

法人籌碼動態

09月26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	-6,116	-1,079	-314	34	403	-38
投信	2,774	-421	182	-8	17	0
自營商	-414	1,661	-307	-54	-617	9
09月26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	34	-4	20,966	2,770	23,401	1,248
投信	0	0	200	0	82	0
自營商	-51	-2	9,964	-7,505	4,455	-851

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口	多	空
奇鋌	2.51	台積電	-50.04	台指期前十大 市場佔比	40.0%	42.5%
華城	1.22	聯發科	-9.26			
智邦	0.90	台達電	-8.35			
亞翔	0.73	鴻海	-6.69	電子期前十大 市場佔比	43.2%	53.7%
旭隼	0.71	廣達	-5.59			
台光電	0.70	日月光投控	-4.92			
台灣大	0.68	聯電	-3.62	金融期前十大 市場佔比	74.4%	75.7%
森崴能源	0.45	台塑化	-3.37			
天鈺	0.45	富邦金	-3.15			
高力	0.34	南亞	-2.55	非金電期前十大 市場佔比	100.0%	85.4%
前十名合計	8.68	後十名合計	-97.55			

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

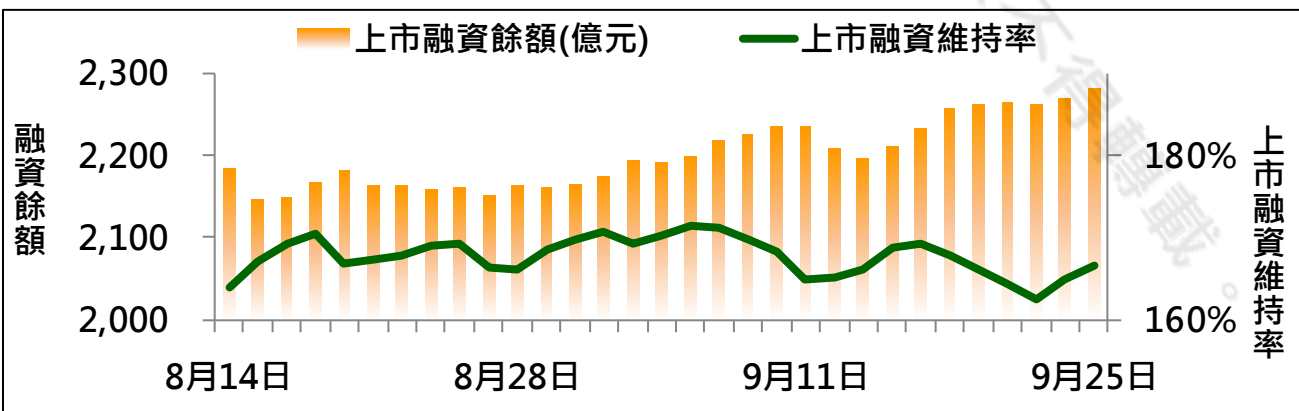
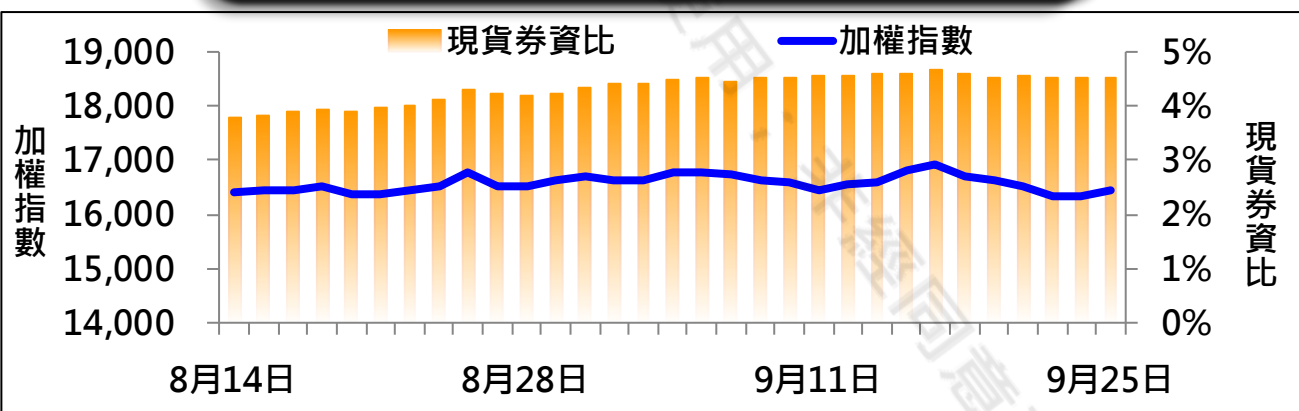
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

