

台指選擇權OI匯報

日期：2023/2/23 結算日：2023/3/1					日期：2023/2/23 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	1	14,400	1,275	8	0	68	13,800	1,893	380
0	0	14,500	2,327	175	0	12	13,900	1,437	240
1	2	14,600	3,788	445	-1	476	14,000	4,386	92
0	1	14,700	3,398	630	0	27	14,100	2,325	9
0	2	14,800	5,584	1,612	0	138	14,200	1,805	89
0	3	14,900	4,707	864	2	58	14,300	1,780	139
16	57	15,000	5,204	2,063	0	269	14,400	2,630	115
0	2	15,050	2,339	1,228	0	93	14,500	3,541	-1,097
45	108	15,100	5,225	3,247	3	250	14,600	2,510	-68
0	35	15,150	3,623	2,119	7	95	14,700	5,849	-556
59	348	15,200	5,985	3,711	6	248	14,800	5,751	1,508
29	253	15,250	5,213	3,221	5	99	14,900	2,924	99
-41	737	15,300	10,152	7,175	-5	464	15,000	9,130	984
933	1,996	15,350	4,287	2,492	-19	228	15,100	4,427	602
285	2,359	15,400	7,976	5,850	-5	553	15,200	5,236	327
791	2,145	15,450	3,946	2,653	132	785	15,300	3,446	288
499	2,478	15,500	6,116	4,799	80	2,147	15,400	4,982	527
268	1,834	15,550	2,460	1,950	-88	2,981	15,500	2,369	488
1,790	5,171	15,600	3,503	2,967	338	3,839	15,600	1,782	644
1,165	3,820	15,650	1,053	954	222	3,165	15,700	536	221
781	5,091	15,700	1,304	1,171	-374	3,630	15,800	268	49
1,101	4,186	15,750	445	422	3	5,926	15,900	178	-15
350	5,129	15,800	533	497	-1,024	9,300	16,000	184	18
1,961	4,328	15,850	68	63	416	7,111	16,100	78	8
1,761	4,231	15,900	53	38	196	9,257	16,200	123	68
874	2,310	15,950	17	8	475	4,231	16,300	71	40
1,066	3,364	16,000	8	4	-166	3,088	16,400	58	53
780	2,089	16,100	8	4	1,006	3,092	16,500	6	2
903	1,916	16,200	0	0	46	1,379	16,600	2	0
-46	271	16,300	0	0	25	1,057	16,700	0	0
31	215	16,400	0	0	73	995	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
15,069	54,784	1.6770	91,875	50,488	1,093	98,117	1.1055	108,469	5,622
昨日 P/C	1.0142	今日增減變化	0.6628	昨日 P/C	1.0600	今日增減變化	0.0455		

更新日期：2023年2月23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23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	103,107,174	44,597,817	58,509,357	-947,751	3,375,982	1,209,046	2,166,936	142,512	
投信	24,208,080	49,923,050	-25,714,970	634,637	400,095	0	400,095	7,809	
自營商	46,774,947	29,263,914	17,511,033	317,073	1,223,555	1,211,827	11,728	71,794	
	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	371,983	1,702,296	-1,330,313	262,979	316,154	0	316,154	85,246	
投信	124,520	0	124,520	632	0	0	0	0	
自營商	515,421	231,708	283,713	-89,526	119,514	400,903	-281,389	-83,428	

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23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	24,820	14,236	10,584	2,433	37,726	32,505	5,221	307	
投信	100	0	100	0	200	113	87	0	
自營商	68,509	58,444	10,065	-371	50,963	69,058	-18,095	-9,433	
特定法人(週)	1,210	0	1,210	110	0	4,509	-4,509	1,086	
特定法人(近月)	17,928	6,566	11,362	1,533	11,012	15,473	-4,461	-3,743	
特定法人(全月)	19,068	4,826	14,242	1,636	17,424	27,076	-9,652	126	
十大交易人(週)	30,471	20,329	10,142	3,767	43,876	30,094	13,782	9,986	
十大交易人(近月)	57,626	52,883	4,743	-1,046	58,654	45,595	13,059	2,848	
十大交易人(全月)	96,377	72,684	23,693	4,134	102,782	81,935	20,847	9,781	
全市場未沖銷(近月)			98,117	1,093			108,469	5,622	
全市場未沖銷(全月)			181,113	23,840			234,335	67,561	

更新日期：2023年2月23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	15600	買權OI最大量	15600
	賣權成交最大量	15300	賣權OI最大量	15300
	整體隱含波動率	12.51%	較前一交易日	-0.52%
	買權隱含波動率	11.57%	較前一交易日	+0.72%
	賣權隱含波動率	13.25%	較前一交易日	-2.56%
電子選擇權	買權成交最大量	730	買權OI最大量	750
	賣權成交最大量	730	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	1620
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年2月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

