

台指選擇權OI匯報

日期：2023/2/22 結算日：2023/3/1					日期：2023/2/22 結算日：2023/3/15				
202303W1					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	13,900	0	0	0	78	13,600	1,124	67
0	0	14,000	477	1	0	1	13,700	905	6
0	0	14,100	40	16	-2	68	13,800	1,513	53
0	0	14,200	338	2	0	12	13,900	1,197	142
0	0	14,300	243	14	0	477	14,000	4,294	20
0	1	14,400	1,267	605	0	27	14,100	2,316	51
0	0	14,500	2,152	35	0	138	14,200	1,716	54
0	1	14,600	3,343	395	0	56	14,300	1,641	98
0	1	14,700	2,768	271	0	269	14,400	2,515	48
1	2	14,800	3,972	282	1	93	14,500	4,638	82
0	3	14,900	3,843	1,795	-1	247	14,600	2,578	355
23	41	15,000	3,141	1,996	-7	88	14,700	6,405	137
51	63	15,100	1,978	926	9	242	14,800	4,243	753
34	35	15,150	1,504	984	2	94	14,900	2,825	197
255	289	15,200	2,274	954	3	469	15,000	8,146	1,147
196	224	15,250	1,992	1,296	27	247	15,100	3,825	704
708	778	15,300	2,977	1,507	24	558	15,200	4,909	335
973	1,063	15,350	1,795	845	254	653	15,300	3,158	381
1,745	2,074	15,400	2,126	996	363	2,067	15,400	4,455	748
1,117	1,354	15,450	1,293	488	377	3,069	15,500	1,881	53
1,595	1,979	15,500	1,317	407	274	3,501	15,600	1,138	-163
1,146	1,566	15,550	510	101	1,138	2,943	15,700	315	-51
2,803	3,381	15,600	536	46	802	4,004	15,800	219	14
1,822	2,655	15,650	99	54	1,795	5,923	15,900	193	24
3,512	4,310	15,700	133	17	959	10,324	16,000	166	8
2,174	3,085	15,750	23	3	-17	6,695	16,100	70	0
2,843	4,779	15,800	36	-4	977	9,061	16,200	55	-64
861	2,367	15,850	5	0	306	3,756	16,300	31	0
510	2,470	15,900	15	5	-114	3,254	16,400	5	1
613	1,436	15,950	9	2	30	2,086	16,500	4	0
1,532	2,298	16,000	4	-1	77	1,333	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
24,669	39,713	1.0142	40,276	14,100	8,680	97,024	1.0600	102,847	5,484
昨日 P/C	0.9782	今日增減變化		0.0360	昨日 P/C	1.1021	今日增減變化		-0.0421

更新日期：2023年2月22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22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	98,401,047	38,943,939	59,457,108	6,855,581	3,060,975	1,036,551	2,024,424	-140,993	
投信	23,846,625	50,196,232	-26,349,607	128,738	392,286	0	392,286	-23,358	
自營商	42,680,760	25,486,800	17,193,960	-3,193,787	1,068,036	1,128,102	-60,066	-57,260	
	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	434,391	2,027,683	-1,593,292	-88,122	230,908	0	230,908	97,070	
投信	123,888	0	123,888	-363	0	0	0	0	
自營商	514,370	141,131	373,239	58,680	116,969	314,930	-197,961	-20,535	

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22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	21,830	13,679	8,151	-9,310	32,221	27,307	4,914	-3,580	
投信	100	0	100	50	200	113	87	0	
自營商	66,072	55,636	10,436	5,191	45,666	54,328	-8,662	2,427	
特定法人(週)	1,100	0	1,100	---	0	5,595	-5,595	---	
特定法人(近月)	15,961	6,132	9,829	-1,997	12,846	13,564	-718	-1,248	
特定法人(全月)	16,958	4,352	12,606	-7,501	15,096	24,874	-9,778	3,378	
十大交易人(週)	25,641	19,266	6,375	---	23,076	19,280	3,796	---	
十大交易人(近月)	55,995	50,206	5,789	-237	56,282	46,071	10,211	-1,091	
十大交易人(全月)	89,261	69,702	19,559	2,354	84,609	73,543	11,066	-10,820	
全市場未沖銷(近月)			97,024	8,680			102,847	5,484	
全市場未沖銷(全月)			157,273	-72,107			166,774	-89,339	

更新日期：2023年2月22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03W1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	15000	賣權OI最大量	14800
	整體隱含波動率	13.03%	較前一交易日	+2.08%
	買權隱含波動率	10.84%	較前一交易日	+2.74%
	賣權隱含波動率	15.80%	較前一交易日	+2.09%
電子選擇權	買權成交最大量	715	買權OI最大量	755
	賣權成交最大量	700	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	1620
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年2月22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	15800	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	15.54%	較前一交易日	-0.47%
	買權隱含波動率	13.61%	較前一交易日	+0.71%
	賣權隱含波動率	17.95%	較前一交易日	+1.39%
	成交量P/C_Ratio值	0.877	較前一交易日	-0.47
	未平倉P/C_Ratio值	1.060	較前一交易日	-0.04
電子選擇權	買權成交最大量	715	買權OI最大量	755
	賣權成交最大量	700	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	1620
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1480

