

台指選擇權OI匯報

日期：2023/1/9 結算日：2023/1/11					日期：2023/1/9 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
34	2,192	14,250	5,298	738	-1	335	13,800	3,745	301
-841	3,172	14,300	7,557	2,933	2	338	13,900	3,258	484
-1,659	1,635	14,350	6,837	3,594	-46	1,216	14,000	4,586	179
-1,480	2,827	14,400	11,184	6,597	-131	2,134	14,100	3,356	1,121
-1,049	3,527	14,450	6,246	5,284	-117	1,268	14,200	2,554	897
-5,053	6,797	14,500	8,247	7,305	-407	1,469	14,300	1,922	386
-2,266	4,344	14,550	6,438	6,187	-355	1,846	14,400	2,075	618
-4,387	6,592	14,600	7,992	7,828	-1,239	2,237	14,500	1,720	1,040
-3,350	5,846	14,650	6,392	6,351	-566	2,025	14,600	972	431
614	7,405	14,700	5,105	5,031	-771	3,098	14,700	1,079	270
3,049	7,441	14,750	3,767	3,746	-756	4,452	14,800	833	592
4,825	10,258	14,800	1,942	1,932	-1,033	5,606	14,900	300	163
4,060	7,509	14,900	623	622	-193	11,811	15,000	164	19
4,903	8,029	15,000	292	290	-3,832	5,091	15,100	144	56
690	1,735	15,100	7	6	403	3,275	15,200	213	47
365	947	15,200	1	0	1,108	3,607	15,300	33	8
296	448	15,300	0	0	700	2,508	15,400	19	2
197	211	15,400	1	1	195	2,288	15,500	18	-1
41	42	15,500	0	0	308	1,337	15,600	35	0
41	41	15,600	1	1	-382	699	15,700	3	0
0	0	15,700	1	1	-118	814	15,800	387	7
13	20	15,800	1	1	-38	515	15,900	23	0
0	0	15,900	0	0	-148	785	16,000	10	-7
0	0	16,000	0	0	77	278	16,100	1	0
0	0	16,100	0	0	3	298	16,200	22	-1
0	0	16,200	0	0	-4	174	16,300	0	-1
0	0	16,300	0	0	-11	147	16,400	98	0
0	0	16,400	0	0	0	849	16,500	0	-1
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
-1,720	84,375	1.8416	155,381	50,639	-5,138	70,656	1.0723	75,765	5,737
昨日 P/C	1.2817	今日增減變化	0.5599	昨日 P/C	0.9320	今日增減變化	0.1403		

更新日期：2023年1月9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9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	101,723,884	64,758,795	36,965,089	-4,285,079	4,610,384	1,292,760	3,317,624	244,791	
投信	31,006,500	54,252,516	-23,246,016	3,845,386	397,354	0	397,354	34,607	
自營商	37,631,796	15,864,148	21,767,648	3,126,720	1,273,225	1,259,989	13,236	-83,610	
	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	764,543	1,436,041	-671,498	-63,977	354,971	4,364	350,607	13,852	
投信	74,438	0	74,438	1,536	0	0	0	0	
自營商	331,869	271,390	60,479	68,078	39,252	375,294	-336,042	17,893	

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9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	37,556	16,242	21,314	2,958	19,349	19,690	-341	-293	
投信	200	200	0	100	600	141	459	200	
自營商	58,104	62,599	-4,495	-19,660	64,718	74,064	-9,346	-16,663	
特定法人(週)	3,543	0	3,543	-2,582	2,418	2,449	-31	-31	
特定法人(近月)	20,100	7,524	12,576	3,139	6,417	8,123	-1,706	379	
特定法人(全月)	26,606	6,191	20,415	4,075	8,141	3,609	4,532	2,961	
十大交易人(週)	31,825	31,712	113	-9,437	62,117	42,306	19,811	11,379	
十大交易人(近月)	36,317	34,032	2,285	-6,295	30,548	37,521	-6,973	2,038	
十大交易人(全月)	84,465	75,154	9,311	-14,896	93,723	82,817	10,906	13,402	
全市場未沖銷(近月)			73,036	-5,230			80,972	8,030	
全市場未沖銷(全月)			193,739	-3,480			276,672	62,449	

更新日期：2023年1月9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	14800
	賣權成交最大量	14400	賣權OI最大量	14400
	整體隱含波動率	13.75%	較前一交易日	+5.16%
	買權隱含波動率	16.26%	較前一交易日	+6.01%
	賣權隱含波動率	12.07%	較前一交易日	+4.80%
電子選擇權	買權成交最大量	690	買權OI最大量	690
	賣權成交最大量	655	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	1480	賣權OI最大量	1520

更新日期：2023年1月9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	15100	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	16.21%	較前一交易日	-0.80%
	買權隱含波動率	14.89%	較前一交易日	+1.71%
	賣權隱含波動率	17.67%	較前一交易日	+0.35%
	成交量P/C_Ratio值	0.944	較前一交易日	-0.19
	未平倉P/C_Ratio值	1.109	較前一交易日	+0.18
電子選擇權	買權成交最大量	690	買權OI最大量	690
	賣權成交最大量	655	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	1480	賣權OI最大量	1520

