

台指選擇權OI匯報

日期：2022/12/28 結算日：2023/1/4					日期：2022/12/28 結算日：2023/1/18				
202301W1					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	1	13,500	2,454	1,420	30	108	13,300	2,550	701 ※
9	14	13,600	2,843	1,639	1	63	13,400	2,758	71
0	1	13,700	2,283	1,594	12	143	13,500	5,321	249
22	24	13,800	2,329	848	6	124	13,600	3,187	58
40	41	13,900	4,824	2,863 ※	27	134	13,700	2,200	31
44	50	13,950	1,759	922	6	265	13,800	3,475	133
294	333	14,000	2,227	617	37	145	13,900	2,291	182
318	340	14,050	1,112	573	172	455	14,000	2,626	161
823	942	14,100	1,552	826	134	2,529	14,100	2,457	225
1,585	1,857	14,150	957	513	168	667	14,200	1,011	-42
1,789	1,949	14,200	1,260	497	395	1,547	14,300	1,014	-185
1,103	1,270	14,250	346	35	480	2,770	14,400	1,234	33
1,915	2,281	14,300	410	-60	930	3,355	14,500	552	-42
1,802	2,143	14,350	201	0	55	2,292	14,600	452	-38
1,711	2,669	14,400	307	89	128	2,736	14,700	794	-16
※ 2,498	3,154	14,450	138	-15	441	3,983	14,800	240	-6
2,056	3,178	14,500	73	20	928	5,270	14,900	134	-4
2,419	3,328	14,550	61	2	551	10,353	15,000	139	-4
1,953	3,294	14,600	27	5	980	7,838	15,100	60	1
1,344	2,554	14,650	1	0	※ 1,132	4,150	15,200	153	16
534	2,261	14,700	7	-4	-1,148	2,846	15,300	26	0
126	769	14,750	0	0	-287	1,745	15,400	17	0
2,339	3,819	14,800	1	-5	-58	1,822	15,500	22	-5
134	594	14,900	7	0	-88	1,211	15,600	35	0
0	541	15,000	1	0	-35	1,083	15,700	3	0
7	162	15,100	1	0	-15	957	15,800	380	0
9	129	15,200	0	0	35	505	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
24,133	37,975	0.7829	29,732	15,261	3,249	68,281	0.8378	57,208	335
昨日 P/C	1.1368	今日增減變化	-0.3539		昨日 P/C	0.8745	今日增減變化	-0.0367	

更新日期：2022年12月28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28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	96,993,307	57,028,064	39,965,243	-2,095,712	4,484,999	1,359,636	3,125,363	-201,353	
投信	44,322,970	69,781,018	-25,458,048	-2,733,125	354,688	0	354,688	-6,513	
自營商	34,014,187	16,333,937	17,680,250	2,263,140	1,027,807	1,112,822	-85,015	35,401	
	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	655,160	1,246,001	-590,841	93,609	93,746	2,841	90,905	50,879	
投信	71,798	0	71,798	-567	0	0	0	0	
自營商	332,066	201,933	130,133	-56,807	79,542	197,423	-117,881	-43,551	

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28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	20,315	10,631	9,684	-1,192	10,177	9,518	659	-1,704	
投信	0	100	-100	0	300	141	159	0	
自營商	51,093	45,352	5,741	1,549	43,256	31,338	11,918	3,247	
特定法人(週)	0	0	0	---	0	1,235	-1,235	---	
特定法人(近月)	11,750	5,989	5,761	648	3,136	5,950	-2,814	1,990	
特定法人(全月)	16,266	5,989	10,277	1,250	6,789	6,487	302	3,127	
十大交易人(週)	17,618	18,965	-1,347	---	13,681	15,249	-1,568	---	
十大交易人(近月)	36,887	31,016	5,871	-1,324	20,834	29,052	-8,218	81	
十大交易人(全月)	65,889	58,781	7,108	5,657	44,904	53,045	-8,141	-10,555	
全市場未沖銷(近月)			68,281	3,249			57,208	335	
全市場未沖銷(全月)			134,997	-77,754			116,596	-100,603	

