

台指選擇權OI匯報

日期：2023/1/16 結算日：2023/1/30					日期：2023/1/16 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
-3	1,160	14,000	8,280	39	0	4	13,300	670	62
-9	2,111	14,100	4,930	-1,141	-1	0	13,400	450	0
-5	1,003	14,200	5,184	-501	0	3	13,500	728	25
-1	1,353	14,300	5,340	-27	0	0	13,600	987	57
-13	238	14,350	2,597	-253	0	2	13,700	1,074	-62
-102	1,526	14,400	4,693	-239	0	18	13,800	775	184
-12	296	14,450	3,160	124	0	15	13,900	724	143
-48	1,961	14,500	7,667	2,448	-1	103	14,000	1,855	188
2	486	14,550	2,517	349	-1	62	14,100	1,051	84
-36	1,599	14,600	4,617	821	0	97	14,200	1,116	81
45	630	14,650	2,796	448	-9	157	14,300	931	96
2	2,419	14,700	3,867	-190	2	289	14,400	981	131
-143	1,166	14,750	3,110	624	-19	394	14,500	893	236
-575	4,502	14,800	4,726	825	-47	1,770	14,600	530	100
-163	2,142	14,850	4,469	2,937	23	1,227	14,700	615	73
328	6,780	14,900	5,075	3,160	※	-31	1,288	525	47
-398	3,020	14,950	1,311	524	40	782	14,900	786	612
-3,360	11,429	15,000	1,435	325	14	1,464	15,000	308	61
736	3,562	15,050	244	6	195	1,785	15,100	167	9
523	6,458	15,100	375	-70	179	1,363	15,200	24	4
32	3,577	15,150	71	-12	180	1,541	15,300	9	3
53	8,458	15,200	236	-20	※	845	3,760	15,400	11
580	580	15,250	4	4	552	2,564	15,500	6	-1
※	1,951	15,300	85	-39	600	1,836	15,600	4	1
-1,050	9,551	15,400	43	3	173	1,123	15,700	1	1
-1,236	7,844	15,500	57	3	145	1,115	15,800	1	0
852	4,133	15,600	59	18	150	866	15,900	0	0
945	4,118	15,700	3	-1	477	1,665	16,000	1	0
934	4,747	15,800	387	0	27	268	16,100	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
-478	126,390	1.0382	131,219	10,869	3,921	29,165	0.7377	21,516	2,593
昨日 P/C	0.9486	今日增減變化	0.0896		昨日 P/C	0.7496	今日增減變化	-0.0119	

更新日期：2023年1月16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16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	105,727,443	77,621,832	28,105,611	-6,570,633	3,888,856	852,002	3,036,854	-315,274	
投信	32,126,450	53,035,693	-20,909,243	810,831	402,104	0	402,104	291	
自營商	44,070,668	23,430,097	20,640,571	1,273,634	1,019,706	704,682	315,024	464,345	
	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	657,354	1,599,712	-942,358	29,930	133,878	21,828	112,050	-100,924	
投信	88,373	0	88,373	14,645	0	0	0	0	
自營商	539,233	311,695	227,538	80,082	91,704	151,369	-59,665	101,048	

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16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	33,092	19,572	13,520	1,097	28,348	20,441	7,907	3,316	
投信	200	200	0	0	600	141	459	0	
自營商	51,870	58,517	-6,647	-5,245	52,195	54,563	-2,368	-7,769	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	19,789	8,783	11,006	1,399	4,814	17,339	-12,525	-5,326	
特定法人(全月)	24,373	8,484	15,889	-1,241	13,360	19,493	-6,133	1,146	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	53,309	49,129	4,180	-2,903	52,645	52,928	-283	331	
十大交易人(全月)	80,645	74,523	6,122	-5,347	74,559	70,887	3,672	1,275	
全市場未沖銷(近月)			127,073	-485			140,360	10,350	
全市場未沖銷(全月)			180,133	4,525			189,684	13,532	

更新日期：2023年1月16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	14800	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	11.26%	較前一交易日	-0.26%
	買權隱含波動率	11.69%	較前一交易日	-0.31%
	賣權隱含波動率	10.86%	較前一交易日	-0.16%
電子選擇權	買權成交最大量	670	買權OI最大量	690
	賣權成交最大量	630	賣權OI最大量	630
金融選擇權	買權成交最大量	1600	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16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	14500	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	16.36%	較前一交易日	-0.31%
	買權隱含波動率	14.33%	較前一交易日	+0.34%
	賣權隱含波動率	18.99%	較前一交易日	-0.00%
	成交量P/C_Ratio值	0.768	較前一交易日	+0.08
	未平倉P/C_Ratio值	0.738	較前一交易日	-0.01
電子選擇權	買權成交最大量	670	買權OI最大量	690
	賣權成交最大量	630	賣權OI最大量	630
金融選擇權	買權成交最大量	1600	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16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

