



法人籌碼動態

10月18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	-19,002	-1,352	343	28	-1,642	-38
投信	-3,665	141	165	0	24	0
自營商	13,283	1	4	-46	192	-15

10月18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	-231	31	20,911	6,065	41,788	1,626
投信	2	0	0	0	-60	0
自營商	205	-28	-4,986	-327	-6,154	-2,160

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
台達電	8.13	台積電	-85.45	台指期前十大 市場佔比	47.1%	51.4%
台塑化	6.28	鴻海	-9.14			
聯發科	5.24	聯電	-2.87			
中鋼	2.34	陽明	-2.86	電子期前十大 市場佔比	54.7%	67.1%
兆豐金	2.02	矽力-KY	-2.61			
國泰金	1.94	長榮	-2.58			
台新金	1.74	研華	-2.55	金融期前十大 市場佔比	62.8%	89.4%
微星	1.53	日月光投控	-2.31			
欣興	1.49	智邦	-2.21			
億豐	1.16	南亞	-1.83	非金電期前十大 市場佔比	92.3%	89.7%
前十名合計	31.86	後十名合計	-114.40			

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

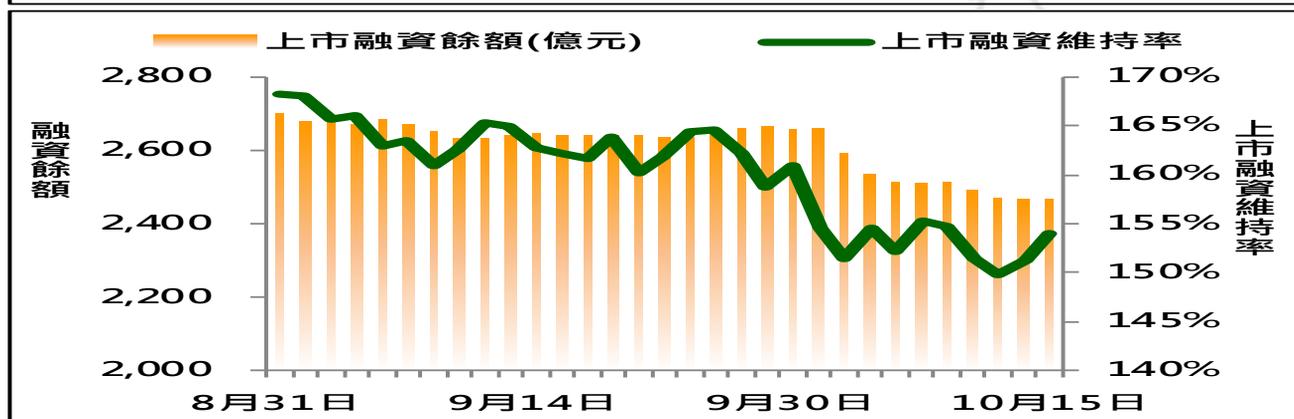
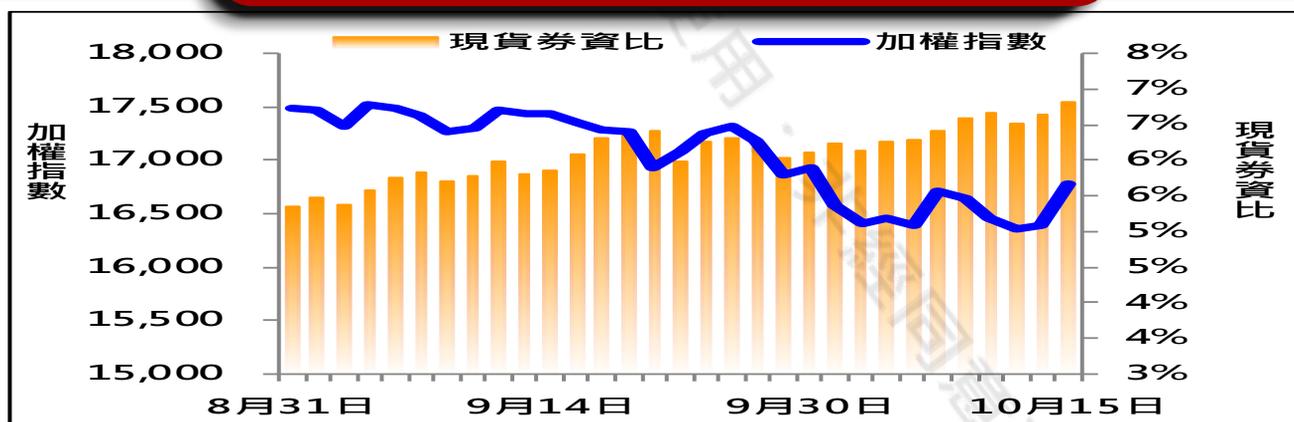


