



## 法人籌碼動態

10月19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	-18,206	796	302	-41	-1,674	-32
投信	-2,930	735	165	0	24	0
自營商	11,689	-1,594	114	110	196	4

10月19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	-280	-49	22,832	1,921	41,398	-390
投信	2	0	0	0	-60	0
自營商	270	65	-5,953	-967	-20,854	-14,700

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	85.45	鴻海	-2.28	台指期前十大 市場佔比	44.3%	50.4%
聯發科	16.25	台塑	-2.10			
南電	8.20	光寶科	-2.09			
台達電	8.13	台塑化	-1.57	電子期前十大 市場佔比	58.0%	66.1%
欣興	6.20	萬海	-1.46			
日月光投控	5.48	國泰金	-1.45			
聯電	4.91	台泥	-1.39	金融期前十大 市場佔比	66.1%	91.2%
矽力-KY	3.84	億豐	-1.26			
景碩	3.19	長榮	-1.20			
聯詠	2.81	富邦金	-1.14	非金電期前十大 市場佔比	93.8%	90.1%
前十名合計	144.46	後十名合計	-15.94			

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

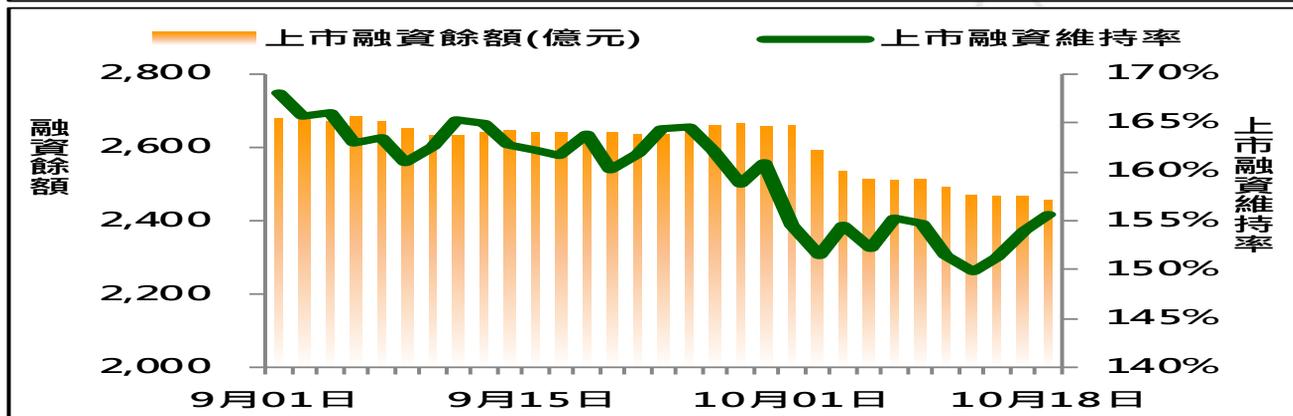
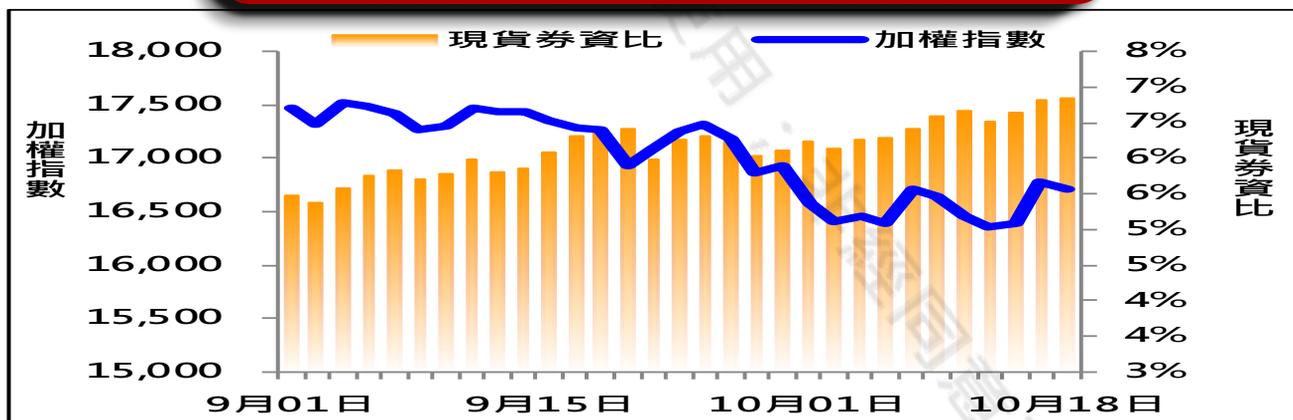


## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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
10月19日	110.9	-18,206	796	38.6	11,689	-1,594

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
10月19日	22,832	41,398	-18,566	-5,953	-20,854	14,901

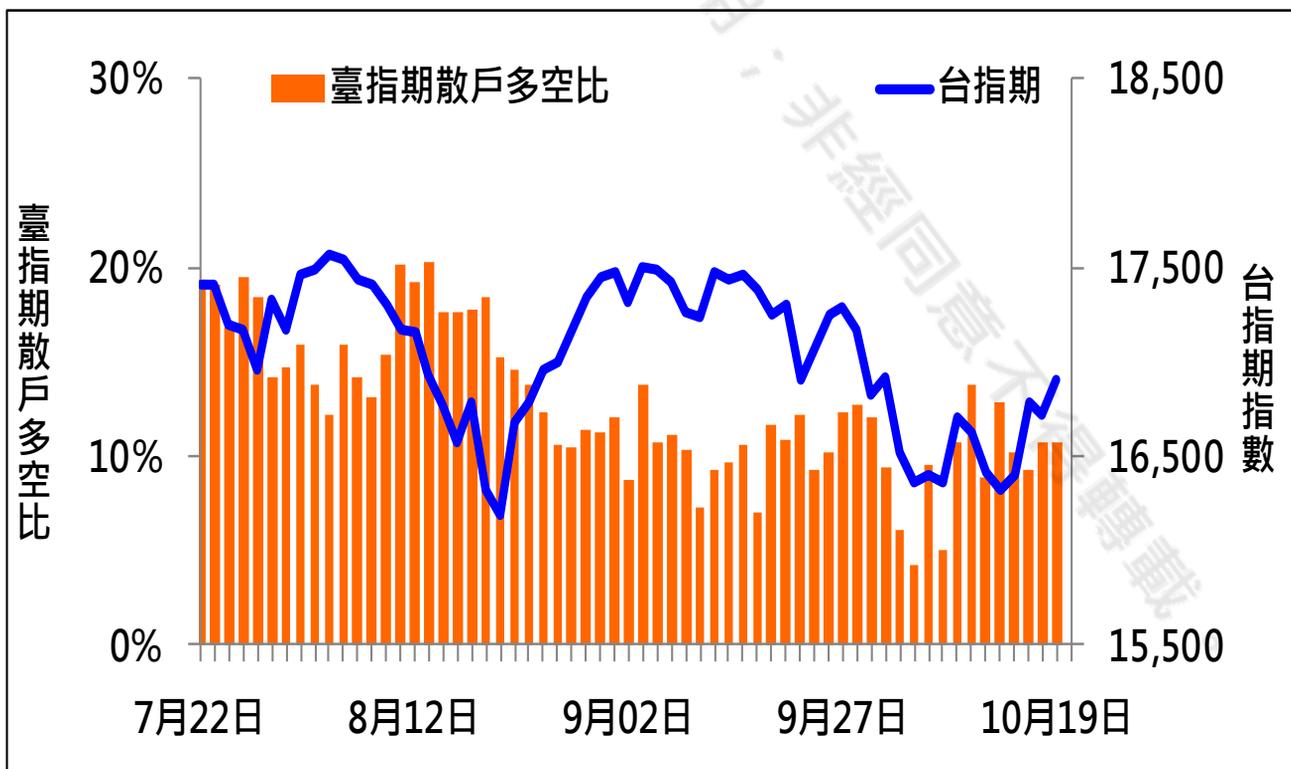
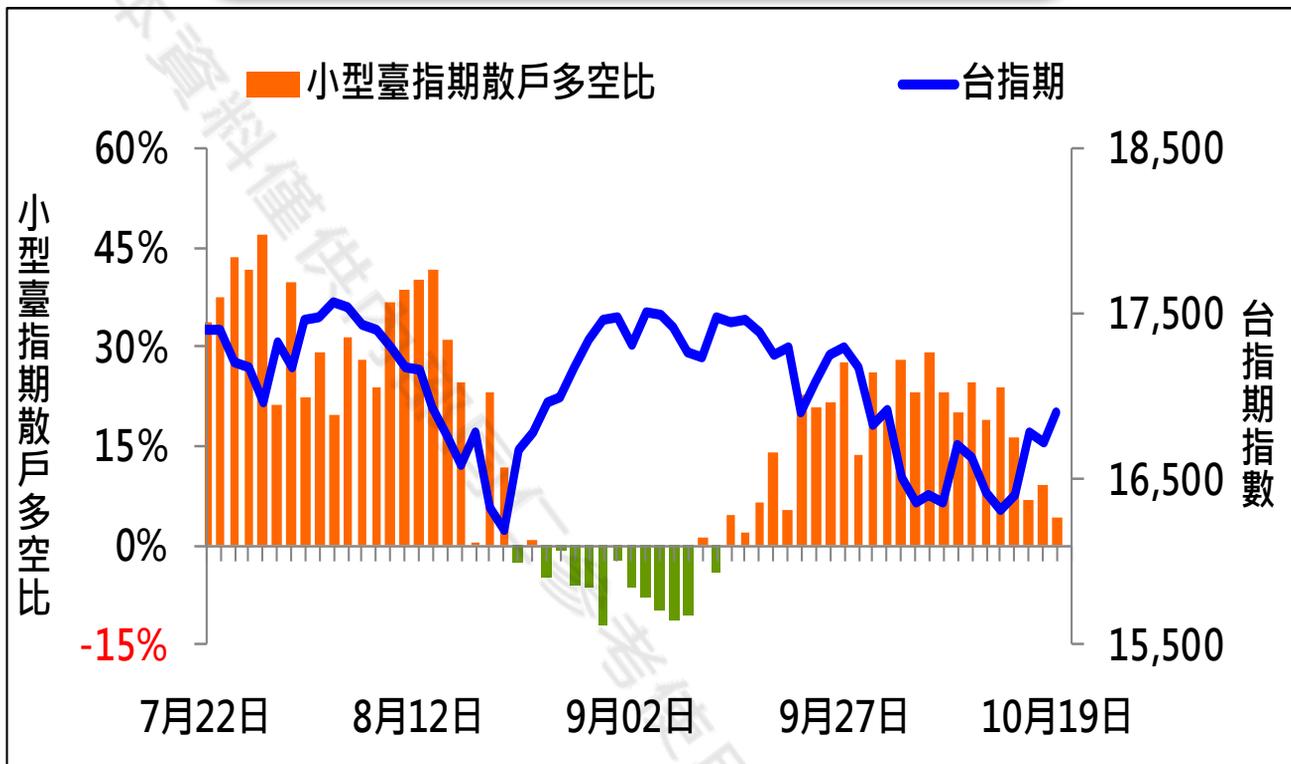
## 現貨券資比 & 上市融資維持率



