



華南金融集團

華南期貨股份有限公司 (104)金管期總字第002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 2017年11月28日 星期二 收盤日報

● 法人動態：

		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				
單位：億	買進	賣出	合計	累計本月至今								
外資及陸資	321.79	406.36	-84.57	-269.61	統一超	2.62	台積電	-28.02				
投信	7.67	21.41	-13.75	-25.07	中華電	1.40	日月光	-7.23				
自營商	78.93	82.34	-3.41	56.14	上銀	1.26	台塑化	-3.43				
合計	408.39	510.11	-101.73	-238.54	中信金	1.05	鴻海	-3.12				
11/27融資	87.21	81.04	6.17	今日 1728.37	台達電	0.94	亞德客-KY	-3.00				
11/27融券	29588	31948	2360	餘額 608856	華新科	0.84	華邦電	-2.80				
單位：口	多		空		晶電	0.79	台化	-2.74				
11/27摩台11月多空比	31		2,266		元大金	0.65	南亞科	-1.88				
台指期前十大佔市場	54.2%		49.1%		元太	0.58	富邦金	-1.84				
電子期前十大佔市場	64.2%		61.6%		聯強	0.54	旺宏	-1.37				
金融期前十大佔市場	33.7%		81.8%		前十名合計	10.66	後十名合計	-55.43				
期貨未平倉 多空淨額	台指期		電子期		金融期		台指選擇權(買權)			台指選擇權(賣權)		
	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	42299	-153	-206	12	-3449	-376	177998	173375	4623	345890	336682	9208
投信	-33368	-74	-238	0	-82	0	-714	-737	23	-326	-322	-4
自營商	-3019	-3830	566	98	654	121	-9276	-7508	-1768	-64926	-49298	-15628

● 觀盤重點提示

- 國際金融：繼上周黑色星期五到昨日網路星期一開啟傳統購物旺季，持續帶動零售類股走揚，此外，美國公布10月新屋銷售創十年新高，推升道瓊、S&P500和Nasdaq盤中再創新高，但因市場觀望本週參議院稅改表決結果，加上科技股多以拉回修正，令指數均從高檔回落；終場道瓊指數漲 0.1%、S&P500跌 0.04%、Nasdaq跌 0.15%、費半指數跌 1.31%。
- 台指選擇權：觀察近日選擇權未平倉分布圖，買權於10700履約價上三檔顯著增加未平倉量約一萬多口，而賣權於10400-10500增加未平倉量約四千口，且隨指數下跌，賣權於10600-10900履約價未平倉量減少約四千口，顯示上檔壓力持續加重，並推估賣權的賣方有執行部位停損，突顯指數偏弱態勢；今日未平倉p/c ratio為 1.62，較前日減少 0.04，成交量p/c ratio為 1，較前日增加 0.03；近月買權最大未平倉量集中在 11000 履約價序列，賣權最大未平倉量集中在 10400 履約價序列。
- 台北股市：(1)基本面及策略：今日在台積電跳空開盤下，指數以低盤開出，權值股中鴻海於平盤震盪、股王大立光則止跌回穩，而金融股在元大金領漲下相對有撐，但終場仍不敵台積電重挫和MSCI調高權重的個股如亞德客-KY、華邦電、旺宏等下跌的力道，使指數走低；終場加權指數下跌 0.41%，收在 10707.07 點，成交值 1391.95 億元。櫃買指數開高震盪，終場指數上漲 0.28%，收在 150.18 點，成交值 428.43 億元。(2)資金面：雖今日台股下跌，且外資連三日現貨賣起，但適逢月底有出口商拋匯的需求，加上匯市尚未有顯著大幅匯出的跡象，使新台幣收在39個月新高；終場新台幣收 30.001 元，小升 0.5 分，台北外匯經紀公司成交量為 7.25 億美元。(3)技術面：本日指數收黑K棒帶上下影線，全場指數均未守住月線，且五日均線開始下彎；以日線型態觀察，MACD和KD指標差離值由正轉負，且量能隨指數下跌略放大，技術面持續轉弱，目前下檔支撐來到季線，短線上季線不宜跌破。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計賣起 101.73 億元，其中外資賣起 84.57 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 42299 口，較前日減少 153 口淨多單，投信淨空單留倉 33368 口，自營商淨空單留倉 3019 口。

● 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	10707.07	10752.58	10692.53	-43.86		1391億	2.58	1.83	5.64	
12月台指期	10708	10753	10695	-41.00	0.01	126676	2.41	2.47	3.01	99065
01月台指期	10694	10740	10684	-41.00	-0.12	2641	1.70	1.74	1.67	3669
12月小台指	10708	10754	10694	-41.00	0.01	78047	1.66	1.74	1.93	32082
01月小台指	10694	10741	10683	-42.00	-0.12	3652	1.37	1.41	1.38	4352
電子指數	458.23	460.75	457.35	-2.80		978億				
12月電子期	457.70	460.80	457.20	-2.85	-0.12	4077	1.34	1.33	1.34	3683
01月電子期	457.00	460.10	456.75	-2.85	-0.27	51	1.13	1.09	1.09	133
金融指數	1168.84	1173.09	1163.68	0.26		59億				
12月金融期	1168.80	1175.80	1165.80	-1.00	-0.00	4596	1.49	1.59	1.71	5137
01月金融期	1170.60	1175.80	1168.00	-0.60	0.15	61	1.40	1.09	1.22	197
摩台指	400.06	401.53	399.26	-2.06						
11月摩台指	400.40	402.00	399.50	-2.10	0.08	61524	-	-	4.65	75661
12月摩台指	399.90	401.50	399.10	-2.20	-0.04	60546	-	-	5.11	165037

