

台指選擇權OI匯報

日期：2023/3/1 結算日：2023/3/8					日期：2023/3/1 結算日：2023/3/15				
202303W2					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	14,700	3,583	2,294	0	68	13,800	1,871	7
0	0	14,750	0	0	0	12	13,900	1,480	76
1	1	14,800	2,412	1,353	0	476	14,000	4,714	548
0	0	14,850	0	0	-3	24	14,100	2,356	-6
17	29	14,900	1,906	1,160	0	138	14,200	1,951	149
0	0	14,950	0	0	-9	49	14,300	2,494	732
3	13	15,000	4,558	2,219	-27	242	14,400	2,670	1
2	2	15,050	1,805	1,498	0	92	14,500	5,253	1,288 ※
16	25	15,100	4,235	3,321	-3	245	14,600	2,830	374
7	10	15,150	2,149	1,522	1	91	14,700	6,282	271
66	102	15,200	5,964	3,730 ※	-1	247	14,800	5,794	855
19	40	15,250	1,808	1,407	-3	100	14,900	4,021	320
87	154	15,300	2,948	2,334	-11	491	15,000	9,285	-207
200	298	15,350	1,743	1,369	-15	261	15,100	4,916	-36
413	669	15,400	2,398	1,745 ※	1,751	3,028	15,200	5,679	109
368	525	15,450	2,184	1,643	-96	678	15,300	4,794	1,113
1,049	1,685	15,500	1,879	1,006	180	2,355	15,400	4,261	211
1,353	1,891	15,550	1,258	532	-109	2,869	15,500	2,908	577
1,213	1,999	15,600	969	436	232	4,220	15,600	1,609	-121
1,736	2,266	15,700	294	166	126	3,741	15,700	707	136
※ 2,150	2,937	15,800	222	182	365	3,965	15,800	348	94
1,808	3,106	15,900	51	30	762	6,158	15,900	223	17
1,603	3,053	16,000	28	23	795	10,332	16,000	148	15
921	1,992	16,100	20	19	-21	7,454	16,100	77	-4
1,231	2,096	16,200	1	-3	151	7,640	16,200	97	-1
91	505	16,300	0	0	351	5,338	16,300	72	0
173	577	16,400	0	0	116	3,638	16,400	74	3
13	418	16,500	0	0	44	3,155	16,500	6	-1
-1	127	16,600	0	0	-6	1,837	16,600	2	0
0	30	16,700	0	0	-70	1,016	16,700	0	0
0	0	16,800	0	0	6	1,029	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
14,539	24,619	1.9234	47,351	30,693	3,865	103,610	1.1176	115,799	6,561
昨日 P/C	1.3195	今日增減變化	0.6039		昨日 P/C	1.0952	今日增減變化	0.0225	

更新日期：2023年3月1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3月1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	91,122,879	45,009,498	46,113,381	-2,393,938	3,505,108	1,667,706	1,837,402	-235,478	
投信	23,490,006	50,350,205	-26,860,199	-14,745	400,835	0	400,835	3,097	
自營商	49,307,409	22,142,000	27,165,409	7,916,874	1,705,381	1,263,456	441,925	682,844	
	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	368,066	1,693,726	-1,325,660	95,371	343,022	0	343,022	26,952	
投信	131,006	0	131,006	6,960	0	0	0	0	
自營商	548,974	358,700	190,274	-86,082	107,374	428,002	-320,628	-9,116	

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報								2023年3月1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	24,984	13,565	11,419	289	39,058	33,368	5,690	-2,346	
投信	100	0	100	0	200	113	87	0	
自營商	53,070	56,358	-3,288	-11,467	50,738	62,544	-11,806	4,042	
特定法人(週)	600	0	600	---	1,441	6,846	-5,405	---	
特定法人(近月)	18,322	7,578	10,744	308	12,320	14,384	-2,064	1,886	
特定法人(全月)	20,191	5,615	14,576	1,287	23,428	29,336	-5,908	6,596	
十大交易人(週)	14,715	13,914	801	---	25,536	24,127	1,409	---	
十大交易人(近月)	58,114	57,835	279	-1,285	61,300	49,289	12,011	98	
十大交易人(全月)	82,255	75,236	7,019	-12,442	90,387	83,856	6,531	-11,322	
全市場未沖銷(近月)			105,960	6,215			118,122	8,884	
全市場未沖銷(全月)			159,037	-49,898			194,170	-60,532	

更新日期：2023年3月1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03W2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	15900
	賣權成交最大量	15200	賣權OI最大量	15200
	整體隱含波動率	15.01%	較前一交易日	+5.35%
	買權隱含波動率	12.13%	較前一交易日	+0.19%
	賣權隱含波動率	17.15%	較前一交易日	+9.66%
電子選擇權	買權成交最大量	745	買權OI最大量	725
	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	1600	買權OI最大量	1580
	賣權成交最大量	1560	賣權OI最大量	1520