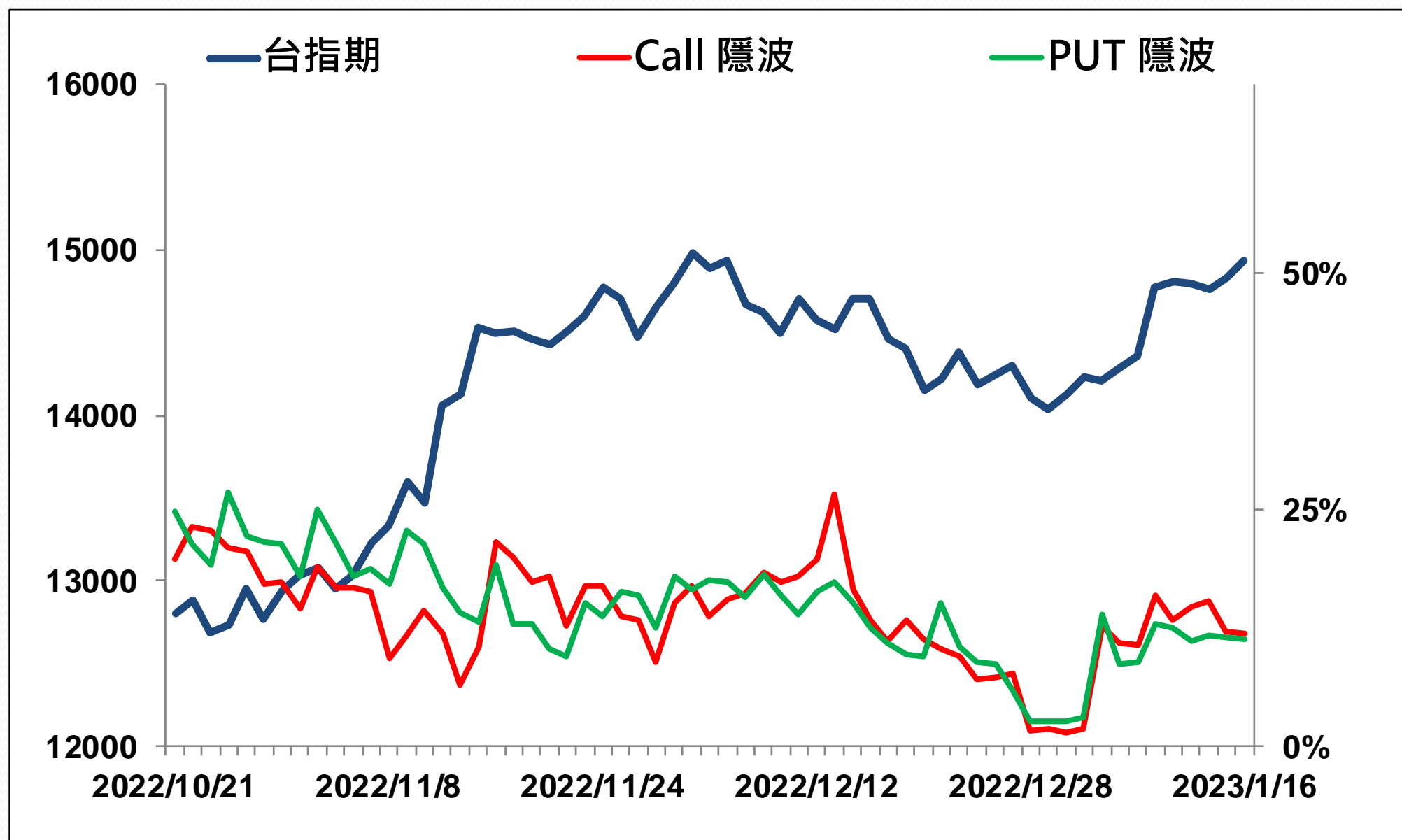
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



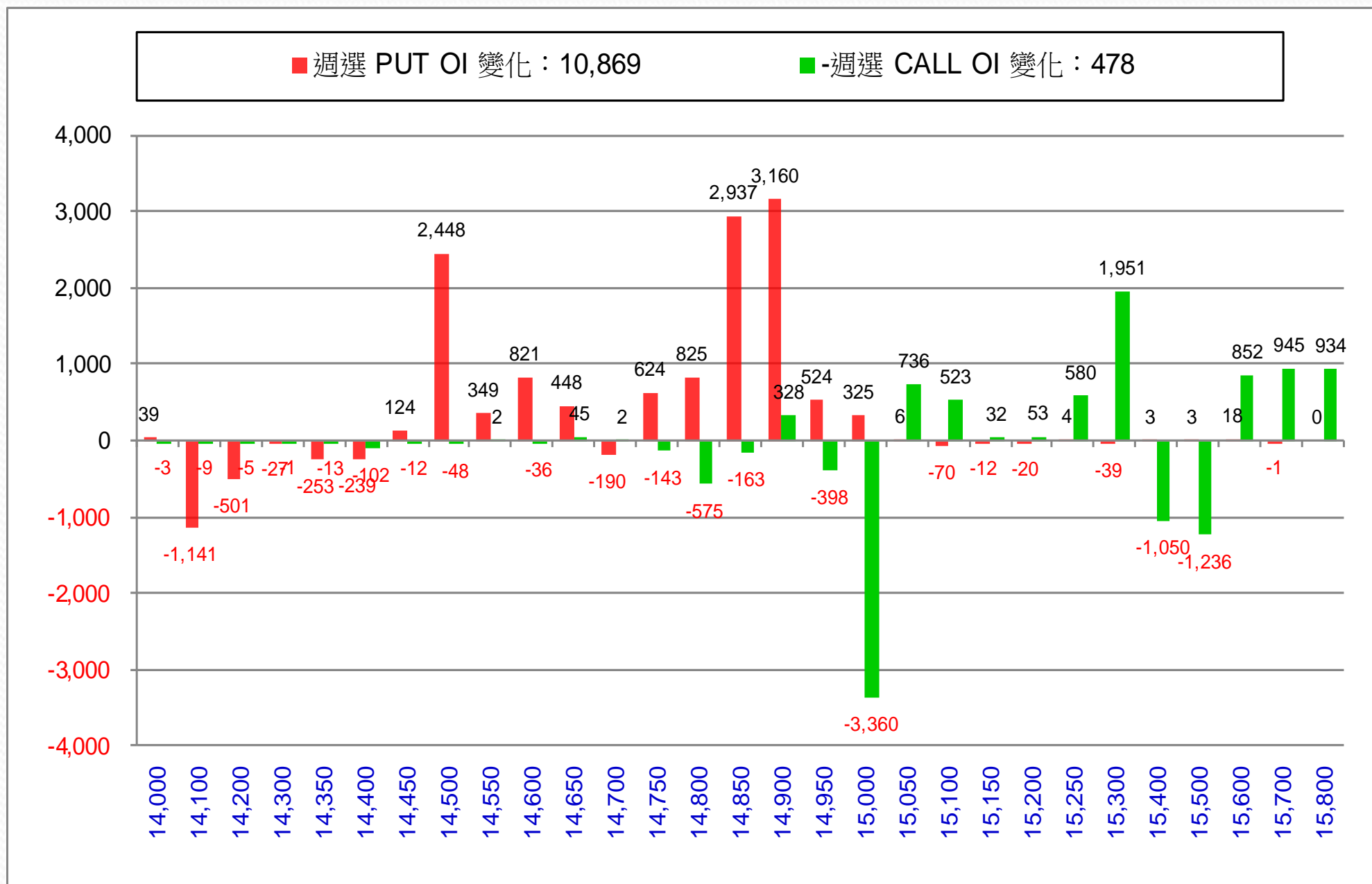
更新日期：2023年1月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年1月16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

