



## 法人籌碼動態

10月08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	-21,144	-2,864	361	54	-1,652	-82
投信	-4,663	-319	167	0	24	0
自營商	13,938	674	-107	-63	267	15

10月08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	-210	-2	7,615	5,354	38,445	1,428
投信	2	0	0	0	-59	0
自營商	180	-3	4,131	-4,218	4,127	4,670

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
鴻海	4.57	台積電	-42.72	台指期前十大 市場佔比	44.9%	52.9%
技嘉	1.82	日月光投控	-6.93			
欣興	1.74	中鋼	-6.76			
台達電	1.71	聯電	-5.73	電子期前十大 市場佔比	51.6%	71.4%
南亞	1.57	大立光	-5.53			
景碩	1.49	長榮	-4.30			
研華	1.40	儒鴻	-2.08	金融期前十大 市場佔比	64.8%	89.7%
智邦	1.29	瑞昱	-1.94			
富邦媒	1.15	台塑化	-1.57			
健策	1.05	陽明	-1.47	非金電期前十大 市場佔比	92.1%	97.0%
前十名合計	17.78	後十名合計	-79.02			

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

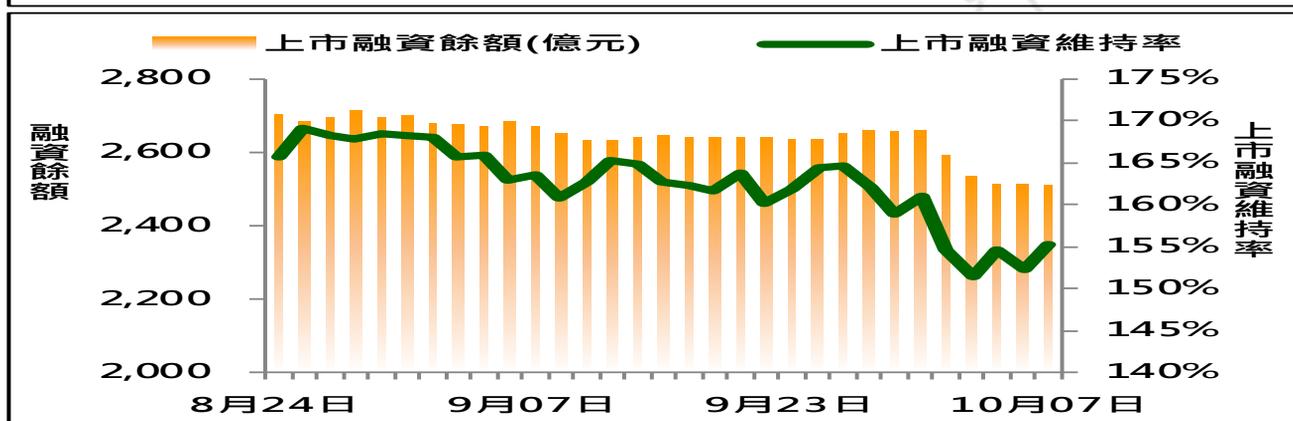
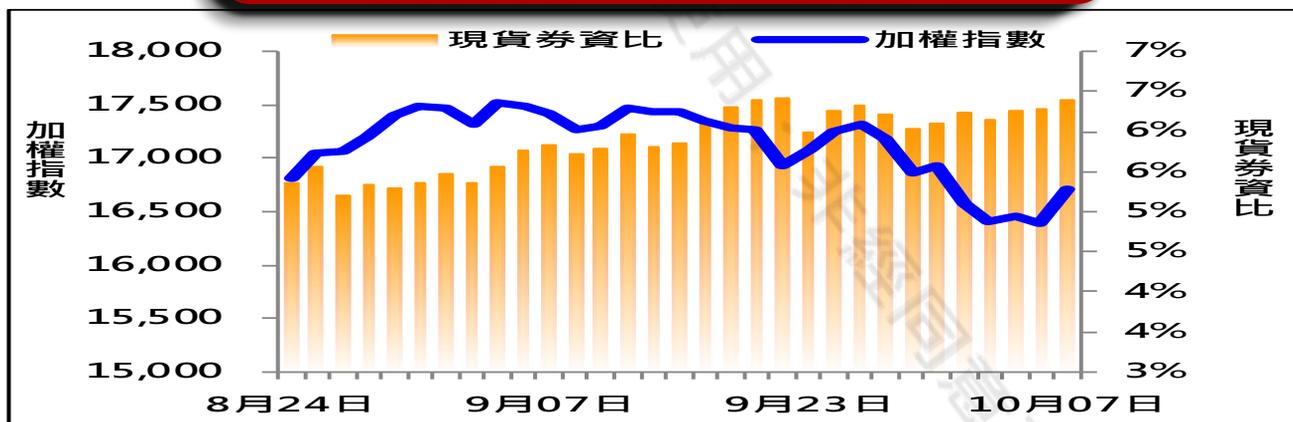


## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
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
10月06日	-238.5	-13,742	3,387	-50.7	15,102	423
10月07日	236.3	-18,280	-4,538	30.8	13,264	-1,838
10月08日	-145.8	-21,144	-2,864	9.4	13,938	674

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
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
10月06日	-3,142	33,864	-37,006	4,366	7,872	-3,506
10月07日	2,261	37,017	-34,756	8,349	-543	8,892
10月08日	7,615	38,445	-30,830	4,131	4,127	4

## 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。

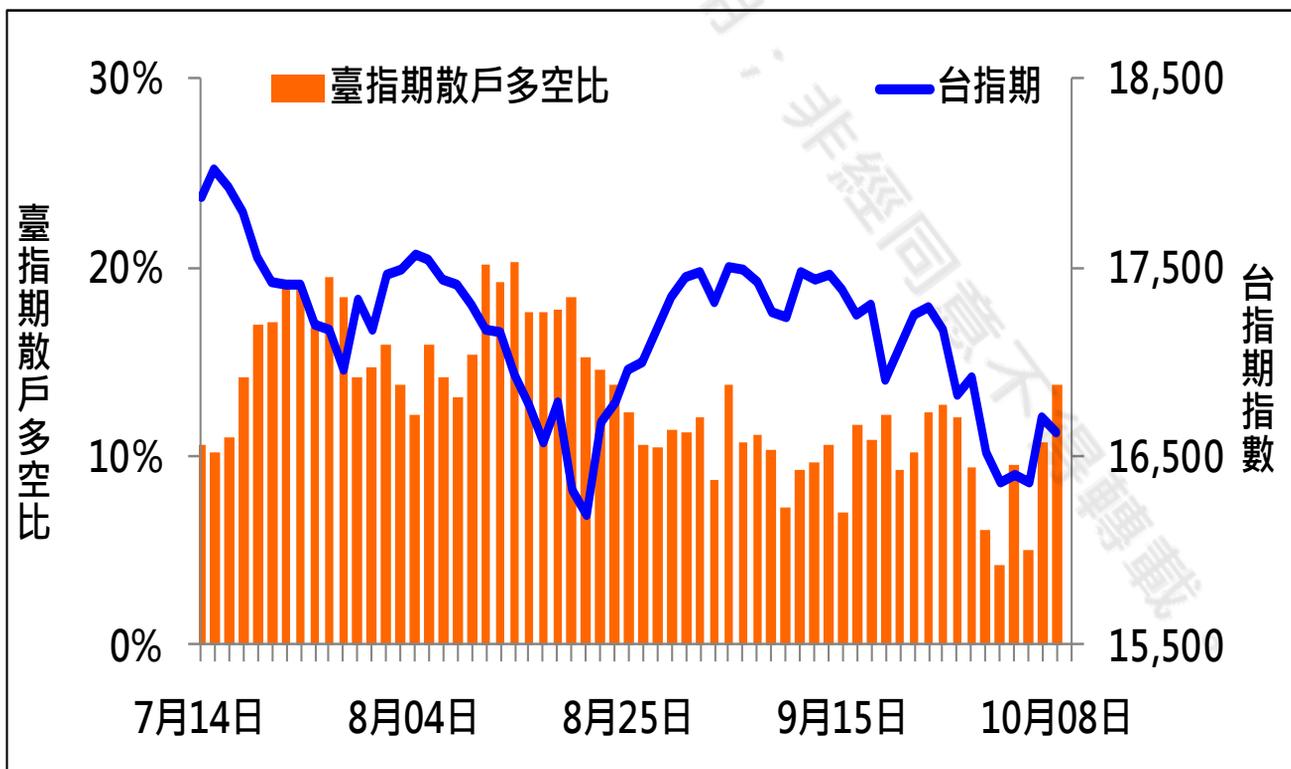
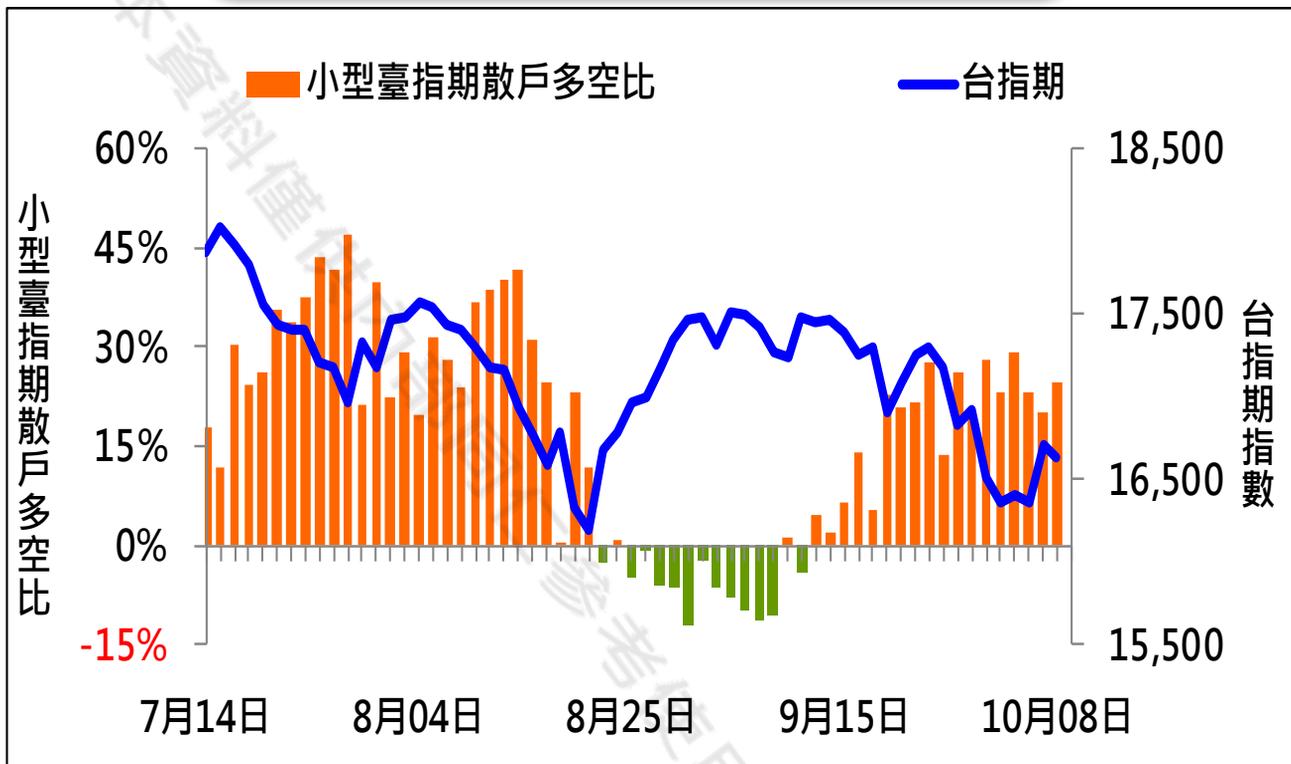
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



