



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04月06日 星期四 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 | | 台股貢獻點數前十名 | | | 台股貢獻點數後十名 | | |
| 外資及陸資 | 259.46 | 260.23 | -0.77 | 113.87 | | | | | 可成 | 2.38 | 台積電 | -17.14 | | |
| 投信 | 6.75 | 11.98 | -5.23 | -7.82 | | | | | 中華電 | 1.71 | 大立光 | -13.00 | | |
| 自營商 | 45.01 | 44.45 | 0.56 | 24.65 | | | | | 台達電 | 1.14 | 台塑化 | -6.30 | | |
| 合計 | 311.21 | 316.65 | -5.45 | 130.70 | | | | | 亞德客-KY | 0.99 | 鴻海 | -5.34 | | |
| 4/5融資(億) | 72.59 | 64.44 | 8.15 | 前日 | 1441.41 | | | | | 友達 | 0.85 | 台化 | -3.10 | |
| 4/5融券(張) | 28086 | 19475 | 8611 | 餘額 | 274889 | | | | | 南亞科 | 0.79 | 華碩 | -2.45 | |
| 單位：口 | 多 | | 空 | | 空 | | | | | 台灣大 | 0.75 | 聯發科 | -2.09 | |
| 4/5摩台4月多空比 | 151 | | 2,707 | | | | | | | 台光電 | 0.70 | 兆豐金 | -1.80 | |
| 台指期前十大佔市場比率 | 53.5% | | 46.3% | | | | | | | 旺宏 | 0.65 | 中鋼 | -1.73 | |
| 電子期前十大佔市場比率 | 53.1% | | 77.4% | | | | | | | 元大金 | 0.53 | 台塑 | -1.68 | |
| 金融期前十大佔市場比率 | 63.9% | | 68.9% | | | | | | | 前十名合計 | 10.48 | 後十名合計 | -54.64 | |
| 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 | 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 | 50820 | -6384 | 2968 | 98 | -1020 | -144 | 81823 | 82610 | -787 | 139031 | 120256 | 18775 | 18775 | |
| 投信 | -35345 | -47 | -315 | 6 | -110 | -9 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 自營商 | -2502 | -571 | 389 | -177 | -599 | -55 | -19098 | -10188 | -8910 | 32798 | 677 | 32121 | | |

外資現貨買賣超前10名個股

| 買超 | | | | | |
|----|-----|--------|----|-----|-------|
| 排名 | 公司 | 張數 | 排名 | 公司 | 張數 |
| 1 | 元大金 | 15,511 | 6 | 可成 | 5,011 |
| 2 | 鴻海 | 13,132 | 7 | 新光金 | 4,730 |
| 3 | 玉山金 | 9,021 | 8 | 南亞科 | 4,439 |
| 4 | 緯創 | 8,172 | 9 | 陽明 | 3,990 |
| 5 | 彩晶 | 6,058 | 10 | 華邦電 | 3,762 |

| 賣超 | | | | | |
|----|-----|---------|----|-----|--------|
| 排名 | 公司 | 張數 | 排名 | 公司 | 張數 |
| 1 | 富邦金 | -21,679 | 6 | 中壽 | -7,953 |
| 2 | 群創 | -13,095 | 7 | 國泰金 | -4,897 |
| 3 | 華航 | -11,117 | 8 | 開發金 | -4,764 |
| 4 | 中信金 | -10,947 | 9 | 長榮航 | -4,079 |
| 5 | 友達 | -10,773 | 10 | 大同 | -3,186 |

