



法人籌碼動態

09月27日	臺股期貨		電子期貨		金融期貨	
	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減
外資及陸資	-601	-738	1,208	-3	189	122
投信	-9,334	114	194	0	63	0
自營商	6,056	389	74	-22	-21	-18
09月27日	非金電期貨		臺指選擇權CALL		臺指選擇權PUT	
	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減
外資及陸資	98	-16	11,354	3,215	17,435	2,662
投信	0	0	-100	0	489	0
自營商	-109	8	-15,095	-2,800	13,770	4,680

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口	多	空
長榮	13.46	富邦金	-4.26	台指期前十大 市場佔比	37.9%	47.2%
台積電	12.37	兆豐金	-3.99			
欣興	2.58	中信金	-3.18			
陽明	2.44	國泰金	-2.57	電子期前十大 市場佔比	68.9%	70.3%
華新	2.20	北極星藥業-KY	-2.35			
聯電	1.79	鴻海	-2.20			
大立光	1.49	台塑	-1.62	金融期前十大 市場佔比	73.5%	59.5%
第一金	1.47	中鋼	-1.50			
采鈺	1.45	長榮航	-1.45			
南電	1.44	中華電	-1.23	非金電期前十大 市場佔比	100.0%	87.4%
前十名合計	40.69	後十名合計	-24.36			

期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

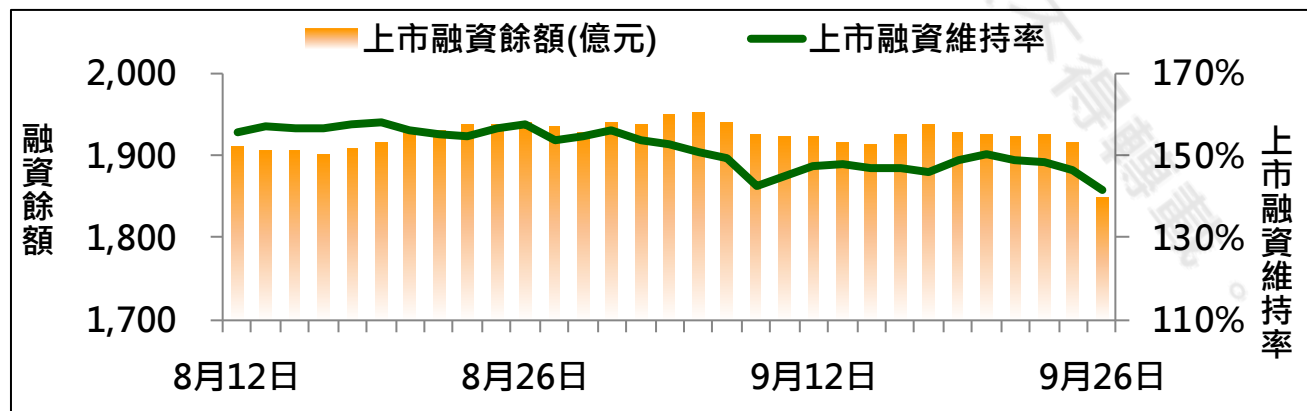
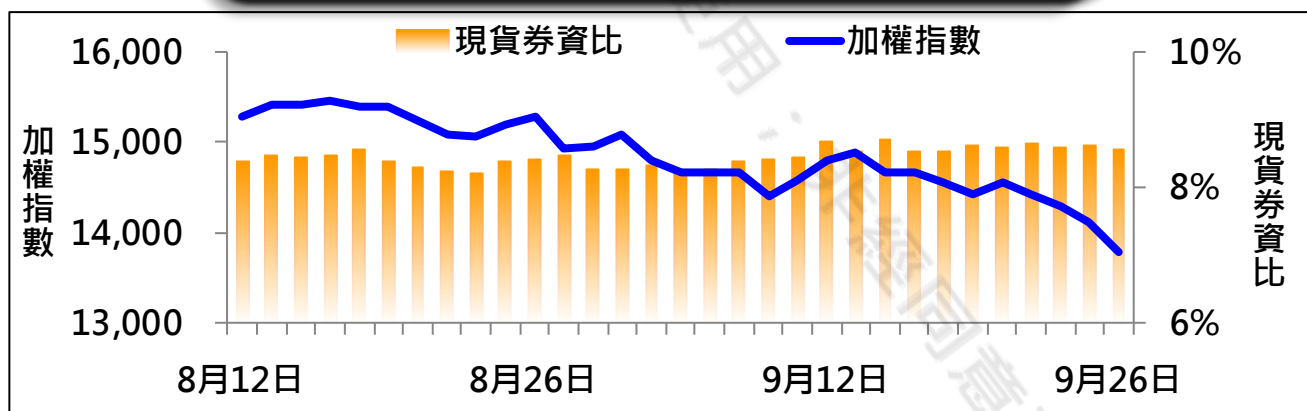


