



## 法人籌碼動態

03月30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	-19,365	976	132	-43	-1,244	90
投信	-5,023	267	77	0	6	0
自營商	22,967	-276	231	6	216	-28

03月30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	0	20,489	-117	30,949	-1,374
投信	1	0	-250	0	682	0
自營商	-41	1	3,048	-6,091	-16,951	715

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	15.74	台積電	-17.11	台指期前十大 市場佔比	47.8%	51.3%
聯電	5.12	台塑	-2.10			
南電	5.12	亞德客-KY	-1.56			
鴻海	4.58	中華電	-1.28	電子期前十大 市場佔比	75.2%	75.5%
台達電	3.86	長榮航	-0.64			
富邦金	3.42	萬海	-0.59			
巨大	3.28	開發金	-0.49	金融期前十大 市場佔比	66.5%	80.0%
日月光投控	2.86	泰福-KY	-0.48			
中租-KY	2.78	矽力-KY	-0.46			
統一	2.44	華航	-0.45	非金電期前十大 市場佔比	96.1%	94.1%
前十名合計	49.19	後十名合計	-25.16			

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

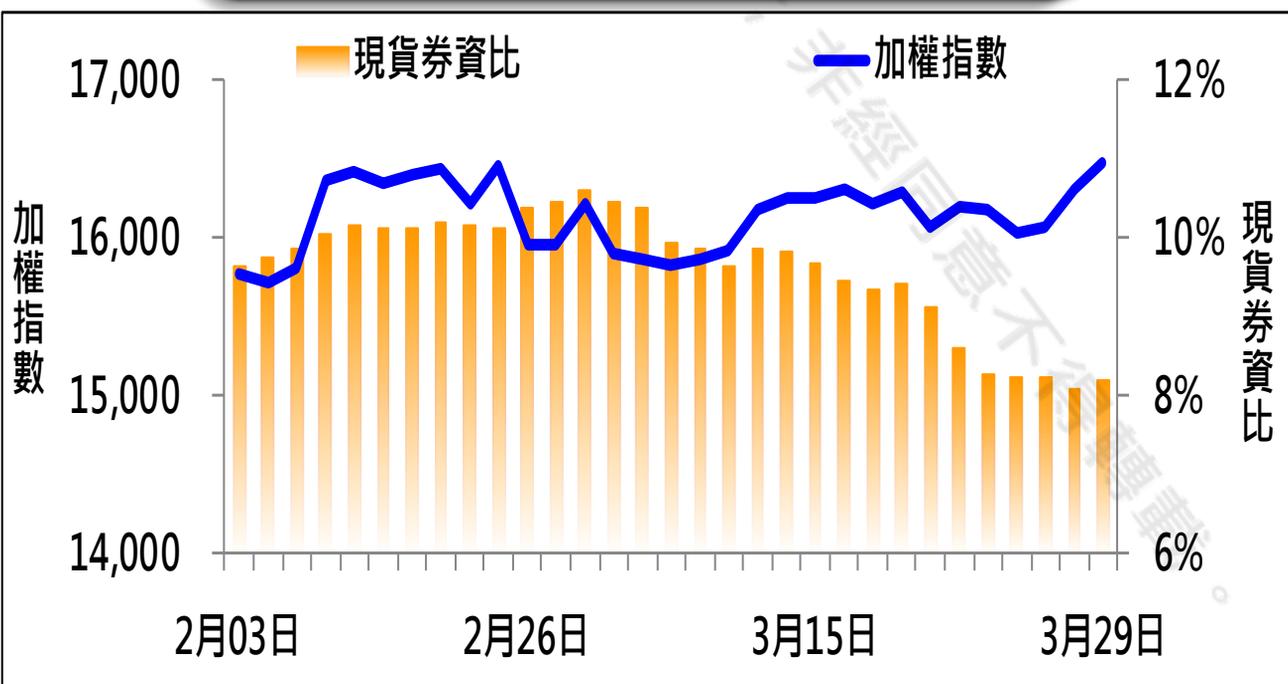


## 法人現貨、期貨 & 選擇權籌碼變化

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	-20,341	2,494	17.7	23,243	-199
03月30日	112.2	-19,365	976	43.8	22,967	-276

