



## 法人籌碼動態

09月22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	-17,828	-1,215	390	-198	-1,368	297
投信	-4,251	-1,962	198	0	24	0
自營商	12,973	2,220	-283	-35	119	-61

09月22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	17	66	-9,720	-158	14,381	-2,355
投信	2	0	0	0	-59	-1
自營商	-51	-79	15,035	-8,116	7,708	878

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
富邦媒	3.46	台積電	-119.42	台指期前十大 市場佔比	46.7%	53.0%
矽力-KY	1.38	聯發科	-15.17			
仁寶	0.80	國泰金	-10.16			
和碩	0.79	台塑化	-9.09	電子期前十大 市場佔比	56.7%	74.0%
聯華	0.67	中鋼	-7.78			
亞泥	0.66	鴻海	-6.84			
智邦	0.64	南亞	-6.78	金融期前十大 市場佔比	71.2%	89.9%
廣達	0.64	富邦金	-6.43			
華碩	0.61	瑞昱	-5.96			
英業達	0.59	長榮	-5.15	非金電期前十大 市場佔比	83.3%	93.5%
前十名合計	10.24	後十名合計	-192.79			

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

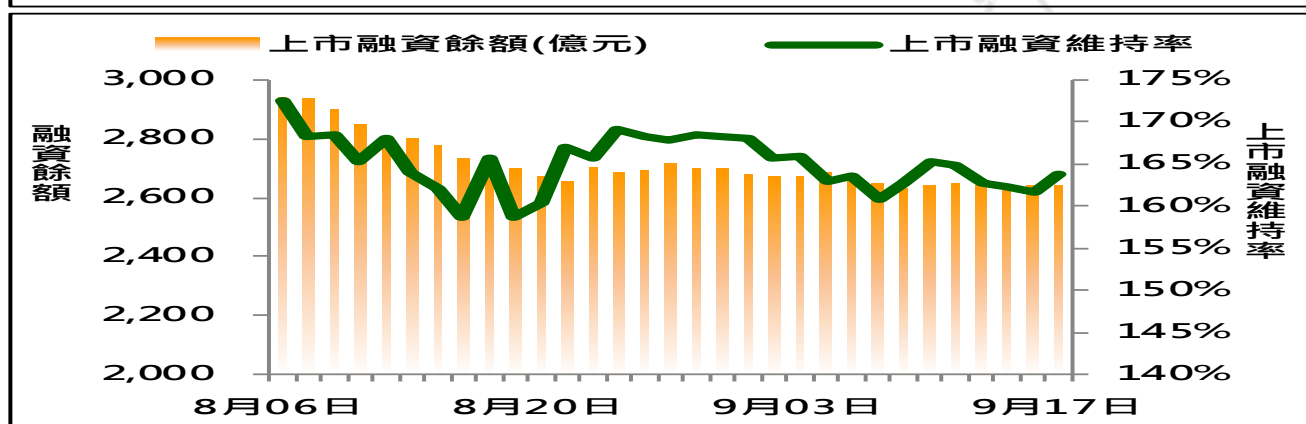
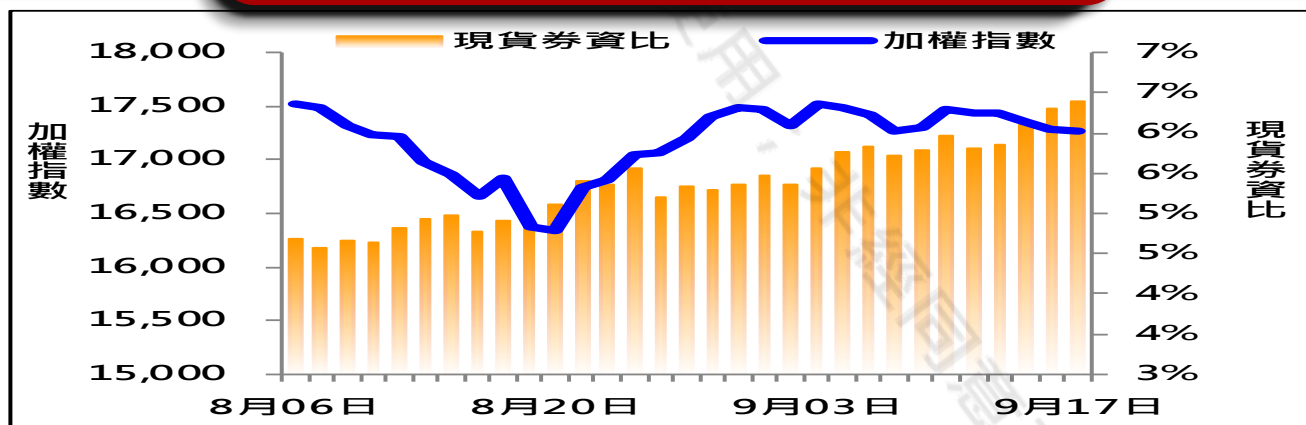


## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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14日	65.5	-15,368	35	-7.1	7,332	-1,014
09月15日	18.6	-15,086	282	-78.1	11,375	4,043
09月16日	-49.5	-17,997	-2,911	-26.4	11,880	505
09月17日	16.0	-16,613	1,384	5.6	10,753	-1,127
09月22日	-355.0	-17,828	-1,215	-93.4	12,973	2,220

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14日	-8,582	29,949	-38,531	17,745	-17,983	35,728
09月15日	-9,494	8,589	-18,083	13,299	4,521	8,778
09月16日	-10,742	13,746	-24,488	14,641	12,077	2,564
09月17日	-9,562	16,736	-26,298	23,151	6,830	16,321
09月22日	-9,720	14,381	-24,101	15,035	7,708	7,327

## 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。

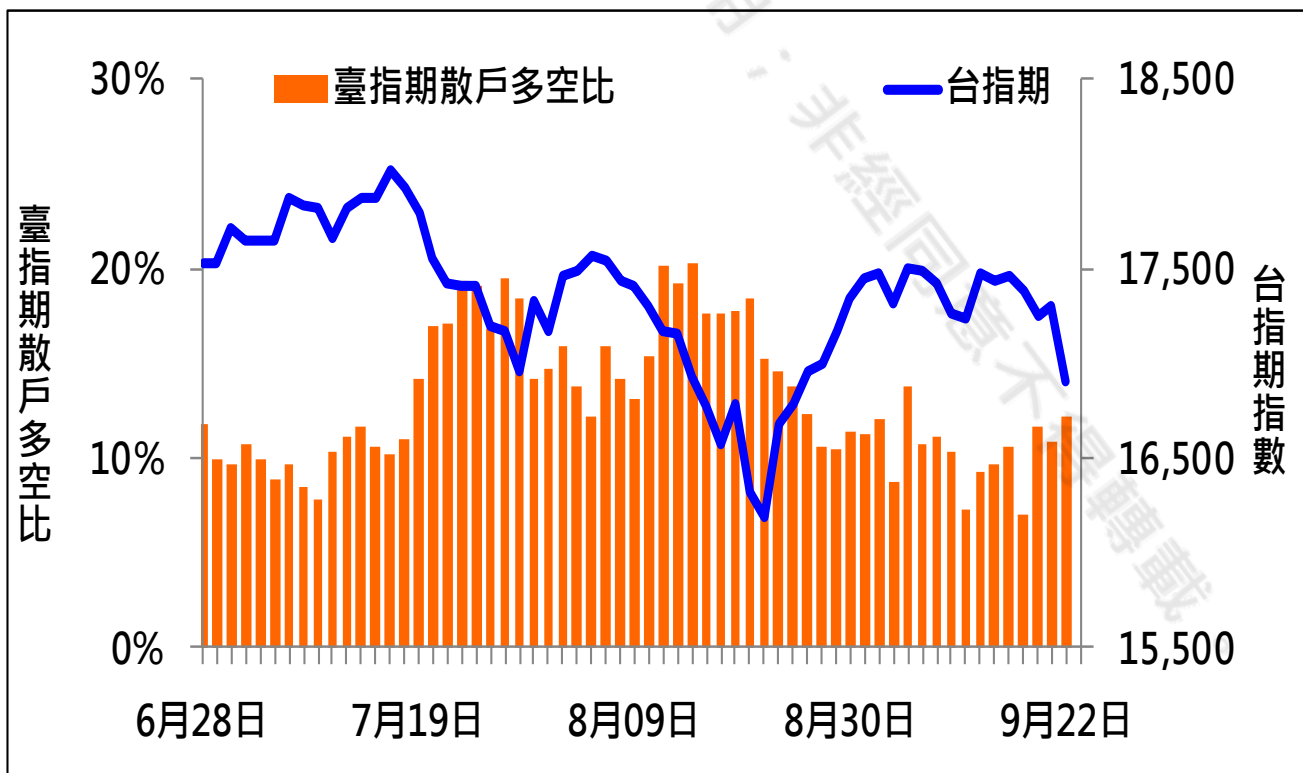
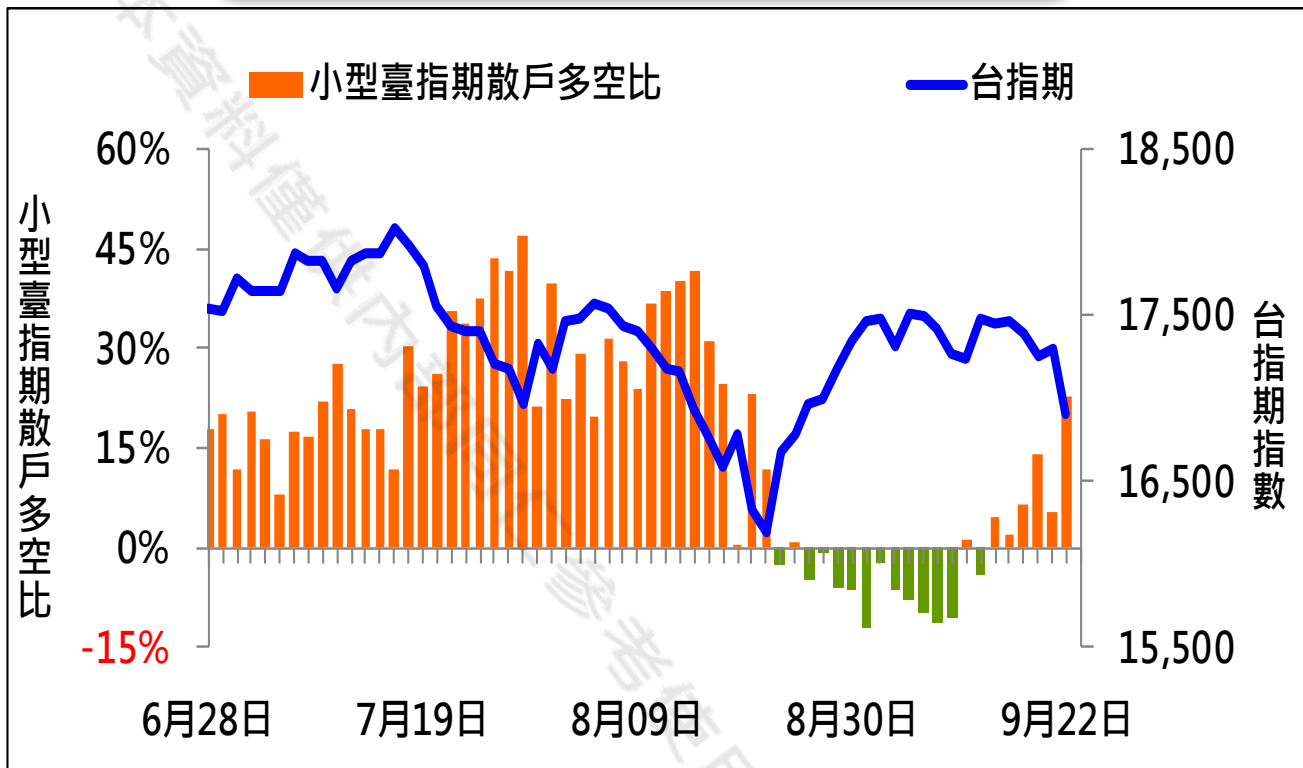
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

