

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	-31,945	-1,681	-385	-80	-359	-25
投信	25,567	-681	191	3	11	0
自營商	-1,683	-1,082	-11	34	301	45
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	0	-11	-357	1,695	6,363	808
投信	0	0	0	0	0	0
自營商	-17	1	4,256	1,594	-5,282	-8,111

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
台積電	106.84	台達電	-3.70
富邦金	6.95	興富發	-2.99
華碩	5.18	緯穎	-2.77
旭隼	3.75	新光金	-2.25
日月光投控	3.48	遠雄	-1.96
中信金	3.19	潤隆	-1.86
豐泰	2.97	祥碩	-1.66
研華	2.73	大立光	-1.48
聯發科	2.53	緯創	-1.38
中華電	2.46	川湖	-1.36
前十名合計	140.07	後十名合計	-21.40

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	52.7%	61.4%
電子期前十大市場佔比	51.1%	75.1%
金融期前十大市場佔比	51.4%	89.3%
非金電期前十大市場佔比	86.5%	81.1%

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

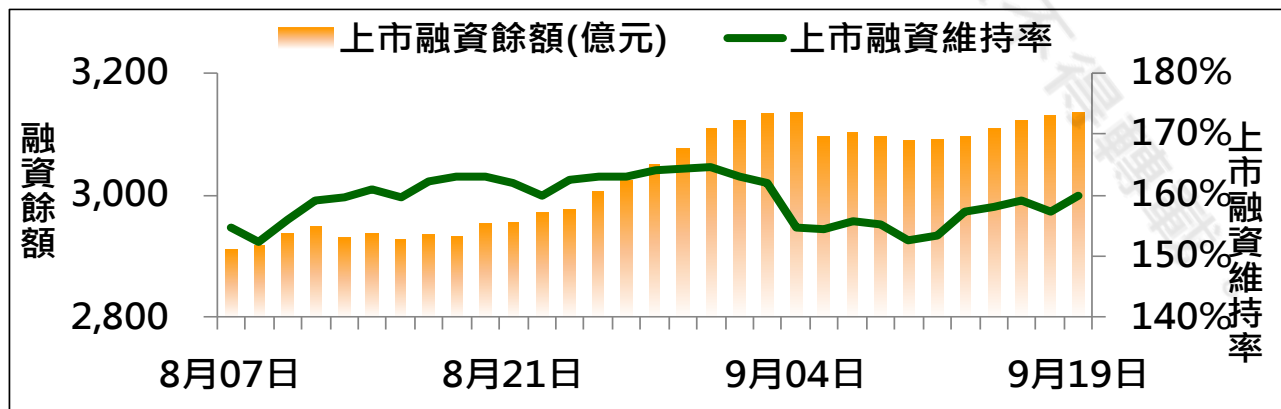
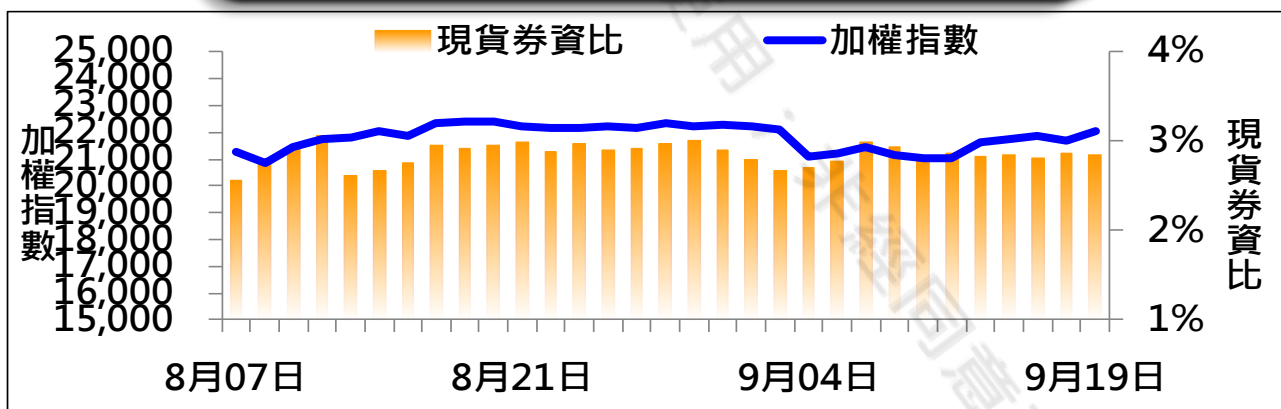
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

