



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29日 星期三 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	271.32	338.69	-67.38	-338.31	台積電	4.67	大立光	-4.83				
投信	8.89	10.60	-1.71	-27.65	鴻海	3.12	台達電	-2.34				
自營商	72.07	74.41	-2.34	53.79	聯發科	1.99	廣達	-1.53				
合計	352.28	423.71	-71.43	-312.17	國泰金	1.81	華碩	-1.20				
11/28融資	76.05	68.09	7.96	今日 1733.92	國巨	1.57	華邦電	-1.15				
11/28融券	278.19	401.06	122.87	餘額 6166.28	致茂	1.32	統一超	-1.12				
單位：口	多		空		華新科	1.31	豐泰	-1.08				
11/28摩台11月多空比	71		151		富邦金	1.11	遠傳	-1.06				
台指期前十大佔市場	54.7%		48.6%		同欣電	0.85	正新	-1.05				
電子期前十大佔市場	63.5%		59.3%		可成	0.83	晶電	-0.90				
金融期前十大佔市場	35.5%		80.4%		前十名合計	18.60	後十名合計	-16.27				
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	42114	-185	-110	96	-3261	188	181925	177998	3927	355945	345890	10055
投信	-33162	206	-138	100	-82	0	-743	-714	-29	-746	-326	-420
自營商	-1367	1652	523	-43	644	-10	-8356	-9276	920	-87931	-64926	-23005

● 觀盤重點提示

- 國際金融：昨(28)日美國公布11月諮商會消費者信心指數，連續第五個月成長且為17年高點，顯示消費者對於美國經濟前景看好，激勵美股指數均開高，但台灣時間凌晨兩點北韓再度發射一枚洲際彈道飛彈，令美股漲幅急速收斂，隨後因美國參議院預算委員會投票批准共和黨人稅改議案，將提交至參議院全體投票，稅改取得進展，加上Fed主席候選人鮑威爾支持放寬銀行業管制，激勵銀行股上漲，推升道瓊、S&P500和Nasdaq盤中再創新高；終場道瓊指數漲 1.09%、S&P500漲 0.98%、Nasdaq漲 0.49%、費半指數跌 0.08%。
- 台指選擇權：觀察近月選擇權未平倉分布圖，買賣權於10700上下四檔均顯著增加未平倉量，其中買權增幅為賣權增幅約兩倍，顯示上檔仍有壓力，但買賣權未平倉均價未有顯著位移，推測指數偏高檔整理；今日未平倉p/c ratio為 1.61，較前日減少 0.01，成交量p/c ratio為 1.07，較前日增加 0.07；近月買權最大未平倉量集中在 10900 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：今日在台積電和鴻海止跌回穩下，指數開高，但反彈力道不強，加上股王大立光開高後走弱，拖累相關光學類股走勢，使得指數於平盤狹幅震盪；此外，需留意明日MSCI將於收盤生效，相關被調整權重個股，今日股價呈現漲跌互見，記憶體廠旺宏和華邦電下跌逾1%，而亞德客-KY、穩懋、國巨平均漲幅逾3%相對抗跌；終場加權指數上漲 0.06%，收在 10713.55 點，成交值 1337.63 億元。櫃買指數開高震盪，終場指數上漲 0.73%，收在 151.28 點，成交值 498.17 億元。(2)資金面：雖近日外資現貨市場連四日持續買起，但成交量並未放大之跡象，推測外資尚未大舉匯出資金，且本週逢月底出口商作帳拋匯，導致匯價創三年多新高；終場新台幣收 29.99 元，升值 1.1 分，台北外匯經紀公司成交量為 7.15 億美元。(3)技術面：本日指數K棒帶長上影線，顯示指數開高後仍不敵上檔壓力走低震盪；以日線型態觀察，KD向下開口擴大且MACD負差離值增加，技術面仍偏弱，但若指數未帶量下跌，短線上指數推估將於月線和季線間做整理。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計賣起 71.43 億元，其中外資賣起 67.38 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 42114 口，較前日減少 185 口淨多單，投信淨空單留倉 33162 口，自營商淨空單留倉 1367 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	10713.55	10762.91	10697.62	6.48		1337億	2.70	1.92	5.51	
12月台指期	10728	10763	10708	21.00	0.13	109201	2.54	2.54	3.26	98783
01月台指期	10715	10750	10696	22.00	0.01	2235	1.55	1.57	1.61	3575
12月小台指	10728	10763	10708	21.00	0.13	64403	1.75	1.75	2.03	32463
01月小台指	10715	10750	10697	21.00	0.01	2696	1.34	1.48	1.45	4653
電子指數	458.49	461.24	457.76	0.26		947億				
12月電子期	459.00	460.95	458.10	1.30	0.11	3112	1.36	1.37	1.39	3572
01月電子期	458.40	460.15	457.55	1.40	-0.02	60	1.24	1.14	1.11	151
金融指數	1170.87	1176.83	1168.44	2.03		51億				
12月金融期	1172.40	1178.20	1170.60	4.00	0.13	3625	1.45	1.56	1.71	5095
01月金融期	1173.40	1179.20	1172.80	2.80	0.22	37	1.32	1.13	1.09	194
摩台指	400.17	402.17	399.63	0.11						
11月摩台指	400.40	402.50	400.00	0.00	0.06	12332	-	-	4.60	29513
12月摩台指	401.00	402.00	399.80	1.10	0.21	46584	-	-	2.56	211732