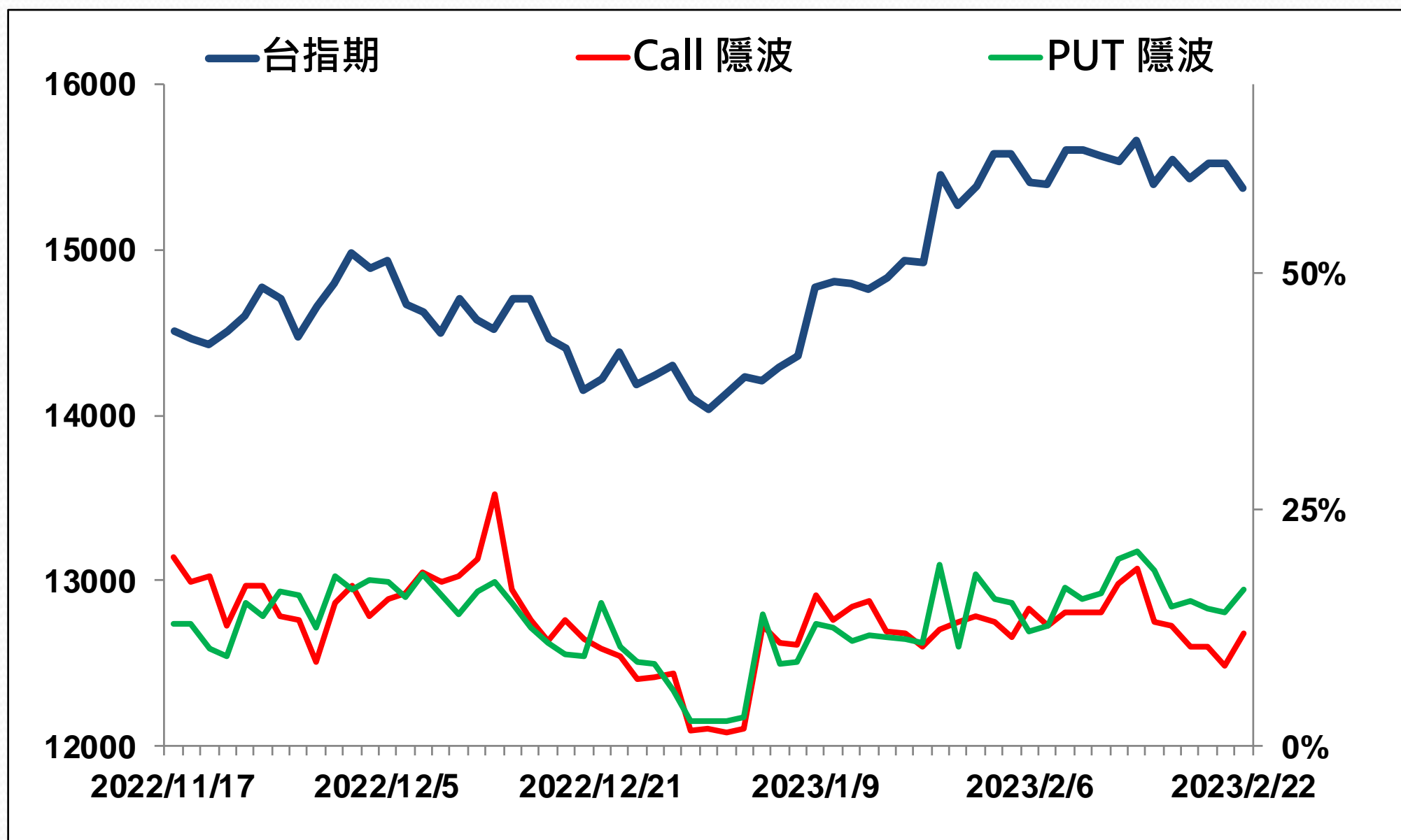
更新日期：2023年2月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



