



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31日 星期五 收盤日報

法人動態:

台股現貨買賣起		台指選擇權(買權)		台指選擇權(賣權)								
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	287.47	309.01	-21.54	697.08	大立光	5.31	台積電	-28.51				
投信	9.32	11.25	-1.93	-33.97	可成	3.56	台塑化	-4.19				
自營商	47.97	38.15	9.82	-39.28	台化	3.35	日月光	-3.45				
合計	344.76	358.41	-13.65	623.83	和碩	1.70	中華電	-3.41				
3/30融資(億)	57.38	51.11	6.27	前日	大同	1.18	台塑	-3.08				
3/30融券(張)	27861	30861	3000	餘額	亞泥	0.89	鴻海	-3.05				
單位: 口	多		空		研華	0.84	聯發科	-2.44				
3/30摩台4月多空比	102		1,124		華碩	0.82	南亞	-2.09				
台指期前十大佔市場比率	53.5%		46.3%		台玻	0.58	富邦金	-2.03				
電子期前十大佔市場比率	53.1%		77.4%		台郡	0.46	國泰金	-1.66				
金融期前十大佔市場比率	63.9%		68.9%		前十名合計	18.68	後十名合計	-53.90				
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	52033	-1618	2347	86	-799	44	80679	84309	-3630	123502	110850	12652
投信	-36678	-417	-310	0	-112	0	0	0	0	0	0	0
自營商	-5074	-840	188	14	-507	-90	7108	-4136	11244	41298	32214	9084

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	華邦電	17,025	6	陽明	6,076
2	中信金	12,548	7	永豐餘	5,789
3	新光金	9,784	8	台新金	5,746
4	華航	6,719	9	開發金	5,061
5	欣興	6,324	10	富邦上証正2	4,847

賣起					
排名	公司	張數	排名	公司	張數
1	友達	-26,402	6	元大台灣50反1	-9,600
2	旺宏	-19,044	7	國泰金	-8,765
3	富邦金	-18,040	8	永豐金	-8,218
4	玉山金	-16,741	9	元大金	-7,279
5	群創	-9,656	10	中壽	-4,296

觀盤重點提示

- 國際金融: 美國股市本週四收盤普遍上漲, 美國公布本週原油庫存增加後油價連續第二個交易日上漲, 金融類股表現強勢, 美元指數走強, 市場預期美國正走在升息的道路, 主要國債價格走低, 國債避險需求衰退, 金融市場投資人情緒偏向樂觀, 美國主要股價指數樂觀看待, 道瓊指數於前個交易日上漲0.33%、那斯達克指數上漲0.28%、S&P 500上漲0.29%, 費城半導體指數上漲0.53%。
- 台指選擇權: 4月買權未平倉最大量在履約價10200點的6.7萬口, 賣權未平倉最大量在履約價9600點的3.8萬口, 指數的初步支撐看9800點, 10000點以上具初步壓力, Put/Call Ratio值1.24, 多頭勢力維持強勢; 由外資選擇權未平倉部位分析, 整體多方佈局偏強, 台指選擇權籌碼偏多看待。
- 台北股市: (1)基本面及策略: 台北股市今日開高走低, 指數開出小紅後買盤無力, 歐美股市連續交易日反彈並未帶給台股激勵, 主要權值股走弱, 整體盤面上並無明顯主流族群帶動, 短線上台股受清明連假影響買盤觀望, 大盤指數緩步走跌, 整體但多頭格局並未改變, 因此建議樂觀看待台股, 4月份台指期終場下跌27點, 跌幅0.27%, 加權指數終場下跌36.63點, 跌幅0.37%。今日盤面以半導體、紡織、資訊類股指數較為弱勢, 玻璃、造紙、光電類股指數則相對其他產業強勢。今日新台幣兌美元走勢偏弱, 新台幣兌美元於本週二創高後連續第三個交易日回貶, 但回貶幅度甚小, 短線上外資持續匯入, 台股資金行情走勢強勢, 建議加權指數逢拉回偏多操作。(2)技術面: 大盤今日量能1008億元較前個交易日明顯增加, 大盤價跌量增顯示部分投資人急於連假前夕離場, 清明連假前投資人觀望心態濃且謹慎留倉, 5日均線連續交易日走勢偏弱, 中長期均線走勢持續翻揚且呈多頭排列, 中長期均線持續扮演支撐角色, 整體型態上低點不破前低, 高點可望挑戰前高, 短線上技術面表現強勢, 技術面偏多看待。(3)籌碼面: [1]現貨三大法人今日合計賣起13.65億元, 其中外資賣起21.54億元終結連續11個交易日買起。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉52033口, 較前日減少1618口淨多單, 投信淨空單留倉36678口, 自營商淨空單留倉5074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	9811.52	9869.65	9811.52	-36.63		1008億	3.87	2.60	4.76	
4月台指期	9821	9872	9812	-27.00	0.10	97882	2.33	2.42	1.99	95150
5月台指期	9811	9860	9803	-27.00	-0.01	2460	1.55	1.66	1.42	5454
月小台指	9822	9872	9813	-26.00	0.11	63538	1.67	1.78	1.49	22989
5月小台指	9810	9860	9803	-28.00	-0.02	2935	1.38	1.49	1.34	4251
電子指數	399.52	402.65	399.52	-2.12		705億				
4月電子期	399.85	402.50	399.80	-1.60	0.00	1854	1.29	1.23	1.17	3876
5月電子期	399.50	401.75	399.45	-1.70	-0.00	26	2.42	1.72	1.21	169
金融指數	1112.90	1119.41	1112.75	-3.79		73億				
4月金融期	1113.60	1118.80	1112.60	-1.80	0.01	1538	1.23	1.28	1.19	2578
5月金融期	1113.40	1119.40	1113.40	-2.20	0.01	12	1.06	1.17	1.00	89
摩台指	362.21	364.83	362.20	-1.91						
3月摩台指	362.70	365.60	362.40	-1.70		35493				226062
4月摩台指	362.80	364.90	362.80	-1.70		7				31

