

台指選擇權OI匯報

日期：2023/2/2 結算日：2023/2/8					日期：2023/2/2 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	1	14,850	1,577	916	-1	63	14,100	1,202	294
-4	14	14,900	3,425	1,818	0	91	14,200	2,229	338
-2	3	14,950	3,514	2,174	-1	123	14,300	2,958	196
3	42	15,000	4,626	1,445	-3	253	14,400	1,395	-261
8	63	15,050	3,330	2,355	-5	355	14,500	6,714	3,104 ※
-2	109	15,100	4,211	2,696	-6	1,460	14,600	4,072	1,138
19	110	15,150	3,997	2,831	-7	1,174	14,700	2,685	866
67	248	15,200	6,520	4,577 ※	-61	1,122	14,800	2,630	-368
36	223	15,250	4,194	2,993	-177	607	14,900	2,902	288
13	459	15,300	6,074	4,461	-125	1,421	15,000	3,313	878
279	1,152	15,350	3,736	2,162	-181	1,356	15,100	2,001	443
-597	1,795	15,400	4,790	3,619	-203	1,185	15,200	2,271	1,050
-228	1,864	15,450	2,073	1,711	-160	1,675	15,300	1,833	663
1,034	3,416	15,500	4,222	3,969	-1,204	3,200	15,400	2,632	1,542
1,044	2,183	15,550	1,850	1,794	-192	3,205	15,500	1,565	1,139
1,209	3,391	15,600	2,369	2,194	59	2,913	15,600	803	471
1,284	2,404	15,650	588	543	-327	3,204	15,700	306	160
429	2,840	15,700	671	617	949	5,238	15,800	116	43
1,101	3,141	15,750	208	202	749	5,137	15,900	69	32
3,447	5,985	15,800	126	109	※ 1,391	5,131	16,000	53	34
2,847	4,875	15,850	42	42	-110	3,109	16,100	18	9
※ 3,567	6,960	15,900	43	30	256	2,522	16,200	12	6
2,136	4,502	16,000	33	28	835	2,137	16,300	5	0
1,262	2,834	16,100	1	1	186	663	16,400	1	-1
775	2,362	16,200	1	0	-350	998	16,500	2	1
388	1,487	16,300	4	4	237	1,010	16,600	1	0
57	851	16,400	0	0	71	1,086	16,700	1	0
-212	756	16,500	0	0	23	848	16,800	50	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
19,963	54,092	1.3170	71,241	44,405	1,945	54,662	1.0742	58,718	11,891
昨日 P/C	0.8925	今日增減變化		0.4245	昨日 P/C	0.8951	今日增減變化		0.1791

更新日期：2023年2月2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2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	100,252,482	74,041,867	26,210,615	13,181,433	2,898,027	1,832,991	1,065,036	-667,745	
投信	31,708,416	49,968,176	-18,259,760	1,893,736	426,619	0	426,619	8,555	
自營商	39,558,077	20,773,380	18,784,697	1,319,328	1,056,015	826,628	229,387	-171,273	
	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	570,422	1,912,867	-1,342,445	31,606	25,225	20,773	4,452	28,231	
投信	89,080	0	89,080	582	0	0	0	0	
自營商	259,421	104,677	154,744	-11,384	103,859	90,503	13,356	-44,606	

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2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	20,665	10,010	10,655	4,193	15,755	13,234	2,521	2,373	
投信	0	100	-100	0	400	111	289	100	
自營商	62,358	56,649	5,709	1,368	51,741	50,412	1,329	-961	
特定法人(週)	1,323	0	1,323	1,013	0	2,023	-2,023	-492	
特定法人(近月)	8,620	9,330	-710	5	4,425	5,987	-1,562	-1,275	
特定法人(全月)	8,861	5,700	3,161	269	5,625	7,126	-1,501	-2,786	
十大交易人(週)	28,448	22,175	6,273	4,353	26,057	24,404	1,653	1,716	
十大交易人(近月)	28,926	26,412	2,514	-2,112	30,334	23,837	6,497	1,347	
十大交易人(全月)	78,697	67,887	10,810	1,141	70,838	57,749	13,089	746	
全市場未沖銷(近月)			58,714	5,294			62,592	14,778	
全市場未沖銷(全月)			157,141	29,645			174,915	62,305	

更新日期：2023年2月2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	15400	賣權OI最大量	15200
	整體隱含波動率	13.89%	較前一交易日	-1.75%
	買權隱含波動率	12.88%	較前一交易日	-1.04%
	賣權隱含波動率	14.73%	較前一交易日	-2.72%
電子選擇權	買權成交最大量	710	買權OI最大量	730
	賣權成交最大量	710	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	1600
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1360

