



廷豐金融科技股份有限公司

Grand Empire AI FinTech Co., Ltd.

廷豐金融科技晨會

2024 年 11 月 29 日





內容

頁碼

一、美國宏觀分析

休市

二、美股市場分析

休市

三、台股市場分析

P. 3

四、期貨市場分析

P. 21



廷豐金融科技股份有限公司

Grand Empire AI FinTech Co., Ltd.

台股市場分析

2024 年 11 月 29 日

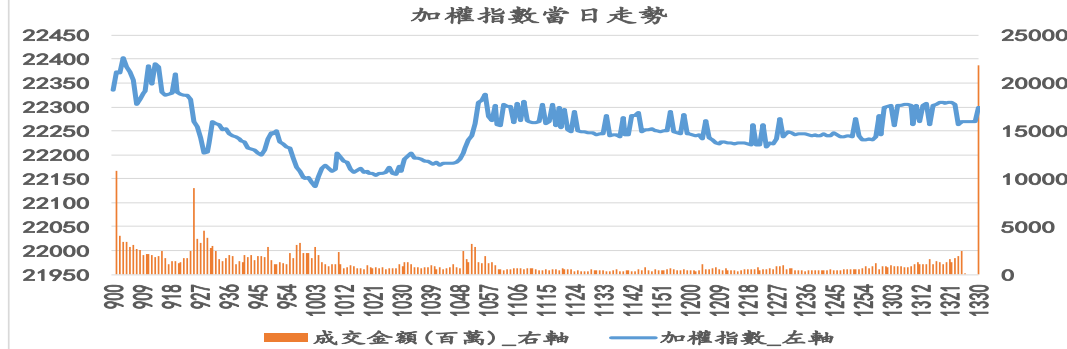


前日盤勢變動/日內走勢

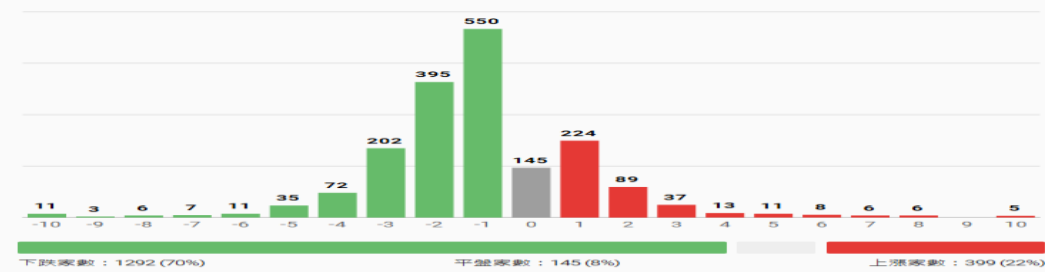
台股加權指數表現: 開平走低小幅支撐, 量能萎縮



大盤日內走勢



漲跌家數



大盤走勢表

	收盤價	收盤漲跌	漲跌幅%	週漲跌幅%	月漲跌幅%	周乖離%	月乖離%	成交金額(億)	五日均量(億)	量能	成交比重%	股淨比	本益比
加權指數	22,299	-35.9	-0.16	-1.14	-2.29	-1.48	-2.55	3,341	3,751	↘	-	2.44	18.70
櫃買指數	253	-2.6	-1.01	-1.99	-4.31	-1.95	-2.79	914	935	→	-	2.75	26.90
電子類	1,212	-1.2	-0.10	-1.17	-2.61	-1.66	-3.07	2,348	2,564	↘	70.28	3.53	21.80
金融保險	2,086	0.3	0.01	0.10	0.32	-0.20	0.06	96	149	↘	2.88	1.33	12.10
運輸類	199	0.2	0.10	-5.63	4.78	-2.39	-1.50	134	230	↘	4.02	1.17	6.20
鋼鐵類	129	-0.5	-0.36	-0.61	-3.06	-1.14	-2.34	13	17	↘	0.40	1.32	33.20

產業走勢分析

加權指數開平走低

- 台股延續戴爾、惠普財報利空影響，暨前日大跌後，華碩仍續跌逾2%，惟部分鴻海、緯創、廣達等AI權值平盤震盪相對持穩。
- 電器電纜族群跌超2%，表現續弱，華新、華城、中興電跌逾2~3%，大亞跌超1%。

大盤類股強弱勢

Beta值	產業指數	收盤價	成交比重 (%)	市值占比 (%)	漲跌幅			強弱分數	強弱變動方向 (10MA)	20D乖離	20D乖離刻度化	60D乖離	60D乖離刻度化	多空訊號			
					日	周	月							11月26日	11月27日	11月28日	
1.00	加權指數	22298.9			-0.16	-2.64	-2.29	35.47	↓	-15.42	-0.03	0.00	-0.01	38.58		▼	▼
1.41	半導體	611.12	26.18	45.41	0.23	-3.5	-3.04	37.61	↓	-10.91	-0.03	6.12	-0.01	34.79		▼	
1.08	電腦及週邊設備	269.79	15.88	6.70	-0.08	-3.2	0.55	45.69	↓	-18.07	-0.03	0.00	0.02	58.56			▼
0.99	電子零組件	222.68	10.26	5.40	-1.15	-3.77	-3.08	17.80	↓	-24.42	-0.03	12.74	-0.03	45.28			▼
0.84	電機類	381.49	3.37	1.65	-1.39	-3.39	-3.51	17.43	↓	-17.61	-0.04	0.00	-0.05	39.28		▼	▼
0.69	電器電纜	95.65	0.30	0.34	-2.03	-4.3	-4.49	0.00	↓	-18.88	-0.04	0.00	-0.05	39.28			▼
0.67	光電	38.9	3.36	1.79	-0.94	-1.27	-2.14	5.75	↓	-12.65	-0.01	20.00	-0.09	10.03	▲		▼
0.62	運輸類	198.52	4.02	2.76	0.1	-5.05	4.78	55.63	↓	-30.70	-0.01	0.00	0.04	49.31		▼	▼
0.56	金融保險	2086.36	2.88	10.80	0.01	0.11	0.32	63.18	↓	-3.12	0.00	70.69	0.00	49.71			
0.57	化學工業	167.87	0.57	0.66	0.04	-0.27	0.19	33.92	↑	4.23	0.00	61.83	-0.01	24.79	▲		
0.46	塑膠類	130.05	0.50	1.33	-0.67	-2.05	-7.71	0.00	↓	-14.41	-0.05	22.71	-0.09	47.74		▼	
0.48	觀光類	117.31	0.09	0.23	-0.88	-1.06	-3.38	11.94	↓	-17.18	-0.02	37.39	-0.03	43.03	▲		▼
0.30	水泥類	158.26	0.22	0.65	-0.13	-1.19	-1.14	18.07	↓	-23.51	-0.01	0.00	-0.01	33.29			▼
0.49	生技醫療	72	1.11	1.10	-1.28	-1.81	-2.91	0.00	↓	-12.37	-0.03	4.12	-0.05	4.61			▼
0.42	鋼鐵類	128.59	0.40	1.17	-0.36	-1.14	-3.06	10.63	↓	-12.65	-0.02	28.72	-0.04	32.29			▼
0.60	營建類	560.93	0.93	1.46	0.37	-0.49	3.31	28.39	↓	-6.38	0.01	51.76	-0.02	65.61			
0.42	綠能環保	110.62	0.25	0.26	-0.93	-1.05	-6.23	0.00	↓	-8.72	-0.03	48.78	-0.08	7.69			005 ▼
0.47	紡織纖維	619.13	0.41	0.88	-1.38	-3.96	-3.84	5.49	↓	-3.24	-0.03	61.63	-0.07	14.57	▲		

➤ 櫃買類股下跌明顯，跌幅超過大盤達1.01%，主要受到融資殺盤影響，跌破年線254點。

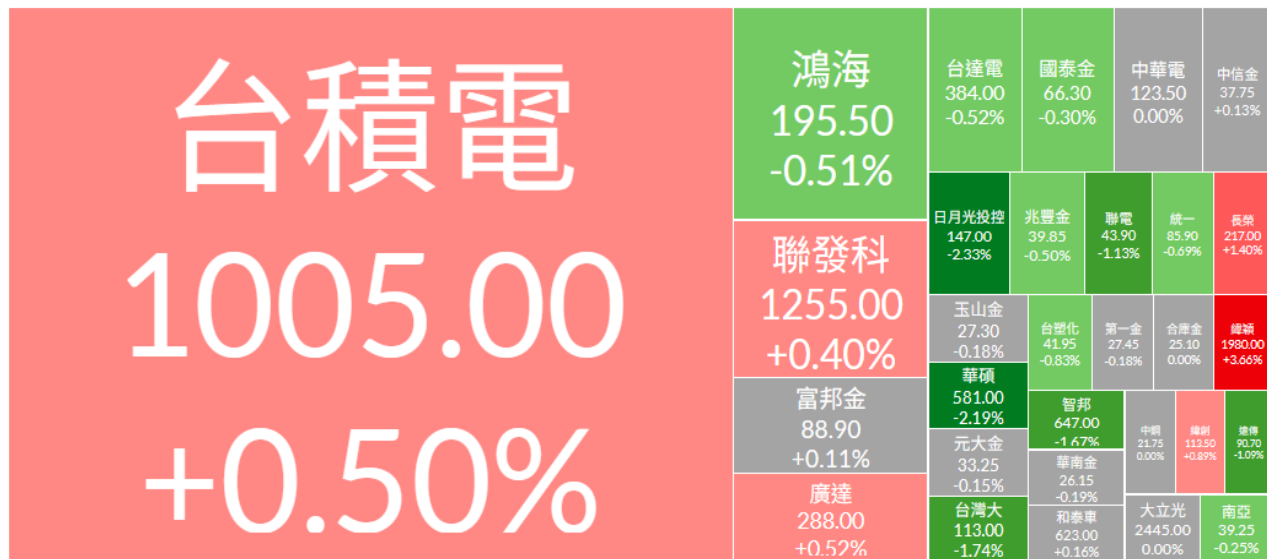
上櫃類股強弱勢

Beta值	產業指數	收盤價	成交比重(%)	市值占比(%)	漲跌幅			強弱分數	強弱變動 方向 (10MA)	20D乖離	20D乖離 刻度化	60D乖離	60D乖離 刻度化	多空訊號		
					日	周	月							11月26日	11月27日	11月28日
1.00	OTC指數	252.82			-1.01	-2.6	-4.31	○ 4.77	↓ -18.47	-0.03	● 42.57	-0.05	○ 11.41			▼
1.21	OTC半導體	114.54	23.37	28.52	-1.22	-3.57	-6.12	○ 0.00	↓ -14.56	-0.04	● 33.18	-0.07	○ 5.63			▼
1.21	OTC通信網路業	145.37	10.15	4.89	-1.52	-2.15	0.99	● 42.11	↓ -9.67	-0.02	● 45.89	-0.02	○ 13.79			
1.18	OTC電子類	406.13	64.66	63.89	-1.08	-3.13	-4.28	○ 4.45	↓ -20.63	-0.03	● 37.34	-0.05	○ 10.12			▼
1.16	OTC光電	81.77	4.02	8.52	-0.81	-2.67	-6.23	○ 8.60	↓ -19.76	-0.03	● 49.61	-0.06	○ 9.31			▼
1.01	OTC電腦及週邊設備	124.41	6.29	5.25	-0.73	-2.59	5.03	● 57.23	↓ -18.48	0.01	● 40.85	0.02	● 65.64			▼
0.74	OTC生技醫療	182.04	2.09	10.41	-1.12	-0.38	-4.92	○ 15.56	↓ -4.59	-0.02	● 63.95	-0.05	● 29.49			
0.89	OTC化學工業	141.18	0.37	1.05	-1.44	-2.87	-6.6	○ 0.00	↓ -10.30	-0.04	● 24.21	-0.08	○ 0.00			▼
0.88	OTC機械類	210.76	13.01	2.98	-0.8	-0.95	-4.2	○ 6.91	↓ -7.73	-0.03	● 49.66	-0.05	○ 10.95	▲		
0.79	OTC營建類	280.56	0.24	2.84	-0.39	-1.5	-2.16	○ 7.68	↓ -6.47	-0.01	● 65.77	-0.09	● 44.22	▲		▼
0.39	OTC鋼鐵類	170.03	0.17	1.75	-0.77	-1.05	-0.85	○ 6.08	↓ -24.54	-0.01	○ 10.99	-0.02	● 22.71	▲		▼
0.50	OTC紡織類	126.67	0.03	0.26	1.13	0.92	0.15	● 32.51	↑ 13.96	0.01	● 91.90	-0.04	● 29.74	▲		006 ▲

台股指數: 電金持平、傳產走弱

- 電子維持-0.1%，金融相對撐盤持平 0.01%、非金電跌-0.48%；以權值股撐盤，中小型下挫；高價股亦跌幅明顯。

大盤熱力圖



類股指數

Beta值	產業指數	收盤價	漲跌幅		
			日	周	月
1.00	加權指數	22299	-0.16	-2.64	-2.29
1.22	電子類	1212	-0.1	-3.21	-2.61
0.56	金融保險	2086	0.01	0.11	0.32
0.52	不含金融電子	14772	-0.48	-2.09	-2.53
1.20	台灣50指數	18564	0.16	-2.82	-2.5
0.73	台灣中型100指數	18984	-0.99	-3.01	-2.3
0.70	中小型代表300指數	11386	-0.93	-2.46	-2.02

上櫃熱力圖



基本面小結



指標強弱判斷									
2024/11/28	觀察指標	現況	數值(0~100)	分數	方向	中期			
基本面	台灣PMI_MOM	50.00	22.87	▼-16.99	▼	2024/11/27	強空	2024/11/28	強空
	台灣PMI_YOY	50.00	47.40	▼-7.16	▼	8.00		8.00	
	美國PMI_YOY	46.50	48.63	▼-1.75	▼				
	外銷訂單(億美元)	554.53	59.49	▼-7.21	▼				
	台股營收年增_YOY	-2.61%	61.14	▼-16.91	▼				
	PE區間	18.70	高於平均1.5個標準差	▼	▼				
	PB區間	2.44	高於平均1個標準差	▼	▼				
	重要事件	台幣	台幣貶0.4分至32.05元	▲	▲				
籌碼面	外資買賣超(億)	-98.9	27.5	▼-6.20	▼	2024/11/27	小多	2024/11/28	小多
	八大官股買賣超(億)	20.2	58.9	▼-8.76	▼	59.00		59.00	
	0050借券賣出餘額(張)	23778.0	67.3	▲2.05	▲				
	借券賣出餘額(萬張)	1260.0	24.2	▲3.35	▲				
技術面	動能均線乖離率	-0.95%	12.27	▼-1.40	▼	2024/11/27	強空	2024/11/28	強空
	創新高低家數比	-4.53%	37.59	▼-3.85	▼	10.00		10.00	
	漲跌家數ADL值(家)	-29465.00	39.86	▼-4.70	▼				
	現貨技術線型	2	19.74	▲1.11	▲				
	顧比例數線(日)	22561	22561	▲	▲				
市場預期面	0050折溢價%	0.00	21.97	▲4.59	▲	2024/11/27	小空	2024/11/28	強多
	投資信心指數	60.29	36.96	▲4.89	▲	44.00		100.00	
	費半	4853	29.71	▲0.24	▲				
					合計	30.14		44.04 ⁰⁰⁸	
						2024/11/27	小空	2024/11/28	小空