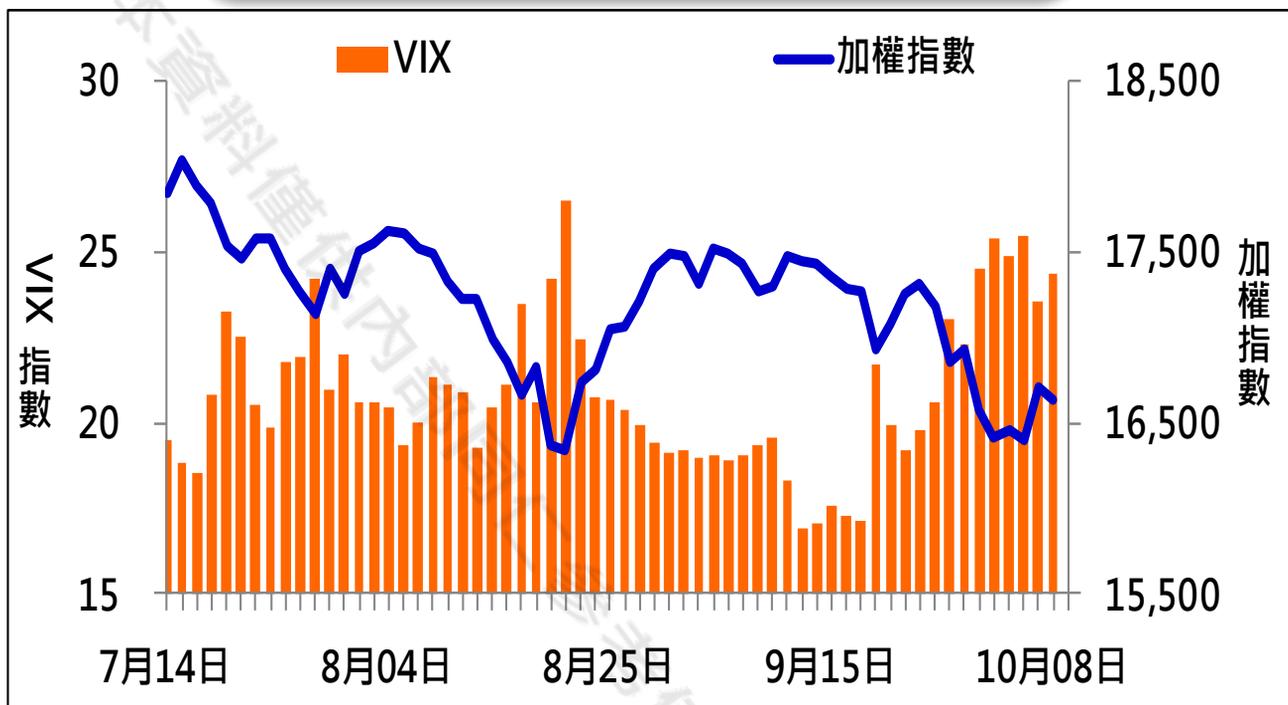
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

