

台指選擇權OI匯報

日期：2023/3/3 結算日：2023/3/8					日期：2023/3/3 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	1,943	261	0	24	14,100	2,394	58
0	0	14,700	3,808	-105	0	138	14,200	2,788	-33
0	1	14,800	3,644	-702	-2	47	14,300	2,536	-35
0	29	14,900	4,477	1,239	-24	218	14,400	3,357	220
-1	23	15,000	7,999	1,142	-2	90	14,500	5,391	395
10	40	15,100	5,659	-167	-1	242	14,600	3,503	57
0	11	15,150	6,420	1,138	1	93	14,700	6,002	-215
14	116	15,200	8,982	1,549	-6	244	14,800	5,256	-547
4	64	15,250	4,473	262	0	101	14,900	4,316	128
20	244	15,300	11,129	3,779	-28	472	15,000	10,094	445
17	342	15,350	4,486	796	-16	252	15,100	5,707	160
15	865	15,400	6,577	2,539	199	3,344	15,200	5,766	-34
-148	802	15,450	6,428	2,952	-71	605	15,300	5,180	150
-1,468	1,479	15,500	6,666	2,404	-160	2,277	15,400	4,287	-104
-310	2,079	15,550	3,450	622	368	3,305	15,500	3,694	1,060
1,193	5,247	15,600	3,999	2,278	73	4,069	15,600	2,667	995
932	4,212	15,650	1,595	873	342	4,135	15,700	904	189
859	5,628	15,700	1,378	883	-196	4,250	15,800	357	-34
1,036	4,764	15,750	969	658	145	6,395	15,900	271	62
3,283	8,522	15,800	633	354	524	11,178	16,000	166	14
1,876	7,388	15,850	148	31	273	8,667	16,100	100	15
※ 3,433	11,205	15,900	150	62	※ 770	8,465	16,200	127	27
2,884	6,819	15,950	139	94	356	5,744	16,300	81	4
763	5,523	16,000	36	4	-180	3,608	16,400	75	1
707	2,431	16,050	63	43	-70	3,089	16,500	10	2
825	4,263	16,100	42	21	67	1,947	16,600	8	2
604	3,243	16,200	3	2	7	1,054	16,700	1	1
42	1,255	16,300	0	0	-7	1,024	16,800	11	8
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
16,466	77,915	1.2756	99,389	23,450	1,862	107,944	1.1313	122,114	2,854
昨日 P/C	1.2358	今日增減變化	0.0398		昨日 P/C	1.1100	今日增減變化	0.0213	

更新日期：2023年3月3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3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	96,873,659	51,799,874	45,073,785	-4,926,230	3,775,901	1,638,764	2,137,137	11,377	
投信	23,459,976	50,217,364	-26,757,388	375,260	445,603	0	445,603	19,283	
自營商	49,896,495	27,183,473	22,713,022	-3,076,256	1,700,001	1,485,900	214,101	6,670	
	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	405,080	1,623,436	-1,218,356	16,473	337,042	1,511	335,531	-15,680	
投信	130,872	0	130,872	235	0	0	0	0	
自營商	440,935	349,026	91,909	18,827	108,767	453,274	-344,507	-21,875	

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3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	31,433	19,152	12,281	1,315	46,303	37,945	8,358	3,302	
投信	150	50	100	0	300	113	187	100	
自營商	74,982	60,195	14,787	10,907	55,976	75,404	-19,428	-11,781	
特定法人(週)	793	2,085	-1,292	-2,278	0	10,006	-10,006	-3,100	
特定法人(近月)	19,796	8,309	11,487	1,466	12,683	16,314	-3,631	-1,805	
特定法人(全月)	22,271	9,063	13,208	-673	25,104	33,788	-8,684	-3,445	
十大交易人(週)	29,082	25,266	3,816	2,448	39,868	28,325	11,543	8,164	
十大交易人(近月)	63,337	60,529	2,808	1,044	64,996	53,914	11,082	-45	
十大交易人(全月)	102,723	82,000	20,723	7,944	106,414	92,374	14,040	7,183	
全市場未沖銷(近月)			114,600	4,153			128,163	5,570	
全市場未沖銷(全月)			216,564	23,380			262,573	31,844	

更新日期：2023年3月3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	15500	賣權OI最大量	15300
	整體隱含波動率	12.72%	較前一交易日	-1.93%
	買權隱含波動率	12.43%	較前一交易日	+0.29%
	賣權隱含波動率	12.99%	較前一交易日	-3.78%
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	720	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	1540	賣權OI最大量	1520