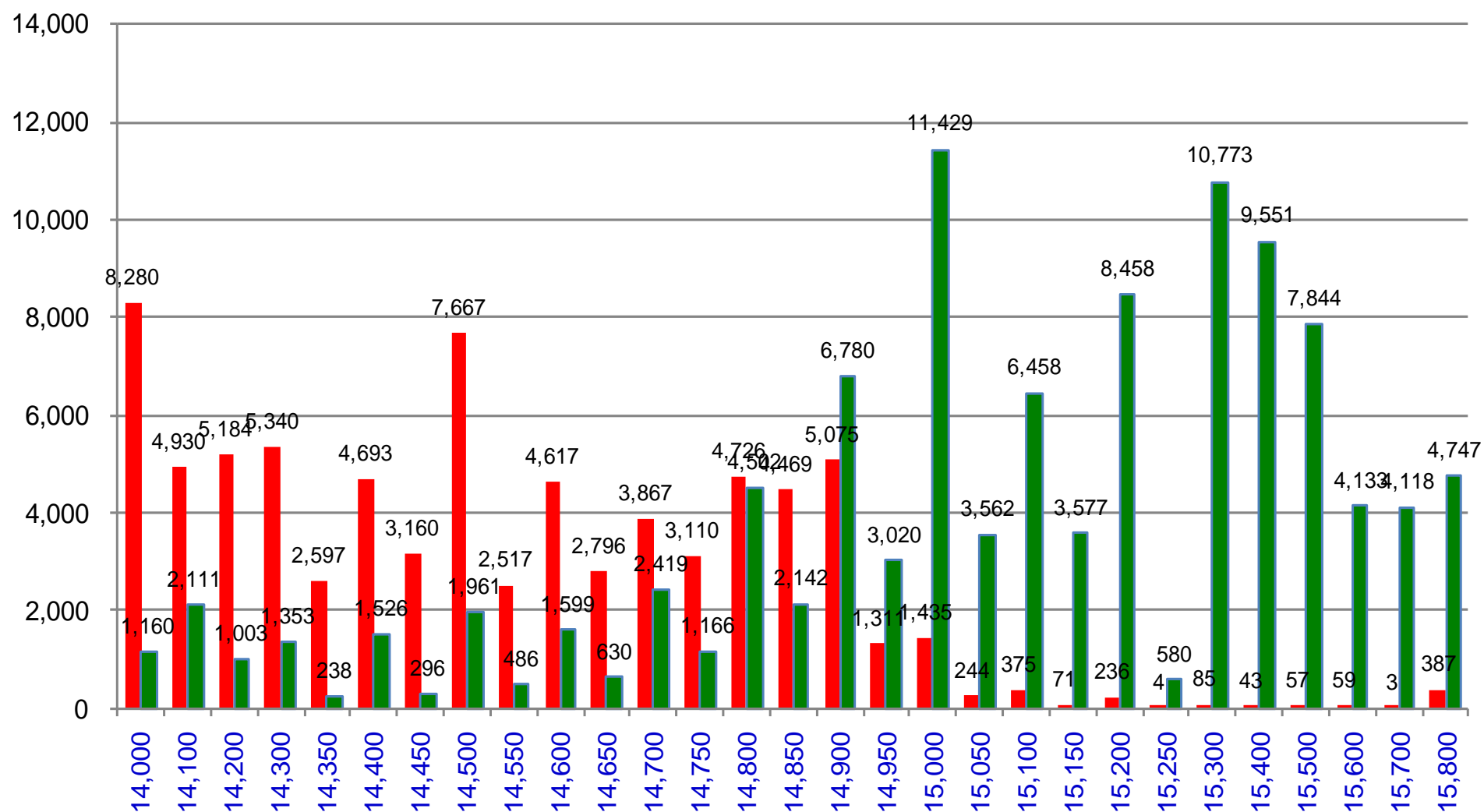


更新日期：2023年1月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：131,219

週選 CALL OI 總額：126,390



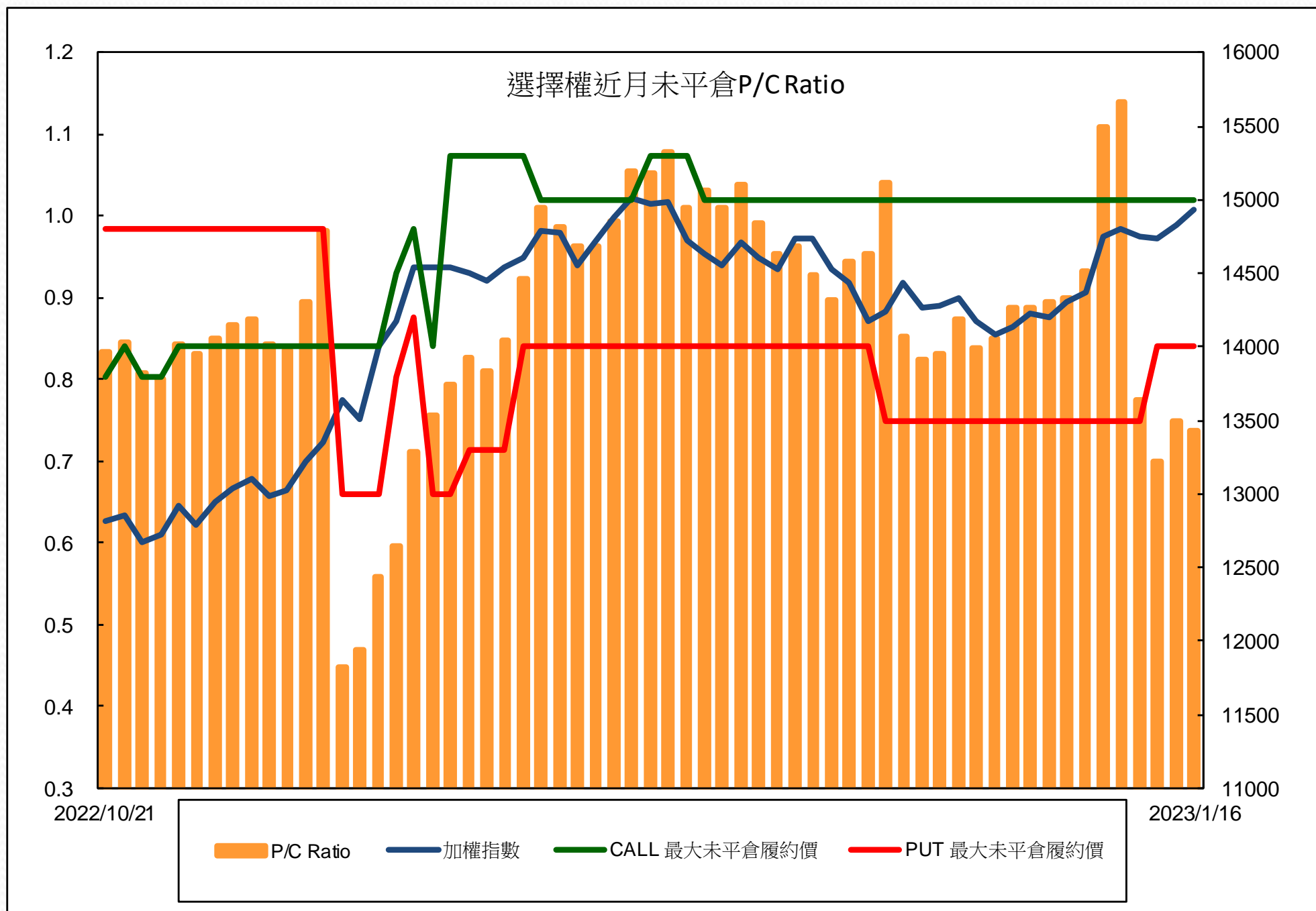
更新日期：2023年1月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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13日	55,222	56,624	-1,402
