



華南金融集團

華南期貨股份有限公司 (104)金管總字第002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03月03日 星期五 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	208.90	258.84	-49.94	-61.36		中華電	1.70		台積電	-22.78		
投信	7.60	12.57	-4.97	-9.77		南亞科	0.91		鴻海	-6.09		
自營商	43.97	47.63	-3.66	-6.82		智邦	0.88		台塑化	-4.18		
合計	260.47	319.04	-58.56	-77.95		台灣大	0.75		南亞	-3.83		
3/2融資(億)	58.57	54.43	4.14	前日	1401.73	美食-KY	0.72		聯發科	-2.78		
3/2融券(張)	29837	37123	7286	餘額	446413	正隆	0.71		中鋼	-2.07		
單位: 口	多			空		和碩	0.68		台塑	-1.96		
3/2摩台3月多空比	816			835		英業達	0.63		國泰金	-1.93		
台指期前十大佔市場比率	53.5%			46.3%		神基	0.61		台達電	-1.71		
電子期前十大佔市場比率	53.1%			77.4%		台玻	0.57		台化	-1.54		
金融期前十大佔市場比率	63.9%			68.9%		前十名合計	8.16		後十名合計	-48.88		
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	50379	-536	1201	82	-1801	-166	79014	74325	4689	98764	93489	5275
投信	-38713	-96	-383	0	-111	0	0	0	0	0	0	0
自營商	-2729	1231	-339	-25	153	-54	-7118	-8341	1223	21792	16032	5760

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	大同	35,693	6	華通	5,538
2	群創	10,712	7	華新	4,123
3	中石化	7,183	8	元大金	3,878
4	中信金	6,797	9	臺企銀	3,496
5	仁寶	6,756	10	日月光	3,458

賣起					
排名	公司	張數	排名	公司	張數
1	玉山金	-74,121	6	台新金	-7,814
2	京元電子	-11,856	7	新光金	-7,243
3	友達	-9,129	8	華邦電	-6,998
4	聯電	-8,185	9	元大滬深300正2	-5,895
5	台積電	-7,987	10	永豐金	-5,874

觀盤重點提示

- 國際金融:美國股市本週四普遍下跌,美國主要指數由歷史高點拉回,道瓊指數收盤連續第2個交易日站上21000點整數關卡,金融市場對於美國聯準會於本月中升息的預期增加,美國聯準會主席葉倫於今日談話將受到各方矚目,國際金融市場情緒偏向樂觀,道瓊指數於前個交易日下跌0.53%、那斯達克指數下跌0.73%、S&P 500下跌0.59%,費城半導體指數下跌1.11%。
- 台指選擇權:3月買權未平倉最大量在履約價10000點的5.3萬口,賣權未平倉最大量在履約價9400點的4.4萬口,指數的初步支撐看9600點,9700點以上具初步壓力,Put/Call Ratio值下降至1.25,多頭勢力轉弱;由外資選擇權未平倉部位分析,整體多方佈局有轉弱現象,台指選擇權籌碼中性看待。
- 台北股市:(1)基本面及策略:台北股市今日開低走低,中小型蘋果供應鏈跌深反彈,美國聯準會升息計畫持續干擾新興市場股市,主要權值股漲幅收斂,大盤多頭氣勢乏力,3月份台指期終場下跌62點,跌幅0.64%,加權指數終場下跌43.59點,跌幅0.45%。今日盤面以鋼鐵、塑膠、半導體類股指數較為弱勢,造紙、玻璃、觀光類股指數則相對其他產業強勢。今日新台幣兌美元大幅走弱,貶值幅度超過0.7%,新台幣兌美元失守30.90關卡收盤更觸及31.00,美元指數受到美國3月份升息機率大幅上升而走揚,短線上在國際熱錢回流美國的情況下,資金行情近期將有所停滯,加權指數面臨回檔機率增加,建議加權指數中性操作。(2)技術面:大盤今日量能843億元,量能較5日均量970億元大幅下滑,指數開盤跌破月線9685點,持續帶動5日均線走弱,短線上技術面偏弱,指數於高檔將面臨小幅修正壓力,但在中長期均線持續走揚的情況下,指數大幅向下修正力道有限,技術面中性看待。(3)籌碼面:[1]現貨三大法人今日合計賣起58.56億元,其中外資賣起49.94億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉50379口,較前日減少536口淨多單,投信淨空單留倉38713口,自營商淨空單留倉2729口,籌碼面中性看待。

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	9648.21	9679.82	9633.88	-43.59		843億	3.58	2.39	4.79	
3月台指期	9629	9672	9623	-62.00	-0.20	121760	2.24	2.26	1.89	100743
4月台指期	9617	9660	9613	-64.00	-0.32	2960	1.56	1.67	1.44	5637
3月小台指	9630	9673	9623	-61.00	-0.19	84796	1.63	1.67	1.43	34037
4月小台指	9619	9661	9613	-62.00	-0.30	4244	1.31	1.40	1.27	3902
電子指數	388.78	390.33	388.42	-2.02		468億				
3月電子期	388.30	389.60	388.00	-2.25	-0.00	1878	1.24	1.19	1.15	2681
4月電子期	387.70	389.20	387.60	-2.60	-0.01	81	1.28	1.31	1.01	174
金融指數	1098.95	1104.58	1097.60	-4.15		74億				
3月金融期	1098.00	1105.60	1097.40	-8.80	-0.01	2821	1.31	1.39	1.26	3234
4月金融期	1098.00	1104.00	1098.00	-8.60	-0.01	72	1.53	1.51	1.07	115
摩台指	355.65	357.17	355.22	-2.29						
3月摩台指	354.80	356.60	354.70	-3.10		37562				230356
4月摩台指	354.90	356.40	354.90	-2.90		201				89

