



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30日 星期四 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	990.85	1127.70	-136.86	-474.59	華邦電	1.94	台積電	-79.48				
投信	9.49	25.58	-16.09	-44.10	華碩	1.87	鴻海	-18.75				
自營商	84.31	98.08	-13.77	40.02	亞泥	1.64	台塑	-6.89				
合計	1084.65	1251.36	-166.72	-478.66	旺宏	1.46	台化	-6.13				
11/29融資	86.36	75.54	10.82	今日 1743.75	亞德客-KY	1.09	聯發科	-4.85				
11/29融券	26085	53136	27051	餘額 636577	群光	0.88	大立光	-4.84				
單位：口	多		空		中石化	0.85	南亞科	-4.56				
11/29摩台12月多空比	499		447		華新	0.85	國泰金	-4.08				
台指期前十大佔市場	52.1%		48.5%		華新科	0.70	可成	-3.61				
電子期前十大佔市場	67.1%		60.9%		彩晶	0.64	廣達	-2.92				
金融期前十大佔市場	37.9%		79.3%		前十名合計	11.93	後十名合計	-136.10				
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	37178	-4936	-121	-11	-2924	337	176667	181925	-5258	363811	355945	7866
投信	-33694	-532	-138	0	-82	0	-274	-743	469	-755	-746	-9
自營商	-1378	-11	534	11	534	-110	-28051	-8356	-19695	-68628	-87931	19303

## 觀盤重點提示

- 國際金融：美國昨(29)公布第三季國內GDP年成長 3.3%，優於預期；Fed褐皮書亦顯示，美國經濟在 11 月中旬之前呈現緩和成長趨勢，反映物價壓力加大且勞動市場需求持續緊縮，經濟數據亮麗令市場預期美國經濟的動能將會持續，美股以高盤開出，受惠最深的以金融族群為主，美銀、花旗、摩根大通平均漲幅逾2%；但日前投研機構摩根史坦利對於半導體、晶片等族群看空的言論效應持續，不僅以高科技產業為主的費半指數成分股跌幅沉重；連續優大型電子股如蘋果、亞馬遜、臉書、Netflix、Alphabet(google母公司)亦有2%起算的跌幅，令科技相關指數均重挫以對，拖累績優股相關指數收黑，與藍籌類股則呈現脫鉤走勢；終場道瓊指數上漲0.44%，創歷史新高；S&P500下跌0.04%、NASDAQ大跌1.27%、費半指數重挫4.39%。
- 台指選擇權：觀察近月選擇權未平倉分布，選擇權買權與賣權今日在10600履約價序列上下四檔增加之未平倉量，買權增加24442口，賣權增加3533口；顯示指數經過連日來下跌後，加上MSCI季底調整，上檔賣壓傾巢而出並跌破重要支撐，短線在未站回季線前，多方建議保守觀望；今日未平倉p/c ratio為1.53，較前日減少0.08，成交量p/c ratio為0.97，較前日減少0.1；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：昨(29)美股主要指數漲跌互見，但科技類股壓力沉重，因此台股本日亦在電子股領跌下，指數跳空跌破季線；三大權值股中積電空下跌逾3%，鴻海與大立光平均亦有2%以上跌幅，使得指數開低後亦欲振乏力；金融類股亦缺乏支撐；僅有非電子且不佔權值的電器電纜與水泥類股相對強勢，但並無助於大盤止跌；尾盤在MSCI季度調整生效影響，大型權值股尾盤遭擠壓，使得指數收在今日最低；終場加權指數大跌1.43%，收在10560.44點，成交值 2299.18 億元，創2009年6月以來大量。櫃買指數開低震盪收黑，終場指數下跌0.65%，收在 150.29 點，成交值 552.27 億元。(2)資金面：美科技股重挫，台股賣壓亦相對沉重，使得本日台幣開盤以30.01元，貶值2分開出，盤中雖有南韓央行宣布升息1碼(0.25個百分點)，為6年來首見，但該決策符合外界預期對於匯市並未造成太大衝擊，令新台幣於平盤間震盪；終場新台幣兌美元貶值2分，收在30.01元，台北外匯經紀公司成交量為 9.04 億美元。(3)技術面：本日台股開低走低，型態上收黑K帶上影線，開盤跳空跌破下檔支撐，盤中雖一度欲站回，但季線仍得而復失，量能則創下8年來新高；技術指標中KD值與MACD負差離持續擴大，本日亦因MSCI季度調整，權值股水位有下修壓力，使得指數倍受壓抑，盤面轉為空方控盤，下檔支撐則移至半年線附近；近期除持續留意權值股是否止穩外，有待訊息面消化完畢後，觀察外資布局方向。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計賣超166.7億元，其中外資賣超136.8億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉37178口，較前日減少4936口淨多單，投信淨空單留倉33694口，自營商淨空單留倉1378口，籌碼面中性偏空看待。

## 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	10560.44	10650.18	10560.44	-153.11	0.15	2299億	2.78	2.17	5.98	
12月台指期	10576	10658	10569	-154.00	0.15	165820	2.41	2.53	3.10	102861
01月台指期	10564	10646	10560	-151.00	0.03	3593	1.65	1.67	1.62	3950
12月小台指	10576	10659	10570	-153.00	0.15	95925	1.68	1.86	2.02	35760
01月小台指	10564	10648	10558	-150.00	0.03	5379	1.35	1.55	1.47	5513
電子指數	448.55	453.54	448.55	-9.94		1618億				
12月電子期	449.00	453.50	448.85	-10.15	0.10	5738	1.40	1.46	1.47	3887
01月電子期	448.35	452.40	448.35	-10.05	-0.04	97	1.03	1.17	1.08	158
金融指數	1162.05	1173.96	1162.05	-8.82		101億				
12月金融期	1167.40	1174.80	1164.00	-5.20	0.46	4762	1.48	1.58	1.66	4749
01月金融期	1168.80	1174.40	1166.00	-4.80	0.58	44	1.76	1.10	1.07	207
摩台指	391.92	396.42	391.84	-8.25						
12月摩台指	392.10	396.60	391.40	-8.90	0.05	58783	-	-	2.11	219068
01月摩台指	392.90	395.50	392.50	-8.40	0.25	84	-	-	3.11	5

