

台指選擇權OI匯報

日期：2023/1/13 結算日：2023/1/30					日期：2023/1/13 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
-1	161	13,700	3,311	133	0	0	13,200	537	15
0	340	13,800	3,879	115	0	4	13,300	608	28
-4	342	13,900	3,398	-1,686	0	1	13,400	450	22
-4	1,163	14,000	8,241	114	0	3	13,500	703	34
-10	2,120	14,100	6,071	601	0	0	13,600	930	67
-192	1,008	14,200	5,685	1,062	0	2	13,700	1,136	325
-8	1,354	14,300	5,367	546	4	18	13,800	591	0
3	251	14,350	2,850	268	1	15	13,900	581	113
-131	1,628	14,400	4,932	507	-6	104	14,000	1,667	163
9	308	14,450	3,036	873	-1	63	14,100	967	54
-149	2,009	14,500	5,219	641	8	97	14,200	1,035	28
-44	484	14,550	2,168	771	-17	166	14,300	835	99
-132	1,635	14,600	3,796	613	-2	287	14,400	850	447
-31	585	14,650	2,348	1,034	-21	413	14,500	657	313
-205	2,417	14,700	4,057	661	-112	1,817	14,600	430	97
-910	1,309	14,750	2,486	570	88	1,204	14,700	542	123
-158	5,077	14,800	3,901	1,245	-293	1,319	14,800	478	-209
-74	2,305	14,850	1,532	968	36	742	14,900	174	61
144	6,452	14,900	1,915	1,090	3	1,450	15,000	247	153
1,341	3,418	14,950	787	542	262	1,590	15,100	158	108
848	14,789	15,000	1,110	524	177	1,184	15,200	20	5
780	2,826	15,050	238	152	-144	1,361	15,300	6	3
-338	5,935	15,100	445	234	473	2,915	15,400	8	4
1,359	3,545	15,150	83	55	143	2,012	15,500	7	1
728	8,405	15,200	256	25	431	1,236	15,600	3	1
1,276	8,822	15,300	124	29	99	950	15,700	0	0
3,475	10,601	15,400	40	13	218	970	15,800	1	0
0	9,080	15,500	54	15	76	716	15,900	0	0
-32	3,281	15,600	41	7	293	1,188	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
11,152	126,868	0.9486	120,350	11,201	1,711	25,244	0.7496	18,923	2,453
昨日 P/C	0.9432	今日增減變化	0.0054	昨日 P/C	0.6999	今日增減變化	0.0497		

更新日期：2023年1月13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13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	99,983,872	65,307,628	34,676,244	17,819,275	4,139,214	787,086	3,352,128	348,282	
投信	31,468,264	53,188,338	-21,720,074	-465,710	401,813	0	401,813	-7,807	
自營商	38,244,922	18,877,985	19,366,937	-4,606,144	750,322	899,643	-149,321	-230,853	
	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	634,368	1,606,656	-972,288	-34,508	220,218	7,244	212,974	-30,693	
投信	73,728	0	73,728	-62	0	0	0	0	
自營商	294,912	147,456	147,456	-37,007	49,149	209,862	-160,713	36,358	

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13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	30,576	18,153	12,423	-300	23,981	19,390	4,591	1,870	
投信	200	200	0	0	600	141	459	0	
自營商	55,222	56,624	-1,402	9,804	52,647	47,246	5,401	-12,599	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	16,987	7,380	9,607	-839	6,956	14,155	-7,199	-603	
特定法人(全月)	22,297	5,167	17,130	3,649	10,437	17,716	-7,279	-1,443	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	56,360	49,277	7,083	9,076	50,336	50,950	-614	8,786	
十大交易人(全月)	82,139	70,670	11,469	11,517	71,399	69,002	2,397	9,312	
全市場未沖銷(近月)			127,558	11,150			130,010	11,165	
全市場未沖銷(全月)			175,608	15,245			176,152	14,725	

更新日期：2023年1月13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	15300	買權OI最大量	15000
	賣權成交最大量	14700	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	11.52%	較前一交易日	-1.66%
	買權隱含波動率	12.00%	較前一交易日	-3.37%
	賣權隱含波動率	11.02%	較前一交易日	+0.19%
電子選擇權	買權成交最大量	710	買權OI最大量	730
	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	1560
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1360

更新日期：2023年1月13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	15400	買權OI最大量	15400
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	16.05%	較前一交易日	+2.14%
	買權隱含波動率	13.98%	較前一交易日	-1.69%
	賣權隱含波動率	18.99%	較前一交易日	-1.15%
	成交量P/C_Ratio值	0.692	較前一交易日	-0.40
	未平倉P/C_Ratio值	0.750	較前一交易日	+0.05
電子選擇權	買權成交最大量	710	買權OI最大量	730
	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	1560
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1360

