

台指選擇權OI匯報

日期：2023/3/14 結算日：2023/3/15					日期：2023/3/14 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
1	49	14,300	2,362	-20	1	1	14,100	673	-25
-2	184	14,400	3,767	197	0	0	14,200	944	133
2	92	14,500	5,414	791	4	4	14,300	967	204
-12	219	14,600	4,203	339	56	89	14,400	1,298	279
0	82	14,700	5,044	461	6	23	14,500	1,507	45
1	233	14,800	7,406	307	4	20	14,600	1,453	488
3	113	14,900	8,907	2,123	7	18	14,700	1,583	-13
19	455	15,000	17,843	1,108	18	49	14,800	2,495	30
-14	234	15,100	10,726	2,144	6	27	14,900	3,065	58
137	173	15,150	7,576	1,503	22	81	15,000	2,105	-143
711	4,127	15,200	12,548	1,312	44	323	15,100	1,079	-6
620	957	15,250	7,511	928	44	120	15,200	1,416	36
1,251	2,825	15,300	12,302	1,225	82	223	15,300	918	-22
3,364	3,948	15,350	7,957	785	172	417	15,400	1,313	-24
4,971	8,972	15,400	11,570	-414	1,087	2,573	15,500	7,738	-182
5,223	7,040	15,450	4,963	-1,956	275	1,283	15,600	536	-6
4,935	12,577	15,500	7,787	-3,519	576	1,744	15,700	542	-17
3,388	10,371	15,550	3,302	-1,425	344	1,850	15,800	546	-3
6,004	18,161	15,600	4,405	-449	155	1,699	15,900	65	0
4,302	12,743	15,650	2,310	-178	-4	2,793	16,000	64	-6
1,194	17,303	15,700	2,628	-383	-883	2,908	16,100	58	2
-1,501	11,865	15,750	1,701	-127	138	3,067	16,200	63	0
-3,142	13,217	15,800	2,146	-140	323	2,808	16,300	55	0
-4,668	8,309	15,850	535	-65	405	3,062	16,400	2	0
-2,641	9,683	15,900	738	-3	47	2,396	16,500	4	1
-1,646	5,096	15,950	398	-6	128	1,675	16,600	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
16,012	246,007	0.8476	208,505	4,326	4,178	44,339	0.8541	37,871	1,608
昨日 P/C	0.8878	今日增減變化	-0.0402		昨日 P/C	0.9029	今日增減變化	-0.0488	

更新日期：2023年3月14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14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	78,698,224	55,398,405	23,299,819	-10,105,285	3,701,302	2,338,868	1,362,434	-278,156	
投信	22,929,167	51,576,904	-28,647,737	-1,523,874	359,985	0	359,985	-22,942	
自營商	55,218,489	24,724,321	30,494,168	5,112,292	1,323,777	1,176,360	147,417	18,995	
	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	870,968	1,794,881	-923,913	172,607	234,972	1,488	233,484	-15,546	
投信	111,548	0	111,548	-16,722	0	0	0	0	
自營商	421,984	521,482	-99,498	-85,300	178,861	405,785	-226,924	2,357	

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14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	43,593	24,760	18,833	-416	57,521	39,340	18,181	2,227	
投信	100	0	100	0	500	113	387	0	
自營商	84,266	94,922	-10,656	-9,626	76,412	63,728	12,684	9,954	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	22,202	8,214	13,988	-3,899	9,793	26,094	-16,301	-659	
特定法人(全月)	29,059	12,421	16,638	-552	22,566	40,712	-18,146	-1,966	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	78,863	89,675	-10,812	-8,059	70,691	76,203	-5,512	-8,767	
十大交易人(全月)	120,803	117,262	3,541	-9,499	95,497	115,924	-20,427	-11,182	
全市場未沖銷(近月)			246,023	16,022			213,749	5,235	
全市場未沖銷(全月)			324,915	26,085			289,526	12,936	

更新日期：2023年3月14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	15600	買權OI最大量	15600
	賣權成交最大量	15300	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	19.62%	較前一交易日	+2.45%
	買權隱含波動率	17.98%	較前一交易日	+4.92%
	賣權隱含波動率	21.48%	較前一交易日	-0.34%
電子選擇權	買權成交最大量	710	買權OI最大量	710
	賣權成交最大量	660	賣權OI最大量	690
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	1500	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年3月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

