



法人籌碼動態

10月20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	-17,463	743	355	53	-1,574	100
投信	-2,706	224	165	0	24	0
自營商	14,852	3,163	193	79	279	83

10月20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	-234	46	4,132	-18,700	13,449	-27,949
投信	2	0	0	0	-61	-1
自營商	196	-74	625	6,578	2,447	23,301

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
祥碩	2.96	台積電	-17.08	台指期前十大 市場佔比	52.5%	59.4%
鴻海	2.28	台達電	-3.85			
欣興	1.98	聯電	-3.68			
富邦媒	1.85	旭隼	-2.30	電子期前十大 市場佔比	71.5%	74.7%
聯發科	1.57	友達	-1.90			
景碩	1.56	富邦金	-1.89			
中租-KY	1.51	台塑化	-1.57	金融期前十大 市場佔比	73.7%	91.4%
華碩	1.35	台泥	-1.48			
南電	1.28	光寶科	-1.32			
信邦	1.15	群創	-1.31	非金電期前十大 市場佔比	95.1%	98.1%
前十名合計	17.49	後十名合計	-36.40			

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

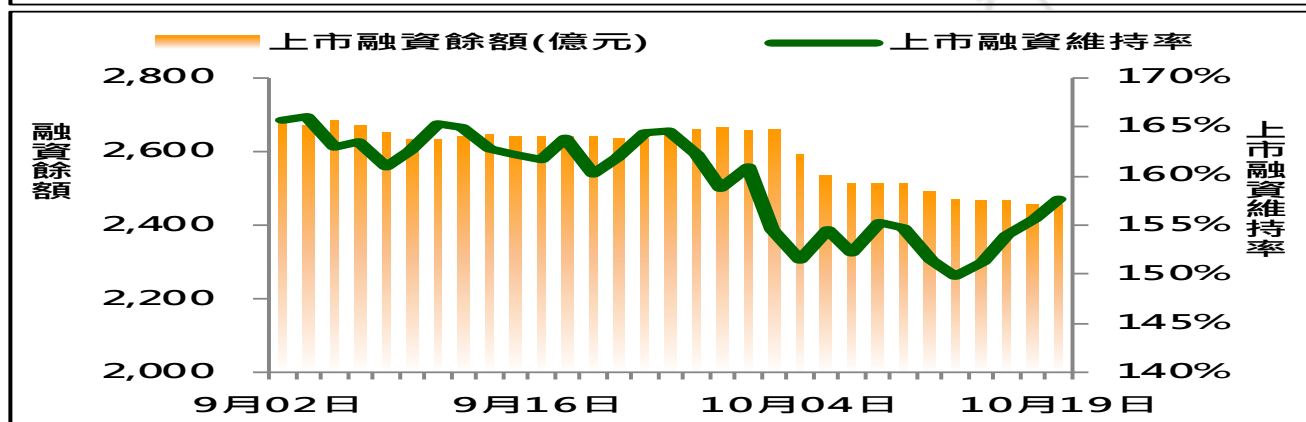
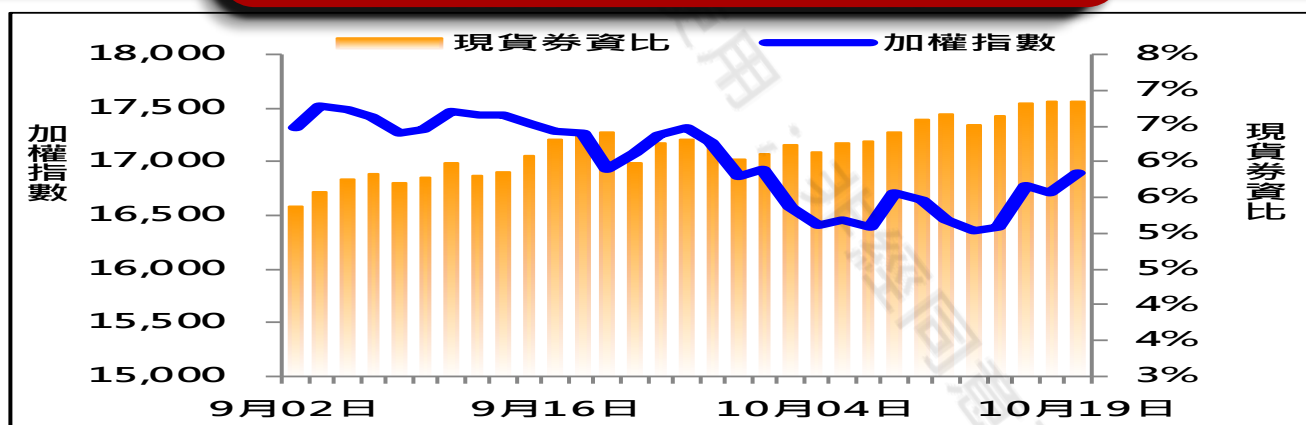


