

台指選擇權OI匯報

日期：2023/2/20 結算日：2023/2/22					日期：2023/2/20 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	686	-15	0	72	13,800	1,228	-338
0	0	14,400	1,020	-34	0	12	13,900	990	-413
4	4	14,500	2,027	4	0	477	14,000	4,264	399
4	4	14,600	1,178	16	0	27	14,100	2,257	572
0	1	14,700	1,929	7	-3	140	14,200	1,683	748
0	2	14,800	4,189	125	0	56	14,300	1,531	-38
0	5	14,900	5,393	-415	0	269	14,400	2,456	107
22	63	15,000	6,315	-1,095	0	92	14,500	4,465	1,063
10	41	15,050	4,531	122	1	248	14,600	2,246	62
4	94	15,100	6,003	-832	2	96	14,700	4,998	516
1	47	15,150	4,285	-976	-1	226	14,800	3,371	304
-122	206	15,200	7,754	579	0	92	14,900	2,515	147
-128	294	15,250	7,057	2,054	-1	468	15,000	6,728	1,300
84	824	15,300	10,720	2,734	-6	183	15,100	2,394	-135
343	1,100	15,350	6,525	1,900	22	503	15,200	4,417	-46
222	2,322	15,400	11,791	3,712	-5	399	15,300	2,390	130
-321	2,637	15,450	7,342	3,908	-83	1,681	15,400	3,860	537
393	5,276	15,500	6,064	3,066	279	1,654	15,500	1,413	-35
55	4,527	15,550	2,848	1,333	178	2,929	15,600	1,204	331
1,103	7,899	15,600	2,207	819	253	1,947	15,700	350	98
1,793	9,444	15,650	1,026	186	371	3,144	15,800	189	39
※ 4,002	14,326	15,700	1,161	124	431	3,480	15,900	174	27
1,530	9,910	15,750	632	213	※ 947	8,429	16,000	160	11
1,243	11,552	15,800	209	-40	625	5,811	16,100	70	-8
727	6,408	15,850	45	-1	86	7,638	16,200	57	2
-358	7,816	15,900	150	22	84	3,283	16,300	31	19
-564	3,167	15,950	29	0	-28	3,462	16,400	4	0
-516	6,333	16,000	128	4	-606	1,962	16,500	4	0
162	2,162	16,050	92	1	-148	1,161	16,600	2	0
64	2,354	16,100	2	0	50	964	16,700	0	0
-22	4,010	16,200	44	0	100	980	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
9,687	107,208	0.9735	104,365	17,517	2,695	83,007	1.1170	92,717	6,001
昨日 P/C	0.8906	今日增減變化		0.0829	昨日 P/C	1.0797	今日增減變化		0.0372

更新日期：2023年2月20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20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	98,010,517	42,674,705	55,335,812	1,341,867	2,838,156	751,618	2,086,538	72,068	
投信	24,201,916	50,747,956	-26,546,040	53,275	414,986	0	414,986	4,578	
自營商	40,477,215	22,663,009	17,814,206	1,325,868	1,047,604	928,520	119,084	29,455	
	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	553,877	1,873,313	-1,319,436	106,427	81,005	10,501	70,504	21,380	
投信	125,736	0	125,736	7,701	0	0	0	0	
自營商	525,228	122,550	402,678	89,491	98,991	187,475	-88,484	-14,068	

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20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	32,140	14,567	17,573	3,421	35,479	26,041	9,438	4,746	
投信	100	50	50	0	100	113	-13	0	
自營商	69,063	60,202	8,861	2,048	58,652	67,304	-8,652	-4,797	
特定法人(週)	11,551	0	11,551	3,950	0	6,320	-6,320	-1,985	
特定法人(近月)	13,917	3,262	10,655	656	8,307	11,378	-3,071	-2,315	
特定法人(全月)	23,557	4,612	18,945	2,946	6,352	22,295	-15,943	-8,228	
十大交易人(週)	44,121	40,389	3,732	1,334	50,208	35,492	14,716	3,763	
十大交易人(近月)	49,437	43,795	5,642	-193	50,792	40,077	10,715	-976	
十大交易人(全月)	95,570	75,638	19,932	1,597	98,001	79,183	18,818	1,141	
全市場未沖銷(近月)			83,007	2,695			92,717	6,001	
全市場未沖銷(全月)			214,613	16,564			241,534	31,700	

更新日期：2023年2月20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	15500	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	12.30%	較前一交易日	-0.02%
	買權隱含波動率	10.20%	較前一交易日	+0.13%
	賣權隱含波動率	14.00%	較前一交易日	-0.86%
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	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	1540	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年2月20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