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20日	-182.0	-6,165	2,234	-93.4	-1,466	-1,341
09月21日	-339.8	-13,203	-7,038	-60.0	-842	624
09月22日	-151.2	-10,613	2,590	-16.9	-808	34
09月25日	-30.8	-5,037	5,576	-10.4	-2,075	-1,267
09月26日	-231.3	-6,116	-1,079	-69.5	-414	1,661

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20日	16,491	16,073	418	-2,459	3,615	-6,074
09月21日	13,883	20,792	-6,909	-8,328	9,903	-18,231
09月22日	15,256	21,516	-6,260	600	10,762	-10,162
09月25日	18,196	22,153	-3,957	17,469	5,306	12,163
09月26日	20,966	23,401	-2,435	9,964	4,455	5,509

現貨券資比 & 上市融資維持率



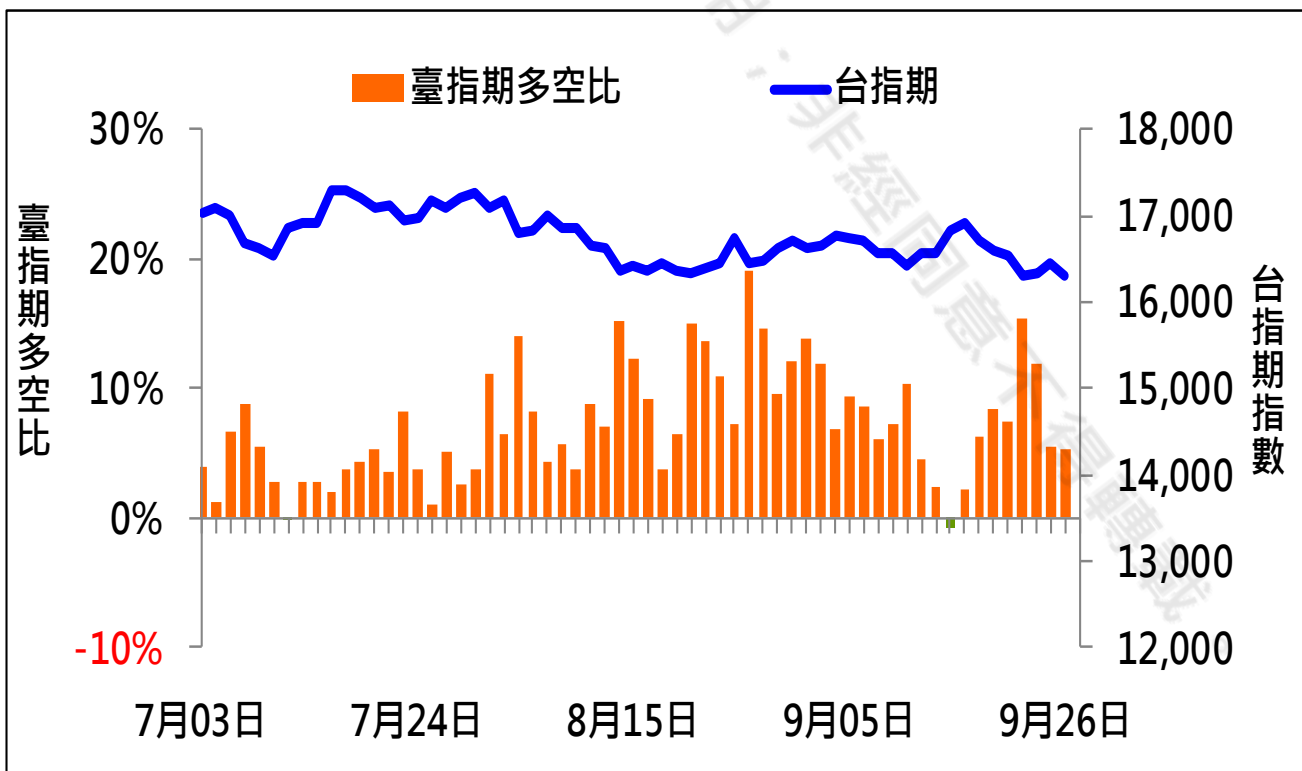
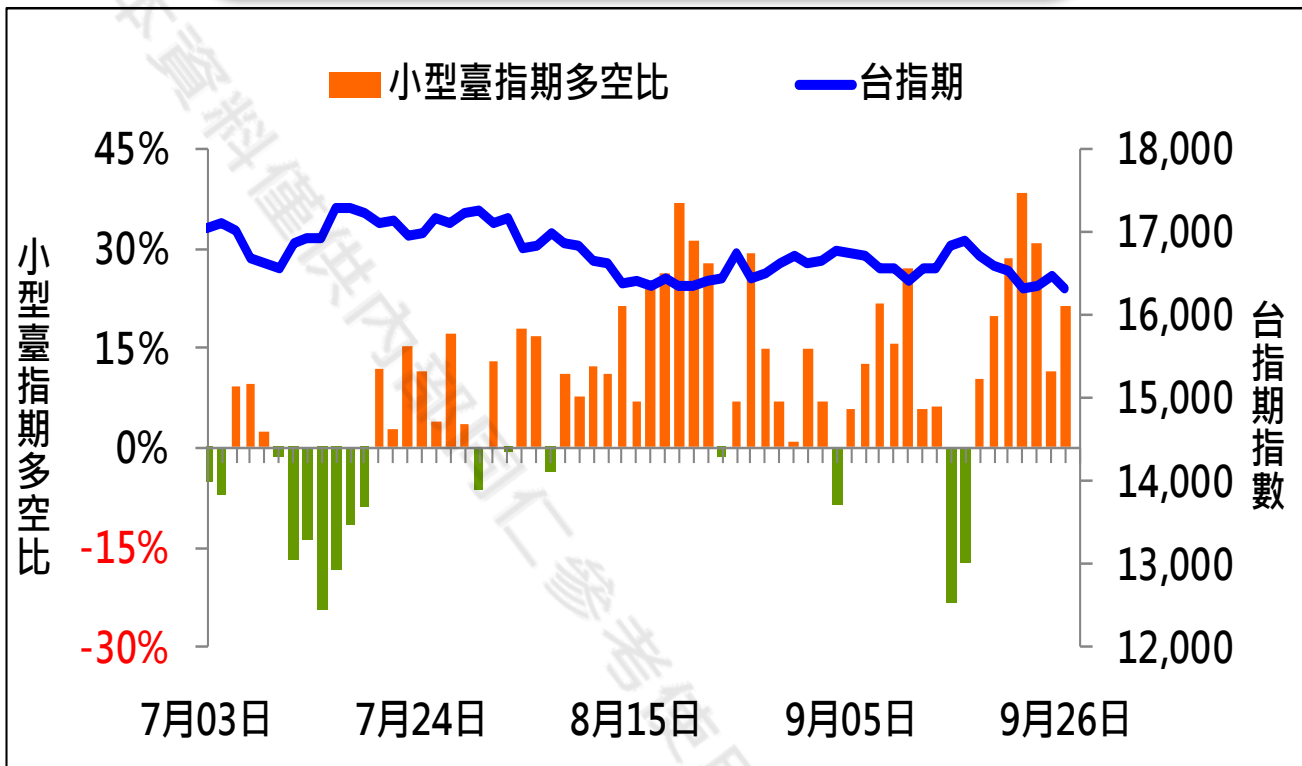
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



