

台指選擇權OI匯報

日期：2023/1/12 結算日：2023/1/30					日期：2023/1/12 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	142	13,600	4,950	1,730 ※	0	2	13,100	381	26	
0	162	13,700	3,178	-185	0	0	13,200	522	160	
-1	340	13,800	3,764	185	0	4	13,300	580	114	
-2	346	13,900	5,084	-263	0	1	13,400	428	175	
-26	1,167	14,000	8,127	1,522	0	3	13,500	669	-381	
-11	2,130	14,100	5,470	156	0	0	13,600	868	-808	
-29	1,200	14,200	4,623	1,033	0	2	13,700	811	-132	
-26	1,362	14,300	4,821	1,561	0	14	13,800	591	-232	
-2	248	14,350	2,582	951	1	14	13,900	468	63	
39	1,759	14,400	4,425	1,238	-2	110	14,000	1,504	252	
-4	299	14,450	2,163	1,098	-1	64	14,100	913	400	
77	2,158	14,500	4,578	930	0	89	14,200	1,007	151	
57	528	14,550	1,397	251	-17	183	14,300	736	9	
-14	1,767	14,600	3,183	854	3	289	14,400	403	11	
48	616	14,650	1,314	364	-99	434	14,500	344	43	
41	2,622	14,700	3,396	718	9	1,929	14,600	333	92	
1,488	2,219	14,750	1,916	1,125	70	1,116	14,700	419	78	
664	5,235	14,800	2,656	922	※	569	1,612	687	571 ※	
1,727	2,379	14,850	564	310	-28	706	14,900	113	19	
1,346	6,308	14,900	825	148	14	1,447	15,000	94	10	
802	2,077	14,950	245	157	126	1,328	15,100	50	8	
1,700	13,941	15,000	586	174	115	1,007	15,200	15	11	
1,227	2,046	15,050	86	36	203	1,505	15,300	3	0	
1,271	6,273	15,100	211	34	357	2,442	15,400	4	1	
1,663	2,186	15,150	28	27	482	1,869	15,500	6	0	
2,141	7,677	15,200	231	-1	140	805	15,600	2	0	
1,864	7,546	15,300	95	15	250	851	15,700	0	0	
2,160	7,126	15,400	27	2	206	752	15,800	1	0	
※	2,285	9,080	15,500	39	0	266	640	15,900	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	
24,660	115,716	0.9432	109,149	15,011	3,344	23,533	0.6999	16,470	819	
昨日 P/C	1.0187	今日增減變化	-0.0755	昨日 P/C	0.7752	今日增減變化	-0.0754			

更新日期：2023年1月12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12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	79,922,989	63,066,020	16,856,969	2,054,810	4,219,045	1,215,199	3,003,846	19,334	
投信	32,114,970	53,369,334	-21,254,364	475,794	409,620	0	409,620	-720	
自營商	41,904,669	17,931,588	23,973,081	68,354	974,306	892,774	81,532	128,416	
	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	633,406	1,571,186	-937,780	-144,703	253,820	10,153	243,667	-81,581	
投信	73,790	0	73,790	-130	0	0	0	0	
自營商	344,348	159,885	184,463	138,286	53,449	250,520	-197,071	101,975	

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12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	29,547	16,824	12,723	-2,717	20,947	18,226	2,721	3,287	
投信	200	200	0	0	600	141	459	0	
自營商	45,322	56,528	-11,206	-3,045	56,823	38,823	18,000	654	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	18,337	7,891	10,446	579	6,487	13,083	-6,596	-5,522	
特定法人(全月)	22,145	8,664	13,481	-2,681	9,949	15,785	-5,836	-4,141	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	45,133	47,126	-1,993	-3,000	45,243	54,643	-9,400	1,188	
十大交易人(全月)	68,972	69,020	-48	-2,978	65,179	72,094	-6,915	3,353	
全市場未沖銷(近月)			116,408	24,683			118,845	17,690	
全市場未沖銷(全月)			160,363	28,384			161,427	18,677	

更新日期：2023年1月12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	14000
	整體隱含波動率	13.18%	較前一交易日	+0.65%
	買權隱含波動率	15.36%	較前一交易日	+0.71%
	賣權隱含波動率	10.82%	較前一交易日	+0.30%
電子選擇權	買權成交最大量	730	買權OI最大量	730
	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	1540	買權OI最大量	1560
	賣權成交最大量	1440	賣權OI最大量	1360

更新日期：2023年1月12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	15000	買權OI最大量	15400
	賣權成交最大量	13600	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	18.19%	較前一交易日	-0.99%
	買權隱含波動率	15.68%	較前一交易日	+0.39%
	賣權隱含波動率	20.14%	較前一交易日	-0.03%
	成交量P/C_Ratio值	1.097	較前一交易日	+0.39
	未平倉P/C_Ratio值	0.700	較前一交易日	-0.08
電子選擇權	買權成交最大量	730	買權OI最大量	730
	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	1540	買權OI最大量	1560
	賣權成交最大量	1440	賣權OI最大量	1360