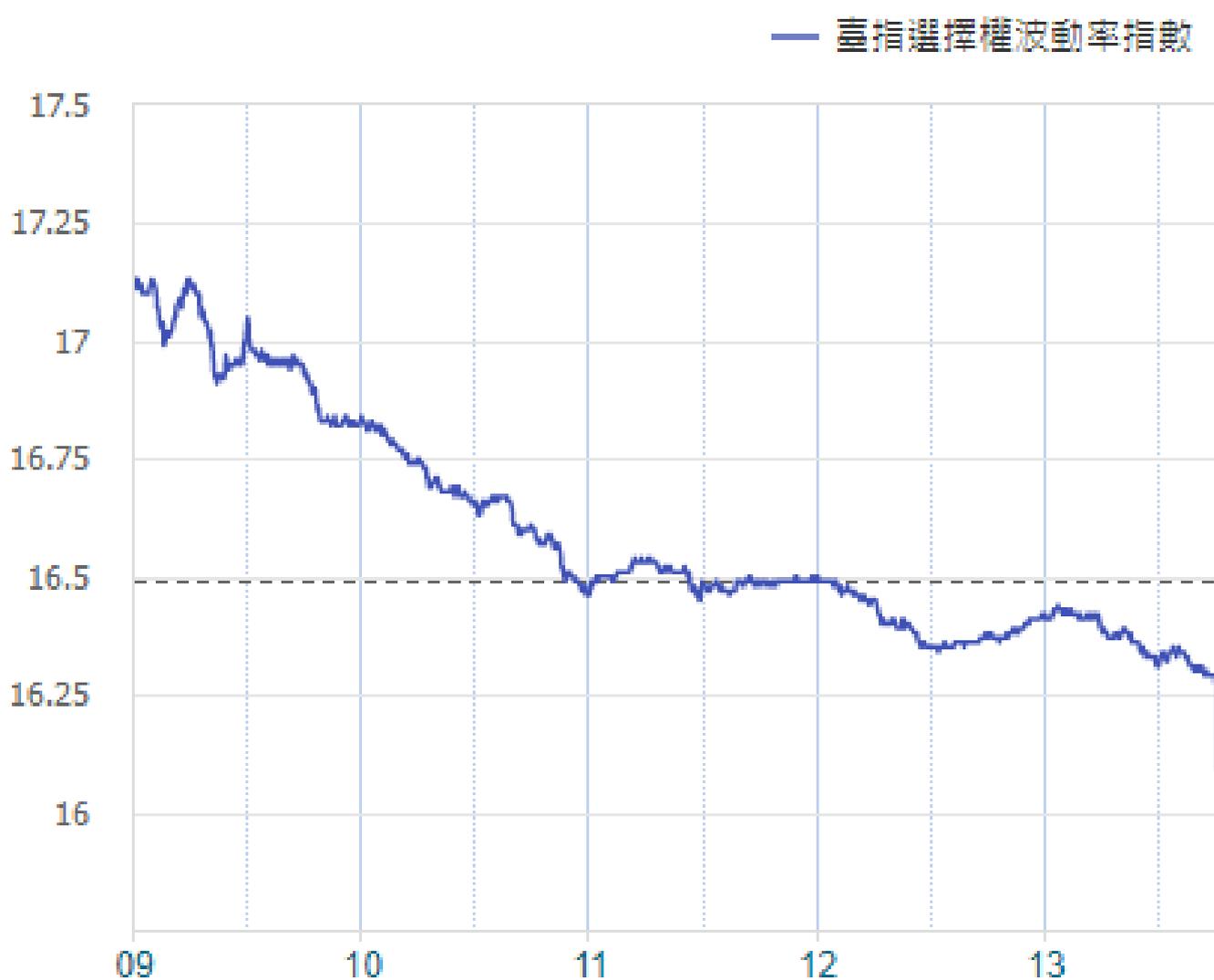
2023年03月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16000	買權OI最大量	16000
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	10000
	整體隱含波動率	15.75%	較前一交易日	-0.27%
	買權隱含波動率	13.13%	較前一交易日	-0.00%
	賣權隱含波動率	17.66%	較前一交易日	-0.37%
	成交量P/C_Ratio值	1.286	較前一交易日	+0.34
	未平倉P/C_Ratio值	1.117	較前一交易日	+0.04
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	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	1540	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年2月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

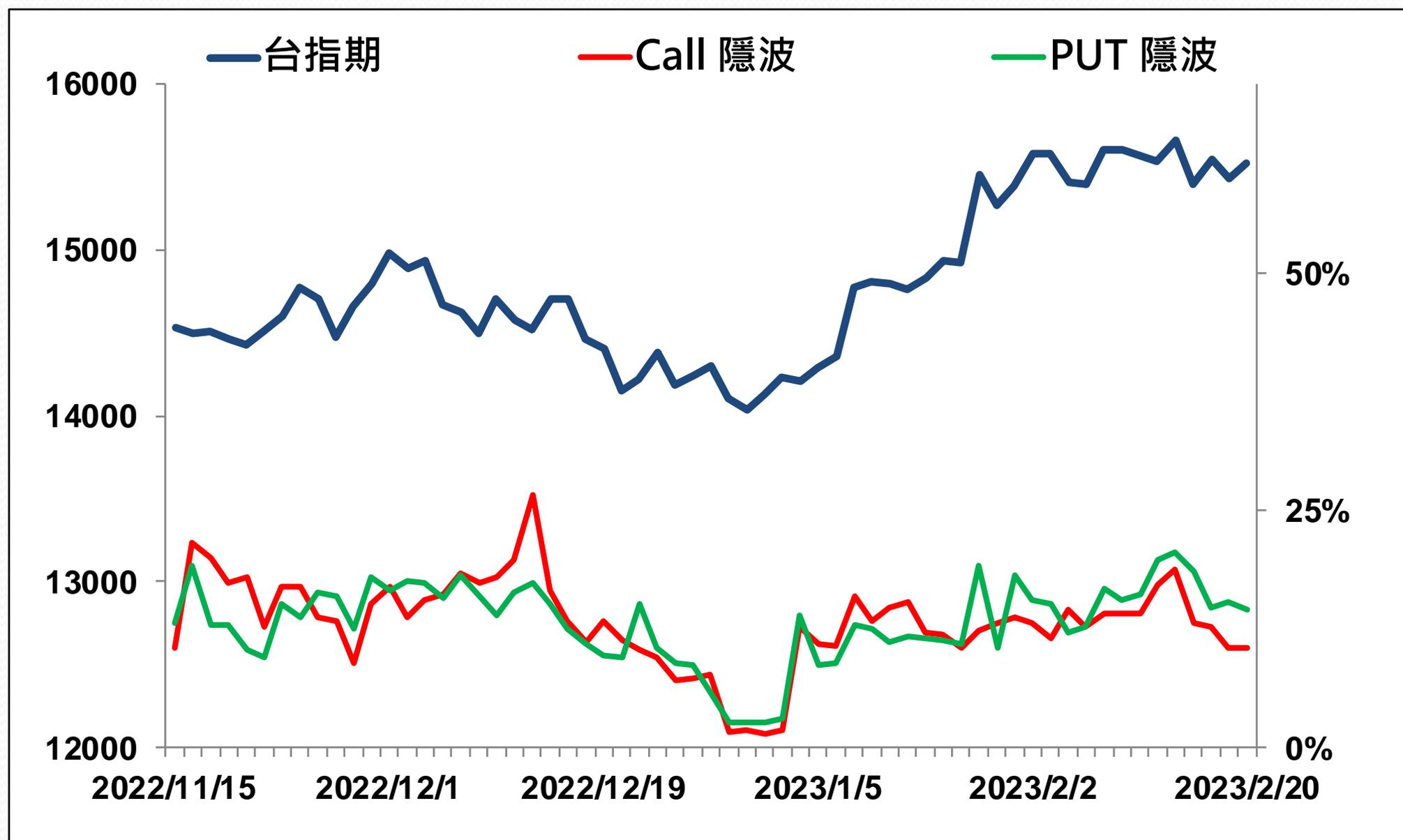
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年2月20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

