

台指選擇權OI匯報

日期：2023/3/10 結算日：2023/3/15					日期：2023/3/10 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	1	10,000	11,837	-3	0	0	8,800	0	0
0	90	14,500	4,621	102	0	0	14,200	751	113
-1	234	14,600	3,395	181	0	0	14,300	714	122
-1	87	14,700	4,361	-19	0	9	14,400	869	231
-5	235	14,800	6,082	96	0	16	14,500	1,395	-95
-2	94	14,900	6,041	770	1	14	14,600	832	145
7	452	15,000	11,092	508	0	8	14,700	1,126	28
0	242	15,100	5,070	286	-1	28	14,800	2,365	-10
94	3,358	15,200	9,176	1,996	3	21	14,900	2,865	-60
219	926	15,300	8,367	1,446	23	63	15,000	2,096	569
201	258	15,350	5,236	1,492	2	31	15,100	1,023	101
694	2,308	15,400	11,130	-60	6	47	15,200	1,267	310
957	1,011	15,450	5,717	632	36	81	15,300	816	-64
1,429	4,831	15,500	10,486	289	15	187	15,400	1,238	-48
4,757	5,519	15,550	3,774	-1,026	434	800	15,500	7,785	-21
5,246	8,650	15,600	5,331	-2,211	576	881	15,600	543	-60
4,572	5,866	15,650	2,621	-421	591	967	15,700	587	110
6,747	11,183	15,700	3,460	-1,123	460	966	15,800	554	13
7,428	9,747	15,750	2,037	-626	697	1,570	15,900	73	2
6,300	14,282	15,800	2,576	-1,009	1,142	2,942	16,000	60	-8
※ 8,993	13,867	15,850	732	-276	※ 1,713	3,452	16,100	56	1
4,958	14,218	15,900	891	-429	533	2,515	16,200	63	7
1,552	7,298	15,950	418	-82	183	2,706	16,300	55	2
915	17,981	16,000	474	-283	123	2,213	16,400	2	0
-981	5,527	16,050	194	52	-87	2,278	16,500	3	-1
-2,108	14,020	16,100	232	-63	-93	1,373	16,600	0	0
-2,351	3,398	16,150	10	0	79	773	16,700	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
45,096	215,274	0.7950	171,144	1,020	8,836	36,103	0.9377	33,853	2,033
昨日 P/C	0.9301	今日增減變化	-0.1351		昨日 P/C	1.1670	今日增減變化	-0.2293	

更新日期：2023年3月10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10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	85,369,905	66,172,547	19,197,358	-13,019,710	3,583,498	2,186,276	1,397,222	-431,888	
投信	22,549,169	51,517,786	-28,968,617	-2,476,633	398,834	0	398,834	-79,272	
自營商	56,862,837	28,066,013	28,796,824	1,271,082	1,516,287	1,178,364	337,923	100,216	
	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	544,897	1,834,730	-1,289,833	209,875	333,630	4,488	329,142	17,234	
投信	129,293	0	129,293	-1,932	0	0	0	0	
自營商	440,299	317,182	123,117	46,566	55,299	369,369	-314,070	-17,598	

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10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	41,604	20,871	20,733	6,651	46,254	37,643	8,611	6,404	
投信	100	0	100	50	500	113	387	100	
自營商	74,719	83,901	-9,182	-10,035	64,848	57,866	6,982	1,871	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	21,548	5,488	16,060	2,300	10,244	19,219	-8,975	-3,449	
特定法人(全月)	28,419	8,686	19,733	1,071	27,575	34,160	-6,585	-4,968	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	75,281	80,900	-5,619	-7,083	71,053	63,012	8,041	-4,190	
十大交易人(全月)	111,399	103,081	8,318	-1,331	89,647	97,470	-7,823	-8,556	
全市場未沖銷(近月)			215,358	45,142			182,686	4,440	
全市場未沖銷(全月)			275,236	61,040			243,160	9,810	

更新日期：2023年3月10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	15800	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	15.44%	較前一交易日	+1.60%
	買權隱含波動率	12.67%	較前一交易日	+0.06%
	賣權隱含波動率	19.25%	較前一交易日	+4.21%
電子選擇權	買權成交最大量	760	買權OI最大量	750
	賣權成交最大量	670	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	1520	賣權OI最大量	1540

