

台指選擇權OI匯報

日期：2023/2/8 結算日：2023/2/15					日期：2023/2/8 結算日：2023/3/15				
202302 月台指選擇權 OI 序列					202303 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
-3	350	14,500	12,144	1,112	0	77	13,800	559	51
0	1,460	14,600	4,109	-482	0	3	13,900	414	-22
-24	1,134	14,700	2,922	-684	-1	483	14,000	1,565	117
0	1,086	14,800	3,267	-1,904	0	27	14,100	622	30
-14	556	14,900	7,190	1,618	0	153	14,200	457	47
-8	30	14,950	2,115	1,141	0	57	14,300	767	-72
-92	1,217	15,000	7,772	3,561	-2	211	14,400	611	101
0	31	15,050	3,979	2,440	0	63	14,500	1,607	76
-141	1,298	15,100	5,121	1,734	2	229	14,600	1,081	366
25	35	15,150	2,809	1,182	16	91	14,700	1,012	143
-63	1,182	15,200	8,402	3,470	-22	201	14,800	1,919	610
42	144	15,250	3,189	1,176	20	82	14,900	765	500
-68	1,970	15,300	4,917	1,406	-15	378	15,000	1,649	231
-27	309	15,350	2,333	1,002	1	148	15,100	510	329
-220	3,513	15,400	5,651	2,185	-6	390	15,200	708	93
-391	476	15,450	1,767	924	-2	95	15,300	518	351
130	3,915	15,500	3,980	2,051	-91	953	15,400	1,226	418
11	1,297	15,550	1,190	757	88	447	15,500	477	237
401	5,764	15,600	2,585	1,171	141	1,709	15,600	116	29
100	1,804	15,650	515	428	180	553	15,700	87	51
594	5,321	15,700	685	322	275	847	15,800	68	13
314	3,964	15,750	170	115	50	968	15,900	21	12
-985	6,917	15,800	239	96	-36	3,704	16,000	54	25
53	2,756	15,850	59	52	201	1,489	16,100	9	4
-75	7,763	15,900	95	31	230	1,066	16,200	23	0
-953	7,801	16,000	118	46	274	1,080	16,300	6	0
3,003	6,287	16,100	73	28	140	1,159	16,400	8	4
1,518	3,483	16,200	10	1	258	722	16,500	6	5
307	2,825	16,300	10	3	65	550	16,600	1	0
1,187	2,158	16,400	33	31	54	273	16,700	0	0
4	1,420	16,500	8	0	27	336	16,800	2	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
4,258	85,200	1.3657	116,358	25,056	2,841	44,134	1.0034	44,285	3,443
昨日 P/C	1.0044	今日增減變化		0.3613	昨日 P/C	0.9891	今日增減變化		0.0143

更新日期：2023年2月8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8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	110,859,626	74,133,883	36,725,743	14,912,381	2,775,841	2,149,157	626,684	-249,557
投信	30,746,122	50,419,645	-19,673,523	265,592	419,780	0	419,780	9,116
自營商	40,571,273	22,801,446	17,769,827	-606,607	1,282,356	839,249	443,107	304,376
	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	529,142	2,062,418	-1,533,276	-105,098	23,755	14,847	8,908	42,999
投信	88,190	0	88,190	-103	0	0	0	0
自營商	383,703	173,279	210,424	9,052	94,944	123,129	-28,185	-54,876

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8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	26,264	11,325	14,939	390	24,508	15,167	9,341	-1,835
投信	100	0	100	100	500	111	389	100
自營商	49,665	53,364	-3,699	-4,103	52,936	61,542	-8,606	-9,964
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	12,006	7,961	4,045	-459	5,225	8,823	-3,598	561
特定法人(全月)	12,686	5,700	6,986	5,046	9,528	17,294	-7,766	5,595
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	37,000	33,172	3,828	1,919	50,311	46,416	3,895	2,899
十大交易人(全月)	67,409	64,994	2,415	-2,523	80,074	71,153	8,921	1,384
全市場未沖銷(近月)			88,391	4,336			118,918	25,885
全市場未沖銷(全月)			140,816	-91,610			172,508	-73,226

更新日期：2023年2月8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	15.54%	較前一交易日	+3.39%
	買權隱含波動率	14.18%	較前一交易日	+1.93%
	賣權隱含波動率	16.77%	較前一交易日	+4.69%
電子選擇權	買權成交最大量	780	買權OI最大量	750
	賣權成交最大量	710	賣權OI最大量	650
金融選擇權	買權成交最大量	1640	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1460	賣權OI最大量	1460

