

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/12/30 結算日：2023/1/4					日期：2022/12/30 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
1	25	13,700	5,335	-740	0	9	13,200	2,232	165
-4	21	13,750	3,333	-150	0	108	13,300	2,763	21
-52	157	13,800	7,026	2,194	0	63	13,400	3,253	-13
-86	81	13,850	4,601	793	-7	133	13,500	6,254	388
-84	423	13,900	10,183	2,062	2	132	13,600	3,472	66
-214	368	13,950	4,949	1,463	-1	131	13,700	2,931	317
-544	1,210	14,000	9,753	4,472	21	342	13,800	3,370	68
-342	1,495	14,050	3,785	1,292	0	241	13,900	2,640	401
-816	2,110	14,100	4,751	1,982	27	986	14,000	2,815	234
69	3,592	14,150	2,870	1,280	8	1,865	14,100	1,797	-668
-84	4,292	14,200	3,639	2,093	157	1,236	14,200	1,166	105
820	4,271	14,250	946	466	-153	1,732	14,300	1,055	75
1,121	6,571	14,300	1,012	635	-156	2,788	14,400	1,188	-1
8	4,834	14,350	347	87	13	3,244	14,500	547	-2
※ 1,823	8,833	14,400	386	166	64	2,365	14,600	449	20
1,575	6,722	14,450	86	-1	10	3,109	14,700	797	10
1,613	6,779	14,500	108	45	36	5,066	14,800	270	13
111	3,566	14,550	54	-6	434	6,348	14,900	135	3
1,182	4,326	14,600	32	6	200	10,470	15,000	134	-2
198	3,210	14,650	3	2	※ 697	7,982	15,100	58	-2
519	2,466	14,700	12	3	-376	3,702	15,200	154	1
295	1,134	14,750	0	0	-26	2,332	15,300	25	0
-28	3,558	14,800	4	0	-15	1,702	15,400	17	0
1	1,173	14,900	2	-1	20	2,209	15,500	19	-3
-9	499	15,000	1	0	-12	1,195	15,600	35	0
-4	162	15,100	1	0	0	1,075	15,700	3	0
-2	35	15,200	0	0	-4	958	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
7,083	72,112	1.1089	79,963	17,198	468	71,517	0.8870	63,433	3,047
昨日 P/C	0.9652	今日增減變化		0.1437	昨日 P/C	0.8499	今日增減變化		0.0370

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30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	101,341,057	46,995,999	54,345,058	14,533,189	4,797,225	1,166,475	3,630,750	231,601	
投信	40,677,703	69,552,681	-28,874,978	-705,933	355,350	0	355,350	2,125	
自營商	32,767,840	16,432,451	16,335,389	-1,657,985	1,076,062	1,521,753	-445,691	-225,373	
	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	648,570	974,349	-325,779	222,783	340,049	1,423	338,626	26,972	
投信	71,731	0	71,731	566	0	0	0	0	
自營商	330,261	348,195	-17,934	-71,306	31,302	395,522	-364,220	-39,890	

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30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	25,044	12,319	12,725	730	12,988	13,182	-194	-51	
投信	0	100	-100	0	300	141	159	0	
自營商	60,697	46,272	14,425	6,439	48,632	42,439	6,193	-7,873	
特定法人(週)	0	0	0	0	0	0	0	-196	
特定法人(近月)	15,115	6,191	8,924	691	3,753	7,414	-3,661	-160	
特定法人(全月)	18,243	6,191	12,052	234	6,143	6,689	-546	-3,372	
十大交易人(週)	28,095	25,384	2,711	5,215	33,672	19,154	14,518	10,216	
十大交易人(近月)	37,401	29,848	7,553	352	25,392	32,934	-7,542	1,212	
十大交易人(全月)	79,516	60,613	18,903	8,299	65,190	59,165	6,025	9,360	
全市場未沖銷(近月)			71,517	468			63,433	3,047	
全市場未沖銷(全月)			182,152	11,822			181,756	27,468	

