

台指選擇權OI匯報

日期：2023/1/17 結算日：2023/1/30					日期：2023/1/17 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	1,163	14,000	8,717	437	0	4	13,300	834	164
-5	2,106	14,100	6,025	1,095	0	0	13,400	455	5
-18	985	14,200	5,443	259	0	3	13,500	810	82
-7	1,346	14,300	3,849	-1,491	0	0	13,600	1,035	48
14	252	14,350	2,503	-94	0	2	13,700	1,069	-5
-35	1,491	14,400	5,798	1,105	0	18	13,800	834	59
15	311	14,450	3,190	30	12	27	13,900	751	27
-155	1,806	14,500	7,649	-18	2	105	14,000	1,873	18
-29	457	14,550	3,142	625	3	65	14,100	1,182	131
-52	1,547	14,600	4,647	30	-1	96	14,200	1,509	393
-62	568	14,650	3,143	347	0	157	14,300	960	29
-369	2,050	14,700	4,919	1,052	0	289	14,400	1,116	135
-120	1,046	14,750	3,234	124	-12	382	14,500	1,131	238
-52	4,450	14,800	4,512	-214	-250	1,520	14,600	1,999	1,469
-171	1,971	14,850	5,132	663	19	1,246	14,700	749	134
-1,470	5,310	14,900	5,567	492	-17	1,271	14,800	711	186
65	3,085	14,950	1,909	598	66	848	14,900	1,167	381
-2,253	9,176	15,000	1,407	-28	195	1,659	15,000	342	34
-934	2,628	15,050	245	1	-18	1,767	15,100	173	6
-629	5,829	15,100	388	13	358	1,721	15,200	62	38
333	3,910	15,150	113	42	208	1,749	15,300	52	43
476	8,934	15,200	264	28	259	4,019	15,400	19	8
2,534	3,114	15,250	9	5	308	2,872	15,500	6	0
2,486	13,259	15,300	102	17	103	1,939	15,600	69	65
3,201	3,201	15,350	0	0	471	1,594	15,700	44	43
2,216	11,767	15,400	44	1	328	1,443	15,800	2	1
325	8,169	15,500	61	4	54	920	15,900	0	0
586	4,719	15,600	64	5	67	1,732	16,000	1	0
269	4,387	15,700	7	4	116	384	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
5,613	132,003	1.0301	135,982	4,763	2,636	31,801	0.8315	26,443	4,927
昨日 P/C	1.0382	今日增減變化	-0.0081		昨日 P/C	0.7377	今日增減變化	0.0938	

更新日期：2023年1月17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17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	107,805,988	79,924,080	27,881,908	-223,703	3,765,428	916,018	2,849,410	-187,444	
投信	29,694,915	52,570,593	-22,875,678	-1,966,435	400,999	0	400,999	-1,105	
自營商	43,985,007	23,505,654	20,479,353	-161,218	807,615	677,741	129,874	-185,150	
	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	611,493	1,593,882	-982,389	-40,031	112,374	10,216	102,158	-9,892	
投信	88,498	0	88,498	125	0	0	0	0	
自營商	322,600	107,052	215,548	-11,990	103,710	157,729	-54,019	5,646	

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17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	33,660	18,521	15,139	1,619	31,254	21,182	10,072	2,165	
投信	200	200	0	0	750	141	609	150	
自營商	59,828	66,733	-6,905	-258	52,748	61,434	-8,686	-6,318	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	20,976	4,765	16,211	5,205	4,814	20,913	-16,099	-3,574	
特定法人(全月)	24,440	8,659	15,781	-108	9,869	23,217	-13,348	-7,215	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	56,870	51,366	5,504	1,324	59,380	53,321	6,059	6,342	
十大交易人(全月)	85,694	80,055	5,639	-483	84,737	72,091	12,646	8,974	
全市場未沖銷(近月)			132,680	5,607			145,310	4,950	
全市場未沖銷(全月)			191,808	11,675			200,645	10,961	

更新日期：2023年1月17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	15300
	賣權成交最大量	14900	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	10.11%	較前一交易日	-1.14%
	買權隱含波動率	10.27%	較前一交易日	-1.42%
	賣權隱含波動率	9.96%	較前一交易日	-0.89%
電子選擇權	買權成交最大量	740	買權OI最大量	730
	賣權成交最大量	650	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	1520	賣權OI最大量	1360

