

# 台指選擇權OI匯報

日期：2023/2/15 結算日：2023/2/22					日期：2023/2/15 結算日：2023/3/15				
202302W4					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
1	1	13,900	38	2	0	78	13,600	899	406
0	0	14,000	95	22	0	1	13,700	549	15
0	0	14,100	131	92	0	72	13,800	1,313	618
0	0	14,200	643	33	8	11	13,900	631	215
0	0	14,300	718	127	1	477	14,000	2,722	508
0	0	14,400	1,002	196	0	27	14,100	544	41
0	0	14,500	1,882	1,377	0	144	14,200	896	143
0	0	14,600	626	297	0	56	14,300	1,265	301
0	0	14,700	1,173	763	49	270	14,400	1,650	245
1	1	14,800	1,613	1,071	2	85	14,500	1,932	272
5	5	14,900	1,908	1,157	-2	246	14,600	2,096	492
6	28	15,000	2,619	1,771	-8	89	14,700	2,593	899
27	41	15,100	2,021	1,248	10	217	14,800	2,478	285
115	159	15,200	3,418	2,413	2	87	14,900	1,635	437
121	134	15,250	1,800	1,035	42	427	15,000	4,251	874
225	276	15,300	1,625	695	4	155	15,100	2,357	420
126	198	15,350	1,479	532	20	401	15,200	3,926	960
765	899	15,400	3,261	1,418	197	326	15,300	1,589	580
782	926	15,450	1,141	141	295	1,298	15,400	1,816	-231
1,645	1,902	15,500	1,887	275	304	925	15,500	911	-116
788	1,475	15,550	1,068	44	223	2,285	15,600	708	82
1,364	3,201	15,600	603	-120	378	1,429	15,700	236	-33
2,830	4,060	15,650	384	68	423	1,590	15,800	126	12
3,086	4,062	15,700	284	69	823	2,104	15,900	53	-34
2,647	3,612	15,750	349	84	※ 1,317	5,448	16,000	94	-11
※ 3,582	4,616	15,800	275	141	650	2,785	16,100	51	4
2,036	3,123	15,850	37	6	1,181	3,401	16,200	89	63
3,532	4,614	15,900	41	-22	971	2,533	16,300	7	0
1,241	2,409	15,950	34	-5	210	2,900	16,400	4	0
1,954	4,613	16,000	111	59	413	1,966	16,500	4	0
714	1,140	16,050	70	50	174	831	16,600	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
29,578	51,383	0.6307	32,407	15,044	8,776	64,635	1.1049	71,412	10,718
昨日 P/C	1.1390	今日增減變化	-0.5083		昨日 P/C	1.0866	今日增減變化	0.0183	

更新日期：2023年2月15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15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	79,275,078	53,734,370	25,540,708	-13,193,504	2,240,002	551,341	1,688,661	360,929	
投信	27,360,700	52,056,935	-24,696,235	-1,976,595	409,897	0	409,897	-9,935	
自營商	38,609,286	18,469,155	20,140,131	5,578,956	981,444	736,083	245,361	33,123	
	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	277,466	1,624,270	-1,346,804	431,894	17,712	1,476	16,236	-38,911	
投信	116,910	0	116,910	-835	0	0	0	0	
自營商	406,847	57,676	349,171	-11,906	51,660	97,416	-45,756	-24,869	

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15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	17,233	7,641	9,592	-1,723	22,363	20,721	1,642	-10,492	
投信	100	0	100	0	100	113	-13	-402	
自營商	48,223	53,268	-5,045	-33,684	40,139	43,182	-3,043	-10,253	
特定法人(週)	4,113	0	4,113	---	800	2,797	-1,997	---	
特定法人(近月)	9,805	2,822	6,983	---	6,500	8,261	-1,761	---	
特定法人(全月)	12,664	0	12,664	6,507	12,019	14,347	-2,328	11,559	
十大交易人(週)	28,976	24,918	4,058	---	17,858	16,860	998	---	
十大交易人(近月)	40,153	36,677	3,476	---	42,877	34,538	8,339	---	
十大交易人(全月)	68,893	58,508	10,385	-25,054	60,933	57,265	3,668	-665	
全市場未沖銷(近月)			64,635	---			71,412	---	
全市場未沖銷(全月)			126,021	-120,144			126,910	-155,027	

更新日期：2023年2月15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02W4週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15800	買權OI最大量	15800
	賣權成交最大量	15200	賣權OI最大量	15200
	整體隱含波動率	15.32%	較前一交易日	-4.59%
	買權隱含波動率	13.16%	較前一交易日	-5.85%
	賣權隱含波動率	18.37%	較前一交易日	-2.35%
電子選擇權	買權成交最大量	425	買權OI最大量	425
	賣權成交最大量	680	賣權OI最大量	690
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	1520	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年2月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

