

台指選擇權 OI 匯報

日期：2023/2/7 結算日：2023/2/8					日期：2023/2/7 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	1,617	-50	0	75	13,900	645	71
0	3	14,600	1,160	-7	-3	84	14,000	2,515	58
0	3	14,700	836	-30	0	63	14,100	1,642	26
1	12	14,800	2,108	-140	0	90	14,200	2,711	-53
0	1	14,850	1,453	-7	-1	122	14,300	4,755	12
1	35	14,900	3,368	-50	2	254	14,400	2,511	135
18	39	14,950	3,273	86	-1	353	14,500	11,032	123
16	211	15,000	6,141	604	2	1,460	14,600	4,591	339
10	87	15,050	3,928	223	-6	1,158	14,700	3,606	229
53	151	15,100	6,107	-112	-101	1,086	14,800	5,171	964
61	154	15,150	5,849	550	-1	570	14,900	5,572	1,936
223	624	15,200	9,798	38	-42	1,309	15,000	4,211	231
331	577	15,250	10,545	4,675	32	1,439	15,100	3,387	521
848	1,667	15,300	10,686	1,127	-24	1,245	15,200	4,932	1,554
1,135	2,542	15,350	9,411	3,954	56	2,038	15,300	3,511	1,027
3,211	6,139	15,400	8,477	771	446	3,733	15,400	3,466	393
2,607	6,646	15,450	4,793	1,146	88	3,785	15,500	1,929	14
2,565	9,413	15,500	3,856	-392	868	5,363	15,600	1,414	-102
※ 6,364	11,579	15,550	2,036	-387	874	4,727	15,700	363	7
1,834	11,379	15,600	1,855	-421	1,344	7,902	15,800	143	-15
-229	8,412	15,650	702	-128	704	7,838	15,900	64	-6
-3,147	7,825	15,700	611	-254	※ 1,430	8,754	16,000	72	2
-1,181	4,851	15,750	198	-11	-439	3,284	16,100	45	-1
-536	6,038	15,800	179	-49	177	1,965	16,200	9	-3
-1,090	4,641	15,850	72	-7	19	2,518	16,300	7	0
-1,792	4,075	15,900	201	0	-1	971	16,400	2	0
-373	1,790	15,950	33	-4	45	1,416	16,500	8	0
-194	4,599	16,000	96	-3	3	1,347	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
9,764	101,389	1.0044	101,834	11,118	5,462	70,215	1.1734	82,393	7,554
昨日 P/C	0.9901	今日增減變化		0.0143	昨日 P/C	1.0965	今日增減變化		0.0769

更新日期：2023年2月7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7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	94,907,448	73,094,086	21,813,362	-2,584,212	2,599,873	1,723,632	876,241	-129,256	
投信	30,821,715	50,760,830	-19,939,115	-156,527	410,664	0	410,664	-824	
自營商	40,131,788	21,755,354	18,376,434	1,314,927	884,687	745,956	138,731	40,301	
	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	531,307	1,959,485	-1,428,178	-8,927	0	34,091	-34,091	-4,505	
投信	88,293	0	88,293	-23	0	0	0	0	
自營商	319,093	117,721	201,372	-3,157	125,953	99,262	26,691	-14,754	

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7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	28,669	14,120	14,549	-413	28,247	17,071	11,176	1,174	
投信	0	0	0	50	400	111	289	0	
自營商	67,797	67,393	404	2,159	69,724	68,366	1,358	-1,234	
特定法人(週)	4,203	0	4,203	694	0	3,580	-3,580	702	
特定法人(近月)	12,445	7,941	4,504	947	5,226	9,385	-4,159	759	
特定法人(全月)	11,485	9,545	1,940	-3,408	3,364	16,725	-13,361	-4,072	
十大交易人(週)	27,292	31,583	-4,291	-1,851	36,244	29,463	6,781	3,528	
十大交易人(近月)	36,461	34,552	1,909	1,744	44,071	43,075	996	-11	
十大交易人(全月)	85,408	80,470	4,938	1,783	96,628	89,091	7,537	1,305	
全市場未沖銷(近月)			84,055	8,538			93,033	10,229	
全市場未沖銷(全月)			232,426	21,373			245,734	24,690	

更新日期：2023年2月7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	15400	買權OI最大量	15550
	賣權成交最大量	15400	賣權OI最大量	15300
	整體隱含波動率	12.16%	較前一交易日	-0.75%
	買權隱含波動率	12.25%	較前一交易日	-2.20%
	賣權隱含波動率	12.08%	較前一交易日	+1.17%
電子選擇權	買權成交最大量	735	買權OI最大量	720
	賣權成交最大量	725	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

