

台指選擇權OI匯報

日期：2023/2/13 結算日：2023/2/15					日期：2023/2/13 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
-2	344	14,500	11,886	-15	0	72	13,800	646	45
0	1,459	14,600	4,470	129	0	3	13,900	445	-11
-3	1,119	14,700	3,865	351	1	476	14,000	1,800	74
-4	1,065	14,800	3,464	-176	0	27	14,100	537	18
-3	533	14,900	7,571	-319	-9	144	14,200	706	83
2	30	14,950	5,239	492	0	56	14,300	961	231
-87	1,029	15,000	8,834	-618	0	209	14,400	763	-2
5	44	15,050	8,235	1,450	20	83	14,500	1,707	97
-88	1,089	15,100	9,931	1,524	15	244	14,600	1,595	391
0	92	15,150	7,344	1,862	0	91	14,700	1,577	236
-72	1,083	15,200	10,681	-37	1	210	14,800	2,374	145
-29	156	15,250	8,966	1,276	1	83	14,900	1,328	82
-197	1,657	15,300	14,317	4,535	-5	379	15,000	2,668	550
156	492	15,350	7,208	2,253	10	154	15,100	1,011	65
468	3,931	15,400	10,318	180	7	394	15,200	2,509	1,258
1,331	1,995	15,450	4,346	1,046	51	148	15,300	820	14
797	5,497	15,500	5,893	-361	16	971	15,400	1,695	249
1,915	4,311	15,550	2,718	5	12	603	15,500	817	192
2,016	10,028	15,600	3,846	-243	126	2,087	15,600	485	88
2,791	6,570	15,650	1,263	180	51	793	15,700	223	42
1,850	10,763	15,700	1,711	118	125	1,161	15,800	92	-8
1,123	7,846	15,750	434	48	147	1,227	15,900	59	29
4,428	15,208	15,800	504	56	453	4,528	16,000	84	-6
4,589	10,207	15,850	160	35	82	1,948	16,100	46	13
3,554	17,504	15,900	406	-125	435	2,313	16,200	25	0
-1,664	5,541	15,950	43	-2	101	1,476	16,300	6	0
-31	14,855	16,000	224	62	744	2,187	16,400	4	-4
-724	4,062	16,050	16	0	89	1,352	16,500	4	-1
-383	9,046	16,100	60	-6	56	574	16,600	2	0
1,363	6,946	16,200	25	-1	-59	527	16,700	0	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
23,597	162,325	1.0672	173,236	13,487	3,227	53,750	1.0337	55,560	3,693
昨日 P/C	1.1515	今日增減變化	-0.0843	昨日 P/C	1.0266	今日增減變化	0.0071		

更新日期：2023年2月13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13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	119,345,147	81,267,818	38,077,329	1,686,585	2,691,338	1,735,295	956,043	97,178	
投信	28,712,727	51,708,428	-22,995,701	-1,471,743	416,310	0	416,310	-2,954	
自營商	40,652,732	19,719,764	20,932,968	2,152,306	1,695,535	1,281,179	414,356	-142,716	
	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	600,208	2,220,897	-1,620,689	-42,346	87,196	19,216	67,980	2,992	
投信	117,223	0	117,223	18,189	0	0	0	0	
自營商	723,569	378,334	345,235	85,274	59,146	107,903	-48,757	-5,919	

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13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	25,419	13,847	11,572	-1,647	34,768	25,007	9,761	-2,068	
投信	100	0	100	0	500	111	389	0	
自營商	87,468	69,346	18,122	5,521	84,673	67,905	16,768	12,095	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	9,294	5,700	3,594	-2,570	5,161	10,347	-5,186	3,908	
特定法人(全月)	10,224	5,700	4,524	191	10,477	23,293	-12,816	4,295	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	62,532	49,582	12,950	-324	60,489	70,844	-10,355	-11,237	
十大交易人(全月)	104,700	83,638	21,062	4,518	101,093	109,077	-7,984	-10,644	
全市場未沖銷(近月)			162,337	23,597			176,365	13,110	
全市場未沖銷(全月)			241,530	34,389			262,026	20,116	

更新日期：2023年2月13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	15900
	賣權成交最大量	15400	賣權OI最大量	15300
	整體隱含波動率	18.49%	較前一交易日	+3.40%
	買權隱含波動率	17.35%	較前一交易日	+3.22%
	賣權隱含波動率	19.87%	較前一交易日	+3.75%
電子選擇權	買權成交最大量	435	買權OI最大量	435
	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	1580	買權OI最大量	1580
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年2月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