法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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12日	-167.6	-15,634	5,510	-14.9	13,230	-708
10月13日	-85.3	-18,436	-2,802	-7.4	12,815	-415
10月14日	34.3	-16,127	2,309	-8.4	12,620	-195
10月15日	279.0	-17,650	-1,523	24.8	13,282	662
10月18日	32.9	-19,002	-1,352	2.5	13,283	1

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12日	12,621	37,408	-24,787	1,988	5,105	-3,117
10月13日	5,743	36,924	-31,181	-3,292	6,400	-9,692
10月14日	7,840	37,599	-29,759	-3,804	6,876	-10,680
10月15日	14,846	40,162	-25,316	-4,659	-3,994	-665
10月18日	20,911	41,788	-20,877	-4,986	-6,154	1,168

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。

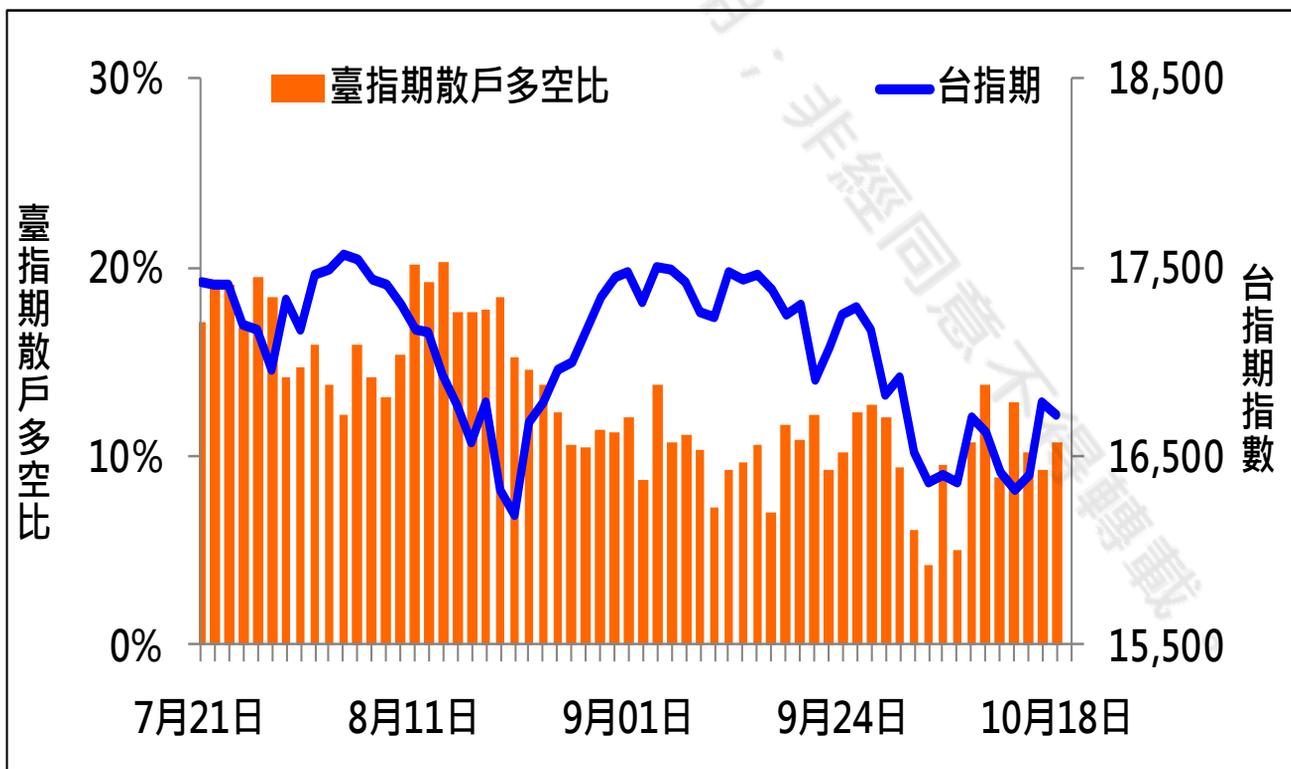
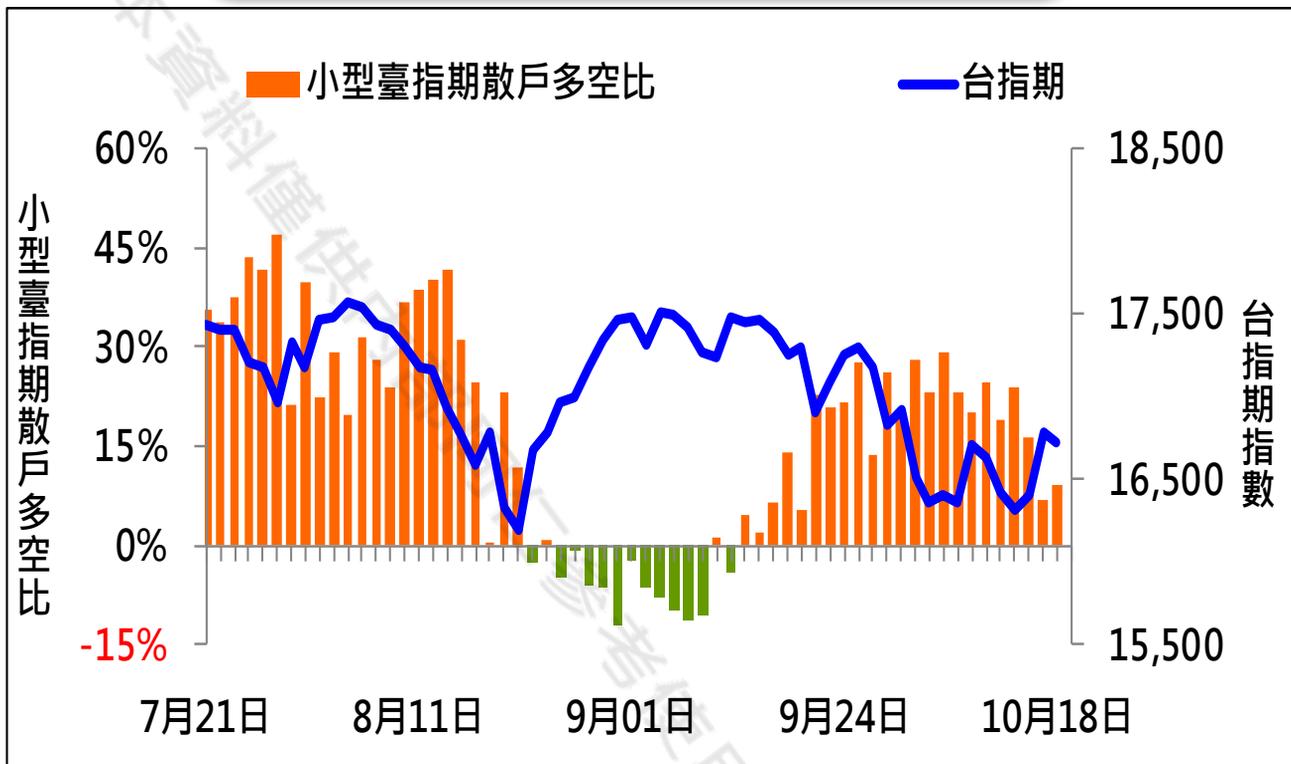
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



