

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/12/22 結算日：2022/12/28					日期：2022/12/22 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
184	441	14,000	12,854	9,268 ※	24	79	13,500	4,521	94
28	69	14,050	3,135	1,972	47	89	13,600	2,616	736
132	398	14,100	6,158	3,364	6	69	13,700	1,381	176
156	1,225	14,150	4,187	2,869	14	233	13,800	2,096	688
-114	3,343	14,200	6,292	3,367	2	71	13,900	1,483	553
-2	1,705	14,250	3,153	2,118	64	244	14,000	2,089	722
444	2,331	14,300	4,518	3,153	1,890	2,121	14,100	1,787	224
1,747	2,985	14,350	2,268	1,439	67	490	14,200	951	226
1,040	3,394	14,400	1,869	1,218	333	925	14,300	1,018	249
115	3,532	14,450	793	410	764	1,797	14,400	1,244	486
2,061	5,622	14,500	759	460	482	1,387	14,500	544	50
※ 2,824	4,930	14,550	611	196	235	1,397	14,600	422	104
2,116	7,095	14,600	540	107	96	1,998	14,700	814	17
2,769	4,911	14,650	257	7	748	2,630	14,800	253	37
2,239	5,038	14,700	160	34	940	2,756	14,900	143	23
768	3,829	14,800	118	10	3,419	8,672	15,000	91	-1
325	1,910	14,900	42	0	※ 4,058	5,942	15,100	52	1
487	3,809	15,000	2	1	426	2,394	15,200	78	23
520	1,339	15,100	2	0	1,305	2,901	15,300	26	0
65	672	15,200	0	0	164	1,760	15,400	16	-10
-42	732	15,300	11	0	910	2,420	15,500	28	0
-86	847	15,400	0	0	63	1,293	15,600	35	0
-62	581	15,500	0	0	118	749	15,700	3	0
0	79	15,600	1	0	127	943	15,800	379	0
0	171	15,700	0	0	-8	432	15,900	23	0
0	28	15,800	0	0	322	1,316	16,000	16	0
-1	7	15,900	0	0	-9	466	16,100	0	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
17,770	61,538	1.3525	83,233	43,785	19,083	55,049	0.8532	46,969	9,544
昨日 P/C	0.9417	今日增減變化	0.4108		昨日 P/C	1.0406	今日增減變化	-0.1873	

更新日期：2022年12月22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22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	106,412,844	62,438,828	43,974,016	5,345,621	4,249,551	721,921	3,527,630	192,718
投信	47,856,796	68,690,471	-20,833,675	498,993	364,927	0	364,927	5,382
自營商	27,702,171	14,119,727	13,582,444	2,477,167	825,053	827,697	-2,644	-67,779
	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	592,342	1,289,656	-697,314	-115,115	61,344	11,413	49,931	52,736
投信	71,981	0	71,981	509	0	0	0	0
自營商	299,920	161,957	137,963	24,799	14,266	105,568	-91,302	-88,498

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22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	21,339	9,594	11,745	-734	12,604	9,977	2,627	-434
投信	0	100	-100	-100	300	141	159	100
自營商	52,318	52,984	-666	4,945	49,060	49,248	-188	-560
特定法人(週)	1,524	0	1,524	0	0	1,070	-1,070	505
特定法人(近月)	9,807	3,483	6,324	-350	2,051	6,141	-4,090	-245
特定法人(全月)	14,026	3,483	10,543	-2,332	2,812	4,867	-2,055	-158
十大交易人(週)	26,308	31,260	-4,952	2,177	37,333	27,117	10,216	4,323
十大交易人(近月)	32,188	25,462	6,726	2,830	18,624	24,503	-5,879	-2,713
十大交易人(全月)	67,802	64,181	3,621	6,341	61,939	57,598	4,341	135
全市場未沖銷(近月)			55,049	19,083			46,969	9,544
全市場未沖銷(全月)			153,018	46,925			158,137	59,726