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。



## 散戶多空比



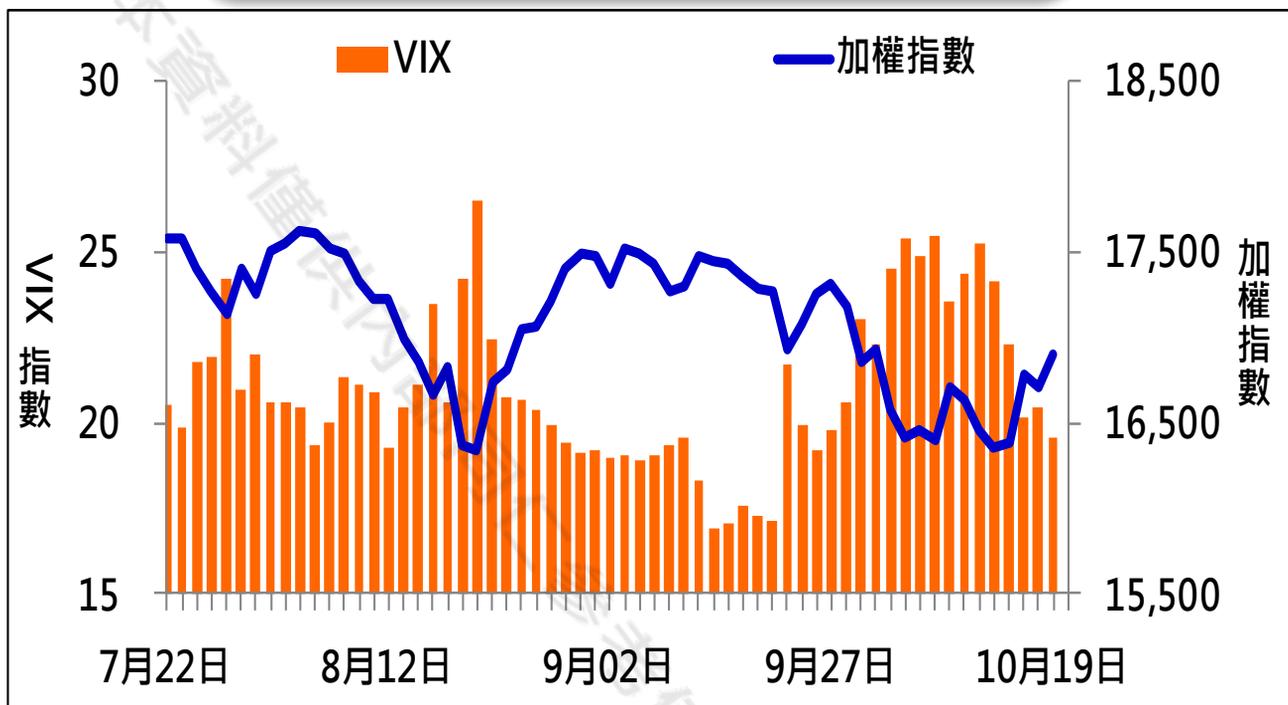
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

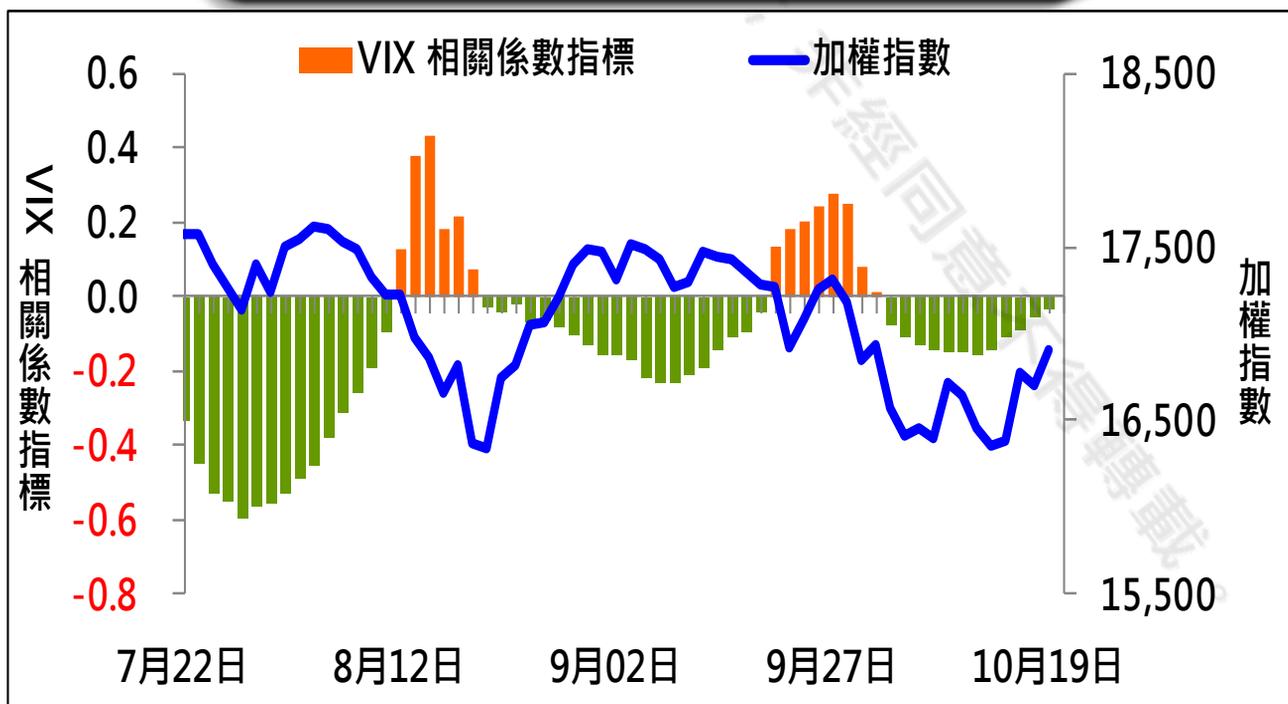
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



