

台指選擇權 OI 匯報

日期：2023/1/5 結算日：2023/1/11					日期：2023/1/5 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
6	24	13,800	5,850	2,288	0	108	13,300	3,226	72
1	27	13,850	4,027	2,026	1	67	13,400	3,902	-38
28	102	13,900	4,963	2,634	1	145	13,500	6,737	-73
31	70	13,950	4,594	2,039	-1	134	13,600	4,481	315
-8	214	14,000	5,887	3,915	0	148	13,700	3,979	240
22	209	14,050	3,139	1,873	6	347	13,800	3,673	346
278	709	14,100	4,077	2,016	14	338	13,900	2,883	-124
-2	574	14,150	2,511	1,834	-54	1,294	14,000	3,782	307
230	2,379	14,200	4,968	3,403	-44	2,278	14,100	2,123	162
201	2,527	14,250	2,463	1,793	-100	1,417	14,200	1,576	231
1,556	4,292	14,300	2,564	1,981	122	1,974	14,300	1,315	208
1,282	2,839	14,350	800	630	-188	2,535	14,400	1,277	81
2,120	4,105	14,400	934	433	-585	3,210	14,500	596	60
1,562	3,188	14,450	246	156	50	2,920	14,600	469	20
3,722	7,254	14,500	227	149	785	4,880	14,700	809	4
3,177	5,103	14,550	90	50	464	5,849	14,800	238	12
5,546	9,387	14,600	103	78	527	7,244	14,900	140	8
※ 5,725	8,505	14,650	16	14	486	12,428	15,000	142	7
2,953	5,874	14,700	49	38	448	8,605	15,100	84	2
1,800	3,817	14,800	5	0	-238	2,907	15,200	163	10
1,485	2,528	14,900	1	1	-8	2,554	15,300	25	0
875	2,729	15,000	1	1	6	1,825	15,400	17	0
148	977	15,100	1	1	-28	1,964	15,500	19	0
101	595	15,200	1	1	-14	1,018	15,600	35	0
25	152	15,300	0	0	-2	1,034	15,700	3	0
3	14	15,400	0	0	-4	964	15,800	380	0
0	0	15,500	0	0	5	553	15,900	23	0
0	0	15,600	0	0	-87	898	16,000	17	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
32,857	68,225	0.9542	65,098	32,388	1,560	78,608	0.8958	70,418	1,356
昨日 P/C	0.9248	今日增減變化	0.0294		昨日 P/C	0.8950	今日增減變化	0.0008	

更新日期：2023年1月5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5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	92,722,817	45,579,640	47,143,177	7,101,179	4,383,272	1,206,836	3,176,436	309,403	
投信	29,841,148	59,039,290	-29,198,142	-106,635	360,484	0	360,484	2,429	
自營商	36,994,846	15,684,291	21,310,555	3,151,191	1,109,811	1,363,529	-253,718	-271,614	
	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	664,178	1,196,440	-532,262	-70,693	352,222	0	352,222	15,898	
投信	72,787	0	72,787	854	0	0	0	0	
自營商	300,234	310,862	-10,628	61,308	37,046	433,462	-396,416	-31,612	

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5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	25,194	12,265	12,929	33	14,151	15,209	-1,058	-182	
投信	0	100	-100	0	400	141	259	100	
自營商	63,637	52,482	11,155	5,833	56,124	38,717	17,407	225	
特定法人(週)	409	0	409	409	0	625	-625	-80	
特定法人(近月)	15,638	6,191	9,447	0	4,477	7,814	-3,337	-10	
特定法人(全月)	18,410	6,191	12,219	0	7,404	6,842	562	-2,188	
十大交易人(週)	30,533	26,777	3,756	1,213	21,590	21,290	300	1,753	
十大交易人(近月)	39,849	34,174	5,675	822	26,928	36,547	-9,619	543	
十大交易人(全月)	85,625	66,250	19,375	6,459	57,534	66,055	-8,521	1,990	
全市場未沖銷(近月)			80,587	2,772			72,419	2,774	
全市場未沖銷(全月)			184,092	38,882			172,712	37,697	

更新日期：2023年1月5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	14500	買權OI最大量	14600
	賣權成交最大量	14200	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	8.49%	較前一交易日	-3.49%
	買權隱含波動率	10.41%	較前一交易日	-1.55%
	賣權隱含波動率	6.69%	較前一交易日	-5.31%
電子選擇權	買權成交最大量	650	買權OI最大量	685
	賣權成交最大量	630	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	1500	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年1月5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	14500	買權OI最大量	15000
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	13500
	整體隱含波動率	15.63%	較前一交易日	+0.73%
	買權隱含波動率	13.10%	較前一交易日	-1.47%
	賣權隱含波動率	17.79%	較前一交易日	+0.35%
	成交量P/C_Ratio值	1.114	較前一交易日	+0.19
	未平倉P/C_Ratio值	0.899	較前一交易日	+0.00
電子選擇權	買權成交最大量	650	買權OI最大量	685
	賣權成交最大量	630	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	1500	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年1月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