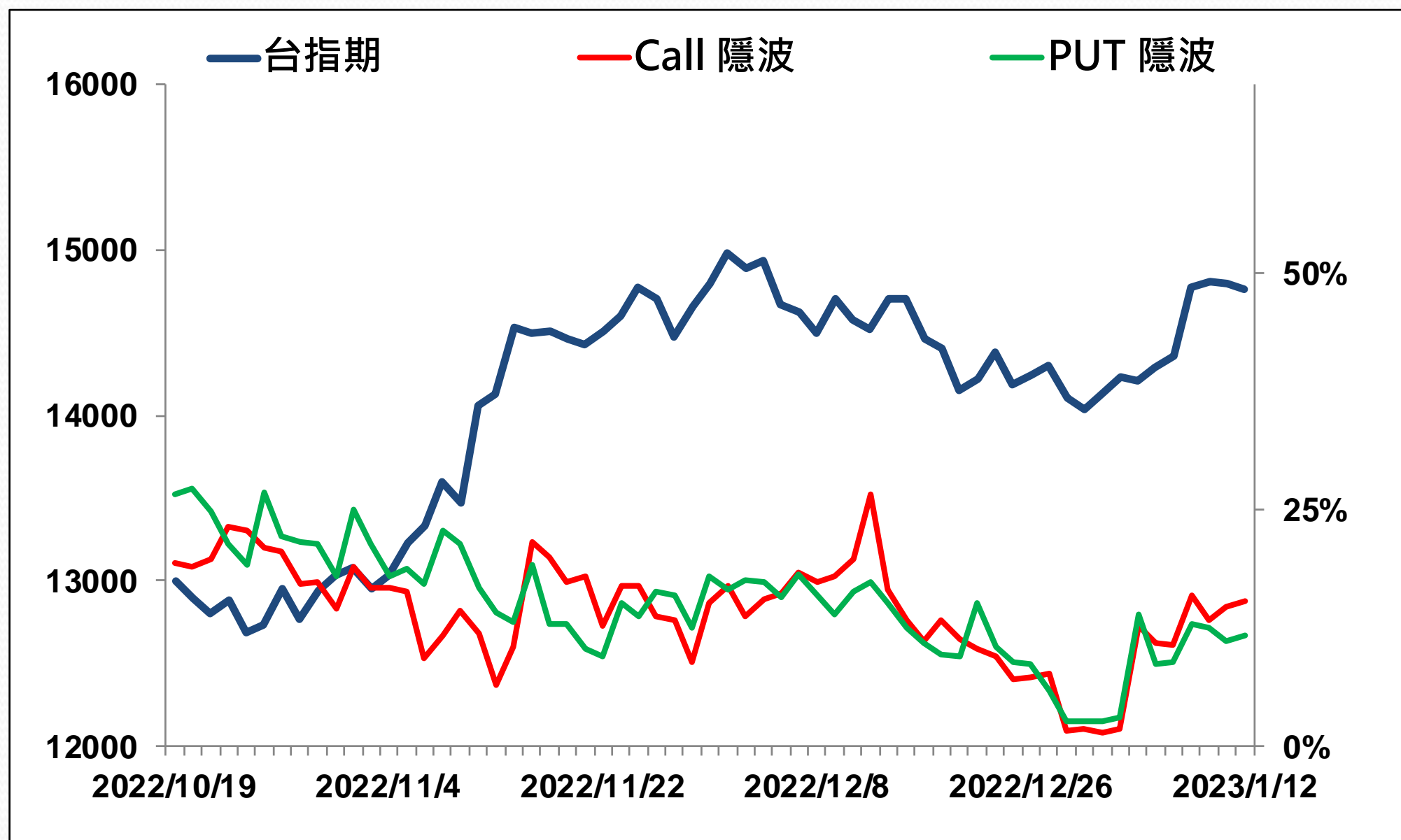
更新日期：2023年1月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



