

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/12/29 結算日：2023/1/4					日期：2022/12/29 結算日：2023/1/30				
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
8	22	13,600	5,785	2,942	0	9	13,200	2,067	91
23	24	13,700	6,075	3,792	0	108	13,300	2,742	192
9	25	13,750	3,483	2,096	0	63	13,400	3,266	508
185	209	13,800	4,832	2,503	-3	140	13,500	5,866	545
133	167	13,850	3,808	2,512	6	130	13,600	3,406	219
466	507	13,900	8,121	3,297	-2	132	13,700	2,614	414
532	582	13,950	3,486	1,727	56	321	13,800	3,302	-173
1,421	1,754	14,000	5,281	3,054	96	241	13,900	2,239	-52
1,497	1,837	14,050	2,493	1,381	504	959	14,000	2,581	-45
1,984	2,926	14,100	2,769	1,217	-672	1,857	14,100	2,465	8
1,666	3,523	14,150	1,590	633	412	1,079	14,200	1,061	50
2,427	4,376	14,200	1,546	286	338	1,885	14,300	980	-34
2,181	3,451	14,250	480	134	174	2,944	14,400	1,189	-45
3,169	5,450	14,300	377	-33	-124	3,231	14,500	549	-3
2,683	4,826	14,350	260	59	9	2,301	14,600	429	-23
※ 4,341	7,010	14,400	220	-87	363	3,099	14,700	787	-7
1,993	5,147	14,450	87	-51	※ 1,047	5,030	14,800	257	17
1,988	5,166	14,500	63	-10	644	5,914	14,900	132	-2
127	3,455	14,550	60	-1	-83	10,270	15,000	136	-3
-150	3,144	14,600	26	-1	-553	7,285	15,100	60	0
458	3,012	14,650	1	0	-72	4,078	15,200	153	0
