

# 台指選擇權OI匯報

日期：2023/2/1 結算日：2023/2/8					日期：2023/2/1 結算日：2023/2/15				
202302W2					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	14,500	1,530	915	0	76	13,900	595	-15
0	1	14,600	1,628	1,412	-1	93	14,000	2,236	-16
0	2	14,700	1,033	836	0	64	14,100	908	30
-4	12	14,800	1,368	822	0	91	14,200	1,891	96
0	1	14,850	661	330	-20	124	14,300	2,762	539
17	18	14,900	1,607	899	-25	256	14,400	1,656	289
0	5	14,950	1,340	862	1	360	14,500	3,610	1,599 ※
16	39	15,000	3,181	1,945 ※	-30	1,466	14,600	2,934	431
54	55	15,050	975	663	7	1,181	14,700	1,819	223
50	111	15,100	1,515	606	-80	1,183	14,800	2,998	280
55	91	15,150	1,166	940	-3	784	14,900	2,614	472
83	181	15,200	1,943	1,374	7	1,546	15,000	2,435	606
115	187	15,250	1,201	872	-64	1,537	15,100	1,558	226
212	446	15,300	1,613	1,099	-8	1,388	15,200	1,221	156
532	873	15,350	1,574	1,414	197	1,835	15,300	1,170	362
※ 1,387	2,392	15,400	1,171	998	200	4,404	15,400	1,090	56
1,199	2,092	15,450	362	316	-30	3,397	15,500	426	7
1,328	2,382	15,500	253	40	179	2,854	15,600	332	16
706	1,139	15,550	56	7	810	3,531	15,700	146	8
803	2,182	15,600	175	-16	※ 1,360	4,289	15,800	73	18
790	1,120	15,650	45	5	1,283	4,388	15,900	37	0
1,001	2,411	15,700	54	0	745	3,740	16,000	19	5
1,131	2,538	15,800	17	1	1,246	3,219	16,100	9	0
1,058	3,393	15,900	13	0	216	2,266	16,200	6	1
542	2,366	16,000	5	0	147	1,302	16,300	5	0
944	1,572	16,100	0	0	173	477	16,400	2	1
1,175	1,587	16,200	1	1	-248	1,348	16,500	1	0
994	1,099	16,300	0	0	447	773	16,600	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
14,201	30,061	0.8925	26,830	18,171	6,937	52,717	0.8883	46,827	5,525
昨日 P/C	0.7231	今日增減變化	0.1694		昨日 P/C	0.9022	今日增減變化	-0.0139	

更新日期：2023年2月1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2月1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	90,370,841	77,341,659	13,029,182	5,119,583	3,047,520	1,314,739	1,732,781	-182,899	
投信	29,964,136	50,117,632	-20,153,496	-347,846	418,064	0	418,064	4,089	
自營商	36,992,056	19,526,687	17,465,369	1,802,670	980,152	579,492	400,660	277,945	
	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	560,489	1,934,540	-1,374,051	-66,389	23,779	47,558	-23,779	29,512	
投信	88,498	0	88,498	80	0	0	0	0	
自營商	284,126	117,998	166,128	-40,182	141,175	83,213	57,962	-26,415	

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報								2023年2月1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	15,820	9,358	6,462	3,300	10,350	10,202	148	-226	
投信	0	100	-100	0	300	111	189	0	
自營商	53,517	49,176	4,341	13,802	38,123	35,833	2,290	-596	
特定法人(週)	310	0	310	---	0	1,531	-1,531	---	
特定法人(近月)	7,101	7,816	-715	368	3,440	3,727	-287	-1,582	
特定法人(全月)	7,092	4,200	2,892	1,513	7,832	6,547	1,285	-916	
十大交易人(週)	20,758	18,838	1,920	---	12,622	12,685	-63	---	
十大交易人(近月)	26,520	21,894	4,626	1,352	22,557	17,407	5,150	1,305	
十大交易人(全月)	69,286	59,617	9,669	11,551	53,081	40,738	12,343	4,996	
全市場未沖銷(近月)			53,420	7,640			47,814	6,512	
全市場未沖銷(全月)			127,496	-42,724			112,610	-25,604	

更新日期：2023年2月1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02W2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	15900
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	15.64%	較前一交易日	+4.31%
	買權隱含波動率	13.93%	較前一交易日	+1.11%
	賣權隱含波動率	17.44%	較前一交易日	+8.06%
電子選擇權	買權成交最大量	745	買權OI最大量	720
	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	1600	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1360

更新日期：2023年2月1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	15800	買權OI最大量	15400
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	14500
	整體隱含波動率	15.86%	較前一交易日	+1.34%
	買權隱含波動率	13.53%	較前一交易日	-2.09%
	賣權隱含波動率	19.34%	較前一交易日	+0.36%
	成交量P/C_Ratio值	0.702	較前一交易日	-0.18
	未平倉P/C_Ratio值	0.895	較前一交易日	-0.01
電子選擇權	買權成交最大量	745	買權OI最大量	720
	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	1600	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1360

