

法人籌碼動態

09月11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	-6,601	-2,714	-504	64	178	-23
投信	1,400	227	179	1	17	0
自營商	-2,245	181	-368	-75	-536	9
09月11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	87	10	29,382	1,883	31,094	339
投信	0	0	200	0	180	0
自營商	-100	-11	-18,457	-10,126	1,711	5,120

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口	多	空
聯發科	2.57	台積電	-25.04	台指期前十大 市場佔比	35.9%	44.4%
台塑化	2.45	廣達	-17.40			
聯電	1.41	台達電	-7.11			
中租-KY	1.39	緯創	-6.07	電子期前十大 市場佔比	52.8%	54.3%
台化	1.32	技嘉	-5.73			
國泰金	1.30	華碩	-5.62			
中信金	1.29	光寶科	-5.32	金融期前十大 市場佔比	69.2%	73.5%
中華電	1.25	鴻海	-4.46			
華南金	0.88	日月光投控	-4.22			
大立光	0.64	奇鋹	-3.89	非金電期前十大 市場佔比	98.2%	89.5%
前十名合計	14.52	後十名合計	-84.86			

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 (112)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

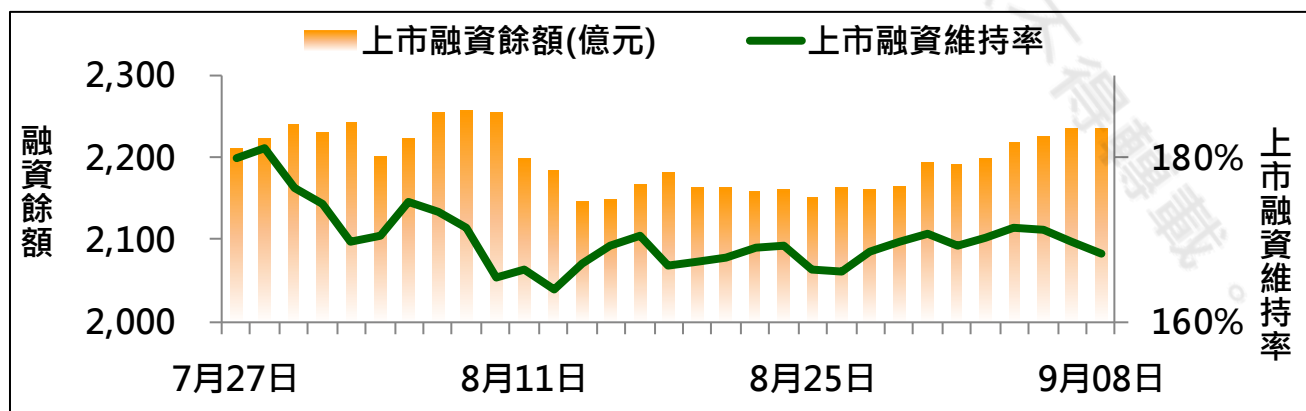
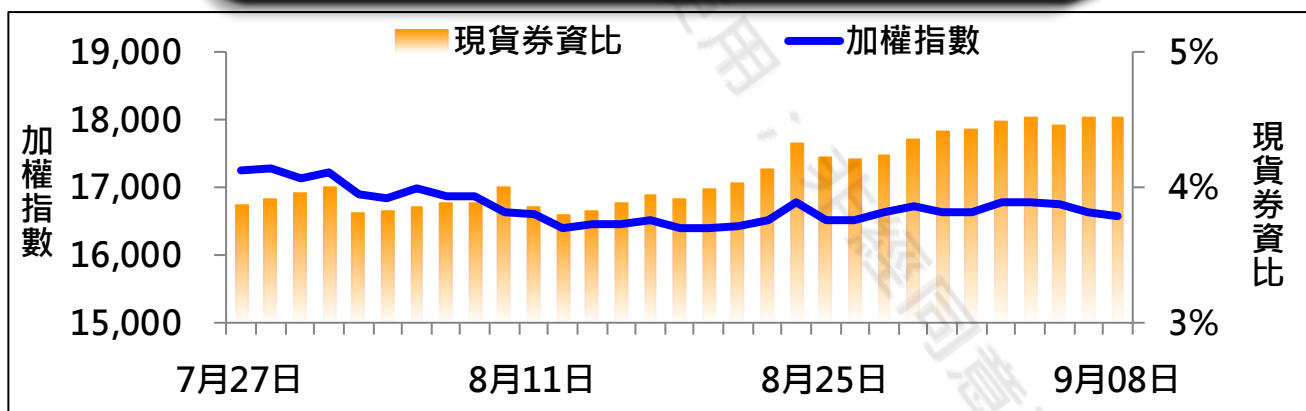
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

