



華南金融集團

華南期貨股份有限公司 (98)金管期總字第019號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL:(02)2718-0000 FAX:(02)2546-3708

3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4, Taipei, TAIWAN

台指期貨 2017年02月22日 星期三 收盤日報

法人動態：

台股現貨買賣起													
單位：億	買進	賣出	合計	累計本月至今日		個股貢獻點數前十名				個股貢獻點數後十名			
外資及陸資	236.94	208.81	28.13	460.11		大立光	7.08	台積電	-17.11				
投信	10.87	11.78	-0.91	-13.02		台塑化	6.29	台塑	-2.24				
自營商	58.44	47.61	10.84	60.94		台玻	1.92	國泰金	-2.21				
合計	306.25	268.20	38.05	508.03		台泥	1.87	台灣大	-1.50				
2/21融資(億)	59.74	57.66	2.08	前日	1382.06	和碩	1.70	南亞	-1.40				
2/21融券(張)	27765	31896	4131	餘額	459553	友達	1.48	富邦金	-1.35				
單位：口	多			空		日月光	1.27	聯電	-1.11				
2/21庫台2月多空比	402			660		TPK-KY	1.25	和泰車	-0.72				
台指期前十大佔市場比率	53.5%			46.3%		台達電	1.14	統一起	-0.69				
電子期前十大佔市場比率	53.1%			77.4%		致茂	1.10	玉晶光	-0.53				
金融期前十大佔市場比率	63.9%			68.9%		前十名合計	25.09	後十名合計	-28.86				
期貨未平倉	台指期		電子期		金融期		台指選擇權(買權)			台指選擇權(賣權)			
多空淨額	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	前日未平倉	增減	未平倉	前日未平倉	增減	
外資及陸資	58196	-2614	910	1	-1596	36	69640	71083	-1443	76482	79053	-2571	
投信	-37793	354	17	0	-110	0	0	0	0	0	0	0	
自營商	-4969	620	-5	5	-245	-25	-6586	18778	-25364	-17107	21622	-38729	

外資現貨買賣起前10名個股

買起					
排名	公司	張數	排名	公司	張數
1	鴻海	8,748	6	中租-KY	4,958
2	新光金	7,333	7	華南金	4,408
3	大同	6,759	8	元大S&P原油正2	4,352
4	台積電	6,731	9	集盛	4,125
5	兆豐金	5,053	10	晶電	3,767

賣起					
排名	公司	張數	排名	公司	張數
1	聯電	-17,378	6	元大金	-6,529
2	群創	-15,338	7	永豐金	-6,366
3	元大滬深300正2	-10,172	8	富邦金	-5,841
4	友達	-9,364	9	玉山金	-4,484
5	富邦上証正2	-8,008	10	中華電	-4,383

觀盤重點提示

- 國際金融:歐美股市本週二普遍上漲,歐洲股市受到歐元區、德國及法國公佈採購經理人指數優於預期而上漲,美國公佈上月採購經理人指數較元月份高點下滑,但仍維持於高檔,企業財報的利多及川普政策方向持續作多美股,家得寶及梅西百貨財報優於預期顯示美國零售及地產景氣走揚,市場等待川普稅改政策內容,國際金融市場情緒偏向樂觀,道瓊指數於前個交易日上漲0.58%、那斯達克指數上漲0.47%、S&P 500上漲0.60%,費城半導體指數上漲1.40%。
- 台指選擇權:3月買權未平倉最大量在履約價10000點的4.4萬口,賣權未平倉最大量在履約價9500點的3.3萬口,指數的初步支撐看9700點,9800點以上具初步壓力,Put/Call Ratio值升至1.34,高於中性值1.00,多頭勢力偏強;由外資選擇權未平倉部位分析,整體多方佈局維持強勢,台指選擇權籌碼偏多看待。
- 台北股市:(1)基本面及策略:台北股市今日受歐美股市強勢表態持續上漲,但指數開高走低並未站上9800點整數大關,鴻海、台積電和聯發科走勢平平,大立光上漲幅度超過2%表現較佳,玉晶光股價連續第2個交易日跌停後,今日早盤上漲超過7%,可惜尾盤逢賣單釋出股價再度走弱,短線上權值股穩盤力道強,中小型類股各自表態,大盤多頭氣勢乏力,買盤於高檔追價意願不強,但尚未看到台股轉空跡象,加權指數落在多方軌道上,型態上以多頭格局看待,3月份台指期終場上漲16點,漲幅0.16%,加權指數終場上漲14.85點,漲幅0.15%。今日盤面以半導體、塑膠、百貨類股指數較為弱勢,玻璃、水泥、光電類股指數則相對其他產業強勢。今日新台幣兌美元早盤升值幅度大,但午盤過後漲幅收斂,技術型態上台幣並未看到轉弱跡象,預期新台幣兌美元匯價於30.75有所支撐,台股資金面並未轉弱趨勢,在國際資金行情支撐下,建議加權指數回檔備多操作。(2)技術面:大盤今日量能994億元,整體量能較昨日上升,指數如能於高檔持續放量超過千億將利於多頭行情,指數收盤站上5日均線,所有均線再度翻揚,技術面偏多看待。(3)籌碼面:[1]現貨三大法人今日合計買起38.05億元,其中外資買起28.13億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉58196口,較前個交易日減少2614口淨多單,投信淨空單留倉37793口,自營商淨空單留倉4969口,籌碼面中性偏多看待。

