

# 台指選擇權OI匯報

日期：2023/2/24 結算日：2023/3/1					日期：2023/2/24 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	14,200	304	0	0	1	13,700	1,014	0
0	0	14,300	405	-2	0	68	13,800	1,864	-29
0	1	14,400	1,273	-2	0	12	13,900	1,404	-33
0	0	14,500	2,321	-6	0	476	14,000	4,166	-220
0	2	14,600	3,636	-152	0	27	14,100	2,362	37
0	1	14,700	3,286	-112	0	138	14,200	1,802	-3
0	2	14,800	5,972	388	0	58	14,300	1,762	-18
0	3	14,900	4,620	-87	0	269	14,400	2,669	39
-7	50	15,000	6,034	830	-1	92	14,500	3,965	424
0	2	15,050	2,217	-122	-2	248	14,600	2,456	-54
-32	76	15,100	5,168	-57	-5	90	14,700	6,011	162
-5	30	15,150	3,729	106	0	248	14,800	4,939	-812
-15	333	15,200	7,188	1,203	4	103	14,900	3,701	777
-46	207	15,250	5,090	-123	38	502	15,000	9,492	362
-57	680	15,300	6,444	-3,708	48	276	15,100	4,952	525
-48	1,948	15,350	4,985	698	724	1,277	15,200	5,570	334
52	2,411	15,400	9,887	1,911	-11	774	15,300	3,681	235
-882	1,263	15,450	7,045	3,099	28	2,175	15,400	4,050	-932
-242	2,236	15,500	7,630	1,514	-3	2,978	15,500	2,331	-38
584	2,418	15,550	3,786	1,326	149	3,988	15,600	1,730	-52
2,340	7,511	15,600	4,152	649	450	3,615	15,700	571	35
1,678	5,498	15,650	1,645	592	-30	3,600	15,800	254	-14
2,397	7,488	15,700	1,939	635	-530	5,396	15,900	206	28
3,290	7,476	15,750	835	390	237	9,537	16,000	133	-51
2,522	7,651	15,800	820	287	364	7,475	16,100	81	3
1,686	6,014	15,850	161	93	-1,768	7,489	16,200	98	-25
1,529	5,760	15,900	107	54	756	4,987	16,300	72	1
956	3,266	15,950	138	121	434	3,522	16,400	71	13
1,974	5,338	16,000	44	36	19	3,111	16,500	7	1
1,188	2,885	16,050	5	5	464	1,843	16,600	2	0
1,307	3,396	16,100	10	2	29	1,086	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
20,404	76,885	1.3195	101,450	9,575	1,628	99,745	1.0952	109,238	769
昨日 P/C	1.6770	今日增減變化	-0.3575		昨日 P/C	1.1055	今日增減變化	-0.0103	

更新日期：2023年2月24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24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	94,039,798	45,532,479	48,507,319	-10,002,038	3,341,578	1,268,698	2,072,880	-94,056	
投信	23,410,962	50,256,416	-26,845,454	-1,130,484	397,738	0	397,738	-2,357	
自營商	46,532,511	27,283,976	19,248,535	1,737,502	1,004,429	1,245,348	-240,919	-252,647	
	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	315,610	1,736,641	-1,421,031	-90,718	319,095	3,025	316,070	-84	
投信	124,046	0	124,046	-474	0	0	0	0	
自營商	515,025	238,669	276,356	-7,357	108,878	420,390	-311,512	-30,123	

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24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	27,256	16,126	11,130	546	42,143	34,107	8,036	2,815	
投信	100	0	100	0	200	113	87	0	
自營商	70,347	62,168	8,179	-1,886	54,670	70,518	-15,848	2,247	
特定法人(週)	2,066	0	2,066	856	0	8,347	-8,347	-3,838	
特定法人(近月)	17,928	7,492	10,436	-926	11,058	15,008	-3,950	511	
特定法人(全月)	19,624	6,335	13,289	-953	17,435	29,939	-12,504	-2,852	
十大交易人(週)	35,802	29,442	6,360	-3,782	51,317	35,422	15,895	2,113	
十大交易人(近月)	55,404	53,840	1,564	-3,179	57,044	45,131	11,913	-1,146	
十大交易人(全月)	99,126	79,665	19,461	-4,232	105,077	87,224	17,853	-2,994	
全市場未沖銷(近月)			99,745	1,628			109,238	769	
全市場未沖銷(全月)			208,935	27,822			254,702	20,367	

更新日期：2023年2月24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	15700	買權OI最大量	15800
	賣權成交最大量	15600	賣權OI最大量	15400
	整體隱含波動率	9.66%	較前一交易日	-2.85%
	買權隱含波動率	11.94%	較前一交易日	+0.37%
	賣權隱含波動率	7.50%	較前一交易日	-5.75%
電子選擇權	買權成交最大量	760	買權OI最大量	760
	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	1580
	賣權成交最大量	1560	賣權OI最大量	1480

更新日期：2023年2月24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	15.56%	較前一交易日	+0.35%
	買權隱含波動率	15.18%	較前一交易日	+1.38%
	賣權隱含波動率	16.04%	較前一交易日	-1.91%
	成交量P/C_Ratio值	0.842	較前一交易日	-0.17
	未平倉P/C_Ratio值	1.095	較前一交易日	-0.01
電子選擇權	買權成交最大量	760	買權OI最大量	760
	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	1580
	賣權成交最大量	1560	賣權OI最大量	1480

