

台指選擇權 OI 匯報

日期：2023/2/16 結算日：2023/2/22					日期：2023/2/16 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
0	0	14,300	710	-8	0	72	13,800	1,660	347
0	0	14,400	1,039	37	1	12	13,900	1,175	544
0	0	14,500	1,911	29	0	477	14,000	3,072	350
0	0	14,600	1,140	514	0	27	14,100	752	208
1	1	14,700	1,820	647	0	144	14,200	902	6
1	2	14,800	3,769	2,156	0	56	14,300	1,325	60
0	5	14,900	4,715	2,807	-1	269	14,400	1,928	278
14	42	15,000	6,894	4,275	6	91	14,500	2,218	286
24	31	15,050	2,254	838	2	248	14,600	1,914	-182
33	74	15,100	4,132	2,111	4	93	14,700	3,249	656
44	53	15,150	3,210	1,300	3	220	14,800	2,692	214
138	297	15,200	5,087	1,669	1	88	14,900	2,020	385
166	300	15,250	4,122	2,322	10	437	15,000	4,963	712
226	502	15,300	5,990	4,365	15	170	15,100	2,450	93
329	527	15,350	4,168	2,689	50	451	15,200	4,265	339
475	1,374	15,400	8,743	5,482	24	350	15,300	2,277	688
734	1,660	15,450	3,042	1,901	247	1,545	15,400	3,219	1,403
1,192	3,094	15,500	4,318	2,431	335	1,260	15,500	1,508	597
789	2,264	15,550	1,703	635	291	2,576	15,600	900	192
875	4,076	15,600	1,603	1,000	-1	1,428	15,700	297	61
-607	3,453	15,650	1,029	645	555	2,145	15,800	154	28
2,205	6,267	15,700	1,079	795	351	2,455	15,900	89	36
1,733	5,345	15,750	486	137	407	5,855	16,000	114	20
3,044	7,660	15,800	293	18	1,257	4,042	16,100	58	7
2,153	5,276	15,850	47	10	2,509	5,910	16,200	56	-33
3,598	8,212	15,900	90	49	362	2,895	16,300	15	8
178	2,587	15,950	43	9	338	3,238	16,400	4	0
-650	3,963	16,000	127	16	449	2,415	16,500	5	1
964	2,104	16,050	91	21	967	1,798	16,600	2	0
322	1,924	16,100	2	-1	86	801	16,700	0	0
218	3,439	16,200	44	0	79	934	16,800	3	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
17,769	69,168	1.0799	74,694	38,961	9,034	73,669	1.0849	79,921	8,509
昨日 P/C	0.6307	今日增減變化		0.4492	昨日 P/C	1.1049	今日增減變化		-0.0200

更新日期：2023年2月16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16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	97,039,083	47,501,753	49,537,330	23,996,622	2,635,966	643,632	1,992,334	303,673	
投信	27,274,856	51,332,312	-24,057,456	638,779	415,435	0	415,435	5,538	
自營商	38,679,421	21,939,192	16,740,229	-3,399,902	997,630	716,772	280,858	35,497	
	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	289,488	1,633,651	-1,344,163	2,641	17,884	2,981	14,903	-1,333	
投信	117,360	0	117,360	450	0	0	0	0	
自營商	397,459	103,277	294,182	-54,989	59,612	107,300	-47,688	-1,932	

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16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	21,086	10,273	10,813	1,221	23,960	22,560	1,400	-242	
投信	100	50	50	-50	100	113	-13	0	
自營商	61,603	51,264	10,339	15,384	52,373	58,301	-5,928	-2,885	
特定法人(週)	4,283	0	4,283	170	0	2,555	-2,555	-558	
特定法人(近月)	11,283	2,517	8,766	1,783	6,510	7,999	-1,489	272	
特定法人(全月)	15,252	2,609	12,643	-21	9,311	14,347	-5,036	-2,708	
十大交易人(週)	33,801	23,840	9,961	5,903	38,113	26,015	12,098	11,100	
十大交易人(近月)	45,517	40,106	5,411	1,935	46,452	34,701	11,751	3,412	
十大交易人(全月)	81,335	60,866	20,469	10,084	84,602	65,652	18,950	15,282	
全市場未沖銷(近月)			73,669	9,034			79,921	8,509	
全市場未沖銷(全月)			158,674	32,653			185,223	58,313	

更新日期：2023年2月16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	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	13.33%	較前一交易日	-1.99%
	買權隱含波動率	12.54%	較前一交易日	-0.62%
	賣權隱含波動率	13.99%	較前一交易日	-4.38%
電子選擇權	買權成交最大量	740	買權OI最大量	750
	賣權成交最大量	695	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	1560	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年2月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

