



## 法人籌碼動態

03月24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	-28,218	-2,241	219	27	-1,233	-156
投信	-6,526	-687	77	0	6	0
自營商	23,846	-27	41	-33	154	28

03月24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	62	7	2,745	-19,370	26,267	7,296
投信	1	0	-250	0	682	0
自營商	-61	-6	4,757	-3,984	-3,896	-15,635

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
聯發科	12.59	台積電	-154.04	台指期前十大 市場佔比	47.3%	56.6%
南電	4.37	鴻海	-11.44			
群創	3.85	聯電	-5.53			
友達	2.38	大立光	-2.66	電子期前十大 市場佔比	76.2%	75.6%
富邦媒	2.17	台塑化	-2.20			
正新	1.77	台達電	-2.14			
儒鴻	1.63	台化	-1.93	金融期前十大 市場佔比	68.5%	85.3%
長榮	1.51	南亞科	-1.74			
裕隆	1.39	台塑	-1.47			
和泰車	1.08	國泰金	-1.46	非金電期前十大 市場佔比	96.7%	95.2%
前十名合計	32.74	後十名合計	-184.61			

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



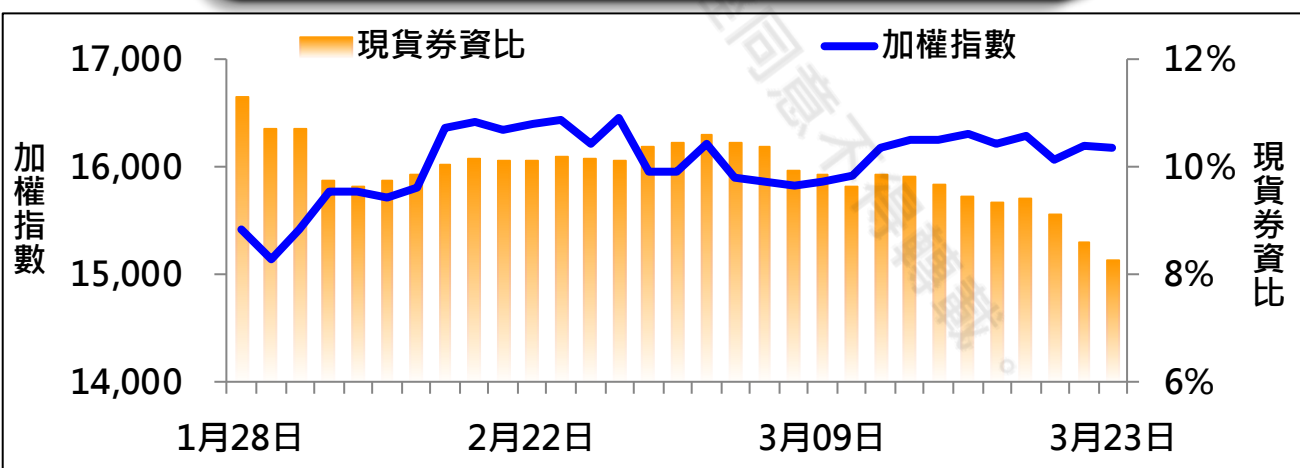
## 法人現貨、期貨&amp;選擇權籌碼變化

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)
03月18日	108.1	-26,714	636	36.7	22,464	-681
03月19日	-387.4	-27,393	-679	-19.8	23,162	698
03月22日	-50.9	-24,953	2,440	26.5	22,765	-397
03月23日	-54.0	-25,977	-1,024	-30.9	23,873	1,108
03月24日	-357.9	-28,218	-2,241	-41.6	23,846	-27

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
03月18日	15,094	16,961	-1,867	14,637	-2,605	17,242
03月19日	16,344	21,532	-5,188	-1,279	7,759	-9,038
03月22日	20,772	18,557	2,215	11,789	4,104	7,685
03月23日	22,115	18,971	3,144	8,741	11,739	-2,998
03月24日	2,745	26,267	-23,522	4,757	-3,896	8,653