更新日期：2023年1月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

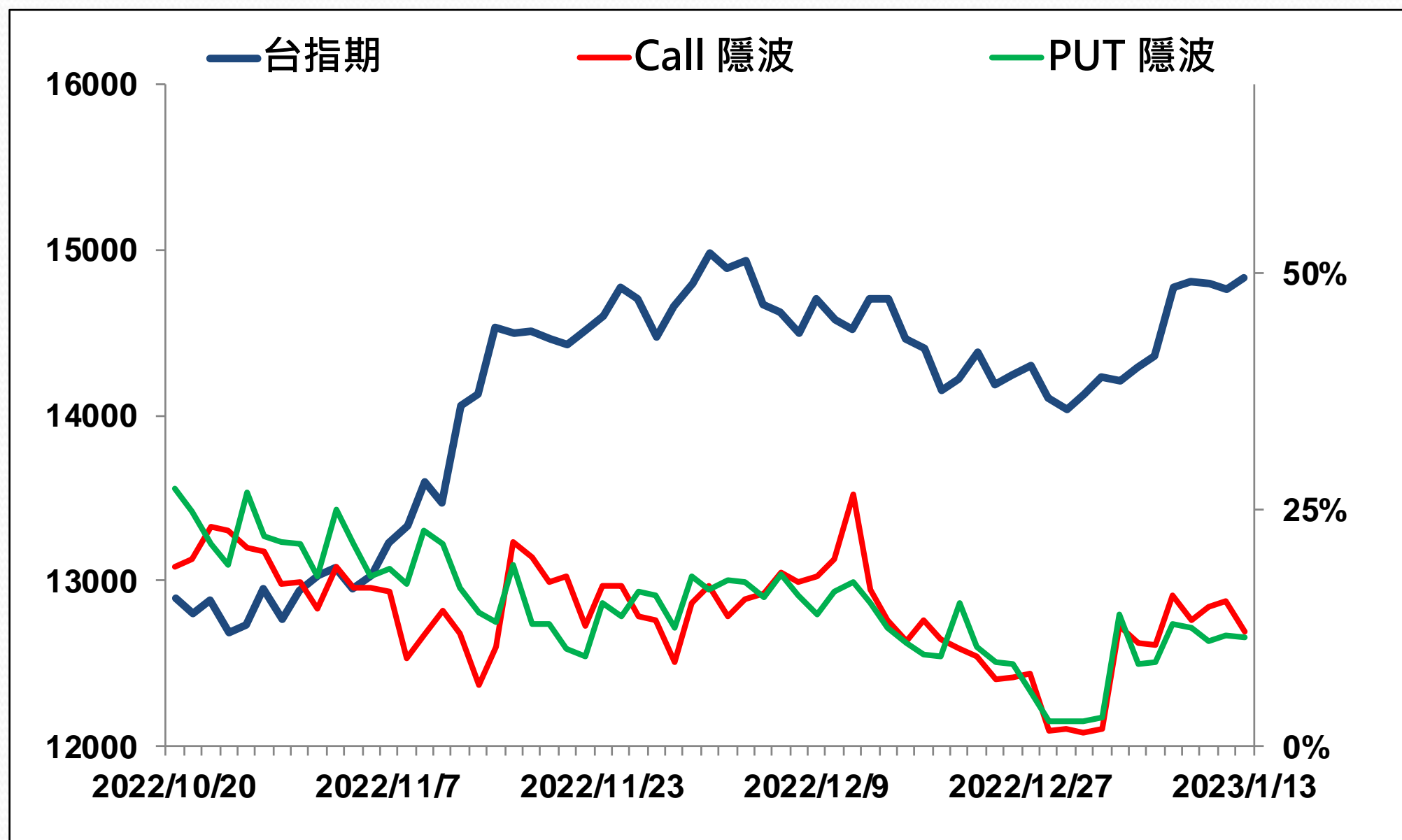
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



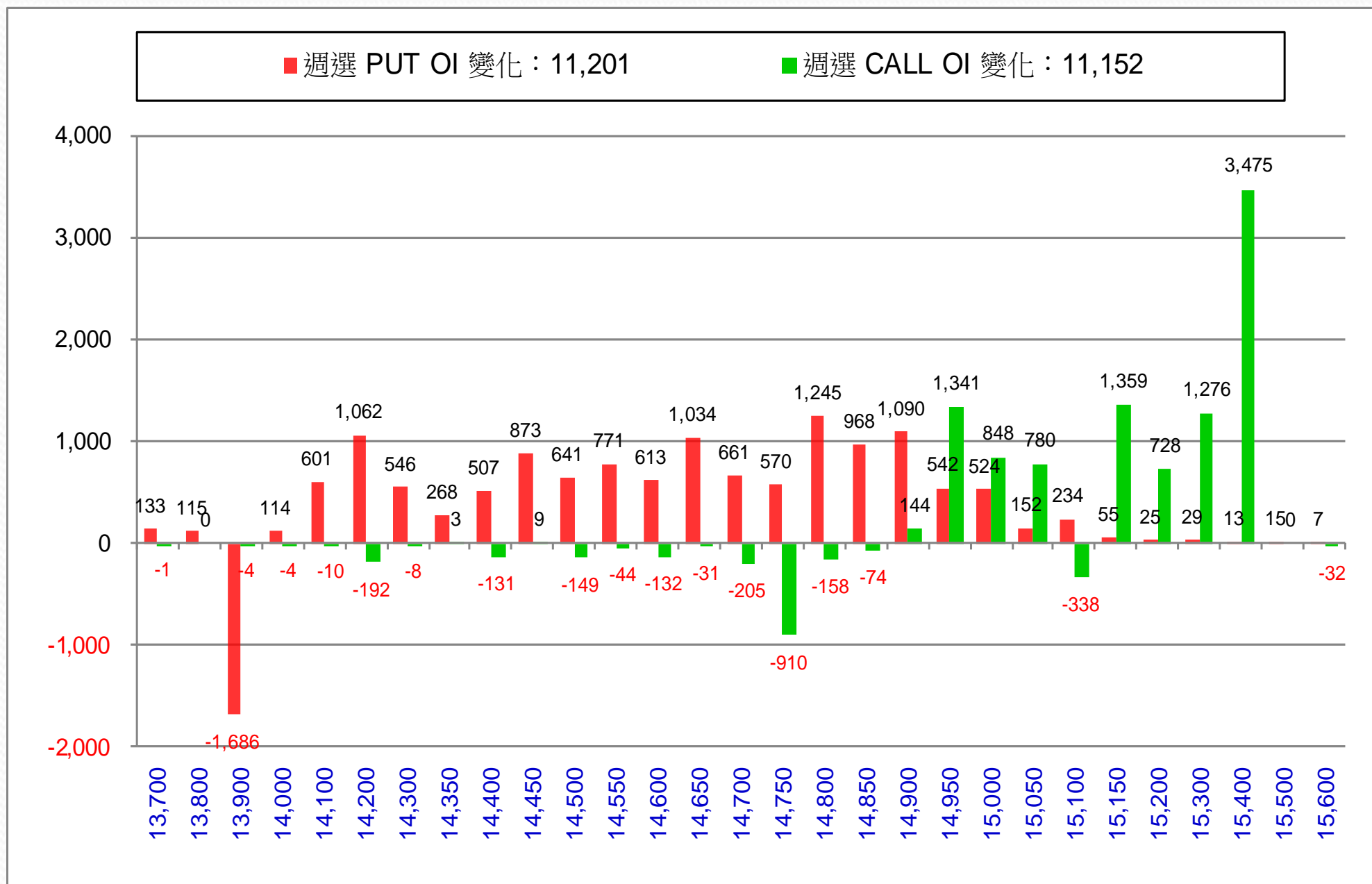
更新日期：2023年1月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年1月13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

