

## 法人籌碼動態

03月26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	-6,476	-1,290	86	-60	-746	-112
投信	4,592	-584	131	0	7	0
自營商	-6,301	-23	-312	48	-194	21
03月26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	30	1	14,592	2,685	27,898	1,175
投信	0	0	0	0	-172	0
自營商	-51	17	11,963	-545	7,748	5,373

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	16.69	鴻海	-15.61	台指期前十大 市場佔比	42.7%	44.2%
聯發科	5.15	台達電	-7.52			
台塑化	4.90	奇鋹	-5.18			
大同	3.91	緯創	-4.66			
士電	3.52	欣興	-3.93	電子期前十大 市場佔比	53.7%	56.3%
台塑	3.07	和碩	-3.17			
富邦金	2.82	瑞昱	-3.14			
南亞	2.81	世芯-KY	-2.81	金融期前十大 市場佔比	49.4%	84.3%
中華電	2.50	群光	-2.32			
兆豐金	2.49	緯穎	-2.25			
前十名合計	47.85	後十名合計	-50.59	非金電期前十大 市場佔比	97.4%	87.3%

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

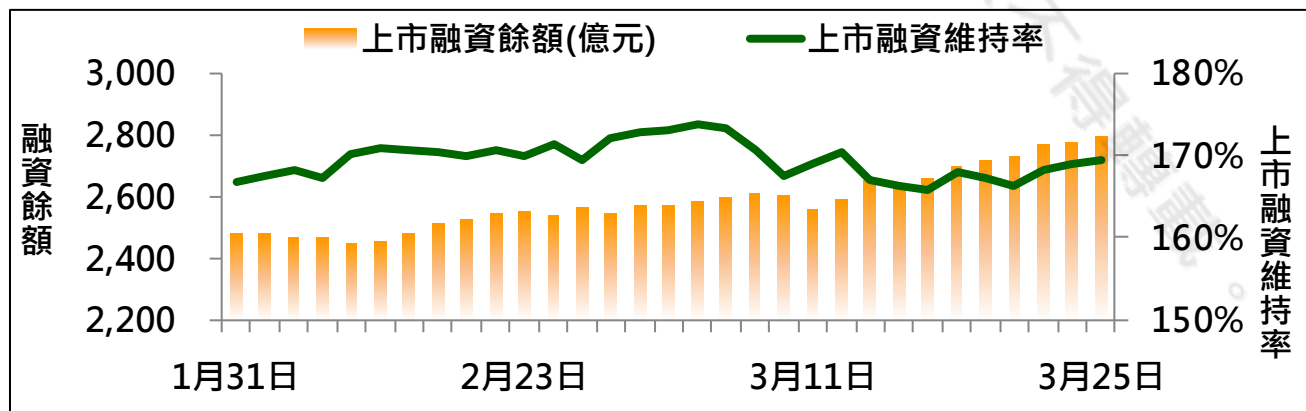
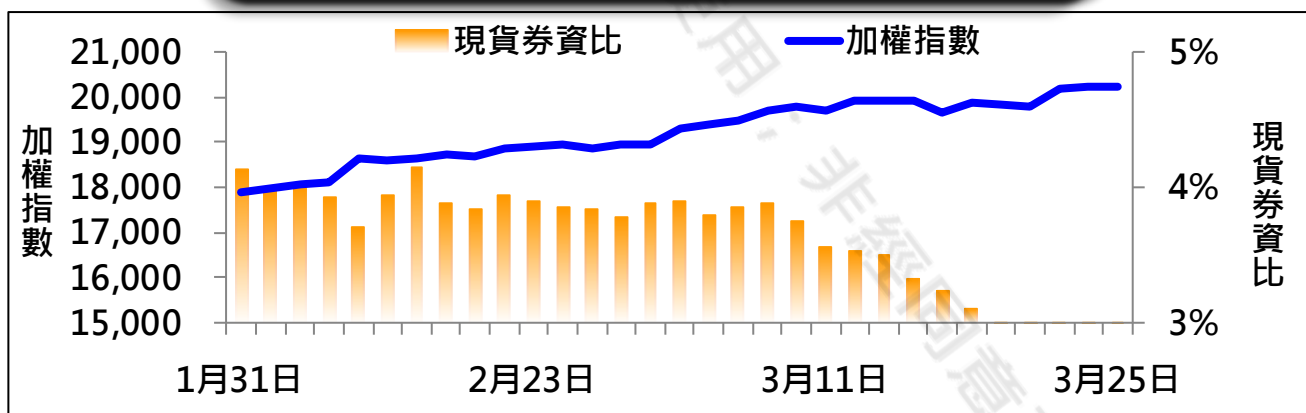
## 法人現貨、期貨 & 選擇權籌碼變化

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20日	-269.8	-4,788	6,188	-98.1	-6,250	-4,177
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

