

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/11/21 結算日：2022/11/23					日期：2022/11/21 結算日：2022/12/21				
202211W4					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	3	13,300	2,174	-96	0	386	12,900	1,067	53
-1	19	13,400	2,745	80	0	409	13,000	4,881	133
0	141	13,500	2,961	-30	0	353	13,100	1,402	-31
0	83	13,600	1,537	175	-10	298	13,200	1,912	33
0	188	13,700	2,101	1	-1	232	13,300	4,939	116
-51	486	13,800	3,189	-99	1	668	13,400	2,060	145
-2	190	13,900	6,309	-140	-5	616	13,500	3,208	48
-18	670	14,000	9,857	451	23	933	13,600	2,440	62
-26	402	14,100	8,885	1,731	-16	532	13,700	3,506	1,064
0	184	14,150	5,134	1,462	-2	970	13,800	1,953	80
-62	760	14,200	8,644	1,312	1	1,617	13,900	1,469	176
-46	162	14,250	5,756	1,160	-9	4,019	14,000	4,157	264
158	655	14,300	6,516	1,122	-93	1,894	14,100	1,907	79
129	624	14,350	4,353	79	10	2,116	14,200	2,586	259
499	2,259	14,400	5,769	1,035	3	1,724	14,300	1,993	102
709	2,170	14,450	3,096	751	98	1,468	14,400	1,597	-192
1,989	6,224	14,500	4,977	487	102	3,741	14,500	1,920	-50
996	4,404	14,550	2,813	-686	95	2,406	14,600	642	-70
2,598	8,744	14,600	2,161	-324	-441	1,534	14,700	454	124
2,759	6,718	14,650	1,156	143	377	2,319	14,800	414	-4
1,283	8,925	14,700	1,508	-3	335	2,534	14,900	203	50
2,858	8,082	14,750	351	151	218	4,477	15,000	116	9
2,288	10,079	14,800	219	-4	-56	2,613	15,100	28	0
2,273	6,393	14,850	168	1	95	3,932	15,200	141	0
1,421	7,882	14,900	49	-39	2,539	7,054	15,300	38	0
240	4,208	14,950	79	7	605	3,486	15,400	517	0
-1,441	10,507	15,000	207	2	94	2,579	15,500	12	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
19,627	129,501	0.7689	99,577	8,569	4,911	97,537	0.8100	79,005	2,452
昨日 P/C	0.8283	今日增減變化	-0.0594		昨日 P/C	0.8265	今日增減變化	-0.0165	

更新日期：2022年11月21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11月21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	107,633,404	74,660,041	32,973,363	-3,450,858	4,540,016	643,552	3,896,464	376,008	
投信	38,571,177	54,269,219	-15,698,042	514,330	451,568	0	451,568	-2,772	
自營商	21,614,637	20,416,905	1,197,732	-904,614	965,290	932,880	32,410	-95,422	
	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	259,210	1,398,253	-1,139,043	-175,308	16,625	36,020	-19,395	22,005	
投信	102,203	0	102,203	525	0	0	0	0	
自營商	315,486	152,564	162,922	15,568	108,061	77,582	30,479	-19,201	

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報								2022年11月21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	40,852	14,269	26,583	842	17,396	11,179	6,217	-80	
投信	0	100	-100	0	200	121	79	0	
自營商	79,625	90,442	-10,817	-5,095	75,080	56,782	18,298	6,005	
特定法人(週)	2,239	0	2,239	-900	0	0	0	2,384	
特定法人(近月)	22,165	3,522	18,643	-138	2,147	9,701	-7,554	392	
特定法人(全月)	25,126	0	25,126	2,732	0	9,825	-9,825	-341	
十大交易人(週)	47,391	61,749	-14,358	-9,565	47,012	46,090	922	-2,728	
十大交易人(近月)	62,443	52,377	10,066	-207	30,060	44,134	-14,074	-1,727	
十大交易人(全月)	107,435	113,206	-5,771	-8,771	75,576	91,044	-15,468	-5,515	
全市場未沖銷(近月)			97,537	4,911			79,005	2,452	
全市場未沖銷(全月)			261,880	29,743			227,887	15,975	