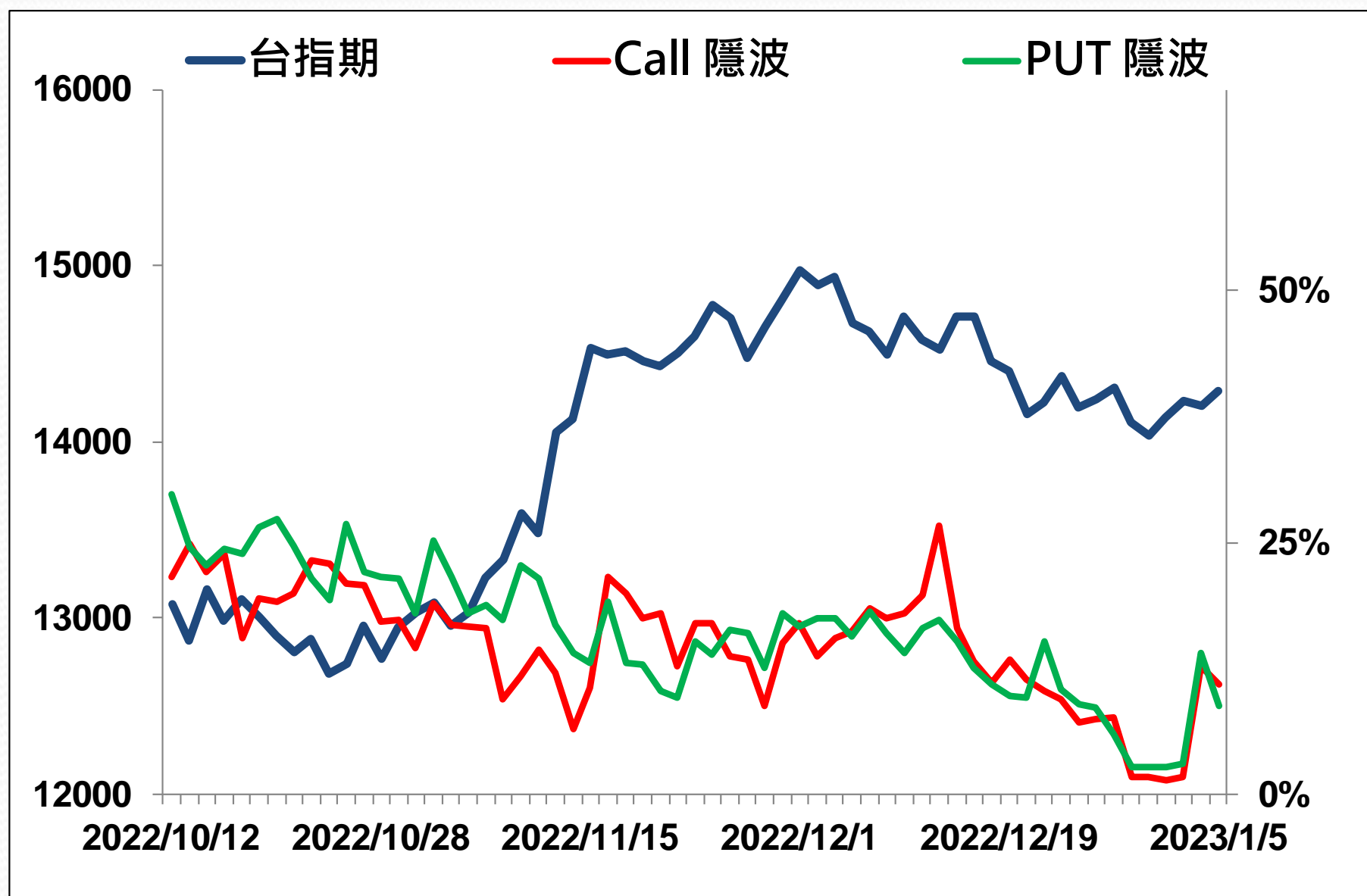
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



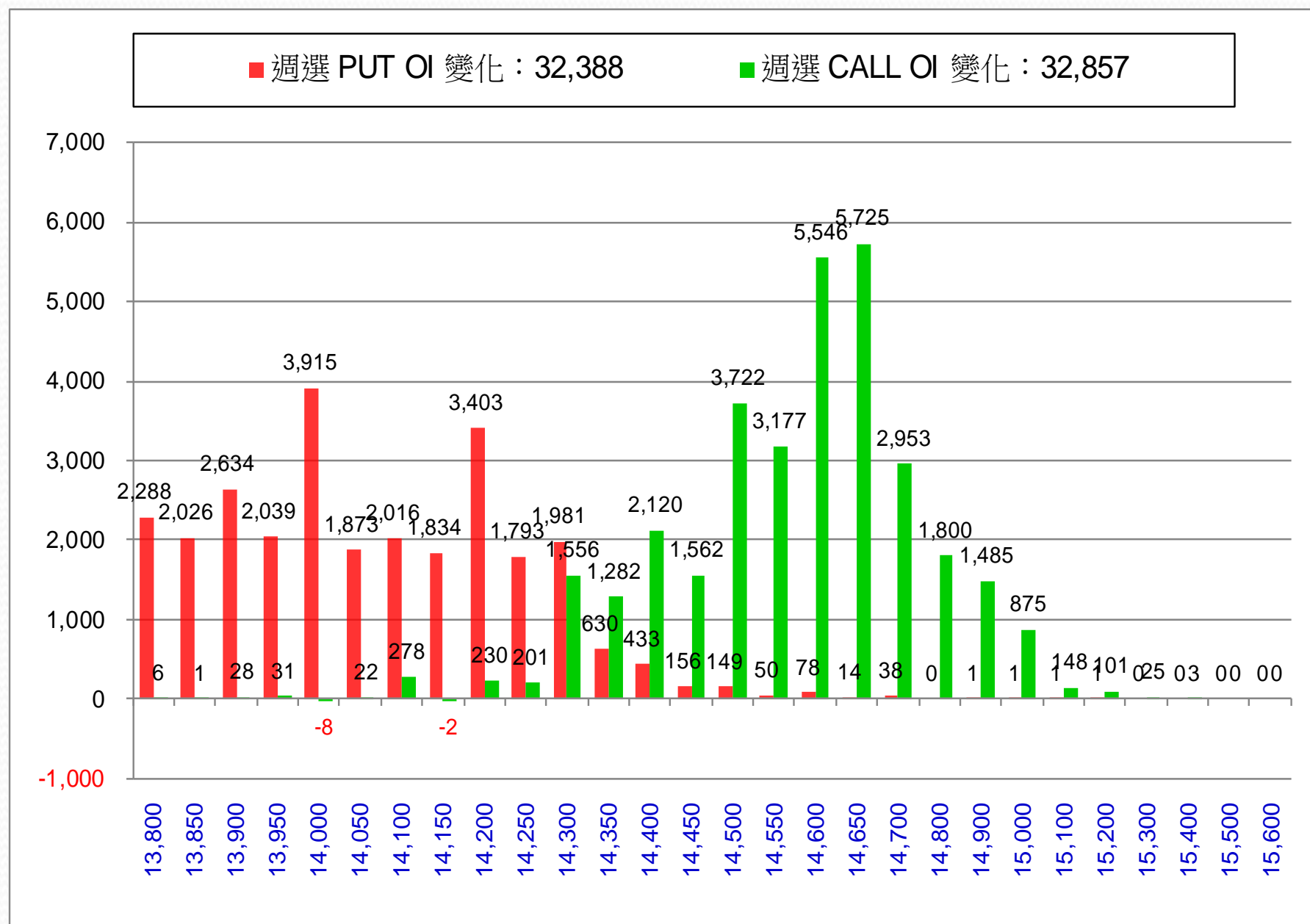
更新日期：2023年1月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



