

法人籌碼動態

09月12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	-1,123	5,478	-549	-45	229	51
投信	1,638	238	192	13	17	0
自營商	-3,733	-1,488	-233	135	-573	-37
09月12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	84	-3	32,492	3,110	31,201	107
投信	0	0	200	0	180	0
自營商	-97	3	1,124	19,581	-13,990	-15,701

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口	多	空
台積電	66.74	廣達	-4.97	台指期前十大 市場佔比	34.6%	45.0%
鴻海	11.15	華碩	-3.94			
聯發科	7.21	緯穎	-2.25			
和泰車	4.04	光寶科	-1.90	電子期前十大 市場佔比	55.2%	55.4%
世芯-KY	3.02	技嘉	-1.84			
聯電	3.02	智原	-1.68			
日月光投控	2.81	美利達	-0.96	金融期前十大 市場佔比	69.8%	72.0%
欣興	2.70	英業達	-0.92			
大立光	2.15	奇鋆	-0.84			
南電	1.97	長榮航太	-0.78	非金電期前十大 市場佔比	98.4%	90.4%
前十名合計	104.81	後十名合計	-20.09			

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

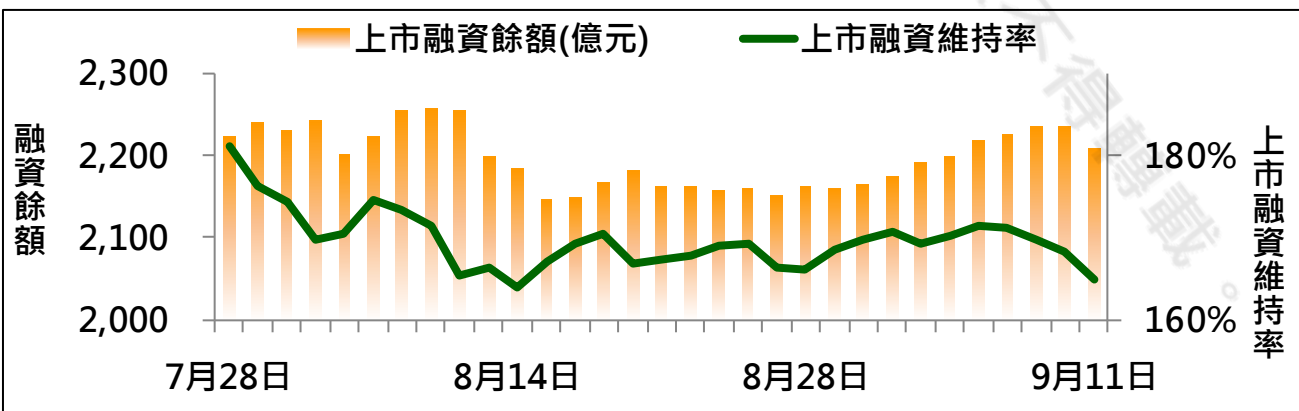
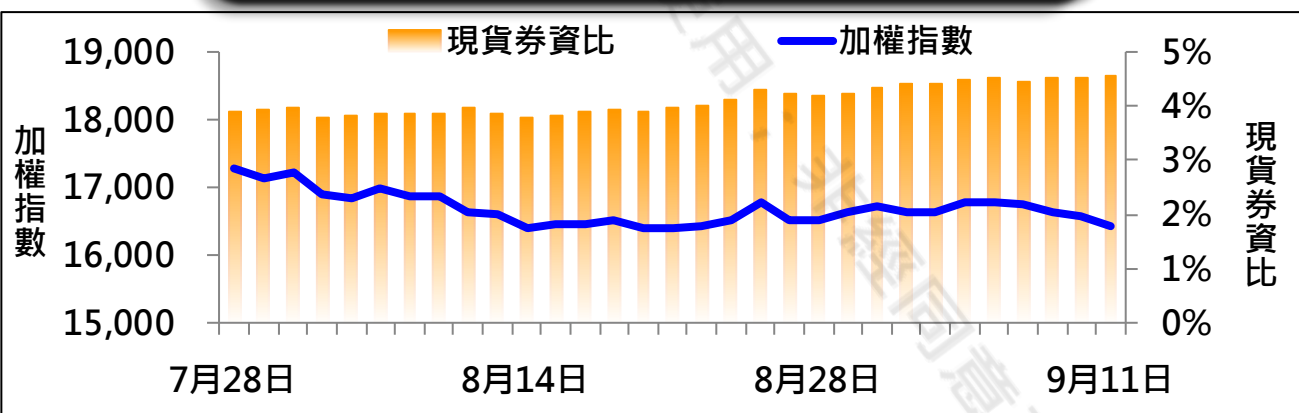
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