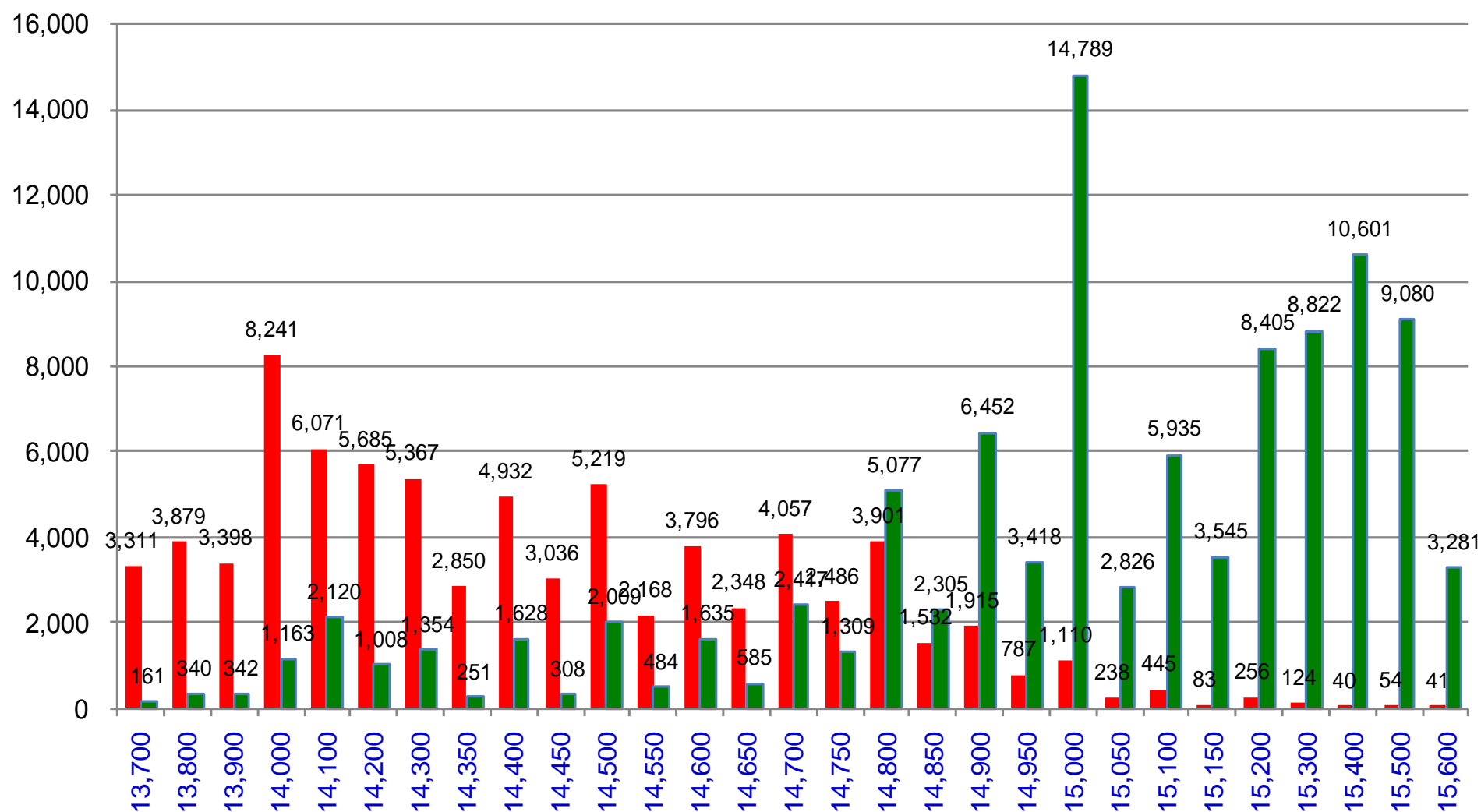


更新日期：2023年1月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：120,350

週選 CALL OI 總額：126,868



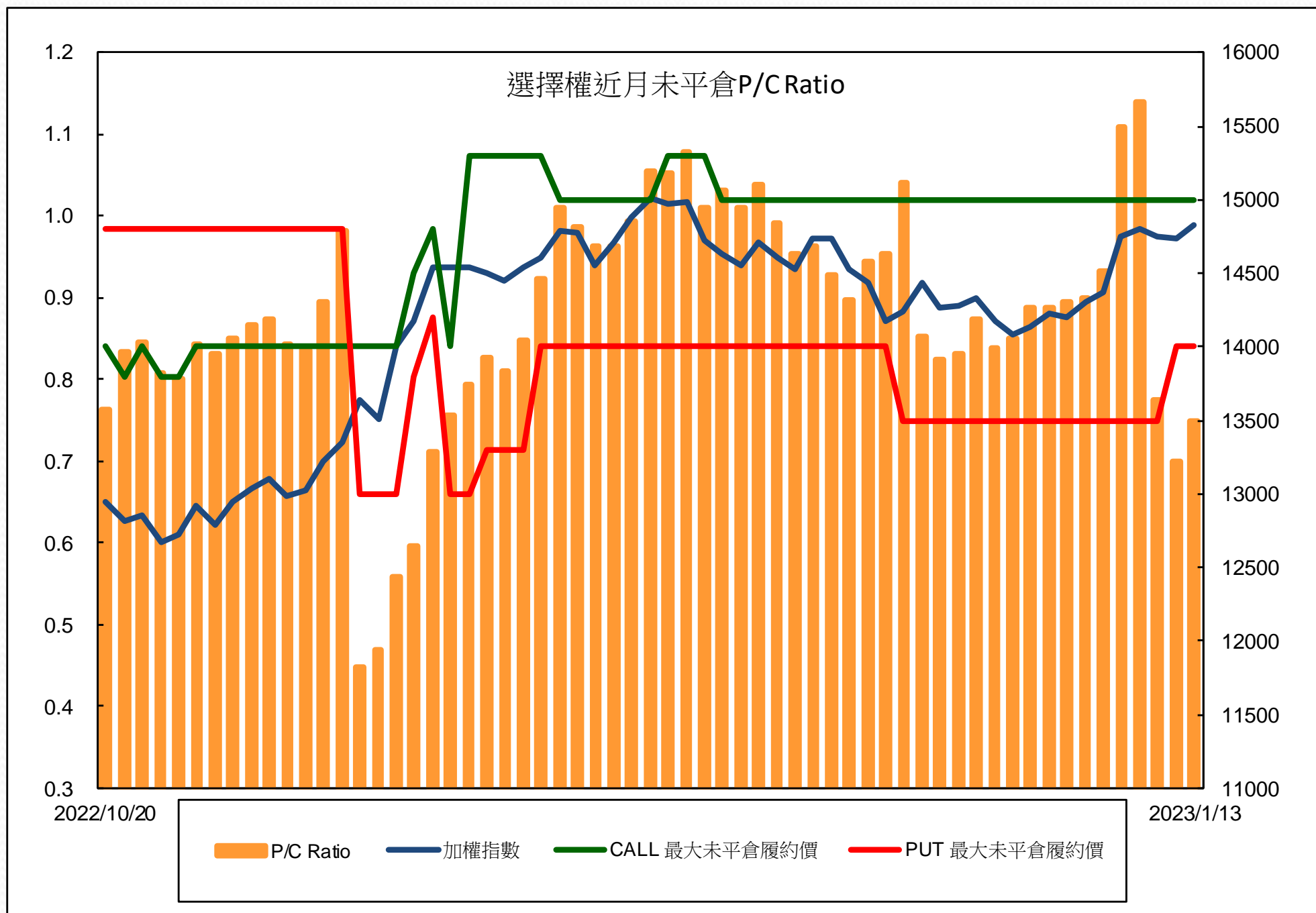
更新日期：2023年1月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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12日	45,322	56,528	-11,206
