



## 法人籌碼動態

03月18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	-26,714	636	-42	-301	-1,276	390
投信	-6,369	47	78	0	6	0
自營商	22,464	-681	375	181	275	-314

03月18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	-186	-19	15,094	14,948	16,961	3,822
投信	1	0	-250	-250	682	750
自營商	187	12	14,637	9,957	-2,605	-1,248

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	16.01	台積電	-17.12	台指期前十大 市場佔比	49.0%	61.5%
華碩	7.97	聯電	-3.89			
聯詠	6.23	聯發科	-2.62			
日月光投控	5.01	國泰金	-1.70	電子期前十大 市場佔比	78.1%	80.2%
大立光	3.76	億豐	-1.64			
廣達	3.70	國巨	-1.48			
南亞科	3.68	台塑	-1.05	金融期前十大 市場佔比	63.8%	85.0%
台達電	3.43	中鋼	-1.04			
南電	2.88	矽力-KY	-0.92			
長榮	2.46	愛普	-0.71	非金電期前十大 市場佔比	97.7%	99.7%
前十名合計	55.12	後十名合計	-32.17			

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

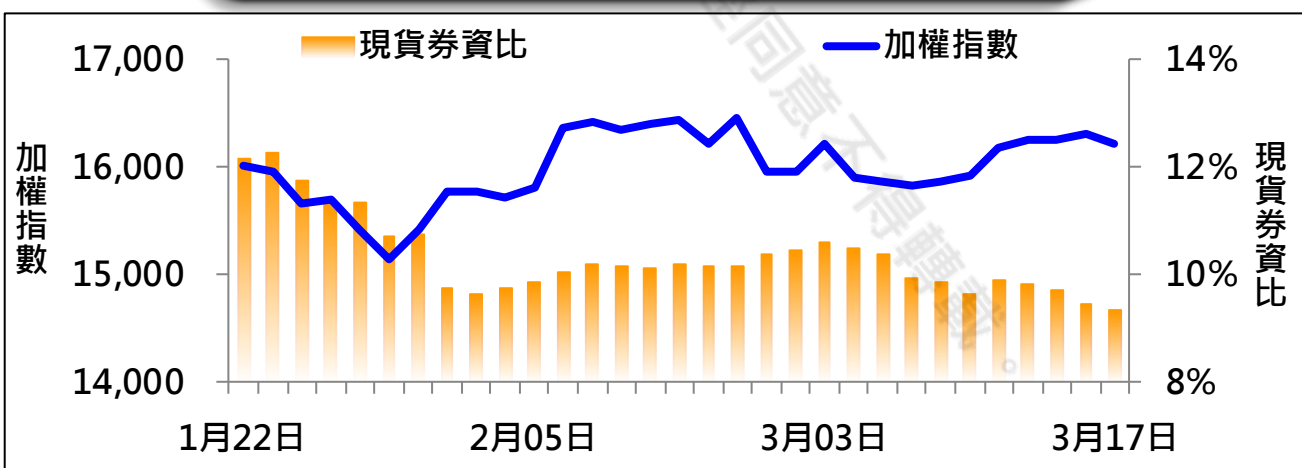


## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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
03月18日	108.1	-26,714	636	36.7	22,464	-681

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
03月18日	15,094	16,961	-1,867	14,637	-2,605	17,242