更新日期：2023年1月12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

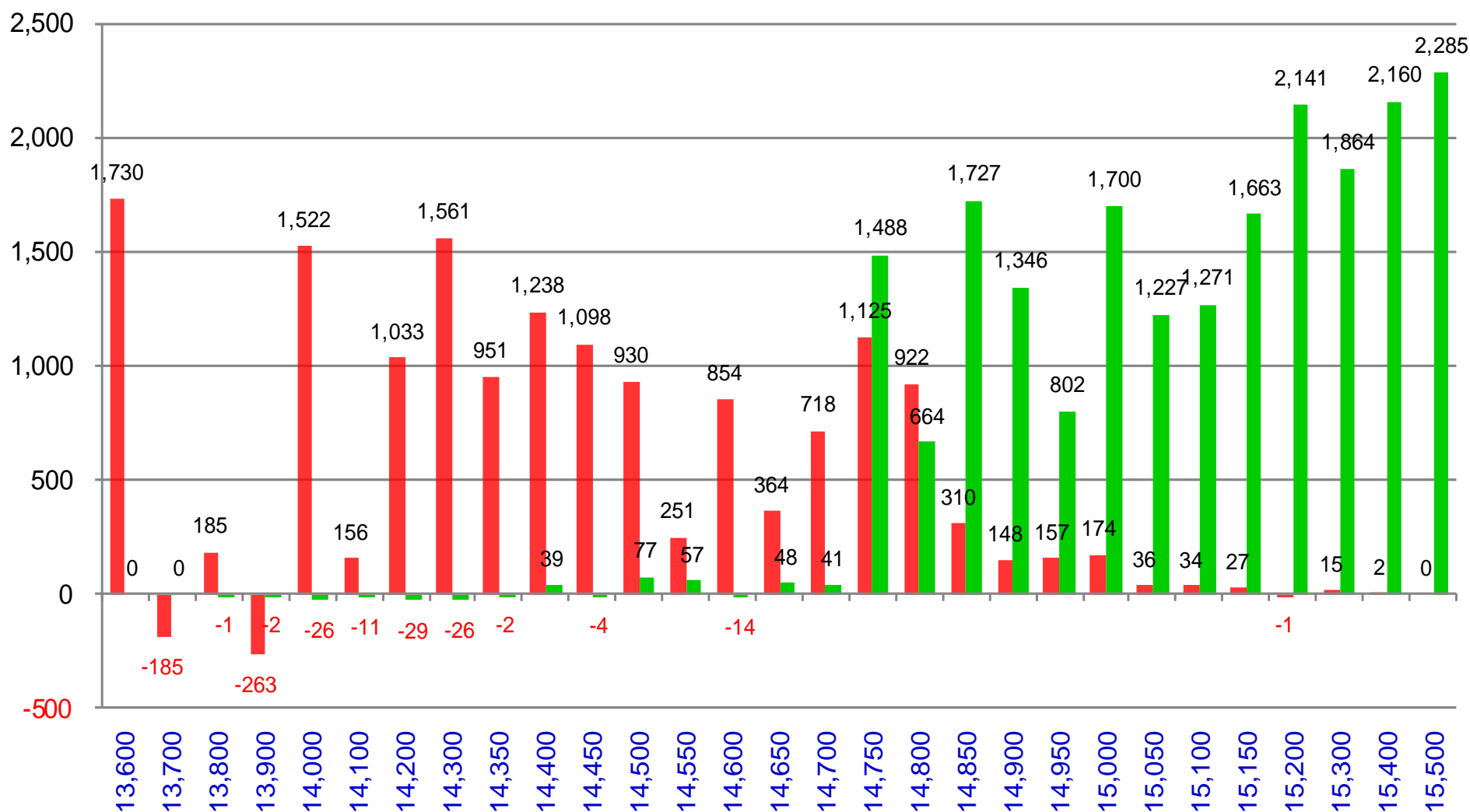


更新日期：2023年1月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

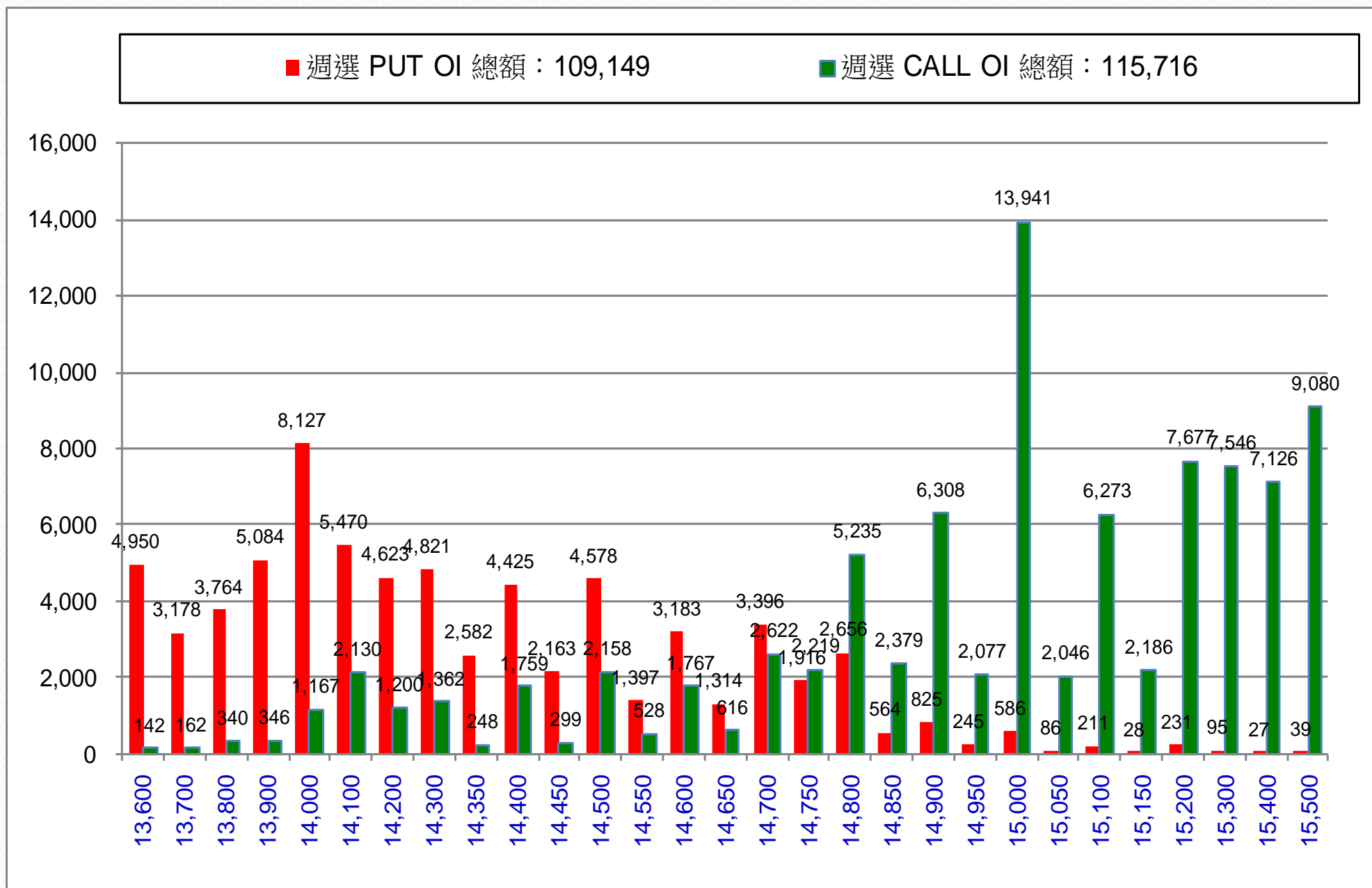
週選 PUT OI 變化：15,011

週選 CALL OI 變化：24,660



更新日期：2023年1月12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



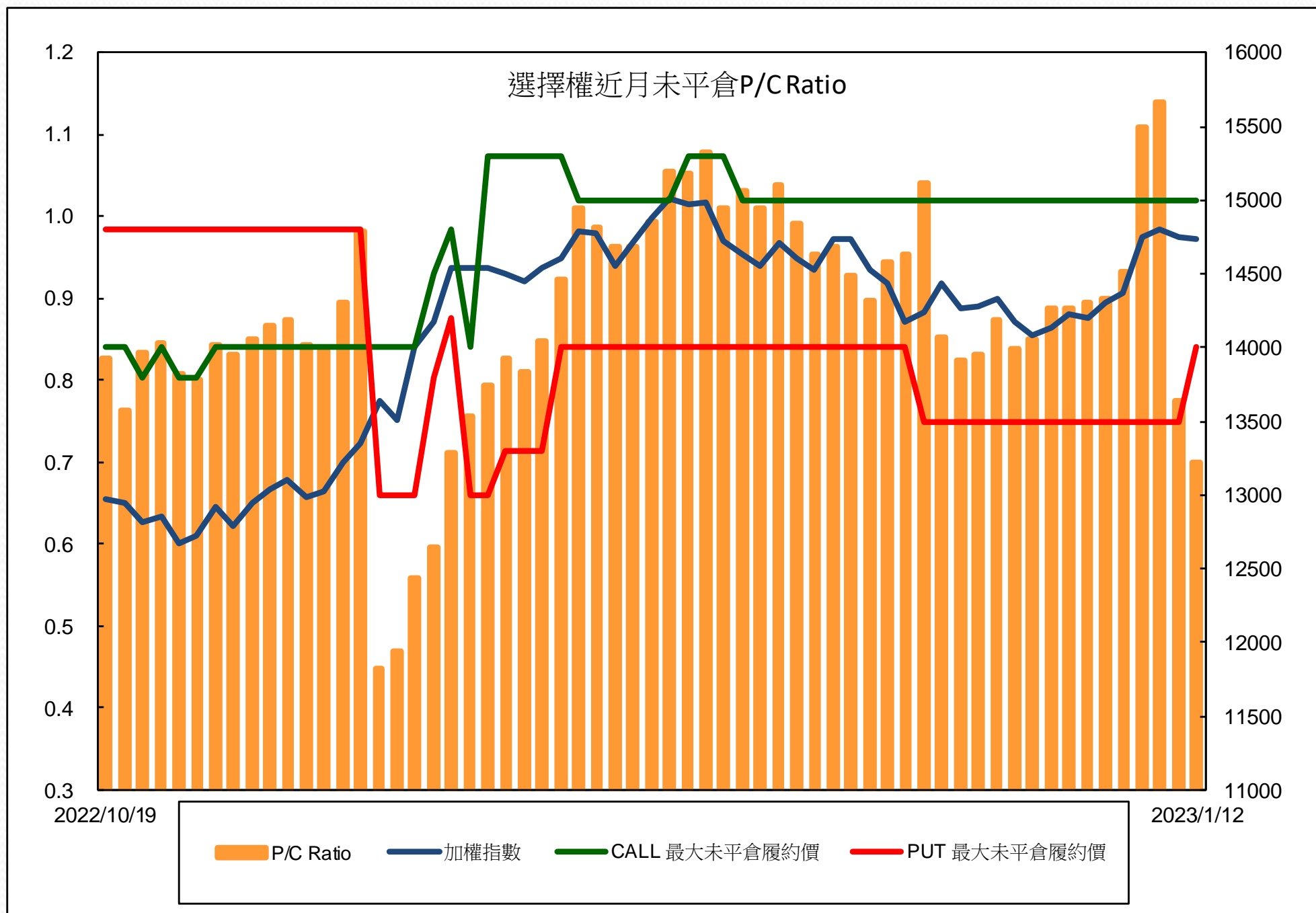
