

台指選擇權OI匯報

日期：2023/2/10 結算日：2023/2/15					日期：2023/2/10 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
-4	346	14,500	11,901	-170	-5	72	13,800	601	29
0	1,459	14,600	4,341	-1	0	3	13,900	456	31
-11	1,122	14,700	3,514	141	-8	475	14,000	1,726	53
-3	1,069	14,800	3,640	11	0	27	14,100	519	-133
4	536	14,900	7,890	-215	0	153	14,200	623	146
-1	28	14,950	4,747	1,051	0	56	14,300	730	19
-93	1,116	15,000	9,452	934	0	209	14,400	765	115
8	39	15,050	6,785	604	0	63	14,500	1,610	43
-34	1,177	15,100	8,407	1,038	0	229	14,600	1,204	9
21	92	15,150	5,482	1,113	-1	91	14,700	1,341	159
-38	1,155	15,200	10,718	1,234	9	209	14,800	2,229	126
14	185	15,250	7,690	2,684	0	82	14,900	1,246	264
-132	1,854	15,300	9,782	1,337	2	384	15,000	2,118	287
-104	336	15,350	4,955	1,013	-4	144	15,100	946	106
-23	3,463	15,400	10,138	2,192	2	387	15,200	1,251	459
102	664	15,450	3,300	785	-14	97	15,300	806	194
195	4,700	15,500	6,254	1,174	4	955	15,400	1,446	-87
547	2,396	15,550	2,713	539	118	591	15,500	625	108
828	8,012	15,600	4,089	761	69	1,961	15,600	397	98
512	3,779	15,650	1,083	427	86	742	15,700	181	79
1,569	8,913	15,700	1,593	378	113	1,036	15,800	100	35
1,381	6,723	15,750	386	192	52	1,080	15,900	30	9
-137	10,780	15,800	448	163	173	4,075	16,000	90	36
1,681	5,618	15,850	125	62	52	1,866	16,100	33	4
※ 4,644	13,950	15,900	531	384	※ 533	1,878	16,200	25	2
2,631	7,205	15,950	45	23	60	1,375	16,300	6	0
4,101	14,886	16,000	162	52	181	1,443	16,400	8	-1
1,167	4,786	16,050	16	6	339	1,263	16,500	5	-1
-23	9,429	16,100	66	9	-96	518	16,600	2	1
1,605	5,583	16,200	26	9	242	586	16,700	0	0
102	4,712	16,300	20	8	87	494	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
21,089	138,728	1.1515	159,749	17,837	2,766	50,523	1.0266	51,867	2,446
昨日 P/C	1.2063	今日增減變化	-0.0548		昨日 P/C	1.0348	今日增減變化	-0.0082	

更新日期：2023年2月10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10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	114,301,924	77,911,180	36,390,744	2,847,197	2,609,751	1,750,886	858,865	483,365	
投信	29,378,071	50,902,029	-21,523,958	-710,438	419,264	0	419,264	-630	
自營商	37,099,506	18,318,844	18,780,662	-1,193,331	1,528,276	971,204	557,072	-78,279	
	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	468,831	2,047,174	-1,578,343	-61,908	88,620	23,632	64,988	4,173	
投信	99,034	0	99,034	103	0	0	0	0	
自營商	372,918	112,957	259,961	108,466	50,225	93,063	-42,838	14,997	

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10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	27,510	14,291	13,219	-2,709	35,652	23,823	11,829	1,574	
投信	100	0	100	0	500	111	389	0	
自營商	71,065	58,464	12,601	12,202	70,514	65,841	4,673	-60	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	11,864	5,700	6,164	-579	2,579	11,673	-9,094	-1,718	
特定法人(全月)	10,033	5,700	4,333	-3,632	6,342	23,453	-17,111	-3,822	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	52,969	39,695	13,274	10,847	59,956	59,074	882	947	
十大交易人(全月)	88,565	72,021	16,544	13,443	98,901	96,241	2,660	1,657	
全市場未沖銷(近月)			138,740	21,090			163,255	17,769	
全市場未沖銷(全月)			207,141	28,971			241,910	26,655	

更新日期：2023年2月10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	16000
	賣權成交最大量	15400	賣權OI最大量	14500
	整體隱含波動率	15.09%	較前一交易日	+0.57%
	買權隱含波動率	14.13%	較前一交易日	+0.06%
	賣權隱含波動率	16.12%	較前一交易日	+1.19%
電子選擇權	買權成交最大量	750	買權OI最大量	750
	賣權成交最大量	690	賣權OI最大量	650
金融選擇權	買權成交最大量	470	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1480	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年2月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

