

台指選擇權OI匯報

日期：2022/12/26 結算日：2022/12/28					日期：2022/12/26 結算日：2023/1/30				
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
0	132	13,850	4,341	-72	0	62	13,400	2,535	50
-27	165	13,900	7,929	1,704	7	131	13,500	4,774	68
-3	187	13,950	5,162	160	0	112	13,600	2,900	70
64	457	14,000	12,210	2,001	1	98	13,700	2,026	185
24	222	14,050	6,773	2,129	7	269	13,800	3,112	461
20	838	14,100	11,939	3,686	4	100	13,900	1,681	225
-63	2,046	14,150	6,114	2,037	-19	285	14,000	2,177	275
-408	6,886	14,200	9,091	2,549	283	2,409	14,100	1,820	40
496	4,042	14,250	4,723	1,374	44	578	14,200	1,105	175
1,122	7,060	14,300	4,483	582	113	1,180	14,300	1,027	27
1,127	6,059	14,350	1,312	-34	52	2,336	14,400	1,210	-20
1,744	10,804	14,400	1,672	262	318	2,393	14,500	516	-4
3,500	10,821	14,450	617	120	273	2,099	14,600	420	5
※ 3,753	13,667	14,500	694	-39	164	2,419	14,700	807	-18
465	8,660	14,550	421	-57	305	3,172	14,800	232	-2
-268	8,577	14,600	477	-3	184	4,288	14,900	137	-2
-528	4,820	14,650	250	0	361	9,317	15,000	120	-1
-868	5,188	14,700	131	-1	374	6,749	15,100	57	5
-103	3,375	14,750	126	0	68	2,805	15,200	108	0
-985	3,619	14,800	112	-1	※ 445	3,941	15,300	26	0
-48	1,906	14,850	32	-1	-378	1,947	15,400	20	-2
-4	1,635	14,900	41	-1	-193	1,776	15,500	28	0
-18	3,744	15,000	2	0	-15	1,315	15,600	35	0
7	1,437	15,100	2	0	111	1,007	15,700	3	0
-115	709	15,200	0	0	-3	939	15,800	380	1
-469	259	15,300	11	0	-3	454	15,900	23	0
0	328	15,400	0	0	-8	1,170	16,000	17	1
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
