

台指選擇權OI匯報

日期：2023/1/30 結算日：2023/2/1					日期：2023/1/30 結算日：2023/2/15				
202302W1					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	0	14,700	70	70	30	57	13,900	681	-70
0	0	14,750	218	218	-2	103	14,000	2,087	214
1	1	14,800	558	558	-1	64	14,100	1,447	265
5	5	14,850	199	199	-5	91	14,200	1,438	-71
0	0	14,900	235	235	-5	152	14,300	1,154	194
0	0	14,950	473	473	-2	287	14,400	1,387	271
9	9	15,000	1,672	1,672	-8	374	14,500	1,572	441
4	4	15,050	724	724	-8	1,512	14,600	2,210	211
15	15	15,100	1,824	1,824	-45	1,201	14,700	1,011	262
11	11	15,150	1,544	1,544	-20	1,251	14,800	1,533	822
38	38	15,200	1,951	1,951	-28	820	14,900	1,788	621
101	101	15,250	1,677	1,677	-85	1,574	15,000	1,503	1,161
415	415	15,300	2,648	2,648	-234	1,533	15,100	721	548
494	494	15,350	2,202	2,202	-246	1,475	15,200	810	748
1,433	1,433	15,400	2,621	2,621	-291	1,458	15,300	395	343
0	0	15,450	0	0	-45	3,974	15,400	558	539
2,571	2,571	15,500	1,289	1,289	216	3,088	15,500	295	289
3,997	3,997	15,600	296	296	212	2,151	15,600	296	227
※ 4,093	4,093	15,700	72	72	330	1,924	15,700	131	87
1,554	1,554	15,800	22	22	652	2,095	15,800	45	43
1,267	1,267	15,900	25	25	※ 1,498	2,418	15,900	8	8
672	672	16,000	0	0	429	2,161	16,000	9	8
147	147	16,100	0	0	549	933	16,100	8	7
33	33	16,200	0	0	295	787	16,200	5	0
25	25	16,300	0	0	456	1,109	16,300	2	1
0	0	16,400	0	0	145	191	16,400	1	0
0	0	16,500	0	0	767	1,218	16,500	1	0
0	0	16,600	0	0	7	325	16,600	1	0
0	0	16,700	0	0	0	206	16,700	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
16,886	16,886	1.2074	20,389	20,389	5,395	37,196	0.9369	34,848	8,405
昨日 P/C	1.0301	今日增減變化	0.1773		昨日 P/C	0.8315	今日增減變化	0.1054	

更新日期：2023年1月30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30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	99,233,073	74,192,341	25,040,732	-2,841,176	3,112,920	837,101	2,275,819	-573,591		
投信	31,260,237	49,446,943	-18,186,706	4,688,972	421,457	0	421,457	20,458		
自營商	33,446,397	17,917,728	15,528,669	-4,950,684	729,459	624,919	104,540	-25,334		
	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	538,441	1,547,823	-1,009,382	-26,993	8,869	1,478	7,391	-94,767		
投信	89,479	0	89,479	981	0	0	0	0		
自營商	213,493	67,501	145,992	-69,556	75,383	63,558	11,825	65,844		

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30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	11,735	7,956	3,779	-11,360	7,147	9,383	-2,236	-12,308		
投信	0	0	0	0	0	111	-111	-720		
自營商	33,450	37,665	-4,215	2,690	24,355	32,667	-8,312	374		
特定法人(週)	0	0	0	---	---	---	---	---		
特定法人(近月)	5,237	6,533	-1,296	---	3,474	2,208	1,266	---		
特定法人(全月)	7,195	5,160	2,035	-13,746	7,762	4,531	3,231	16,579		
十大交易人(週)	8,186	12,264	-4,078	---	---	---	---	---		
十大交易人(近月)	19,936	17,255	2,681	---	17,629	11,668	5,961	---		
十大交易人(全月)	43,496	43,773	-277	-5,916	48,027	28,460	19,567	6,921		
全市場未沖銷(近月)			37,196	---			34,848	---		
全市場未沖銷(全月)			87,502	-104,306			89,495	-111,150		

更新日期：2023年1月30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02W1週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15600	買權OI最大量	15700
	賣權成交最大量	15400	賣權OI最大量	15300
	整體隱含波動率	14.76%	較前一交易日	+4.65%
	買權隱含波動率	11.66%	較前一交易日	+1.39%
	賣權隱含波動率	17.57%	較前一交易日	+7.61%
電子選擇權	買權成交最大量	750	買權OI最大量	730
	賣權成交最大量	700	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30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	16000	買權OI最大量	15400
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	13000
	整體隱含波動率	17.23%	較前一交易日	-0.30%
	買權隱含波動率	13.18%	較前一交易日	-0.83%
	賣權隱含波動率	21.44%	較前一交易日	+1.86%
	成交量P/C_Ratio值	0.939	較前一交易日	-0.10
	未平倉P/C_Ratio值	0.937	較前一交易日	+0.11
電子選擇權	買權成交最大量	750	買權OI最大量	730
	賣權成交最大量	700	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30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