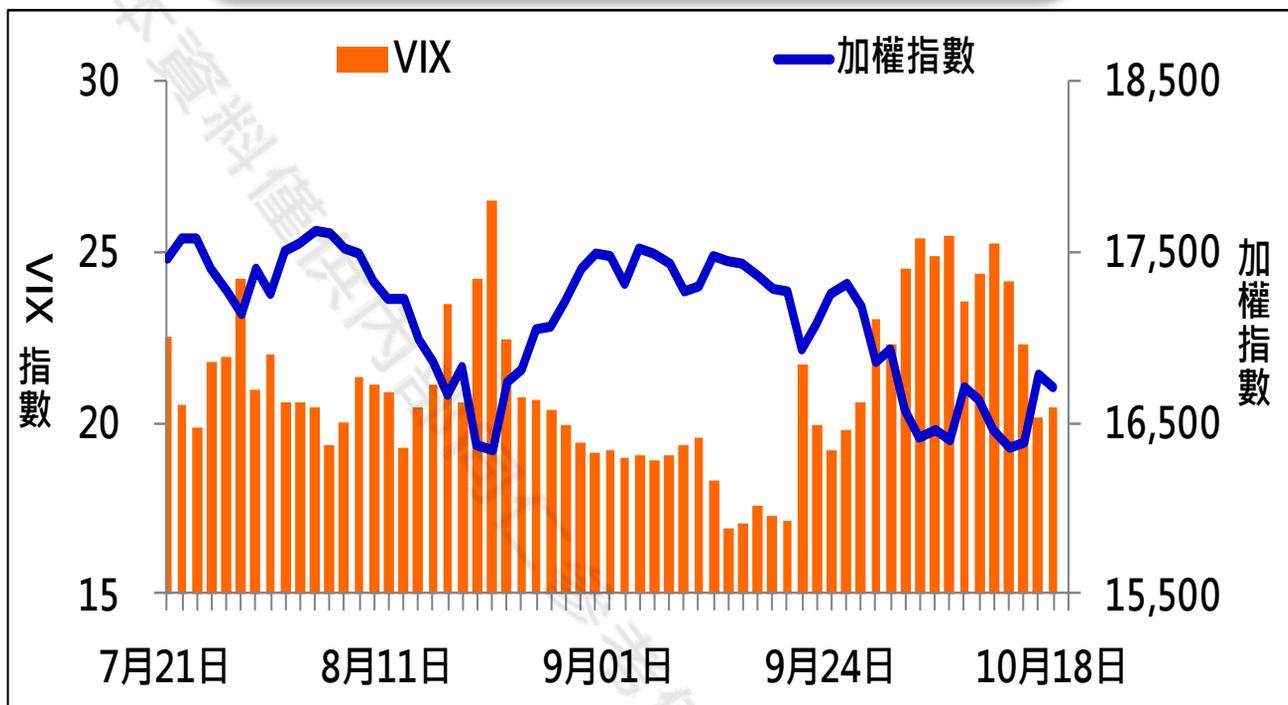
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

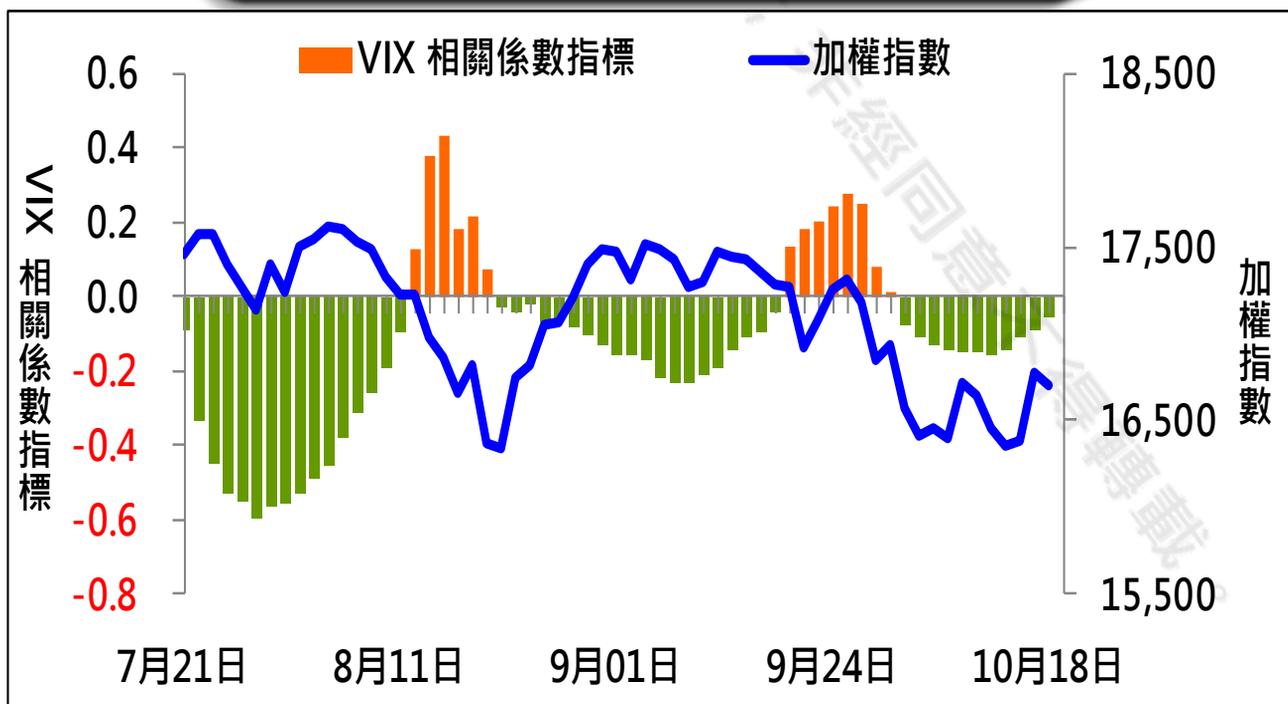
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