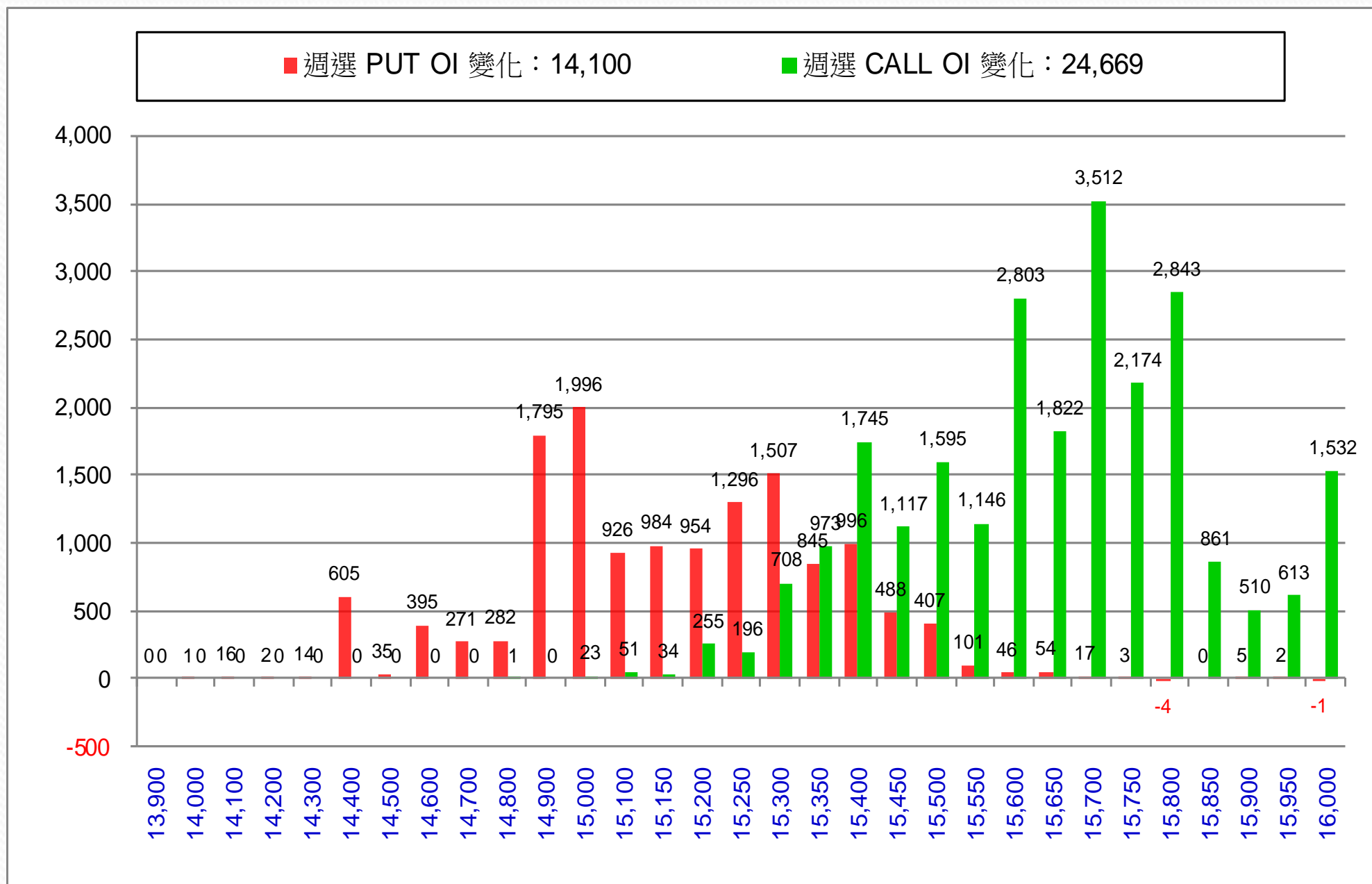
更新日期：2023年2月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



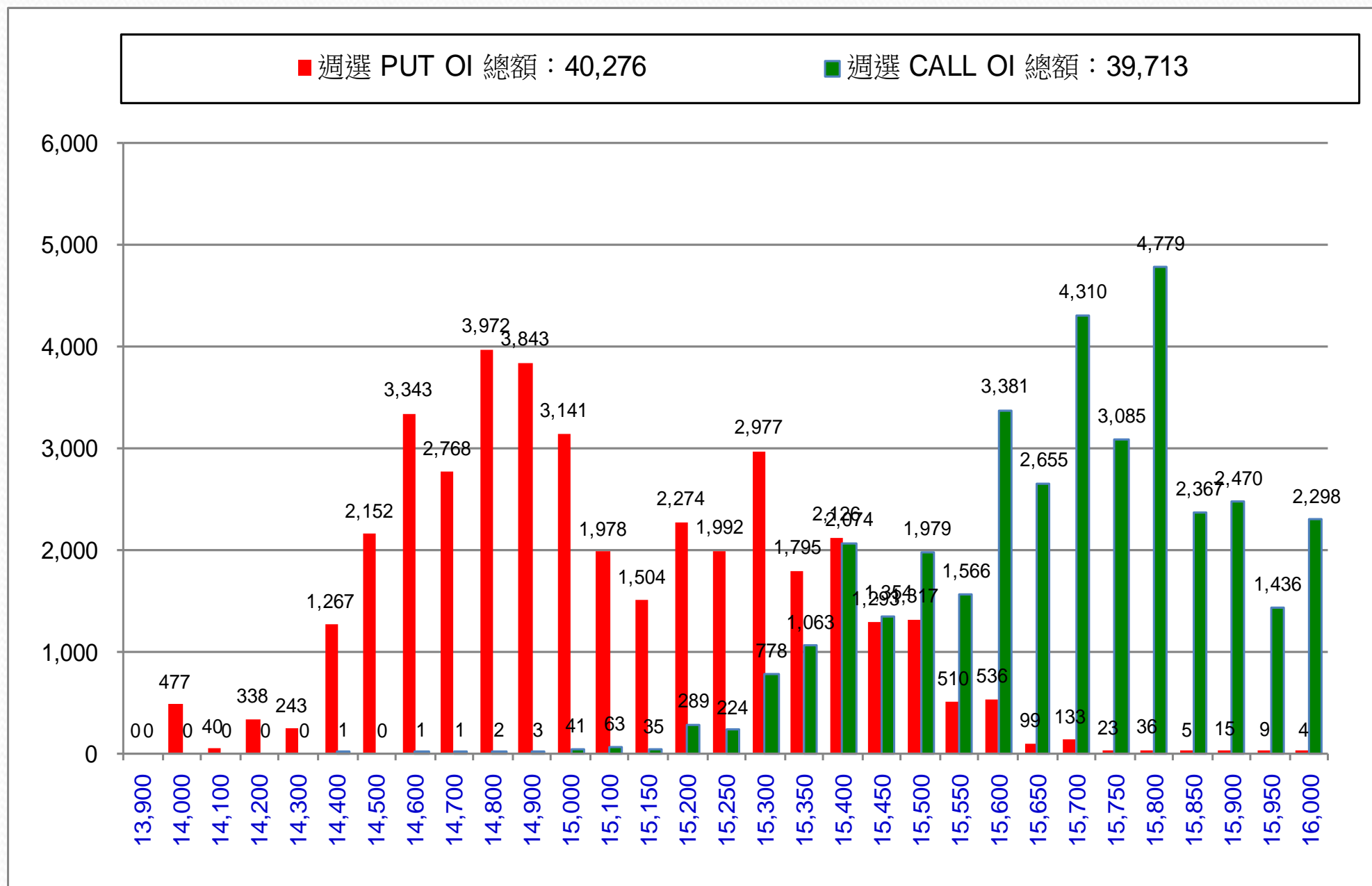
更新日期：2023年2月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年2月22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