-314	1,947	14,700	9	2	-488	2,358	15,300	25	-1
70	839	14,750	0	0	-28	1,717	15,400	17	0
-233	3,586	14,800	4	3	367	2,189	15,500	22	0
578	1,172	14,900	3	-4	-4	1,207	15,600	35	0
-33	508	15,000	1	0	-8	1,075	15,700	3	0
4	166	15,100	1	0	5	962	15,800	380	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
27,004	65,029	0.9652	62,765	30,350	2,768	71,049	0.8499	60,386	3,178
昨日 P/C	0.7829	今日增減變化		0.1823	昨日 P/C	0.8378	今日增減變化		0.0121

更新日期：2023年1月3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29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	94,104,909	54,293,040	39,811,869	-153,374	4,678,949	1,279,800	3,399,149	273,786	
投信	41,664,139	69,833,184	-28,169,045	-2,710,997	353,225	0	353,225	-1,463	
自營商	33,729,498	15,736,124	17,993,374	313,124	1,102,915	1,323,233	-220,318	-135,303	
	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	618,244	1,166,806	-548,562	42,279	313,064	1,410	311,654	220,749	
投信	71,165	0	71,165	-633	0	0	0	0	
自營商	329,136	275,764	53,372	-76,761	23,973	348,303	-324,330	-206,449	

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29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	23,682	11,687	11,995	2,311	12,583	12,726	-143	-802	
投信	0	100	-100	0	300	141	159	0	
自營商	56,560	48,574	7,986	2,245	48,577	34,511	14,066	2,148	