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。

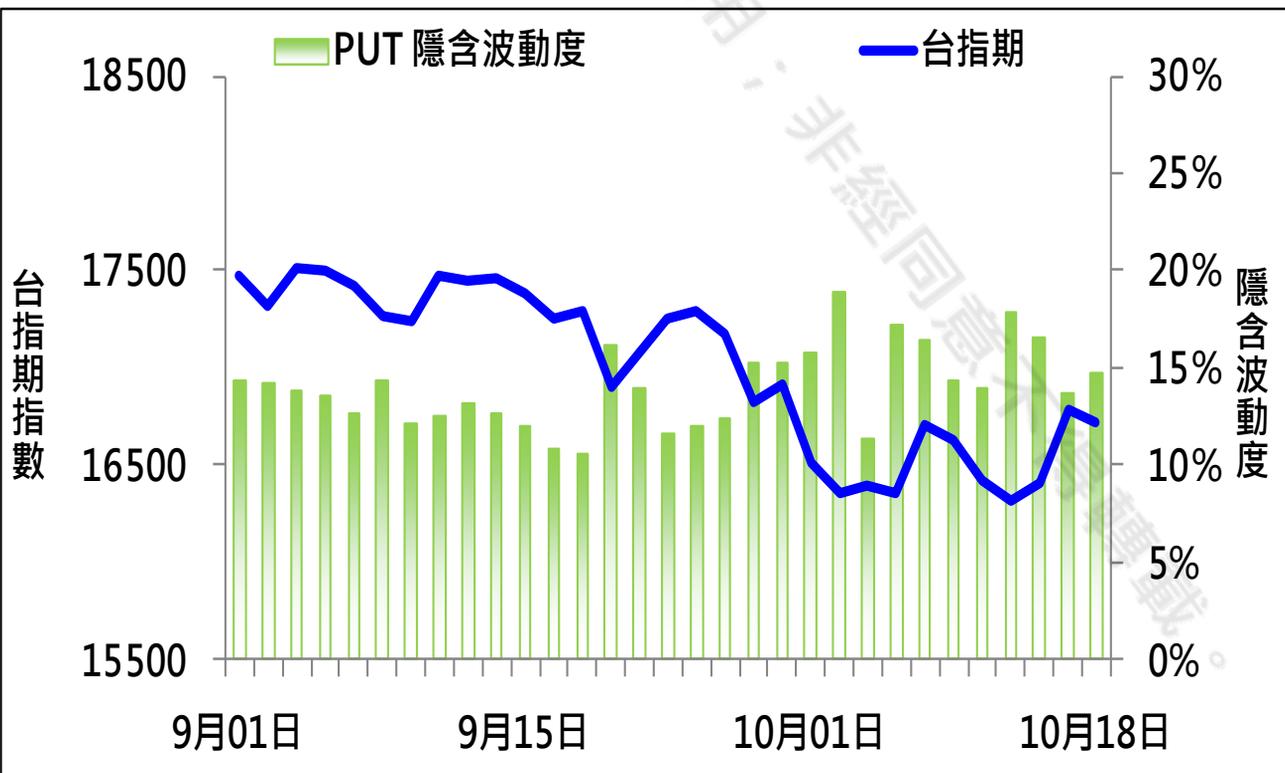
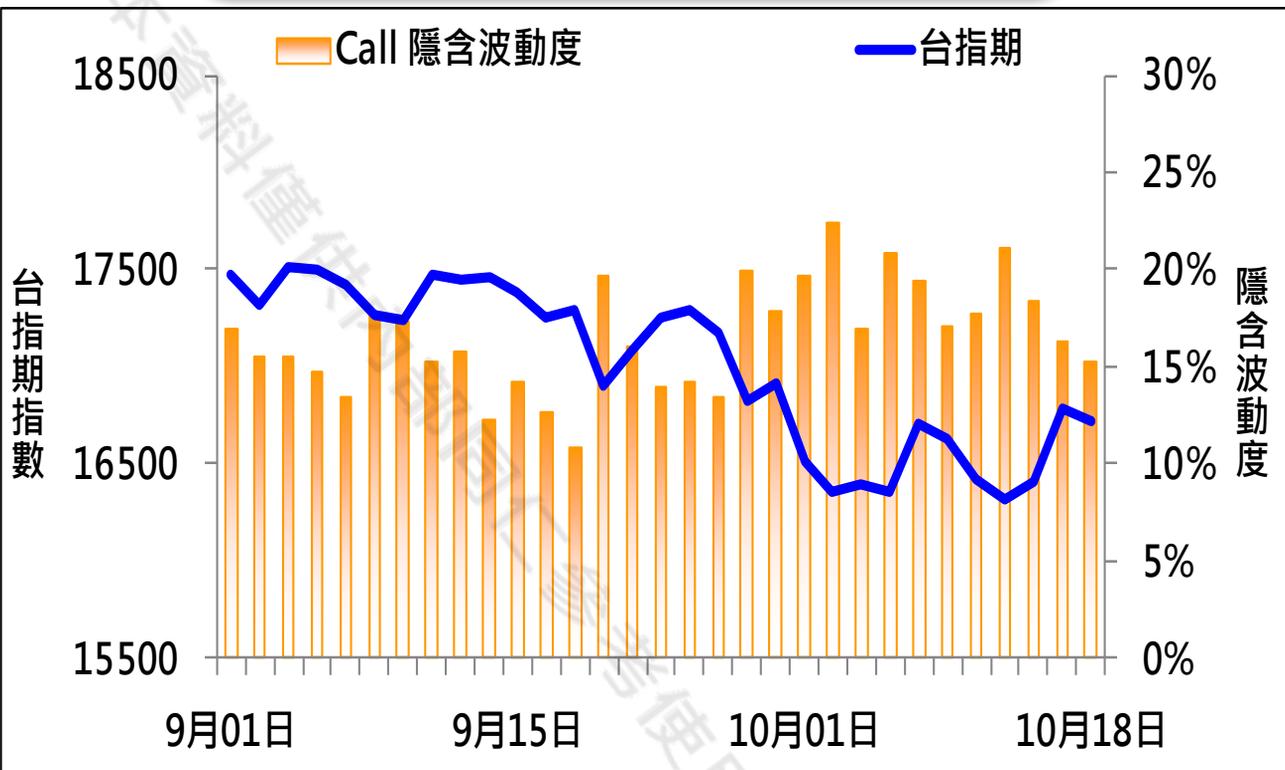
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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：2021/10/18

結算日：2021/10/20

OI 增減	Call	202110月 履約價	Put	OI 增減
0	1	15,950	2,298	-1,207
-3	236	16,000	14,773	-1,293
0	14	16,050	2,700	306
-26	218	16,100	7,661	-1,374
0	59	16,150	2,820	-215
-5	646	16,200	8,805	-1,564
-1	114	16,250	3,182	77
-76	1,573	16,300	9,436	-776
-13	499	16,350	3,989	-788
-207	4,688	16,400	16,830	2,121 ※
-24	1,024	16,450	5,194	1,860
-511	4,420	16,500	11,974	215
-359	1,406	16,550	5,399	1,991
-598	6,497	16,600	10,853	1,460
-114	2,731	16,650	3,910	1,803
-388	7,631	16,700	9,212	-835
1,023	4,648	16,750	2,904	827
1,159	14,226	16,800	6,582	1,507
1,637	8,507	16,850	1,231	896
4,729	18,464	16,900	3,553	486
6,250	10,817	16,950	190	140
5,278	23,065	17,000	3,129	-35
※ 6,549	6,549	17,050	20	20
2,097	15,588	17,100	1,992	51
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
30,891	239,492	0.9697	232,232	3,901