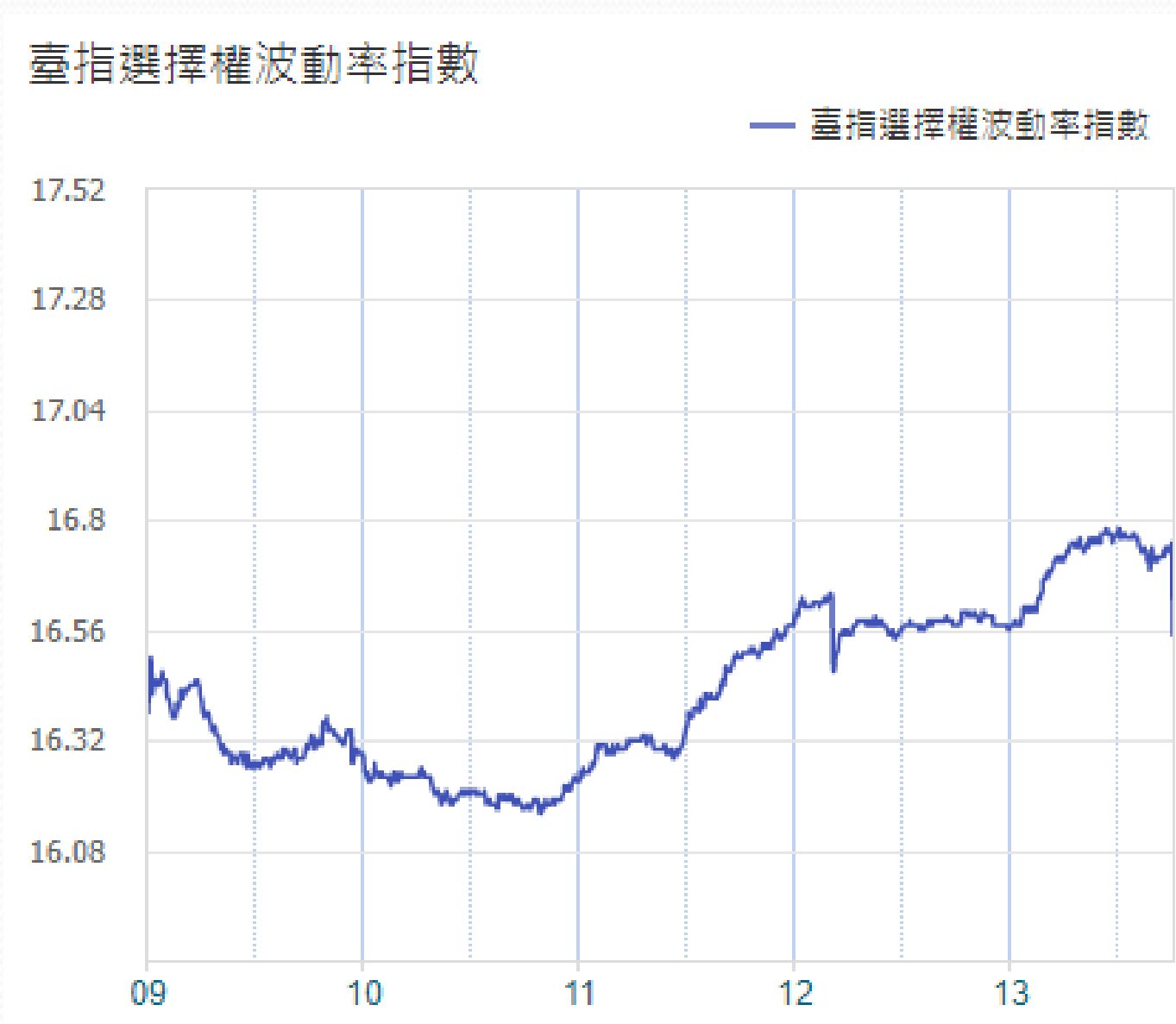
台指選擇權匯報

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	15.91%	較前一交易日	-0.36%
	買權隱含波動率	13.80%	較前一交易日	+0.20%
	賣權隱含波動率	17.95%	較前一交易日	+0.00%
	成交量P/C_Ratio值	1.007	較前一交易日	+0.13
	未平倉P/C_Ratio值	1.106	較前一交易日	+0.05
電子選擇權	買權成交最大量	730	買權OI最大量	750
	賣權成交最大量	730	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	1620
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1480

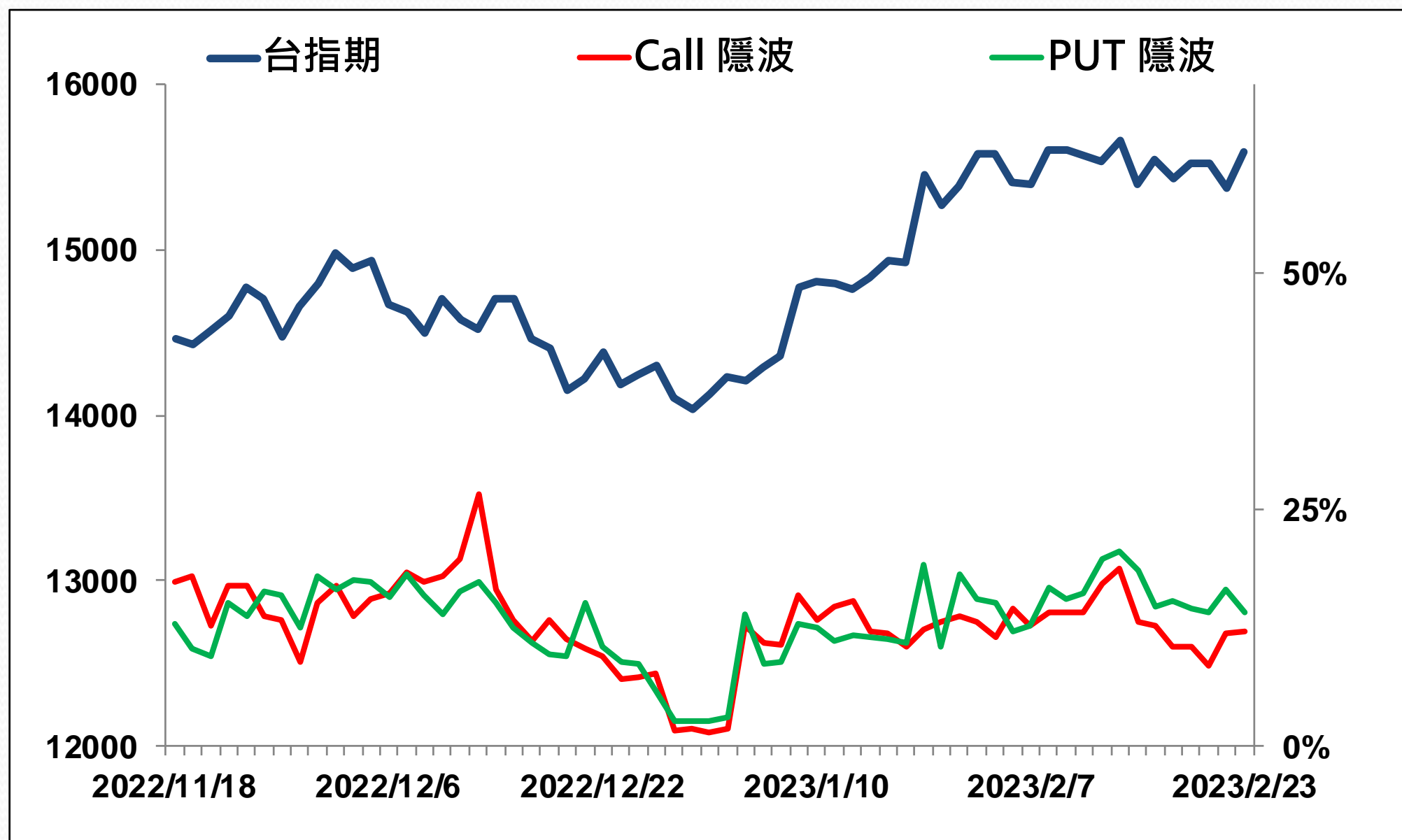
更新日期：2023年2月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