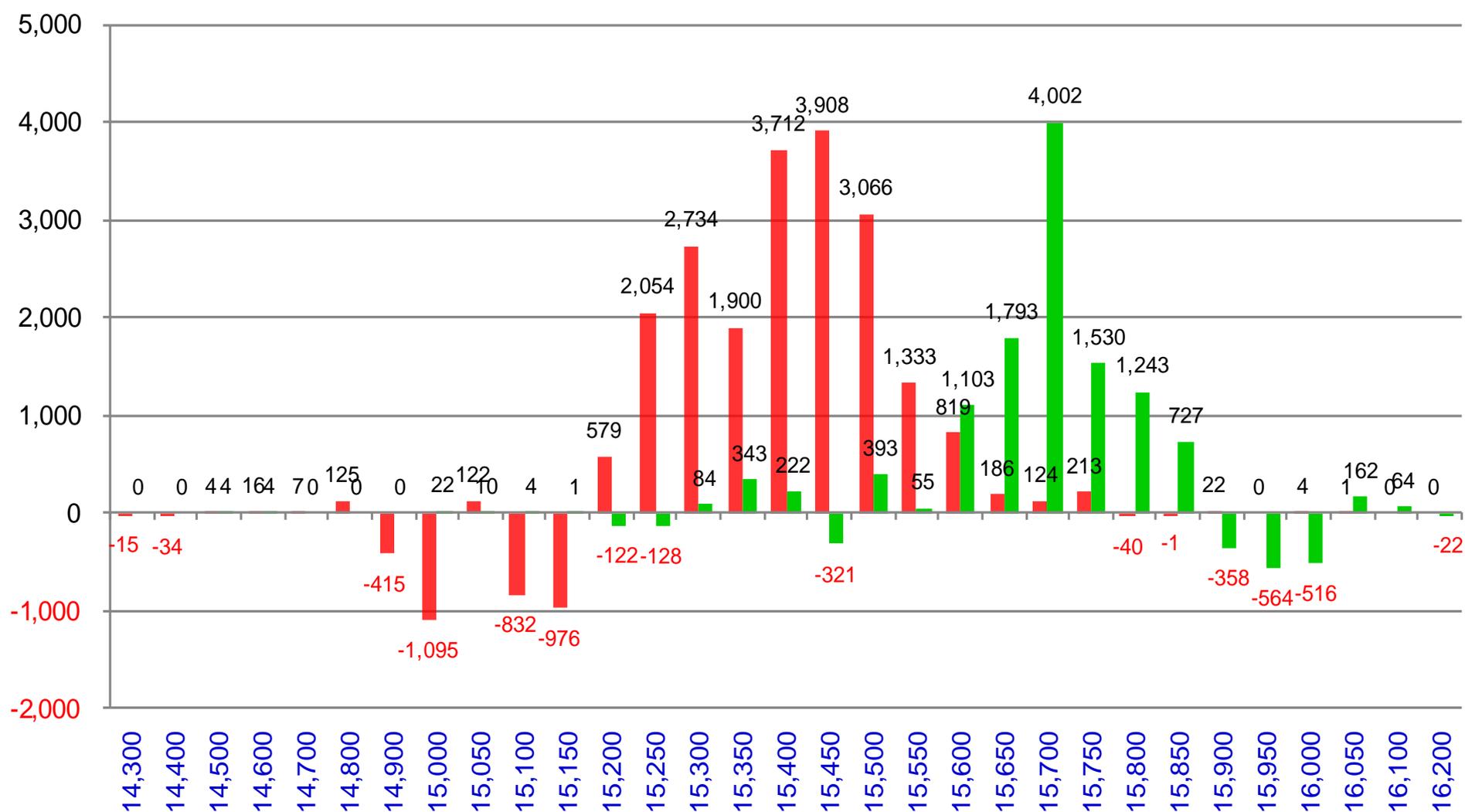


更新日期：2023年2月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：17,517

週選 CALL OI 變化：9,687

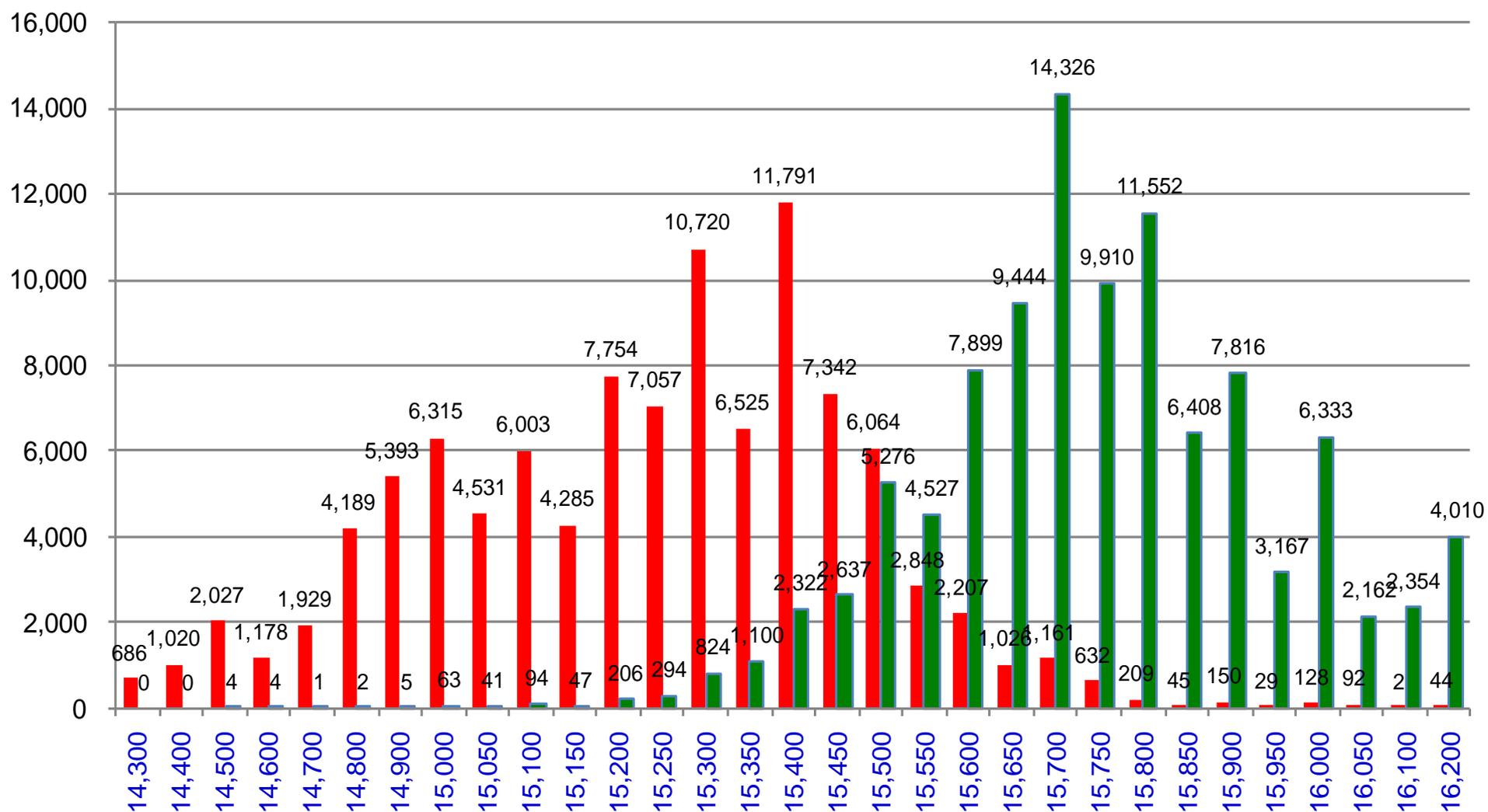


更新日期：2023年2月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：104,365

週選 CALL OI 總額：107,208