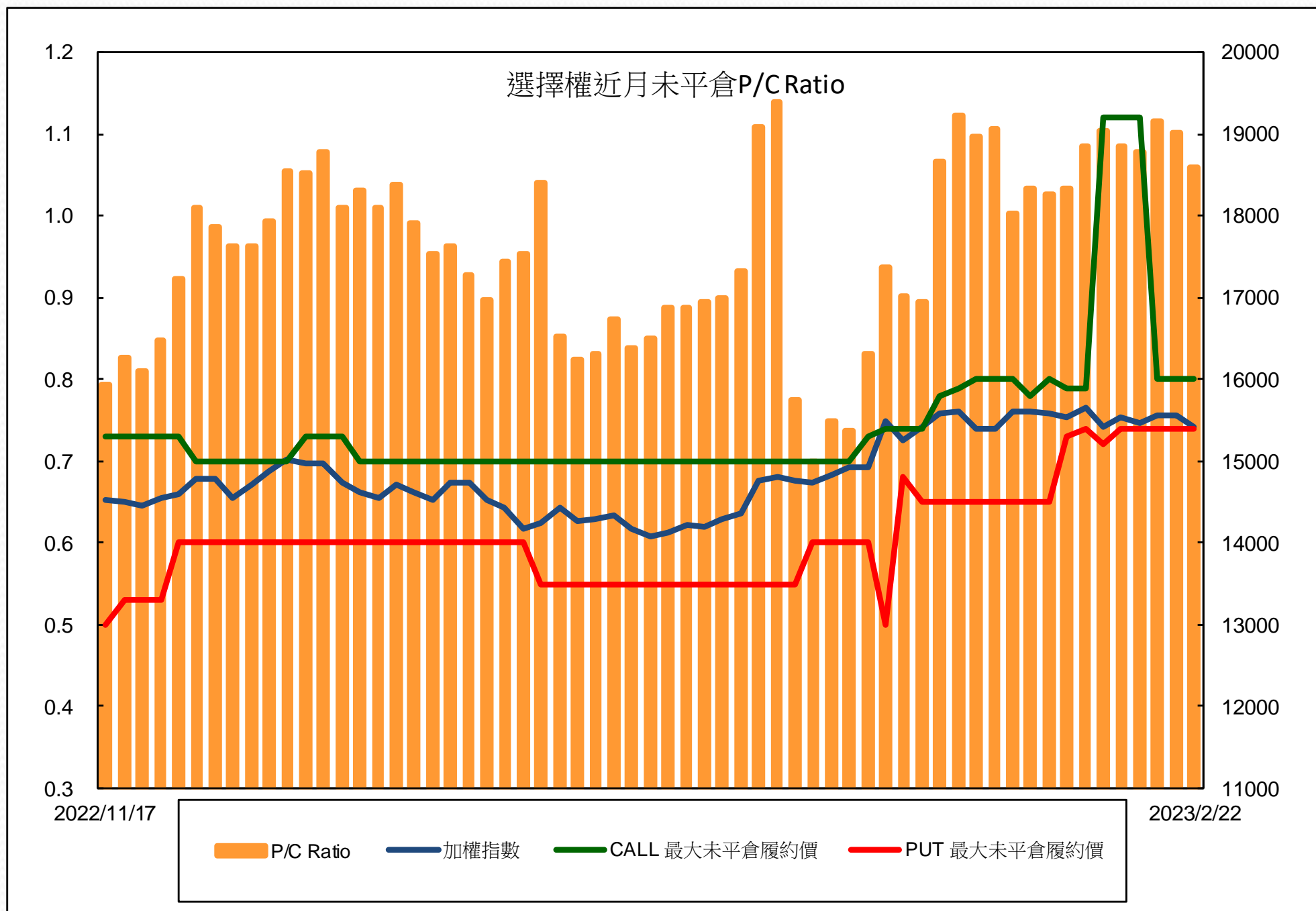
更新日期：2023年2月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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21日	69,550	64,305	5,245
	2月22日	66,072	55,636	10,436
Put	2月21日	60,232	71,321	-11,089
	2月22日	45,666	54,328	-8,662

