

台指選擇權OI匯報

日期：2022/12/5 結算日：2022/12/7					日期：2022/12/5 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
-1	37	14,200	3,715	246	-2	597	13,500	3,751	-18
2	43	14,300	3,356	-131	0	883	13,600	3,837	9
-1	29	14,350	2,699	94	4	515	13,700	4,942	63
-24	230	14,400	4,251	-991	-2	945	13,800	3,611	1
-31	84	14,450	5,850	-415	0	1,609	13,900	3,249	233
6	208	14,500	7,870	677	7	3,356	14,000	10,276	1,004
-1	258	14,550	6,082	785	8	1,766	14,100	3,900	315
19	302	14,600	8,322	824	8	2,191	14,200	7,624	-198
35	1,051	14,650	4,885	-388	-30	1,776	14,300	3,379	259
97	1,153	14,700	8,624	2,733	-2	1,555	14,400	5,609	2,190
-75	996	14,750	5,021	1,012	-29	3,314	14,500	3,138	149
62	2,793	14,800	8,268	1,467	-1	2,715	14,600	3,844	497
-8	1,805	14,850	5,971	1,989	114	2,747	14,700	3,311	1,068
657	3,374	14,900	6,464	2,921	39	3,403	14,800	2,828	394
191	3,541	14,950	3,946	2,214	-65	2,400	14,900	1,298	468
2,159	8,837	15,000	5,097	1,872	234	5,560	15,000	1,250	251
1,840	6,071	15,050	2,642	1,292	206	4,080	15,100	588	113
1,814	8,761	15,100	1,445	588	521	5,356	15,200	438	122
※ 2,615	10,042	15,150	698	306	474	6,198	15,300	336	150
2,349	11,935	15,200	489	171	114	5,324	15,400	714	94
2,271	6,057	15,250	107	-43	364	5,117	15,500	108	18
1,634	11,325	15,300	138	34	※ 1,191	6,126	15,600	96	35
2,560	4,013	15,350	6	6	471	5,457	15,700	53	13
388	10,545	15,400	71	10	237	4,868	15,800	456	1
1,602	2,387	15,450	8	4	88	2,035	15,900	65	0
-858	7,171	15,500	28	15	128	4,033	16,000	33	10
-592	5,646	15,600	23	21	20	903	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
18,137	118,350	0.9230	109,232	16,096	4,083	124,461	1.0789	134,279	7,561
昨日 P/C	0.9294	今日增減變化		-0.0064	昨日 P/C	1.0527	今日增減變化		0.0262

更新日期：2022年12月5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5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	125,165,350	114,388,071	10,777,279	7,627,713	3,991,022	1,226,509	2,764,513	427,037		
投信	49,274,972	60,881,554	-11,606,582	-2,301,105	458,898	417,180	41,718	-405,765		
自營商	34,991,825	22,146,887	12,844,938	488,280	1,559,956	1,596,204	-36,248	547,525		
	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	533,275	1,632,006	-1,098,731	-275,510	0	117,523	-117,523	-31,249		
投信	105,736	0	105,736	-41	0	0	0	0		
自營商	396,904	171,641	225,263	12,176	301,712	217,580	84,132	42,453		

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5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	53,835	15,848	37,987	622	26,180	15,765	10,415	1,583		
投信	350	200	150	0	400	121	279	0		
自營商	75,328	98,290	-22,962	4,442	85,586	63,738	21,848	-8,356		
特定法人(週)	1,079	0	1,079	-87	0	1,775	-1,775	577		
特定法人(近月)	33,624	5,667	27,957	322	4,013	11,520	-7,507	-48		
特定法人(全月)	30,663	0	30,663	-117	4,254	16,679	-12,425	-906		
十大交易人(週)	36,286	54,426	-18,140	-881	38,584	37,772	812	611		
十大交易人(近月)	72,595	64,100	8,495	1,271	63,614	63,370	244	2,515		
十大交易人(全月)	112,482	119,016	-6,534	118	96,961	103,654	-6,693	7,546		
全市場未沖銷(近月)			124,461	4,083			134,279	7,561		
全市場未沖銷(全月)			277,225	25,843			277,742	28,974		

