



法人籌碼動態

09月10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	-14,302	-2,647	236	39	-1,601	-53
投信	-959	587	201	0	24	0
自營商	7,455	277	296	43	127	0

09月10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	-184	-5	-9,692	-1,362	24,747	3,267
投信	2	0	0	0	-62	0
自營商	173	12	17,404	4,762	-10,222	-1,326

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
台積電	25.59	大立光	-1.76	台指期前十大 市場佔比	42.0%	50.5%
聯發科	12.55	廣達	-1.40			
長榮	12.02	嘉里大榮	-0.63			
日月光投控	8.64	緯穎	-0.58	電子期前十大 市場佔比	66.7%	67.0%
鴻海	4.56	台達電	-0.43			
富邦媒	4.38	南帝	-0.40			
聯詠	4.10	台郡	-0.30	金融期前十大 市場佔比	66.2%	86.8%
中鋼	3.89	宅配通	-0.27			
陽明	3.46	揚明光	-0.21			
萬海	2.92	正隆	-0.18	非金電期前十大 市場佔比	95.8%	88.5%
前十名合計	82.12	後十名合計	-6.15			

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

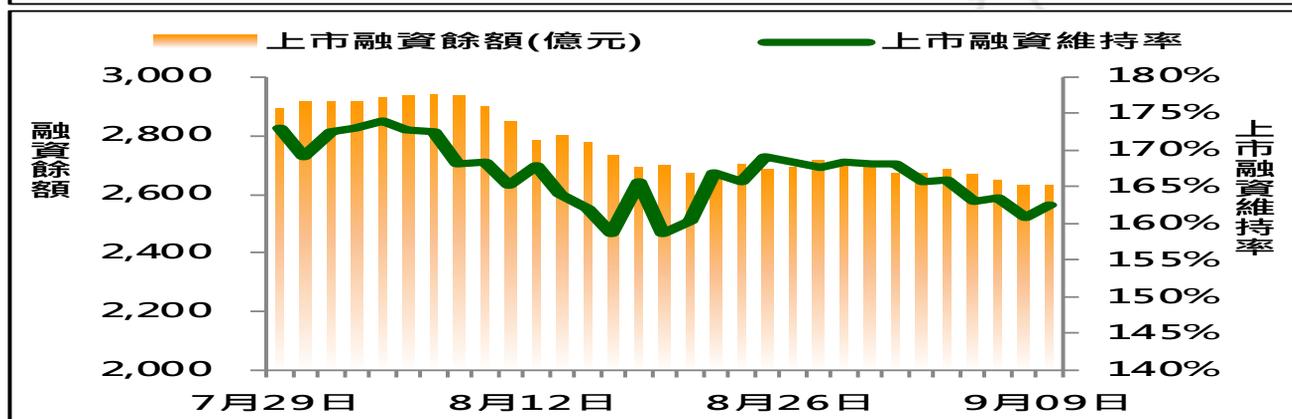
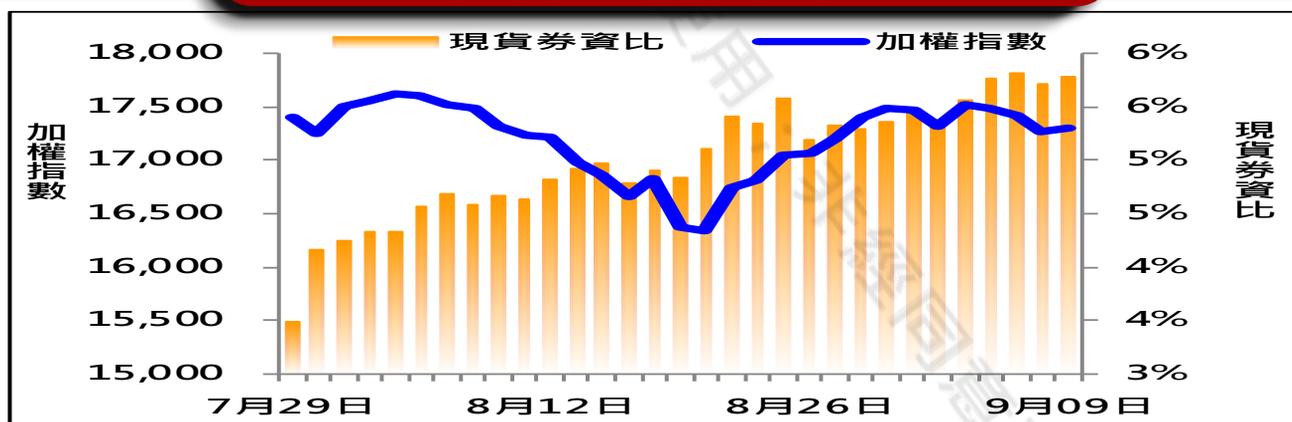