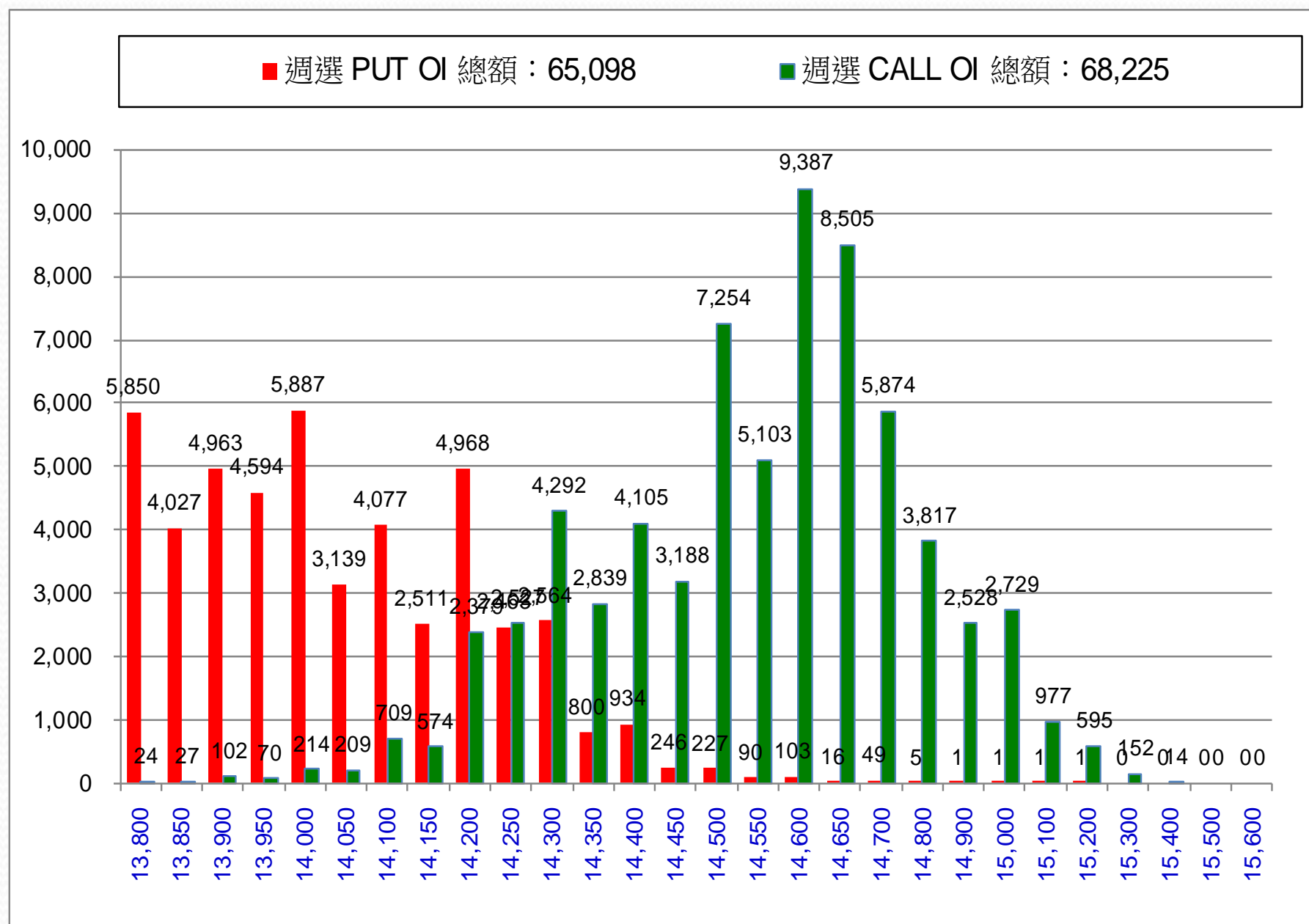
更新日期：2023年1月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年1月5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



