

# 台指選擇權 OI 匯報

日期：2023/1/3 結算日：2023/1/4					日期：2023/1/3 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
-11	10	13,750	3,791	458	0	108	13,300	3,009	246
103	260	13,800	7,326	300	3	66	13,400	3,506	253
67	148	13,850	5,543	942	11	144	13,500	6,646	392
537	960	13,900	9,286	-897	3	135	13,600	4,142	670
268	636	13,950	8,411	3,462	-2	129	13,700	3,508	577
1,379	2,589	14,000	10,741	988	7	349	13,800	3,604	234
750	2,245	14,050	7,301	3,516	89	330	13,900	2,949	309
1,320	3,430	14,100	9,824	5,073	438	1,424	14,000	3,117	302
492	4,084	14,150	8,909	6,039	442	2,307	14,100	1,883	86
996	5,288	14,200	6,828	3,189	344	1,580	14,200	1,333	167
※ 4,181	8,452	14,250	5,207	4,261	-153	1,579	14,300	1,087	32
4,159	10,730	14,300	1,581	569	109	2,897	14,400	1,201	13
3,818	8,652	14,350	738	391	507	3,751	14,500	540	-7
-306	8,527	14,400	452	66	464	2,829	14,600	441	-8
-2,218	4,504	14,450	83	-3	818	3,927	14,700	801	4
-652	6,127	14,500	73	-35	51	5,117	14,800	233	-37
123	3,689	14,550	55	1	314	6,662	14,900	131	-4
-1,363	2,963	14,600	28	-4	※ 1,444	11,914	15,000	136	2
-166	3,044	14,650	2	-1	-149	7,833	15,100	91	33
-107	2,359	14,700	11	-1	-12	3,690	15,200	153	-1
-30	1,104	14,750	0	0	193	2,525	15,300	25	0
-599	2,959	14,800	1	-3	121	1,823	15,400	17	0
-255	918	14,900	2	0	-235	1,974	15,500	19	0
-24	475	15,000	1	0	-11	1,184	15,600	35	0
-5	157	15,100	1	0	-1	1,074	15,700	3	0
1	36	15,200	0	0	10	968	15,800	380	0
0	118	15,300	0	0	3	515	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
12,452	84,564	1.2851	108,674	28,711	4,904	76,421	0.8879	67,857	4,424
昨日 P/C	1.1089	今日增減變化	0.1762		昨日 P/C	0.8870	今日增減變化	0.0010	

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								2023年1月3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	95,481,699	50,098,749	45,382,950	-8,962,108	4,569,318	1,609,025	2,960,293	-670,457	
投信	35,643,304	66,442,716	-30,799,412	-1,924,434	359,297	0	359,297	3,947	
自營商	33,183,959	15,663,057	17,520,902	1,185,513	1,317,038	1,301,720	15,318	461,009	
	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	652,169	1,041,077	-388,908	-63,129	356,350	0	356,350	17,724	
投信	71,798	0	71,798	67	0	0	0	0	
自營商	345,526	459,211	-113,685	-95,751	41,313	436,125	-394,812	-30,592	

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報								2023年1月3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	25,306	12,488	12,818	93	14,518	13,706	812	1,006	
投信	0	100	-100	0	300	141	159	0	
自營商	62,227	52,143	10,084	-4,341	55,333	53,012	2,321	-3,872	
特定法人(週)	0	0	0	0	0	0	0	0	
特定法人(近月)	15,296	6,191	9,105	181	4,069	7,574	-3,505	156	
特定法人(全月)	18,405	6,191	12,214	162	3,768	5,722	-1,954	-1,408	
十大交易人(週)	35,266	35,136	130	-2,581	47,492	27,050	20,442	5,924	
十大交易人(近月)	37,640	32,045	5,595	-1,958	26,914	35,828	-8,914	-1,372	
十大交易人(全月)	85,460	69,965	15,495	-3,408	77,065	69,124	7,941	1,916	
全市場未沖銷(近月)			76,421	4,904			67,857	4,424	
全市場未沖銷(全月)			207,378	25,226			222,208	40,452	