更新日期：2023年1月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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11日	41,690	49,851	-8,161
	1月12日	45,322	56,528	-11,206
Put	1月11日	52,013	34,667	17,346
	1月12日	56,823	38,823	18,000

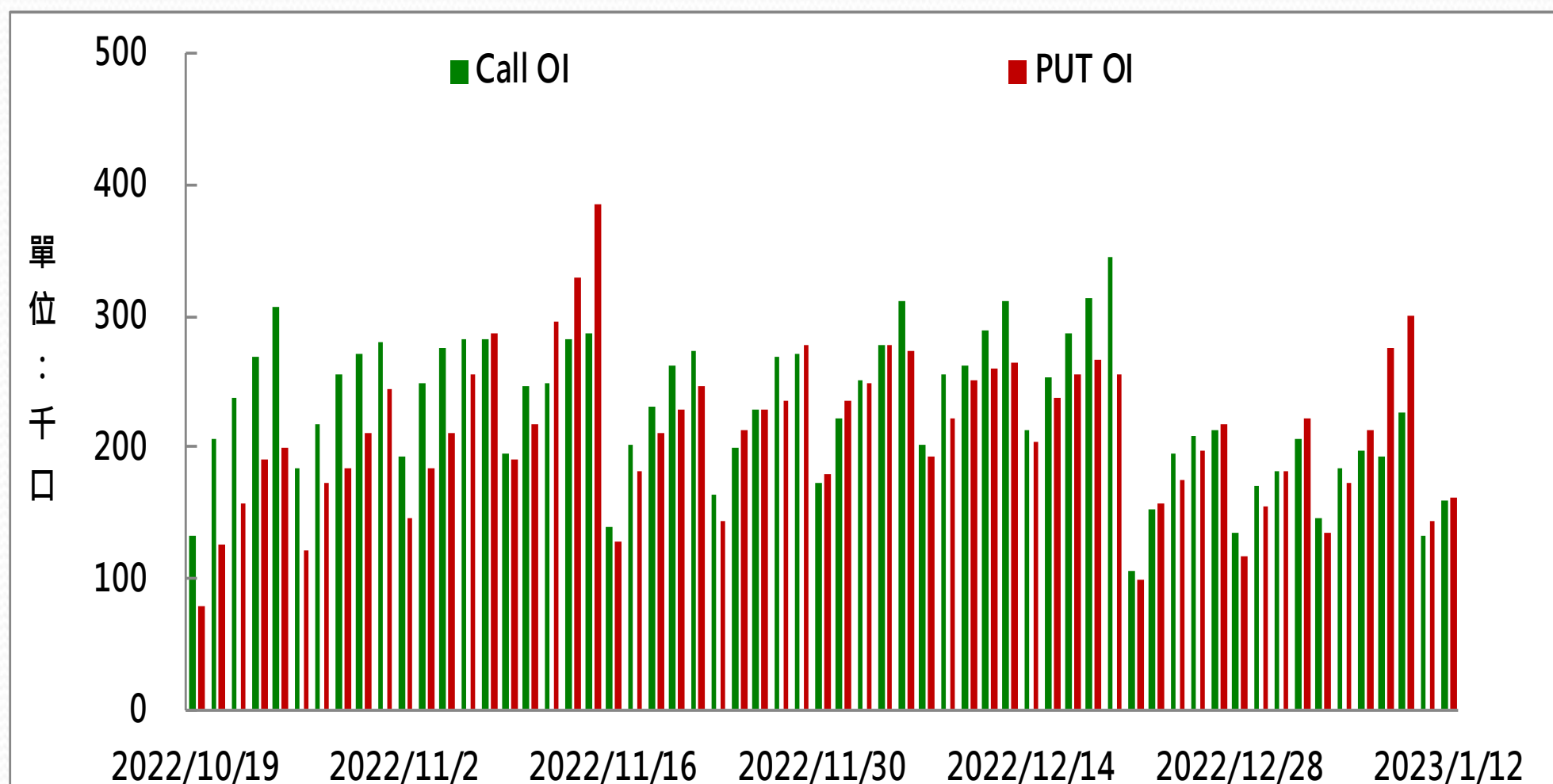
更新日期：2023年1月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年1月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