更新日期：2023年1月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

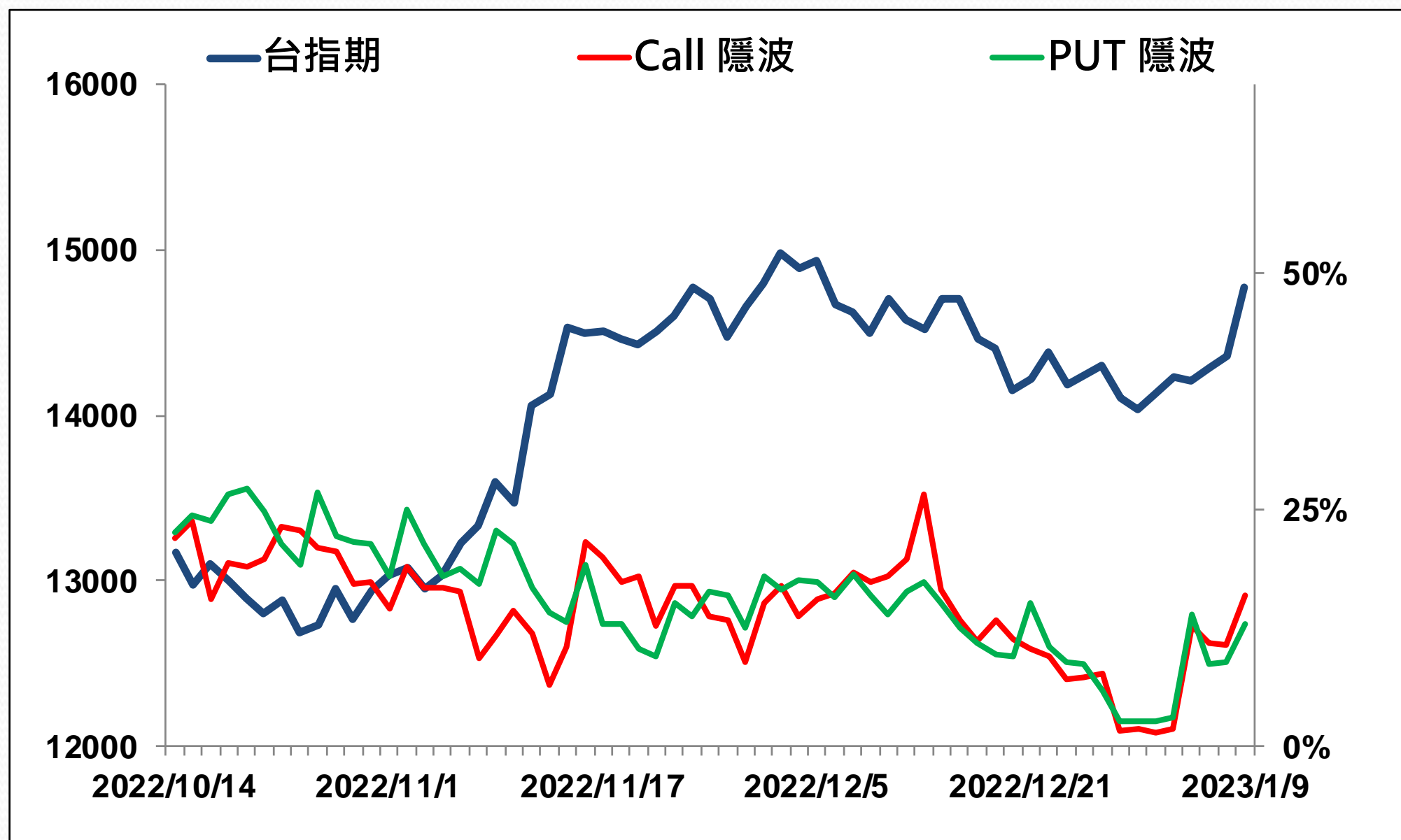
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年1月9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

