

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/12/27 結算日：2022/12/28					日期：2022/12/27 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
-1	164	13,900	6,326	-1,603	0	62	13,400	2,687	152
-16	171	13,950	3,774	-1,388	0	131	13,500	5,072	298
-59	398	14,000	11,820	-390	6	118	13,600	3,129	229
-47	175	14,050	5,459	-1,314	9	107	13,700	2,169	143
-34	804	14,100	12,592	653	-10	259	13,800	3,342	230
-1,095	951	14,150	5,452	-662	8	108	13,900	2,109	428
-3,408	3,478	14,200	10,269	1,178	-2	283	14,000	2,465	288
-992	3,050	14,250	8,044	3,321	-14	2,395	14,100	2,232	412
-49	7,011	14,300	8,371	3,888	-79	499	14,200	1,053	-52
538	6,597	14,350	5,192	3,880	-28	1,152	14,300	1,199	172
-535	10,269	14,400	5,940	4,268	-46	2,290	14,400	1,201	-9
※ 2,666	13,487	14,450	1,495	878	32	2,425	14,500	594	78
1,039	14,706	14,500	1,096	402	138	2,237	14,600	490	70
160	8,820	14,550	691	270	189	2,608	14,700	810	3
317	8,894	14,600	448	-29	370	3,542	14,800	246	14
-326	4,494	14,650	251	1	54	4,342	14,900	138	1
-812	4,376	14,700	124	-7	※ 485	9,802	15,000	143	23
-349	3,026	14,750	136	10	109	6,858	15,100	59	2
130	3,749	14,800	114	2	213	3,018	15,200	137	29
-7	1,899	14,850	32	0	53	3,994	15,300	26	0
45	1,680	14,900	41	0	85	2,032	15,400	17	-3
-40	3,704	15,000	4	2	104	1,880	15,500	27	-1
-69	1,368	15,100	2	0	-16	1,299	15,600	35	0
-40	669	15,200	0	0	111	1,118	15,700	3	0
0	259	15,300	11	0	33	972	15,800	380	0
-5	323	15,400	0	0	16	470	15,900	23	0
0	581	15,500	0	0	-2	1,168	16,000	17	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
-2,992	105,670	1.1368	120,122	9,458	1,952	65,032	0.8745	56,873	4,408
昨日 P/C	1.0184	今日增減變化	0.1184		昨日 P/C	0.8317	今日增減變化	0.0428	

更新日期：2022年12月27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27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	100,852,197	58,791,242	42,060,955	544,612	4,577,833	1,251,117	3,326,716	103,212	
投信	45,773,139	68,498,062	-22,724,923	1,157,739	361,201	0	361,201	1,877	
自營商	32,941,017	17,523,907	15,417,110	-298,835	829,700	950,116	-120,416	-224,561	
	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	657,314	1,341,764	-684,450	-40,310	41,456	1,430	40,026	-8,444	
投信	72,365	0	72,365	461	0	0	0	0	
自營商	349,761	162,821	186,940	-6,300	62,898	137,228	-74,330	-8,756	

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27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	22,819	11,943	10,876	686	14,353	11,990	2,363	-761	
投信	0	100	-100	0	300	141	159	0	
自營商	65,245	61,053	4,192	3,405	62,949	54,278	8,671	-659	
特定法人(週)	1,524	0	1,524	0	0	1,290	-1,290	-1,290	
特定法人(近月)	10,566	5,453	5,113	312	1,678	6,482	-4,804	-744	
特定法人(全月)	14,480	5,453	9,027	-117	0	2,825	-2,825	-238	
十大交易人(週)	35,151	47,853	-12,702	-45	50,092	38,944	11,148	5,423	
十大交易人(近月)	37,015	29,820	7,195	924	21,551	29,850	-8,299	-874	
十大交易人(全月)	82,040	80,589	1,451	2,467	76,324	73,910	2,414	3,215	
全市場未沖銷(近月)			65,032	1,952			56,873	4,408	
全市場未沖銷(全月)			212,751	3,006			217,199	18,997	

更新日期：2022年12月27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	14300	賣權OI最大量	14100
	整體隱含波動率	5.99%	較前一交易日	-1.46%
	買權隱含波動率	7.25%	較前一交易日	+0.33%
	賣權隱含波動率	4.96%	較前一交易日	-2.93%
電子選擇權	買權成交最大量	685	買權OI最大量	685
	賣權成交最大量	655	賣權OI最大量	620
金融選擇權	買權成交最大量	1520	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27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