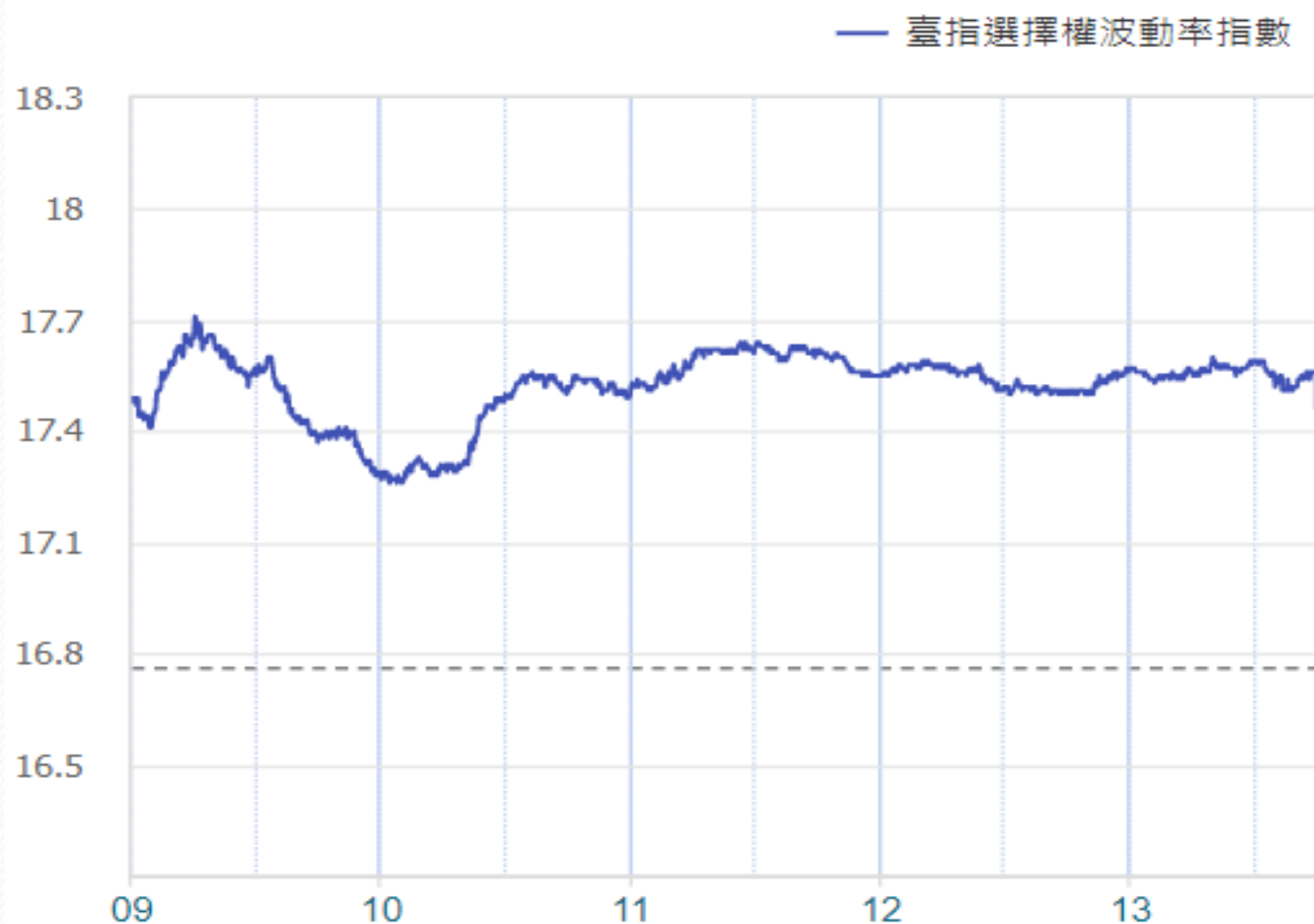
台指選擇權匯報

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	15200	賣權OI最大量	10000
	整體隱含波動率	15.60%	較前一交易日	+2.17%
	買權隱含波動率	14.37%	較前一交易日	-0.08%
	賣權隱含波動率	16.73%	較前一交易日	-3.77%
	成交量P/C_Ratio值	1.041	較前一交易日	-0.08
	未平倉P/C_Ratio值	1.027	較前一交易日	-0.01
電子選擇權	買權成交最大量	750	買權OI最大量	750
	賣權成交最大量	690	賣權OI最大量	650
金融選擇權	買權成交最大量	620	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1480	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年2月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

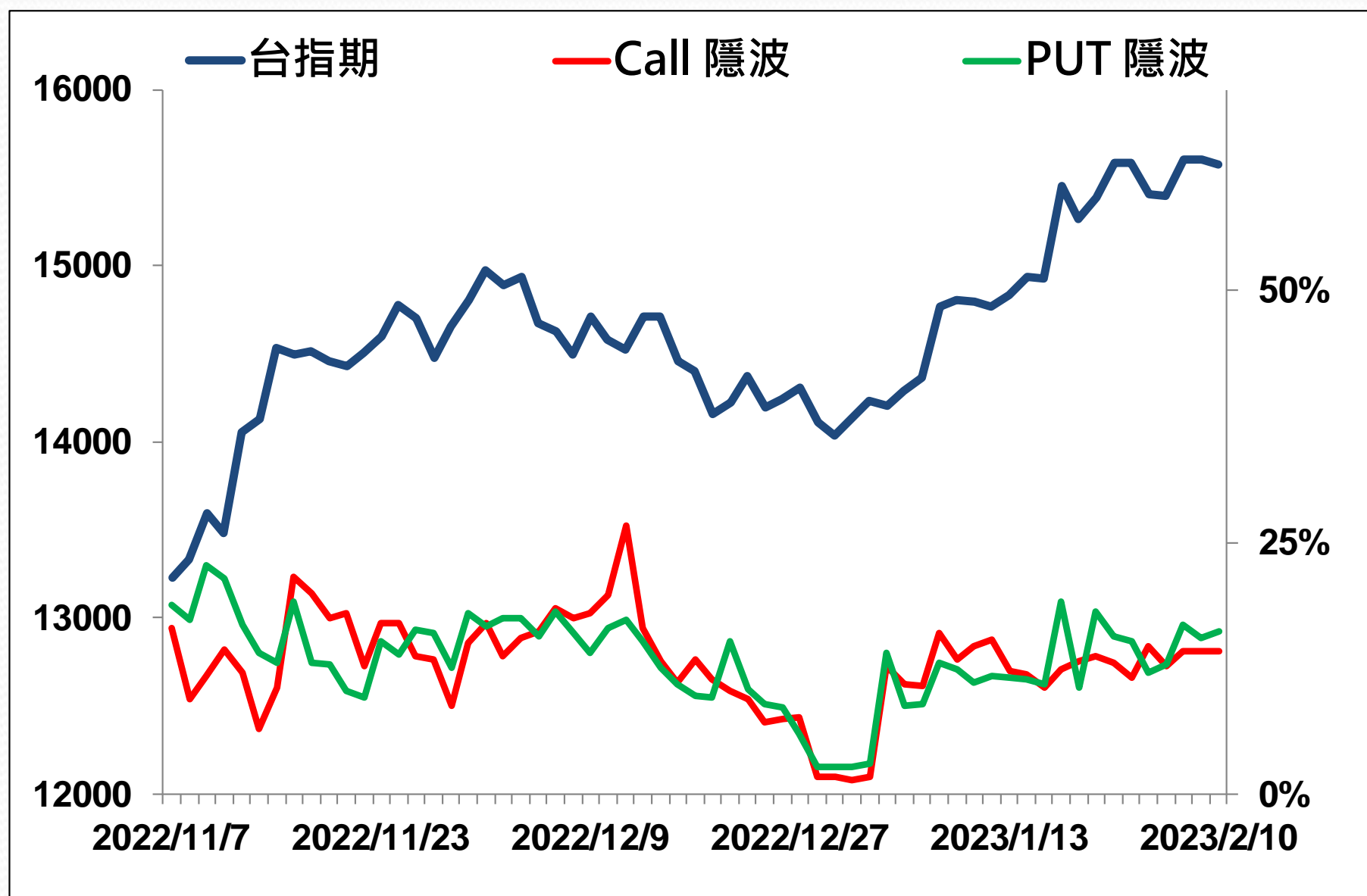
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