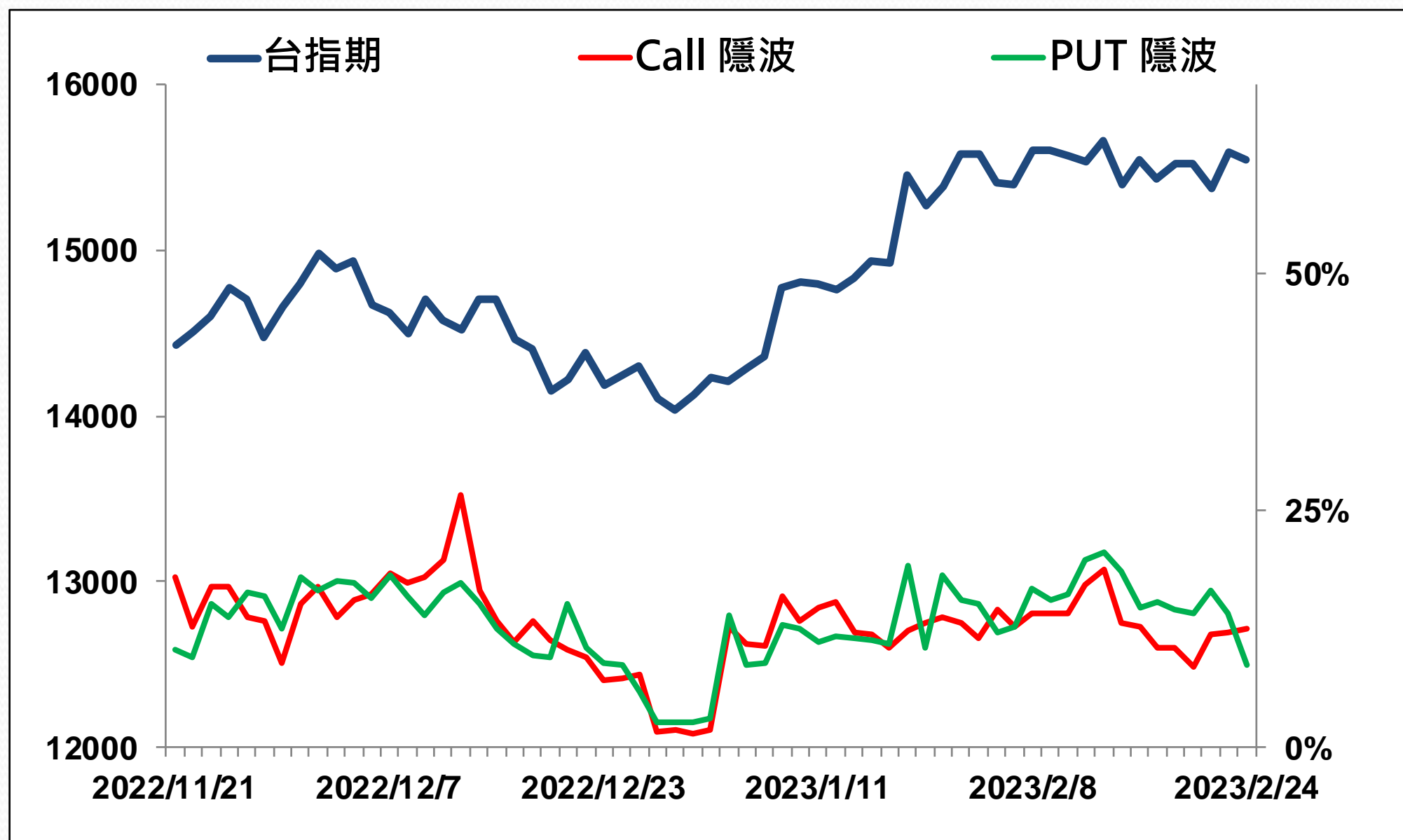
更新日期：2023年2月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權當日波動率指數