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20日	5,835	17,092	-11,257	11,125	-4,222	15,347
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

## 現貨券資比 & 上市融資維持率



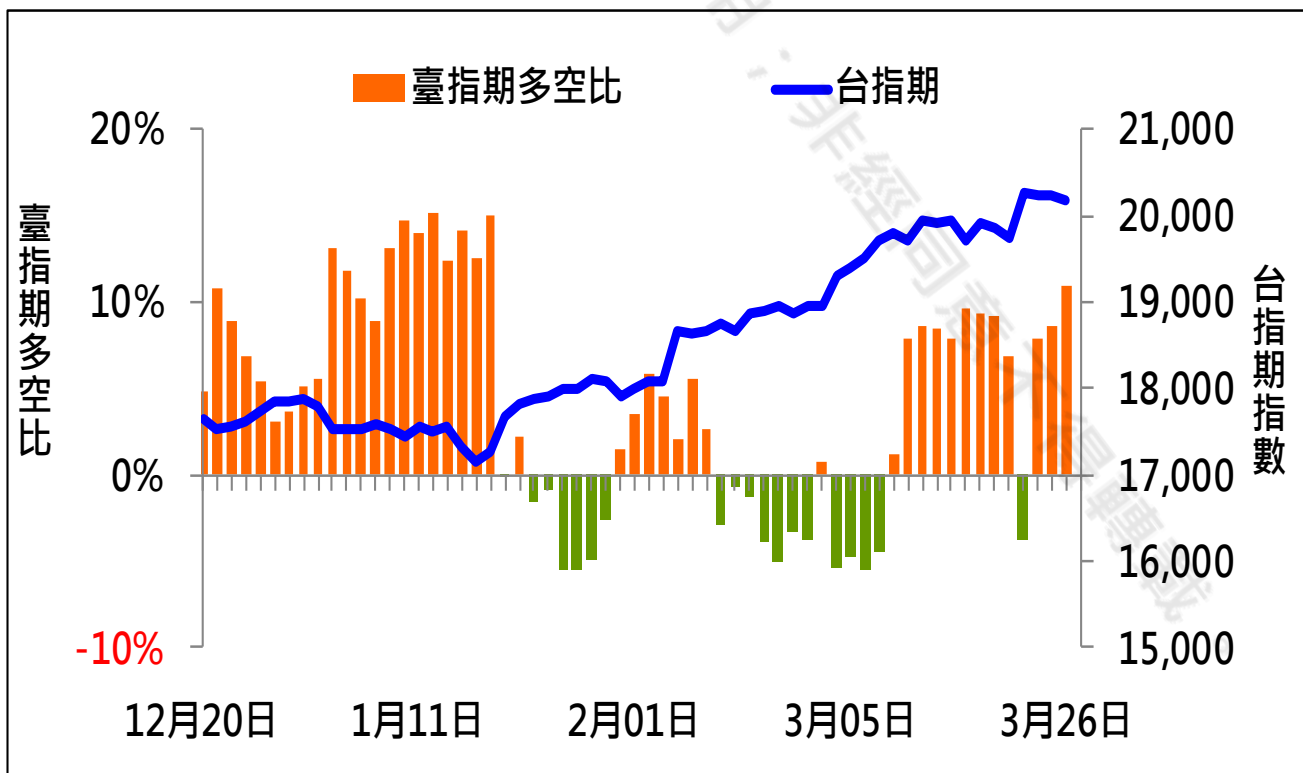
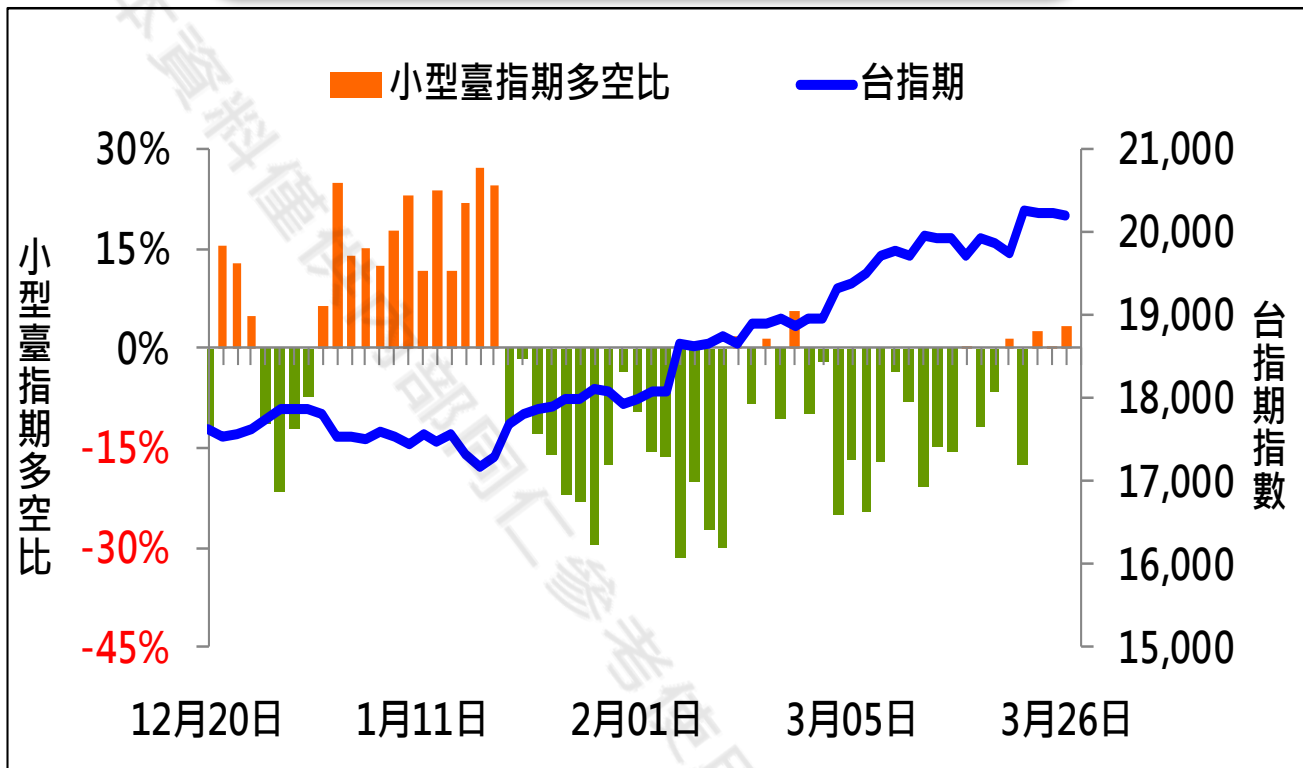
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