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	14400	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	640	買權OI最大量	685
	賣權成交最大量	615	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	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	14900	買權OI最大量	15000
	賣權成交最大量	12600	賣權OI最大量	13500
	整體隱含波動率	16.84%	較前一交易日	-0.46%
	買權隱含波動率	13.87%	較前一交易日	-0.05%
	賣權隱含波動率	18.99%	較前一交易日	-0.67%
	成交量P/C_Ratio值	1.206	較前一交易日	+0.45
	未平倉P/C_Ratio值	0.887	較前一交易日	+0.04
電子選擇權	買權成交最大量	640	買權OI最大量	685
	賣權成交最大量	615	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	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

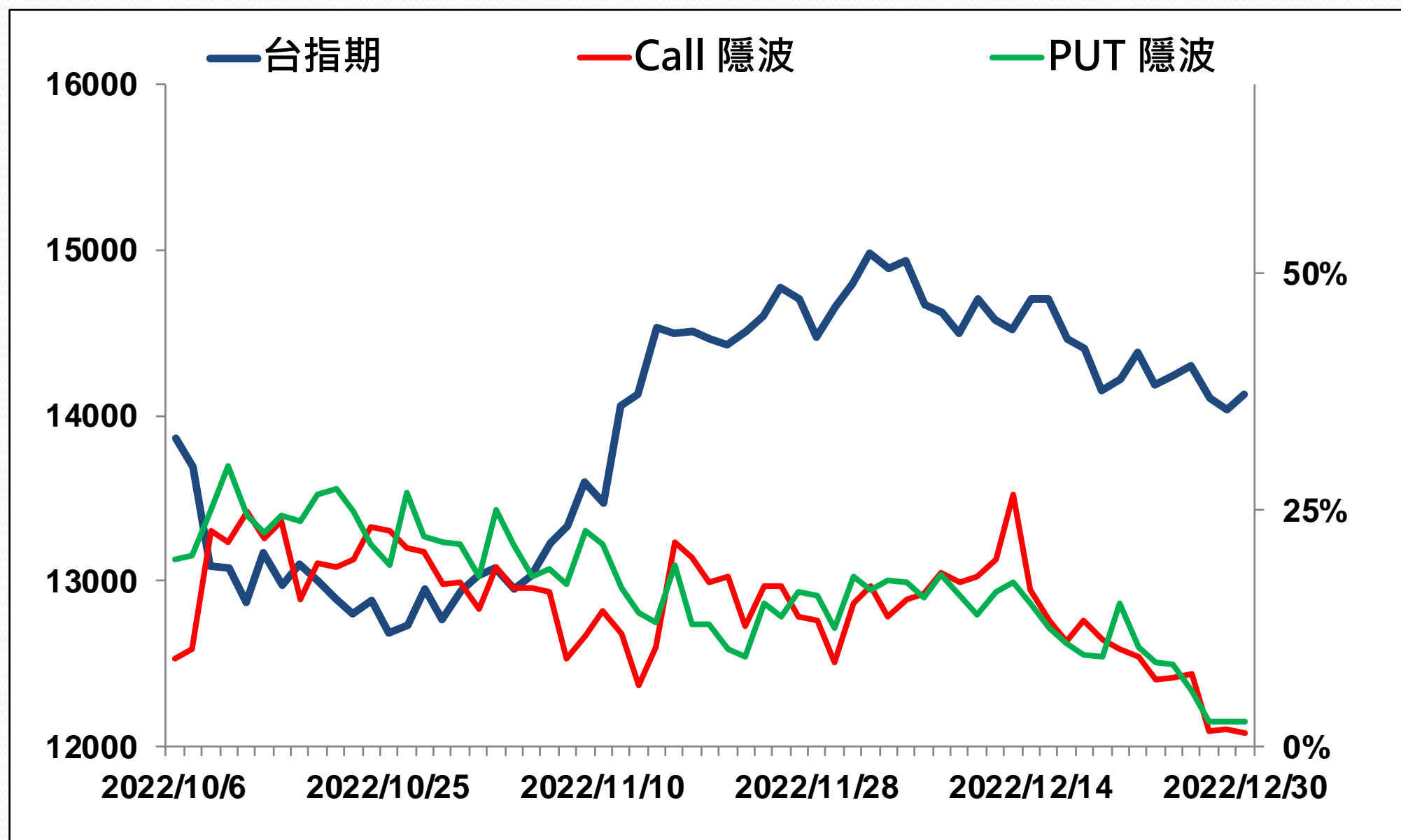
# 選擇權當日波動率指數

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

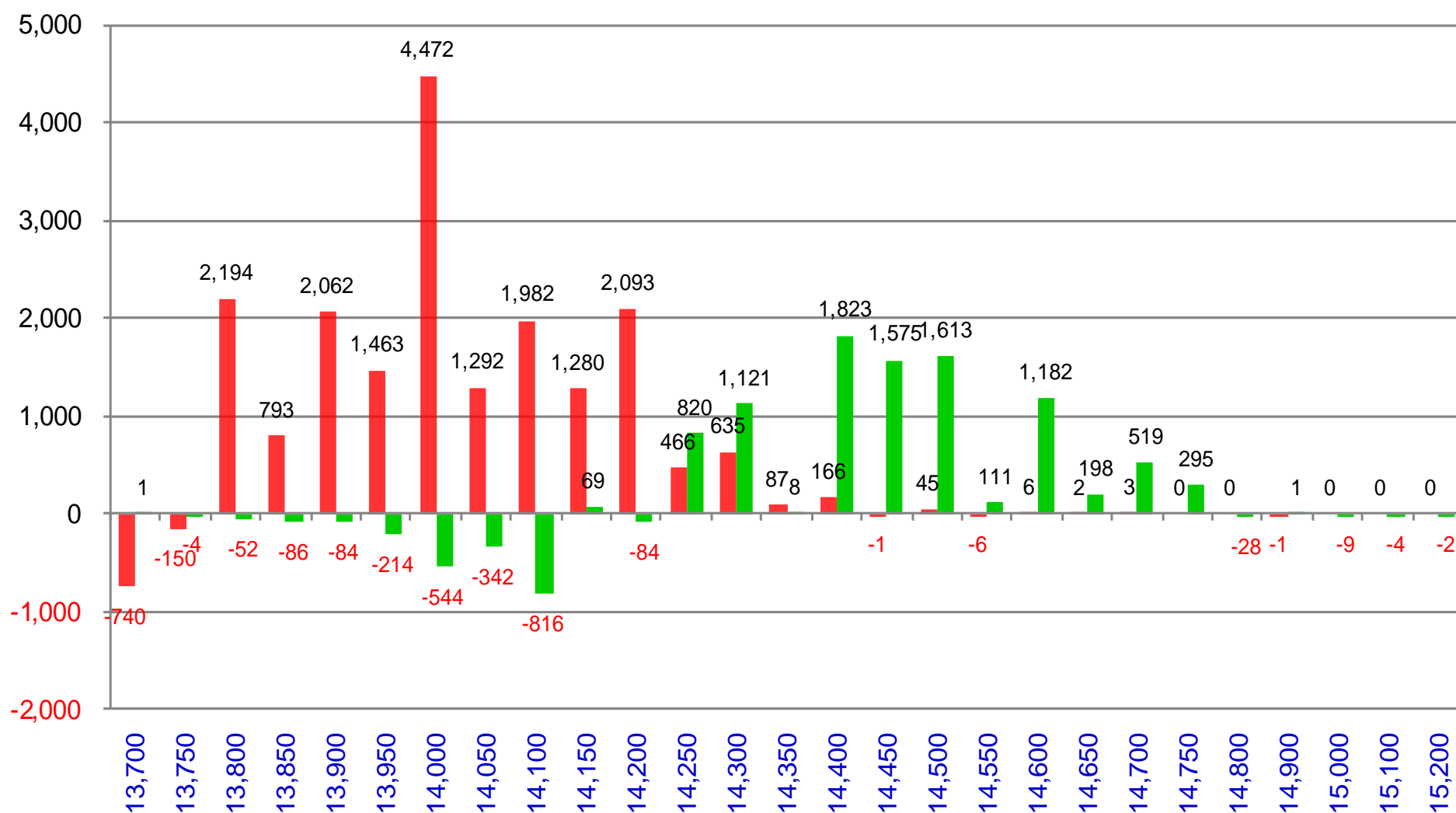


更新日期：2023年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI每日變化量

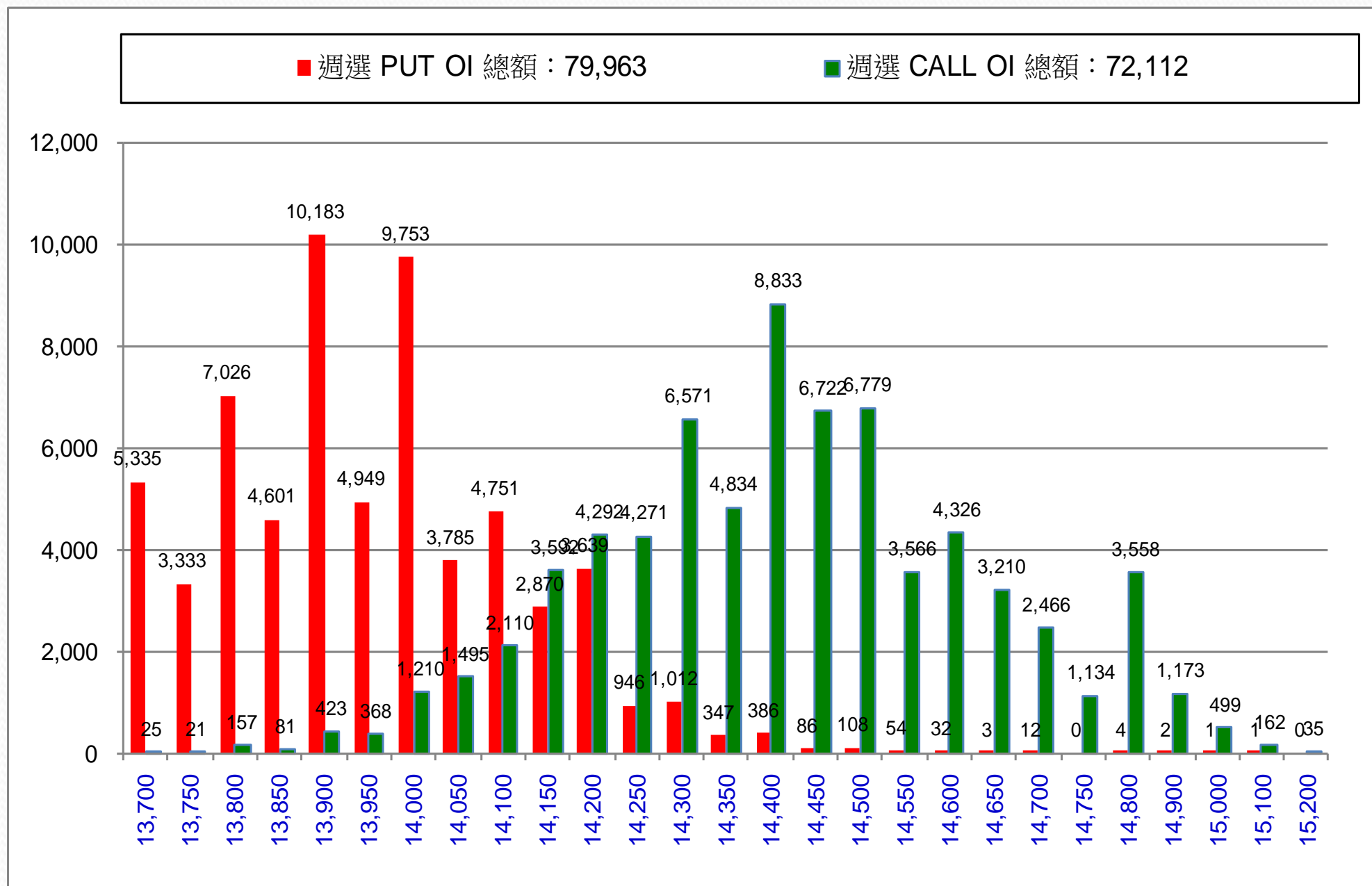
週選 PUT OI 變化：17,198

週選 CALL OI 變化：7,083



