

台指選擇權OI匯報

日期：2023/1/6 結算日：2023/1/11					日期：2023/1/6 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
1	28	13,850	4,704	677	1	68	13,400	4,185	283
16	118	13,900	6,424	1,461	0	145	13,500	6,553	-184
-9	61	13,950	4,993	399	10	144	13,600	4,173	-308
17	231	14,000	7,857	1,970	4	152	13,700	4,751	772 ※
32	241	14,050	6,684	3,545	-11	336	13,800	3,444	-229
-142	567	14,100	7,700	3,623	-2	336	13,900	2,774	-109
-69	505	14,150	7,538	5,027 ※	-32	1,262	14,000	4,407	625
-50	2,329	14,200	9,771	4,803	-13	2,265	14,100	2,235	112
-369	2,158	14,250	4,560	2,097	-32	1,385	14,200	1,657	81
-279	4,013	14,300	4,624	2,060	-98	1,876	14,300	1,536	221
455	3,294	14,350	3,243	2,443	-334	2,201	14,400	1,457	180
202	4,307	14,400	4,587	3,653	266	3,476	14,500	680	84
1,388	4,576	14,450	962	716	-329	2,591	14,600	541	72
※ 4,596	11,850	14,500	942	715	-1,011	3,869	14,700	809	0
1,507	6,610	14,550	251	161	-641	5,208	14,800	241	3
1,592	10,979	14,600	164	61	-605	6,639	14,900	137	-3
691	9,196	14,650	41	25	-424	12,004	15,000	145	3
917	6,791	14,700	74	25	※ 318	8,923	15,100	88	4
1,616	5,433	14,800	10	5	-35	2,872	15,200	166	3
921	3,449	14,900	1	0	-55	2,499	15,300	25	0
397	3,126	15,000	2	1	-17	1,808	15,400	17	0
68	1,045	15,100	1	0	129	2,093	15,500	19	0
-13	582	15,200	1	0	11	1,029	15,600	35	0
0	152	15,300	0	0	47	1,081	15,700	3	0
0	14	15,400	0	0	-32	932	15,800	380	0
1	1	15,500	0	0	0	553	15,900	23	0
0	0	15,600	0	0	35	933	16,000	17	0
0	0	15,700	0	0	0	201	16,100	1	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
13,478	81,703	1.2817	104,721	39,623	-2,814	75,794	0.9239	70,028	-390
昨日 P/C	0.9542	今日增減變化	0.3275		昨日 P/C	0.8986	今日增減變化	0.0253	

更新日期：2023年1月6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6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	96,181,149	54,930,981	41,250,168	-5,893,009	4,316,161	1,243,328	3,072,833	-103,603	
投信	29,904,266	56,995,668	-27,091,402	2,106,740	362,747	0	362,747	2,263	
自營商	36,322,344	17,681,416	18,640,928	-2,669,627	1,329,640	1,232,794	96,846	350,564	
	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	598,406	1,205,927	-607,521	-75,259	341,054	4,299	336,755	-15,467	
投信	72,902	0	72,902	115	0	0	0	0	
自營商	349,318	356,917	-7,599	3,029	30,065	384,000	-353,935	42,481	

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6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	32,076	13,720	18,356	5,427	16,273	16,321	-48	1,010	
投信	0	100	-100	0	400	141	259	0	
自營商	70,282	55,117	15,165	4,010	62,321	55,004	7,317	-10,090	
特定法人(週)	6,125	0	6,125	5,716	0	0	0	625	
特定法人(近月)	15,628	6,191	9,437	-10	5,829	7,914	-2,085	1,252	
特定法人(全月)	22,531	6,191	16,340	4,121	7,414	5,843	1,571	1,009	
十大交易人(週)	40,498	30,948	9,550	5,794	44,541	36,109	8,432	8,132	
十大交易人(近月)	39,233	30,653	8,580	2,905	25,619	34,630	-9,011	608	
十大交易人(全月)	94,588	70,381	24,207	4,832	75,102	77,598	-2,496	6,025	
全市場未沖銷(近月)			78,266	-2,321			72,942	523	
全市場未沖銷(全月)			197,219	13,127			214,223	41,511	

更新日期：2023年1月6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	14500
	賣權成交最大量	14200	賣權OI最大量	14200
	整體隱含波動率	8.59%	較前一交易日	+0.09%
	買權隱含波動率	10.24%	較前一交易日	-0.17%
	賣權隱含波動率	7.27%	較前一交易日	+0.58%
電子選擇權	買權成交最大量	680	買權OI最大量	690
	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	1540
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1480

