

# 台指選擇權OI匯報

日期：2023/2/6 結算日：2023/2/8					日期：2023/2/6 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	1,667	-49	0	75	13,900	574	-29
0	3	14,600	1,167	-88	-3	87	14,000	2,457	-20
1	3	14,700	866	-41	0	63	14,100	1,616	83
-1	11	14,800	2,248	22	0	90	14,200	2,764	399
0	1	14,850	1,460	35	0	123	14,300	4,743	839
0	34	14,900	3,418	-77	-1	252	14,400	2,376	663
0	21	14,950	3,187	17	-1	354	14,500	10,909	2,050 ※
144	195	15,000	5,537	277	3	1,458	14,600	4,252	68
0	77	15,050	3,705	222	8	1,164	14,700	3,377	336
2	98	15,100	6,219	1,498	86	1,187	14,800	4,207	455
-4	93	15,150	5,299	694	3	571	14,900	3,636	657
156	401	15,200	9,760	2,977 ※	-35	1,351	15,000	3,980	480
70	246	15,250	5,870	1,395	105	1,407	15,100	2,866	692
271	819	15,300	9,559	2,260	38	1,269	15,200	3,378	670
461	1,407	15,350	5,457	646	453	1,982	15,300	2,484	344
1,012	2,928	15,400	7,706	185	167	3,287	15,400	3,073	422
1,986	4,039	15,450	3,647	-297	513	3,697	15,500	1,915	-115
3,173	6,848	15,500	4,248	-2,153	1,458	4,495	15,600	1,516	446
2,684	5,215	15,550	2,423	-907	735	3,853	15,700	356	-32
4,989	9,545	15,600	2,276	-1,153	1,377	6,558	15,800	158	6
5,035	8,641	15,650	830	-427	1,084	7,134	15,900	70	1
※ 5,566	10,972	15,700	865	40	※ 1,668	7,324	16,000	70	13
1,005	6,032	15,750	209	-114	-711	3,723	16,100	46	1
-1,263	6,574	15,800	228	-52	-1,227	1,788	16,200	12	0
-776	5,731	15,850	79	-22	122	2,499	16,300	7	0
-3,038	5,867	15,900	201	76	72	972	16,400	2	0
-3,161	2,163	15,950	37	4	210	1,371	16,500	8	3
-1,592	4,793	16,000	99	3	208	1,344	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
14,759	91,625	0.9901	90,716	4,992	6,342	64,753	1.1558	74,839	8,475
昨日 P/C	1.1152	今日增減變化	-0.1251		昨日 P/C	1.1238	今日增減變化	0.0319	

更新日期：2023年2月6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6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	97,669,245	73,271,671	24,397,574	-4,674,958	2,660,141	1,654,644	1,005,497	-16,360
投信	30,810,919	50,593,507	-19,782,588	-1,116,550	411,488	0	411,488	-6,702
自營商	40,384,681	23,323,174	17,061,507	435,467	912,544	814,114	98,430	-157,663
	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	523,697	1,942,948	-1,419,251	-12,085	0	29,586	-29,586	-39,981
投信	88,316	0	88,316	-410	0	0	0	0
自營商	286,638	82,109	204,529	42,636	140,454	99,009	41,445	39,939

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6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	26,915	11,953	14,962	3,441	25,257	15,255	10,002	4,826
投信	0	50	-50	50	400	111	289	0
自營商	63,861	65,616	-1,755	-13,700	65,618	63,026	2,592	6,135
特定法人(週)	3,509	0	3,509	2,386	0	4,282	-4,282	-2,311
特定法人(近月)	11,473	7,916	3,557	3,286	5,217	10,135	-4,918	-1,703
特定法人(全月)	11,048	5,700	5,348	1,558	6,495	15,784	-9,289	-2,596
十大交易人(週)	27,272	29,712	-2,440	-8,523	31,726	28,473	3,253	-4,661
十大交易人(近月)	33,821	33,656	165	-663	39,760	38,753	1,007	-3,478
十大交易人(全月)	82,745	79,590	3,155	-8,087	88,540	82,308	6,232	-8,940
全市場未沖銷(近月)			75,517	11,775			82,804	11,170
全市場未沖銷(全月)			211,053	28,893			221,044	20,156

更新日期：2023年2月6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	15700
	賣權成交最大量	15400	賣權OI最大量	15200
	整體隱含波動率	12.91%	較前一交易日	+0.16%
	買權隱含波動率	14.45%	較前一交易日	+3.31%
	賣權隱含波動率	10.90%	較前一交易日	-3.49%
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	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	1560	賣權OI最大量	1360

更新日期：2023年2月6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	16000
	賣權成交最大量	15200	賣權OI最大量	14500
	整體隱含波動率	16.07%	較前一交易日	-0.18%
	買權隱含波動率	15.41%	較前一交易日	+2.06%
	賣權隱含波動率	16.97%	較前一交易日	-1.26%
	成交量P/C_Ratio值	0.780	較前一交易日	-0.21
	未平倉P/C_Ratio值	1.096	較前一交易日	-0.03
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	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	1560	賣權OI最大量	1360