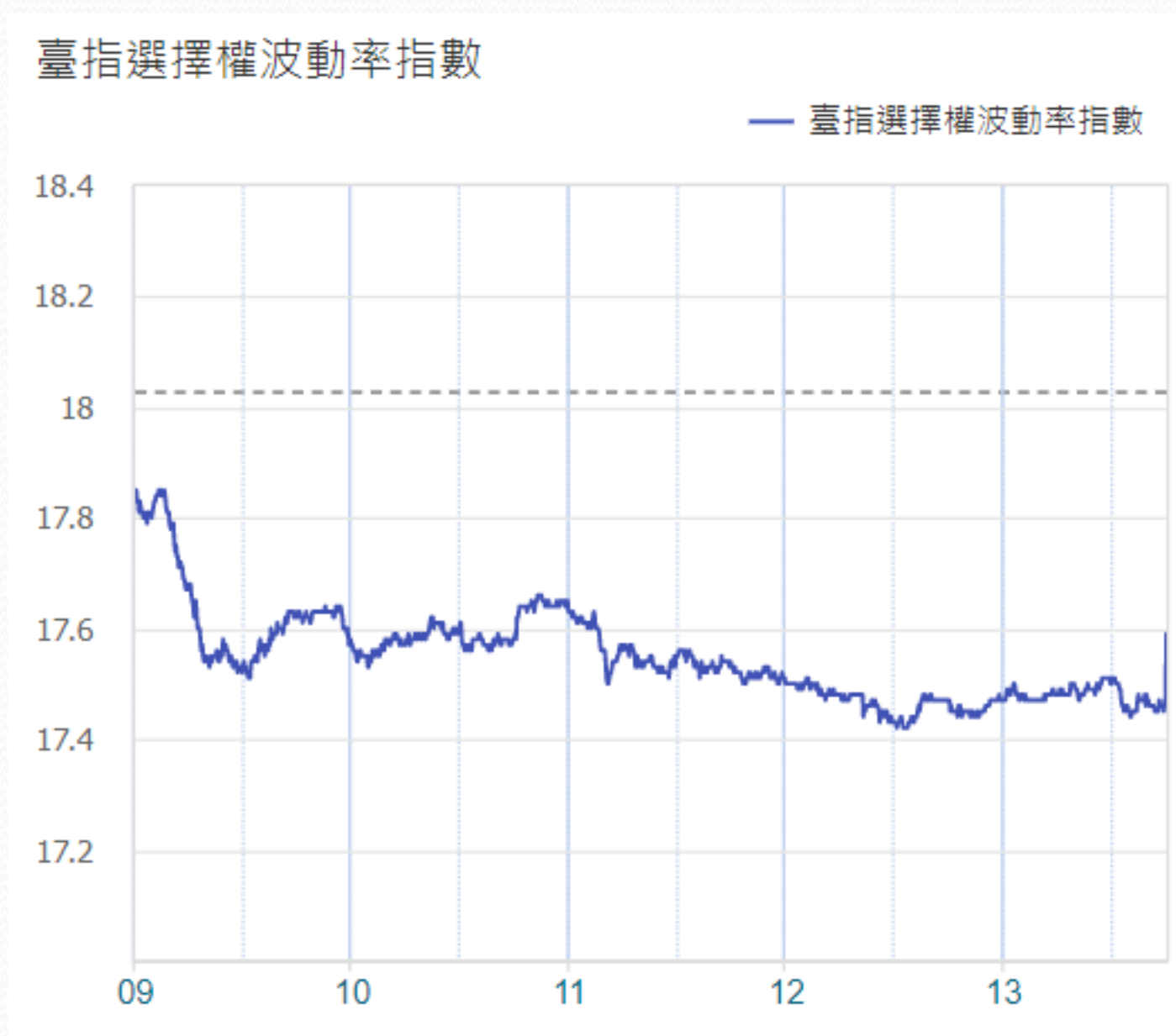
更新日期：2023年2月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	15700	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	15.67%	較前一交易日	+0.40%
	買權隱含波動率	14.61%	較前一交易日	-0.81%
	賣權隱含波動率	16.78%	較前一交易日	-0.19%
	成交量P/C_Ratio值	0.880	較前一交易日	+0.10
	未平倉P/C_Ratio值	1.107	較前一交易日	+0.01
電子選擇權	買權成交最大量	735	買權OI最大量	720
	賣權成交最大量	725	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

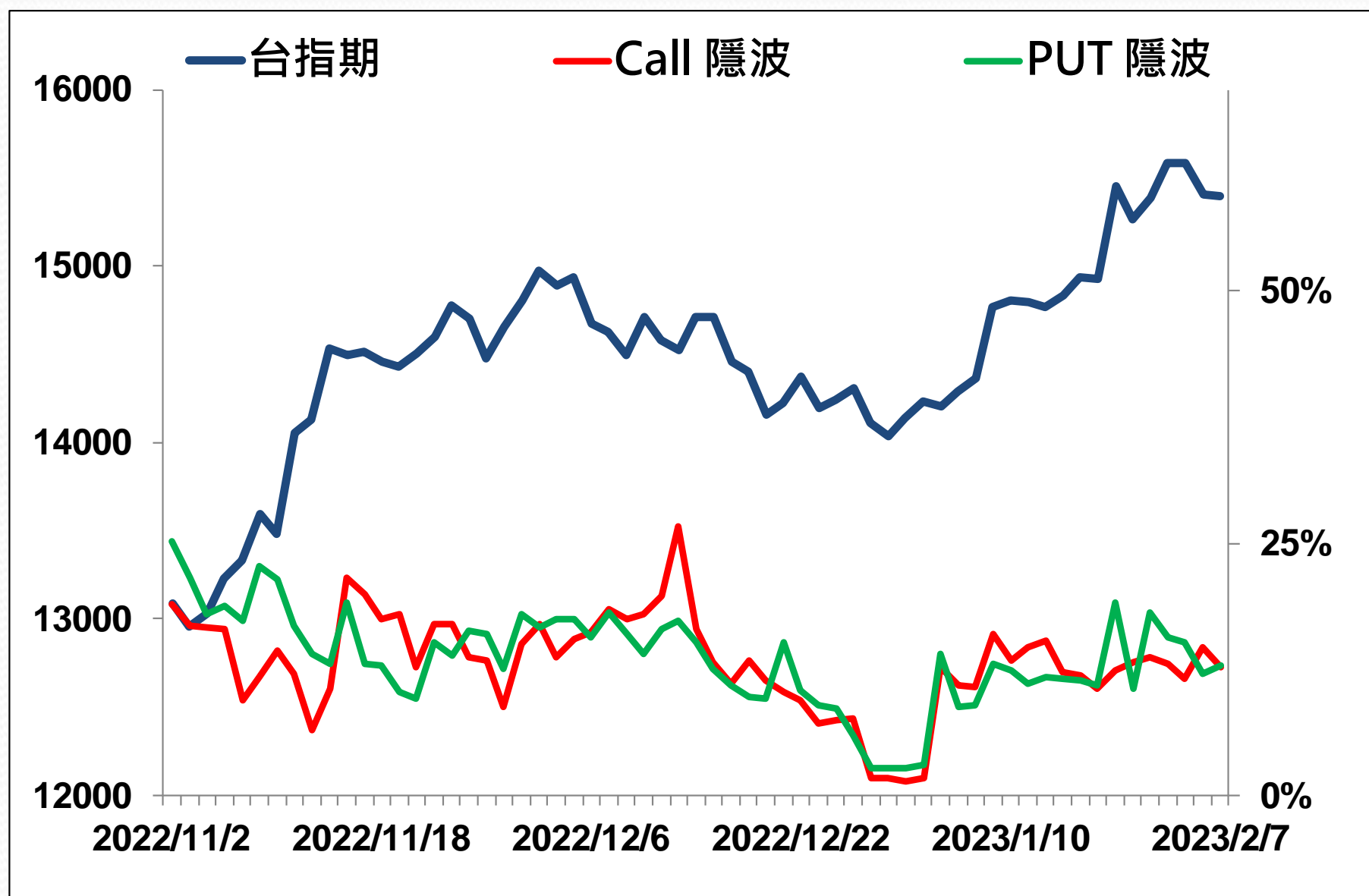
更新日期：2023年2月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



