

台指選擇權OI匯報

日期：2023/1/11 結算日：2023/1/30					日期：2023/1/11 結算日：2023/2/15				
202301 月台指選擇權 OI 序列					202302 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
0	144	13,500	7,906	713	0	0	13,200	362	12
0	142	13,600	3,220	-156	0	4	13,300	466	8
0	162	13,700	3,363	-427	0	1	13,400	253	-13
6	341	13,800	3,579	-1,982	-1	3	13,500	1,050	-4
0	348	13,900	5,347	441	0	0	13,600	1,671	-2
-8	1,193	14,000	6,605	1,721	0	2	13,700	943	37
-15	2,141	14,100	5,314	761	0	14	13,800	823	57
-12	1,229	14,200	3,590	808	-2	13	13,900	405	74
-46	1,388	14,300	3,260	1,210	-3	112	14,000	1,252	43
-45	1,720	14,400	3,187	703	-1	65	14,100	513	189
134	303	14,450	1,065	213	-2	89	14,200	856	104
79	2,081	14,500	3,648	1,196	-4	200	14,300	727	420
45	471	14,550	1,146	187	-1	286	14,400	392	116
-118	1,781	14,600	2,329	634	8	533	14,500	301	61
59	568	14,650	950	220	-12	1,920	14,600	241	51
-137	2,581	14,700	2,678	955	-62	1,046	14,700	341	-4
418	731	14,750	791	378	43	1,043	14,800	116	41
830	4,571	14,800	1,734	531	13	734	14,900	94	4
517	652	14,850	254	168	-15	1,433	15,000	84	-3
126	4,962	14,900	677	97	-11	1,202	15,100	42	6
1,113	1,275	14,950	88	65	211	892	15,200	4	0
1,355	12,241	15,000	412	97	118	1,302	15,300	3	0
499	819	15,050	50	24	111	2,085	15,400	3	1
264	5,002	15,100	177	21	155	1,387	15,500	6	3
388	523	15,150	1	1	152	665	15,600	2	0
1,016	5,536	15,200	232	9	80	601	15,700	0	0
1,597	5,682	15,300	80	4	30	546	15,800	1	0
1,922	4,966	15,400	25	6	18	374	15,900	0	0
※ 1,961	6,795	15,500	39	1	136	815	16,000	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
13,397	90,806	1.0187	92,507	8,566	1,304	20,189	0.7752	15,651	1,402
昨日 P/C	1.5431	今日增減變化	-0.5244		昨日 P/C	0.7545	今日增減變化	0.0207	

更新日期：2023年1月11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11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	82,423,174	67,621,015	14,802,159	-12,567,736	4,314,014	1,329,502	2,984,512	-108,766	
投信	32,131,968	53,862,126	-21,730,158	-193,846	410,340	0	410,340	90	
自營商	39,536,007	15,631,280	23,904,727	1,056,073	1,085,478	1,132,362	-46,884	-60,187	
	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	743,815	1,536,892	-793,077	-110,311	333,960	8,712	325,248	-25,528	
投信	73,920	0	73,920	-394	0	0	0	0	
自營商	315,676	269,499	46,177	53,934	56,522	355,568	-299,046	29,817	

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11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	29,570	14,130	15,440	-5,306	16,797	17,363	-566	-1,474	
投信	200	200	0	0	600	141	459	0	
自營商	41,690	49,851	-8,161	1,820	52,013	34,667	17,346	27,260	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	17,255	7,388	9,867	-4,075	6,487	7,561	-1,074	-526	
特定法人(全月)	24,503	8,341	16,162	-1,621	9,881	11,576	-1,695	-6,147	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	40,736	39,729	1,007	-3,833	37,395	47,983	-10,588	-1,818	
十大交易人(全月)	63,616	60,686	2,930	-2,271	55,721	65,989	-10,268	-20,418	
全市場未沖銷(近月)			91,725	13,393			101,155	11,854	
全市場未沖銷(全月)			131,979	-95,348			142,750	-158,637	

更新日期：2023年1月11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	14500	賣權OI最大量	13500
	整體隱含波動率	12.52%	較前一交易日	+0.22%
	買權隱含波動率	14.66%	較前一交易日	+1.45%
	賣權隱含波動率	10.52%	較前一交易日	-0.92%
電子選擇權	買權成交最大量	720	買權OI最大量	690
	賣權成交最大量	620	賣權OI最大量	630
金融選擇權	買權成交最大量	1580	買權OI最大量	1560
	賣權成交最大量	1480	賣權OI最大量	1360

更新日期：2023年1月11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02月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15200	買權OI最大量	15400
	賣權成交最大量	14300	賣權OI最大量	13600
	整體隱含波動率	17.20%	較前一交易日	-1.16%
	買權隱含波動率	15.28%	較前一交易日	+1.09%
	賣權隱含波動率	20.17%	較前一交易日	+2.64%
	成交量P/C_Ratio值	0.703	較前一交易日	-0.39
	未平倉P/C_Ratio值	0.775	較前一交易日	-0.36
電子選擇權	買權成交最大量	720	買權OI最大量	690
	賣權成交最大量	620	賣權OI最大量	630
金融選擇權	買權成交最大量	1580	買權OI最大量	1560
	賣權成交最大量	1480	賣權OI最大量	1360

