

# 台指選擇權OI匯報

日期：2023/3/2 結算日：2023/3/8					日期：2023/3/2 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	14,600	1,682	240	0	24	14,100	2,336	-20	
0	0	14,700	3,913	330	0	138	14,200	2,821	870 ※	
0	1	14,800	4,346	1,934	0	49	14,300	2,571	77	
0	29	14,900	3,238	1,332	0	242	14,400	3,137	467	
11	24	15,000	6,857	2,299	0	92	14,500	4,996	-257	
5	30	15,100	5,826	1,591	-2	243	14,600	3,446	616	
1	11	15,150	5,282	3,133	1	92	14,700	6,217	-65	
0	102	15,200	7,433	1,469	3	250	14,800	5,803	9	
20	60	15,250	4,211	2,403	1	101	14,900	4,188	167	
70	224	15,300	7,350	4,402 ※	9	500	15,000	9,649	364	
27	325	15,350	3,690	1,947	7	268	15,100	5,547	631	
181	850	15,400	4,038	1,640	117	3,145	15,200	5,800	121	
425	950	15,450	3,476	1,292	-2	676	15,300	5,030	236	
1,262	2,947	15,500	4,262	2,383	82	2,437	15,400	4,391	130	
498	2,389	15,550	2,828	1,570	68	2,937	15,500	2,634	-274	
2,055	4,054	15,600	1,721	752	-224	3,996	15,600	1,672	63	
1,570	3,280	15,650	722	474	52	3,793	15,700	715	8	
2,503	4,769	15,700	495	201	481	4,446	15,800	391	43	
1,916	3,728	15,750	311	153	92	6,250	15,900	209	-14	
2,302	5,239	15,800	279	57	322	10,654	16,000	152	4	
3,104	5,512	15,850	117	81	※	940	8,394	16,100	85	8
※	4,666	15,900	88	37	55	7,695	16,200	100	3	
2,243	3,935	15,950	45	17	50	5,388	16,300	77	5	
1,707	4,760	16,000	32	4	150	3,788	16,400	74	0	
1,009	1,724	16,050	20	20	4	3,159	16,500	8	2	
1,446	3,438	16,100	21	1	43	1,880	16,600	6	4	
543	2,639	16,200	1	0	31	1,047	16,700	0	0	
708	1,213	16,300	0	0	2	1,031	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	
28,495	61,449	1.2358	75,939	29,923	2,472	106,082	1.1242	119,260	3,461	
昨日 P/C	1.9234	今日增減變化	-0.6876		昨日 P/C	1.1148	今日增減變化	0.0094		

更新日期：2023年3月2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2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	95,170,981	45,170,966	50,000,015	3,886,634	3,720,080	1,594,320	2,125,760	288,358	
投信	23,368,951	50,501,599	-27,132,648	-272,449	426,320	0	426,320	25,485	
自營商	49,493,574	23,704,296	25,789,278	-1,376,131	1,544,370	1,336,939	207,431	-234,494	
	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	413,683	1,648,512	-1,234,829	90,831	352,712	1,501	351,211	8,189	
投信	130,637	0	130,637	-369	0	0	0	0	
自營商	475,912	402,830	73,082	-117,192	117,048	439,680	-322,632	-2,004	

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2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	27,086	16,120	10,966	-453	40,833	35,777	5,056	-634	
投信	100	0	100	0	200	113	87	0	
自營商	61,633	57,753	3,880	7,168	57,135	64,782	-7,647	4,159	
特定法人(週)	986	0	986	386	0	6,906	-6,906	-1,501	
特定法人(近月)	18,322	8,301	10,021	-723	12,679	14,505	-1,826	238	
特定法人(全月)	20,221	6,340	13,881	-695	24,218	29,457	-5,239	669	
十大交易人(週)	20,432	19,064	1,368	567	31,372	27,993	3,379	1,970	
十大交易人(近月)	60,409	58,645	1,764	1,485	62,275	51,148	11,127	-884	
十大交易人(全月)	88,650	75,871	12,779	5,760	95,758	88,901	6,857	326	
全市場未沖銷(近月)			110,447	4,487			122,593	4,471	
全市場未沖銷(全月)			193,184	34,147			230,729	36,559	

更新日期：2023年3月2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	15400	賣權OI最大量	15200
	整體隱含波動率	14.65%	較前一交易日	-0.36%
	買權隱含波動率	12.15%	較前一交易日	+0.02%
	賣權隱含波動率	16.77%	較前一交易日	-0.38%
電子選擇權	買權成交最大量	730	買權OI最大量	725
	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	1600	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1520

更新日期：2023年3月2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	#DIV/0!
	買權隱含波動率	12.62%	較前一交易日	#DIV/0!
	賣權隱含波動率	18.96%	較前一交易日	#DIV/0!
	成交量P/C_Ratio值	1.168	較前一交易日	+0.17
	未平倉P/C_Ratio值	1.110	較前一交易日	-0.00
電子選擇權	買權成交最大量	730	買權OI最大量	725
	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	1600	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1520