台指期貨收盤行情

簡稱	收盤價	最高價	最低價	漲跌	價差(%)	成交量	委買均量	委賣均量	成交均量	OI
加權指數	9778.78	9820.07	9770.10	14.85		994億	3.25	2.45	5.11	
3月台指期	9783	9827	9767	16.00	0.04	121402	2.43	2.43	2.03	98449
4月台指期	9771	9812	9756	16.00	-0.08	2162	1.66	1.70	1.49	3929
3月小台指	9781	9827	9768	14.00	0.02	78676	1.69	1.73	1.49	34554
4月小台指	9771	9813	9757	16.00	-0.08	3001	1.41	1.43	1.32	2557
電子指數	394.23	396.55	393.89	0.30		610億				
3月電子期	394.60	396.20	394.05	0.60	0.00	2261	1.36	1.33	1.24	2713
4月電子期	394.10	395.50	393.85	0.60	-0.00	41	1.42	1.41	1.00	91
金融指數	1106.78	1113.04	1104.32	-1.51		56億				
3月金融期	1107.80	1115.20	1105.40	-1.40	0.01	2839	1.41	1.47	1.35	3286
4月金融期	1107.00	1112.00	1105.40	-1.80	0.00	23	1.76	1.67	1.05	37
摩台指	361.32	363.64	361.07	-0.33						
2月摩台指	361.60	363.80	361.00	-0.20		83470				101099
3月摩台指	361.30	364.00	360.80	-0.50		77131				158458

<本文僅供參考,並不做任何獲利保證。>



華南金融集團

華南期貨股份有限公司

(98)金管期總字第019號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL:(02)2718-0000 FAX:(02)2546-3708

3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4 Taipei, TAIWAN.