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
09月12日	83.7	-1,123	5,478	-37.2	-3,733	-1,488

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
09月12日	32,492	31,201	1,291	1,124	-13,990	15,114

現貨券資比 & 上市融資維持率



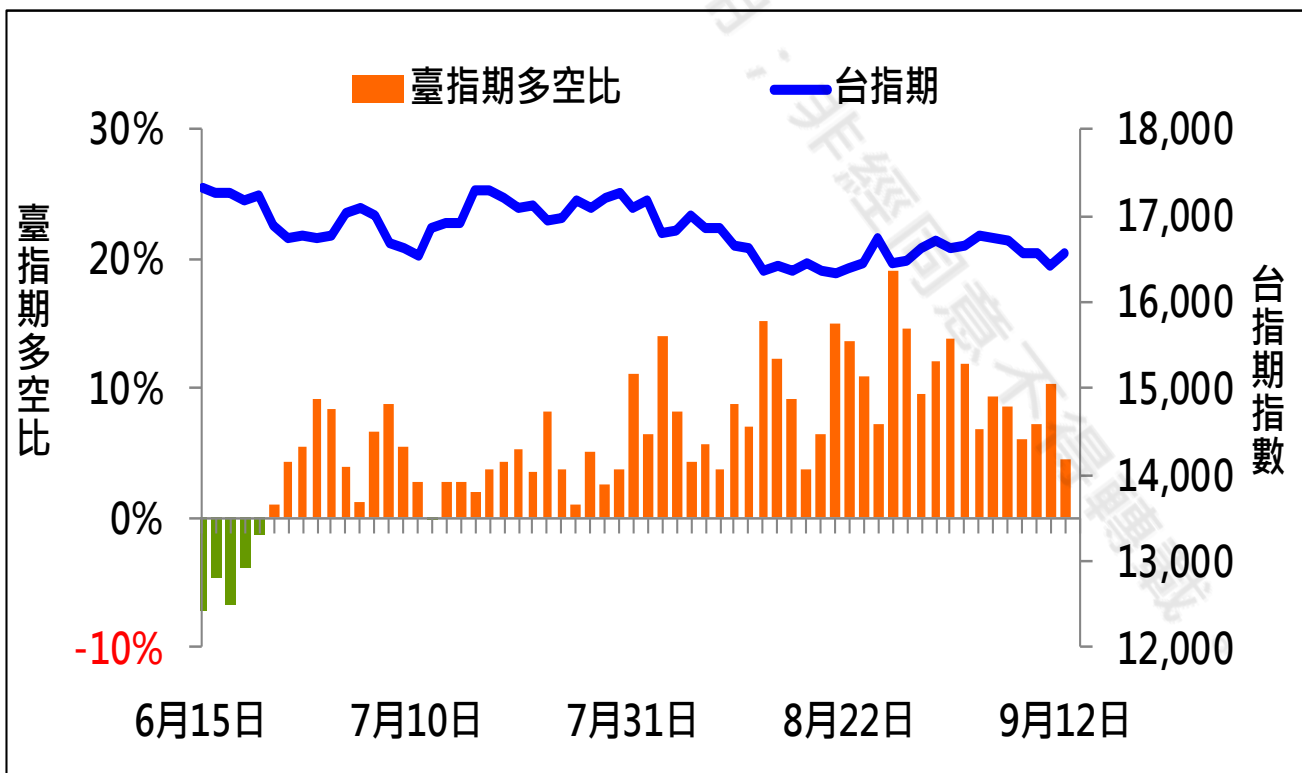
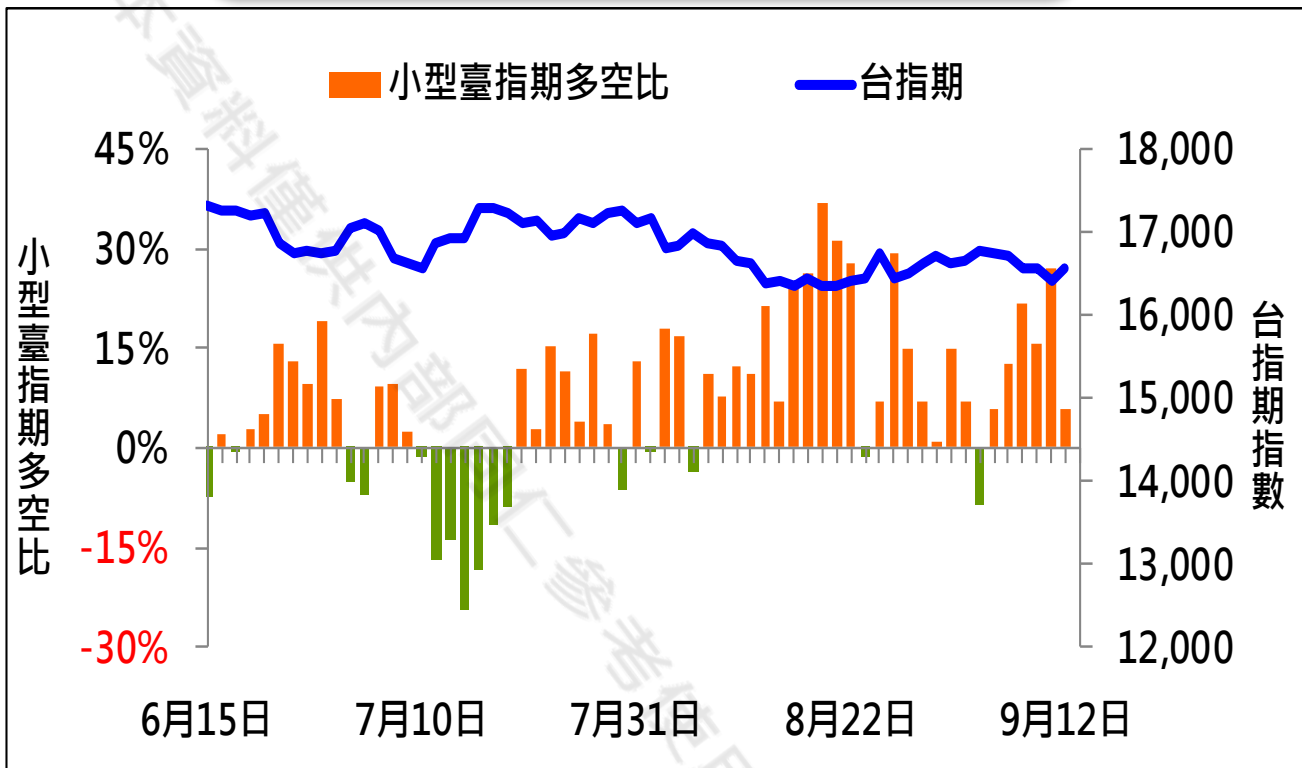
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



