



法人籌碼動態

10月05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	-17,129	-5,972	357	-9	-1,541	156
投信	-5,509	426	185	0	24	0
自營商	14,679	1,248	-216	15	207	-25

10月05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	-74	0	-2,993	363	34,202	5,984
投信	2	0	0	0	-59	0
自營商	35	-22	-16,576	-5,225	14,027	-1,687

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
台塑	8.38	聯發科	-13.09	台指期前十大 市場佔比	44.9%	54.8%
萬海	5.48	鴻海	-6.84			
南電	5.00	日月光投控	-4.32			
台塑化	4.70	富邦媒	-3.23	電子期前十大 市場佔比	51.7%	80.0%
南亞	4.44	研華	-3.05			
台達電	4.27	大立光	-2.87			
友達	3.33	中租-KY	-2.77	金融期前十大 市場佔比	68.3%	89.8%
中鋼	3.12	富邦金	-2.27			
矽力-KY	2.15	統一	-1.50			
景碩	1.56	中華電	-1.28	非金電期前十大 市場佔比	83.3%	96.8%
前十名合計	42.42	後十名合計	-41.22			

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

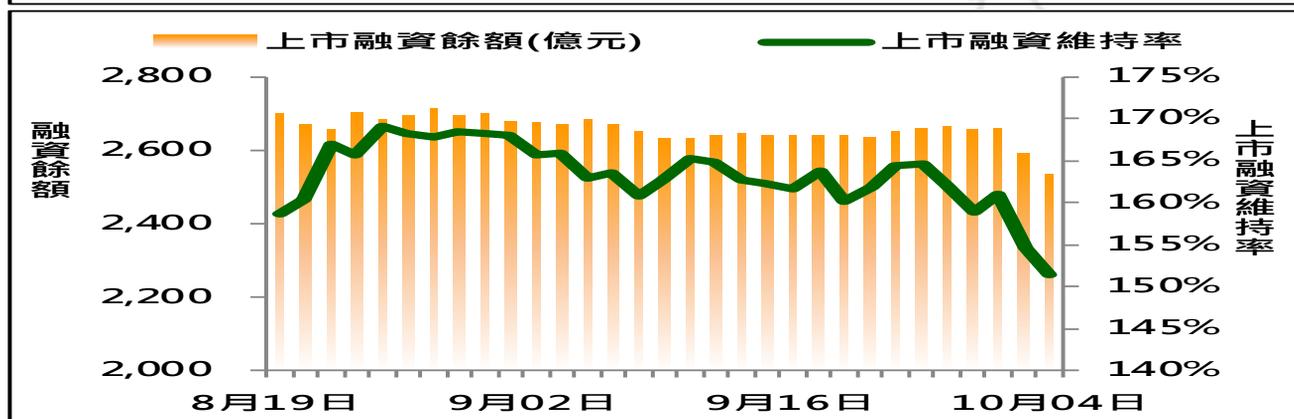


法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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29日	-354.6	-18,170	276	-106.9	13,606	1,198
09月30日	-78.9	-16,731	1,439	-8.0	13,752	146
10月01日	-396.5	-13,037	3,694	-69.0	13,838	86
10月04日	-31.1	-11,157	1,880	-24.4	13,431	-407
10月05日	-163.4	-17,129	-5,972	6.3	14,679	1,248

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29日	-5,275	18,912	-24,187	5,919	7,485	-1,566
09月30日	-1,462	24,657	-26,119	6,475	8,162	-1,687
10月01日	-6,537	27,087	-33,624	-2,832	10,230	-13,062
10月04日	-3,356	28,218	-31,574	-11,351	15,714	-27,065
10月05日	-2,993	34,202	-37,195	-16,576	14,027	-30,603