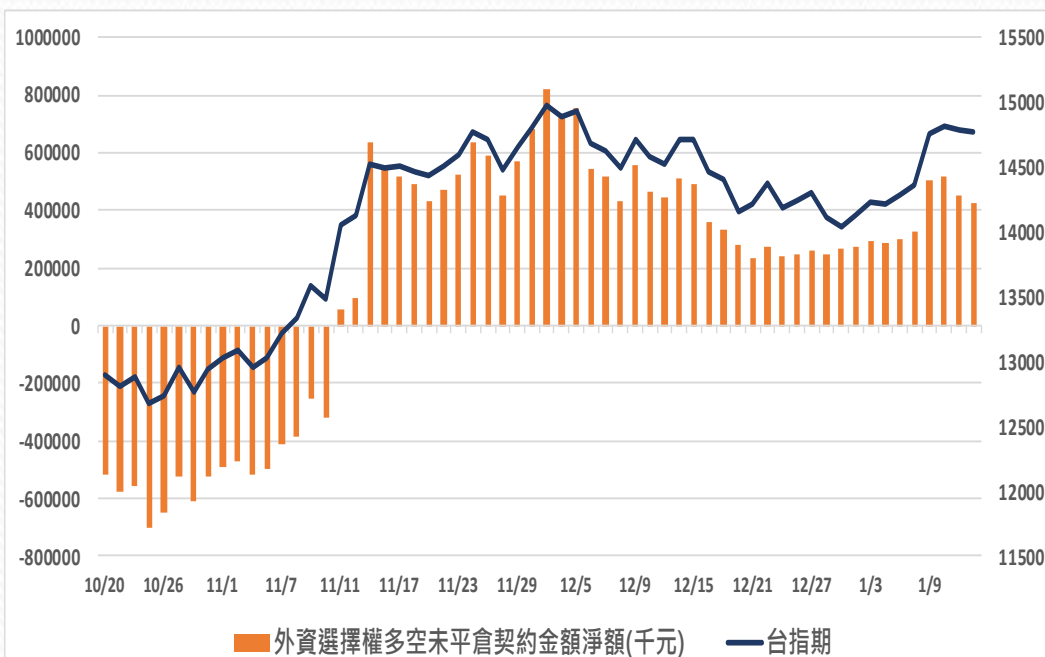
選擇權全月Put Call OI



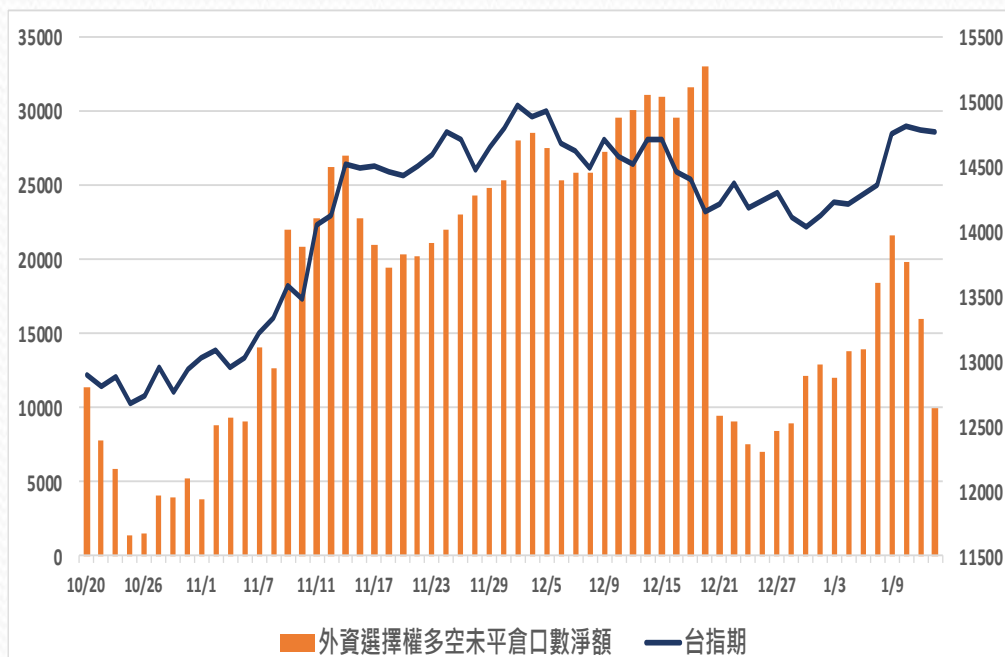
更新日期：2023年1月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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

