

法人籌碼動態

09月20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	-6,165	2,234	-307	254	251	42
投信	2,234	225	190	0	17	0
自營商	-1,466	-1,341	-258	45	-452	74
09月20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	17	-49	16,491	-25,821	16,073	-22,220
投信	0	0	0	-200	-118	-398
自營商	-41	40	-2,459	20,520	3,615	-229

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口	多	空
文晔	2.96	台積電	-25.08	台指期前十大 市場佔比	43.3%	54.6%
微星	2.59	聯發科	-7.22			
技嘉	2.05	智邦	-5.60			
台化	1.32	世芯-KY	-3.61	電子期前十大 市場佔比	59.6%	52.6%
長榮	1.02	國泰金	-3.40			
台塑化	0.92	創意	-2.81			
台光電	0.91	聯詠	-2.75	金融期前十大 市場佔比	76.9%	82.2%
致茂	0.89	欣興	-2.46			
華城	0.88	富邦金	-2.26			
萬海	0.72	中租-KY	-2.23	非金電期前十大 市場佔比	100.0%	91.5%
前十名合計	14.28	後十名合計	-57.41			

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

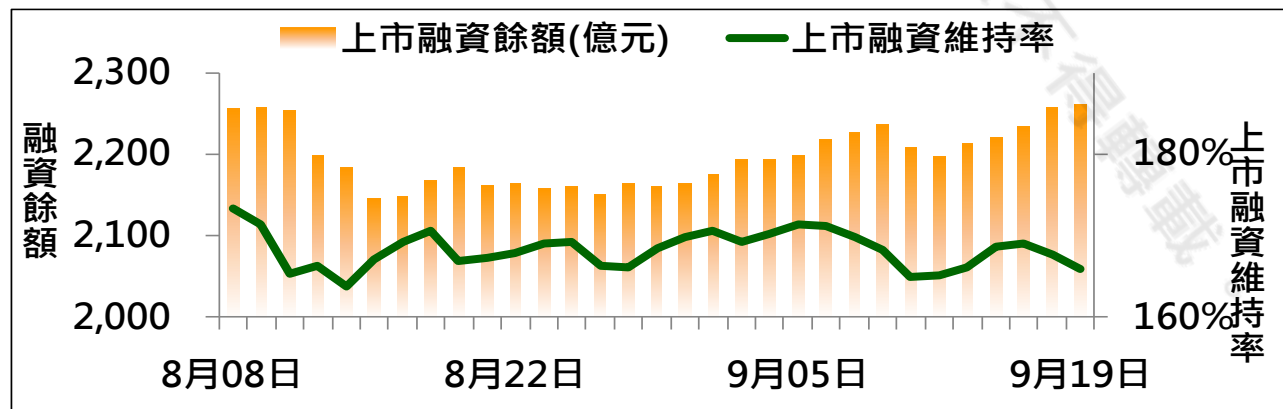
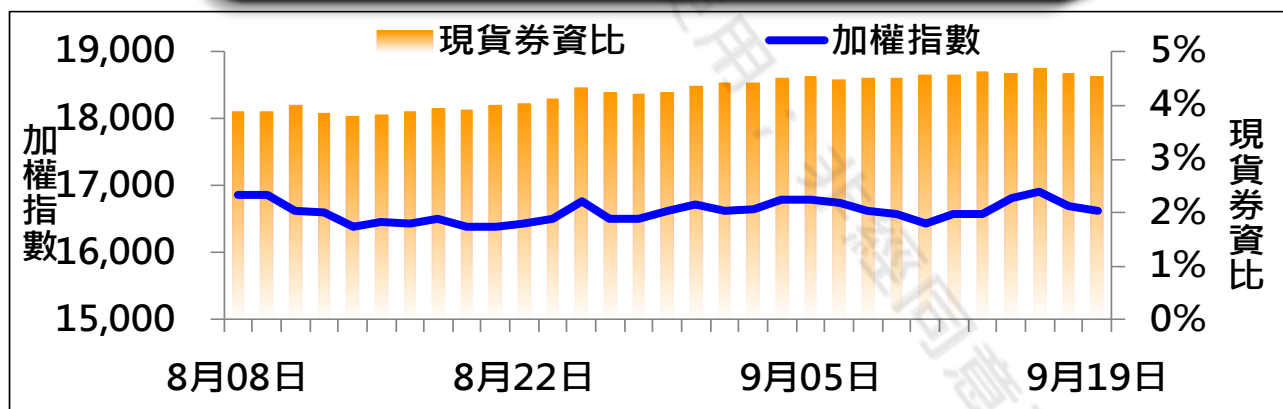
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

