

台指選擇權OI匯報

日期：2023/3/7 結算日：2023/3/8					日期：2023/3/7 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	37	15,100	3,940	-518	-5	213	14,400	2,620	-62
-2	9	15,150	2,973	-701	0	90	14,500	4,540	-209
-23	37	15,200	5,645	-1,308	0	241	14,600	3,268	-184
-26	37	15,250	3,496	-515	0	90	14,700	4,986	-789
-21	175	15,300	9,428	-830	0	241	14,800	4,482	75
-19	316	15,350	4,337	-869	0	97	14,900	3,661	-392
-45	559	15,400	6,219	-1,188	0	451	15,000	10,217	-645
-17	566	15,450	7,525	-227	-9	239	15,100	3,851	-1,098
-160	1,157	15,500	10,654	193	-7	3,321	15,200	5,537	-109
-278	1,380	15,550	8,785	658	-52	739	15,300	5,360	-322
-467	3,750	15,600	9,184	2,151	-46	2,159	15,400	6,566	1,242 ※
-473	3,103	15,650	7,947	1,639	-60	3,547	15,500	4,805	525
-880	4,176	15,700	9,914	3,351	-218	3,199	15,600	4,156	801
-542	4,174	15,750	9,548	4,716 ※	-88	3,817	15,700	2,721	1,015
-673	7,305	15,800	9,045	4,047	91	4,140	15,800	1,715	1,031
-793	7,163	15,850	6,144	4,054	-175	4,637	15,900	1,062	628
-702	12,652	15,900	4,603	3,977	-667	10,569	16,000	372	134
1,785	10,838	15,950	1,310	943	223	9,246	16,100	212	105
※ 2,824	11,419	16,000	1,157	891	※ 834	10,237	16,200	124	10
2,060	5,688	16,050	403	308	262	6,162	16,300	174	49
805	6,277	16,100	230	198	274	3,249	16,400	134	39
998	998	16,150	0	0	223	3,442	16,500	35	17
147	4,203	16,200	4	1	311	2,342	16,600	9	1
-17	1,216	16,300	0	0	-1	1,210	16,700	3	0
-23	734	16,400	1	1	-12	1,015	16,800	3	0
-57	412	16,500	0	0	0	770	16,900	0	0
0	7	16,600	0	0	23	2,573	17,000	1	0
0	30	16,700	0	0	0	1,380	17,100	21	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
3,400	88,541	1.6332	144,603	19,104	1,011	107,955	1.1547	124,654	1,608
昨日 P/C	1.4740	今日增減變化		0.1592	昨日 P/C	1.1554	今日增減變化		-0.0008

更新日期：2023年3月7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7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	100,703,171	51,973,972	48,729,199	9,455,080	3,767,255	1,571,936	2,195,319	83,116	
投信	23,037,773	49,243,035	-26,205,262	-457,175	480,231	0	480,231	2,608	
自營商	52,061,744	31,355,613	20,706,131	-3,275,944	1,339,004	1,231,522	107,482	-67,611	
	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	451,738	1,794,362	-1,342,624	-47,210	307,280	1,536	305,744	-26,292	
投信	132,216	0	132,216	319	0	0	0	0	
自營商	431,289	366,758	64,531	-31,252	85,904	371,418	-285,514	40,338	

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7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	34,434	22,753	11,681	-26	49,864	39,860	10,004	-1,444	
投信	100	50	50	0	400	113	287	100	
自營商	78,286	62,033	16,253	5,432	64,528	93,653	-29,125	-8,421	
特定法人(週)	852	2,717	-1,865	-11	0	11,091	-11,091	-33	
特定法人(近月)	23,113	8,584	14,529	3,292	13,220	14,257	-1,037	1,775	
特定法人(全月)	26,692	10,710	15,982	3,224	27,147	34,212	-7,065	1,409	
十大交易人(週)	32,134	29,563	2,571	788	59,724	29,882	29,842	11,568	
十大交易人(近月)	60,336	58,012	2,324	301	66,511	52,765	13,746	3,550	
十大交易人(全月)	104,170	86,956	17,214	1,577	126,689	96,162	30,527	12,056	
全市場未沖銷(近月)			115,668	1,501			136,574	4,661	
全市場未沖銷(全月)			233,468	7,195			323,867	26,795	

更新日期：2023年3月7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	15800	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	12.85%	較前一交易日	-1.04%
	買權隱含波動率	13.57%	較前一交易日	-0.61%
	賣權隱含波動率	12.31%	較前一交易日	-1.35%
電子選擇權	買權成交最大量	755	買權OI最大量	755
	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	1560	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7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	15500	賣權OI最大量	10000
	整體隱含波動率	15.14%	較前一交易日	+0.63%
	買權隱含波動率	14.40%	較前一交易日	-0.36%
	賣權隱含波動率	15.64%	較前一交易日	-1.10%
	成交量P/C_Ratio值	1.413	較前一交易日	+0.31
	未平倉P/C_Ratio值	1.181	較前一交易日	+0.03
電子選擇權	買權成交最大量	755	買權OI最大量	755
	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	1560	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7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