更新日期：2023年2月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理



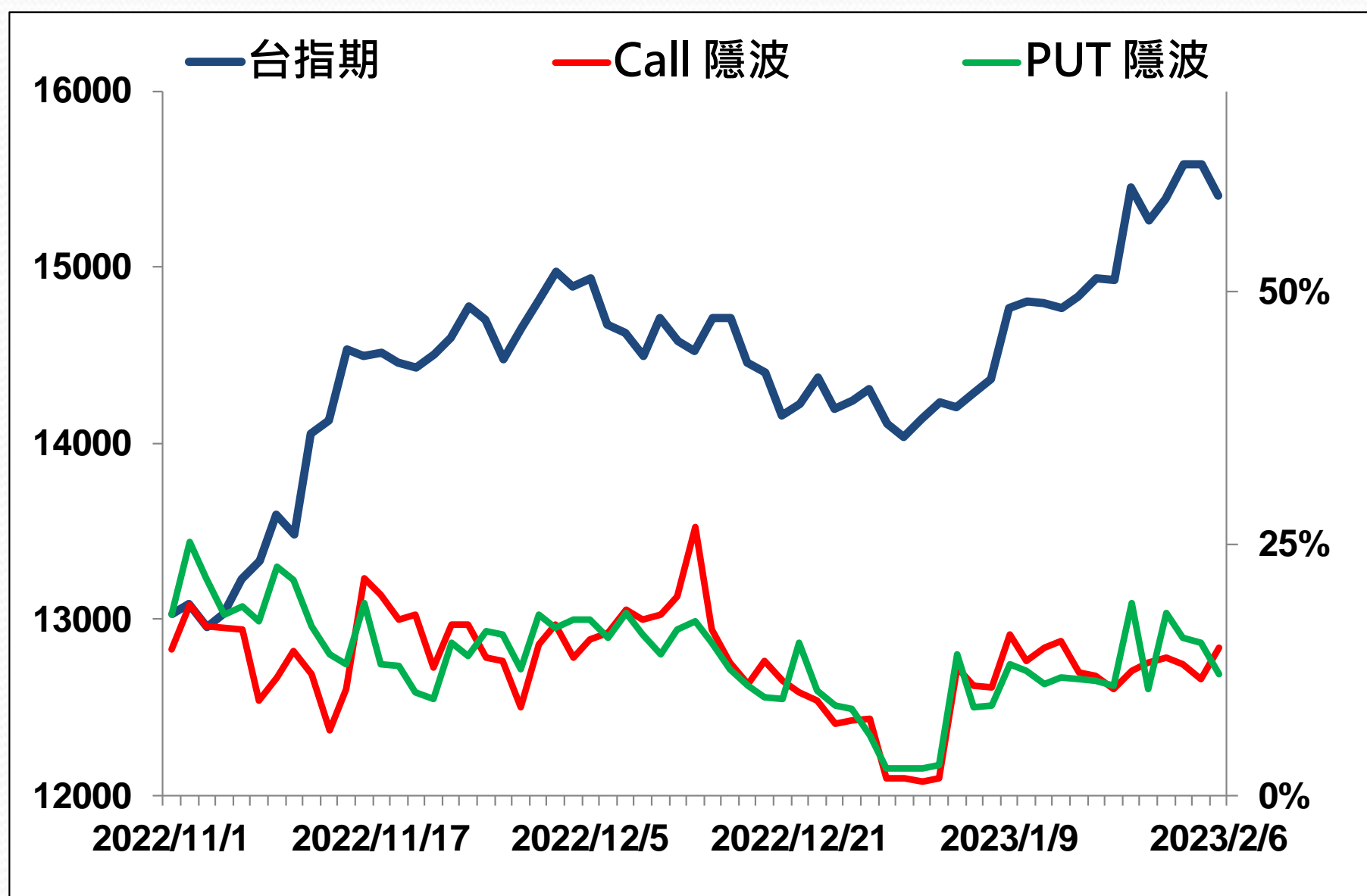
# 選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



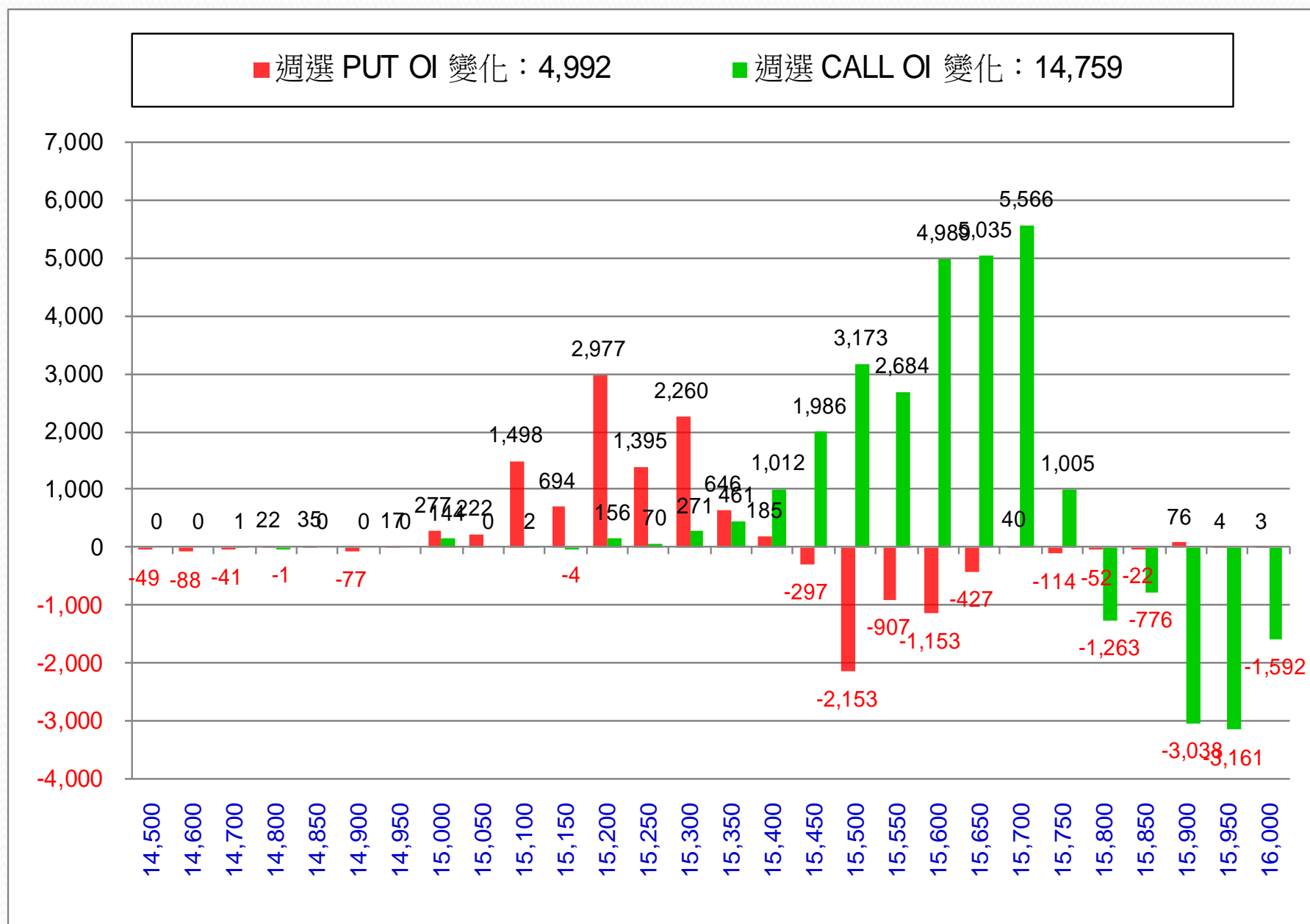
更新日期：2023年2月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2023年2月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