更新日期：2023年2月24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

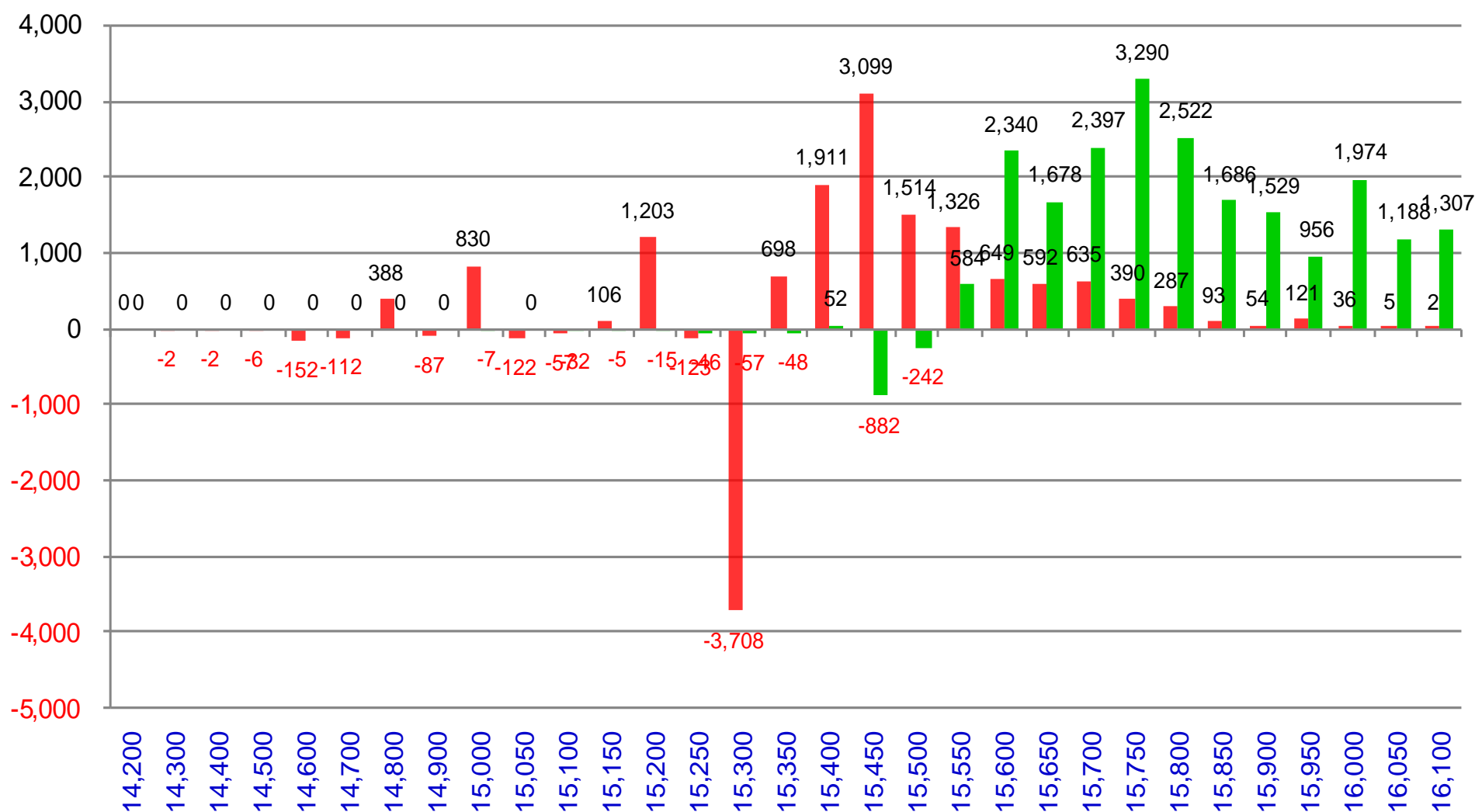


更新日期：2023年2月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：9,575

週選 CALL OI 變化：20,404

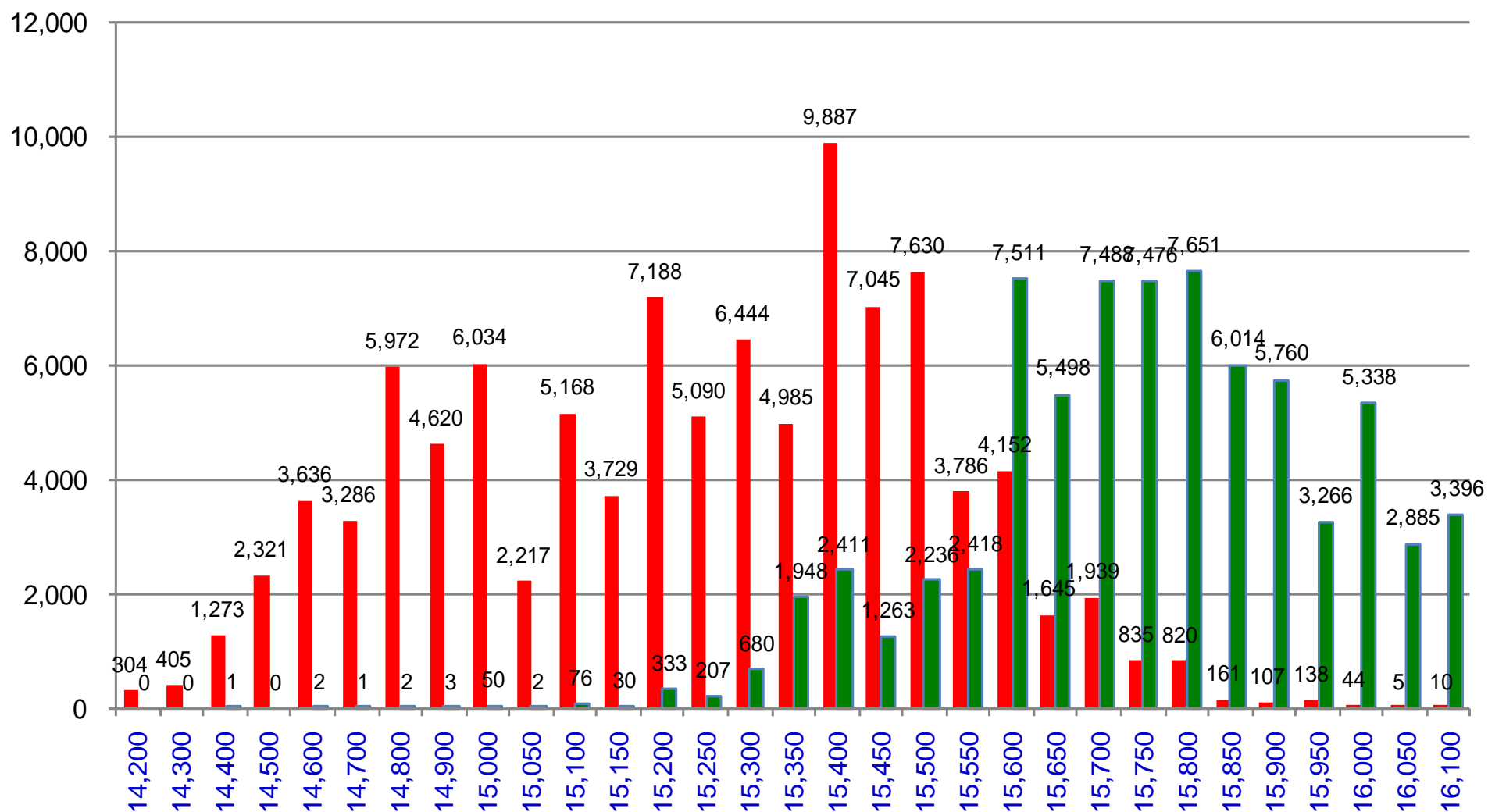


更新日期：2023年2月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：101,450