更新日期：2023年3月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

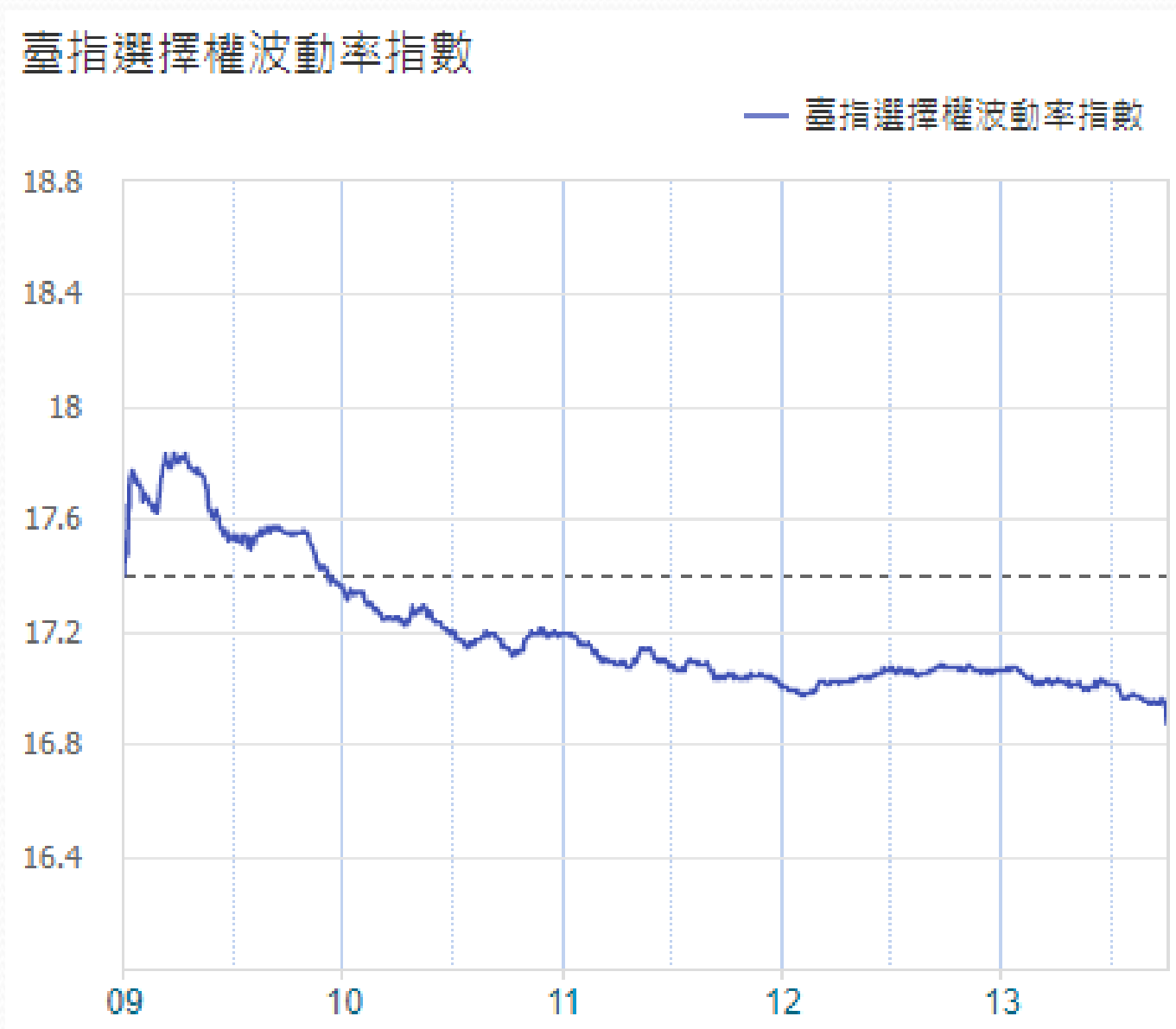
台指選擇權匯報

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	16.01%	較前一交易日	-0.46%
	買權隱含波動率	12.86%	較前一交易日	-2.32%
	賣權隱含波動率	18.89%	較前一交易日	+2.84%
	成交量P/C_Ratio值	0.998	較前一交易日	+0.16
	未平倉P/C_Ratio值	1.115	較前一交易日	+0.02
電子選擇權	買權成交最大量	745	買權OI最大量	725
	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	1600	買權OI最大量	1580
	賣權成交最大量	1560	賣權OI最大量	1520

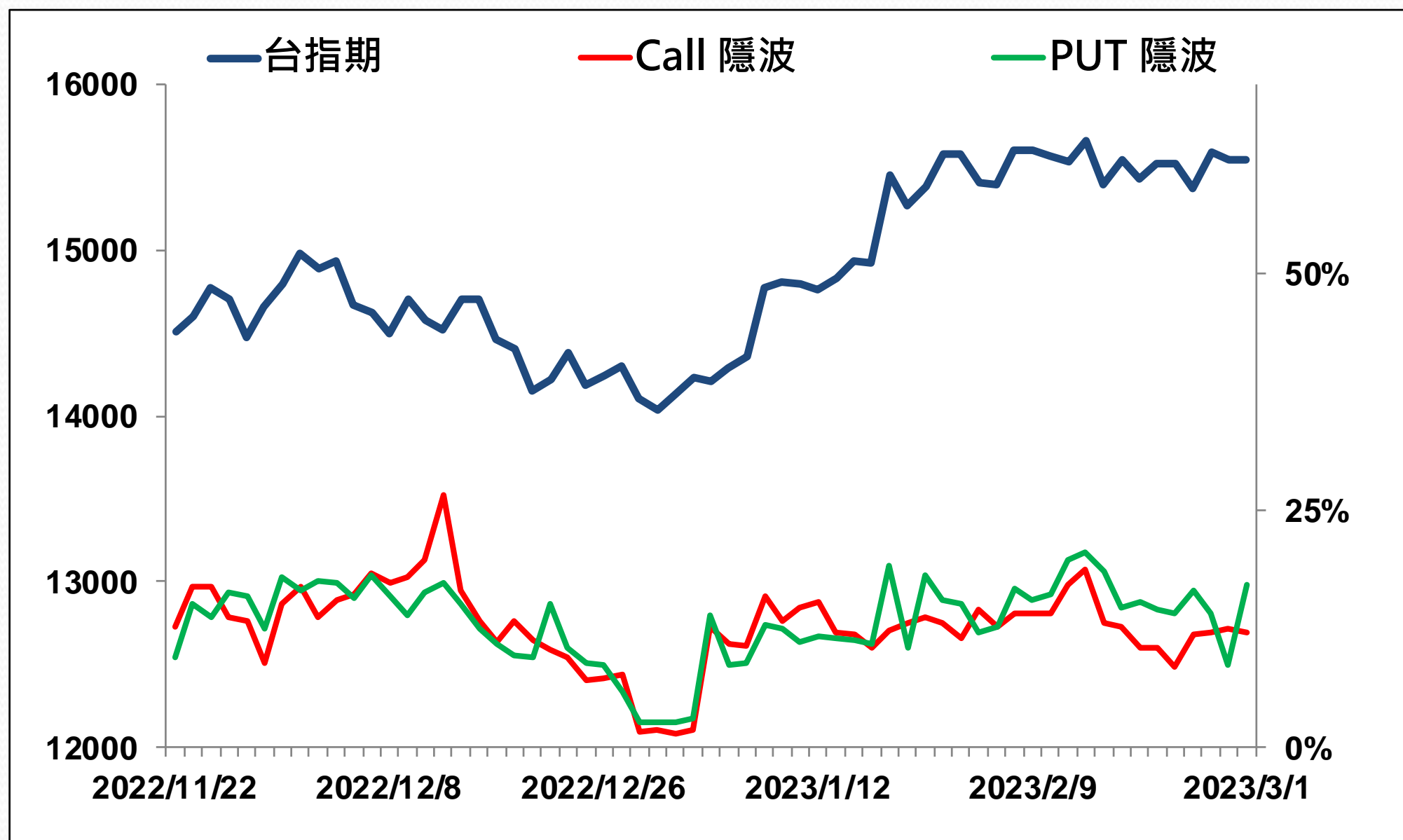
更新日期：2023年3月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