特定法人(週)	0	0	0	0	871	675	196	1,431	
特定法人(近月)	14,222	5,989	8,233	2,472	3,773	7,274	-3,501	-687	
特定法人(全月)	17,807	5,989	11,818	1,541	7,937	5,111	2,826	2,524	
十大交易人(週)	22,394	24,898	-2,504	-1,157	23,487	19,185	4,302	5,870	
十大交易人(近月)	37,621	30,420	7,201	1,330	23,204	31,958	-8,754	-536	
十大交易人(全月)	74,044	63,440	10,604	3,496	55,432	58,767	-3,335	4,806	
全市場未沖銷(近月)			71,049	2,768			60,386	3,178	
全市場未沖銷(全月)			170,330	35,333			154,288	37,692	

更新日期：2023年1月3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	14200	買權OI最大量	14400
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	13900
	整體隱含波動率	1.23%	較前一交易日	+0.00%
	買權隱含波動率	0.77%	較前一交易日	+0.00%
	賣權隱含波動率	1.67%	較前一交易日	+0.00%
電子選擇權	買權成交最大量	670	買權OI最大量	690
	賣權成交最大量	610	賣權OI最大量	620
金融選擇權	買權成交最大量	1500	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1420	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年1月3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	14100	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	16.37%	較前一交易日	+0.03%
	買權隱含波動率	13.92%	較前一交易日	+0.60%
	賣權隱含波動率	19.66%	較前一交易日	-0.64%
	成交量P/C_Ratio值	0.756	較前一交易日	-0.07
	未平倉P/C_Ratio值	0.850	較前一交易日	+0.01
電子選擇權	買權成交最大量	670	買權OI最大量	690
	賣權成交最大量	610	賣權OI最大量	620
金融選擇權	買權成交最大量	1500	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1420	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

