



華南金融集團

華南期貨股份有限公司 (104)金管期總字第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07日 星期二 收盤日報

法人動態:

台股現貨買賣起				台股選擇權(買權)				台股選擇權(賣權)										
單位:億	買進	賣出	合計	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	174.09	159.64	14.45	54790	626	1251	6	-1560	158	88492	87224	1268	102853	96515	6338			
投信	14.22	8.83	5.39	投信	-37569	748	-383	0	-111	0	0	0	0	0	0			
自營商	43.21	36.21	7.00	自營商	-2123	1005	-268	24	141	-85	7175	3156	4019	5641	3086	2555		
合計	231.52	204.68	26.84	合計	-2123	1005	-268	24	141	-85	7175	3156	4019	5641	3086	2555		
3/6融資(億)	46.63	42.53	4.10	3/6融資(億)	46.63	42.53	4.10	3/6融資(億)	46.63	42.53	4.10	3/6融資(億)	46.63	42.53	4.10			
3/6融券(張)	21337	24908	3571	3/6融券(張)	21337	24908	3571	3/6融券(張)	21337	24908	3571	3/6融券(張)	21337	24908	3571			
單位:口	多			空			多			空			多			空		
3/6摩台3月多空比	1,597			981			1,597			981			1,597			981		
台指期前十大佔市場比率	53.5%			46.3%			53.5%			46.3%			53.5%			46.3%		
電子期前十大佔市場比率	53.1%			77.4%			53.1%			77.4%			53.1%			77.4%		
金融期前十大佔市場比率	63.9%			68.9%			63.9%			68.9%			63.9%			68.9%		
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		
外資及陸資	54790			626			1251			6			-1560			158		
投信	-37569			748			-383			0			-111			0		
自營商	-2123			1005			-268			24			141			-85		

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	旺宏	32,700	6	東元	3,770
2	群創	10,760	7	華航	3,003
3	中信金	4,861	8	華新	2,989
4	元大金	4,184	9	鴻海	2,967
5	華通	3,943	10	陽明	2,935

賣起					
排名	公司	張數	排名	公司	張數
1	聯電	-15,510	6	台積電	-3,567
2	友達	-10,955	7	永豐金	-3,375
3	玉山金	-6,707	8	彩晶	-3,144
4	華邦電	-6,230	9	正隆	-3,005
5	京元電子	-3,641	10	台新金	-2,875

觀盤重點提示

- 國際金融:美國股市本週一普遍下跌,美國聯準會升息機率提高及朝鮮半島局勢緊張成為多頭壓力,金融類股和原物料類股走弱,上週五美國聯準會主席葉倫談話受到各方矚目,勞動市場與通貨膨脹數據保持強勁提升本月美國升息的可能性,短線上留意本週四歐盟央行最新利率決議及本週五美國非農就業數據報告,非農報告將是本月是否升息的重要參考指標,道瓊指數於前個交易日下跌0.24%、那斯達克指數下跌0.37%、S&P 500下跌0.33%,費城半導體指數上漲0.02%。
- 台指選擇權:3月買權未平倉最大量在履約價10000點的4.9萬口,賣權未平倉最大量在履約價9400點的4.9萬口,指數的初步支撐看9700點,9800點以上具初步壓力,Put/Call Ratio值上升至1.31,多頭勢力稍強;由外資選擇權未平倉部位分析,整體多方佈局小幅轉強,台指選擇權籌碼中性偏多看待。
- 台北股市:(1)基本面及策略:台北股市今日開高走高,加權指數終場收至最高點,鴻海、台積電力守平盤之上,大立光於午盤過後走弱,傳產類股表現較強,台塑四寶為多頭指標,大盤短線上跌深反彈,3月份台指期終場上漲45點,漲幅0.46%,加權指數終場上漲55.44點,漲幅0.57%。今日盤面以光電、觀光、資服類股指數較為弱勢,玻璃、造紙、塑膠類股指數則相對其他產業強勢。今日新台幣兌美元小幅轉強,新台幣兌美元突破30.90關卡,美元指數受到美國3月份升息機率大幅上升持續落於多方軌道上,短線上在國際熱錢回流美國的情況下,台股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699億元較昨日持平,量能較5日均量844億元下滑,量縮整理有機會終結近期跌勢,指數收盤站上月線9707點,中長期均線持續走揚,短線上技術面由弱轉強,技術面偏多看待。(3)籌碼面:[1]現貨三大法人今日合計買起26.84億元,其中外資買起14.45億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉54790口,較前日增加626口淨多單,投信淨空單留倉37569口,自營商淨空單留倉2123口,籌碼面偏多看待。