	1月13日	55,222	56,624	-1,402
Put	1月12日	56,823	38,823	18,000
	1月13日	52,647	47,246	5,401

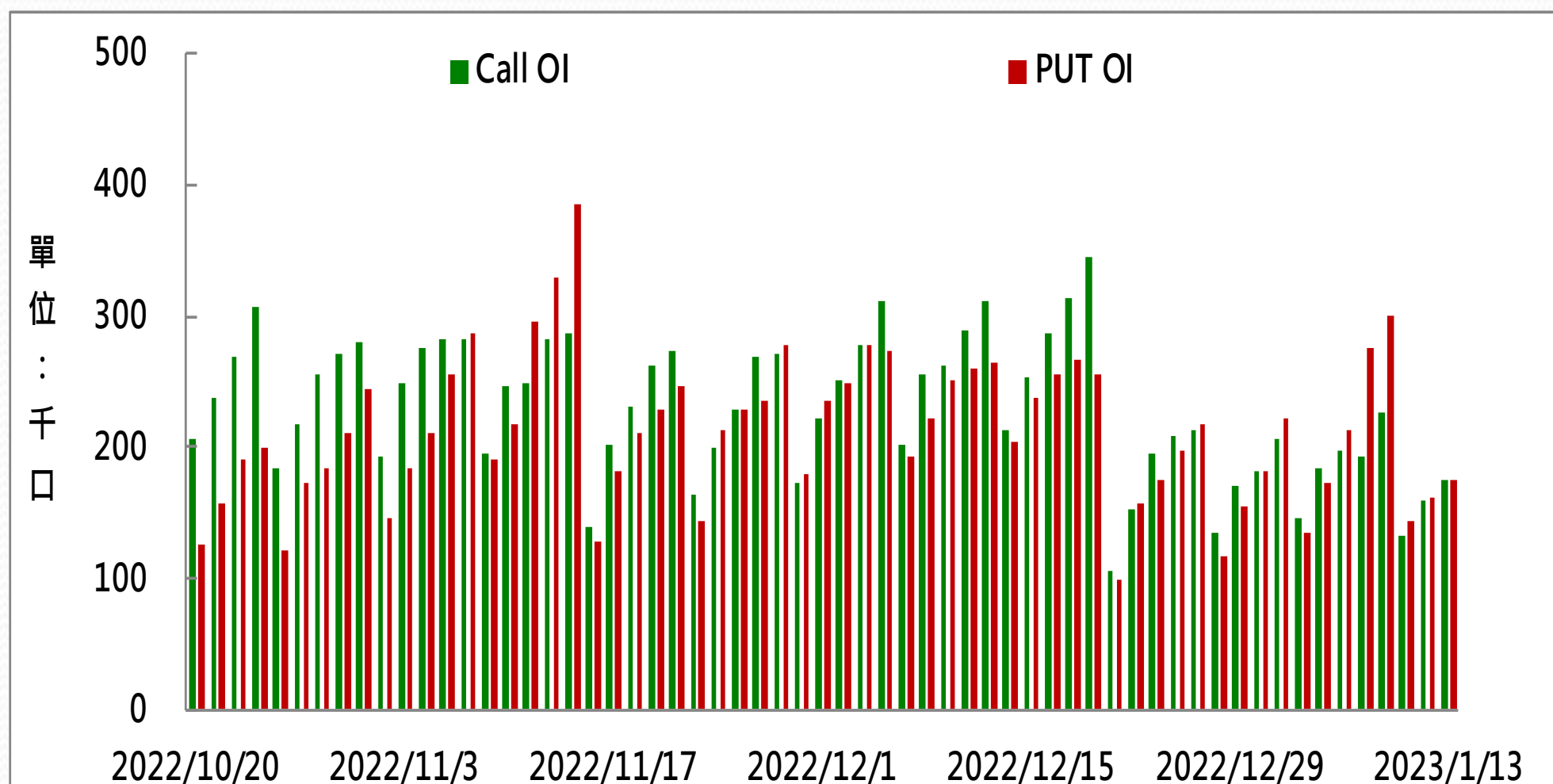
更新日期：2023年1月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年1月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