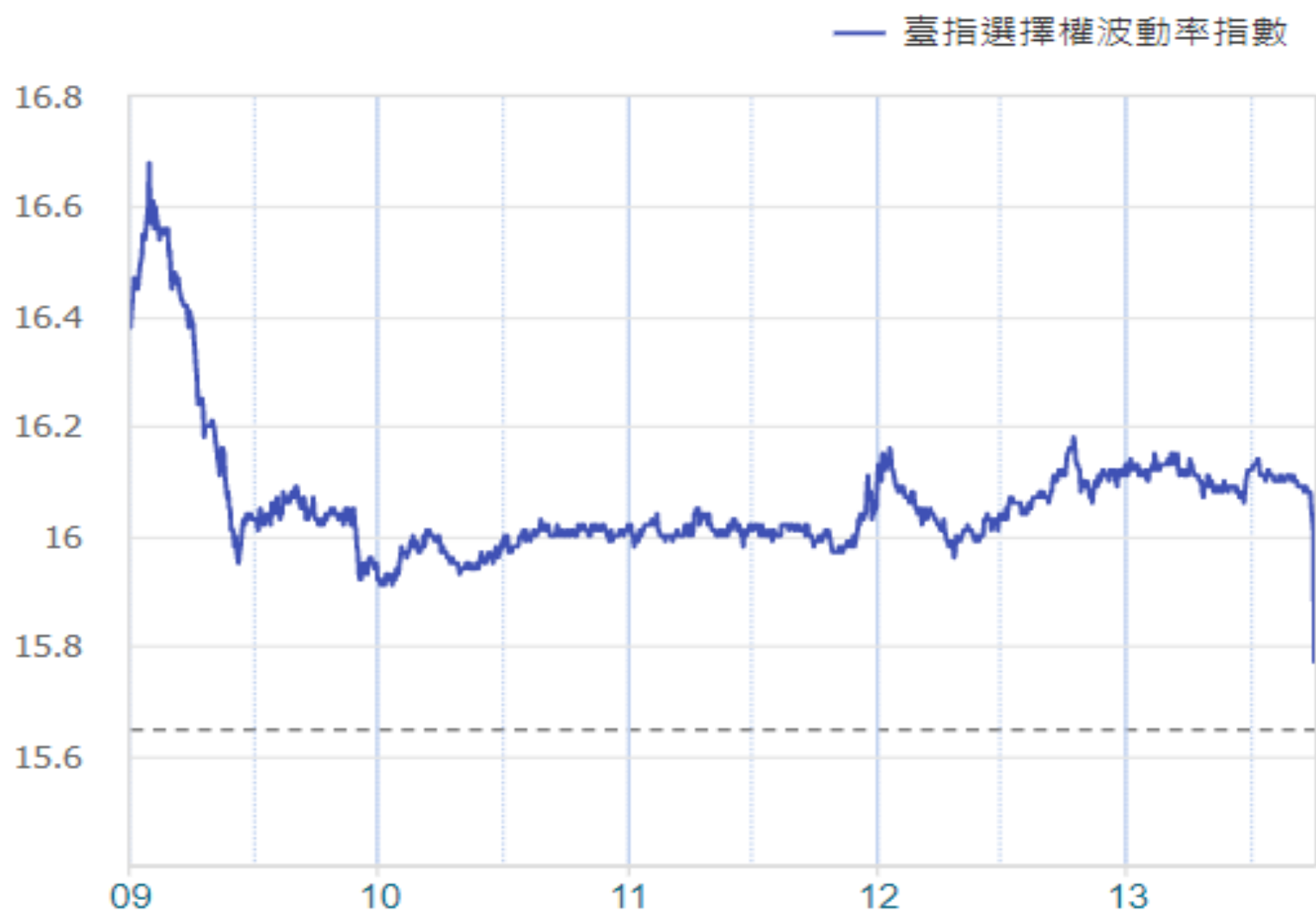
# 台指選擇權匯報

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	13800	賣權OI最大量	13500
	整體隱含波動率	16.59%	較前一交易日	-0.05%
	買權隱含波動率	13.49%	較前一交易日	+0.30%
	賣權隱含波動率	19.11%	較前一交易日	-0.79%
	成交量P/C_Ratio值	1.273	較前一交易日	+0.35
	未平倉P/C_Ratio值	0.875	較前一交易日	+0.04
電子選擇權	買權成交最大量	685	買權OI最大量	685
	賣權成交最大量	655	賣權OI最大量	620
金融選擇權	買權成交最大量	1520	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27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