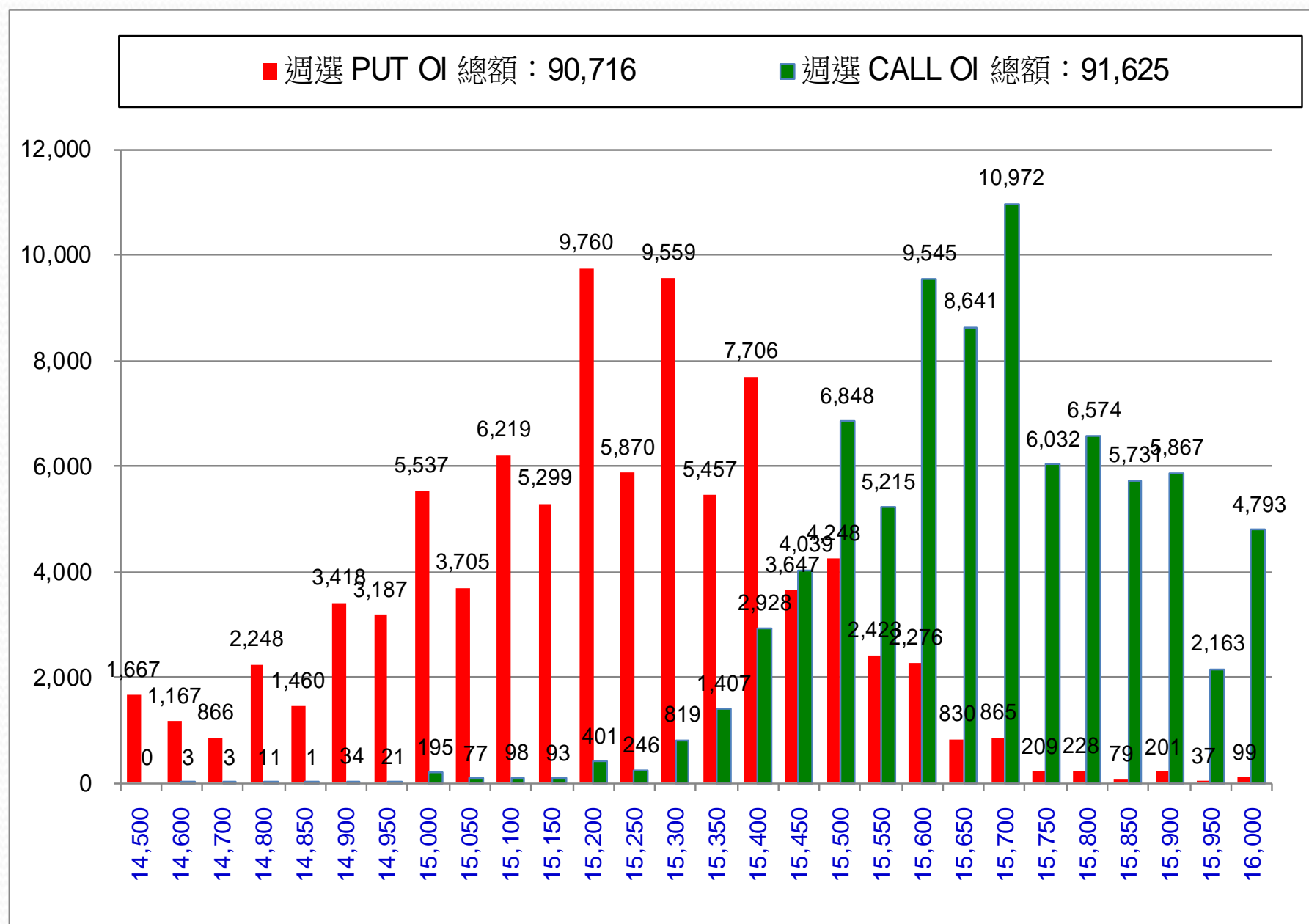
# 台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年2月6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2月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