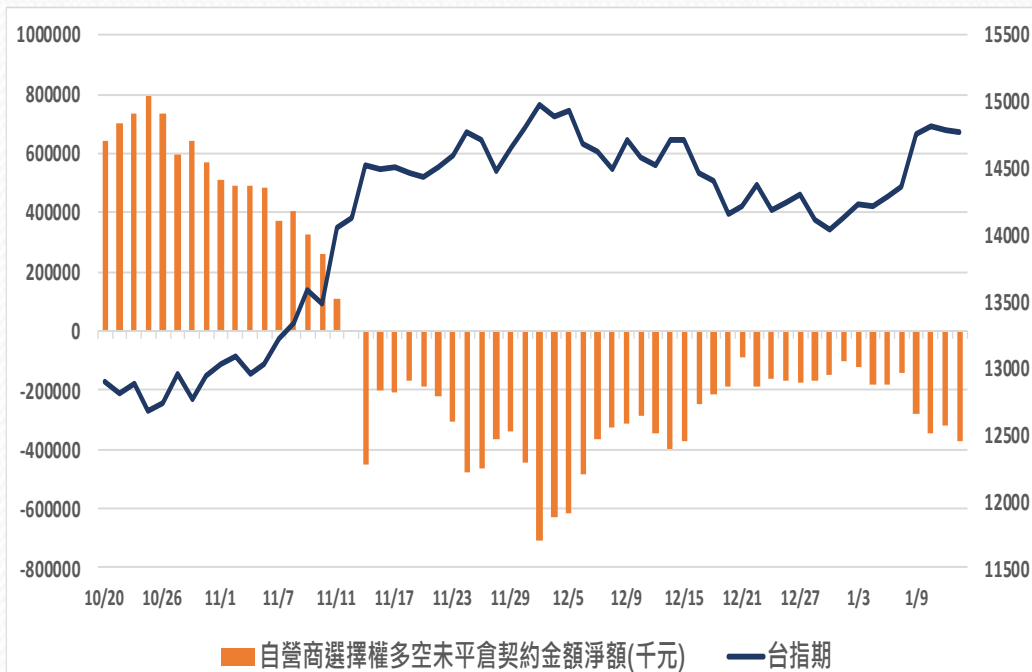
日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/1/6	14366	18404	4417	324192	23166
2023/1/9	14765	21655	3251	506550	182358
2023/1/10	14810	19838	-1817	519305	12755
2023/1/11	14791	16006	-3832	449187	-70118
2023/1/12	14766	10002	-6004	423269	-25918

更新日期：2023年1月12日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參

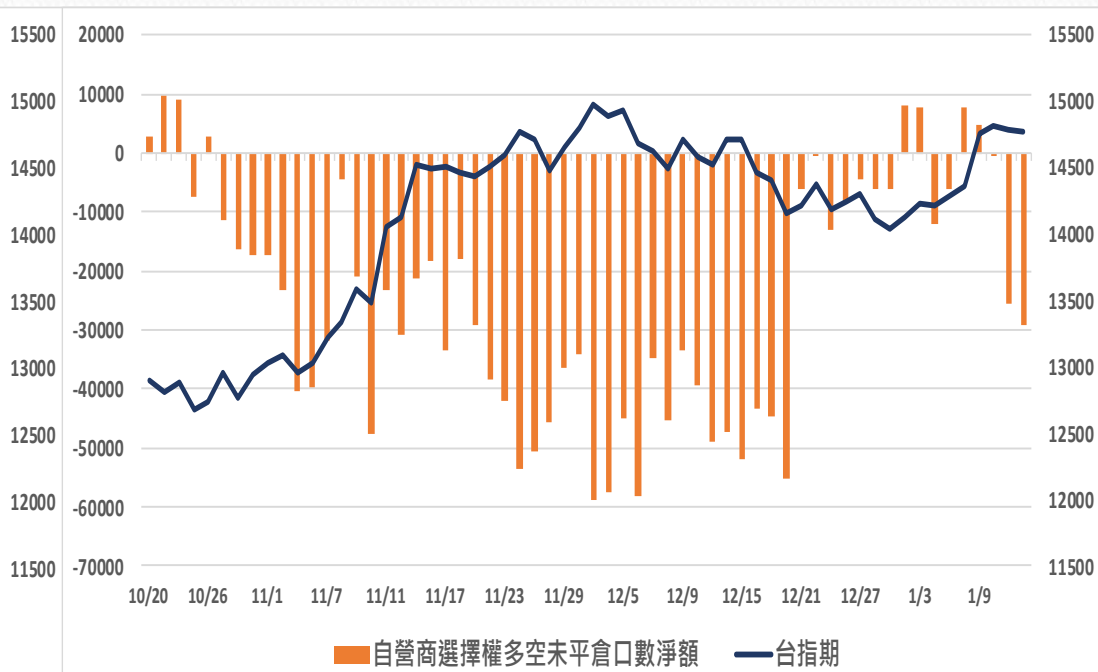
考

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



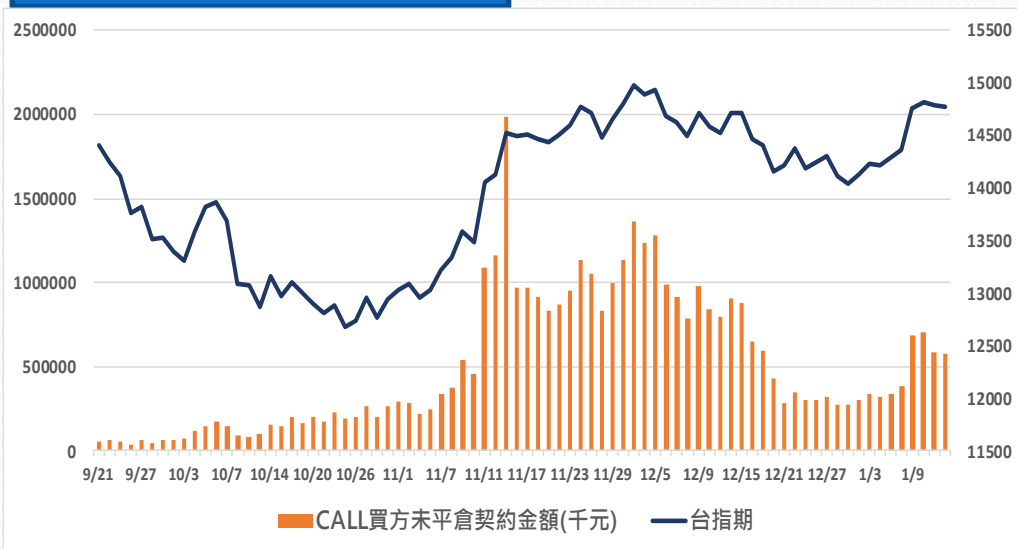
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/1/6	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
2023/1/12	14766	-29206	-3699	-369089	-52788