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	14250	買權OI最大量	14300
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	14000
	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	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	14700	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	16.84%	較前一交易日	+0.00%
	買權隱含波動率	14.54%	較前一交易日	+0.67%
	賣權隱含波動率	18.75%	較前一交易日	-0.24%
	成交量P/C_Ratio值	1.046	較前一交易日	-0.16
	未平倉P/C_Ratio值	0.888	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	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

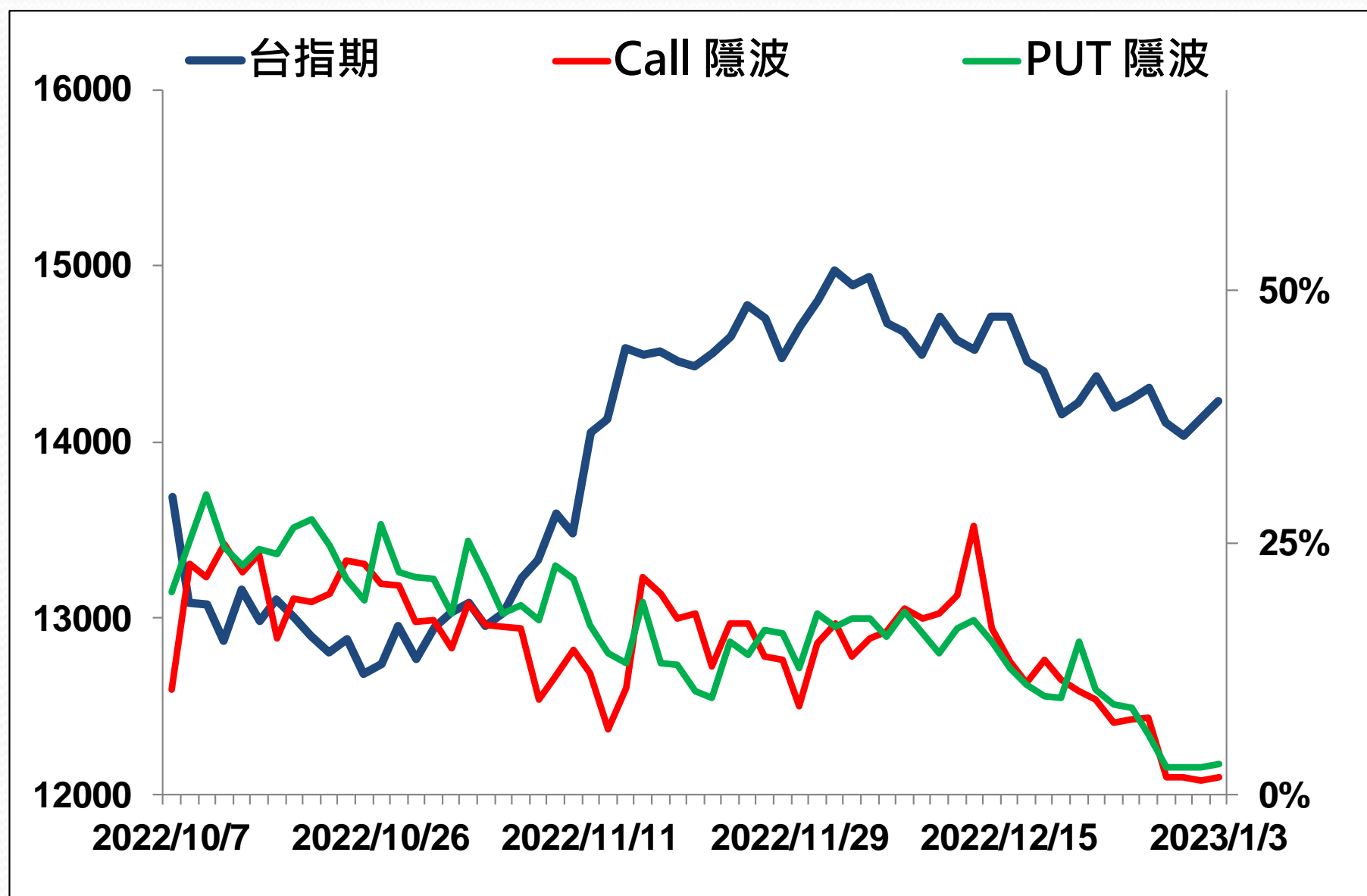
## 臺指選擇權波動率指數

— 臺指選擇權波動率指數



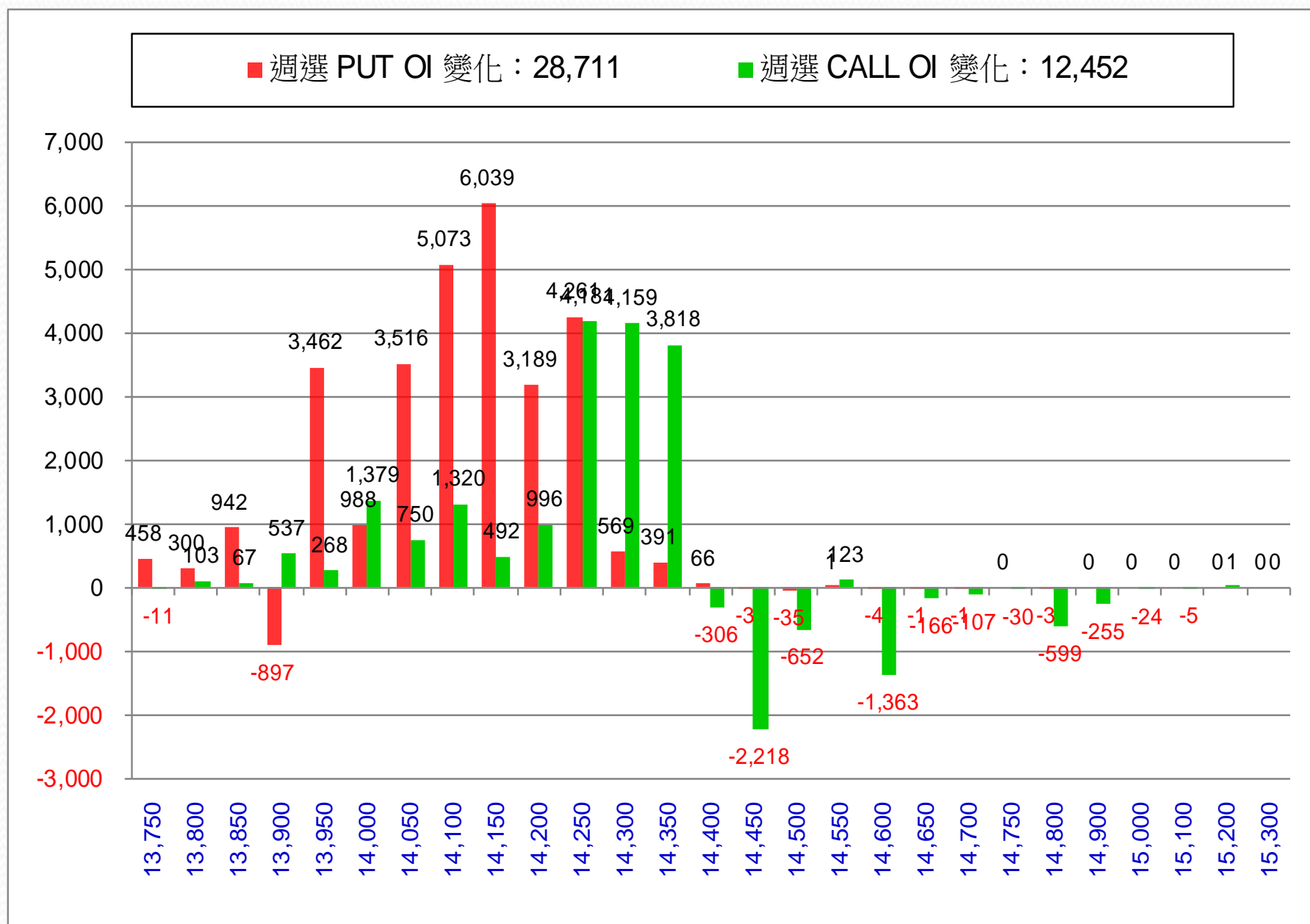
更新日期：2023年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