8,402	108,662	1.0184	110,664	16,180	2,496	63,080	0.8317	52,465	2,521
昨日 P/C	0.9424	今日增減變化	0.0760		昨日 P/C	0.8244	今日增減變化	0.0073	

更新日期：2022年12月26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26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	100,942,081	59,425,738	41,516,343	3,408,184	4,512,385	1,288,881	3,223,504	64,012
投信	44,637,562	68,520,224	-23,882,662	-584,324	359,324	0	359,324	1,352
自營商	32,466,424	16,750,479	15,715,945	203,452	924,342	820,197	104,145	-41,119
	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	615,678	1,259,818	-644,140	93,204	49,896	1,426	48,470	-5,517
投信	71,904	0	71,904	259	0	0	0	0
自營商	335,550	142,310	193,240	2,186	31,363	96,937	-65,574	-8,750

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26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	22,111	11,921	10,190	-67	13,234	10,110	3,124	415
投信	0	100	-100	0	300	141	159	0
自營商	63,604	62,817	787	3,723	59,550	50,220	9,330	-777
特定法人(週)	1,524	0	1,524	0	0	0	0	1,290
特定法人(近月)	9,837	5,036	4,801	30	2,081	6,141	-4,060	30
特定法人(全月)	14,180	5,036	9,144	-36	2,812	5,399	-2,587	1,762
十大交易人(週)	36,280	48,937	-12,657	942	43,781	38,056	5,725	-852
十大交易人(近月)	35,419	29,148	6,271	593	20,048	27,473	-7,425	555
十大交易人(全月)	79,655	80,671	-1,016	2,460	69,200	70,001	-801	539
全市場未沖銷(近月)			63,080	2,496			52,465	2,521
全市場未沖銷(全月)			209,745	13,946			198,202	23,470

更新日期：2022年12月26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	7.45%	較前一交易日	+0.39%
	買權隱含波動率	6.91%	較前一交易日	+0.59%
