



法人籌碼動態

03月17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	-27,350	-449	259	751	-1,666	236
投信	-6,416	-94	78	-51	6	0
自營商	23,145	3,356	194	-249	589	-89

03月17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	-167	345	146	-11,538	13,139	-22,198
投信	1	0	0	500	-68	-1,999
自營商	175	-366	4,680	-4,410	-1,357	16,400

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	13.79	台塑化	-7.26	台指期前十大 市場佔比	51.6%	64.2%
聯詠	2.12	聯發科	-5.80			
愛普	1.89	富邦金	-3.43			
台達電	1.72	國泰金	-3.17			
南電	1.18	矽力-KY	-2.45	電子期前十大 市場佔比	77.6%	84.1%
陽明	0.86	南亞	-2.37			
長榮	0.80	台化	-1.94			
友達	0.80	國巨	-1.81	金融期前十大 市場佔比	62.9%	87.3%
中鋼	0.78	緯穎	-1.80			
微星	0.70	南亞科	-1.54	非金電期前十大 市場佔比	99.5%	100.0%
前十名合計	24.64	後十名合計	-31.57			

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

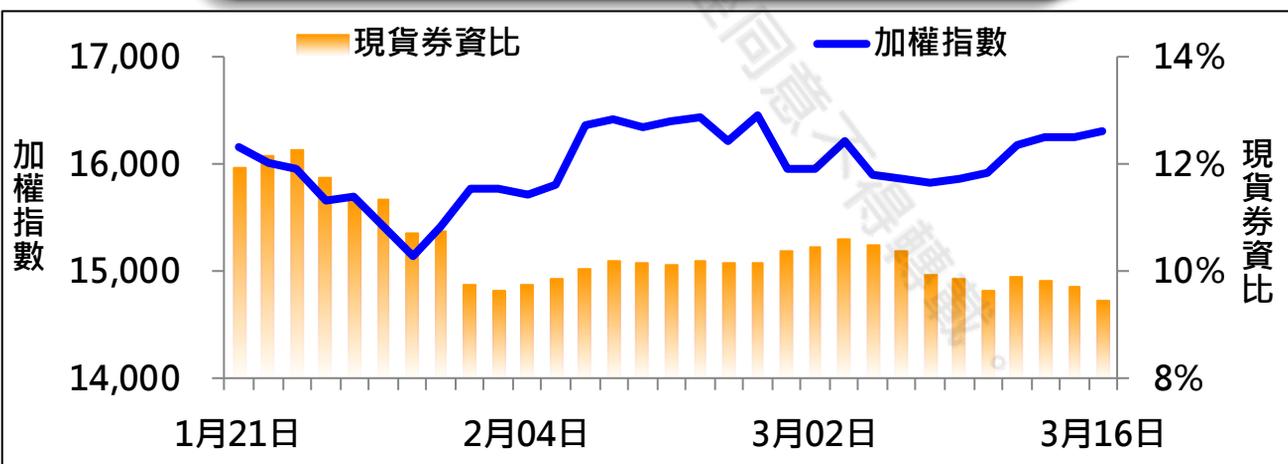


法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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11日	194.4	-27,138	-5,458	46.4	19,458	80
03月12日	60.2	-28,859	-1,721	9.8	21,063	1,605
03月15日	-29.7	-30,305	-1,446	-2.3	21,266	203
03月16日	-11.6	-26,901	3,404	8.5	19,789	-1,477
03月17日	-129.3	-27,350	-449	-10.7	23,145	3,356

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11日	14,398	21,594	-7,196	-2,689	-5,701	3,012
03月12日	12,846	25,588	-12,742	-3,018	-4,655	1,637
03月15日	14,037	32,753	-18,716	-6,020	-2,696	-3,324
03月16日	11,684	35,337	-23,653	9,090	-17,757	26,847
03月17日	146	13,139	-12,993	4,680	-1,357	6,037

