

台指選擇權OI匯報

日期：2023/1/4 結算日：2023/1/11					日期：2023/1/4 結算日：2023/1/30				
202301W2					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
2	32	13,700	2,843	489	0	108	13,300	3,154	145
11	18	13,800	3,562	2,200	0	66	13,400	3,940	434
1	26	13,850	2,001	1,541	0	144	13,500	6,810	164
-10	74	13,900	2,329	1,024	0	135	13,600	4,166	24
20	39	13,950	2,555	2,123	19	148	13,700	3,739	231
85	222	14,000	1,972	1,225	-8	341	13,800	3,327	-277
1	187	14,050	1,266	700	-6	324	13,900	3,007	58
-13	431	14,100	2,061	1,283	-76	1,348	14,000	3,475	358
177	576	14,150	677	428	15	2,322	14,100	1,961	78
819	2,149	14,200	1,565	1,063	-63	1,517	14,200	1,345	12
1,039	2,326	14,250	670	425	273	1,852	14,300	1,107	20
1,436	2,736	14,300	583	418	-174	2,723	14,400	1,196	-5
812	1,557	14,350	170	119	44	3,795	14,500	536	-4
1,008	1,985	14,400	501	368	41	2,870	14,600	449	8
742	1,626	14,450	90	47	168	4,095	14,700	805	4
1,847	3,532	14,500	78	46	268	5,385	14,800	226	-7
1,272	1,926	14,550	40	37	55	6,717	14,900	132	1
2,115	3,841	14,600	25	16	28	11,942	15,000	135	-1
1,705	2,780	14,650	2	1	324	8,157	15,100	82	-9
※ 2,343	2,921	14,700	11	6	-545	3,145	15,200	153	0
1,495	2,017	14,800	5	0	37	2,562	15,300	25	0
777	1,043	14,900	0	0	-4	1,819	15,400	17	0
1,706	1,854	15,000	0	0	18	1,992	15,500	19	0
600	829	15,100	0	0	-152	1,032	15,600	35	0
55	494	15,200	0	0	-38	1,036	15,700	3	0
60	127	15,300	0	0	0	968	15,800	380	0
11	11	15,400	0	0	33	548	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
20,120	35,368	0.9248	32,710	17,987	627	77,048	0.8964	69,062	1,205
昨日 P/C	1.2851	今日增減變化	-0.3603		昨日 P/C	0.8879	今日增減變化	0.0084	

更新日期：2023年1月4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4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	86,756,306	46,714,308	40,041,998	-5,340,952	4,400,442	1,533,409	2,867,033	-93,260	
投信	31,765,640	60,857,147	-29,091,507	1,707,905	358,055	0	358,055	-1,242	
自營商	34,127,113	15,967,749	18,159,364	638,462	1,255,431	1,237,535	17,896	2,578	
	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	642,899	1,104,468	-461,569	-72,661	336,324	0	336,324	-20,026	
投信	71,933	0	71,933	135	0	0	0	0	
自營商	320,697	392,633	-71,936	41,749	37,013	401,817	-364,804	30,008	

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4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	23,904	11,008	12,896	78	12,304	13,180	-876	-1,688	
投信	0	100	-100	0	300	141	159	0	
自營商	53,302	47,980	5,322	-4,762	50,187	33,005	17,182	14,861	
特定法人(週)	0	0	0	---	0	545	-545	---	
特定法人(近月)	15,638	6,191	9,447	342	4,477	7,804	-3,327	178	
特定法人(全月)	18,410	6,191	12,219	5	9,592	6,842	2,750	4,704	
十大交易人(週)	19,893	17,350	2,543	---	13,568	15,021	-1,453	---	
十大交易人(近月)	38,101	33,248	4,853	-742	26,003	36,165	-10,162	-1,248	
十大交易人(全月)	75,361	62,445	12,916	-2,579	50,158	60,669	-10,511	-18,452	
全市場未沖銷(近月)			77,815	1,394			69,645	1,788	
全市場未沖銷(全月)			145,210	-62,168			135,015	-87,193	

更新日期：2023年1月4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01W2週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	14600	買權OI最大量	14600
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	13800
	整體隱含波動率	11.98%	較前一交易日	+10.75%
	買權隱含波動率	11.96%	較前一交易日	+11.19%
	賣權隱含波動率	12.00%	較前一交易日	+10.33%
電子選擇權	買權成交最大量	350	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	1560	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4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	14600	買權OI最大量	15000
	賣權成交最大量	13700	賣權OI最大量	13500
	整體隱含波動率	16.05%	較前一交易日	+0.79%
	買權隱含波動率	14.56%	較前一交易日	+0.02%
	賣權隱含波動率	17.60%	較前一交易日	-1.15%
	成交量P/C_Ratio值	0.920	較前一交易日	-0.13
	未平倉P/C_Ratio值	0.895	較前一交易日	+0.01
電子選擇權	買權成交最大量	420	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	1560	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4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

