

# 台指選擇權 OI 匯報

日期：2023/1/10					日期：2023/1/10				
202301W2					202301 月台指選擇權 OI 序列				
日期	Call	履約價	Put	OI 增減	日期	Call	履約價	Put	OI 增減
-310	2,862	14,300	6,788	-769	0	335	13,800	5,561	1,816 ※
-214	1,421	14,350	6,253	-584	10	348	13,900	4,906	1,648
-401	2,426	14,400	13,838	2,654	-15	1,201	14,000	4,884	298
-331	3,196	14,450	4,386	-1,860	22	2,156	14,100	4,553	1,197
-548	6,249	14,500	7,883	-364	-27	1,241	14,200	2,782	228
-777	3,567	14,550	6,695	257	-35	1,434	14,300	2,050	128
-2,189	4,403	14,600	9,067	1,075	-81	1,765	14,400	2,484	409
-1,207	4,639	14,650	8,106	1,714	-235	2,002	14,500	2,452	732
-2,026	5,379	14,700	12,670	7,565 ※	-126	1,899	14,600	1,695	723
-1,502	5,939	14,750	8,470	4,703	-380	2,718	14,700	1,723	644
3,134	13,392	14,800	9,123	7,181	-711	3,741	14,800	1,203	370
4,431	4,431	14,850	1,644	1,644	-770	4,836	14,900	580	280
6,116	13,625	14,900	2,587	1,964	-925	10,886	15,000	315	151
3,492	3,492	14,950	193	193	-353	4,738	15,100	156	12
※ 7,238	15,267	15,000	971	679	1,245	4,520	15,200	223	10
2,779	2,779	15,050	8	8	478	4,085	15,300	76	43
3,633	5,368	15,100	124	117	536	3,044	15,400	19	0
557	557	15,150	1	1	※ 2,546	4,834	15,500	38	20
2,957	3,904	15,200	48	47	2,210	3,547	15,600	34	-1
755	1,203	15,300	12	12	605	1,304	15,700	3	0
452	663	15,400	5	4	25	839	15,800	387	0
217	259	15,500	5	5	134	649	15,900	23	0
24	65	15,600	1	0	125	910	16,000	10	0
40	40	15,700	1	0	14	292	16,100	1	0
24	44	15,800	1	0	2	300	16,200	22	0
23	23	15,900	1	1	19	193	16,300	0	0
0	0	16,000	0	0	35	182	16,400	98	0
0	0	16,100	0	0	-1	848	16,500	0	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
26,162	110,537	1.5431	170,567	15,186	4,584	75,240	1.0746	80,852	5,087
昨日 P/C	1.8416	今日增減變化	-0.2985	昨日 P/C	1.1087	今日增減變化	-0.0341		

更新日期：2023年1月10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10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	91,104,098	63,734,203	27,369,895	-9,595,194	4,452,573	1,359,295	3,093,278	-224,346	
投信	32,241,370	53,777,682	-21,536,312	1,709,704	410,250	0	410,250	12,896	
自營商	39,323,376	16,474,722	22,848,654	1,081,006	1,241,173	1,227,870	13,303	67	
	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	772,542	1,455,308	-682,766	-11,268	353,687	2,911	350,776	169	
投信	74,314	0	74,314	-124	0	0	0	0	
自營商	309,622	317,379	-7,757	-68,236	39,200	368,063	-328,863	7,179	

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10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	38,535	17,789	20,746	-568	23,040	22,132	908	1,249	
投信	200	200	0	0	600	141	459	0	
自營商	61,279	71,260	-9,981	-5,486	73,660	83,574	-9,914	-568	
特定法人(週)	4,496	1,576	2,920	-623	3,065	5,124	-2,059	-2,028	
特定法人(近月)	20,133	6,191	13,942	1,366	6,455	7,003	-548	1,158	
特定法人(全月)	26,984	9,201	17,783	-2,632	9,848	5,396	4,452	-80	
十大交易人(週)	36,032	42,944	-6,912	-7,025	69,560	48,645	20,915	1,104	
十大交易人(近月)	39,226	34,386	4,840	2,555	35,102	43,872	-8,770	-1,797	
十大交易人(全月)	90,663	85,462	5,201	-4,110	107,047	96,897	10,150	-756	
全市場未沖銷(近月)			78,332	5,296			89,301	8,329	
全市場未沖銷(全月)			227,327	33,588			301,387	24,715	

更新日期：2023年1月10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	14800	買權OI最大量	15000
	賣權成交最大量	14800	賣權OI最大量	14400
	整體隱含波動率	12.30%	較前一交易日	-1.45%
	買權隱含波動率	13.21%	較前一交易日	-3.05%
	賣權隱含波動率	11.44%	較前一交易日	-0.63%
電子選擇權	買權成交最大量	685	買權OI最大量	670
	賣權成交最大量	665	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	1540	賣權OI最大量	1520