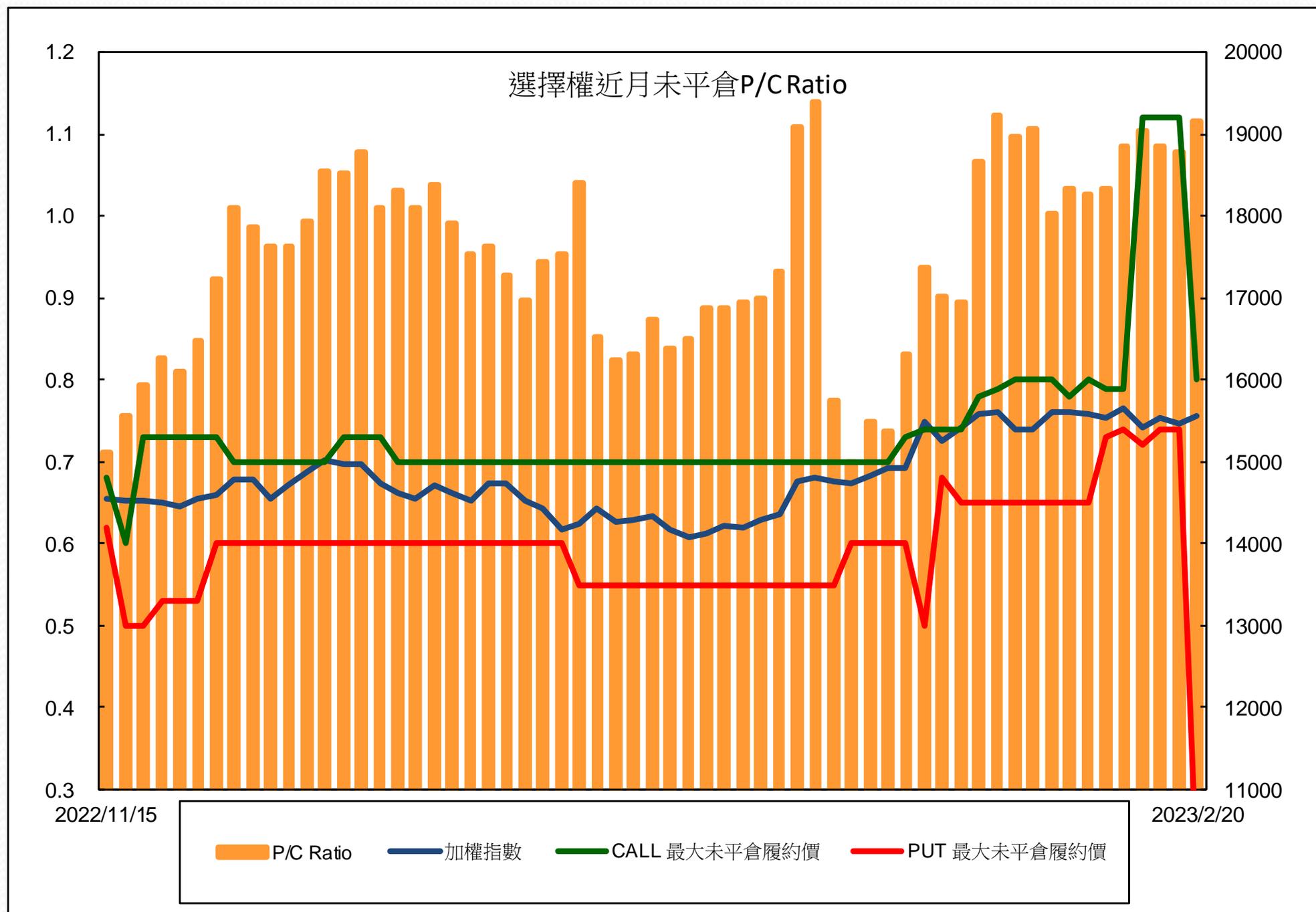
更新日期：2023年2月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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17日	67,008	60,195	6,813
	2月20日	69,063	60,202	8,861
Put	2月17日	58,285	62,140	-3,855
	2月20日	58,652	67,304	-8,652

