



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20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							
單位：億	買進	賣出	合計	前五日	台股現貨買賣起							
外資及陸資	147.52	168.75	-21.22	129.23	台股現貨買賣起							
投信	6.76	10.14	-3.38	1.93	台股現貨買賣起							
自營商	48.62	48.85	-0.23	-12.05	台股現貨買賣起							
合計	202.91	227.73	-24.83	119.11	台股現貨買賣起							
12/19融資(億)	39.42	36.85	2.57	1319.01	台股現貨買賣起							
12/19融券(張)	30839	23790	7049	餘額	台股現貨買賣起							
單位：口	多				空							
12/19摩台12月多空比	678				880							
台指期前十大佔市場比率	53.5%				46.3%							
電子期前十大佔市場比率	53.1%				77.4%							
金融期前十大佔市場比率	63.9%				68.9%							
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	未平倉	增減	未平倉	增減
外資及陸資	60420	-5387	619	-243	317	-130	72539	79900	-7361	134676	110785	23891
投信	-41929	-16	-507	-18	-273	-1	28	0	28	0	24	-24
自營商	-2619	3807	674	-98	343	-8	-4367	24118	-28485	-25372	-63431	38059

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	中鋼	16,212	6	華新	2,742
2	鴻海	10,938	7	旺宏	2,282
3	中信金	6,026	8	富邦金	2,249
4	群創	4,423	9	聯電	2,194
5	南亞科	3,652	10	台茶	1,744

賣起					
排名	公司	張數	排名	公司	張數
1	新光金	-12,846	6	陽明	-3,570
2	日月光	-10,716	7	英業達	-3,436
3	台積電	-7,953	8	聯發科	-3,403
4	台新金	-4,045	9	統一	-3,241
5	富邦上証正2	-3,713	10	彩晶	-3,176

觀盤重點提示

- 國際金融:美國股市本週一普遍上漲,聖誕節假期前夕交易清淡,市場關注美國聯準會主席葉倫於巴爾的摩大學畢業典禮的演說,她提及美國經濟持續復甦,本屆畢業生將進入10年以來最強勁的就業市場,美元指數應聲漲破103整數關卡,市場持續消化美國聯準會偏鷹派的貨幣政策,短線上在美元過強且聖誕假期將至情況下,預期美國股市漲勢將有所收斂,建議投資人偏保守操作,道瓊指數上漲0.20%、那斯達克指數上漲0.37%、S&P 500 上漲0.20%,費城半導體指數上漲0.98%。
- 台指選擇權:12月買權未平倉最大量在履約價9400點的4.8萬口,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,整體多方佈局近期有轉弱的跡象,台指選擇權籌碼中性看待。
- 台北股市:(1)基本面及策略:台北股市今日開小高整理,早盤過後指數壓回至平盤下,隨後於終場拉回至平盤上,期貨正價差拉大至18點,台指期終場上漲16點,漲幅0.17,現貨指數終場上漲3.09點,漲幅0.03%,型態上以多頭盤整格局看待。今日盤面以油燃、玻璃、橡膠類股指數較為弱勢,鋼鐵、塑膠、水泥類股指數則相對其他產業強勢。今日新台幣兌美元持續走跌至32元大關,為連續第四個交易日走弱,整體亞幣兌美元偏弱,美元指數續於高檔震盪,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:大盤今日持續回測月線支撐,5日均線連續第二日下彎帶給大盤壓力,且預期盤面成交量於聖誕節前將持續清淡,上檔壓力恐難被突破,技術面上中性看待。(3)籌碼面:[1]現貨三大法人今日合計賣起24.83億元,其中外資賣起21.22億元。[2]期貨外資今日淨部位多單來到60420口,較前個交易日減少5387口淨多單,投信淨空單留倉41929口,自營商淨空單留倉2619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	9242.41	9258.69	9199.84	3.09		596億	3.40	2.37	5.45	
12月台指期	9260	9266	9209	16.00	0.19	94397	2.25	2.29	1.84	32524
1月台指期	9254	9256	9208	21.00	0.13	19873	1.85	1.83	1.52	80847
12月小台指	9262	9266	9209	18.00	0.21	62194	1.59	1.66	1.41	17369
1月小台指	9253	9257	9209	20.00	0.11	17265	1.54	1.60	1.39	12446
電子指數	368.56	368.56	365.99	0.46		335億				
12月電子期	368.95	369.95	366.70	0.40	0.00	2431	1.31	1.36	1.20	1969
1月電子期	368.55	369.35	366.30	0.55	-0.00	1103	1.31	1.20	1.11	2562
金融指數	1084.53	1086.61	1080.29	-1.00		44億				
12月金融期	1087.00	1088.80	1082.00	0.40	0.03	2236	1.32	1.28	1.18	1671
1月金融期	1088.60	1088.80	1083.20	3.00	0.04	833	1.19	1.14	1.06	1565
摩台指	344.23	344.68	342.32	0.02						
12月摩台指	344.40	345.00	342.70	0.20		33400				196332
1月摩台指	344.40	344.90	343.00	0.10		5664				14852