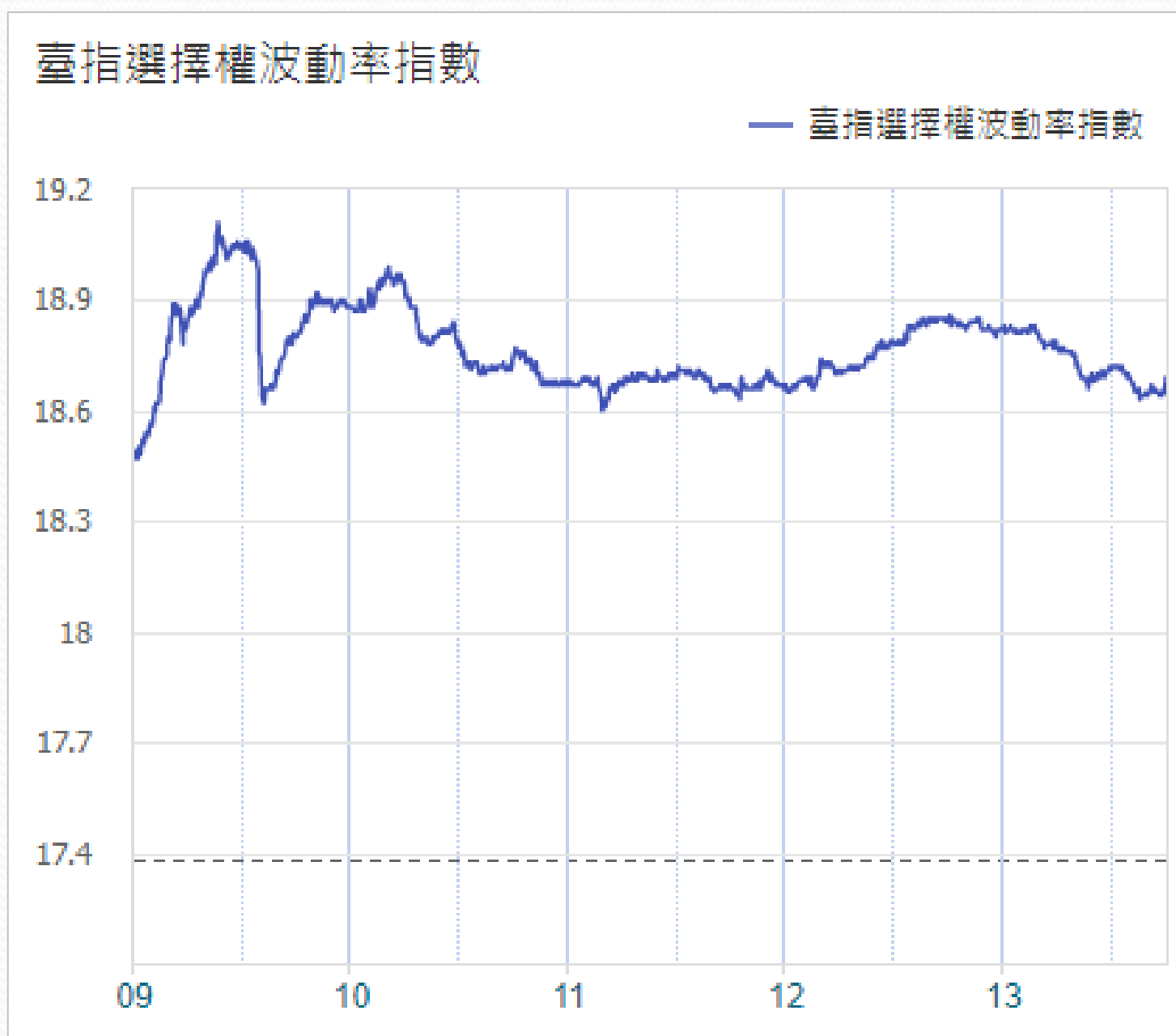
台指選擇權匯報

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	17.61%	較前一交易日	-2.02%
	買權隱含波動率	15.06%	較前一交易日	+0.68%
	賣權隱含波動率	19.60%	較前一交易日	+2.87%
	成交量P/C_Ratio值	1.056	較前一交易日	+0.01
	未平倉P/C_Ratio值	1.034	較前一交易日	+0.01
電子選擇權	買權成交最大量	505	買權OI最大量	505
	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	1580	買權OI最大量	1580
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1480

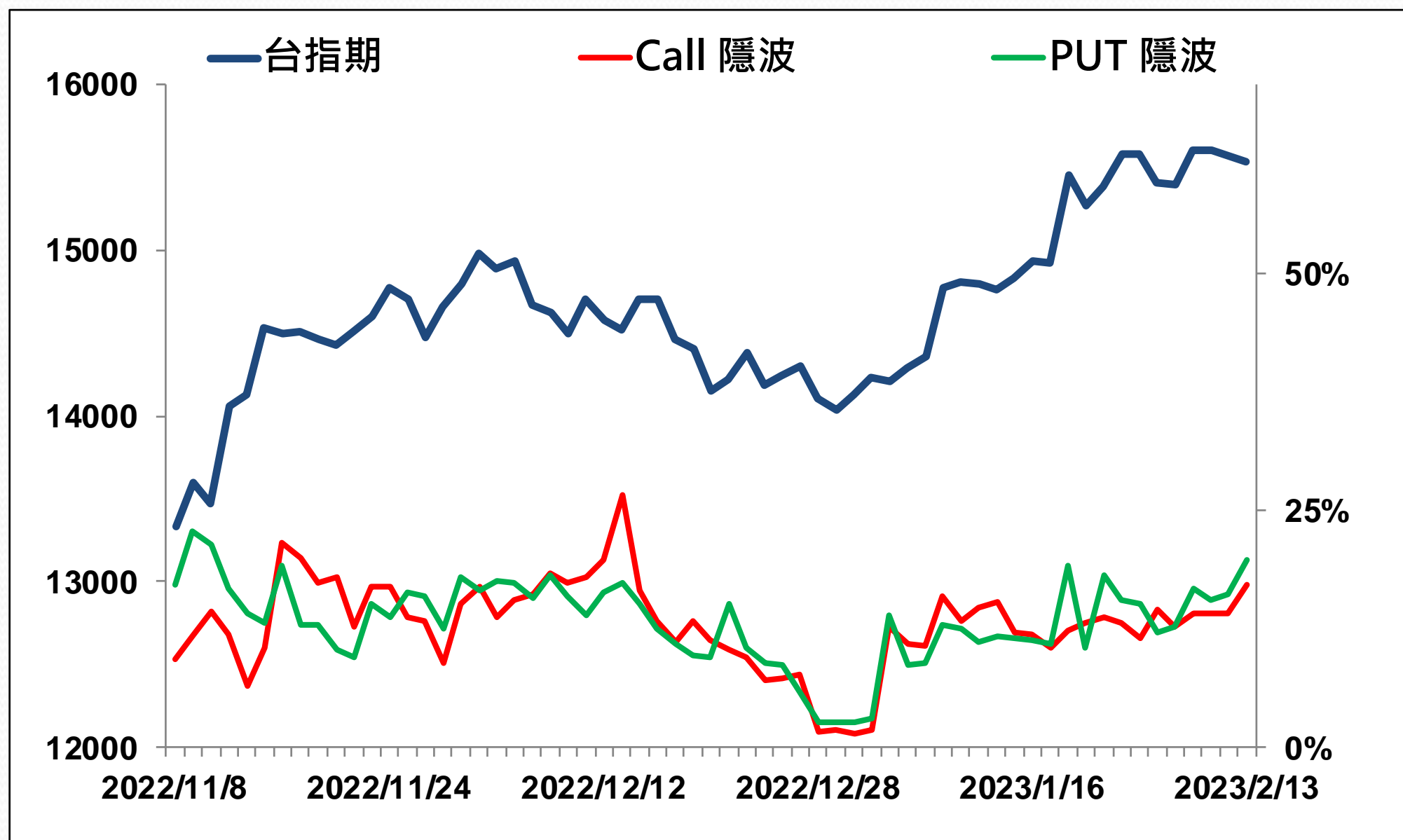
更新日期：2023年2月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