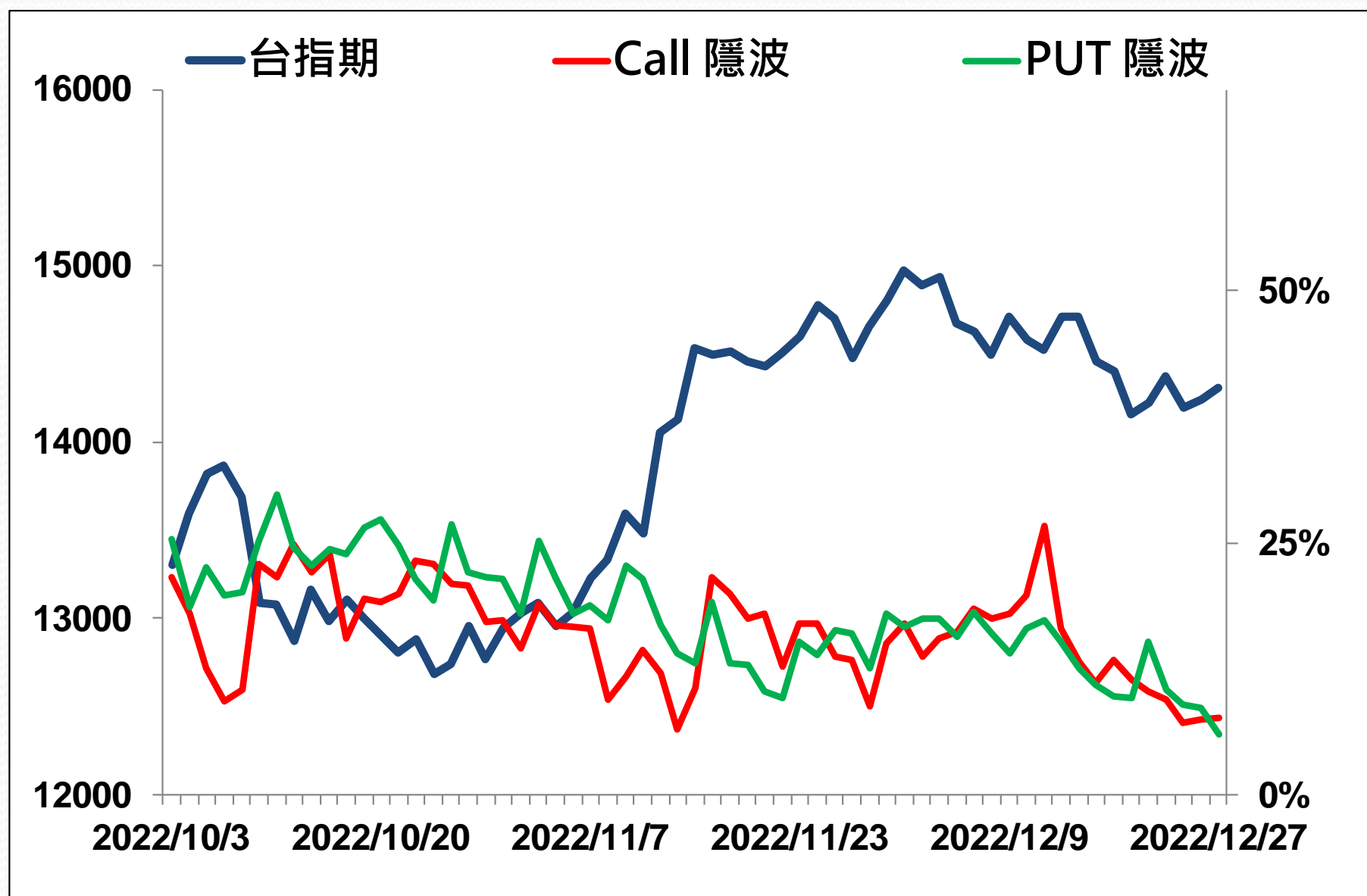
# 選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



