

# 台指選擇權 OI 匯報

日期：2023/2/9 結算日：2023/2/15					日期：2023/2/9 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
0	350	14,500	12,071	-73	0	77	13,800	572	13
-1	1,459	14,600	4,342	233	0	3	13,900	425	11
-1	1,133	14,700	3,373	451	0	483	14,000	1,673	108
-14	1,072	14,800	3,629	362	0	27	14,100	652	30
-24	532	14,900	8,105	915	0	153	14,200	477	20
-1	29	14,950	3,696	1,581	-1	56	14,300	711	-56
-8	1,209	15,000	8,518	746	-2	209	14,400	650	39
0	31	15,050	6,181	2,202	0	63	14,500	1,567	-40
-87	1,211	15,100	7,369	2,248	0	229	14,600	1,195	114
36	71	15,150	4,369	1,560	1	92	14,700	1,182	170
11	1,193	15,200	9,484	1,082	-1	200	14,800	2,103	184
27	171	15,250	5,006	1,817	0	82	14,900	982	217
16	1,986	15,300	8,445	3,528	4	382	15,000	1,831	182
131	440	15,350	3,942	1,609	0	148	15,100	840	330
-27	3,486	15,400	7,946	2,295	-5	385	15,200	792	84
86	562	15,450	2,515	748	16	111	15,300	612	94
590	4,505	15,500	5,080	1,100	-2	951	15,400	1,533	307
552	1,849	15,550	2,174	984	26	473	15,500	517	40
1,420	7,184	15,600	3,328	743	183	1,892	15,600	299	183
1,463	3,267	15,650	656	141	103	656	15,700	102	15
2,023	7,344	15,700	1,215	530	76	923	15,800	65	-3
1,378	5,342	15,750	194	24	60	1,028	15,900	21	0
※ 4,000	10,917	15,800	285	46	198	3,902	16,000	54	0
1,181	3,937	15,850	63	4	325	1,814	16,100	29	20
1,543	9,306	15,900	147	52	279	1,345	16,200	23	0
3,037	4,574	15,950	22	4	235	1,315	16,300	6	0
2,984	10,785	16,000	110	-8	103	1,262	16,400	9	1
1,975	3,619	16,050	10	0	202	924	16,500	6	0
3,165	9,452	16,100	57	-16	64	614	16,600	1	0
495	3,978	16,200	17	7	71	344	16,700	0	0
1,785	4,610	16,300	12	2	71	407	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
29,258	117,639	1.2063	141,912	25,526	3,623	47,757	1.0348	49,421	5,136
昨日 P/C	1.3657	今日增減變化	-0.1594		昨日 P/C	1.0034	今日增減變化	0.0314	

更新日期：2023年2月9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9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	105,103,997	71,560,450	33,543,547	-3,182,196	2,605,078	2,229,578	375,500	-251,184	
投信	29,786,640	50,600,160	-20,813,520	-1,139,997	419,894	0	419,894	114	
自營商	40,371,227	20,397,234	19,973,993	2,204,166	1,457,011	821,660	635,351	192,244	
	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	527,113	2,043,548	-1,516,435	16,841	74,165	13,350	60,815	51,907	
投信	98,931	0	98,931	10,741	0	0	0	0	
自營商	347,796	196,301	151,495	-58,929	57,798	115,633	-57,835	-29,650	

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9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	28,240	12,312	15,928	989	33,413	23,158	10,255	914	
投信	100	0	100	0	500	111	389	0	
自營商	59,587	59,188	399	4,098	65,638	60,905	4,733	13,339	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	12,443	5,700	6,743	2,698	2,971	10,347	-7,376	-3,778	
特定法人(全月)	13,665	5,700	7,965	979	9,841	23,130	-13,289	-5,523	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	43,923	41,496	2,427	-1,401	54,560	54,625	-65	-3,960	
十大交易人(全月)	76,416	73,315	3,101	686	89,108	88,105	1,003	-7,918	
全市場未沖銷(近月)			117,650	29,259			145,486	26,568	
全市場未沖銷(全月)			178,170	37,354			215,255	42,747	

更新日期：2023年2月9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	15600	買權OI最大量	15800
	賣權成交最大量	15400	賣權OI最大量	14500
	整體隱含波動率	14.52%	較前一交易日	-1.03%
	買權隱含波動率	14.07%	較前一交易日	-0.11%
	賣權隱含波動率	14.93%	較前一交易日	-1.84%
電子選擇權	買權成交最大量	770	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9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	19200
	賣權成交最大量	14800	賣權OI最大量	10000
	整體隱含波動率	17.77%	較前一交易日	-1.92%
	買權隱含波動率	14.45%	較前一交易日	+0.56%
	賣權隱含波動率	20.50%	較前一交易日	+3.16%
	成交量P/C_Ratio值	1.120	較前一交易日	-0.11
	未平倉P/C_Ratio值	1.035	較前一交易日	+0.03
電子選擇權	買權成交最大量	770	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9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

