

台指選擇權OI匯報

日期：2023/2/14 結算日：2023/2/15					日期：2023/2/14 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	1,459	14,600	3,967	-503	0	3	13,900	416	-29
0	1,119	14,700	3,829	-36	0	476	14,000	2,214	414
-10	1,055	14,800	3,103	-361	0	27	14,100	503	-34
-3	530	14,900	6,655	-916	0	144	14,200	753	47
0	30	14,950	4,782	-457	0	56	14,300	964	3
-144	885	15,000	8,325	-509	12	221	14,400	1,405	642
0	44	15,050	6,435	-1,800	0	83	14,500	1,660	-47
-145	944	15,100	8,020	-1,911	4	248	14,600	1,604	9
-23	69	15,150	7,218	-126	6	97	14,700	1,694	117
52	1,135	15,200	9,380	-1,301	-3	207	14,800	2,193	-181
-13	143	15,250	7,395	-1,571	2	85	14,900	1,198	-130
-178	1,479	15,300	10,571	-3,746	6	385	15,000	3,377	709
-163	329	15,350	9,934	2,726	-3	151	15,100	1,937	926
-789	3,142	15,400	13,957	3,639	-13	381	15,200	2,966	457
-767	1,228	15,450	7,855	3,509	-19	129	15,300	1,009	189
-1,313	4,184	15,500	9,999	4,106	32	1,003	15,400	2,047	352
-1,805	2,506	15,550	6,137	3,419	18	621	15,500	1,027	210
-3,139	6,889	15,600	6,941	3,095	-25	2,062	15,600	626	141
-1,331	5,239	15,650	2,626	1,363	258	1,051	15,700	269	46
-633	10,130	15,700	2,184	473	6	1,167	15,800	114	22
766	8,612	15,750	887	453	54	1,281	15,900	87	28
-424	14,784	15,800	827	323	-397	4,131	16,000	105	21
1,403	11,610	15,850	356	196	187	2,135	16,100	47	1
3,293	20,797	15,900	575	169	-93	2,220	16,200	26	1
1,117	6,658	15,950	43	0	86	1,562	16,300	7	1
2,254	17,109	16,000	351	127	503	2,690	16,400	4	0
555	4,617	16,050	57	41	201	1,553	16,500	4	0
1,134	10,180	16,100	60	0	83	657	16,600	2	0
860	7,806	16,200	28	3	92	619	16,700	0	0
182	5,050	16,300	23	1	21	704	16,800	2	0
-34	3,956	16,400	41	-8	-25	622	16,900	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
-1,457	160,868	1.1391	183,239	10,003	2,109	55,859	1.0866	60,694	5,134
昨日 P/C	1.0672	今日增減變化	0.0719	昨日 P/C	1.0337	今日增減變化	0.0529		

更新日期：2023年2月14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14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	101,402,114	62,667,902	38,734,212	656,883	2,857,684	1,529,952	1,327,732	371,689	
投信	29,275,296	51,994,936	-22,719,640	276,061	419,832	0	419,832	3,522	
自營商	40,962,226	26,401,051	14,561,175	-6,371,793	1,321,697	1,109,459	212,238	-202,118	
	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	508,651	2,287,349	-1,778,698	-158,009	81,967	26,820	55,147	-12,833	
投信	117,745	0	117,745	522	0	0	0	0	
自營商	599,702	238,625	361,077	15,842	125,141	146,028	-20,887	27,870	

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14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	25,405	14,090	11,315	-257	39,928	27,794	12,134	2,373	
投信	100	0	100	0	500	111	389	0	
自營商	101,299	72,660	28,639	10,517	81,315	74,105	7,210	-9,558	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	9,327	5,700	3,627	33	2,631	11,941	-9,310	-4,124	
特定法人(全月)	11,857	5,700	6,157	1,633	10,563	24,450	-13,887	-1,071	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	69,539	44,393	25,146	12,196	59,866	62,190	-2,324	8,031	
十大交易人(全月)	116,210	80,771	35,439	14,377	106,116	101,783	4,333	12,317	
全市場未沖銷(近月)			160,880	-1,457			186,122	9,757	
全市場未沖銷(全月)			246,165	4,635			281,937	19,911	

更新日期：2023年2月14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	15400
	整體隱含波動率	19.91%	較前一交易日	+1.42%
	買權隱含波動率	19.01%	較前一交易日	+1.66%
	賣權隱含波動率	20.71%	較前一交易日	+0.84%
電子選擇權	買權成交最大量	440	買權OI最大量	750
	賣權成交最大量	690	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1640	買權OI最大量	1580
	賣權成交最大量	1480	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年2月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