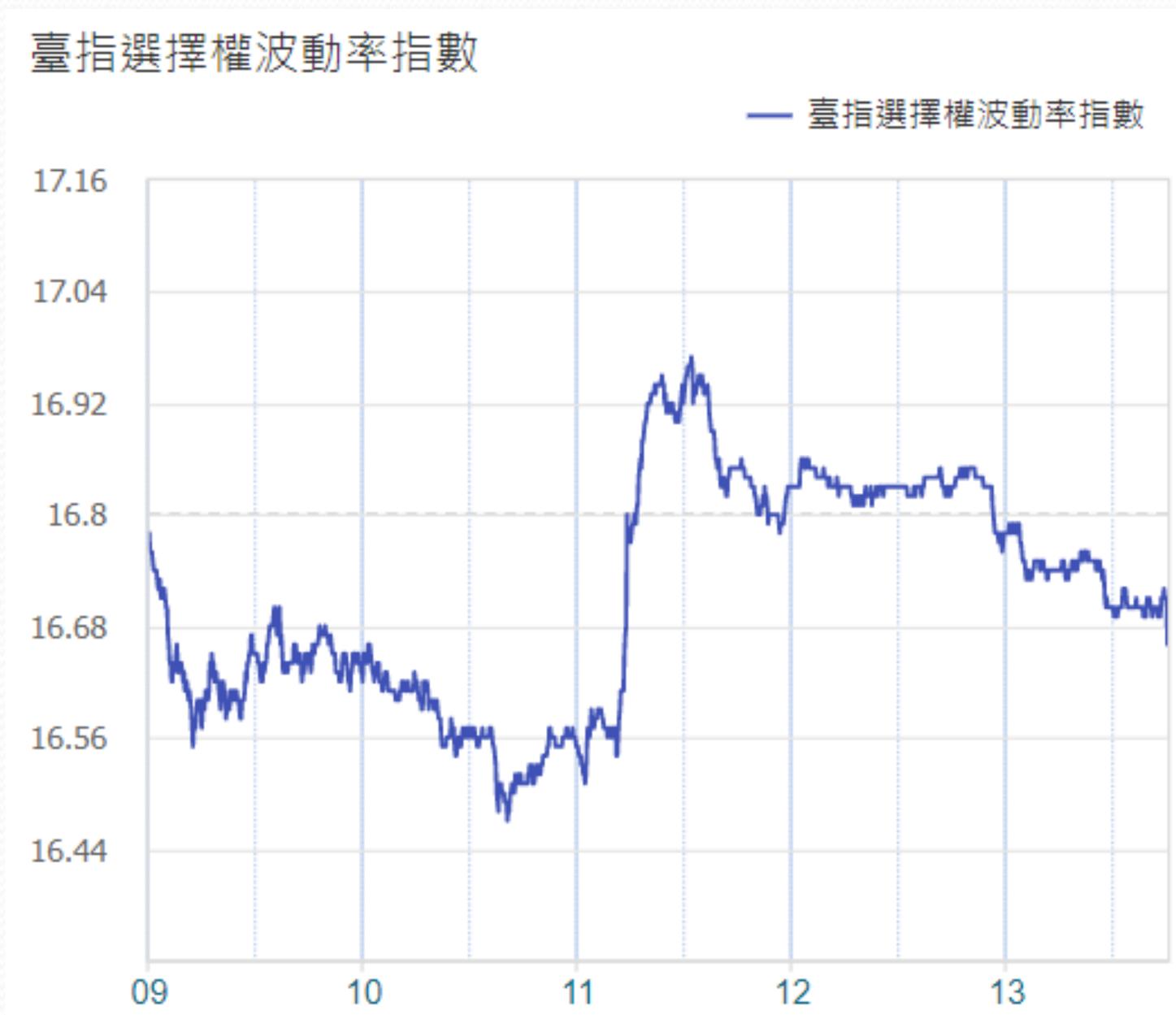
更新日期：2023年1月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	15000	買權OI最大量	15000
	賣權成交最大量	13400	賣權OI最大量	13500
	整體隱含波動率	15.41%	較前一交易日	+0.22%
	買權隱含波動率	13.18%	較前一交易日	+0.08%
	賣權隱含波動率	17.31%	較前一交易日	-0.47%
	成交量P/C_Ratio值	1.130	較前一交易日	+0.02
	未平倉P/C_Ratio值	0.932	較前一交易日	+0.03
電子選擇權	買權成交最大量	680	買權OI最大量	690
	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	1540
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1480

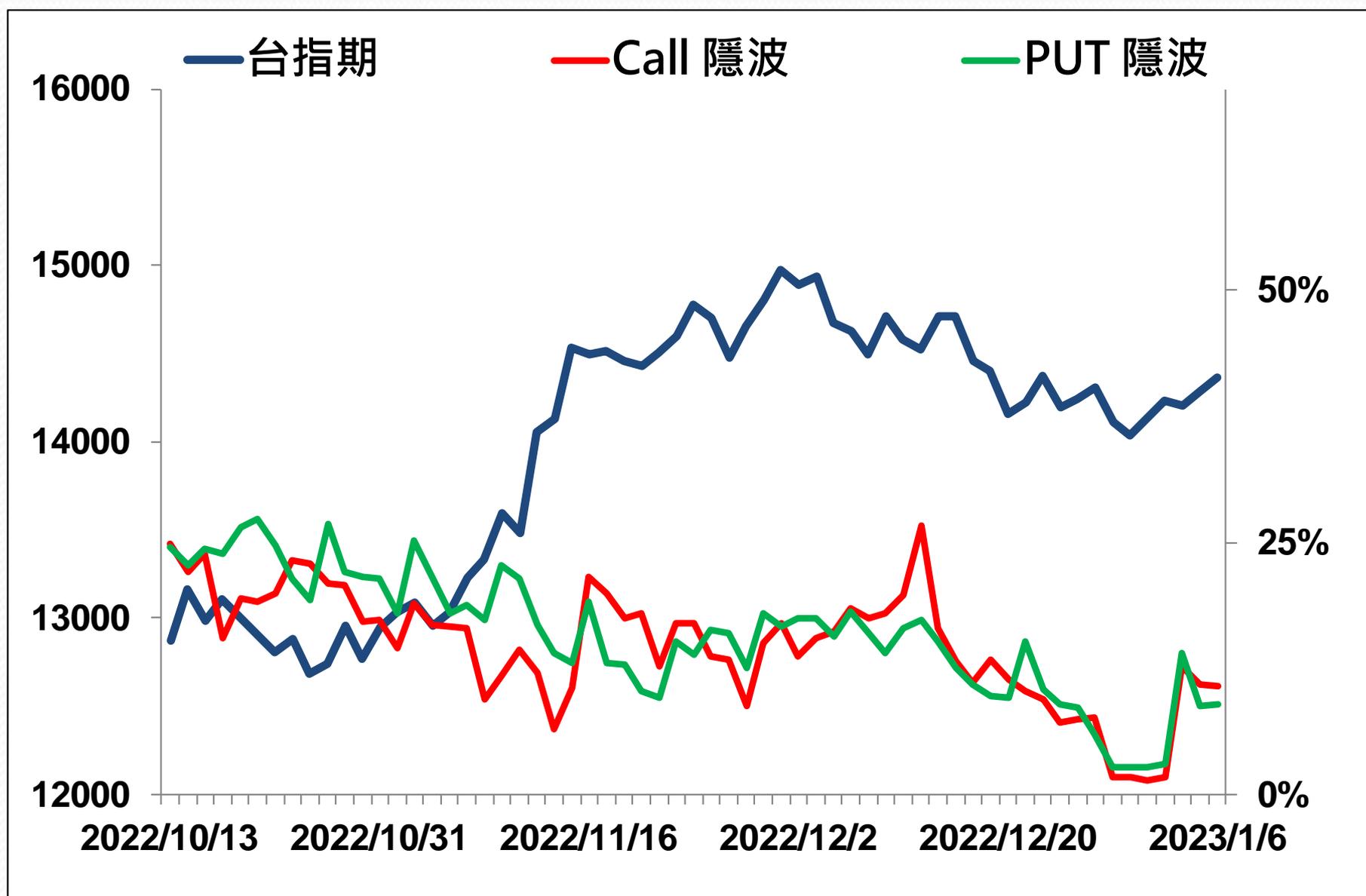
更新日期：2023年1月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