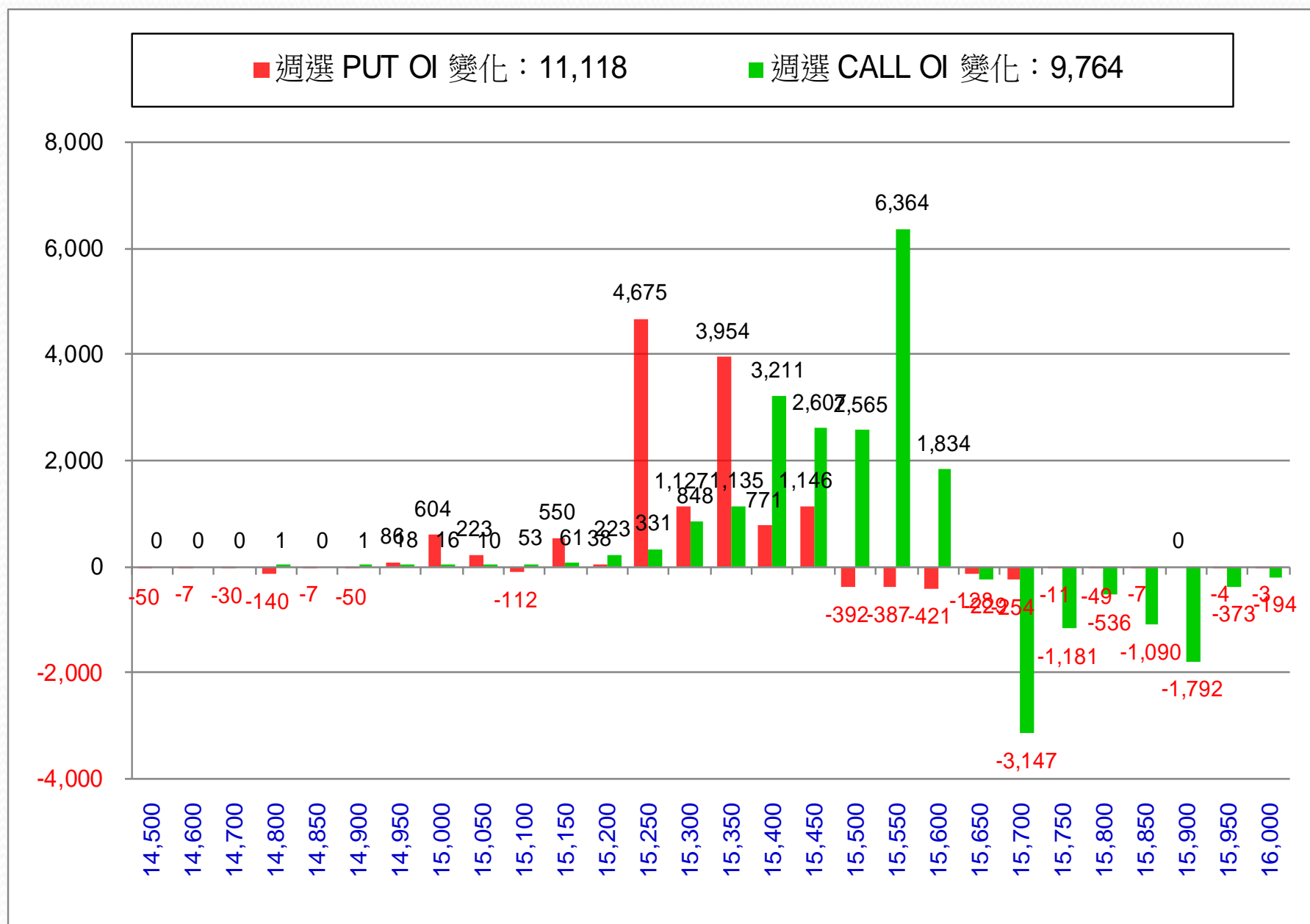
更新日期：2023年2月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



