

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/12/21 結算日：2022/12/28					日期：2022/12/21 結算日：2023/1/18				
202212W4					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
11	46	13,800	3,533	1,527	0	26	13,300	1,326	185
130	130	13,850	1,189	1,189	0	62	13,400	1,681	257
16	48	13,900	2,897	1,282	21	55	13,500	4,427	646
136	136	13,950	726	726	7	42	13,600	1,880	202
158	257	14,000	3,586	1,789	3	63	13,700	1,205	220
29	41	14,050	1,163	727	47	219	13,800	1,408	333
155	266	14,100	2,794	1,646	-1	69	13,900	930	68
876	1,069	14,150	1,318	571	-16	180	14,000	1,367	141
※ 2,941	3,457	14,200	2,925	1,535	25	231	14,100	1,563	173
1,409	1,707	14,250	1,035	295	111	423	14,200	725	200
1,342	1,887	14,300	1,365	307	220	592	14,300	769	134
721	1,238	14,350	829	-16	175	1,033	14,400	758	-29
1,600	2,354	14,400	651	-16	139	905	14,500	494	-8
1,482	3,417	14,450	383	25	281	1,162	14,600	318	-20
1,429	3,561	14,500	299	16	202	1,902	14,700	797	40
1,100	2,106	14,550	415	16	666	1,882	14,800	216	-6
2,743	4,979	14,600	433	55	624	1,816	14,900	120	0
1,280	2,799	14,700	126	-25	※ 693	5,253	15,000	92	-1
624	3,061	14,800	108	-1	128	1,884	15,100	51	4
-19	1,585	14,900	42	-3	24	1,968	15,200	55	1
339	3,322	15,000	1	-3	51	1,596	15,300	26	0
144	819	15,100	2	0	-84	1,596	15,400	26	-10
32	607	15,200	0	0	121	1,510	15,500	28	0
-17	774	15,300	11	0	71	1,230	15,600	35	1
-24	933	15,400	0	0	12	631	15,700	3	0
-13	643	15,500	0	0	-61	816	15,800	379	295
-193	79	15,600	1	1	2	440	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
18,440	41,626	0.9417	39,198	20,689	3,326	35,966	1.0406	37,425	6,302
昨日 P/C	0.7419	今日增減變化	0.1998		昨日 P/C	0.9535	今日增減變化	0.0870	

更新日期：2022年12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12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	101,443,870	62,815,475	38,628,395	8,306,113	3,954,997	620,085	3,334,912	745,387
投信	47,130,776	68,463,444	-21,332,668	-1,000,634	359,545	0	359,545	3,030
自營商	24,486,380	13,381,103	11,105,277	-2,846,616	768,593	703,458	65,135	-46,487
	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	539,018	1,121,217	-582,199	348,949	11,218	14,023	-2,805	75,288
投信	71,472	0	71,472	-38	0	0	0	0
自營商	247,174	134,010	113,164	-134,170	30,851	33,655	-2,804	-92,053

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	16,744	4,265	12,479	-30,160	10,472	7,411	3,061	-6,468
投信	0	0	0	-550	200	141	59	-420
自營商	34,166	39,777	-5,611	33,163	34,654	34,282	372	-15,870
特定法人(週)	1,524	0	1,524	---	860	2,435	-1,575	---
特定法人(近月)	7,903	1,229	6,674	---	1,615	5,460	-3,845	---
特定法人(全月)	12,875	0	12,875	-29,039	4,540	6,437	-1,897	9,726
十大交易人(週)	20,694	27,823	-7,129	---	21,738	15,845	5,893	---
十大交易人(近月)	19,237	15,341	3,896	---	15,783	18,949	-3,166	---
十大交易人(全月)	46,255	48,975	-2,720	19,702	45,054	40,848	4,206	-6,283
全市場未沖銷(近月)			35,966	---			37,425	---
全市場未沖銷(全月)			106,093	-238,234			98,411	-158,266

更新日期：2022年12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12W4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	14600
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	11.46%	較前一交易日	+1.39%
	買權隱含波動率	9.62%	較前一交易日	-1.52%
	賣權隱含波動率	13.42%	較前一交易日	+4.36%
電子選擇權	買權成交最大量	355	買權OI最大量	640
	賣權成交最大量	620	賣權OI最大量	620
金融選擇權	買權成交最大量	1580	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1420	賣權OI最大量	1480

