

台指選擇權OI匯報

日期：2022/12/2 結算日：2022/12/7					日期：2022/12/2 結算日：2022/12/21					
202212W1					202212月台指選擇權OI序列					
OI 增減	Call	履約價	Put	OI 增減	OI 增減	Call	履約價	Put	OI 增減	
0	41	14,300	3,487	-356	0	511	13,700	4,879	112	
0	30	14,350	2,605	279	-1	947	13,800	3,610	223	
-21	254	14,400	5,242	1,388	0	1,609	13,900	3,016	65	
-11	115	14,450	6,265	1,769	※	-6	3,349	14,000	9,272	-39
7	202	14,500	7,193	565	1	1,758	14,100	3,585	203	
-57	259	14,550	5,297	750	11	2,183	14,200	7,822	129	
-3	283	14,600	7,498	1,231	-29	1,806	14,300	3,120	63	
-66	1,016	14,650	5,273	1,575	27	1,557	14,400	3,419	29	
117	1,056	14,700	5,891	357	13	3,343	14,500	2,989	-65	
33	1,071	14,750	4,009	926	-37	2,716	14,600	3,347	219	
89	2,731	14,800	6,801	1,013	-78	2,633	14,700	2,243	267	
166	1,813	14,850	3,982	698	-45	3,364	14,800	2,434	306	
877	2,717	14,900	3,543	679	-125	2,465	14,900	830	95	
1,027	3,350	14,950	1,732	171	-433	5,326	15,000	999	-114	
2,008	6,678	15,000	3,225	614	148	3,874	15,100	475	-5	
1,050	4,231	15,050	1,350	114	-154	4,835	15,200	316	28	
2,253	6,947	15,100	857	4	264	5,724	15,300	186	9	
2,746	7,427	15,150	392	-75	363	5,210	15,400	620	-16	
※	3,683	9,586	318	15	150	4,753	15,500	90	-17	
1,552	3,786	15,250	150	26	275	4,935	15,600	61	0	
2,076	9,691	15,300	104	7	※	855	4,986	15,700	40	0
1,453	1,453	15,350	0	0	158	4,631	15,800	455	0	
1,517	10,157	15,400	61	-29	4	1,947	15,900	65	0	
785	785	15,450	4	4	59	3,905	16,000	23	0	
1,686	8,029	15,500	13	-7	-13	883	16,100	1	0	
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計	增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計	
24,501	100,213	0.9294	93,136	10,811	2,215	120,378	1.0527	126,718	2,028	
昨日 P/C	1.0870	今日增減變化	-0.1576	昨日 P/C	1.0552	今日增減變化	-0.0026			

更新日期：2022年12月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指期貨、選擇權籌碼匯報

期貨三大法人未平倉金額匯報								2022年12月2日	
單位：千元	臺股期貨				電子期貨				
	買方金額	賣方金額	淨部位	淨部位增減	買方金額	賣方金額	淨部位	淨部位增減	
外資	119,680,984	116,531,418	3,149,566	-5,539,402	3,860,587	1,523,111	2,337,476	-158,638	
投信	48,316,441	57,621,918	-9,305,477	-1,716,609	447,483	0	447,483	-2,544	
自營商	34,212,778	21,856,120	12,356,658	2,029,575	1,267,109	1,850,882	-583,773	-128,070	
	金融期貨				非金電期貨				
	買方金額	賣方金額	淨部位	淨部位增減	買方金額	賣方金額	淨部位	淨部位增減	
外資	424,641	1,247,862	-823,221	-109,669	20,131	106,405	-86,274	-3,932	
投信	105,777	0	105,777	-1,256	0	0	0	0	
自營商	370,986	157,899	213,087	17,630	228,551	186,872	41,679	-4,533	