更新日期：2023年3月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

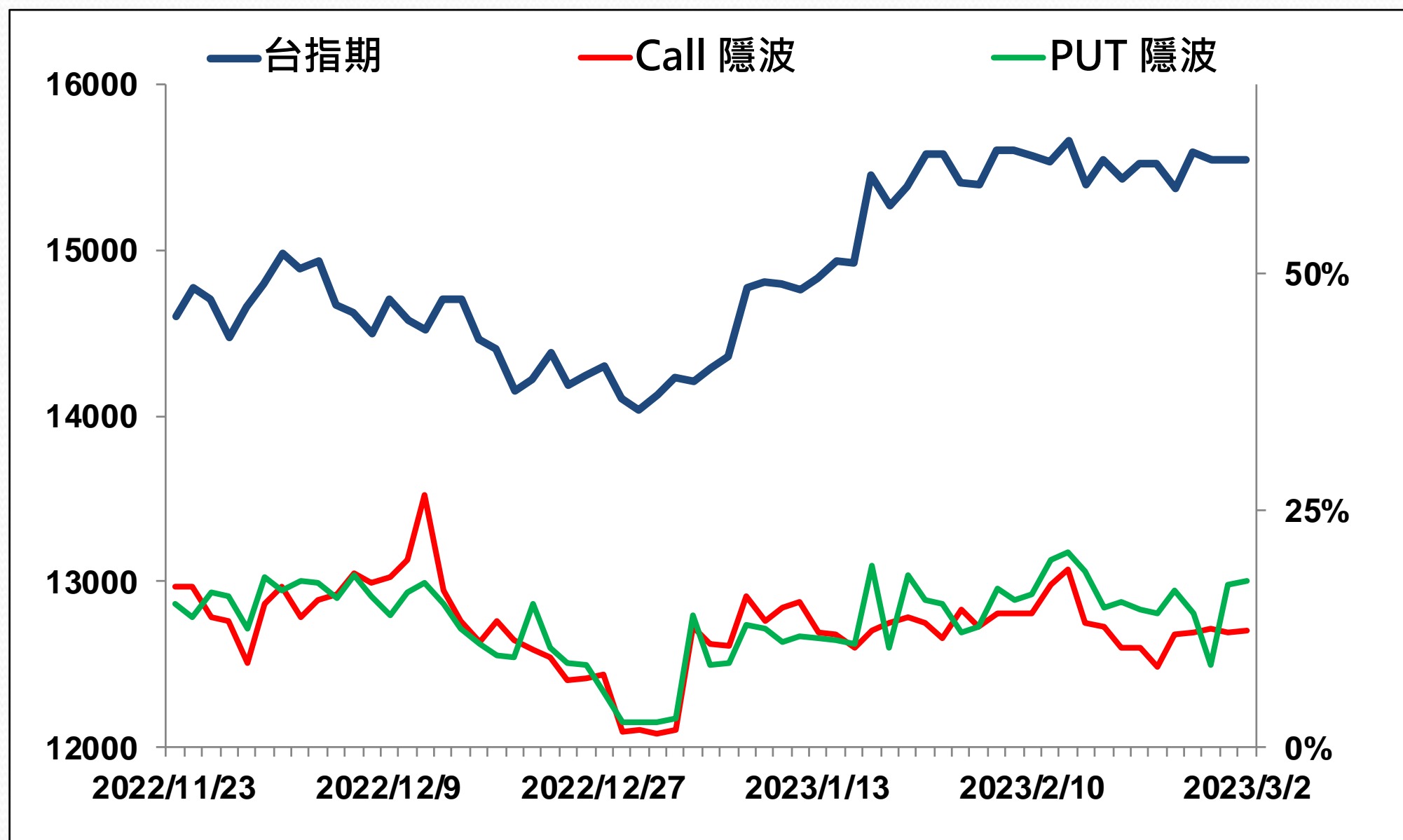
# 選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



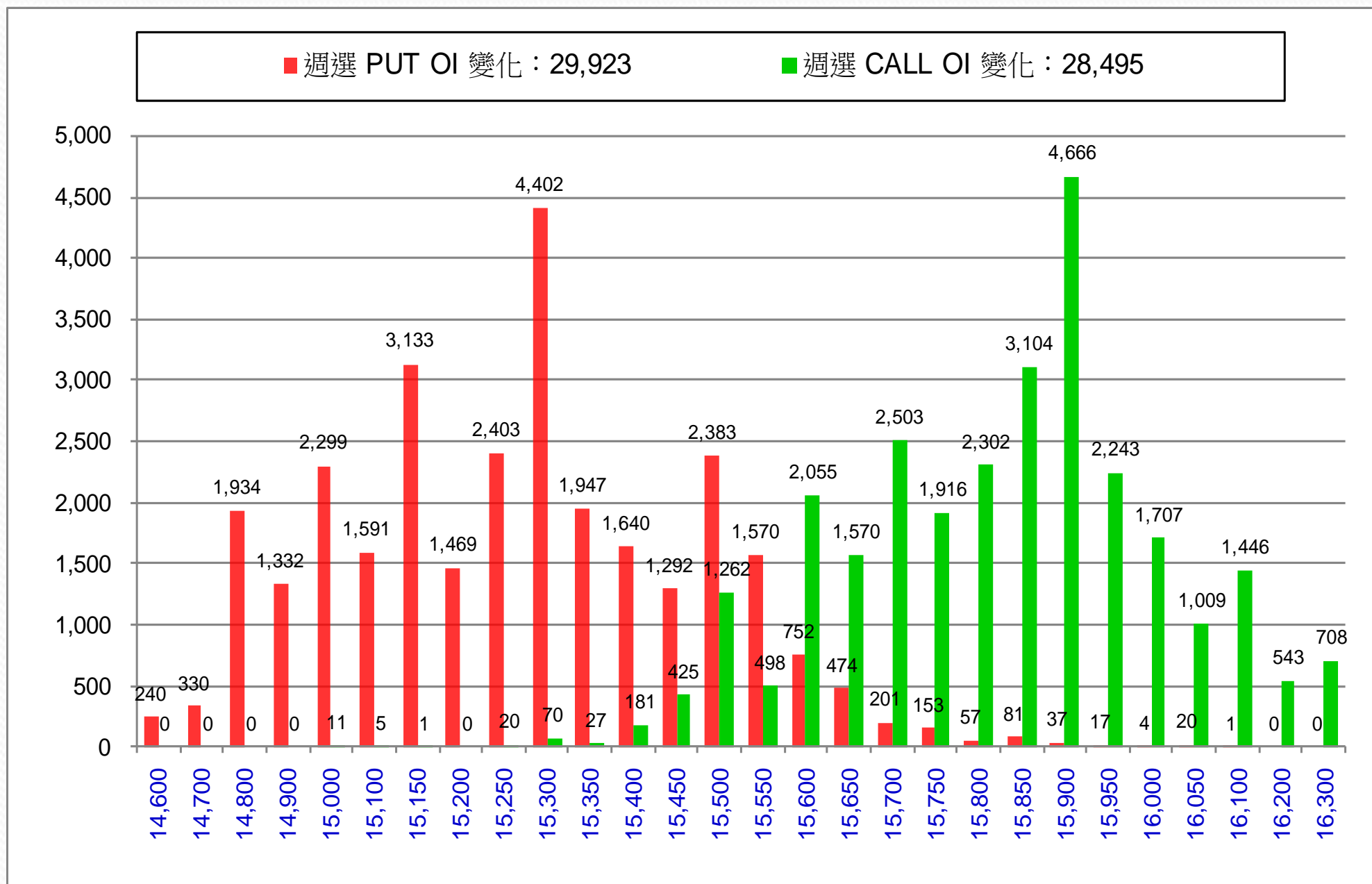
更新日期：2023年3月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2023年3月2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