更新日期：2023年1月10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

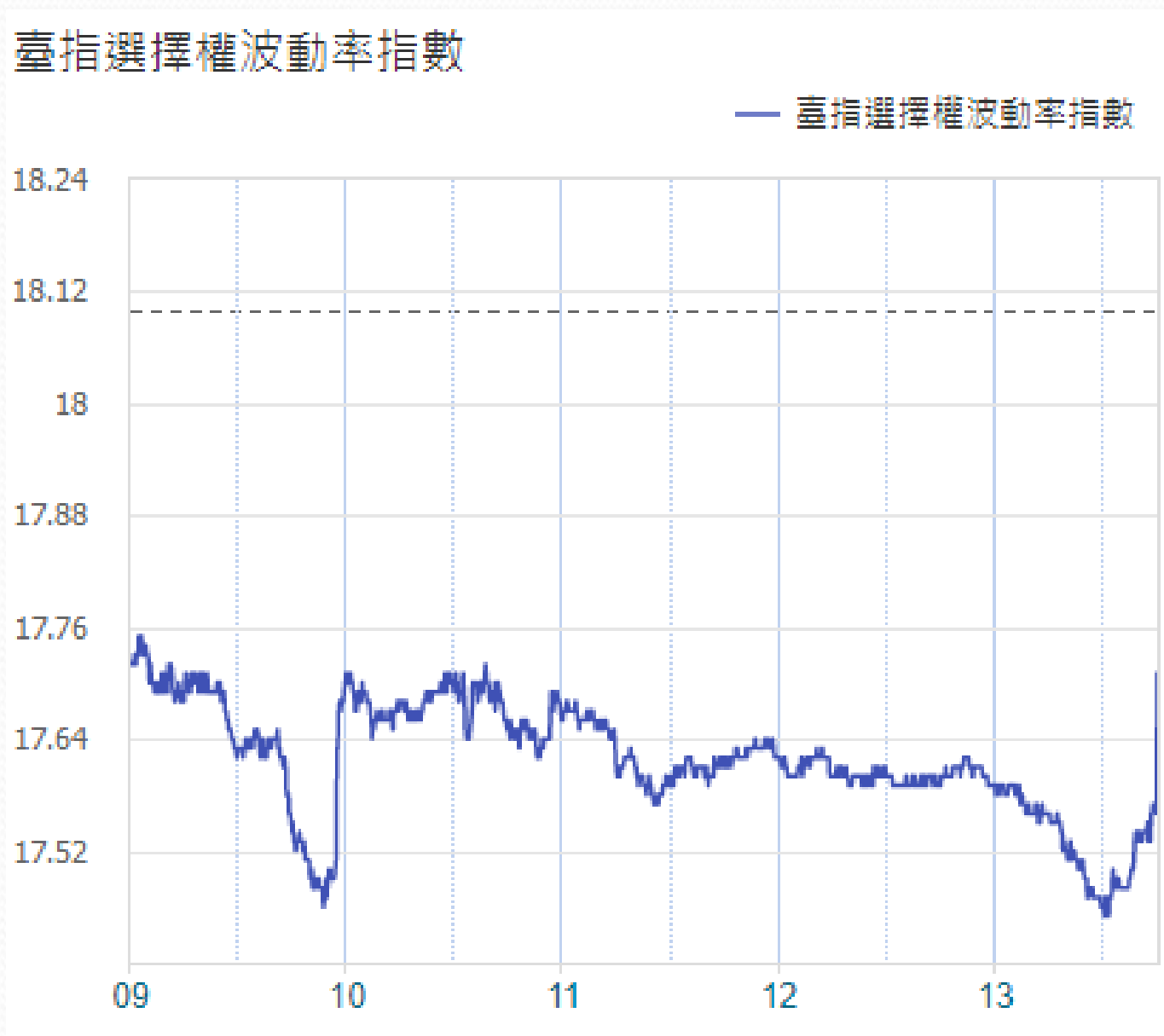
## 2023年01月選擇權分析表

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	13700	賣權OI最大量	13500
	整體隱含波動率	16.03%	較前一交易日	+0.17%
	買權隱含波動率	14.20%	較前一交易日	-0.69%
	賣權隱含波動率	17.52%	較前一交易日	-0.14%
	成交量P/C_Ratio值	1.094	較前一交易日	+0.15
	未平倉P/C_Ratio值	1.140	較前一交易日	+0.03
電子選擇權	買權成交最大量	685	買權OI最大量	670
	賣權成交最大量	665	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	1540	賣權OI最大量	1520

