

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/11/23 結算日：2022/11/30					日期：2022/11/23 結算日：2022/12/21				
202211W5					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	1	13,600	936	327	-1	352	13,100	1,280	-105
0	1	13,700	2,169	-3	3	294	13,200	1,903	-2
0	12	13,800	1,642	684	0	232	13,300	5,011	6
13	20	13,900	1,750	475	1	669	13,400	2,081	-111
8	34	14,000	3,534	1,807	0	608	13,500	3,398	139
-2	48	14,100	3,030	1,587	2	933	13,600	2,701	290
2	48	14,150	1,363	559	-3	529	13,700	4,440	808
6	45	14,200	1,850	803	-16	941	13,800	2,456	504
0	14	14,250	1,508	531	-10	1,604	13,900	1,976	290
14	143	14,300	1,434	675	0	4,026	14,000	6,518	2,101
121	182	14,350	1,197	586	-4	1,909	14,100	2,317	265
-238	866	14,400	1,442	699	-5	2,122	14,200	2,912	207
-48	248	14,450	1,144	444	31	1,789	14,300	2,281	234
26	653	14,500	1,513	871	58	1,865	14,400	1,749	137
437	1,129	14,550	877	570	44	3,937	14,500	2,205	144
446	1,848	14,600	1,065	951	31	2,540	14,600	1,789	691
976	2,049	14,650	440	372	525	2,224	14,700	780	110
1,564	2,547	14,700	452	238	298	3,001	14,800	713	169
1,579	2,402	14,750	172	147	50	2,680	14,900	245	45
1,689	2,865	14,800	112	108	45	5,704	15,000	215	94
1,052	1,990	14,850	32	29	-123	2,076	15,100	38	1
1,362	2,858	14,900	26	17	742	4,575	15,200	162	23
1,151	2,589	14,950	1	0	-1,083	5,777	15,300	42	2
2,802	4,987	15,000	8	4	99	3,573	15,400	518	-1
1,744	2,960	15,100	0	0	257	2,983	15,500	12	0
1,955	2,626	15,200	6	5	377	2,046	15,600	46	0
834	1,363	15,300	2	2	59	1,429	15,700	31	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
20,481	41,328	0.7290	30,129	12,841	2,773	102,341	0.9237	94,537	10,016
昨日 P/C	0.8632	今日增減變化	-0.1342		昨日 P/C	0.8489	今日增減變化	0.0749	

更新日期：2022年11月23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23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	110,935,827	77,272,298	33,663,529	2,510,630	4,693,920	612,013	4,081,907	160,946	
投信	40,351,636	53,607,528	-13,255,892	853,600	456,277	0	456,277	1,870	
自營商	22,941,935	18,336,991	4,604,944	3,368,560	1,158,402	1,024,566	133,836	76,726	
	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	380,466	1,402,115	-1,021,649	-4,815	39,155	36,358	2,797	21	
投信	104,590	0	104,590	2,015	0	0	0	0	
自營商	322,864	165,222	157,642	17,912	166,410	156,621	9,789	-12,417	

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23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	39,150	12,654	26,496	1,023	16,426	11,122	5,304	18	
投信	0	100	-100	0	200	121	79	0	
自營商	53,517	72,730	-19,213	-2,145	57,861	35,124	22,737	1,490	
特定法人(週)	551	0	551	---	433	944	-511	---	
特定法人(近月)	25,008	3,522	21,486	1,547	3,680	10,466	-6,786	327	
特定法人(全月)	29,356	3,632	25,724	-332	3,921	12,243	-8,322	736	
十大交易人(週)	20,704	25,257	-4,553	---	12,945	14,332	-1,387	---	
十大交易人(近月)	62,368	53,575	8,793	-2,235	38,942	51,684	-12,742	826	
十大交易人(全月)	87,150	82,773	4,377	13,043	55,327	71,357	-16,030	-508	
全市場未沖銷(近月)			102,341	2,773			94,537	10,016	
全市場未沖銷(全月)			164,636	-108,339			142,883	-104,839	

