

法人籌碼動態

09月27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	-36,237	844	-294	66	-454	-33
投信	25,284	-348	199	0	11	0
自營商	-1,408	124	-21	-28	313	-3
09月27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	11	13	4,791	68	6,391	716
投信	0	0	-400	0	0	0
自營商	17	-8	12,006	11,052	6,098	3,053

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口	多	空
南亞	7.38	台積電	-124.82	台指期前十大 市場佔比	52.0%	63.1%
台塑化	7.03	富邦金	-7.97			
台塑	6.94	聯發科	-5.13			
中鋼	6.82	日月光投控	-4.93	電子期前十大 市場佔比	60.0%	72.7%
鴻海	6.67	國泰金	-4.16			
中租-KY	6.51	旭隼	-2.96			
亞德客-KY	5.45	中信金	-2.58	金融期前十大 市場佔比	47.3%	86.3%
萬海	4.95	兆豐金	-2.54			
台化	4.61	聯詠	-2.54			
長榮	4.11	國巨	-2.31	非金電期前十大 市場佔比	85.7%	71.4%
前十名合計	60.48	後十名合計	-159.94			

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

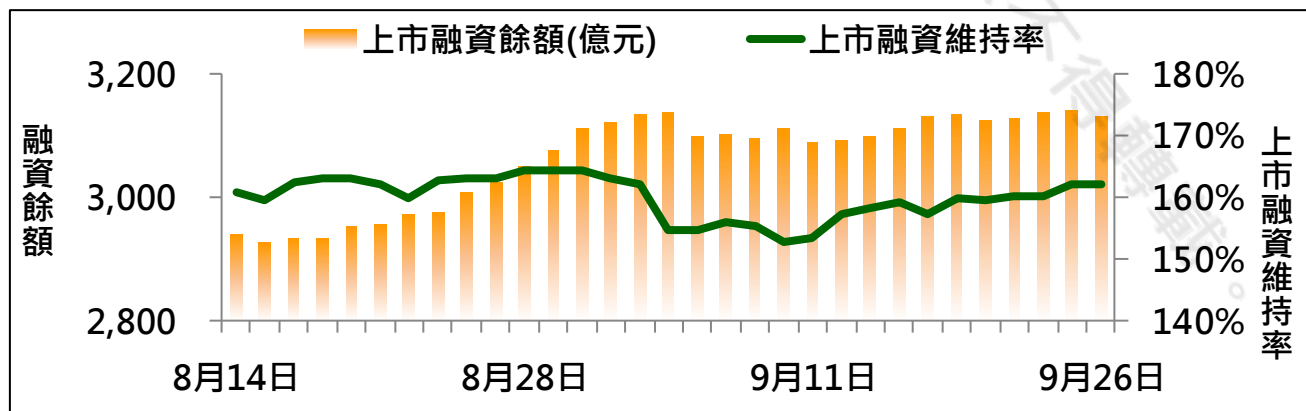
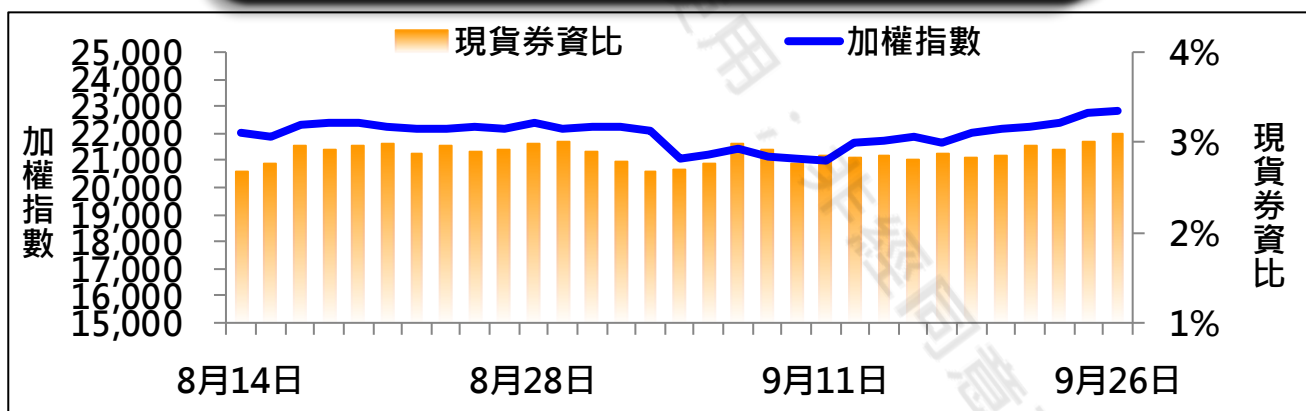
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