更新日期：2023年2月23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

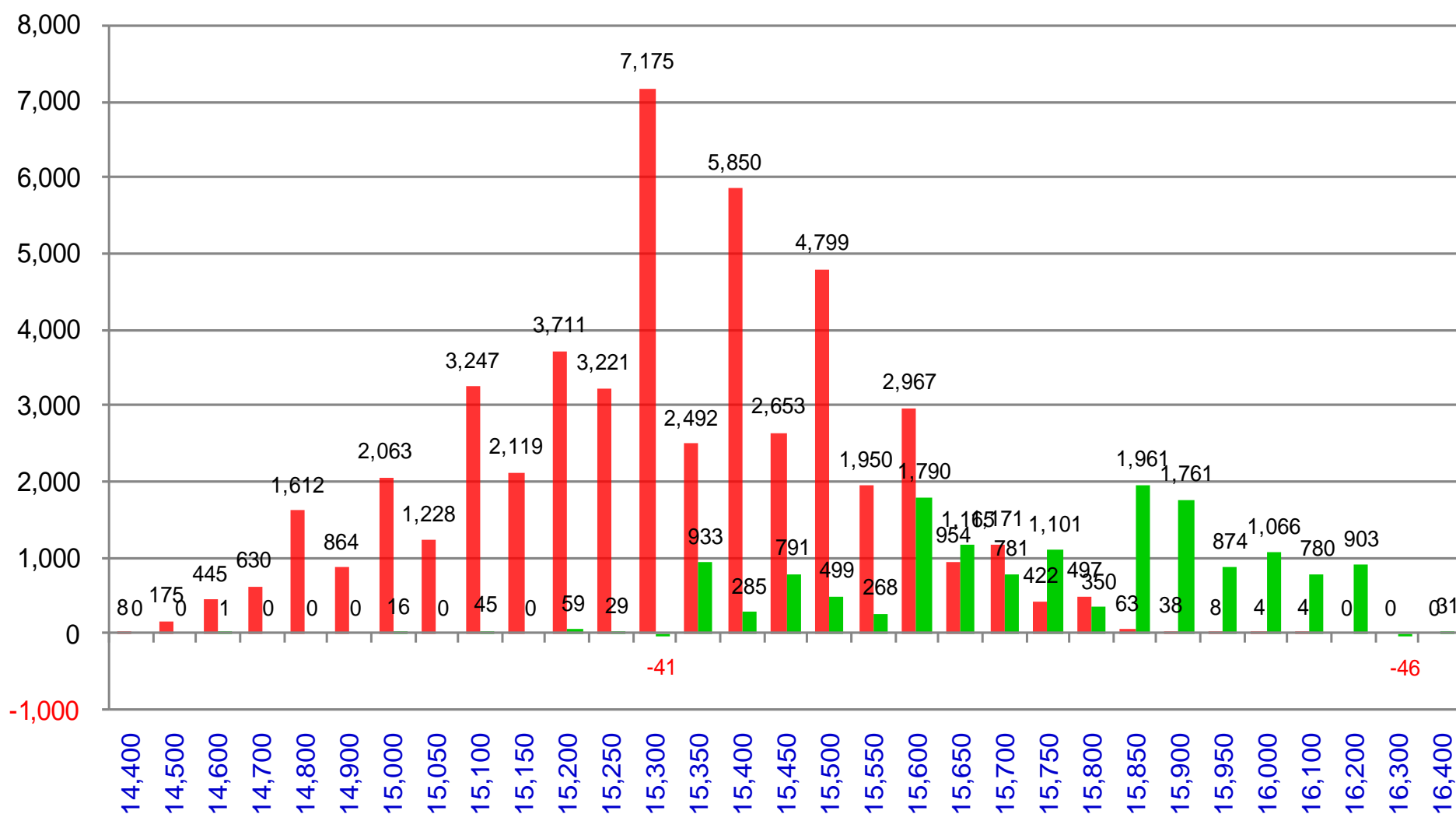


更新日期：2023年2月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：50,488

週選 CALL OI 變化：15,069

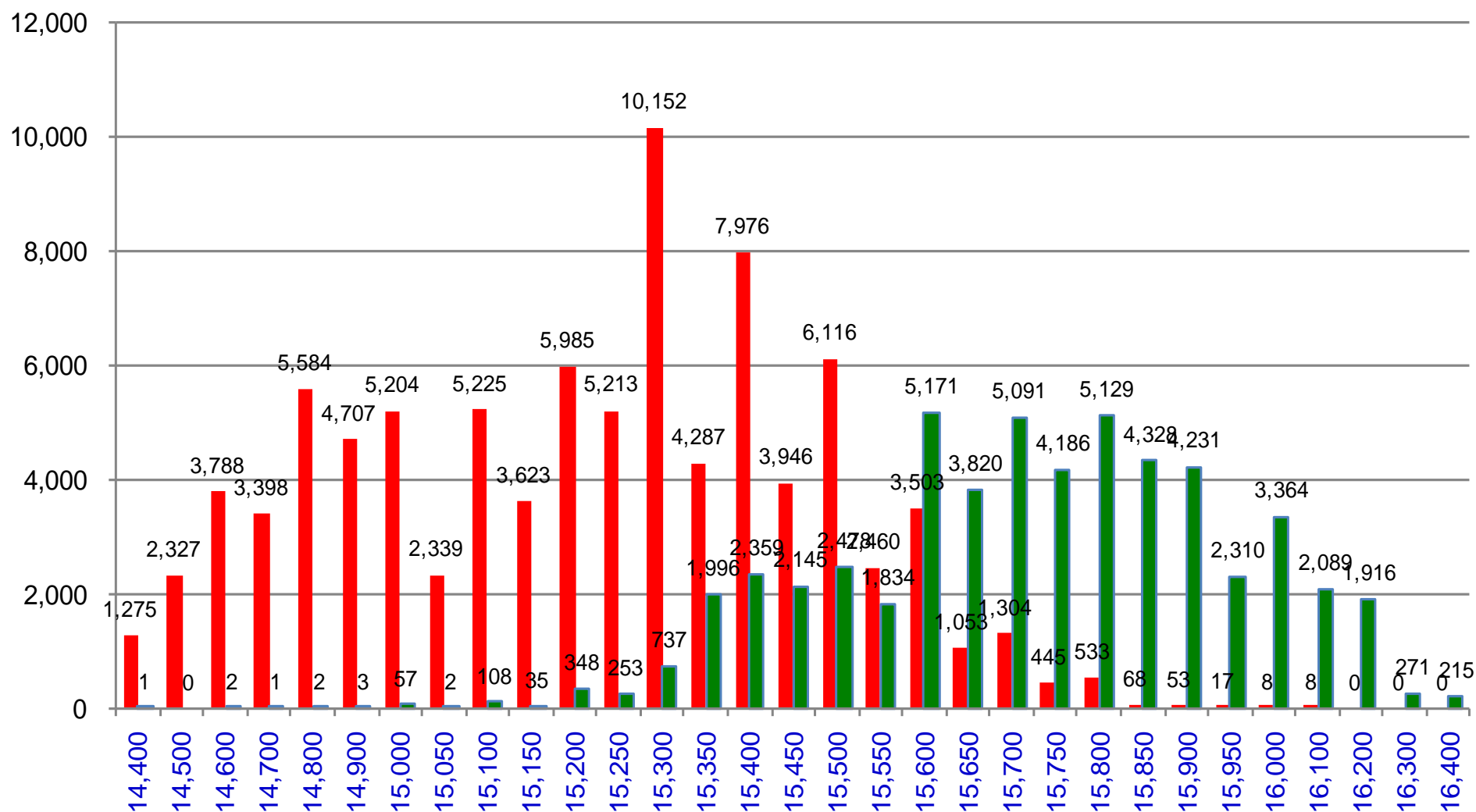


更新日期：2023年2月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：91,875