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
09月18日	-258.2	-6,811	-5,342	-96.9	-510	1,641
09月19日	-127.2	-8,399	-1,588	-65.4	-125	385
09月20日	-182.0	-6,165	2,234	-93.4	-1,466	-1,341

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
09月18日	40,439	36,298	4,141	-19,559	3,539	-23,098
09月19日	42,312	38,293	4,019	-22,979	3,844	-26,823
09月20日	16,491	16,073	418	-2,459	3,615	-6,074

現貨券資比 & 上市融資維持率



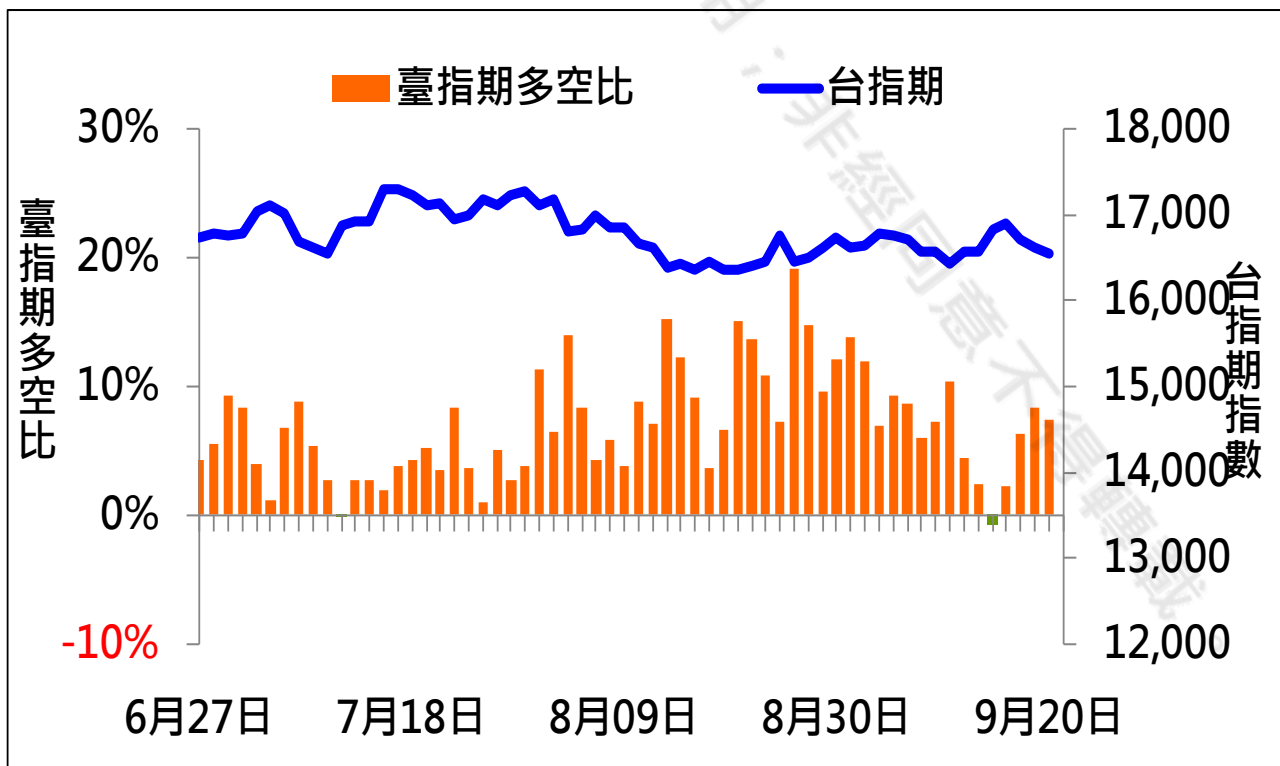
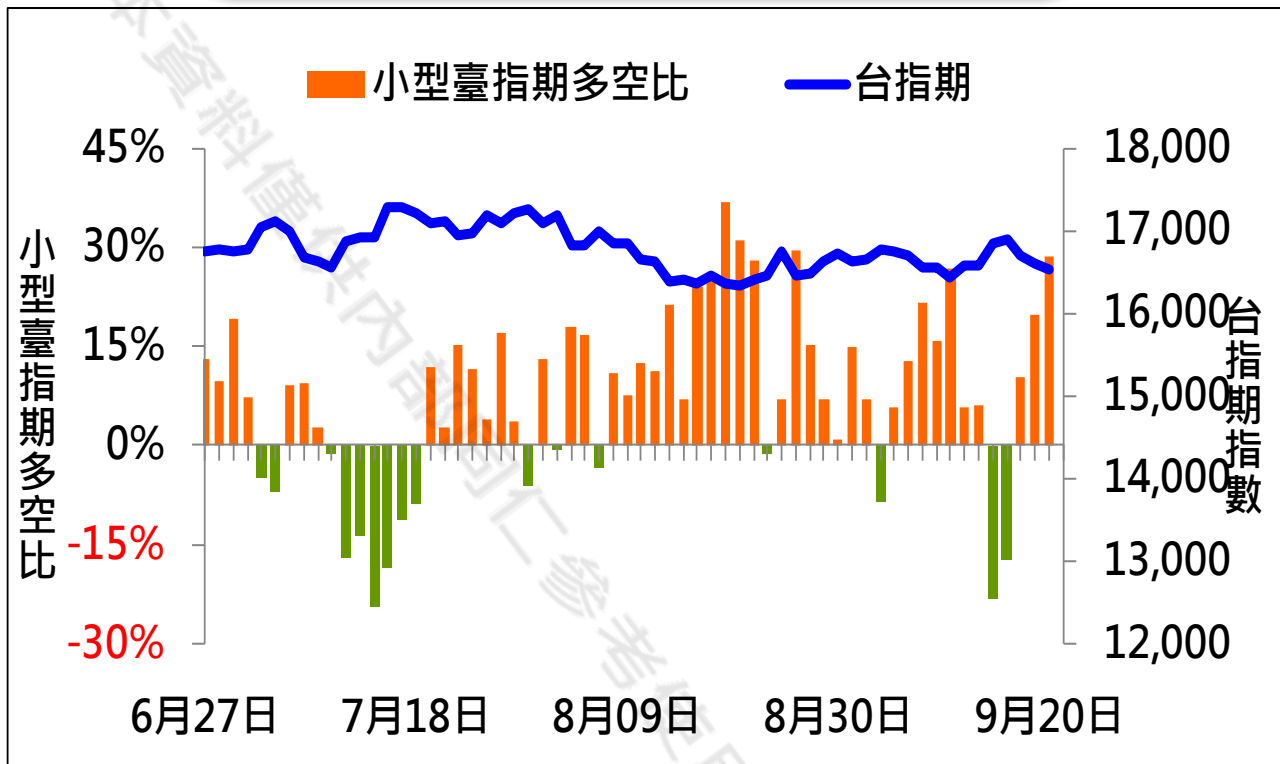
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