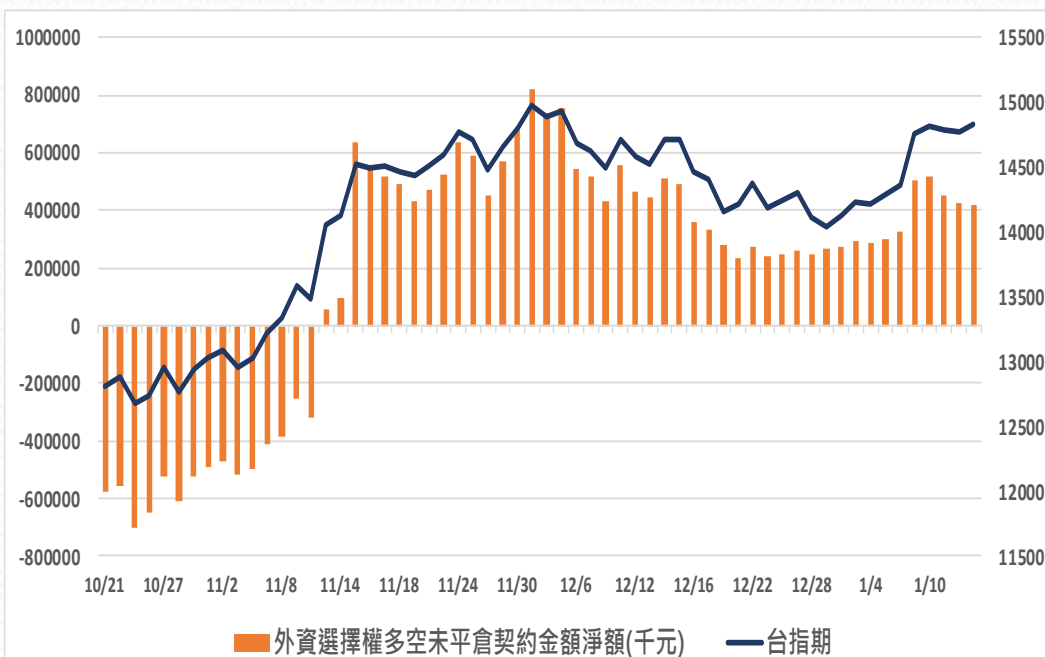
選擇權全月Put Call OI



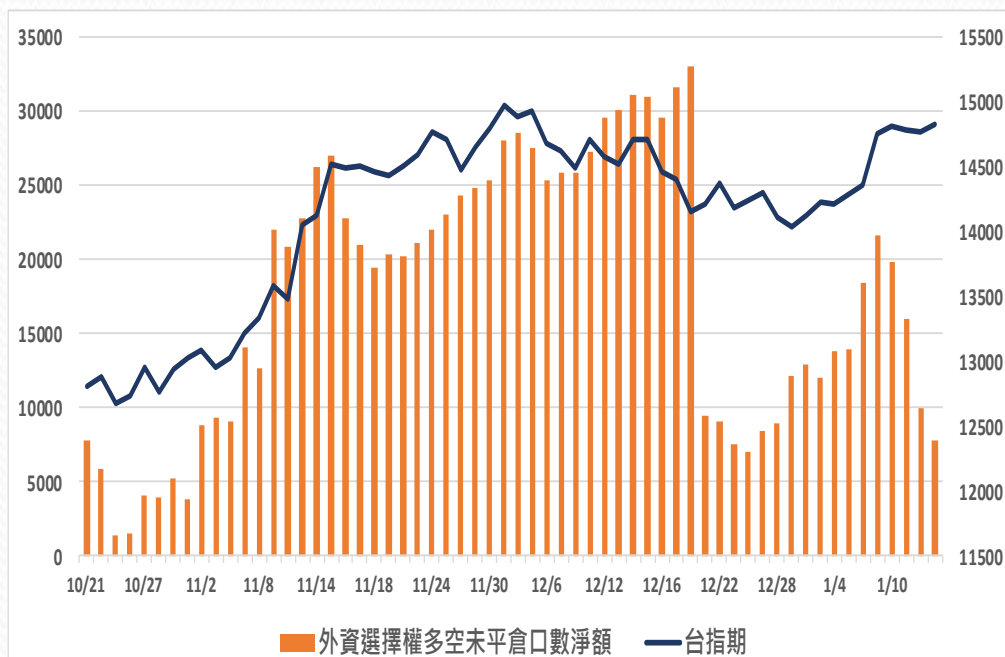
更新日期：2023年1月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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