更新日期：2023年1月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

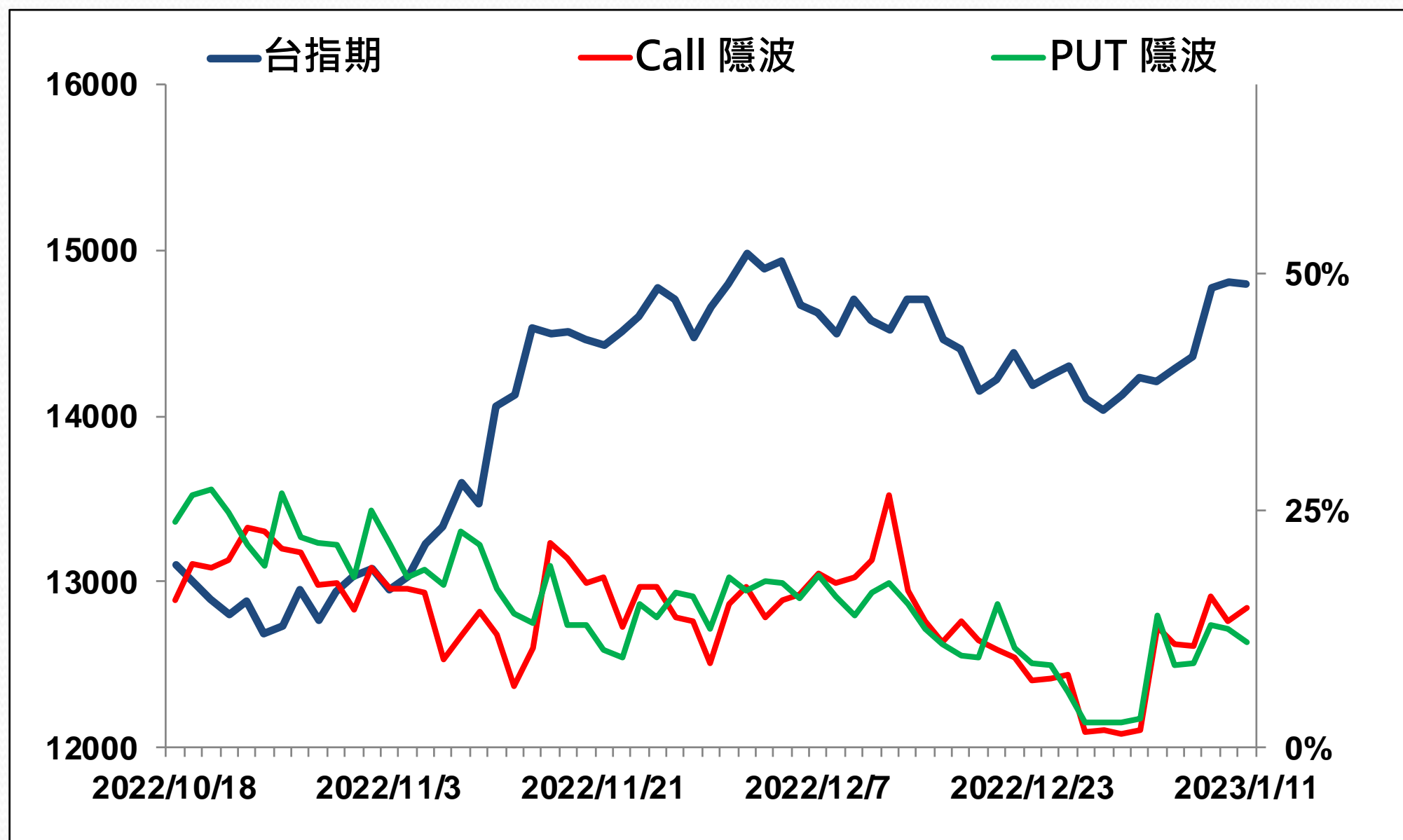
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年1月11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