更新日期：2023年3月3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

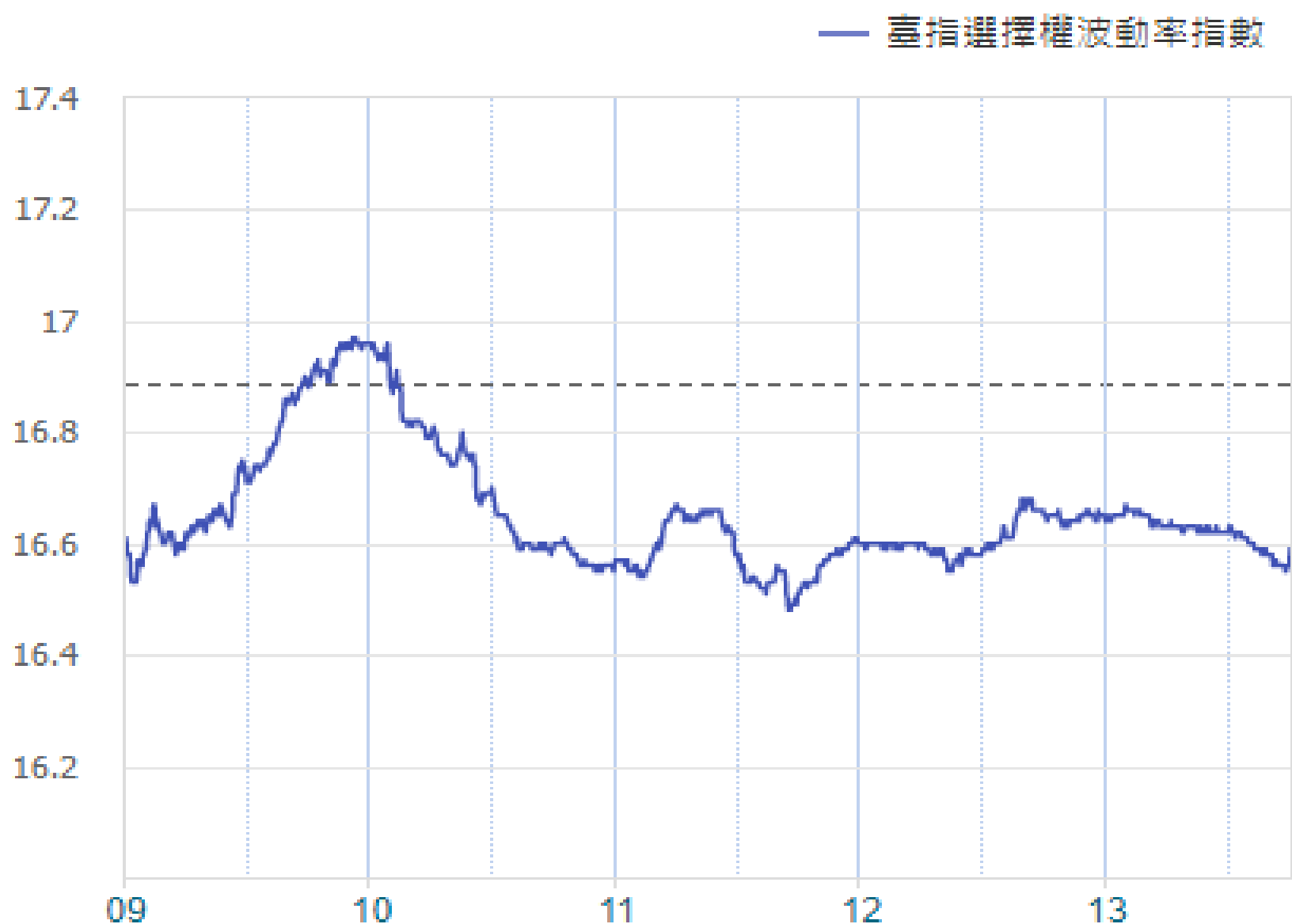
2023年03月選擇權分析表

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	15.15%	較前一交易日	+0.85%
	買權隱含波動率	13.69%	較前一交易日	+1.07%
	賣權隱含波動率	16.44%	較前一交易日	-2.52%
	成交量P/C_Ratio值	1.131	較前一交易日	-0.04
	未平倉P/C_Ratio值	1.118	較前一交易日	+0.01
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	720	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	1540	賣權OI最大量	1520

更新日期：2023年3月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

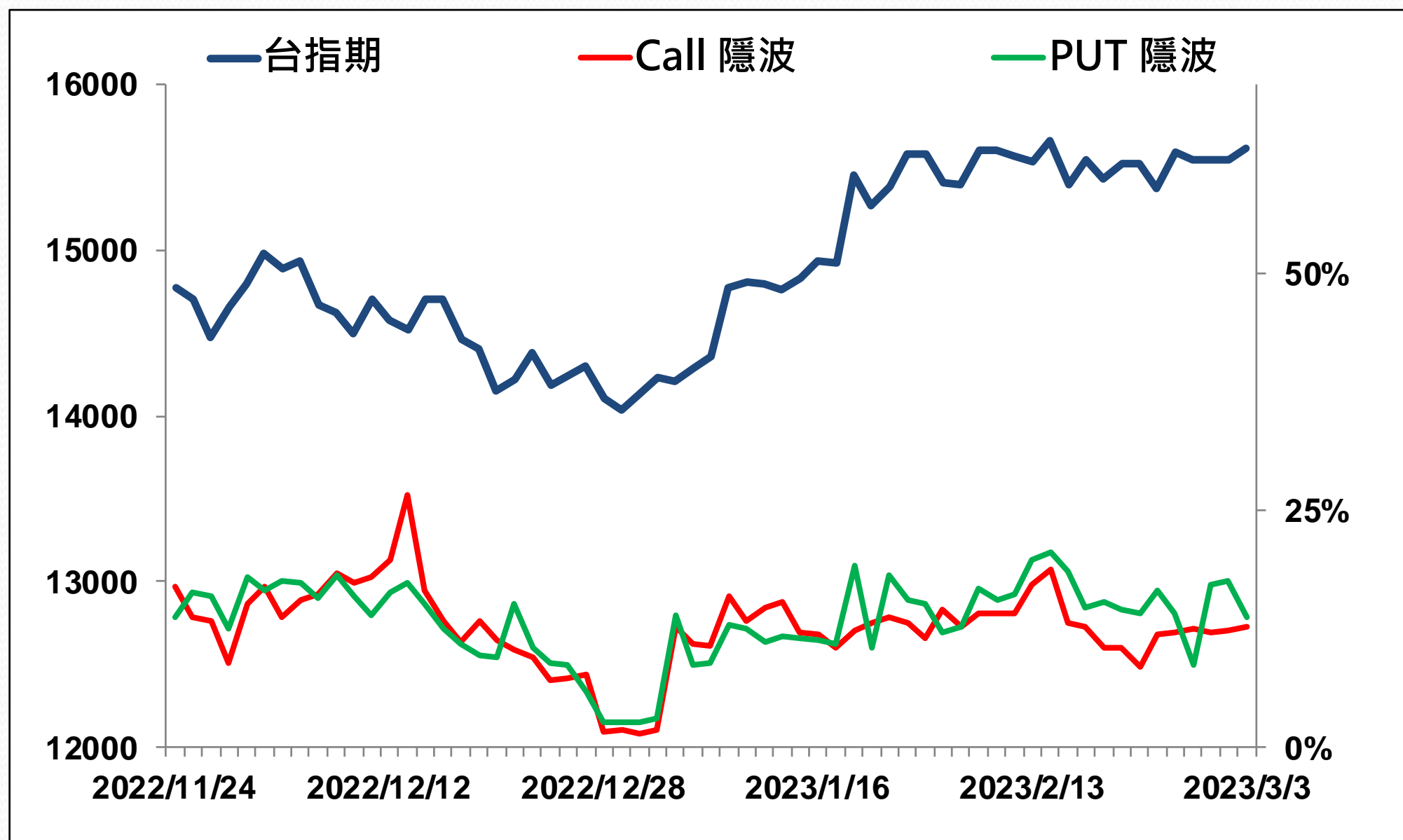
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年3月3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