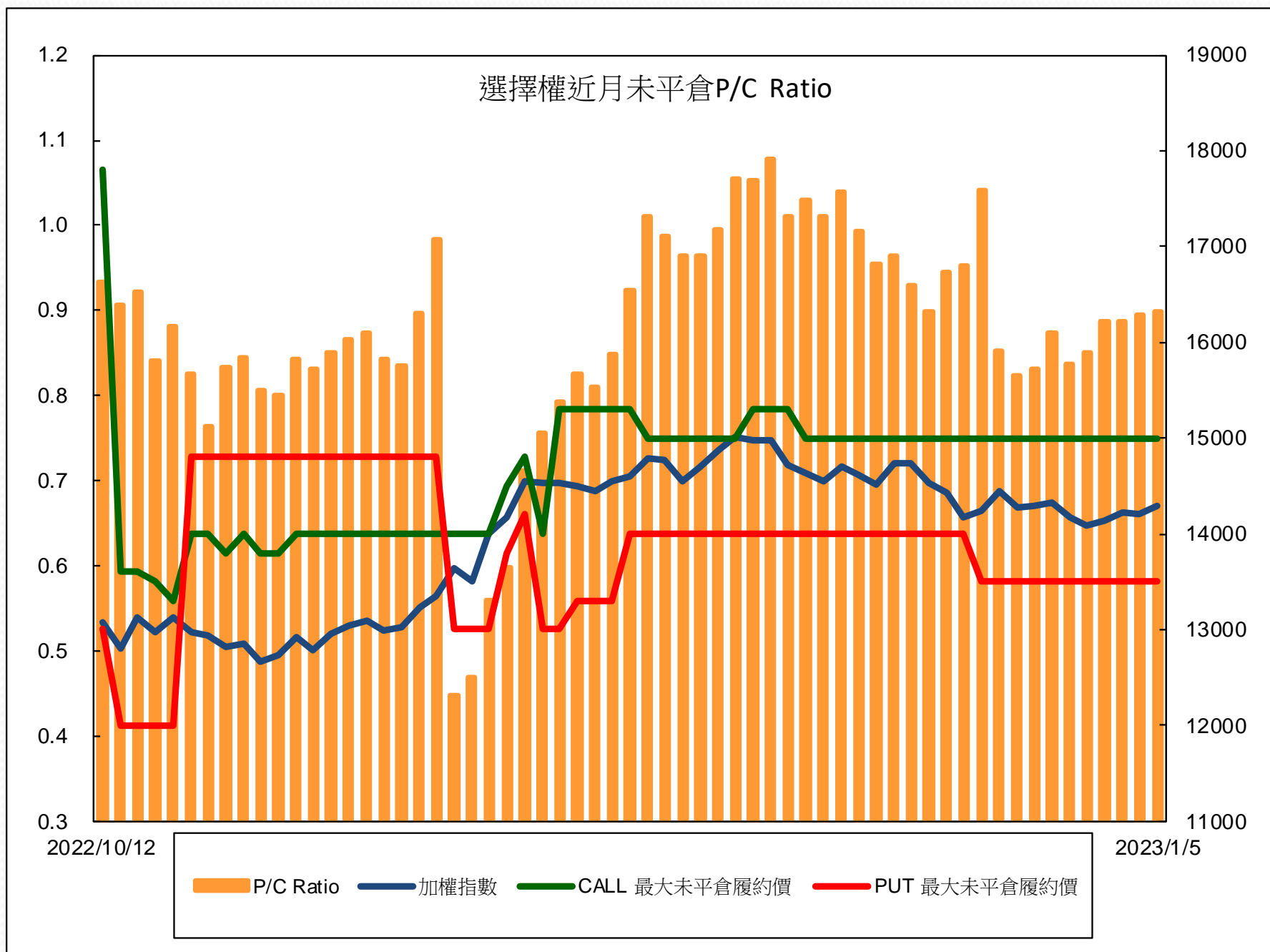
更新日期：2023年1月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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4日	53,302	47,980	5,322
	1月5日	63,637	52,482	11,155
Put	1月4日	50,187	33,005	17,182
	1月5日	56,124	38,717	17,407

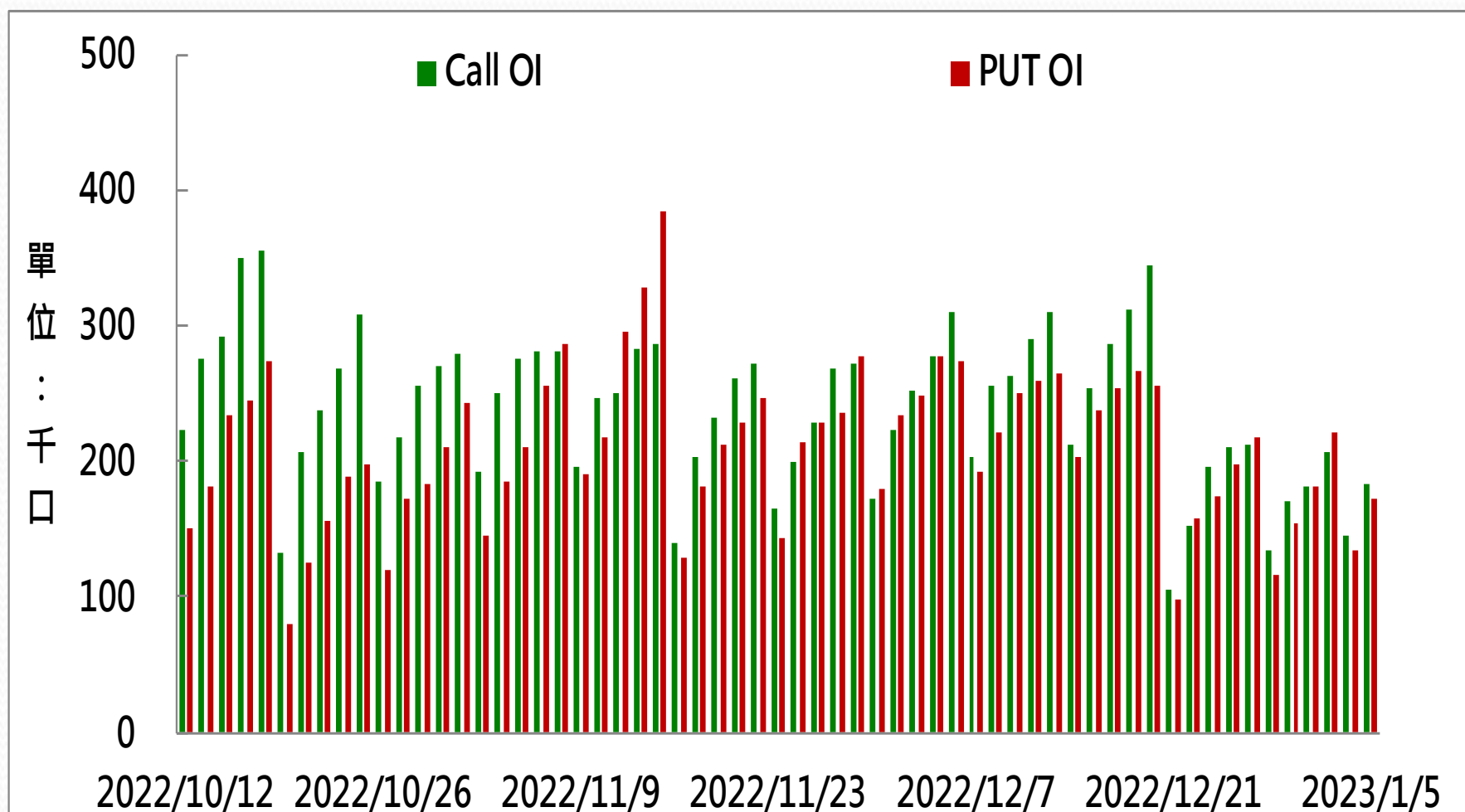
更新日期：2023年1月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