更新日期：2023年2月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

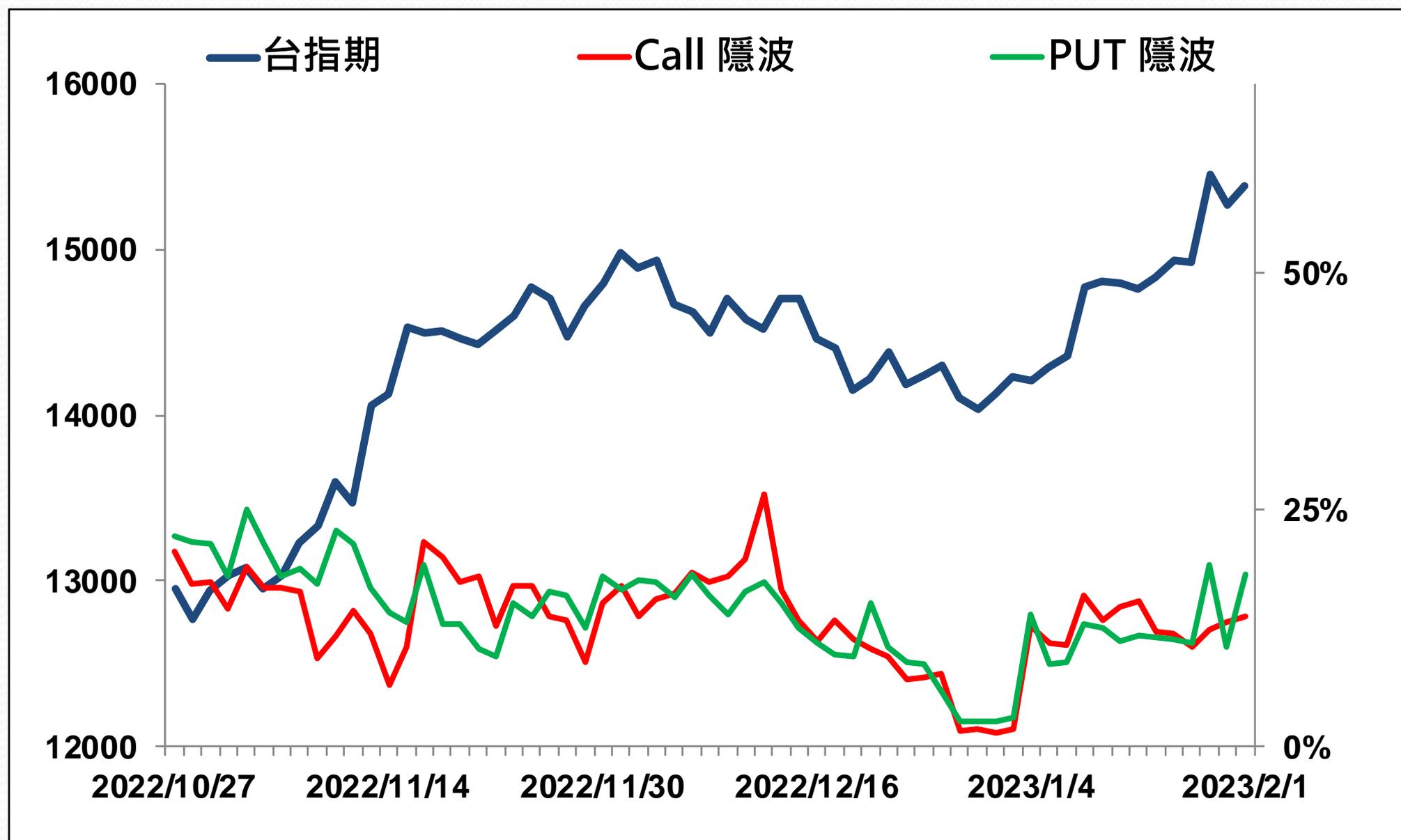
# 選擇權當日波動率指數

## 臺指選擇權波動率指數



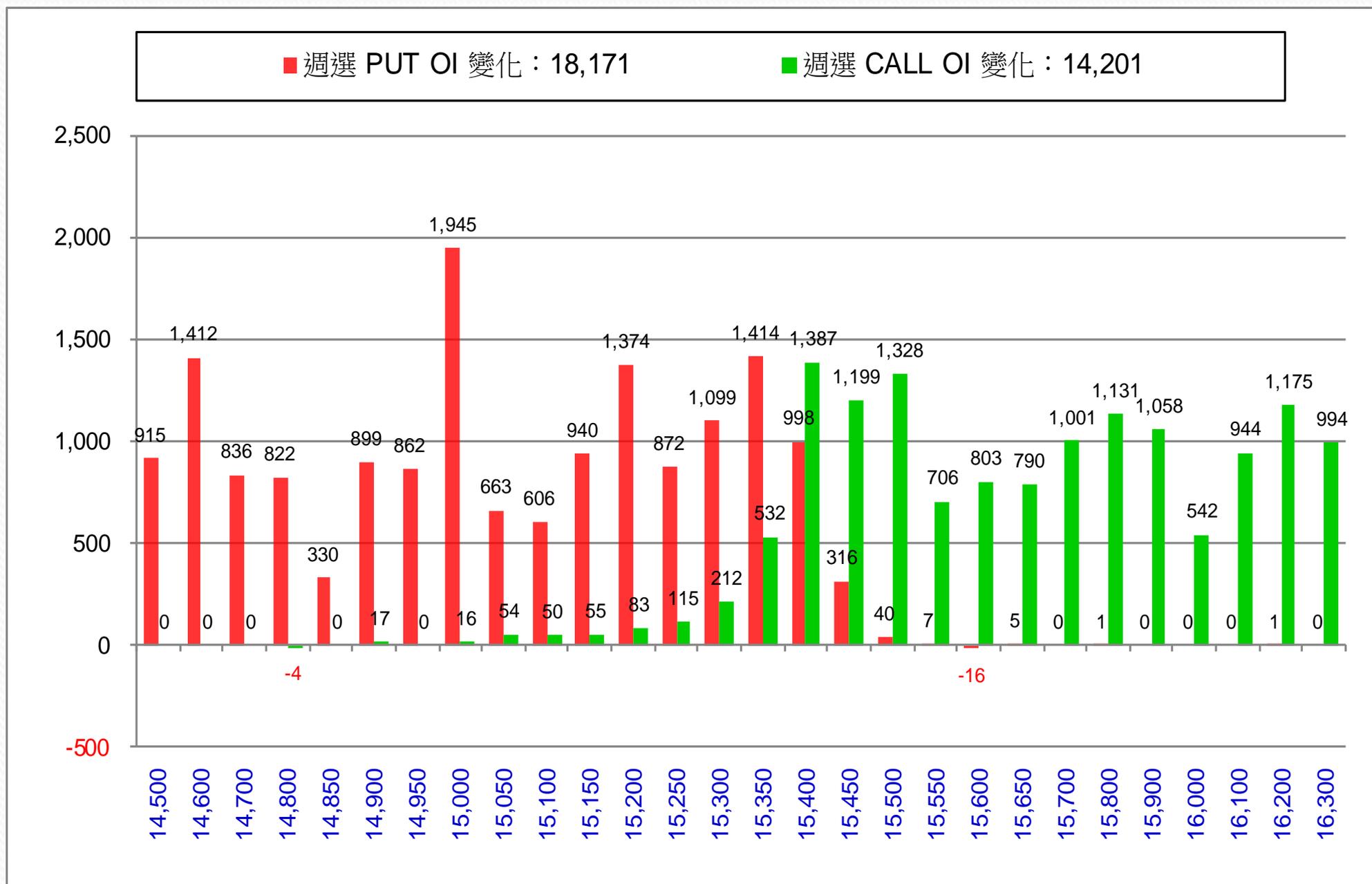
更新日期：2023年2月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2023年2月1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

