

## 法人籌碼動態

03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	-3,340	3,136	67	-19	-779	-33
投信	4,842	250	131	0	7	0
自營商	-7,448	-1,147	-370	-58	-207	-13
03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	34	4	14,635	43	24,930	-2,968
投信	0	0	20	20	-172	0
自營商	-62	-11	9,434	-2,529	-2,201	-9,949

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
鴻海	29.04	台積電	-25.07	台指期前十大市場佔比	42.5%	42.8%
聯發科	18.04	華城	-6.56			
中信金	5.18	世芯-KY	-4.45			
廣達	4.36	日月光投控	-4.23			
中華電	3.75	士電	-4.11	電子期前十大市場佔比	55.3%	58.5%
大聯大	3.45	台塑化	-2.46			
上銀	2.91	智邦	-2.26			
長榮	2.73	緯穎	-2.25	金融期前十大市場佔比	49.1%	83.4%
統一	2.01	文晔	-1.98			
華碩	1.80	中興電	-1.78	非金電期前十大市場佔比	98.8%	88.6%
前十名合計	73.26	後十名合計	-55.16			

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 (112)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

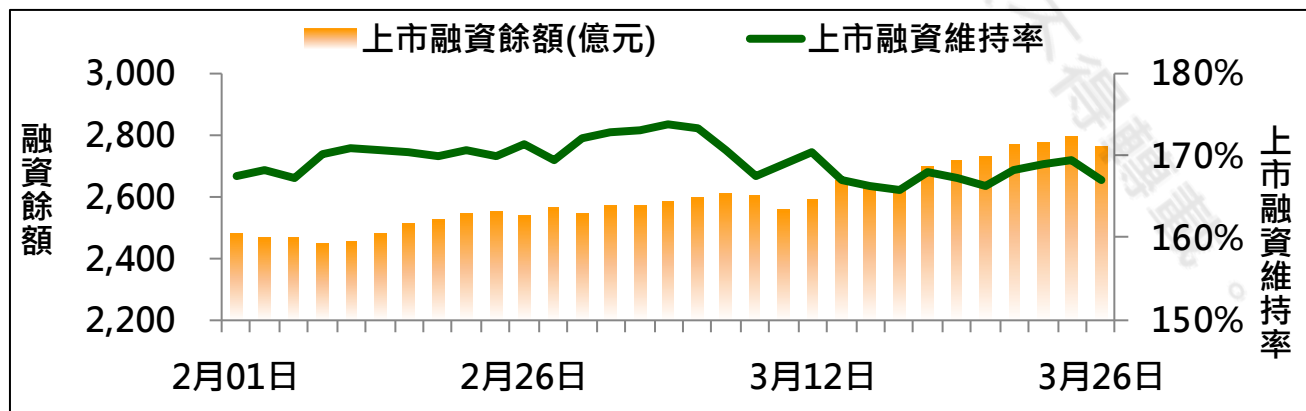
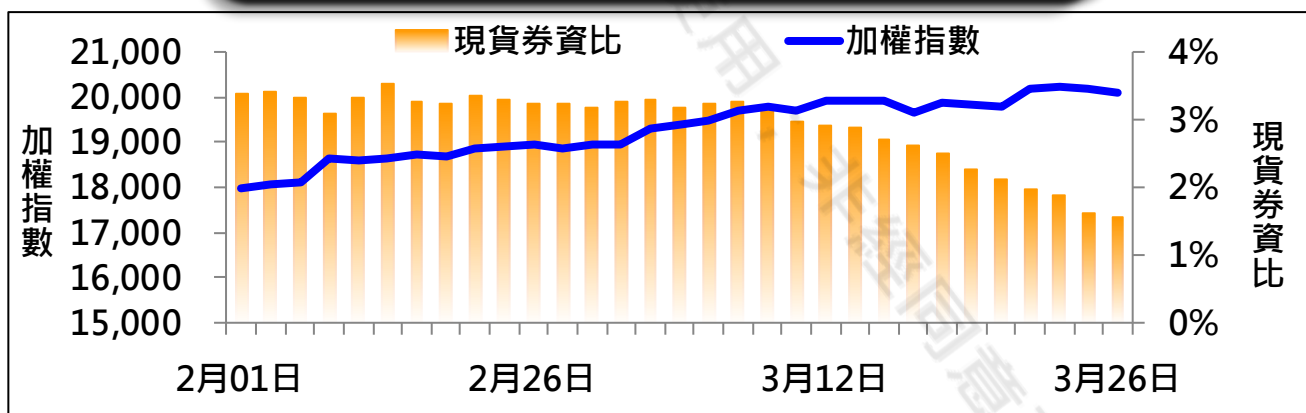
## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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21日	183.6	4,132	8,920	61.4	-6,289	-39
03月22日	22.0	-5,442	-9,574	13.1	-5,533	756
03月25日	-91.2	-5,186	256	10.5	-6,278	-745
03月26日	-54.2	-6,476	-1,290	-60.9	-6,301	-23
03月27日	-68.9	-3,340	3,136	16.8	-7,448	-1,147