更新日期：2022年12月22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	14500	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	8.39%	較前一交易日	-3.07%
	買權隱含波動率	8.46%	較前一交易日	-1.16%
	賣權隱含波動率	8.32%	較前一交易日	-5.10%
電子選擇權	買權成交最大量	660	買權OI最大量	640
	賣權成交最大量	640	賣權OI最大量	620
金融選擇權	買權成交最大量	1560	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1480	賣權OI最大量	1480

更新日期：2022年12月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

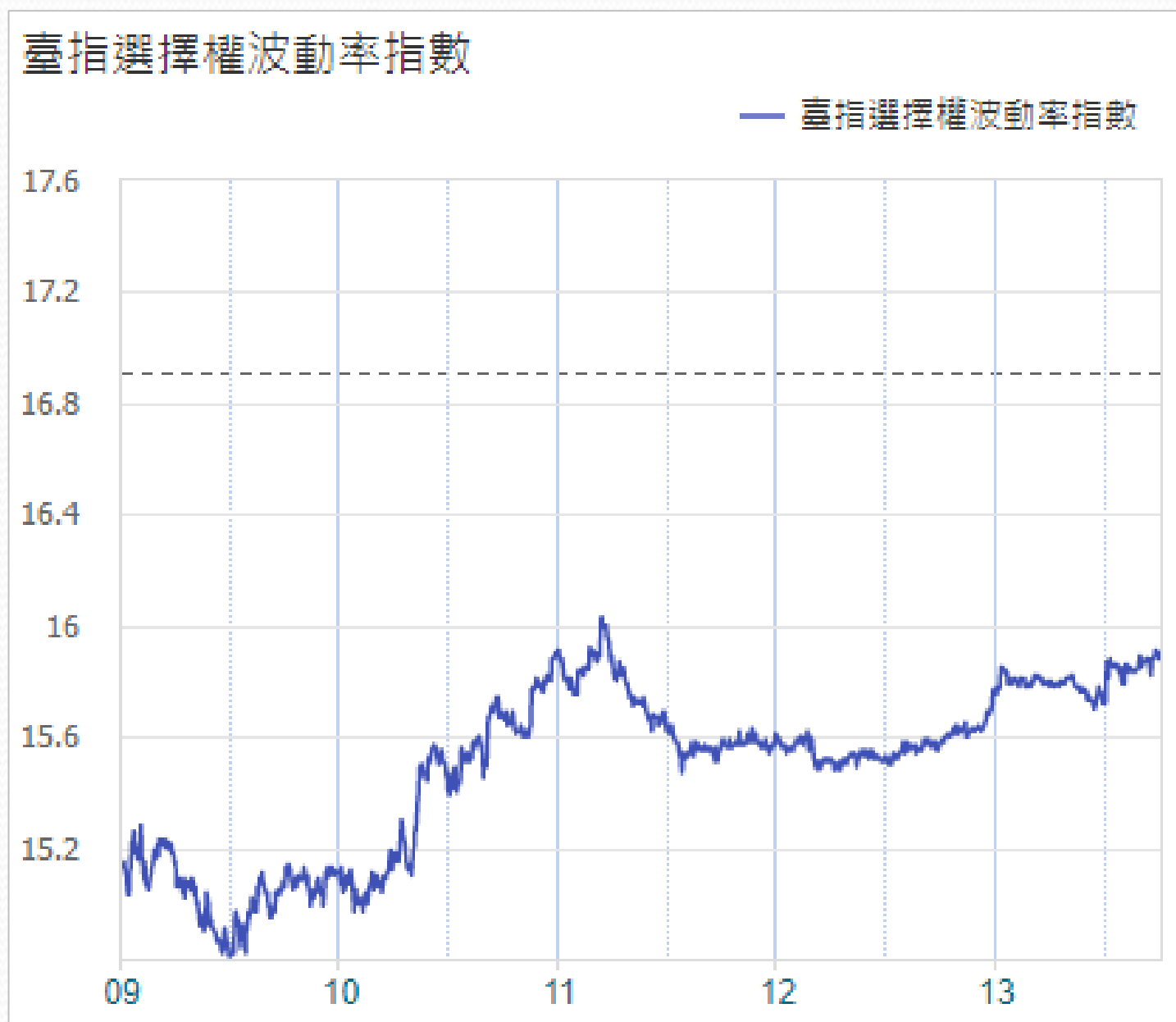