法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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
09月10日	150.2	-14,302	-2,647	25.7	7,455	277

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
09月10日	-9,692	24,747	-34,439	17,404	-10,222	27,626

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。

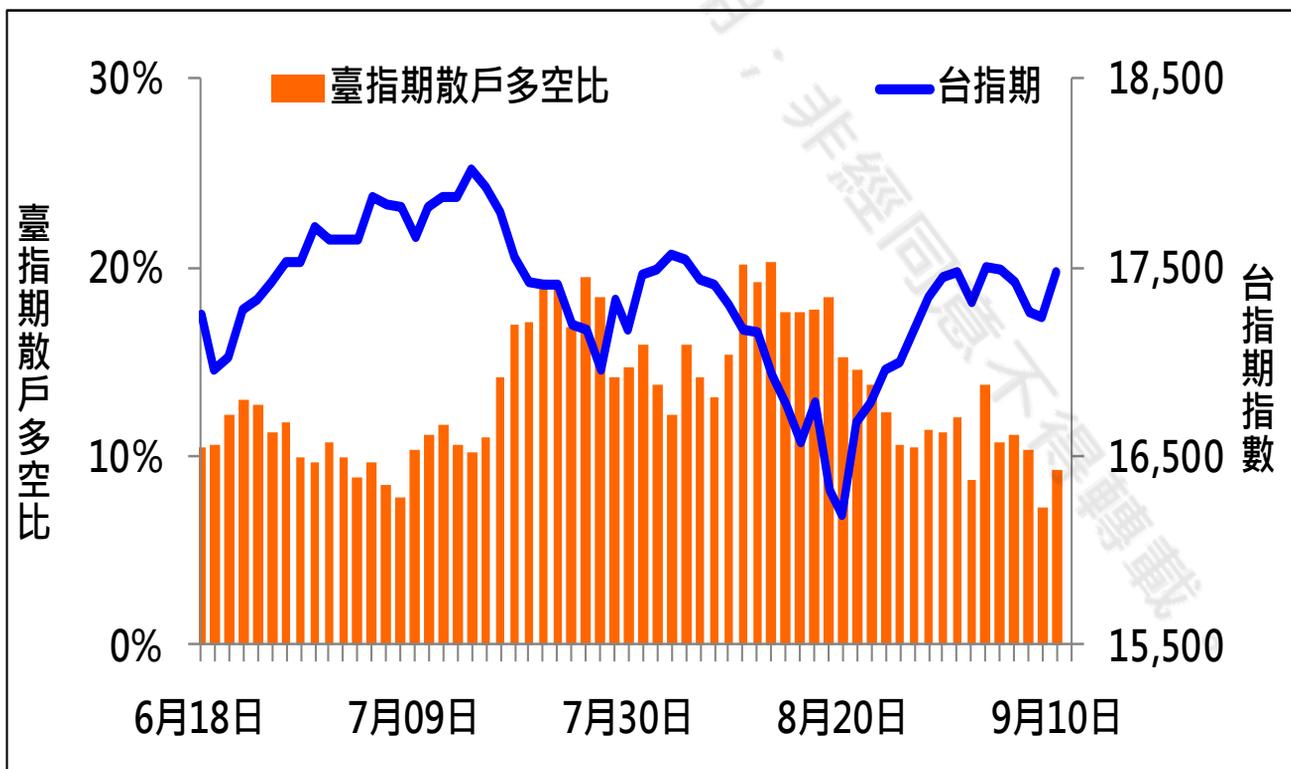
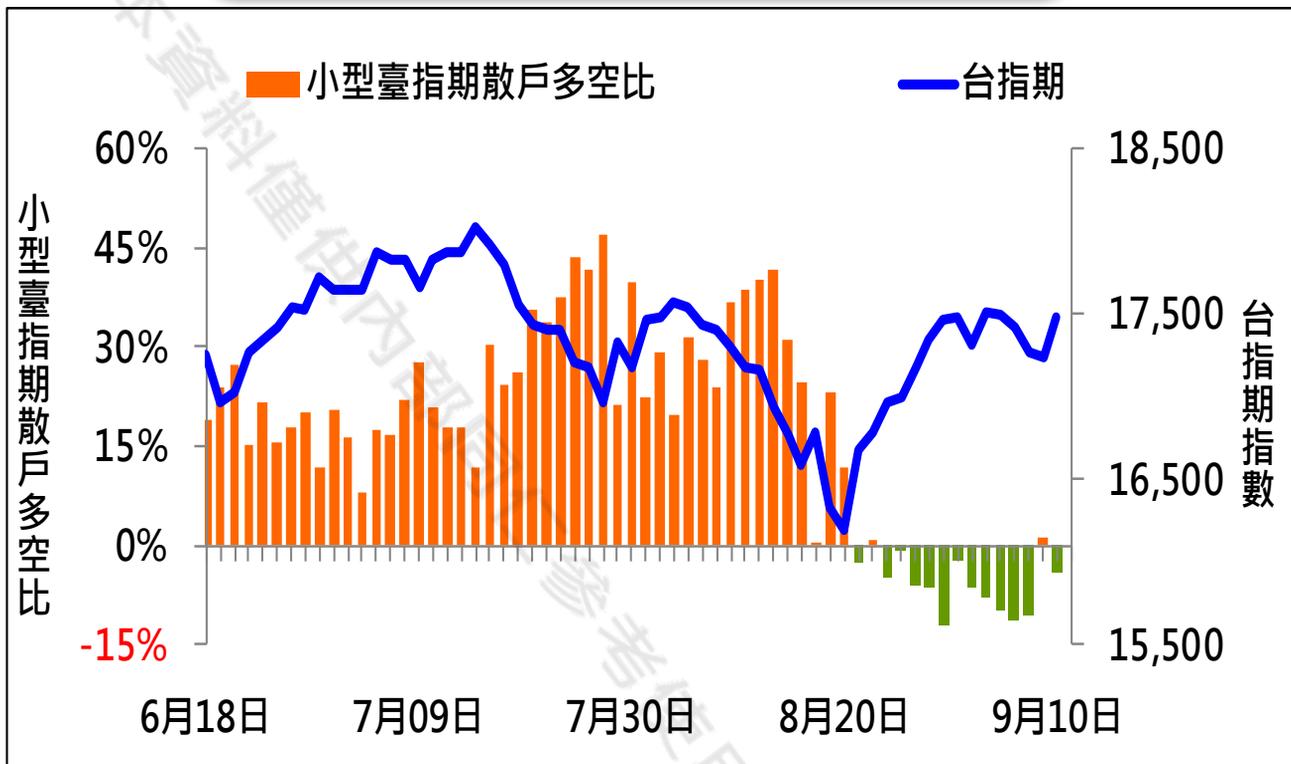
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

