

台指選擇權OI匯報

日期：2022/12/16 結算日：2022/12/21					日期：2022/12/16 結算日：2023/1/18				
202212 月台指選擇權 OI 序列					202301 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	594	13,500	4,294	-18	0	83	13,000	1,006	186
-1	870	13,600	4,737	123	0	457	13,100	484	1
-44	471	13,700	5,342	430	0	9	13,200	580	71
-50	890	13,800	6,878	1,274	0	26	13,300	470	146
-84	1,497	13,900	8,022	1,397	0	11	13,400	1,031	579
6	3,354	14,000	19,385	3,220	1	31	13,500	3,082	288
69	1,585	14,100	8,465	1,860	8	32	13,600	1,489	307
7	131	14,150	4,828	1,516	10	33	13,700	797	186
97	2,133	14,200	13,000	-101	10	169	13,800	845	185
61	137	14,250	4,565	541	1	33	13,900	621	128
238	1,889	14,300	10,919	1,772	4	88	14,000	1,044	11
452	707	14,350	4,865	1,418	10	65	14,100	1,483	-33
1,930	3,417	14,400	9,298	1,481	6	180	14,200	410	22
3,221	3,531	14,450	2,997	-44	18	195	14,300	557	26
4,141	8,827	14,500	7,358	-1,332	80	358	14,400	652	90
2,381	2,794	14,550	2,344	79	30	387	14,500	559	41
3,987	7,836	14,600	4,563	-1,426	-15	353	14,600	475	-38
3,601	5,174	14,650	1,654	-925	84	1,187	14,700	792	-58
3,836	9,581	14,700	2,920	-490	185	555	14,800	217	-1
4,128	6,705	14,750	831	-478	79	867	14,900	121	-13
4,221	14,184	14,800	1,584	-191	1,270	3,769	15,000	114	-5
3,474	7,737	14,850	279	-6	481	969	15,100	37	1
1,944	11,731	14,900	784	-116	480	1,607	15,200	55	0
1,456	6,334	14,950	75	-9	245	1,812	15,300	26	0
531	15,826	15,000	671	-39	102	1,329	15,400	47	0
-3,678	4,026	15,050	13	2	272	1,379	15,500	28	1
-3,724	8,458	15,100	638	7	54	1,015	15,600	22	10
-2,412	2,686	15,150	10	-1	-49	639	15,700	3	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
23,915	230,570	0.8820	203,369	9,303	3,811	26,534	0.8979	23,826	2,714
昨日 P/C	0.9391	今日增減變化	-0.0571		昨日 P/C	0.9291	今日增減變化	-0.0312	

更新日期：2022年12月16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16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	111,245,466	91,685,206	19,560,260	3,119,126	4,337,026	1,670,731	2,666,295	-400,202	
投信	50,881,454	66,647,341	-15,765,887	-4,776,453	376,329	0	376,329	-30,173	
自營商	36,510,891	23,053,399	13,457,492	3,473,705	1,686,696	1,346,675	340,021	447,534	
	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	790,129	1,633,204	-843,075	-284,986	5,702	149,683	-143,981	24,726	
投信	72,403	0	72,403	-32,587	0	0	0	0	
自營商	535,224	355,604	179,620	47,345	306,265	196,535	109,730	-44,501	

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16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	57,428	18,789	38,639	-119	28,099	19,098	9,001	1,213	
投信	450	0	450	100	400	121	279	0	
自營商	70,972	98,704	-27,732	-3,644	73,626	57,940	15,686	-12,117	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	32,809	4,022	28,787	233	4,387	14,014	-9,627	-1,775	
特定法人(全月)	40,071	4,298	35,773	573	4,811	16,925	-12,114	-1,775	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	86,205	93,707	-7,502	-4,872	76,828	67,755	9,073	6,375	
十大交易人(全月)	113,185	119,044	-5,859	-4,586	97,201	88,431	8,770	9,892	
全市場未沖銷(近月)			230,570	23,915			203,369	9,303	
全市場未沖銷(全月)			287,516	33,892			254,810	17,590	