更新日期：2023年1月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

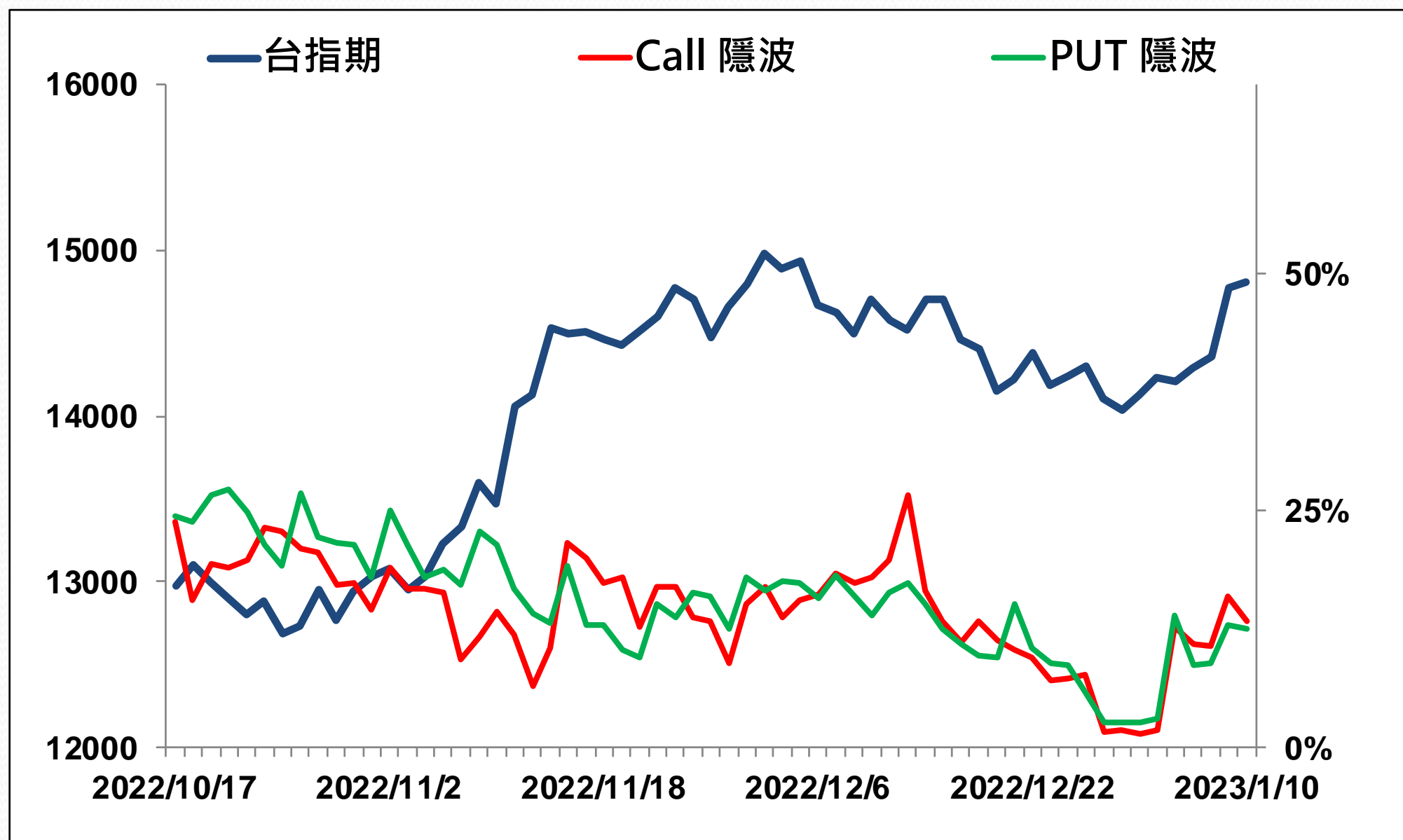


# 選擇權當日波動率指數



更新日期：2023年1月10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

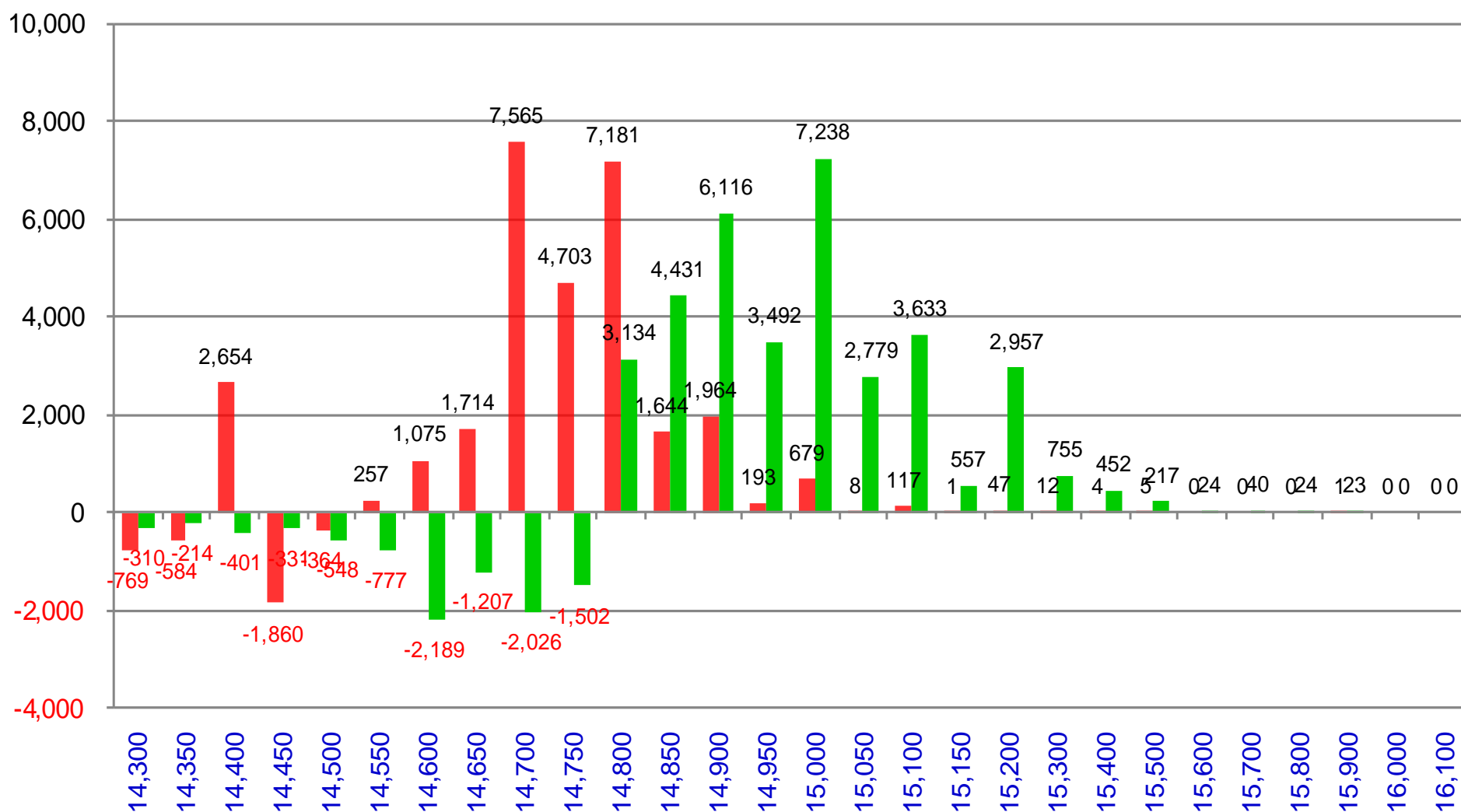


更新日期：2023年1月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：15,186

週選 CALL OI 變化：26,162



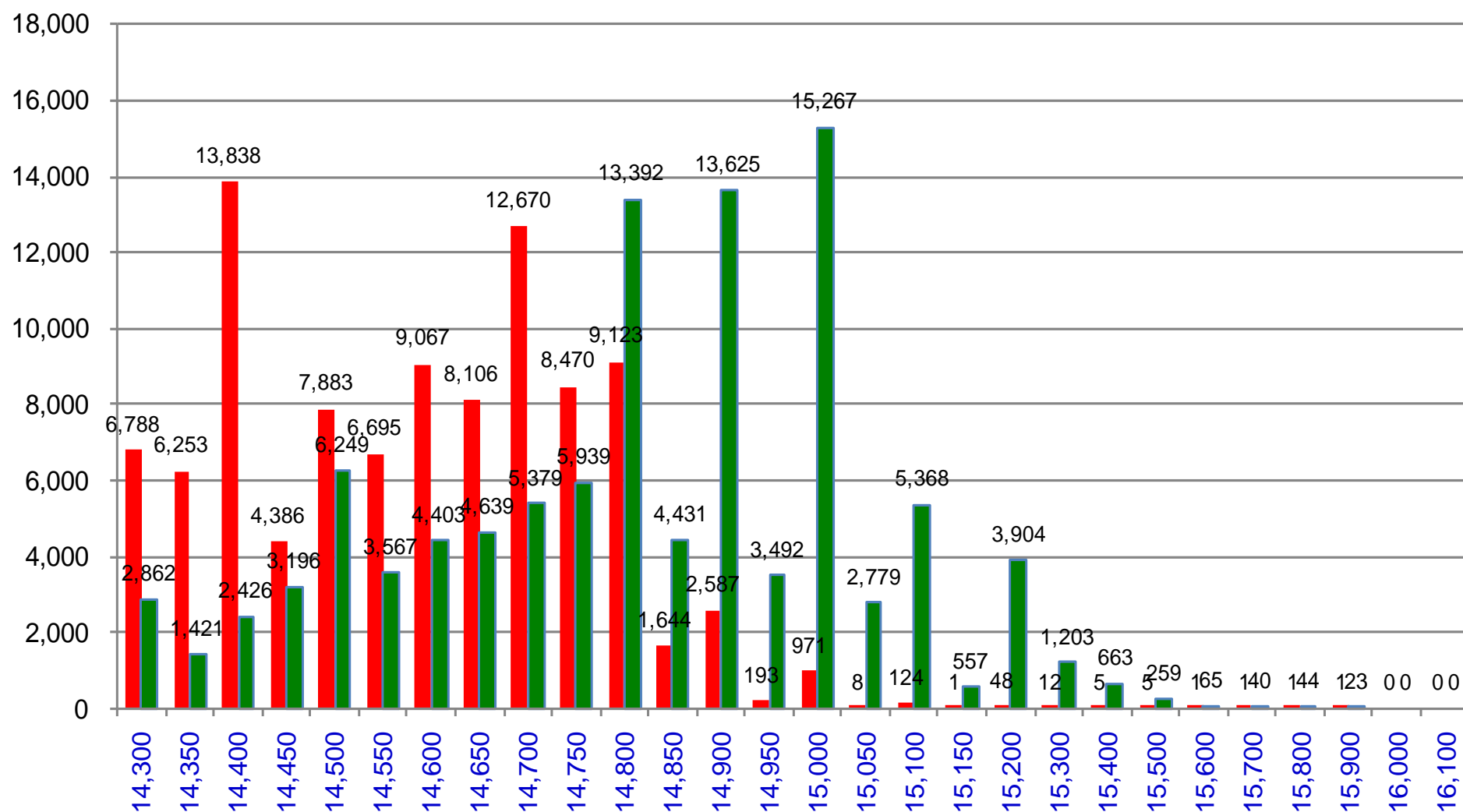
更新日期：2023年1月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理