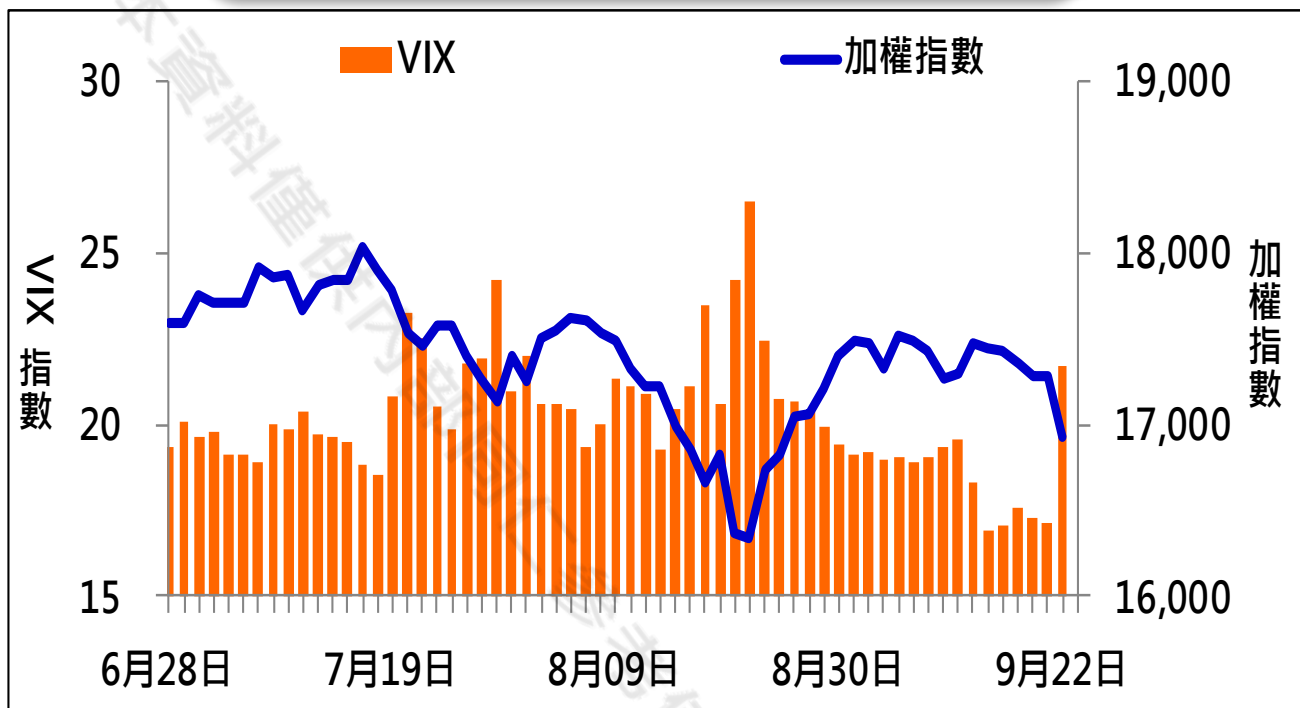
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