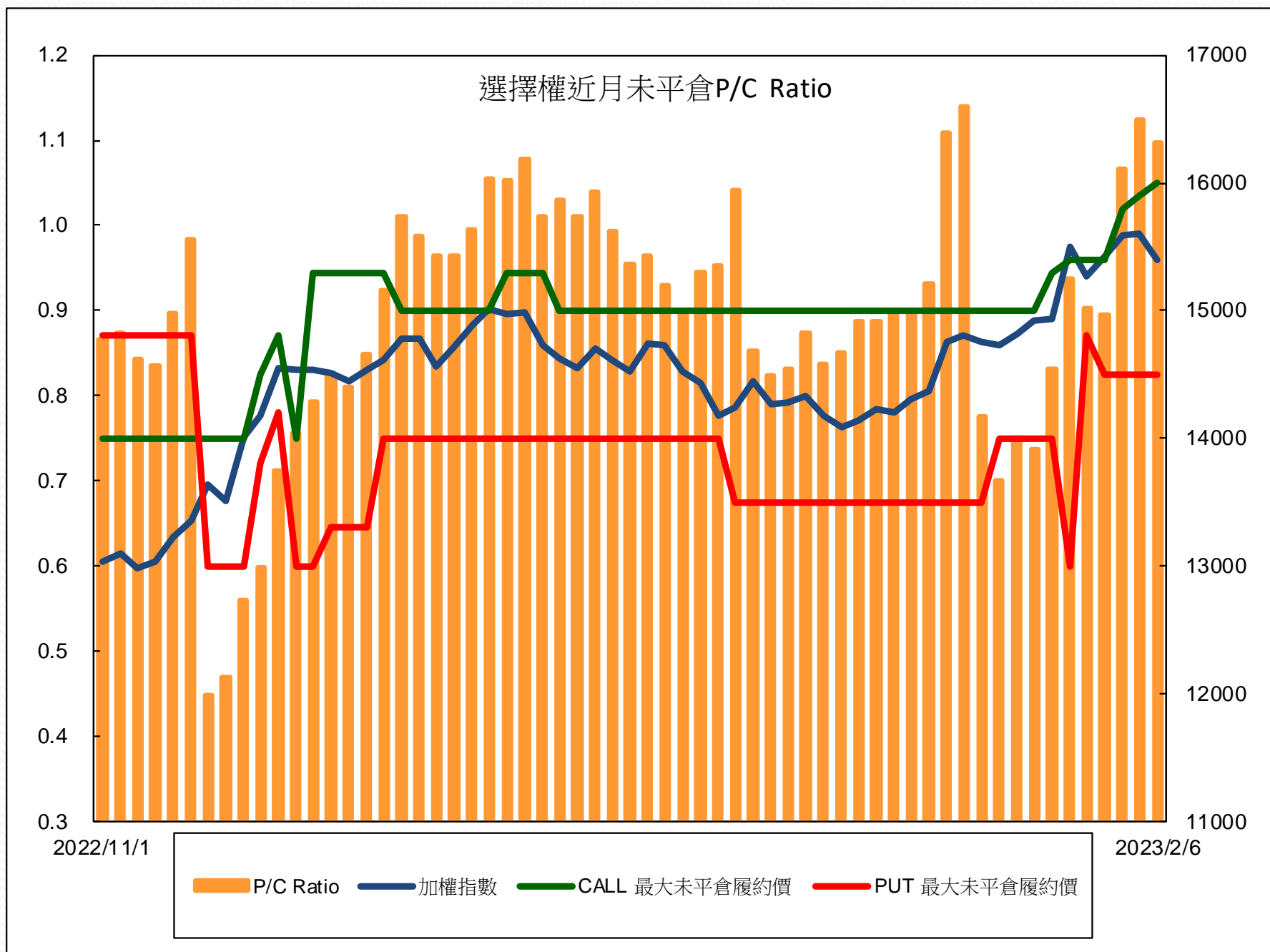


# 自營商選擇權OI部位統計

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3日	69,734	57,789	11,945
	2月6日	63,861	65,616	-1,755
Put	2月3日	55,402	58,945	-3,543
	2月6日	65,618	63,026	2,592

更新日期：2023年2月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

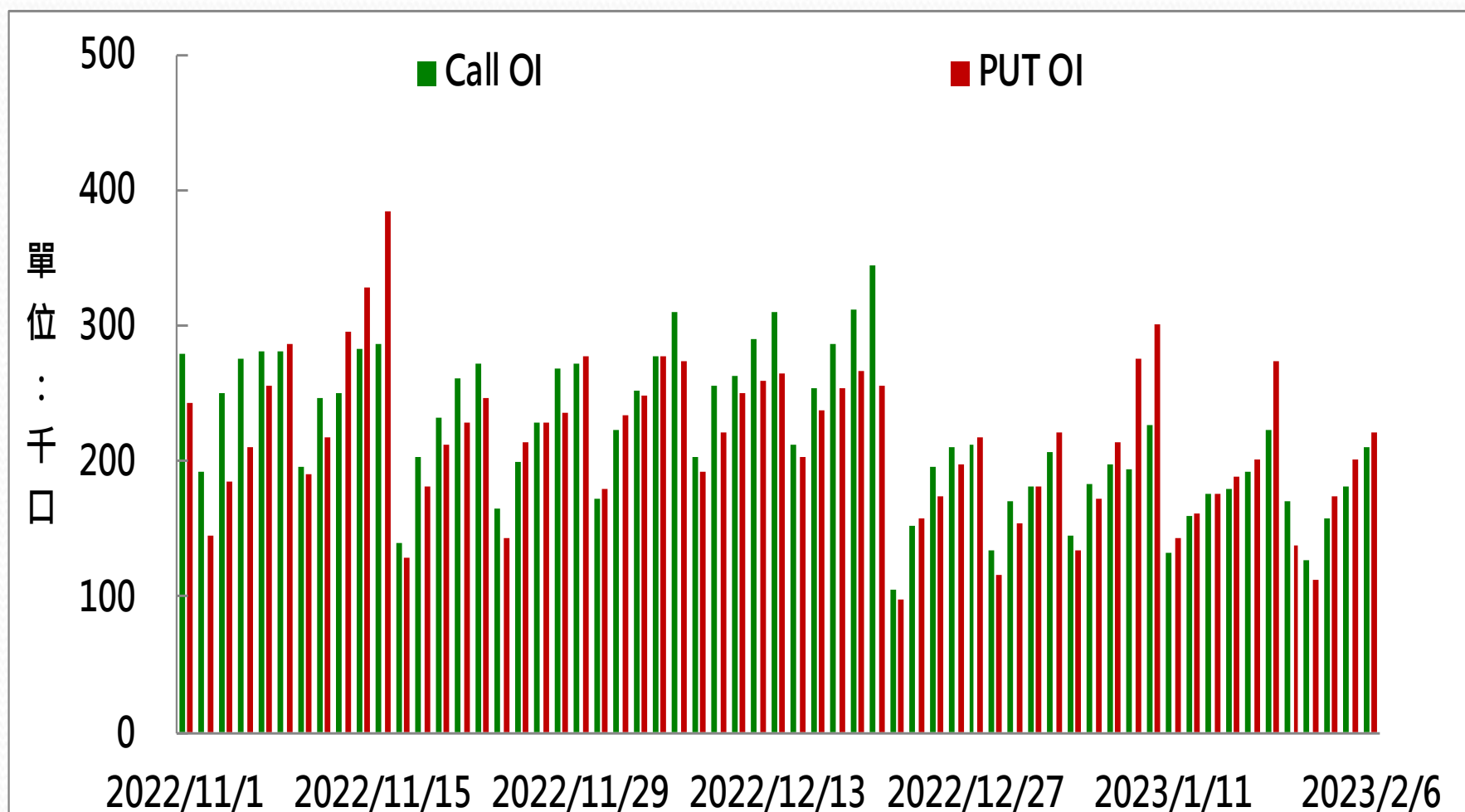
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理