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。

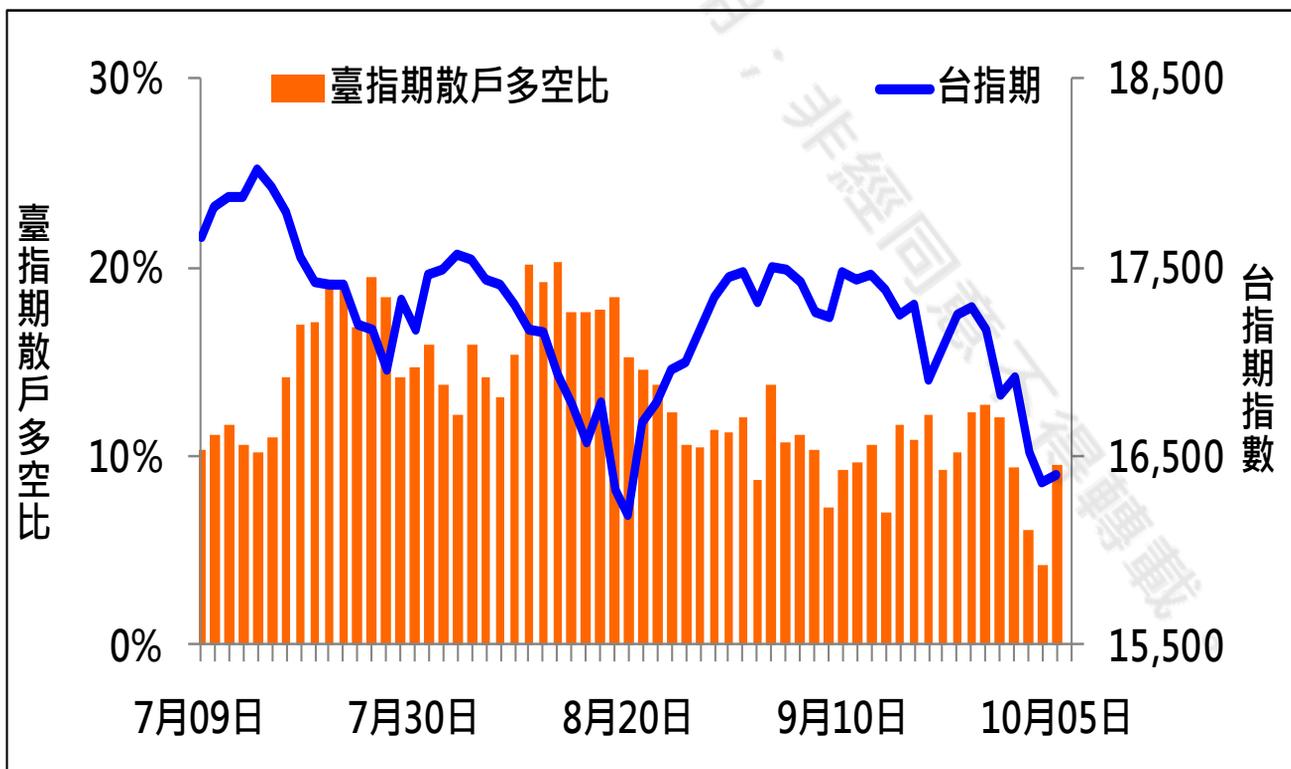
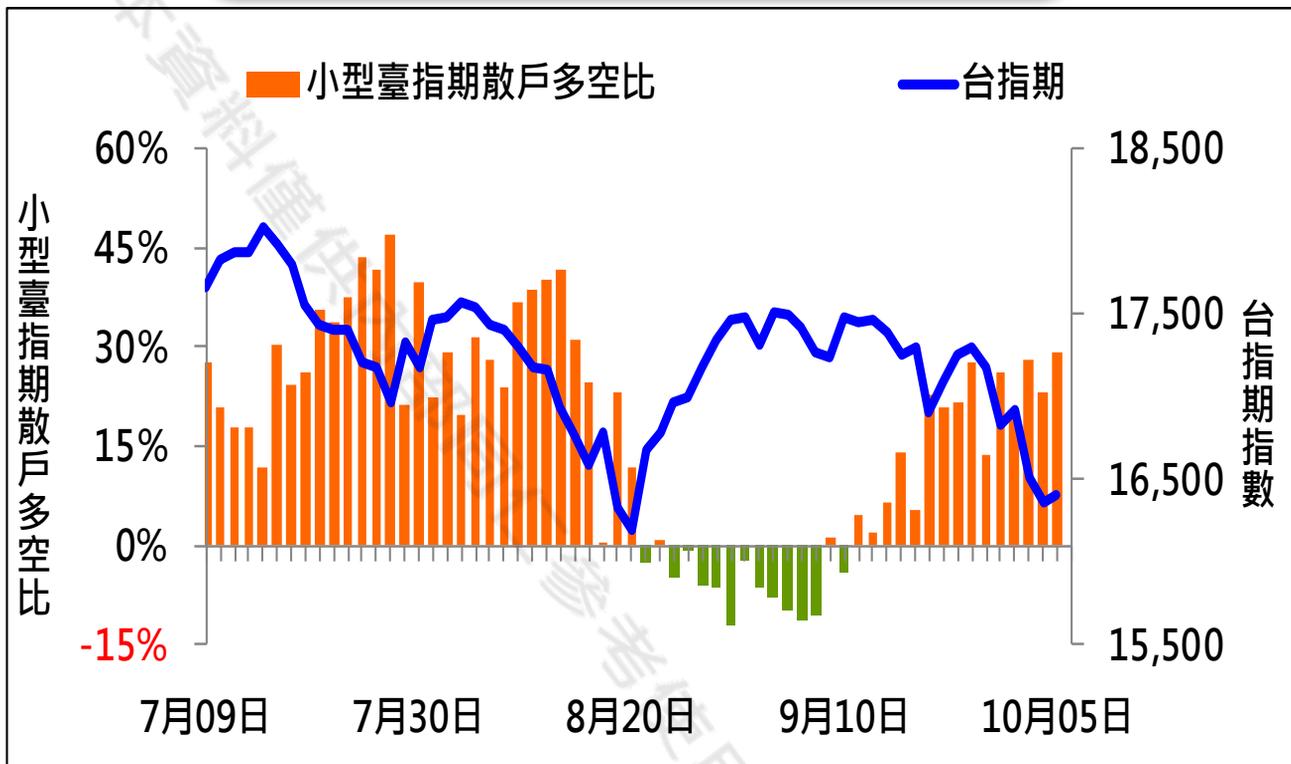
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