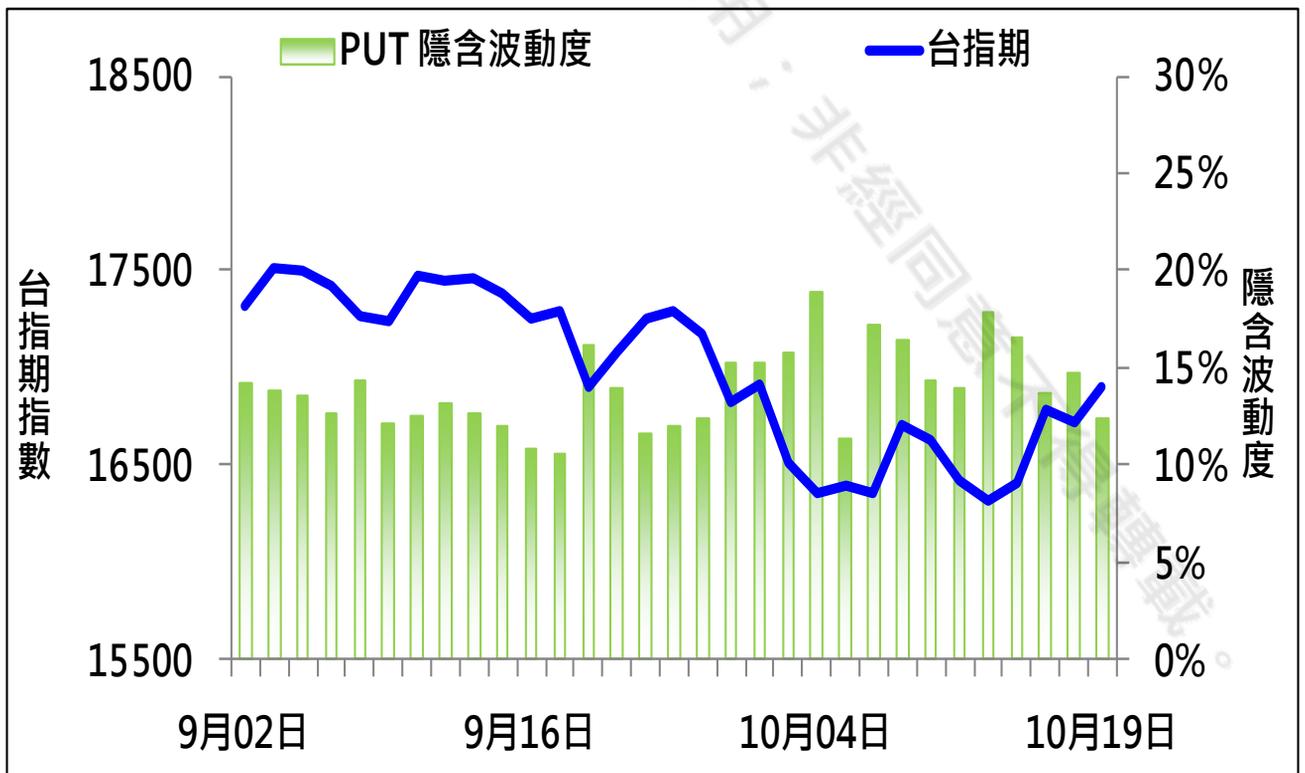
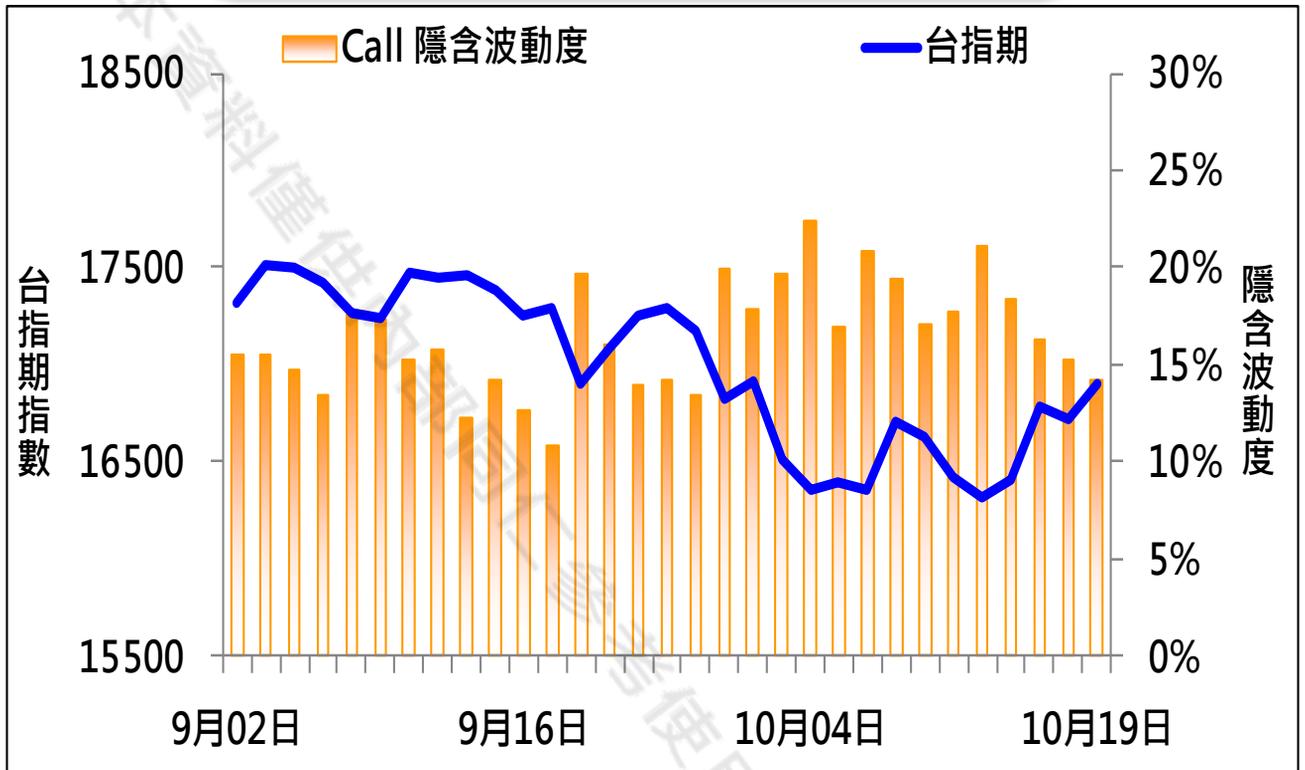
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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。