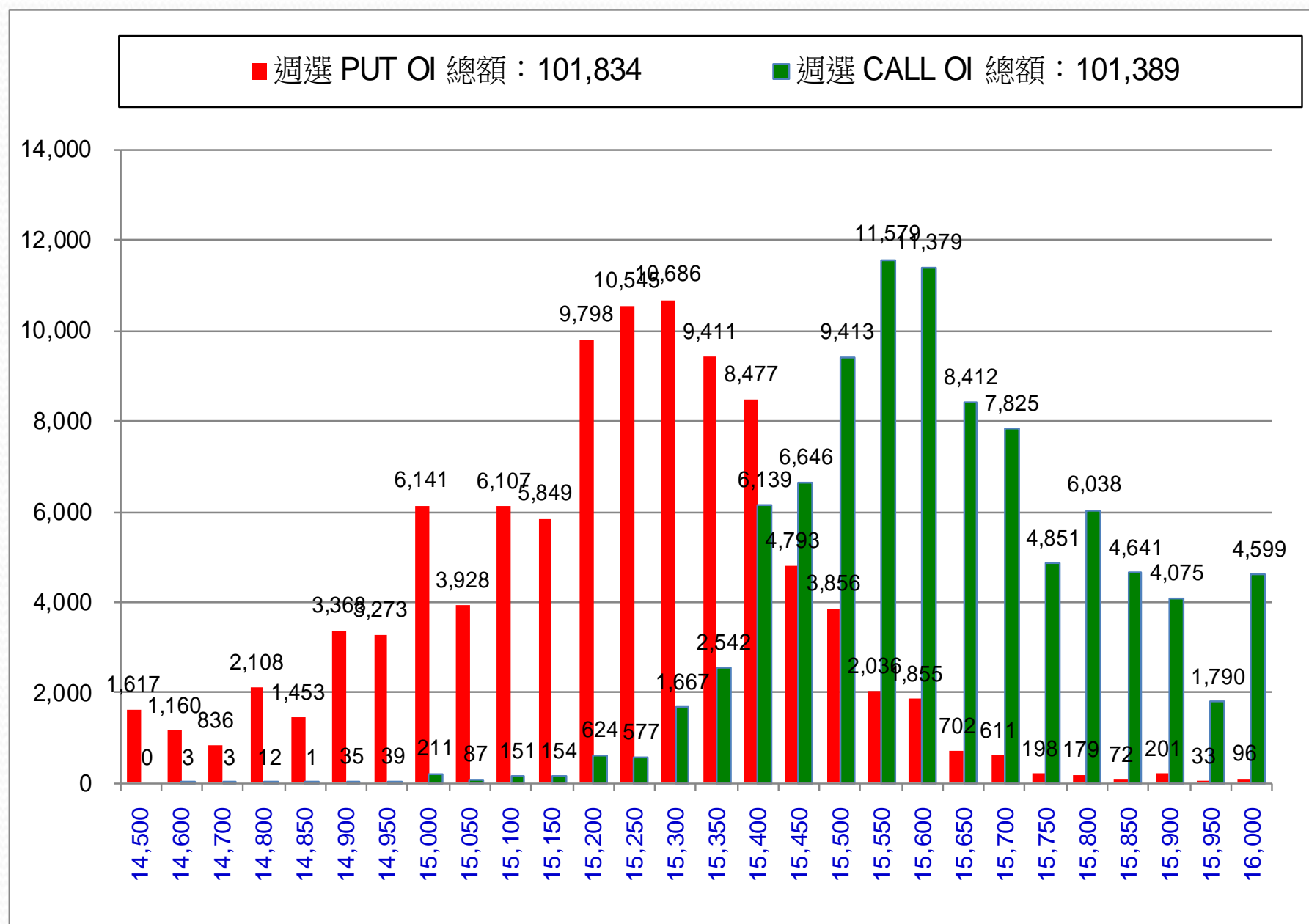
更新日期：2023年2月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年2月7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



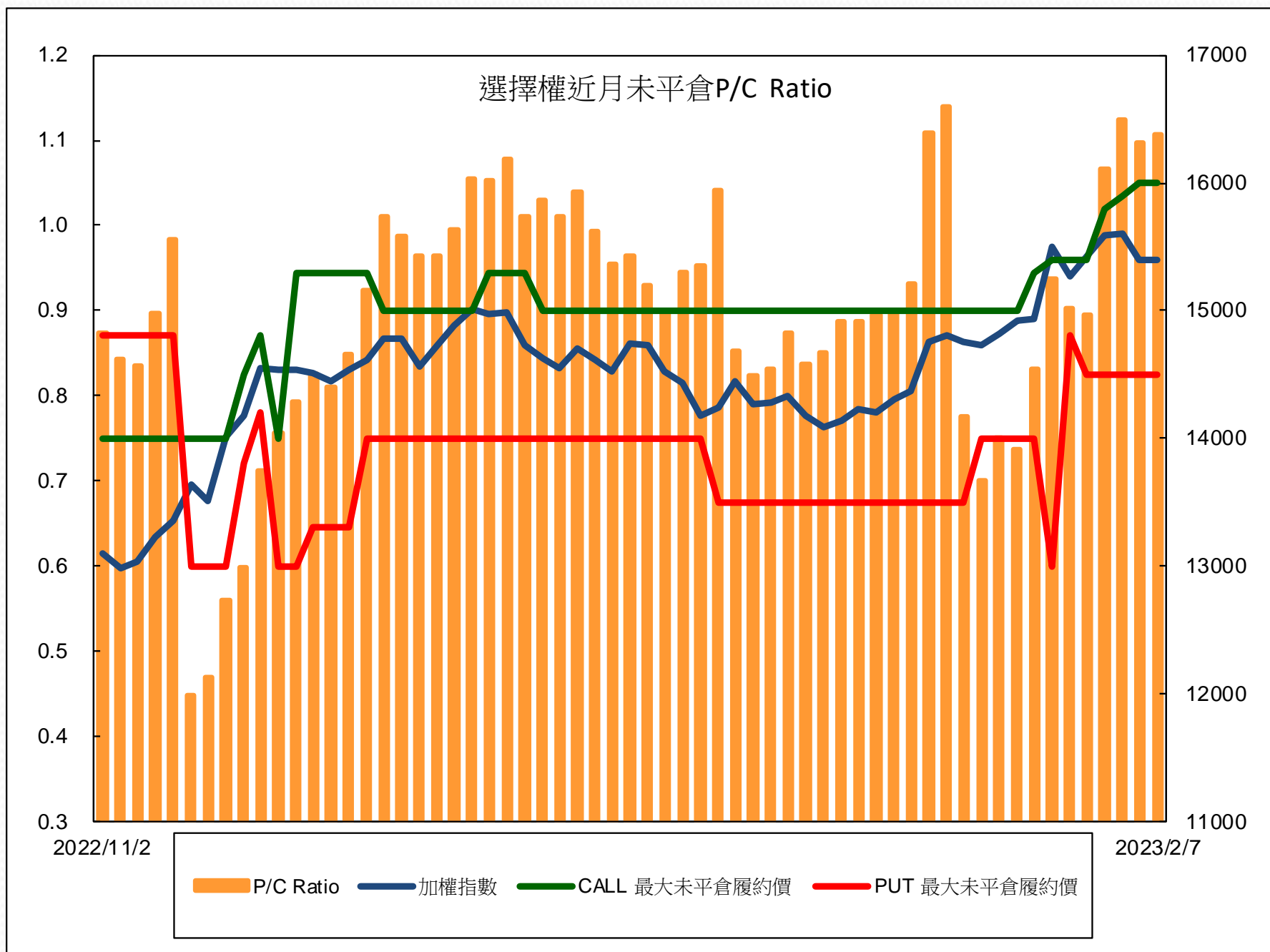
更新日期：2023年2月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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6日	63,861	65,616	-1,755
	2月7日	67,797	67,393	404
Put	2月6日	65,618	63,026	2,592
	2月7日	69,724	68,366	1,358