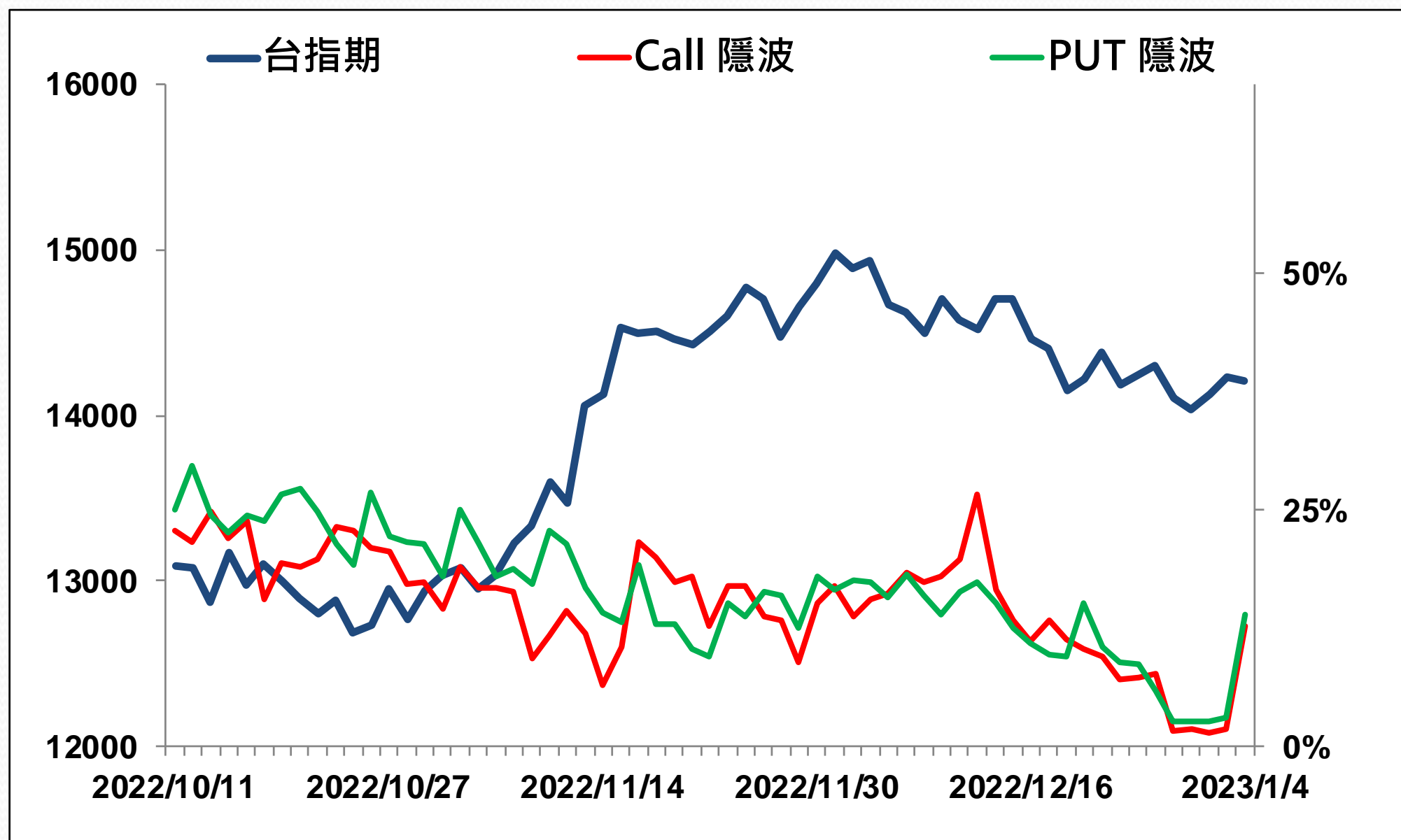
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



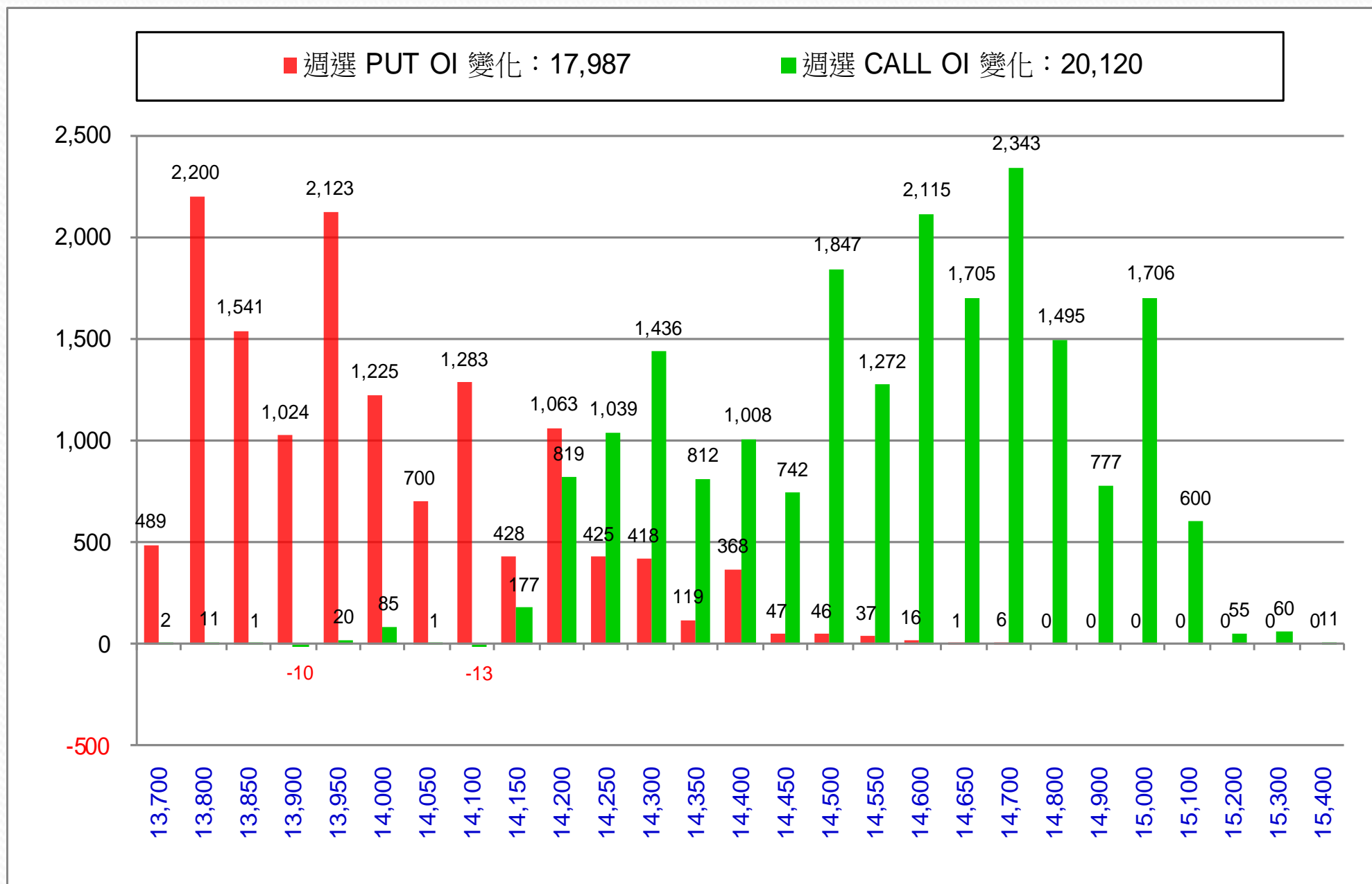
更新日期：2023年1月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年1月4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