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05日	12.0	-6,230	-2,740	-9.3	-1,293	1,291
09月06日	-80.6	-5,132	1,098	-41.9	-1,741	-448
09月07日	-178.5	-3,110	2,022	-78.3	-1,857	-116
09月08日	-137.8	-3,887	-777	-62.7	-2,426	-569
09月11日	-145.8	-6,601	-2,714	-111.1	-2,245	181

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05日	31,058	23,203	7,855	-12,604	-1,232	-11,372
09月06日	25,450	23,158	2,292	-7,481	-4,117	-3,364
09月07日	26,946	24,033	2,913	-5,656	-997	-4,659
09月08日	27,499	30,755	-3,256	-8,331	-3,409	-4,922
09月11日	29,382	31,094	-1,712	-18,457	1,711	-20,168

現貨券資比 & 上市融資維持率



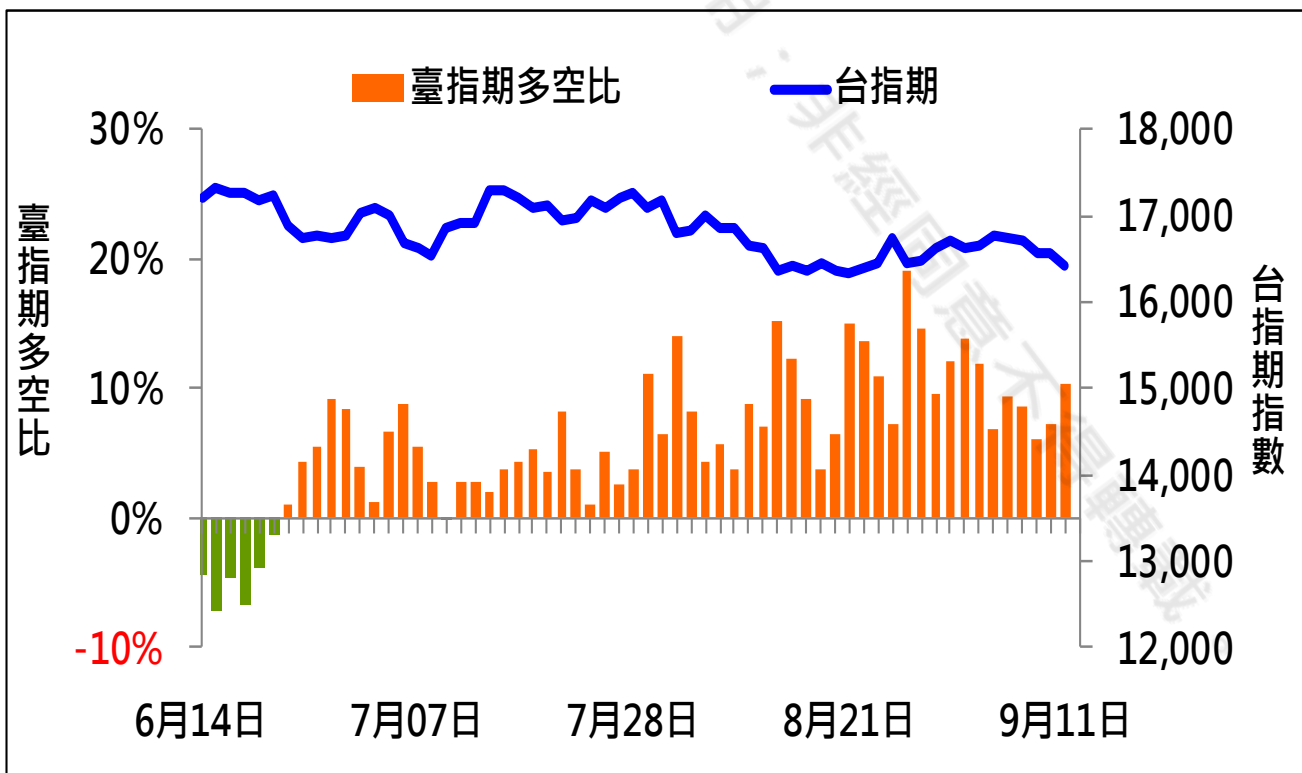
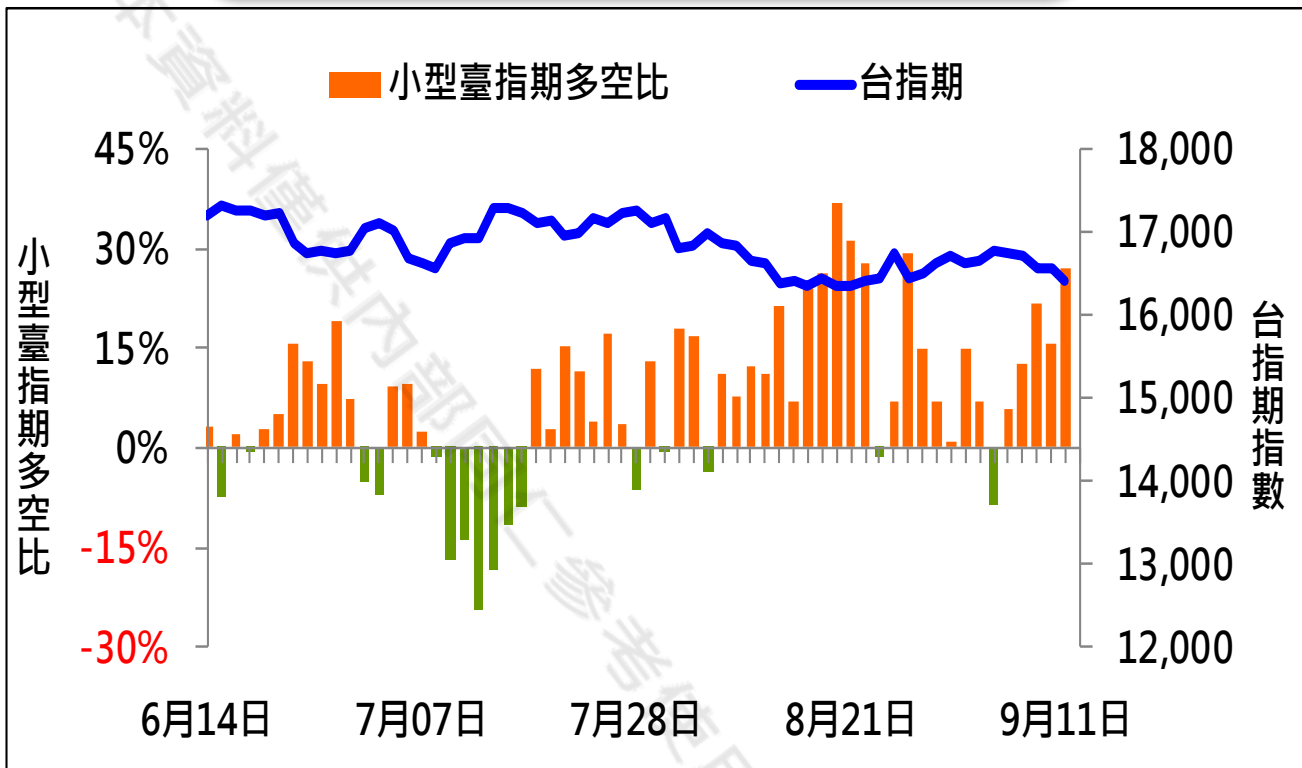
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)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