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：2021/10/18

結算日：2021/11/17

OI 增減	Call	202111月 履約價	Put	OI 增減
0	0	15,700	1,078	293
0	62	15,800	1,459	303
0	4	15,900	773	93
0	49	16,000	2,536	618 ※
0	33	16,100	1,116	361
7	261	16,200	2,674	-60
-1	657	16,300	944	-2
18	1,240	16,400	1,532	35
10	696	16,500	2,509	82
-18	650	16,600	3,603	11
34	878	16,700	2,756	131
141	909	16,800	610	126
51	828	16,900	611	54
105	1,338	17,000	465	6
775	2,896	17,100	401	6
218	1,484	17,200	775	3
253	1,575	17,300	1,347	1
631	1,654	17,400	466	1
413	1,922	17,500	24	0
377	2,162	17,600	11	1
175	1,641	17,700	7	0
※ 1,260	2,166	17,800	2	0
679	1,229	17,900	11	0
143	2,453	18,000	3	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
5,711	37,825	1.0113	38,254	2,979
昨日 P/C	1.0984	今日增減變化		-0.0871

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。

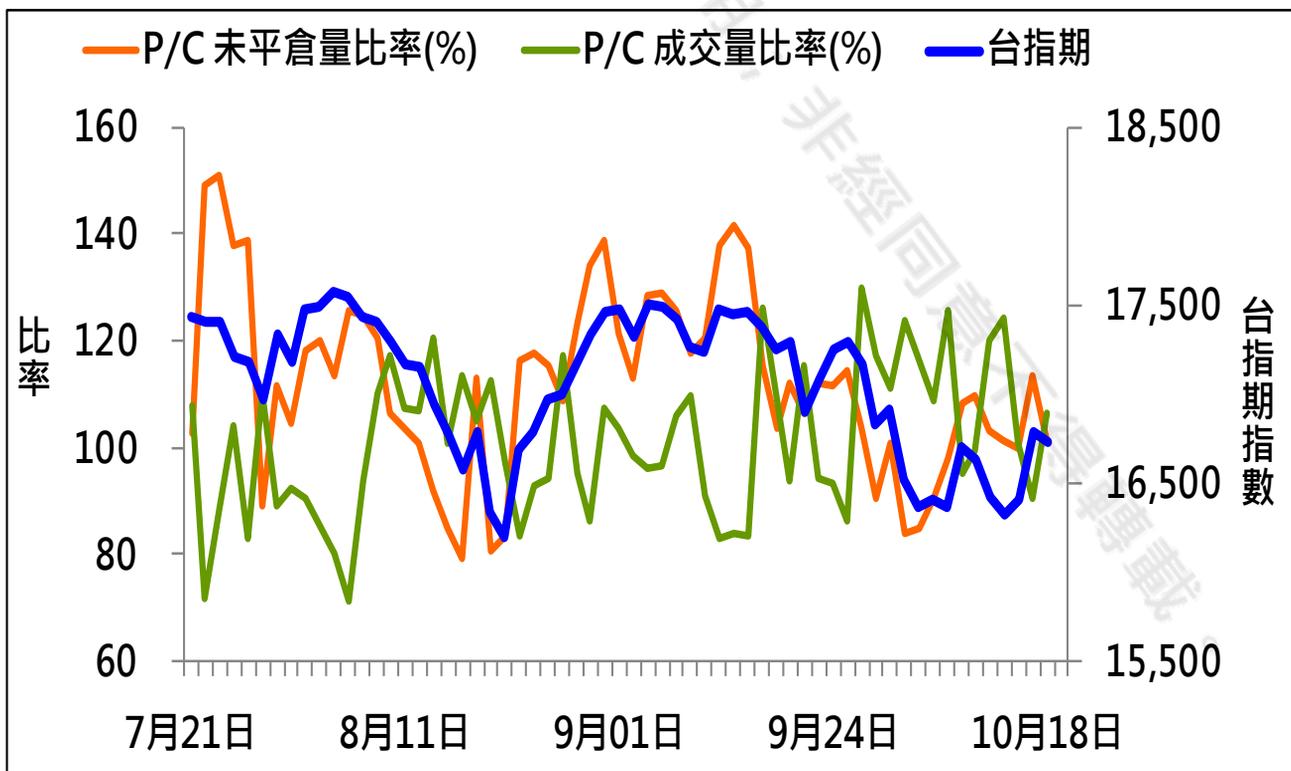
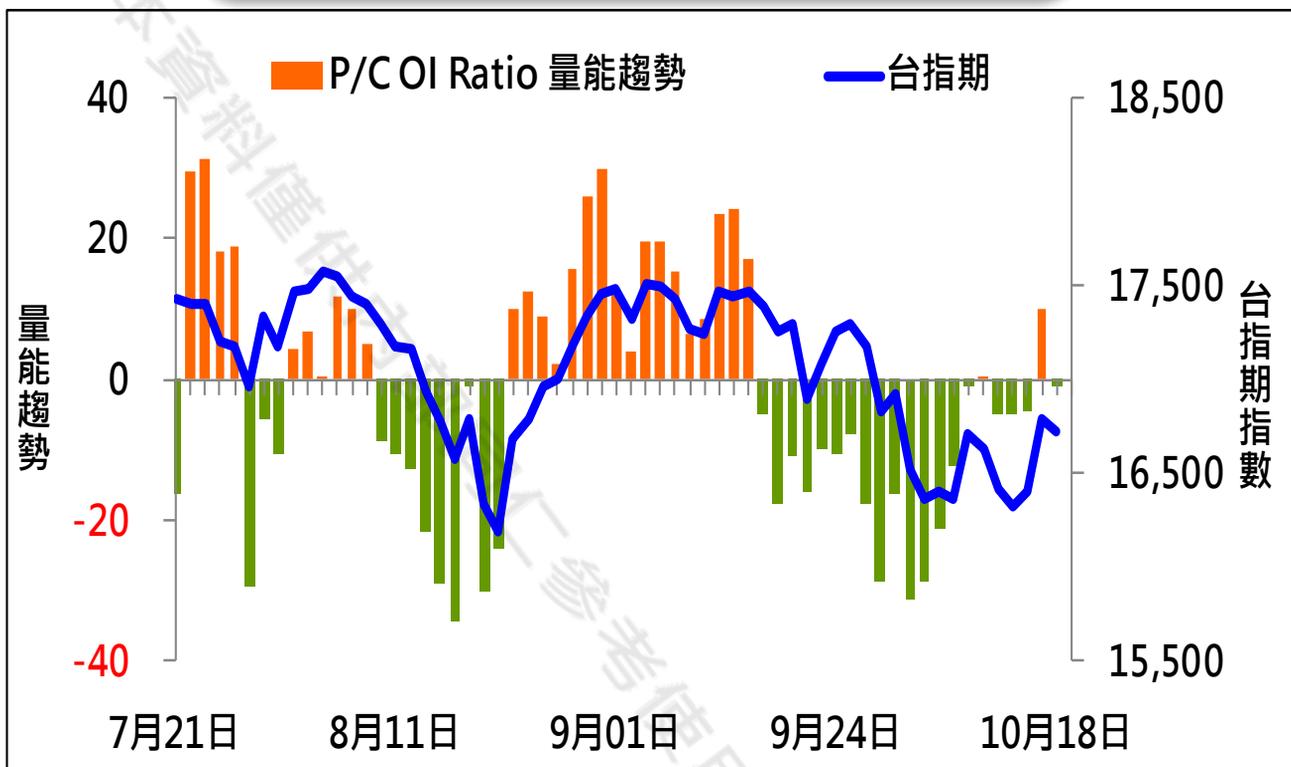
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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*) 日線圖 2021/10/18 開 16800 高 16870 低 16705 收 16721 s 點量 109628 口 -59 (-0.35%)

SMA5 16528.60↑ SMA20 16778.55↓ SMA60 17053.20↓ SMA120 17086.38↓ SMA200 16628.58↑



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