



## 法人籌碼動態

09月09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	-11,655	2,542	197	134	-1,548	47
投信	-1,546	-736	201	-8	24	0
自營商	7,178	566	253	-144	127	-66

09月09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	-179	113	-8,330	4,643	21,480	-611
投信	2	0	0	0	-62	0
自營商	161	-101	12,642	-3,222	-8,896	1,752

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
聯電	6.95	聯發科	-5.76	台指期前十大 市場佔比	43.6%	50.4%
中鋼	3.89	萬海	-4.01			
日月光投控	3.60	台塑	-2.93			
祥碩	3.30	富邦媒	-2.30	電子期前十大 市場佔比	63.4%	65.2%
中租-KY	2.52	鴻海	-2.28			
國巨	2.38	和泰車	-2.16			
南電	2.23	矽力-KY	-1.84	金融期前十大 市場佔比	67.2%	86.8%
亞德客-KY	1.74	緯穎	-1.55			
聯詠	1.60	台化	-1.35			
儒鴻	1.44	中華電	-1.28	非金電期前十大 市場佔比	93.2%	85.8%
前十名合計	29.66	後十名合計	-25.46			

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 (109)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

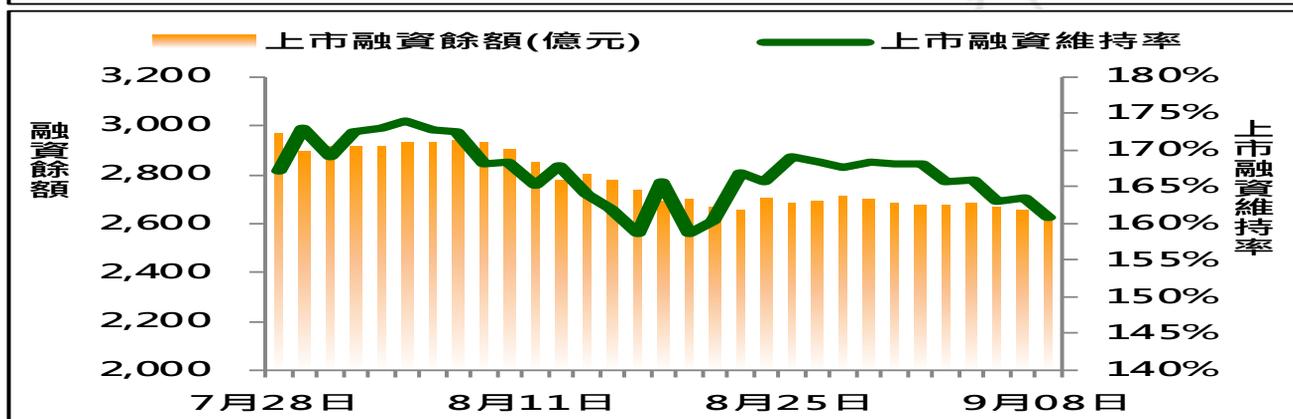
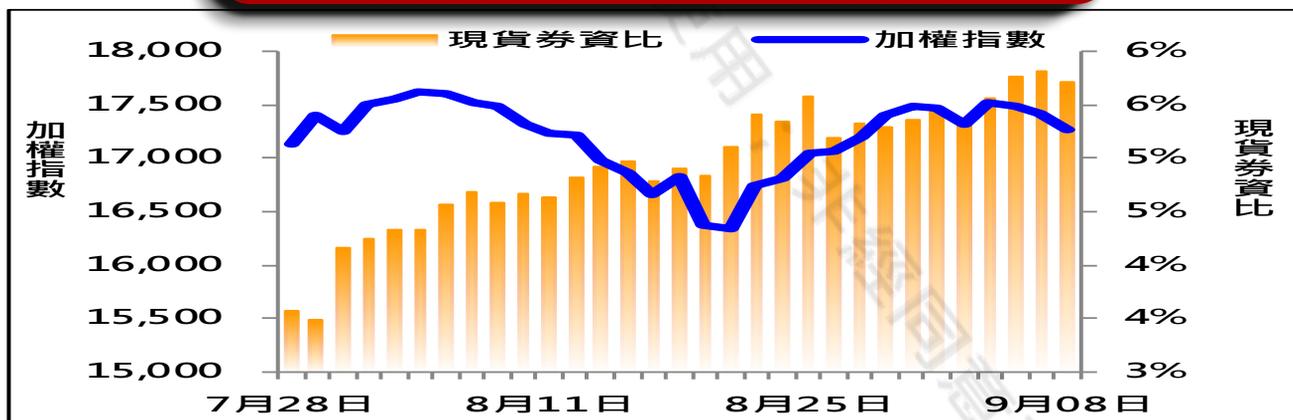


## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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03日	324.8	-19,816	-4,011	42.9	6,882	-794
09月06日	96.0	-16,296	3,520	-0.8	6,322	-560
09月07日	61.6	-15,580	716	-21.6	6,318	-4
09月08日	-10.9	-14,197	1,383	-70.4	6,612	294
09月09日	-6.6	-11,655	2,542	-5.1	7,178	566

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03日	-13,327	20,486	-33,813	13,279	2,859	10,420
09月06日	-13,990	24,474	-38,464	25,041	493	24,548
09月07日	-13,396	25,809	-39,205	10,659	1,274	9,385
09月08日	-12,973	22,091	-35,064	15,864	-10,648	26,512
09月09日	-8,330	21,480	-29,810	12,642	-8,896	21,538

## 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。

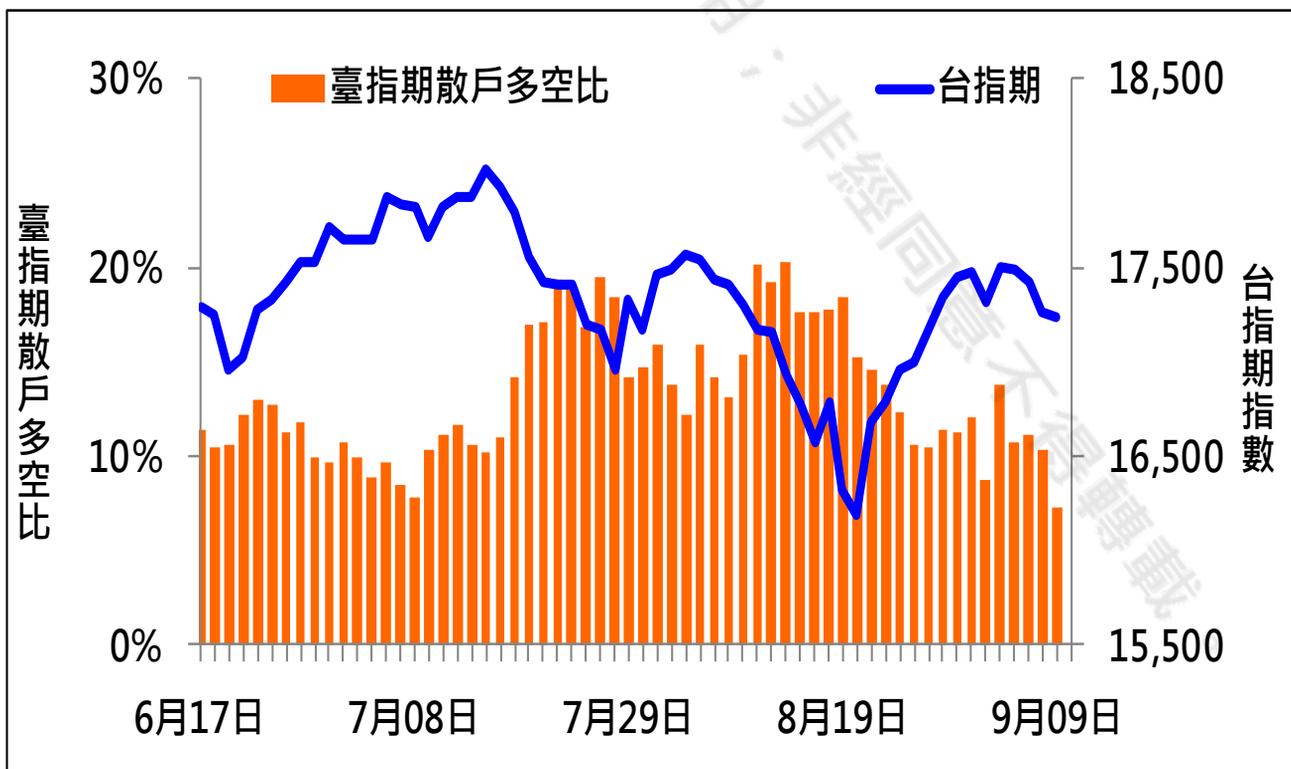
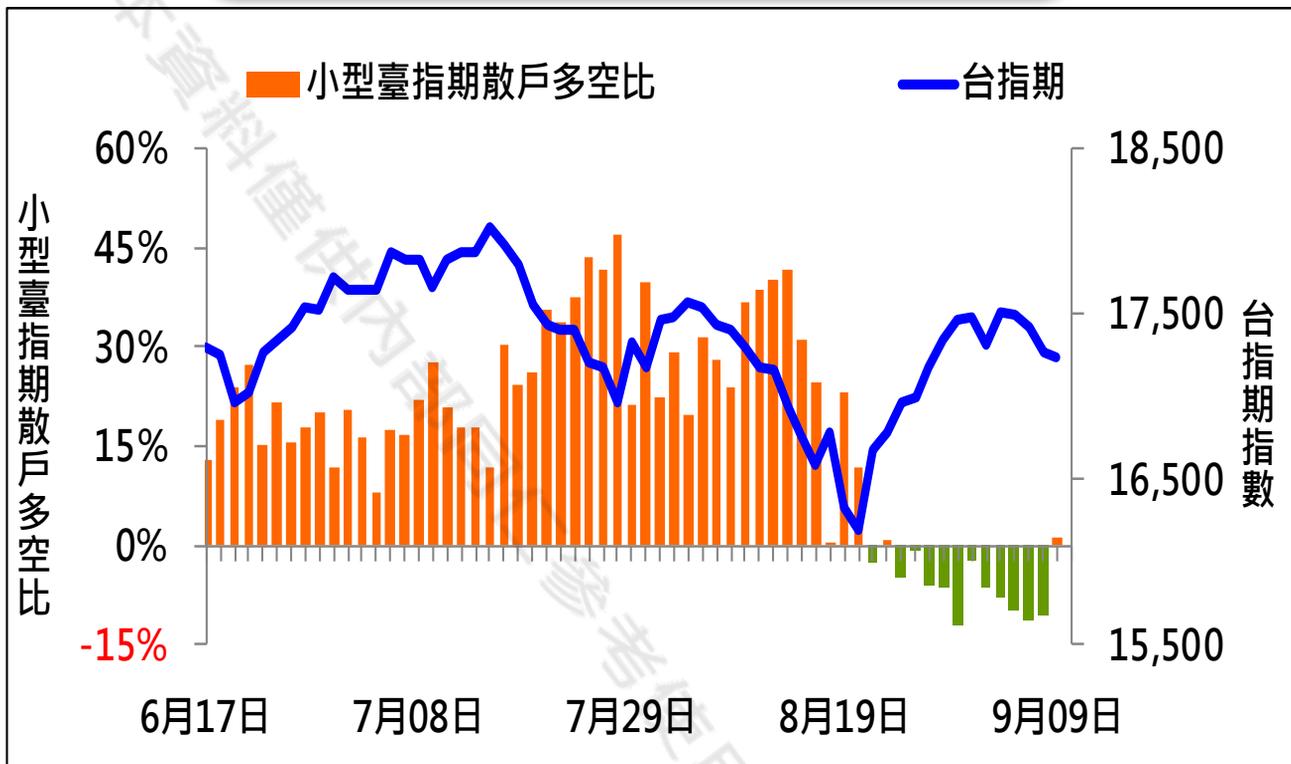
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