## 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。

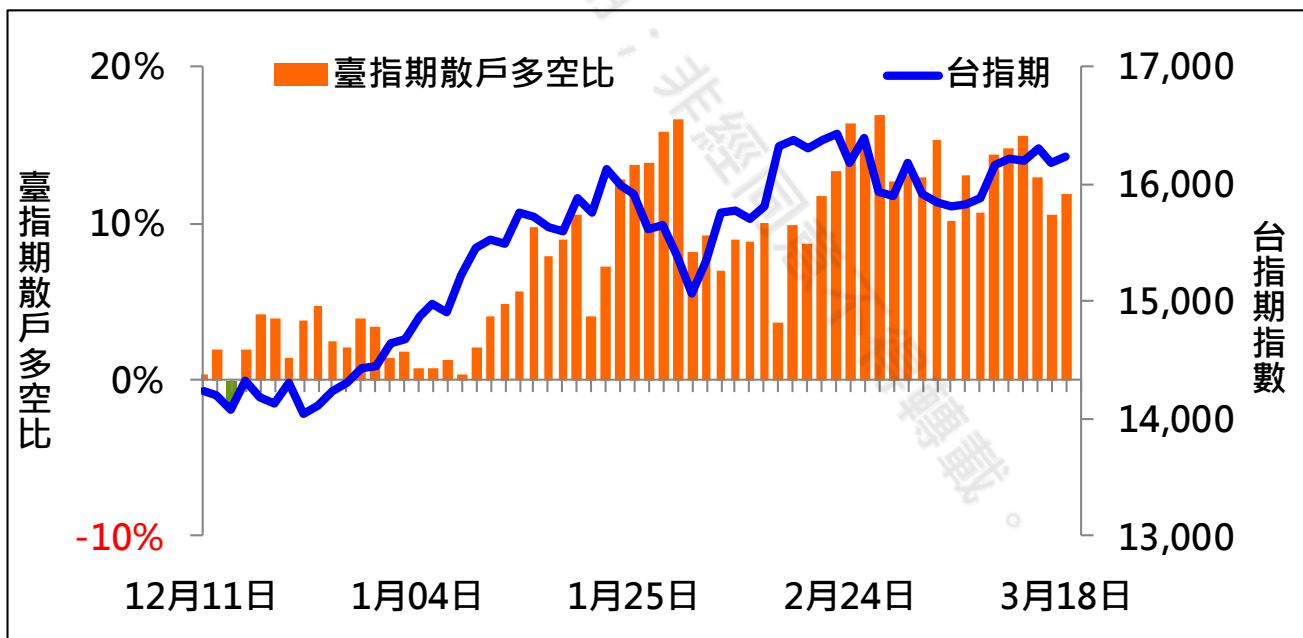
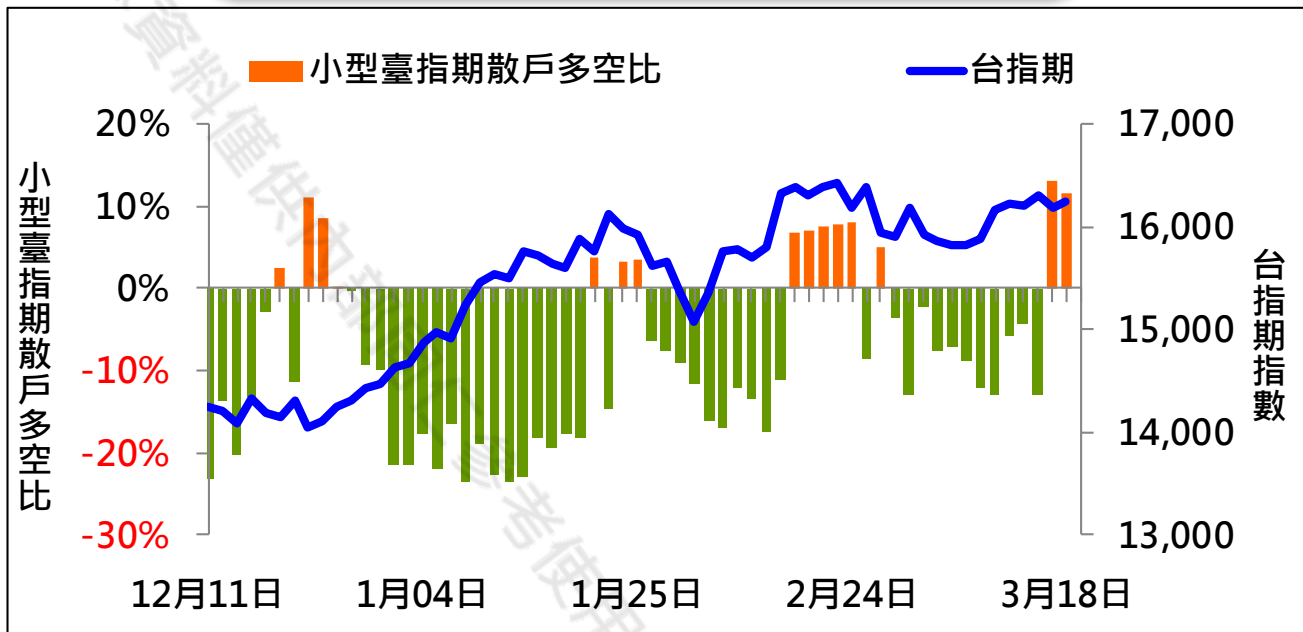
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