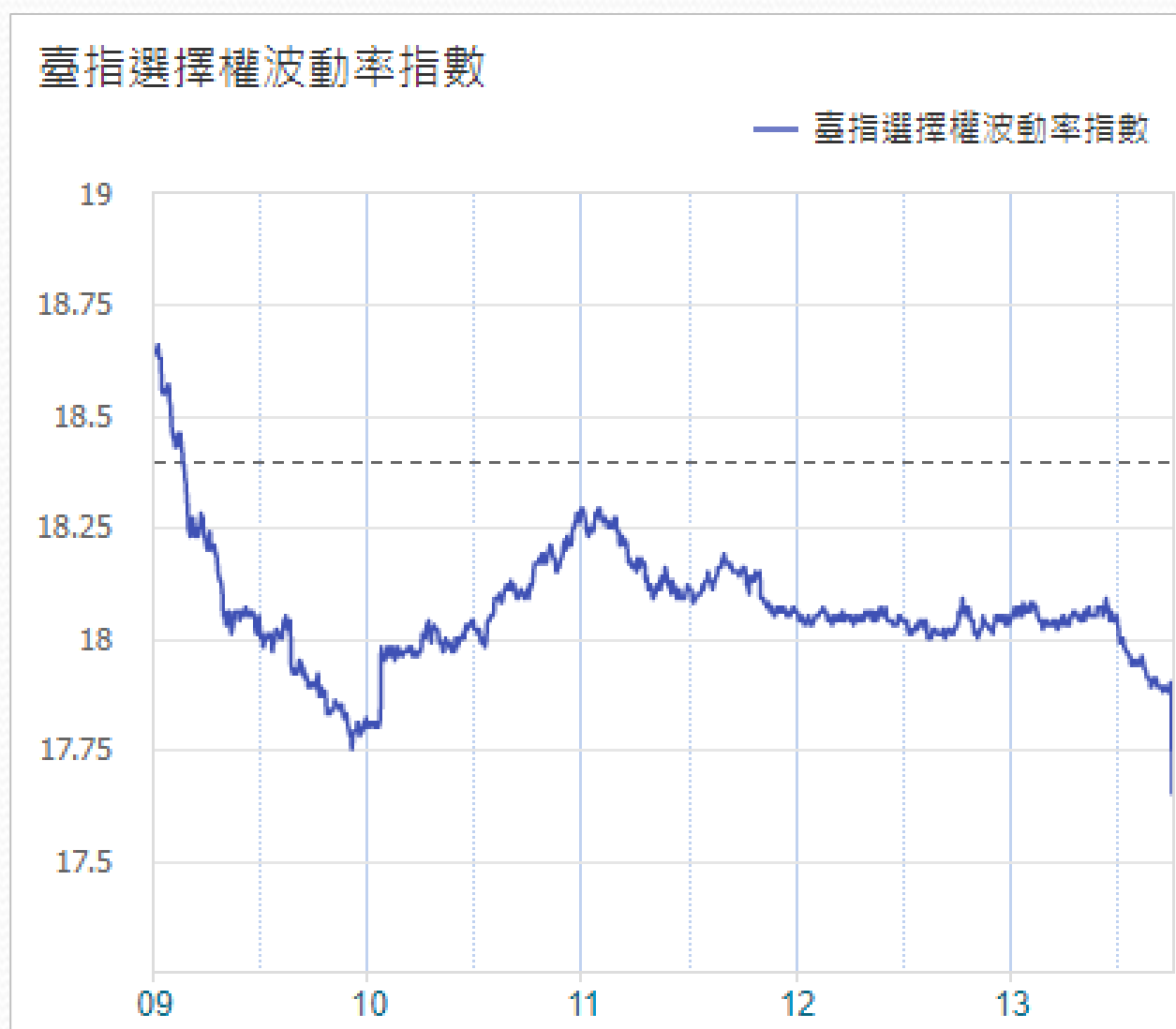
# 台指選擇權匯報

## 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	15000	賣權OI最大量	10000
	整體隱含波動率	16.04%	較前一交易日	+2.04%
	買權隱含波動率	13.37%	較前一交易日	-1.70%
	賣權隱含波動率	18.88%	較前一交易日	-1.49%
	成交量P/C_Ratio值	0.944	較前一交易日	-0.26
	未平倉P/C_Ratio值	1.105	較前一交易日	+0.02
電子選擇權	買權成交最大量	495	買權OI最大量	495
	賣權成交最大量	680	賣權OI最大量	690
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	1520	賣權OI最大量	1480

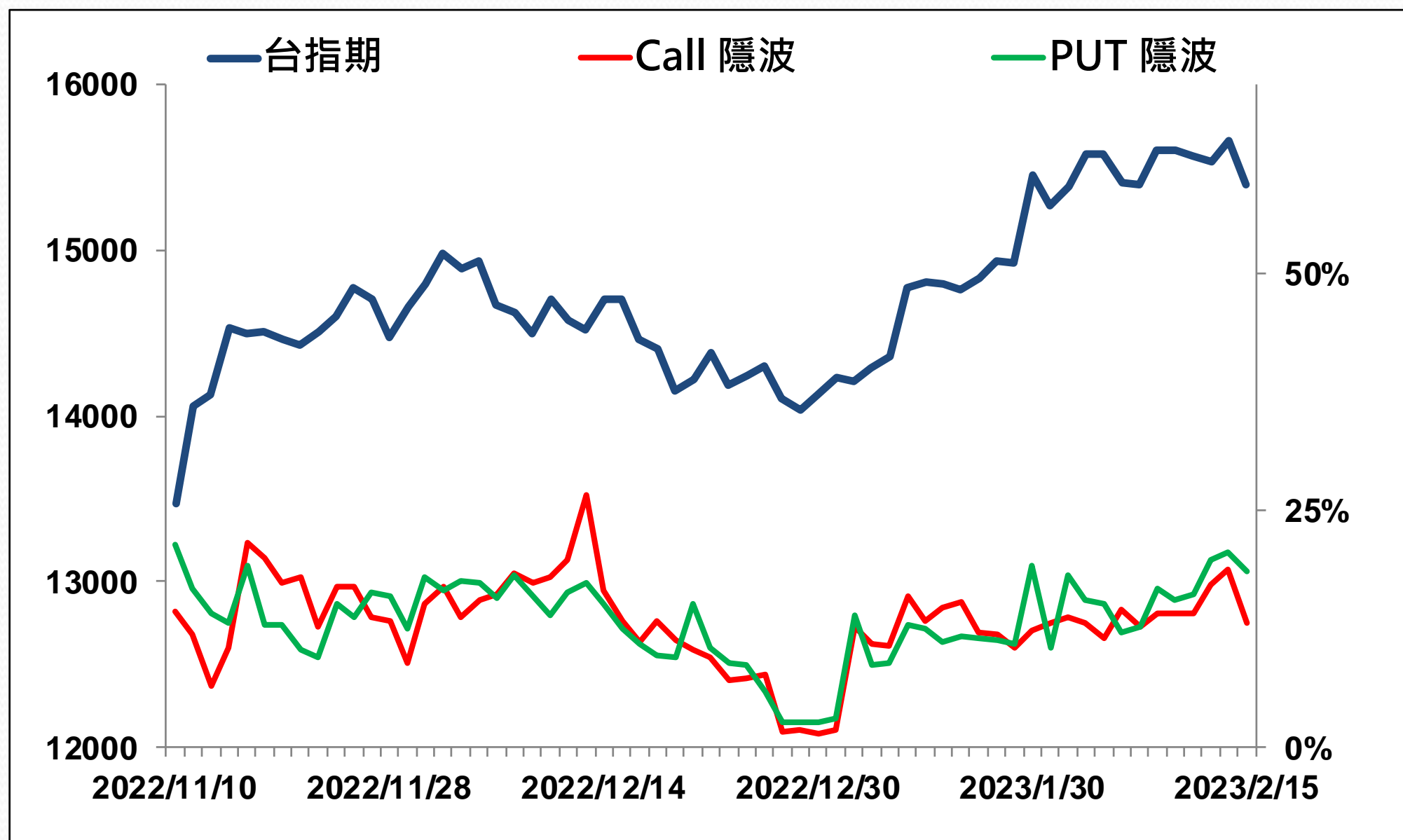
更新日期：2023年2月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權當日波動率指數



