

# 台指選擇權OI匯報

日期：2023/2/17 結算日：2023/2/22					日期：2023/2/17 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	14,200	640	-4	0	1	13,700	713	-6
0	0	14,300	701	-9	0	72	13,800	1,566	-94
0	0	14,400	1,054	15	0	12	13,900	1,403	228
0	0	14,500	2,023	112	0	477	14,000	3,865	793
0	0	14,600	1,162	22	0	27	14,100	1,685	933
0	1	14,700	1,922	102	-1	143	14,200	935	33
0	2	14,800	4,064	295	0	56	14,300	1,569	244
0	5	14,900	5,808	1,093	0	269	14,400	2,349	421
-1	41	15,000	7,410	516	1	92	14,500	3,402	1,184
0	31	15,050	4,409	2,155	-1	247	14,600	2,184	270
16	90	15,100	6,835	2,703	1	94	14,700	4,482	1,233
-7	46	15,150	5,261	2,051	7	227	14,800	3,067	375
31	328	15,200	7,175	2,088	4	92	14,900	2,368	348
122	422	15,250	5,003	881	32	469	15,000	5,428	465
238	740	15,300	7,986	1,996	19	189	15,100	2,529	79
230	757	15,350	4,625	457	30	481	15,200	4,463	198
726	2,100	15,400	8,079	-664	54	404	15,300	2,260	-17
1,298	2,958	15,450	3,434	392	219	1,764	15,400	3,323	104
1,789	4,883	15,500	2,998	-1,320	115	1,375	15,500	1,448	-60
2,208	4,472	15,550	1,515	-188	175	2,751	15,600	873	-27
2,720	6,796	15,600	1,388	-215	266	1,694	15,700	252	-45
4,198	7,651	15,650	840	-189	628	2,773	15,800	150	-4
4,057	10,324	15,700	1,037	-42	594	3,049	15,900	147	58
3,035	8,380	15,750	419	-67	1,627	7,482	16,000	149	35
2,649	10,309	15,800	249	-44	1,144	5,186	16,100	78	20
405	5,681	15,850	46	-1	1,642	7,552	16,200	55	-1
-38	8,174	15,900	128	38	304	3,199	16,300	12	-3
1,144	3,731	15,950	29	-14	252	3,490	16,400	4	0
2,886	6,849	16,000	124	-3	153	2,568	16,500	4	-1
-104	2,000	16,050	91	0	-489	1,309	16,600	2	0
366	2,290	16,100	2	0	113	914	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
28,353	97,521	0.8906	86,848	12,154	6,643	80,312	1.0797	86,716	6,795
昨日 P/C	1.0799	今日增減變化	-0.1893		昨日 P/C	1.0849	今日增減變化	-0.0051	

更新日期：2023年2月17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17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	95,287,644	41,293,699	53,993,945	4,456,615	2,627,192	612,722	2,014,470	22,136	
投信	24,358,008	50,957,323	-26,599,315	-2,541,859	410,408	0	410,408	-5,027	
自營商	37,898,559	21,410,221	16,488,338	-251,891	1,005,790	916,161	89,629	-191,229	
	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	338,367	1,764,230	-1,425,863	-81,700	49,124	0	49,124	34,221	
投信	118,035	0	118,035	675	0	0	0	0	
自營商	432,795	119,608	313,187	19,005	66,971	141,387	-74,416	-26,728	

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17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	26,649	12,497	14,152	3,339	28,943	24,251	4,692	3,292	
投信	100	50	50	0	100	113	-13	0	
自營商	67,008	60,195	6,813	-3,526	58,285	62,140	-3,855	2,073	
特定法人(週)	7,601	0	7,601	3,318	0	4,335	-4,335	-1,780	
特定法人(近月)	12,526	2,527	9,999	1,233	7,592	8,348	-756	733	
特定法人(全月)	15,999	0	15,999	3,356	9,619	17,334	-7,715	-2,679	
十大交易人(週)	39,839	37,441	2,398	-7,563	41,067	30,114	10,953	-1,145	
十大交易人(近月)	48,468	42,633	5,835	424	48,606	36,915	11,691	-60	
十大交易人(全月)	89,681	71,346	18,335	-2,134	89,527	71,850	17,677	-1,273	
全市場未沖銷(近月)			80,312	6,643			86,716	6,795	
全市場未沖銷(全月)			198,049	39,375			209,834	24,611	

更新日期：2023年2月17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	15600	買權OI最大量	15700
	賣權成交最大量	15400	賣權OI最大量	15400
	整體隱含波動率	12.32%	較前一交易日	-1.01%
	買權隱含波動率	10.07%	較前一交易日	-2.47%
	賣權隱含波動率	14.86%	較前一交易日	+0.87%
電子選擇權	買權成交最大量	755	買權OI最大量	755
	賣權成交最大量	725	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1620	買權OI最大量	1580
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年2月17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