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21日	8,848	18,694	-9,846	4,139	4,464	-325
03月22日	9,705	22,184	-12,479	4,371	11,144	-6,773
03月25日	11,907	26,723	-14,816	12,508	2,375	10,133
03月26日	14,592	27,898	-13,306	11,963	7,748	4,215
03月27日	14,635	24,930	-10,295	9,434	-2,201	11,635

## 現貨券資比 & 上市融資維持率



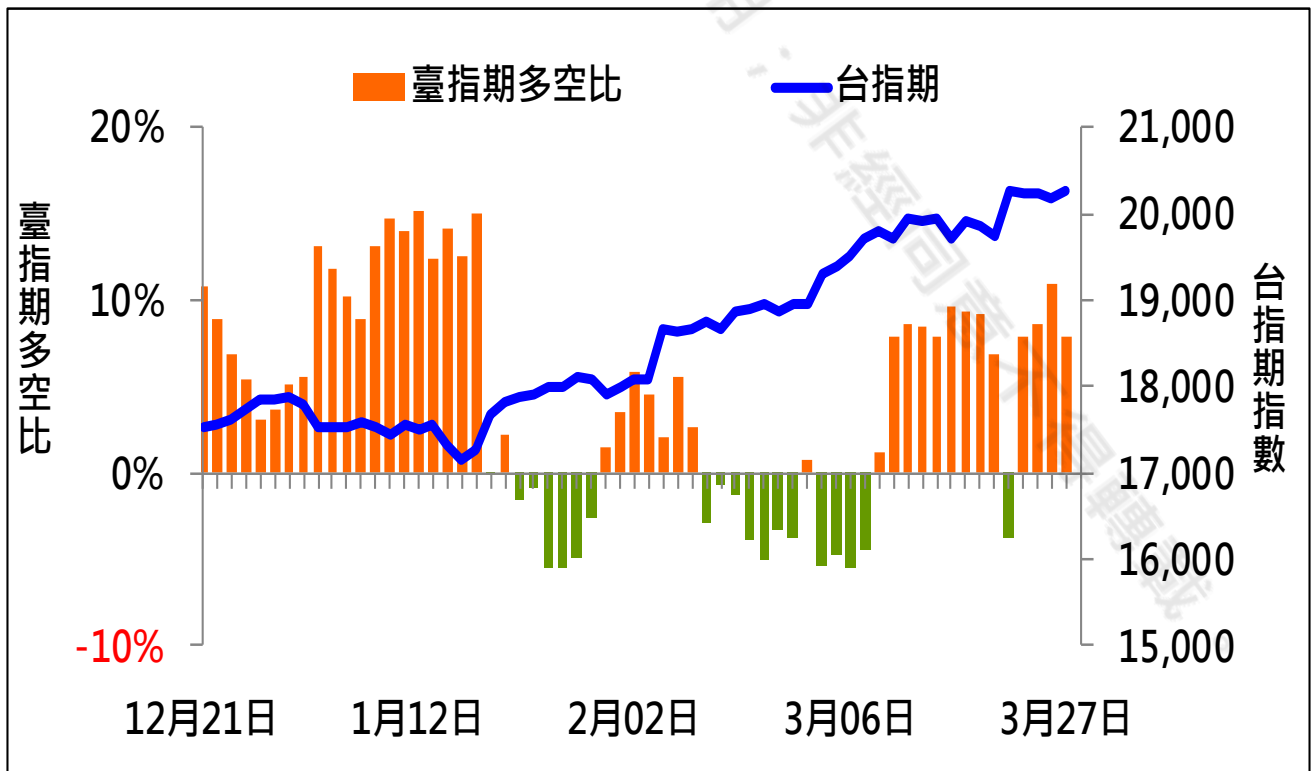
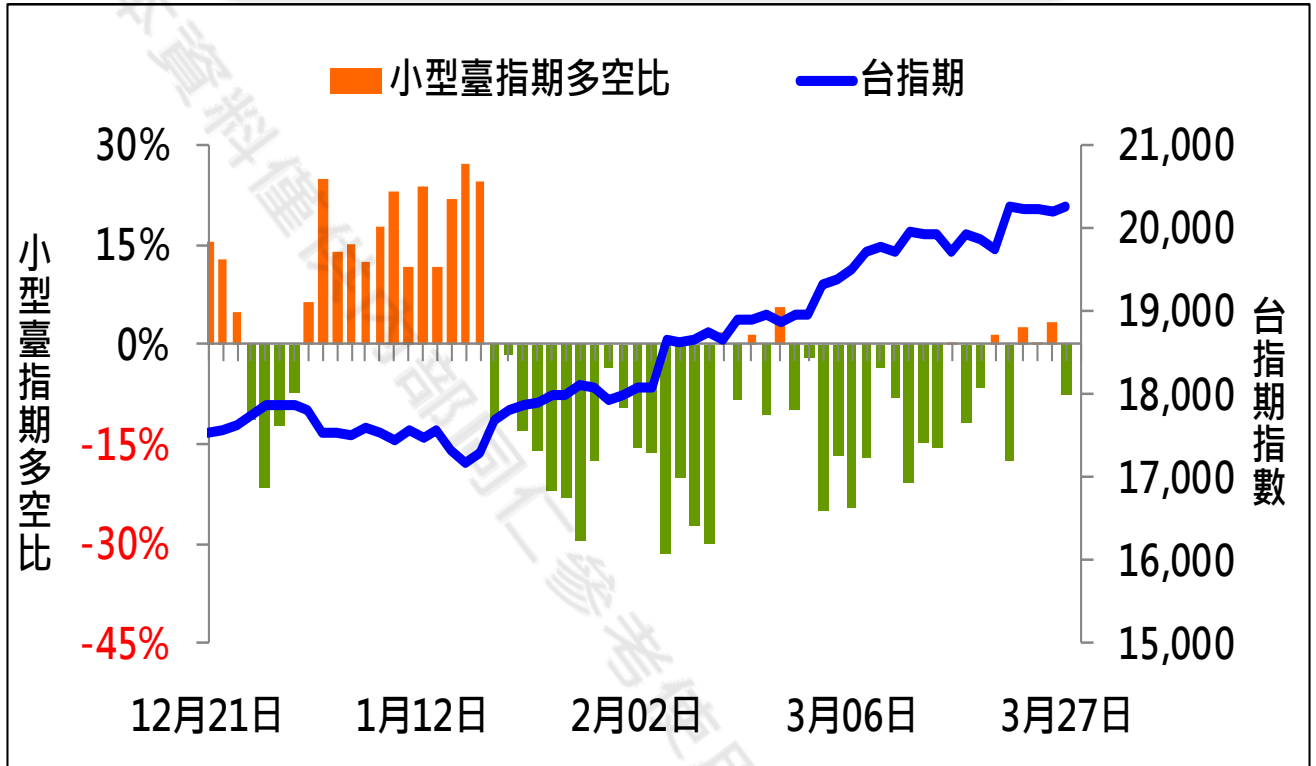
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)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