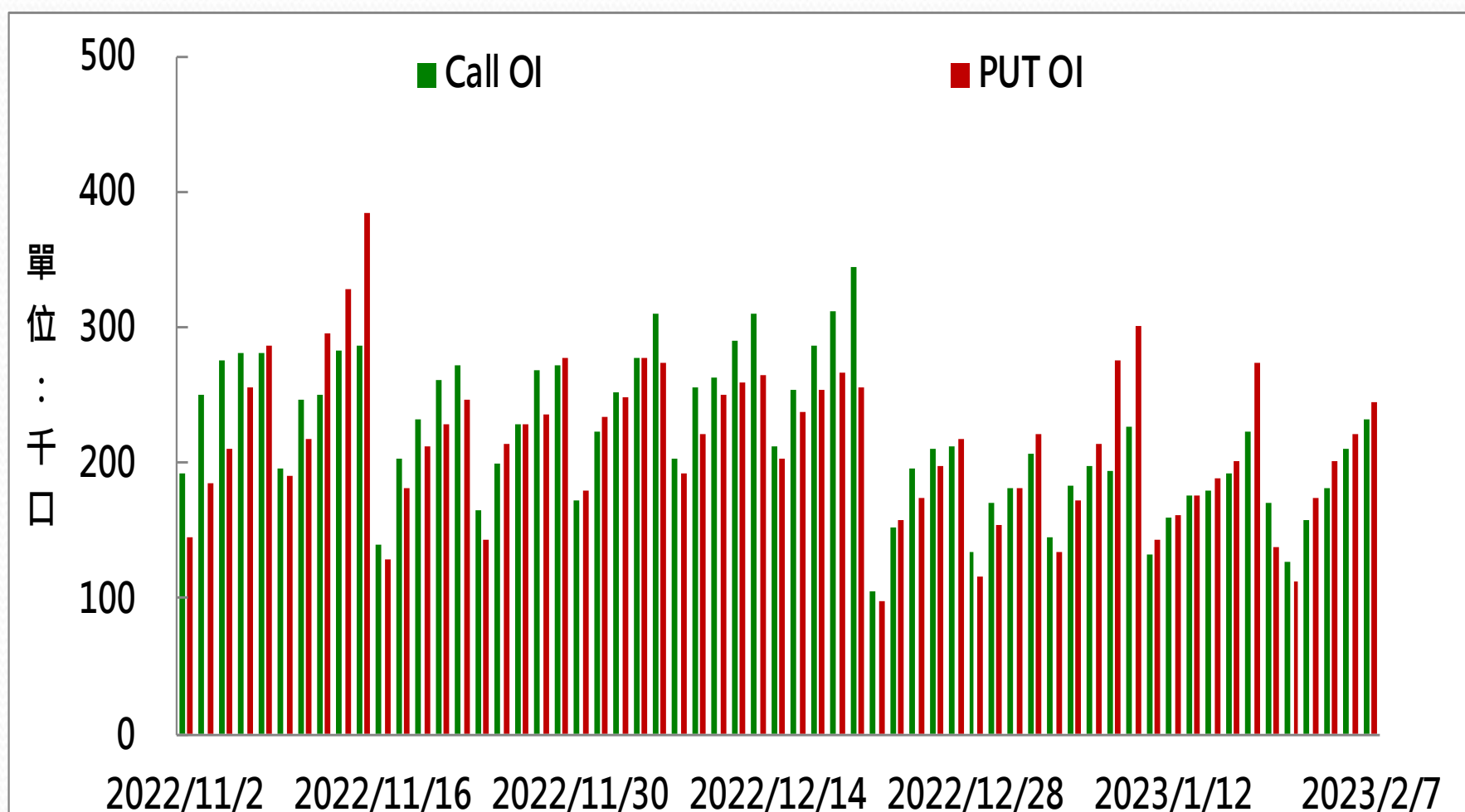
更新日期：2023年2月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