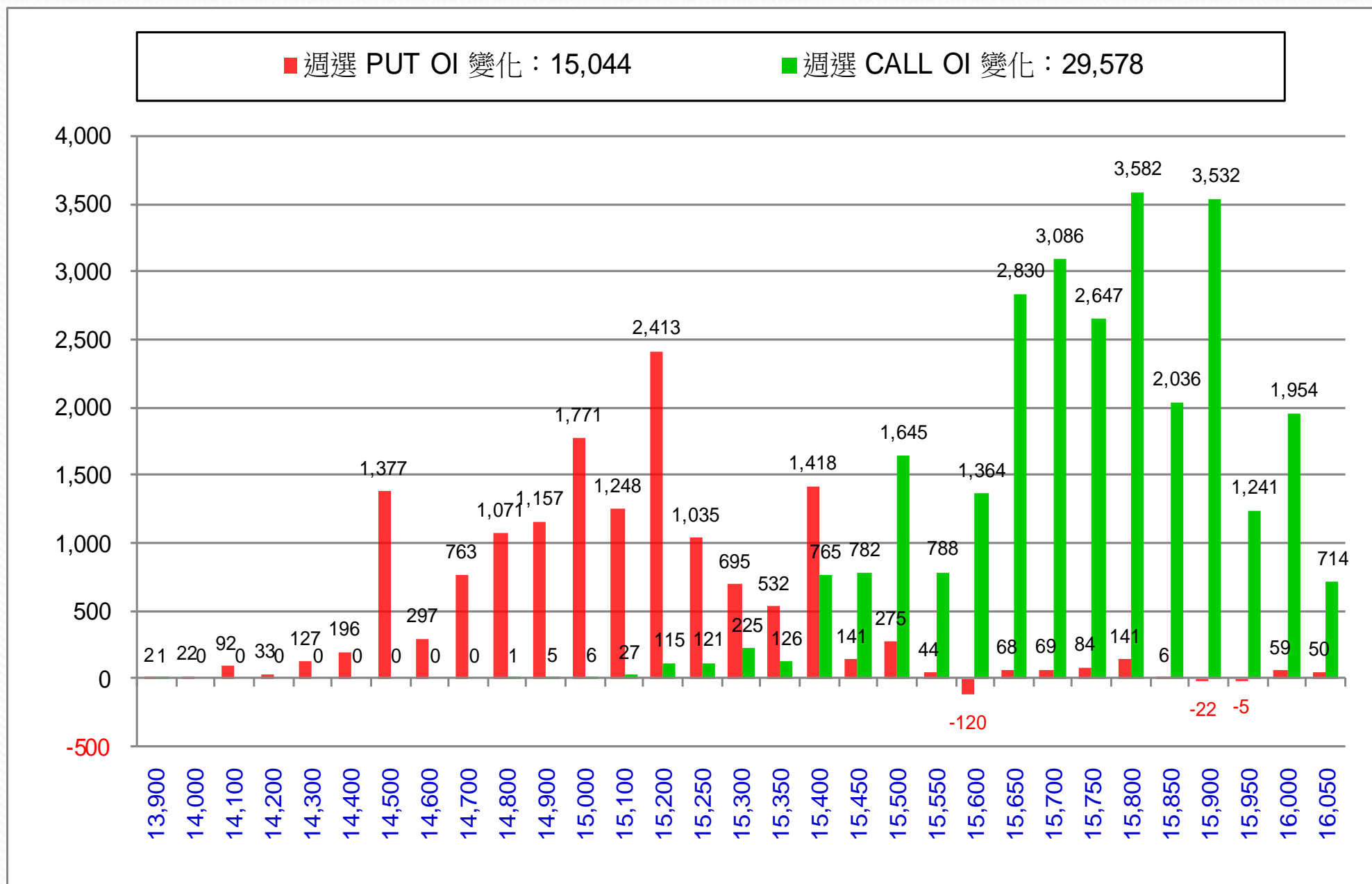
更新日期：2023年2月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2023年2月15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