*75以上多/空、75~55小多/空、45~55中立

三大法人買賣超：

外資賣超98.9億，投信買超36.9億，連9日買超

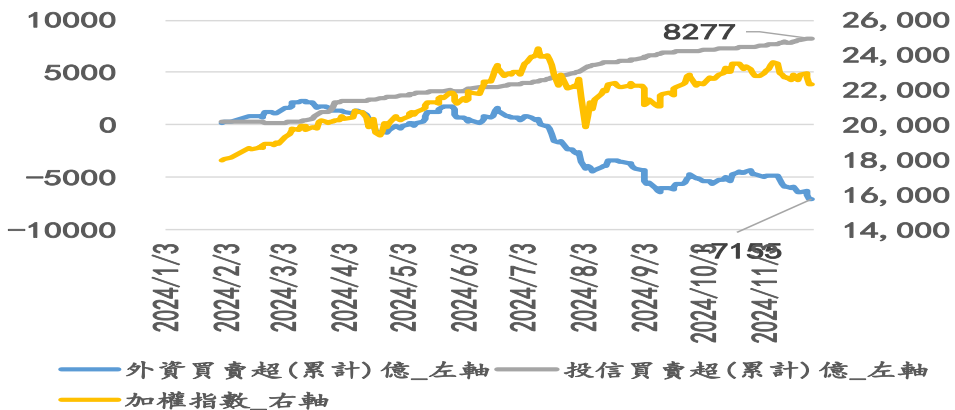
三大法人買賣超金額變化(億)

日期	投信	自營商(合計)	外資	合計
20241128	+36.9	-81.3	-98.9	-143.3
20241127	+26.2	-139.6	-410.6	-524.0
20241126	+33.7	-78.5	-292.5	-337.4
20241125	+59.8	+40.0	+52.2	+152.0
20241122	+46.8	+34.5	+80.4	+161.8
近五日合計	+203.5	-224.9	-669.4	-690.9

三大法人買賣超



累計買賣超	五日	二十日	六十日	年初至今
外資	-669	-2465	-3072	-7155
投信	+203	+802	+2058	+8277



外資買賣超族群：

買超00632R、美債ETF；賣超聯電、高股息ETF。

外資前十大買賣超(張數)

外資買超股								外資賣超股							
代碼	個股	買超張	買超金額	漲跌(%)	乖離20D	連買天數	產業	代碼	個股	賣超張	賣超金額	漲跌(%)	乖離20D	賣超天數	產業
00632R	元大台灣50反1	36028	1.22	0.00	2.73	0	ETF	2303	聯電	-33512	-14.58	-1.13	-3.38	-8	電子-半導體
3706	神達	26677	21.62	-0.72	25.49	6	電子-電腦及週邊設備	00878	國泰永續	-22415	-4.88	-1.00	-2.33	0	ETF
00679B	元大美債20年	19979	5.92	0.71	2.28	0	ETF	2312	金寶	-18243	-5.67	-10.00	6.03	-1	電子-其他電子
00712	復華富時不動產	14835	1.46	0.61	2.15	0	ETF	00929	復華台灣	-17445	-3.09	-0.73	-1.84	0	ETF
2354	鴻準	13441	10.60	-2.86	-11.39	3	電子-其他電子	1815	富喬	-11183	-3.12	1.65	14.48	-1	電子-電子零組件
2618	長榮航	10517	4.39	0.36	4.56	3	航運業	00919	群益台灣	-9271	-2.13	-0.43	-1.19	0	ETF
2344	華邦電	7556	1.22	-3.31	-12.02	1	電子-半導體	1802	台玻	-9215	-1.81	-2.51	1.03	-1	玻璃陶瓷
2609	陽明	6414	4.65	1.12	-0.45	1	航運業	1605	華新	-8077	-2.15	-3.45	-7.43	-3	電器電纜
00680L	元大美債20正2	5946	0.50	1.33	3.07	0	ETF	3481	群創	-7874	-1.18	-0.66	-2.79	-4	電子-光電
00887	永豐中國科技50	5647	0.49	1.29	-2.56	0	ETF	2887	台新金	-7402	-1.28	-0.86	0.52	-3	金融保險

外資前十大買賣超(金額)

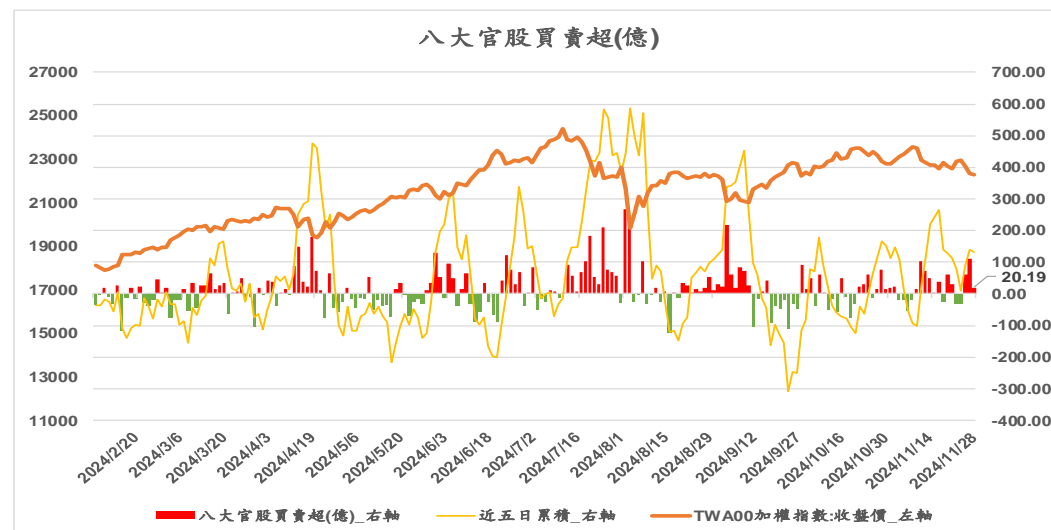
外資買超股						外資賣超股					
代碼	個股	買超金額(億)	漲跌(%)	乖離20D	產業	代碼	個股	賣超金額(億)	漲跌(%)	乖離20D	產業
3706	神達	21.62	-0.72	25.49	電子-電腦及週邊設備	2330	台積電	-22.53	0.5	-3.16	電子-半導體
2354	鴻準	10.60	-2.86	-11.39	電子-其他電子	2303	聯電	-14.58	-1.13	-3.38	電子-半導體
3661	世芯-KY	7.57	-0.93	-6.49	電子-半導體	2454	聯發科	-11.66	0.4	-1.67	電子-半導體
6669	緯穎	6.64	3.66	-3.77	電子-電腦及週邊設備	0050	元大台灣50	-11.48	-0.16	-2.96	ETF
3665	貿聯-KY	6.19	-2.42	6.67	電子-其他電子	2317	鴻海	-8.32	-0.51	-6.32	電子-其他電子
00679B	元大美債20年	5.92	0.71	2.28	ETF	2357	華碩	-8.12	-2.19	-4.31	電子-電腦及週邊設備
3529	力旺	5.82	-1.06	-9.03	電子-半導體	3711	日月光投控	-7.83	-2.33	-4.41	電子-半導體
2609	陽明	4.65	1.12	-0.45	航運業	2308	台達電	-7.00	-0.52	-2.03	電子-電子零組件
4979	華星光	4.44	2.37	12.28	電子-通信網路	3450	聯鈞	-6.74	-4.71	-2.42	電子-半導體 010
3653	健策	4.44	-2.24	-10.63	電子-電子零組件	3034	聯詠	-6.46	0.31	-0.96	電子-半導體

八大官股買賣超:買超20億



- 官股買超20億, (最大賣超為8/19金額為123.9億), 五日累積達買超130億
- 買超權值金寶、鴻海、日月光

八大官股買賣超金額



八大官股買賣超股票

官股買超股				官股賣超股					
代號	股票	買超金額	漲跌幅	產業	代號	股票	賣超金額	漲跌幅	產業
2312	金寶	2.18156	-10.0%	電子-其他電子	2354	鴻準	-7.14148	-2.86%	電子-其他電子
2317	鴻海	1.99679	-0.5%	電子-其他電子	4979	華星光	-3.41056	2.37%	電子-通信網路
3711	日月光	1.90678	-2.3%	電子-半導體	3706	神達	-3.00215	-0.72%	電子-電腦及週邊設備
4510	高鋒	1.38012	-9.9%	電機機械	2609	陽明	-1.4687	1.12%	航運業
2327	國巨	1.24789	-2.5%	電子-電子零組件	2382	廣達	-1.22718	0.52%	電子-電腦及週邊設備
3450	聯鈞	1.2242	-4.7%	電子-半導體	2383	台光電	-0.96085	-0.96%	電子-電子零組件
2303	聯電	1.05964	-1.1%	電子-半導體	2059	川湖	-0.88023	-2.11%	電子-電子零組件
2454	聯發科	1.05565	0.4%	電子-半導體	2618	長榮航	-0.76893	0.36%	航運業
2603	長榮	0.9913	1.4%	航運業	2892	第一金	-0.67111	-0.18%	金融保險
2455	全新	0.84263	-0.3%	電子-通信網路	5274	信驊	-0.6701	1.78%	電子-半導體

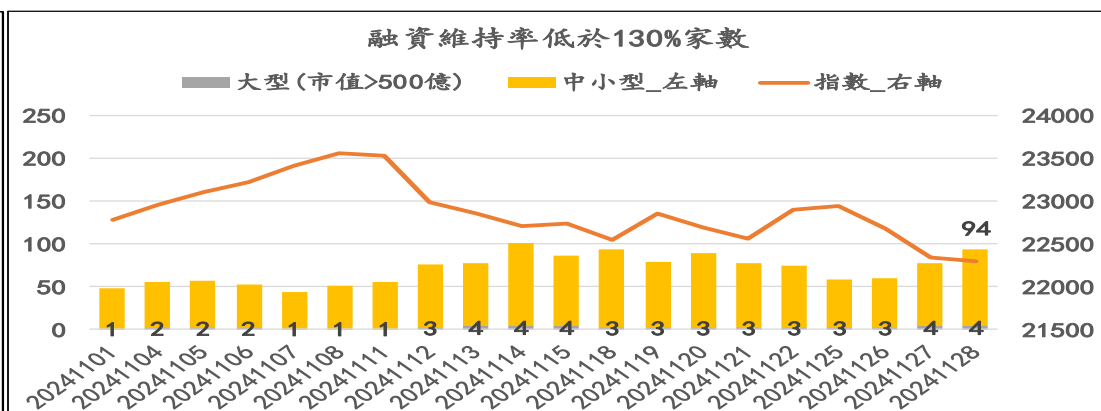
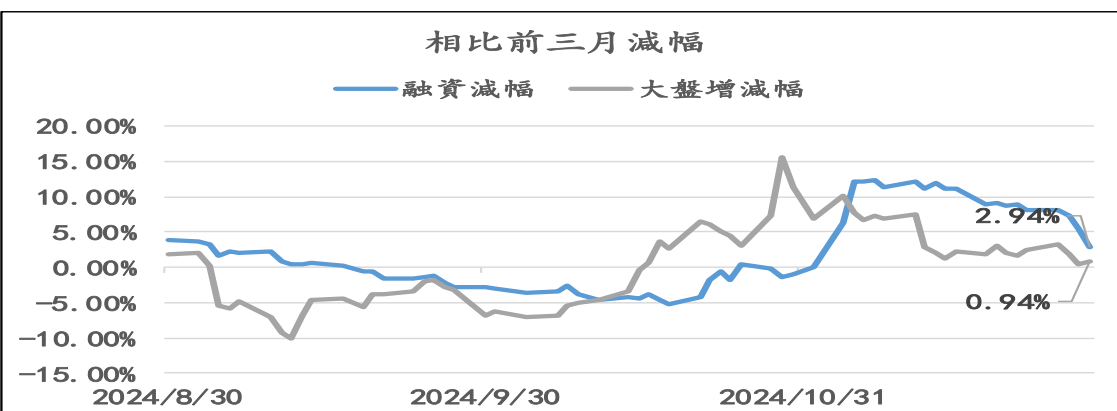
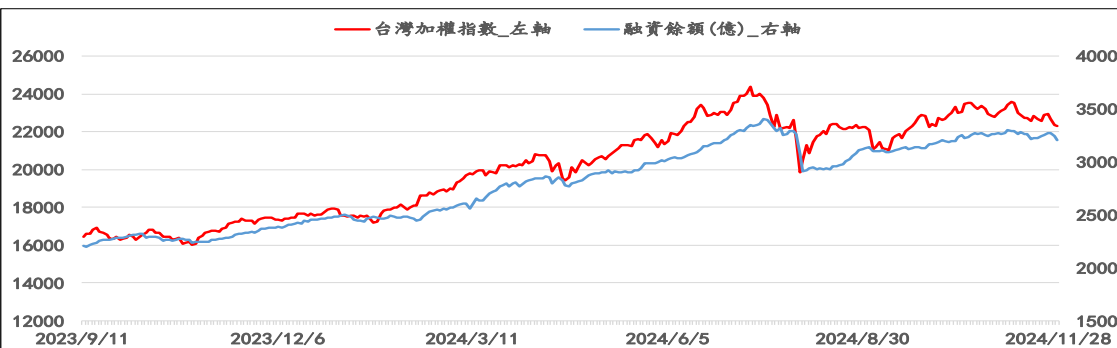
八大官股買賣超金額

日期	收盤價	八大官股買賣超(億)	近五日累積
2024/11/28	22299	20	130
2024/11/27	22335	112	141
2024/11/26	22679	60	89
2024/11/25	22948	-30	8
2024/11/22	22904	-32	77
2024/11/21	22556	31	111
2024/11/20	22688	60	128
2024/11/19	22849	-21	140
2024/11/18	22547	40	26611
2024/11/15	22743	2	242

融資/融券分析: 散戶融資大減46.11億維持率跌至155.79%



融資券(億元/萬張數)	資餘	資增減	週增/減	券餘	券增減	週增/減	融資維持率
加權指數	3202	-46.11	-42.15	27.85	-0.66	-0.86	155.79
OTC指數	1140	-8.26	11.01	10.51	-0.45	0.47	151.91



融資維持率	130%	150%	160%	167%
指數預估	18607.4	21470.1	22901.5	23903.4

日期	加權指數	融資餘額(億)	融資增減幅(億)	融資維持率(%)
2024/11/28	22298.9	3201.73	-46.11	155.79
2024/11/27	22334.78	3247.84	-23.24	157.18
2024/11/26	22678.76	3271.07	3.70	160.92
2024/11/25	22948.37	3267.38	17.12	162.72
2024/11/22	22904.32	3250.26	6.38	161.01

