



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27日

星期二

收盤日報

法人動態：

| 台股現貨買賣起 | | | | | | | | | | | | |
|---------------|--------|-------|-------|---------|---------|-----------|-----------|-------|-----------|-----------|-------|-------|
| 單位：億 | 買進 | 賣出 | 合計 | 前五日 | | 個股貢獻點數前十名 | | | 個股貢獻點數後十名 | | | |
| 外資及陸資 | 50.35 | 57.07 | -6.72 | -210.84 | | 台積電 | 4.78 | 富邦金 | -2.64 | | | |
| 投信 | 6.43 | 4.14 | 2.29 | 10.93 | | 台塑化 | 3.51 | 國泰金 | -2.08 | | | |
| 自營商 | 26.72 | 23.68 | 3.04 | -4.25 | | 鴻海 | 1.28 | 台化 | -1.51 | | | |
| 合計 | 83.50 | 84.89 | -1.38 | -204.16 | | 聯發科 | 1.17 | 南亞 | -1.46 | | | |
| 12/26融資(億) | 23.65 | 22.37 | 1.28 | 前日 | 1330.33 | 大立光 | 0.99 | 中鋼 | -0.87 | | | |
| 12/26融券(張) | 21278 | 32344 | 11066 | 餘額 | 459845 | 日月光 | 0.73 | 南亞科 | -0.76 | | | |
| 單位：口 | 多 | | | 空 | | 微星 | 0.65 | 兆豐金 | -0.75 | | | |
| 12/26摩台12月多空比 | 1,666 | | | 264 | | 統一 | 0.63 | 台達電 | -0.48 | | | |
| 台指期前十大佔市場比率 | 53.5% | | | 46.3% | | 鴻準 | 0.52 | 榮化 | -0.46 | | | |
| 電子期前十大佔市場比率 | 53.1% | | | 77.4% | | 可成 | 0.43 | 統一超 | -0.38 | | | |
| 金融期前十大佔市場比率 | 63.9% | | | 68.9% | | 前十名合計 | 14.68 | 後十名合計 | -11.39 | | | |
| 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 | 前日未平倉 | 增減 | 未平倉 | 前日未平倉 | 增減 |
| 外資及陸資 | 52148 | -737 | 672 | 58 | -11 | 9 | 25073 | 25317 | -244 | 48351 | 43264 | 5087 |
| 投信 | -42084 | -9 | -507 | 0 | -273 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 自營商 | -3002 | 155 | 260 | 15 | -58 | -75 | 10611 | 9026 | 1585 | 26775 | 15775 | 11000 |

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 | 18,040 | 6 | 華新 | 1,746 |
| 2 | 元大滬深300正2 | 10,979 | 7 | 國泰臺灣加權反 | 1,692 |
| 3 | 富邦上証正2 | 7,155 | 8 | 長榮航 | 1,640 |
| 4 | 中石化 | 3,258 | 9 | 宏基 | 1,479 |
| 5 | 元大S&P石油 | 1,820 | 10 | 群創 | 1,170 |

| 賣起 | | | | | |
|----|----------|---------|----|-----|---------|
| 排名 | 公司 | 張數 | 排名 | 公司 | 張數 |
| 1 | 友達 | - 4,289 | 6 | 陽明 | - 1,701 |
| 2 | 元大台灣50反1 | - 3,004 | 7 | 新光金 | - 1,642 |
| 3 | 彩晶 | - 2,700 | 8 | 元大金 | - 1,555 |
| 4 | 台積電 | - 2,369 | 9 | 統一 | - 1,510 |
| 5 | 玉山金 | - 1,993 | 10 | 永豐金 | - 1,299 |

