

法人籌碼動態

09月28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	-10,084	-1,835	-314	64	384	4
投信	3,012	229	182	0	16	-1
自營商	172	476	-340	-67	-557	28
09月28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	5	-4	18,807	4,086	16,811	1,467
投信	0	0	200	0	82	0
自營商	-19	4	15,220	8,077	6,129	-1,658

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口	多	空
9128.66	0.00	9128.66	0.00	台指期前十大 市場佔比	39.1%	47.0%
9128.66	0.00	9128.66	0.00			
9128.66	0.00	9128.66	0.00			
9128.66	0.00	9128.66	0.00	電子期前十大 市場佔比	42.7%	56.5%
9128.66	0.00	9128.66	0.00			
9128.66	0.00	9128.66	0.00			
9128.66	0.00	9128.66	0.00	金融期前十大 市場佔比	76.0%	75.3%
9128.66	0.00	9128.66	0.00			
9128.66	0.00	9128.66	0.00			
9128.66	0.00	9128.66	0.00	非金電期前十大 市場佔比	99.3%	89.0%
9128.66	0.00	9128.66	0.00			
前十名合計	0.00	後十名合計	0.00			

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

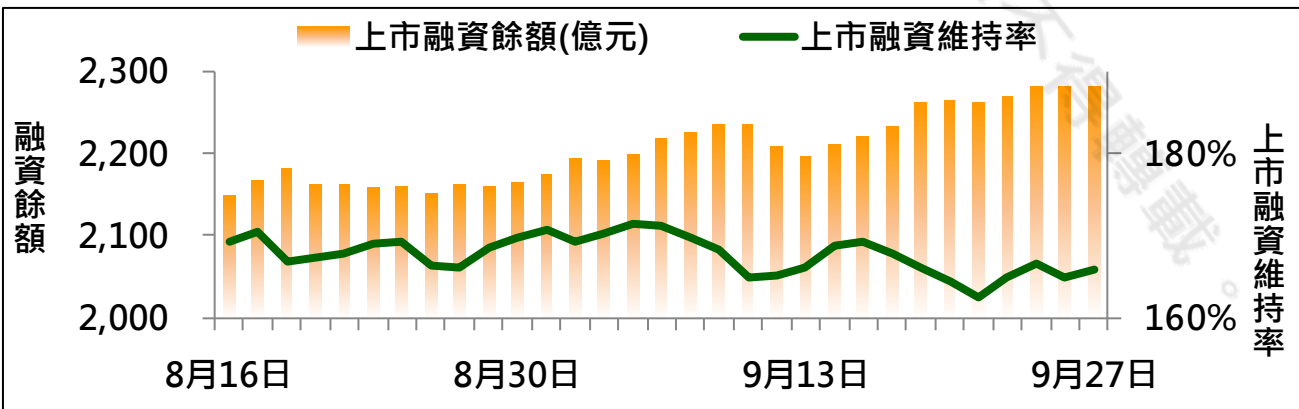
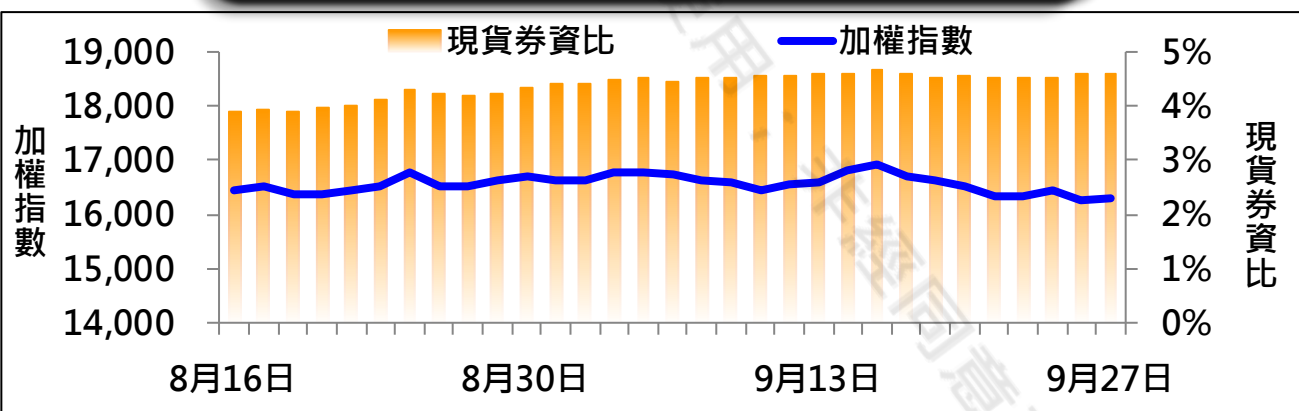
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