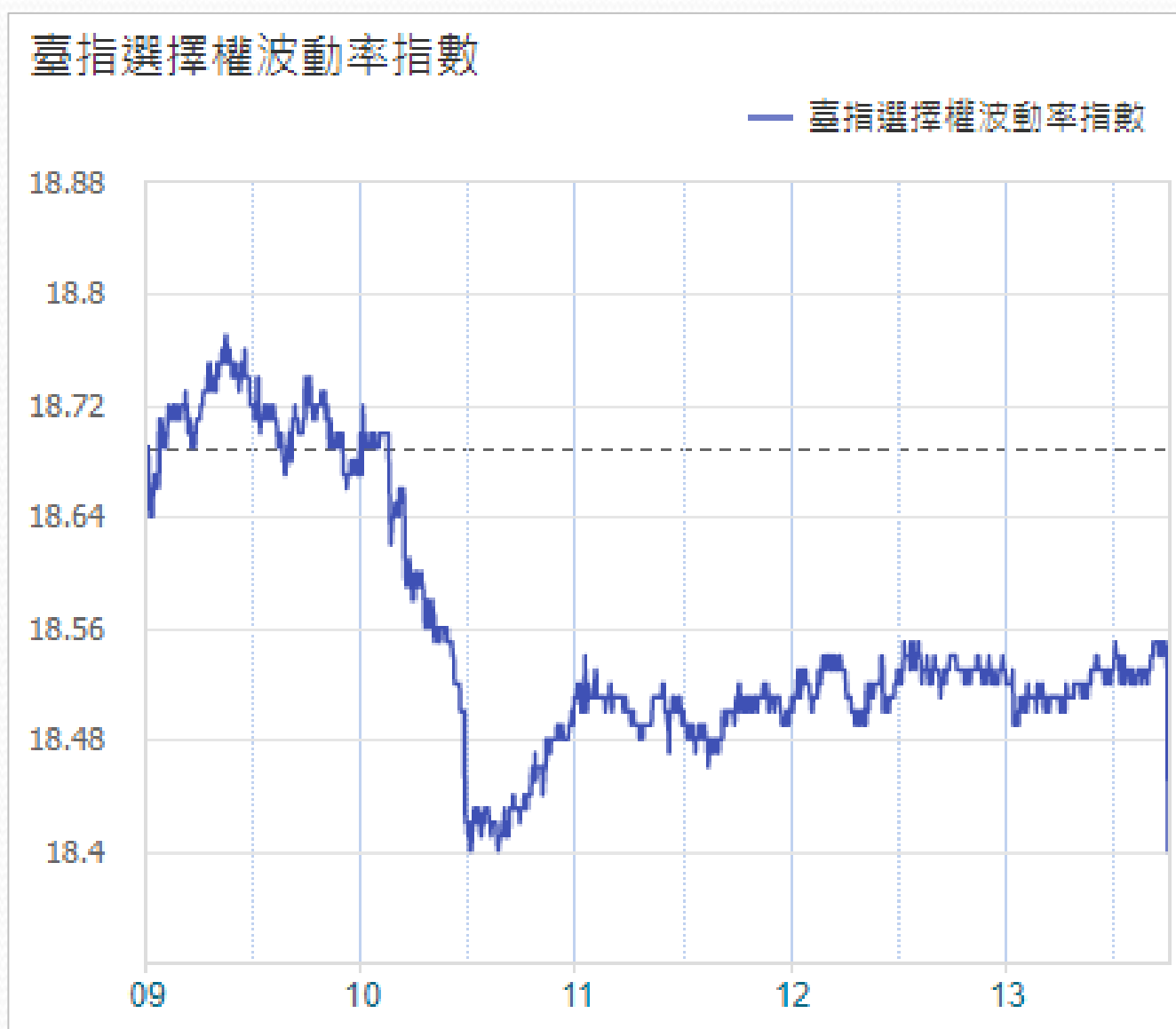
台指選擇權匯報

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	18.08%	較前一交易日	-0.46%
	買權隱含波動率	15.07%	較前一交易日	+0.01%
	賣權隱含波動率	20.36%	較前一交易日	+0.76%
	成交量P/C_Ratio值	1.207	較前一交易日	+0.15
	未平倉P/C_Ratio值	1.087	較前一交易日	+0.05
電子選擇權	買權成交最大量	510	買權OI最大量	750
	賣權成交最大量	690	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1640	買權OI最大量	1580
	賣權成交最大量	1480	賣權OI最大量	1480

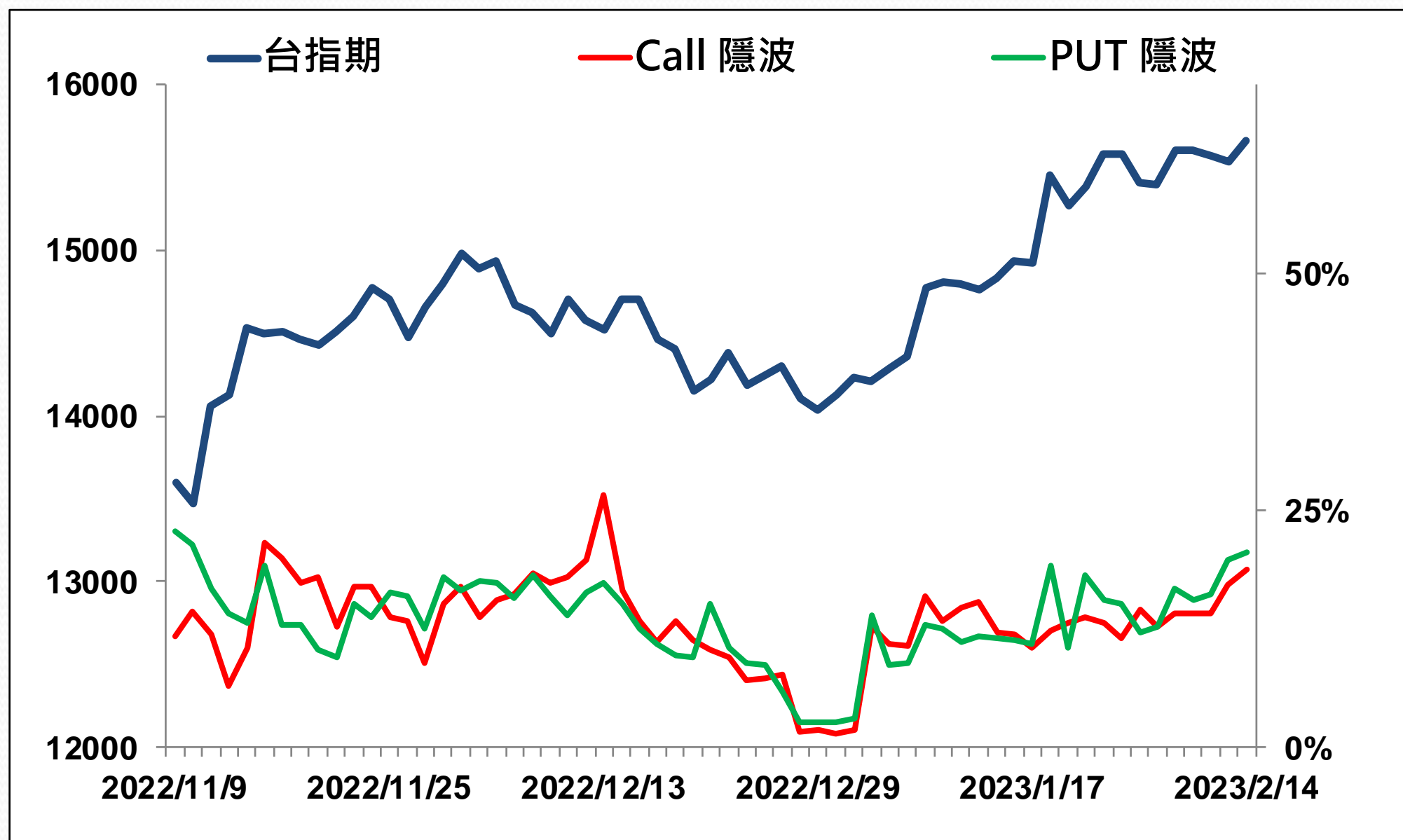
更新日期：2023年2月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



