

# 台指選擇權OI匯報

日期：2023/1/31 結算日：2023/2/1					日期：2023/1/31 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	14,000	1	0	0	17	13,800	680	-66
0	0	14,100	0	0	19	76	13,900	610	-71
0	0	14,200	11	0	-9	94	14,000	2,252	165
1	1	14,300	0	0	0	64	14,100	878	-569
0	0	14,400	1	0	0	91	14,200	1,795	357
0	0	14,500	184	184	-8	144	14,300	2,223	1,069
1	1	14,600	12	0	-6	281	14,400	1,367	-20
0	0	14,700	70	0	-15	359	14,500	2,011	439
0	1	14,800	569	11	-16	1,496	14,600	2,503	293
0	0	14,900	485	250	-27	1,174	14,700	1,596	585
-1	8	15,000	3,130	1,458	12	1,263	14,800	2,718	1,185 ※
14	18	15,050	2,112	1,388	-33	787	14,900	2,142	354
193	208	15,100	7,060	5,236 ※	-35	1,539	15,000	1,829	326
314	325	15,150	6,658	5,114	68	1,601	15,100	1,332	611
1,063	1,101	15,200	6,135	4,184	-79	1,396	15,200	1,065	255
1,320	1,421	15,250	6,242	4,565	180	1,638	15,300	808	413
3,719	4,134	15,300	6,066	3,418	230	4,204	15,400	1,034	476
4,994	5,488	15,350	2,887	685	339	3,427	15,500	419	124
7,214	8,647	15,400	4,285	1,664	524	2,675	15,600	316	20
7,302	7,302	15,450	3,586	3,586	797	2,721	15,700	138	7
※ 8,882	11,453	15,500	1,884	595	834	2,929	15,800	55	10
3,993	3,993	15,550	226	226	687	3,105	15,900	37	29
5,261	9,258	15,600	485	189	834	2,995	16,000	14	5
2,237	2,237	15,650	10	10	1,040	1,973	16,100	9	1
4,838	8,931	15,700	88	16	※ 1,263	2,050	16,200	5	0
701	701	15,750	5	5	46	1,155	16,300	5	3
2,156	3,710	15,800	32	10	113	304	16,400	1	0
528	528	15,850	0	0	378	1,596	16,500	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
55,420	72,301	0.7231	52,282	32,792	8,584	45,780	0.9022	41,302	6,454
昨日 P/C	1.2074	今日增減變化	-0.4843		昨日 P/C	0.9369	今日增減變化	-0.0347	

更新日期：2023年1月31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31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	92,143,765	84,234,166	7,909,599	-17,131,133	3,066,245	1,150,565	1,915,680	-360,139	
投信	30,276,444	50,082,094	-19,805,650	-1,618,944	413,975	0	413,975	-7,482	
自營商	34,999,254	19,336,555	15,662,699	134,030	810,770	688,055	122,715	18,175	
	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	553,778	1,861,440	-1,307,662	-298,280	14,803	68,094	-53,291	-60,682	
投信	88,418	0	88,418	-1,061	0	0	0	0	
自營商	285,421	79,111	206,310	60,318	146,550	62,173	84,377	72,552	

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31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	13,574	10,412	3,162	-617	11,310	10,936	374	2,610	
投信	0	100	-100	-100	300	111	189	300	
自營商	50,829	60,290	-9,461	-5,246	42,264	39,378	2,886	11,198	
特定法人(週)	0	0	0	0	0	1,000	-1,000	-70	
特定法人(近月)	5,527	6,610	-1,083	213	3,503	2,208	1,295	29	
特定法人(全月)	4,379	3,000	1,379	-656	5,680	3,479	2,201	-1,030	
十大交易人(週)	28,309	38,170	-9,861	-5,783	26,247	27,371	-1,124	-6,203	
十大交易人(近月)	21,521	18,247	3,274	593	19,093	15,248	3,845	-2,116	
十大交易人(全月)	66,259	68,141	-1,882	-1,605	59,355	52,008	7,347	-12,220	
全市場未沖銷(近月)			45,780	8,584			41,302	6,454	
全市場未沖銷(全月)			170,220	82,718			138,214	48,719	

更新日期：2023年1月31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	15500	買權OI最大量	15500
	賣權成交最大量	15400	賣權OI最大量	15100
	整體隱含波動率	11.34%	較前一交易日	-3.43%
	買權隱含波動率	12.82%	較前一交易日	+1.16%
	賣權隱含波動率	9.38%	較前一交易日	-8.19%
電子選擇權	買權成交最大量	735	買權OI最大量	690
	賣權成交最大量	695	賣權OI最大量	630
金融選擇權	買權成交最大量	1620	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1360

更新日期：2023年1月31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	15500	買權OI最大量	15400
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	14800
	整體隱含波動率	17.20%	較前一交易日	+0.03%
	買權隱含波動率	15.62%	較前一交易日	+2.44%
	賣權隱含波動率	18.99%	較前一交易日	-2.46%
	成交量P/C_Ratio值	0.877	較前一交易日	-0.06
	未平倉P/C_Ratio值	0.902	較前一交易日	-0.03
電子選擇權	買權成交最大量	735	買權OI最大量	690
	賣權成交最大量	695	賣權OI最大量	630
金融選擇權	買權成交最大量	1620	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1360

