



法人籌碼動態

05月27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	-23,354	-760	701	-40	-1,456	57
投信	-3,845	-156	145	71	8	0
自營商	21,927	-11	-26	-48	241	-17

05月27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	-154	4	-4,356	-1,743	-7,771	-316
投信	2	0	0	0	-65	0
自營商	203	-1	1,487	1,319	-2,694	367

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
萬海	9.11	台積電	-25.55	台指期前十大 市場佔比	53.2%	58.9%
矽力-KY	3.98	台塑化	-10.32			
長榮	3.60	鴻海	-9.11			
中租-KY	3.52	聯發科	-8.36	電子期前十大 市場佔比	71.7%	71.6%
台達電	2.99	中信金	-3.94			
陽明	2.88	豐泰	-3.33			
華航	2.76	南亞	-3.13	金融期前十大 市場佔比	59.6%	87.7%
長榮航	2.51	聯電	-2.86			
日月光投控	2.16	中華電	-2.55			
兆豐金	2.01	華碩	-2.32	非金電期前十大 市場佔比	96.3%	90.7%
前十名合計	35.50	後十名合計	-71.45			

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

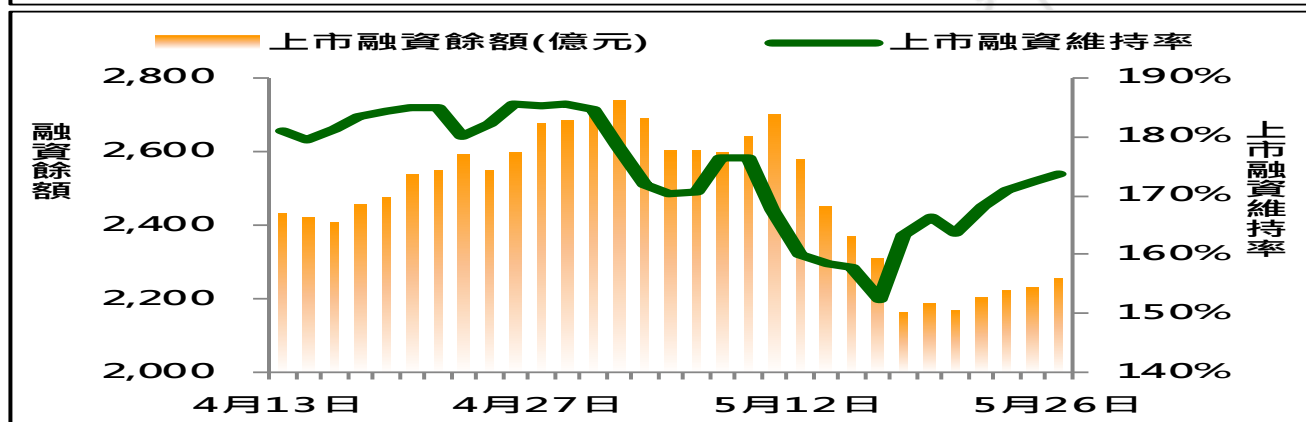
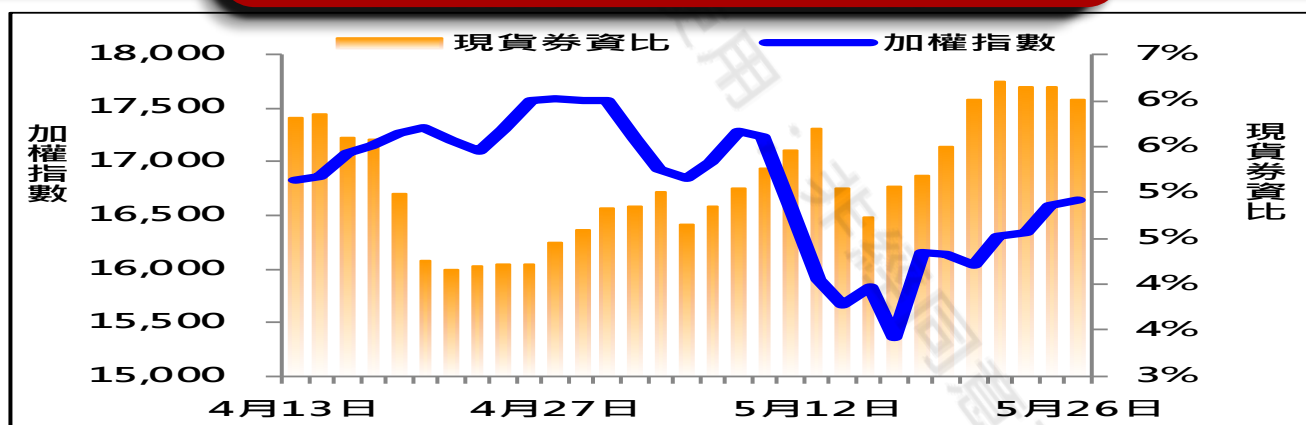


