

法人籌碼動態

09月15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	-1,469	-3,405	-569	-41	203	-39
投信	1,949	-610	196	-4	17	0
自營商	-2,151	1,823	-147	55	-582	6
09月15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	61	-2	37,141	2,769	31,606	1,955
投信	0	0	200	0	280	100
自營商	-75	0	-4,416	-6,068	-4,940	9,059

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	66.92	台塑化	-3.69	台指期前十大 市場佔比	35.8%	43.5%
聯發科	15.48	廣達	-2.49			
長榮	6.14	鴻海	-2.24			
智邦	3.70	玉山金	-1.84	電子期前十大 市場佔比	57.9%	59.3%
聯詠	2.85	富邦金	-1.81			
南電	2.71	華碩	-1.68			
南亞科	2.40	健策	-1.51	金融期前十大 市場佔比	68.2%	74.6%
緯穎	2.26	智原	-1.48			
欣興	2.21	緯創	-1.40			
祥碩	2.13	技嘉	-1.33	非金電期前十大 市場佔比	93.6%	90.1%
前十名合計	106.80	後十名合計	-19.48			

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

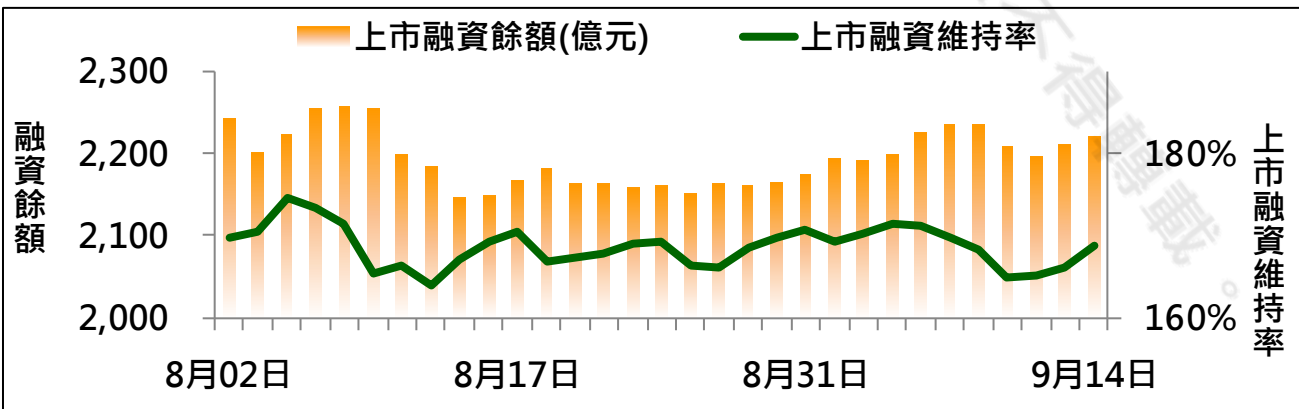
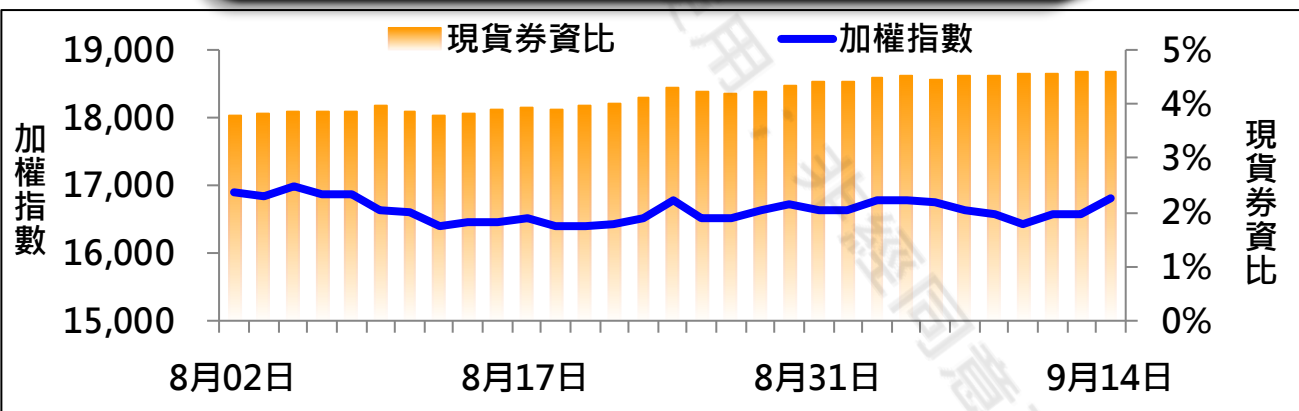
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

