

台指選擇權OI匯報

日期：2022/12/23 結算日：2022/12/28					日期：2022/12/23 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
5	37	13,800	6,118	1,752	1	62	13,400	2,485	181
0	132	13,850	4,413	1,435	45	124	13,500	4,706	185
122	192	13,900	6,225	1,638	23	112	13,600	2,830	214
22	190	13,950	5,002	2,374	28	97	13,700	1,841	460
-48	393	14,000	10,209	-2,645	29	262	13,800	2,651	555
129	198	14,050	4,644	1,509	25	96	13,900	1,456	-27
420	818	14,100	8,253	2,095	60	304	14,000	1,902	-187
884	2,109	14,150	4,077	-110	5	2,126	14,100	1,780	-7
3,951	7,294	14,200	6,542	250	44	534	14,200	930	-21
1,841	3,546	14,250	3,349	196	142	1,067	14,300	1,000	-18
3,607	5,938	14,300	3,901	-617	487	2,284	14,400	1,230	-14
1,947	4,932	14,350	1,346	-922	688	2,075	14,500	520	-24
※ 5,666	9,060	14,400	1,410	-459	429	1,826	14,600	415	-7
3,789	7,321	14,450	497	-296	257	2,255	14,700	825	11
4,292	9,914	14,500	733	-26	237	2,867	14,800	234	-19
3,265	8,195	14,550	478	-133	※ 1,348	4,104	14,900	139	-4
1,750	8,845	14,600	480	-60	284	8,956	15,000	121	30
437	5,348	14,650	250	-7	433	6,375	15,100	52	0
1,018	6,056	14,700	132	-28	343	2,737	15,200	108	30
-67	3,478	14,750	126	-13	595	3,496	15,300	26	0
775	4,604	14,800	113	-5	565	2,325	15,400	22	6
25	1,954	14,850	33	0	-451	1,969	15,500	28	0
-271	1,639	14,900	42	0	37	1,330	15,600	35	0
-47	3,762	15,000	2	0	147	896	15,700	3	0
91	1,430	15,100	2	0	-1	942	15,800	379	0
152	824	15,200	0	0	25	457	15,900	23	0
-4	728	15,300	11	0	-138	1,178	16,000	16	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
33,248	100,260	0.9424	94,484	11,079	5,535	60,584	0.8244	49,944	2,975
昨日 P/C	1.3525	今日增減變化	-0.4101		昨日 P/C	0.8532	今日增減變化	-0.0288	

更新日期：2022年12月23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23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	98,192,436	60,084,277	38,108,159	-5,865,857	4,350,138	1,190,646	3,159,492	-368,138
投信	44,749,268	68,047,606	-23,298,338	-2,464,663	357,972	0	357,972	-6,955
自營商	31,174,947	15,662,454	15,512,493	1,930,049	887,148	741,884	145,264	147,908
	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	544,799	1,282,143	-737,344	-40,030	53,987	0	53,987	4,056
投信	71,645	0	71,645	-336	0	0	0	0
自營商	326,879	135,825	191,054	53,091	18,469	75,293	-56,824	34,478

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23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	21,937	11,680	10,257	-1,488	13,067	10,358	2,709	82
投信	0	100	-100	0	300	141	159	0
自營商	58,677	61,613	-2,936	-2,270	57,890	47,783	10,107	10,295
特定法人(週)	1,524	0	1,524	0	0	1,290	-1,290	-220
特定法人(近月)	9,807	5,036	4,771	-1,553	2,051	6,141	-4,090	0
特定法人(全月)	14,216	5,036	9,180	-1,363	2,812	7,161	-4,349	-2,294
十大交易人(週)	32,776	46,375	-13,599	-8,647	39,530	32,953	6,577	-3,639
十大交易人(近月)	34,277	28,599	5,678	-1,048	19,110	27,090	-7,980	-2,101
十大交易人(全月)	74,776	78,252	-3,476	-7,097	65,434	66,774	-1,340	-5,681
全市場未沖銷(近月)			60,584	5,535			49,944	2,975
全市場未沖銷(全月)			195,799	42,781			174,732	16,595