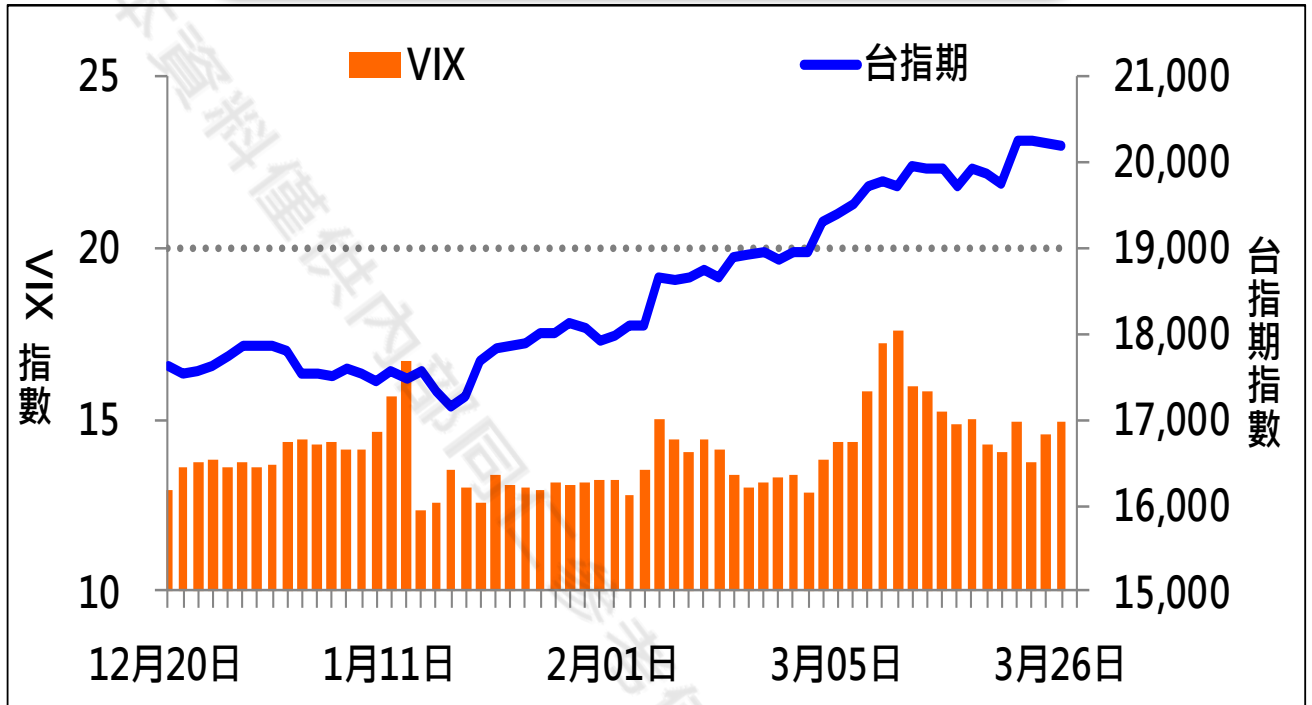


期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

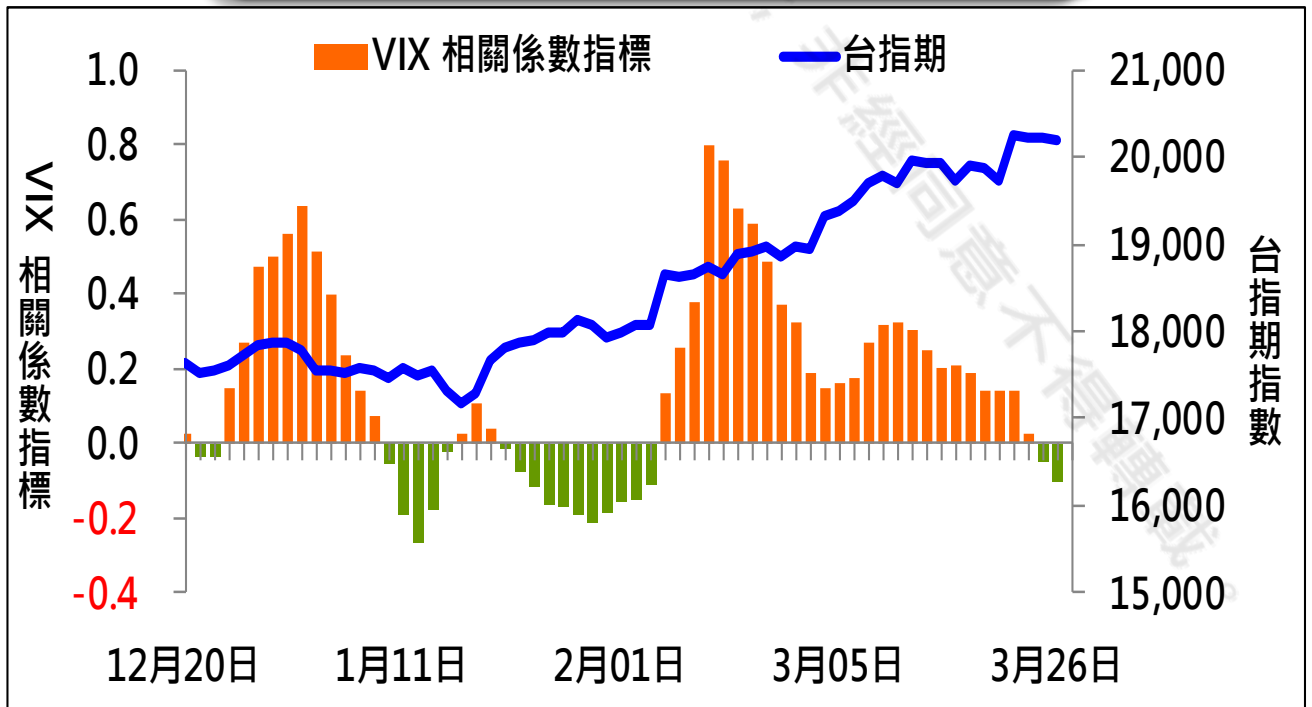
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年金管期總字第007號  
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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