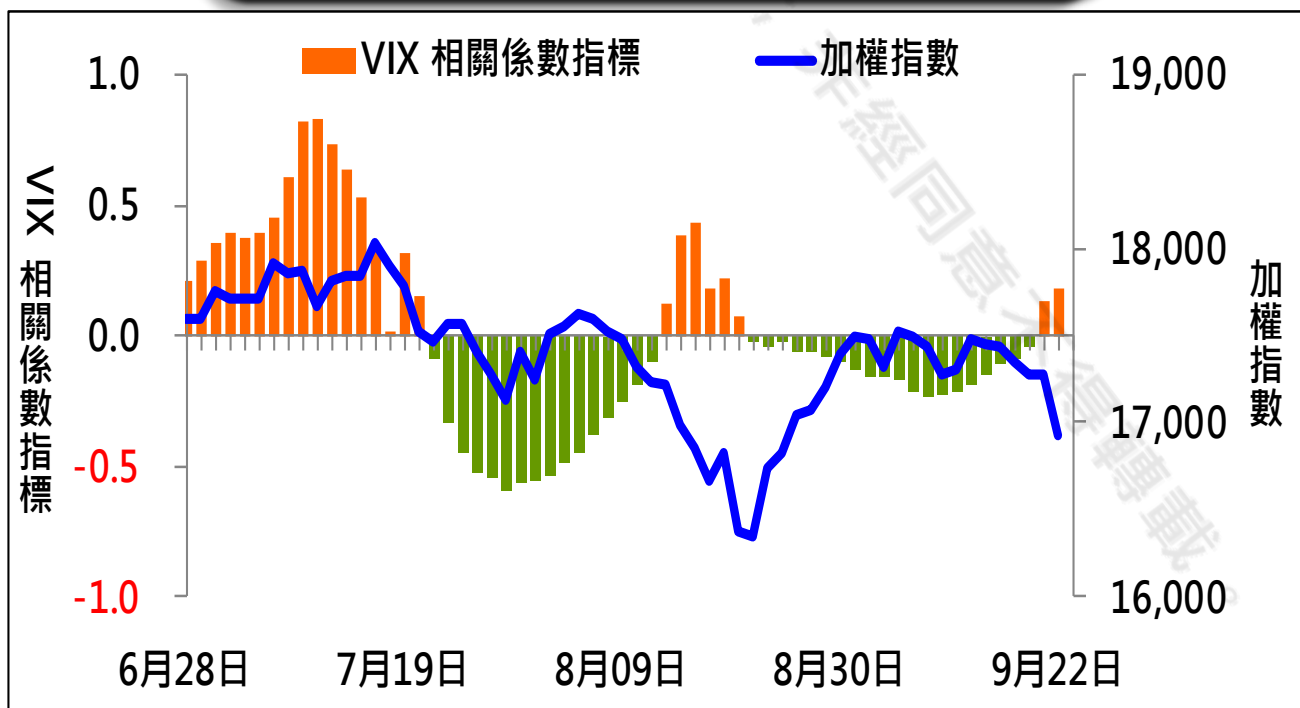
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