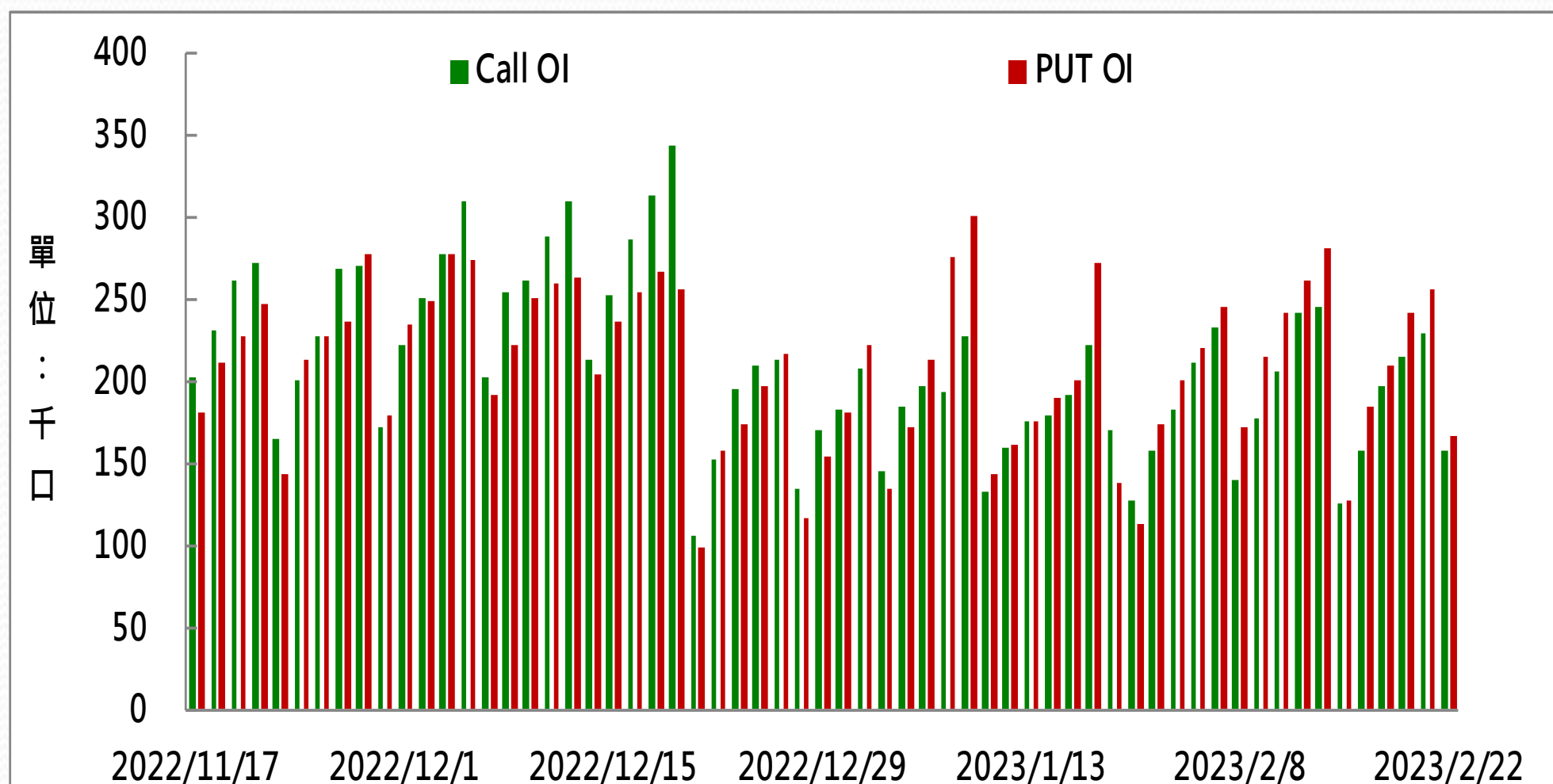
更新日期：2023年2月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