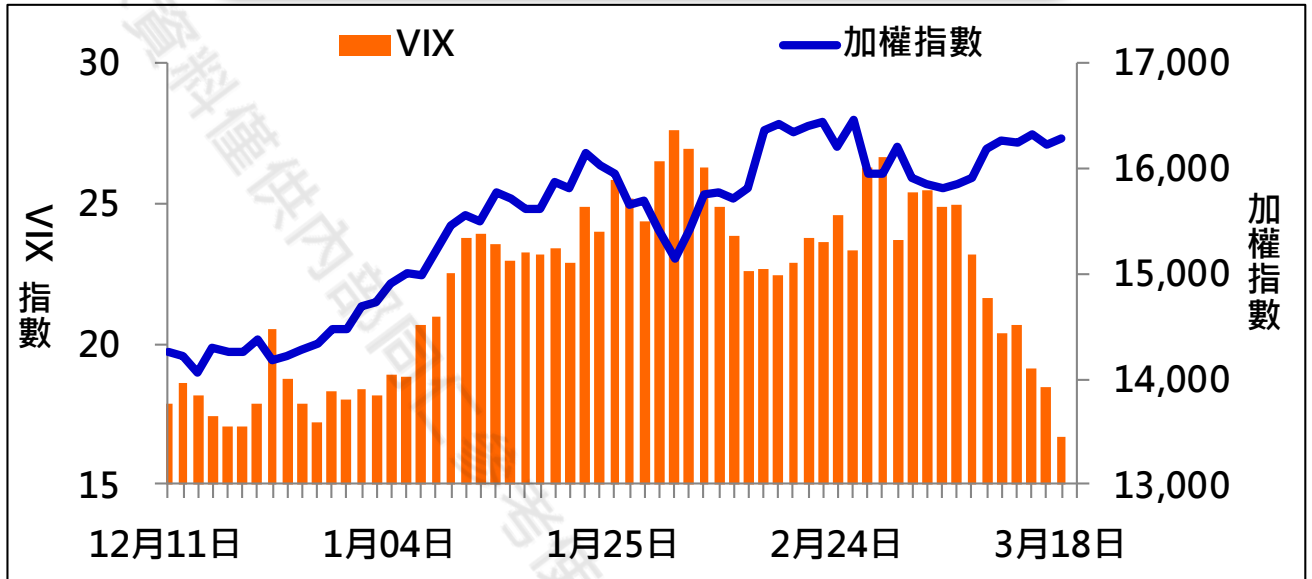
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

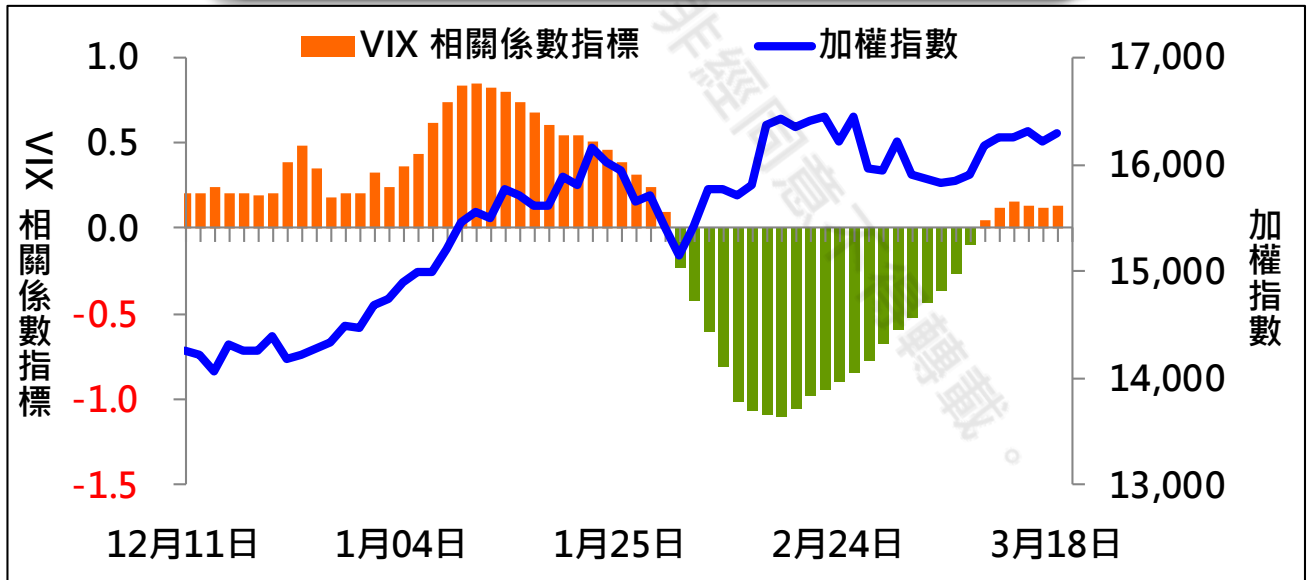
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