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
09月27日	-14.9	-8,249	-2,133	-53.2	-304	110
09月28日	-77.1	-10,084	-1,835	-18.1	172	476

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
09月27日	14,721	15,344	-623	7,143	7,787	-644
09月28日	18,807	16,811	1,996	15,220	6,129	9,091

現貨券資比 & 上市融資維持率



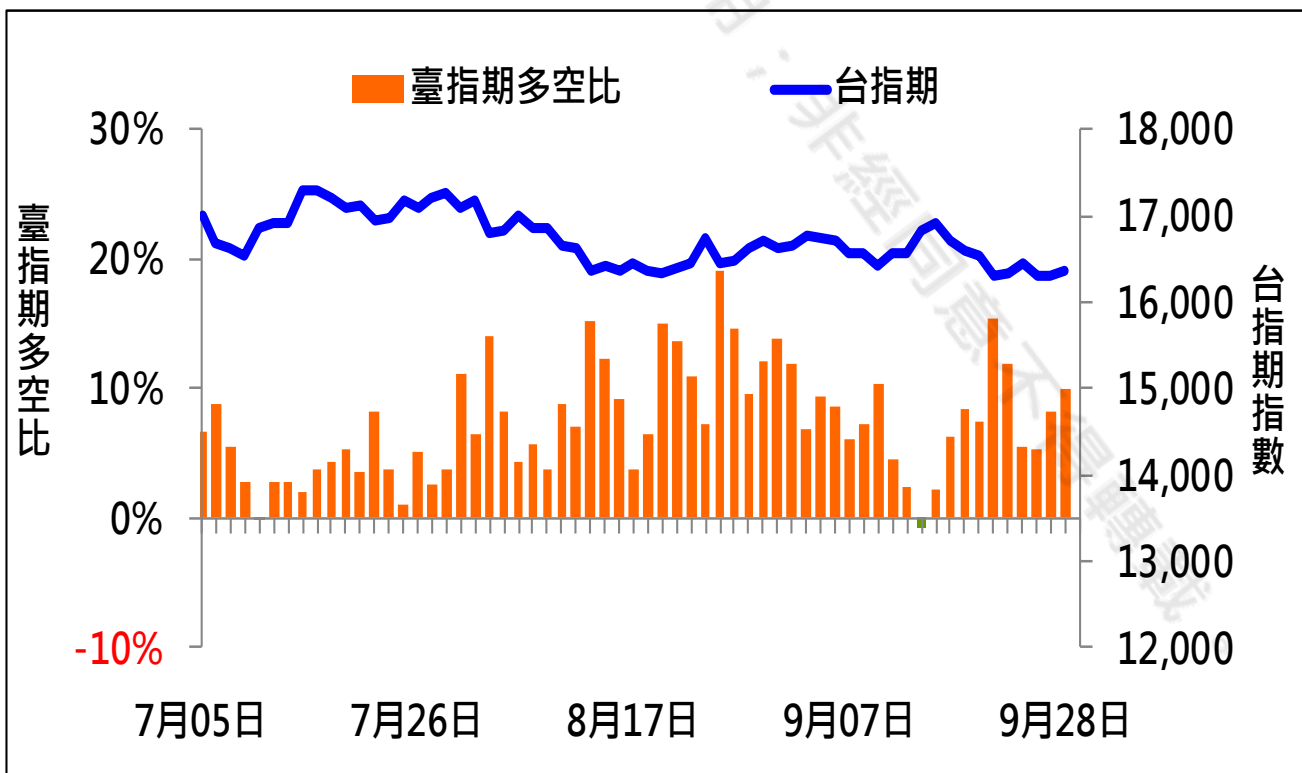
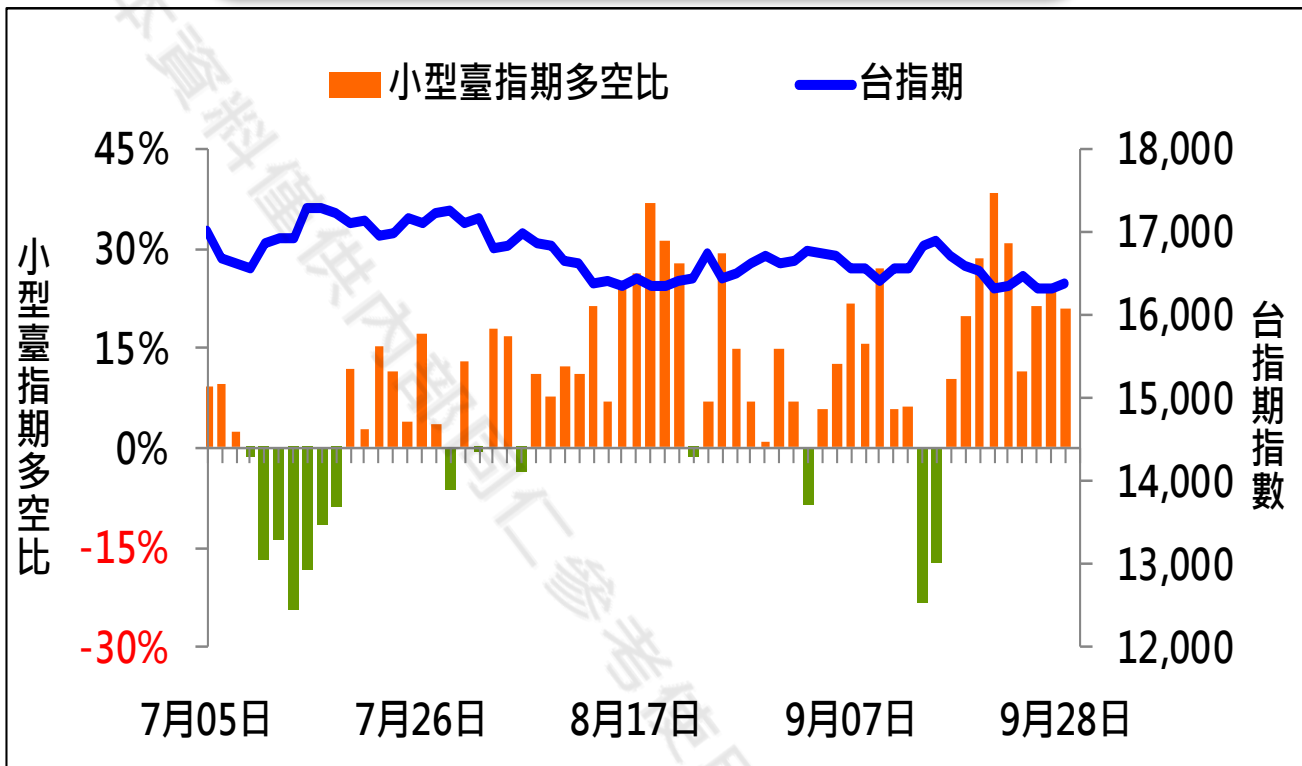
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