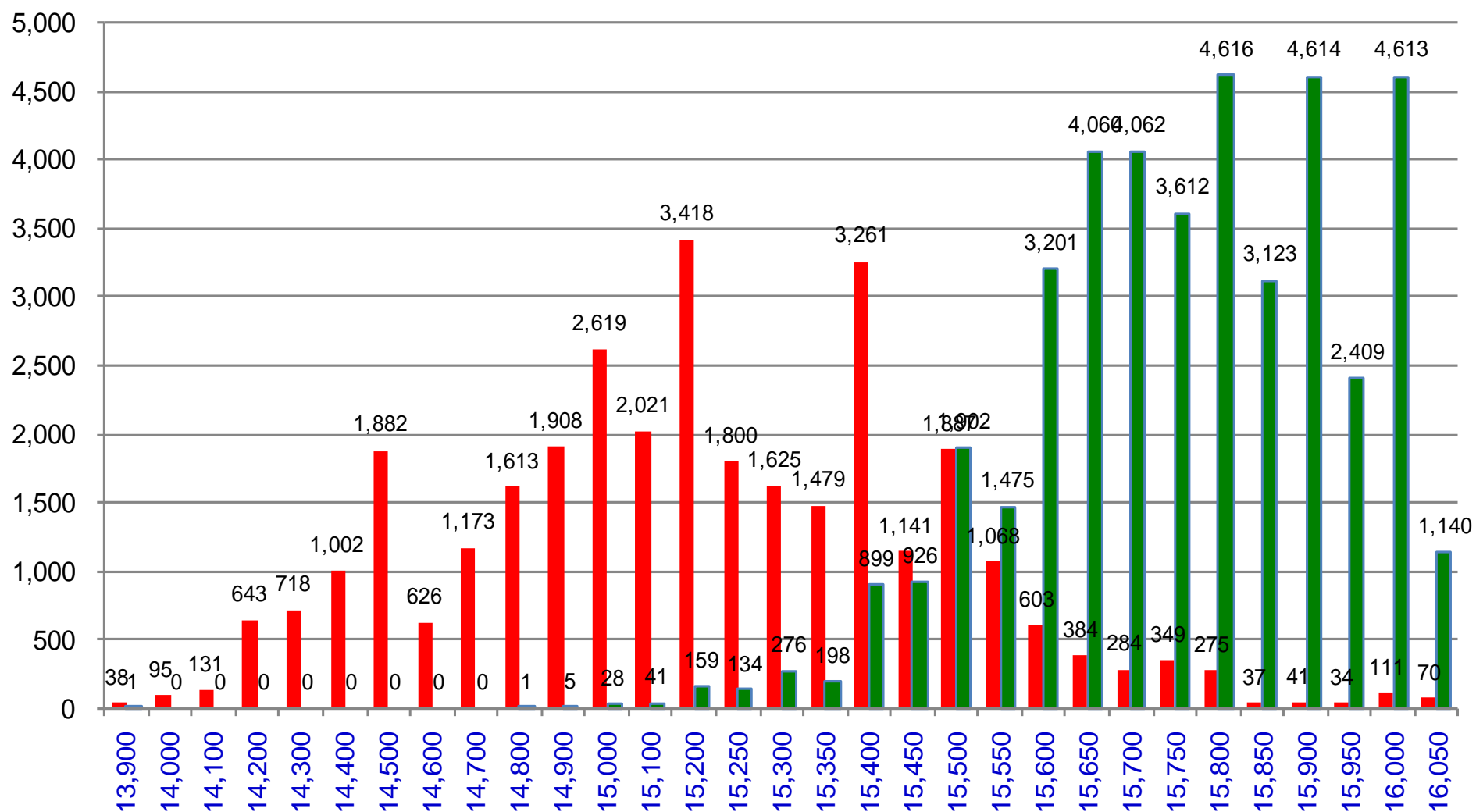


更新日期：2023年2月15日      資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：32,407

週選 CALL OI 總額：51,383



更新日期：2023年2月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

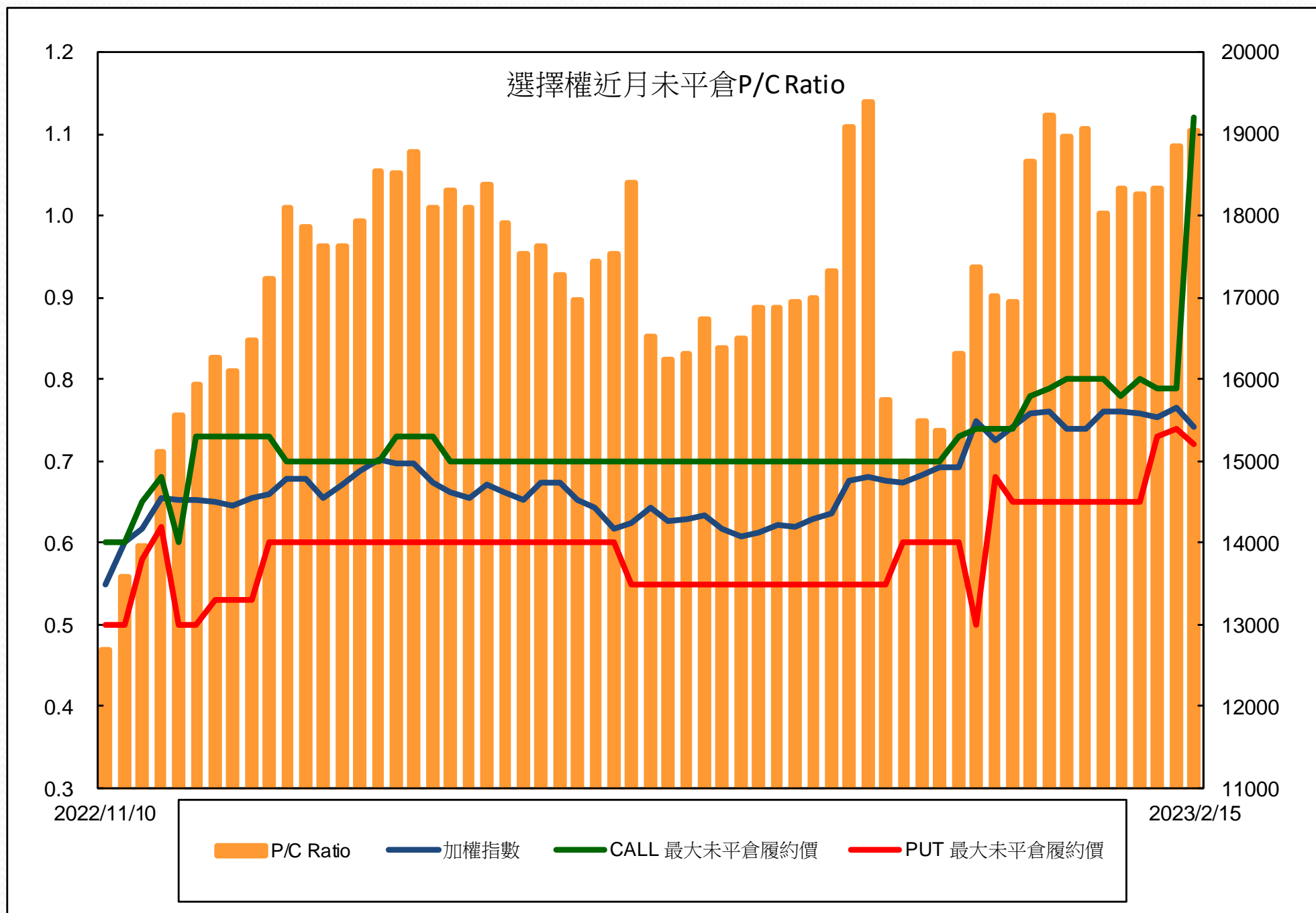


# 自營商選擇權OI部位統計

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14日	101,299	72,660	28,639
	2月15日	48,223	53,268	-5,045
Put	2月14日	81,315	74,105	7,210
	2月15日	40,139	43,182	-3,043