法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
05月21日	174.3	-21,320	-2,337	3.8	22,481	150
05月24日	-1.2	-24,270	-2,950	13.9	22,973	492
05月25日	-11.8	-22,944	1,326	44.9	21,580	-1,393
05月26日	19.6	-22,594	350	25.3	21,938	358
05月27日	-123.5	-23,354	-760	-9.8	21,927	-11

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
05月21日	-2,751	-3,087	336	-1,548	-2,192	644
05月24日	-1,614	-3,621	2,007	-1,872	-3,859	1,987
05月25日	1,559	-5,094	6,653	6,052	-15,229	21,281
05月26日	-2,613	-7,455	4,842	168	-3,061	3,229
05月27日	-4,356	-7,771	3,415	1,487	-2,694	4,181

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。

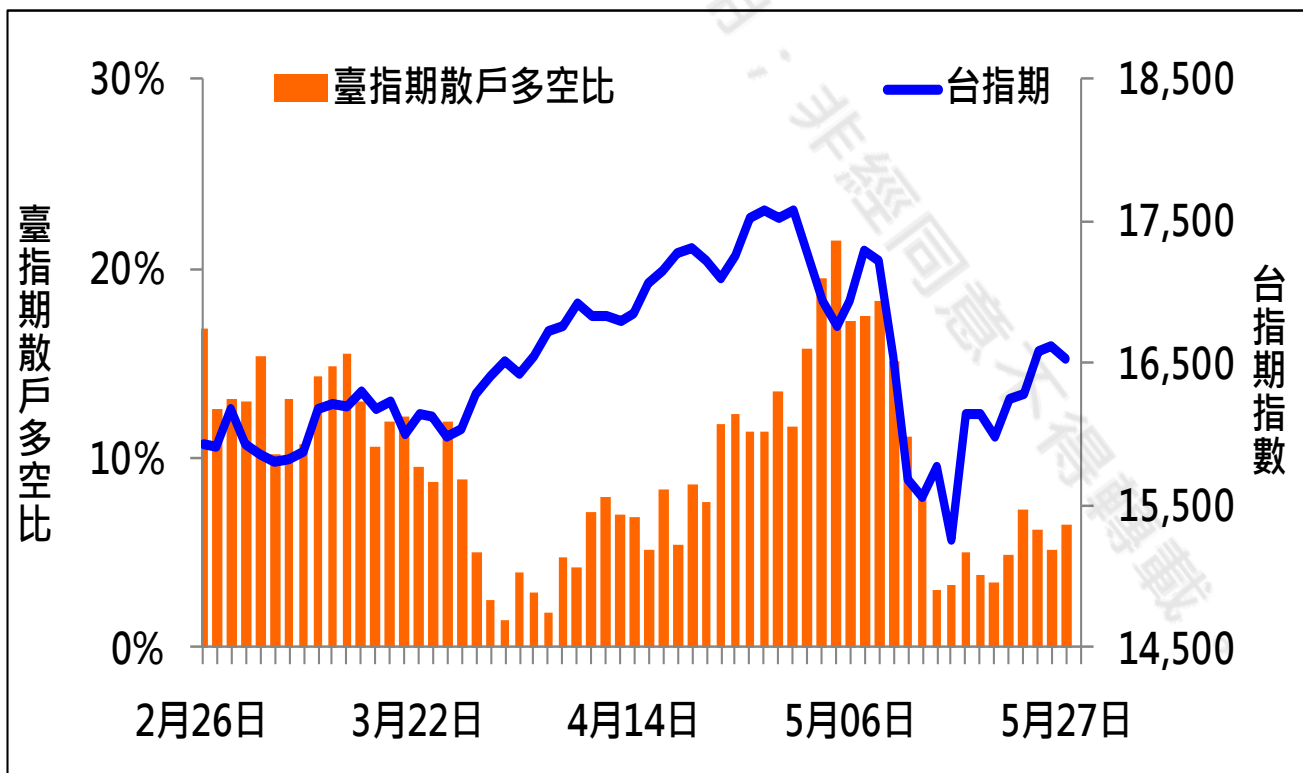
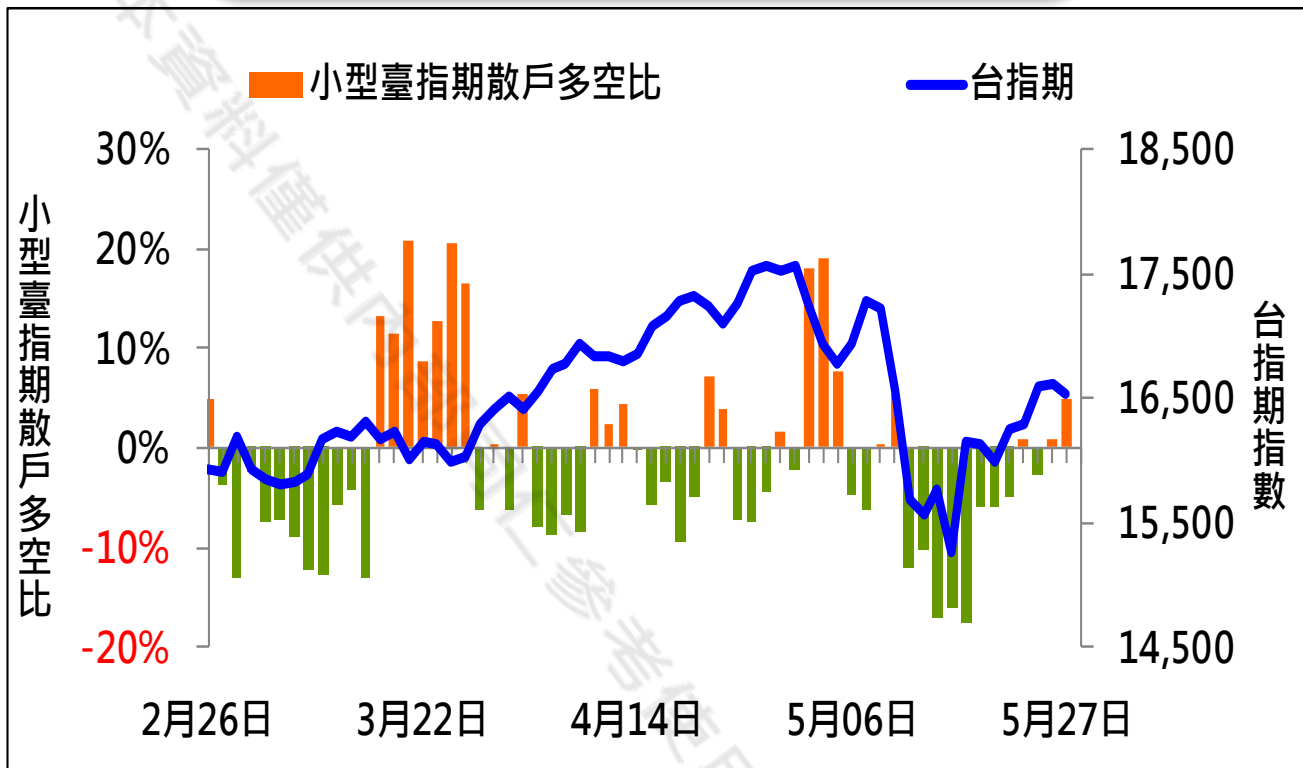
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管總字第007號