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



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

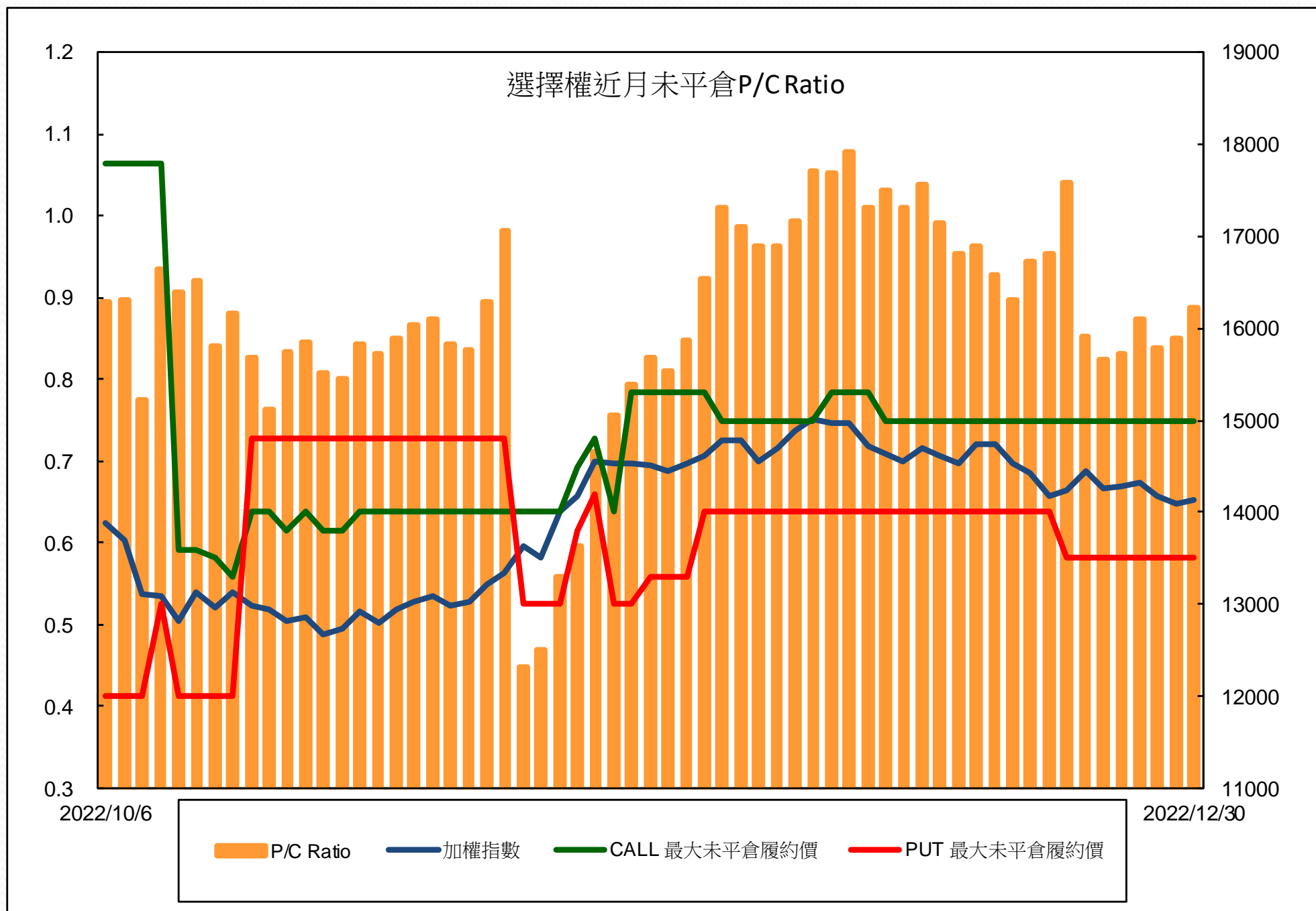


# 自營商選擇權OI部位統計

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29日	56,560	48,574	7,986
	12月30日	60,697	46,272	14,425
Put	12月29日	48,577	34,511	14,066
	12月30日	48,632	42,439	6,193

