

台指選擇權OI匯報

日期：2023/3/9 結算日：2023/3/15					日期：2023/3/9 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
-2	88	14,700	4,380	-73	0	0	14,300	592	81
-1	240	14,800	5,986	870	0	9	14,400	638	39
-2	96	14,900	5,271	621	0	16	14,500	1,490	-81
-12	445	15,000	10,584	-40	4	13	14,600	687	109
0	242	15,100	4,784	516	0	8	14,700	1,098	116
-64	3,264	15,200	7,180	660	3	29	14,800	2,375	41
-28	707	15,300	6,921	833	0	18	14,900	2,925	296
0	57	15,350	3,744	1,666	1	40	15,000	1,527	139
-477	1,614	15,400	11,190	3,046	4	29	15,100	922	99
-4	54	15,450	5,085	2,210	2	41	15,200	957	37
-28	3,402	15,500	10,197	3,628	4	45	15,300	880	49
141	762	15,550	4,800	1,525	2	172	15,400	1,286	587
35	3,404	15,600	7,542	2,344	-11	366	15,500	7,806	121
104	1,294	15,650	3,042	1,240	37	305	15,600	603	34
313	4,436	15,700	4,583	1,154	61	376	15,700	477	2
770	2,319	15,750	2,663	1,433	17	506	15,800	541	-9
1,861	7,982	15,800	3,585	1,323	67	873	15,900	71	2
1,473	4,874	15,850	1,008	416	494	1,800	16,000	68	-22
2,321	9,260	15,900	1,320	194	-12	1,739	16,100	55	4
2,437	5,746	15,950	500	254	123	1,982	16,200	56	14
3,637	17,066	16,000	757	168	307	2,523	16,300	53	14
3,446	6,508	16,050	142	56	156	2,090	16,400	2	0
※ 5,482	16,128	16,100	295	-16	296	2,365	16,500	4	4
3,355	5,749	16,150	10	4	136	1,466	16,600	0	0
1,522	14,025	16,200	129	-3	73	694	16,700	0	0
627	3,401	16,250	3	1	156	606	16,800	2	0
666	9,058	16,300	185	-6	-5	546	16,900	1	0
260	4,721	16,400	137	2	61	576	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
28,268	170,177	0.9301	158,284	23,750	3,547	27,267	1.1670	31,820	2,036
昨日 P/C	0.9338	今日增減變化	-0.0037		昨日 P/C	1.2556	今日增減變化	-0.0887	

更新日期：2023年3月9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9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	90,751,138	58,534,070	32,217,068	-1,115,037	3,729,613	1,900,503	1,829,110	-166,480	
投信	22,791,199	49,283,183	-26,491,984	9,847	478,106	0	478,106	677	
自營商	51,894,233	24,368,491	27,525,742	475,702	1,365,532	1,127,825	237,707	47,814	
	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	434,297	1,934,005	-1,499,708	-33,487	314,951	3,043	311,908	11,128	
投信	131,225	0	131,225	-924	0	0	0	0	
自營商	445,249	368,698	76,551	-54,025	72,954	369,426	-296,472	-6,694	

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9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	33,667	19,585	14,082	518	39,569	37,362	2,207	1,627	
投信	100	50	50	0	400	113	287	0	
自營商	65,403	64,550	853	646	62,996	57,885	5,111	1,542	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	19,248	5,488	13,760	-2,588	10,731	16,257	-5,526	-1,920	
特定法人(全月)	26,779	8,117	18,662	206	28,261	29,878	-1,617	-1,281	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	69,443	67,979	1,464	-2,601	71,274	59,043	12,231	105	
十大交易人(全月)	96,511	86,862	9,649	-1,043	91,499	90,766	733	-1,491	
全市場未沖銷(近月)			170,216	28,275			178,246	25,969	
全市場未沖銷(全月)			214,196	37,206			233,350	34,077	

更新日期：2023年3月9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	15400
	整體隱含波動率	13.84%	較前一交易日	-0.12%
	買權隱含波動率	12.61%	較前一交易日	+0.73%
	賣權隱含波動率	15.04%	較前一交易日	-1.45%
電子選擇權	買權成交最大量	810	買權OI最大量	780
	賣權成交最大量	710	賣權OI最大量	660
金融選擇權	買權成交最大量	1660	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1540