更新日期：2023年2月2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

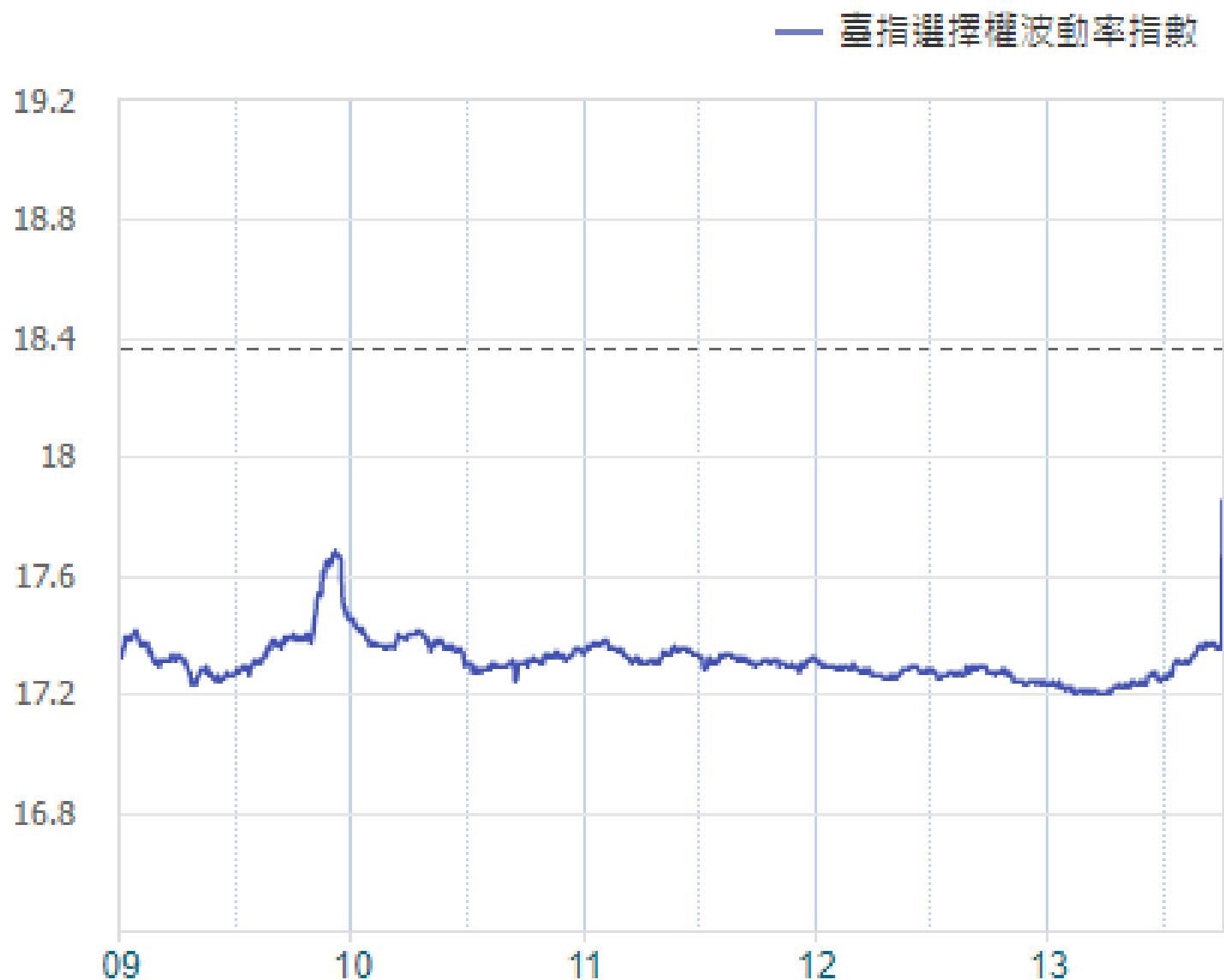
2023年02月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16000	買權OI最大量	15800
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	14500
	整體隱含波動率	16.02%	較前一交易日	-0.16%
	買權隱含波動率	13.59%	較前一交易日	+0.06%
	賣權隱含波動率	18.38%	較前一交易日	-0.96%
	成交量P/C_Ratio值	0.984	較前一交易日	+0.28
	未平倉P/C_Ratio值	1.066	較前一交易日	+0.17
電子選擇權	買權成交最大量	710	買權OI最大量	730
	賣權成交最大量	710	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	1600
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1360

更新日期：2023年2月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

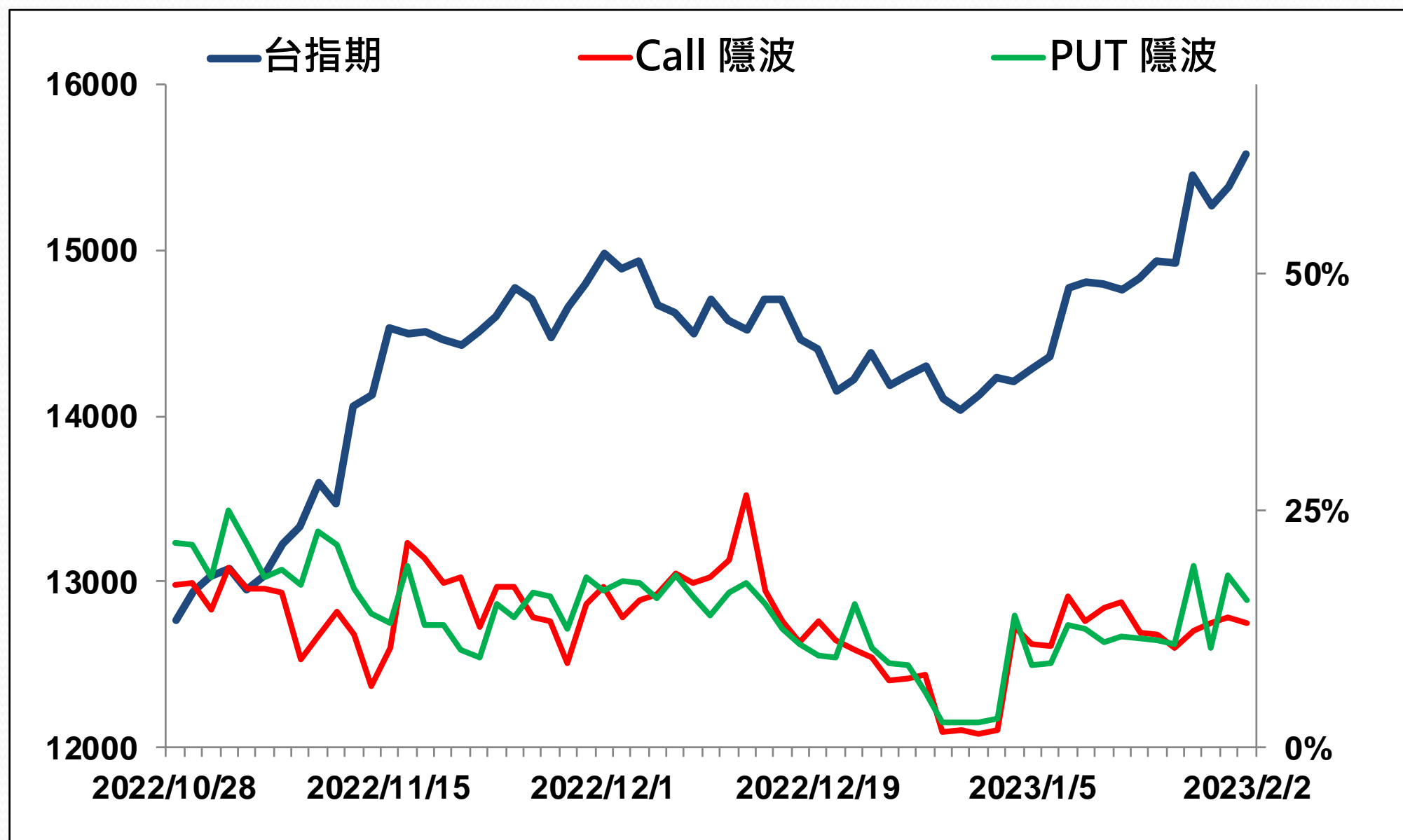
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年2月2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