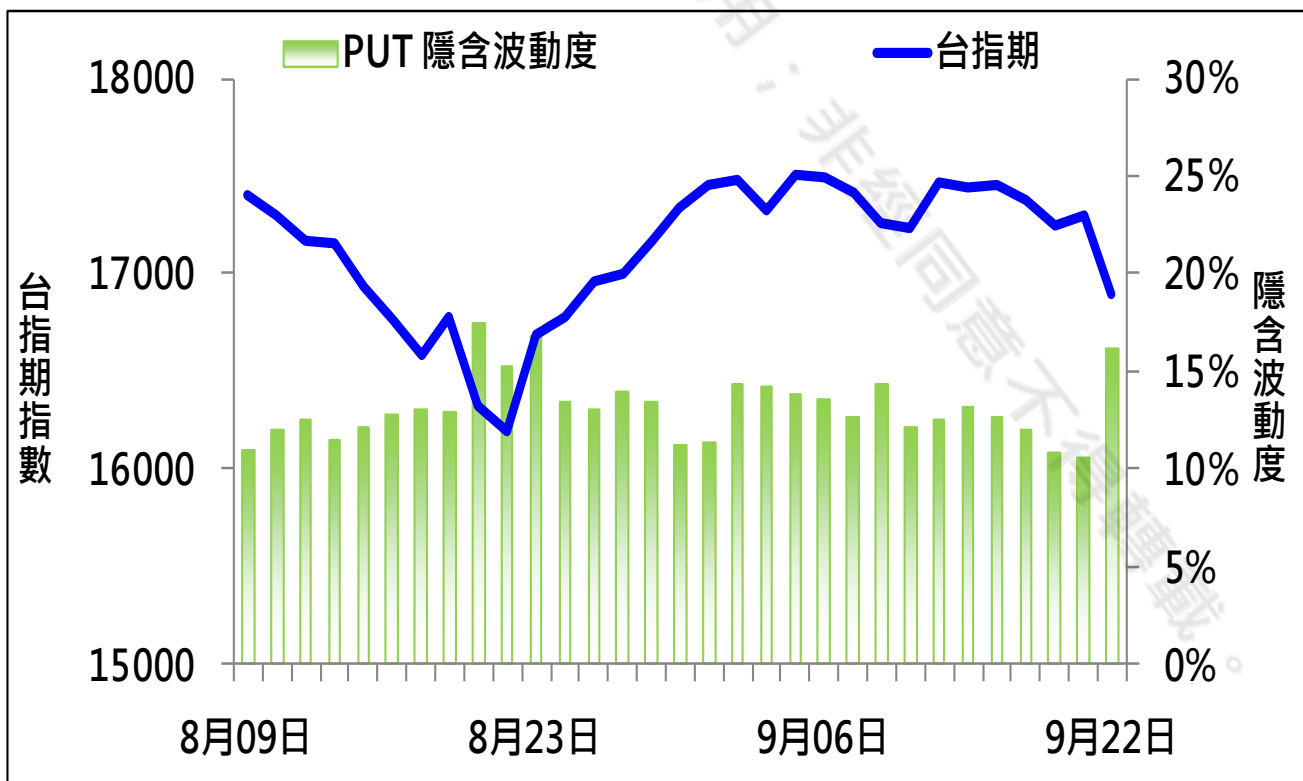
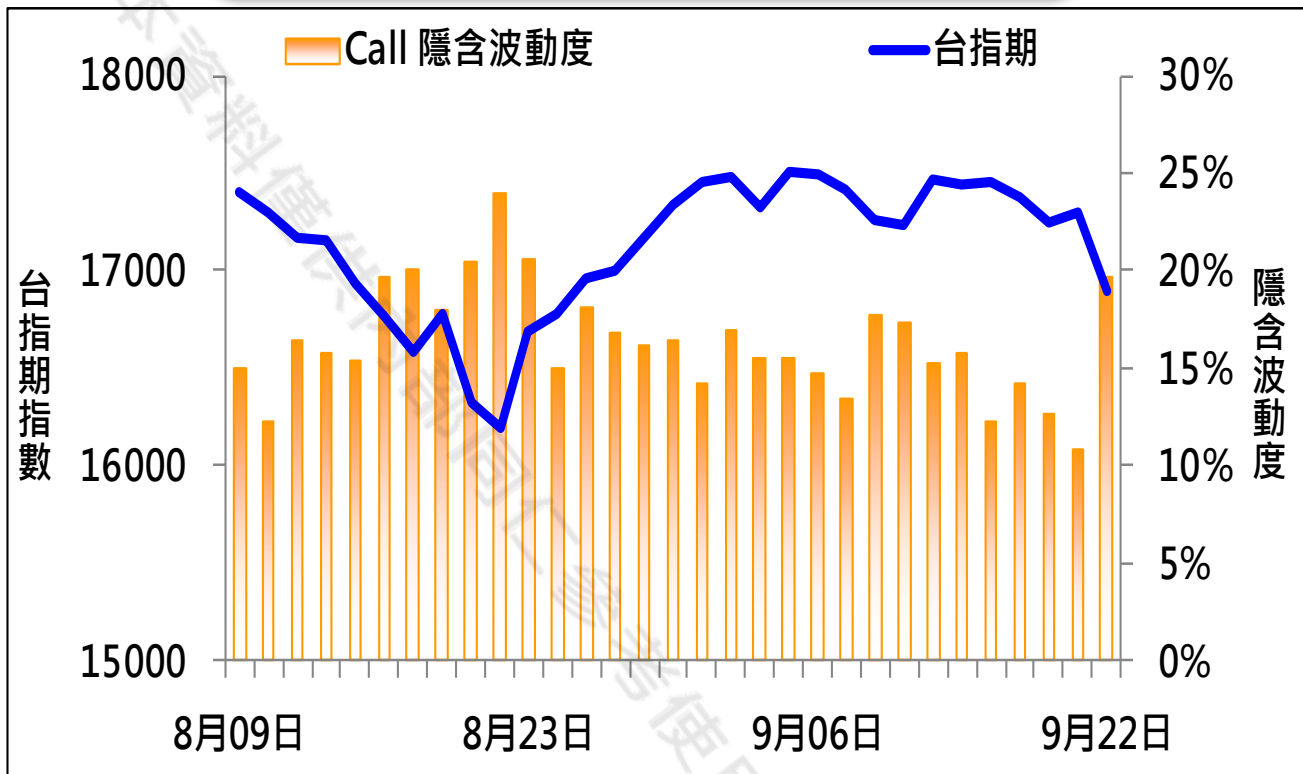
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



