



## 法人籌碼動態

03月29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	-20,341	2,494	175	-48	-1,334	9
投信	-5,290	99	77	0	6	0
自營商	23,243	-199	225	33	244	-9

03月29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	43	3	20,606	2,378	32,323	6,636
投信	1	0	-250	0	682	0
自營商	-42	13	9,139	-3,860	-17,666	-5,999

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	77.00	聯詠	-1.81	台指期前十大 市場佔比	48.1%	52.4%
鴻海	9.15	聯電	-1.64			
廣達	5.10	儒鴻	-1.36			
南亞	4.19	聯發科	-1.05	電子期前十大 市場佔比	75.2%	74.3%
群創	3.84	富邦媒	-0.92			
友達	3.65	大立光	-0.89			
仁寶	3.42	國巨	-0.82	金融期前十大 市場佔比	65.2%	80.7%
巨大	3.22	祥碩	-0.80			
日月光投控	2.86	南電	-0.75			
中鋼	2.60	南亞科	-0.71	非金電期前十大 市場佔比	96.2%	93.8%
前十名合計	115.03	後十名合計	-10.74			

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



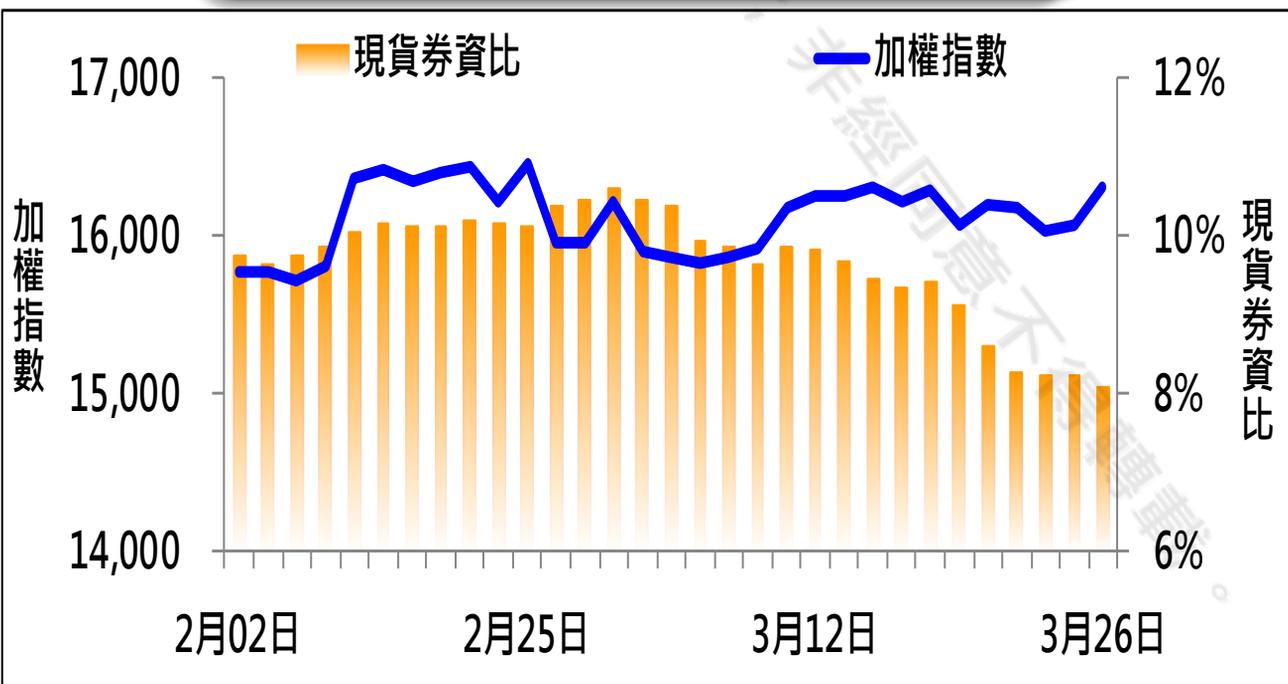
## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
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
03月25日	-165.8	-25,105	3,113	-8.1	23,465	-381
03月26日	226.7	-22,835	2,270	15.7	23,442	-23
03月29日	87.4	-26,341	2,404	17.7	23,343	100