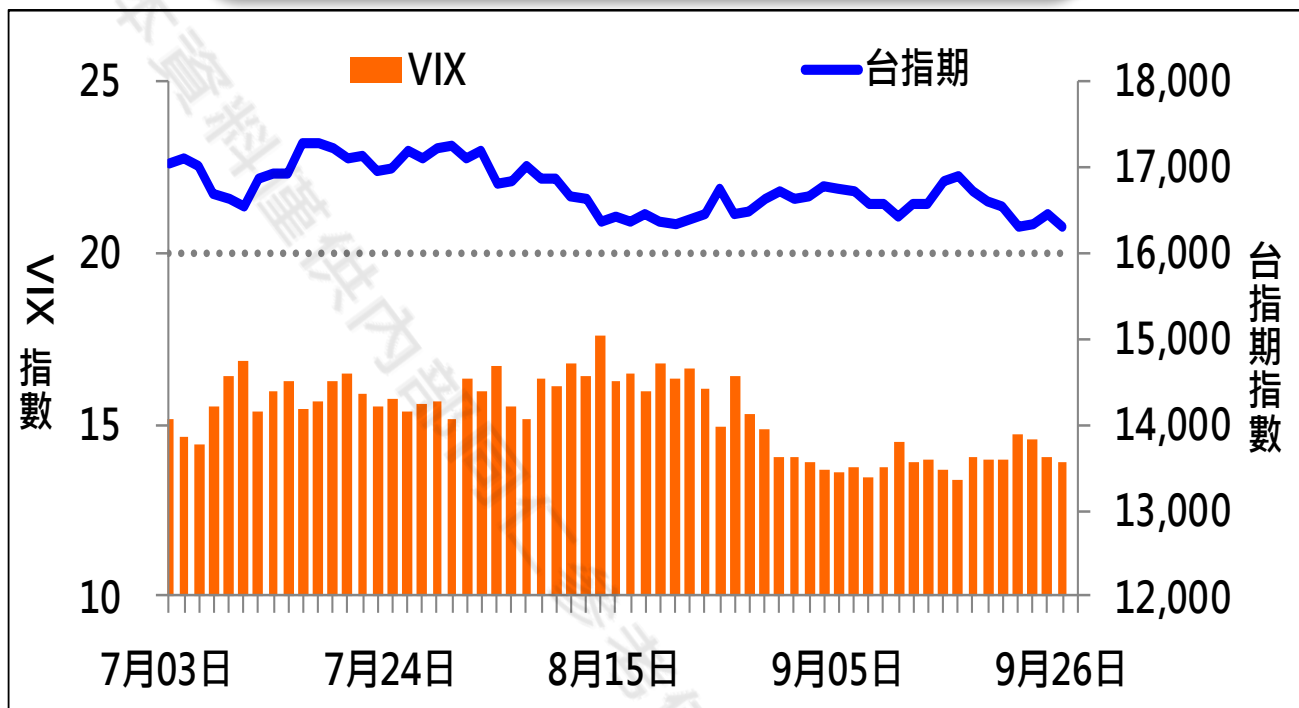
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

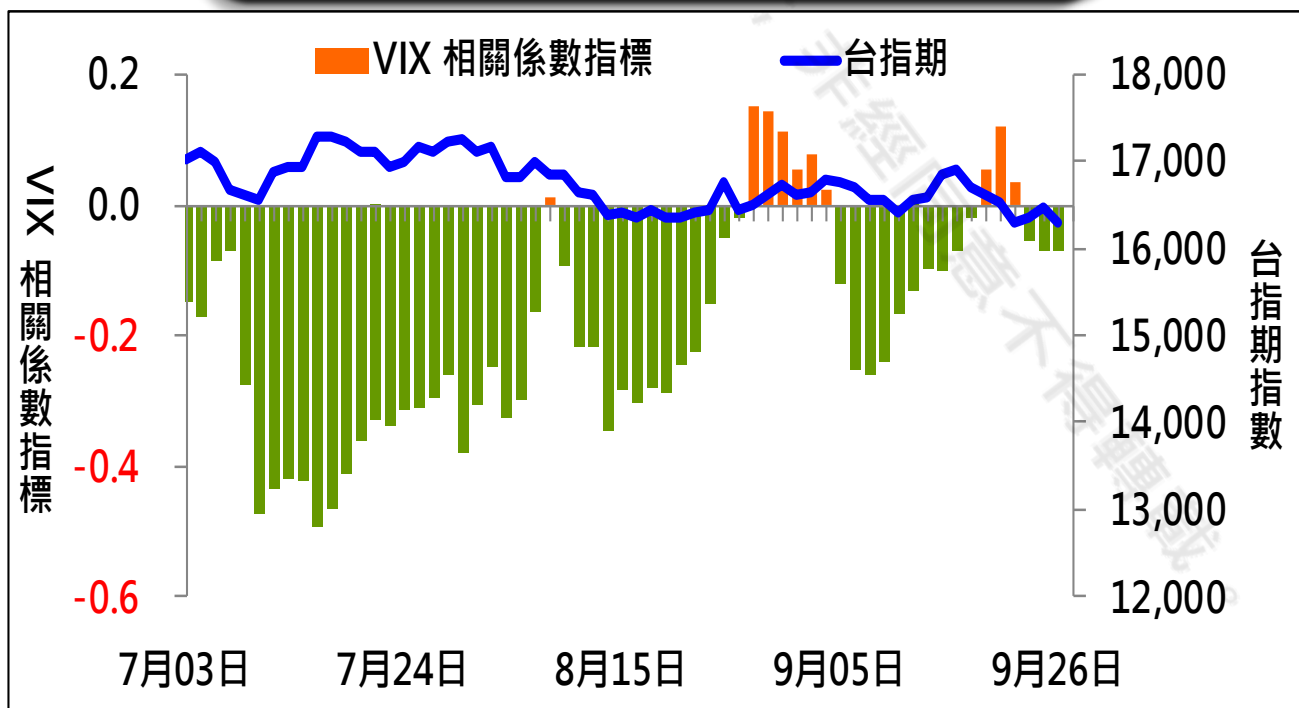
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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