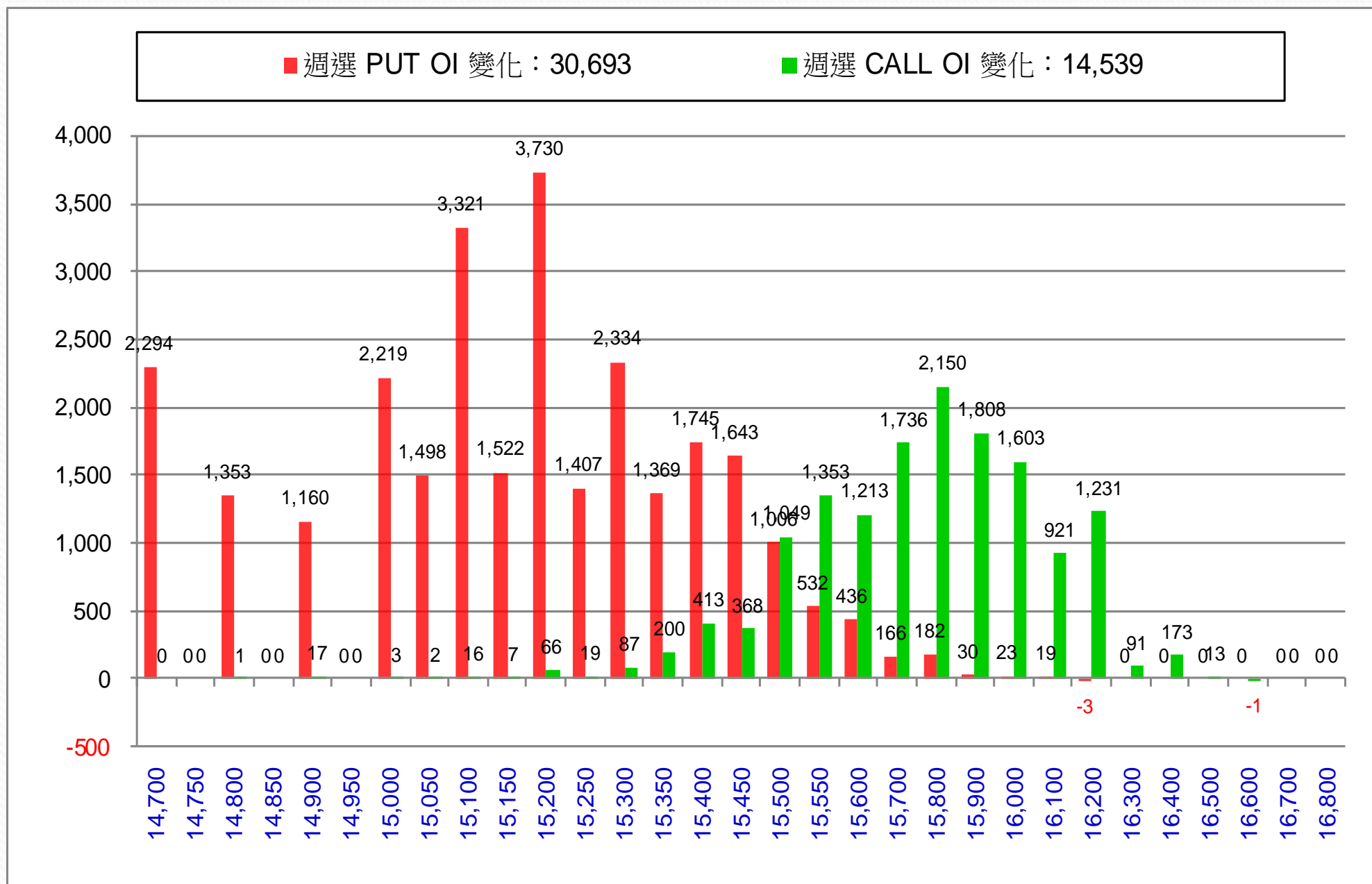
更新日期：2023年3月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年3月1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

