

台指選擇權 OI 匯報

日期：2023/2/21 結算日：2023/2/22					日期：2023/2/21 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	682	-4	-2	70	13,800	1,460	232	
0	0	14,400	1,018	-2	0	12	13,900	1,055	65	
0	4	14,500	2,021	-6	0	477	14,000	4,274	10	
0	4	14,600	1,177	-1	0	27	14,100	2,265	8	
0	1	14,700	1,928	-1	-2	138	14,200	1,662	-21	
0	2	14,800	3,968	-221	0	56	14,300	1,543	12	
0	5	14,900	5,163	-230	0	269	14,400	2,467	11	
-2	61	15,000	5,467	-848	0	92	14,500	4,556	91	
-3	38	15,050	4,383	-148	0	248	14,600	2,223	-23	
-4	90	15,100	5,411	-592	-1	95	14,700	6,268	1,270 ※	
0	47	15,150	4,204	-81	7	233	14,800	3,490	119	
-35	171	15,200	7,913	159	0	92	14,900	2,628	113	
3	297	15,250	7,877	820	-2	466	15,000	6,999	271	
-77	747	15,300	11,213	493	37	220	15,100	3,121	727	
-91	1,009	15,350	7,287	762	31	534	15,200	4,574	157	
15	2,337	15,400	11,344	-447	0	399	15,300	2,777	387	
223	2,860	15,450	8,682	1,340	23	1,704	15,400	3,707	-153	
-346	4,930	15,500	8,284	2,220 ※	※	1,038	2,692	15,500	1,828	415
2,025	6,552	15,550	4,279	1,431	298	3,227	15,600	1,301	97	
※	4,858	12,757	2,711	504	-142	1,805	15,700	366	16	
3,307	12,751	15,650	1,541	515	58	3,202	15,800	205	16	
59	14,385	15,700	1,124	-37	648	4,128	15,900	169	-5	
-233	9,677	15,750	471	-161	936	9,365	16,000	158	-2	
-384	11,168	15,800	188	-21	901	6,712	16,100	70	0	
-875	5,533	15,850	70	25	446	8,084	16,200	119	62	
-2,759	5,057	15,900	146	-4	167	3,450	16,300	31	0	
-286	2,881	15,950	29	0	-94	3,368	16,400	4	0	
-138	6,195	16,000	128	0	94	2,056	16,500	4	0	
-65	2,097	16,050	92	0	95	1,256	16,600	2	0	
-29	2,325	16,100	2	0	64	1,028	16,700	0	0	
-1	4,009	16,200	43	-1	31	1,011	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	
5,037	112,245	0.9782	109,795	5,430	5,337	88,344	1.1021	97,363	4,646	
昨日 P/C	0.9735	今日增減變化	0.0047	昨日 P/C	1.1170	今日增減變化	-0.0149			

更新日期：2023年2月21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21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	95,100,821	42,499,294	52,601,527	-2,734,285	3,098,436	933,019	2,165,417	78,879	
投信	24,279,581	50,757,926	-26,478,345	67,695	415,644	0	415,644	658	
自營商	42,284,970	21,897,223	20,387,747	2,573,541	1,078,330	1,081,136	-2,806	-121,890	
	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	446,675	1,951,845	-1,505,170	-185,734	133,838	0	133,838	63,334	
投信	124,251	0	124,251	-1,485	0	0	0	0	
自營商	495,432	180,873	314,559	-88,119	108,258	285,684	-177,426	-88,942	

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21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	33,021	15,560	17,461	-112	36,323	27,829	8,494	-944	
投信	100	50	50	0	200	113	87	100	
自營商	69,550	64,305	5,245	-3,616	60,232	71,321	-11,089	-2,437	
特定法人(週)	10,454	0	10,454	-1,097	0	7,723	-7,723	-1,403	
特定法人(近月)	15,088	3,262	11,826	1,171	12,165	11,635	530	3,601	
特定法人(全月)	24,728	4,621	20,107	1,162	10,948	24,104	-13,156	2,787	
十大交易人(週)	43,651	43,323	328	-3,404	56,066	36,431	19,635	4,919	
十大交易人(近月)	52,007	45,981	6,026	384	53,625	42,323	11,302	587	
十大交易人(全月)	97,245	80,040	17,205	-2,727	104,892	83,006	21,886	3,068	
全市場未沖銷(近月)			88,344	5,337			97,363	4,646	
全市場未沖銷(全月)			229,380	14,767			256,113	14,579	

更新日期：2023年2月21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	15500	賣權OI最大量	15400
	整體隱含波動率	10.95%	較前一交易日	-1.35%
	買權隱含波動率	8.10%	較前一交易日	-2.09%
	賣權隱含波動率	13.71%	較前一交易日	-0.29%
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	690	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	1560	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年2月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