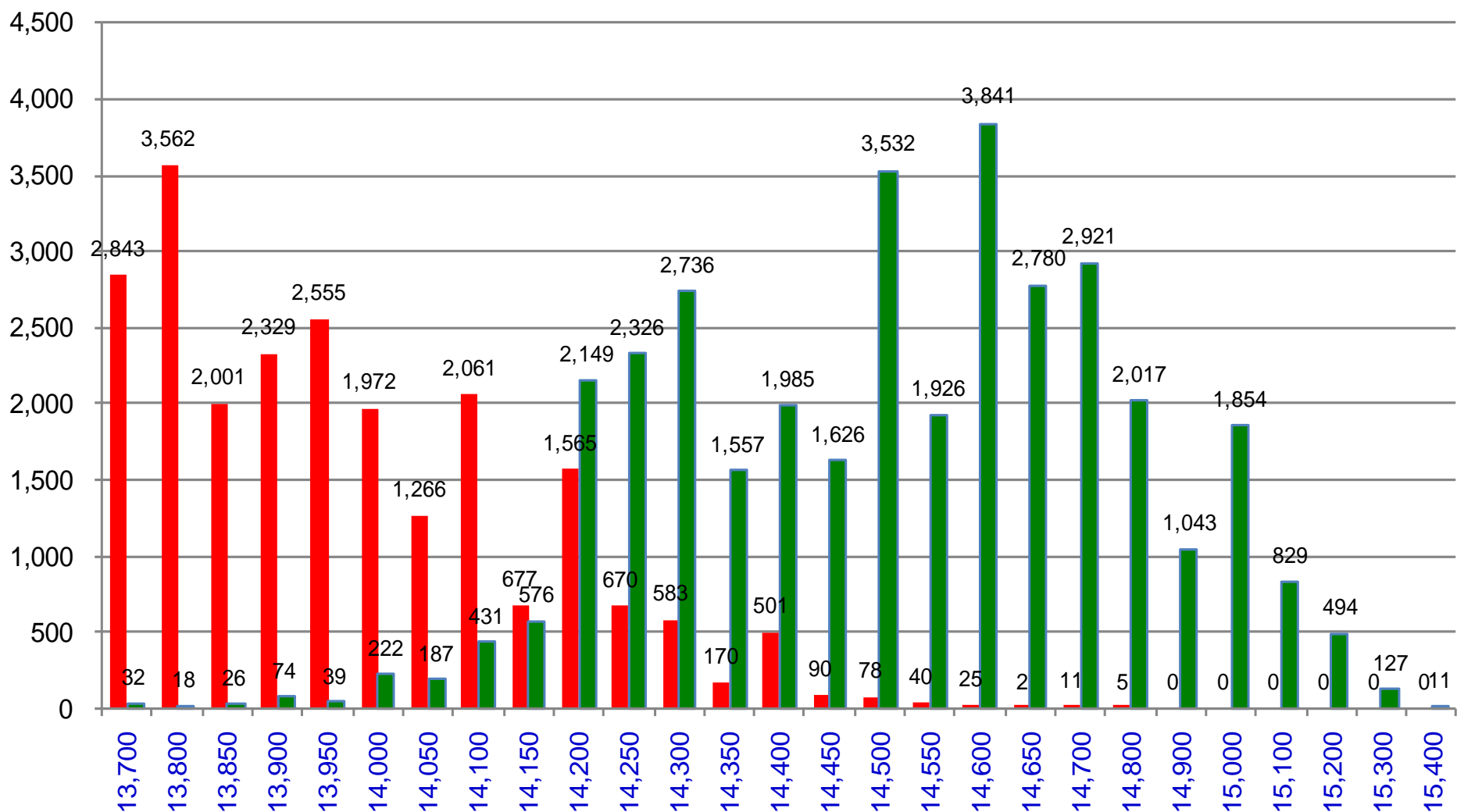


更新日期：2023年1月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：32,710

週選 CALL OI 總額：35,368



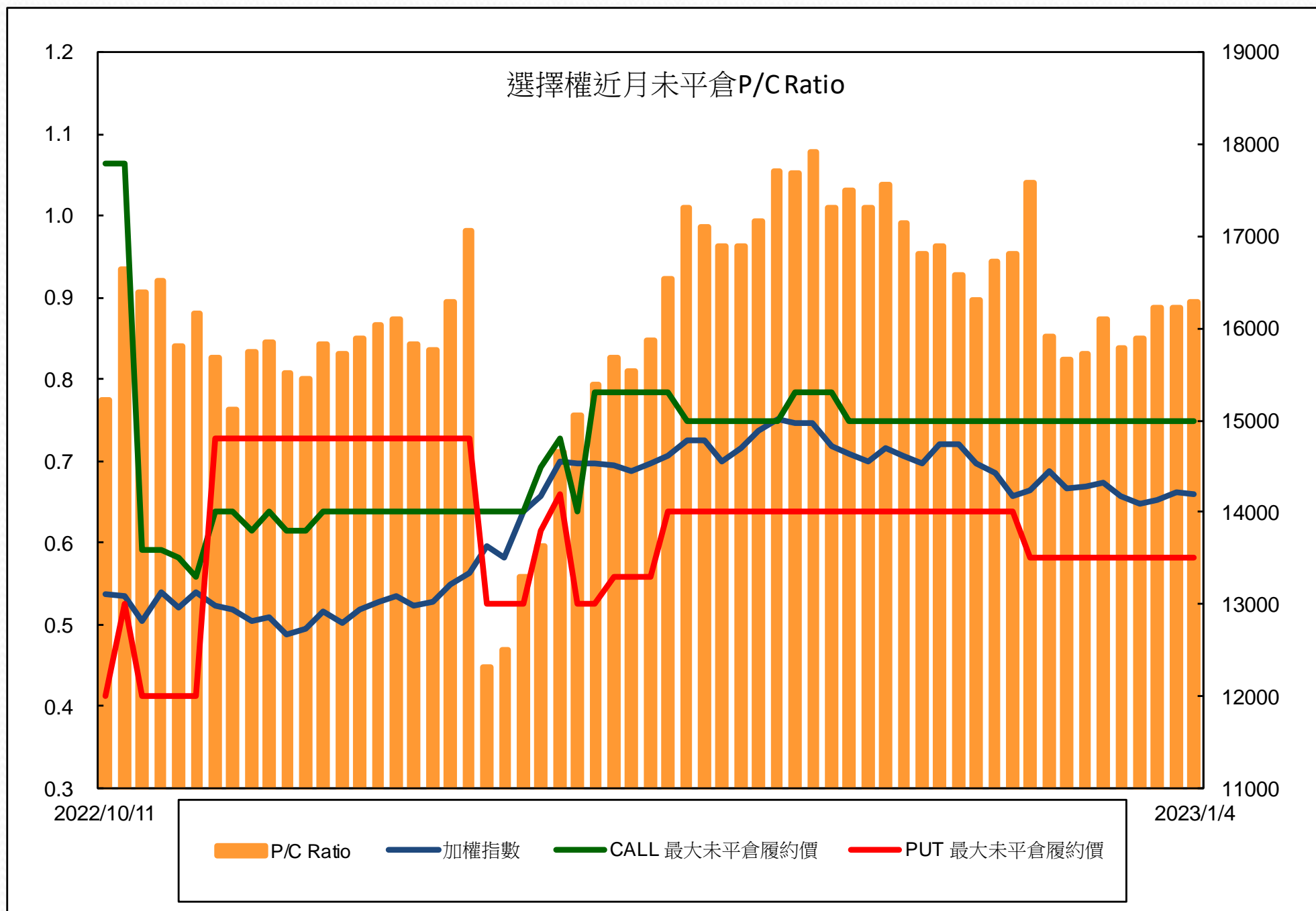
更新日期：2023年1月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	