

台指選擇權OI匯報

日期：2022/12/19 結算日：2022/12/21					日期：2022/12/19 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
-6	221	13,300	3,760	-9	0	490	12,900	640	58
-2	618	13,400	2,651	226	0	83	13,000	1,208	202
-4	590	13,500	4,546	252	0	457	13,100	519	35
0	870	13,600	5,038	301	0	9	13,200	901	321
-13	458	13,700	5,575	233	0	26	13,300	828	358
-7	883	13,800	7,319	441	0	11	13,400	1,142	111
-4	1,493	13,900	8,792	770	2	33	13,500	3,461	379
28	3,382	14,000	20,057	672	0	32	13,600	1,507	18
37	1,622	14,100	10,221	1,756	51	84	13,700	794	-3
54	185	14,150	5,422	594	2	171	13,800	1,070	225
-1	2,132	14,200	12,396	-604	22	55	13,900	838	217
238	375	14,250	5,206	641	36	124	14,000	1,193	149
425	2,314	14,300	11,485	566	11	76	14,100	1,352	-131
1,086	1,793	14,350	6,465	1,600	-3	177	14,200	468	58
2,083	5,500	14,400	9,596	298	-4	191	14,300	649	92
1,933	5,464	14,450	3,183	186	16	374	14,400	734	82
3,297	12,124	14,500	7,466	108	43	430	14,500	545	-14
3,428	6,222	14,550	1,809	-535	193	546	14,600	378	-97
※ 3,885	11,721	14,600	3,578	-985	99	1,286	14,700	785	-7
3,454	8,628	14,650	1,391	-263	314	869	14,800	200	-17
3,445	13,026	14,700	2,562	-358	140	1,007	14,900	120	-1
891	7,596	14,750	712	-119	※ 497	4,266	15,000	106	-8
-1,706	12,478	14,800	1,404	-180	449	1,418	15,100	38	1
-400	7,337	14,850	266	-13	151	1,758	15,200	55	0
-1,785	9,946	14,900	769	-15	147	1,959	15,300	26	0
-1,371	4,963	14,950	75	0	108	1,437	15,400	47	0
-1,381	14,445	15,000	641	-30	-17	1,362	15,500	28	0
-130	3,896	15,050	13	0	109	1,124	15,600	22	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
14,579	245,149	0.8509	208,586	5,217	2,845	29,379	0.9444	27,745	3,919
昨日 P/C	0.8820	今日增減變化	-0.0311		昨日 P/C	0.8979	今日增減變化	0.0464	

更新日期：2022年12月19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19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	115,495,476	86,614,024	28,881,452	9,321,192	4,121,890	1,611,101	2,510,789	-155,506	
投信	49,647,929	66,702,816	-17,054,887	-1,289,000	364,203	0	364,203	-12,126	
自營商	36,063,521	22,236,671	13,826,850	369,358	1,825,611	1,386,662	438,949	98,928	
	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	801,767	1,657,713	-855,946	-12,871	12,745	110,452	-97,707	46,274	
投信	72,324	0	72,324	-79	0	0	0	0	
自營商	726,475	524,375	202,100	22,480	285,820	212,202	73,618	-36,112	

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19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	60,171	18,163	42,008	3,369	29,027	18,650	10,377	1,376	
投信	450	0	450	0	400	121	279	0	
自營商	77,873	107,718	-29,845	-2,113	72,824	58,029	14,795	-891	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	33,045	4,022	29,023	236	4,387	13,279	-8,892	735	
特定法人(全月)	41,586	4,298	37,288	1,515	5,033	17,431	-12,398	-284	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	88,283	101,469	-13,186	-5,684	74,706	65,897	8,809	-264	
十大交易人(全月)	121,394	129,799	-8,405	-2,546	97,555	87,557	9,998	1,228	
全市場未沖銷(近月)			245,149	14,579			208,586	5,217	
全市場未沖銷(全月)			312,975	25,459			267,433	12,623	