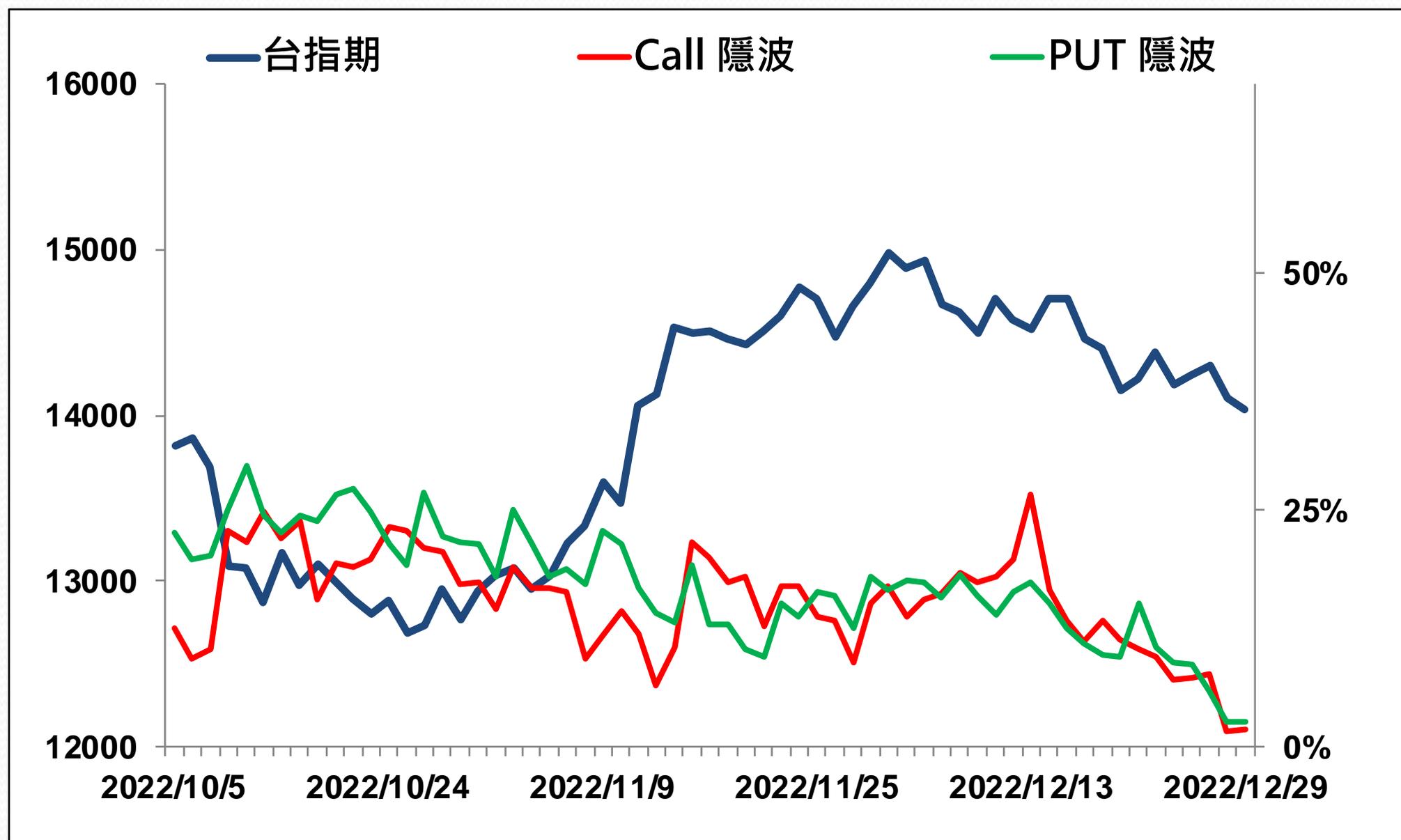
# 選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



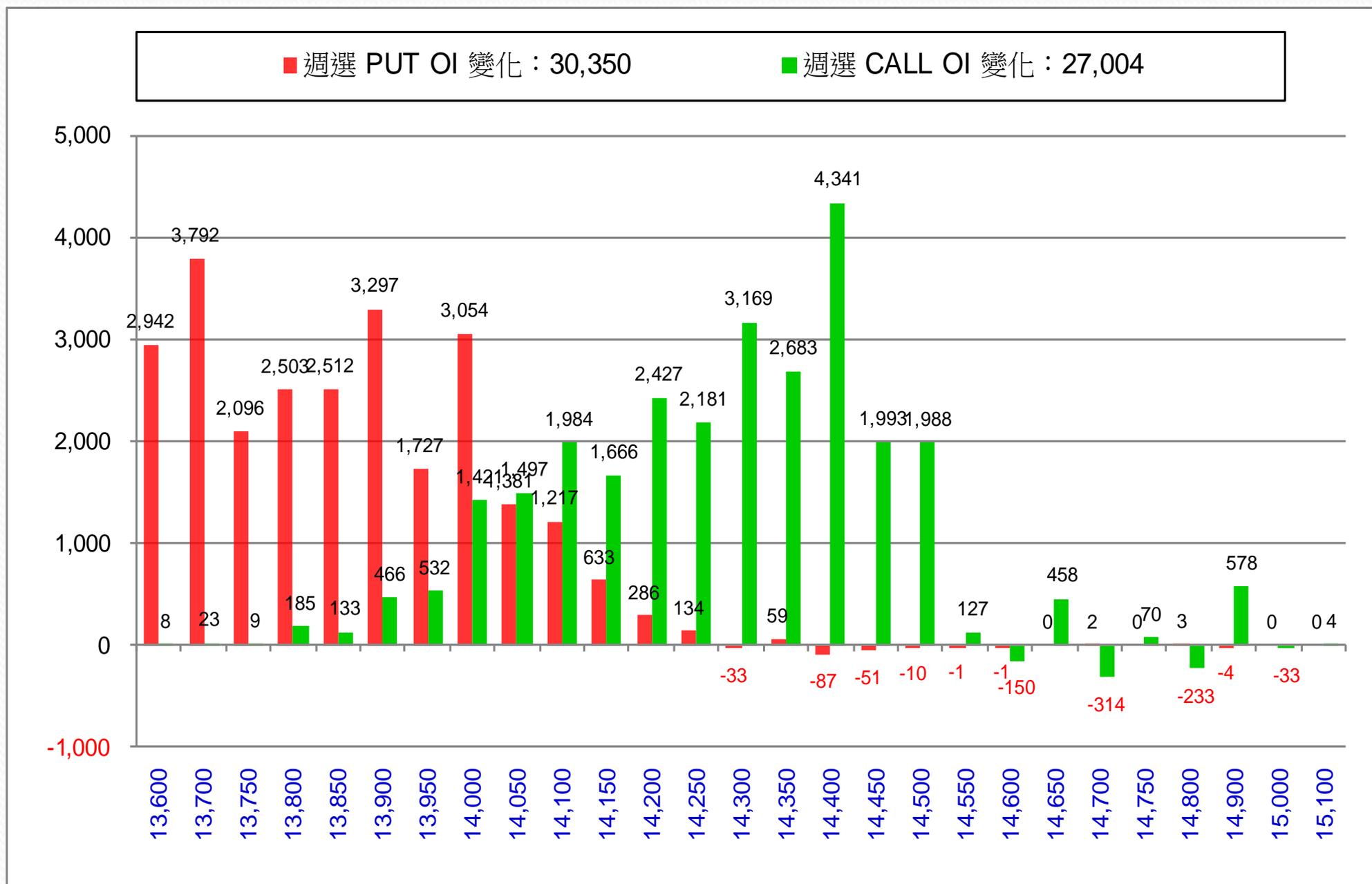
更新日期：2023年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2023年1月3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

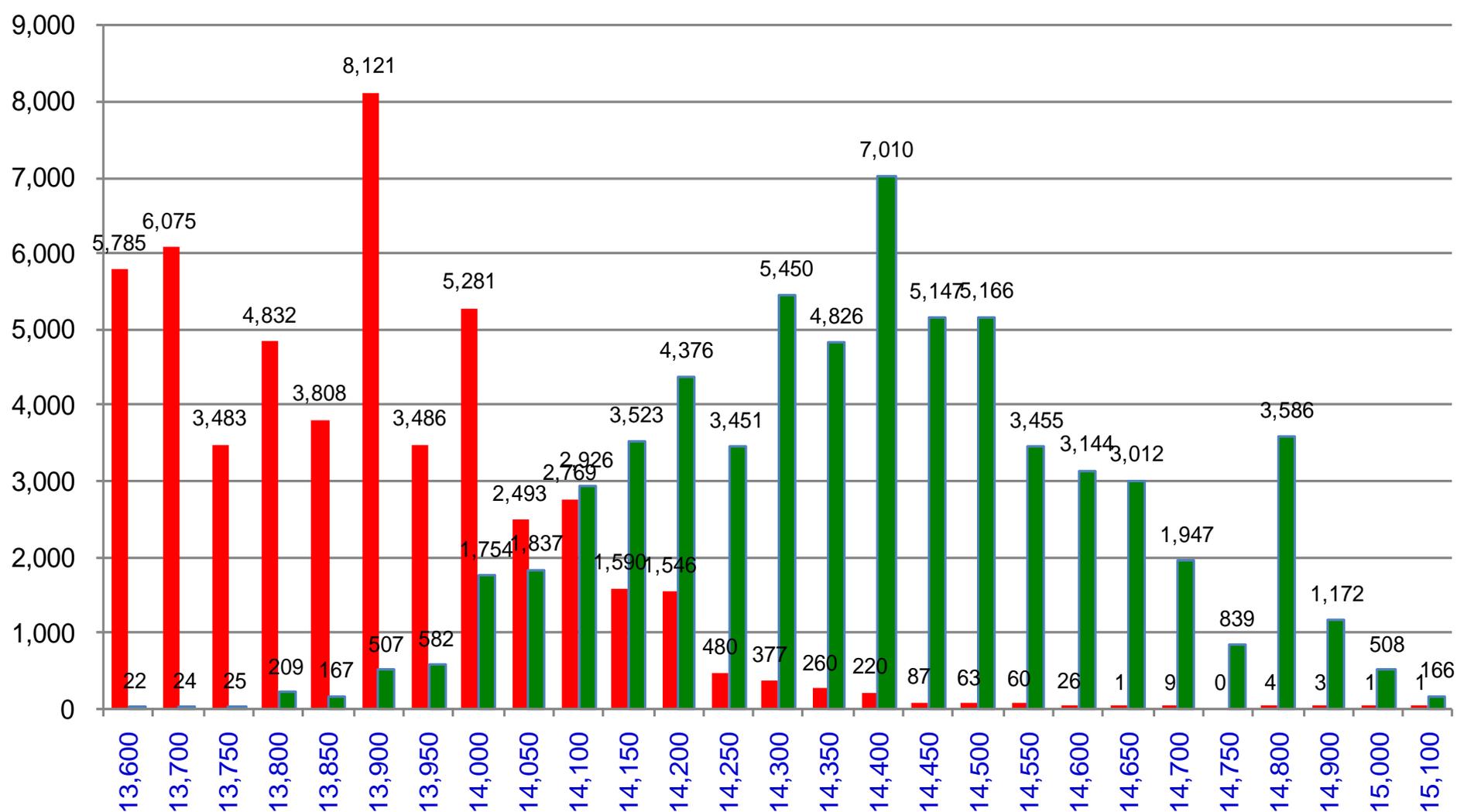


更新日期：2023年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：62,765

週選 CALL OI 總額：65,029



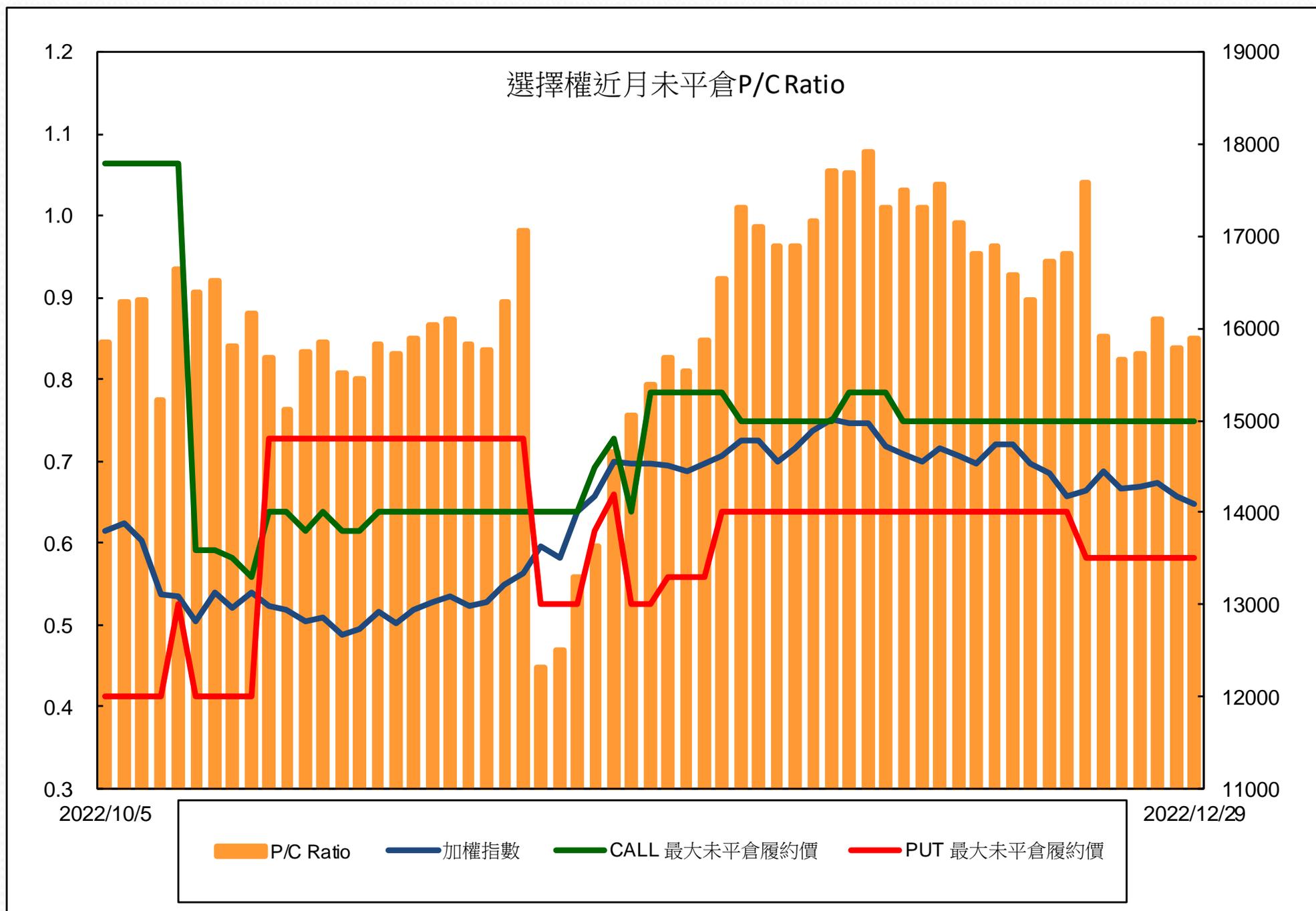
更新日期：2023年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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28日	51,093	45,352	5,741