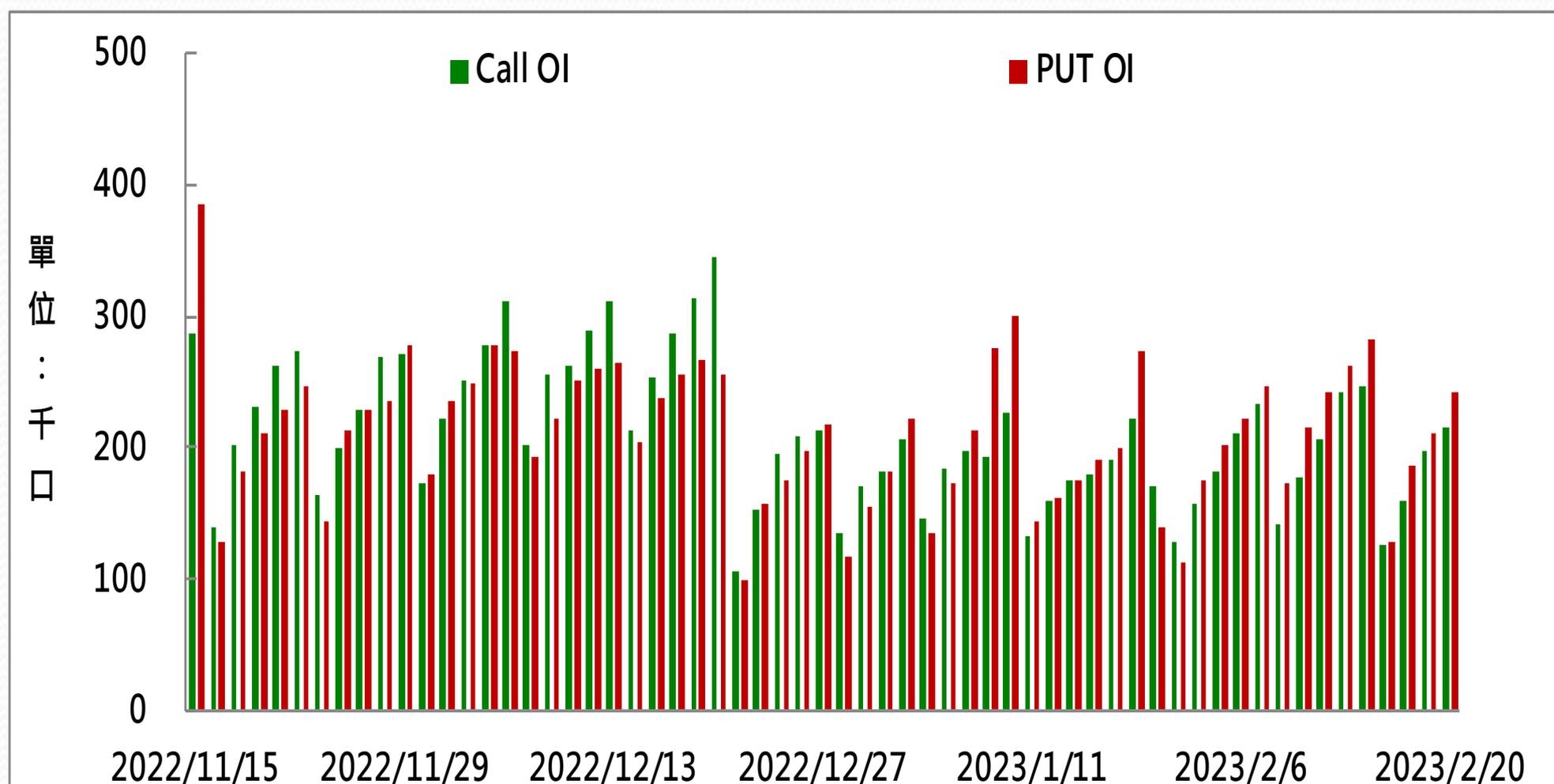
更新日期：2023年2月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