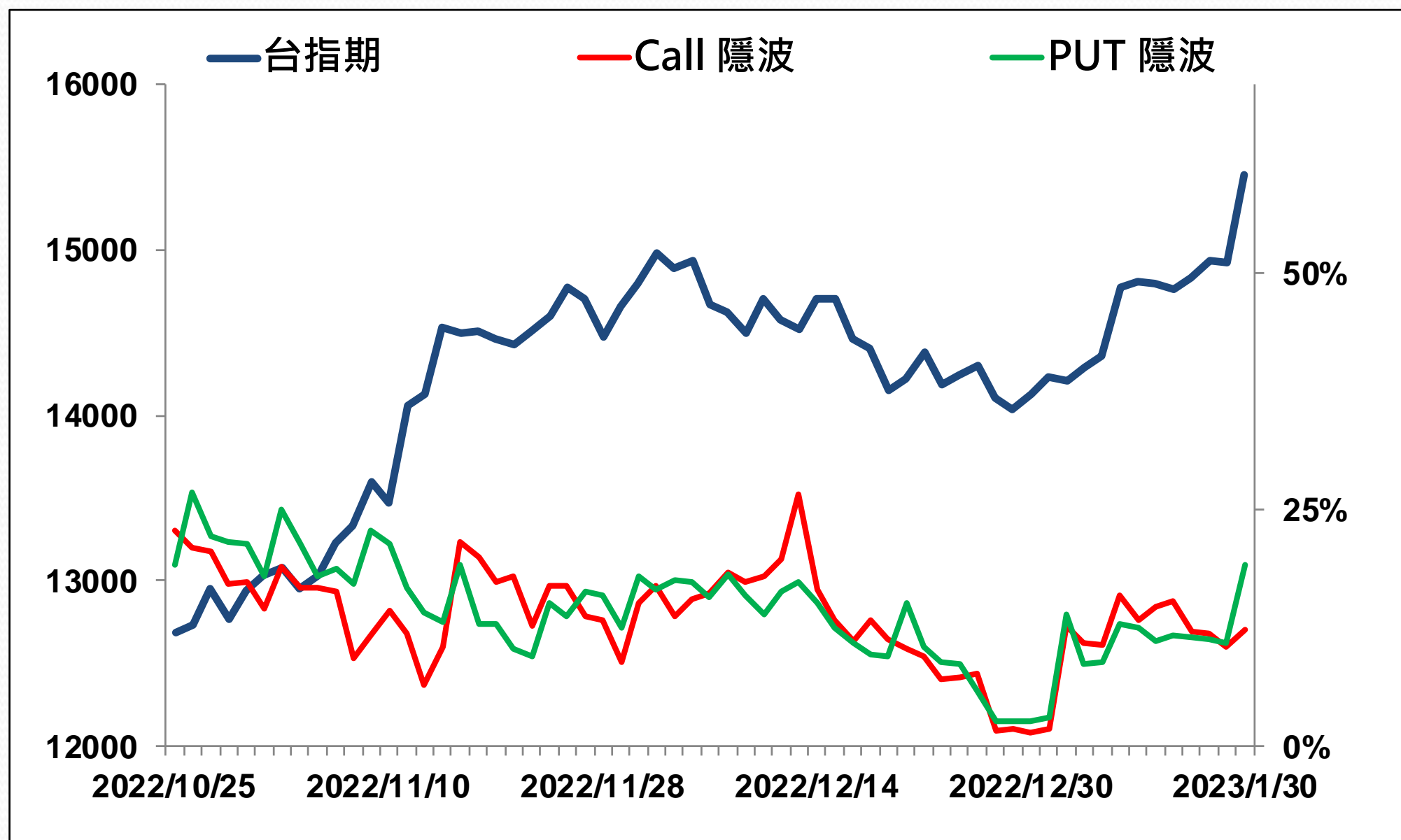
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



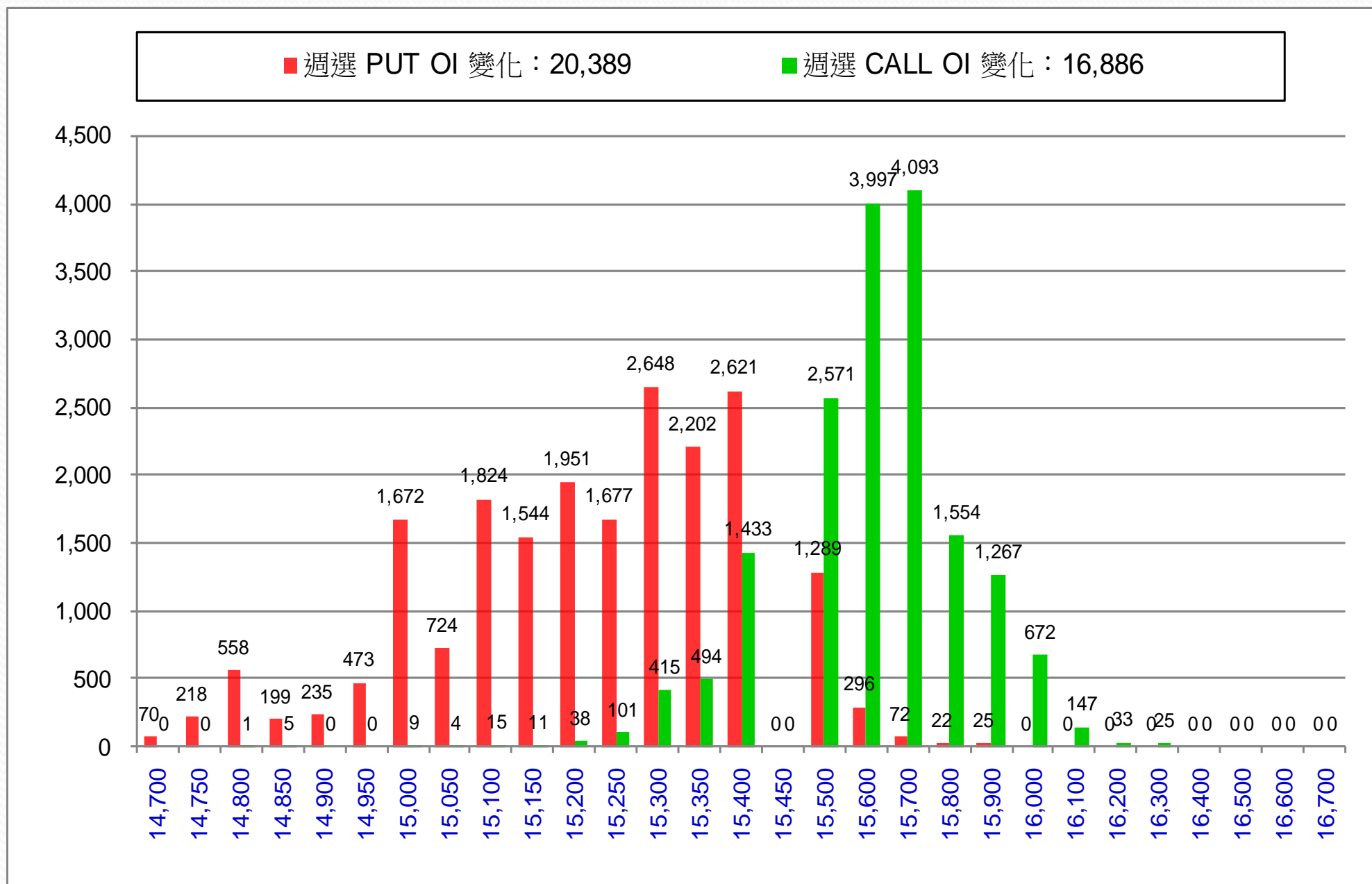
更新日期：2023年1月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年1月30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

