

台指選擇權OI匯報

日期：2023/2/3 結算日：2023/2/8					日期：2023/2/3 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	1,425	-152	0	63	14,100	1,533	331
20	34	14,900	3,495	70	-1	90	14,200	2,365	136
18	21	14,950	3,170	-344	0	123	14,300	3,904	946
9	51	15,000	5,260	634	0	253	14,400	1,713	318
14	77	15,050	3,483	153	0	355	14,500	8,859	2,145 ※
-13	96	15,100	4,721	510	-5	1,455	14,600	4,184	112
-13	97	15,150	4,605	608	-18	1,156	14,700	3,041	356
-3	245	15,200	6,783	263	-21	1,101	14,800	3,752	1,122
-47	176	15,250	4,475	281	-39	568	14,900	2,979	77
89	548	15,300	7,299	1,225	-35	1,386	15,000	3,500	187
-206	946	15,350	4,811	1,075	-54	1,302	15,100	2,174	173
121	1,916	15,400	7,521	2,731 ※	46	1,231	15,200	2,708	437
189	2,053	15,450	3,944	1,871	-146	1,529	15,300	2,140	307
259	3,675	15,500	6,401	2,179	-80	3,120	15,400	2,651	19
348	2,531	15,550	3,330	1,480	-21	3,184	15,500	2,030	465
1,165	4,556	15,600	3,429	1,060	124	3,037	15,600	1,070	267
1,202	3,606	15,650	1,257	669	-86	3,118	15,700	388	82
※ 2,566	5,406	15,700	825	154	-57	5,181	15,800	152	36
1,886	5,027	15,750	323	115	913	6,050	15,900	69	0
1,852	7,837	15,800	280	154	525	5,656	16,000	57	4
1,632	6,507	15,850	101	59	※ 1,325	4,434	16,100	45	27
1,945	8,905	15,900	125	82	493	3,015	16,200	12	0
1,012	5,324	15,950	33	5	240	2,377	16,300	7	2
1,883	6,385	16,000	96	63	237	900	16,400	2	1
840	840	16,050	20	20	163	1,161	16,500	5	3
1,179	4,013	16,100	7	6	126	1,136	16,600	1	0
240	2,602	16,200	7	6	9	1,095	16,700	1	0
226	1,713	16,300	6	2	109	957	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
18,462	76,866	1.1152	85,724	14,455	3,749	58,411	1.1362	66,364	7,646
昨日 P/C	1.3170	今日增減變化	-0.2018		昨日 P/C	1.0660	今日增減變化	0.0701	

更新日期：2023年2月3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3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	99,286,825	70,214,293	29,072,532	2,861,917	2,921,382	1,899,525	1,021,857	-43,179	
投信	31,305,345	49,971,383	-18,666,038	-406,278	418,190	0	418,190	-8,429	
自營商	38,865,833	22,239,793	16,626,040	-2,158,657	995,096	739,003	256,093	26,706	
	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	546,367	1,953,533	-1,407,166	-64,721	31,185	20,790	10,395	5,943	
投信	88,726	0	88,726	-354	0	0	0	0	
自營商	252,169	90,276	161,893	7,149	99,407	97,901	1,506	-11,850	

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3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	22,506	10,985	11,521	866	20,224	15,048	5,176	2,655	
投信	0	100	-100	0	400	111	289	0	
自營商	69,734	57,789	11,945	6,236	55,402	58,945	-3,543	-4,872	
特定法人(週)	1,123	0	1,123	-200	0	1,971	-1,971	52	
特定法人(近月)	9,608	9,337	271	981	4,776	7,991	-3,215	-1,653	
特定法人(全月)	9,490	5,700	3,790	629	6,031	12,724	-6,693	-5,192	
十大交易人(週)	34,775	28,692	6,083	-190	31,063	23,149	7,914	6,261	
十大交易人(近月)	30,519	29,691	828	-1,686	34,837	30,352	4,485	-2,012	
十大交易人(全月)	85,109	73,867	11,242	432	80,943	65,771	15,172	2,083	
全市場未沖銷(近月)			63,742	5,028			71,634	9,042	
全市場未沖銷(全月)			182,160	25,019			200,888	25,973	

更新日期：2023年2月3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	15800	買權OI最大量	15900
	賣權成交最大量	15500	賣權OI最大量	15400
	整體隱含波動率	12.76%	較前一交易日	-1.14%
	買權隱含波動率	11.14%	較前一交易日	-1.75%
	賣權隱含波動率	14.40%	較前一交易日	-0.33%
電子選擇權	買權成交最大量	435	買權OI最大量	730
	賣權成交最大量	730	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	1540	賣權OI最大量	1360

更新日期：2023年2月3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	15900
	賣權成交最大量	15400	賣權OI最大量	14500
	整體隱含波動率	15.89%	較前一交易日	+0.13%
	買權隱含波動率	13.35%	較前一交易日	-0.24%
	賣權隱含波動率	18.23%	較前一交易日	-0.15%
	成交量P/C_Ratio值	0.993	較前一交易日	+0.01
	未平倉P/C_Ratio值	1.124	較前一交易日	+0.06
電子選擇權	買權成交最大量	505	買權OI最大量	730
	賣權成交最大量	730	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	1540	賣權OI最大量	1360