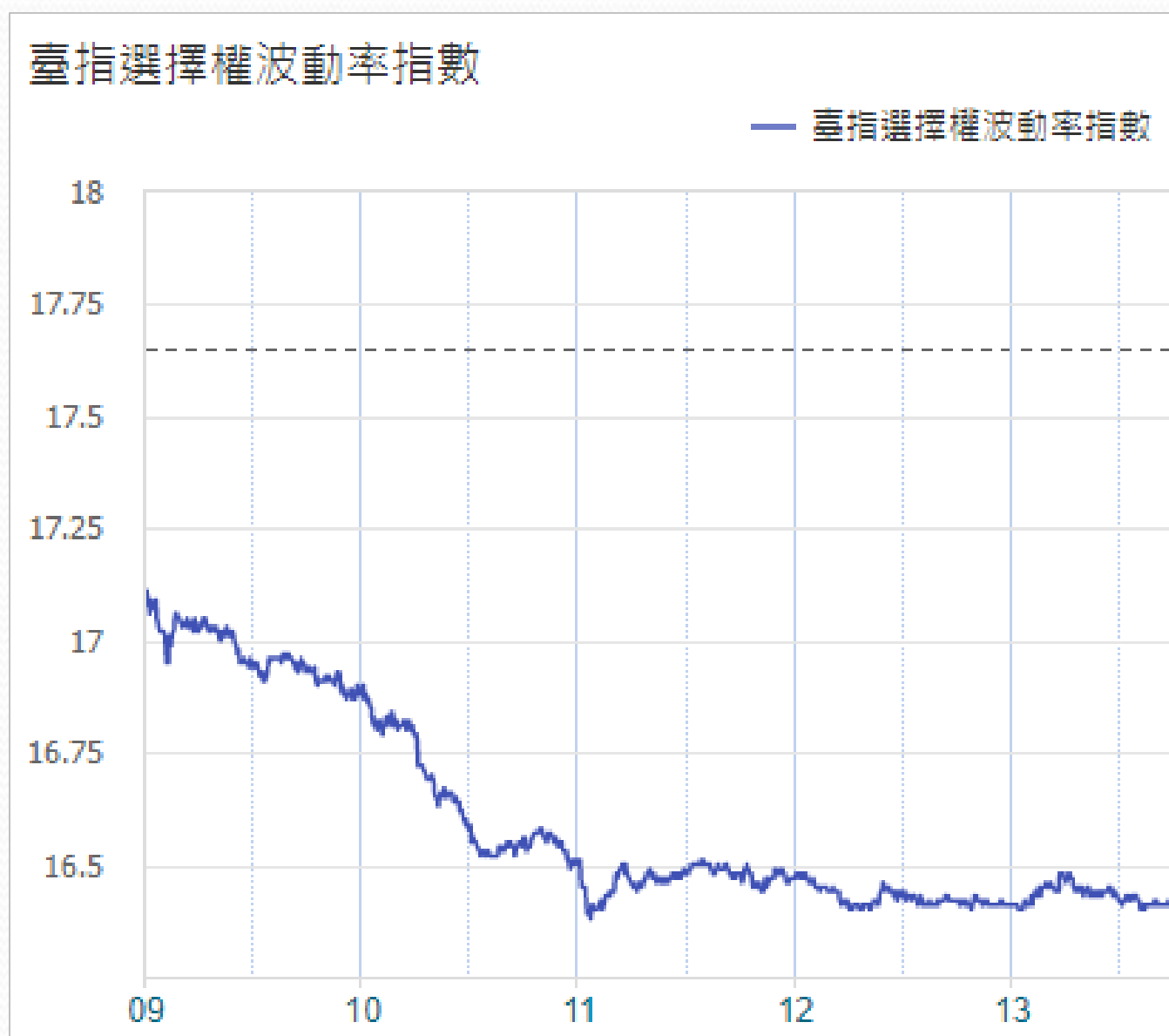
台指選擇權匯報

2023年03月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16200	買權OI最大量	19200
	賣權成交最大量	14700	賣權OI最大量	10000
	整體隱含波動率	16.02%	較前一交易日	+0.02%
	買權隱含波動率	13.75%	較前一交易日	+0.38%
	賣權隱含波動率	17.93%	較前一交易日	-0.94%
	成交量P/C_Ratio值	1.070	較前一交易日	+0.13
	未平倉P/C_Ratio值	1.085	較前一交易日	-0.02
電子選擇權	買權成交最大量	740	買權OI最大量	750
	賣權成交最大量	695	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	1560	賣權OI最大量	1480

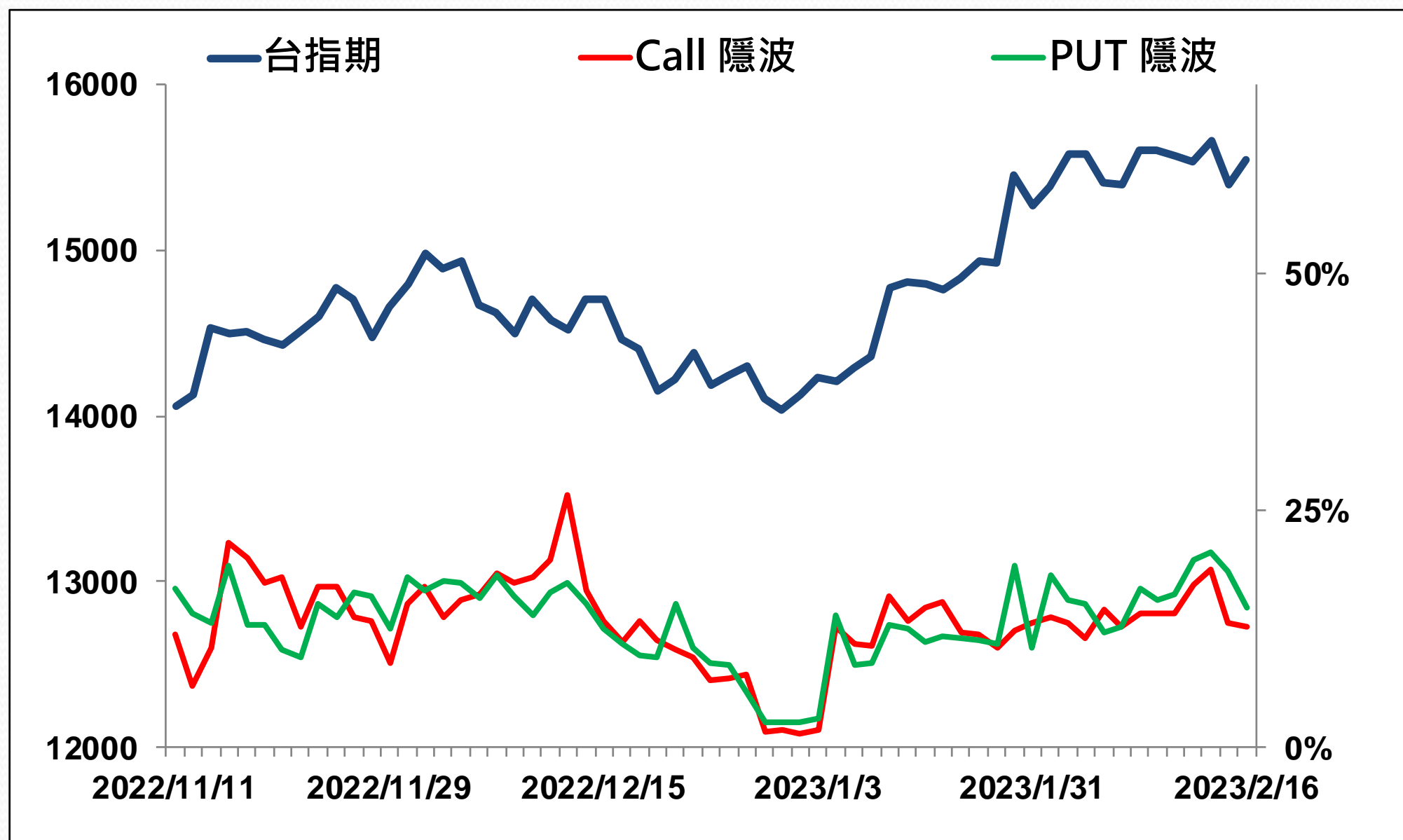
更新日期：2023年2月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