# 台指選擇權匯報

## 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	12900	賣權OI最大量	13500
	整體隱含波動率	16.54%	較前一交易日	+1.02%
	買權隱含波動率	12.85%	較前一交易日	-0.10%
	賣權隱含波動率	21.34%	較前一交易日	-0.77%
	成交量P/C_Ratio值	0.775	較前一交易日	-0.21
	未平倉P/C_Ratio值	0.853	較前一交易日	-0.19
電子選擇權	買權成交最大量	660	買權OI最大量	640
	賣權成交最大量	640	賣權OI最大量	620
金融選擇權	買權成交最大量	1560	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1480	賣權OI最大量	1480

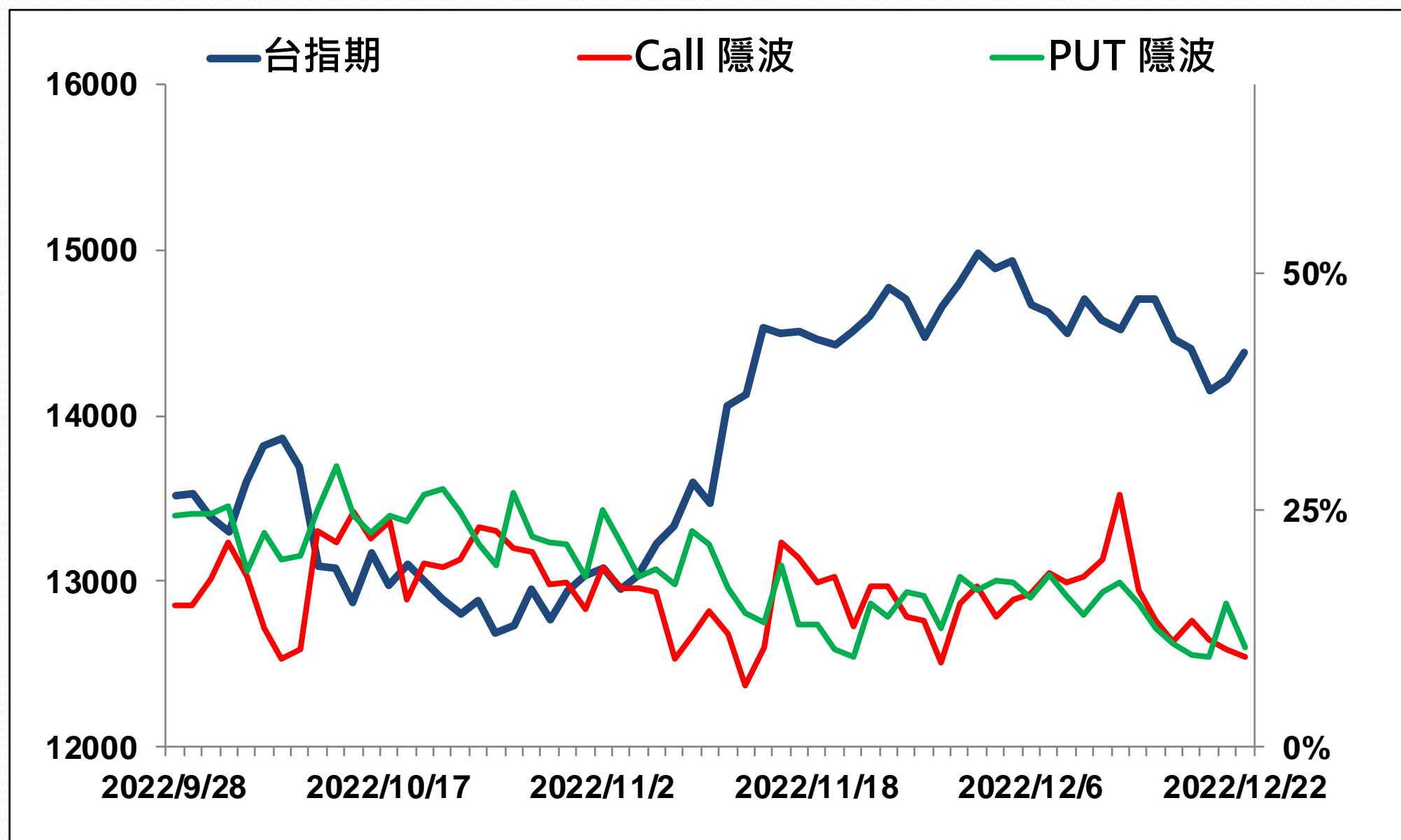
更新日期：2022年12月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權當日波動率指數