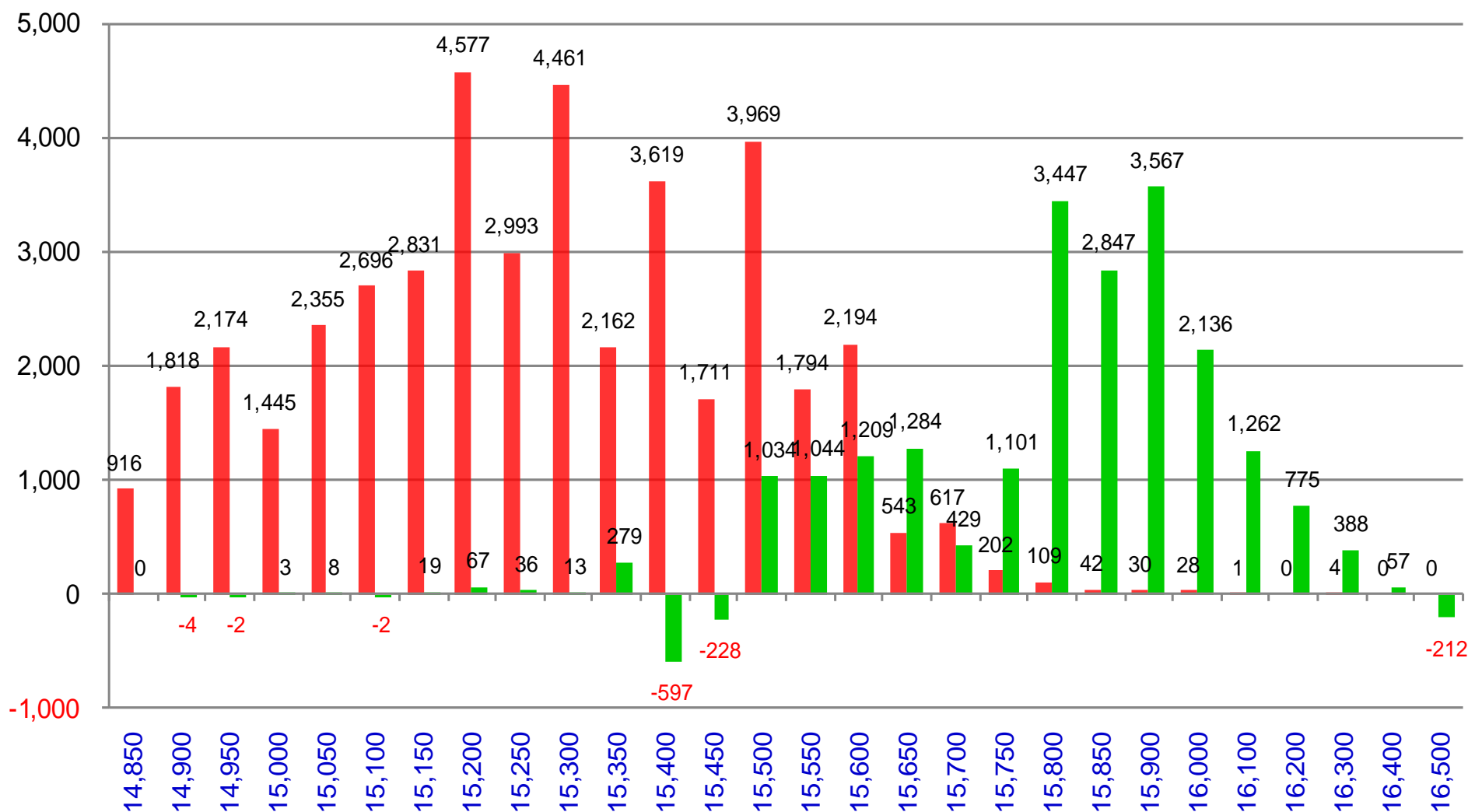


更新日期：2023年2月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：44,405

週選 CALL OI 變化：19,963

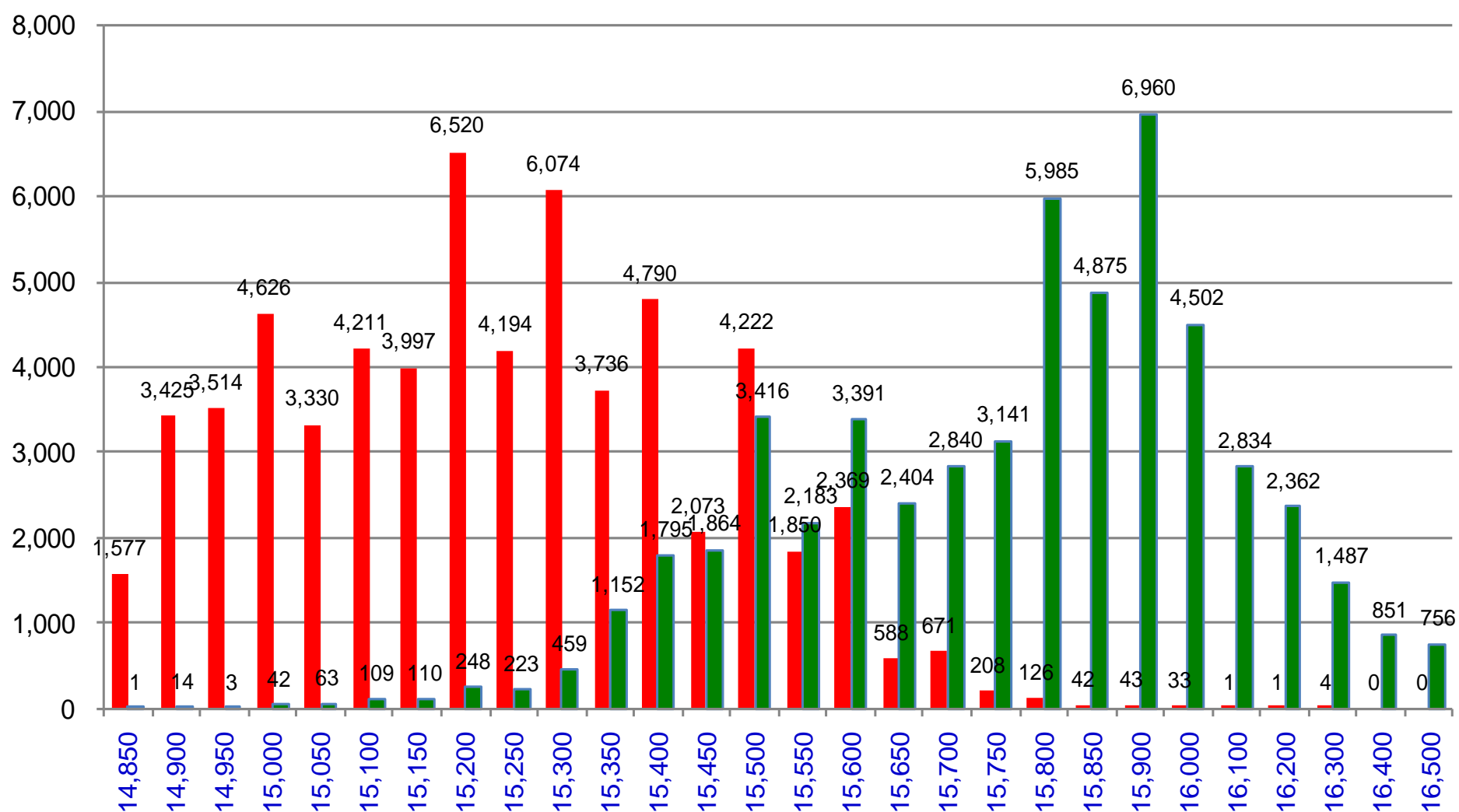


更新日期：2023年2月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：71,241