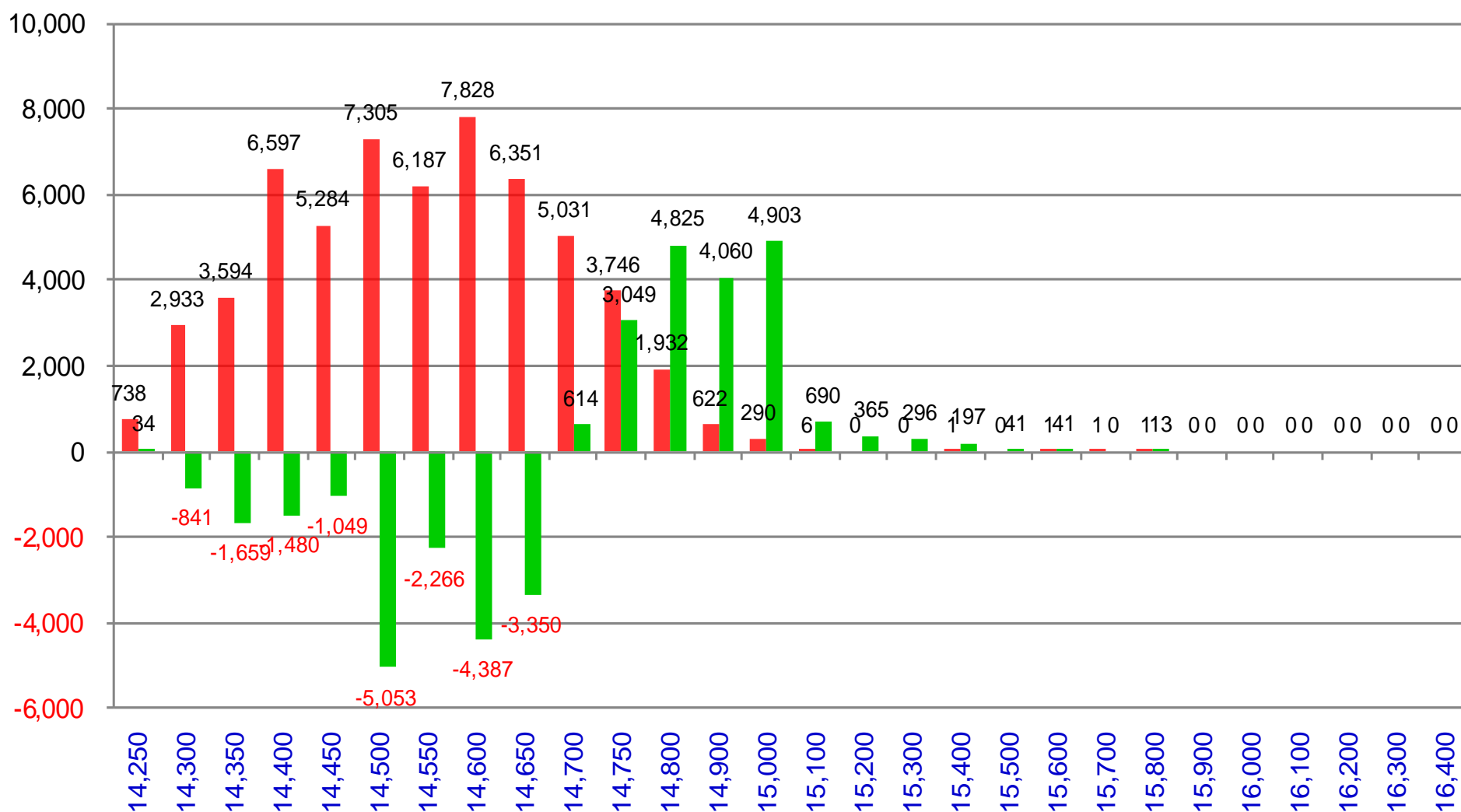


更新日期：2023年1月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

■ 週選 PUT OI 變化：50,639

■ -週選 CALL OI 變化：1,720

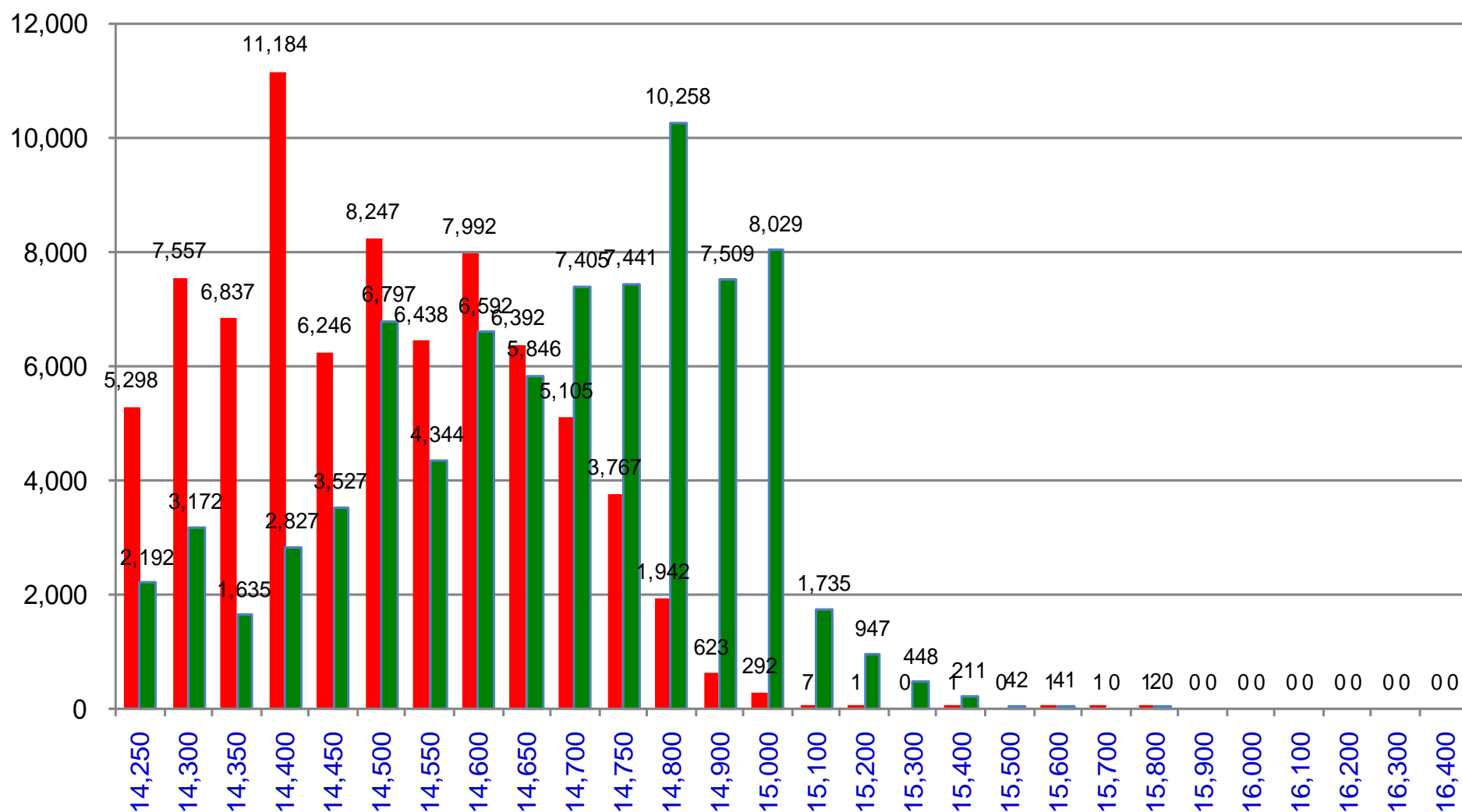


更新日期：2023年1月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：155,381

週選 CALL OI 總額：84,375



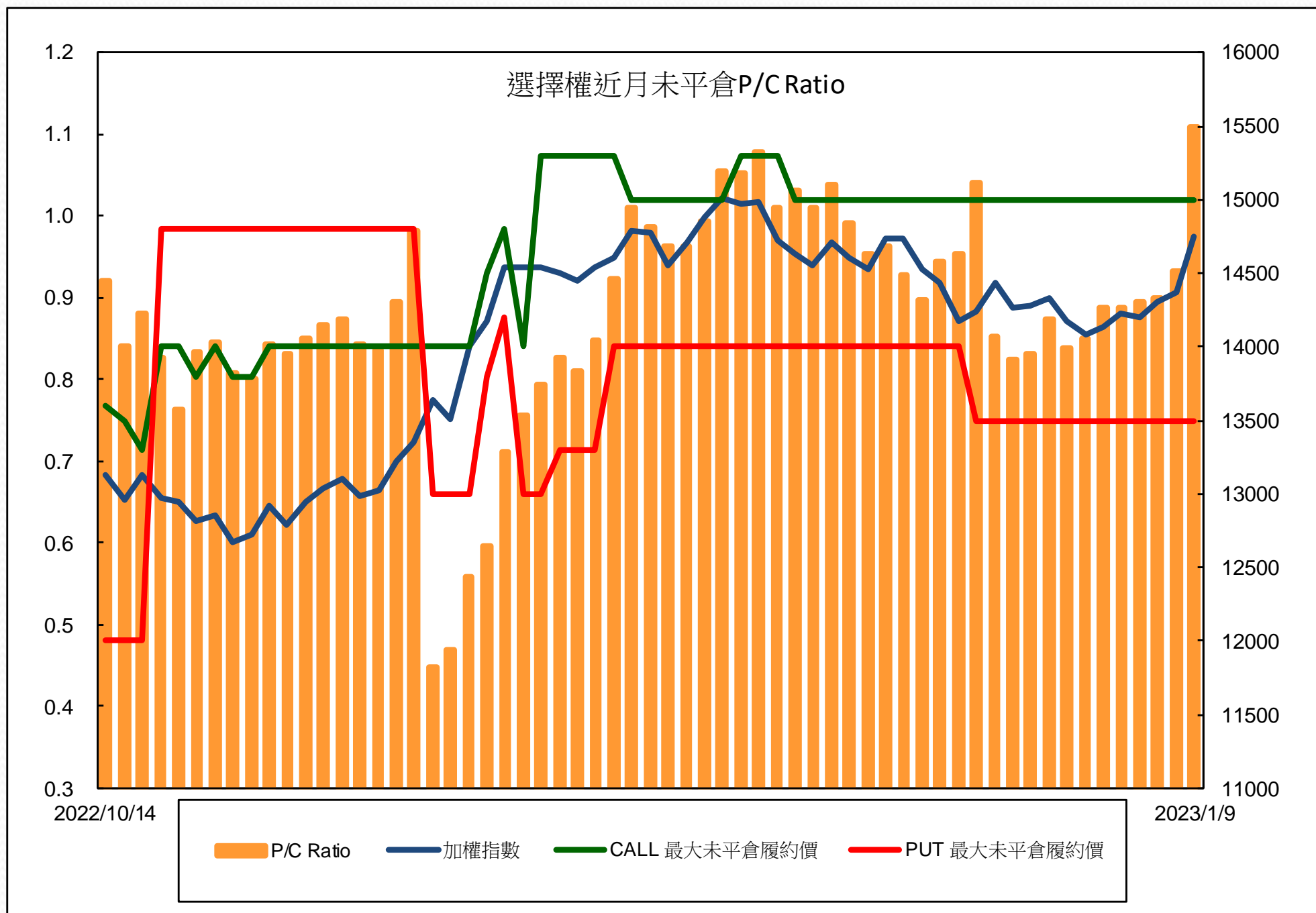
