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11月29日　星期二　收盤日報

法人動態：

	台股現貨買賣超				
單位：億	買進	賣出	合計	前五日	
外資及陸資	240.81	241.21	-0.41	34.37	
投信	11.07	7.97	3.09	7.94	
自營商	62.78	52.23	10.55	32.64	
合計	314.65	301.42	13.24	74.96	
11/28融資(億)	51.61	48.93	2.68	前日	1276.74
11/28融券(張)	23763	33196	9433	餘額	494334

單位：口	多	空
11/28摩台12月多空比	256	1,760
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%

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
鴻海	5.29	台積電	-22.80
台塑	3.08	台塑化	-8.37
可成	1.69	國泰金	-6.35
台化	1.29	中信金	-2.14
大立光	1.18	正新	-1.71
鴻準	1.12	日月光	-1.57
華新	0.77	和泰車	-1.44
群創	0.66	聯發科	-1.39
中華	0.46	兆豐金	-1.20
富邦金	0.45	華碩	-1.14
前十名合計	15.99	後十名合計	-48.11

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	78237	-2962	1680	-46	479	-342	72532	73806	-1274	96030	92513	3517
投信	-41092	-133	-498	0	-266	-1	0	0	0	15	67	-52
自營商	-6490	99	643	-71	215	15	50890	47031	3859	-36564	-38996	2432

外資現貨買賣超前10名個股

買超

排名	公司	張數	排名	公司	張數
1	鴻海	18,272	6	中鋼	5,326
2	華新	8,510	7	富邦金	5,076
3	FB上証正2	7,381	8	第一金	4,812
4	大同	7,168	9	元大S&P原油正2	4,154
5	新光金	5,851	10	瀚宇博	3,651

賣超

排名	公司	張數	排名	公司	張數
1	群創	-16,444	6	統一	-5,501
2	中壽	-8,953	7	合庫金	-4,798
3	友達	-7,436	8	華亞科	-4,058
4	中信金	-6,235	9	國泰金	-3,496
5	玉山金	-5,547	10	台灣大	-3,460

觀盤重點提示

1. 國際金融:美國股市於本週一由歷史高點回落，金融類股漲多拉回，公用事業等防禦型類股上漲，市場持續關注本週石油輸出國組織即將召開的會議，市場預期石油輸出國組織極有可能在本週會議上達成減產協議，油價收斂上週五跌幅，美國10年期公債殖利率小幅回落，美元指數於101點上下盤整，主要基本面變化不大，美國聯準會即將於12月升息的訊號漸趨明確，全球資金回流美國，短線上美股跌點有限，建議投資人逢美股回檔可偏多操作，道瓊指數下跌0.28%、那斯達克指數下跌0.56%、S&P 500 下跌0.53%。
2. 台指選擇權:12月買權未平倉最大量在履約價9400點的3.8萬口，賣權未平倉量最大量在履約價8900點的2.9萬口，指數的初步支撐為9100點，9200點以上見初步壓力；由外資選擇權未平倉部位分析，整體多方佈局偏強，台指選擇權籌碼偏多看待。
3. 台北股市:(1)基本面及策略:台北股市今日在平盤附近做整理，前幾個交易日較強勢的金融類股隨美股走弱，台積電於午盤過後逢特定賣盤，顯示特定交易人策略性壓低摩台結算行情，指數終場小幅下跌29.86點，跌幅0.32%，型態上以偏多盤整格局看待。今日盤面以油燃、半導體、金融類股指數較為弱勢，電纜、玻璃、光電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，多數亞幣兌美元今日持續走強，近期弱勢的亞幣有止跌的跡象，市場預期美國聯準會於下個月升息，升息的利空已逐漸反映在新興市場股市，短線上台股跌點有限，建議逢台股回檔時利用選擇權建立賣權多頭價差交易策略，如果行情在短期內偏多盤整即可有獲利機會。(2)技術面:大盤今日於季線之上盤整，加權指數試圖收復美國總統大選開票日的長黑，可惜並未成功，顯示指數於上檔時仍有些許壓力，但5日均線與季線持續走揚，月線也可望在本週走平翻揚，大盤上檔壓力逐漸被突破，整體量能小幅增加至748億元，技術面上偏多看待。(3)籌碼面:[1]現貨三大法人今日合計買超13.24億元，其中外資賣超0.41億元。[2]期貨外資今日淨部位多單來到78237口，較前個交易日減少2962口淨多單，投信淨空單留倉41092口，自營商淨空單留倉6490口，籌碼面偏多看待。