更新日期：2023年1月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

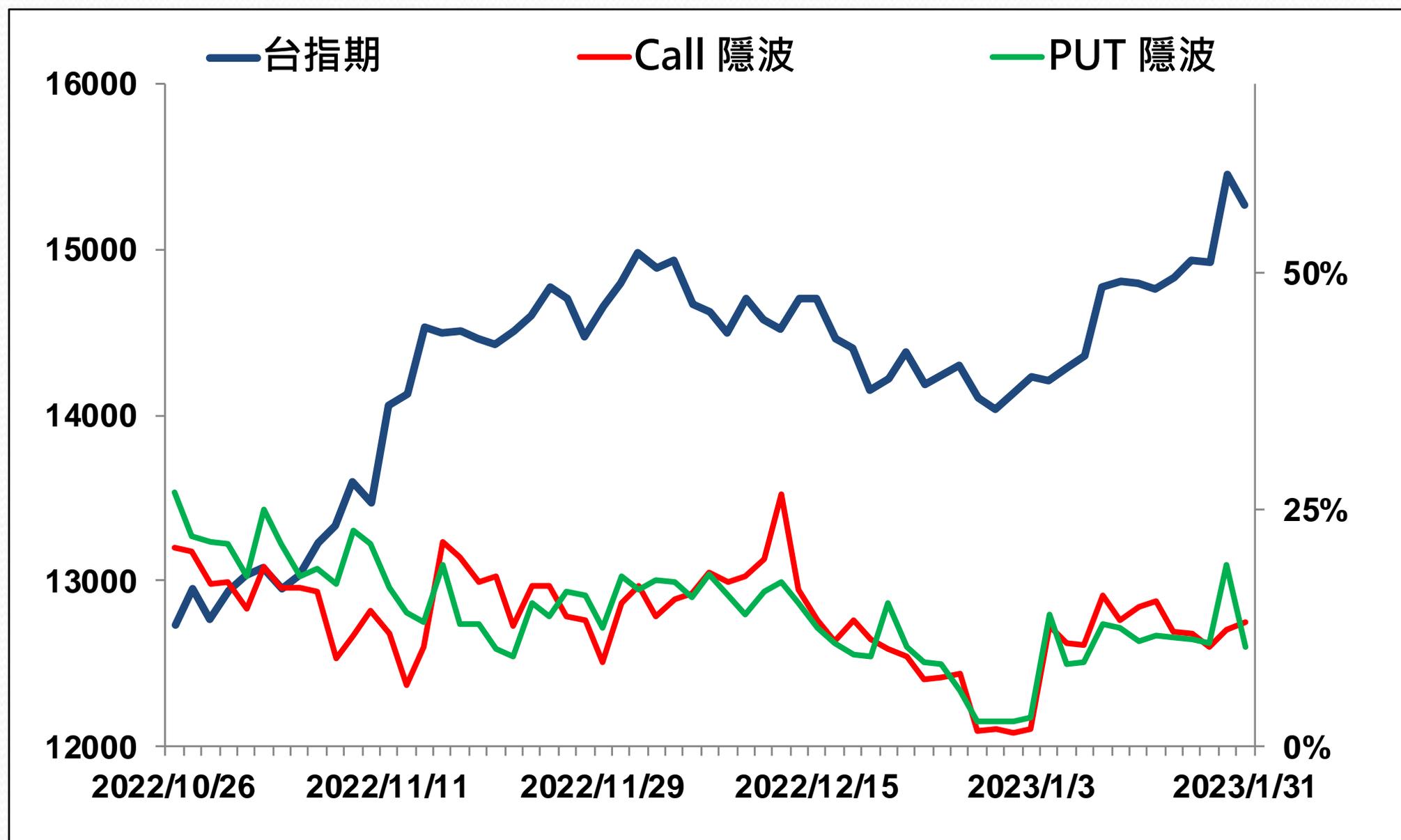
# 選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年1月31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