## 近月選擇權OI變化

日期：2021/10/19

結算日：2021/10/20

OI 增減	Call	202110月 履約價	Put	OI 增減
-30	616	16,200	7,963	-842
-2	112	16,250	2,666	-516
-93	1,480	16,300	7,538	-1,898
-23	476	16,350	3,436	-553
-126	4,562	16,400	14,635	-2,195
-199	825	16,450	4,906	-288
-190	4,230	16,500	10,361	-1,613
-95	1,311	16,550	5,277	-122
-358	6,139	16,600	13,117	2,264
-137	2,594	16,650	7,277	3,367
-535	7,096	16,700	15,819	6,607
-1,521	3,127	16,750	8,303	5,399
-3,514	10,712	16,800	10,961	4,379
-527	7,980	16,850	5,062	3,831
-3,081	15,383	16,900	13,121	9,568
-726	10,091	16,950	4,618	4,428
1,501	24,566	17,000	4,048	919
2,980	9,529	17,050	368	348
3,123	18,711	17,100	2,229	237
2,171	3,267	17,150	368	368
1,550	15,024	17,200	3,715	162
1,217	1,999	17,250	1	1
219	8,951	17,300	2,501	-3
-436	6,996	17,400	1,330	-2
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
4,367	243,859	1.0674	260,300	28,068