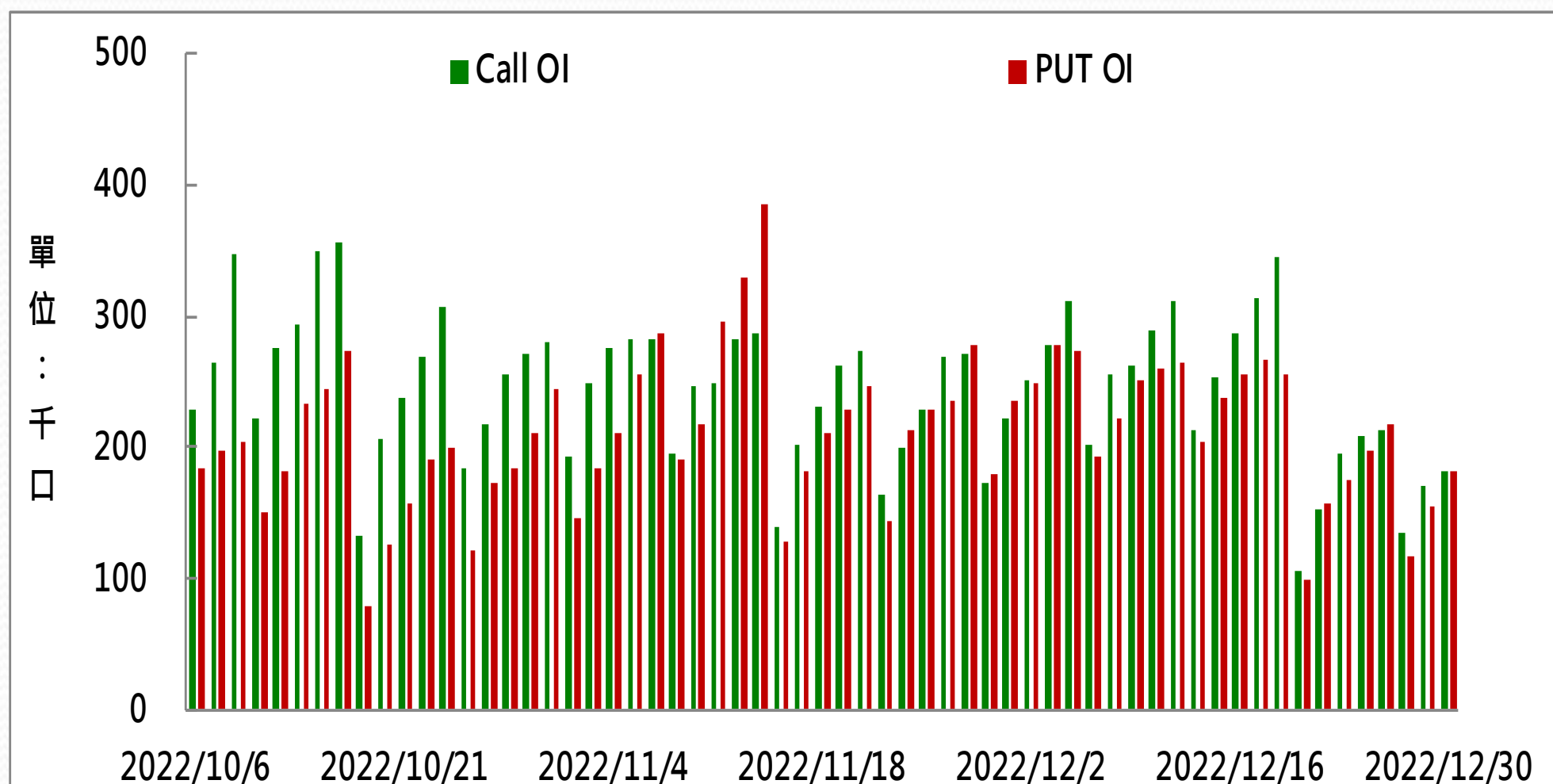
更新日期：2023年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