法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

日期	外資現貨 & 期貨籌碼變化			自營商現貨 & 期貨籌碼變化		
	現貨買賣超 (億)	期貨留倉 (口)	留倉增減 (口)	現貨買賣超 (億)	期貨留倉 (口)	留倉增減 (口)
09月21日	-92.6	7,583	-5,540	-16.7	4,223	4,769
09月22日	-194.6	6,183	-1,400	-31.9	5,686	1,463
09月23日	-140.5	4,661	-1,522	-28.9	5,341	-345
09月26日	-78.5	137	-4,524	-31.8	5,667	326
09月27日	-63.5	-601	-738	-1.9	6,056	389

日期	外資選擇權籌碼變化			自營商選擇權籌碼變化		
	CALL 未平倉	PUT 未平倉	未平倉淨部位	CALL 未平倉	PUT 未平倉	未平倉淨部位
09月21日	4,282	11,037	-6,755	2,927	-5,935	8,862
09月22日	4,370	13,745	-9,375	5,133	5,080	53
09月23日	6,032	14,272	-8,240	-1,701	7,397	-9,098
09月26日	8,139	14,773	-6,634	-12,295	9,090	-21,385
09月27日	11,354	17,435	-6,081	-15,095	13,770	-28,865

現貨券資比 & 上市融資維持率



期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

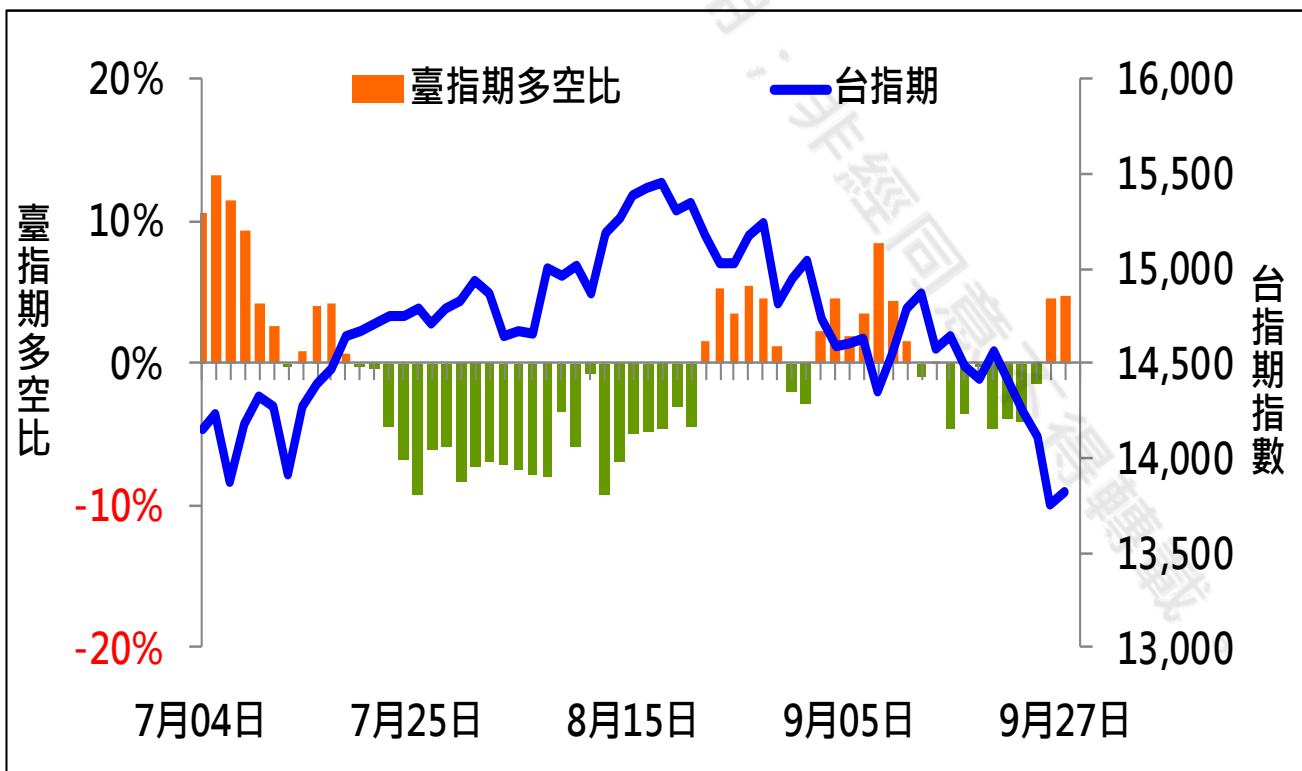
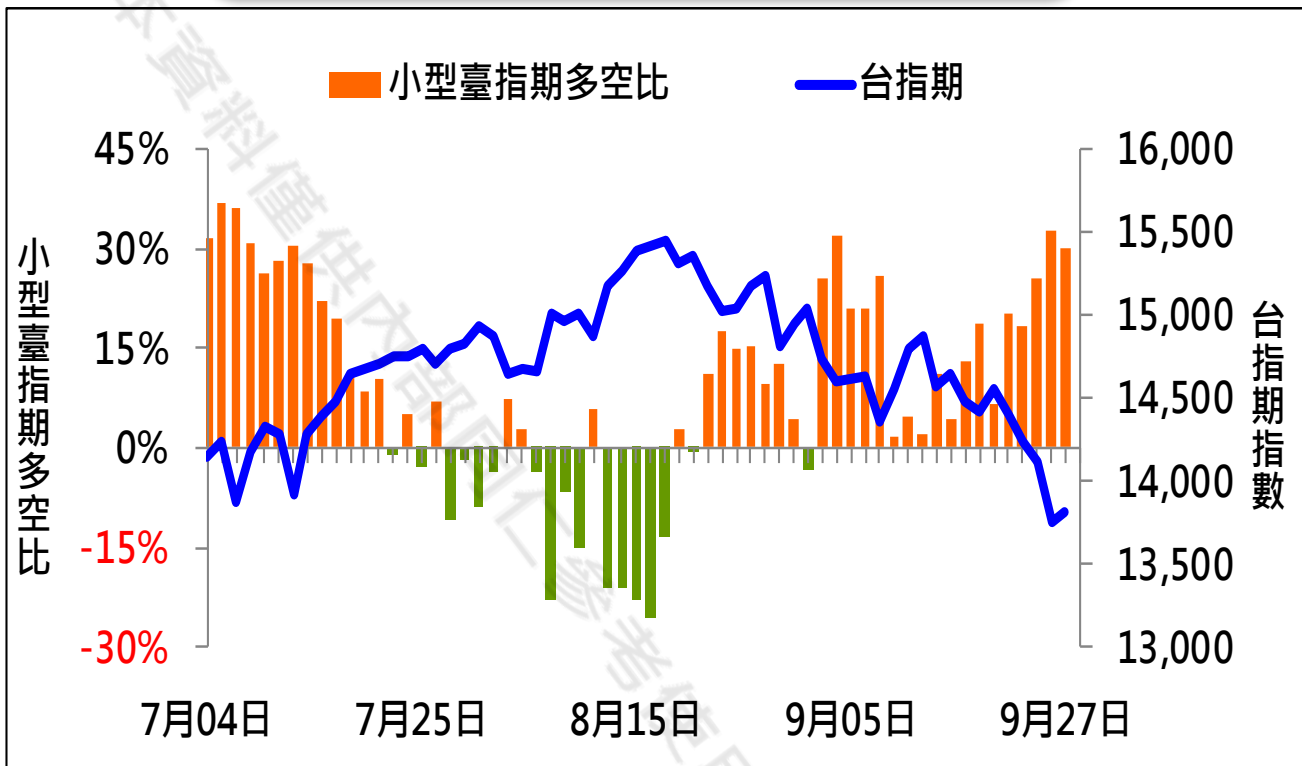
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