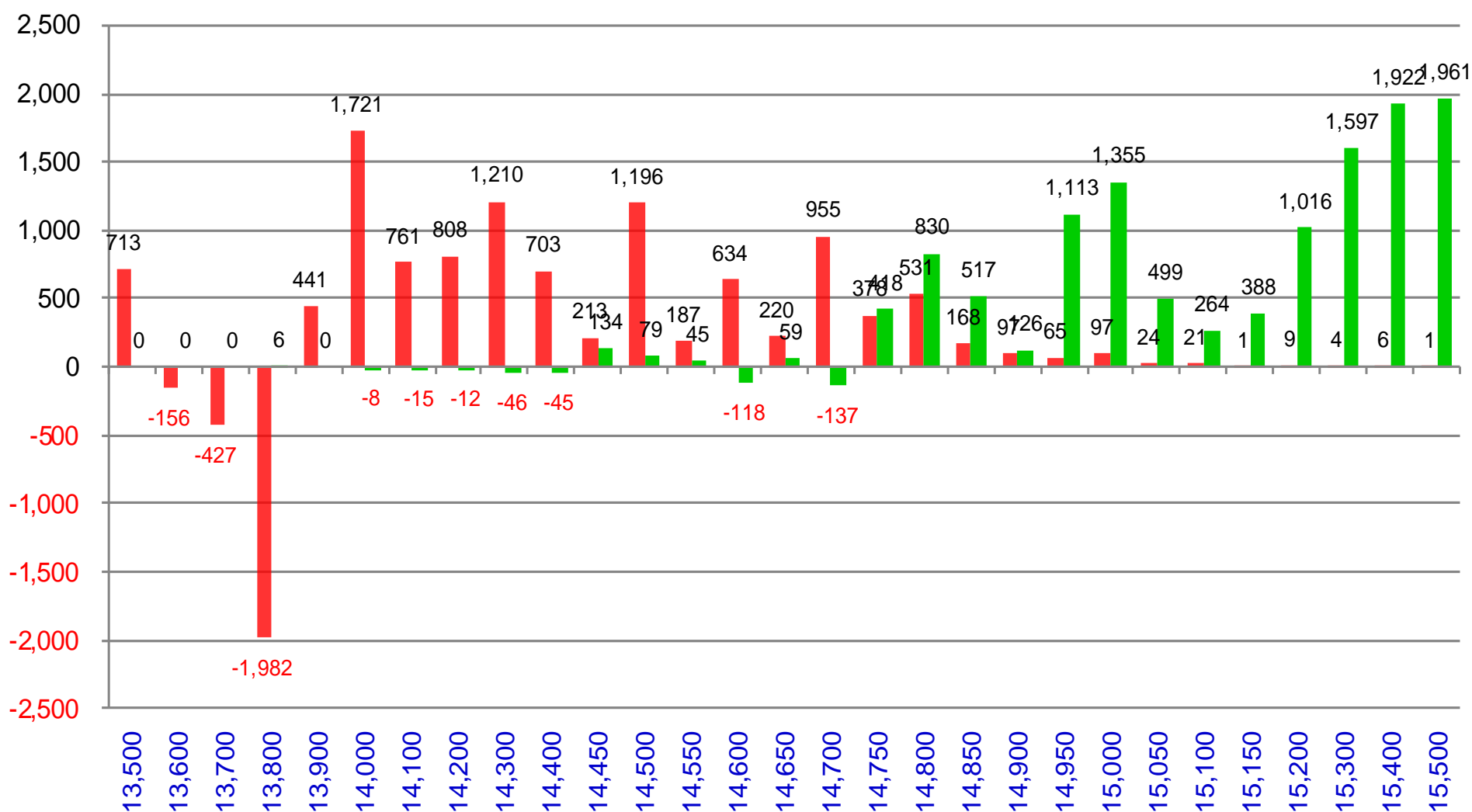


更新日期：2023年1月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

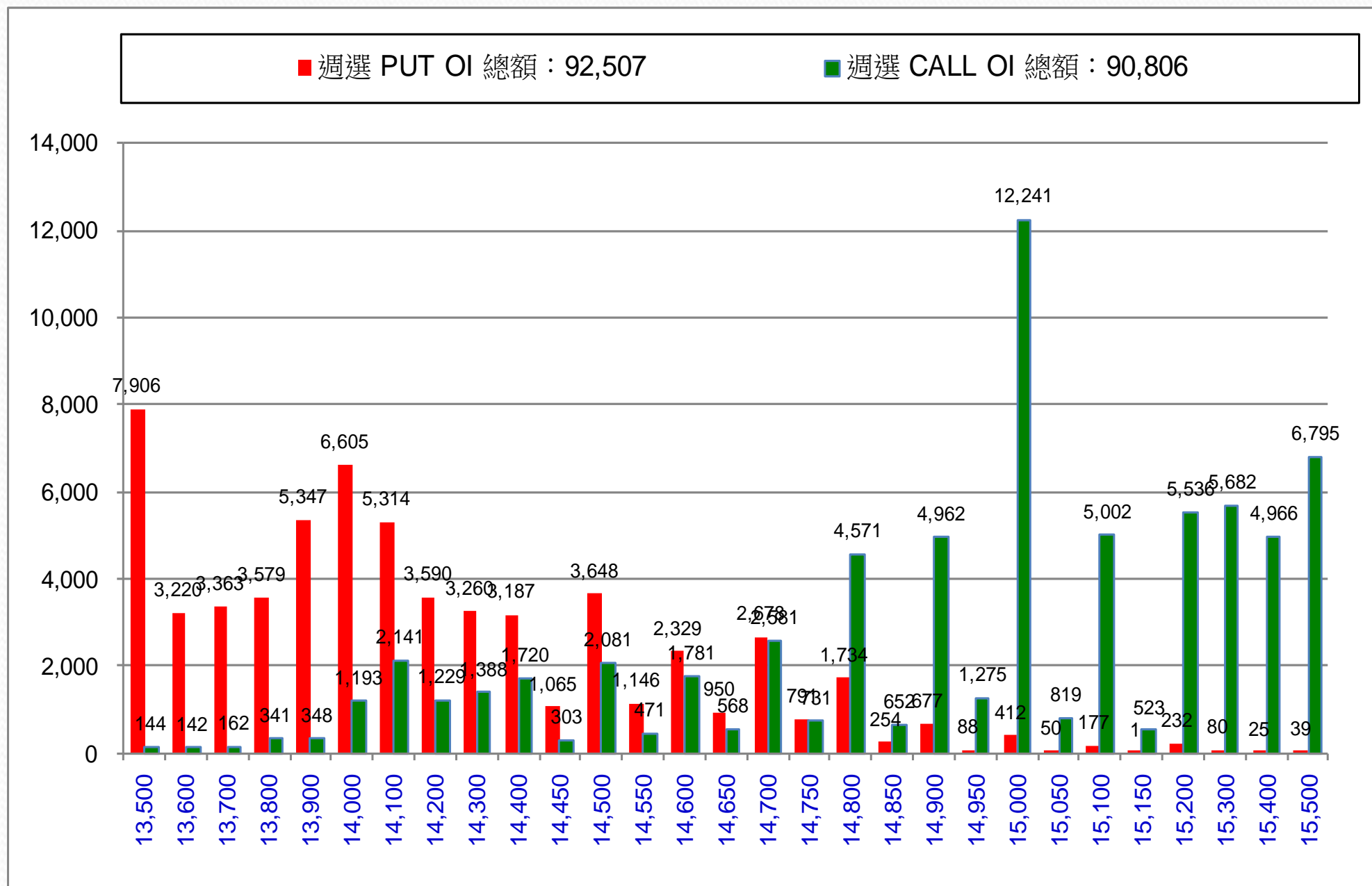
週選 PUT OI 變化：8,566

週選 CALL OI 變化：13,397



更新日期：2023年1月11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



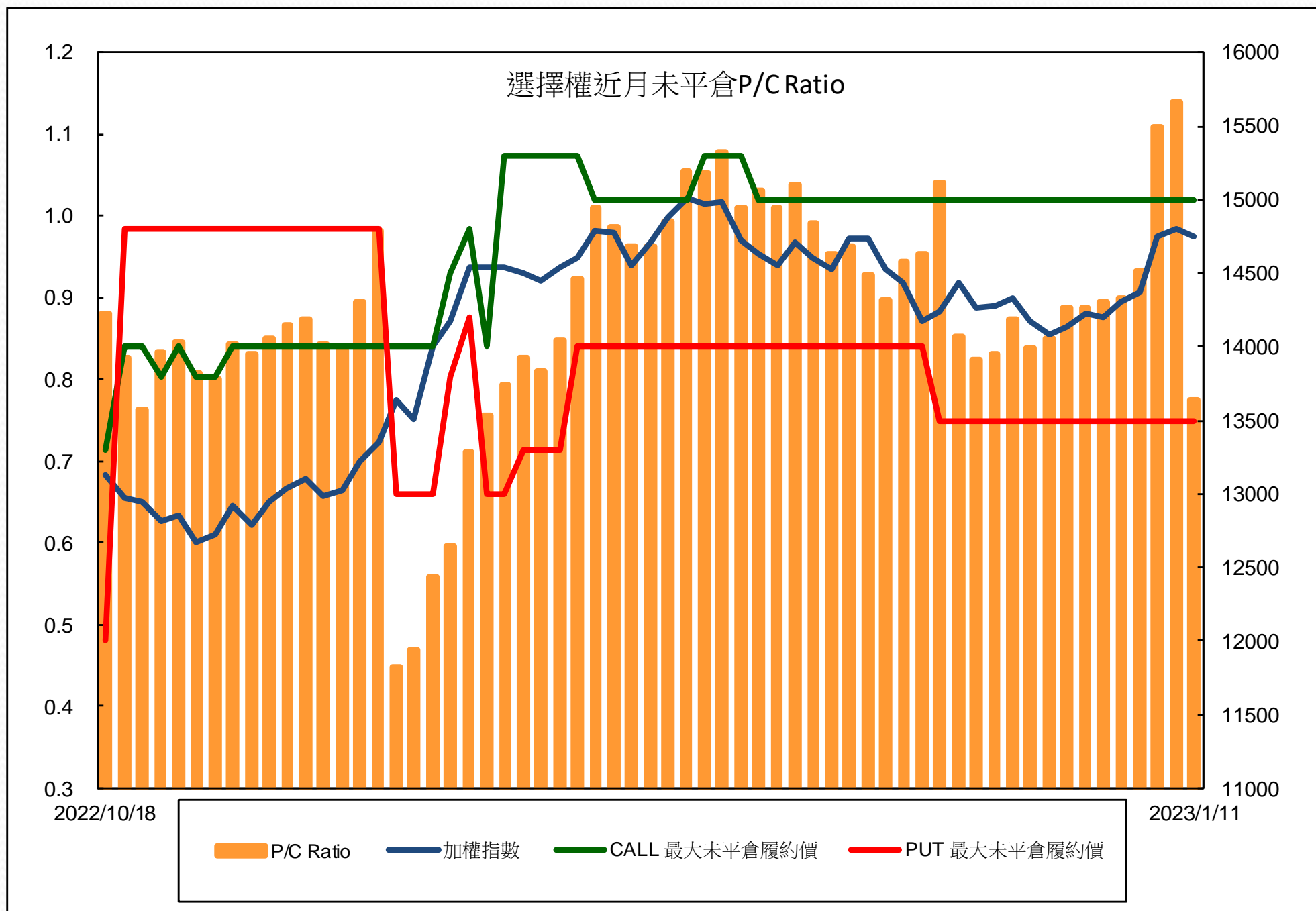
