

台指選擇權OI匯報

日期：2022/12/20 結算日：2022/12/21					日期：2022/12/20 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
1	619	13,400	2,653	2	0	26	13,300	1,141	313
0	590	13,500	4,377	-169	51	62	13,400	1,424	282
1	871	13,600	4,868	-170	1	34	13,500	3,781	320
-2	456	13,700	5,755	180	3	35	13,600	1,678	171
13	896	13,800	8,967	1,648	-24	60	13,700	985	191
52	1,545	13,900	9,813	1,021	1	172	13,800	1,075	5
314	3,696	14,000	16,583	-3,474	15	70	13,900	862	24
283	283	14,050	2,222	2,222	72	196	14,000	1,226	33
1,711	3,333	14,100	10,858	637	130	206	14,100	1,390	38
2,832	3,017	14,150	5,596	174	135	312	14,200	525	57
5,801	7,933	14,200	8,934	-3,462	181	372	14,300	635	-14
4,211	4,586	14,250	3,907	-1,299	484	858	14,400	787	53
7,288	9,602	14,300	7,900	-3,585	336	766	14,500	502	-43
5,958	7,751	14,350	4,461	-2,004	335	881	14,600	338	-40
5,606	11,106	14,400	5,742	-3,854	414	1,700	14,700	757	-28
1,662	7,126	14,450	2,031	-1,152	347	1,216	14,800	222	22
347	12,471	14,500	4,323	-3,143	185	1,192	14,900	120	0
1,060	7,282	14,550	1,649	-160	294	4,560	15,000	93	-13
-1,747	9,974	14,600	3,259	-319	338	1,756	15,100	47	9
-1,161	7,467	14,650	1,334	-57	186	1,944	15,200	54	-1
-1,927	11,099	14,700	2,360	-202	-414	1,545	15,300	26	0
-1,647	5,949	14,750	679	-33	243	1,680	15,400	36	-11
-2,066	10,412	14,800	1,267	-137	27	1,389	15,500	28	0
-824	6,513	14,850	245	-21	35	1,159	15,600	34	12
-1,359	8,587	14,900	757	-12	-24	619	15,700	3	0
-821	4,142	14,950	73	-2	-6	877	15,800	84	8
-1,072	13,373	15,000	637	-4	15	438	15,900	23	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
19,739	254,203	0.7419	188,588	-19,998	3,261	32,640	0.9535	31,123	3,378
昨日 P/C	0.8500	今日增減變化		-0.1081	昨日 P/C	0.9444	今日增減變化		0.0091

更新日期：2022年12月20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20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	119,001,268	88,678,986	30,322,282	1,440,830	4,368,797	1,779,272	2,589,525	78,736
投信	47,967,629	68,299,663	-20,332,034	-3,277,147	356,515	0	356,515	-7,688
自營商	36,618,313	22,666,420	13,951,893	125,043	1,343,342	1,231,720	111,622	-327,327
	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	834,351	1,765,499	-931,148	-75,202	11,148	89,241	-78,093	19,614
投信	71,510	0	71,510	-814	0	0	0	0
自營商	545,309	297,975	247,334	45,234	207,746	118,497	89,249	15,631

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20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	61,275	18,636	42,639	631	28,623	19,094	9,529	-848
投信	550	0	550	100	600	121	479	200
自營商	75,405	114,179	-38,774	-8,929	76,215	59,973	16,242	1,447
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	32,772	4,297	28,475	-548	3,993	12,351	-8,358	534
特定法人(全月)	41,914	0	41,914	4,626	4,897	16,520	-11,623	775
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	84,564	113,293	-28,729	-15,543	74,653	63,421	11,232	2,423
十大交易人(全月)	119,076	141,498	-22,422	-14,017	101,474	90,985	10,489	491
全市場未沖銷(近月)			264,888	19,739			188,588	-19,998
全市場未沖銷(全月)			344,327	31,352			256,677	-10,756

更新日期：2022年12月20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	14400	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	10.07%	較前一交易日	-0.97%
	買權隱含波動率	11.14%	較前一交易日	-2.14%
	賣權隱含波動率	9.07%	較前一交易日	-0.04%
電子選擇權	買權成交最大量	350	買權OI最大量	350
	賣權成交最大量	350	賣權OI最大量	350
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20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