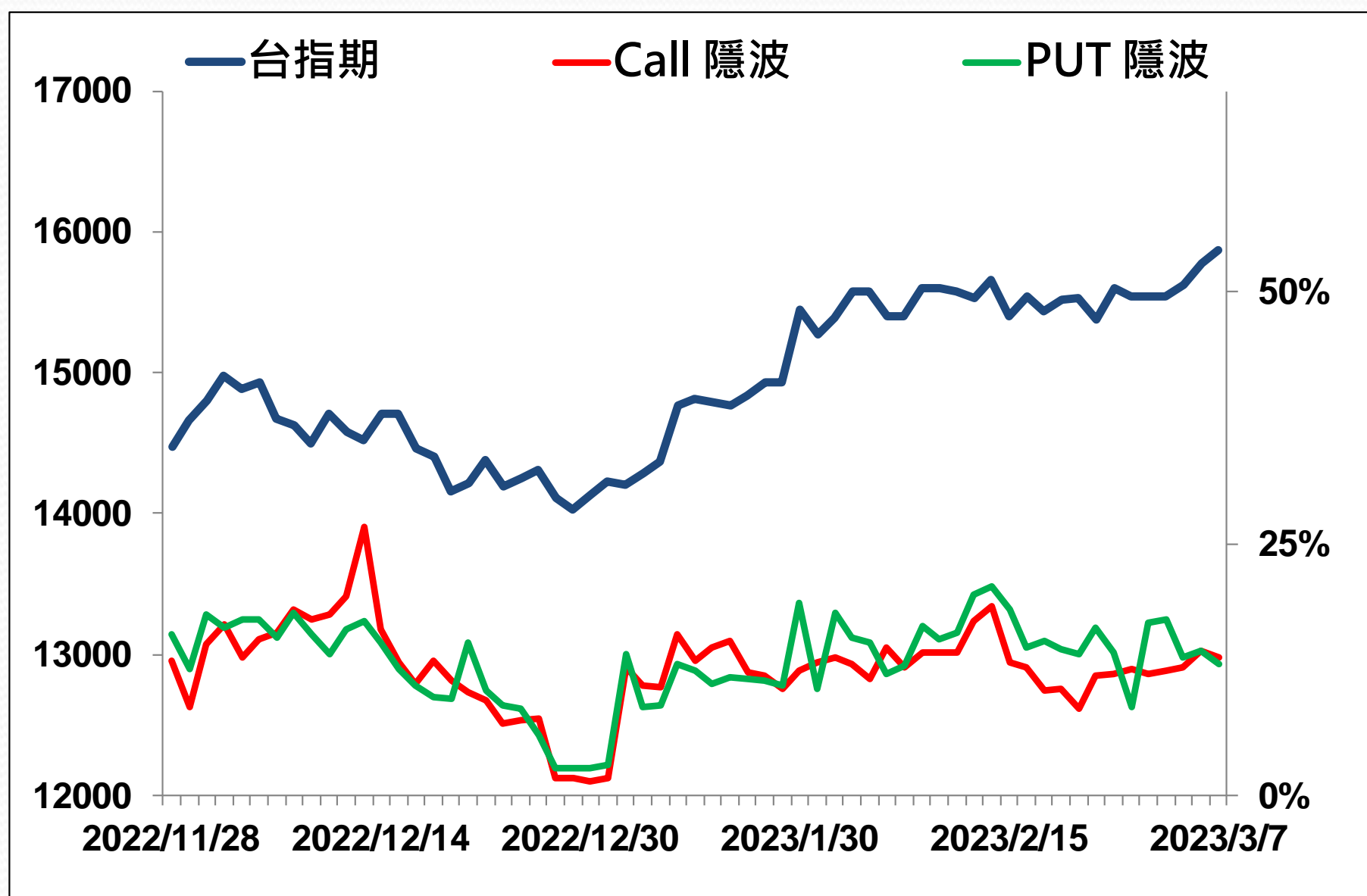
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



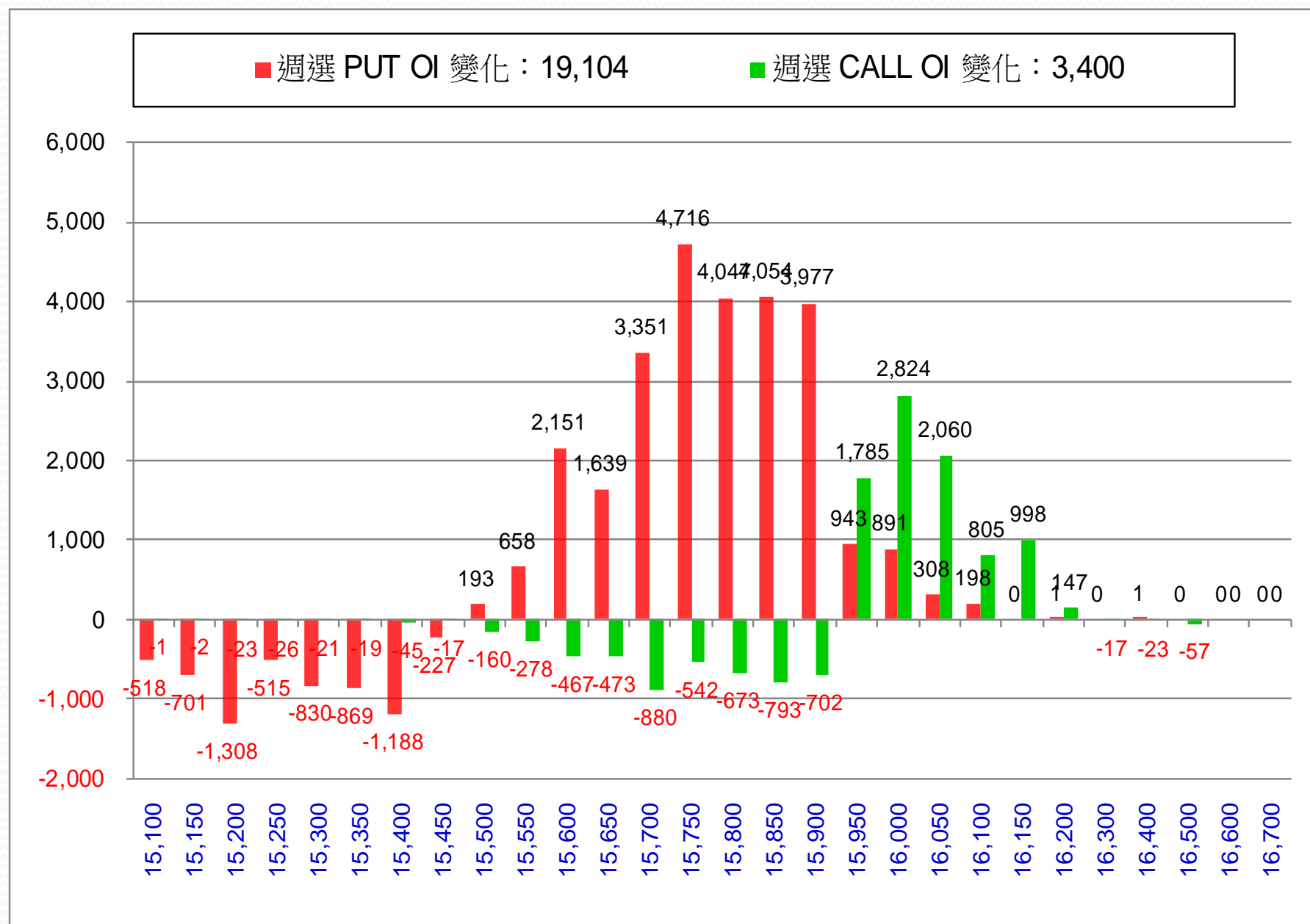
更新日期：2023年3月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