更新日期：2023年1月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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10日	61,279	71,260	-9,981
	1月11日	41,690	49,851	-8,161
Put	1月10日	73,660	83,574	-9,914
	1月11日	52,013	34,667	17,346

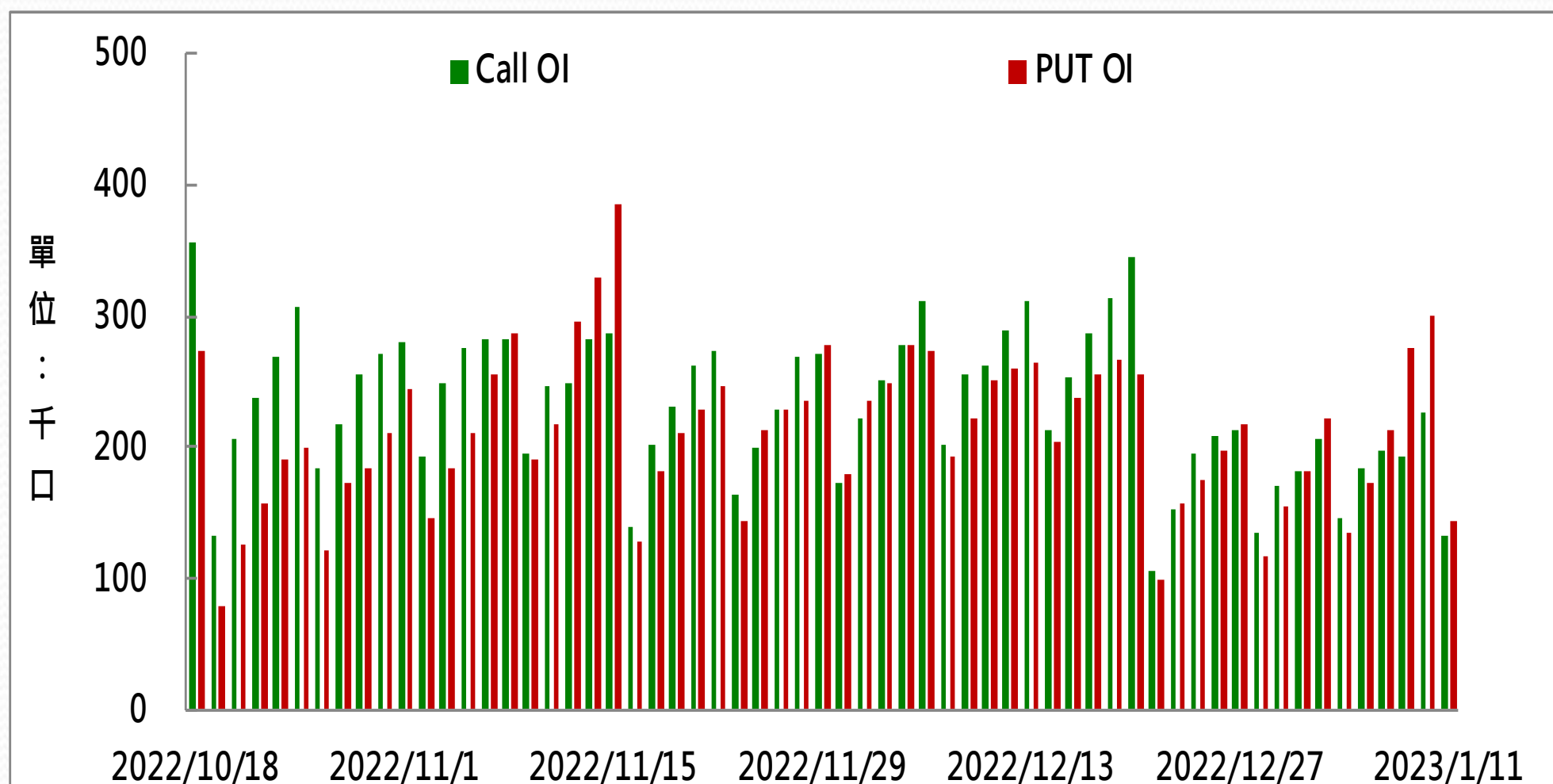
更新日期：2023年1月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年1月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