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
09月14日	189.4	1,936	2,603	3.0	-3,974	-820
09月15日	84.6	-1,469	-3,405	-26.9	-2,151	1,823

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
09月14日	34,372	29,651	4,721	1,652	-13,999	15,651
09月15日	37,141	31,606	5,535	-4,416	-4,940	524

現貨券資比 & 上市融資維持率



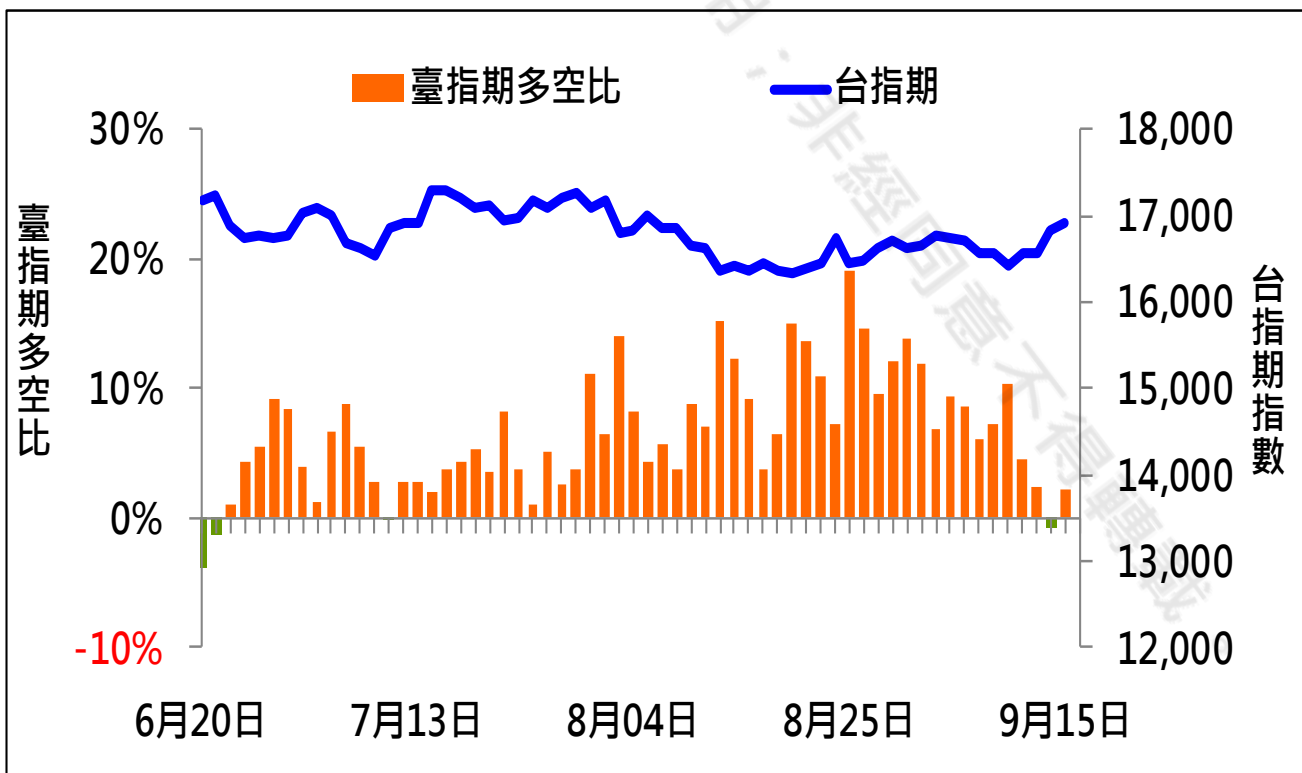
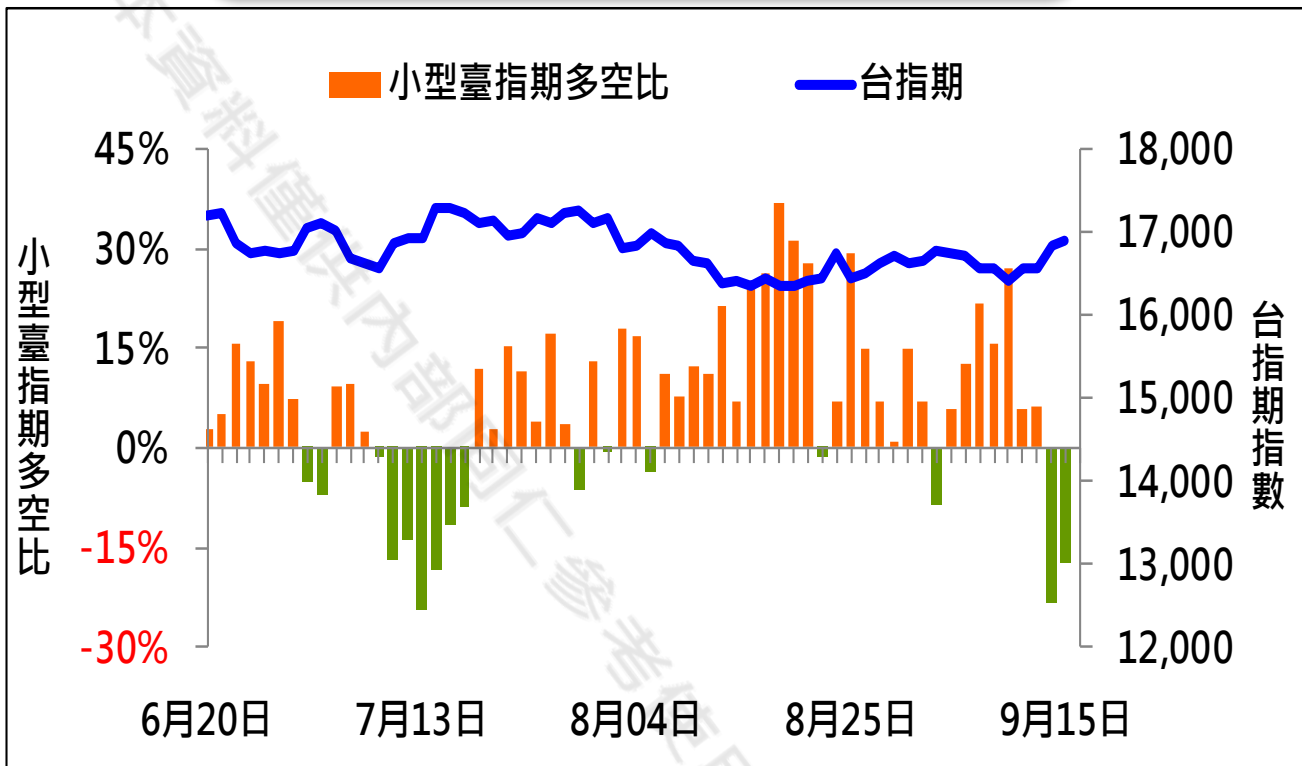
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