觀盤重點提示

- 國際金融：歐美主要市場逢周一聖誕節假期休市一日。
- 台指選擇權：1月買權未平倉最大量在履約價9500點的2.7萬口，賣權未平倉最大量在履約價8800點的1.9萬口，指數的初步支撐看9100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：台北股市今日在平盤上下整理，指數早盤走高可惜買盤進場意願不積極，昨日表現較佳的蘋股和金融類股回弱，盤面缺乏主流股的帶動，且量能受歐美聖誕假期影響持續收縮，1月台指期下跌11點，跌幅0.12%，現貨指數終場小跌1.27點，跌幅0.01%，型態上以多頭盤整格局看待。今日盤面以電纜、化工、塑膠類股指數較為弱勢，油燃、食品、橡膠類股指數則相對其他產業強勢。今日新台幣兌美元持續走貶，整體貶值幅度達0.18%且創下近期新低，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：大盤今日量縮狹幅整理，技術面受制於量能大幅萎縮變化有限，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1.38億元，其中外資賣起6.72億元。[2]期貨外資今日淨部位多單來到52148口，較前個交易日減少737口淨多單，投信淨空單留倉42084口，自營商淨空單留倉3002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 | 9109.27 | 9132.05 | 9100.83 | -1.27 | | 334億 | 3.81 | 2.46 | 5.34 | |
| 1月台指期 | 9113 | 9130 | 9106 | -11.00 | 0.04 | 47613 | 2.09 | 2.12 | 1.76 | 96270 |
| 2月台指期 | 9100 | 9117 | 9096 | -12.00 | -0.10 | 619 | 1.61 | 1.59 | 1.50 | 914 |
| 1月小台指 | 9113 | 9130 | 9106 | -11.00 | 0.04 | 36473 | 1.57 | 1.61 | 1.40 | 25523 |
| 2月小台指 | 9101 | 9116 | 9096 | -11.00 | -0.09 | 848 | 1.42 | 1.51 | 1.37 | 1470 |
| 電子指數 | 364.75 | 365.51 | 364.06 | 0.49 | | 186億 | | | | |
| 1月電子期 | 364.70 | 365.05 | 363.80 | 0.20 | -0.00 | 981 | 1.42 | 1.33 | 1.19 | 3512 |
| 2月電子期 | 363.90 | 364.05 | 363.50 | -0.15 | -0.01 | 5 | 2.80 | 3.13 | 1.00 | 51 |
| 金融指數 | 1062.70 | 1068.65 | 1061.52 | -5.47 | | 21億 | | | | |
| 1月金融期 | 1064.20 | 1068.60 | 1062.00 | -4.40 | 0.02 | 1661 | 1.25 | 1.33 | 1.19 | 2220 |
| 2月金融期 | 1062.40 | 1066.40 | 1061.80 | -5.60 | -0.00 | 36 | 1.66 | 1.75 | 1.01 | 61 |
| 摩台指 | 339.41 | 340.02 | 338.77 | 0.24 | | | | | | |
| 12月摩台指 | 339.20 | 339.60 | 338.40 | 0.10 | | 40905 | | | | 94626 |
| 1月摩台指 | 339.60 | 340.70 | 338.90 | 0.00 | | 34643 | | | | 120038 |

