

法人籌碼動態

09月11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	-27,727	-762	-299	-32	-548	-13
投信	24,354	354	170	18	15	-3
自營商	422	-9	-37	17	166	-18
09月11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	-15	3	-11,590	-1,520	5,235	115
投信	0	0	-86	0	20	0
自營商	1	-3	-1,463	-13,455	-15,205	516

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口	多	空
長榮	3.45	台積電	-25.15	台指期前十大 市場佔比	52.4%	51.0%
大立光	3.24	聯發科	-10.34			
廣達	3.12	富邦金	-4.25			
聯電	2.84	台達電	-3.78	電子期前十大 市場佔比	56.8%	72.9%
新光金	2.55	日月光投控	-3.55			
萬海	2.45	中信金	-2.60			
南亞	2.44	兆豐金	-1.86	金融期前十大 市場佔比	49.4%	82.2%
鴻海	2.24	玉山金	-1.77			
光寶科	2.20	億豐	-1.66			
聯詠	2.16	統一	-1.65	非金電期前十大 市場佔比	92.3%	79.5%
前十名合計	26.69	後十名合計	-56.62			

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

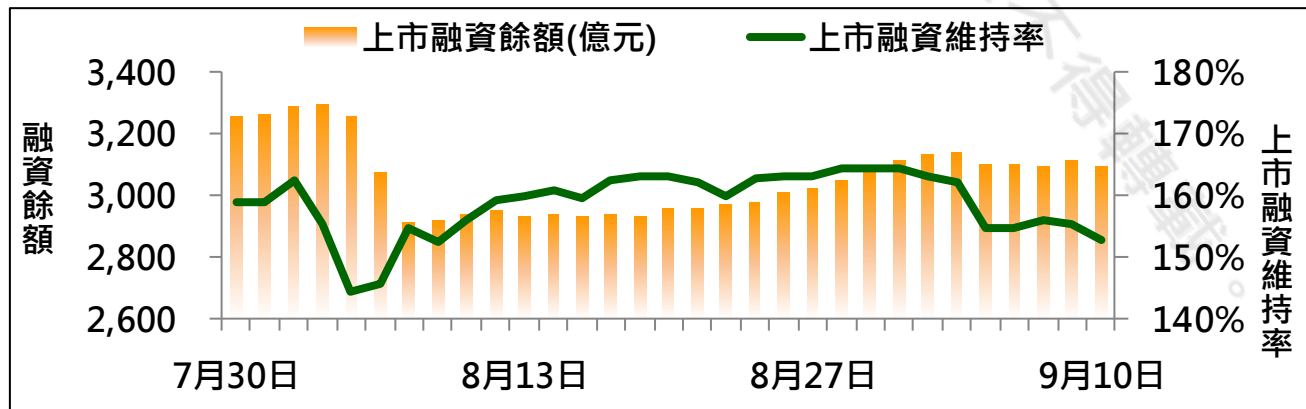
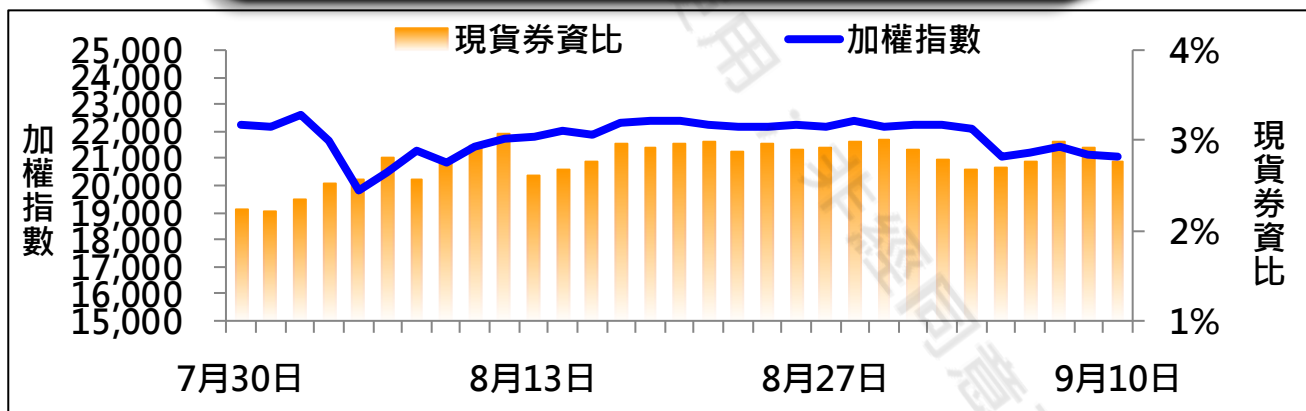
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