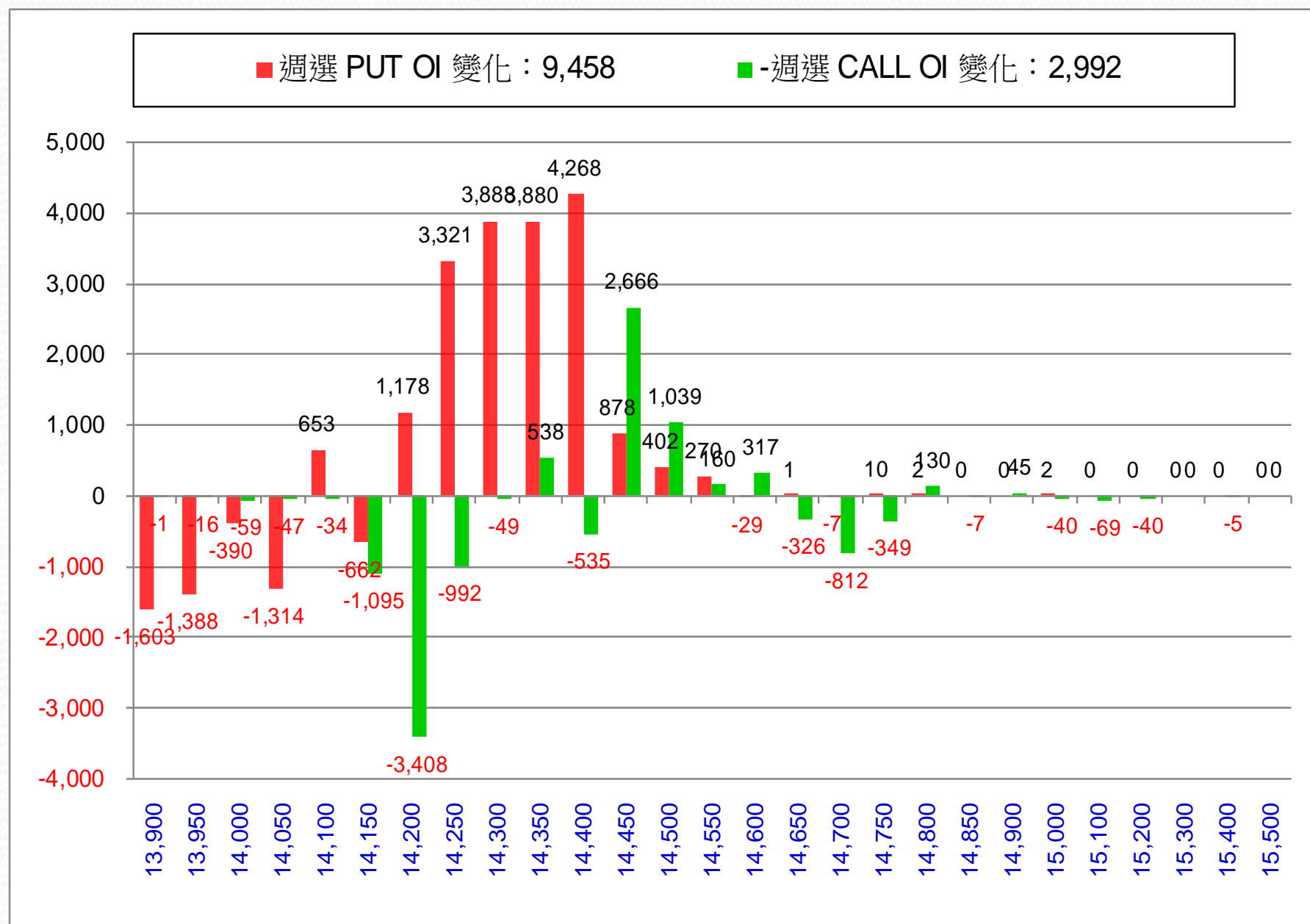
更新日期：2022年12月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