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報								2022年12月2日	
	買權 CALL				賣權 PUT				
	買方口數	賣方口數	淨部位	淨部位增減	買方口數	賣方口數	淨部位	淨部位增減	
外資	52,823	15,458	37,365	992	24,271	15,439	8,832	495	
投信	350	200	150	0	400	121	279	0	
自營商	63,455	90,859	-27,404	3,840	83,943	53,739	30,204	2,602	
特定法人(週)	1,166	0	1,166	1,166	0	2,352	-2,352	-1,502	
特定法人(近月)	33,276	5,641	27,635	283	3,961	11,420	-7,459	0	
特定法人(全月)	30,780	0	30,780	384	4,202	15,721	-11,519	-187	
十大交易人(週)	28,214	45,473	-17,259	-3,805	33,945	33,744	201	1,599	
十大交易人(近月)	69,285	62,061	7,224	1,035	57,832	60,103	-2,271	548	
十大交易人(全月)	101,524	108,176	-6,652	1,894	84,065	98,304	-14,239	1,886	
全市場未沖銷(近月)			120,378	2,215			126,718	2,028	
全市場未沖銷(全月)			251,382	28,966			248,768	14,104	

更新日期：2022年12月2日 資料來源：台灣期貨交易所·凱基期貨整理

台指選擇權匯報

2022年12W1週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15200	買權OI最大量	15400
	賣權成交最大量	14800	賣權OI最大量	14600
	整體隱含波動率	14.95%	較前一交易日	-0.92%
	買權隱含波動率	13.30%	較前一交易日	-3.54%
	賣權隱含波動率	16.65%	較前一交易日	+1.78%
電子選擇權	買權成交最大量	720	買權OI最大量	640
	賣權成交最大量	670	賣權OI最大量	510
金融選擇權	買權成交最大量	1600	買權OI最大量	1560
	賣權成交最大量	470	賣權OI最大量	1520