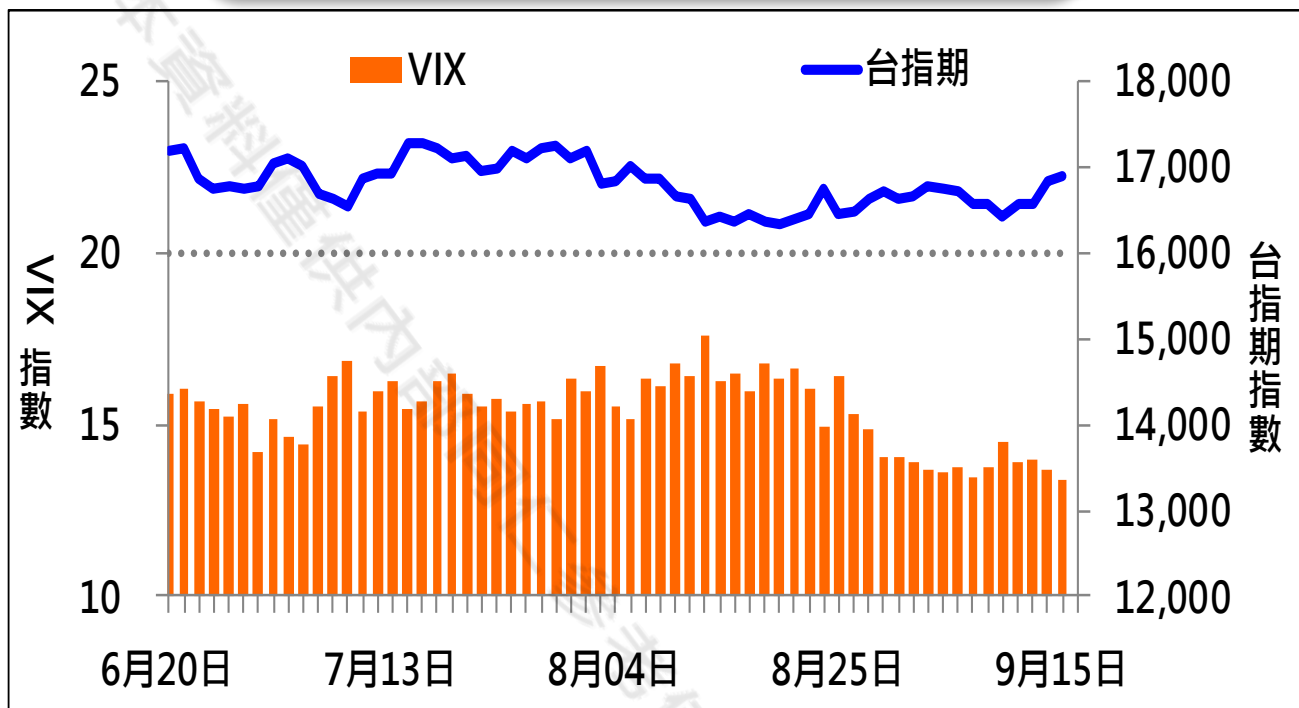
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