# 台指週選擇權OI 每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：170,567

■ 週選 CALL OI 總額：110,537



更新日期：2023年1月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

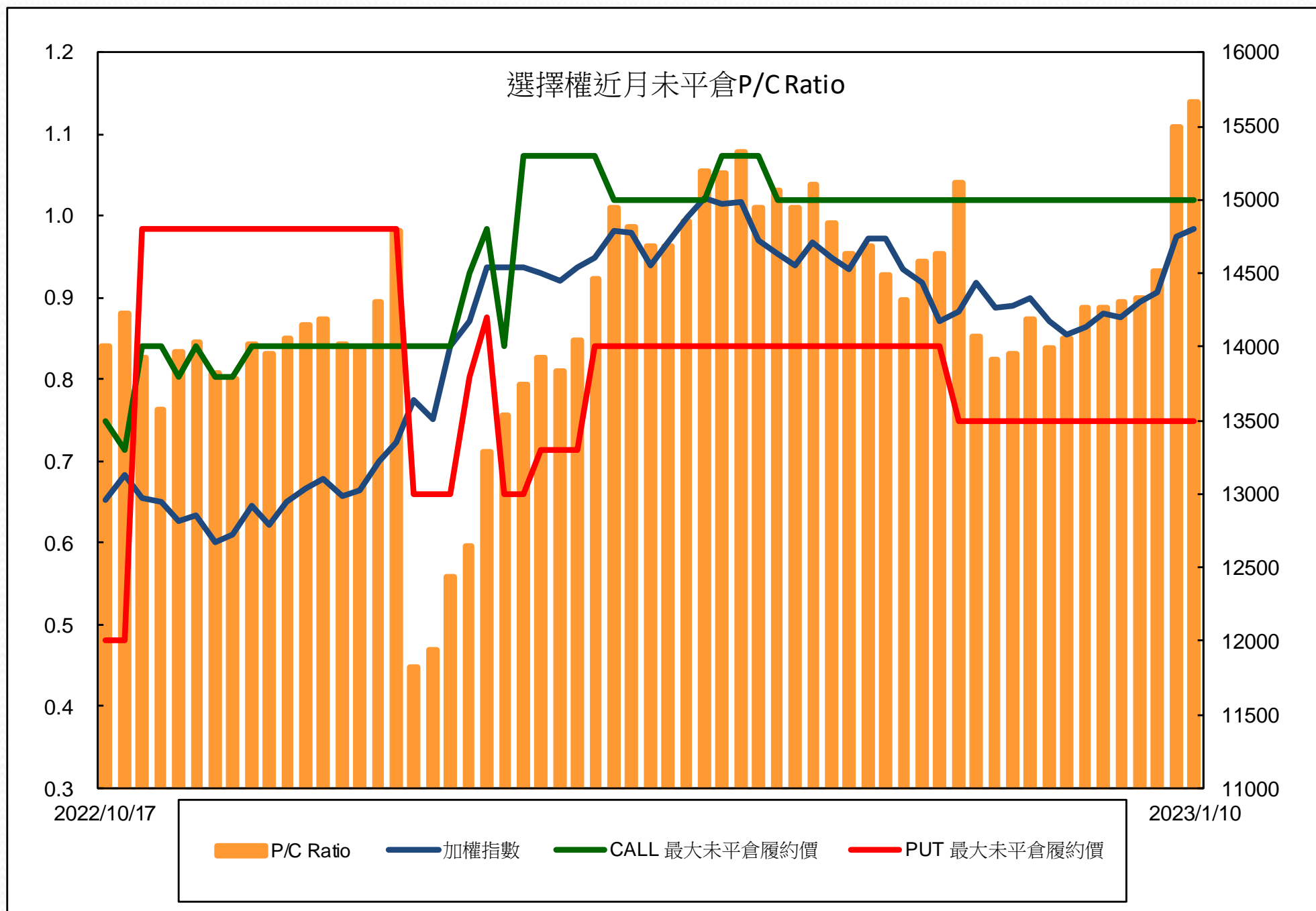


# 自營商選擇權OI部位統計

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9日	58,104	62,599	-4,495
	1月10日	61,279	71,260	-9,981
Put	1月9日	64,718	74,064	-9,346
	1月10日	73,660	83,574	-9,914