法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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
10月20日	-49.2	-17,463	743	-16.6	14,852	3,163

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
10月20日	4,132	13,449	-9,317	625	2,447	-1,822

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。

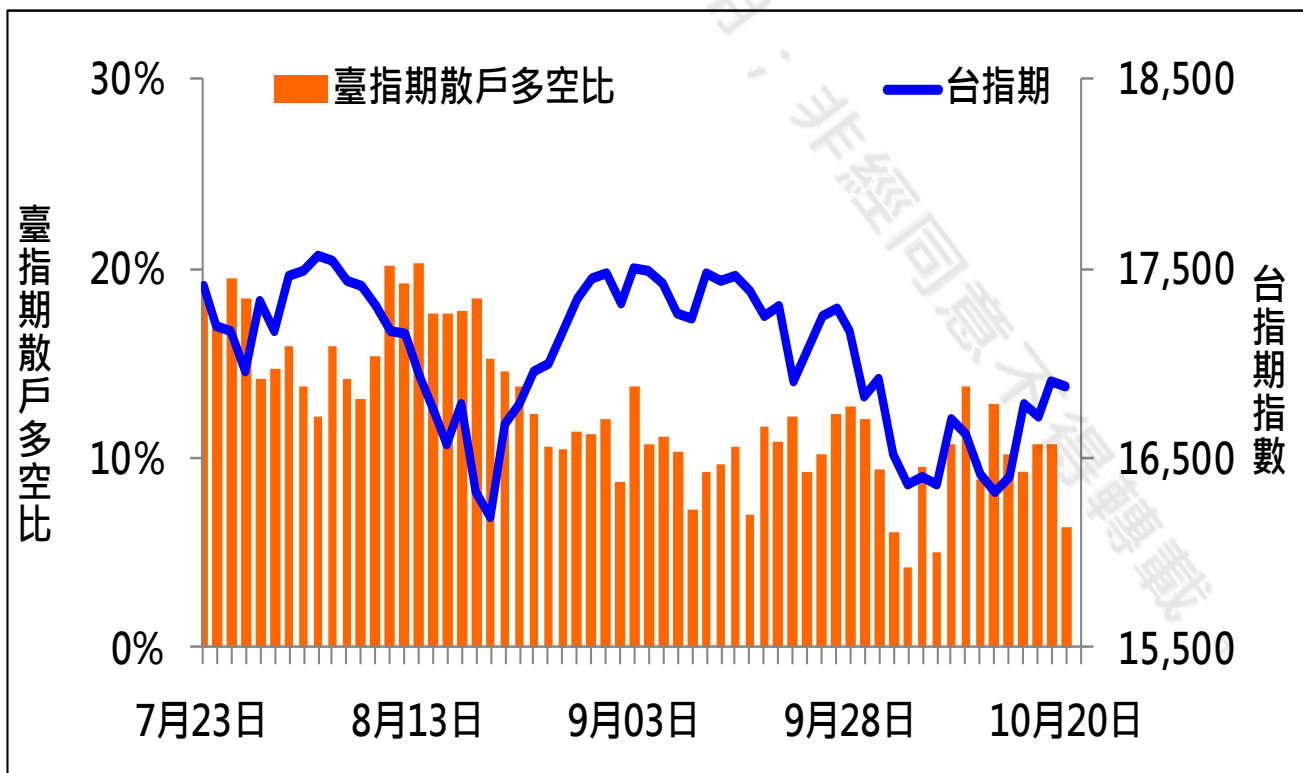
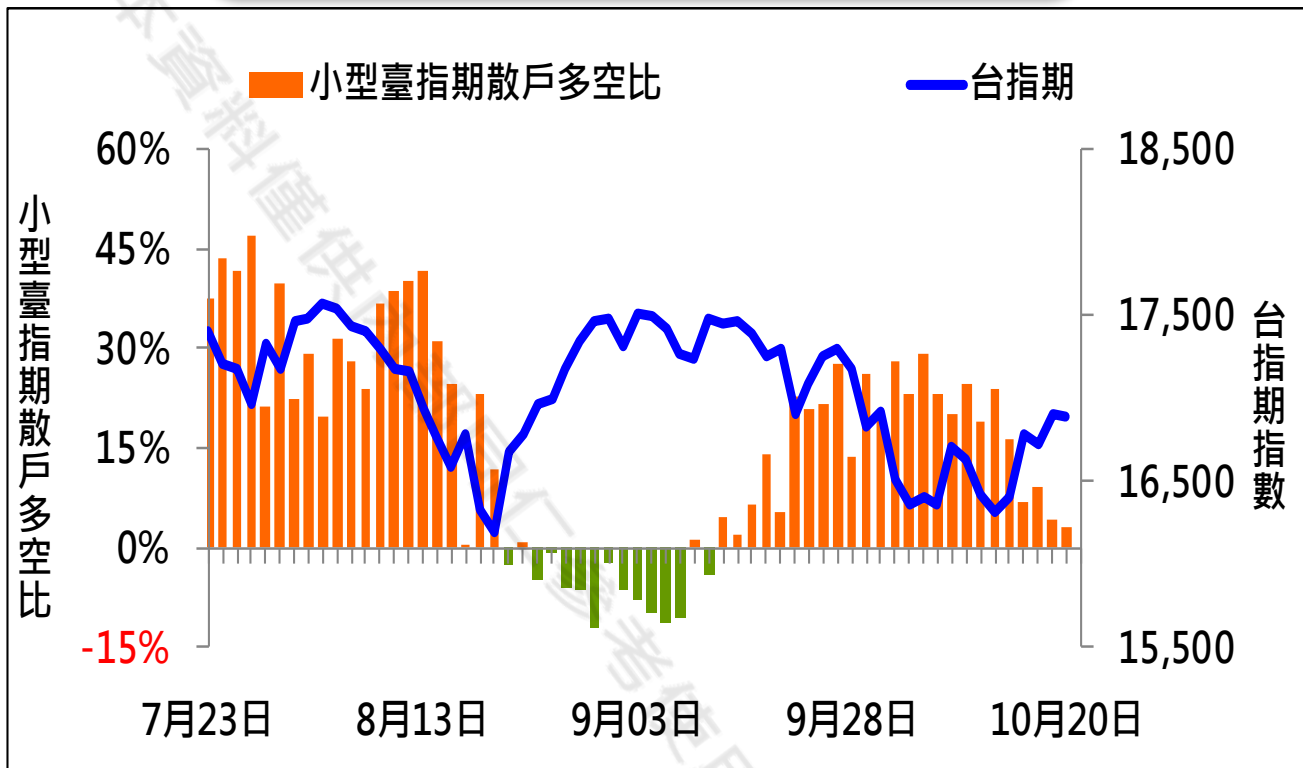
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