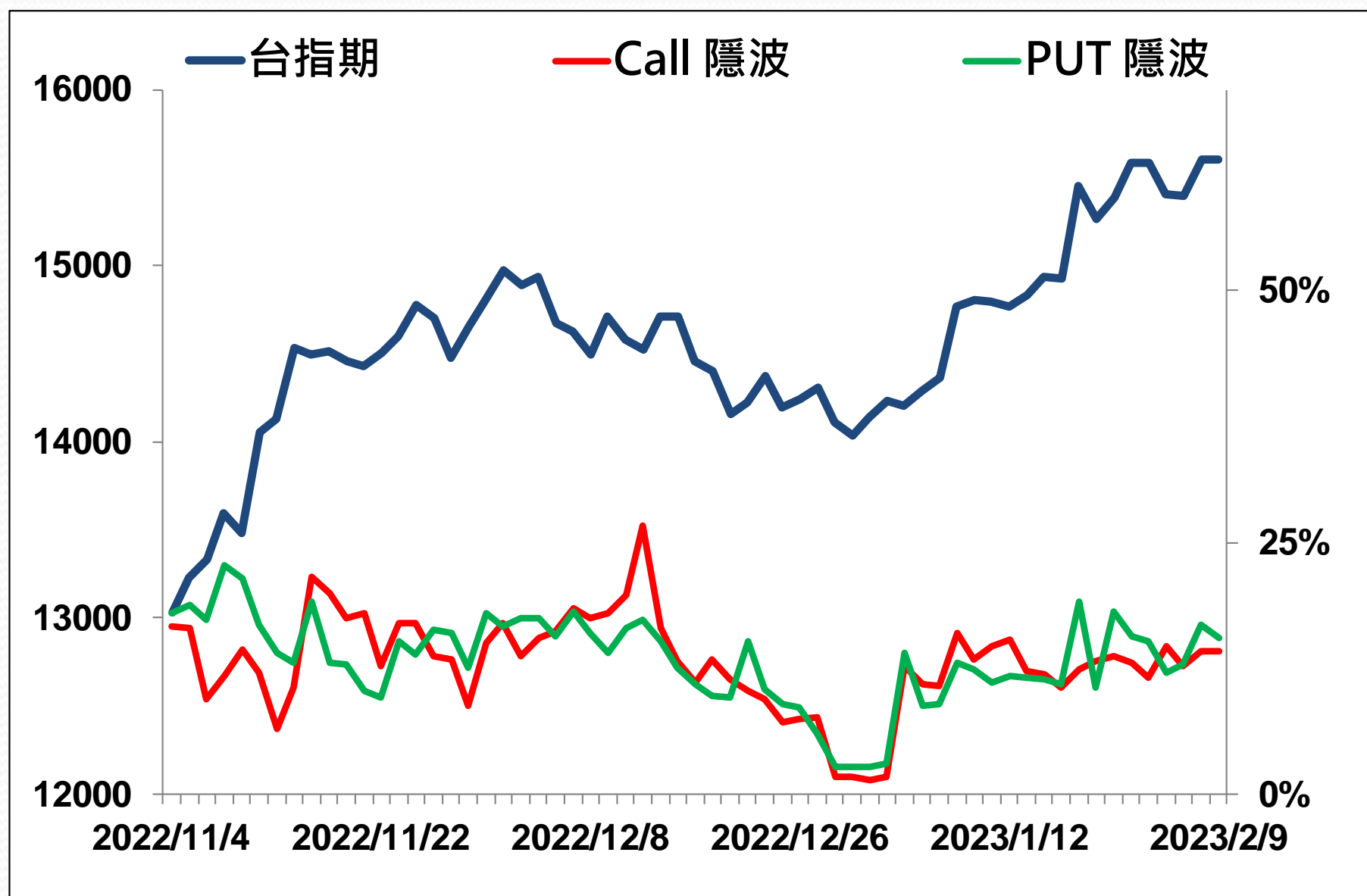
# 選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



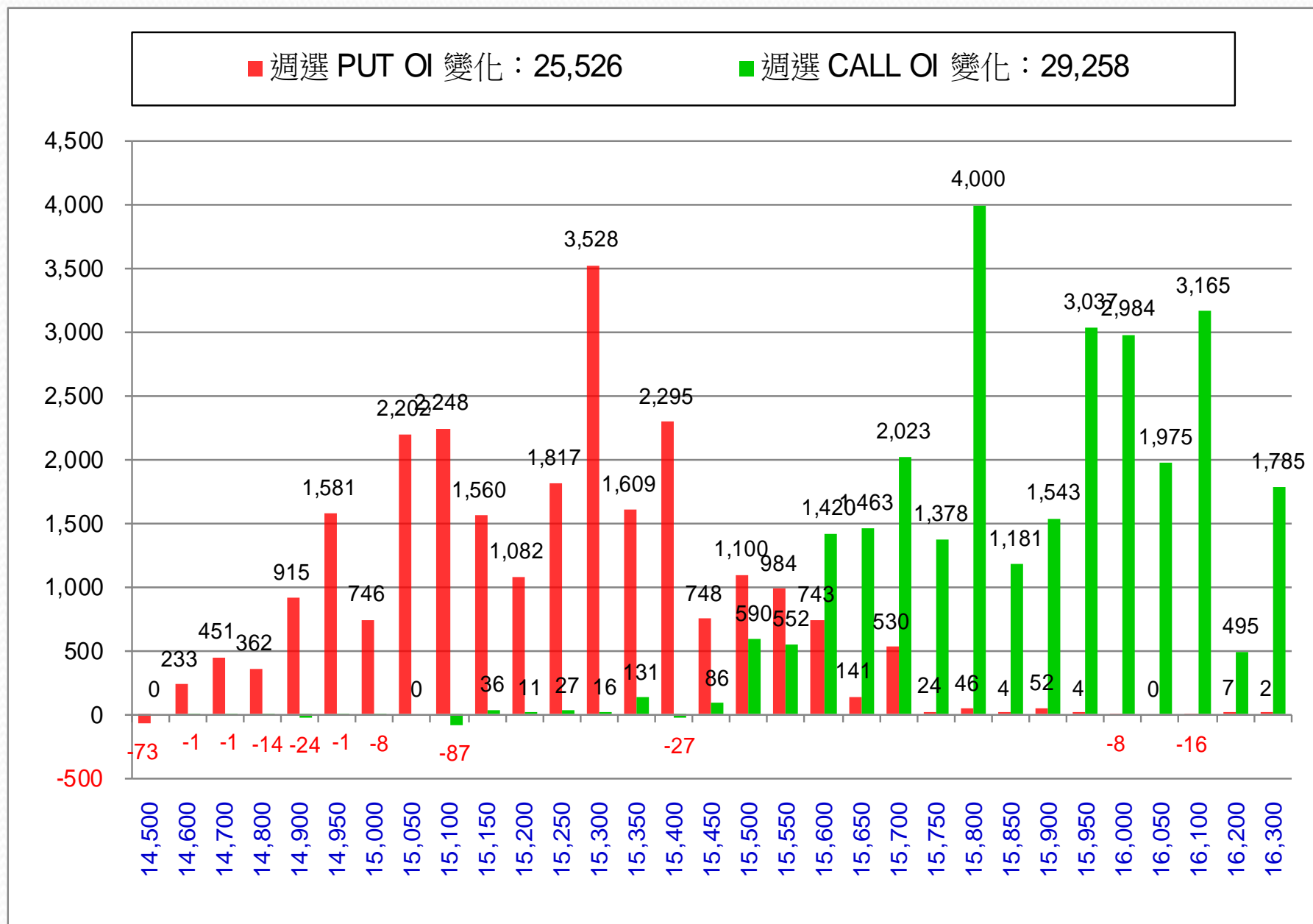
更新日期：2023年2月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