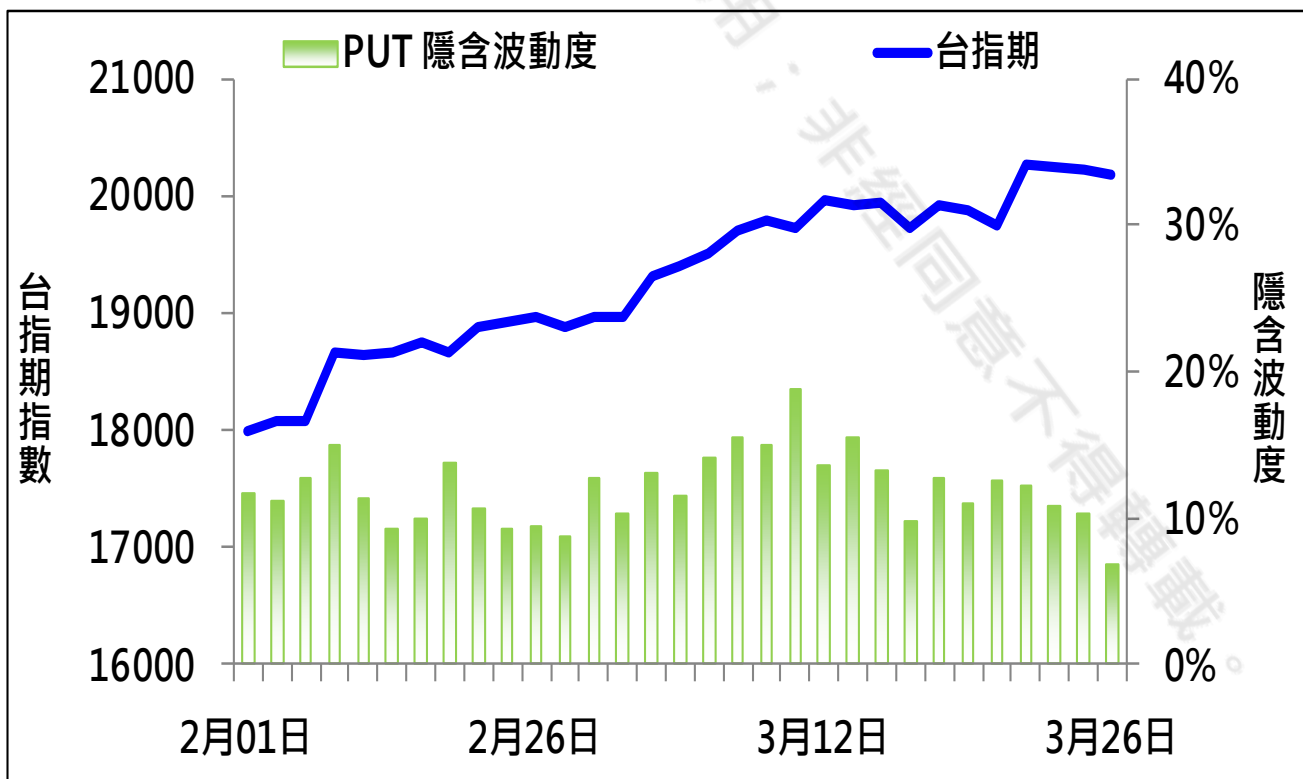
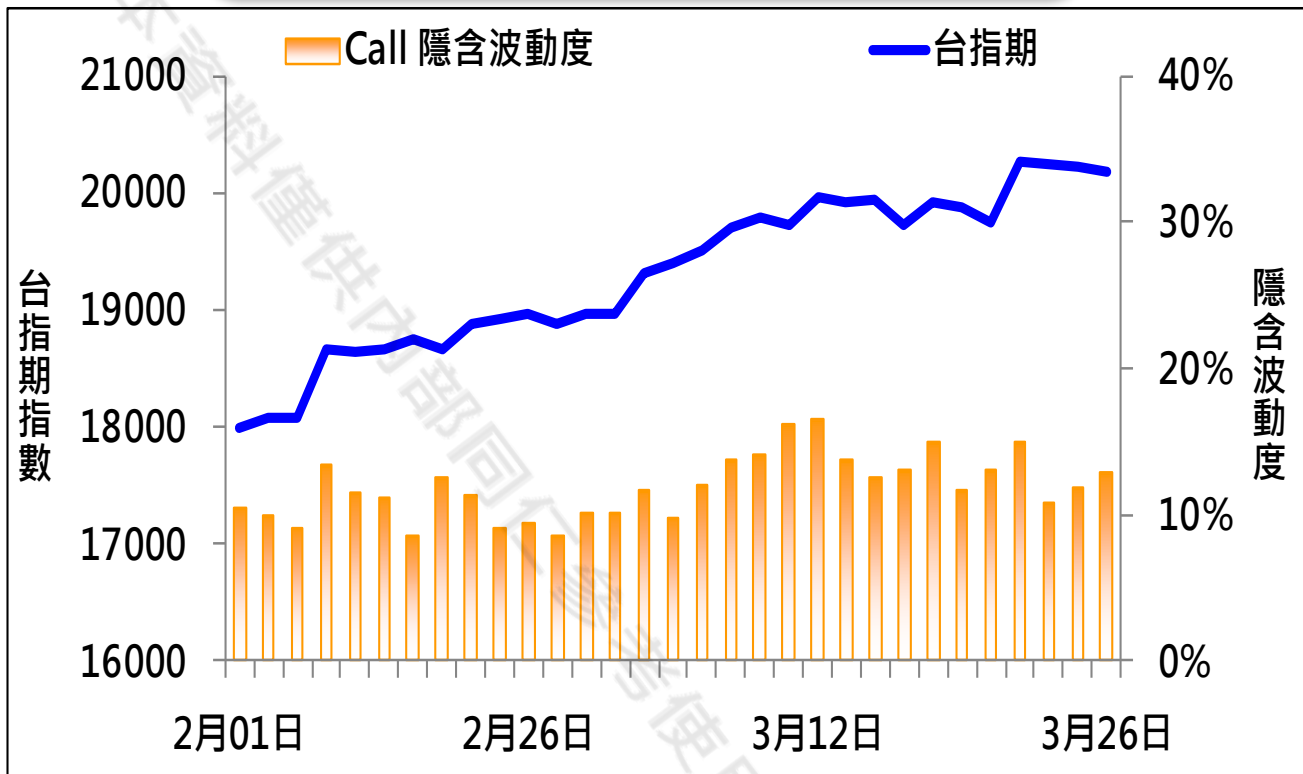