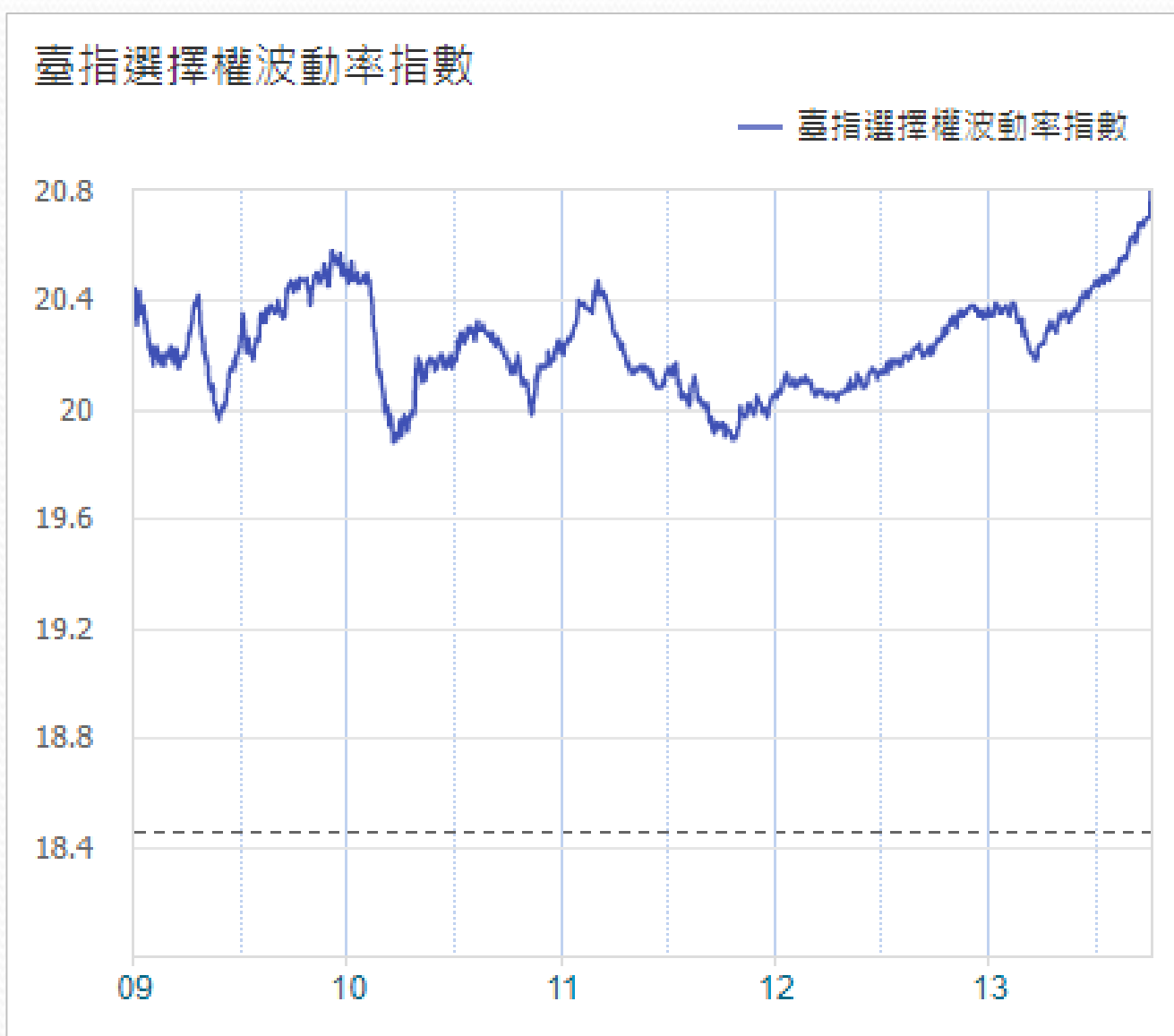
台指選擇權匯報

2023年04月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16000	買權OI最大量	18300
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	19.03%	較前一交易日	-1.71%
	買權隱含波動率	15.16%	較前一交易日	+1.85%
	賣權隱含波動率	23.42%	較前一交易日	+1.56%
	成交量P/C_Ratio值	0.892	較前一交易日	+0.02
	未平倉P/C_Ratio值	0.854	較前一交易日	-0.05
電子選擇權	買權成交最大量	710	買權OI最大量	710
	賣權成交最大量	660	賣權OI最大量	690
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	1500	賣權OI最大量	1540