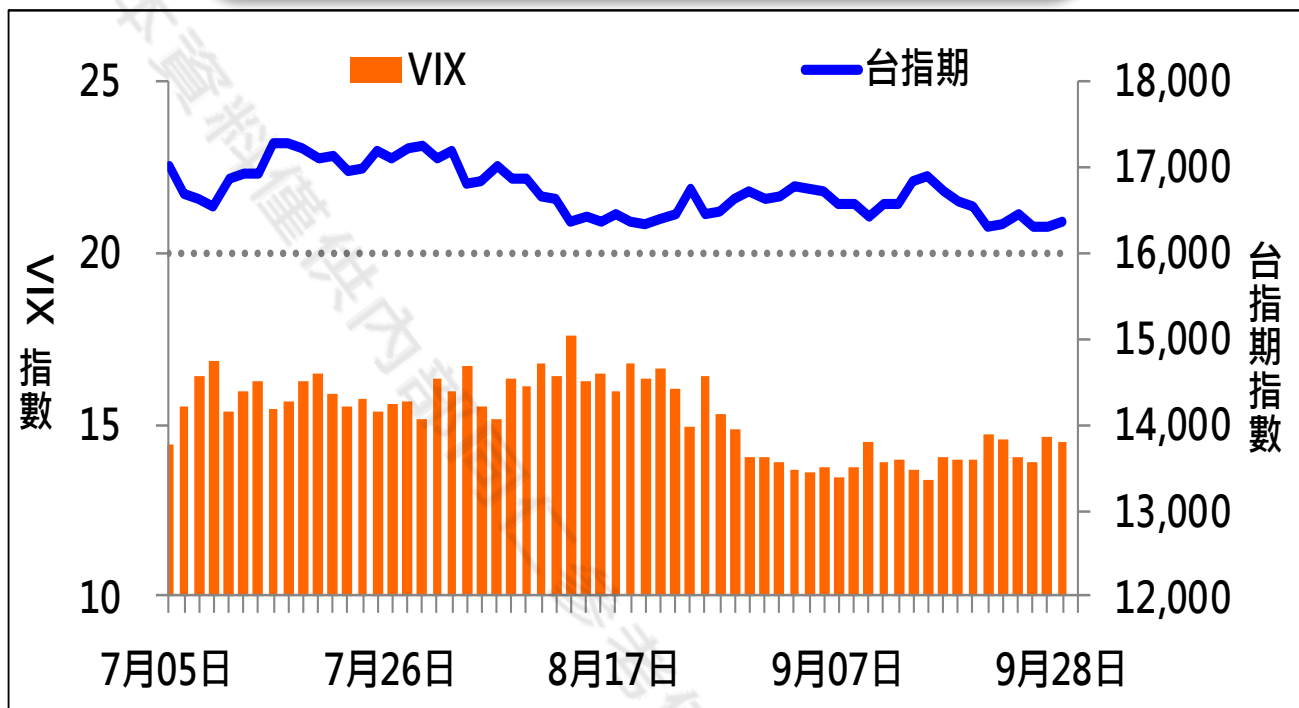
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