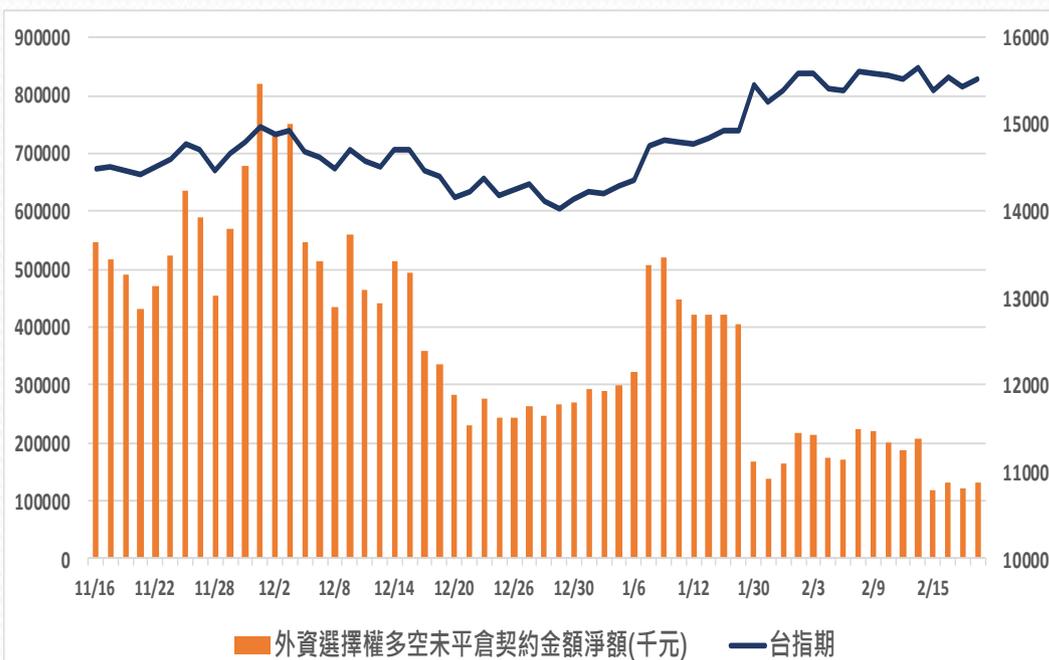
選擇權全月Put Call OI



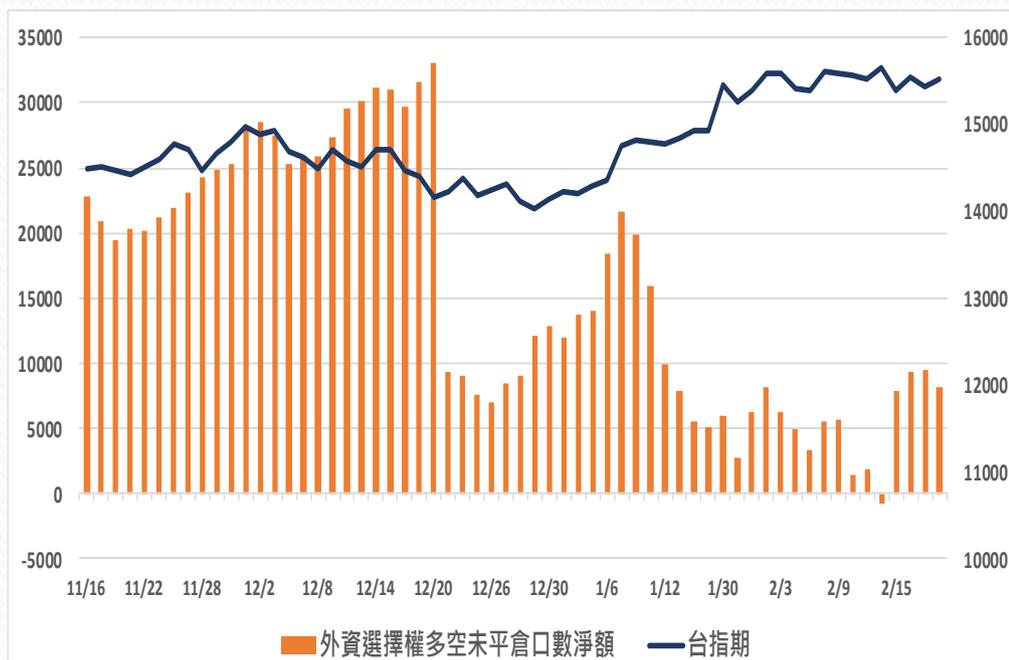
更新日期：2023年2月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



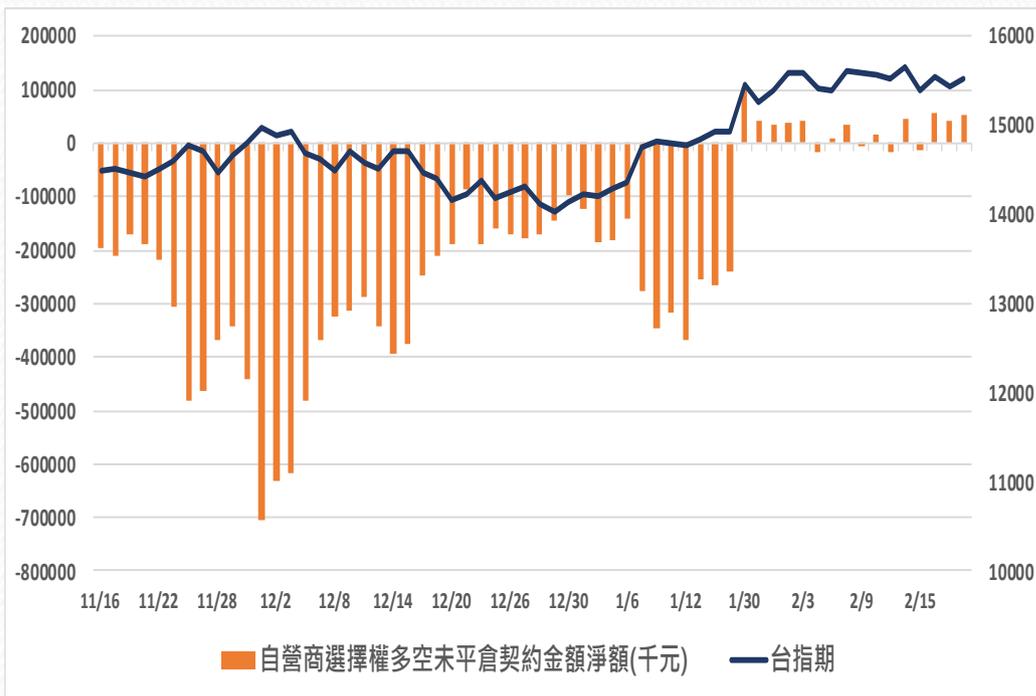
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/14	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
2023/2/20	15524	8135	-1325	132735	11501