- 累計融資金額3202億，融資大減46.11億，（融資水位高點2024/7/17，融資餘額為3405億）
- 融資維持率跌至155.79%，不足160%。
- *融資維持率若低於150%以下多呈現跌深反彈。
- 融資維持率低於130%家數上升至94家。

籌碼面小結



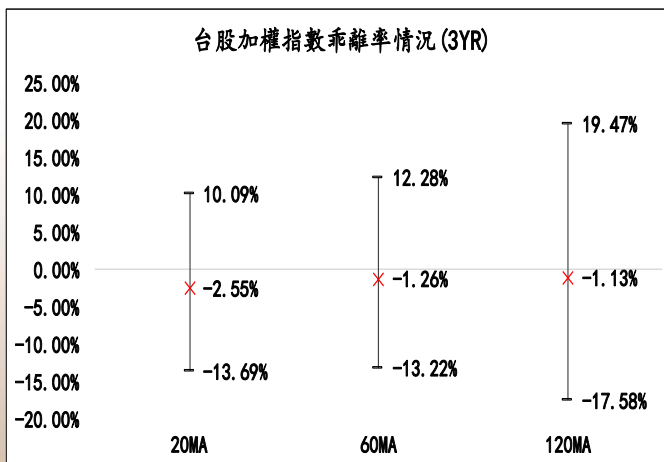
指標強弱判斷										
2024/11/28	觀察指標	現況	數值(0~100)	分數	方向	中期				
基本面	台灣PMI_MOM	50.00	22.87	▼-16.99	▼	2024/11/27	強空	2024/11/28	強空	
	台灣PMI_YOY	50.00	47.40	▼-7.16	▼	8.00		8.00		
	美國PMI_YOY	46.50	48.63	▼-1.75	▼					
	外銷訂單(億美元)	554.53	59.49	▼-7.21	▼					
	台股營收年增_YOY	-2.61%	61.14	▼-16.91	▼					
	PE區間	18.70	高於平均1.5個標準差	▼	▼					
	PB區間	2.44	高於平均1個標準差	▼	▼					
	重要事件	台幣	台幣貶0.4分至32.05元	▲	▲					
籌碼面	外資買賣超(億)	-98.9	27.5	▼-6.20	▼	2024/11/27	小多	2024/11/28	小多	
	八大官股買賣超(億)	20.2	58.9	▼-8.76	▼	59.00		59.00		
	0050債券賣出餘額(張)	23778.0	67.3	▲2.05	▲					
	債券賣出餘額(萬張)	1260.0	24.2	▲3.35	▲					
技術面	動能均線乖離率	-0.95%	12.27	▼-1.40	▼	2024/11/27	強空	2024/11/28	強空	
	創新高低家數比	-4.53%	37.59	▼-3.85	▼	10.00		10.00		
	漲跌家數ADL值(家)	-29465.00	39.86	▼-4.70	▼					
	現貨技術線型	2	19.74	▲1.11	▲					
	顧比倒數線(日)	22561	22561	▲	▲					
市場預期面	0050折溢價%	0.00	21.97	▲4.59	▲	2024/11/27	小空	2024/11/28	強多	
	投資信心指數	60.29	36.96	▲4.89	▲	44.00		100.00		
	費半	4853	29.71	▲0.24	▲					
					合計					
						30.14	44.04 ₀₁₃			
*75以上多/空、75~55小多/空、45~55中立						2024/11/27	小空	2024/11/28	小空	

加權指數價量技術分析：連二日跌破季線，量能萎縮



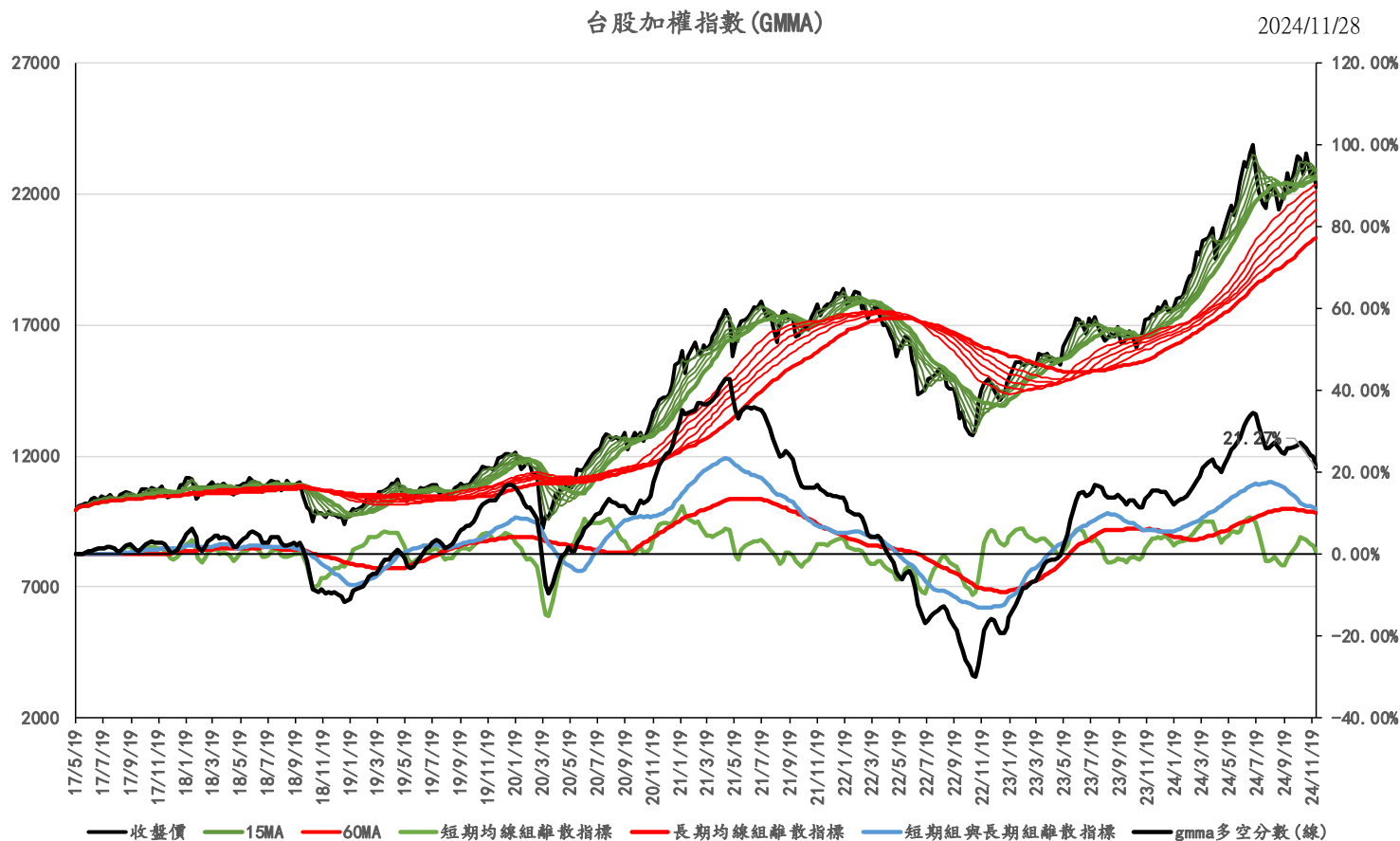
20MA	22883.3	↓
10MA	22654.7	↓
5MA	22633.0	↓
60MA	22583.9	↑
120MA	22554.4	↑
加權指數	22298.9	↓
200MA	20890.1	↑

- 成交量萎縮至3336億，量能略低於五日均量3747億
- 月/季線乖離：-2.55%/-1.26%
- KD走低、MACD翻負擴大
- 月均線22,883反壓，跌破季線22583
- 跌破前低22503，回測前前低22231點。
- 下方支撐22000。



	方向	分數
KD	空	-2
MACD	空方	-2
RSI	空方	-2
均線	空方	-2
成交量	量縮	
總計	空方	-8

台股週線：短組看多趨勢減弱，整體看多趨勢減弱



	2024/11/22	2024/11/28	變化
收盤價	22904	22299	多→空
15MA	22598	22595	短均上揚→短均下彎
60MA	20264	20360	長均上揚
短組離散	2.07%	0.24%	短組看多趨勢減弱
長組離散	10.25%	10.05%	長組看多趨勢減弱
短長組間距	11.52%	10.98%	整體看多趨勢減弱

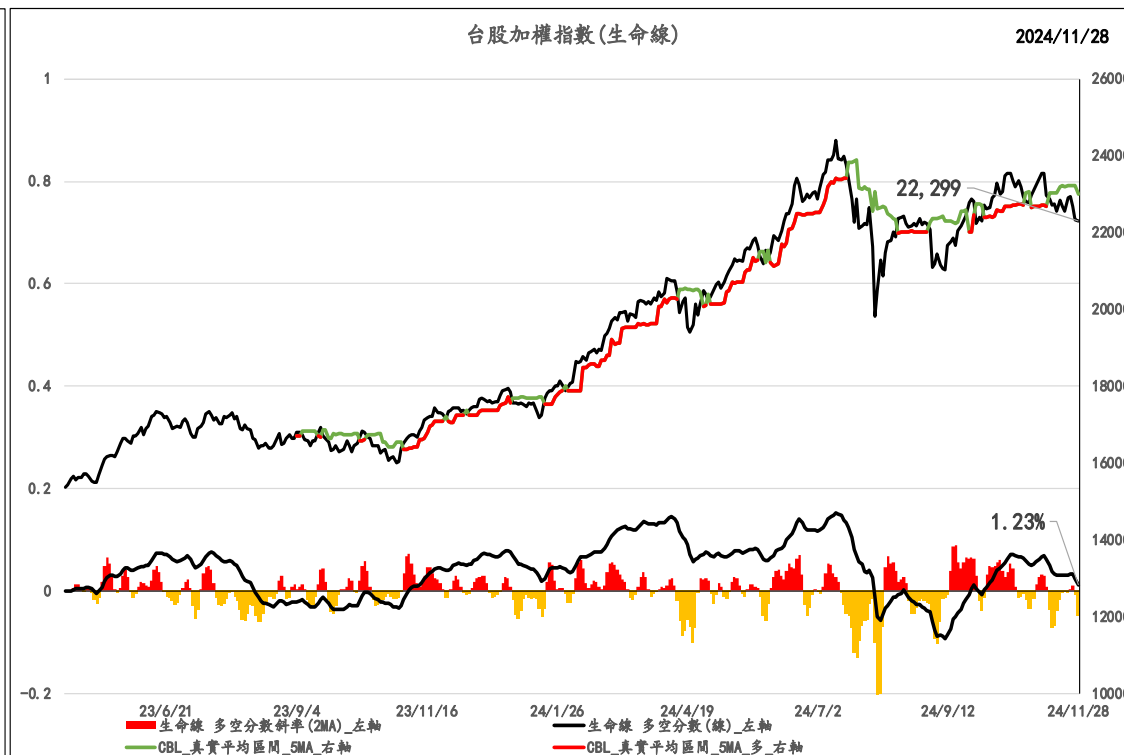
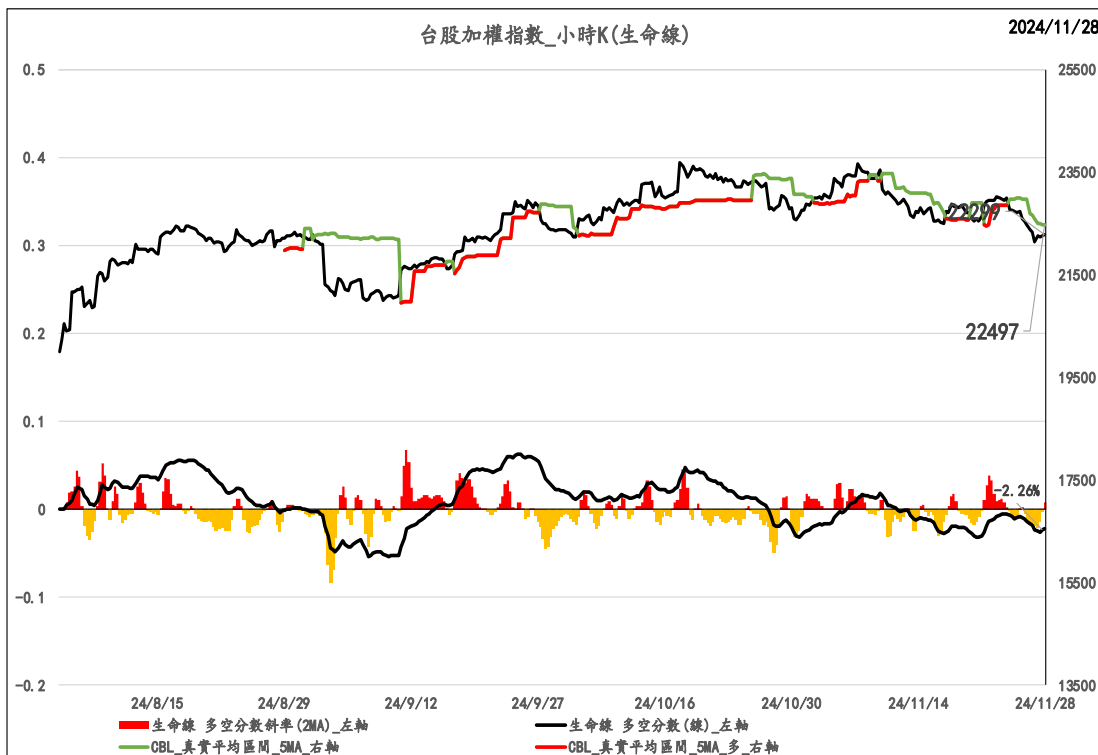
技術面

台股小時/日線： **短組看空趨勢增強，整體看多趨勢減弱**

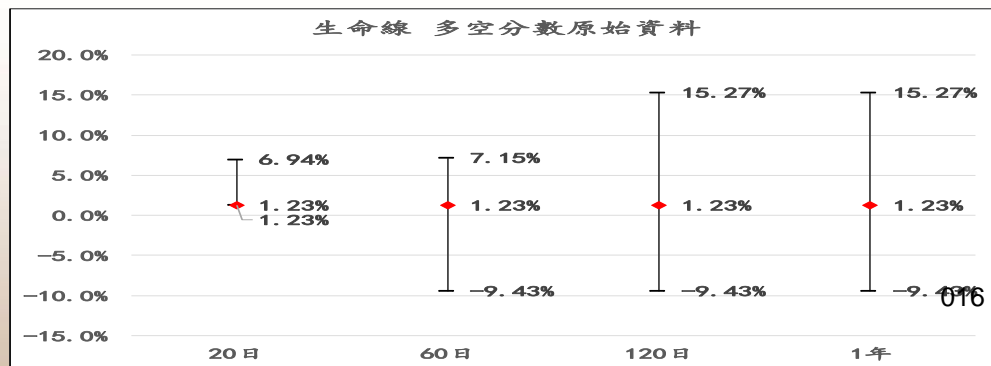


台股指數	GP趨勢	顧比倒數線
小時K	空	22497

台股指數	GP趨勢	顧比倒數線
日K	空	23005



	2024/11/27	2024/11/28	變化
收盤價	22335	22299	空
15MA	22887	22813	短均下彎
60MA	22582	22584	長均下彎→長均上揚
短組離散	-1.02%	-1.64%	短組看空趨勢增強
長組離散	1.97%	1.86%	長組看多趨勢減弱
短長組間距	1.35%	1.01%	整體看多趨勢減弱