更新日期：2022年12月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

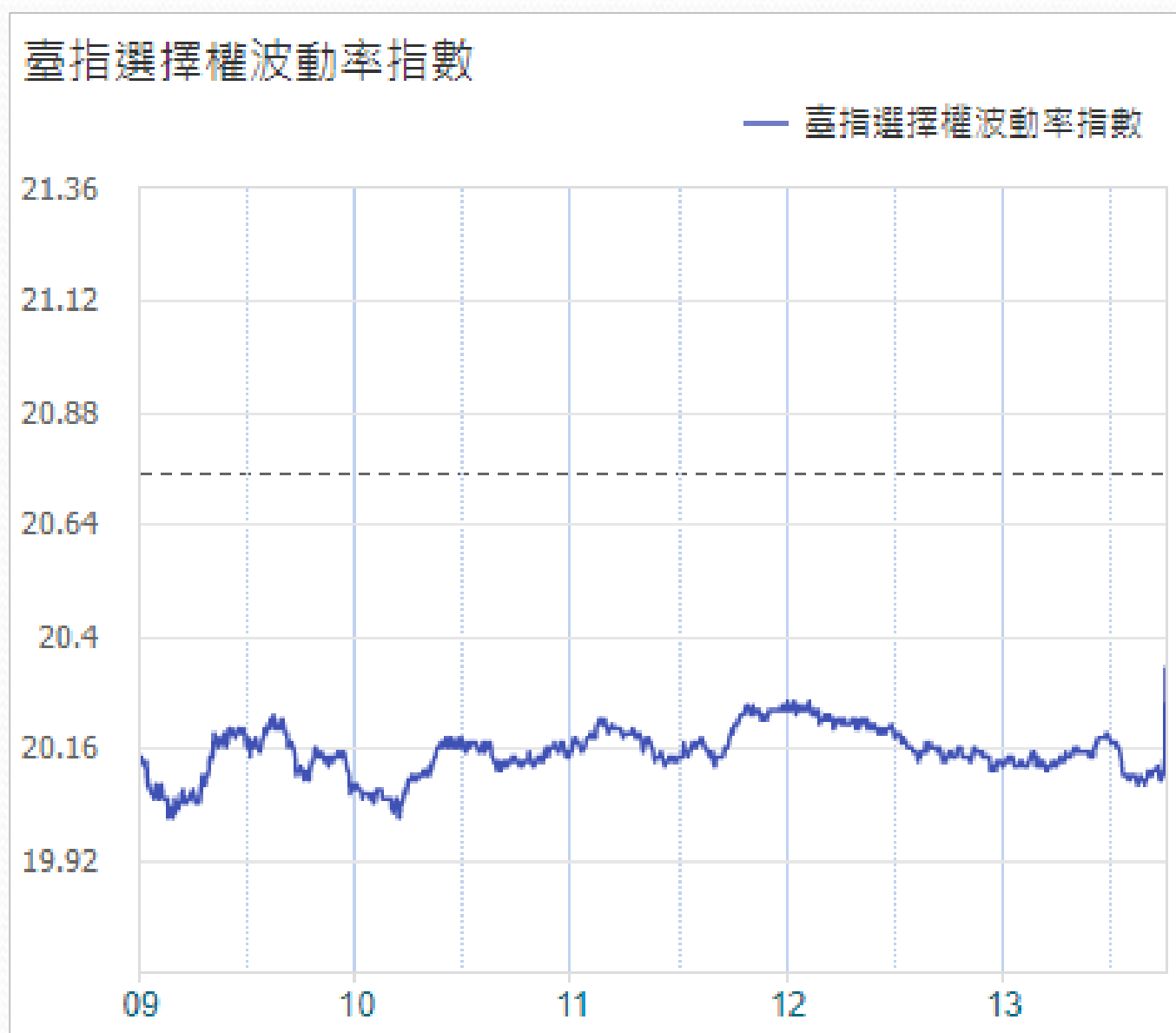
台指選擇權匯報

2022年12月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15000	買權OI最大量	15300
	賣權成交最大量	14400	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	19.24%	較前一交易日	+0.64%
	買權隱含波動率	15.71%	較前一交易日	-1.54%
	賣權隱含波動率	24.00%	較前一交易日	+1.17%
	成交量P/C_Ratio值	0.723	較前一交易日	-0.17
	未平倉P/C_Ratio值	1.053	較前一交易日	-0.00
電子選擇權	買權成交最大量	720	買權OI最大量	640
	賣權成交最大量	670	賣權OI最大量	510
金融選擇權	買權成交最大量	1600	買權OI最大量	1560
	賣權成交最大量	620	賣權OI最大量	1520