週選 CALL OI 總額：54,092



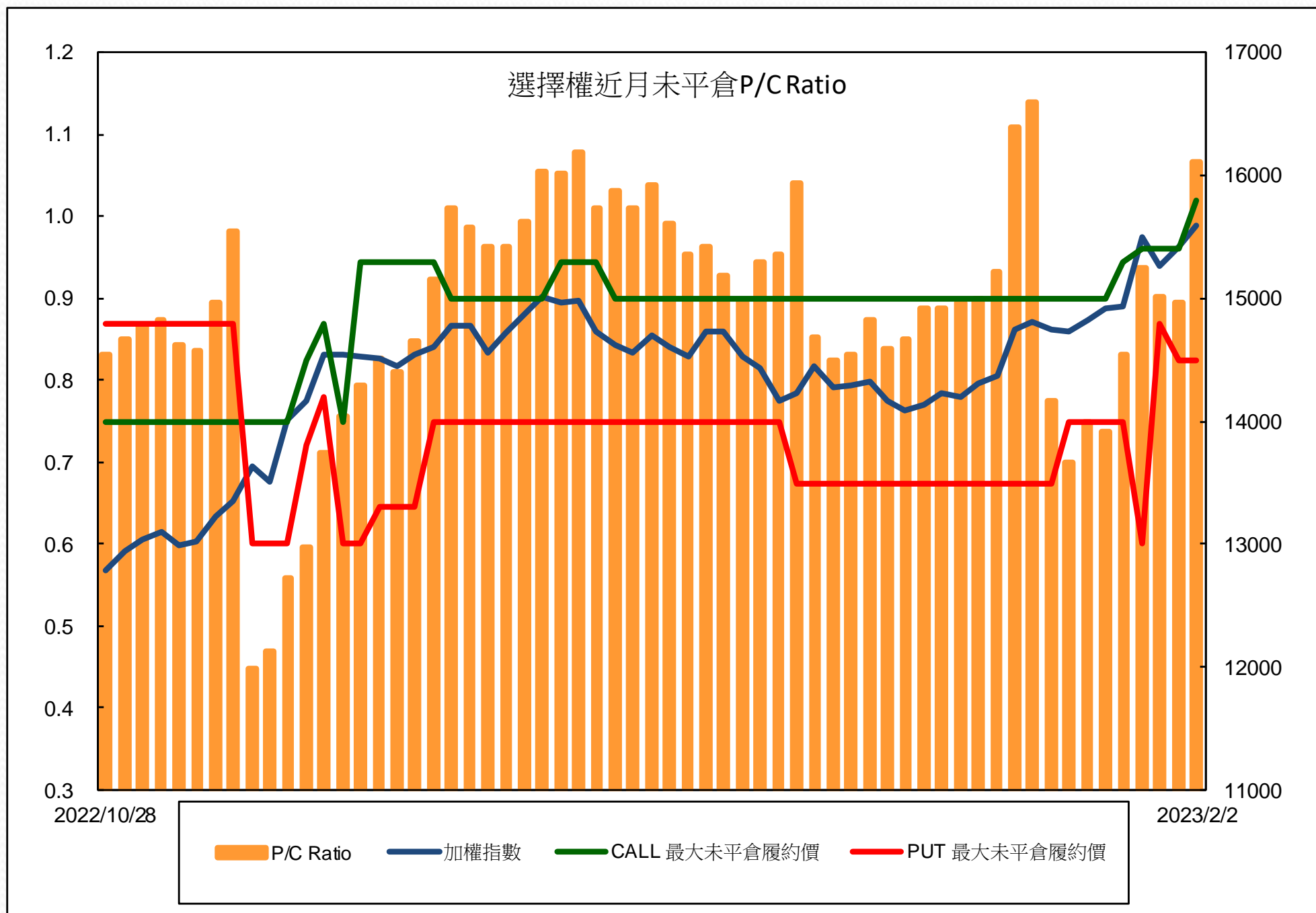
更新日期：2023年2月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	2月1日	53,517	49,176	4,341
	2月2日	62,358	56,649	5,709
Put	2月1日	38,123	35,833	2,290
	2月2日	51,741	50,412	1,329