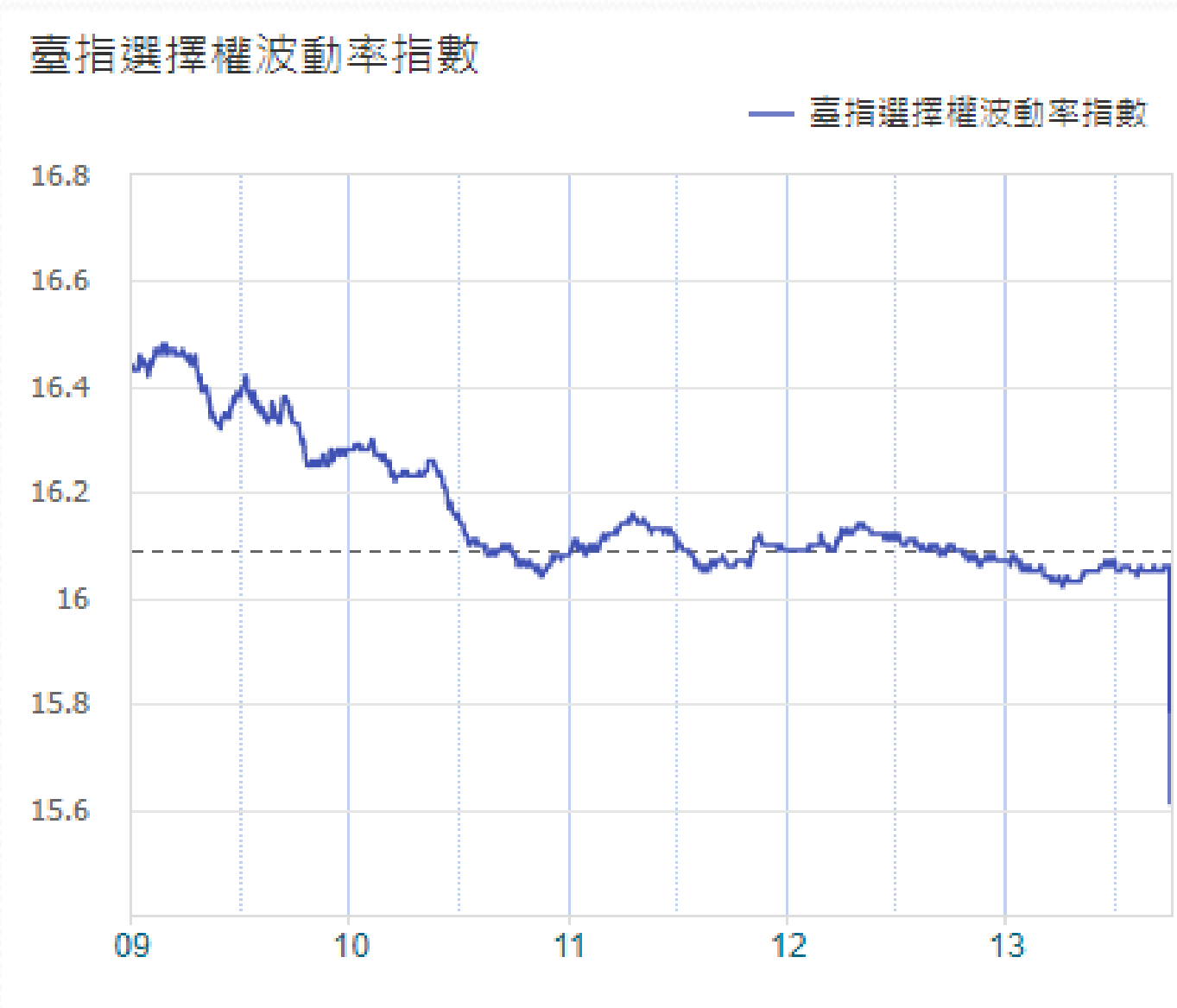
台指選擇權匯報

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	15.08%	較前一交易日	+0.67%
	買權隱含波動率	12.90%	較前一交易日	-0.23%
	賣權隱含波動率	16.56%	較前一交易日	-1.10%
	成交量P/C_Ratio值	1.352	較前一交易日	+0.07
	未平倉P/C_Ratio值	1.102	較前一交易日	-0.01
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	690	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	1560	賣權OI最大量	1480

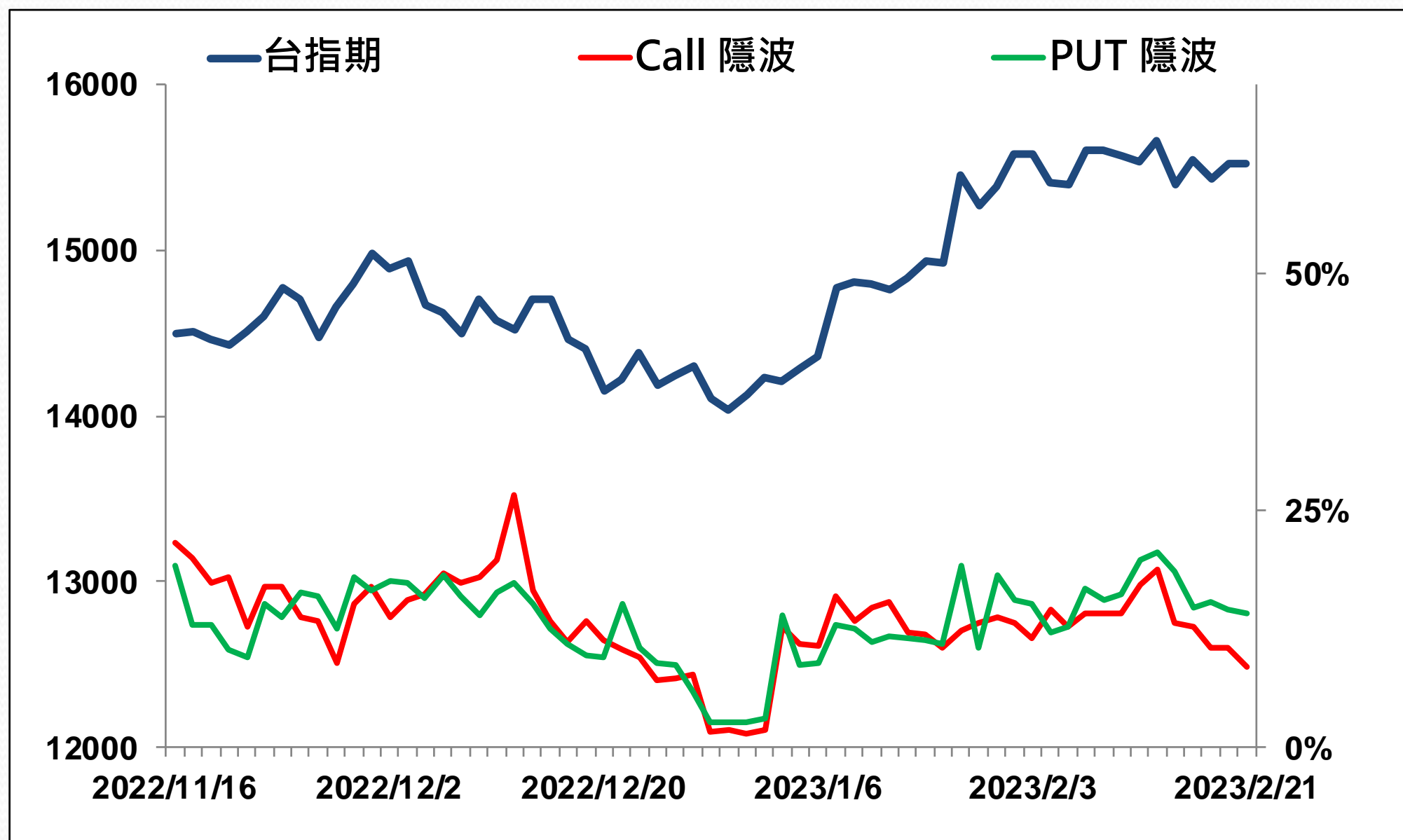
更新日期：2023年2月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