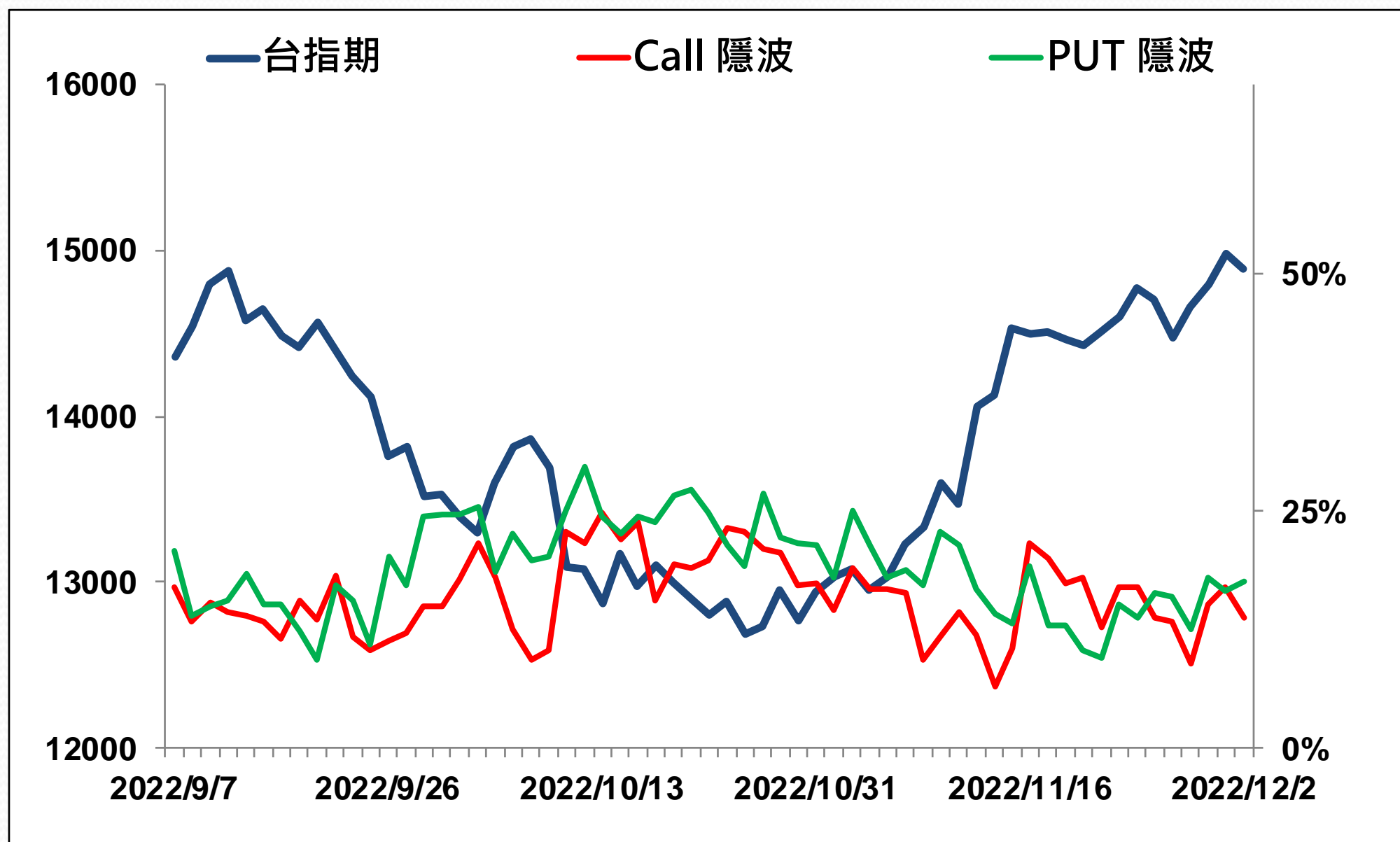
更新日期：2022年12月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