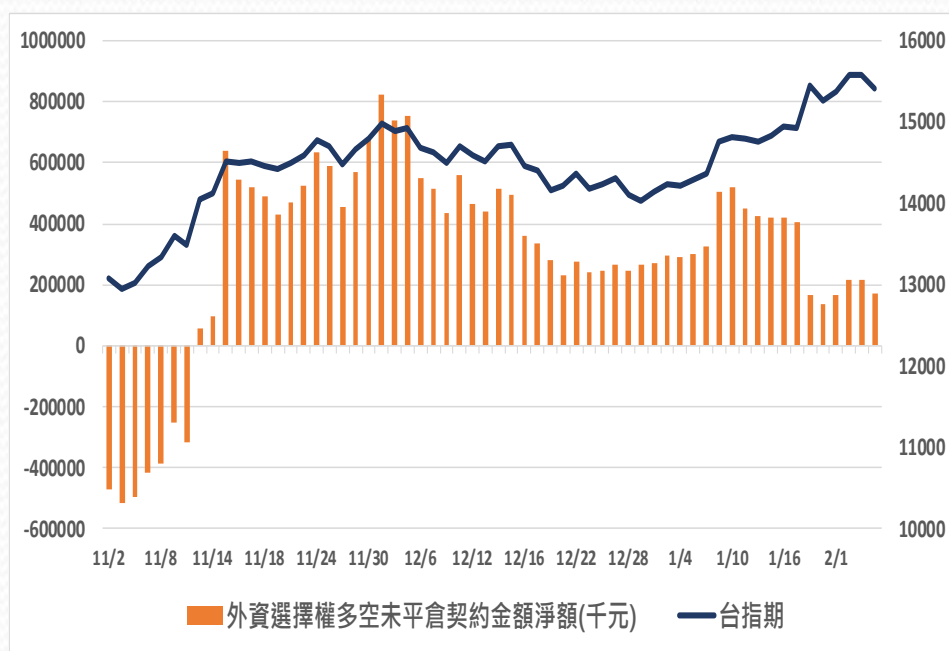
# 選擇權全月Put Call OI



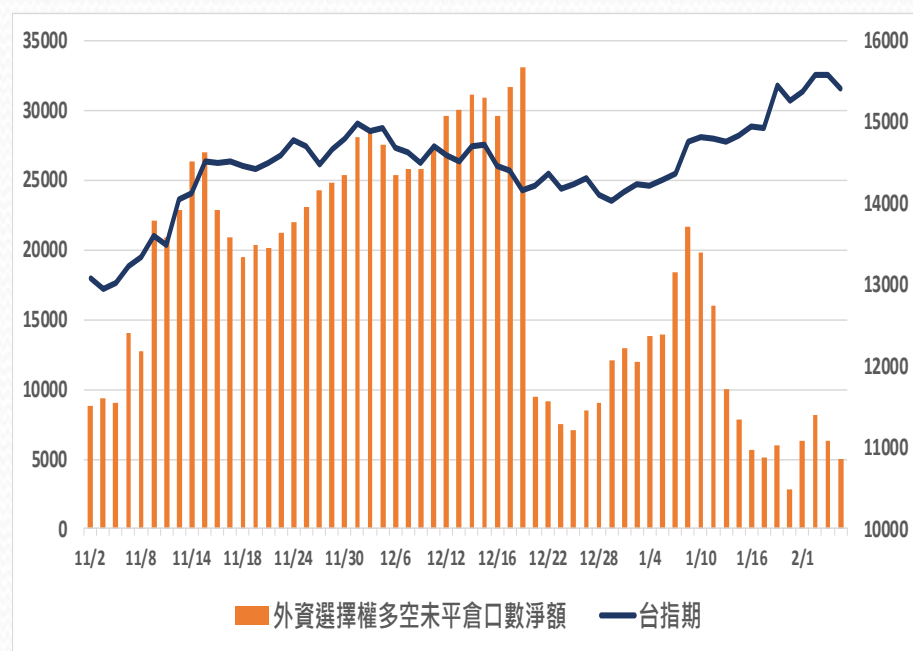
更新日期：2023年2月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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