台指選擇權收盤行情

買權	結算價	最高價	最低價	漲跌	成交量	OI	OI 增減	時間價值	Delta	隱含波幅
3月10600C	1.0	1.0	0.7	0.2	423	4310	314	1.0	0.10	14.1%
3月10400C	1.9	2.2	1.7	0.2	1893	22823	532	1.9	0.16	12.2%
3月10200C	6.2	8.2	5.4	0.0	9721	28765	1612	6.2	0.25	11.0%
3月10000C	24.5	34.0	23.5	0.0	19379	44926	2055	24.5	0.37	10.3%
3月9900C	49.5	66.0	46.0	1.5	16720	34377	322	49.5	0.43	10.5%
3月9800C	90.0	112.0	83.0	6.0	13287	28520	-1878	90.0	0.50	10.7%
3月9700C	146.0	177.0	138.0	7.0	3865	10467	-478	63.0	0.57	4.3%
3月9600C	220.0	255.0	209.0	11.0	1190	10111	-325	37.0	0.63	3.1%
全履約價合計					64693	203060				
賣權	結算價	最高價	最低價	漲跌	成交量	OI	OI 增減	時間價值	Delta	隱含波幅
3月9800P	108.0	115.0	86.0	-10.0	9378	8911	3206	91.0	-0.63	10.6%
3月9700P	63.0	69.0	50.0	-9.0	12546	16504	3005	63.0	-0.57	10.6%
3月9600P	36.5	41.5	28.5	-5.5	16502	28272	3758	36.5	-0.50	11.1%
3月9500P	21.0	25.0	16.0	-2.5	12642	33457	4787	21.0	-0.43	11.8%
3月9400P	12.5	15.0	9.6	-1.5	12155	31083	3782	12.5	-0.36	12.6%
3月9300P	7.2	9.1	5.6	-0.9	6266	22265	-485	7.2	-0.30	13.3%
3月9200P	4.7	5.6	3.8	-0.5	2715	12983	33	4.7	-0.24	14.3%
3月9100P	3.5	3.7	2.6	0.1	2648	12313	84	3.5	-0.19	15.6%
3月9000P	2.3	2.5	1.8	0.0	2120	18364	390	2.3	-0.15	16.4%
全履約價合計					82492	271724				
距到期日：	21 天		Put/Call Ratio(volume)		1.28	1.34				

國際股市/外匯/大宗物資行情

名稱	收盤價	漲跌	漲跌幅	最高價	最低價	5日均價	10日均	30日均價	近期評析
道瓊指數	20743.00	118.95	0.58	20757.64	20663.37	-	-	-	走勢偏多
NASDAQ	5865.95	27.37	0.47	5867.89	5847.50	-	-	-	走勢偏多
S&P500	2365.38	14.22	0.60	2366.71	2354.91	-	-	-	走勢偏多
費城半導體指數	990.44	13.64	1.40	990.59	980.97	-	-	-	走勢偏多
日經指數	19379.87	-1.57	-0.01	19419.22	19329.28	-	-	-	走勢偏多
韓國首爾	2106.61	3.68	0.17	2108.98	2101.56	-	-	-	高檔震盪
恆生指數	24178.11	214.48	0.90	24201.92	23999.55	-	-	-	走勢偏多
上海綜合	3261.22	7.89	0.24	3261.38	3243.84	-	-	-	走勢偏多
滬深300指數	3489.76	6.94	0.20	3489.95	3473.52	-	-	-	走勢偏多
A50指數	10587.83	7.75	0.07	10596.80	10551.01	-	-	-	走勢偏多
美元指數	101.59	0.15	0.15	101.61	101.25	-	-	-	走勢偏多
歐元	1.0541	-0.0037	-0.35	1.0556	1.0503	1.0609	1.0621	1.0673	走勢偏弱
黃金	1236.03	-0.88	-0.07	1237.41	1233.30	1236.18	1234.08	1216.23	走勢偏多
名稱	昨日結算價	漲跌	漲跌幅	最高價	最低價	5日均價	10日均	30日均價	近期評析
N輕原油1705	54.61	0.02	0.04	54.87	54.50	41.22	42.54	43.51	由弱轉強
黃豆1705	1026.25	0.25	0.02	1040.50	1036.25	900.15	910.15	915.15	由強轉弱
小麥1705	449.75	2.00	0.44	452.75	450.00	500.52	502.50	510.52	高檔盤整
玉米1705	376.50	1.00	0.27	378.00	376.25	410.25	400.54	414.25	多頭回檔
咖啡1705	151.85	2.30	1.54	152.50	149.50	120.00	121.00	124.50	由弱轉強

新加坡交易所SGX

名稱	收盤價	漲跌	漲跌幅	最高價	最低價	5日均價	10日均	30日均價	近期評析
摩根印尼指數1702	6220.00	-25.00	-0.40	6205.00	6180.00	5458.00	5658.00	5356.00	由強轉弱
日經指數	19379.87	-1.57	-0.01	19419.22	19329.28	-	-	-	走勢偏多
A50指數1702	10570.00	17.50	0.17	10630.00	10557.50	-	-	-	走勢偏多
印度指數1702	8910.50	6.50	-0.08	8957.50	8892.50	7956.00	7825.00	7768.00	走勢偏多

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>