週選 CALL OI 總額：76,885



更新日期：2023年2月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

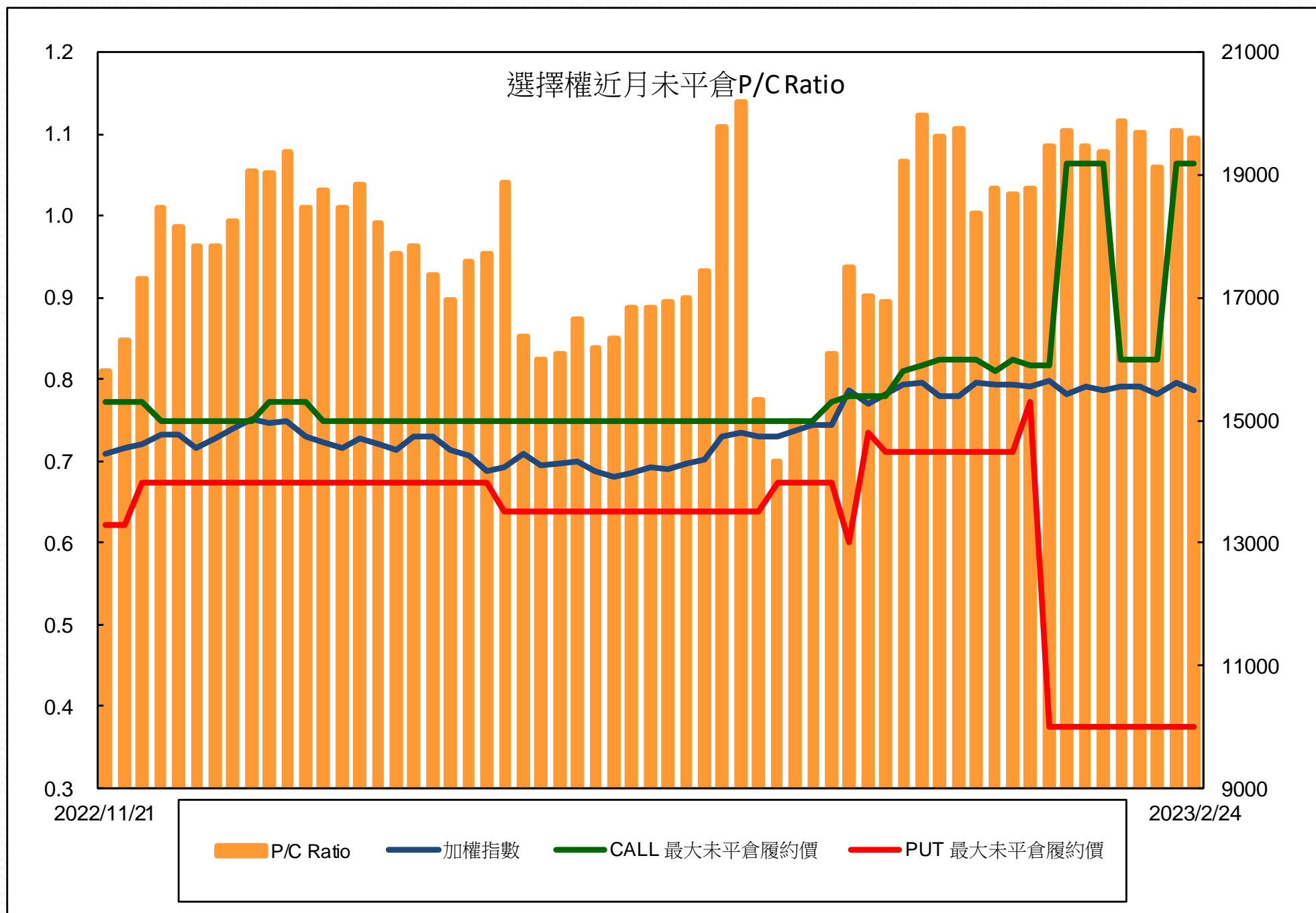


# 自營商選擇權OI部位統計

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23日	68,509	58,444	10,065
	2月24日	70,347	62,168	8,179
Put	2月23日	50,963	69,058	-18,095
	2月24日	54,670	70,518	-15,848