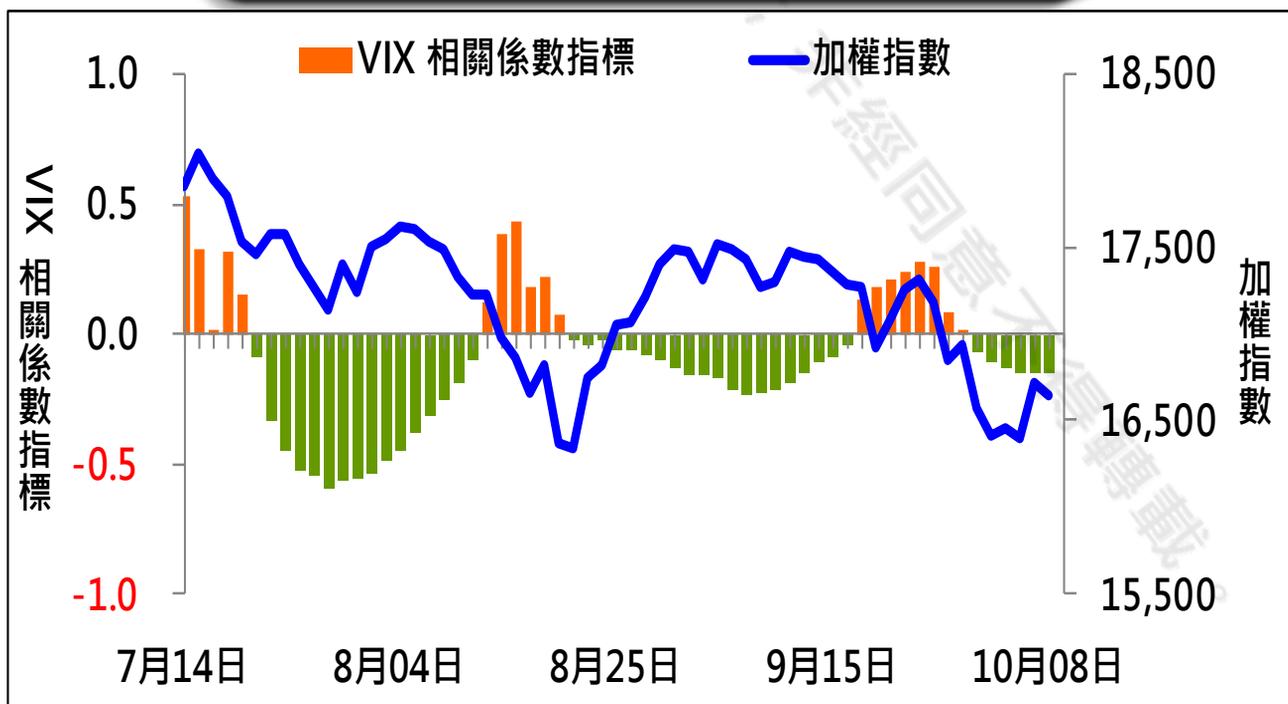
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