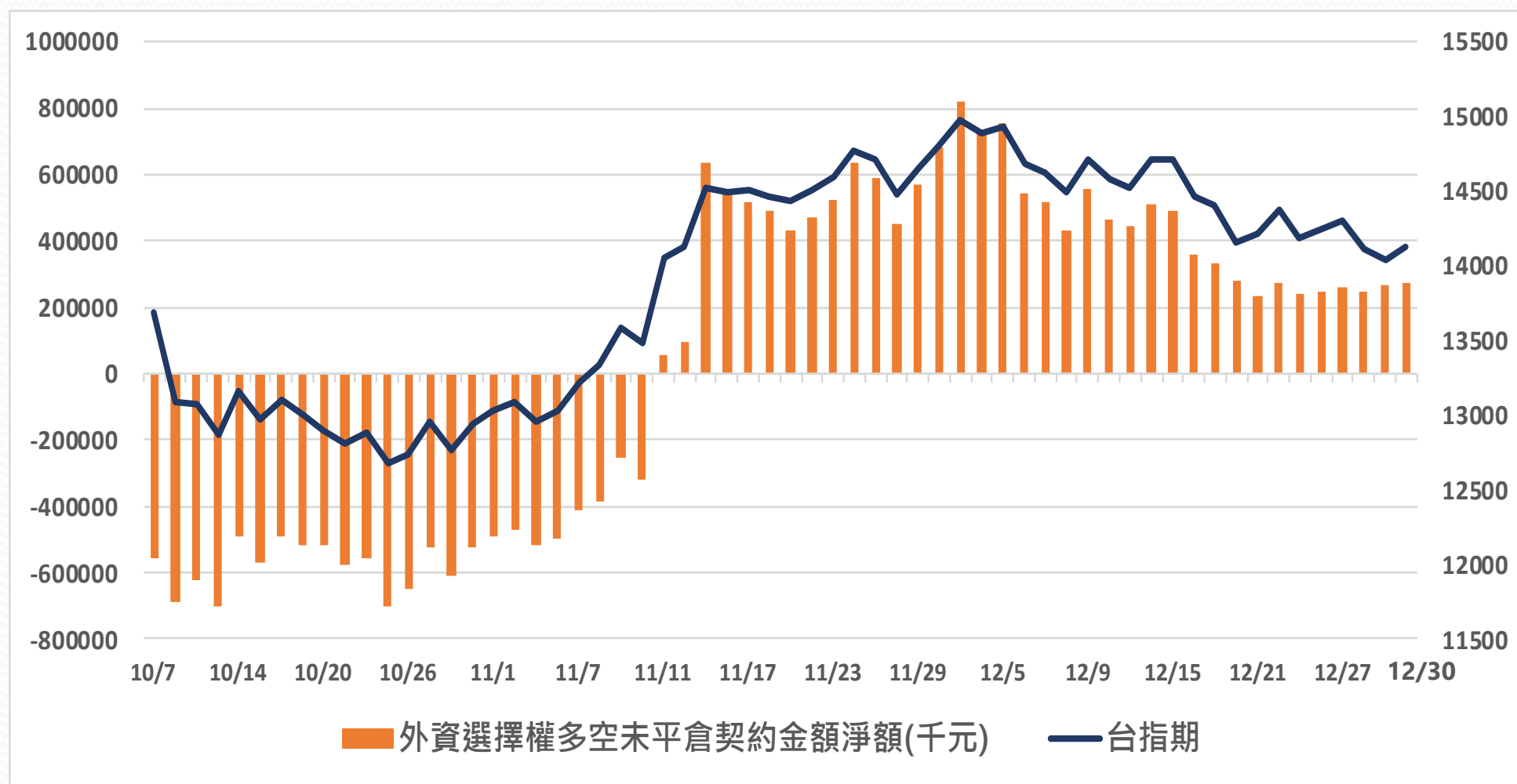
更新日期：2023年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權全月Put Call OI