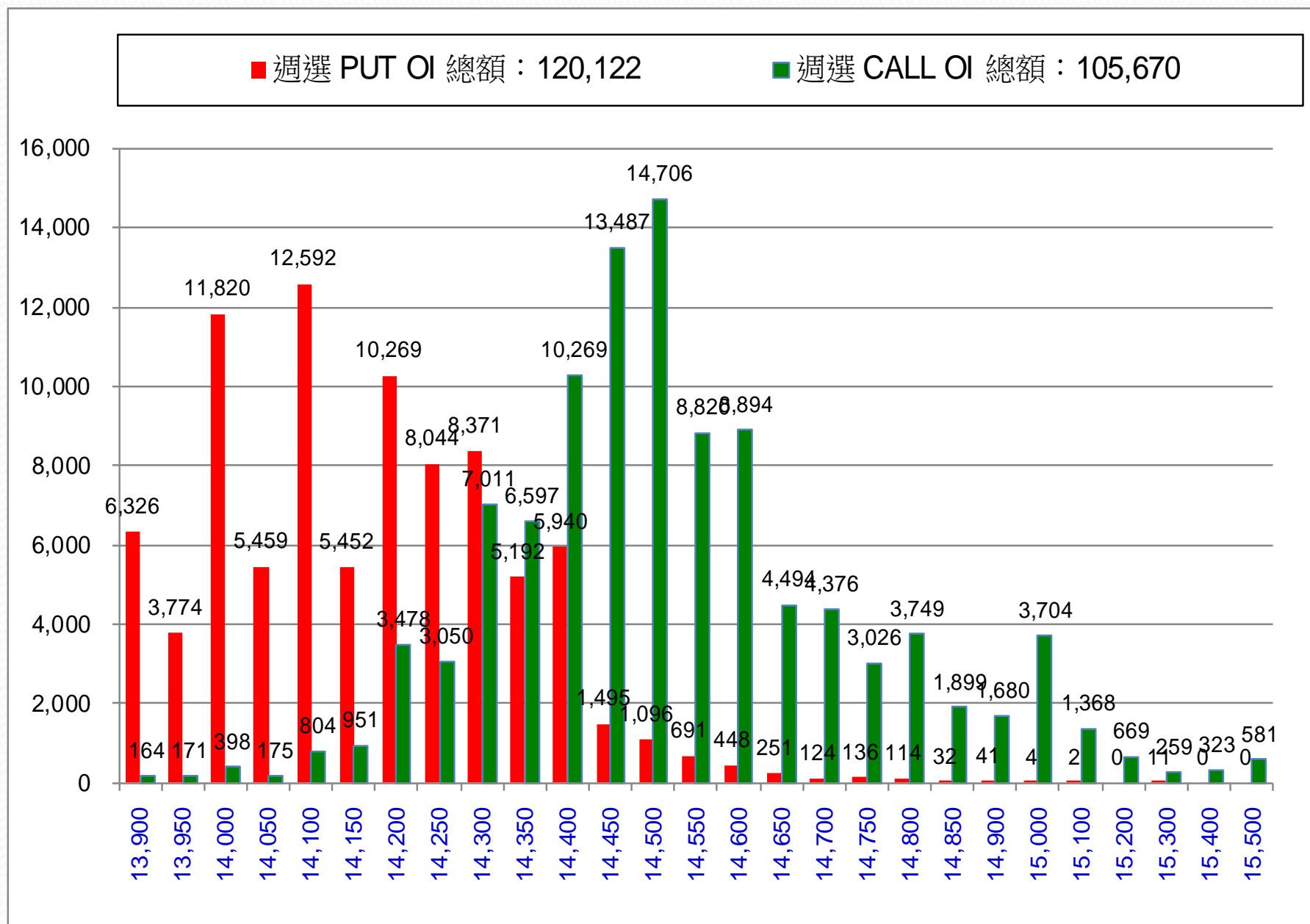
更新日期：2022年12月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年12月27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27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