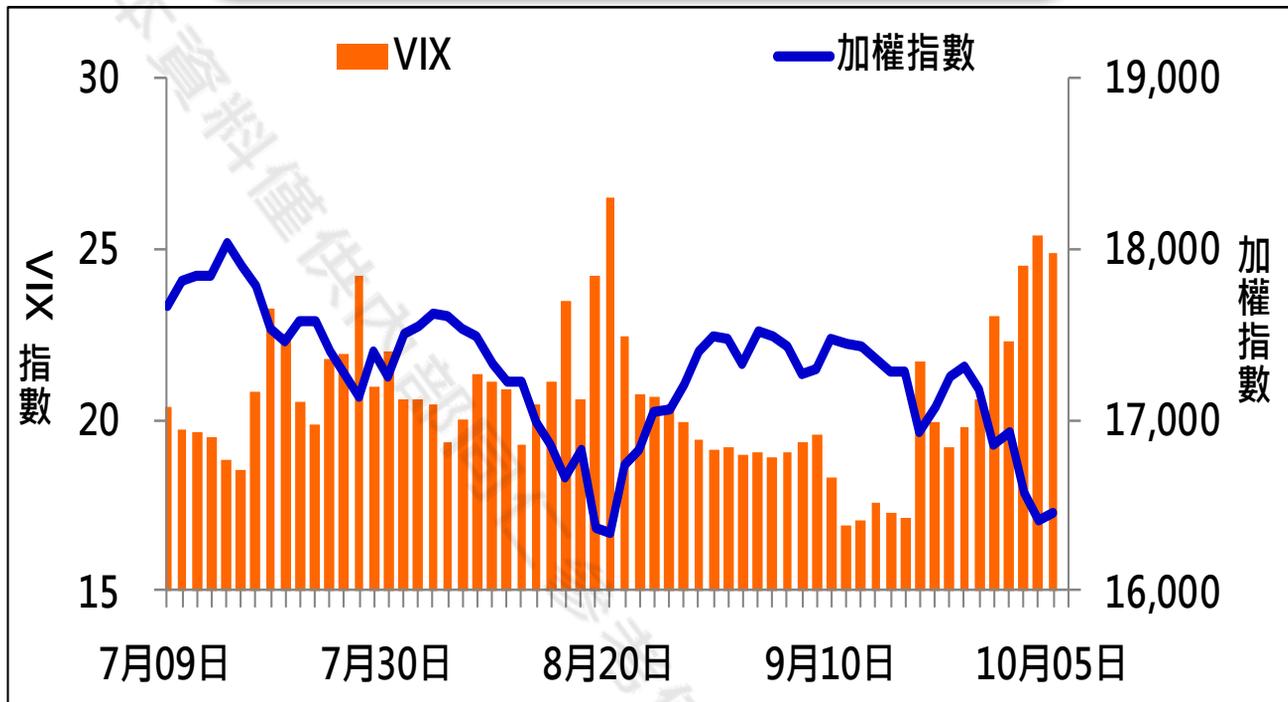
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