更新日期：2023年1月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

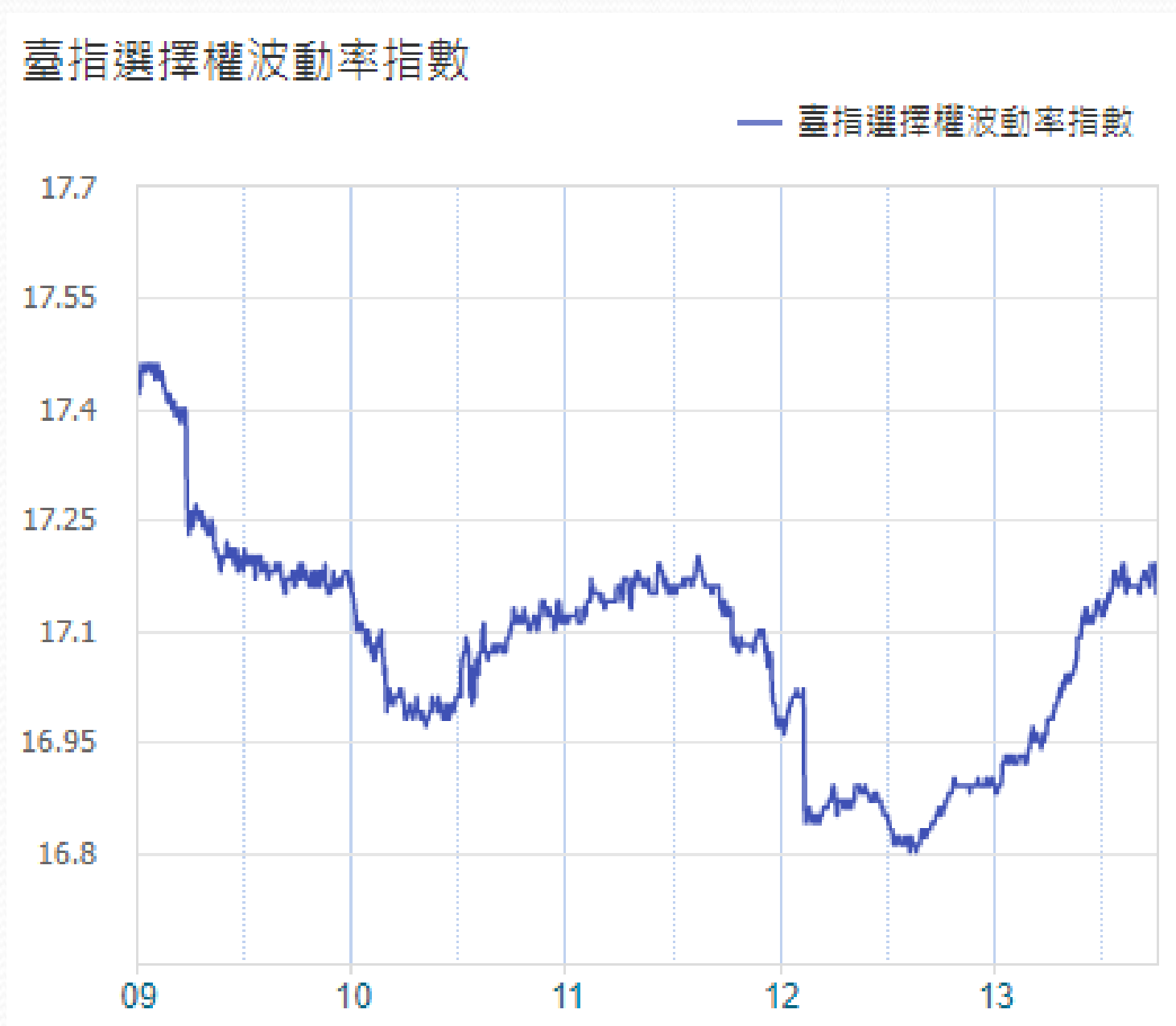
台指選擇權匯報

2023年02月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15100	買權OI最大量	15400
	賣權成交最大量	14600	賣權OI最大量	13000
	整體隱含波動率	16.93%	較前一交易日	-0.57%
	買權隱含波動率	14.01%	較前一交易日	-0.32%
	賣權隱含波動率	19.58%	較前一交易日	+0.60%
	成交量P/C_Ratio值	1.040	較前一交易日	+0.27
	未平倉P/C_Ratio值	0.832	較前一交易日	+0.09
電子選擇權	買權成交最大量	740	買權OI最大量	730
	賣權成交最大量	650	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	1520	賣權OI最大量	1360

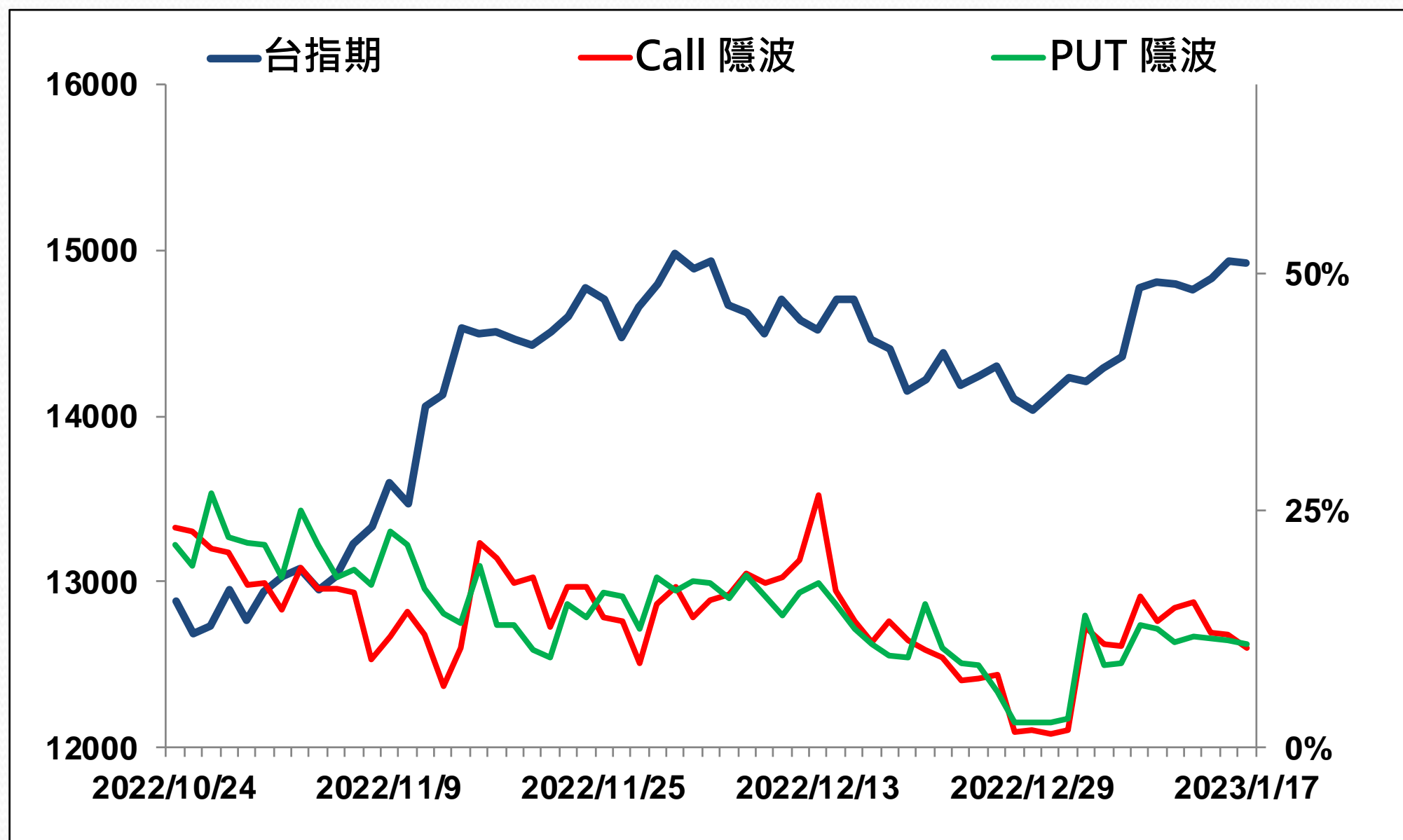
更新日期：2023年1月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