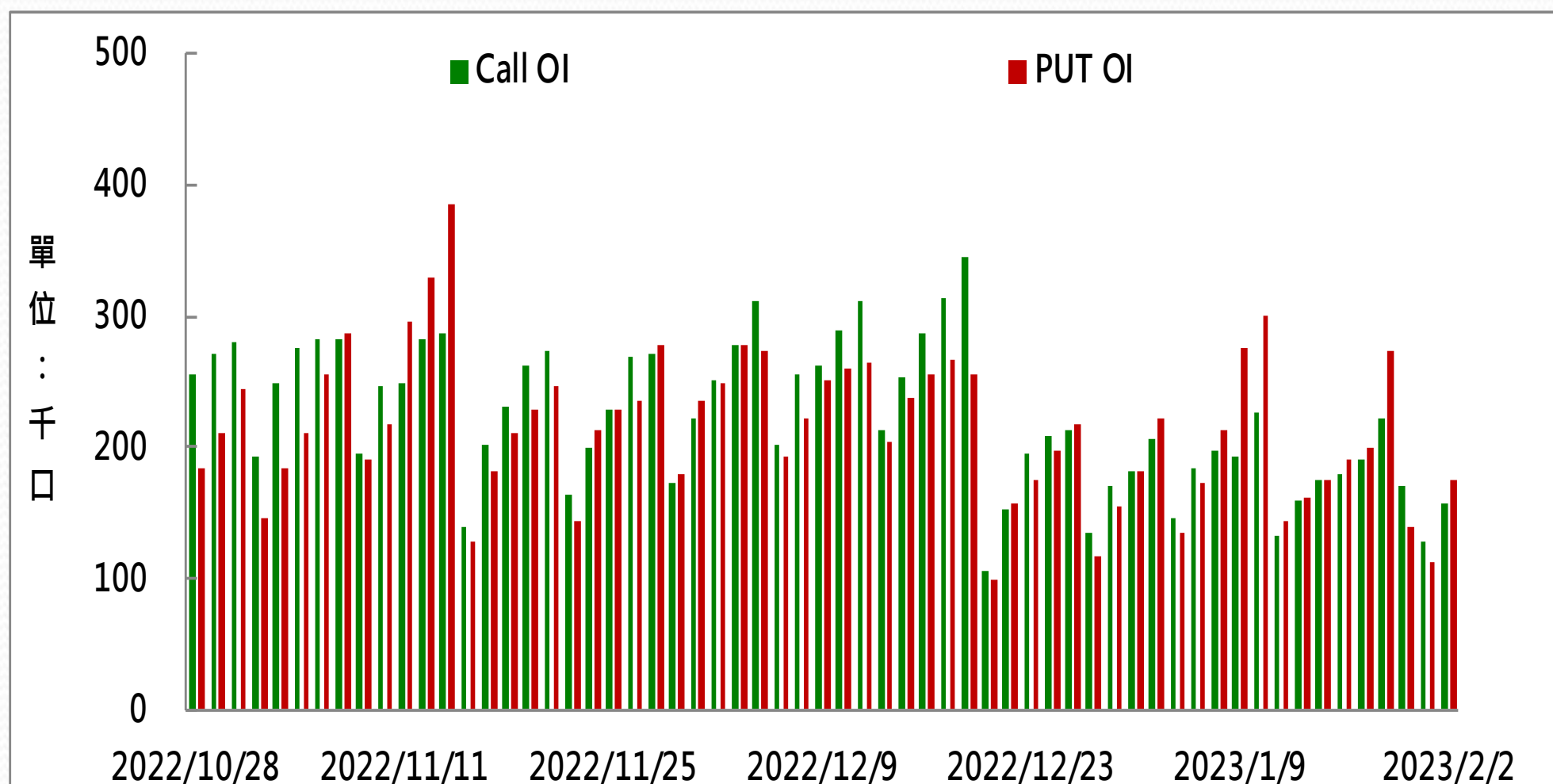
更新日期：2023年2月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