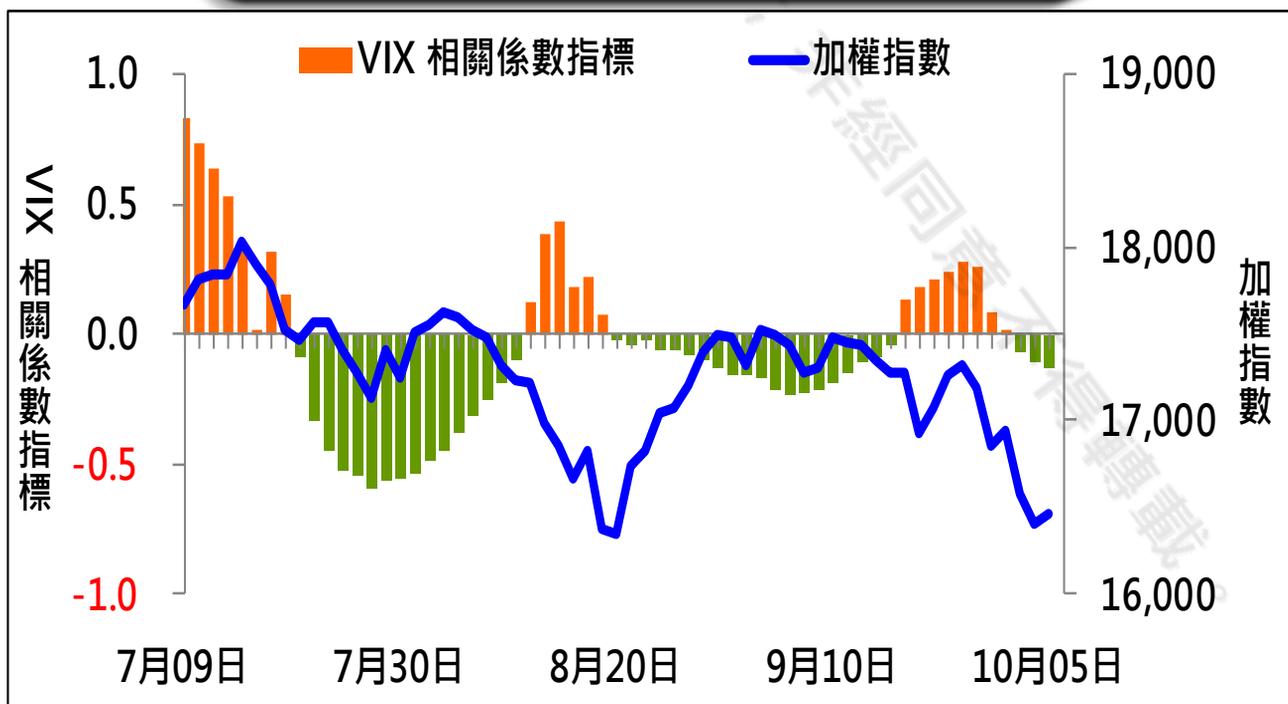
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