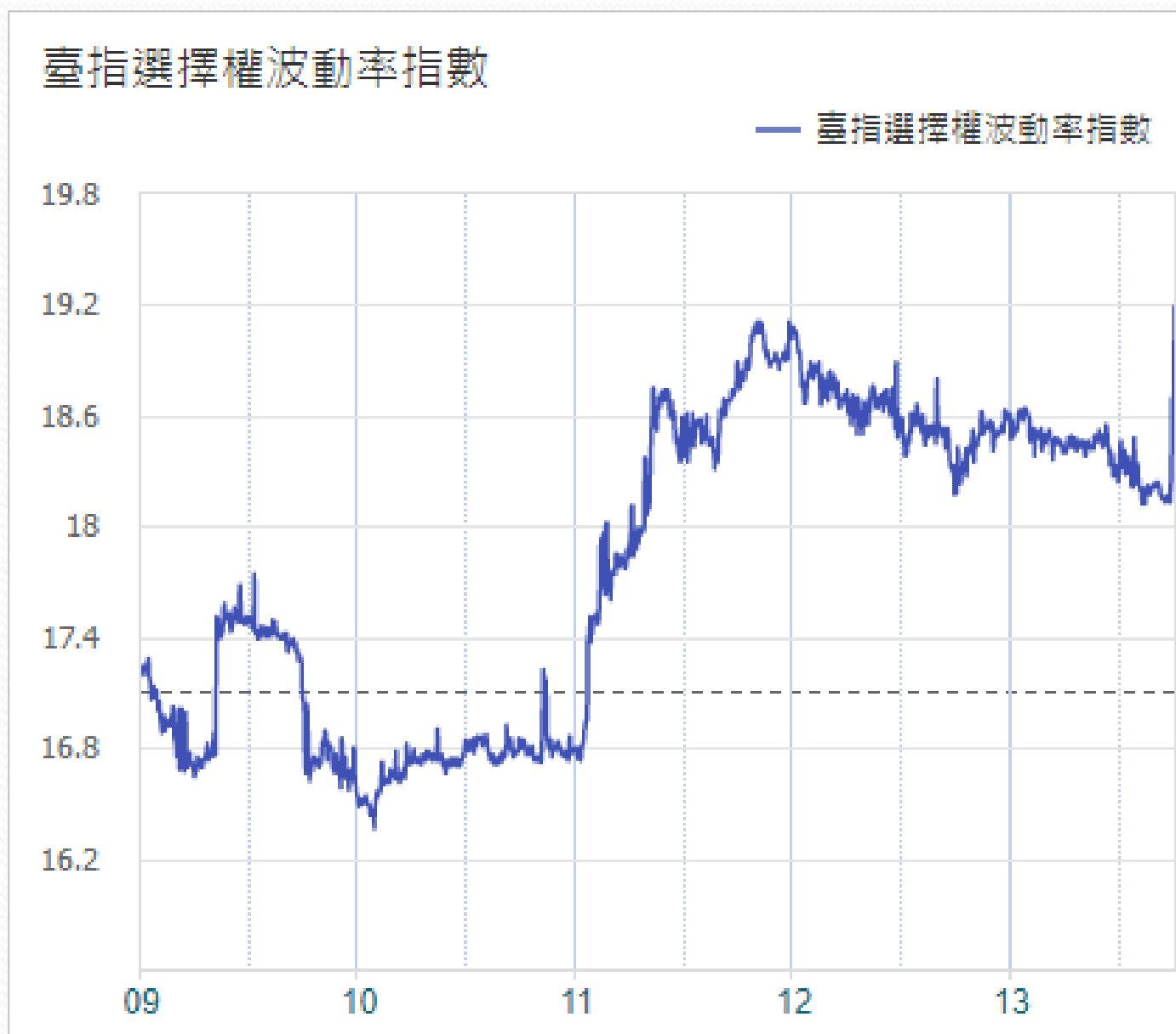
台指選擇權匯報

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	17.86%	較前一交易日	+0.69%
	買權隱含波動率	14.95%	較前一交易日	+0.89%
	賣權隱含波動率	21.72%	較前一交易日	-1.15%
	成交量P/C_Ratio值	0.798	較前一交易日	-0.18
	未平倉P/C_Ratio值	0.954	較前一交易日	+0.01
電子選擇權	買權成交最大量	420	買權OI最大量	420
	賣權成交最大量	420	賣權OI最大量	420
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