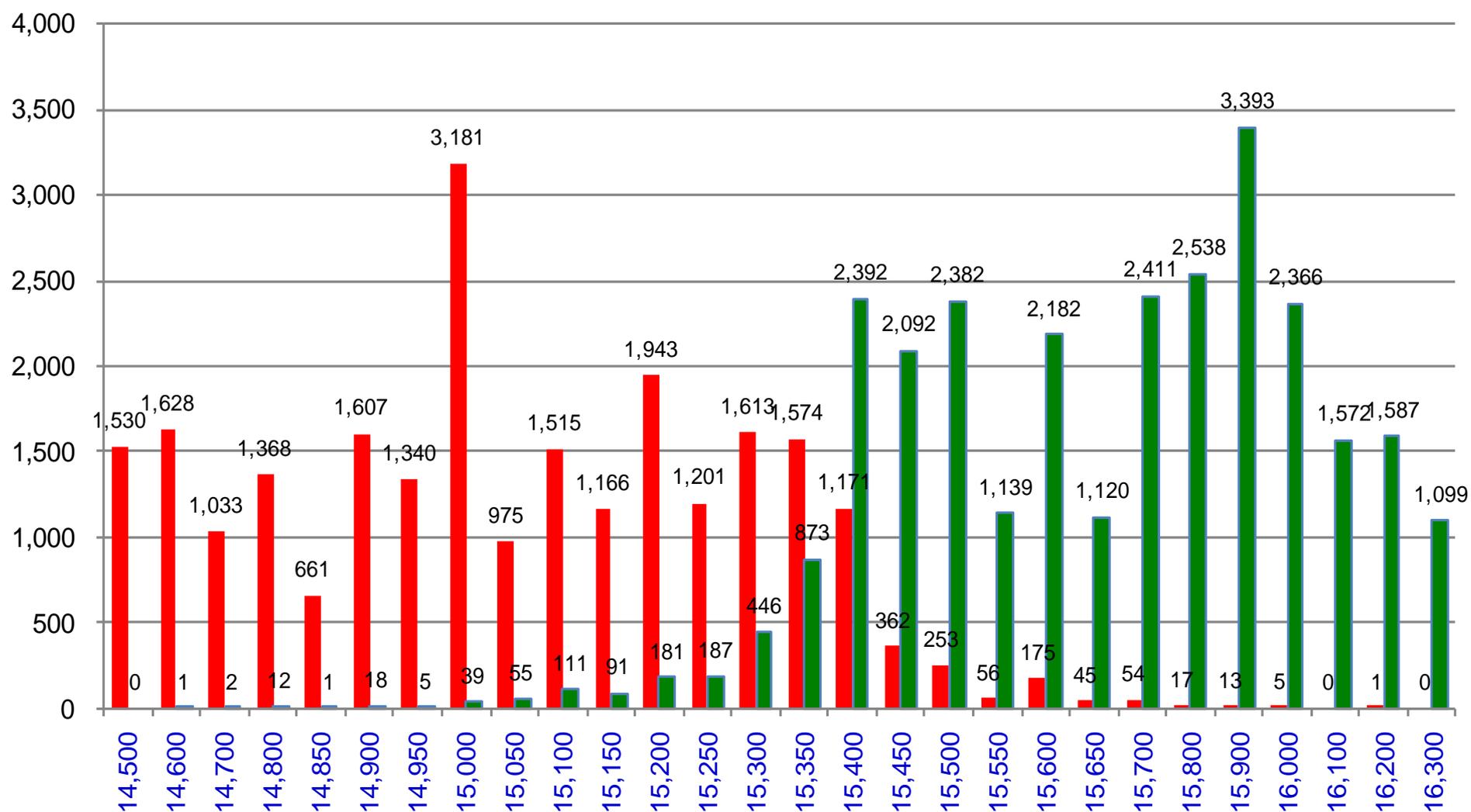


更新日期：2023年2月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：26,830

週選 CALL OI 總額：30,061



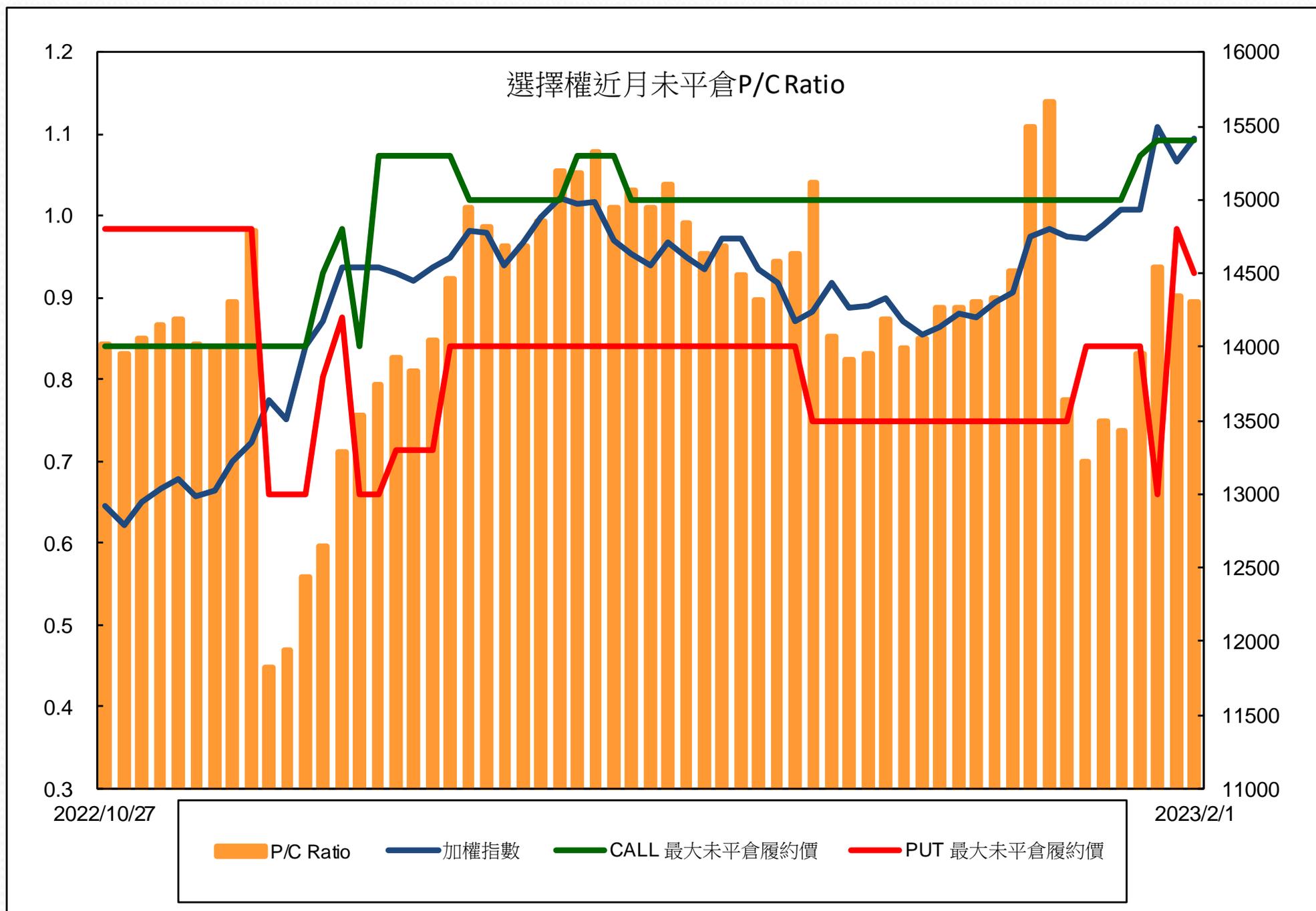
更新日期：2023年2月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