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。

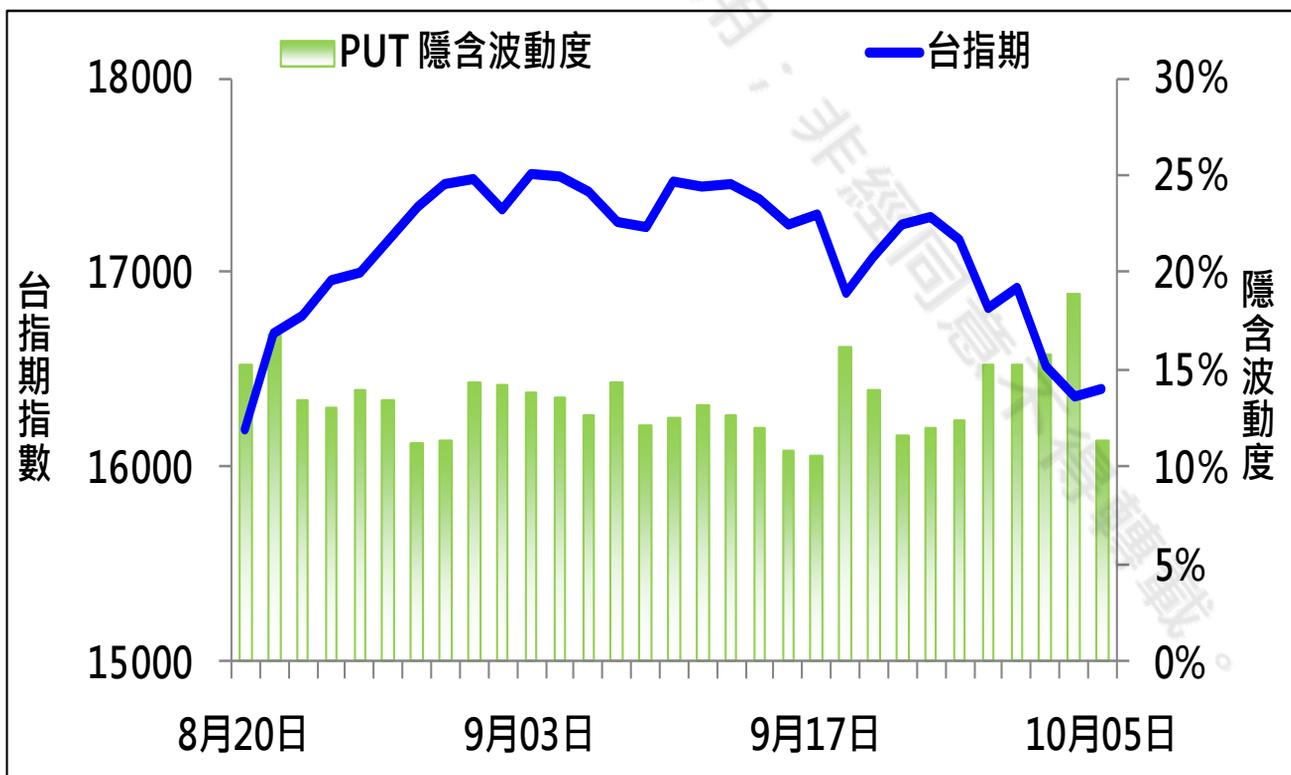
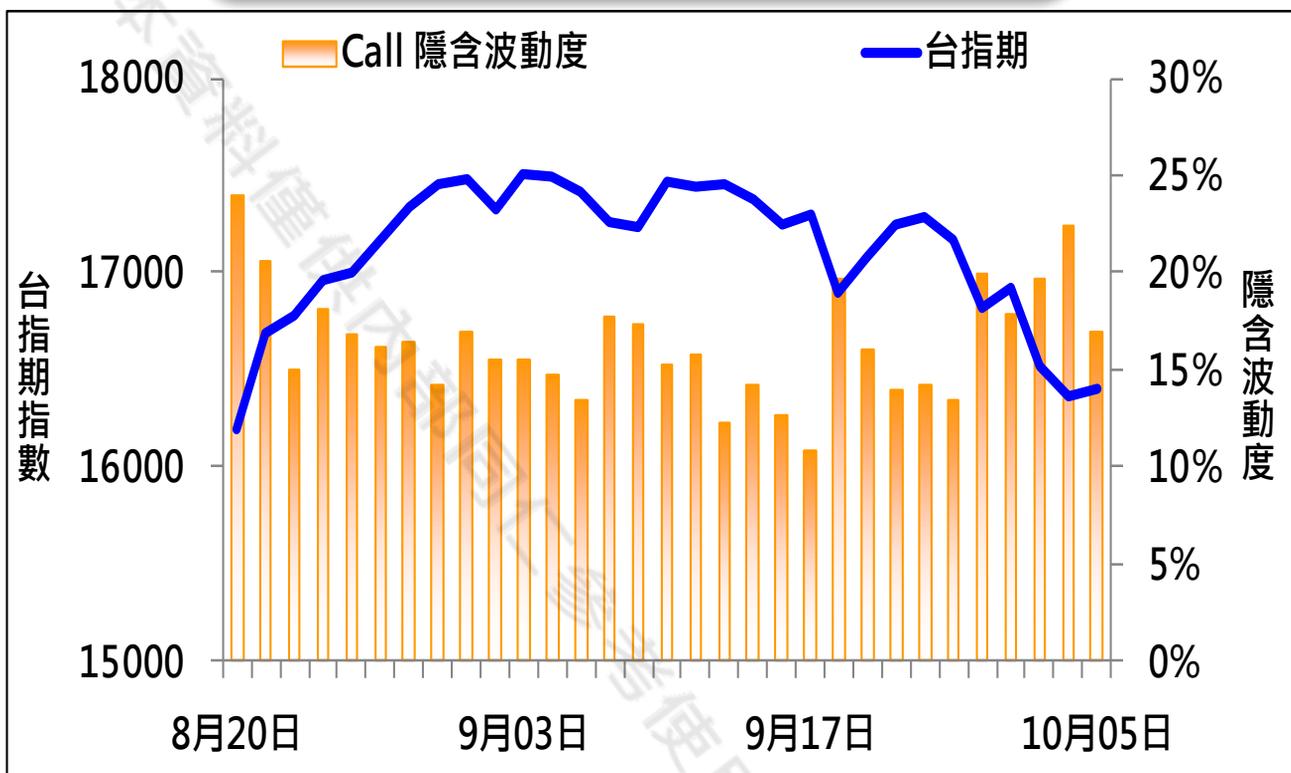
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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：2021/10/5