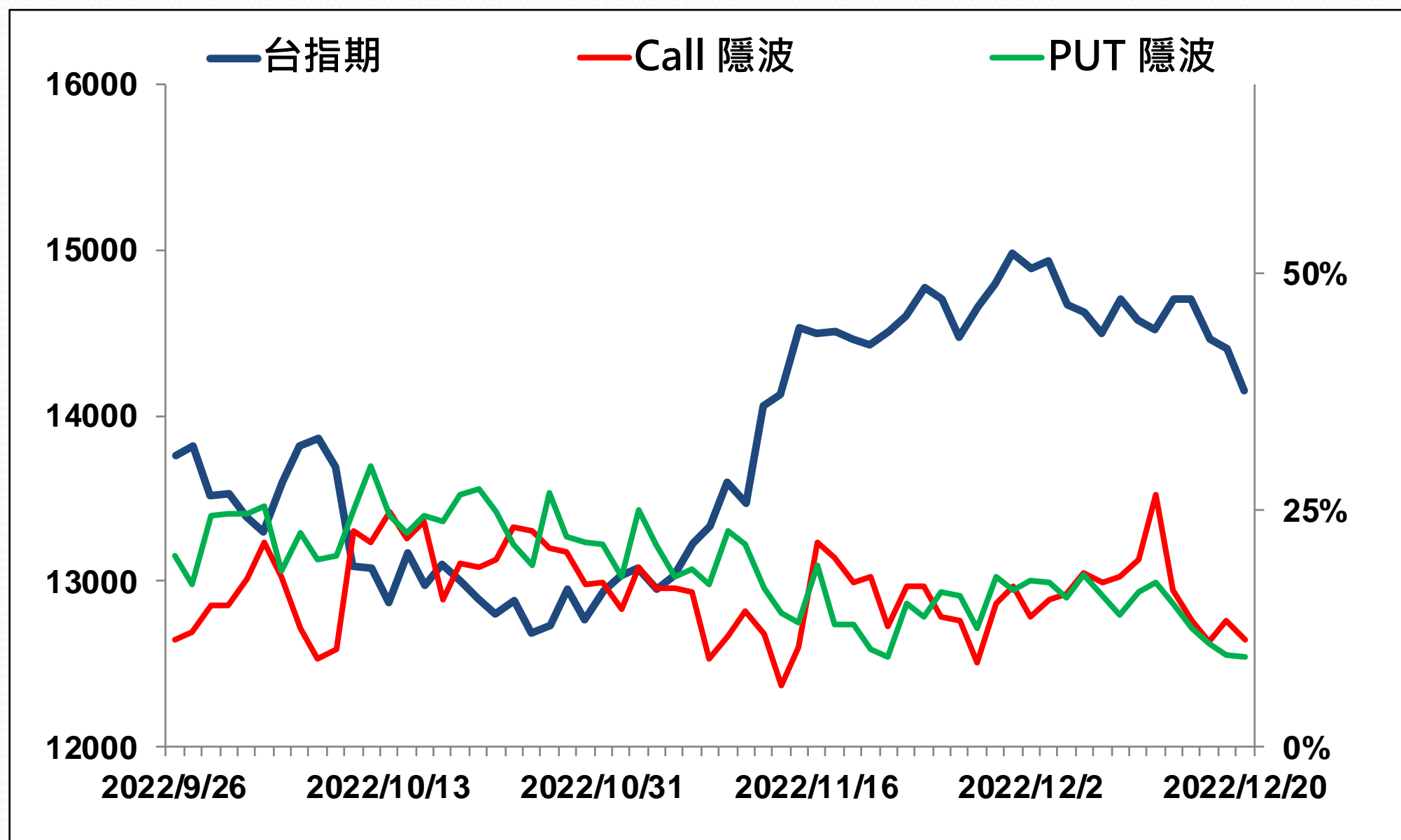
更新日期：2022年12月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