更新日期：2023年2月13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

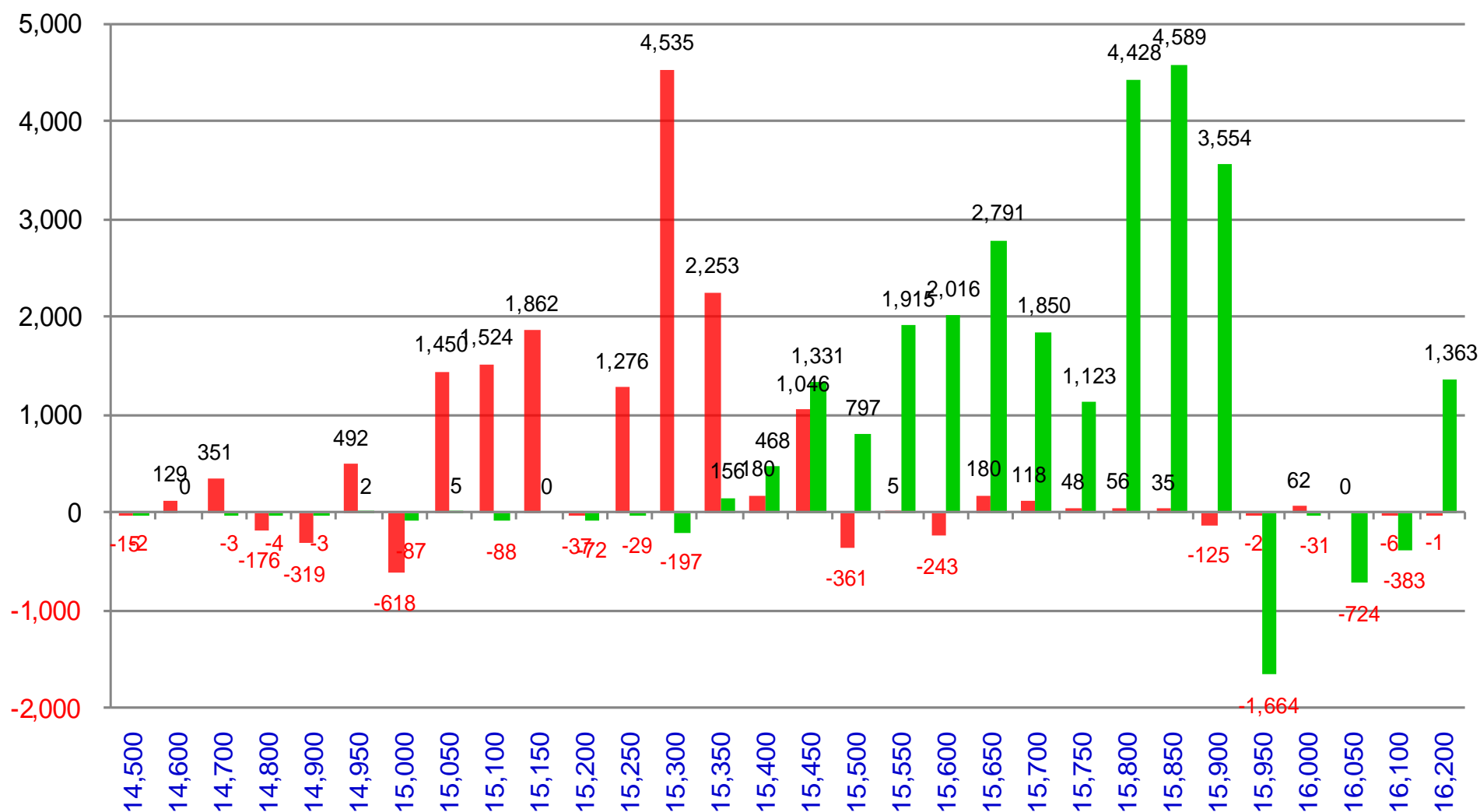


更新日期：2023年2月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：13,487

週選 CALL OI 變化：23,597

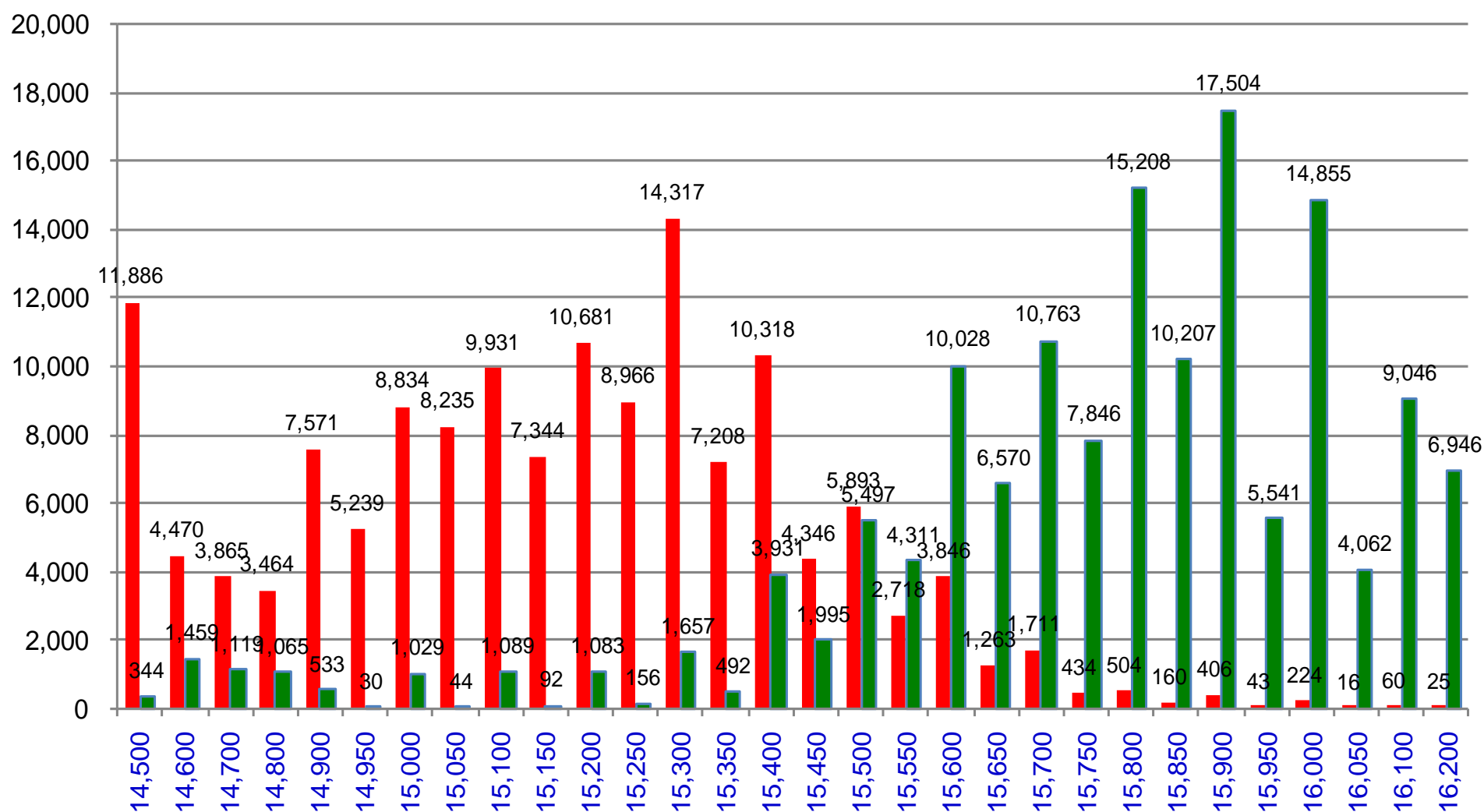


更新日期：2023年2月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：173,236