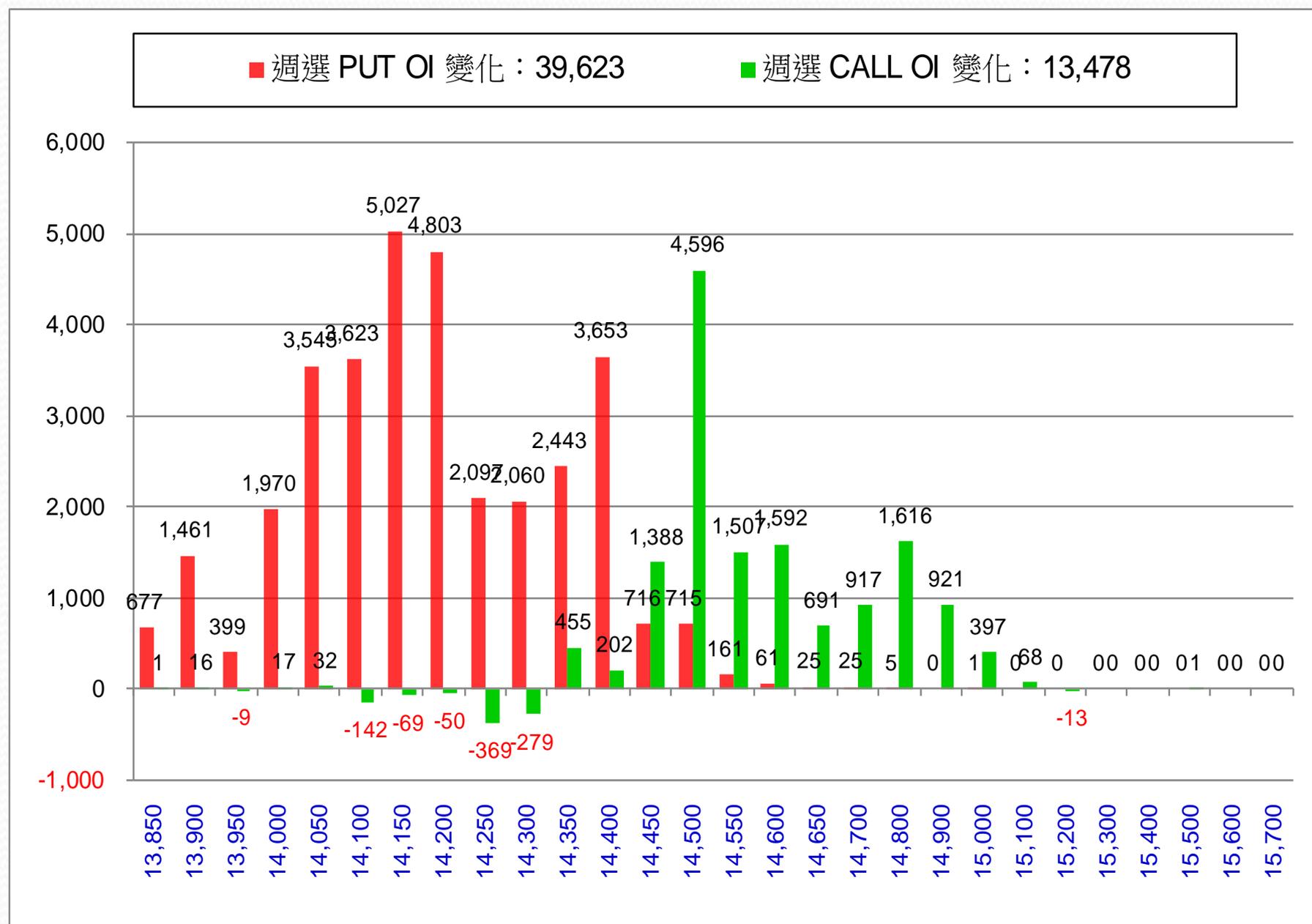
更新日期：2023年1月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