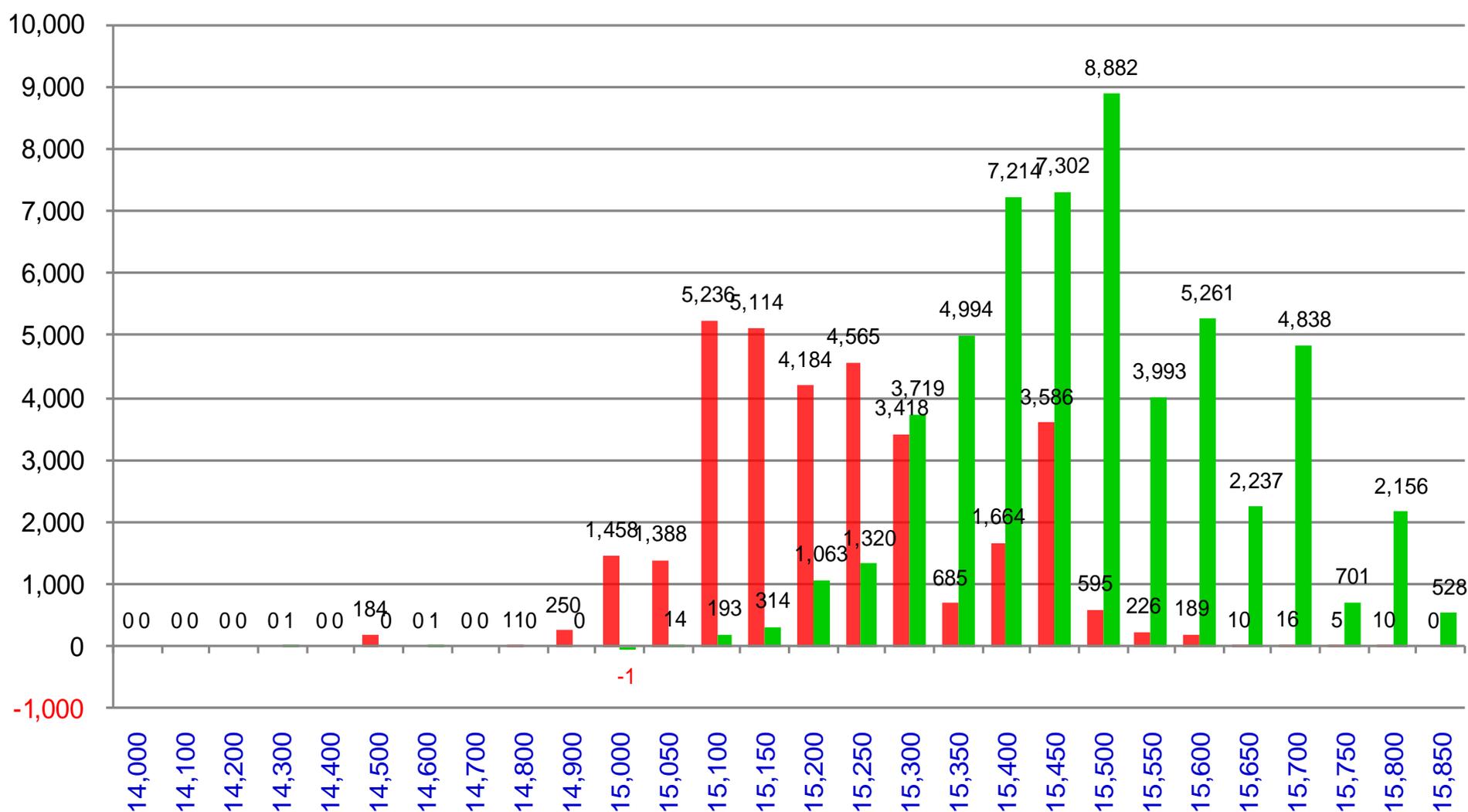


更新日期：2023年1月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI每日變化量

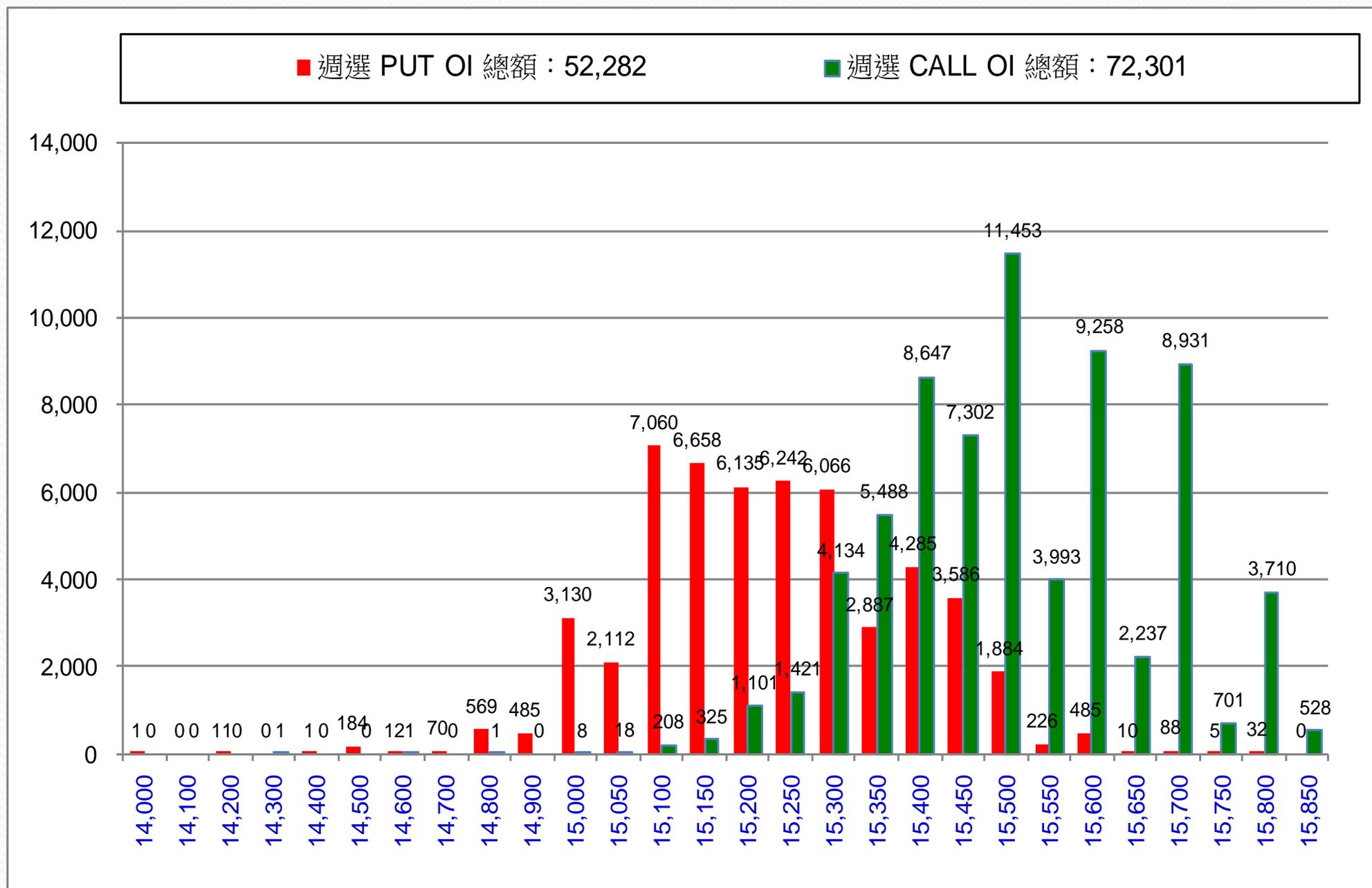
週選 PUT OI 變化：32,792

週選 CALL OI 變化：55,420



更新日期：2023年1月31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



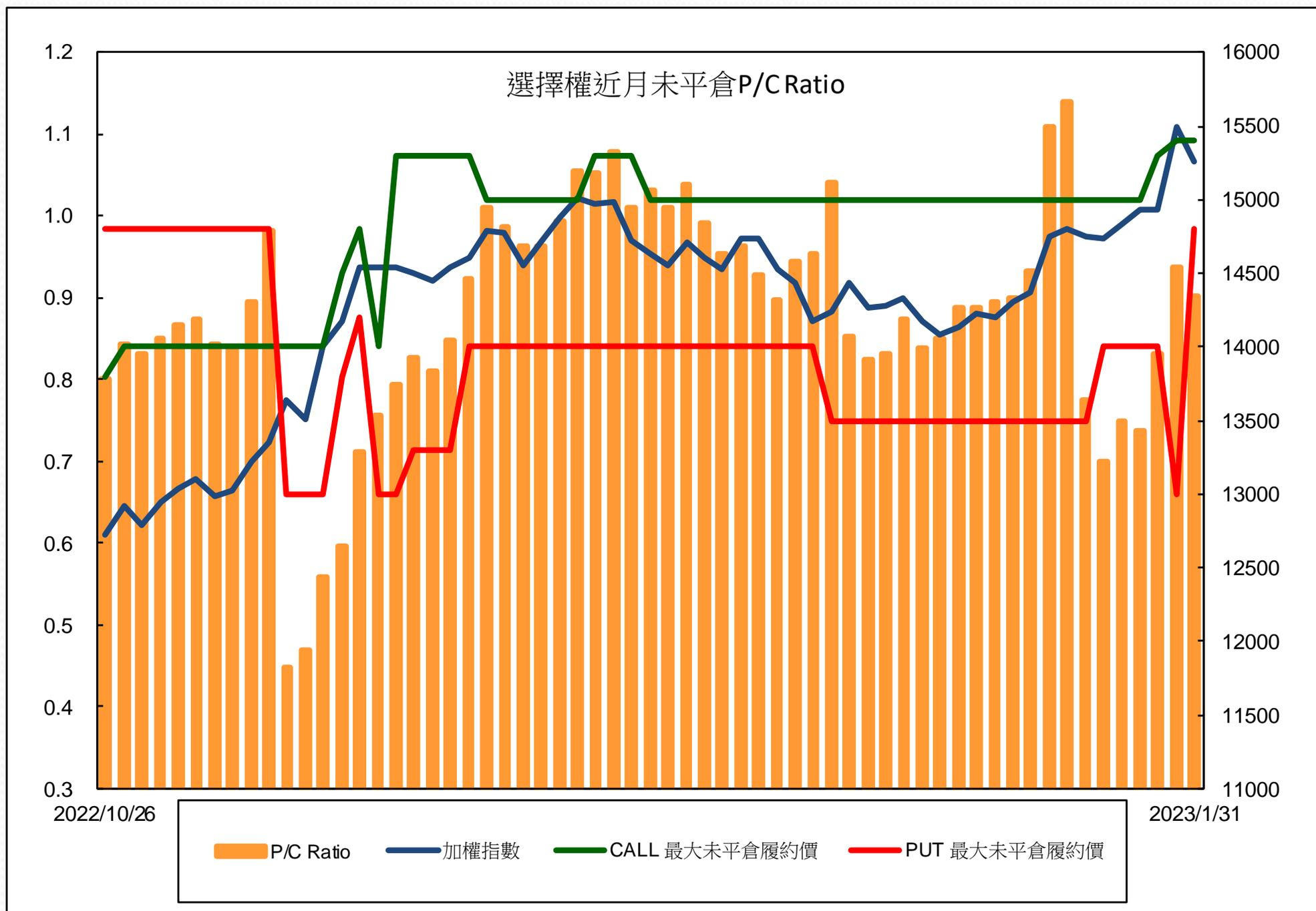
