

台指選擇權 OI 匯報

日期：2023/3/6 結算日：2023/3/8					日期：2023/3/6 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
1	30	14,900	3,783	-694	0	47	14,300	2,407	-129
-1	22	15,000	6,879	-1,120	0	218	14,400	2,682	-675
-2	38	15,100	4,458	-1,201	0	90	14,500	4,749	-642
0	11	15,150	3,674	-2,746	-1	241	14,600	3,452	-51
-56	60	15,200	6,953	-2,029	-3	90	14,700	5,775	-227
-1	63	15,250	4,011	-462	-3	241	14,800	4,407	-849
-48	196	15,300	10,258	-871	-4	97	14,900	4,053	-263
-7	335	15,350	5,206	720	-21	451	15,000	10,862	768
-261	604	15,400	7,407	830	-4	248	15,100	4,949	-758
-219	583	15,450	7,752	1,324	-16	3,328	15,200	5,646	-120
-162	1,317	15,500	10,461	3,795	186	791	15,300	5,682	502
-421	1,658	15,550	8,127	4,677	-72	2,205	15,400	5,324	1,037
-1,030	4,217	15,600	7,033	3,034	302	3,607	15,500	4,280	586
-636	3,576	15,650	6,308	4,713	-652	3,417	15,600	3,355	688
-572	5,056	15,700	6,563	5,185	-230	3,905	15,700	1,706	802
-48	4,716	15,750	4,832	3,863	-201	4,049	15,800	684	327
-544	7,978	15,800	4,998	4,365	-1,583	4,812	15,900	434	163
568	7,956	15,850	2,090	1,942	58	11,236	16,000	238	72
2,149	13,354	15,900	626	476	356	9,023	16,100	107	7
2,234	9,053	15,950	367	228	※ 938	9,403	16,200	114	-13
※ 3,072	8,595	16,000	266	230	156	5,900	16,300	125	44
1,197	3,628	16,050	95	32	-633	2,975	16,400	95	20
1,209	5,472	16,100	32	-10	130	3,219	16,500	18	8
813	4,056	16,200	3	0	84	2,031	16,600	8	0
-22	1,233	16,300	0	0	157	1,211	16,700	3	2
19	757	16,400	0	0	3	1,027	16,800	3	-8
-2	469	16,500	0	0	74	770	16,900	0	0
-4	7	16,600	0	0	-101	2,550	17,000	1	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
7,226	85,141	1.4740	125,499	26,110	-1,000	106,944	1.1506	123,046	932
昨日 P/C	1.2756	今日增減變化	0.1984		昨日 P/C	1.1184	今日增減變化	0.0322	

更新日期：2023年3月6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6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	92,820,732	53,546,613	39,274,119	-5,799,666	3,720,100	1,607,897	2,112,203	-24,934
投信	23,856,727	49,604,814	-25,748,087	1,009,301	477,623	0	477,623	32,020
自營商	51,336,692	27,354,617	23,982,075	1,269,053	1,497,805	1,322,712	175,093	-39,008
	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	438,086	1,733,500	-1,295,414	-77,058	332,036	0	332,036	-3,495
投信	131,897	0	131,897	1,025	0	0	0	0
自營商	408,249	312,466	95,783	3,874	97,424	423,276	-325,852	18,655

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6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	32,642	20,935	11,707	-574	49,558	38,110	11,448	3,090
投信	100	50	50	-50	300	113	187	0
自營商	73,597	62,776	10,821	-3,966	61,569	82,273	-20,704	-1,276
特定法人(週)	632	2,486	-1,854	-562	1,678	12,736	-11,058	-1,052
特定法人(近月)	19,677	8,440	11,237	-250	12,694	15,506	-2,812	819
特定法人(全月)	22,739	9,981	12,758	-450	25,663	34,137	-8,474	210
十大交易人(週)	28,643	26,860	1,783	-2,033	47,956	29,682	18,274	6,731
十大交易人(近月)	60,427	58,404	2,023	-785	64,873	54,677	10,196	-886
十大交易人(全月)	100,535	84,898	15,637	-5,086	114,945	96,474	18,471	4,431
全市場未沖銷(近月)			114,167	-433			131,913	3,750
全市場未沖銷(全月)			226,273	9,709			297,072	34,499

更新日期：2023年3月6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	15800	買權OI最大量	15900
	賣權成交最大量	15600	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	13.89%	較前一交易日	+1.17%
	買權隱含波動率	14.19%	較前一交易日	+1.75%
	賣權隱含波動率	13.66%	較前一交易日	+0.67%
電子選擇權	買權成交最大量	760	買權OI最大量	725
	賣權成交最大量	735	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6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	15.77%	較前一交易日	-0.62%
	買權隱含波動率	14.76%	較前一交易日	+1.07%
	賣權隱含波動率	16.74%	較前一交易日	+0.30%
	成交量P/C_Ratio值	1.104	較前一交易日	-0.03
	未平倉P/C_Ratio值	1.155	較前一交易日	+0.04
電子選擇權	買權成交最大量	760	買權OI最大量	725
	賣權成交最大量	735	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6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