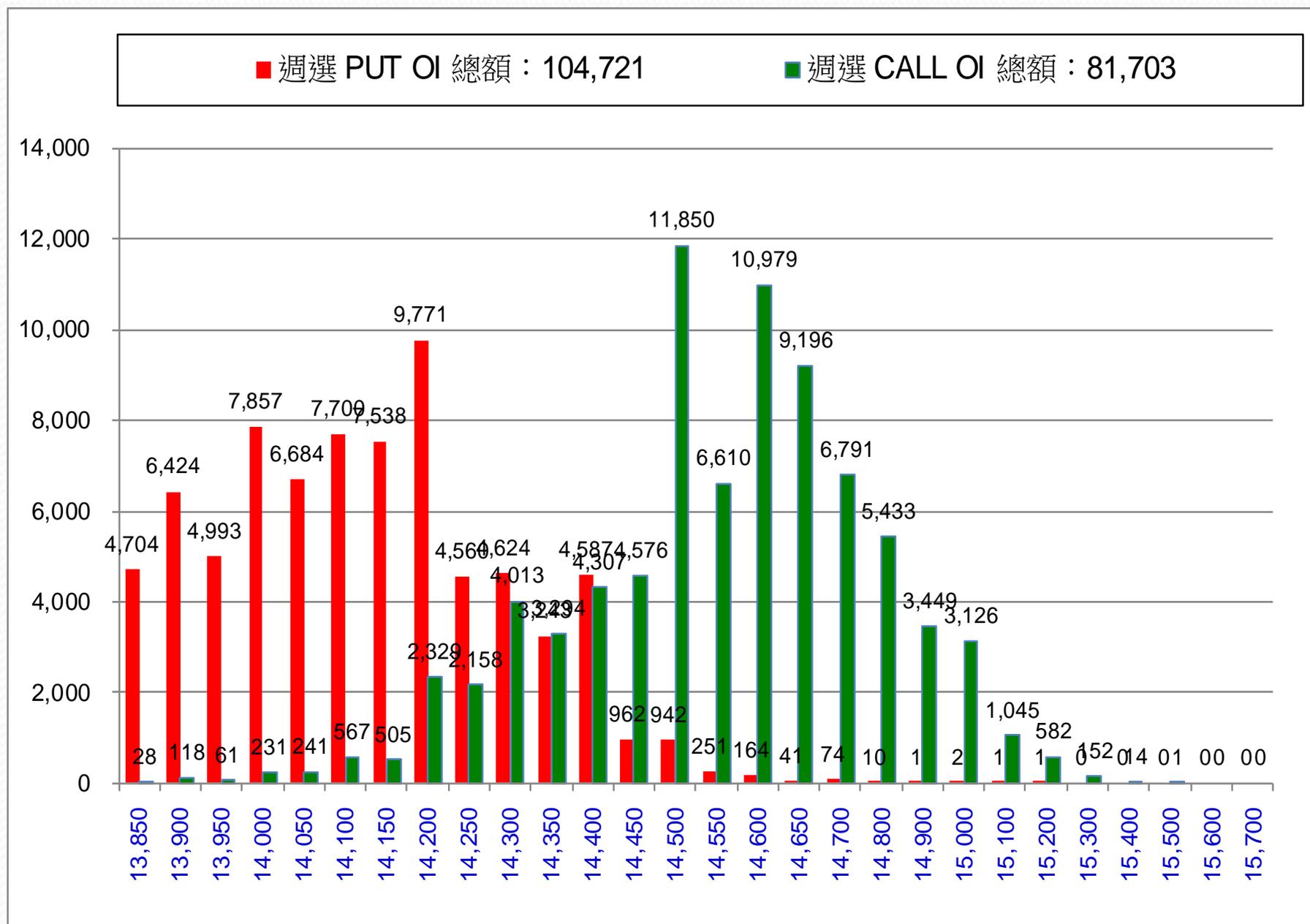
更新日期：2023年1月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年1月6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



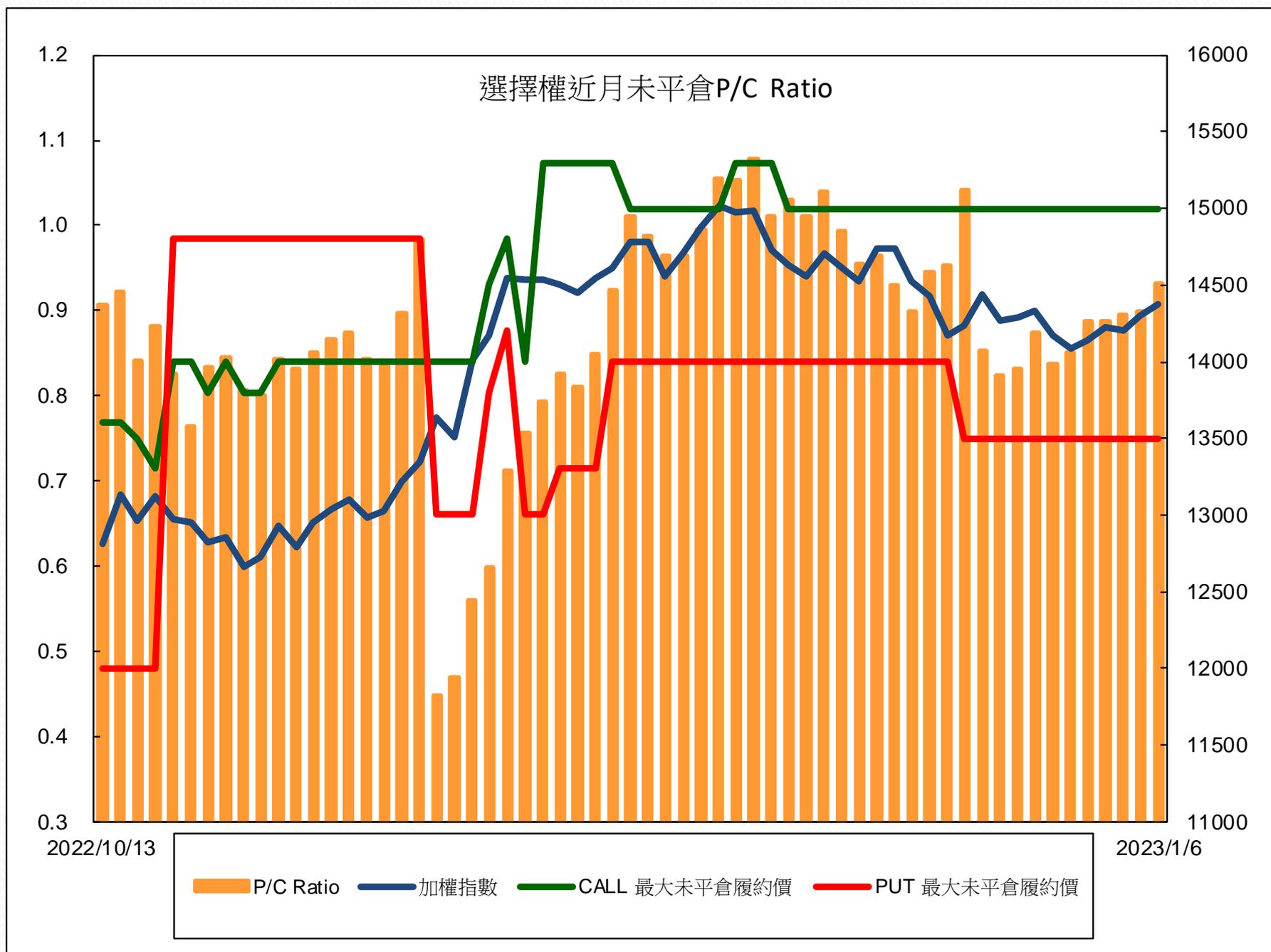
更新日期：2023年1月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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5日	63,637	52,482	11,155
	1月6日	70,282	55,117	15,165
Put	1月5日	56,124	38,717	17,407
	1月6日	62,321	55,004	7,317