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
03月25日	9,527	25,769	-16,242	11,699	-5,750	17,449
03月26日	18,228	25,687	-7,459	12,999	-11,667	24,666
03月29日	20,606	32,323	-11,717	9,139	-17,666	26,805

## 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。

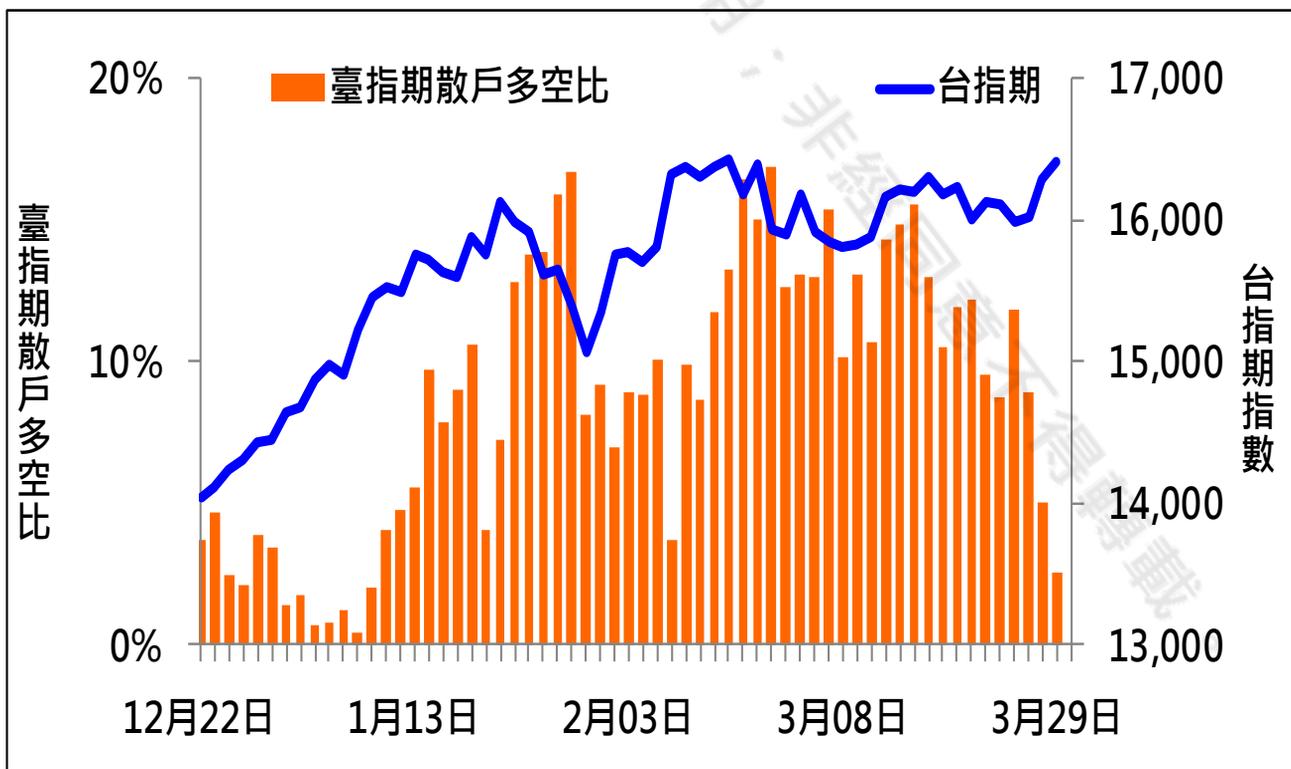
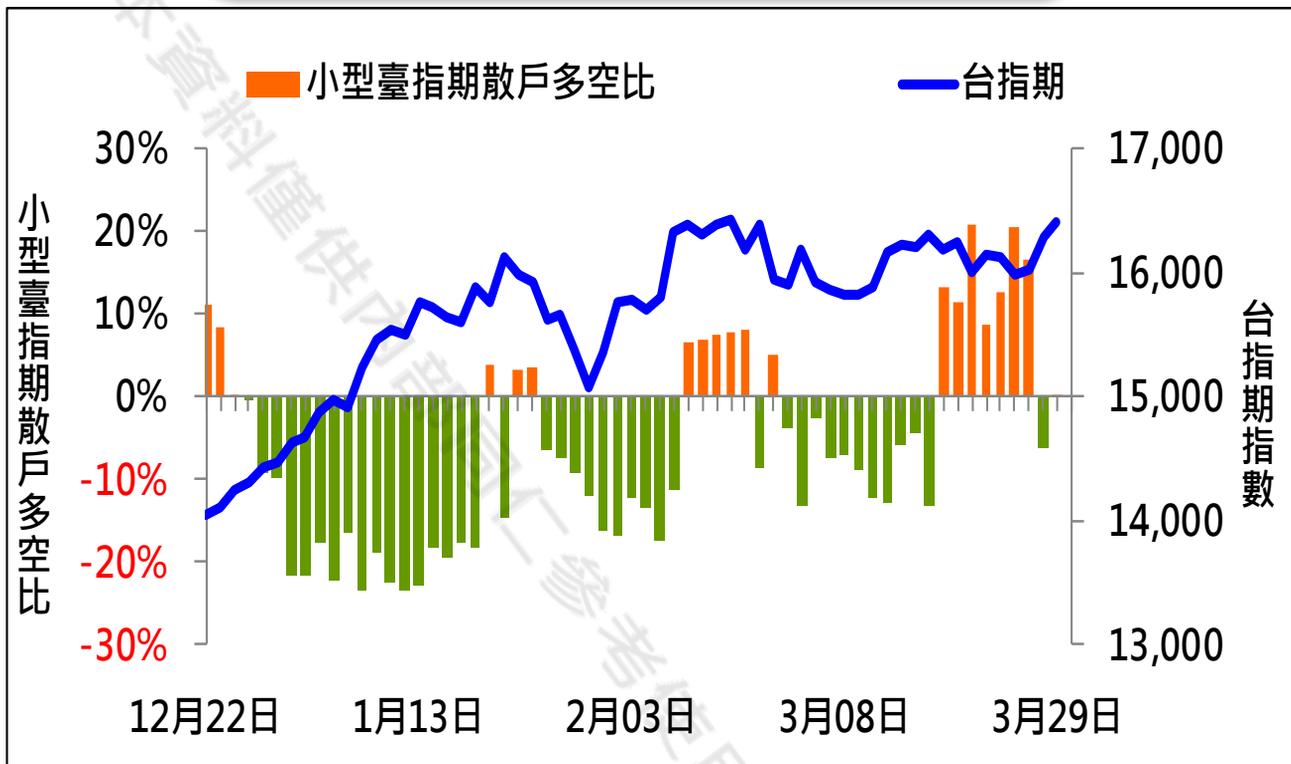
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