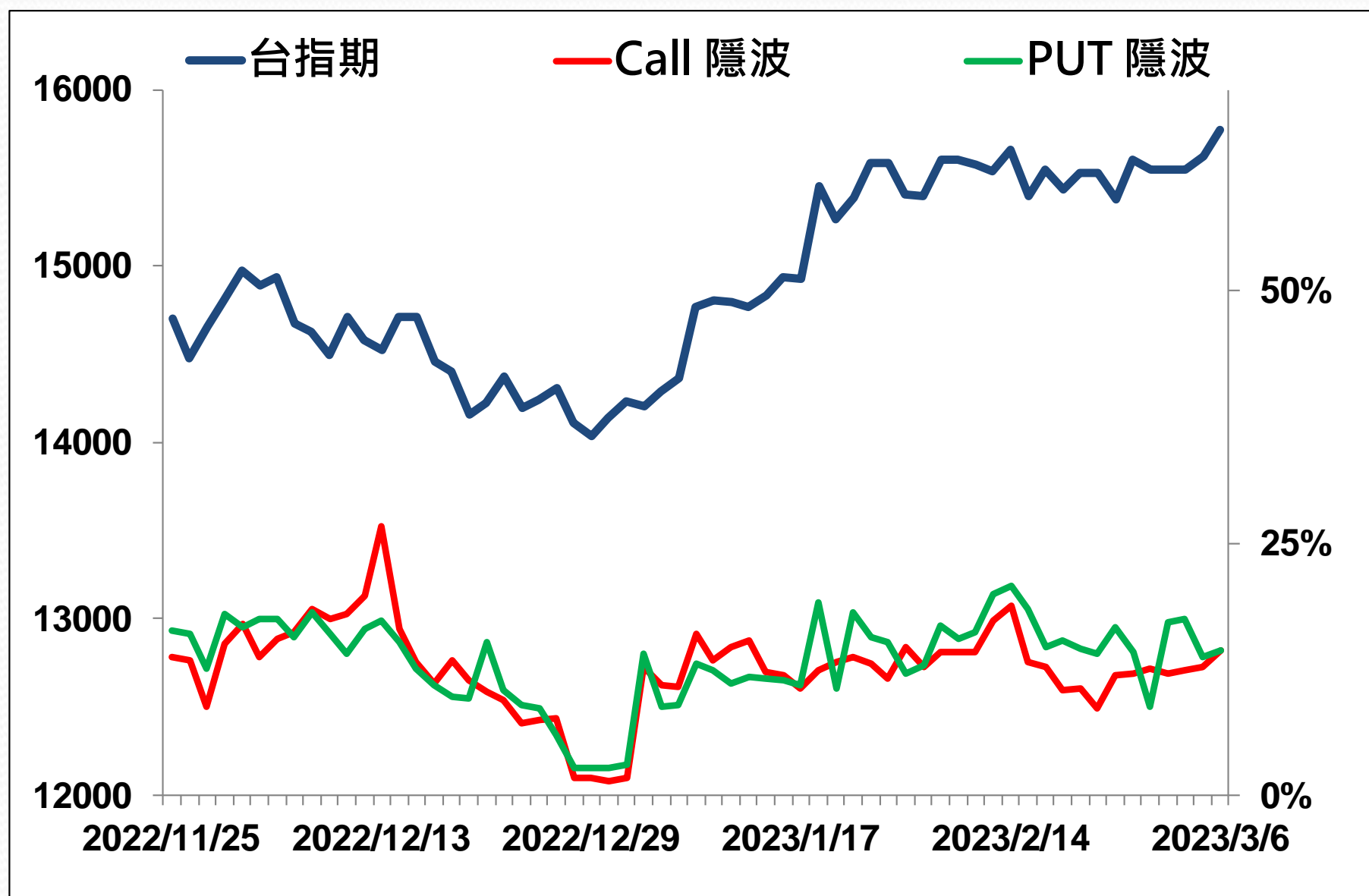
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



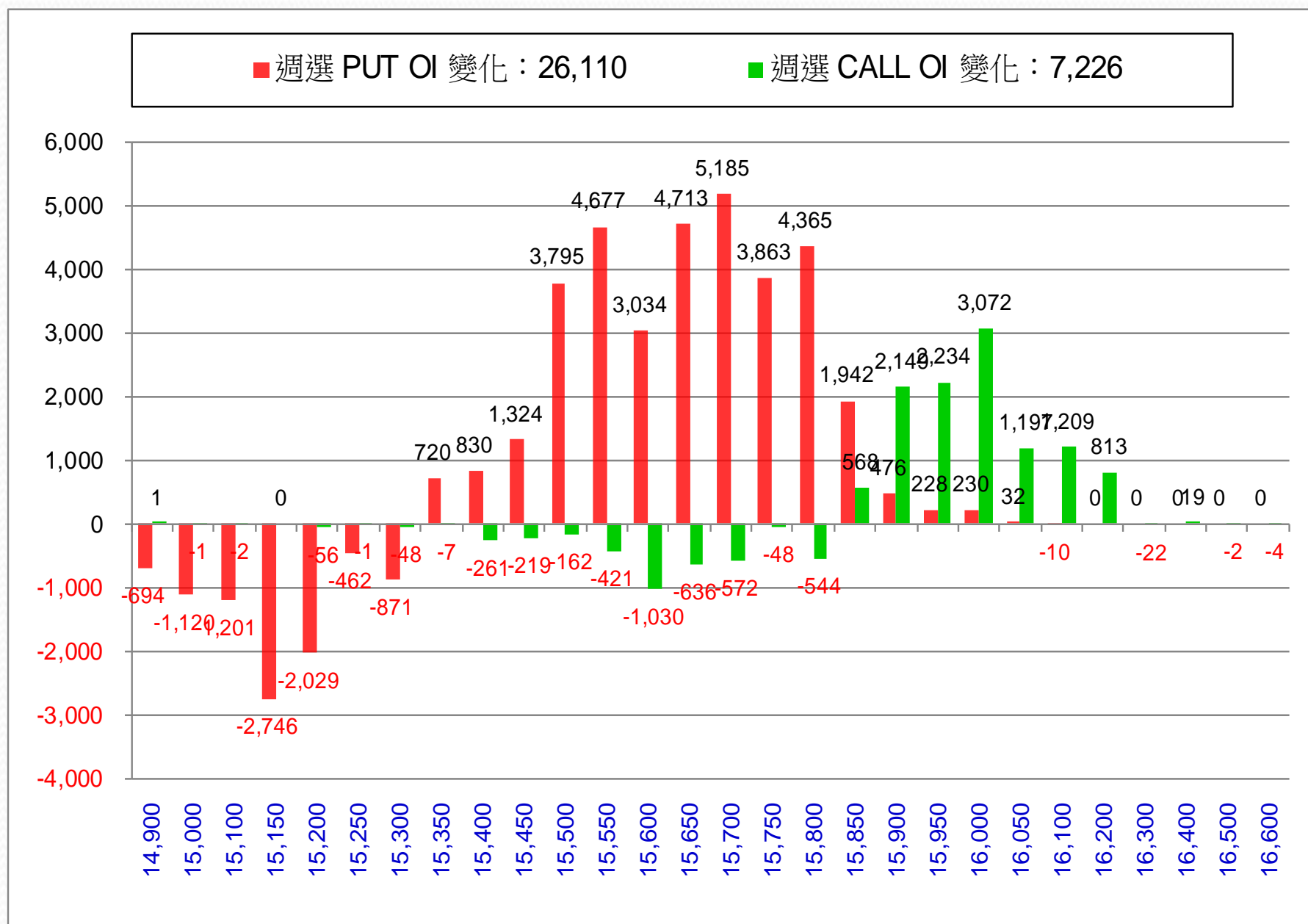
更新日期：2023年3月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