更新日期：2022年11月23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11W5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	15000
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	13.77%	較前一交易日	+3.74%
	買權隱含波動率	16.67%	較前一交易日	+4.47%
	賣權隱含波動率	10.17%	較前一交易日	+1.76%
電子選擇權	買權成交最大量	725	買權OI最大量	640
	賣權成交最大量	645	賣權OI最大量	510
金融選擇權	買權成交最大量	1540	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1220

更新日期：2022年11月23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	14000	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	20.20%	較前一交易日	-0.74%
	買權隱含波動率	17.56%	較前一交易日	+0.97%
	賣權隱含波動率	22.28%	較前一交易日	-0.67%
	成交量P/C_Ratio值	1.239	較前一交易日	+0.46
	未平倉P/C_Ratio值	0.924	較前一交易日	+0.07
電子選擇權	買權成交最大量	725	買權OI最大量	640
	賣權成交最大量	645	賣權OI最大量	510
金融選擇權	買權成交最大量	1540	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1220

更新日期：2022年11月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

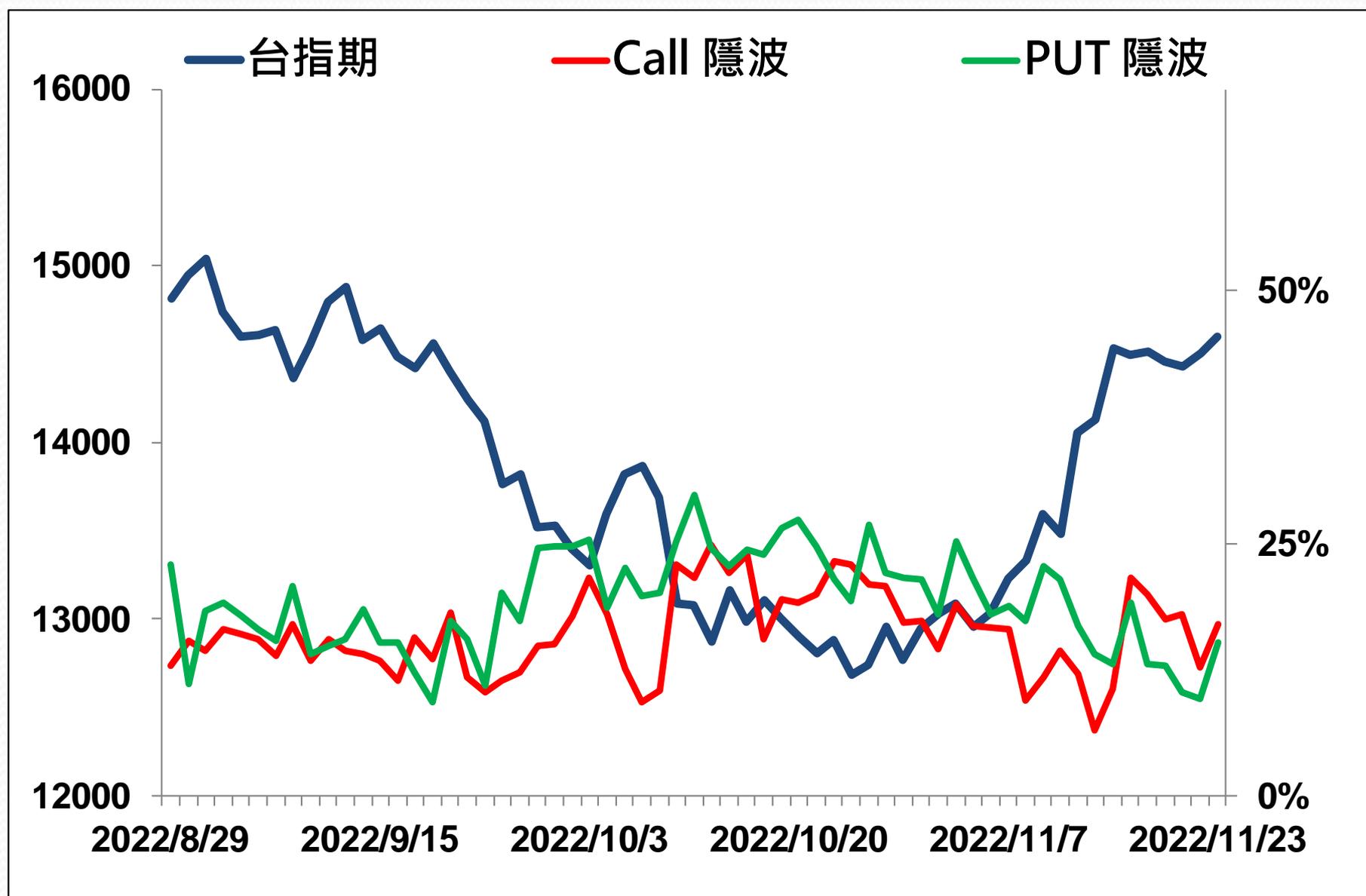
# 選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