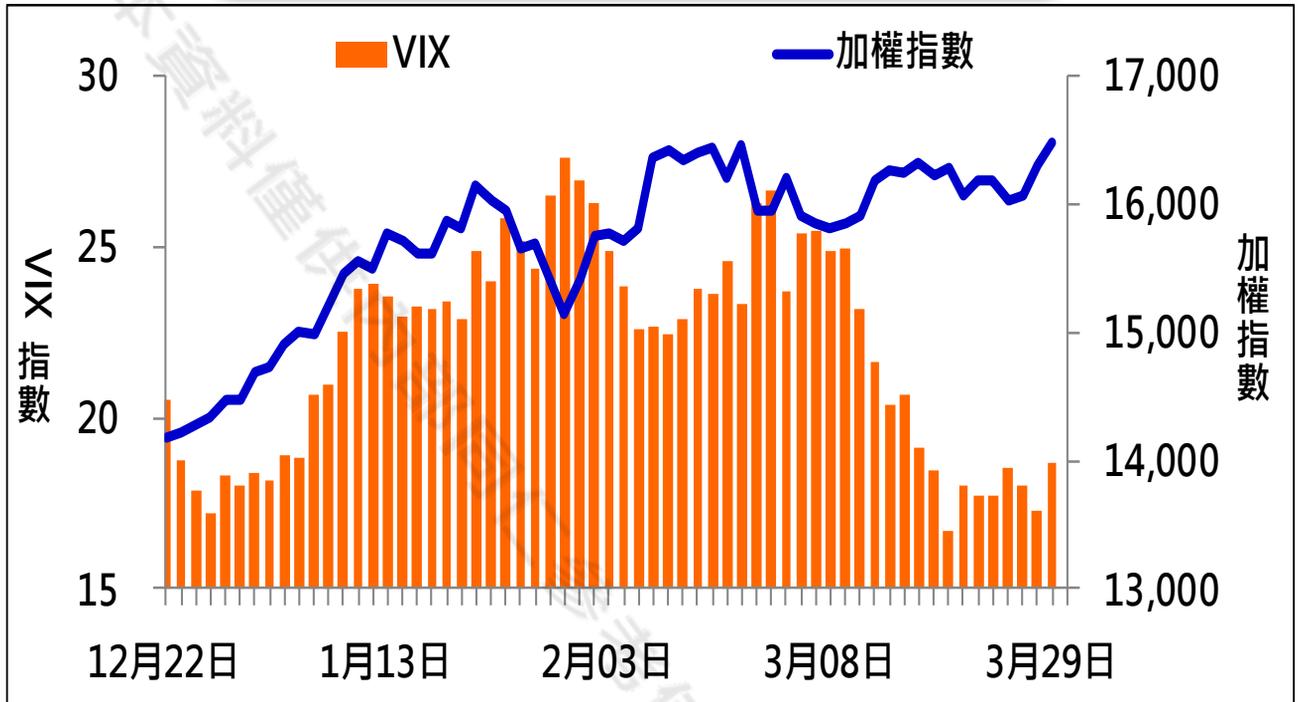
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