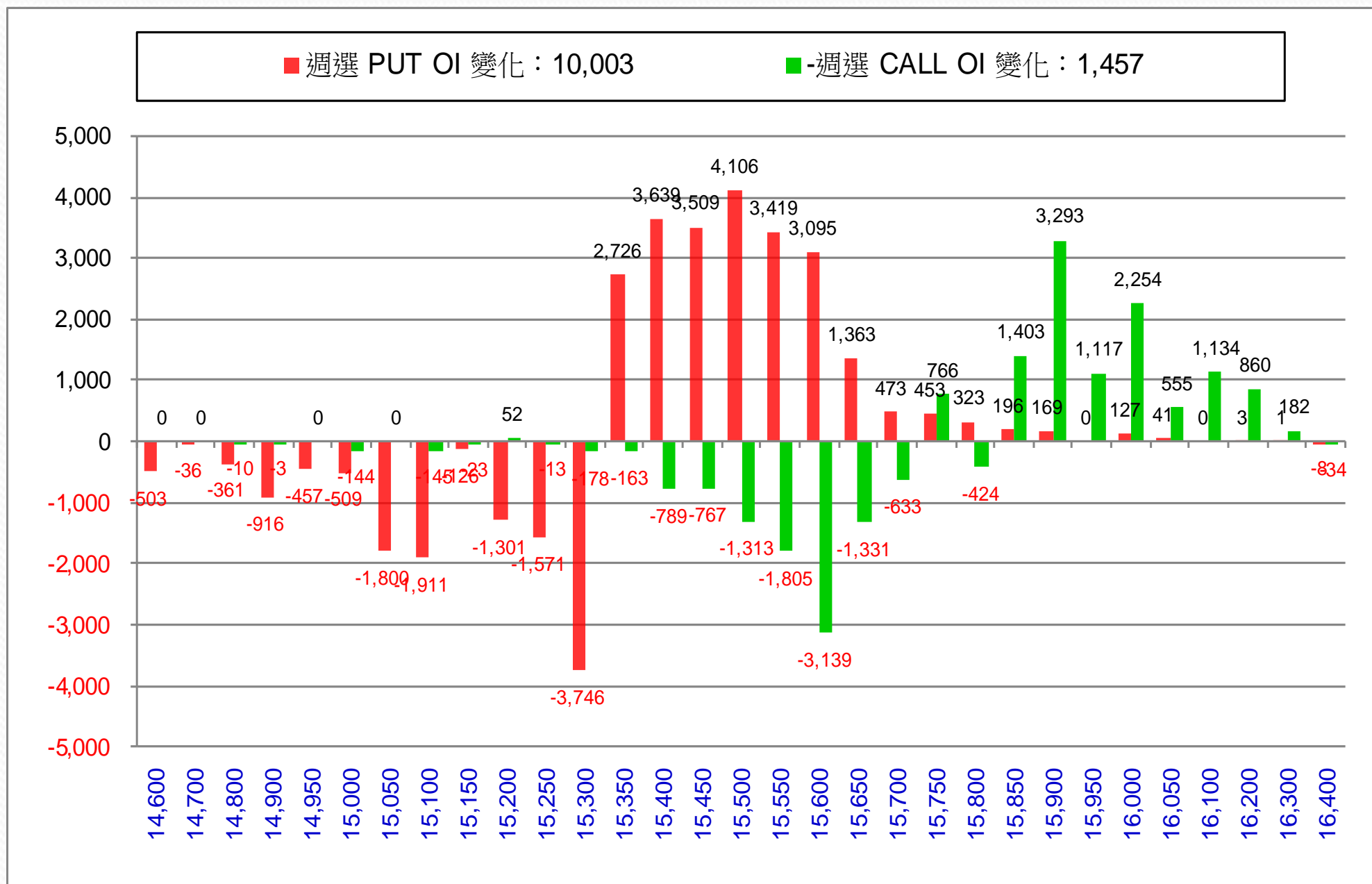
更新日期：2023年2月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年2月14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