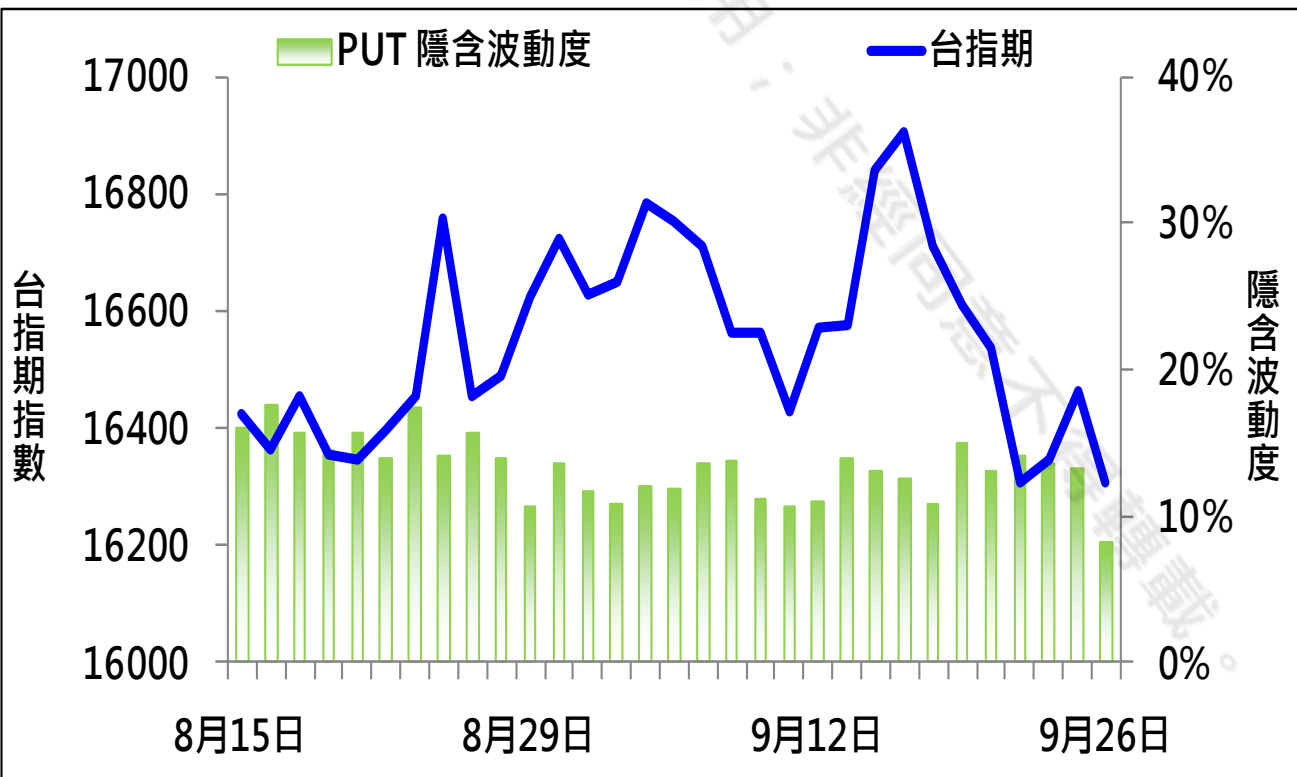
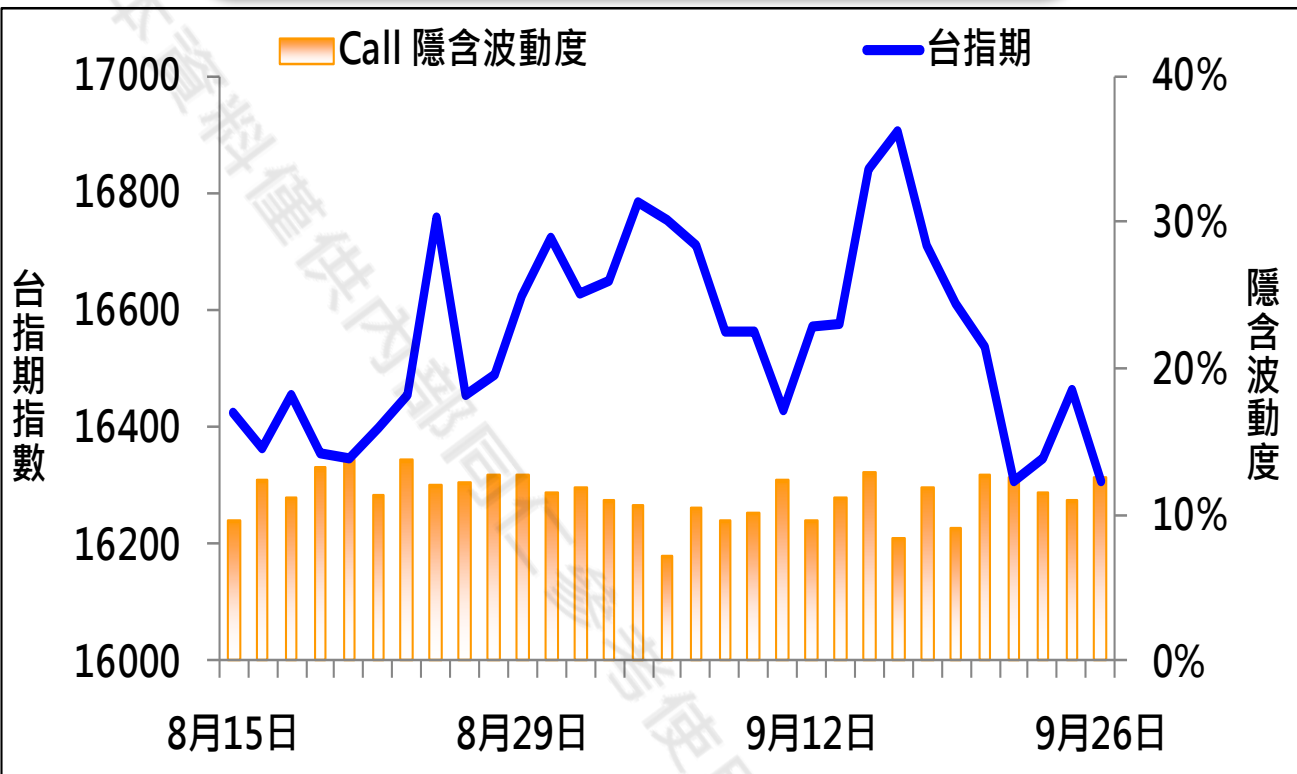
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2023/9/26