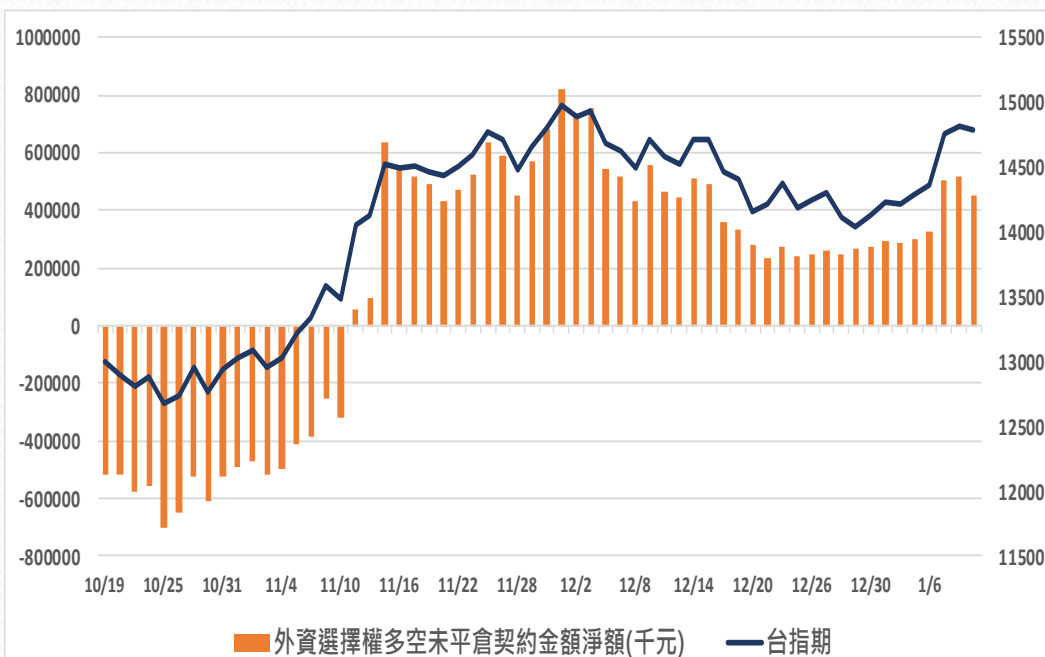
選擇權全月Put Call OI



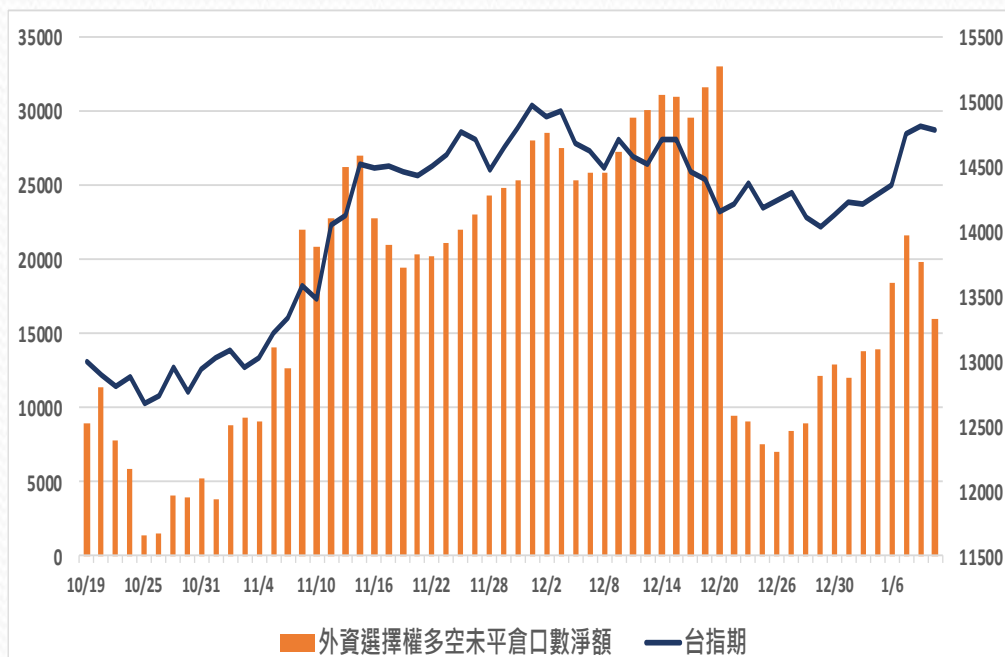
更新日期：2023年1月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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