週選 CALL OI 總額：54,784



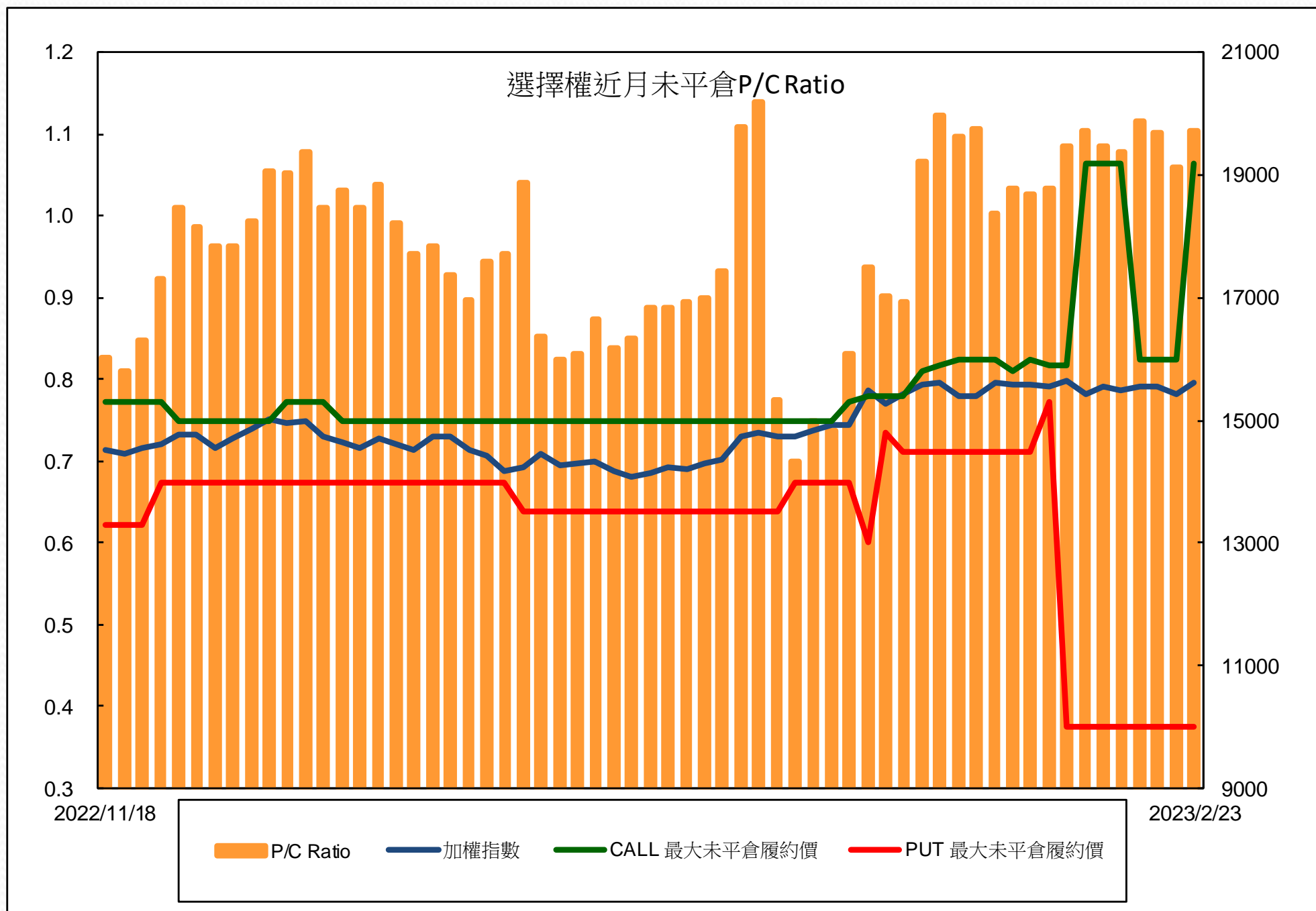
更新日期：2023年2月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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22日	66,072	55,636	10,436
	2月23日	68,509	58,444	10,065
Put	2月22日	45,666	54,328	-8,662
	2月23日	50,963	69,058	-18,095