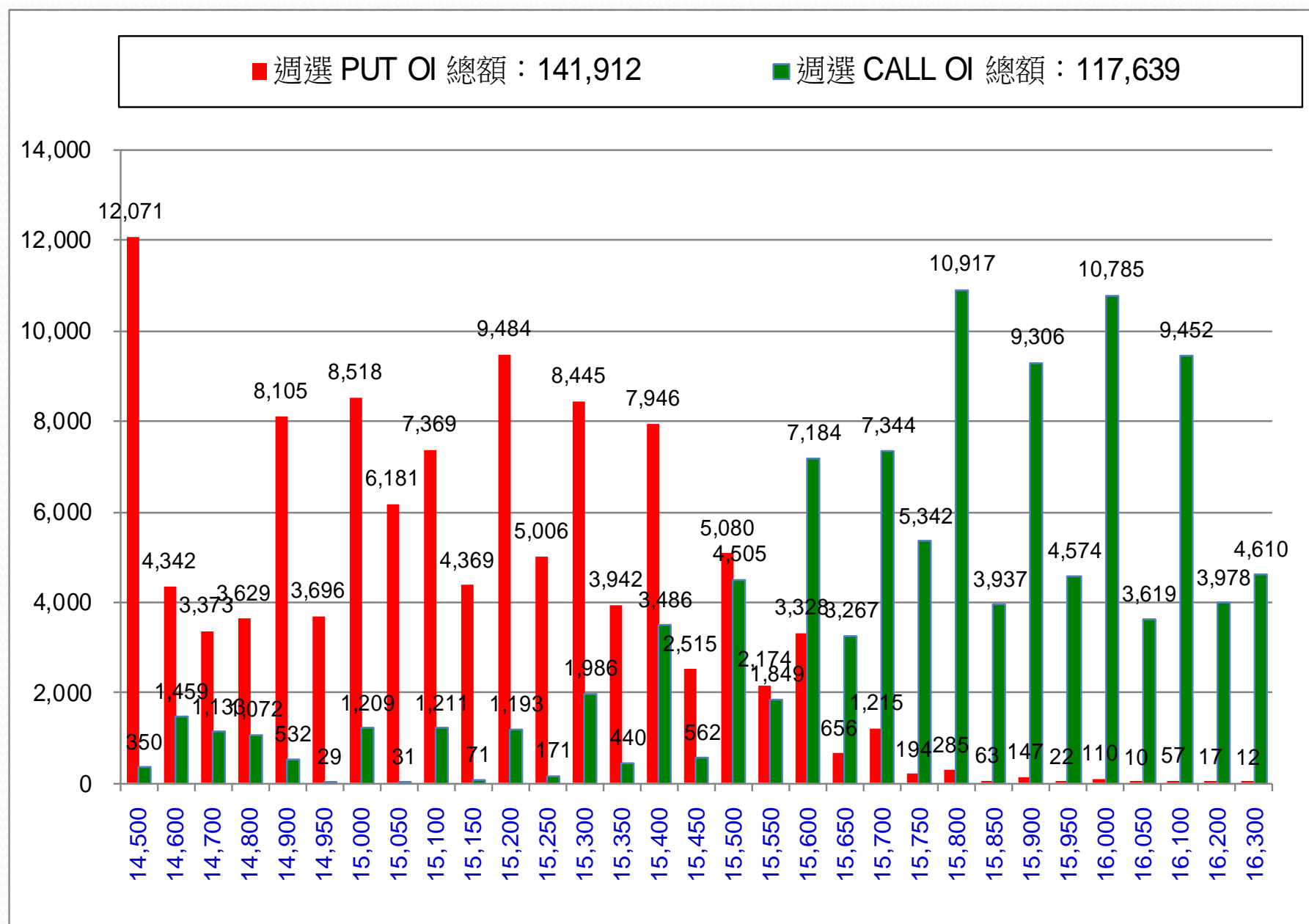
更新日期：2023年2月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年2月9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9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