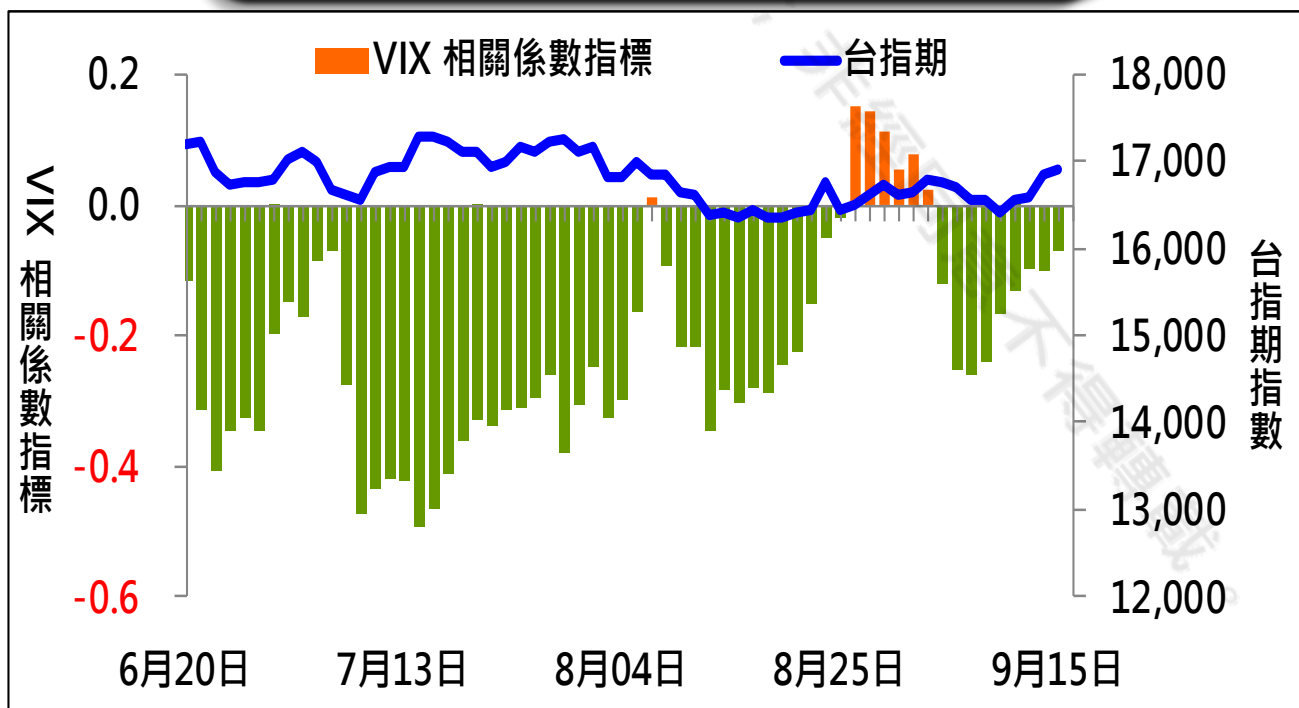
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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