週選 CALL OI 總額：162,325



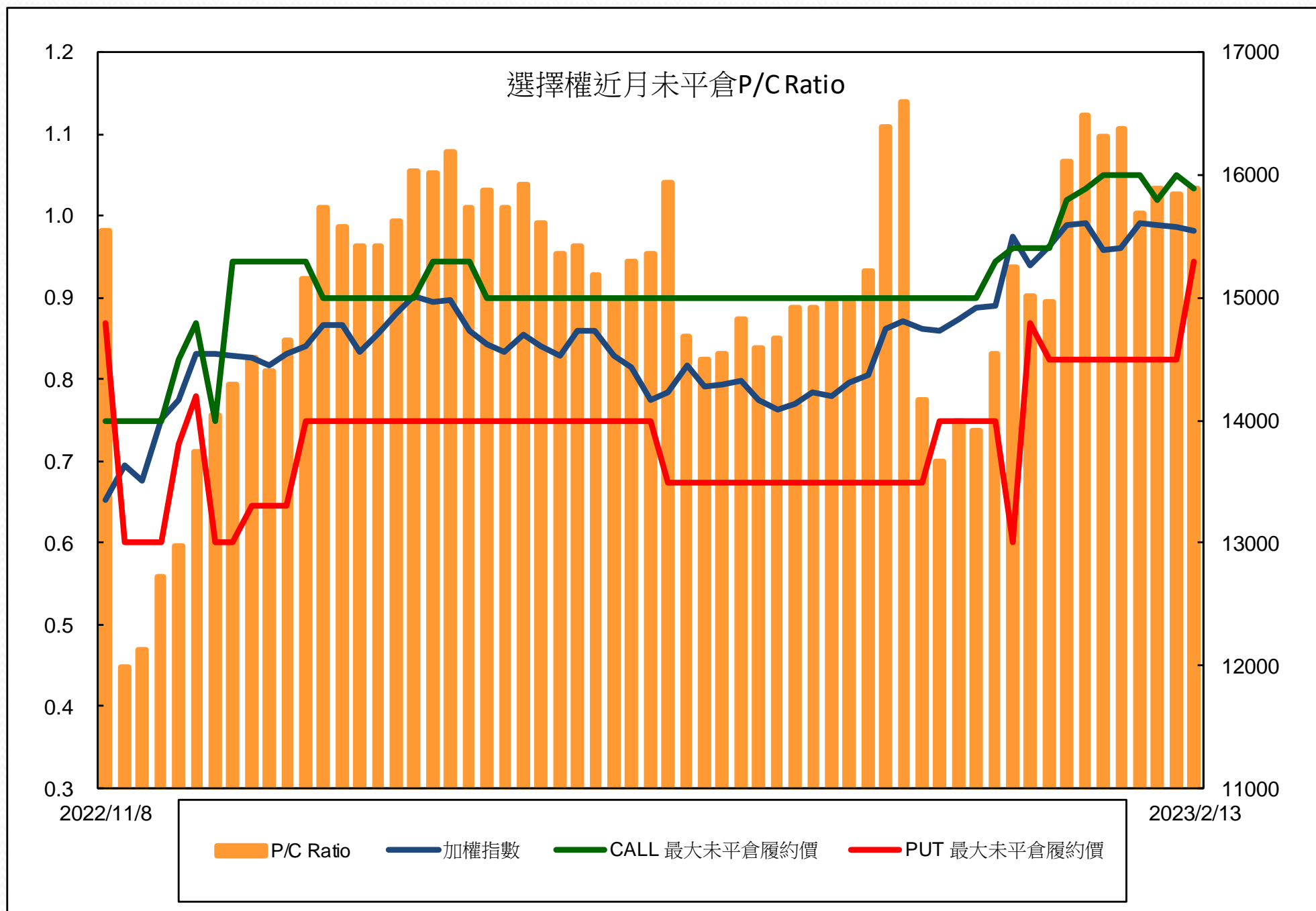
更新日期：2023年2月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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10日	71,065	58,464	12,601
	2月13日	87,468	69,346	18,122
Put	2月10日	70,514	65,841	4,673
	2月13日	84,673	67,905	16,768

