



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

台指期貨 2017年11月20日 星期一 收盤日報

● 法人動態：

台股現貨買賣起												
單位：億	買進	賣出	合計	累計本月至今	個股貢獻點數前十名			個股貢獻點數後十名				
外資及陸資	249.41	275.00	-25.59	-252.18	國泰金	3.62	台積電	-28.04				
投信	9.58	13.06	-3.48	-12.97	台化	1.90	鴻海	-9.37				
自營商	67.79	62.11	5.68	21.73	富邦金	1.66	聯發科	-5.42				
合計	326.77	350.17	-23.40	-243.41	新光金	1.22	統一超	-2.06				
11/17融資	69.63	71.98	-2.35	今日 1676.66	致茂	1.18	台塑化	-1.72				
11/17融券	26339	45194	18855	餘額 591507	聯電	1.14	日月光	-1.42				
單位：口	多		空		美食-KY	1.06	中華電	-1.40				
11/17摩台11月多空比	93		2,424		元太	1.03	和碩	-1.13				
台指期前十大佔市場	57.7%		48.7%		台塑	0.92	可成	-1.11				
電子期前十大佔市場	66.0%		57.1%		大同	0.89	鴻準	-0.66				
金融期前十大佔市場	49.2%		75.2%		前十名合計	14.60	後十名合計	-52.32				
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	43336	-3938	100	-100	-1361	197	136975	130542	6433	284948	278330	6618
投信	-31272	-670	-230	0	-62	0	-704	-719	15	-727	-727	0
自營商	-827	1182	152	-59	359	182	18520	29367	-10847	-59559	-82710	23151

● 觀盤重點提示

- 國際金融：上週四美國通過眾議院稅改的版本，接下來參議院版本預計將於美國感恩節過後當周進行表決，但目前傳出共和黨有六位參議員的態度不明朗，對於參議院稅改版本仍有疑慮，市場投資人擔憂稅改前景對未來經濟的影響，使得美股指數全面收黑；而個股表現方面，適逢本周為美國感恩節，體育用品大廠Nike提前反應購物旺季，股價大漲3.42%，漲幅居道瓊成分股之冠，但仍不敵稅改不確性帶來的影響；終場道瓊指數跌 0.43%、S&P500跌 0.26%、Nasdaq跌 0.15%、費半指數跌 0.47%。
- 台指選擇權：今日近月選擇權買賣權於10700履約價上下四檔均有顯著增加未平倉量，其中買權未平倉量增幅約為賣權未平倉量增幅的兩倍，顯示目前指數上檔壓力沉重，加上買賣權未平倉均價皆向下位移，短線上指數弱勢整理機率仍高；今日未平倉p/c ratio為 1.68，較前日減少 0.07，成交量p/c ratio為 1.14，較前日減少 0.17；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 10000 履約價序列。
- 台北股市：(1)基本面及策略：今日台股開平高，但受美國科技股走低影響，拖累本日台股三大權值股走勢，台積電和鴻海皆下跌逾1%，而股王大立光於午後亦走弱，聯發科開高後賣壓湧現壓低股價走勢，雖金融指數上漲0.66%相較大盤抗跌，但仍不敵權重佔比高的電子類股股價走低，今指數盤中由紅翻黑，尾盤更收在今日相對低點；終場加權指數下跌 0.35%，收在 10664.55 點，成交值 1085.85 億元。櫃買指數開高走低震盪，終場指數上漲 0.03%，收在 148.02 點，成交值 447.8 億元。(2)資金面：今日新台幣貶值1.9分，以30.120元開盤，而本日台股於平盤附近小跌，雖外資於現貨市場賣起，但外匯市場仍維持交投清淡，令台幣呈現區間整理，目前靜待國際新事件和外資資金動向，對於新台幣走勢較有明確方向，短線量能若持續低迷，台幣恐維持區間整理態勢；終場新台幣兌美元小貶 0.1 分，收在 30.102 元，台北外匯經紀公司成交量為 5.34 億美元。(3)技術面：今日指數收黑K帶上下影線，成交量較前一交易日減少兩成，開盤雖開平高，但仍不敵上檔月線的壓力，加上權值股跌幅擴大使指數終場收在相對低點；以日線型態觀察，短線上於五日均線仍有支撐，且技術指標MACD和KD兩者負差離有收斂跡象；短線上季線不宜跌破，且台股需帶量上漲加上美股止跌回溫，則有利台股突破區間整理。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計賣起 23.4 億元，其中外資賣起 25.59 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 43336 口，較前日減少 3938 口淨多單，投信淨空單留倉 31272 口，自營商淨空單留倉 827 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	10664.55	10728.39	10656.18	-37.09		1085億	2.97	1.89	5.84	
12月台指期	10666	10719	10654	-36.00	0.01	99685	2.31	2.44	2.87	95960
01月台指期	10654	10704	10643	-34.00	-0.10	1284	1.62	1.71	1.72	1515
12月小台指	10666	10720	10653	-38.00	0.01	67814	1.66	1.83	2.01	29912
01月小台指	10654	10705	10642	-34.00	-0.10	2014	1.33	1.37	1.36	1456
電子指數	458.23	463.10	457.85	-3.66		682億				
12月電子期	458.45	462.25	458.10	-3.45	0.05	3528	1.36	1.39	1.47	3043
01月電子期	457.85	461.20	457.50	-3.15	-0.08	68	1.36	1.56	1.24	60
金融指數	1146.30	1147.73	1139.84	7.48		65億				
12月金融期	1146.40	1146.80	1138.60	8.60	0.01	2789	1.59	1.47	1.69	3086
01月金融期	1147.00	1147.00	1139.80	8.00	0.06	53	2.00	1.11	1.23	43
摩台指	400.75	403.60	400.34	-2.25						
11月摩台指	401.10	403.40	400.70	-2.00	0.09	32252	-	-	2.10	216086
12月摩台指	401.20	403.00	400.50	-2.40	0.11	131	-	-	1.96	9010