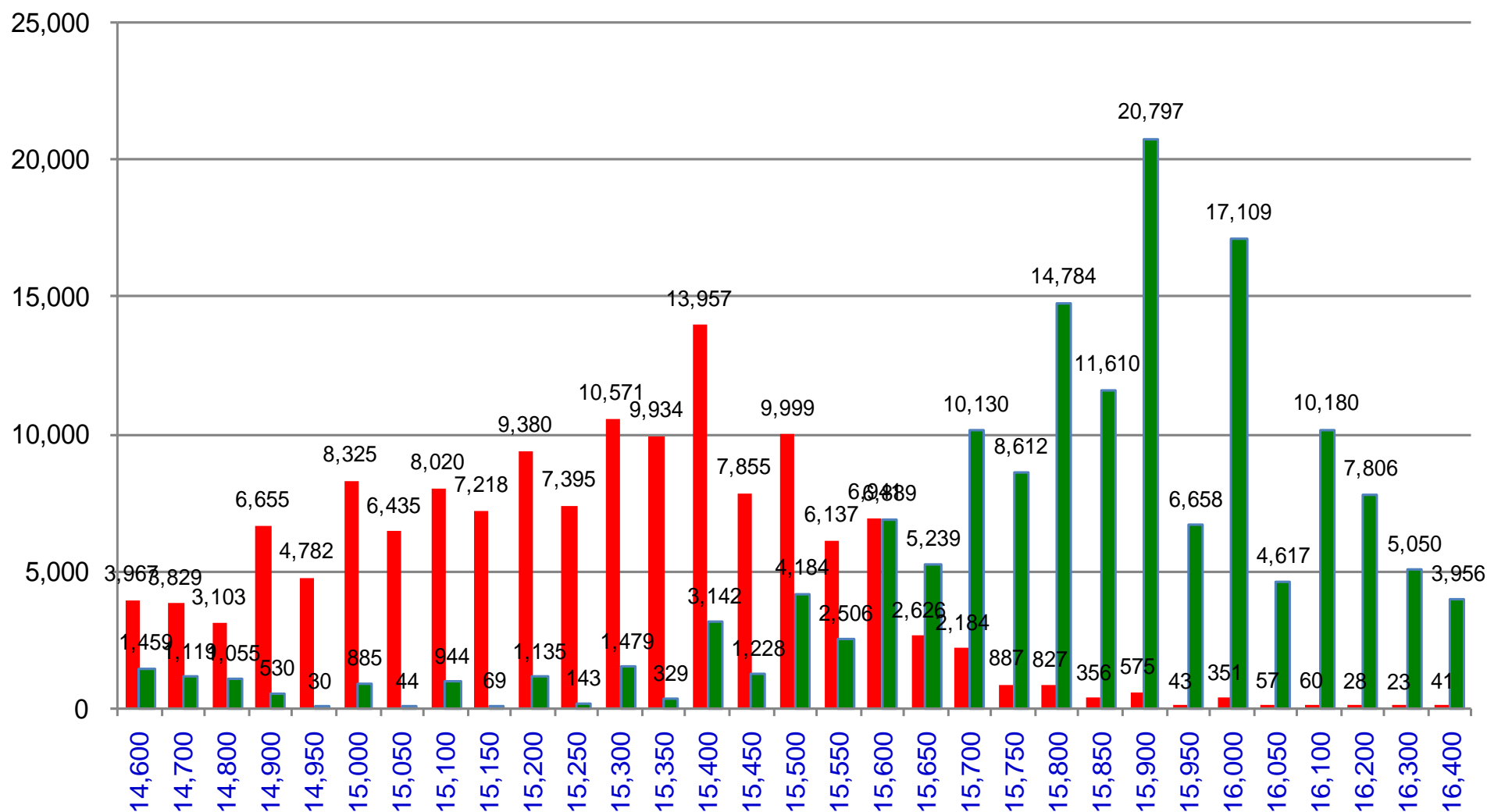


更新日期：2023年2月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：183,239

週選 CALL OI 總額：160,868



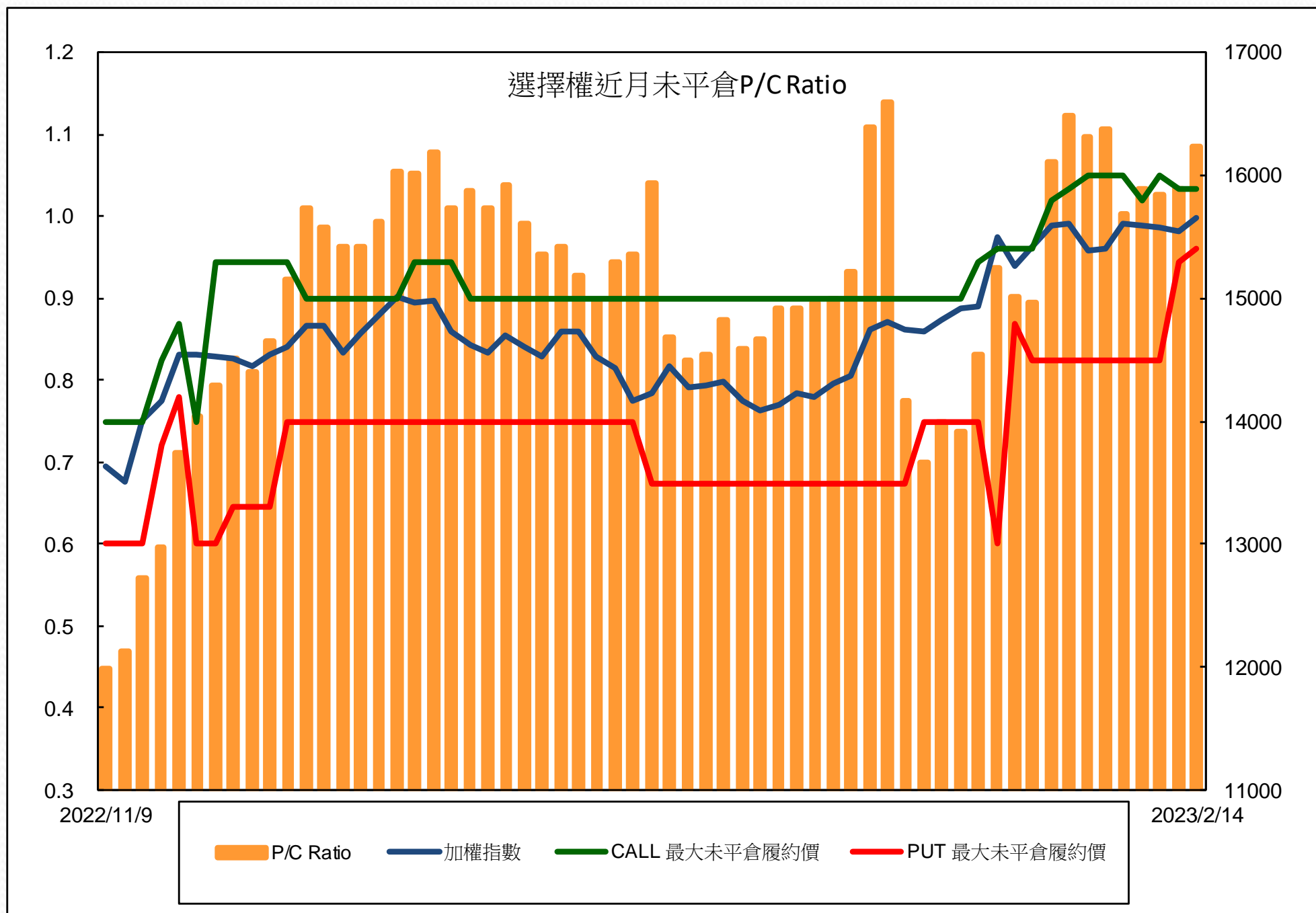
更新日期：2023年2月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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13日	87,468	69,346	18,122
	2月14日	101,299	72,660	28,639
Put	2月13日	84,673	67,905	16,768
	2月14日	81,315	74,105	7,210