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23日	115.9	-35,862	-3,917	29.0	-1,807	-124
09月24日	105.5	-31,749	4,113	24.2	-1,810	-3
09月25日	347.4	-34,290	-2,541	128.2	-1,942	-132
09月26日	212.1	-37,081	-2,791	48.7	-1,532	410
09月27日	246.9	-36,237	844	45.2	-1,408	124

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23日	1,542	6,351	-4,809	2,480	-7,633	10,113
09月24日	2,323	5,734	-3,411	3,477	-13,384	16,861
09月25日	-943	6,340	-7,283	-1,171	-3,671	2,500
09月26日	4,723	5,675	-952	954	3,045	-2,091
09月27日	4,791	6,391	-1,600	12,006	6,098	5,908

現貨券資比 & 上市融資維持率

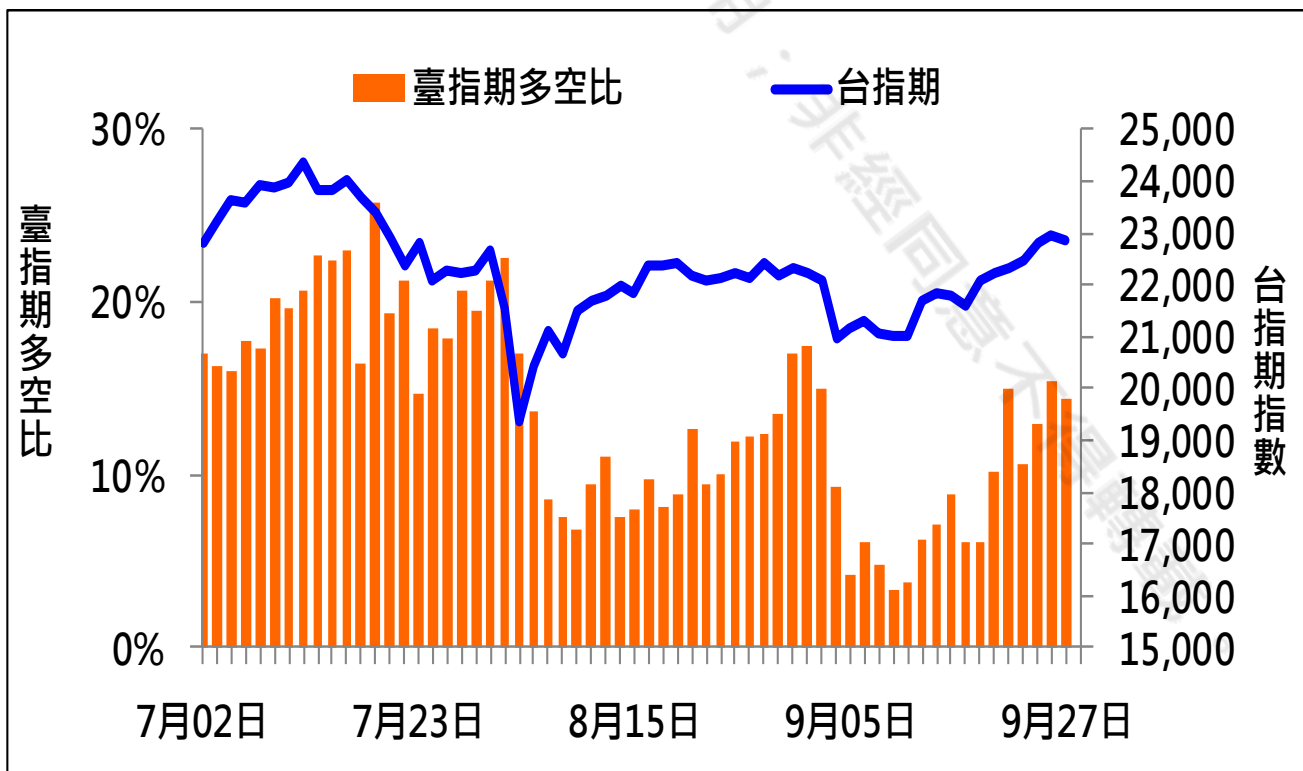
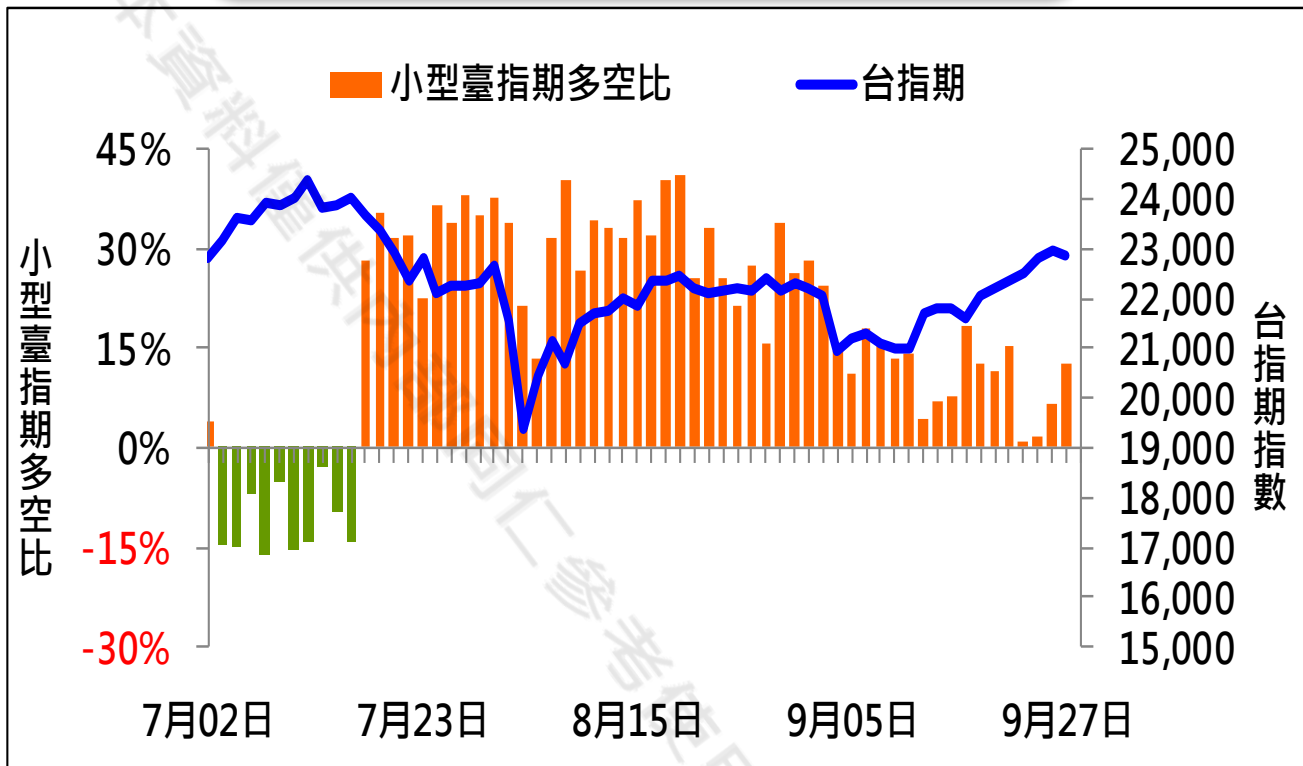


