



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27日 星期一 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	251.94	334.83	-82.89	-185.04	日月光	10.22	台積電	-65.39				
投信	5.78	10.69	-4.91	-10.03	聯發科	2.56	大立光	-12.08				
自營商	76.30	95.44	-19.14	59.55	台化	2.32	鴻海	-9.36				
合計	334.02	440.96	-106.94	-135.51	華邦電	1.86	台達電	-5.61				
11/24融資	90.37	73.48	16.89	今日 1723.47	台塑	1.83	國泰金	-5.43				
11/24融券	33000	38328	5328	餘額 609239	矽品	1.74	富邦金	-2.77				
單位：口	多		空		國巨	1.51	中信金	-1.76				
11/24摩台11月多空比	31		2,266		華新科	1.28	台塑化	-1.72				
台指期前十大佔市場	54.8%		48.8%		南亞	1.14	南亞科	-1.68				
電子期前十大佔市場	65.9%		57.9%		大同	0.76	可成	-1.67				
金融期前十大佔市場	34.4%		79.0%		前十名合計	25.23	後十名合計	-107.47				
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	42452	-4457	-218	-388	-3073	143	173375	168190	5185	336682	319741	16941
投信	-33294	-1208	-238	0	-82	0	-737	-737	0	-322	-322	0
自營商	811	-1104	468	20	533	-76	-7508	5270	-12778	-49298	-65569	16271

● 觀盤重點提示

- 國際金融：上週五(24)為美國黑色星期五，為傳統上銷售旺季，根據全美零售聯合會預計11、12月的銷售額總計將成長4%至6820億美元，成為近三年來強勁購物季，帶動上周五美國零售類股大漲，其中亞馬遜更連續三個交易日收盤均創新高，加上科技股領漲，推升S&P 500、Nasdaq和費半指數收盤再締新猷；終場道瓊指數漲 0.14%、S&P500漲 0.21%、Nasdaq漲 0.32%、費半指數漲 0.95%。
- 台指選擇權：觀察近月選擇權未平倉分布圖，本日未平倉量以買權增加較為顯著，且賣權於10600-11000未平倉量減少逾四千口，顯示指數上檔壓力加重，並隨指數大跌，推測選擇權賣方減碼賣出之賣權部位執行停損；買賣權未平倉均價均向下位移，突顯指數恐偏弱整理；今日未平倉p/c ratio為 1.66，較前日減少 0.04，成交量p/c ratio為 0.97，較前日減少 0.34；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：本週適逢摩台結算和MSCI調整權重生效，台股權值股過賣壓空襲，其中台積電因遭大摩調降評等，今開盤即跌破月線，開低走低大跌約3%，而組裝廠鴻海下跌1.44%，股王大立光亦是外資調節對象，股價重挫逾4%，在電子權值股領跌且金融股未能撐起盤勢下，使指數開低走低；本日個股較抗跌為MSCI調升權重的個股如華邦電、旺宏、國巨等，以及日月光和矽品因結合案獲大陸批准，受此激勵股價均走揚，但終場仍不敵權重股拖累大盤；終場加權指數下跌 0.95%，收在 10750.93 點，成交值 1337.61 億元。權買指數開高震盪走低，終場指數下跌 0.29%，收在 149.76 點，成交值 454.72 億元。(2)資金面：因歐洲經濟增長看好，激勵歐元持續上漲，使得美元走弱；本日新台幣兌美元開盤小升0.5分，以30.005元開出，雖台股大跌，外資賣超加大，但盤中沒有顯著資金匯出的動作，成交量相對偏低；終場新台幣收 30.006 元，小升 0.4 分，台北外匯經紀公司成交量為 5.45 億美元。(3)技術面：本日指數收長黑K棒，並一舉攪破五日線和月線，且KD和MACD正差離值均呈現收斂，但均線僅月線出現下彎，短線上若指數能站回月線，則有利多頭格局延續，但若指數往季線靠攏，台股恐偏弱整理，需嚴設停損。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計賣超 106.94 億元，其中外資賣超 82.89 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 42452 口，較前日減少 4457 口淨多單，投信淨空單留倉 33294 口，自營商淨多單留倉 811 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	10750.93	10856.00	10746.74	-103.16	-0.96	1337億	2.58	1.81	5.79	
12月台指期	10749	10848	10737	-104.00	-0.96	133070	2.41	2.62	3.06	98939
01月台指期	10736	10836	10725	-103.00	-0.94	2865	1.62	1.60	1.63	3485
12月小台指	10749	10848	10737	-105.00	-0.96	83499	1.63	1.89	1.99	31064
01月小台指	10736	10836	10725	-104.00	-0.94	4132	1.42	1.51	1.49	4127
電子指數	461.03	467.22	460.95	-6.53	-1.41	977億				
12月電子期	460.65	467.25	460.25	-7.05	-1.51	4163	1.37	1.40	1.42	3158
01月電子期	459.85	467.05	459.60	-7.20	-1.57	119	1.20	1.41	1.18	112
金融指數	1168.58	1180.63	1165.68	-11.06	-0.95	50億				
12月金融期	1169.80	1182.40	1166.20	-10.40	-0.89	4496	1.49	1.68	1.74	4842
01月金融期	1171.20	1182.80	1168.00	-10.40	-0.89	57	1.44	1.21	1.33	182
摩台指	402.12	406.32	402.12	-5.74	-1.43					
11月摩台指	402.50	408.10	402.20	-5.70	-1.41	94870	-	-	5.21	137269
12月摩台指	402.10	407.50	401.50	-5.40	-1.35	69443	-	-	8.27	96340