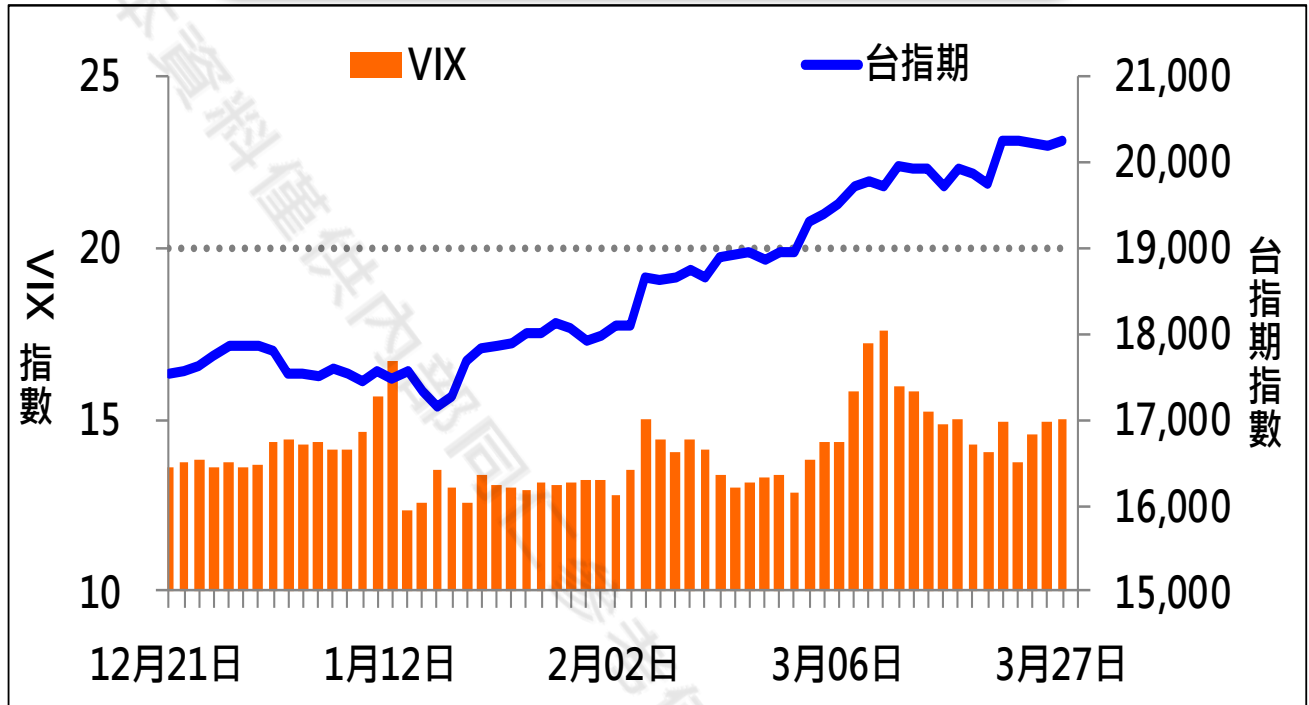


期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

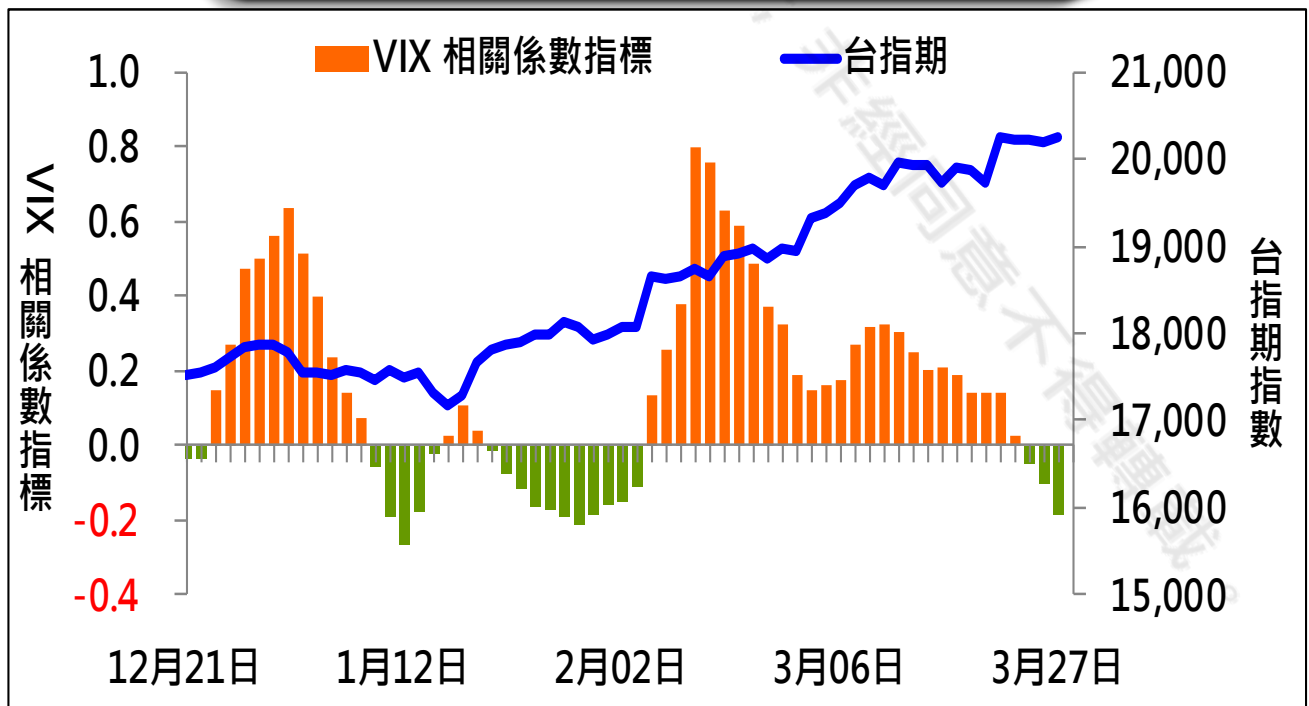
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年金管期總字第007號  
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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