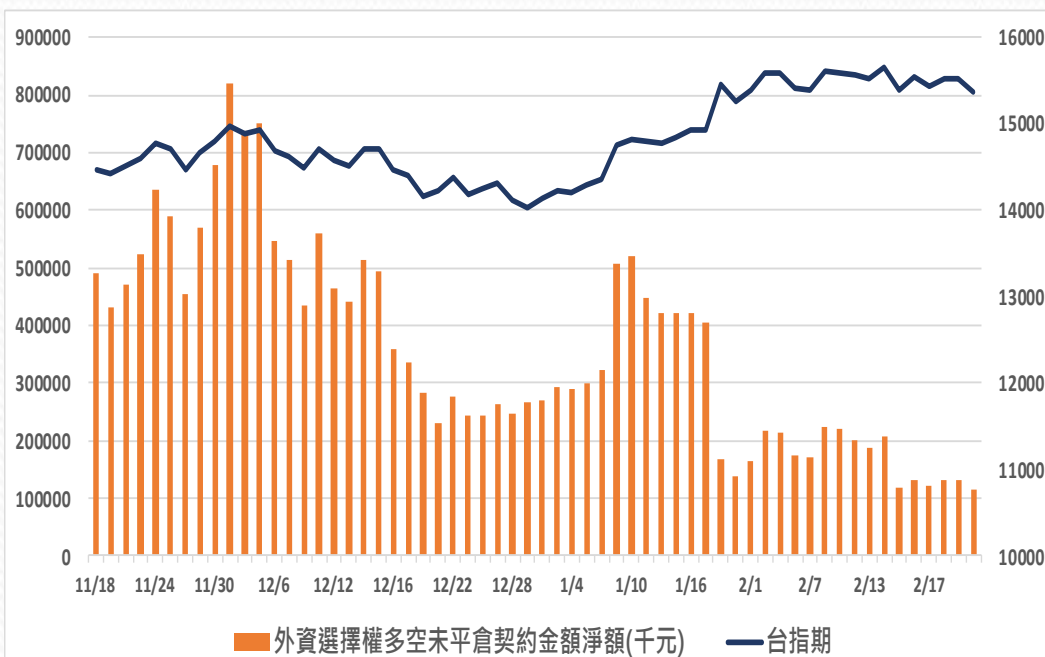
選擇權全月Put Call OI



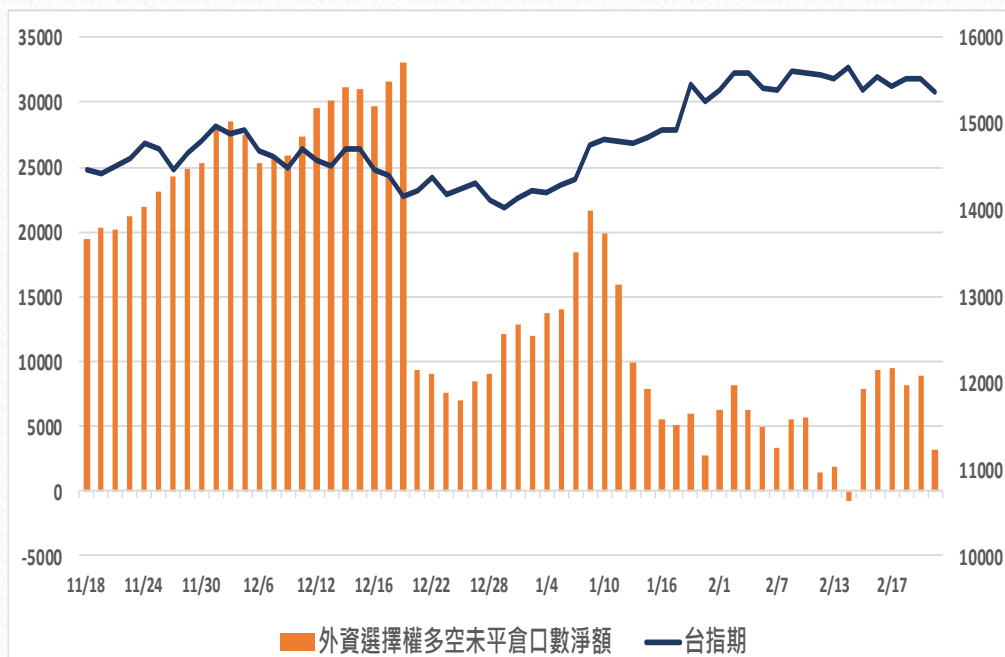
更新日期：2023年2月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



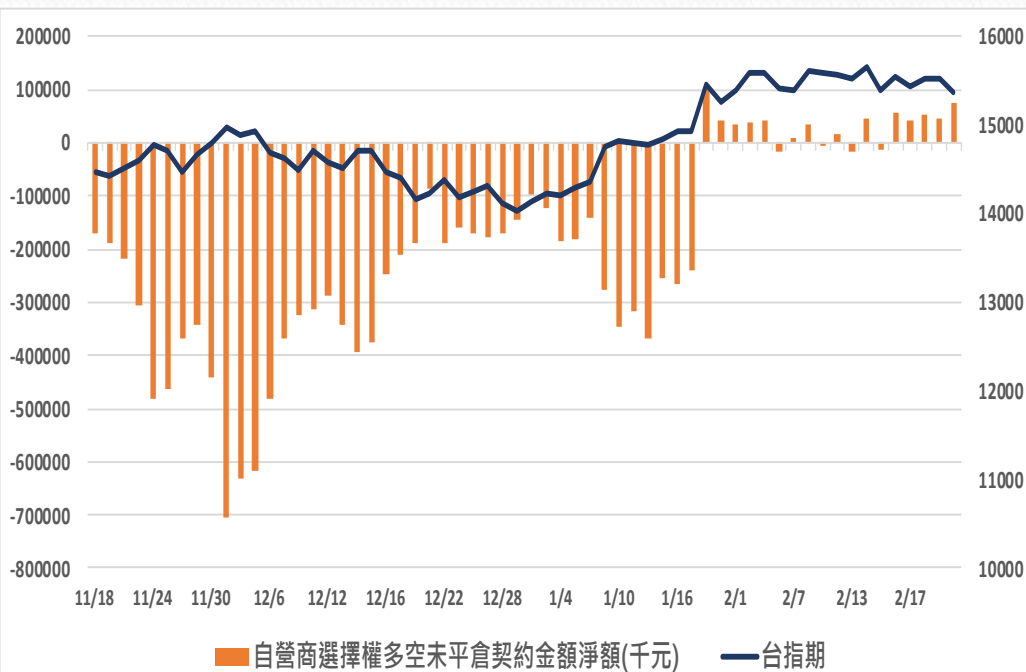
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/16	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
2023/2/22	15375	3237	-5730	115674	-14797