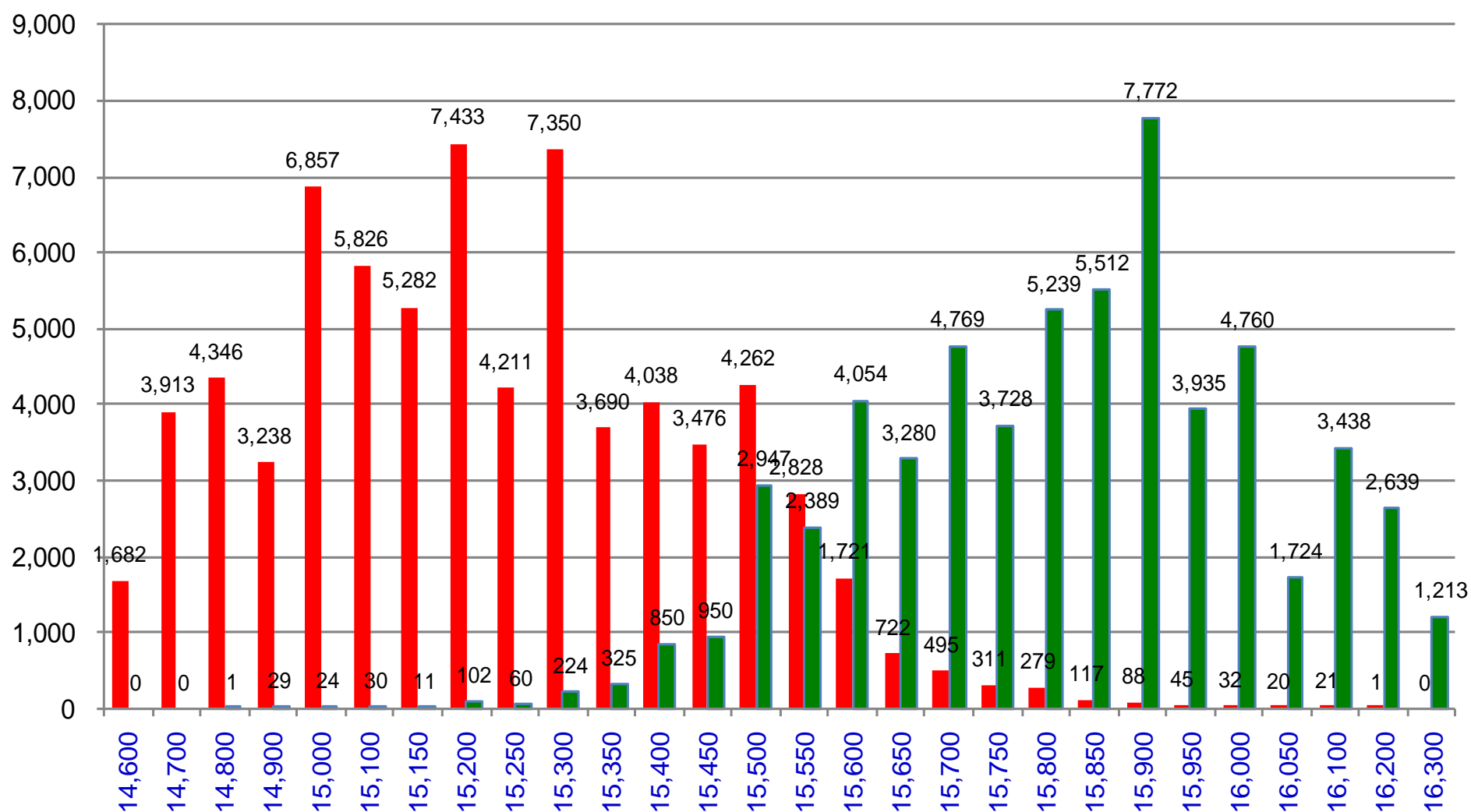


更新日期：2023年3月2日    資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：75,939

週選 CALL OI 總額：61,449



更新日期：2023年3月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

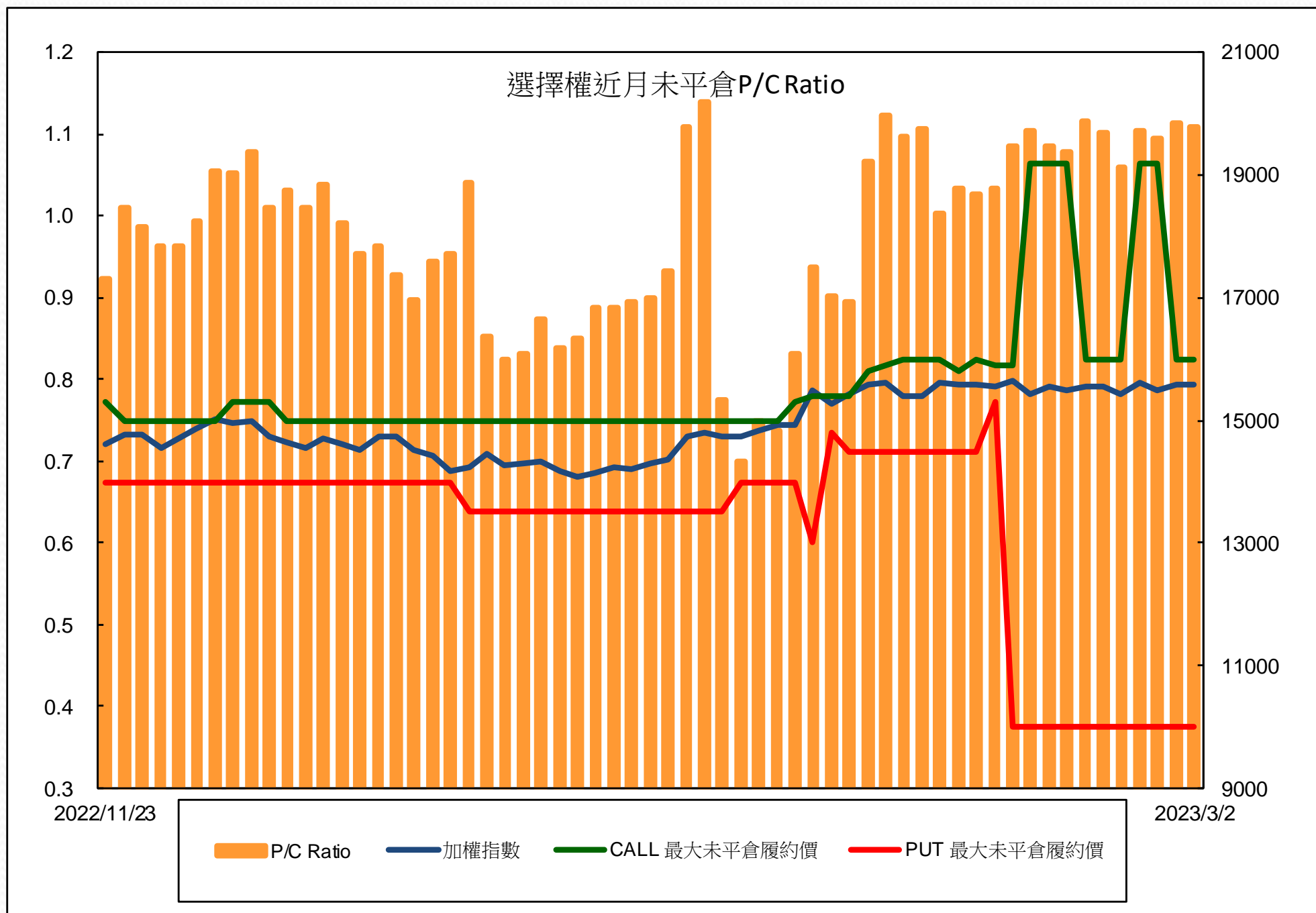