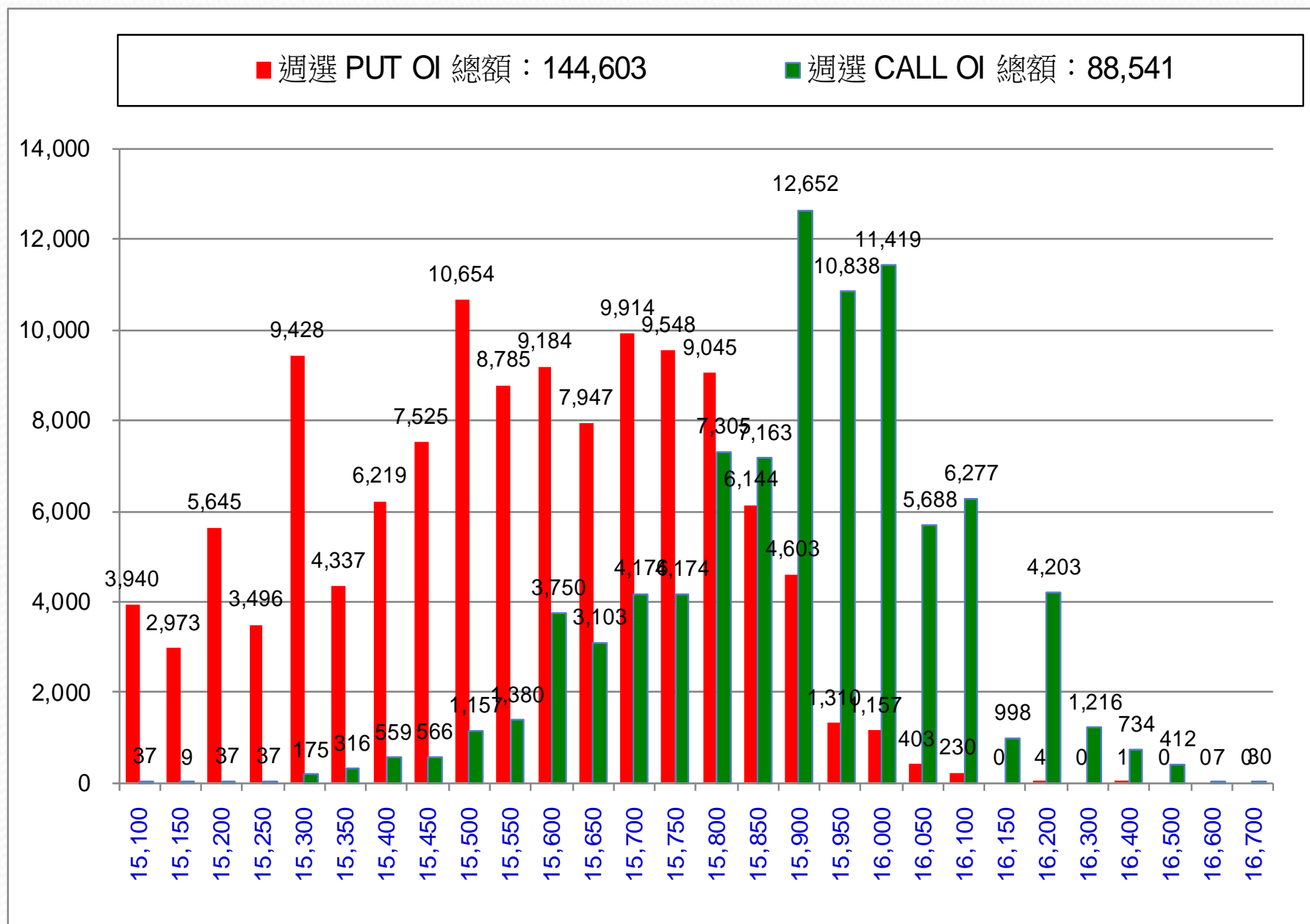
更新日期：2023年3月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年3月7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