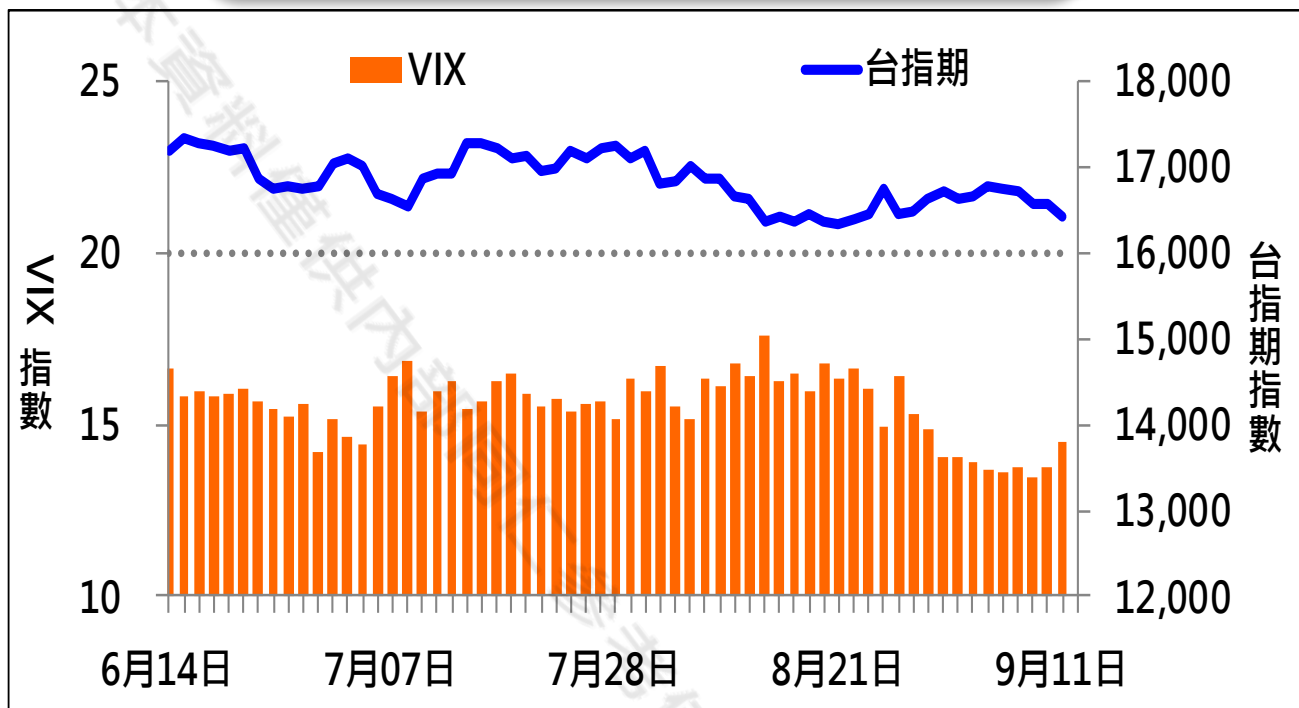
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年金管期總字第007號

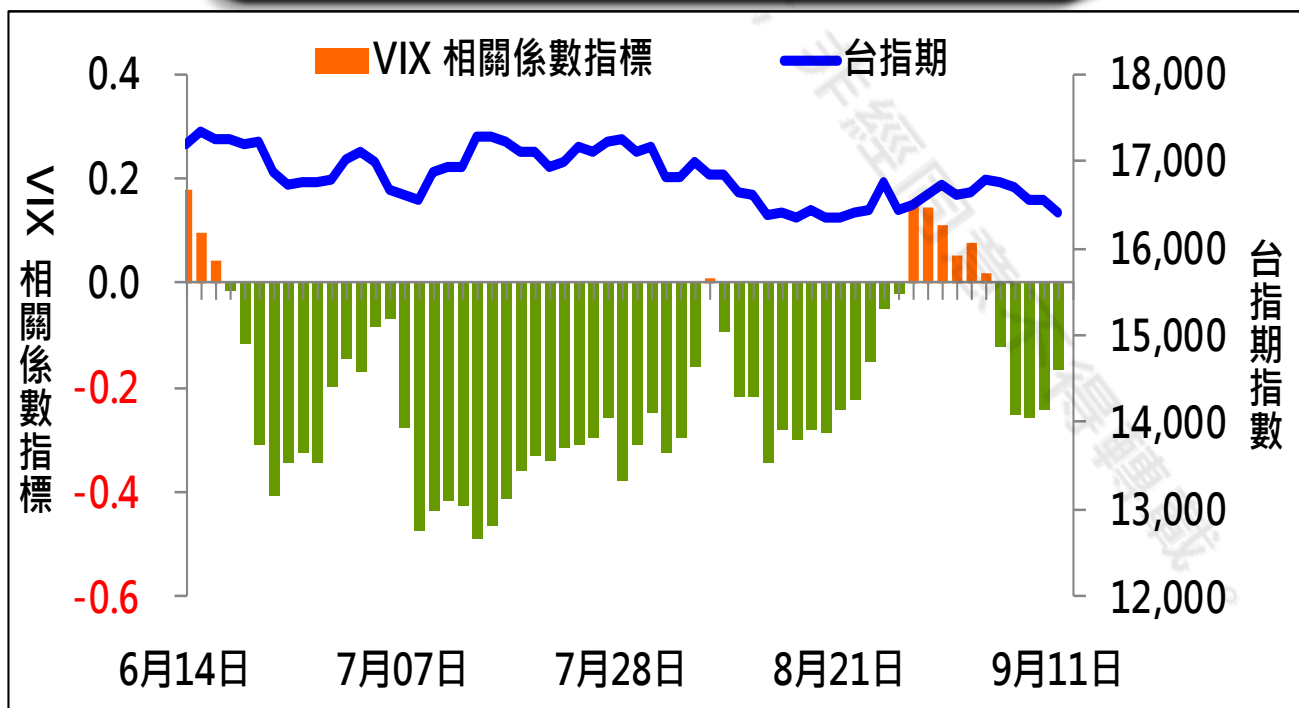
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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