更新日期：2023年2月20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



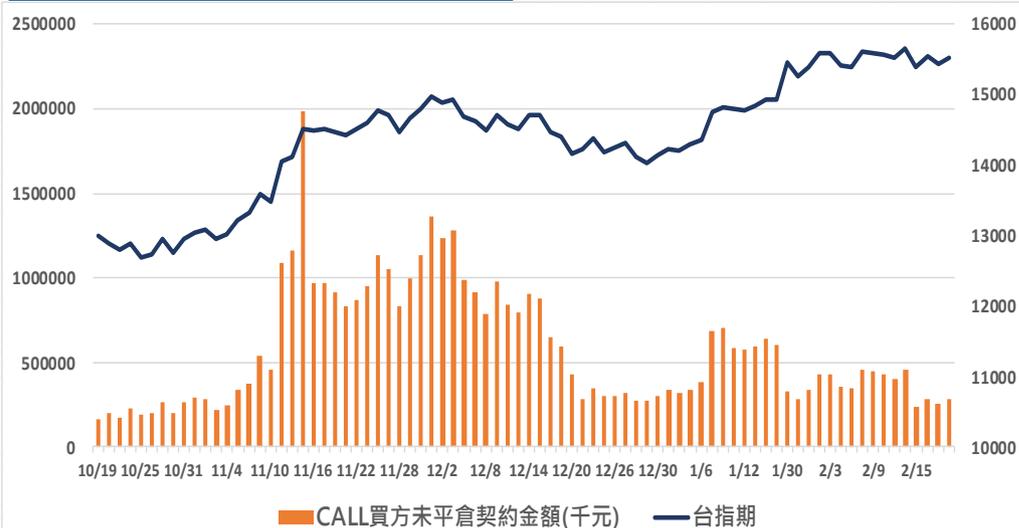
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/14	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
2023/2/20	15524	17513	6845	52469	10174

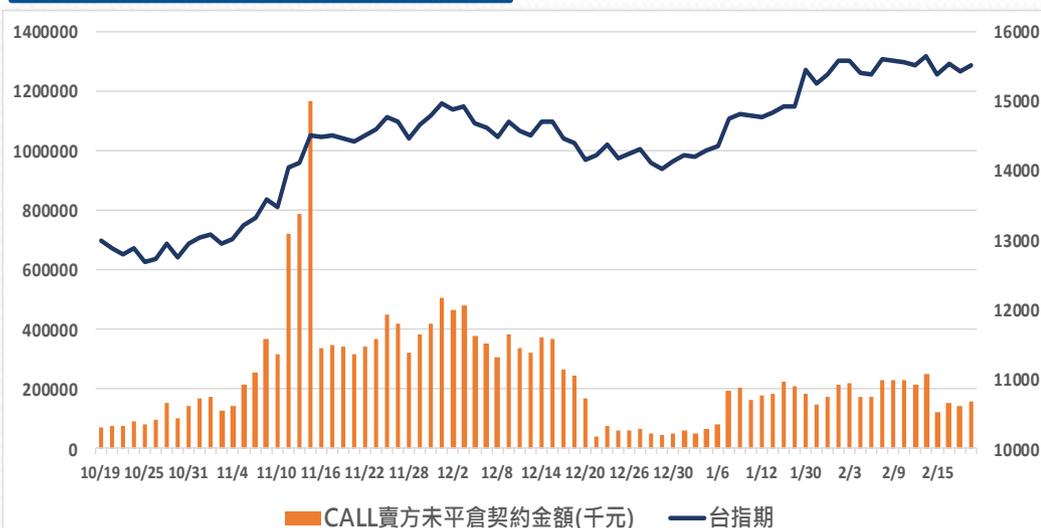
更新日期：2023年2月20日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