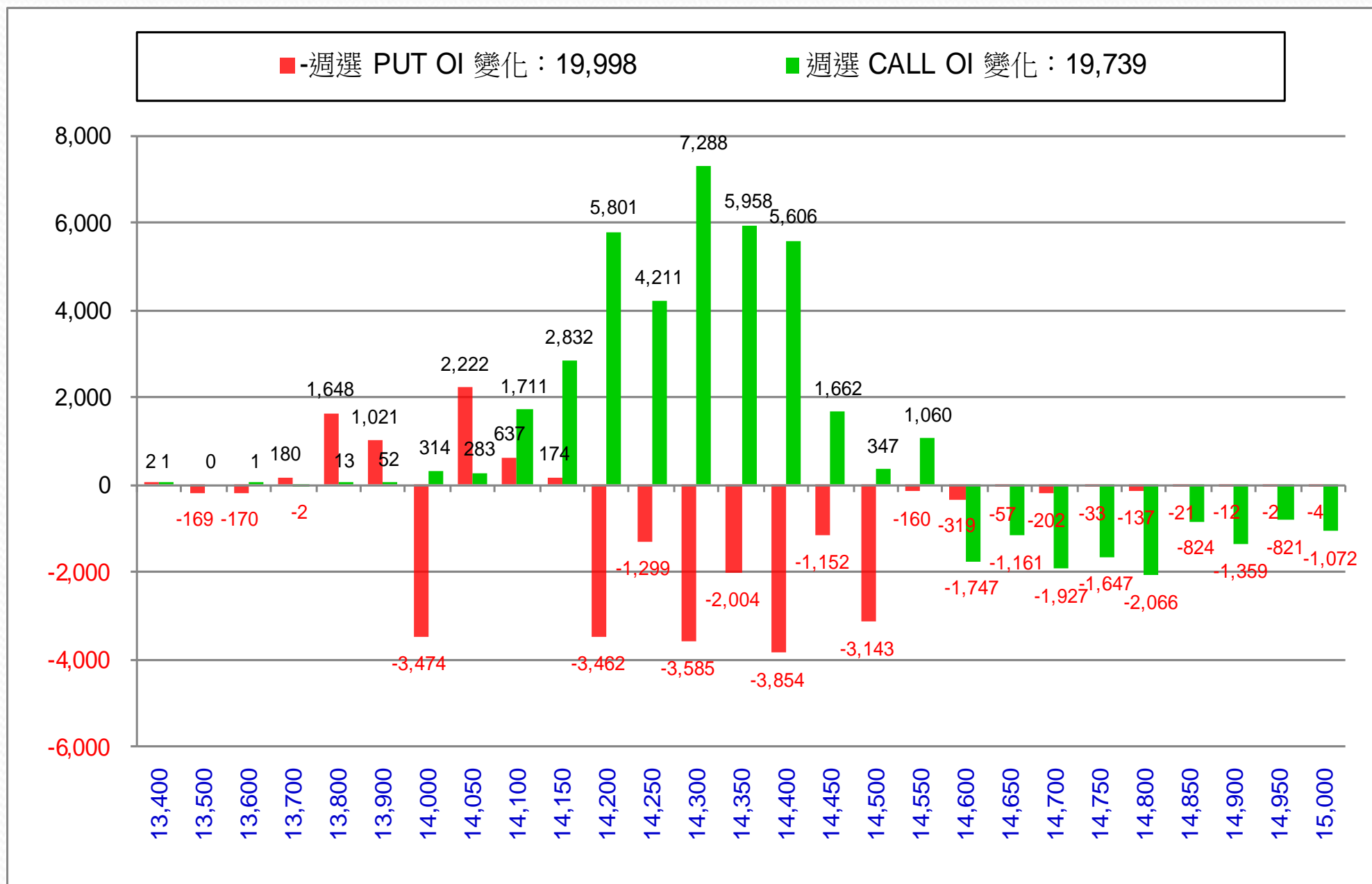
更新日期：2022年12月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年12月20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