更新日期：2023年1月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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6日	70,282	55,117	15,165
	1月9日	58,104	62,599	-4,495
Put	1月6日	62,321	55,004	7,317
	1月9日	64,718	74,064	-9,346

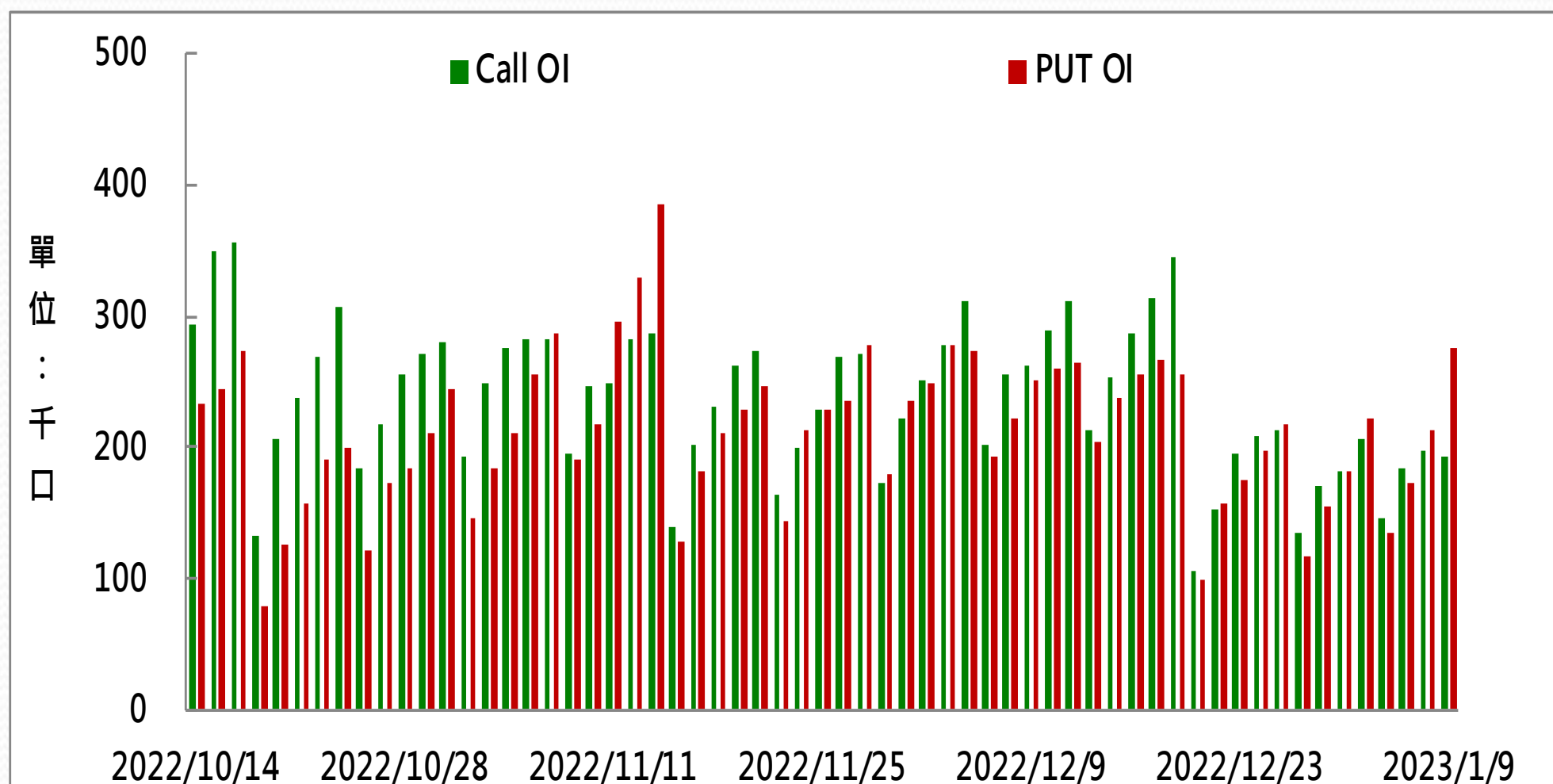
更新日期：2023年1月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年1月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