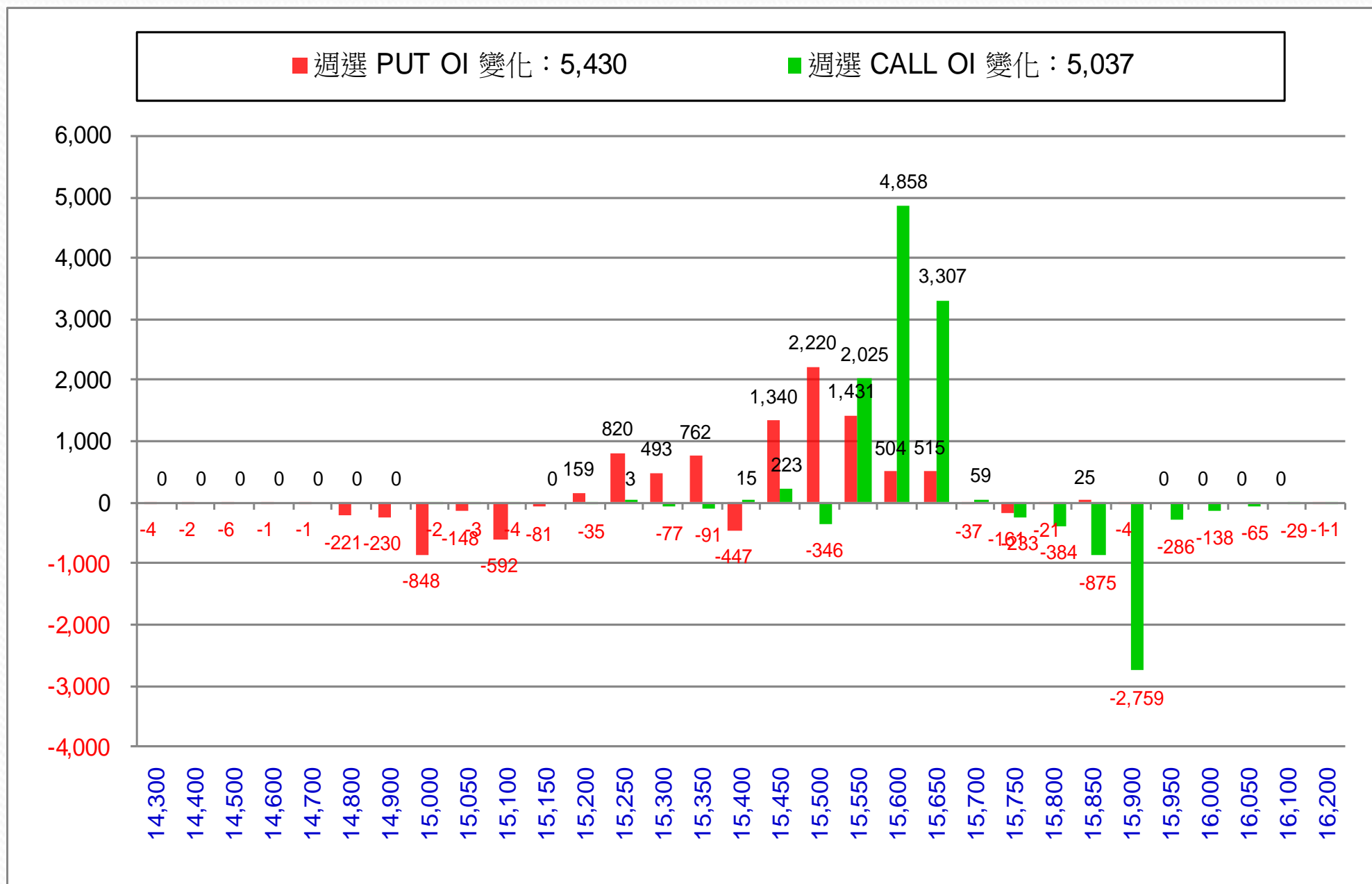
更新日期：2023年2月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年2月21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