更新日期：2022年12月19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	14500	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	11.04%	較前一交易日	+0.32%
	買權隱含波動率	13.28%	較前一交易日	+2.28%
	賣權隱含波動率	9.11%	較前一交易日	-1.29%
電子選擇權	買權成交最大量	365	買權OI最大量	365
	賣權成交最大量	365	賣權OI最大量	365
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19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	13500	賣權OI最大量	13500
	整體隱含波動率	18.55%	較前一交易日	-1.14%
	買權隱含波動率	14.06%	較前一交易日	+0.18%
	賣權隱含波動率	22.87%	較前一交易日	+0.85%
	成交量P/C_Ratio值	0.982	較前一交易日	+0.21
	未平倉P/C_Ratio值	0.944	較前一交易日	+0.05
電子選擇權	買權成交最大量	435	買權OI最大量	435
	賣權成交最大量	435	賣權OI最大量	435
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19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

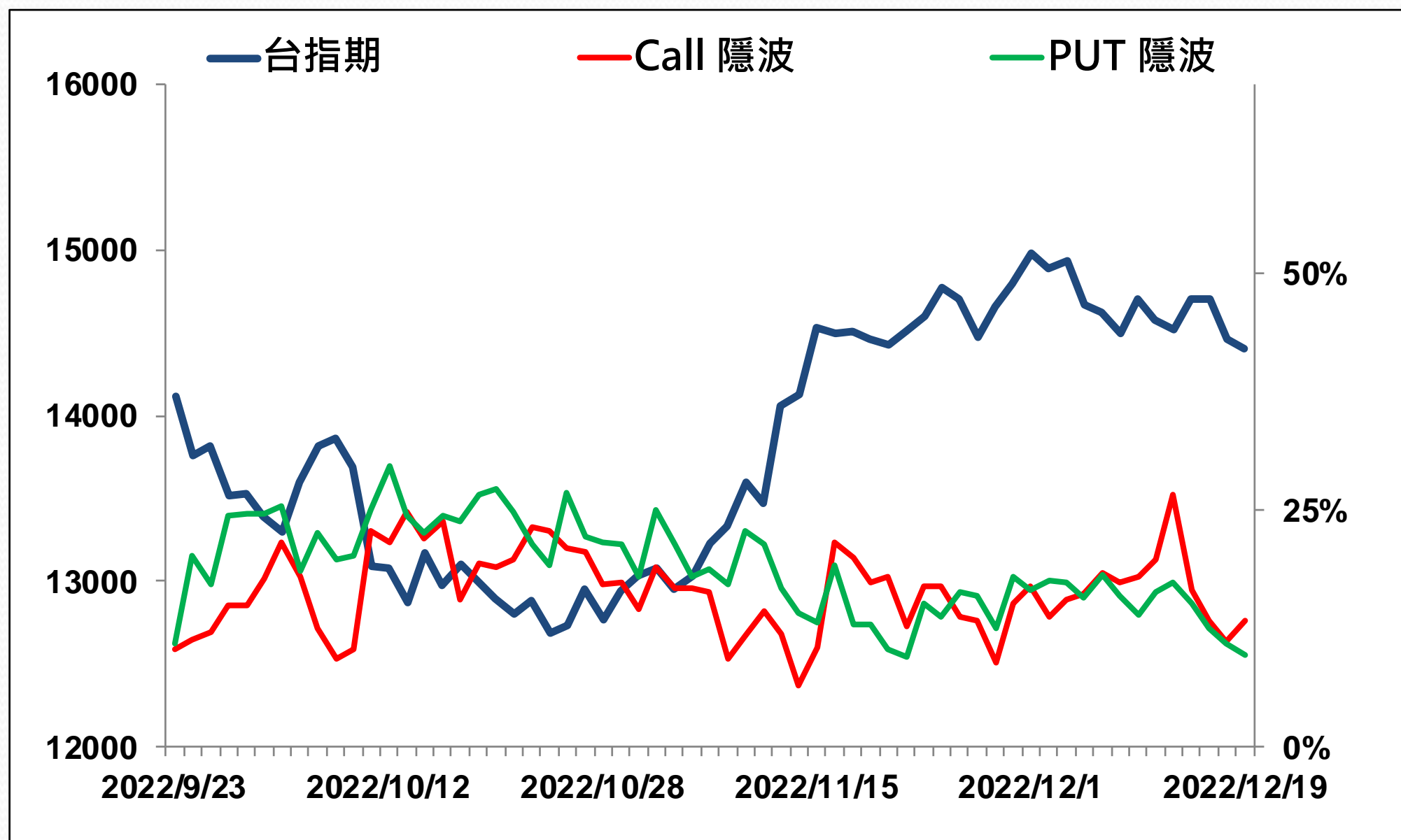
臺指選擇權波動率指數



更新日期：2022年12月19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

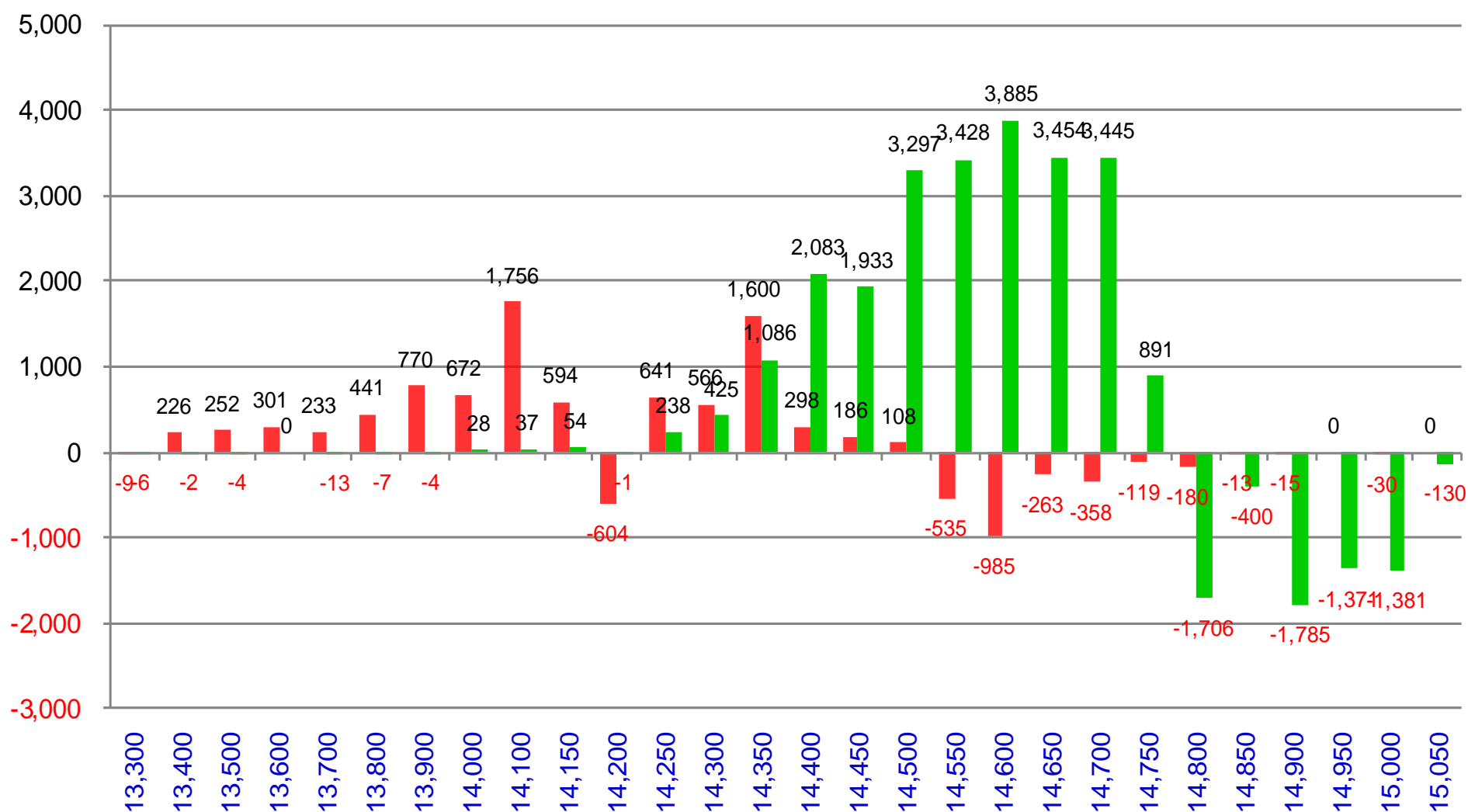


更新日期：2022年12月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：5,217

週選 CALL OI 變化：14,579

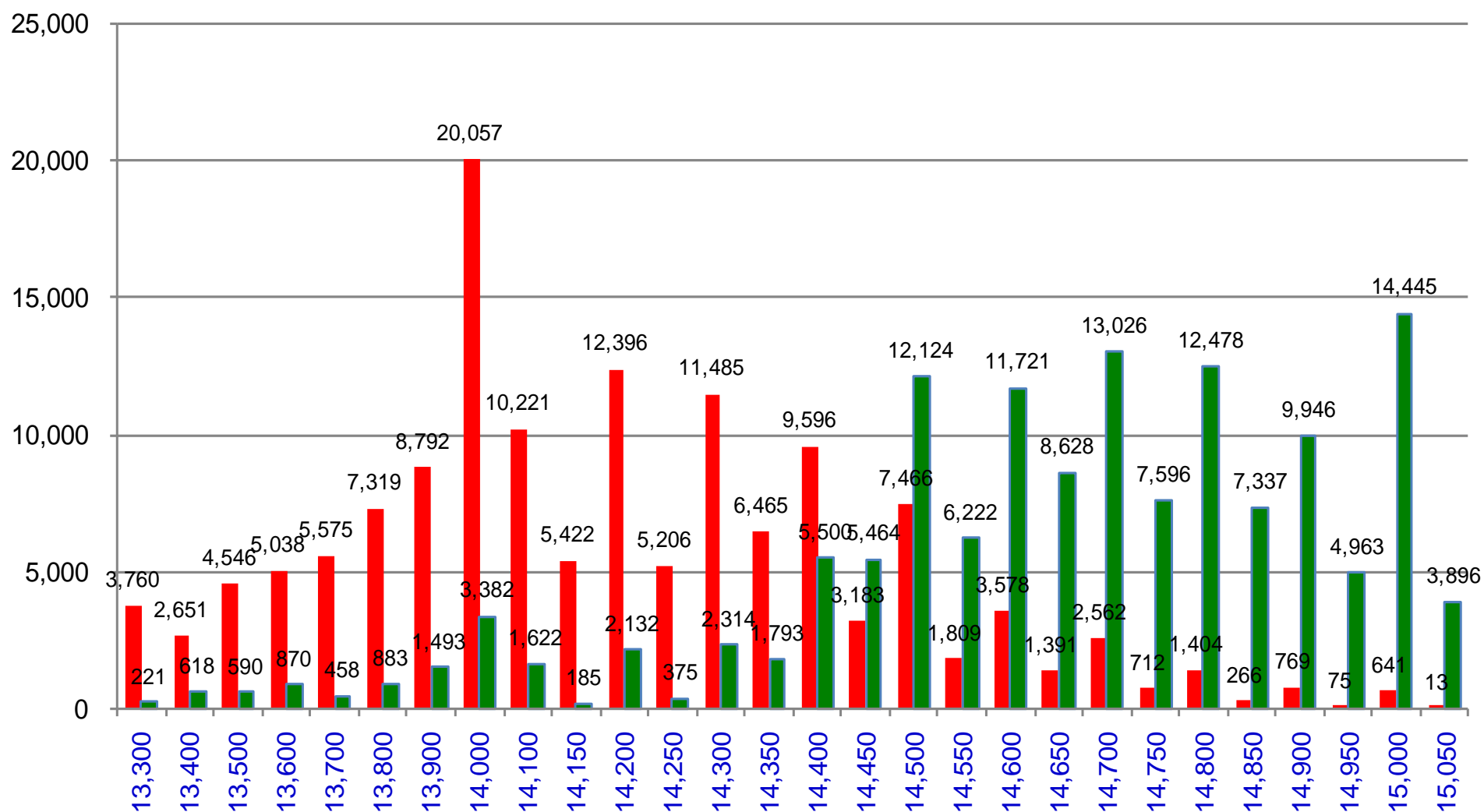