更新日期：2023年1月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

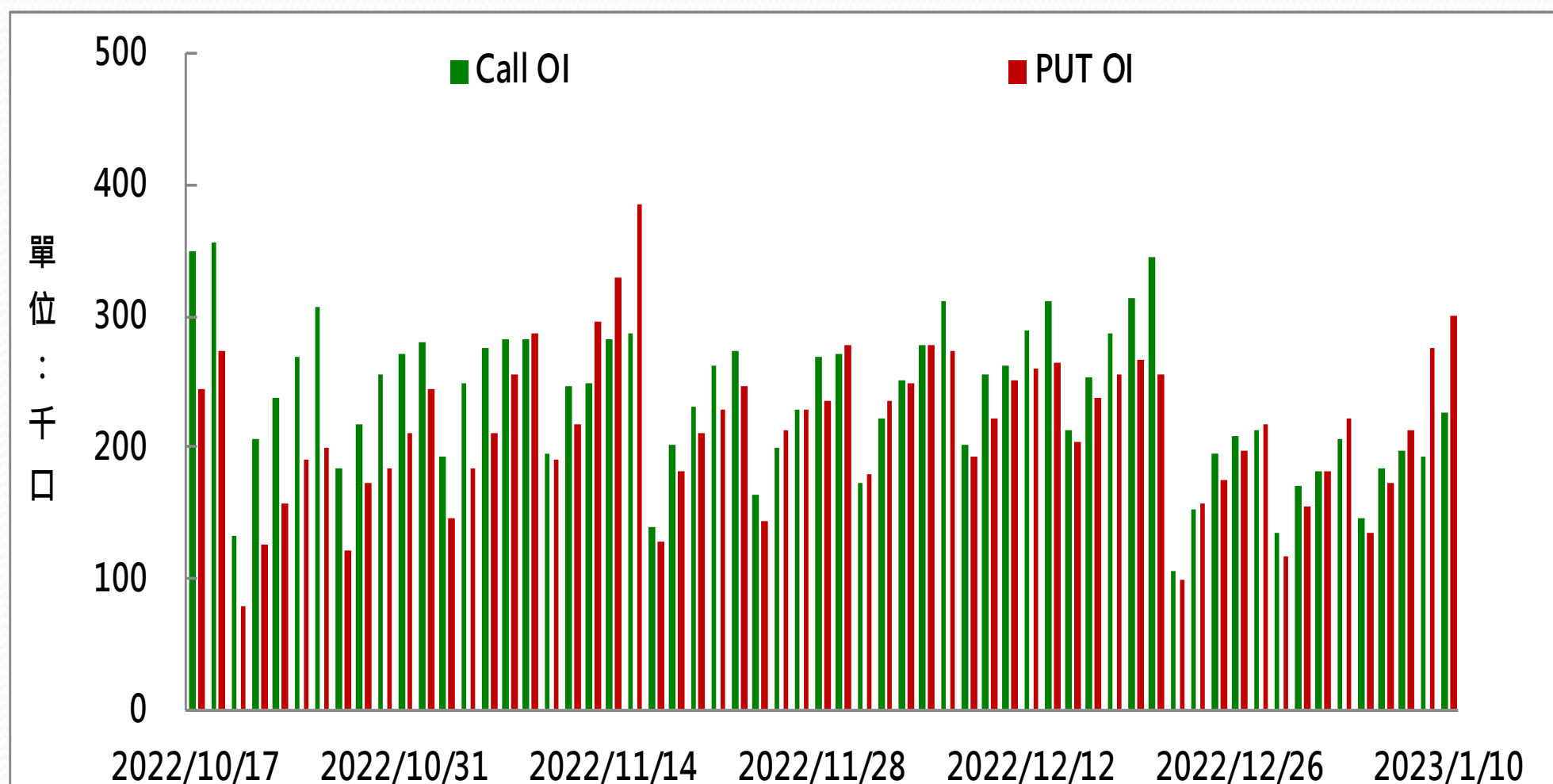
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年1月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理



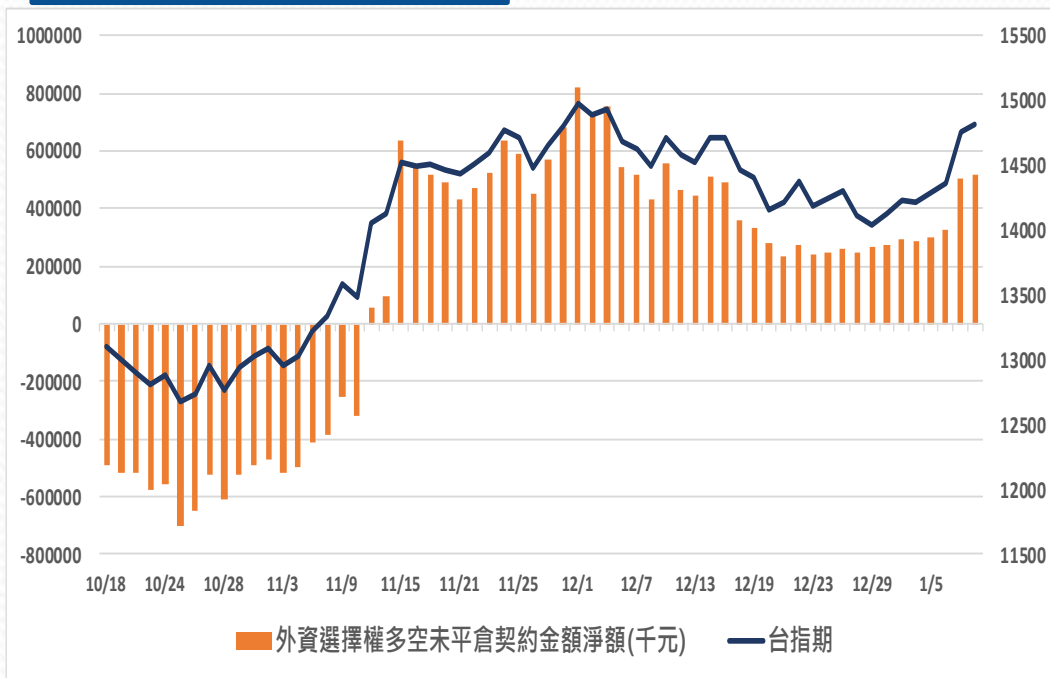
# 選擇權全月Put Call OI



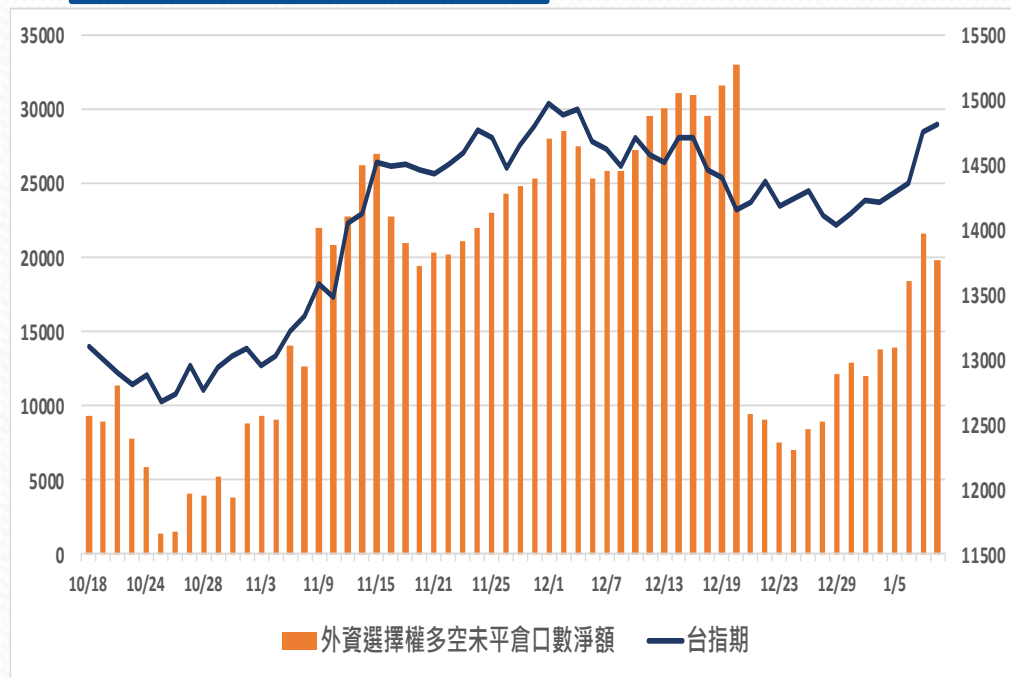
更新日期：2023年1月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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