更新日期：2023年2月16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

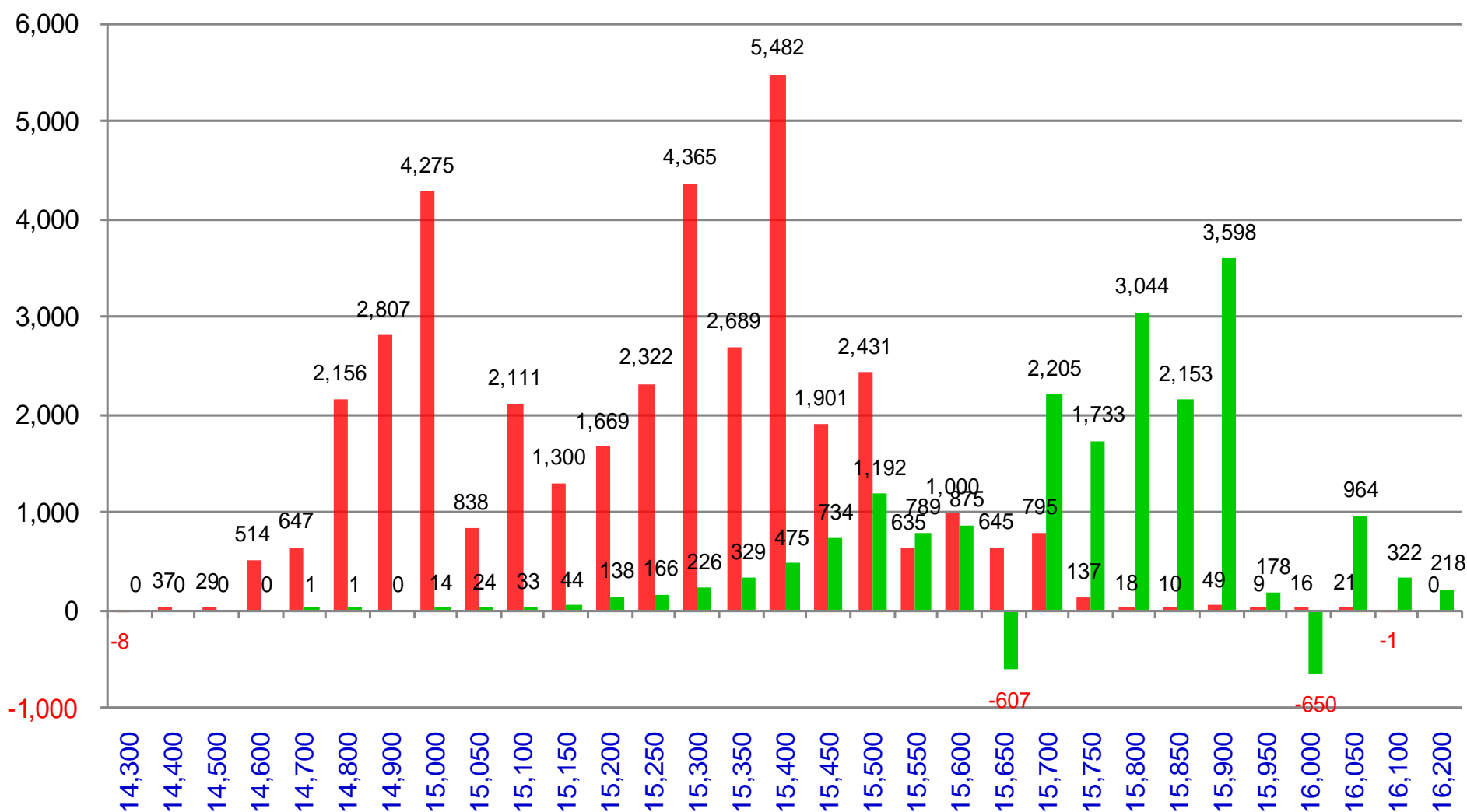


更新日期：2023年2月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：38,961

週選 CALL OI 變化：17,769

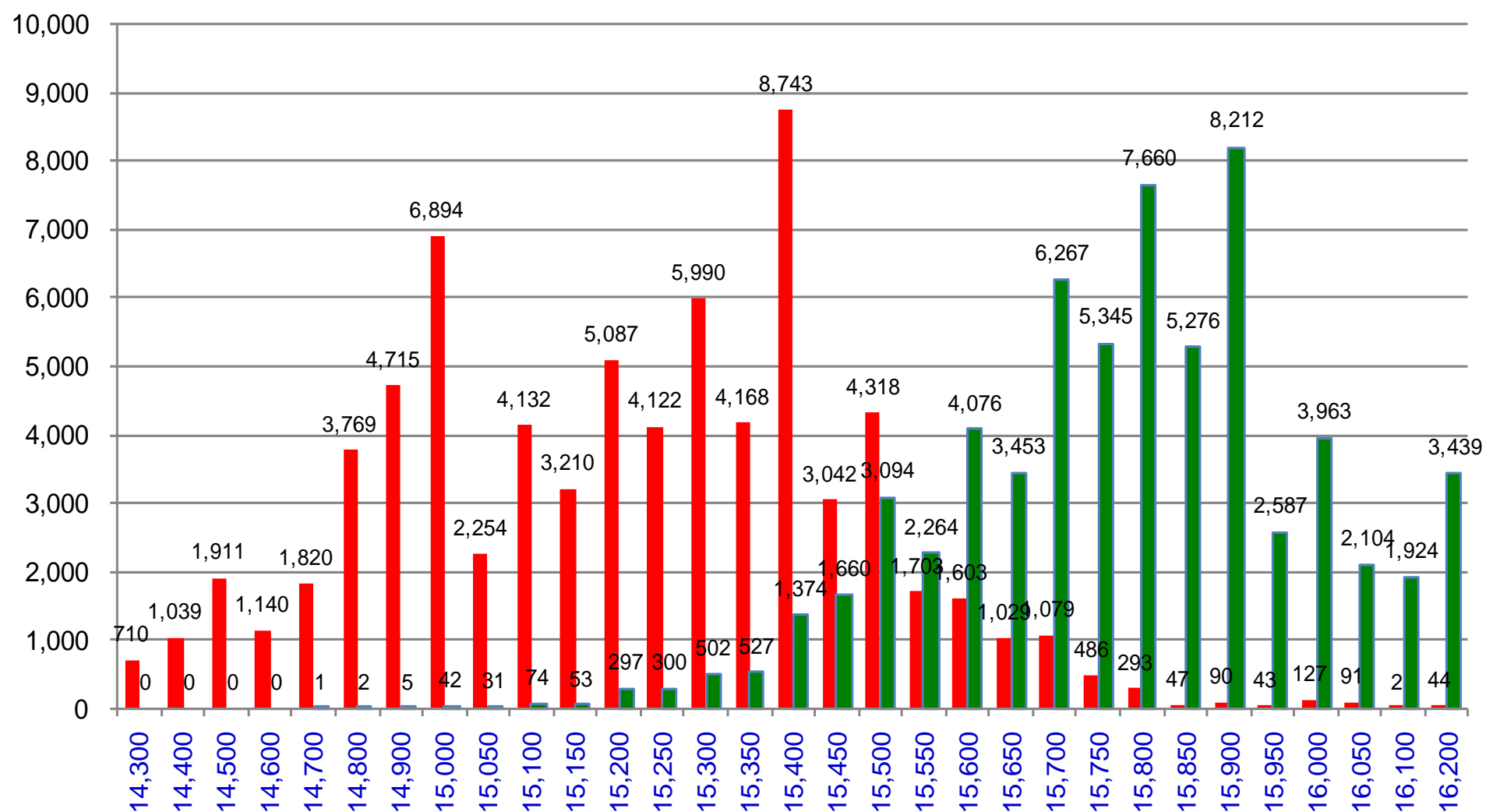


更新日期：2023年2月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：74,694