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
03月30日	20,489	30,949	-10,460	3,048	-16,951	19,999

## 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。

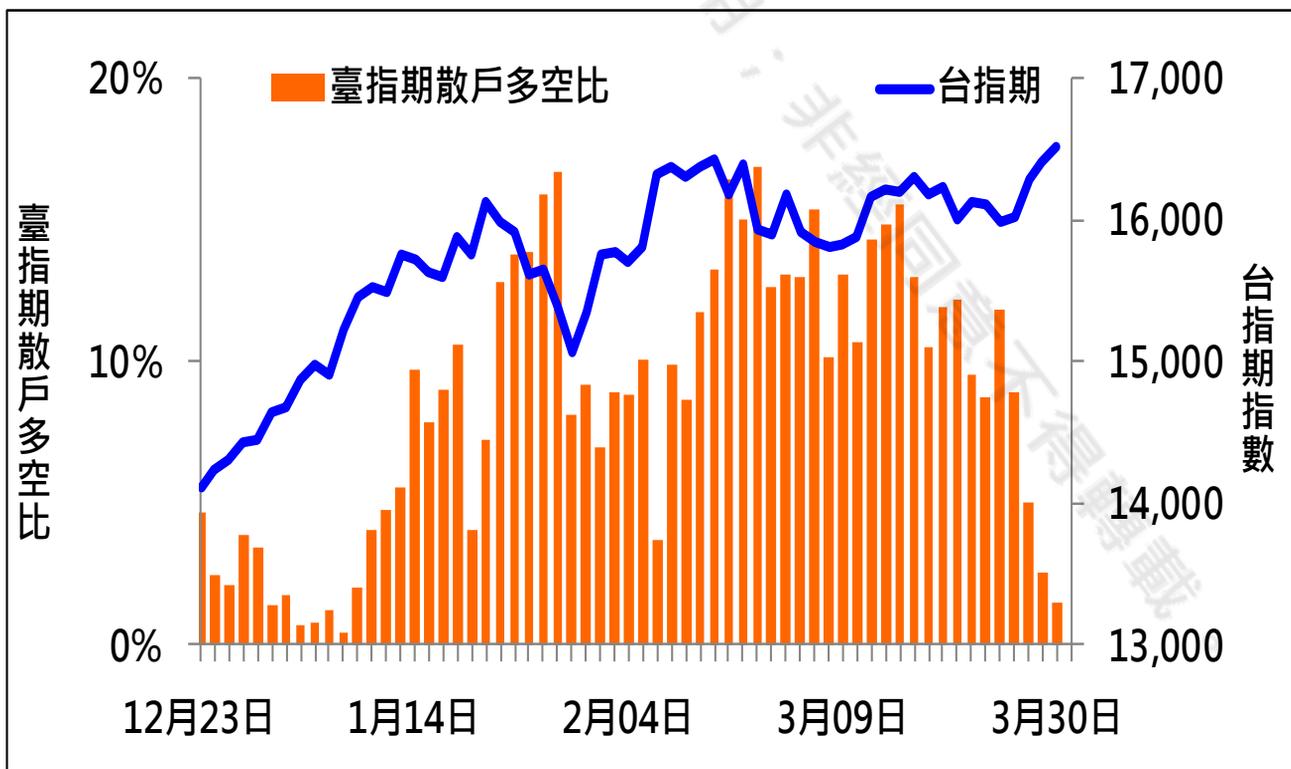
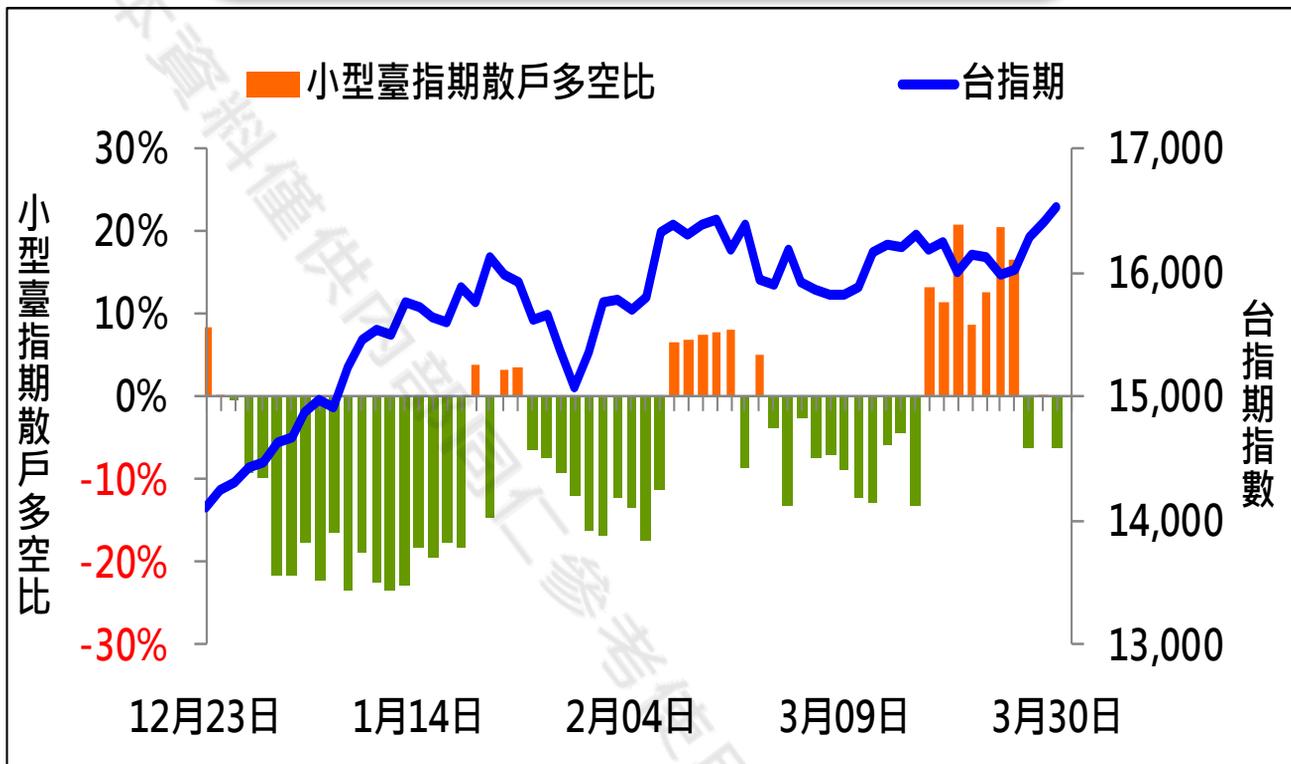
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