更新日期：2022年12月28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01W1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	14800
	賣權成交最大量	13900	賣權OI最大量	13900
	整體隱含波動率	1.23%	較前一交易日	-4.76%
	買權隱含波動率	0.77%	較前一交易日	-6.47%
	賣權隱含波動率	1.67%	較前一交易日	-3.29%
電子選擇權	買權成交最大量	675	買權OI最大量	685
	賣權成交最大量	625	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	1520	賣權OI最大量	1480

更新日期：2022年12月28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	14900	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	16.40%	較前一交易日	+0.19%
	買權隱含波動率	13.31%	較前一交易日	-0.18%
	賣權隱含波動率	20.30%	較前一交易日	+1.19%
	成交量P/C_Ratio值	0.825	較前一交易日	-0.45
	未平倉P/C_Ratio值	0.838	較前一交易日	-0.04
電子選擇權	買權成交最大量	675	買權OI最大量	685
	賣權成交最大量	625	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	1520	賣權OI最大量	1480

更新日期：2022年12月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

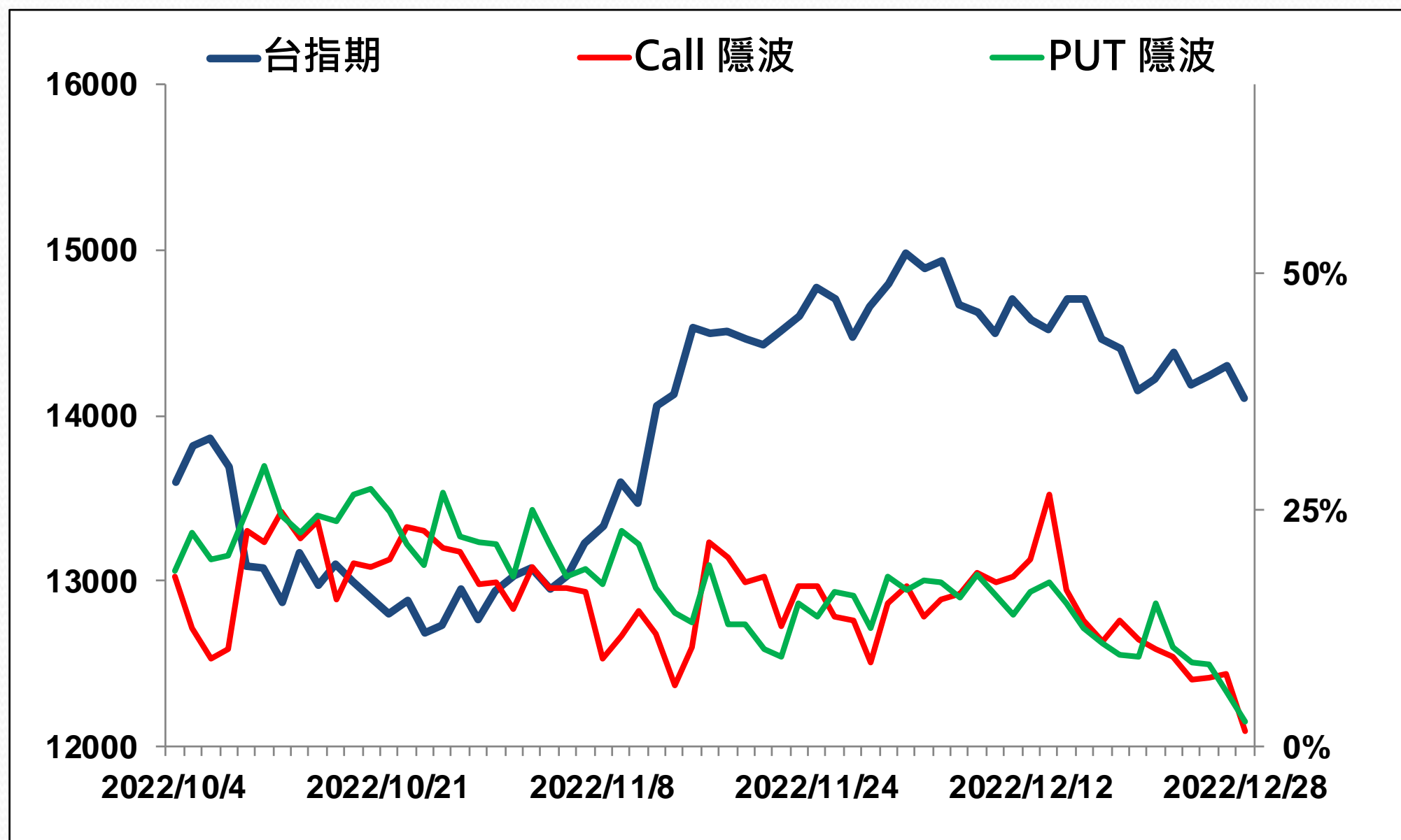
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