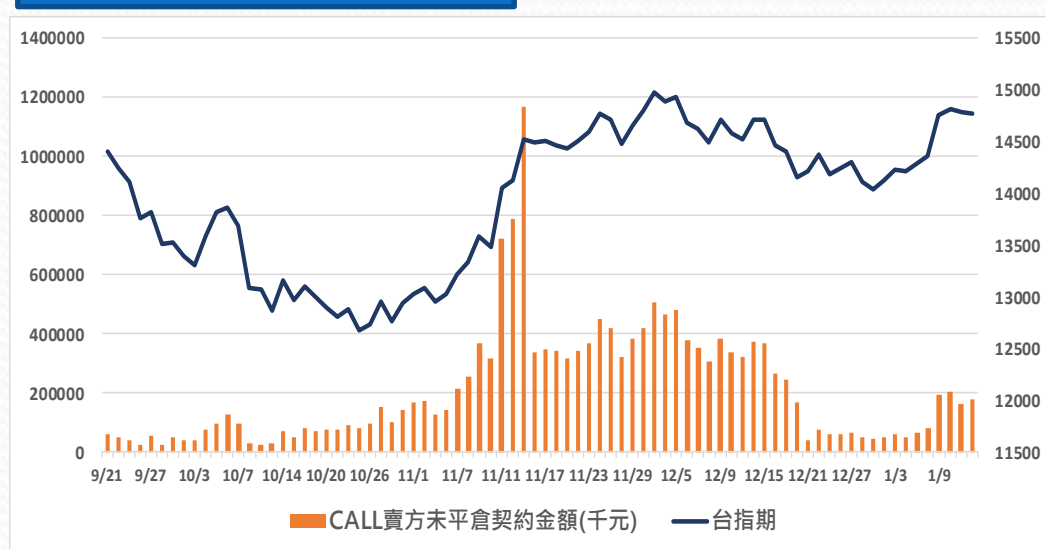
更新日期：2023年1月12日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

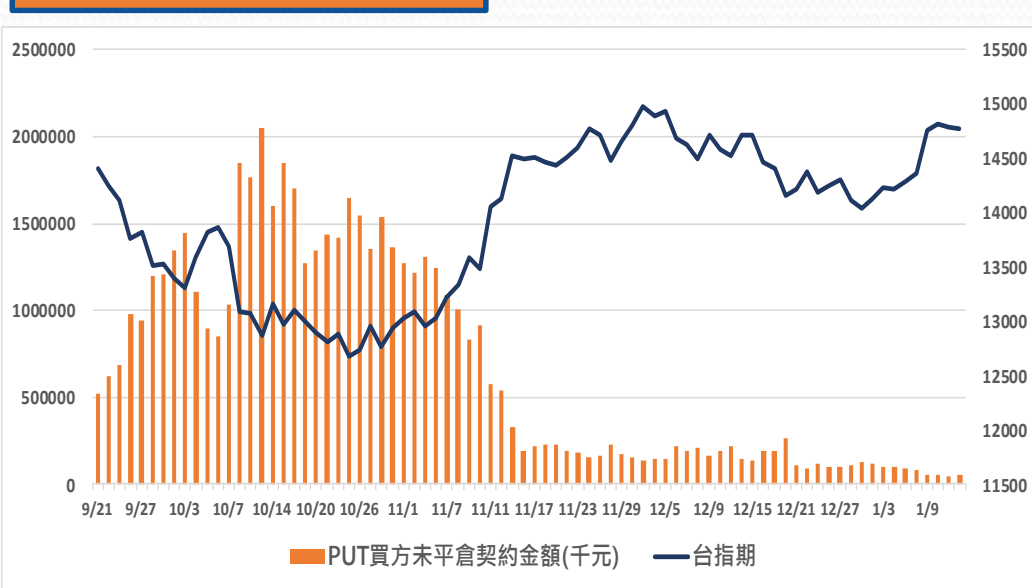
CALL買方未平倉金額



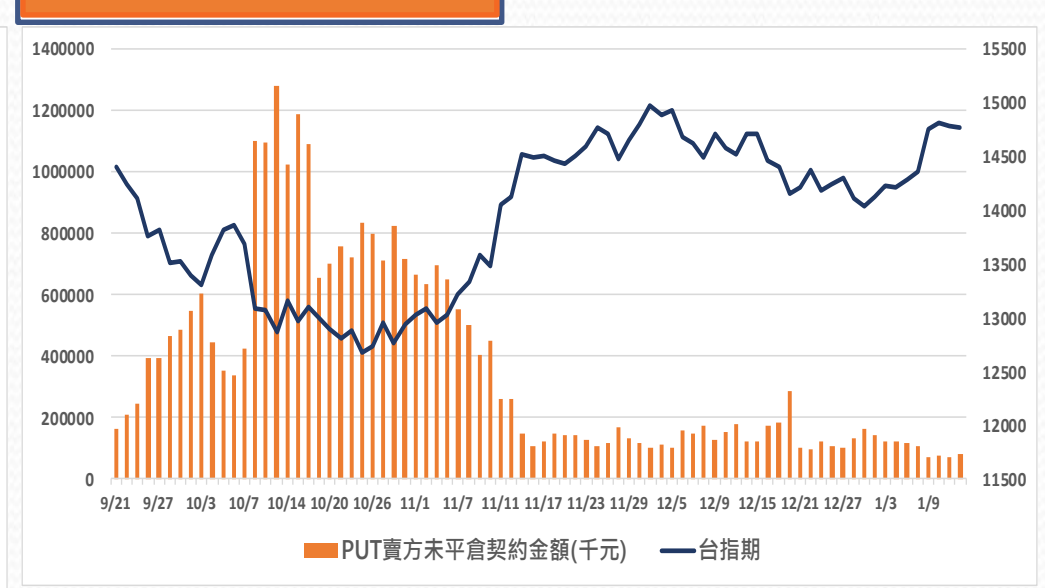
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