觀盤重點提示

- 國際金融：美國股市本週三收盤普遍下跌，三大指數開高走低且震盪幅度加大，美國公布三月份ADP就業人數增加26.3萬人，遠超過市場預期18.5萬人，美國三月ISM非製造業指數降至55.2，低於市場預期57.0，創去年底以來新低，美國聯準會3月份會議紀要顯示，部分官員指出金融類股表現強勢，美元指數走強，市場預期美國正走在升息的道路上，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下跌0.20%，那斯達克指數下跌0.57%，S&P 500下跌0.31%，費城半導體指數下跌0.69%。
- 台指選擇權：4月買權未平倉最大量在履約價10200點的7.2萬口，賣權未平倉最大量在履約價9600點的4.1萬口，指數的初步支撐看9800點，10000點以上具初步壓力，Put/Call Ratio值1.29，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：台北股市今日受歐美股市收盤表現不佳而開低走低，且失守9900點整數關卡，主要權值股漲多拉回修正，其中又以台積電、大立光及台塑化影響指數最大，鴻海未能延續昨日大漲氣勢，鴻海集團股同步走弱，短線上市場憂心強勢台幣將侵蝕電子股第一季獲利，除此之外台股盤面上並無重大利空，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65點，跌幅0.65%，加權指數終場下跌51.68點，跌幅0.52%。今日盤面以光電、玻璃、油燃類股指數較為弱勢，生醫、造紙、化工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，新台幣兌美元連續第五個交易日走貶，且回貶幅度擴大，但整體格局仍維持強勢，短線外資並未棄守台股，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898億元較前個交易日明顯減少，大盤價跌量縮顯示盤面利於多方，5日均線連續交易日走勢轉強終結上周以來偏弱走勢，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超5.45億元，其中外資賣超0.77億元，[2]期貨外資今日淨部位多單留倉50820口，較前日減少6384口淨多單，投信淨空單留倉35345口，自營商淨空單留倉2502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 | 9897.80 | 9946.66 | 9879.85 | -51.68 | -0.01 | 898億 | 3.63 | 2.50 | 4.90 | |
| 4月台指期 | 9897 | 9941 | 9880 | -65.00 | -0.01 | 110268 | 2.31 | 2.52 | 2.00 | 96228 |
| 5月台指期 | 9889 | 9929 | 9873 | -63.00 | -0.09 | 3144 | 1.60 | 1.65 | 1.42 | 7526 |
| 4月小台指 | 9897 | 9941 | 9881 | -65.00 | -0.01 | 75692 | 1.61 | 1.88 | 1.49 | 22324 |
| 5月小台指 | 9887 | 9930 | 9873 | -65.00 | -0.11 | 4405 | 1.39 | 1.46 | 1.29 | 5078 |
| 電子指數 | 404.94 | 407.39 | 404.02 | -2.38 | | 620億 | | | | |
| 4月電子期 | 404.55 | 406.00 | 403.80 | -2.45 | -0.00 | 1871 | 1.29 | 1.27 | 1.17 | 4496 |
| 5月電子期 | 404.30 | 405.20 | 403.60 | -2.30 | -0.01 | 71 | 1.38 | 1.34 | 1.03 | 208 |
| 金融指數 | 1113.03 | 1115.89 | 1111.27 | -3.16 | | 62億 | | | | |
| 4月金融期 | 1113.20 | 1119.00 | 1112.20 | -6.60 | 0.00 | 1998 | 1.29 | 1.38 | 1.27 | 2894 |
| 5月金融期 | 1112.00 | 1117.80 | 1112.00 | -7.80 | -0.01 | 50 | 1.38 | 1.54 | 1.02 | 136 |
| 摩台指 | 366.61 | 368.35 | 365.73 | -2.39 | | | | | | |
| 4月摩台指 | 366.10 | 368.40 | 365.60 | -3.30 | | 40292 | | | | 235002 |
| 5月摩台指 | 366.20 | 368.30 | 365.90 | -3.50 | | 54 | | | | 73 |

<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 | 0.4 | 0.7 | 0.4 | -0.3 | 110 | 1895 | -38 | 0.4 | 0.03 | 17.3% |
| 4月10600C | 0.7 | 1.0 | 0.6 | -0.7 | 1096 | 8493 | 160 | 0.7 | 0.08 | 14.9% |
| 4月10400C | 1.5 | 2.6 | 1.5 | -1.5 | 3475 | 34959 | 365 | 1.5 | 0.15 | 12.4% |
| 4月10200C | 6.3 | 10.5 | 5.8 | -6.2 | 18045 | 72559 | 1212 | 6.3 | 0.27 | 10.8% |
| 4月10000C | 34.5 | 53.0 | 31.5 | -25.5 | 26656 | 49095 | 1077 | 34.5 | 0.42 | 10.0% |
| 4月9900C | 72.0 | 101.0 | 66.0 | -40.0 | 18936 | 22909 | 1293 | 72.0 | 0.51 | 9.8% |
| 4月9800C | 135.0 | 172.0 | 125.0 | -50.0 | 3616 | 9454 | 595 | 38.0 | 0.59 | 4.3% |
| 4月9700C | 215.0 | 255.0 | 202.0 | -59.0 | 1109 | 4380 | 143 | 18.0 | 0.67 | 3.1% |
| 全履約價合計 | | | | | 68711 | 211031 | | | | |
| 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 | 77.0 | 87.0 | 59.0 | 28.5 | 12115 | 15085 | 1694 | 74.0 | -0.73 | 10.1% |
| 4月9800P | 39.0 | 44.5 | 29.5 | 14.5 | 17745 | 28562 | 917 | 39.0 | -0.58 | 10.5% |
| 4月9700P | 18.5 | 22.0 | 14.0 | 6.5 | 14897 | 30549 | 1293 | 18.5 | -0.49 | 11.1% |
| 4月9600P | 8.8 | 10.5 | 7.2 | 2.6 | 9883 | 41652 | 3413 | 8.8 | -0.41 | 11.9% |
| 4月9500P | 4.6 | 5.3 | 4.0 | 1.0 | 5086 | 33998 | -73 | 4.6 | -0.33 | 12.9% |
| 4月9400P | 2.7 | 3.1 | 2.5 | 0.2 | 2688 | 22393 | 153 | 2.7 | -0.25 | 14.2% |
| 4月9300P | 1.7 | 2.0 | 1.7 | 0.0 | 1161 | 17738 | -29 | 1.7 | -0.19 | 15.5% |
| 4月9200P | 1.1 | 1.4 | 1.1 | 0.1 | 1140 | 16544 | 478 | 1.1 | -0.13 | 16.8% |
| 4月9100P | 0.8 | 1.0 | 0.8 | -0.1 | 558 | 12611 | 165 | 0.8 | -0.09 | 18.3% |
| 全履約價合計 | | | | | 72483 | 272137 | | | | |
| 距到期日： | 13 天 | | Put/Call Ratio(volume) | | 1.05 | 1.29 | | | | |