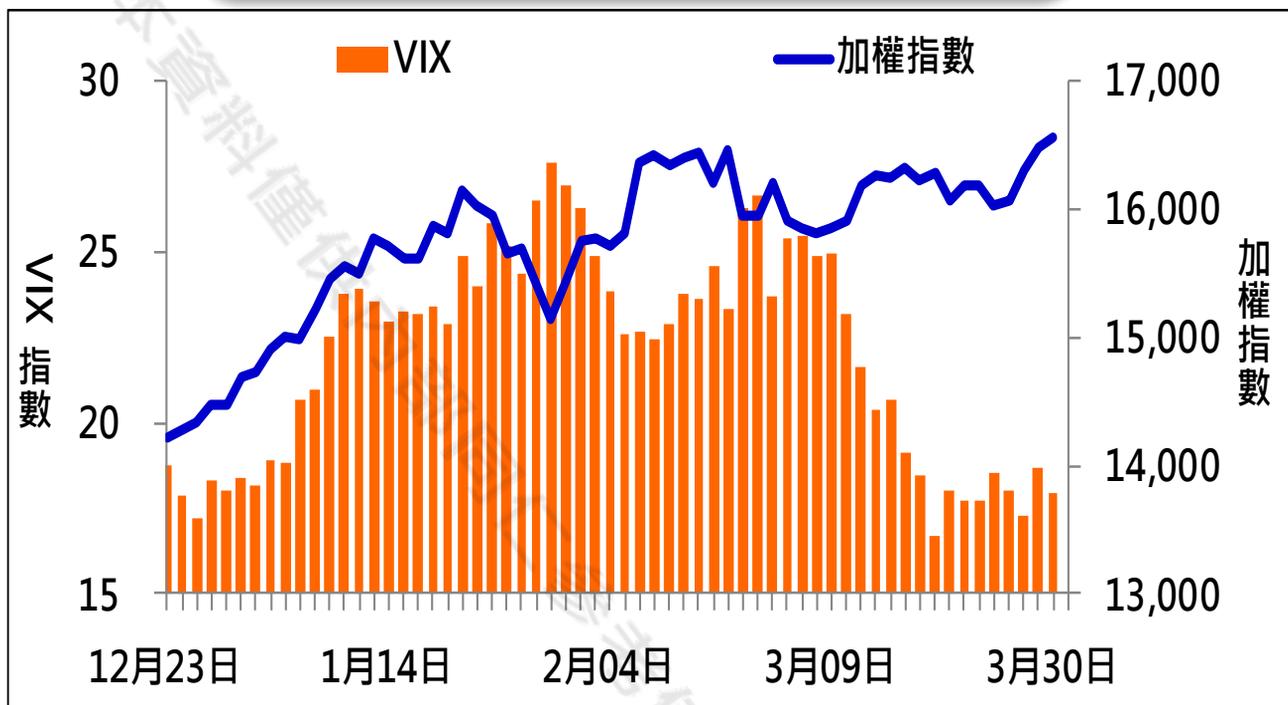
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