期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



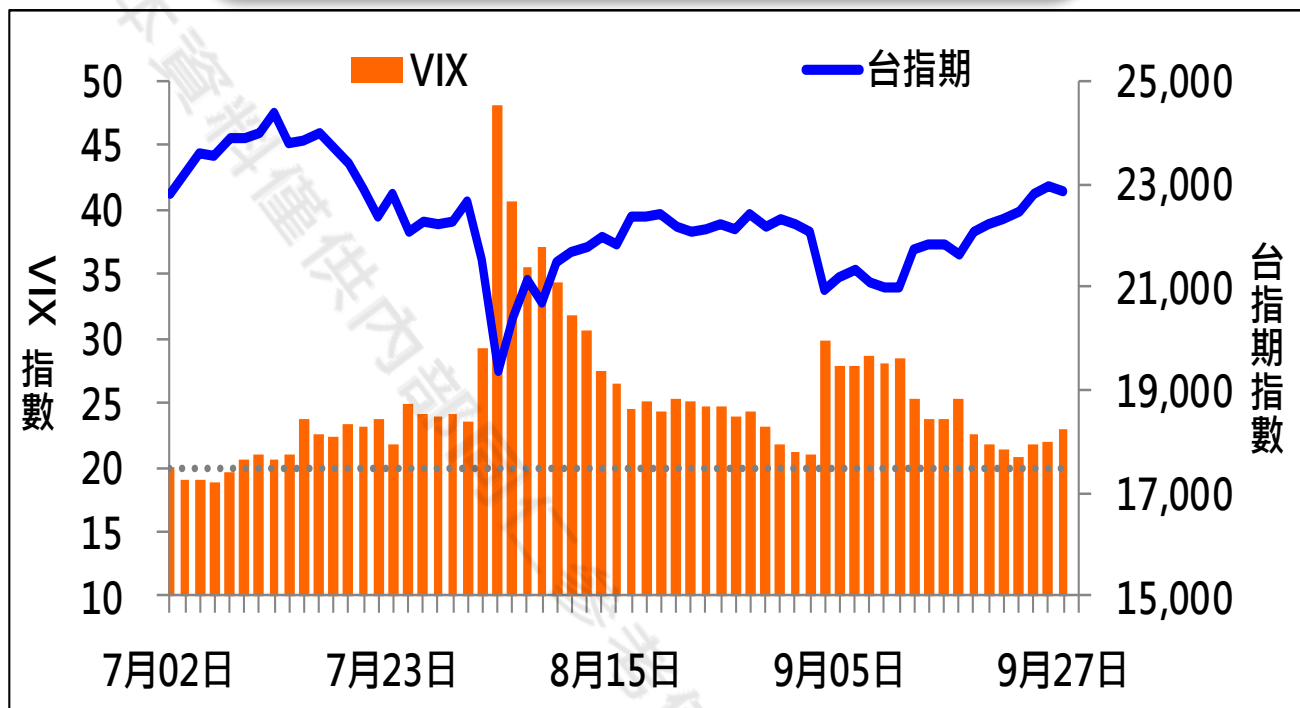
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