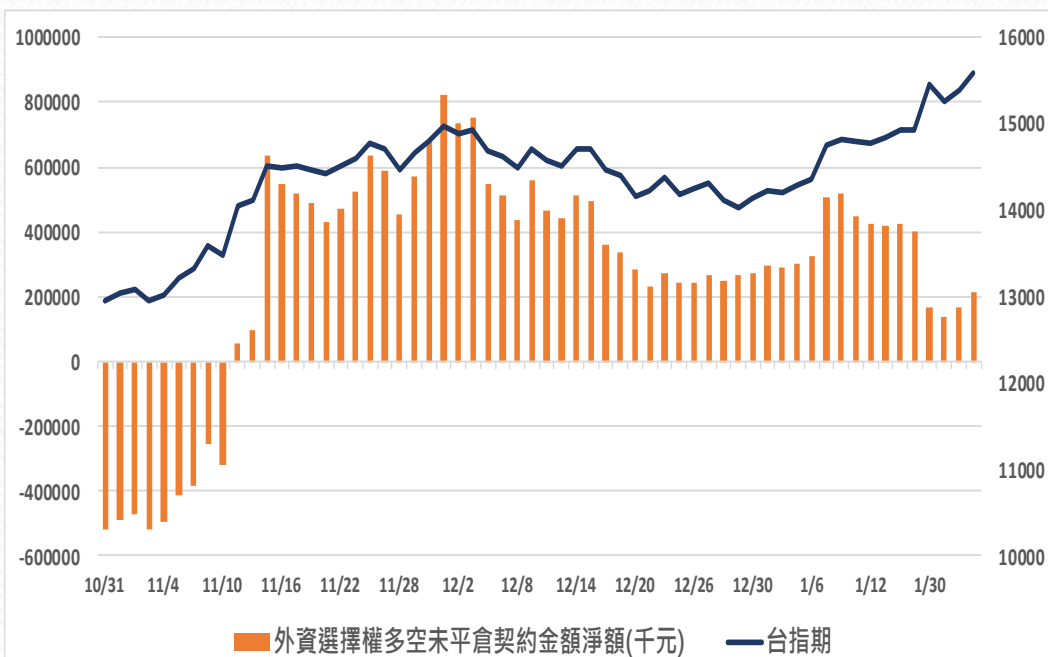
選擇權全月Put Call OI



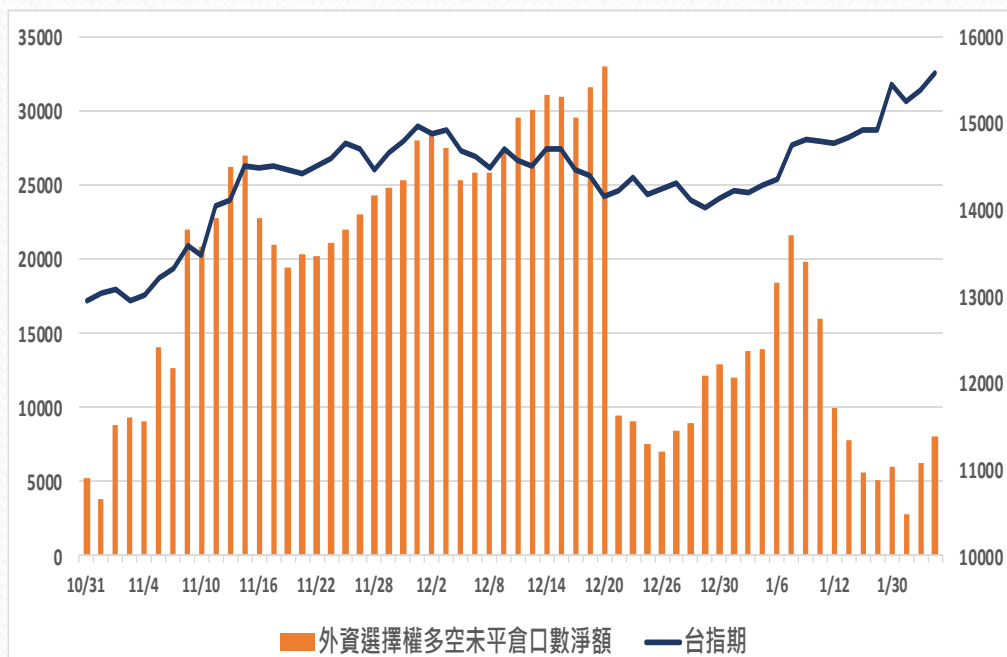
更新日期：2023年2月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



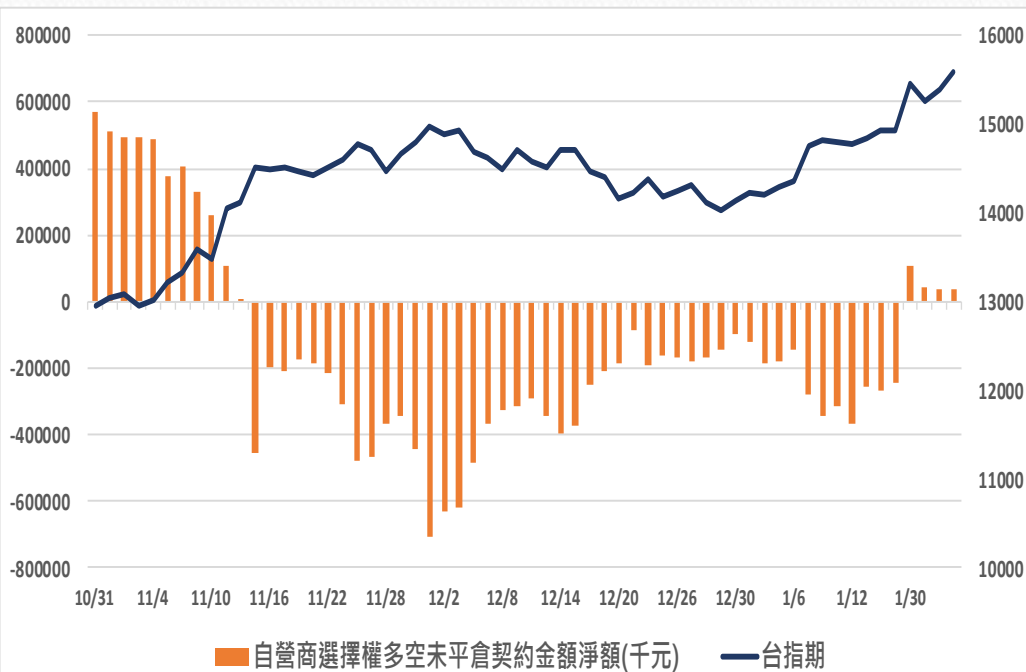
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/1/17	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
2023/2/2	15580	8134	1820	216797	51360

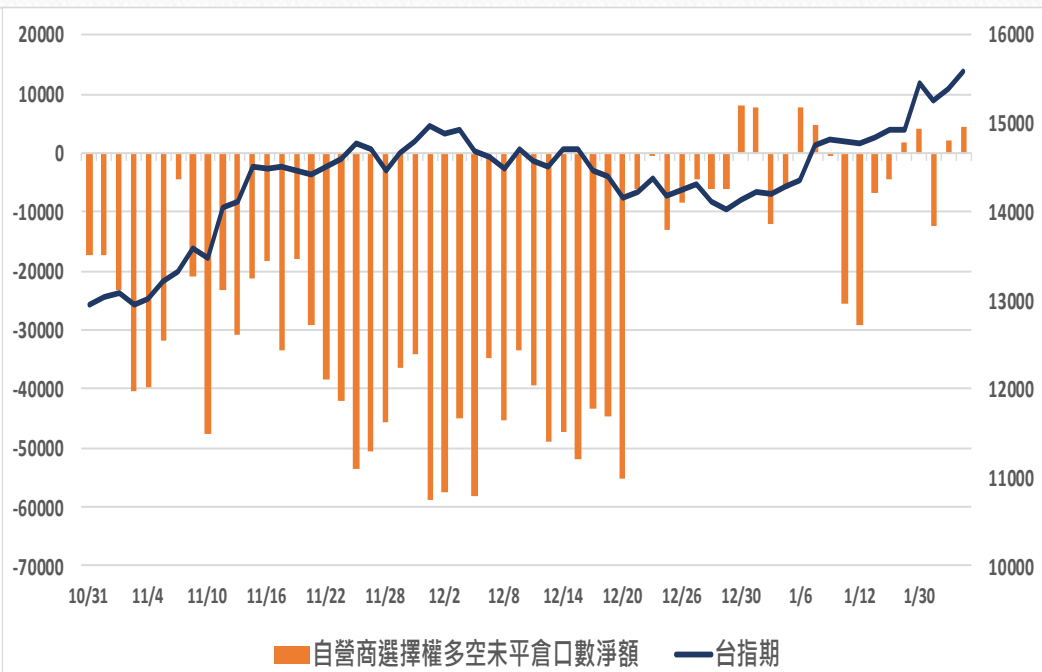
更新日期：2023年2月2日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