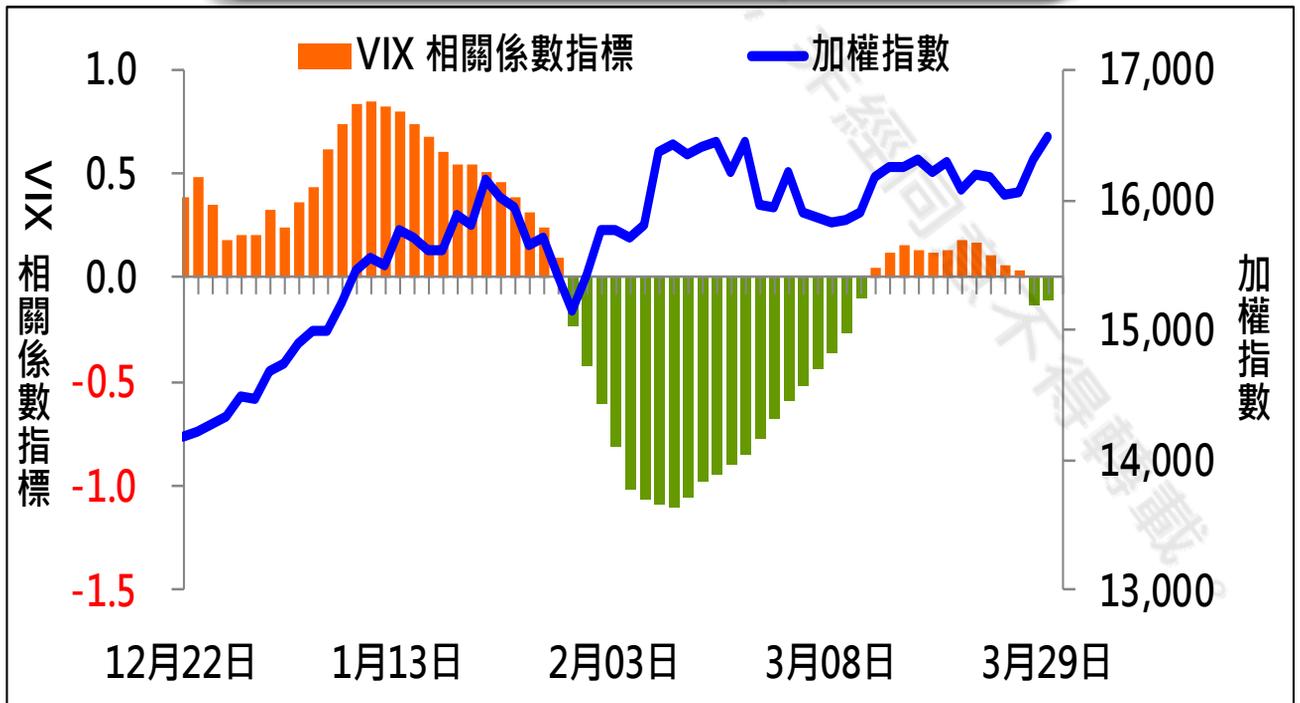
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



