



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

台股期貨 2016年12月26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				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				台股現貨買賣起				
外資及陸資	38.19	50.03	-11.85	-223.80	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起				
投信	3.81	7.16	-3.36	-10.70	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起				
自營商	26.26	28.03	-1.78	7.61	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起				
合計	68.25	85.23	-16.98	-226.89	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起				
12/23融資(億)	31.71	28.16	3.55	前日	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起				
12/23融券(張)	27861	23808	4053	餘額	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起				
單位：口	多			空	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起				
12/23摩台12月多空比	1,648			248	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起				
台指期前十大佔市場比率	53.5%			46.3%	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起				
電子期前十大佔市場比率	53.1%			77.4%	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起				
金融期前十大佔市場比率	63.9%			68.9%	台股現貨買賣起				台股現貨買賣起				
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(買權)		台指選擇權(買權)		
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	52885	-129	614	-2	-20	16	25317	21329	3988	45650	43264	2386	
投信	-42075	549	-507	0	-273	0	0	0	0	0	0	0	
自營商	-3157	842	245	18	17	217	9026	1794	7232	25026	15775	9251	

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	中信金	11,019	6	華夏	1,537
2	第一金	1,930	7	華通	1,071
3	鴻海	1,582	8	中華電	1,014
4	國泰臺灣加權反1	1,572	9	中壽	890
5	聯電	1,549	10	南亞	867

賣起					
排名	公司	張數	排名	公司	張數
1	富邦上証正2	- 3,454	6	日月光	- 1,944
2	彩晶	- 3,194	7	陽明	- 1,709
3	台積電	- 3,107	8	遠東新	- 1,642
4	友達	- 3,095	9	中鋼	- 1,633
5	新光金	- 3,074	10	元大S&P原油正2	- 1,360

觀盤重點提示

- 國際金融：美國股市上週五小幅回落，美國股市多頭於美國總統大選後明顯出現放緩的跡象，歐美主要市場受假期影響交易清淡，主要股票指數僅於盤面上狹幅整理，短線上在聖誕假期及新年假期期間，美國股市於區間狹幅整理的機率較高，建議投資人偏保守操作，道瓊指數上漲0.07%、那斯達克指數上漲0.28%、S&P 500 上漲0.13%，費城半導體指數上漲0.53%。
- 台指選擇權：1月買權未平倉最大量在履約價9500點的2.6萬口，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：台北股市今日跌深反彈，指數早盤及尾盤走高，蘋概股和金融類股為大盤一大看點，可惜量能受歐美聖誕假期影響明顯收縮，指數僅上漲31.90點，漲幅0.35%，型態上以多頭盤整格局看待。今日盤面以紡織、玻璃、鋼鐵類股指數較為弱勢，金融、食品、塑膠類股指數則相對其他產業強勢。今日新台幣兌美元由升轉貶，且振幅於近幾個交易日有擴大跡象，11月中以來盤整區間已實質被跌破，美國升息的後續動作持續在市場發酵，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：大盤今日量縮狹幅整理，技術面延續上周走勢，指數於上週跌破月線及季線後，短中期均線連續交易日下彎，上檔壓力區間逐漸成型，且預期盤面成交量於聖誕節前後將持續清淡，上檔壓力恐難被突破，技術面上偏空看待。(3)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計賣起16.98億元，其中外資賣起11.85億元。[2]期貨外資今日淨部位多單來到52885口，較前個交易日減少129口淨多單，投信淨空單留倉42075口，自營商淨空單留倉3157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	9110.54	9127.74	9083.28	31.90		318億	3.74	2.34	5.40	
1月台指期	9123	9131	9089	31.00	0.14	69826	2.13	2.11	1.78	96956
2月台指期	9111	9118	9080	31.00	0.01	898	1.52	1.46	1.41	839
1月小台指	9125	9132	9089	33.00	0.16	52331	1.58	1.58	1.39	24932
2月小台指	9112	9118	9079	32.00	0.02	1822	1.49	1.48	1.42	1341
電子指數	364.26	365.24	363.29	1.20		167億				
1月電子期	364.55	364.80	363.30	1.30	0.00	1269	1.28	1.33	1.22	3540
2月電子期	364.05	364.25	362.70	1.40	-0.00	14	2.15	2.00	1.00	48
金融指數	1068.17	1068.17	1058.12	11.07		19億				
1月金融期	1068.20	1069.20	1060.40	8.20	0.00	2131	1.32	1.30	1.22	2258
2月金融期	1068.00	1068.00	1060.00	8.60	-0.00	51	1.93	1.66	1.16	59
摩台指	339.17	339.59	338.01	1.60						
12月摩台指	339.10	339.20	337.80	1.40		14295				118439
1月摩台指	339.70	339.70	338.20	1.50		6791				107283