更新日期：2022年12月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度

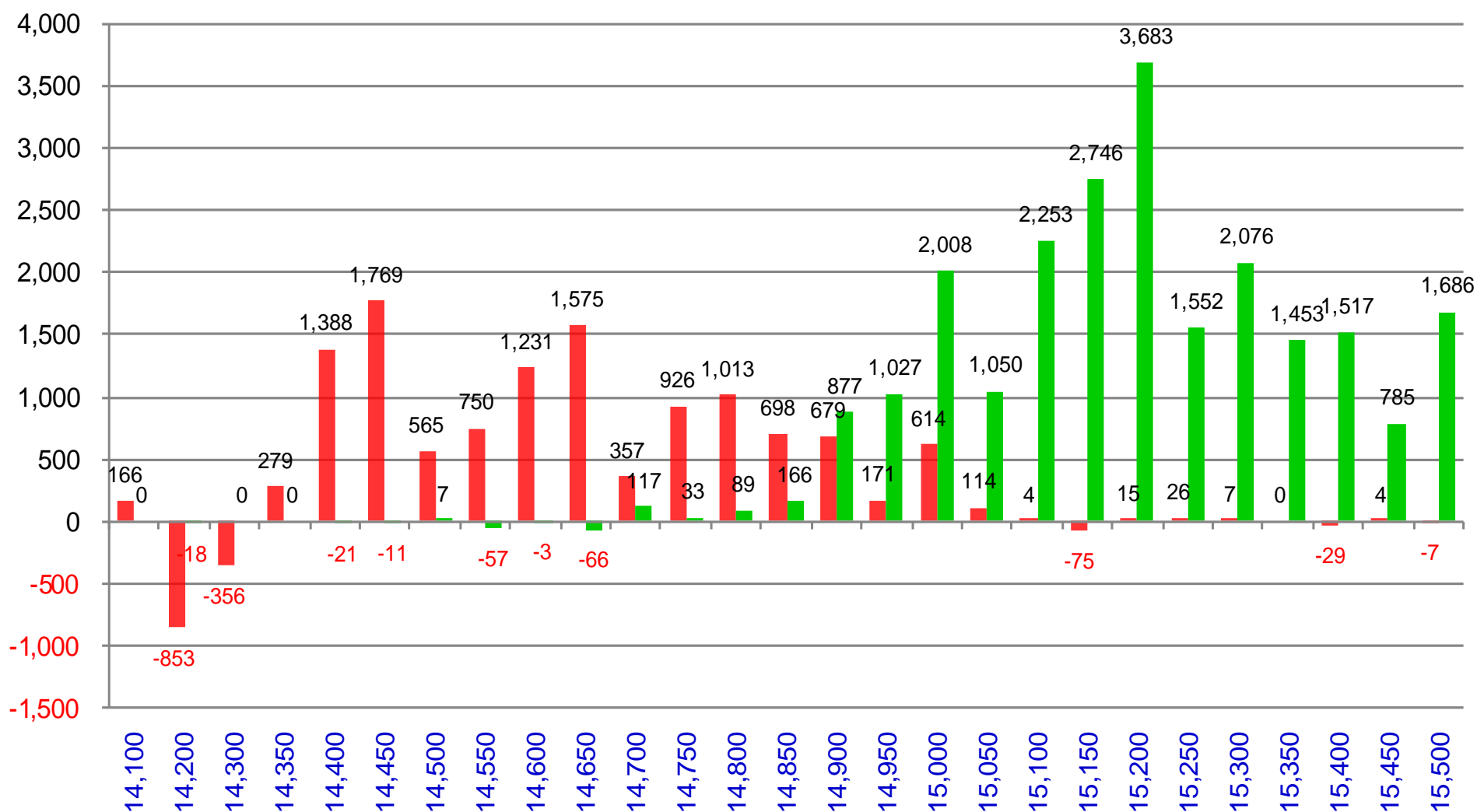


更新日期：2022年12月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：10,811

週選 CALL OI 變化：24,501

