

法人籌碼動態

09月13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	-667	456	-495	54	259	30
投信	2,083	445	200	8	17	0
自營商	-3,154	579	-314	-81	-609	-36
09月13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	82	-2	30,002	-2,490	30,110	-1,091
投信	0	0	200	0	180	0
自營商	-93	4	-2,313	-3,437	-12,504	1,486

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口	多	空
廣達	5.60	台積電	-25.05	台指期前十大 市場佔比	34.8%	45.0%
台塑化	3.37	鴻海	-6.70			
創意	3.24	日月光投控	-4.22			
中信金	2.26	欣興	-1.72	電子期前十大 市場佔比	56.9%	57.0%
亞德客-KY	2.19	和泰車	-1.58			
世芯-KY	2.10	大立光	-1.50			
聯發科	2.06	華城	-1.43	金融期前十大 市場佔比	68.8%	72.8%
智原	1.80	中華電	-1.25			
台泥	1.66	國巨	-1.09			
南亞科	1.60	台光電	-1.02	非金電期前十大 市場佔比	98.5%	89.0%
前十名合計	25.87	後十名合計	-45.56			

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

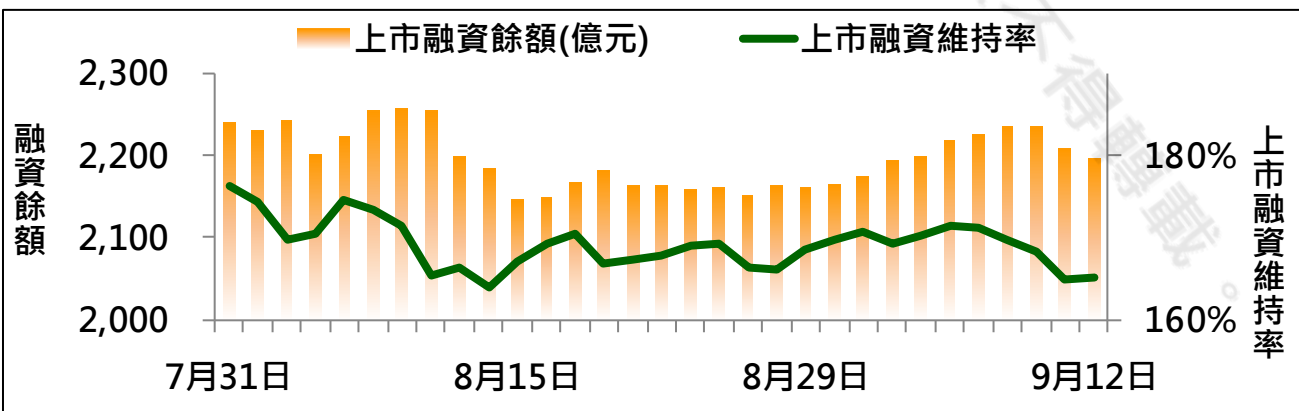
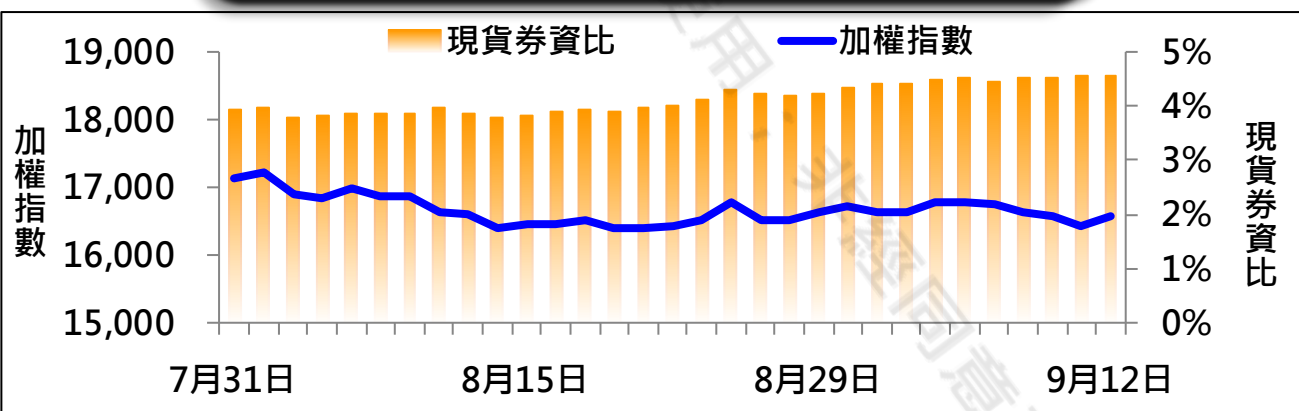
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