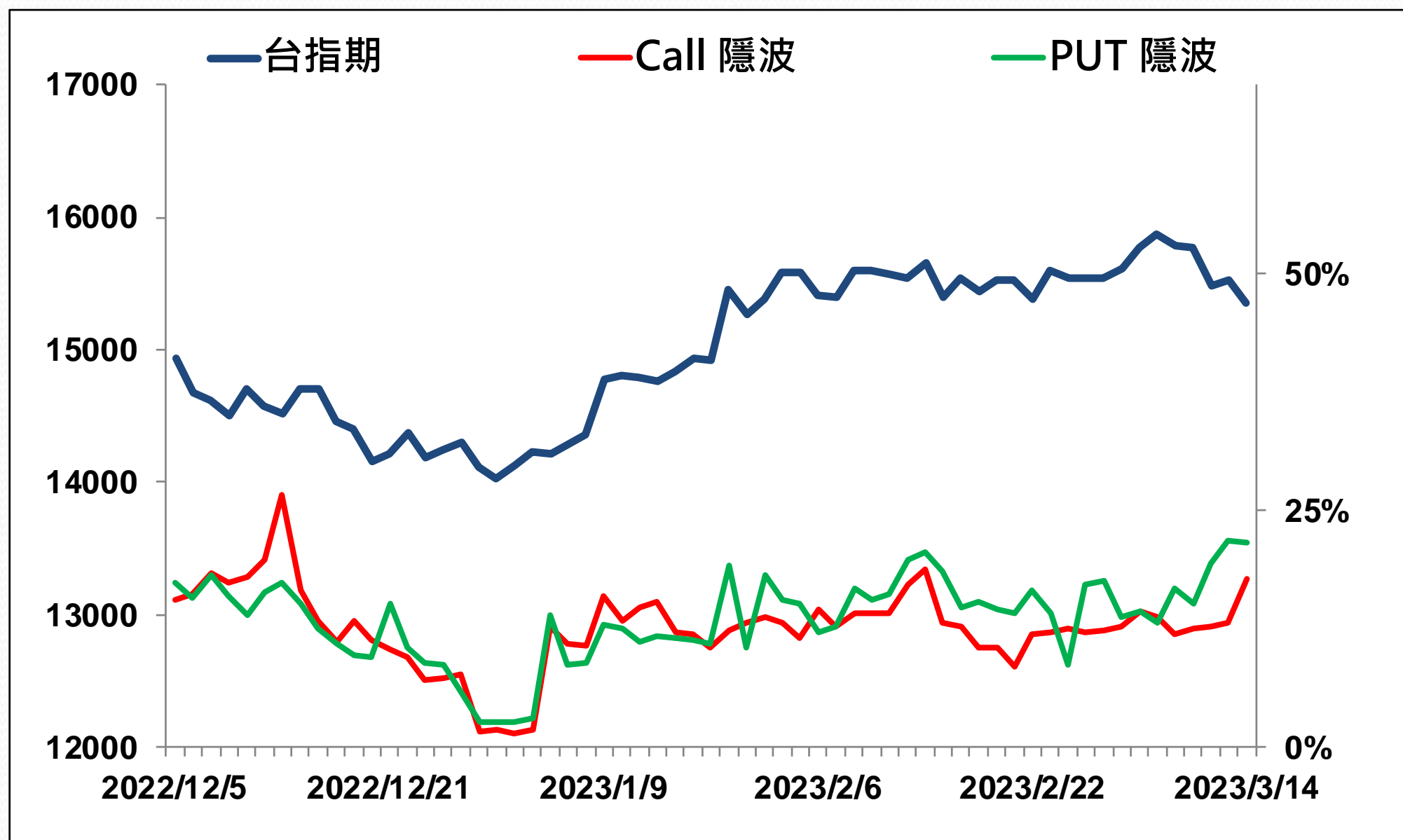
更新日期：2023年3月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