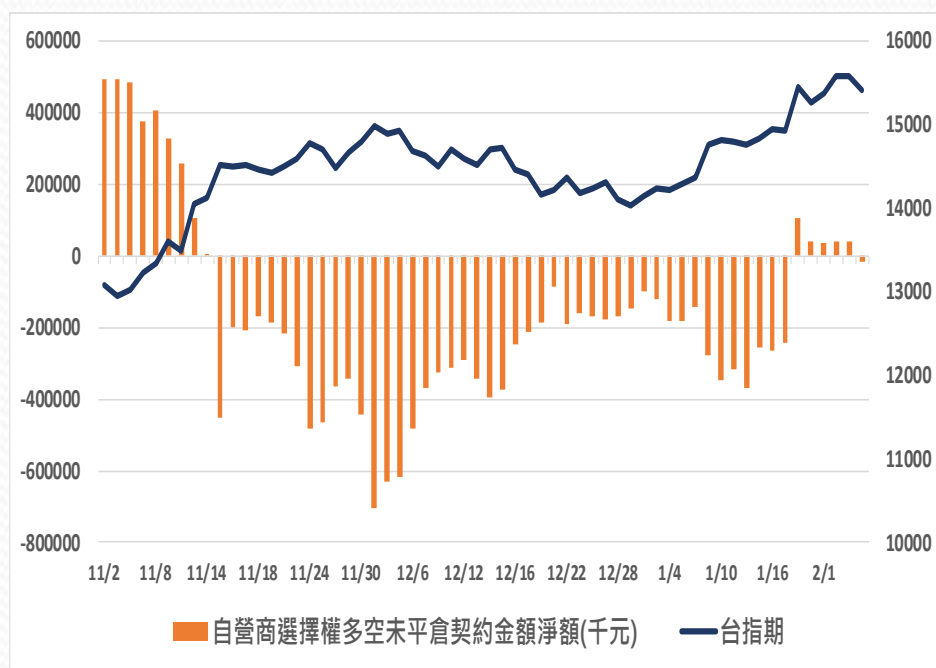
日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/1/31	15268	2788	-3227	138725	-28549
2023/2/1	15382	6314	3526	165437	26712
2023/2/2	15580	8134	1820	216797	51360
2023/2/3	15581	6345	-1789	213736	-3061
2023/2/6	15407	4960	-1385	173051	-40685

更新日期：2023年2月6日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

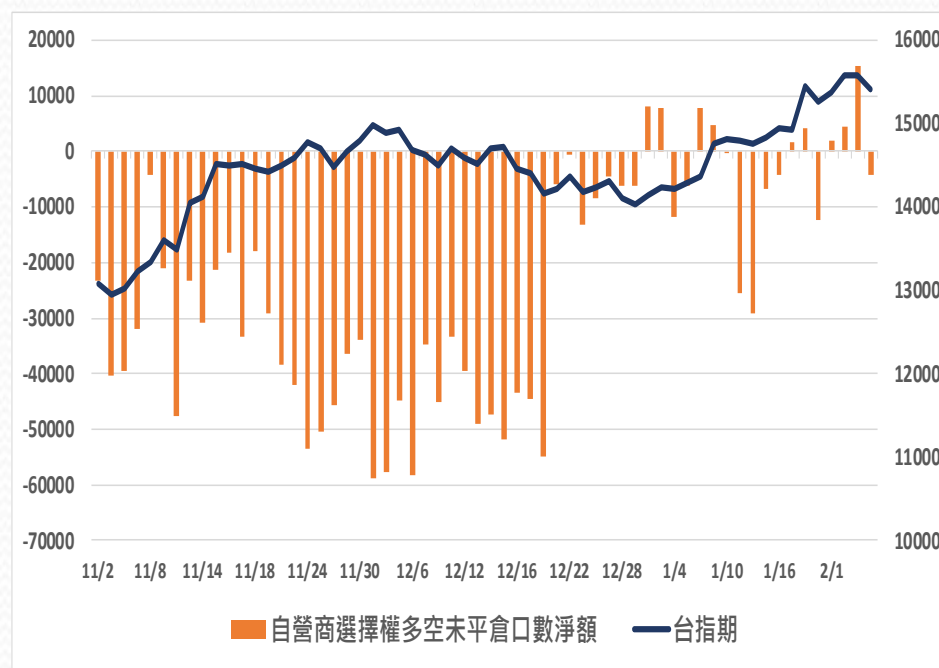


# 自營商選擇權多空未平倉淨額

## 多空未平倉金額淨額



## 多空未平倉口數淨額



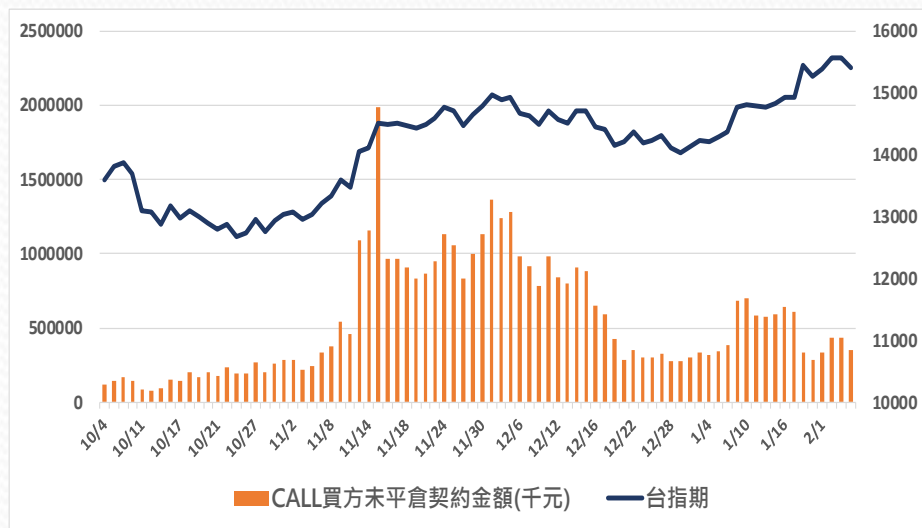
### 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/1/31	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
2023/2/6	15407	-4347	-19835	-16154	-57414