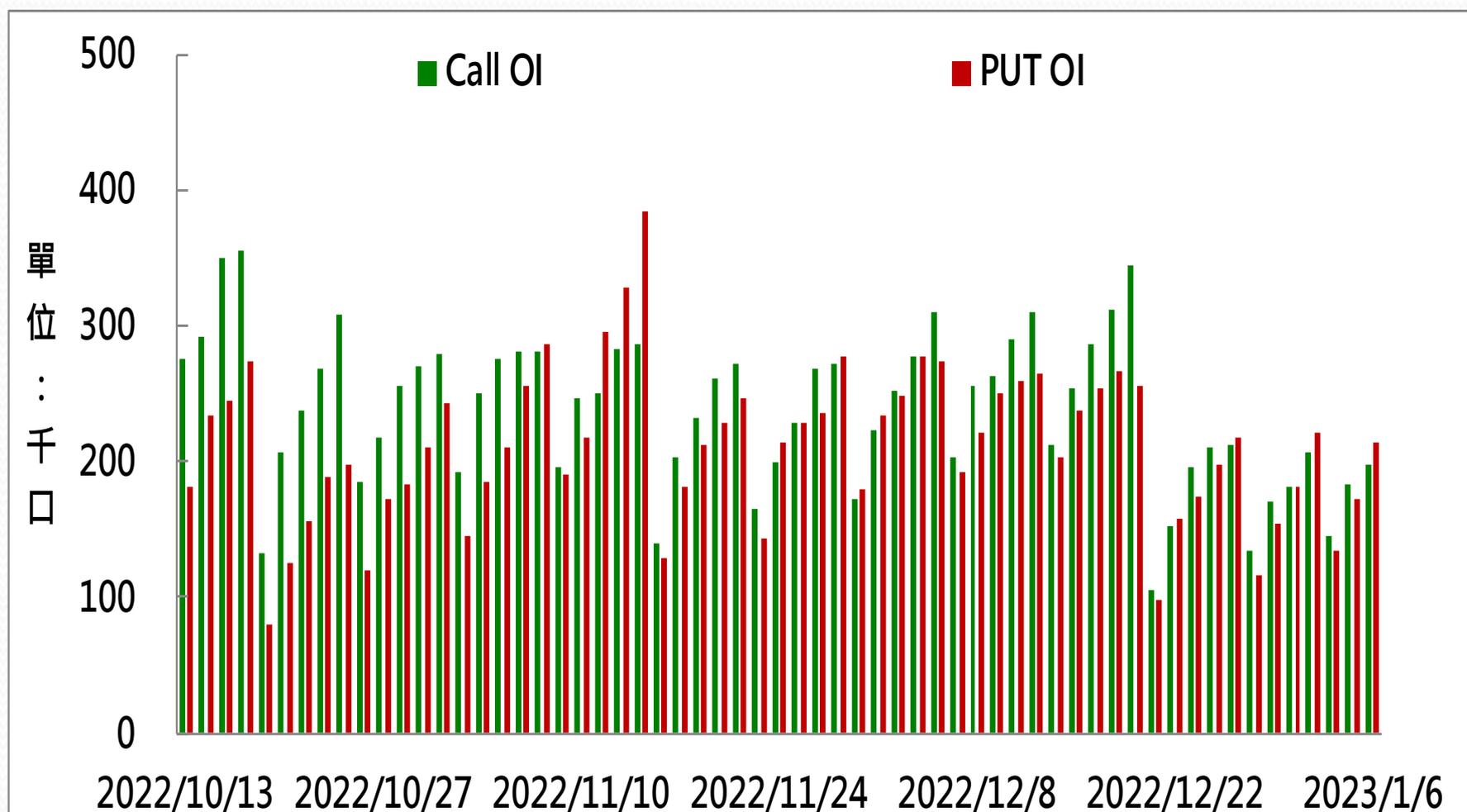
更新日期：2023年1月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