更新日期：2023年3月14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

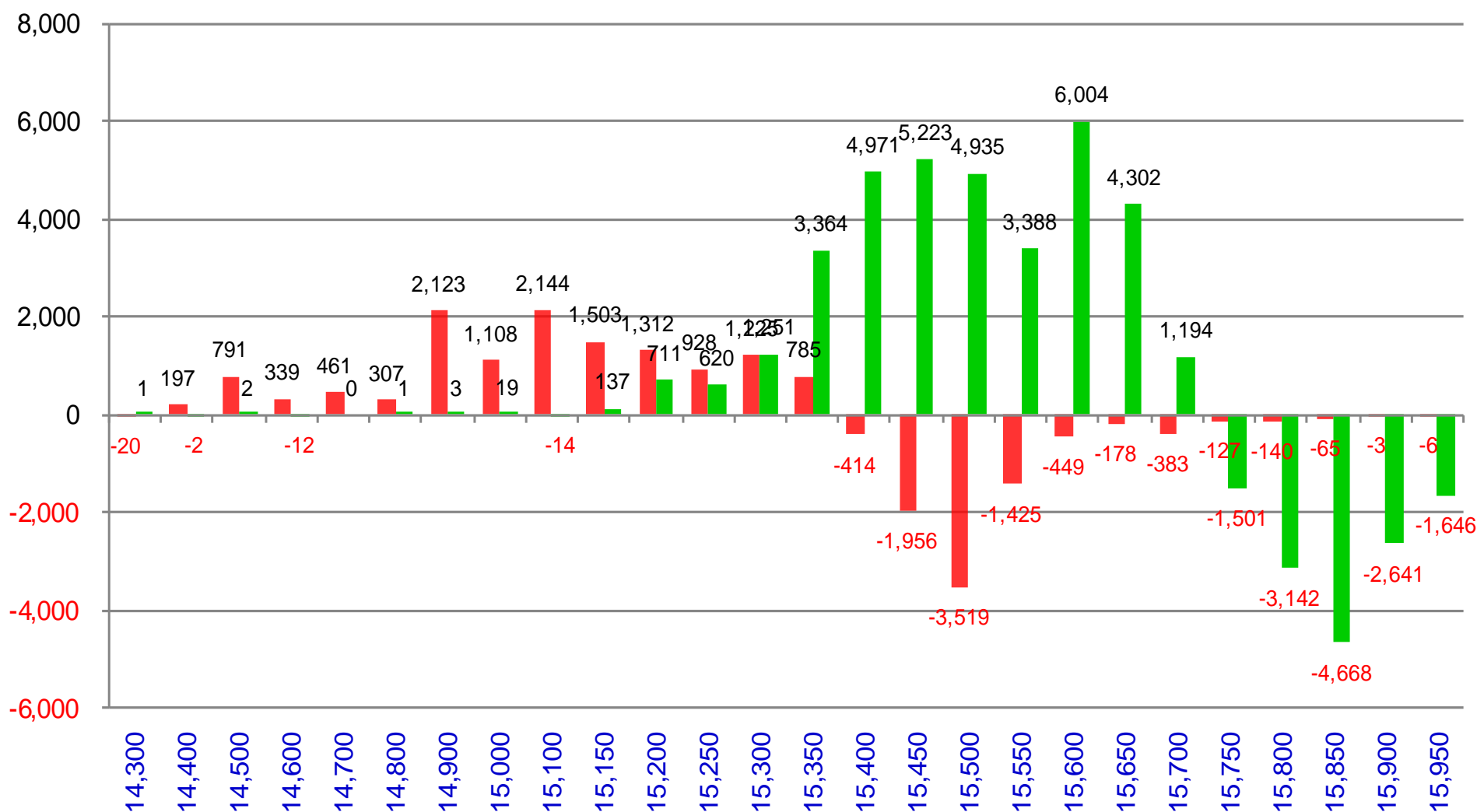


更新日期：2023年3月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：4,326

週選 CALL OI 變化：16,012