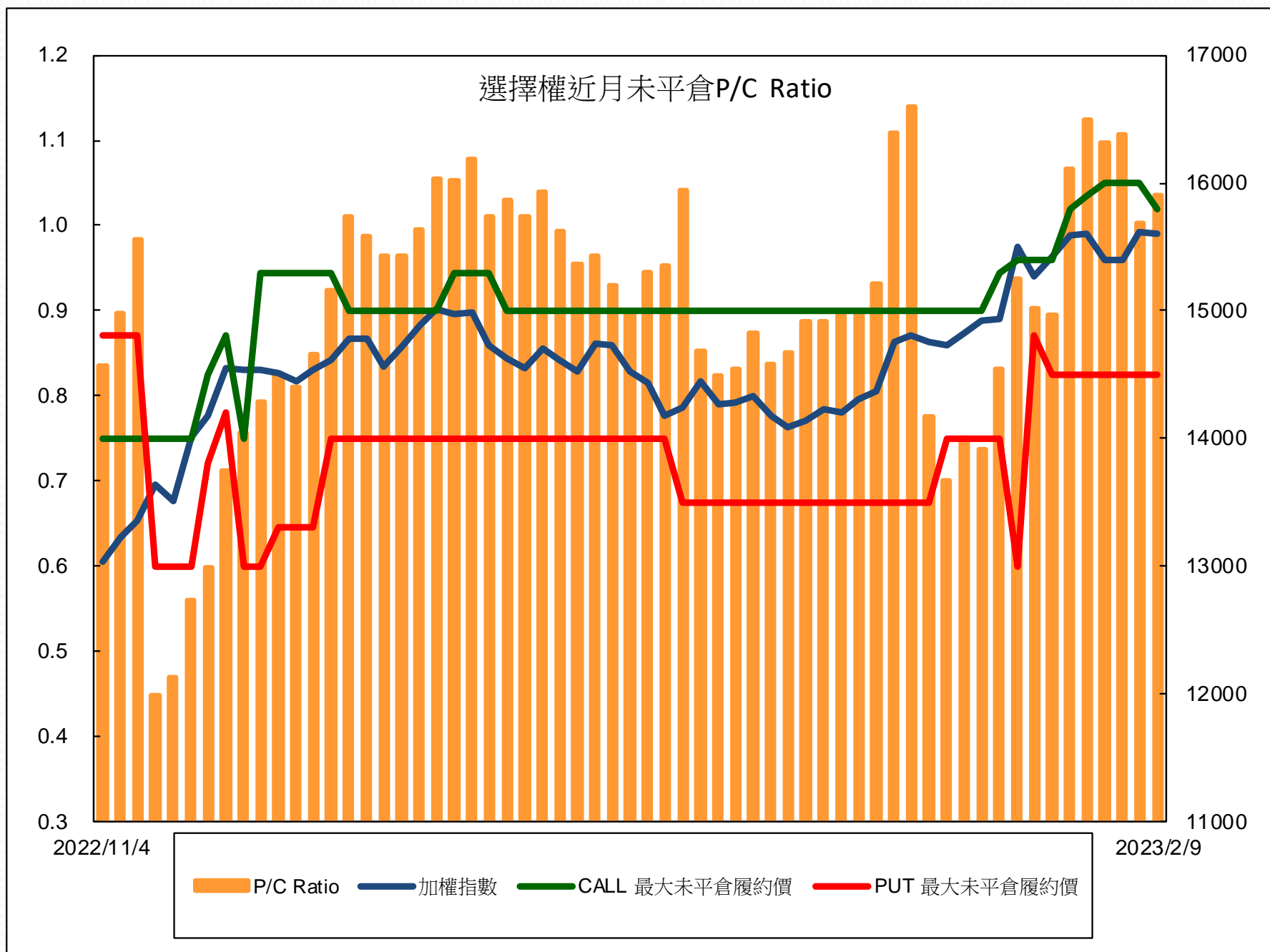


# 自營商選擇權OI部位統計

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8日	49,665	53,364	-3,699
	2月9日	59,587	59,188	399
Put	2月8日	52,936	61,542	-8,606
	2月9日	65,638	60,905	4,733

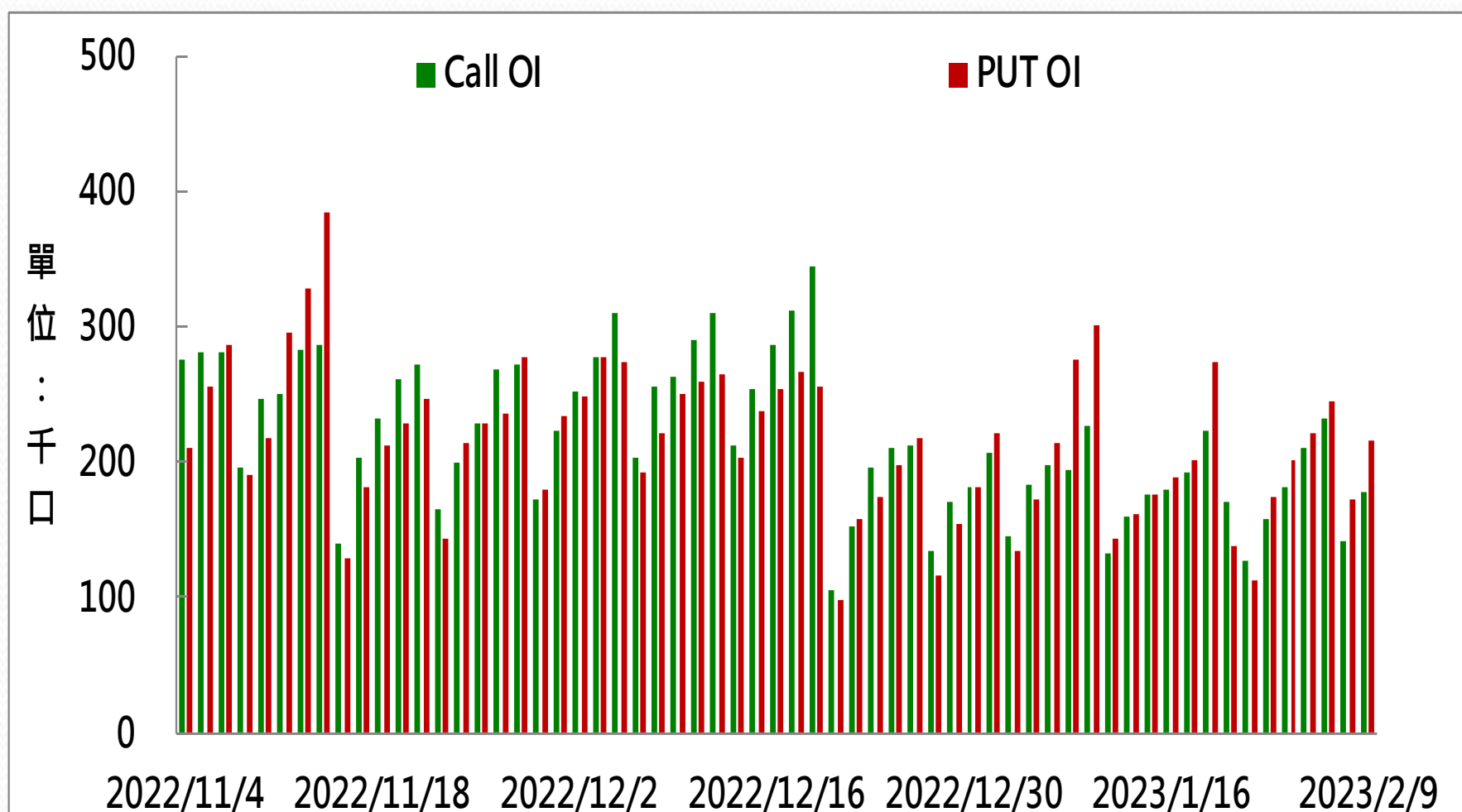
更新日期：2023年2月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