更新日期：2023年2月3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

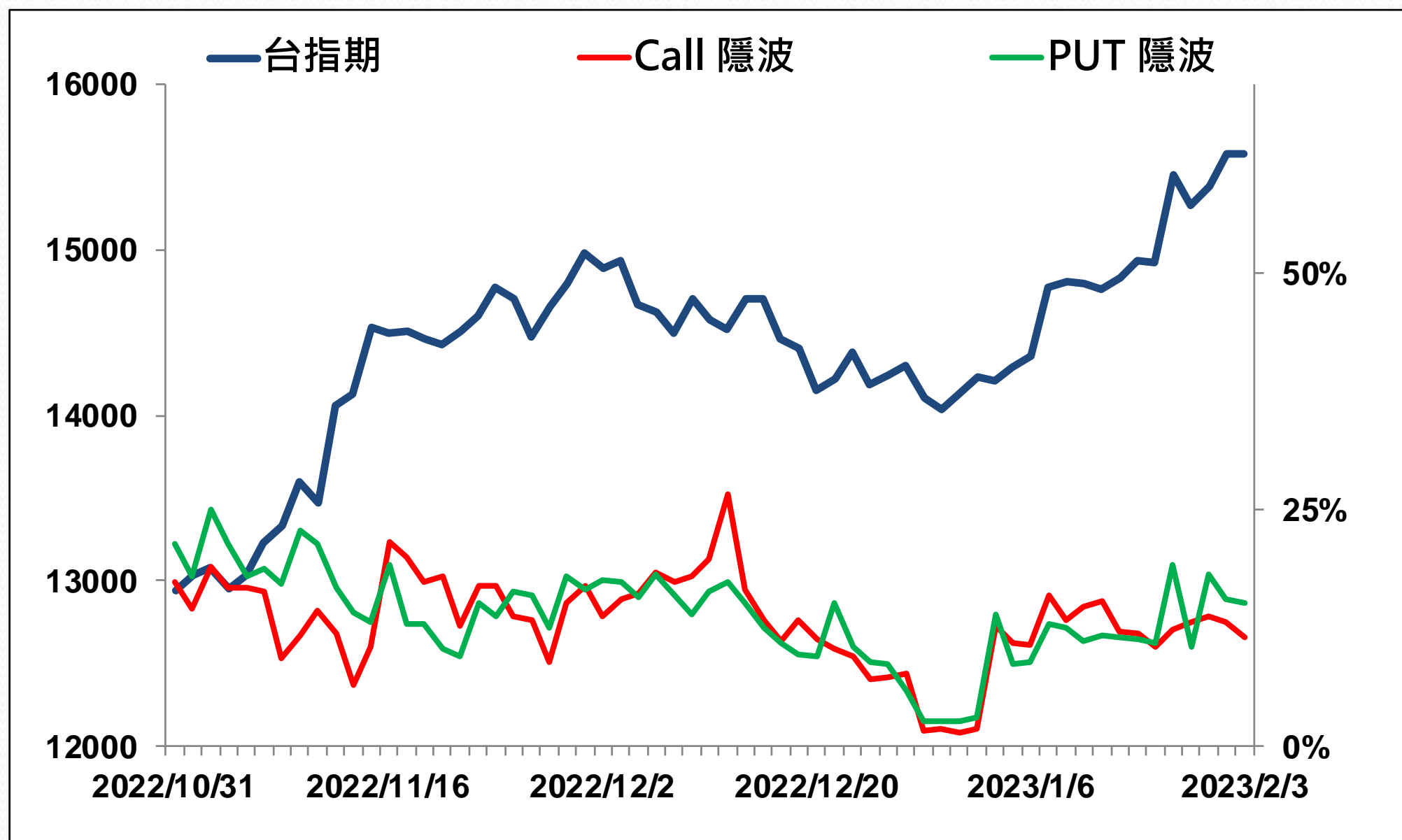
臺指選擇權波動率指數

— 臺指選擇權波動率指數



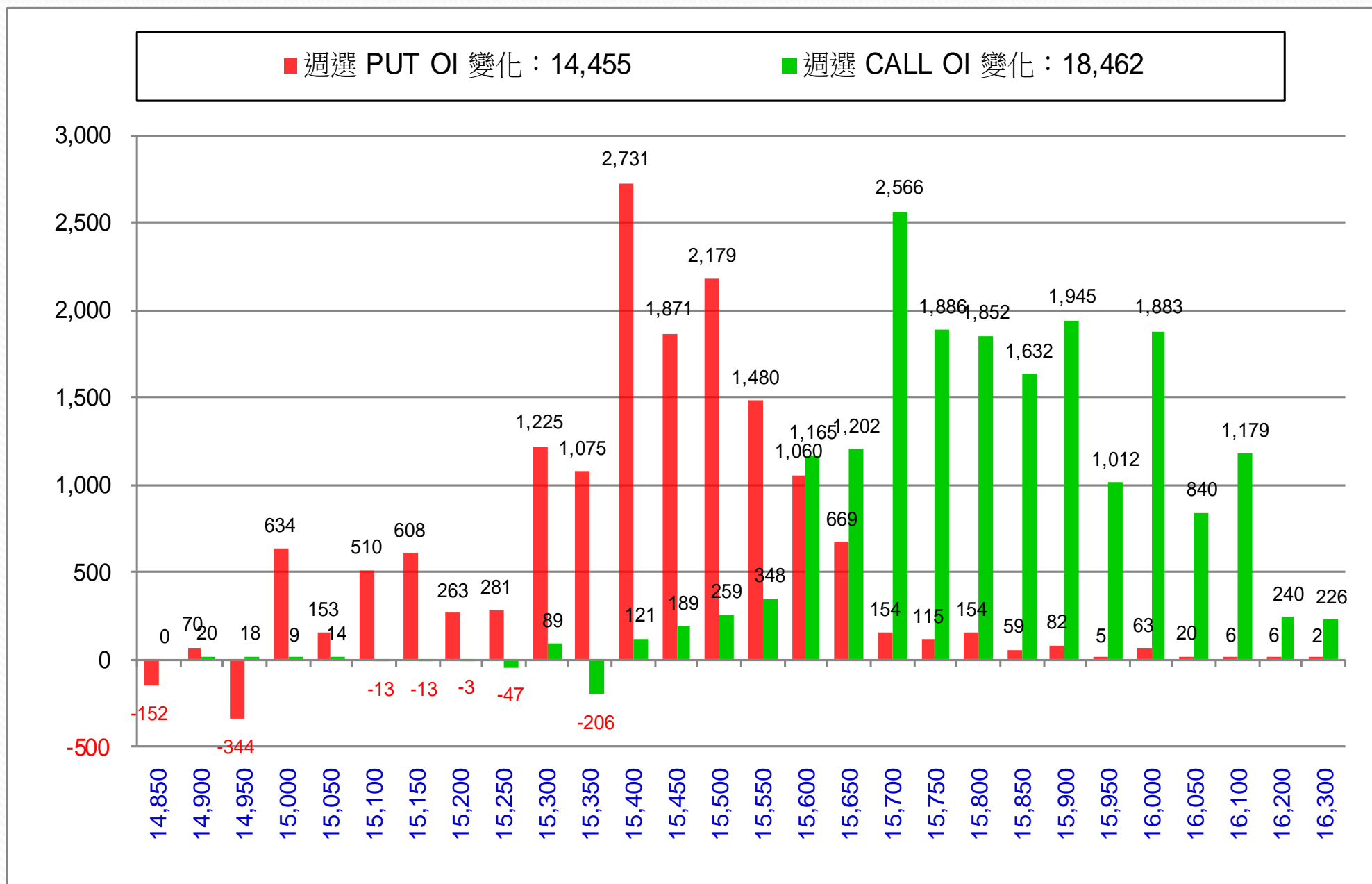
更新日期：2023年2月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年2月3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