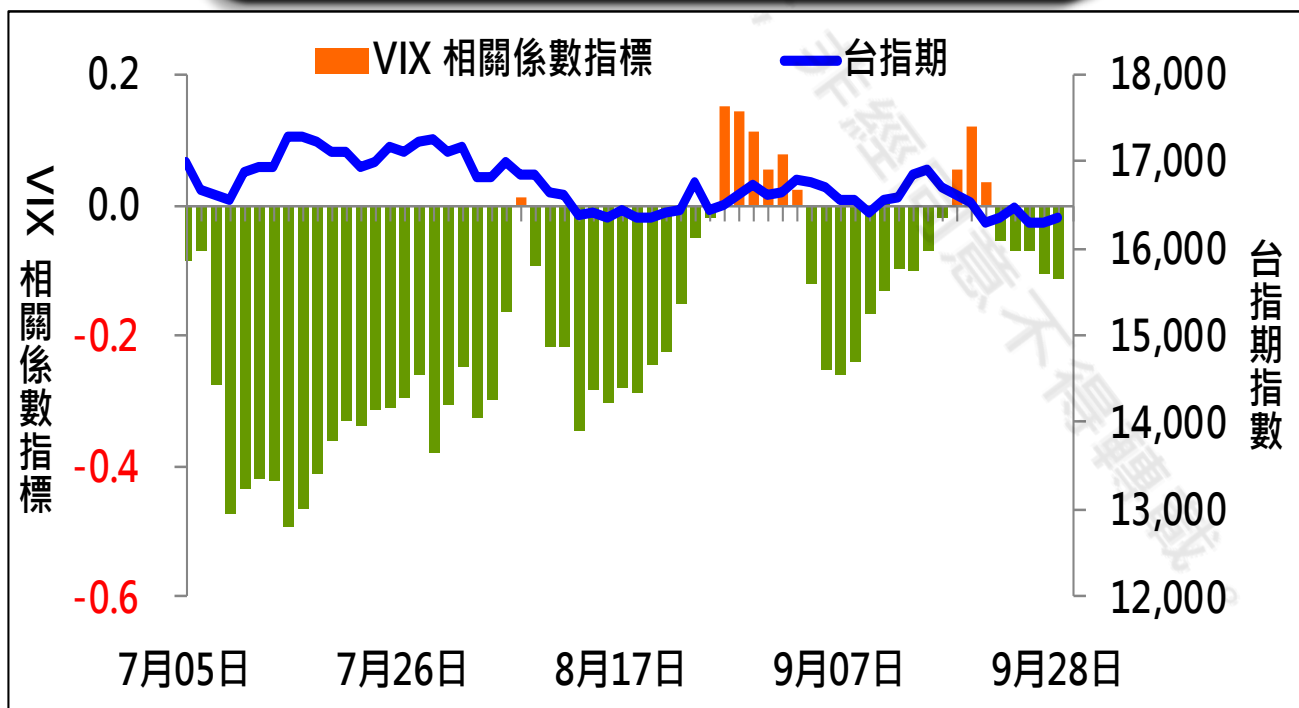
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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