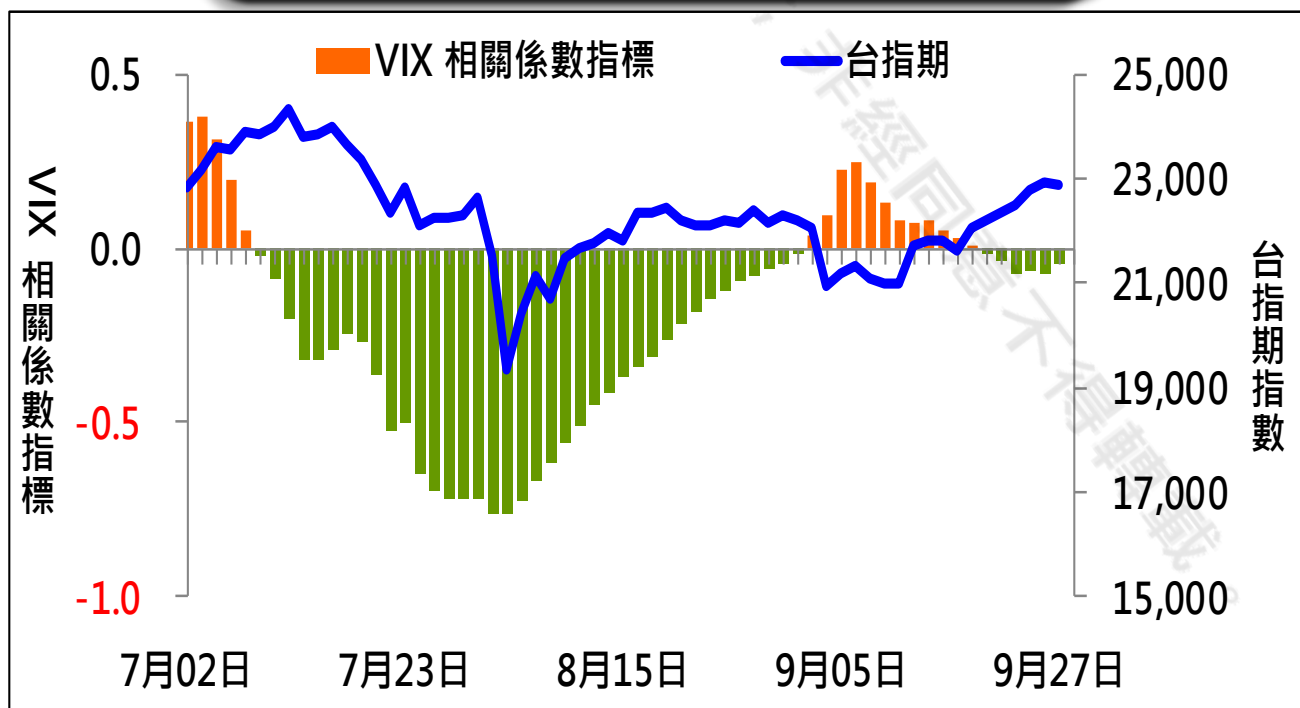
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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