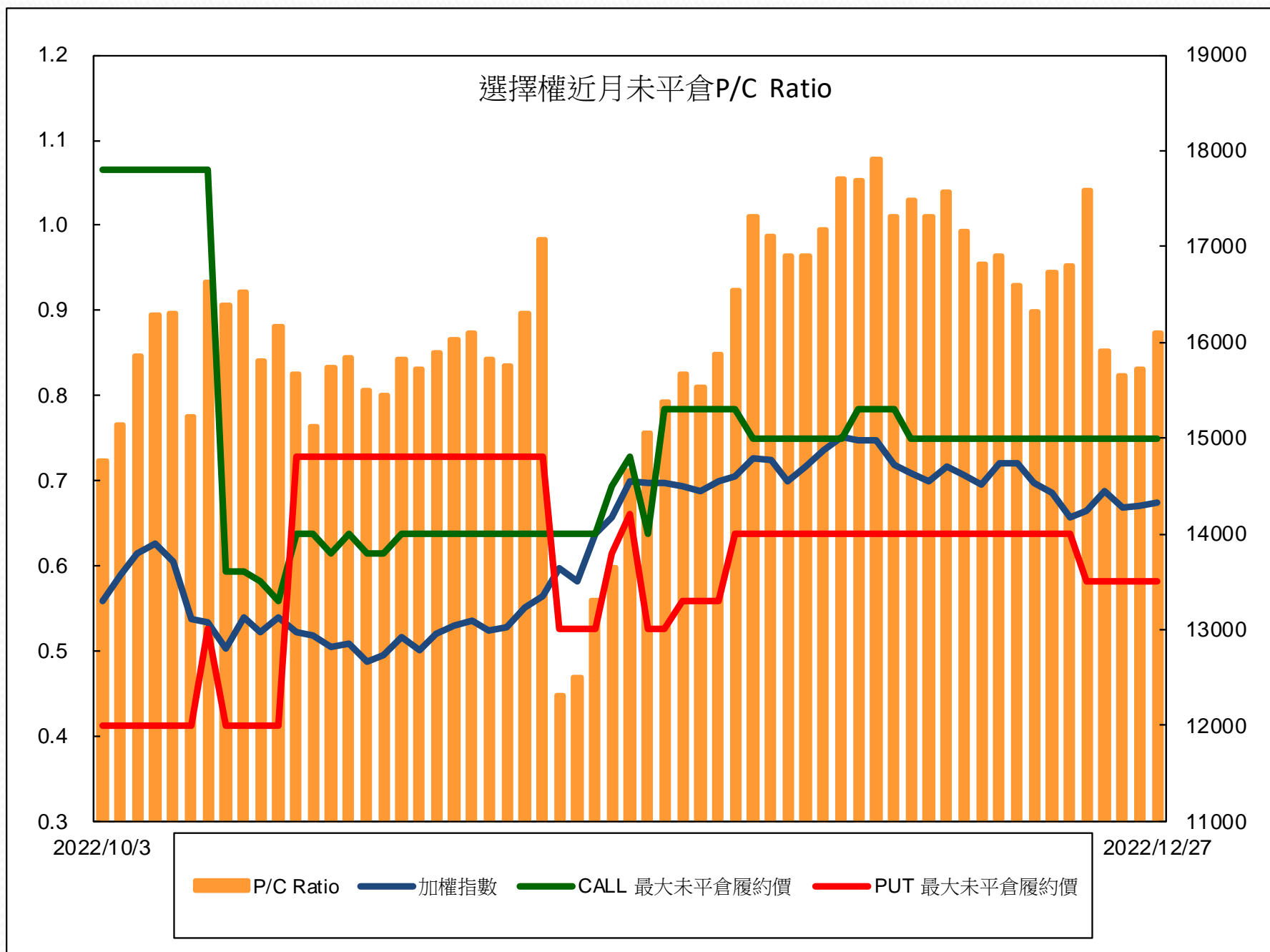


# 自營商選擇權OI部位統計

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26日	63,604	62,817	787
	12月27日	65,245	61,053	4,192
Put	12月26日	59,550	50,220	9,330
	12月27日	62,949	54,278	8,671

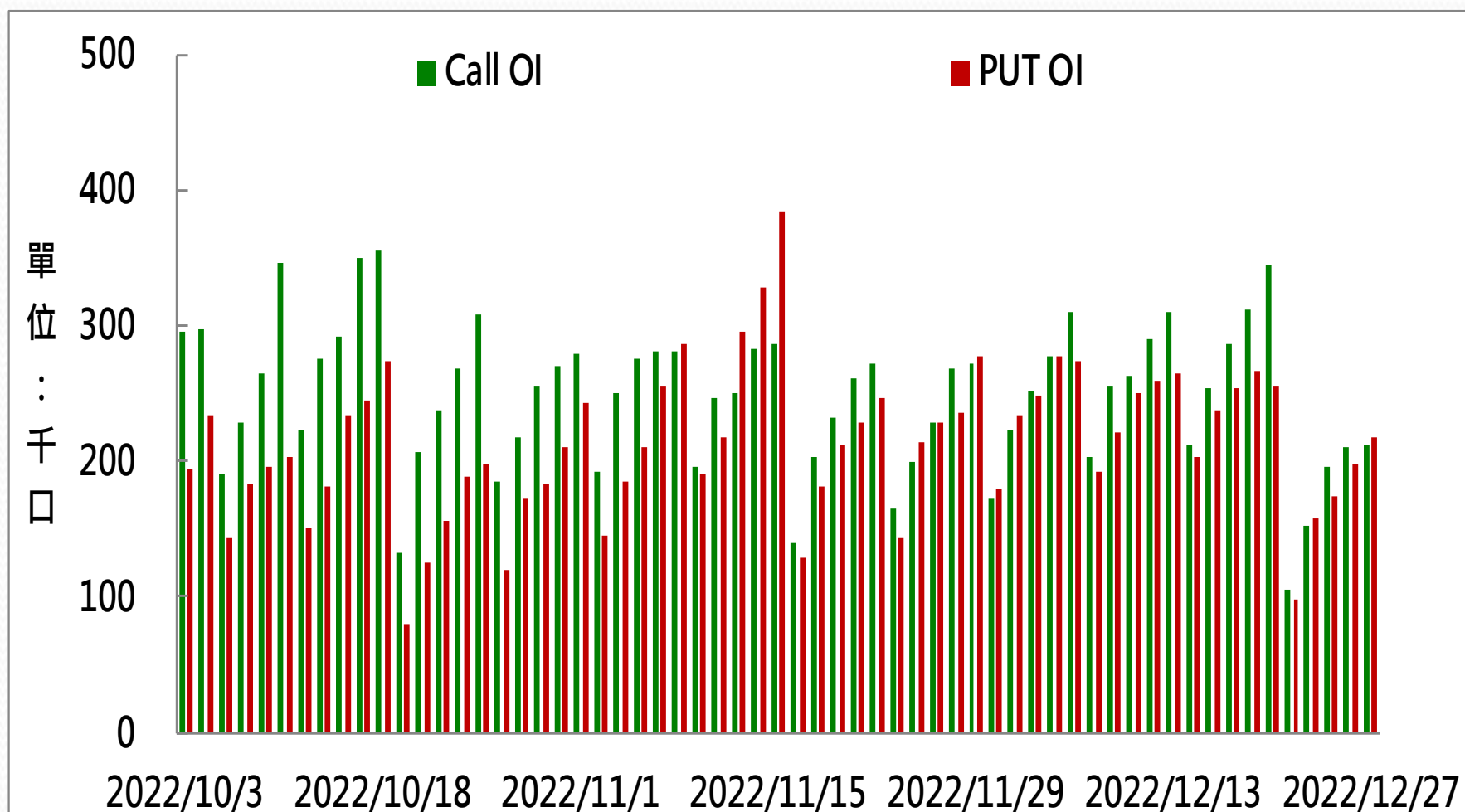
更新日期：2022年12月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