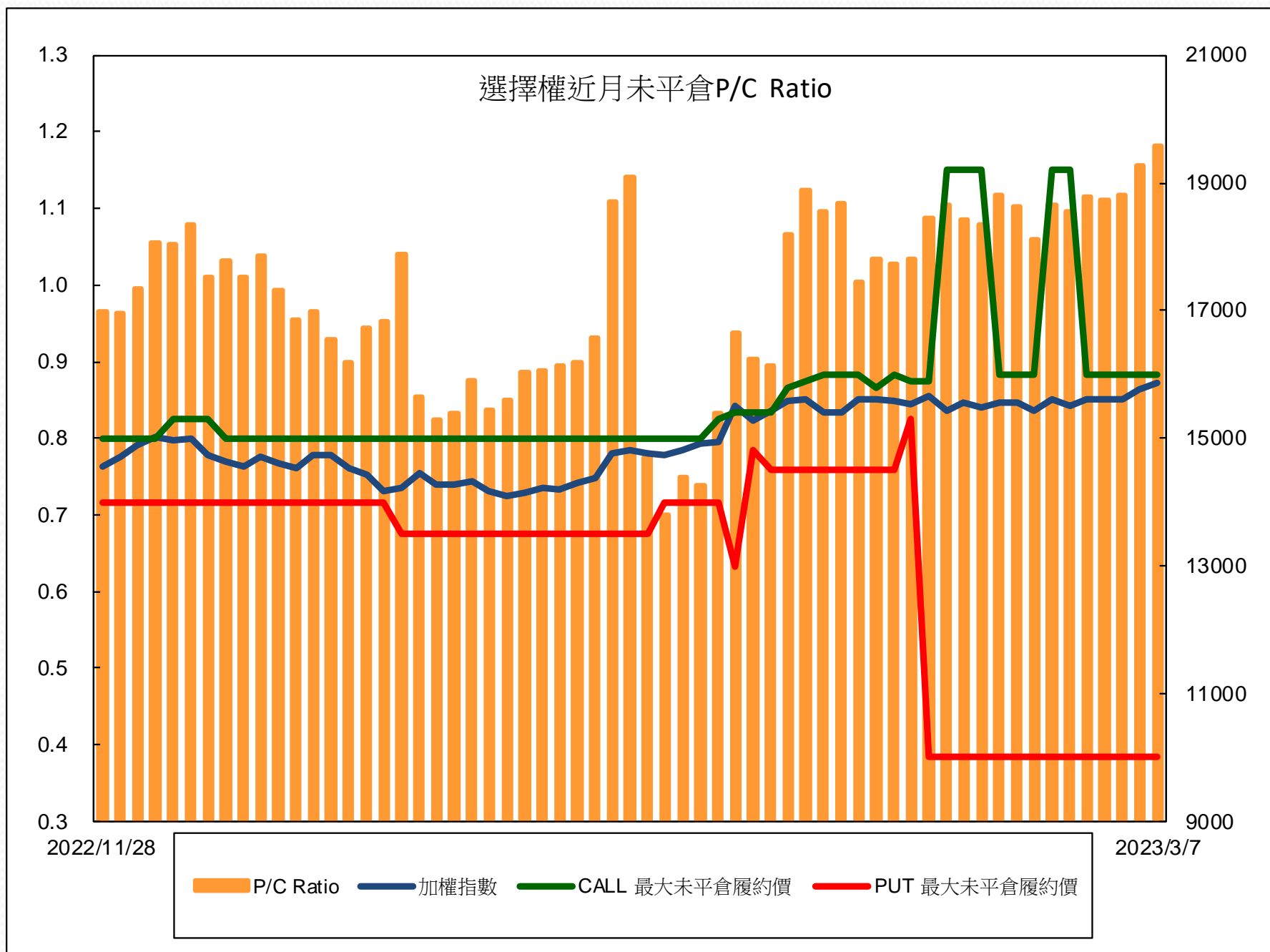
更新日期：2023年3月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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6日	73,597	62,776	10,821
	3月7日	78,286	62,033	16,253
Put	3月6日	61,569	82,273	-20,704
	3月7日	64,528	93,653	-29,125

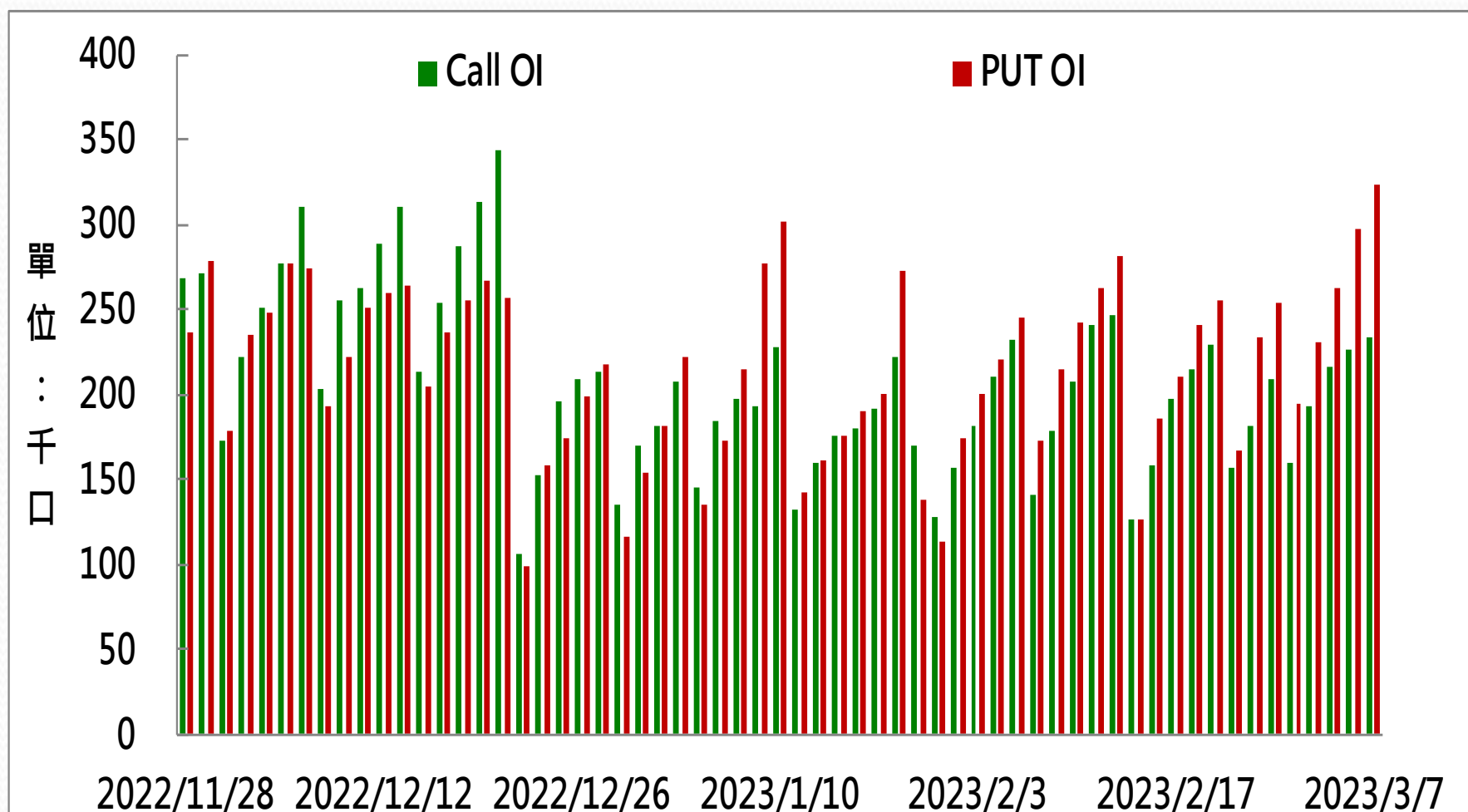
更新日期：2023年3月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