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
09月13日	-18.3	-667	456	-40.3	-3,154	579

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
09月13日	30,002	30,110	-108	-2,313	-12,504	10,191

現貨券資比 & 上市融資維持率



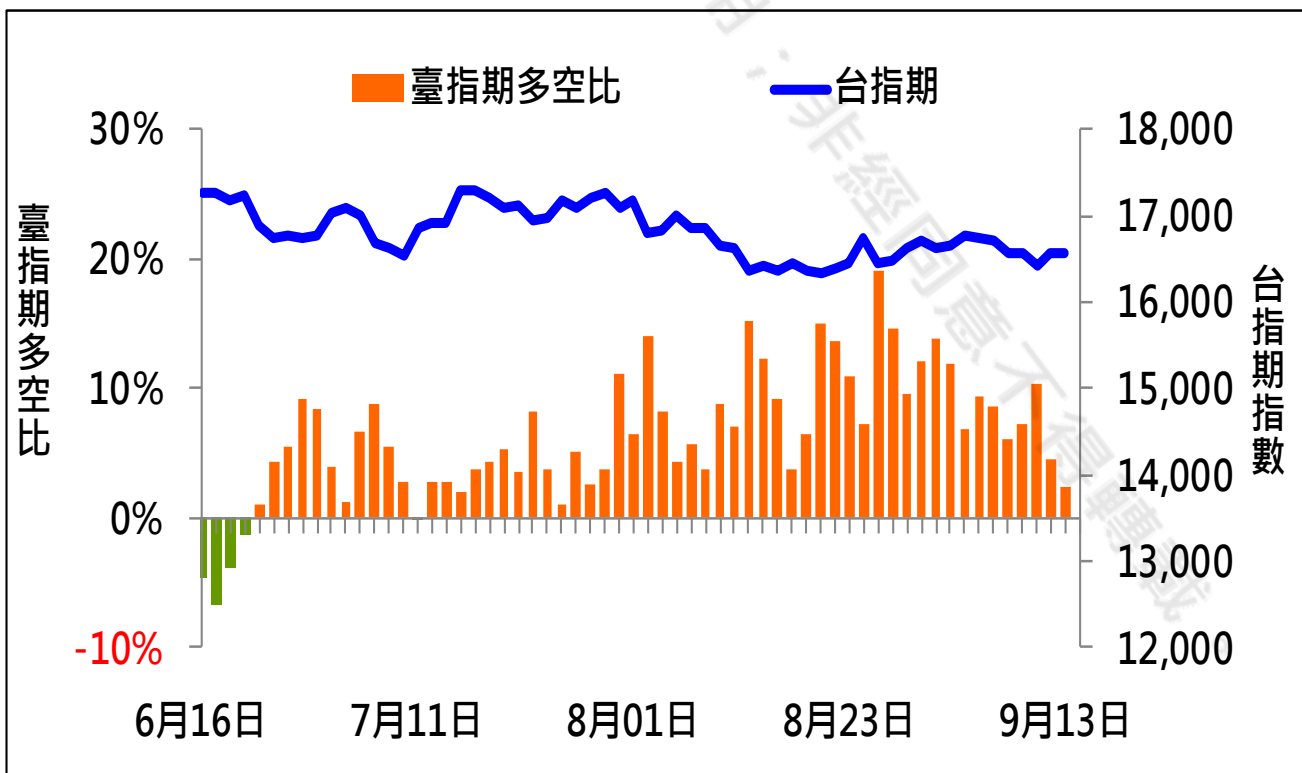
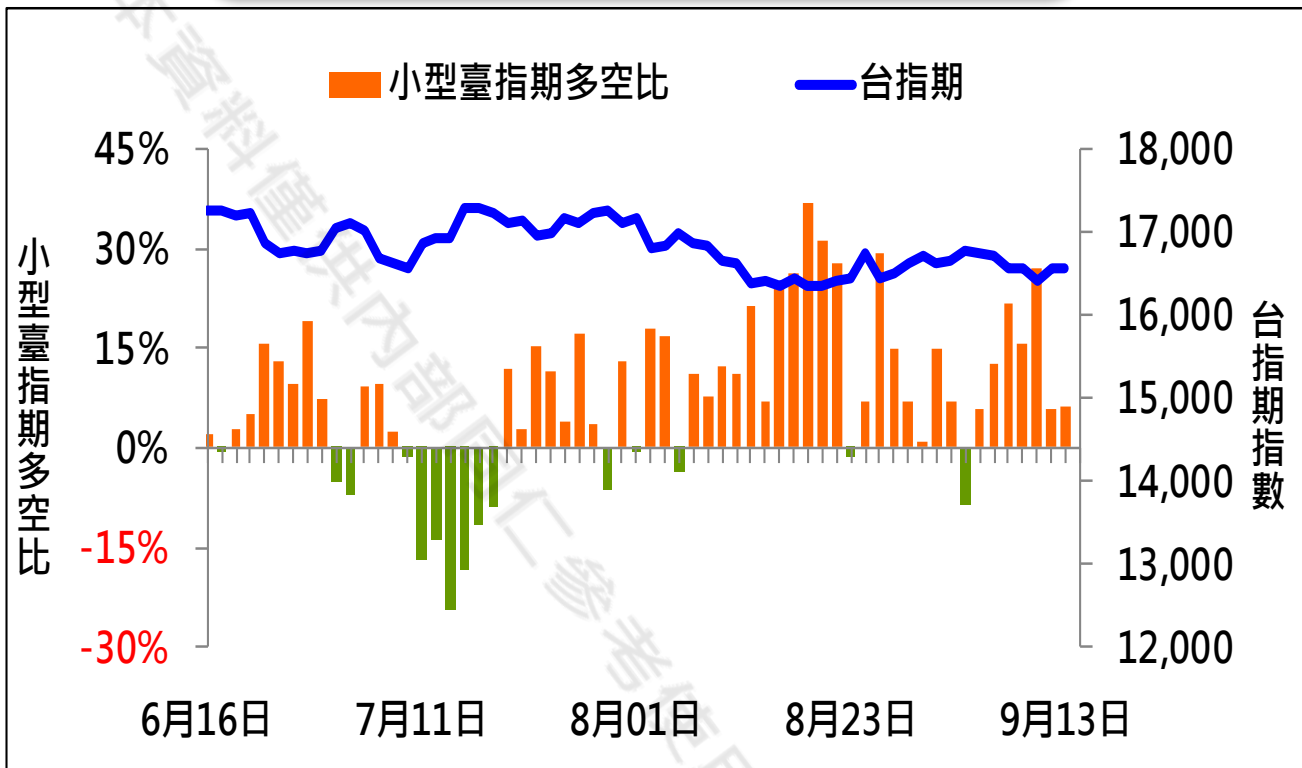
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