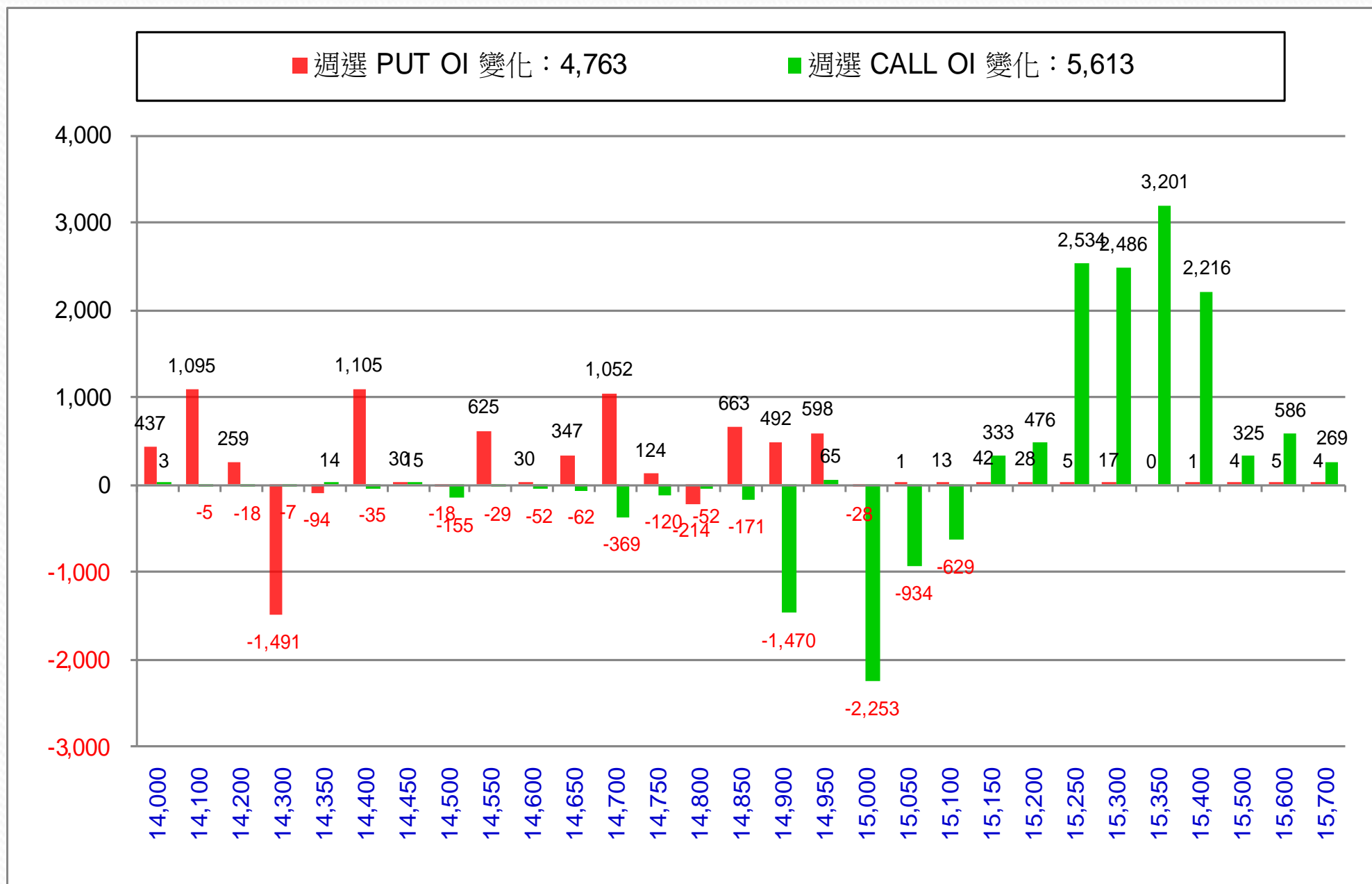
更新日期：2023年1月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年1月17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

