

# 台指選擇權OI匯報

日期：2023/3/8 結算日：2023/3/15					日期：2023/3/8 結算日：2023/4/19				
202303 月台指選擇權 OI 序列					202304 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	90	14,700	4,453	-533	0	0	14,300	511	35
0	241	14,800	5,116	634	0	9	14,400	599	39
1	98	14,900	4,650	989	3	16	14,500	1,571	154
6	457	15,000	10,624	407	0	9	14,600	578	105
3	242	15,100	4,268	417	0	8	14,700	982	171
7	3,328	15,200	6,520	983	1	26	14,800	2,334	107
-4	735	15,300	6,088	728	2	18	14,900	2,629	688
-68	2,091	15,400	8,144	1,578	5	39	15,000	1,388	263
-6	58	15,450	2,875	1,339	-2	25	15,100	823	68
-117	3,430	15,500	6,569	1,764	0	39	15,200	920	160
58	621	15,550	3,275	930	-1	41	15,300	831	491
170	3,369	15,600	5,198	1,042	2	170	15,400	699	58
421	1,190	15,650	1,802	533	-25	377	15,500	7,685	73
306	4,123	15,700	3,429	708	41	268	15,600	569	34
607	1,549	15,750	1,230	421	85	315	15,700	475	48
1,981	6,121	15,800	2,262	547	39	489	15,800	550	23
2,055	3,401	15,850	592	131	47	806	15,900	69	22
2,302	6,939	15,900	1,126	64	217	1,306	16,000	90	9
1,380	3,309	15,950	246	128	70	1,751	16,100	51	-13
※ 2,860	13,429	16,000	589	217	120	1,859	16,200	42	19
1,654	3,062	16,050	86	75	503	2,216	16,300	39	12
1,400	10,646	16,100	311	99	※ 673	1,934	16,400	2	0
1,789	2,394	16,150	6	4	405	2,069	16,500	0	0
2,266	12,503	16,200	132	8	82	1,330	16,600	0	0
2,774	2,774	16,250	2	2	35	621	16,700	0	0
2,230	8,392	16,300	191	17	46	450	16,800	2	0
1,212	4,461	16,400	135	1	174	551	16,900	1	0
779	4,221	16,500	35	0	72	515	17,000	0	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
26,272	141,852	0.9338	132,456	13,089	2,721	23,720	1.2556	29,784	3,000
昨日 P/C	1.6332	今日增減變化	-0.6994		昨日 P/C	1.2755	今日增減變化	-0.0198	

更新日期：2023年3月8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8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	86,047,779	52,715,674	33,332,105	-15,397,094	3,685,868	1,690,278	1,995,590	-199,729	
投信	22,834,485	49,336,316	-26,501,831	-296,569	477,429	0	477,429	-2,802	
自營商	50,779,726	23,729,686	27,050,040	6,343,909	1,319,311	1,129,418	189,893	82,411	
	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	438,923	1,905,144	-1,466,221	-123,597	300,780	0	300,780	-4,964	
投信	132,149	0	132,149	-67	0	0	0	0	
自營商	442,061	311,485	130,576	66,045	77,765	367,543	-289,778	-4,264	

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8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	32,640	19,076	13,564	1,883	36,657	36,077	580	-9,424	
投信	100	50	50	0	400	113	287	0	
自營商	59,593	59,386	207	-16,046	57,047	53,478	3,569	32,694	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	22,836	6,488	16,348	1,819	10,651	14,257	-3,606	-2,569	
特定法人(全月)	26,958	8,502	18,456	2,474	27,560	27,896	-336	6,729	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	67,006	62,941	4,065	1,741	67,650	55,524	12,126	-1,620	
十大交易人(全月)	88,274	77,582	10,692	-6,522	84,986	82,762	2,224	-28,303	
全市場未沖銷(近月)			141,941	26,273			152,277	15,703	
全市場未沖銷(全月)			176,990	-56,478			199,273	-124,594	

更新日期：2023年3月8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	15000
	整體隱含波動率	13.97%	較前一交易日	+1.11%
	買權隱含波動率	11.87%	較前一交易日	-1.70%
	賣權隱含波動率	16.49%	較前一交易日	+4.18%
電子選擇權	買權成交最大量	445	買權OI最大量	730
	賣權成交最大量	690	賣權OI最大量	660
金融選擇權	買權成交最大量	1620	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	490	賣權OI最大量	1440