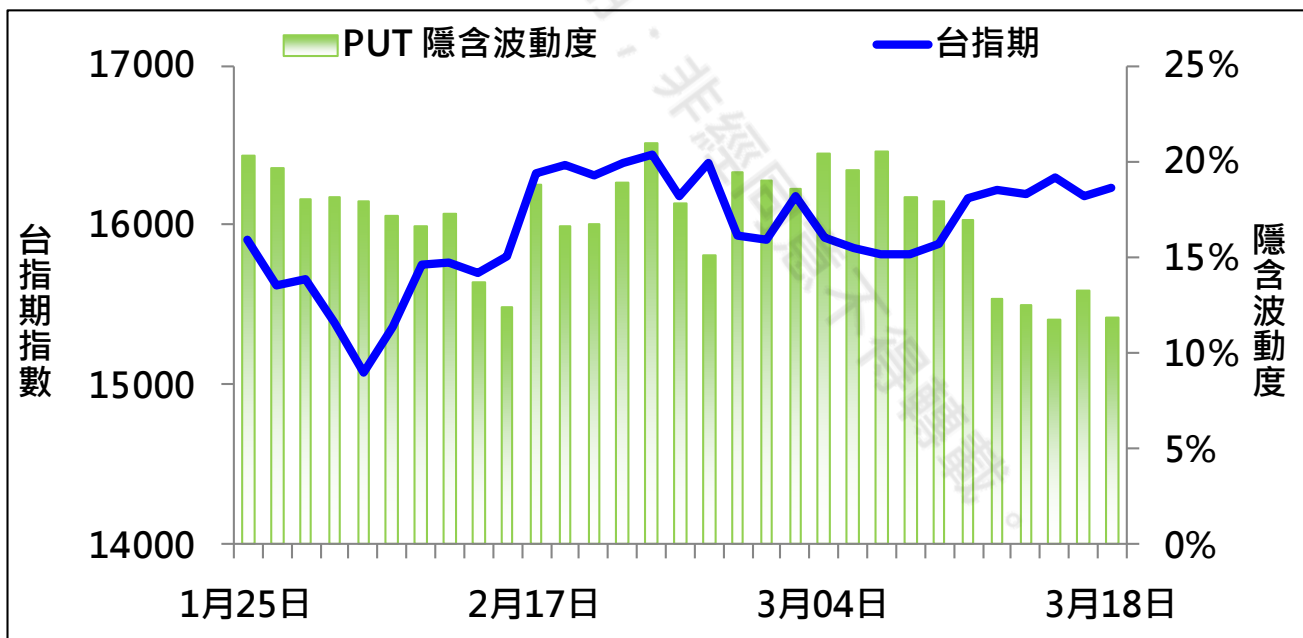
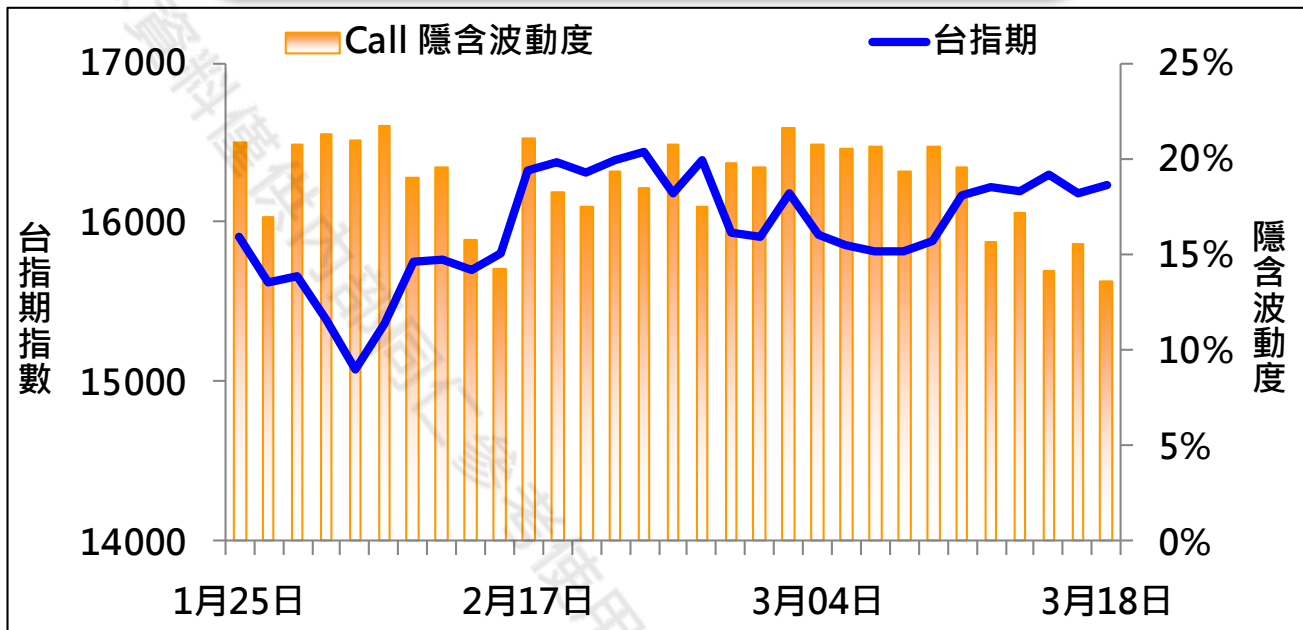
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/3/18