更新日期：2023年1月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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30日	33,450	37,665	-4,215
	1月31日	50,829	60,290	-9,461
Put	1月30日	24,355	32,667	-8,312
	1月31日	42,264	39,378	2,886

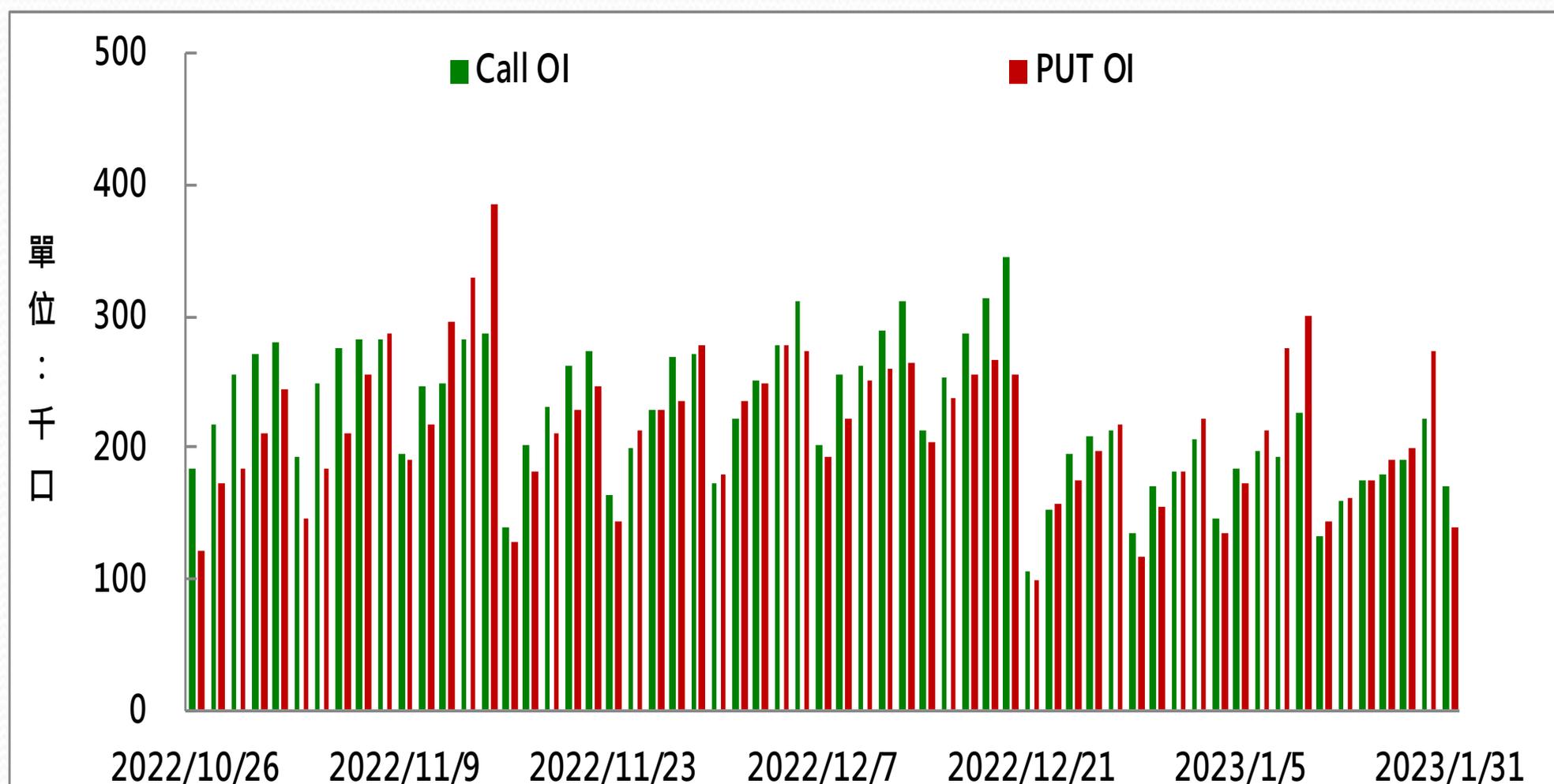
更新日期：2023年1月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年1月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