期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2024/3/26

結算日：2024/3/27

Call	202403W4 履約價	Put	OI 增減
2	19,400	3,587	-168
0	19,450	5,094	-408
0	19,550	4,262	-1,063
-13	19,600	4,437	-468
2	19,650	3,204	-553
-27	19,700	7,966	-1,685
-18	19,750	6,422	-379
-117	19,800	10,458	-1,307
8	19,850	8,299	-1,481
-137	19,900	9,372	-1,599
-164	19,950	8,101	-1,104
355	20,000	14,008	-111
285	20,050	9,198	2,892
1,390	20,100	9,757	2,193
2,336	20,150	6,503	413
2,881	20,200	7,136	895
2,584	20,250	2,458	-337
※ 9,097	20,300	3,484	802
4,753	20,350	1,600	792
3,921	20,400	1,294	686
1,821	20,450	265	62
-191	20,500	284	63
284	20,550	67	59
-2,108	20,600	36	10
849	20,650	29	28
-242	20,700	137	-2
706	20,750	50	50
26,957	總計	154,461	-4,838
P/C		增減	-0.2856

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

## 雙週選擇權OI變化

資料日期：2024/3/26

結算日：2024/4/17

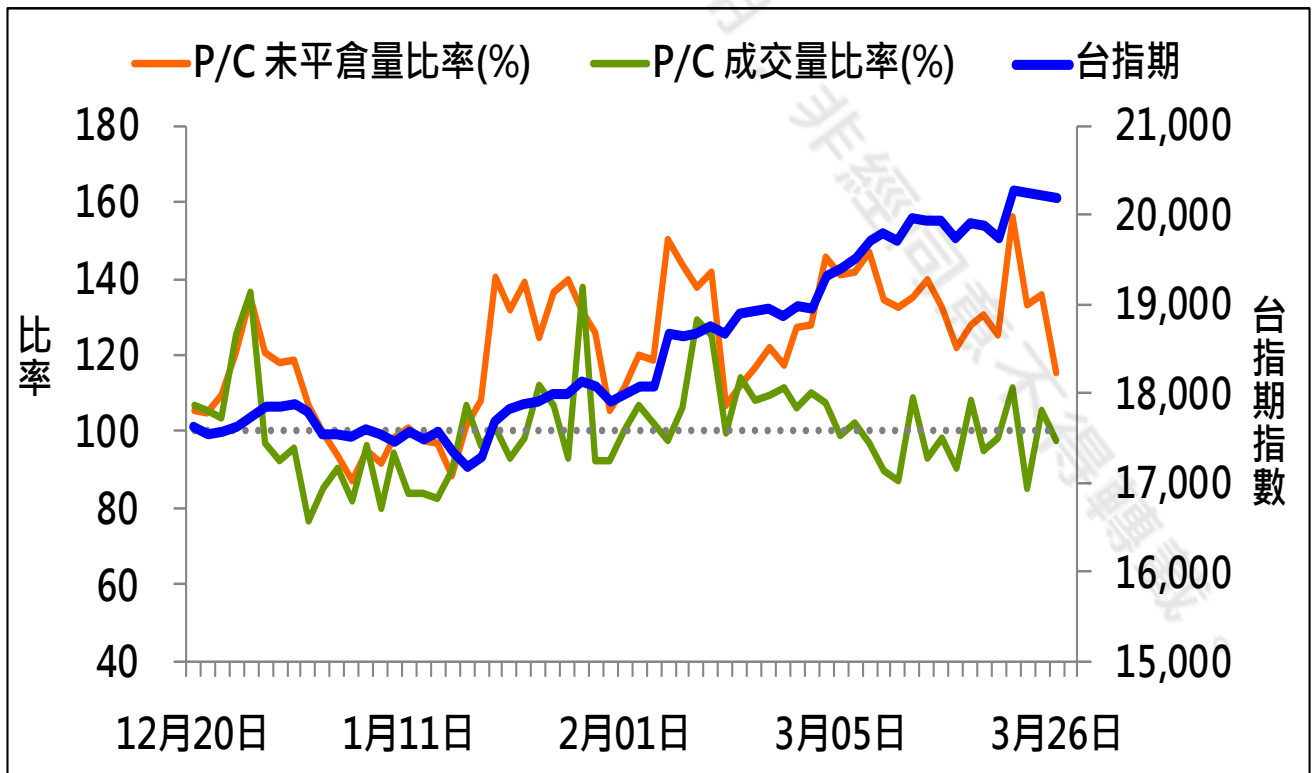
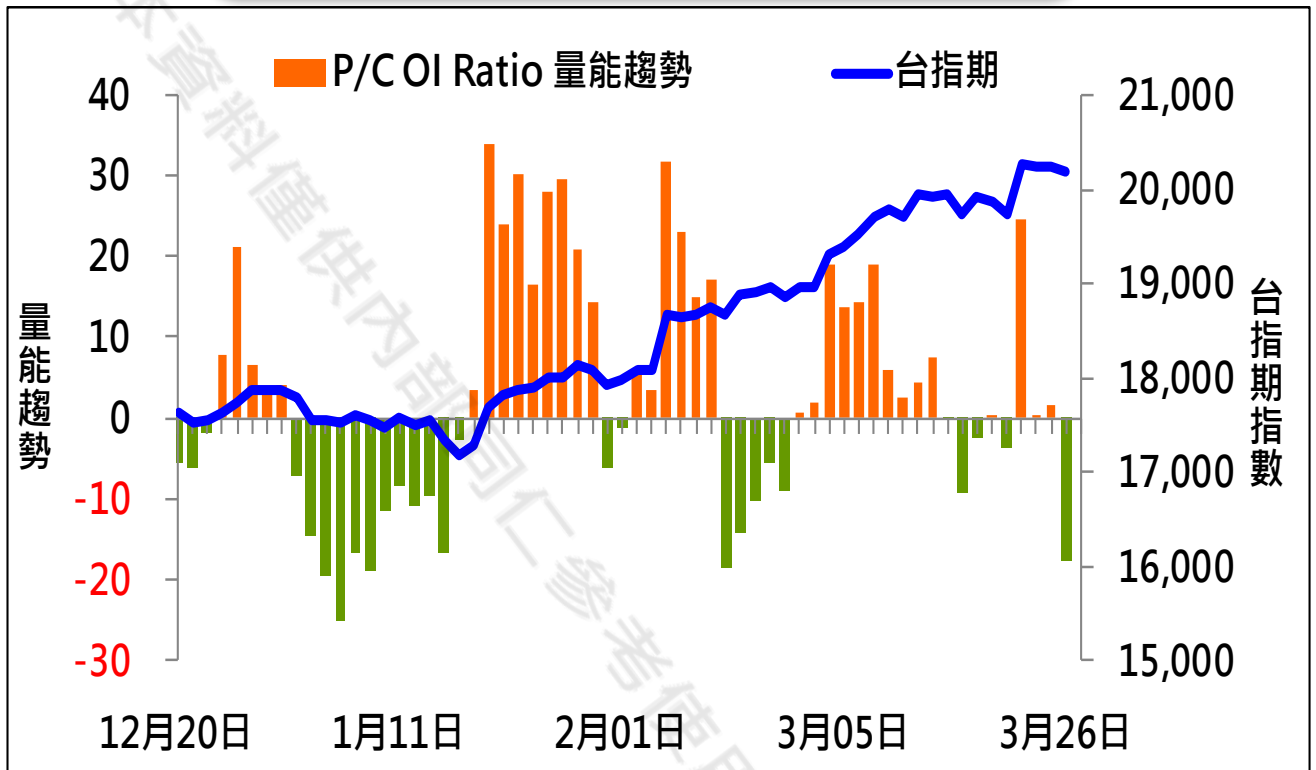
OI 增減	Call	202404 月 履約價	Put	OI 增減
0	32	18,700	1,797	510
3	96	18,800	1,381	-150
1	114	18,900	1,584	77
-1	196	19,000	7,272	606
0	110	19,100	1,529	99
0	100	19,200	2,821	375
-3	126	19,300	3,693	111
-6	264	19,400	2,380	-5
15	441	19,500	3,197	-53
-7	599	19,600	4,934	262
-2	663	19,700	3,022	274
179	1,631	19,800	3,790	933
-51	1,242	19,900	2,034	322
-195	2,130	20,000	2,060	94
26	1,653	20,100	2,330	612
-88	2,889	20,200	2,372	780
1,096	5,064	20,300	564	203
546	3,435	20,400	303	97
1,100	5,465	20,500	306	78
※ 1,679	4,419	20,600	81	-5
330	4,240	20,700	79	51
14	4,960	20,800	14	-2
222	3,323	20,900	4	3
772	3,544	21,000	14	9
68	1,120	21,100	2	2
-381	1,337	21,200	8	8
5,392	63,812	總計	67,538	5,795
P/C	1.0584		增減	0.0015