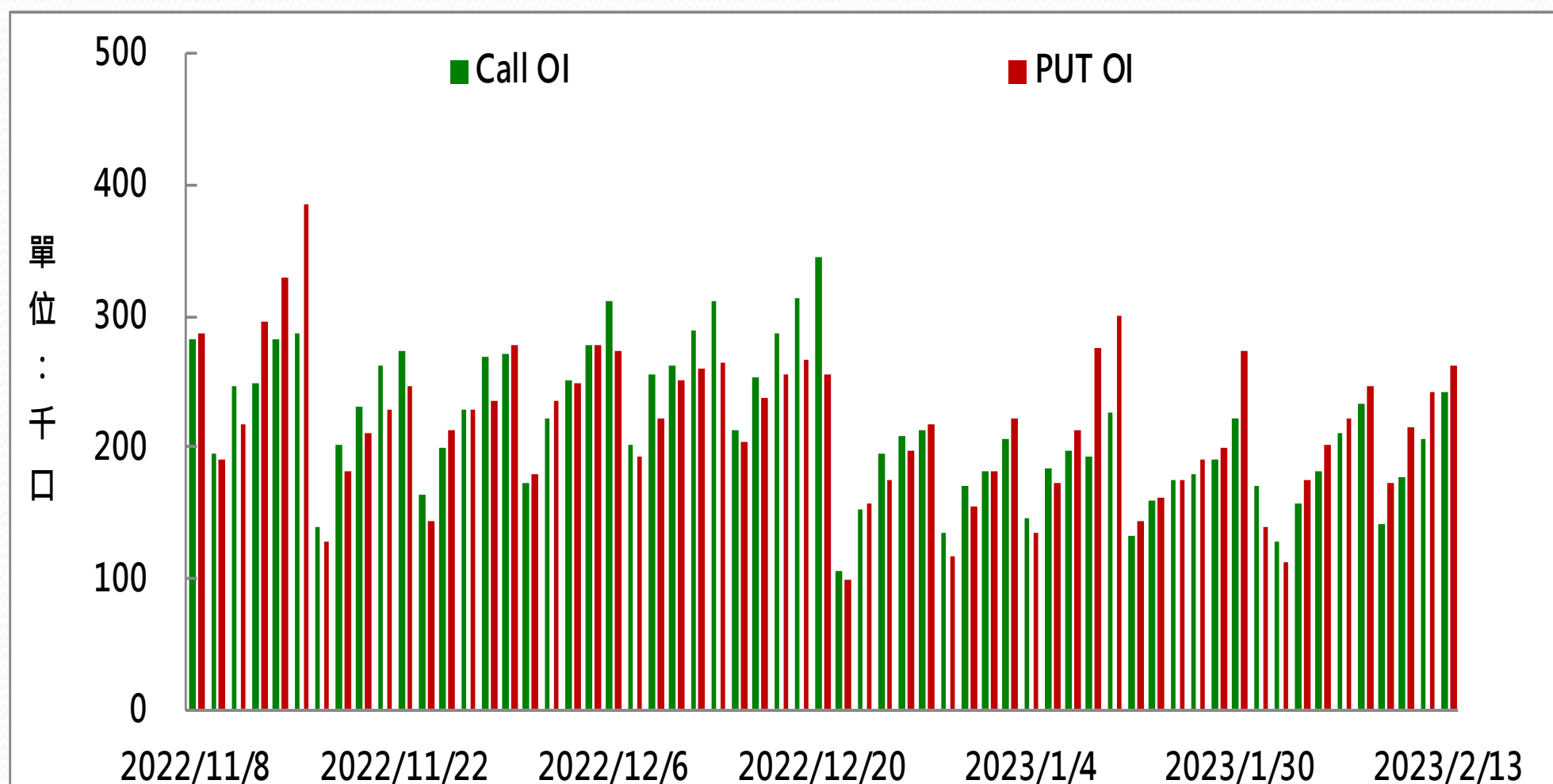
更新日期：2023年2月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

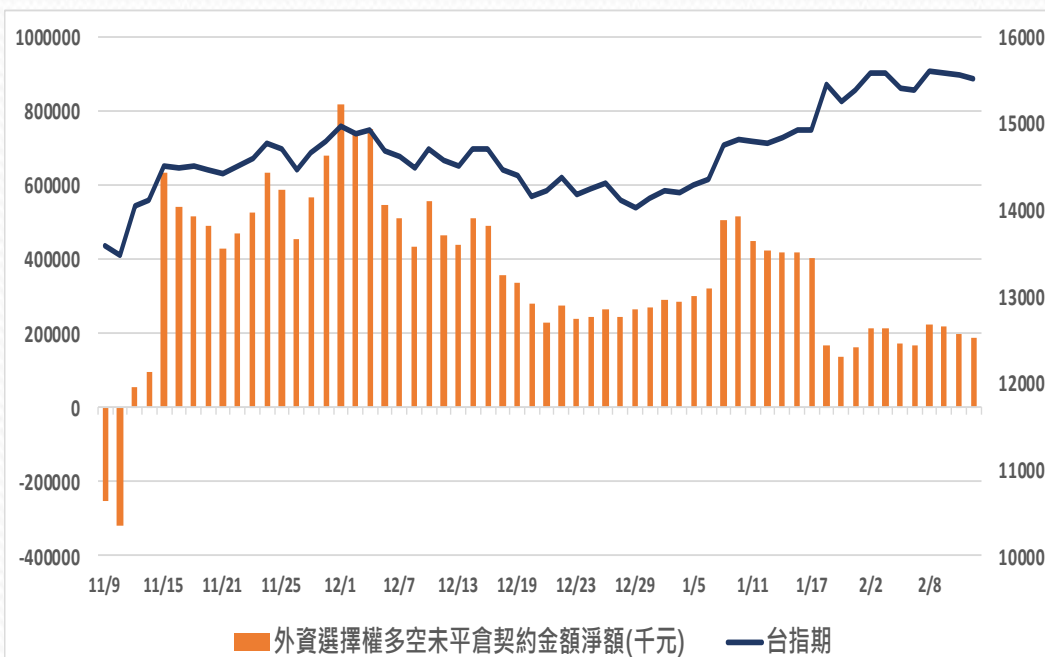
選擇權全月Put Call OI



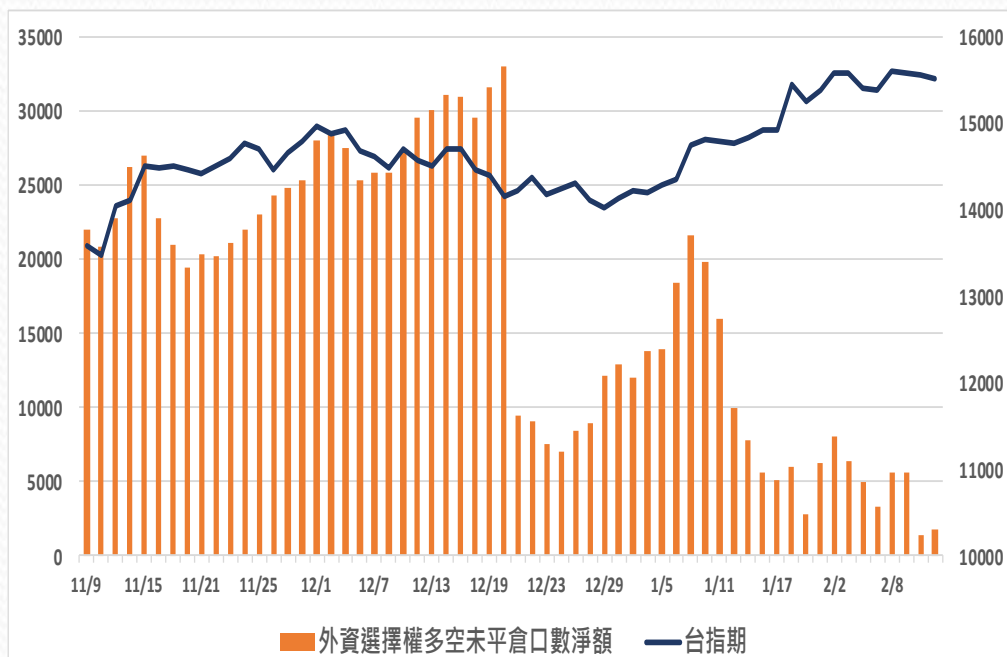
更新日期：2023年2月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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