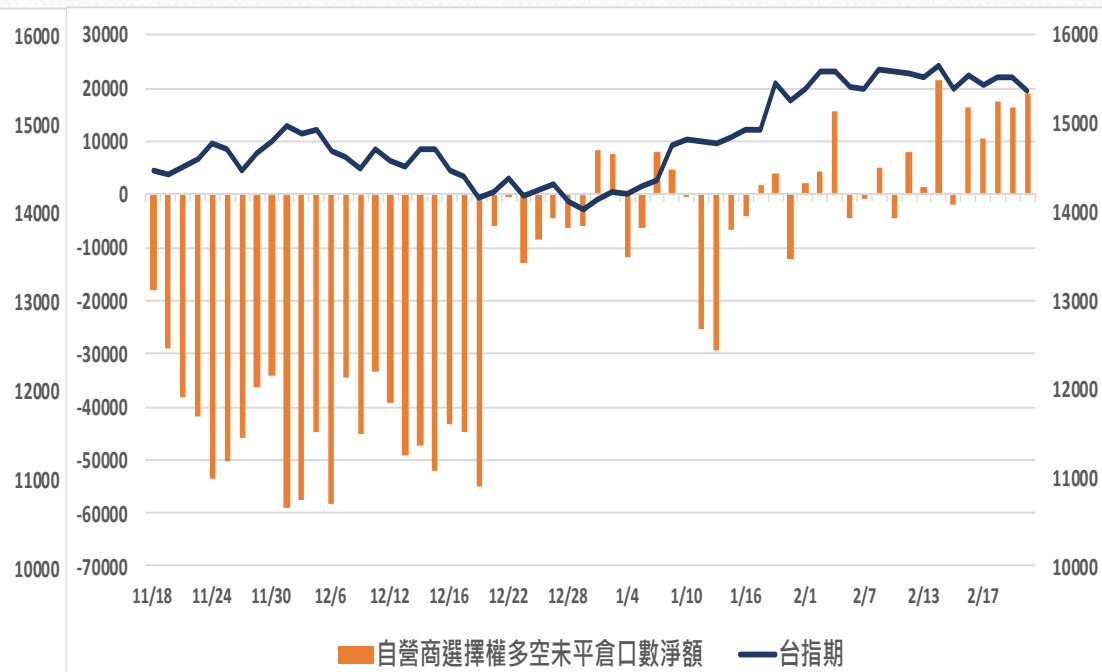
更新日期：2023年2月22日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



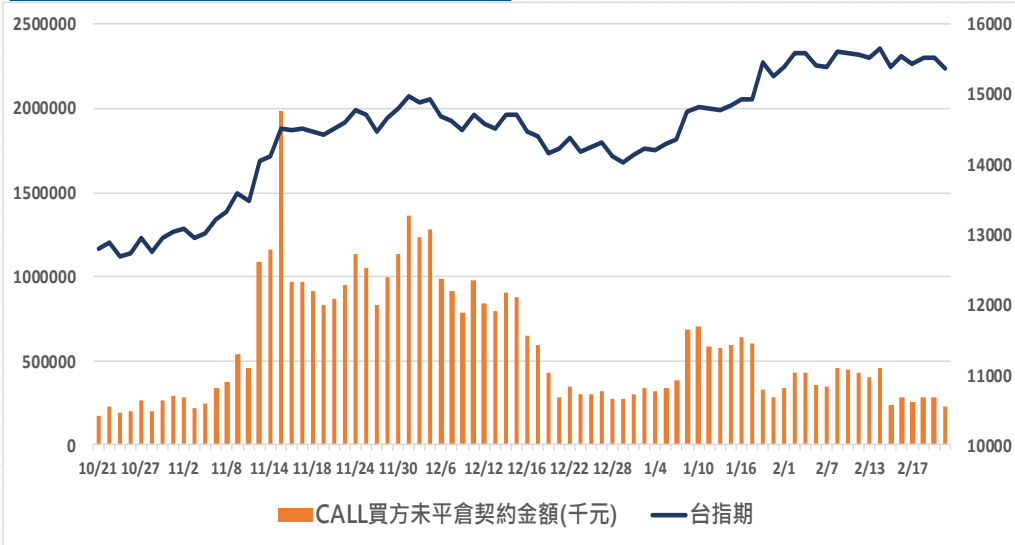
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/16	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
2023/2/22	15375	19098	2764	76325	28967

