



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

台指期貨 2016年12月19日

星期一

收盤日報

法人動態:

台股現貨買賣起					台股現貨買賣起					
單位:億	買進	賣出	合計	前五日	台股現貨買超		台股現貨賣超			
外資及陸資	122.06	142.02	-19.96	130.50	南亞	2.11	台積電	-28.68		
投信	5.93	10.65	-4.72	0.59	正新	1.86	鴻海	-6.13		
自營商	35.32	42.61	-7.29	-19.12	台達電	0.57	國泰金	-5.56		
合計	163.31	195.27	-31.97	111.97	冠德	0.38	中華電	-5.15		
12/16融資(億)	43.18	37.26	5.92	前日	廣達	0.34	大立光	-5.04		
12/16融券(張)	20052	21482	1430	餘額	慧洋-KY	0.20	台化	-3.37		
單位:口	多			空	建大	0.17	台塑	-2.82		
12/16摩台12月多空比	528			1,017	統領	0.16	兆豐金	-2.11		
台指期前十大佔市場比率	53.5%			46.3%	緯創	0.12	中鋼	-2.09		
電子期前十大佔市場比率	53.1%			77.4%	興富發	0.10	可成	-2.05		
金融期前十大佔市場比率	63.9%			68.9%	前十名合計	6.01	後十名合計	-62.99		
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	增減
外資及陸資	65807	-13496	862	-262	423	-24	73139	79900	-6761	138006
投信	-41913	-2003	-489	0	-273	-1	0	0	0	24
自營商	-6426	-99	772	-381	296	-55	9610	24118	-14508	-36330

外資現貨買賣起前10名個股

買超					
排名	公司	張數	排名	公司	張數
1	中信金	19,280	6	群創	4,574
2	開發金	5,531	7	南亞	3,372
3	國喬	5,363	8	富邦金	3,330
4	中鋼	5,022	9	友達	3,312
5	華新	4,768	10	臺企銀	3,006

賣超					
排名	公司	張數	排名	公司	張數
1	彩晶	- 5,971	6	大同	- 3,617
2	陽明	- 5,393	7	合庫金	- 2,750
3	玉山金	- 5,045	8	中壽	- 2,490
4	中華電	- 4,818	9	富邦上証正2	- 2,124
5	統一	- 3,628	10	第一金	- 1,990

觀盤重點提示

- 國際金融:美國股市本週五普遍下跌,美元指數升至14年來新高後回落,主要兌美元指數的貨幣跌幅收斂,但新興市場貨幣兌美元依舊偏弱,資金持續從新興市場回流美國,美國10年期國債殖利率從上週四觸及2.6%後回落,市場預期短線上資金要持續大幅從債市撤出的機率不高,市場持續消化美國聯準會偏鷹派的貨幣政策,短線上在美元過於強勢及原物料商品受到壓抑的情況下,預期美國股市漲勢將有所收斂,建議投資人偏保守操作,道瓊指數下跌0.04%、那斯達克指數下跌0.36%、S&P 500下跌0.18%,費城半導體指數下跌1.00%。
- 台指選擇權:12月買權未平倉最大量在履約價9400點的5.1萬口,賣權未平倉最大量在履約價9000點的5.3萬口,指數的初步支撐看9200點,9300點以上見初步壓力;由外資選擇權未平倉部位分析,整體多方佈局於今日轉弱,盤面上攻機率減緩,但下行支撐力依然強勢。
- 台北股市:(1)基本面及策略:台北股市今日開低走低,相較於其他亞洲市場走勢相對疲弱,整體價跌量縮,加上外資聖誕假期前效應,指數不易有大行情,指數終場下跌87.46點,跌幅0.94%,型態上以多頭回檔格局看待。今日盤面以光電、水泥、鋼鐵類股指數較為弱勢,油燃、橡膠、營建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,相較於其他亞幣反彈,台幣表現相對不理想,預期美國升息效應逐漸發酵,短線上市場資金面不明朗,指數操作方式建議區間保守操作。(2)技術面:大盤今日回測月線支撐,但收盤失守月線且誘使5日均線下彎,短線上走勢偏弱難料,但在中長期均線皆上揚的情況,可預見指數下行支撐力道增強,技術面上中性看待。(3)籌碼面:[1]現貨三大法人今日合計賣超31.97億元,其中外資賣超19.96億元。[2]期貨外資今日淨部位多單來到65807口,較前個交易日增加1509口淨多單,投信淨空單留倉41913口,自營商淨空單留倉6426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	9239.32	9317.03	9237.98	-87.46		569億	3.46	2.40	5.09	
12月台指期	9246	9317	9242	-65.00	0.07	99368	2.27	2.46	1.94	51957
1月台指期	9233	9308	9231	-68.00	-0.07	14557	2.14	2.32	1.78	59149
12月小台指	9245	9317	9242	-66.00	0.06	67754	1.61	1.73	1.44	21921
1月小台指	9235	9308	9232	-66.00	-0.05	13016	1.54	1.72	1.43	9391
電子指數	368.10	371.92	368.08	-4.10		308億				
12月電子期	368.55	371.65	368.45	-3.00	0.00	2445	1.34	1.44	1.25	2678
1月電子期	368.10	371.15	368.00	-2.95	0.00	552	1.52	1.48	1.18	2036
金融指數	1085.53	1095.38	1083.37	-10.25		48億				
12月金融期	1086.80	1094.00	1084.60	-6.40	0.01	2531	1.30	1.36	1.21	2118
1月金融期	1085.40	1092.00	1083.80	-5.60	-0.00	543	1.25	1.33	1.10	1111
摩台指	344.21	347.28	344.19	-3.59						
12月摩台指	344.20	347.00	344.10	-2.80		24660				205009
1月摩台指	344.30	347.10	344.30	-2.70		1880				13308