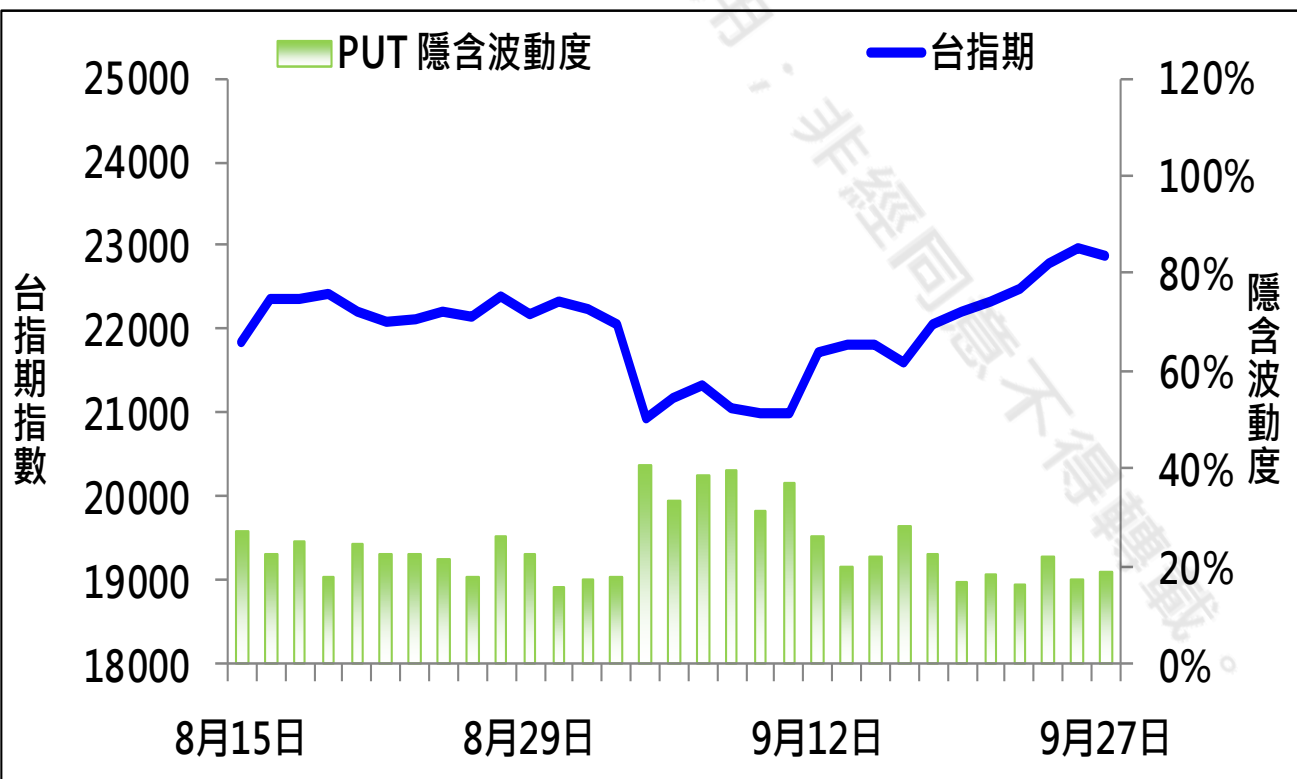
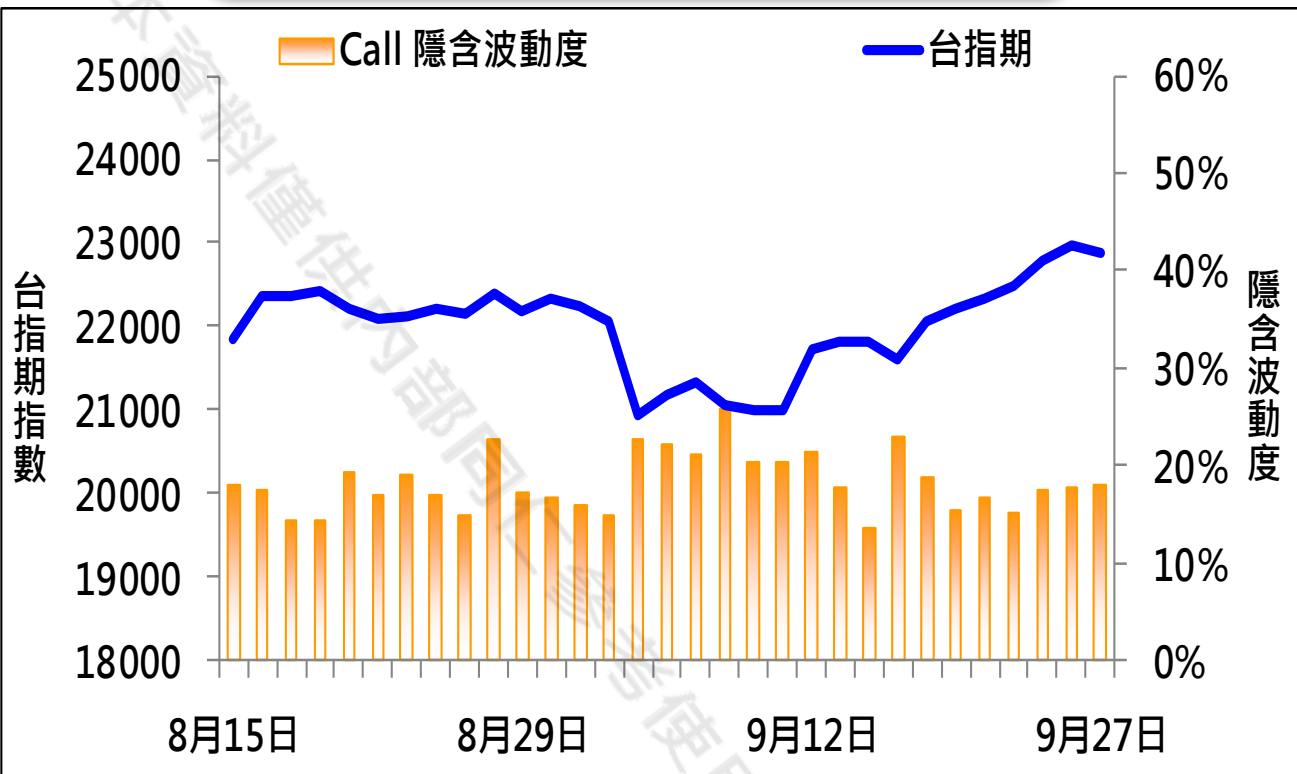
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2024/9/27