	1月16日	51,870	58,517	-6,647
Put	1月13日	52,647	47,246	5,401
	1月16日	52,195	54,563	-2,368

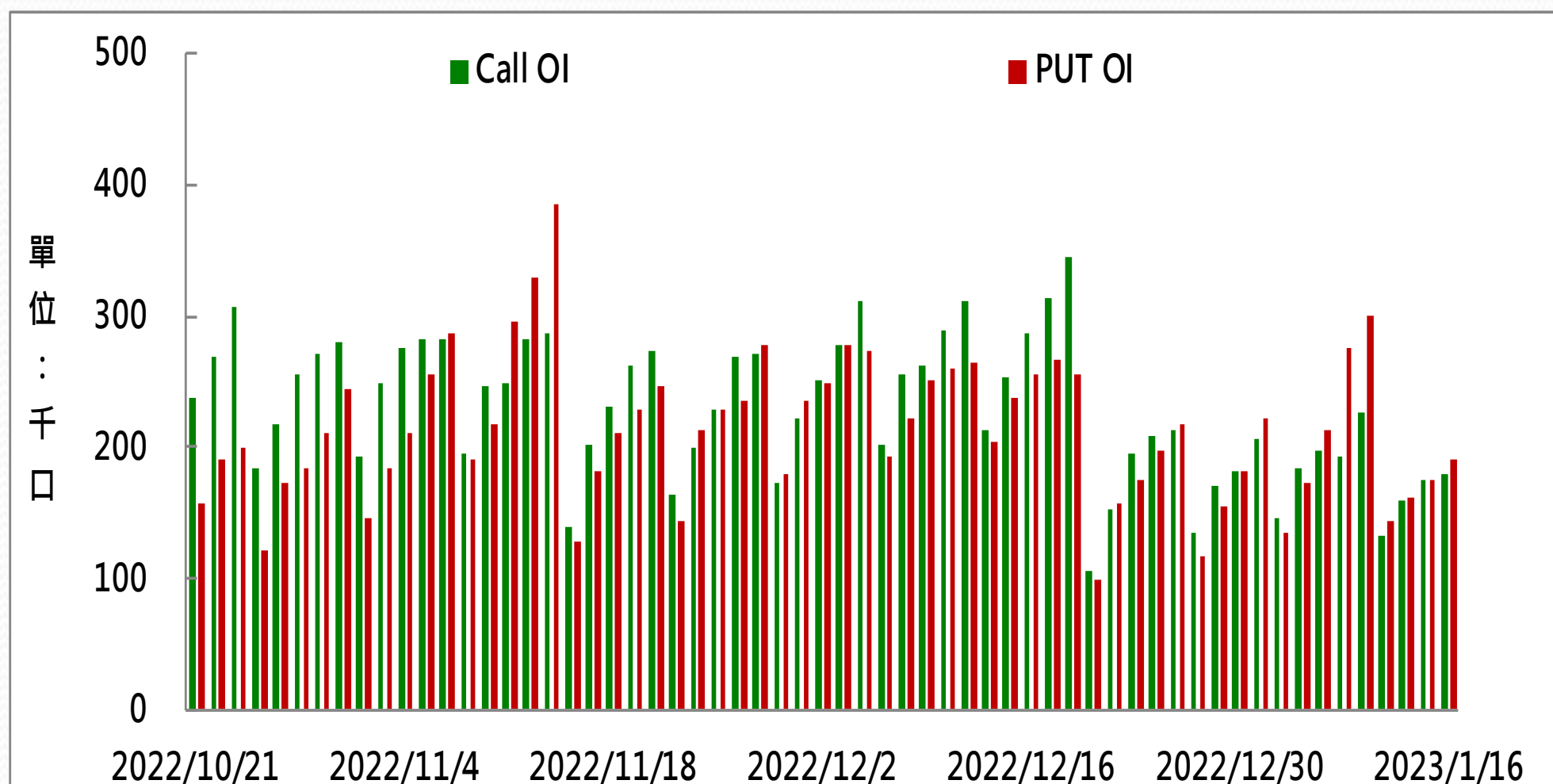
更新日期：2023年1月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年1月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