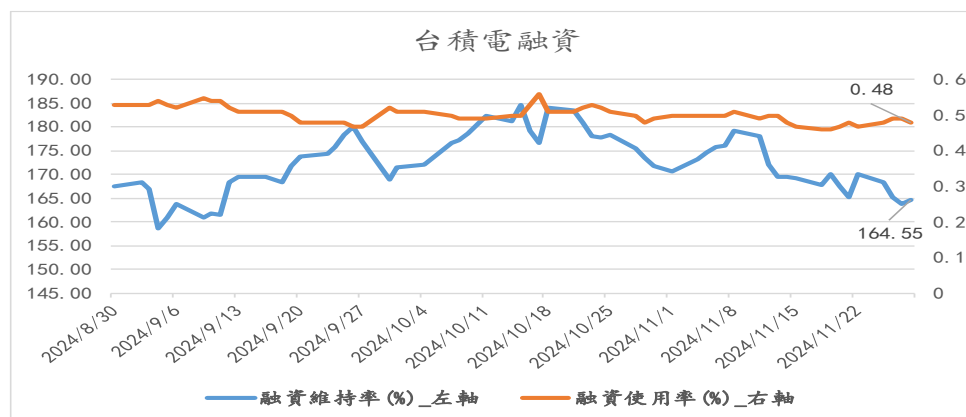


技術面-重要個股

• 台積電:外資賣超22.5億



資餘(張)	資增減(張)	融資維持率(%)	融資使用率%	融資成本	收盤價	漲幅(%)
31297	-660	164.5531	0.48	1017.909	1005	0.5



累計買賣超	五日	二十日	六十日	年初至今
外資	-227	-1190	-393	-206
投信	+31	+94	+176	+394

三大法人買賣超金額變化(億)

日期	外資	投信	自營商	合計
20241122	77.2	5.0	6.8	89.0
20241125	-74.2	15.1	13.3	-45.7
20241126	-110.5	1.1	-1.6	-111.0
20241127	-96.8	-0.3	-7.7	-104.7
20241128	-22.5	10.5	-0.8	-12.9
近五日合計	-226.7	31.4	10.0	-185.4

20MA	1037.8	↓
10MA	1022.0	↓
5MA	1017.0	↓
60MA	1007.1	↑
台積電	1005.0	↑
120MA	980.5	↑
200MA	845.0	↑

- 台積電收至1005元。
- 跌破所有短均。
- 外資賣超22.5億。
- 跌破季線1006元
- 回測千元整數關卡、力守前低996元。

技術面小結



指標強弱判斷										
2024/11/28	觀察指標	現況	數值(0~100)	分數	方向	中期				
基本面	台灣PMI_MOM	50.00	22.87	▼-16.99	▼	8.00	2024/11/27	強空	2024/11/28	強空
	台灣PMI_YOY	50.00	47.40	▼-7.16	▼		8.00			
	美國PMI_YOY	46.50	48.63	▼-1.75	▼					
	外銷訂單(億美元)	554.53	59.49	▼-7.21	▼					
	台股營收年增_YOY	-2.61%	61.14	▼-16.91	▼					
	PE區間	18.70	高於平均1.5個標準差	▼	▼					
	PB區間	2.44	高於平均1個標準差	▼	▼					
	重要事件	台幣	台幣貶0.4分至32.05元	▲	▲					
籌碼面	外資買賣超(億)	-98.9	27.5	▼-6.20	▼	59.00				
	八大官股買賣超(億)	20.2	58.9	▼-8.76	▼		59.00			
	0050借券賣出餘額(張)	23778.0	67.3	▲2.05	▲					
	借券賣出餘額(萬張)	1260.0	24.2	▲3.35	▲					
技術面	動能均線乖離率	-0.95%	12.27	▼-1.40	▼	10.00	2024/11/27	強空	2024/11/28	強空
	創新高低家數比	-4.53%	37.59	▼-3.85	▼		10.00			
	漲跌家數ADL值(家)	-29465.00	39.86	▼-4.70	▼					
	現貨技術線型	2	19.74	▲1.11	▲					
	顧比例數線(日)	22561	22561	▲	▲					
市場預期面	0050折溢價%	0.00	21.97	▲4.59	▲	44.00	2024/11/27	小空	2024/11/28	強多
	投資信心指數	60.29	36.96	▲4.89	▲		44.00			100.00
	費半	4853	29.71	▲0.24	▲					
					合計					
						30.14	44.04 ₀₁₈			
					*75以上多/空、75~55小多/空、45~55中立	2024/11/27	小空	2024/11/28	小空	

總表： 整體分數維持小空 (30.14=>44.04)

指標強弱判斷										
2024/11/28	觀察指標	現況	數值(0~100)	分數	方向	中期				
基本面	台灣PMI_MOM	50.00	22.87	▼-16.99	▼	2024/11/27	強空	2024/11/28	強空	
	台灣PMI_YOY	50.00	47.40	▼-7.16	▼	8.00		8.00		
	美國PMI_YOY	46.50	48.63	▼-1.75	▼					
	外銷訂單(億美元)	554.53	59.49	▼-7.21	▼					
	台股營收年增_YOY	-2.61%	61.14	▼-16.91	▼					
	PE區間	18.70	高於平均1.5個標準差	▼	▼					
	PB區間	2.44	高於平均1個標準差	▼	▼					
	重要事件	台幣	台幣貶0.4分至32.05元	▲	▲					
籌碼面	外資買賣超(億)	-98.9	27.5	▼-6.20	▼	2024/11/27	小多	2024/11/28	小多	
	八大官股買賣超(億)	20.2	58.9	▼-8.76	▼	59.00		59.00		
	0050債券賣出餘額(張)	23778.0	67.3	▲2.05	▲					
	債券賣出餘額(萬張)	1260.0	24.2	▲3.35	▲					
技術面	動能均線乖離率	-0.95%	12.27	▼-1.40	▼	2024/11/27	強空	2024/11/28	強空	
	創新高低家數比	-4.53%	37.59	▼-3.85	▼	10.00		10.00		
	漲跌家數ADL值(家)	-29465.00	39.86	▼-4.70	▼					
	現貨技術線型	2	19.74	▲1.11	▲					
	顧比倒數線(日)	22561	22561	▲	▲					
市場預期面	0050折溢價%	0.00	21.97	▲4.59	▲	2024/11/27	小空	2024/11/28	強多	
	投資信心指數	60.29	36.96	▲4.89	▲	44.00		100.00		
	費半	4853	29.71	▲0.24	▲					
					合計					
						30.14	44.04 ⁰¹⁹			
						2024/11/27	小空	2024/11/28	小空	

*75以上多/空、75~55小多/空、45~55中立

盤勢預測

總結(日): 台股日盤勢預估: 前收22,298, 台股連二日季線失守, 外資續賣, 融資下殺, 惟短線跌多, 融資淨額下降, 加上美股休市, 預計台股平盤震盪至22,100~22,400點。

主因:

- 籌碼面: 外資續賣, 投信買盤力道收斂, 整體融資水平下滑, 大盤融資維持率不足160%, 櫃買殺盤融資維持率接近150%, 有望短線提前大盤落底, 關注融資資金回復程度。
- 技術面: 連二日跌破季線, 成交金額萎縮, 下跌收下影線支撐, 須補量高於4000億元之上較有望止跌。
- 基本面: 10月出口月增年增, 維持連12月出口增長。AI族群仍持續強勁, 消費類電子展望一般。10月營收4.16兆, 月增2.2%、年增11.5%; 1-10月累積36.53兆, 年增11.7%。主要金控雙雄法說會後表現, 富邦金前九月稅後純益1,213億元, EPS 8.61元, 位居金控同業第一, 旗下壽險國內、國外股票報酬達26.78%、23.59%。市場預期全年EPS有望超過10元, 股利政策有望25年殖利率上看5.5%
- 政策面: 美聯儲利率會議市場預期降息0~1碼(12/18) (4.5%=>4.25%)。
- 外生變數: 中東衝突(以黎停火協議)、俄烏衝突。美國總統大選以川普全面執政為主。

11/25 (星期一)	11/26 (星期二)	11/27 (星期三)	11/28 (星期四)	11/29 (星期五)
MSCI生效 工業生產指數	富邦金法說	台灣消費者信心 國發會景氣燈號 國泰金法說	美國感恩節休市	美國感恩節提前收市



廷豐金融科技股份有限公司

Grand Empire AI FinTech Co., Ltd.

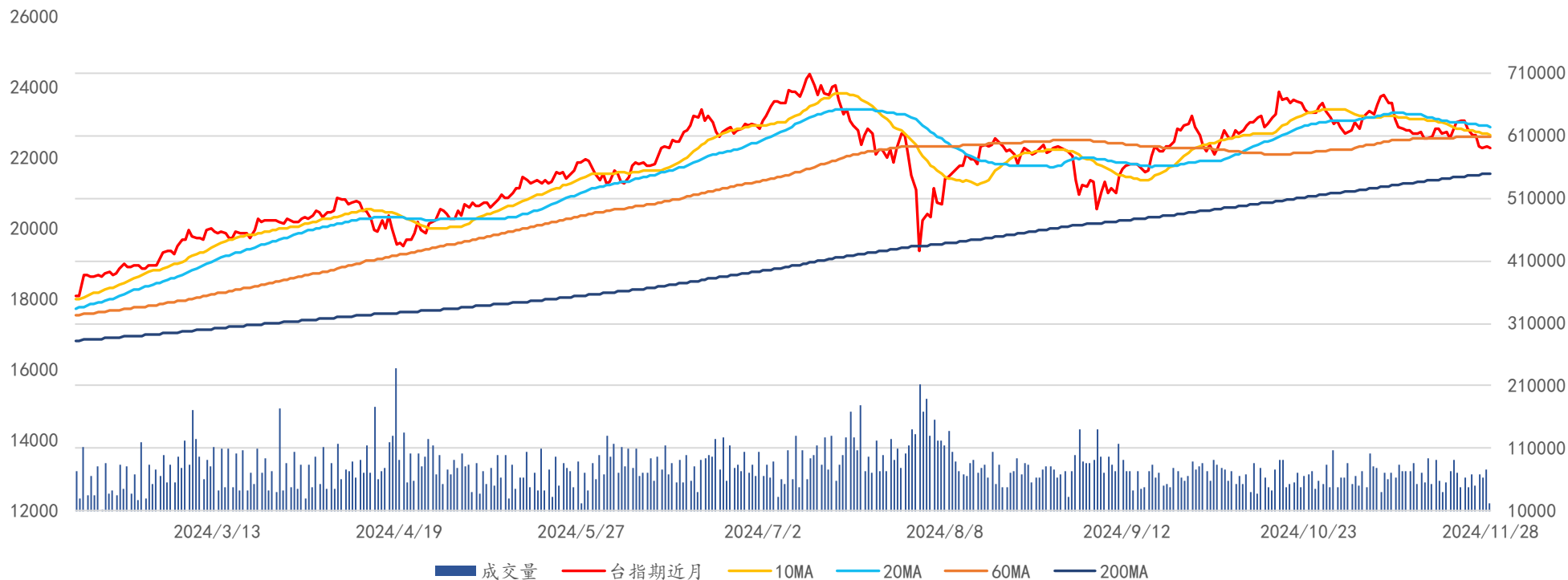
期貨市場分析

2024 年 11 月 29 日



一、期貨市場概況

台指期市場概況(日)



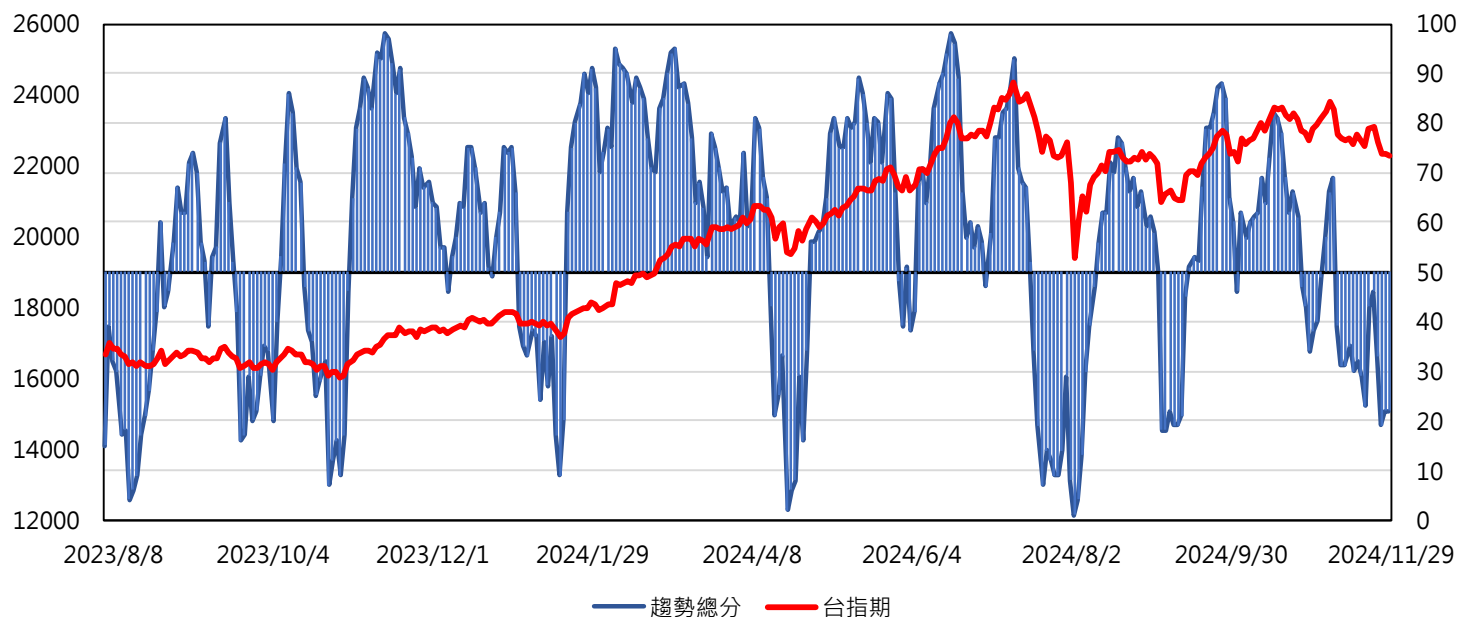
台指期貨價格變動											
		台指期近月	成交量	5MA	10MA	20MA	60MA	200MA	成交量5MA	成交量20MA	成交量60MA
2024/11/28	PM	22277	21722	22653	22677	22898	22618	21569	45,955	56,823	62,729
2024/11/28		22337	75167	22705	22699	22908	22618	21558	68,785	75,427	75,672
2024/11/27	PM	22268	62298	22729	22716	22922	22616	21547	60,005	58,889	63,497
2024/11/27		22347	67320	22777	22743	22942	22615	21537	68,557	74,832	75,759
2024/11/26	PM	22651	50607	22810	22765	22958	22616	21526	58,649	58,923	63,739
2024/11/26		22636	68259	22831	22774	22971	22612	21514	63,133	76,845	75,922
2024/11/25	PM	22855	48363	22853	22786	22988	22608	21503	59,917	58,830	64,253
2024/11/25		23066	61805	22829	22799	23005	22602	21490	67,676	77,672	75,852
2024/11/22	PM	23052	46783	22780	22824	23016	22595	21477	60,974	58,847	64,504
2024/11/22		23038	71376	22730	22850	23022	22588	21464	73,984	77,447	76,197