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。

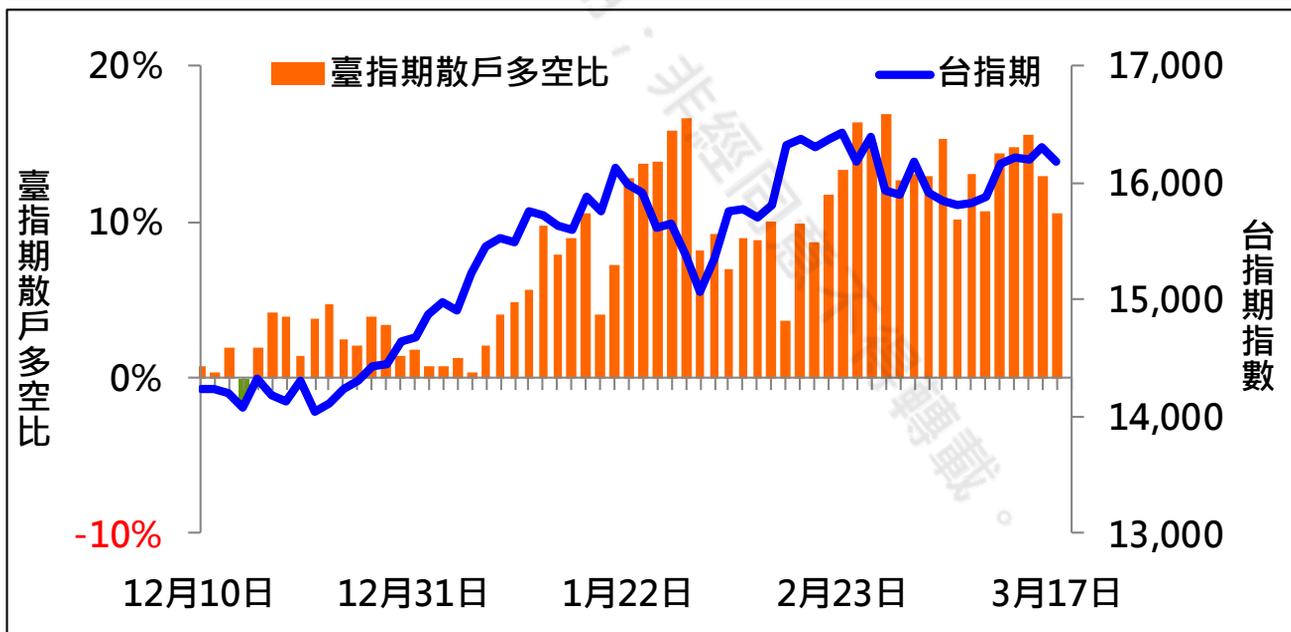
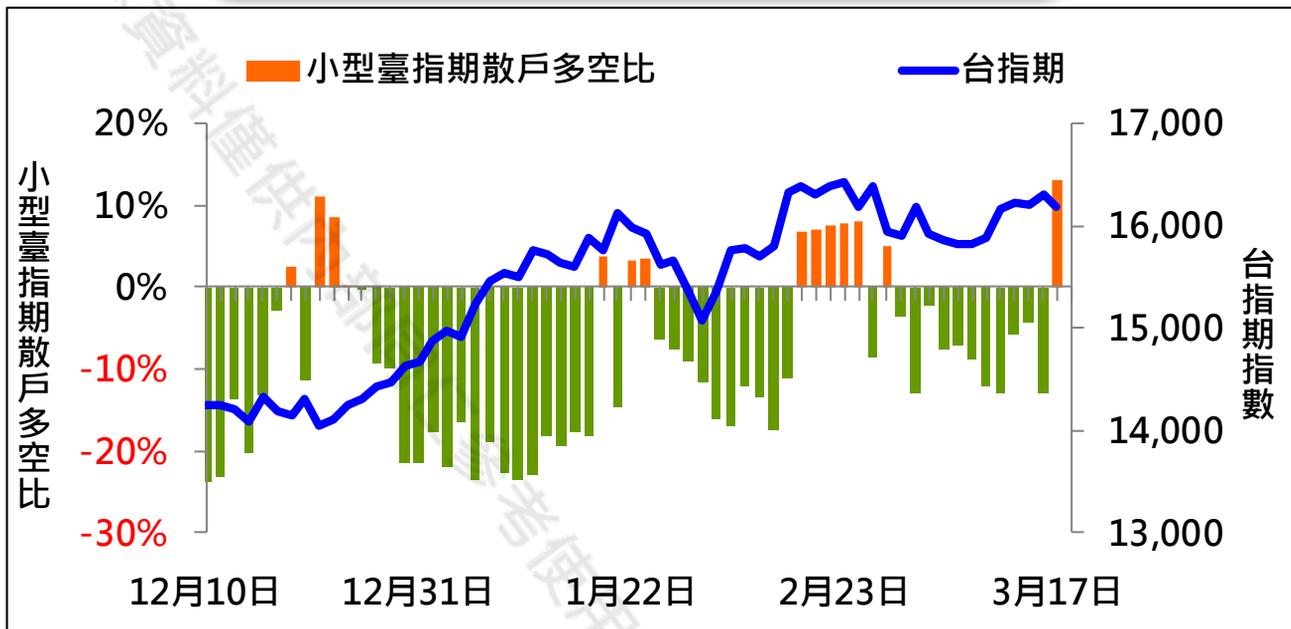
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