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31日	50,829	60,290	-9,461
	2月1日	53,517	49,176	4,341
Put	1月31日	42,264	39,378	2,886
	2月1日	38,123	35,833	2,290

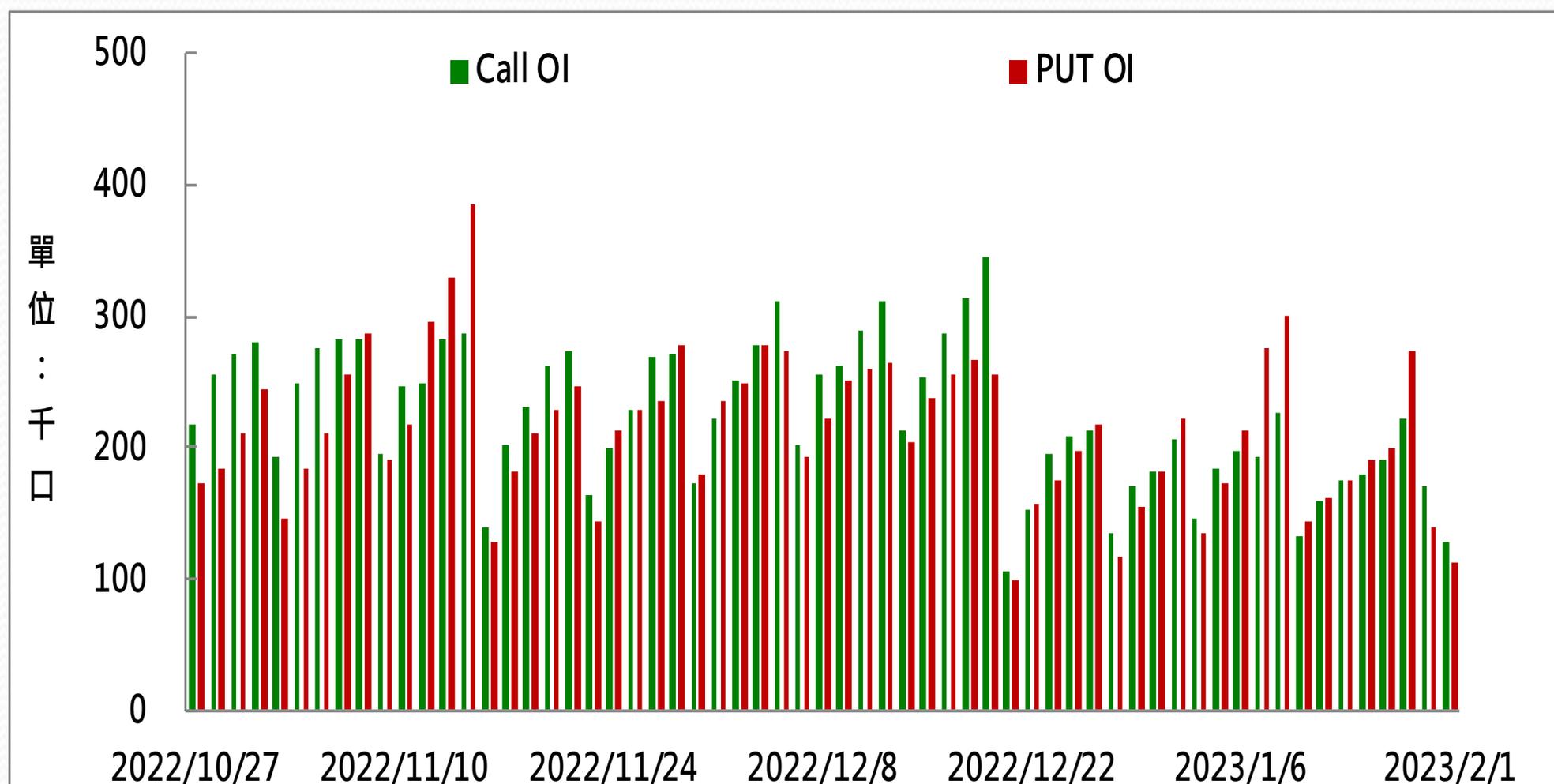
更新日期：2023年2月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