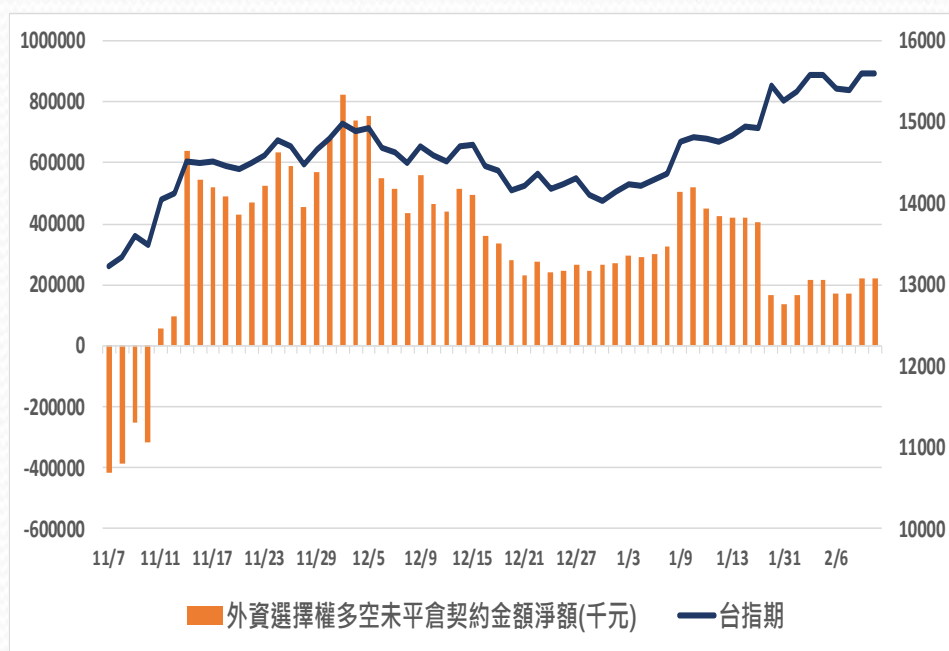
# 選擇權全月Put Call OI



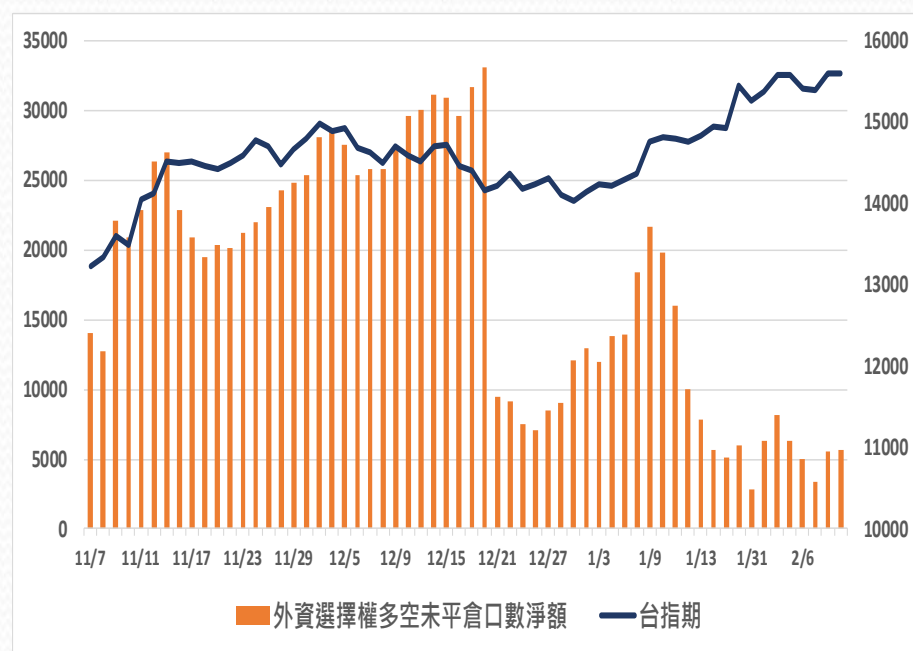
更新日期：2023年2月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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