	賣權隱含波動率	7.89%	較前一交易日	+0.15%
電子選擇權	買權成交最大量	675	買權OI最大量	640
	賣權成交最大量	635	賣權OI最大量	620
金融選擇權	買權成交最大量	1540	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26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	16.54%	較前一交易日	-0.23%
	買權隱含波動率	13.19%	較前一交易日	+0.37%
	賣權隱含波動率	19.90%	較前一交易日	-0.82%
	成交量P/C_Ratio值	0.925	較前一交易日	+0.12
	未平倉P/C_Ratio值	0.832	較前一交易日	+0.01
電子選擇權	買權成交最大量	675	買權OI最大量	640
	賣權成交最大量	635	賣權OI最大量	620
金融選擇權	買權成交最大量	1540	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26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

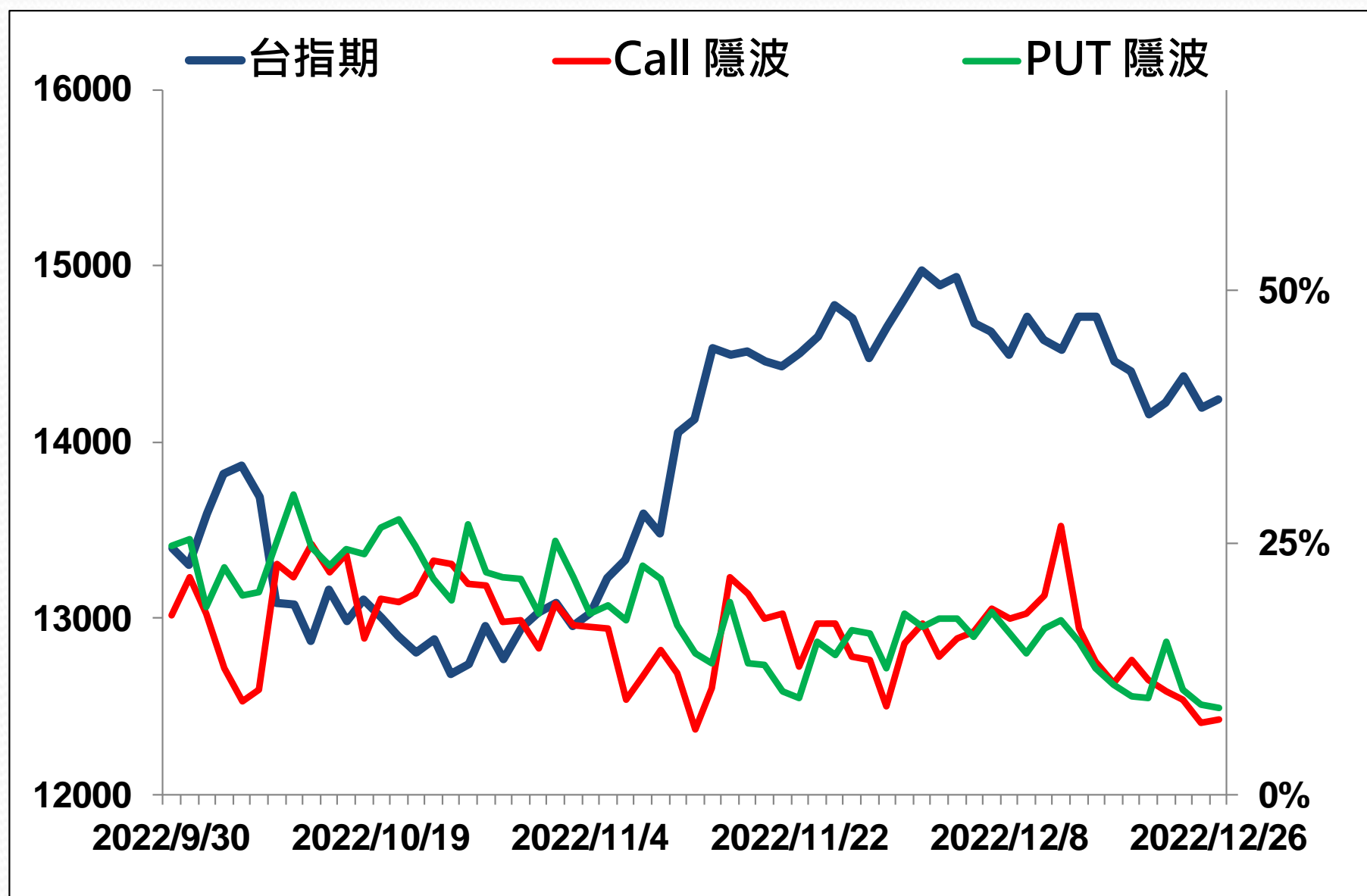
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



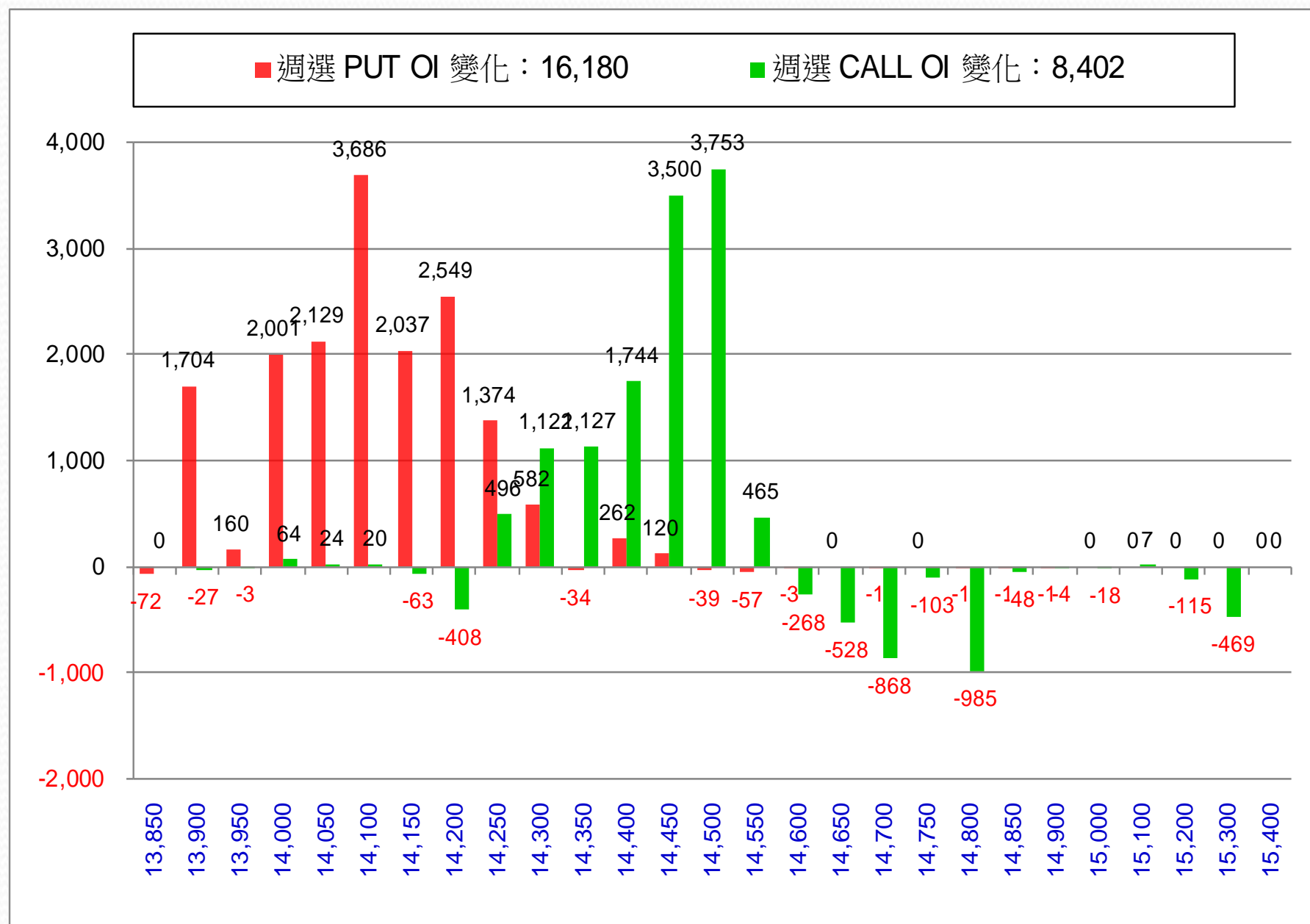
更新日期：2022年12月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