■ 週選 CALL OI 總額：69,168



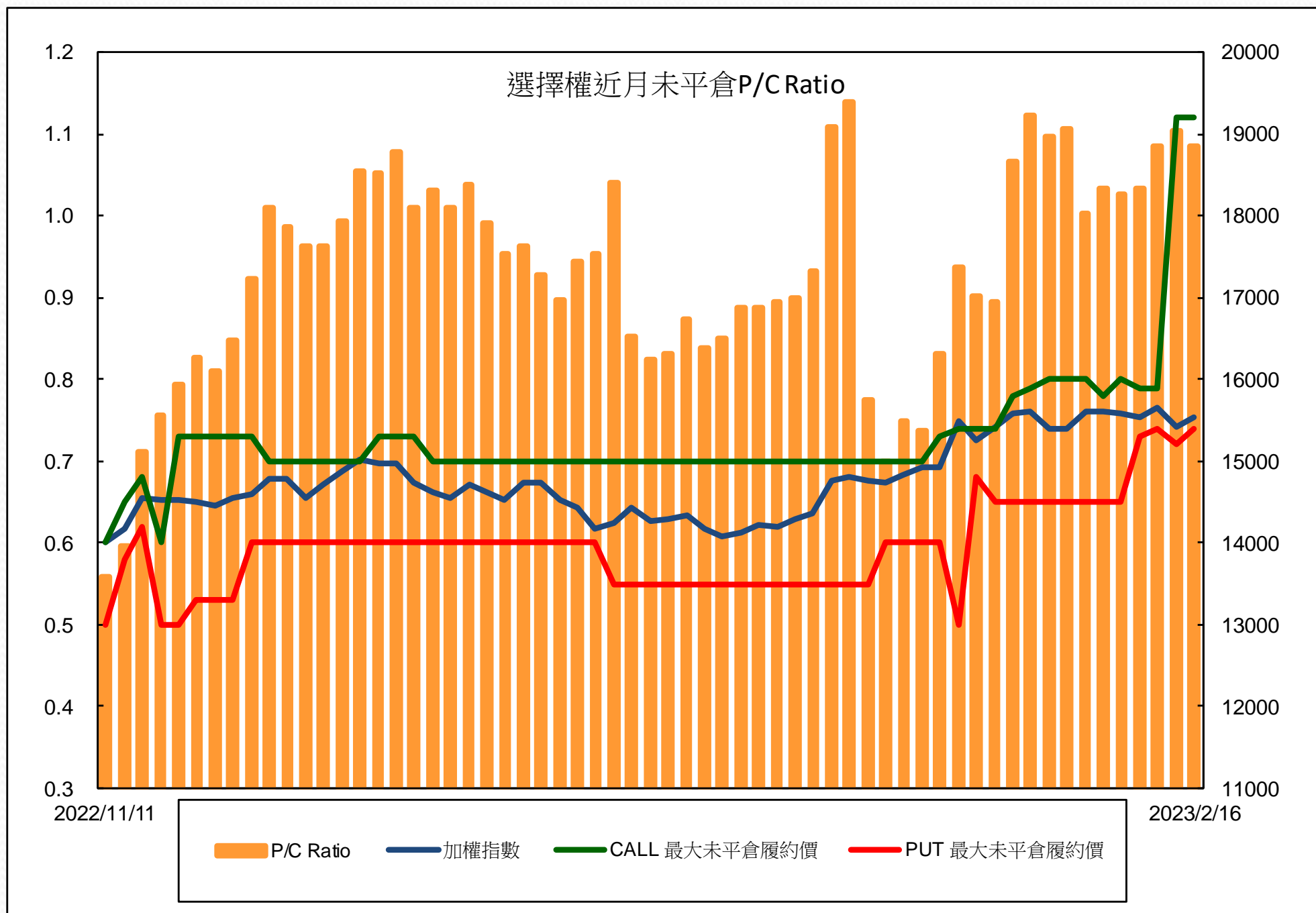
更新日期：2023年2月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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15日	48,223	53,268	-5,045
	2月16日	61,603	51,264	10,339
Put	2月15日	40,139	43,182	-3,043
	2月16日	52,373	58,301	-5,928