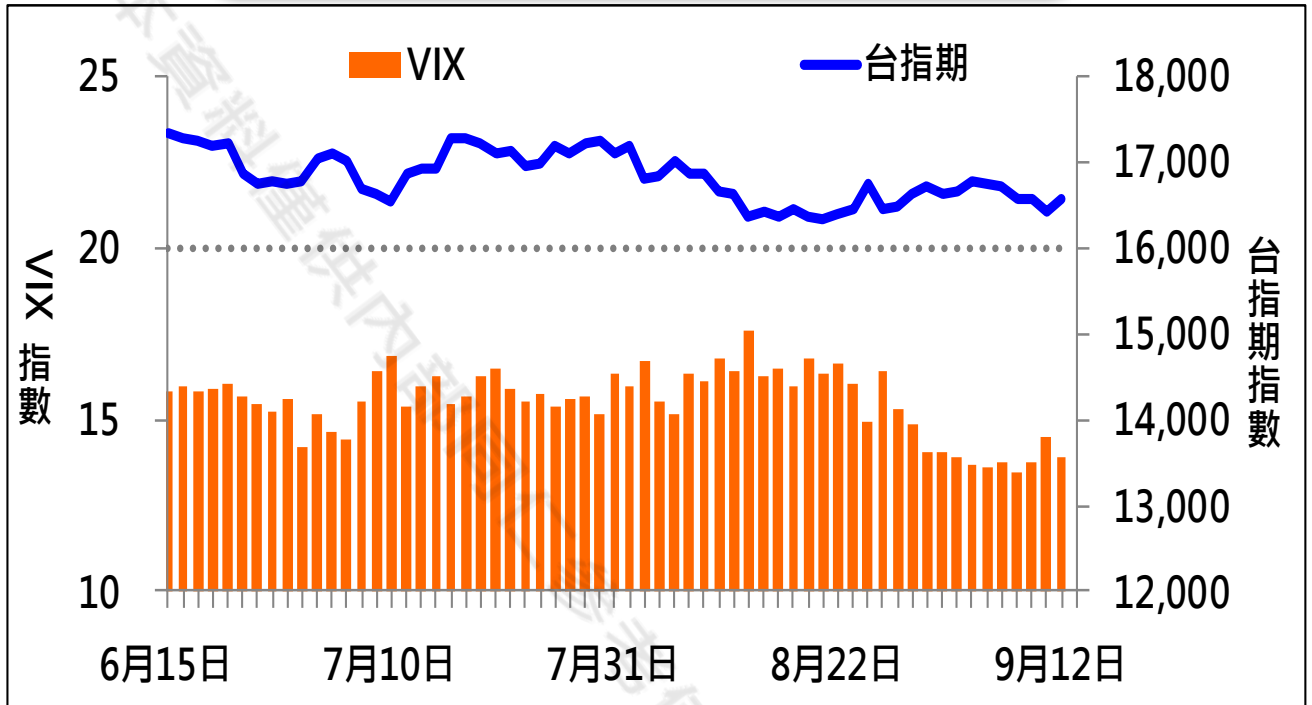
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