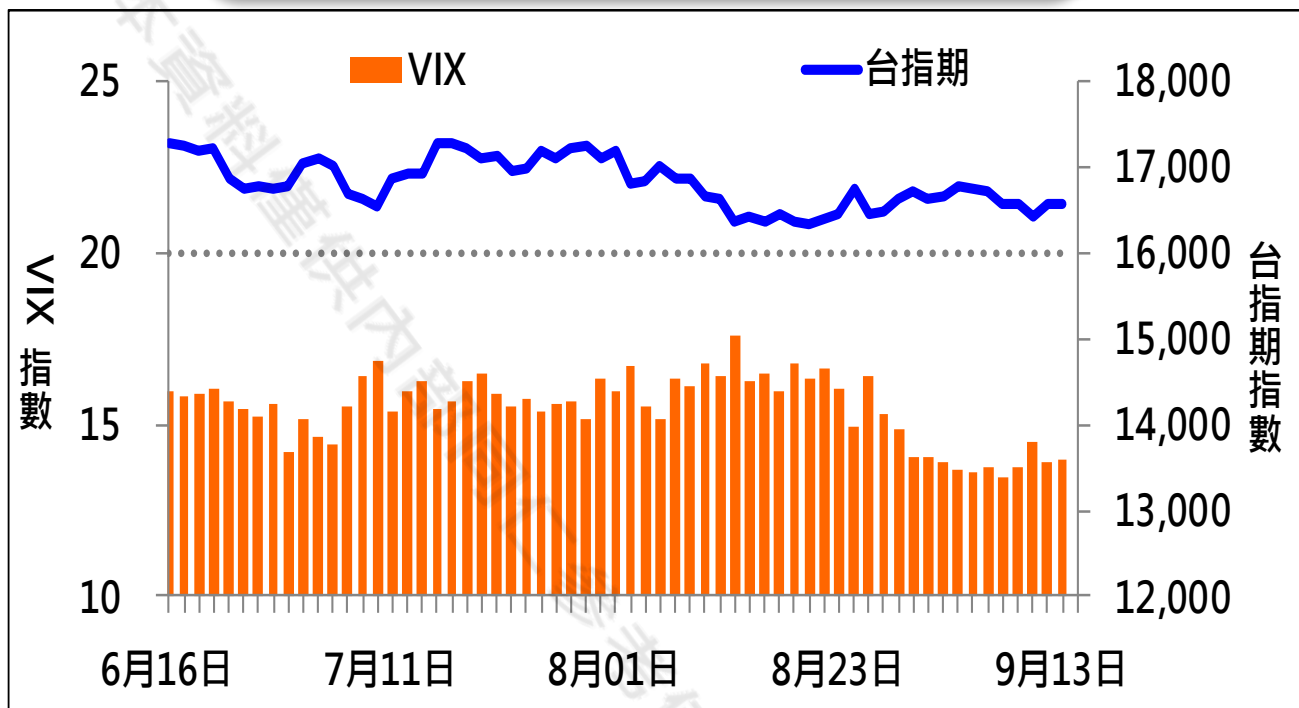
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