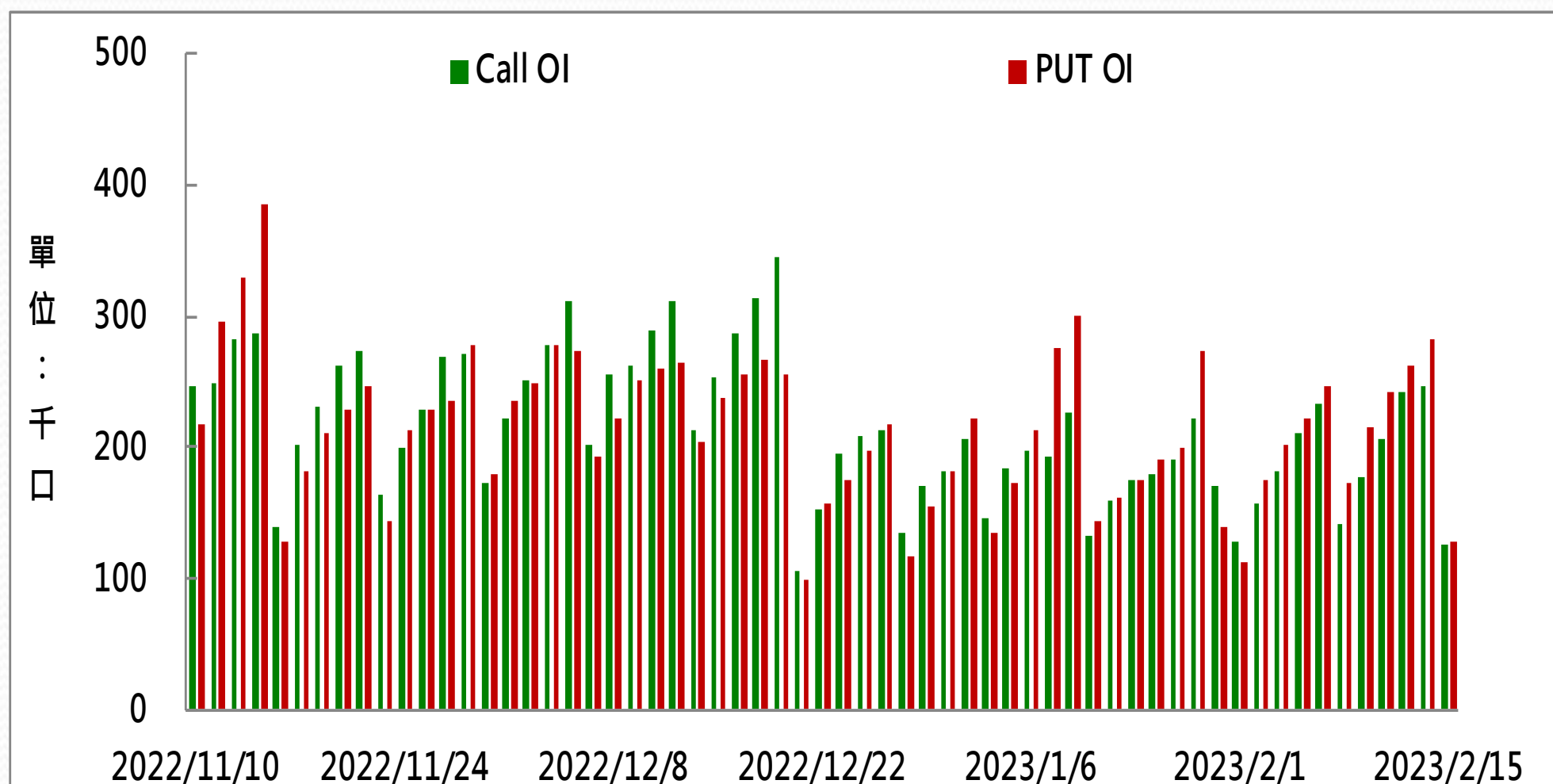
更新日期：2023年2月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