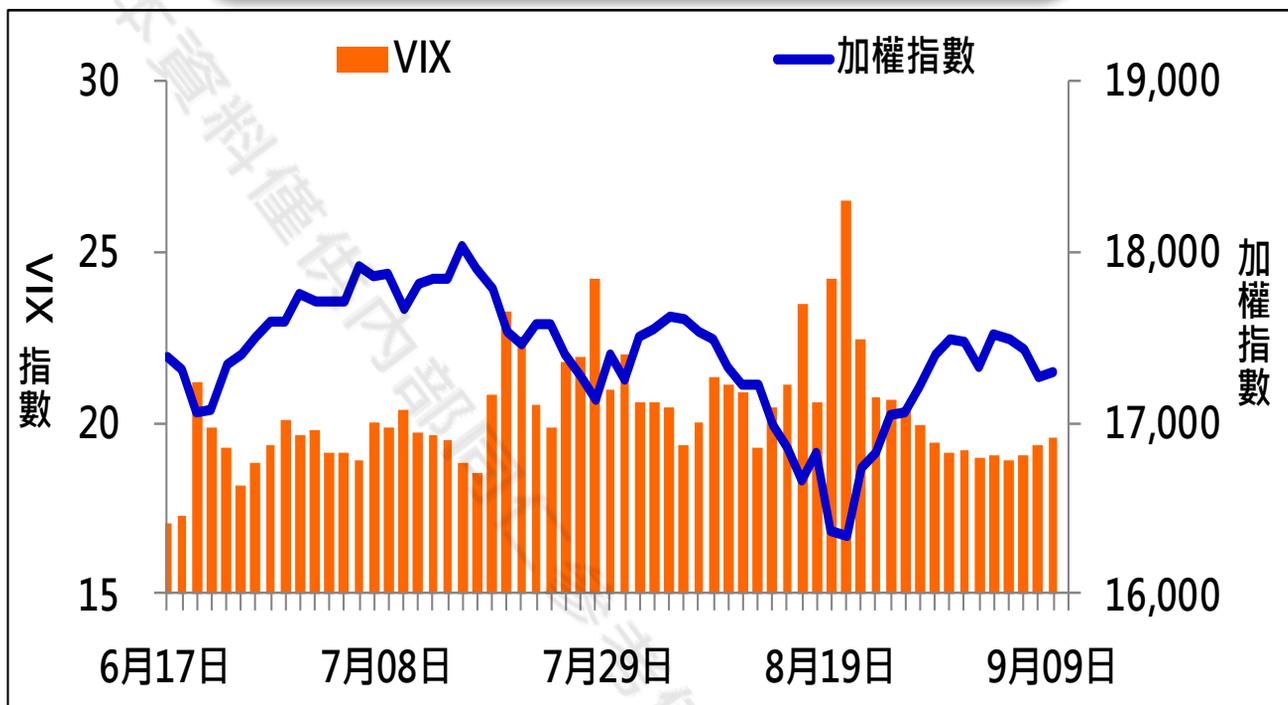
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

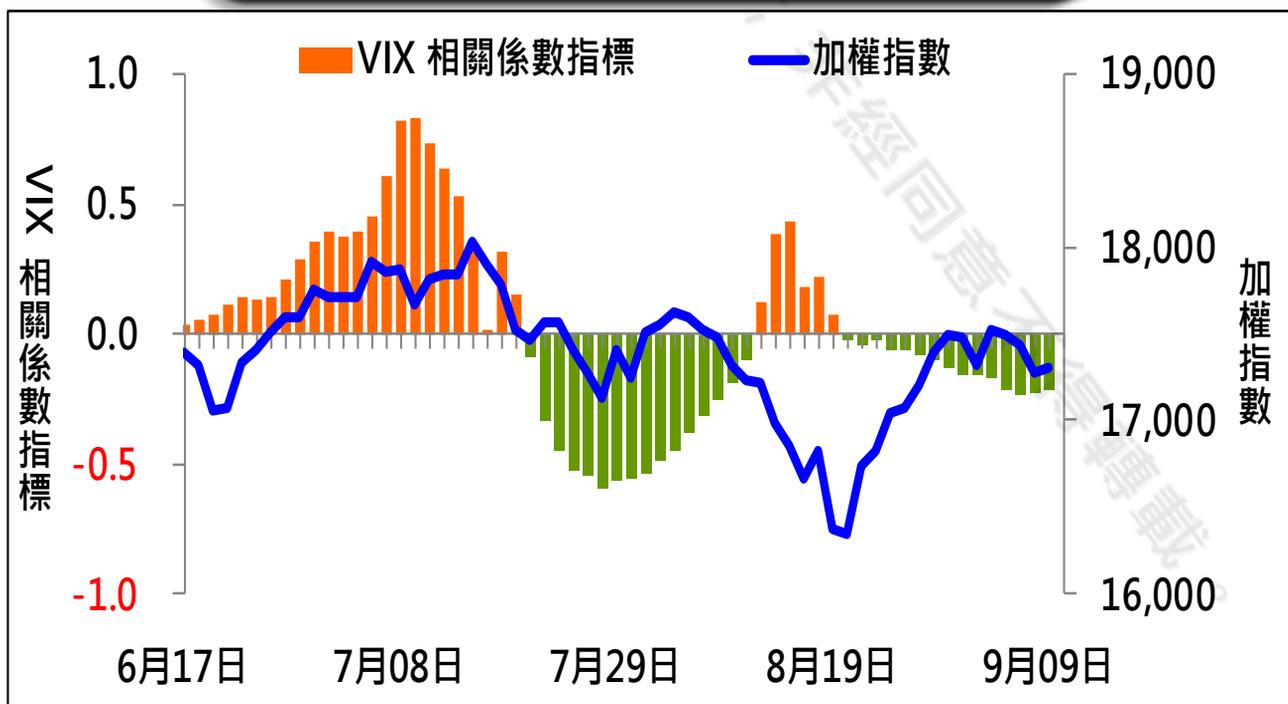
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