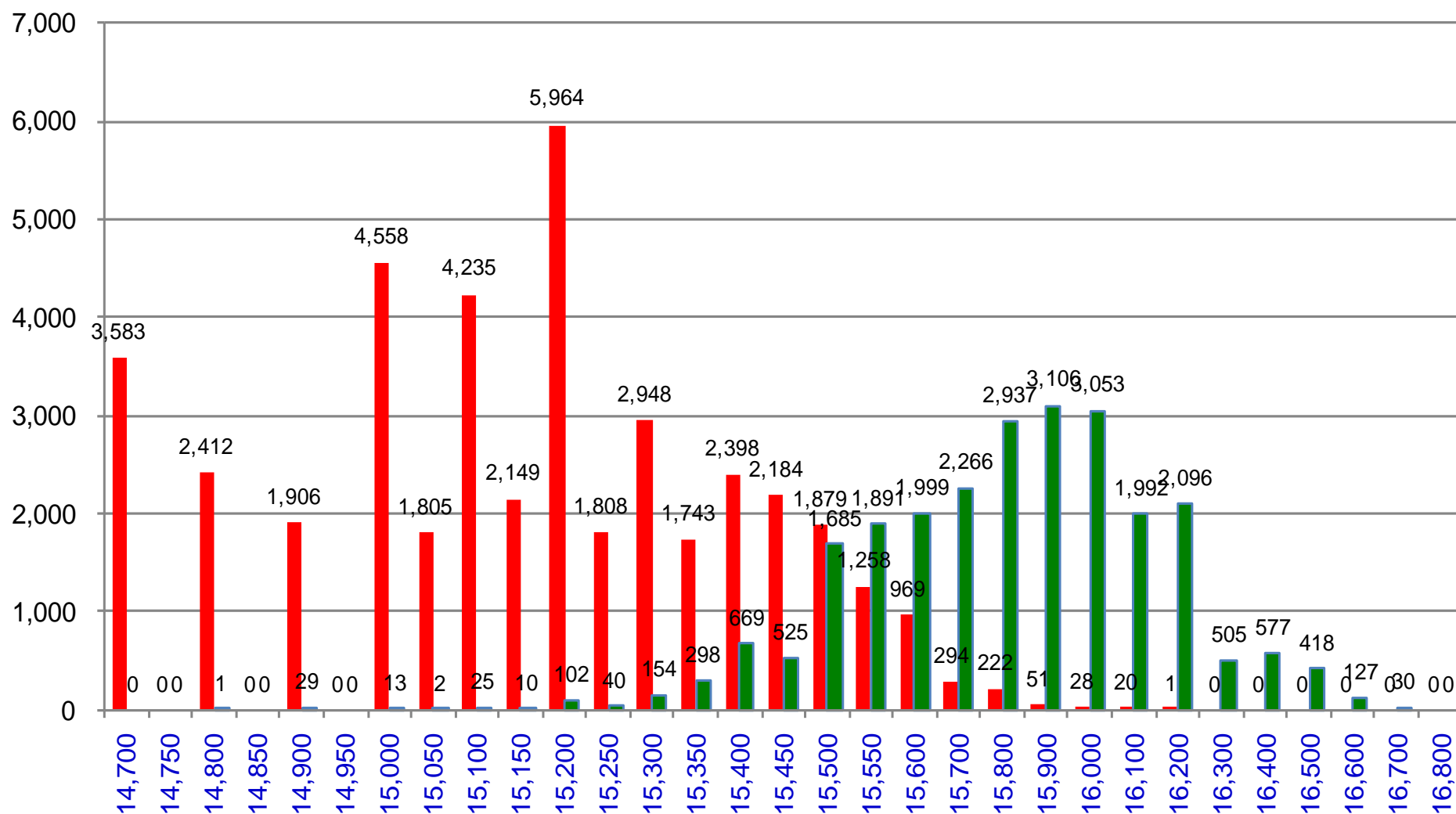


更新日期：2023年3月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：47,351

■ 週選 CALL OI 總額：24,619



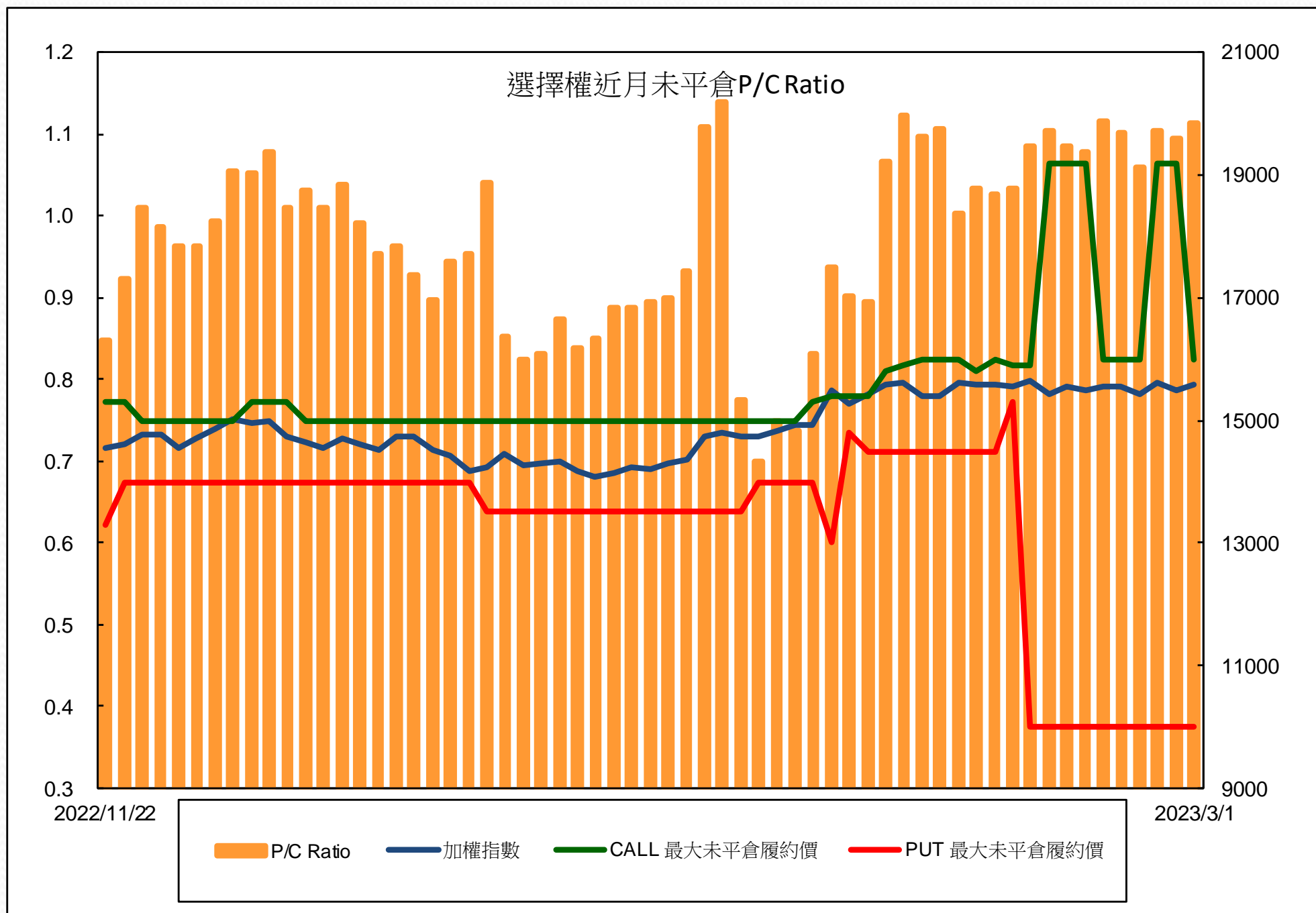
更新日期：2023年3月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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24日	70,347	62,168	8,179
	3月1日	53,070	56,358	-3,288
Put	2月24日	54,670	70,518	-15,848
	3月1日	50,738	62,544	-11,806