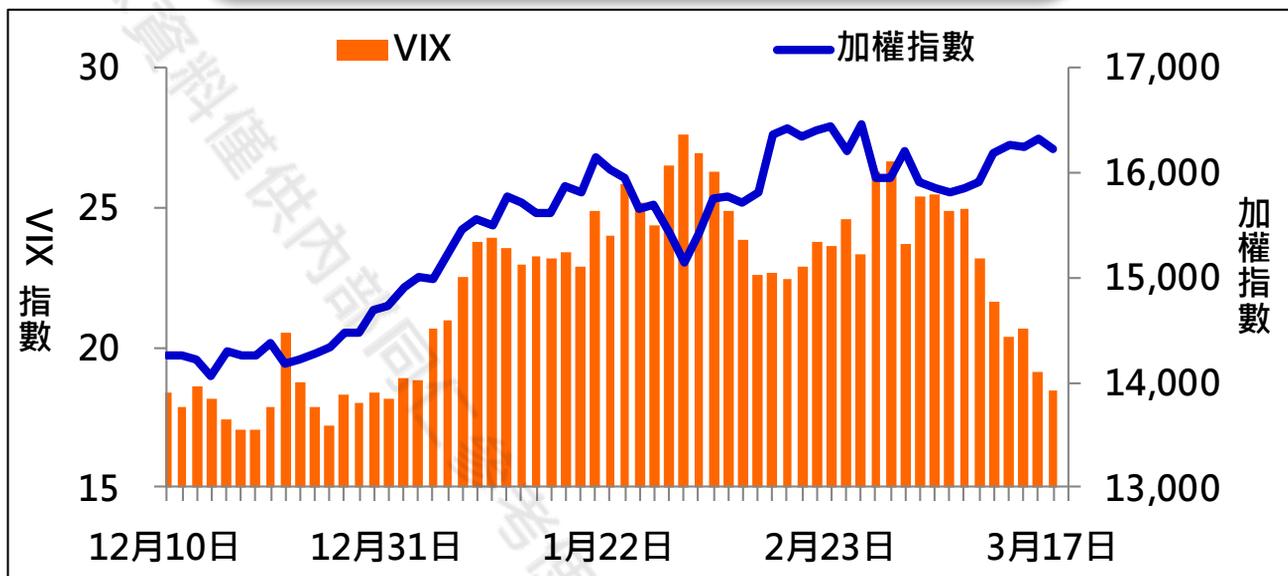
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