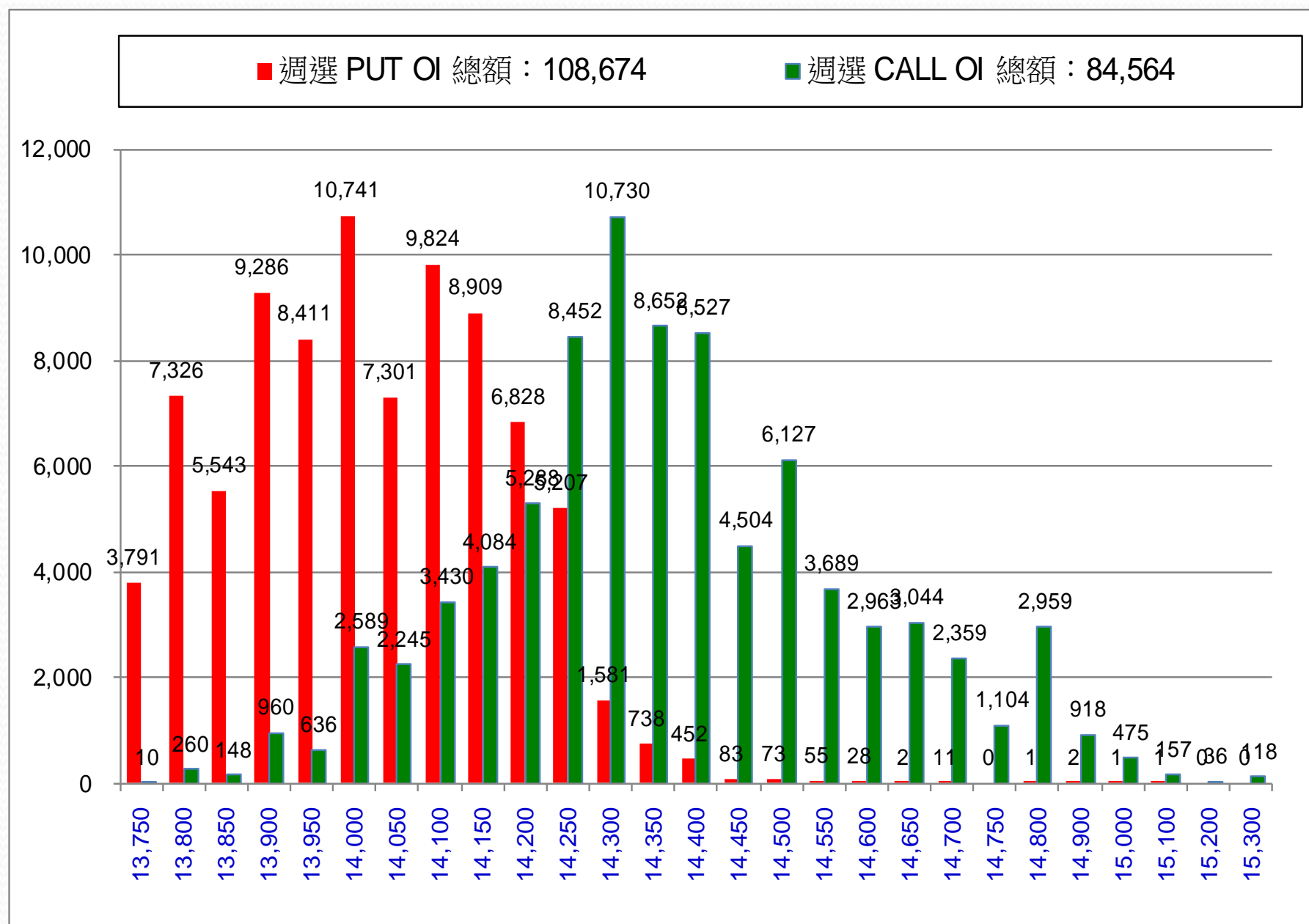
更新日期：2023年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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