更新日期：2022年12月5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	15000	買權OI最大量	15200
	賣權成交最大量	14900	賣權OI最大量	14700
	整體隱含波動率	15.86%	較前一交易日	+0.91%
	買權隱含波動率	15.28%	較前一交易日	+1.98%
	賣權隱含波動率	16.48%	較前一交易日	-0.18%
電子選擇權	買權成交最大量	730	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	1580	買權OI最大量	1560
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1480

更新日期：2022年12月5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	15500	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	19.99%	較前一交易日	-0.75%
	買權隱含波動率	16.71%	較前一交易日	+1.01%
	賣權隱含波動率	22.85%	較前一交易日	-1.15%
	成交量P/C_Ratio值	1.005	較前一交易日	+0.28
	未平倉P/C_Ratio值	1.079	較前一交易日	+0.03
電子選擇權	買權成交最大量	730	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	1580	買權OI最大量	1560
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1480

更新日期：2022年12月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

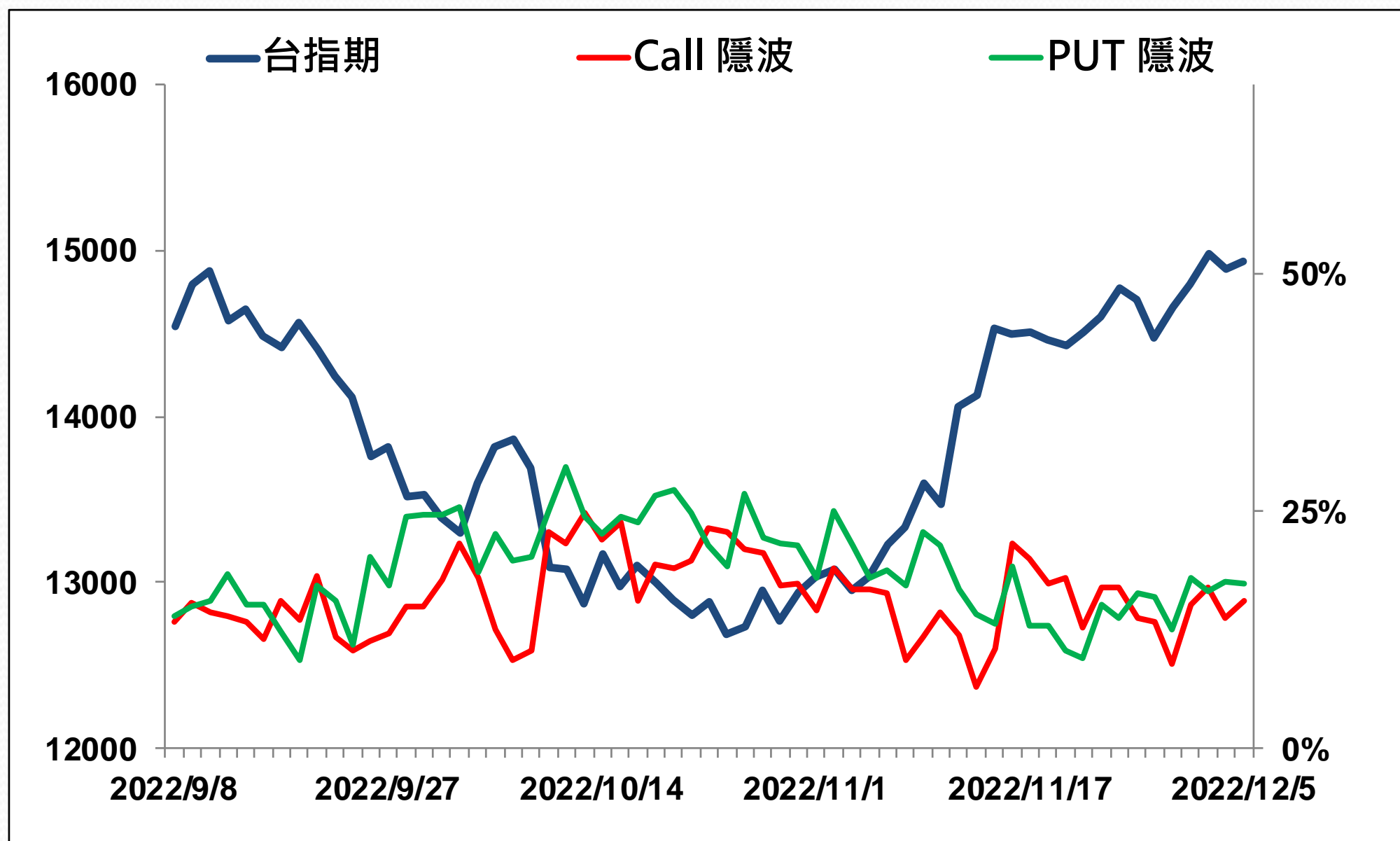
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2022年12月5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