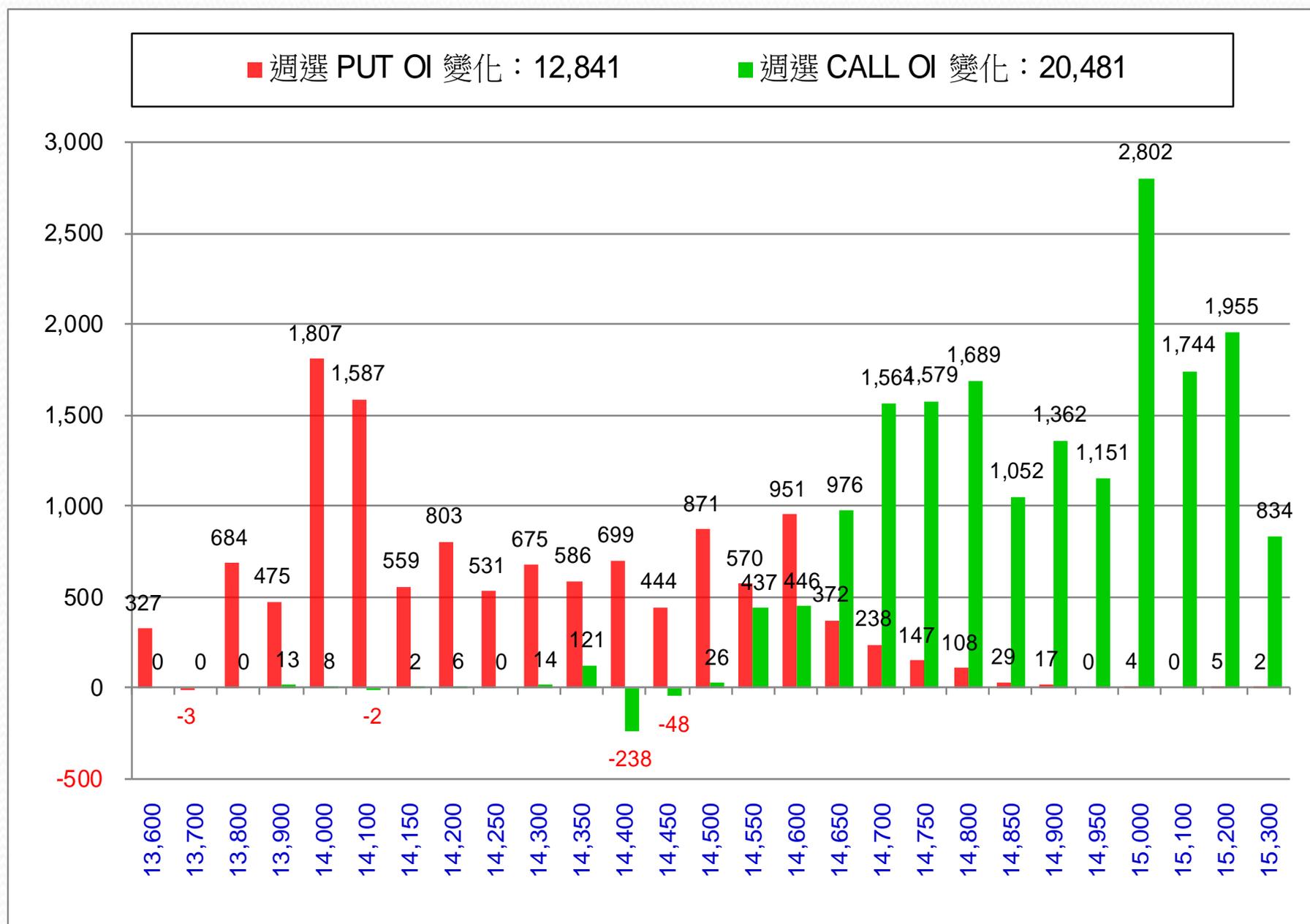
更新日期：2022年11月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