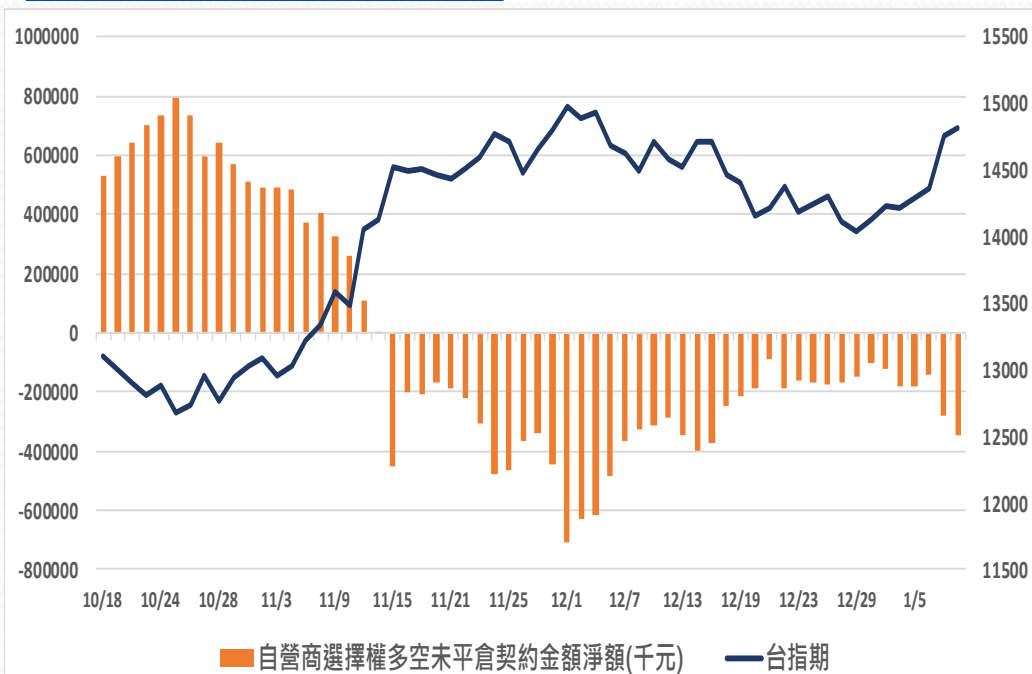
日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/1/4	14209	13772	1766	289034	-4559
2023/1/5	14289	13987	215	301026	11992
2023/1/6	14366	18404	4417	324192	23166
2023/1/9	14765	21655	3251	506550	182358
2023/1/10	14810	19838	-1817	519305	12755