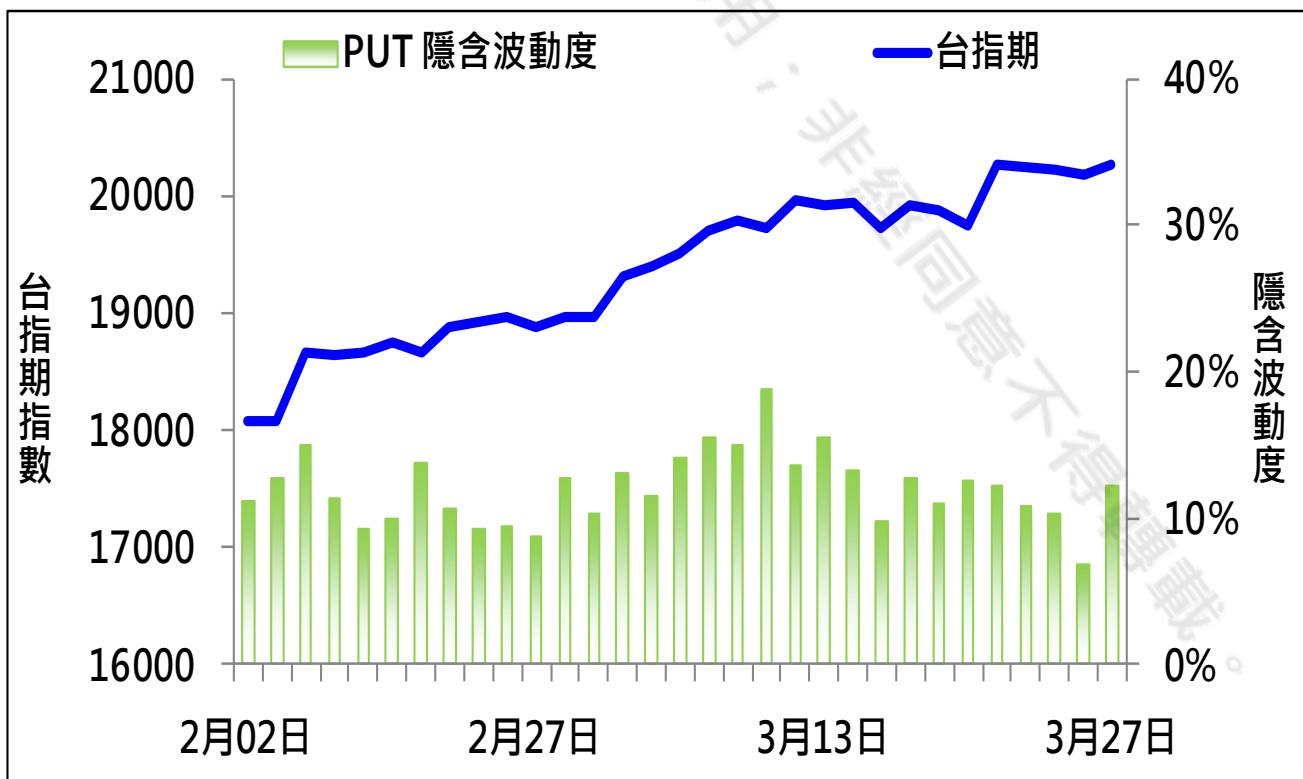
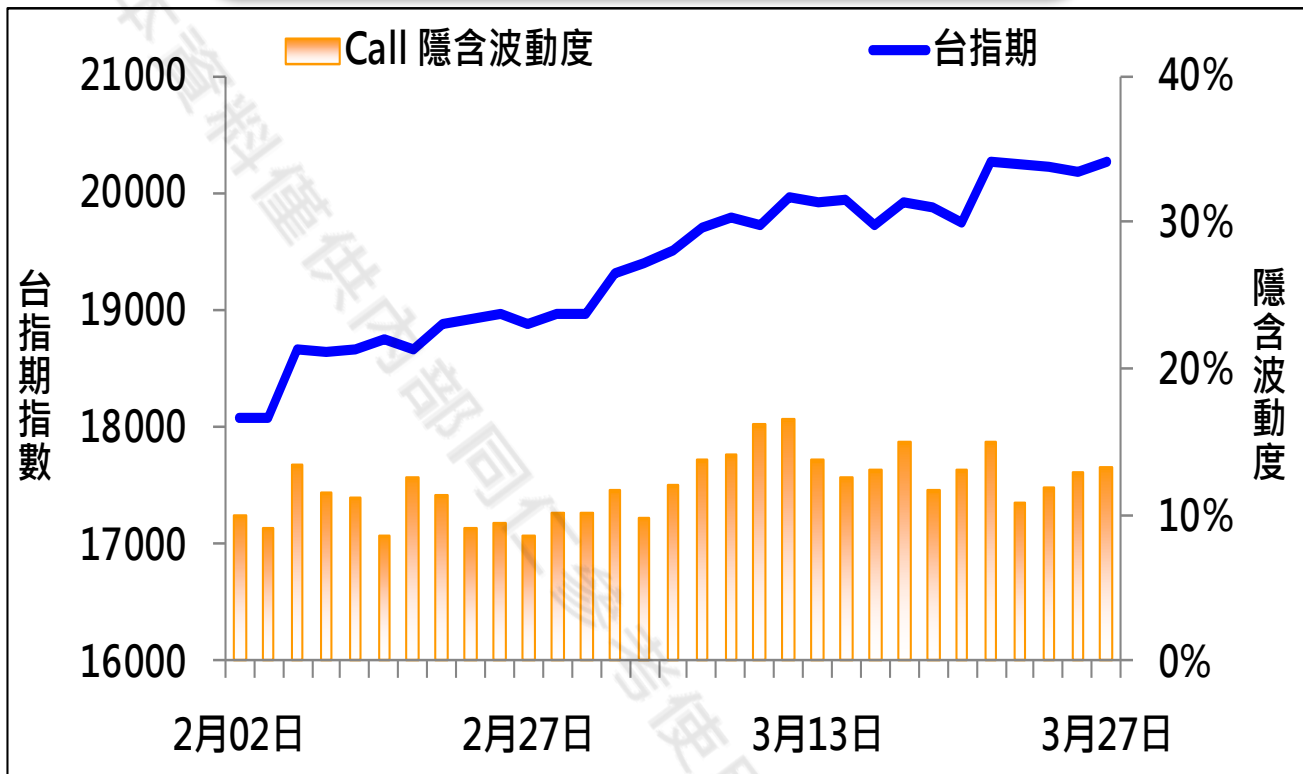


