



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28日 星期二 收盤日報

## 法人動態:

台股現貨買賣起					台股現貨買賣起				台股現貨買賣起					
單位:億	買進	賣出	合計	累計本月至今日	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起					
外資及陸資	334.11	-212.53	121.58	668.85	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起					
投信	7.37	-15.46	-8.09	-35.01	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起					
自營商	41.96	-62.08	-20.12	-60.36	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起					
合計	383.44	-290.07	93.37	573.48	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起					
3/27融資(億)	55.92	64.20	-8.28	前日 1431.99	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起					
3/27融券(張)	35427	25519	9908	餘額 358047	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起					
單位:口	多				空				台股現貨買賣起					
3/27摩台3月多空比	2				2.171				台股現貨買賣起					
台指期前十大佔市場比率	53.5%				46.3%				台股現貨買賣起					
電子期前十大佔市場比率	53.1%				77.4%				台股現貨買賣起					
金融期前十大佔市場比率	63.9%				68.9%				台股現貨買賣起					
期貨未平倉	台指期				電子期				金融期					
多空淨額	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減	台指選擇權(買權)	增減	未平倉	增減	台指選擇權(賣權)	增減
外資及陸資	53629	-4025	1980	439	-860	102	90200	86481	3719	113640	113395	245		
投信	-36216	-226	-309	0	-112	0	0	0	0	0	0	0		
自營商	-3442	-299	121	-98	-544	-103	6041	19263	-13222	61024	41468	19556		

## 外資現貨買賣起前10名台股

買起					
排名	公司	張數	排名	公司	張數
1	旺宏	47,156	6	元大金	9,886
2	開發金	14,754	7	晶電	7,667
3	台積電	13,746	8	群創	5,276
4	新光金	12,299	9	中信金	5,091
5	聯電	9,916	10	元大滬深300正2	5,078

賣起					
排名	公司	張數	排名	公司	張數
1	玉山金	-29,930	6	奇美材	-2,203
2	彩晶	-6,420	7	南茂	-2,172
3	榮成	-2,509	8	元大台灣	-2,003
4	友達	-2,487	9	富邦金	-1,768
5	永豐金	-2,326	10	台泥	-1,729

## 觀盤重點提示

- 國際金融:美國股市本週一普遍收跌,投資人重新評估川普政府所推行法案的未來展望,道瓊工業平均指數連續八天下跌,盤中一度大跌近200點,但隨後縮小跌幅。原本支持股市上漲的川普式展望,目前已大幅消退,投資人等待新的利多消息出現。道瓊指數於前個交易日下跌0.22%、那斯達克指數上漲0.2%、S&P 500下跌0.1%,費城半導體指數上漲0.16%。
- 台指選擇權:4月買權未平倉最大量在履約價10200點的5.9萬口,賣權未平倉最大量在履約價9600點的3.4萬口,指數的初步支撐看9800點,10000點以上具初步壓力,Put/Call Ratio值1.27,多頭勢力開始消退;由外資選擇權未平倉部位分析,整體多方佈局仍在,台指選擇權籌碼中性看待。
- 台北股市:(1)基本面及策略:台北股市今日開高走低,盤中一度跌破9800點,所幸午盤過後,由台積電、鴻海、台塑等重量權值股領軍,終場小跌0.32點,以9876.45點作收,成交值擴大到1033.29億元。今日盤中新台幣兌美元走勢依然強勁,外資持續匯入,明顯形成外資和內資對作的局面;雖然今天中小型股殺聲震天,但短線上外資仍大幅買起台股,國際資金對於台股仍站在有利一方。建議加權指數逢拉回偏多操作。(2)技術面:大盤今日量能1033億元,較前個交易日大幅增加,今日又收了長下影線,顯示低接買盤強勁;指數連日以來,高檔震盪,短中期均線雖開始走平,但中長期均線持續扮演支撐角色,短線上技術面中性看待。(3)籌碼面:[1]現貨三大法人今日合計買起93.37億元,其中外資買起121.58億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉53629口,較前日增加4025口淨多單,投信淨空單留倉36216口,自營商淨空單留倉3442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	9876.45	9924.14	9799.28	-0.32		1033億	2.82	2.13	4.78	
4月台指期	9883	9927	9805	17.00	0.07	180269	2.44	2.52	2.04	96978
5月台指期	9872	9914	9795	18.00	-0.05	4328	1.64	1.64	1.46	5216
月小台指	9884	9927	9805	18.00	0.08	112976	1.65	1.75	1.46	22797
5月小台指	9872	9913	9794	18.00	-0.05	5748	1.38	1.40	1.28	3493
電子指數	403.18	405.36	399.78	0.39		659億				
4月電子期	403.50	405.50	400.15	1.30	0.00	3622	1.28	1.26	1.17	3547
5月電子期	403.20	405.00	400.50	1.40	0.00	67	1.51	1.29	1.01	155
金融指數	1117.10	1122.96	1110.32	-4.17		73億				
4月金融期	1118.80	1122.80	1111.20	0.60	0.02	3038	1.31	1.37	1.25	2707
5月金融期	1117.60	1122.20	1112.40	-1.60	0.01	60	1.50	1.49	1.11	66
摩台指	366.72	367.85	364.01	0.56						
3月摩台指	366.80	368.00	364.60	1.00		66820				151206
4月摩台指	366.50	368.10	364.60	0.60		39704				124779