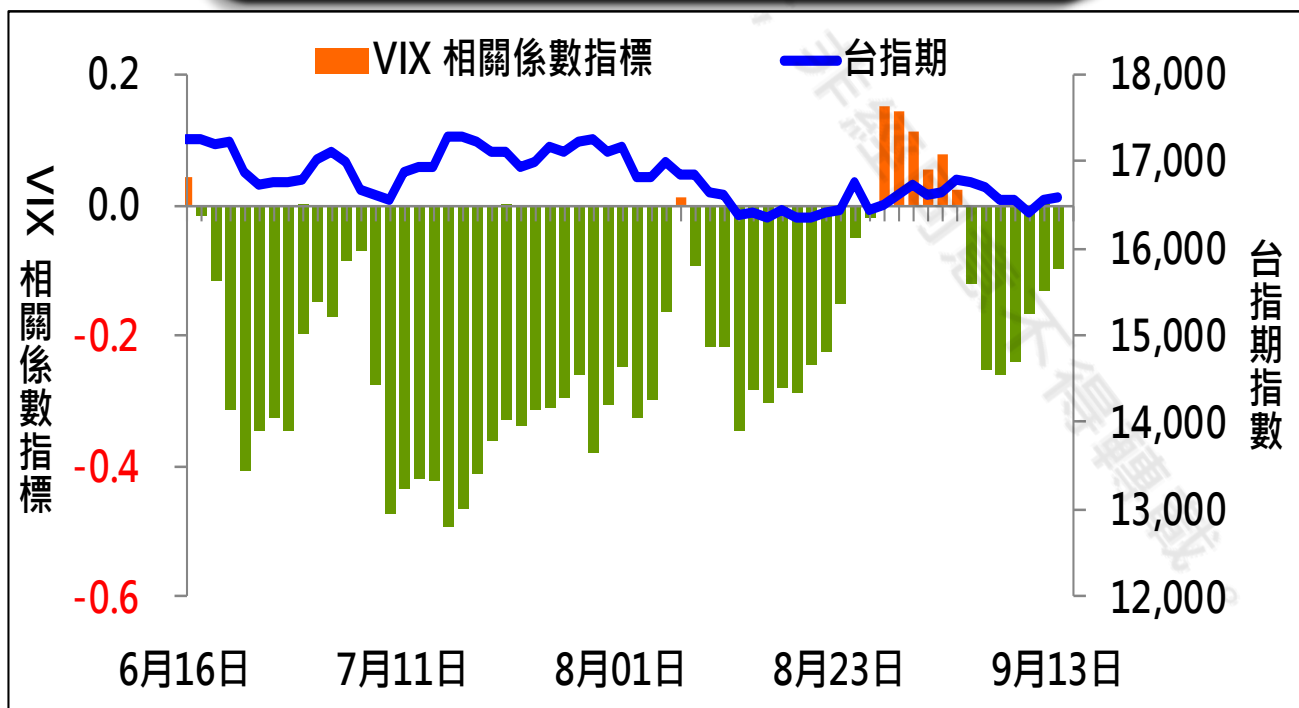
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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