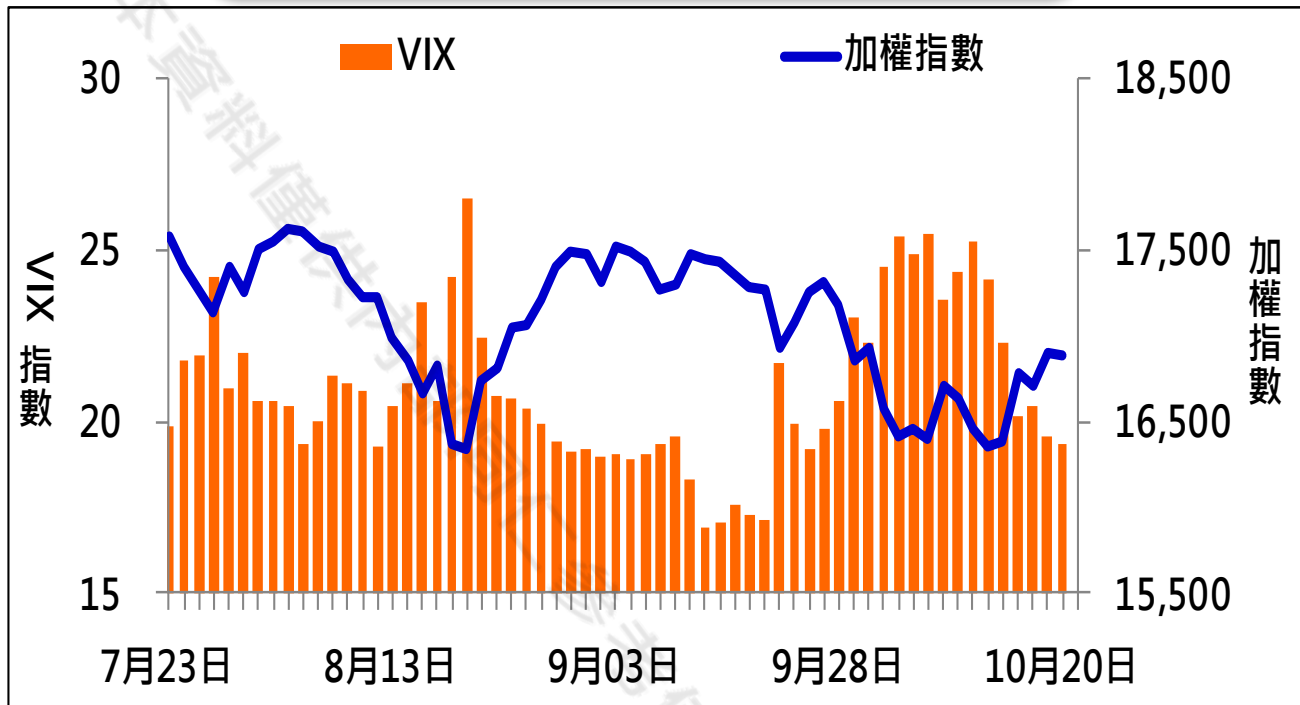
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