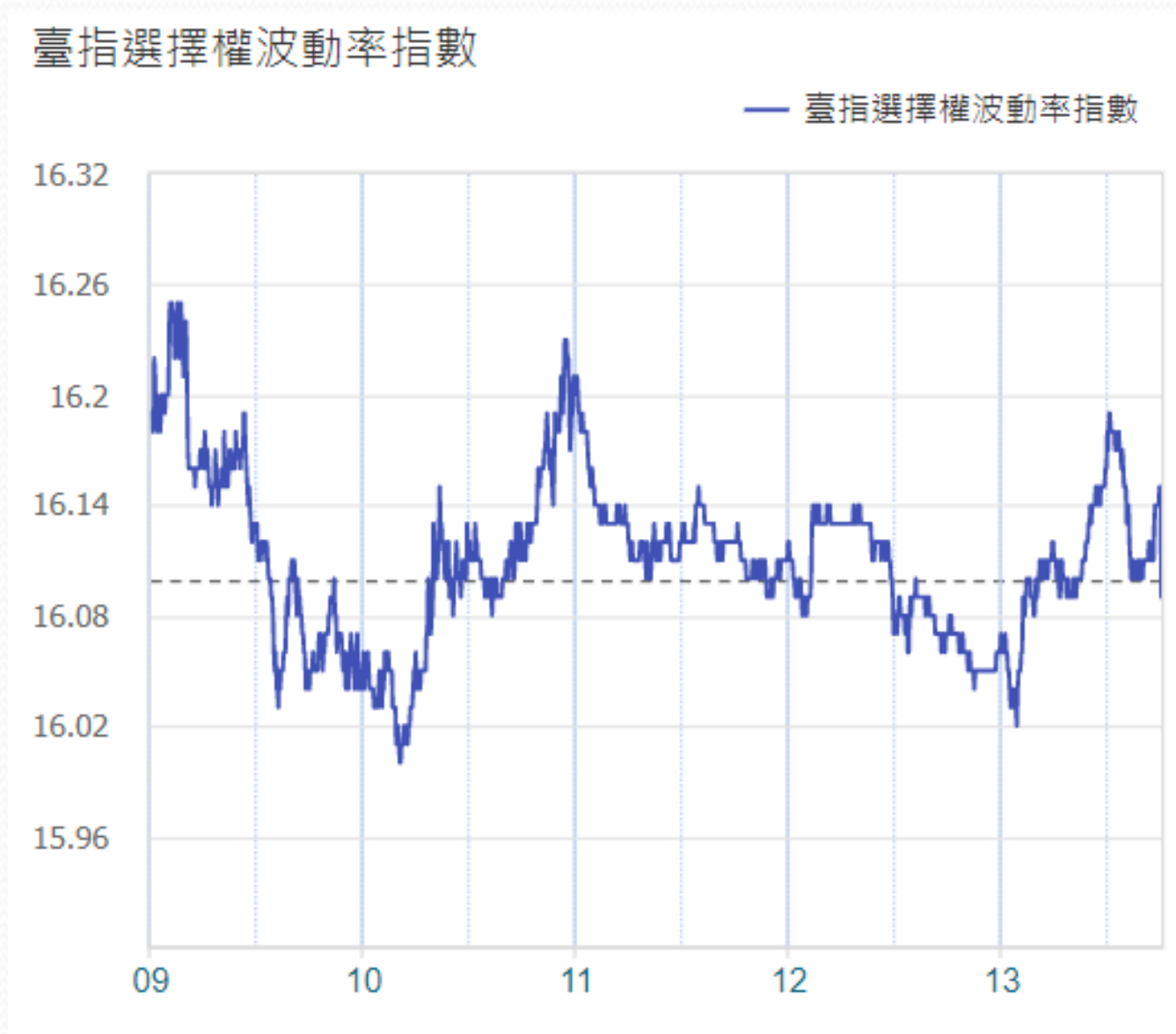
更新日期：2023年3月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指選擇權匯報

2023年04月選擇權分析表				
台指選擇權	買權成交最大量	16400	買權OI最大量	16300
	賣權成交最大量	14900	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	15.37%	較前一交易日	-0.23%
	買權隱含波動率	12.46%	較前一交易日	-1.93%
	賣權隱含波動率	18.85%	較前一交易日	+3.21%
	成交量P/C_Ratio值	0.934	較前一交易日	-0.48
	未平倉P/C_Ratio值	1.256	較前一交易日	+0.07
電子選擇權	買權成交最大量	515	買權OI最大量	730
	賣權成交最大量	690	賣權OI最大量	660
金融選擇權	買權成交最大量	1620	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	660	賣權OI最大量	1440

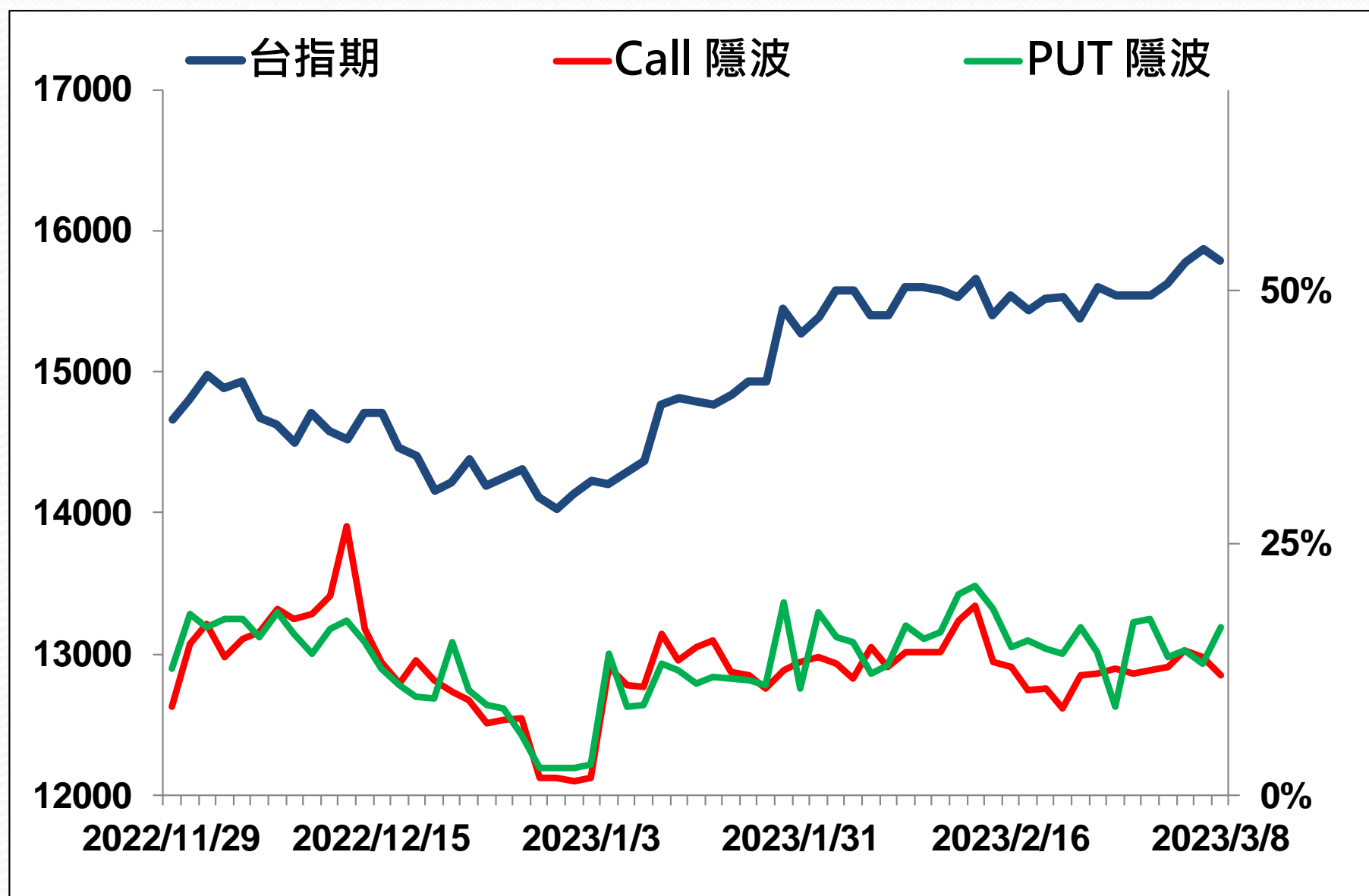
更新日期：2023年3月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權當日波動率指數