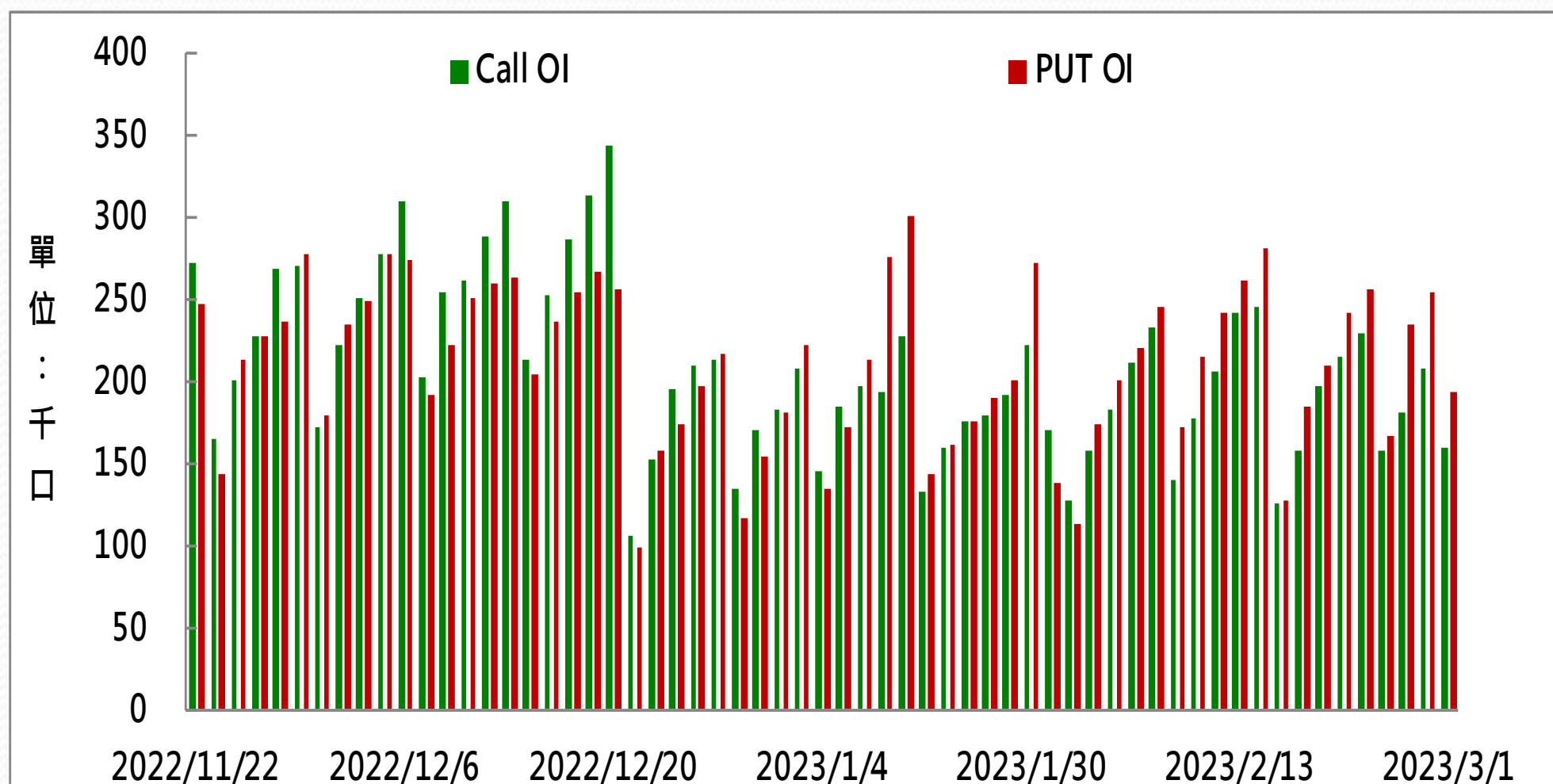
更新日期：2023年3月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