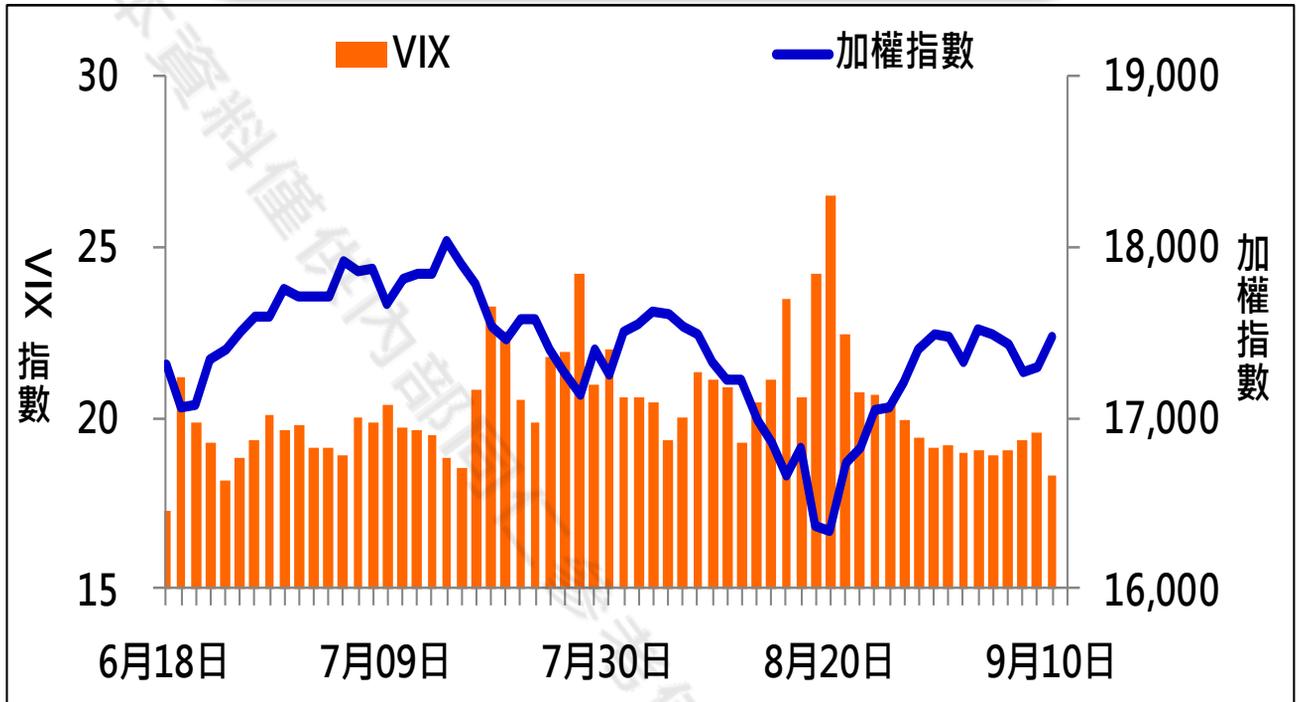
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