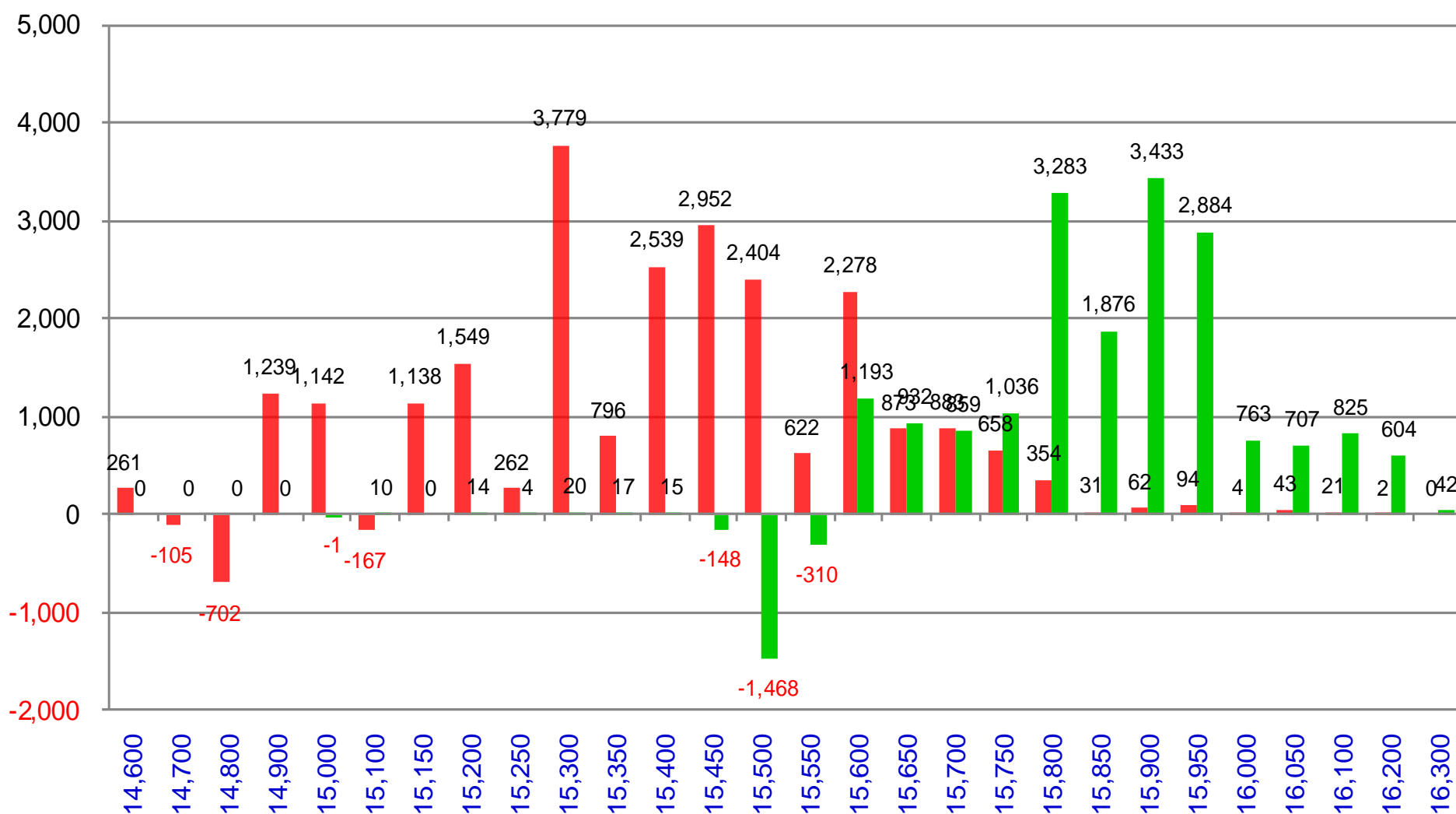


更新日期：2023年3月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：23,450

週選 CALL OI 變化：16,466

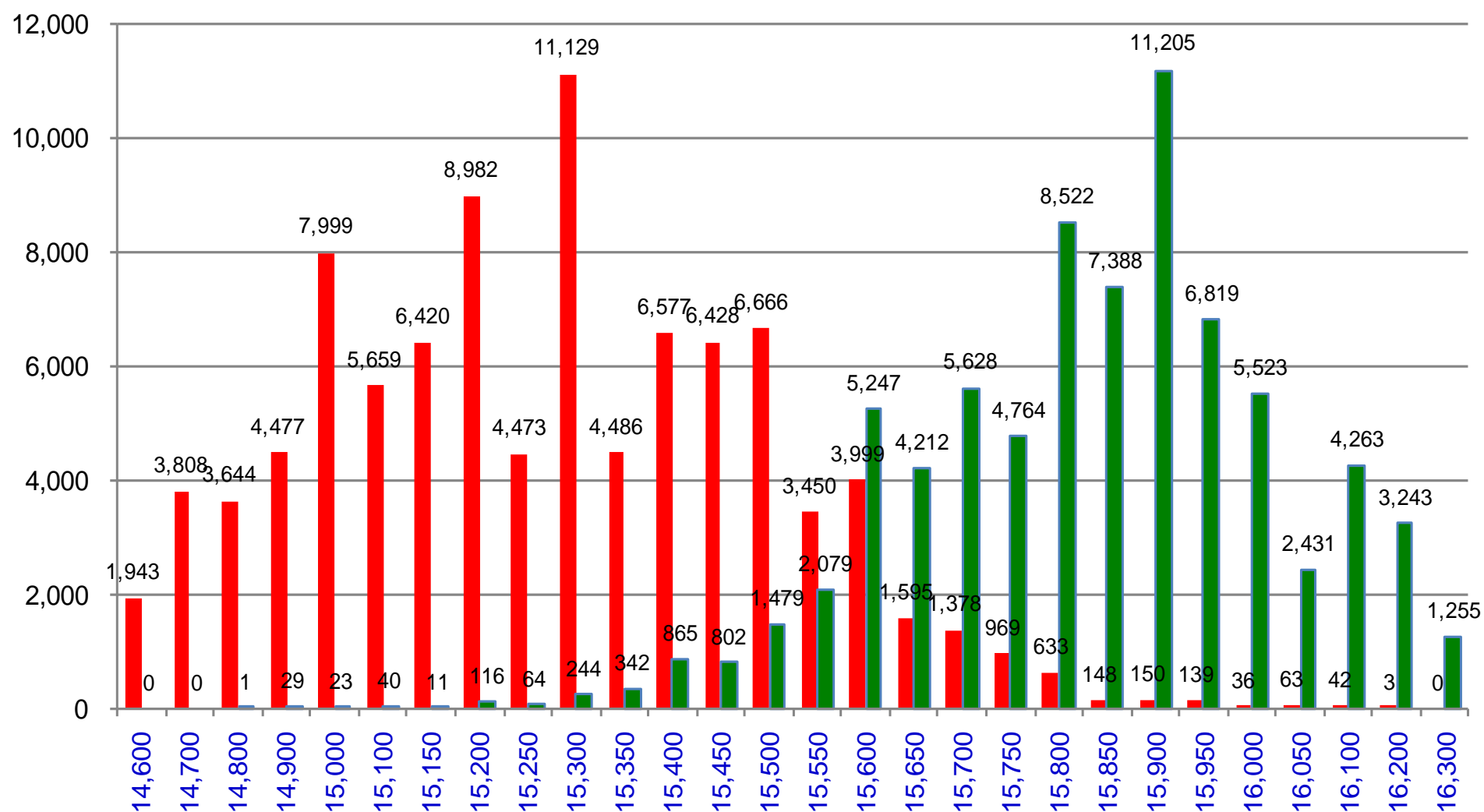


更新日期：2023年3月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：99,389

■ 週選 CALL OI 總額：77,915