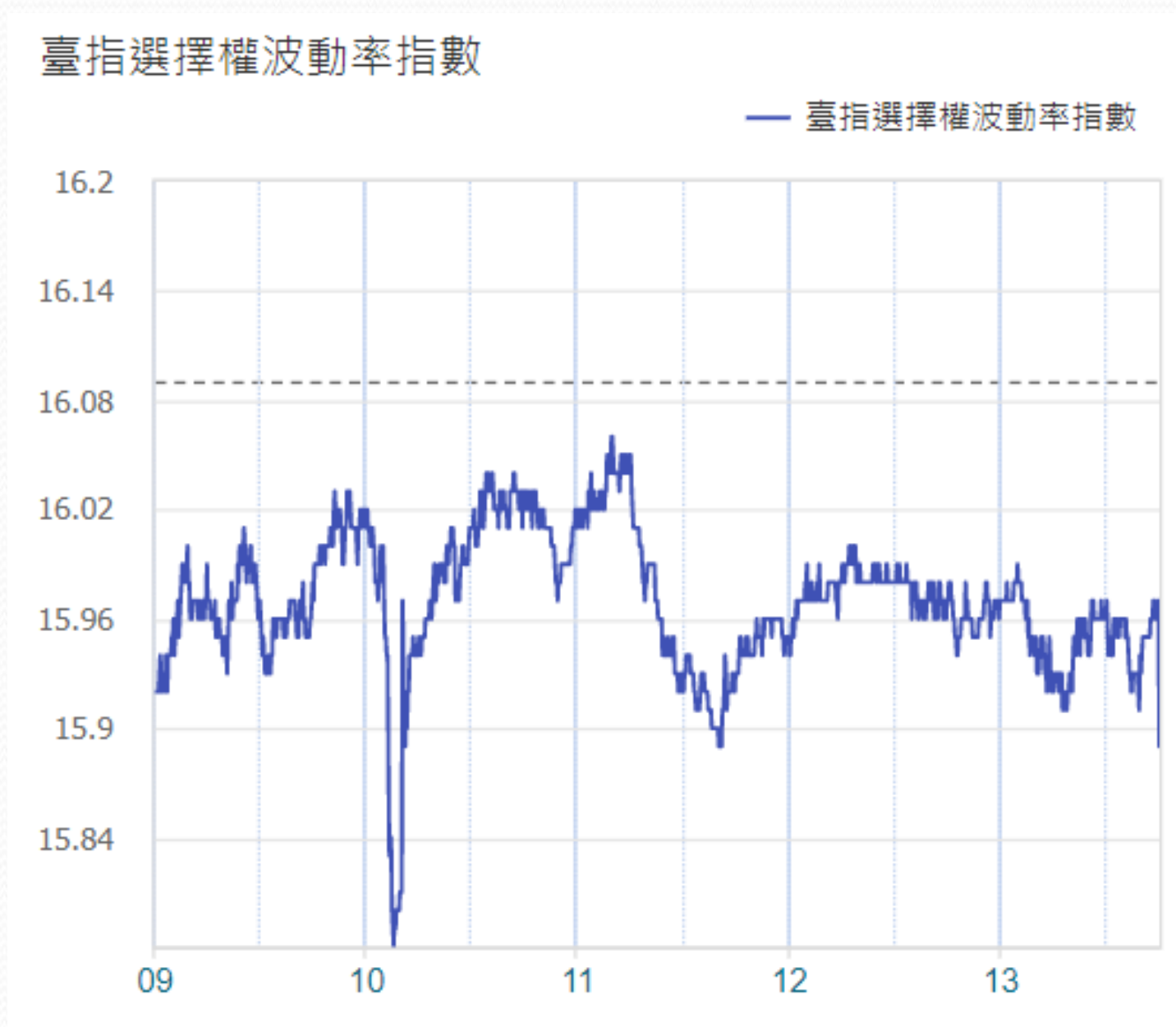
更新日期：2023年3月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	18300	買權OI最大量	16300
	賣權成交最大量	15400	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	15.29%	較前一交易日	+0.08%
	買權隱含波動率	12.73%	較前一交易日	+0.27%
	賣權隱含波動率	18.39%	較前一交易日	-0.46%
	成交量P/C_Ratio值	0.729	較前一交易日	-0.21
	未平倉P/C_Ratio值	1.167	較前一交易日	-0.09
電子選擇權	買權成交最大量	810	買權OI最大量	780
	賣權成交最大量	710	賣權OI最大量	660
金融選擇權	買權成交最大量	1660	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1540

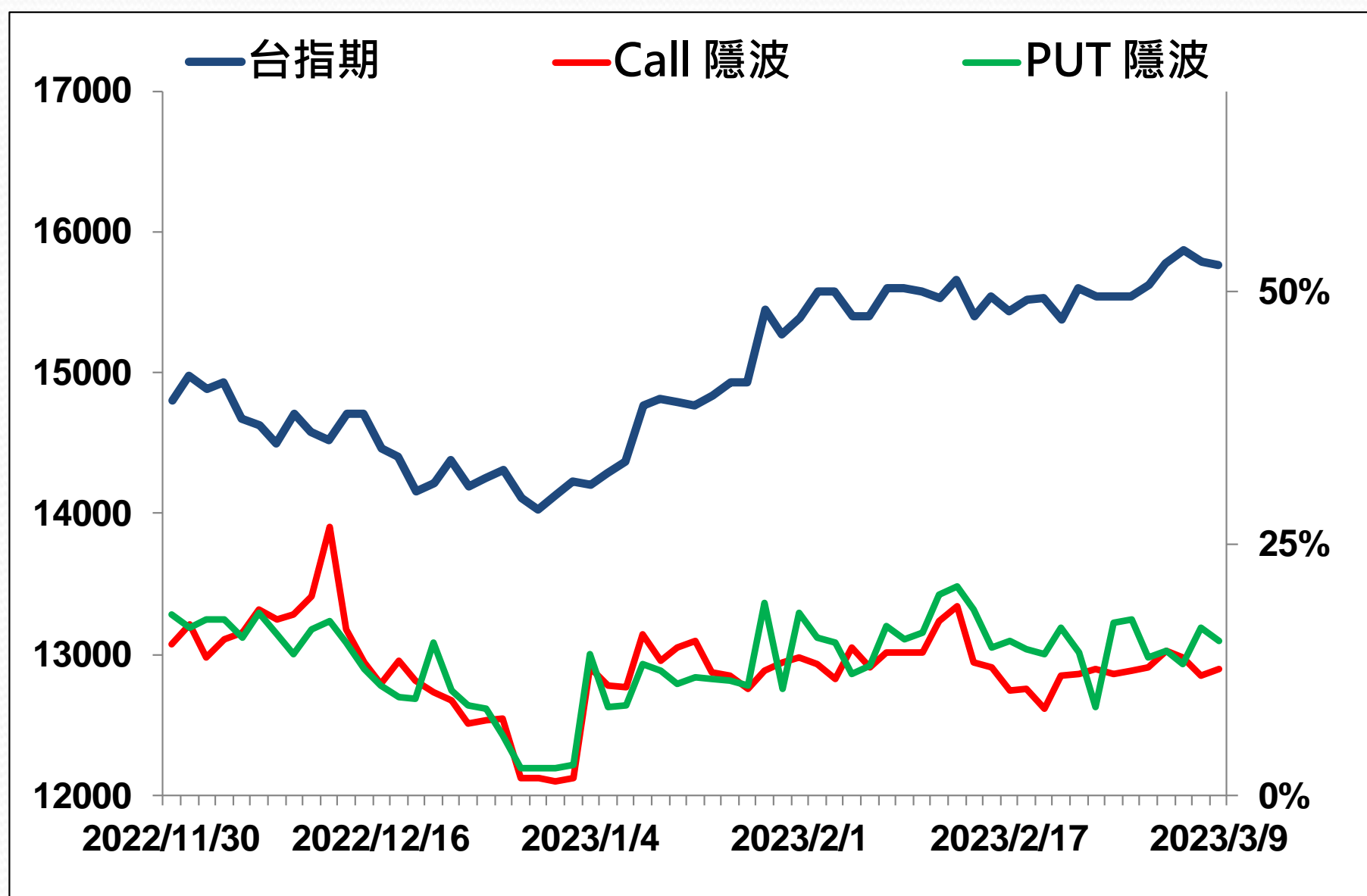
更新日期：2023年3月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