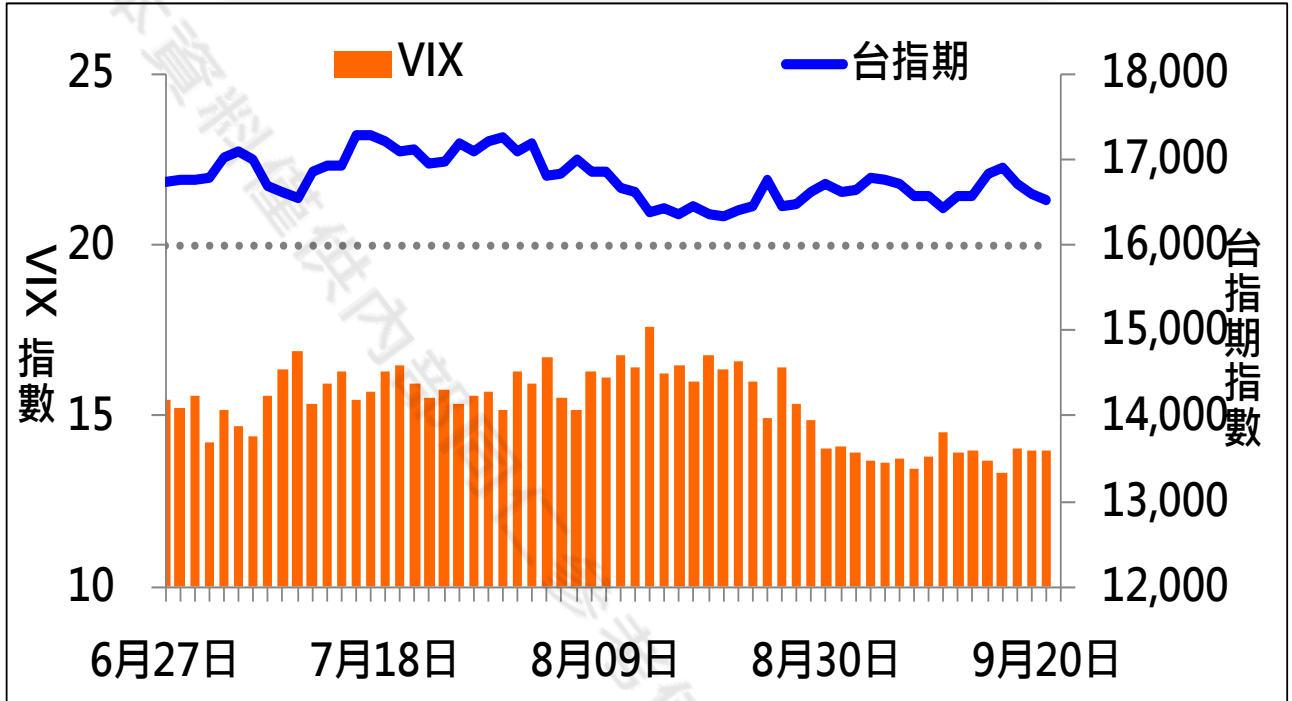
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

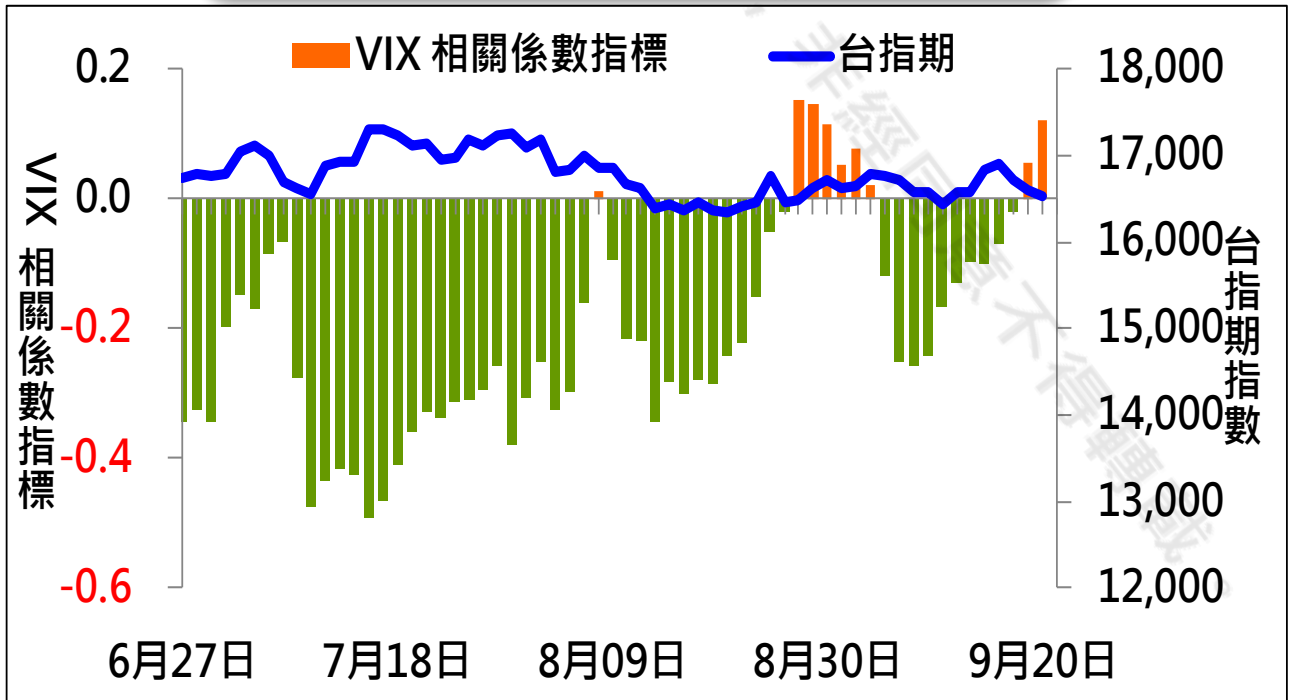
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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