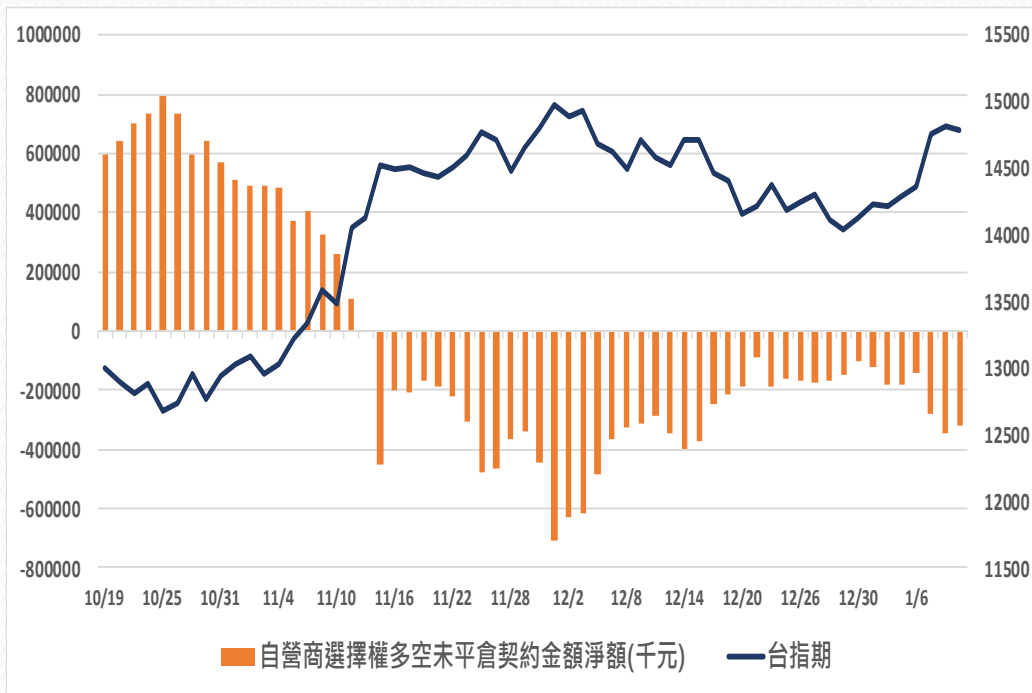
日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/1/5	14289	13987	215	301026	11992
2023/1/6	14366	18404	4417	324192	23166
2023/1/9	14765	21655	3251	506550	182358
2023/1/10	14810	19838	-1817	519305	12755
2023/1/11	14791	16006	-3832	449187	-70118

更新日期：2023年1月11日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參

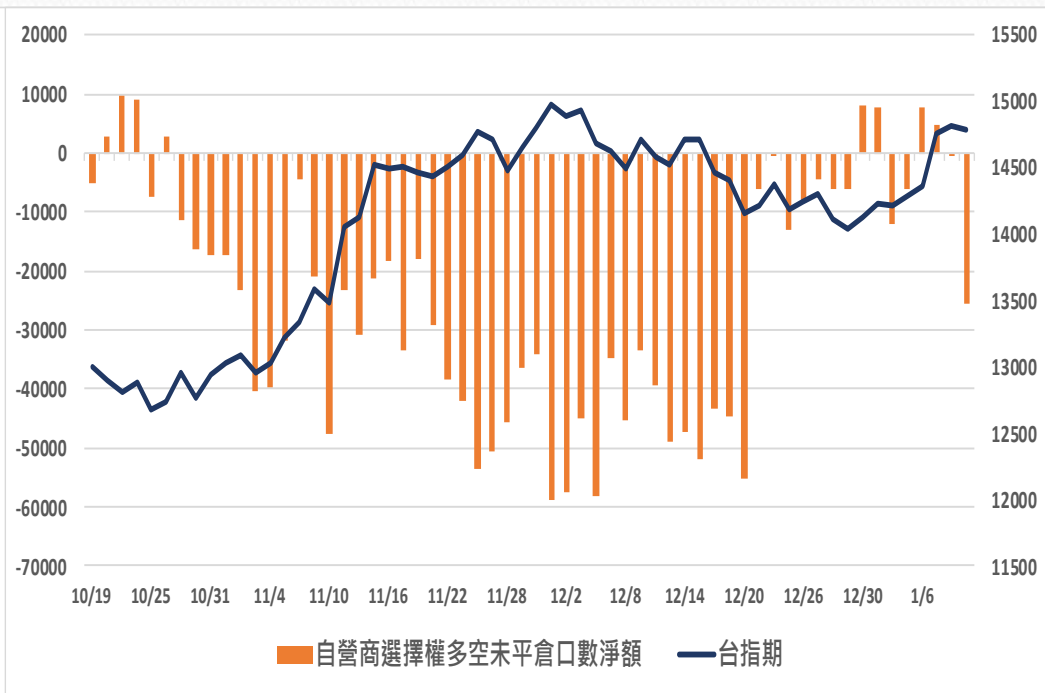
考

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



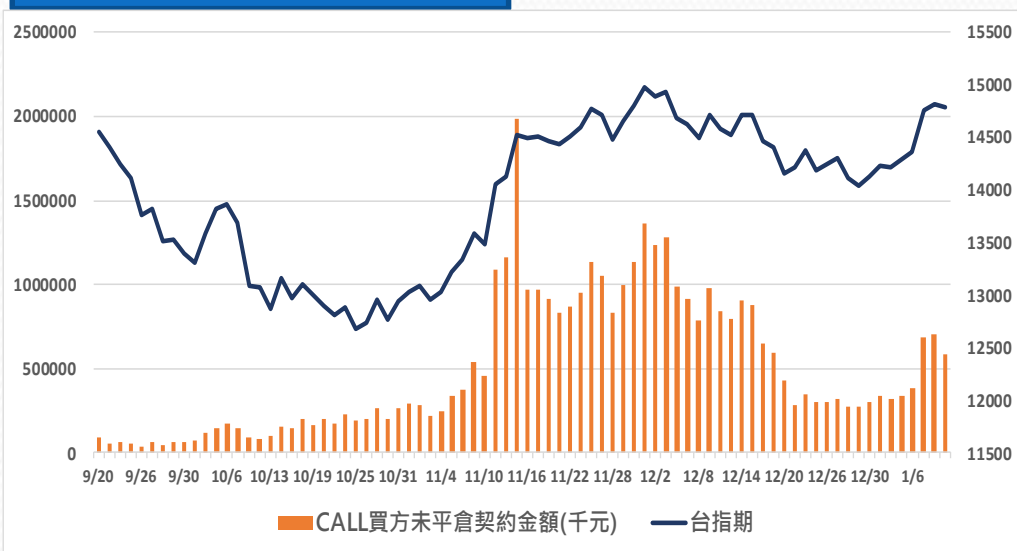
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/1/5	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
2023/1/11	14791	-25507	-25440	-316301	29024