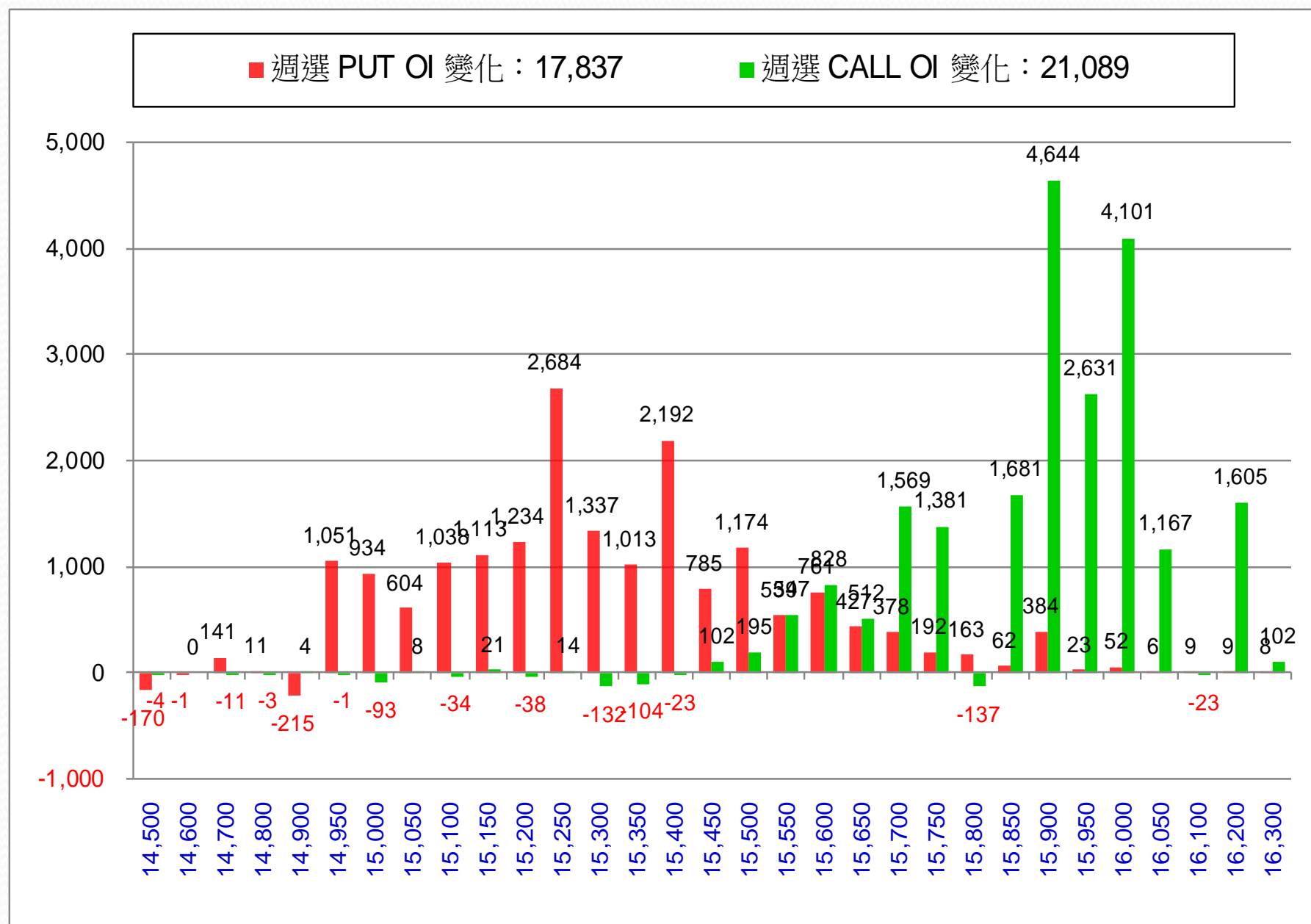
更新日期：2023年2月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