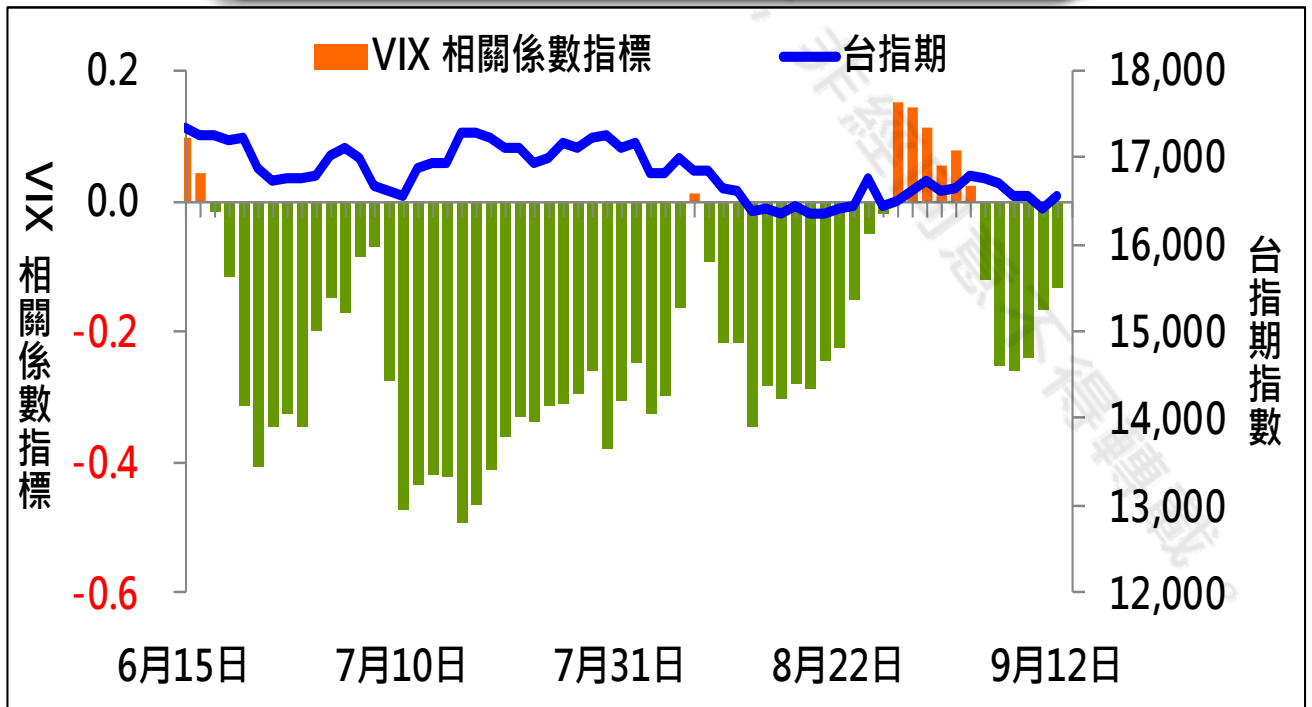
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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