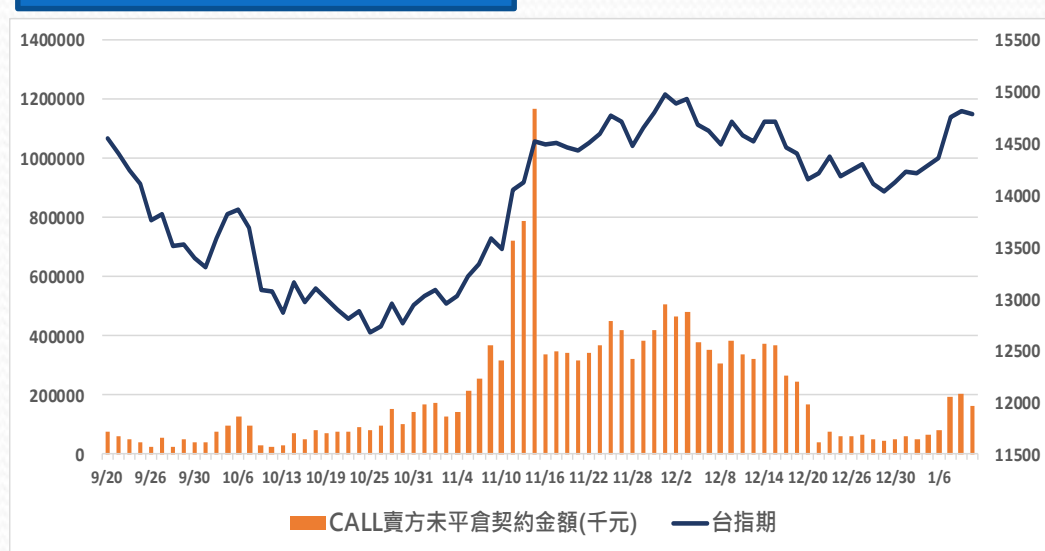
更新日期：2023年1月11日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

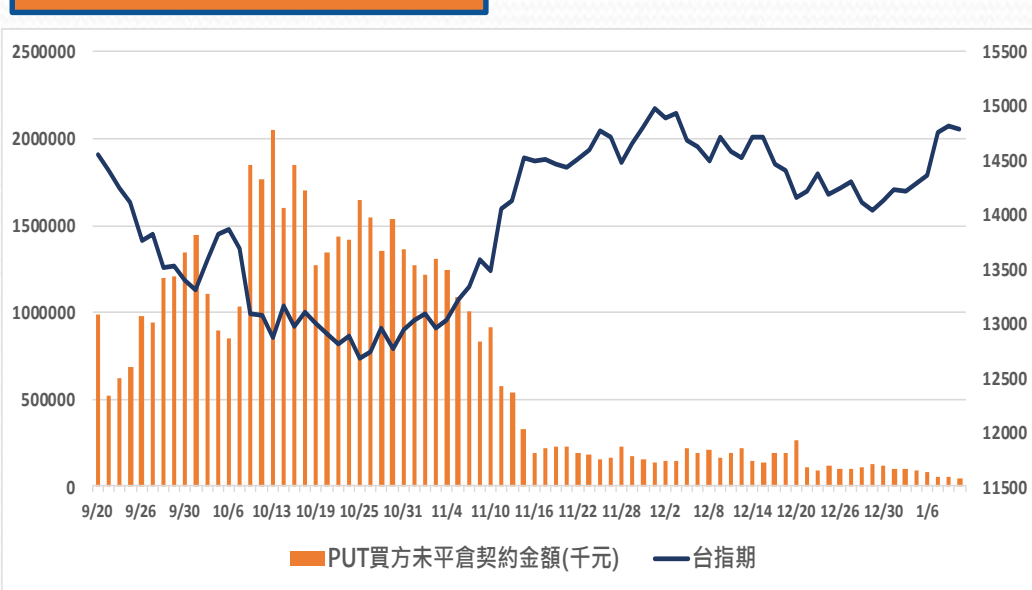
CALL買方未平倉金額



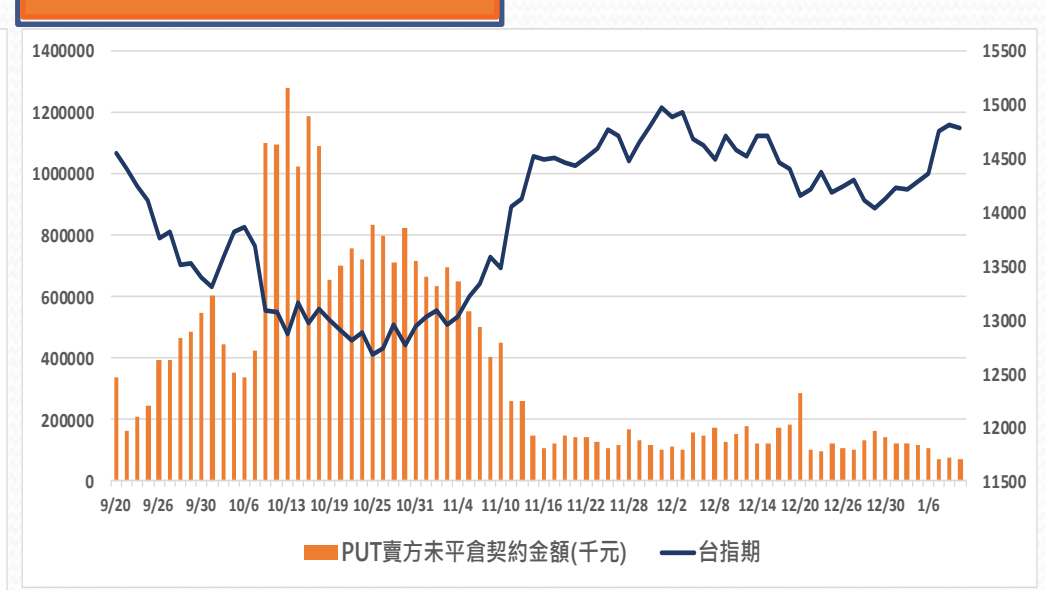
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