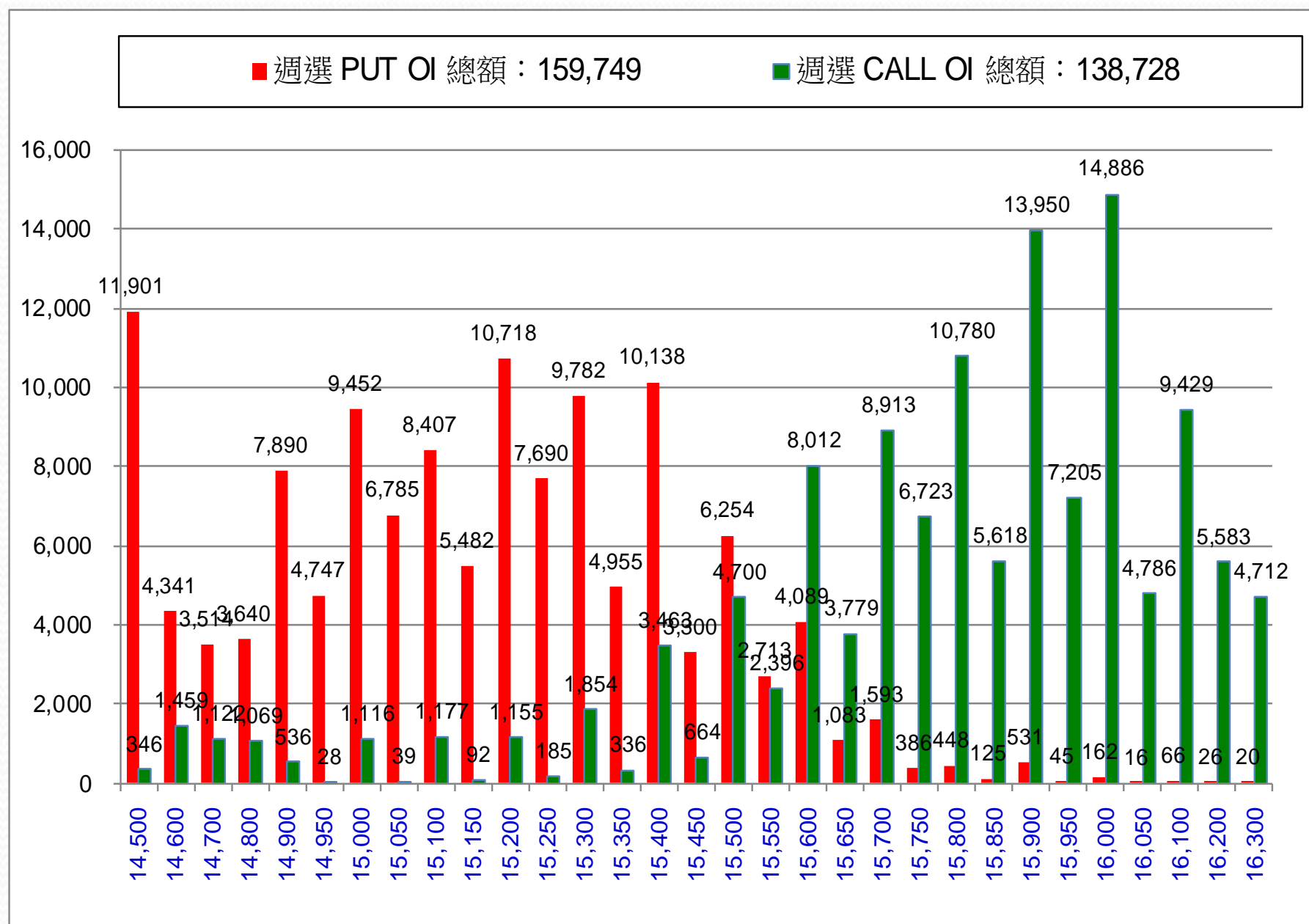
更新日期：2023年2月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年2月10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



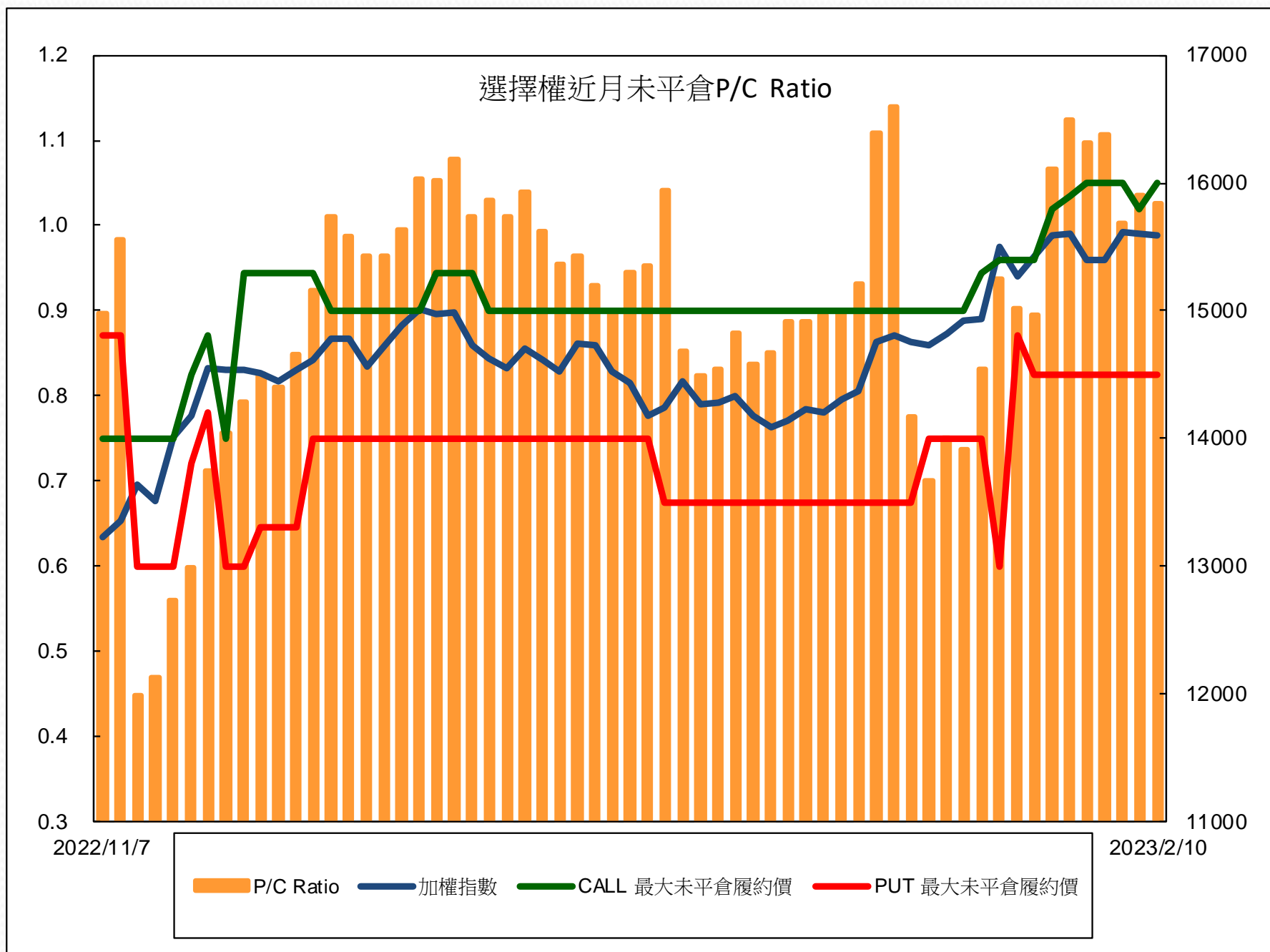
更新日期：2023年2月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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9日	59,587	59,188	399
	2月10日	71,065	58,464	12,601
Put	2月9日	65,638	60,905	4,733
	2月10日	70,514	65,841	4,673