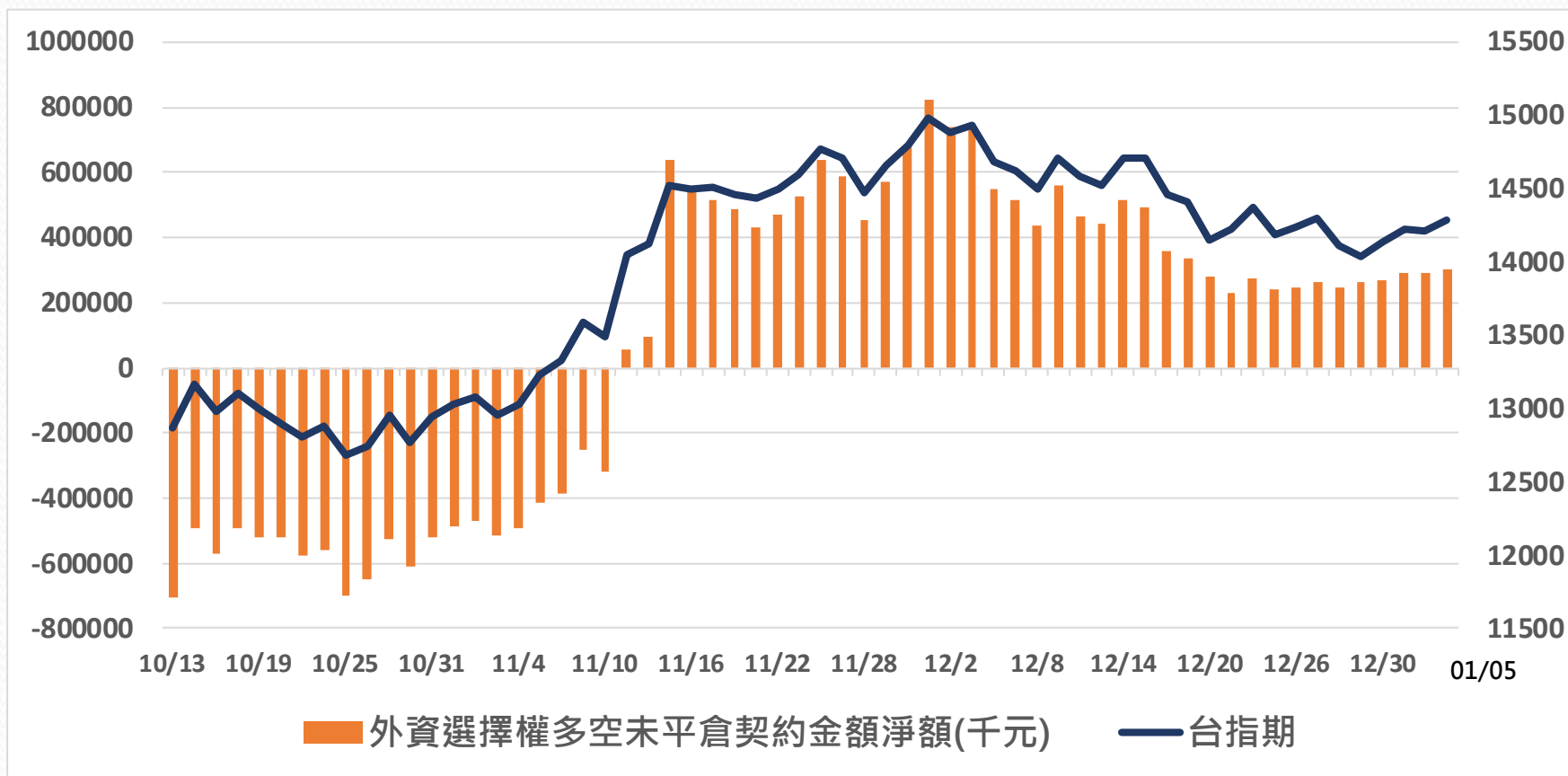
更新日期：2023年1月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權全月Put Call OI