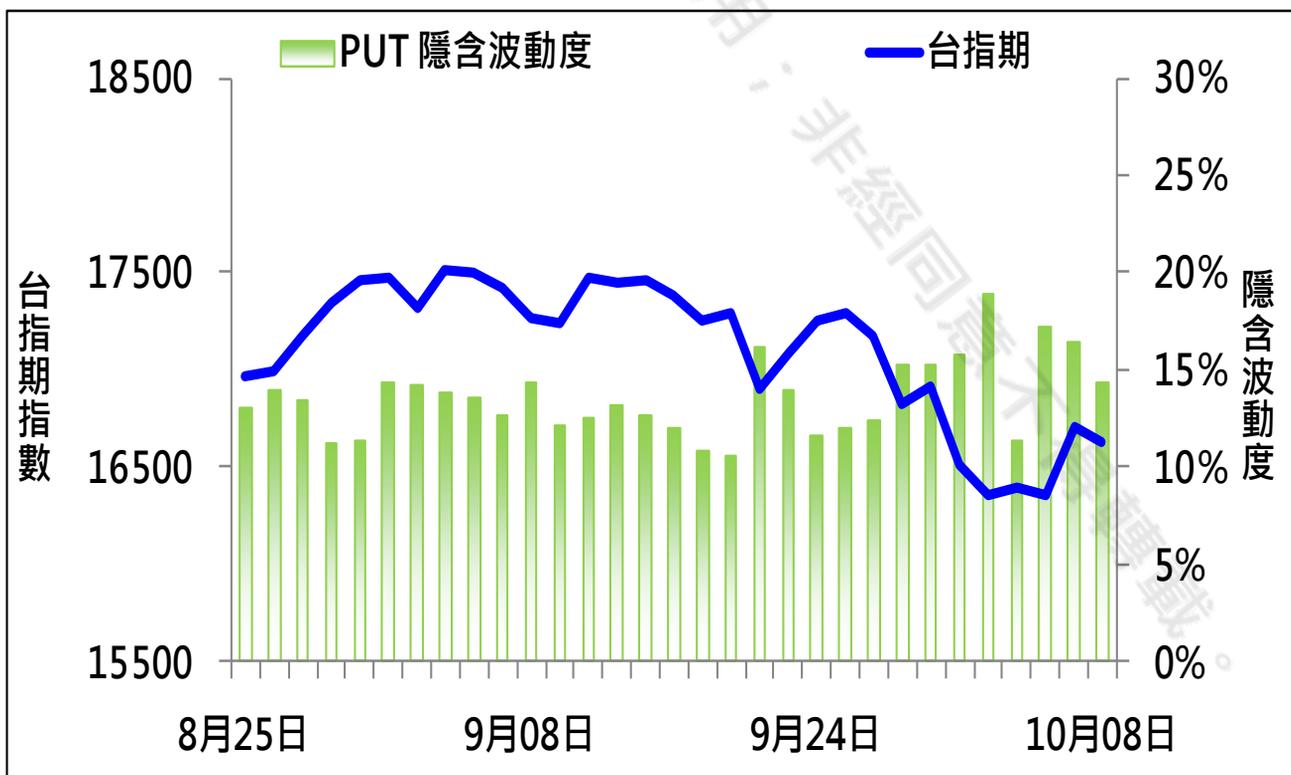
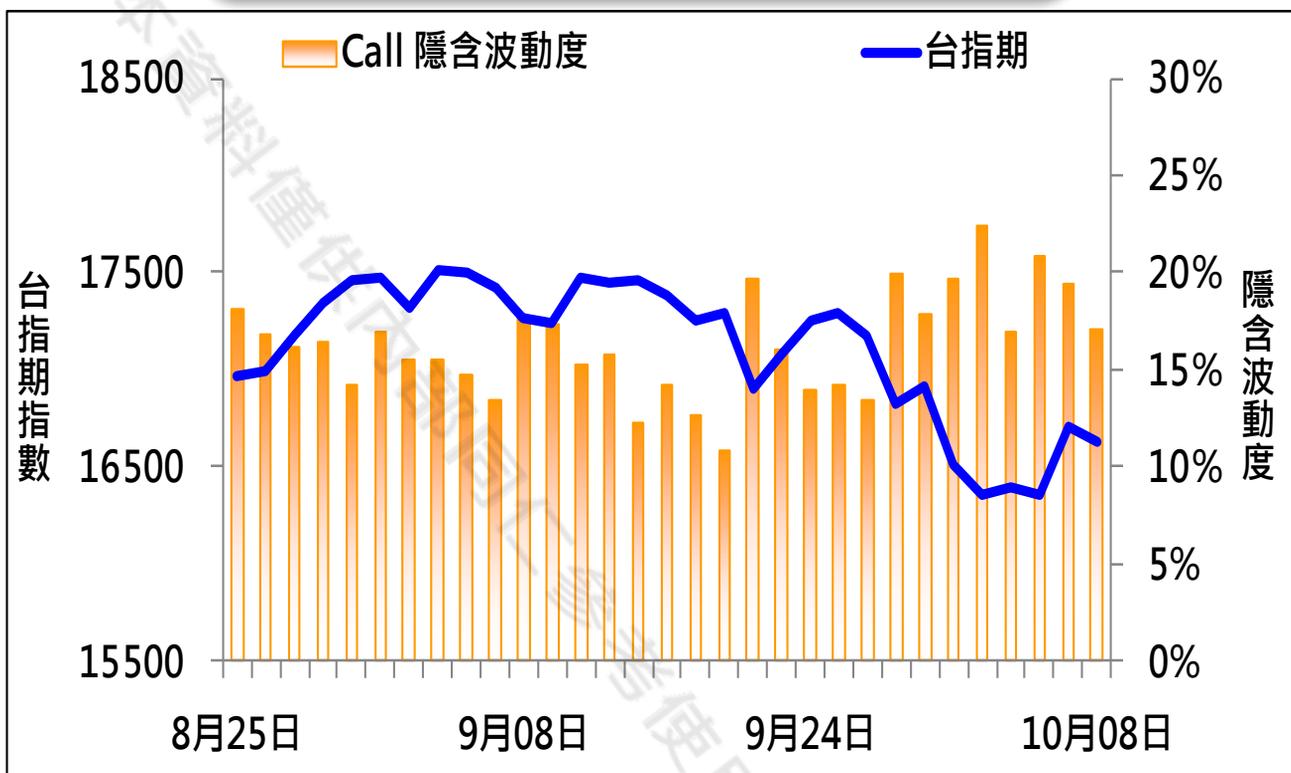
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/10/8