更新日期：2022年11月21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11W4週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	14600	買權OI最大量	15000
	賣權成交最大量	14500	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	14.01%	較前一交易日	-0.42%
	買權隱含波動率	18.01%	較前一交易日	+0.60%
	賣權隱含波動率	9.13%	較前一交易日	-2.43%
電子選擇權	買權成交最大量	700	買權OI最大量	640
	賣權成交最大量	650	賣權OI最大量	510
金融選擇權	買權成交最大量	1500	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1400	賣權OI最大量	1220

更新日期：2022年11月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

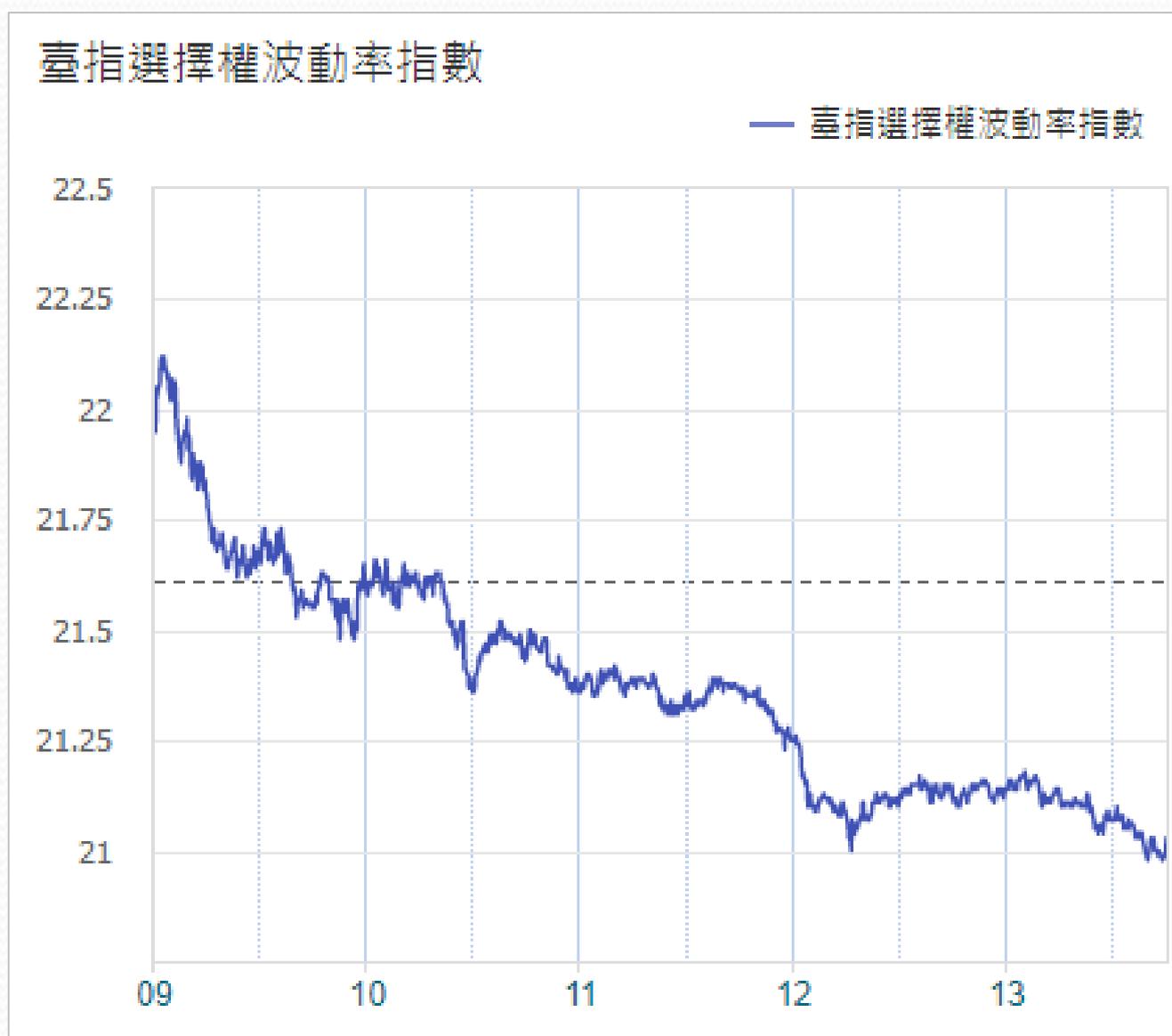