## 週選擇權OI變化

日期：2021/9/22

結算日：2021/9/29

OI 增減	Call	202109W5 履約價	Put	OI 增減
0	0	16,250	0	0
14	14	16,300	923	923
0	0	16,350	0	0
9	9	16,400	1,592	1,592
0	0	16,450	0	0
107	107	16,500	1,970	1,970
0	0	16,550	0	0
116	116	16,600	2,181	2,181 ※
0	0	16,650	0	0
139	139	16,700	962	962
0	0	16,750	0	0
381	381	16,800	1,234	1,234
243	243	16,850	412	412
829	829	16,900	960	960
496	496	16,950	311	311
1,371	1,371	17,000	397	397
1,465	1,465	17,100	91	91
2,526	2,526	17,200	22	22
2,234	2,234	17,300	29	29
※ 2,617	2,617	17,400	22	22
1,453	1,453	17,500	21	21
531	531	17,600	0	0
530	530	17,700	0	0
703	703	17,800	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
16,999	16,999	1.2350	20,993	20,993

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：2021/9/22

結算日：2021/10/20

OI 增減	Call	202110月 履約價	Put	OI 增減
0	0	15,700	1,386	313
33	150	15,800	1,333	361
0	7	15,900	1,696	221
0	34	16,000	6,318	106
3	30	16,100	1,658	343
16	64	16,200	3,028	951
1	26	16,300	2,215	179
3	92	16,400	2,455	244
59	173	16,500	3,014	288
17	181	16,600	3,610	11
94	218	16,700	3,694	203
542	767	16,800	2,276	894
504	852	16,900	2,055	20
945	1,306	17,000	3,036	324
901	1,276	17,100	1,173	-106
681	2,120	17,200	3,133	-200
832	4,546	17,300	2,288	-67
564	4,206	17,400	1,127	-32
702	5,031	17,500	468	-42
535	2,956	17,600	446	40
214	3,237	17,700	164	-5
630	3,861	17,800	39	-2
232	3,250	17,900	110	-4
※ 1,692	6,279	18,000	23	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
10,209	69,925	1.0902	76,233	7,315
昨日 P/C	1.1541	今日增減變化		-0.0639