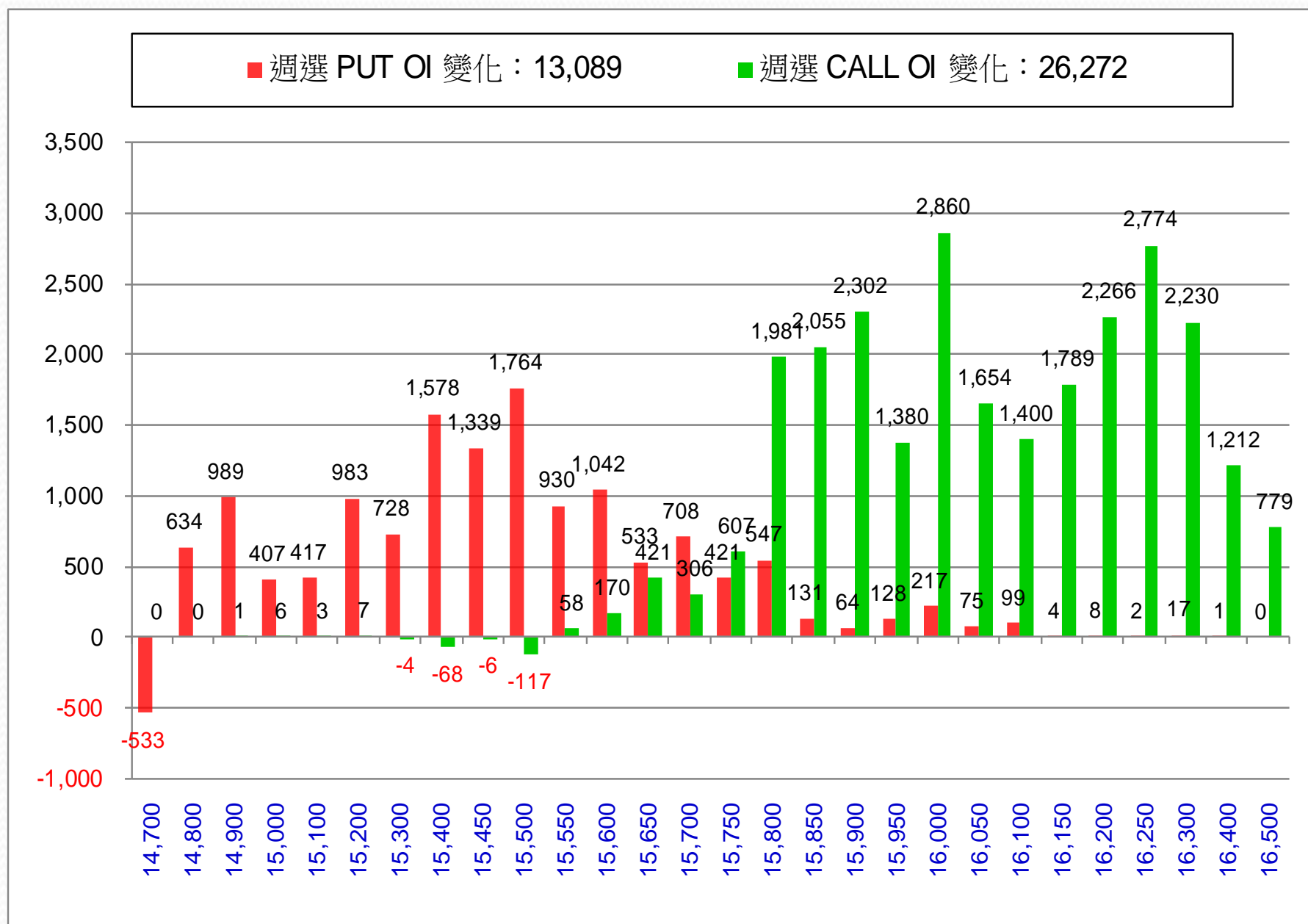
更新日期：2023年3月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