更新日期：2022年12月16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	14800	買權OI最大量	15000
	賣權成交最大量	14300	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	10.72%	較前一交易日	-1.93%
	買權隱含波動率	11.00%	較前一交易日	-2.22%
	賣權隱含波動率	10.40%	較前一交易日	-1.68%
電子選擇權	買權成交最大量	370	買權OI最大量	370
	賣權成交最大量	370	賣權OI最大量	370
金融選擇權	買權成交最大量	450	買權OI最大量	450
	賣權成交最大量	450	賣權OI最大量	450

更新日期：2022年12月16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

2023年01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	15000
	賣權成交最大量	13400	賣權OI最大量	13500
	整體隱含波動率	17.41%	較前一交易日	-0.14%
	買權隱含波動率	13.88%	較前一交易日	-0.27%
	賣權隱含波動率	22.03%	較前一交易日	+1.20%
	成交量P/C_Ratio值	0.777	較前一交易日	-0.09
	未平倉P/C_Ratio值	0.898	較前一交易日	-0.03
電子選擇權	買權成交最大量	440	買權OI最大量	440
	賣權成交最大量	440	賣權OI最大量	440
金融選擇權	買權成交最大量	590	買權OI最大量	590
	賣權成交最大量	590	賣權OI最大量	590

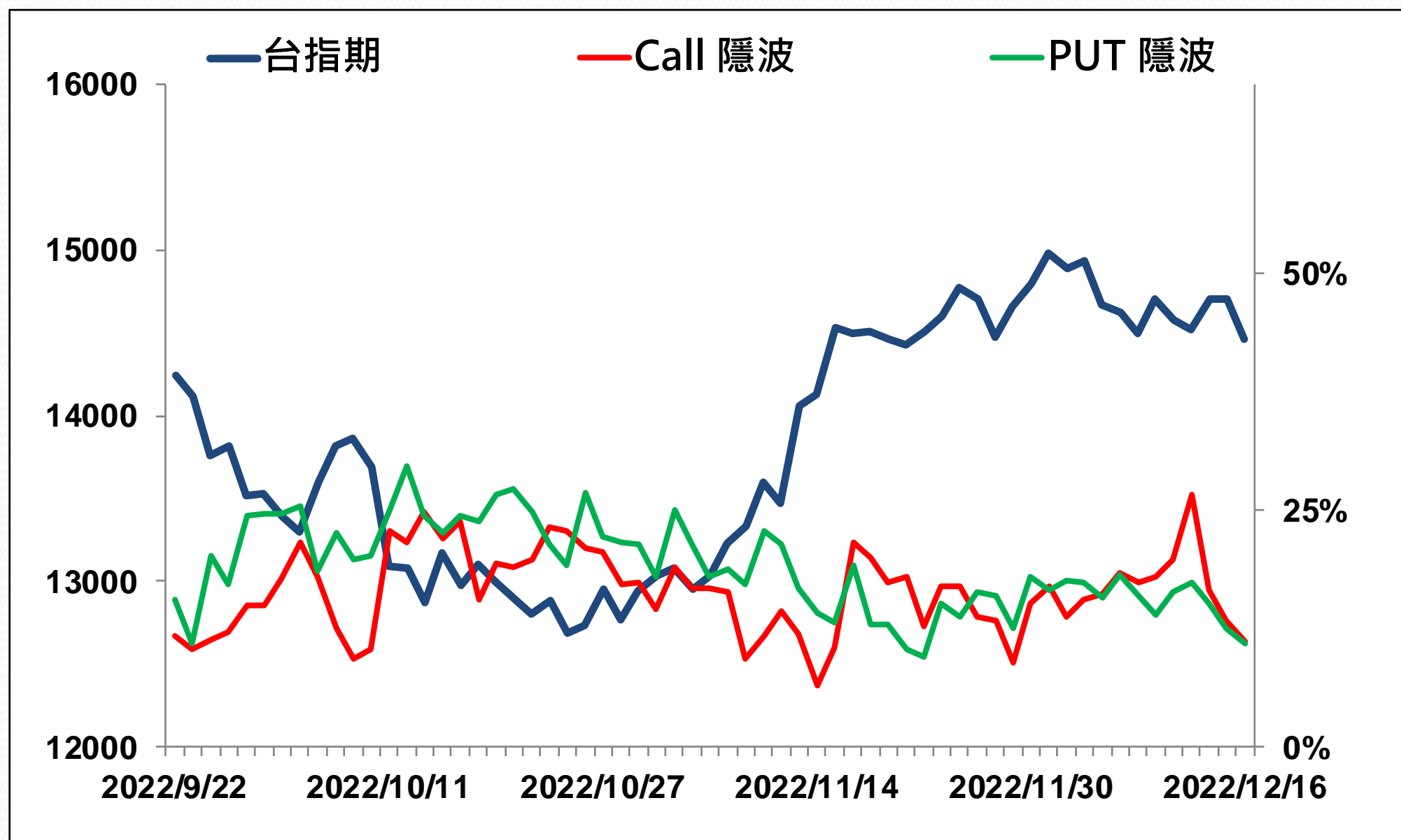
更新日期：2022年12月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