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

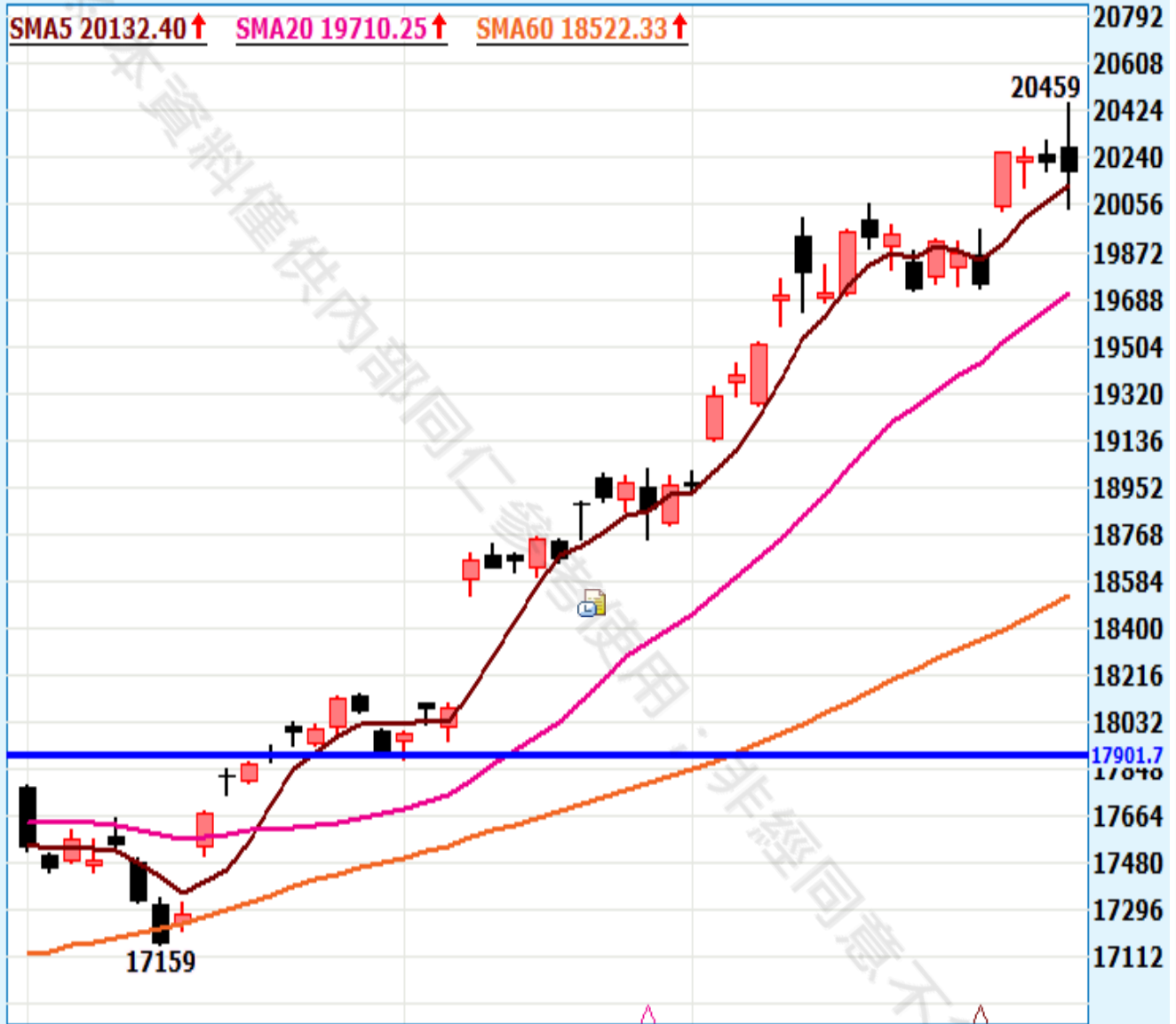
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



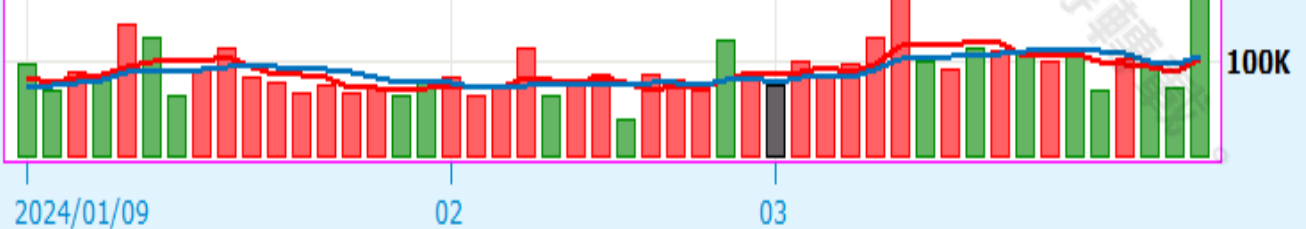
## 盤後重點觀察

台股指數近月(一般)(FITX\*1) 日線圖 2024/03/26 收 20185 點 量 173522 □ -44 (-0.22%)

SMA5 20132.40 ↑ SMA20 19710.25 ↑ SMA60 18522.33 ↑



成交量 173522 ↑ □ MA5 102494 ↑ □ MA10 104514 ↑ □



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 (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 (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

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