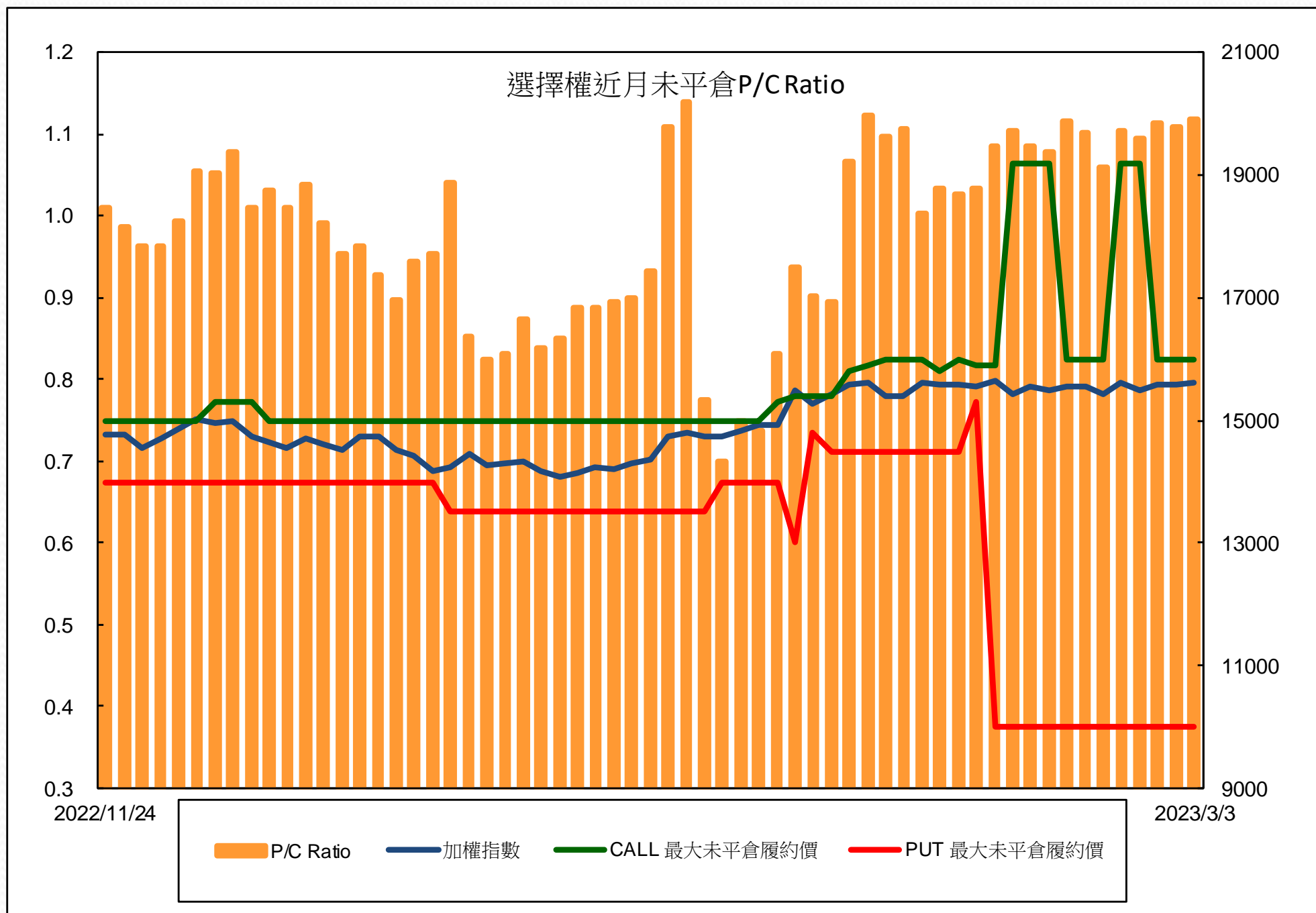
更新日期：2023年3月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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2日	61,633	57,753	3,880
	3月3日	74,982	60,195	14,787
Put	3月2日	57,135	64,782	-7,647
	3月3日	55,976	75,404	-19,428