結算日：2021/3/24

OI 增減	Call	202103W4 履約價	Put	OI 增減
25	25	15,600	5,100	3,357
-4	31	15,700	6,126	3,722
1	1	15,750	1,607	1,607
13	95	15,800	6,351	3,721
34	48	15,850	3,565	1,654
52	87	15,900	8,723	6,101
48	57	15,950	5,176	3,152
180	395	16,000	10,060	6,513 ※
108	201	16,050	3,331	2,597
527	886	16,100	4,378	3,056
409	695	16,150	3,603	2,706
714	2,016	16,200	4,169	3,000
1,037	3,526	16,300	2,708	2,176
1,747	3,843	16,350	946	724
1,203	3,889	16,400	1,262	1,028
1,262	3,670	16,450	335	303
3,584	7,220	16,500	261	206
3,199	5,577	16,550	111	105
※ 7,914	10,704	16,600	77	62
3,330	5,798	16,650	15	14
5,091	7,132	16,700	67	47
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
43,162	74,488	1.0920	81,338	51,031

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：2021/3/18

結算日：2021/4/21

OI 增減	Call	202104月 履約價	Put	OI 增減
1	11	15,000	5,600	1,298
0	2	15,100	2,586	1,220
10	22	15,200	2,537	494
11	37	15,300	3,063	766
3	74	15,400	2,148	250
9	61	15,500	3,805	488
7	108	15,600	4,975	1,516
15	147	15,700	1,495	378
11	208	15,800	2,742	601
1	532	15,900	1,742	77
144	1,376	16,000	3,497	819
61	1,388	16,100	2,662	946
138	1,533	16,200	3,393	1,770
1,158	3,409	16,300	2,399	1,465
924	2,436	16,400	633	225
559	2,584	16,500	222	129
858	2,120	16,600	78	29
971	3,513	16,700	99	39
878	4,008	16,800	43	5
521	2,260	16,900	41	15
※ 2,487	6,689	17,000	59	7
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
12,974	52,945	1.3282	70,323	14,018