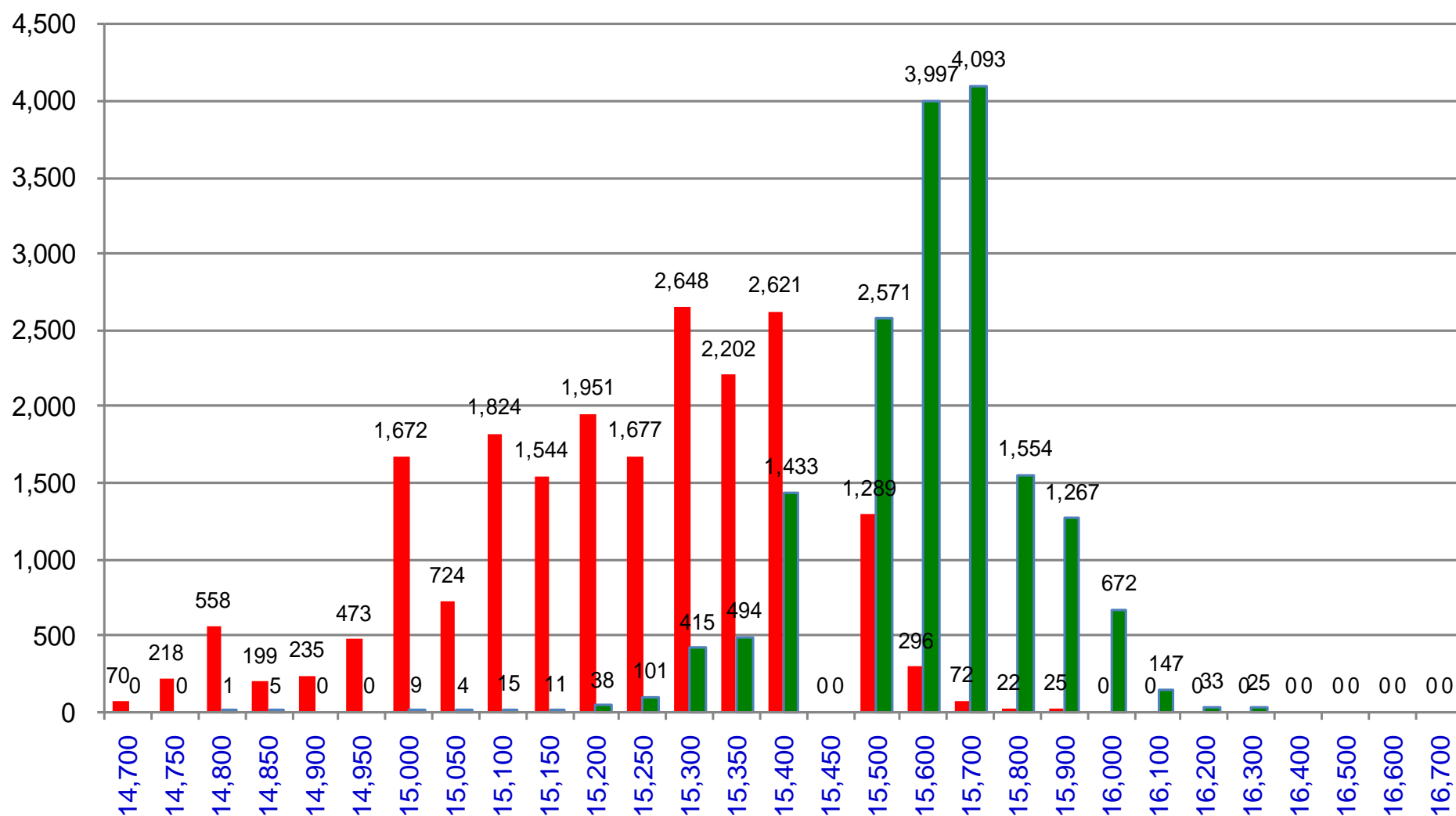


更新日期：2023年1月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：20,389

週選 CALL OI 總額：16,886



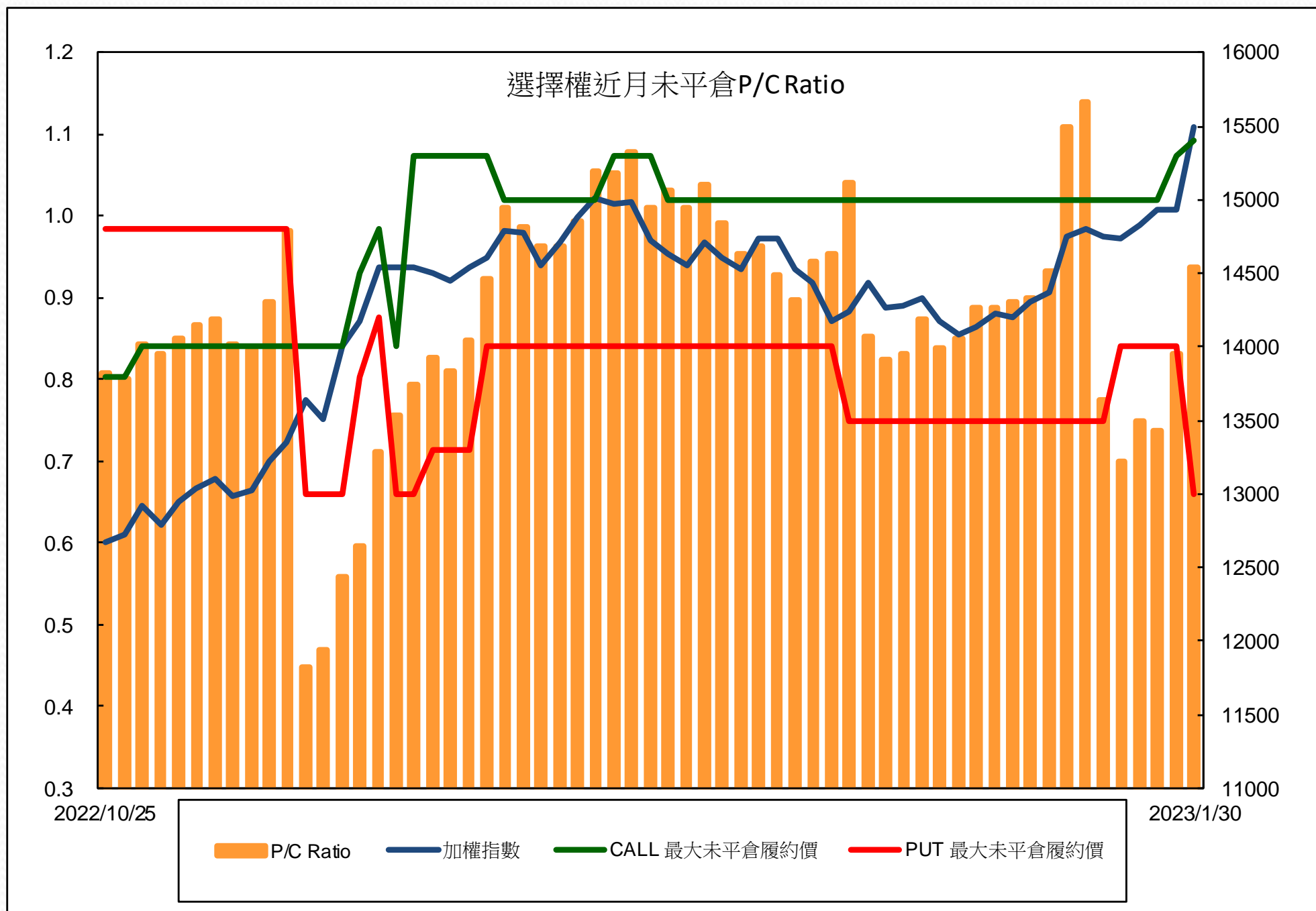
更新日期：2023年1月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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17日	59,828	66,733	-6,905