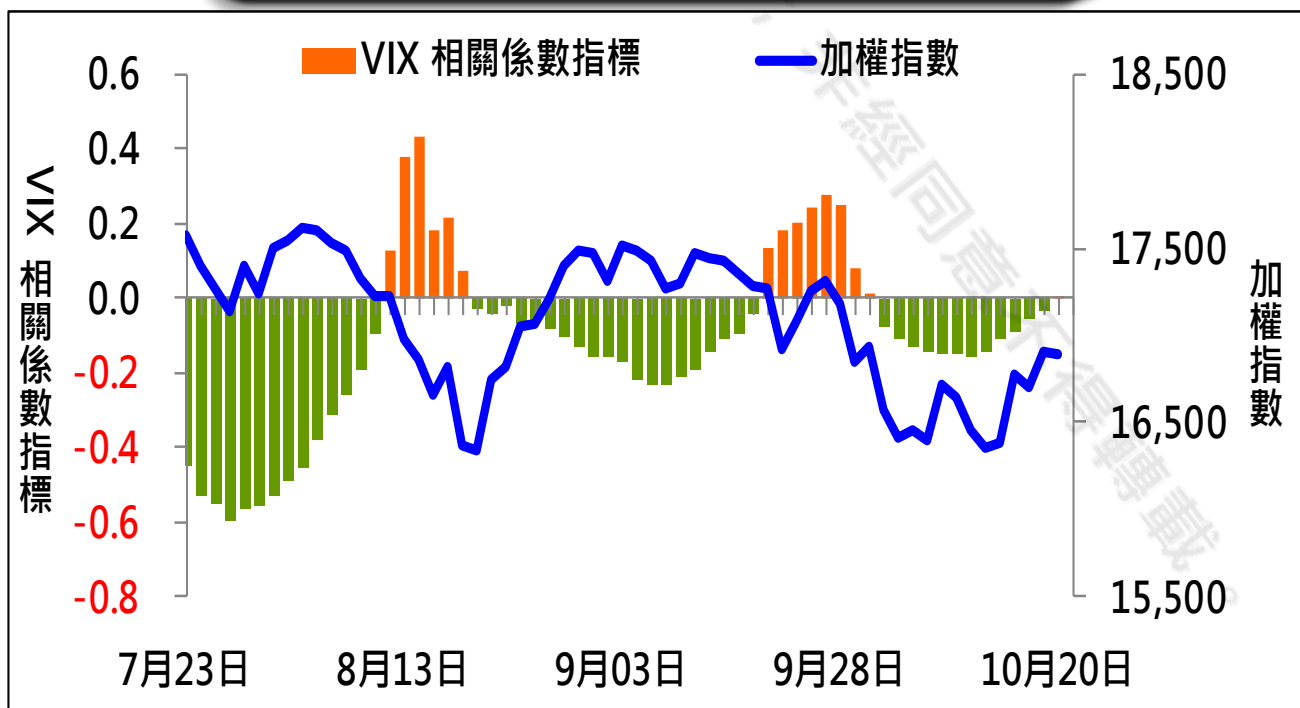
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