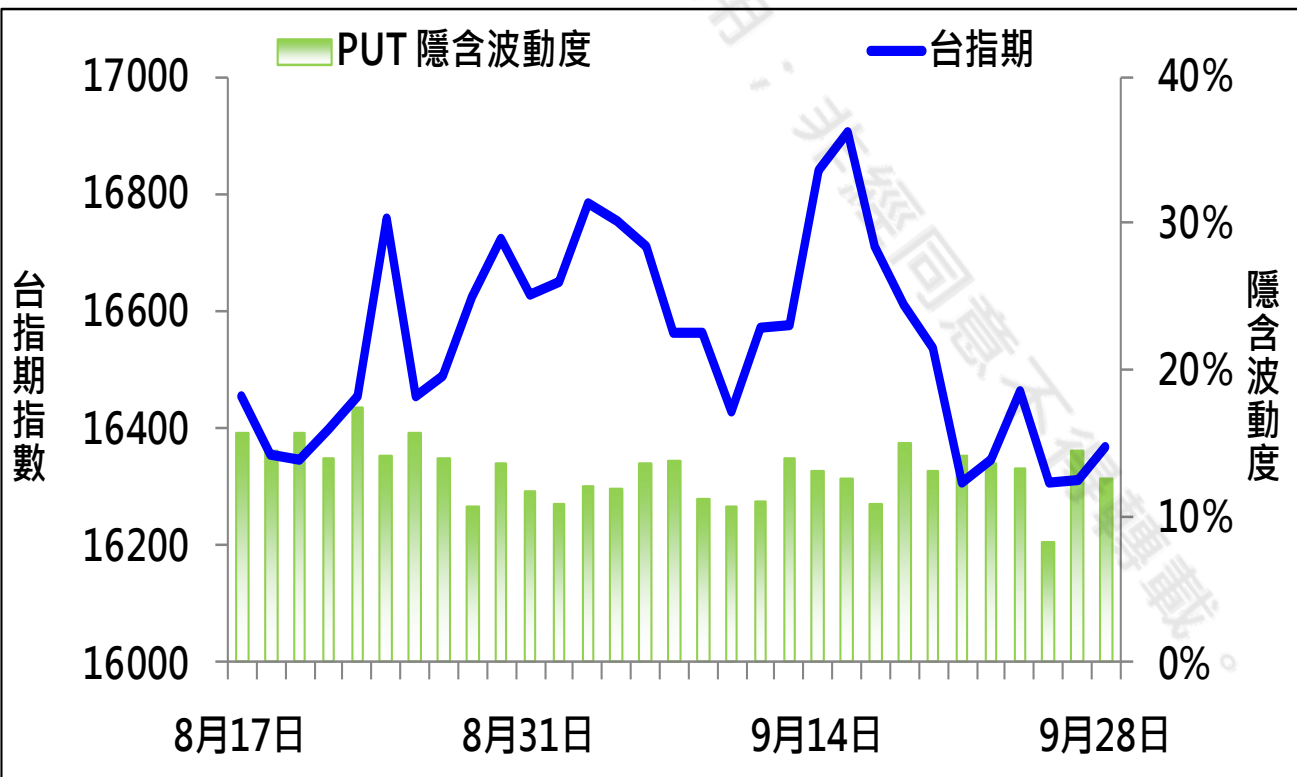
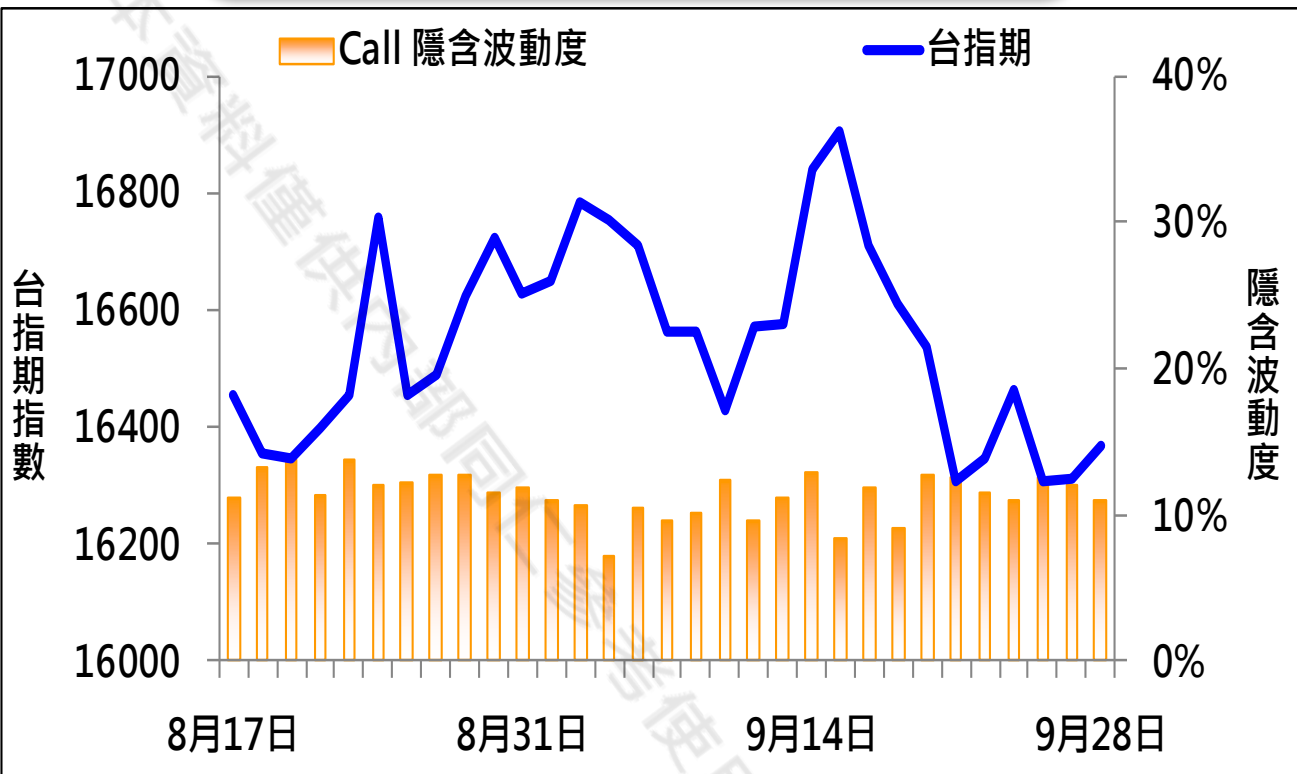
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2023/9/28