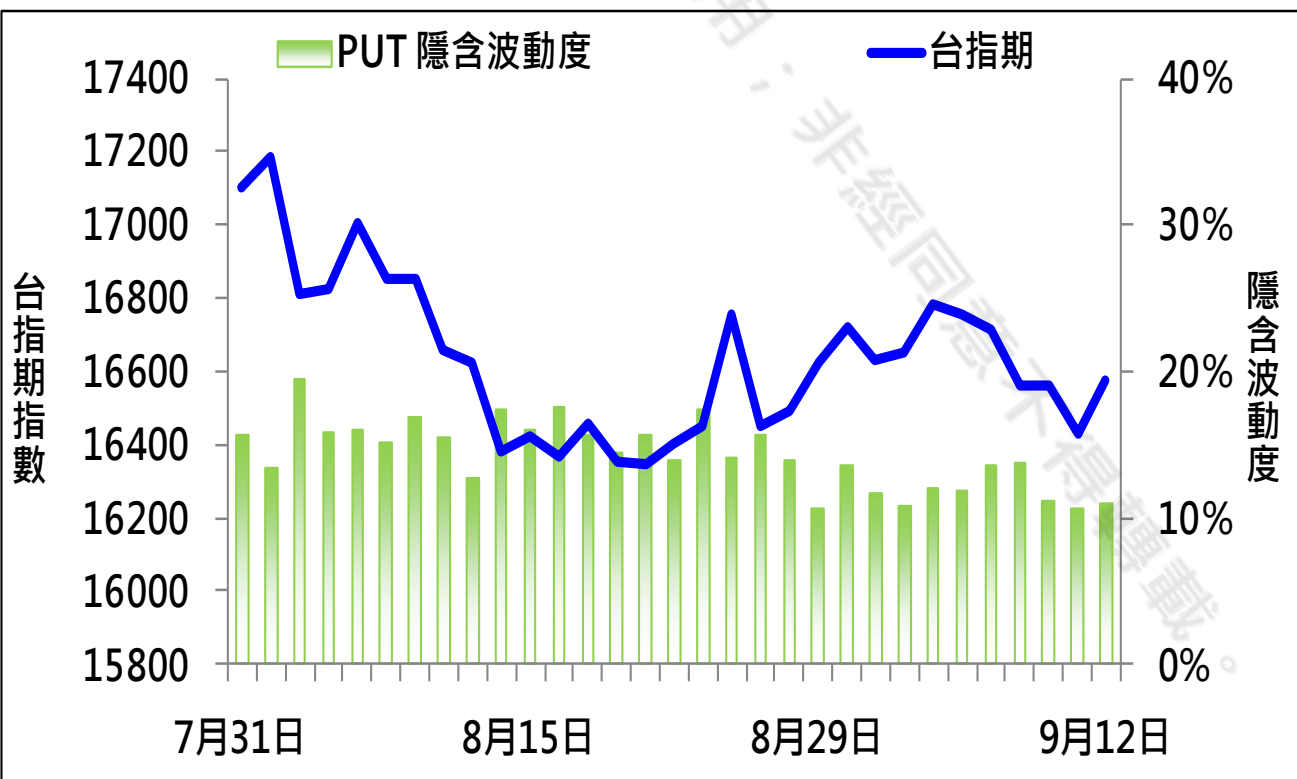
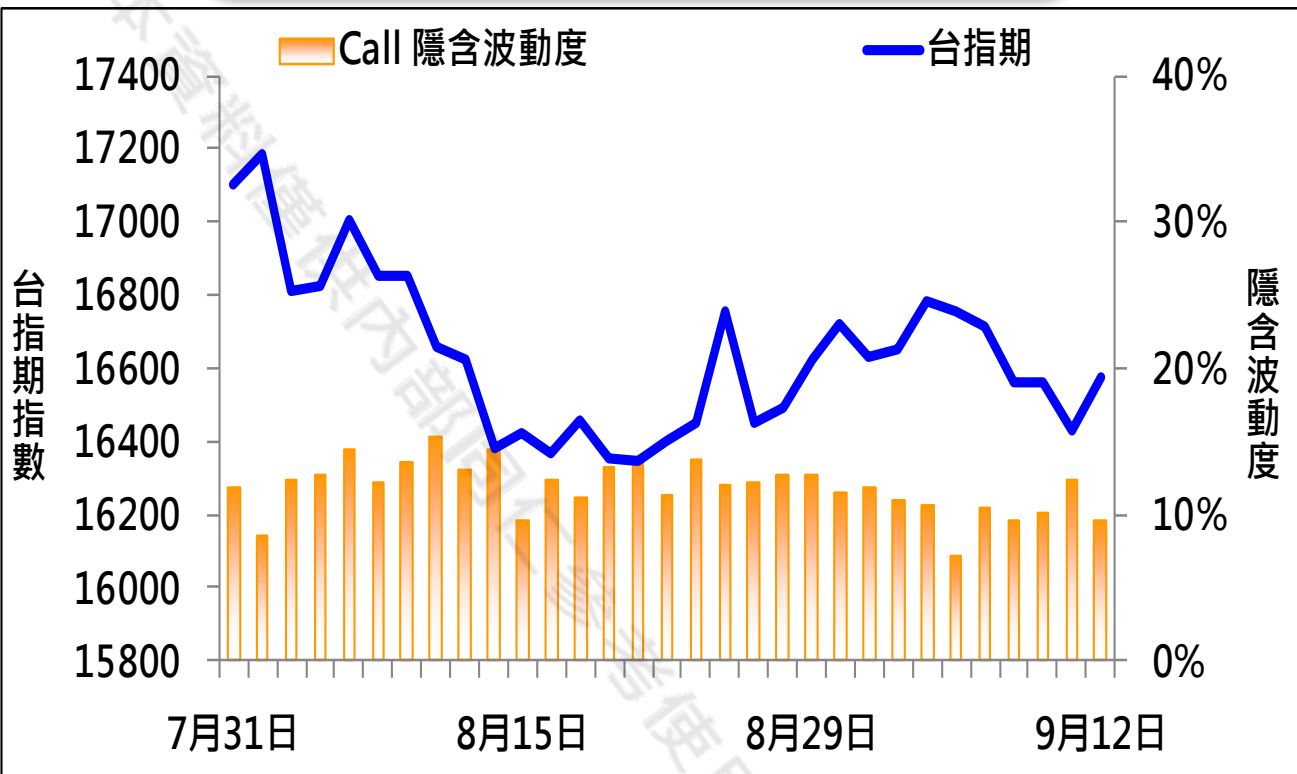