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05日	-253.6	-25,669	5,248	-149.5	-29	-1,232
09月06日	12.0	-27,531	-1,862	-74.7	-295	-266
09月09日	-501.2	-28,097	-566	-116.2	1,168	1,463
09月10日	-270.1	-26,965	1,132	-75.4	431	-737
09月11日	-85.1	-27,727	-762	-47.0	422	-9

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05日	-13,033	3,055	-16,088	9,233	-15,981	25,214
09月06日	-11,141	4,661	-15,802	9,236	-17,964	27,200
09月09日	-12,200	4,562	-16,762	9,708	-10,870	20,578
09月10日	-10,070	5,120	-15,190	11,992	-15,721	27,713
09月11日	-11,590	5,235	-16,825	-1,463	-15,205	13,742

現貨券資比 & 上市融資維持率

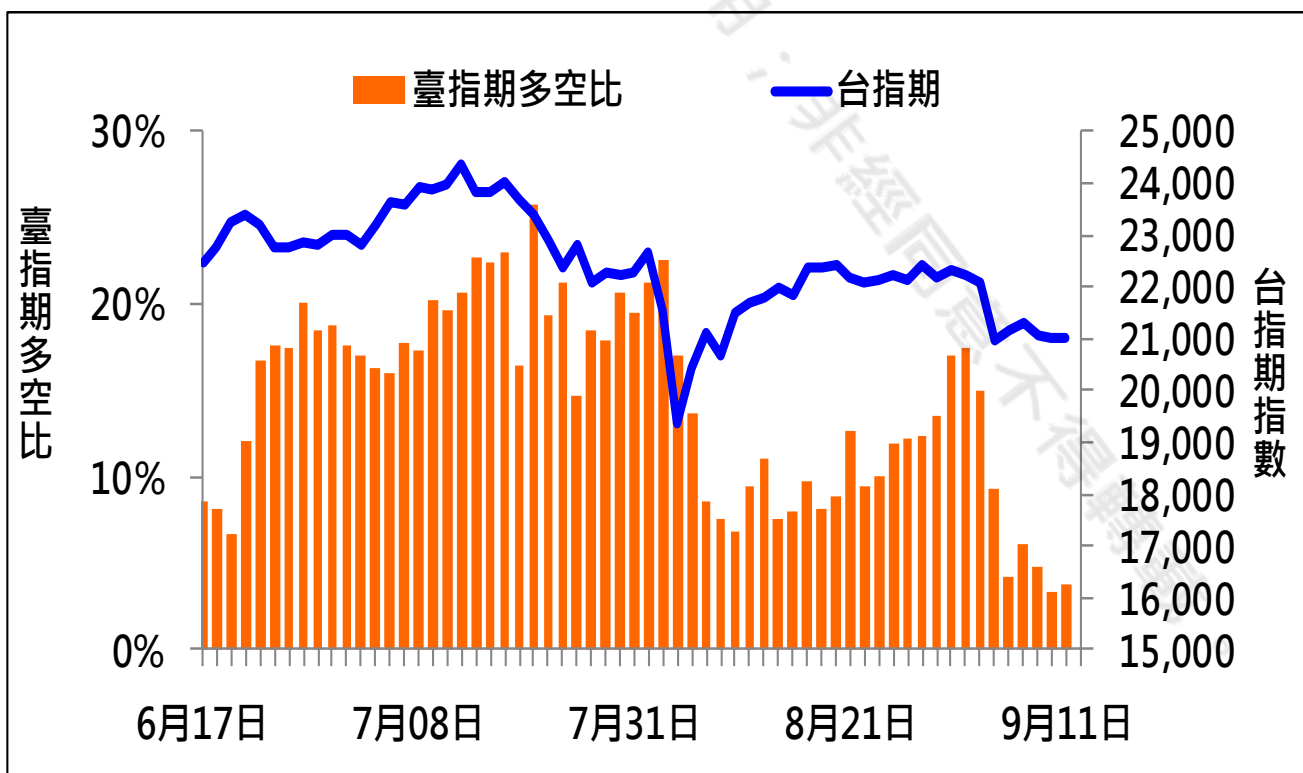
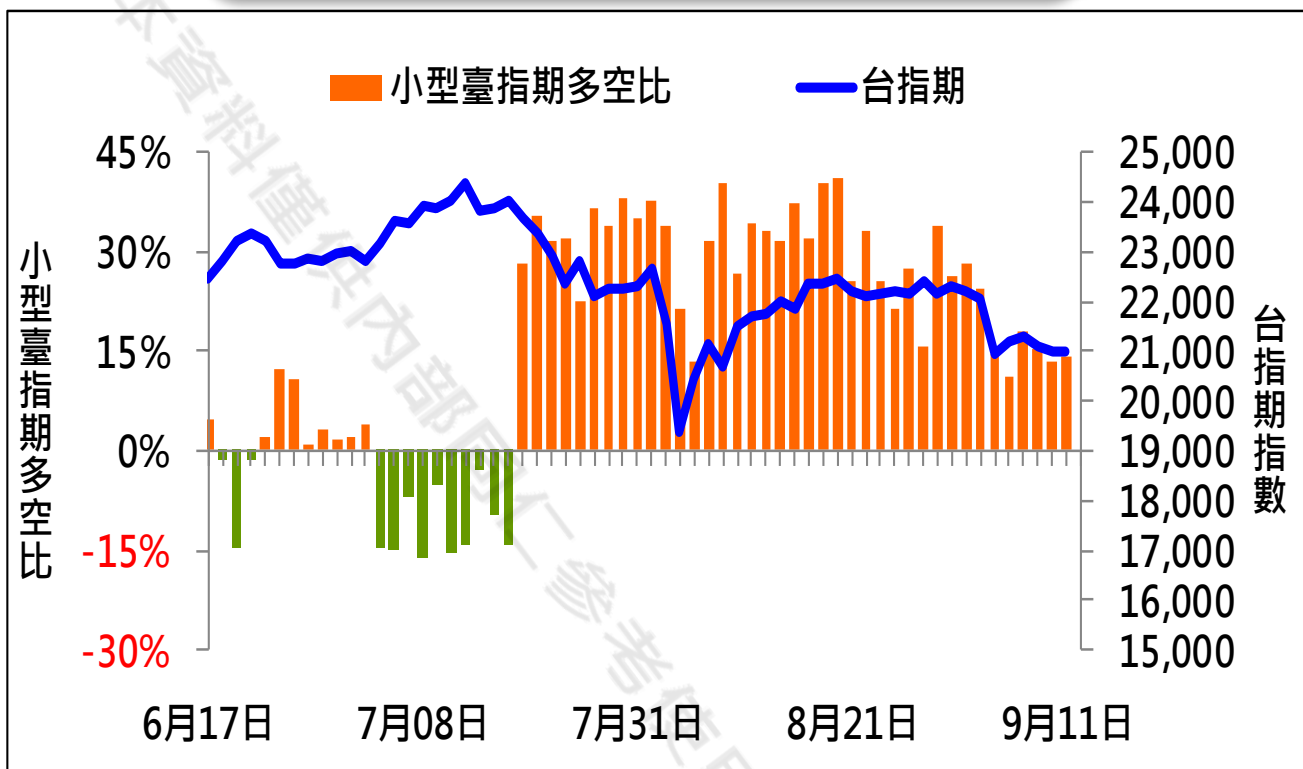