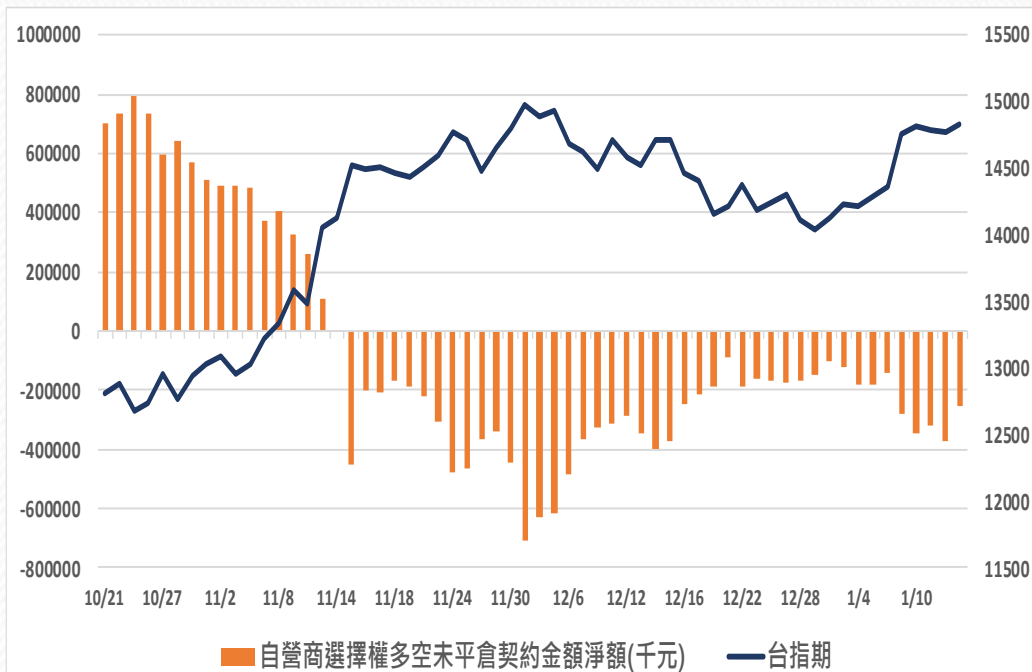
日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/1/9	14765	21655	3251	506550	182358
2023/1/10	14810	19838	-1817	519305	12755
2023/1/11	14791	16006	-3832	449187	-70118
2023/1/12	14766	10002	-6004	423269	-25918
2023/1/13	14834	7832	-2170	421569	-1700

更新日期：2023年1月13日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參

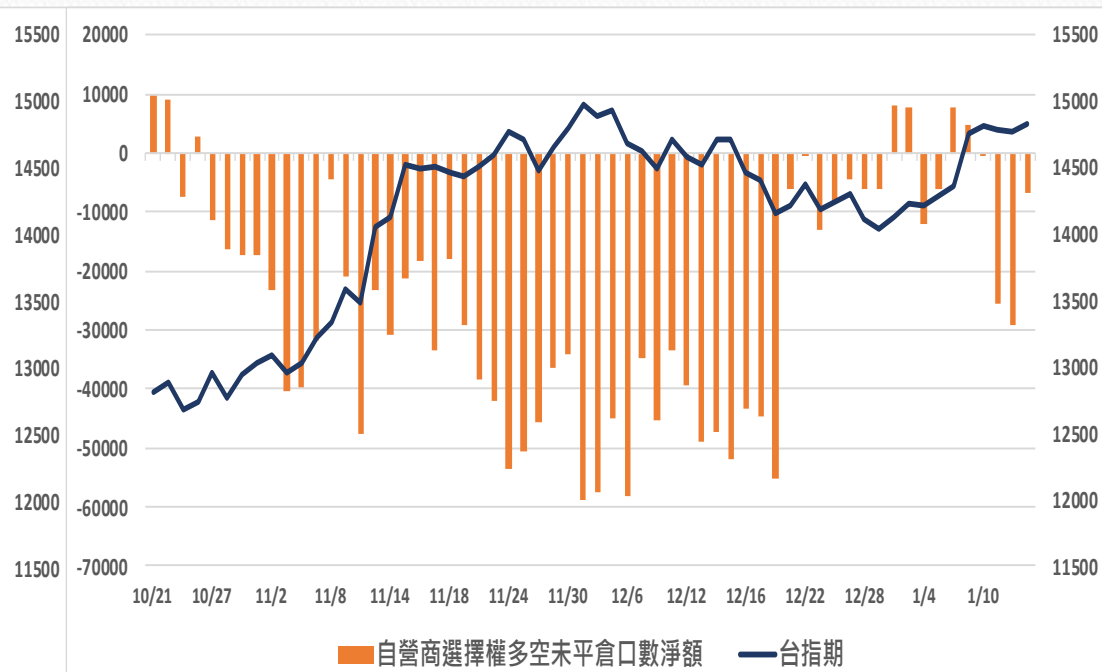
考

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



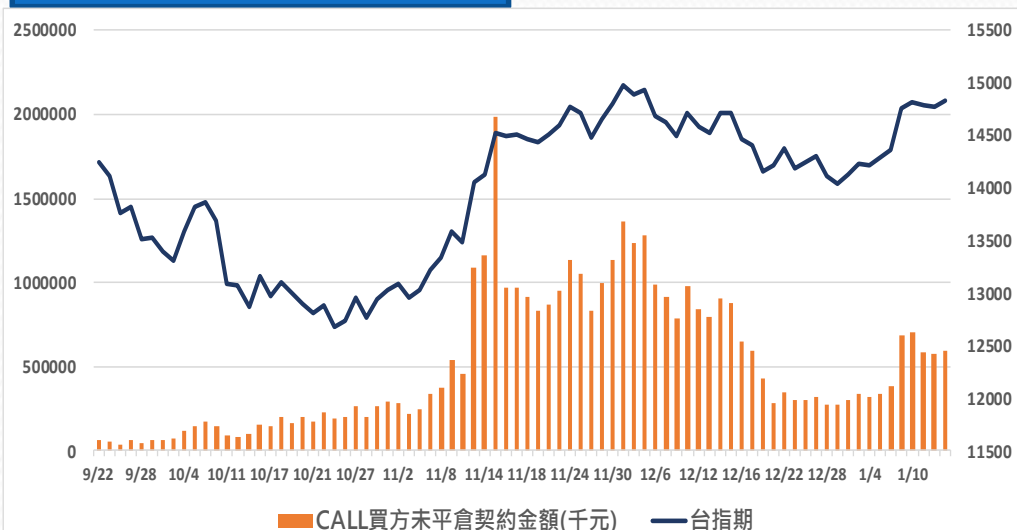
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/1/9	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
2023/1/13	14834	-6803	22403	-255706	113383