※

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：2021/10/19

結算日：2021/11/17

OI 增減	Call	202111月 履約價	Put	OI 增減
0	4	15,900	930	157
-1	48	16,000	2,942	406
0	33	16,100	1,373	257
2	263	16,200	3,062	388
8	665	16,300	1,164	220
-5	1,235	16,400	1,613	81
-3	693	16,500	2,657	148
4	654	16,600	3,765	162
36	914	16,700	3,073	317
54	963	16,800	850	240
416	1,244	16,900	742	131
33	1,371	17,000	572	107
-84	2,812	17,100	395	-6
83	1,567	17,200	770	-5
314	1,889	17,300	1,346	-1
329	1,983	17,400	467	1
743	2,665	17,500	27	3
186	2,348	17,600	12	1
227	1,868	17,700	8	1
※ 820	2,986	17,800	4	2
231	1,460	17,900	11	0
374	2,827	18,000	3	0
46	843	18,100	3	0
83	621	18,200	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
4,359	42,184	1.0218	43,104	4,850
昨日 P/C	1.0113	今日增減變化		0.0105

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。

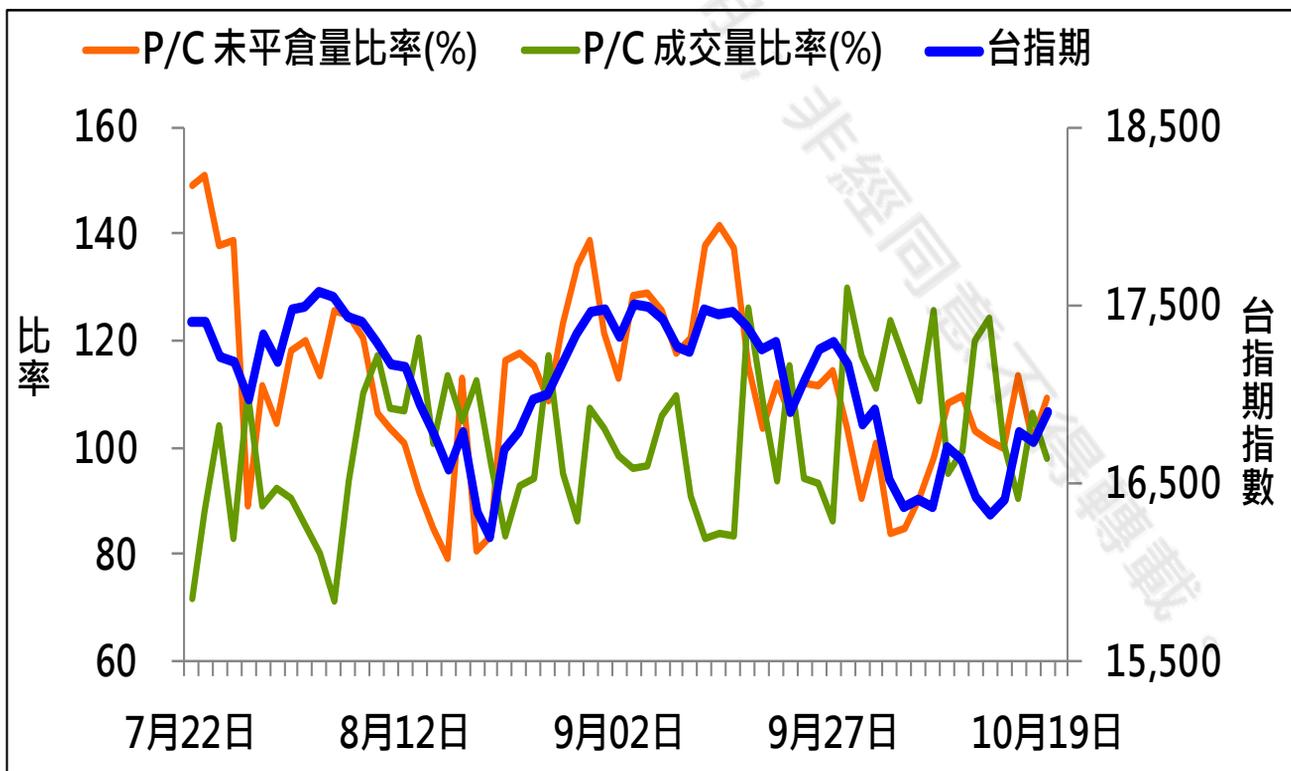
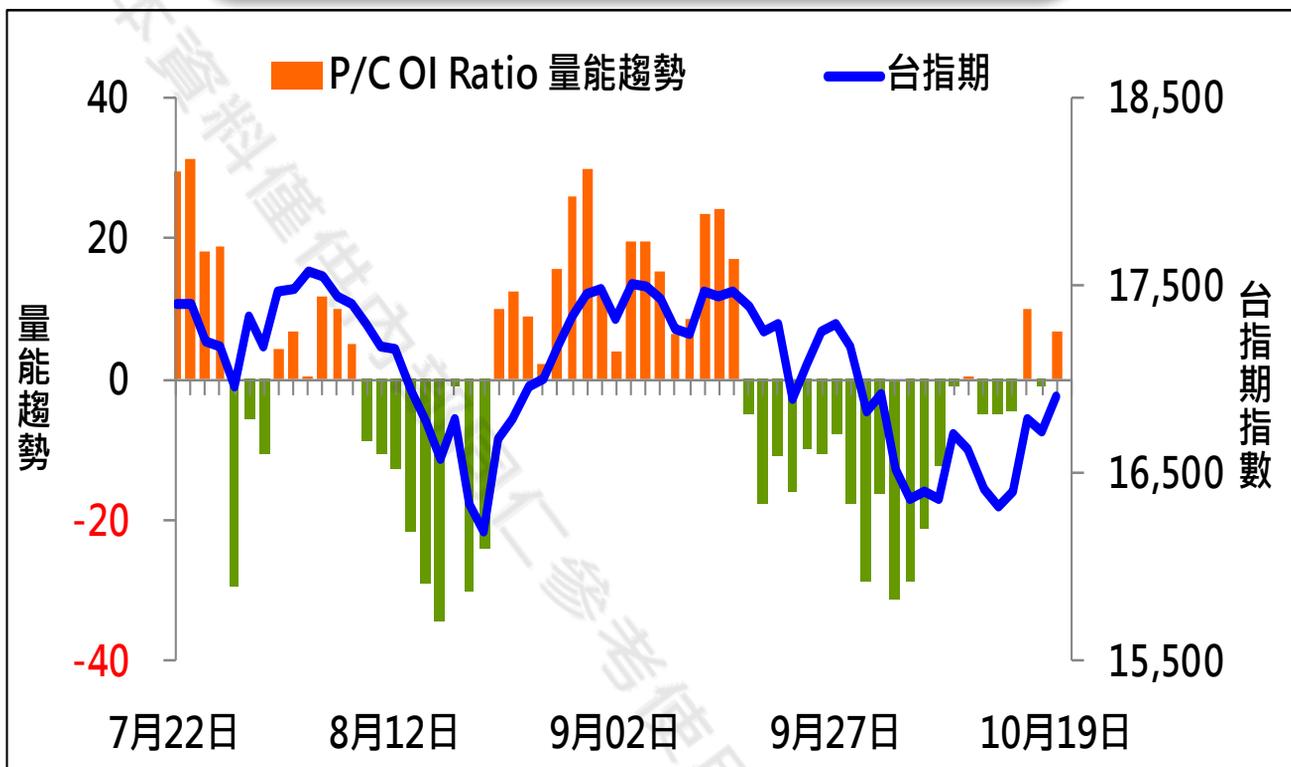
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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 2021/10/19 開 16810 高 16954 低 16787 收 16903 s 點量 97333 口 +182 (+1.09%)

SMA5 16625.40↑ SMA20 16761.35↓ SMA60 17044.82↓ SMA120 17080.82↓ SMA200 16641.56↑



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