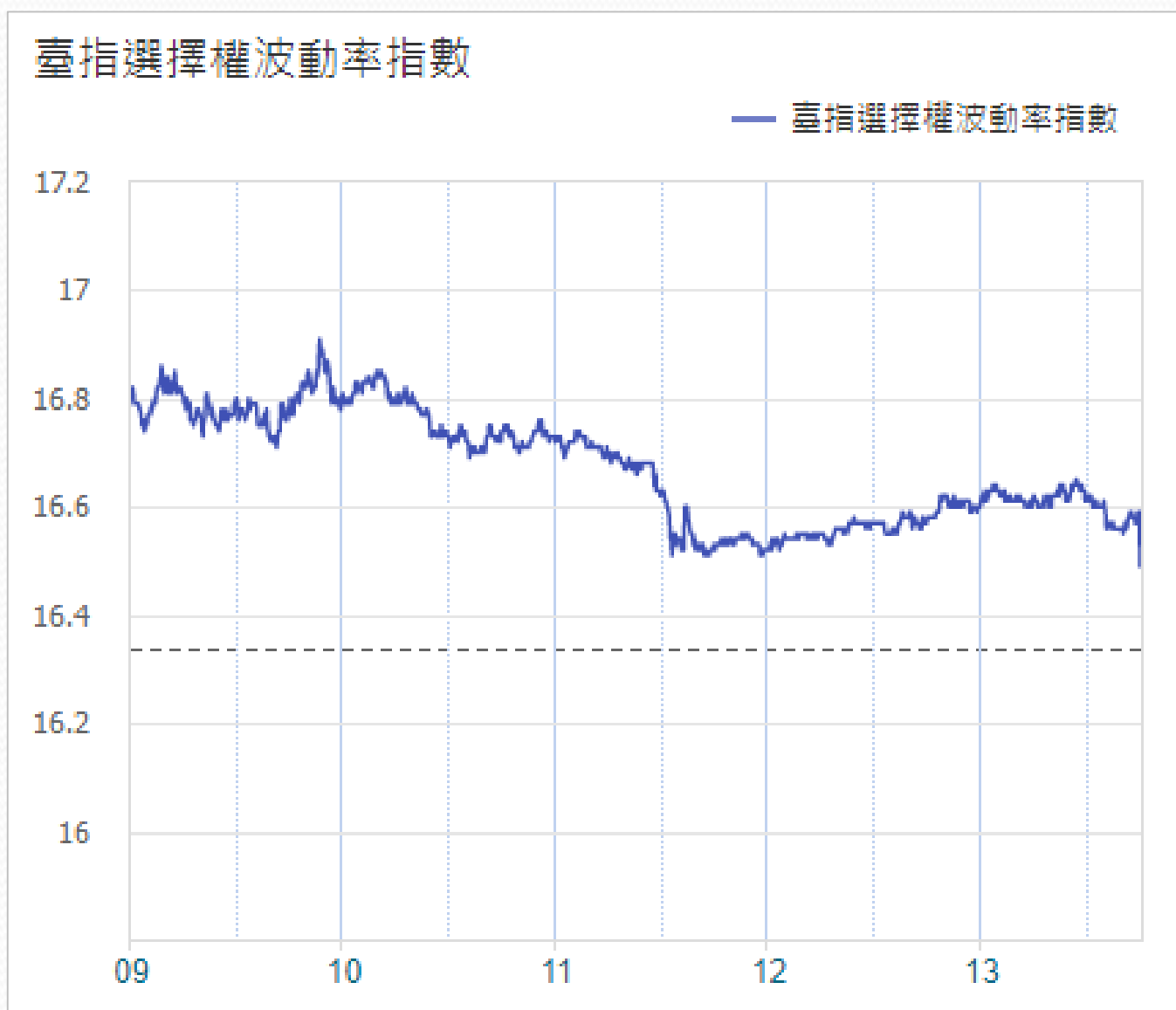
## 2023年03月選擇權分析表

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	15.47%	較前一交易日	+0.55%
	買權隱含波動率	13.14%	較前一交易日	-0.61%
	賣權隱含波動率	18.03%	較前一交易日	+0.10%
	成交量P/C_Ratio值	0.950	較前一交易日	-0.12
	未平倉P/C_Ratio值	1.080	較前一交易日	-0.01
電子選擇權	買權成交最大量	755	買權OI最大量	755
	賣權成交最大量	725	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1620	買權OI最大量	1580
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年2月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