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 | 20648.15 | -41.09 | -0.20 | 20887.50 | 20639.55 | - | - | - | 走勢偏多 |
| NASDAQ | 5864.98 | -33.63 | -0.57 | 5936.39 | 5856.26 | - | - | - | 走勢偏多 |
| S&P500 | 2352.95 | -7.21 | -0.31 | 2378.36 | 2350.64 | - | - | - | 走勢偏多 |
| 費城半導體指數 | 993.53 | -6.95 | -0.69 | 1010.02 | 992.76 | - | - | - | 走勢偏多 |
| 日經指數 | 18597.06 | -264.21 | -1.40 | 18797.44 | 18532.65 | - | - | - | 高檔修正 |
| 韓國首爾 | 2152.75 | -8.10 | -0.37 | 2153.83 | 2143.30 | - | - | - | 走勢偏多 |
| 恆生指數 | 24273.72 | -127.08 | -0.52 | 24381.63 | 24210.69 | - | - | - | 走勢偏多 |
| 上海綜合 | 3281.00 | 10.69 | 0.33 | 3286.67 | 3265.76 | - | - | - | 走勢偏多 |
| 滬深300指數 | 3514.05 | 10.16 | 0.29 | 3517.78 | 3495.72 | - | - | - | 走勢偏多 |
| A50指數 | 10530.75 | 30.25 | 0.29 | 10548.58 | 10464.11 | - | - | - | 走勢偏多 |
| 美元指數 | 100.65 | 0.13 | 0.13 | 100.75 | 100.38 | - | - | - | 走勢偏多 |
| 歐元 | 1.0664 | -0.0009 | -0.08 | 1.0684 | 1.0627 | 1.0670 | 1.0737 | 1.0671 | 由弱轉強 |
| 黃金 | 1252.66 | 1.31 | 0.10 | 1258.87 | 1252.66 | 1249.81 | 1249.35 | 1235.55 | 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 | 51.60 | 0.05 | 0.10 | 51.66 | 51.23 | 41.22 | 42.54 | 43.51 | 走勢偏空 |
| 黃豆1707 | 944.25 | 0.25 | 0.03 | 957.50 | 954.00 | 900.15 | 910.15 | 915.15 | 走勢偏空 |
| 小麥1707 | 442.50 | -0.50 | -0.11 | 443.00 | 440.75 | 500.52 | 502.50 | 510.52 | 走勢偏多 |
| 玉米1707 | 372.50 | -0.50 | -0.13 | 373.00 | 371.50 | 410.25 | 400.54 | 414.25 | 走勢偏多 |
| 咖啡1707 | 139.60 | 0.50 | 0.36 | 140.10 | 139.55 | 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 | 6625.00 | -20.00 | -0.30 | 6620.00 | 6560.00 | 5458.00 | 5658.00 | 5356.00 | 走勢偏多 |
| 日經指數 | 18597.06 | -264.21 | -1.40 | 18797.44 | 18532.65 | - | - | - | 高檔修正 |
| A50指數1704 | 10530.00 | - | - | - | - | - | - | - | 走勢偏多 |
| 印度指數1704 | 9287.50 | -32.50 | 0.21 | 9311.00 | 9226.00 | 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。>