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

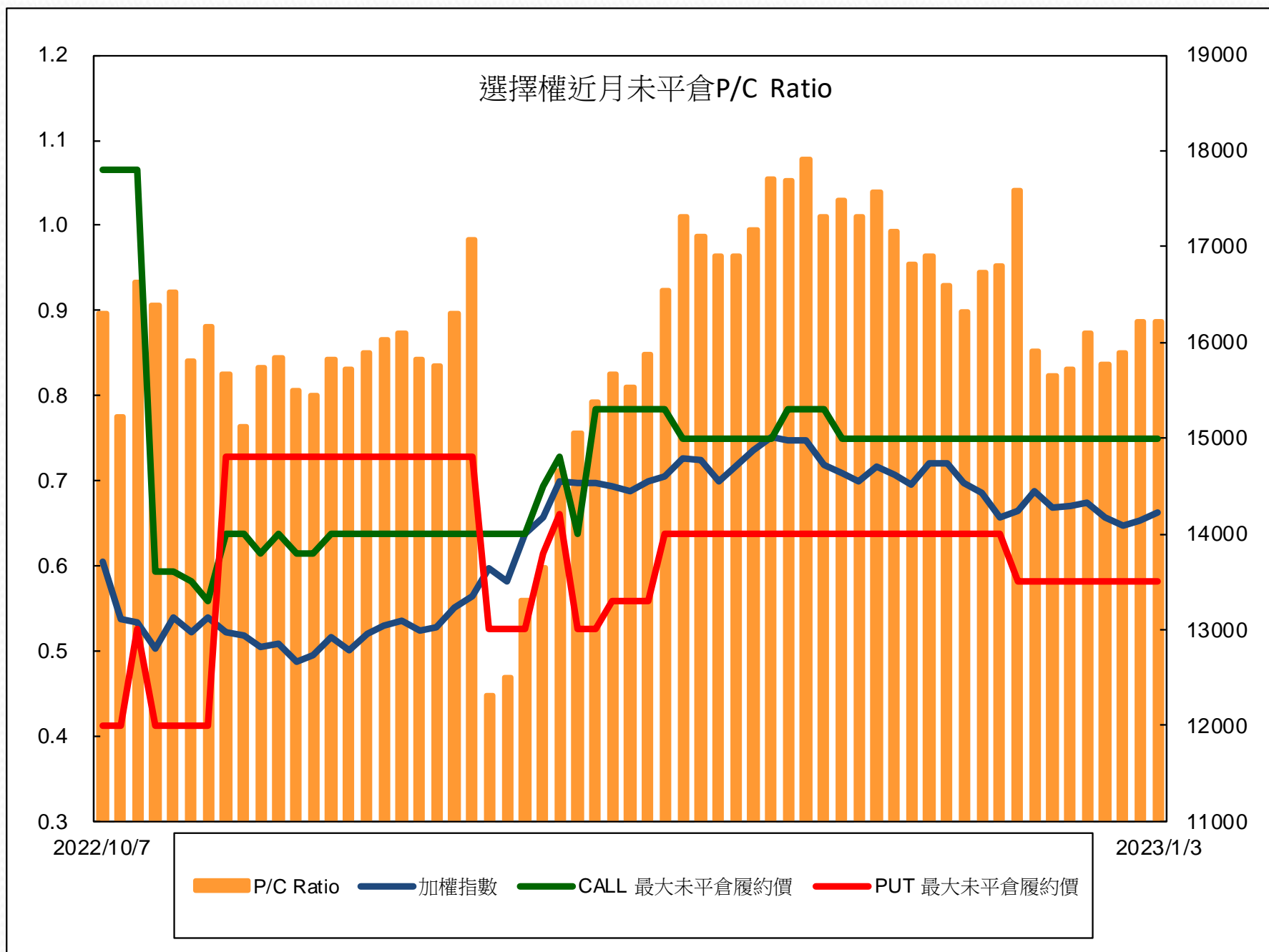


# 自營商選擇權OI部位統計

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30日	60,697	46,272	14,425
	1月3日	62,227	52,143	10,084
Put	12月30日	48,632	42,439	6,193
	1月3日	55,333	53,012	2,321