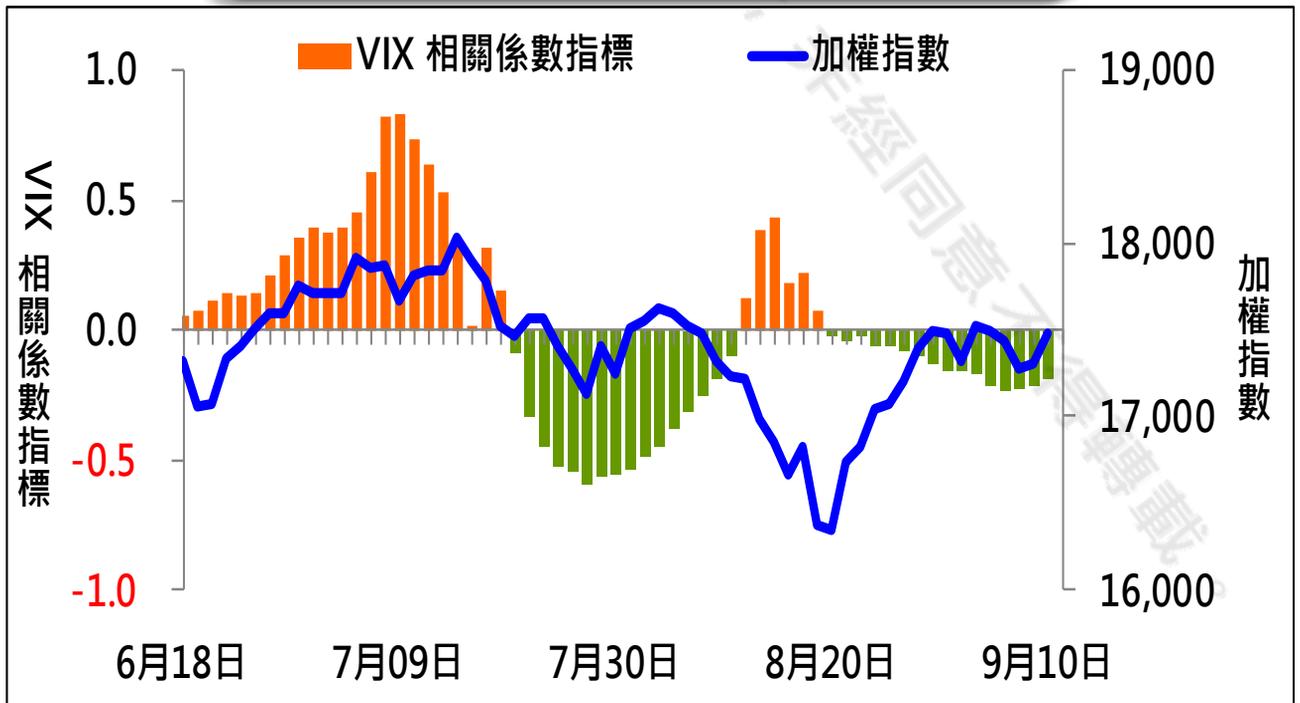
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標