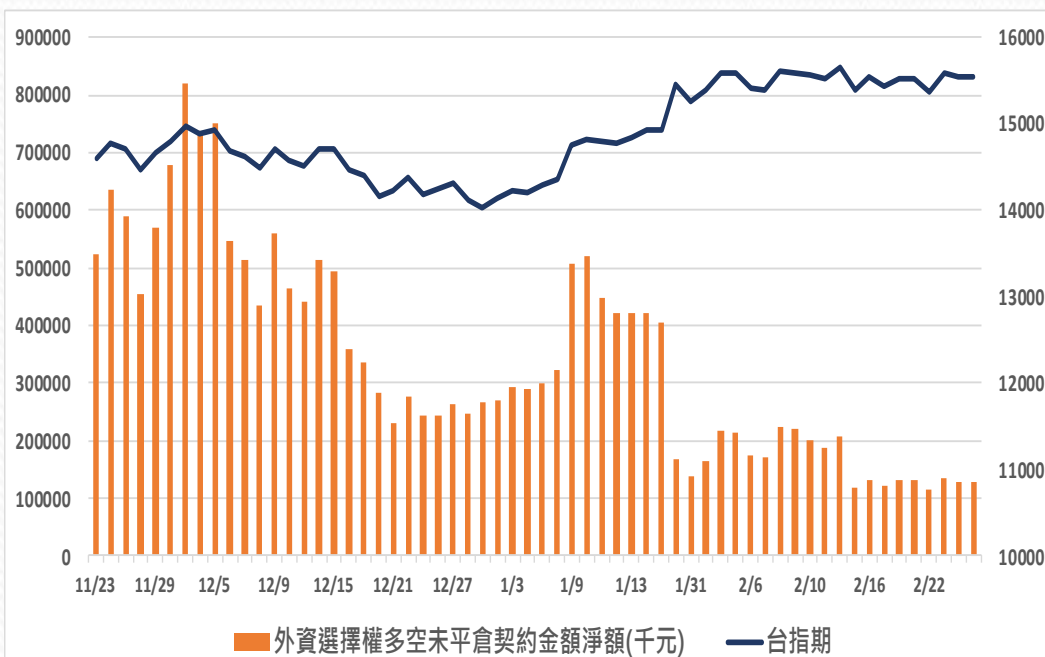
選擇權全月Put Call OI



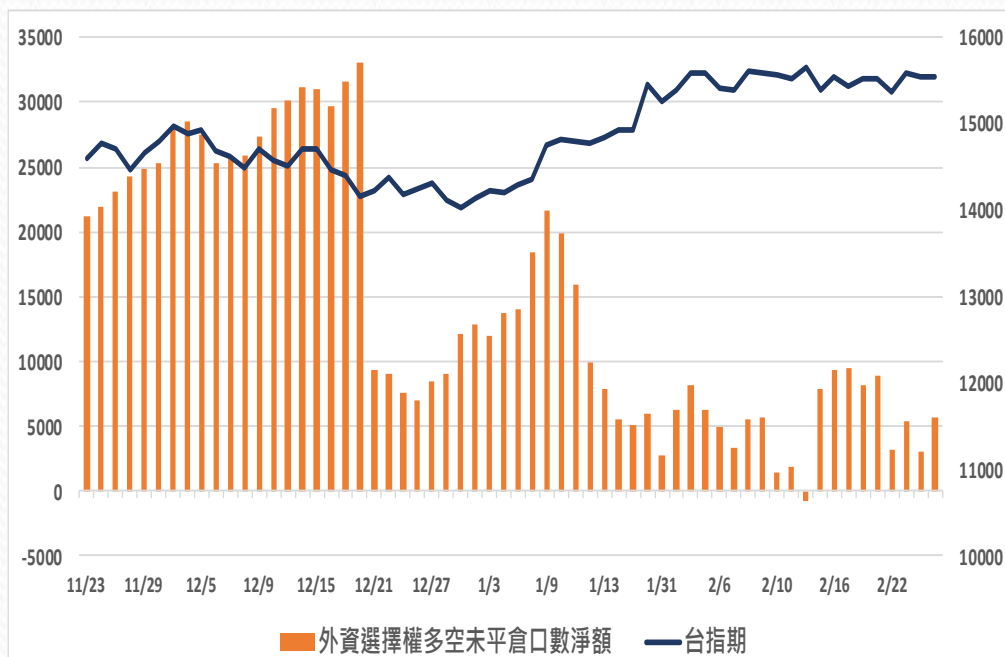
更新日期：2023年3月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



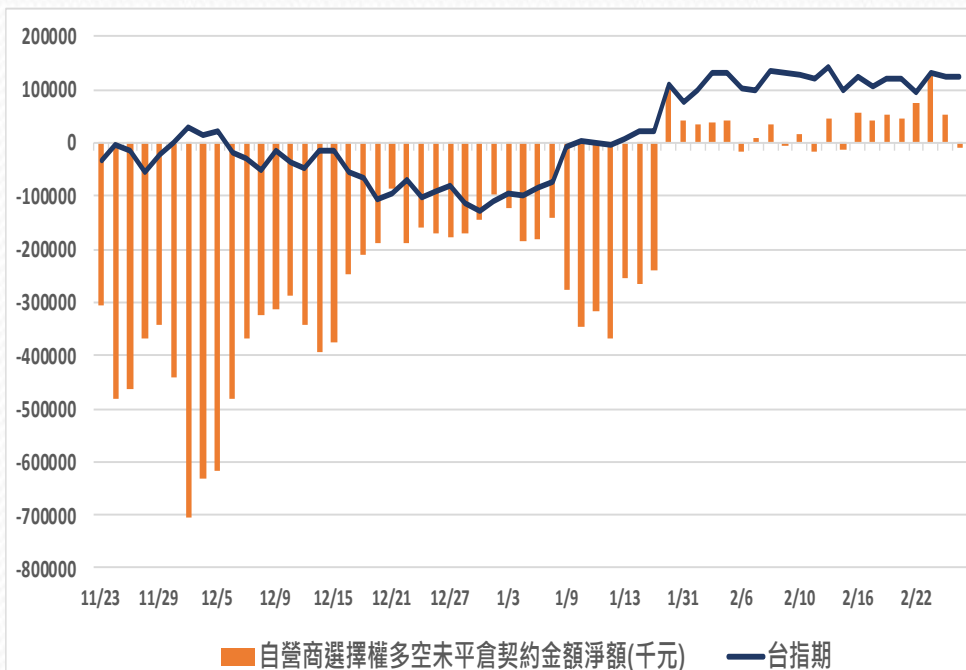
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/21	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
2023/3/1	15546	5729	2635	127965	1111

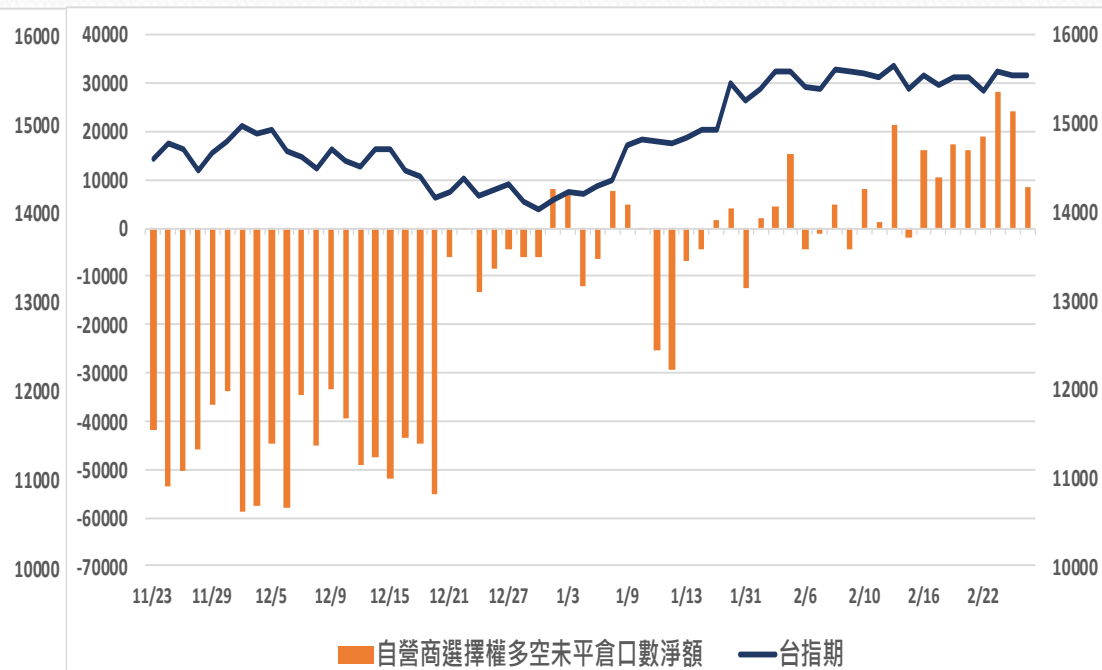
更新日期：2023年3月1日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