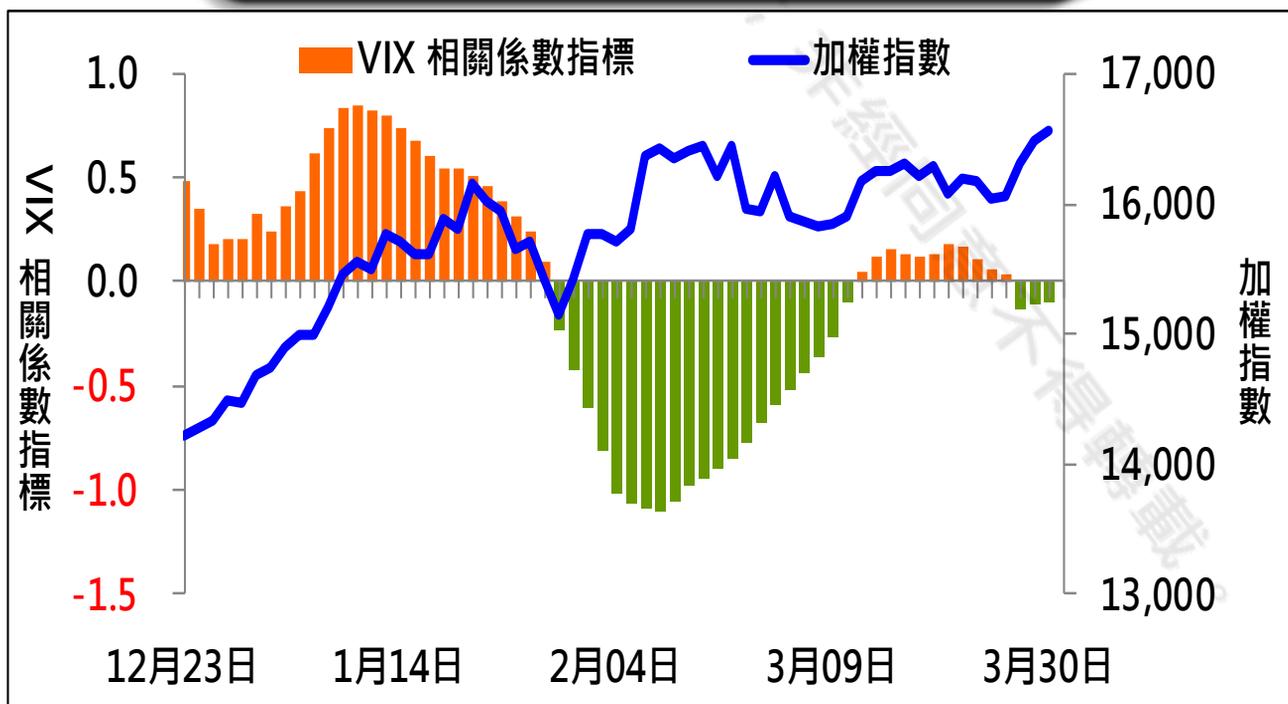
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