結算日：2021/10/13

OI 增減	Call	202110W2 履約價	Put	OI 增減
2	139	16,100	3,408	1,038
1	168	16,150	1,982	876
0	213	16,200	5,323	1,514
-40	555	16,250	2,959	1,139
-23	569	16,300	6,723	2,310
-64	928	16,350	2,821	712
-97	1,054	16,400	5,910	1,693
-35	917	16,450	2,701	883
-116	1,608	16,500	4,752	1,737
-47	1,117	16,550	2,055	664
136	2,856	16,600	5,077	2,015
183	2,569	16,650	2,593	364
339	3,411	16,700	3,419	645
562	3,276	16,750	1,331	434
1,390	7,055	16,800	1,386	451
1,739	5,402	16,850	476	229
1,685	6,285	16,900	457	123
1,670	4,936	16,950	95	60
3,263	9,208	17,000	177	120
※	4,637	17,050	1	1
3,262	9,670	17,100	38	15
1,523	1,523	17,150	0	0
2,247	4,637	17,200	18	7
942	2,184	17,300	8	8
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
24,549	77,896	1.1590	90,283	21,972

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：2021/10/8

結算日：2021/10/20

OI 增減	Call	202110月 履約價	Put	OI 增減
0	0	15,000	14,635	-1,299
0	0	15,100	2,695	1,191
0	32	15,200	4,288	1,096
0	0	15,300	2,359	176
0	0	15,400	3,113	660
0	181	15,500	4,241	-47
0	43	15,600	3,088	205
0	17	15,700	3,274	122
0	192	15,800	5,612	862
-2	86	15,900	3,984	-194
-2	284	16,000	12,949	-302
-9	283	16,100	5,866	78
-20	600	16,200	7,283	17
-11	1,239	16,300	4,866	395
-101	1,772	16,400	4,560	972
35	2,380	16,500	4,068	186
46	5,238	16,600	5,446	312
515	4,142	16,700	5,189	1,457
322	5,298	16,800	3,377	83
249	5,887	16,900	2,726	108
-1,043	8,204	17,000	3,176	-99
430	6,021	17,100	2,121	-28
※ 1,256	7,265	17,200	3,597	-42
771	7,137	17,300	2,546	5
390	6,982	17,400	1,388	-1
707	10,976	17,500	350	-65
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
3,091	147,213	0.9689	142,637	5,346
昨日 P/C	0.9526	今日增減變化		0.0163