期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)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 (112)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

資料日期：2024/3/27

結算日：2024/4/3

OI 增減	Call	202404W1 履約價	Put	OI 增減
0	0	19,450	547	117
2	3	19,500	2,167	1,455
0	15	19,600	3,206	1,465
5	10	19,650	2,856	822
-2	19	19,700	2,745	1,157
5	27	19,750	2,379	1,086
-3	54	19,800	2,480	1,270
22	63	19,850	2,015	1,002
-7	131	19,900	2,186	1,080
-61	115	19,950	1,418	468
-92	273	20,000	2,544	585
37	137	20,050	1,233	792
216	561	20,100	1,978	1,261
124	363	20,150	1,505	1,028
160	1,441	20,200	1,909	961
655	1,069	20,250	800	511
778	1,411	20,300	602	237
750	1,460	20,350	142	45
1,166	2,088	20,400	220	94
1,270	1,839	20,450	78	34
1,646	2,952	20,500	250	95
717	1,532	20,550	139	119
1,372	2,686	20,600	50	9
539	1,612	20,650	3	3
361	2,099	20,700	4	0
848	1,431	20,750	7	0
1,379	2,270	20,800	2	0
15,463	34,720	總計	44,804	19,728
P/C	1.2904		增減	-0.0117

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 (112)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



## 次月選擇權OI變化

資料日期：2024/3/27

結算日：2024/4/17

OI 增減	Call	202404月 履約價	Put	OI 增減
0	96	18,800	1,451	70
-1	113	18,900	1,497	-87
0	196	19,000	8,209	937
0	110	19,100	1,584	55
3	103	19,200	2,902	81
2	128	19,300	4,061	368
0	264	19,400	2,484	104
0	441	19,500	3,274	77
32	631	19,600	4,770	-164
-13	650	19,700	2,873	-149
36	1,667	19,800	4,411	621
-24	1,218	19,900	2,400	366
-15	2,115	20,000	2,312	252
1	1,654	20,100	2,355	25
※ 1,233	4,122	20,200	2,703	331
-198	4,866	20,300	824	260
-153	3,282	20,400	279	-24
-119	5,346	20,500	301	-5
-192	4,227	20,600	80	-1
141	4,381	20,700	84	5
806	5,766	20,800	14	0
285	3,608	20,900	6	2
194	3,738	21,000	16	2
-159	961	21,100	2	0
11	1,348	21,200	8	0
14	2,203	21,300	7	0
-25	63,787	總計	71,036	3,498
P/C	1.1136		增減	0.0553