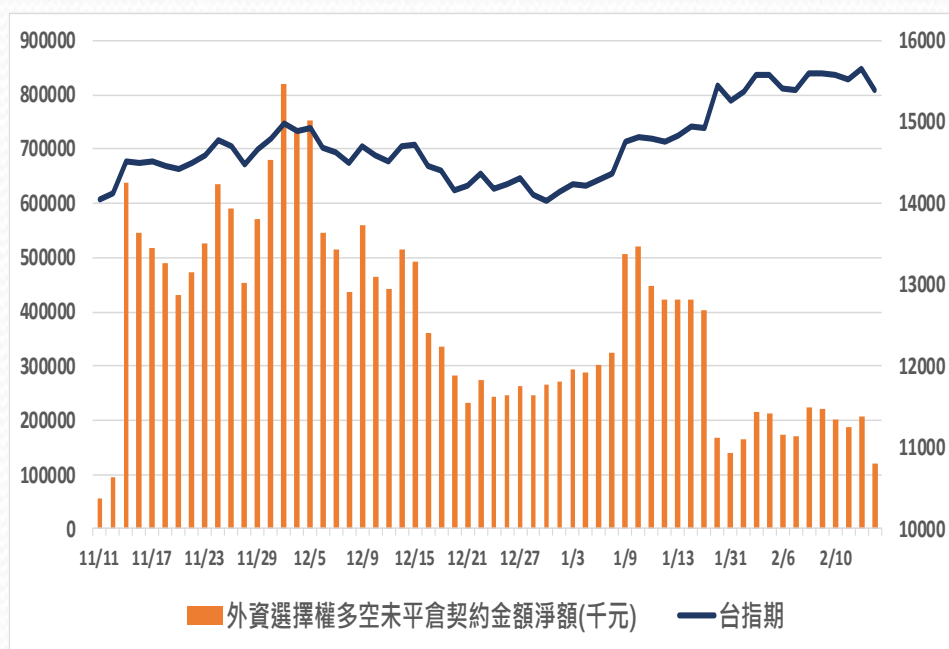
# 選擇權全月Put Call OI



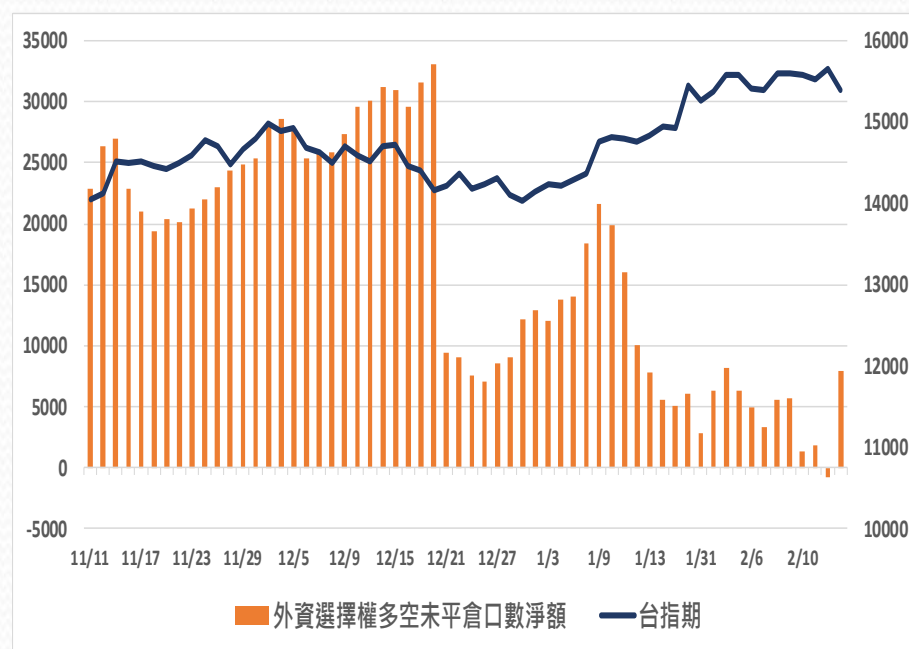
更新日期：2023年2月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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



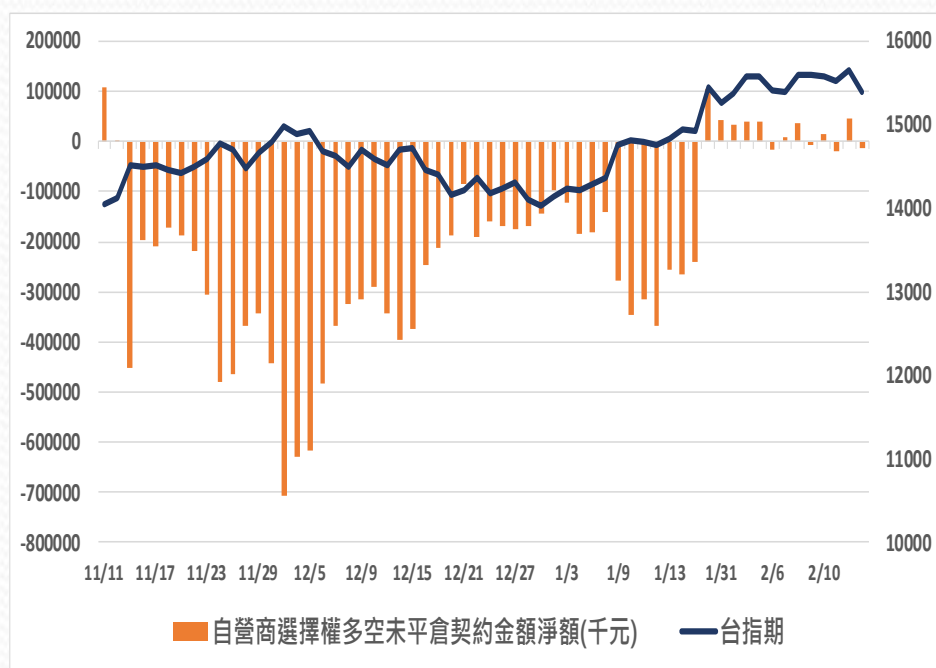
### 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/9	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
2023/2/15	15398	7950	8769	119685	-88799

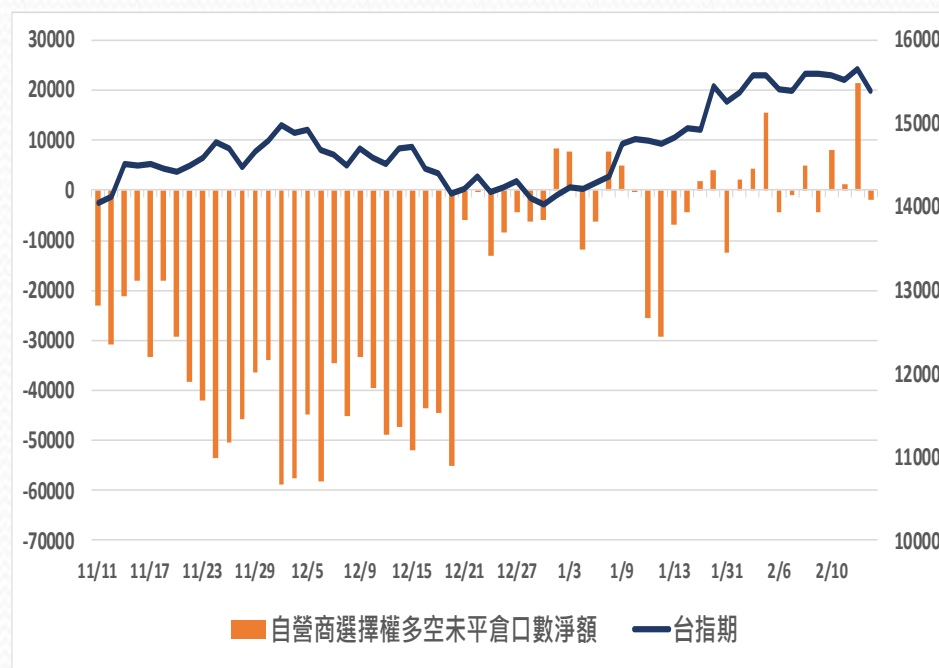
更新日期：2023年2月15日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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