<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9700C	1.3	1.7	1.2	-0.1	968	13136	-54	1.3	0.17	11.3%
1月9600C	3.1	3.8	2.5	0.0	2844	19991	428	3.1	0.22	11.1%
1月9500C	7.5	8.8	6.0	0.2	6240	26046	1172	7.5	0.27	11.1%
1月9400C	17.5	19.5	14.0	1.0	7626	22900	1994	17.5	0.33	11.2%
1月9300C	38.0	42.0	31.5	4.0	8107	15789	2038	38.0	0.39	11.6%
1月9200C	73.0	78.0	61.0	8.0	5807	10600	1277	73.0	0.46	12.2%
1月9100C	123.0	130.0	107.0	12.0	3303	5079	795	100.0	0.53	4.3%
1月9000C	186.0	195.0	166.0	16.0	1390	2725	440	63.0	0.60	3.1%
全履約價合計					37049	137638				
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9200P	148.0	172.0	147.0	-24.0	1420	7199	130	71.0	-0.67	11.5%
1月9100P	97.0	117.0	97.0	-22.0	4240	9824	315	97.0	-0.61	11.9%
1月9000P	62.0	77.0	62.0	-17.0	8310	16948	972	62.0	-0.54	12.5%
1月8900P	39.0	49.0	38.5	-13.0	4883	13674	527	39.0	-0.47	13.1%
1月8800P	24.0	30.5	23.5	-9.0	4648	17875	880	24.0	-0.40	13.8%
1月8700P	15.0	19.0	14.5	-5.5	4200	16362	627	15.0	-0.33	14.6%
1月8600P	9.0	12.5	8.9	-4.0	2805	12408	196	9.0	-0.27	15.2%
1月8500P	5.0	7.5	5.0	-2.9	3110	10719	1127	5.0	-0.22	15.7%
1月8400P	3.6	4.6	3.6	-1.5	1210	5739	463	3.6	-0.17	16.9%
全履約價合計					37235	141973				
距到期日：	23 天		Put/Call Ratio(volume)		1.01	1.03				

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	19933.81	14.93	0.07	19934.15	19899.06	-	-	-	強勢整理
NASDAQ	5462.69	15.27	0.28	5462.69	5441.76	-	-	-	弱勢整理
S&P500	2263.79	2.83	0.13	2263.79	2258.84	-	-	-	強勢整理
費城半導體指數	927.92	4.86	0.53	928.04	920.43	-	-	-	強勢整理
日經指數	19396.64	-31.03	-0.16	19432.48	19385.94	-	-	-	由強轉弱
韓國首爾	2037.75	1.85	0.09	2039.76	2034.80	-	-	-	弱勢整理
恆生指數	21574.76	-61.44	-0.28	21601.07	21491.83	-	-	-	弱勢整理
上海綜合	3122.57	12.42	0.40	3122.88	3068.42	-	-	-	弱勢整理
滬深300指數	3322.40	14.80	0.45	3322.42	3267.05	-	-	-	弱勢整理
A50指數	9994.29	65.23	0.66	9997.37	9815.17	-	-	-	弱勢整理
美元指數	102.96	0.04	0.04	103.02	102.83	-	-	-	走勢偏多
歐元	1.0451	-0.0001	-0.01	1.0468	1.0434	1.0418	1.0484	1.0602	弱勢整理
黃金	1132.69	-	-	-	-	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	30日均價	近期評析
N輕原油1703	53.92	-	-	-	-	41.22	42.54	43.51	由弱轉強
黃豆1703	989.00	-5.00	-0.50	1006.75	997.00	900.15	910.15	915.15	走勢偏多
小麥1705	406.75	-2.25	-0.55	410.50	406.00	500.52	502.50	510.52	走勢偏弱
玉米1705	352.50	-0.25	-0.07	354.25	352.00	410.25	400.54	414.25	盤整格局
咖啡1705	138.40	-3.10	-2.19	141.95	138.20	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	5720.00	-	-	-	-	5458.00	5658.00	5356.00	由弱轉強
日經指數	19396.64	-31.03	-0.16	19432.48	19385.94	-	-	-	由強轉弱
A50指數1612	9892.50	127.50	1.29	10020.00	9780.00	-	-	-	弱勢整理
印度指數1612	7996.00	-77.50	0.08	8014.00	7896.00	7956.00	7825.00	7768.00	弱勢整理

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>