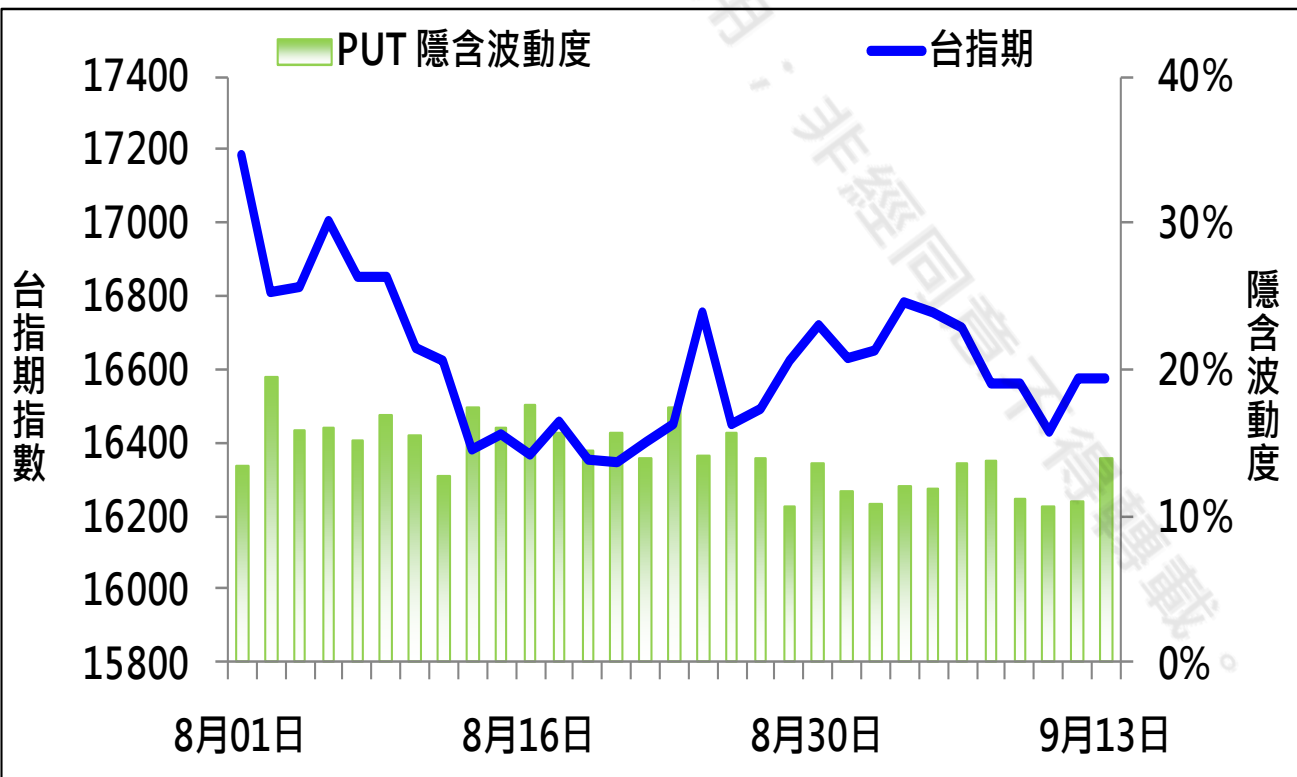
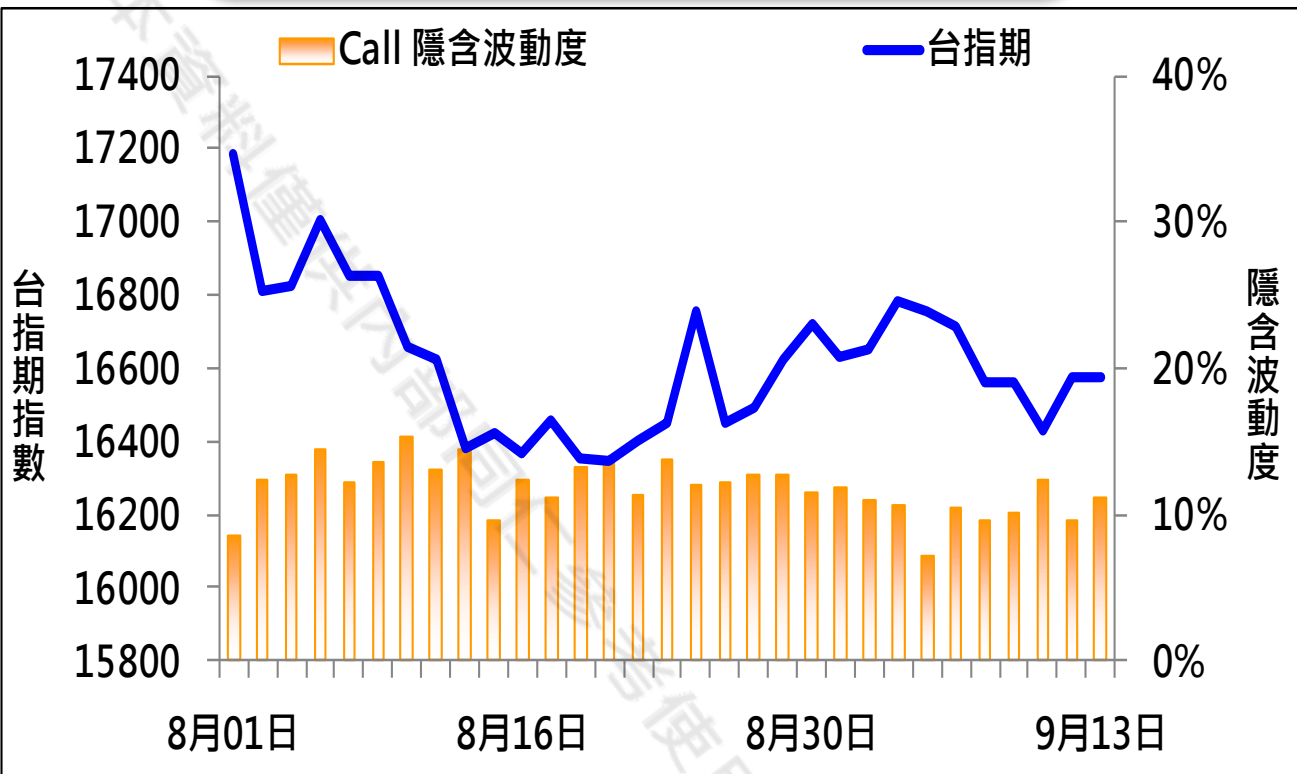
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