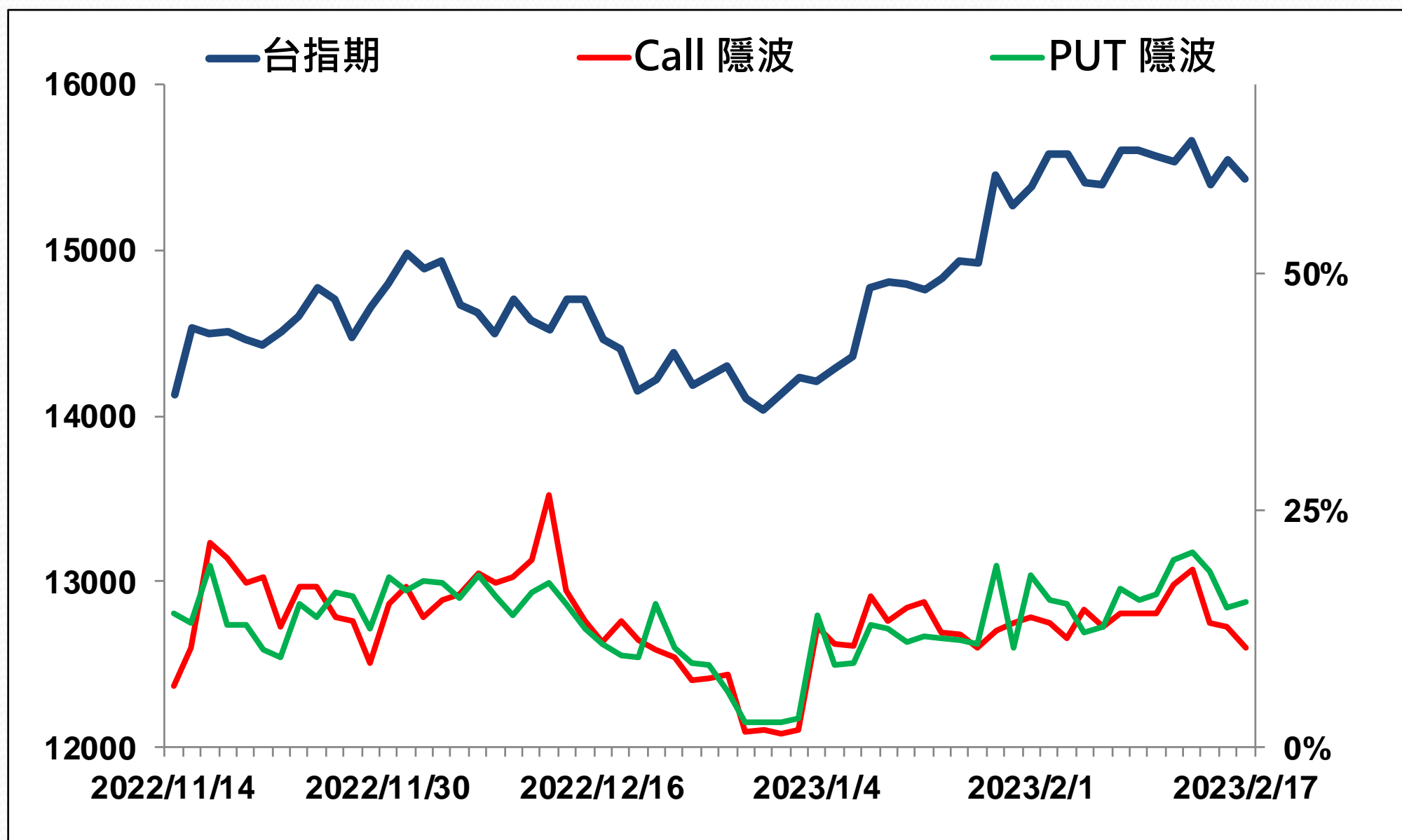


# 選擇權當日波動率指數



更新日期：2023年2月17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

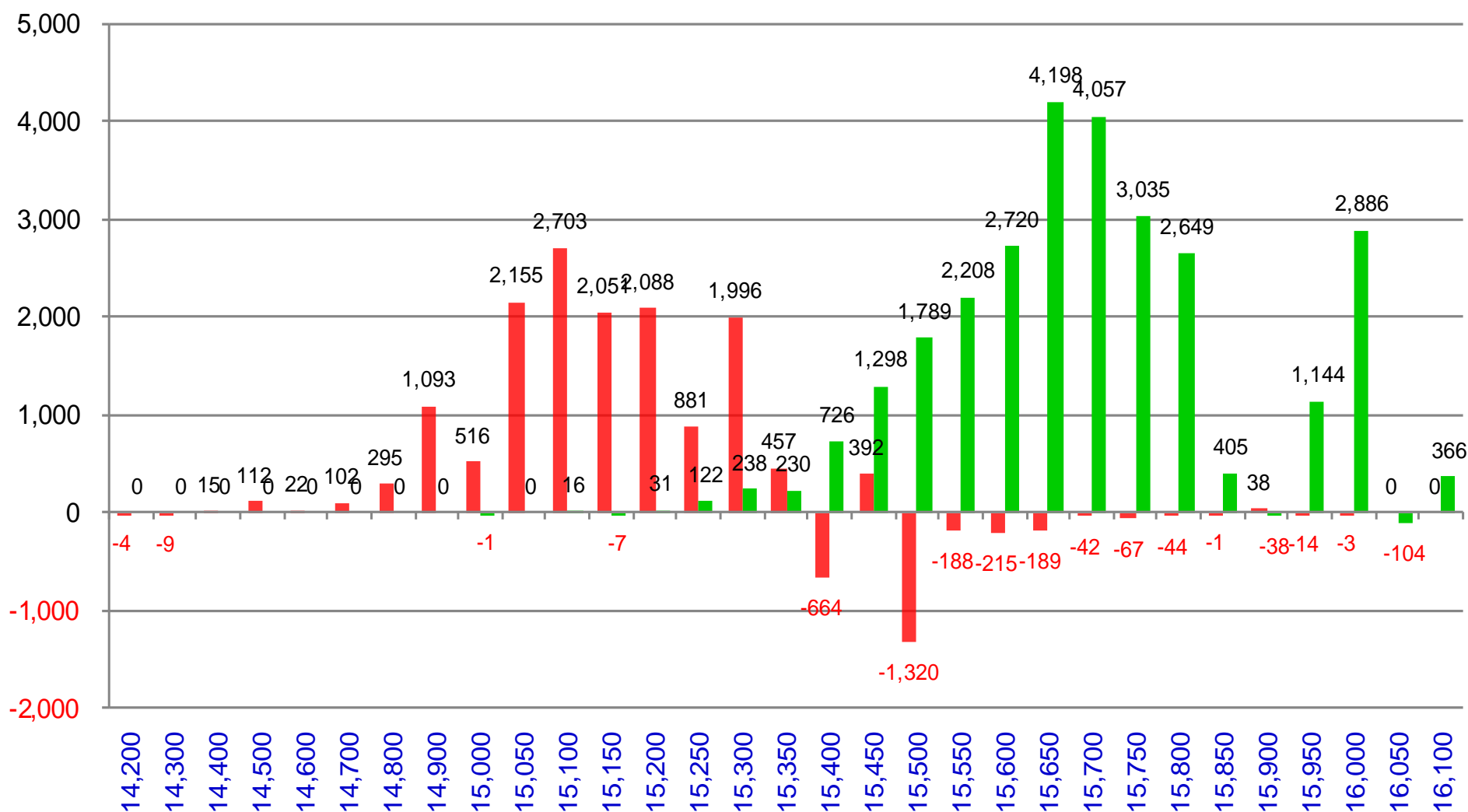


更新日期：2023年2月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：12,154

週選 CALL OI 變化：28,353



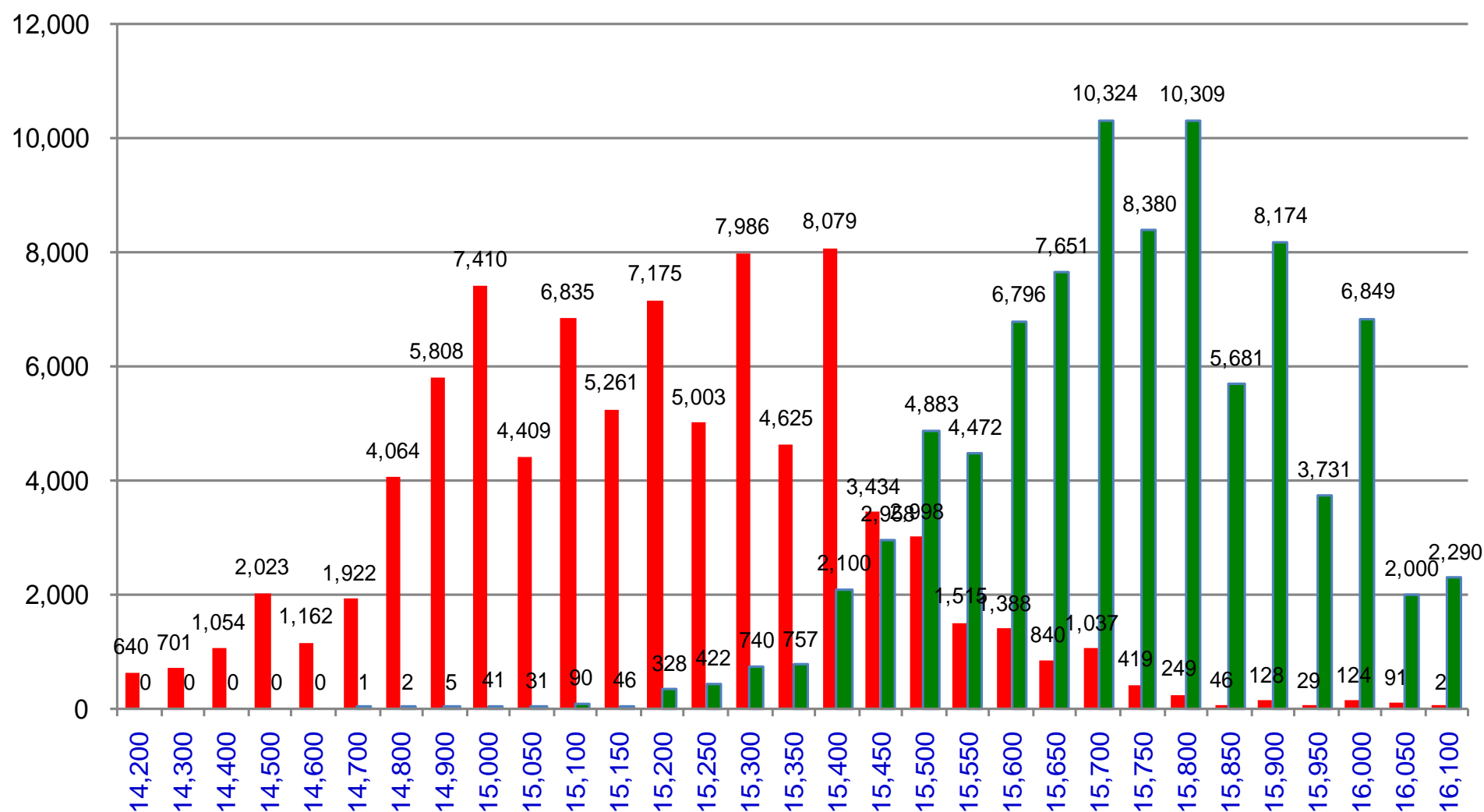
更新日期：2023年2月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理



# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：86,848

週選 CALL OI 總額：97,521



更新日期：2023年2月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

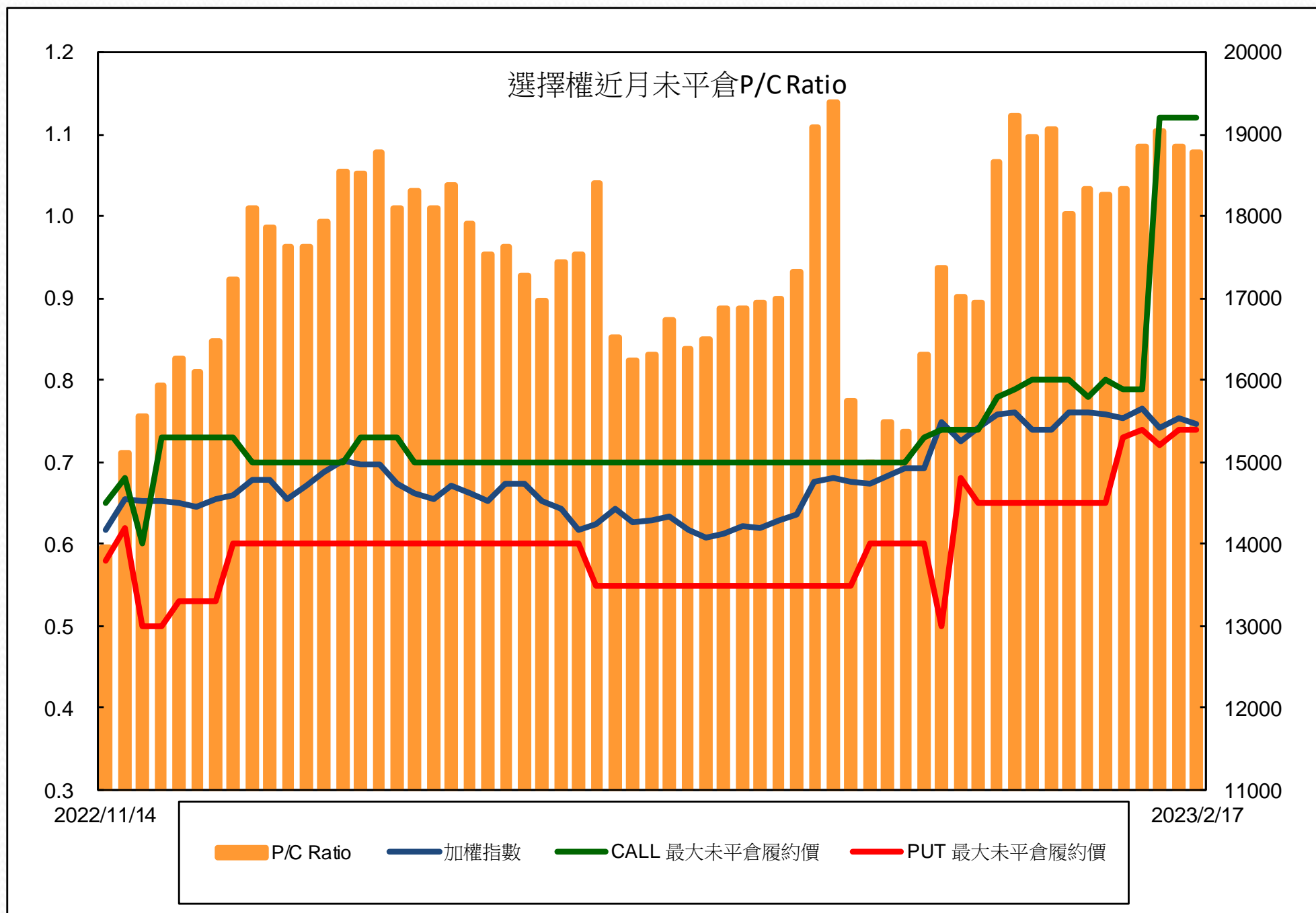


# 自營商選擇權OI部位統計

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16日	61,603	51,264	10,339
	2月17日	67,008	60,195	6,813
Put	2月16日	52,373	58,301	-5,928
	2月17日	58,285	62,140	-3,855