更新日期：2022年12月23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	14400	買權OI最大量	14500
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	7.06%	較前一交易日	-1.32%
	買權隱含波動率	6.32%	較前一交易日	-2.13%
	賣權隱含波動率	7.74%	較前一交易日	-0.59%
電子選擇權	買權成交最大量	655	買權OI最大量	640
	賣權成交最大量	630	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	1440	賣權OI最大量	1480

更新日期：2022年12月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

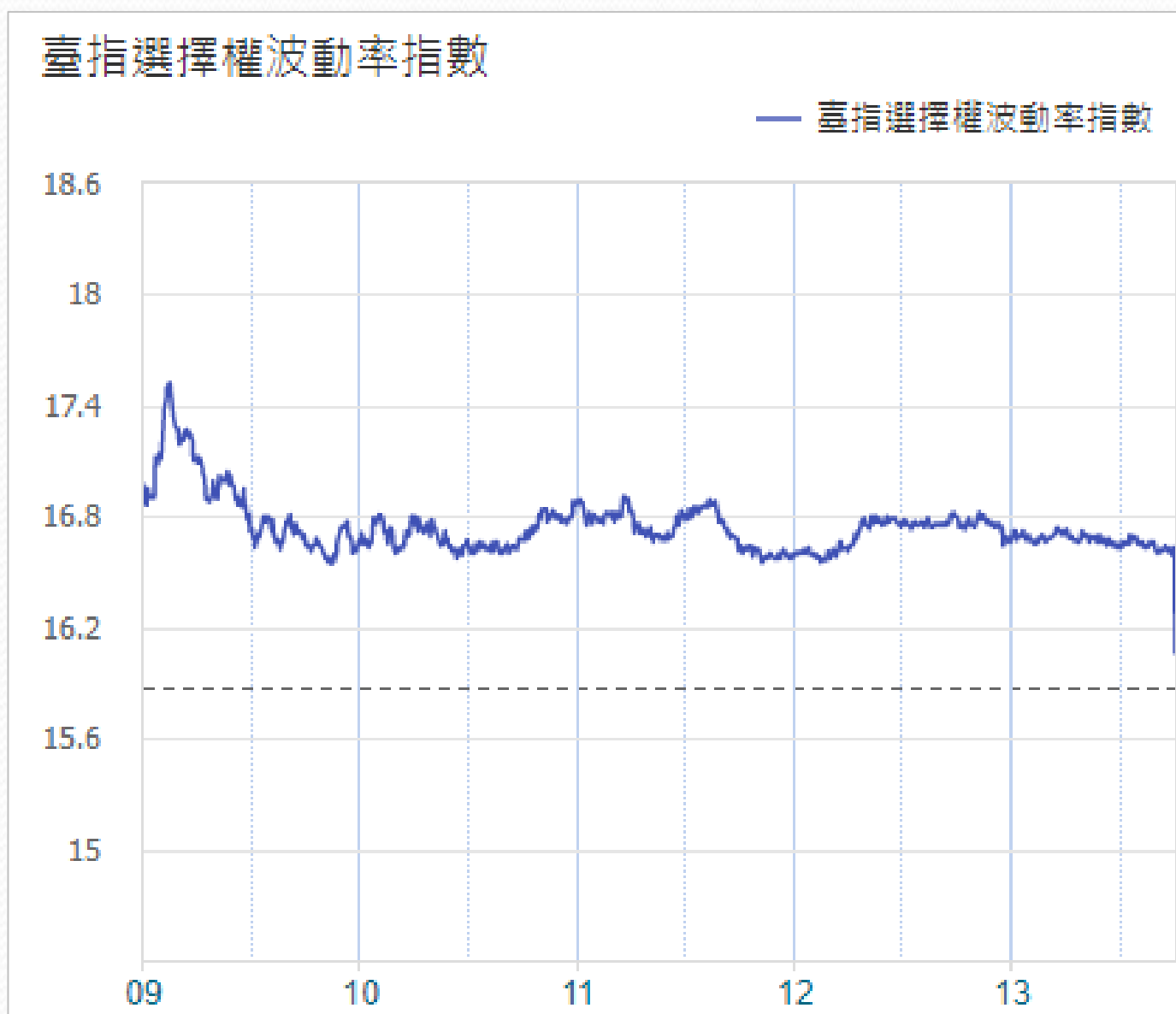
台指選擇權匯報