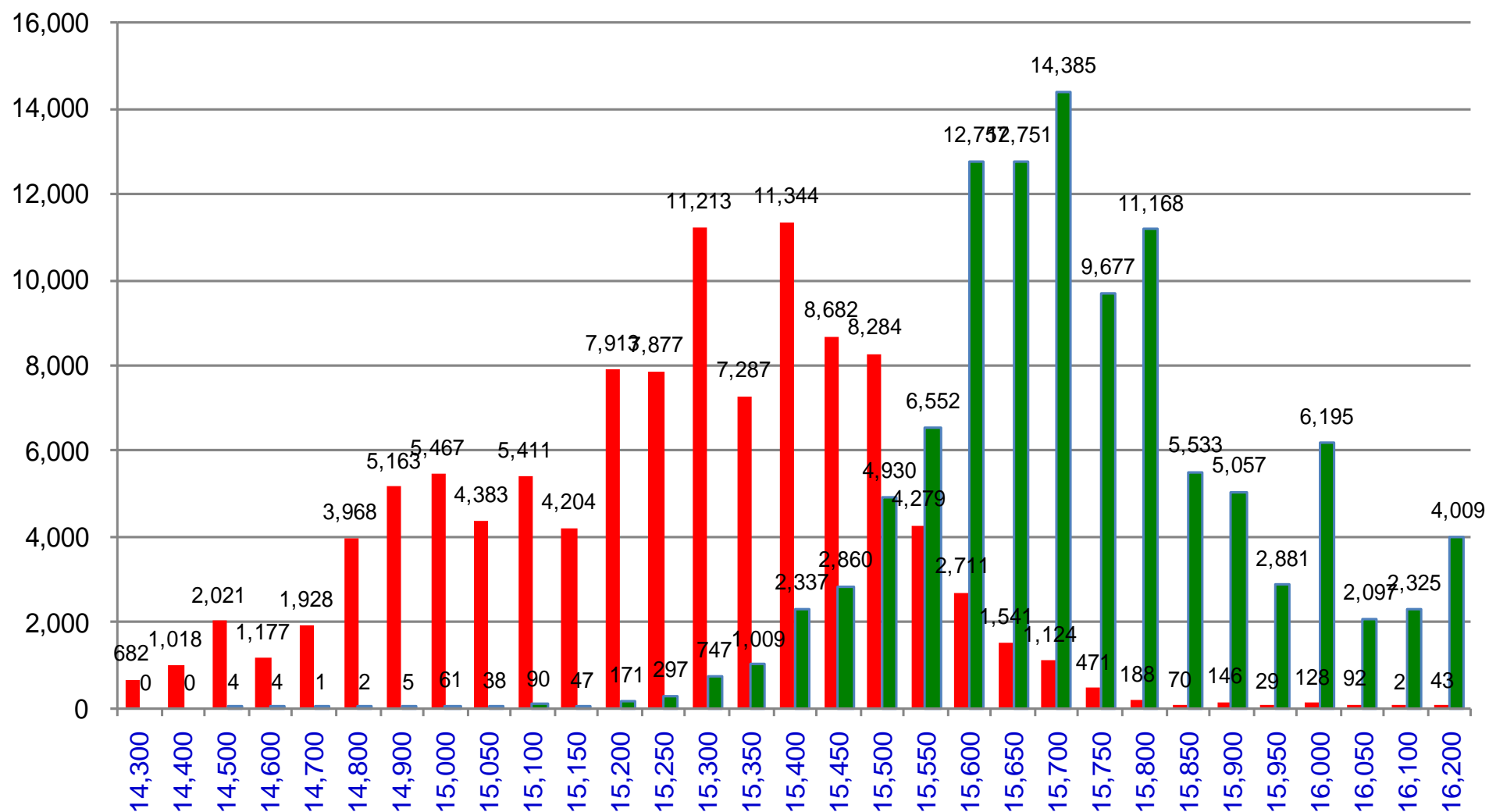


更新日期：2023年2月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：109,795

週選 CALL OI 總額：112,245



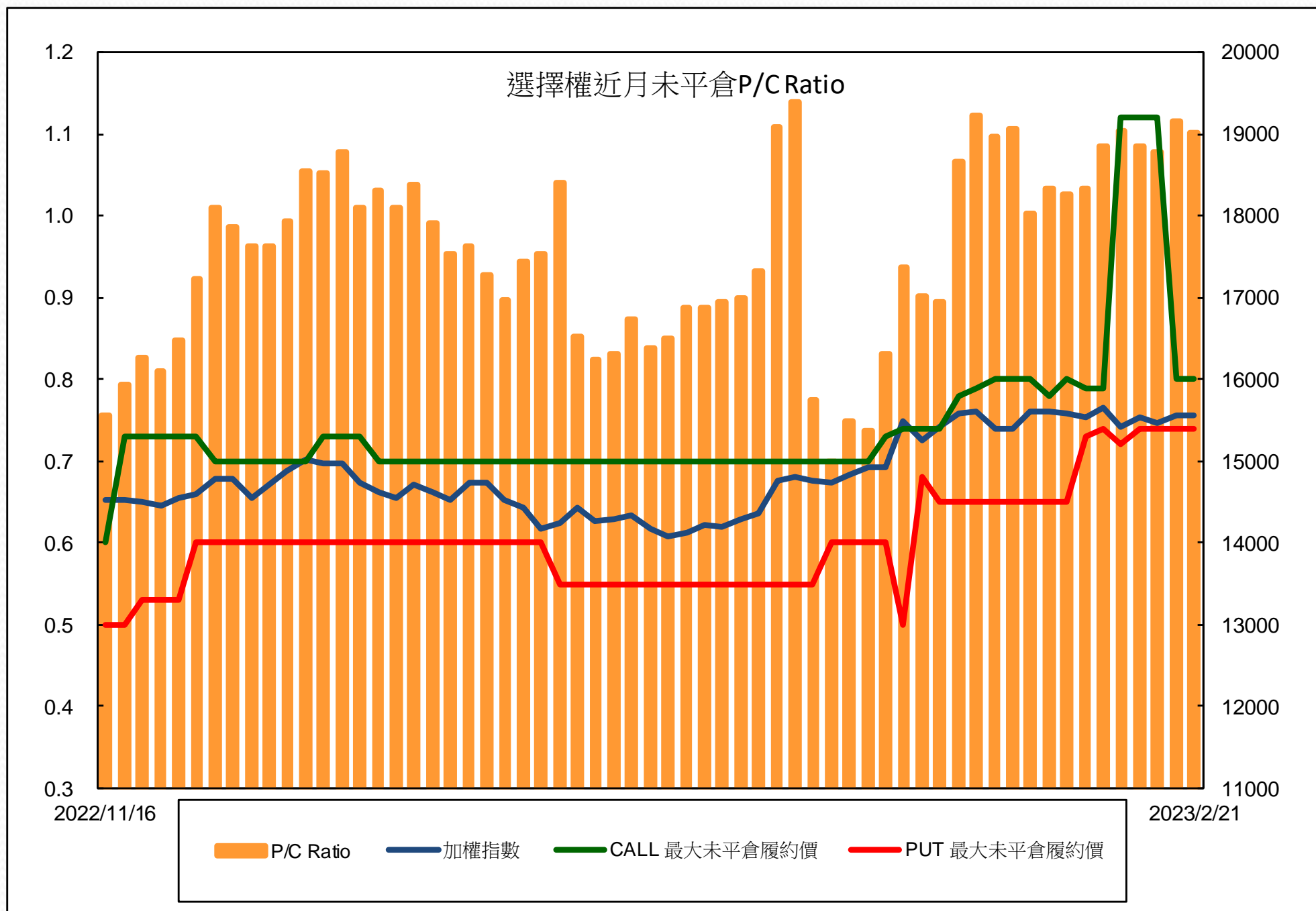
更新日期：2023年2月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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20日	69,063	60,202	8,861
	2月21日	69,550	64,305	5,245
Put	2月20日	58,652	67,304	-8,652
	2月21日	60,232	71,321	-11,089