更新日期：2023年2月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

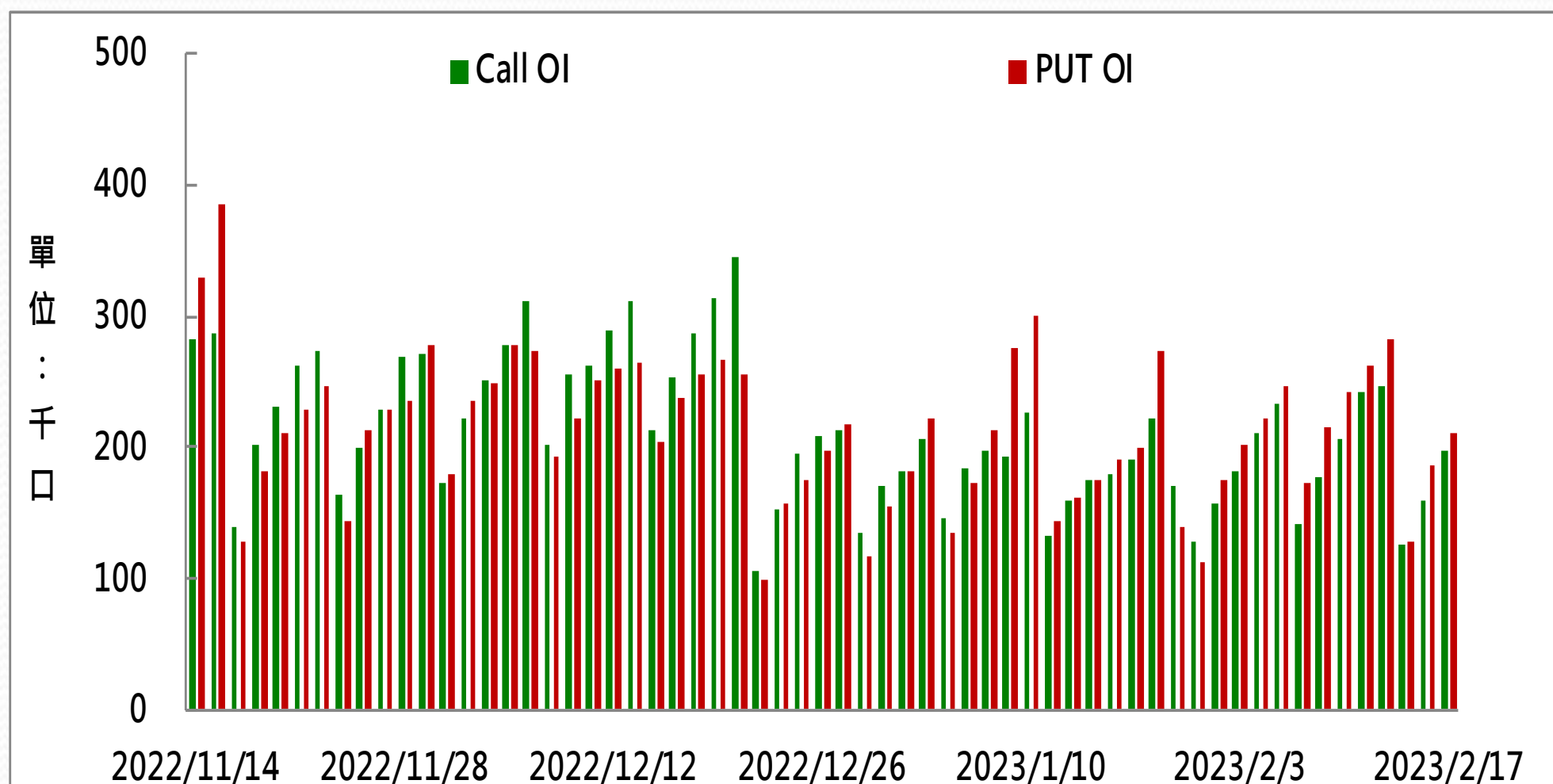
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理