1月3日	62,227	52,143	10,084
	1月4日	53,302	47,980	5,322
Put	1月3日	55,333	53,012	2,321
	1月4日	50,187	33,005	17,182

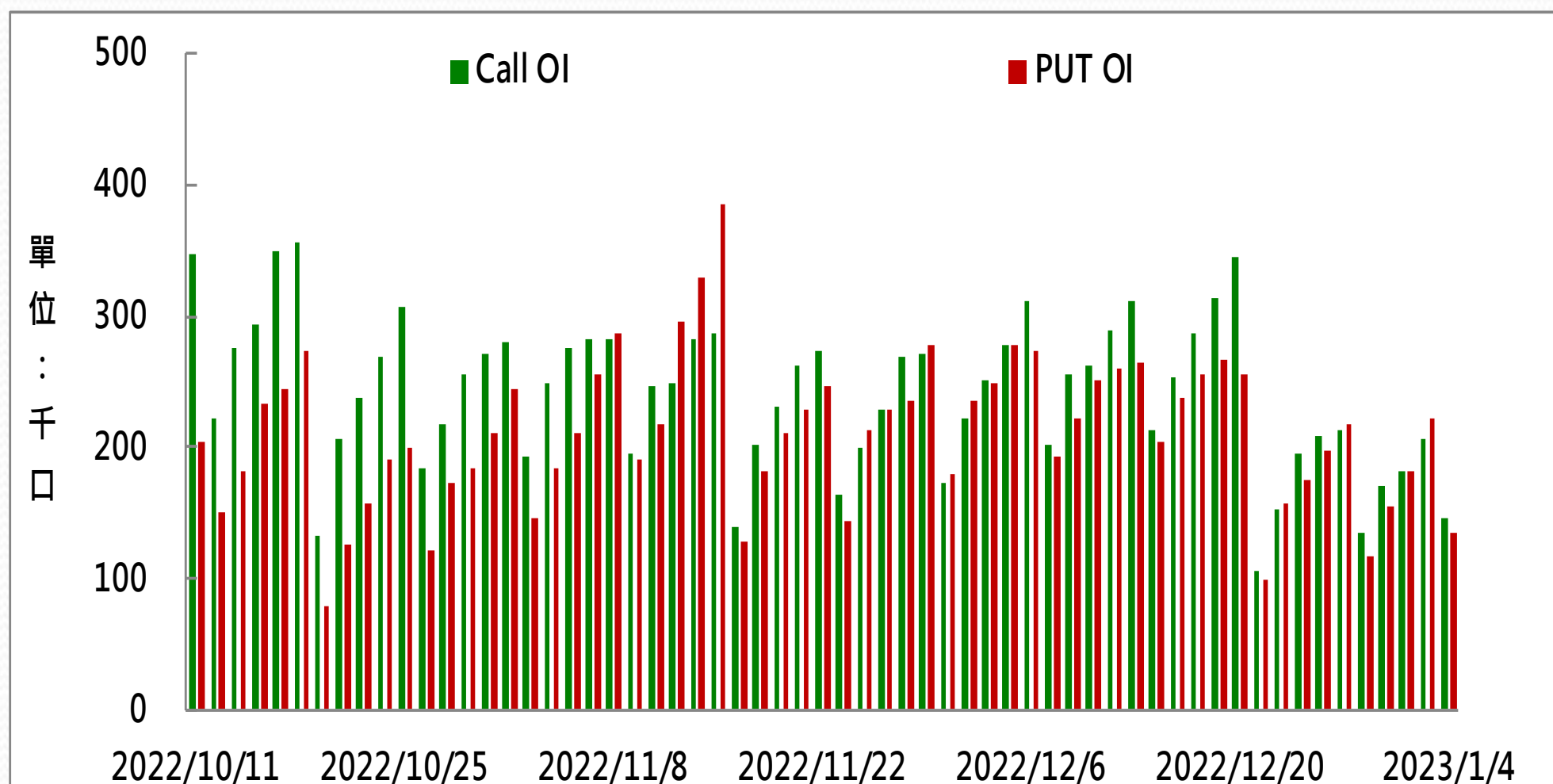
更新日期：2023年1月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