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



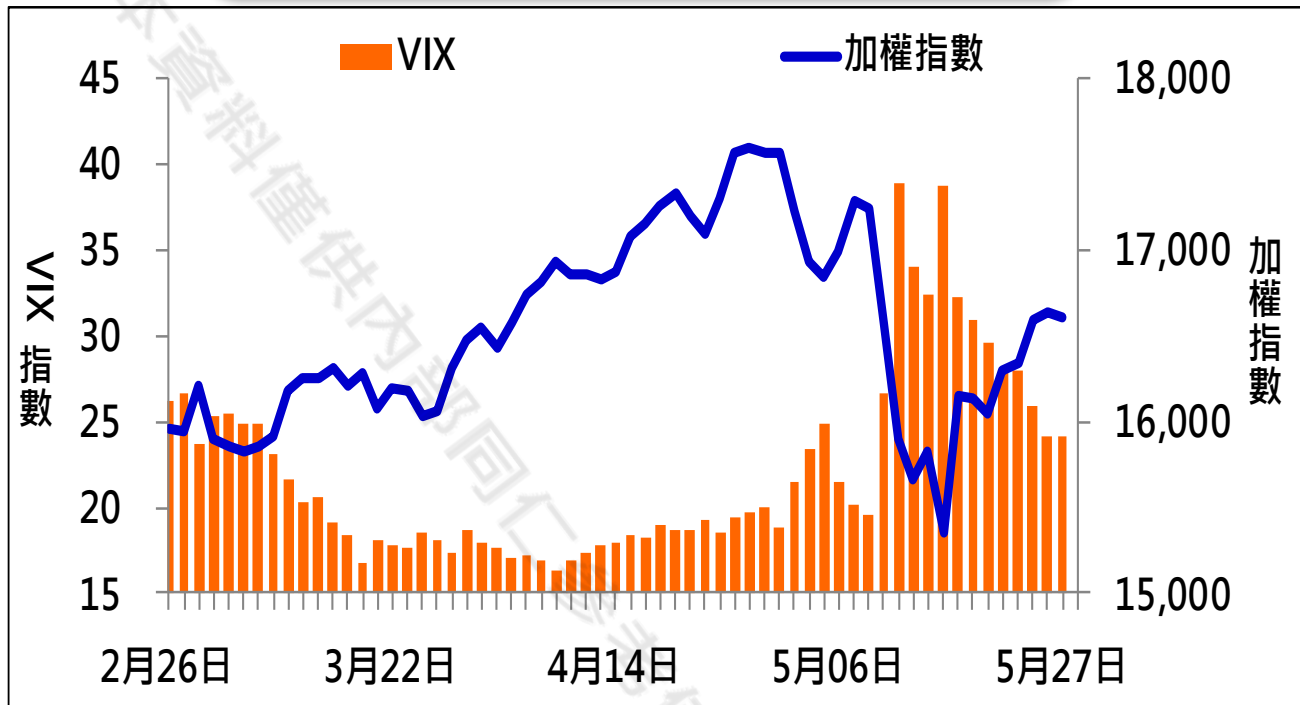
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