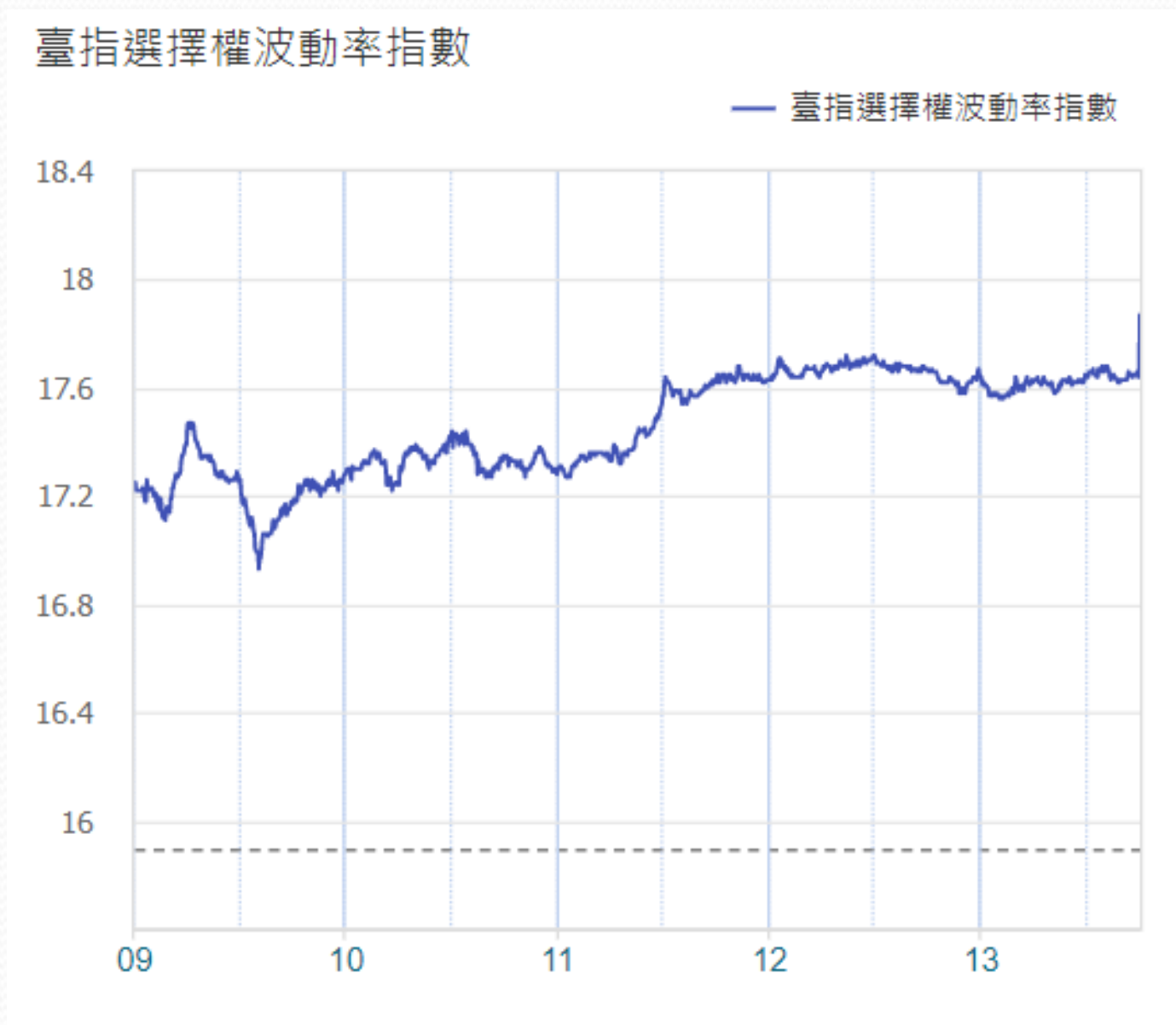
更新日期：2023年3月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	16100	買權OI最大量	16100
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	15.94%	較前一交易日	-0.65%
	買權隱含波動率	13.62%	較前一交易日	+0.89%
	賣權隱含波動率	20.46%	較前一交易日	+2.06%
	成交量P/C_Ratio值	0.549	較前一交易日	-0.18
	未平倉P/C_Ratio值	0.938	較前一交易日	-0.23
電子選擇權	買權成交最大量	760	買權OI最大量	750
	賣權成交最大量	670	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	1520	賣權OI最大量	1540

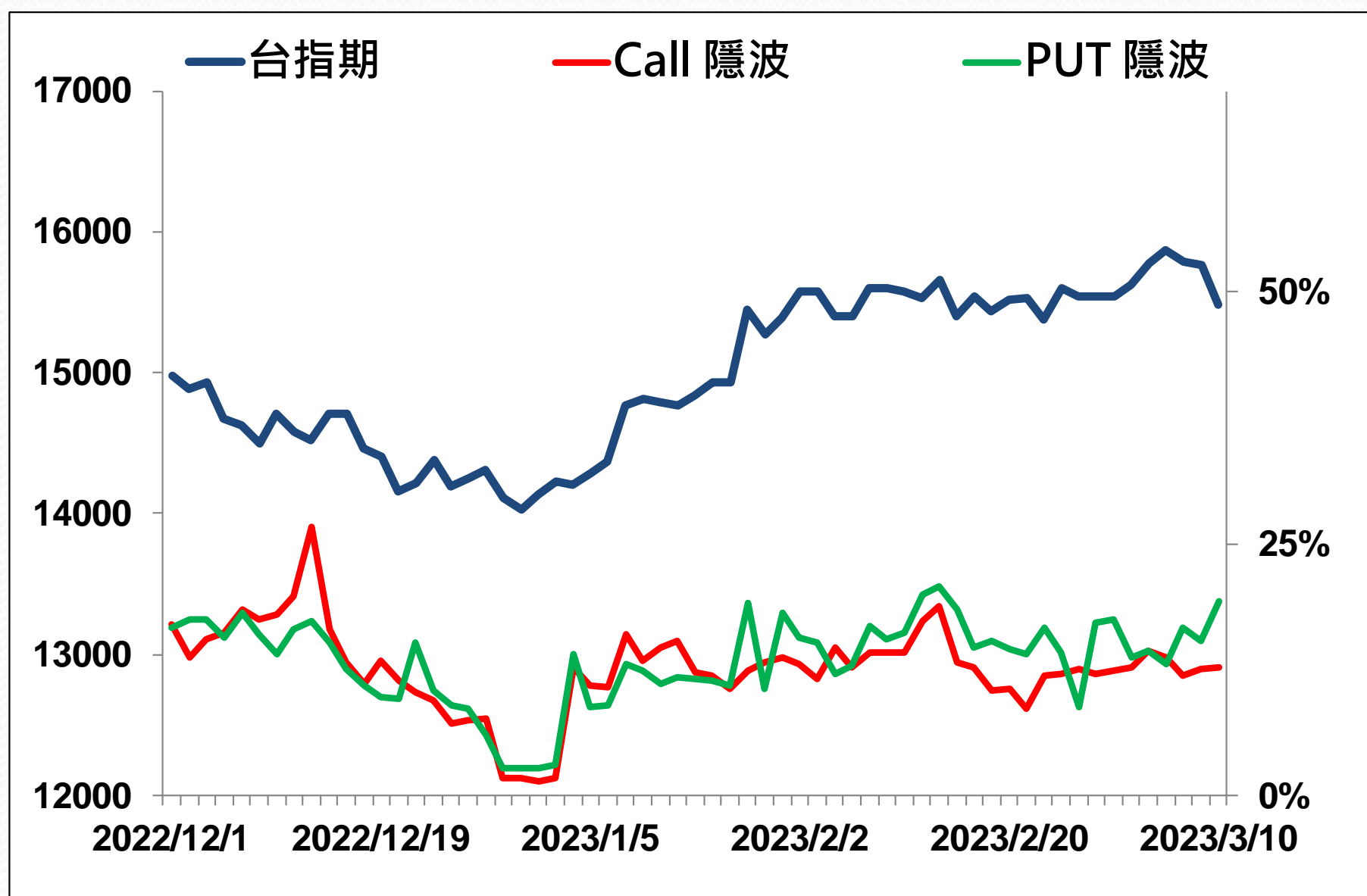
更新日期：2023年3月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