結算日：2023/9/27

Call	202309W4 履約價	Put	OI 增減
0	15,850	1,278	251
13	15,900	7,119	235
0	15,950	2,376	339
-53	16,000	10,746	676
-26	16,050	4,635	302
101	16,100	12,071	2,183
78	16,150	9,567	1,047
567	16,200	12,085	285
1,447	16,250	12,704	3,534
3,906	16,300	11,008	-2,169
※ 11,126	16,350	6,194	-152
8,314	16,400	5,980	-3,763
4,893	16,450	3,222	-496
3,350	16,500	3,322	-937
1,273	16,550	1,875	-381
-2,124	16,600	2,045	-393
-1,963	16,650	1,125	-206
-1,968	16,700	942	-120
-1,332	16,750	398	-22
-1,246	16,800	672	-14
23	16,850	216	0
-288	16,900	168	-2
-96	16,950	144	0
-582	17,000	146	-1
24,940	總計	132,877	-692
P/C	0.9321	增減	-0.2035

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：2023/9/26

結算日：2023/10/18

OI 增減	Call	202310 月 履約價	Put	OI 增減
0	3	15,000	3,349	569 ※
0	1	15,100	1,181	110
0	0	15,200	1,550	-92
1	6	15,300	1,038	71
1	7	15,400	1,306	75
1	14	15,500	2,186	194
1	15	15,600	3,670	-1,146
4	15	15,700	2,534	-201
3	53	15,800	4,780	295
-1	57	15,900	3,038	15
42	171	16,000	8,042	-2,684
46	403	16,100	2,929	-136
77	409	16,200	3,438	-260
112	820	16,300	3,869	178
79	1,871	16,400	3,599	-459
182	2,986	16,500	2,056	79
※ 775	3,693	16,600	992	-47
626	3,168	16,700	577	-9
760	5,343	16,800	1,072	12
57	3,690	16,900	236	0
-496	7,904	17,000	152	6
-75	4,392	17,100	75	0
-46	7,413	17,200	99	-5
-61	993	17,800	4	0
1,842	70,037	總計	56,245	-2,941
P/C	0.8031		增減	-0.0648