<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10400C	0.4	0.7	0.4	-0.3	685	25043	199	0.4	0.05	15.8%
3月10200C	0.8	1.6	0.7	-1.0	3315	31500	-648	0.8	0.11	13.2%
3月10000C	2.4	5.0	2.4	-4.7	18027	53071	-586	2.4	0.21	10.7%
3月9900C	5.8	12.0	5.5	-10.7	19842	41416	1040	5.8	0.28	9.8%
3月9800C	15.5	28.0	15.5	-21.5	26171	40146	5000	15.5	0.36	9.3%
3月9700C	41.5	63.0	41.0	-34.5	20712	20528	3940	41.5	0.44	9.2%
3月9600C	89.0	117.0	88.0	-47.0	6629	12320	1090	60.0	0.54	4.3%
3月9500C	159.0	192.0	158.0	-53.0	1743	4431	35	30.0	0.63	3.1%
全履約價合計					97007	247234				
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9700P	110.0	121.0	88.0	25.0	10854	18449	-726	39.0	-0.72	9.8%
3月9600P	60.0	68.0	45.0	15.5	19716	34343	906	60.0	-0.64	10.6%
3月9500P	29.5	35.0	21.0	7.5	18556	38860	2809	29.5	-0.56	11.2%
3月9400P	13.5	16.5	9.5	3.5	11122	44675	1511	13.5	-0.46	11.9%
3月9300P	6.3	8.1	4.8	1.1	3770	25033	250	6.3	-0.37	12.7%
3月9200P	3.2	4.2	2.6	0.2	2914	14267	502	3.2	-0.29	13.8%
3月9100P	1.9	2.6	1.6	-0.1	1829	13155	581	1.9	-0.21	15.2%
3月9000P	1.2	1.8	1.1	-0.1	899	20055	-123	1.2	-0.15	16.6%
3月8900P	0.9	1.1	0.8	0.0	390	9569	139	0.9	-0.10	18.3%
全履約價合計					79558	308914				
距到期日：	12 天		Put/Call Ratio(volume)		0.82	1.25				

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日均價	30日均價	近期評析
道瓊指數	21002.97	-112.58	-0.53	21129.20	20996.61	-	-	-	走勢偏多
NASDAQ	5861.22	-42.81	-0.73	5897.01	5856.30	-	-	-	走勢偏多
S&P500	2381.92	-14.04	-0.59	2394.75	2380.17	-	-	-	走勢偏多
費城半導體指數	974.33	-10.93	-1.11	988.09	973.33	-	-	-	走勢偏多
日經指數	19469.17	-95.63	-0.49	19587.79	19392.75	-	-	-	走勢偏多
韓國首爾	2078.75	-23.90	-1.14	2091.59	2072.09	-	-	-	走勢偏弱
恆生指數	23552.72	-175.35	-0.74	23635.24	23511.60	-	-	-	走勢偏弱
上海綜合	3218.31	-11.72	-0.36	3221.16	3206.61	-	-	-	走勢偏弱
滬深300指數	3427.86	-7.24	-0.21	3428.88	3412.83	-	-	-	走勢偏弱
A50指數	10348.62	-22.93	-0.22	10371.55	10311.44	-	-	-	走勢偏弱
美元指數	102.09	-0.06	-0.06	102.17	101.97	-	-	-	走勢偏多
歐元	1.0505	0.0012	0.11	1.0527	1.0501	1.0554	1.0568	1.0655	走勢偏弱
黃金	1234.78	-6.45	-0.52	1236.00	1225.20	1248.28	1243.78	1226.78	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日均價	30日均價	近期評析
N輕原油1705	53.07	0.24	0.45	53.40	53.00	41.22	42.54	43.51	由弱轉強
黃豆1705	1026.75	1.75	0.17	1041.00	1036.50	900.15	910.15	915.15	由強轉弱
小麥1705	452.75	-2.75	-0.61	451.75	449.00	500.52	502.50	510.52	高檔盤整
玉米1705	379.50	0.75	0.20	380.50	377.75	410.25	400.54	414.25	多頭回檔
咖啡1705	144.35	-0.50	-0.35	146.50	142.45	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日均價	30日均價	近期評析
摩根印尼指數1703	6220.00	-20.00	-0.32	6220.00	6185.00	5458.00	5658.00	5356.00	由強轉弱
日經指數	19469.17	-95.63	-0.49	19587.79	19392.75	-	-	-	走勢偏多
A50指數1703	10352.50	-5.00	-0.05	10385.00	10335.00	-	-	-	走勢偏弱
印度指數1703	8921.00	-18.00	0.13	8937.00	8870.00	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。>