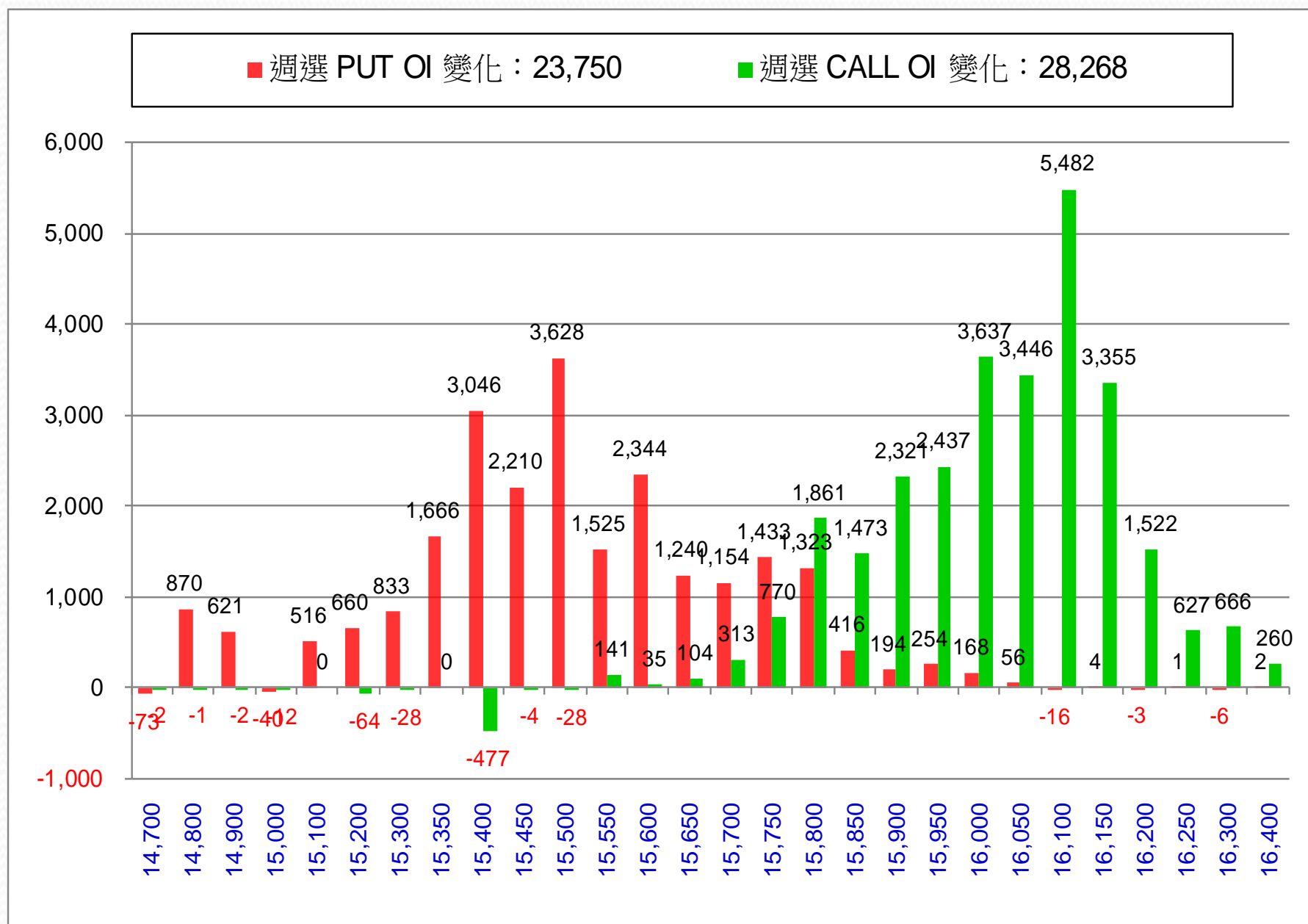
更新日期：2023年3月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



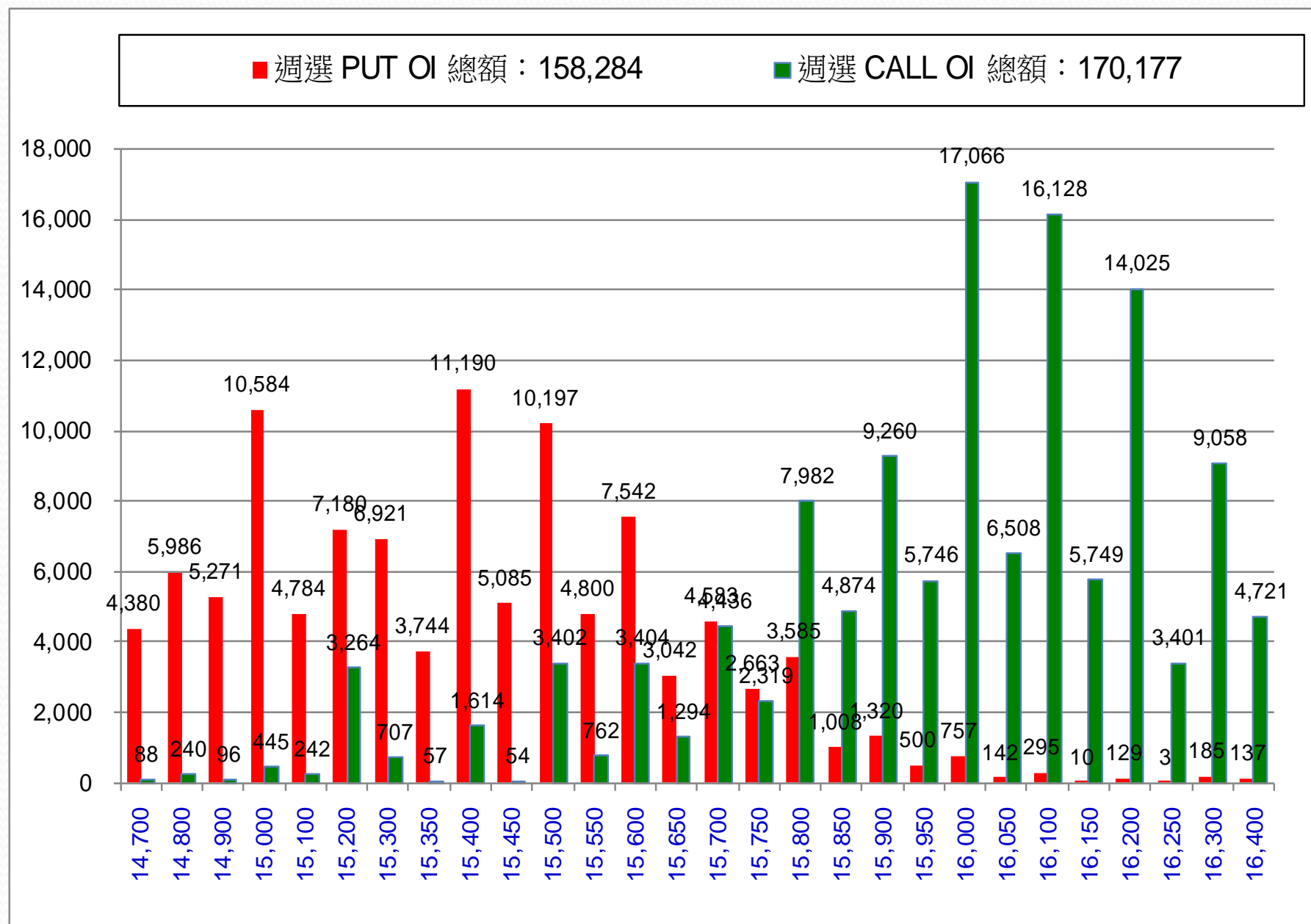
更新日期：2023年3月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年3月9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