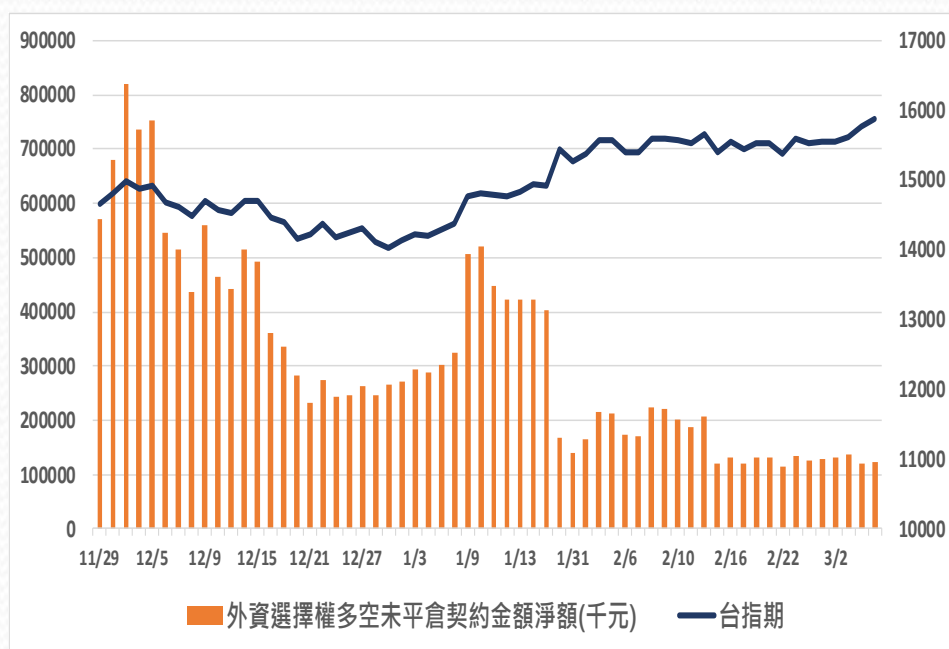
選擇權全月Put Call OI



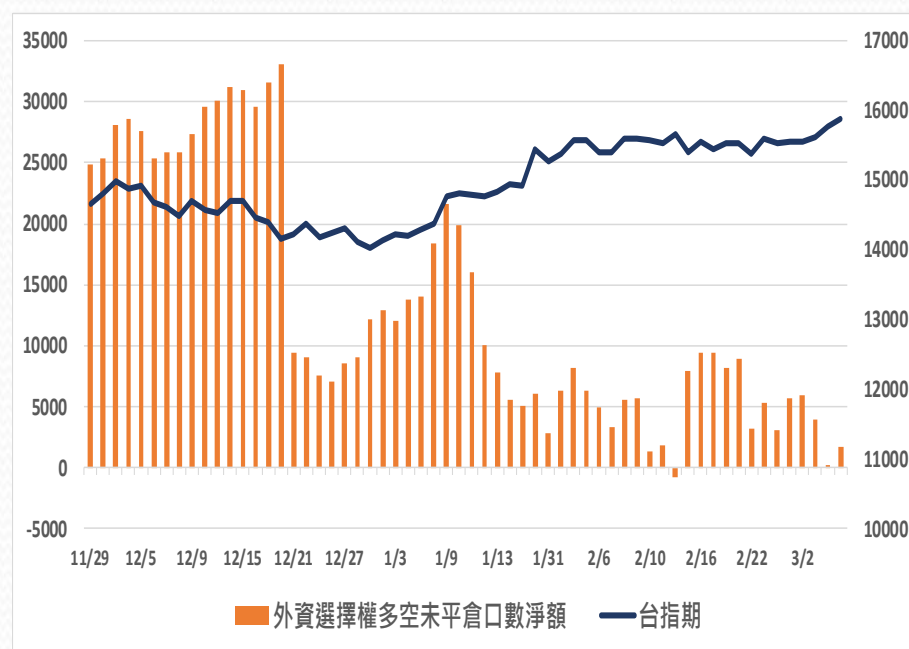
更新日期：2023年3月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