	1月30日	33,450	37,665	-4,215
Put	1月17日	52,748	61,434	-8,686
	1月30日	24,355	32,667	-8,312

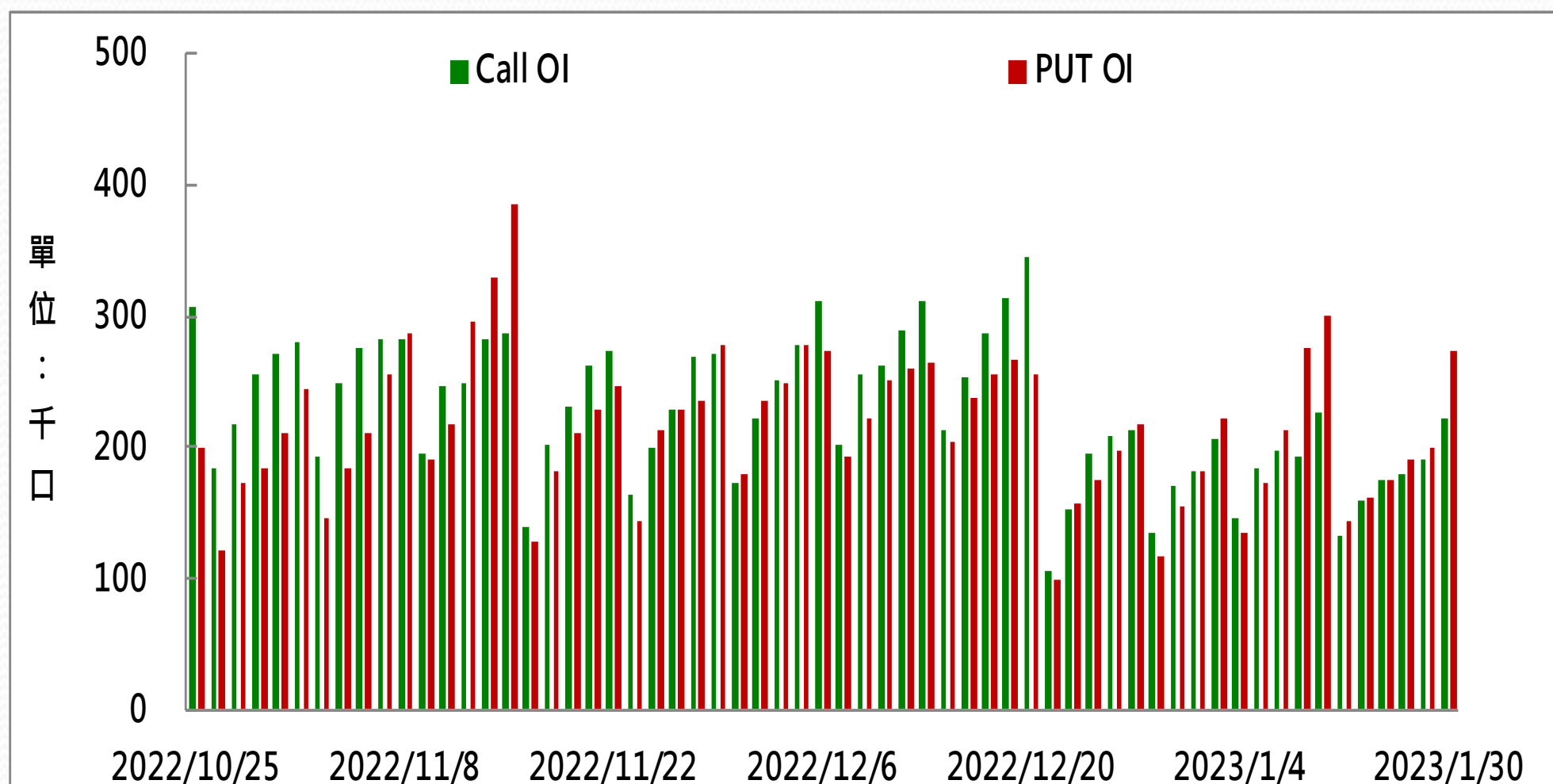
更新日期：2023年1月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年1月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