## 現貨券資比



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。

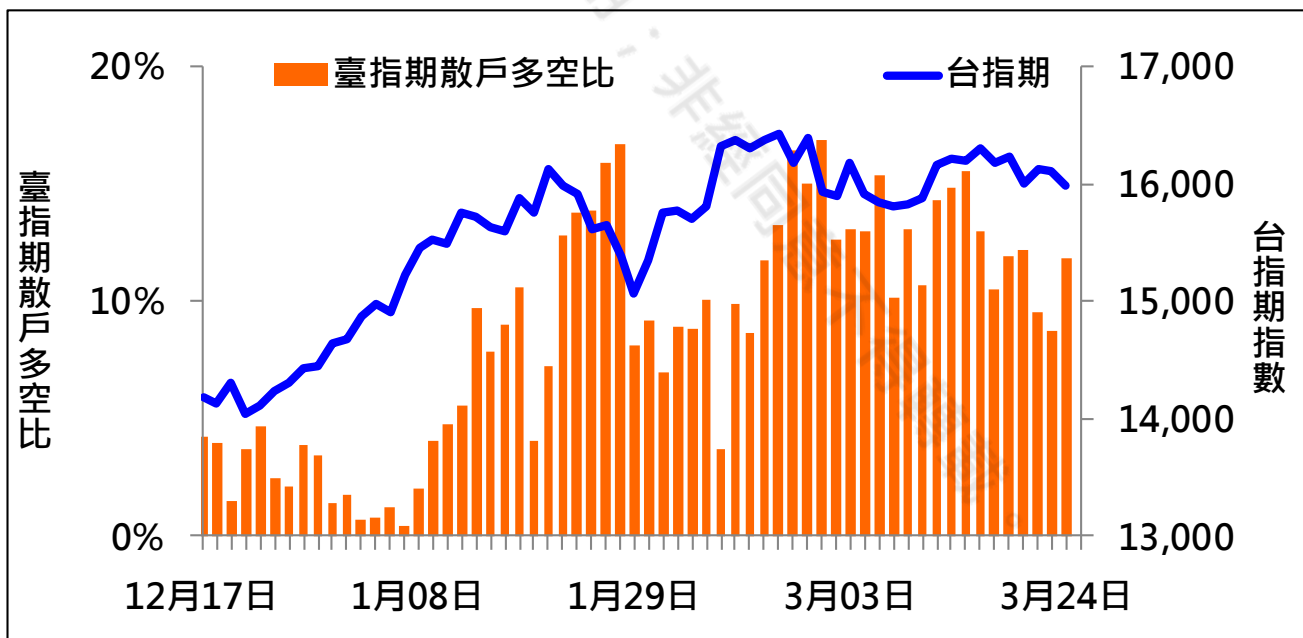
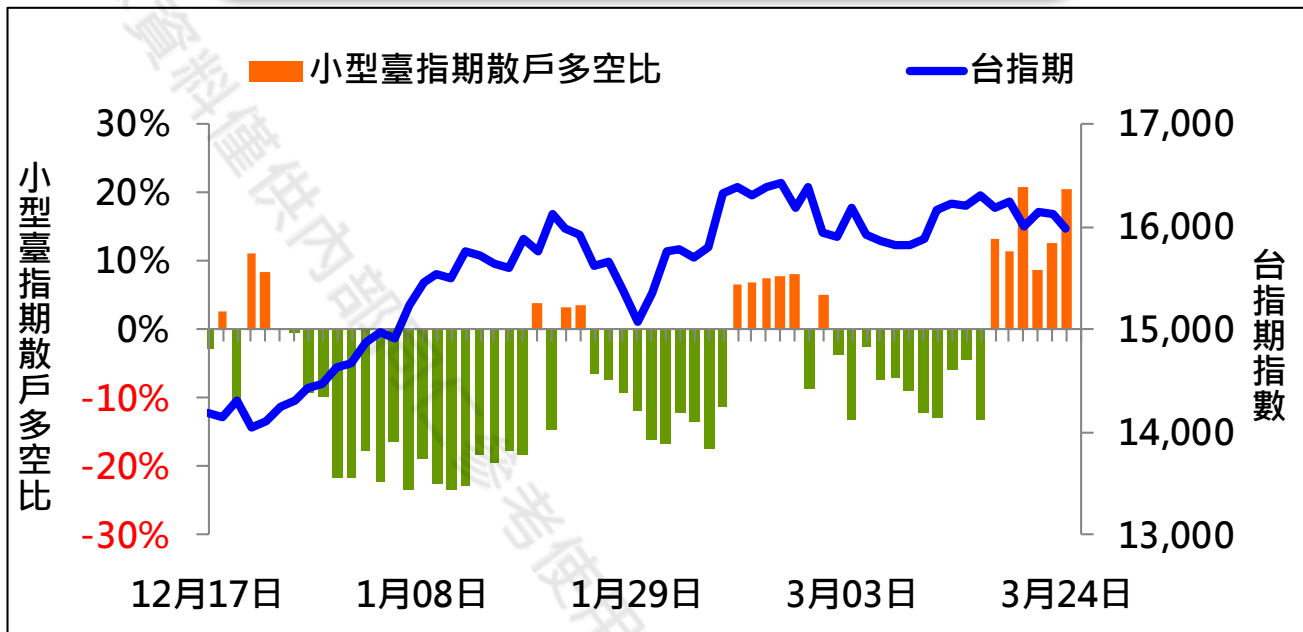
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