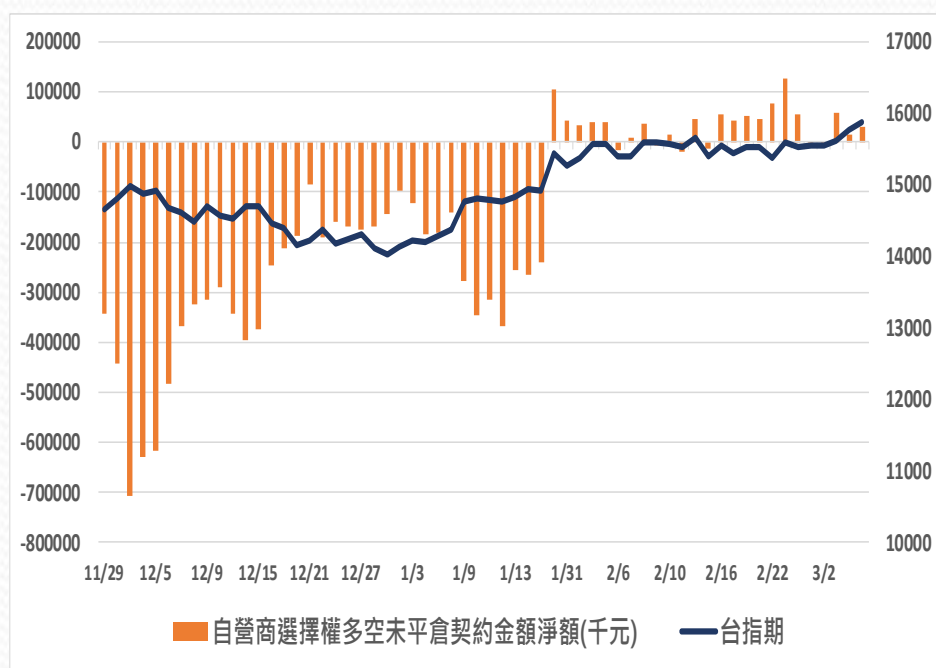
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/1	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
2023/3/7	15873	1677	1418	122042	2741

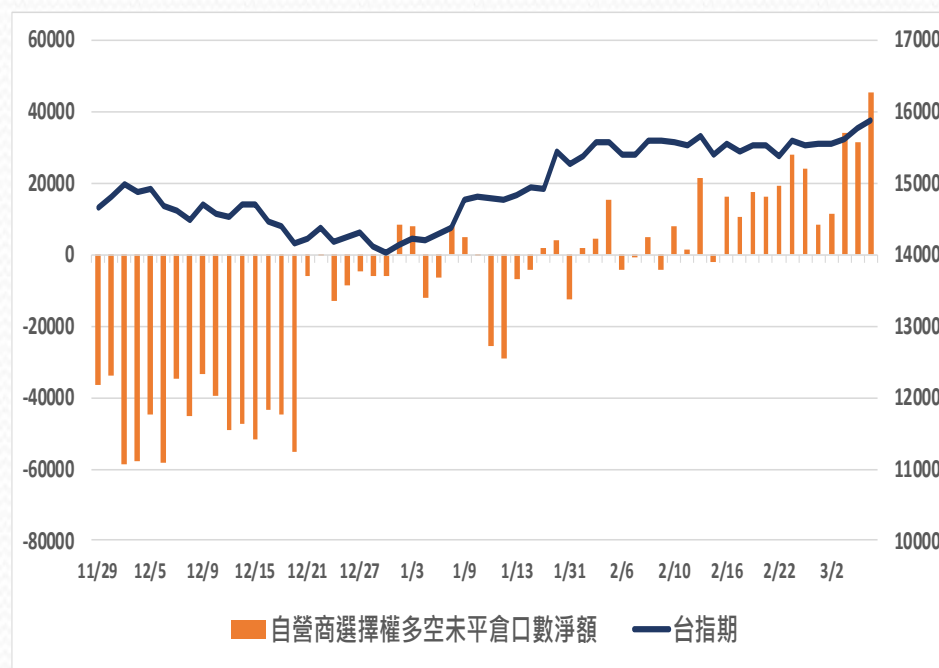
更新日期：2023年3月7日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



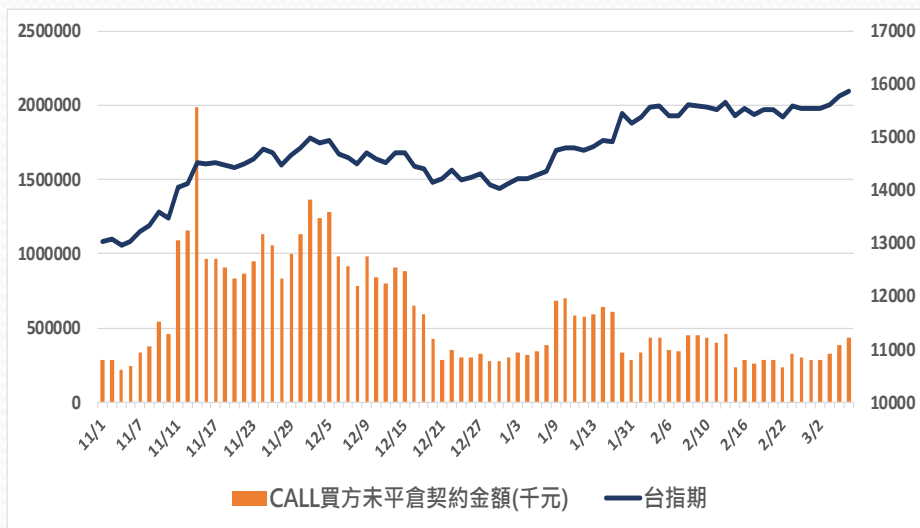
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/1	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
2023/3/7	15873	45378	13853	30145	15691