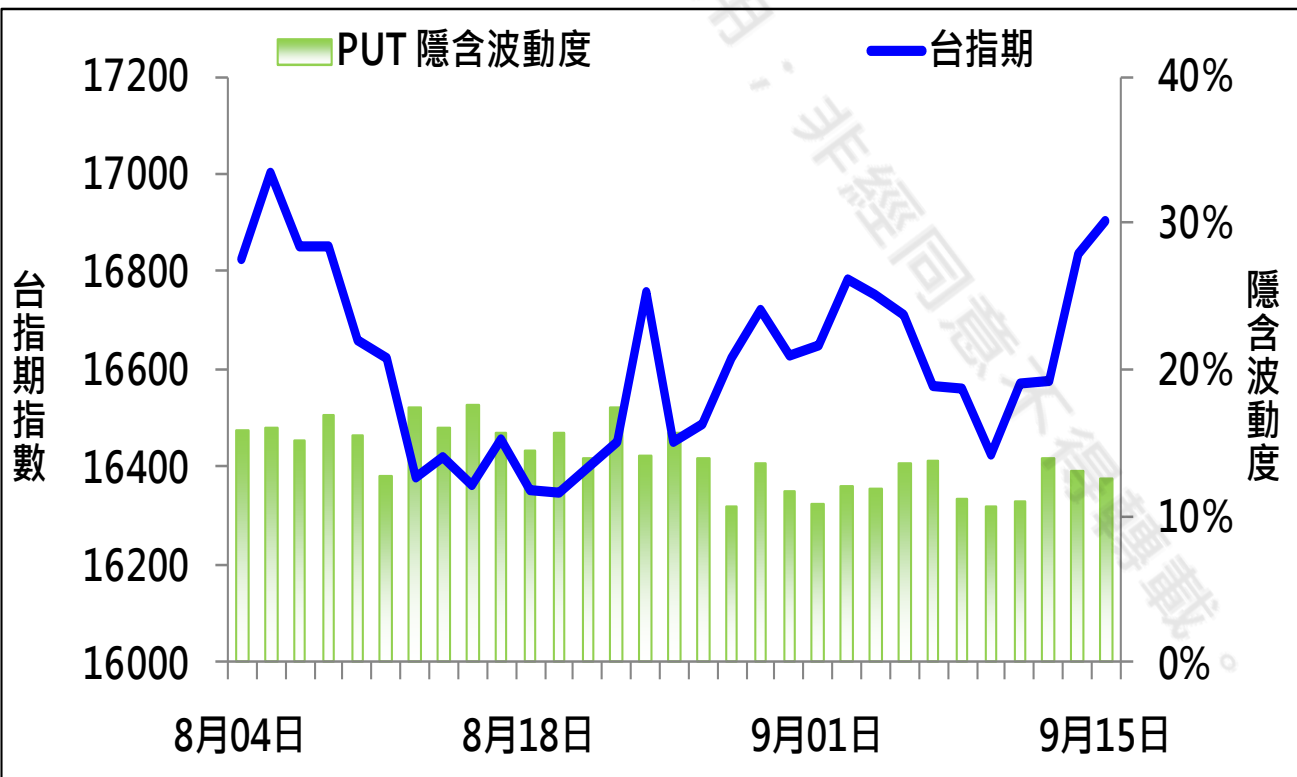
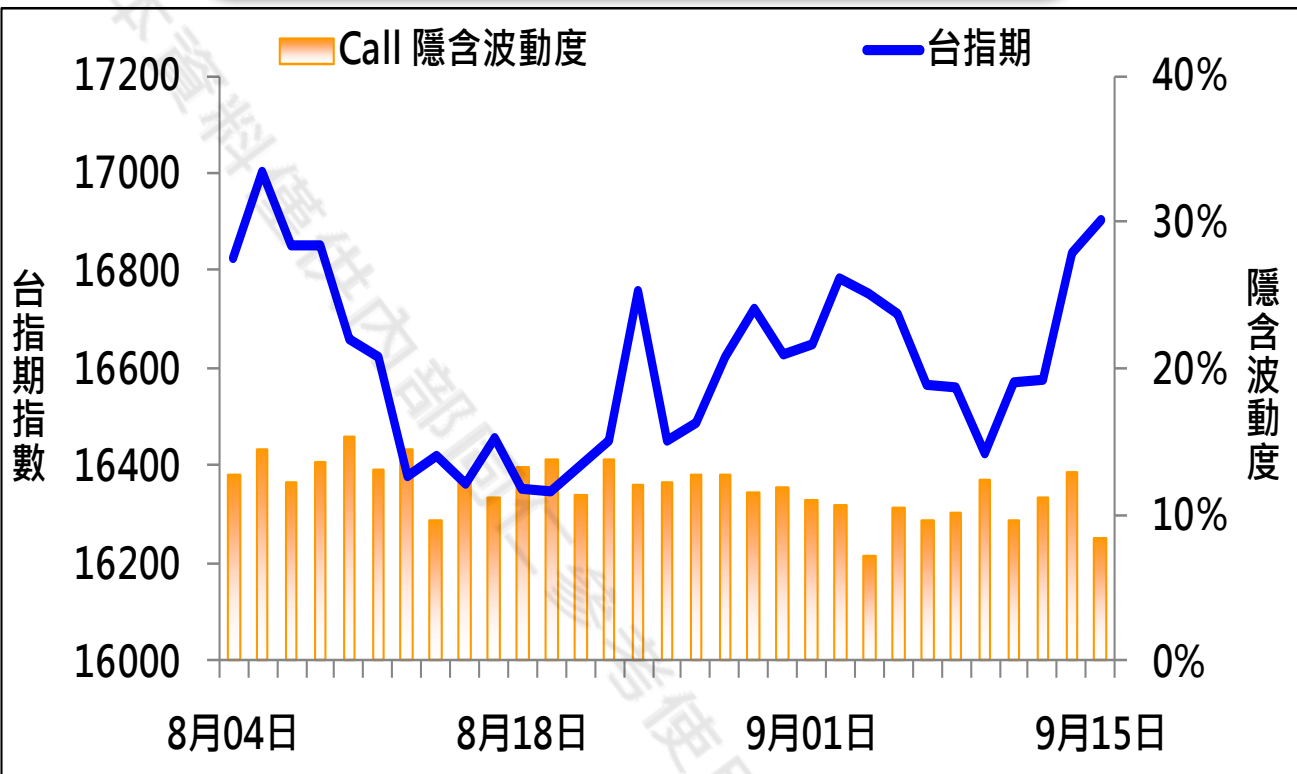
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2023/9/15