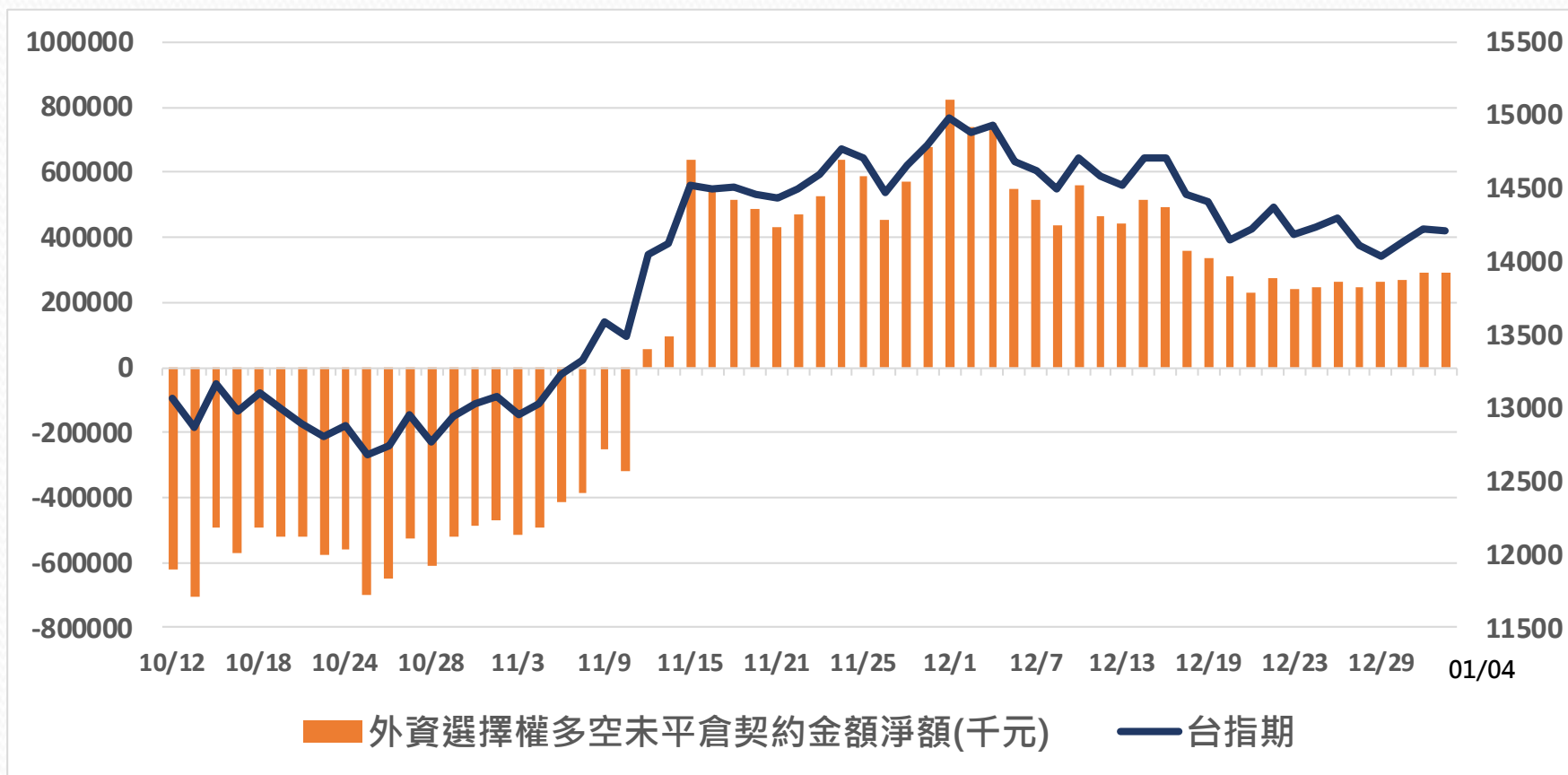
更新日期：2023年1月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權全月Put Call OI