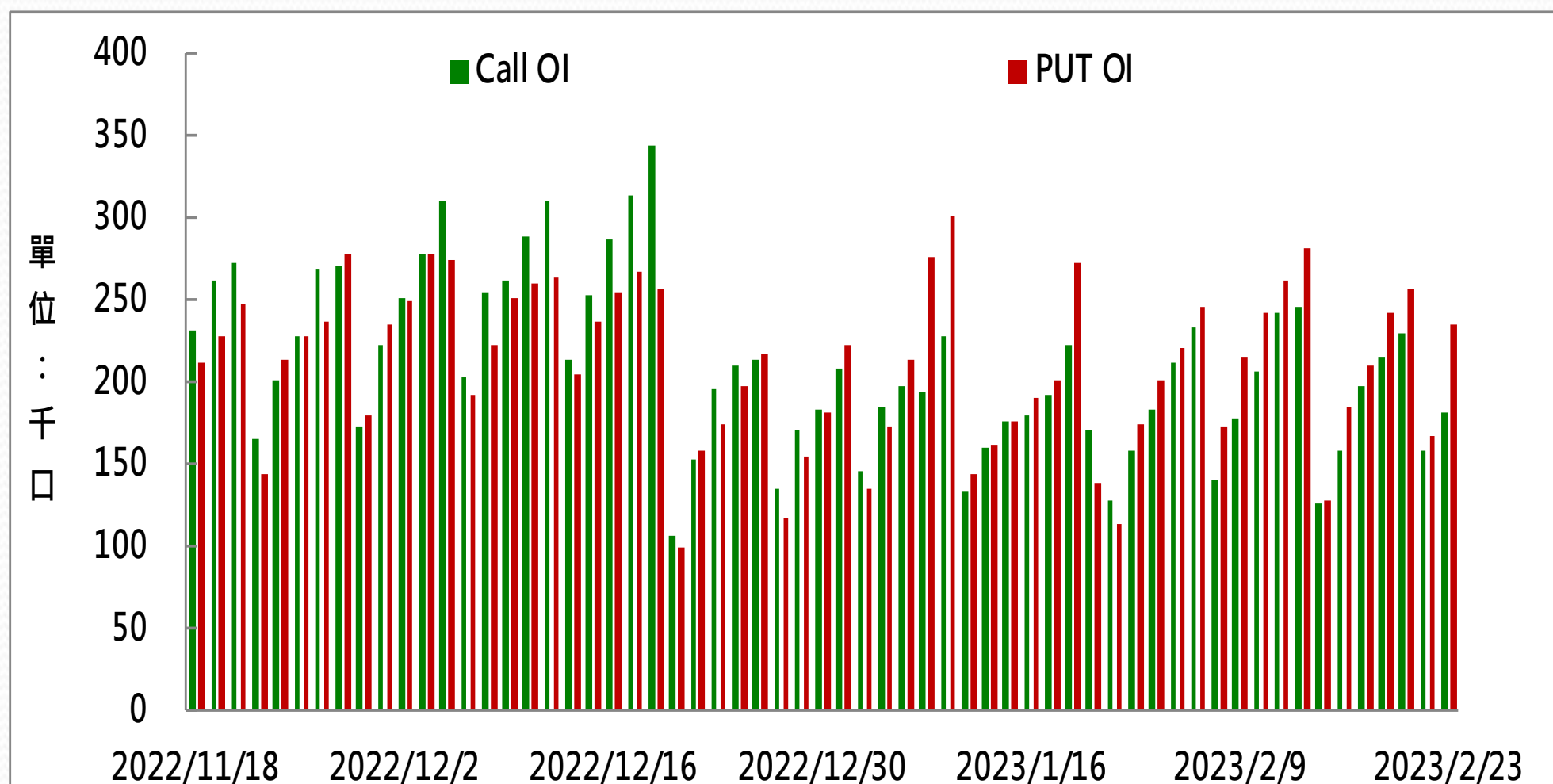
更新日期：2023年2月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