2023年01月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	14800	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	16.32%	較前一交易日	+0.23%
	買權隱含波動率	12.82%	較前一交易日	-0.03%
	賣權隱含波動率	20.72%	較前一交易日	-0.62%
	成交量P/C_Ratio值	0.801	較前一交易日	+0.03
	未平倉P/C_Ratio值	0.824	較前一交易日	-0.03
電子選擇權	買權成交最大量	655	買權OI最大量	640
	賣權成交最大量	630	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	1440	賣權OI最大量	1480

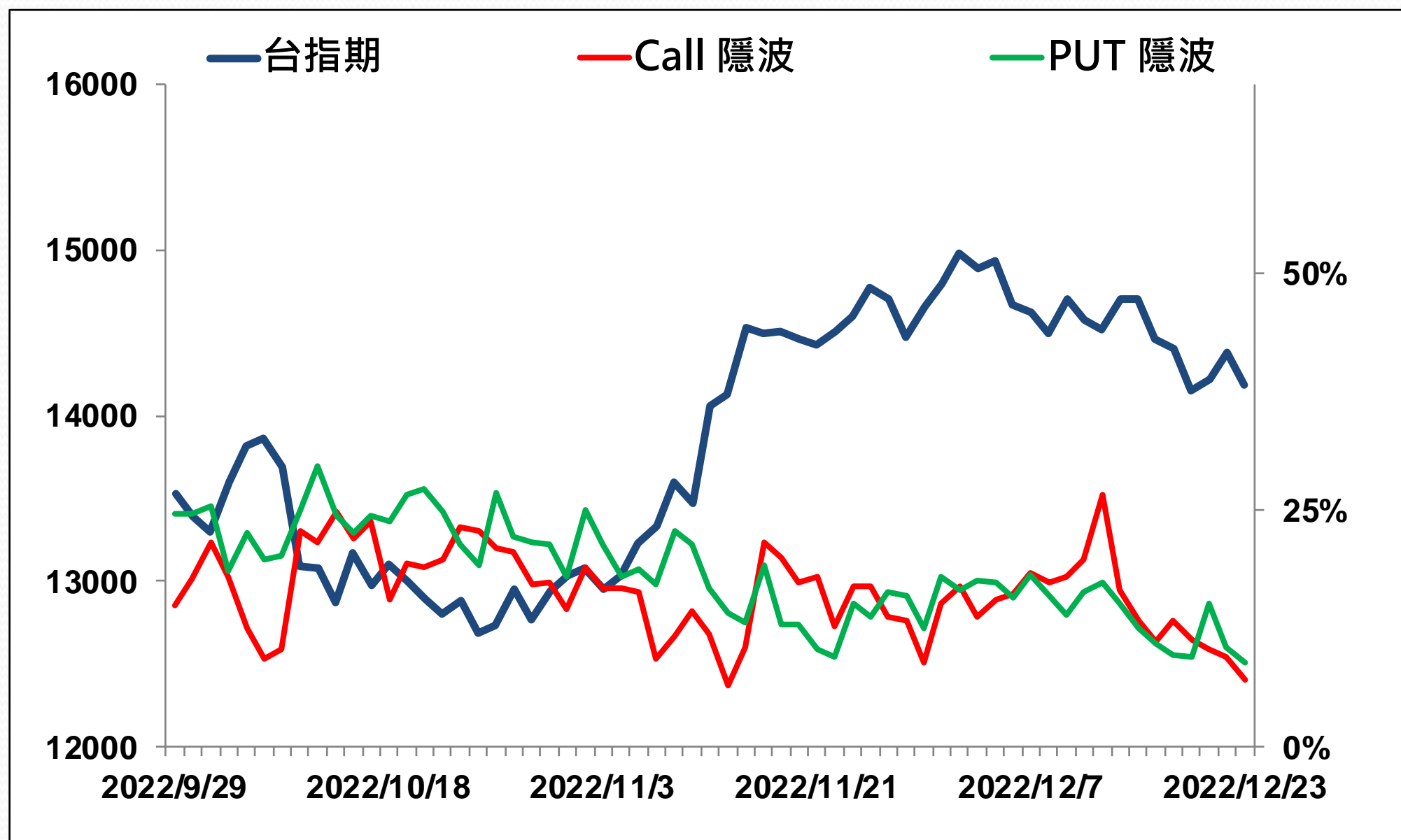
更新日期：2022年12月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