期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



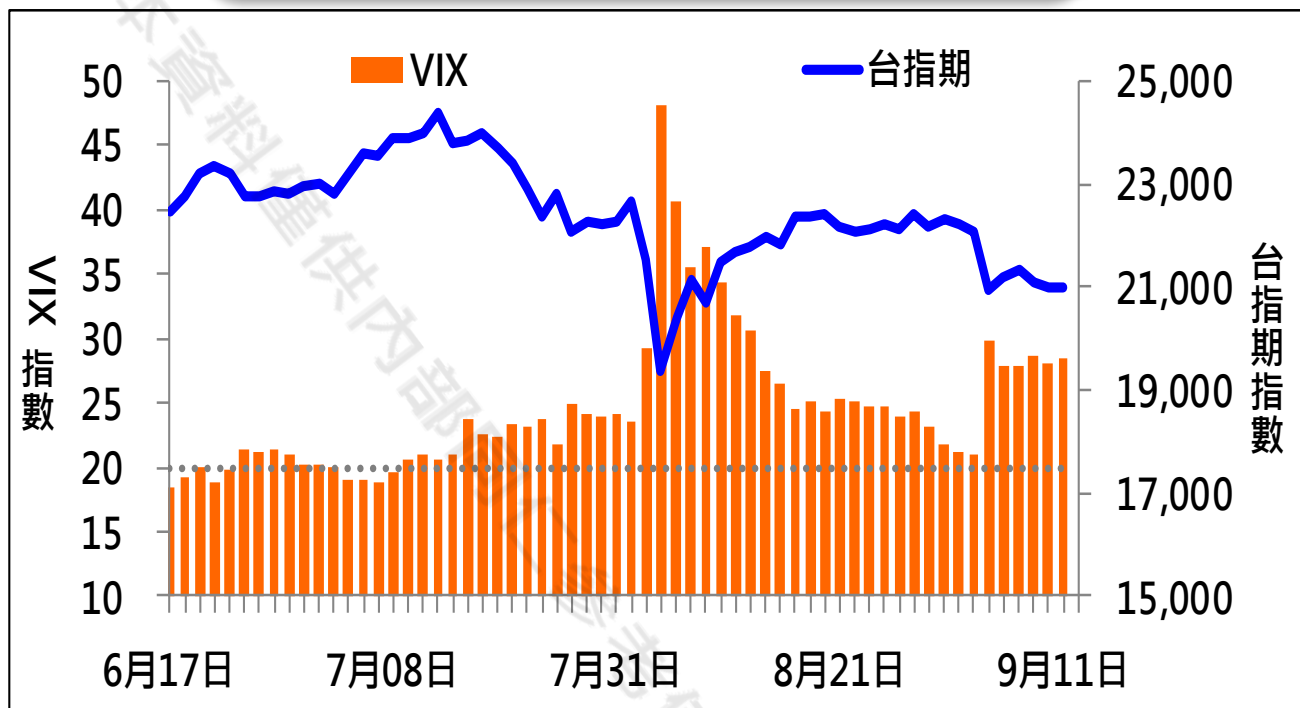
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

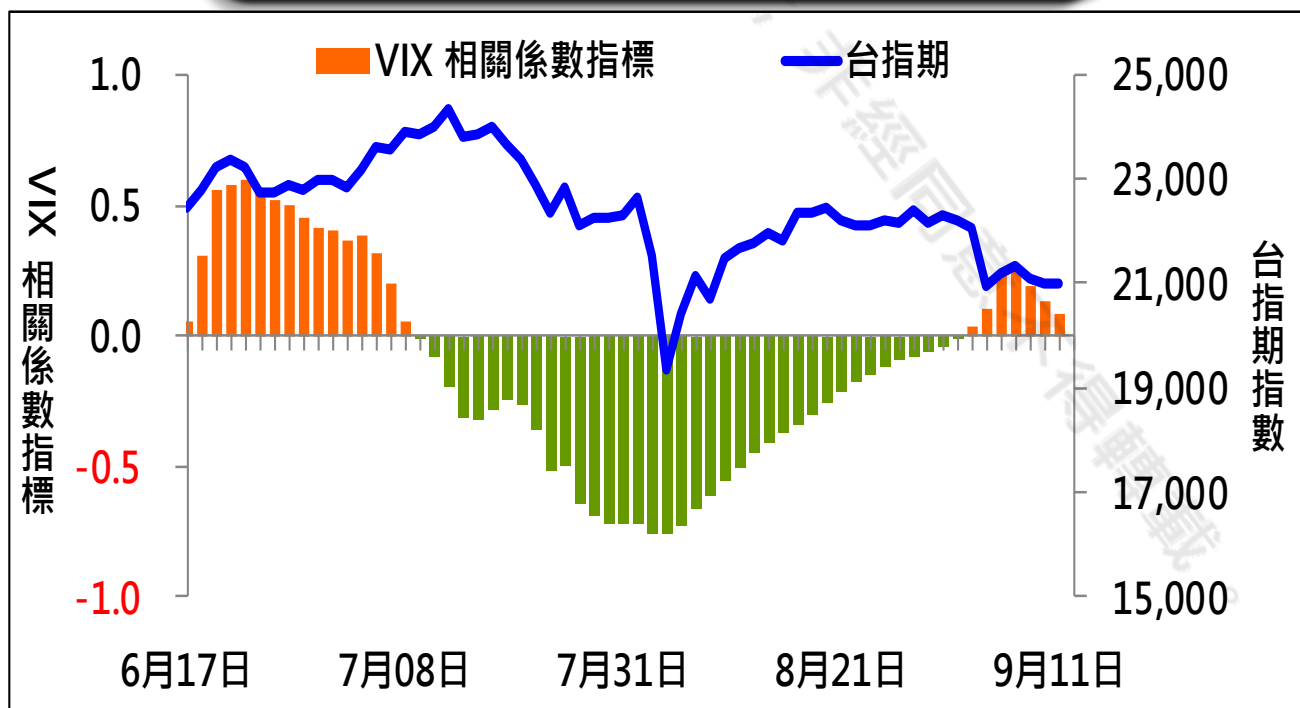
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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