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。

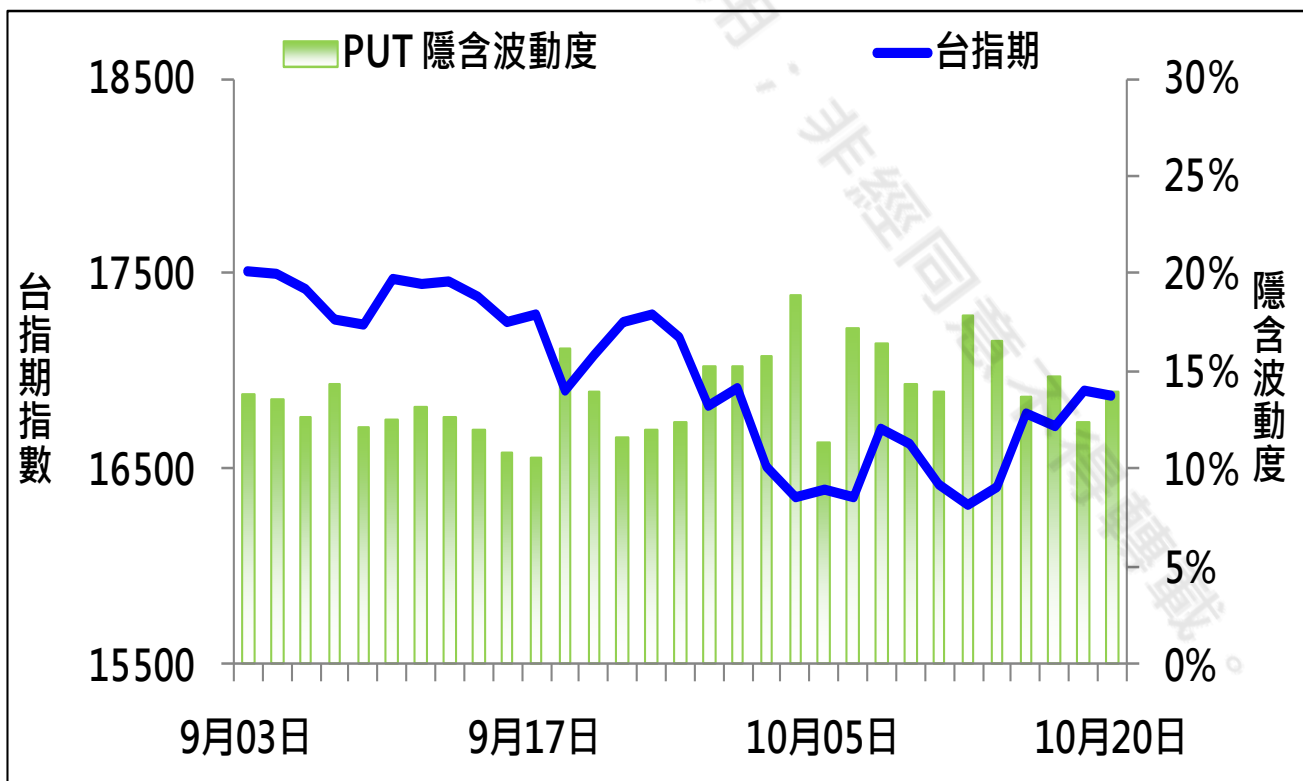
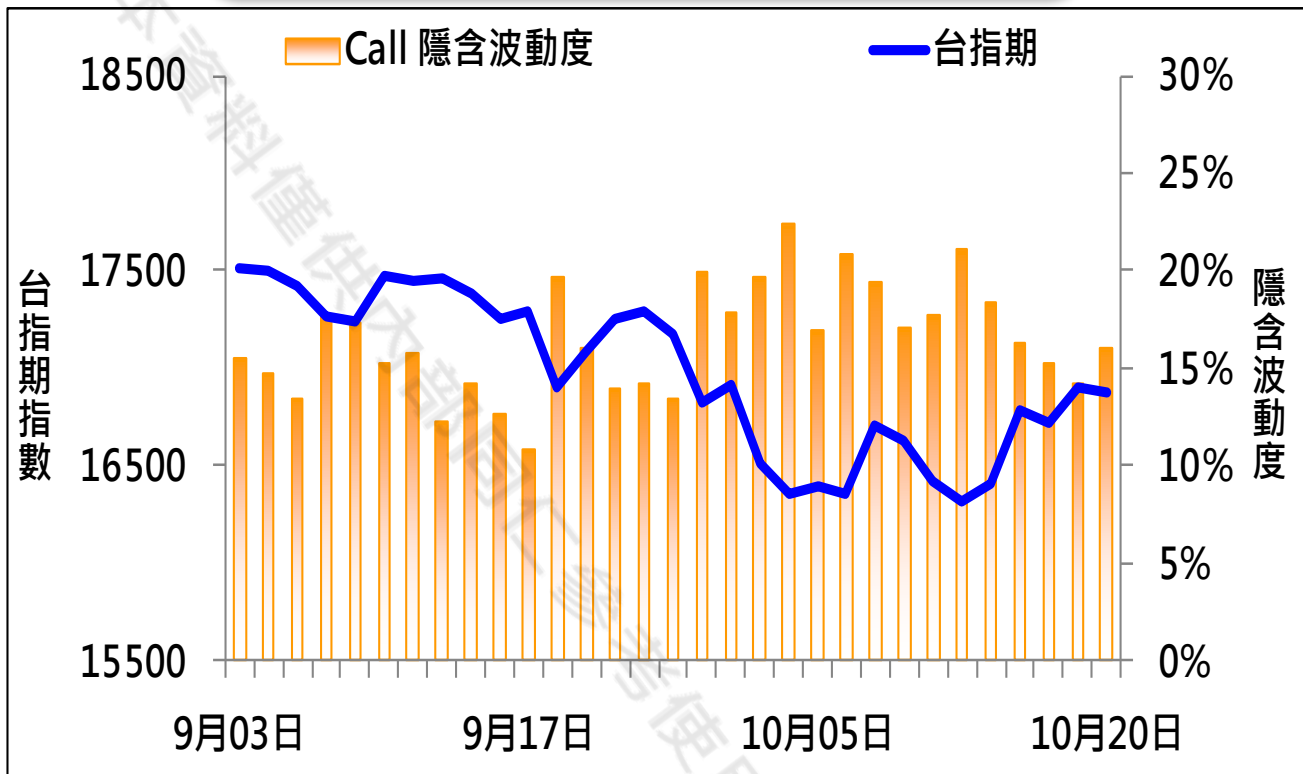
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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：2021/10/20