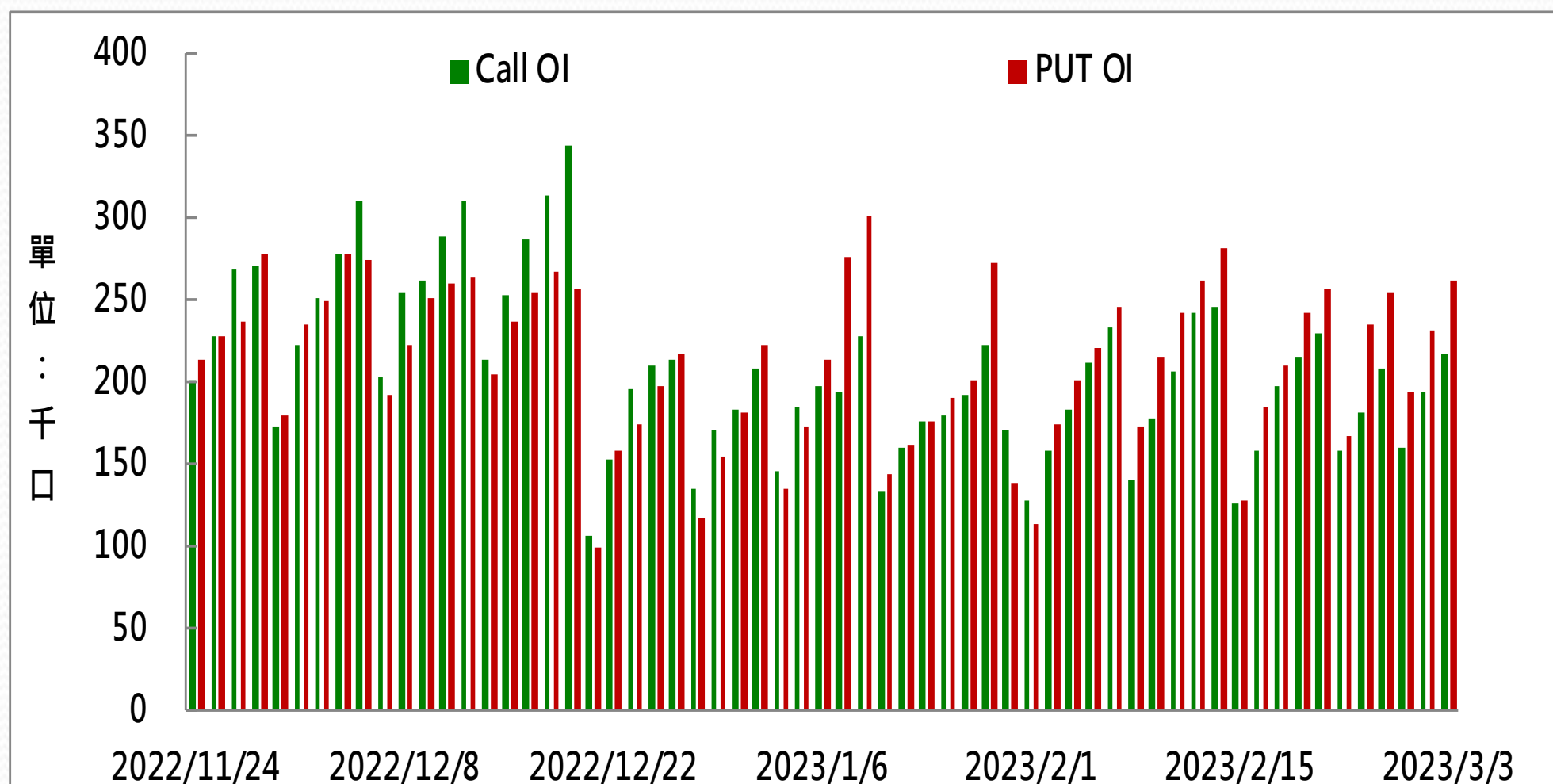
更新日期：2023年3月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