期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2023/9/12

結算日：2023/9/13

OI 增減	Call	202309W2 履約價	Put	OI 增減
1	1	16,050	140	140
-5	10	16,100	3,874	-342
0	20	16,150	4,056	-445
34	167	16,200	6,987	-542
-95	183	16,250	5,754	-189
-128	440	16,300	10,589	1,970
-792	514	16,350	9,196	1,220
-1,605	3,441	16,400	16,322	667
-1,991	2,667	16,450	12,241	4,212
-2,402	5,754	16,500	12,792	2,877
2,379	10,718	16,550	8,959	5,493
1,420	13,472	16,600	5,559	2,438
※ 2,497	11,005	16,650	2,923	773
2,346	10,689	16,700	2,493	260
186	8,020	16,750	1,931	77
-2,430	7,950	16,800	733	-131
-674	5,007	16,850	784	-7
-994	6,494	16,900	170	-20
-639	3,971	16,950	45	-1
-190	5,638	17,000	47	-6
-219	3,573	17,050	10	0
-37	2,513	17,100	50	0
-27	2,834	17,150	8	0
-10	2,776	17,200	14	0
-3,542	112,395	總計	122,885	18,790
P/C	1.0933		增減	0.1955

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

近月選擇權OI變化

資料日期：2023/9/12

結算日：2023/9/20

OI 增減	Call	202309 月 履約價	Put	OI 增減
0	0	15,950	926	926
-9	143	16,000	11,812	-619
0	0	16,050	300	300
0	168	16,100	7,119	636
1	6	16,150	1,683	1,078 ※
1	930	16,200	10,922	930
-3	59	16,250	1,699	643
-250	2,145	16,300	9,398	223
115	371	16,350	1,124	150
124	2,258	16,400	5,514	900
-183	717	16,450	1,352	446
-204	2,711	16,500	5,326	856
309	1,451	16,550	1,244	484
-1,703	6,230	16,600	6,057	1,073
880	2,264	16,650	240	-11
-159	5,025	16,700	1,712	257
815	3,251	16,750	95	2
※ 1,093	8,966	16,800	2,385	-185
921	2,888	16,850	76	3
-174	6,106	16,900	815	-93
401	2,444	16,950	16	2
-248	13,222	17,000	907	-80
196	1,327	17,050	4	0
-29	5,590	17,100	141	-1
17	704	17,150	2	0
654	118,222	總計	120,601	9,016
P/C	1.0201		增減	0.0710