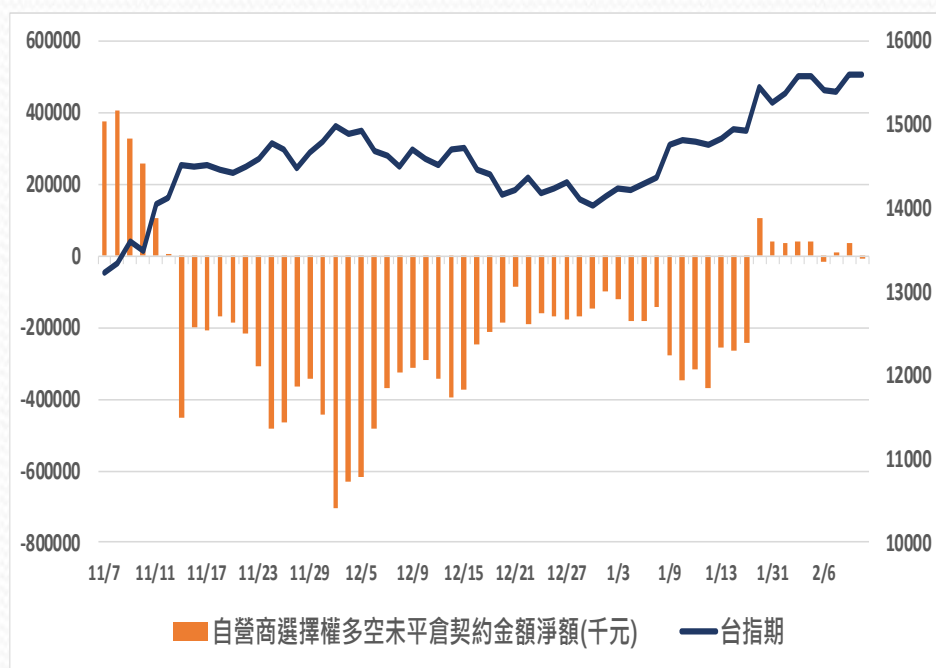
### 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/3	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
2023/2/9	15600	5673	75	219880	-3028

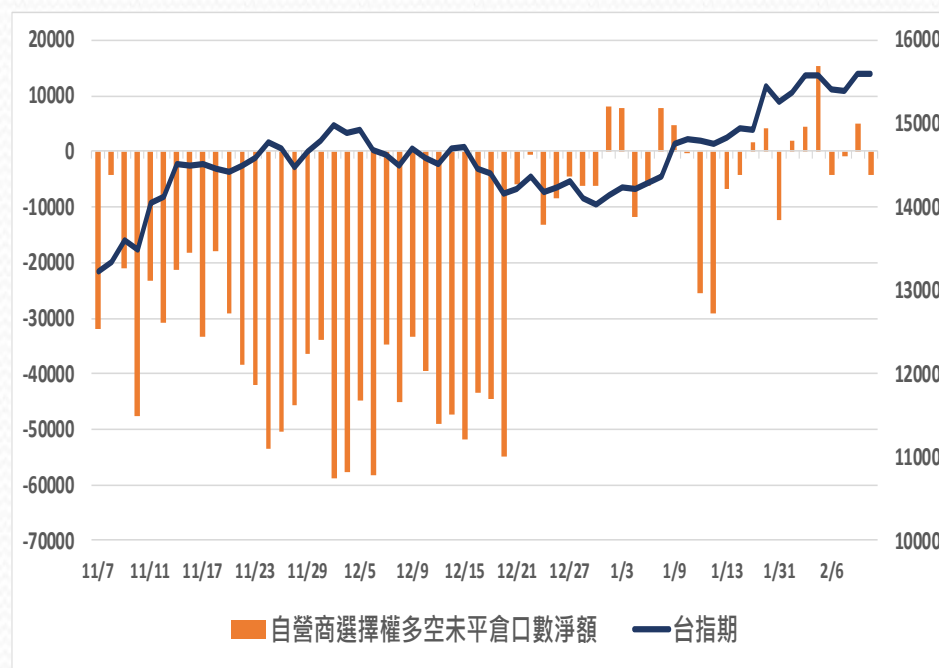
更新日期：2023年2月9日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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



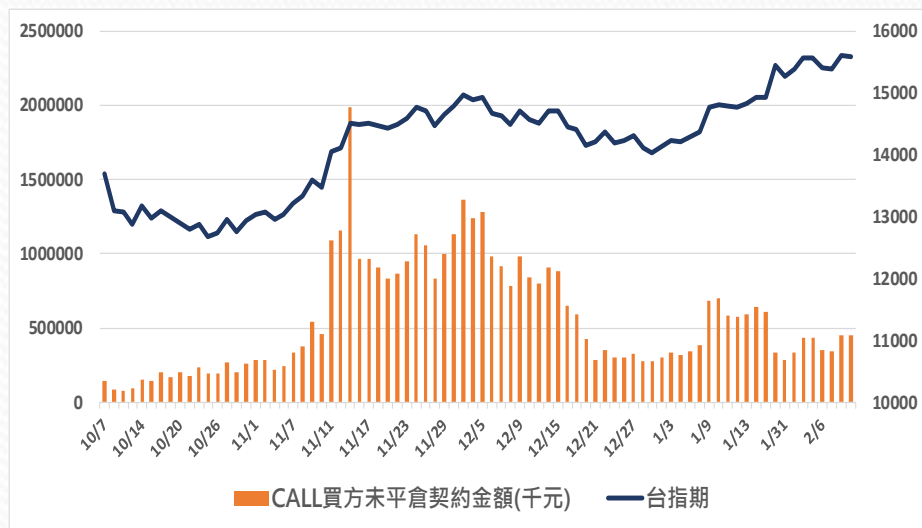
### 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/3	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
2023/2/9	15600	-4334	-9241	-7451	-43681