## 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。

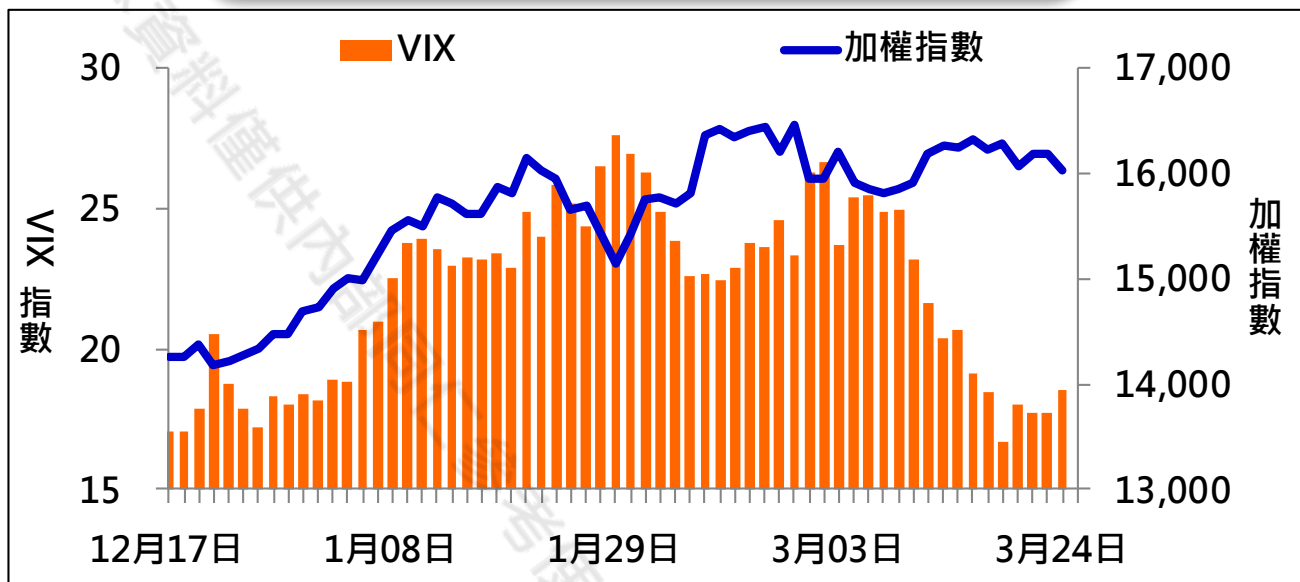
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