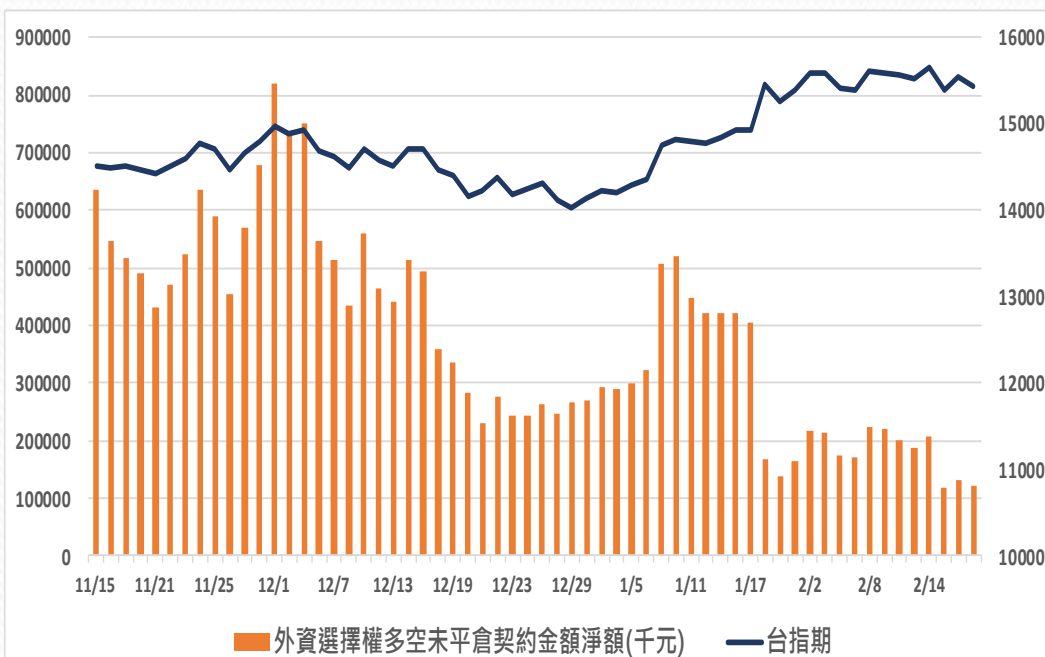
# 選擇權全月Put Call OI



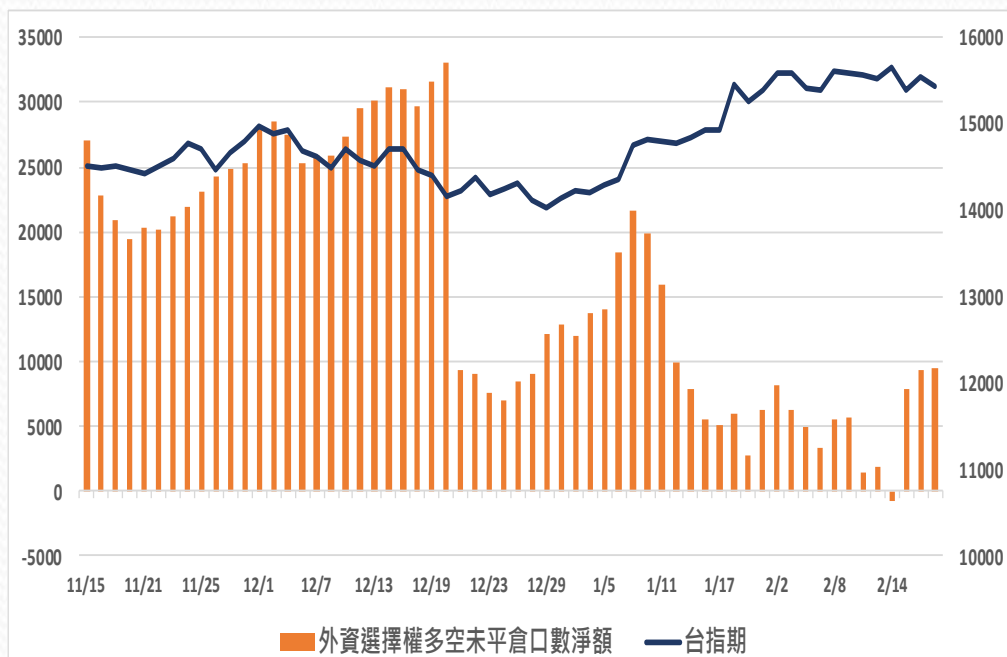
更新日期：2023年2月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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

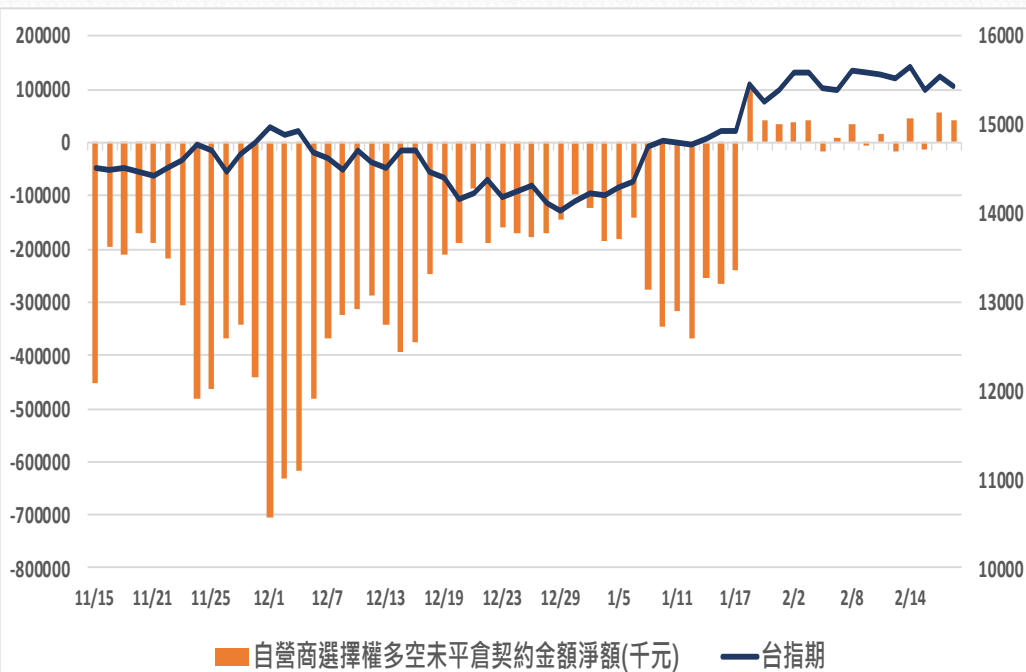
日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/2/13	15532	1811	421	188744	-13312
2023/2/14	15658	-819	-2630	208484	19740
2023/2/15	15398	7950	8769	119685	-88799
2023/2/16	15543	9413	1463	132305	12620
2023/2/17	15436	9460	47	121234	-11071