更新日期：2023年2月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

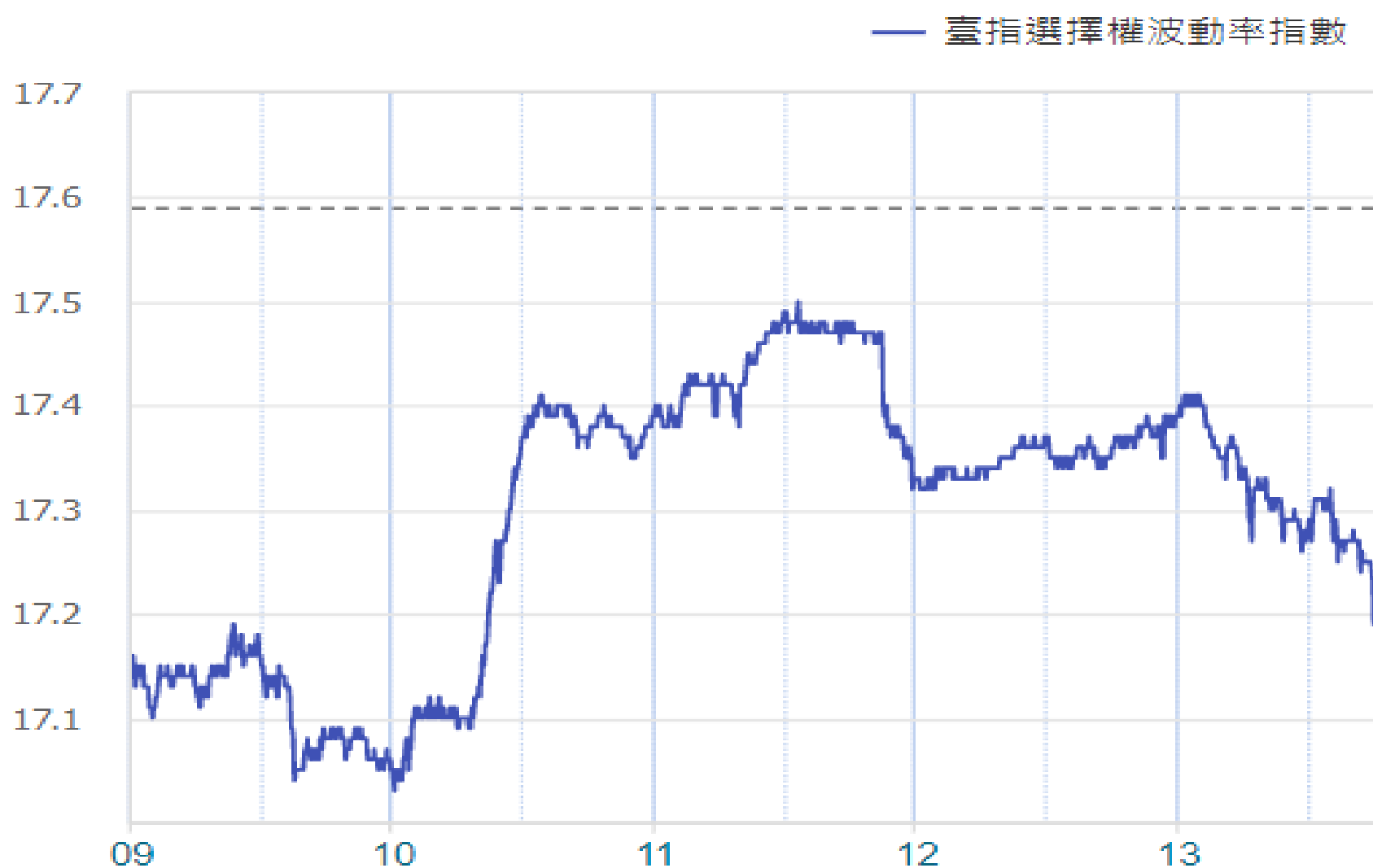
台指選擇權匯報

2023年03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	15.84%	較前一交易日	-0.18%
	買權隱含波動率	13.89%	較前一交易日	-0.72%
	賣權隱含波動率	17.34%	較前一交易日	+0.57%
	成交量P/C_Ratio值	1.235	較前一交易日	+0.35
	未平倉P/C_Ratio值	1.003	較前一交易日	-0.10
電子選擇權	買權成交最大量	780	買權OI最大量	750
	賣權成交最大量	710	賣權OI最大量	650
金融選擇權	買權成交最大量	1640	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1460	賣權OI最大量	1460

更新日期：2023年2月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

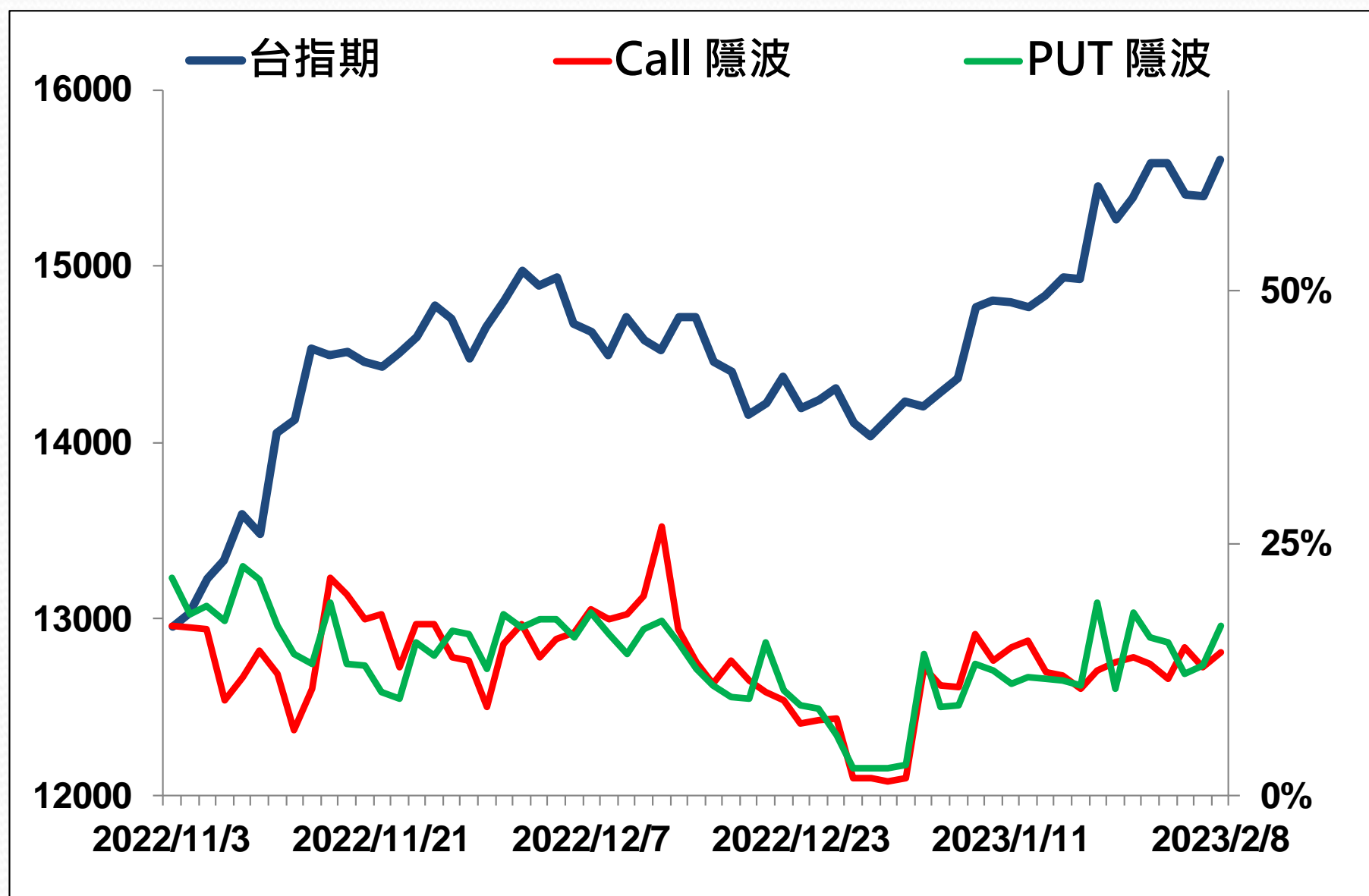
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