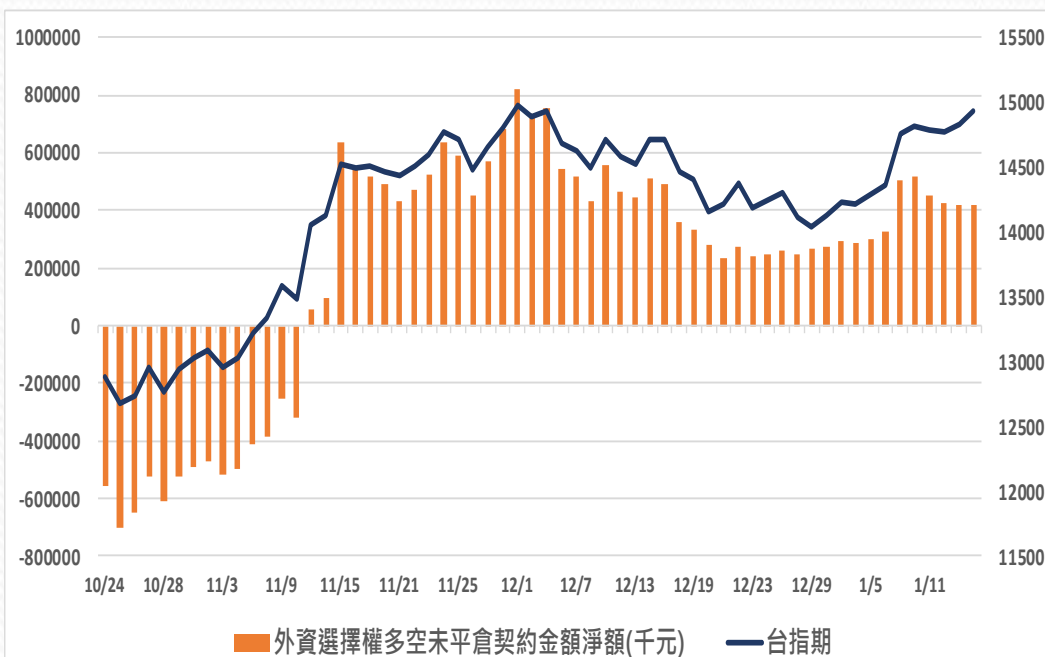
選擇權全月Put Call OI



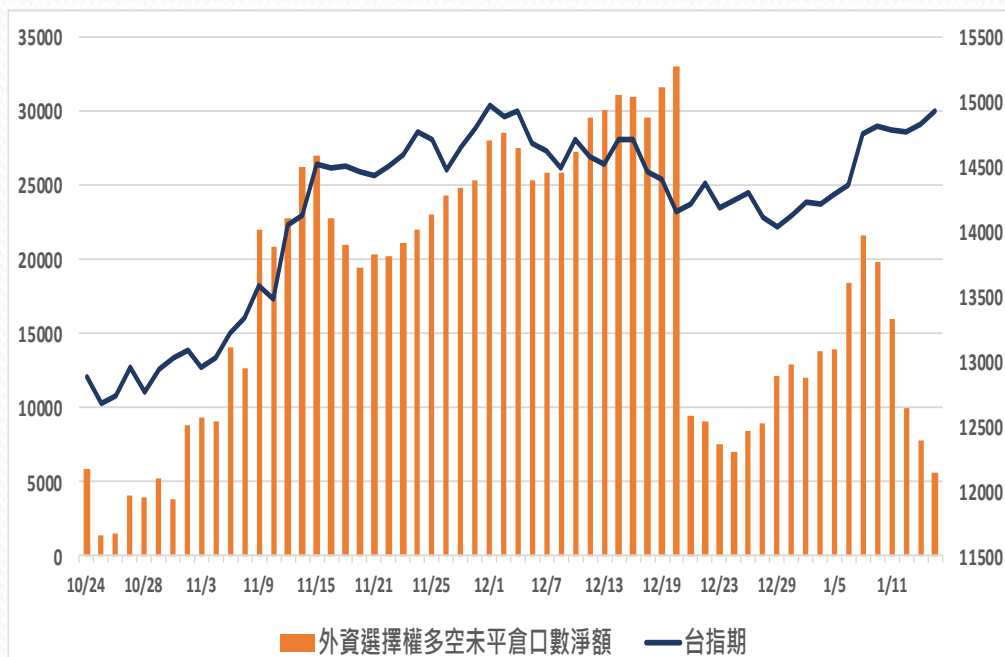
更新日期：2023年1月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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