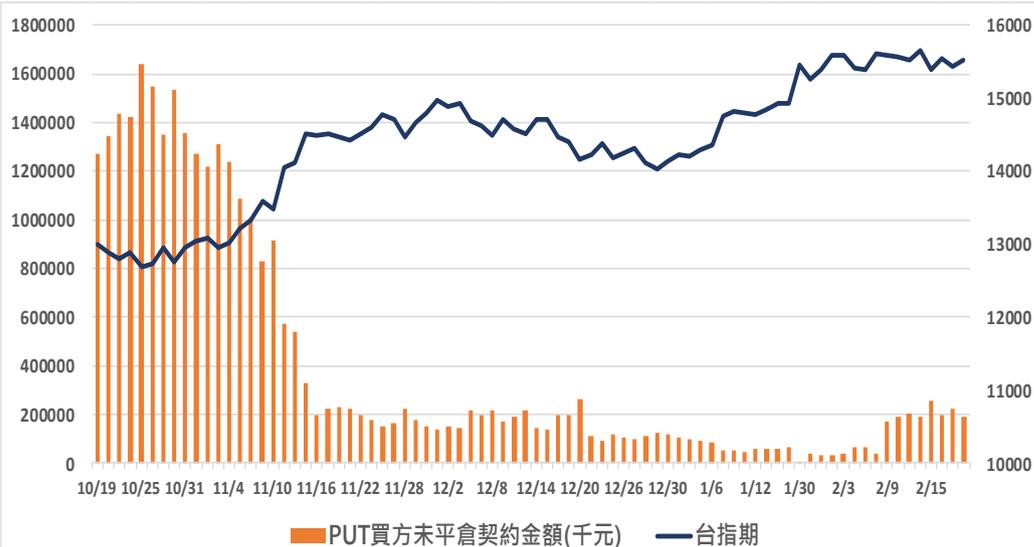
CALL買方未平倉金額



CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



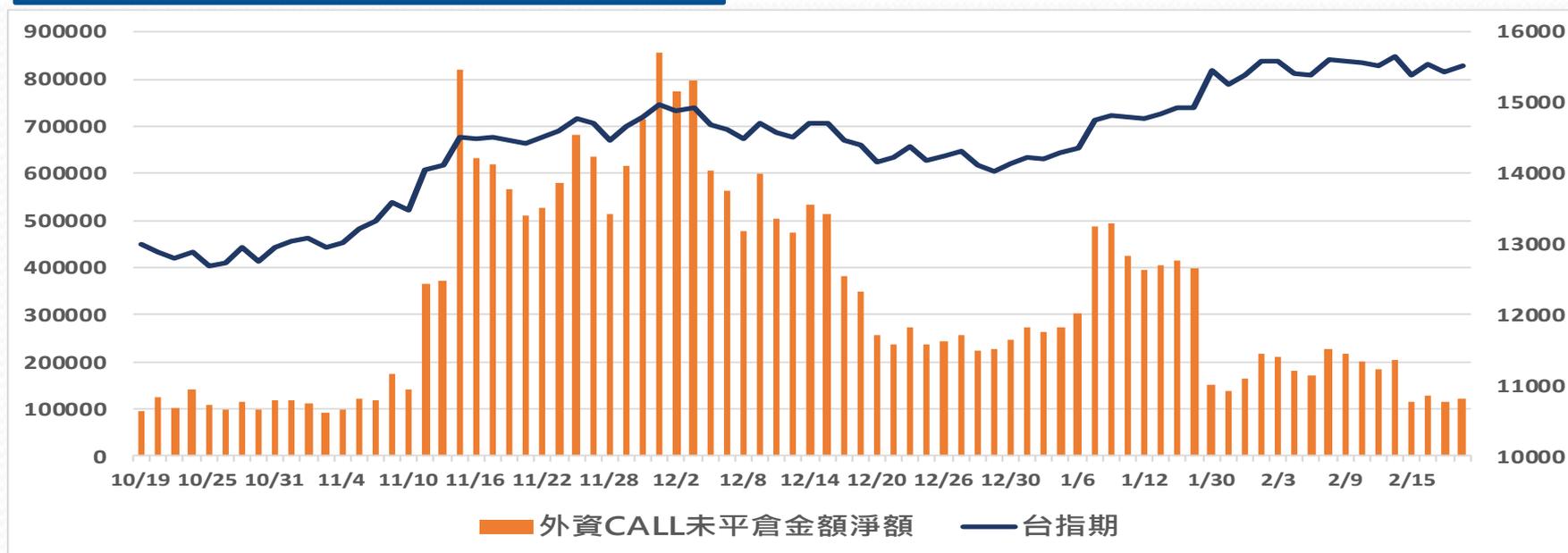
PUT賣方未平倉金額



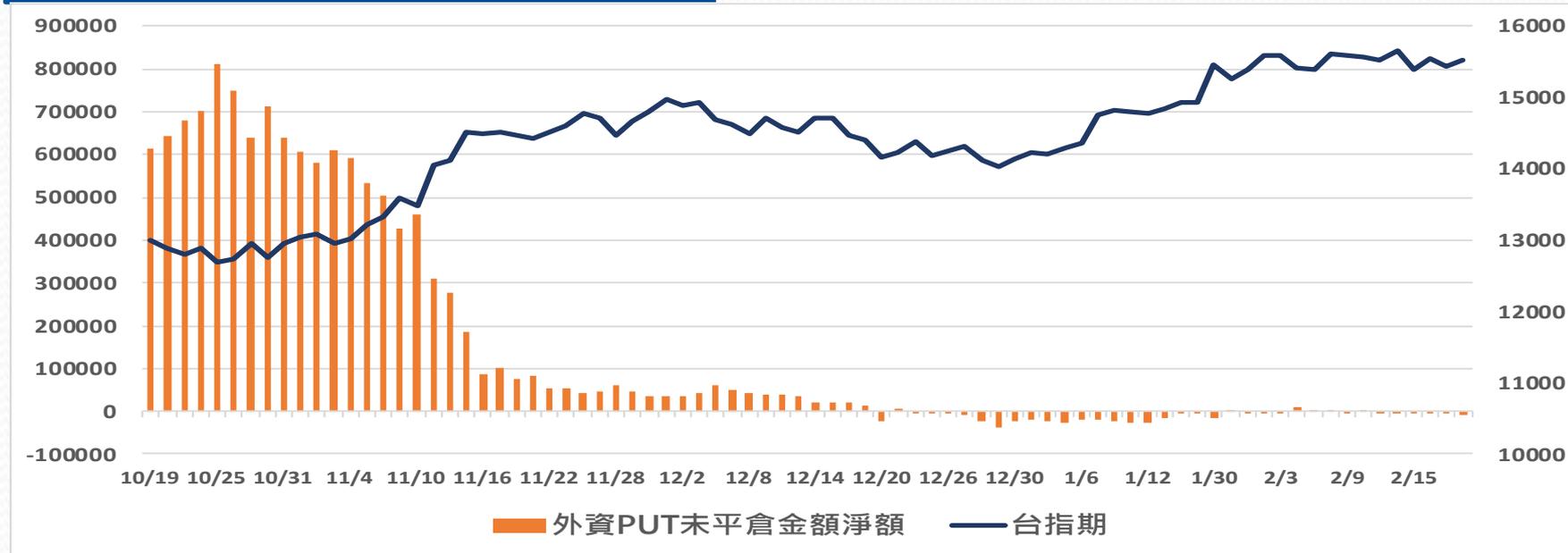
更新日期：2023年2月20日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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20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20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