近月選擇權OI變化

資料日期：2023/9/13

結算日：2023/9/20

OI 增減	Call	202309 月 履約價	Put	OI 增減
5	173	16,100	7,035	-84
0	6	16,150	2,275	592
-5	925	16,200	13,606	2,684
1	60	16,250	4,390	2,691
-152	1,993	16,300	11,500	2,102
-6	365	16,350	2,131	1,007
32	2,290	16,400	7,147	1,633
-28	689	16,450	2,122	770
-32	2,679	16,500	6,488	1,162
629	2,080	16,550	2,246	1,002
748	6,978	16,600	7,524	1,467
537	2,801	16,650	995	755
※ 3,031	8,056	16,700	2,335	623
924	4,175	16,750	492	397
910	9,876	16,800	2,310	-75
1,503	4,391	16,850	93	17
1,383	7,489	16,900	810	-5
958	3,402	16,950	23	7
14	13,236	17,000	910	3
654	1,981	17,050	20	16
152	5,742	17,100	131	-10
230	934	17,150	6	4
-480	5,533	17,200	156	2
186	443	17,250	0	0
10,897	129,119	總計	141,578	20,977
P/C	1.0965		增減	0.0764

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：2023/9/13

結算日：2023/10/18

OI 增減	Call	202310 月 履約價	Put	OI 增減
0	0	15,200	359	6
0	0	15,300	456	187
0	4	15,400	440	3
0	9	15,500	901	88
0	2	15,600	1,160	-198
2	3	15,700	781	259
0	20	15,800	2,042	-13
0	22	15,900	777	51
1	36	16,000	3,319	182
0	29	16,100	2,075	76
2	25	16,200	883	15
19	116	16,300	1,815	77
3	151	16,400	2,431	589
95	775	16,500	1,492	-27
470	798	16,600	1,245	102
185	870	16,700	353	68
55	827	16,800	231	10
159	2,008	16,900	78	0
※ 1,463	2,843	17,000	55	-2
-377	3,494	17,100	5	0
192	3,545	17,200	38	1
-44	2,830	17,300	15	0
61	3,252	17,400	3	0
55	1,974	17,500	10	6
2,589	30,548	總計	23,765	1,561
P/C	0.7780		增減	-0.0162