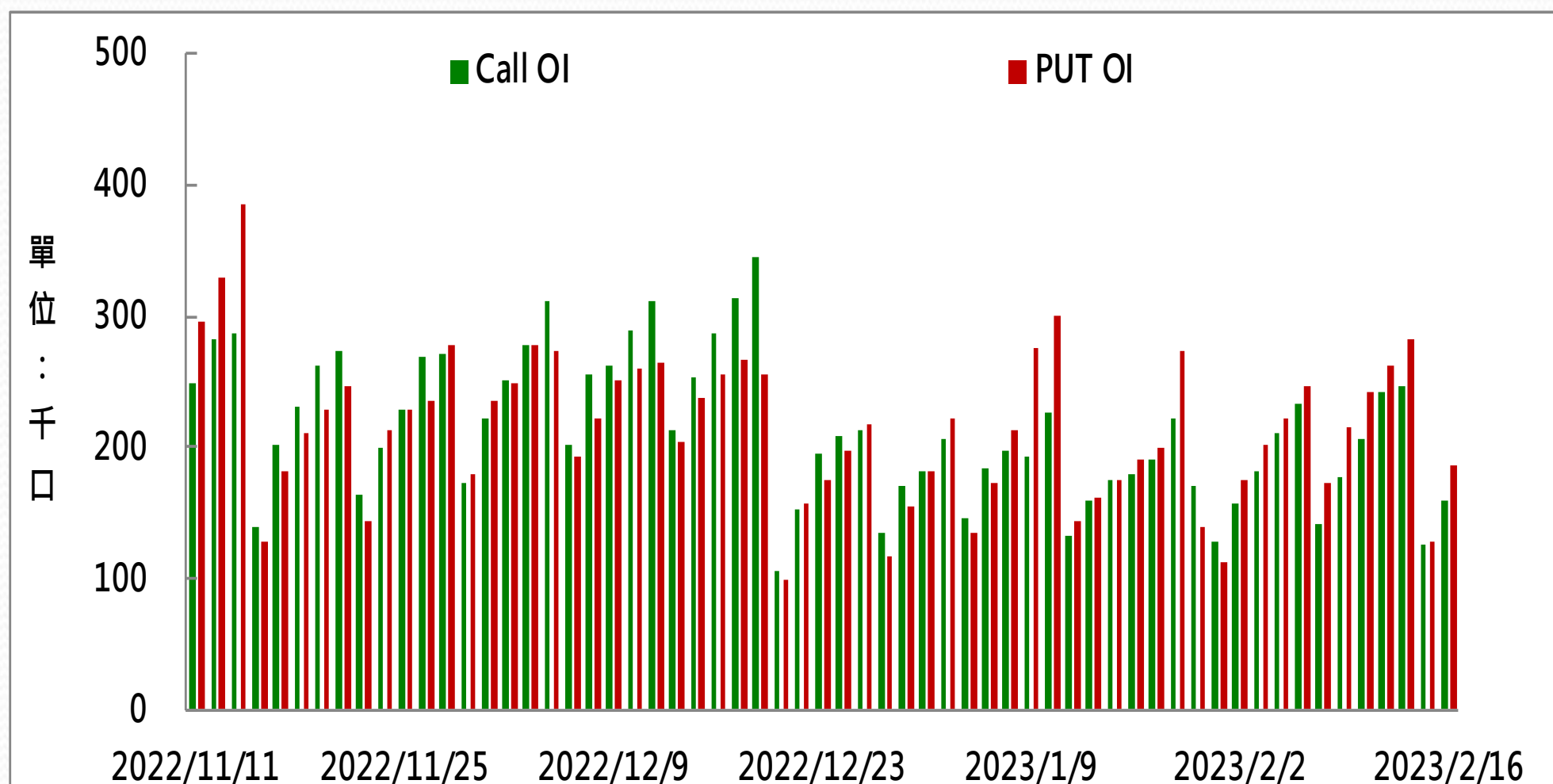
更新日期：2023年2月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