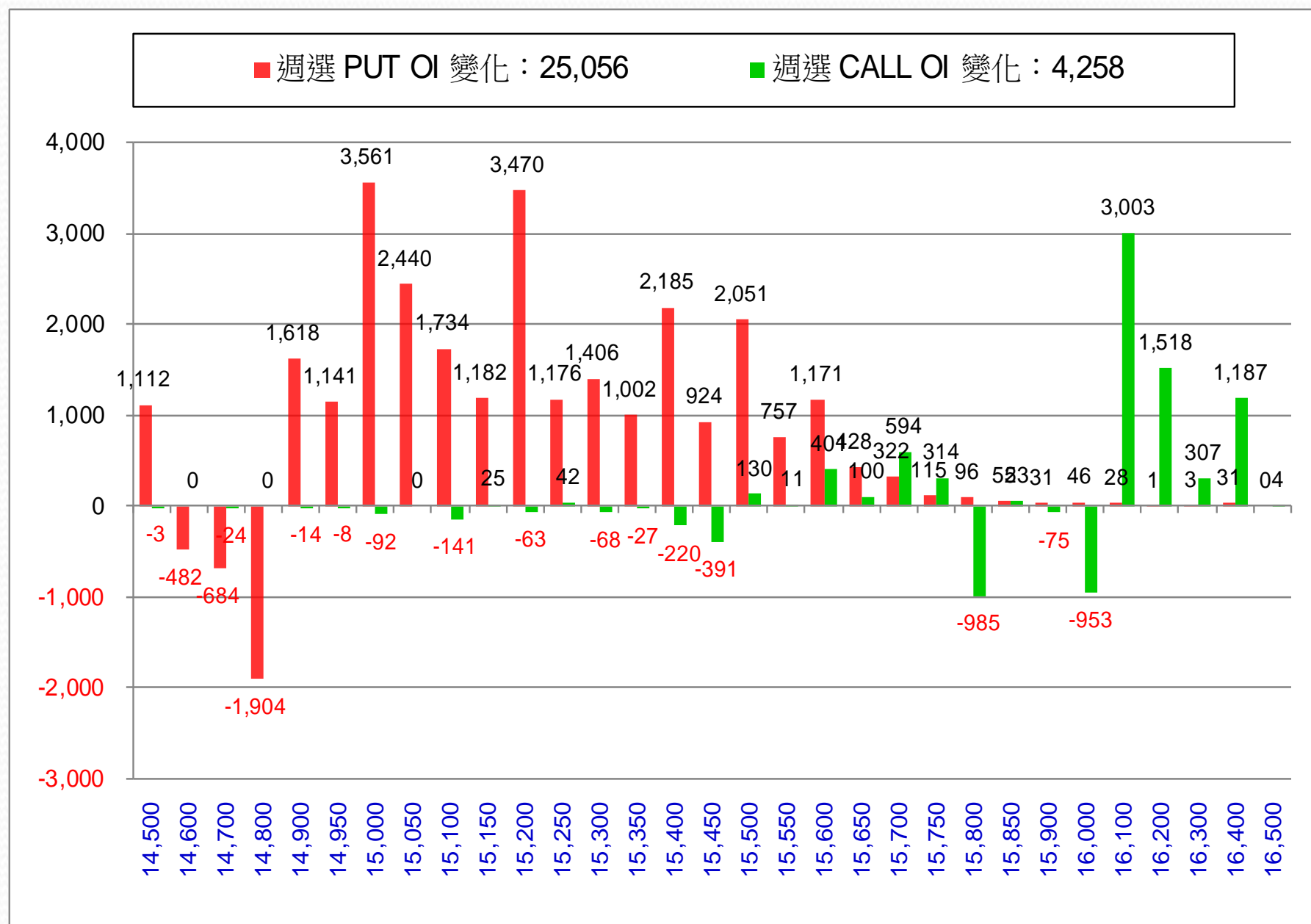
更新日期：2023年2月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