# 自營商選擇權OI部位統計

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	3月1日	53,070	56,358	-3,288
	3月2日	61,633	57,753	3,880
Put	3月1日	50,738	62,544	-11,806
	3月2日	57,135	64,782	-7,647

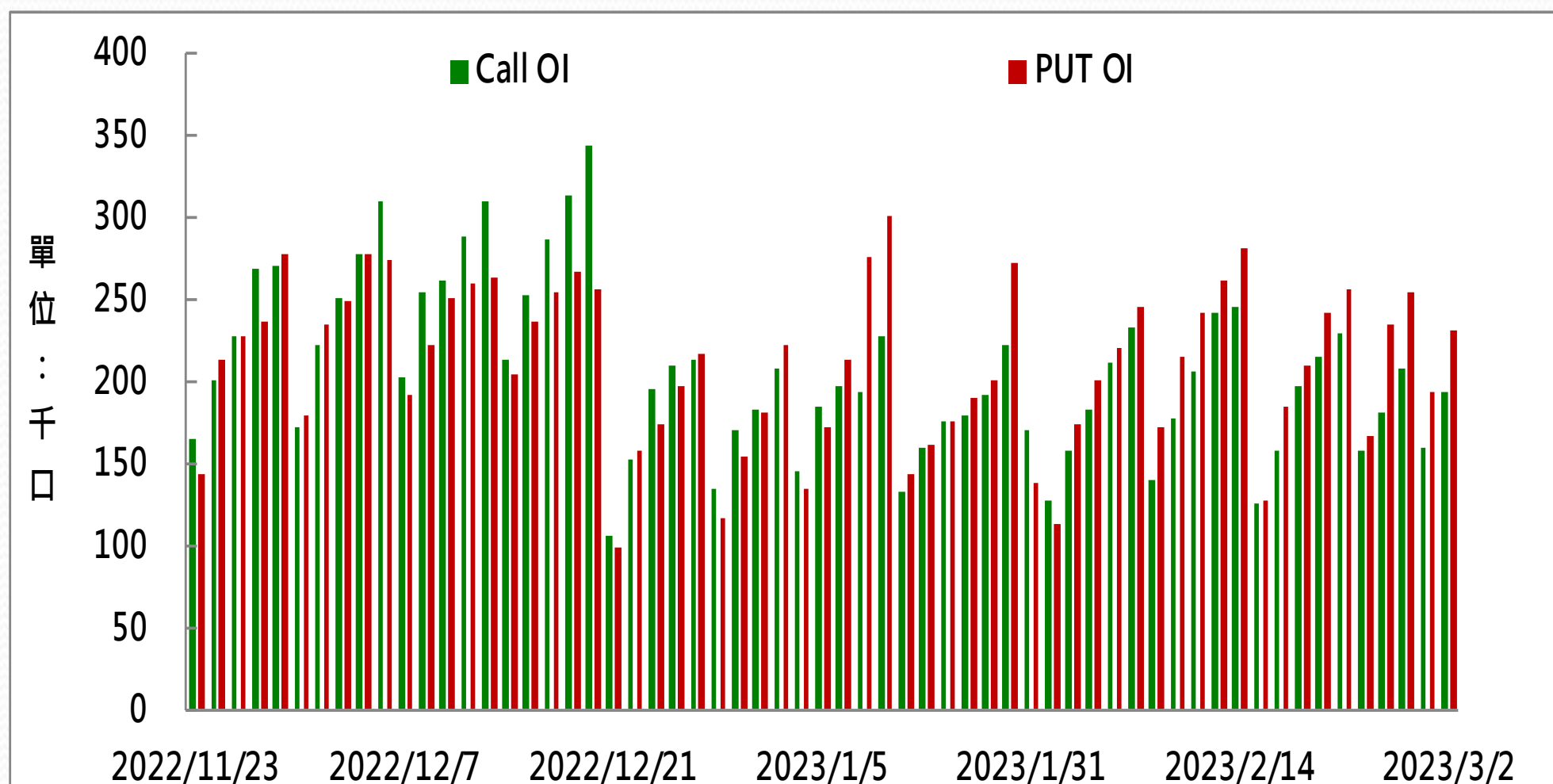
更新日期：2023年3月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