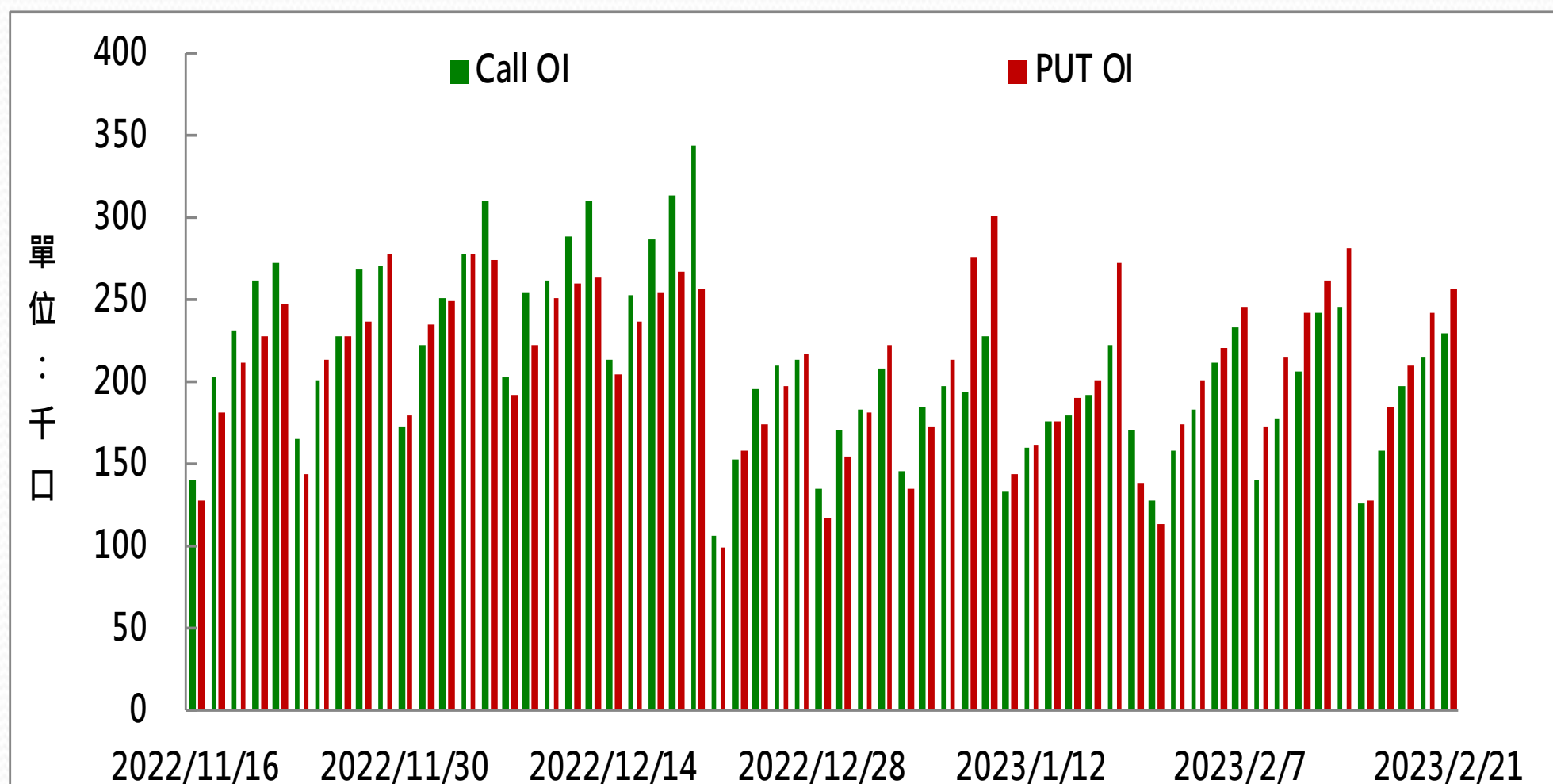
更新日期：2023年2月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