結算日：2021/10/6

OI 增減	Call	202110W1 履約價	Put	OI 增減
34	34	15,900	6,477	2,175
2	2	15,950	3,514	3,514
65	102	16,000	9,862	1,389
143	143	16,050	1,693	1,693
441	483	16,100	8,048	2,067
103	201	16,150	3,542	2,164
1,315	1,453	16,200	10,955	4,848 ※
838	921	16,250	4,043	2,301
2,165	2,787	16,300	6,621	11
1,597	2,030	16,350	3,752	1,678
※ 5,954	7,423	16,400	5,398	711
3,620	5,246	16,450	2,802	272
4,051	7,264	16,500	3,376	-822
3,706	6,566	16,550	1,940	-210
5,435	12,348	16,600	2,575	-386
1,136	6,952	16,650	1,150	-334
-2,041	8,186	16,700	1,986	-193
-1,683	4,706	16,750	1,232	-30
-3,306	7,104	16,800	2,137	-65
-377	7,051	16,850	1,464	-9
-2,370	7,596	16,900	1,312	-78
-1,223	4,762	16,950	688	-3
-1,629	8,383	17,000	576	-68
-580	4,540	17,050	217	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
13,744	143,058	0.7799	111,572	22,944

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：2021/10/5

結算日：2021/10/20

OI 增減	Call	202110月 履約價	Put	OI 增減
0	0	15,100	1,220	84
32	32	15,200	1,639	265
0	0	15,300	1,895	434
0	0	15,400	2,020	307
1	91	15,500	3,741	-461
1	41	15,600	2,514	-37
16	16	15,700	2,904	-127
-4	230	15,800	4,928	309
46	75	15,900	3,867	614
98	265	16,000	12,527	-19
176	285	16,100	5,304	933
639	768	16,200	6,603	286
338	774	16,300	4,079	121
560	1,704	16,400	3,323	-412
440	2,407	16,500	3,689	15
433	4,749	16,600	4,735	-206
441	3,383	16,700	3,734	-44
786	5,789	16,800	3,268	-247
-48	4,445	16,900	2,659	-36
604	6,949	17,000	3,491	-119
79	4,434	17,100	2,139	-20
636	6,382	17,200	3,674	-32
101	6,813	17,300	2,553	-6
-40	6,899	17,400	1,409	-4
※ 1,410	10,375	17,500	437	-3
-250	8,539	17,600	369	-14
-142	5,113	17,700	173	0
-265	8,098	17,800	56	0
-14	7,320	17,900	60	-1
-49	9,099	18,000	21	0
-226	6,218	18,100	6	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
5,465	143,366	0.9220	132,182	5,068
昨日 P/C	0.9218	今日增減變化		0.0002