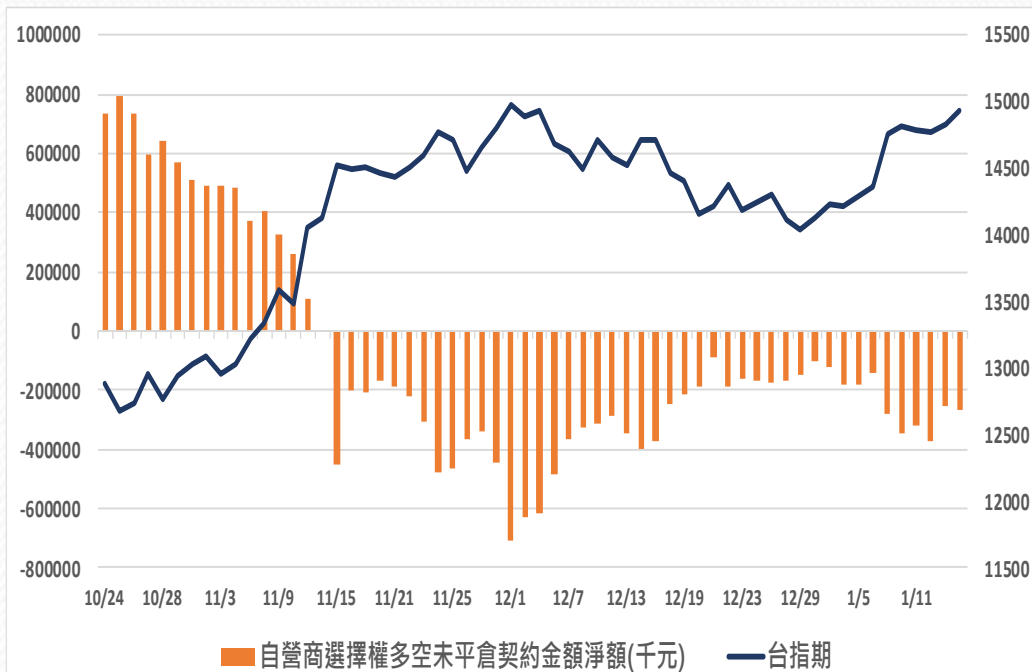
日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/1/10	14810	19838	-1817	519305	12755
2023/1/11	14791	16006	-3832	449187	-70118
2023/1/12	14766	10002	-6004	423269	-25918
2023/1/13	14834	7832	-2170	421569	-1700
2023/1/16	14938	5613	-2219	422178	609

更新日期：2023年1月16日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參

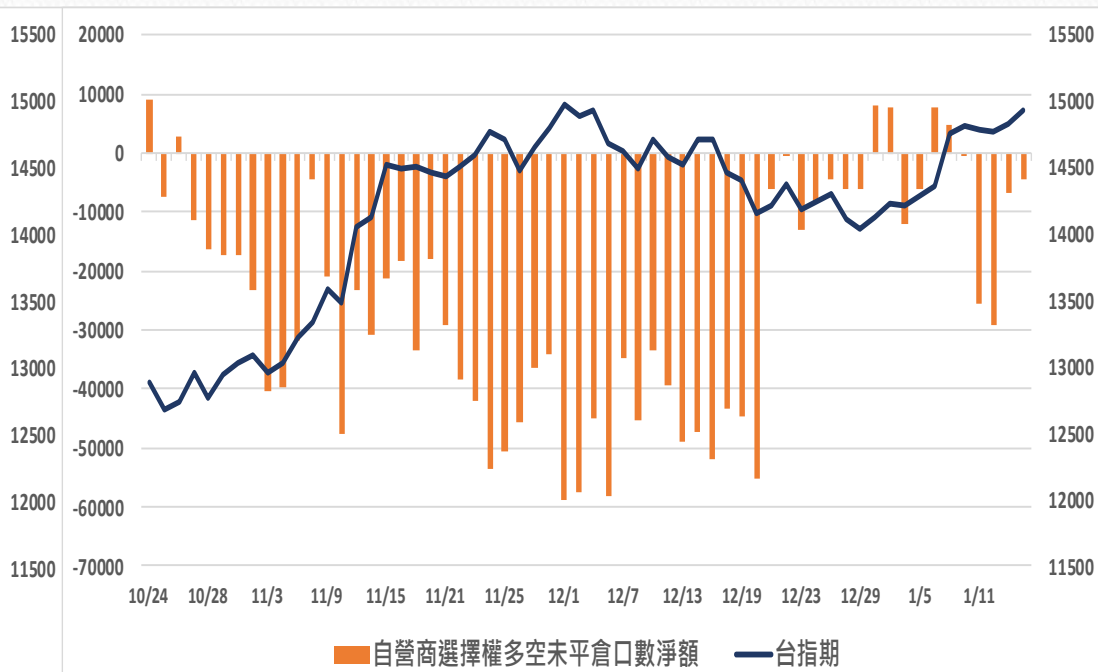
考

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



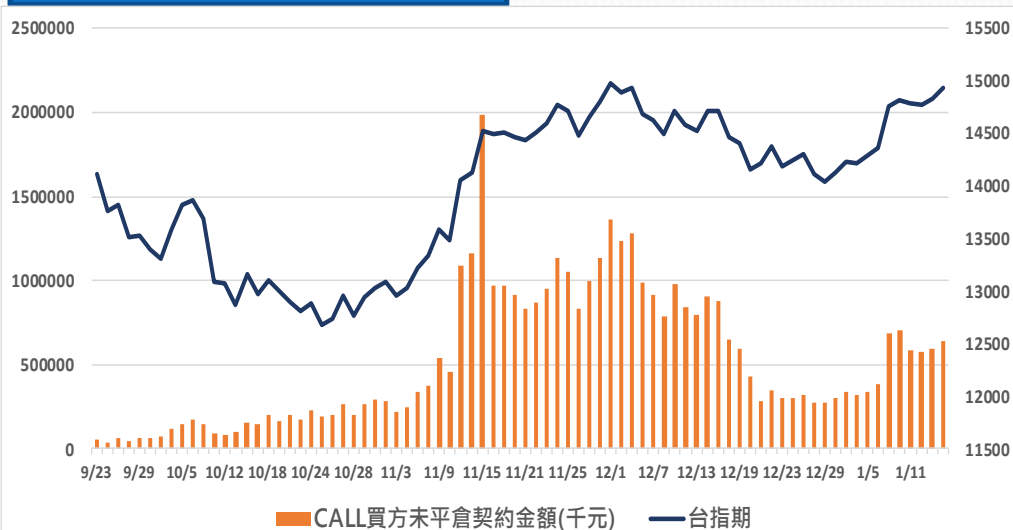
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/1/10	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
2023/1/16	14938	-4279	2524	-265431	-9725