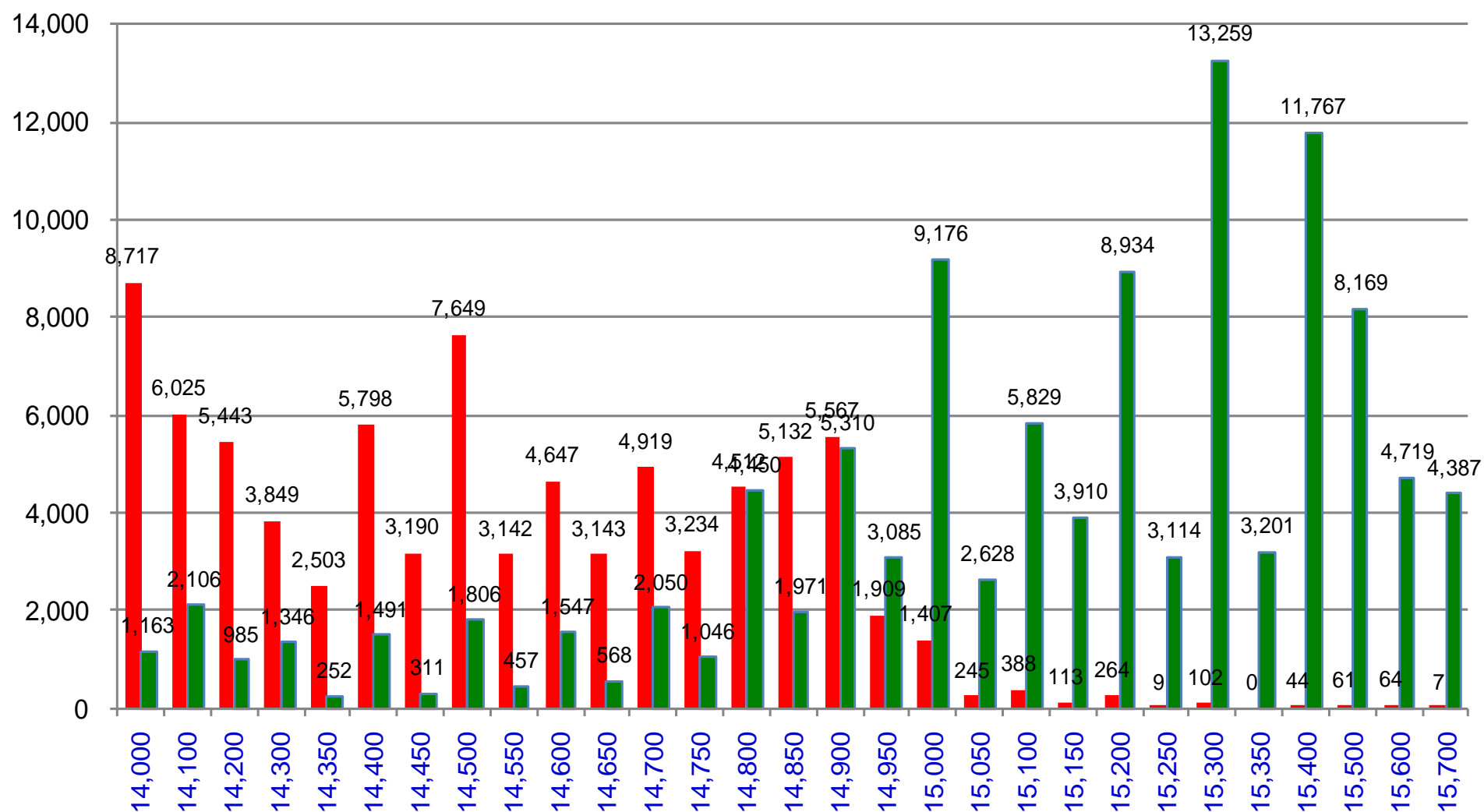


更新日期：2023年1月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：135,982

週選 CALL OI 總額：132,003



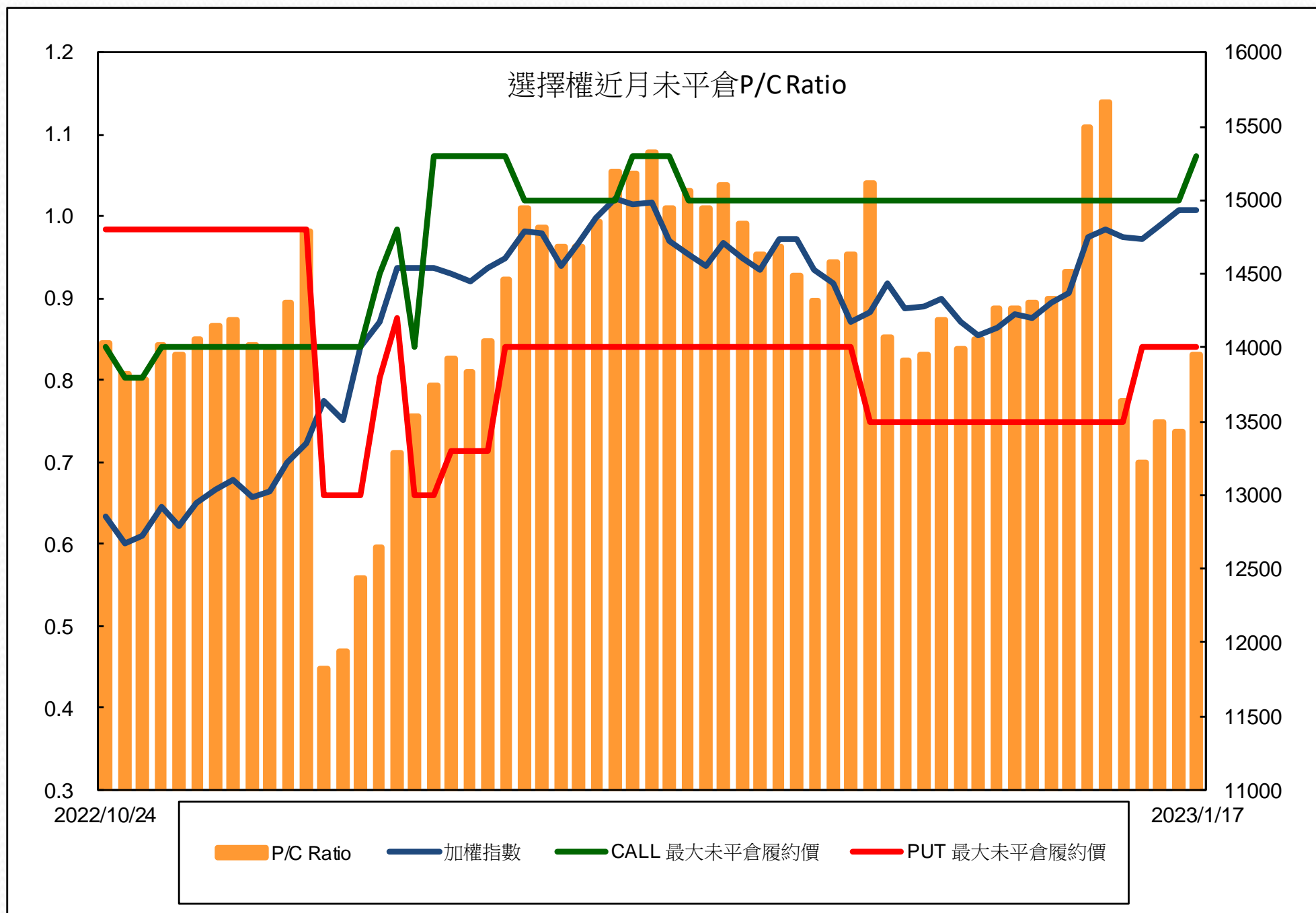
更新日期：2023年1月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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16日	51,870	58,517	-6,647
	1月17日	59,828	66,733	-6,905
Put	1月16日	52,195	54,563	-2,368
	1月17日	52,748	61,434	-8,686