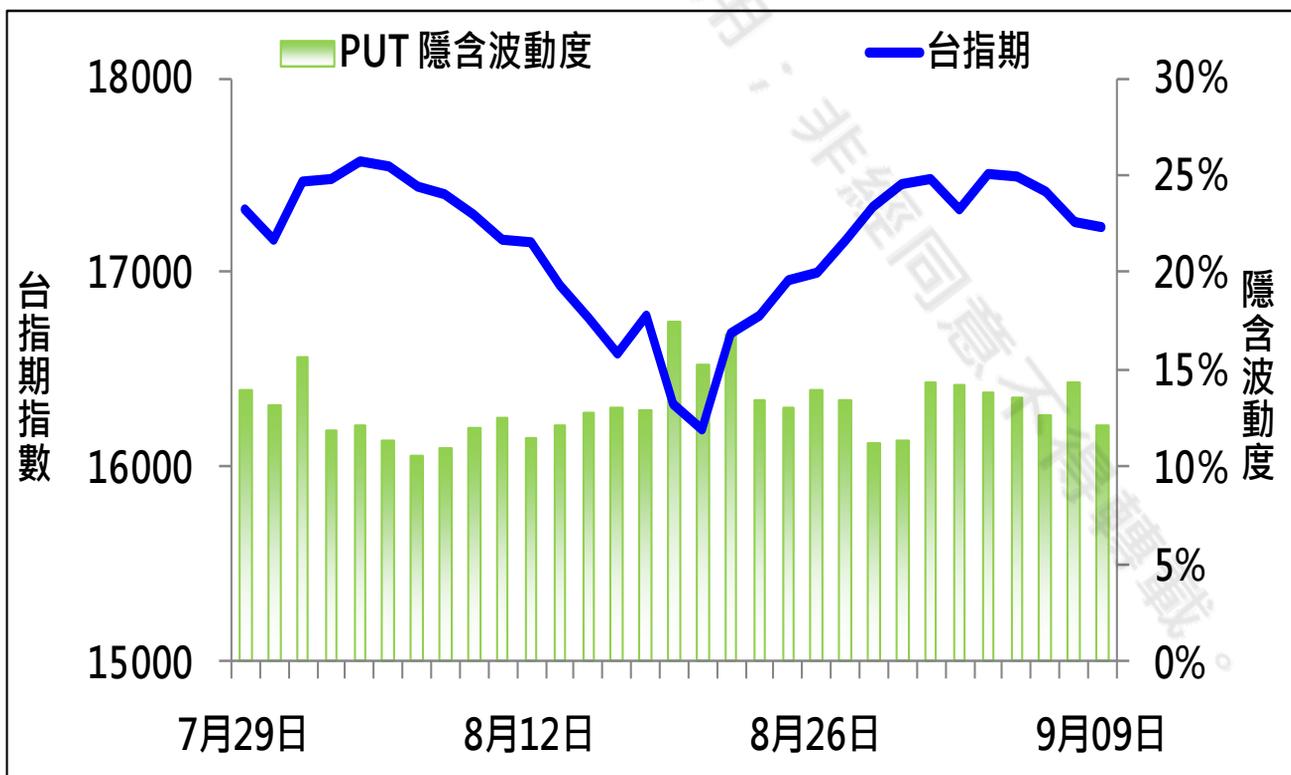
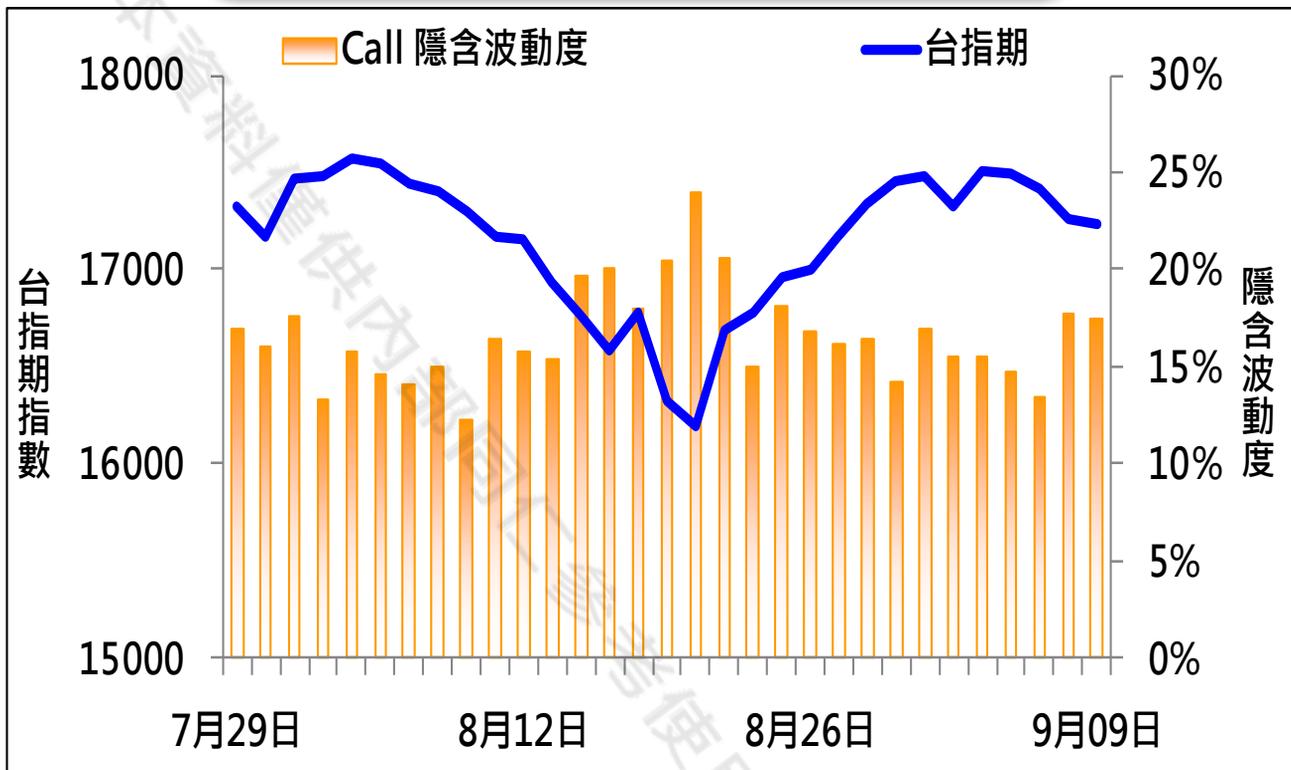
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)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 (109)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