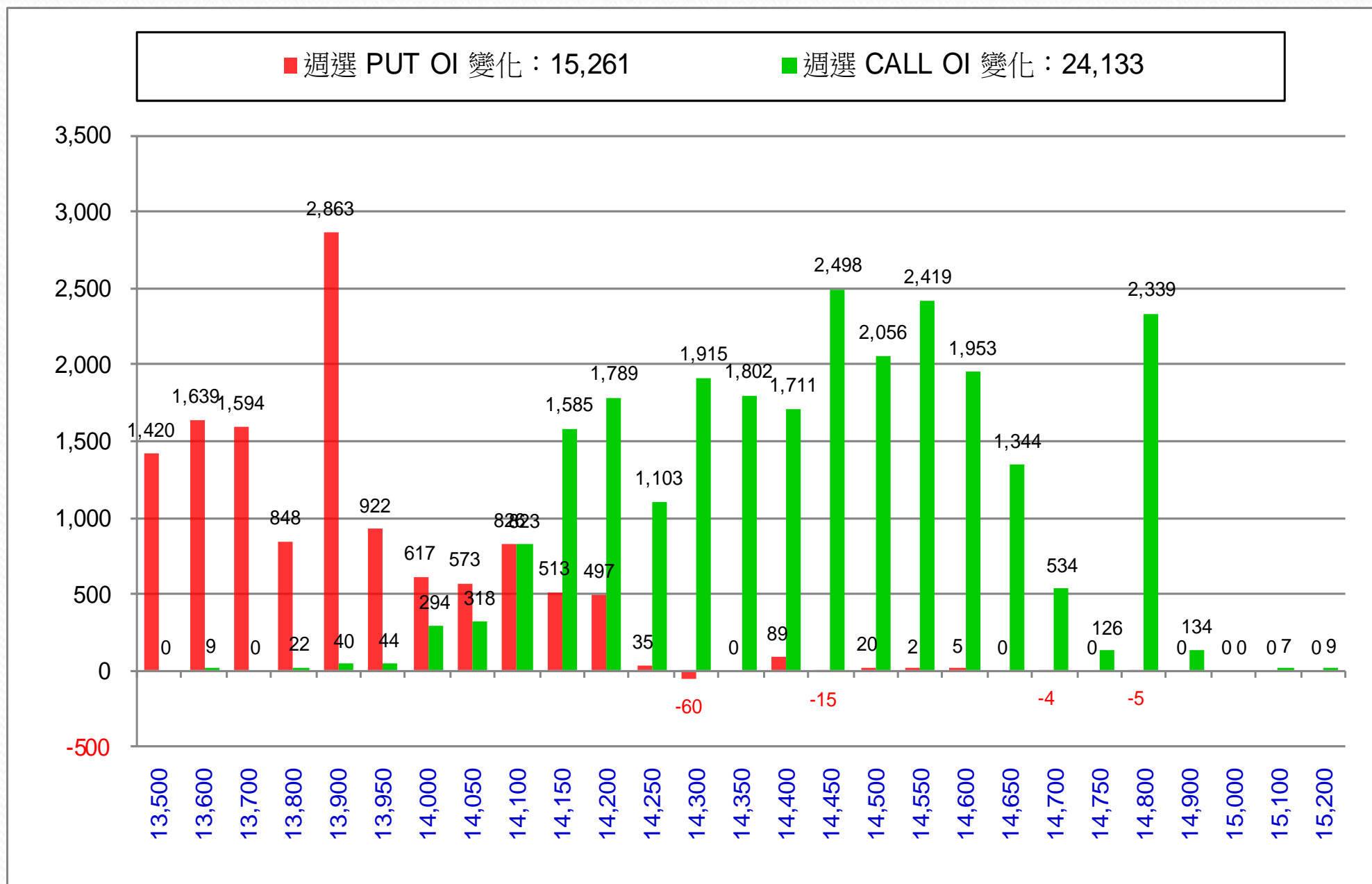
更新日期：2022年12月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