更新日期：2022年12月16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

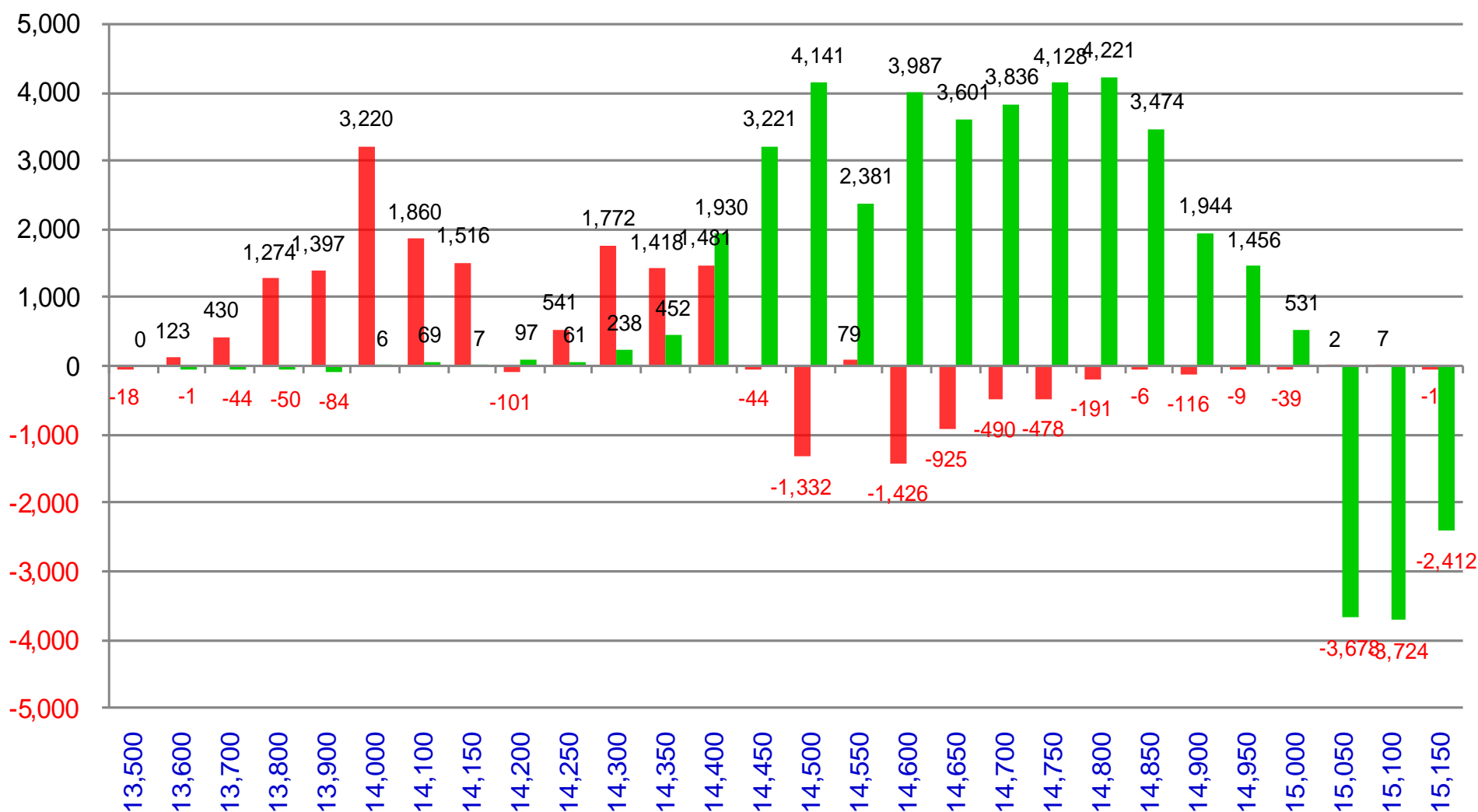


更新日期：2022年12月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：9,303

週選 CALL OI 變化：23,915