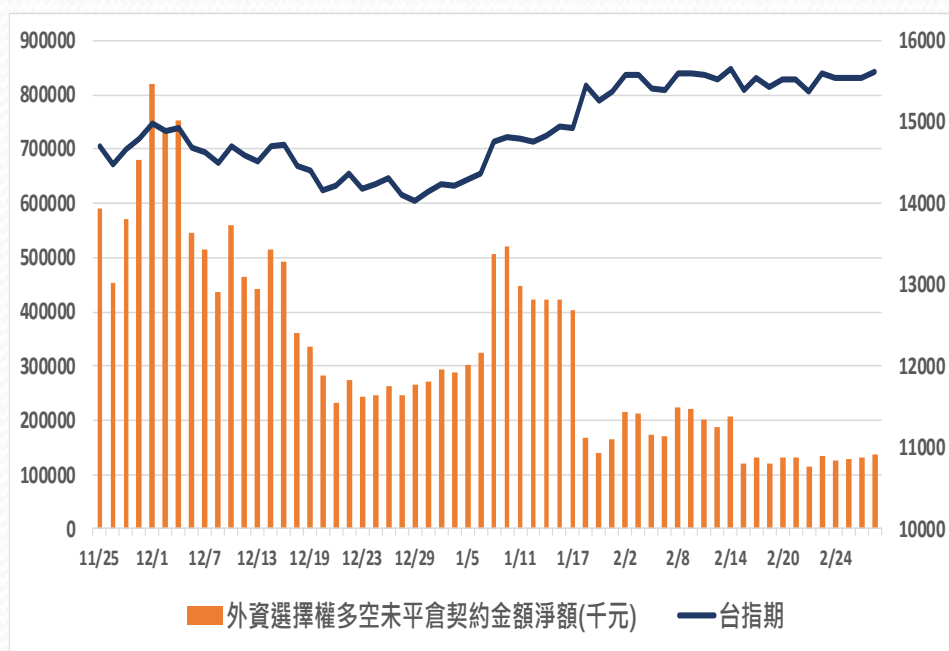
選擇權全月Put Call OI



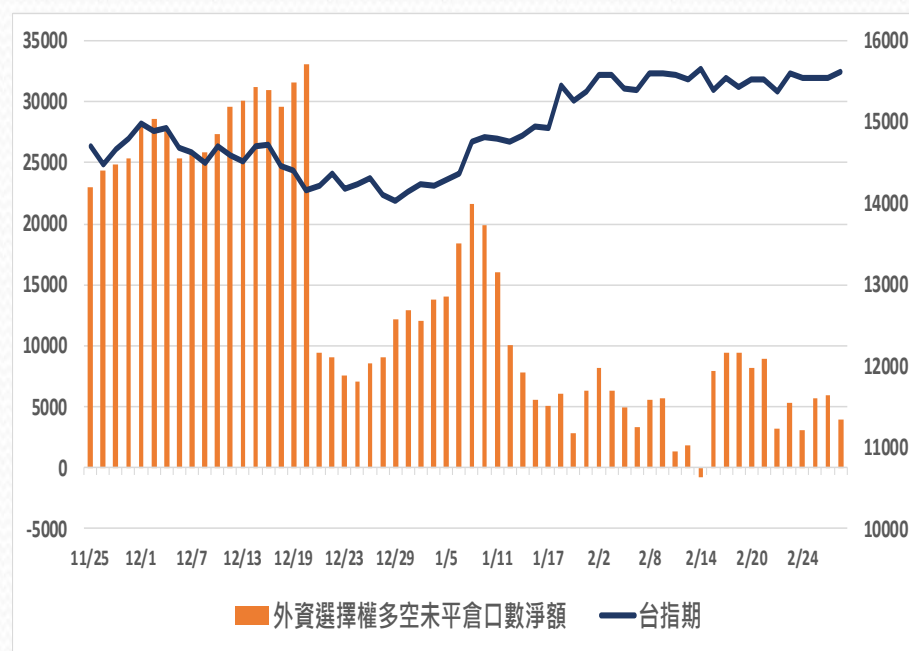
更新日期：2023年3月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



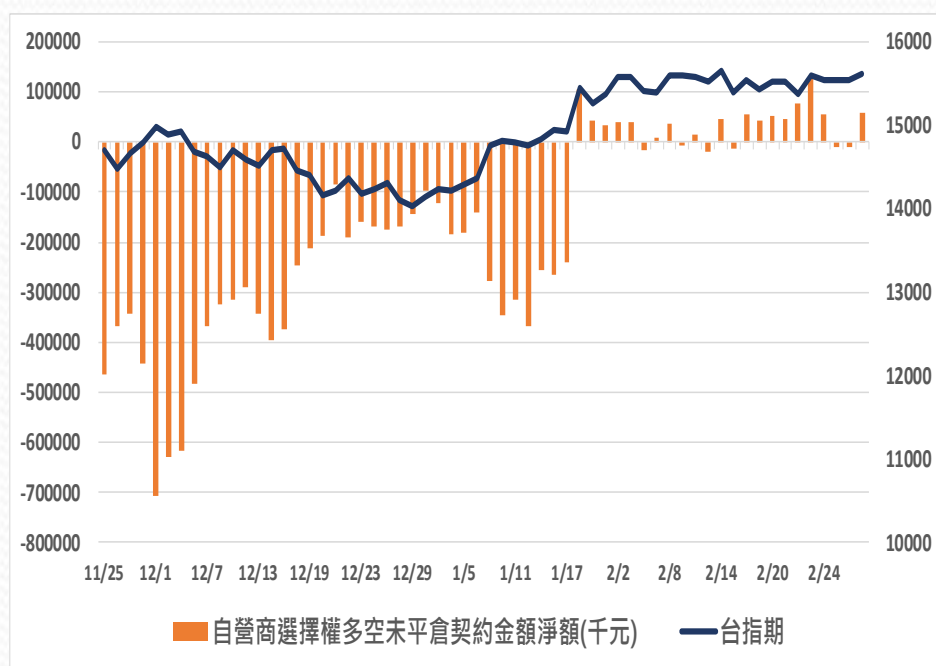
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/23	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
2023/3/3	15615	3923	-1987	136154	3668

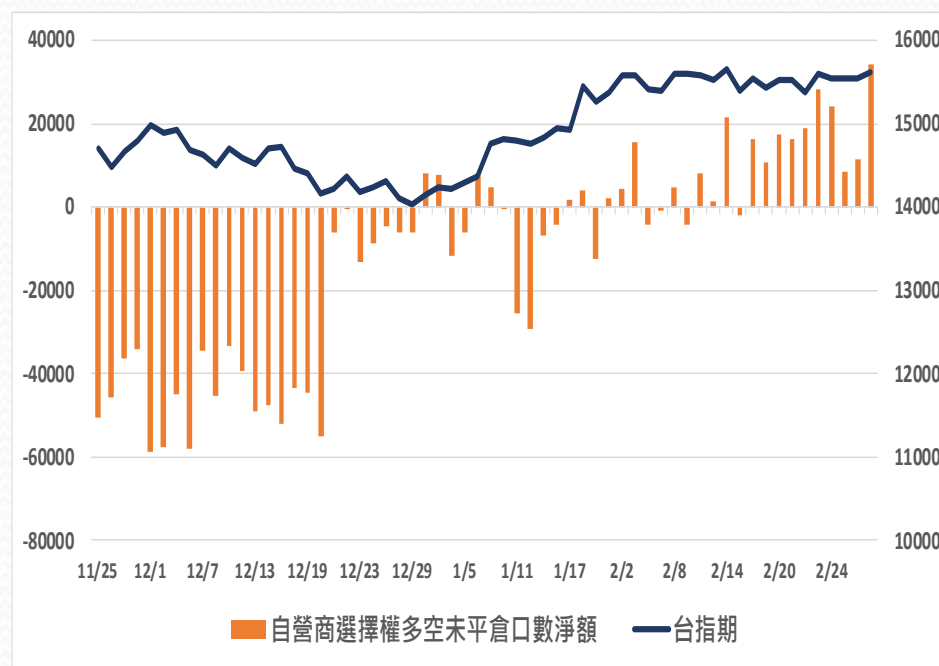
更新日期：2023年3月3日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