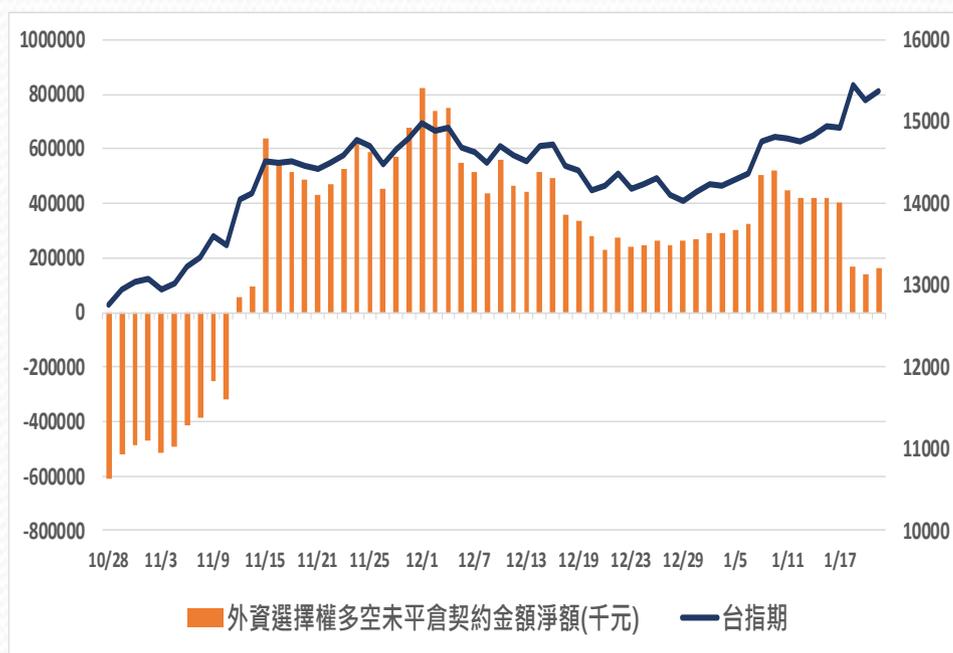
# 選擇權全月Put Call OI



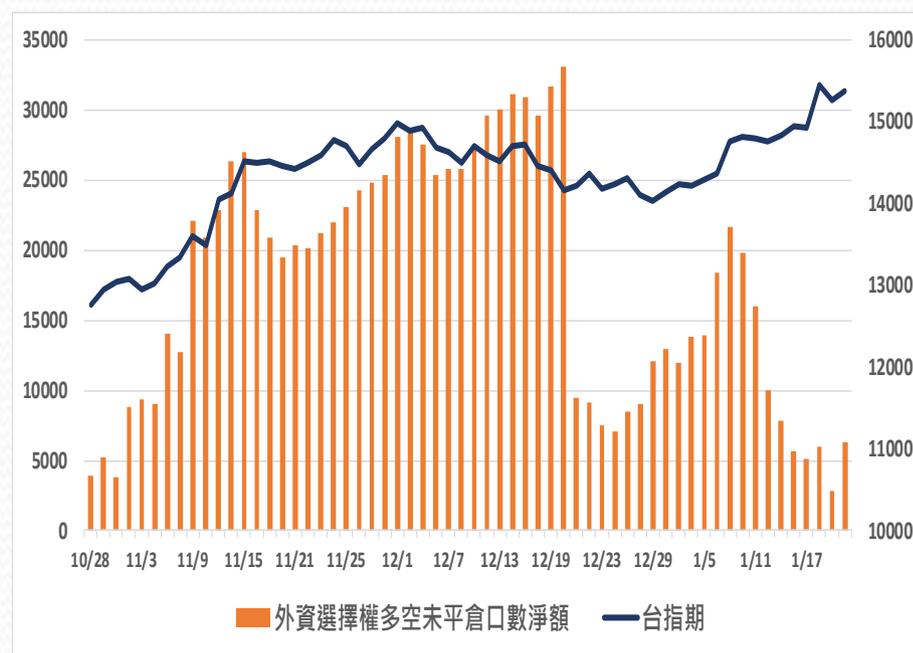
更新日期：2023年2月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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