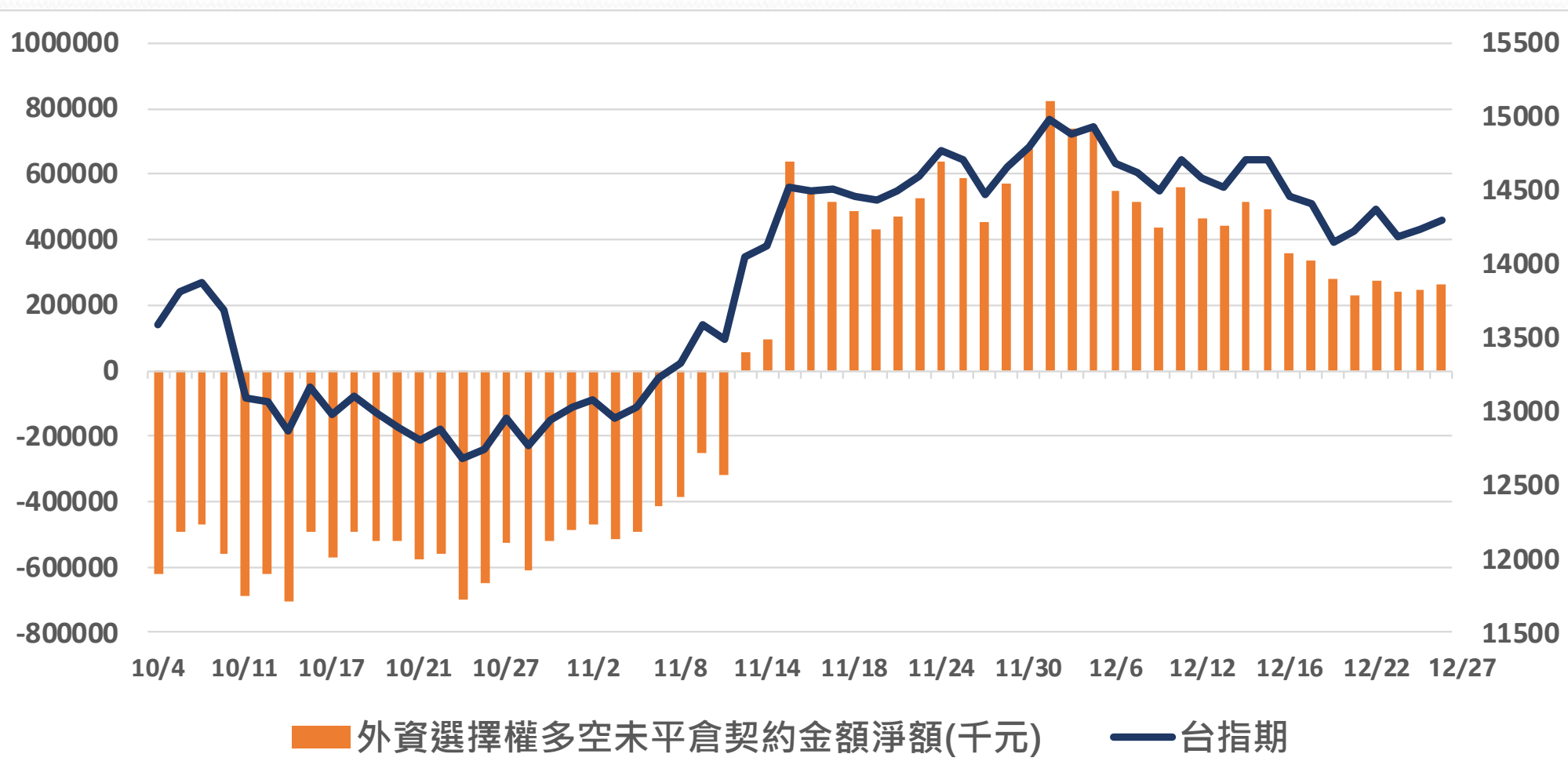
更新日期：2022年12月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整