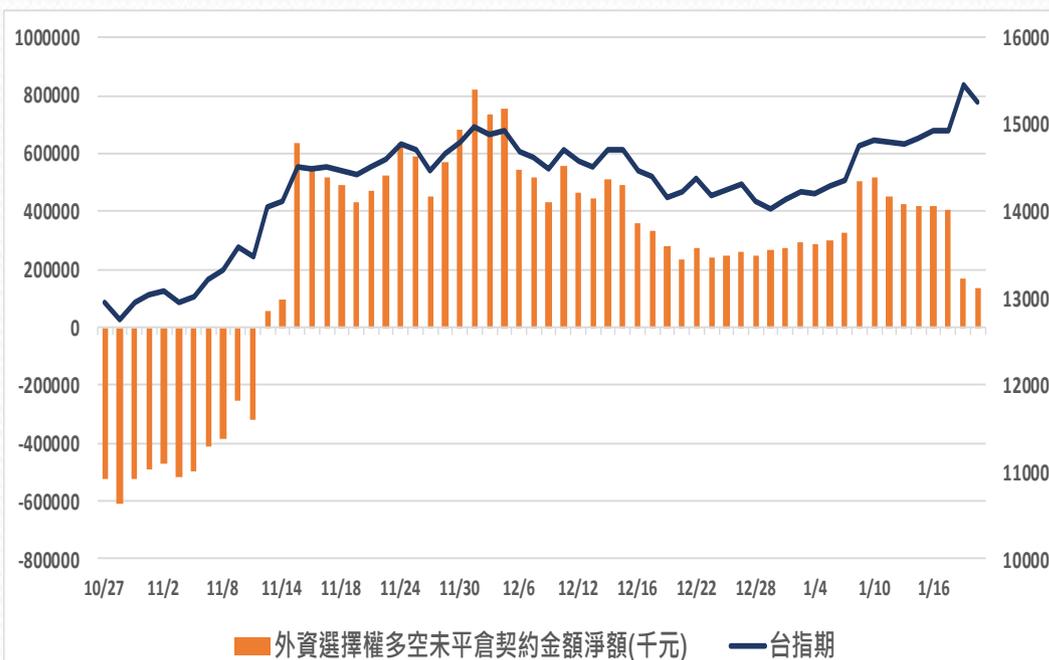
# 選擇權全月Put Call OI



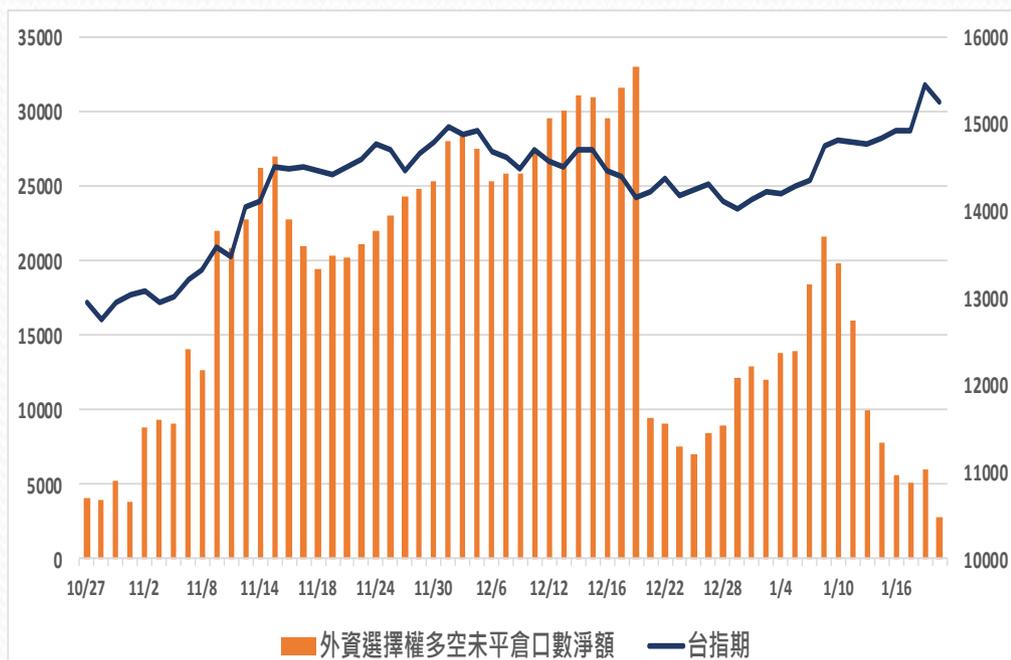
更新日期：2023年1月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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