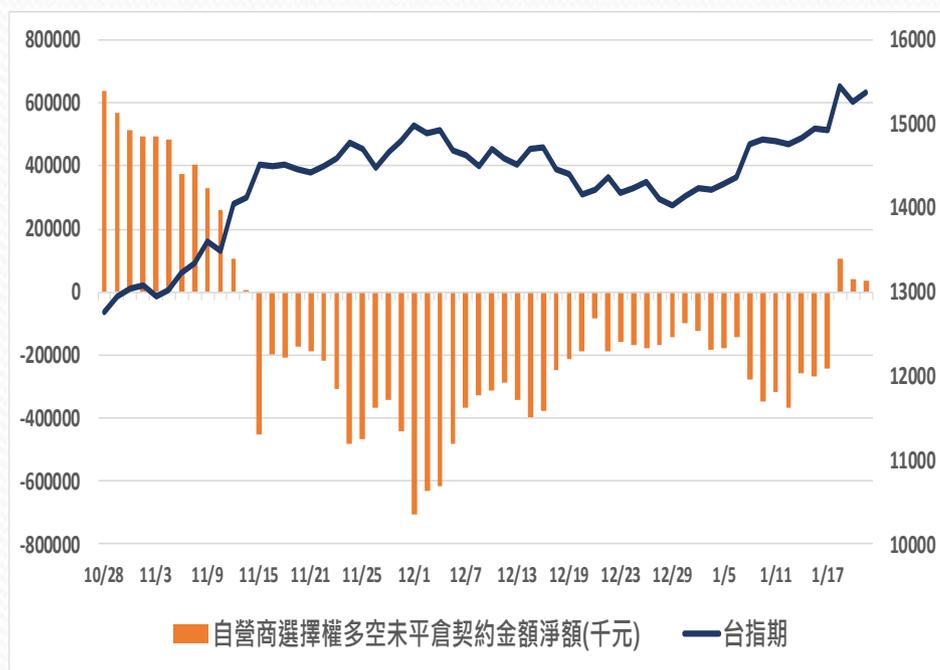
### 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/1/16	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
2023/2/1	15382	6314	3526	165437	26712

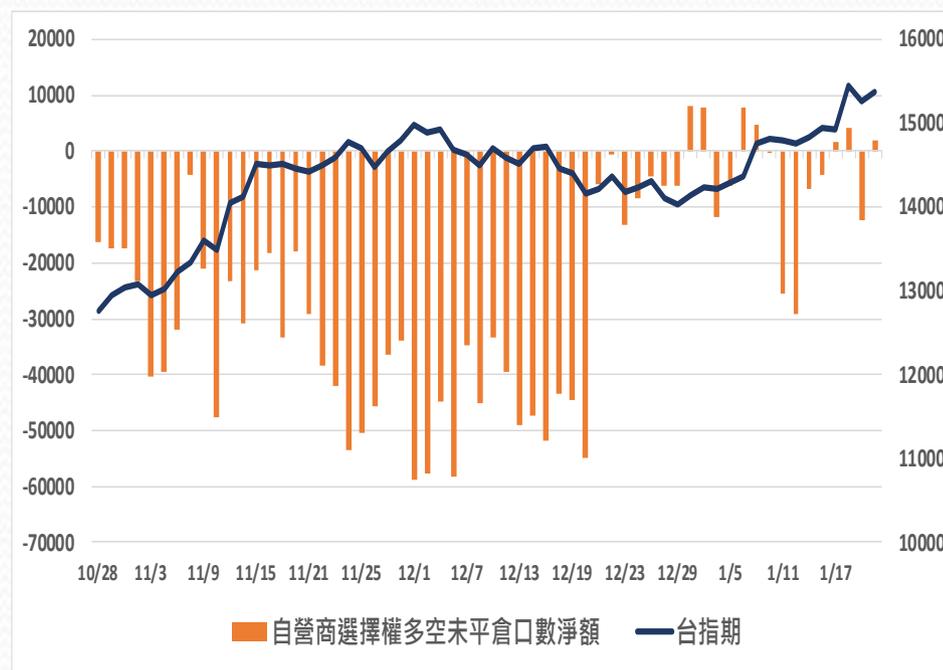
更新日期：2023年2月1日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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



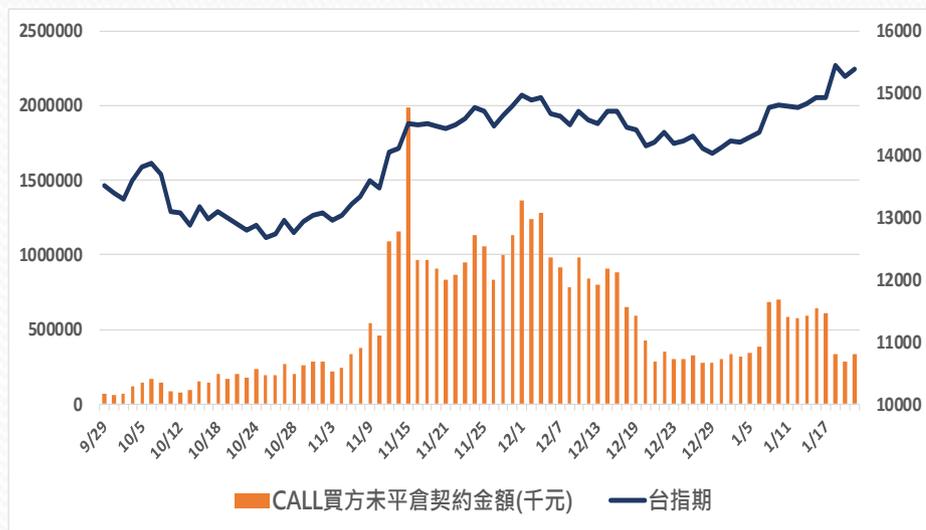
### 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/1/16	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
2023/2/1	15382	2051	14398	34958	-6727