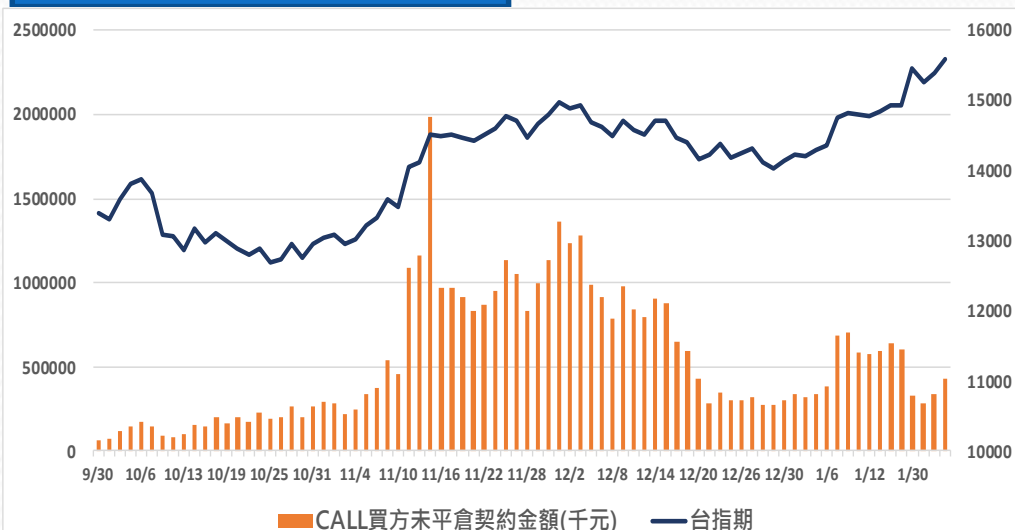
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/1/17	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
2023/2/2	15580	4380	2329	38550	3592

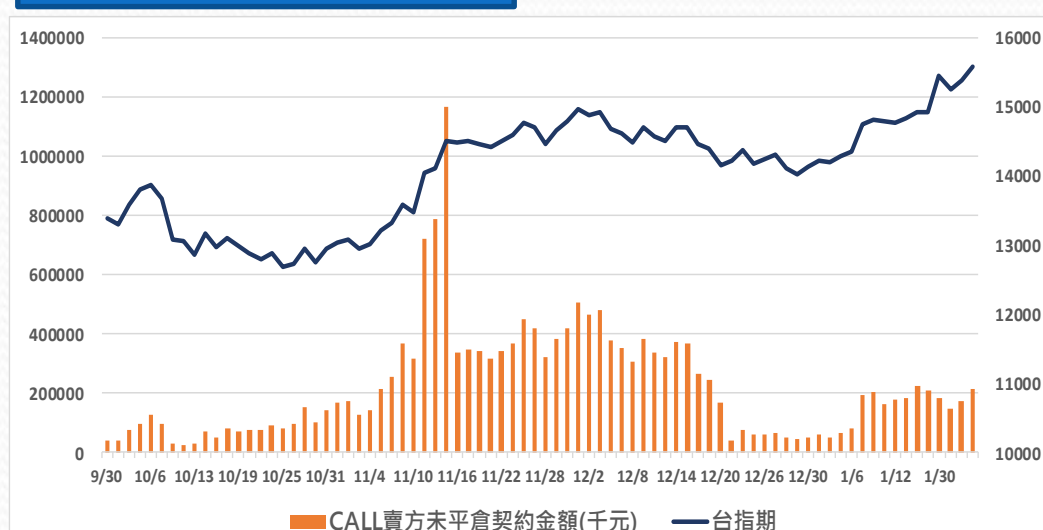
更新日期：2023年2月2日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

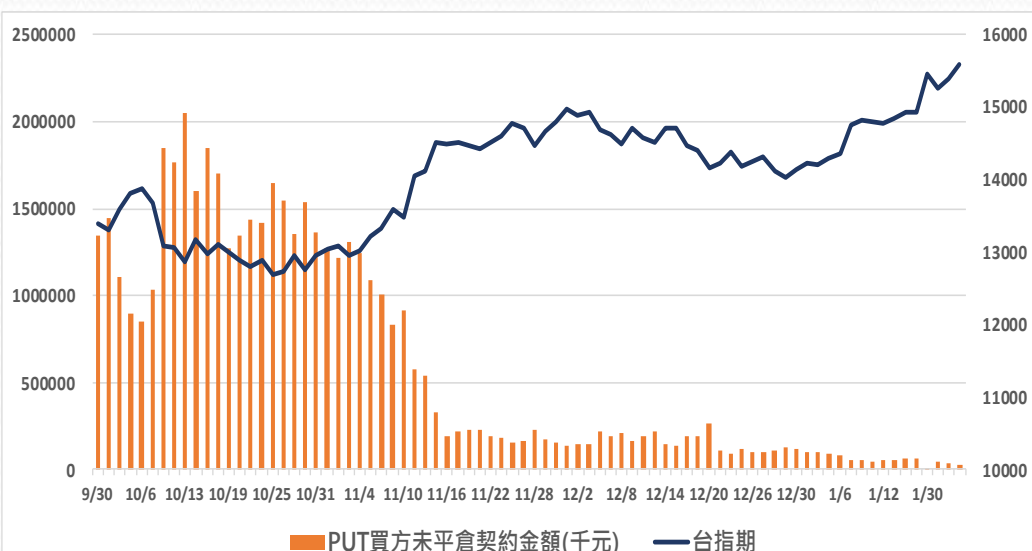
CALL買方未平倉金額



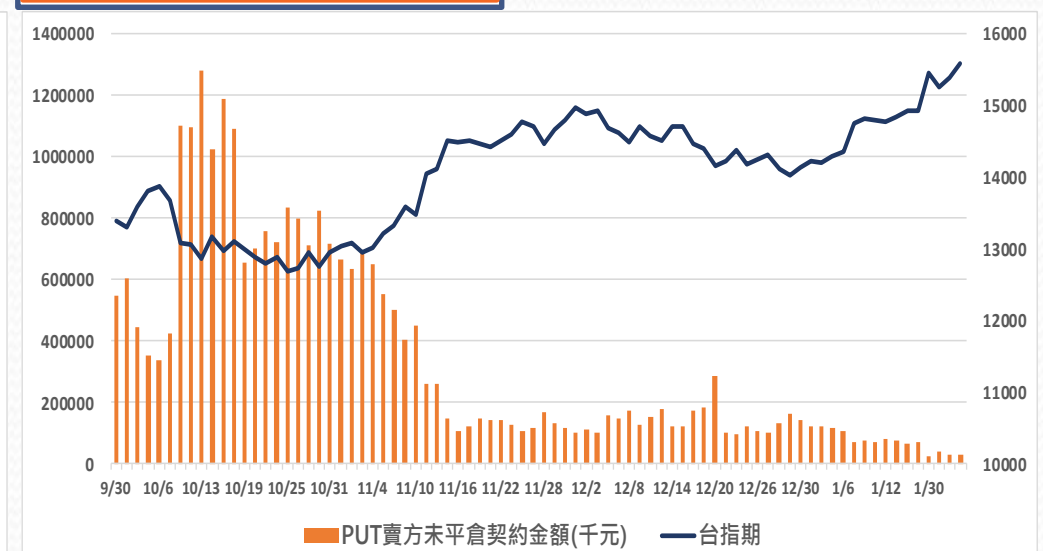
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