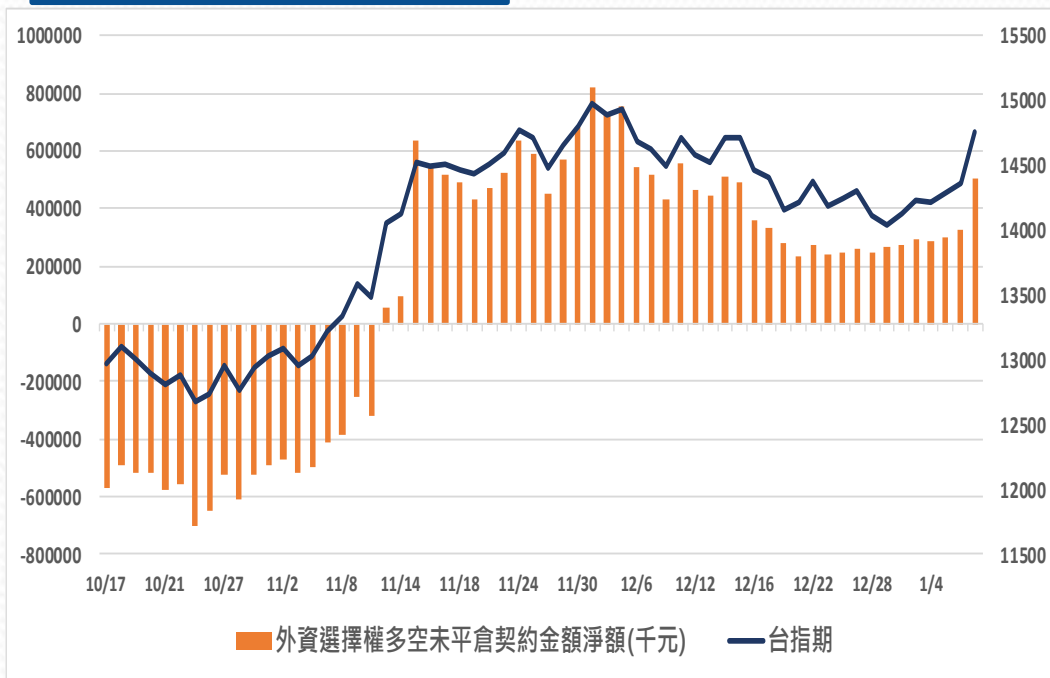
選擇權全月Put Call OI



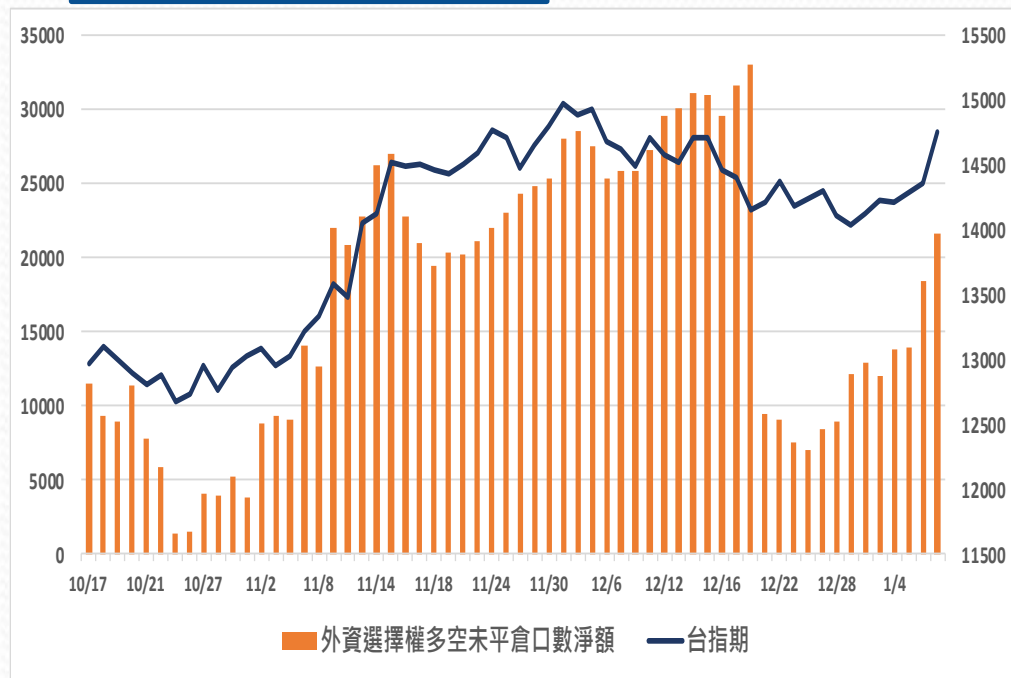
更新日期：2023年1月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