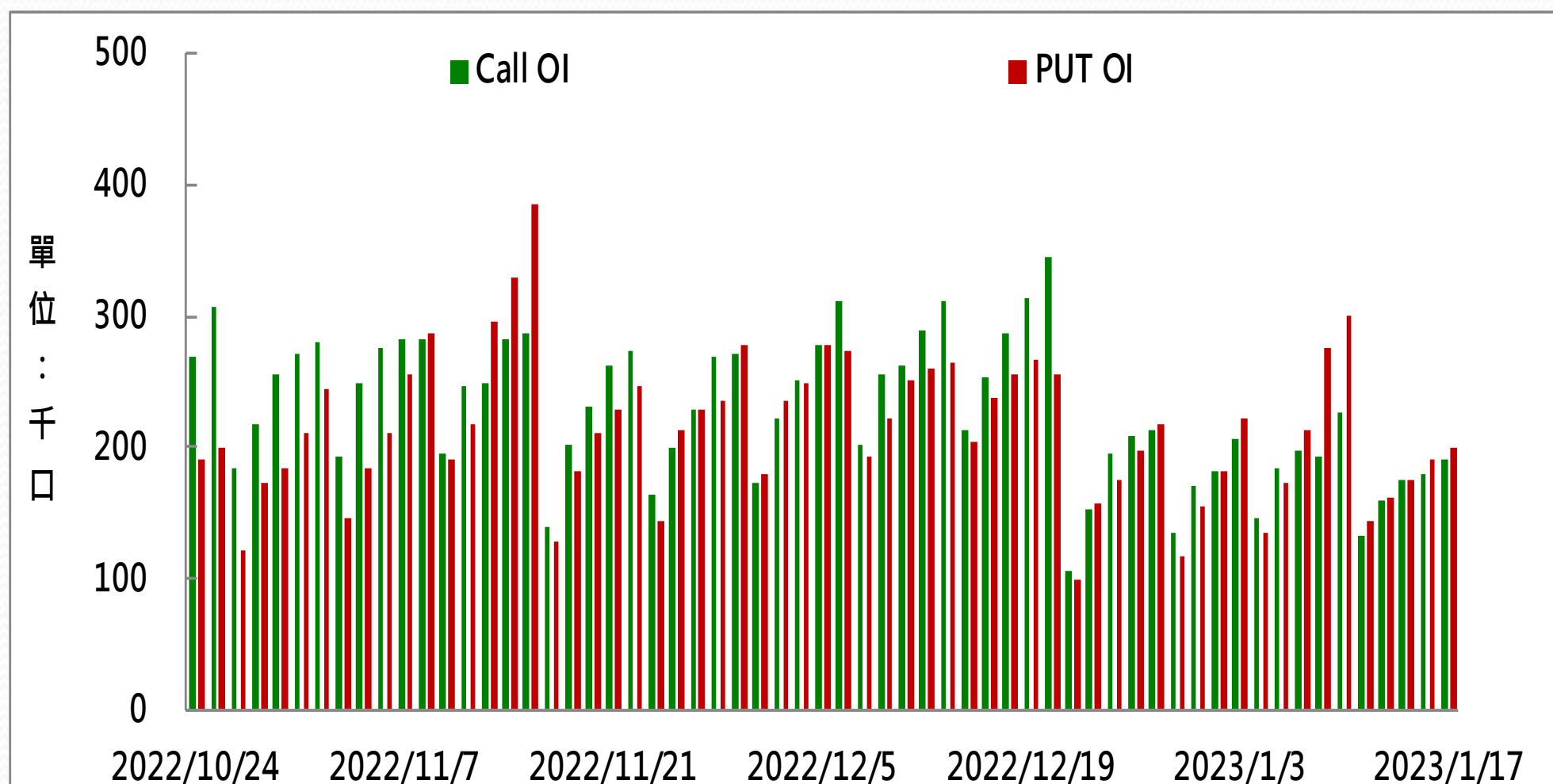
更新日期：2023年1月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年1月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