日期：2021/9/9

結算日：2021/9/15

OI 增減	Call	202109月 履約價	Put	OI 增減
0	449	16,200	5,852	1,320
0	543	16,300	6,399	1,453
-3	2,547	16,400	7,543	3,247
0	2,586	16,500	12,836	4,953
-1	4,980	16,600	11,685	5,090
-1	5,388	16,700	10,422	3,441
-4	2,578	16,800	10,079	3,257
11	11	16,850	993	993
-44	3,637	16,900	9,052	1,992
34	59	16,950	2,031	1,297
-185	6,745	17,000	14,255	3,974
148	173	17,050	1,849	1,025
193	3,274	17,100	7,483	2,012
818	1,069	17,150	1,890	1,174
1,992	6,932	17,200	8,084	1,505
1,532	2,191	17,250	1,806	1,132
1,739	7,612	17,300	3,966	582
1,852	3,051	17,350	1,093	357
2,143	13,431	17,400	3,748	173
1,431	2,636	17,450	342	44
3,670	12,592	17,500	1,958	-139
2,729	3,714	17,550	31	-2
3,556	12,626	17,600	429	-17
※	4,372	17,650	3	0
	3,855	17,700	411	1
	1,600	17,750	16	1
-1,741	10,548	17,800	139	-12
852	2,783	17,850	2	1
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
30,640	187,451	1.1369	213,104	42,173