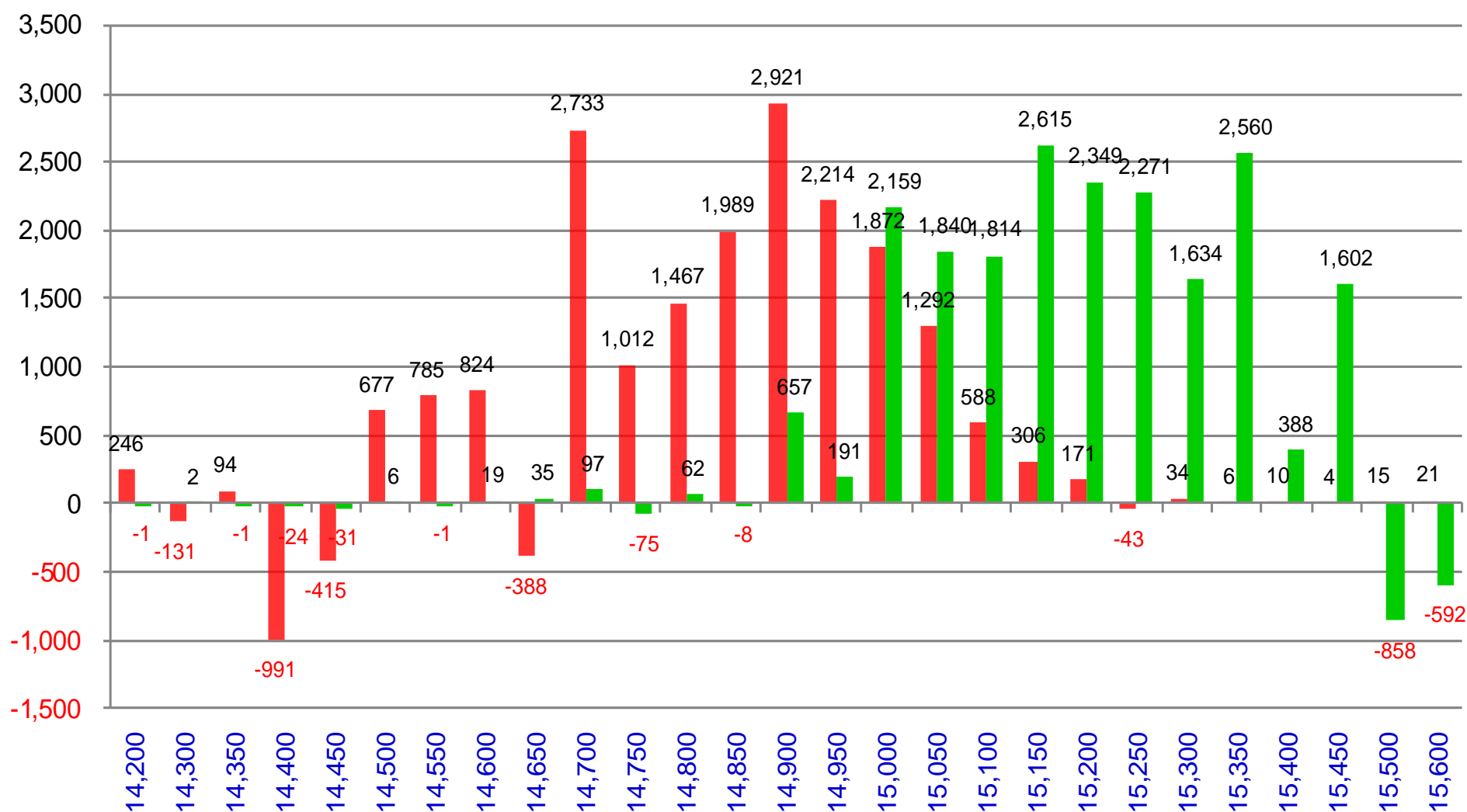


更新日期：2022年12月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：16,096

週選 CALL OI 變化：18,137

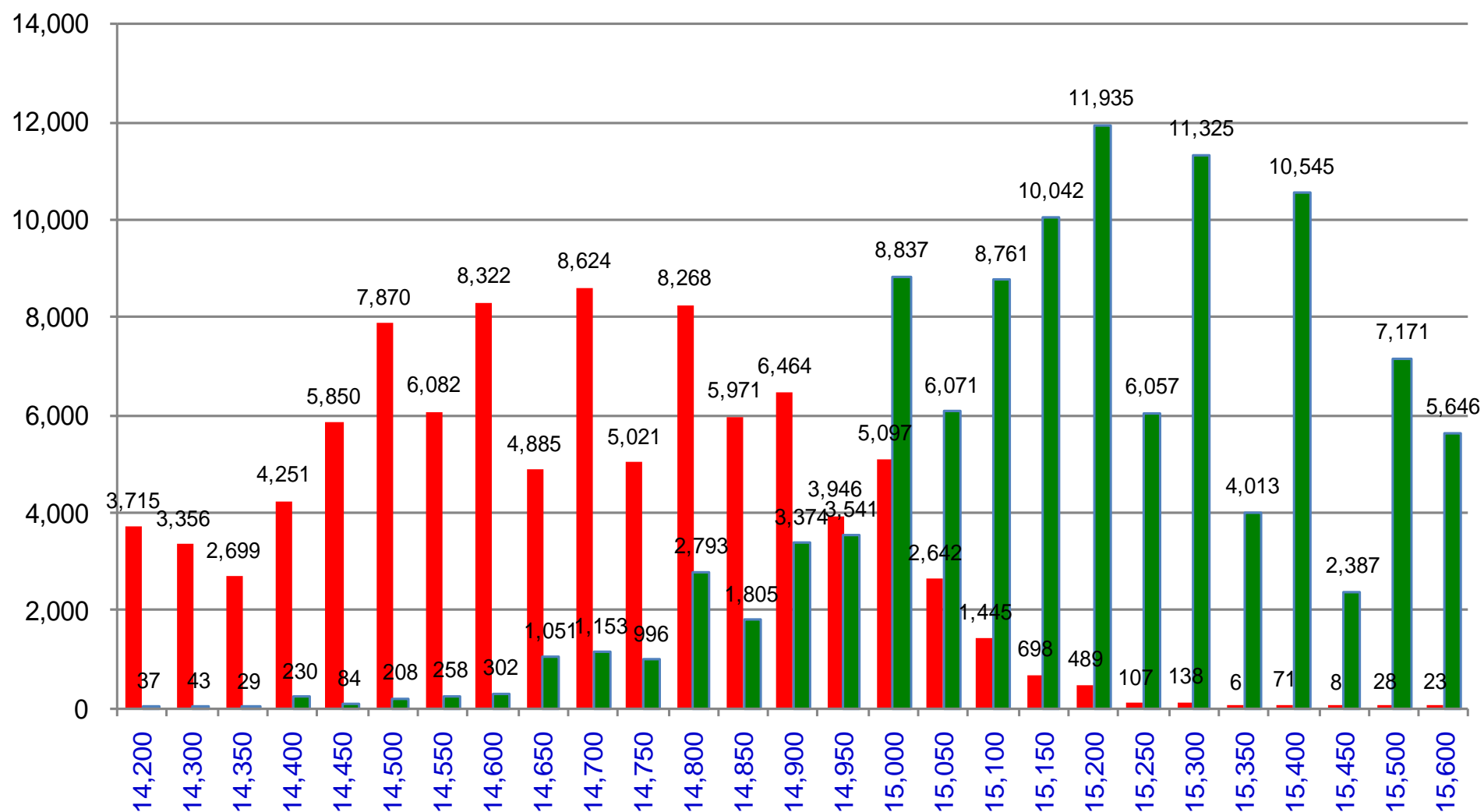