更新日期：2023年2月17日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

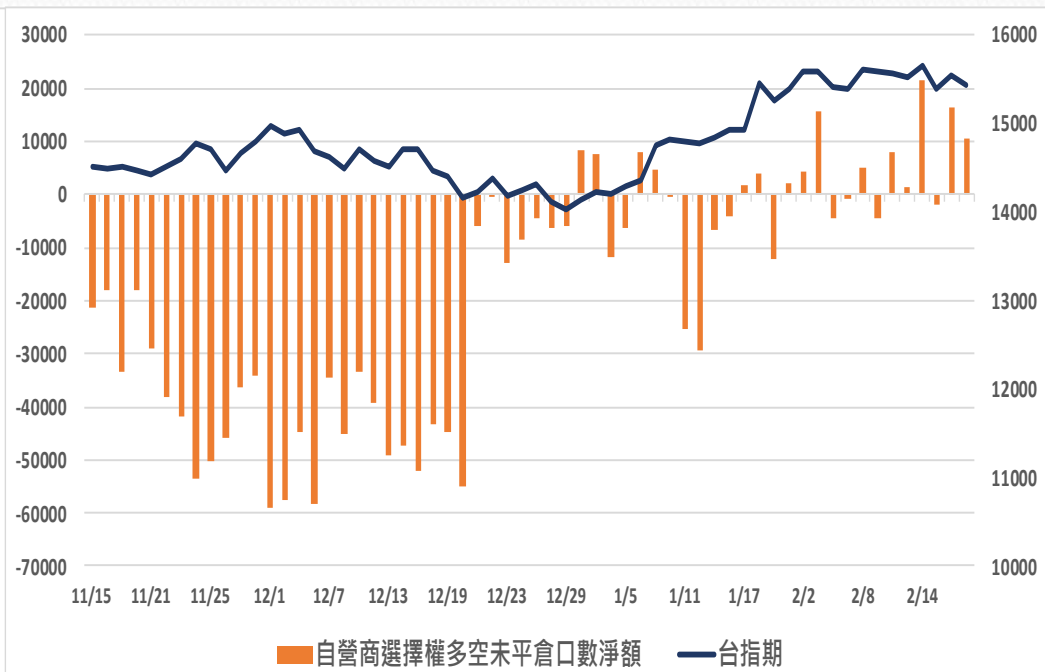


# 自營商選擇權多空未平倉淨額

## 多空未平倉金額淨額



## 多空未平倉口數淨額



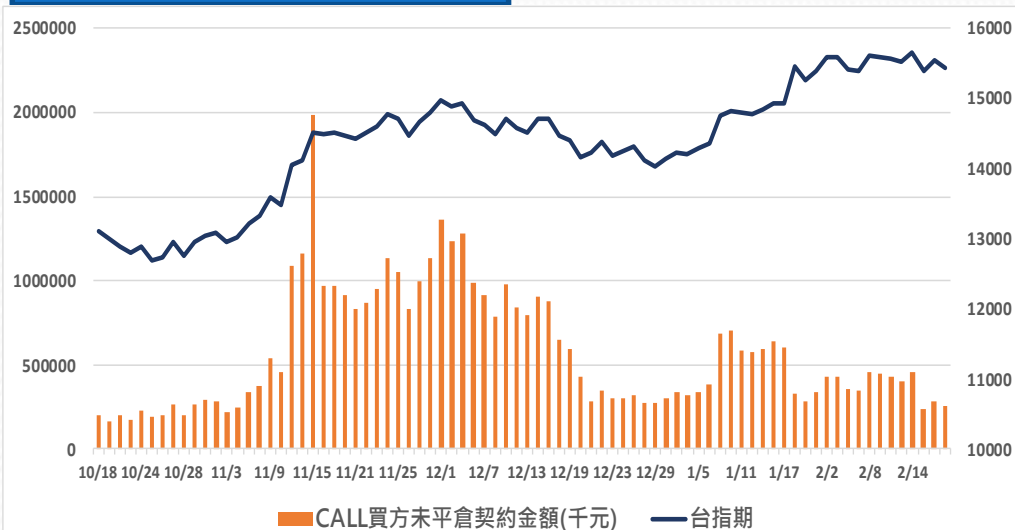
## 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/13	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
2023/2/17	15436	10668	-5599	42295	-14091

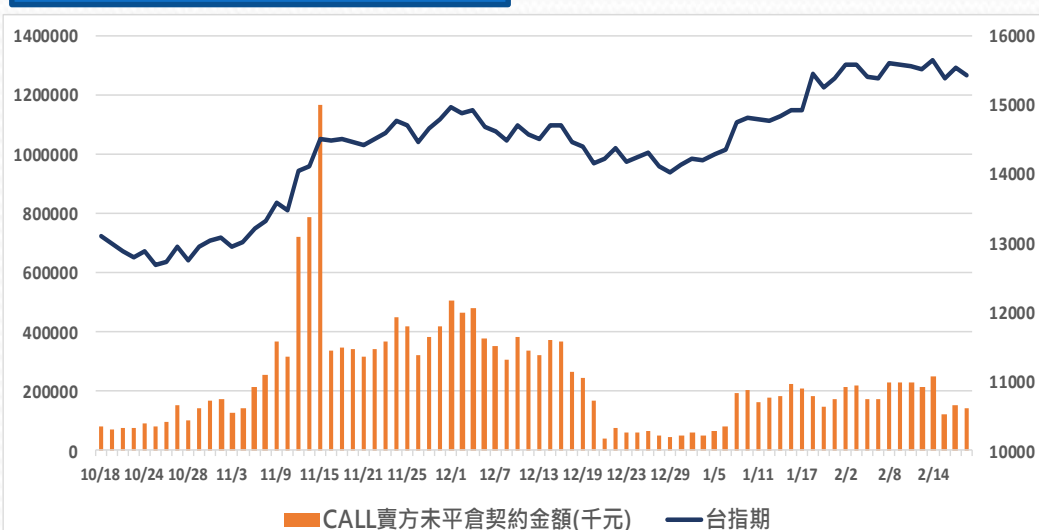
更新日期：2023年2月17日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 外資買賣權未平倉金額