更新日期：2022年12月23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

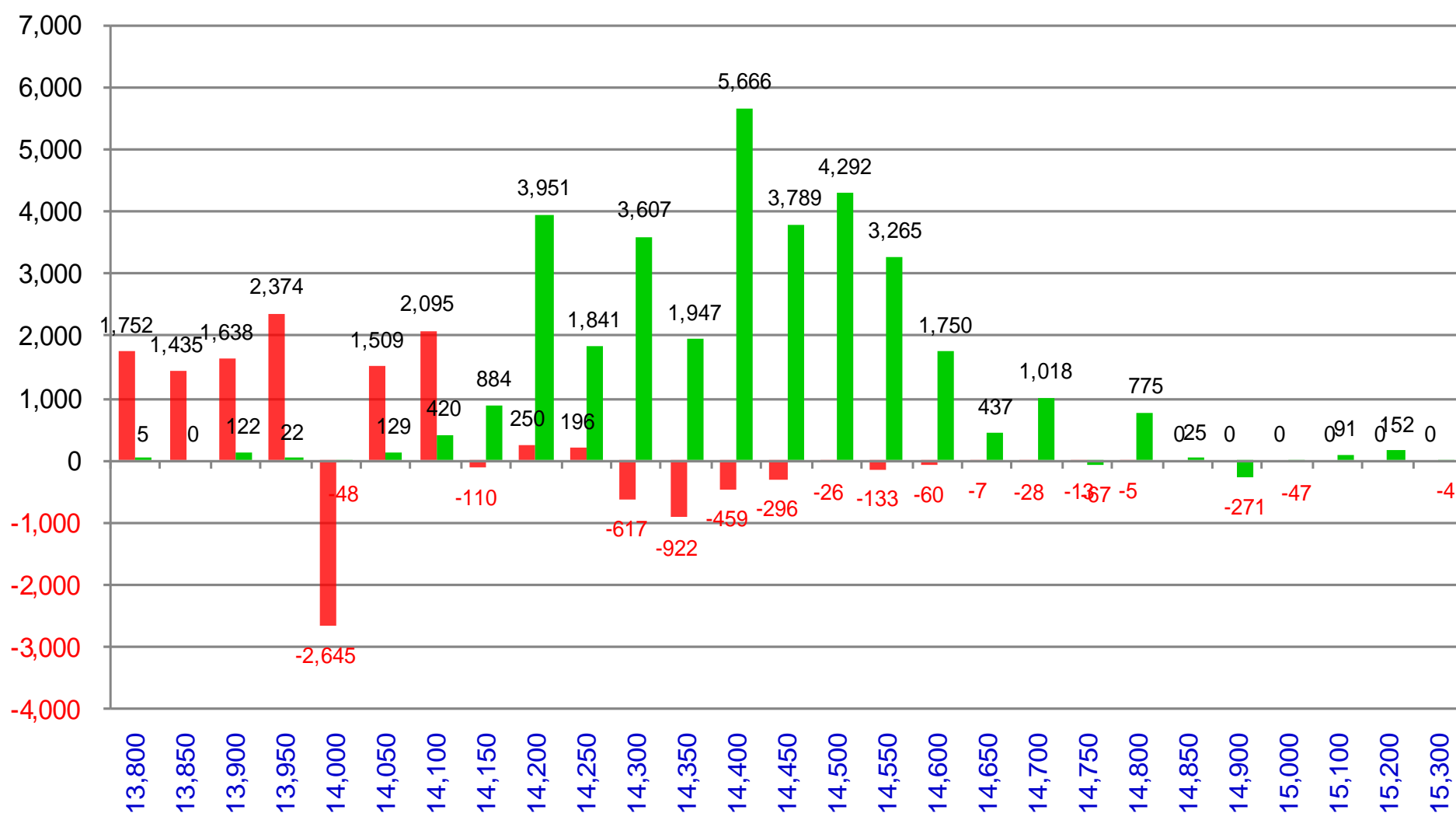


更新日期：2022年12月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：11,079

週選 CALL OI 變化：33,248