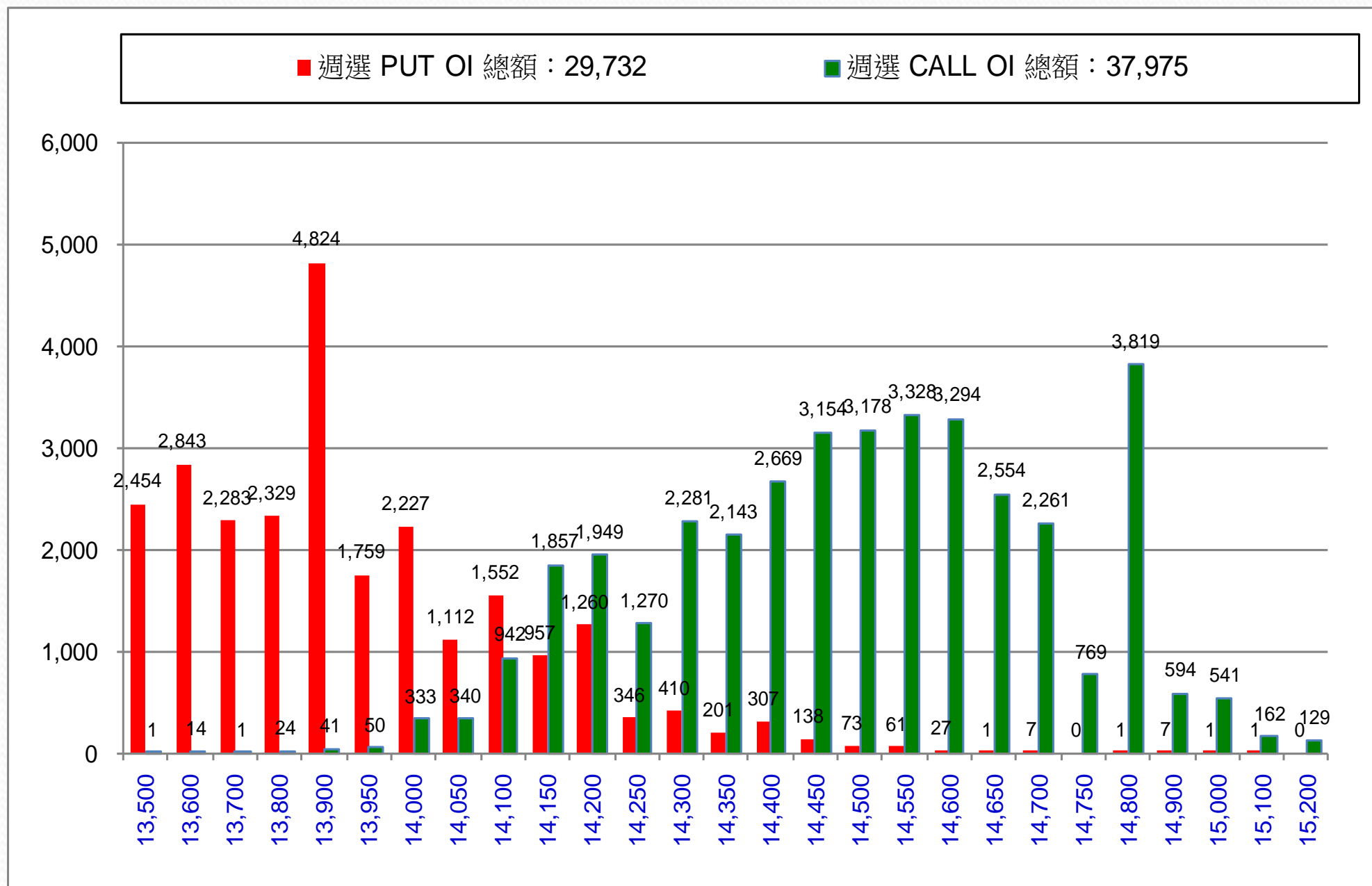
更新日期：2022年12月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年12月28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