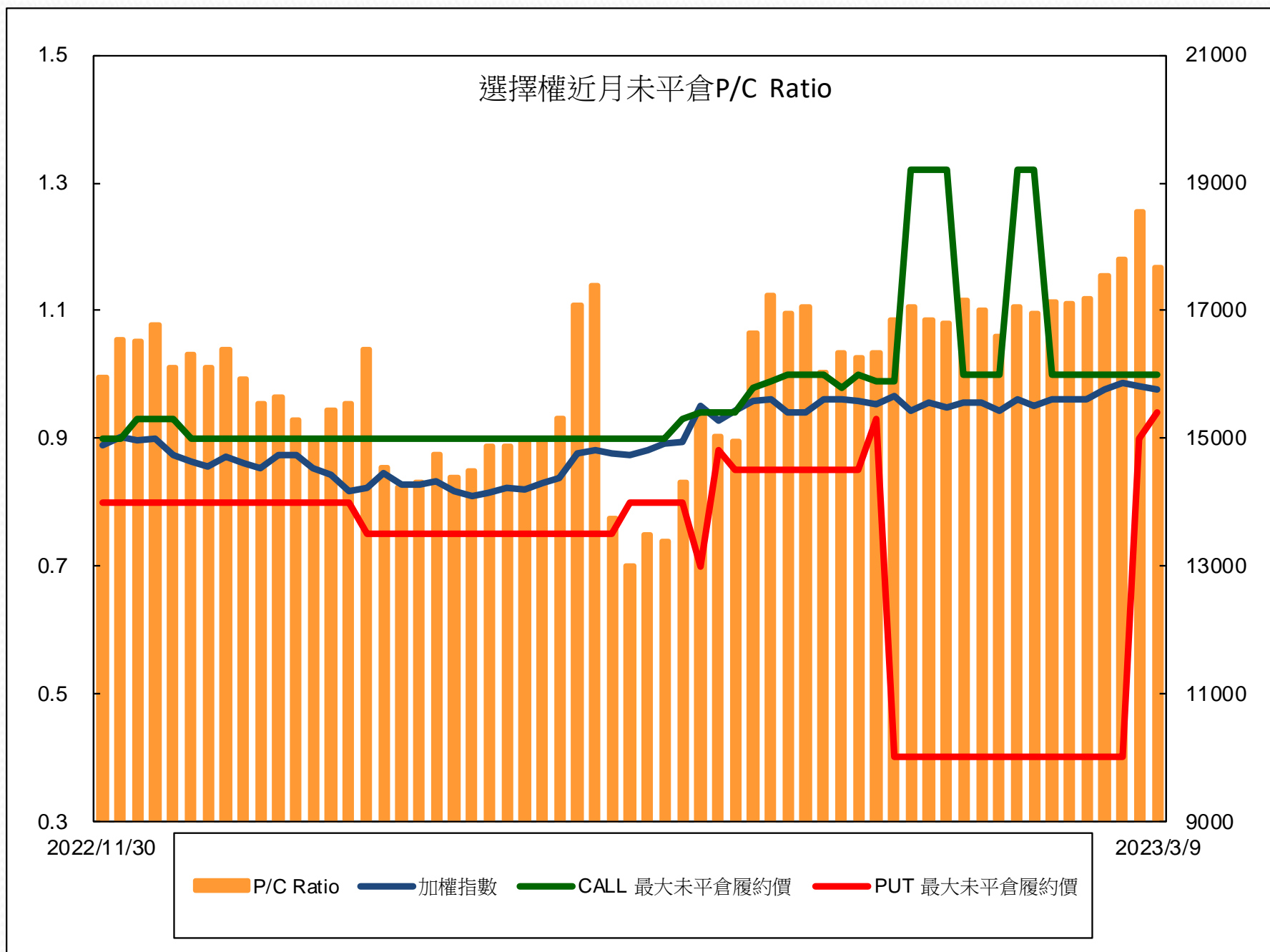
更新日期：2023年3月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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8日	59,593	59,386	207
	3月9日	65,403	64,550	853
Put	3月8日	57,047	53,478	3,569
	3月9日	62,996	57,885	5,111