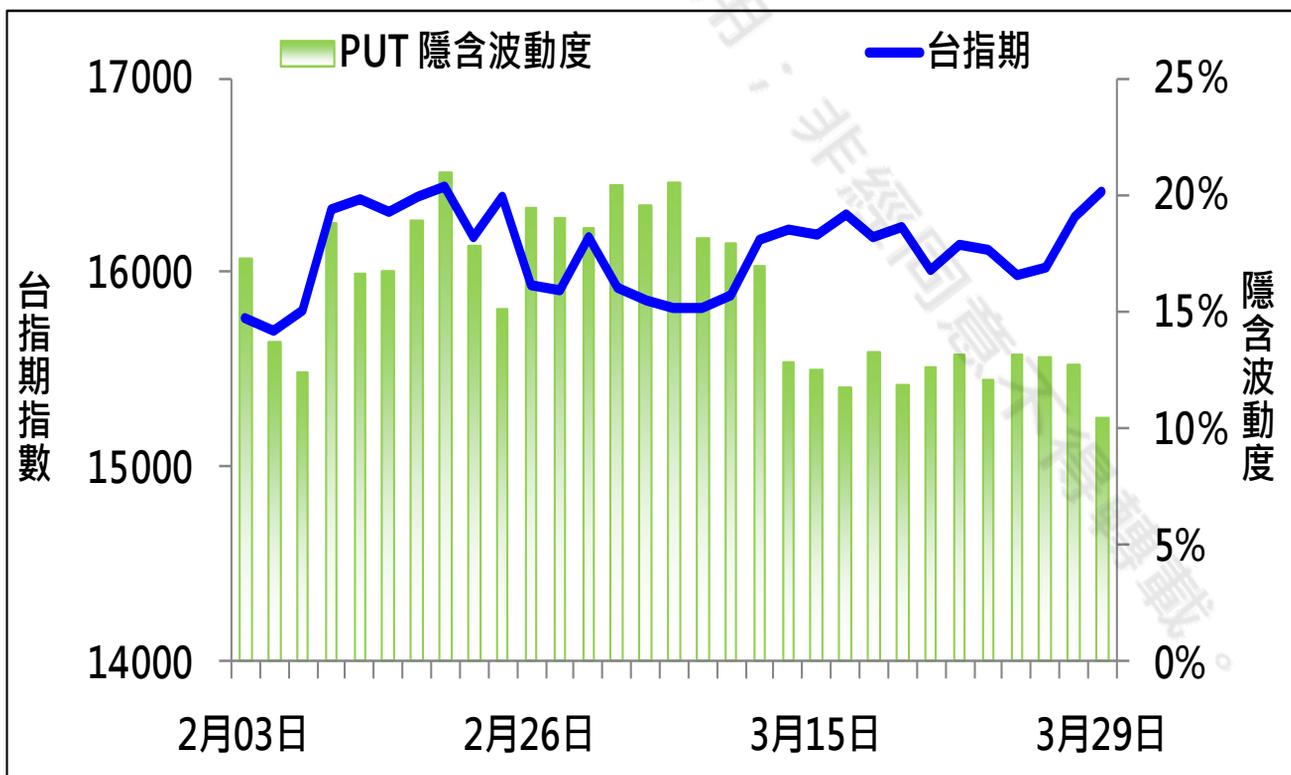
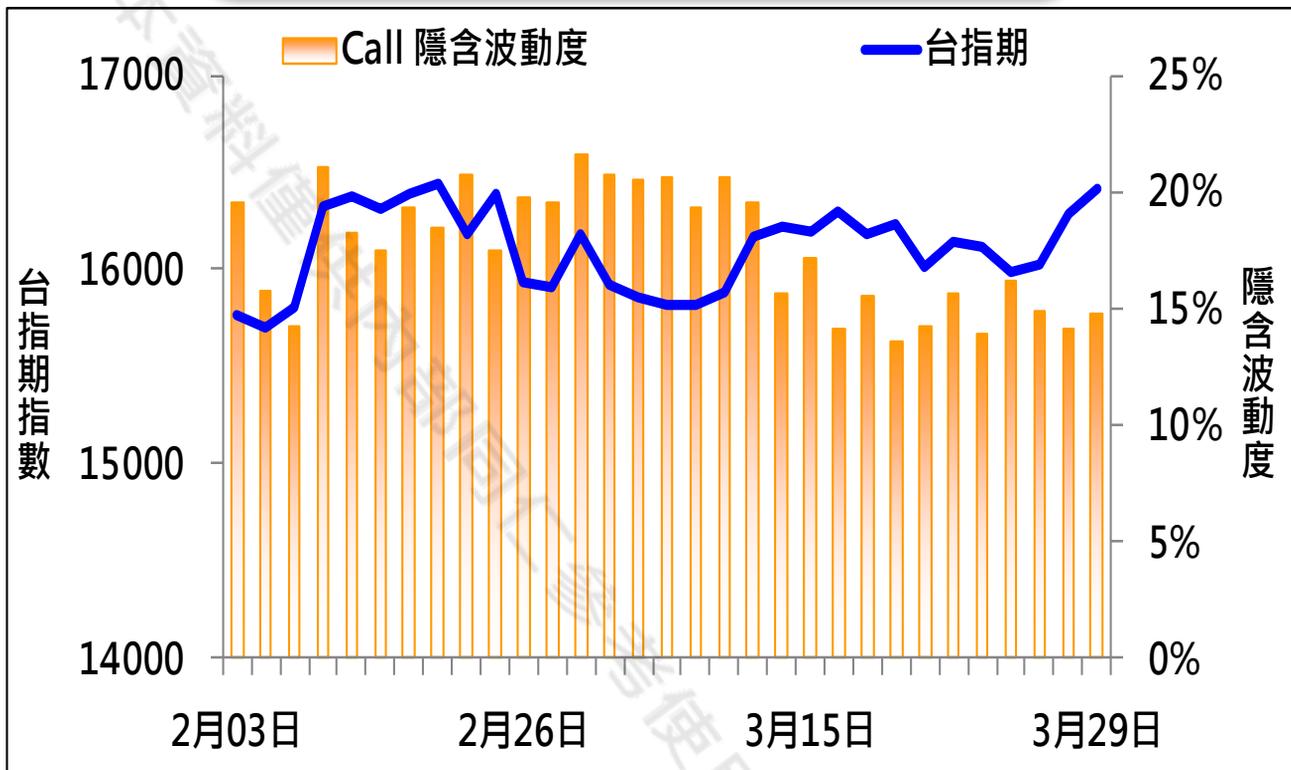
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/3/29