更新日期：2022年12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

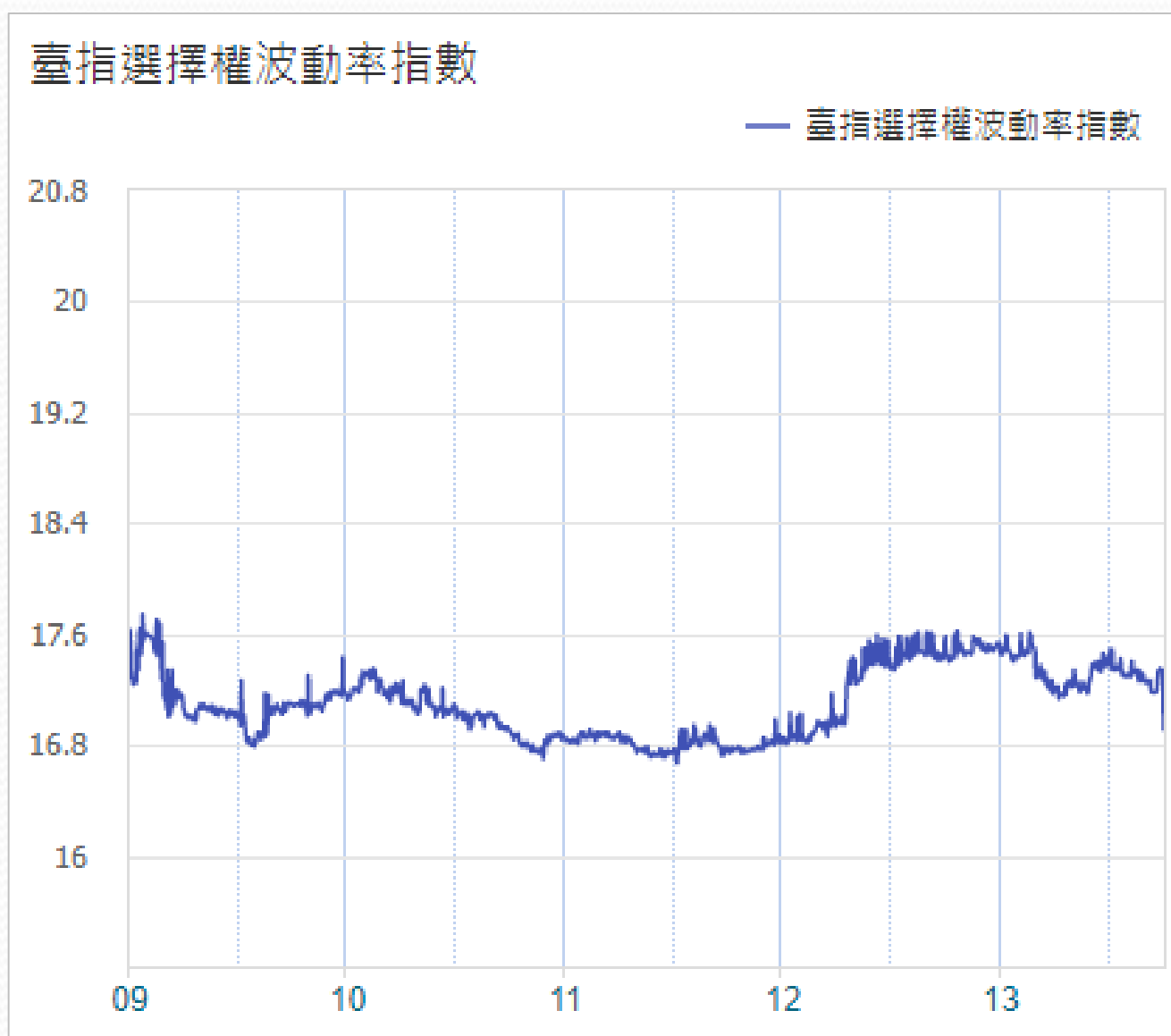
## 2023年01月選擇權分析表

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	17.56%	較前一交易日	+0.29%
	買權隱含波動率	12.95%	較前一交易日	-2.00%
	賣權隱含波動率	22.10%	較前一交易日	+0.38%
	成交量P/C_Ratio值	0.981	較前一交易日	+0.18
	未平倉P/C_Ratio值	1.041	較前一交易日	+0.09
電子選擇權	買權成交最大量	425	買權OI最大量	640
	賣權成交最大量	620	賣權OI最大量	620
金融選擇權	買權成交最大量	1580	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1420	賣權OI最大量	1480