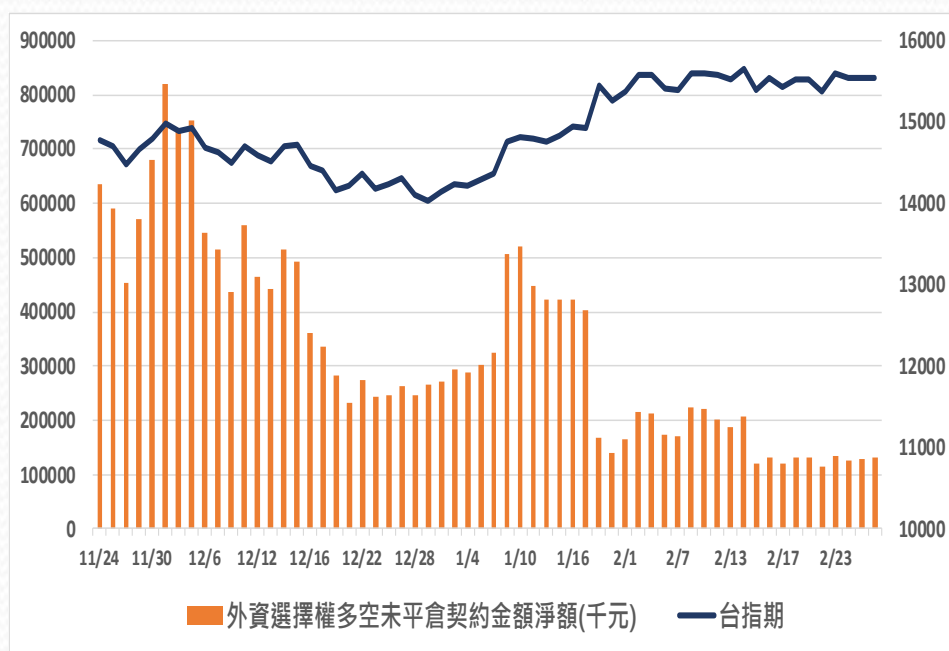
# 選擇權全月Put Call OI



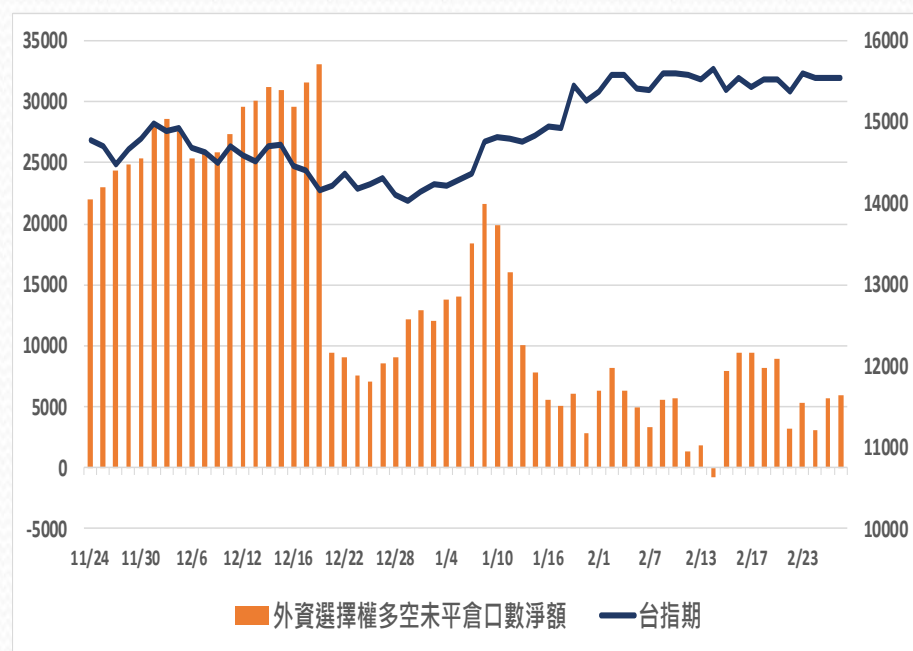
更新日期：2023年3月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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



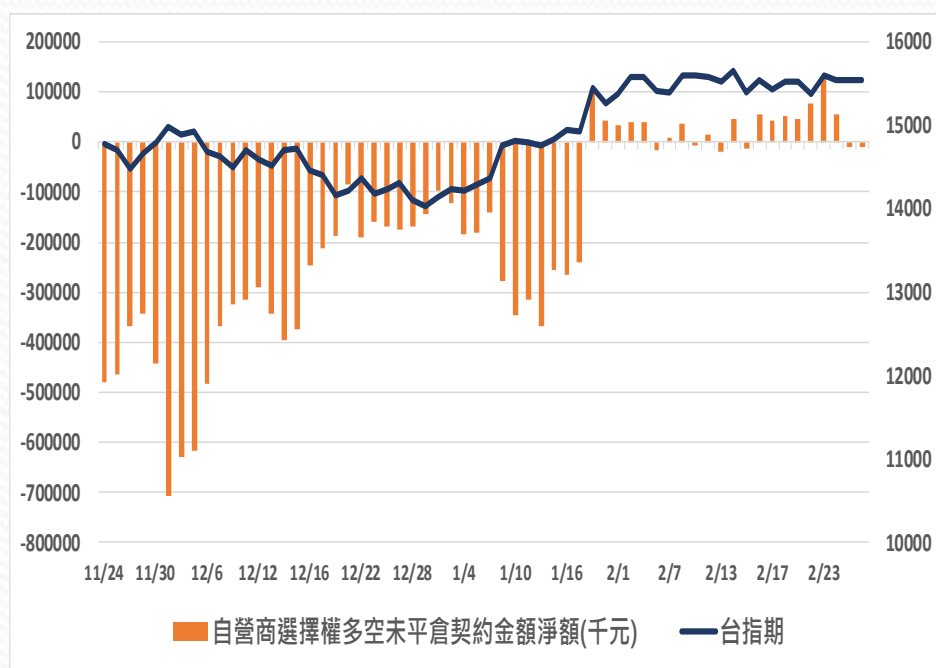
### 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/22	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
2023/3/2	15542	5910	181	132486	4521