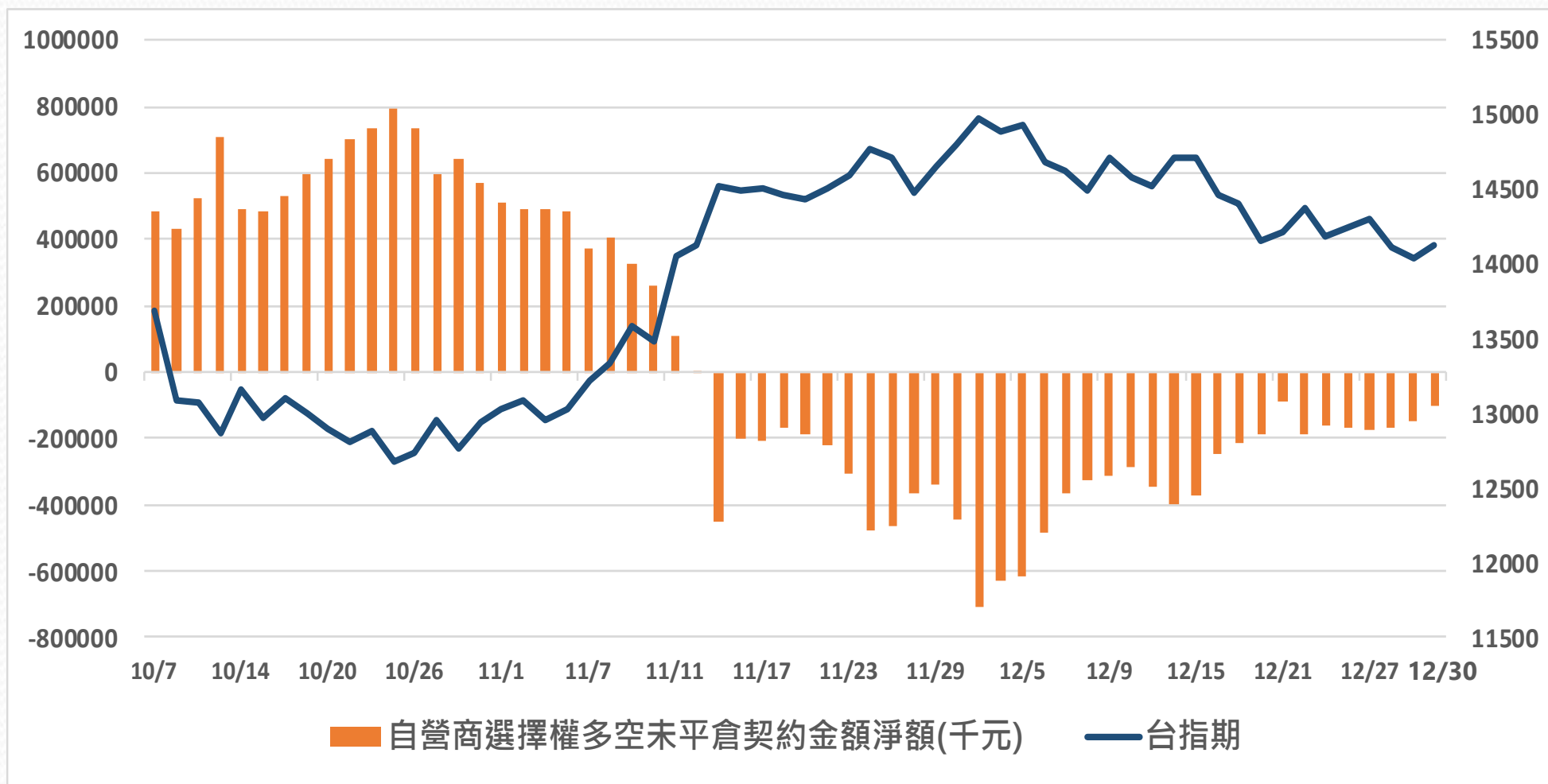
更新日期：2023年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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