# 台指選擇權匯報

## 2022年12月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15300	買權OI最大量	15300
	賣權成交最大量	13700	賣權OI最大量	13300
	整體隱含波動率	19.98%	較前一交易日	+0.84%
	買權隱含波動率	17.70%	較前一交易日	-0.20%
	賣權隱含波動率	22.88%	較前一交易日	-0.96%
	成交量P/C_Ratio值	0.814	較前一交易日	-0.11
	未平倉P/C_Ratio值	0.810	較前一交易日	-0.02
電子選擇權	買權成交最大量	700	買權OI最大量	640
	賣權成交最大量	650	賣權OI最大量	510
金融選擇權	買權成交最大量	1500	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1400	賣權OI最大量	1220

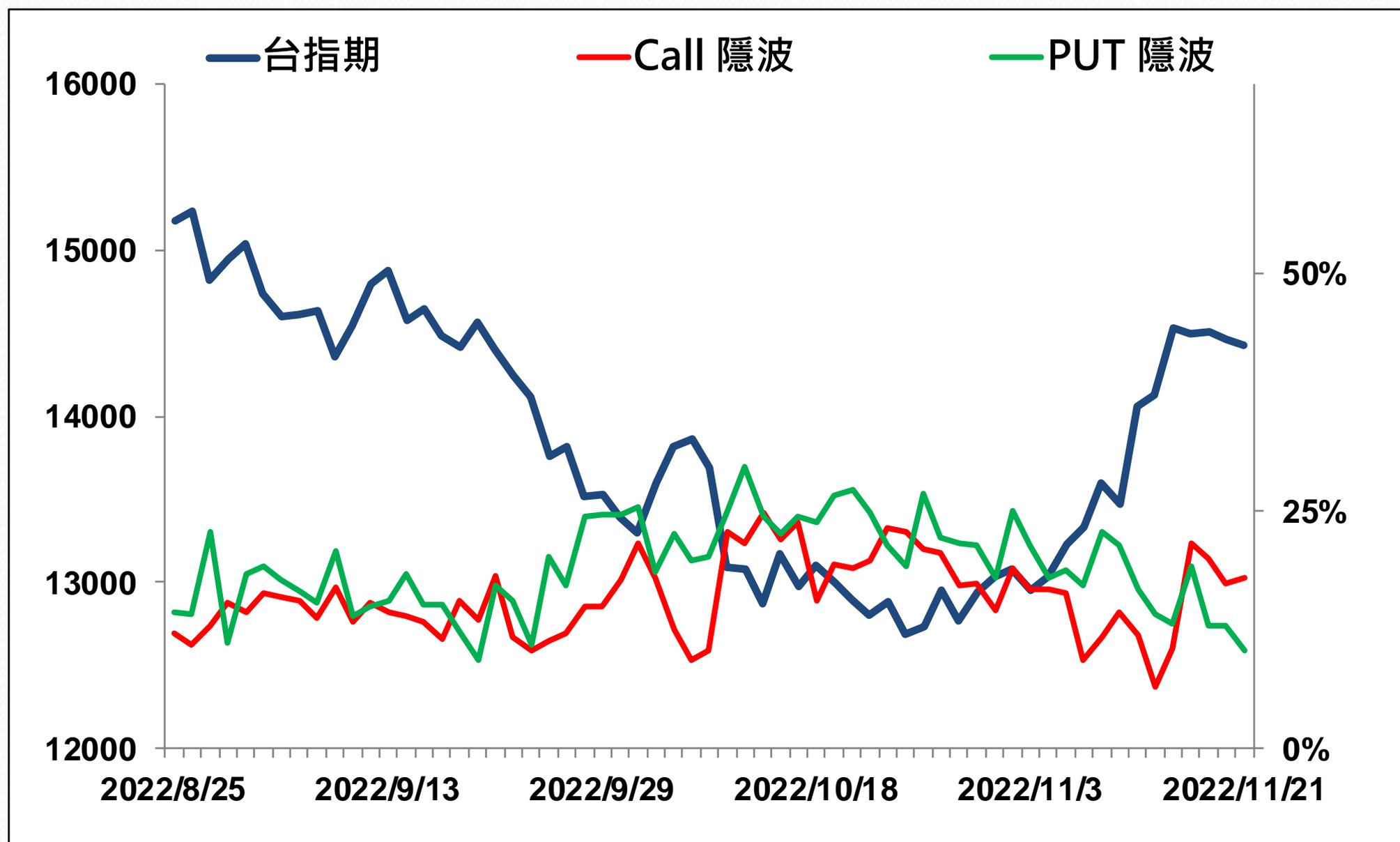
更新日期：2022年11月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權當日波動率指數