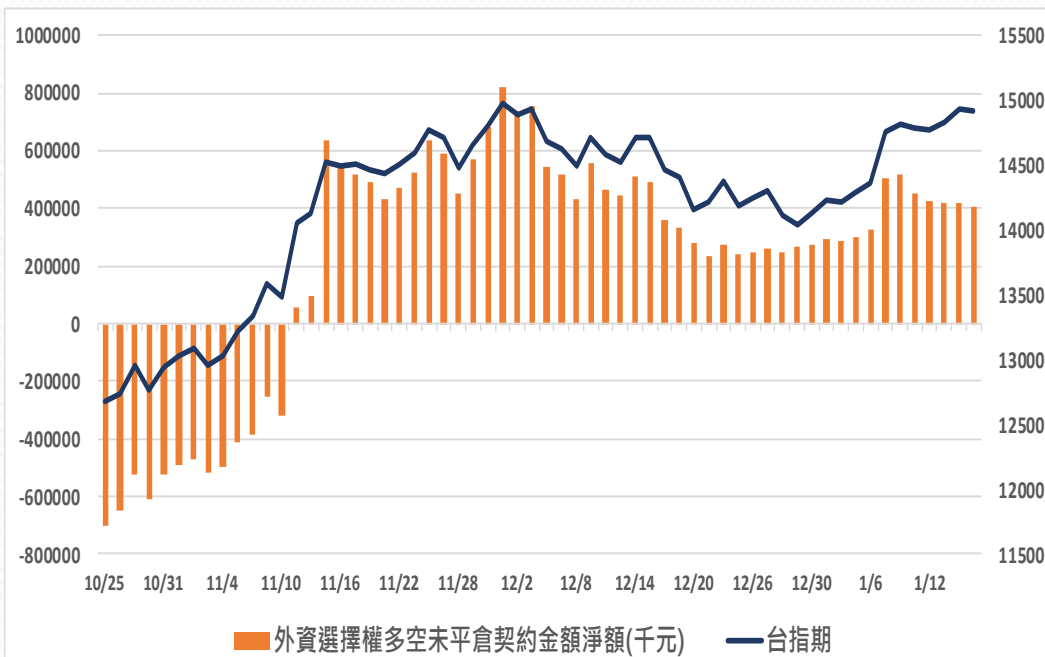
選擇權全月Put Call OI



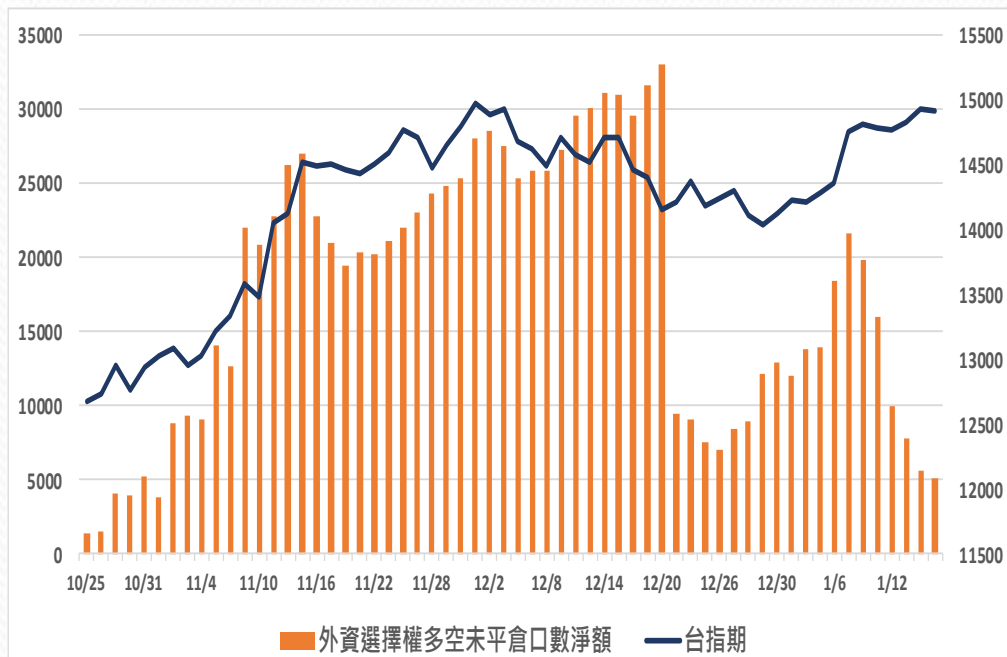
更新日期：2023年1月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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

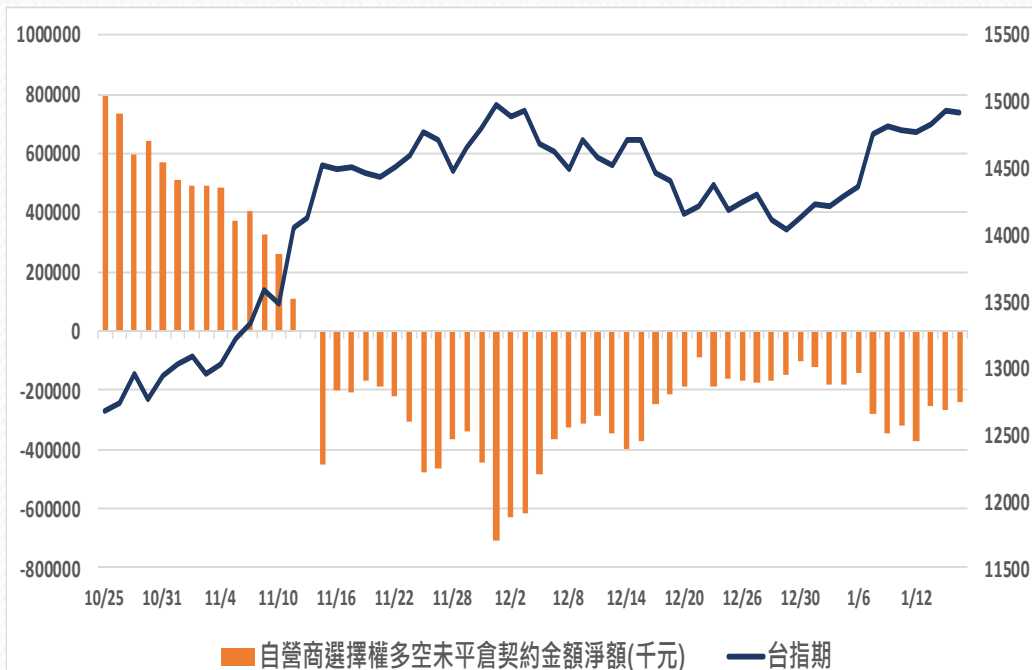
日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/1/11	14791	16006	-3832	449187	-70118
2023/1/12	14766	10002	-6004	423269	-25918
2023/1/13	14834	7832	-2170	421569	-1700
2023/1/16	14938	5613	-2219	422178	609
2023/1/17	14925	5067	-546	403693	-18485