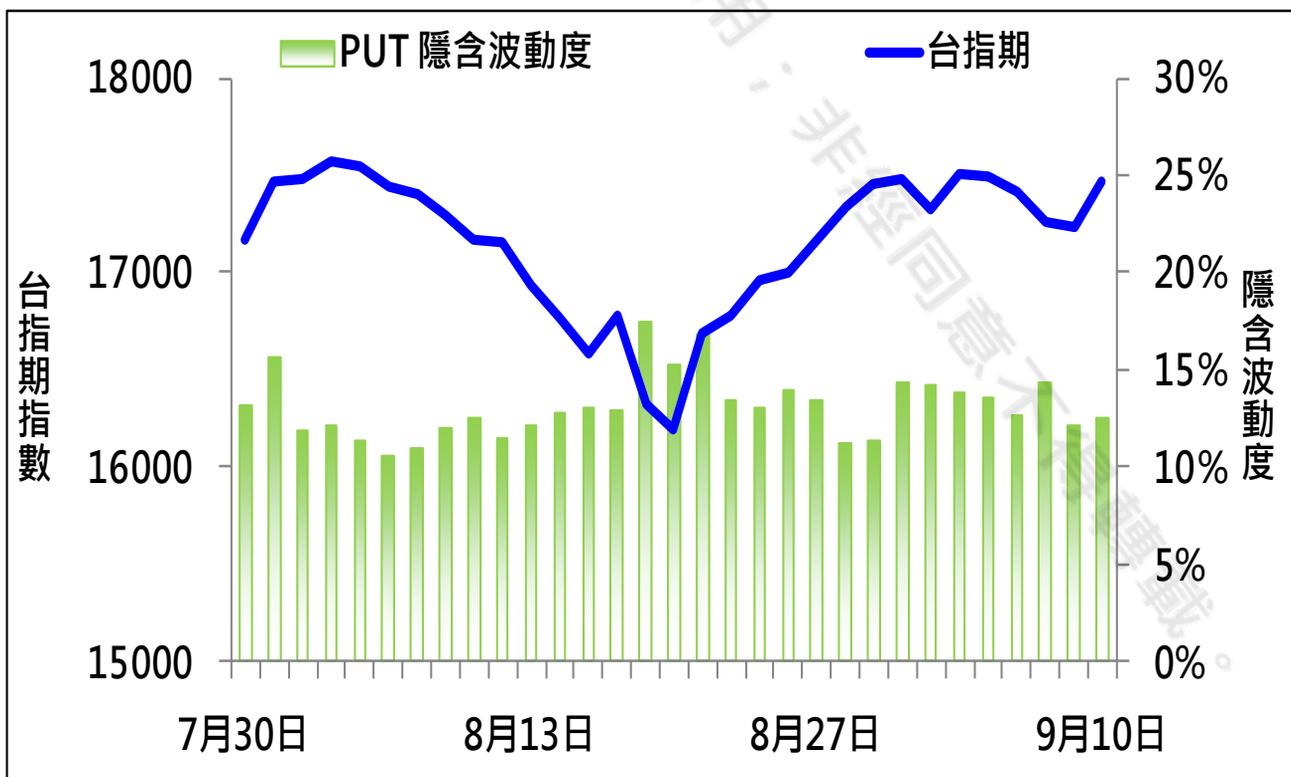
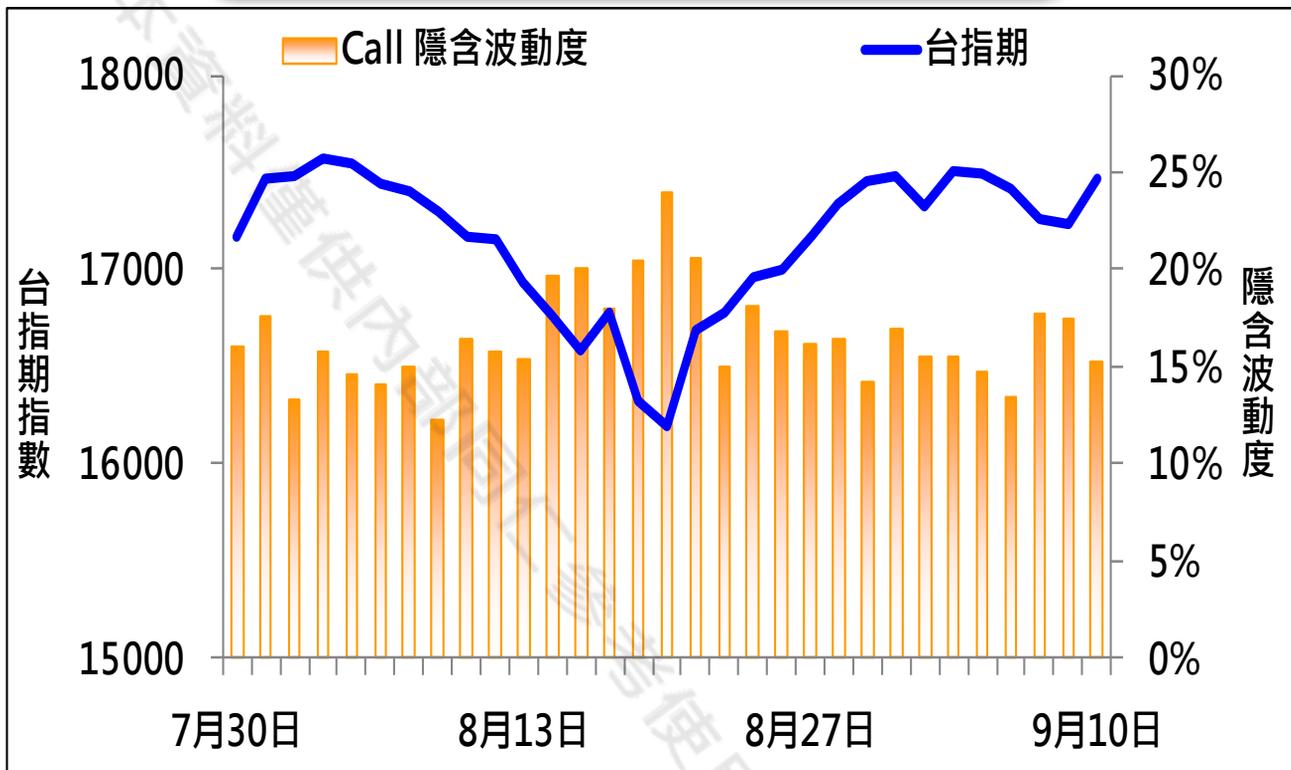
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/9/10