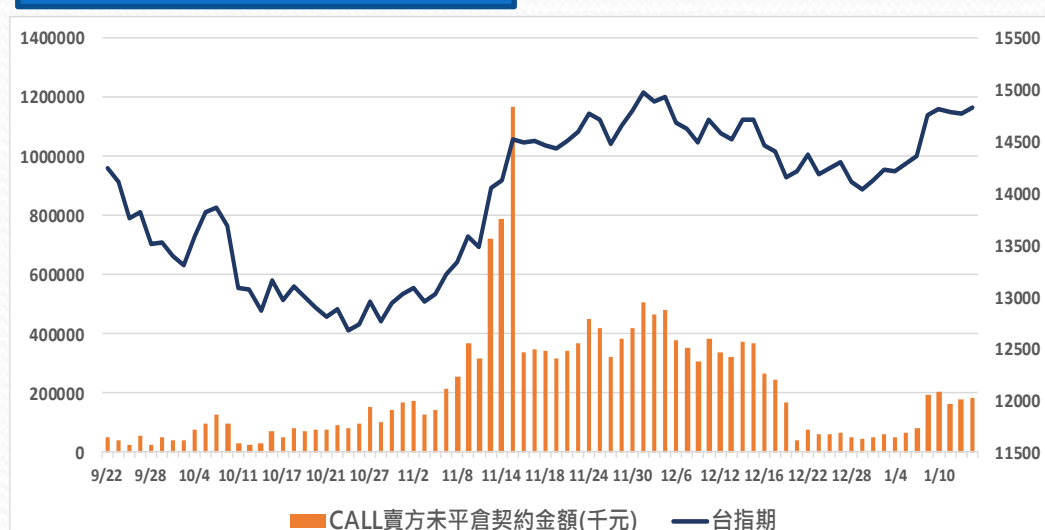
更新日期：2023年1月13日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

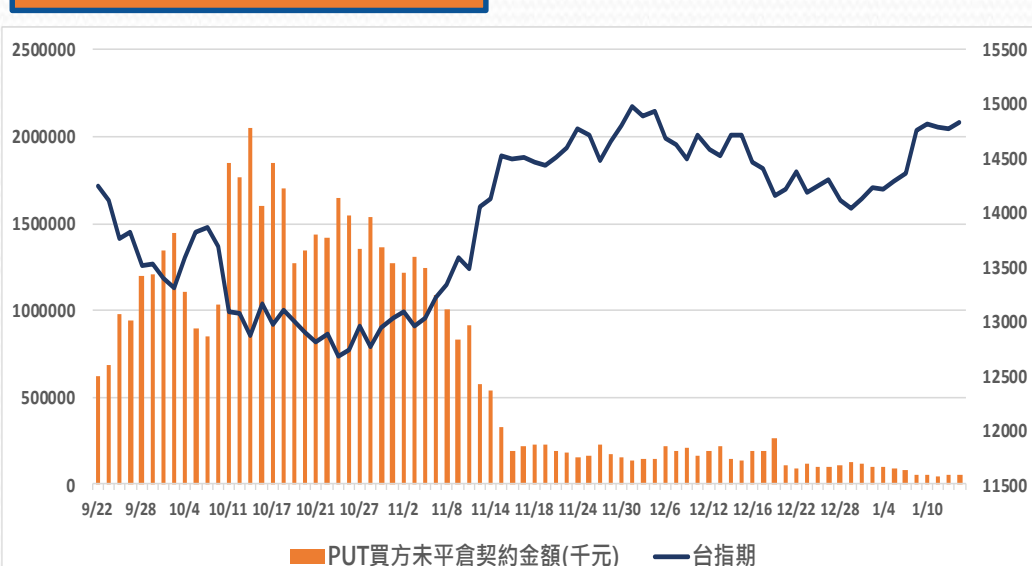
CALL買方未平倉金額



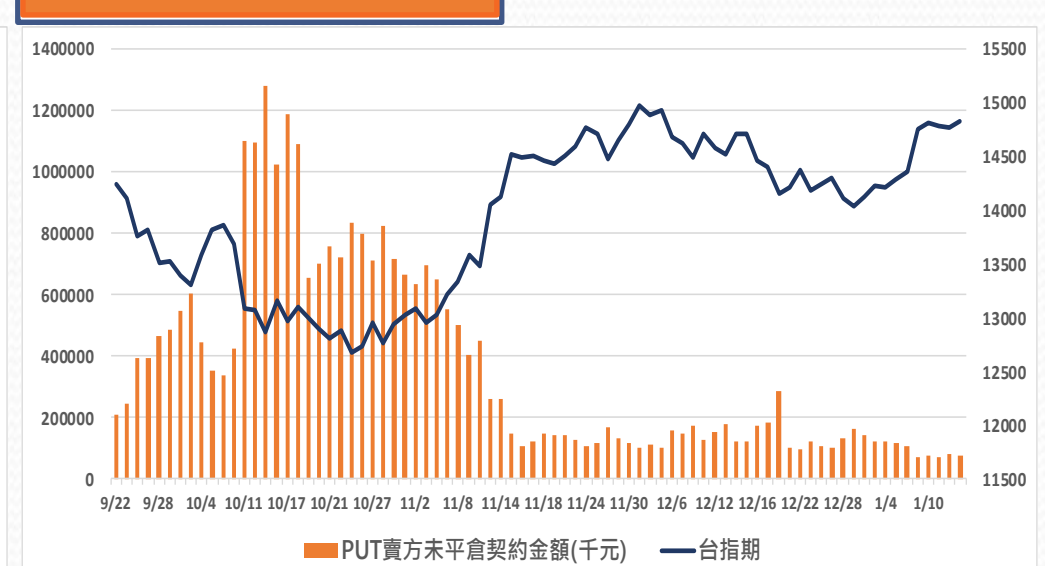
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