<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

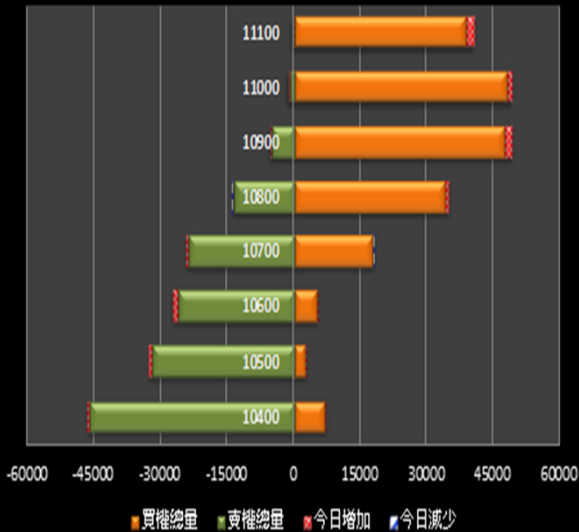
(104)金管總字第002號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL:(02)2718-0000 FAX:(02)2546-3708

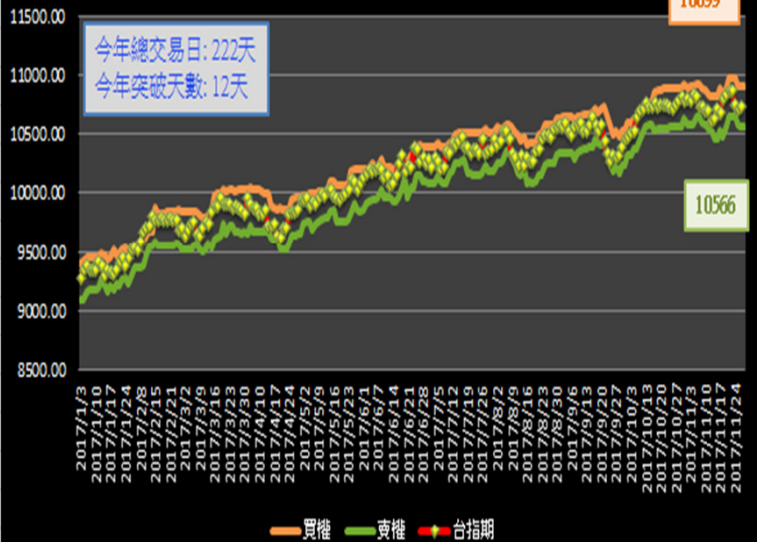
3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4 Taipei, TAIWAN.