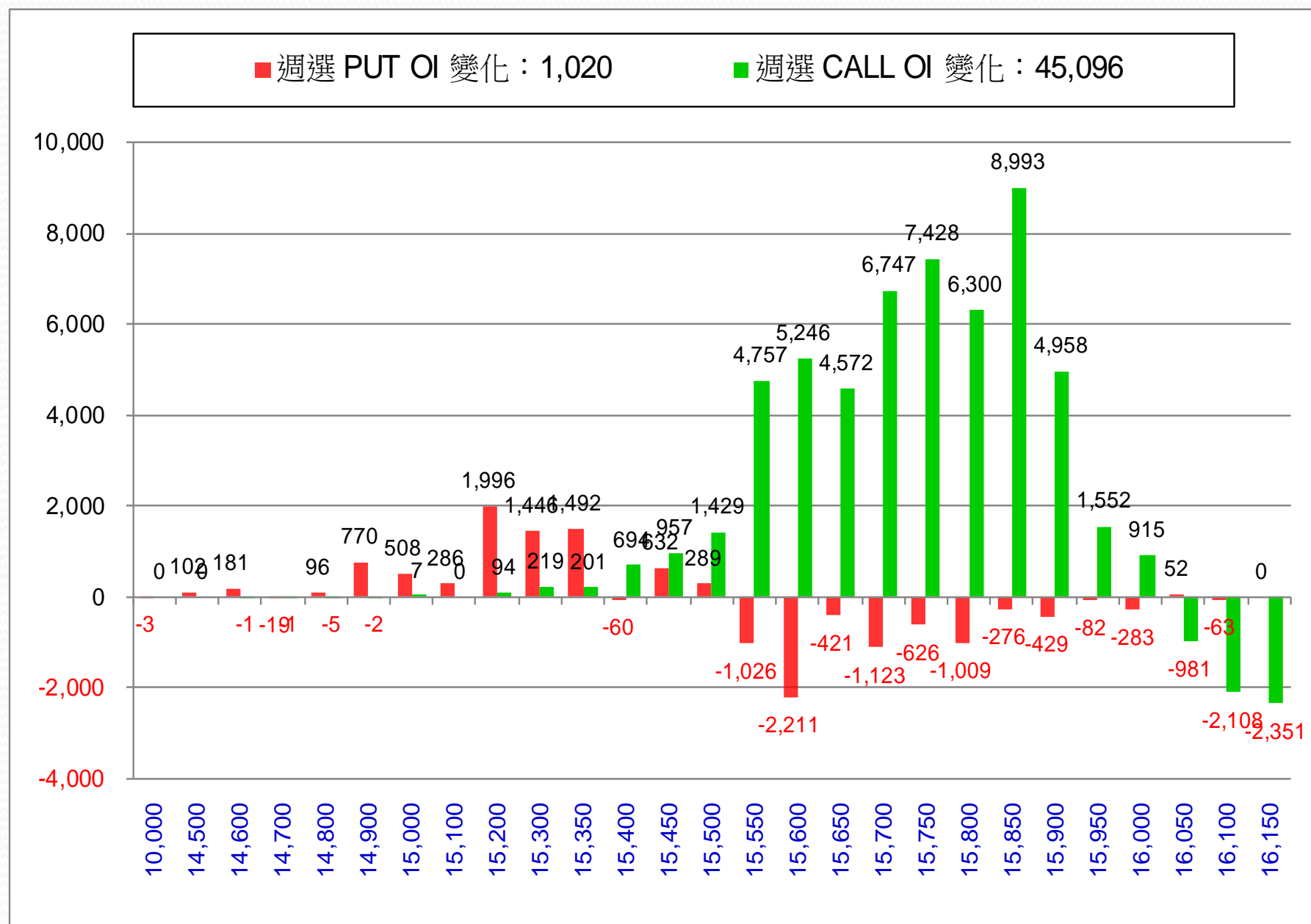
更新日期：2023年3月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



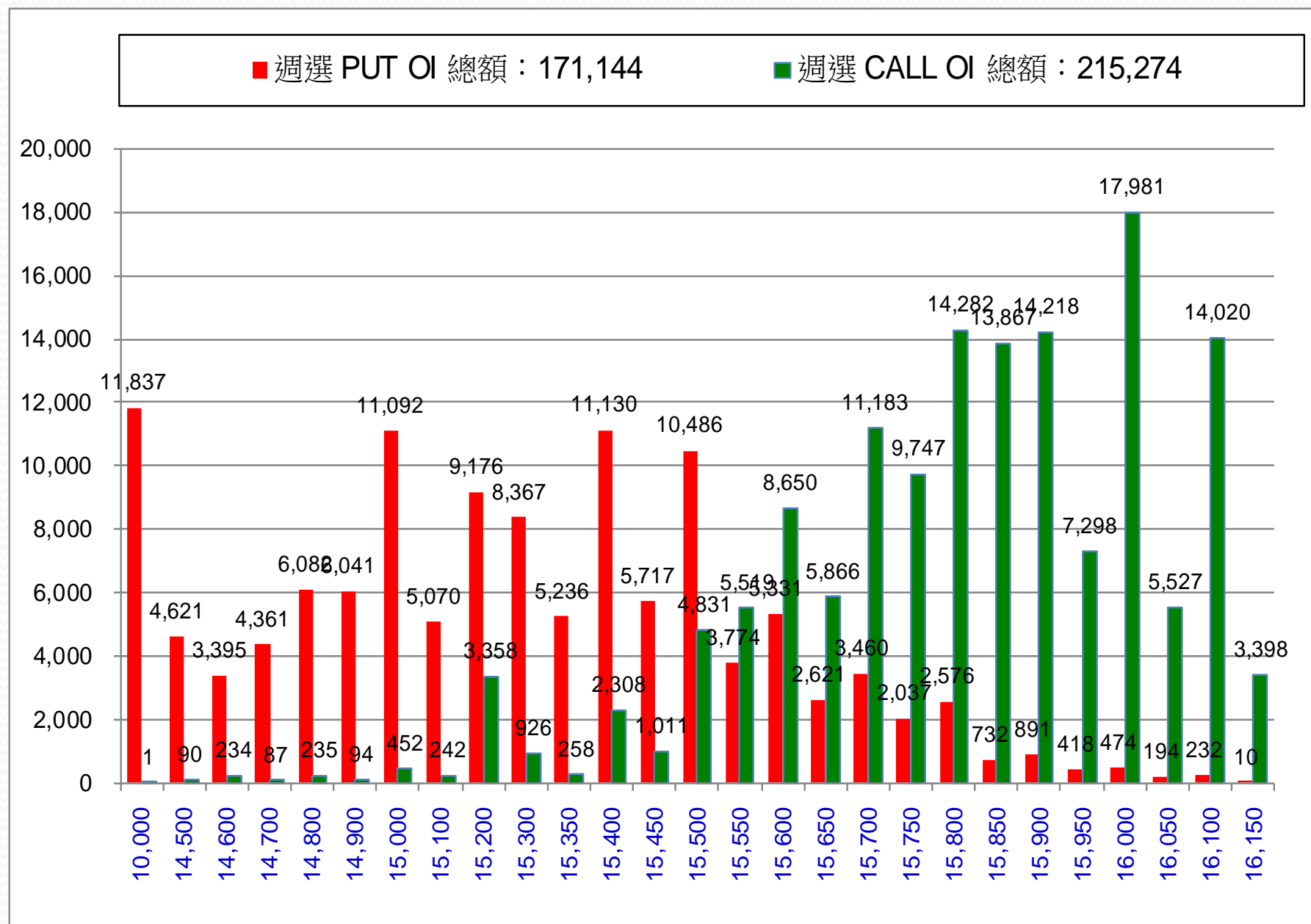
更新日期：2023年3月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年3月10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