結算日：2024/10/2

OI 增減	Call	202410W1 履約價	Put	OI 增減
-12	79	22,350	1,636	-121
-30	248	22,400	4,430	398
4	101	22,450	1,671	143
40	359	22,500	3,299	546
-12	138	22,550	1,554	254
-29	398	22,600	3,837	1,136
-8	401	22,650	1,710	588
139	828	22,700	2,502	702
-69	741	22,750	2,728	886
-213	1,218	22,800	2,990	1,396
-9	608	22,850	1,278	271
25	1,685	22,900	2,724	1,635 ※
113	1,200	22,950	1,012	438
-45	3,476	23,000	2,495	1,400
264	1,429	23,050	464	245
474	3,296	23,100	915	669
882	1,526	23,150	266	205
-224	4,451	23,200	505	285
893	1,328	23,250	205	199
710	6,272	23,300	490	389
301	1,314	23,350	82	73
1,422	4,930	23,400	203	59
6,512	38,737	總計	70,123	13,690
P/C	1.8102		增減	0.0590

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：2024/9/27

結算日：2024/10/16

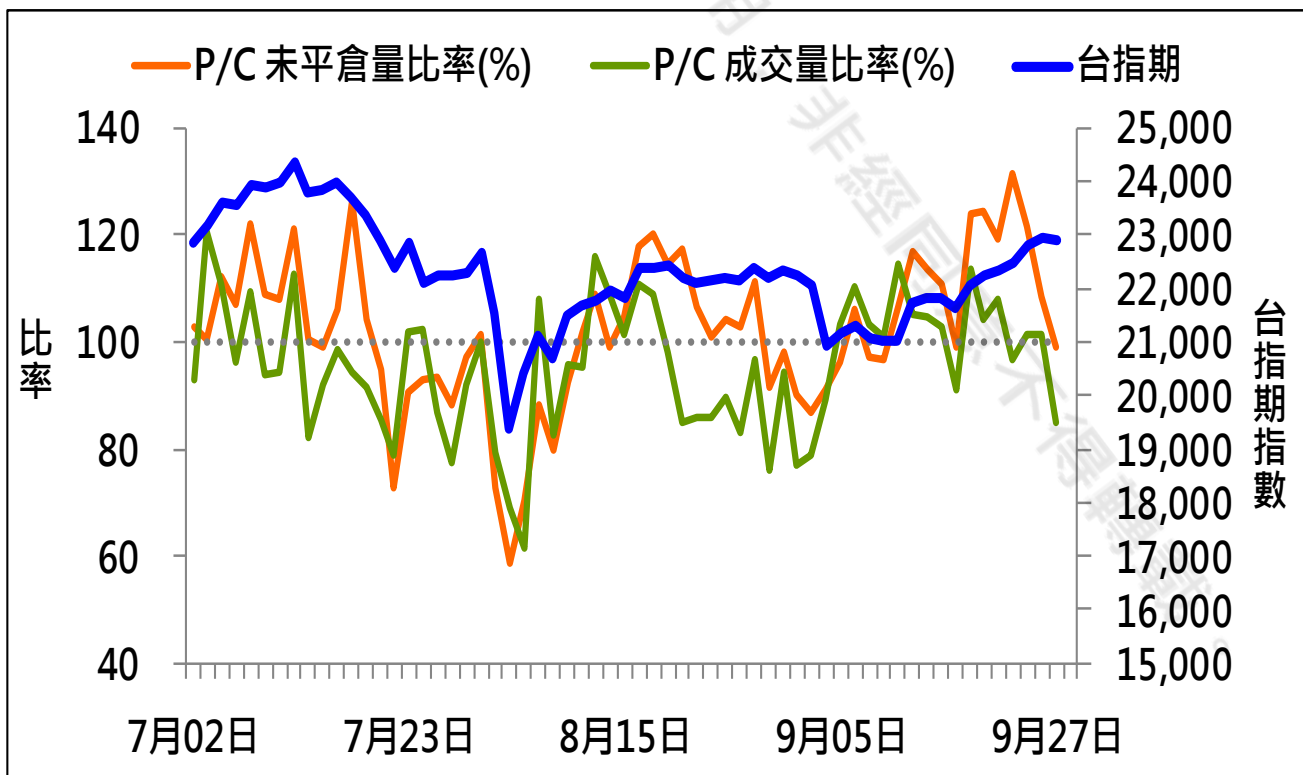