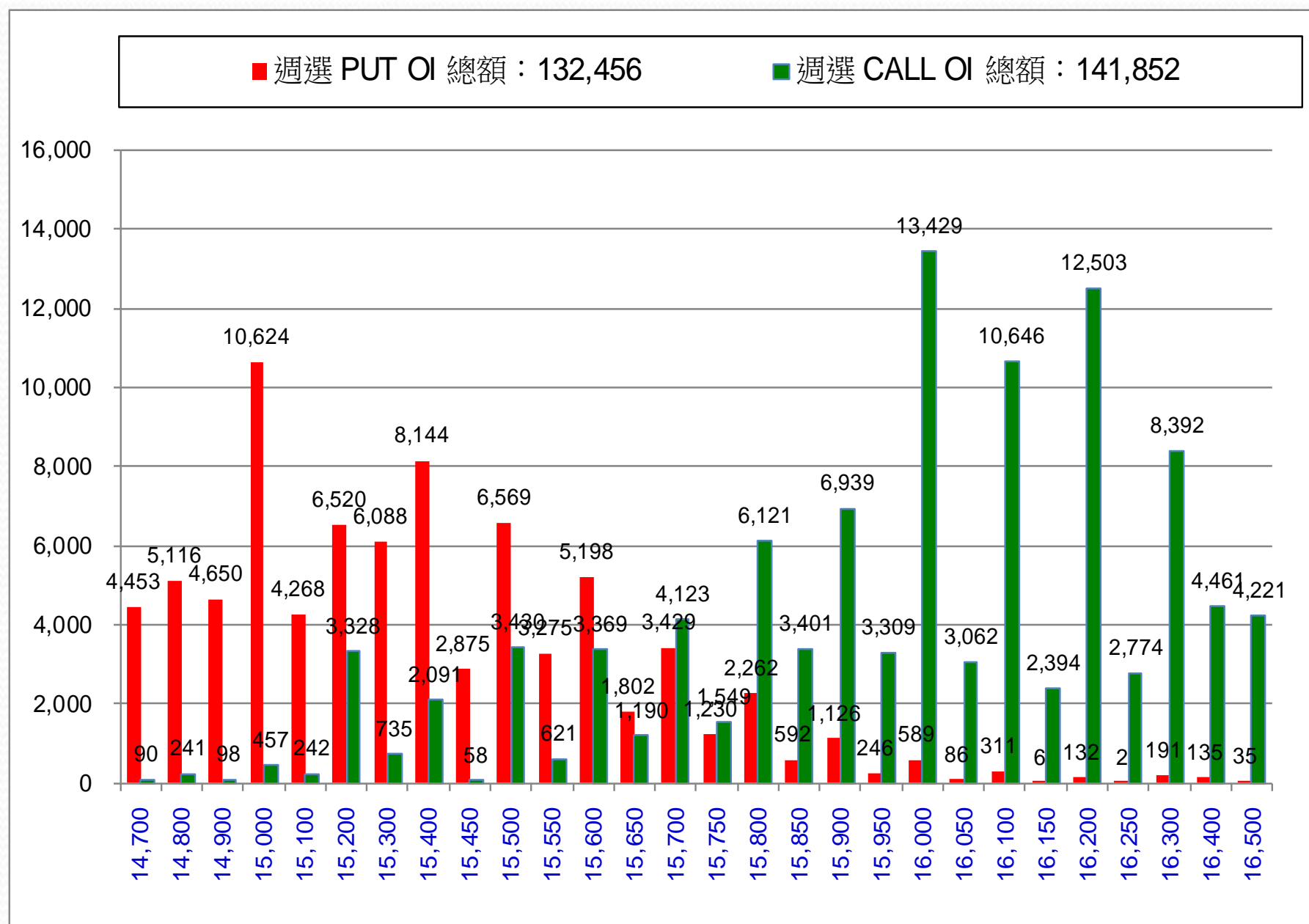
更新日期：2023年3月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年3月8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8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

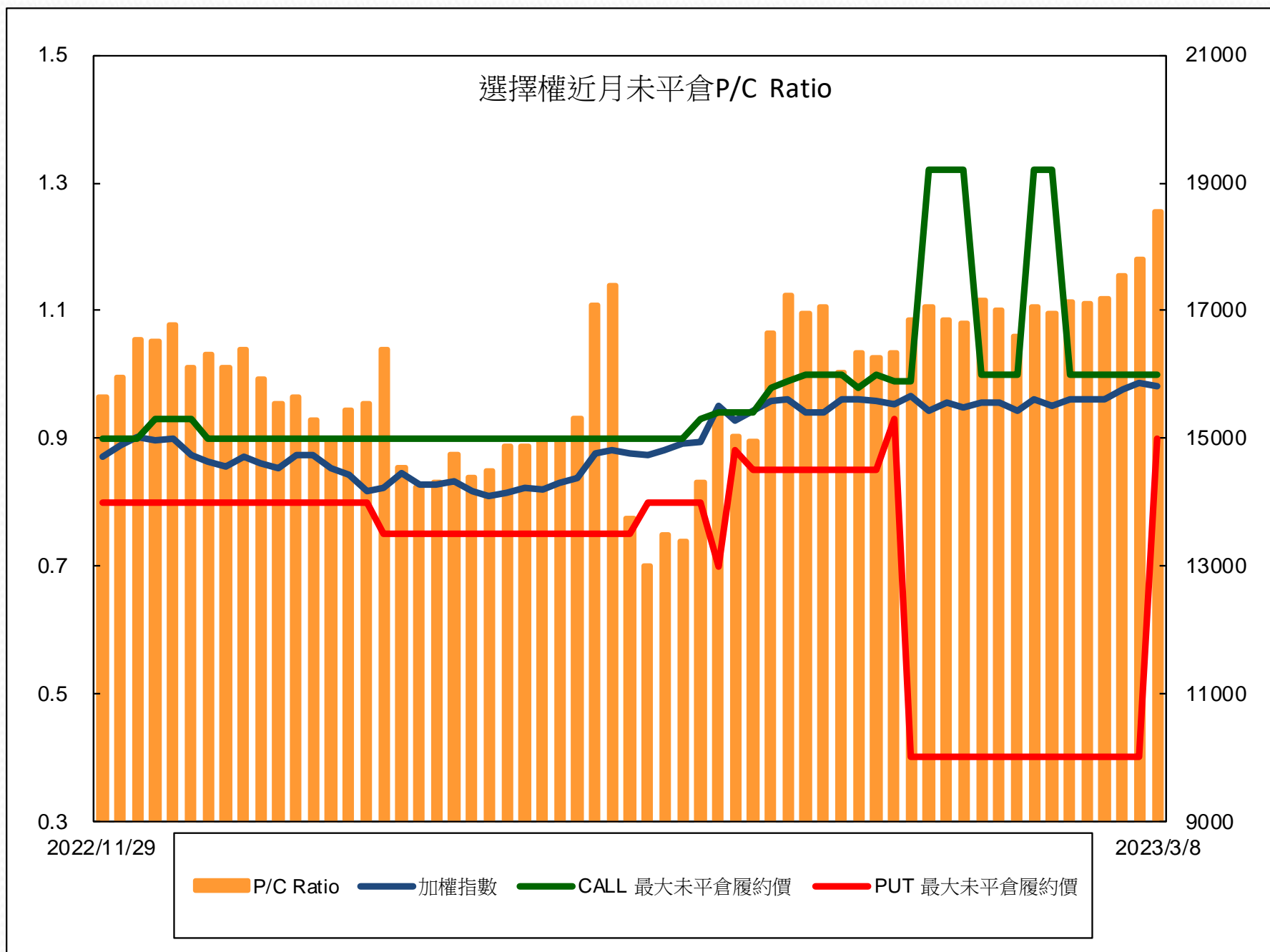


# 自營商選擇權OI部位統計

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7日	78,286	62,033	16,253
	3月8日	59,593	59,386	207
Put	3月7日	64,528	93,653	-29,125
	3月8日	57,047	53,478	3,569