&lt;本文僅供參考,並不做任何獲利保證。&gt;



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
4月10800C	0.4	0.4	0.4	0.0	525	1761	-314.0	0.4	0.08	13.6%
4月10600C	1.0	1.0	0.7	0.1	949	8094	325.0	1.0	0.13	12.3%
4月10400C	3.0	3.2	1.7	0.6	7012	30217	2335.0	3.0	0.21	11.0%
4月10200C	12.0	15.0	6.2	2.0	35014	99221	5121.0	12.0	0.31	10.3%
4月10000C	49.0	63.0	28.5	3.0	29285	43069	3165.0	49.0	0.44	10.1%
4月9900C	89.0	110.0	57.0	4.0	22660	24010	2455.0	89.0	0.50	10.4%
4月9800C	147.0	176.0	103.0	5.0	7285	9221	1439.0	64.0	0.57	4.3%
4月9700C	221.0	255.0	167.0	7.0	2281	4103	156.0	38.0	0.63	3.1%
全履約價合計					97311	187299				
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
4月9900P	105.0	152.0	83.0	-14.0	11964	8796	-207.0	88.0	-0.69	10.1%
4月9800P	63.0	97.0	49.5	-13.0	19170	21878	651.0	63.0	-0.56	10.3%
4月9700P	36.0	60.0	28.0	-11.0	18613	26918	497.0	36.0	-0.50	10.7%
4月9600P	20.5	35.5	15.5	-7.5	14215	33631	793.0	20.5	-0.43	11.3%
4月9500P	11.5	20.0	9.0	-5.0	18029	32377	1357.0	11.5	-0.37	11.9%
4月9400P	6.6	12.0	5.4	-3.9	7877	20962	-528.0	6.6	-0.31	12.6%
4月9300P	4.2	7.3	3.4	-2.0	4257	16555	440.0	4.2	-0.25	13.5%
4月9200P	2.7	4.4	2.3	-1.4	3357	14862	1351.0	2.7	-0.20	14.4%
4月9100P	1.9	2.7	1.6	-0.8	1763	10995	314.0	1.9	-0.15	15.5%
全履約價合計					104830	237321				
距到期日：	22 天	Put/Call Ratio(volume)			1.08	1.27				

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	20550.98	-45.74	-0.22	20578.46	20412.80	-	-	-	走勢偏多
NASDAQ	5840.37	11.63	0.20	5849.20	5769.39	-	-	-	走勢偏多
S&P500	2341.59	-2.39	-0.10	2344.90	2322.25	-	-	-	走勢偏多
費城半導體指數	1005.95	1.60	0.16	1008.48	990.66	-	-	-	走勢偏多
日經指數	19202.87	217.28	1.14	19203.64	19113.44	-	-	-	高檔修正
韓國首爾	2163.31	7.65	0.35	2169.14	2157.71	-	-	-	走勢偏多
恆生指數	24345.87	152.17	0.63	24360.00	24274.52	-	-	-	走勢偏多
上海綜合	3252.95	-14.01	-0.43	3265.63	3246.09	-	-	-	走勢偏多
滬深300指數	3469.81	-8.23	-0.24	3482.29	3461.47	-	-	-	走勢偏多
A50指數	10396.89	-28.10	-0.27	10444.98	10377.64	-	-	-	走勢偏多
美元指數	99.26	0.03	0.03	99.35	99.15	-	-	-	走勢偏多
歐元	1.0865	-0.0008	-0.07	1.0873	1.0843	1.0809	1.0763	1.0646	由弱轉強
黃金	1255.28	-1.49	-0.12	1255.33	1251.00	1246.19	1233.41	1232.06	由弱轉強
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1706	48.30	0.42	0.87	48.76	48.35	41.22	42.54	43.51	走勢偏空
黃豆1707	971.50	2.25	0.23	986.25	981.50	900.15	910.15	915.15	走勢偏空
小麥1707	434.75	-1.00	-0.23	435.50	433.50	500.52	502.50	510.52	走勢偏多
玉米1707	363.50	0.50	0.14	364.75	363.50	410.25	400.54	414.25	走勢偏多
咖啡1707	141.55	-0.10	-0.07	142.00	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	6440.00	35.00	0.54	6480.00	6425.00	5458.00	5658.00	5356.00	走勢偏多
日經指數	19202.87	217.28	1.14	19203.64	19113.44	-	-	-	高檔修正
A50指數1703	10385.00	-	-	-	-	-	-	-	走勢偏多
印度指數1703	9072.50	33.00	0.11	9122.50	9047.50	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。>