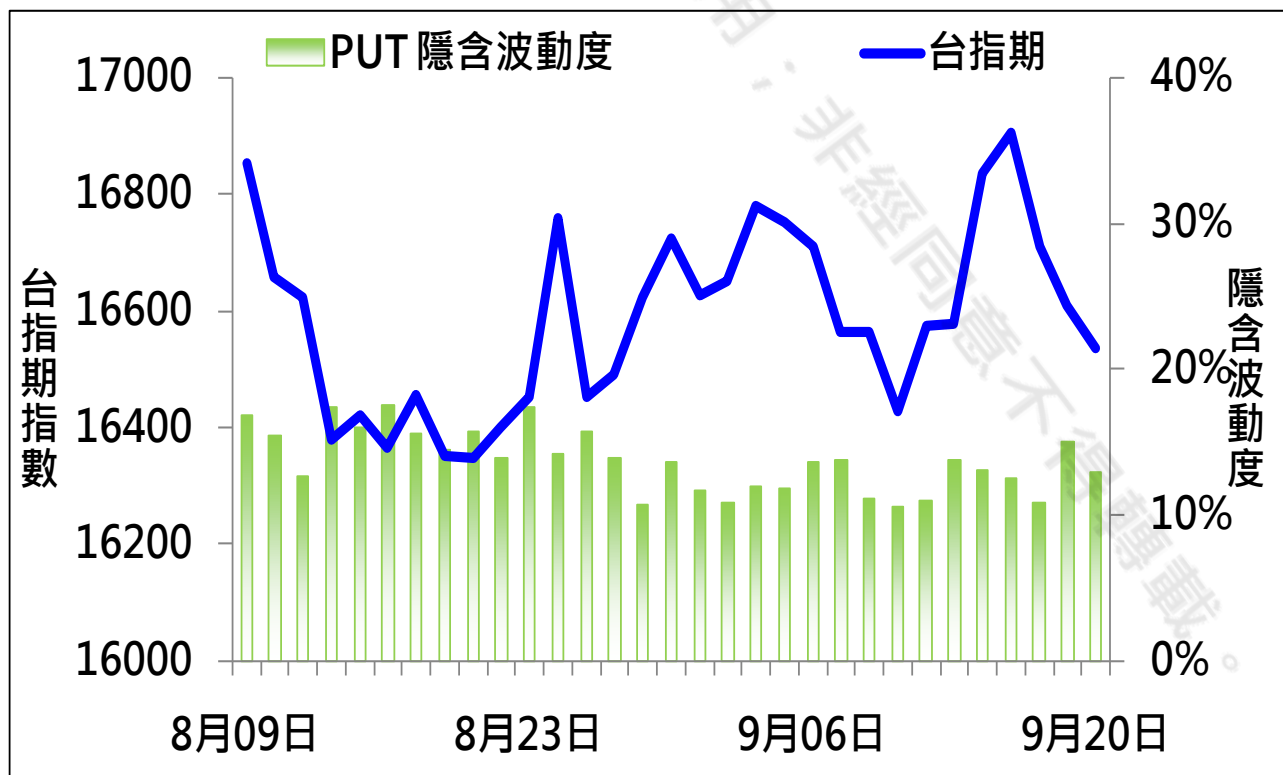
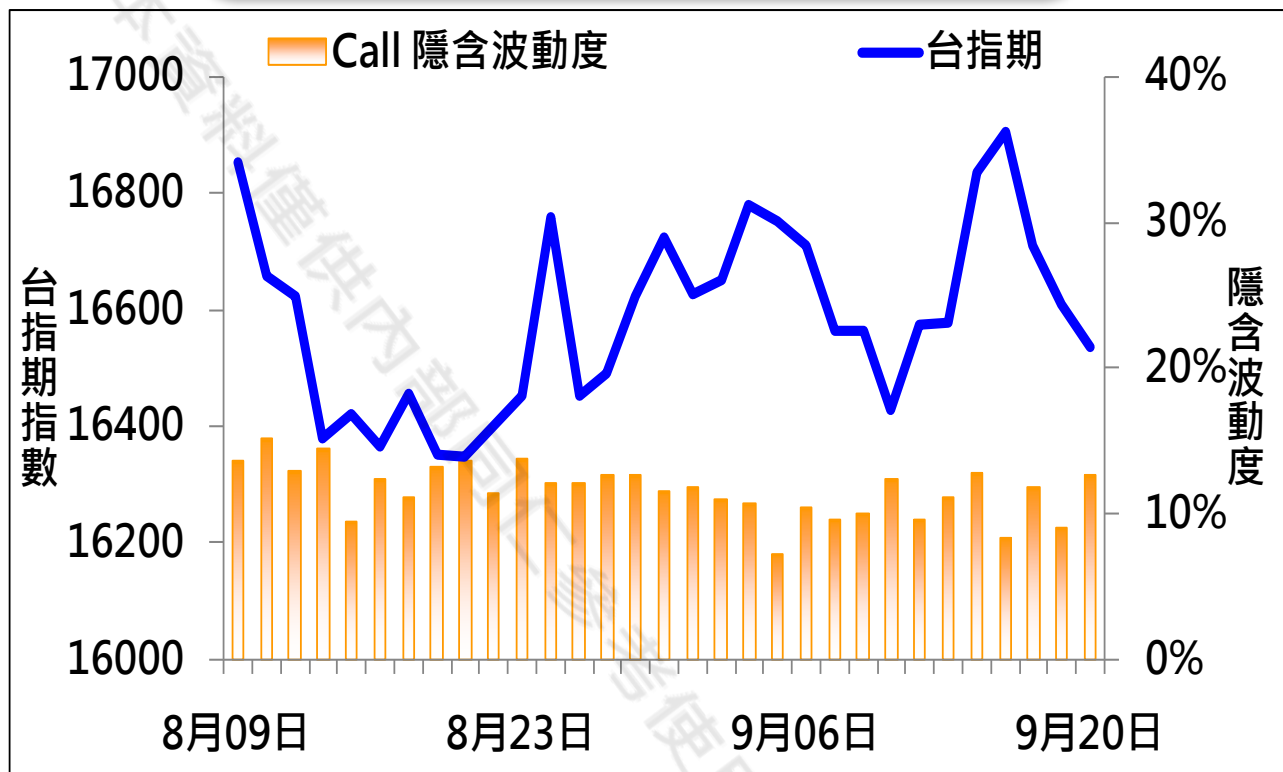
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