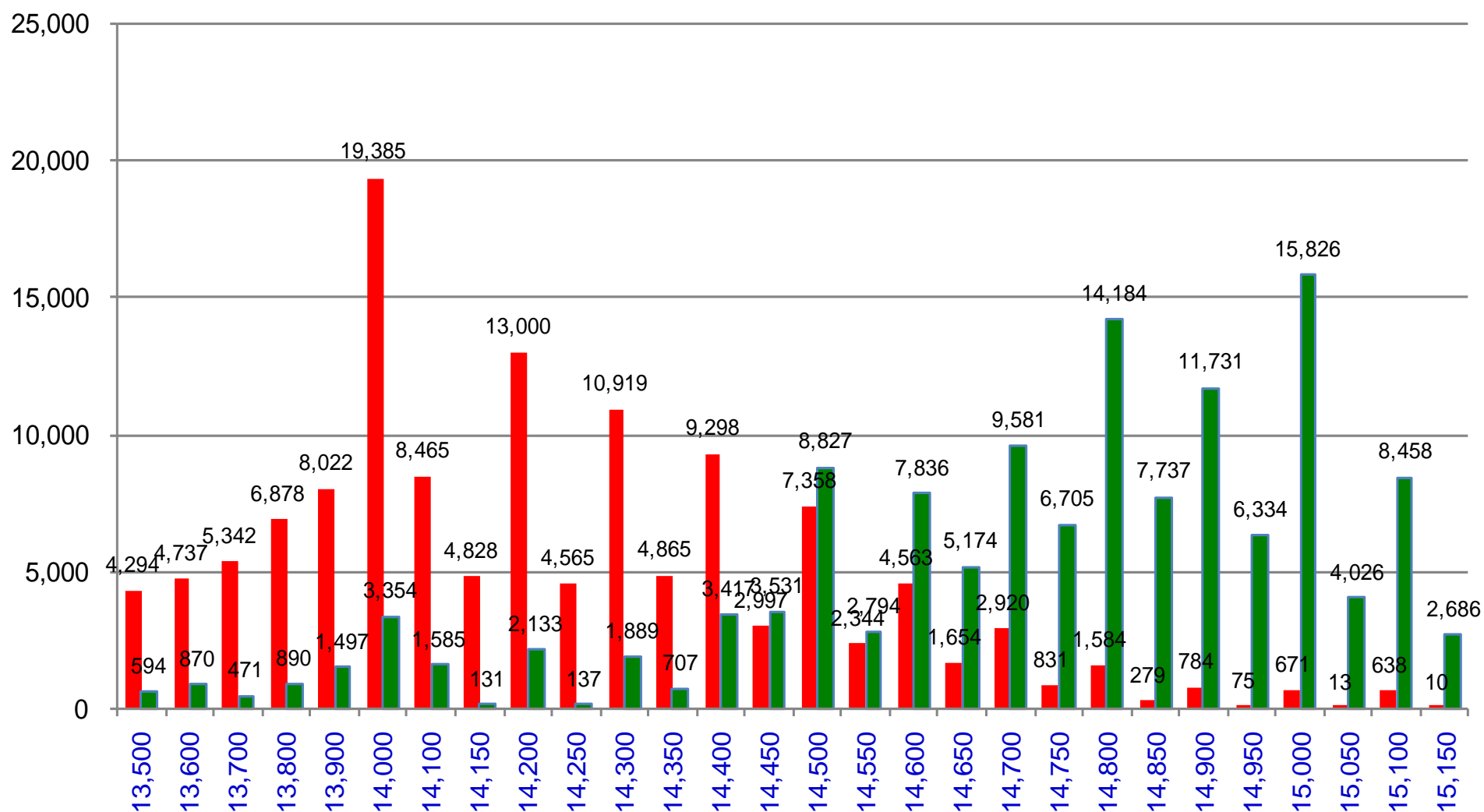


更新日期：2022年12月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：203,369

週選 CALL OI 總額：230,570



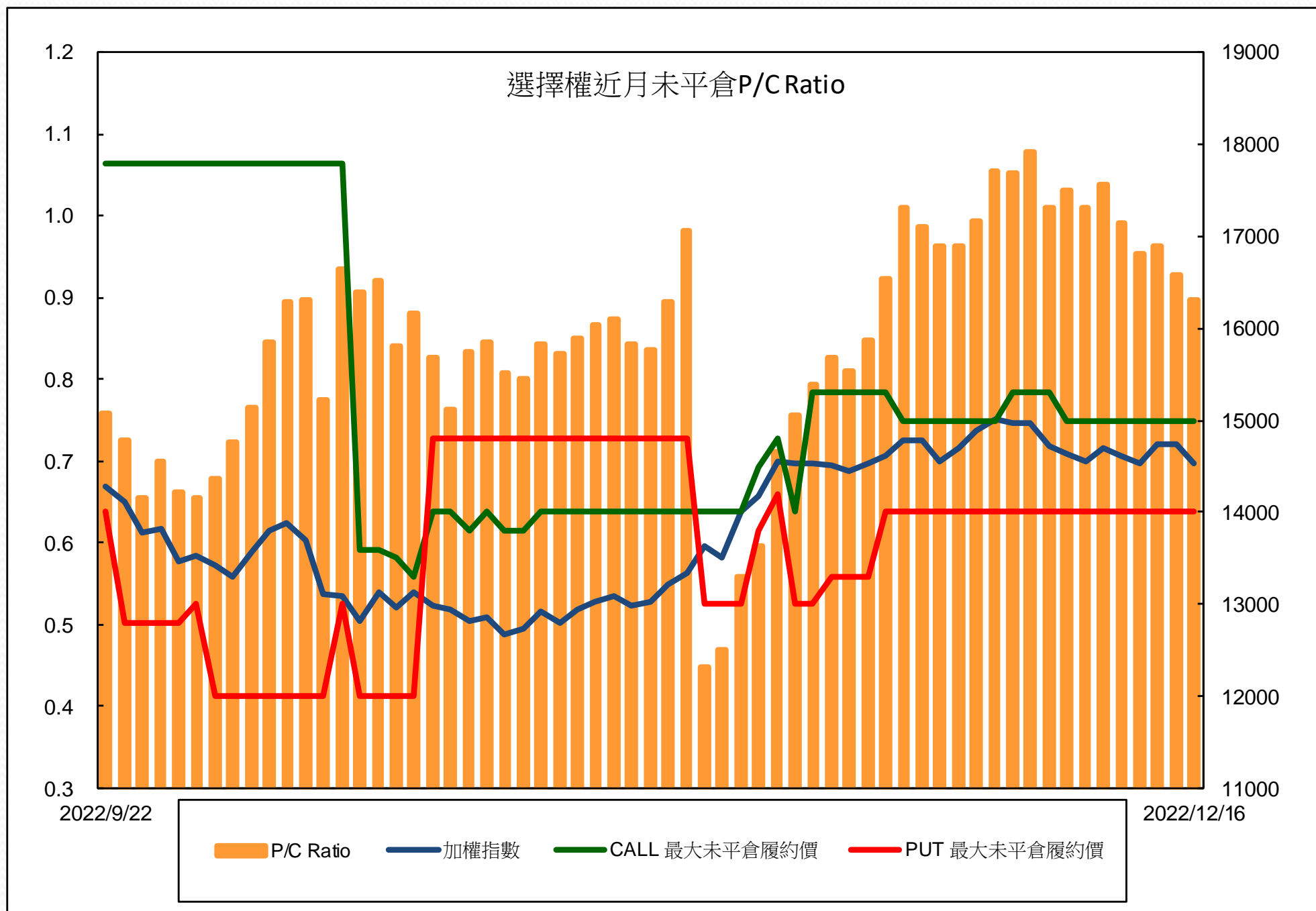
更新日期：2022年12月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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15日	72,253	96,341	-24,088
	12月16日	70,972	98,704	-27,732
Put	12月15日	79,309	51,506	27,803
	12月16日	73,626	57,940	15,686