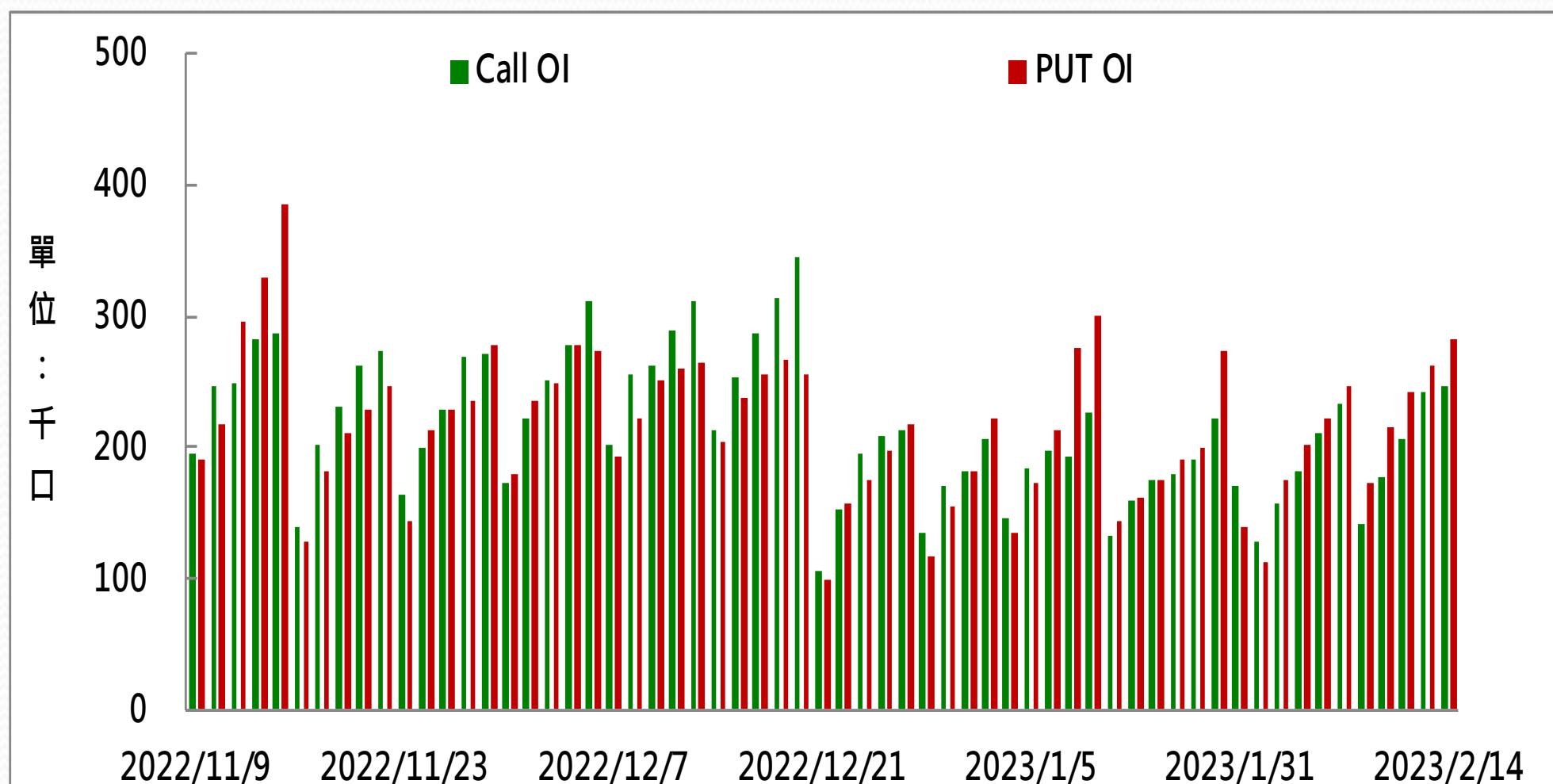
更新日期：2023年2月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