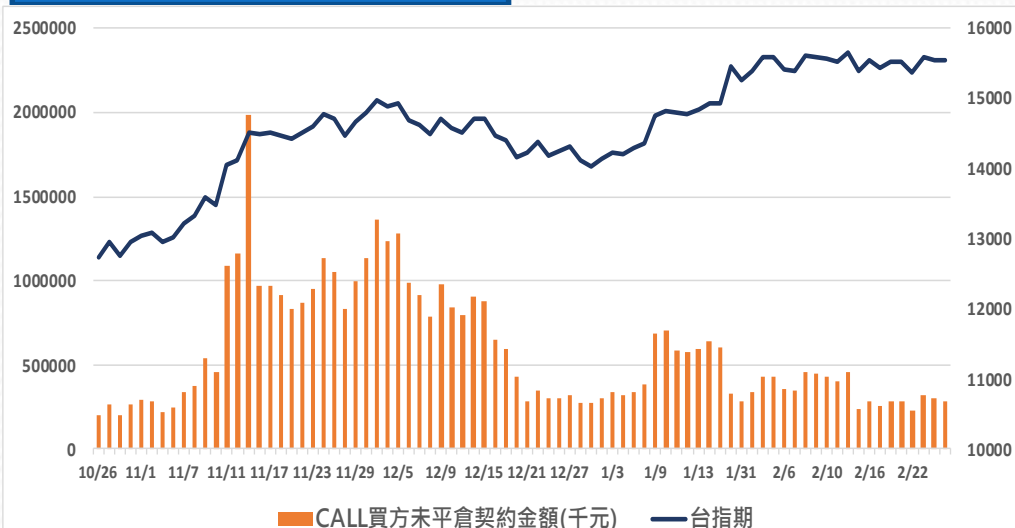
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/21	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
2023/3/1	15546	8518	-15509	-9298	-63365

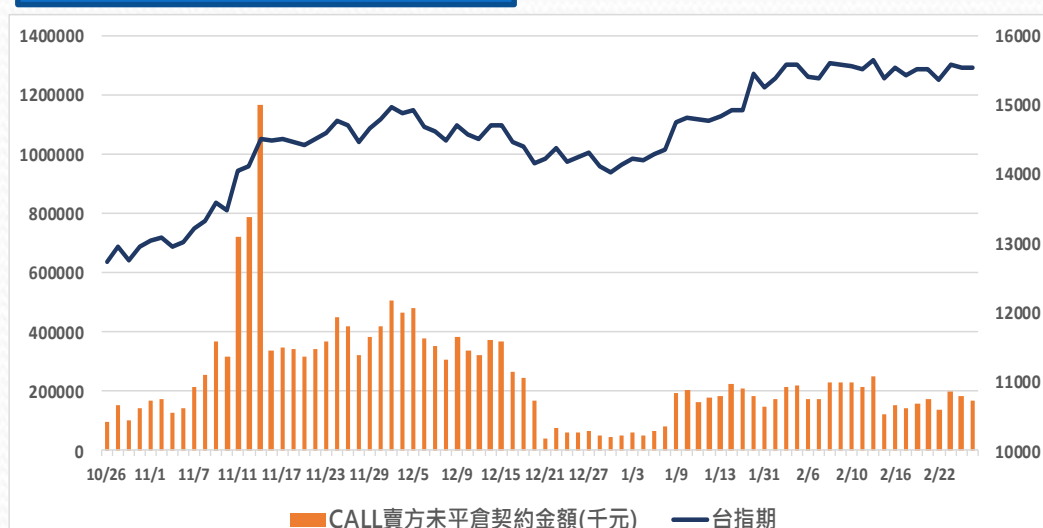
更新日期：2023年3月1日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