結算日：2023/9/20

OI 增減	Call	202309 月 履約價	Put	OI 增減
-5	902	16,200	12,390	-2,299
-13	37	16,250	5,155	-1,156
-49	1,811	16,300	13,118	-656
-41	303	16,350	4,744	344
-113	1,973	16,400	11,447	-1,055
-44	735	16,450	6,884	1,451
-50	2,217	16,500	11,254	-606
-141	1,732	16,550	6,830	670
-87	6,238	16,600	15,117	2,931
-510	2,633	16,650	7,469	3,199
-1,007	4,004	16,700	10,550	3,990
-595	3,397	16,750	8,214	1,286
-462	11,378	16,800	7,878	2,916
-545	4,955	16,850	4,328	1,654
-283	10,008	16,900	3,992	2,482
529	7,835	16,950	1,165	952
405	16,826	17,000	1,767	538
1,479	7,606	17,050	252	205
※ 5,346	13,239	17,100	331	165
2,115	3,968	17,150	34	16
1,530	8,117	17,200	187	24
1,067	1,981	17,250	1	-1
603	7,221	17,300	502	-5
1,046	7,082	17,400	207	11
10,469	159,977	總計	210,328	12,648
P/C	1.3147		增減	-0.0075

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：2023/9/15

結算日：2023/10/18

OI 增減	Call	202310 月 履約價	Put	OI 增減
0	2	15,600	966	-13
0	3	15,700	874	80
0	21	15,800	2,154	127
0	23	15,900	1,281	31
0	35	16,000	3,729	299
2	31	16,100	2,196	108
0	27	16,200	1,117	103
-19	86	16,300	2,168	139
-11	134	16,400	4,201	1,106 ※
-5	744	16,500	1,610	-23
-59	727	16,600	866	-584
-9	904	16,700	545	-69
43	965	16,800	484	114
280	2,469	16,900	299	52
492	3,436	17,000	220	104
-609	3,042	17,100	17	7
162	3,855	17,200	87	37
267	3,264	17,300	20	5
93	3,594	17,400	4	1
※ 725	3,014	17,500	4	0
107	1,423	17,600	3	0
41	550	17,700	21	0
15	662	17,800	3	0
0	40	18,400	0	0
1,770	34,989	總計	28,267	1,940
P/C	0.8079		增減	0.0154