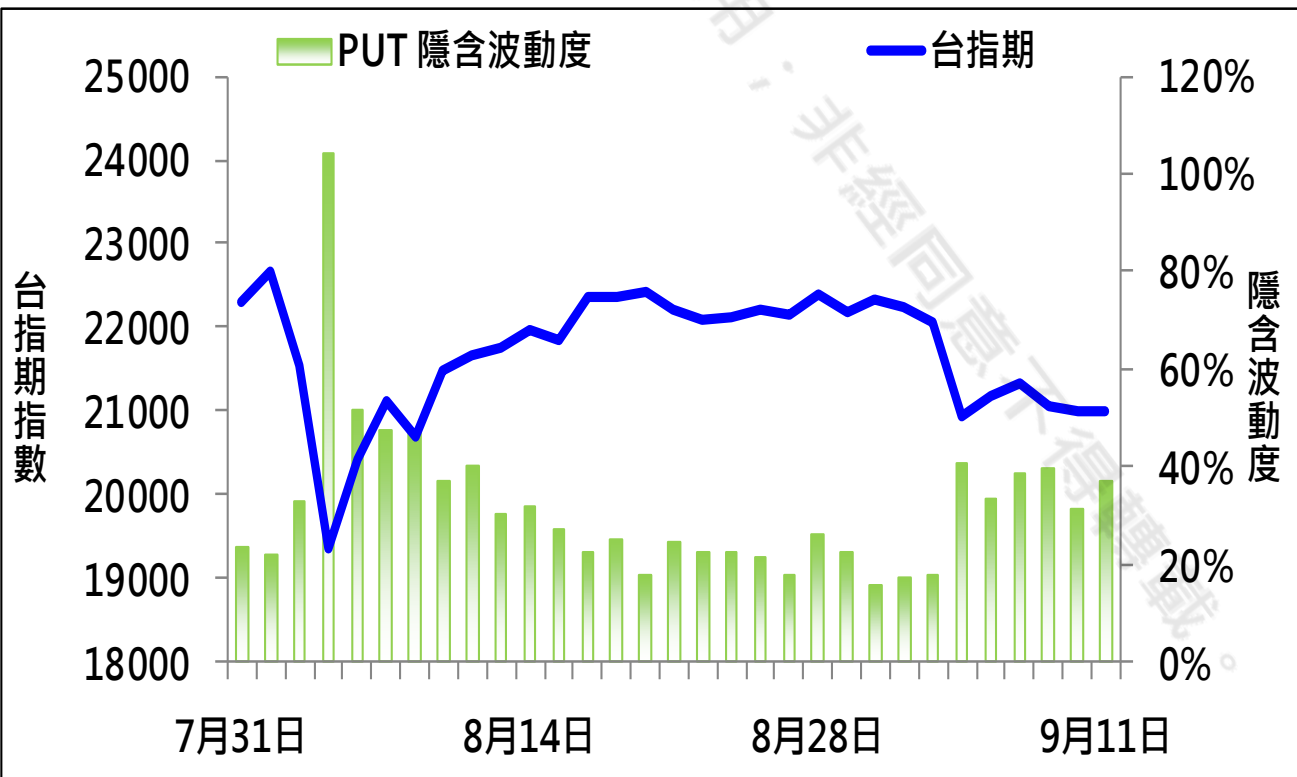
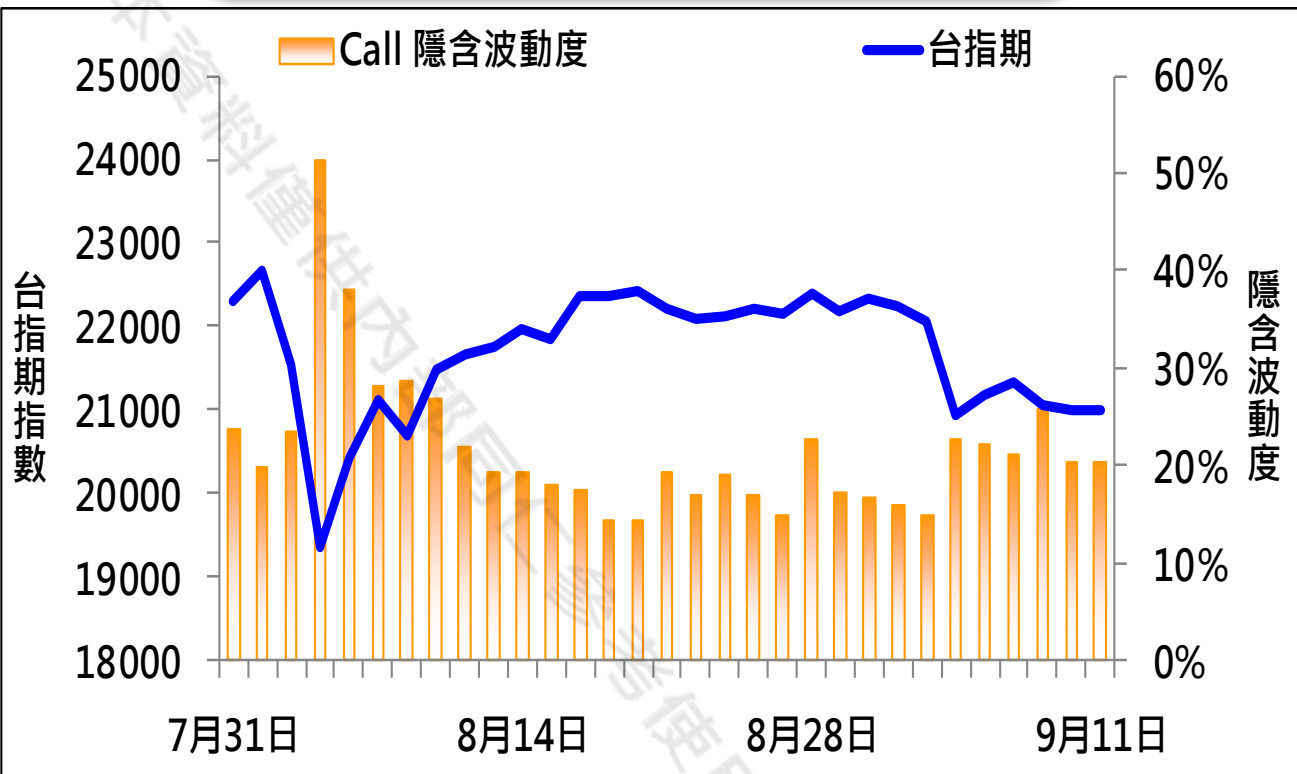
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2024/9/11