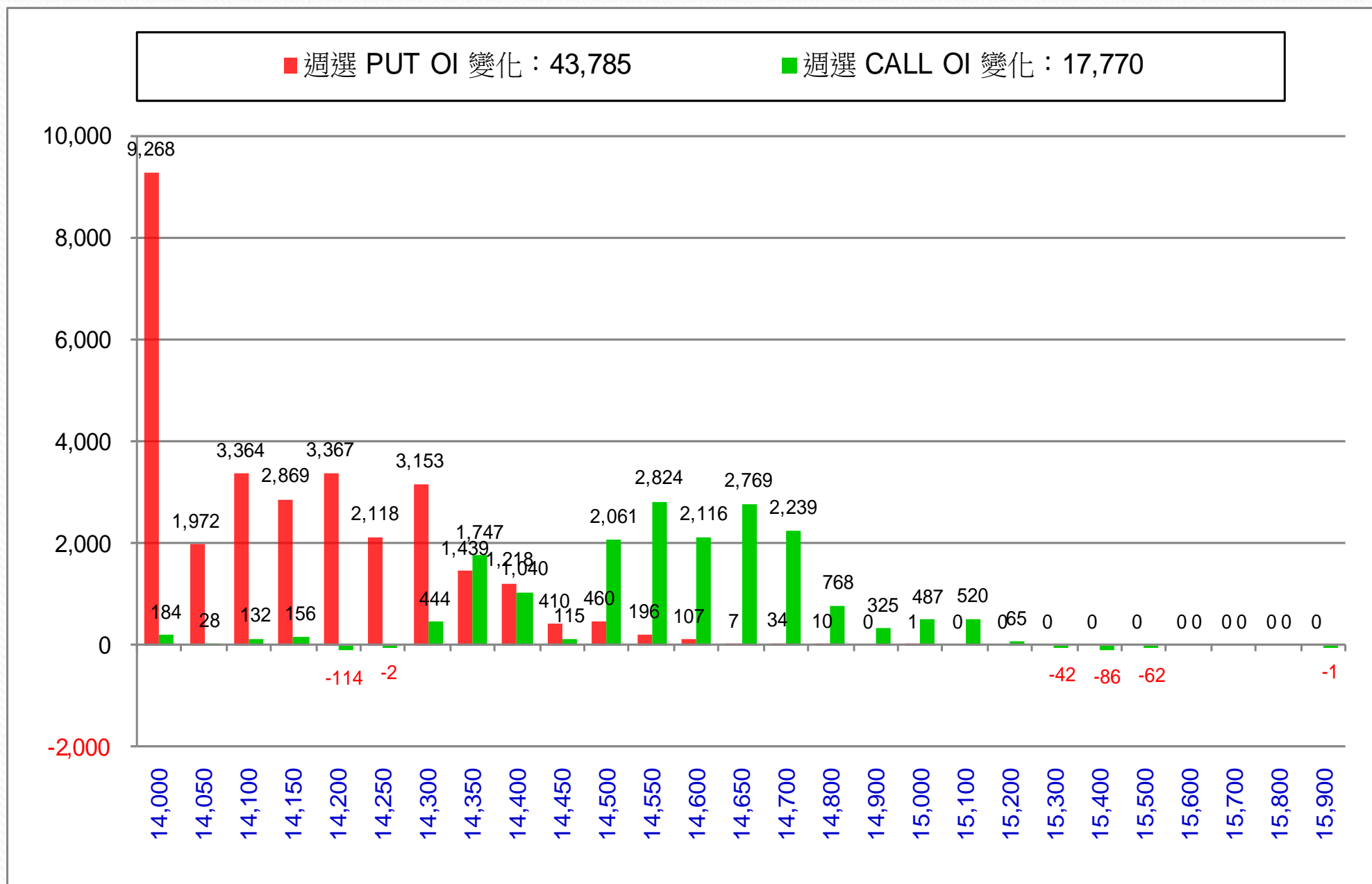
更新日期：2022年12月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2022年12月22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