結算日：2021/10/27

OI 增減	Call	202110W4 履約價	Put	OI 增減
1	1	16,000	721	721
0	0	16,100	4,731	4,731 ※
0	0	16,200	2,191	2,191
3	3	16,300	1,239	1,239
6	6	16,400	2,167	2,167
5	5	16,450	569	569
3	3	16,500	1,120	1,120
3	3	16,550	1,137	1,137
32	32	16,600	2,028	2,028
35	35	16,650	1,005	1,005
43	43	16,700	1,054	1,054
26	26	16,750	580	580
116	116	16,800	1,336	1,336
259	259	16,850	467	467
661	661	16,900	989	989
892	892	16,950	462	462
1,527	1,527	17,000	506	506
533	533	17,050	75	75
1,281	1,281	17,100	66	66
897	897	17,150	53	53
2,290	2,290	17,200	134	134
1,770	1,770	17,250	1	1
※ 3,675	3,675	17,300	23	23
1,288	1,288	17,350	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
18,954	18,954	1.2865	24,385	24,385

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：2021/10/20

結算日：2021/11/17

OI 增減	Call	202111月 履約價	Put	OI 增減
0	4	15,900	1,018	88
1	49	16,000	3,288	346
0	33	16,100	1,466	93
4	267	16,200	3,280	218
0	665	16,300	1,471	307
-1	1,234	16,400	1,832	219
25	718	16,500	3,019	362
-7	647	16,600	3,795	30
-9	905	16,700	2,916	-157
-33	930	16,800	894	44
226	1,470	16,900	1,082	340
280	1,651	17,000	844	272
246	3,058	17,100	513	118
242	1,809	17,200	777	7
-18	1,871	17,300	1,240	-106
250	2,233	17,400	470	3
※ 696	3,361	17,500	27	0
181	2,529	17,600	15	3
432	2,300	17,700	8	0
293	3,279	17,800	4	0
237	1,697	17,900	10	-1
280	3,107	18,000	3	0
221	1,064	18,100	3	0
71	692	18,200	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
3,975	46,159	1.0283	47,465	4,361
昨日 P/C	1.0218	今日增減變化		0.0065