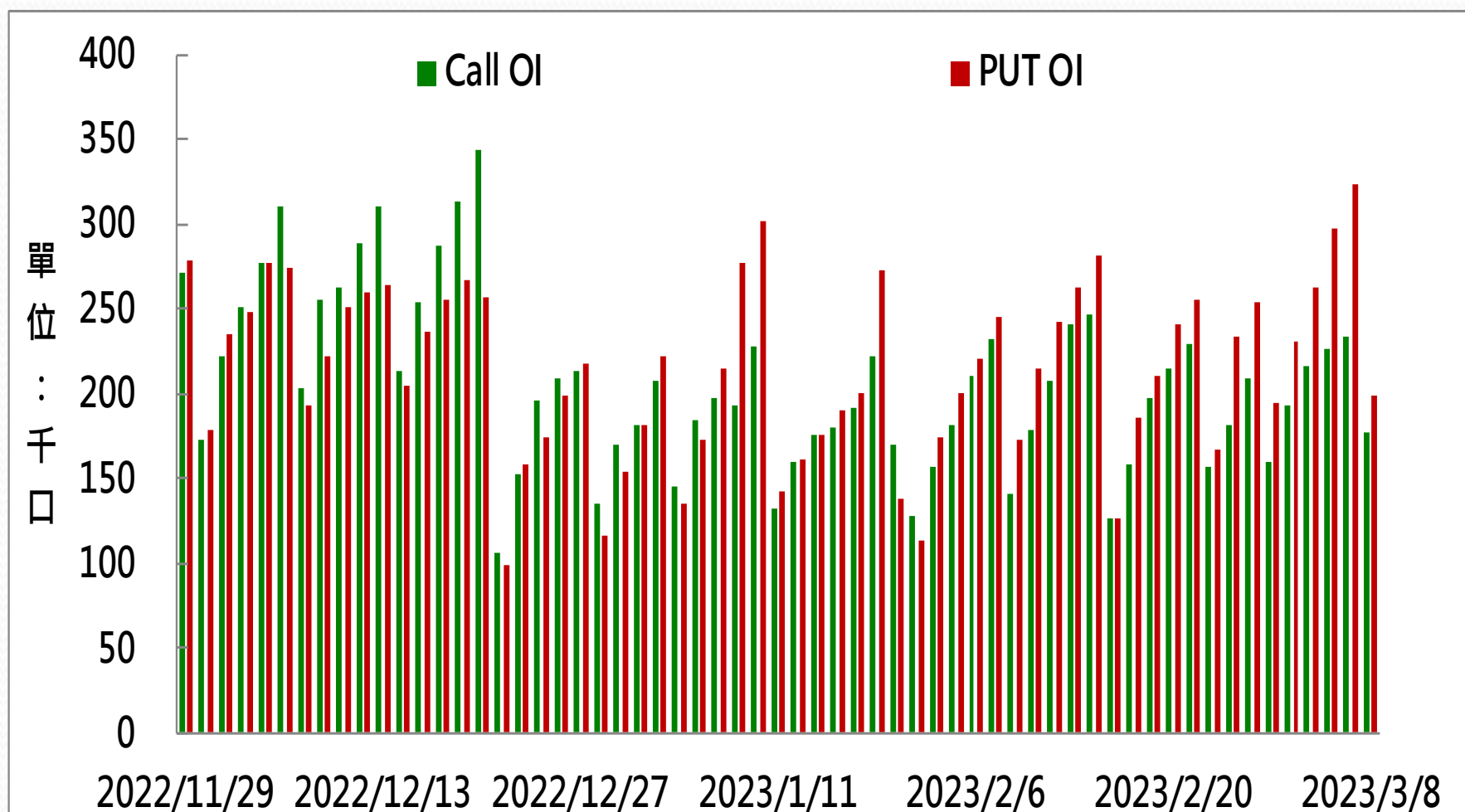
更新日期：2023年3月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