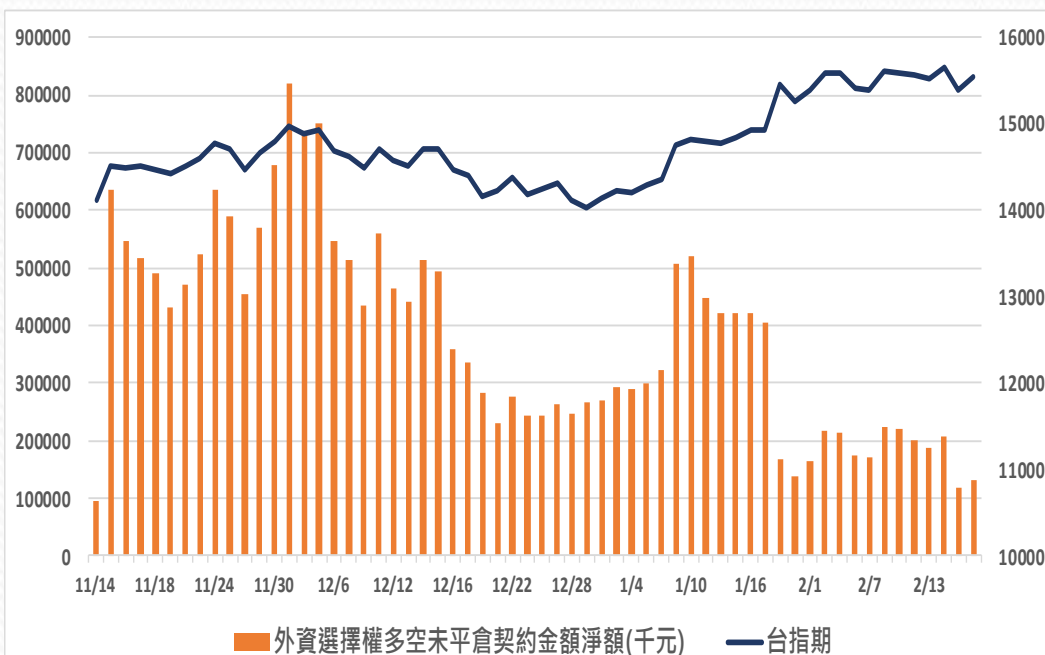
選擇權全月Put Call OI



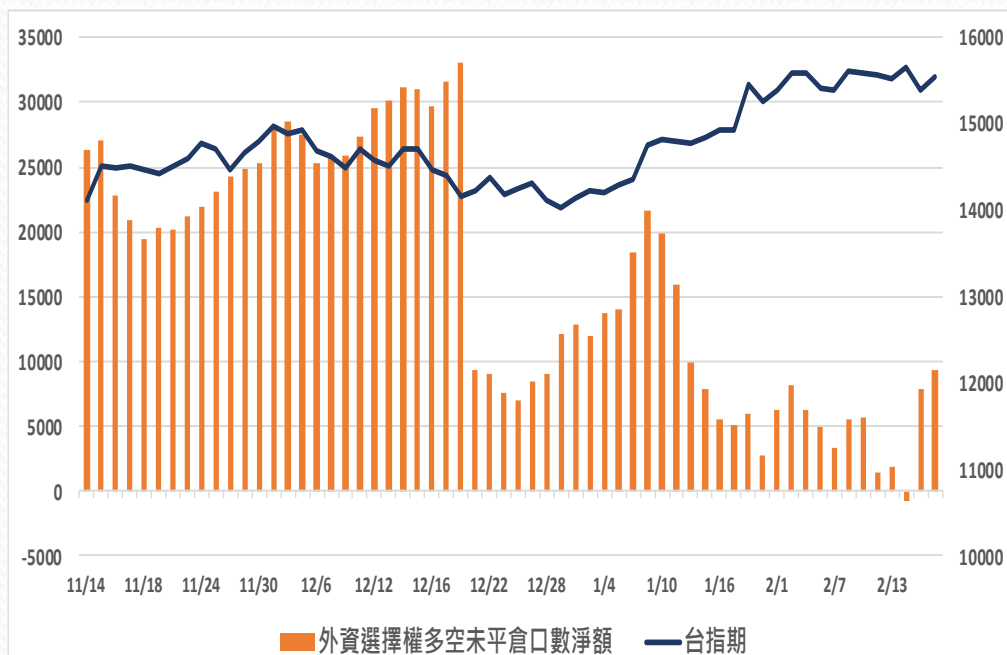
更新日期：2023年2月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



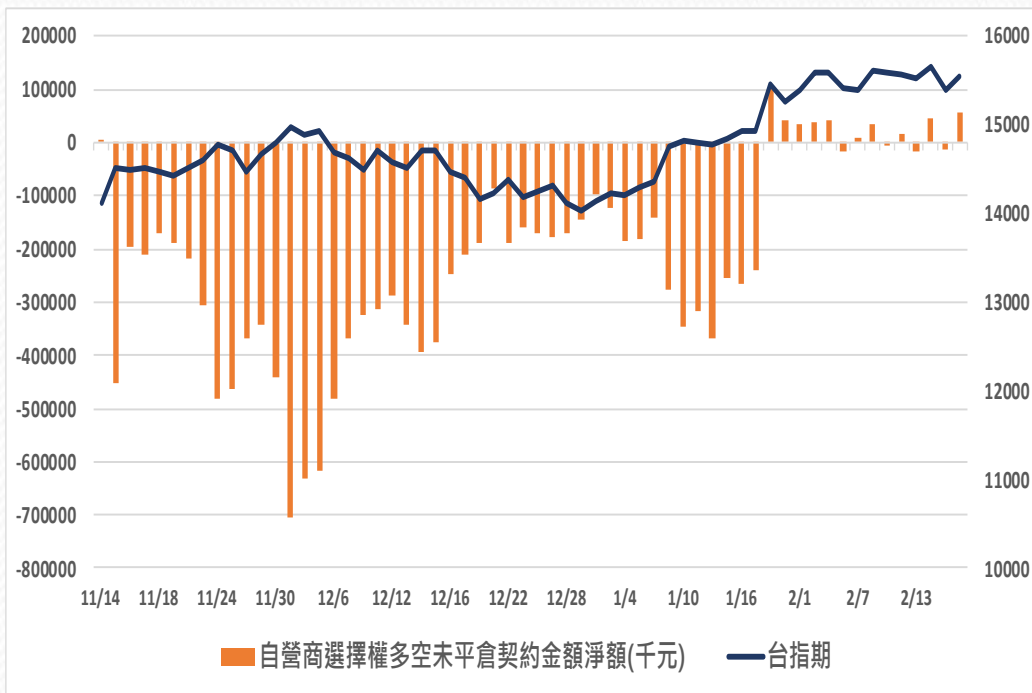
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/10	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
2023/2/16	15543	9413	1463	132305	12620

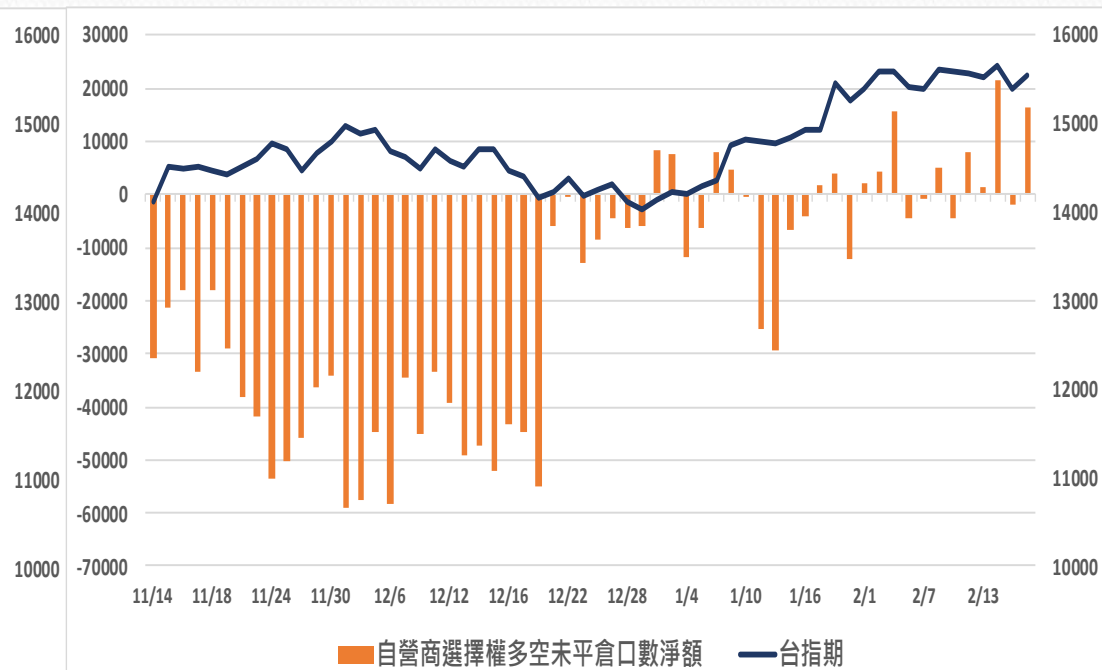
更新日期：2023年2月16日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