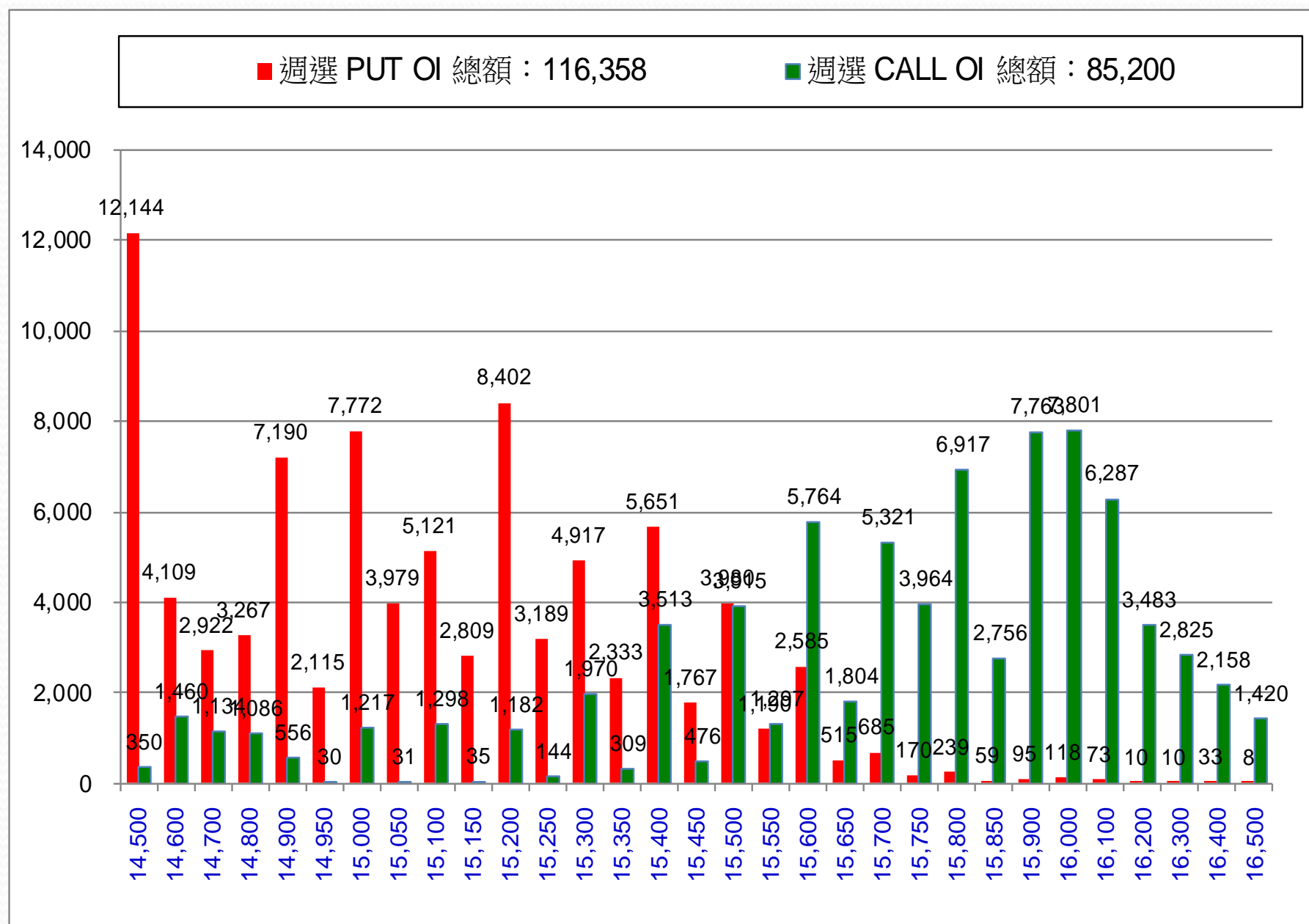
更新日期：2023年2月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年2月8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



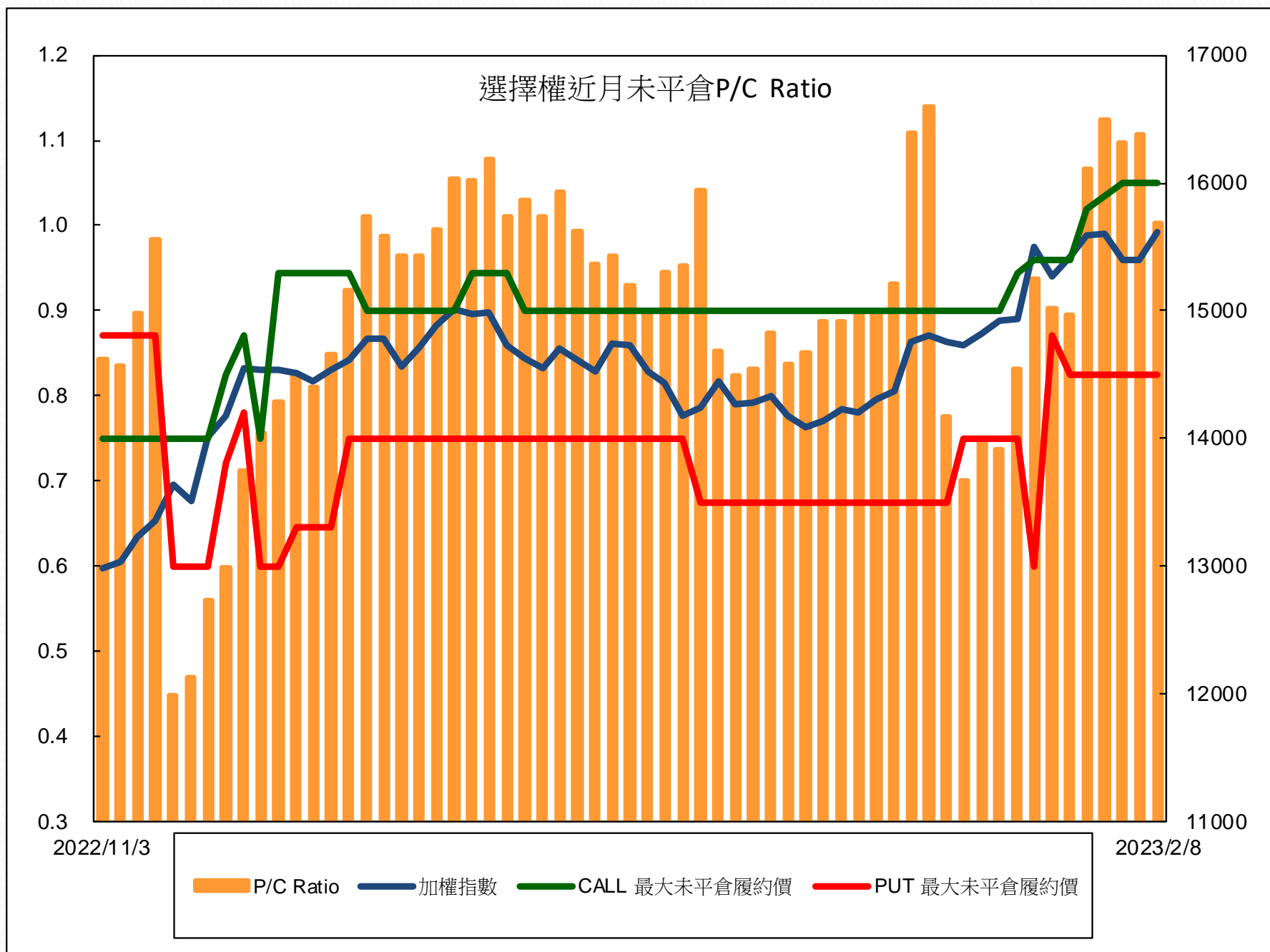
更新日期：2023年2月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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7日	67,797	67,393	404
	2月8日	49,665	53,364	-3,699
Put	2月7日	69,724	68,366	1,358
	2月8日	52,936	61,542	-8,606