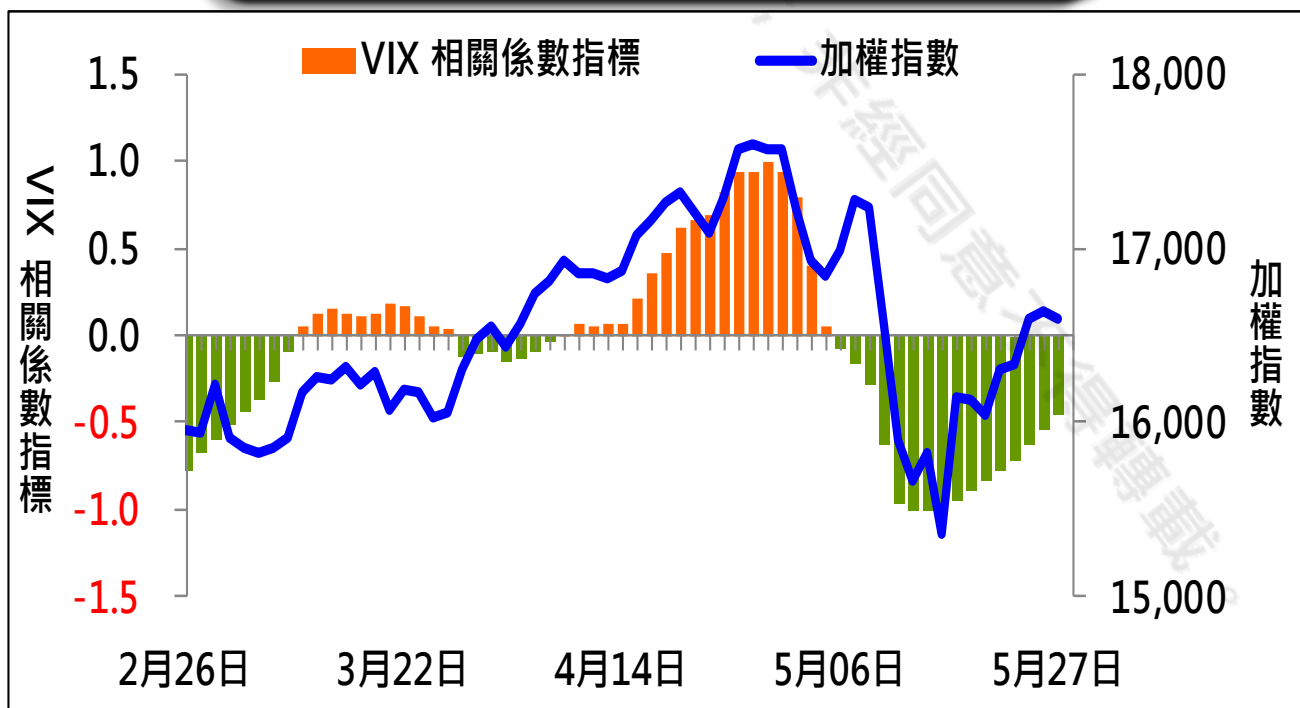
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