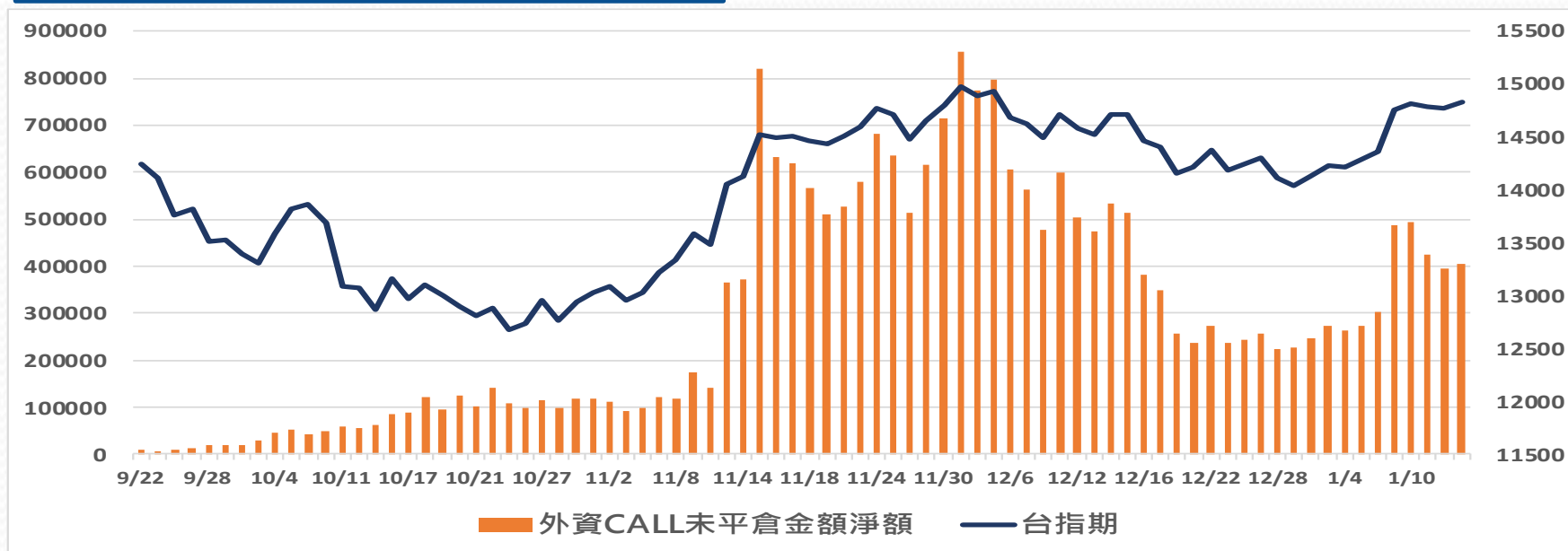
PUT賣方未平倉金額



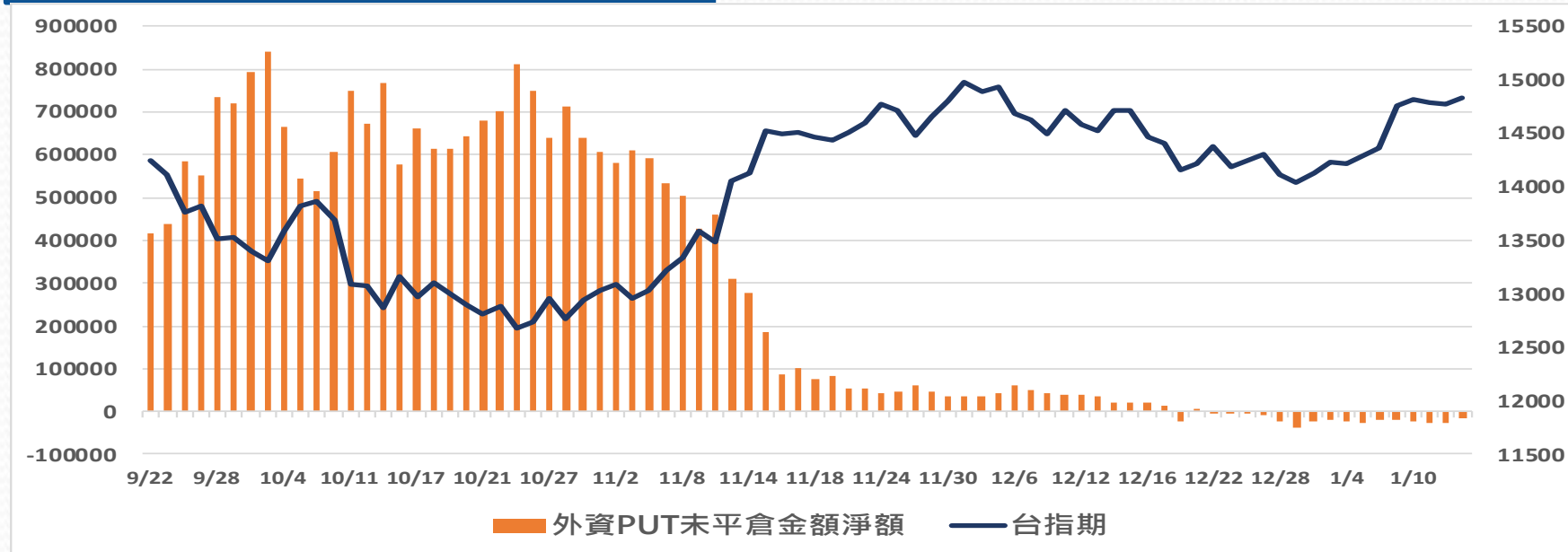
更新日期：2023年1月13日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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13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13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