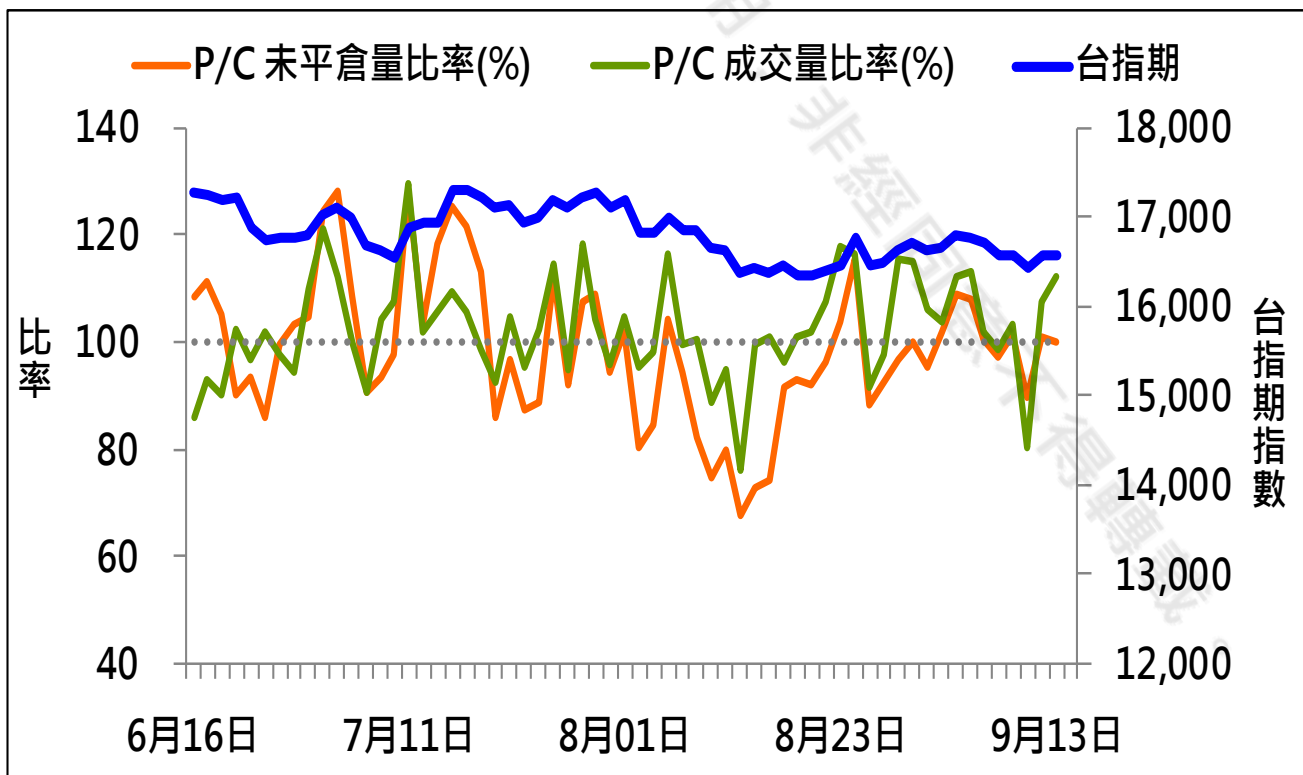
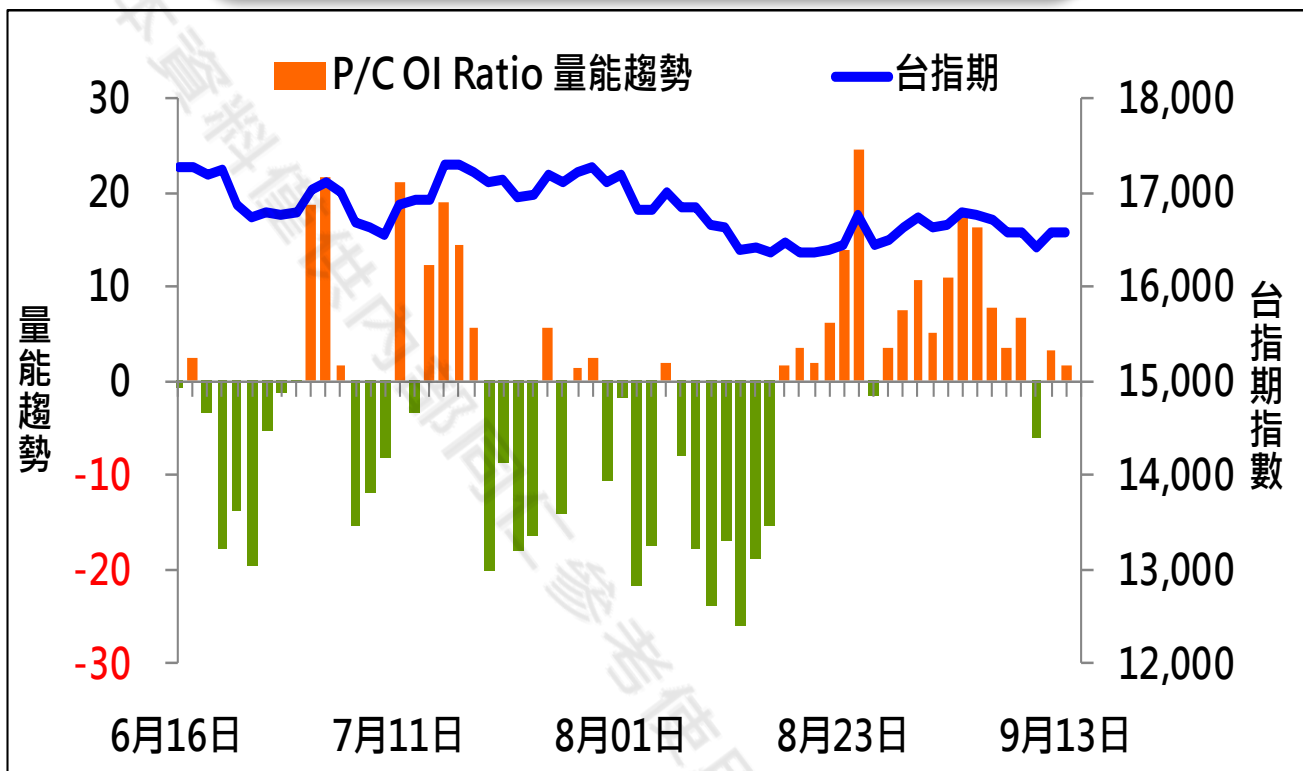
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

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 2023/09/13 開 16570 高 16645 低 16523 收 16579 s點 量 79200 口 +9 (+0.05%)

SMA5 16539.80 ↓ SMA20 16567.45 ↑ SMA60 16810.73 ↓ SMA120 16428.81 ↑



圖片來源：嘉實資訊

期權交易財務槓桿高，交易者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，交易者須自行判斷與負責，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