2023/9/20

2023/9/27

OI 增減	Call	202309W4 履約價	Put	OI 增減
0	0	15,600	846	710
0	0	15,700	604	418
0	0	15,800	1,072	615
0	1	15,900	545	253
1	3	16,000	1,739	954
1	3	16,100	2,157	467
3	8	16,150	1,020	472
7	9	16,200	2,294	1,471
5	29	16,250	2,055	1,369
97	102	16,300	4,171	2,882 ※
48	57	16,350	1,916	857
212	242	16,400	2,364	904
175	209	16,450	1,683	604
310	432	16,500	3,114	1,716
860	1,004	16,550	2,168	1,110
1,552	1,891	16,600	2,444	1,053
578	1,713	16,650	1,091	-8
※ 2,772	4,207	16,700	1,491	274
1,288	2,994	16,750	612	-149
2,050	4,214	16,800	735	12
1,438	2,507	16,850	221	-9
2,232	3,689	16,900	198	26
922	2,451	16,950	143	-1
1,565	4,181	17,000	148	-41
20,610	43,097	總計	37,608	16,269
P/C	0.8726		增減	-0.0763

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

2023/9/20

2023/10/18

OI 增減	Call	202310月 履約價	Put	OI 增減
0	0	15,200	915	25
4	4	15,300	564	31
0	4	15,400	627	83
0	9	15,500	1,235	283
1	3	15,600	1,459	165
2	5	15,700	1,323	234
0	21	15,800	3,443	173
0	23	15,900	2,162	227
1	36	16,000	4,242	-265
4	38	16,100	2,311	94
40	71	16,200	2,313	498
14	139	16,300	4,593	776
216	431	16,400	4,777	137
78	924	16,500	2,010	362
436	1,171	16,600	1,122	181
328	1,739	16,700	596	-33
602	2,793	16,800	1,169	402
299	3,500	16,900	280	-28
798	5,873	17,000	144	-59
767	4,116	17,100	69	6
※ 875	5,880	17,200	101	3
310	4,163	17,300	11	-2
171	4,585	17,400	6	1
-4	1,132	18,000	1	0
6,084	51,502	總計	39,536	3,644
P/C	0.7677		增減	-0.0226