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。

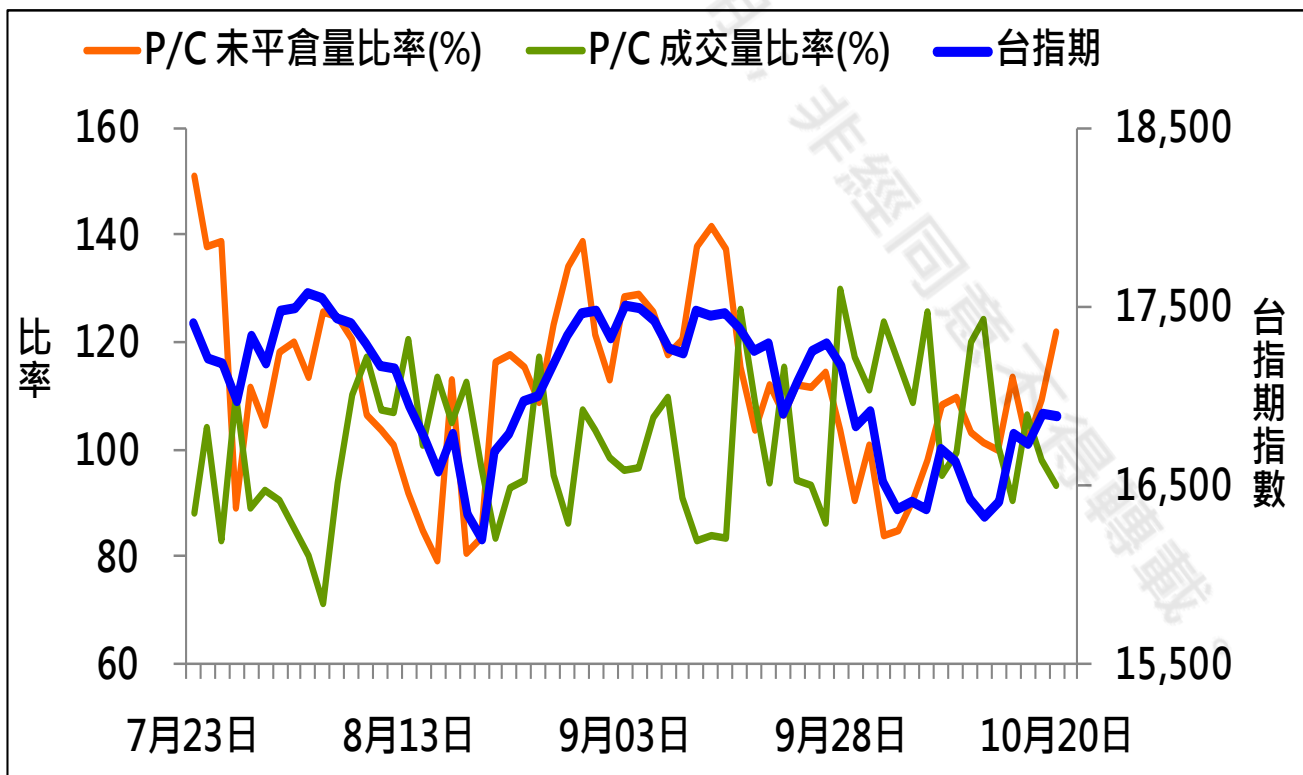
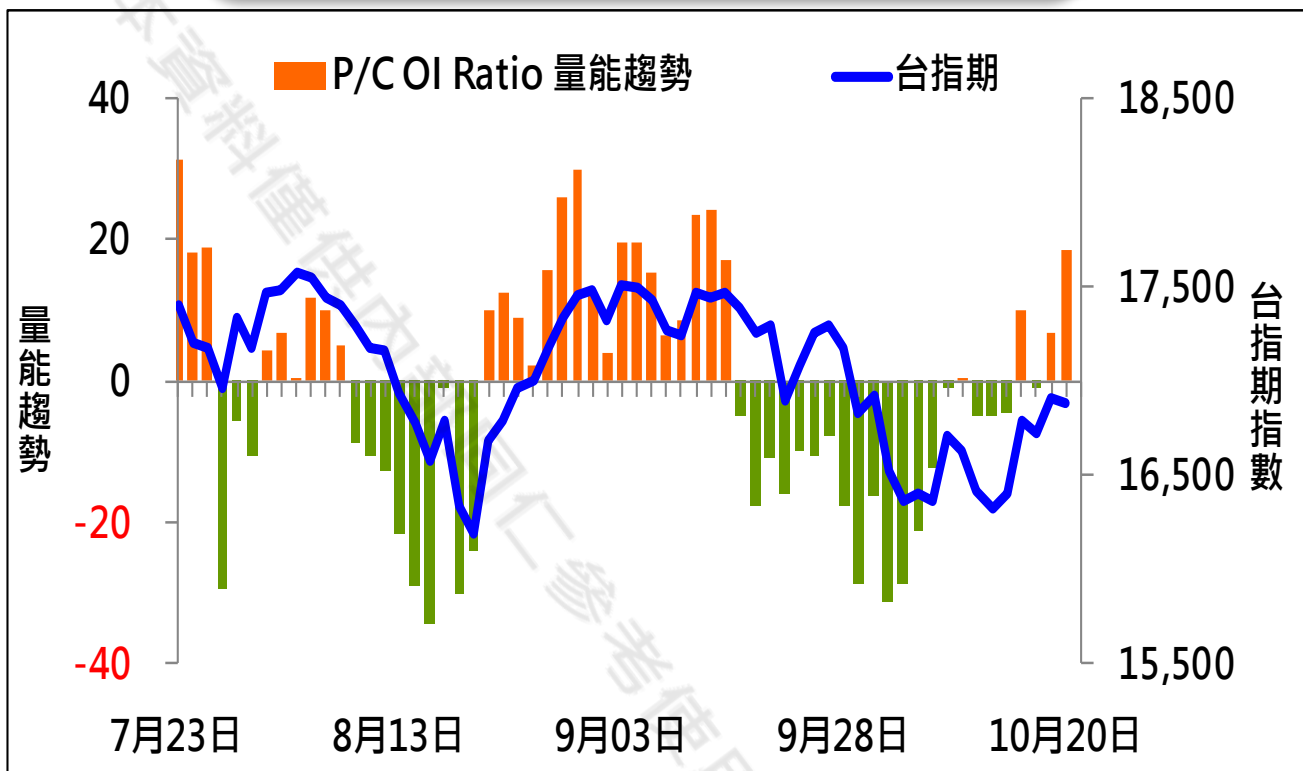
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