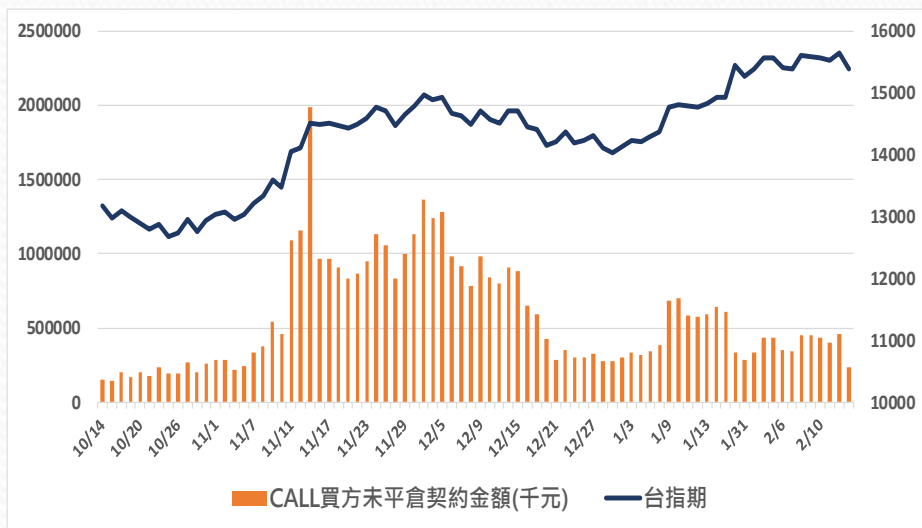
## 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/9	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
2023/2/15	15398	-2002	-23431	-12206	-58124

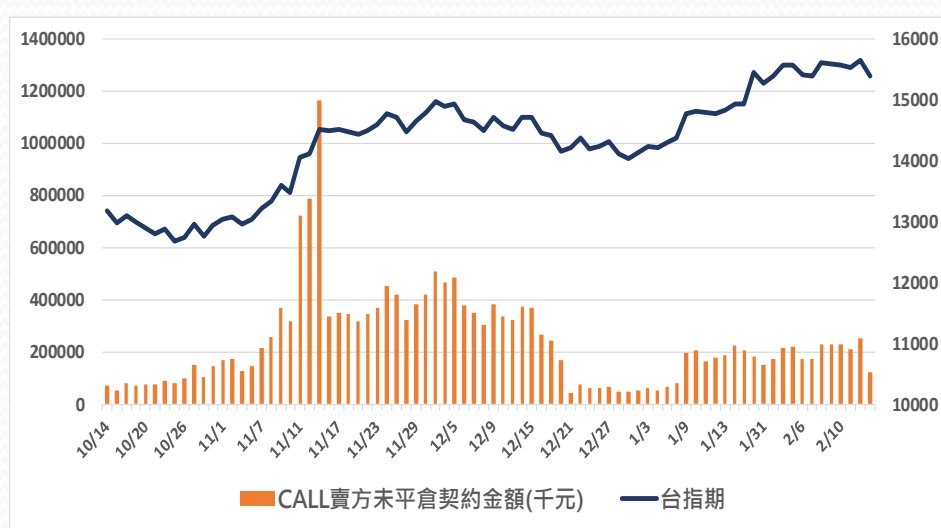
更新日期：2023年2月15日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 外資買賣權未平倉金額