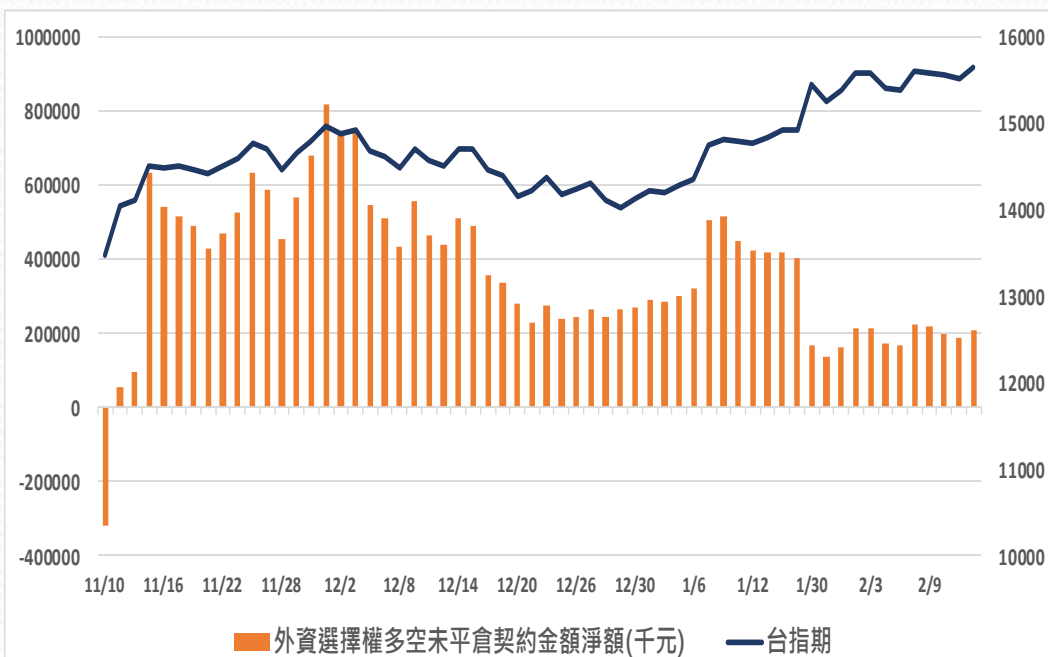
選擇權全月Put Call OI



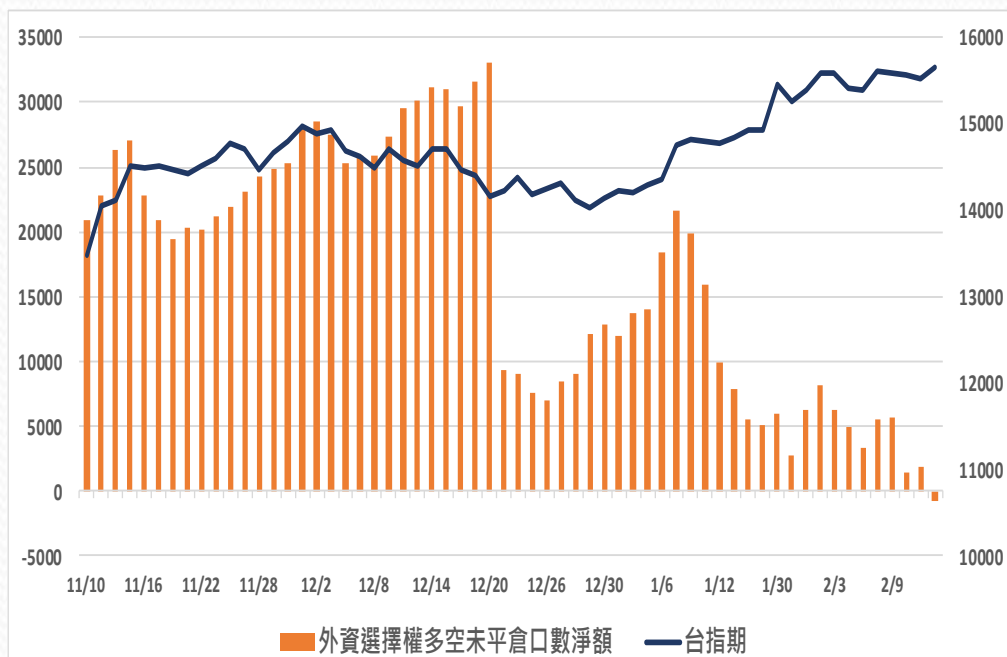
更新日期：2023年2月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



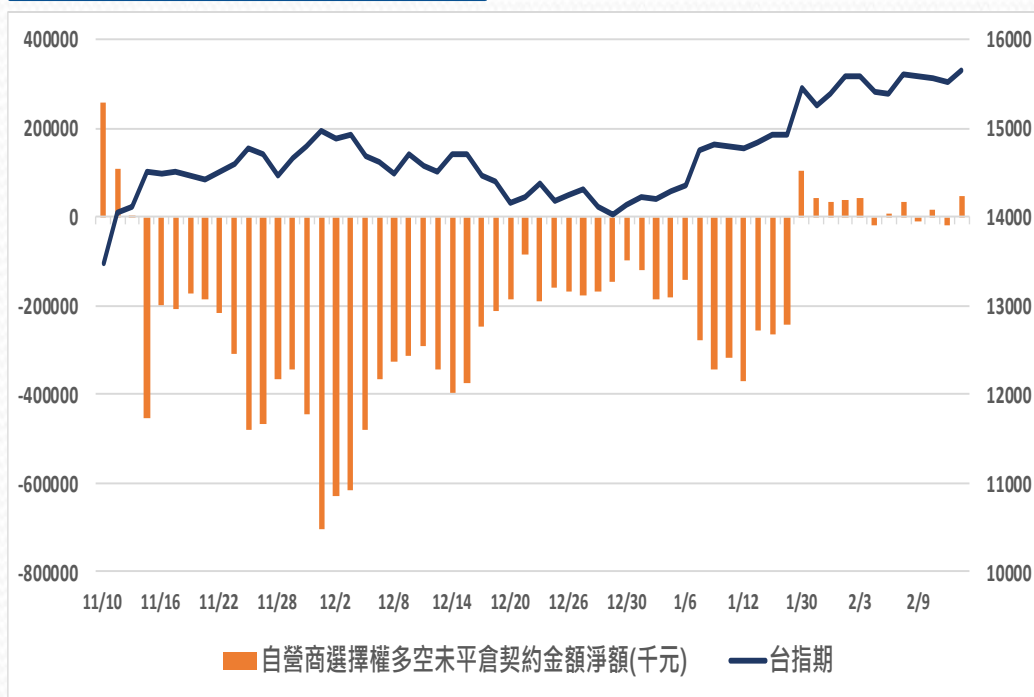
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/8	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
2023/2/14	15658	-819	-2630	208484	19740

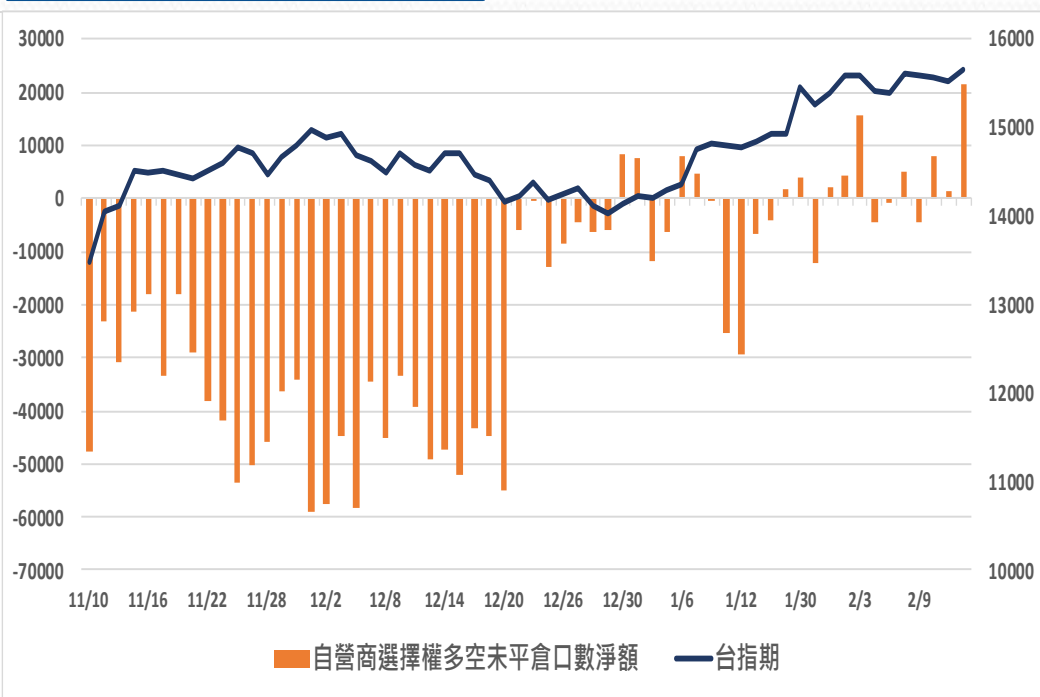
更新日期：2023年2月14日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