更新日期：2023年1月17日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參

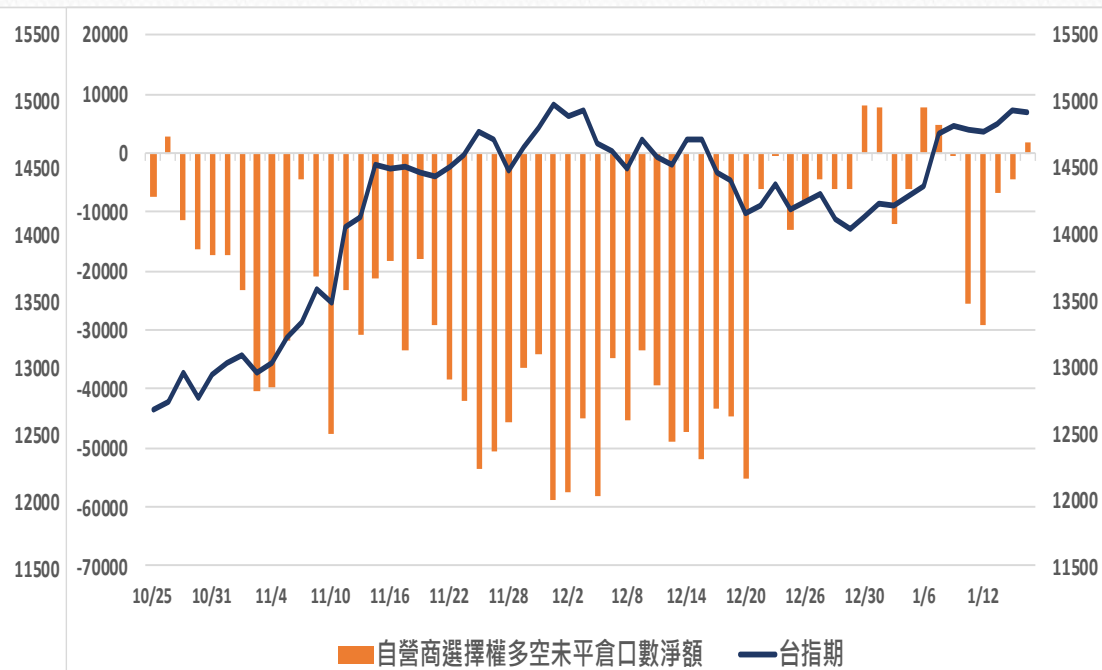
考

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



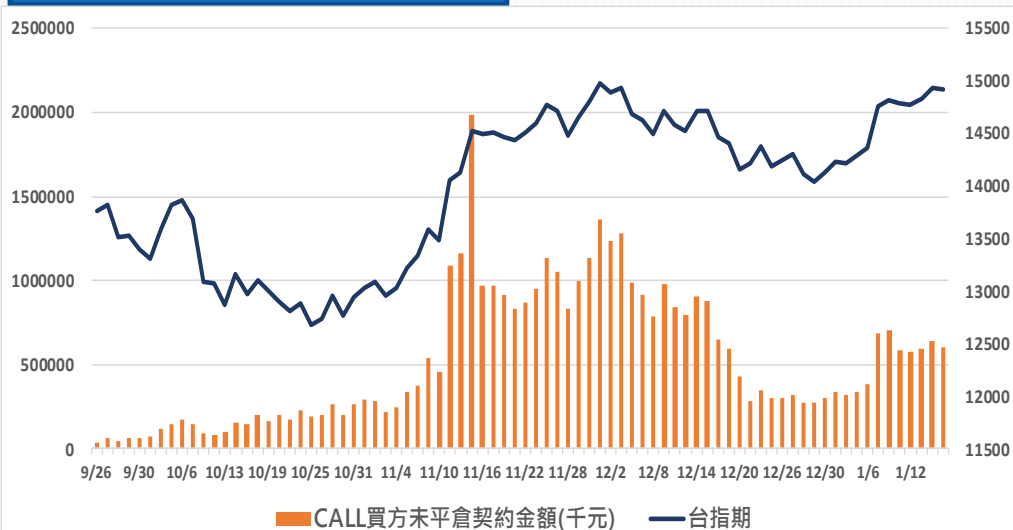
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/1/11	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
2023/1/17	14925	1781	6060	-240806	24625

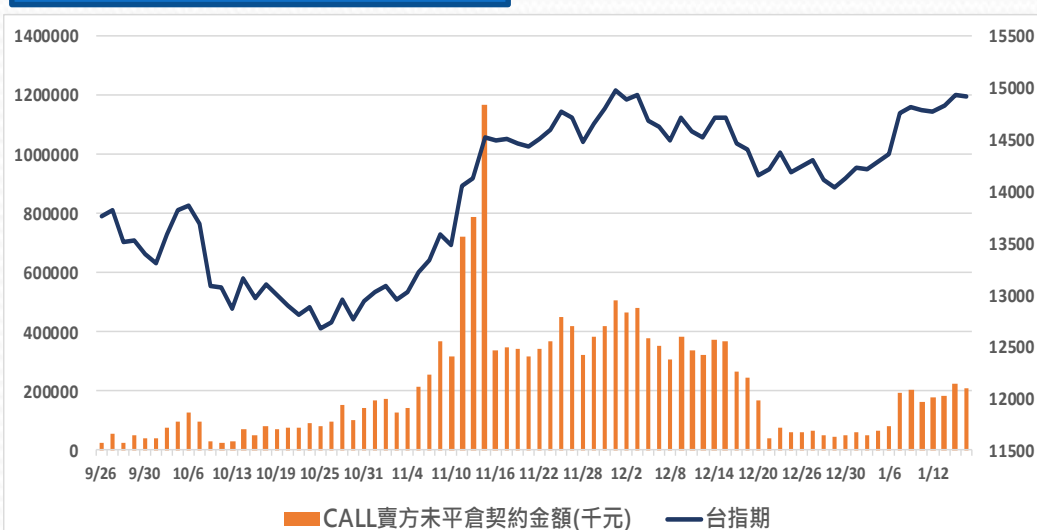
更新日期：2023年1月17日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

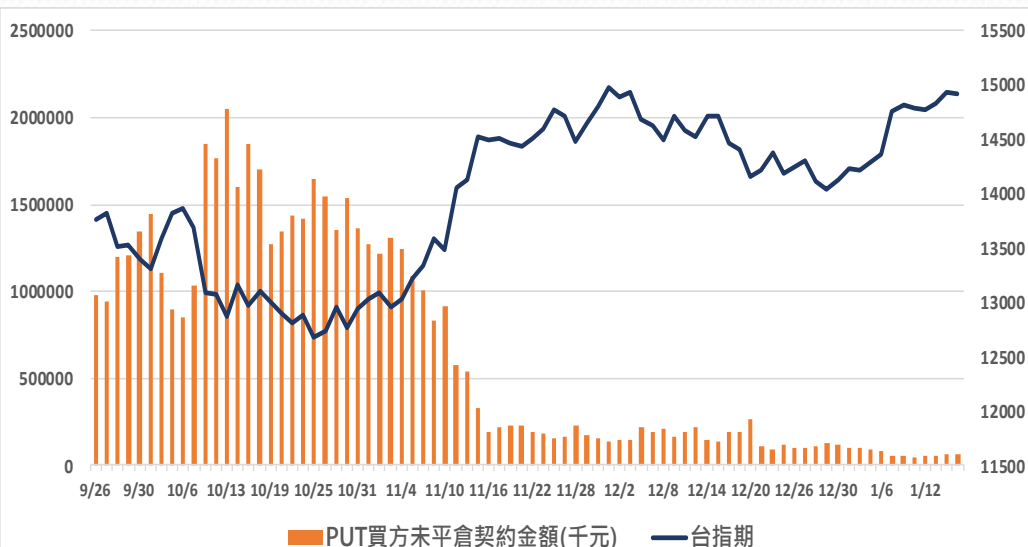
CALL買方未平倉金額



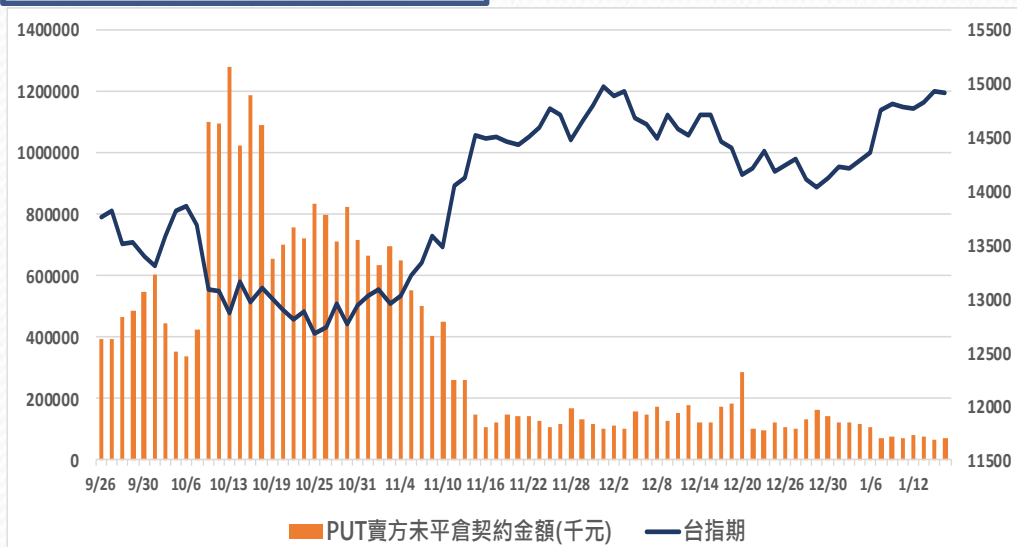
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