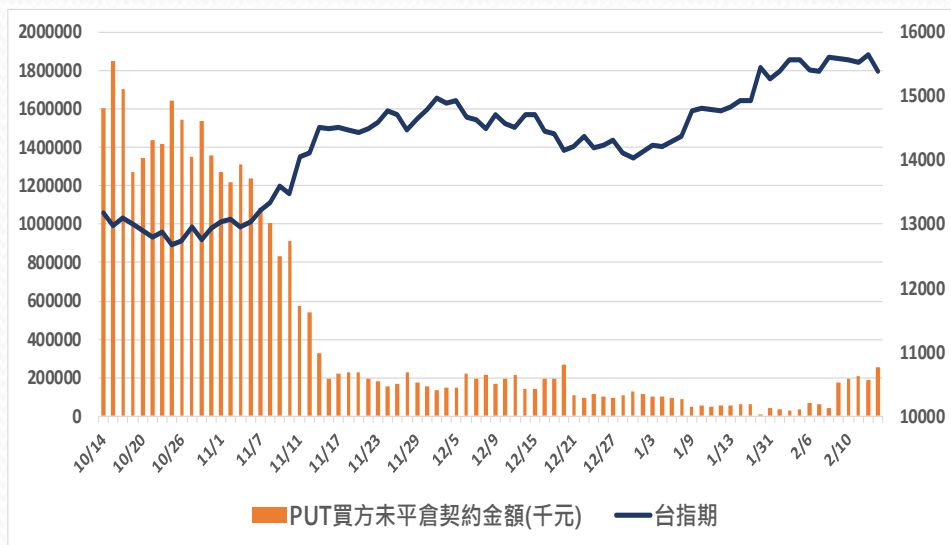
## CALL買方未平倉金額



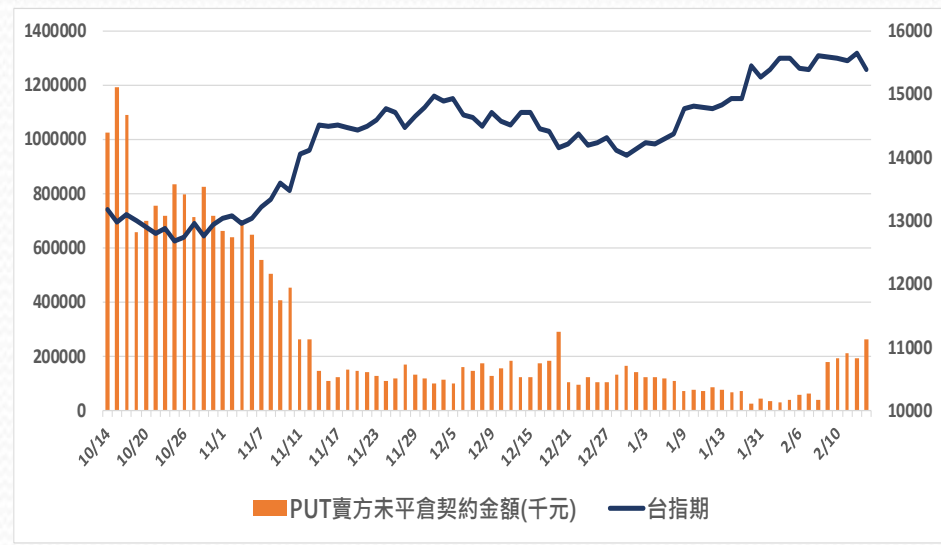
## CALL賣方未平倉金額



## PUT買方未平倉金額



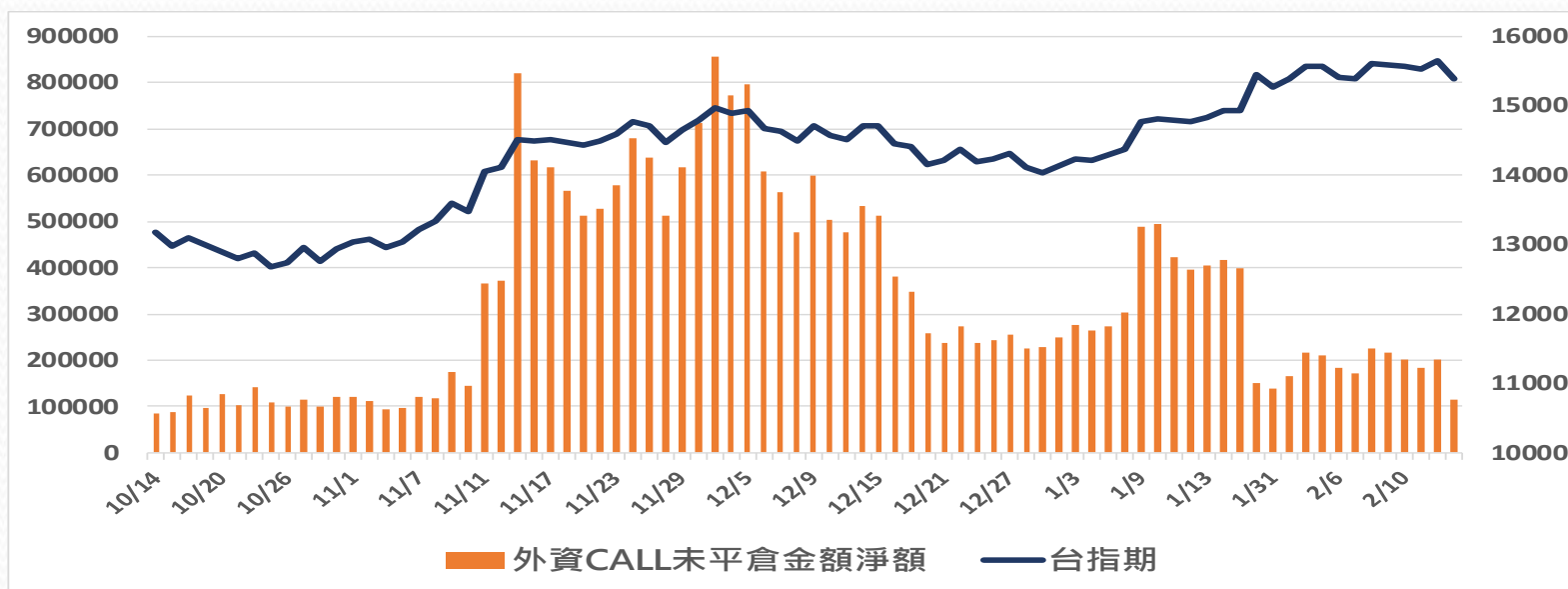
## PUT賣方未平倉金額



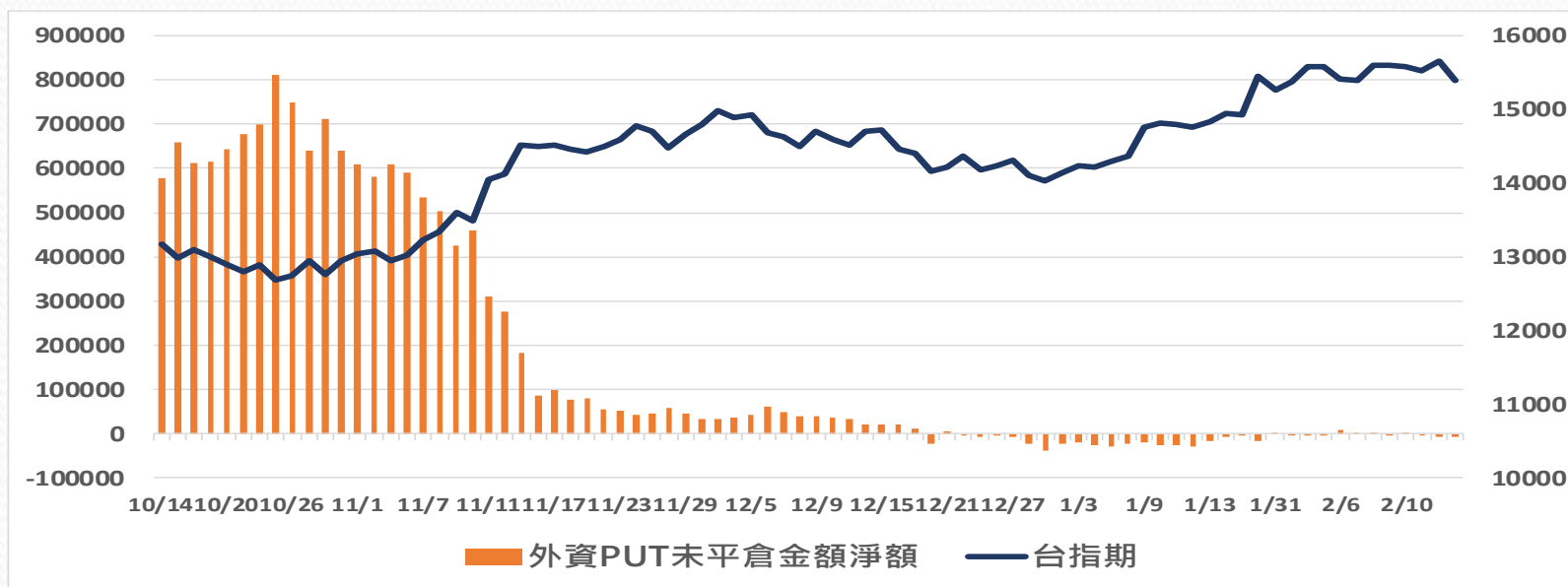
更新日期：2023年2月15日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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15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15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