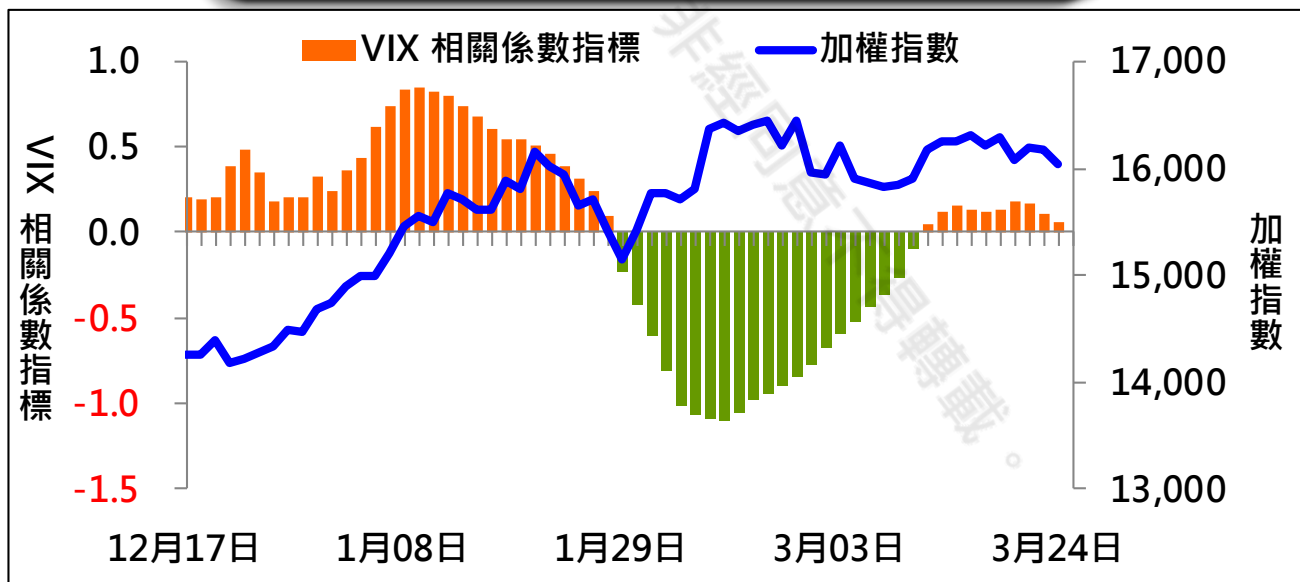
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## 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。