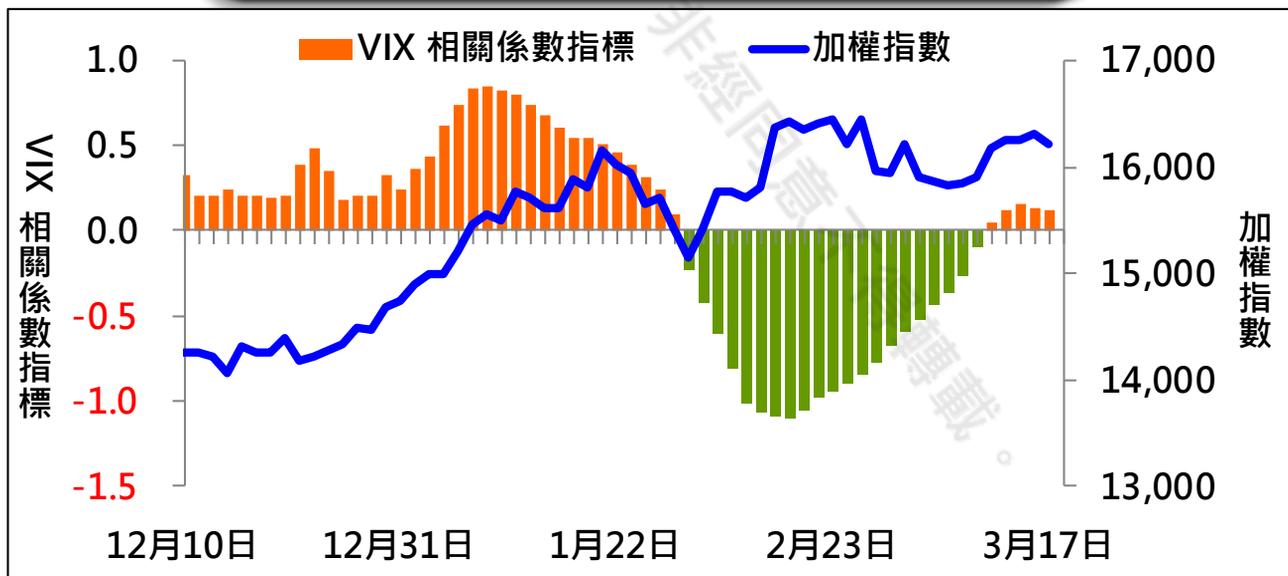
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標