<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
4月10800C	0.3	0.4	0.3	-0.1	138	1888	74	0.3	0.05	15.2%
4月10600C	0.7	0.9	0.7	-0.1	604	8422	309	0.7	0.10	13.7%
4月10400C	1.7	2.2	1.6	-0.3	2738	33807	1780	1.7	0.16	12.0%
4月10200C	5.8	8.3	5.3	-1.6	14825	67518	3464	5.8	0.26	10.7%
4月10000C	25.0	38.0	23.0	-8.5	19828	46586	1885	25.0	0.39	9.9%
4月9900C	51.0	75.0	48.0	-15.0	15433	24858	259	51.0	0.46	9.8%
4月9800C	97.0	130.0	93.0	-21.0	5667	9969	557	76.0	0.53	4.3%
4月9700C	162.0	203.0	157.0	-27.0	1098	4551	122	41.0	0.60	3.1%
全履約價合計					57226	205194				
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	131.0	135.0	103.0	13.0	6737	9314	-2	52.0	-0.74	9.6%
4月9800P	75.0	80.0	59.0	5.0	13513	24324	-623	75.0	-0.61	9.5%
4月9700P	41.0	43.5	32.0	2.5	12424	28805	224	41.0	-0.54	10.0%
4月9600P	22.5	23.0	17.0	2.0	13330	38685	2243	22.5	-0.47	10.7%
4月9500P	11.5	12.0	9.0	1.0	9616	35141	1139	11.5	-0.40	11.3%
4月9400P	6.7	6.7	5.2	0.2	3642	21932	572	6.7	-0.33	12.2%
4月9300P	3.9	4.0	3.1	0.0	1776	17230	40	3.9	-0.27	13.1%
4月9200P	2.5	2.6	2.1	-0.1	1656	16219	527	2.5	-0.21	14.2%
4月9100P	1.6	1.7	1.4	-0.2	469	11853	231	1.6	-0.16	15.2%
全履約價合計					65627	254435				
距到期日：	19 天		Put/Call Ratio(volume)		1.15	1.24				

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	20728.49	69.17	0.33	20753.78	20643.60	-	-	-	走勢偏多
NASDAQ	5914.34	16.79	0.28	5916.77	5894.01	-	-	-	走勢偏多
S&P500	2368.06	6.93	0.29	2370.42	2358.58	-	-	-	走勢偏多
費城半導體指數	1011.81	5.32	0.53	1014.00	1005.39	-	-	-	走勢偏多
日經指數	18909.26	-153.96	-0.81	19210.92	18909.26	-	-	-	高檔修正
韓國首爾	2160.23	-4.41	-0.20	2166.93	2159.80	-	-	-	走勢偏多
恆生指數	24111.59	-189.50	-0.78	24329.98	24105.38	-	-	-	走勢偏多
上海綜合	3222.51	12.27	0.38	3226.25	3205.54	-	-	-	走勢偏多
滬深300指數	3456.05	19.29	0.56	3456.31	3430.82	-	-	-	走勢偏多
A50指數	10407.13	65.54	0.63	10414.47	10321.20	-	-	-	走勢偏多
美元指數	100.44	-0.07	-0.07	100.60	100.43	-	-	-	走勢偏多
歐元	1.0678	0.0016	0.15	1.0695	1.0670	1.0783	1.0778	1.0659	由弱轉強
黃金	1242.30	0.00	0.00	1244.37	1239.60	1249.11	1243.89	1233.57	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	30日均價	近期評析
N輕原油1706	50.78	-0.07	-0.14	50.81	50.49	41.22	42.54	43.51	走勢偏空
黃豆1707	963.00	-1.00	-0.10	977.25	971.25	900.15	910.15	915.15	走勢偏空
小麥1707	434.00	0.00	0.00	436.00	433.50	500.52	502.50	510.52	走勢偏多
玉米1707	365.00	0.75	0.21	366.25	365.00	410.25	400.54	414.25	走勢偏多
咖啡1707	141.70	-	-	-	-	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	30日均價	近期評析
摩根印尼指數1704	6485.00	5.00	0.08	6530.00	6485.00	5458.00	5658.00	5356.00	走勢偏多
日經指數	18909.26	-153.96	-0.81	19210.92	18909.26	-	-	-	高檔修正
A50指數1704	10367.50	85.00	0.82	10452.50	10350.00	-	-	-	走勢偏多
印度指數1704	9194.50	-2.00	0.29	9233.00	9174.50	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。>