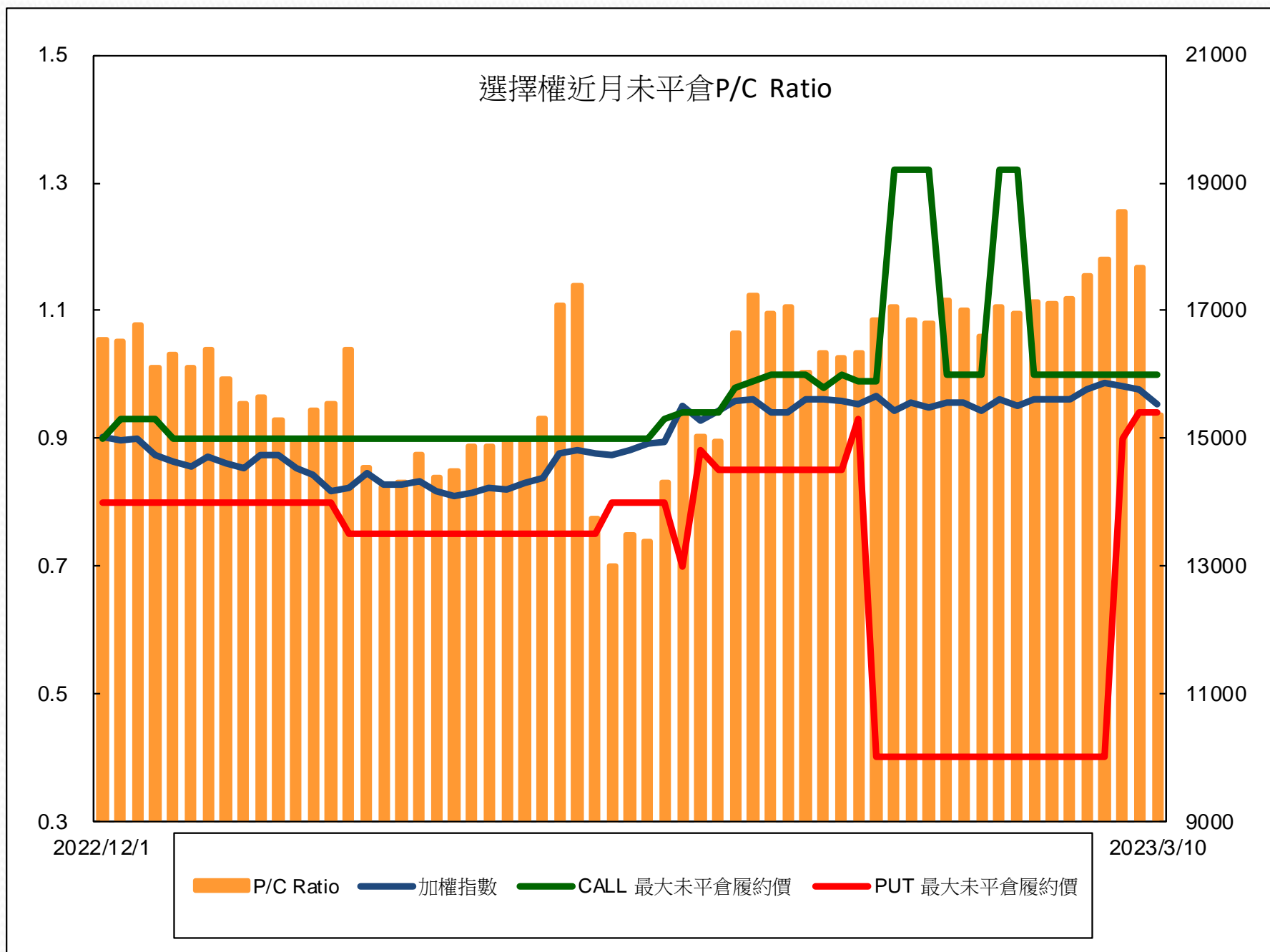
更新日期：2023年3月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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9日	65,403	64,550	853
	3月10日	74,719	83,901	-9,182
Put	3月9日	62,996	57,885	5,111
	3月10日	64,848	57,866	6,982