更新日期：2022年12月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：109,232

週選 CALL OI 總額：118,350



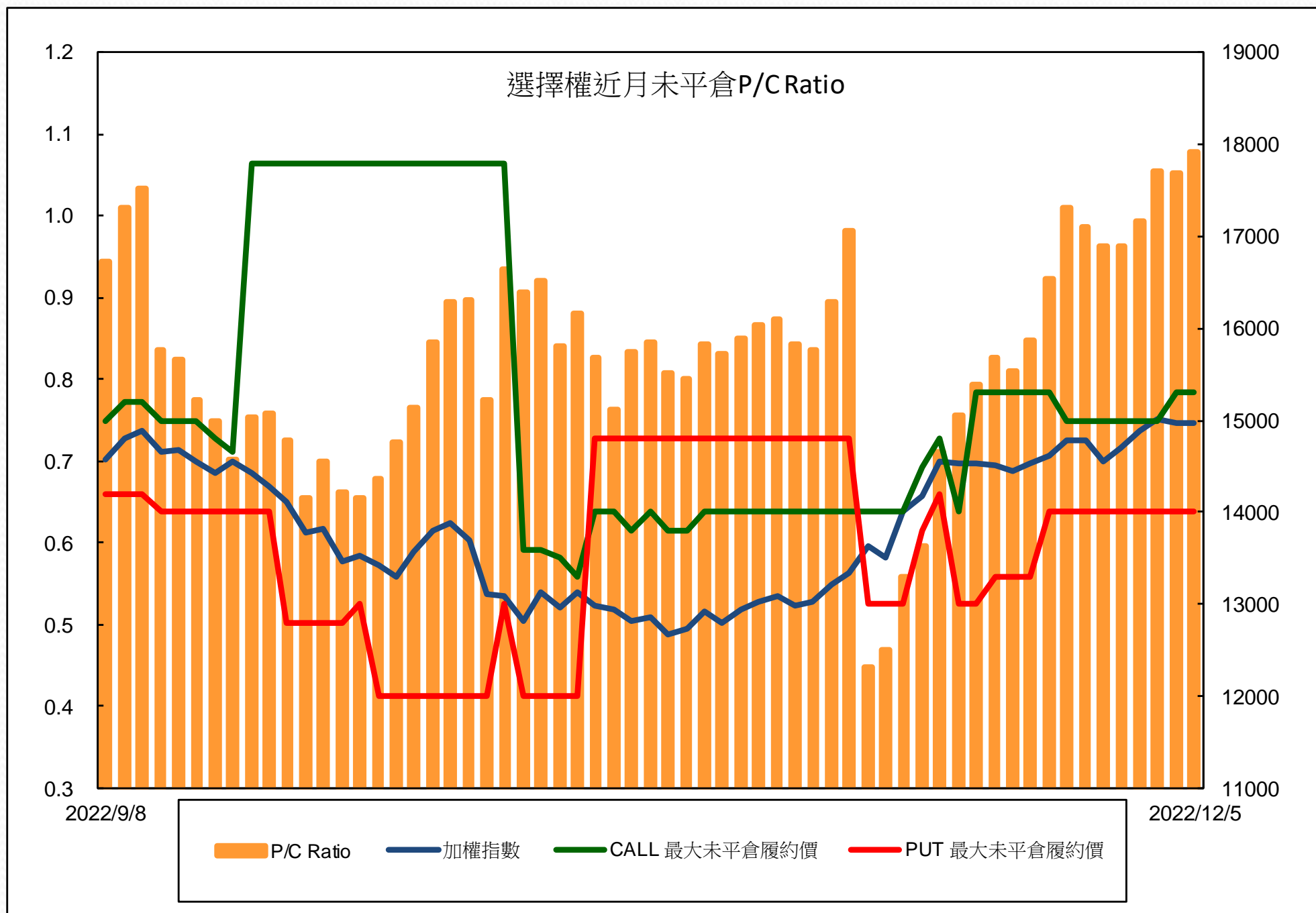
更新日期：2022年12月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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2日	63,455	90,859	-27,404
	12月5日	75,328	98,290	-22,962
Put	12月2日	83,943	53,739	30,204
	12月5日	85,586	63,738	21,848