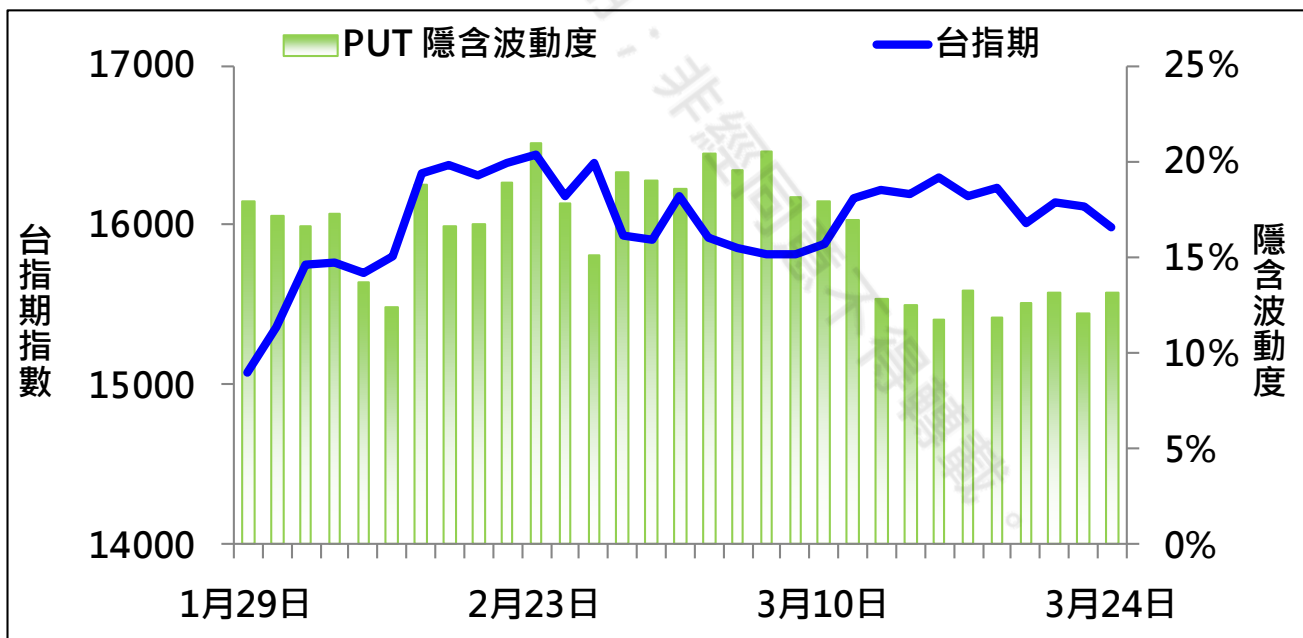
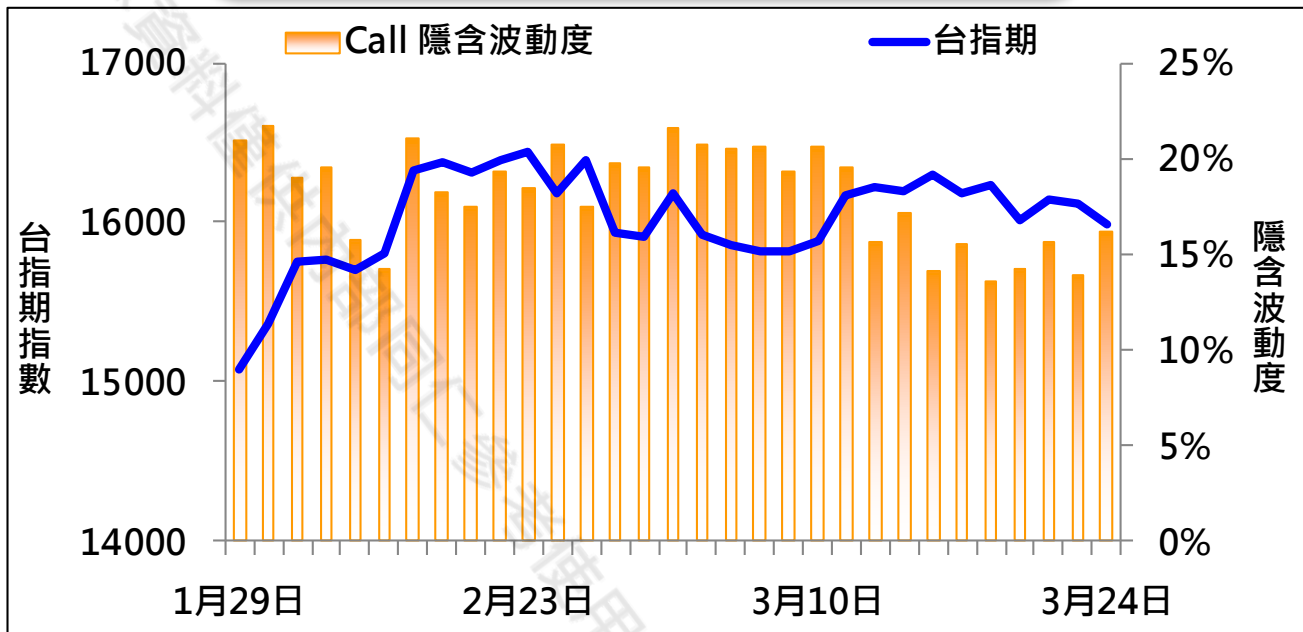
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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：2021/3/24