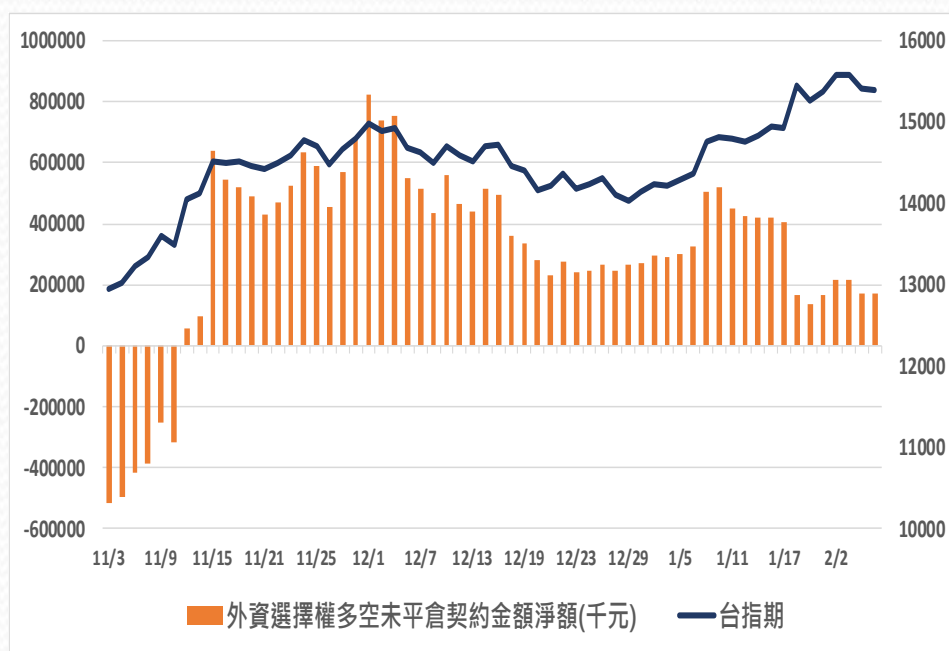
選擇權全月Put Call OI



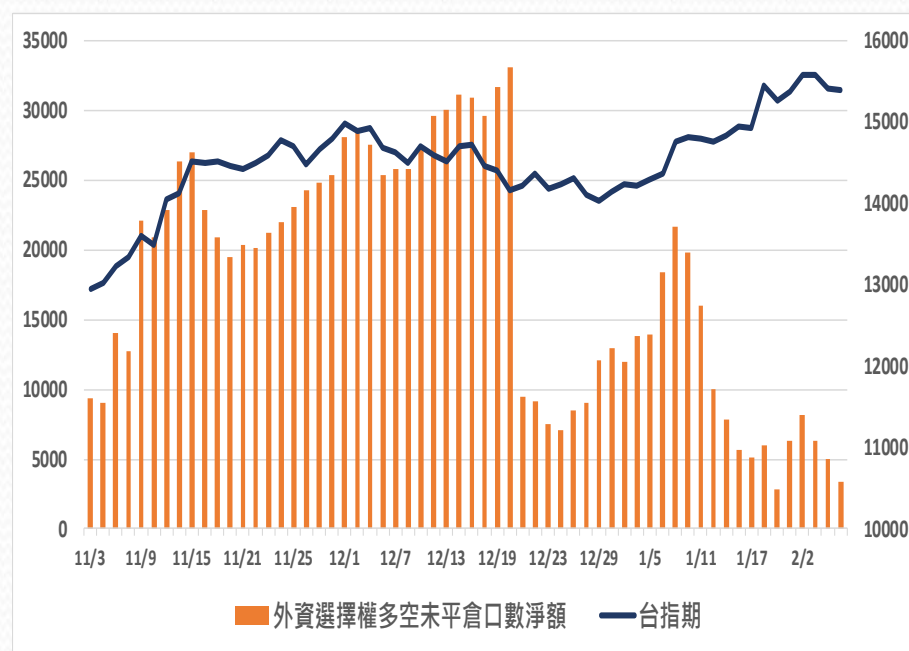
更新日期：2023年2月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



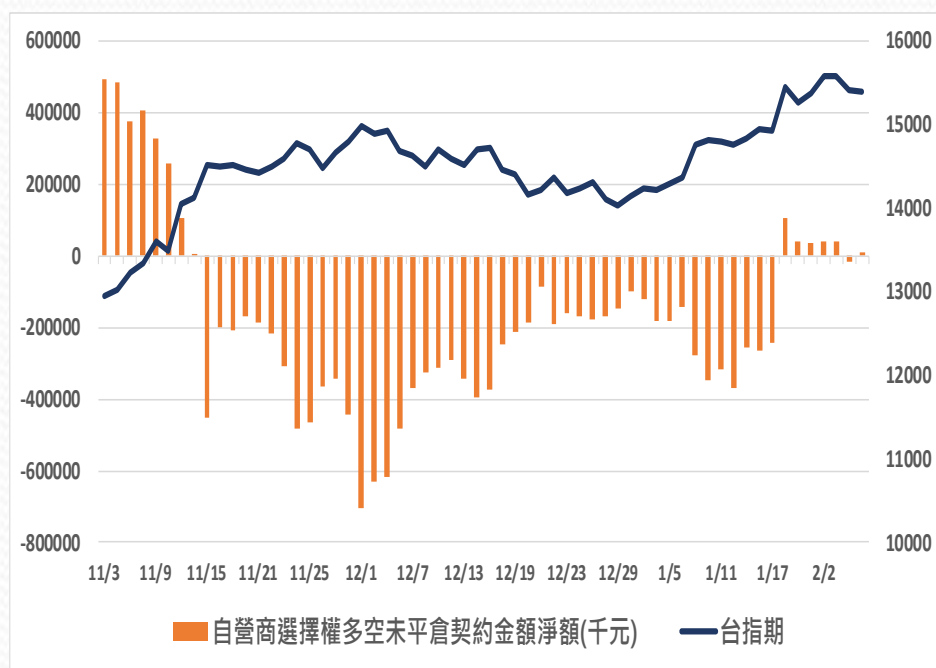
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/1	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
2023/2/7	15397	3373	-1587	169963	-3088

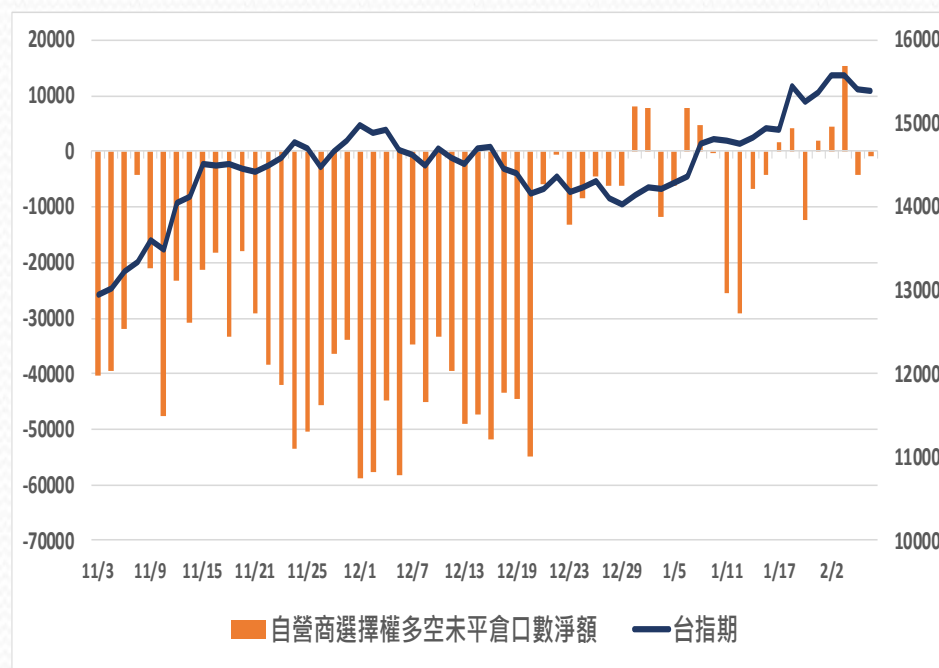
更新日期：2023年2月7日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