更新日期：2022年12月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：208,586

週選 CALL OI 總額：245,149



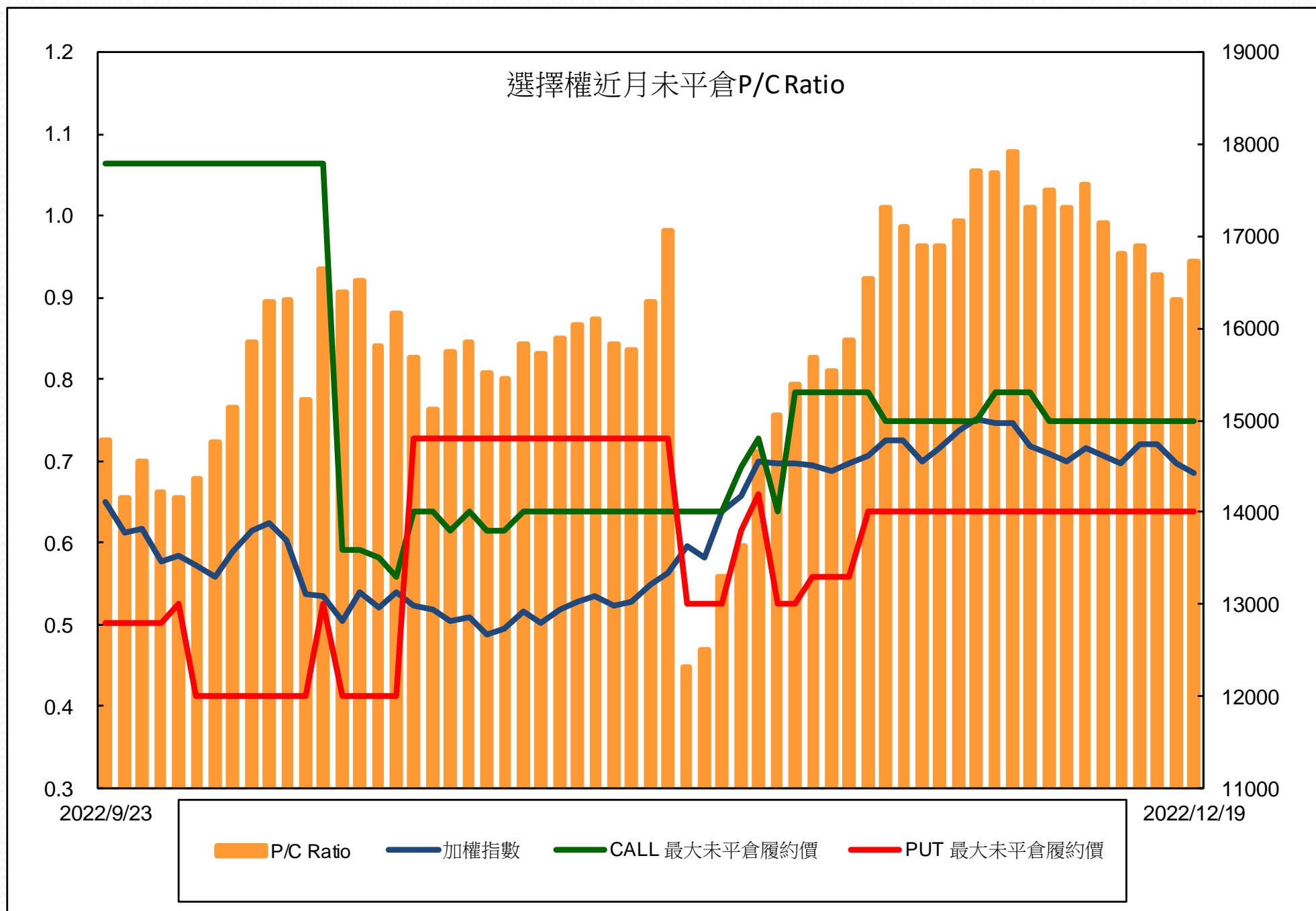
更新日期：2022年12月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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16日	70,972	98,704	-27,732
	12月19日	77,873	107,718	-29,845
Put	12月16日	73,626	57,940	15,686
	12月19日	72,824	58,029	14,795