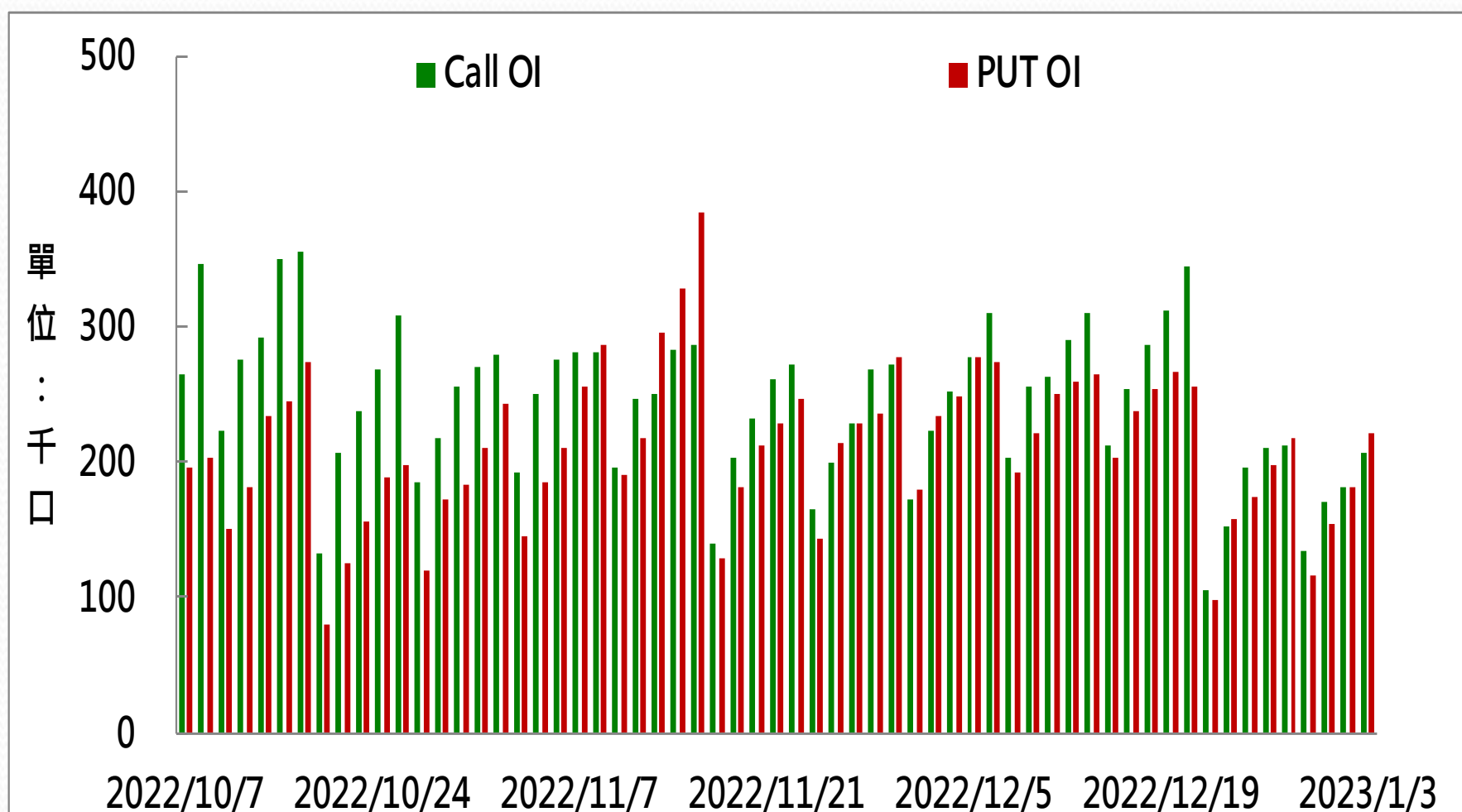
更新日期：2023年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