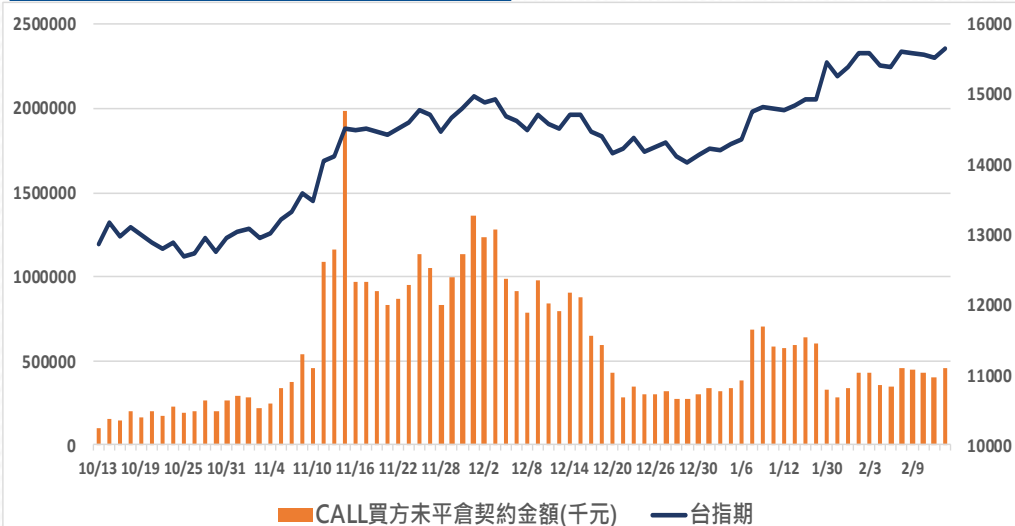
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/8	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
2023/2/14	15658	21429	20075	45918	64009

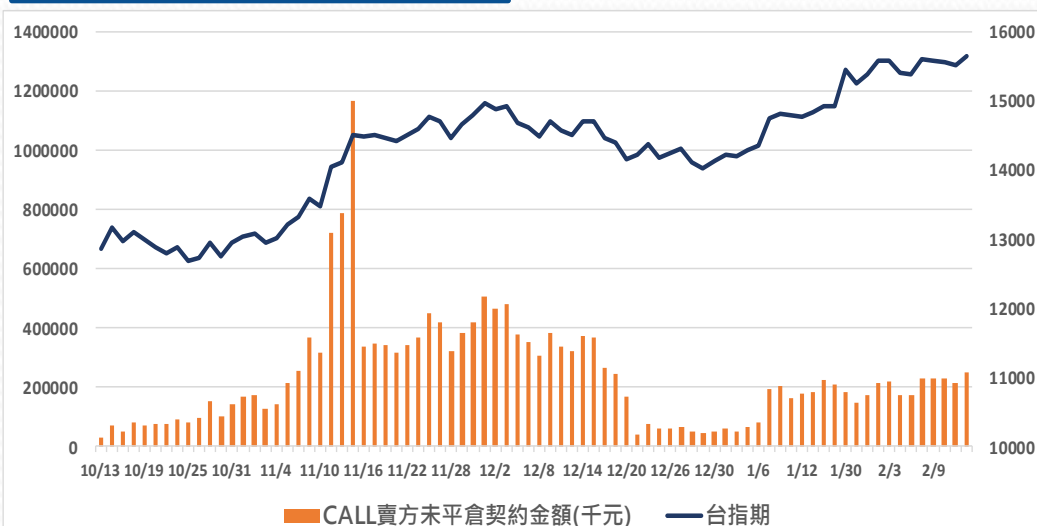
更新日期：2023年2月14日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