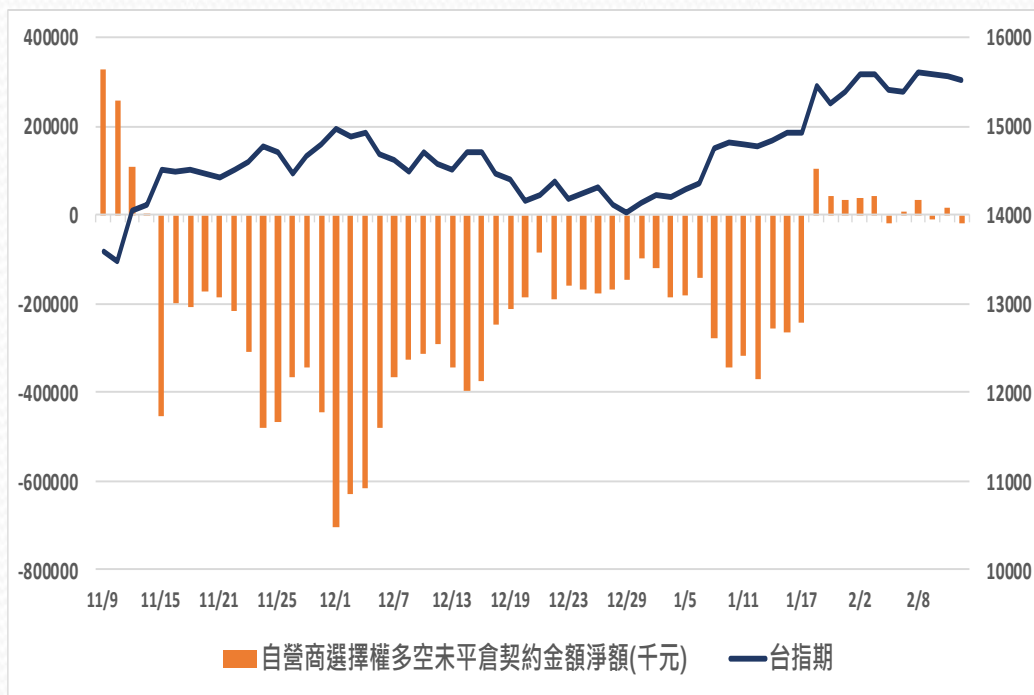
日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/2/7	15397	3373	-1587	169963	-3088
2023/2/8	15604	5598	2225	222908	52945
2023/2/9	15600	5673	75	219880	-3028
2023/2/10	15577	1390	-4283	202056	-17824
2023/2/13	15532	1811	421	188744	-13312