	12月29日	56,560	48,574	7,986
Put	12月28日	43,256	31,338	11,918
	12月29日	48,577	34,511	14,066

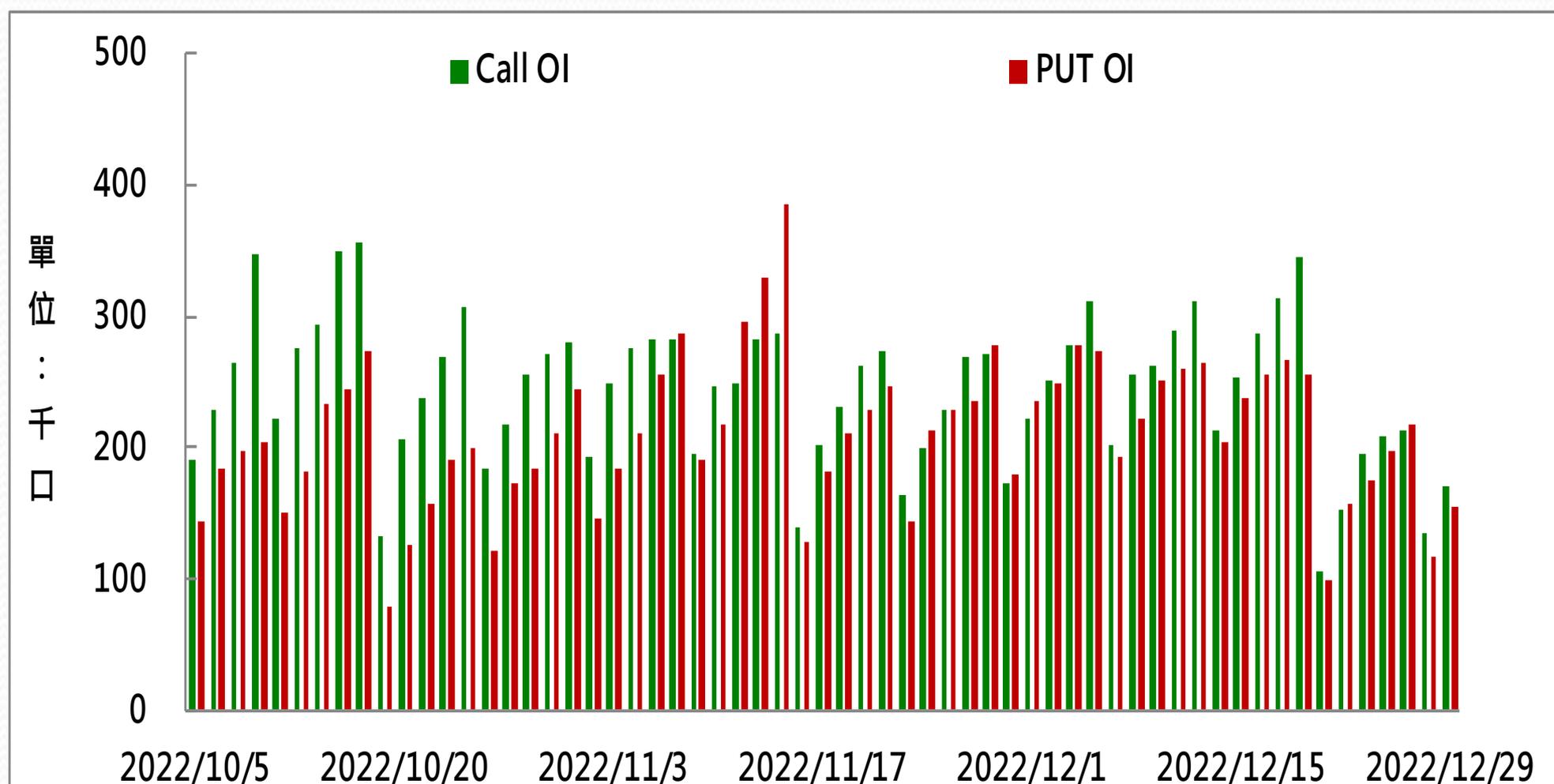
更新日期：2023年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



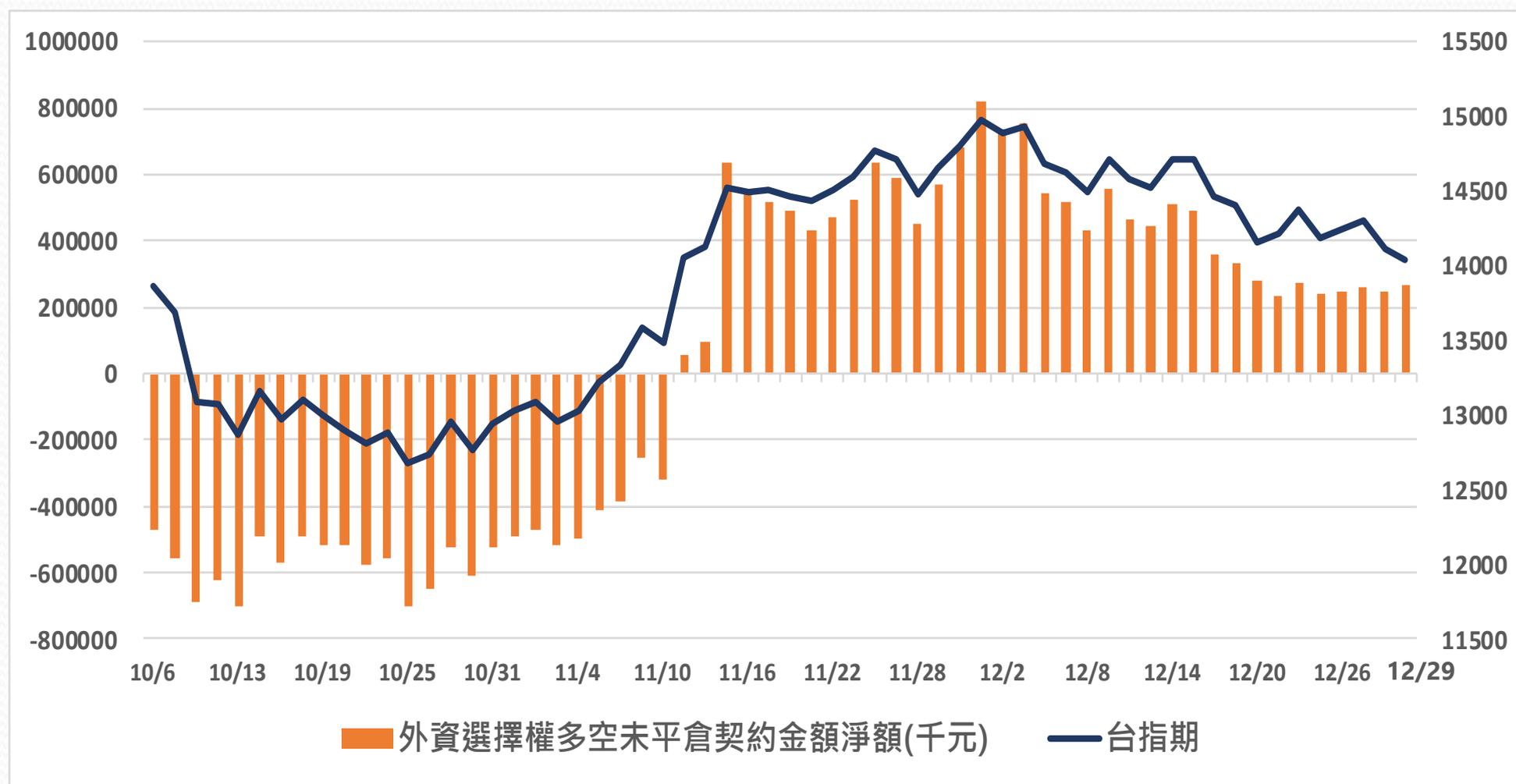
更新日期：2023年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權全月Put Call OI



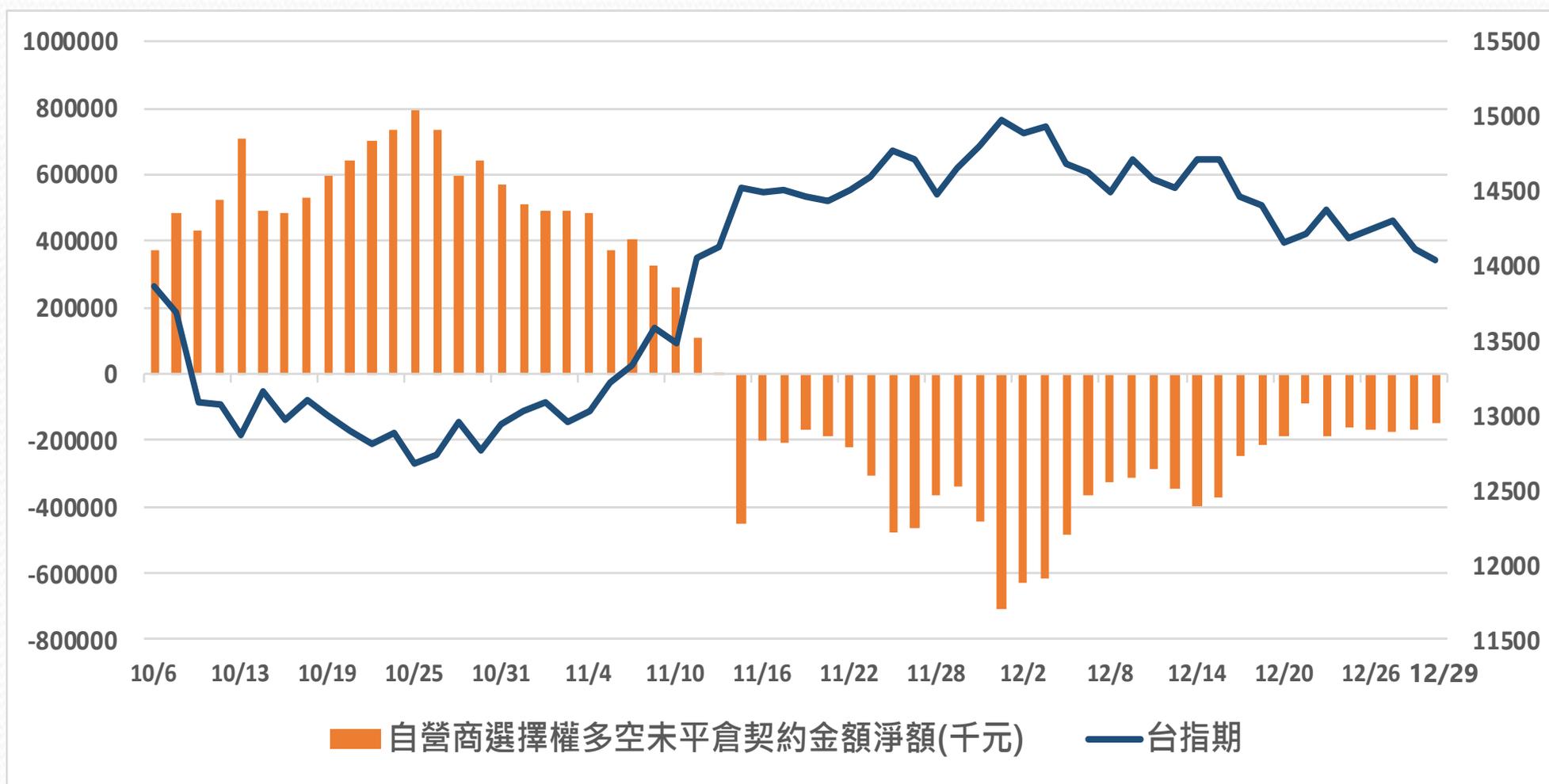
更新日期：2023年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 外資選擇權多空未平倉淨額



更新日期：2023年1月3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：2023年1月3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：2023年1月3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