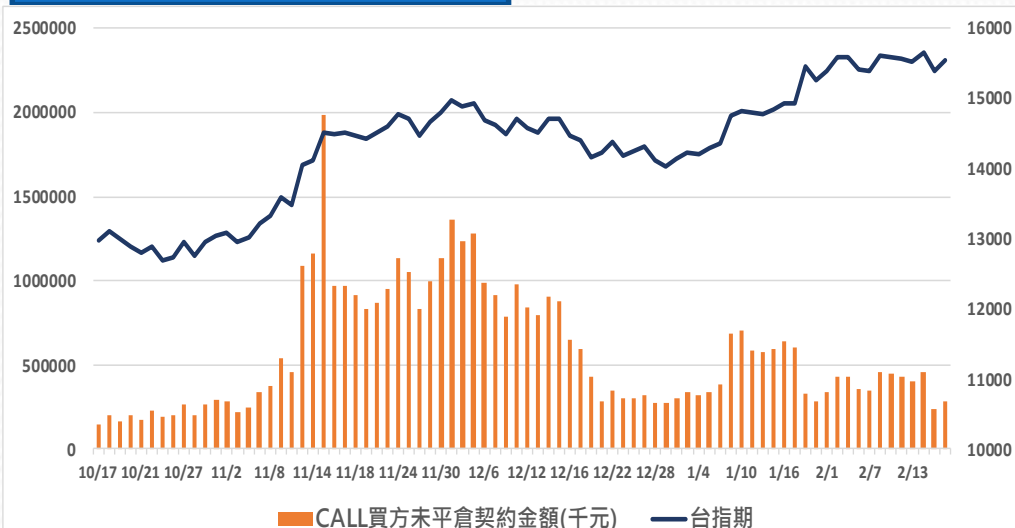
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/10	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
2023/2/16	15543	16267	18269	56386	68592

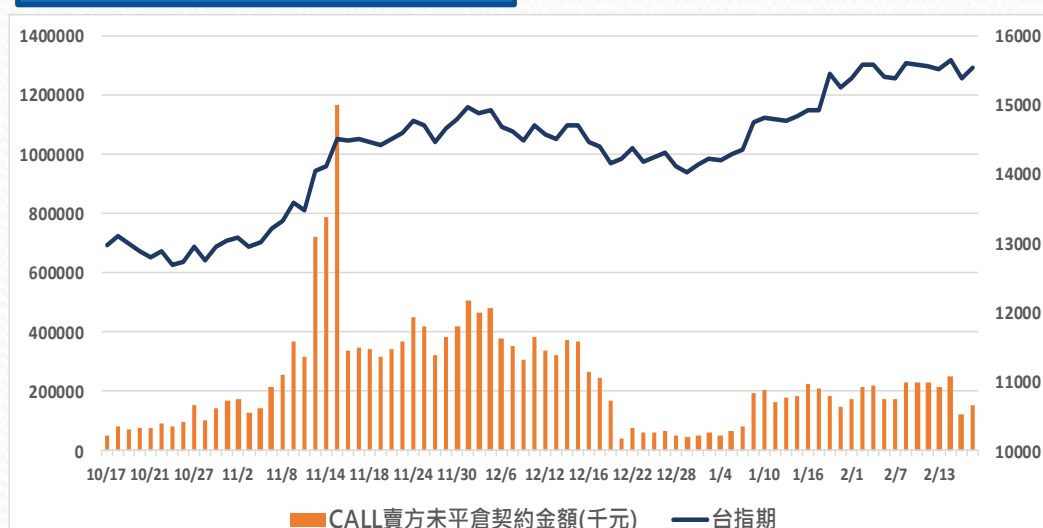
更新日期：2023年2月16日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

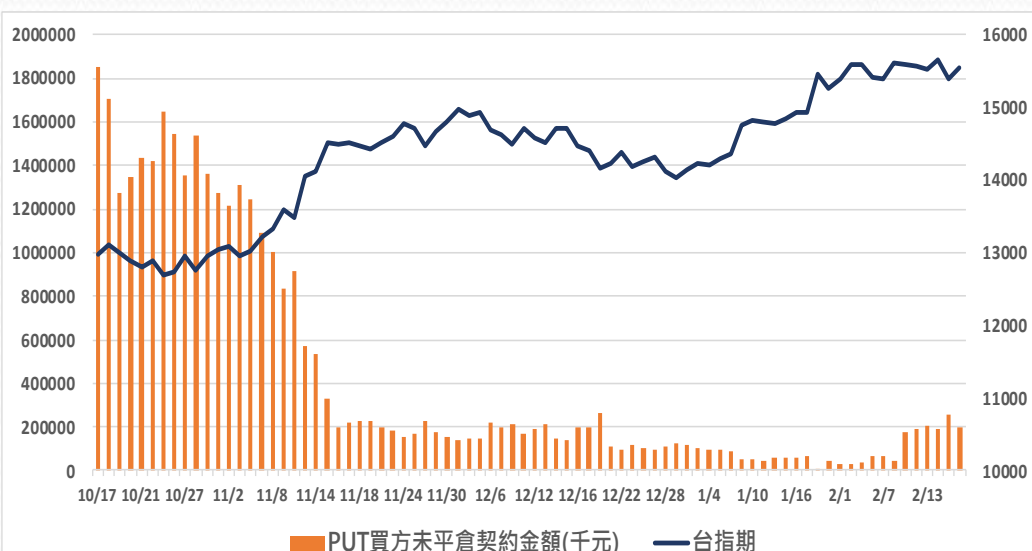
CALL買方未平倉金額



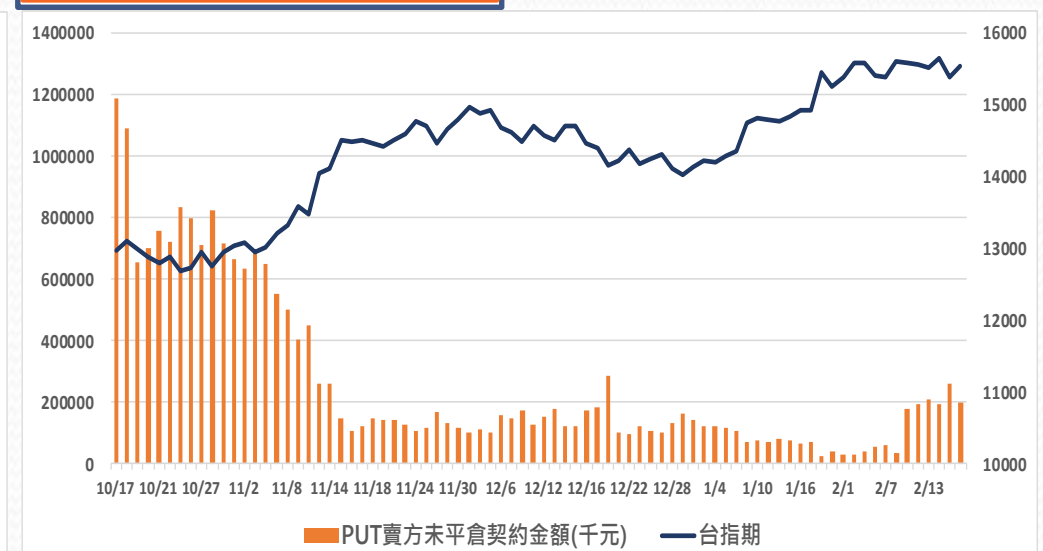
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