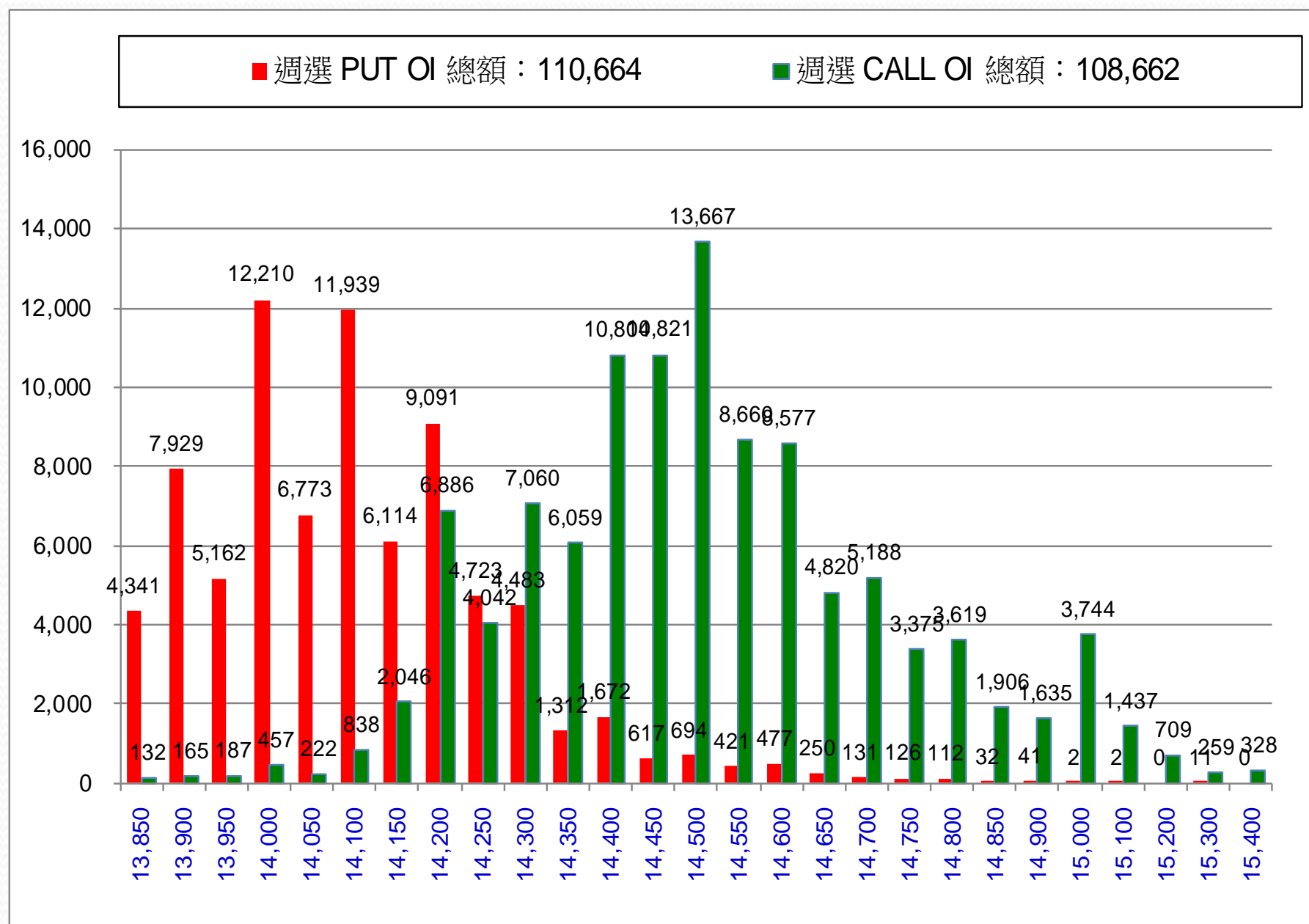
更新日期：2022年12月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年12月26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



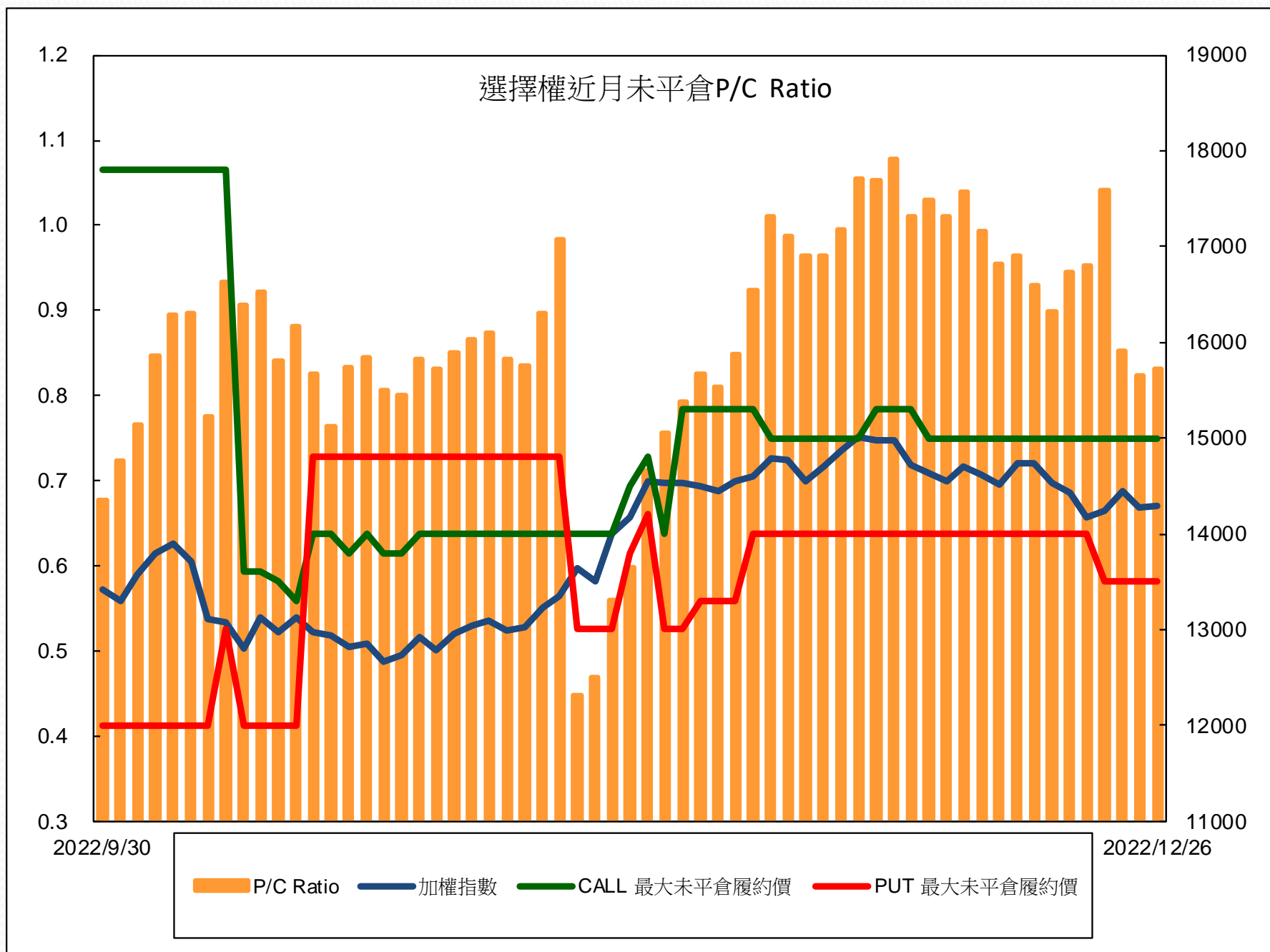
更新日期：2022年12月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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23日	58,677	61,613	-2,936
	12月26日	63,604	62,817	787
Put	12月23日	57,890	47,783	10,107
	12月26日	59,550	50,220	9,330

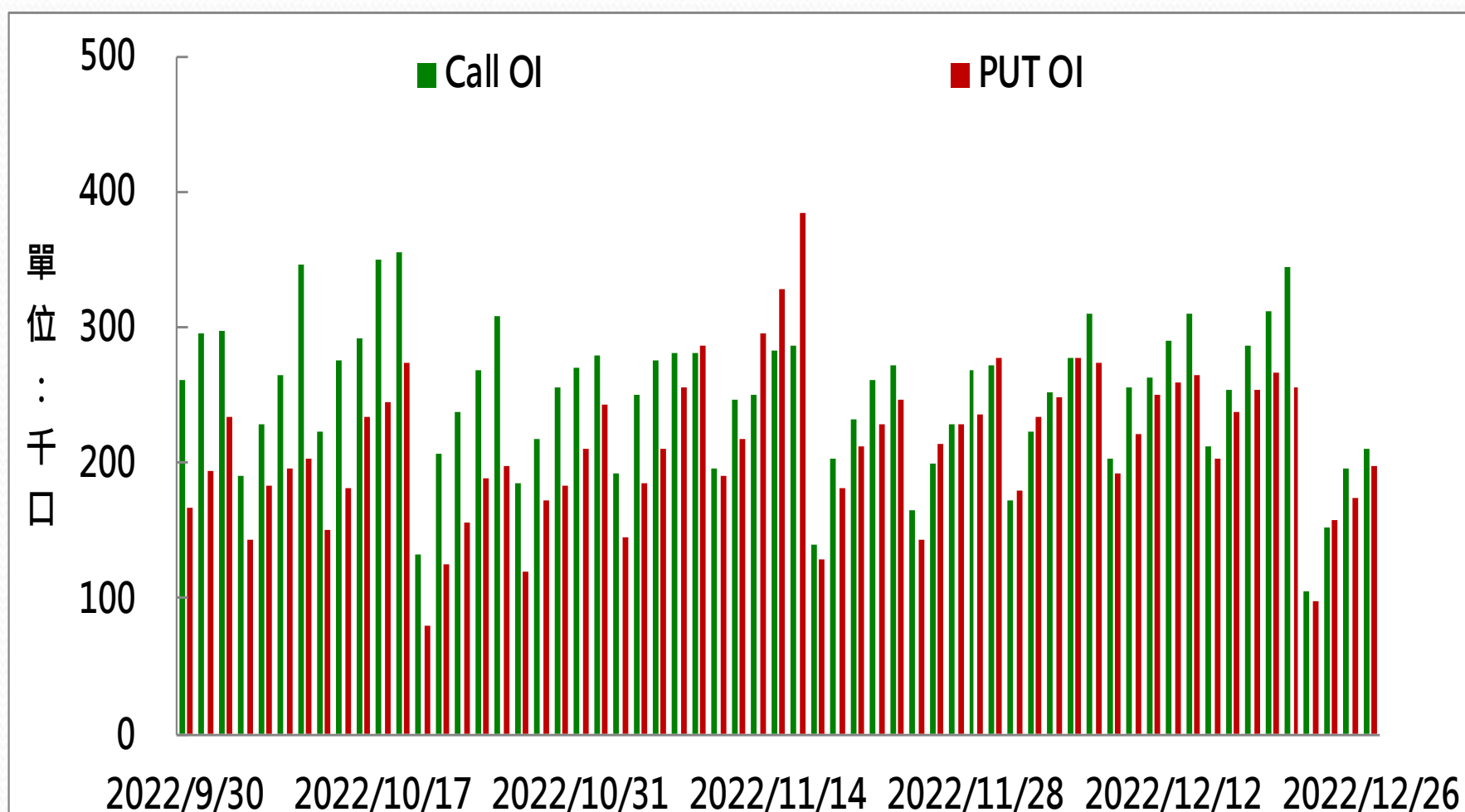
更新日期：2022年12月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年12月26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26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26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