結算日：2021/3/31

OI 增減	Call	202103W5 履約價	Put	OI 增減
1	1	15,200	1,427	1,427
0	0	15,300	4,762	4,762 ※
2	2	15,400	1,590	1,590
3	3	15,500	2,478	2,478
10	10	15,600	3,459	3,459
38	38	15,700	3,834	3,834
84	84	15,750	1,222	1,222
70	70	15,800	1,451	1,451
31	31	15,850	675	675
444	444	15,900	1,252	1,252
301	301	15,950	555	555
1,036	1,036	16,050	684	684
1,505	1,505	16,100	392	392
1,642	1,642	16,150	169	169
2,008	2,008	16,200	106	106
1,877	1,877	16,250	22	22
3,557	3,557	16,300	167	167
2,395	2,395	16,350	59	59
※ 3,938	3,938	16,400	17	17
1,774	1,774	16,450	11	11
2,253	2,253	16,500	5	5
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
27,384	27,384	1.0800	29,574	29,574

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：2021/3/24

結算日：2021/4/21

OI 增減	Call	202104 月 履約價	Put	OI 增減
0	25	15,000	11,370	4,548 ※
0	2	15,100	3,367	212
1	24	15,200	3,103	196
2	43	15,300	3,899	288
11	102	15,400	3,045	-78
5	75	15,500	4,856	46
0	171	15,600	4,156	-466
7	201	15,700	5,019	2,477
57	332	15,800	4,390	613
20	604	15,900	3,220	31
559	2,821	16,000	6,169	189
536	2,974	16,100	3,268	-89
414	3,431	16,200	3,736	-337
1,028	5,731	16,300	2,569	0
175	5,508	16,400	690	-7
398	3,648	16,500	275	-3
※ 1,264	4,763	16,600	100	-1
716	4,638	16,700	108	-1
367	6,327	16,800	78	33
55	4,072	16,900	14	0
25	7,675	17,000	85	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
6,299	77,975	1.2318	96,052	8,585
昨日 P/C	1.2203	今日增減變化		0.0115