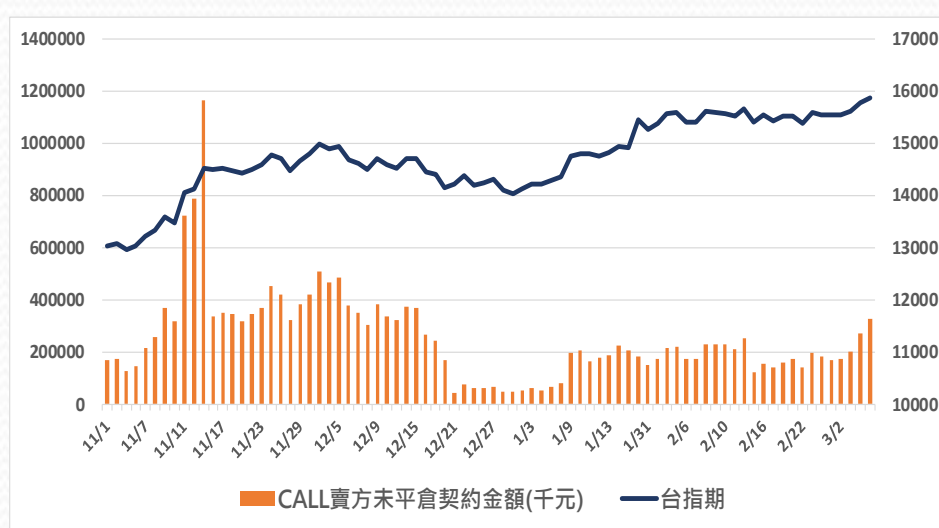
更新日期：2023年3月7日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

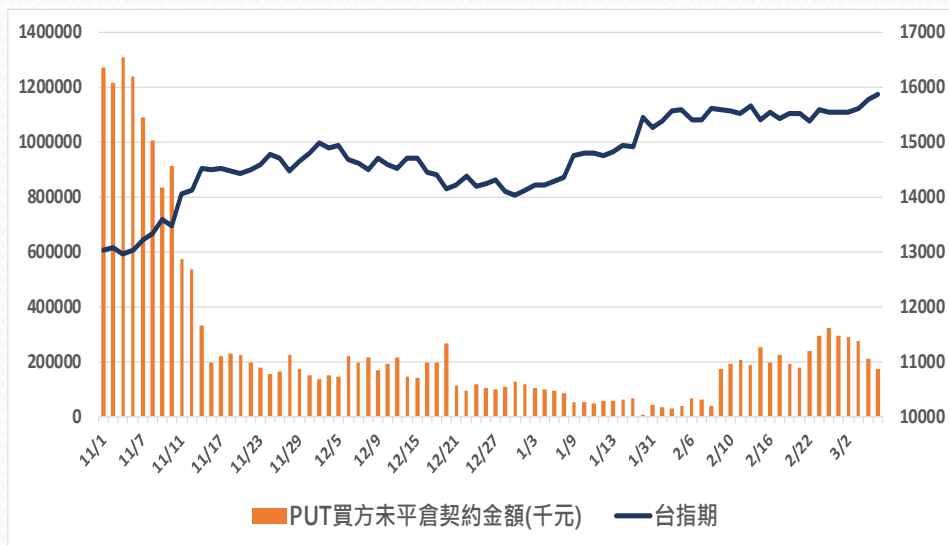
CALL買方未平倉金額



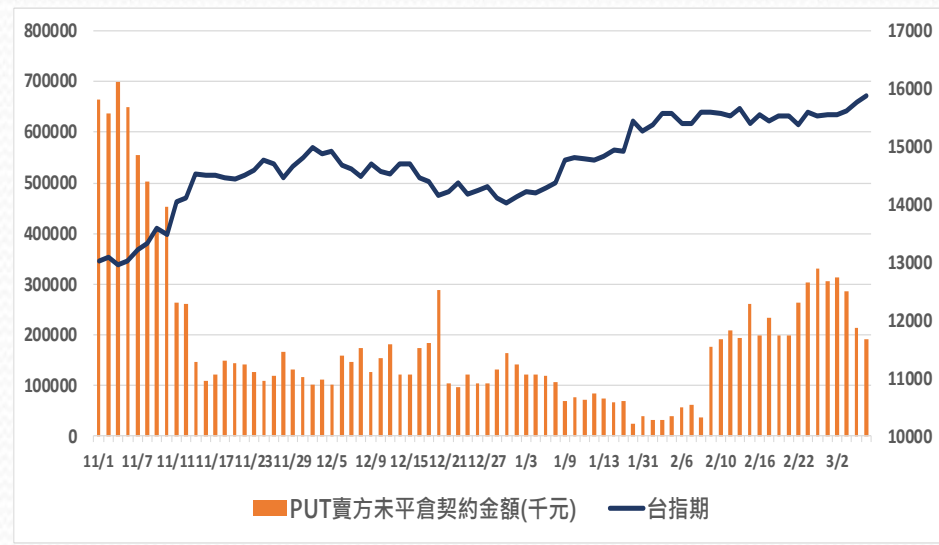
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