結算日：2024/9/18

OI 增減	Call	202409 月 履約價	Put	OI 增減
4	37	20,000	7,861	1,593
0	27	20,100	979	211
-1	21	20,200	1,129	192
0	4	20,300	1,777	223
0	7	20,400	2,274	387
11	74	20,500	2,788	695
8	75	20,600	1,322	438
0	86	20,700	1,630	579
22	196	20,800	1,652	372
19	299	20,900	2,069	190
459	1,031	21,000	4,215	603
116	252	21,050	275	143
185	635	21,100	1,350	146
498	960	21,200	1,199	59
618	1,119	21,300	823	78
286	962	21,400	1,200	-18
883	2,478	21,500	3,339	29
804	2,969	21,600	1,433	7
970	2,017	21,700	1,253	5
969	2,963	21,800	1,121	-14
689	1,813	21,900	615	-6
710	4,929	22,000	2,752	-241
570	2,863	22,100	873	0
※ 1,484	3,870	22,200	607	-21
197	2,783	22,300	974	-1
-107	2,118	22,400	339	-23
131	3,482	22,500	1,131	-1
1	2,450	22,600	213	1
-4	1,326	22,700	135	0
-183	2,235	22,800	136	0
8	1,536	22,900	145	0
-179	5,739	23,000	615	-2
13,128	88,293	總計	92,615	12,856
P/C	1.0490		增減	-0.0122