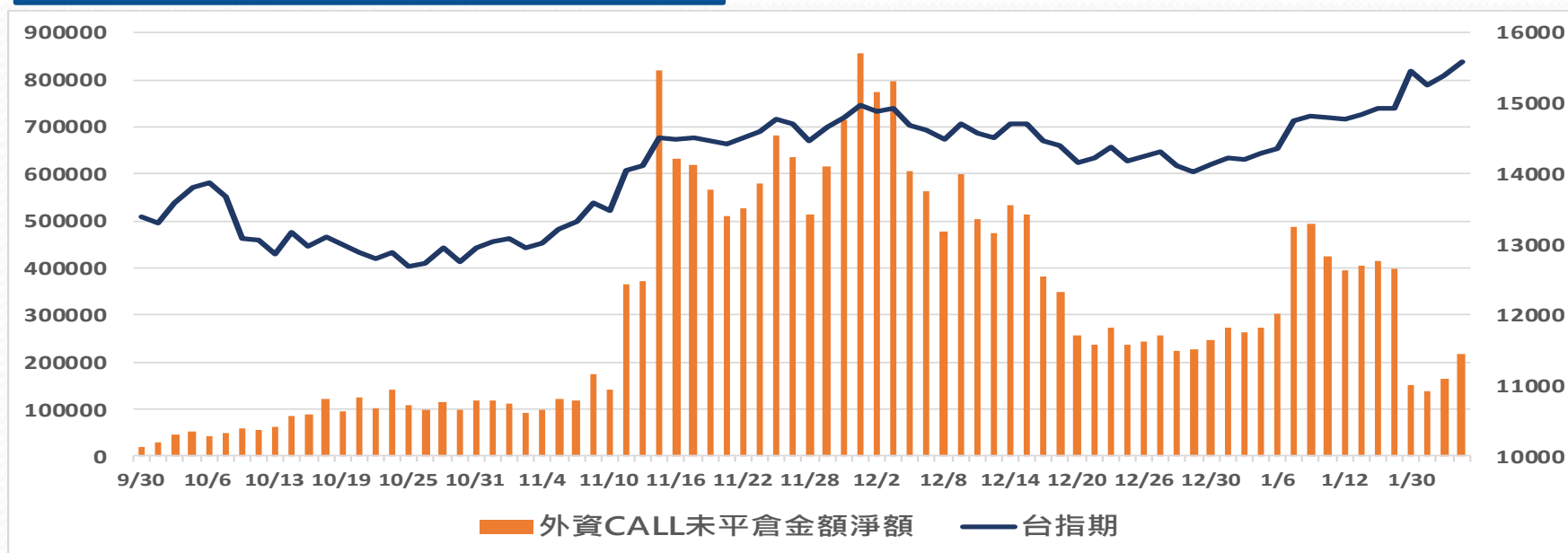
PUT賣方未平倉金額



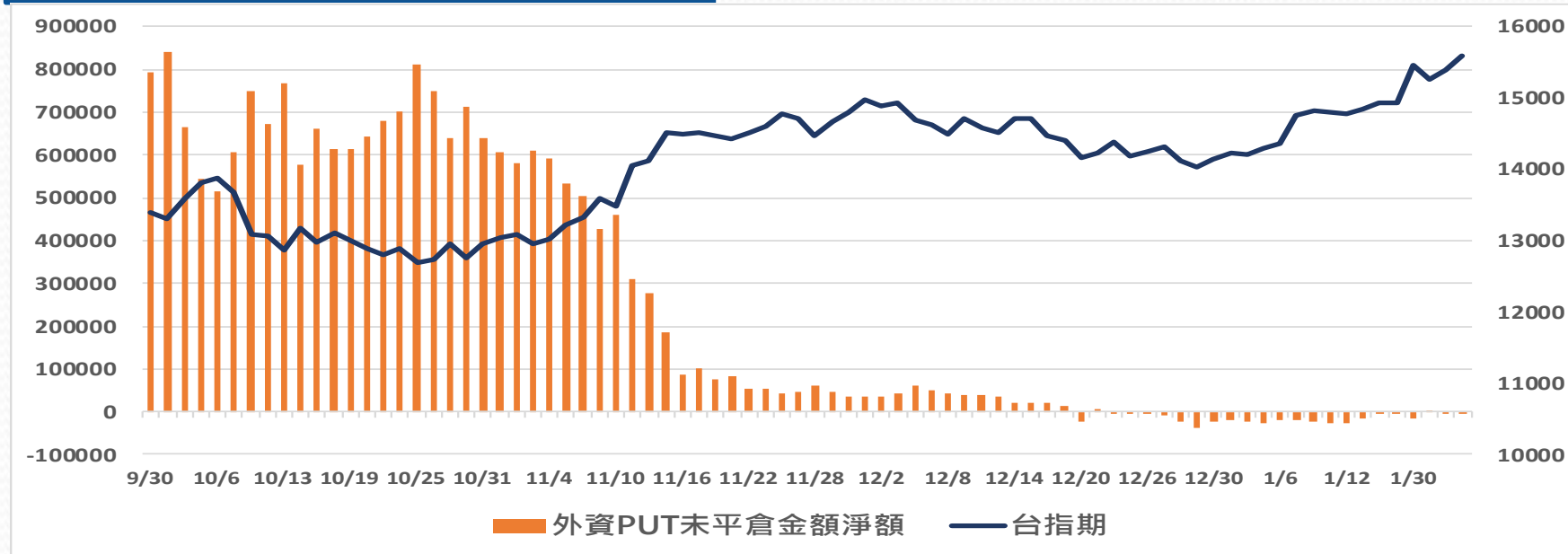
更新日期：2023年2月2日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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2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2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