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	9192.38	9249.06	9192.38	-29.86		748億	3.40	2.35	5.62	
12月台指期	9203	9238	9196	-20.00	0.12	102736	2.22	2.28	1.89	110775
1月台指期	9181	9215	9175	-21.00	-0.12	1449	1.59	1.51	1.39	4981
12月小台指	9202	9239	9196	-21.00	0.10	75130	1.62	1.67	1.44	29497
1月小台指	9182	9217	9174	-20.00	-0.11	2851	1.45	1.44	1.32	3132
電子指數	368.70	371.83	368.70	-0.94		381億				
12月電子期	368.90	371.25	368.85	-0.80	0.00	2134	1.21	1.23	1.15	4094
1月電子期	368.15	370.40	368.15	-0.75	-0.01	42	1.35	1.44	1.20	153
金融指數	1060.71	1067.63	1060.58	-9.21		87億				
12月金融期	1063.40	1068.40	1061.40	-6.20	0.03	3461	1.34	1.63	1.24	2841
1月金融期	1061.20	1065.80	1059.60	-6.80	0.01	68	1.38	1.35	1.09	181
摩台指	343.47	346.47	343.47	-1.74						
11月摩台指	344.50	346.10	344.10	-0.70		14155				31137
12月摩台指	344.30	346.10	344.20	-1.30		38103				196319

<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	1.2	1.4	1.1	-0.2	173	11961	46	1.2	0.16	11.7%
12月9700C	1.8	2.5	1.8	-0.7	1844	13806	363	1.8	0.20	10.6%
12月9600C	4.5	6.4	4.5	-1.8	3821	18207	-444	4.5	0.26	10.5%
12月9500C	12.0	15.5	11.5	-3.0	6532	29208	731	12.0	0.31	10.6%
12月9400C	29.0	36.0	28.0	-6.0	7320	38450	808	29.0	0.38	11.0%
12月9300C	59.0	74.0	58.0	-11.0	9692	28022	662	59.0	0.44	11.5%
12月9200C	109.0	129.0	107.0	-13.0	6819	18008	381	106.0	0.51	4.3%
12月9100C	175.0	198.0	171.0	-14.0	2174	7731	209	72.0	0.58	3.1%
			全履約價合計		39576	210527				
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	158.0	162.0	135.0	13.0	1774	4830	117	61.0	-0.69	11.3%
12月9200P	107.0	110.0	91.0	8.0	4855	8263	716	107.0	-0.62	12.0%
12月9100P	72.0	74.0	60.0	7.0	6970	13267	1583	72.0	-0.56	13.0%
12月9000P	47.5	49.0	39.5	3.5	7020	17063	1035	47.5	-0.49	13.8%
12月8900P	32.0	33.5	27.0	2.0	4528	29489	131	32.0	-0.41	14.8%
12月8800P	21.5	22.5	18.0	1.0	5357	23744	981	21.5	-0.35	15.8%
12月8700P	15.5	16.0	13.0	1.5	3247	21390	1113	15.5	-0.28	17.0%
12月8600P	11.0	11.5	9.4	1.0	3223	21255	552	11.0	-0.22	18.1%
12月8500P	8.4	8.5	7.0	0.6	1985	16659	-15	8.4	-0.17	19.4%
			全履約價合計		49756	298586				
距到期日：	22 天		Put/Call Ratio(volume)		1.26	1.42				

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	19097.90	-54.24	-0.28	19138.72	19072.25	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
NASDAQ	5368.81	-30.11	-0.56	5396.27	5364.91	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
S&P500	2201.72	-11.63	-0.53	2211.14	2200.36	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
費城半導體指數	887.26	-3.71	-0.42	891.46	886.28	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
日經指數	18307.04	-49.85	-0.27	18327.51	18258.82	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
韓國首爾	1978.39	0.26	0.01	1982.53	1972.31	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
恆生指數	22737.07	-93.50	-0.41	22868.14	22724.59	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
上海綜合	3282.92	5.92	0.18	3301.21	3263.40	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
滬深300指數	3564.04	28.96	0.82	3583.72	3521.38	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
A50指數	10653.90	145.59	1.39	10705.12	10467.72	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
美元指數	101.24	0.08	0.08	101.40	101.11	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
歐元	1.0606	0.0002	0.02	1.0622	1.0587	1.0585	1.0618	1.0844	弱勢整理
黃金	1193.01	-1.00	-0.08	1194.80	1188.50	1192.30	1205.29	1248.62	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日均價**	**30日均價**	**近期評析**
N輕原油1702	47.99	-0.50	-1.04	47.86	47.43	41.22	42.54	43.51	由弱轉強
黃豆1703	1056.00	-5.00	-0.47	1067.50	1057.00	900.15	910.15	915.15	走勢偏多
小麥1703	416.50	-2.75	-0.66	415.75	413.50	500.52	502.50	510.52	走勢偏弱
玉米1703	358.25	-2.00	-0.56	357.75	356.00	410.25	400.54	414.25	盤整格局
咖啡1703	156.65	1.55	1.00	157.15	154.45	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1611	5825.00	55.00	0.94	5890.00	5825.00	5458.00	5658.00	5356.00	走勢偏弱
日經指數	18307.04	-49.85	-0.27	18327.51	18258.82	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
A50指數1611	10517.50	135.00	1.28	10702.50	10472.50	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
印度指數1612	8149.50	50.50	0.19	8218.50	8131.50	7956.00	7825.00	7768.00	由弱轉強

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>