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：2024/9/11

結算日：2024/10/16

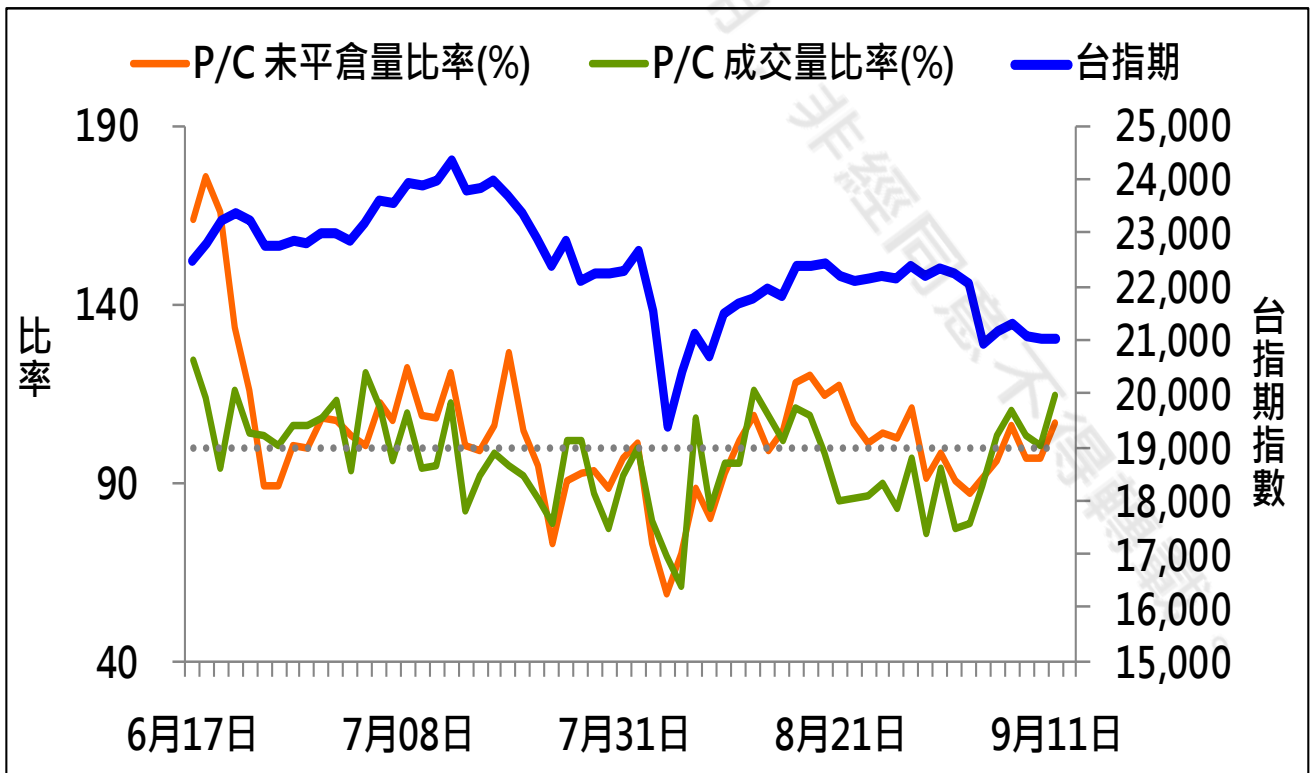
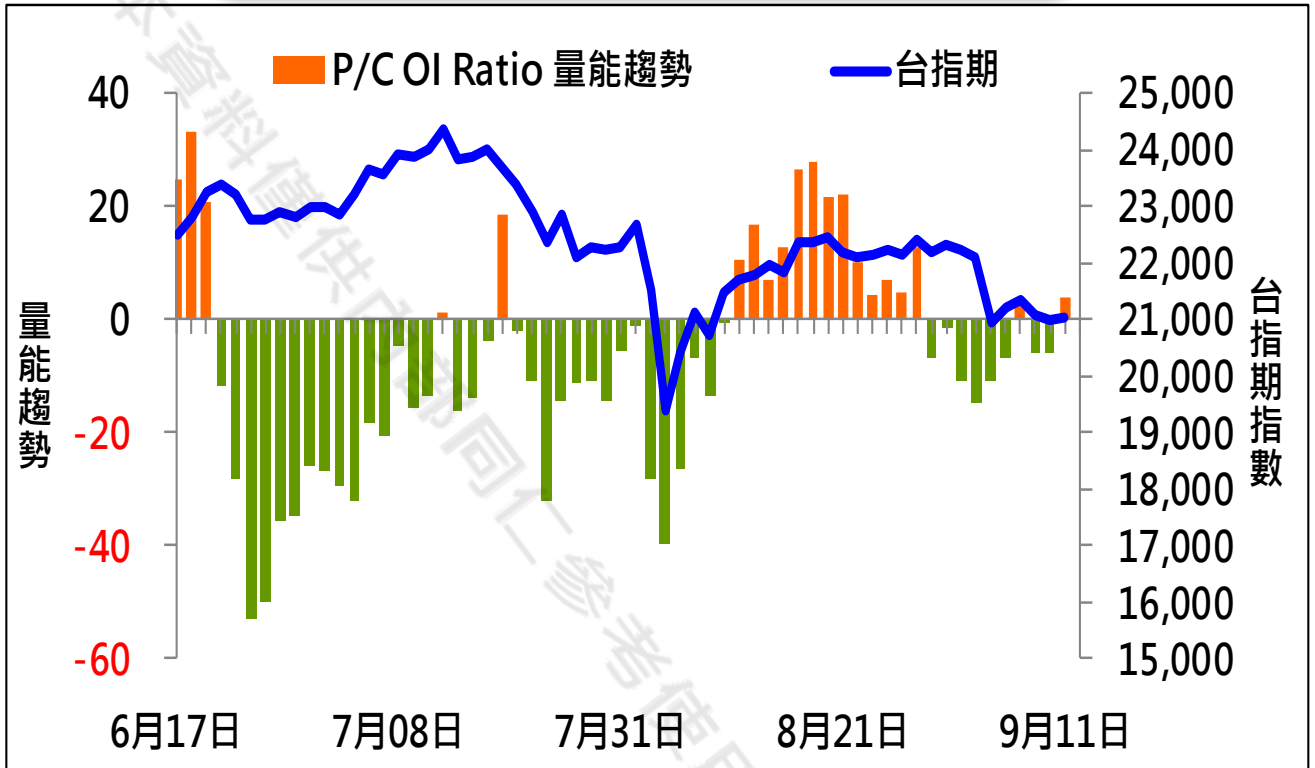
OI 增減	Call	202410 月 履約價	Put	OI 增減
1	8	20,000	1,735	280 ※
0	12	20,100	98	12
0	21	20,200	350	65
0	11	20,300	142	4
0	20	20,400	86	-2
0	32	20,500	356	61
2	9	20,600	217	9
9	42	20,700	108	9
0	34	20,800	455	1
2	18	20,900	246	-2
32	123	21,000	440	-7
3	69	21,100	49	1
6	62	21,200	1,608	16
7	56	21,300	731	0
3	111	21,400	55	2
24	477	21,500	183	1
26	276	21,600	73	-2
1	105	21,700	60	0
1	345	21,800	146	-1
3	111	21,900	129	0
14	579	22,000	458	-5
※ 211	278	22,100	512	1
4	181	22,200	17	0
5	206	22,300	54	0
0	531	22,400	30	0
-63	735	22,500	15	0
95	439	22,600	43	0
17	280	22,700	23	0
17	850	22,800	26	0
0	123	22,900	21	0
114	1,506	23,000	15	0
416	16,283	總計	15,034	691
P/C	0.9233		增減	0.0193

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 2024/09/10 收 **21005**s 點 量 96402 口

SMA5 21105.40↓ **SMA10 21668.00**↓ **SMA20 21923.10**↓ **SMA60 22442.83**↓



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