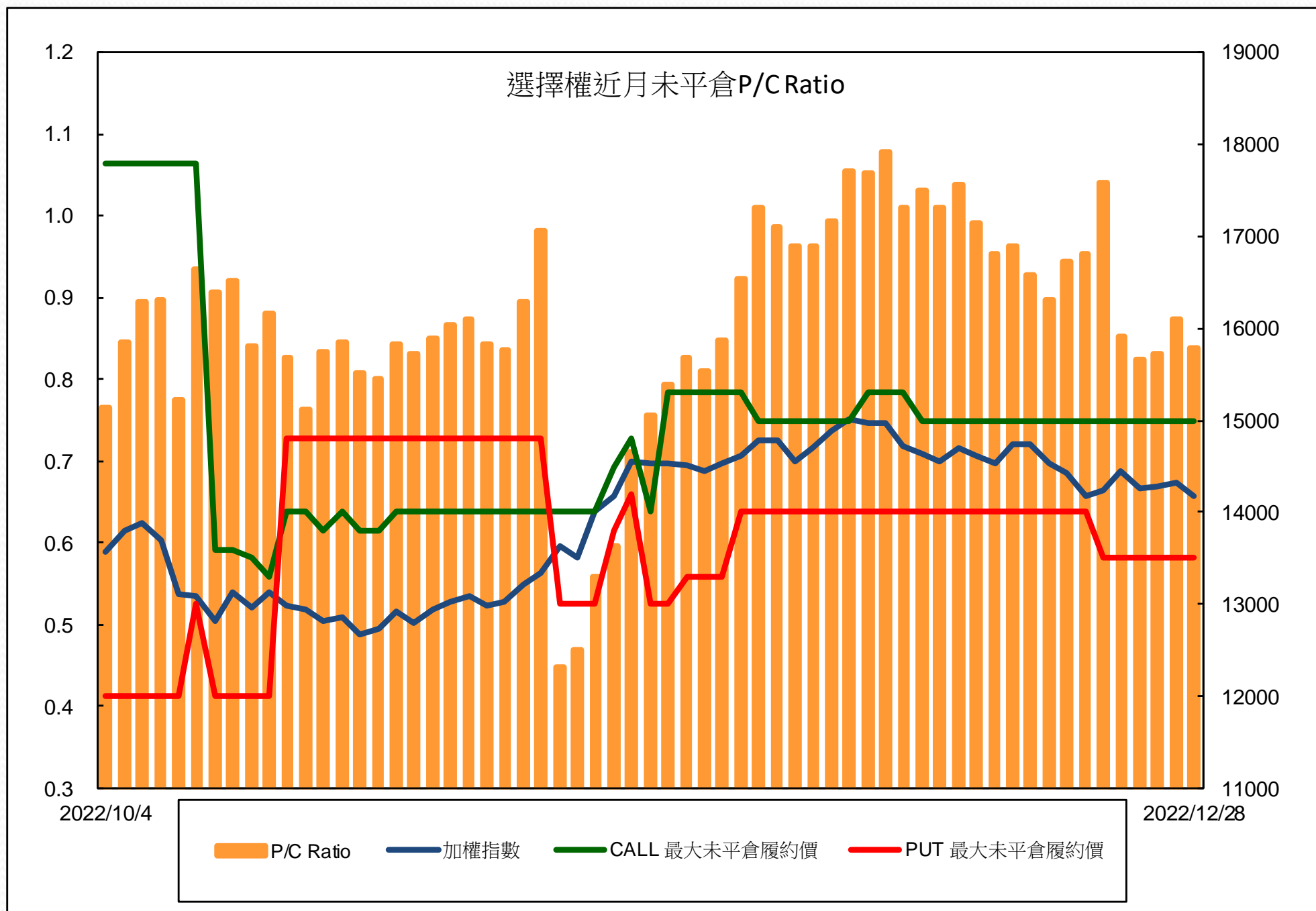
更新日期：2022年12月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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27日	65,245	61,053	4,192
	12月28日	51,093	45,352	5,741
Put	12月27日	62,949	54,278	8,671
	12月28日	43,256	31,338	11,918