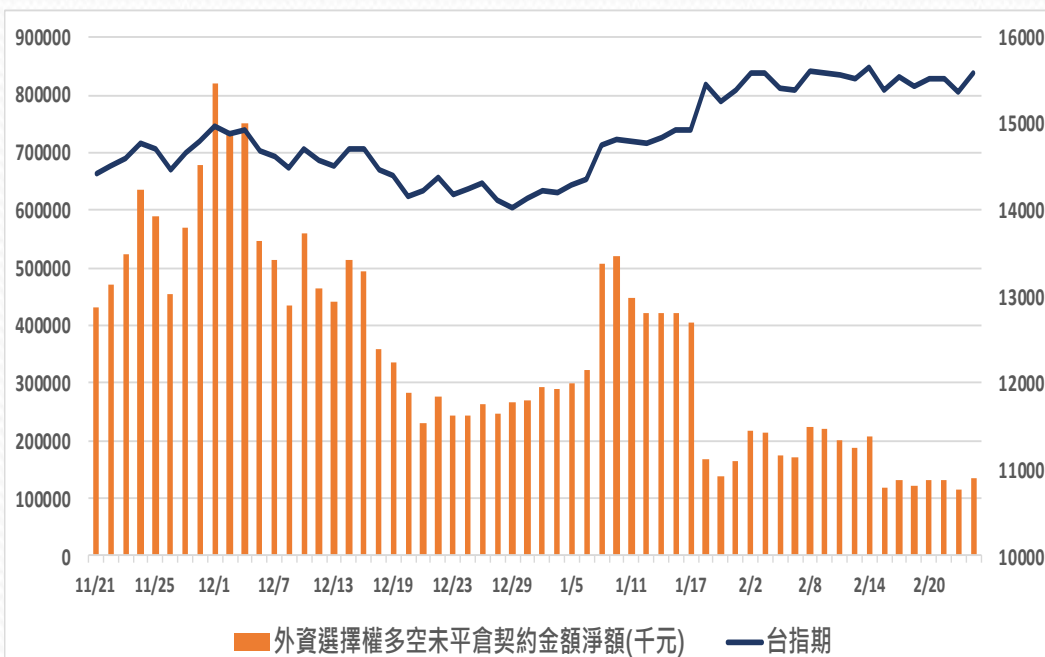
選擇權全月Put Call OI



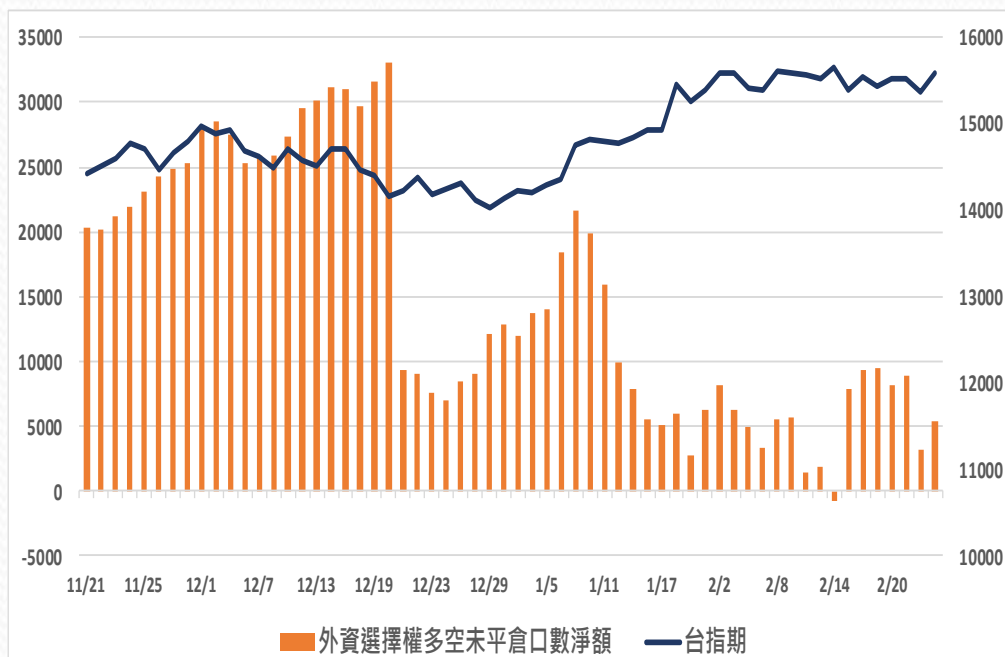
更新日期：2023年2月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



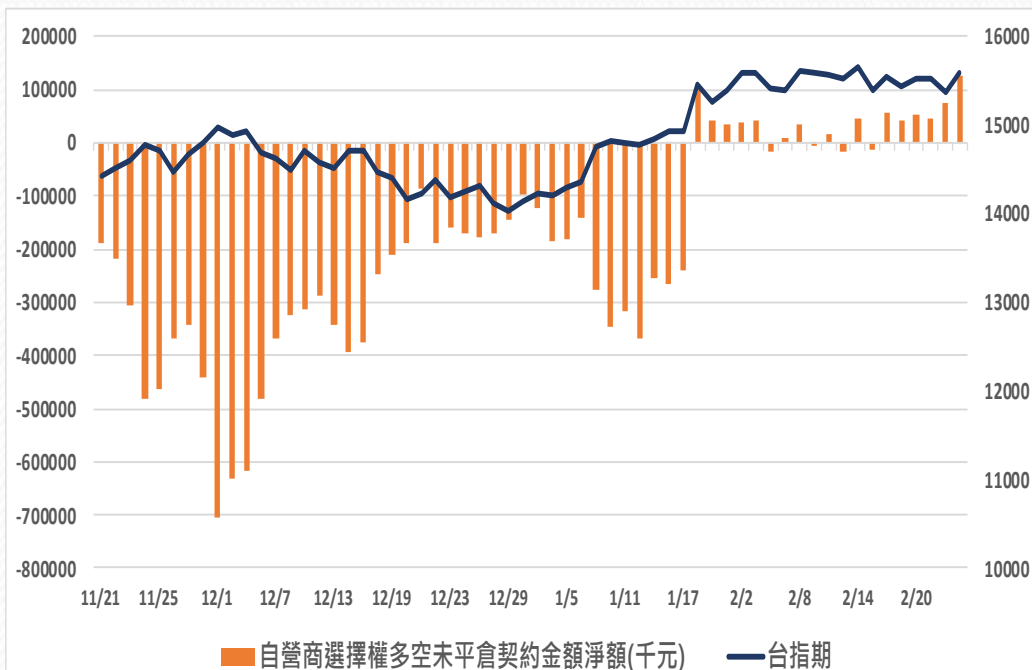
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/17	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
2023/2/23	15600	5363	2126	133718	18044

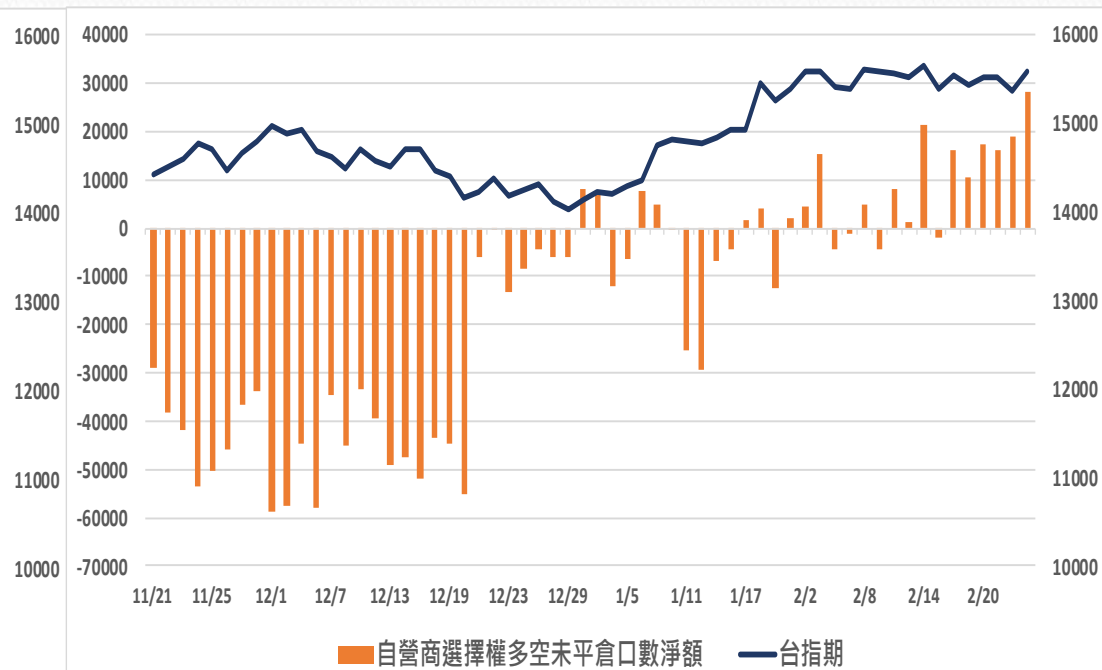
更新日期：2023年2月23日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