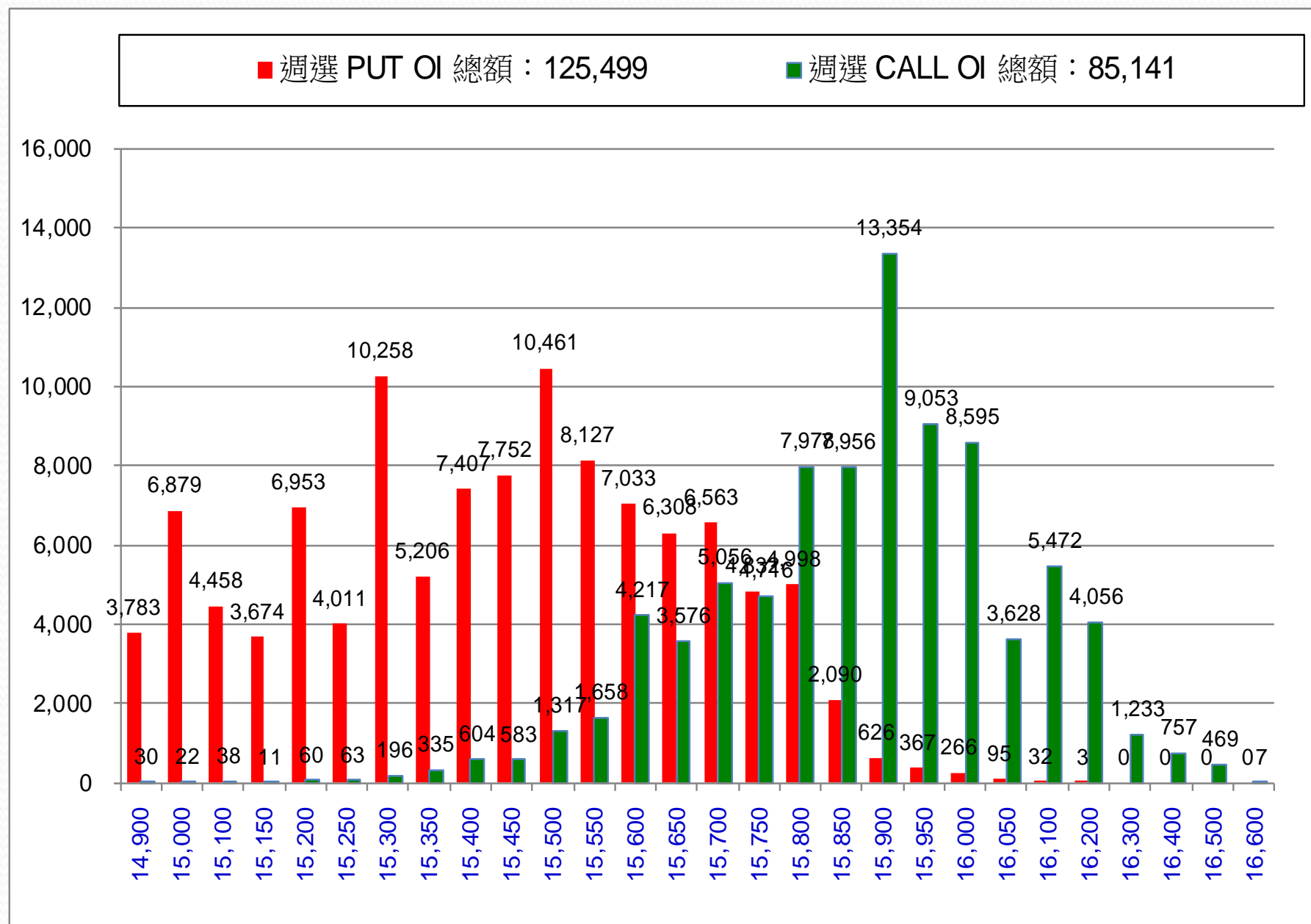
更新日期：2023年3月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年3月6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