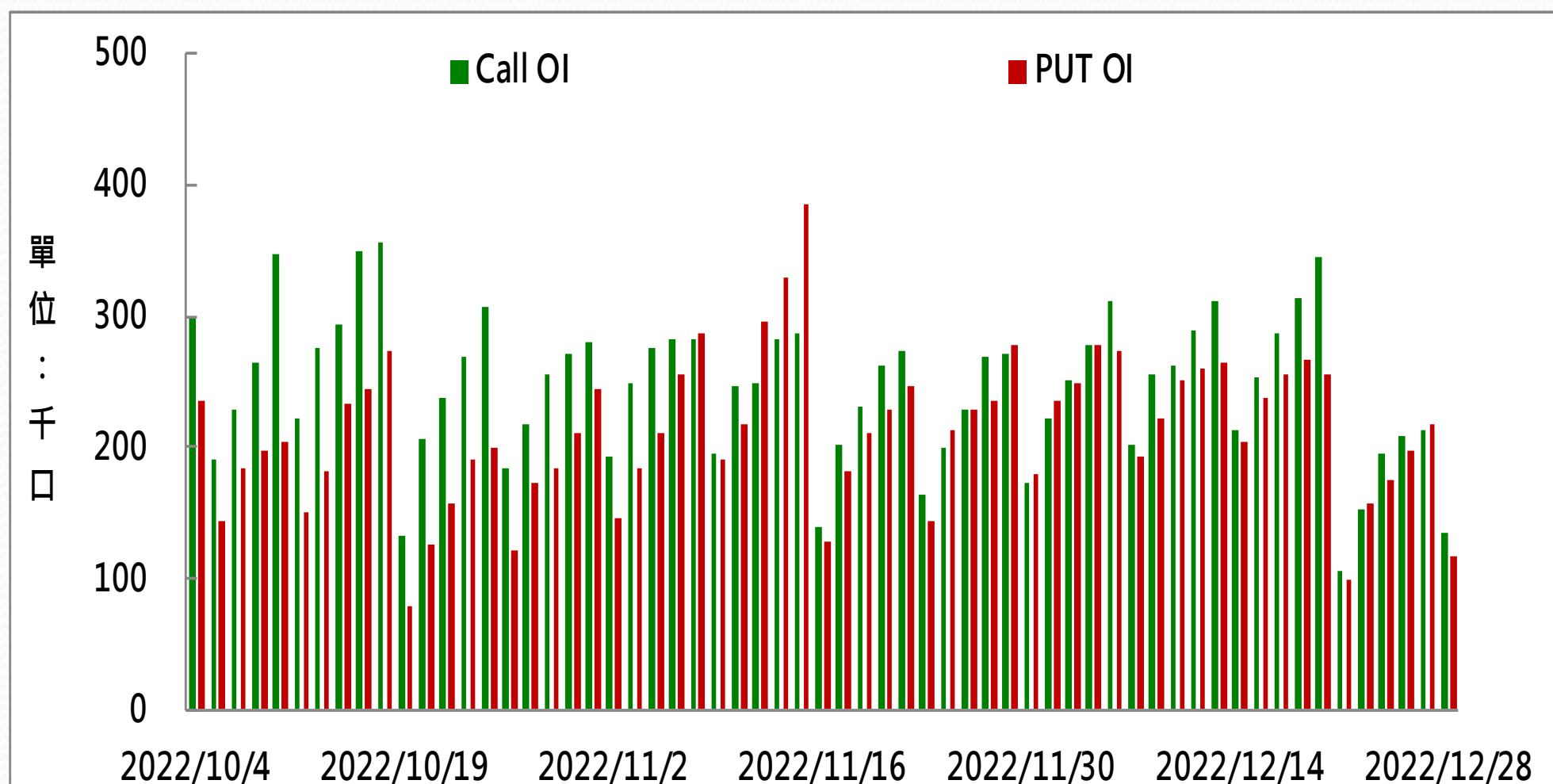
更新日期：2022年12月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