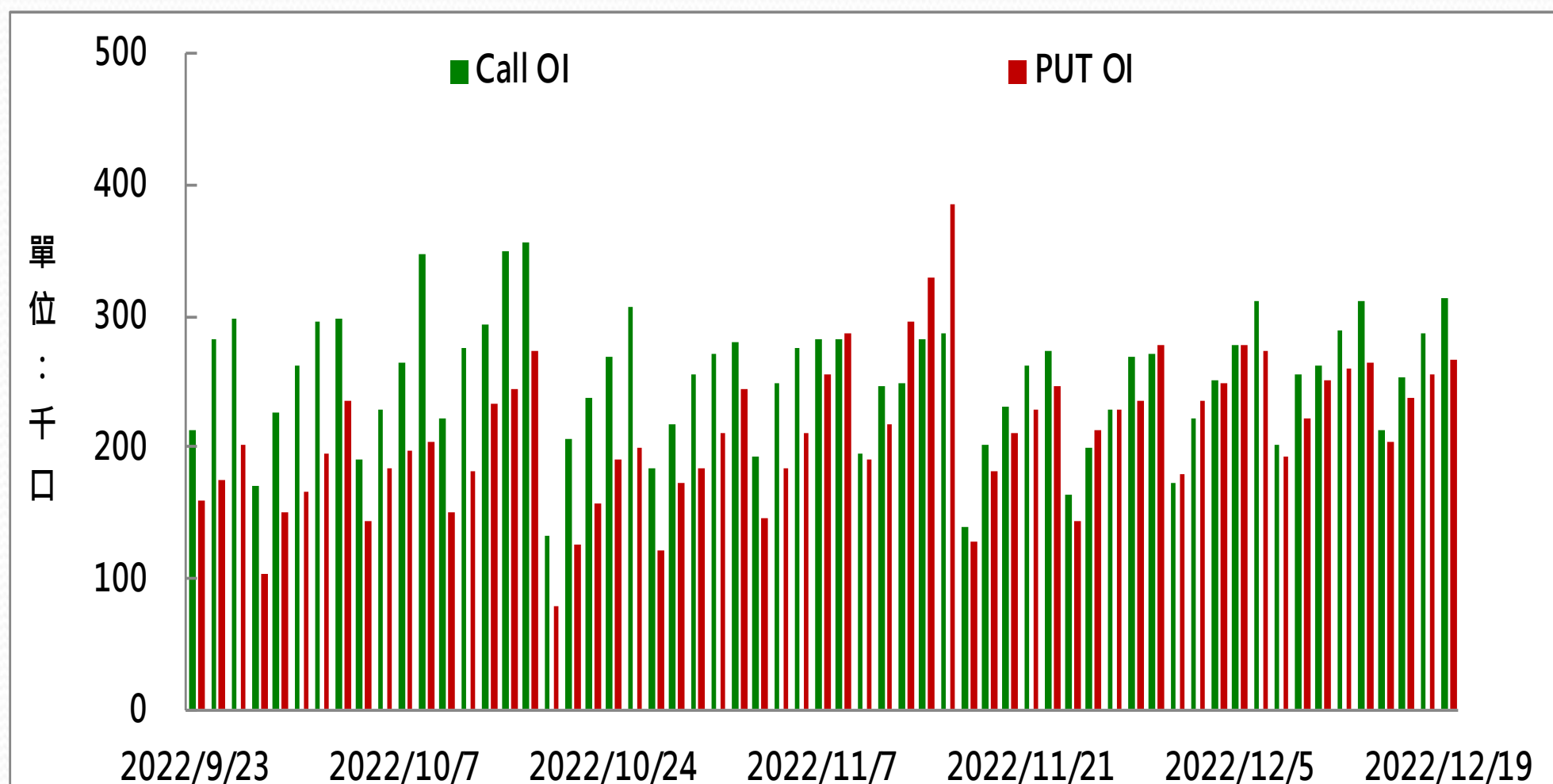
更新日期：2022年12月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年12月19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19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19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