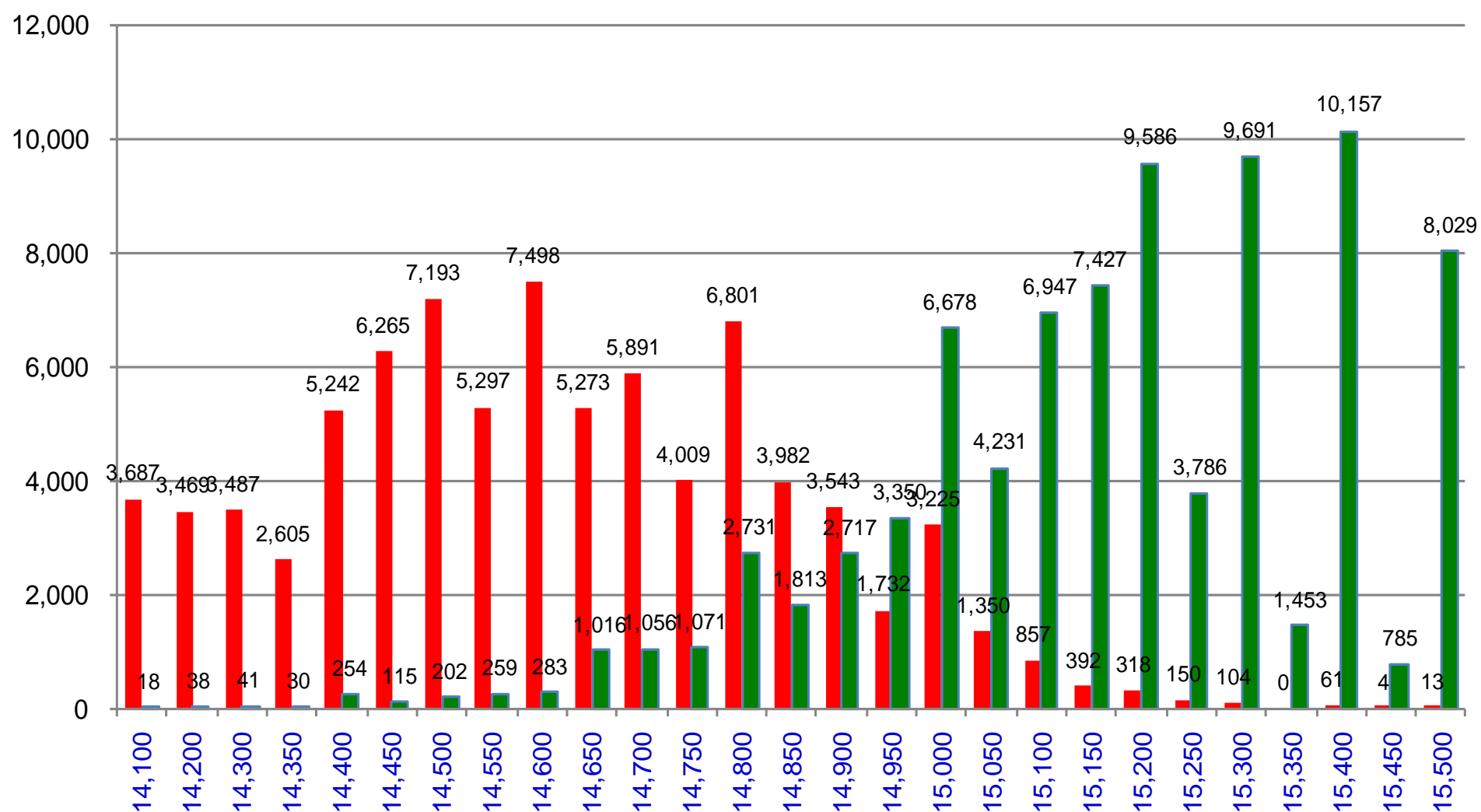


更新日期：2022年12月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：93,136

週選 CALL OI 總額：100,213



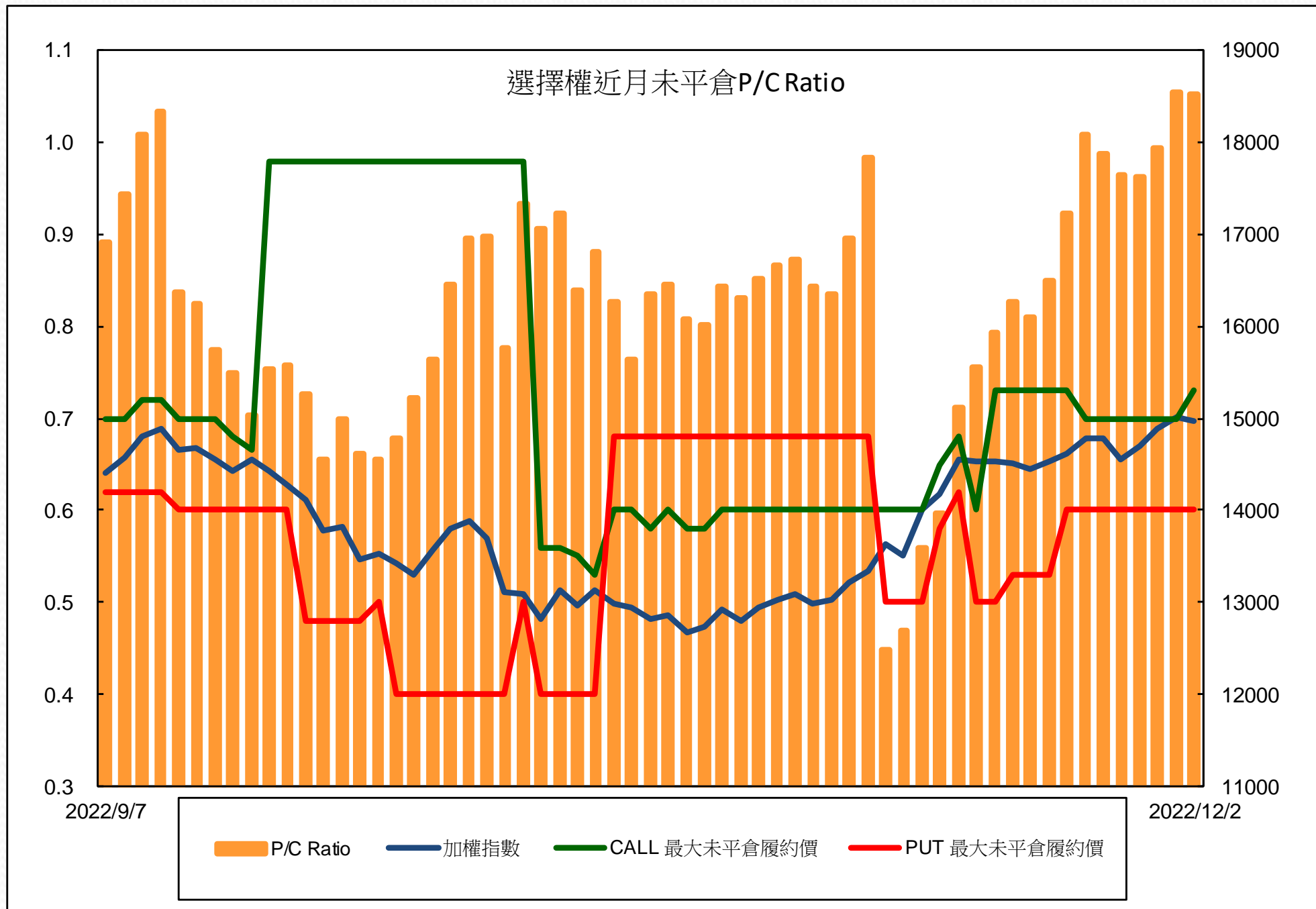
更新日期：2022年12月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