更新日期：2022年12月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

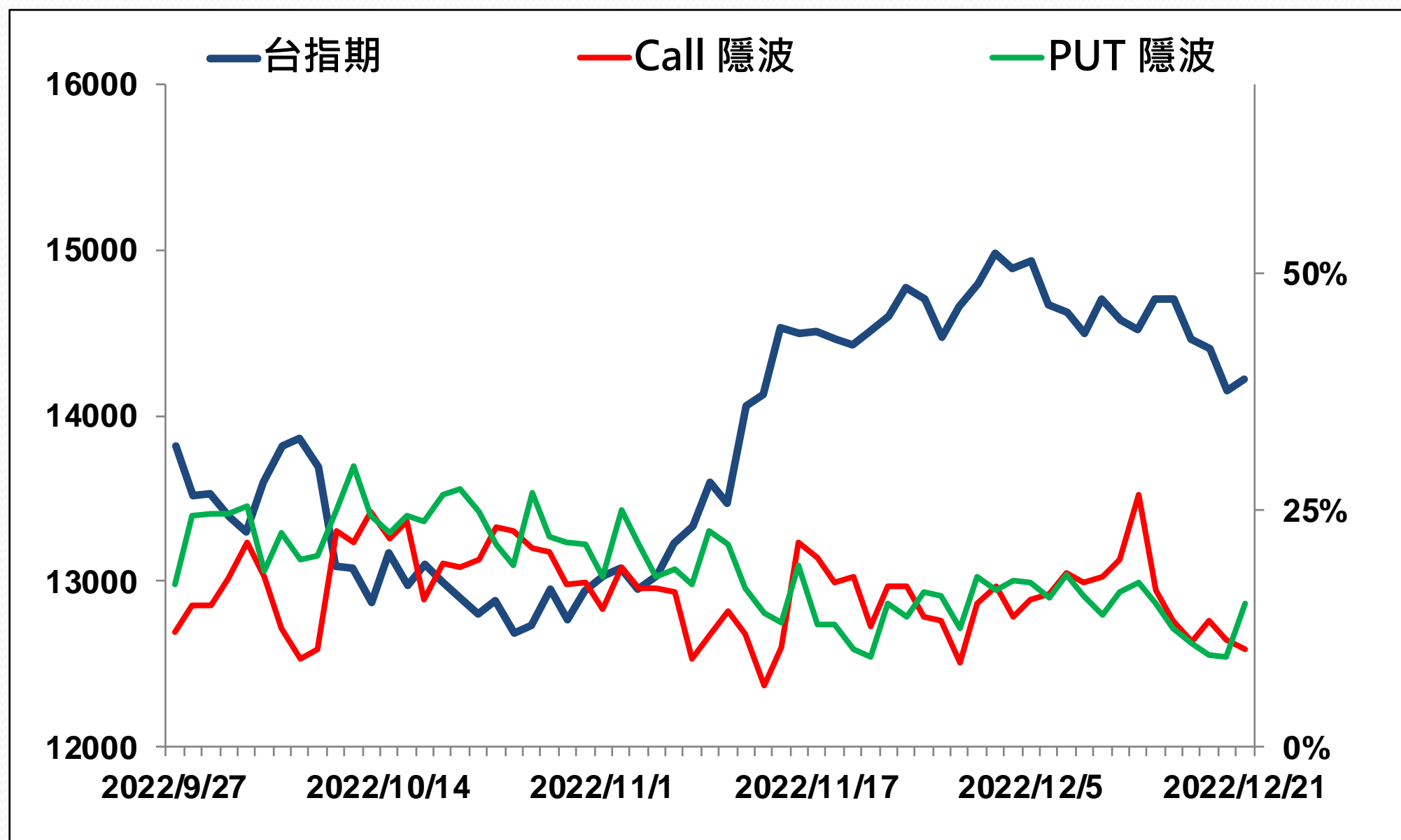


# 選擇權當日波動率指數



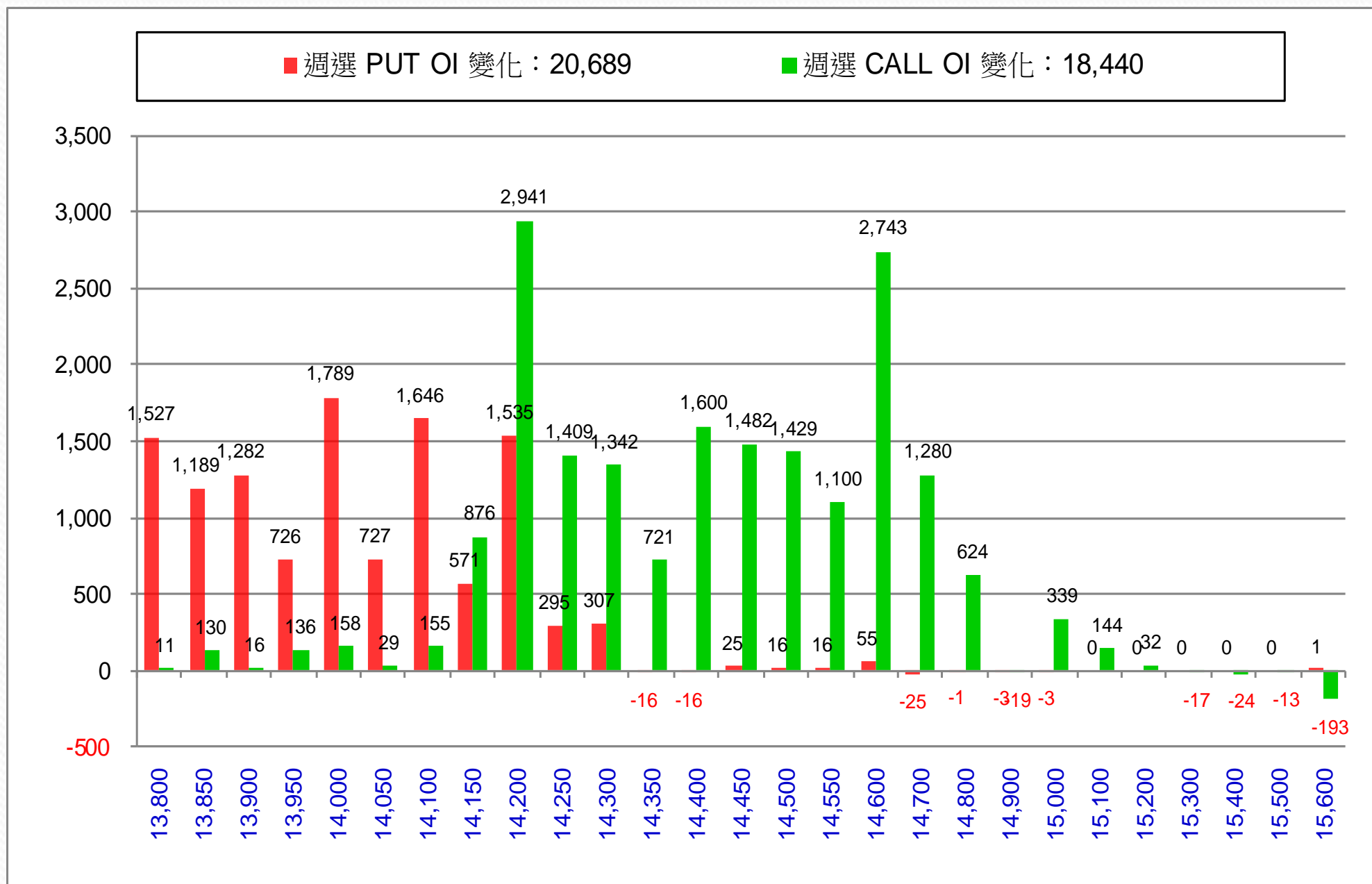
更新日期：2022年12月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2022年12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