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。

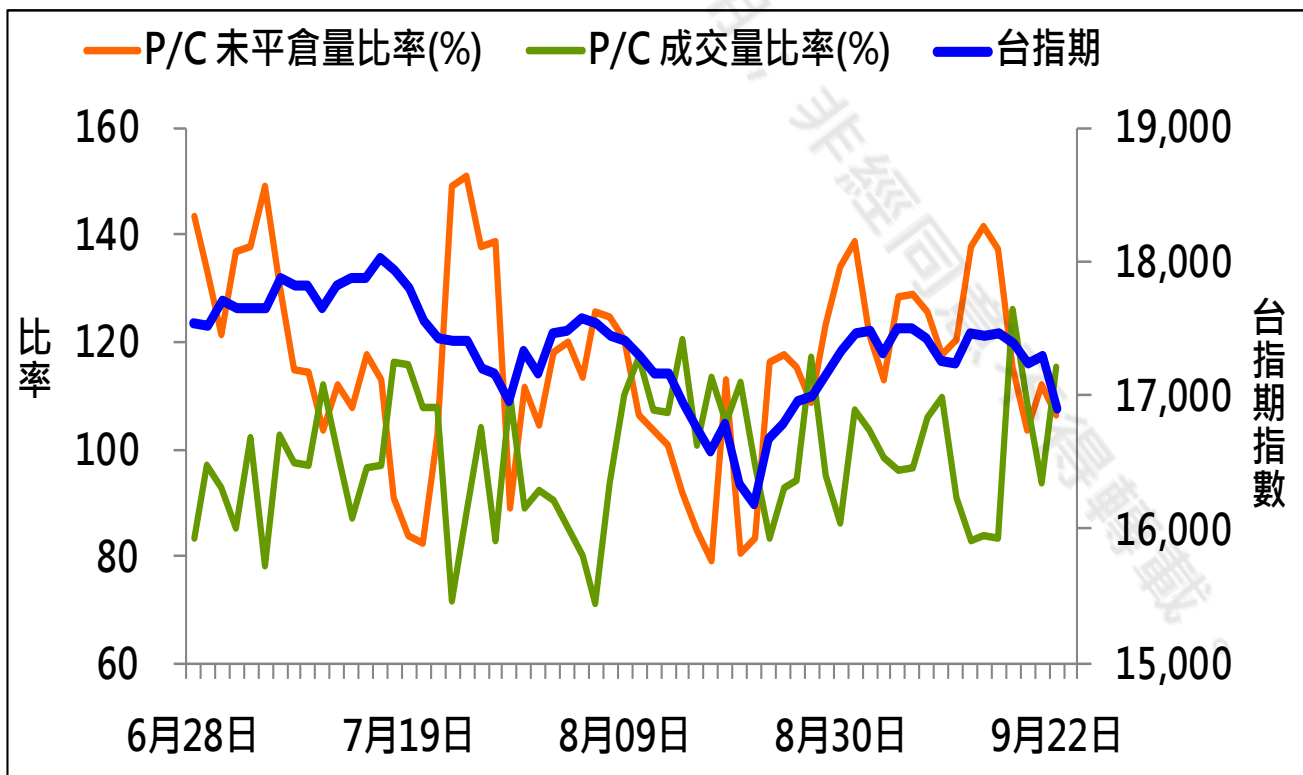
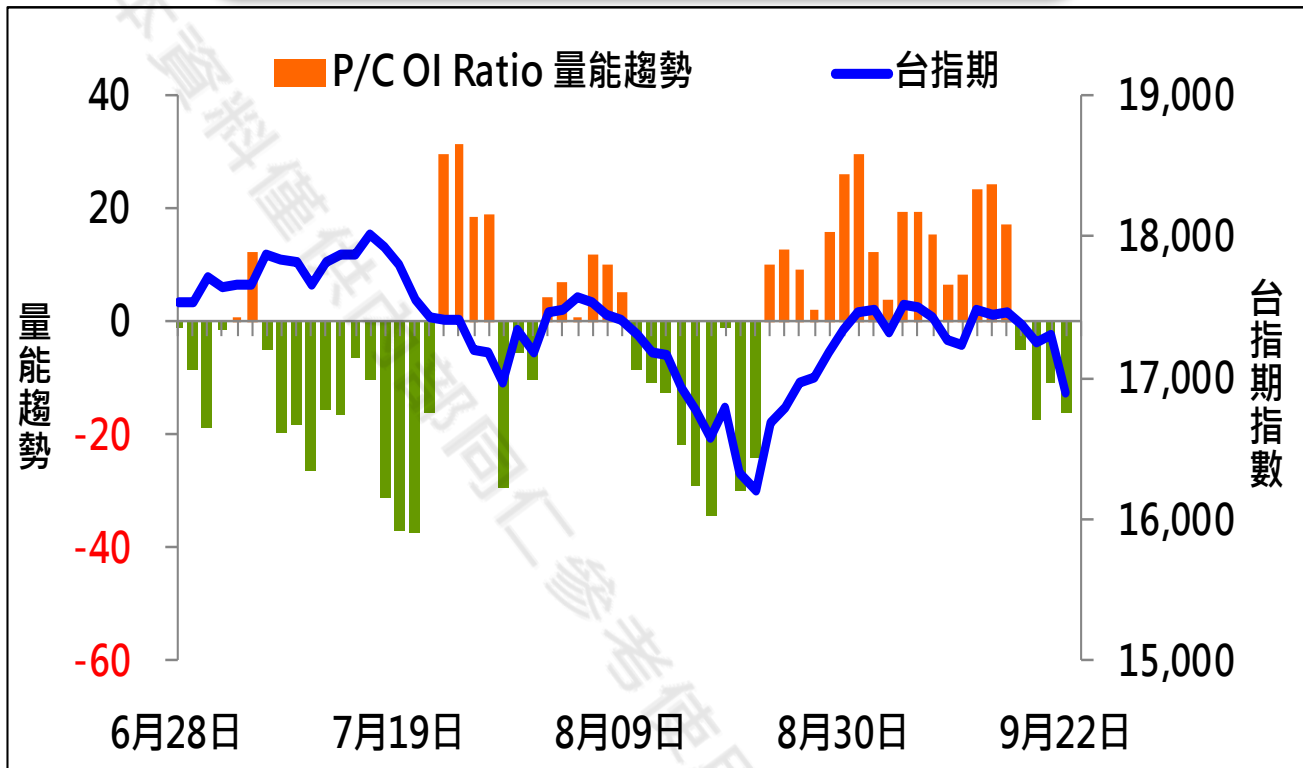
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