自營商選擇權OI部位統計

選擇權	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	12月1日	57,790	89,034	-31,244
	12月2日	63,455	90,859	-27,404
Put	12月1日	82,637	55,035	27,602
	12月2日	83,943	53,739	30,204

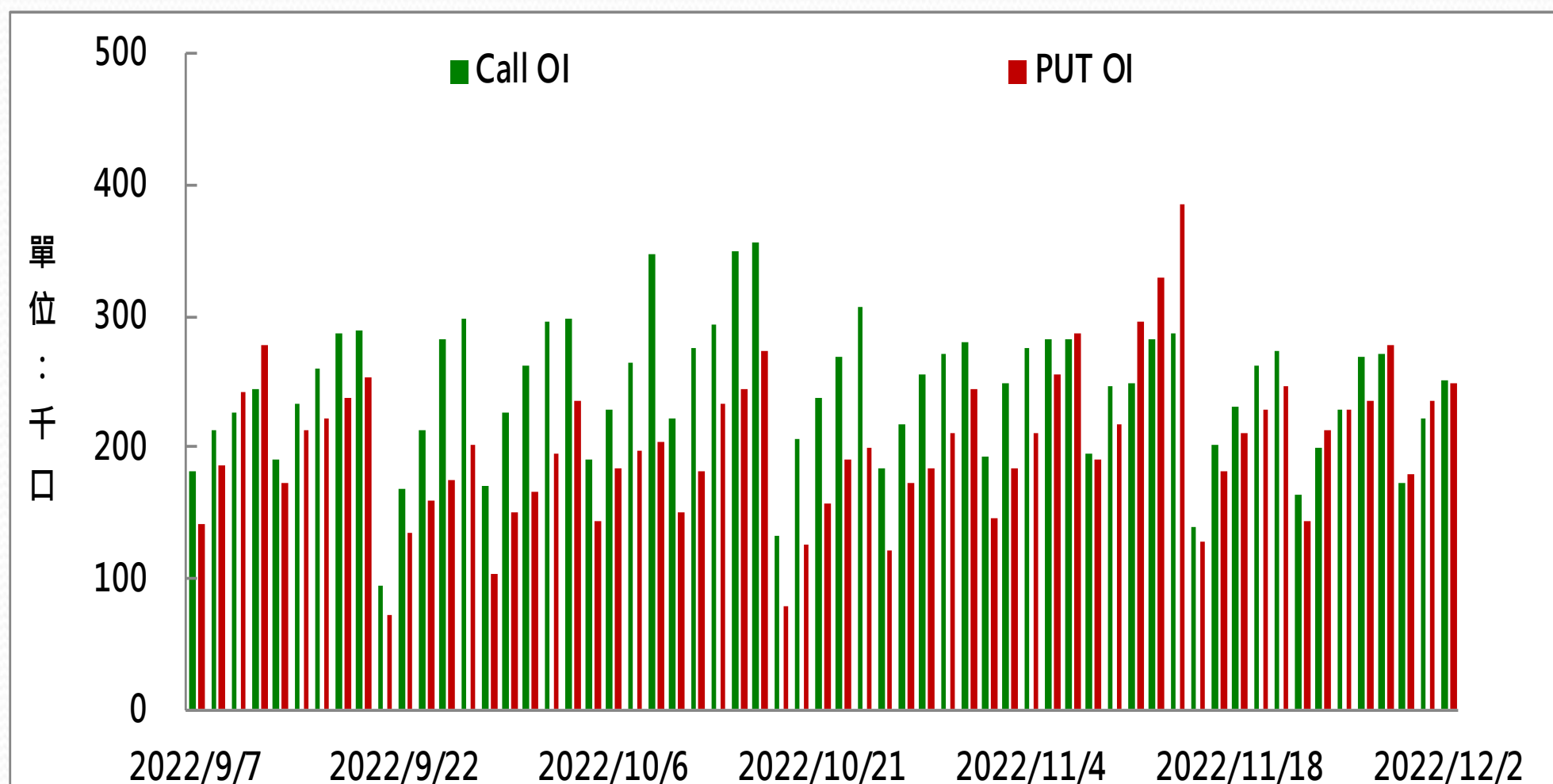
更新日期：2022年12月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年12月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權全月Put Call OI