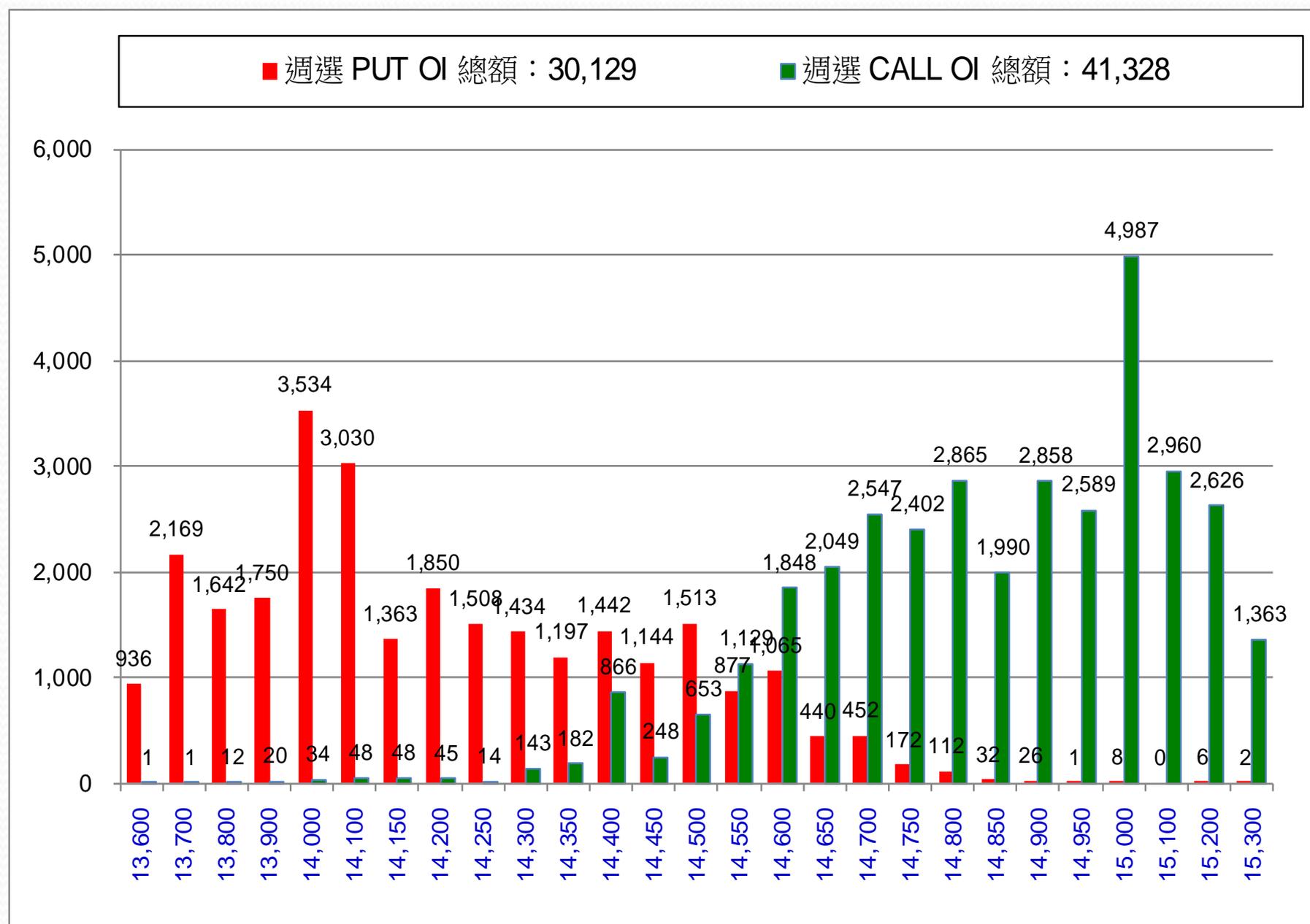
更新日期：2022年11月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年11月23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