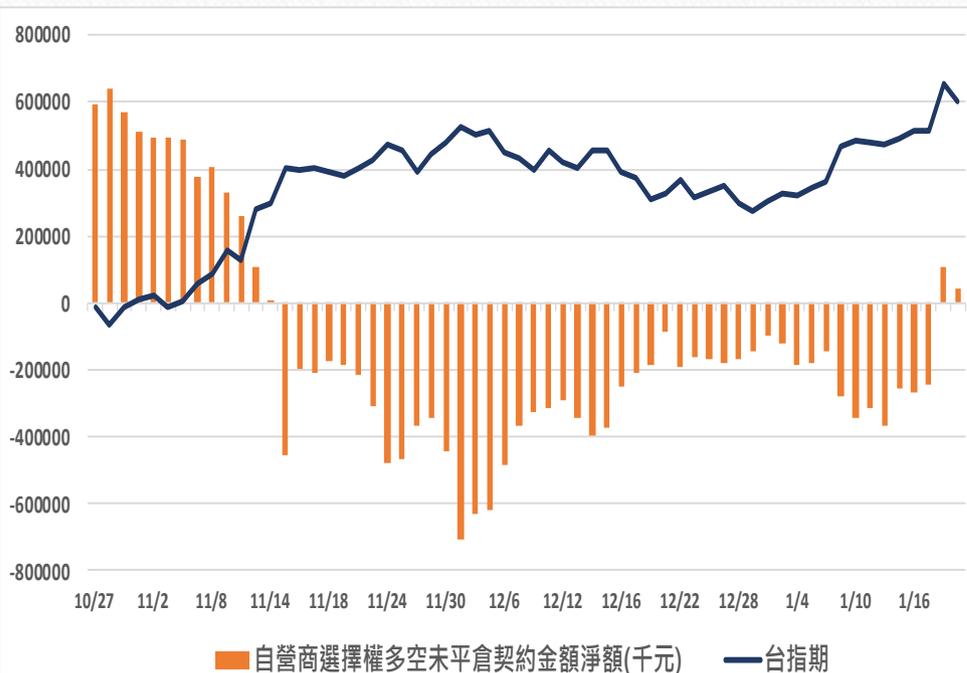
日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/1/13	14834	7832	-2170	421569	-1700
2023/1/16	14938	5613	-2219	422178	609
2023/1/17	14925	5067	-546	403693	-18485
2023/1/30	15451	6015	948	167274	-236419
2023/1/31	15268	2788	-3227	138725	-28549

更新日期：2023年1月31日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參

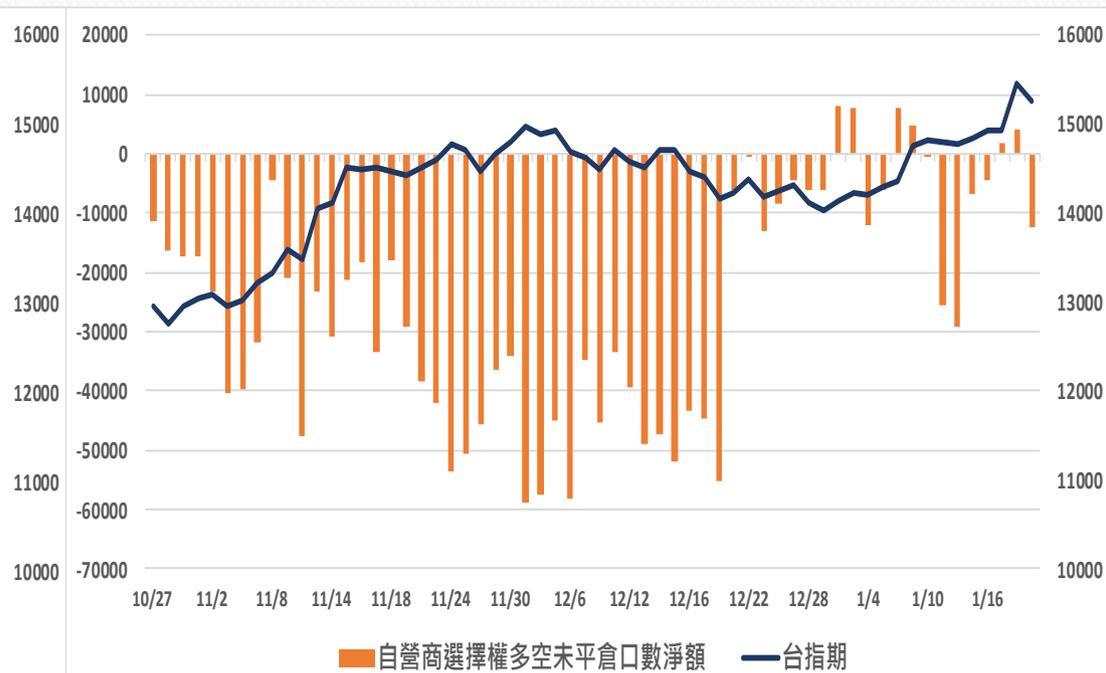
考

# 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



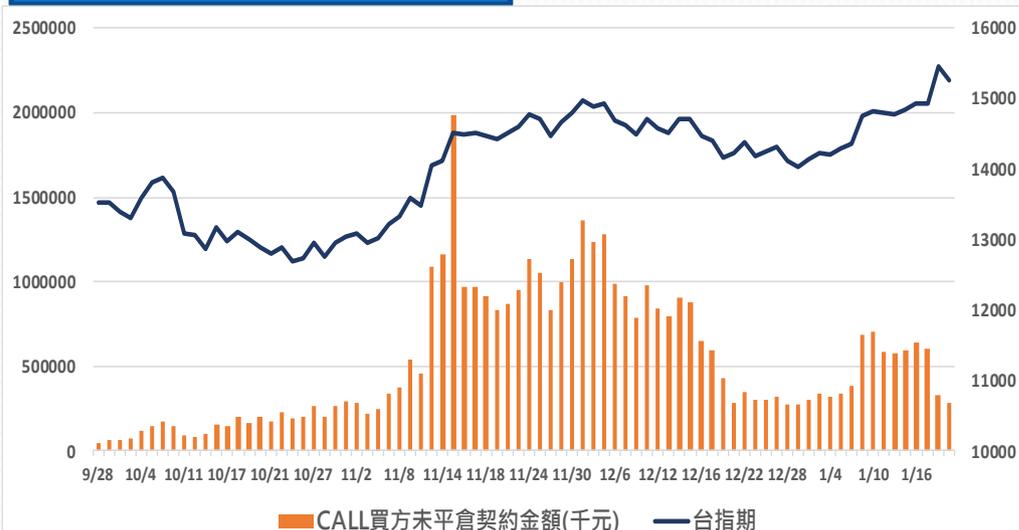
## 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/1/13	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
2023/1/31	15268	-12347	-16444	41685	-63184