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13日	29.4	-31,780	-1,410	-31.3	1,018	459
09月16日	-20.5	-32,276	-496	-51.7	378	-640
09月18日	-159.2	-30,477	1,799	-155.8	414	36
09月19日	271.1	-30,264	213	60.1	-601	-1,015
09月20日	237.9	-31,945	-1,681	-0.7	-1,683	-1,082

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13日	-6,455	6,945	-13,400	-990	-11,766	10,776
09月16日	-4,605	5,822	-10,427	-4,481	-18,050	13,569
09月18日	-2,687	3,450	-6,137	-2,595	-4,514	1,919
09月19日	-2,052	5,555	-7,607	2,662	2,829	-167
09月20日	-357	6,363	-6,720	4,256	-5,282	9,538

現貨券資比 & 上市融資維持率



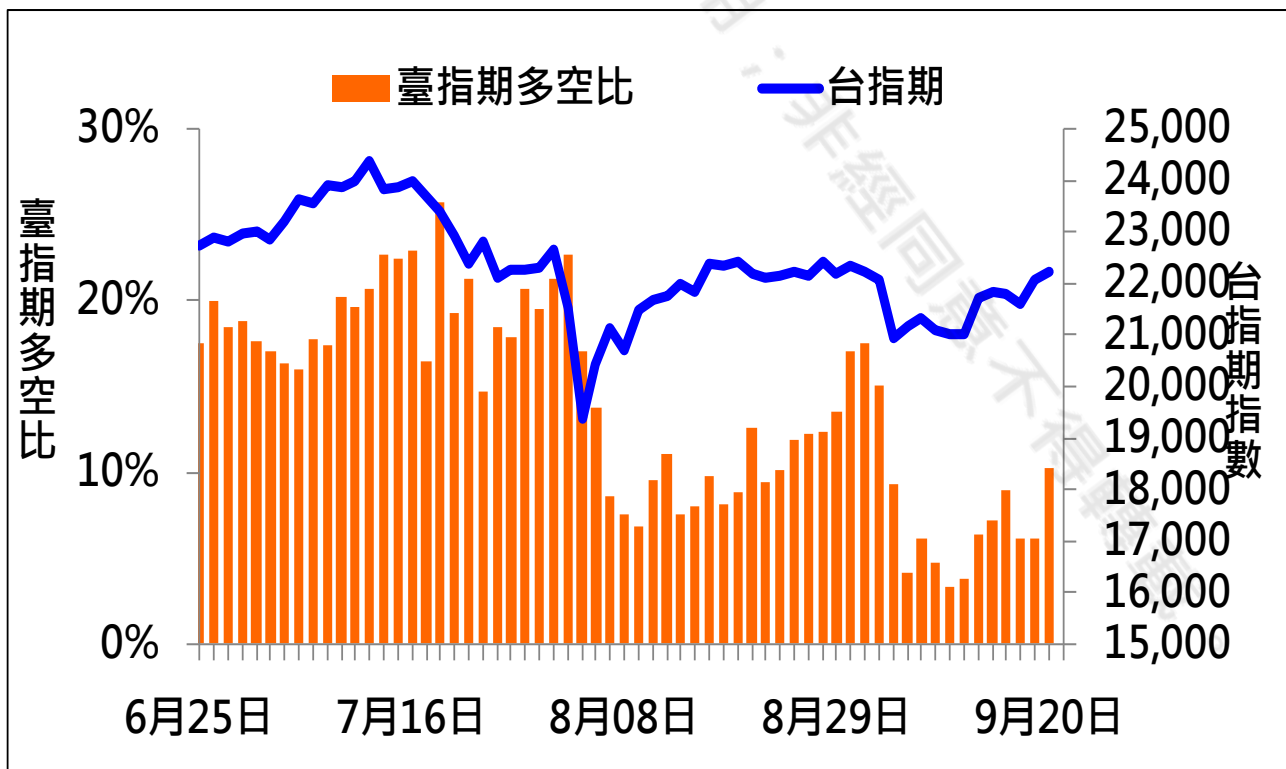
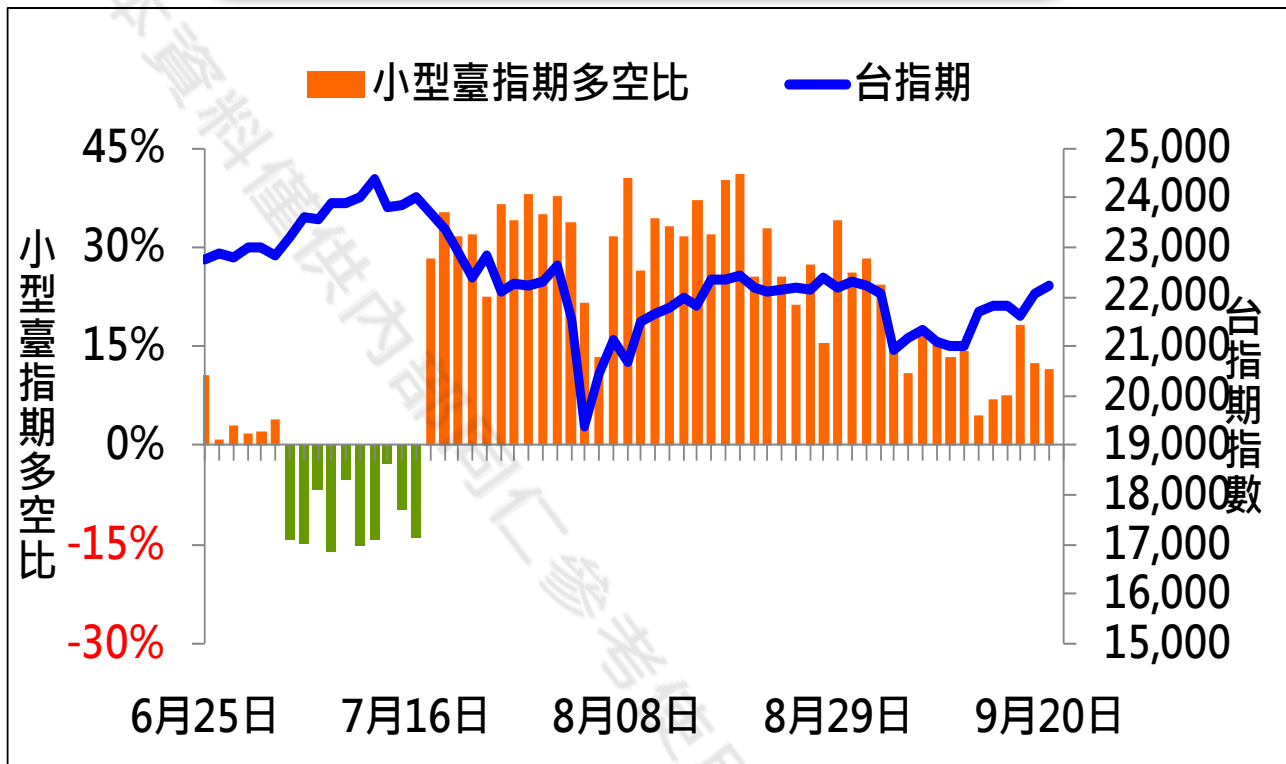
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