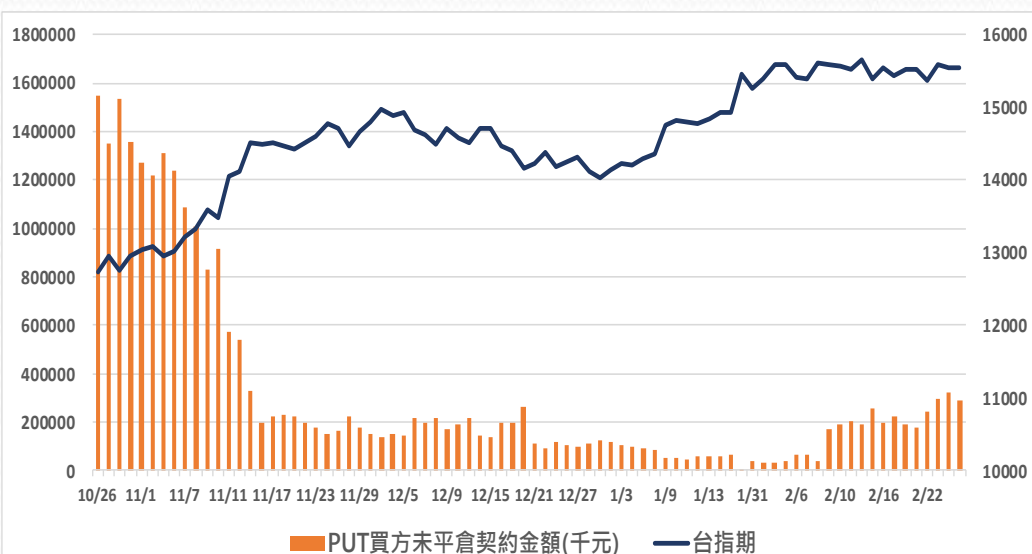
CALL買方未平倉金額



CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



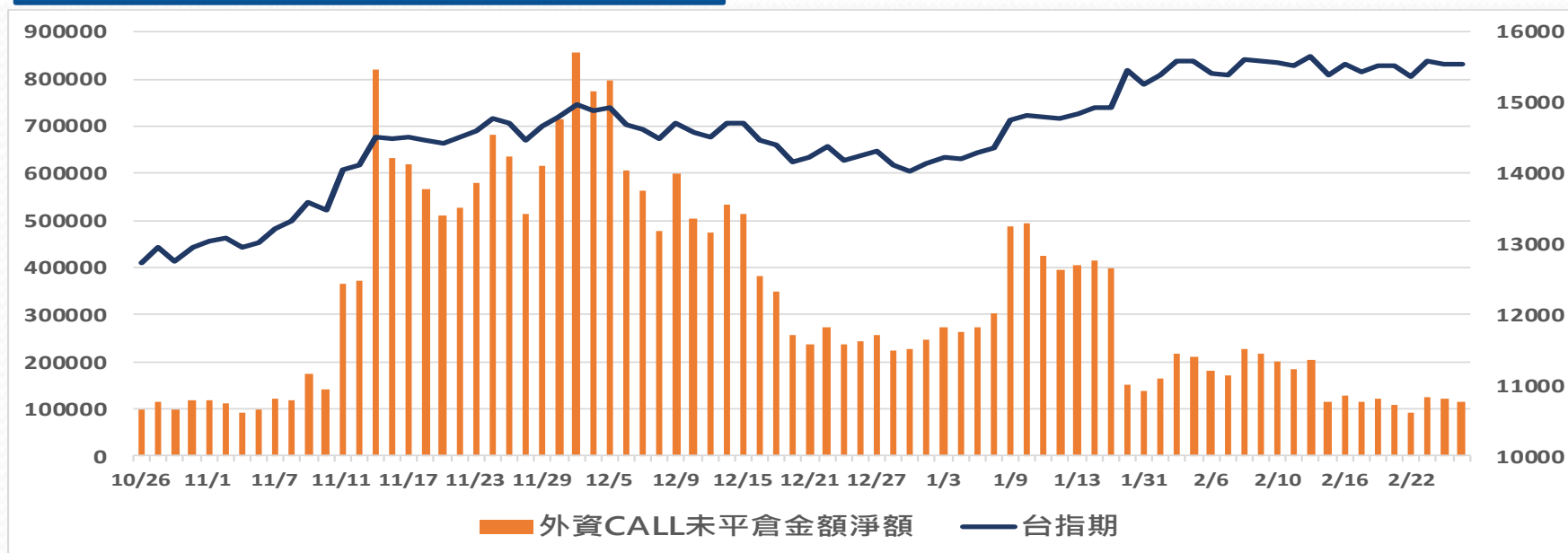
PUT賣方未平倉金額



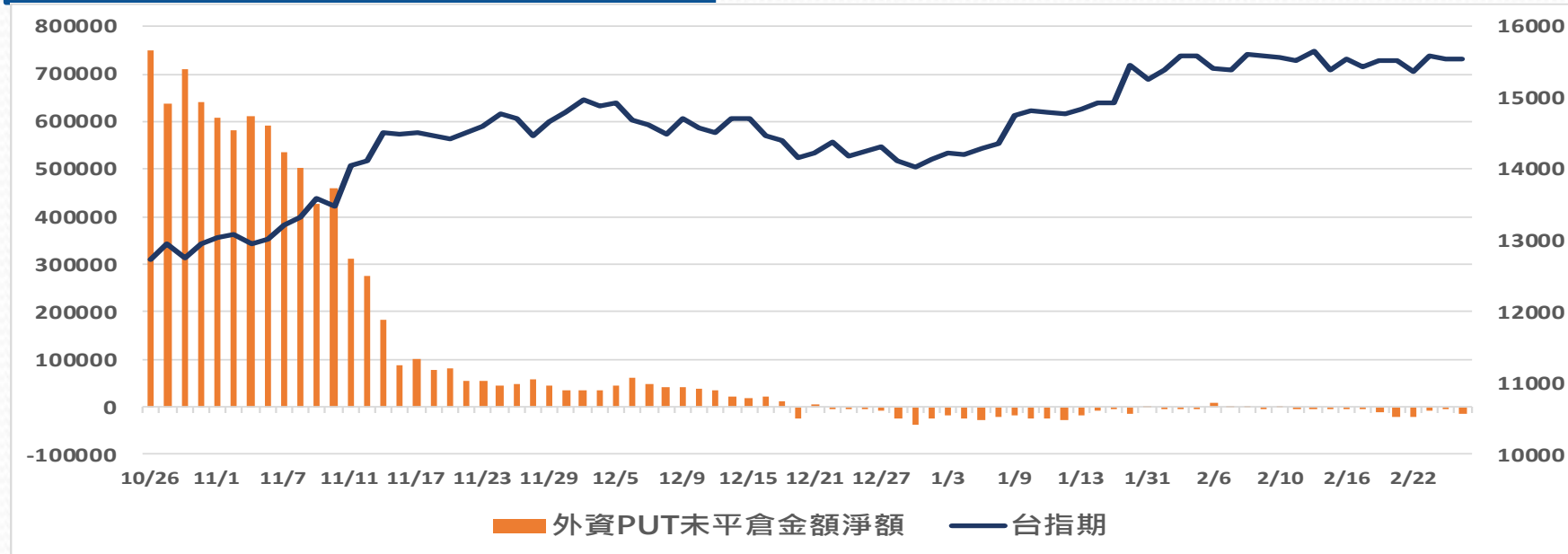
更新日期：2023年3月1日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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3月1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3月1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