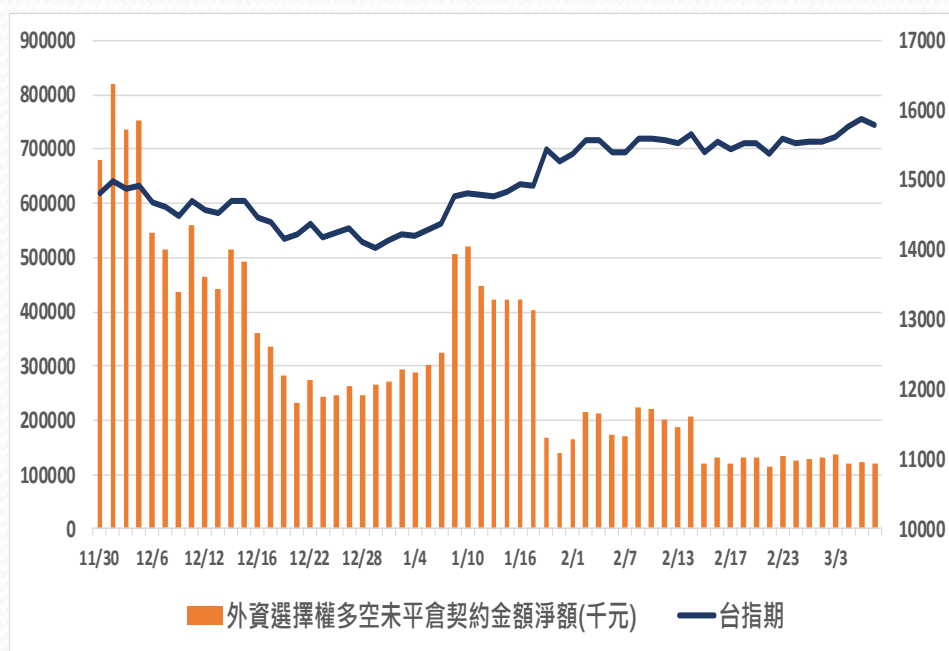
# 選擇權全月Put Call OI



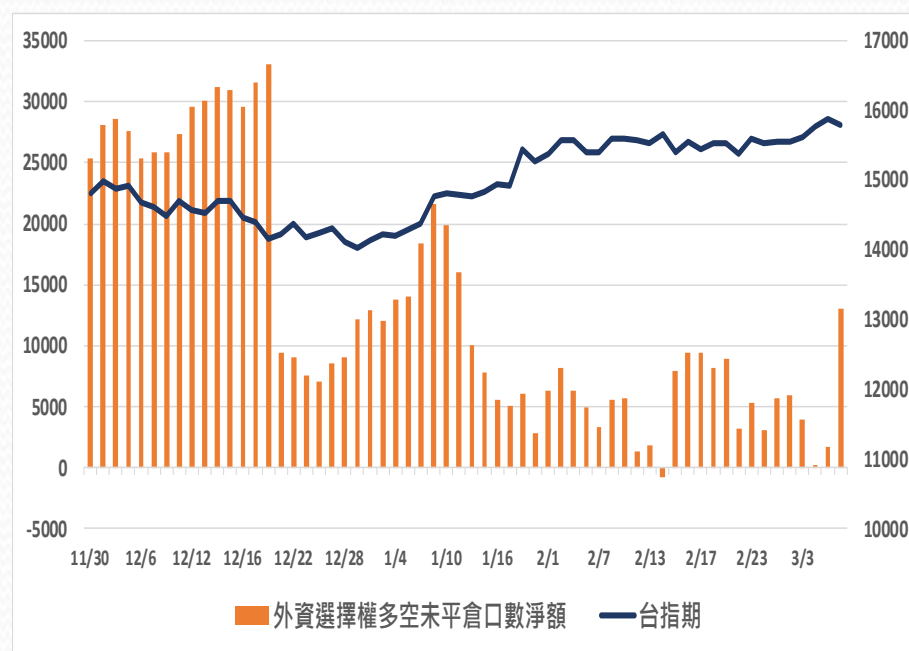
更新日期：2023年3月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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



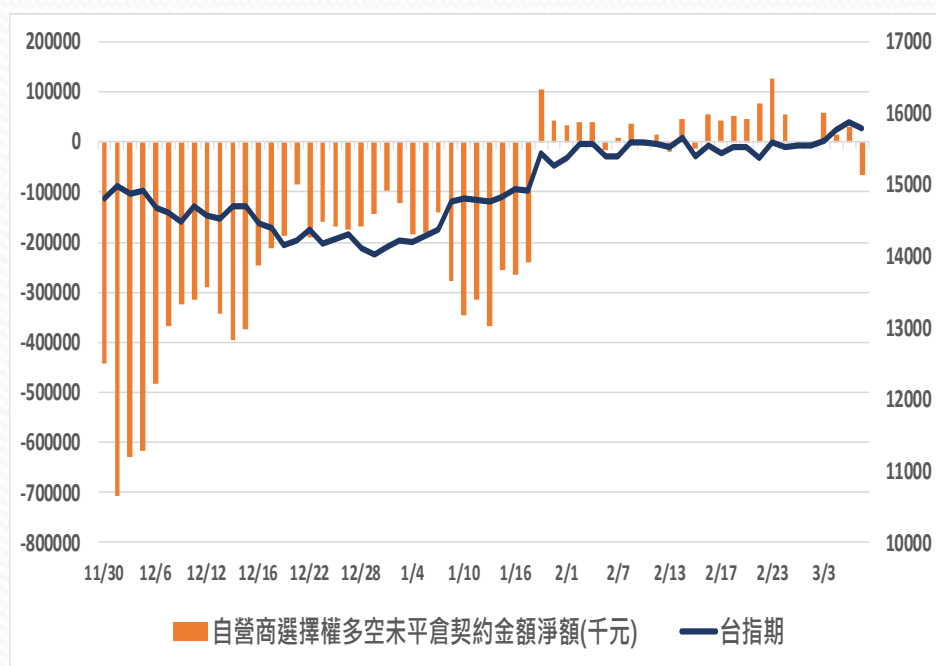
### 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/2	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
2023/3/8	15785	12984	11307	119611	-2431

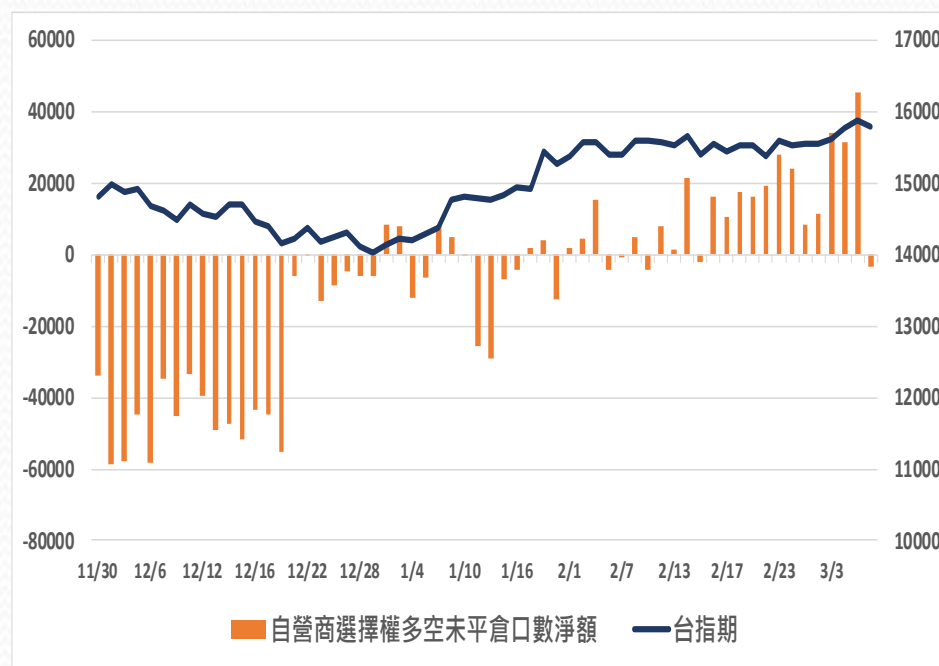
更新日期：2023年3月8日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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