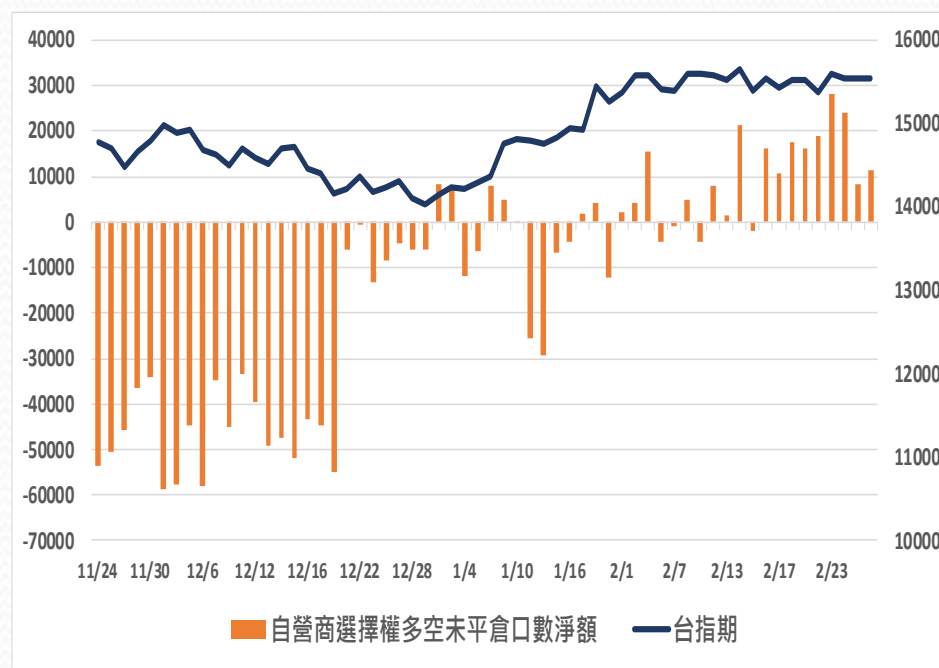
更新日期：2023年3月2日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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



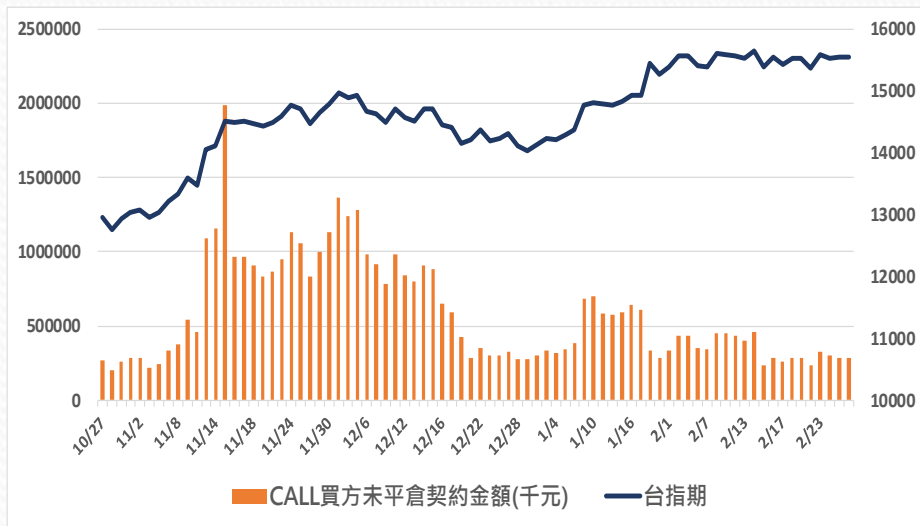
## 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/22	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
2023/3/2	15542	11527	3009	-9698	-400

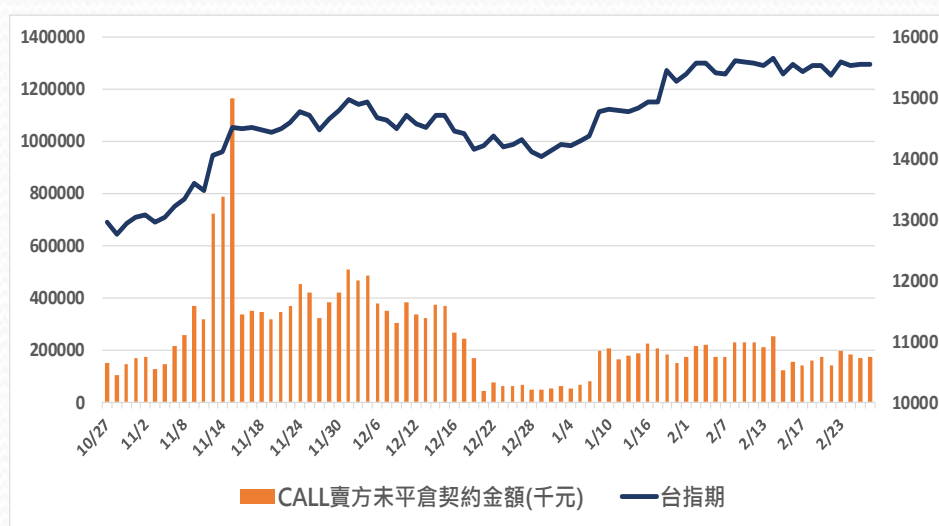
更新日期：2023年3月2日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 外資買賣權未平倉金額