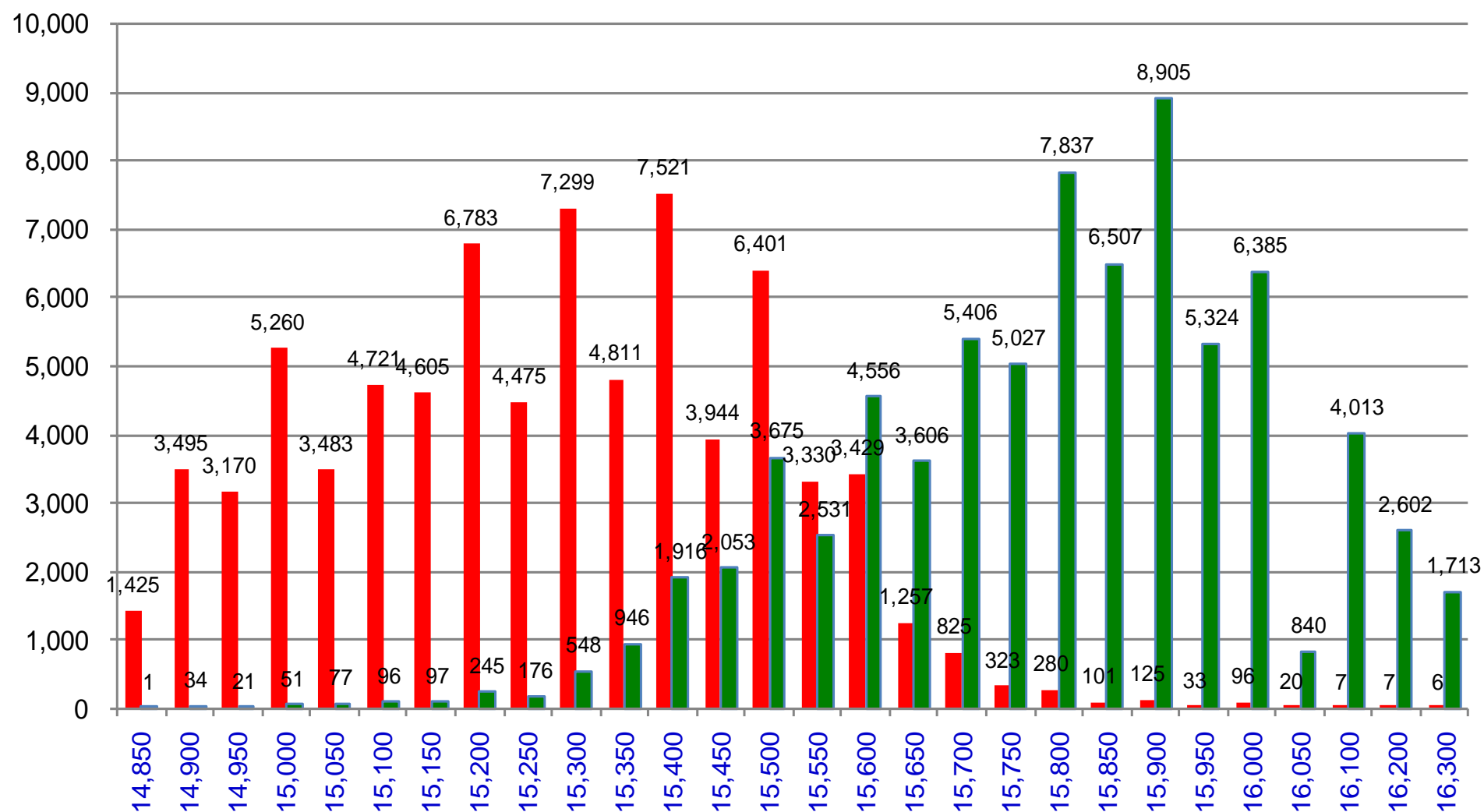


更新日期：2023年2月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：85,724

週選 CALL OI 總額：76,866



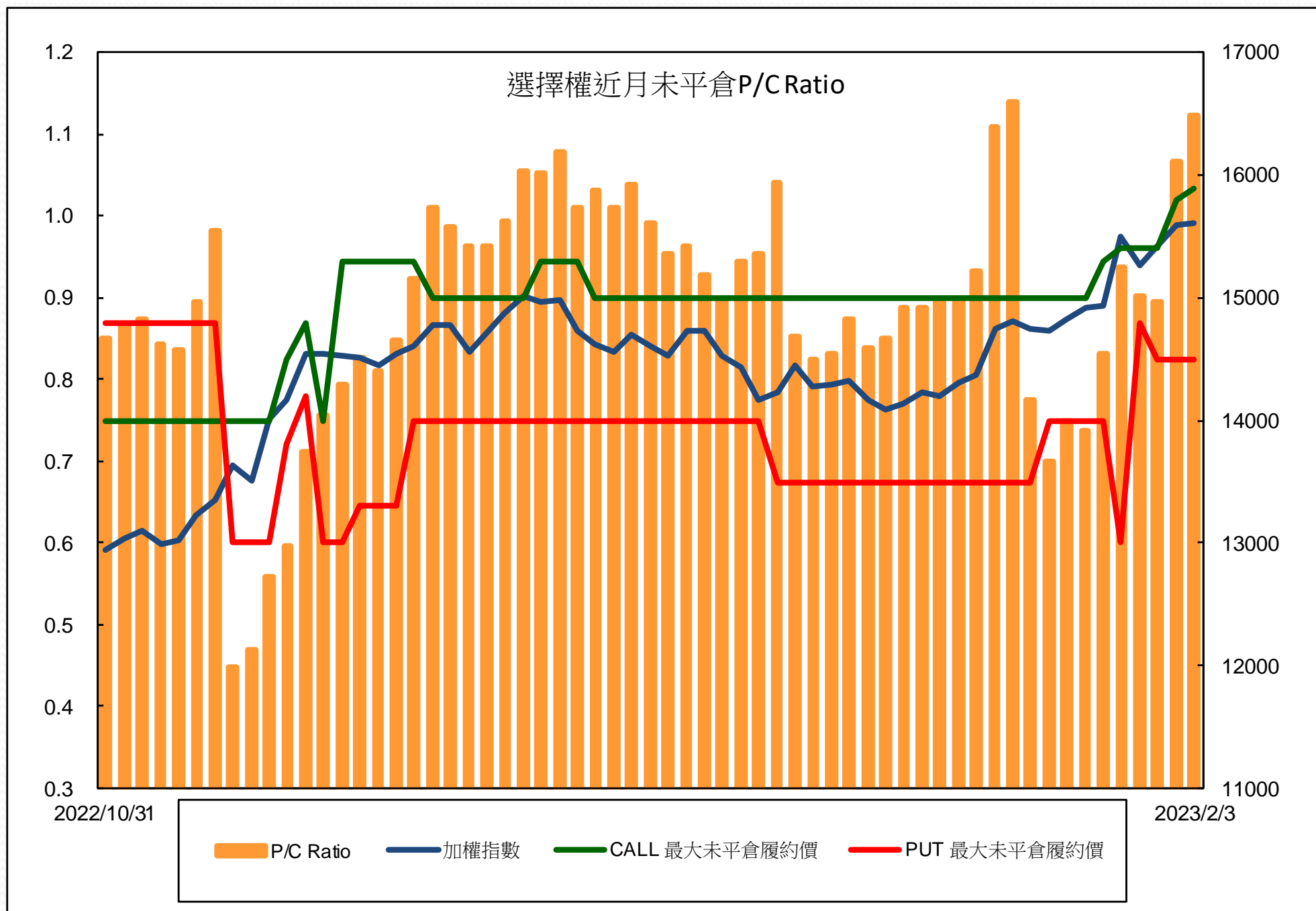
更新日期：2023年2月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