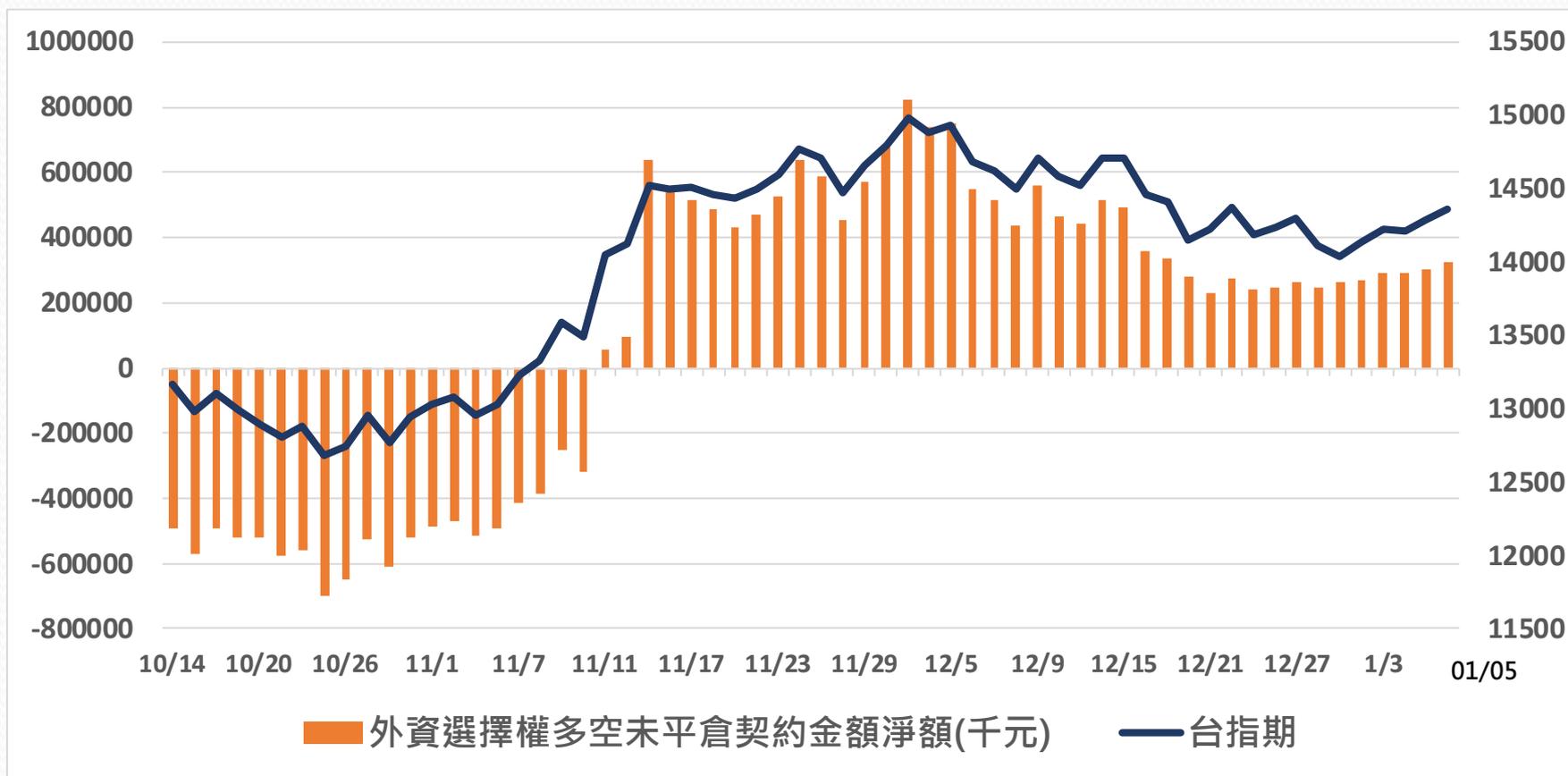
更新日期：2023年1月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權全月Put Call OI



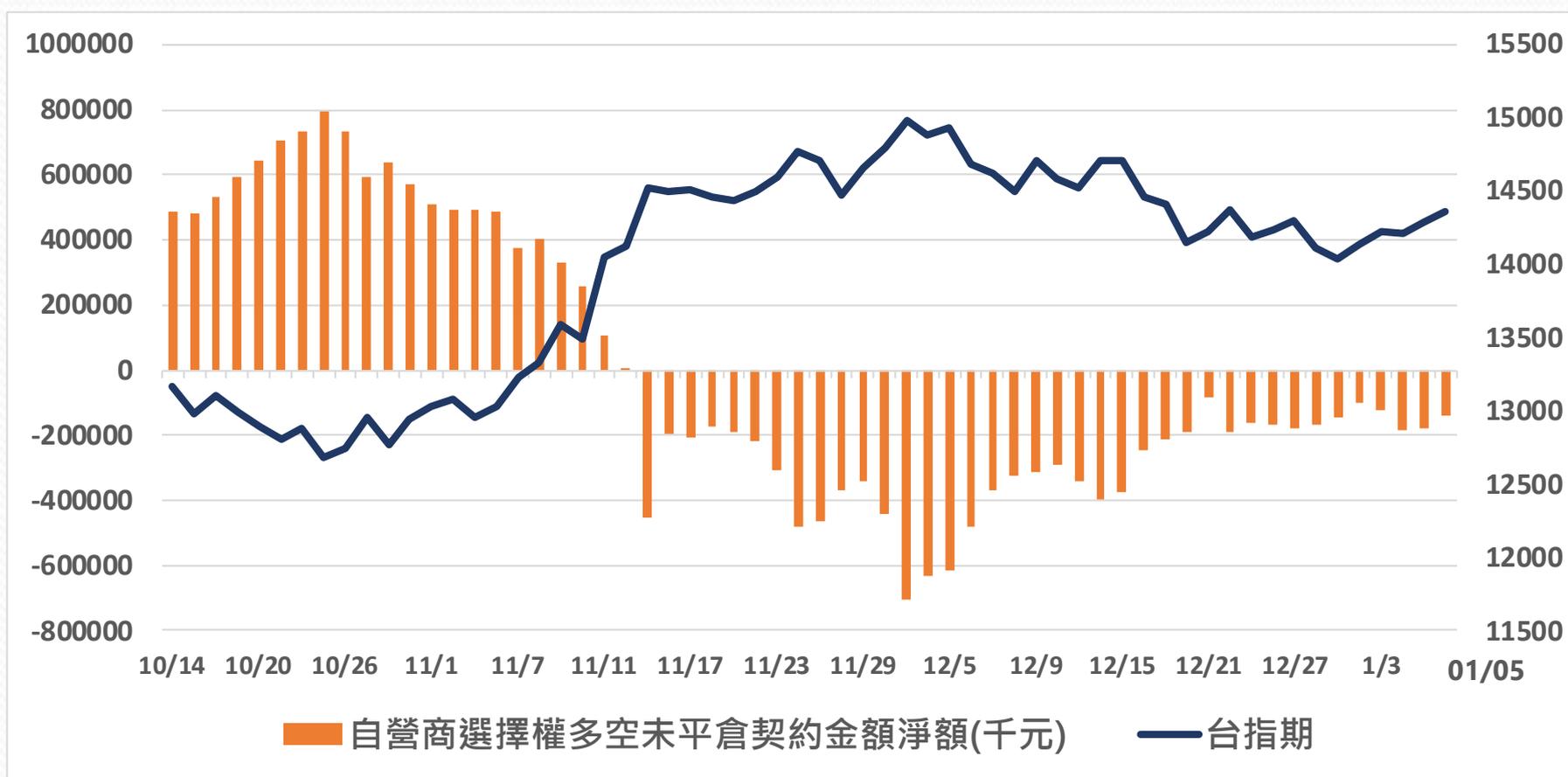
更新日期：2023年1月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