外資選擇權多空未平倉淨額

多空未平倉金額淨額



多空未平倉口數淨額



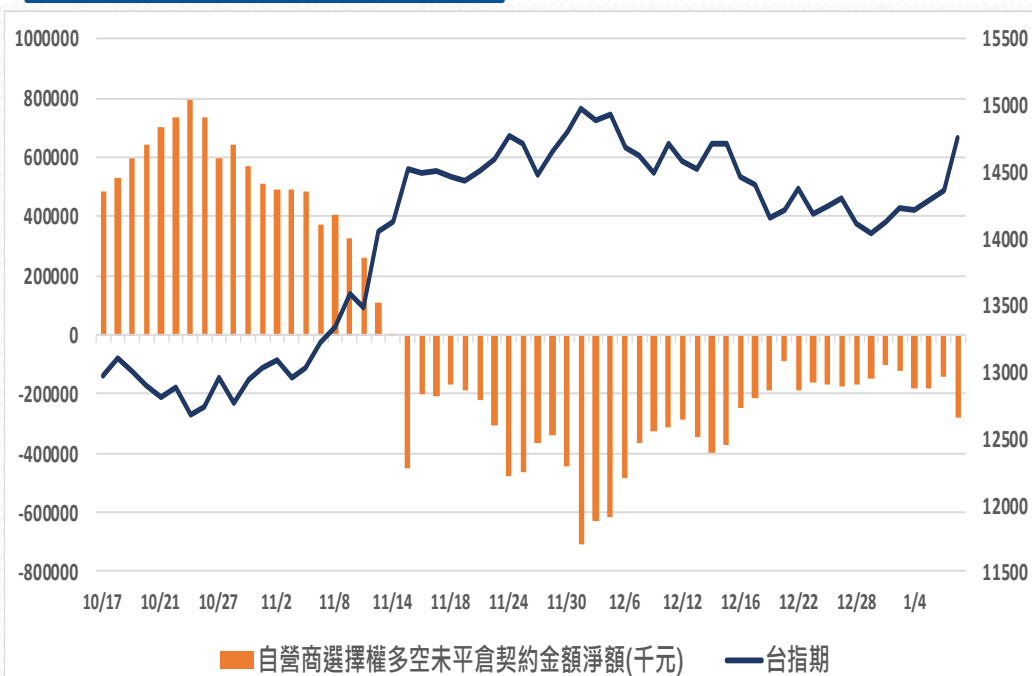
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/1/3	14230	12006	-913	293593	22145
2023/1/4	14209	13772	1766	289034	-4559
2023/1/5	14289	13987	215	301026	11992
2023/1/6	14366	18404	4417	324192	23166
2023/1/9	14765	21655	3251	506550	182358

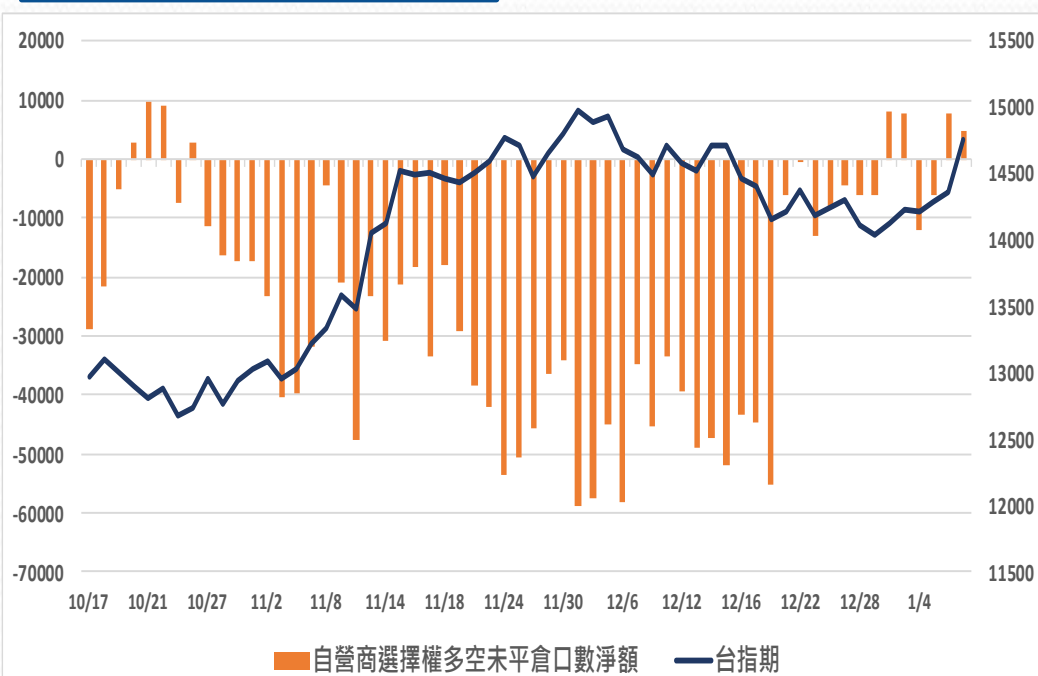
更新日期：2023年1月9日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

自營商選擇權多空未平倉淨額

多空未平倉金額淨額



多空未平倉口數淨額



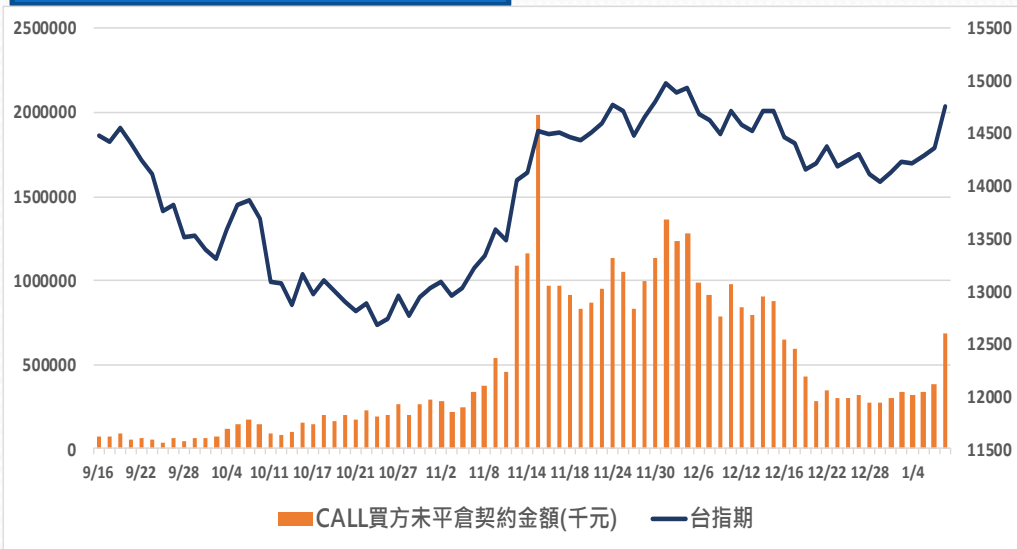
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/1/3	14230	7763	-469	-121091	-22737
2023/1/4	14209	-11860	-19623	-183438	-62347
2023/1/5	14289	-6252	5608	-179752	3686
2023/1/6	14366	7848	14100	-141890	37862
2023/1/9	14765	4851	-2997	-278375	-136485