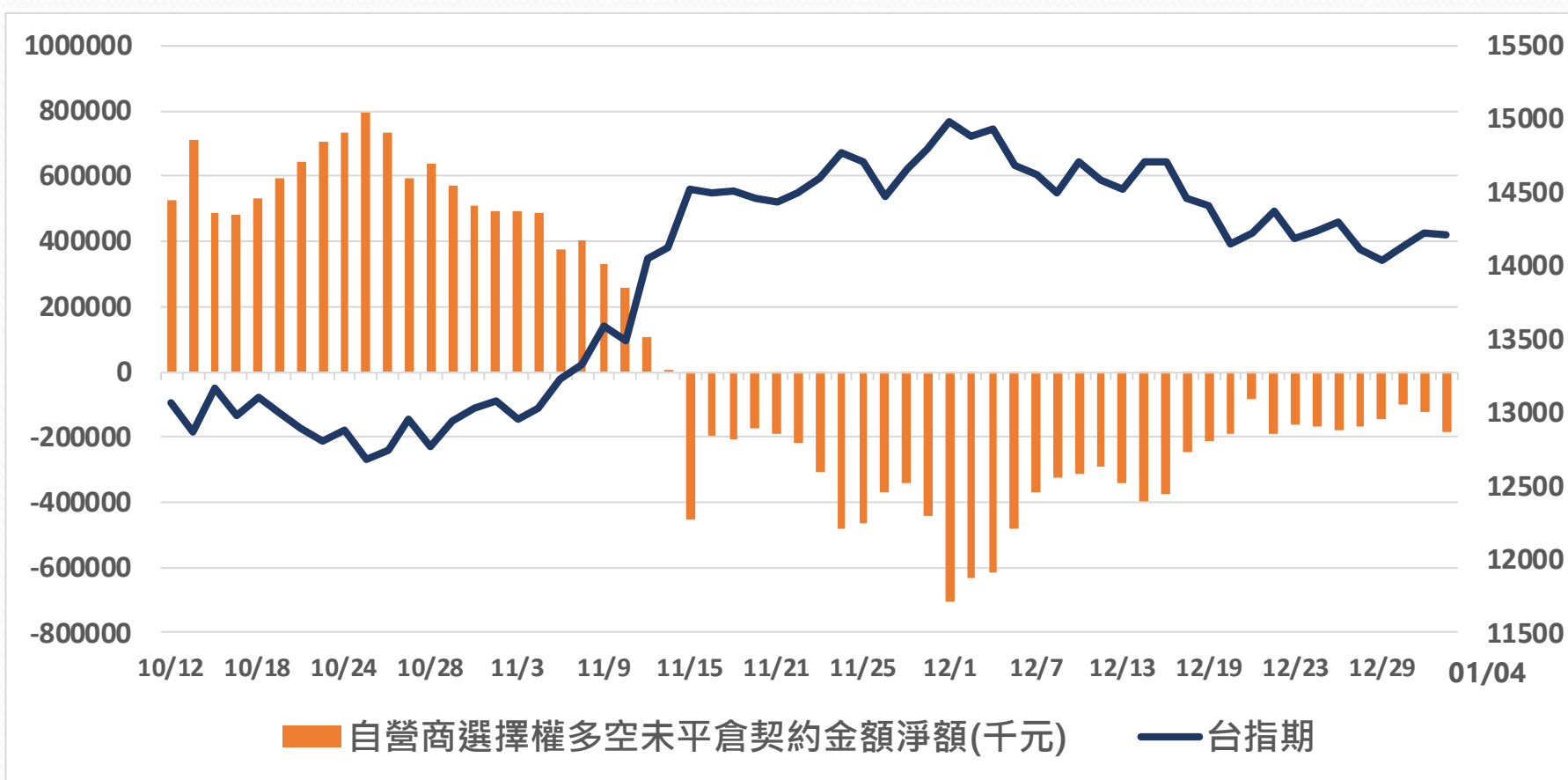
更新日期：2023年1月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