散戶多空比



期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

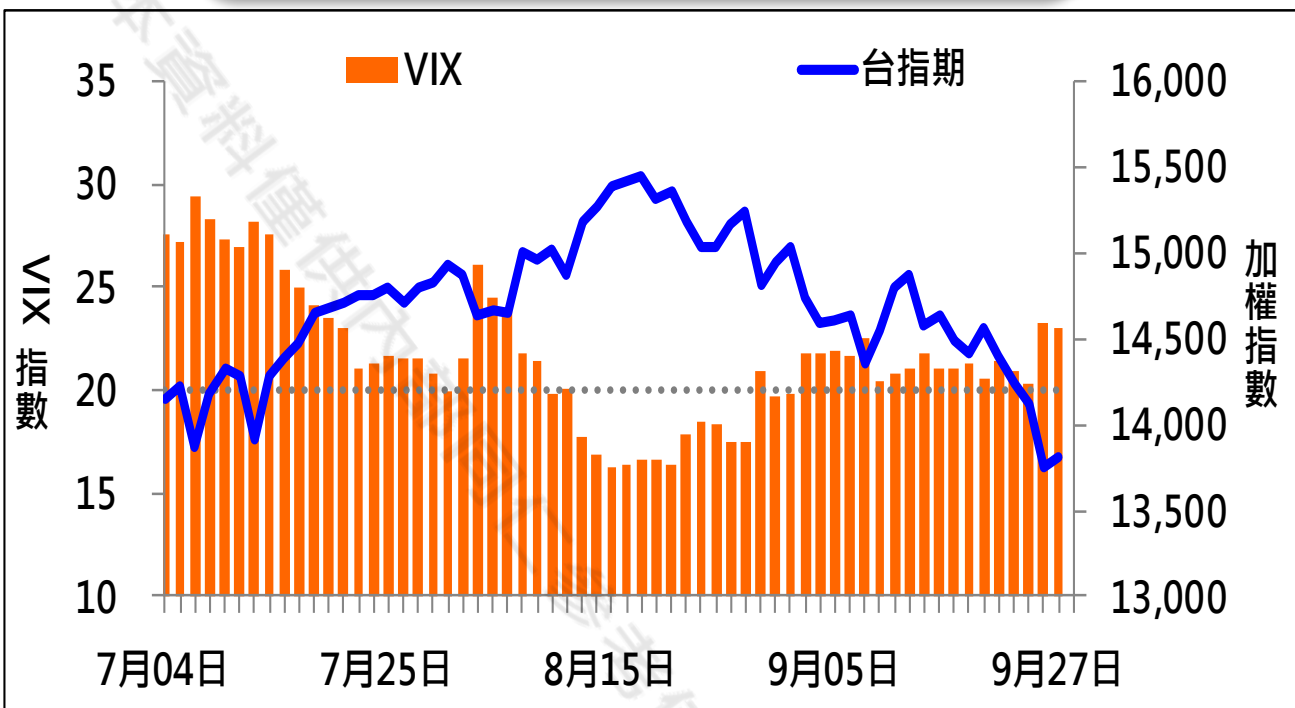
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

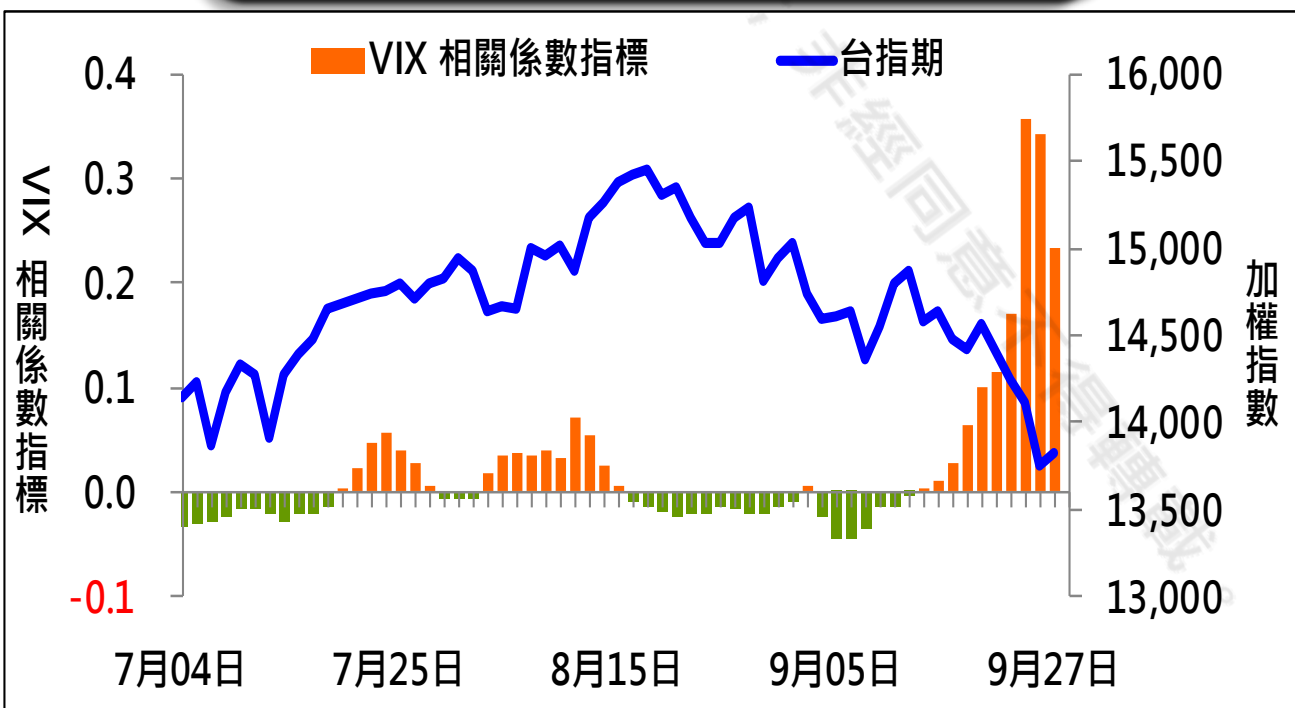
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標