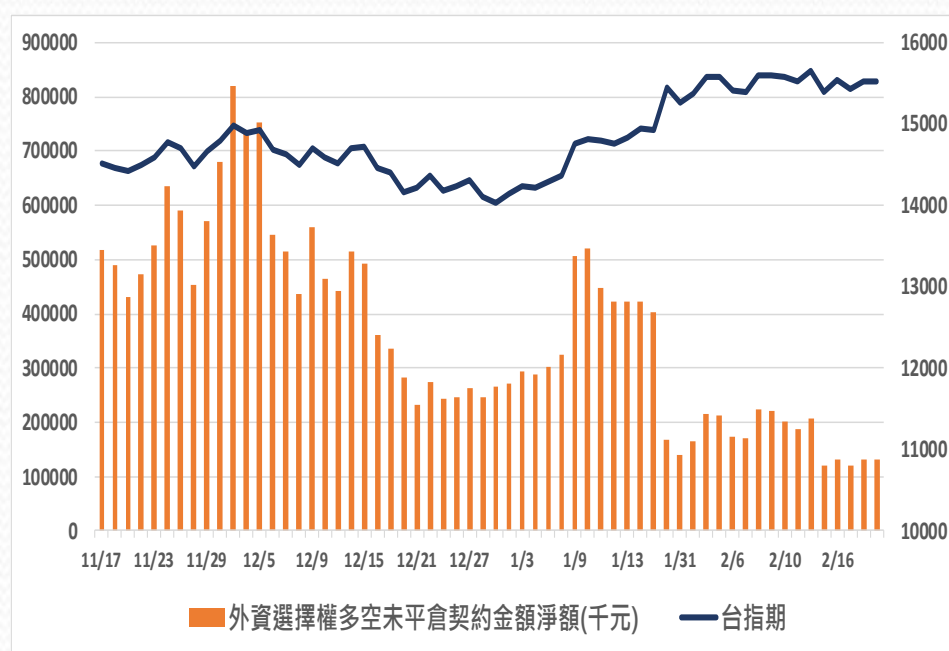
選擇權全月Put Call OI



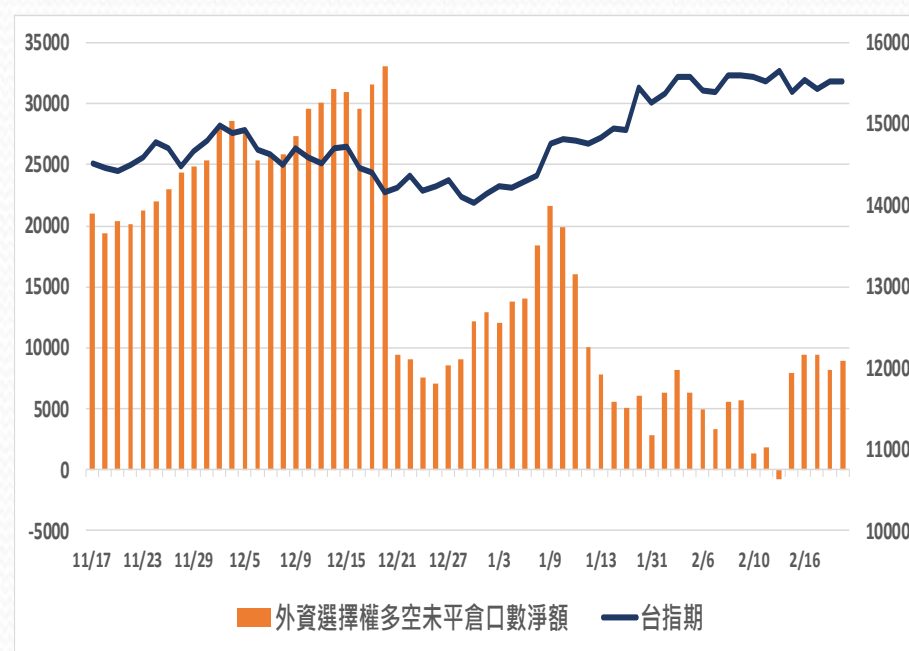
更新日期：2023年2月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



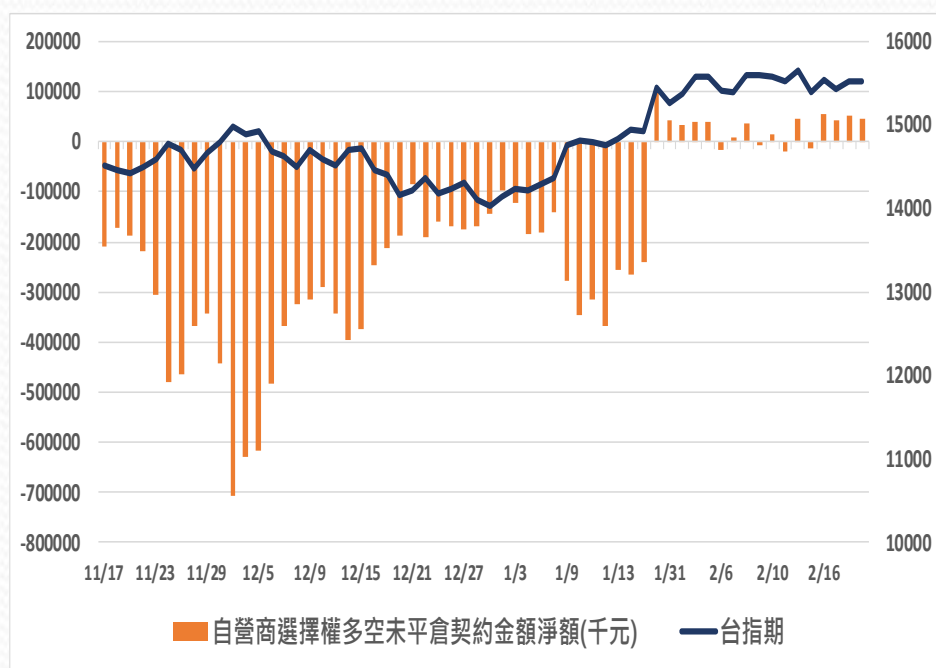
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/15	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
2023/2/21	15528	8967	832	130471	-2264

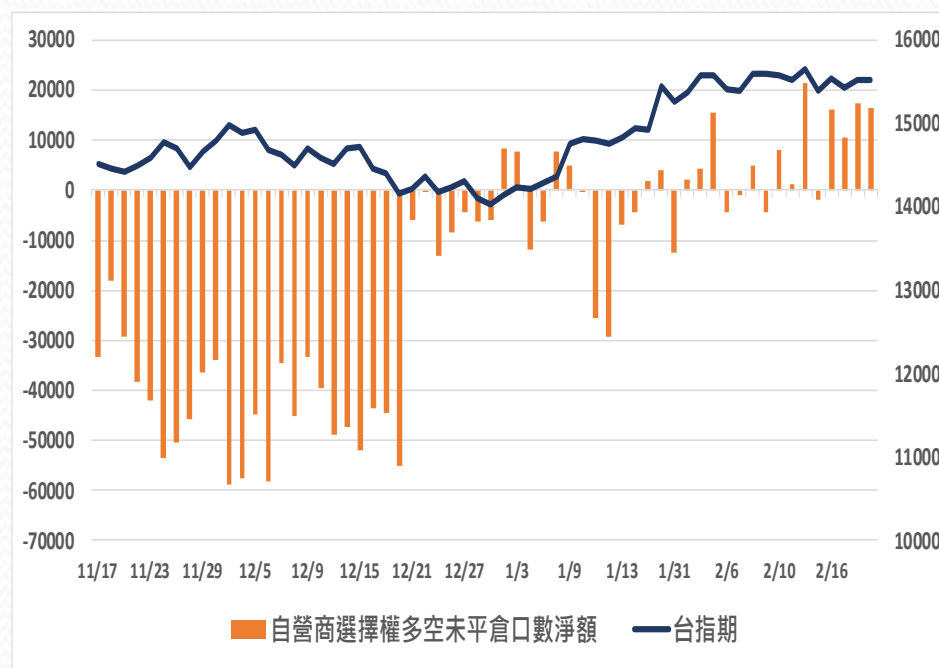
更新日期：2023年2月21日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