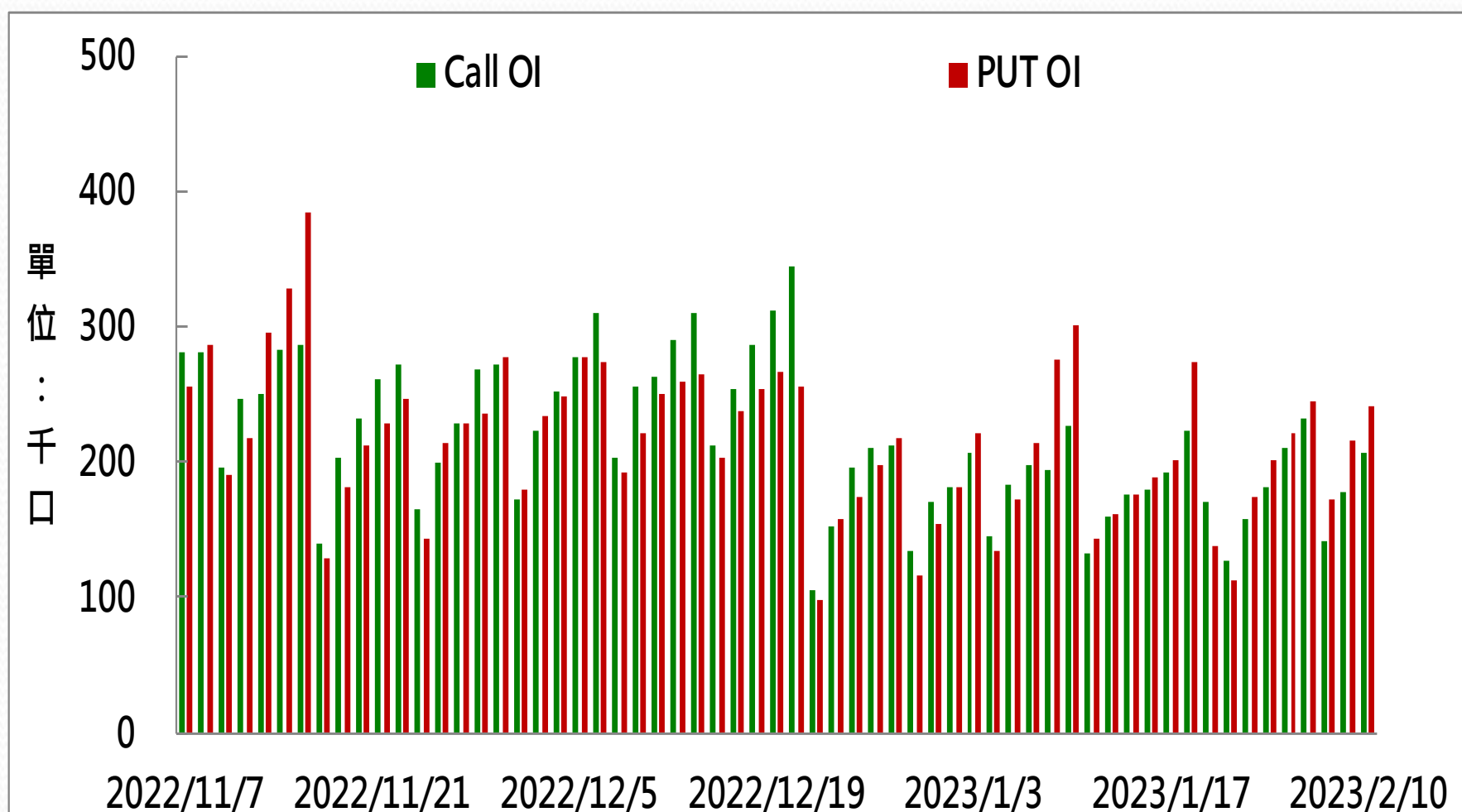
更新日期：2023年2月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