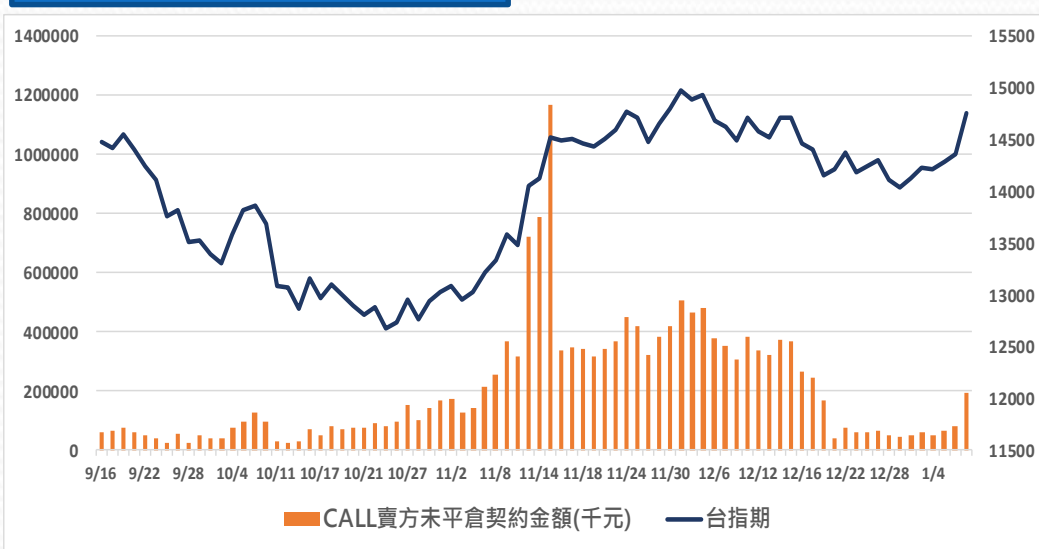
更新日期：2023年1月9日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

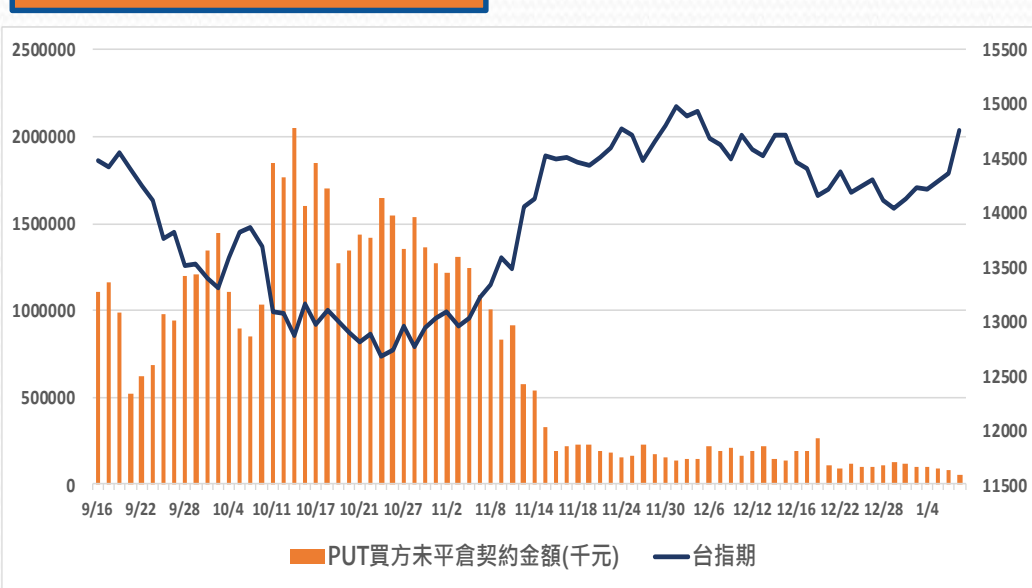
CALL買方未平倉金額



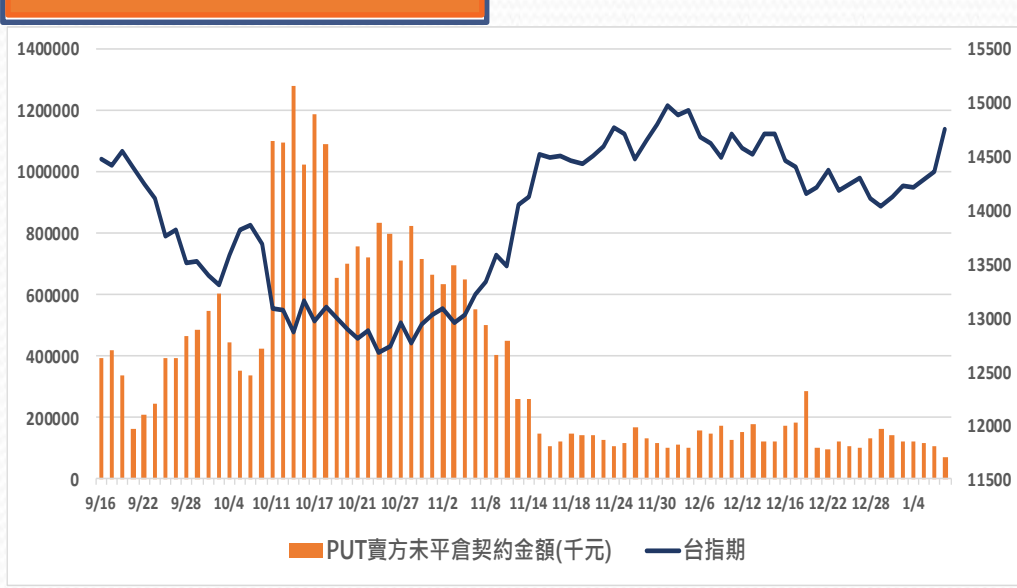
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