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2日	62,358	56,649	5,709
	2月3日	69,734	57,789	11,945
Put	2月2日	51,741	50,412	1,329
	2月3日	55,402	58,945	-3,543

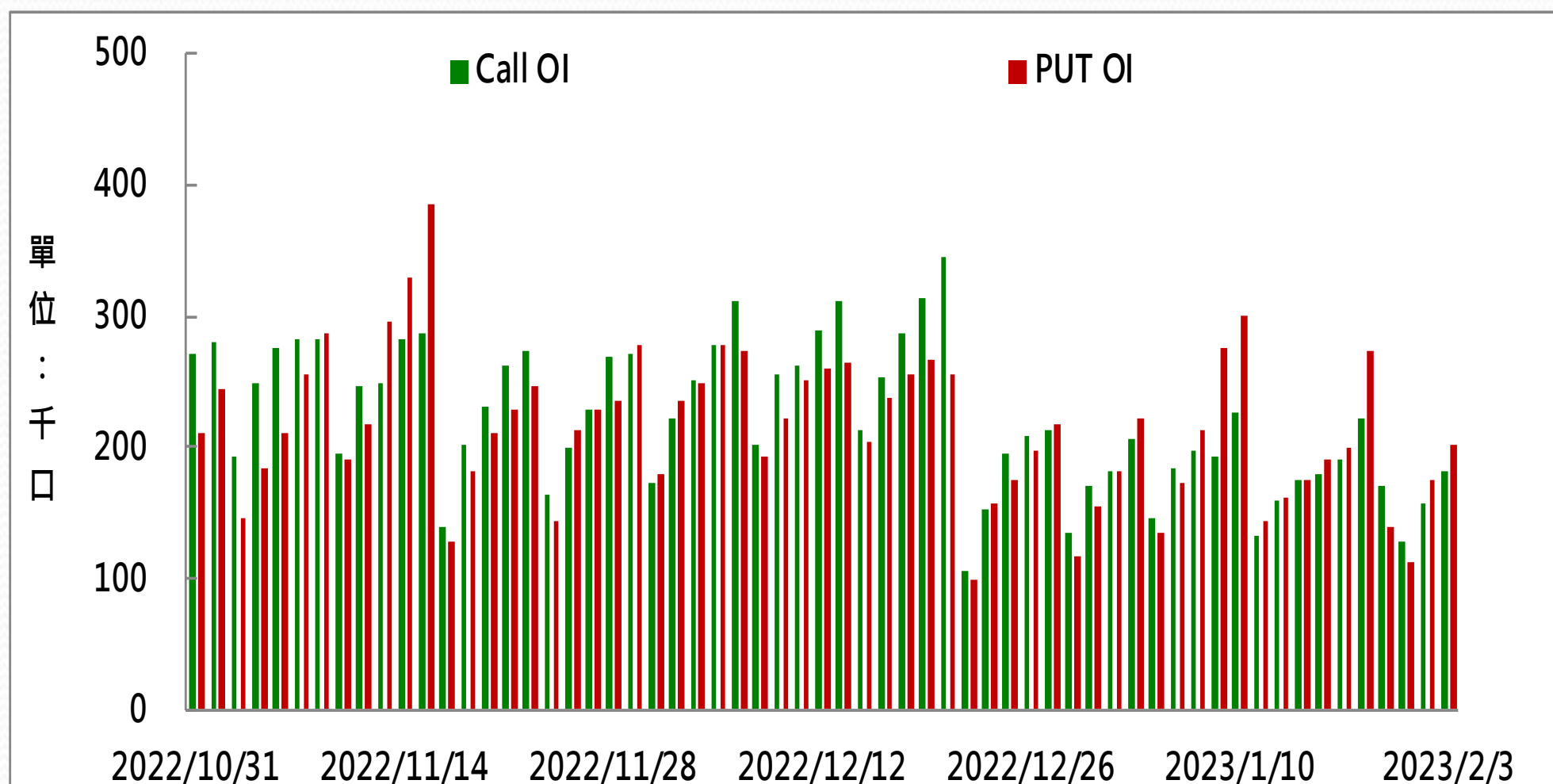
更新日期：2023年2月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