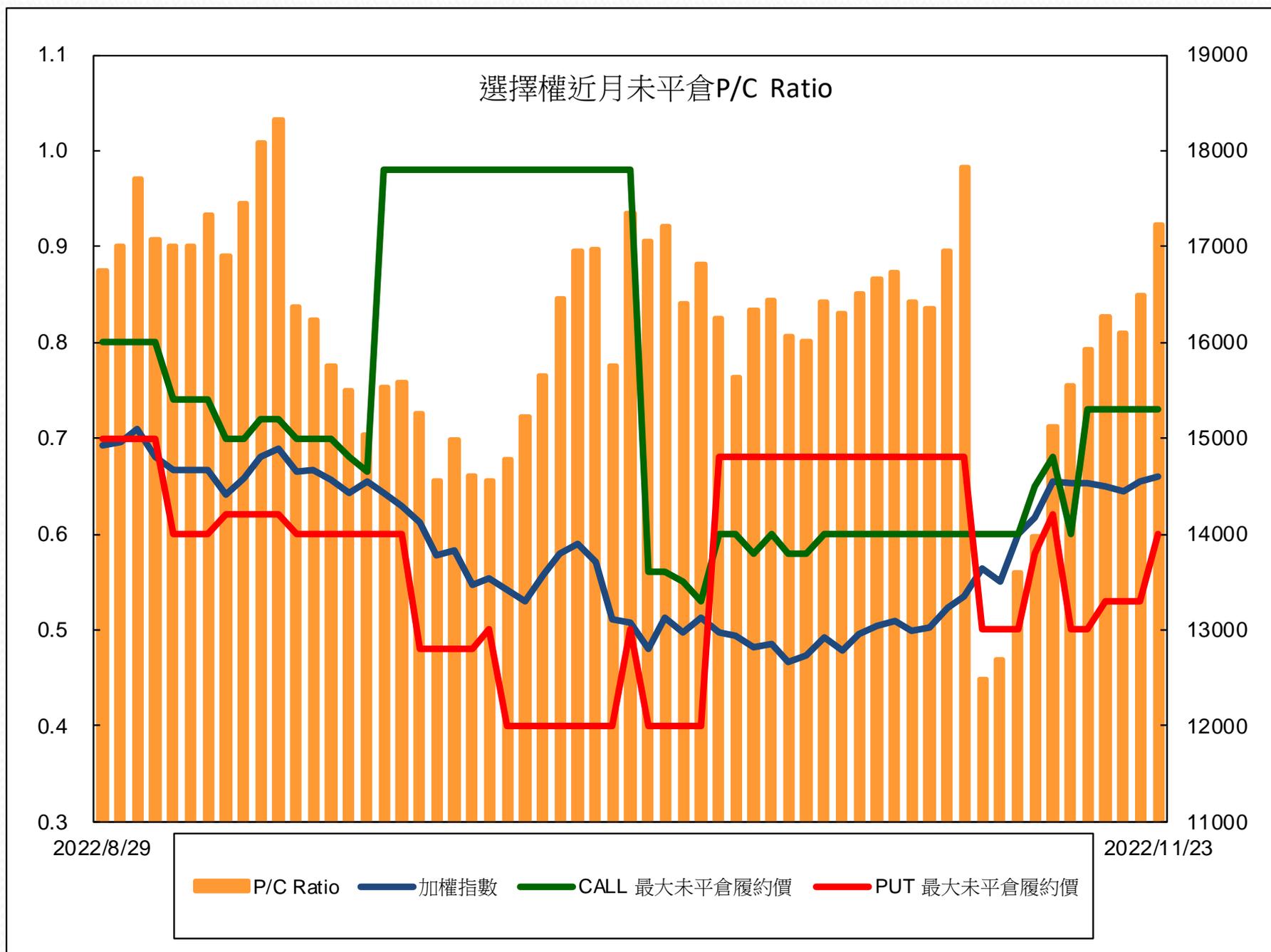
更新日期：2022年11月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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22日	76,879	93,947	-17,068
	11月23日	53,517	72,730	-19,213
Put	11月22日	81,410	60,163	21,247
	11月23日	57,861	35,124	22,737