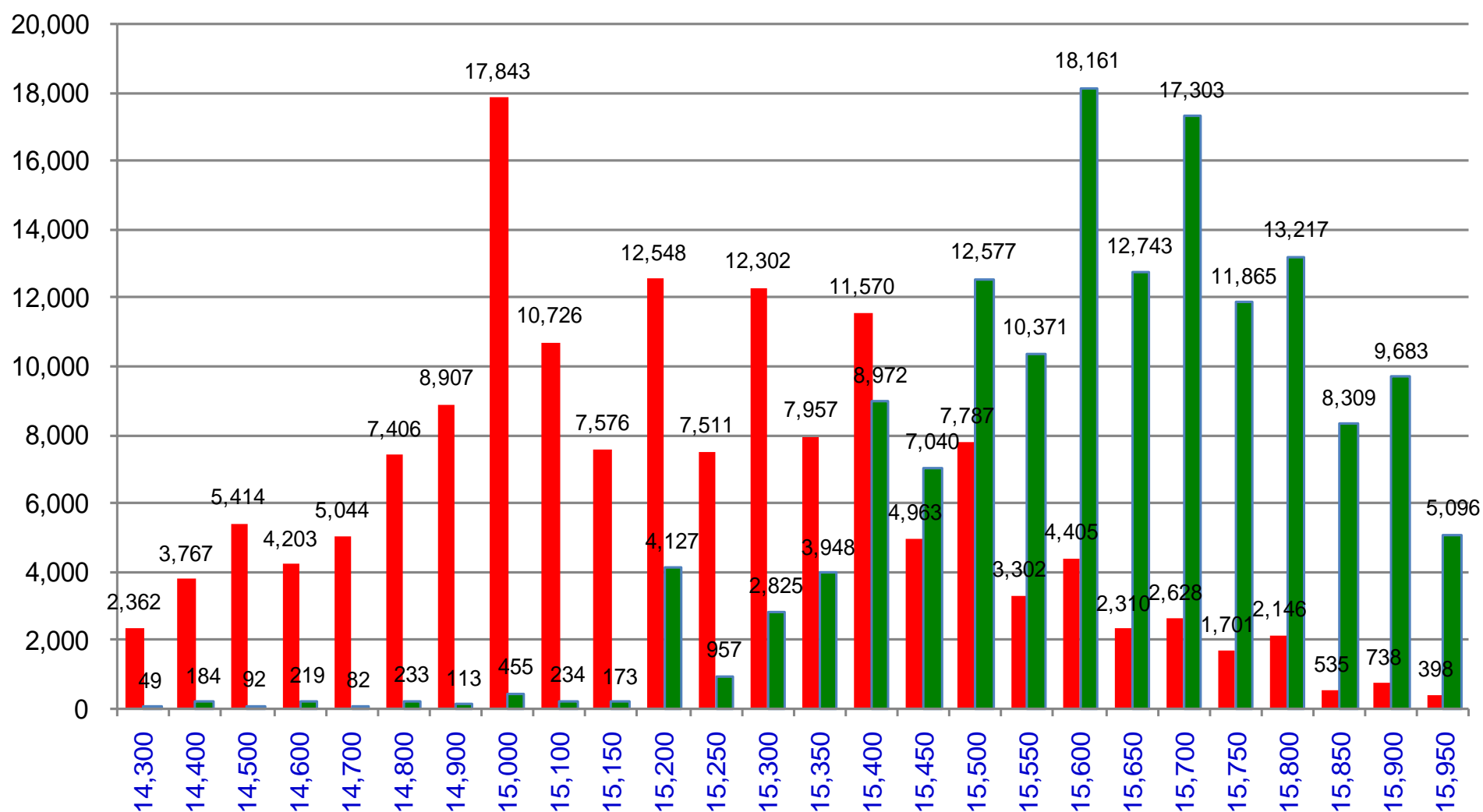


更新日期：2023年3月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：208,505

週選 CALL OI 總額：246,007



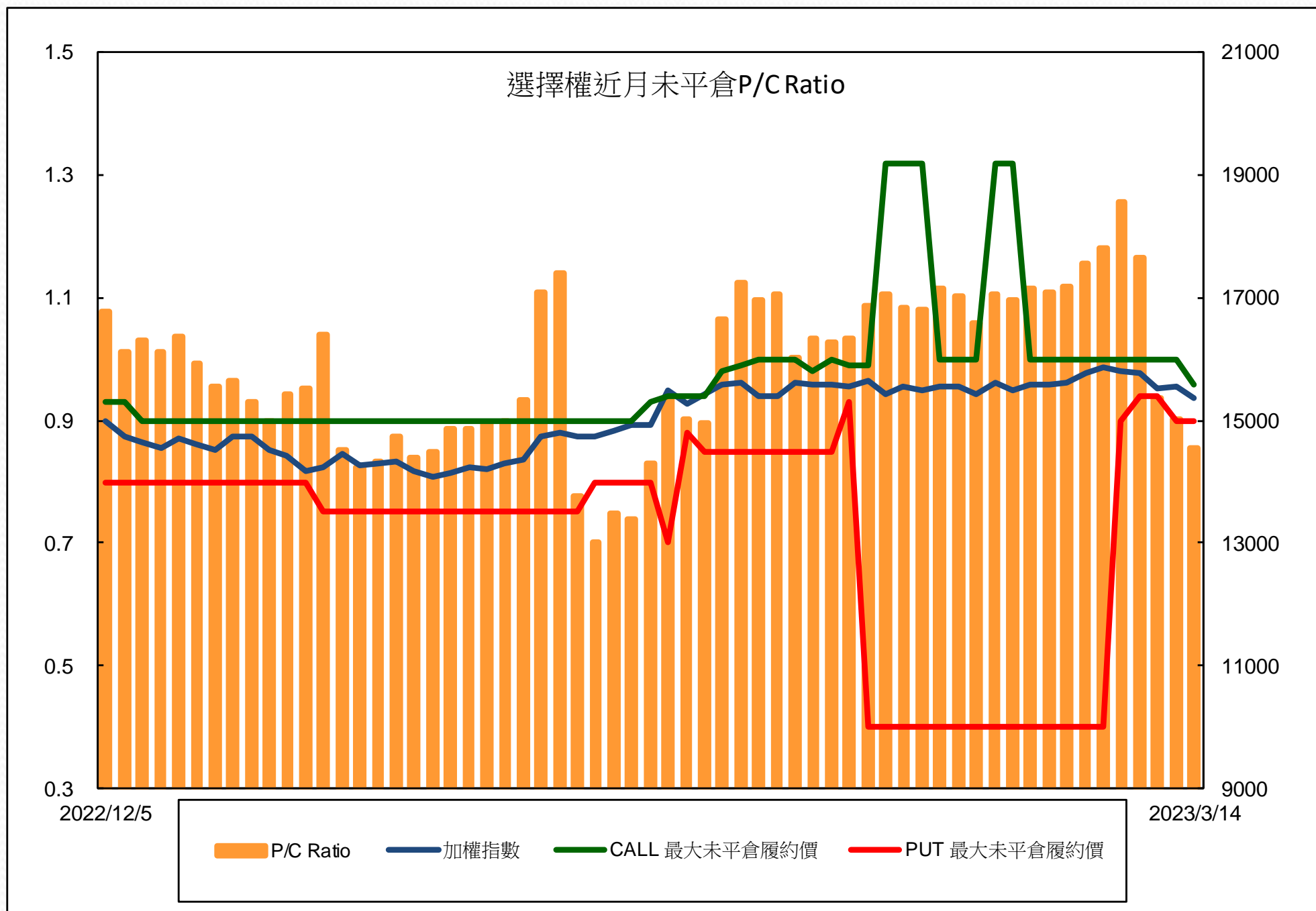
更新日期：2023年3月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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13日	84,055	85,085	-1,030
	3月14日	84,266	94,922	-10,656
Put	3月13日	68,298	65,568	2,730
	3月14日	76,412	63,728	12,684