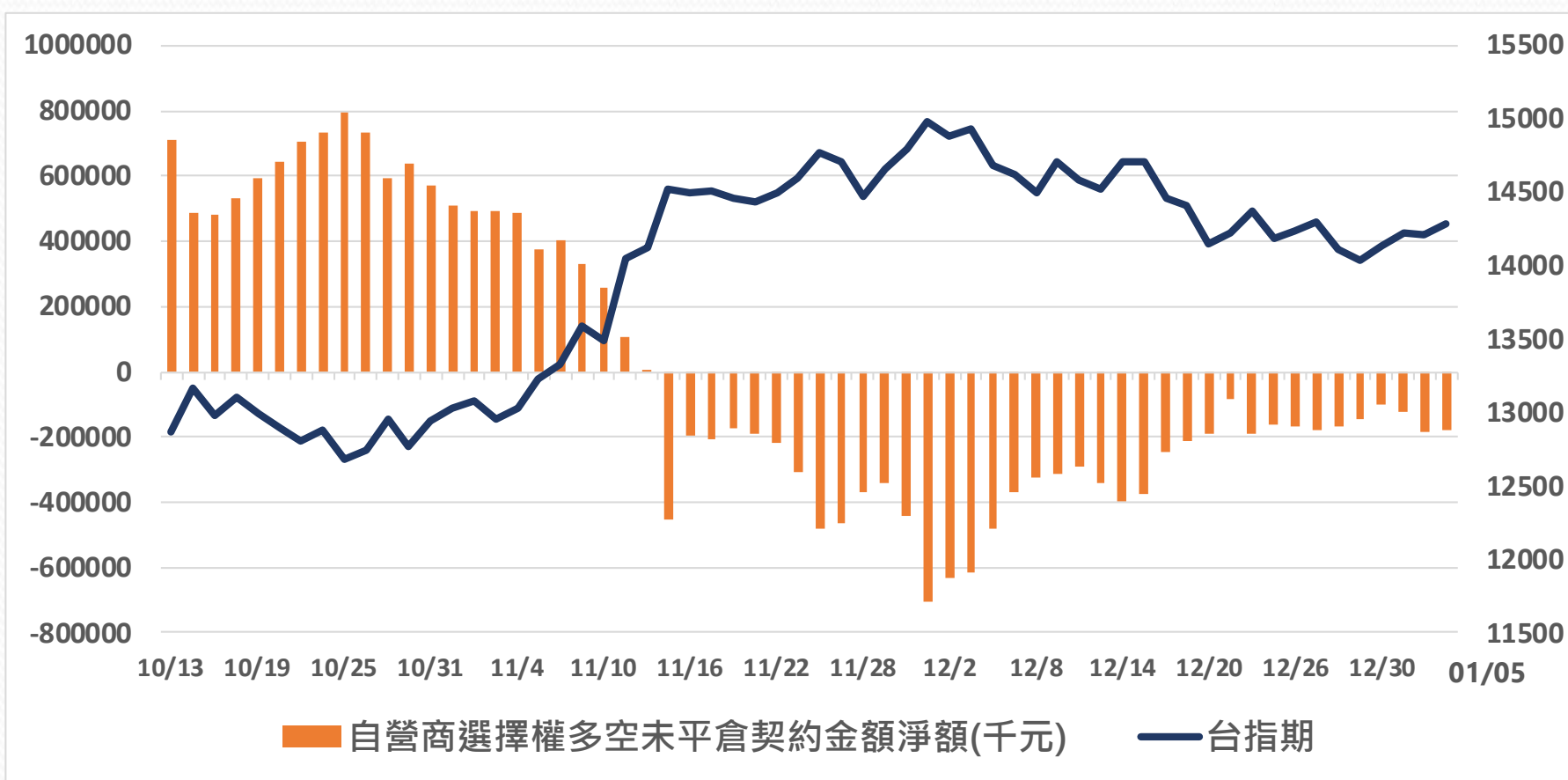
更新日期：2023年1月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