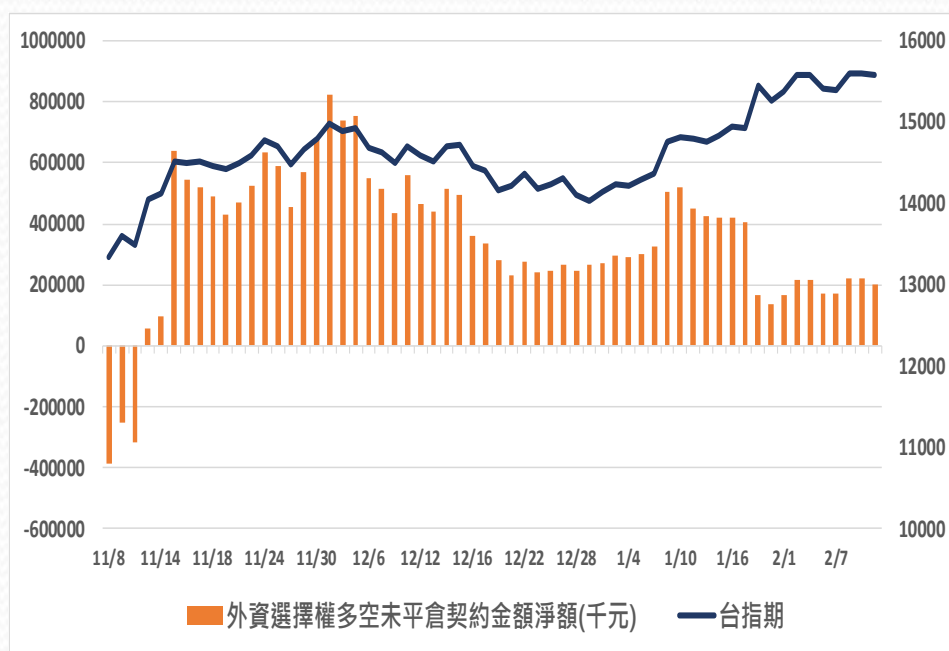
選擇權全月Put Call OI



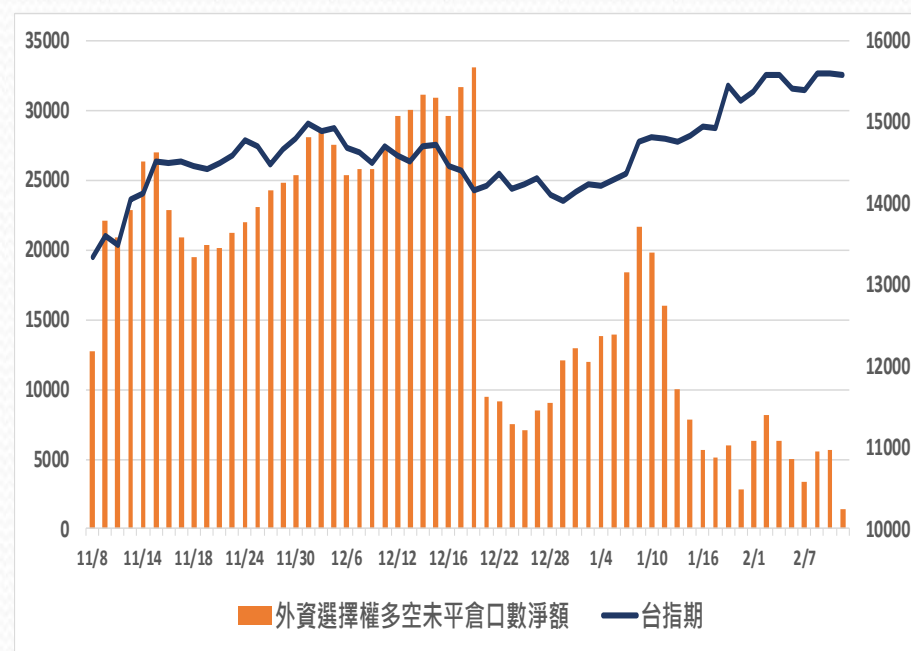
更新日期：2023年2月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



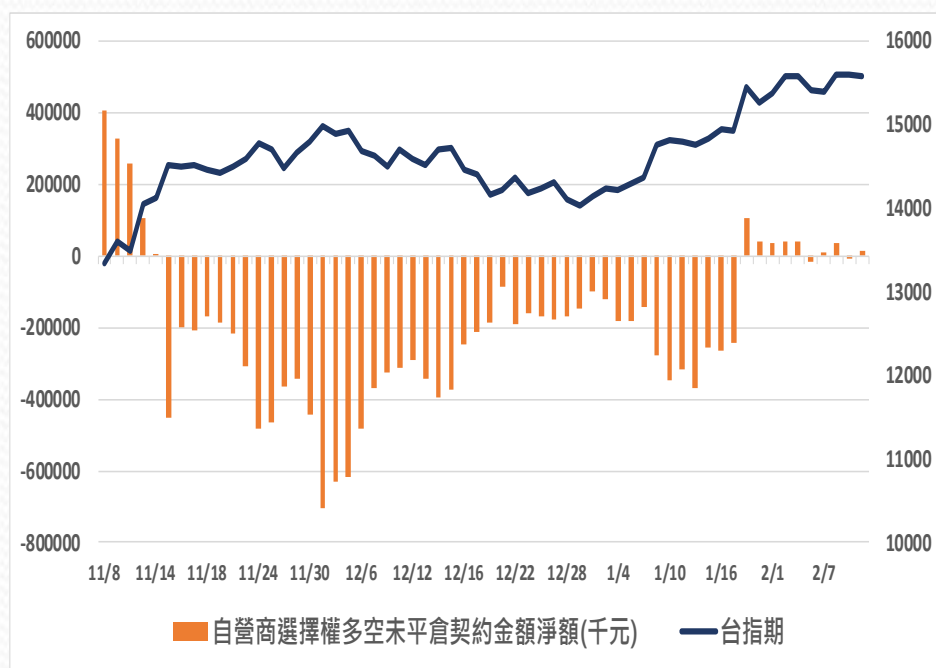
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/6	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
2023/2/10	15577	1390	-4283	202056	-17824

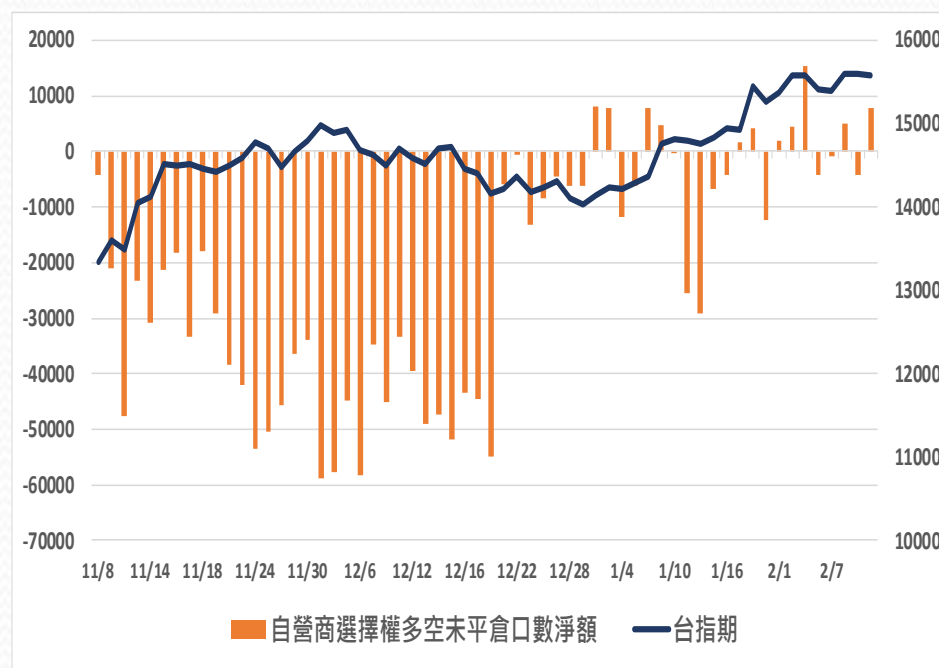
更新日期：2023年2月10日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