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

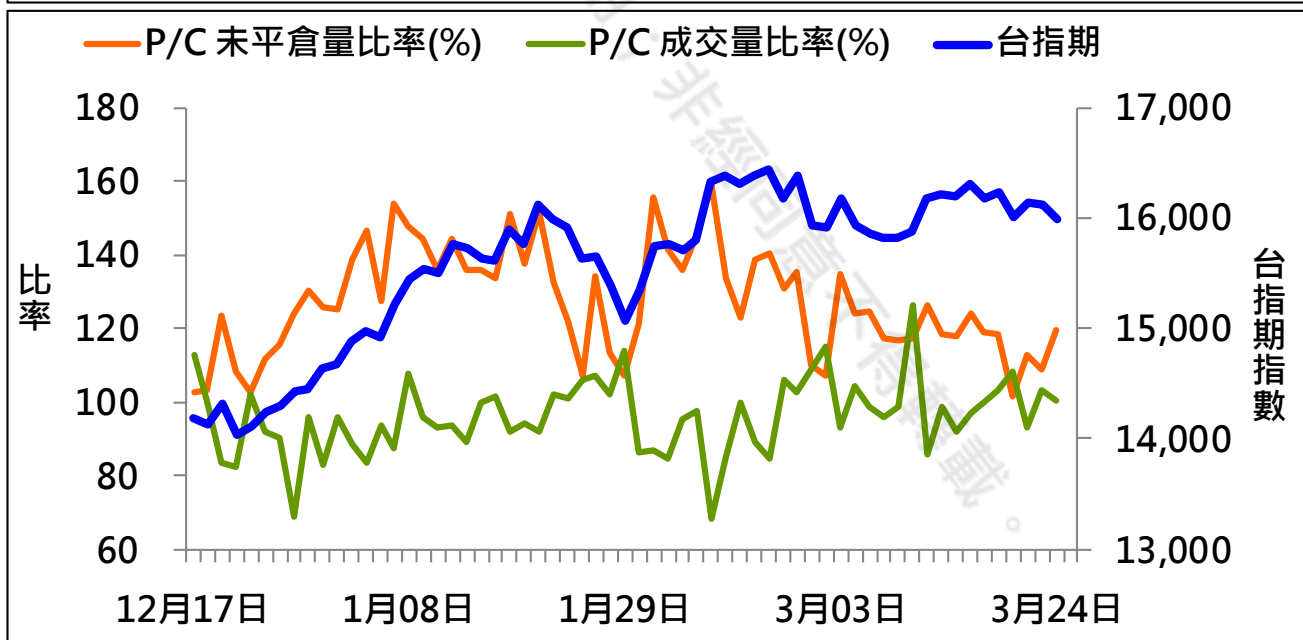
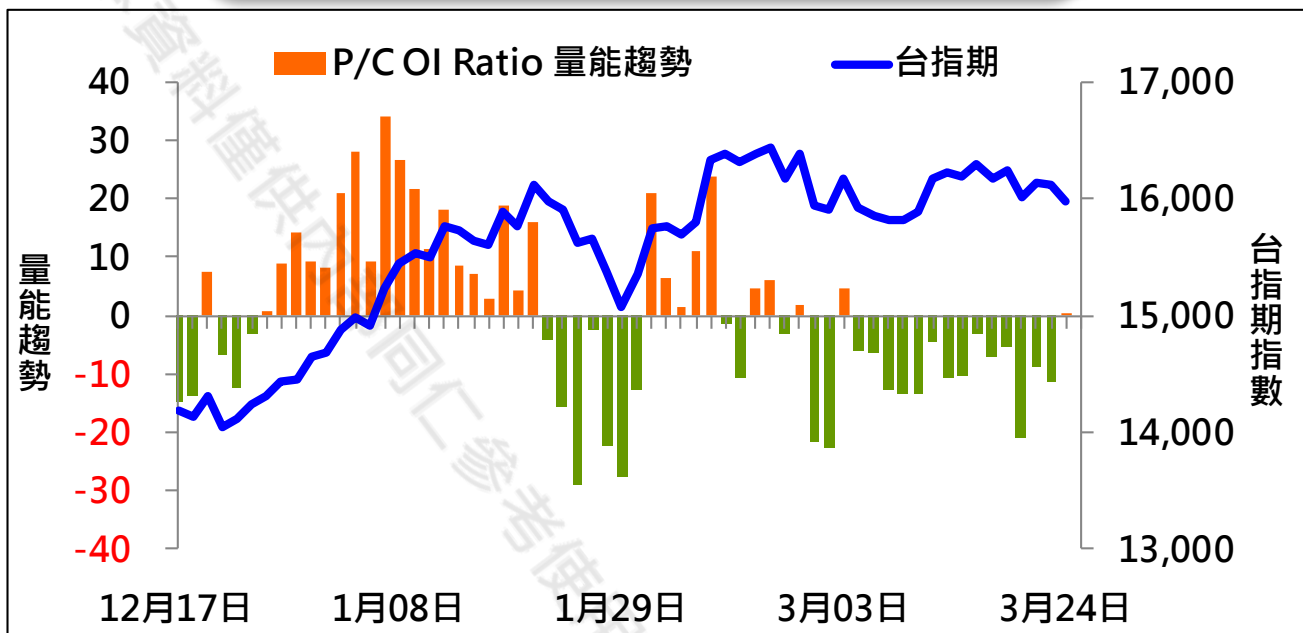
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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