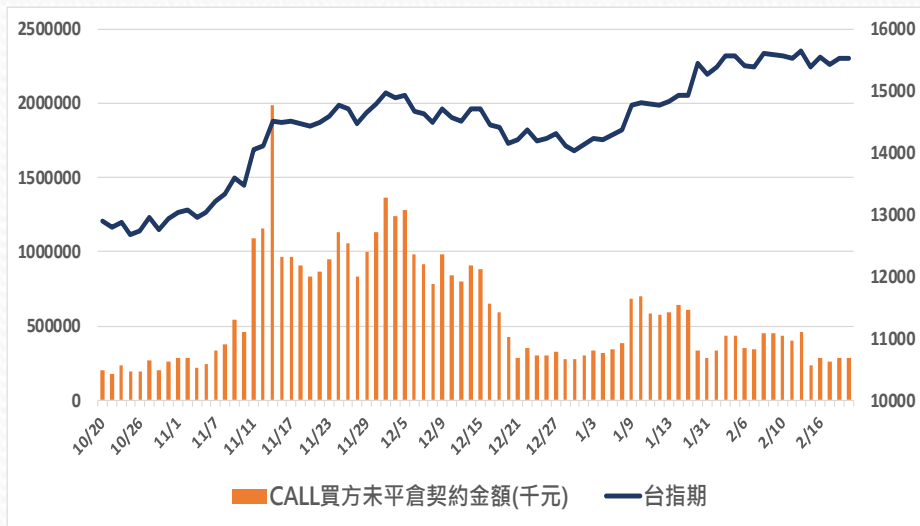
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/15	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
2023/2/21	15528	16334	-1179	47358	-5111

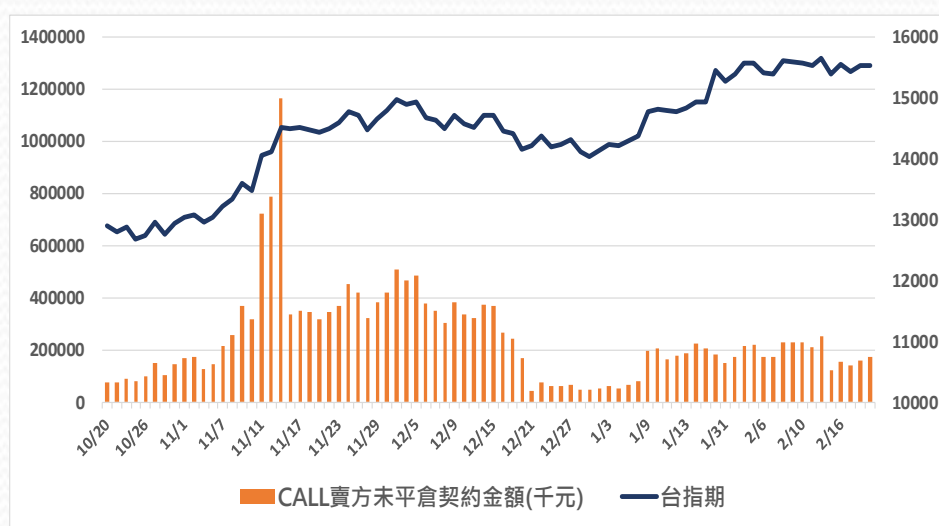
更新日期：2023年2月21日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

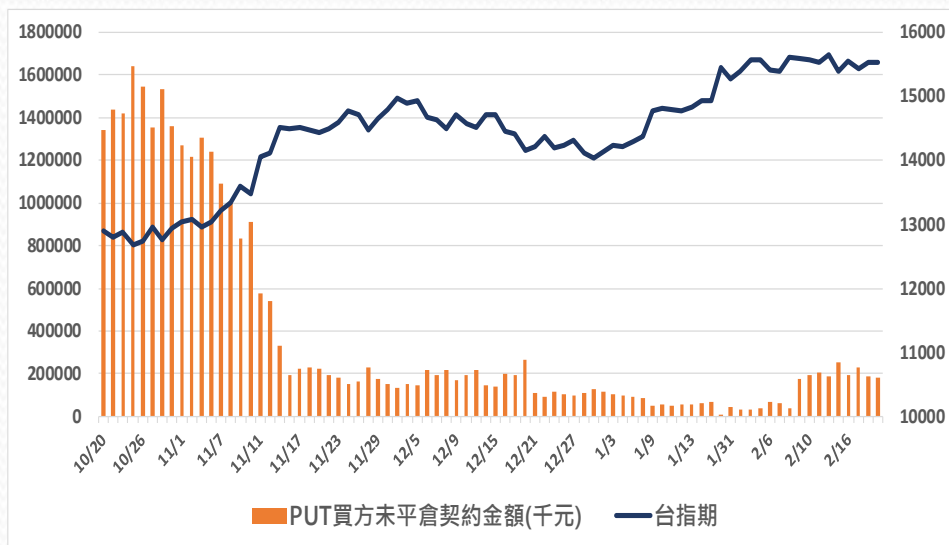
CALL買方未平倉金額



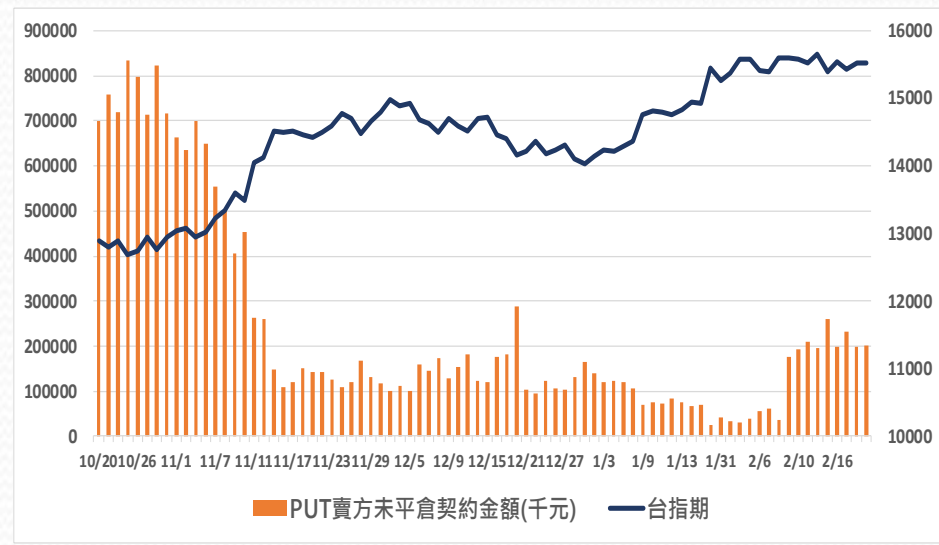
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