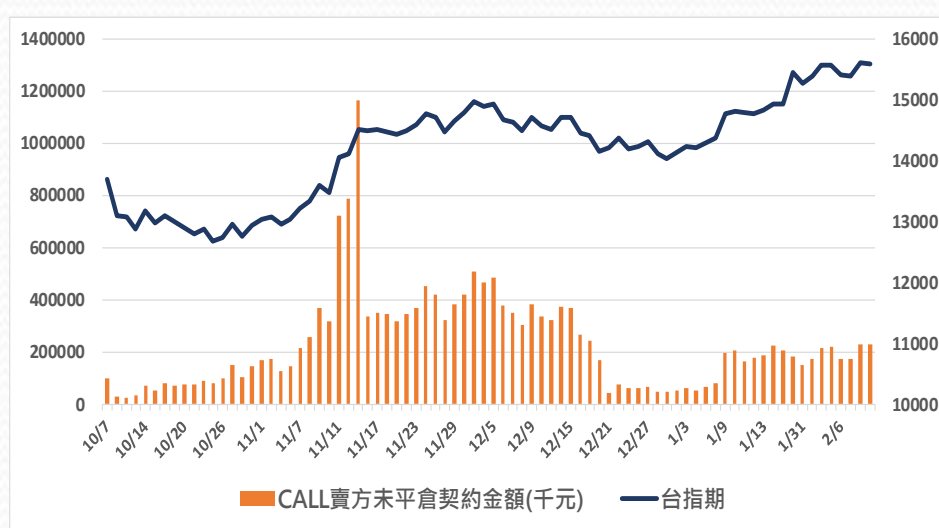
更新日期：2023年2月9日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 外資買賣權未平倉金額