更新日期：2023年1月10日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

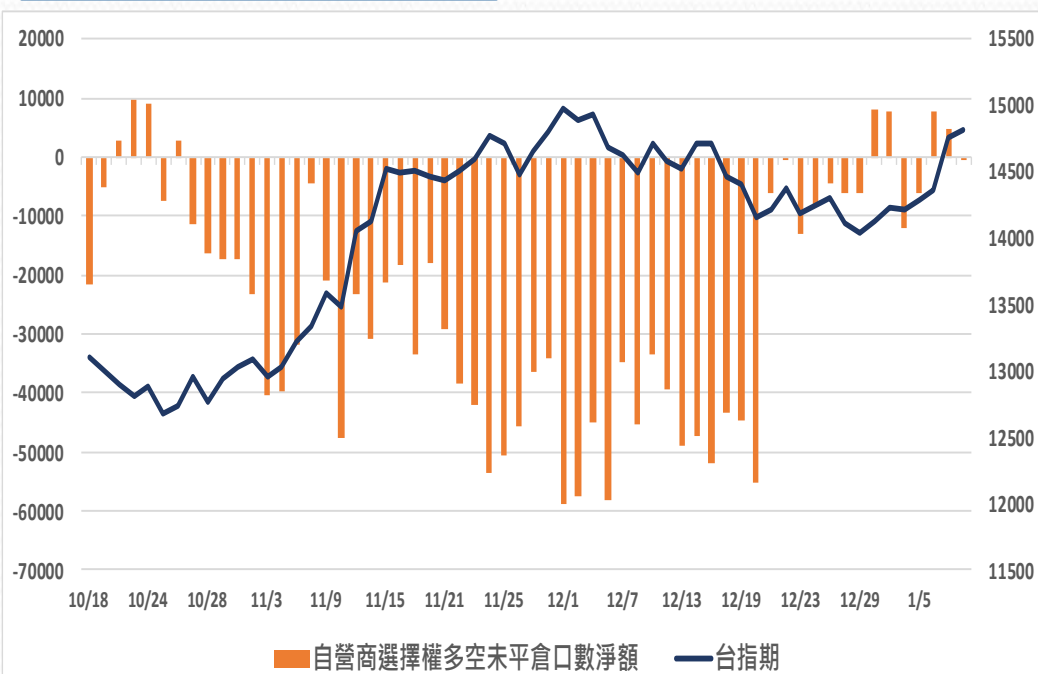


# 自營商選擇權多空未平倉淨額

## 多空未平倉金額淨額



## 多空未平倉口數淨額



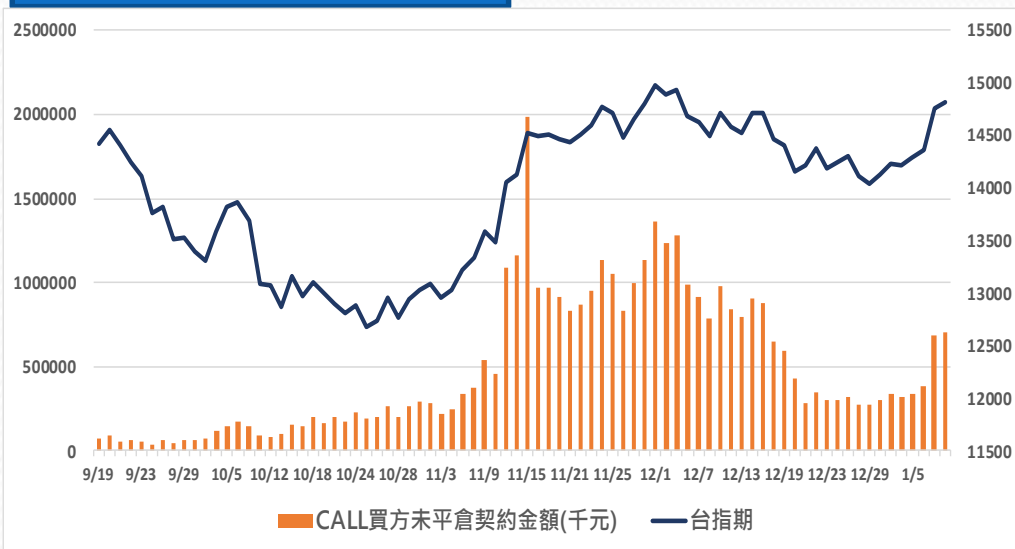
## 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/1/4	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
2023/1/10	14810	-67	-4918	-345325	-66950

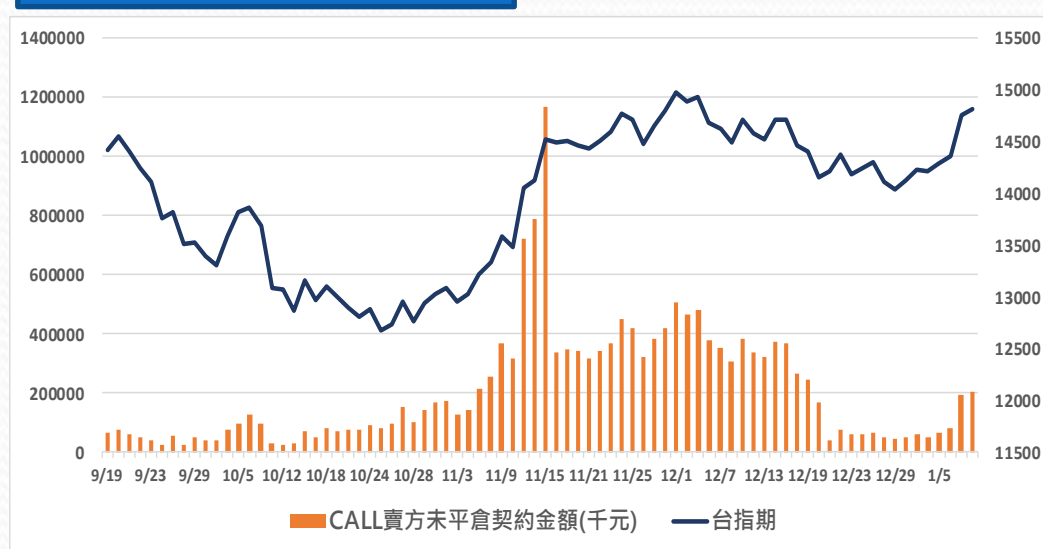
更新日期：2023年1月10日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 外資買賣權未平倉金額