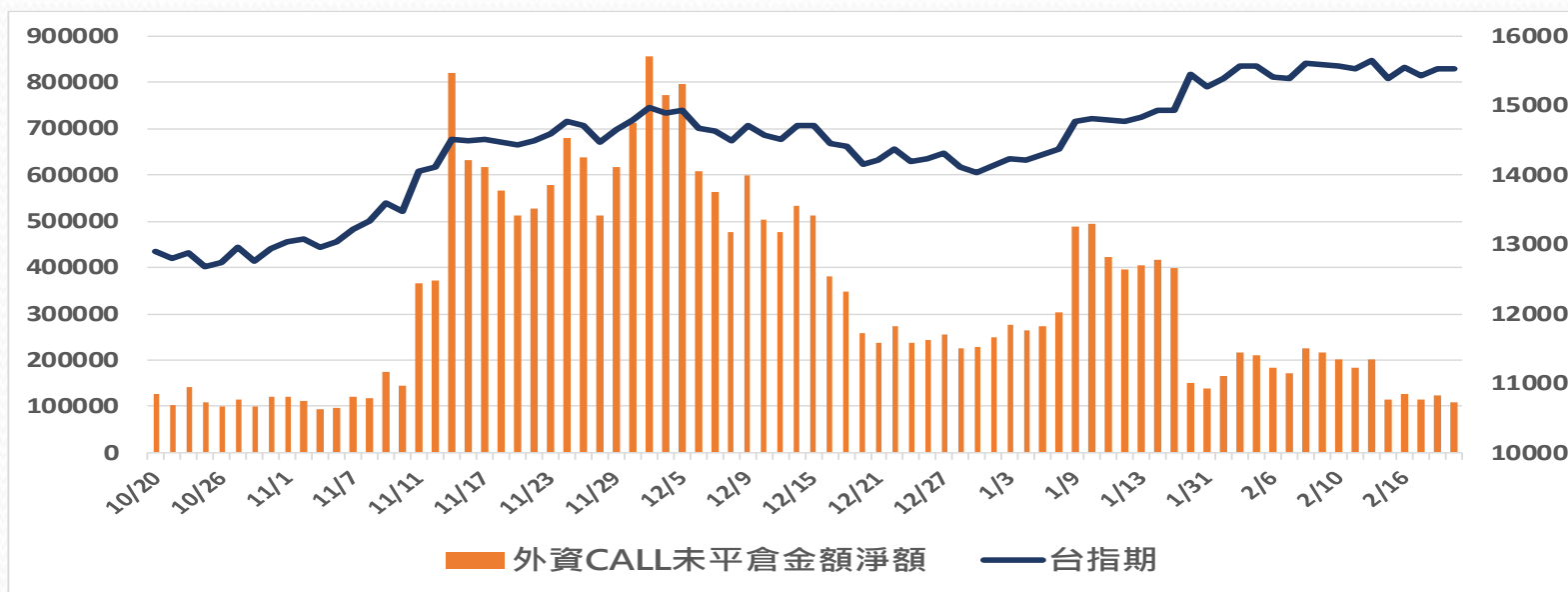
PUT賣方未平倉金額



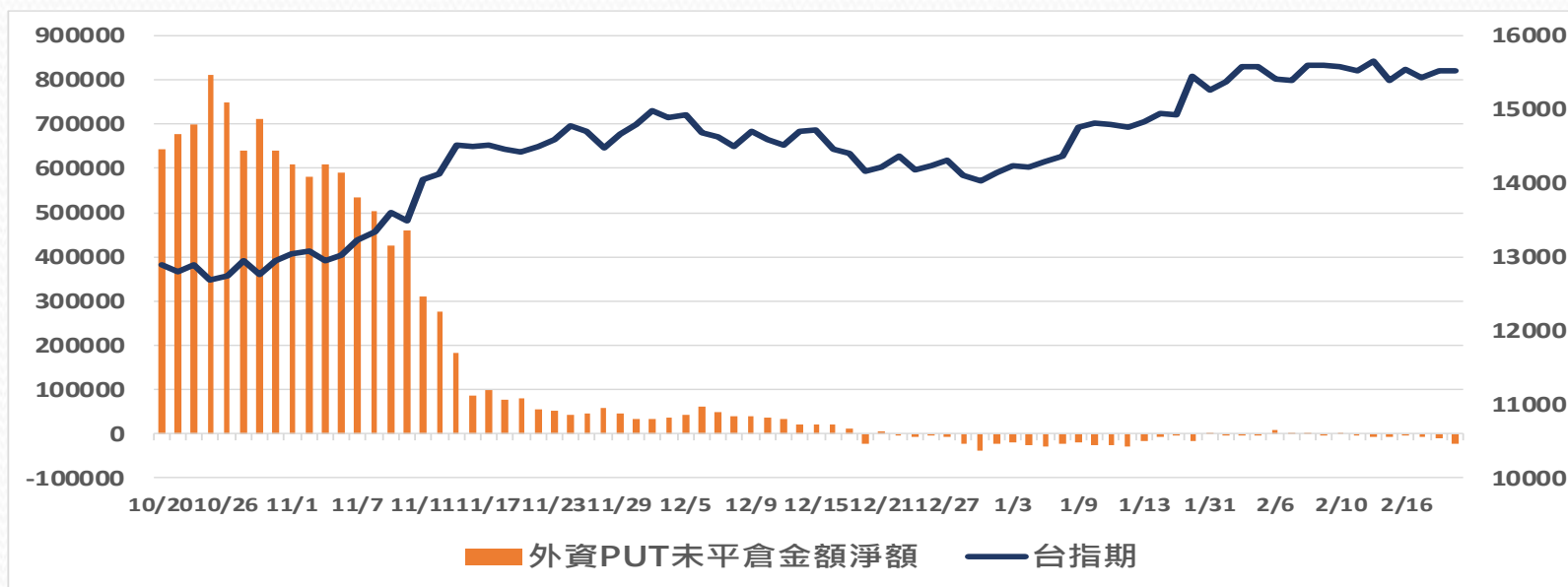
更新日期：2023年2月21日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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21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21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