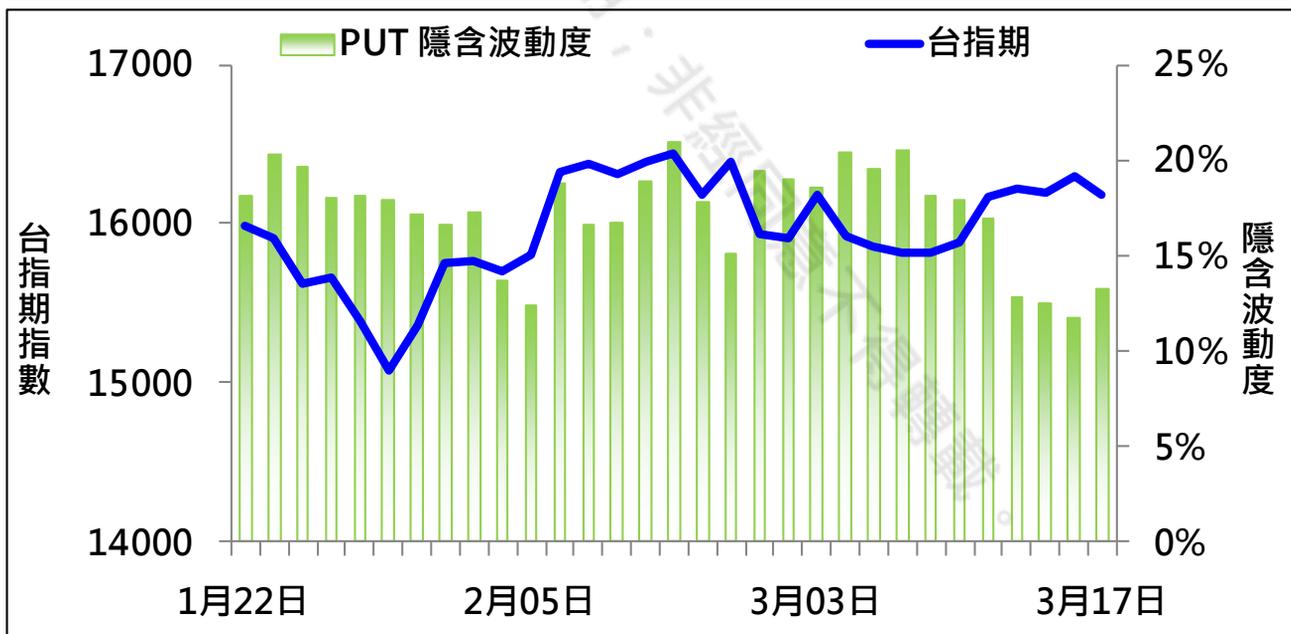
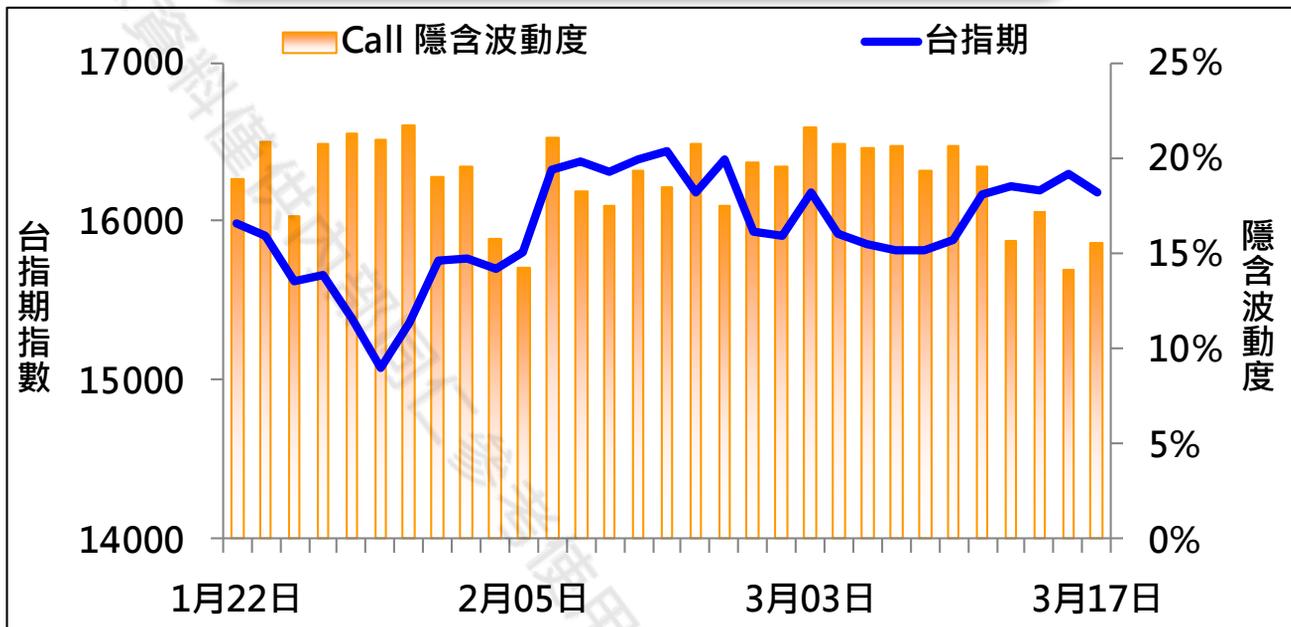
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/3/17