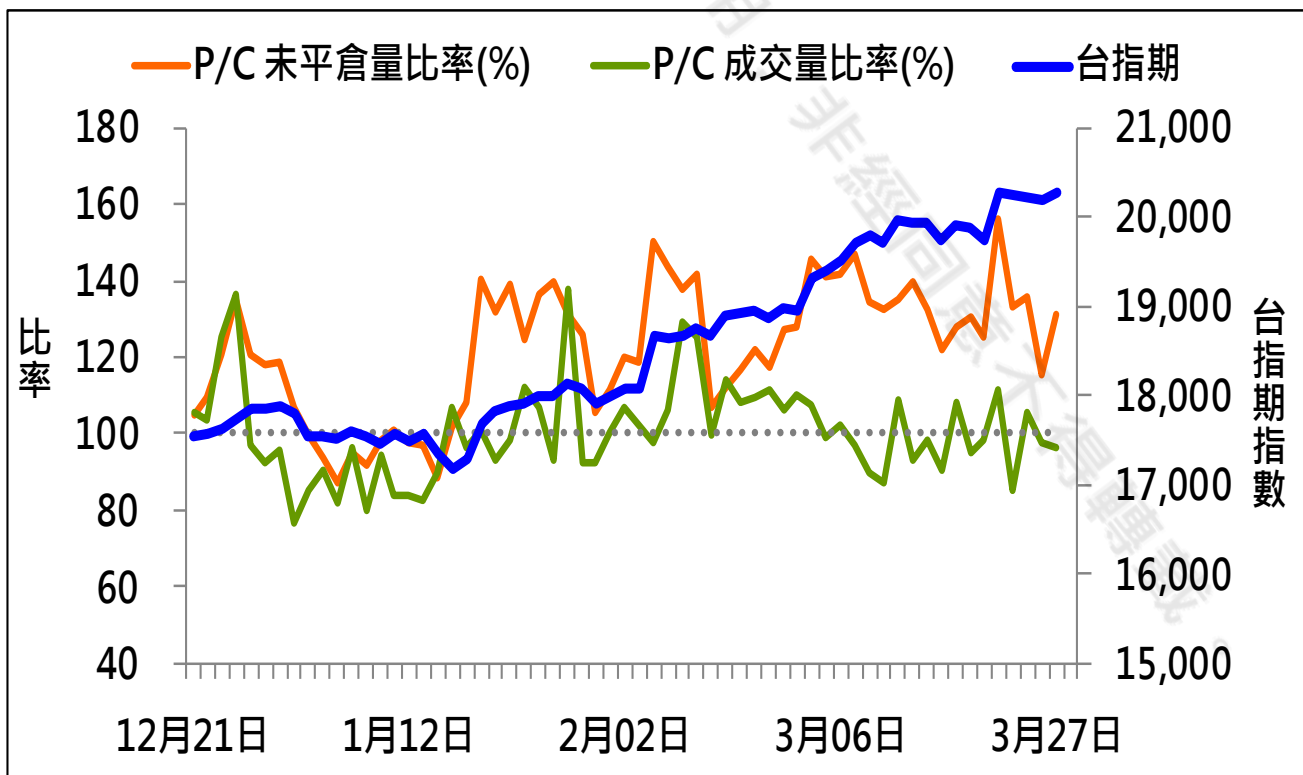
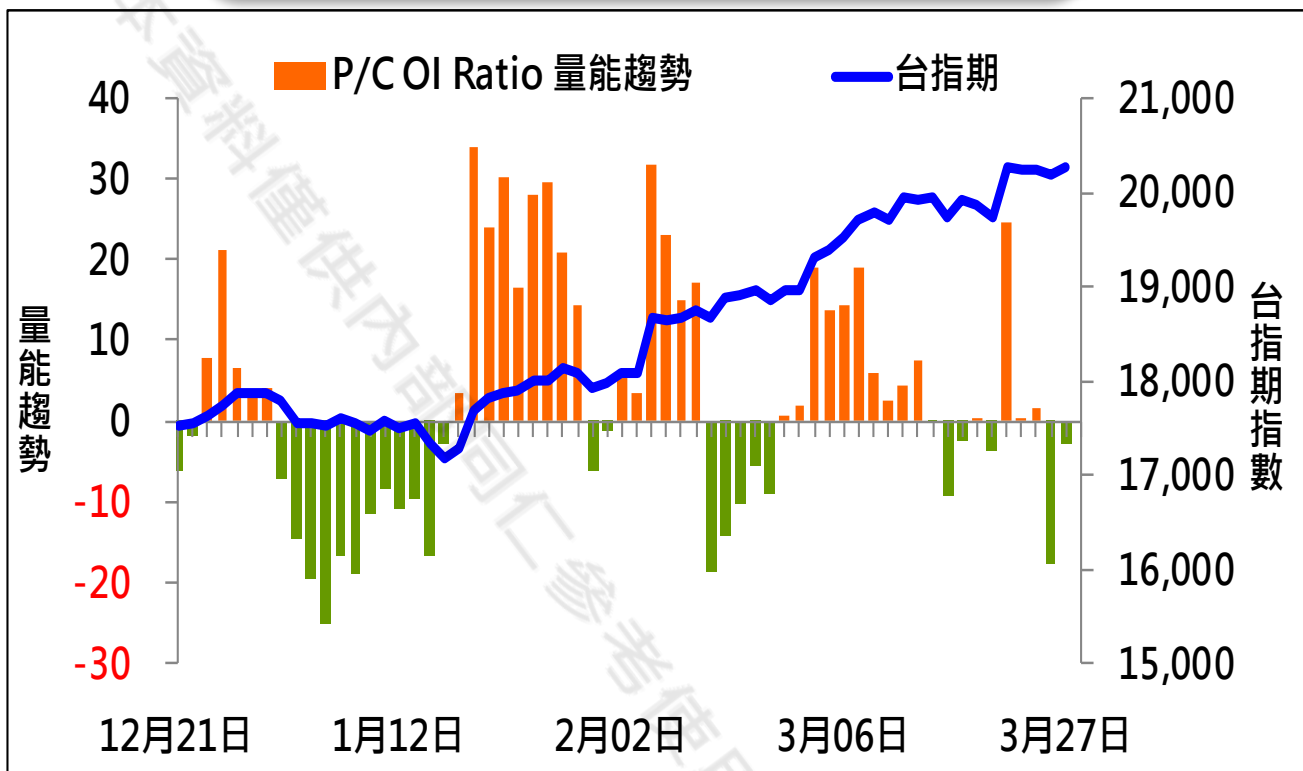
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)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 (112)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