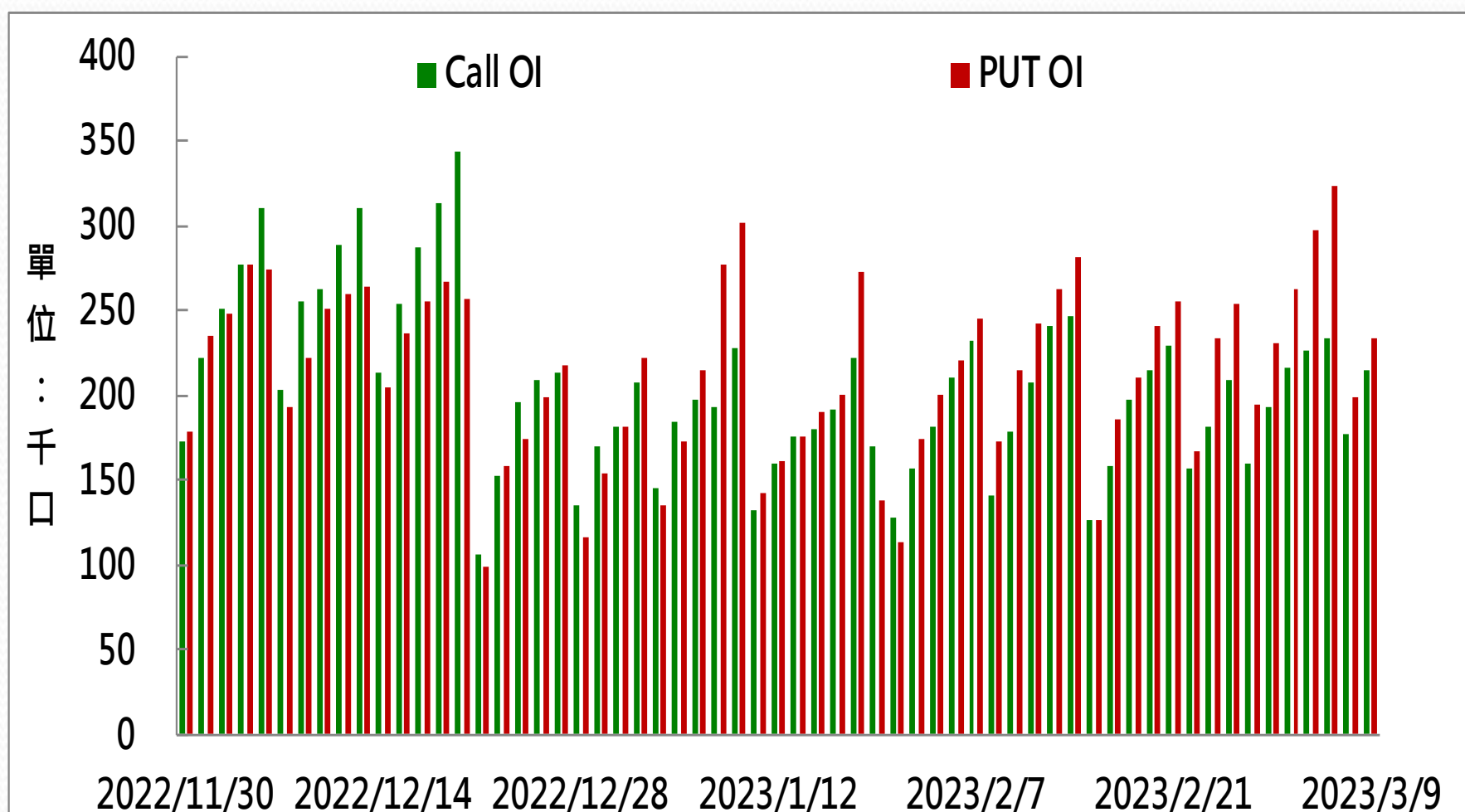
更新日期：2023年3月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