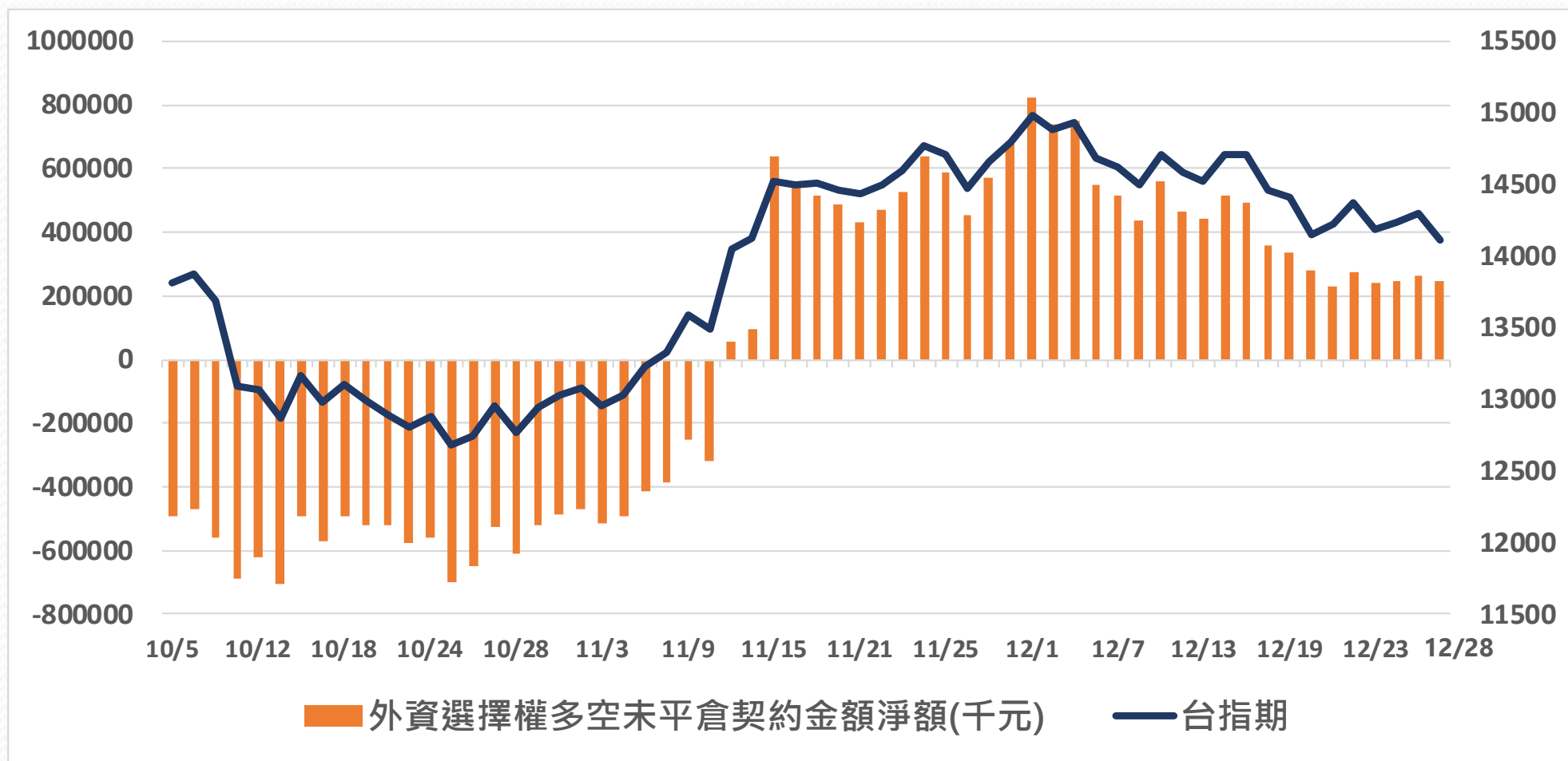
更新日期：2022年12月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整