結算日：2021/3/24

OI 增減	Call	202103W4 履約價	Put	OI 增減
0	0	15,200	845	845
0	0	15,300	599	599
0	0	15,400	1,840	1,840
1	1	15,500	2,759	2,759
0	0	15,600	1,743	1,743
35	35	15,700	2,404	2,404
82	82	15,800	2,630	2,630
14	14	15,850	1,911	1,911
35	35	15,900	2,622	2,622
9	9	15,950	2,024	2,024
215	215	16,000	3,547	3,547
93	93	16,050	734	734
359	359	16,100	1,322	1,322
1,302	1,302	16,200	1,169	1,169
1,858	1,858	16,250	772	772
2,489	2,489	16,300	532	532
2,096	2,096	16,350	222	222
2,686	2,686	16,400	234	234
2,408	2,408	16,450	32	32
※ 3,636	3,636	16,500	55	55
2,378	2,378	16,550	6	6
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
32,898	32,898	0.9174	30,182	30,182

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：2021/3/17

結算日：2021/4/21

OI 增減	Call	202104月 履約價	Put	OI 增減
1	10	15,000	4,302	1,083 ※
0	2	15,100	1,366	437
3	12	15,200	2,043	385
0	26	15,300	2,297	338
5	71	15,400	1,898	373
9	52	15,500	3,317	226
1	101	15,600	3,459	61
26	132	15,700	1,117	178
13	197	15,800	2,141	55
65	531	15,900	1,665	-82
199	1,232	16,000	2,678	317
343	1,327	16,100	1,716	853
429	1,395	16,200	1,623	655
202	2,251	16,300	934	223
357	1,512	16,400	408	210
379	2,025	16,500	93	12
489	1,262	16,600	49	0
183	2,542	16,700	60	6
533	3,130	16,800	38	7
408	1,739	16,900	26	25
※ 1,167	4,202	17,000	52	48
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
7,521	39,971	1.4086	56,305	7,505