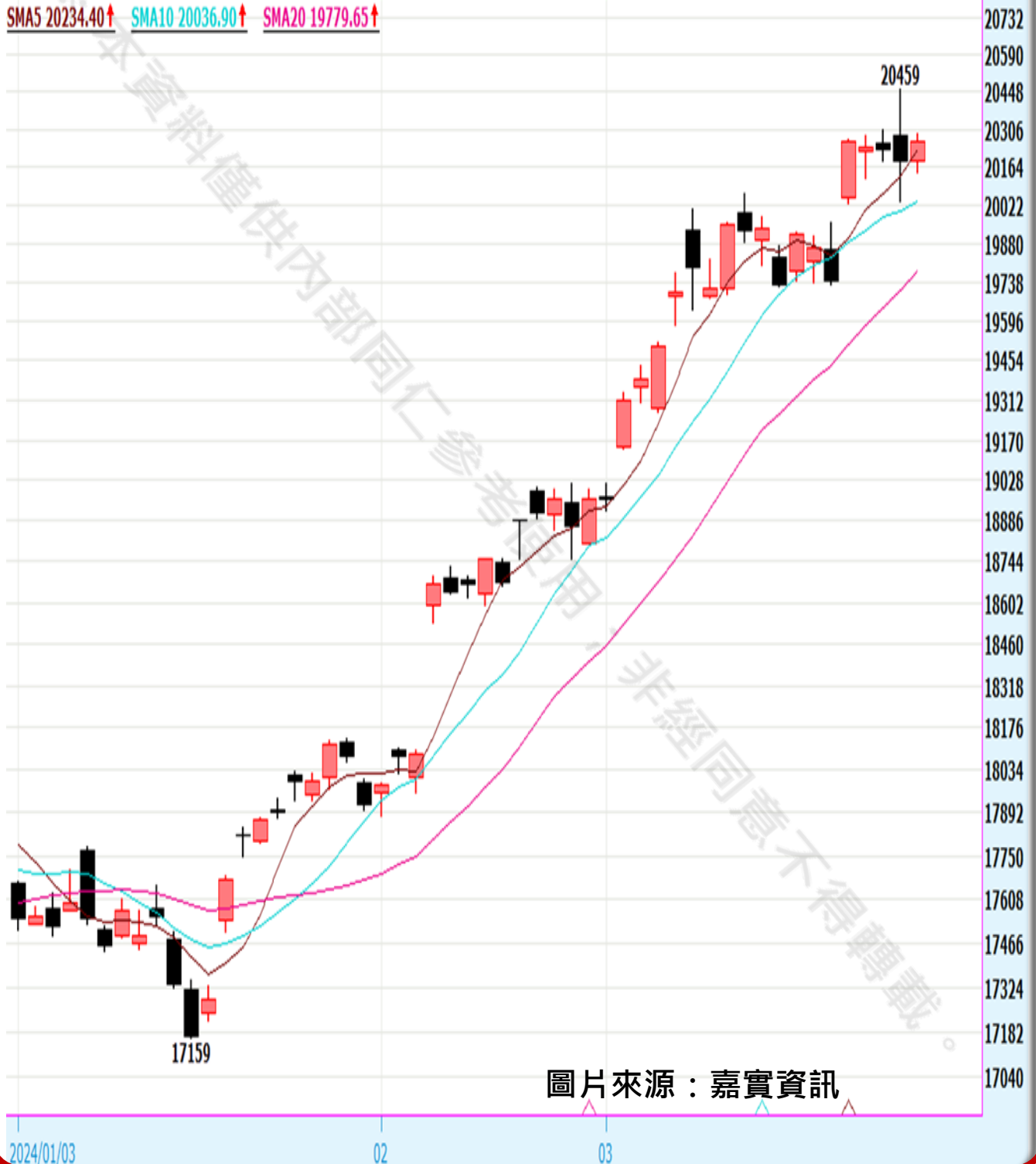
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## 盤後重點觀察

台股指數近月(一般)(FITX\*1) 日線圖 2024/03/27 開 20185 高 20288 低 20148 收 20258 s 點量 86234 口 +73 (+0.36%)

SMA5 20234.40↑ SMA10 20036.90↑ SMA20 19779.65↑



圖片來源：嘉實資訊

期權交易財務槓桿高，交易者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，交易者須自行判斷與負責，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 (112)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 (112)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