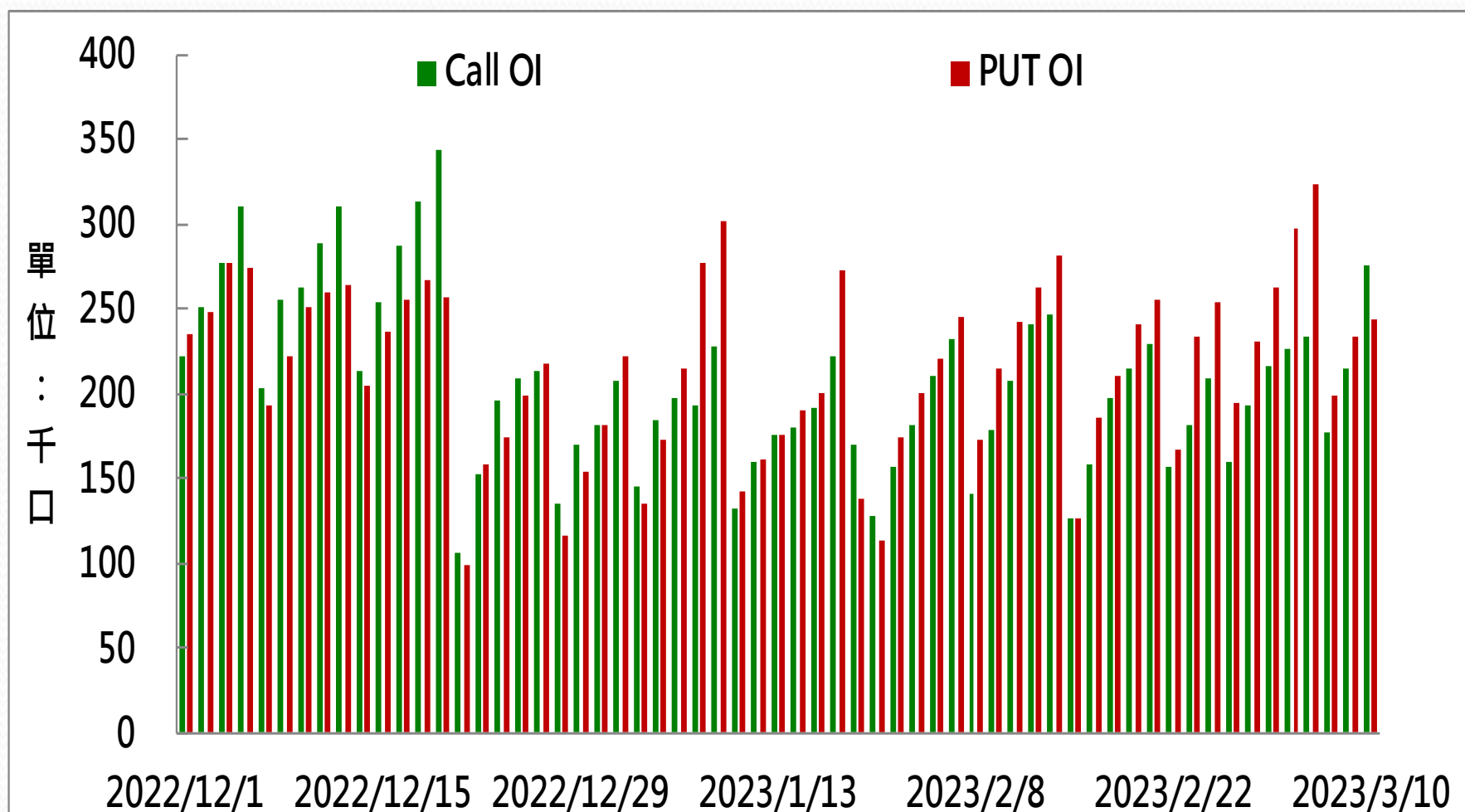
更新日期：2023年3月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