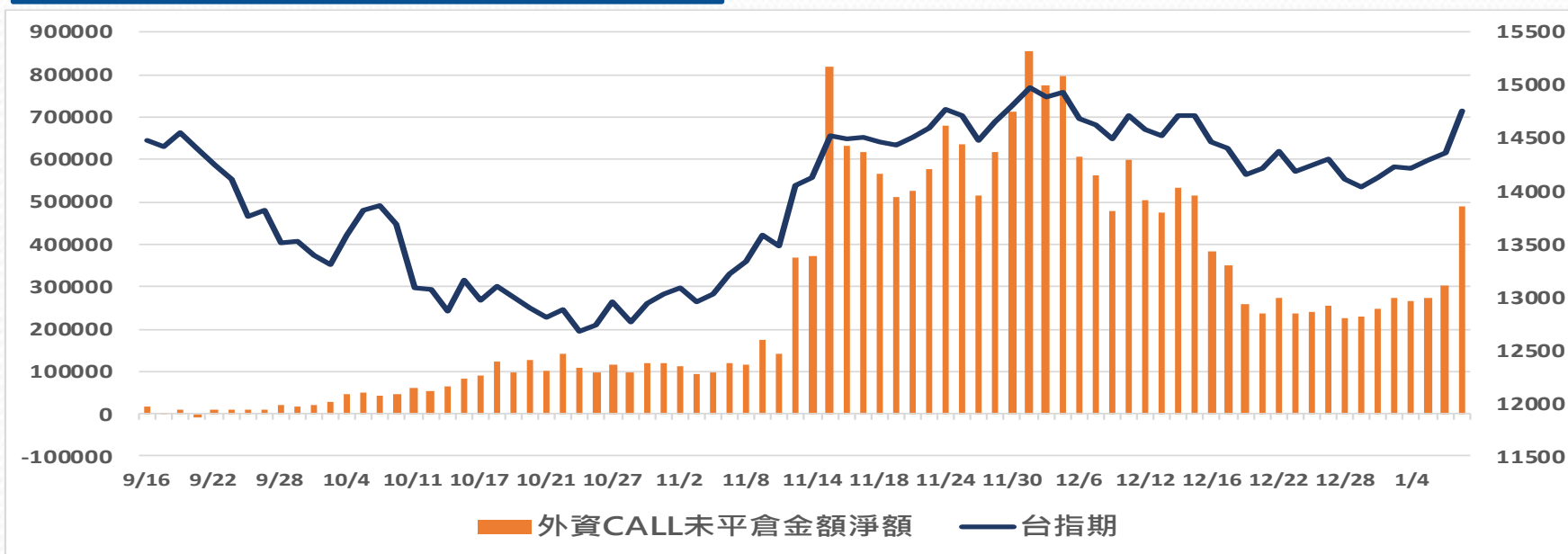
PUT賣方未平倉金額



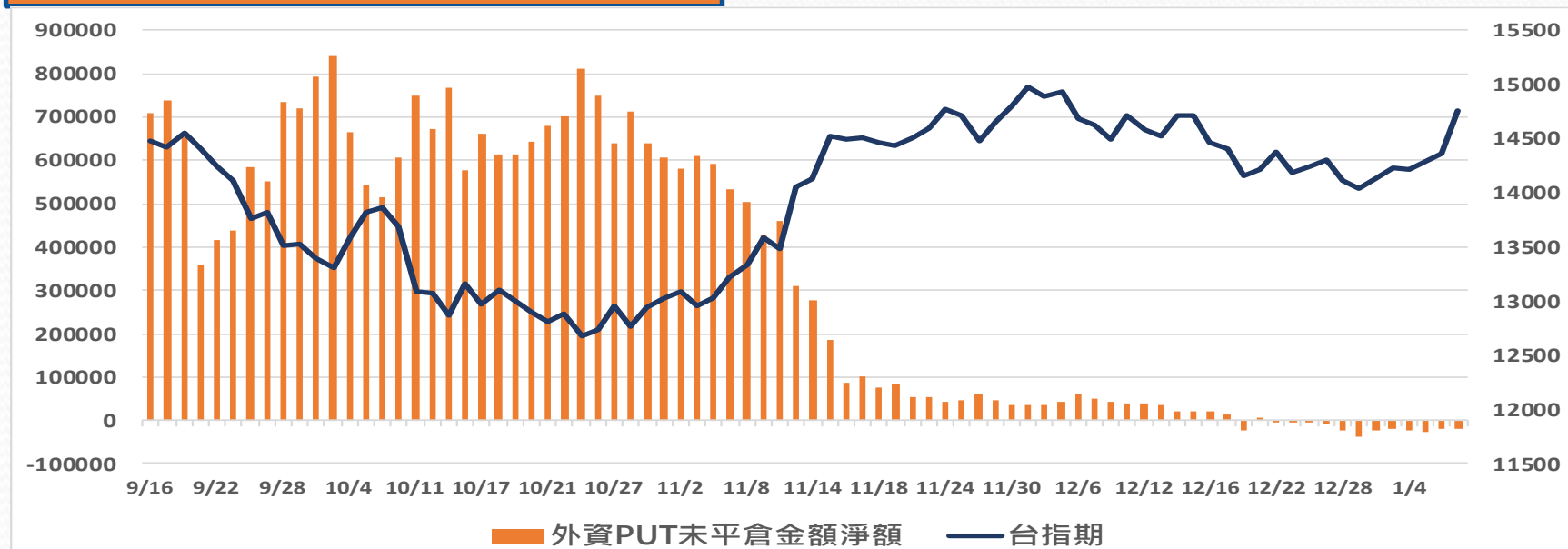
更新日期：2023年1月9日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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9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9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