



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30日 星期三 收盤日報

● 法人動態：

單位：億	台股現貨買賣起				個股貢獻點數前十名				個股貢獻點數後十名			
	買進	賣出	合計	前五日	台塑化	17.44	中鋼	-2.59	台積電	9.49	可成	-1.97
外資及陸資	494.92	484.67	10.25	23.46	台化	3.00	國泰金	-1.84	大立光	2.45	兆豐金	-1.24
投信	7.91	6.21	1.70	9.20	台塑	2.10	統一	-1.04	中信金	1.78	日月光	-0.87
自營商	47.86	60.34	-12.47	9.60	台達電	1.90	英業達	-0.99	彰銀	1.31	瑞昱	-0.55
合計	550.69	551.22	-0.53	42.26	和泰車	1.30	聯電	-0.46	亞泥	1.29	元大金	-0.44
11/29融資(億)	46.14	40.86	5.28	前日	1281.10	前10名合計	42.08	後10名合計	-12.01			
11/29融券(張)	23797	39941	16144	餘額	506870							
單位：口	多				空							
11/29摩台12月多空比	427				2,290							
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		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	80059	1822	1694	14	336	-143	71745	72532	-787	87157	96030	-8873
投信	-40955	137	-498	0	-272	-6	0	0	0	0	15	-15
自營商	-7218	-728	566	-77	224	9	45245	50890	-5645	-48872	-36564	-12308

● 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	13,856	6	華南金	5,691
2	中壽	9,449	7	華新	5,690
3	群創	6,920	8	台化	5,403
4	富邦金	6,551	9	國喬	5,331
5	光寶科	6,371	10	大聯大	5,249

賣起					
排名	公司	張數	排名	公司	張數
1	聯電	-17,351	6	兆豐金	-7,624
2	友達	-10,546	7	統一	-7,438
3	新光金	-9,906	8	元大S&P原油正2	-4,757
4	彩晶	-9,037	9	元大金	-4,616
5	英業達	-8,332	10	正新	-3,577

● 觀盤重點提示

- 國際金融:美國股市於本週二小幅上漲,美國公佈第三季度GDP年增長率達3.2%,為近兩年以來最大增幅,經濟指標利多的消息提振主要股價指數也推升聯準會於下個月升息的機率,相對於美國經濟情勢好轉,油價下跌帶給美國股市上漲的壓力,市場對於OPEC是否真的能有效縮減石油生產量抱持懷疑態度,油價大幅下滑,短線上油價受到單一言論的影響甚大,建議投資人持續關注油價走勢,短線上美股跌點有限,建議投資人逢美股回檔可偏多操作,道瓊指數上漲0.12%、那斯達克指數上漲0.21%、S&P 500 上漲0.13%。
- 台指選擇權:12月買權未平倉最大量在履約價9400點的3.9萬口,賣權未平倉最大量在履約價8900點的3.1萬口,指數的初步支撐看9100點,9300點以上見初步壓力;由外資選擇權未平倉部位分析,整體多方佈局偏強,台指選擇權籌碼偏多看待。
- 台北股市:(1)基本面及策略:台北股市今日開高整理,盤勢接近午盤時受到鴻海等權值股翻黑而拉回至平盤,但隨後即見到買盤進場拉抬,加上尾盤逢MSCI調整權重,加權指數終場出量收至今日最高點,指數終場上漲48.33點,漲幅0.53%,型態上以偏多盤整格局看待。今日盤面以鋼鐵、玻璃、食品類股指數較為弱勢,油燃、營建、汽車類股指數則相對其他產業強勢。今日新台幣兌美元呈現貶值,亞幣兌美元匯率走勢漲跌互見,人民幣兌美元走勢較強,日圓兌美元相較之下偏弱,近期弱勢的亞幣有止跌的跡象,美元指數不再突破近期新高價位,市場預期美國聯準會於下個月升息,息息的利空已逐漸反映於新興市場,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:大盤今日持續站穩季線,成交量能受到MSCI盤後調整影響放大至1009億元,加權指數逐步收復美國總統大選開票日的長黑,5日均線與季線持續走揚,月線於今日開始走平翻揚,大盤上檔壓力逐漸被突破,整體下檔技術支撐力強,技術面上偏多看待。(3)籌碼面:[1]現貨三大法人今日合計賣起0.53億元,其中外資買起10.25億元。[2]期貨外資今日淨部位多單來到80059口,較前個交易日增加1822口淨多單,投信淨空單留倉40955口,自營商淨空單留倉7218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	9240.71	9240.71	9189.62	48.33		1009億	3.82	2.79	5.71	
12月台指期	9226	9245	9177	24.00	-0.16	121118	2.29	2.28	1.92	110726
1月台指期	9206	9223	9157	24.00	-0.38	1910	1.60	1.61	1.47	5504
12月小台指	9228	9245	9177	26.00	-0.14	85625	1.69	1.67	1.47	29221
1月小台指	9204	9222	9157	22.00	-0.40	3470	1.53	1.52	1.45	3371
電子指數	369.69	370.63	368.25	0.99		525億				
12月電子期	369.35	370.40	367.45	0.40	-0.00	2248	1.23	1.23	1.16	4045
1月電子期	368.60	369.30	367.00	0.45	-0.01	45	1.20	1.18	1.10	167
金融指數	1062.53	1067.67	1056.34	1.82		123億				
12月金融期	1064.40	1071.00	1057.60	1.40	0.02	3951	1.32	1.62	1.24	2878
1月金融期	1062.20	1068.40	1056.20	1.00	-0.00	75	1.37	1.62	1.11	162
摩台指	344.80	345.24	343.11	1.33						
12月摩台指	345.10	346.00	343.20	0.80		36063				203431
1月摩台指	344.70	344.80	344.30	0.10		769				11