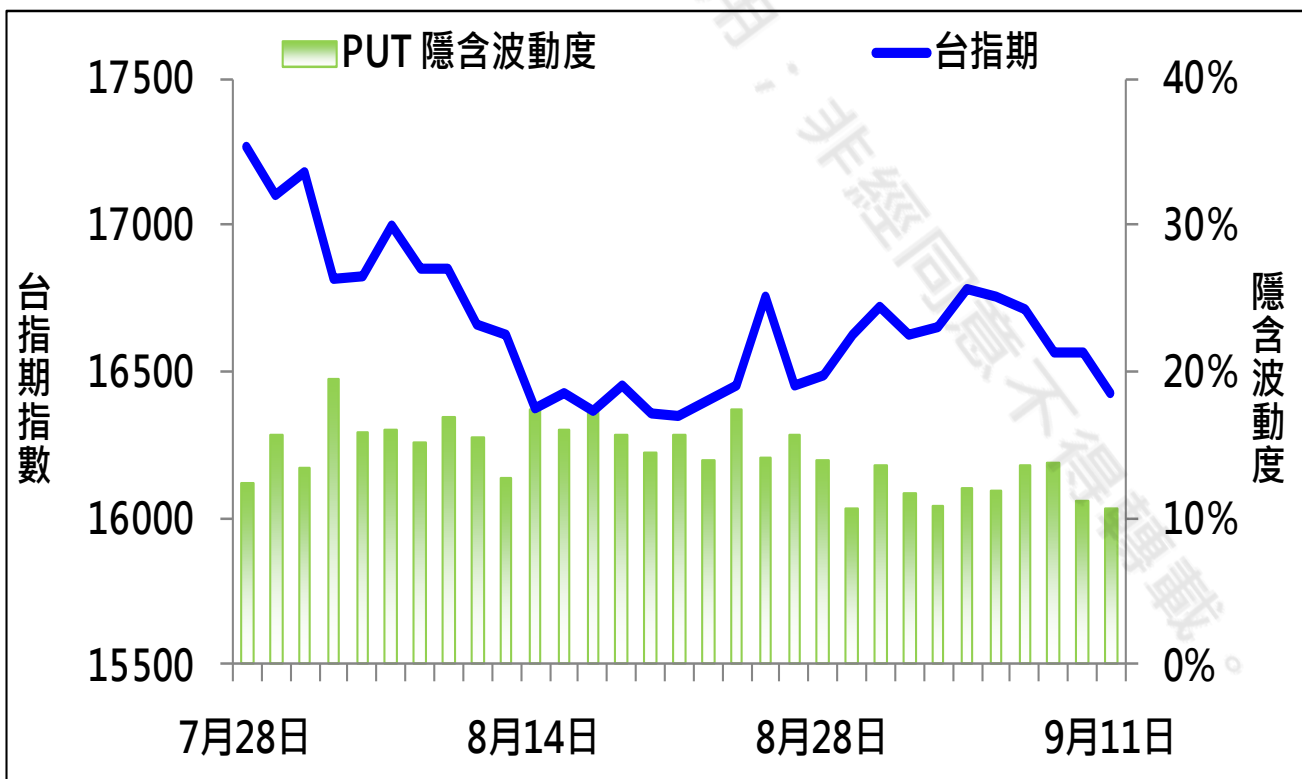
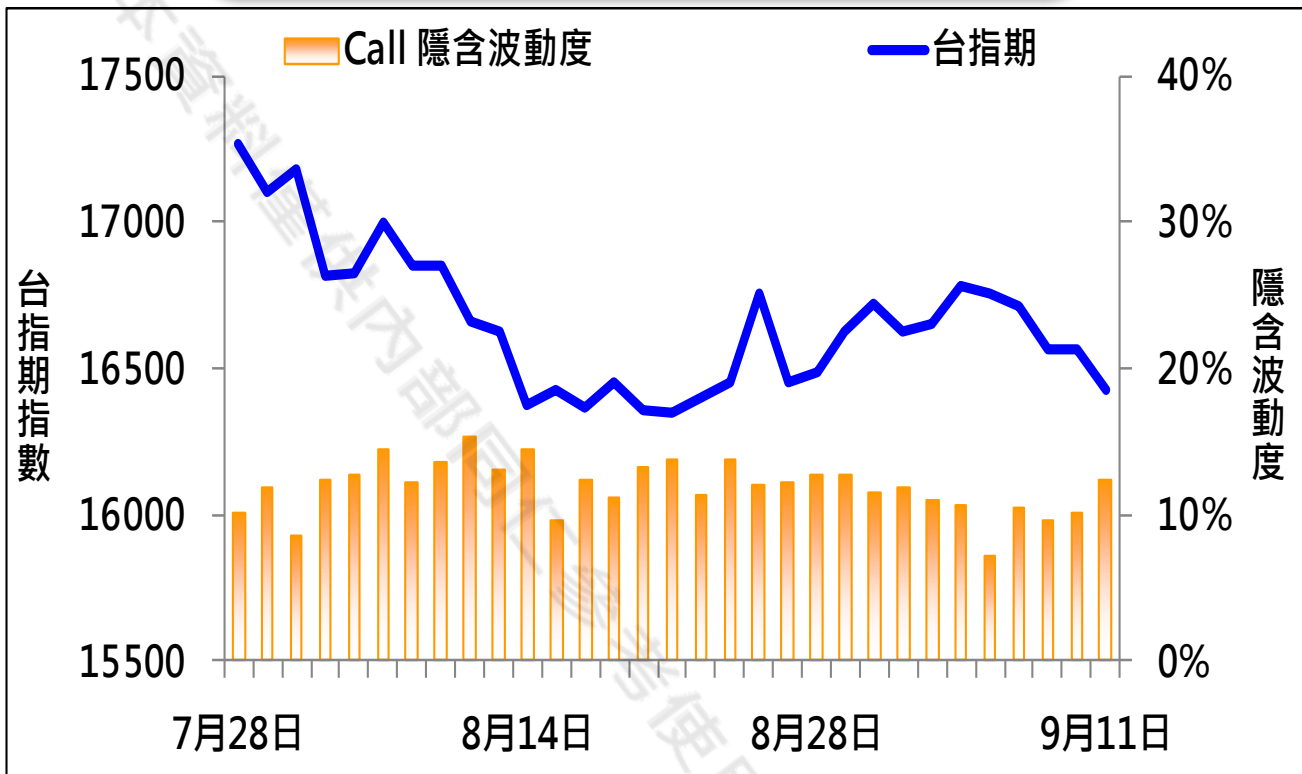
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)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 (112)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