<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
12月9800C	0.1	0.2	0.1	-0.1	9	15107	-1	0.1	0.00	38.5%
12月9700C	0.1	0.4	0.1	0.2	192	20070	-176	0.1	0.00	32.3%
12月9600C	0.2	0.4	0.1	0.1	1282	39031	-316	0.2	0.00	27.9%
12月9500C	0.2	0.4	0.1	0.0	1121	41036	-725	0.2	0.03	20.9%
12月9400C	0.4	1.0	0.2	-0.4	15115	48701	-2571	0.4	0.13	15.0%
12月9300C	7.0	14.5	2.4	-5.0	65784	42795	8824	7.0	0.37	13.6%
12月9200C	65.0	75.0	30.0	3.0	49696	18954	4867	5.0	0.69	4.3%
12月9100C	160.0	167.0	112.0	12.0	2502	4333	57	0.0	0.91	3.1%
全履約價合計					136012	271747				
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
12月9300P	47.0	92.0	46.5	-20.0	43409	24645	-7706	7.0	-0.97	11.0%
12月9200P	5.7	20.5	5.0	-11.8	67374	46802	4788	5.7	-0.87	13.0%
12月9100P	0.6	1.9	0.5	-2.5	14665	44874	3805	0.6	-0.63	16.3%
12月9000P	0.3	0.9	0.2	-0.5	1144	53194	-314	0.3	-0.31	22.7%
12月8900P	0.3	0.4	0.1	-0.2	969	42146	-492	0.3	-0.09	30.4%
12月8800P	0.3	0.4	0.1	-0.2	781	34343	-255	0.3	-0.01	38.0%
12月8700P	0.3	0.3	0.2	-0.1	143	24099	-71	0.3	-0.00	45.6%
12月8600P	0.3	0.3	0.2	0.0	40	23000	-39	0.3	-0.00	#VALUE!
12月8500P	0.2	0.3	0.2	0.0	106	18577	-24	0.2	-0.00	#VALUE!
全履約價合計					134147	462591				
距到期日：	1 天	Put/Call Ratio(volume)			0.99	1.70				

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	19883.06	39.65	0.20	19917.78	19832.95	0.00	0.00	0.00	強勢整理
NASDAQ	5457.44	20.28	0.37	5483.42	5436.54	0.00	0.00	0.00	強勢整理
S&P500	2262.53	4.46	0.20	2267.47	2258.21	0.00	0.00	0.00	強勢整理
費城半導體指數	909.68	8.83	0.98	913.29	902.39	0.00	0.00	0.00	強勢整理
日經指數	19494.53	102.93	0.53	19511.20	19356.81	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
韓國首爾	2041.94	3.55	0.17	2047.38	2040.81	0.00	0.00	0.00	弱勢整理
恆生指數	21729.06	-103.62	-0.47	21873.56	21667.19	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
上海綜合	3102.88	-15.20	-0.49	3117.01	3084.80	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
滬深300指數	3309.06	-19.92	-0.60	3329.10	3289.27	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
A50指數	9947.65	-72.89	-0.73	10031.94	9878.43	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
美元指數	103.38	0.25	0.24	103.43	103.03	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
歐元	1.0396	-0.0013	-0.13	1.0418	1.0374	1.0480	1.0568	1.0654	弱勢整理
黃金	1139.10	-5.47	-0.48	1139.51	1131.60	1140.22	1153.41	1190.79	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1702	53.06	0.11	0.21	53.23	52.84	41.22	42.54	43.51	由弱轉強
黃豆1703	1021.50	-9.50	-0.92	1034.75	1020.75	900.15	910.15	915.15	走勢偏多
小麥1705	417.50	-0.75	-0.18	418.75	416.25	500.52	502.50	510.52	走勢偏弱
玉米1705	360.00	-1.00	-0.28	360.25	358.75	410.25	400.54	414.25	盤整格局
咖啡1705	146.55	0.15	0.10	147.40	146.70	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	5920.00	-40.00	-0.68	5945.00	5855.00	5458.00	5658.00	5356.00	由弱轉強
日經指數	19494.53	102.93	0.53	19511.20	19356.81	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
A50指數1612	9912.50	10.00	0.10	9922.50	9910.00	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
印度指數1612	8132.00	-35.50	0.39	8142.50	8065.00	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。>