更新日期：2022年11月21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

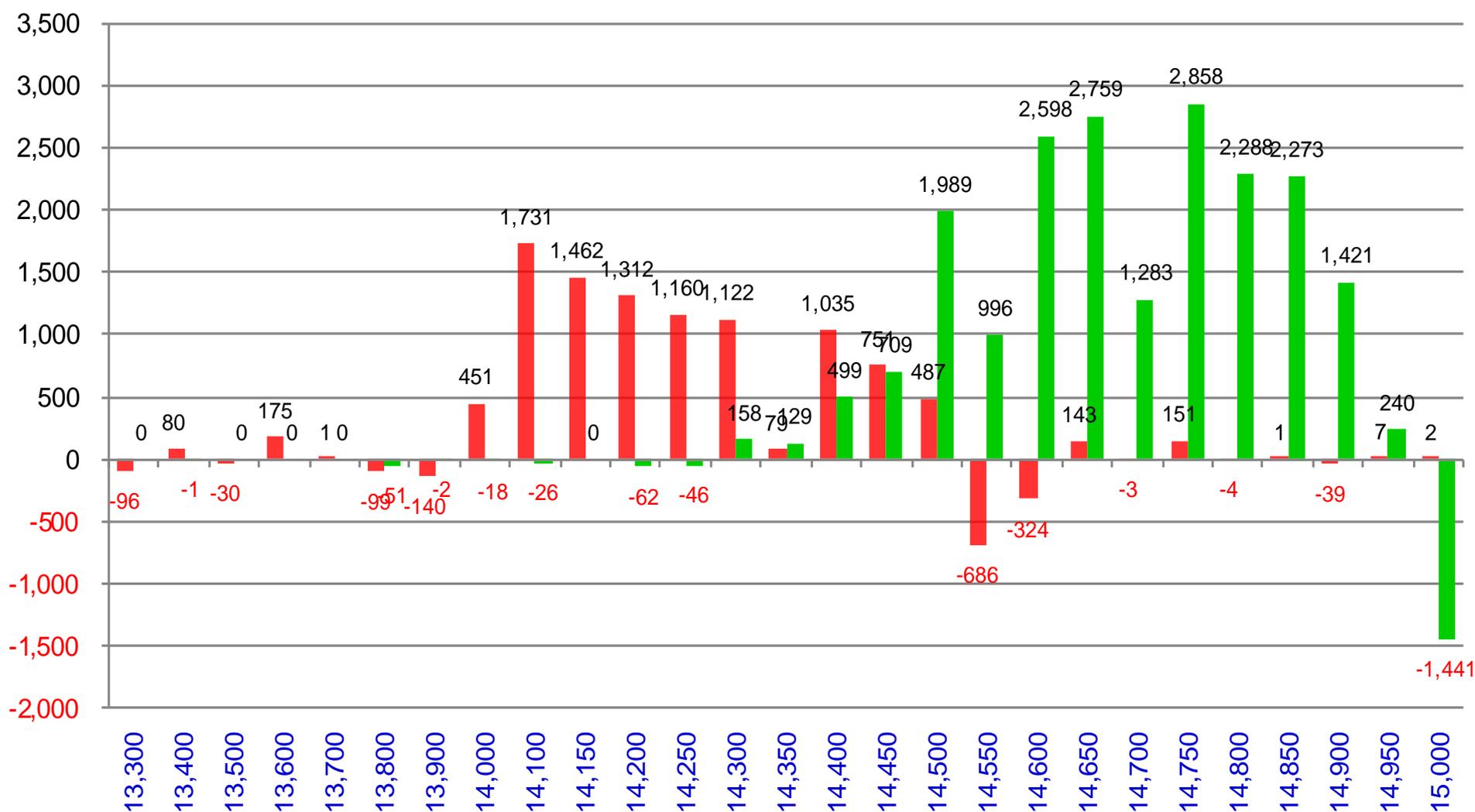


更新日期：2022年11月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：8,569

週選 CALL OI 變化：19,627