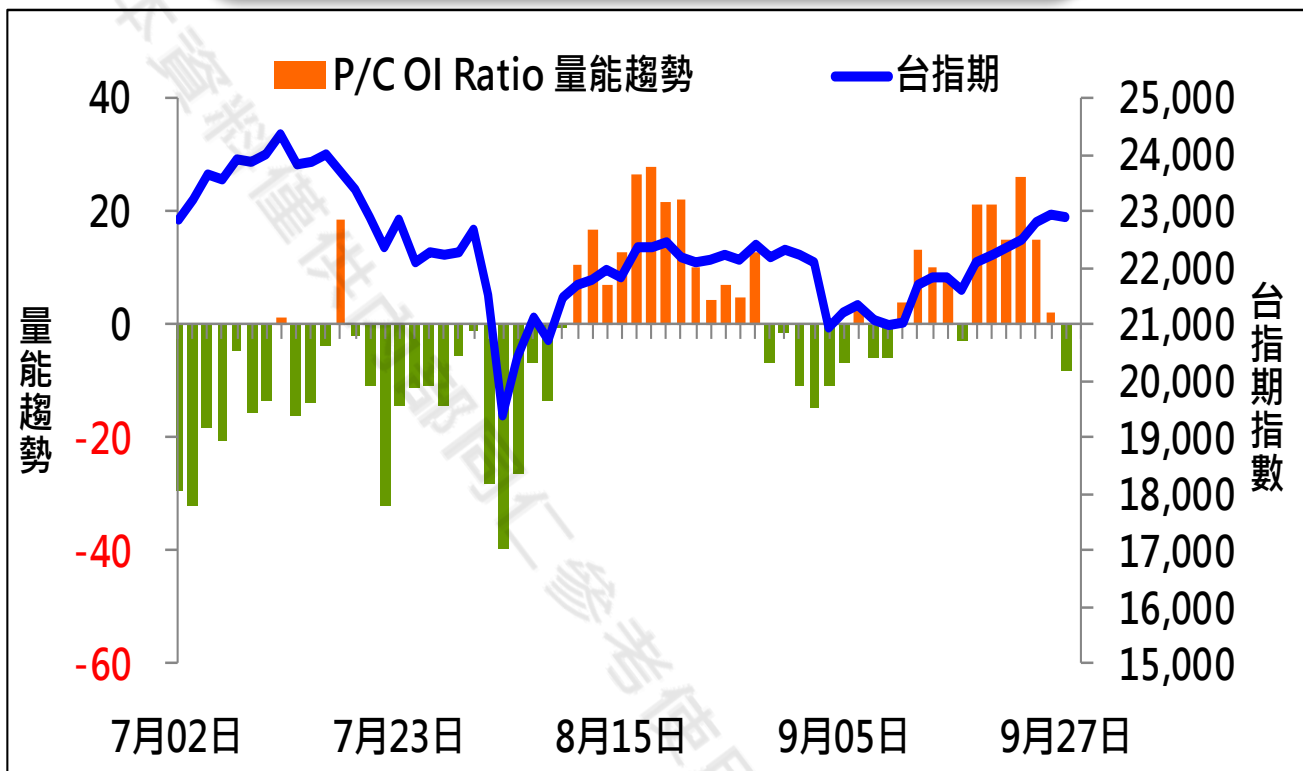
OI 增減	Call	202410 月 履約價	Put	OI 增減
0	231	16,800	3,698	44
0	12	20,100	559	16
0	11	20,300	389	21
1	33	20,500	1,756	110
0	41	20,700	549	10
0	25	20,900	1,520	-24
0	76	21,100	495	-12
-1	63	21,300	1,100	25
0	549	21,500	2,446	72
-2	843	21,700	1,481	118
11	219	21,900	668	-61
-11	1,978	22,000	1,780	120
6	560	22,300	1,242	489
-21	932	22,400	702	18
-104	3,123	22,500	772	99
-40	1,111	22,600	482	136
-33	1,046	22,700	546	20
-115	1,880	22,800	587	177
-20	740	22,900	347	175
-448	3,355	23,000	389	101
136	1,293	23,100	179	33
32	2,552	23,200	147	41
109	1,882	23,300	141	70
-130	1,819	23,400	144	100
-325	2,205	23,500	71	24
-301	1,458	23,600	61	53
107	1,382	23,700	23	15
51	589	23,900	24	24
69	158	24,900	0	0
104	47,763	總計	65,483	3,966
P/C	1.3710		增減	0.0802