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 (109)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

日期：2021/9/9

結算日：2021/10/20

OI 增減	Call	202110月 履約價	Put	OI 增減	
0	7	15,900	404	35	
2	35	16,000	2,462	17	
0	27	16,100	427	40	
0	10	16,200	513	44	
0	26	16,300	1,313	643 ※	
0	88	16,400	824	430	
0	112	16,500	907	61	
4	131	16,600	1,854	80	
-4	123	16,700	1,809	164	
12	214	16,800	592	-68	
12	319	16,900	512	124	
40	227	17,000	539	75	
29	268	17,100	427	-64	
74	854	17,200	1,814	578	
39	606	17,300	605	6	
48	1,082	17,400	381	6	
48	715	17,500	88	9	
34	570	17,600	88	0	
39	410	17,700	20	1	
※	699	1,465	17,800	17	1
179	918	17,900	4	2	
190	1,449	18,000	10	0	
64	1,330	18,100	3	0	
188	914	18,200	2	0	
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計	
2,490	18,376	1.3072	24,022	3,183	
昨日 P/C	1.3118	今日增減變化		-0.0045	

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。

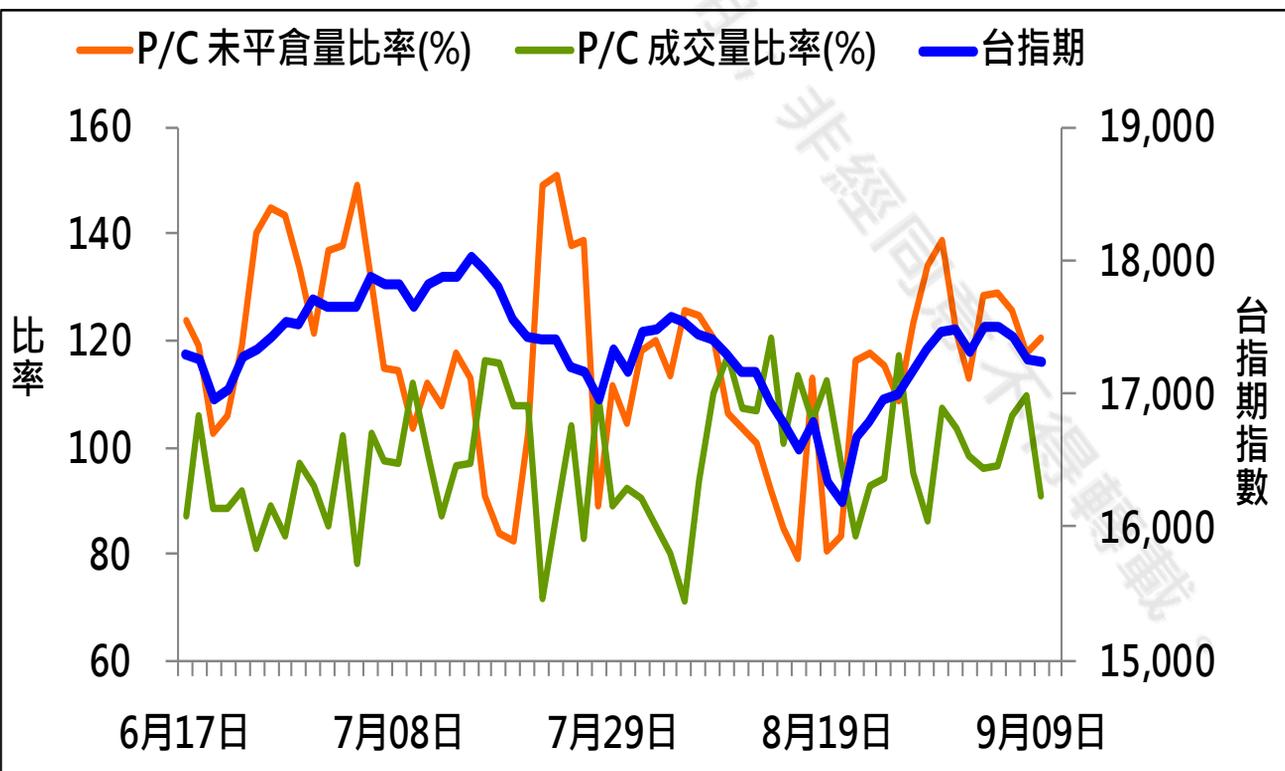
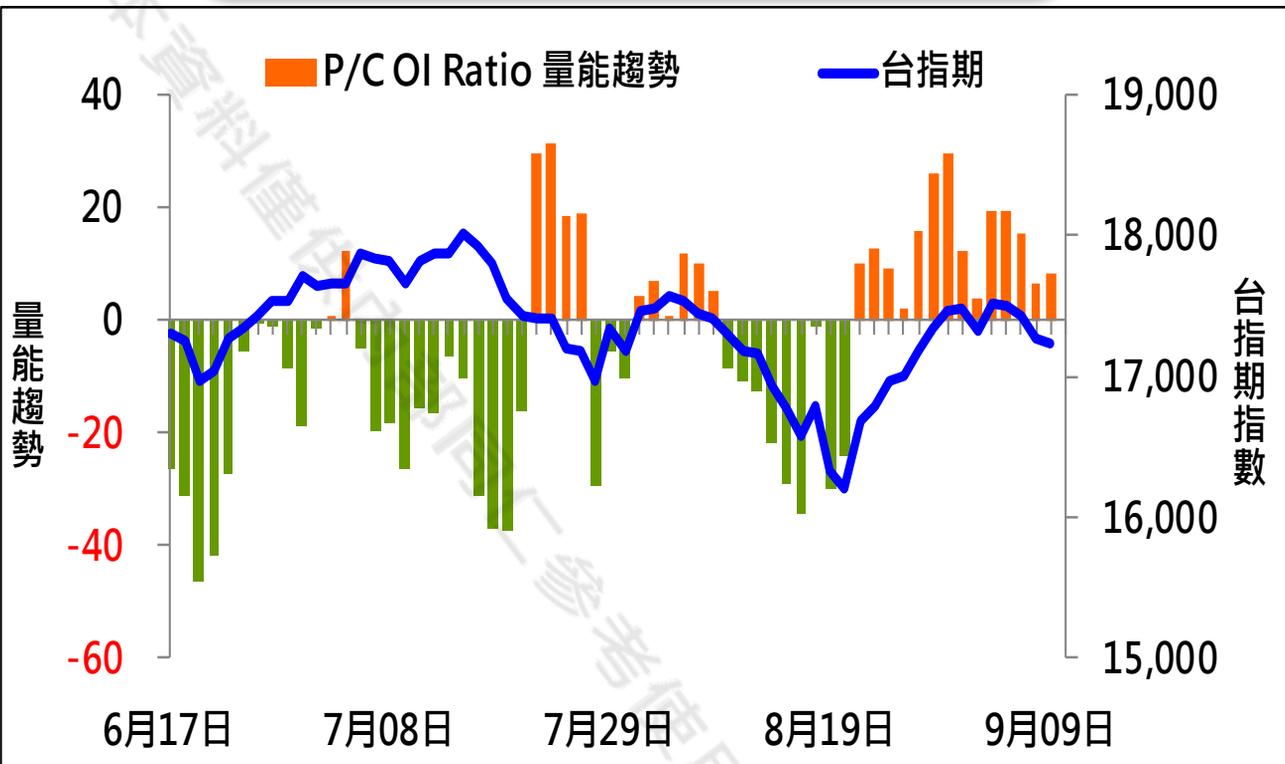
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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 (109)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 2021/09/09 開 17142 高 17291 低 17084 收 17235 量 125037 口 -25 (-0.14%)

SMA5 17384.00↓ SMA10 17367.50↑ SMA20 17033.95↑ SMA60 17342.92↓ SMA120 17059.70↑



圖片來源：嘉實資訊

期權交易財務槓桿高，交易者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，交易者須自行判斷與負責，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 (109)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 (109)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