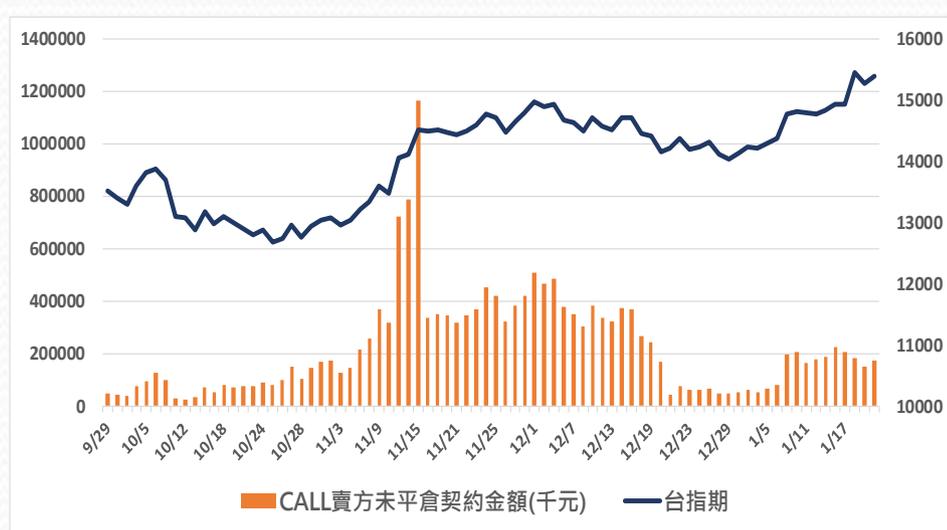
更新日期：2023年2月1日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 外資買賣權未平倉金額