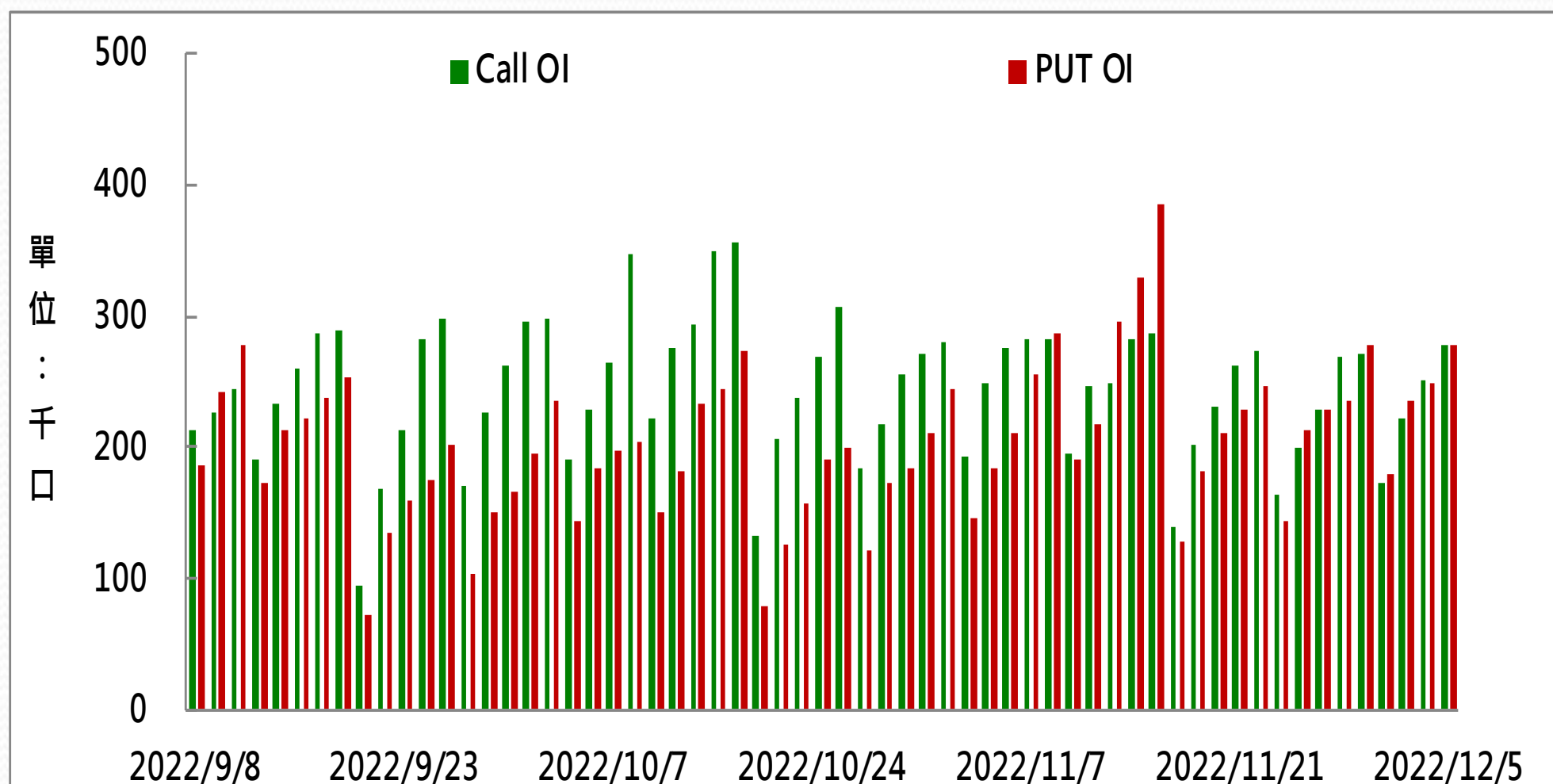
更新日期：2022年12月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年12月5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5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5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