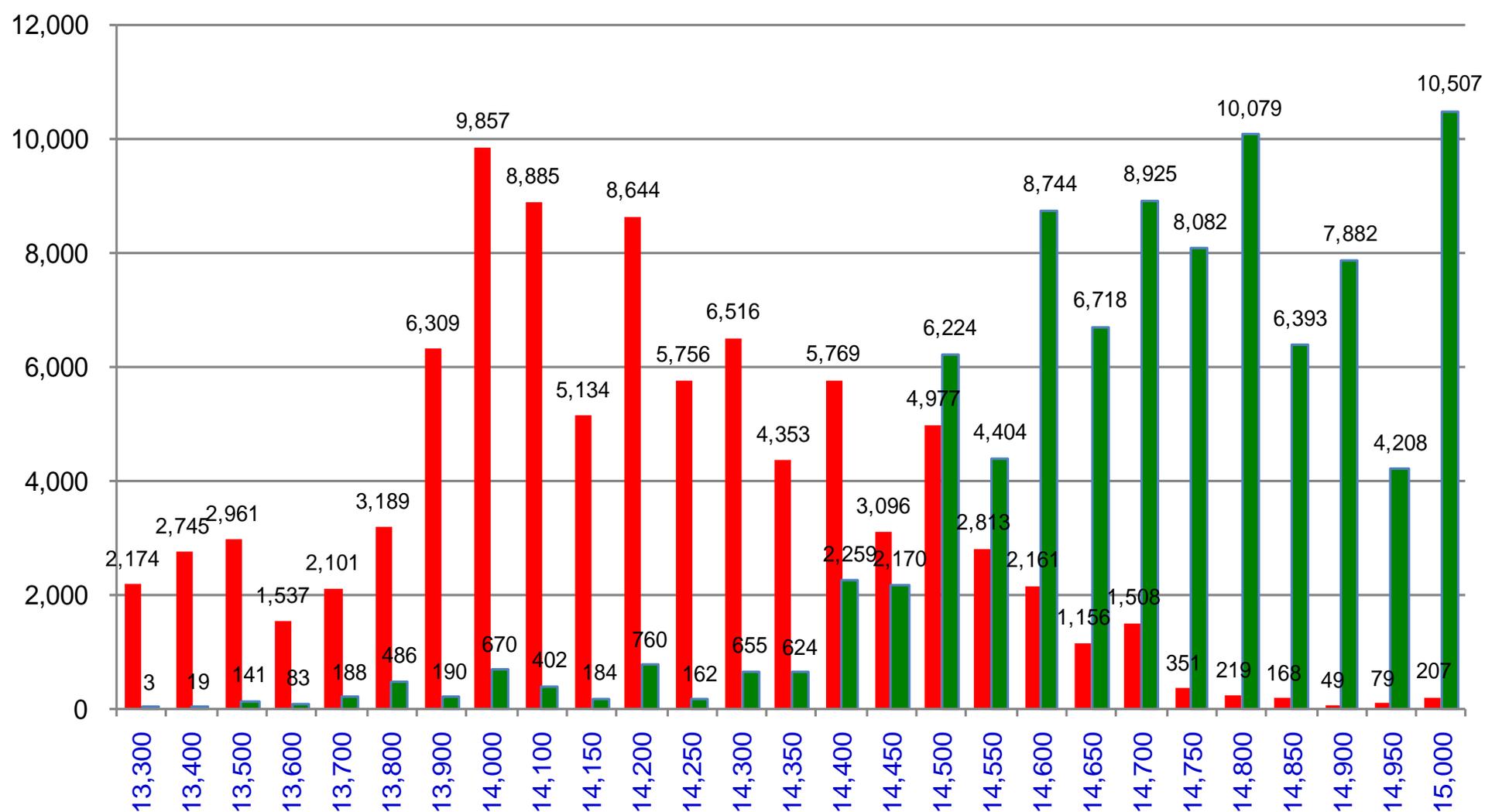


更新日期：2022年11月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：99,577

週選 CALL OI 總額：129,501



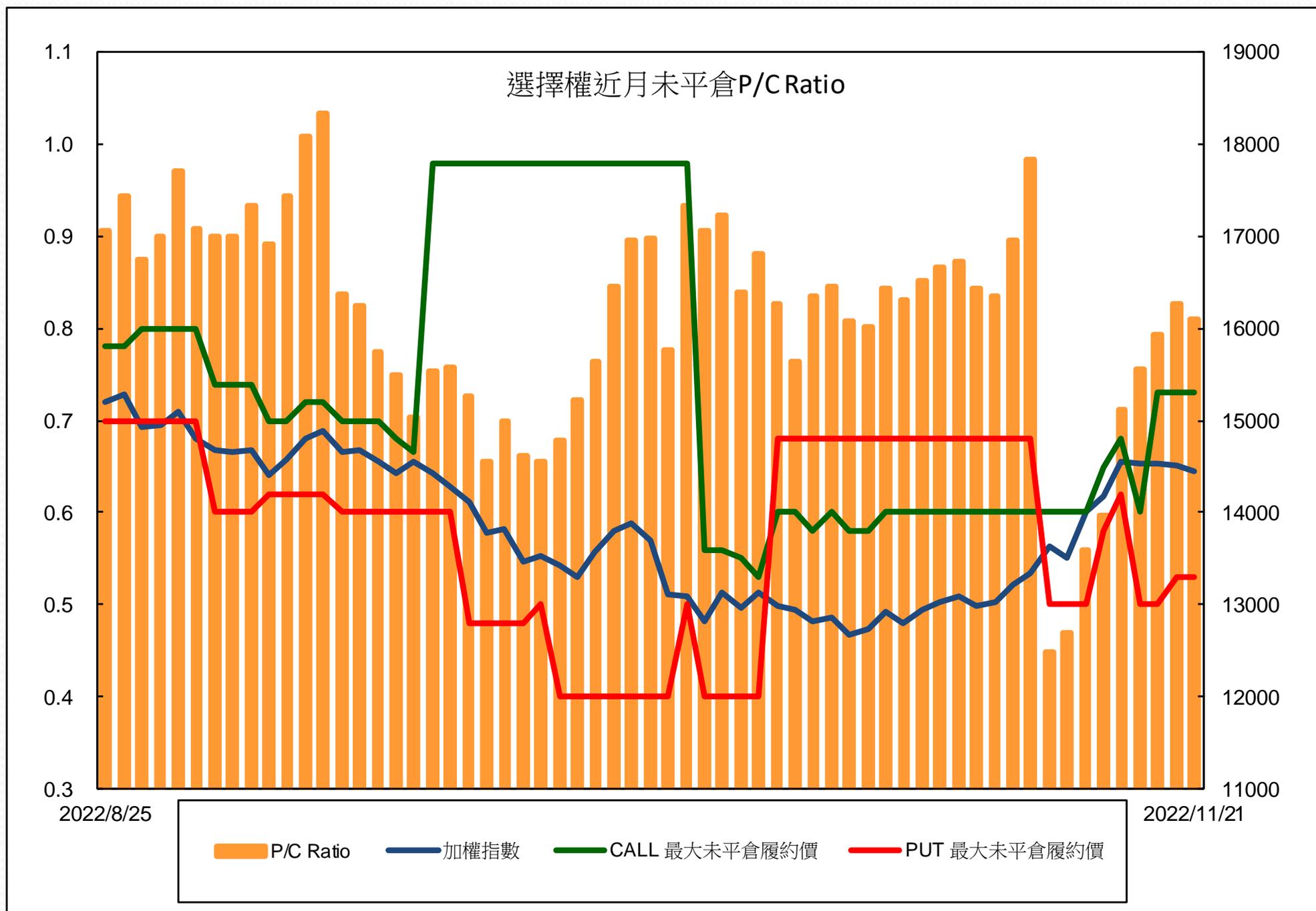
更新日期：2022年11月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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	11月18日	74,378	80,100	-5,722
	11月21日	79,625	90,442	-10,817
Put	11月18日	72,026	59,733	12,293
	11月21日	75,080	56,782	18,298