更新日期：2023年2月13日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參

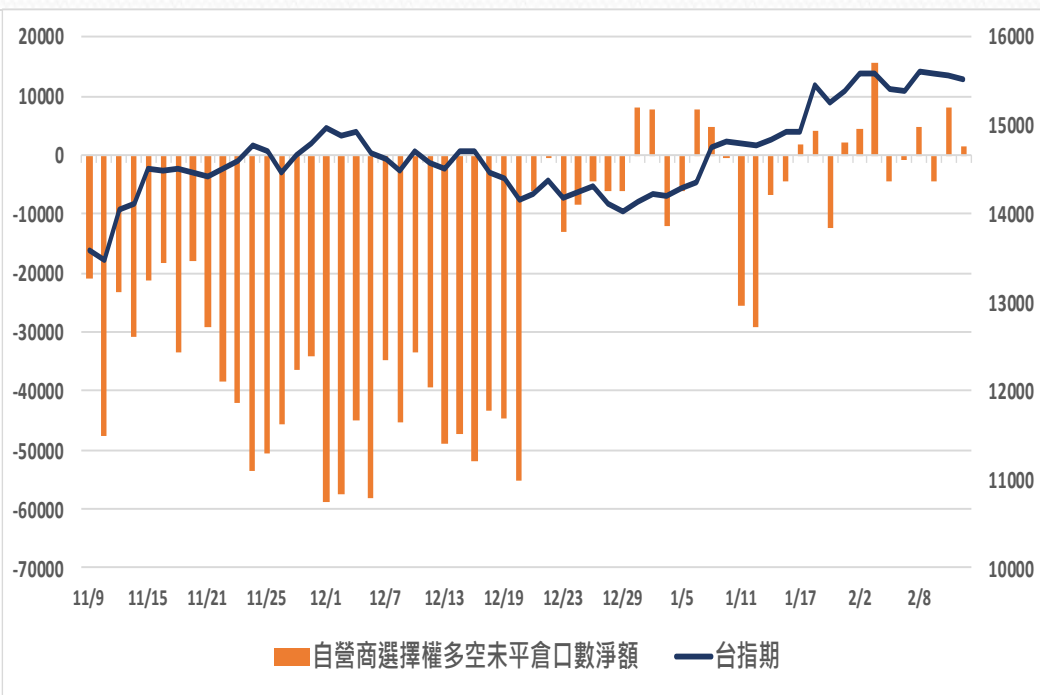
考

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



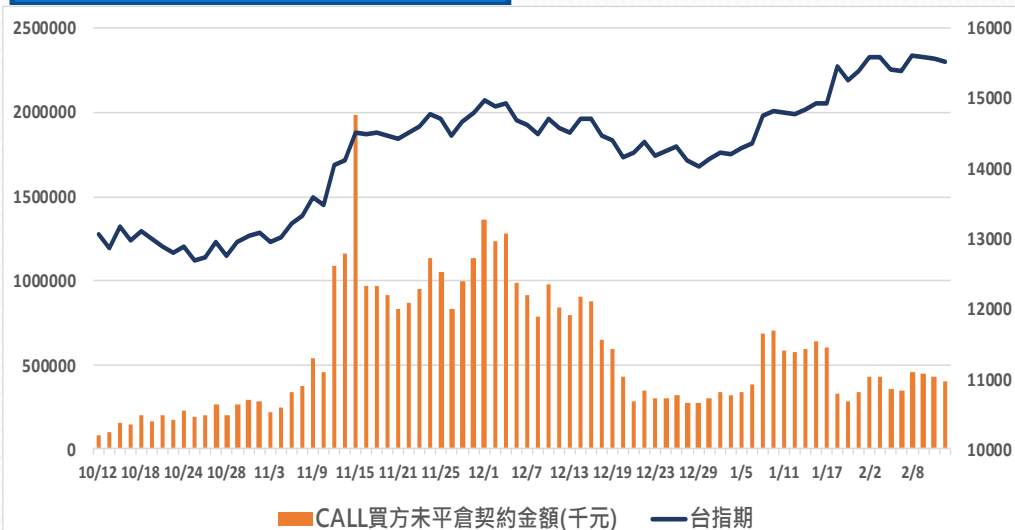
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/7	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
2023/2/13	15532	1354	-6574	-18091	-33052

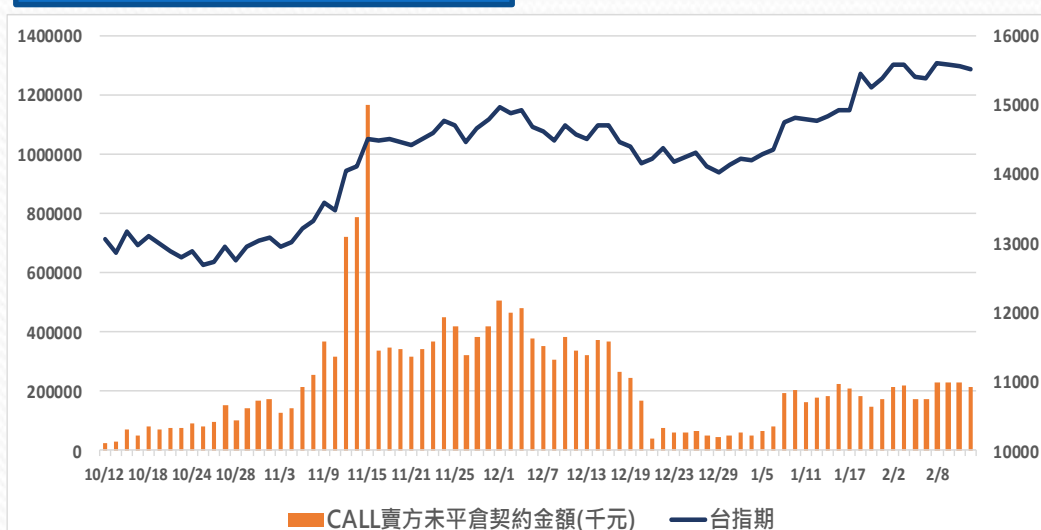
更新日期：2023年2月13日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

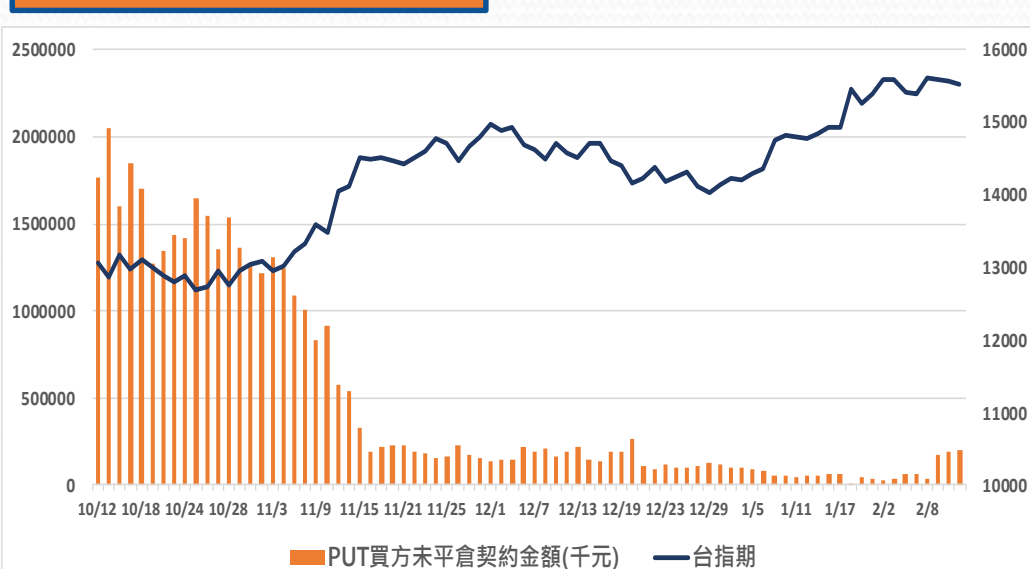
CALL買方未平倉金額



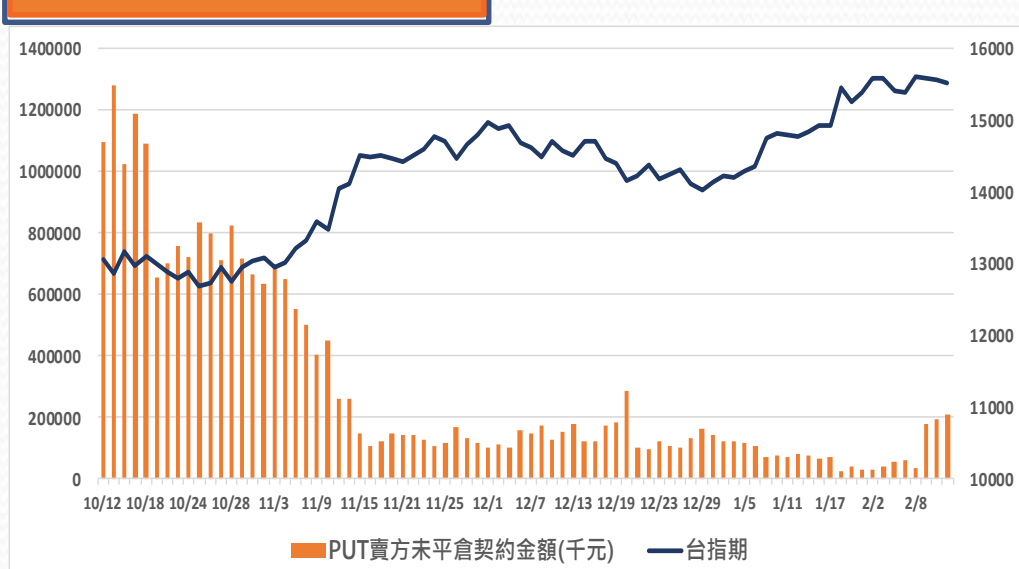
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