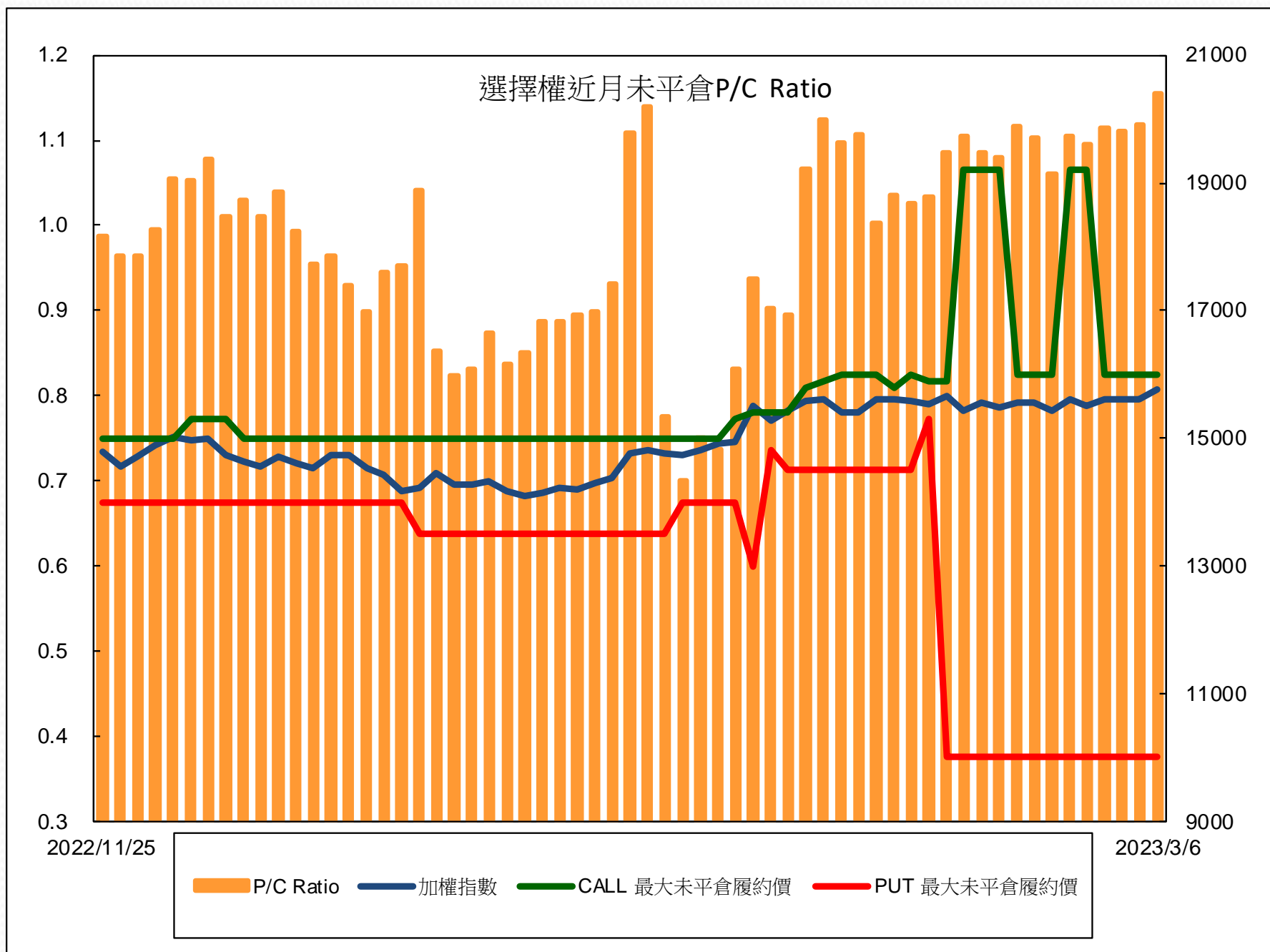
更新日期：2023年3月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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3日	74,982	60,195	14,787
	3月6日	73,597	62,776	10,821
Put	3月3日	55,976	75,404	-19,428
	3月6日	61,569	82,273	-20,704

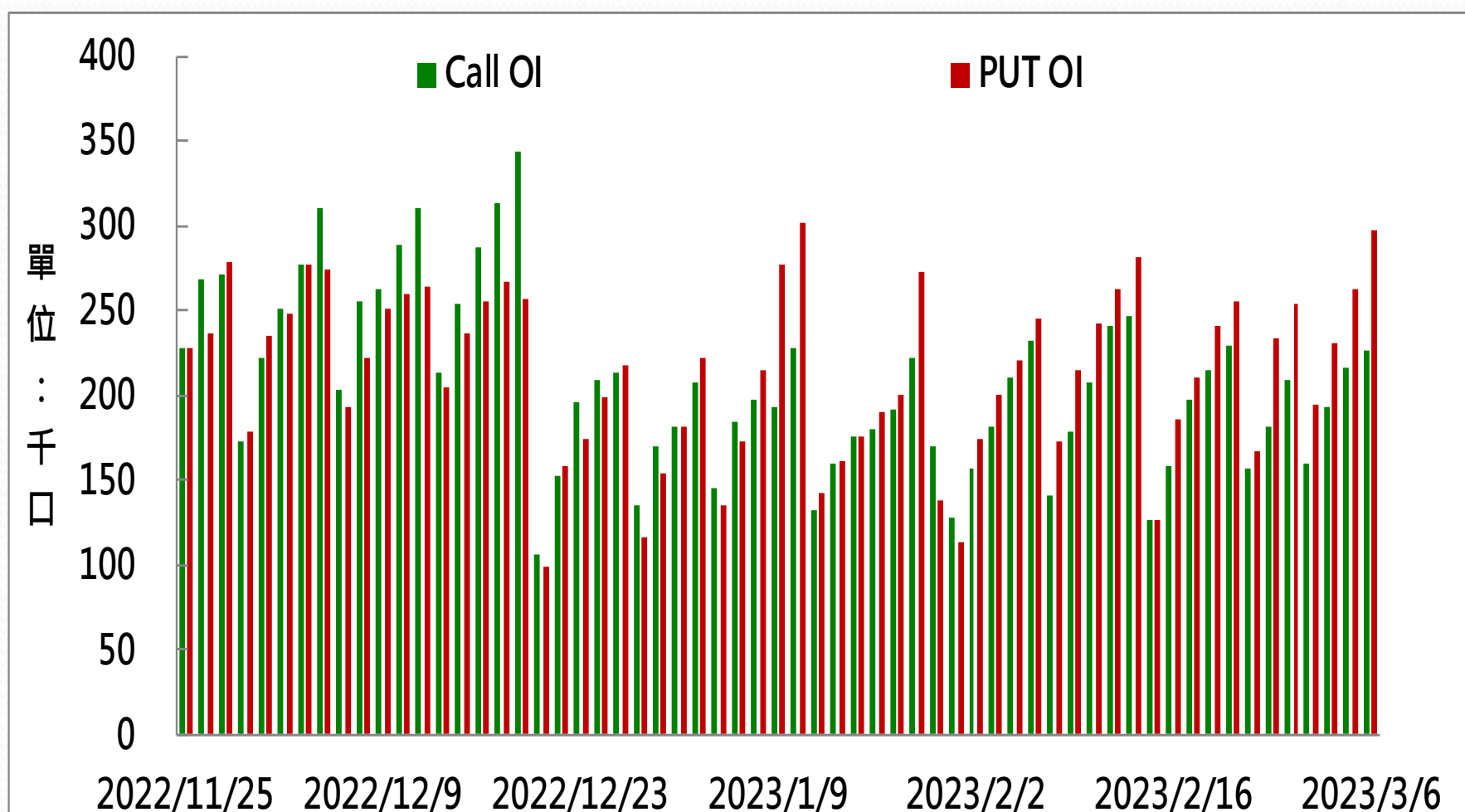
更新日期：2023年3月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