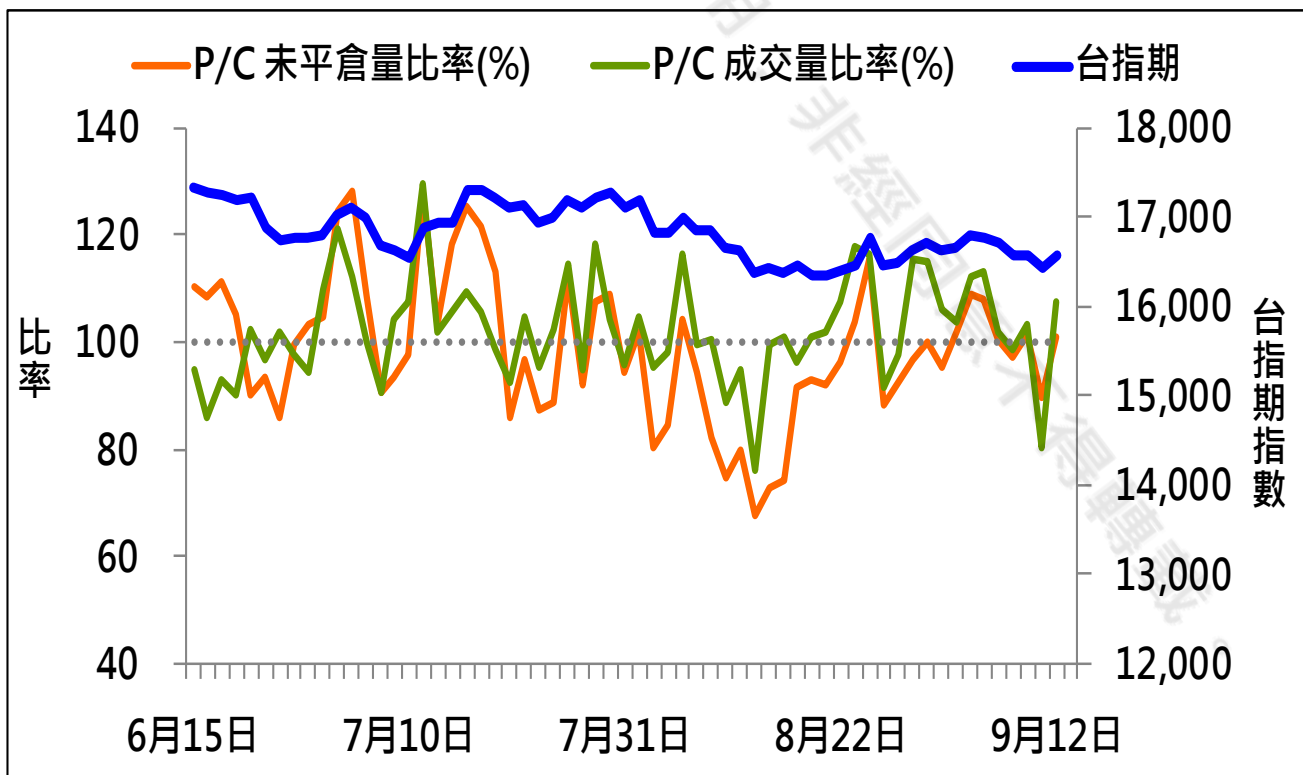
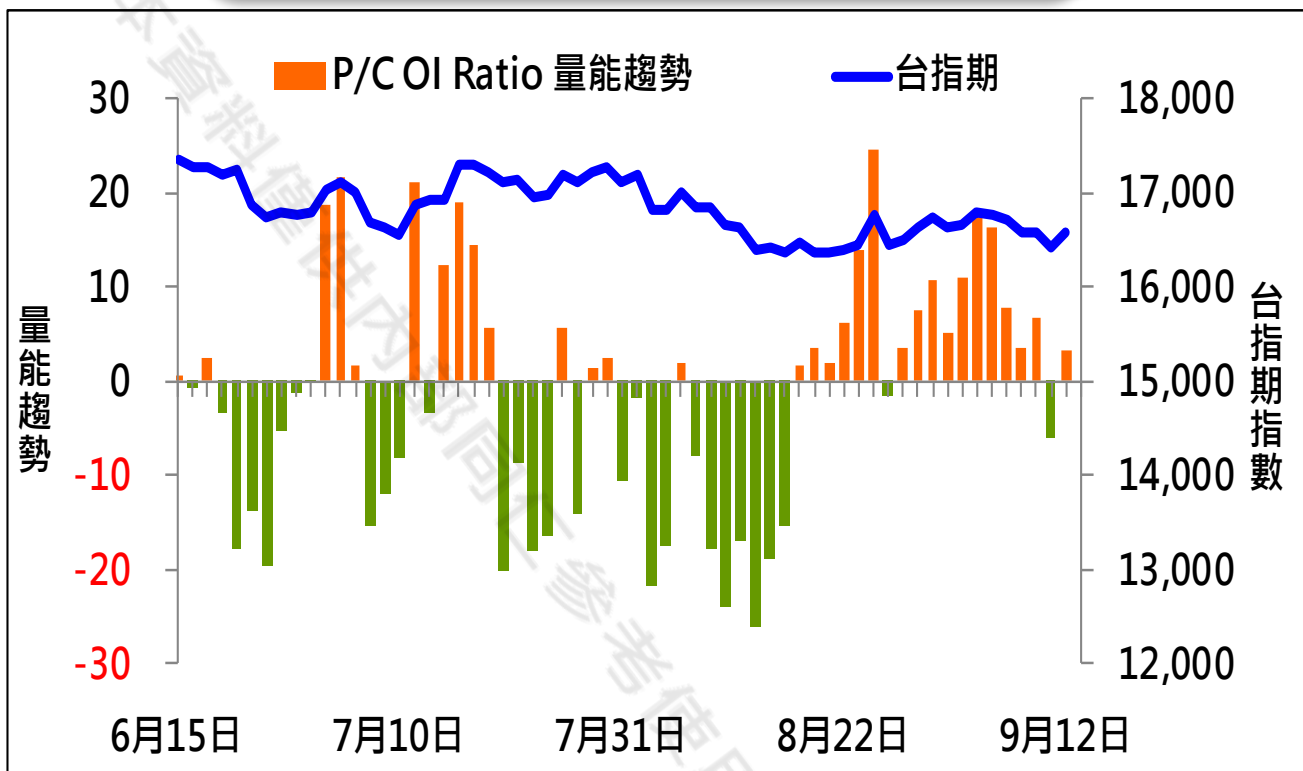
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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。