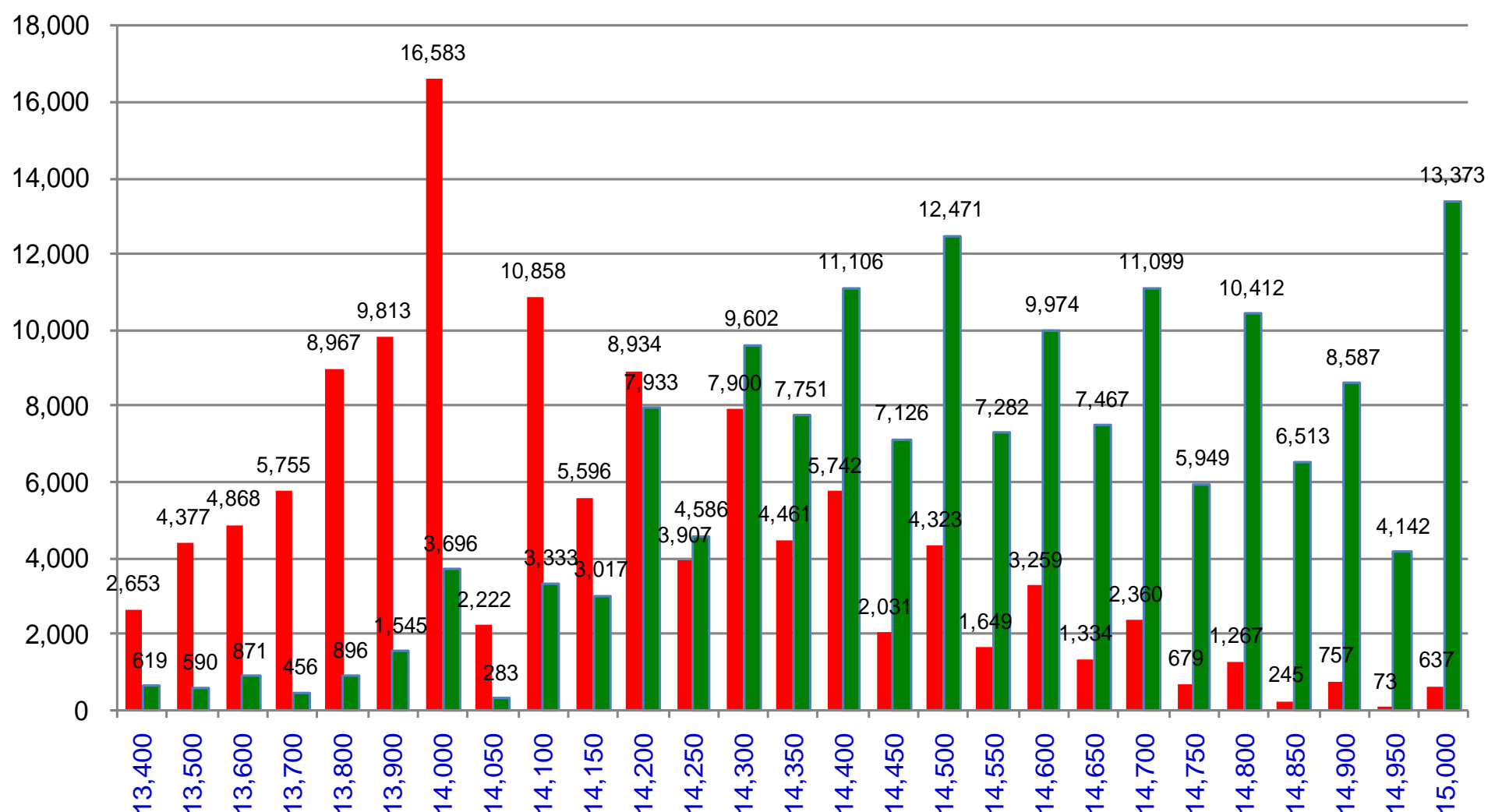


更新日期：2022年12月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：188,588

週選 CALL OI 總額：254,203



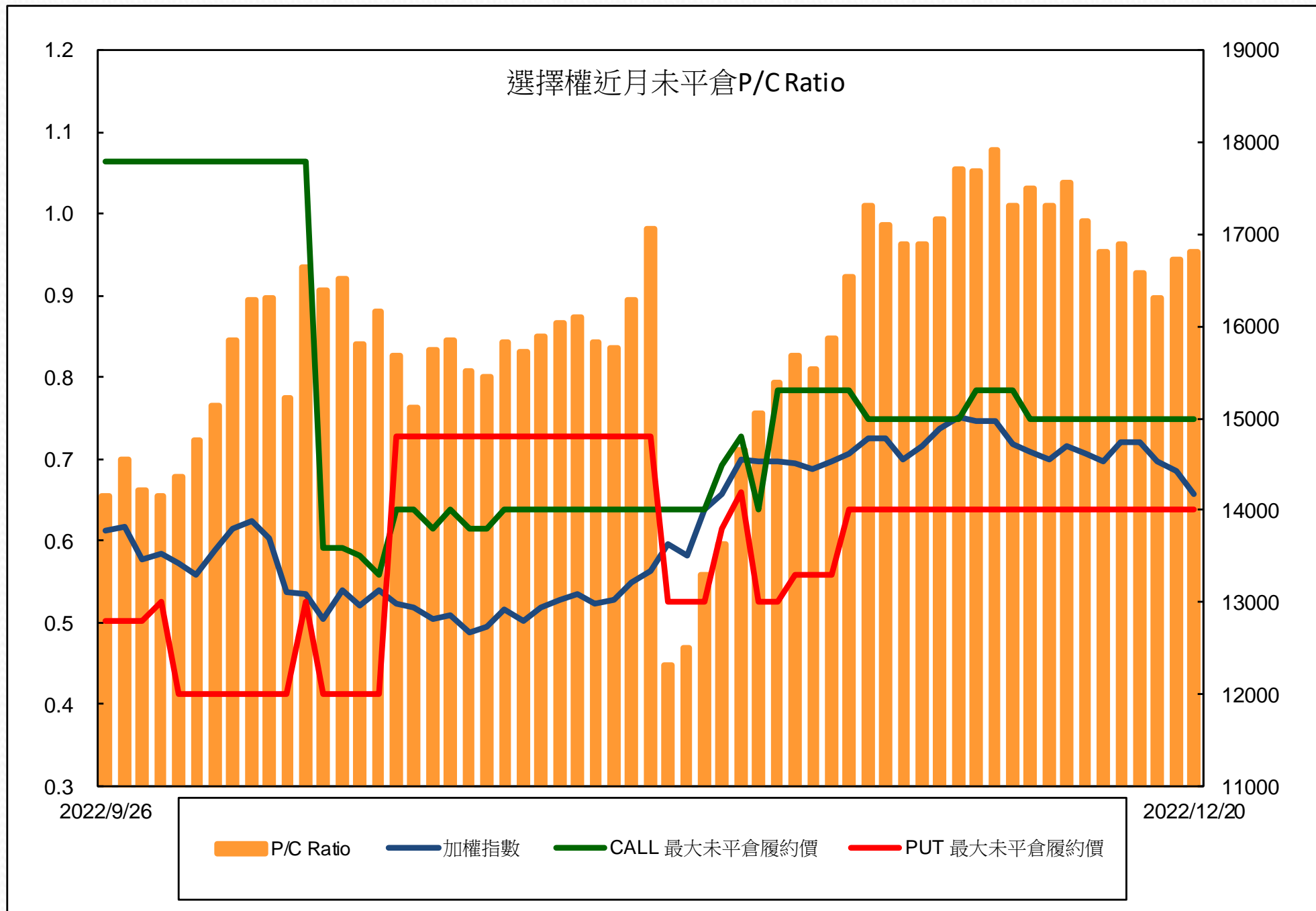
更新日期：2022年12月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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19日	77,873	107,718	-29,845
	12月20日	75,405	114,179	-38,774
Put	12月19日	72,824	58,029	14,795
	12月20日	76,215	59,973	16,242