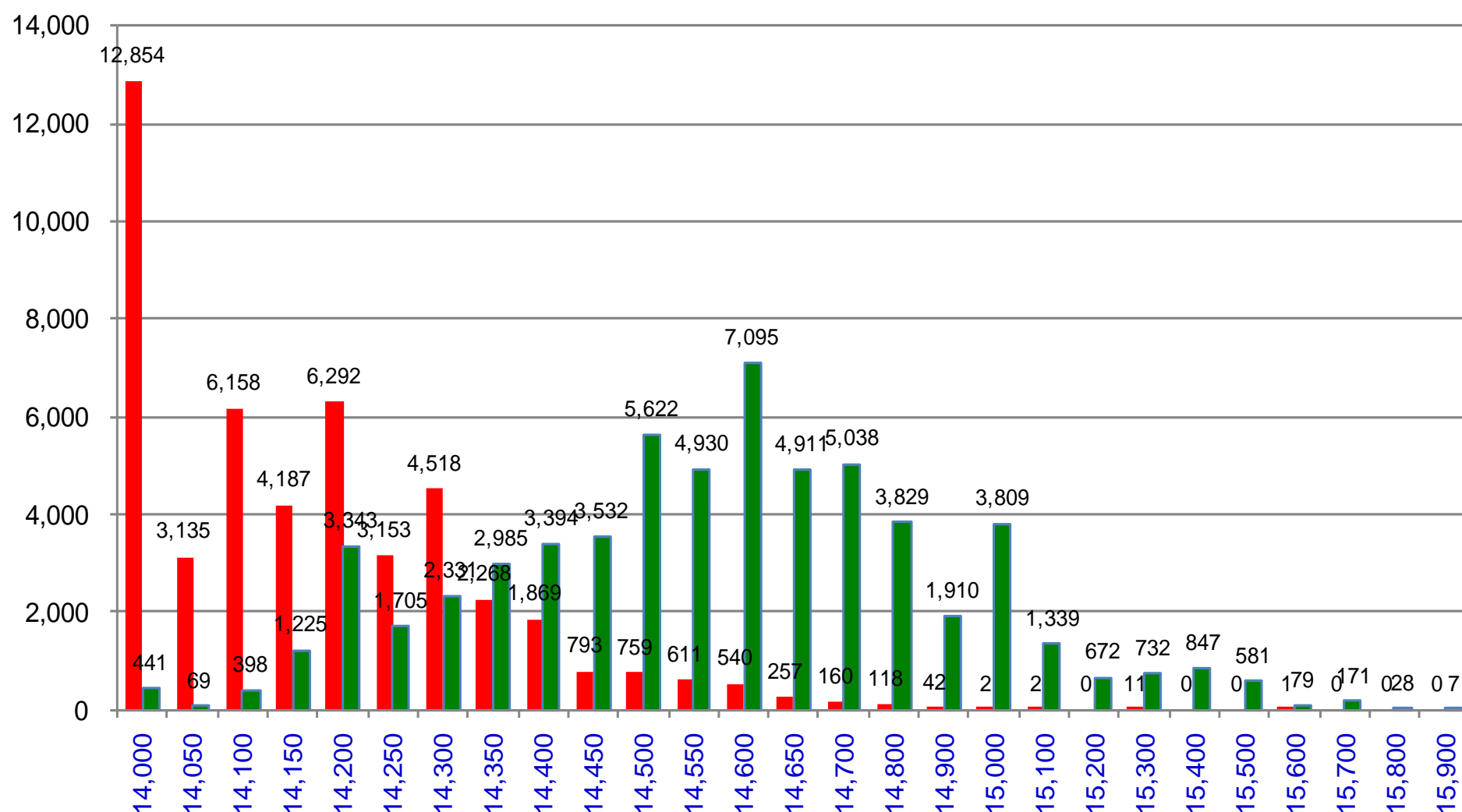


更新日期：2022年12月22日    資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：83,233