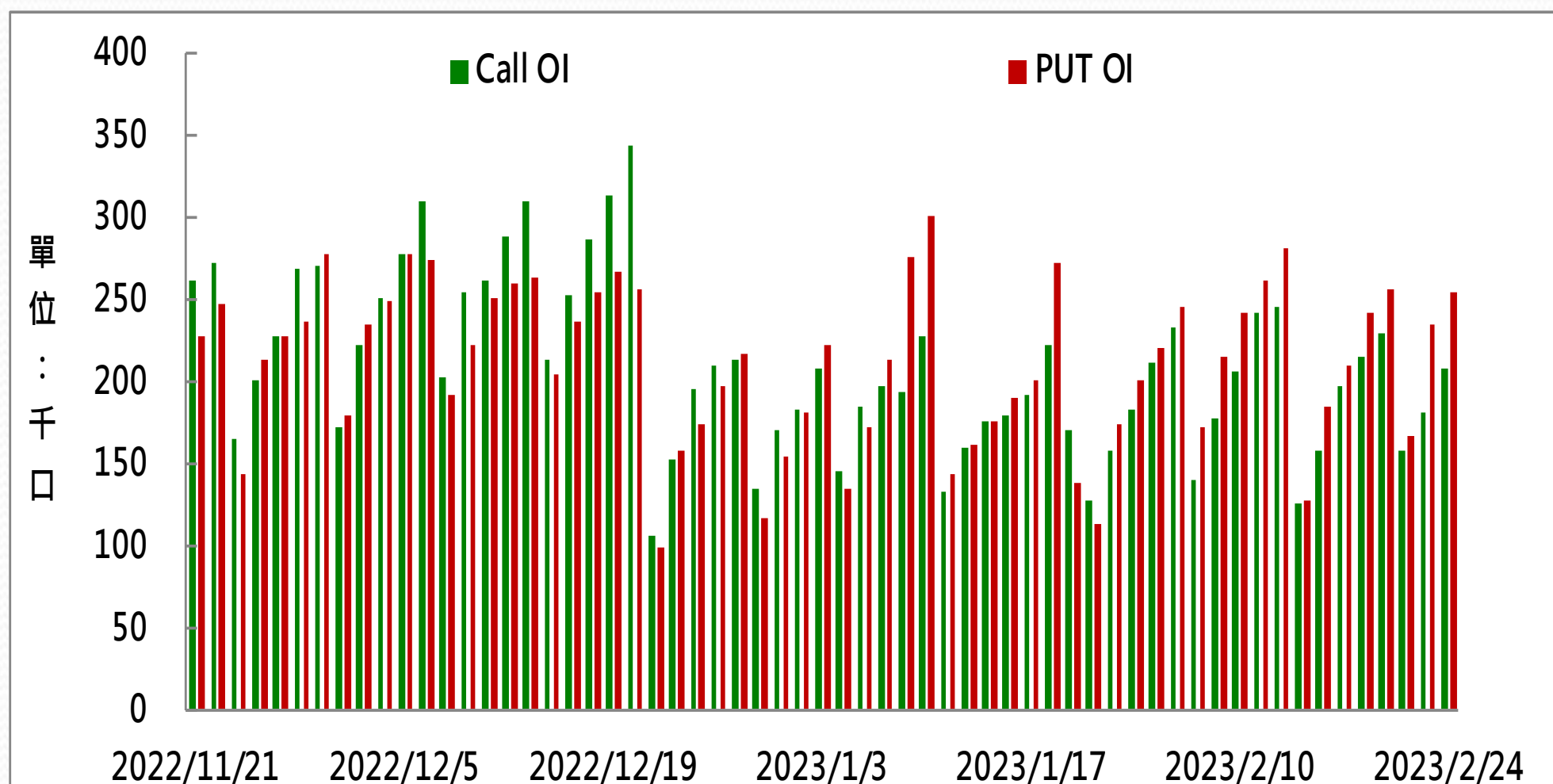
更新日期：2023年2月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年2月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