二、技術面分析

技術面趨勢指標

11月22日	11月25日	11月26日	11月27日	11月28日	11月28日夜盤
43	46	33	19	22	22

台指期技術趨勢分數走勢



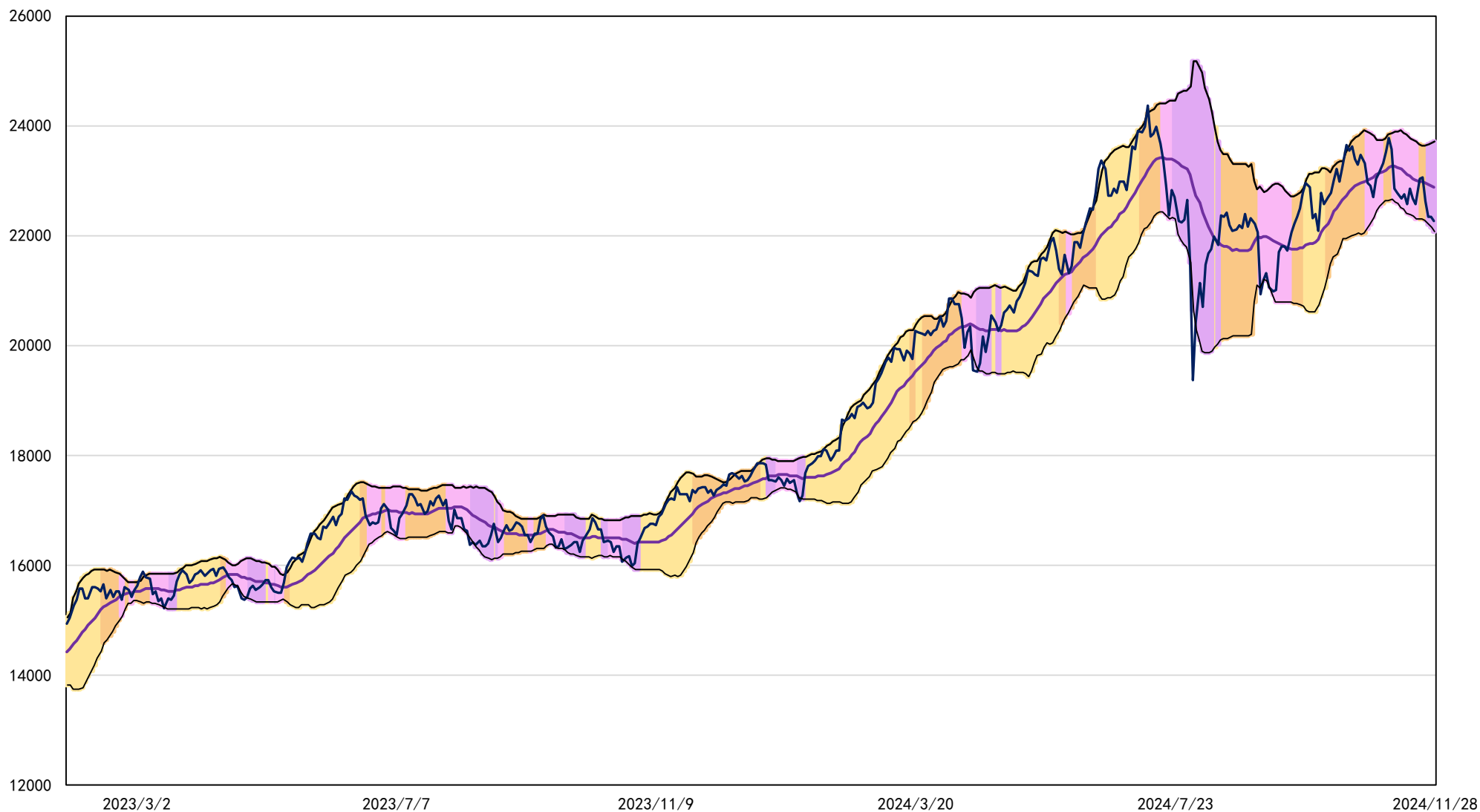
- 技術面分數：
19 -> 22 -> 22
- 趨勢指標分數維持空方位階，須注意 20 分以下後的轉折。

趨勢指標分項					
	權重	11月27日	11月28日	11月28日夜盤	變動
SAR拋物線指標	20%	3	3	3	0
MACD均線異同指標	20%	6	5	4	-2
MTM動能指標	20%	2	6	6	+4
FI勁道指標	20%	5	6	7	+2
CCI順勢指標	20%	3	2	2	-1
總分	100%	19	22	22	+3

指標分數對照	
分數區間	多空位階
0分~25分	空方
25分~45分	偏空
45分~55分	中性
55分~75分	偏多
75分~100分	多方

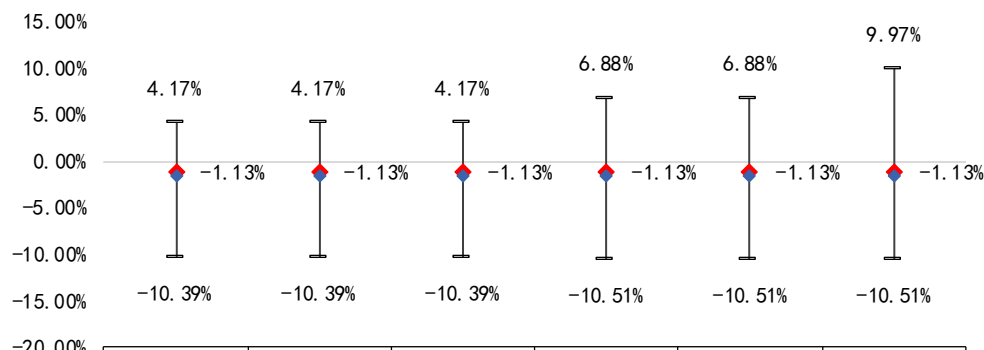
布林通道

股價處於中軸以下，維持紫色空方攻擊階段，上軌23712，下軌22074，中軸22893。



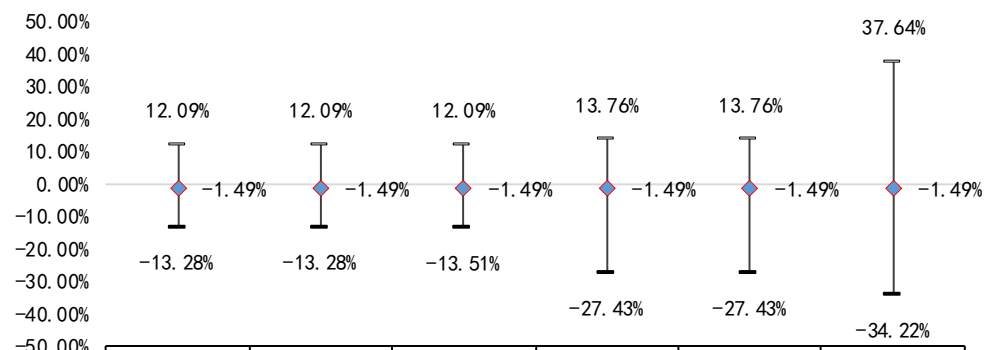
台指期乖離程度

5日均線乖離情況



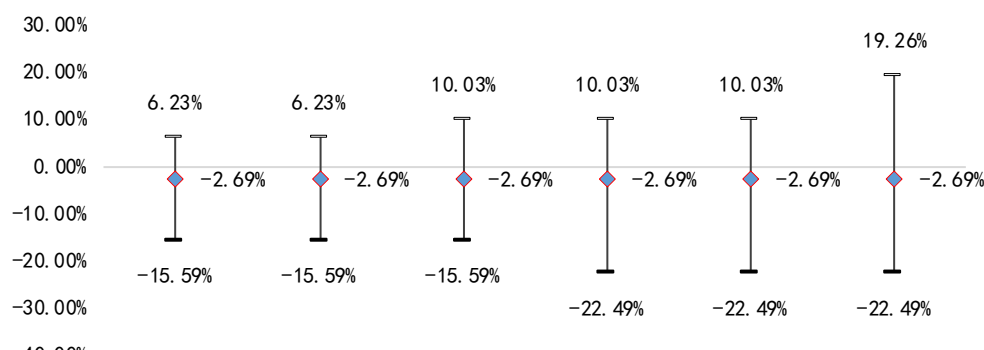
	半年內	1年內	3年內	5年內	10年內	歷史上
High	4.17%	4.17%	4.17%	6.88%	6.88%	9.97%
Low	-10.39%	-10.39%	-10.39%	-10.51%	-10.51%	-10.51%
Close	-1.13%	-1.13%	-1.13%	-1.13%	-1.13%	-1.13%
Last	-1.53%	-1.53%	-1.53%	-1.53%	-1.53%	-1.53%

60日均線乖離情況



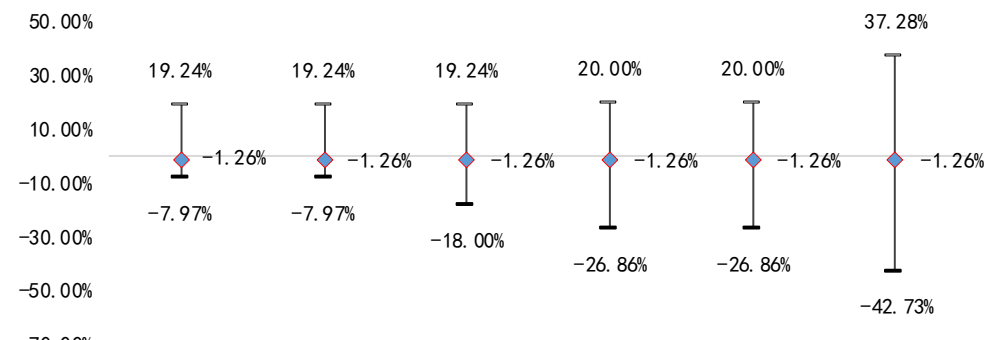
	半年內	1年內	3年內	5年內	10年內	歷史上
High	12.09%	12.09%	12.09%	13.76%	13.76%	37.64%
Low	-13.28%	-13.28%	-13.51%	-27.43%	-27.43%	-34.22%
Close	-1.49%	-1.49%	-1.49%	-1.49%	-1.49%	-1.49%
Last	-1.23%	-1.23%	-1.23%	-1.23%	-1.23%	-1.23%

20日均線乖離情況



	半年內	1年內	3年內	5年內	10年內	歷史上
High	6.23%	6.23%	10.03%	10.03%	10.03%	19.26%
Low	-15.59%	-15.59%	-15.59%	-22.49%	-22.49%	-22.49%
Close	-2.69%	-2.69%	-2.69%	-2.69%	-2.69%	-2.69%
Last	-2.53%	-2.53%	-2.53%	-2.53%	-2.53%	-2.53%

120日均線乖離情況



	半年內	1年內	3年內	5年內	10年內	歷史上
High	19.24%	19.24%	19.24%	20.00%	20.00%	37.28%
Low	-7.97%	-7.97%	-18.00%	-26.86%	-26.86%	-42.73%
Close	-1.26%	-1.26%	-1.26%	-1.26%	-1.26%	-1.26%
Last	-0.96%	-0.96%	-0.96%	-0.96%	-0.96%	-0.96%

三、籌碼面分析

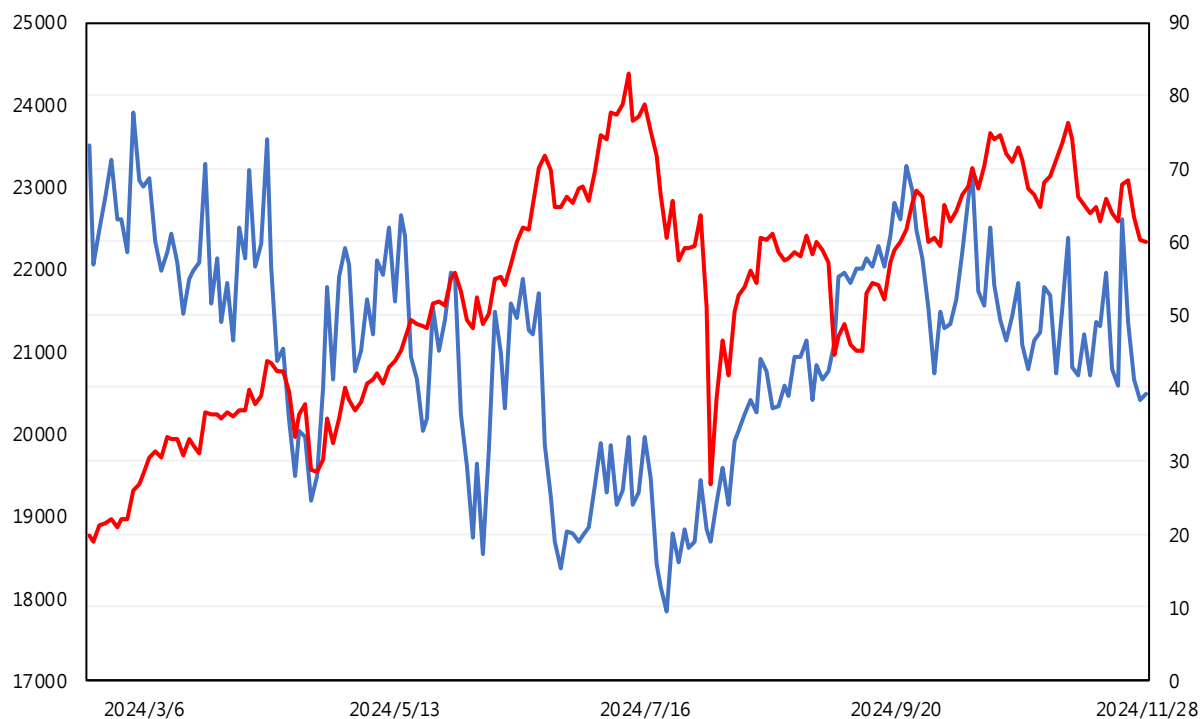
籌碼綜合指標

11月19日	11月20日	11月21日	11月22日	11月25日	11月26日	11月27日	11月28日
55.6	42.5	40.3	62.9	49.1	41.2	38.3	39.1