週選 CALL OI 總額：61,538



更新日期：2022年12月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

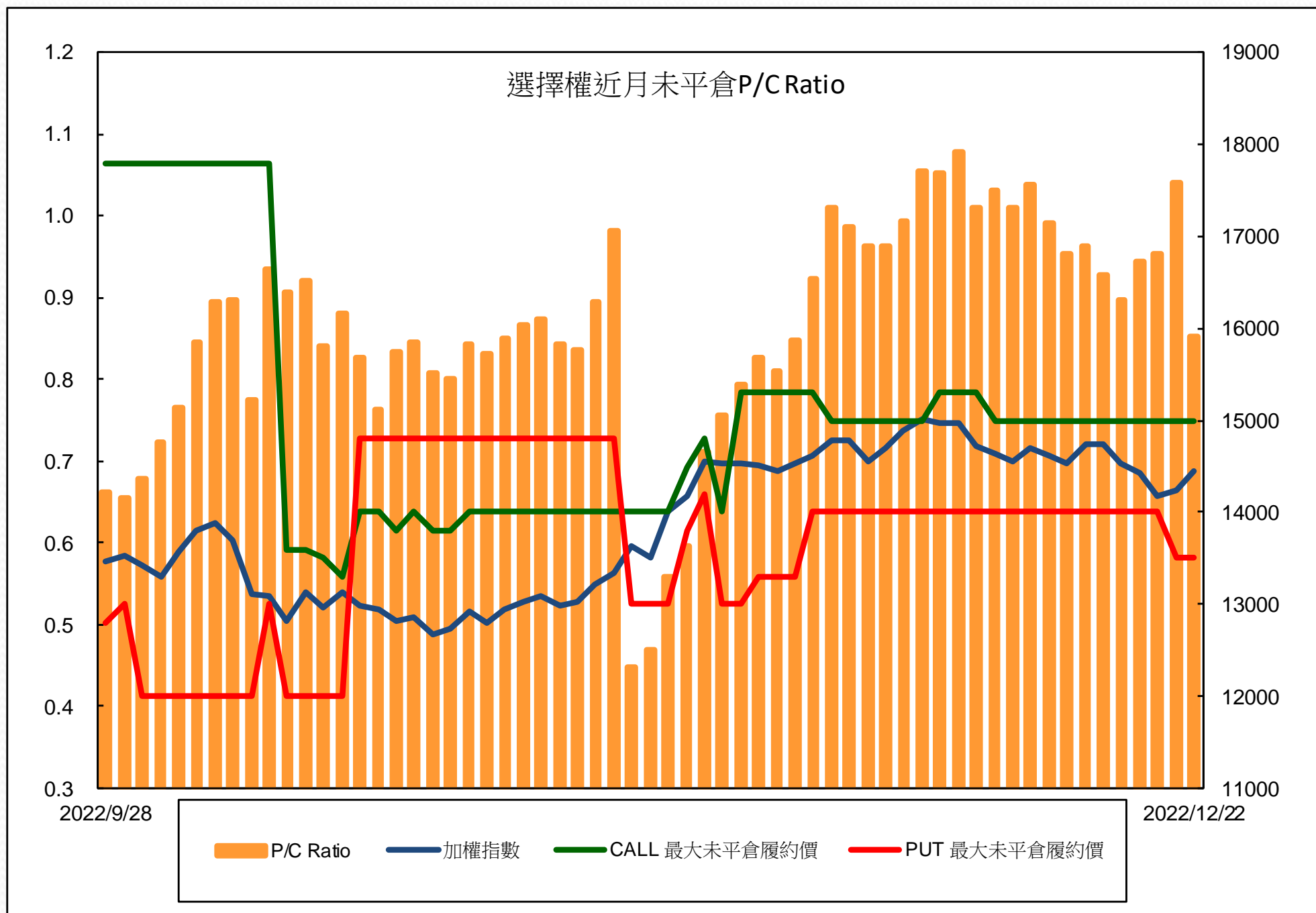


# 自營商選擇權OI部位統計

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21日	34,166	39,777	-5,611
	12月22日	52,318	52,984	-666
Put	12月21日	34,654	34,282	372
	12月22日	49,060	49,248	-188