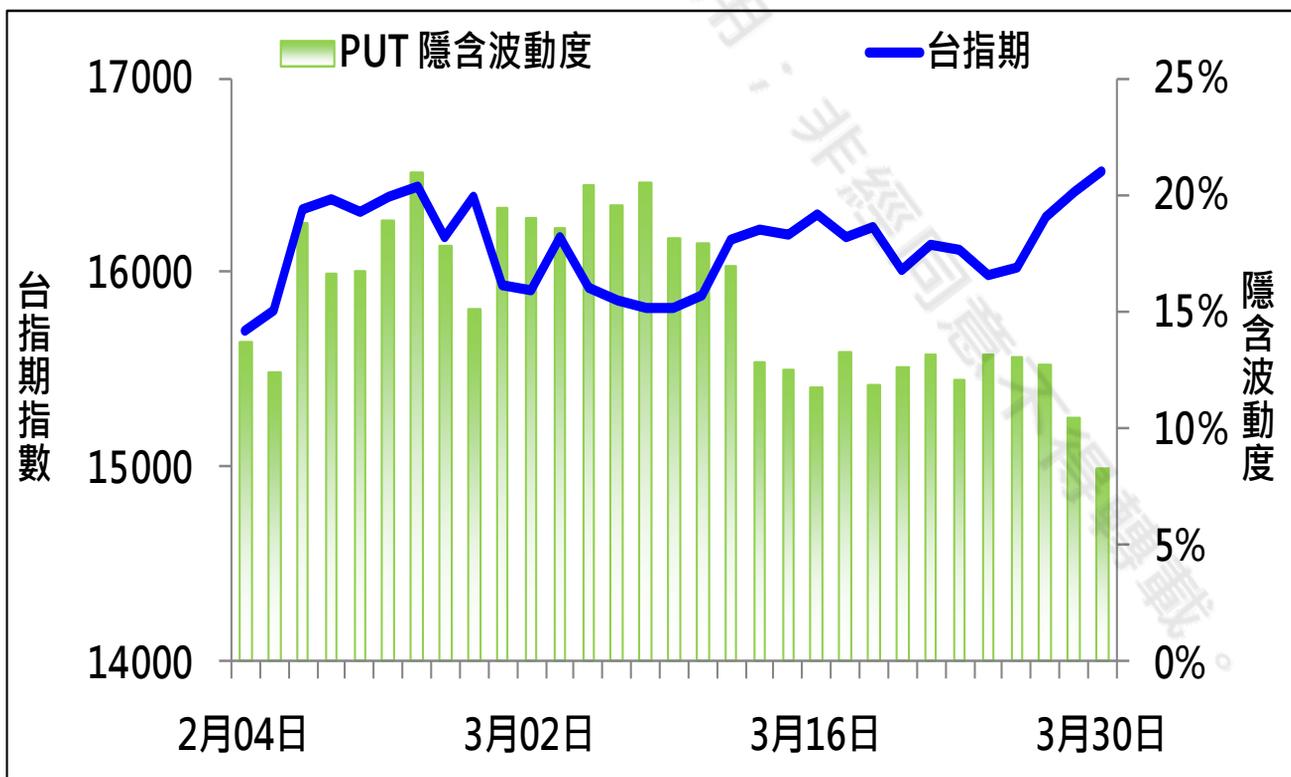
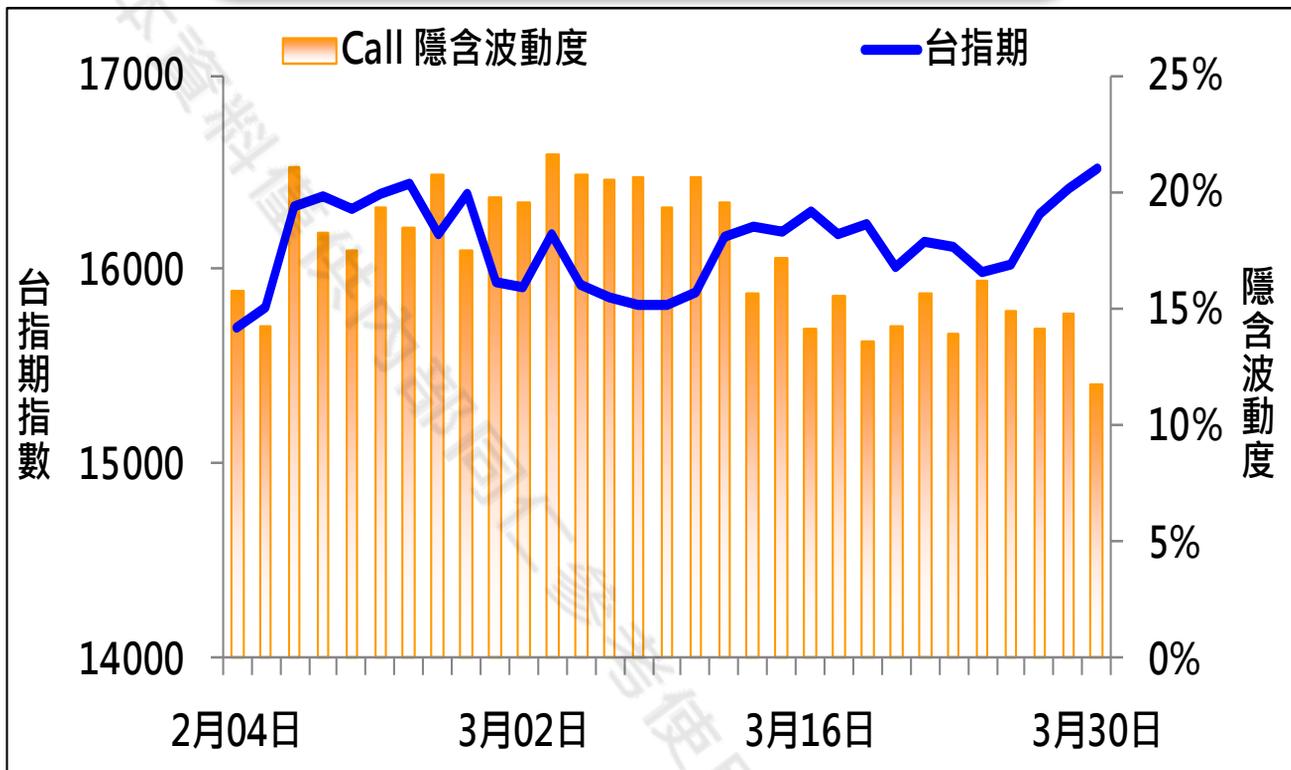
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/3/30