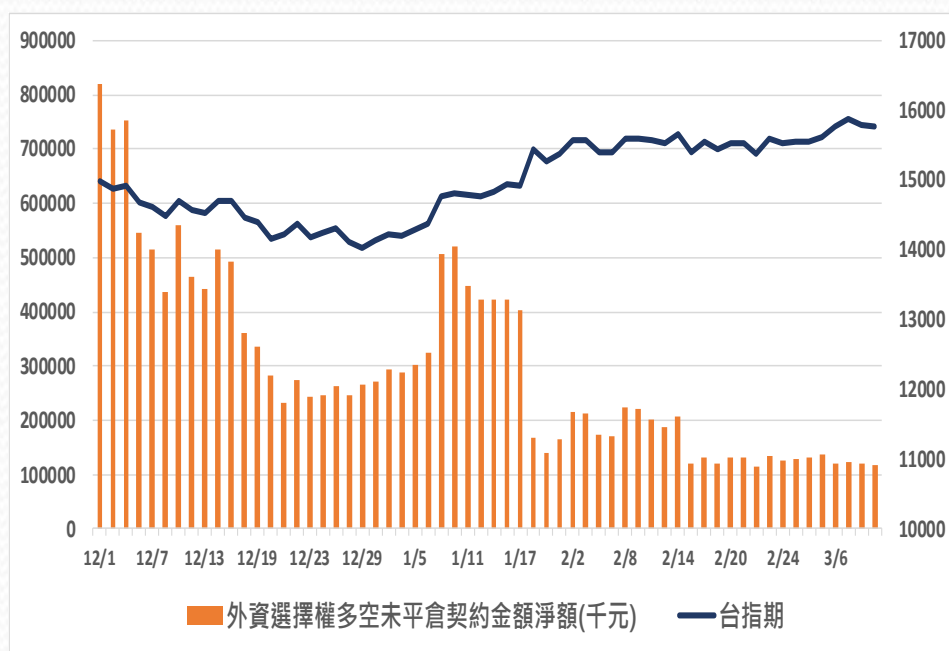
選擇權全月Put Call OI



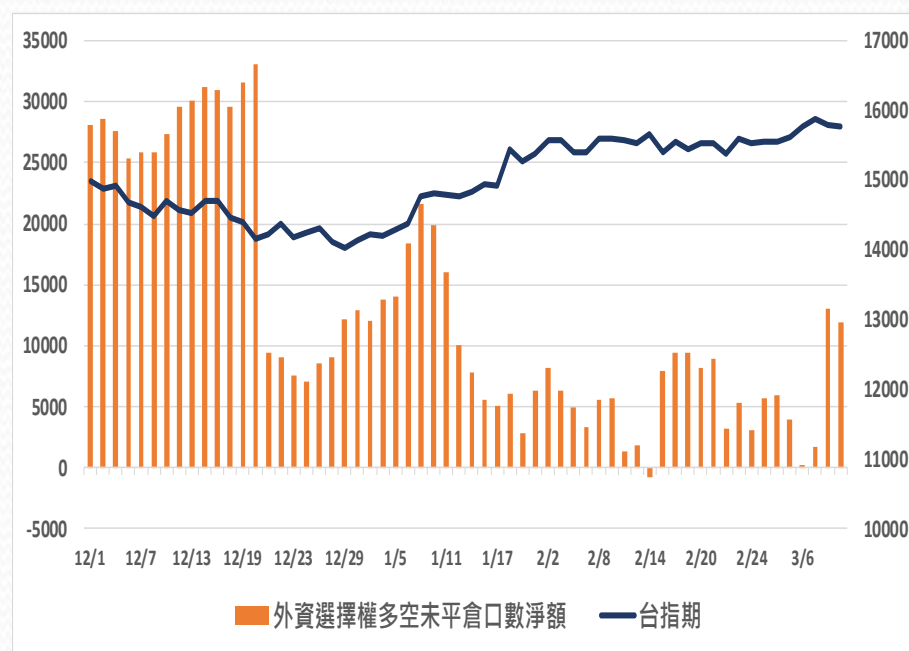
更新日期：2023年3月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



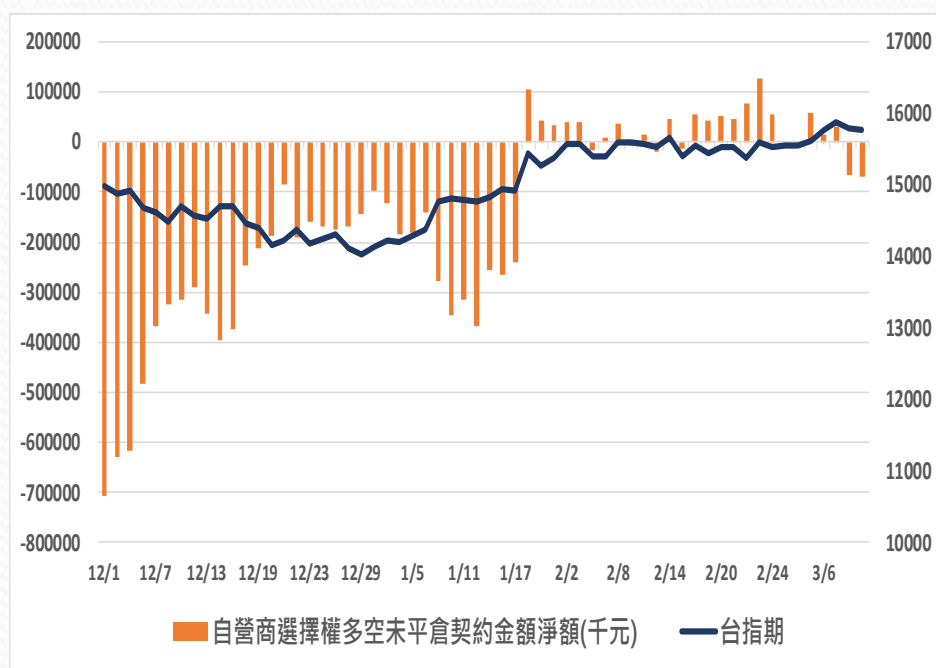
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/3	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
2023/3/9	15766	11875	-1109	116241	-3370

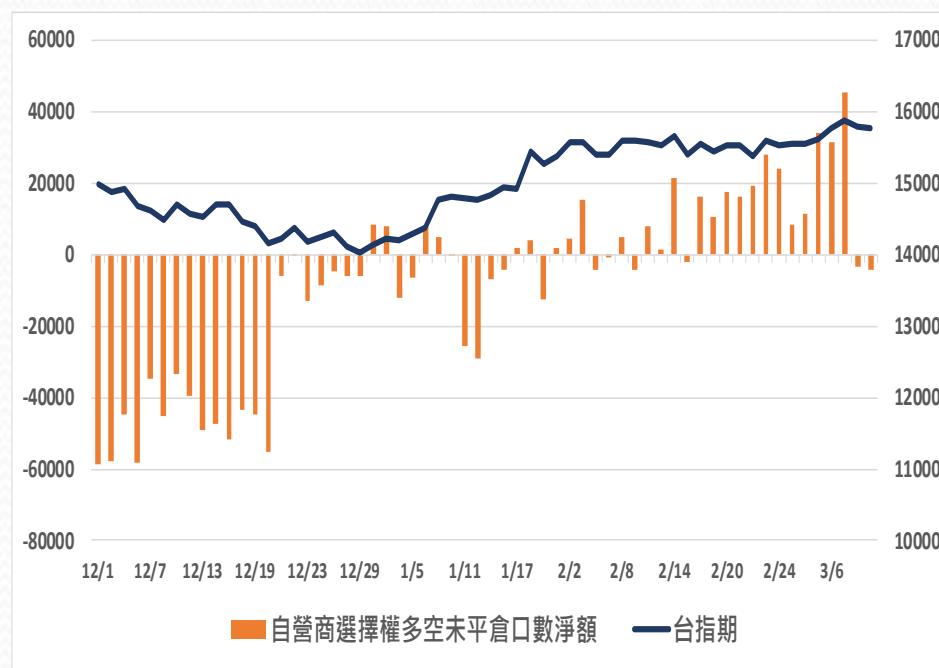
更新日期：2023年3月9日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