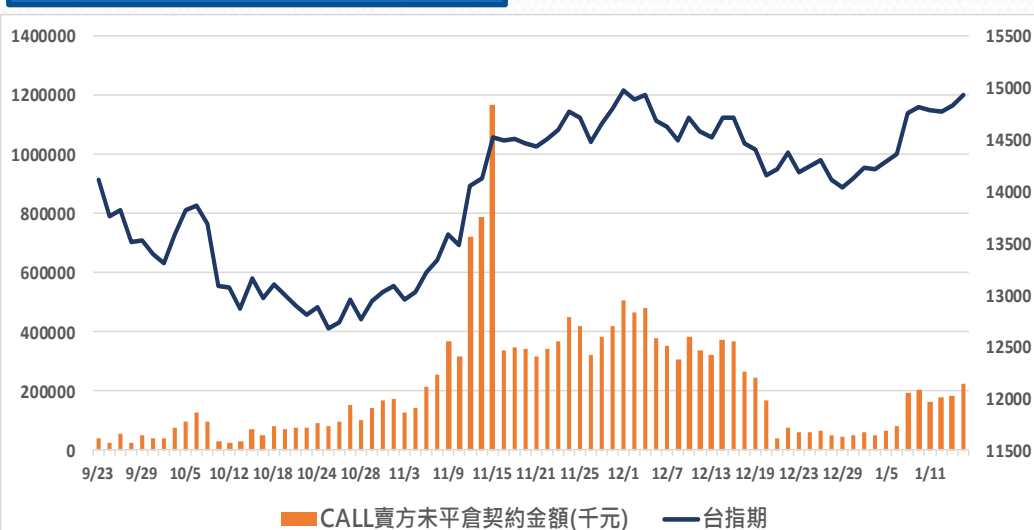
更新日期：2023年1月16日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

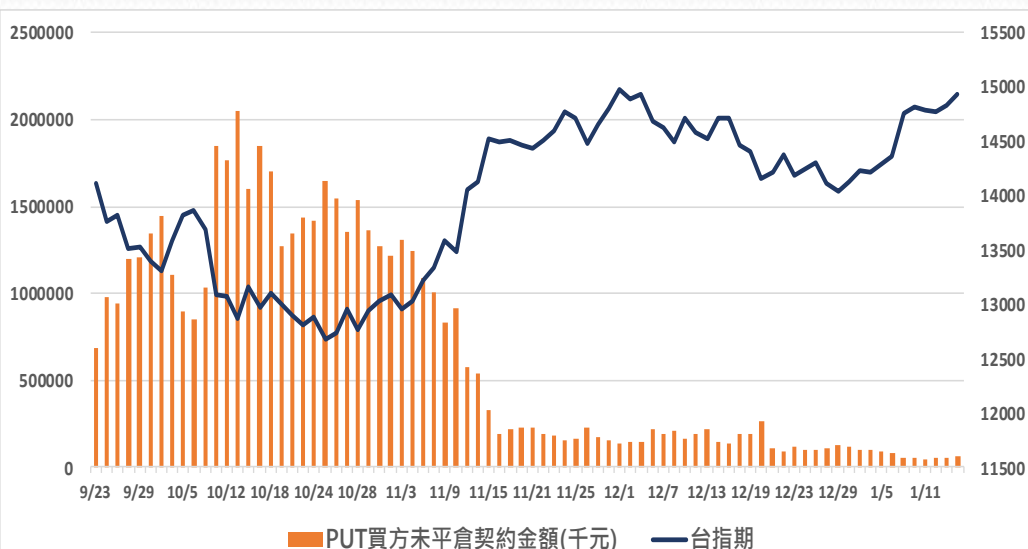
CALL買方未平倉金額



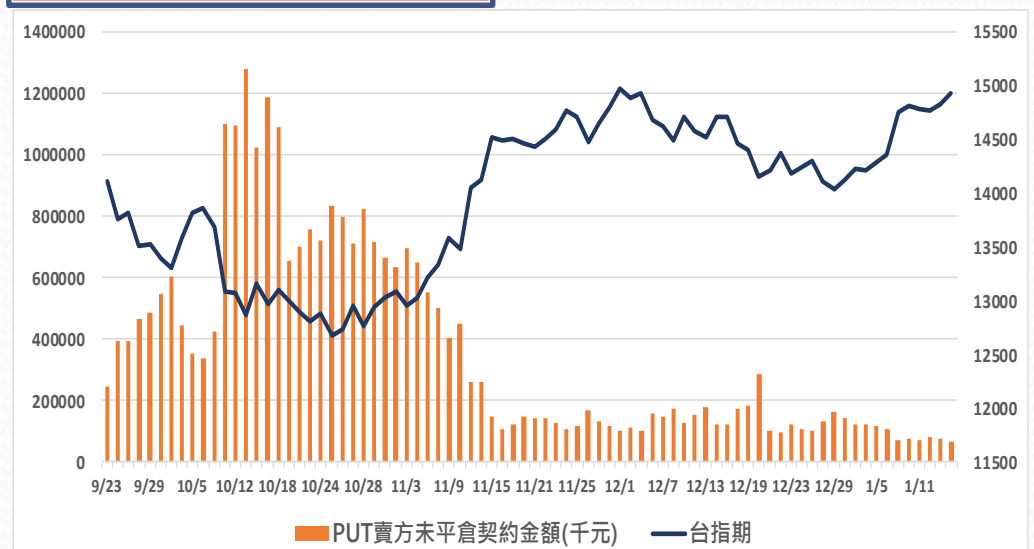
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