結算日：2021/9/15

OI 增減	Call	202109 月 履約價	Put	OI 增減
-1	2,585	16,500	10,963	-1,873
12	4,992	16,600	12,421	736
-4	5,384	16,700	10,646	224
-32	2,546	16,800	10,617	538
-2	9	16,850	4,035	3,042
-44	3,593	16,900	10,928	1,876
17	76	16,950	3,307	1,276
-157	6,588	17,000	14,979	724
-28	145	17,050	3,514	1,665
-177	3,097	17,100	9,300	1,817
-229	840	17,150	2,860	970
-1,921	5,011	17,200	10,455	2,371
-768	1,423	17,250	3,624	1,818
-1,396	6,216	17,300	7,198	3,232
-945	2,106	17,350	2,570	1,477
-1,127	12,304	17,400	6,418	2,670
649	3,285	17,450	2,524	2,182
-64	12,528	17,500	2,872	914
830	4,544	17,550	193	162
-1,182	11,444	17,600	880	451
-504	6,000	17,650	45	42
-1,195	11,033	17,700	512	101
※ 1,140	6,252	17,750	15	-1
97	10,645	17,800	168	29
-48	2,735	17,850	9	7
399	5,684	17,900	110	2
73	1,444	17,950	0	-2
-354	10,908	18,000	42	1
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
-7,801	179,648	1.3121	235,723	24,039