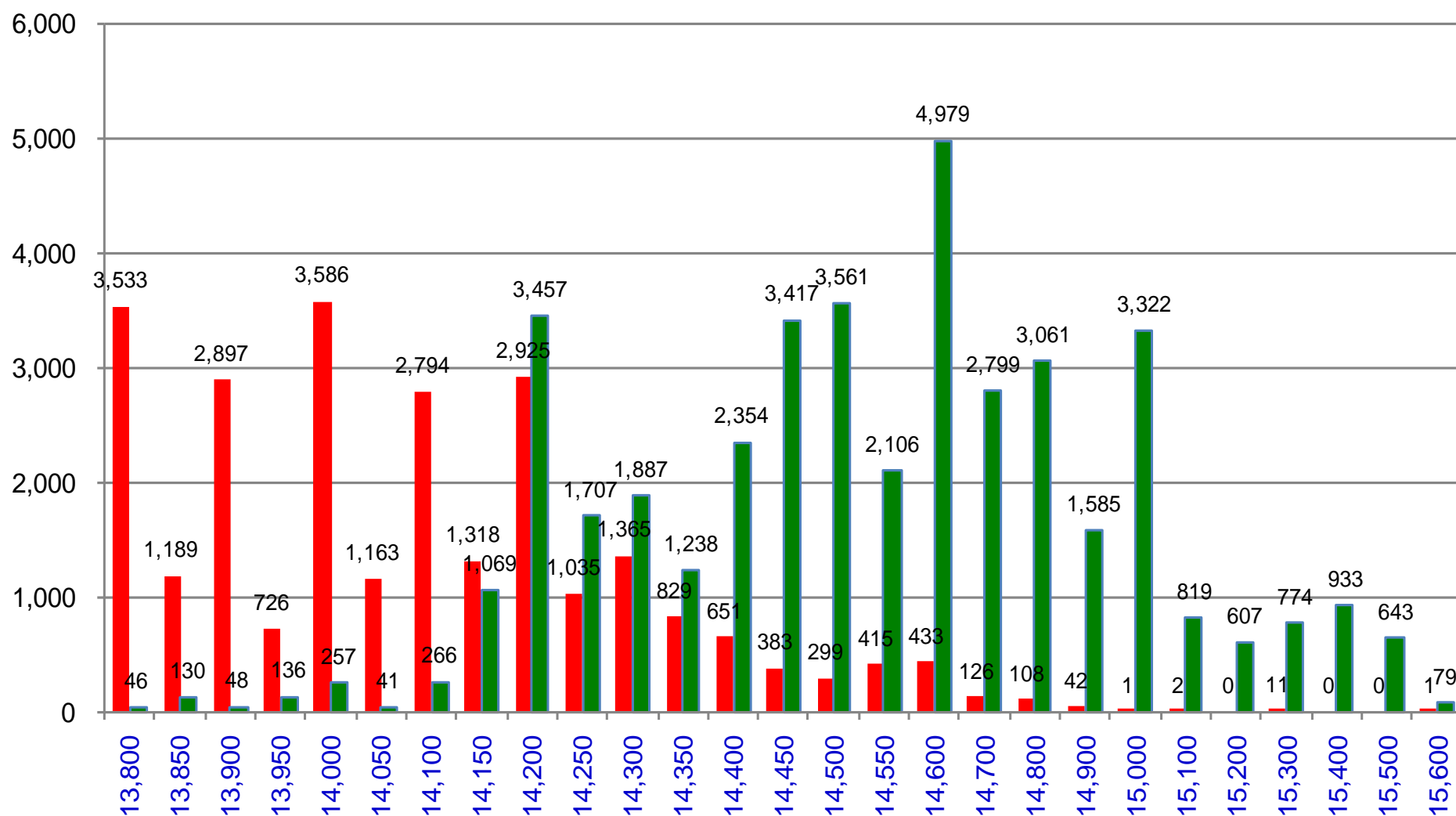
更新日期：2022年12月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理



# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：39,198

週選 CALL OI 總額：41,626



更新日期：2022年12月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

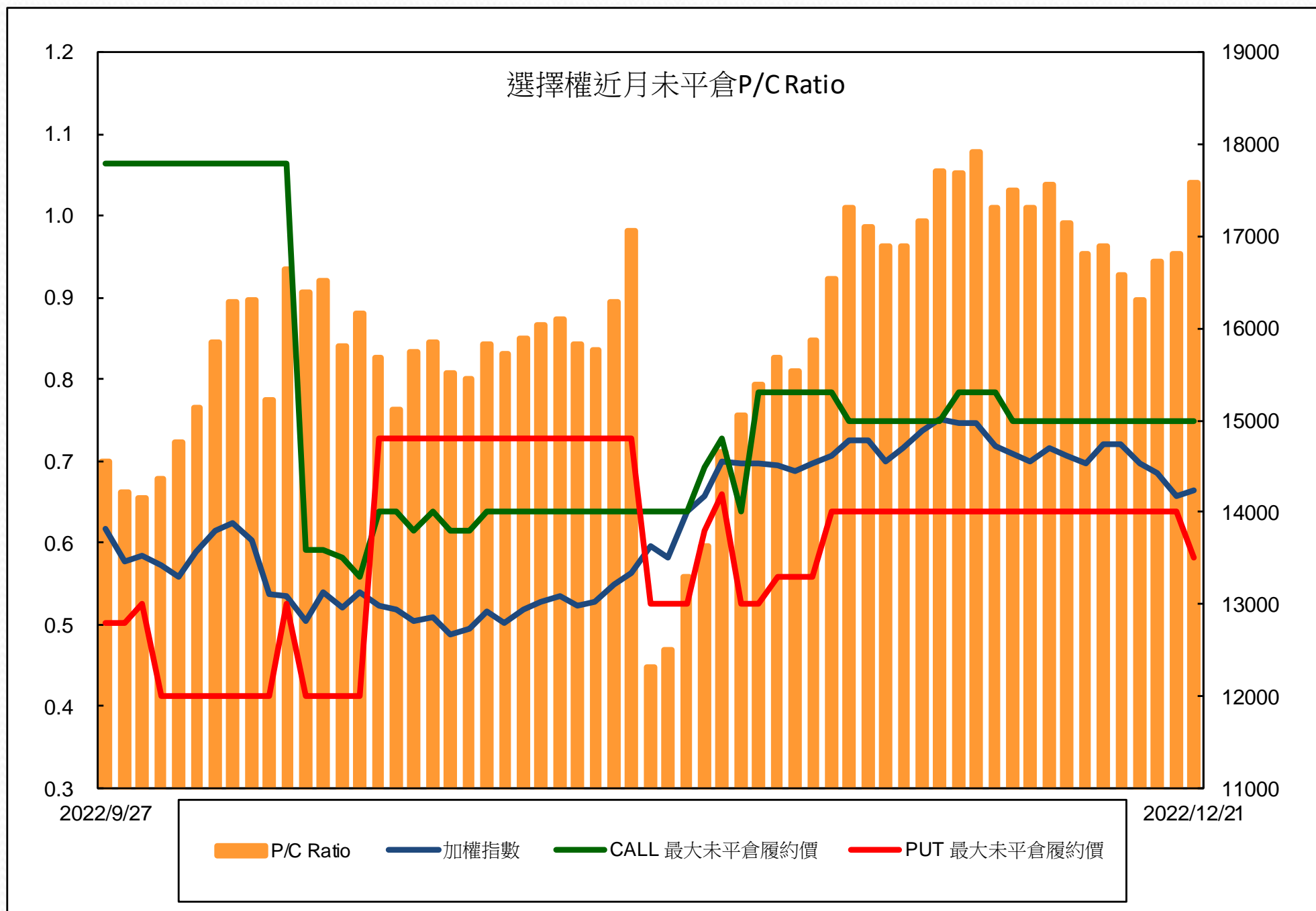


# 自營商選擇權OI部位統計

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	12月20日	75,405	114,179	-38,774
	12月21日	34,166	39,777	-5,611
Put	12月20日	76,215	59,973	16,242
	12月21日	34,654	34,282	372