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。

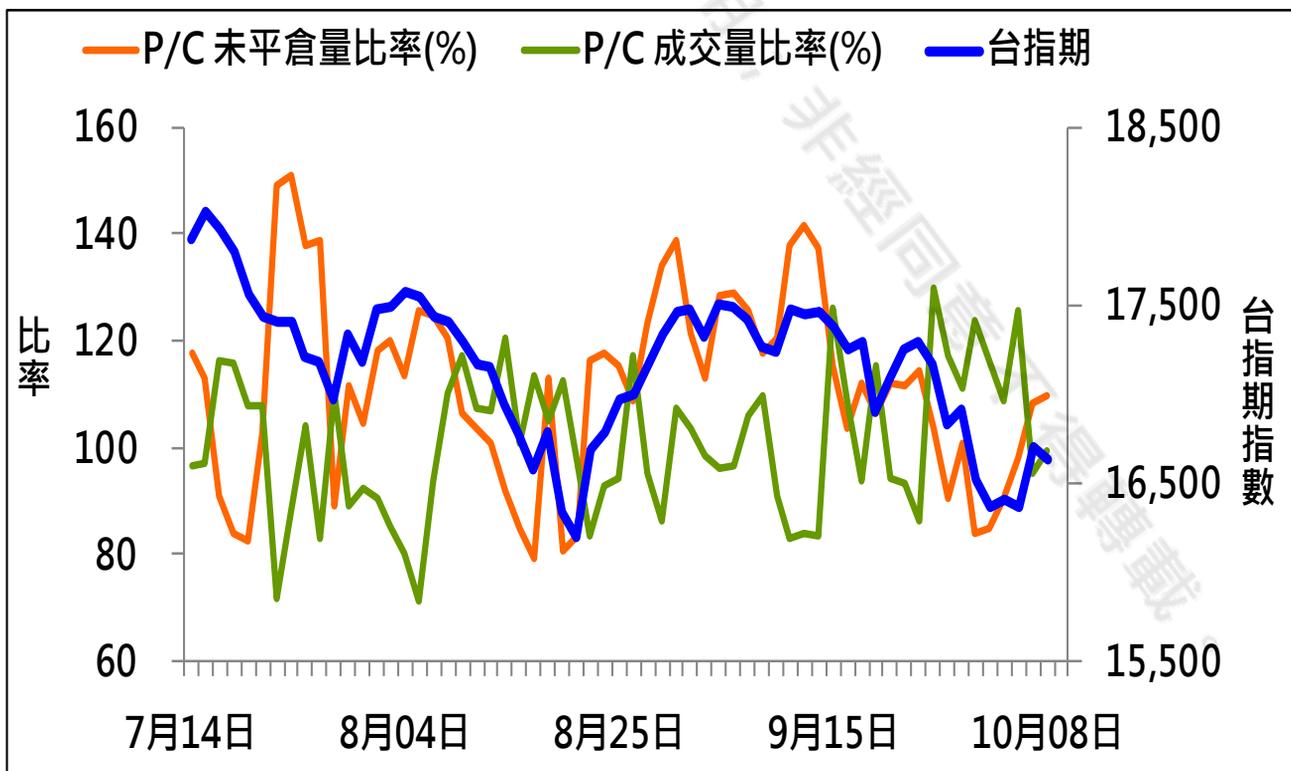
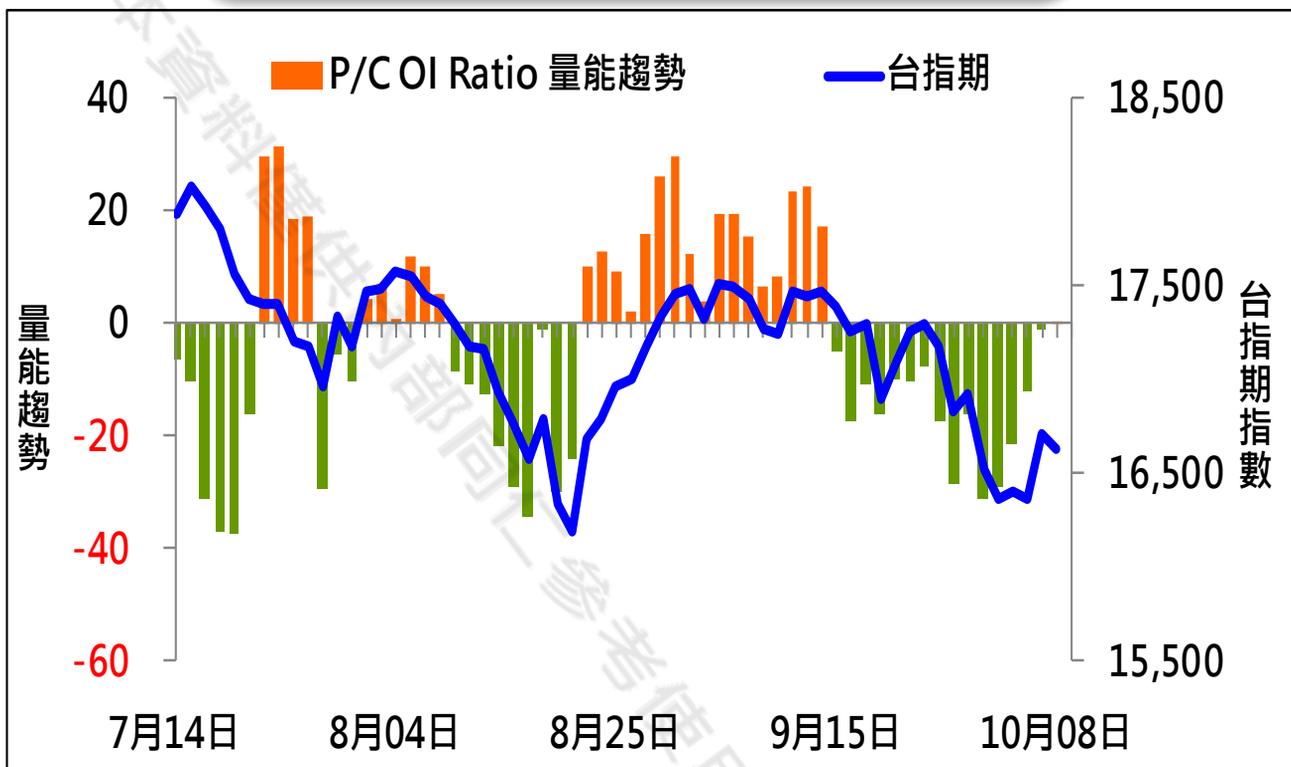
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