期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

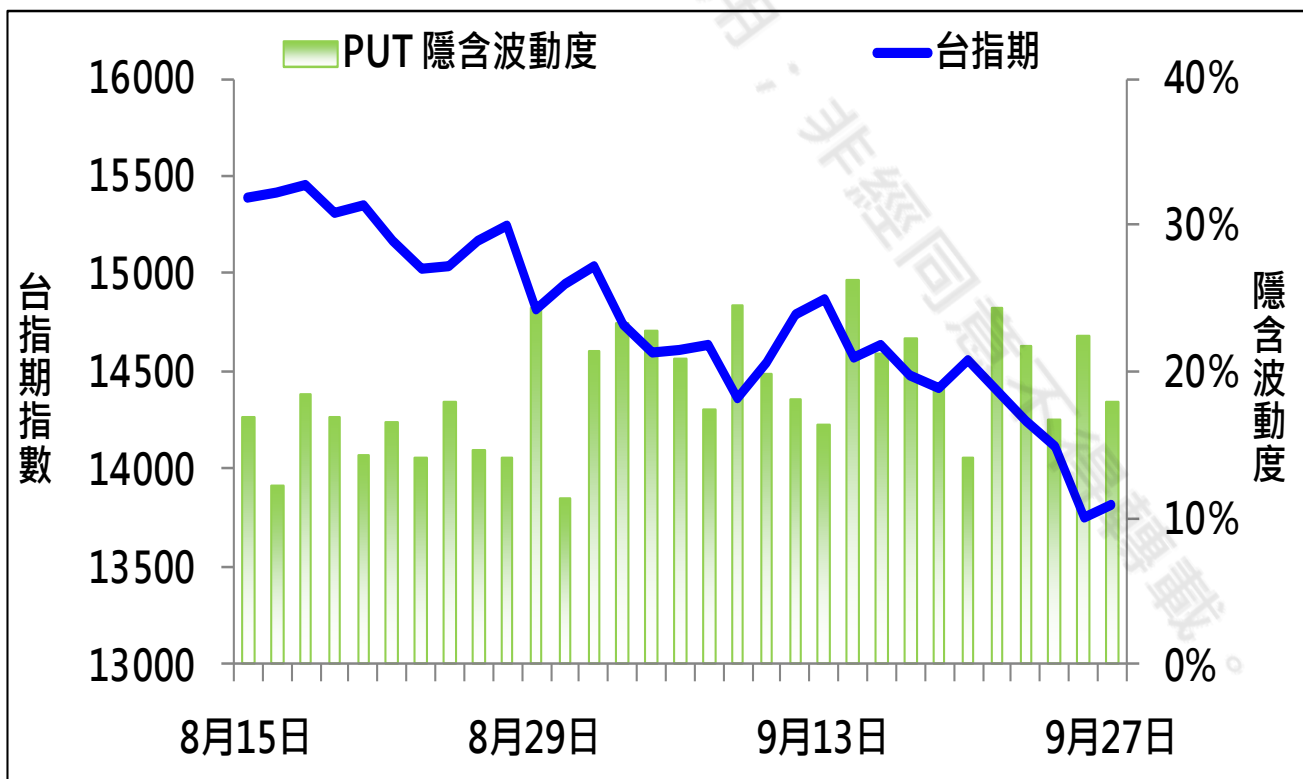
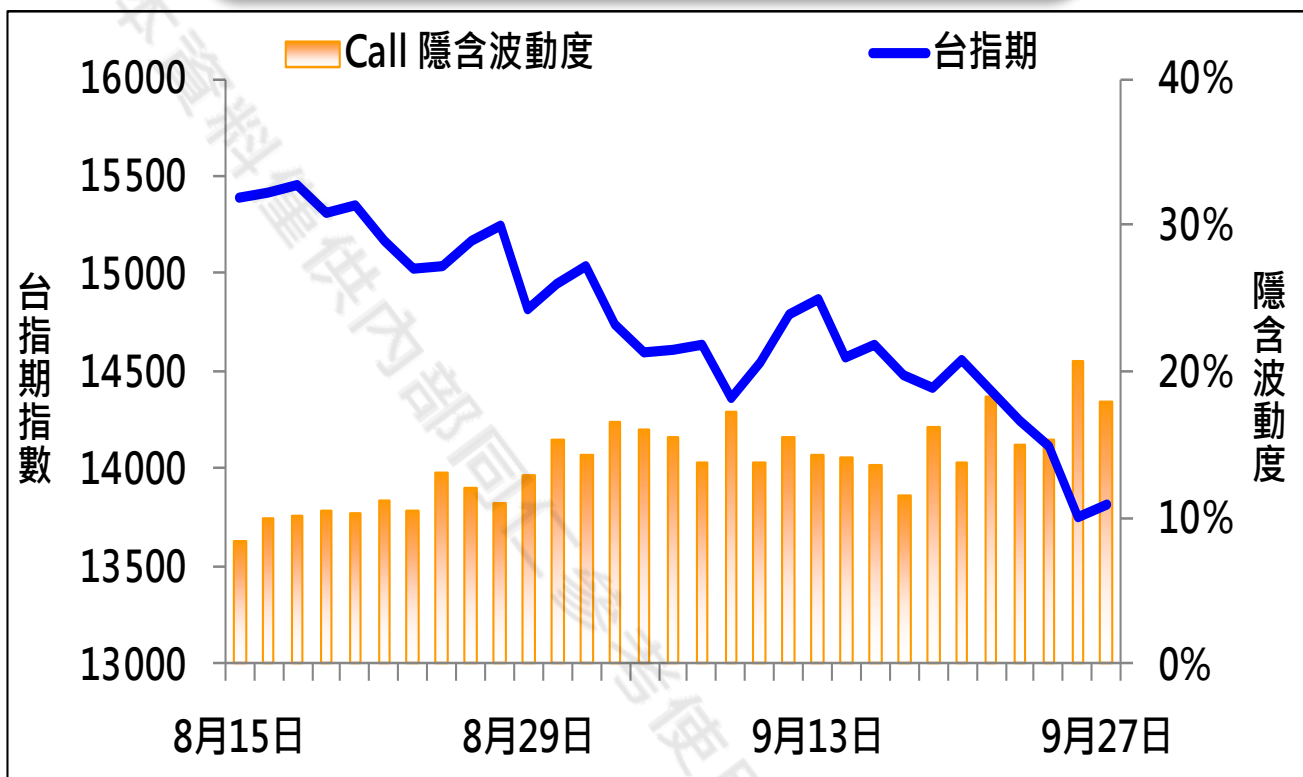
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