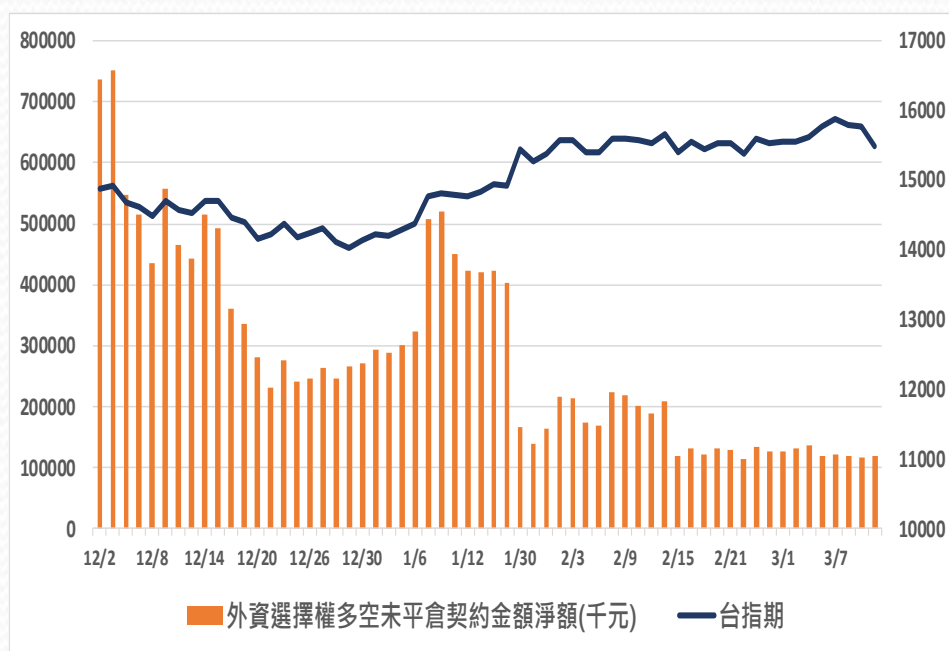
選擇權全月Put Call OI



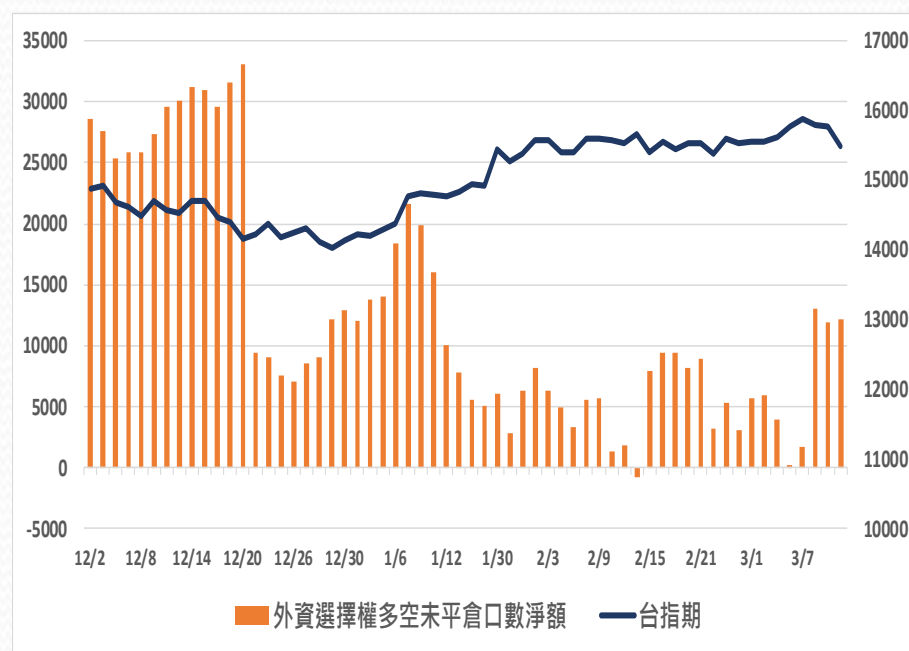
更新日期：2023年3月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



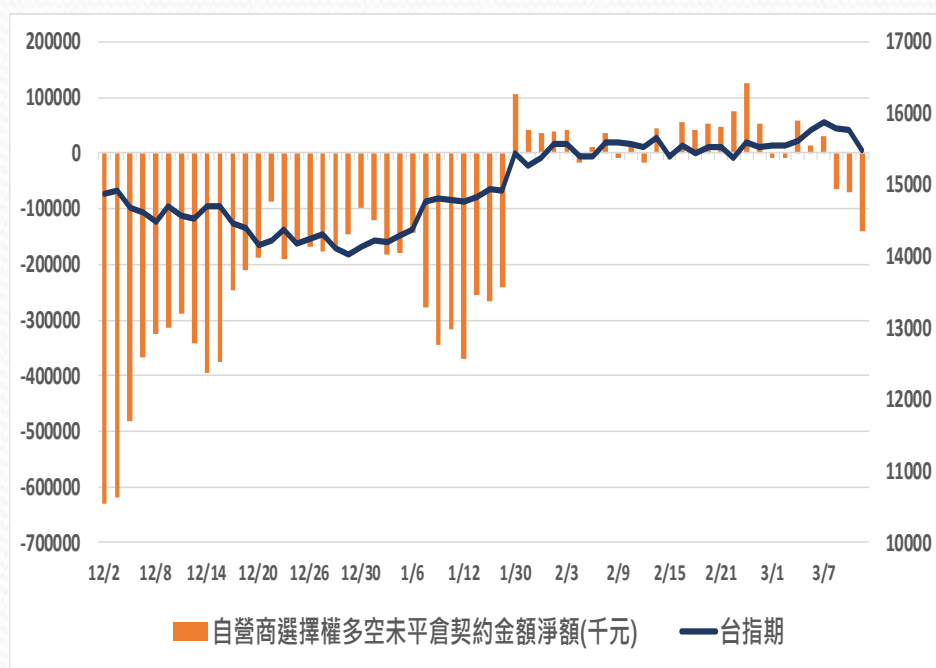
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/6	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
2023/3/10	15481	12122	247	119028	2787

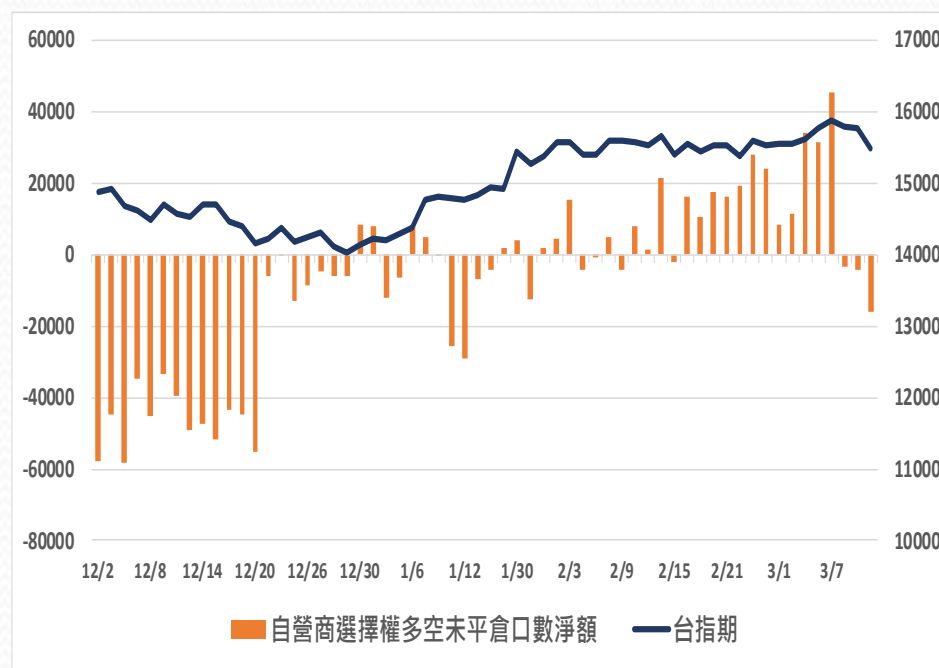
更新日期：2023年3月10日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