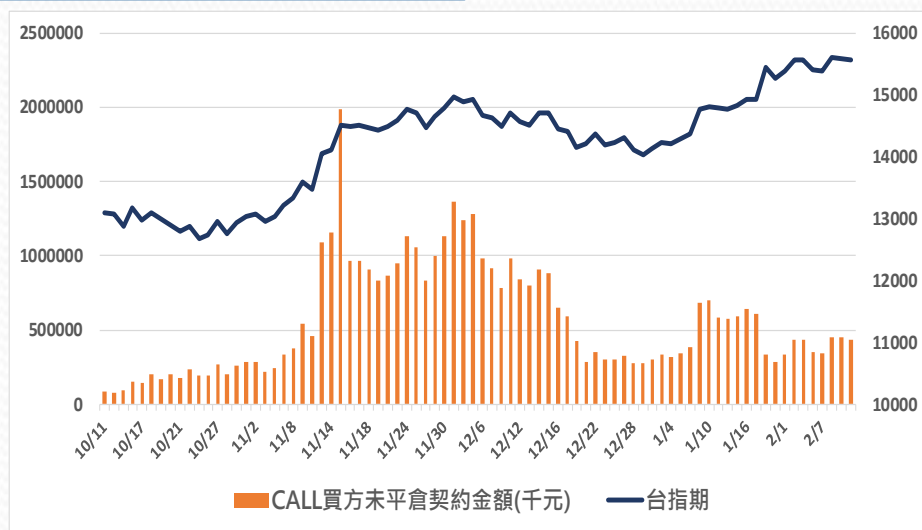
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/6	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
2023/2/10	15577	7928	12262	14961	22412

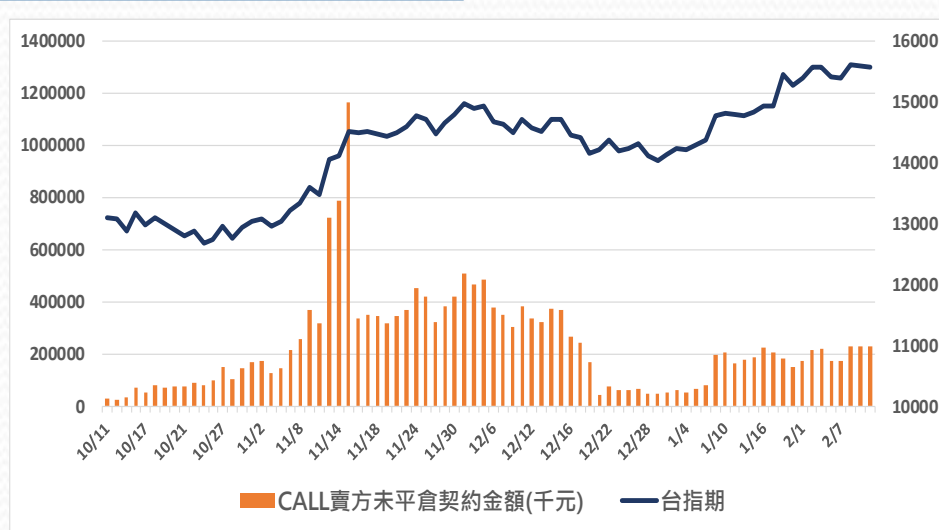
更新日期：2023年2月10日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

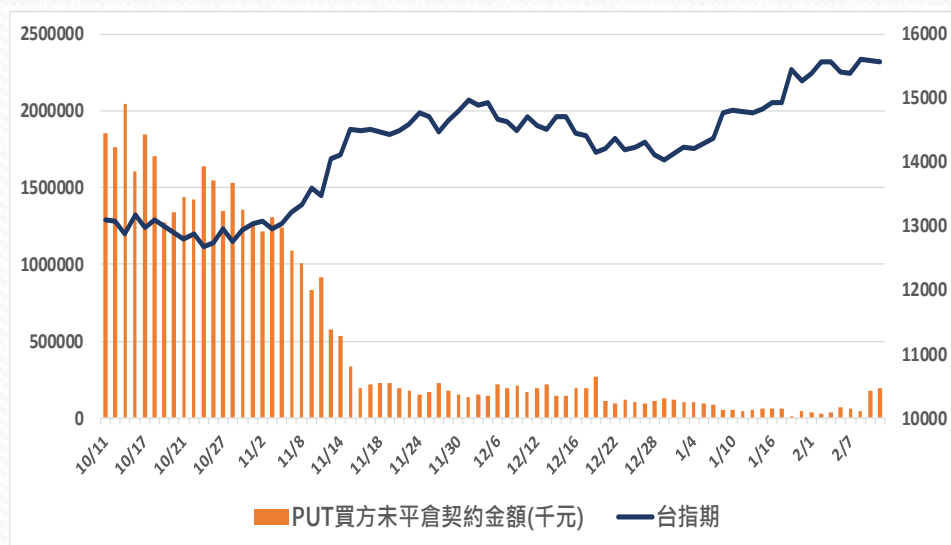
CALL買方未平倉金額



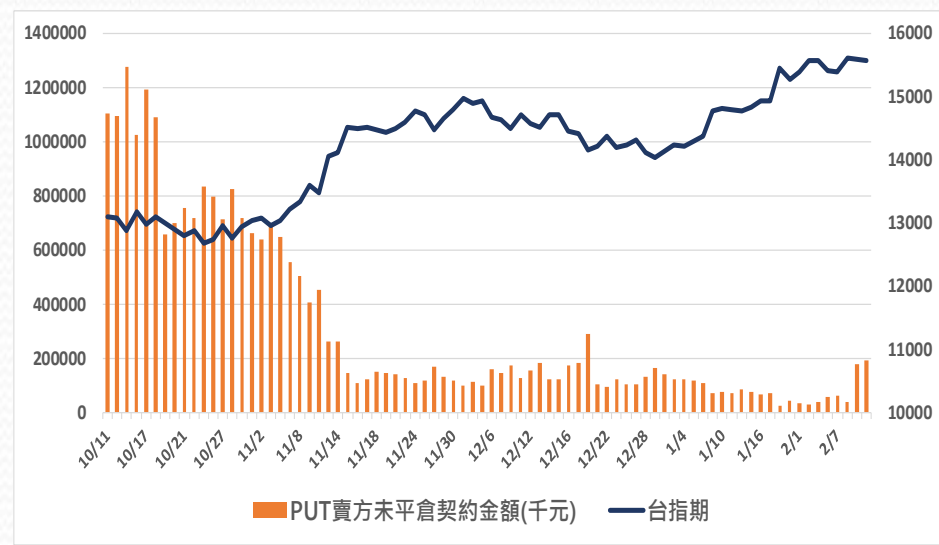
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