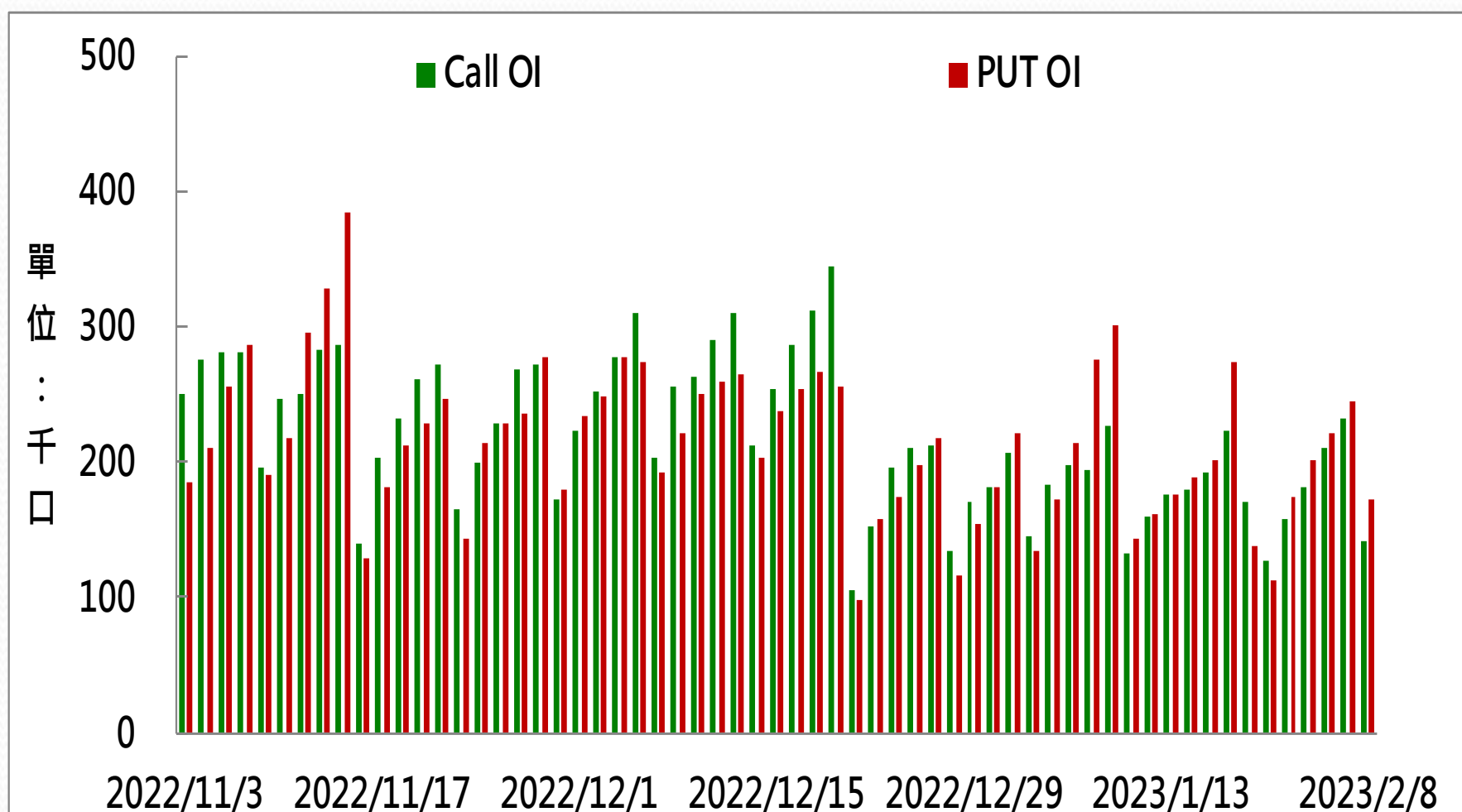
更新日期：2023年2月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