結算日：2023/10/4

Call	202310W1 履約價	Put	OI 增減	
OI 增減				
-3	15	15,900	6,008	3,813
0	14	15,950	3,972	2,435
107	139	16,000	6,675	3,050
13	25	16,050	3,662	2,065
79	243	16,100	5,142	2,513
148	306	16,150	4,862	2,586
711	1,111	16,200	6,713	3,868
482	1,300	16,250	4,041	2,157
519	2,911	16,300	3,803	1,636
972	2,266	16,350	1,927	1,014
820	3,934	16,400	2,610	1,294
2,016	4,293	16,450	712	403
3,561	6,351	16,500	561	225
4,764	7,299	16,550	322	134
5,254	8,464	16,600	227	83
3,953	6,092	16,650	110	46
2,476	6,762	16,700	49	12
1,877	4,820	16,750	15	-4
1,878	5,460	16,800	26	1
252	2,367	16,850	12	0
691	1,830	16,900	15	0
1,341	2,807	16,950	11	2
1,261	2,197	17,000	19	-1
239	577	17,050	7	0
34,898	75,676	總計	76,820	39,880
P/C	1.0151		增減	0.1092

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：2023/9/28

結算日：2023/10/18

OI 增減	Call	202310月 履約價	Put	OI 增減
0	1	15,100	1,536	64
0	0	15,200	1,852	422
-1	6	15,300	1,123	13
0	12	15,400	1,737	114
0	14	15,500	2,728	206
2	17	15,600	4,604	358
1	16	15,700	3,025	594
-25	56	15,800	6,544	699
34	91	15,900	3,410	117
29	190	16,000	8,673	325
2	380	16,100	2,950	-211
16	1,175	16,200	4,106	114
257	1,766	16,300	3,542	-229
290	2,215	16,400	2,705	-346
137	4,037	16,500	1,856	-111
※ 965	4,999	16,600	974	13
480	4,032	16,700	560	3
571	6,339	16,800	1,019	-95
298	3,844	16,900	190	-15
46	8,092	17,000	155	7
-8	4,400	17,100	55	-2
-72	7,380	17,200	94	-3
-109	5,519	17,300	11	-1
21	987	17,900	5	0
3,232	76,574	總計	62,092	2,037
P/C	0.8109		增減	-0.0080