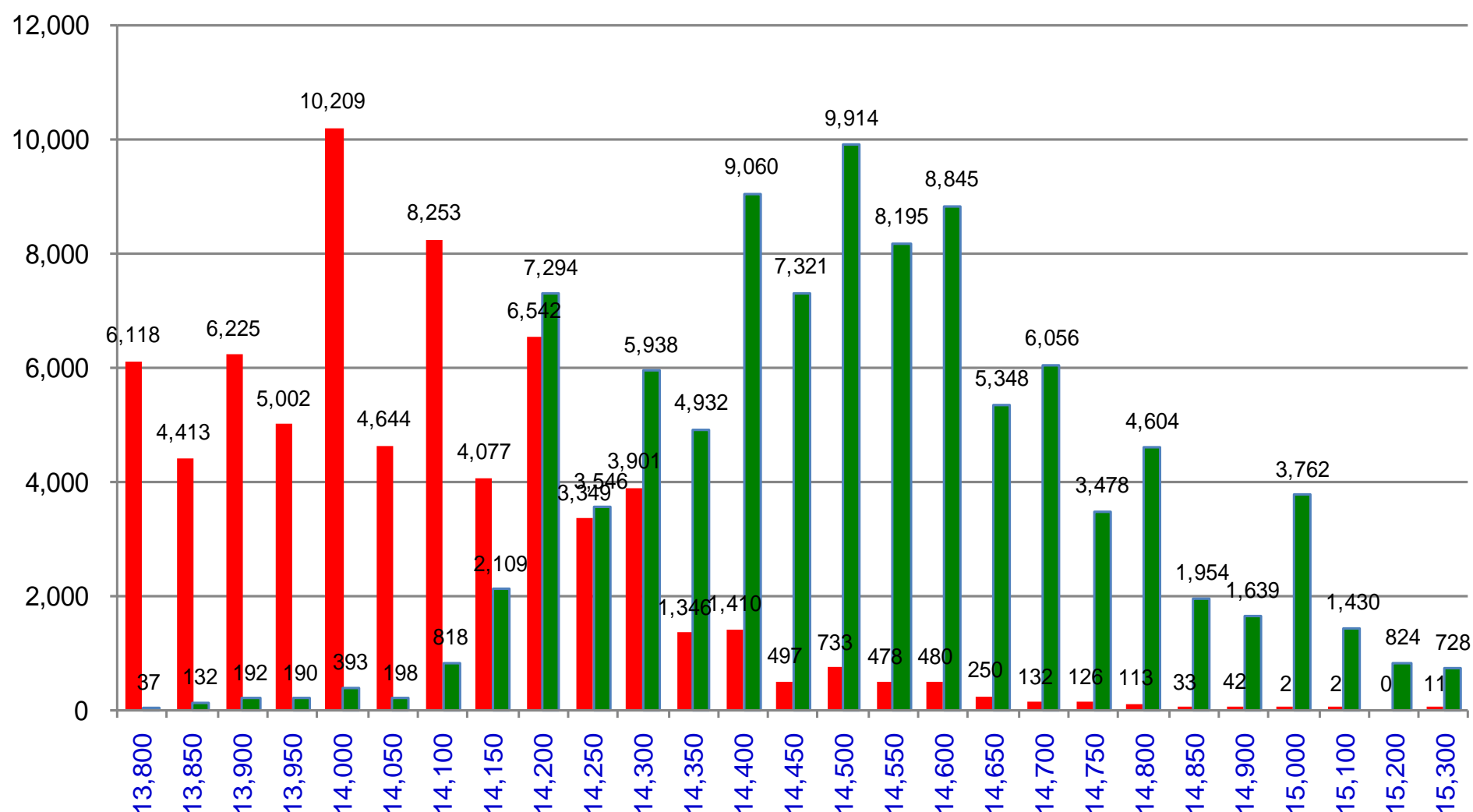


更新日期：2022年12月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：94,484

週選 CALL OI 總額：100,260



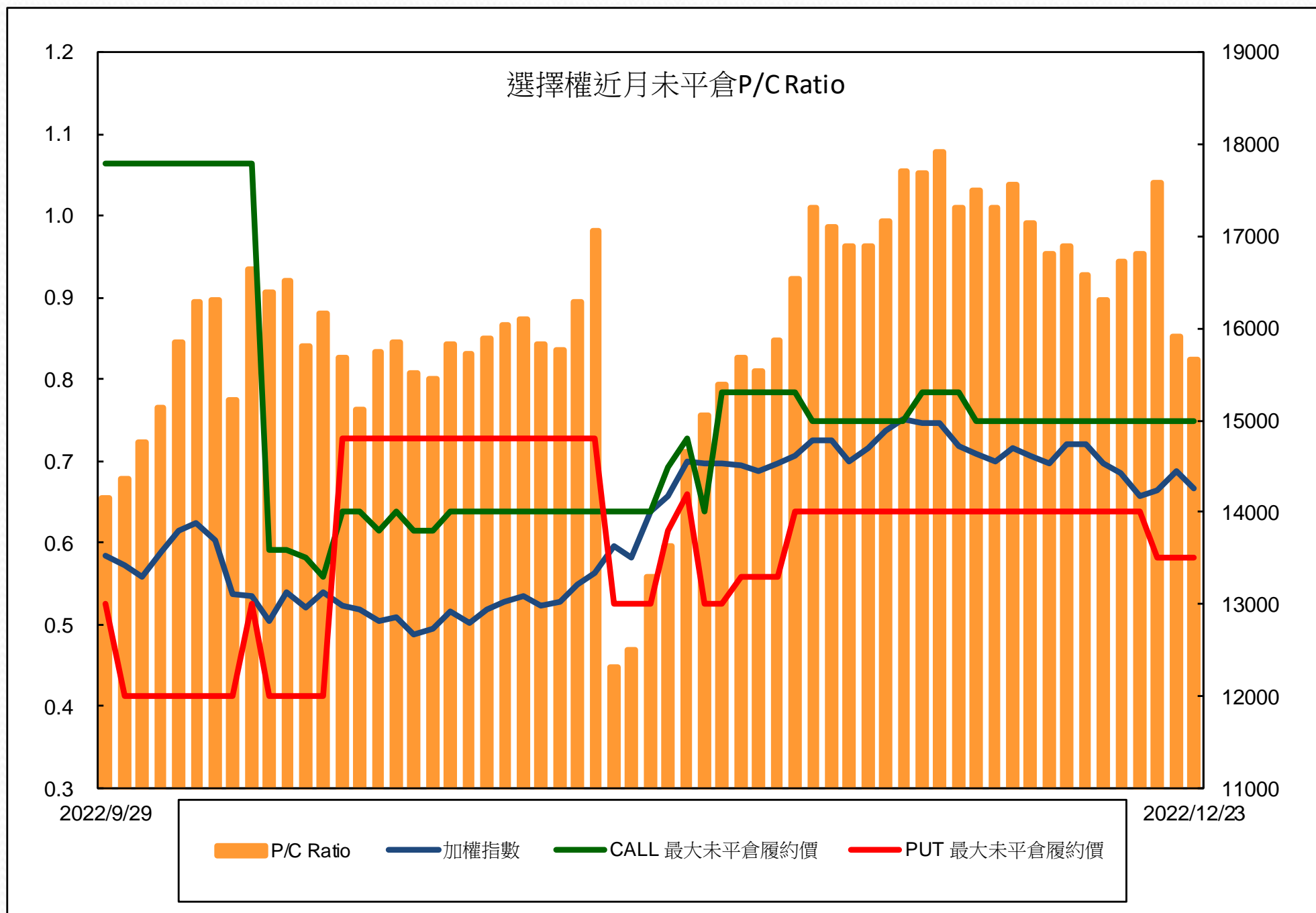
更新日期：2022年12月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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22日	52,318	52,984	-666
	12月23日	58,677	61,613	-2,936
Put	12月22日	49,060	49,248	-188
	12月23日	57,890	47,783	10,107