結算日：2021/3/31

OI 增減	Call	202103W5 履約價	Put	OI 增減
-112	2,046	16,050	6,426	-1,464
-900	3,215	16,100	9,687	-112
254	3,443	16,150	6,947	577
-351	4,938	16,200	11,280	-436
-315	3,584	16,250	7,655	1,830
-1,232	7,191	16,300	13,693	1,035
-632	4,812	16,350	11,181	5,650 ※
-3,152	7,913	16,400	13,489	5,567
-1,049	6,003	16,450	10,300	5,537
3,667	12,594	16,550	3,702	2,966
4,395	18,407	16,600	2,483	1,525
※ 5,837	12,574	16,650	643	443
2,523	14,183	16,700	233	-23
1,741	5,213	16,750	84	76
1,264	6,280	16,800	53	21
492	492	16,850	0	0
90	3,061	16,900	5	3
44	44	16,950	2	2
57	1,218	17,000	1	1
30	145	17,100	0	0
40	41	17,200	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
12,392	122,653	1.5709	192,679	9,306

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：2021/3/30

結算日：2021/4/21

OI 增減	Call	202104月 履約價	Put	OI 增減
0	24	15,000	11,559	183
0	2	15,100	2,974	-96
0	23	15,200	2,555	122
0	36	15,300	3,216	-373
0	119	15,400	3,537	32
0	67	15,500	6,735	353
3	179	15,600	4,572	-1,011
-2	835	15,700	6,150	156
-10	1,685	15,800	6,563	766
-7	884	15,900	5,165	397
-32	2,983	16,000	7,856	882
-94	2,430	16,100	3,954	175
0	2,698	16,200	4,981	701
-150	4,829	16,300	2,652	-4
-22	5,154	16,400	2,167	935
50	4,514	16,500	1,543	575
-203	4,334	16,600	532	162
65	4,348	16,700	230	73
-70	6,387	16,800	98	25
321	6,078	16,900	79	45
152	8,991	17,000	97	5
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
514	82,896	1.3075	108,385	3,535
昨日 P/C	1.2727	今日增減變化		0.0348