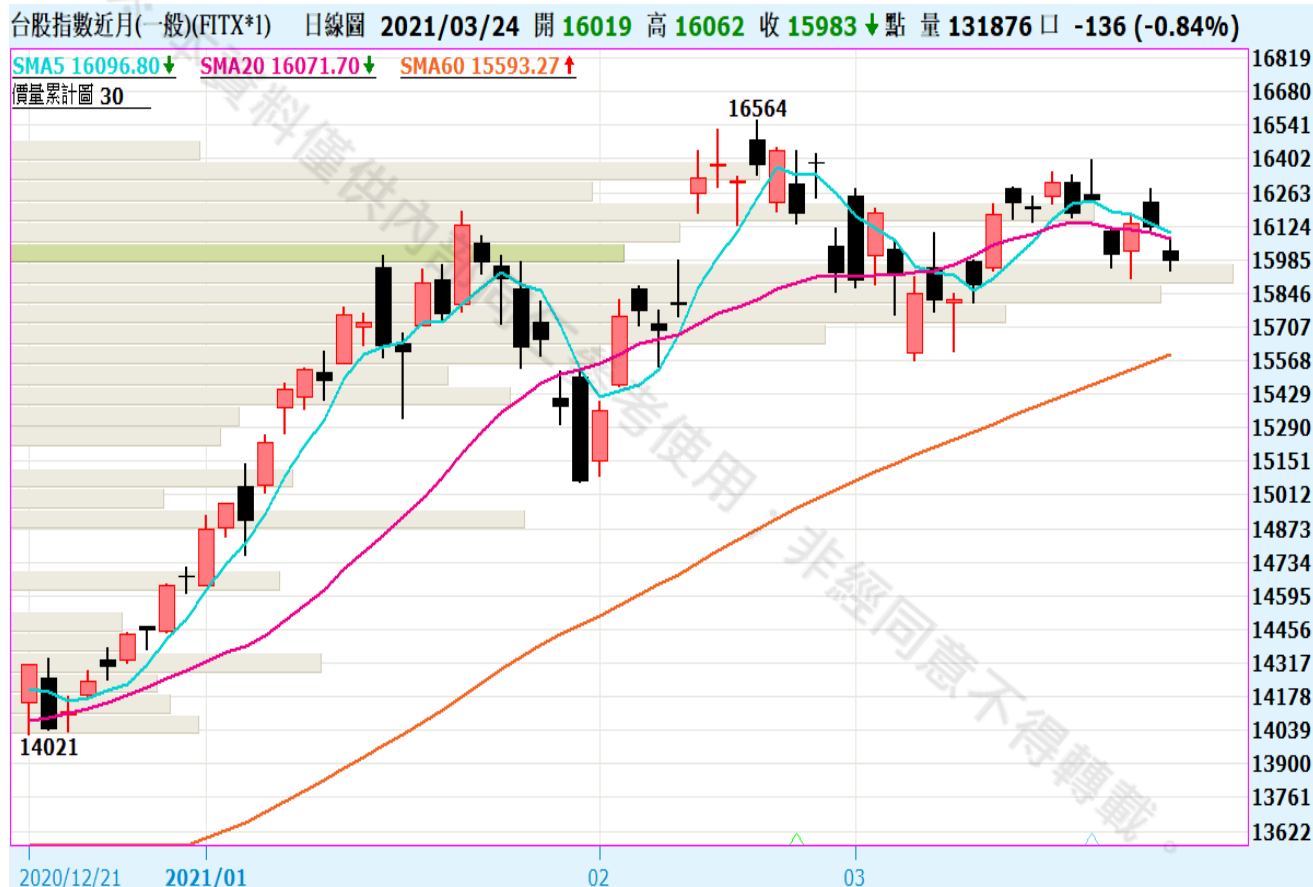
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所





## 盤後重點觀察



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