<本文僅供參考,並不做任何獲利保證。>



● 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	1.0	1.2	0.9	-0.2	503	12293	332	1.0	0.16	10.8%
12月9700C	1.9	2.2	1.2	0.1	1215	13945	139	1.9	0.21	10.1%
12月9600C	4.6	5.9	3.3	0.1	3390	18810	603	4.6	0.26	9.7%
12月9500C	12.5	15.5	8.9	0.5	5771	29650	442	12.5	0.32	9.7%
12月9400C	33.0	37.0	22.5	4.0	9494	39194	744	33.0	0.39	10.3%
12月9300C	67.0	75.0	50.0	8.0	11803	28144	122	67.0	0.46	10.6%
12月9200C	119.0	131.0	95.0	10.0	6459	18075	67	93.0	0.53	4.3%
12月9100C	189.0	201.0	155.0	14.0	2321	7379	-352	63.0	0.60	3.1%
全履約價合計					42400	212455				
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	139.0	171.0	130.0	-19.0	1565	4696	-134	65.0	-0.68	11.0%
12月9200P	92.0	118.0	86.0	-15.0	6878	9571	1308	92.0	-0.61	11.9%
12月9100P	61.0	78.0	57.0	-11.0	8263	14598	1331	61.0	-0.54	12.9%
12月9000P	40.0	52.0	37.5	-7.5	9702	18036	973	40.0	-0.47	13.9%
12月8900P	26.5	34.0	25.0	-5.5	8915	31440	1951	26.5	-0.40	14.9%
12月8800P	17.5	23.0	17.0	-4.0	5981	24781	1037	17.5	-0.33	15.8%
12月8700P	12.0	16.0	12.0	-3.5	4036	22283	893	12.0	-0.26	16.9%
12月8600P	9.0	11.5	8.8	-2.0	3144	21547	292	9.0	-0.21	18.3%
12月8500P	6.7	8.2	6.5	-1.7	3903	17378	719	6.7	-0.16	19.5%
全履約價合計					61324	308266				
距到期日：	21 天		Put/Call Ratio(volume)		1.45	1.45				

● 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	19121.60	23.70	0.12	19144.40	19062.22	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
NASDAQ	5379.92	11.11	0.21	5403.86	5360.56	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
S&P500	2204.66	2.94	0.13	2210.46	2198.15	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
費城半導體指數	885.25	-2.01	-0.23	890.86	881.52	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
日經指數	18308.48	1.44	0.01	18370.31	18280.66	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
韓國首爾	1983.48	5.09	0.26	1988.44	1977.09	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
恆生指數	22789.77	52.70	0.23	22889.47	22755.00	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
上海綜合	3250.03	-32.89	-1.00	3277.27	3239.52	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
滬深300指數	3538.00	-26.04	-0.73	3567.07	3527.02	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
A50指數	10537.38	-116.52	-1.09	10677.62	10502.58	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
美元指數	101.20	0.21	0.21	101.22	100.84	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
歐元	1.0654	-0.0031	-0.29	1.0660	1.0618	1.0591	1.0611	1.0834	弱勢整理
黃金	1188.56	-1.67	-0.14	1194.68	1185.77	1187.56	1201.39	1246.31	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	46.13	0.68	1.47	47.07	46.13	41.22	42.54	43.51	由弱轉強
黃豆1703	1042.50	2.00	0.19	1061.25	1045.00	900.15	910.15	915.15	走勢偏多
小麥1703	408.75	2.50	0.61	412.50	408.50	500.52	502.50	510.52	走勢偏弱
玉米1703	349.00	3.00	0.86	352.00	349.00	410.25	400.54	414.25	盤整格局
咖啡1703	153.05	-3.95	-2.52	157.40	152.50	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	5930.00	60.00	1.01	6005.00	5875.00	5458.00	5658.00	5356.00	走勢偏弱
日經指數	18308.48	1.44	0.01	18370.31	18280.66	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
A50指數1612	10717.50	-167.50	-1.56	10735.00	10535.00	0.00	0.00	0.00	走勢偏多
印度指數1612	8173.50	24.50	0.22	8209.00	8141.50	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。>