



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23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	前五日	前日	
外資及陸資	109.50	174.35	-64.85	-232.28	1327.47	
投信	4.00	7.64	-3.64	2.30		
自營商	37.97	39.50	-1.53	-11.98		
合計	151.46	221.48	-70.02	-241.96		
12/22融資(億)	34.95	32.77	2.18		460673	
12/22融券(張)	30403	27345	3058			
單位：口	多		空			
12/22摩台12月多空比	1,644		389			
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
外資及陸資	53014	-970	616	-33	-36	-46
投信	-42624	-55	-507	0	-273	7
自營商	-3999	141	227	-41	-200	-19
台指選擇權(買權)	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減
前日未平倉	24084	-2755	43264	43324		
台指選擇權(賣權)	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減
前日未平倉	15775	11873	3902			

外資現貨買賣起前10名個股

買超		賣超	
排名	公司	張數	排名
1	南亞科	4,248	6
2	聯電	3,687	7
3	南亞	3,398	8
4	中信金	3,008	9
5	佳世達	2,199	10

買超		賣超	
排名	公司	張數	排名
1	台積電	-13,904	6
2	彩晶	-7,464	7
3	台新金	-5,993	8
4	元大金	-5,798	9
5	玉山金	-4,873	10

觀盤重點提示

- 國際金融:美國股市本週四小幅回落,美國股市多頭於美國總統大選後明顯出現放緩的跡象,主要市場受假期影響交易清淡,美元指數於103關卡上下整理,投資人持續消化多空交雜的經濟數據,黃金等貴重金數受到美元持續強勢的影響走弱,市場持續對於明年美國聯準會偏鷹派的貨幣政策仍有所期待,短線上在美元過於強勢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,道瓊指數下跌0.12%,那斯達克指數下跌0.44%、S&P 500 下跌0.19%,費城半導體指數上漲0.52%。
- 台指選擇權:1月買權未平倉最大量在履約價9500點的2.4萬口,賣權未平倉最大量在履約價8800點的1.7萬口,指數的初步支撐看9000點,9200點以上見初步壓力;由外資選擇權未平倉部位分析,整體佈局近期持續轉弱,台指選擇權籌碼偏空看待。
- 台北股市:(1)基本面及策略:台北股市今日走勢偏弱,指數早盤雖一度翻紅,但整體買盤追價意願不足,月初表現較強勢的金融及傳產類股於本週出現較大的跌點,加上外資連日以來持續賣超台積電,都間接影響盤面投資人信心,指數開低走低終場下跌40.11點,跌幅0.44%,型態上以多頭回檔格局看待。今日盤面以塑膠、水泥、鋼鐵類股指數較為弱勢,觀光、運輸、營建類股指數則相對其他產業強勢。今日新台幣兌美元跌點擴大,整體跌幅為近期新高且超過0.4%,近1個月盤整區間已實質被跌破,美國升息的後續動作已在台灣發酵,短線上市場資金面不明朗,加權指數操作方式建議區間保守偏空操作。(2)技術面:大盤於前個交易日跌破月線後,接連貫破季線支撐,短中期均線連續交易日下彎,顯示原有的支撐力道已逐漸轉換為壓力區,在預期盤面成交量於聖誕節前將持續清淡,上檔壓力區恐難被突破,技術面上偏空看待。(3)籌碼面:[1]現貨三大法人今日合計賣超70.02億元,其中外資賣超64.85億元。[2]期貨外資今日淨部位多單來到53014口,較前個交易日減少970口淨多單,投信淨空單留倉42624口,自營商淨空單留倉3999口,籌碼面偏空看待。

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	9078.64	9128.83	9078.64	-40.11		526億	3.60	2.35	5.10	
12月台指期	9090	9147	9088	-38.00	0.13	108371	2.22	2.23	1.84	95607
1月台指期	9080	9135	9076	-39.00	0.01	1205	1.45	1.43	1.32	723
12月小台指	9093	9147	9088	-35.00	0.16	78644	1.61	1.66	1.42	24643
1月小台指	9080	9133	9078	-39.00	0.01	2580	1.40	1.50	1.33	1252
電子指數	363.06	365.35	363.06	-1.18		292億				
12月電子期	363.30	365.30	362.90	-0.90	0.00	2023	1.29	1.29	1.19	3562
1月電子期	362.65	364.75	362.65	-1.00	-0.00	37	1.60	2.00	1.03	45
金融指數	1057.10	1063.65	1052.60	-2.90		45億				
12月金融期	1060.00	1067.00	1052.80	-2.60	0.03	4070	1.31	1.29	1.21	2195
1月金融期	1059.40	1065.00	1052.40	-2.20	0.03	103	1.64	1.58	1.18	39
摩台指	337.57	339.69	337.57	-1.50						
12月摩台指	337.70	339.60	337.40	-1.10		48367				150899
1月摩台指	338.20	340.00	337.90	-1.00		28695				66764