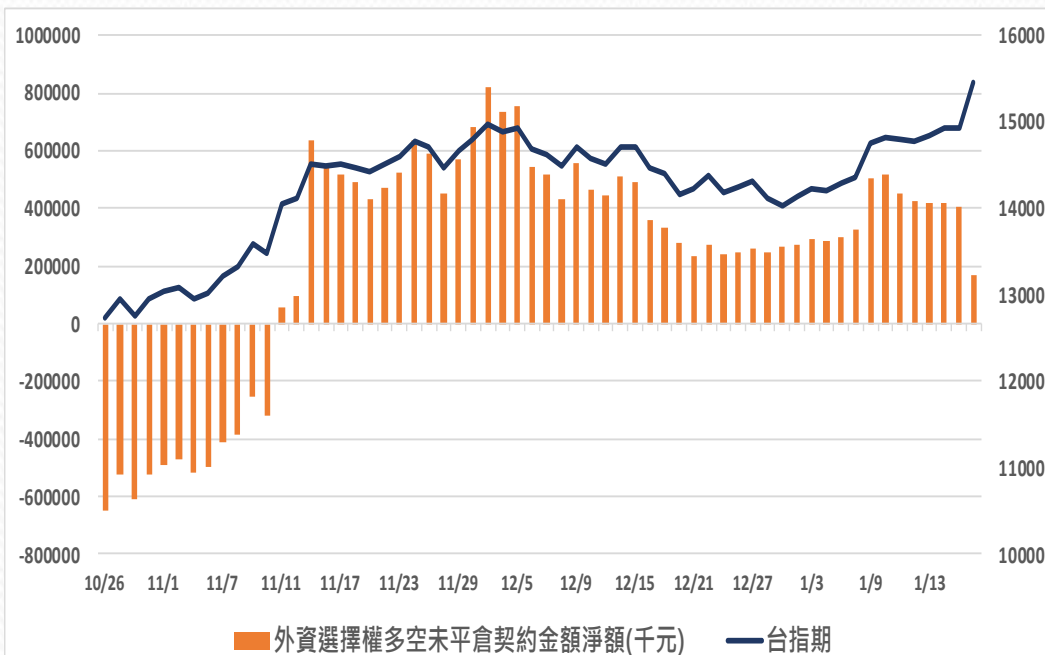
選擇權全月Put Call OI



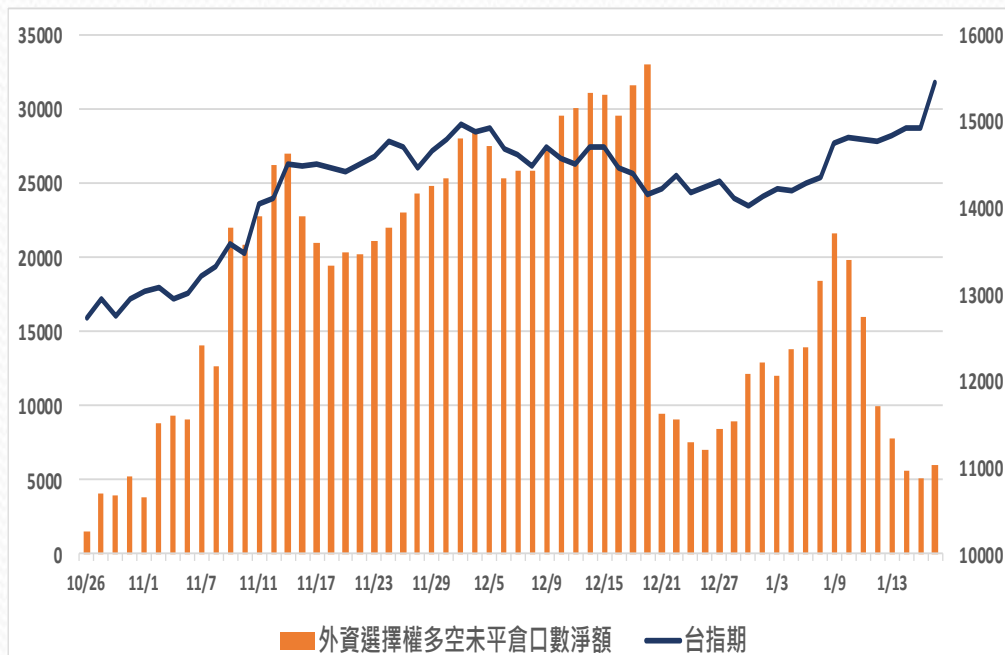
更新日期：2023年1月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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