CALL、PUT隱含波動率



期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



週選擇權OI變化

日期：2022/9/27

結算日：2022/9/28

OI 增減	Call	202209W4 履約價	Put	OI 增減
6	6	13,450	1,187	1,187
43	78	13,500	10,362	2,366
74	74	13,550	2,031	2,031
64	276	13,600	13,437	2,561
68	68	13,650	3,358	3,358
570	1,117	13,700	12,763	1,203
1,264	1,860	13,750	4,585	2,207
2,702	5,826	13,800	9,829	1,950
1,824	5,239	13,850	4,195	2,916
2,129	7,469	13,900	5,891	-402
1,988	6,831	13,950	1,142	-346
※ 4,876	14,760	14,000	4,146	-511
1,964	9,542	14,050	1,121	-246
2,216	12,176	14,100	2,047	-397
-108	8,100	14,150	1,550	-168
-1,871	9,804	14,200	1,769	-257
-273	6,404	14,250	1,309	-76
-719	9,732	14,300	1,922	-162
-686	8,112	14,350	1,143	-29
-979	7,906	14,400	1,191	-32
-947	6,293	14,450	441	-11
-1,473	6,644	14,500	1,064	-21
-399	4,172	14,550	481	-5
-498	8,309	14,600	805	-10
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
7,844	174,365	0.6701	116,844	16,890
昨日 P/C	0.6002	今日增減變化		0.0699

期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



近月選擇權OI變化

日期：2022/9/27

結算日：2022/10/19

OI 增減	Call	202210 月 履約價	Put	OI 增減
0	173	12,800	5,031	900
1	16	13,000	4,267	814
-3	24	13,200	3,120	765
4	29	13,400	2,776	439
12	83	13,600	2,690	521
1,084	1,690	13,800	4,537	1,886
919	1,547	13,900	2,222	-88
※ 1,464	2,785	14,000	3,040	-57
568	3,418	14,200	1,044	-28
790	3,980	14,400	1,265	-14
-225	4,360	14,600	1,168	-32
916	7,547	14,800	649	-9
18	8,550	15,000	885	12
-143	6,058	15,200	471	0
-120	3,042	15,400	88	0
-151	2,545	15,600	29	0
-12	1,271	15,800	136	0
-185	2,919	16,000	4	1
0	470	16,200	24	0
-3	336	16,400	0	0
0	251	16,600	0	0
60	155	17,000	2	0
0	5	17,400	607	0
54	9,924	17,800	2	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
6,746	92,575	0.6987	64,678	8,360
昨日 P/C	0.6562	今日增減變化	0.0425	