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。

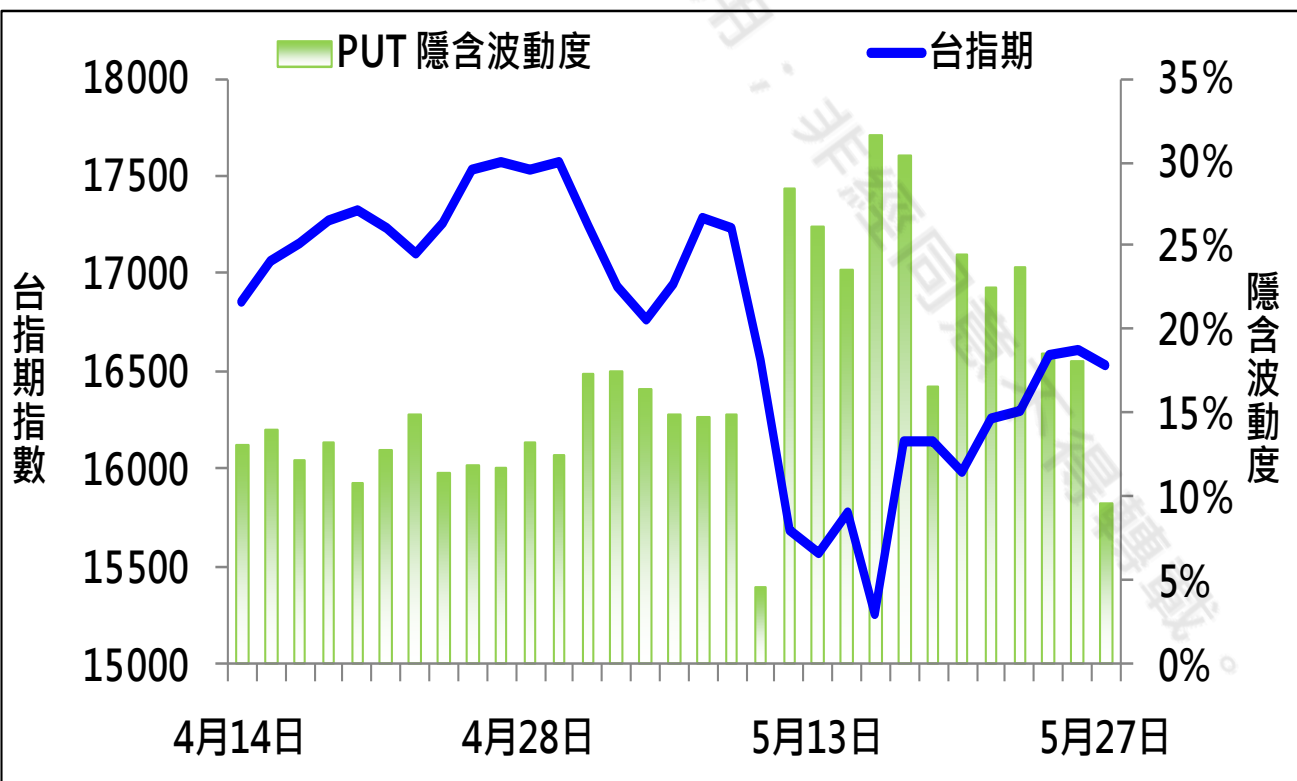
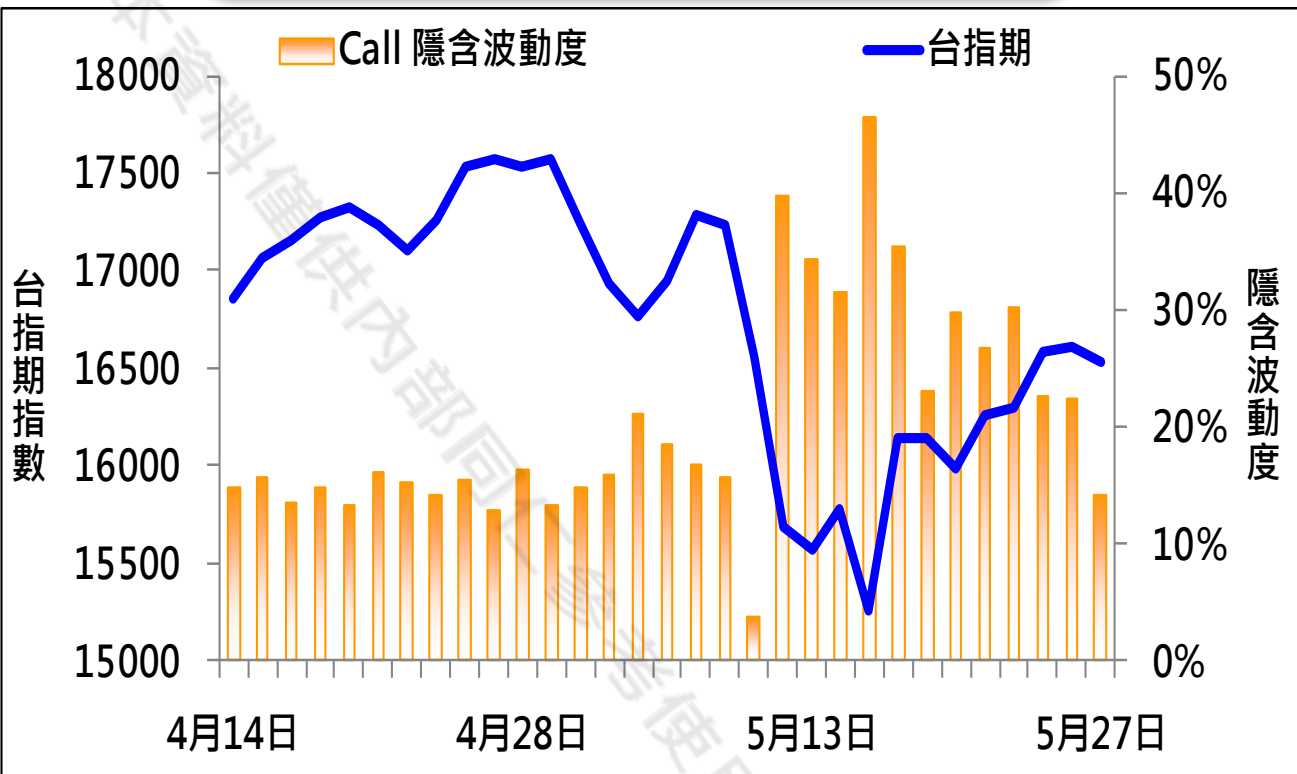
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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：2021/5/27