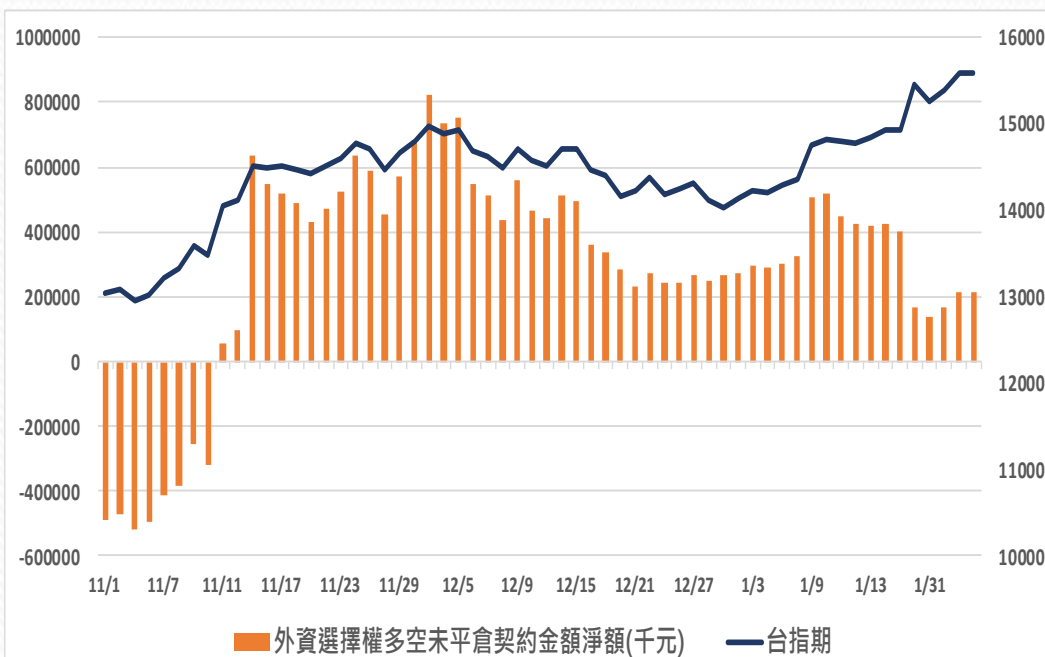
選擇權全月Put Call OI



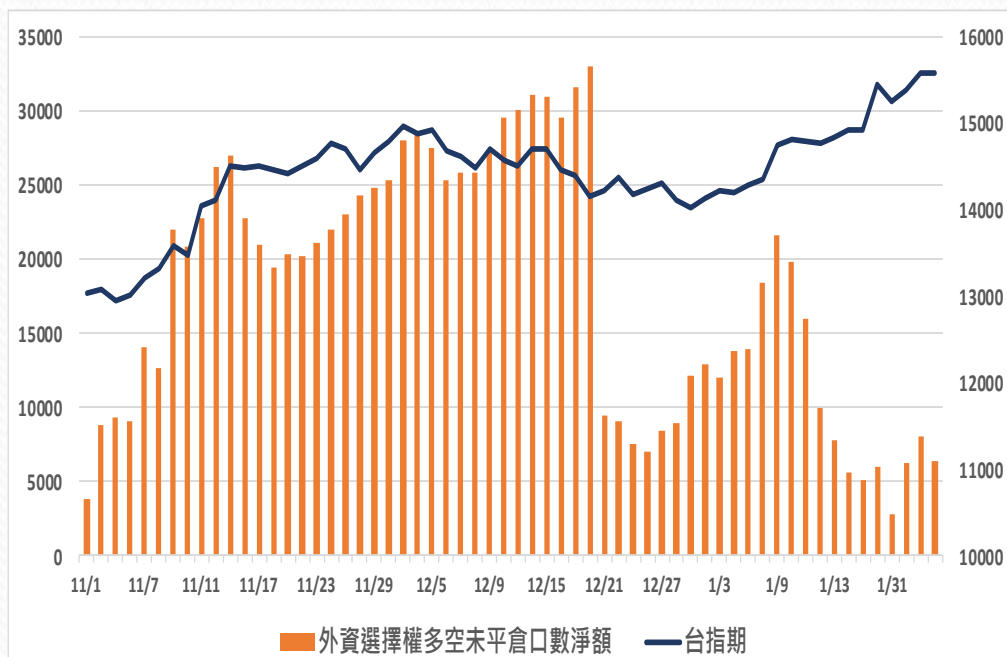
更新日期：2023年2月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