➤ 籌碼分數：**38.3 -> 39.1**

➤ 籌碼指標分數維持偏空位階，外資日盤籌碼空單存量升至 4 萬 8 千口。

台指期籌碼分數走勢



籌碼指標分項					
	指標現況	變動	權重	11月27日	11月28日
外資期貨	-47382口	-1629口	9.20%	1	1
外資選擇權	-5846口	+2000口	9.63%	3	4
前五大期貨	-9817口	+221口	8.29%	2	2
次五大期貨	-3700口	+383口	7.96%	5	5
外資買賣超	-3072.15億	-98.85億	7.32%	5	5
投信買賣超	2058.11億	36.91億	8.70%	3	3
自營買賣超	-2466.44億	-81.34億	8.09%	8	7
韭菜指標	18.49%	-0.97%	7.86%	3	3
散戶選擇權	14.55%	-0.74%	6.95%	1	2
VIX	21.78	+0.25	9.74%	8	8
PC_Ratio	76.82%	-0.17%	7.23%	1	1
自營選擇權	2243口	-1630口	9.05%	5	5
單日總分			100%	38.27	39.12

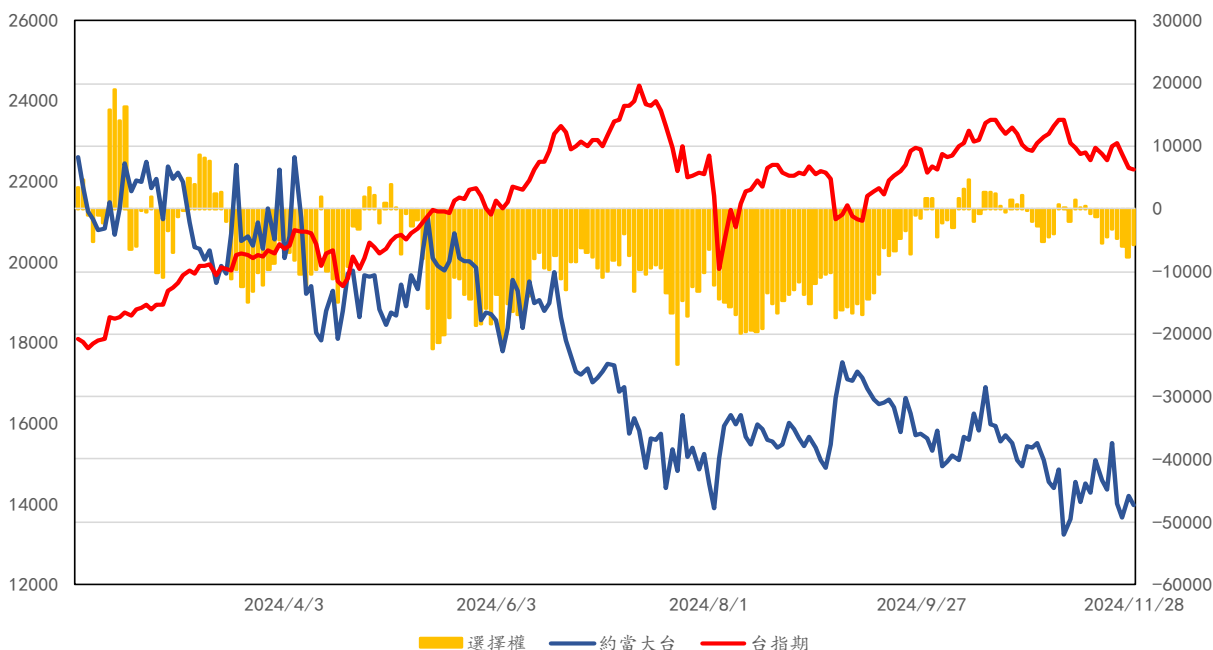
指標分數對照				
0分~25分	25分~45分	45分~55分	55分~75分	75分~100分
空方	偏空	中性	偏多	多方

外資期權未平倉量

➤ 外資現貨賣超金額為 98 億。期貨空單存量維持 4 萬 8 千口。

➤ 選擇權淨部位空單為 5 千 8 百口，前一交易日賣 call、賣 put，處於偏空。

外資期貨、選擇權未平倉量



外資期貨未平倉						
日期	期貨(大台)		期貨(小台)		約當大台	
2024/11/28	-47,260	▼-1922	-489	▲1174	-47,382	▼-1629
2024/11/27	-45,338	▲3124	-1,663	▲2069	-45,754	▲3641
2024/11/26	-48,462	▼-2119	-3,732	▼-935	-49,395	▼-2353
2024/11/25	-46,343	▼-8141	-2,797	▼-5820	-47,042	▼-9596
2024/11/22	-38,202	▲5505	3,023	▲7704	-37,446	▲7431
2024/11/21	-43,707	▼-1822	-4,681	▲1194	-44,877	▼-1524
2024/11/20	-41,885	▼-516	-5,875	▼-10629	-43,354	▼-3173
2024/11/19	-41,369	▲5214	4,754	▼-316	-40,181	▲5135
2024/11/18	-46,583	▼-1399	5,070	▼-408	-45,316	▼-1501
2024/11/15	-45,184	▲2064	5,478	▲3331	-43,815	▲2897
2024/11/14	-47,248	▼-2454	2,147	▼-2316	-46,711	▼-3033
2024/11/13	-44,794	▲4711	4,463	▲4775	-43,678	▲5905
2024/11/12	-49,505	▲2193	-312	▲724	-49,583	▲2374
2024/11/11	-51,698	▼-8870	-1,036	▼-5893	-51,957	▼-10343
2024/11/08	-42,828	▲3118	4,857	▼-345	-41,614	▲3032
2024/11/07	-45,946	▼-1321	5,202	▲1415	-44,646	▼-967

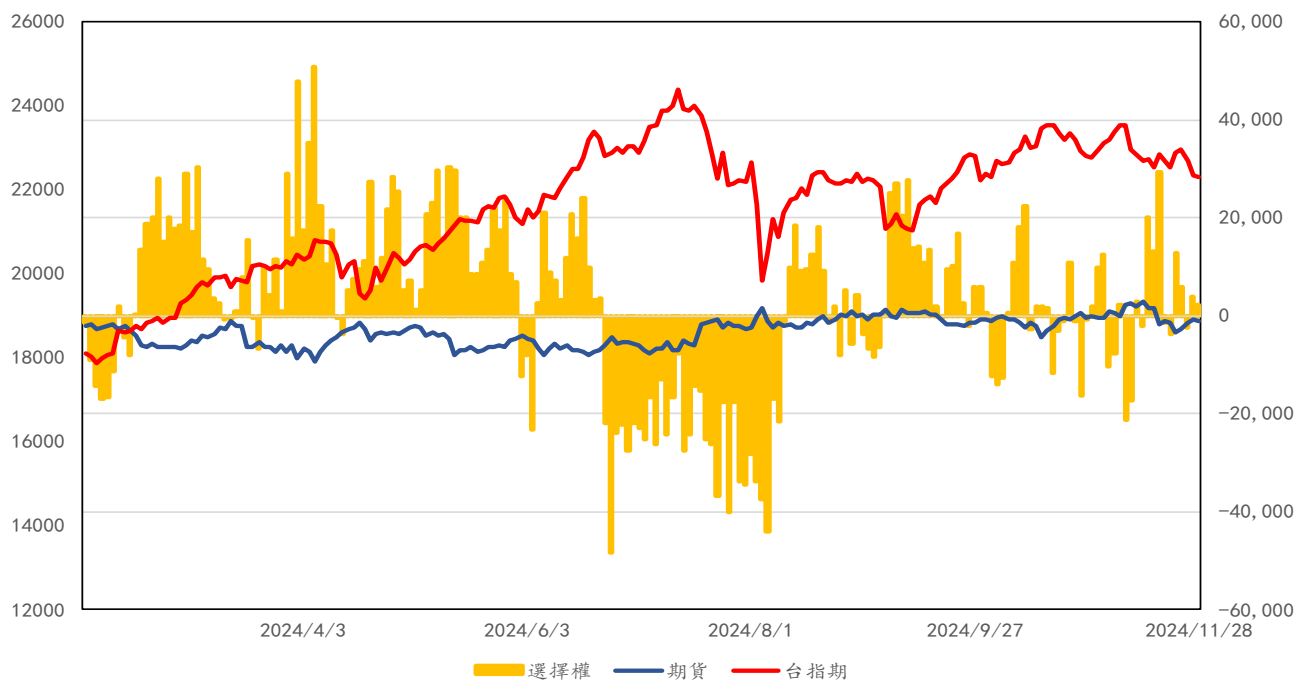
外資選擇權						
日期	買權 Call		賣權 Put		未平倉淨部位	
2024/11/28	-9,264	▼-205	-3,418	▼-2205	-5,846	▲2000
2024/11/27	-9,059	▼-3120	-1,213	▼-1212	-7,846	▼-1908
2024/11/26	-5,939	▼-1549	-1	▼-302	-5,938	▼-1247
2024/11/25	-4,390	▼-1865	301	▼-337	-4,691	▼-1528
2024/11/22	-2,525	▼-394	638	▼-1710	-3,163	▲1316
2024/11/21	-2,131	▼-551	2,348	▼-1658	-4,479	▲1107
2024/11/20	-1,580	▼-4601	4,006	▼-258	-5,586	▼-4343

外資選擇權未平倉淨額						
外資	買方		賣方		淨額	
	口數	金額(百萬)	口數	金額(百萬)	口數	金額(百萬)
2024/11/28						
買權	15,674	67.76	24,938	121.46	-9,264	-53.70
賣權	19,111	268.14	22,529	324.74	-3,418	-56.60

自營期權未平倉量

自營選擇權昨日買Call、買Put，日盤淨部位多單為2千2百口。

自營期貨、選擇權未平倉量



自營商期權未平倉					
日期	期貨		選擇權		台指期
2024/11/28	-973	▼-254	2,243	▼-1630	22299
2024/11/27	-719	▲676	3,873	▲6267	22335
2024/11/26	-1,395	▲1349	-2,394	▼-8391	22679
2024/11/25	-2,744	▲525	5,997	▼-6897	22948
2024/11/22	-3,269	▼-1997	12,894	▲16607	22904
2024/11/21	-1,272	▼-259	-3,713	▼-2309	22556
2024/11/20	-1,013	▲778	-1,404	▼-30878	22688
2024/11/19	-1,791	▼-3378	29,474	▲16361	22849
2024/11/18	1,587	▲122	13,113	▼-6840	22547
2024/11/15	1,465	▼-1294	19,953	▲22113	22743
2024/11/14	2,759	▲919	-2,160	▼-4931	22715
2024/11/13	1,840	▼-829	2,771	▲19970	22860
2024/11/12	2,669	▲419	-17,199	▲4056	22982
2024/11/11	2,250	▲2361	-21,255	▼-23548	23530
2024/11/8	-111	▼-817	2,293	▲10134	23554
2024/11/7	706	▼-152	-7,841	▲2563	23409
2024/11/6	858	▲1327	-10,404	▼-22846	23217
2024/11/5	-469	▲46	12,442	▲2544	23107
2024/11/4	-515	▼-403	9,898	▲7932	22965
2024/11/1	-112	▲285	1,966	▲2845	22780
2024/10/30	-397	▼-1138	-879	▲15501	22820

自營商選擇權未平倉淨額						
自營	買方		賣方		淨額	
	口數	金額(百萬)	口數	金額(百萬)	口數	金額(百萬)
2024/11/28						
買權	45,555	477.46	37,978	217.57	7,577	259.90
賣權	37,286	576.22	31,952	305.15	5,334	271.08

自營選擇權						
日期	買權Call		賣權Put		未平倉淨部位	
2024/11/28	7,577	▲3871	5,334	▲5501	2,243	▼-1630
2024/11/27	3,706	▼-2090	-167	▼-8357	3,873	▲6267
2024/11/26	5,796	▼-7496	8,190	▲895	-2,394	▼-8391
2024/11/25	13,292	▼-2828	7,295	▲4069	5,997	▼-6897
2024/11/22	16,120	▲14449	3,226	▼-2158	12,894	▲16607

三大法人期權數據(含夜盤資訊)



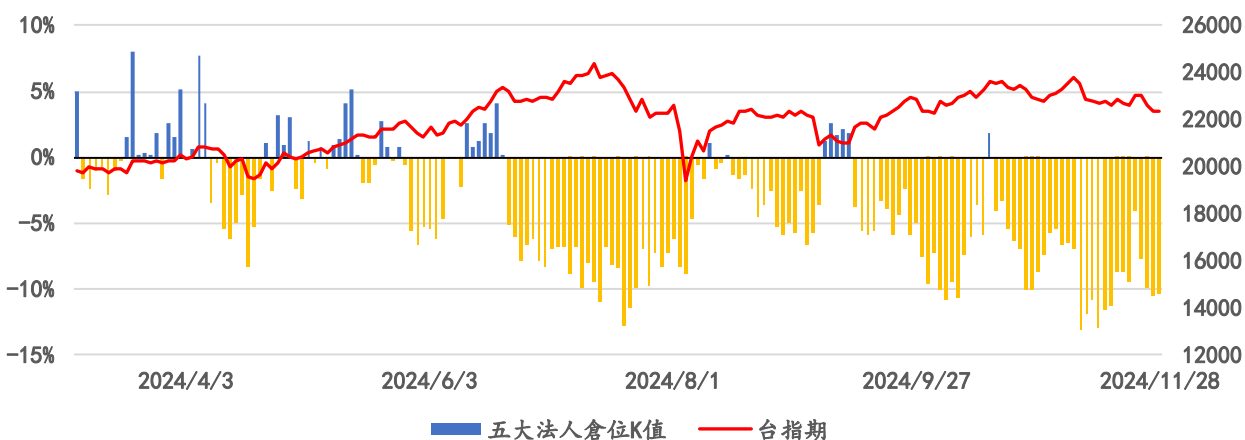
三大法人期貨														
日期	台股大盤			交易口數淨額			未平倉口數							
	指數	漲跌	漲跌幅	外資	投信	自營	外資	昨日差異	投信	昨日差異	自營	昨日差異	合計	合計差異
11/28夜盤	22,277	-60	▼-0.27	249	0	345	-47,133	▲249	27,015	0	-3,142	▲345	-23,261	▲594
11/28	22,337	-10	▼-0.04	-1,684	1,245	-247	-47,382	▼-3,864	27,015	▲1,245	-3,487	▼-331	-23,855	▼-2,951
11/27夜盤	22,268	-79	▼-0.35	2,236	0	117	-43,518	▲2,236	25,770	0	-3,156	▲117	-20,904	▲2,353
11/27	22,347	-289	▼-1.28	3,686	-81	472	-45,754	▲1,806	25,770	▼-81	-3,273	▲761	-23,257	▲2,485
11/26夜盤	22,651	+15	▲0.07	1,836	0	-257	-47,559	▲1,836	25,851	0	-4,034	▼-257	-25,742	▲1,579
11/26	22,636	-430	▼-1.86	-2,046	-865	1,326	-49,395	▼-776	25,851	▼-865	-3,777	▲1,039	-27,320	▼-602
11/25夜盤	22,855	-211	▼-0.85	-1,577	0	210	-48,619	▼-1,577	26,716	0	-4,816	▲210	-26,718	▼-1,367
11/25	23,066	+28	▲0.12	-9,268	-239	174	-47,042	▼-5,994	26,716	▼-239	-5,025	▼-158	-25,351	▼-6,390
11/22夜盤	23,052	+14	▲0.06	-3,603	0	230	-41,049	▼-3,603	26,955	0	-4,868	▲230	-18,961	▼-3,372
11/22	23,038	+465	▲2.06	6,879	77	-1,502	-37,446	▲7,431	26,955	▲77	-5,098	▼-1,517	-15,589	▲5,992
11/21	22,573	-113	▼-0.5	-1,284	139	-232	-44,877	▼-1,524	26,878	▲139	-3,581	▼-339	-21,581	▼-1,723
11/20	22,686	-164	▼-0.72	-8,197	-316	2,692	-43,354	▼-3,173	26,739	▼-316	-3,243	▲1,288	-19,858	▼-2,201