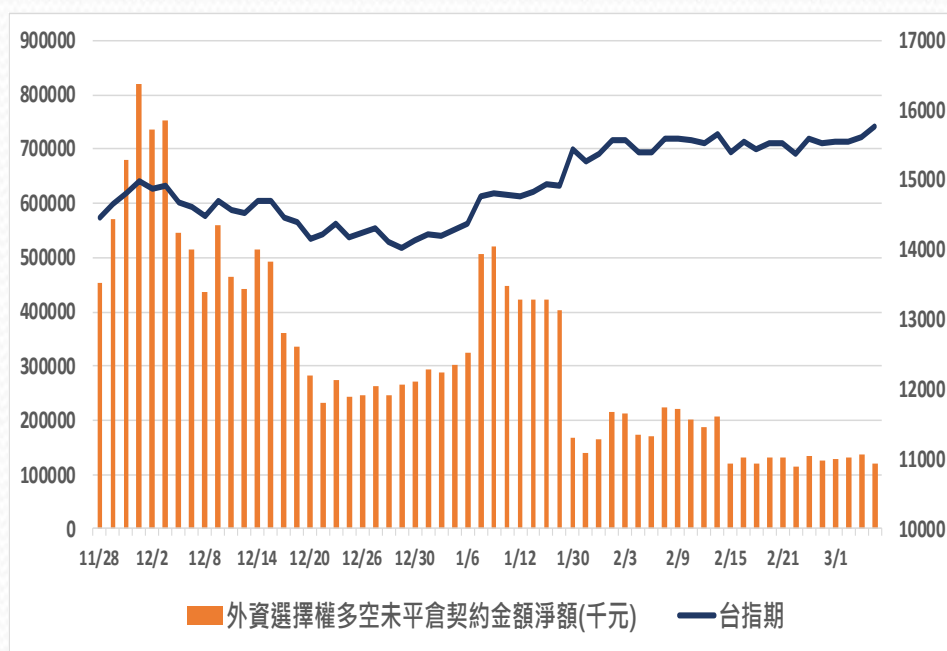
選擇權全月Put Call OI



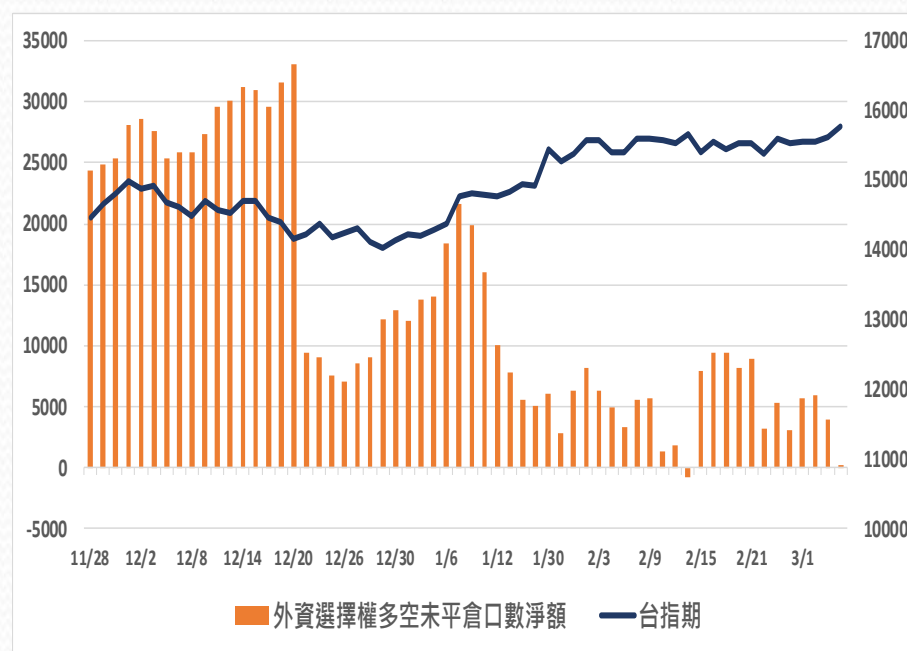
更新日期：2023年3月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