<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 | 1.1 | 1.4 | 1.1 | -0.2 | 929 | 13091 | -45 | 1.1 | 0.16 | 11.4% |
| 1月9600C | 2.5 | 3.1 | 2.4 | -0.6 | 1248 | 20594 | 603 | 2.5 | 0.21 | 11.0% |
| 1月9500C | 6.0 | 7.5 | 6.0 | -1.5 | 3477 | 27121 | 1075 | 6.0 | 0.26 | 10.8% |
| 1月9400C | 14.0 | 17.5 | 13.5 | -3.5 | 5902 | 25137 | 2237 | 14.0 | 0.32 | 10.8% |
| 1月9300C | 32.0 | 39.0 | 32.0 | -6.0 | 5624 | 17121 | 1332 | 32.0 | 0.38 | 11.1% |
| 1月9200C | 64.0 | 74.0 | 63.0 | -9.0 | 4545 | 12148 | 1548 | 64.0 | 0.45 | 11.5% |
| 1月9100C | 112.0 | 124.0 | 111.0 | -11.0 | 2365 | 5588 | 509 | 99.0 | 0.52 | 4.3% |
| 1月9000C | 175.0 | 190.0 | 174.0 | -11.0 | 1098 | 2973 | 248 | 62.0 | 0.59 | 3.1% |
| 全履約價合計 | | | | | 25592 | 145188 | | | | |
| 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 | 152.0 | 158.0 | 146.0 | 4.0 | 1079 | 7259 | 60 | 65.0 | -0.68 | 11.5% |
| 1月9100P | 99.0 | 106.0 | 96.0 | 2.0 | 3335 | 10324 | 500 | 99.0 | -0.62 | 11.8% |
| 1月9000P | 61.0 | 69.0 | 60.0 | -1.0 | 7114 | 17888 | 940 | 61.0 | -0.55 | 12.2% |
| 1月8900P | 38.0 | 43.0 | 37.0 | -1.0 | 3453 | 14561 | 887 | 38.0 | -0.48 | 13.0% |
| 1月8800P | 22.5 | 26.5 | 22.0 | -1.5 | 4310 | 19174 | 1299 | 22.5 | -0.41 | 13.5% |
| 1月8700P | 13.5 | 16.5 | 13.0 | -1.5 | 2398 | 17536 | 1174 | 13.5 | -0.34 | 14.3% |
| 1月8600P | 8.2 | 9.9 | 7.9 | -0.8 | 2846 | 13822 | 1414 | 8.2 | -0.27 | 15.1% |
| 1月8500P | 4.6 | 6.1 | 4.6 | -0.4 | 1877 | 11232 | 513 | 4.6 | -0.22 | 15.6% |
| 1月8400P | 3.2 | 3.9 | 3.0 | -0.4 | 823 | 6286 | 547 | 3.2 | -0.16 | 16.7% |
| 全履約價合計 | | | | | 29156 | 149836 | | | | |
| 距到期日： | 22 天 | | Put/Call Ratio(volume) | | 1.14 | 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 | - | - | - | 強勢整理 |
| 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 | 19403.06 | 6.42 | 0.03 | 19478.58 | 19352.06 | - | - | - | 強勢整理 |
| 韓國首爾 | 2042.17 | 4.42 | 0.22 | 2044.43 | 2037.12 | - | - | - | 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 | 3114.66 | -7.91 | -0.25 | 3127.88 | 3113.75 | - | - | - | 弱勢整理 |
| 滬深300指數 | 3316.39 | -6.01 | -0.18 | 3330.23 | 3315.83 | - | - | - | 弱勢整理 |
| A50指數 | 9966.98 | -27.31 | -0.27 | 10015.82 | 9965.06 | - | - | - | 弱勢整理 |
| 美元指數 | 103.03 | 0.07 | 0.07 | 103.15 | 102.97 | - | - | - | 走勢偏多 |
| 歐元 | 1.0456 | -0.0008 | -0.08 | 1.0464 | 1.0432 | 1.0431 | 1.0455 | 1.0579 | 弱勢整理 |
| 黃金 | 1132.69 | 11.22 | 0.99 | 1149.09 | 1131.30 | 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 | 0.26 | 0.48 | 54.24 | 53.90 | 41.22 | 42.54 | 43.51 | 由弱轉強 |
| 黃豆1703 | 989.00 | 14.00 | 1.40 | 1012.00 | 998.00 | 900.15 | 910.15 | 915.15 | 走勢偏多 |
| 小麥1705 | 406.75 | 6.25 | 1.54 | 413.00 | 407.75 | 500.52 | 502.50 | 510.52 | 走勢偏弱 |
| 玉米1705 | 352.50 | 3.50 | 0.99 | 356.00 | 353.00 | 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 | 80.00 | 1.40 | 5800.00 | 5675.00 | 5458.00 | 5658.00 | 5356.00 | 由弱轉強 |
| 日經指數 | 19403.06 | 6.42 | 0.03 | 19478.58 | 19352.06 | - | - | - | 強勢整理 |
| A50指數1612 | 10020.00 | -40.00 | -0.40 | 10020.00 | 9940.00 | - | - | - | 弱勢整理 |
| 印度指數1612 | 7911.00 | 56.00 | 0.05 | 7973.00 | 7905.00 | 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。>