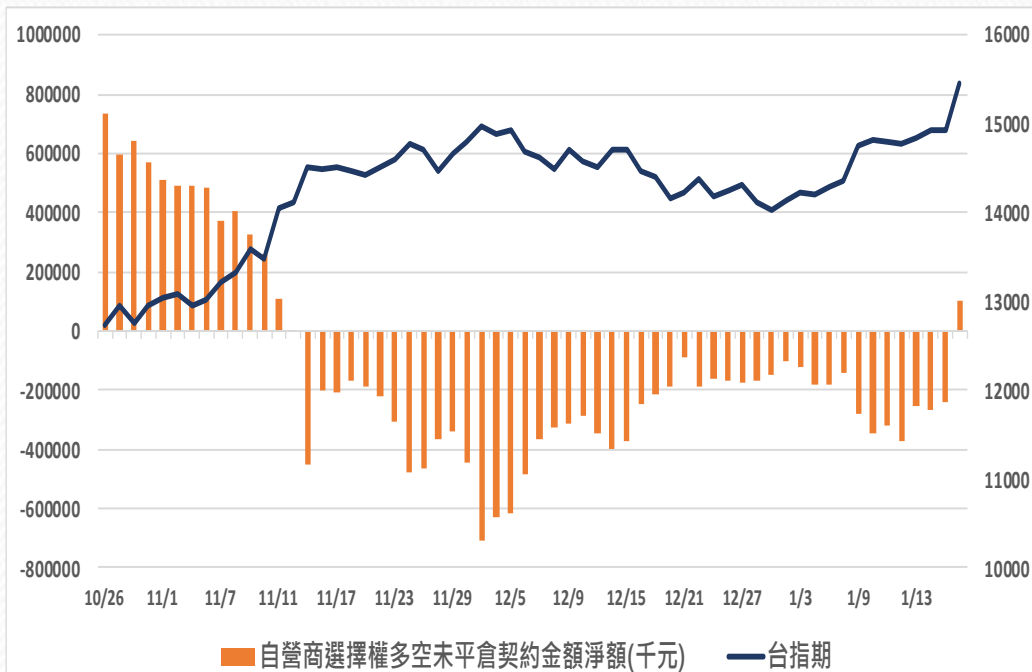
日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/1/12	14766	10002	-6004	423269	-25918
2023/1/13	14834	7832	-2170	421569	-1700
2023/1/16	14938	5613	-2219	422178	609
2023/1/17	14925	5067	-546	403693	-18485
2023/1/30	15451	6015	948	167274	-236419

更新日期：2023年1月30日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參

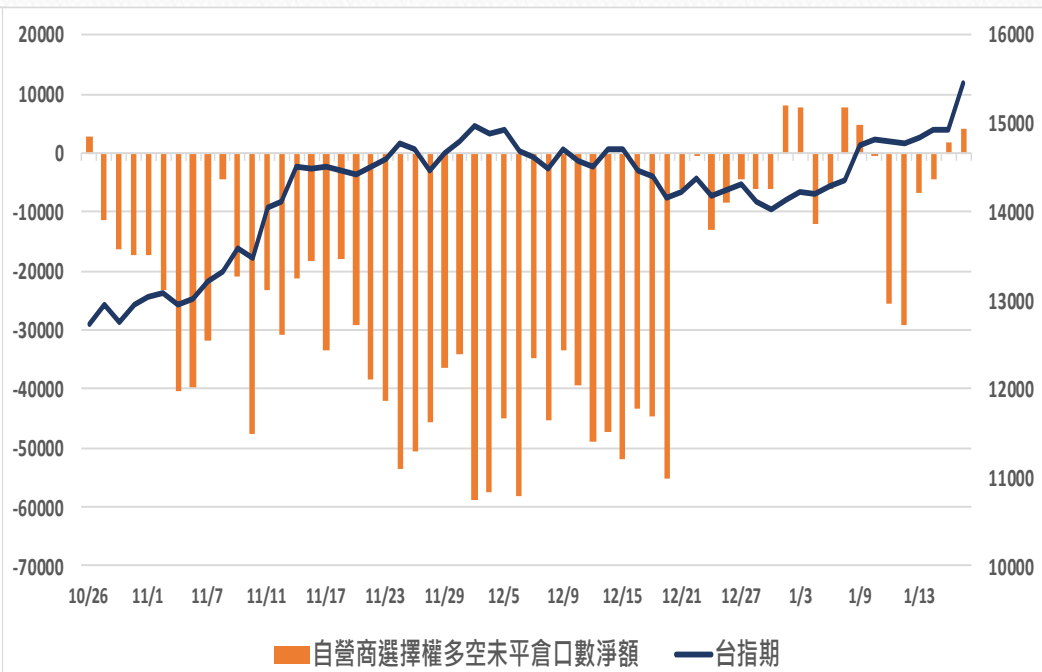
考

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



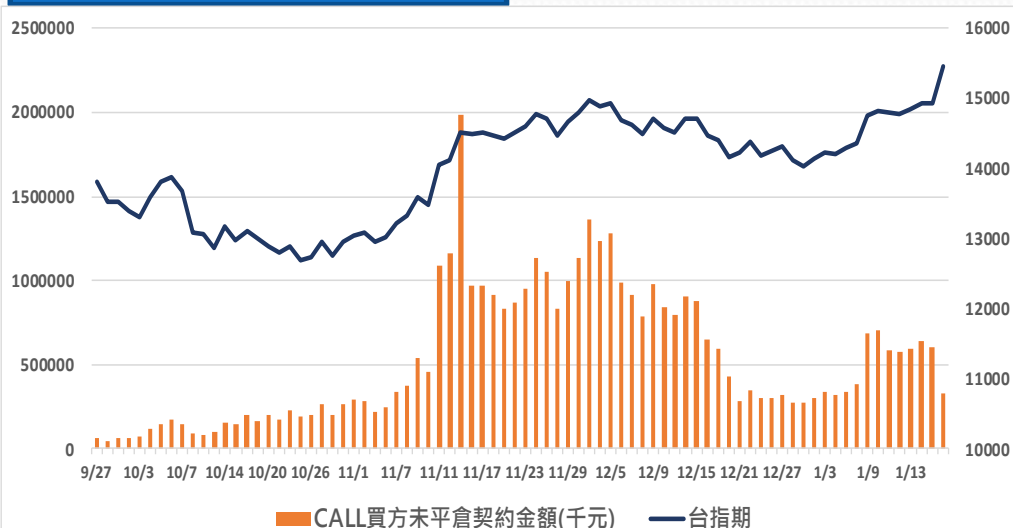
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/1/12	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
2023/1/30	15451	4097	2316	104869	345675