結算日：2021/3/31

OI 增減	Call	202103W5 履約價	Put	OI 增減
-347	2,103	16,000	12,597	3,139
-727	2,158	16,050	7,890	2,150
-1,231	4,115	16,100	9,799	3,532
-1,465	3,189	16,150	6,370	2,108
-1,173	5,289	16,200	11,716	6,804
-834	3,899	16,250	5,825	3,018
-1,943	8,423	16,300	12,658	10,296 ※
-4,126	5,444	16,350	5,531	4,761
-854	11,065	16,400	7,922	7,115
1,002	10,266	16,500	2,227	1,874
1,662	8,927	16,550	736	637
※ 7,285	14,012	16,600	958	906
4,668	6,737	16,650	200	188
5,333	11,660	16,700	256	256
3,472	3,472	16,750	8	8
3,269	5,016	16,800	32	32
2,618	2,971	16,900	2	2
882	1,161	17,000	0	0
110	115	17,100	0	0
1	1	17,200	0	0
0	0	17,300	1	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
17,304	113,475	1.5936	180,837	43,719

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：2021/3/29

結算日：2021/4/21

OI 增減	Call	202104月 履約價	Put	OI 增減
-1	24	15,000	11,376	-58
0	2	15,100	3,070	-60
0	23	15,200	2,433	-409
-5	36	15,300	3,589	26
-8	119	15,400	3,505	177
-2	67	15,500	6,382	433
-16	176	15,600	5,583	-68
613	837	15,700	5,994	456
※ 1,360	1,695	15,800	5,797	789 ※
294	891	15,900	4,768	633
-168	3,015	16,000	6,974	722
-121	2,524	16,100	3,779	373
-234	2,698	16,200	4,280	392
-13	4,979	16,300	2,656	193
-124	5,176	16,400	1,232	284
-90	4,464	16,500	968	536
-1,710	4,537	16,600	370	206
-730	4,283	16,700	157	40
178	6,457	16,800	73	22
604	5,757	16,900	34	1
927	8,839	17,000	92	1
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
1,477	82,382	1.2727	104,850	4,407
昨日 P/C	1.2415	今日增減變化		0.0312