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。

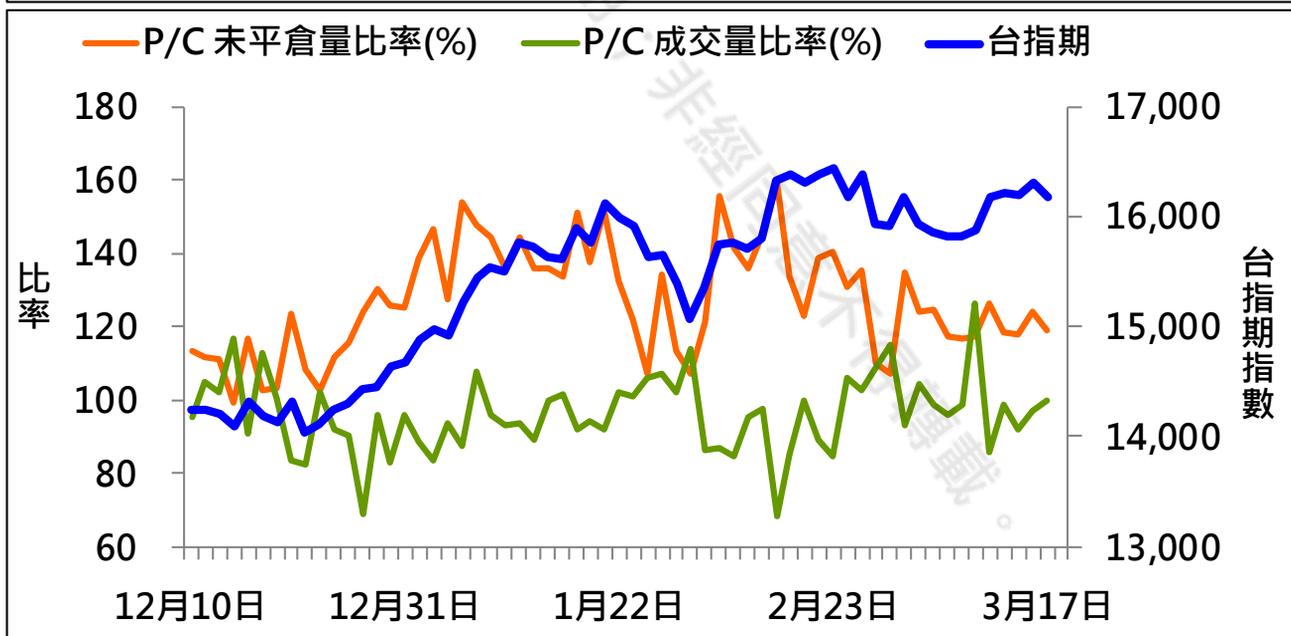
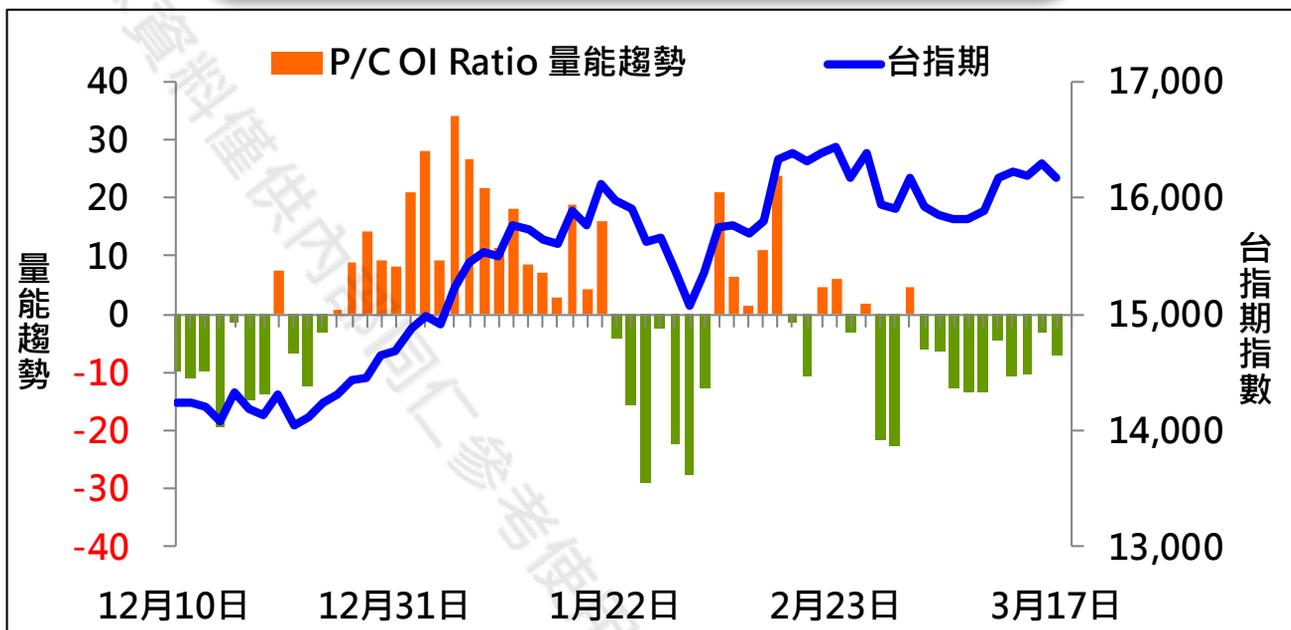
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