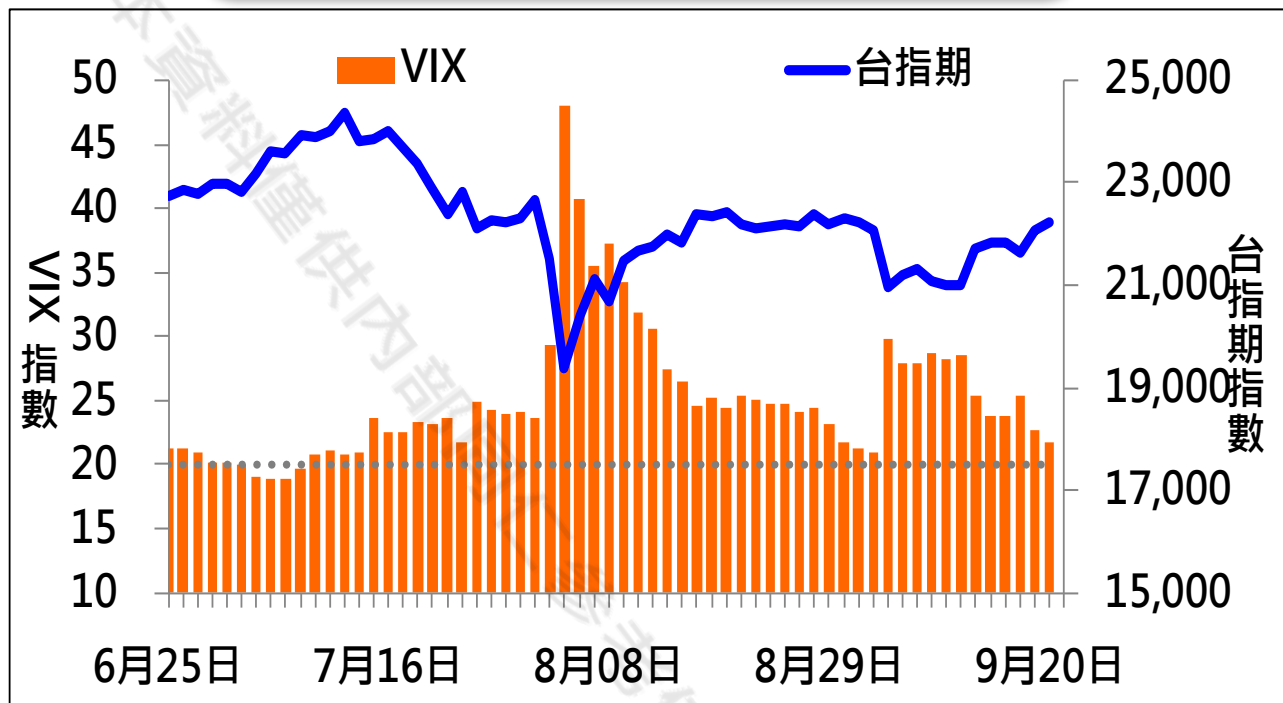
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

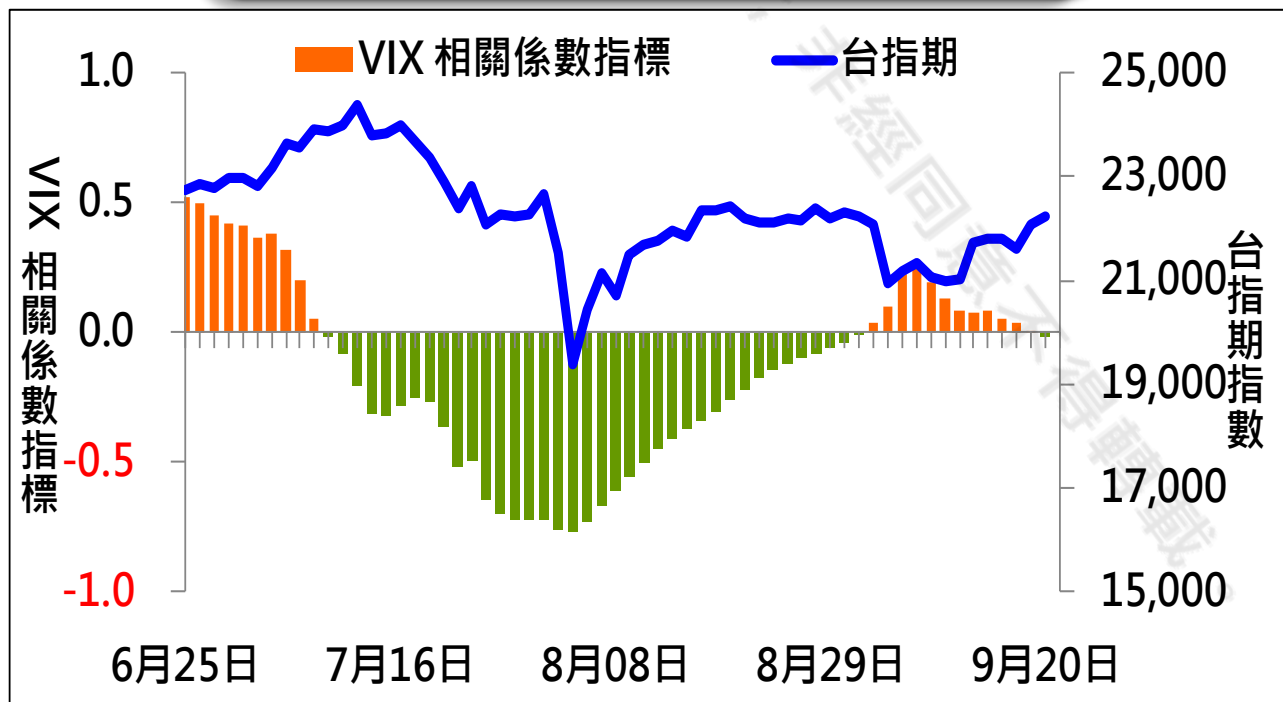
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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