<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
1月9600C	3.1	4.5	3.0	-0.9	5543	19563	601	3.1	0.22	11.1%
1月9500C	7.3	11.0	7.1	-2.3	12461	24874	1679	7.3	0.26	11.0%
1月9400C	16.5	24.0	15.5	-5.0	12170	20906	3215	16.5	0.32	11.2%
1月9300C	34.0	49.0	33.0	-10.0	11251	13751	3157	34.0	0.38	11.4%
1月9200C	65.0	88.0	63.0	-17.0	9210	9323	2050	65.0	0.44	11.9%
1月9100C	111.0	142.0	109.0	-20.0	6077	4284	1164	111.0	0.51	12.6%
1月9000C	170.0	207.0	168.0	-27.0	1705	2285	572	80.0	0.57	4.3%
1月8900C	242.0	285.0	239.0	-31.0	383	1483	153	52.0	0.64	3.1%
全履約價合計					61633	129309				
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
1月9100P	119.0	122.0	96.0	15.0	7342	9509	-123	109.0	-0.62	11.8%
1月9000P	79.0	82.0	63.0	10.0	14581	15976	1161	79.0	-0.56	12.3%
1月8900P	52.0	54.0	40.5	7.5	7282	13147	1254	52.0	-0.49	13.0%
1月8800P	33.0	34.5	26.0	4.5	7401	16995	1600	33.0	-0.43	13.6%
1月8700P	20.5	22.5	16.5	2.5	7132	15735	3261	20.5	-0.36	14.2%
1月8600P	13.0	14.0	10.0	1.5	3959	12212	1626	13.0	-0.30	14.9%
1月8500P	7.9	8.9	6.8	0.3	3750	9592	942	7.9	-0.24	15.5%
1月8400P	5.1	6.0	4.6	0.1	1674	5276	729	5.1	-0.19	16.2%
1月8300P	3.5	4.0	3.1	0.2	945	4209	233	3.5	-0.15	17.2%
全履約價合計					60946	135816				
距到期日：	26 天	Put/Call Ratio(volume)		0.99	1.05					

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	19918.88	-23.08	-0.12	19933.83	19882.19	0.00	0.00	0.00	強勢整理
NASDAQ	5447.42	-24.01	-0.44	5472.01	5432.77	0.00	0.00	0.00	強勢整理
S&P500	2260.96	-4.22	-0.19	2263.18	2256.08	0.00	0.00	0.00	強勢整理
費城半導體指數	923.06	4.73	0.52	928.29	919.45	0.00	0.00	0.00	強勢整理
日經指數	19427.67	-16.82	-0.09	19427.67	19327.51	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
韓國首爾	2035.90	0.17	0.01	2037.71	2031.54	0.00	0.00	0.00	弱勢整理
恆生指數	21574.76	-61.44	-0.28	21601.07	21491.83	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
上海綜合	3110.15	-29.41	-0.94	3138.40	3103.75	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
滬深300指數	3307.60	-28.07	-0.84	3334.89	3300.88	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
A50指數	9929.06	-55.11	-0.55	9985.93	9896.95	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
美元指數	103.05	-0.04	-0.04	103.10	102.94	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
歐元	1.0437	0.0004	0.04	1.0452	1.0426	1.0418	1.0484	1.0602	弱勢整理
黃金	1128.71	2.55	0.23	1132.10	1127.90	1132.81	1141.34	1176.80	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1703	53.86	-0.35	-0.65	53.70	53.48	41.22	42.54	43.51	由弱轉強
黃豆1703	994.50	-0.75	-0.07	1005.75	997.50	900.15	910.15	915.15	走勢偏多
小麥1705	410.00	0.00	0.00	410.50	409.50	500.52	502.50	510.52	走勢偏弱
玉米1705	354.00	-0.50	-0.14	354.25	353.25	410.25	400.54	414.25	盤整格局
咖啡1705	141.35	-5.55	-3.78	146.50	140.95	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日均價	30日均價	近期評析
摩根印尼指數1612	5745.00	0.00	0.00	5765.00	5705.00	5458.00	5658.00	5356.00	由弱轉強
日經指數	19427.67	-16.82	-0.09	19427.67	19327.51	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
A50指數1612	9970.00	-55.00	-0.55	9995.00	9867.50	0.00	0.00	0.00	由強轉弱
印度指數1612	7991.00	17.00	0.13	8036.00	7945.50	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。>