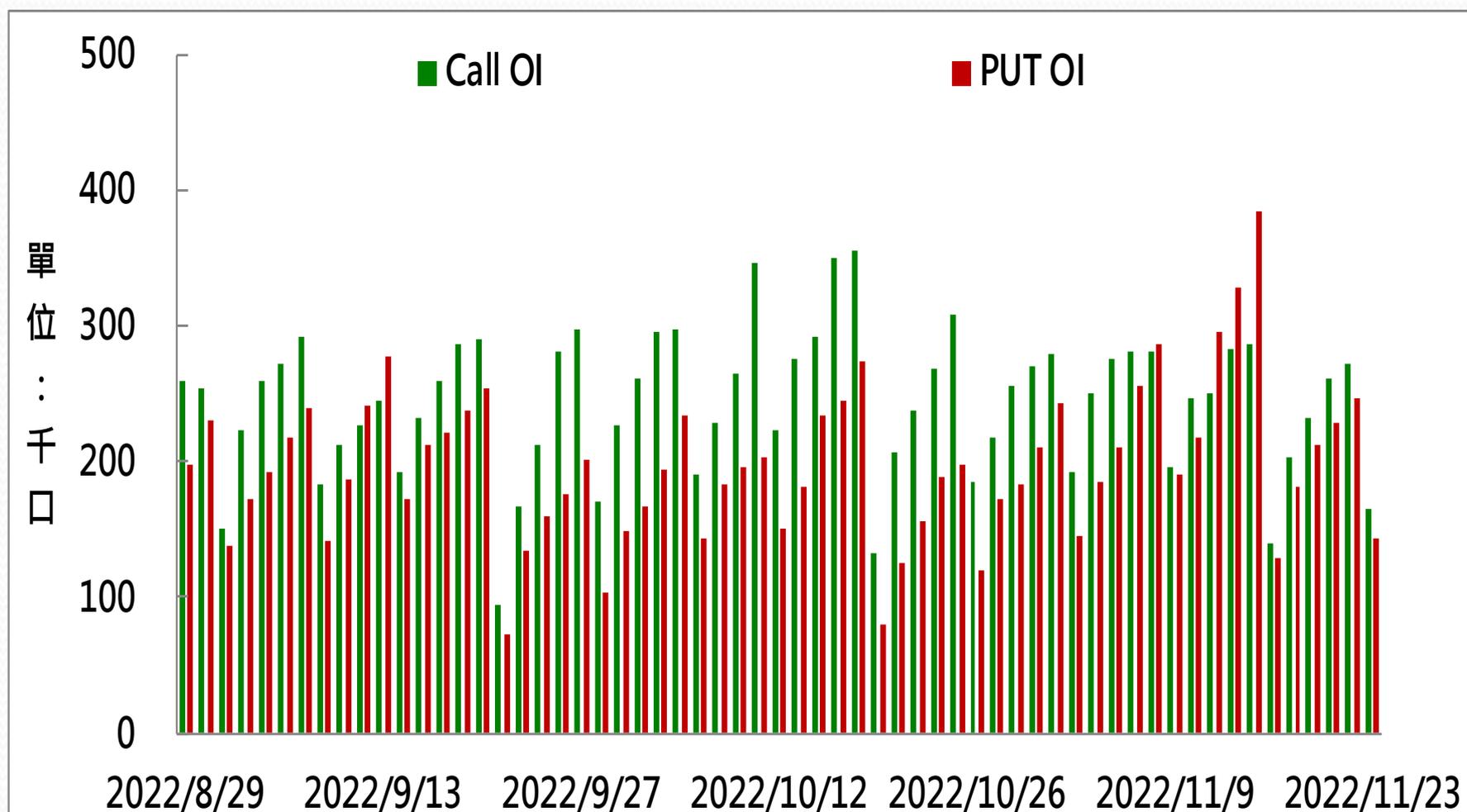
更新日期：2022年11月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年11月23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23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23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