期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

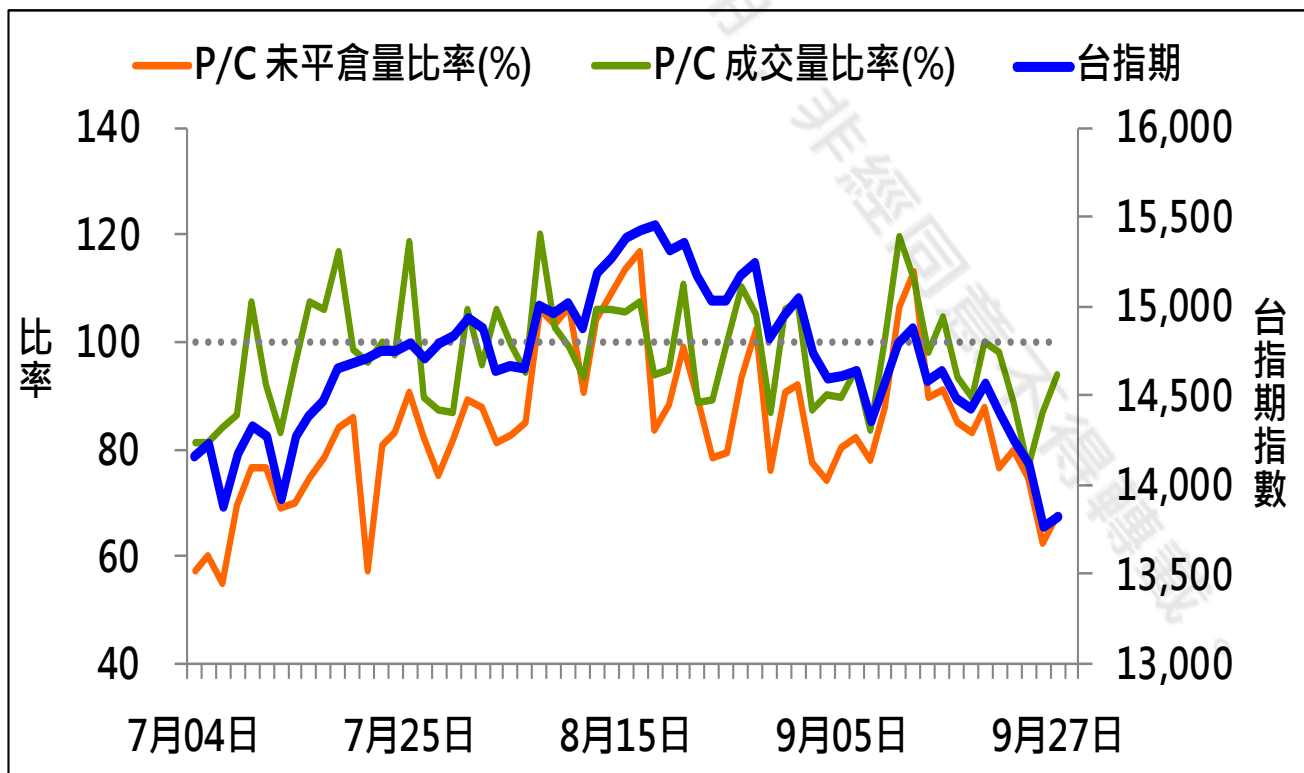
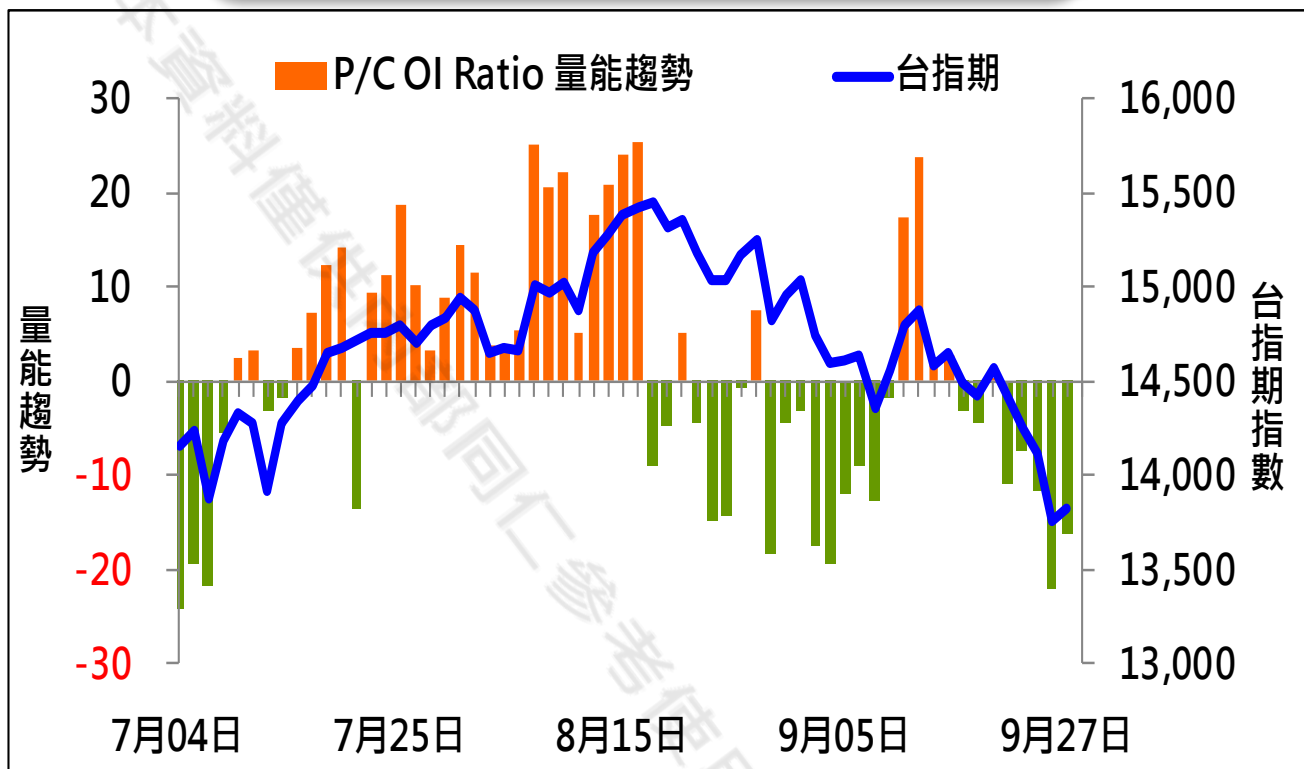
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