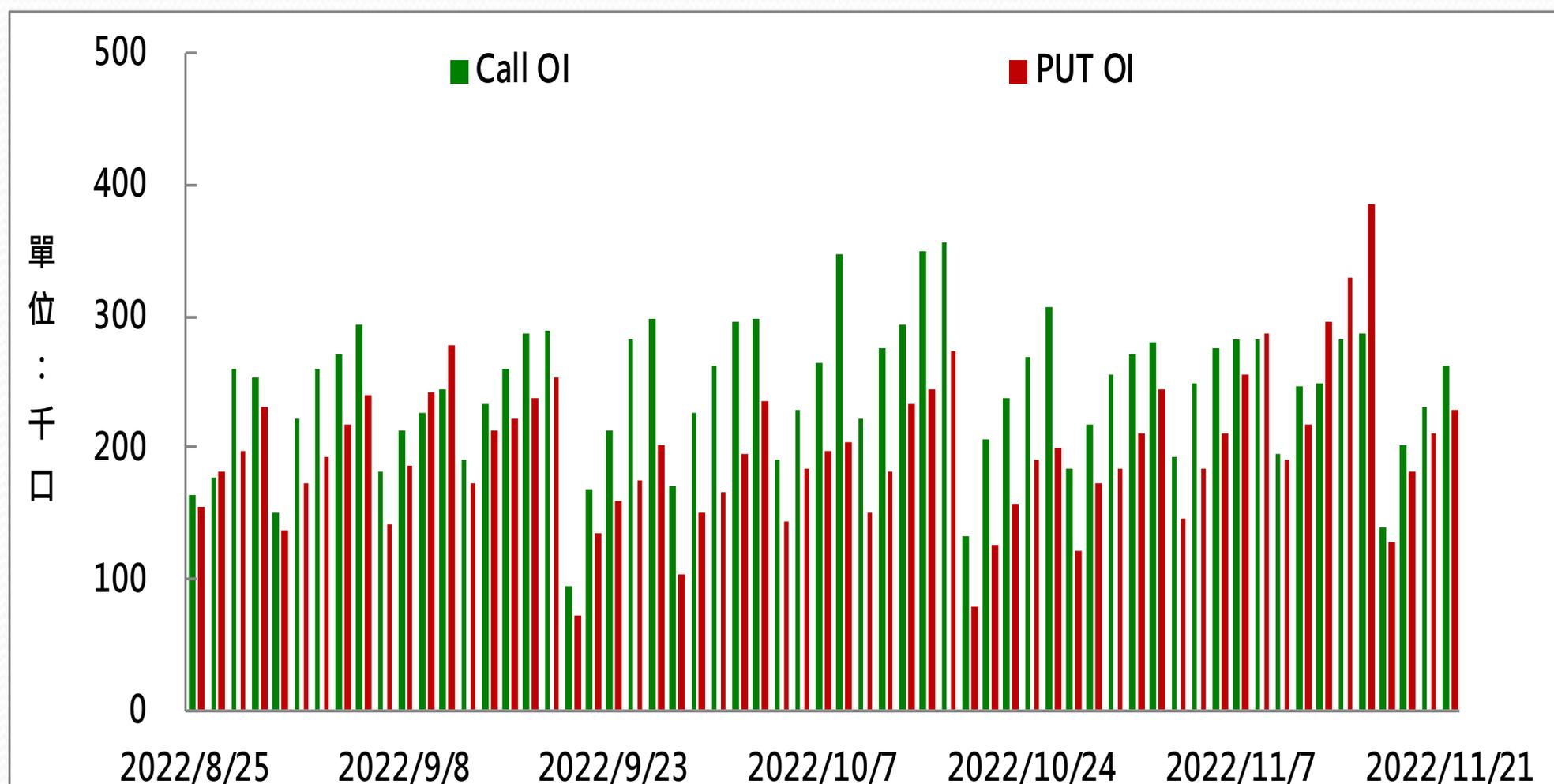
更新日期：2022年11月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年11月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整

# 選擇權全月Put Call OI



更新日期：2022年11月21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11月21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