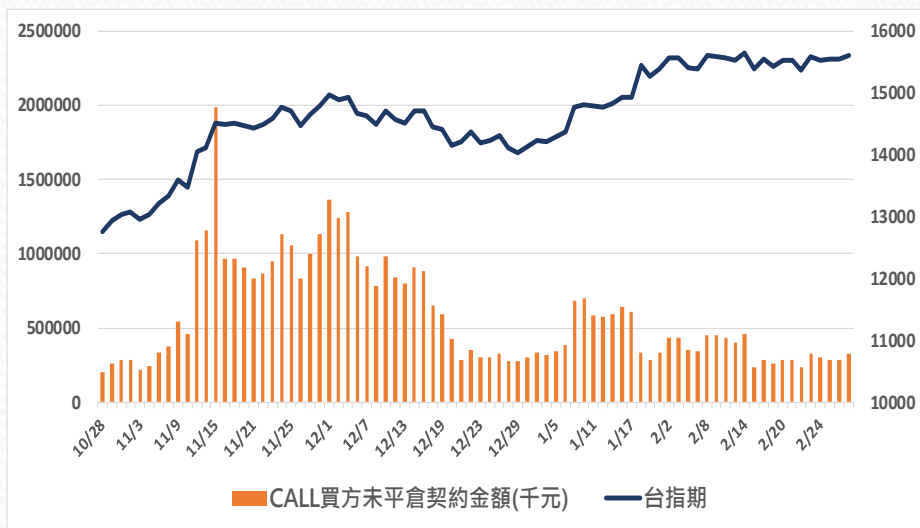
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/23	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
2023/3/3	15615	34215	22688	58074	67772

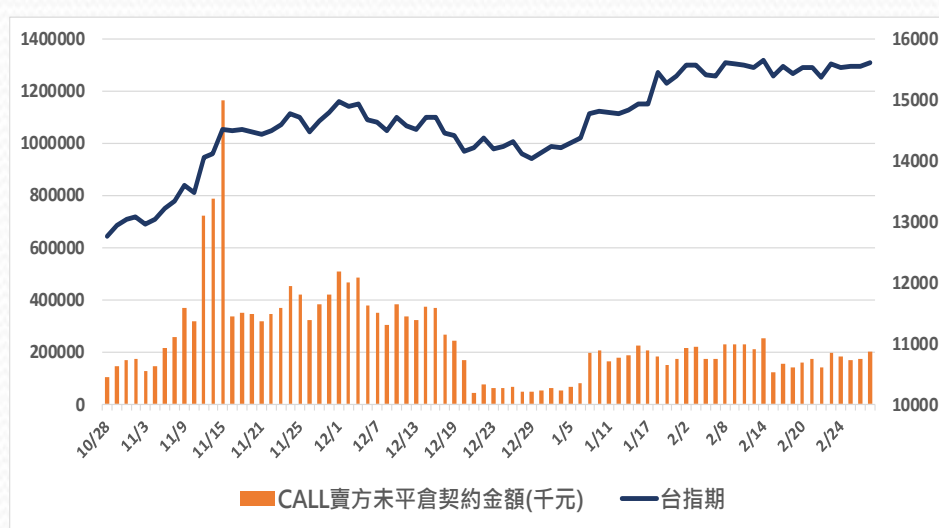
更新日期：2023年3月3日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