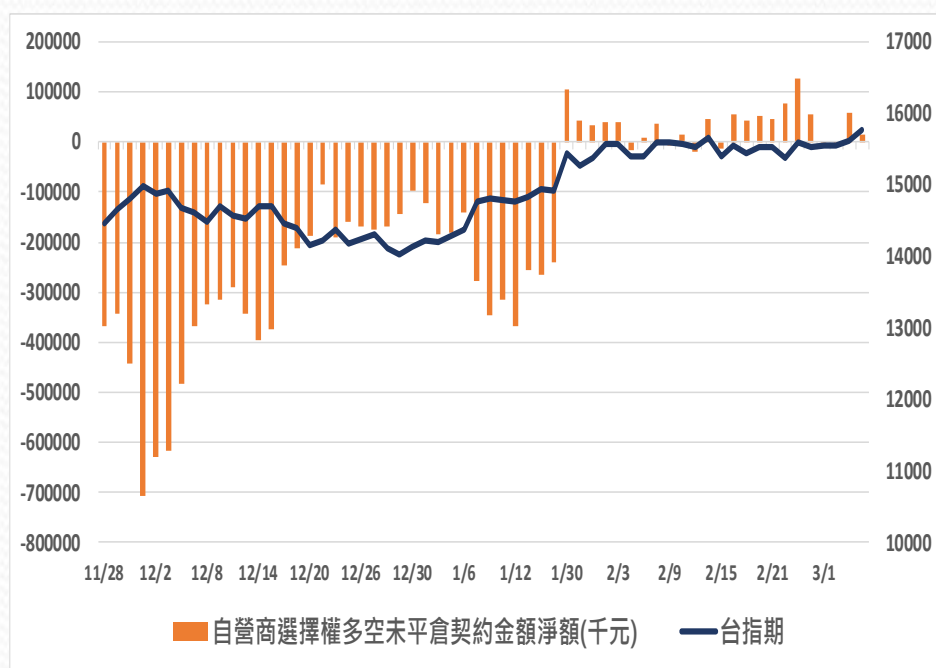
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/24	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
2023/3/6	15772	259	-3664	119301	-16853

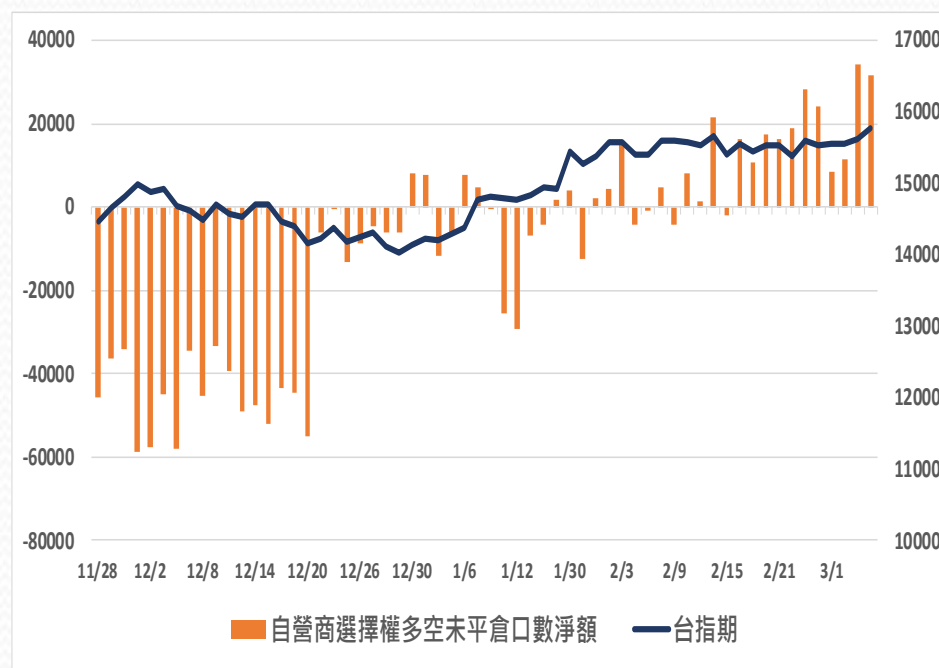
更新日期：2023年3月6日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



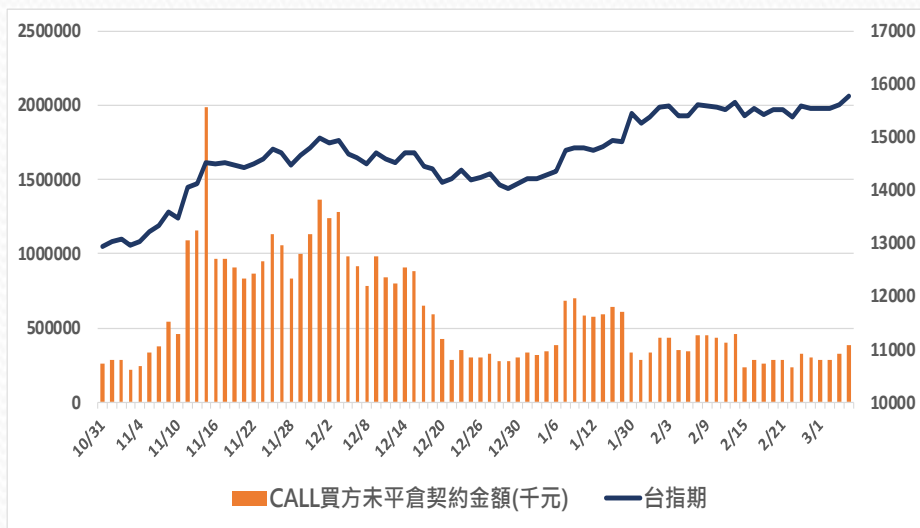
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/2/24	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
2023/3/6	15772	31525	-2690	14454	-43620