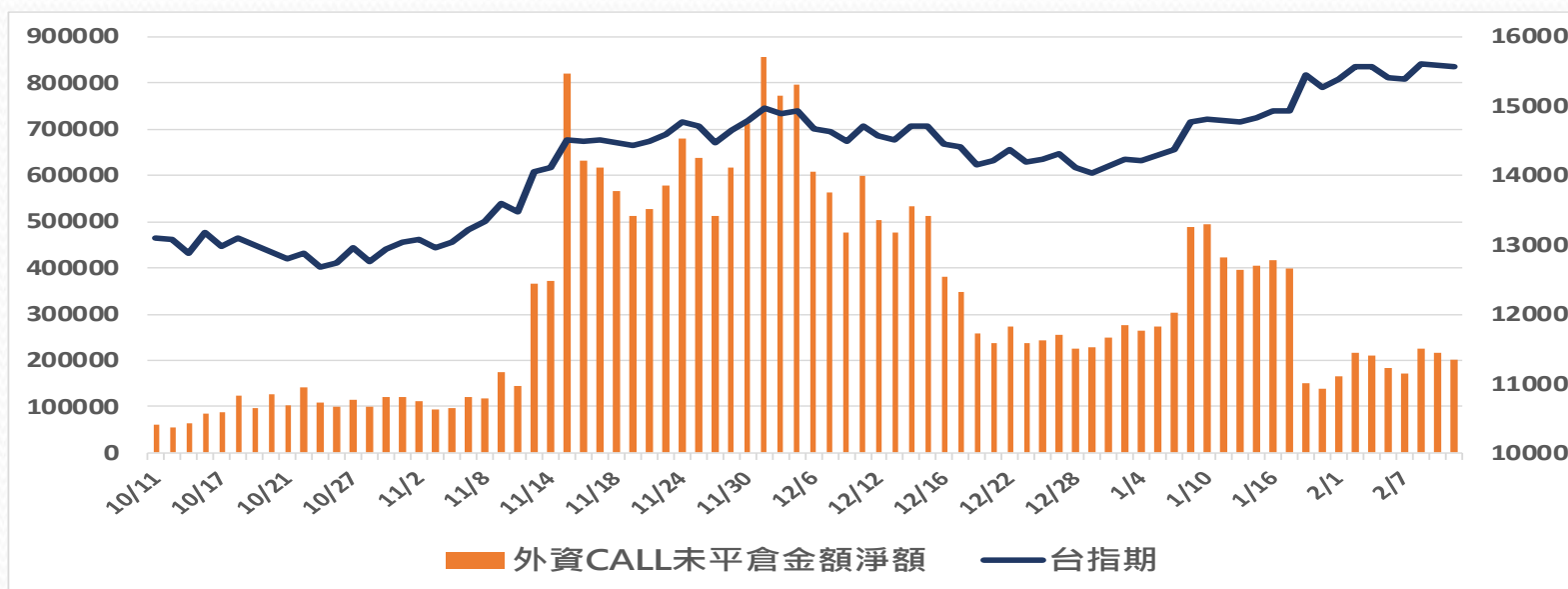
PUT賣方未平倉金額



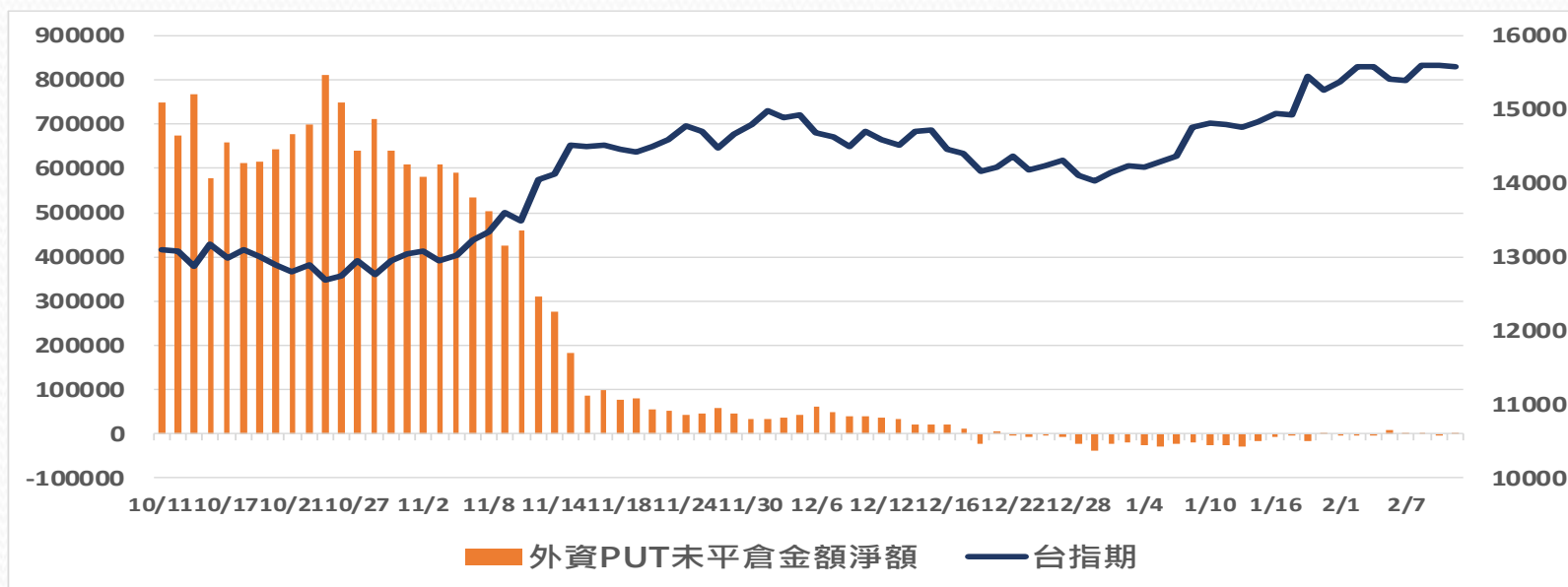
更新日期：2023年2月10日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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10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10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