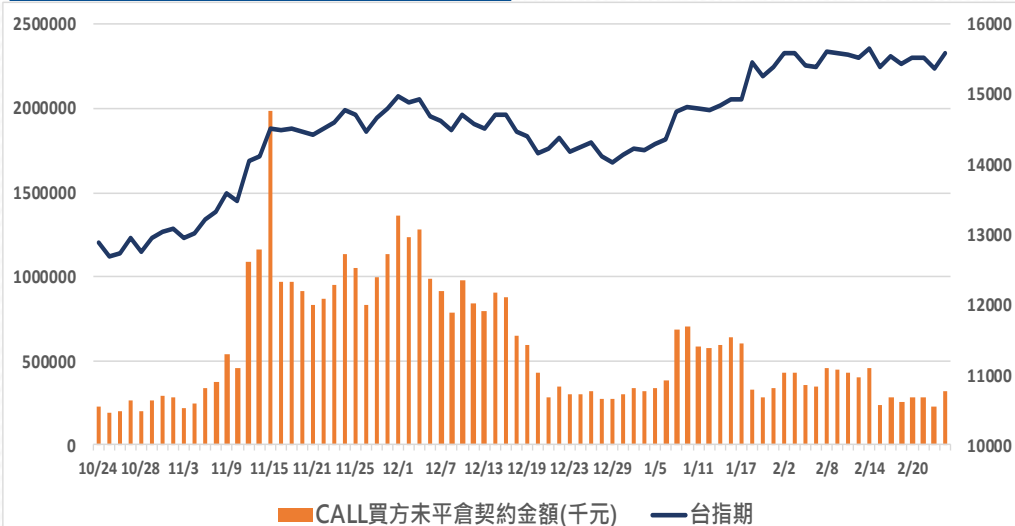
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/17	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
2023/2/23	15600	28160	9062	125832	49507

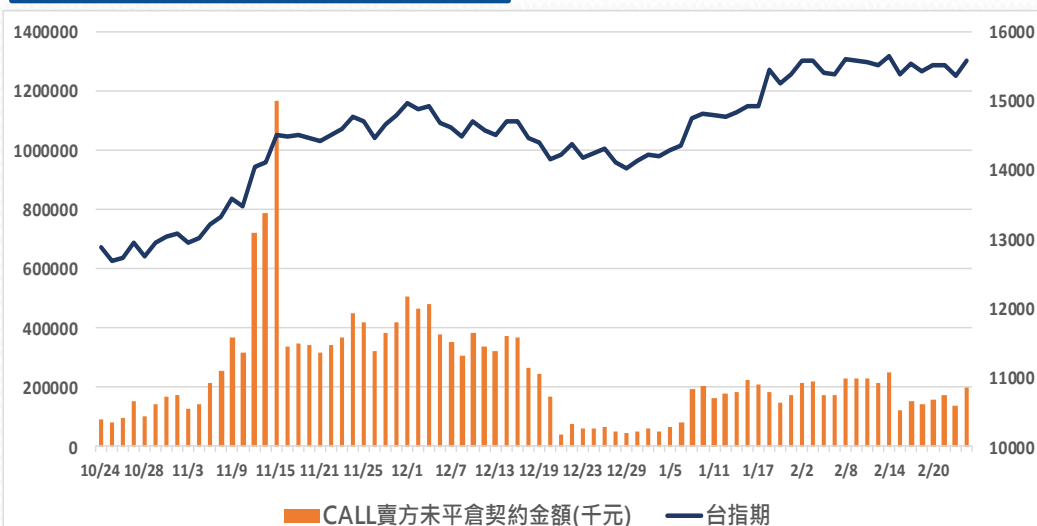
更新日期：2023年2月23日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