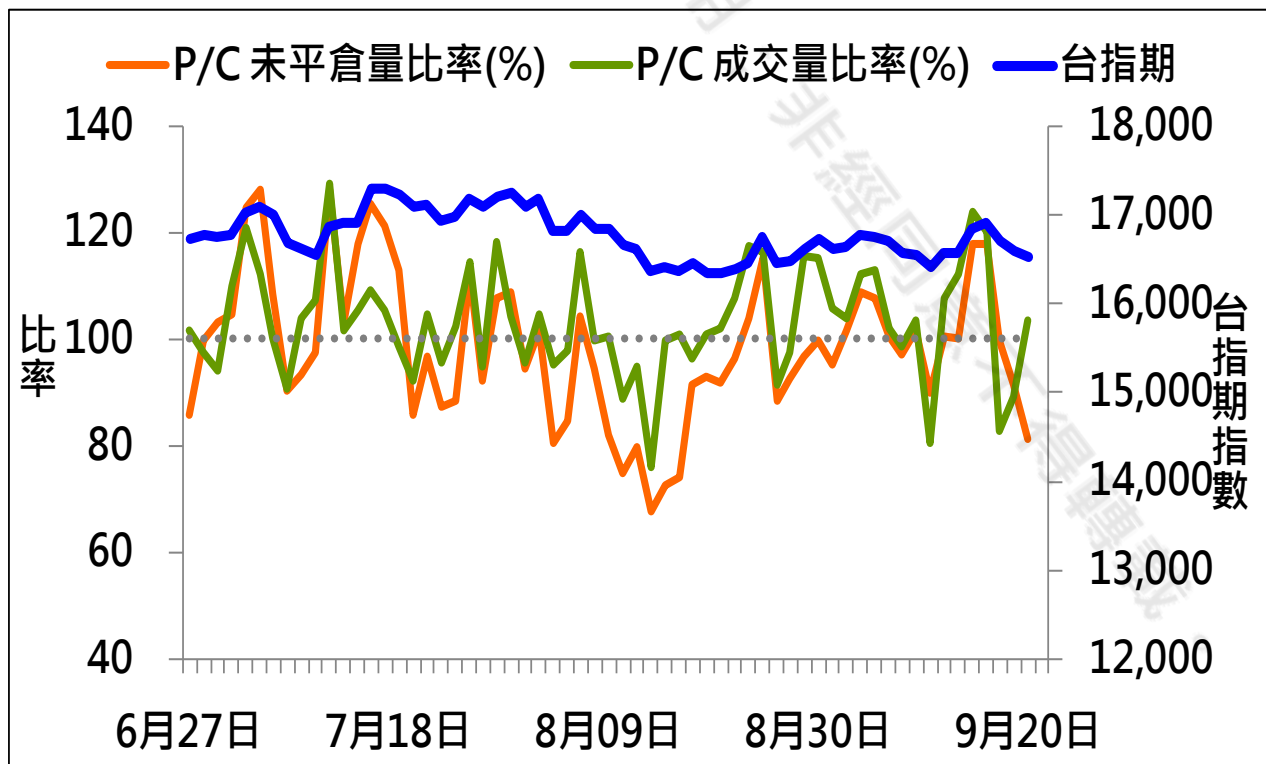
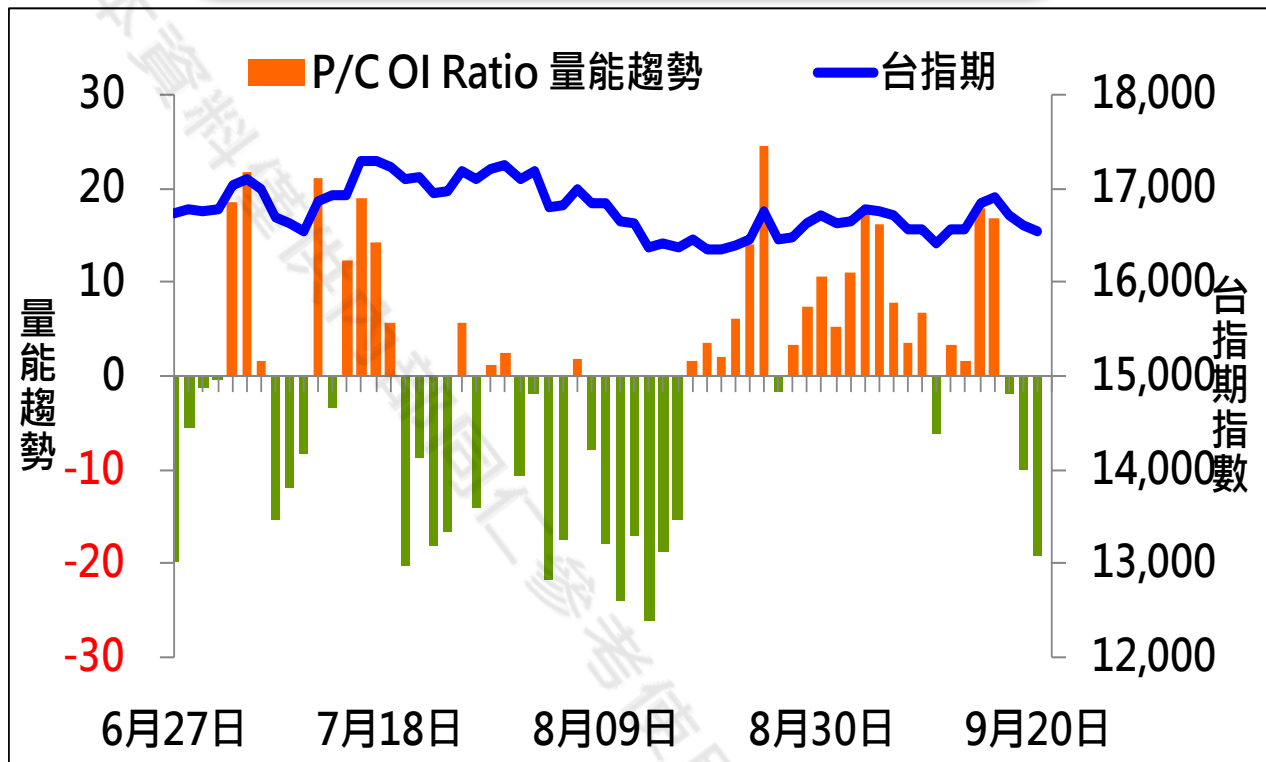
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



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