三大法人選擇權																
日期	台股大盤			交易口數淨額				P/C比	未平倉口數							P/C比
	指數	漲跌	漲跌幅	外資	投信	自營	外資		昨日差異	投信	昨日差異	自營	昨日差異	合計	合計差異	
11/28夜盤	22,277	-60	▼-0.27	-242	0	-4,386	-	-6,088	▼-242	-124	0	-2,143	▼-4,386	-8,355	▼-4,628	-
11/28	22,337	-10	▼-0.04	2,000	0	-1,630	90.3%	-5,846	▲1,847	-124	0	2,243	▼-842	-3,727	▲1,005	76.8%
11/27夜盤	22,268	-79	▼-0.35	153	0	-788	-	-7,693	▲153	-124	0	3,085	▼-788	-4,732	▼-635	-
11/27	22,347	-289	▼-1.28	2,019	0	-22,397	86.3%	-7,846	▼-3,258	-124	0	3,873	▲6,635	-4,097	▲3,377	77.0%
11/26夜盤	22,651	+15	▲0.07	1,350	0	-368	-	-4,588	▲1,350	-124	0	-2,762	▼-368	-7,474	▲982	-
11/26	22,636	-430	▼-1.86	-1,247	0	-8,391	74.5%	-5,938	▼-363	-124	0	-2,394	▼-3,725	-8,456	▼-4,088	85.4%
11/25夜盤	22,855	-211	▼-0.91	-884	0	-4,666	-	-5,575	▼-884	-124	0	1,331	▼-4,666	-4,368	▼-5,550	-
11/25	23,066	+28	▲0.12	-1,528	0	-6,897	101.7%	-4,691	▼-1,428	-124	0	5,997	▼-6,527	1,182	▼-7,955	101.7%
11/22夜盤	23,052	+14	▲0.06	-100	0	-370	-	-3,263	▼-100	-124	0	12,524	▼-370	9,137	▼-470	-
11/22	23,038	+465	▲2.06	1,316	-80	16,607	101.0%	-3,163	▲1,316	-124	▼-80	12,894	▲16,607	9,607	▲17,843	108.7%
11/21	22,573	-113	▼-0.5	1,107	0	-2,309	82.8%	-4,479	▲1,107	-44	0	-3,713	▼-2,309	-8,236	▼-1,202	85.5%
11/20	22,686	-164	▼-0.72	-29	-44	-31,876	104.6%	-5,586	▼-4,343	-44	▲68	-1,404	▼-30,878	-7,034	▼-35,153	94.3%

前十大交易人期貨未平倉

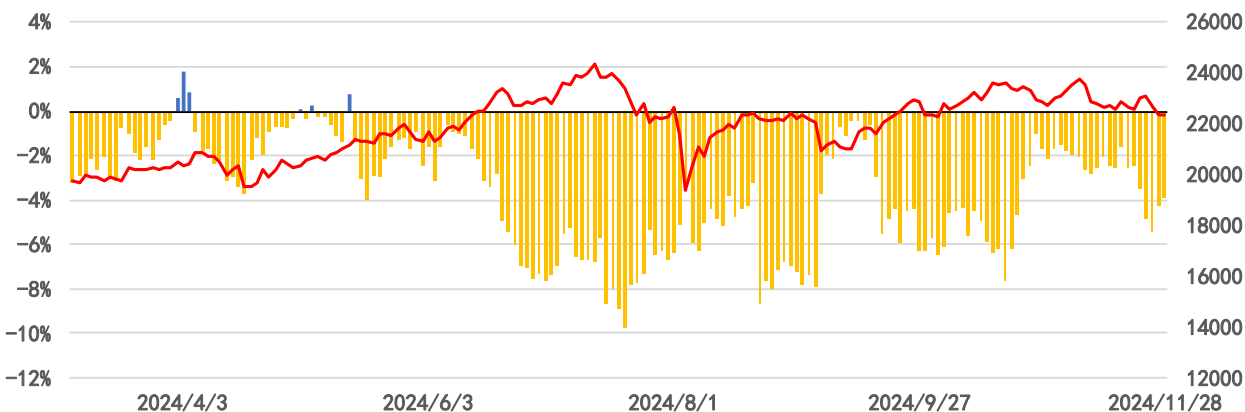
前五大空單淨部位維持 1 萬口，K 值為 -10.35%，指標為空方；次五大空單淨部位降至 3 千 7 百口，K 值為 -3.90%。前五大次五大變動方向偏多，淨部位維持偏空。

前五大法人倉位K值走勢圖



■ 五大法人倉位K值 — 台指期

次五大法人倉位K值走勢圖



■ 次五大法人倉位K值 — 台指期

前五大交易人期貨未平倉

日期	K值	前五大淨部位	全部未平倉量
2024/11/28	-10.35%	-9817 ▲221	94859 ▼-931
2024/11/27	-10.48%	-10038 ▼-634	95790 ▲1746
2024/11/26	-10.00%	-9404 ▼-2188	94044 ▼-679
2024/11/25	-7.62%	-7216 ▼-3656	94723 ▲5593
2024/11/22	-3.99%	-3560 ▲4767	89130 ▲1467
2024/11/21	-9.50%	-8327 ▼-1128	87663 ▲4451
2024/11/20	-8.65%	-7199 ▲1277	83212 ▼-14513

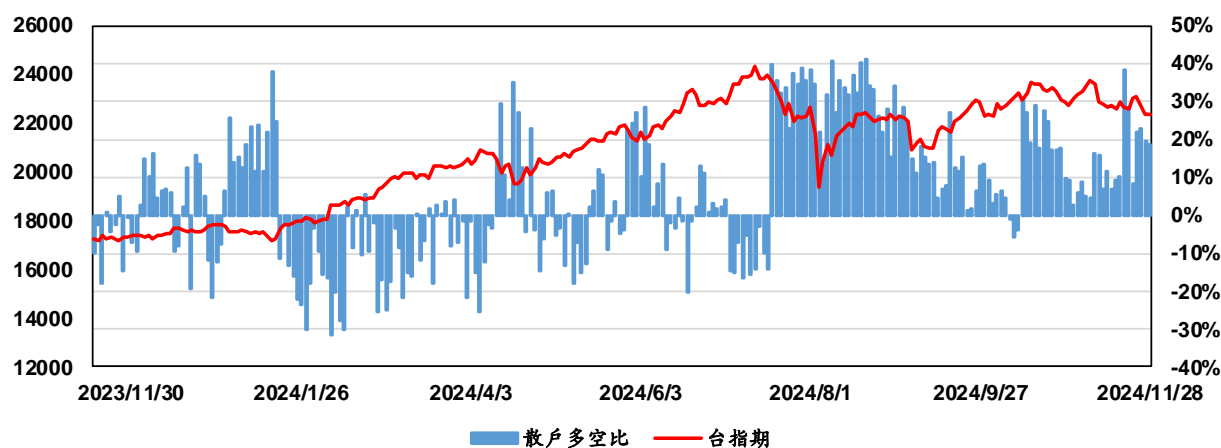
次五大交易人期貨未平倉

日期	K值	次五大淨部位	全部未平倉量
2024/11/28	-3.90%	-3700 ▲383	94859 ▼-931
2024/11/27	-4.26%	-4083 ▲982	95790 ▲1746
2024/11/26	-5.39%	-5065 ▼-489	94044 ▼-679
2024/11/25	-4.83%	-4576 ▼-1457	94723 ▲5593
2024/11/22	-3.50%	-3119 ▼-940	89130 ▲1467
2024/11/21	-2.49%	-2179 ▼-85	87663 ▲4451
2024/11/20	-2.52%	-2094 ▼-2094	83212 ▼-14513

散戶指標——韭菜指標(小台散戶多空比)

韭菜指標降至 19.46 %，散戶維持多方，多單部位降至 1 萬 2 千口，指標方向空方。

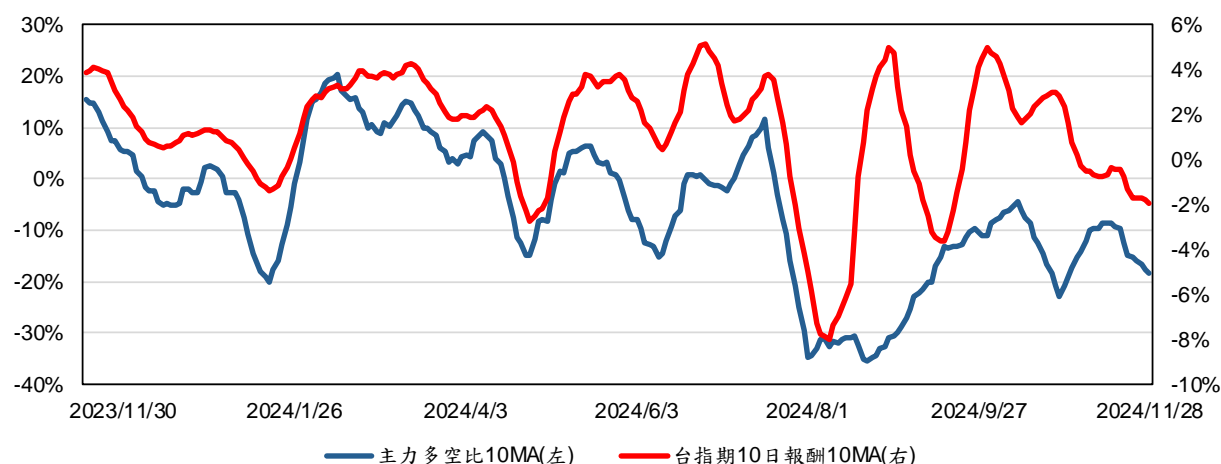
近一年韭菜指標和台指期原始數據走勢圖



散戶指標(小台散戶多空比)

日期	散戶多空比	變動	散戶未平倉	變動
2024/11/28	18.49%	▼-0.97%	10410	▼-1332
2024/11/27	19.46%	▼-3.64%	11742	▼-1379
2024/11/26	23.10%	▲1.13%	13121	▲1336
2024/11/25	21.97%	▲13.58%	11785	▲7629
2024/11/22	8.39%	▼-20.18%	4156	▼-9626
2024/11/21	28.57%	▼-9.61%	13782	▼-872
2024/11/20	38.18%	▲27.79%	14654	▲8588
2024/11/19	10.39%	▲0.92%	6066	▲238
2024/11/18	9.46%	▲2.48%	5828	▲1511
2024/11/15	6.99%	▼-4.45%	4317	▼-2525
2024/11/14	11.44%	▲4.49%	6842	▲2741
2024/11/13	6.94%	▼-8.87%	4101	▼-5548

韭菜指標(反轉)和台指期平滑差分走勢圖



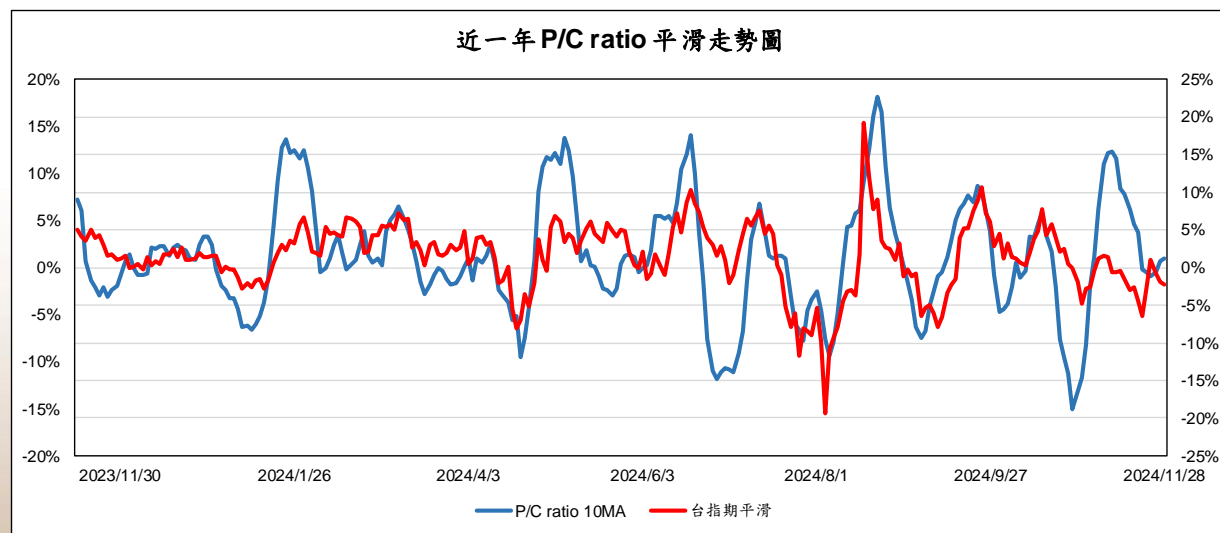
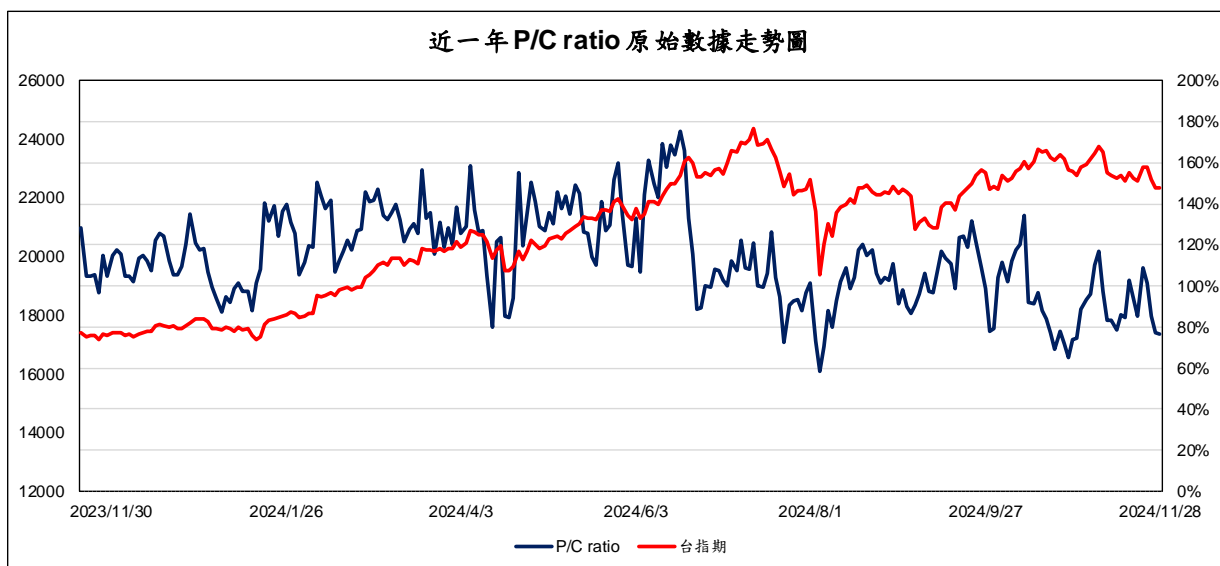
散戶指標平滑化