<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

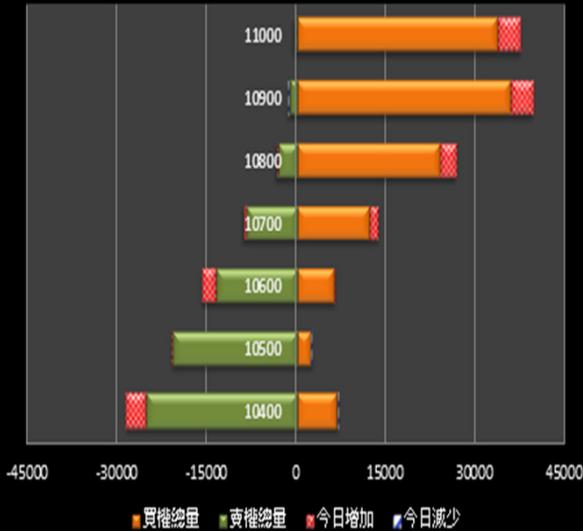
(104)金管期總字第002號

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

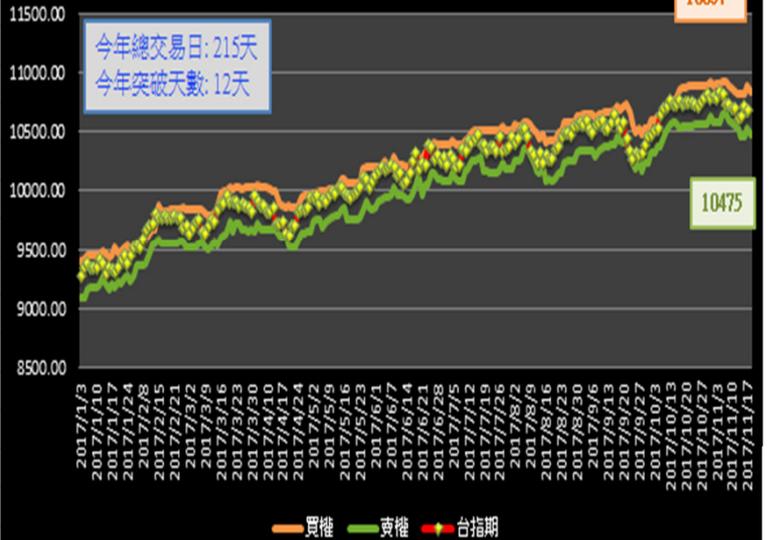
3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4 Taipei, TAIWAN.

台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖

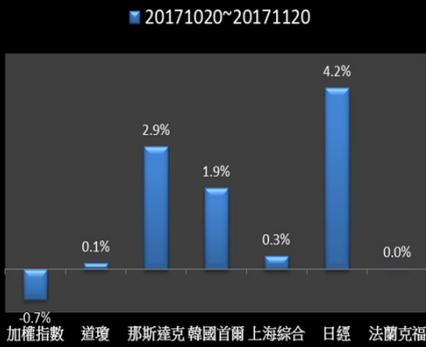


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

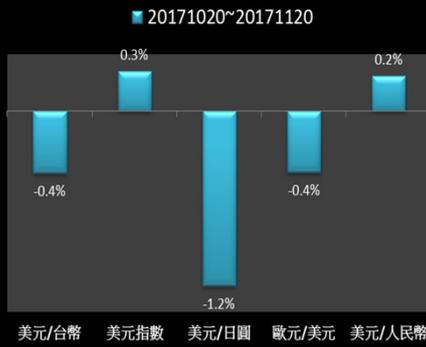


國際指數/商品期貨/外匯行情

國際股市月績效表現



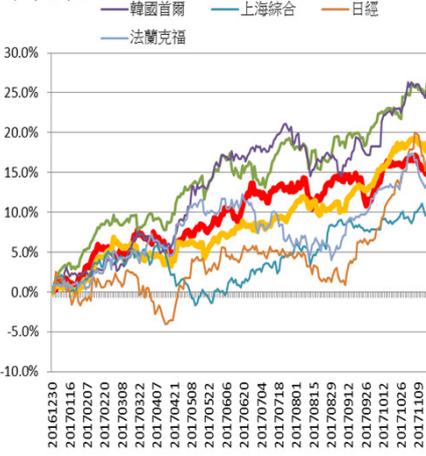
國際外匯月績效表現



國際商品期貨月績效表現



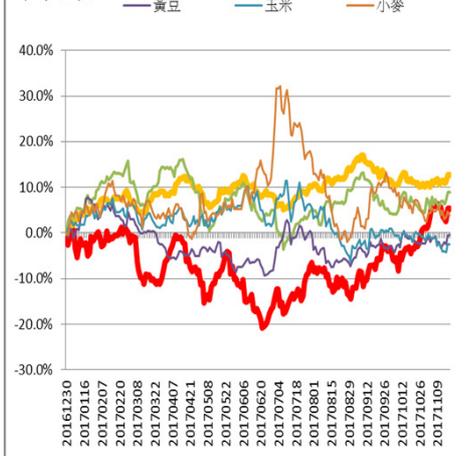
今年漲幅



今年漲幅



今年漲幅



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>