結算日：2021/6/2

OI 增減	Call	202106W1 履約價	Put	OI 增減
-4	34	16,000	5,370	3,232 ※
34	54	16,100	2,380	1,537
6	11	16,150	1,476	1,195
65	84	16,200	3,683	2,921
40	46	16,250	1,214	498
127	138	16,300	3,608	2,236
175	190	16,350	1,166	617
248	325	16,400	1,748	958
327	365	16,450	1,179	595
969	1,151	16,500	1,426	767
1,077	1,225	16,550	2,152	1,721
1,003	1,570	16,600	1,348	600
1,843	2,431	16,650	1,018	552
2,114	2,954	16,700	459	334
991	1,554	16,750	156	58
2,320	3,152	16,800	184	87
2,207	2,846	16,850	57	3
2,569	3,667	16,900	54	43
1,522	2,130	16,950	6	6
※ 3,465	4,633	17,000	20	16
1,642	2,696	17,050	3	3
2,936	4,459	17,100	22	12
2,207	5,065	17,200	2	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
32,238	49,100	1.0683	52,453	33,328

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：2021/5/27

結算日：2021/6/16

OI 增減	Call	202106月 履約價	Put	OI 增減
0	170	15,100	2,155	574
0	230	15,200	11,114	-33
0	272	15,300	3,240	-21
0	432	15,400	2,305	128
0	376	15,500	3,974	588
1	3,183	15,600	3,913	255
-11	2,460	15,700	2,812	49
2	744	15,800	10,951	292
2	732	15,900	2,936	37
10	1,347	16,000	4,539	-31
2	1,596	16,100	2,003	-49
32	2,752	16,200	2,604	30
-23	2,179	16,300	2,111	300
408	2,701	16,400	1,774	1,010
-52	3,288	16,500	2,567	225
372	3,508	16,600	1,246	122
532	2,245	16,700	947	12
334	3,921	16,800	825	8
326	2,261	16,900	305	-64
※ 867	5,711	17,000	5,685	-19
618	3,227	17,100	223	2
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
5,624	87,826	1.5898	139,622	5,877
昨日 P/C	1.7618	今日增減變化		-0.1720