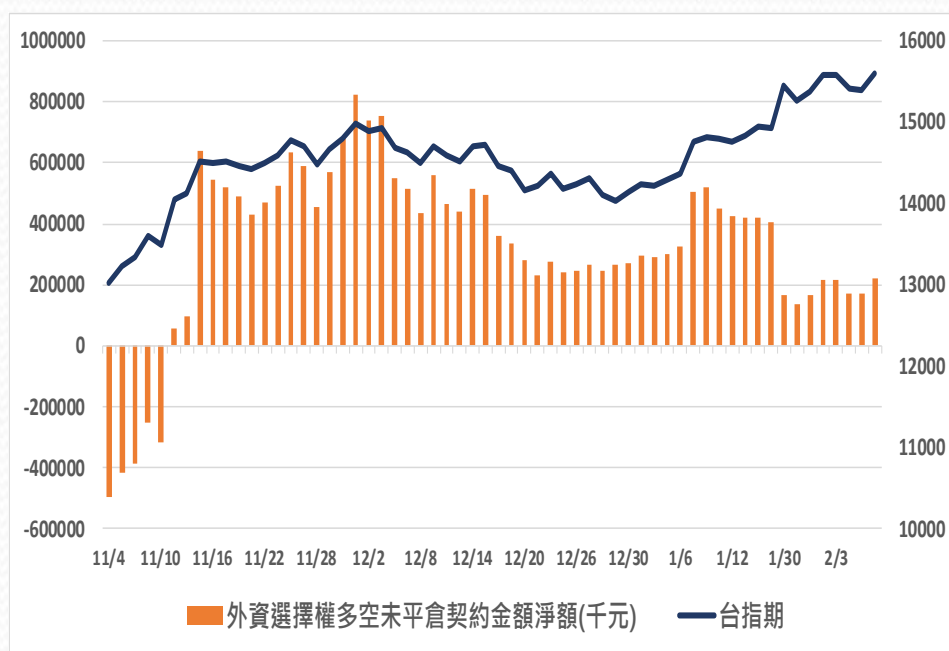
選擇權全月Put Call OI



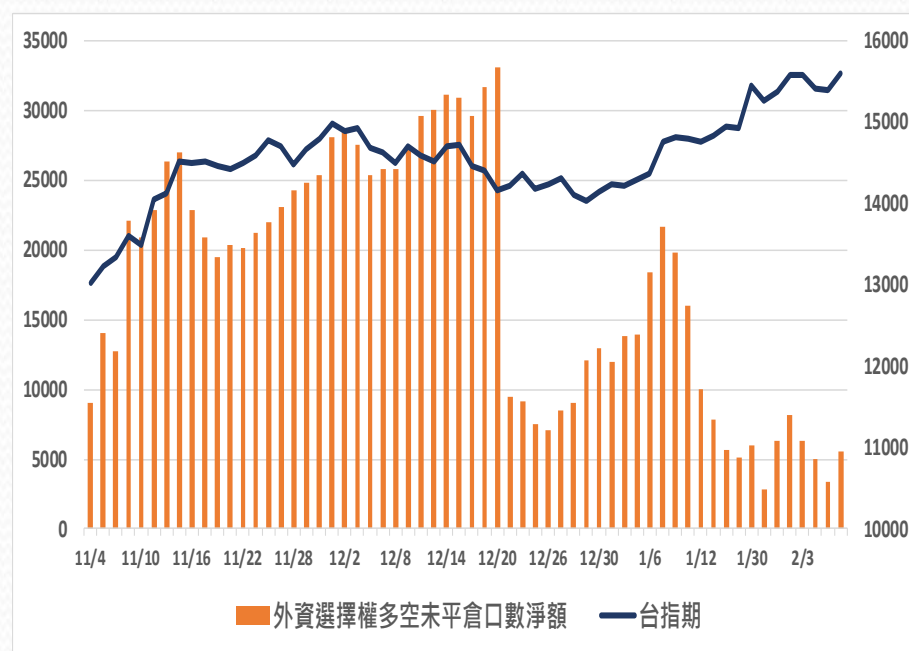
更新日期：2023年2月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



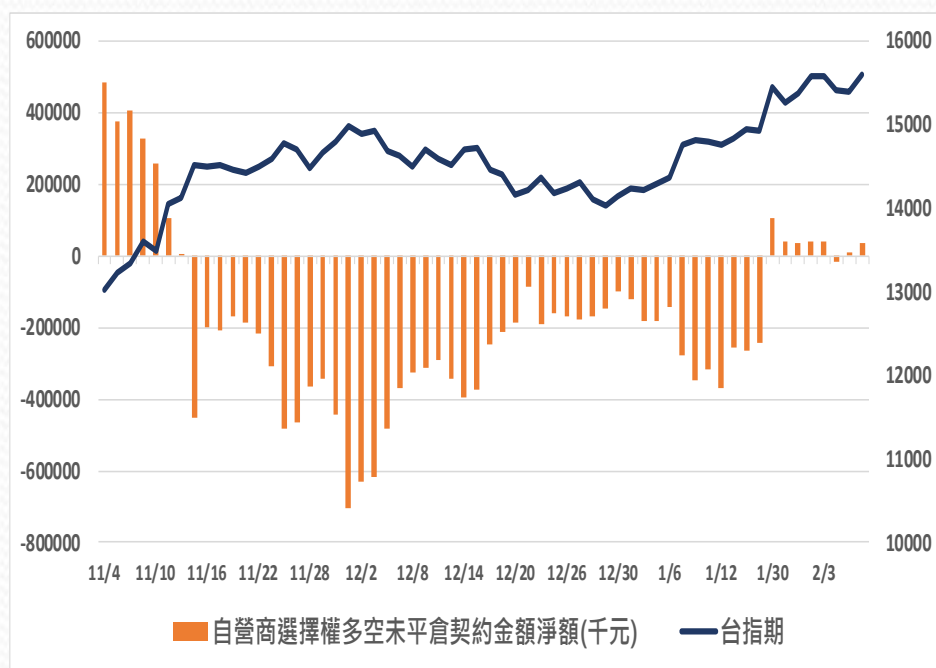
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/2	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
2023/2/8	15604	5598	2225	222908	52945

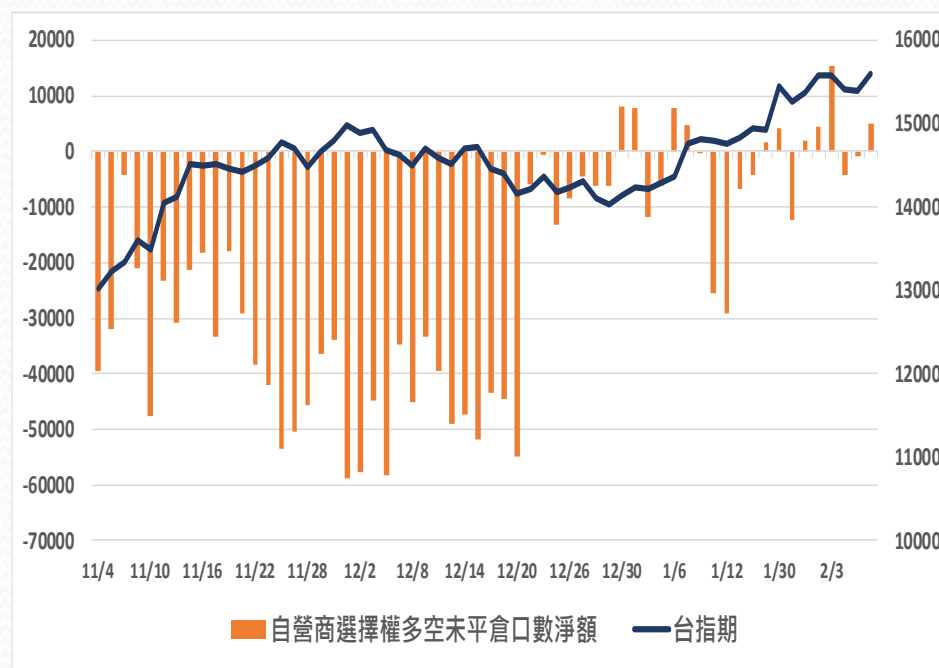
更新日期：2023年2月8日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