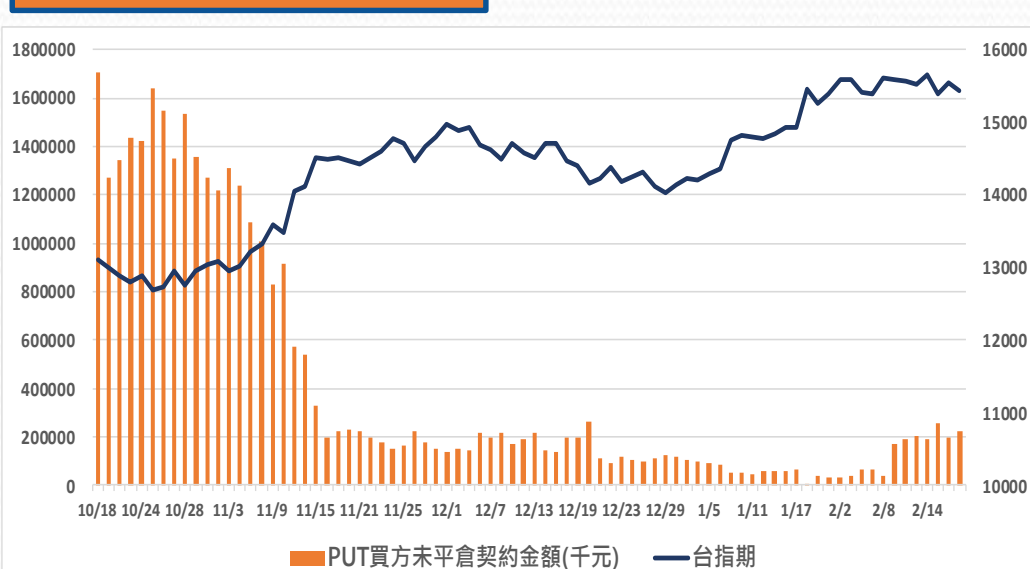
## CALL買方未平倉金額



## CALL賣方未平倉金額



## PUT買方未平倉金額



## PUT賣方未平倉金額

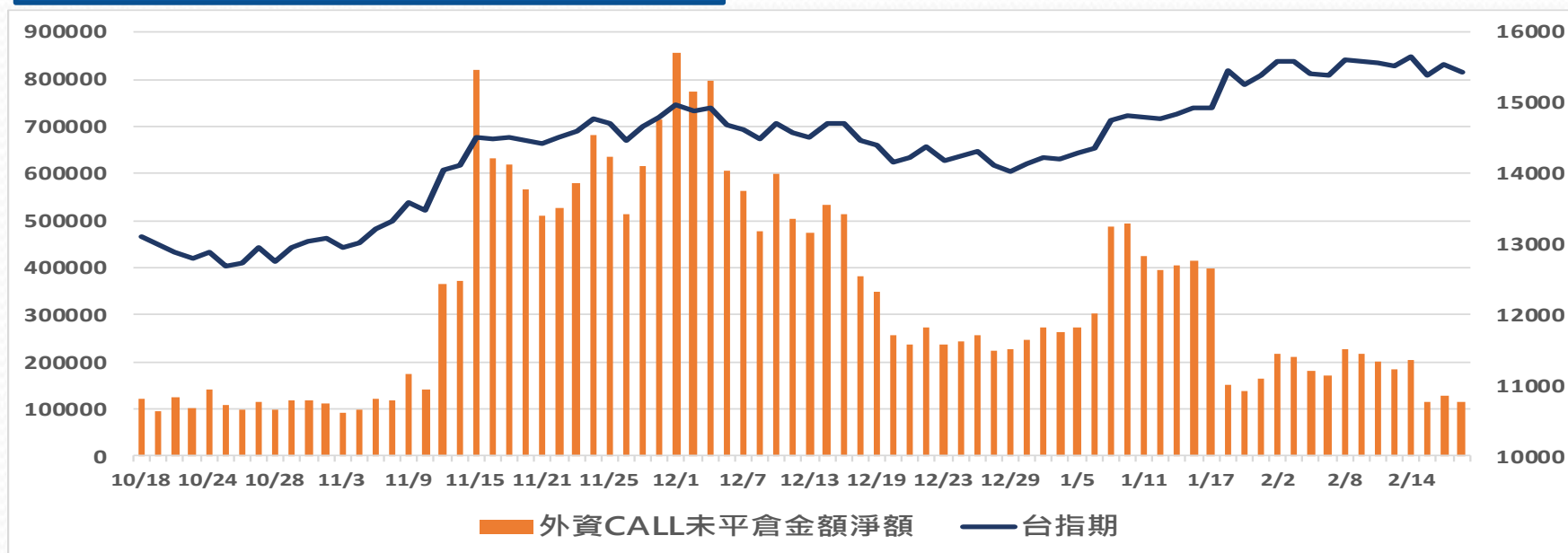


更新日期：2023年2月17日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

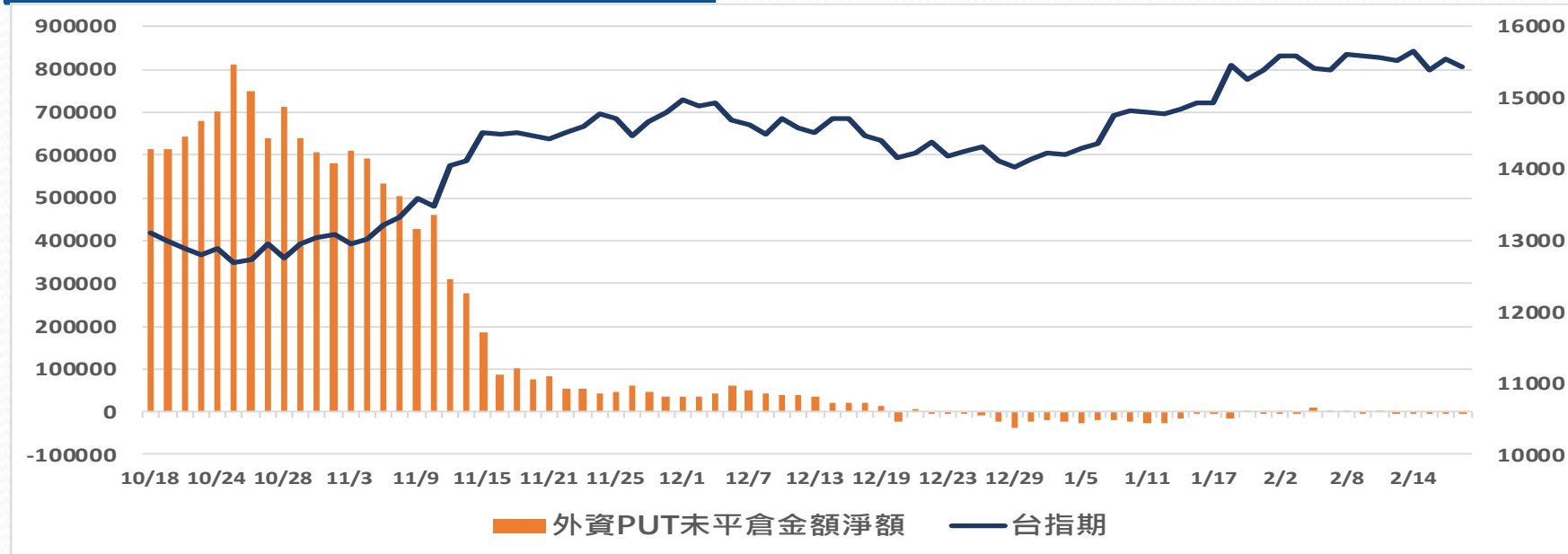


# 外資買賣權未平倉金額淨額

## 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17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17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