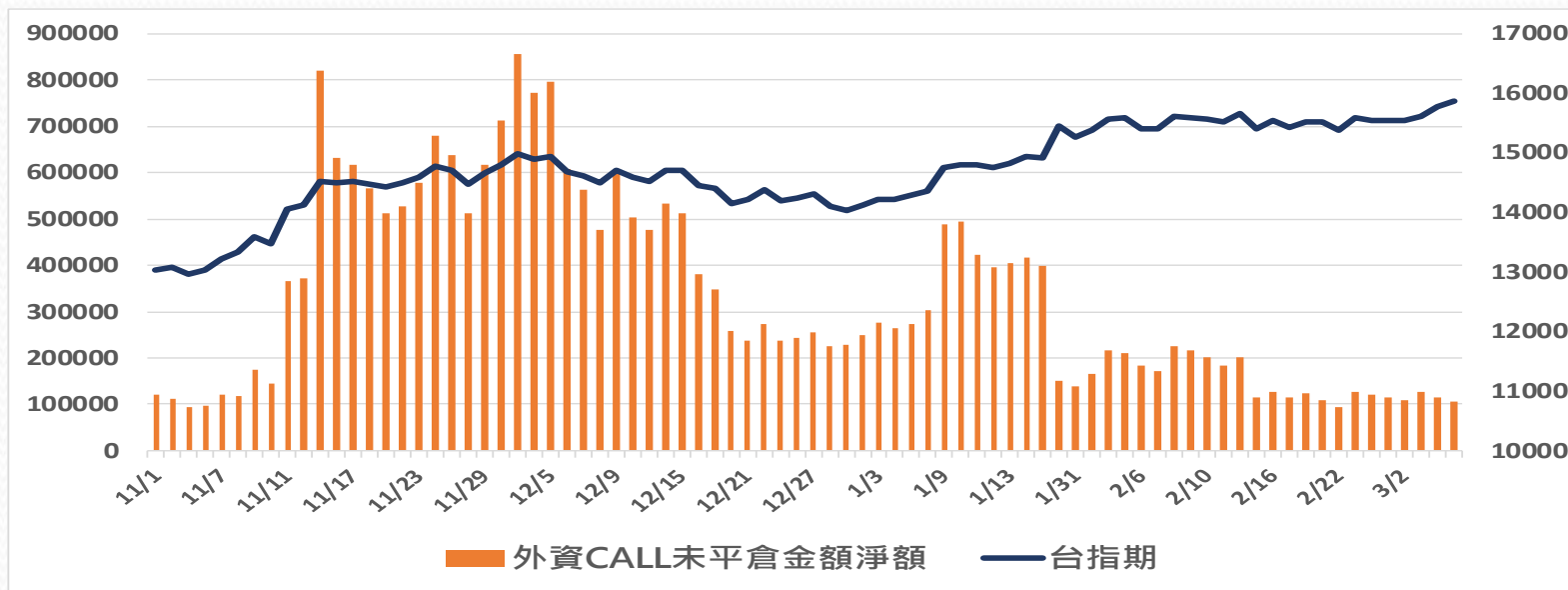
PUT賣方未平倉金額



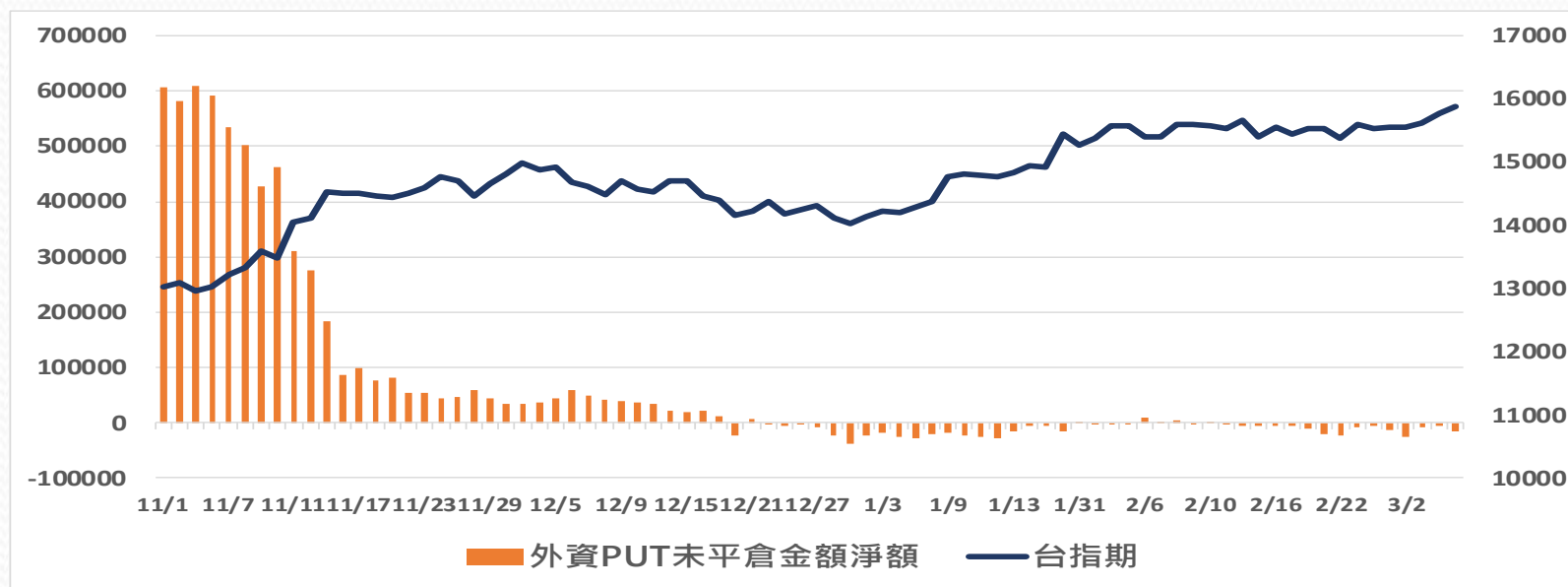
更新日期：2023年3月7日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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7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7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