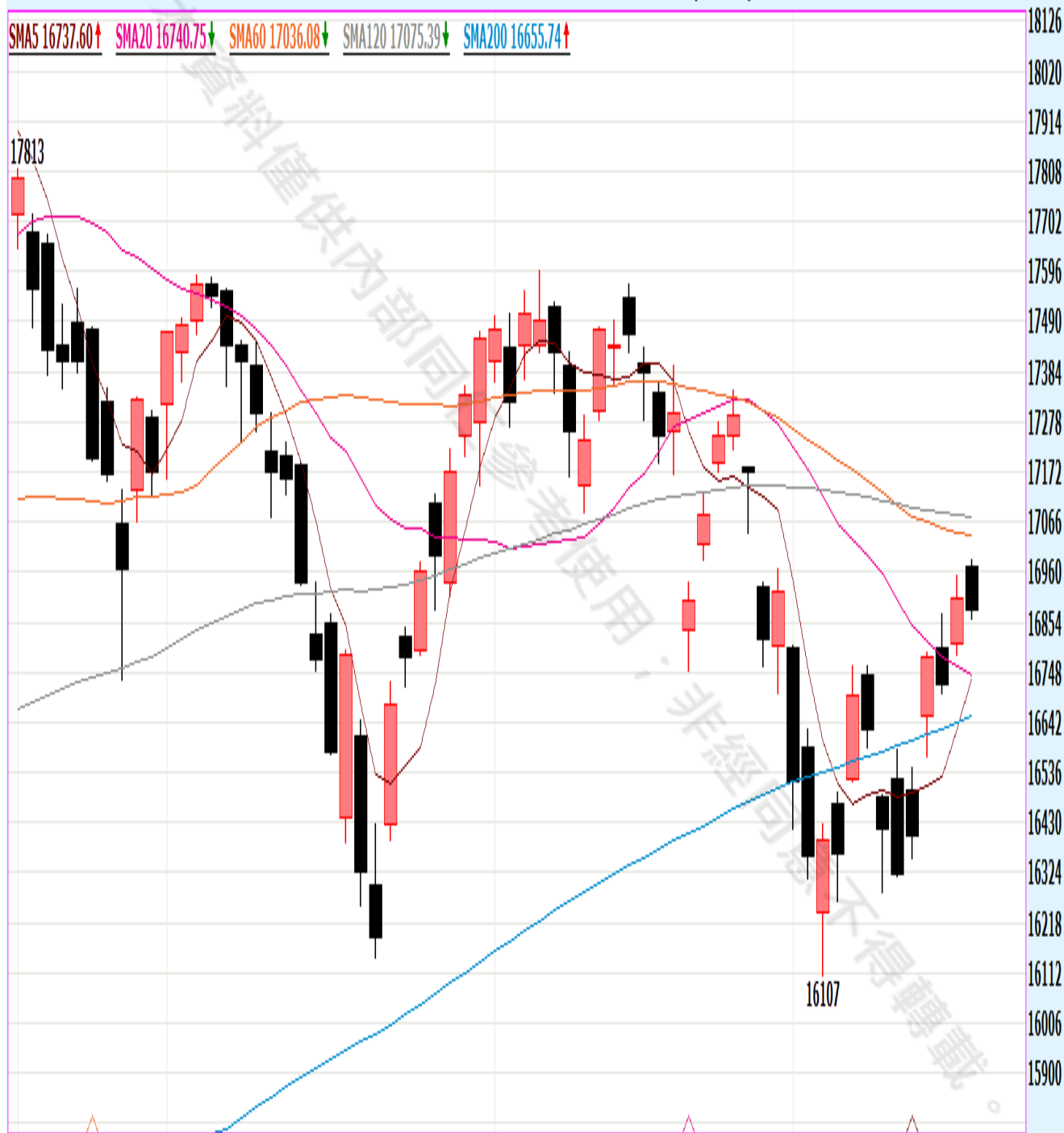
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



盤後重點觀察

台股指數近月(一般)(FTTX*1) 日線圖 2021/10/20 開 16973 高 16987 低 16863 收 16882 s 點 量 56080 口 -21 (-0.12%)

SMA5 16737.60↑ SMA20 16740.75↓ SMA60 17036.08↓ SMA120 17075.39↓ SMA200 16655.74↑



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