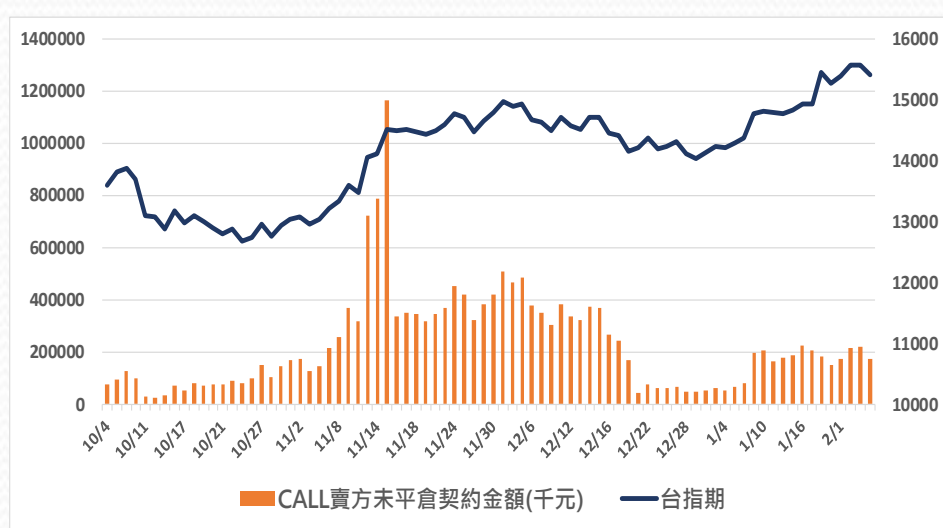
更新日期：2023年2月6日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 外資買賣權未平倉金額