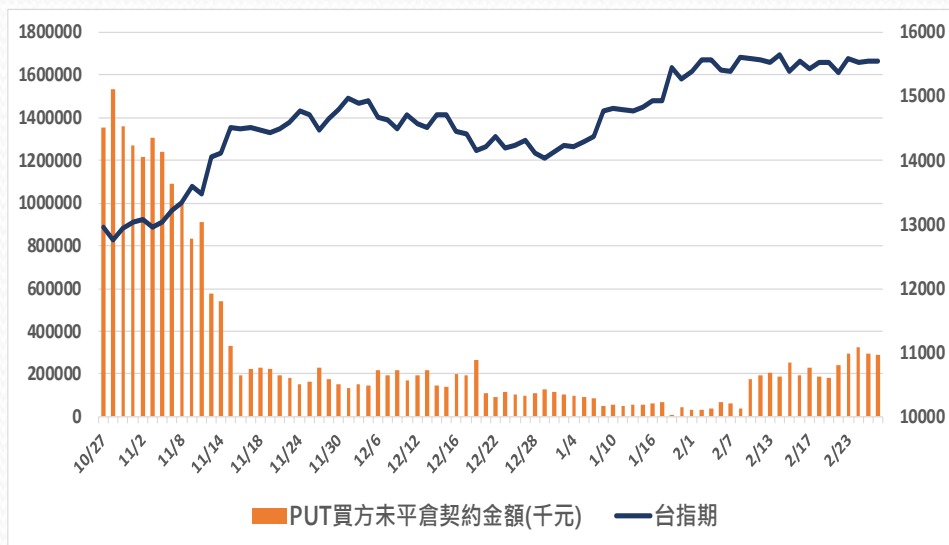
## CALL買方未平倉金額



## CALL賣方未平倉金額



## PUT買方未平倉金額



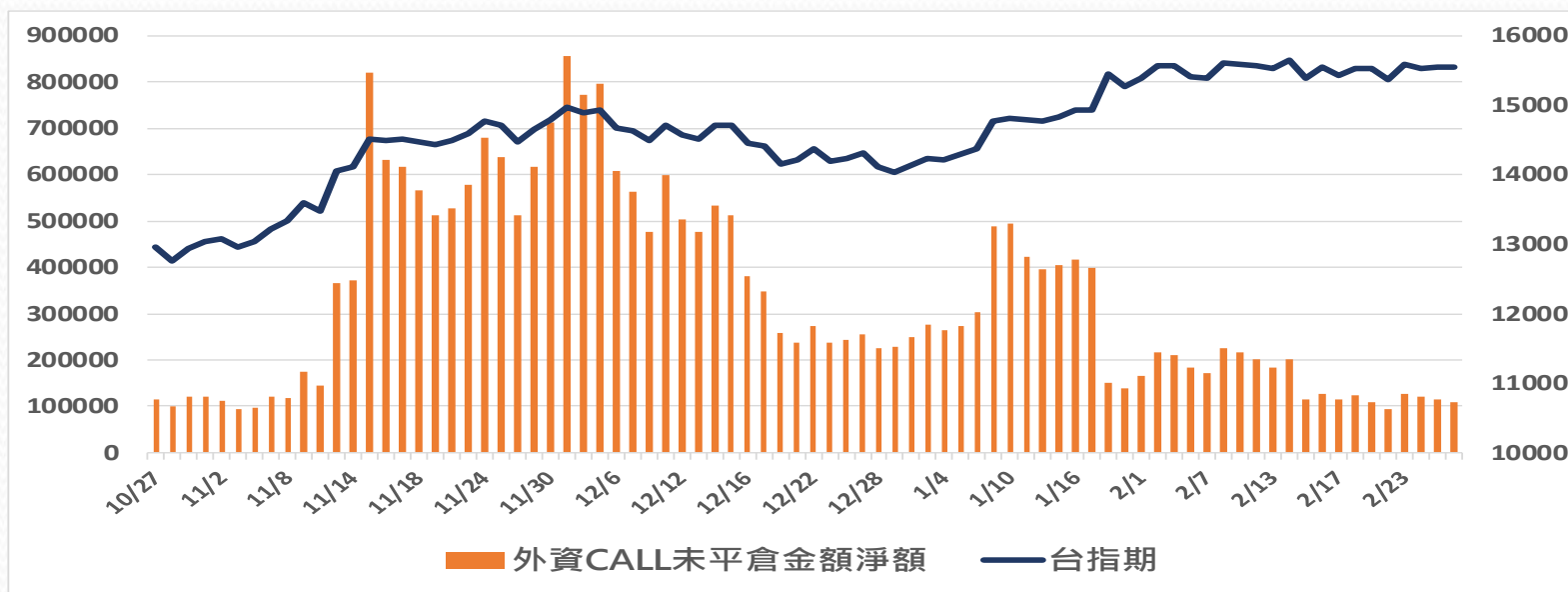
## PUT賣方未平倉金額



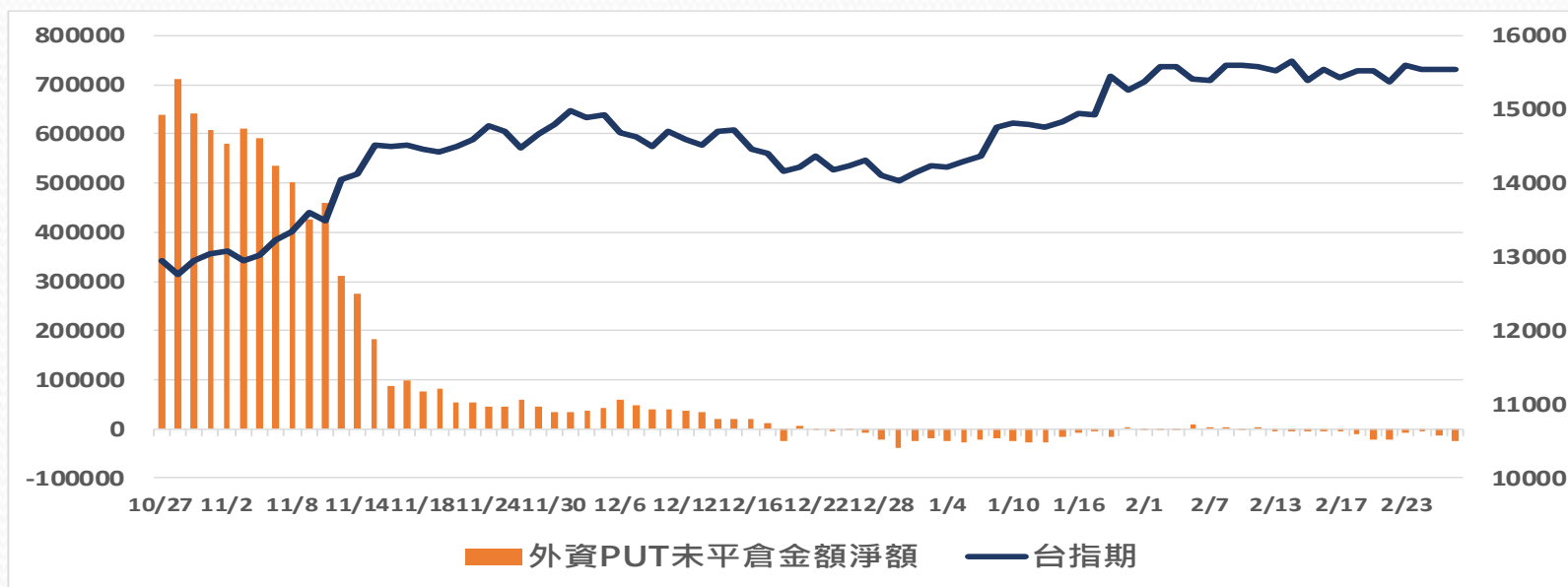
更新日期：2023年3月2日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 外資買賣權未平倉金額淨額