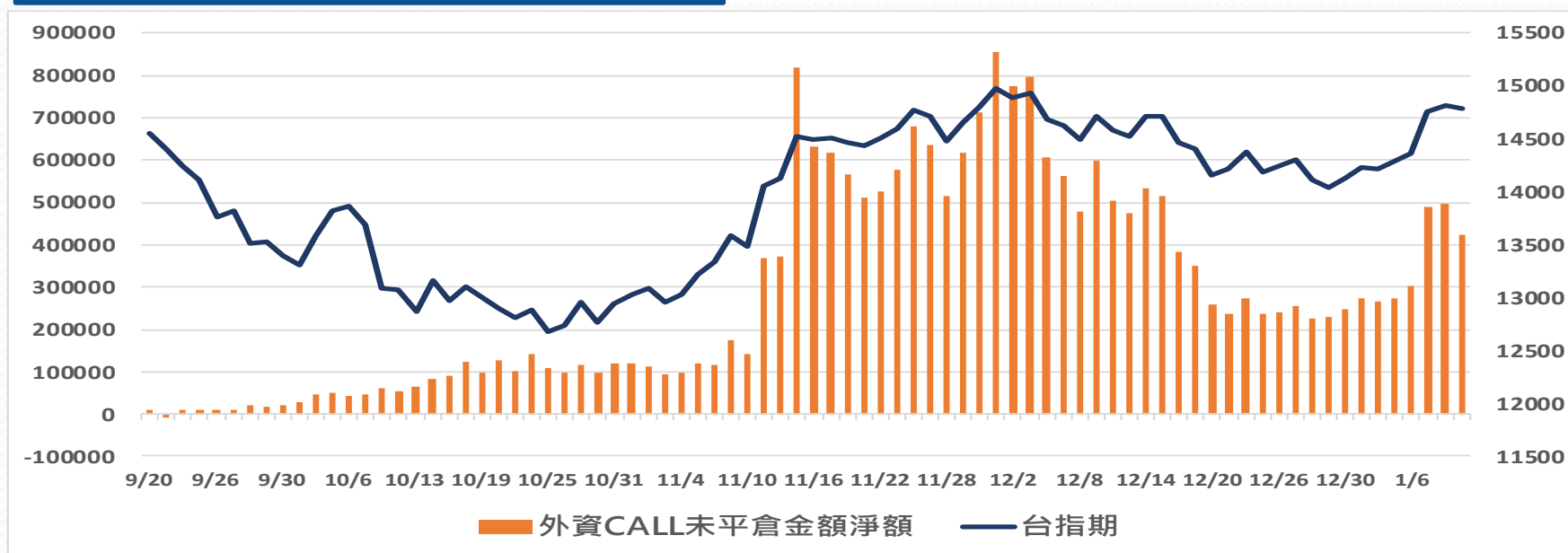
PUT賣方未平倉金額



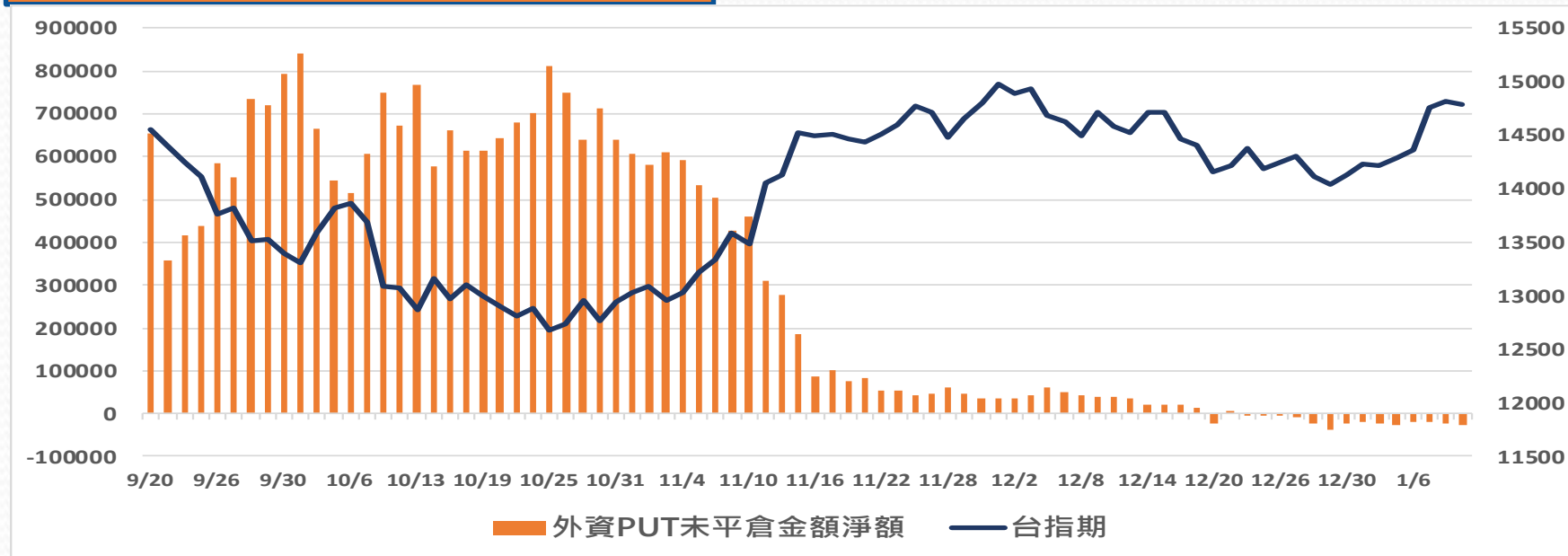
更新日期：2023年1月11日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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11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11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