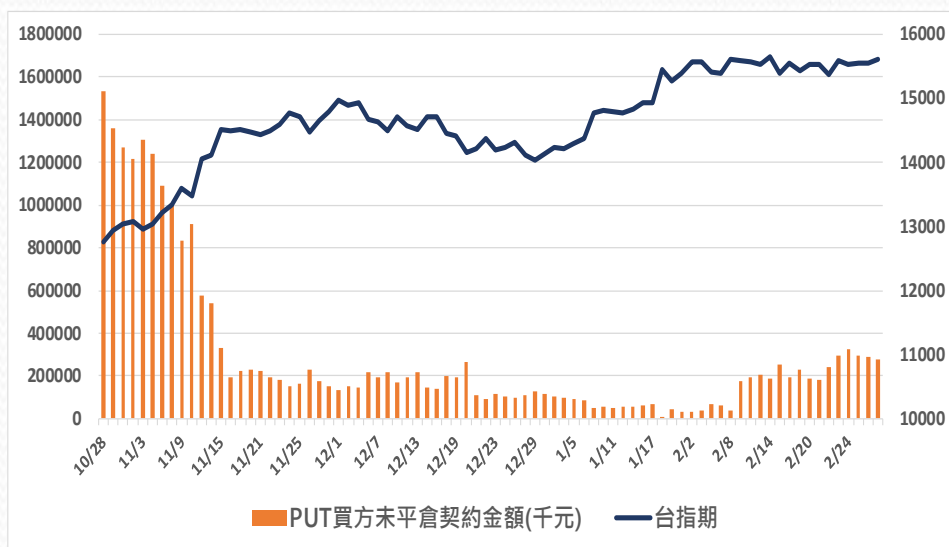
CALL買方未平倉金額



CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



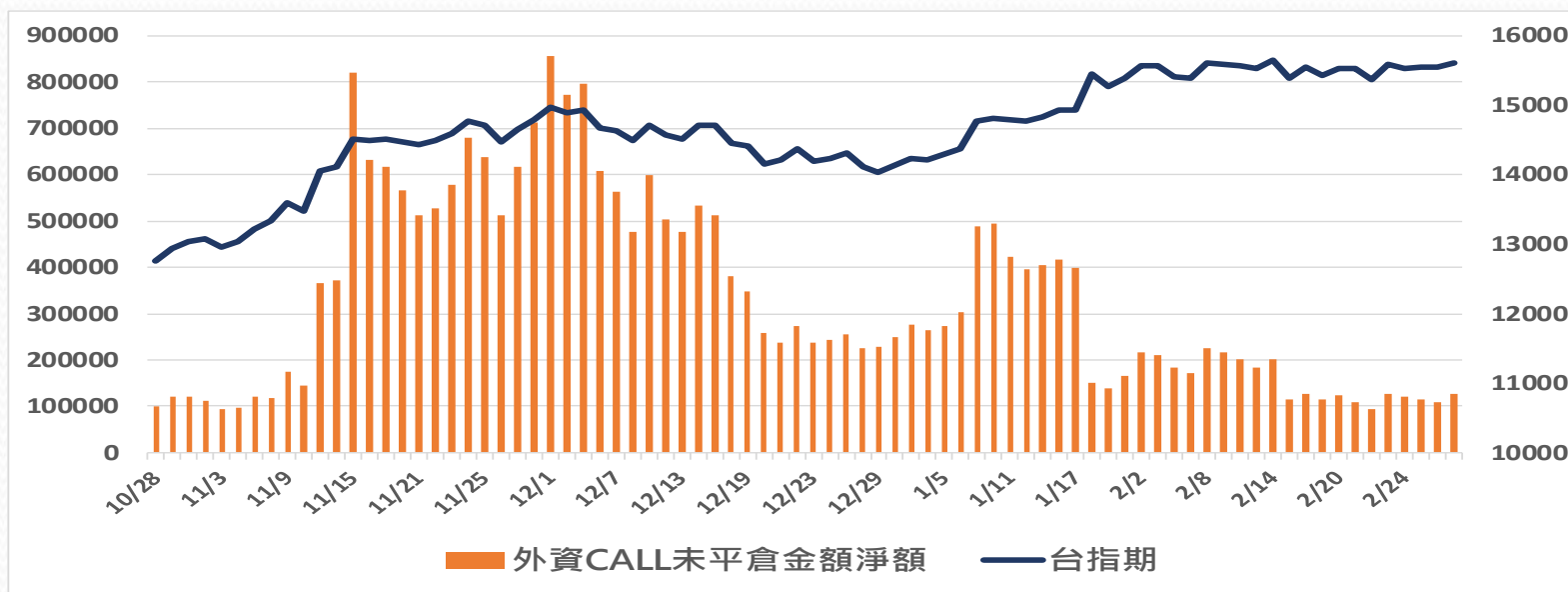
PUT賣方未平倉金額



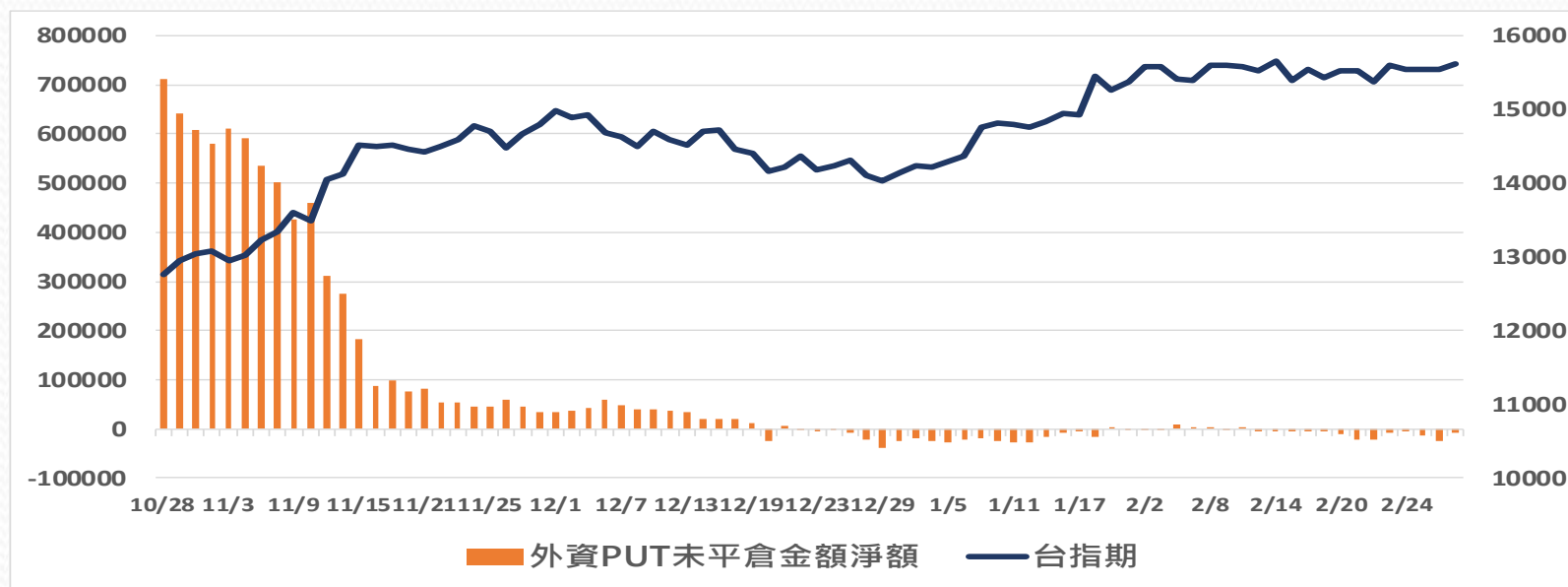
更新日期：2023年3月3日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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3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3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