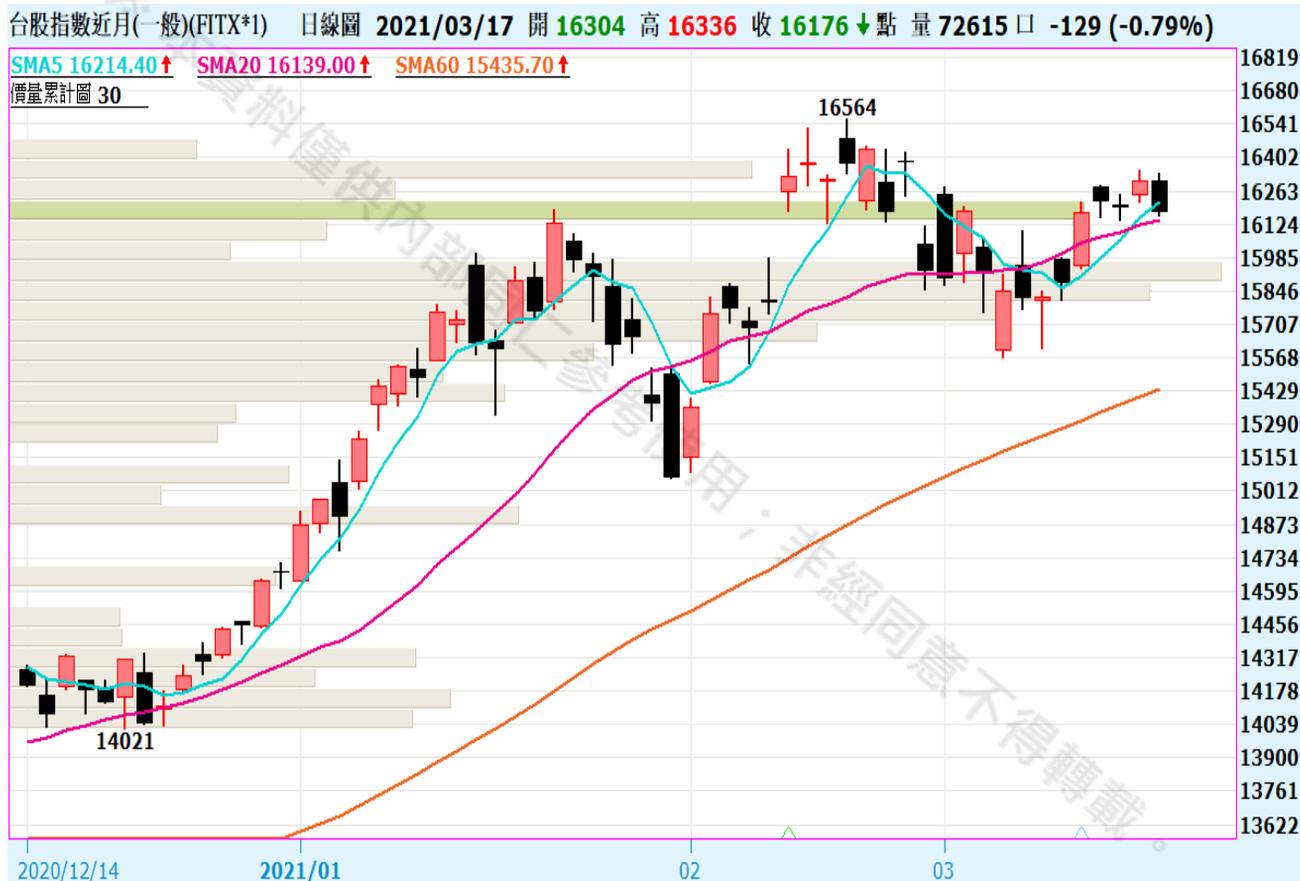
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



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



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