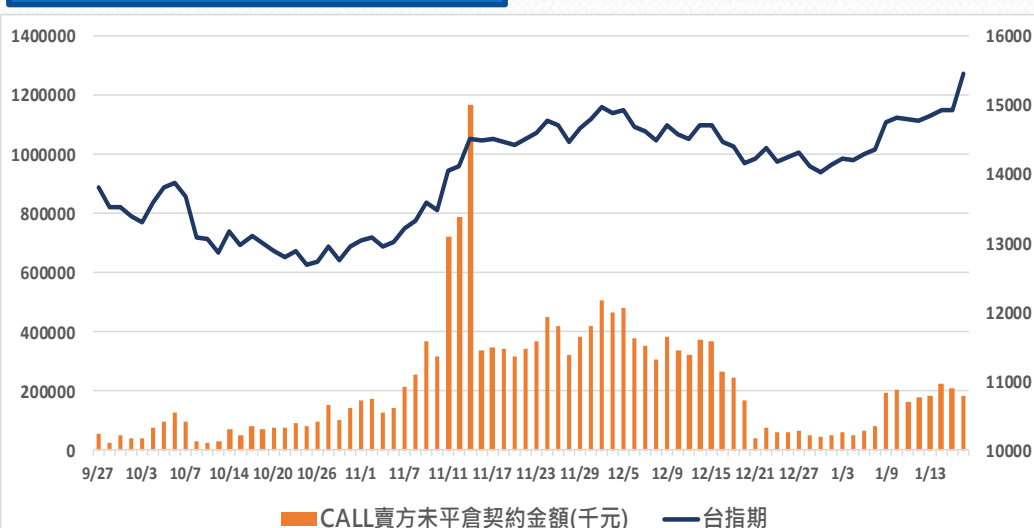
更新日期：2023年1月30日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

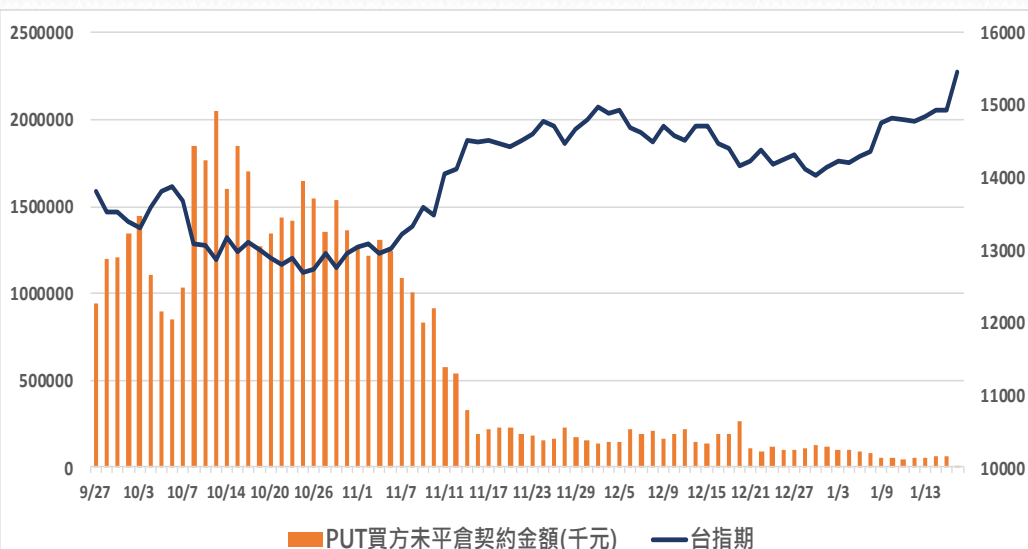
CALL買方未平倉金額



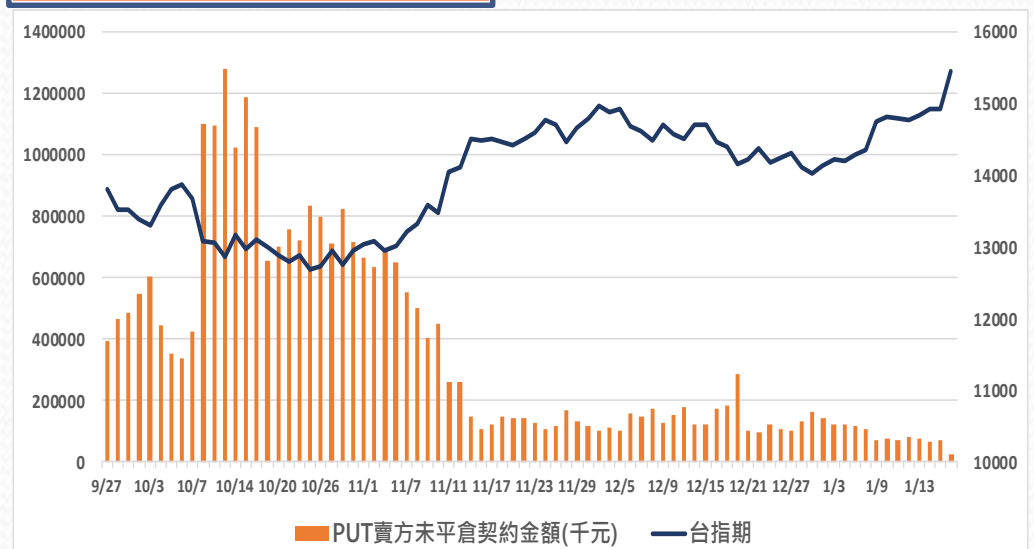
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