<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

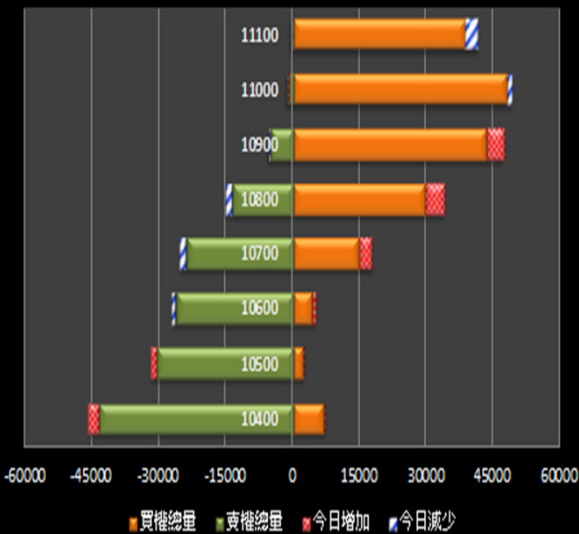
(104)金管期總字第002號

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.

台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖

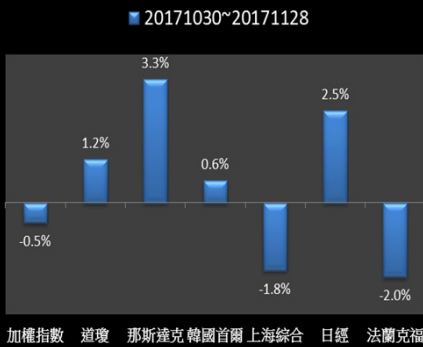


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

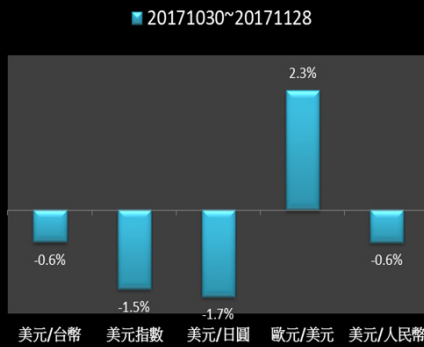


國際指數/商品期貨/外匯行情

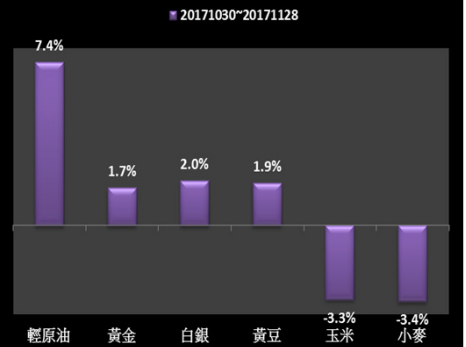
國際股市月績效表現



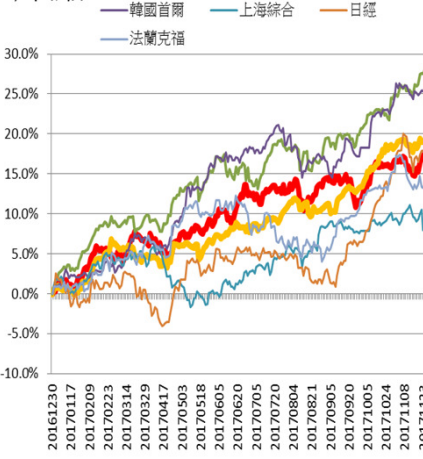
國際外匯月績效表現



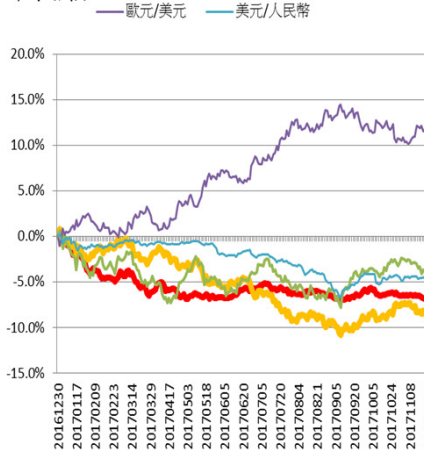
國際商品期貨月績效表現



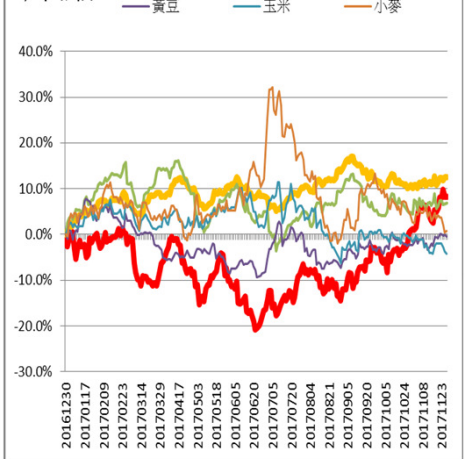
今年漲幅



今年漲幅



今年漲幅



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>