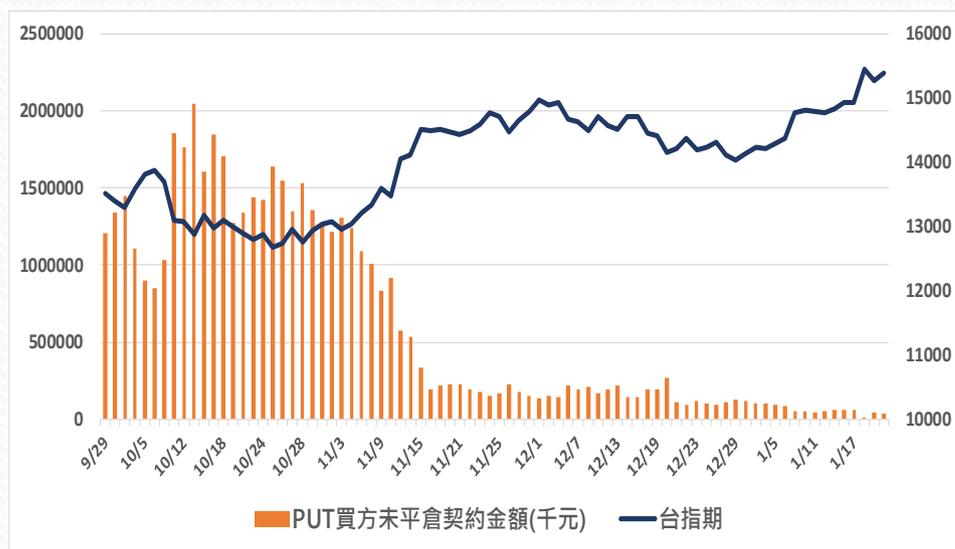
## CALL買方未平倉金額



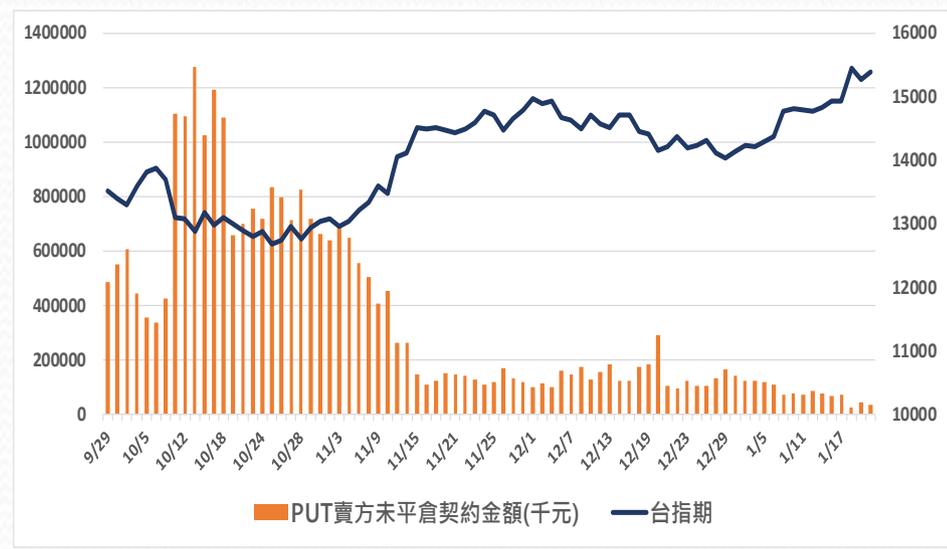
## CALL賣方未平倉金額



## PUT買方未平倉金額



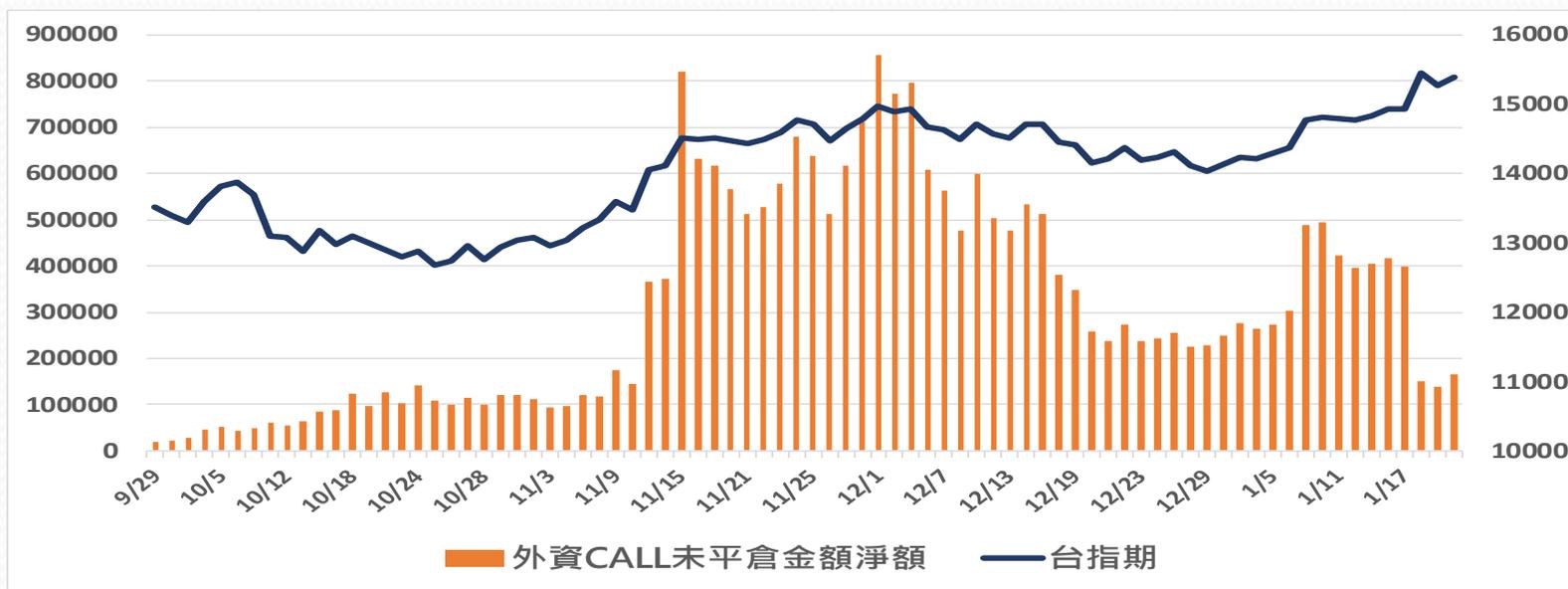
## PUT賣方未平倉金額



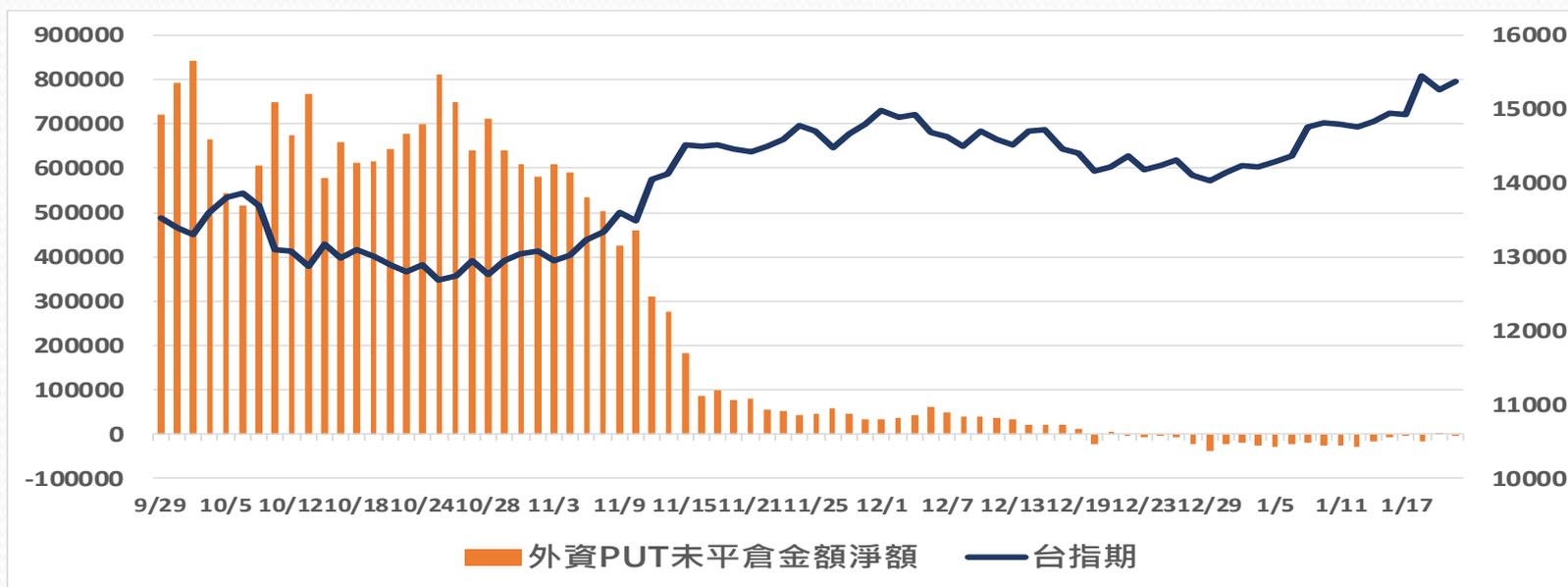
更新日期：2023年2月1日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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2月1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2月1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