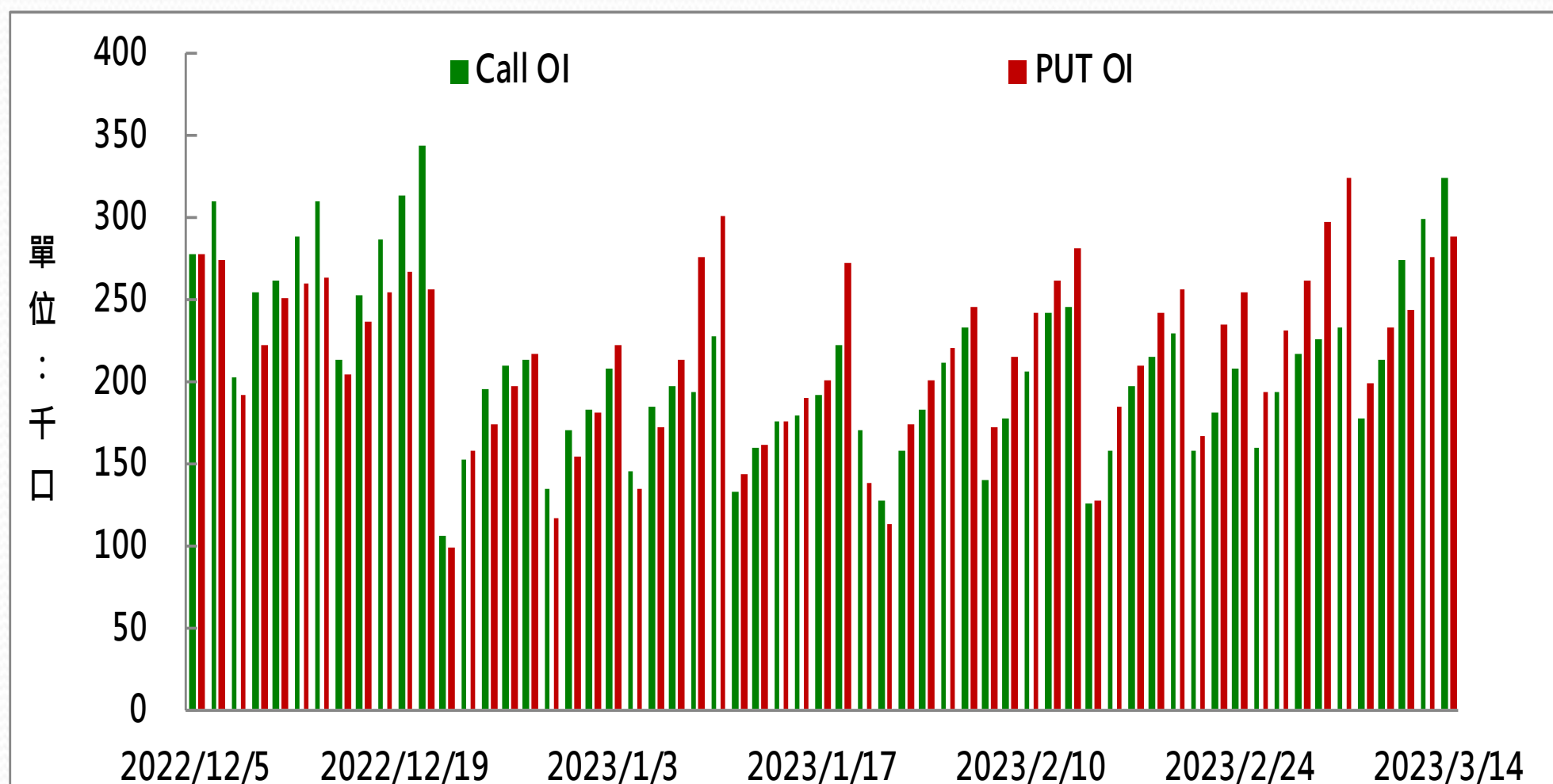
更新日期：2023年3月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