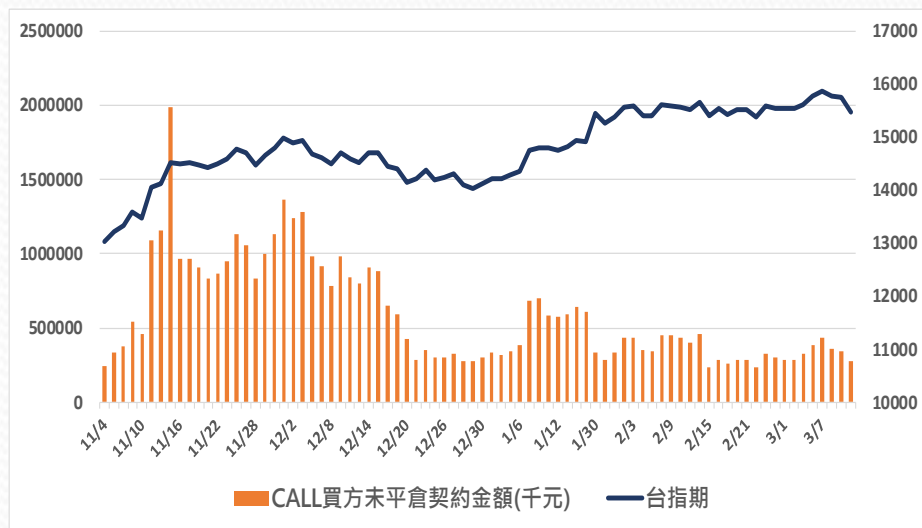
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/6	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
2023/3/10	15481	-16164	-11906	-138817	-68304

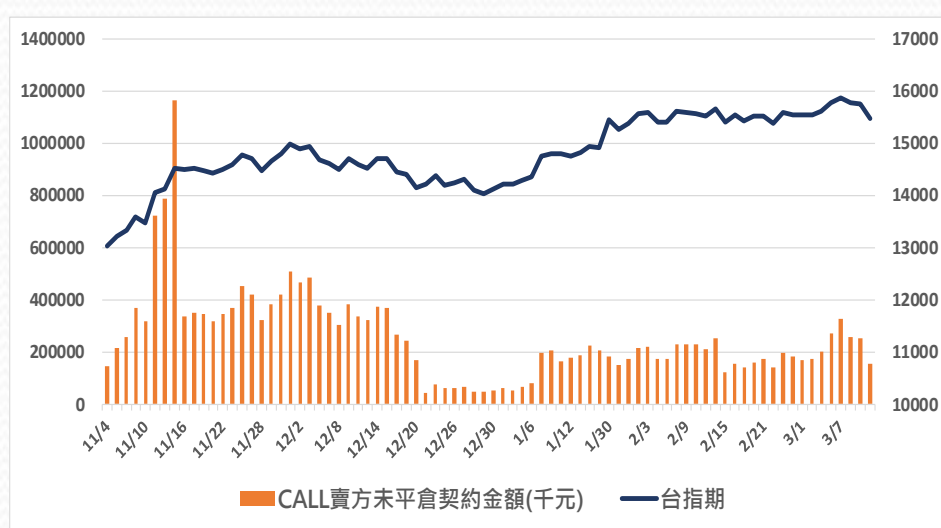
更新日期：2023年3月10日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

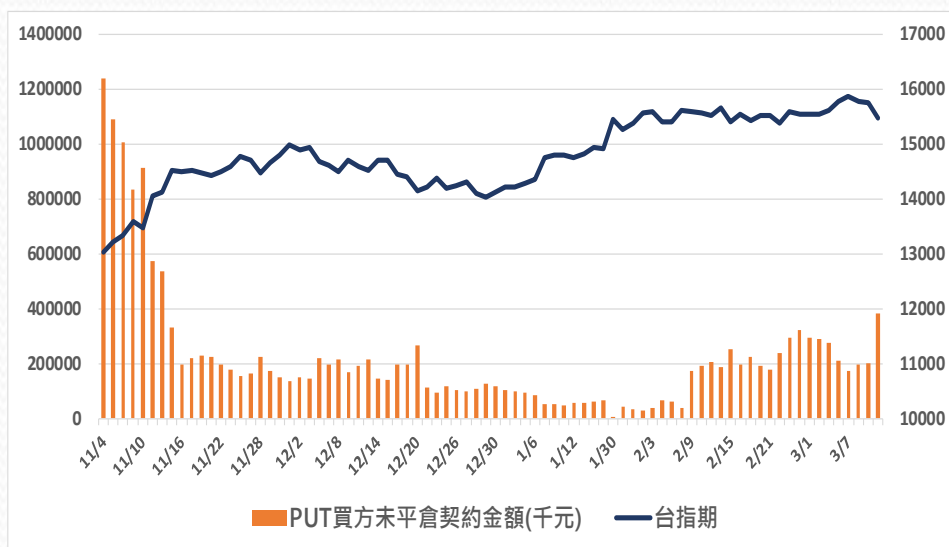
CALL買方未平倉金額



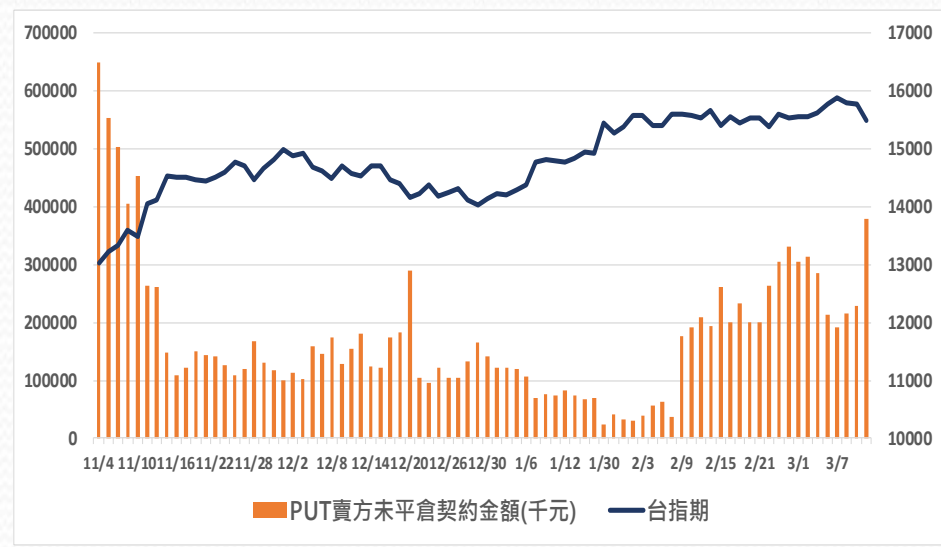
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