# 選擇權全月Put Call OI



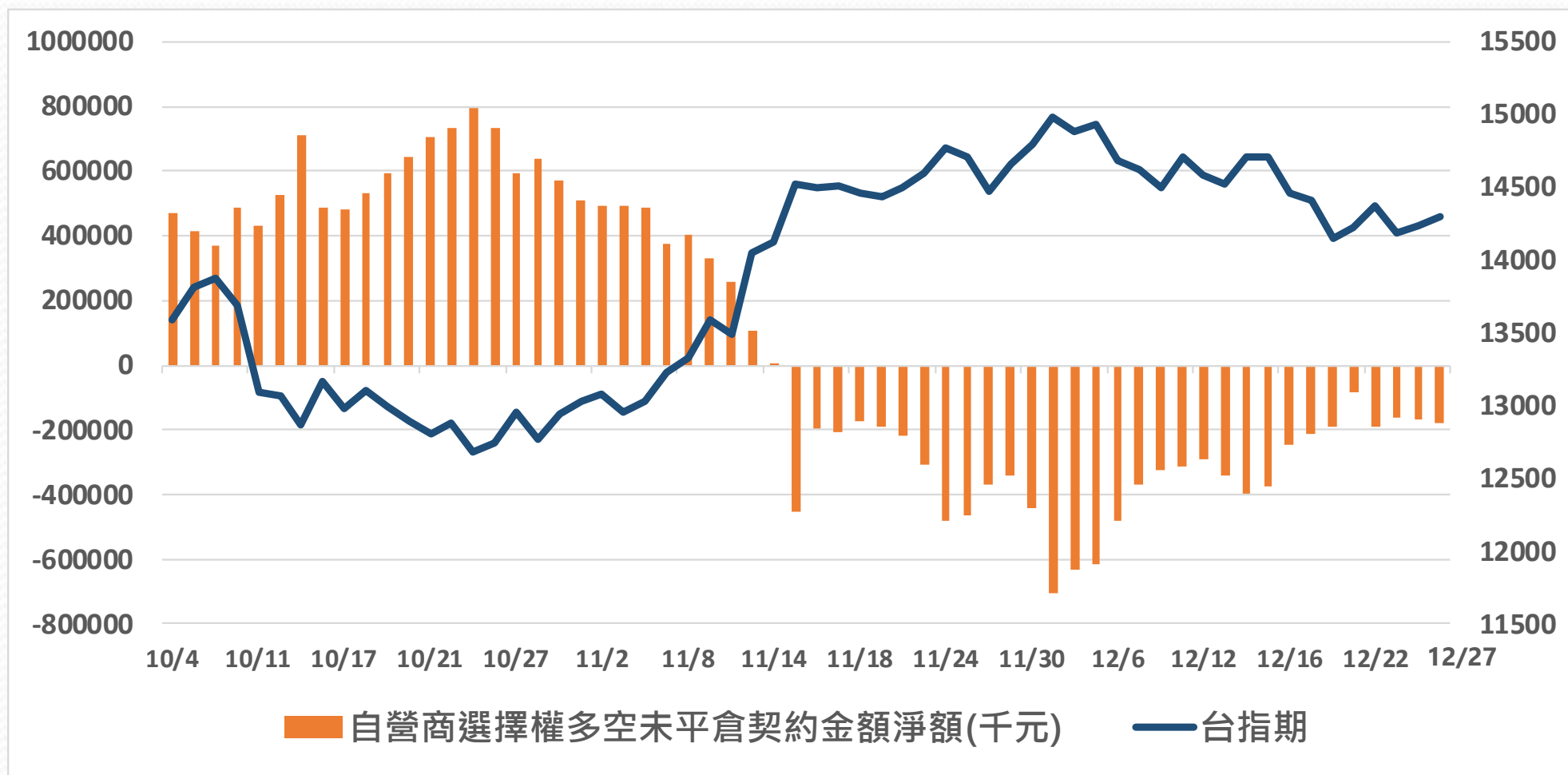
更新日期：2022年12月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 外資選擇權多空未平倉淨額



更新日期：2022年12月27日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 自營商選擇權多空未平倉淨額



更新日期：2022年12月27日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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27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