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。

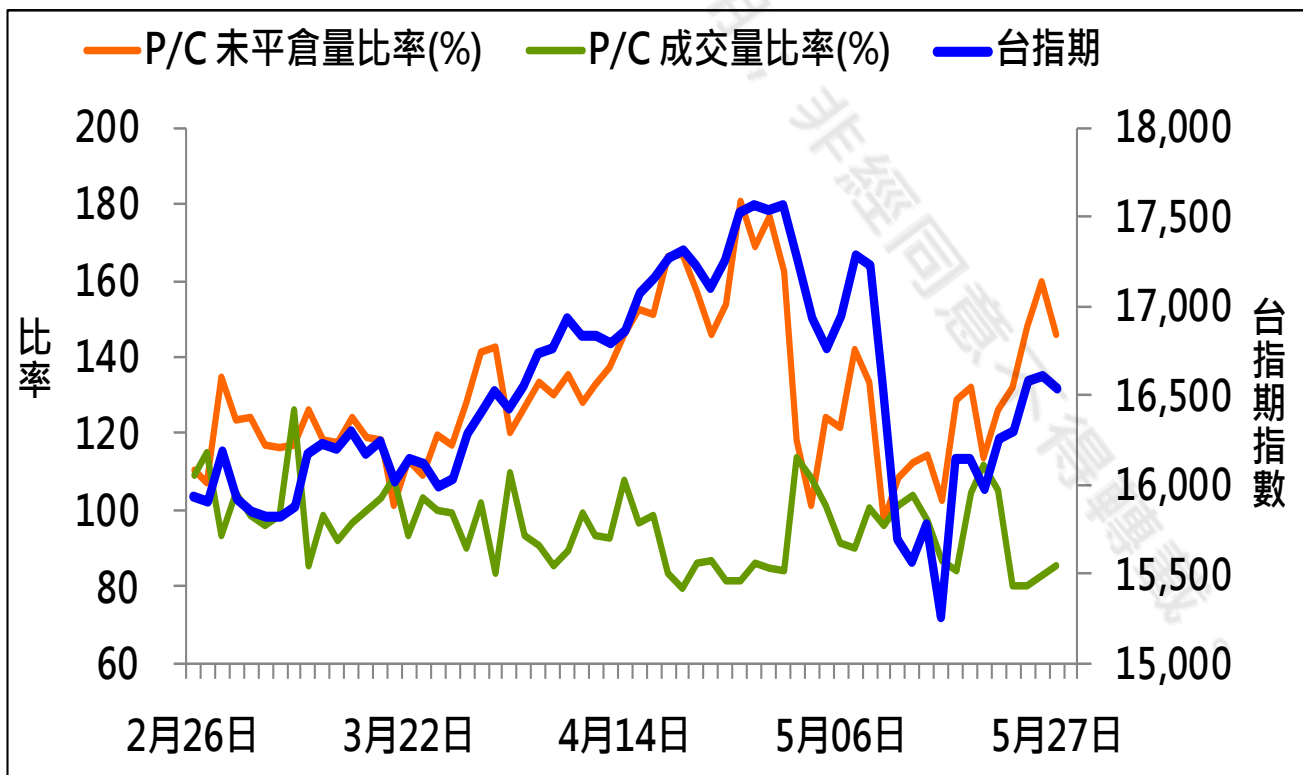
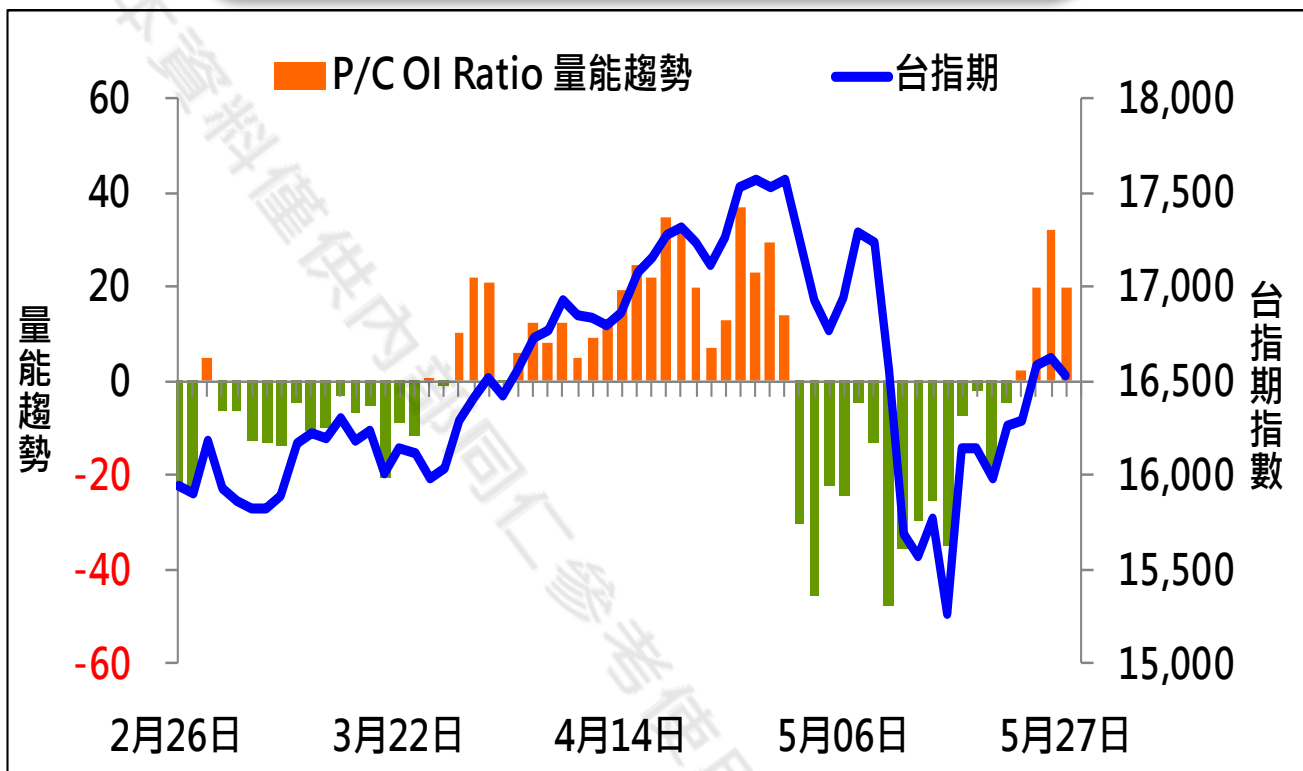
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