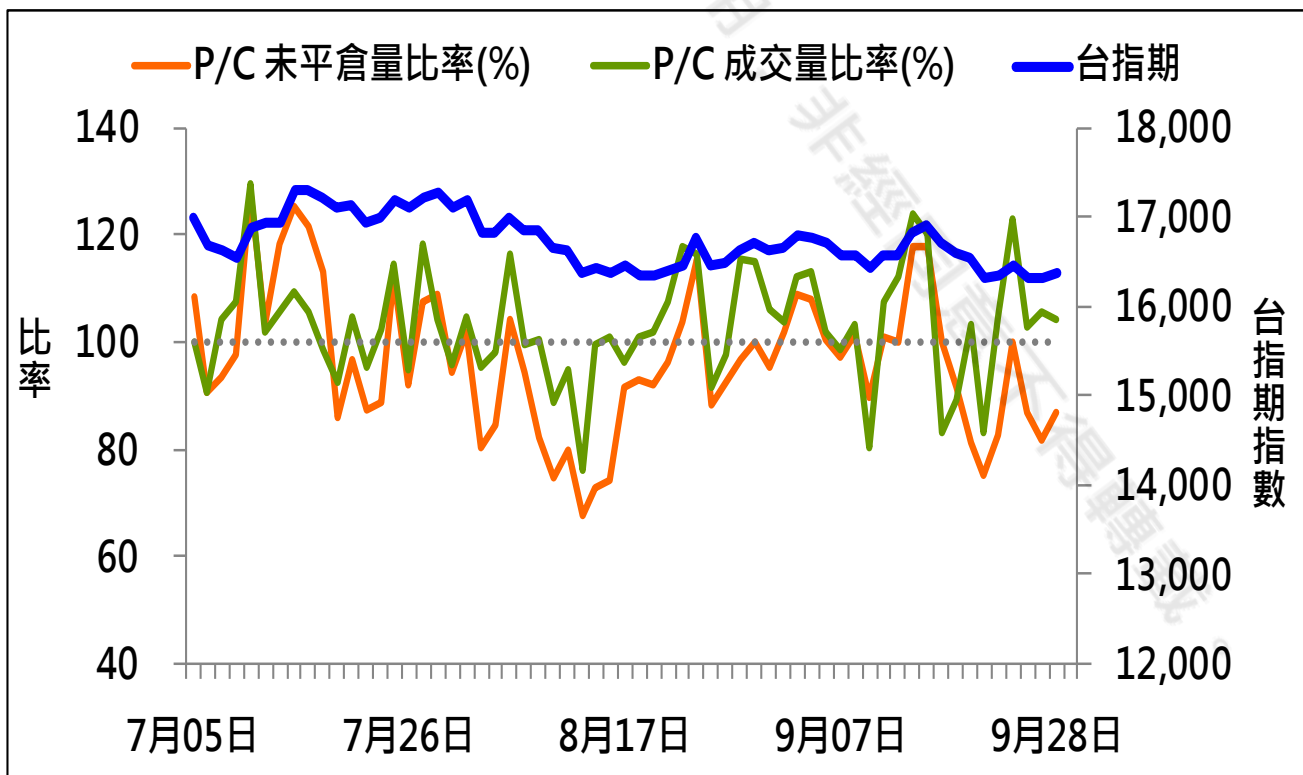
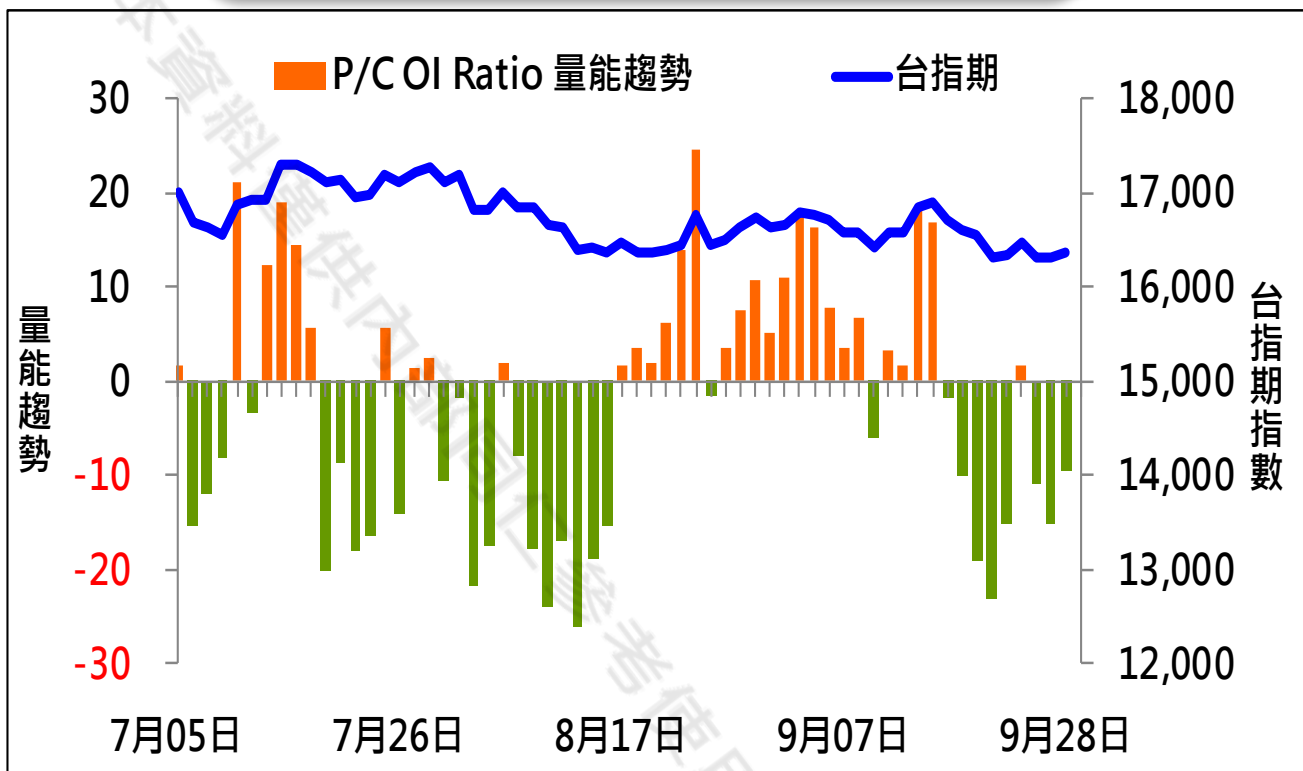
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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 2023/09/28 開 16342 高 16435 低 16295 收 16367 s 點 量 90613 口 +56 (+0.34%)

SMA5 16358.40↑ SMA10 16486.20↓ SMA120 16497.61↑



2023/07/27

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

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