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。

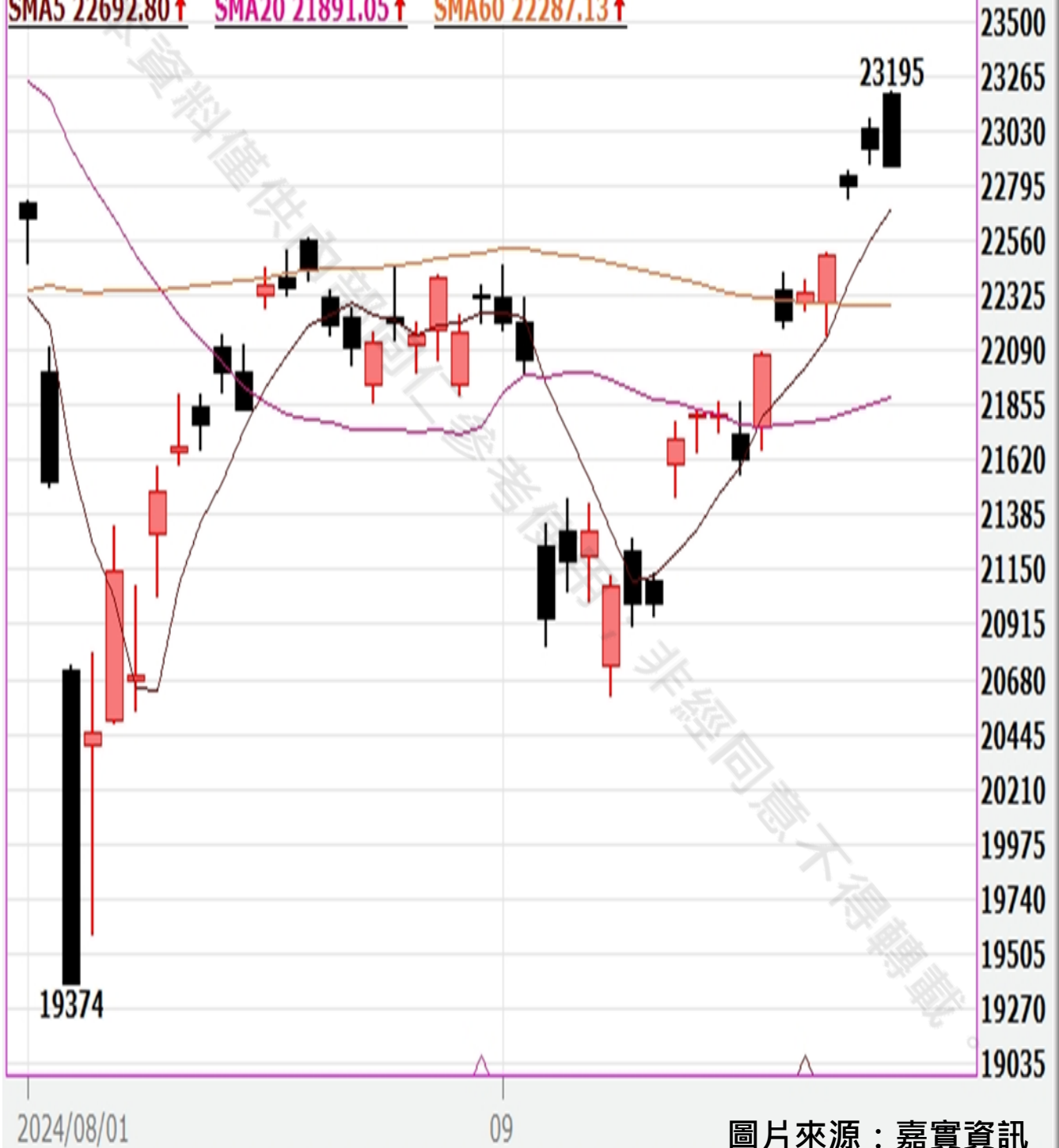
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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 2024/09/27 收 **22884** ↓ 點 量 75510 口

SMA5 22692.80 ↑ **SMA20 21891.05 ↑** **SMA60 22287.13 ↑**



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