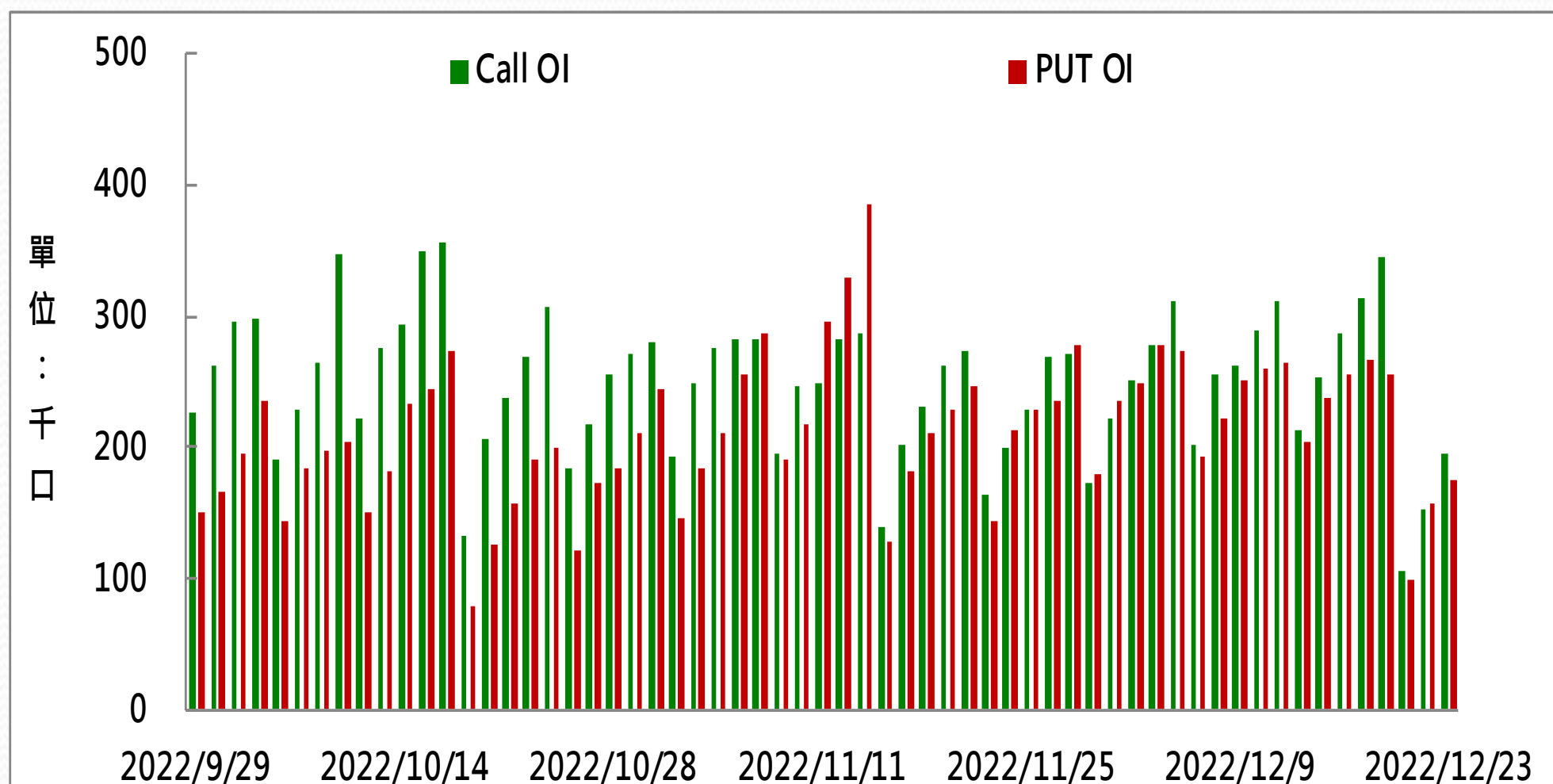
更新日期：2022年12月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年12月23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23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23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