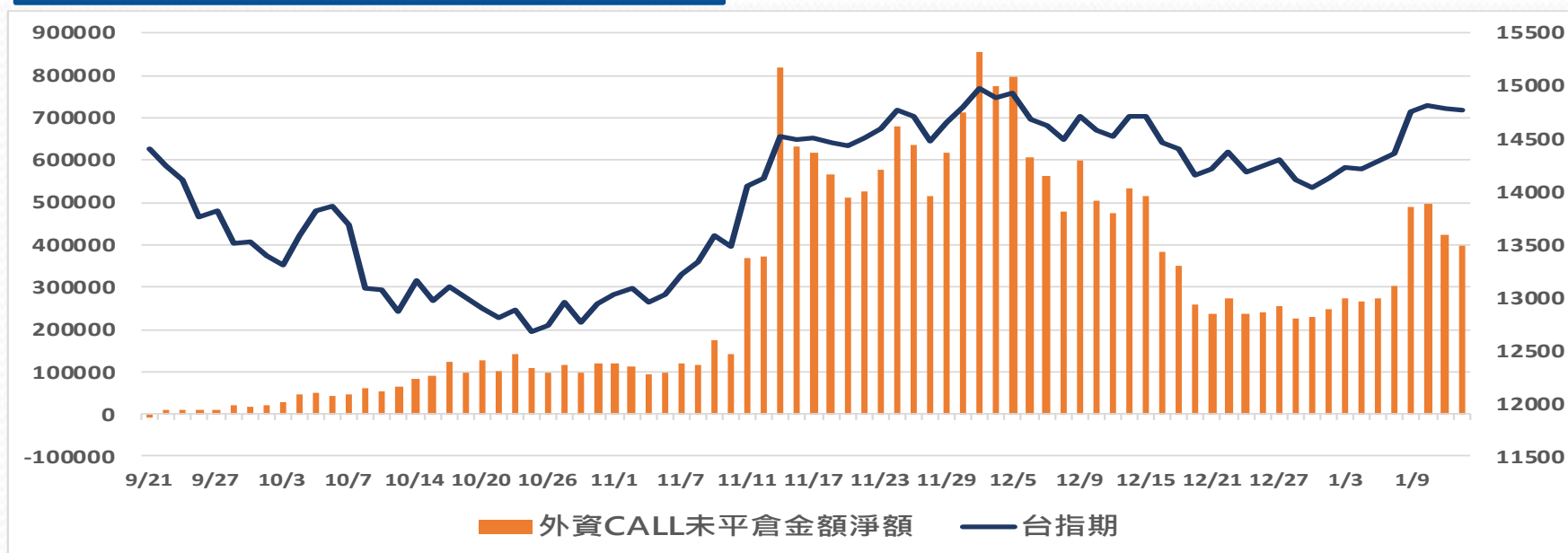
PUT賣方未平倉金額



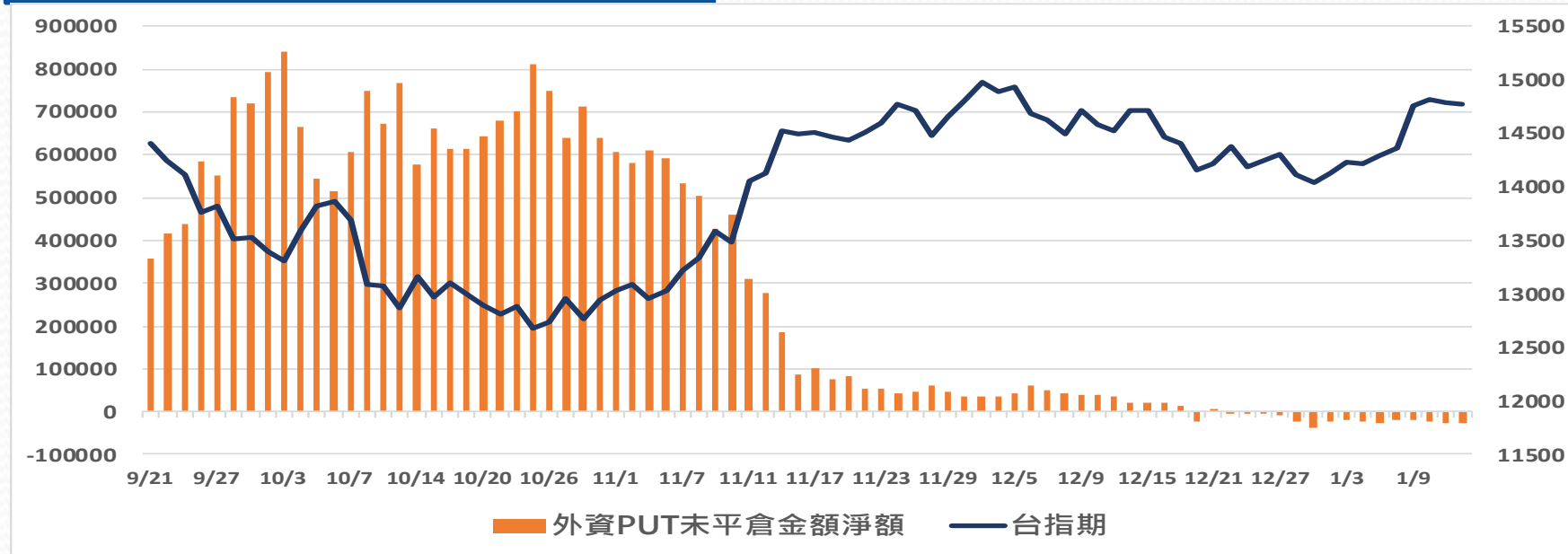
更新日期：2023年1月12日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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12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12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