外資選擇權多空未平倉淨額



更新日期：2023年1月6日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

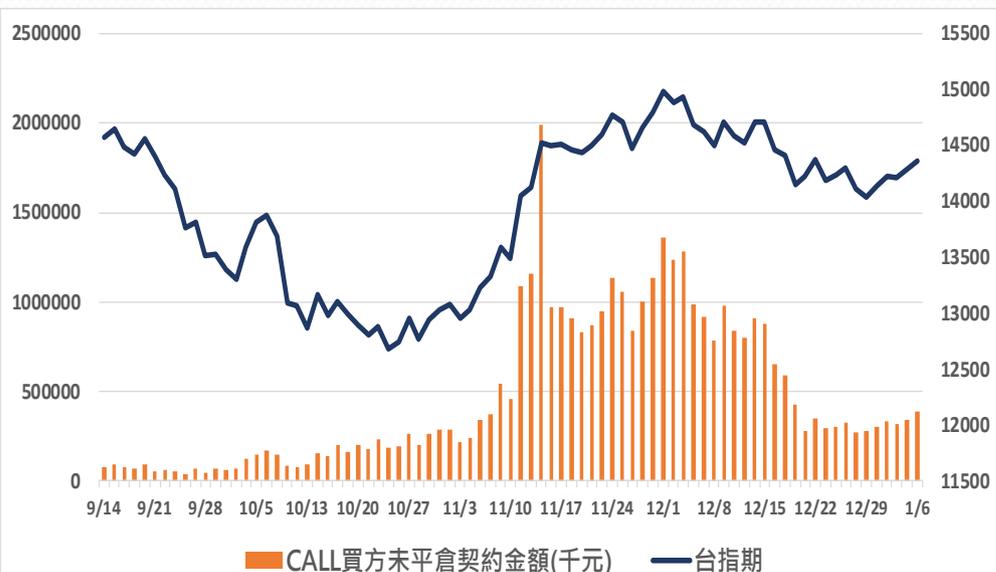
自營商選擇權多空未平倉淨額



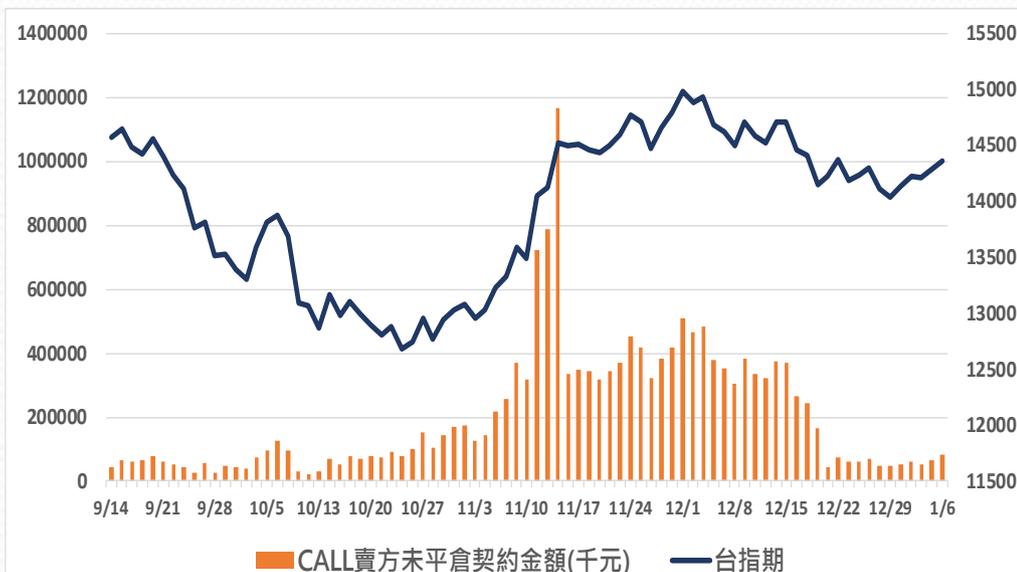
更新日期：2023年1月6日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