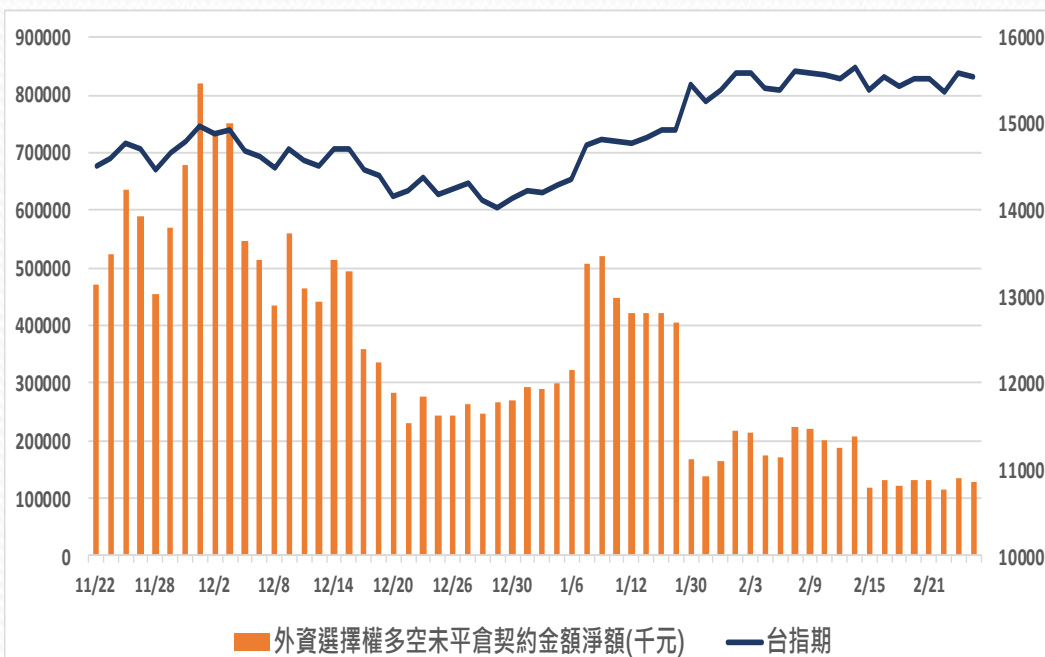
# 選擇權全月Put Call OI



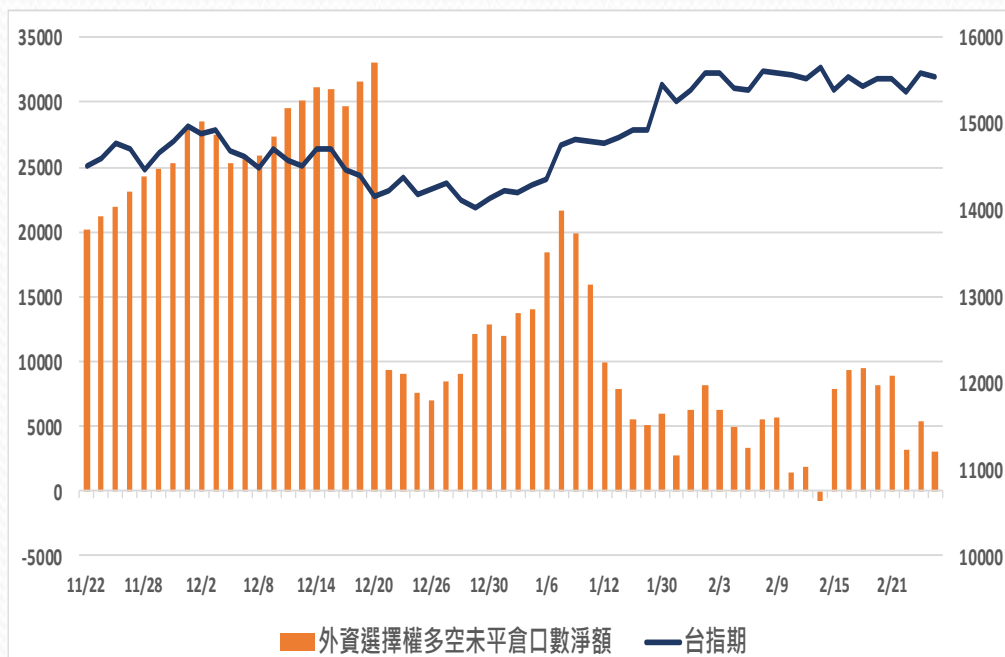
更新日期：2023年2月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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



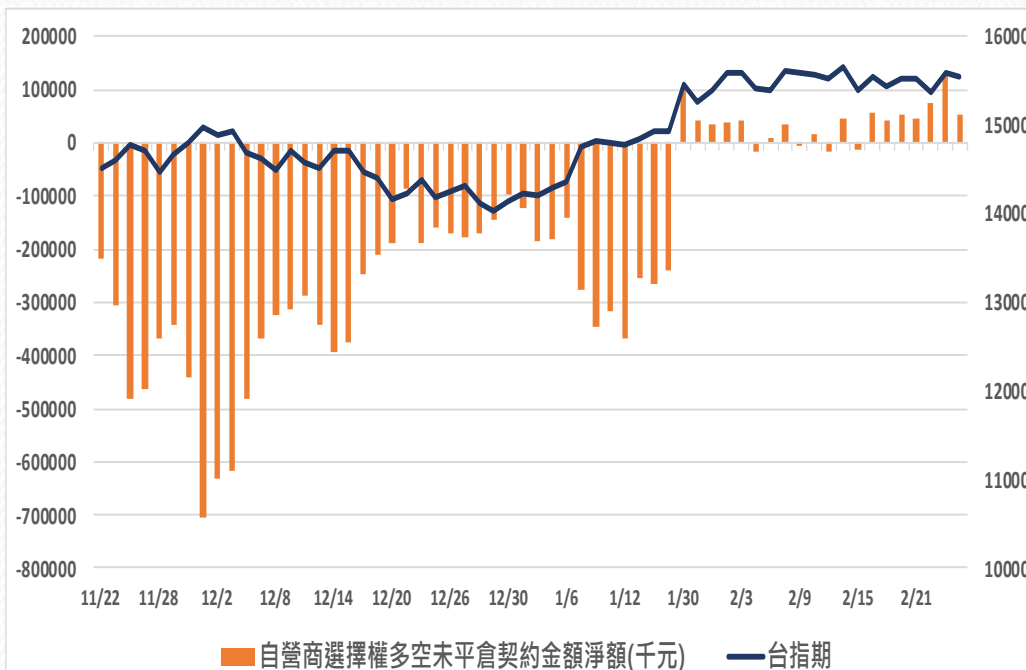
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/20	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
2023/2/24	15541	3094	-2269	126854	-6864

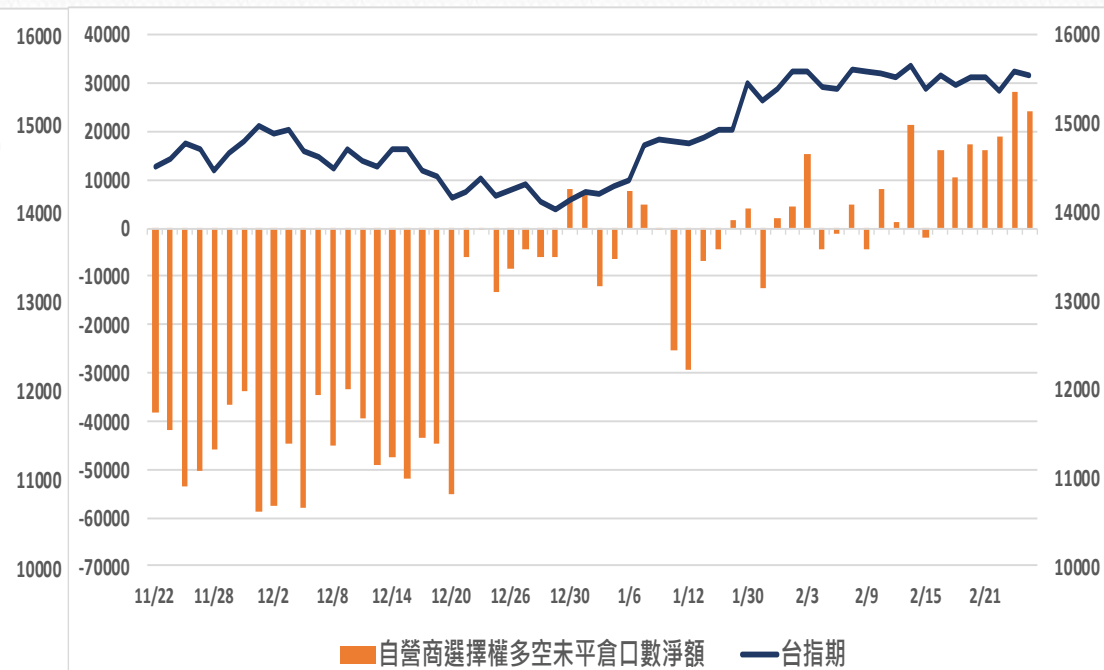
更新日期：2023年2月24日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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