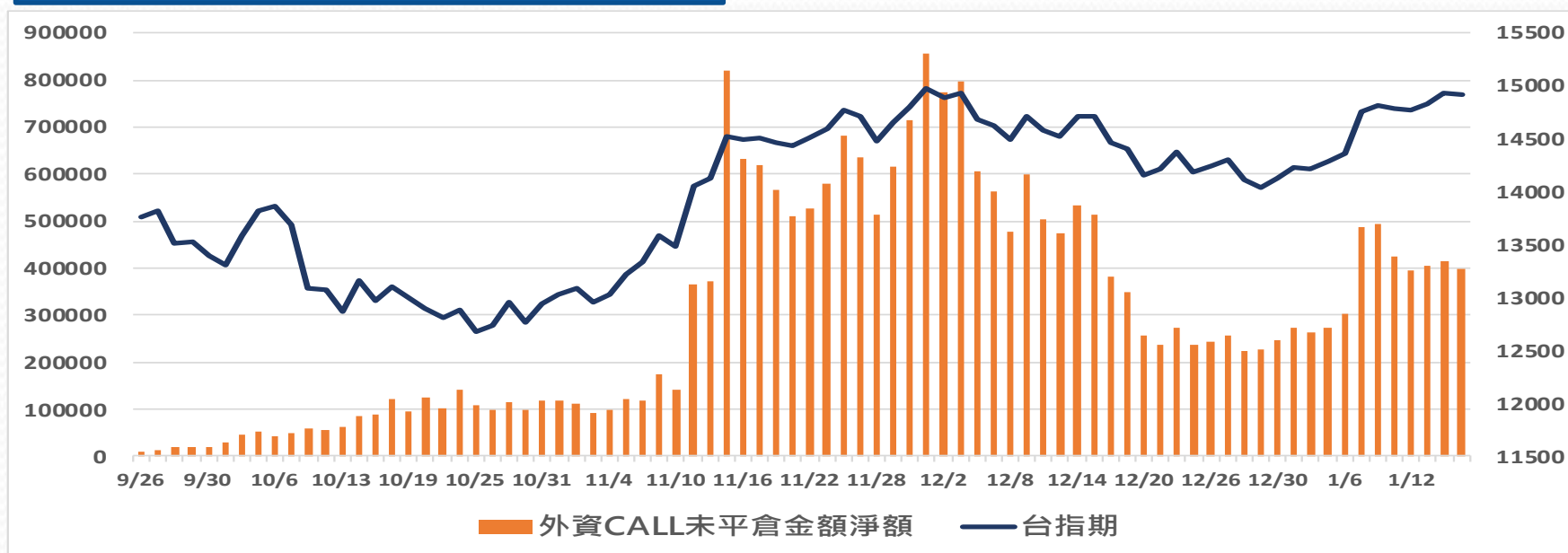
PUT賣方未平倉金額



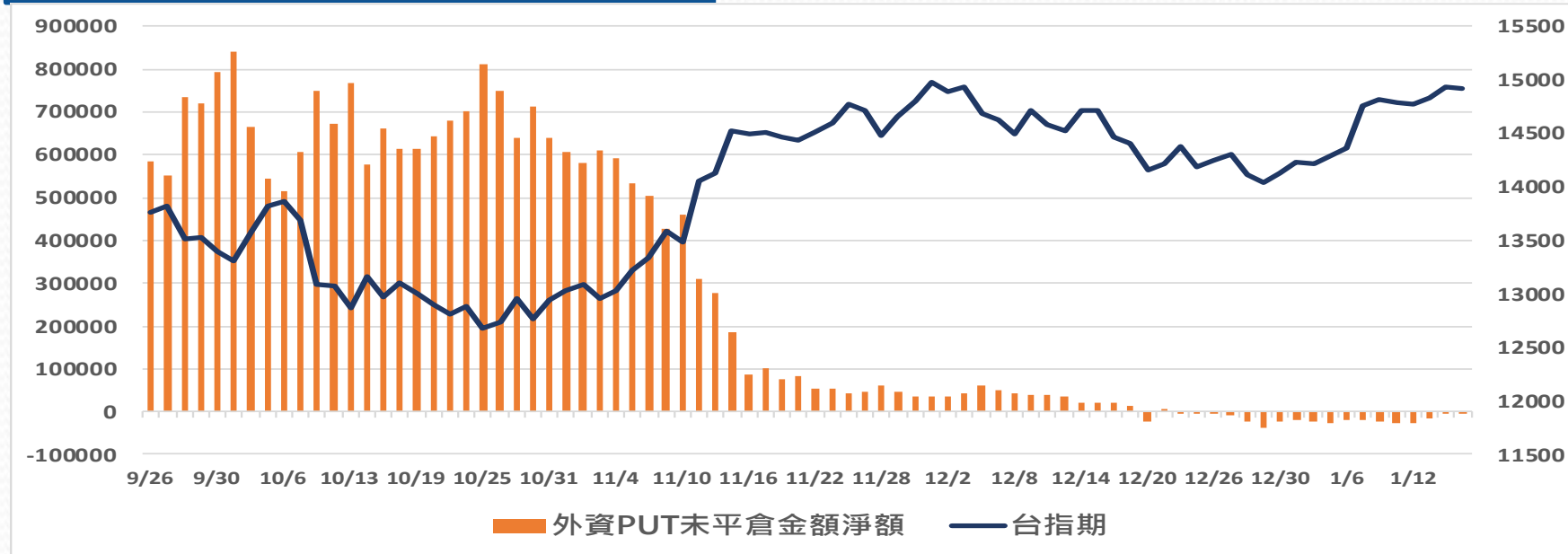
更新日期：2023年1月17日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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17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17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