	主力10MA	台指報酬10MA
2024/11/28	-18.50%	-1.97%
2024/11/27	-17.79%	-1.82%
2024/11/26	-16.54%	-1.72%
2024/11/25	-15.81%	-1.71%
2024/11/22	-15.27%	-1.69%
2024/11/21	-14.88%	-1.33%
2024/11/20	-12.51%	-0.72%
2024/11/19	-9.59%	-0.40%
2024/11/18	-9.15%	-0.40%

四、市場預期分析

未平倉量 P/C ratio

未平倉量PC Ratio指標降至 76.82%，指標偏空，80%以下可能為轉折點；平滑化指標升至 1.15%，處於中性位階。

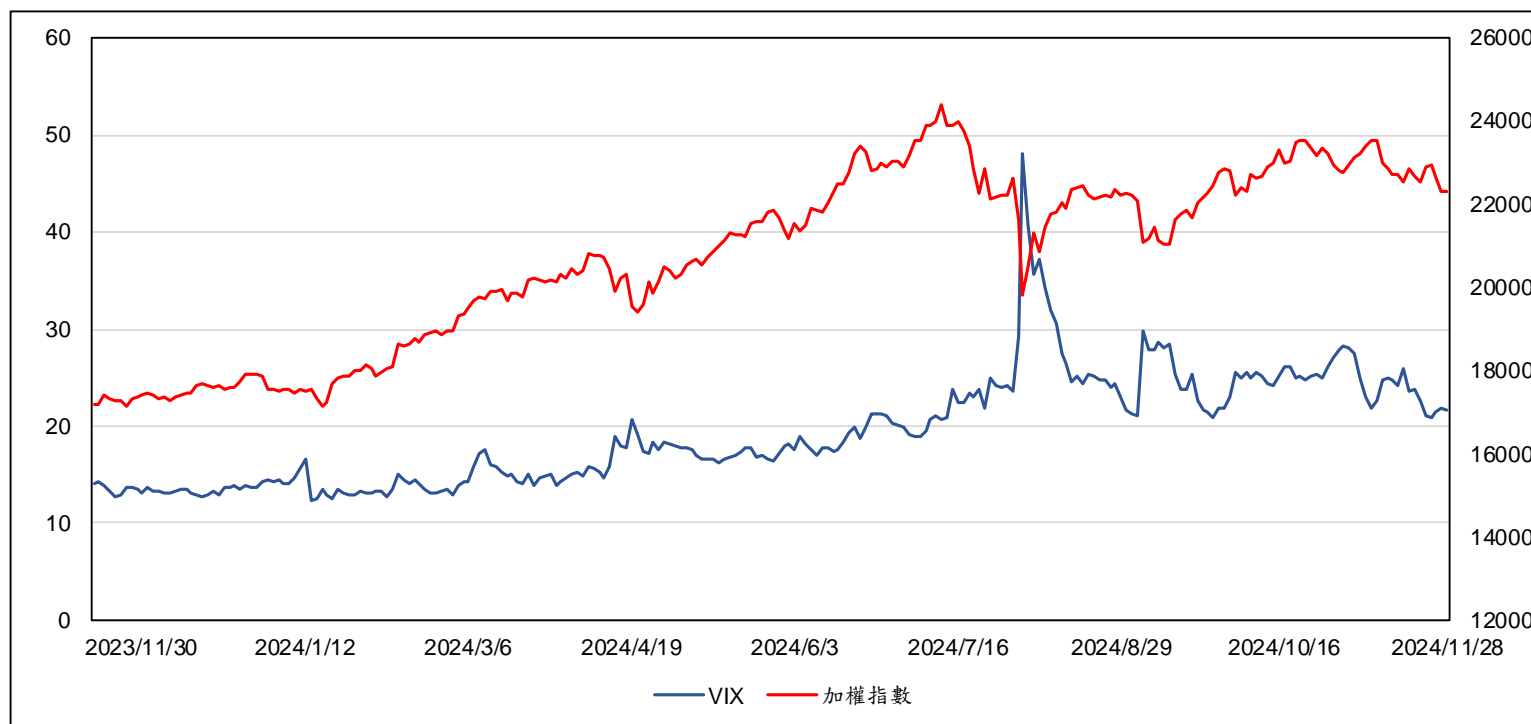


PC Ratio		
日期	P/C ratio	台指期
2024/11/28	76.82%	22337
2024/11/27	76.99%	22347
2024/11/26	85.37%	22636
2024/11/25	101.74%	23066
2024/11/22	108.67%	23038
2024/11/21	85.47%	22573
2024/11/20	94.28%	22686
2024/11/19	102.95%	22850

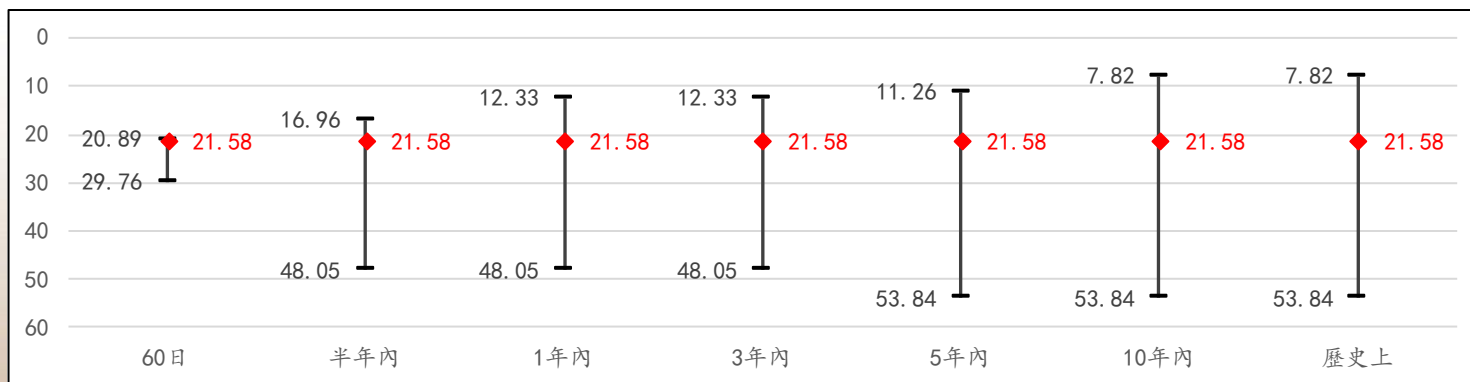
PC Ratio平滑指標		
	P/C ratio 10MA	台指期
2024/11/28	1.15%	22337
2024/11/27	0.79%	22347
2024/11/26	-0.66%	22636
2024/11/25	-1.09%	23066
2024/11/22	-0.55%	23038
2024/11/21	-0.25%	22573
2024/11/20	4.67%	22686
2024/11/19	5.70%	22850

台股VIX波動率指數

VIX分數維持 21.58，指標偏多。



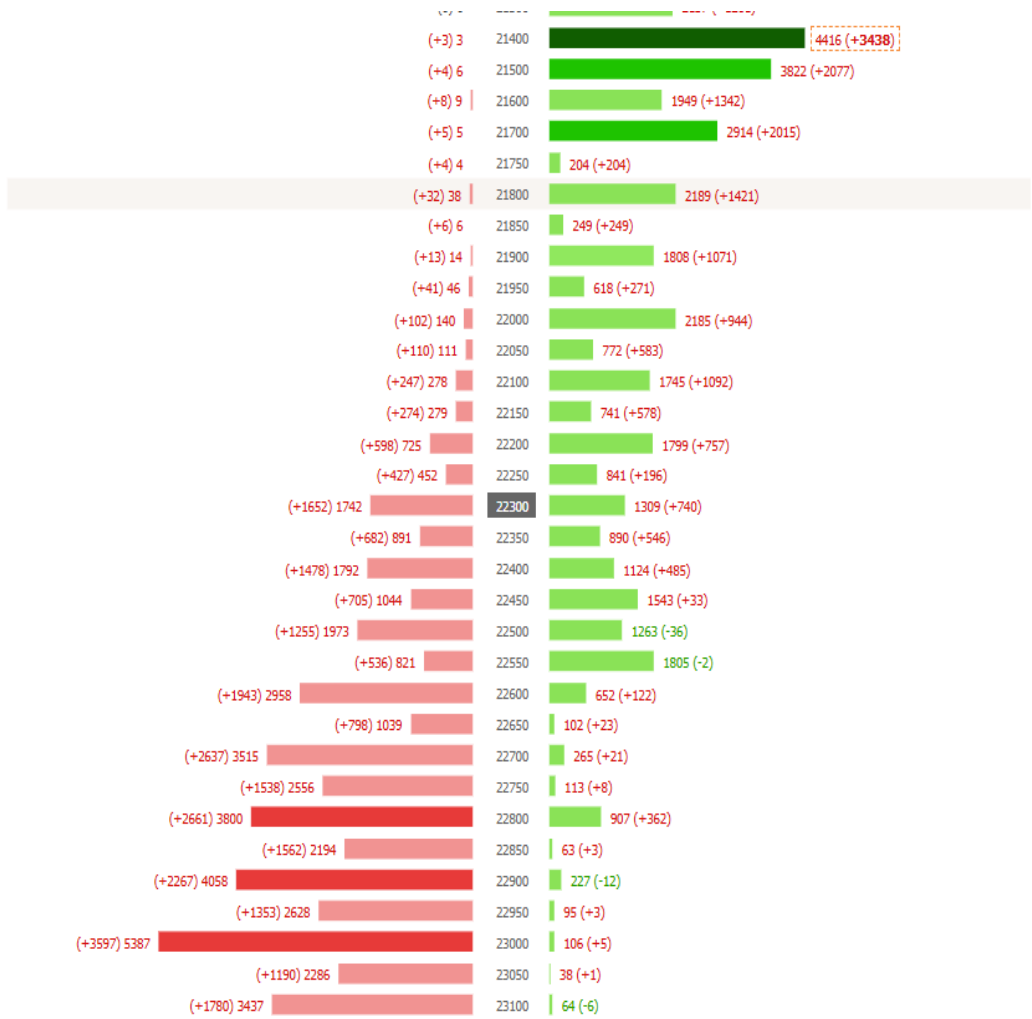
台股VIX波動率		
日期	收盤價	加權指數
2024/11/28	21.58	22299
2024/11/27	21.78	22335
2024/11/26	21.53	22679
2024/11/25	20.9	22948
2024/11/22	21.07	22904
2024/11/21	22.62	22556
2024/11/20	23.77	22688
2024/11/19	23.5	22849
2024/11/18	25.86	22547
2024/11/15	24.16	22743
2024/11/14	24.8	22715
2024/11/13	24.92	22860
2024/11/12	24.81	22982
2024/11/11	22.64	23530



選擇權支撐壓力量表

202412W4 (12/4 結算)

最大未平倉壓力位
23000



最大未平倉支撐位
21400

日盤期現貨價差

- 原期現貨價差：38.1 點。
- 考慮除權息後期現貨價差：截至 12 月結算除權息預估剩餘點數為 0 點，合計價差 38.1 點，指標偏多。

結論

- 籌碼面:外資空單部位維持 4 萬 8 千口; 自營商選擇權多單為 2 千口 ; 前五大法人空單維持 1 萬口, 法人籌碼空方力道持平。
- 技術面:期貨價格跌破季線與半年線支撐, 下方支撐為整數關口 22000。
- 結論:期貨技術面跌破關鍵支撐, 呈空方趨勢, 須關注台積電於千元關口與季線的洗刷, 預計今日開低震盪, 波動區間為 22000 至 22500。

期貨指標強弱判斷訊號										2024-11-29	
類別	組合	觀察指標	方向	權重	11月27日 分數	11月28日 分數	11月27日 分數	11月28日 分數	即時		
技術面 40%	趨勢指標	SAR	▲	20%	3	3	19.00	22.00	22.00		
		MACD	▲	20%	6	5					
		MTM	▲	20%	2	6					
		FI	▲	20%	5	6					
		CCI	▲	20%	3	2					
籌碼面 40%	籌碼指標	外資期貨	▼	9%	1	1	38.27	39.12	39.12		
		外資選擇權	▼	10%	3	4					
		前五大期貨	▼	8%	2	2					
		次五大期貨	▲	8%	5	5					
		外資買賣超	▼	7%	5	5					
		投信買賣超	▲	9%	3	3					
		自營買賣超	▼	8%	8	7					
		韭菜指標	▼	8%	3	3					
		散戶選擇權	▼	7%	1	2					
		自營選擇權	▼	10%	8	8					
市場預期 20%		VIX	▲	7%	1	1					
		P/C ratio	▼	9%	5	5					
綜合分數		11月21日	11月22日	11月25日	11月26日	11月27日	11月28日	即時			
		33.37	54.96	47.83	37.91	30.56	32.27	32.27			

免責聲明

此報告內容由廷豐金融科技股份有限公司（下稱「廷豐金融科技」）編製，所提供之內容及數據僅供參考用途，如有任何更改，恕不另行通知。該內容及數據包括但不限於聲明、評論、意見、建議，圖表影像，新聞及研究報告(下稱「資料」)，均屬於廷豐金融科技之財產，未經廷豐金融科技之事先書面同意，均不得以任何方式及任何形式複製、複印、出版、披露、發放、傳送或引用給任何其他人。

廷豐金融科技皆致力保證所提供內容與資料之準確性及可靠性，但不擔保資訊內容之正確性、即時性、完整性或可靠性。廷豐金融科技在任何情況下均不會承擔因數據不準確、錯誤、延誤或遺漏而導致損失或造成破壞之責任(包括民事侵權行為責任、合約責任或任何其他責任)。

本文所有資料內容不代表任何形式之推介、要約、承諾、勸誘或保證，亦不應被解讀為投資建議。

閣下作出任何投資決定時，應自行衡量風險，若閣下有任何疑問，應諮詢其他專業人士意見。

廷豐金融科技不會對任何人士和或第三方因使用任何本公司提供之資料或服務而產生的直接、間接、相應或附帶的任何類型的損失承擔責任。