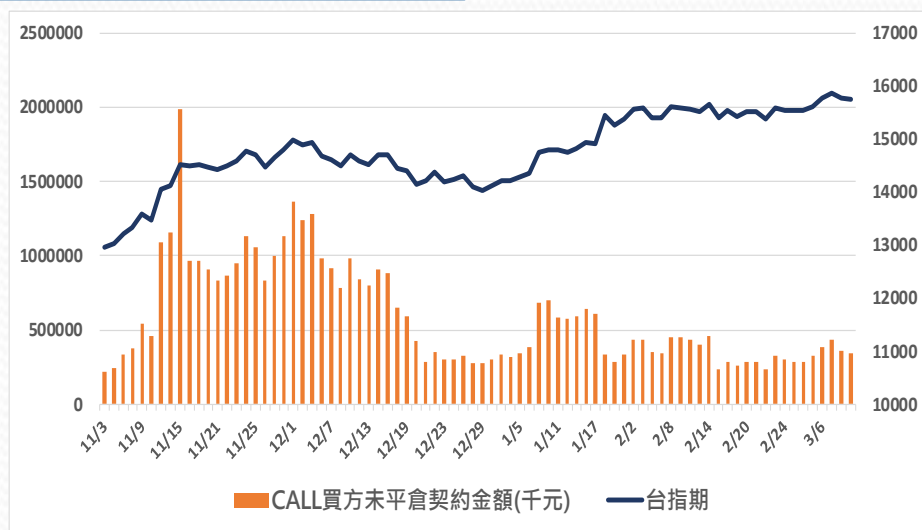
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/3	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
2023/3/9	15766	-4258	-896	-70513	-6102

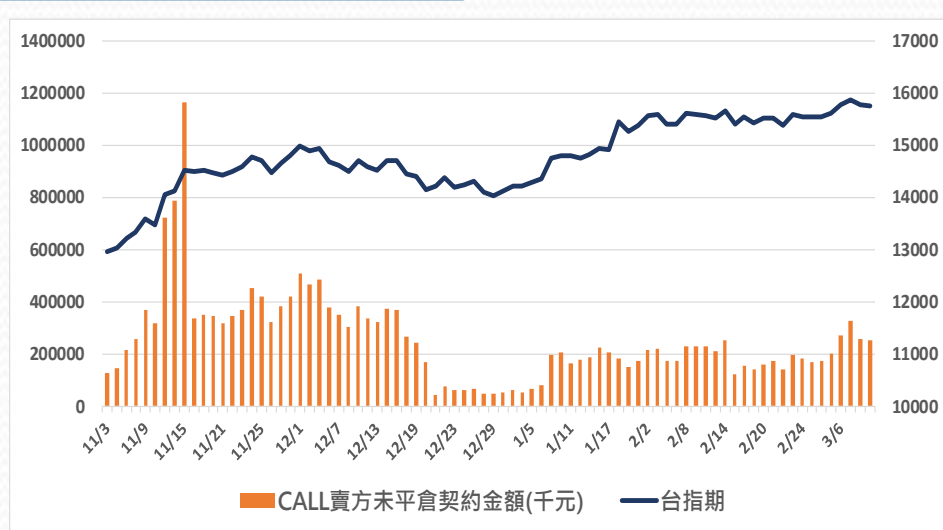
更新日期：2023年3月9日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

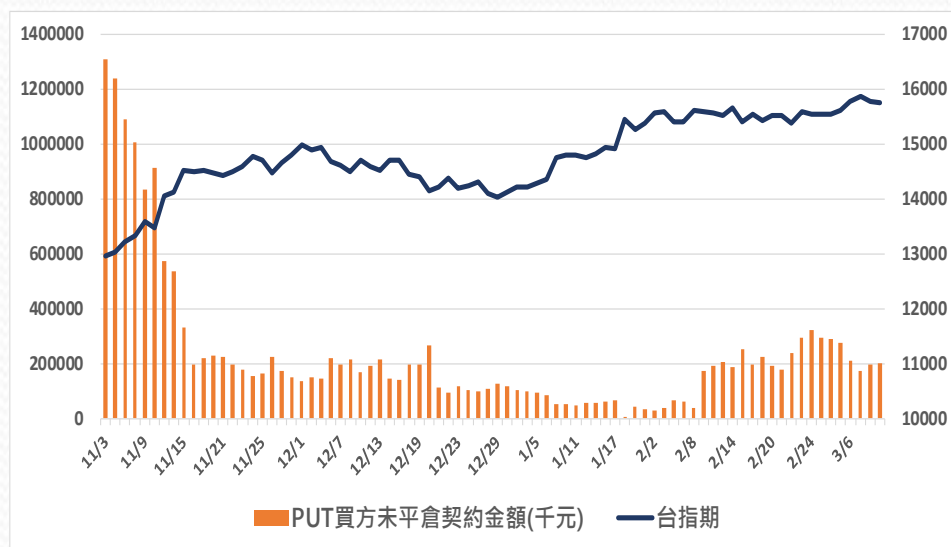
CALL買方未平倉金額



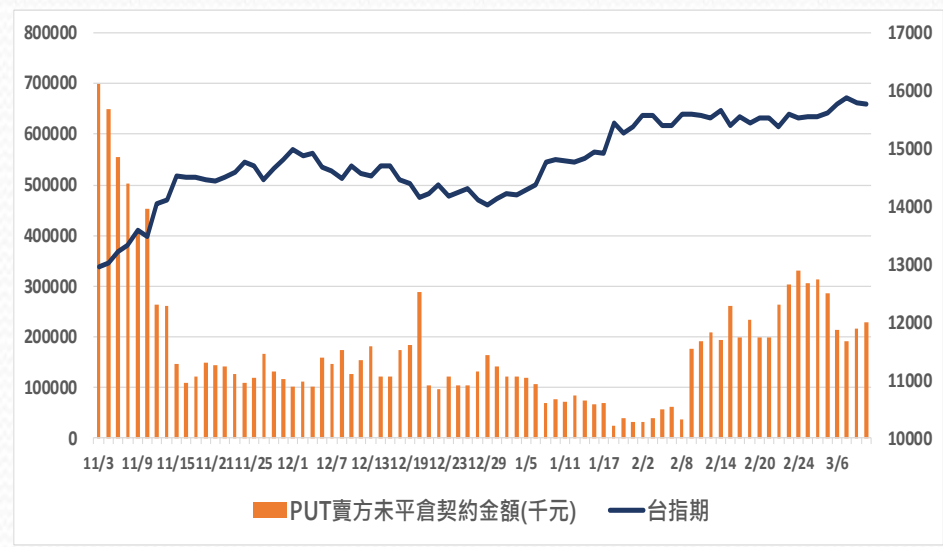
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