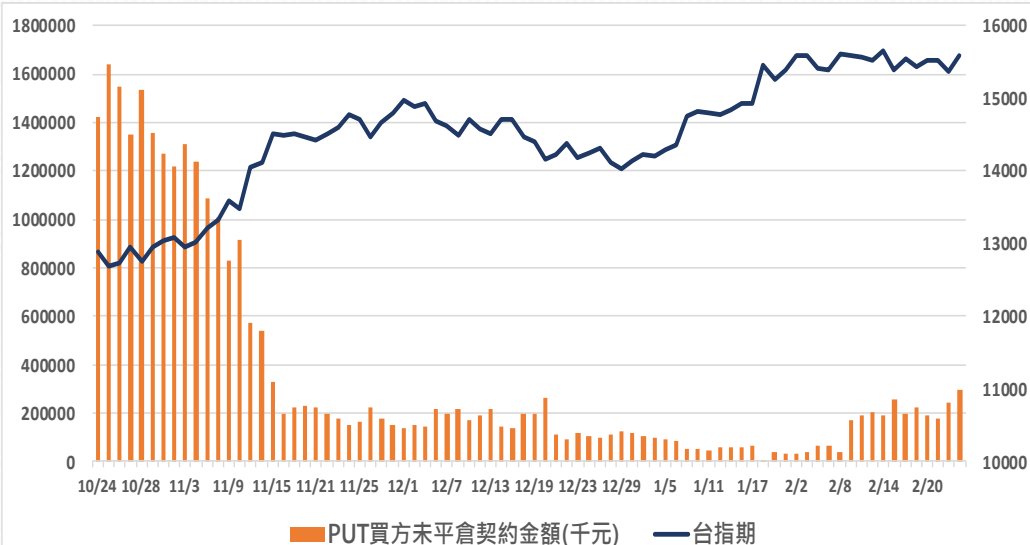
CALL買方未平倉金額



CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



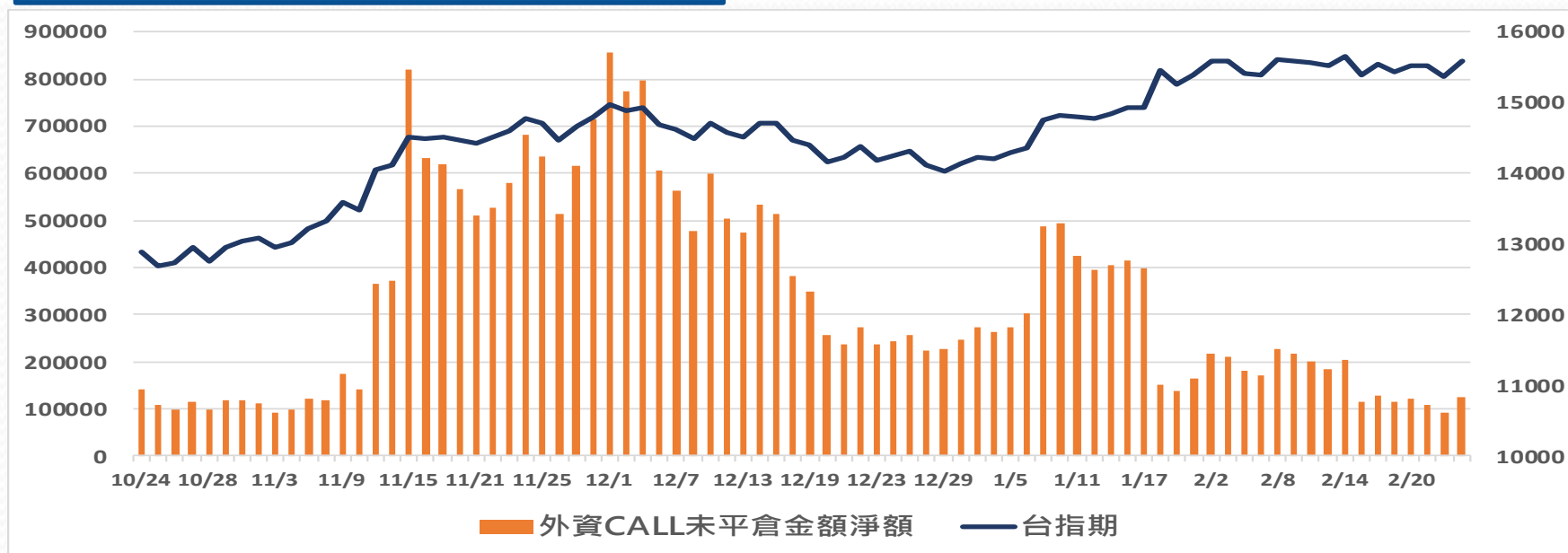
PUT賣方未平倉金額



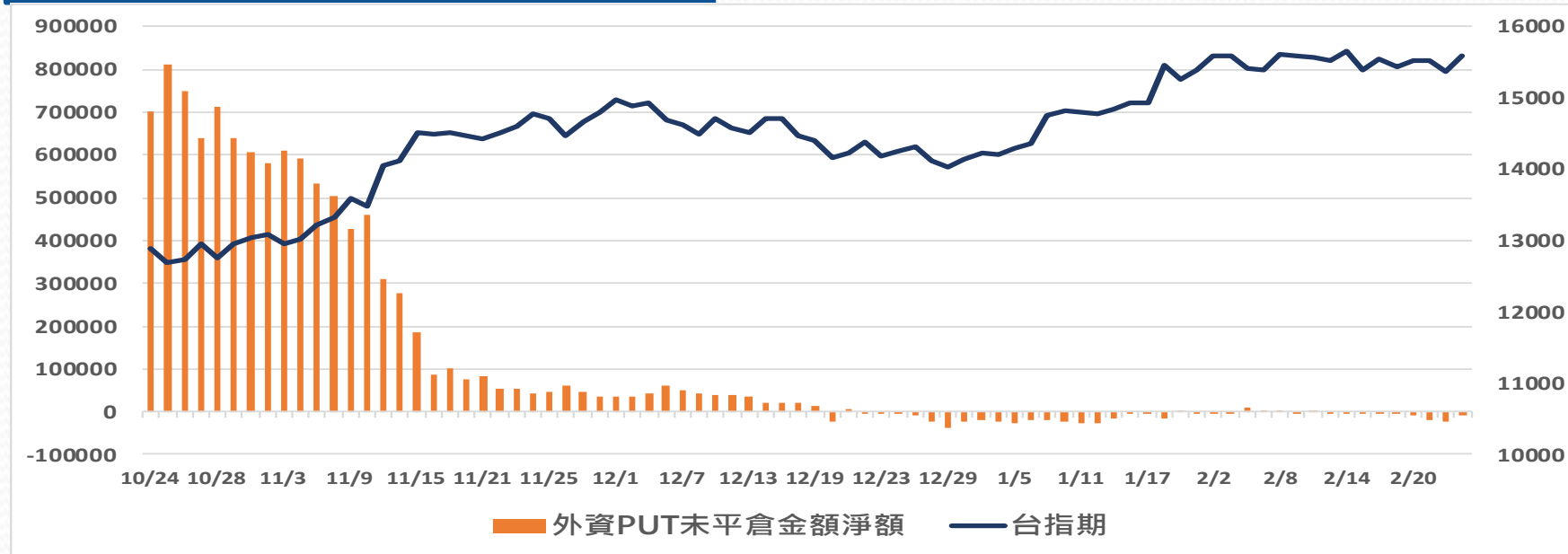
更新日期：2023年2月23日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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23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23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