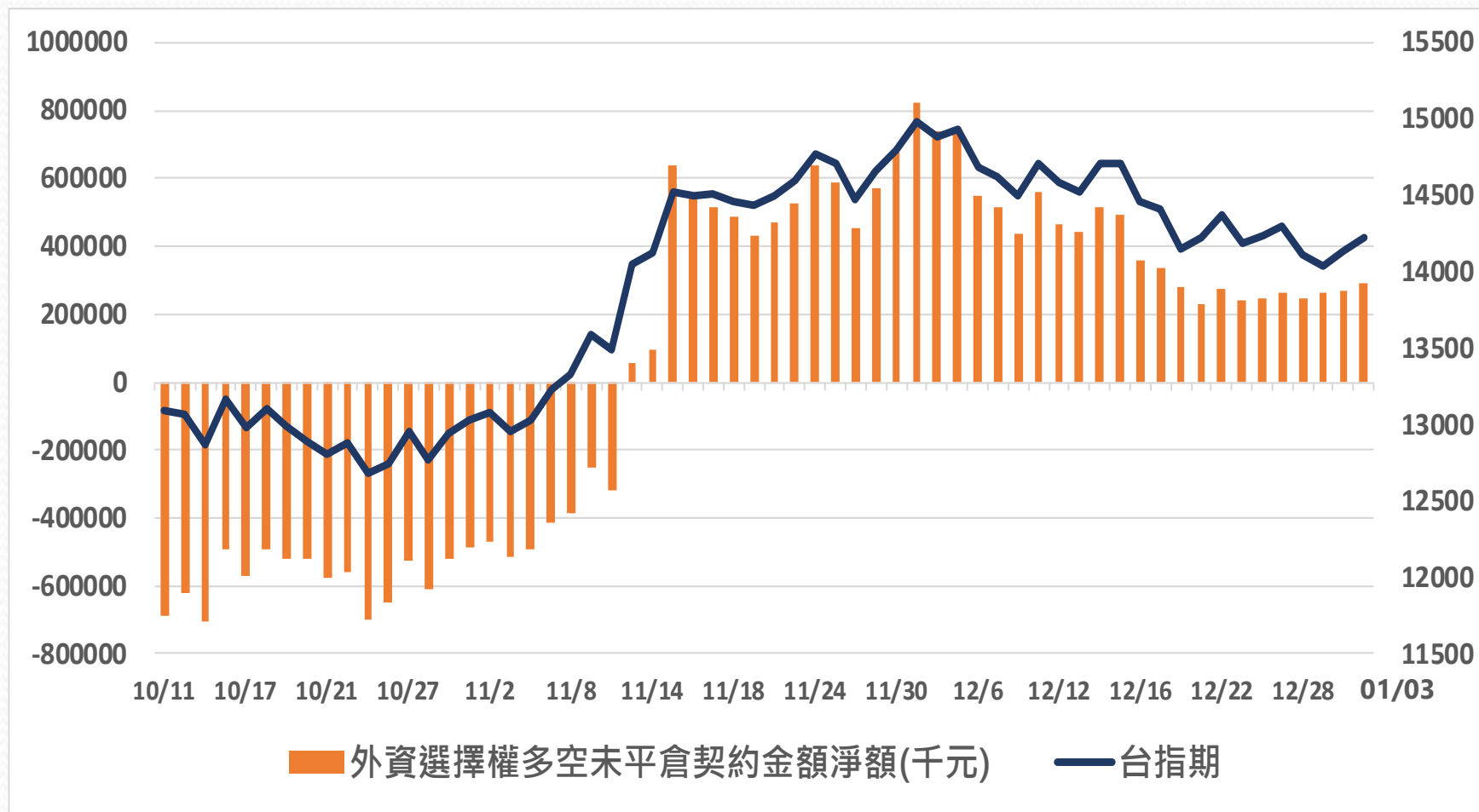
更新日期：2023年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權全月Put Call OI