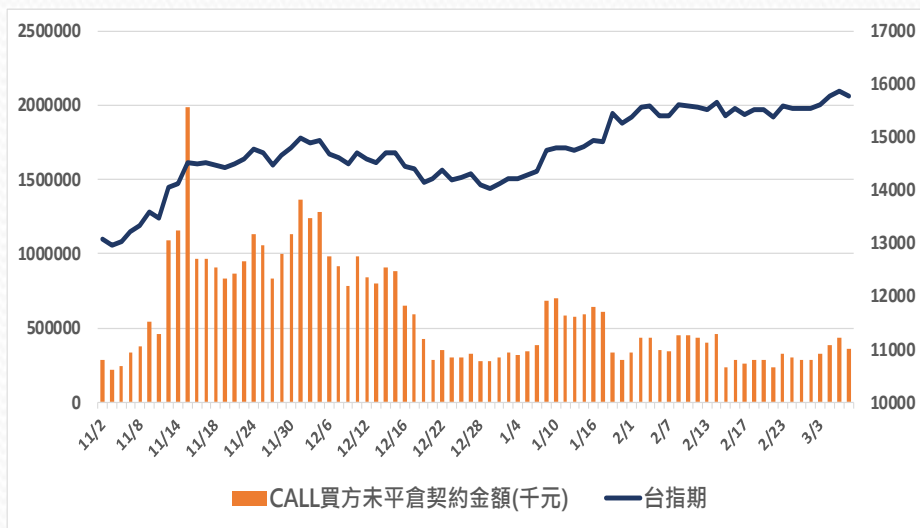
## 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/2	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
2023/3/8	15785	-3362	-48740	-64411	-94556

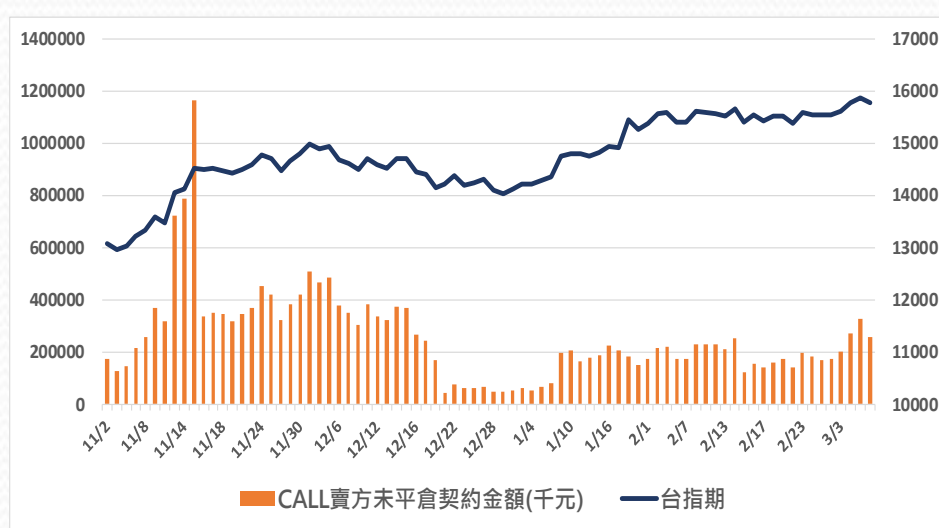
更新日期：2023年3月8日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 外資買賣權未平倉金額