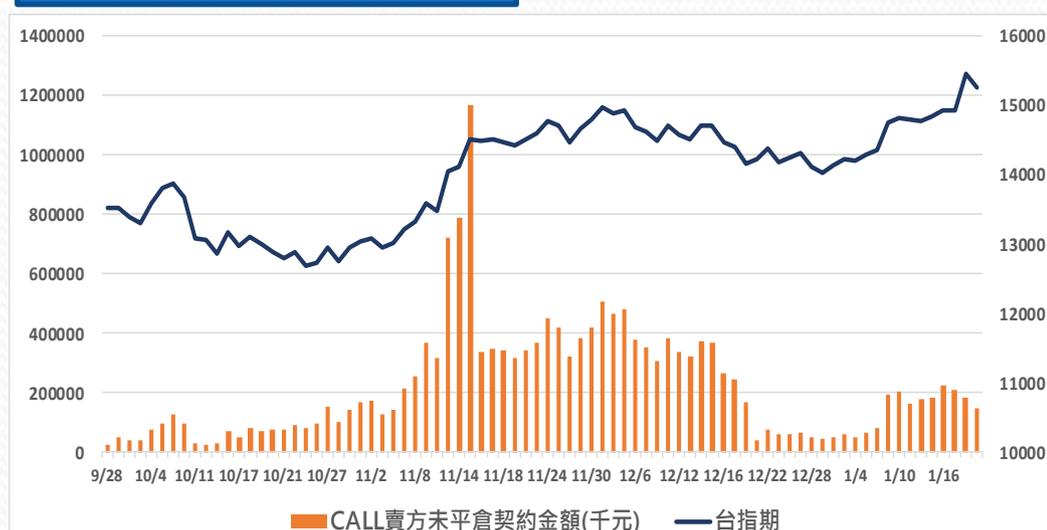
更新日期：2023年1月31日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 外資買賣權未平倉金額