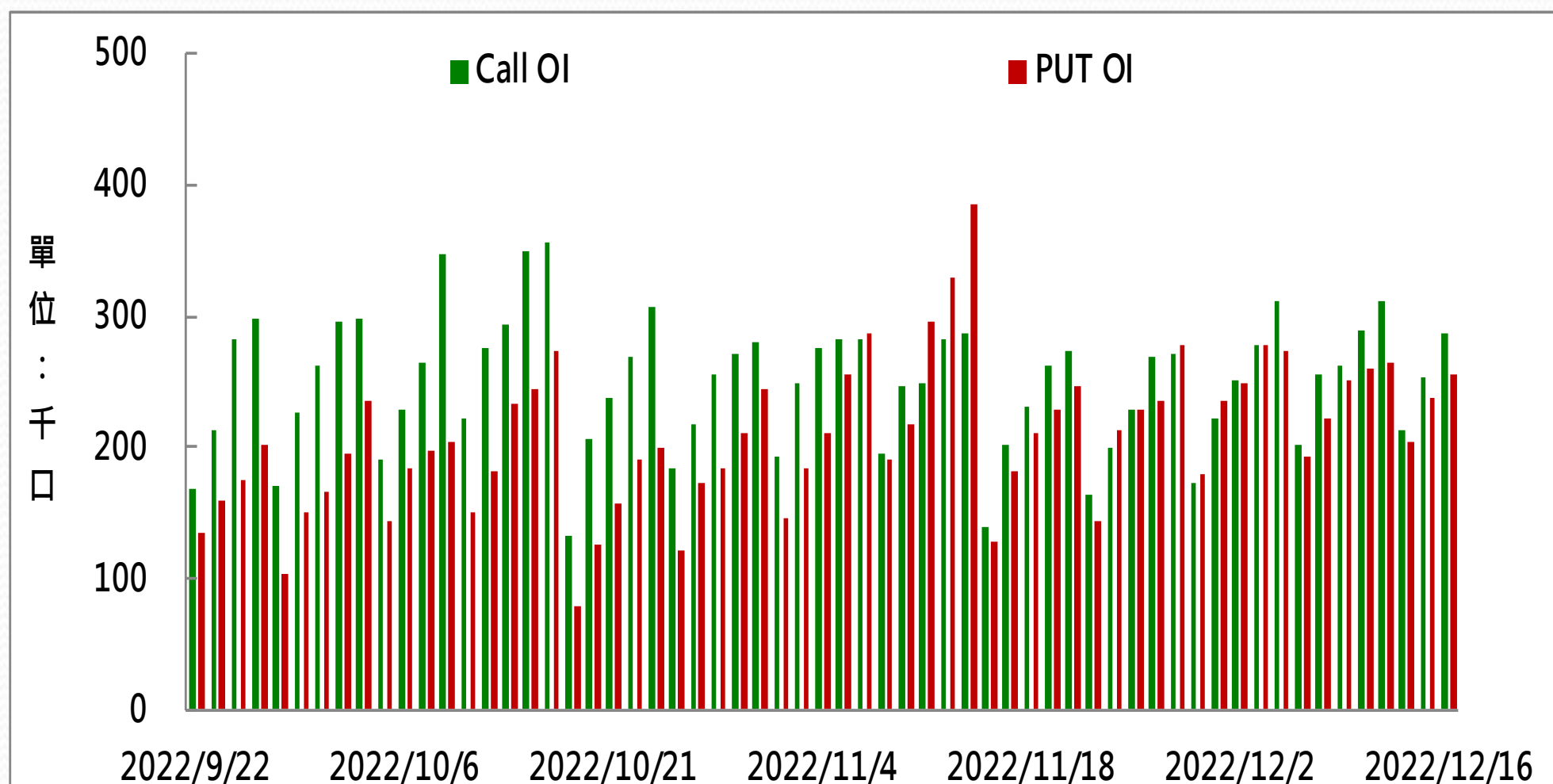
更新日期：2022年12月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年12月16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12月16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16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