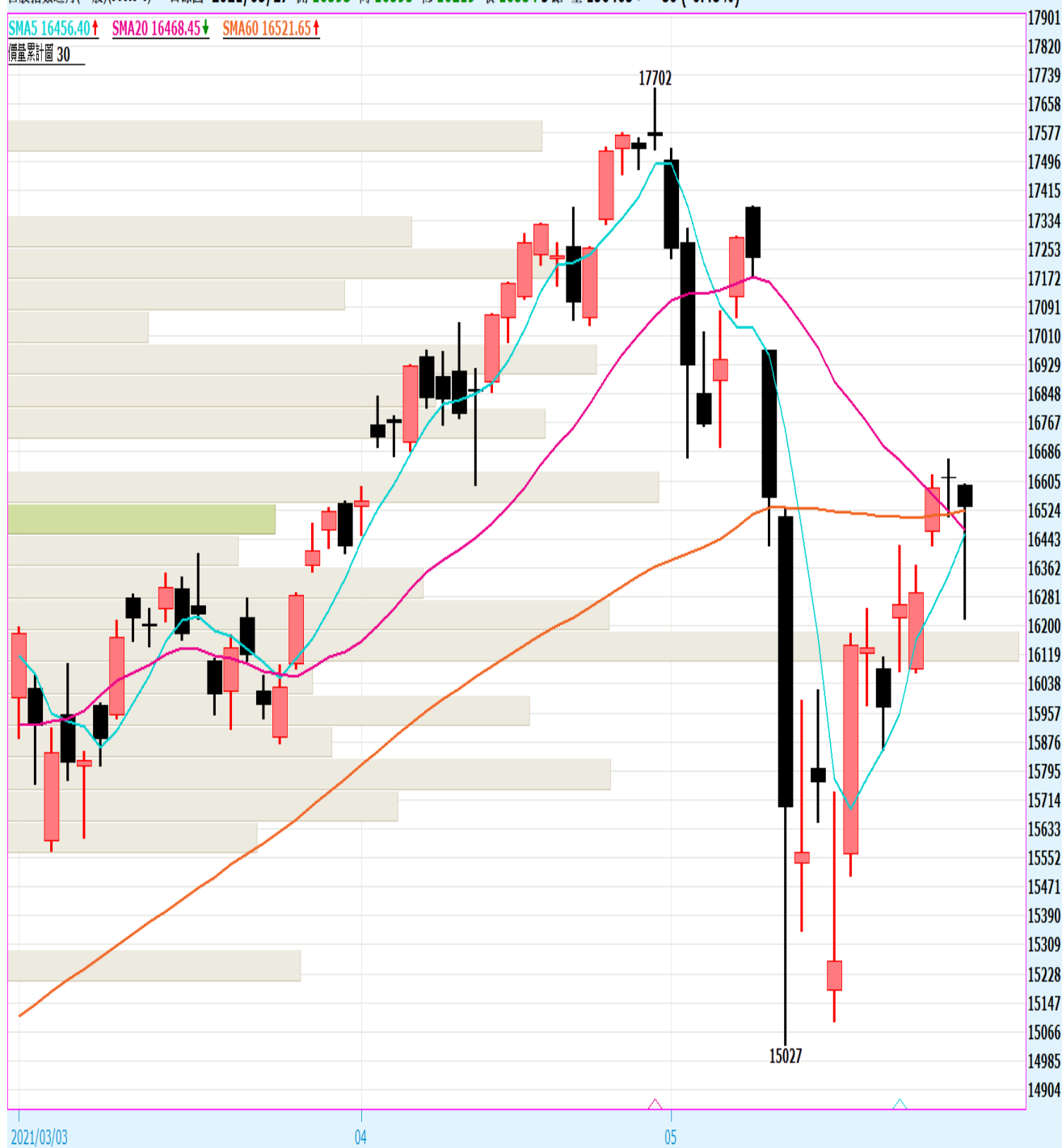


盤後重點觀察

台股指數近月(一般)(FTTX*) 日線圖 2021/05/27 開 16593 高 16595 低 16219 收 16534 s 點 量 150465 口 -80 (-0.48%)

SMA5 16456.40 ↑ SMA20 16468.45 ↓ SMA60 16521.65 ↑

價量累計圖 30



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



個股除權息公告表

除權息日期	除權息標的	股期代碼	現金股息	股票股利	預估扣除點數
2021/5/28	6456 GIS-KY	--	4.0	0.0	0.44
2021/5/28	2461 光群雷	--	1.0	0.0	0.05
2021/5/31	8210 勤誠	--	4.0	0.0	0.16
2021/6/1	1702 南僑	ERF	2.0	0.0	0.19
2021/6/3	3443 創意	JBF	5.0	0.0	0.22
2021/6/3	2809 京城銀	--	1.8	0.0	0.66
2021/6/3	5434 崇越	--	8.0	0.0	0.48
2021/6/3	1342 八貫	--	2.5	0.0	0.06
2021/6/3	2722 夏都	--	0.5	0.0	0.02
2021/6/7	1597 直得	--	1.5	0.0	0.04
2021/6/7	6024 群益期	--	2.9	0.0	0.20
2021/6/8	2347 聯強	GAF	3.3	0.0	1.81
2021/6/9	1504 東元	EMF	1.2	0.0	0.81
2021/6/9	1907 永豐餘	QKF	1.5	0.0	0.82

每週預估扣除點數

	202106W1	202106W2	202106	202106W4	202106W5
單週點數	0.85	3.48	3.40	23.49	4.14
累計點數	0.85	4.33	7.72	31.22	35.35

- 1.本公告表資訊來源為台灣證券交易所及嘉實資訊。
- 2.本公告表資訊以報告當日該標的及加權指數之收盤價為基礎，其公式如下：

$$\text{預扣點數} = \frac{\text{標的除息之市值}}{\text{加權指數收盤總市值}} \times \text{加權指數收盤價}$$

- 3.本資料僅供參考，詳情請查閱台灣證券交易所資訊。

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