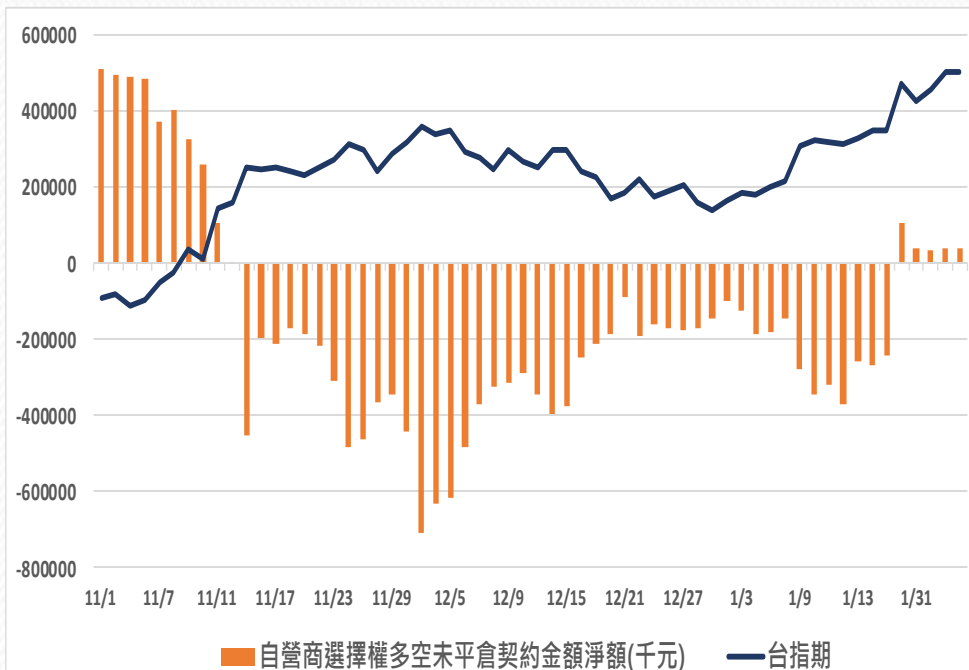
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/1/30	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
2023/2/3	15581	6345	-1789	213736	-3061

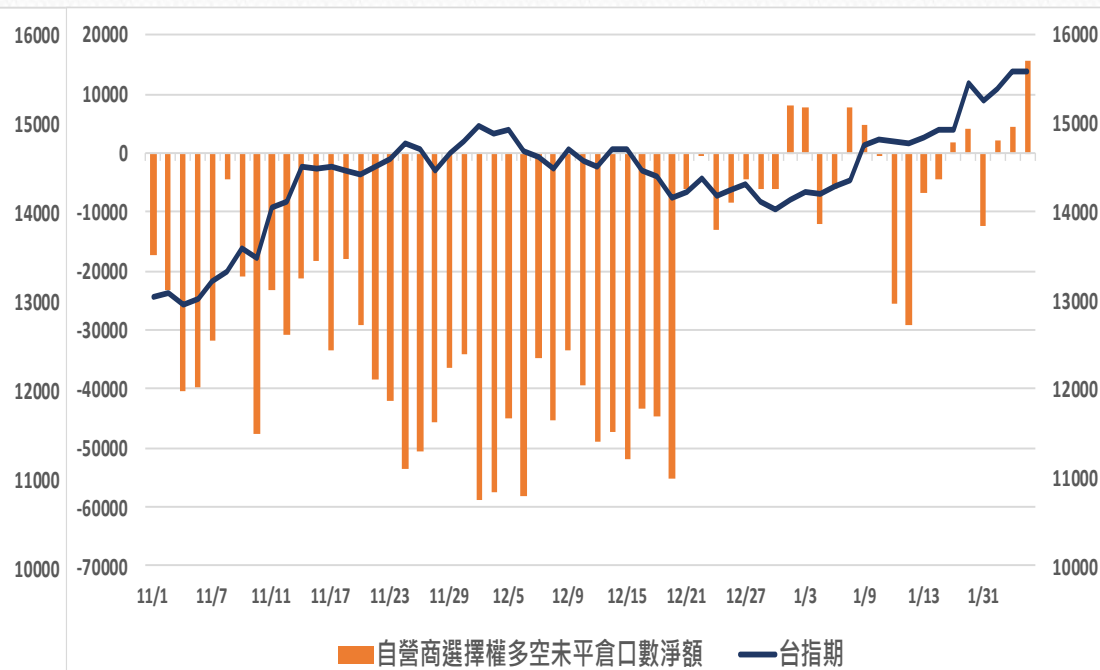
更新日期：2023年2月3日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



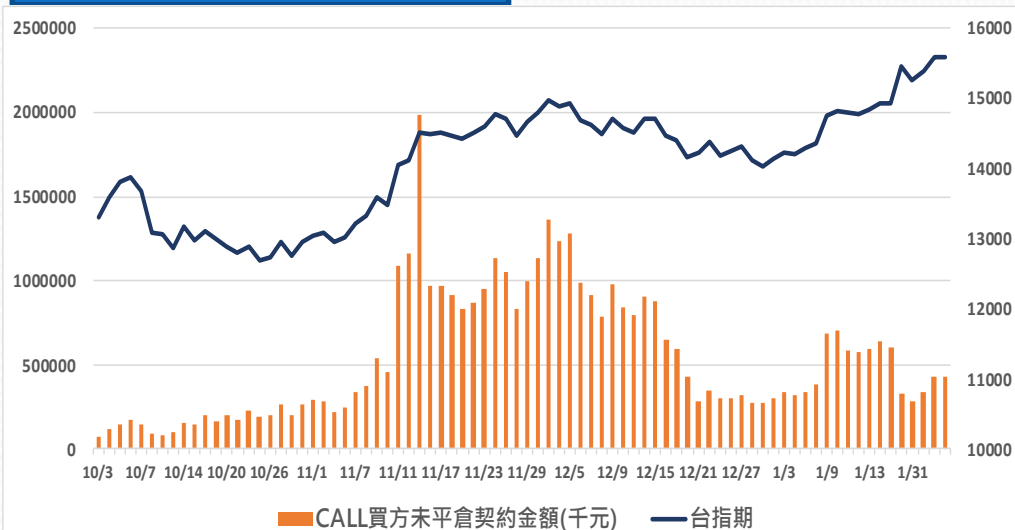
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/1/30	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
2023/2/3	15581	15488	11108	41260	2710