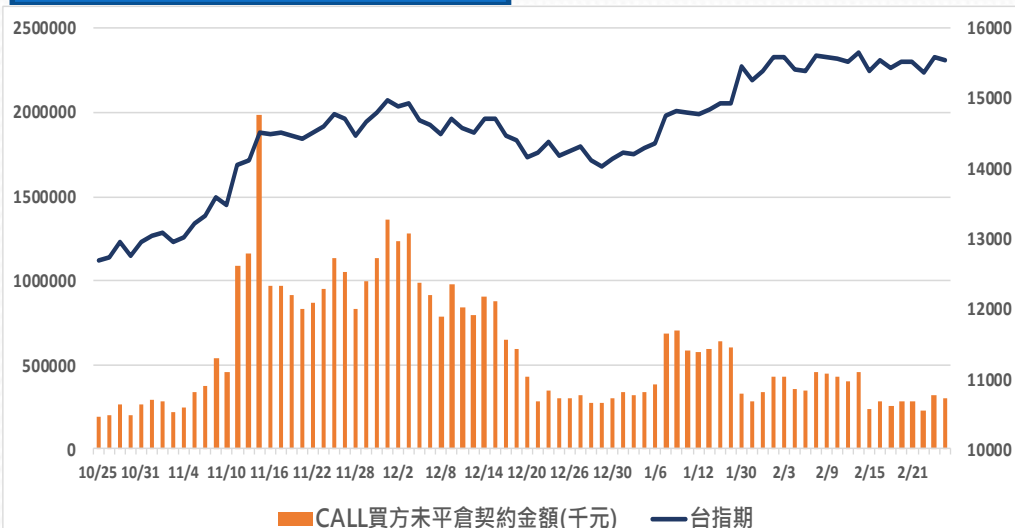
## 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/20	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
2023/2/24	15541	24027	-4133	54067	-71765

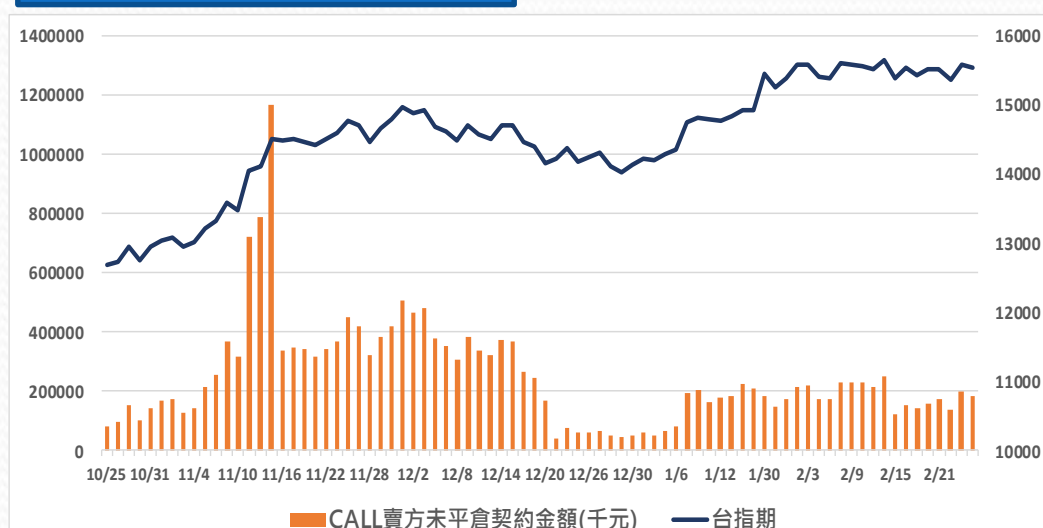
更新日期：2023年2月24日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 外資買賣權未平倉金額