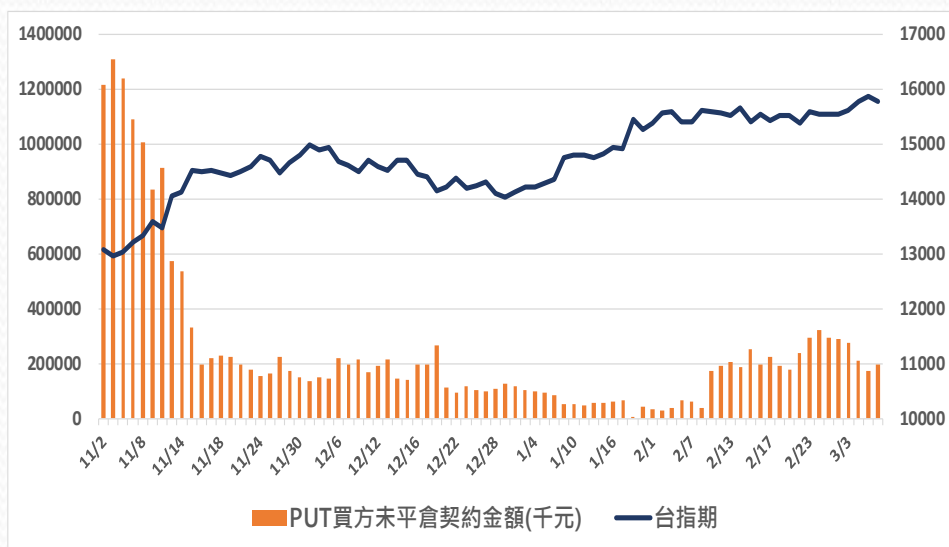
## CALL買方未平倉金額



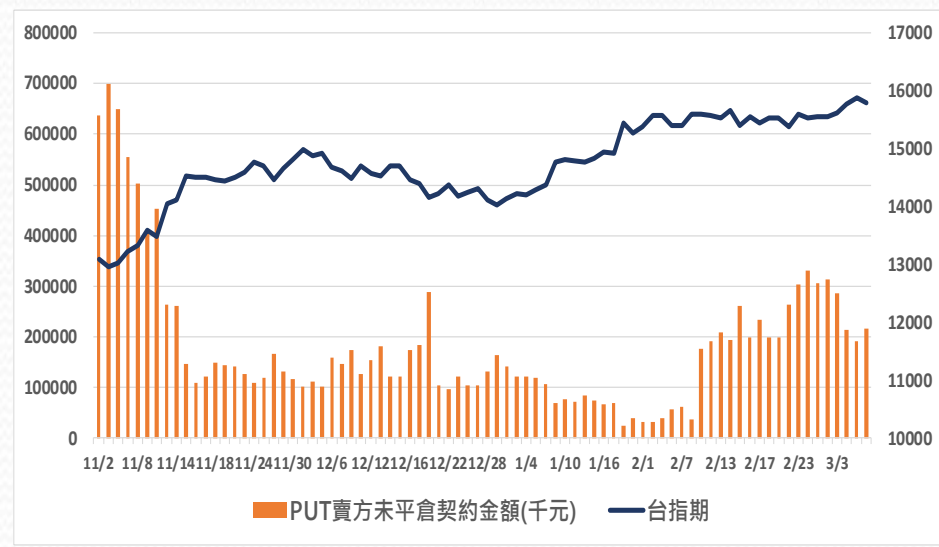
## CALL賣方未平倉金額



## PUT買方未平倉金額



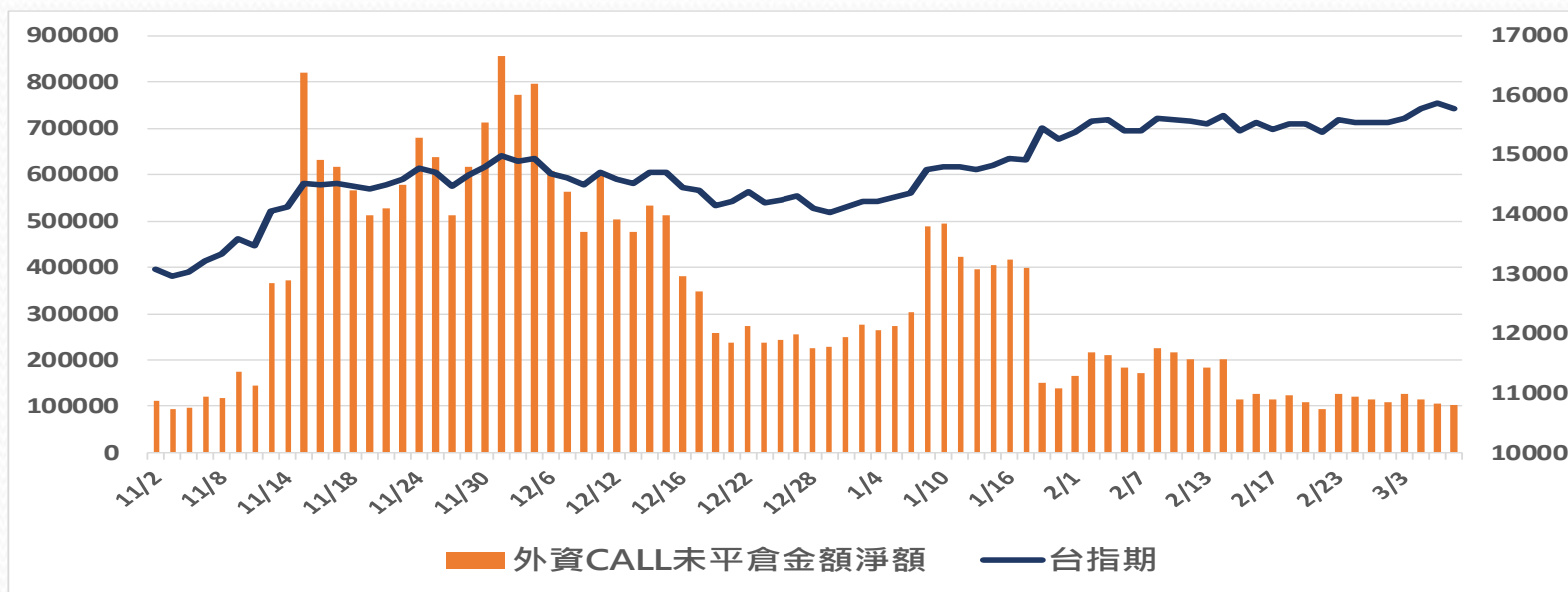
## PUT賣方未平倉金額



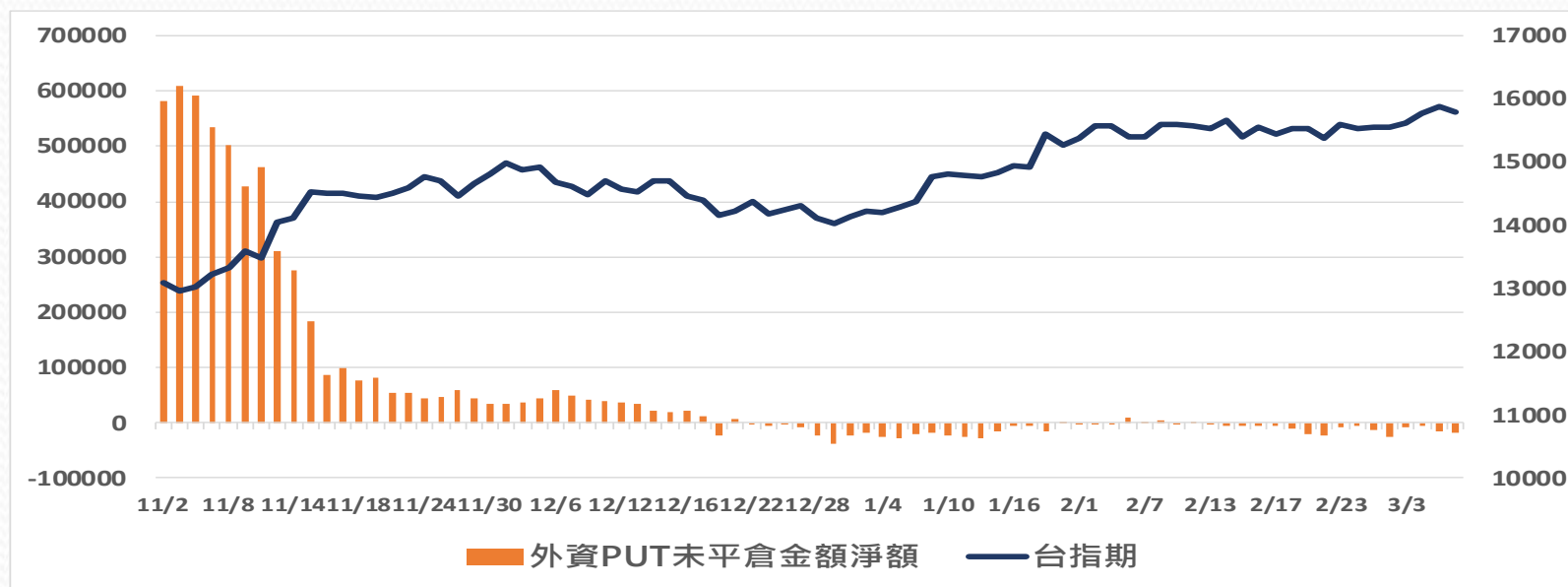
更新日期：2023年3月8日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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8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8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