台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖

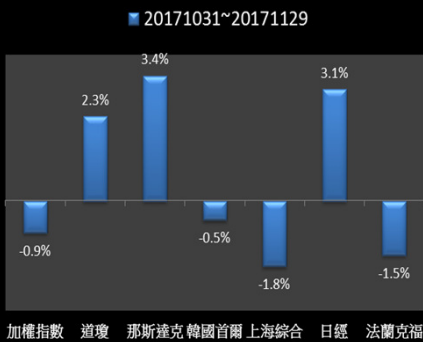


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

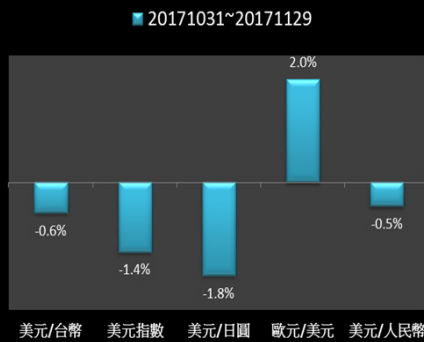


國際指數/商品期貨/外匯行情

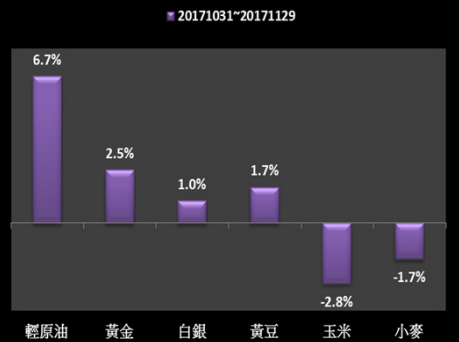
國際股市月績效表現



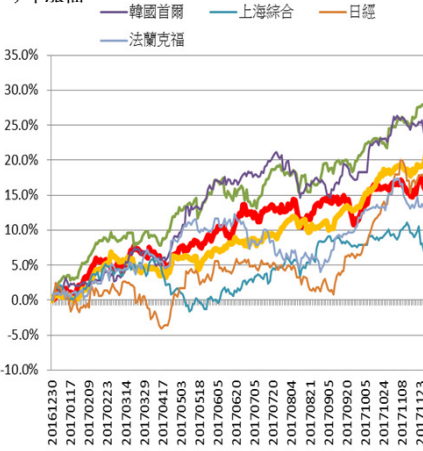
國際外匯月績效表現



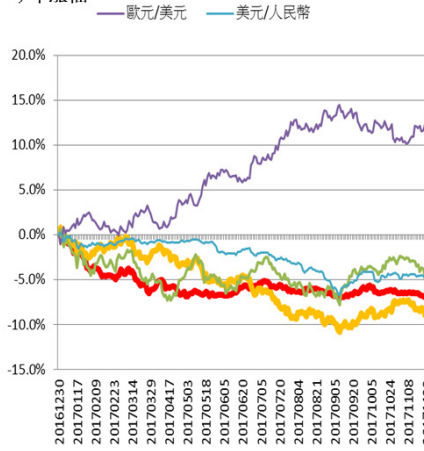
國際商品期貨月績效表現



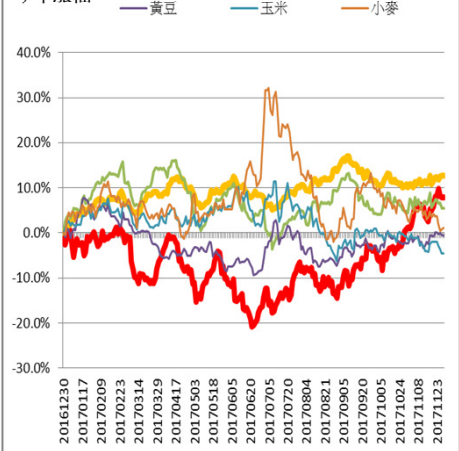
今年漲幅



今年漲幅



今年漲幅



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>