<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

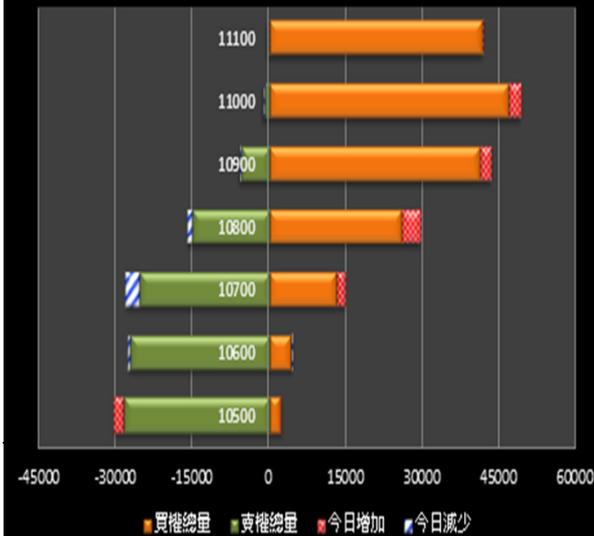
(104)金管期總字第002號

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

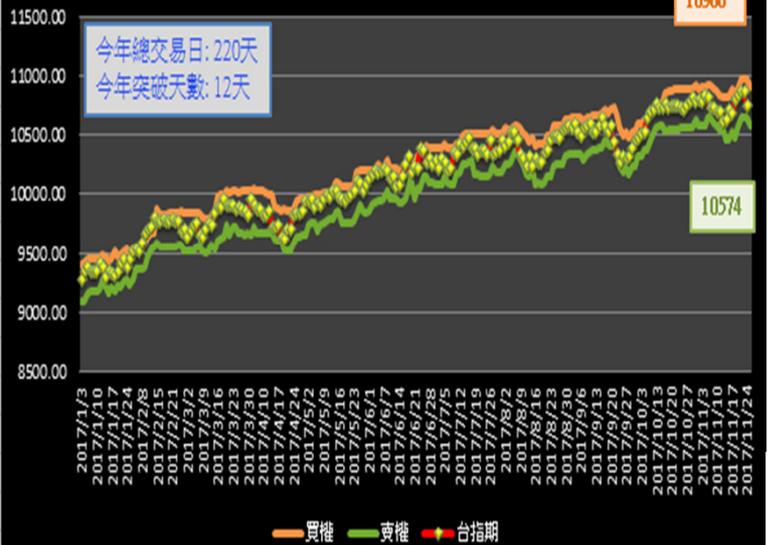
3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4 Taipei, TAIWAN.

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



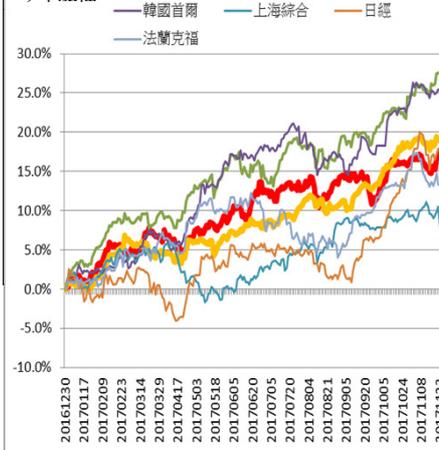
國際外匯月績效表現



國際商品期貨月績效表現



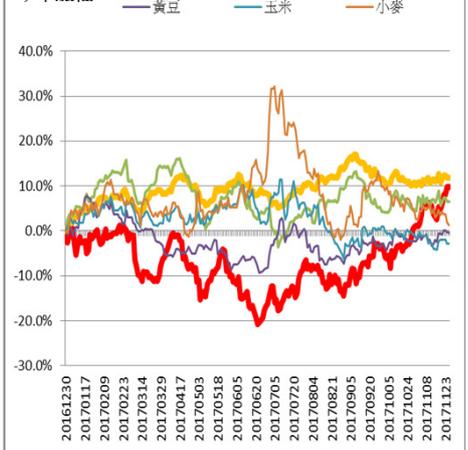
今年漲幅



今年漲幅



今年漲幅



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>