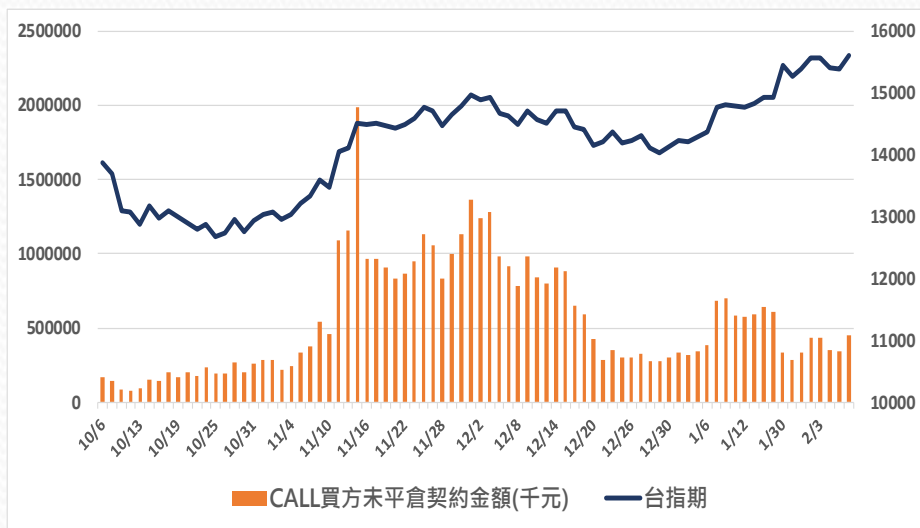
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/2	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
2023/2/8	15604	4907	5861	36230	26176

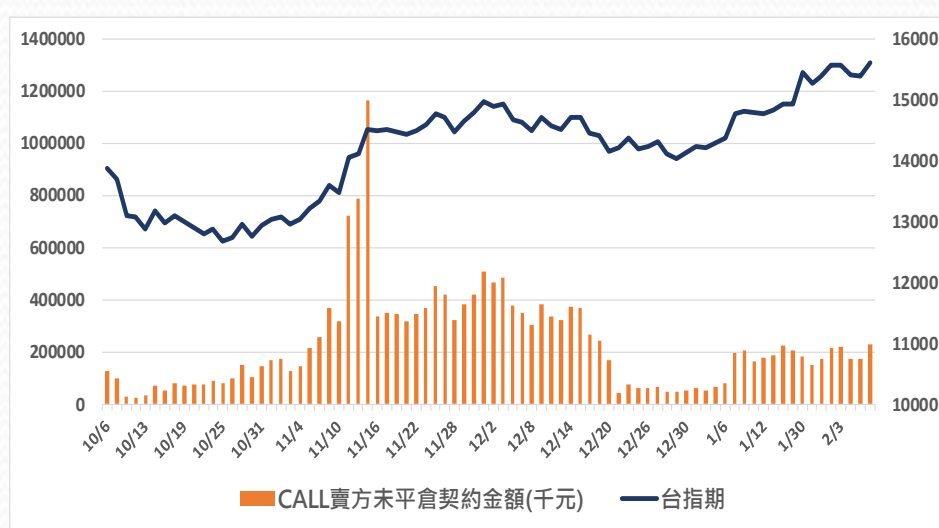
更新日期：2023年2月8日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

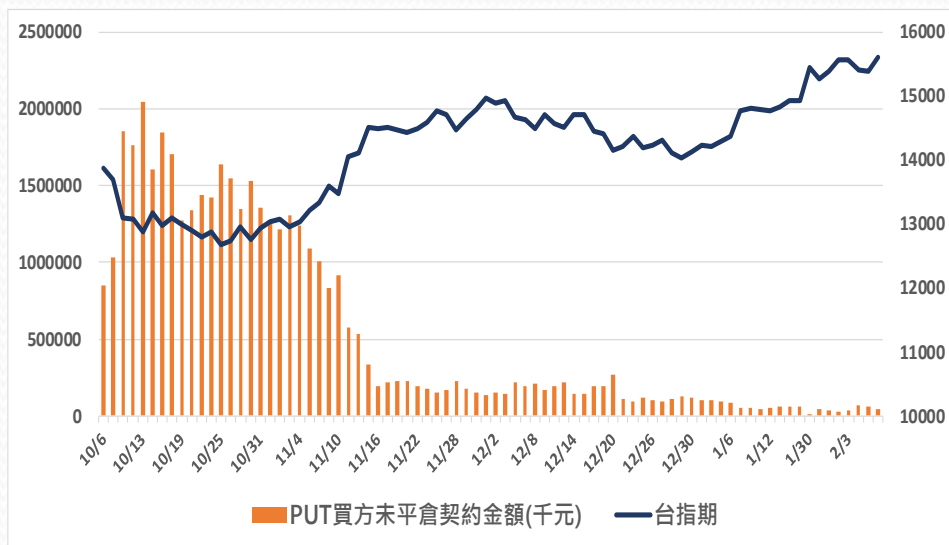
CALL買方未平倉金額



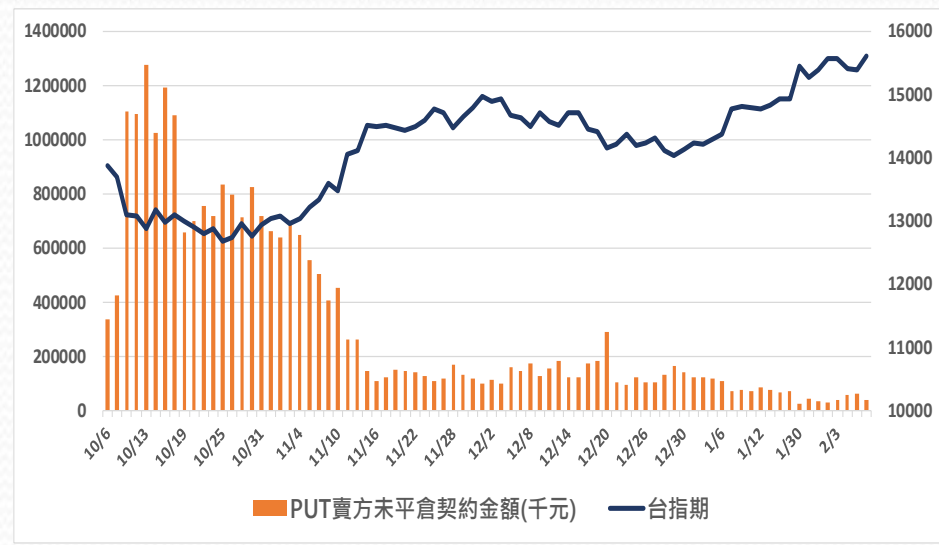
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