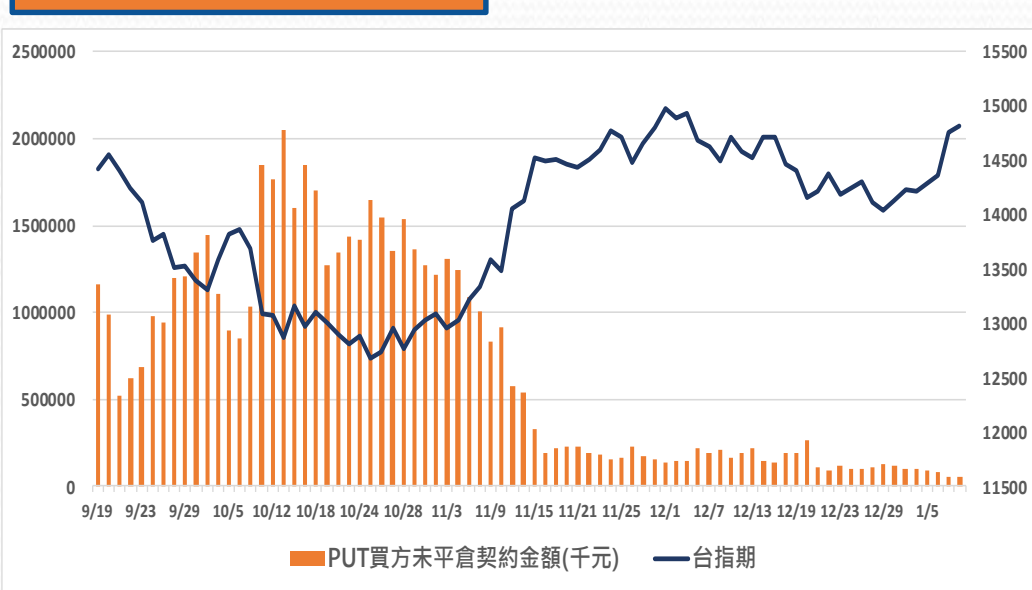
## CALL買方未平倉金額



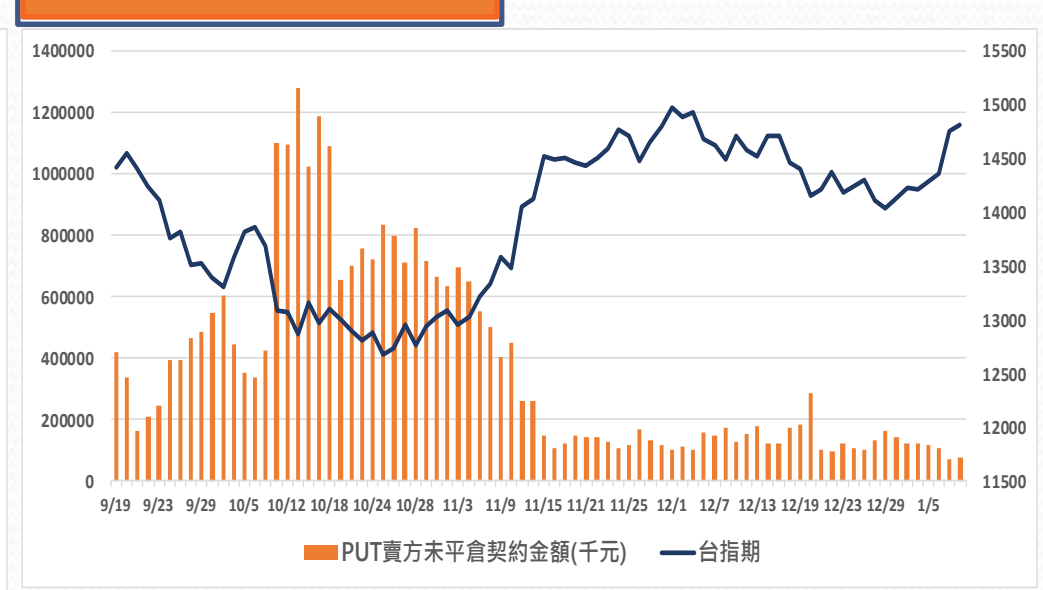
## CALL賣方未平倉金額



## PUT買方未平倉金額



## PUT賣方未平倉金額

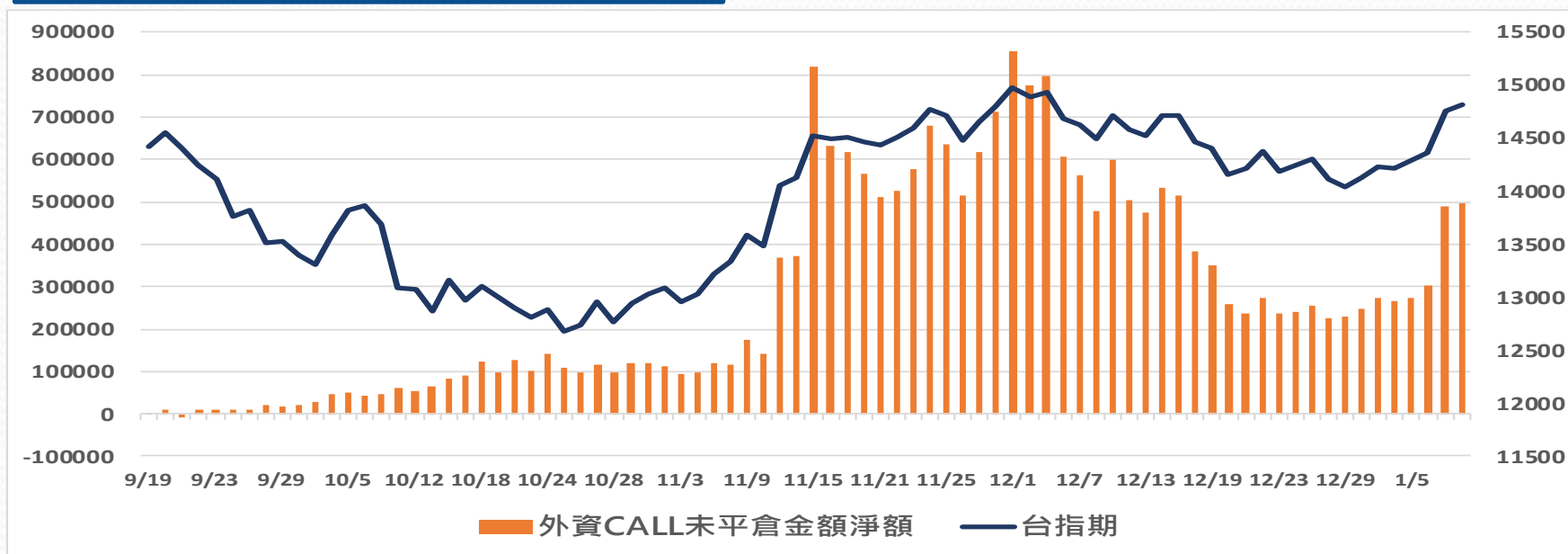


更新日期：2023年1月10日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

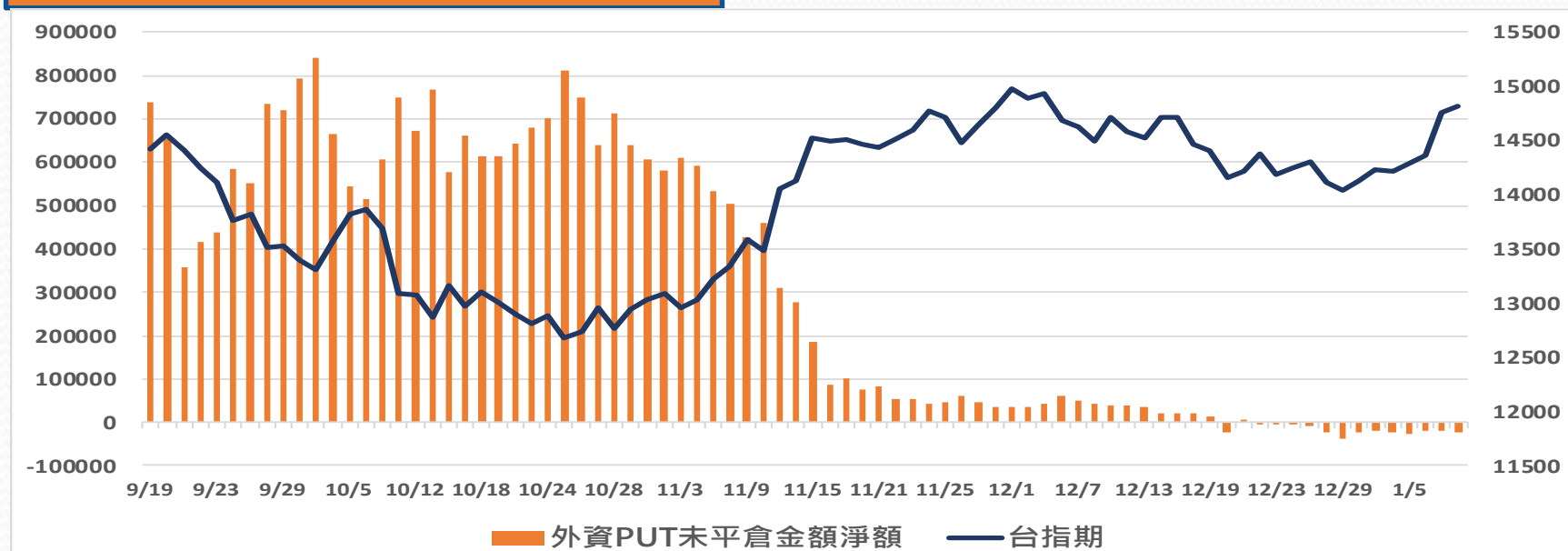


# 外資買賣權未平倉金額淨額

## 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10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10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