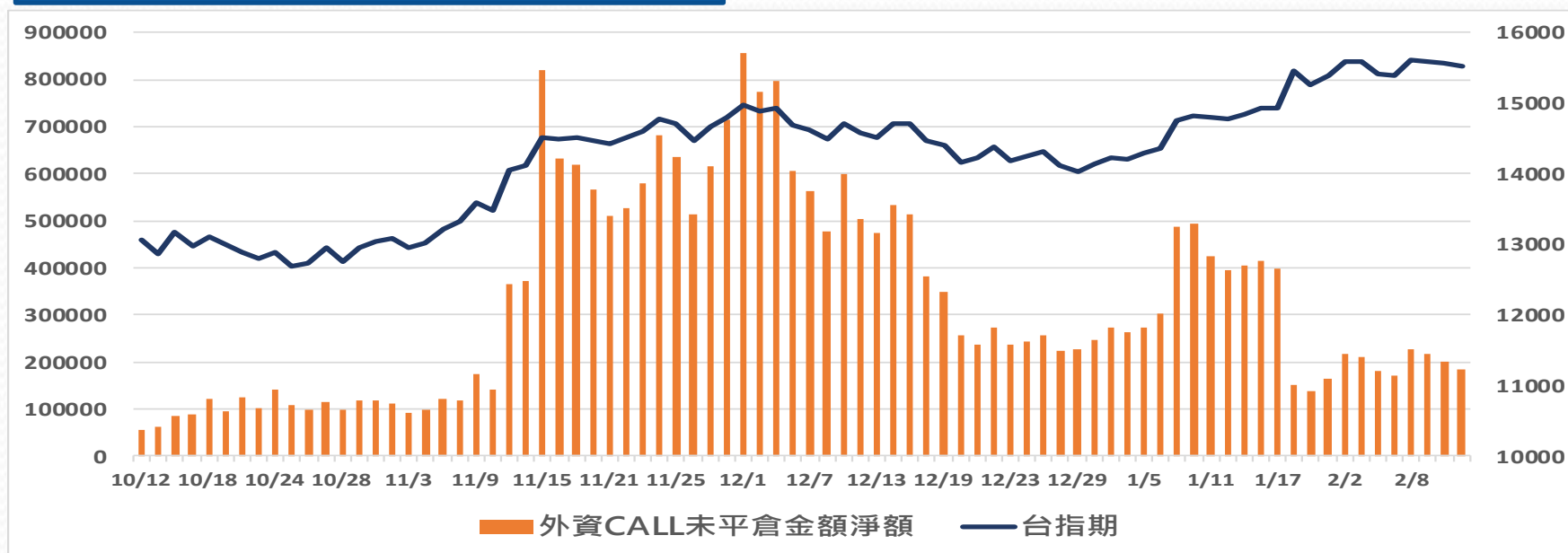
PUT賣方未平倉金額



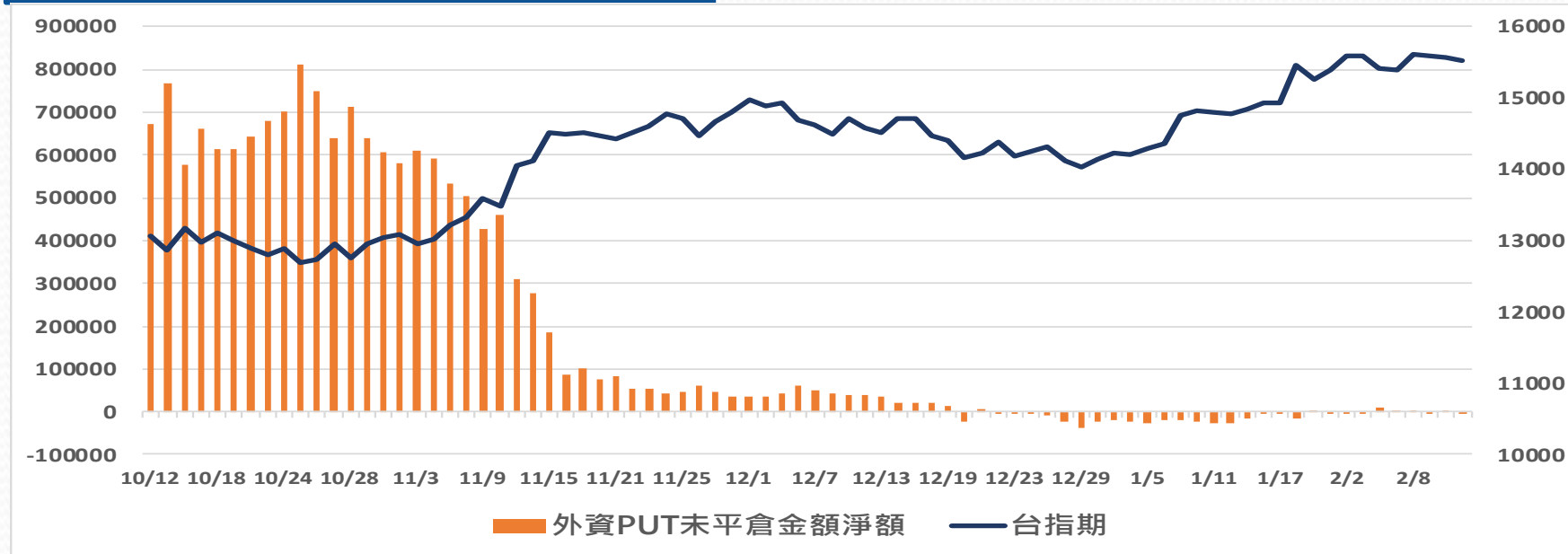
更新日期：2023年2月13日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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13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13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