外資選擇權多空未平倉淨額



更新日期：2023年1月4日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

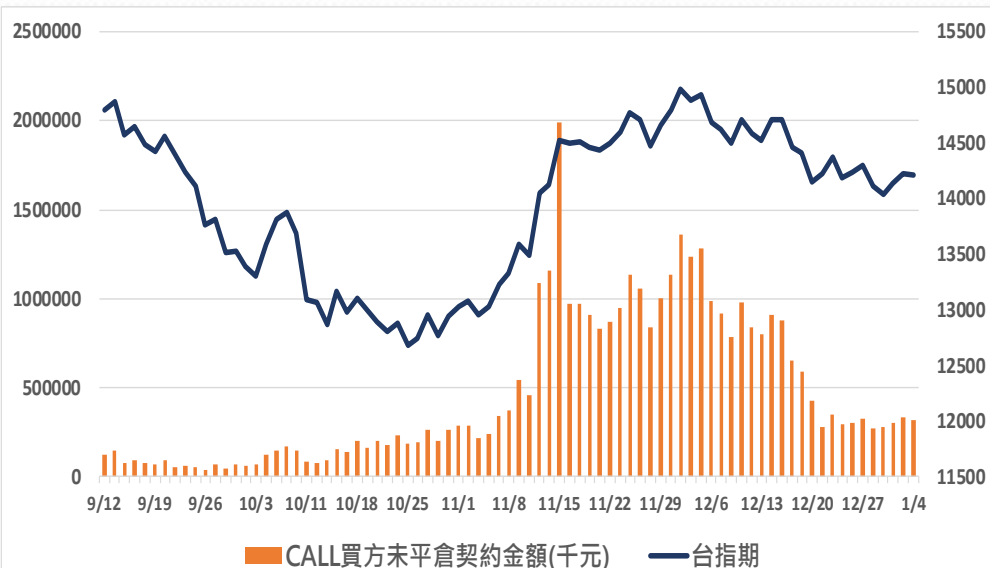
自營商選擇權多空未平倉淨額



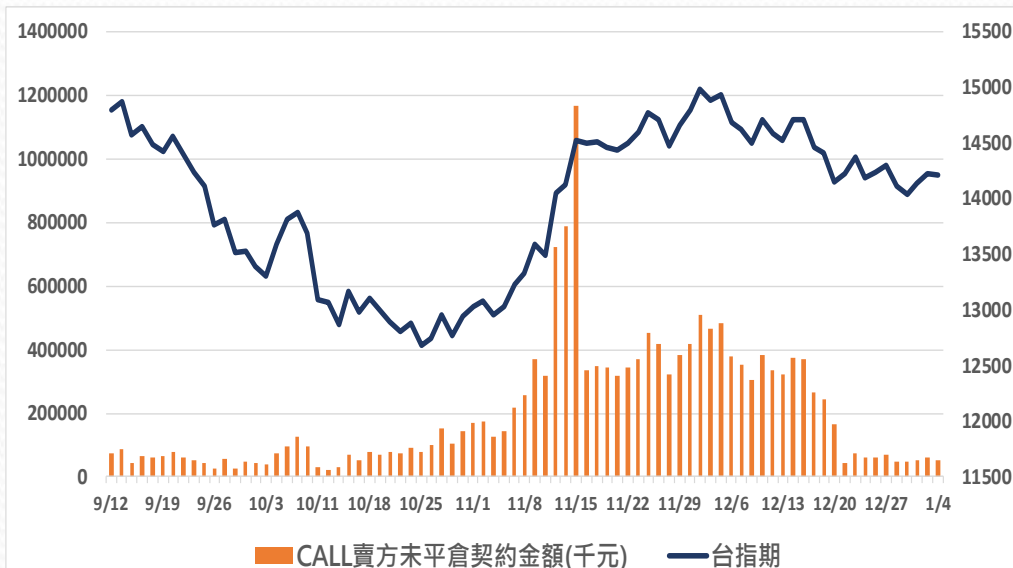
更新日期：2023年1月4日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

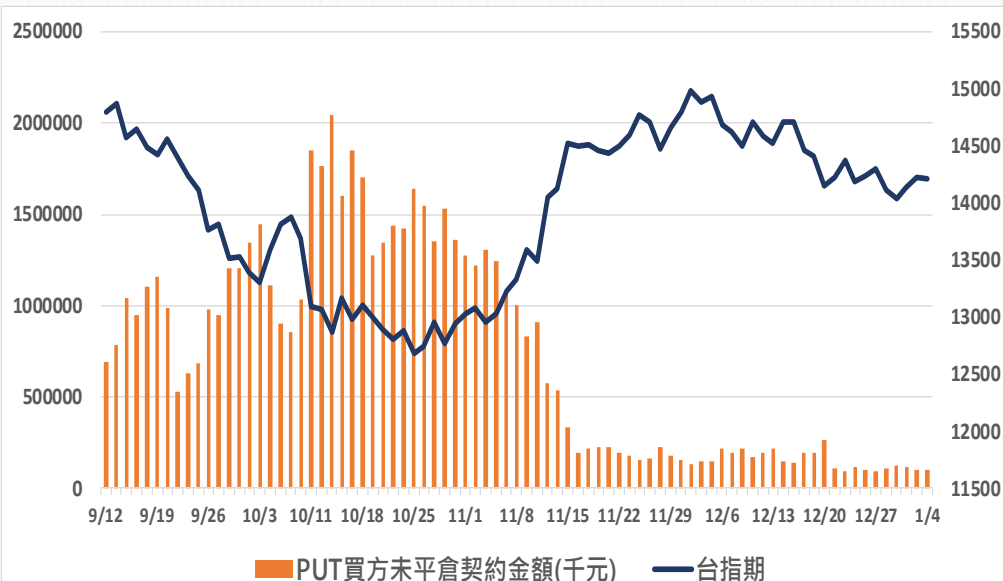
CALL買方未平倉金額



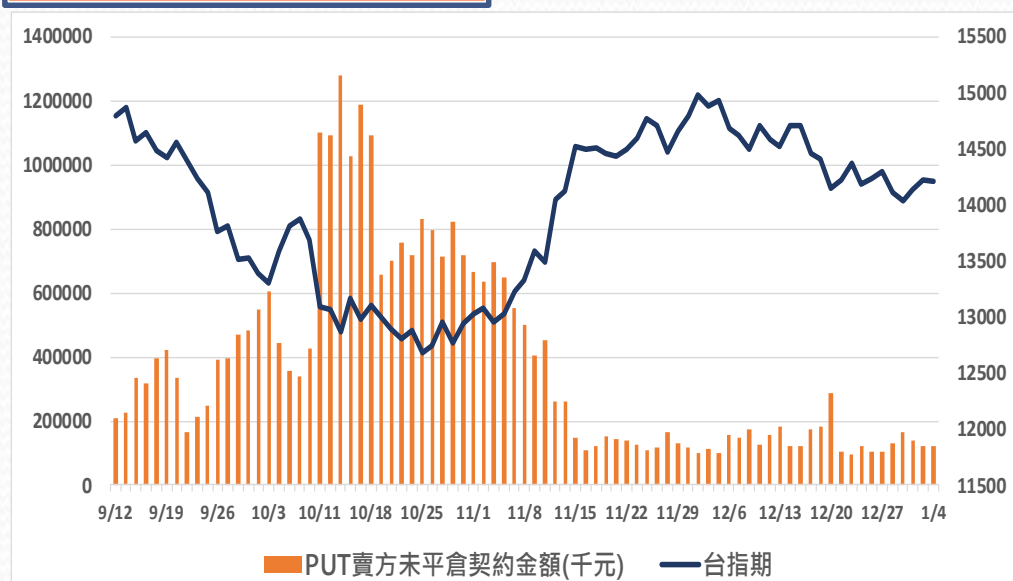
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