<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	隱合波幅
12月9800C	0.2	0.3	0.2	0.1	20	15108	-2	0.2	0.00	29.2%
12月9700C	0.2	0.3	0.1	0.0	93	20246	-53	0.2	0.00	24.6%
12月9600C	0.2	0.5	0.1	-0.3	5425	39347	-798	0.2	0.02	19.9%
12月9500C	0.3	1.0	0.2	-1.5	14225	41761	-1971	0.3	0.07	15.7%
12月9400C	0.8	8.7	0.7	-10.7	45064	51272	2257	0.8	0.19	11.9%
12月9300C	12.0	47.0	11.5	-38.0	65877	33971	9966	12.0	0.38	12.5%
12月9200C	62.0	124.0	59.0	-61.0	14011	14087	1326	16.0	0.61	4.3%
12月9100C	148.0	218.0	146.0	-64.0	1096	4276	-303	2.0	0.81	3.1%
全履約價合計					146780	261947				
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	隱合波幅
12月9300P	67.0	70.0	29.5	27.0	64297	32351	2469	13.0	-0.93	12.1%
12月9200P	17.5	18.0	6.7	5.0	42715	42014	2087	17.5	-0.81	13.2%
12月9100P	3.1	3.5	1.3	-0.1	13681	41069	3503	3.1	-0.62	14.6%
12月9000P	0.8	0.9	0.5	-0.1	7014	53508	-2904	0.8	-0.39	17.5%
12月8900P	0.5	0.7	0.3	0.0	2049	42638	-273	0.5	-0.19	22.1%
12月8800P	0.5	0.5	0.2	0.0	315	34598	-94	0.5	-0.07	27.8%
12月8700P	0.4	0.4	0.2	0.0	191	24170	-4	0.4	-0.02	32.6%
12月8600P	0.3	0.5	0.2	0.1	762	23039	-247	0.3	-0.00	36.9%
12月8500P	0.3	0.4	0.2	0.1	31	18601	3	0.3	-0.00	42.2%
全履約價合計					141214	464320				
距到期日：	2 天		Put/Call Ratio(volume)		0.96		1.77			

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	19843.41	-8.83	-0.04	19923.17	19821.00	0.00	0.00	0.00	強勢整理
NASDAQ	5437.16	-19.70	-0.36	5474.58	5426.01	0.00	0.00	0.00	強勢整理
S&P500	2258.07	-3.96	-0.18	2268.05	2254.24	0.00	0.00	0.00	強勢整理
費城半導體指數	900.85	-9.12	-1.00	916.57	896.68	0.00	0.00	0.00	強勢整理
日經指數	19391.60	-9.55	-0.05	19399.26	19307.14	0.00	0.00	0.00	強勢整理
韓國首爾	2038.39	-3.85	-0.19	2046.03	2037.04	0.00	0.00	0.00	弱勢整理
恆生指數	21832.68	-188.07	-0.85	21955.94	21786.56	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
上海綜合	3118.08	-4.90	-0.16	3125.28	3110.08	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
滬深300指數	3328.98	-17.05	-0.51	3344.86	3325.00	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
A50指數	10020.54	-54.65	-0.54	10075.38	10008.12	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
美元指數	102.66	-0.15	-0.15	102.81	102.52	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
歐元	1.0445	0.0018	0.17	1.0479	1.0436	1.0528	1.0605	1.0676	弱勢整理
黃金	1133.52	6.40	0.56	1142.14	1134.24	1144.78	1156.53	1195.55	弱勢整理
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1702	52.95	0.40	0.76	53.59	53.00	41.22	42.54	43.51	由弱轉強
黃豆1703	1036.75	-5.50	-0.53	1049.00	1038.25	900.15	910.15	915.15	走勢偏多
小麥1705	421.75	2.50	0.59	425.50	423.50	500.52	502.50	510.52	走勢偏弱
玉米1705	363.00	-0.25	-0.07	363.50	361.75	410.25	400.54	414.25	盤整格局
咖啡1703	142.45	0.25	0.18	143.20	140.80	120.00	121.00	124.50	走勢偏弱

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1612	5995.00	-45.00	-0.75	6000.00	5950.00	5458.00	5658.00	5356.00	由弱轉強
日經指數	19391.60	-9.55	-0.05	19399.26	19307.14	0.00	0.00	0.00	強勢整理
A50指數1612	10070.00	-57.50	-0.57	10107.50	10010.00	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
印度指數1612	8147.00	-11.00	-0.08	8166.50	8112.00	7956.00	7825.00	7768.00	由強轉弱

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>