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。

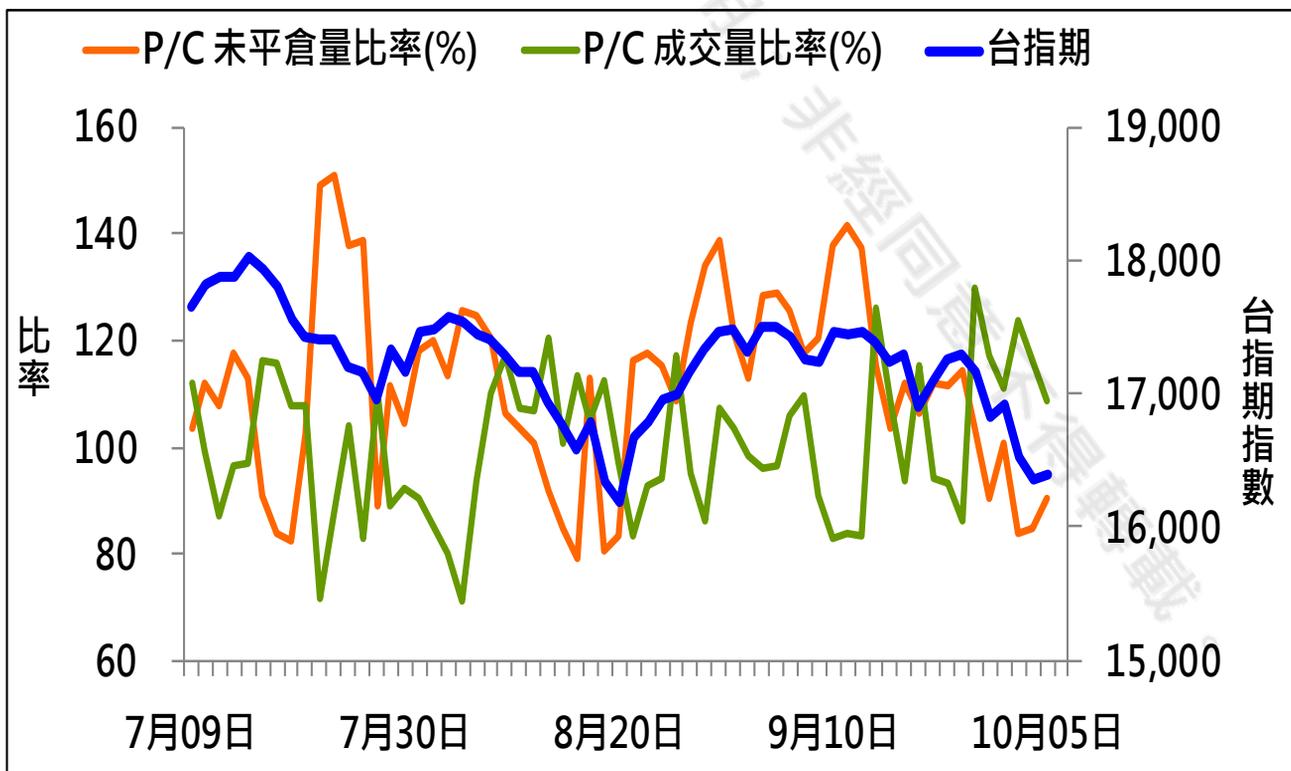
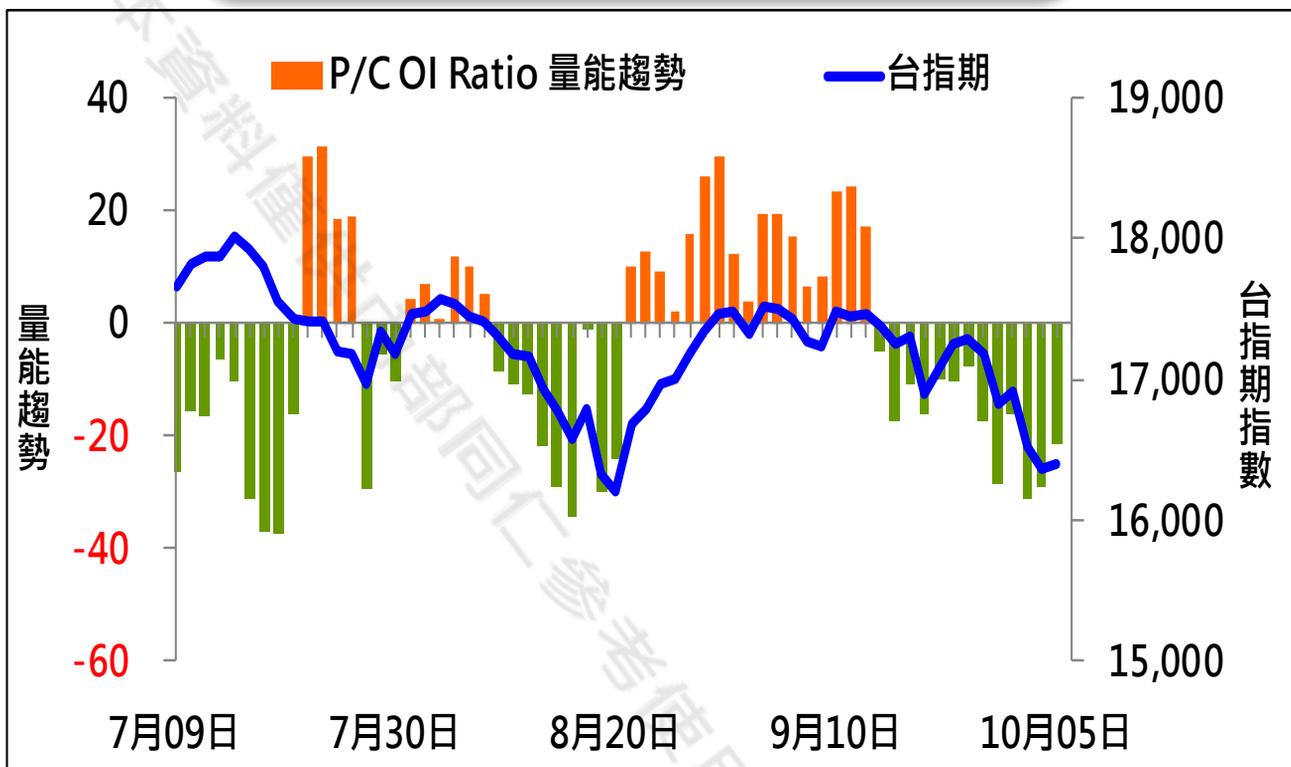
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