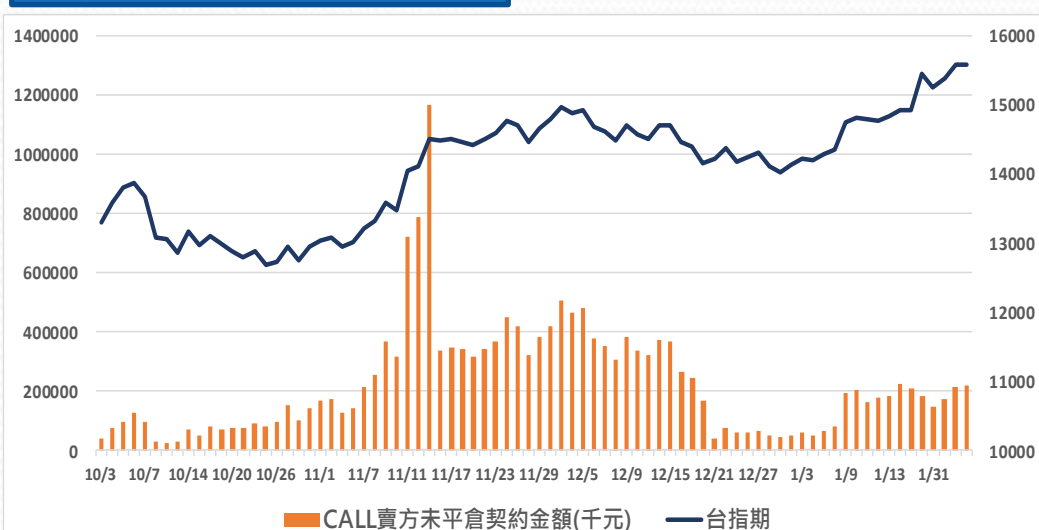
更新日期：2023年2月3日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

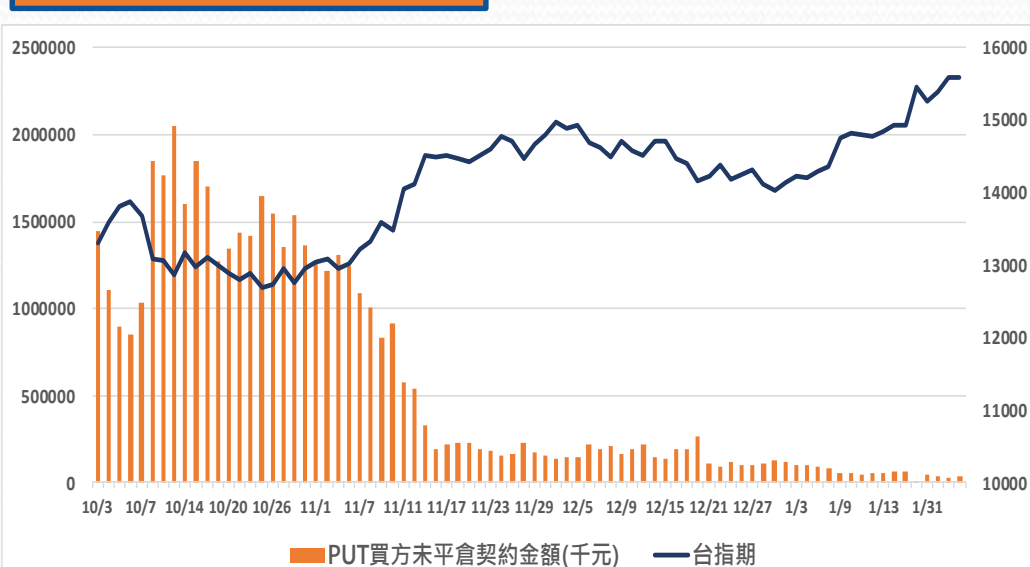
CALL買方未平倉金額



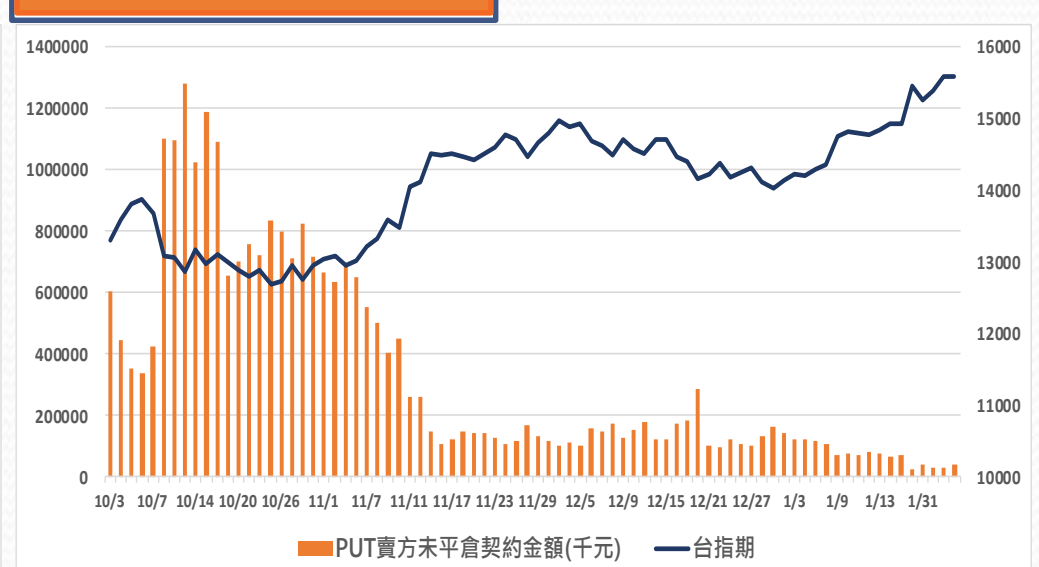
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