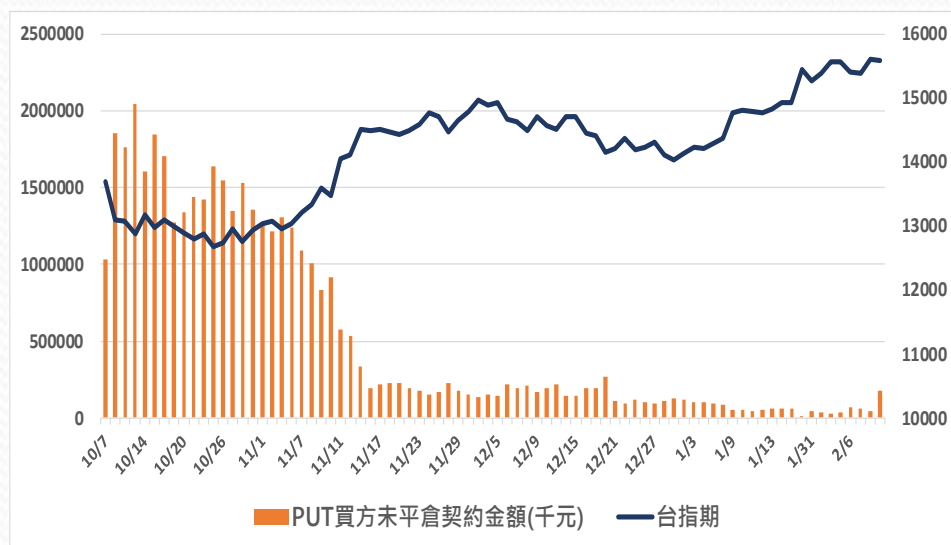
## CALL買方未平倉金額



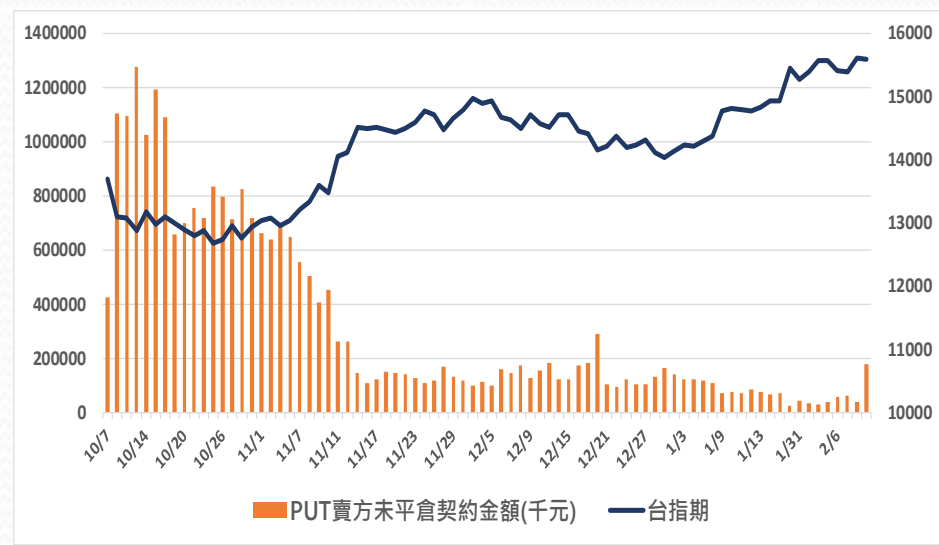
## CALL賣方未平倉金額



## PUT買方未平倉金額



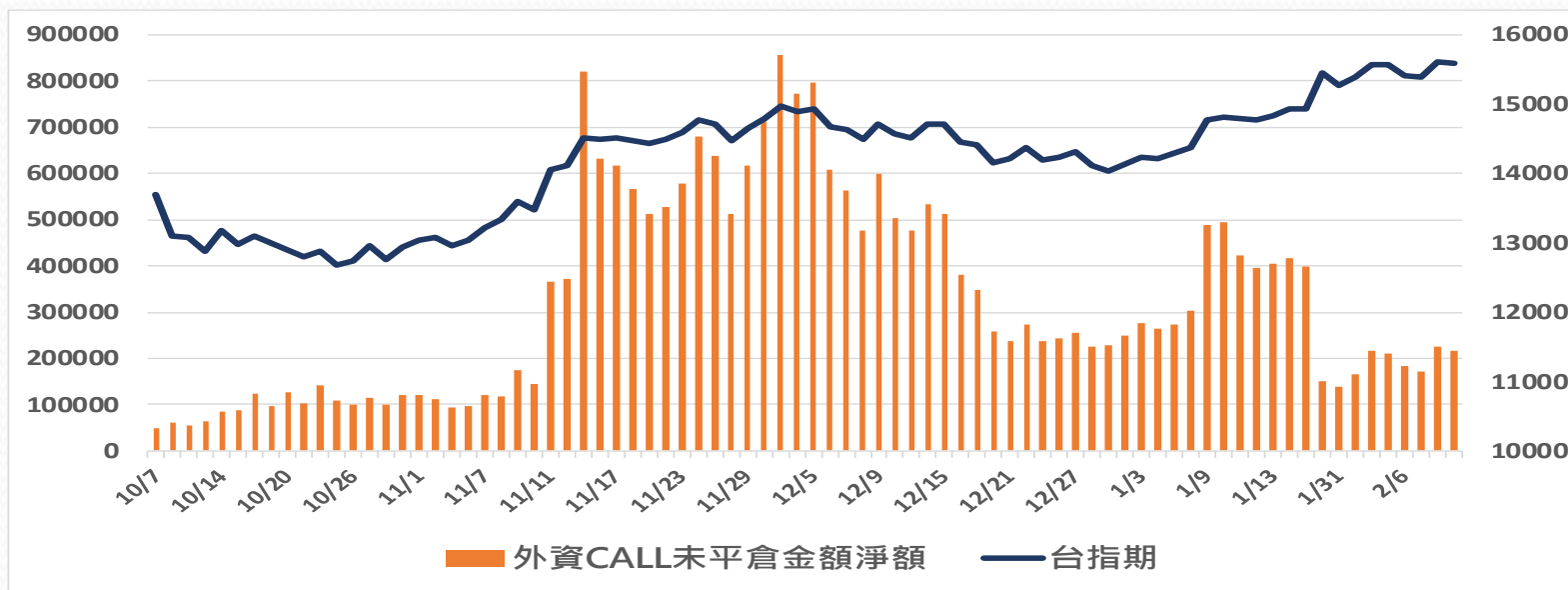
## PUT賣方未平倉金額



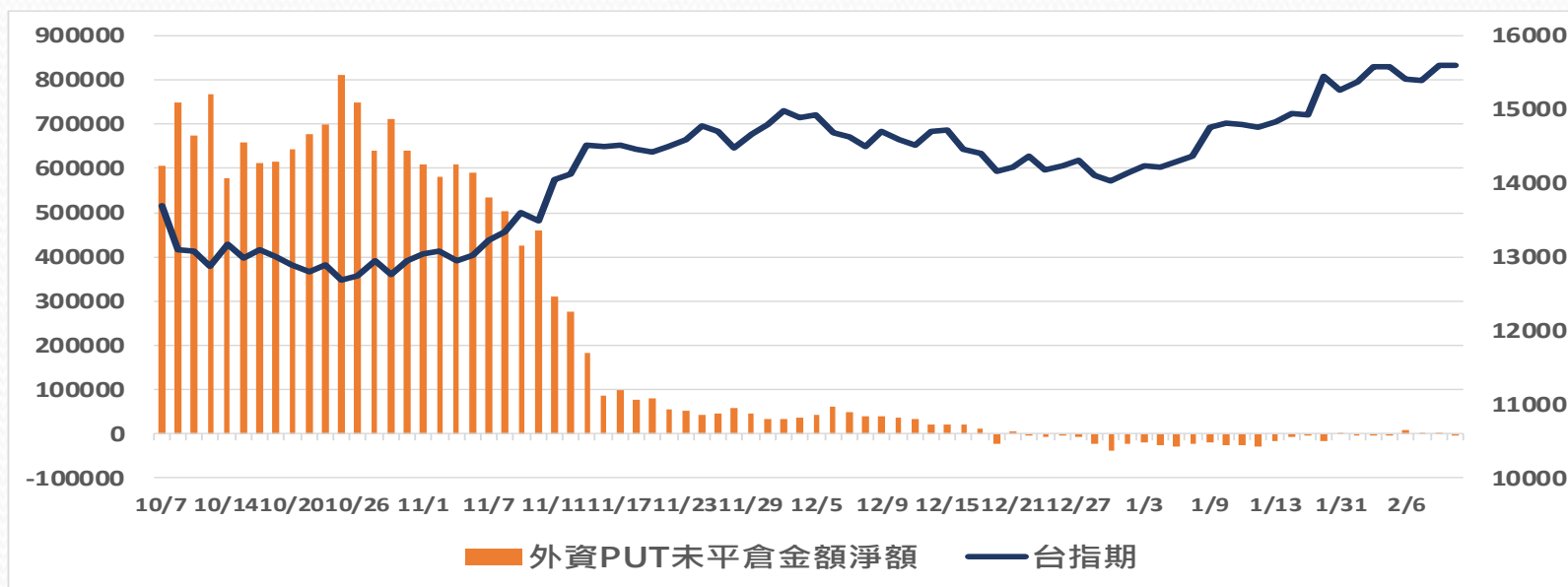
更新日期：2023年2月9日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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9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9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