更新日期：2022年12月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

免責聲明及警語

- 一、本報告中的訊息包括來自各項已公開或據信為可靠之資訊來源，為製作報告當時所知之資訊及基於特定時間或期間所作之意見，惟凱基期貨股份有限公司（以下稱本公司）對本報告內容的準確性、完整性和及時性不作任何聲明或保證，本報告所載之資訊或意見日後如有任何變動，本公司將不作通知。
- 二、本報告內容僅供參考，不具有或隱含任何法律效果，本公司就其內容不負任何法律責任。本報告內容不代表未來獲利之預期或保證，交易人應審慎評估，慎重考量自身財務能力及承受風險能力，並特別留意控管風險，如有需要，應諮詢相關財務顧問或專業人士。
- 三、本報告內容不構成亦不得視為對任何投資標的或任何交易之招攬、要約、宣傳、廣告、遊說、引誘或推薦。在任何情況下，本公司不對任何人閱讀本報告或基於本報告觀點所進行的交易所引致的任何損益承擔任何責任。
- 四、本報告內容所涉相關圖表及數據可能採用特定軟體及程式、模型運算，以歷史數據進行繪製及統計，其結果並不代表具有預測未來之能力。
- 五、本報告內容所用技術分析指標可能隨參數設定之不同，而有不同的結果。技術分析指標係將過去歷史資料經由統計分析技術所得之指標數值，僅供參考性質，通常作為事後驗證之用途，且係依據過去歷史資料所得，不具領先意涵，亦不代表具有預測未來之能力。
- 六、本報告內容之著作權屬於本公司所擁有，非經本公司事先書面同意，禁止任何未經本公司授權擅自加以摘錄、引用、轉貼、下載、複製、編輯、翻譯或傳輸行為，任何侵犯本公司著作權之行為，本公司將予究責。
- 七、本報告僅限由本公司傳送予與本公司簽訂顧問契約之客戶閱讀，如有任何人未經本公司事先書面同意而將本報告傳送予他人，本公司將予究責。

許可證照字號：110年金管期總字第005號 KGI凱基期貨地址：台北市重慶南路一段2號6樓部份、12樓及13樓

<http://www.kgifutures.com.tw> 電話(02)2361-9889

更新日期：2022年12月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考