## BUY CALL-SELL CALL(未平倉金額)

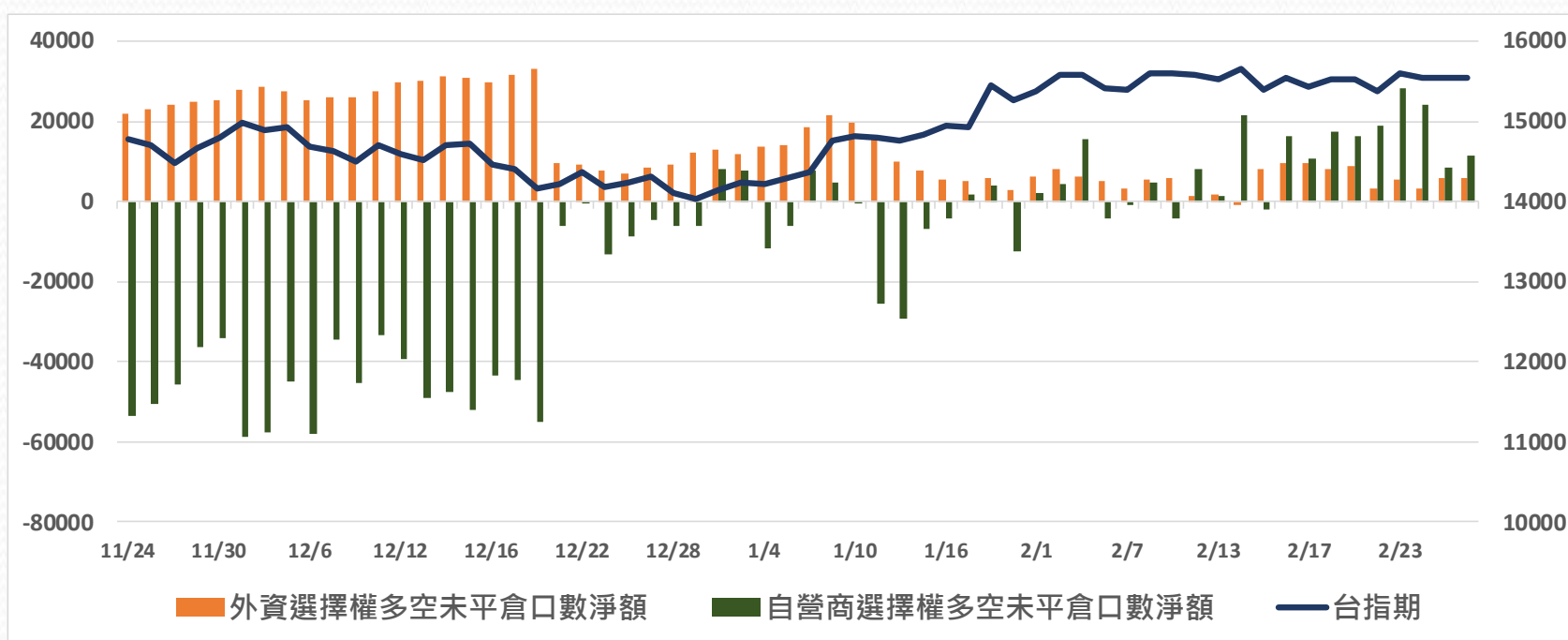
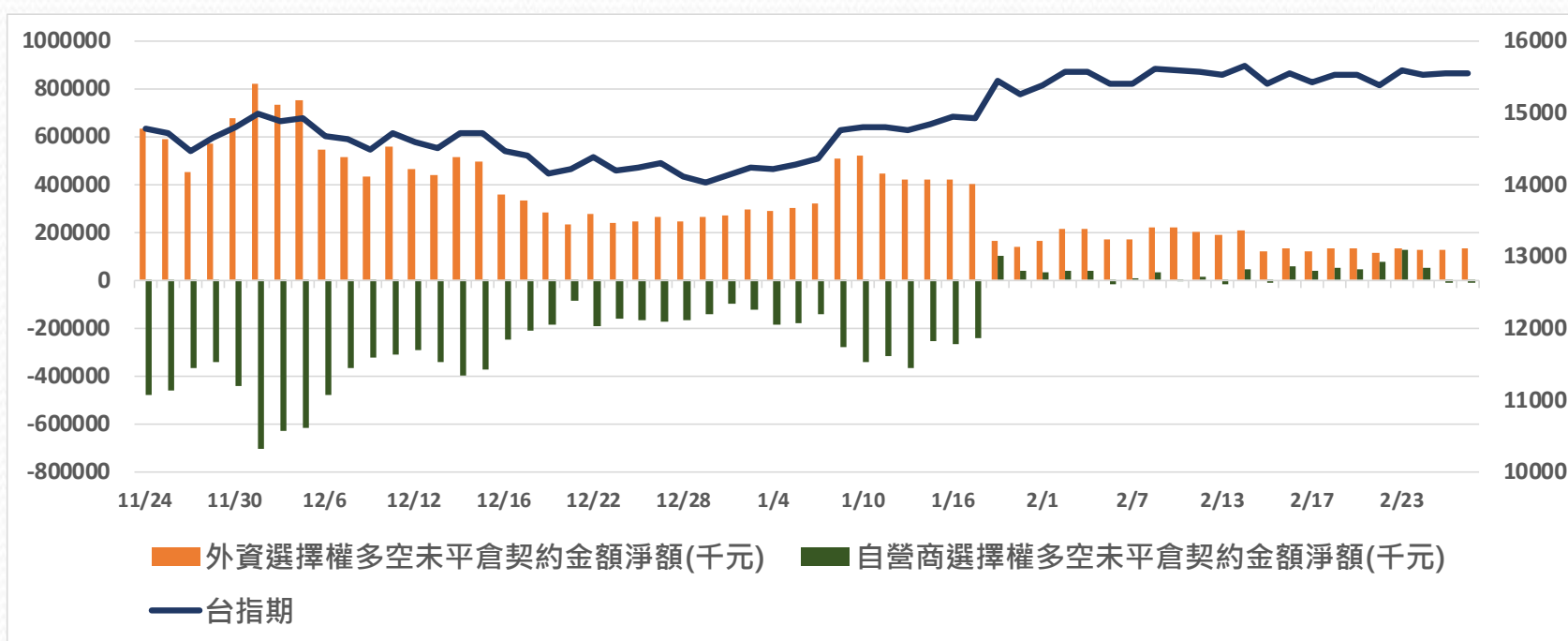


## BUY PUT-SELL PUT(未平倉金額)



更新日期：2023年3月2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.自營商選擇權多空未平倉淨額





# 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2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