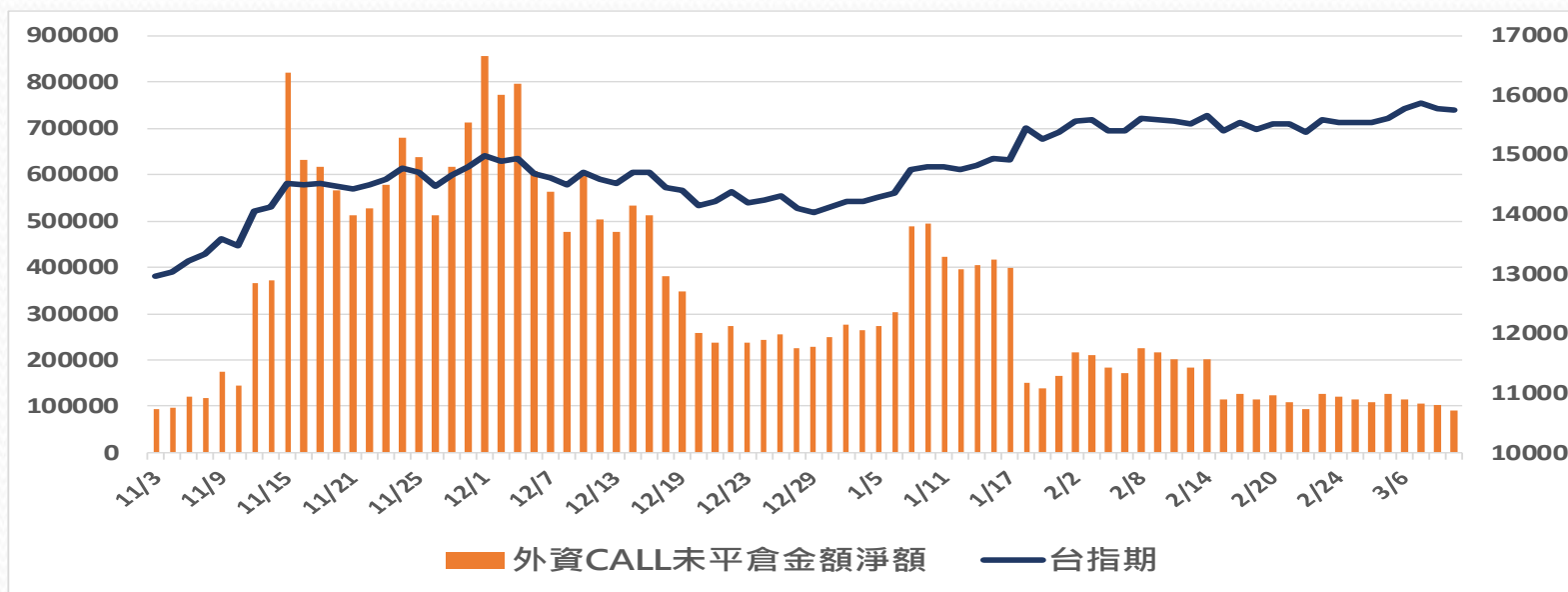
PUT賣方未平倉金額



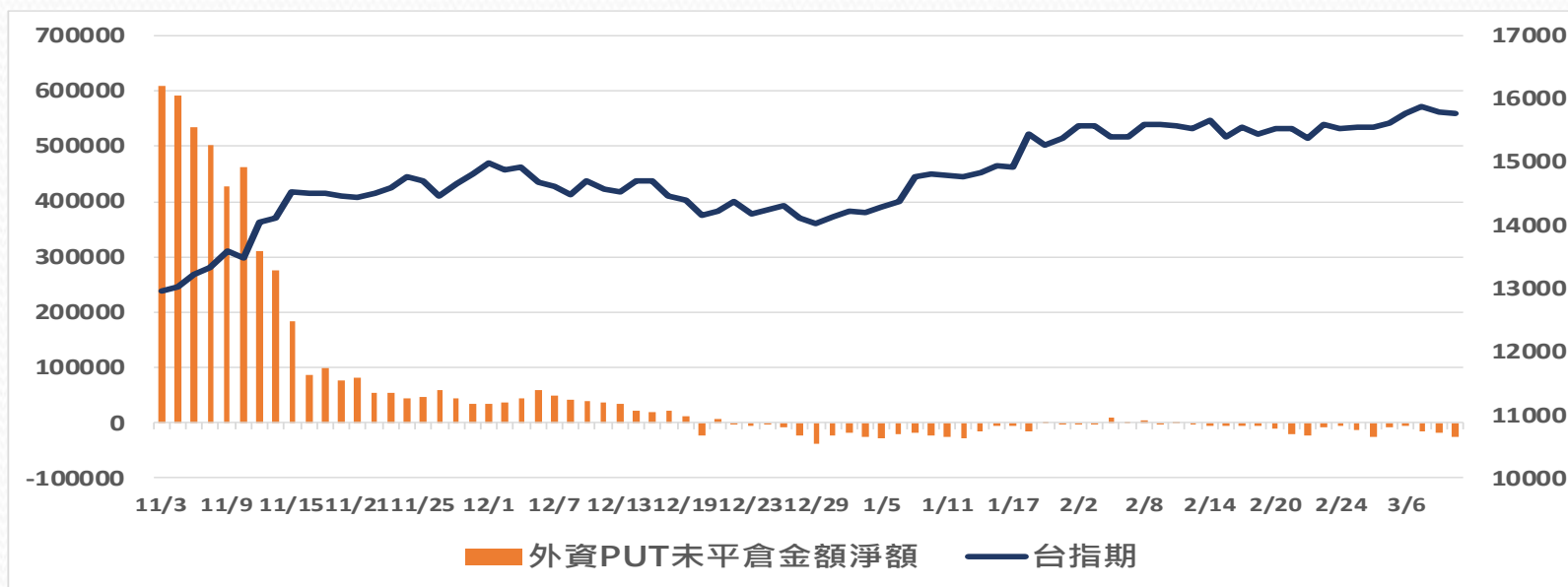
更新日期：2023年3月9日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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9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9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