外資選擇權多空未平倉淨額



更新日期：2023年1月5日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

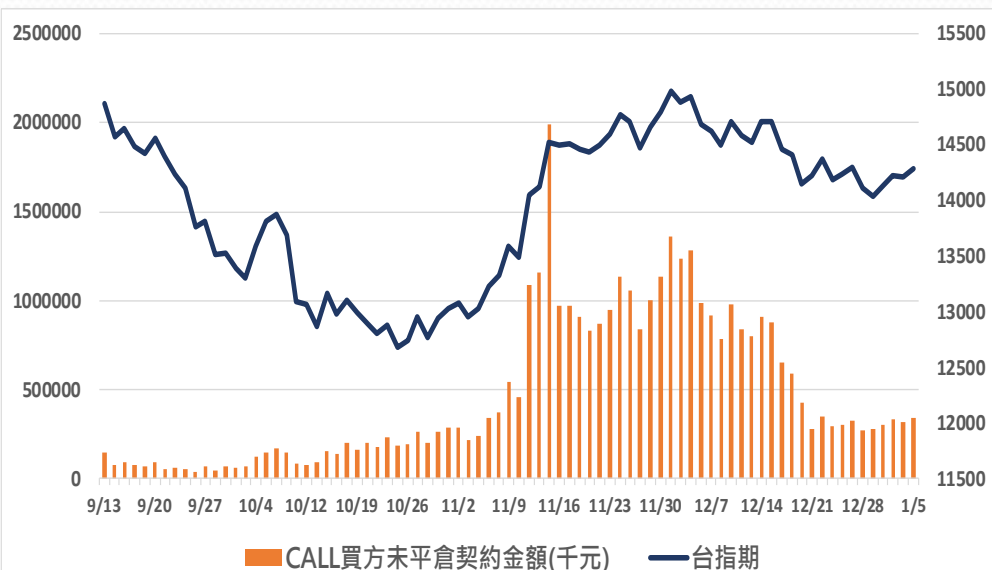
自營商選擇權多空未平倉淨額



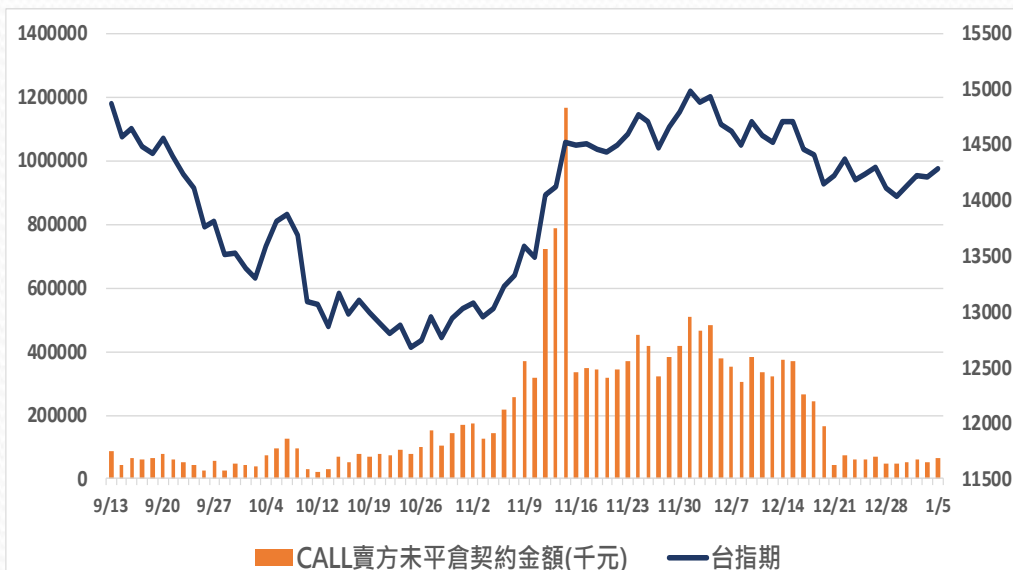
更新日期：2023年1月5日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

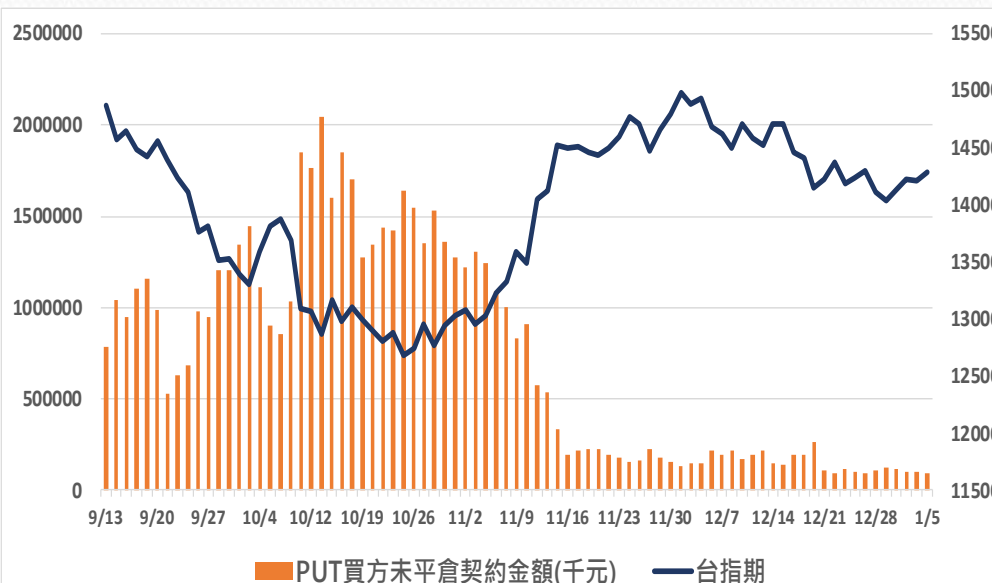
CALL買方未平倉金額



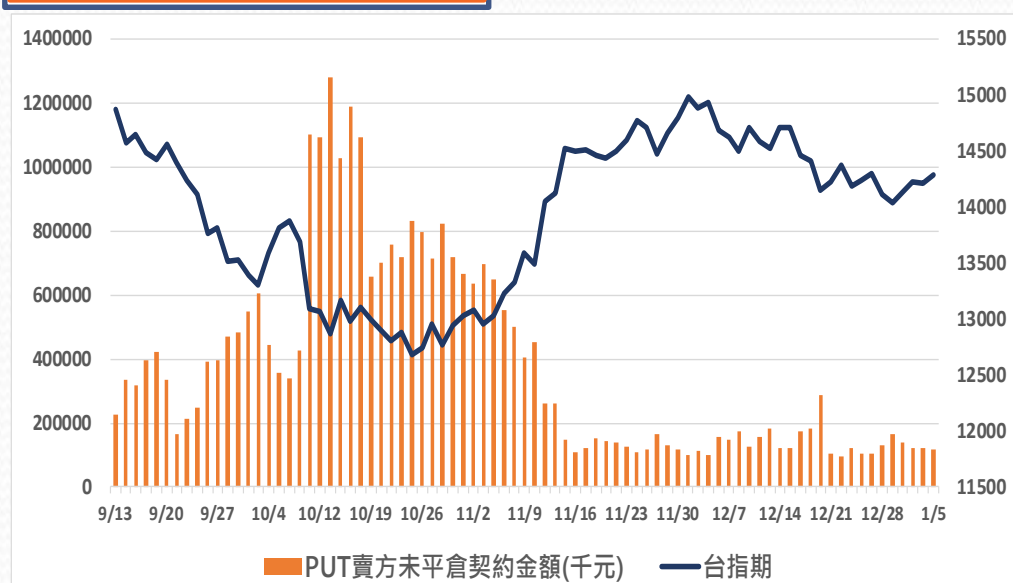
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