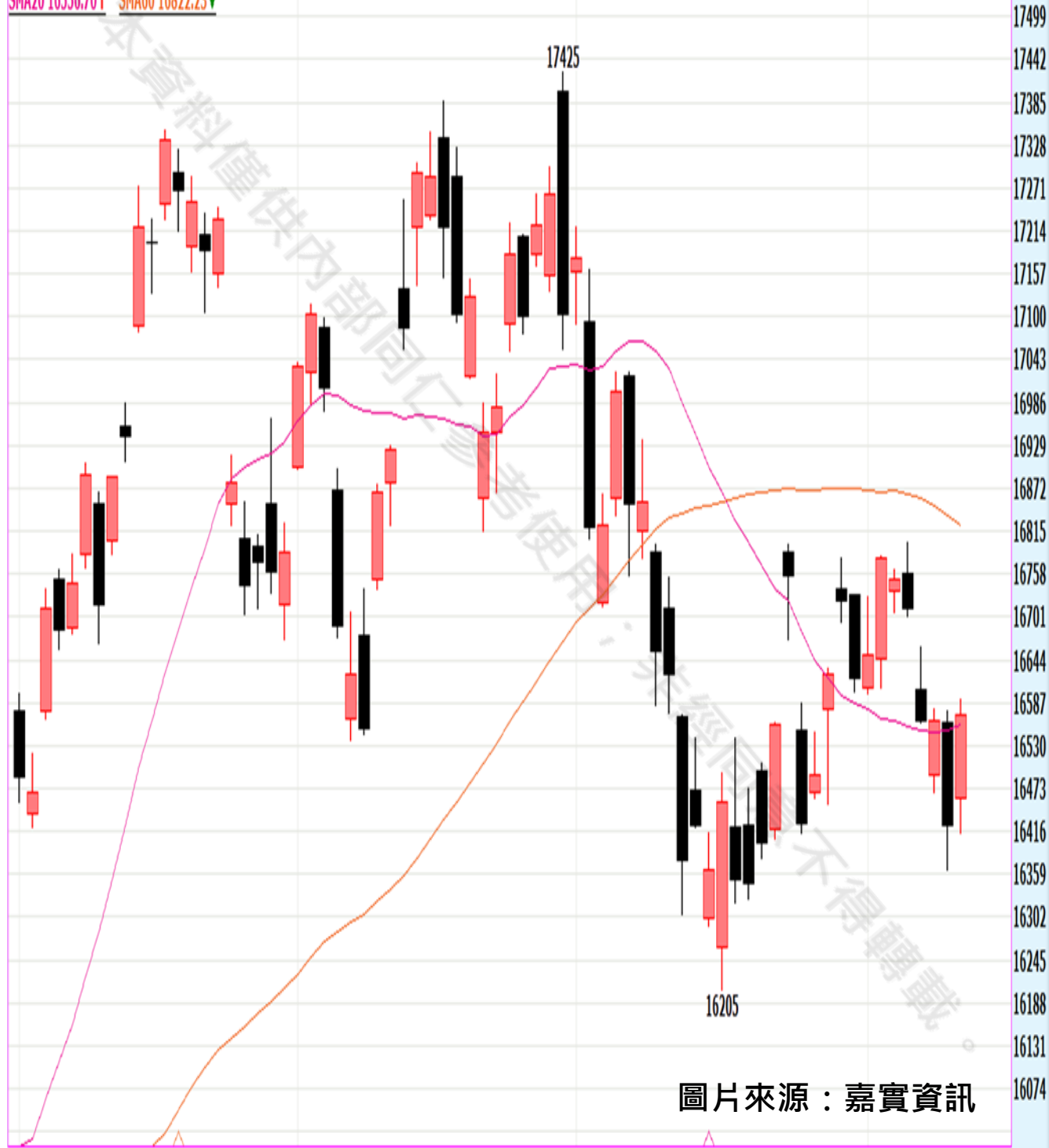
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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)(FUTX*1) 日線圖 2023/09/12 開 16459 高 16591 低 16413 收 16570 s 點量 94566 □ +145 (+0.88%)

SMA20 16556.70↑ SMA60 16822.23↓



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 (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