資料日期：2023/9/7

結算日：2023/9/13

OI 增減	Call	202309W2 履約價	Put	OI 增減
0	1	16,100	3,742	2,212
0	0	16,150	2,896	1,725
-1	26	16,200	5,112	3,305
1	48	16,250	3,038	1,877
16	33	16,300	4,642	2,593
4	11	16,350	4,200	2,533
104	144	16,400	8,747	5,700
238	264	16,450	5,441	2,778
529	727	16,500	7,393	3,081
1,059	1,126	16,550	3,745	1,919
3,204	3,385	16,600	4,540	1,742
3,267	3,595	16,650	2,684	663
3,437	4,382	16,700	2,942	-159
3,826	5,330	16,750	2,080	548
4,102	6,623	16,800	812	141
4,247	5,735	16,850	888	87
※ 6,038	8,173	16,900	284	46
3,712	5,907	16,950	53	10
3,781	7,188	17,000	97	35
408	3,705	17,050	10	2
-141	3,676	17,100	57	42
700	2,411	17,150	8	2
681	3,278	17,200	8	2
1,071	1,503	17,250	0	0
40,385	70,706	總計	76,835	36,982
P/C	1.0867		增減	-0.2277

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 (112)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

次月選擇權OI變化

資料日期：2023/9/7

結算日：2023/10/18

OI 增減	Call	202310 月 履約價	Put	OI 增減
0	0	15,200	197	14
0	0	15,300	130	9
0	4	15,400	226	46
0	8	15,500	592	148
0	2	15,600	1,157	122
0	1	15,700	393	76
0	20	15,800	1,901	80
0	21	15,900	401	27
0	33	16,000	2,314	468
1	24	16,100	1,976	4
1	19	16,200	723	49
※ -1	24	16,300	839	148
2	51	16,400	1,186	62
-3	101	16,500	947	98
62	147	16,600	941	66
26	166	16,700	210	16
180	422	16,800	223	-5
159	398	16,900	73	1
301	963	17,000	32	-5
400	2,539	17,100	5	0
282	2,734	17,200	36	1
271	2,928	17,300	15	0
591	3,122	17,400	3	0
59	1,940	17,500	4	0
2,656	21,225	總計	16,190	1,562
P/C	0.7628		增減	-0.0250