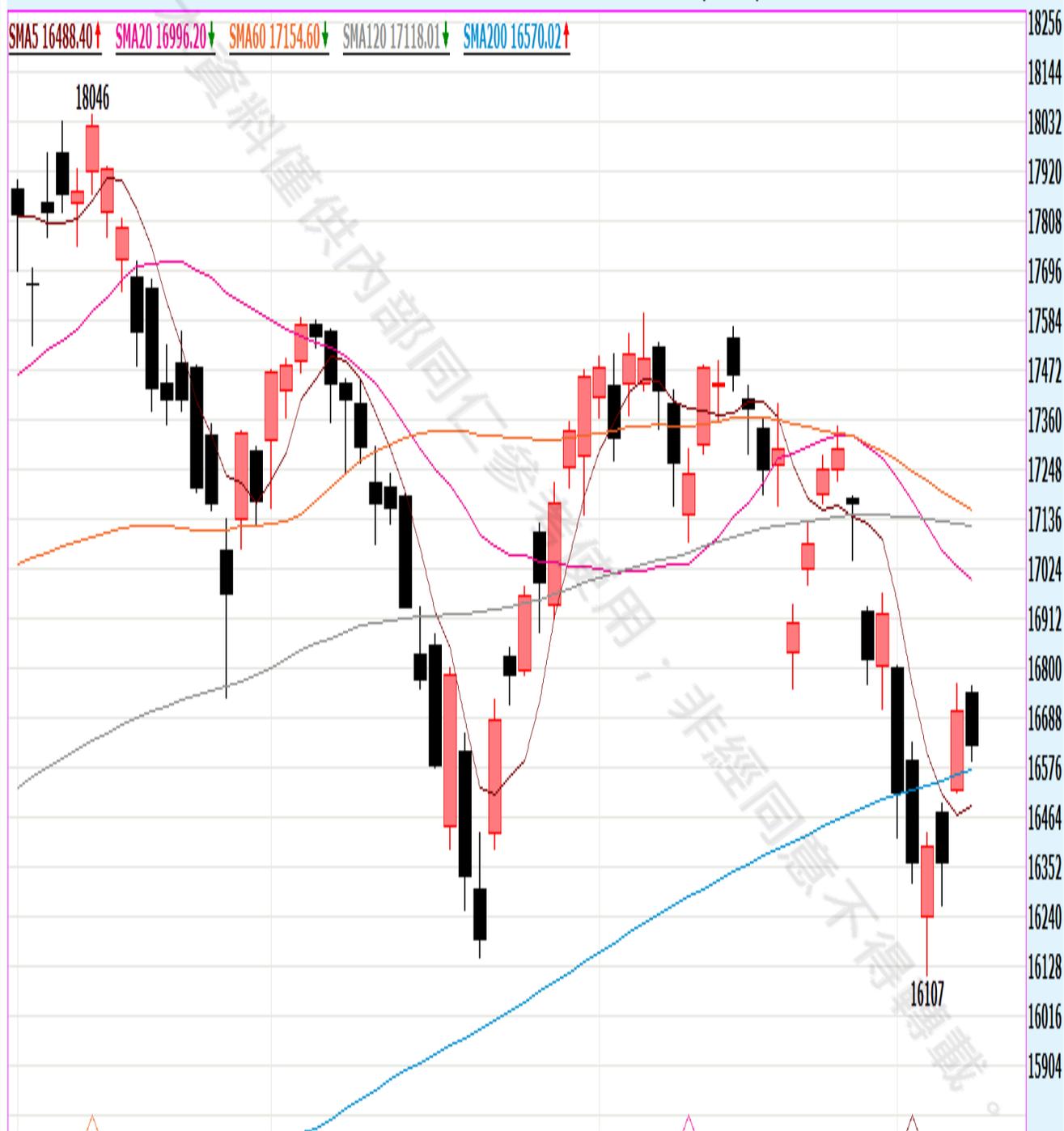
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## 盤後重點觀察

台股指數近月(一般)(FTTX\*1) 日線圖 2021/10/08 開 16740 高 16759 低 16591 收 16625 s 點 量 101061 口 -74 (-0.44%)

SMA5 16488.40 ↑ SMA20 16996.20 ↓ SMA60 17154.60 ↓ SMA120 17118.01 ↓ SMA200 16570.02 ↑



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