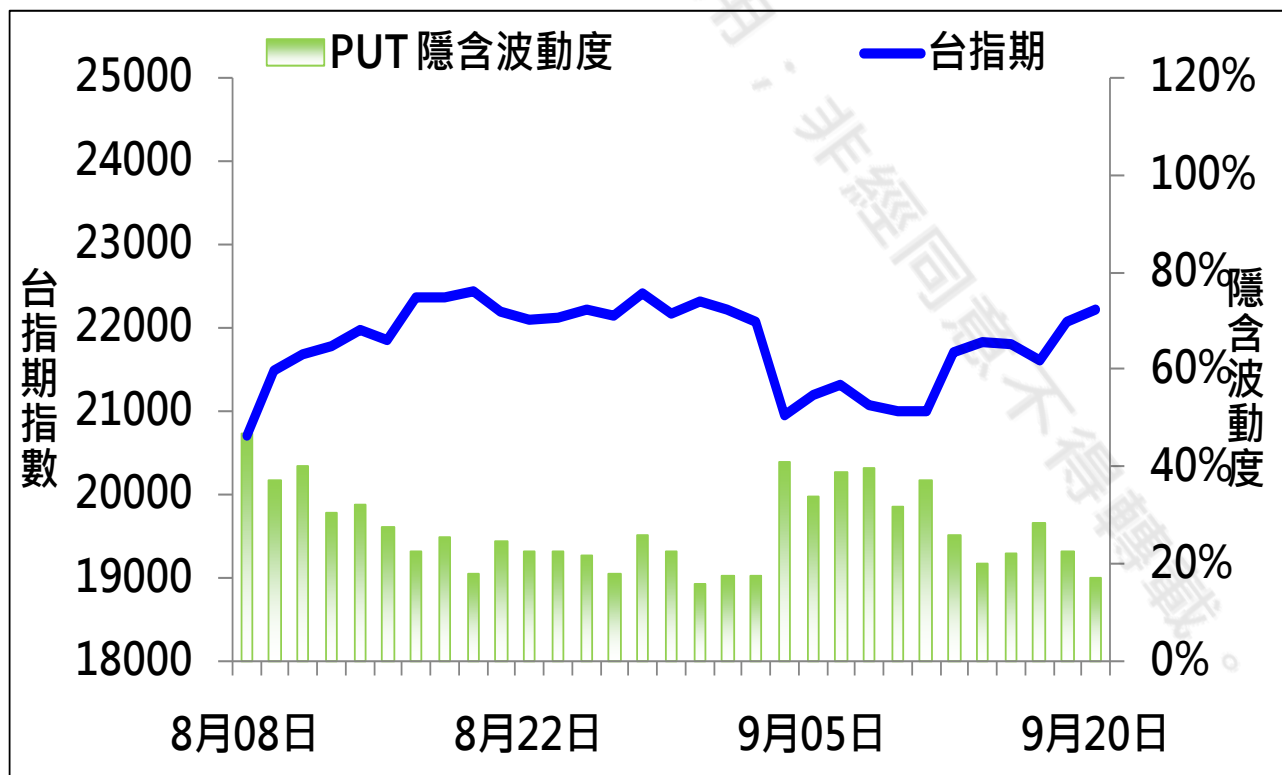
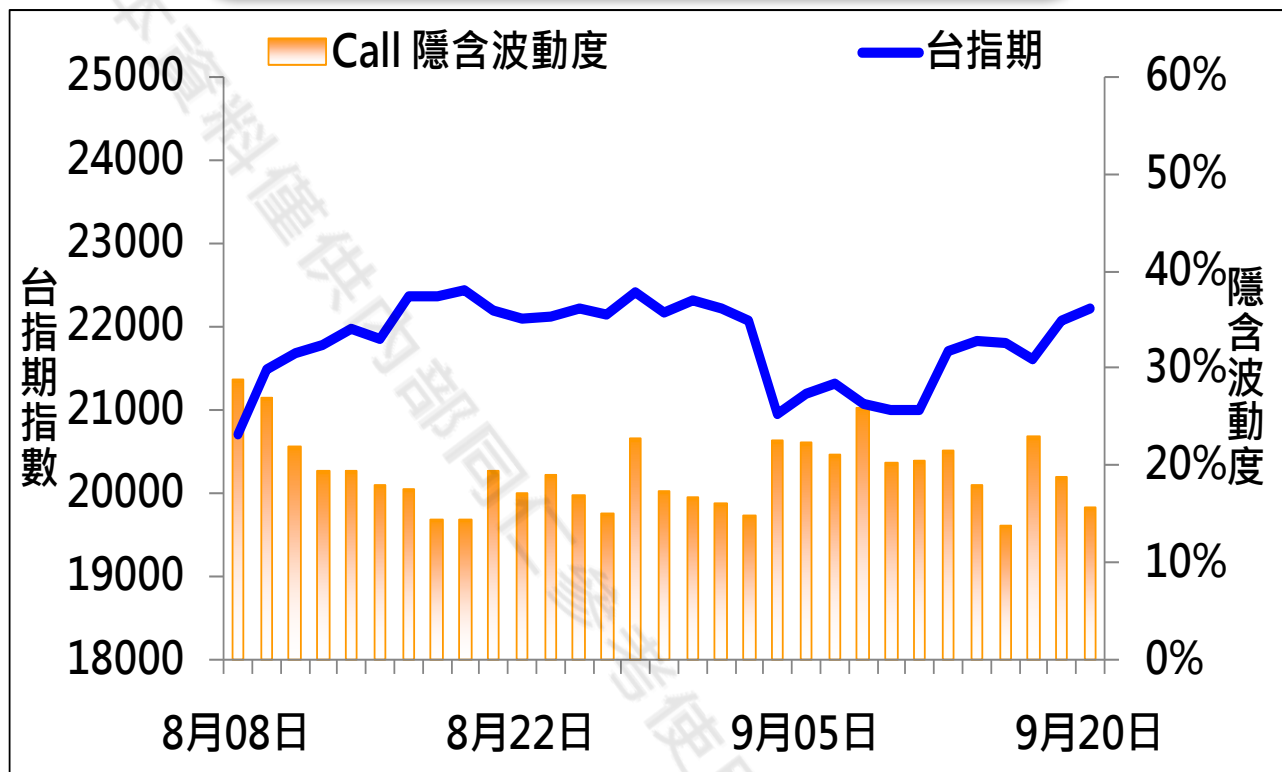
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2024/9/20