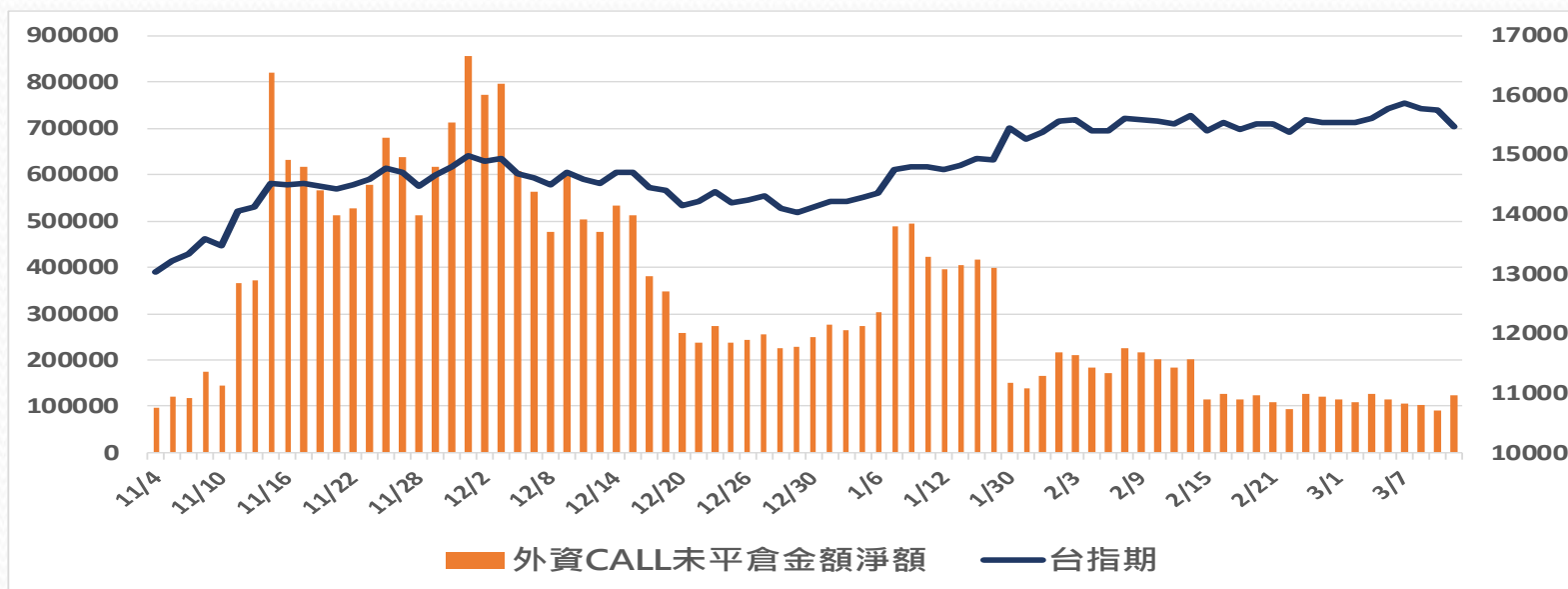
PUT賣方未平倉金額



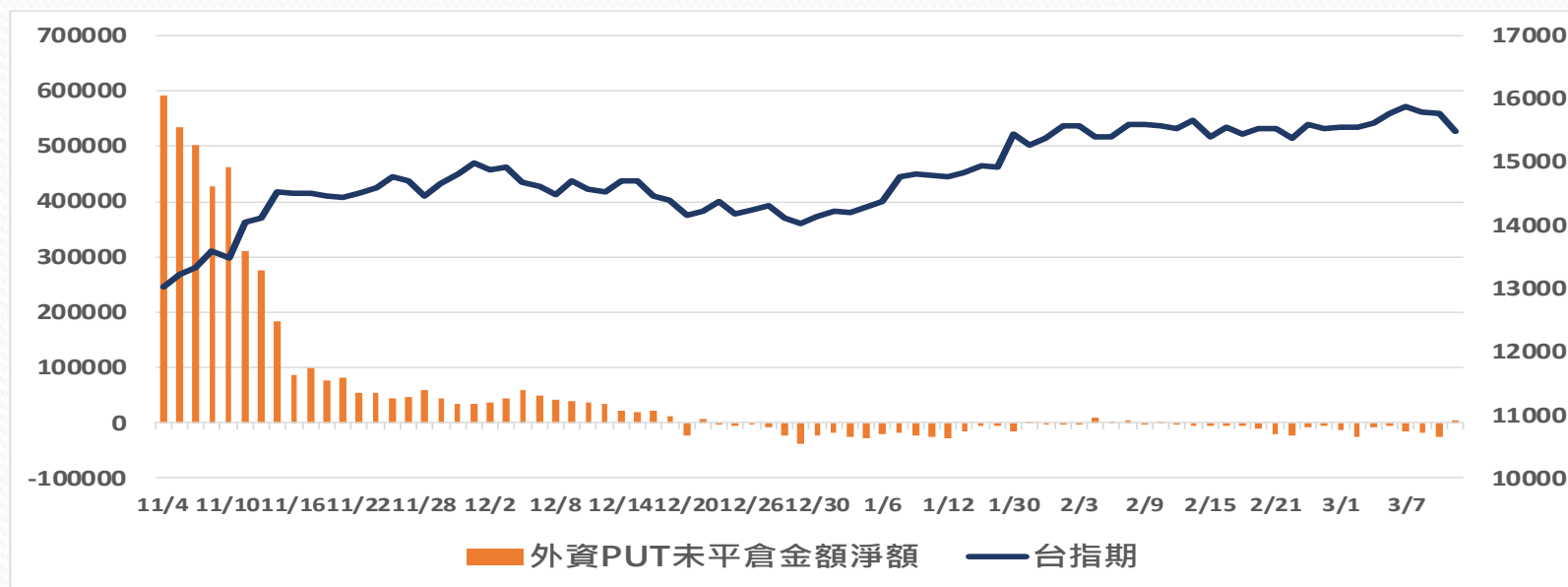
更新日期：2023年3月10日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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10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10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