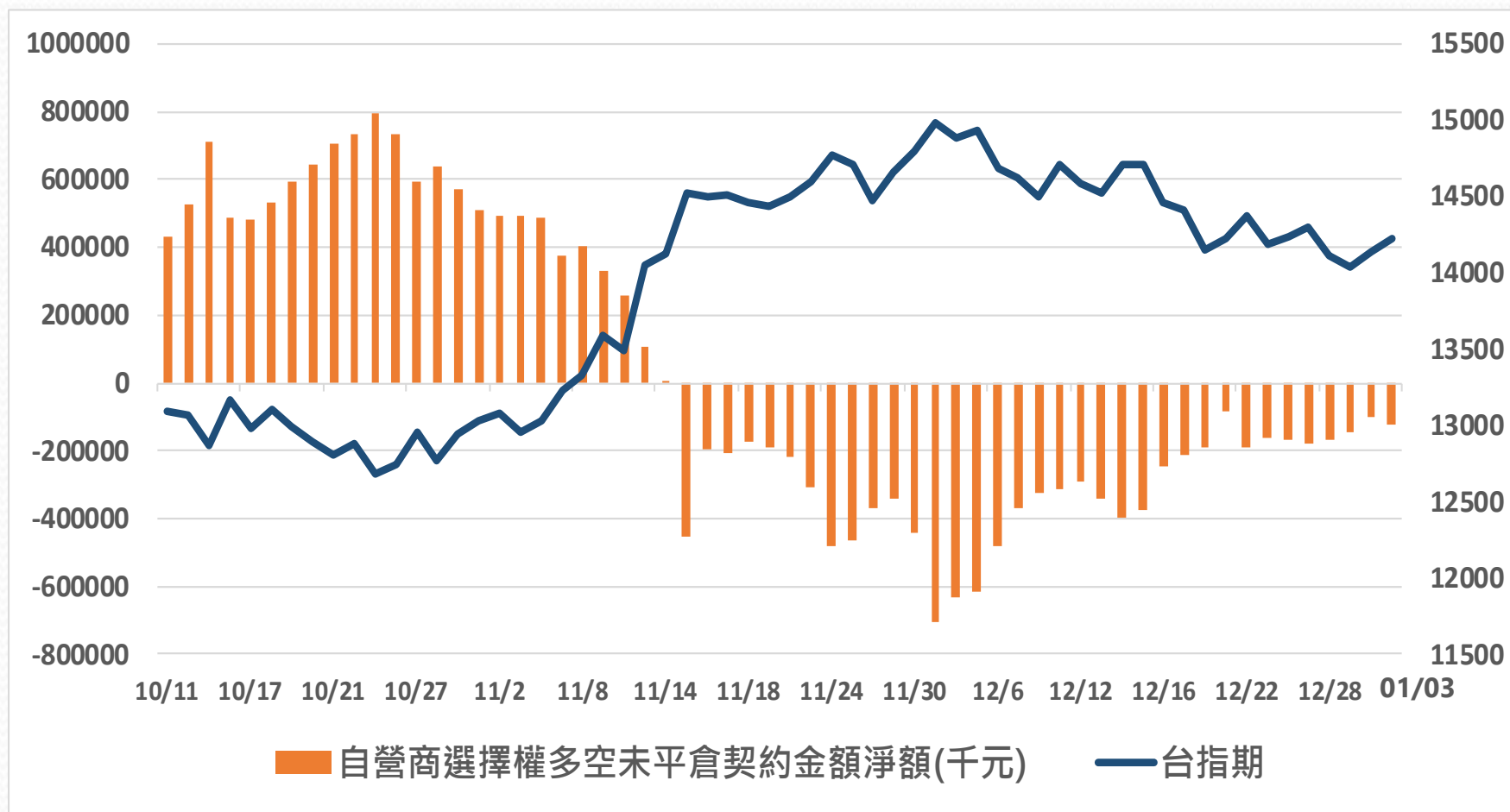
更新日期：2023年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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