選擇權全月Put Call OI



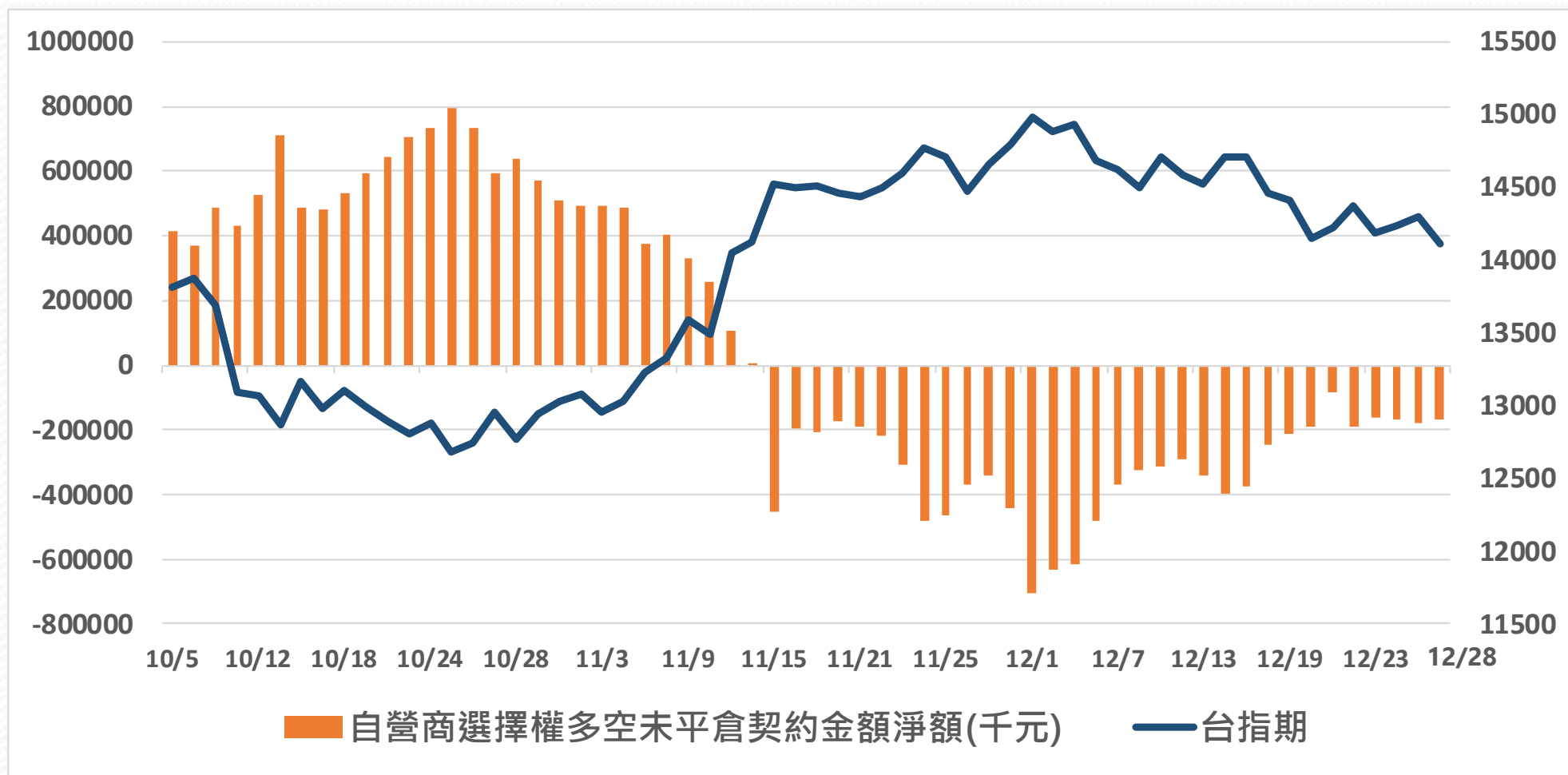
更新日期：2022年12月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

外資選擇權多空未平倉淨額



更新日期：2022年12月28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28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28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