※

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。

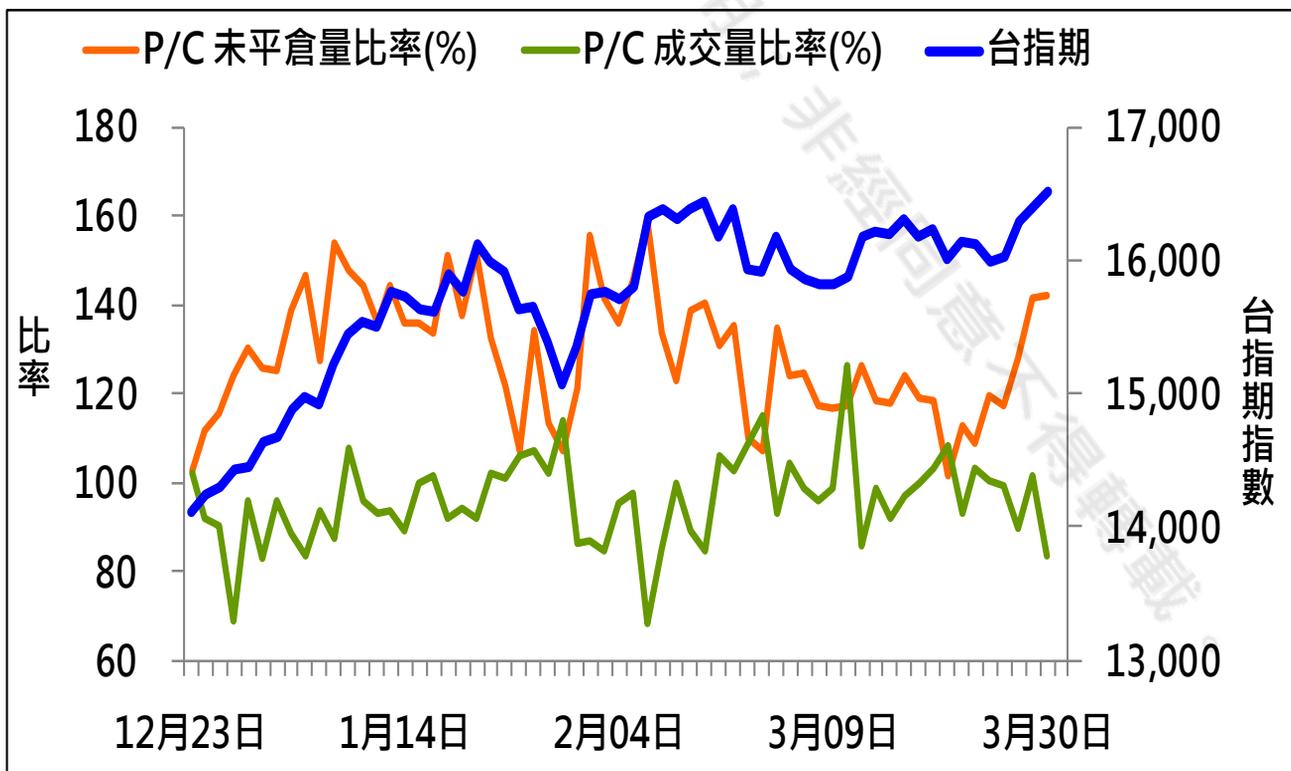
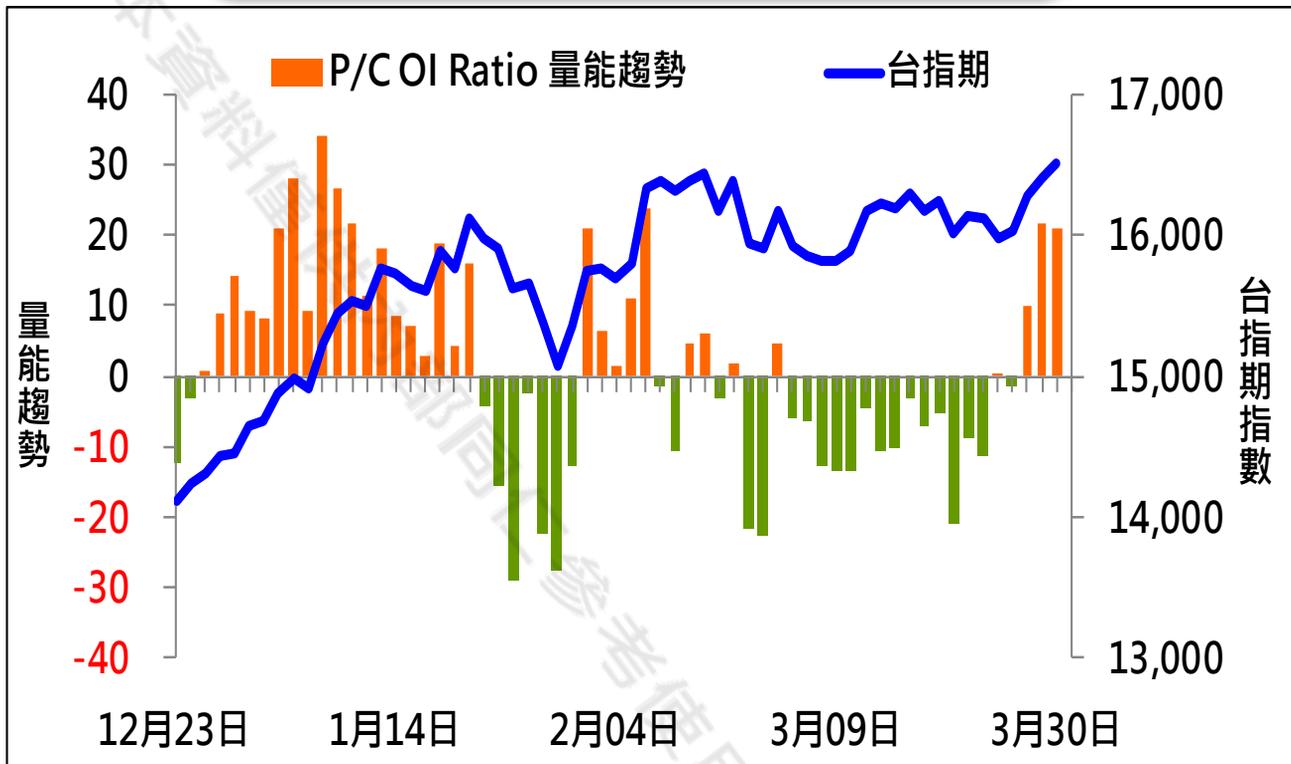
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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