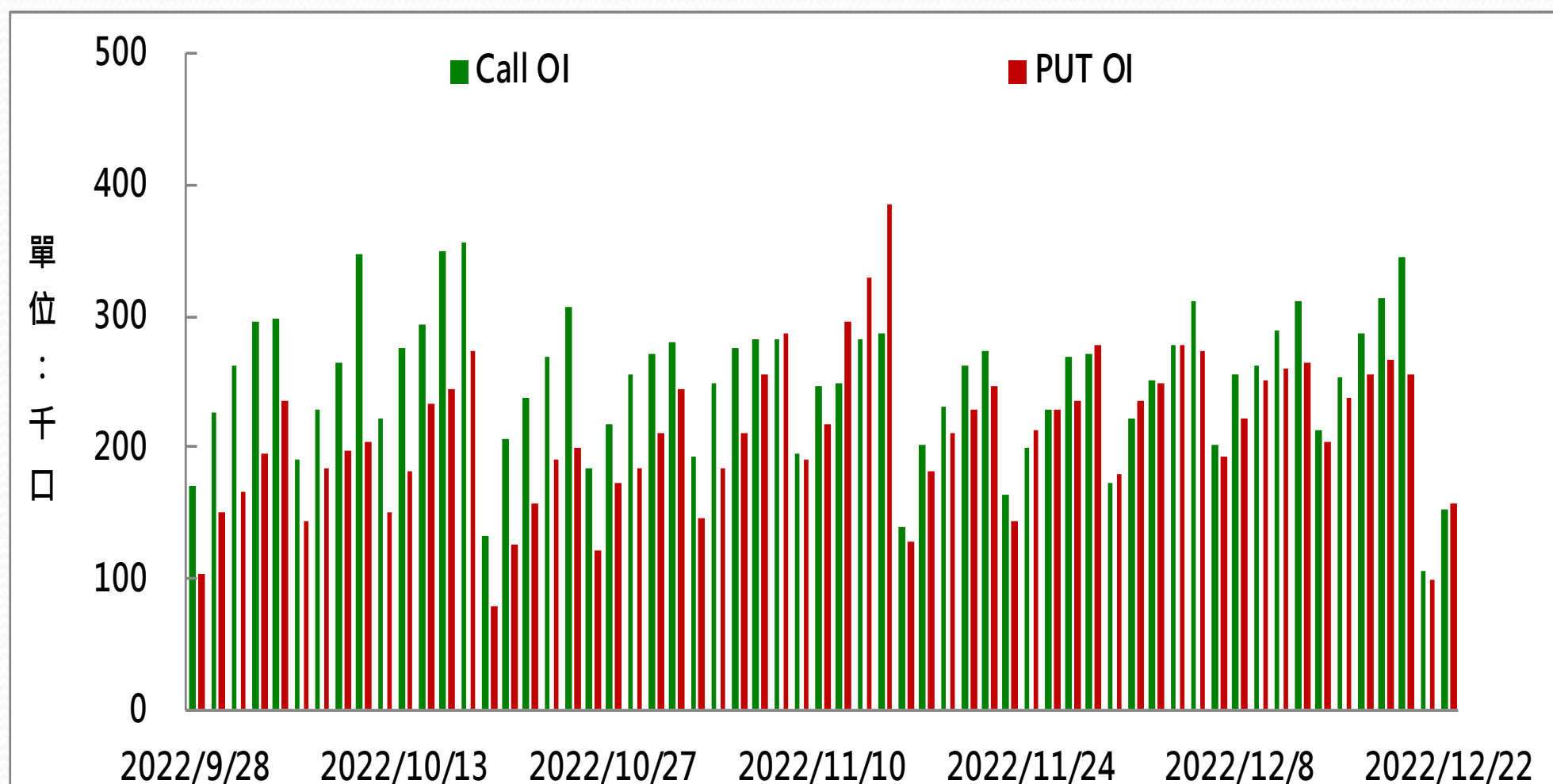
更新日期：2022年12月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年12月22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22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22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