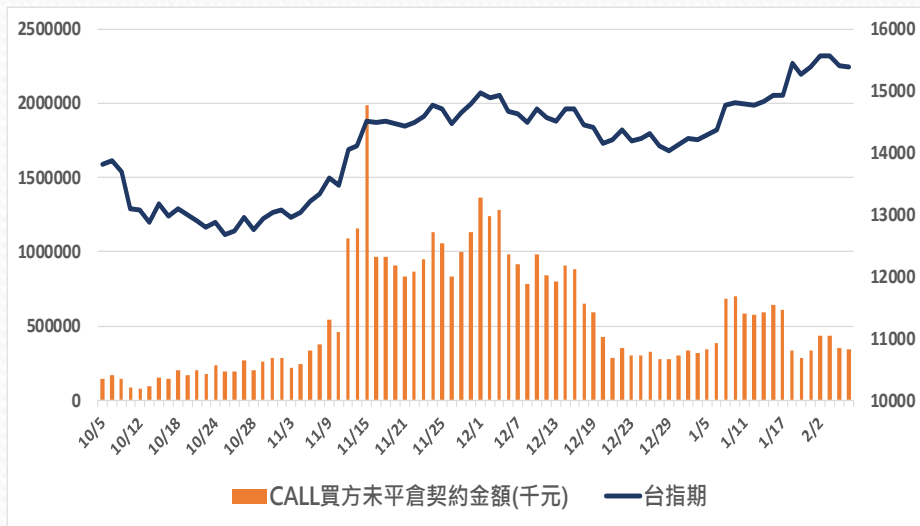
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/1	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
2023/2/7	15397	-954	3393	10054	26208

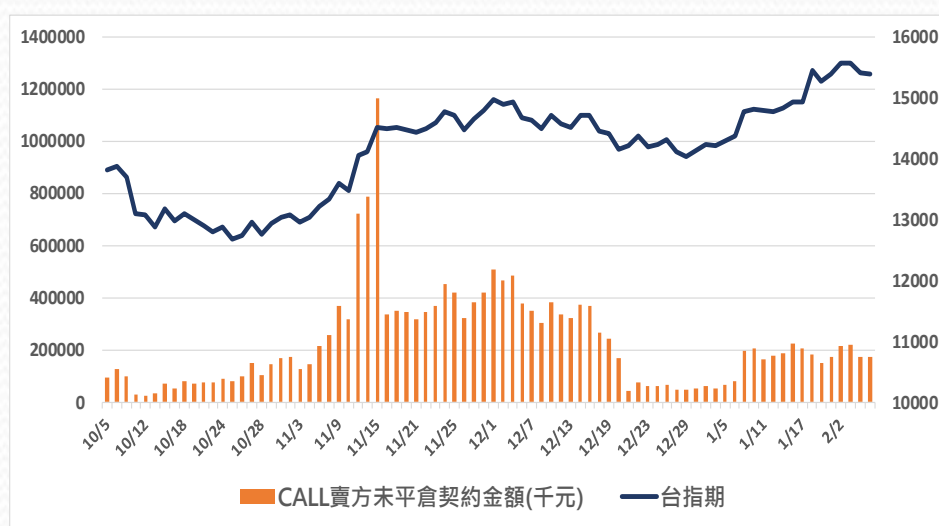
更新日期：2023年2月7日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

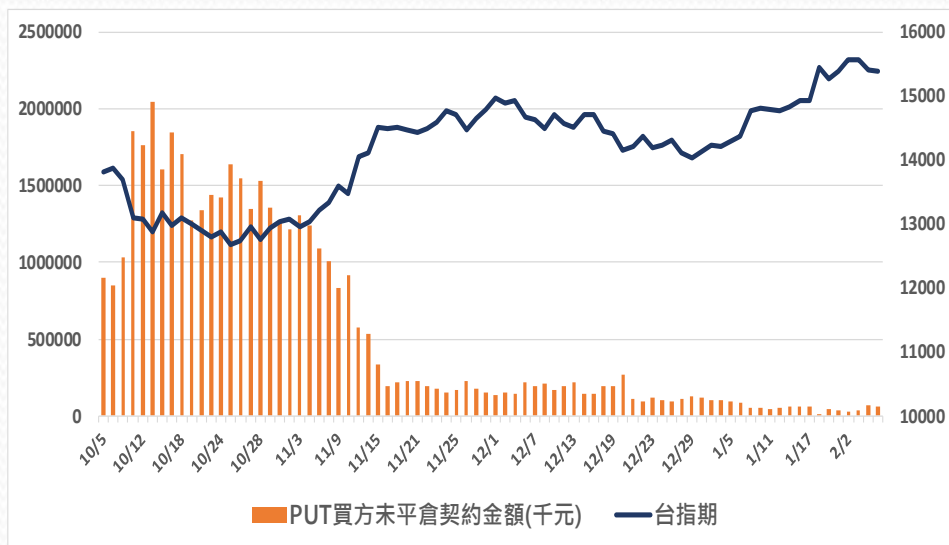
CALL買方未平倉金額



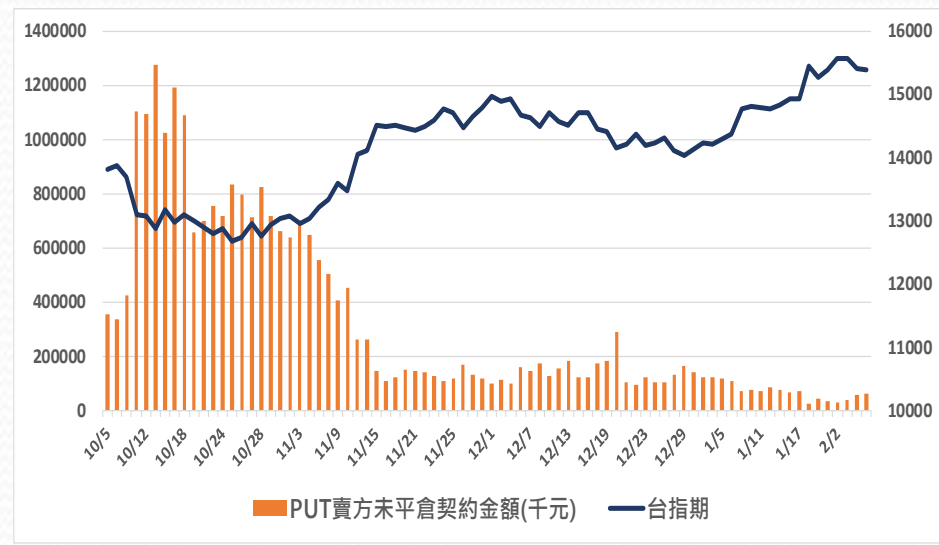
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