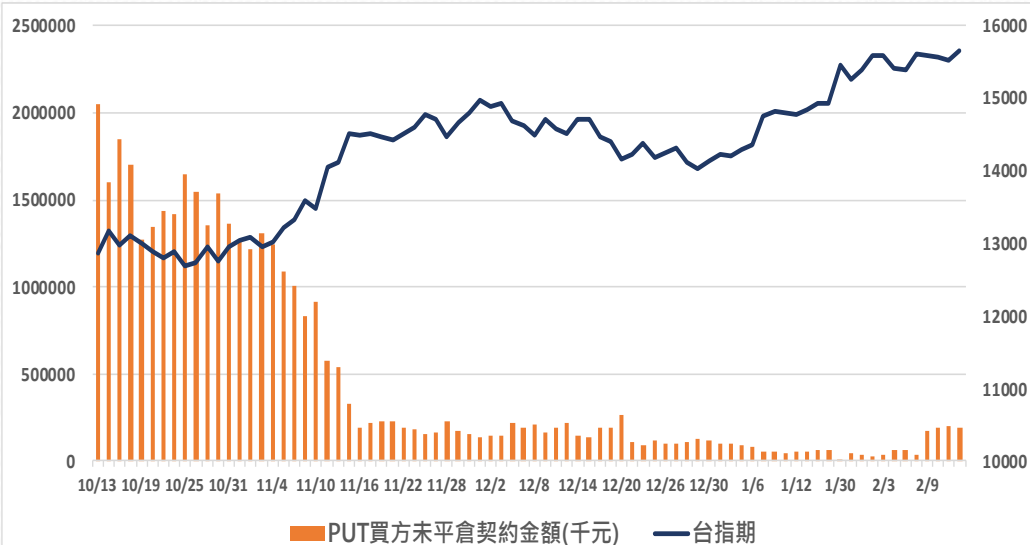
CALL買方未平倉金額



CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



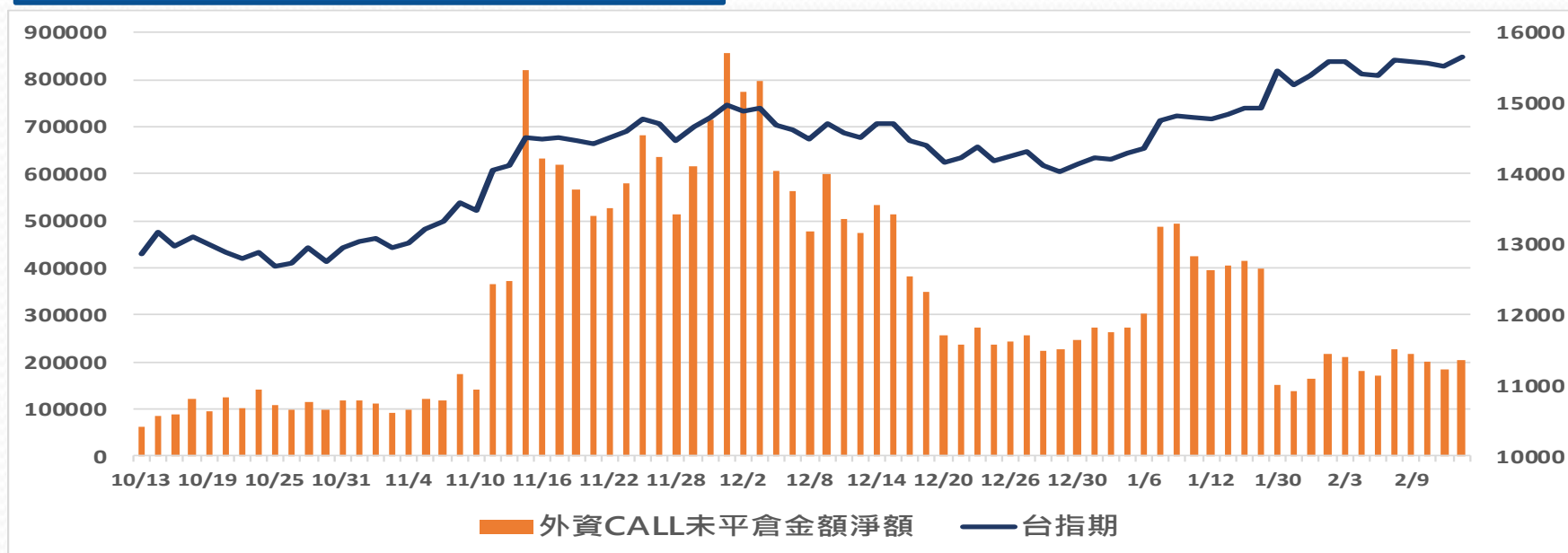
PUT賣方未平倉金額



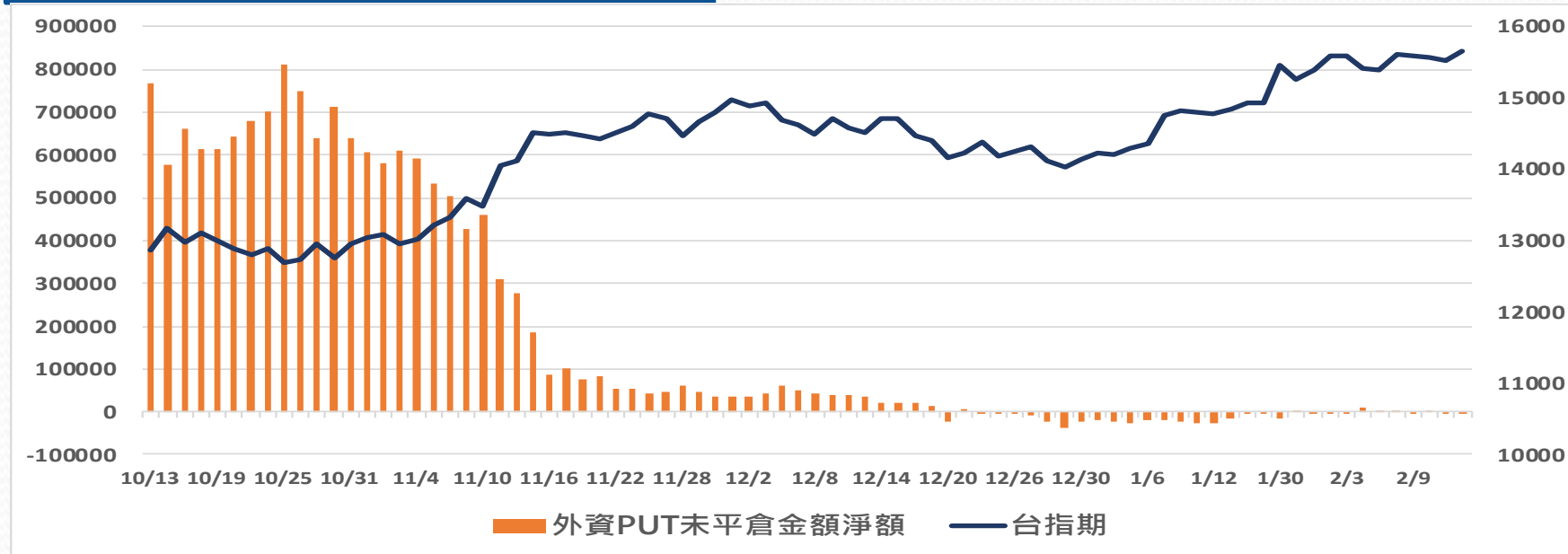
更新日期：2023年2月14日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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14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14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