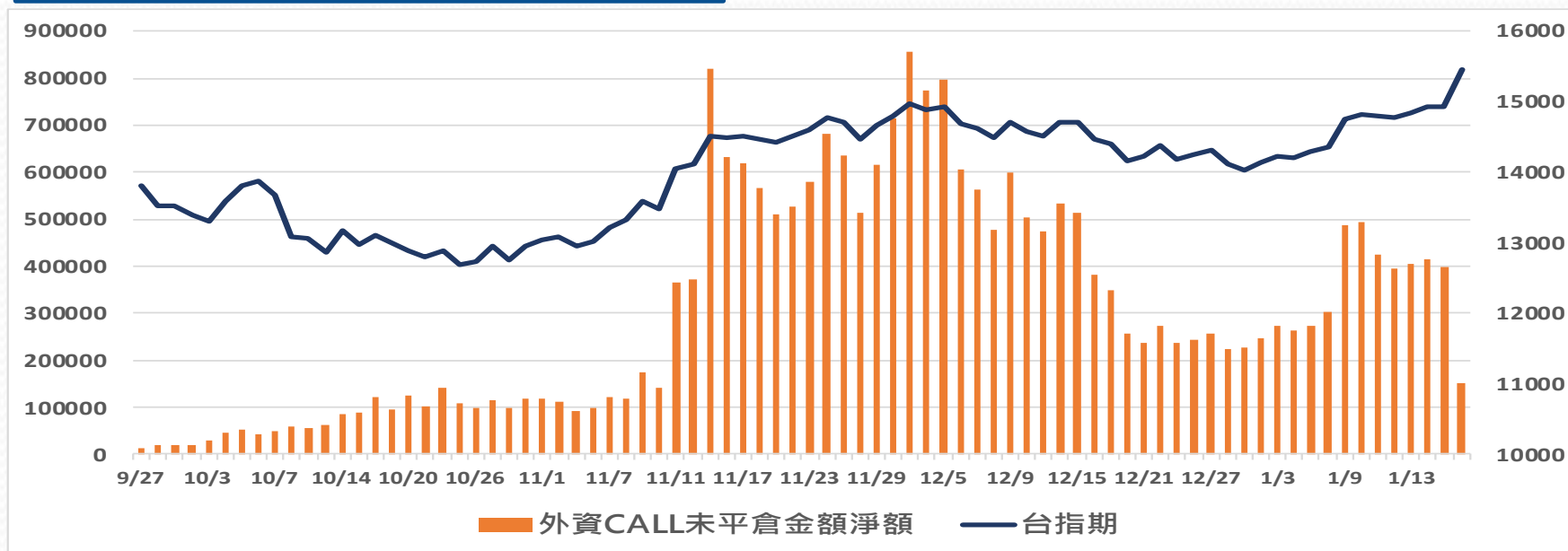
PUT賣方未平倉金額



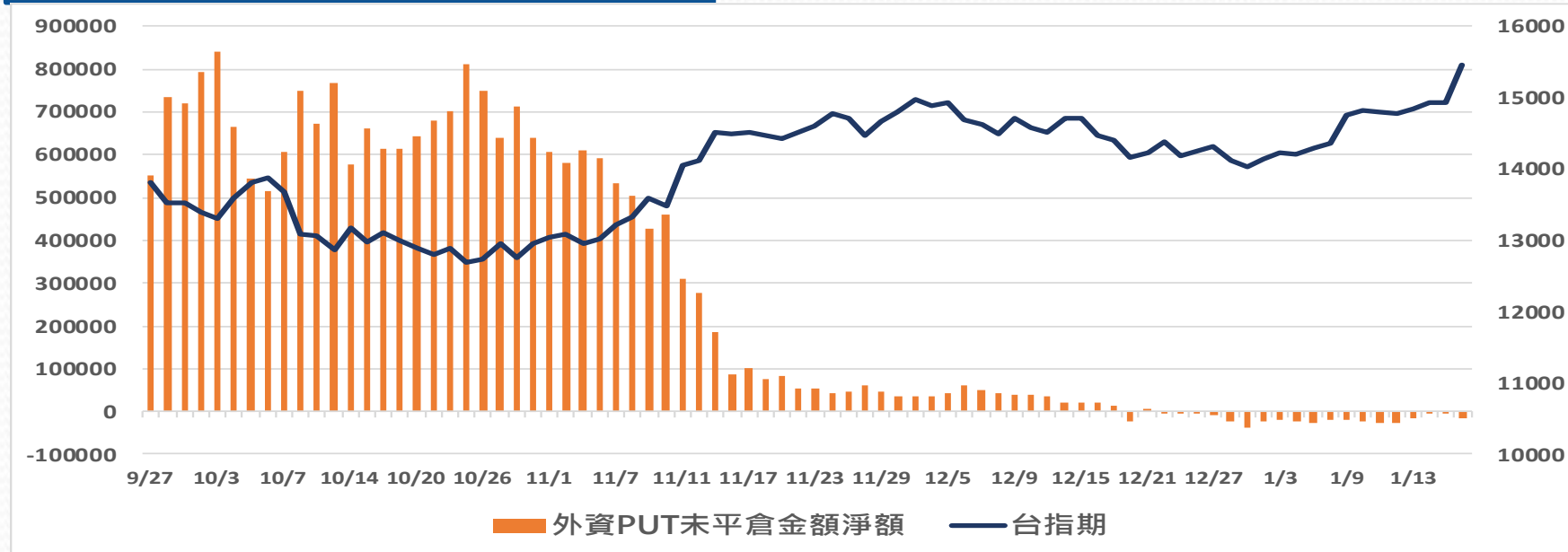
更新日期：2023年1月30日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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30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30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