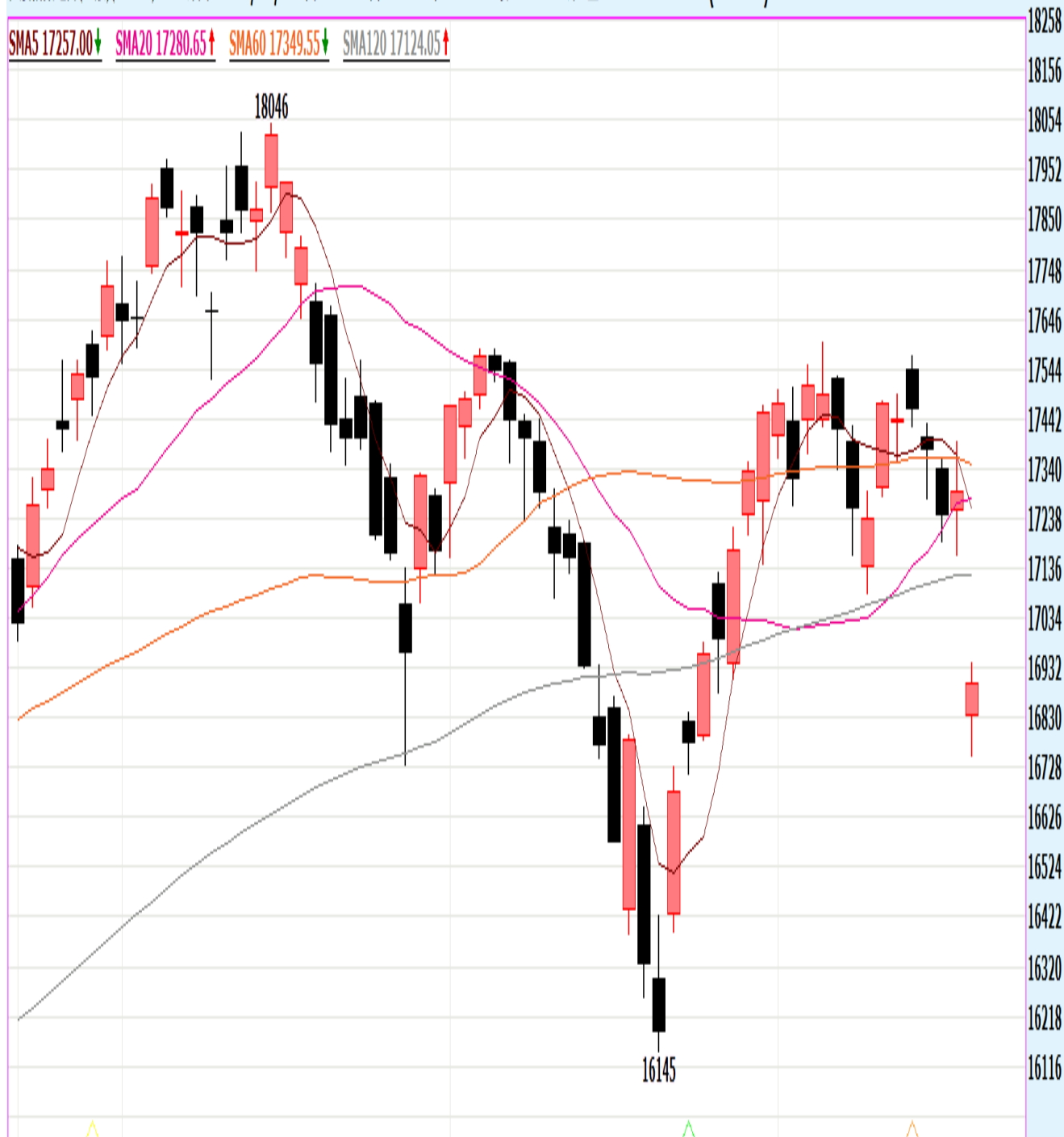




## 盤後重點觀察

台股指數近月(一般)(FTTX\*1) 日線圖 2021/09/22 開 16835 高 16940 低 16751 收 16900 s 點 量 134553 □ -394 (-2.28%)

SMA5 17257.00 ↓ SMA20 17280.65 ↑ SMA60 17349.55 ↓ SMA120 17124.05 ↑



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