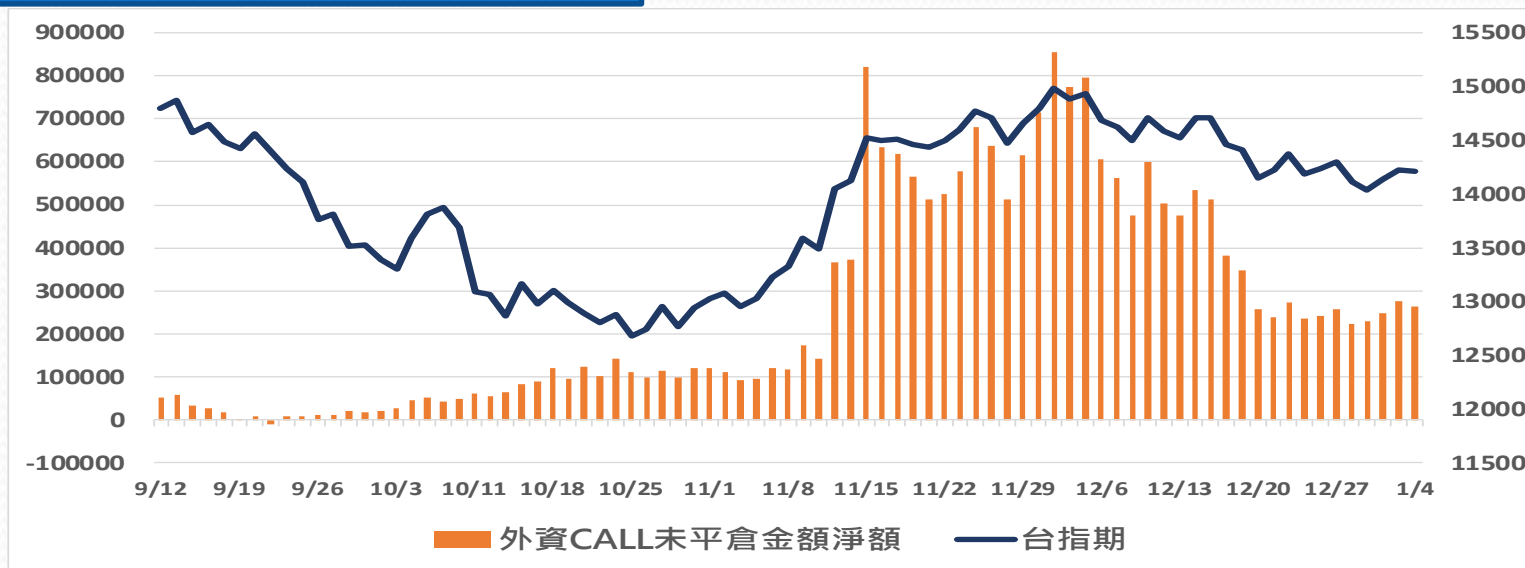
PUT賣方未平倉金額



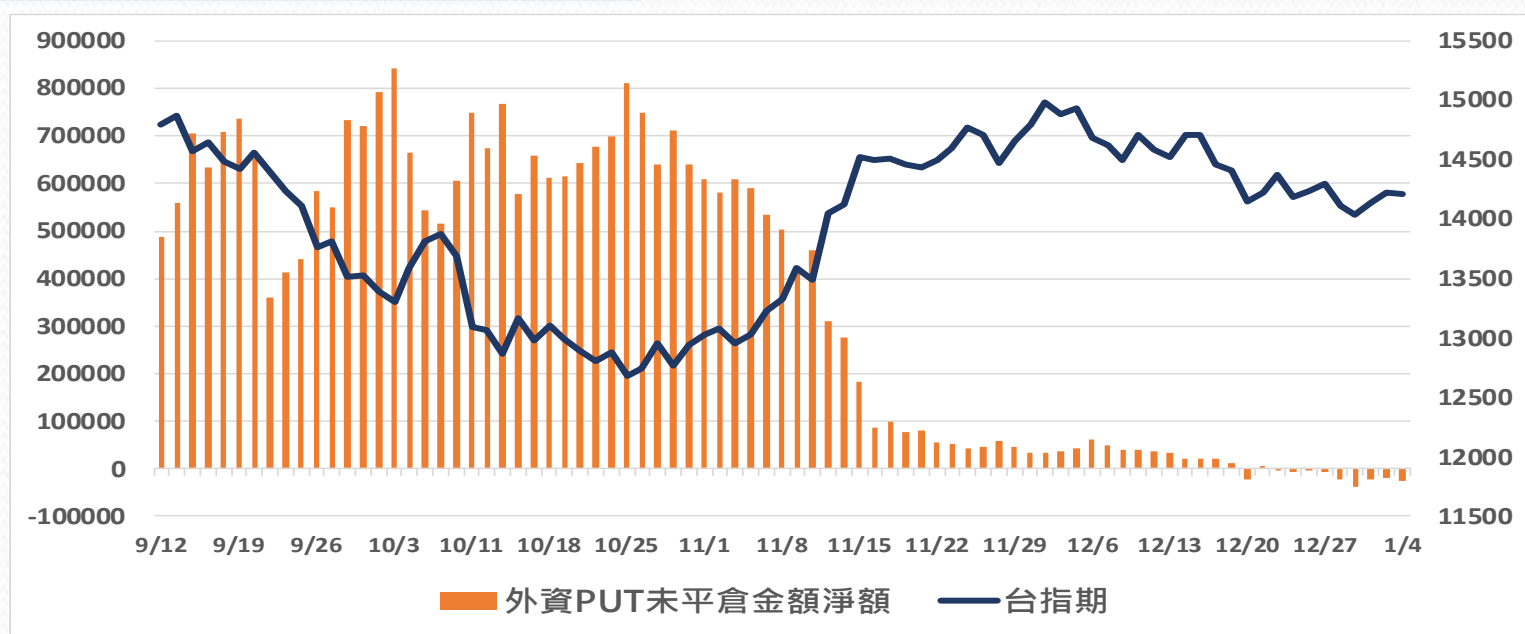
更新日期：2023年1月4日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額淨額

BUY CALL-SELL CALL(未平倉金額)



BUY PUT-SELL PUT(未平倉金額)



更新日期：2023年1月4日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。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4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