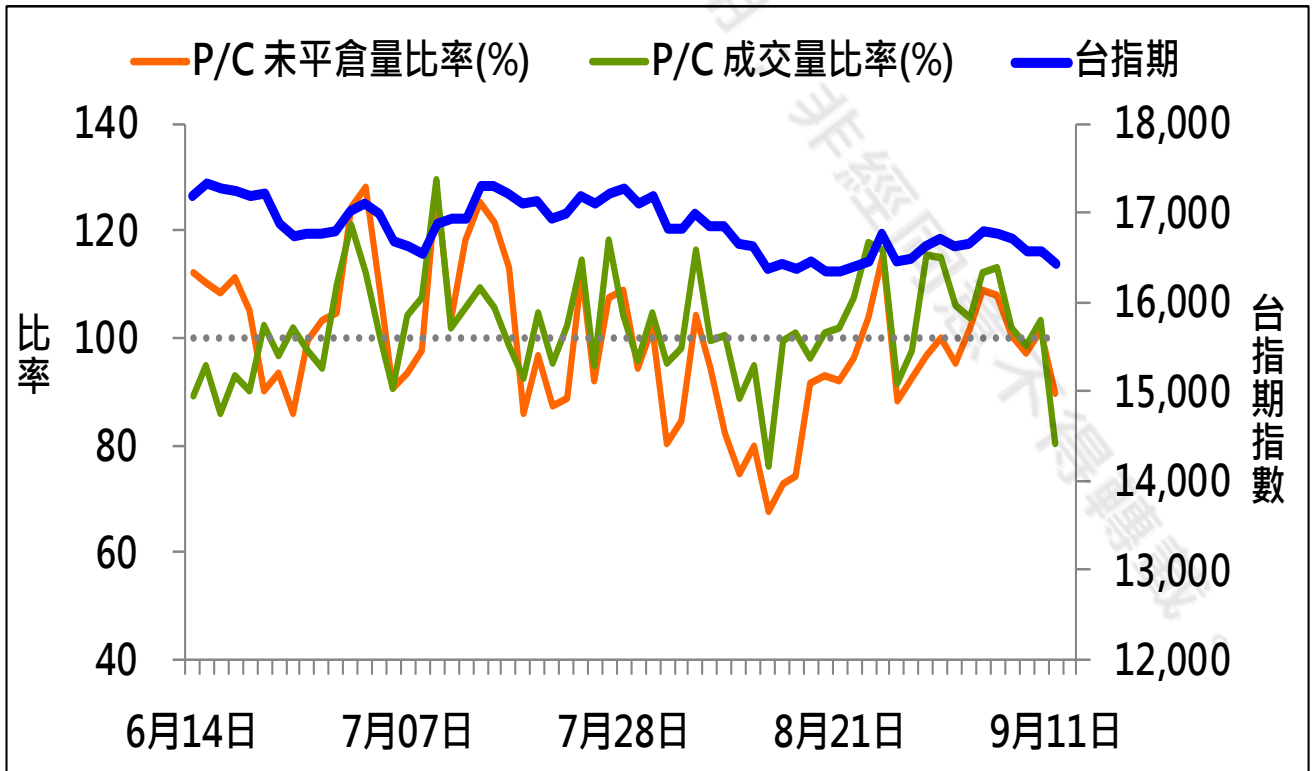
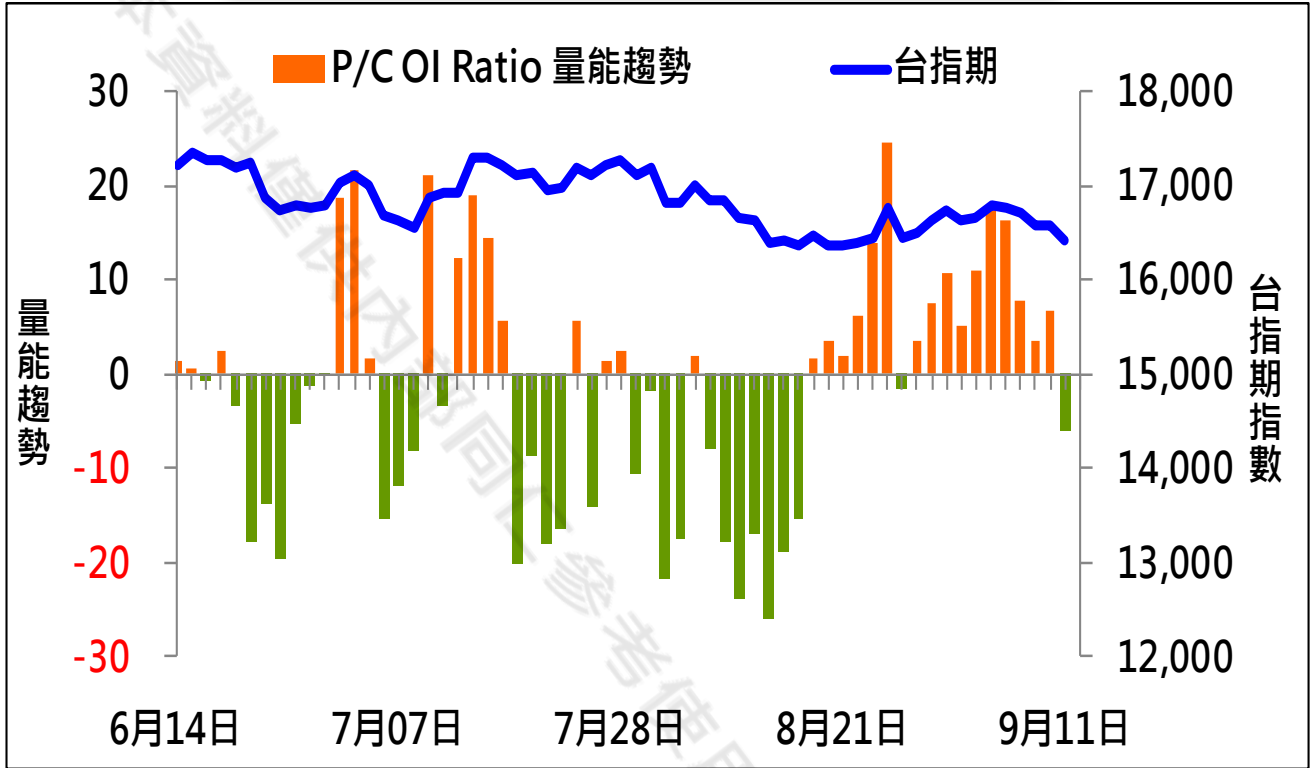
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)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 (112)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

台股指數近月(一般)(FITX*1) 日線圖 2023/09/11 開 16560 高 16577 低 16366 收 16425 s點 量 104377 口 -137 (-0.83%)

SMA5 16603.00↓ SMA20 16549.35↑ SMA60 16835.00↓ SMA120 16409.03↑



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 (112)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