結算日：2024/9/25

OI 增減	Call	202409W4 履約價	Put	OI 增減
0	23	20,900	1,650	-454
0	48	21,000	3,673	9
-1	6	21,050	1,120	-57
0	45	21,100	2,498	-179
0	36	21,200	2,382	-220
-5	56	21,300	3,162	308
-3	61	21,400	3,269	621
-15	115	21,500	4,983	1,717
-39	190	21,600	3,003	1,120
-108	740	21,700	3,045	1,097
-288	597	21,800	3,456	2,405
-147	826	21,900	2,252	1,080
-309	1,534	22,000	4,067	3,025
-1,817	1,610	22,100	1,581	1,126
-178	685	22,150	750	664
115	2,041	22,200	1,248	1,139
139	2,838	22,300	848	774
1,347	4,880	22,400	783	725
1,385	5,255	22,500	285	274
2,265	4,253	22,600	162	132
1,808	1,808	22,650	21	21
※ 3,496	5,538	22,700	32	9
1,980	4,264	22,800	64	57
1,274	2,741	22,900	12	12
1,194	3,701	23,000	7	6
15,137	63,745	總計	87,064	20,780
P/C	1.3658		增減	0.0022

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：2024/9/20

結算日：2024/10/16

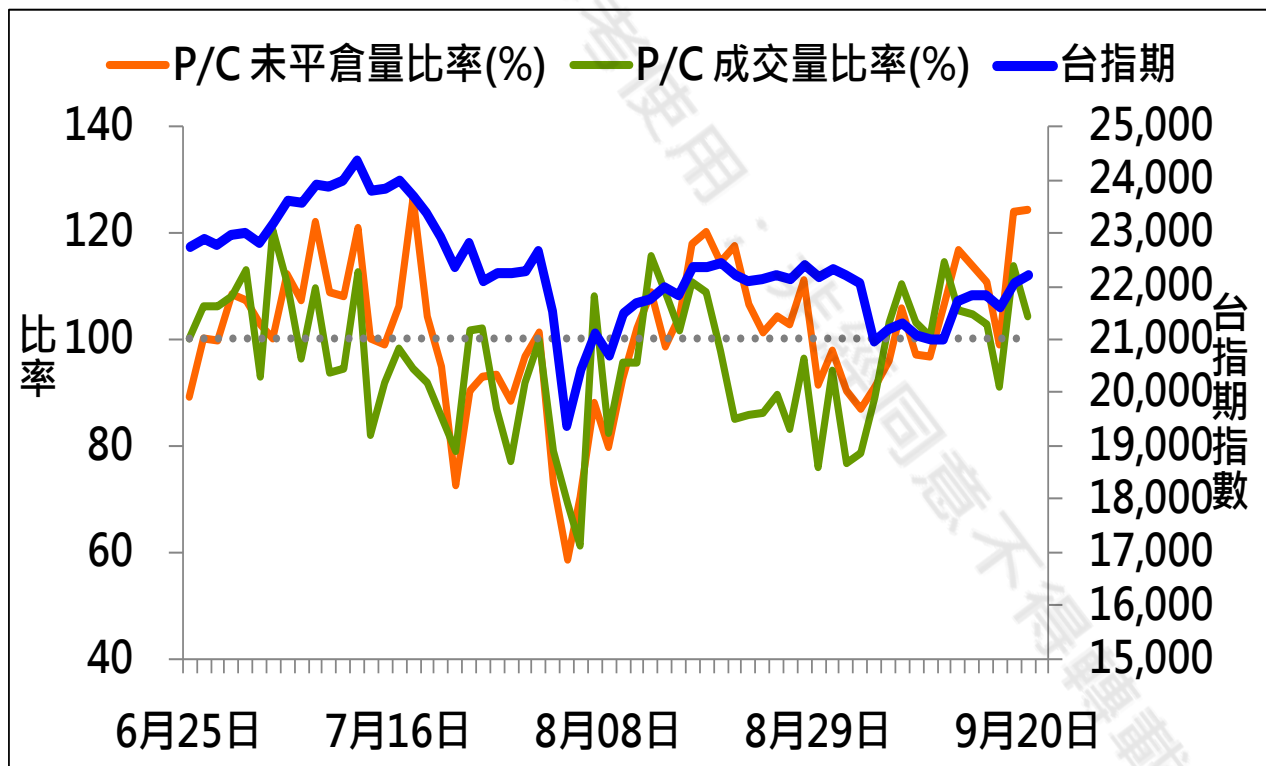
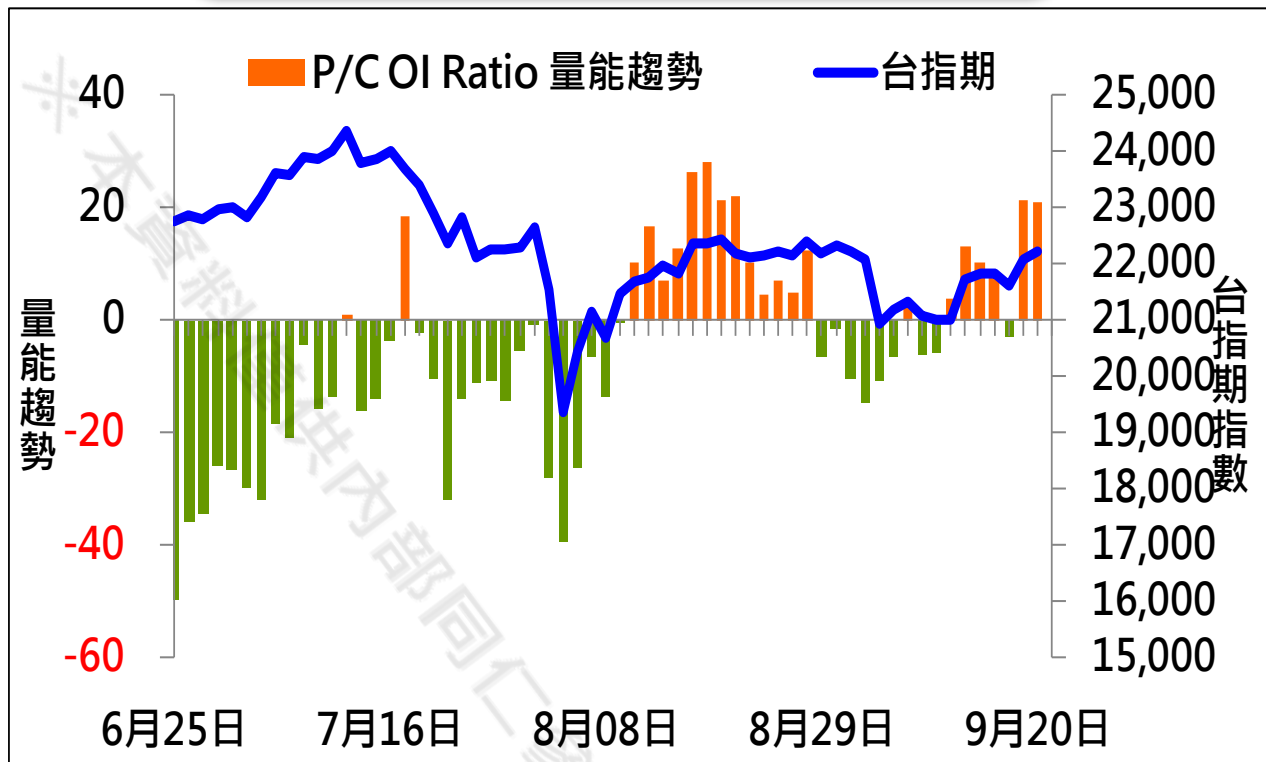
OI 增減	Call	202410月 履約價	Put	OI 增減
-15	93	21,000	2,083	222
-6	76	21,100	213	38
0	84	21,200	1,977	219
-13	68	21,300	986	99
2	129	21,400	616	71
-13	549	21,500	1,615	843
-43	266	21,600	465	170
-134	895	21,700	1,304	95
-35	608	21,800	591	287
-20	246	21,900	540	199
-50	2,340	22,000	767	196
39	869	22,100	743	149
427	992	22,200	221	76
27	551	22,300	208	144
407	1,263	22,400	182	123
※ 1,111	3,166	22,500	208	176
23	1,053	22,600	83	29
86	909	22,700	35	9
106	2,157	22,800	39	13
33	739	22,900	33	11
381	3,321	23,000	34	5
541	952	23,100	46	0
177	1,837	23,200	41	0
4,584	35,874	總計	36,619	5,855
P/C	1.0208		增減	0.0376

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