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	9738.07	9738.07	9690.20	55.44		699億	3.82	2.57	5.28	
3月台指期	9727	9734	9682	45.00	-0.11	94350	2.38	2.30	1.95	98996
4月台指期	9714	9719	9668	46.00	-0.25	2959	1.55	1.64	1.42	8004
3月小台指	9729	9733	9681	47.00	-0.09	63497	1.71	1.66	1.46	34444
4月小台指	9715	9719	9668	47.00	-0.24	4406	1.56	1.44	1.37	4800
電子指數	391.93	391.93	389.98	2.32		409億				
3月電子期	391.40	391.75	389.90	1.85	-0.01	1907	1.29	1.33	1.21	2717
4月電子期	391.05	391.30	389.20	1.85	-0.01	63	1.64	1.31	1.01	230
金融指數	1107.23	1107.43	1103.54	1.08		43億				
3月金融期	1105.80	1109.40	1103.80	-0.60	-0.01	2182	1.29	1.28	1.21	3222
4月金融期	1106.00	1108.40	1104.00	-0.20	-0.01	30	1.51	1.51	1.00	173
摩台指	358.68	358.68	356.82	2.18						
3月摩台指	357.60	358.20	356.30	1.40		31276				225174
4月摩台指	357.40	358.10	357.00	1.10		227				364

<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	0.2	0.4	0.2	-0.1	125	4611	-123	0.2	0.01	20.2%
3月10400C	0.4	0.4	0.2	0.0	442	25329	-4	0.4	0.04	17.2%
3月10200C	0.6	0.8	0.5	-0.2	1147	31241	-63	0.6	0.10	13.3%
3月10000C	1.7	2.6	1.5	-0.7	9439	49318	-2623	1.7	0.23	9.6%
3月9900C	6.2	7.2	4.6	-0.2	12406	42748	-740	6.2	0.32	8.8%
3月9800C	24.5	26.5	17.0	3.0	21051	46431	1722	24.5	0.43	8.6%
3月9700C	71.0	74.0	51.0	15.0	15211	20812	-336	44.0	0.54	4.3%
3月9600C	146.0	150.0	113.0	30.0	4703	11843	-207	19.0	0.65	3.1%
全履約價合計					65179	250210				
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	95.0	134.0	93.0	-42.0	5483	10852	253	22.0	-0.77	8.7%
3月9700P	42.5	69.0	40.0	-31.5	14257	24469	2775	42.5	-0.68	9.6%
3月9600P	16.5	30.5	15.5	-18.0	20763	40920	3240	16.5	-0.57	10.5%
3月9500P	6.3	13.0	6.0	-7.7	14826	41194	-1241	6.3	-0.46	11.6%
3月9400P	2.8	5.4	2.6	-3.6	14548	49109	2696	2.8	-0.35	13.0%
3月9300P	1.6	3.0	1.5	-1.5	3718	23900	-509	1.6	-0.26	14.9%
3月9200P	1.0	1.6	0.9	-0.8	1278	14290	28	1.0	-0.17	16.7%
3月9100P	0.7	1.0	0.6	-0.3	695	13008	-321	0.7	-0.11	18.7%
3月9000P	0.5	0.7	0.5	-0.3	734	20175	43	0.5	-0.06	20.6%
全履約價合計					77796	326830				
距到期日：	8 天		Put/Call Ratio(volume)		1.19	1.31				

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	20954.34	-51.37	-0.24	20986.43	20912.11	-	-	-	高檔修正
NASDAQ	5849.18	-21.57	-0.37	5857.74	5827.46	-	-	-	高檔修正
S&P500	2375.31	-7.81	-0.33	2378.80	2367.98	-	-	-	高檔修正
費城半導體指數	974.18	0.21	0.02	976.03	963.03	-	-	-	高檔修正
日經指數	19344.15	-34.99	-0.18	19375.09	19317.10	-	-	-	高檔修正
韓國首爾	2094.05	12.69	0.61	2096.79	2079.16	-	-	-	打底盤整
恆生指數	23681.07	84.79	0.36	23728.00	23585.77	-	-	-	高檔修正
上海綜合	3242.41	8.54	0.26	3242.66	3226.82	-	-	-	走勢偏多
滬深300指數	3453.96	7.48	0.22	3454.04	3440.06	-	-	-	走勢偏多
A50指數	10405.97	37.53	0.36	10407.52	10358.51	-	-	-	走勢偏多
美元指數	101.62	-0.08	-0.08	101.75	101.53	-	-	-	走勢偏多
歐元	1.0582	0.0009	0.09	1.0603	1.0571	1.0564	1.0565	1.0647	走勢偏弱
黃金	1225.87	-0.78	-0.06	1227.50	1223.96	1238.59	1242.54	1227.99	走勢偏弱
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	53.71	0.05	0.09	53.82	53.52	41.22	42.54	43.51	高檔盤整
黃豆1705	1026.75	-1.25	-0.12	1041.75	1035.00	900.15	910.15	915.15	由強轉弱
小麥1705	458.50	0.25	0.05	460.50	458.50	500.52	502.50	510.52	走勢偏多
玉米1705	378.50	-0.50	-0.13	379.75	377.75	410.25	400.54	414.25	走勢偏多
咖啡1705	141.45	-1.80	-1.26	144.40	141.40	120.00	121.00	124.50	走勢偏空

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	6235.00	-15.00	-0.24	6260.00	6215.00	5458.00	5658.00	5356.00	走勢偏多
日經指數	19344.15	-34.99	-0.18	19375.09	19317.10	-	-	-	高檔修正
A50指數1703	10370.00	30.00	0.29	10412.50	10367.50	-	-	-	由弱轉強
印度指數1703	8977.00	-6.00	-0.08	8986.00	8949.00	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。>