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。

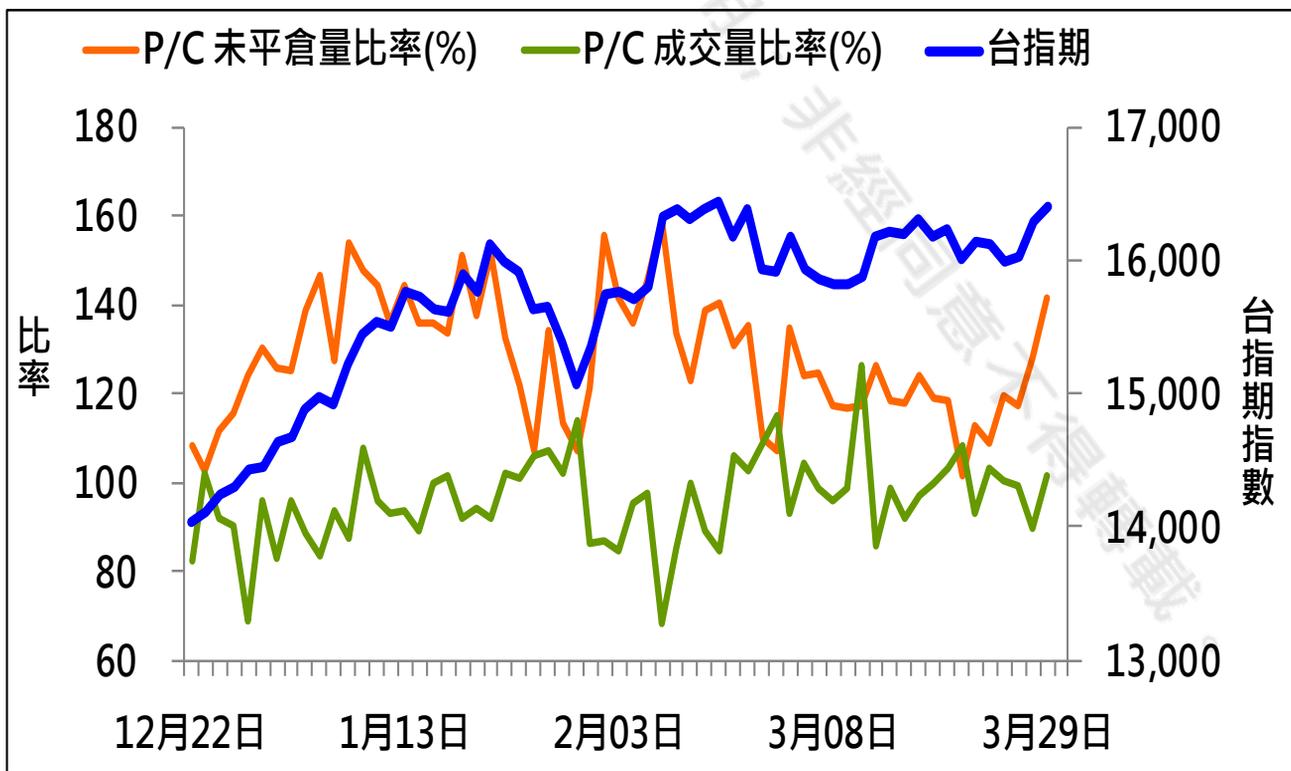
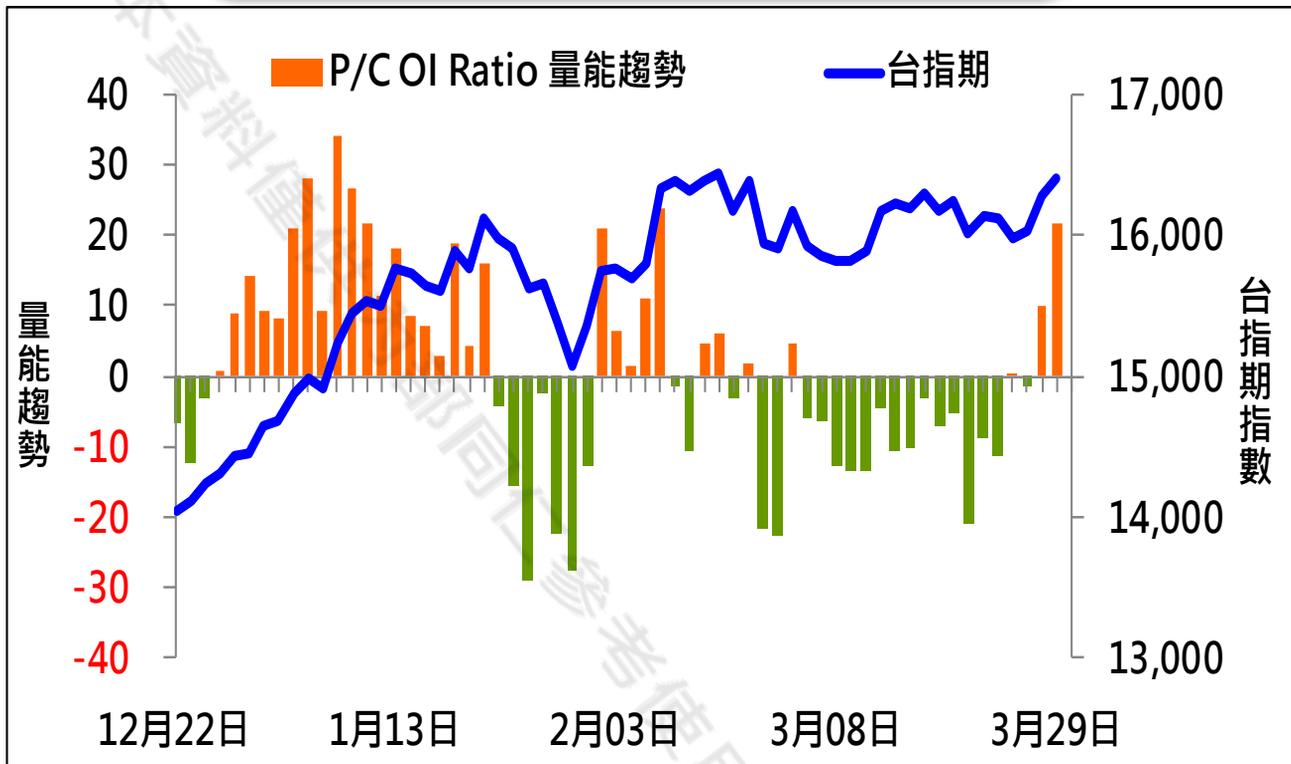
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



期貨市場  
盤後分析

台股指數近月(一般)(FITX\*1) 日線圖 2021/03/29 開 16370 高 16485 收 16411 ↑ 點 量 112020 口 +126 (+0.77%)

SMA5 16165.20 ↑ SMA20 16082.95 ↑ SMA60 15697.15 ↑

價量累計圖 30



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