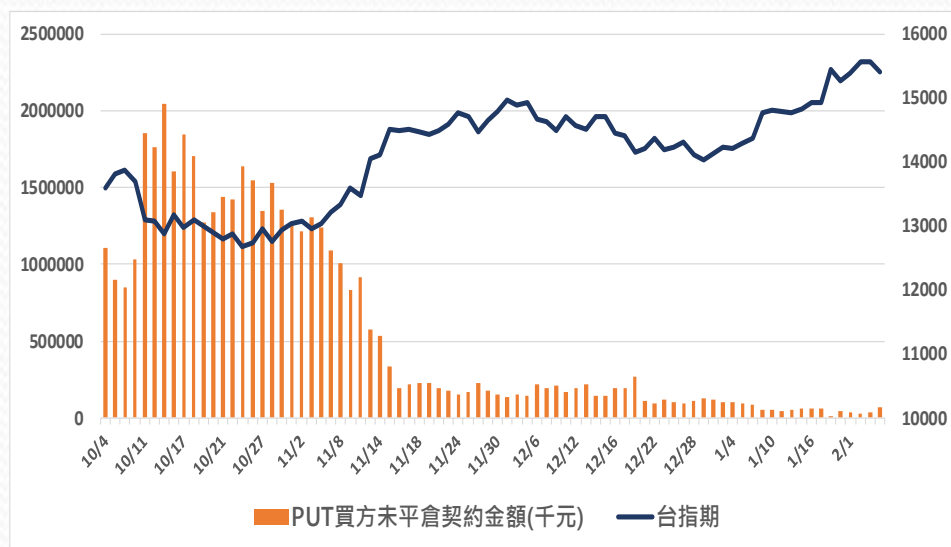
## CALL買方未平倉金額



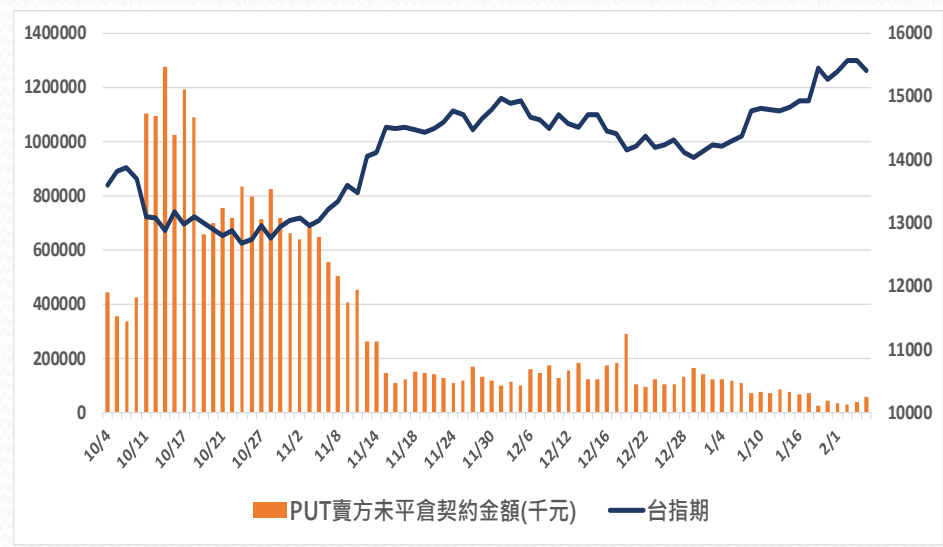
## CALL賣方未平倉金額



## PUT買方未平倉金額



## PUT賣方未平倉金額

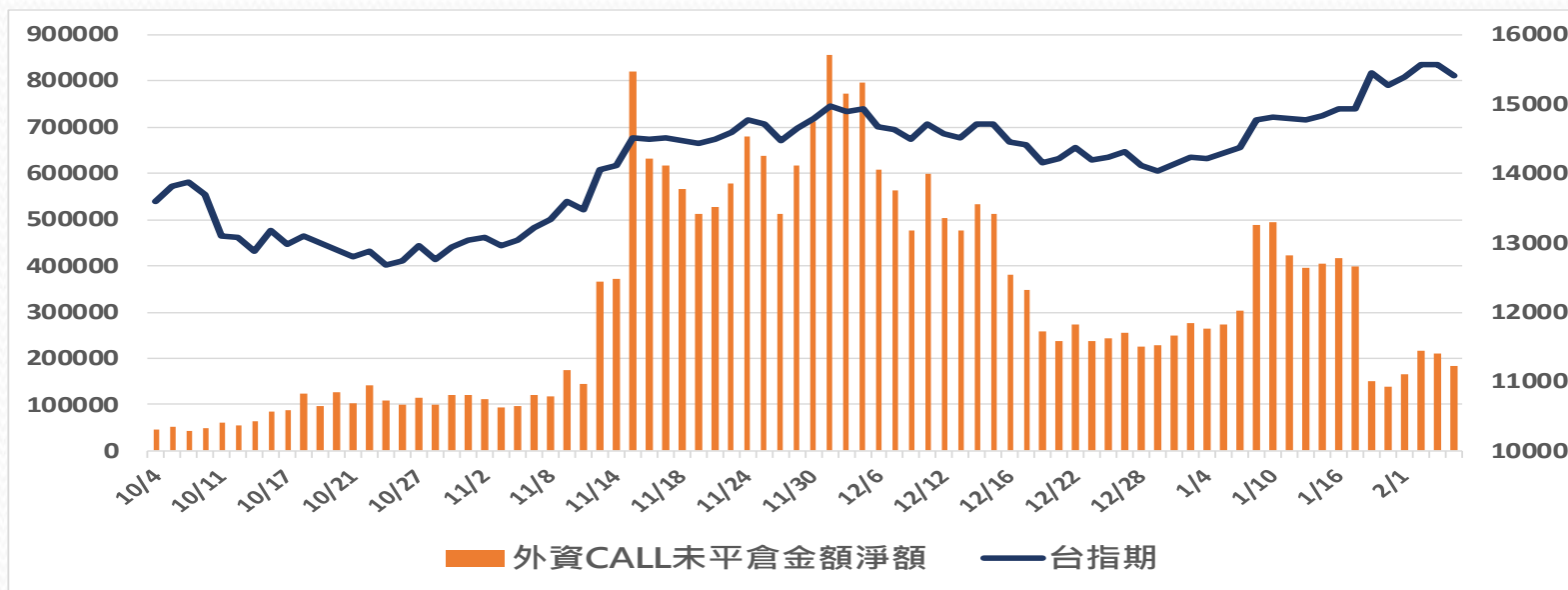


更新日期：2023年2月6日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

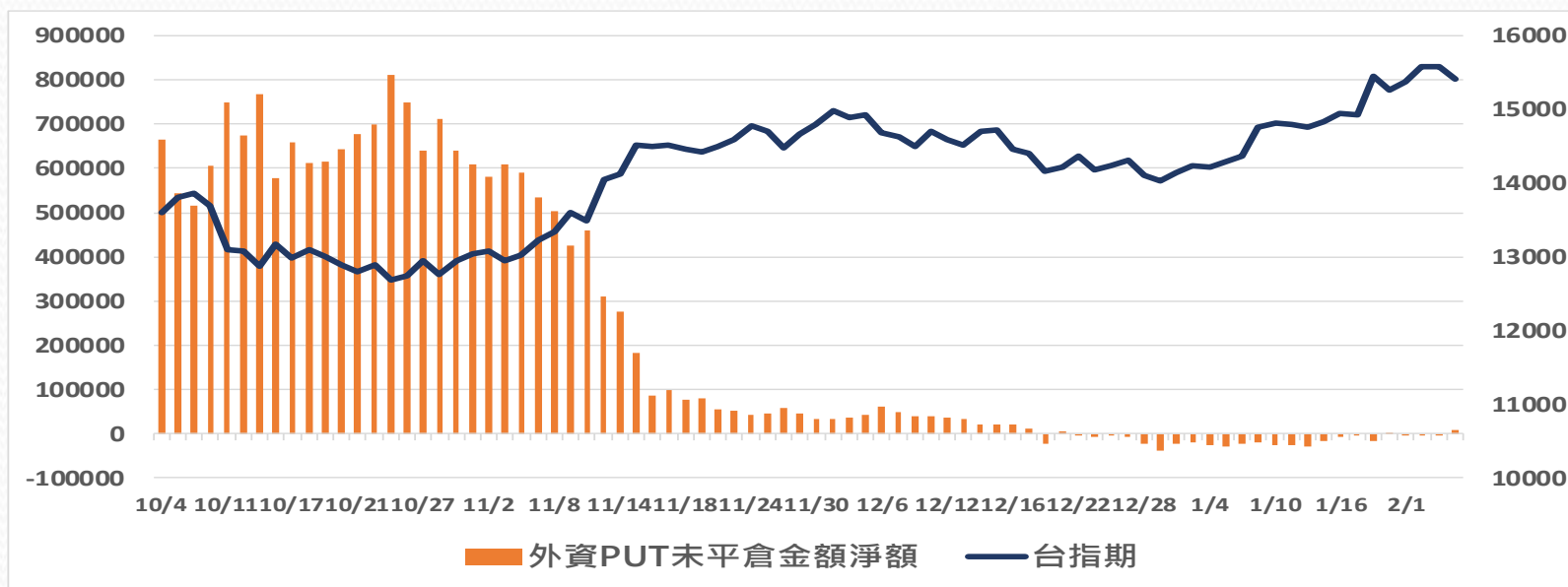


# 外資買賣權未平倉金額淨額

## 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6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6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