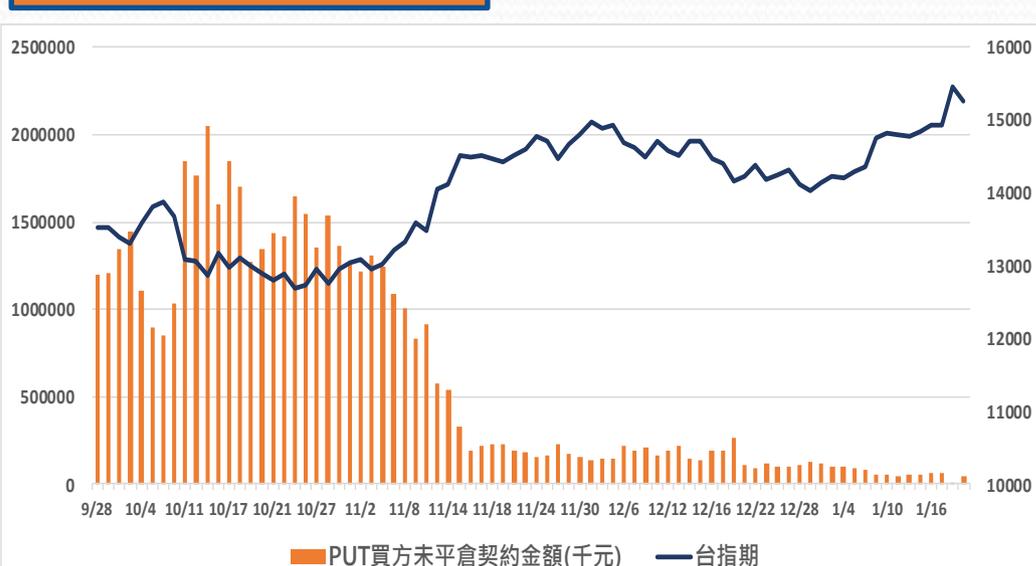
## CALL買方未平倉金額



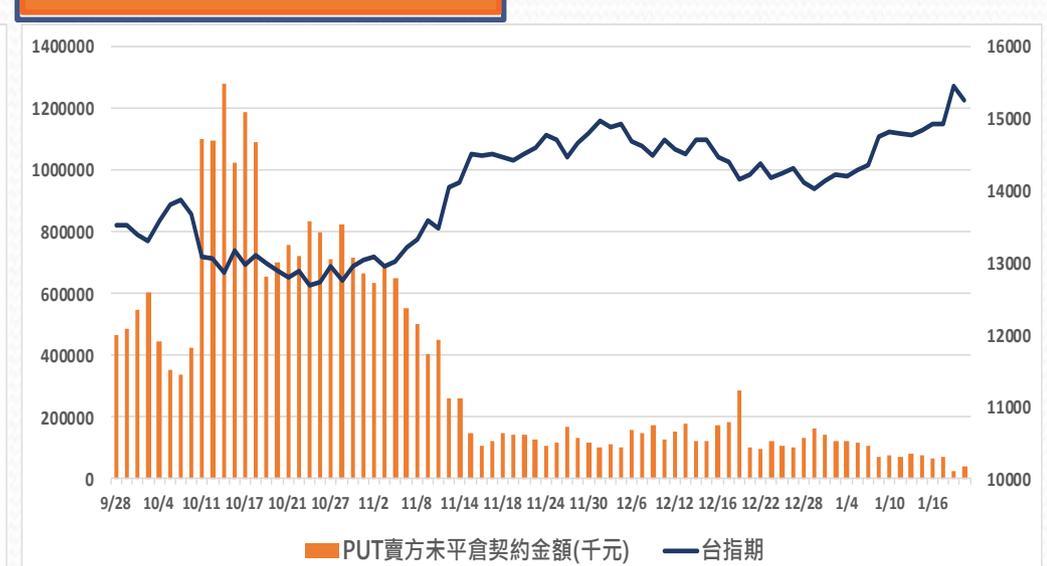
## CALL賣方未平倉金額



## PUT買方未平倉金額



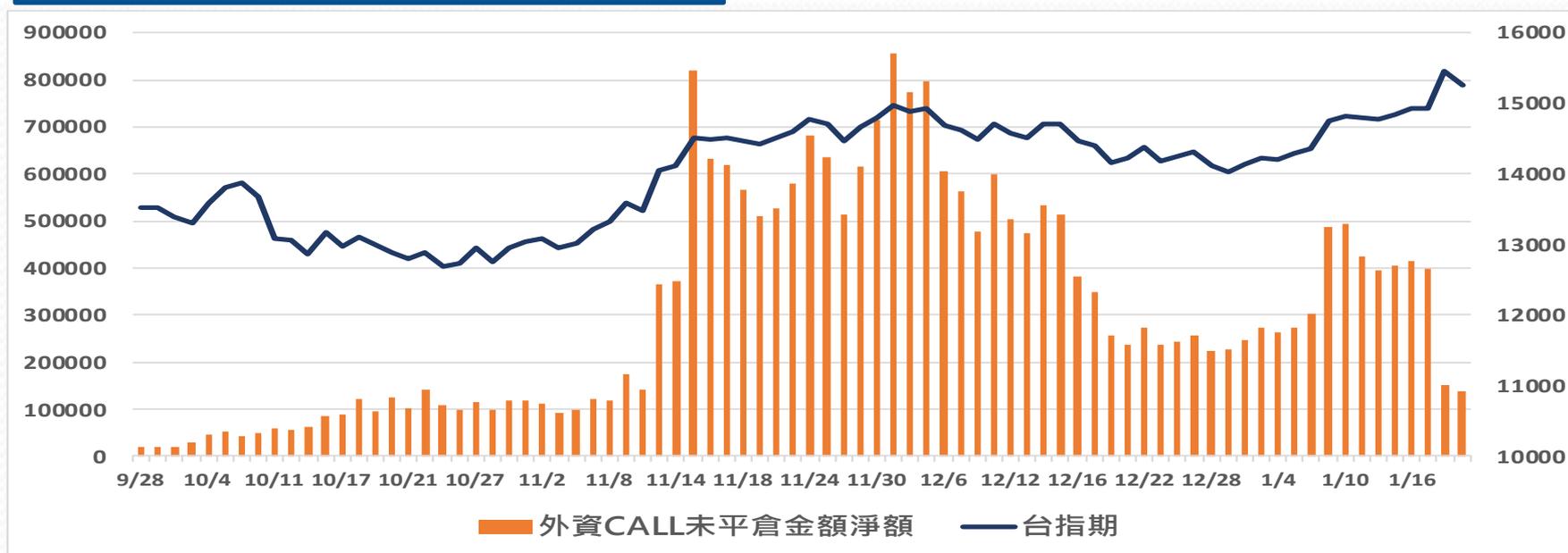
## PUT賣方未平倉金額



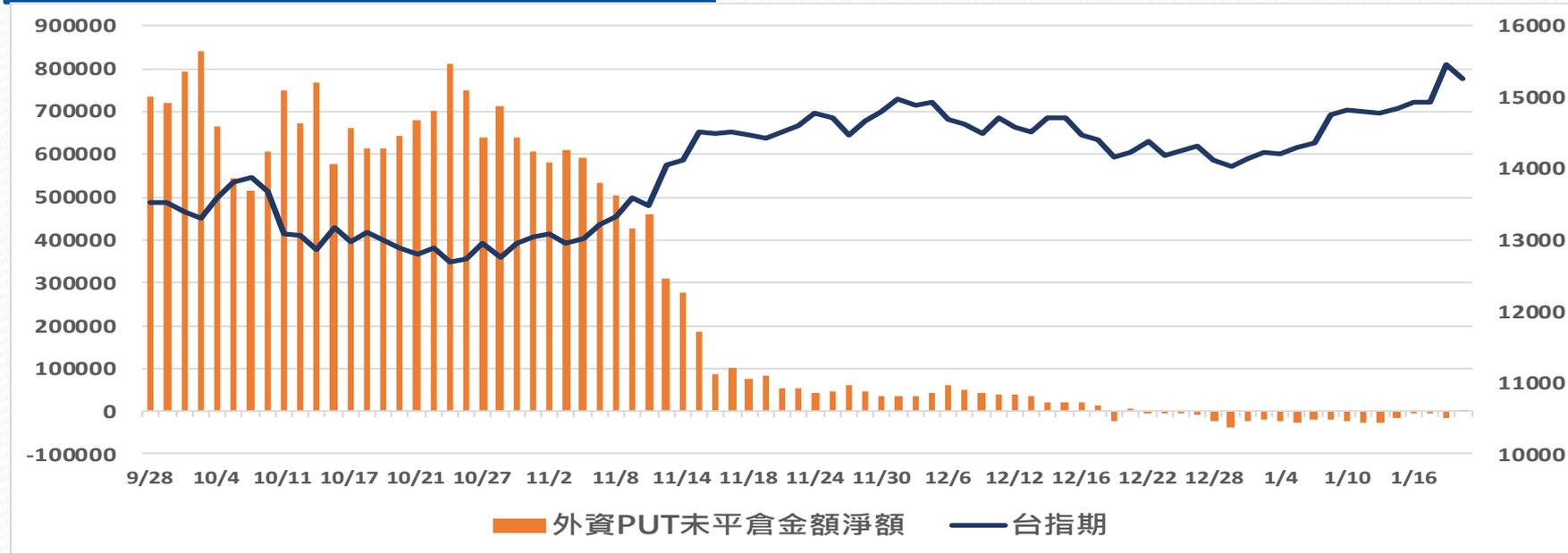
更新日期：2023年1月31日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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31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31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