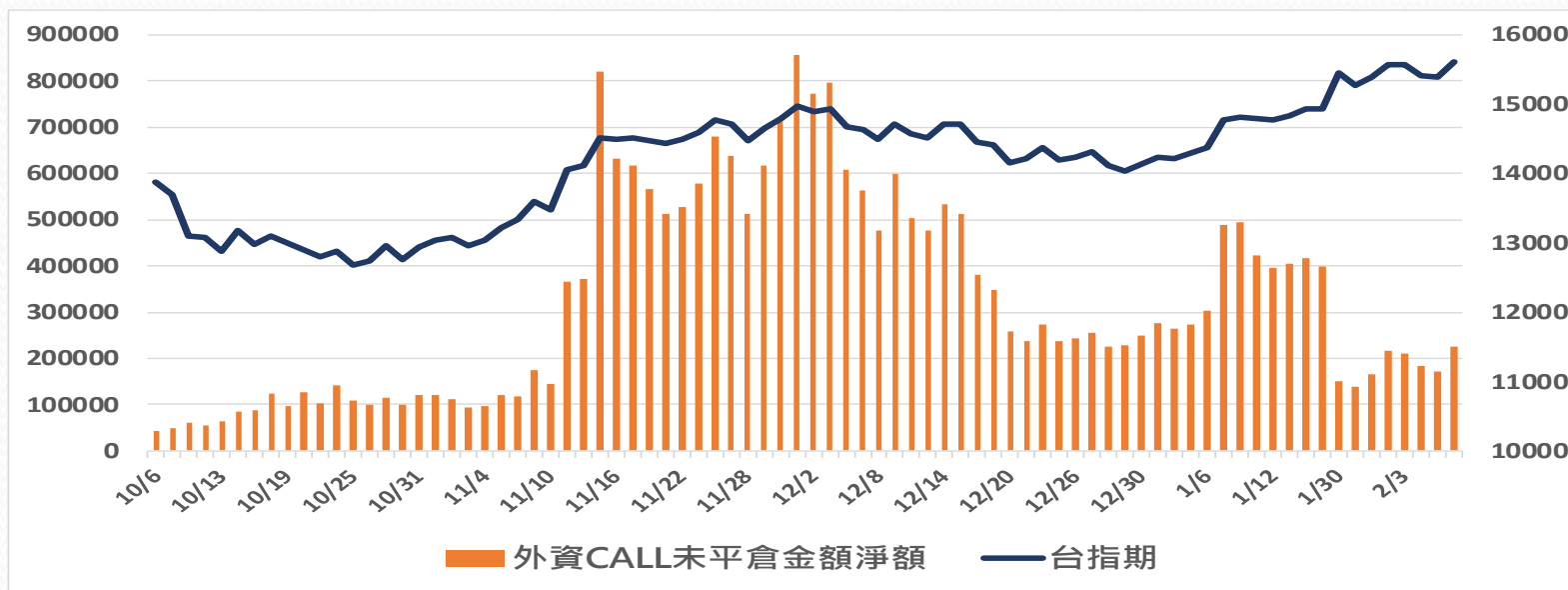
PUT賣方未平倉金額



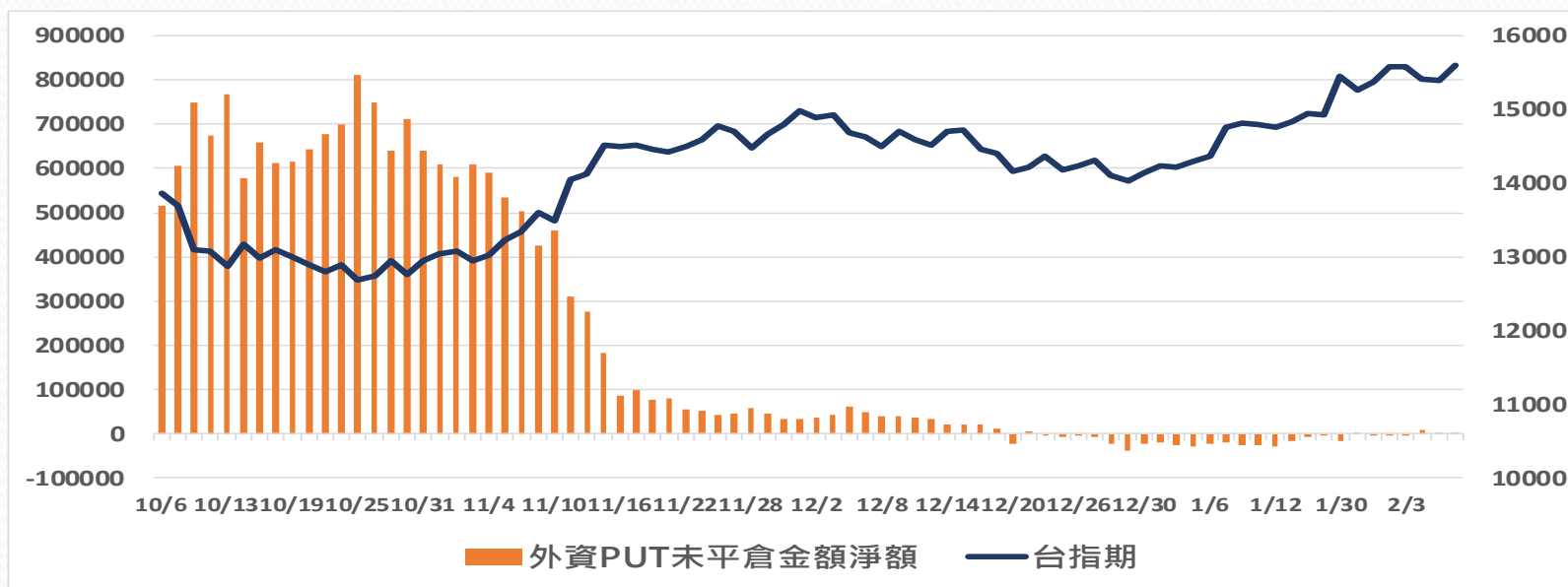
更新日期：2023年2月8日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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8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8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