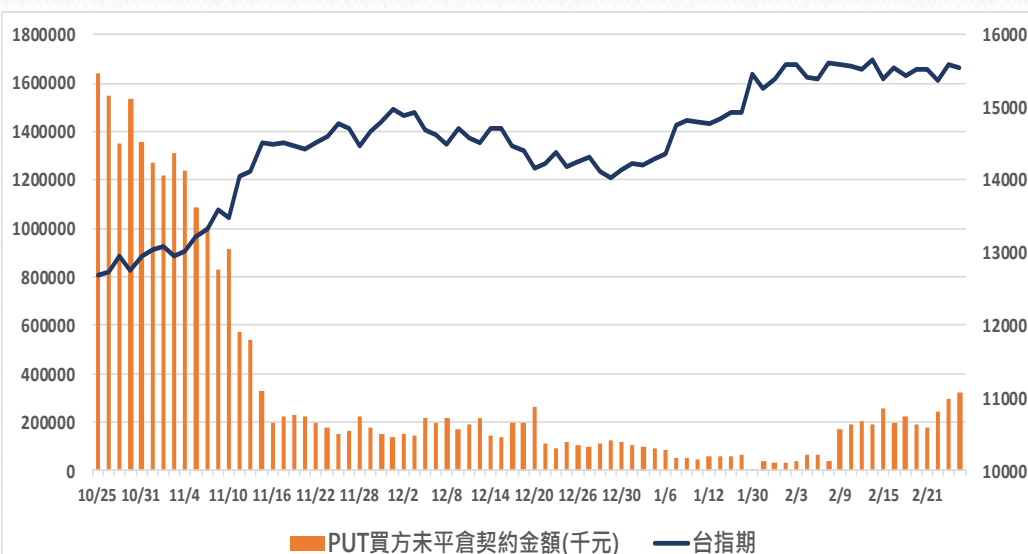
## CALL買方未平倉金額



## CALL賣方未平倉金額



## PUT買方未平倉金額



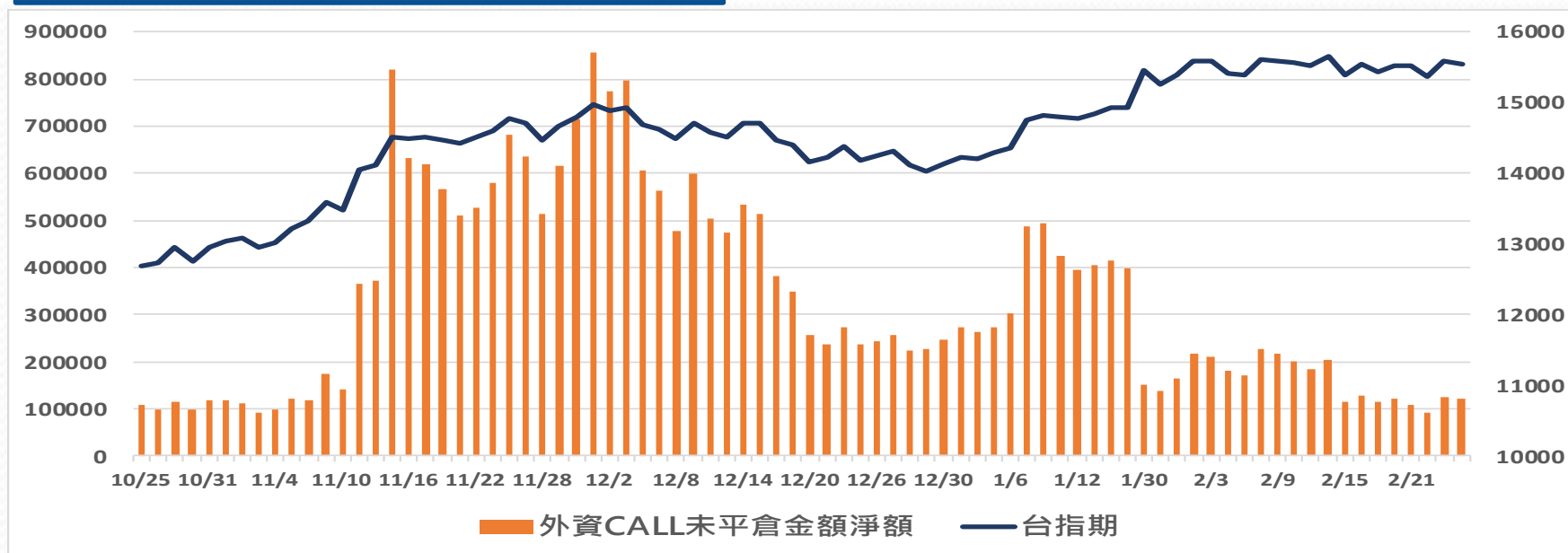
## PUT賣方未平倉金額



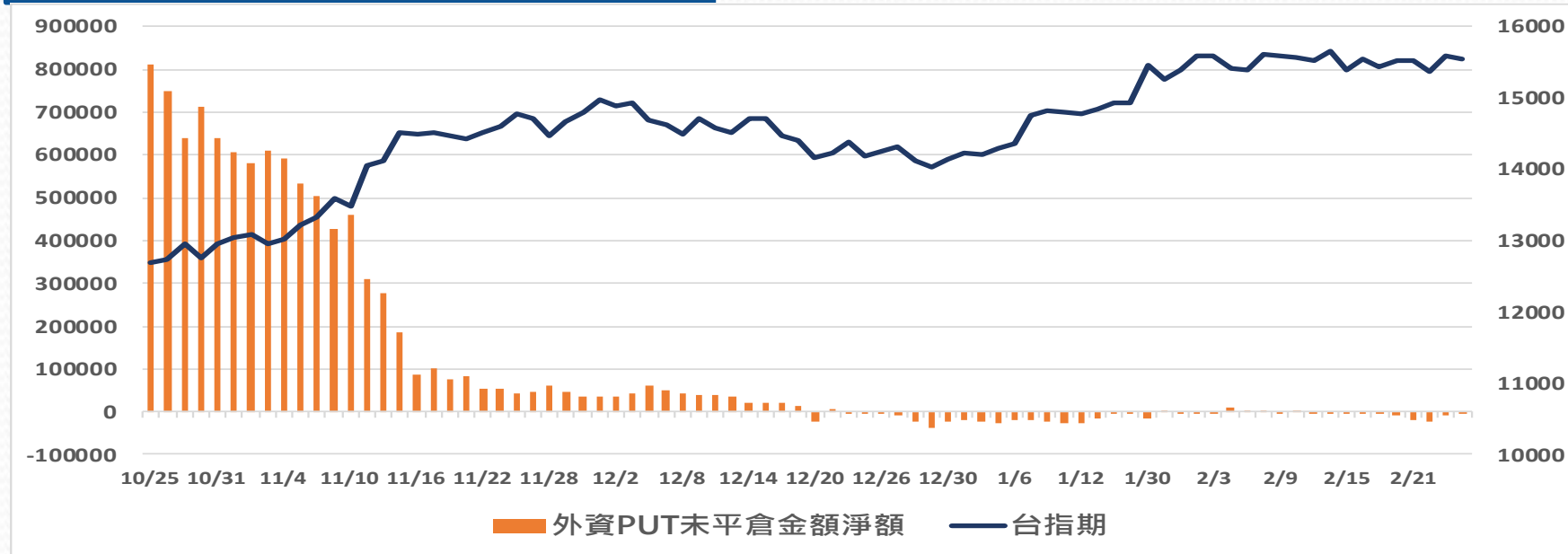
更新日期：2023年2月24日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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24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24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