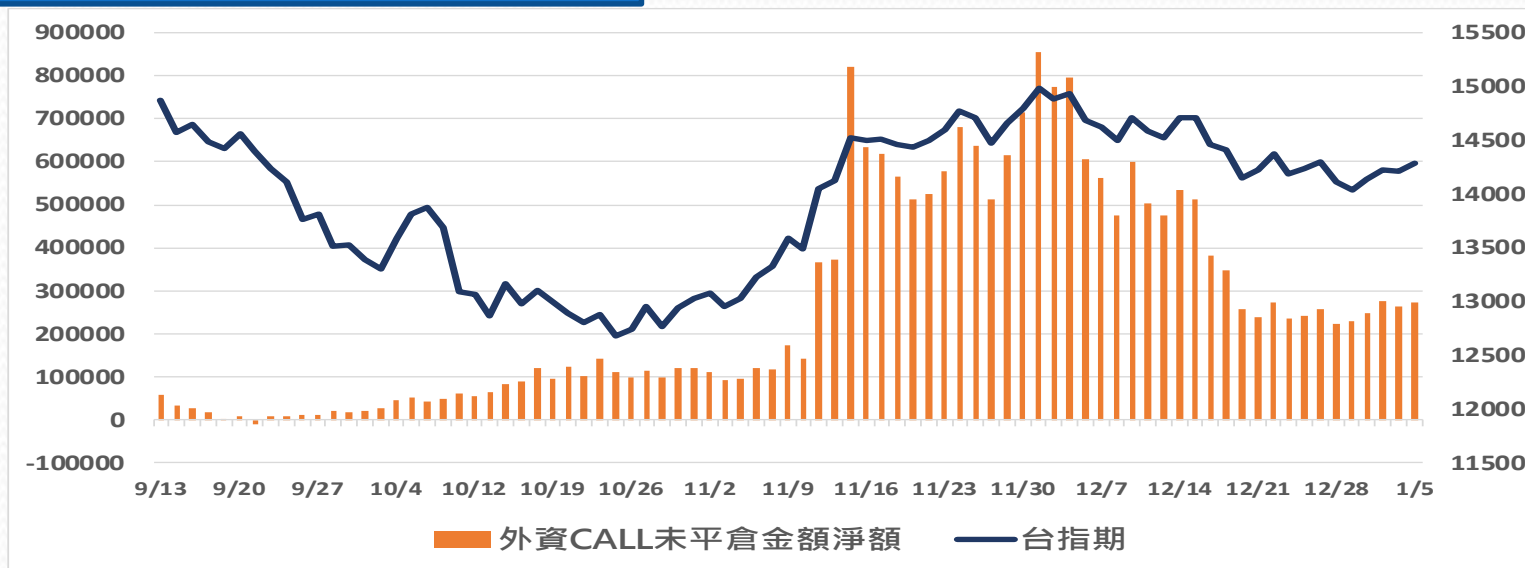
PUT賣方未平倉金額



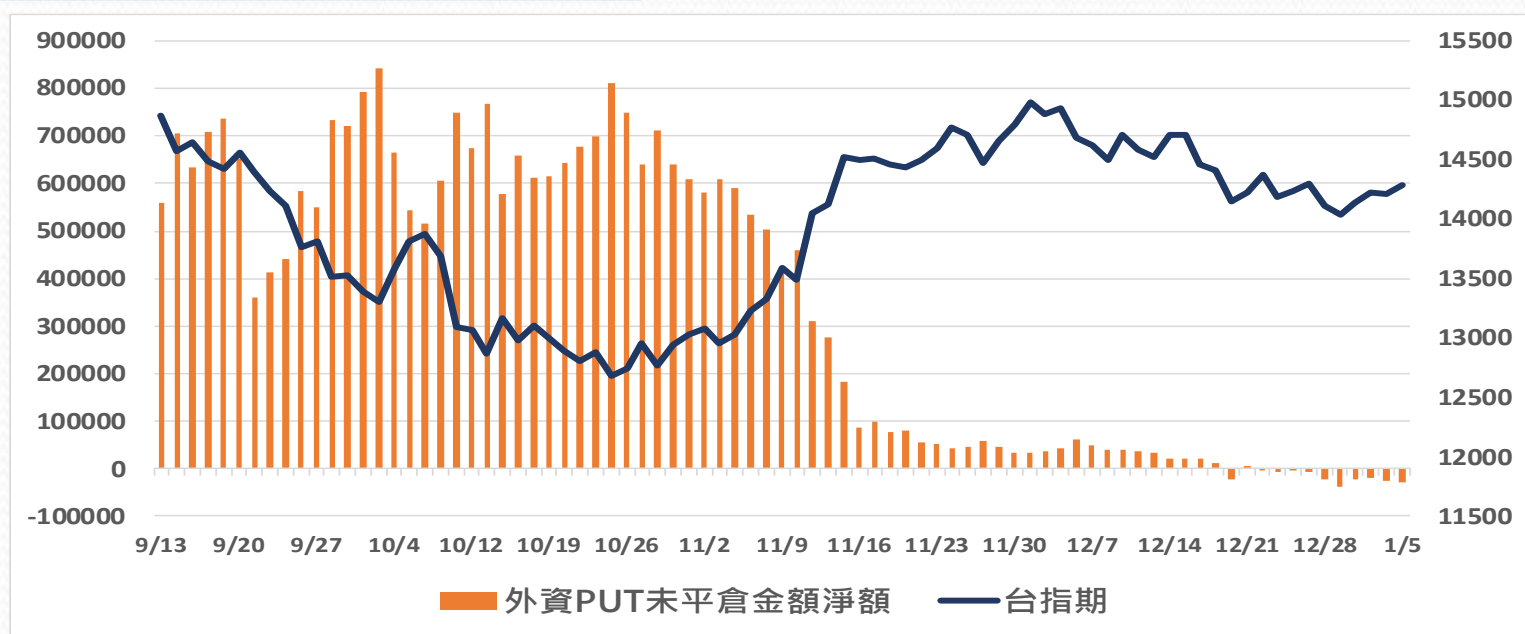
更新日期：2023年1月5日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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5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5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