更新日期：2022年12月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

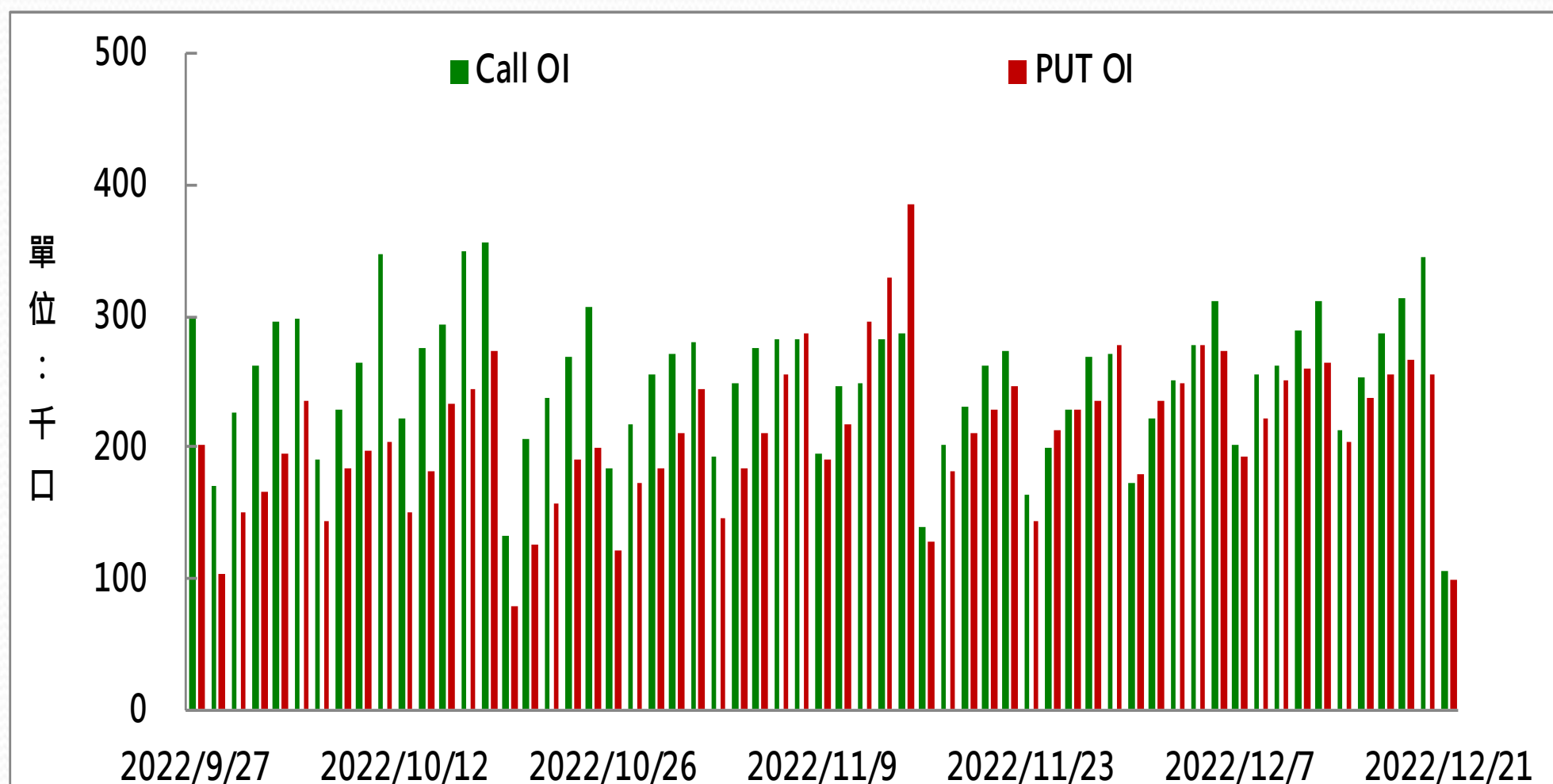
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年12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12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12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