成交量及未平倉量比率 & 量能趨勢圖



期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



盤後重點觀察



圖片來源：嘉實資訊

期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



免責聲明與警語

- 一、本報告中的訊息包括來自各項已公開或據信為可靠之資訊來源，為製作報告當時所知之資訊及基於特定時間或期間所作之意見，惟華南期貨股份有限公司（以下稱本公司）對本報告內容的準確性、完整性和及時性不作任何聲明或保證，本報告所載之資訊或意見日後如有任何變動，本公司將不作通知。
- 二、本報告內容僅供參考，不具有或隱含任何法律效果，本公司就其內容不負任何法律責任。本報告內容不代表未來獲利之預期或保證，交易人應審慎評估，慎重考量自身財務能力及承受風險能力，並特別留意控管風險，如有需要，應諮詢相關財務顧問或專業人士。
- 三、本報告內容不構成亦不得視為對任何投資標的或任何交易之招攬、要約、宣傳、廣告、遊說、引誘或推薦。在任何情況下，本公司不對任何人閱讀本報告或基於本報告觀點所進行的交易所引致的任何損益承擔任何責任。
- 四、本報告內容所涉相關圖表及數據可能採用特定軟體及程式、模型運算，以歷史數據進行繪製及統計，其結果並不代表具有預測未來之能力。
- 五、本報告內容所用技術分析指標可能隨參數設定之不同，而有不同的結果。技術分析指標係將過去歷史資料經由統計分析技術所得之指標數值，僅供參考性質，通常作為事後驗證之用途，且係依據過去歷史資料所得，不具領先意涵，亦不代表具有預測未來之能力。
- 六、本報告內容之著作權屬於本公司所擁有，非經本公司事先書面同意，禁止任何未經本公司授權擅自加以摘錄、引用、轉貼、下載、複製、編輯、翻譯或傳輸行為，任何侵犯本公司著作權之行為，本公司將予究責。
- 七、本報告僅限由本公司傳送予與本公司簽訂顧問契約之客戶閱讀，如有任何人未經本公司事先書面同意而將本報告傳送予他人，本公司將予究責。
- 八、期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX/02-25463700