更新日期：2023年2月22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

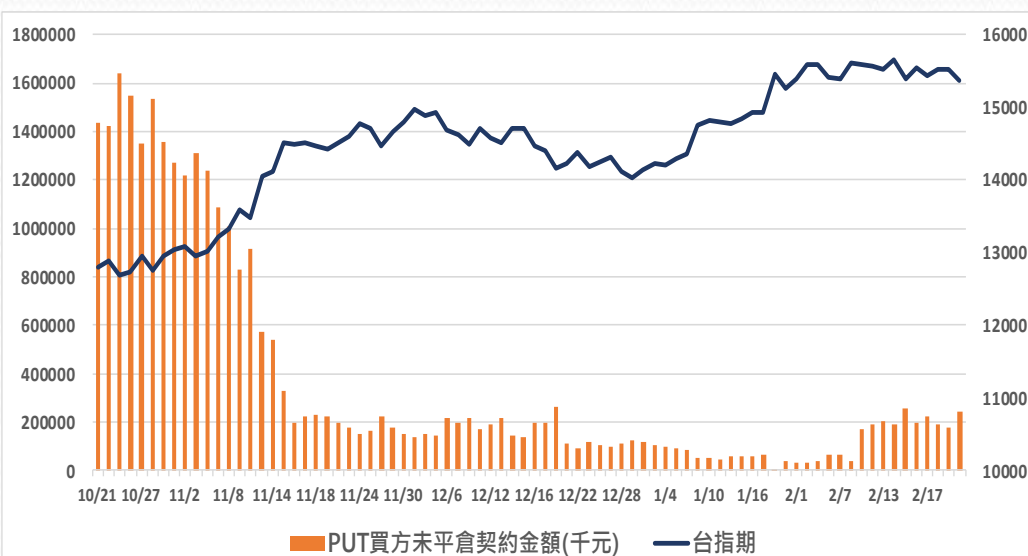
CALL買方未平倉金額



CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



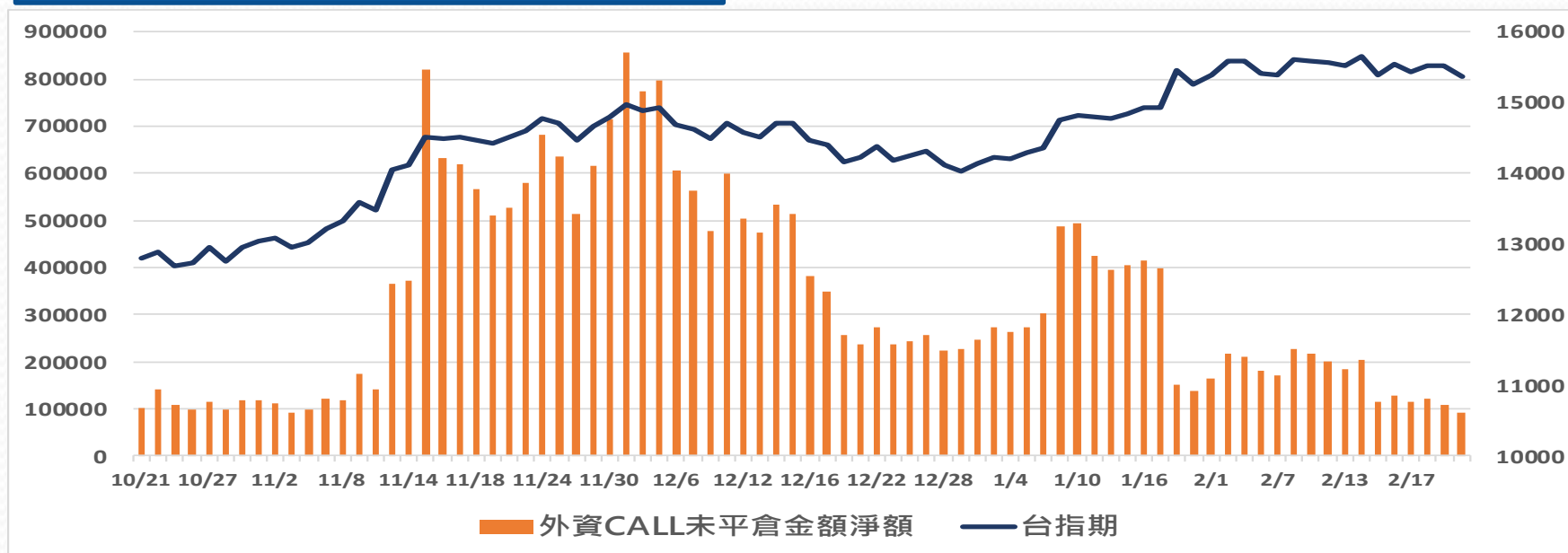
PUT賣方未平倉金額



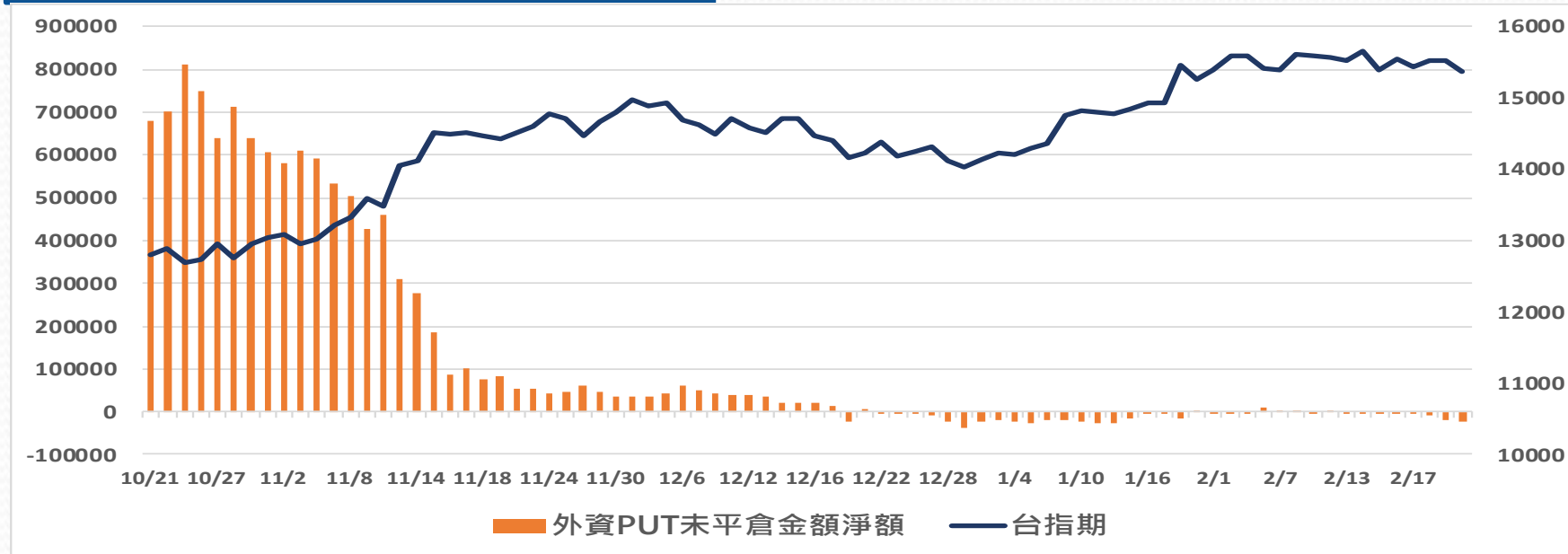
更新日期：2023年2月22日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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22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22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