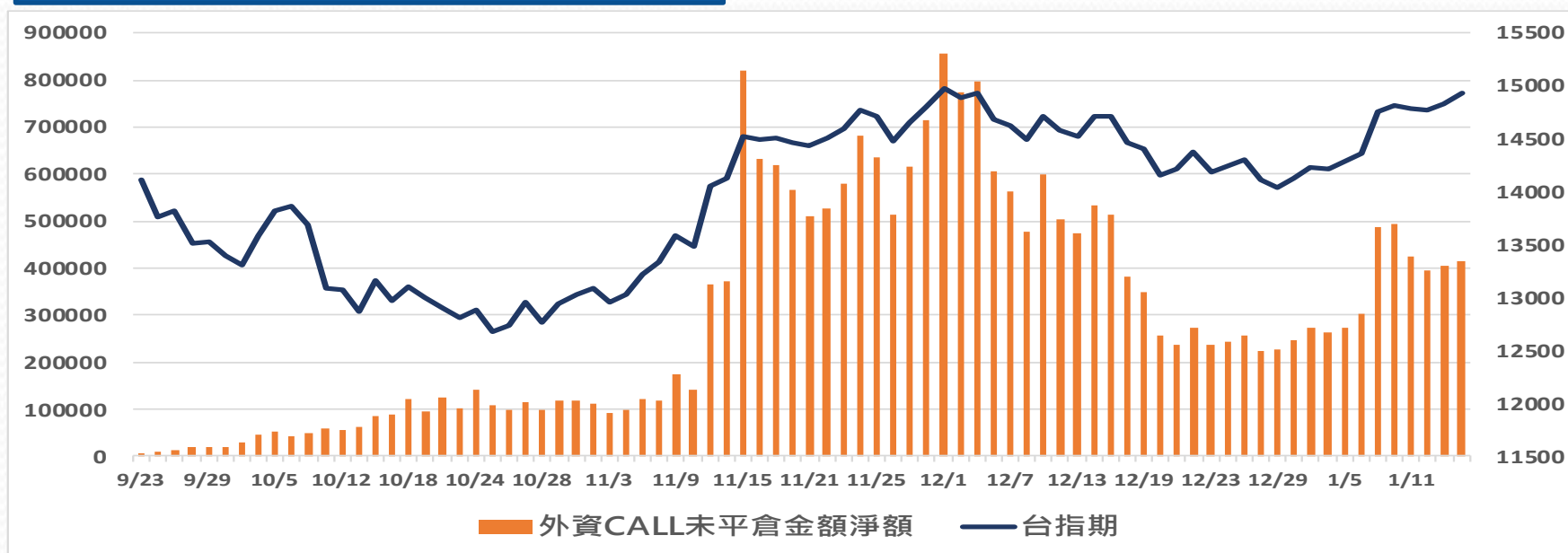
PUT賣方未平倉金額



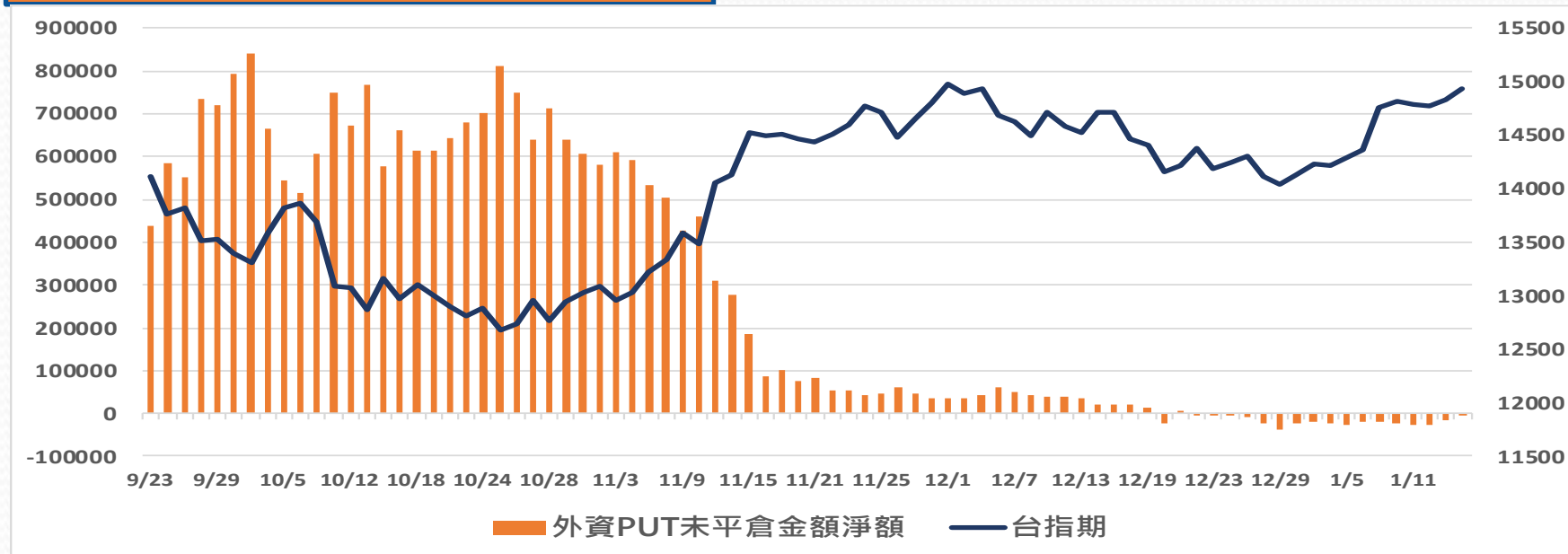
更新日期：2023年1月16日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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16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16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