&lt;本文僅供參考，並不做任何獲利保證。&gt;



華南金融集團

華南期貨股份有限公司

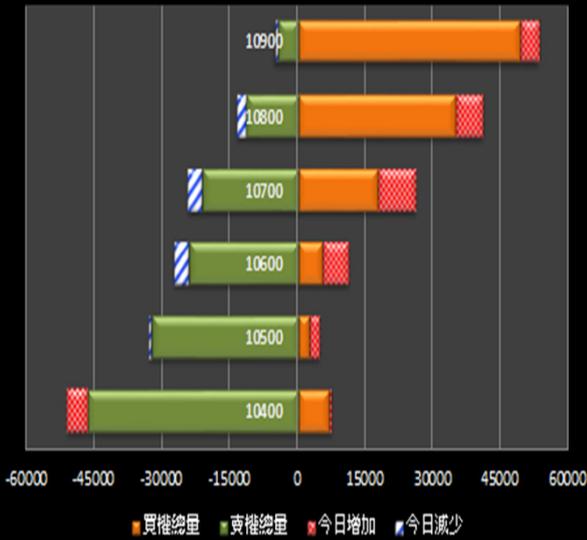
(104)金管期總字第002號

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

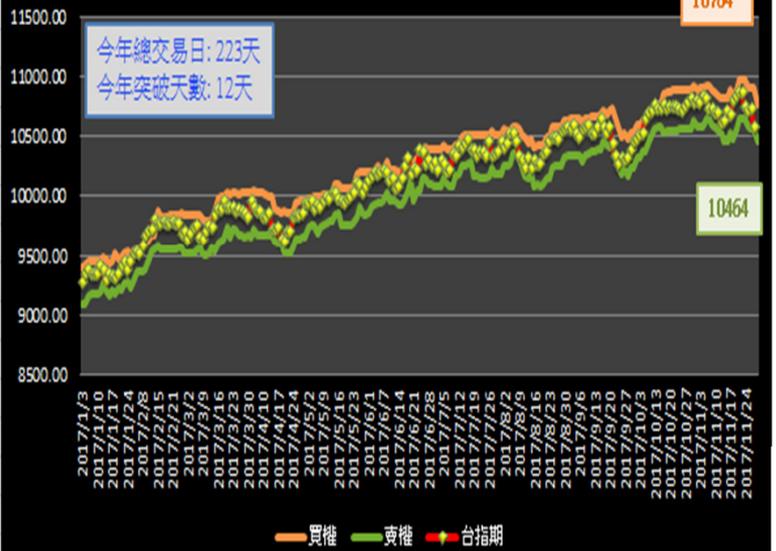
3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4 Taipei, TAIWAN.

### 台指選擇權未平倉解析

#### 近月選擇權未平倉分佈圖

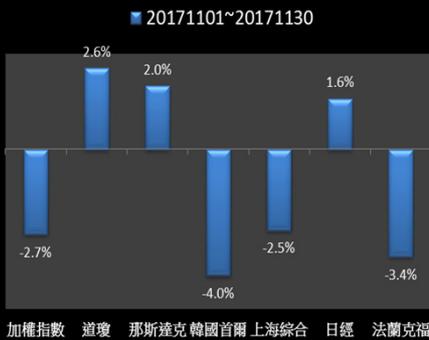


#### 近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖



### 國際指數/商品期貨/外匯行情

#### 國際股市月績效表現



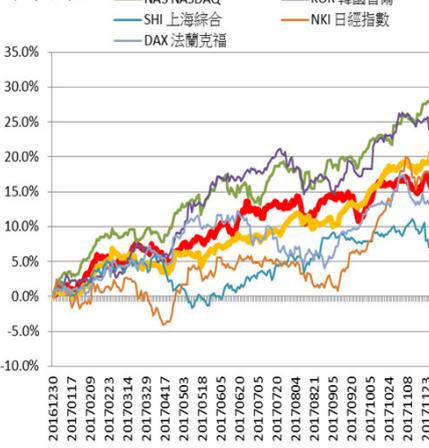
#### 國際外匯月績效表現



#### 國際商品期貨月績效表現



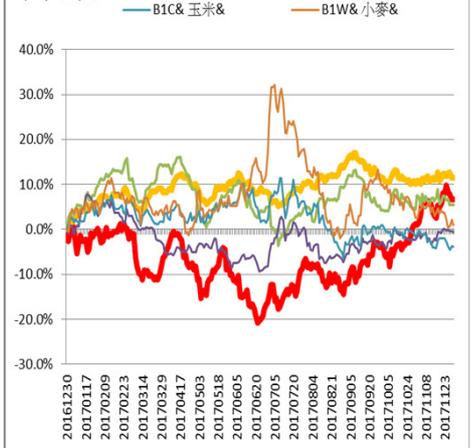
#### 今年漲幅



#### 今年漲幅



#### 今年漲幅



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>