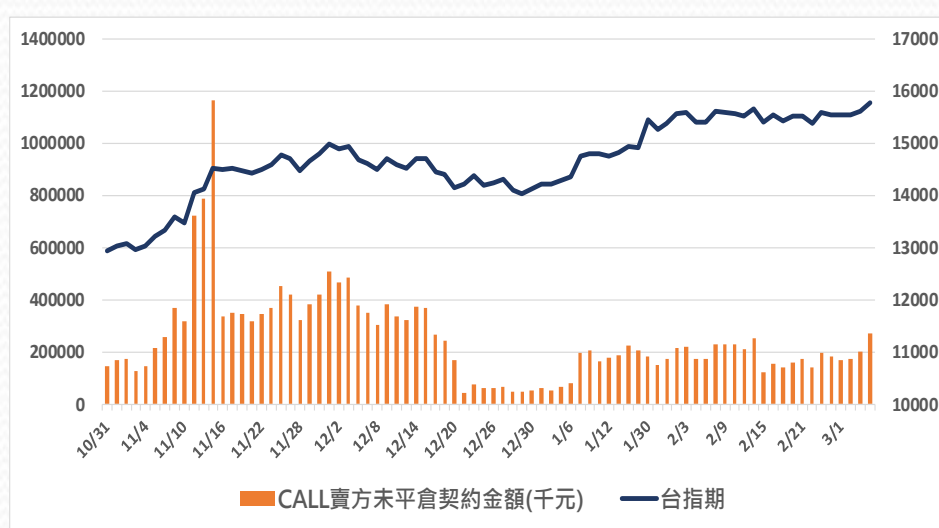
更新日期：2023年3月6日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

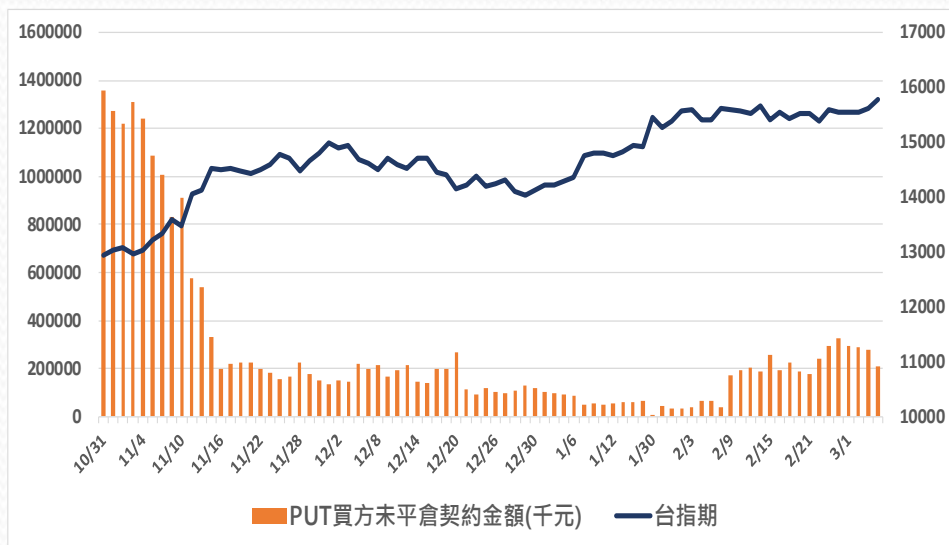
CALL買方未平倉金額



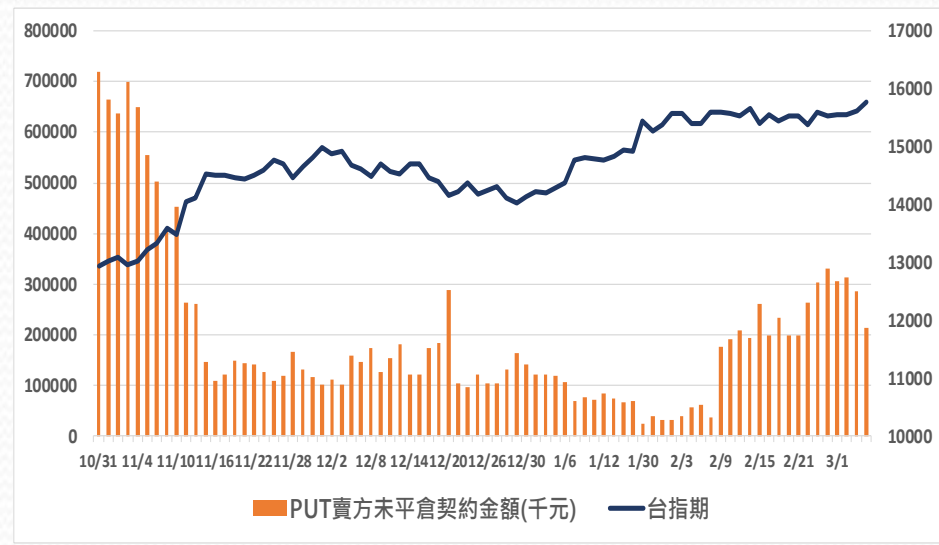
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