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：2021/9/10

結算日：2021/10/20

OI 增減	Call	202110月 履約價	Put	OI 增減
0	35	16,000	2,792	330
0	27	16,100	845	418
0	10	16,200	805	292
0	26	16,300	1,476	163
0	88	16,400	1,639	815
0	112	16,500	1,134	227
-2	129	16,600	2,251	397
-2	121	16,700	2,354	545
-6	208	16,800	677	85
-11	308	16,900	714	202
5	232	17,000	982	443
-2	266	17,100	596	169
-48	806	17,200	1,950	136
18	624	17,300	1,143	538
8	1,090	17,400	413	32
8	723	17,500	227	139
2	572	17,600	91	3
98	508	17,700	21	1
102	1,567	17,800	18	1
274	1,192	17,900	4	0
217	1,666	18,000	10	0
263	1,593	18,100	3	0
305	1,219	18,200	3	1
※	1,356	18,300	0	0
366	909	18,400	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
4,337	22,713	1.3705	31,129	7,107
昨日 P/C	1.3072	今日增減變化		0.0633

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。

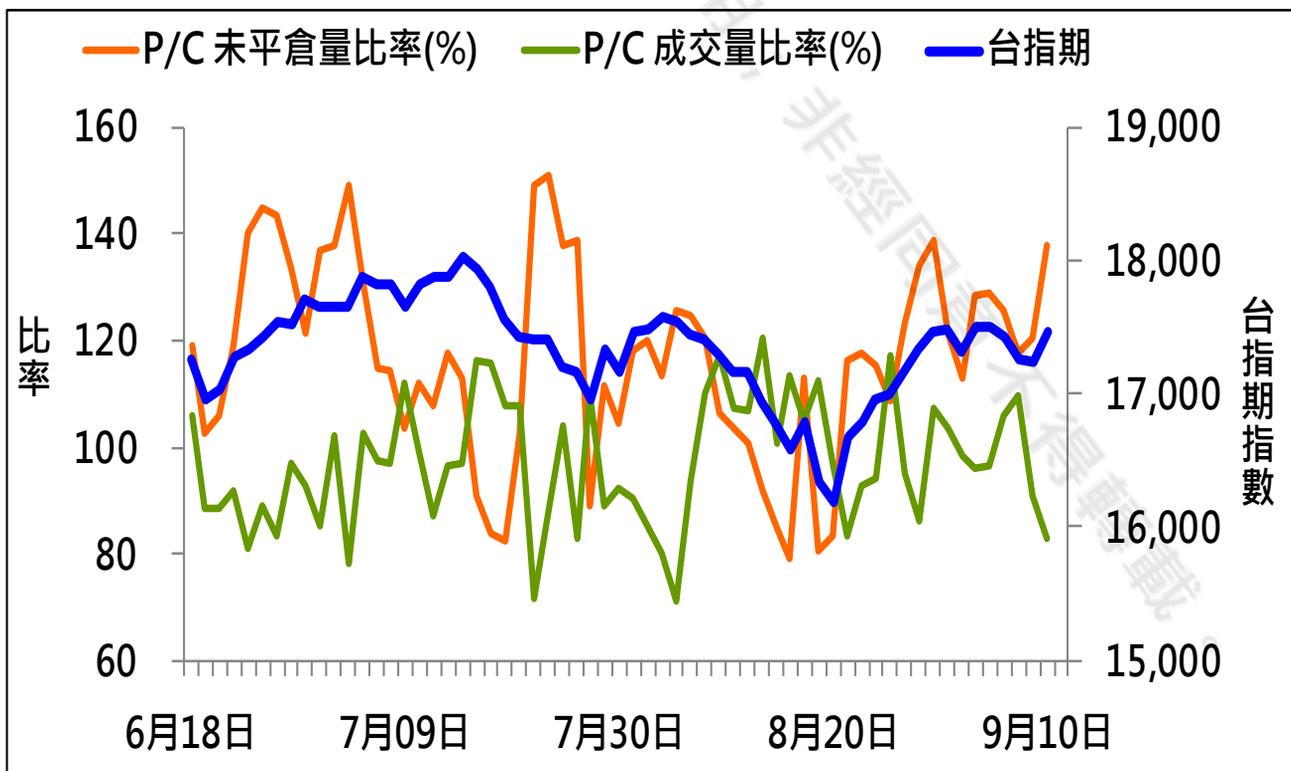
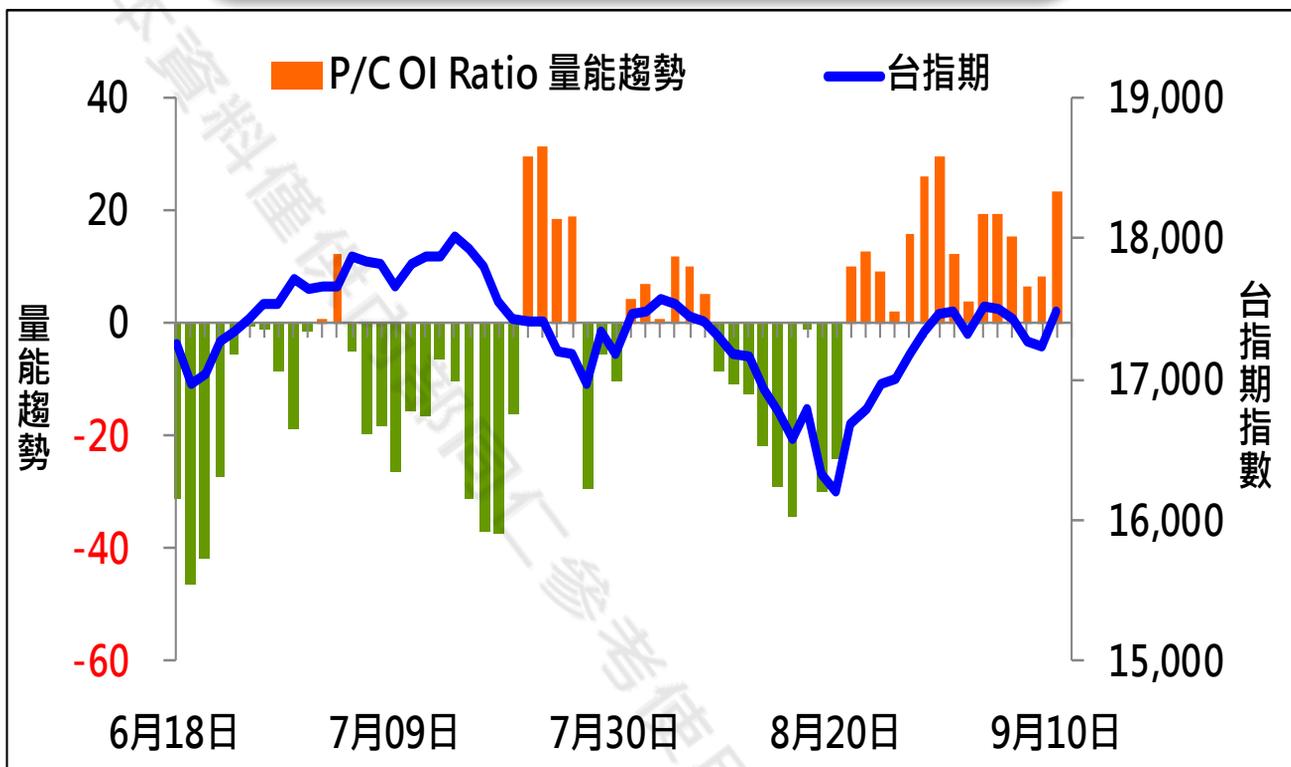
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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 2021/09/10 開 17300 高 17479 低 17284 收 17473 s 點 量 111079 口 +235 (+1.36%)

SMA5 17377.60 ↓ SMA10 17397.90 ↑ SMA20 17060.95 ↑ SMA60 17346.62 ↑ SMA120 17070.86 ↑



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 (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