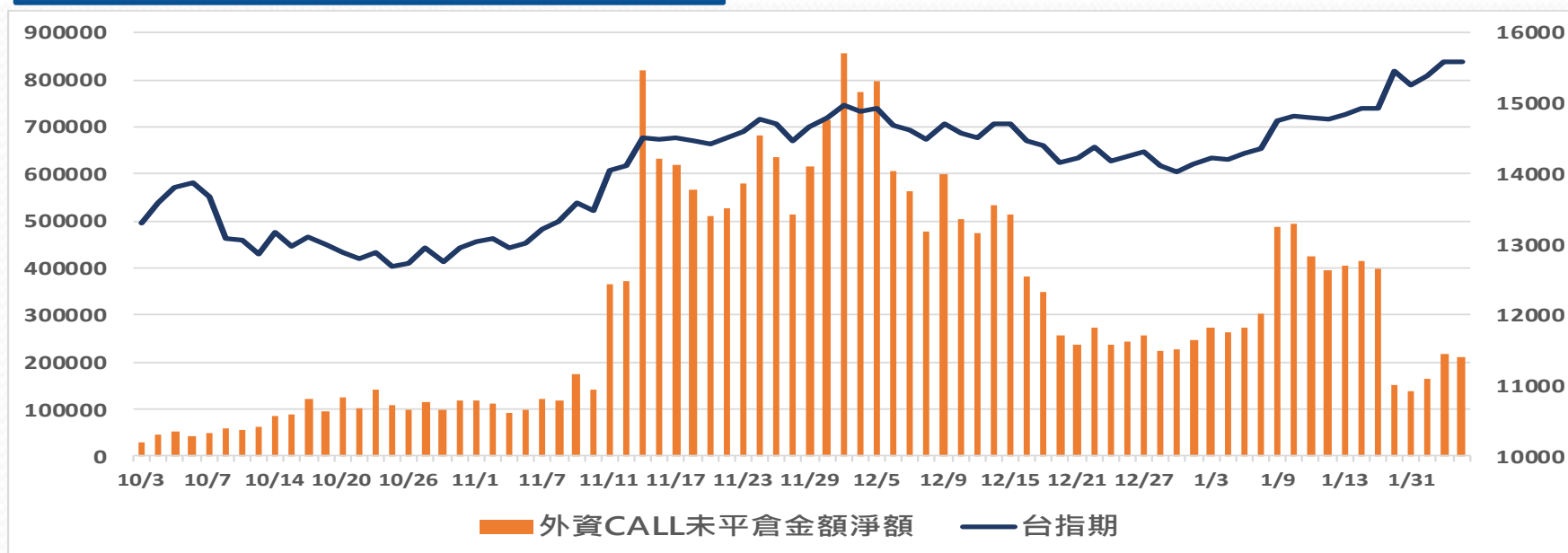
PUT賣方未平倉金額



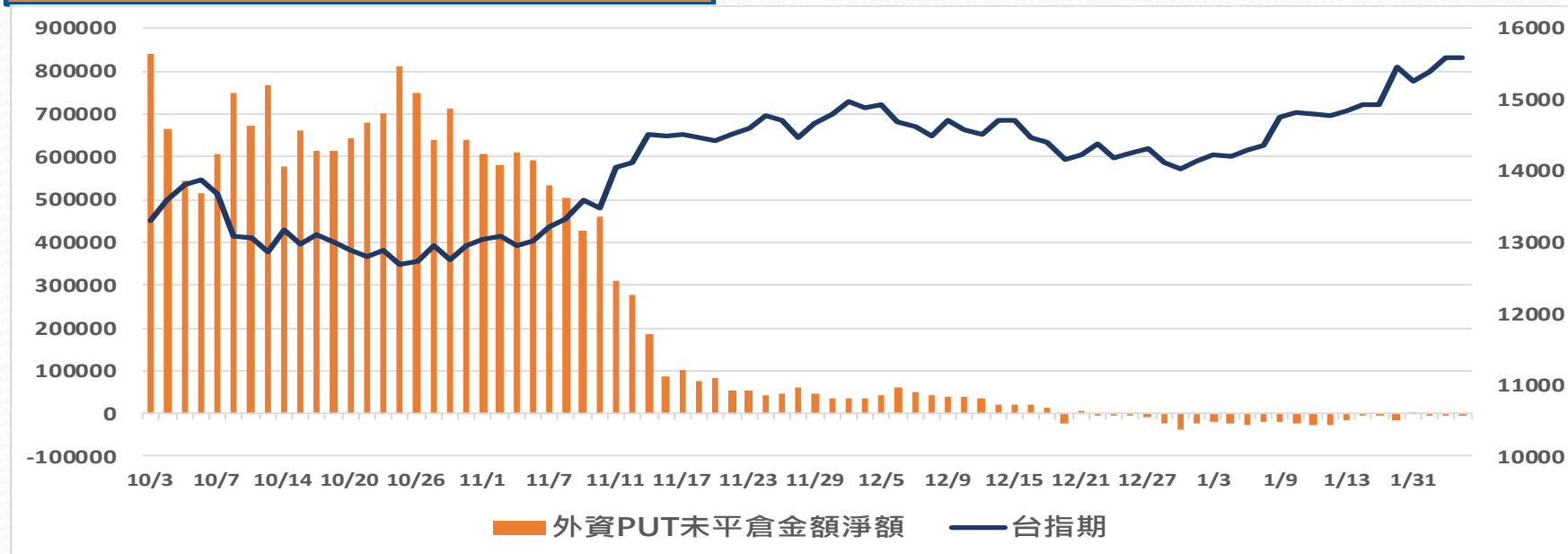
更新日期：2023年2月3日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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3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3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