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。

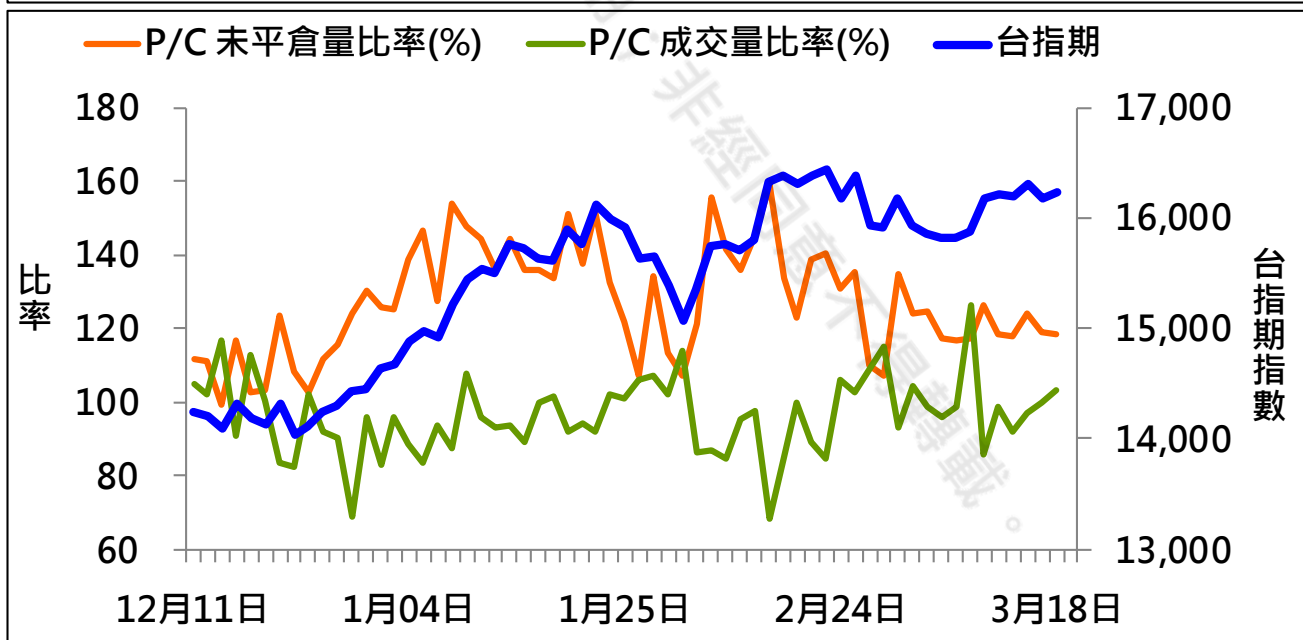
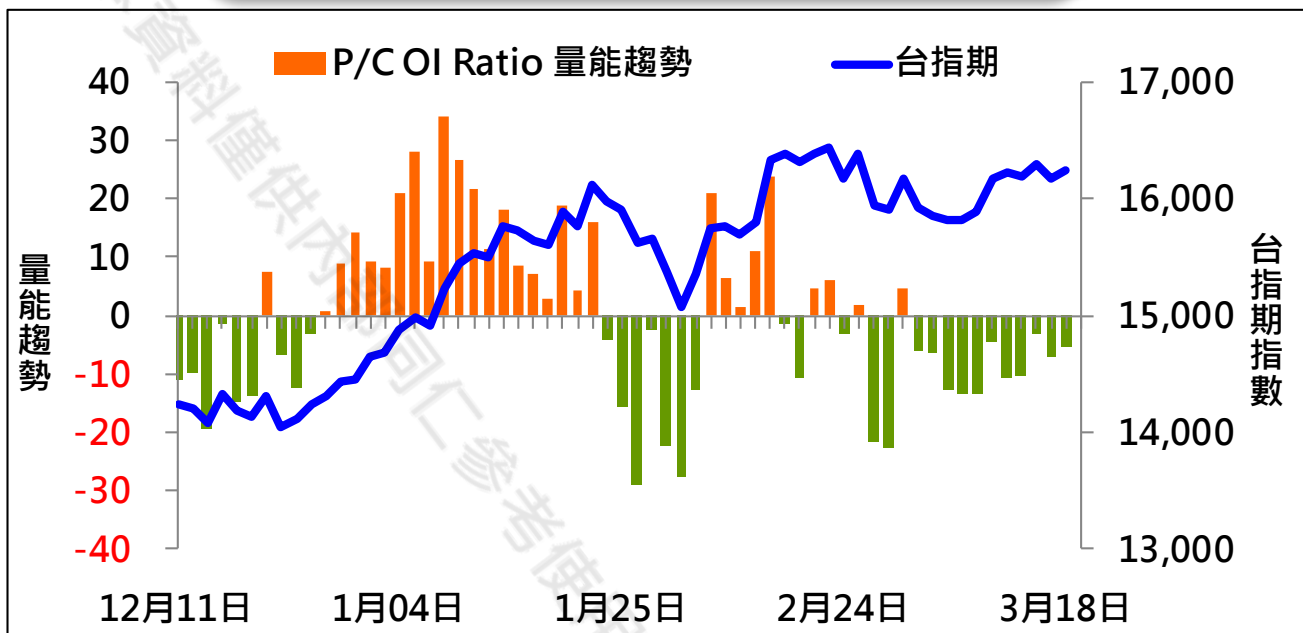
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