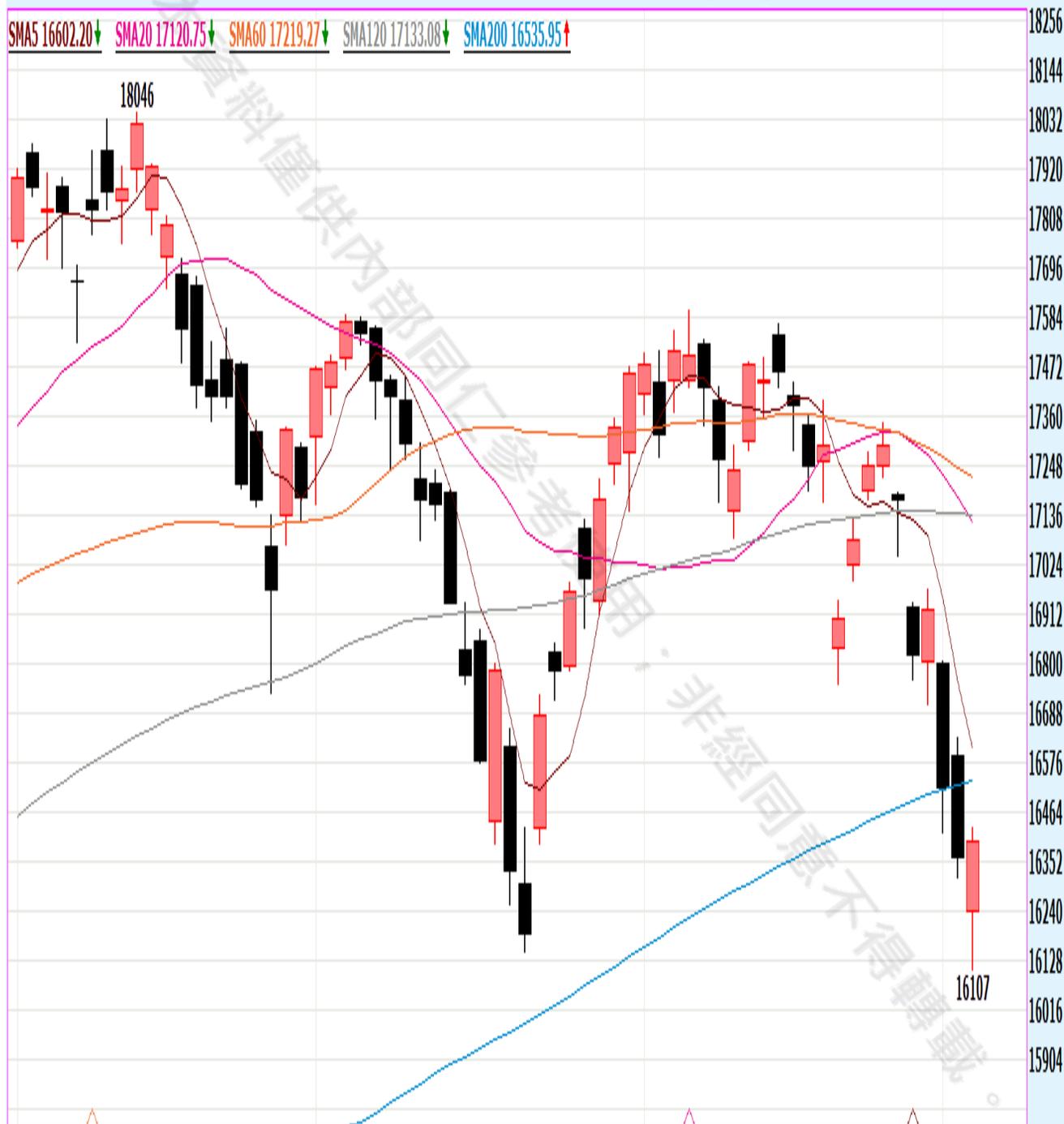
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



盤後重點觀察

台股指數近月(一般)(FTTX*1) 日線圖 2021/10/05 開 16240 高 16424 低 16107 收 16395 s 點 量 151416 口 +34 (+0.21%)

SMA5 16602.20 ↓ SMA20 17120.75 ↓ SMA60 17219.27 ↓ SMA120 17133.00 ↓ SMA200 16535.95 ↑



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