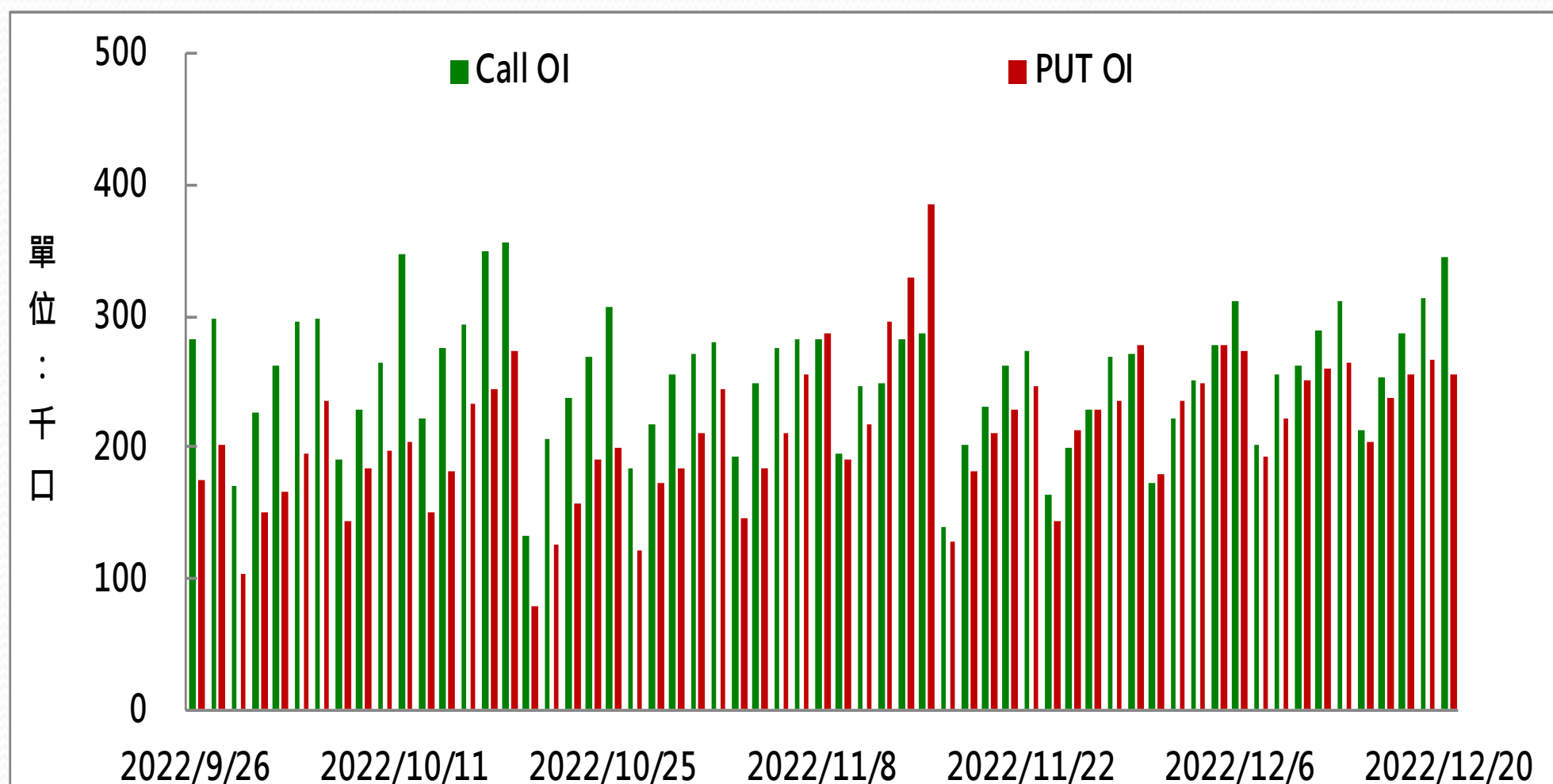
更新日期：2022年12月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年12月20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20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20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