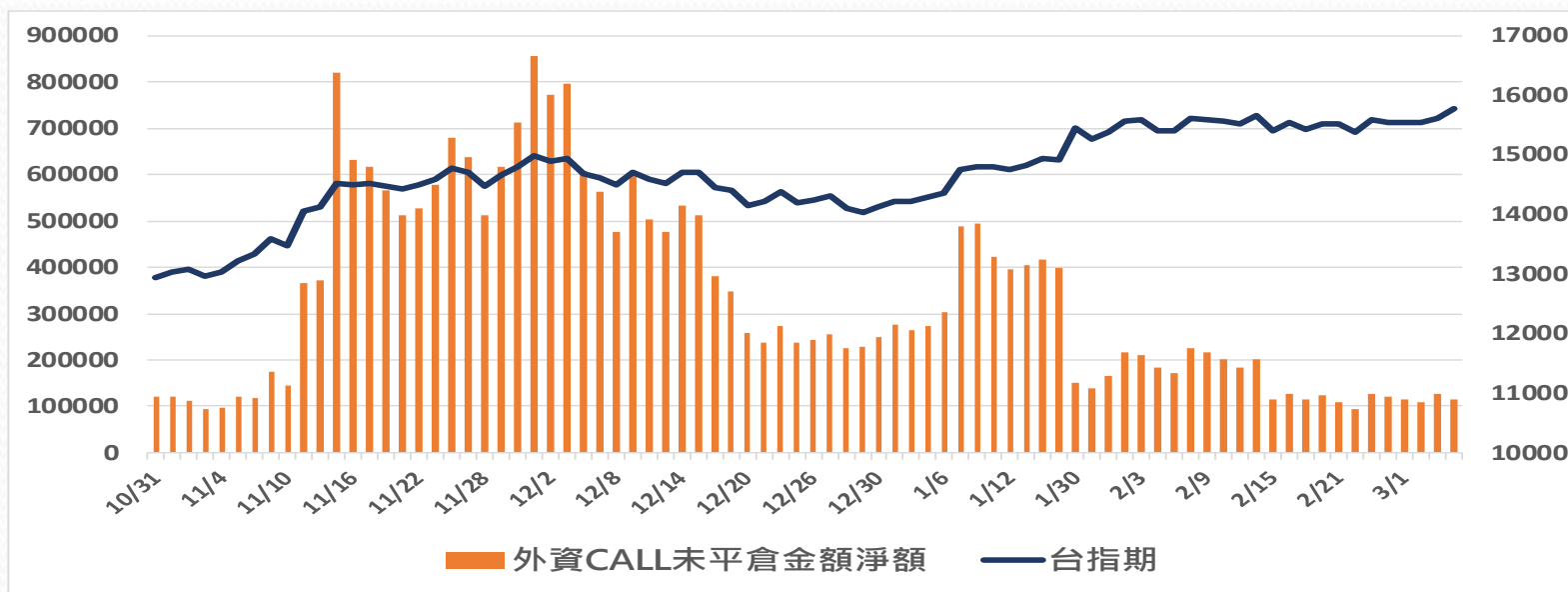
PUT賣方未平倉金額



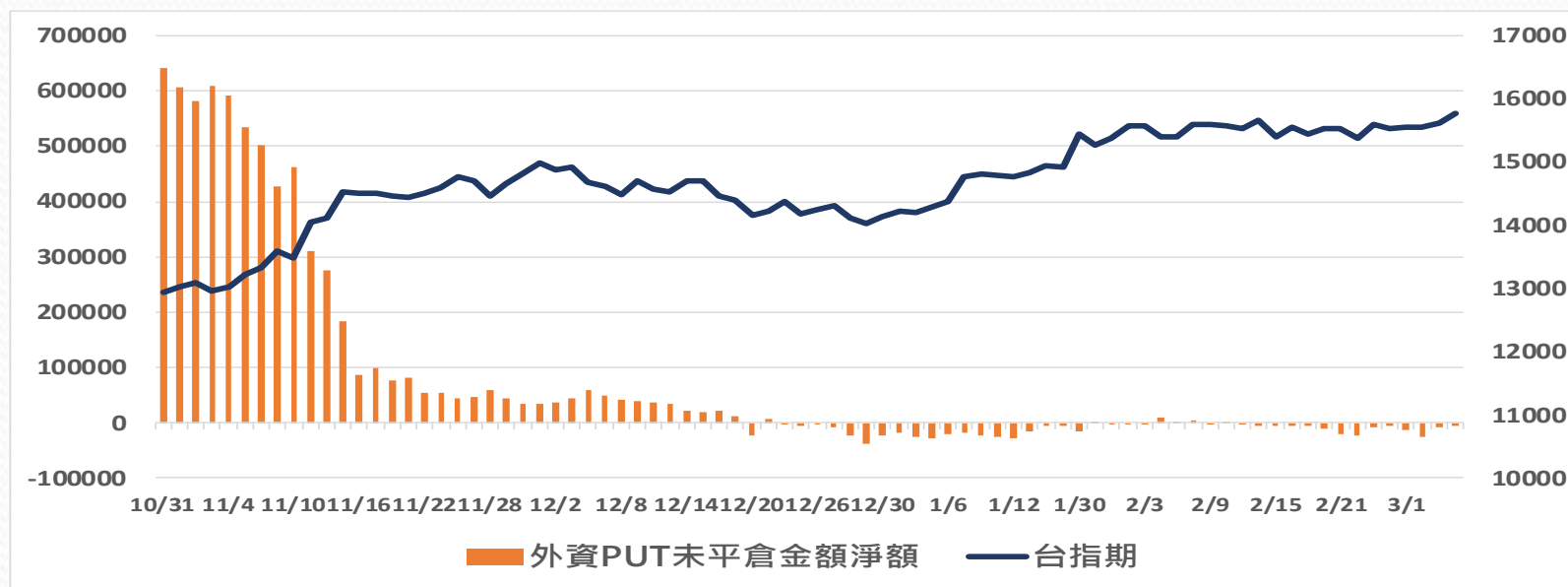
更新日期：2023年3月6日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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6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6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