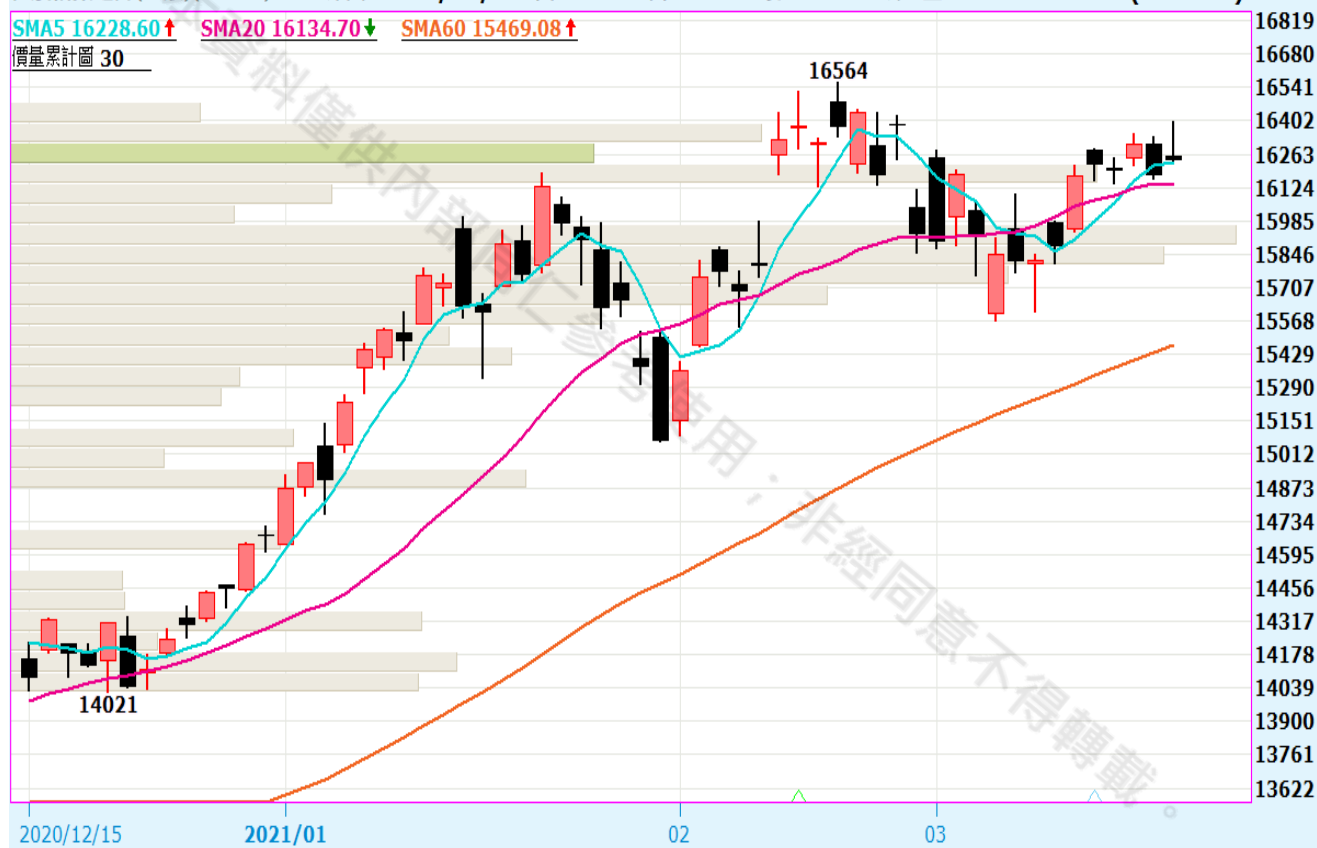


## 盤後重點觀察

台股指數近月(一般)(FITX\*1) 日線圖 2021/03/18 開 16255 高 16401 收 16239 ↑ 點 量 138744 口 +62 (+0.38%)

SMA5 16228.60 ↑ SMA20 16134.70 ↓ SMA60 15469.08 ↑

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



## 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