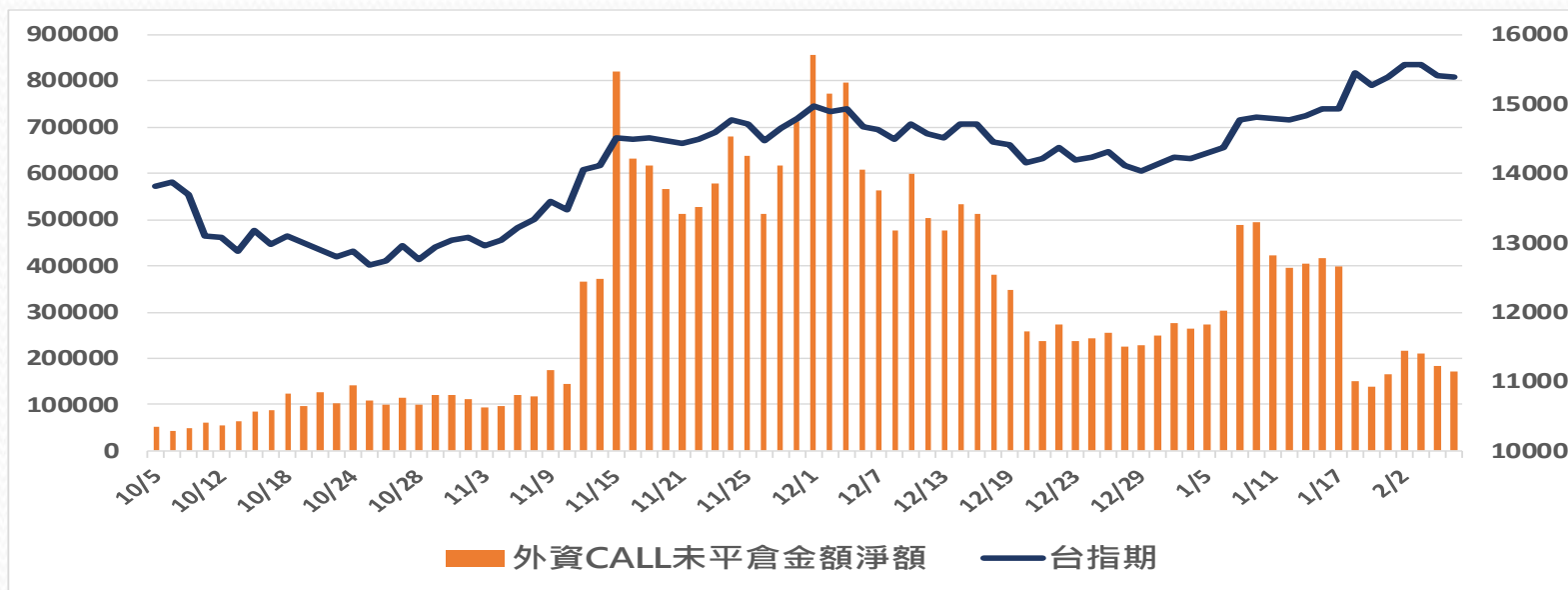
PUT賣方未平倉金額



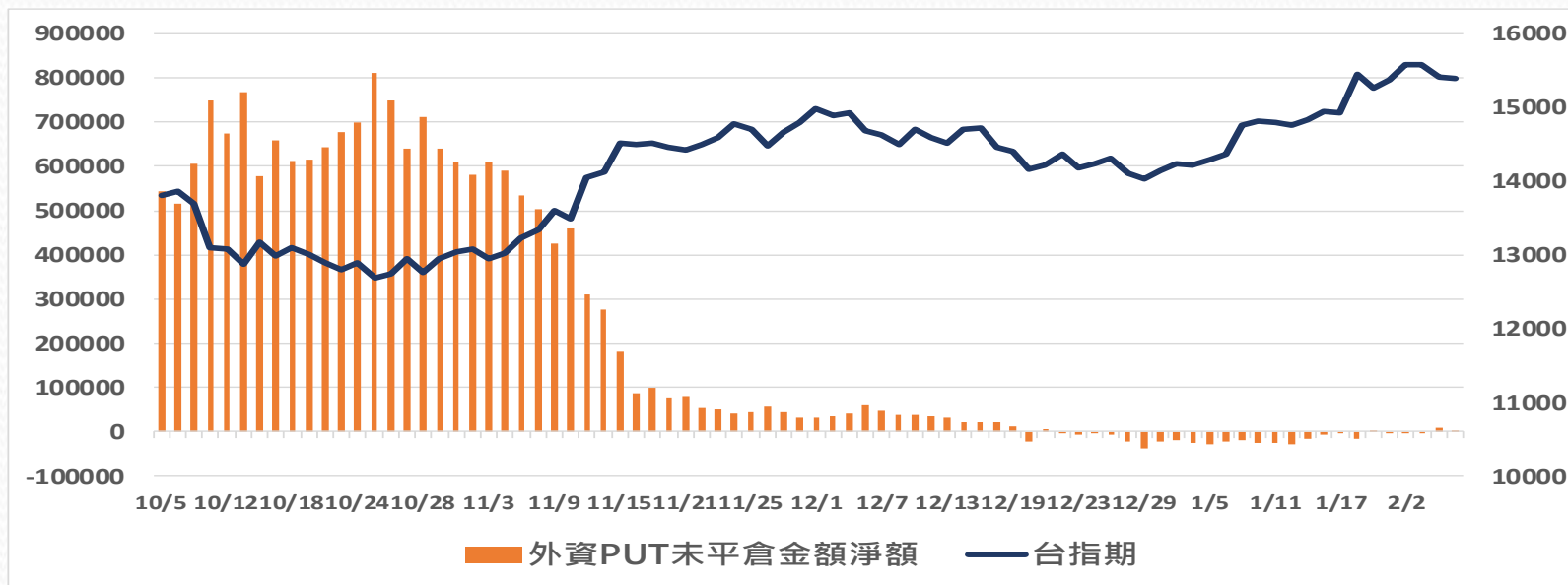
更新日期：2023年2月7日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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7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7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