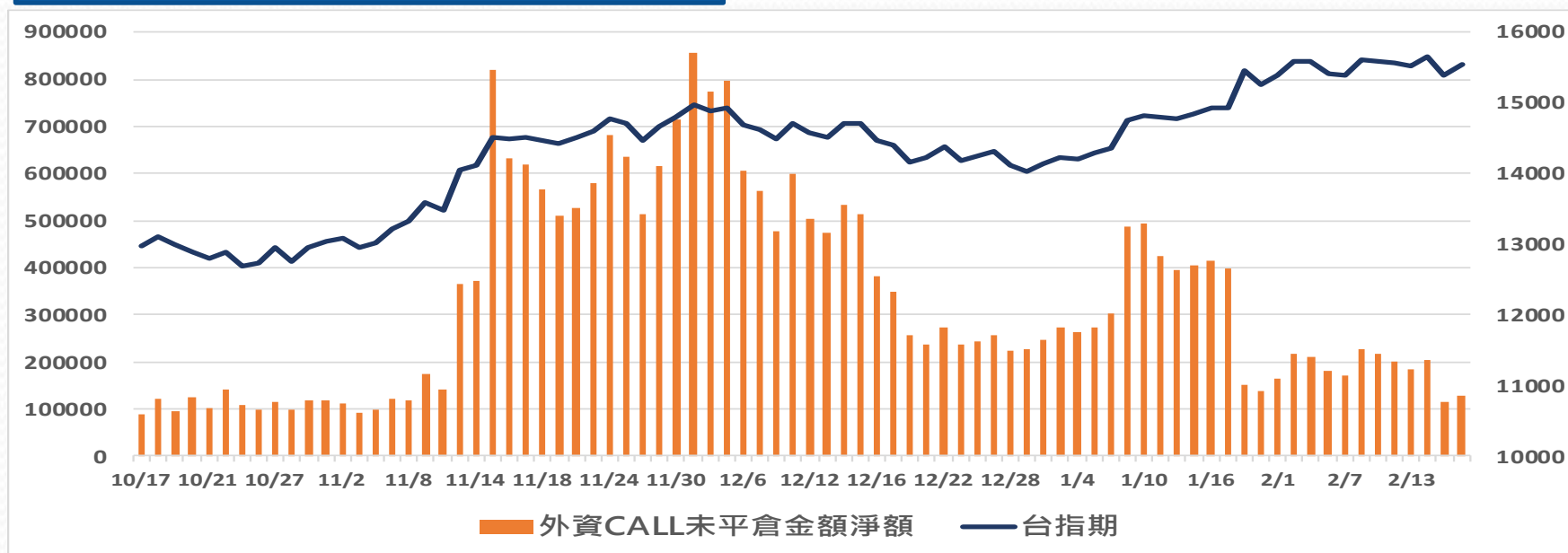
PUT賣方未平倉金額



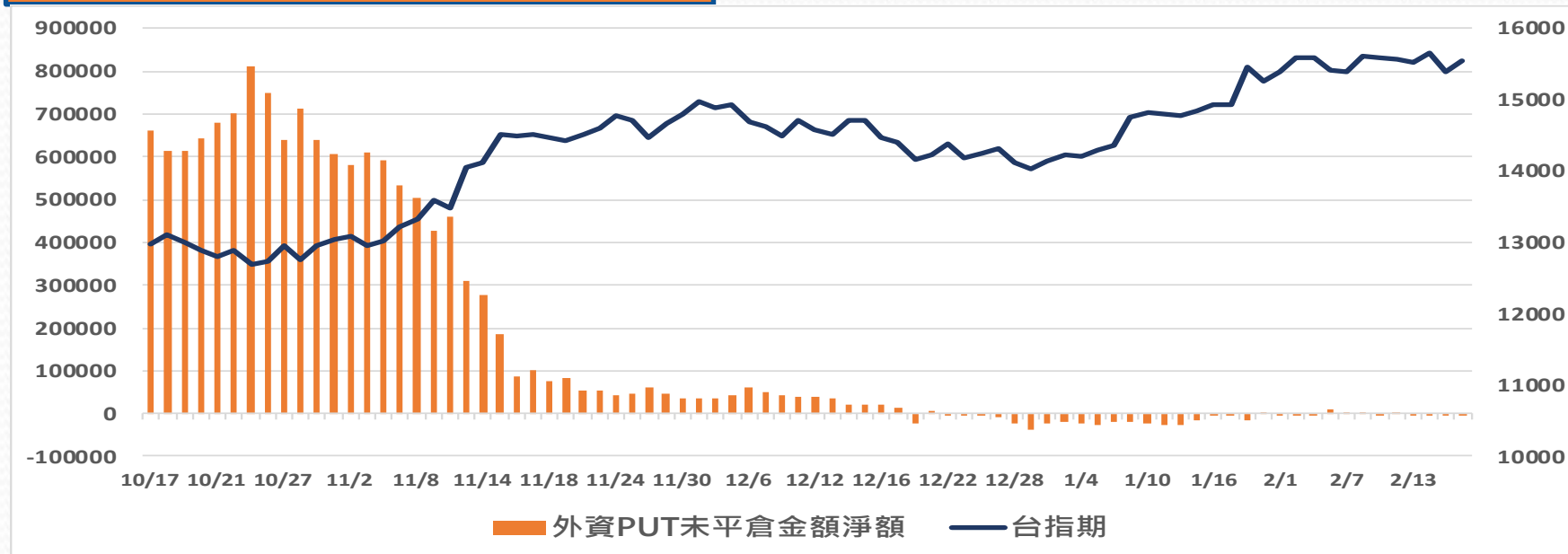
更新日期：2023年2月16日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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16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16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