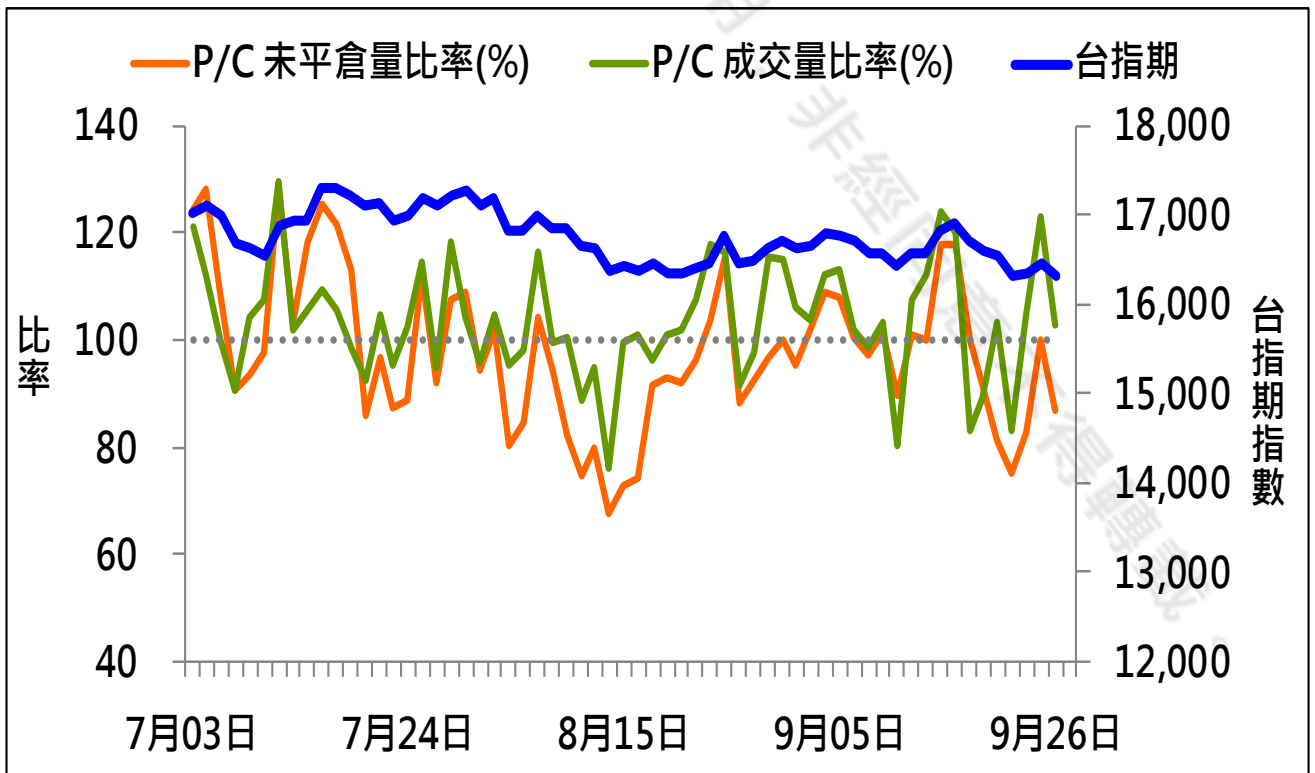
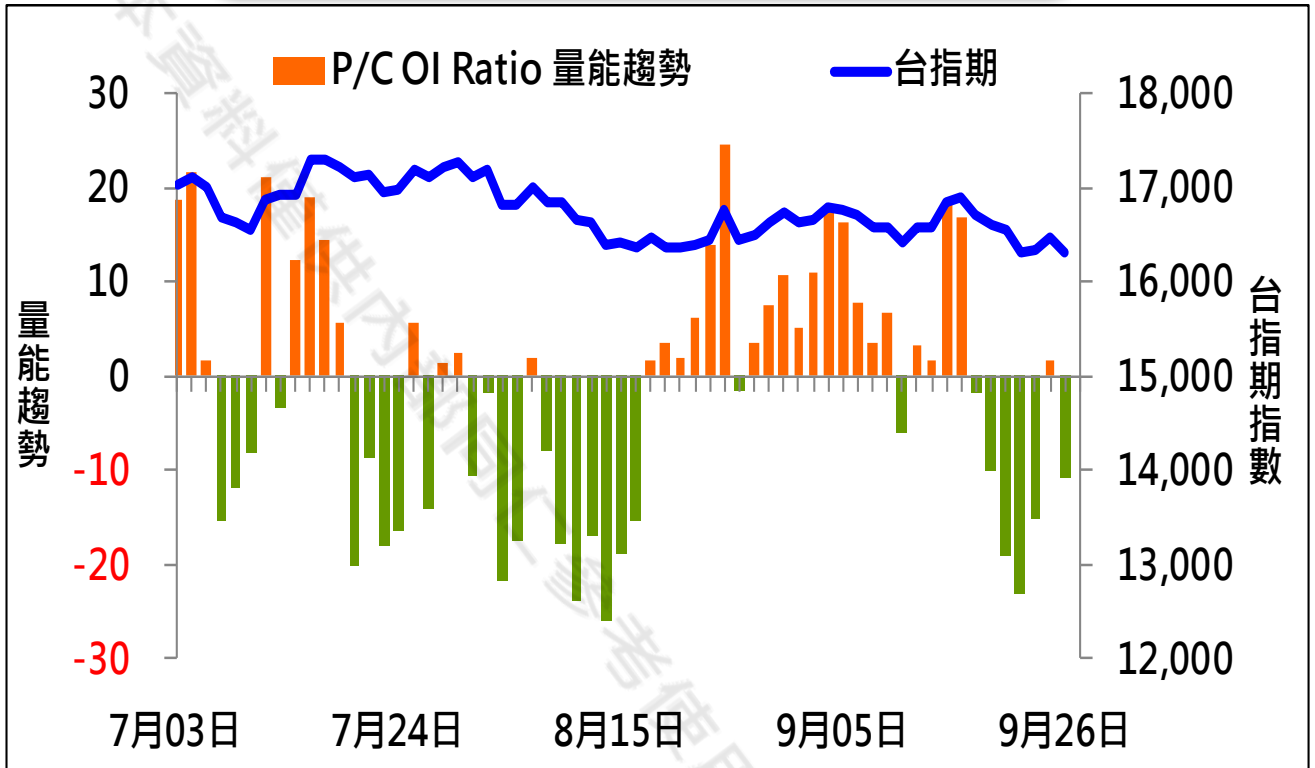
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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)(FTTX*1) 日線圖 2023/09/26 開 16400 高 16408 收 16305 s 點 量 88022 口 -160 (-0.97%)



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