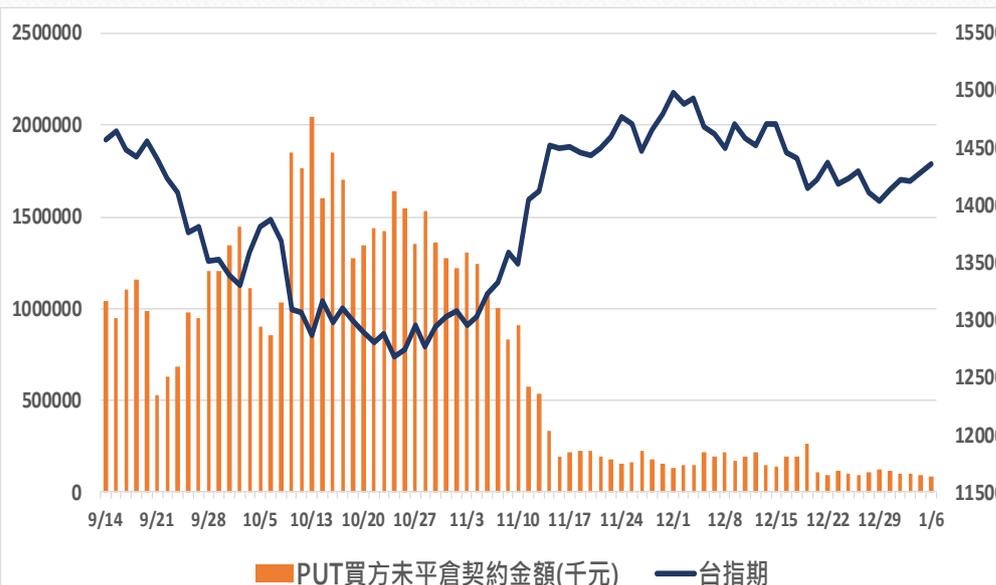
CALL買方未平倉金額



CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



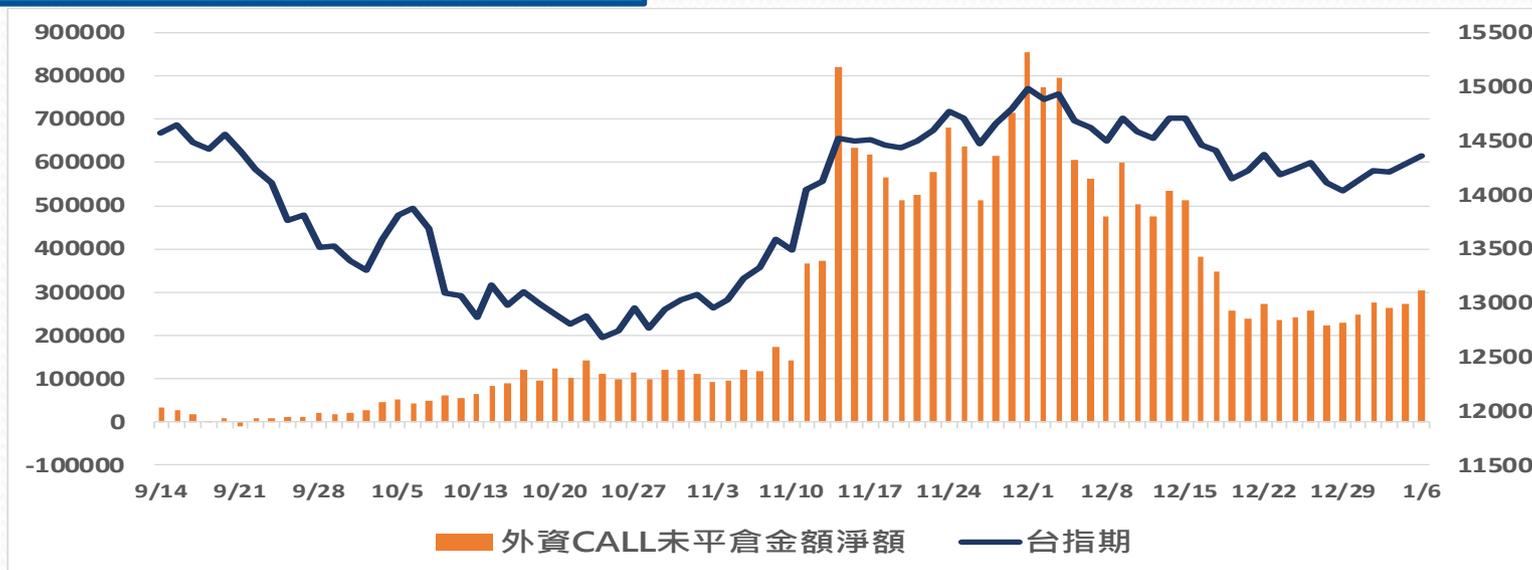
PUT賣方未平倉金額



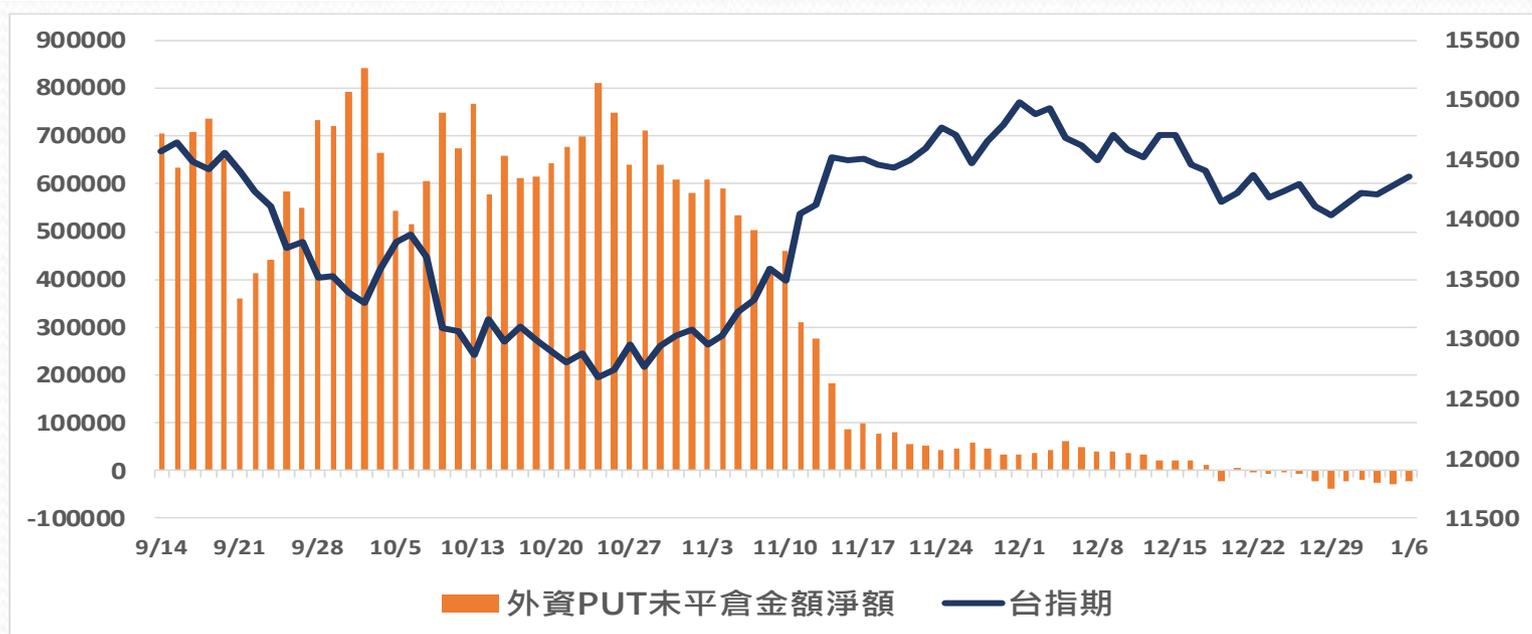
更新日期：2023年1月6日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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6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6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