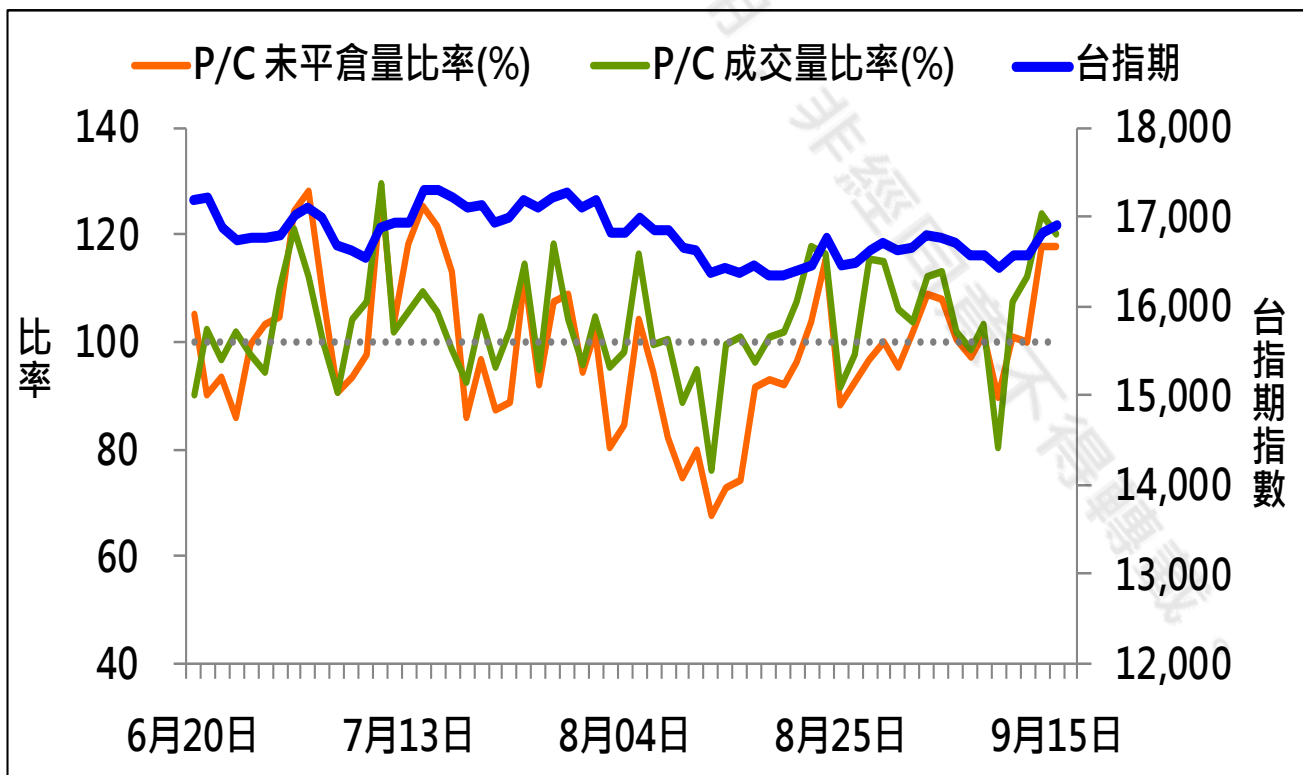
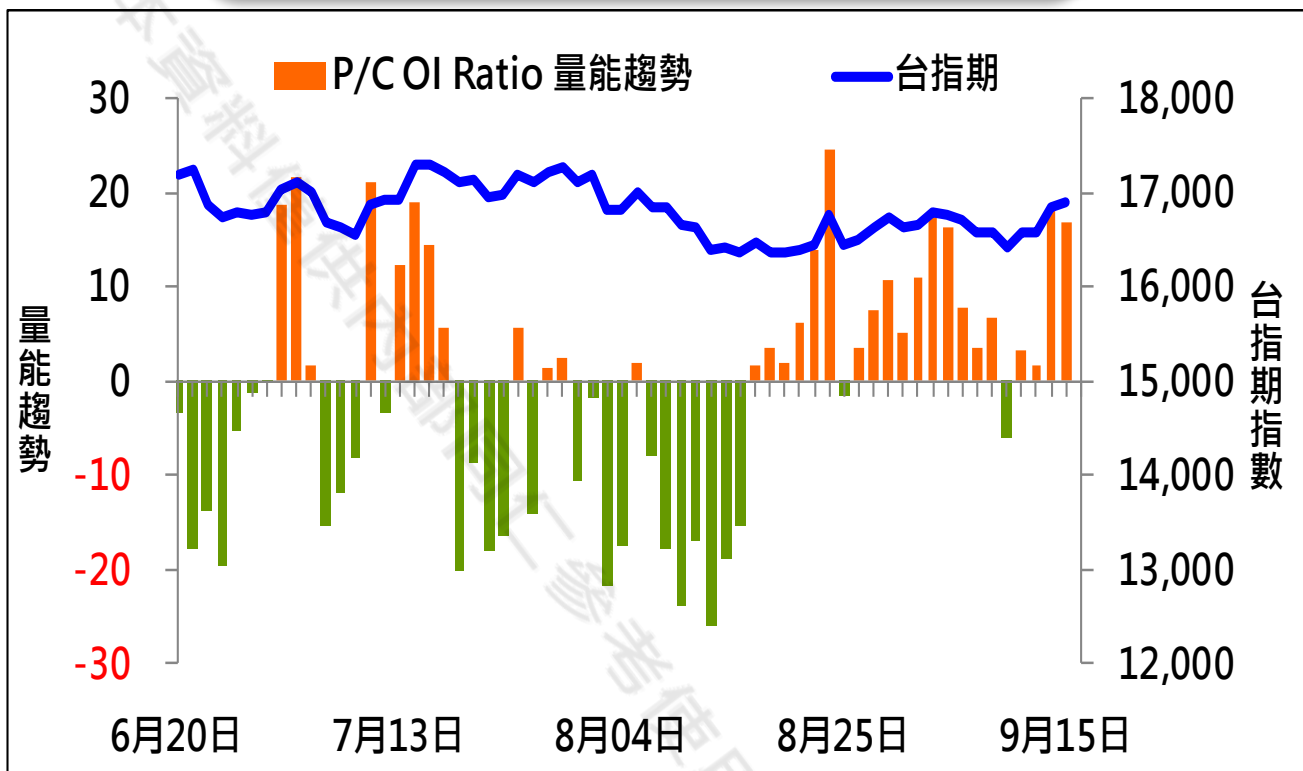
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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 2023/09/15 開 16848 高 16918 收 16906 ↑ 點 量 76226 □ +70 (+0.42%)



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