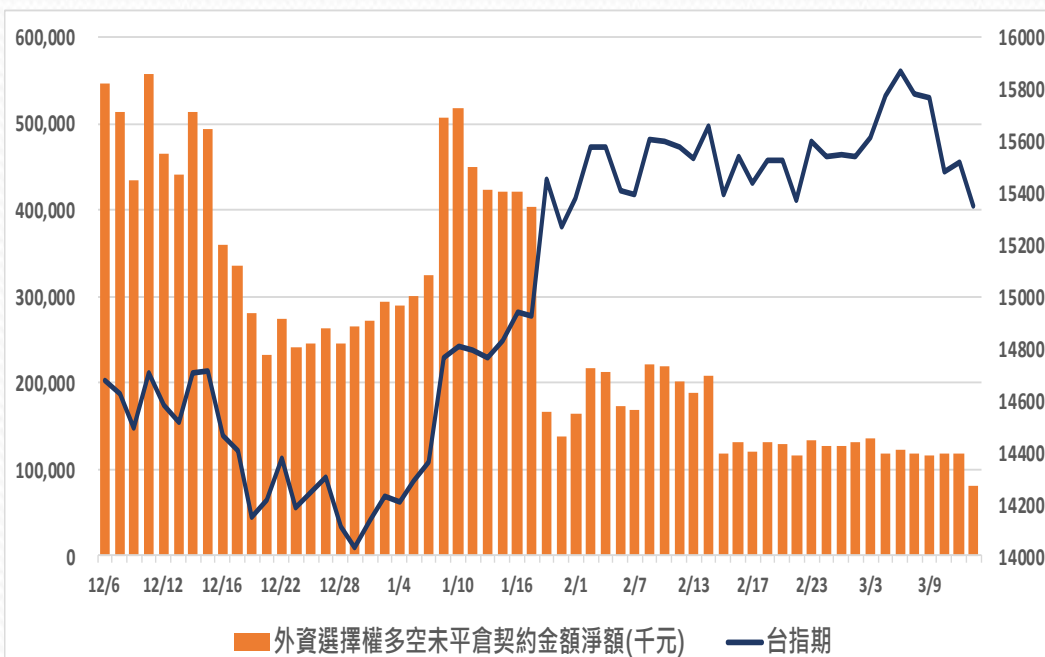
選擇權全月Put Call OI



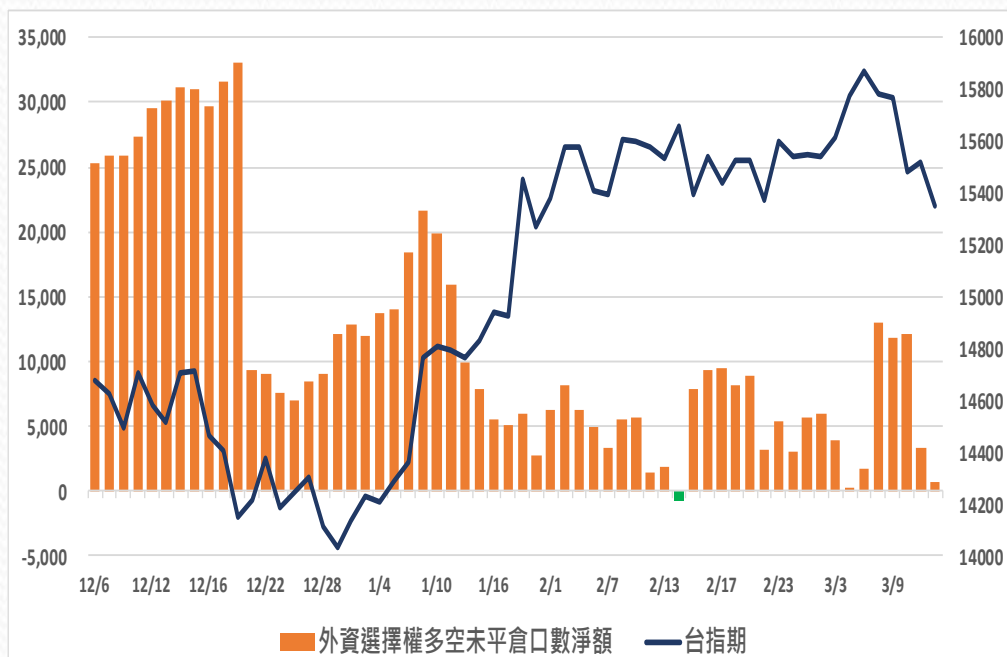
更新日期：2023年3月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



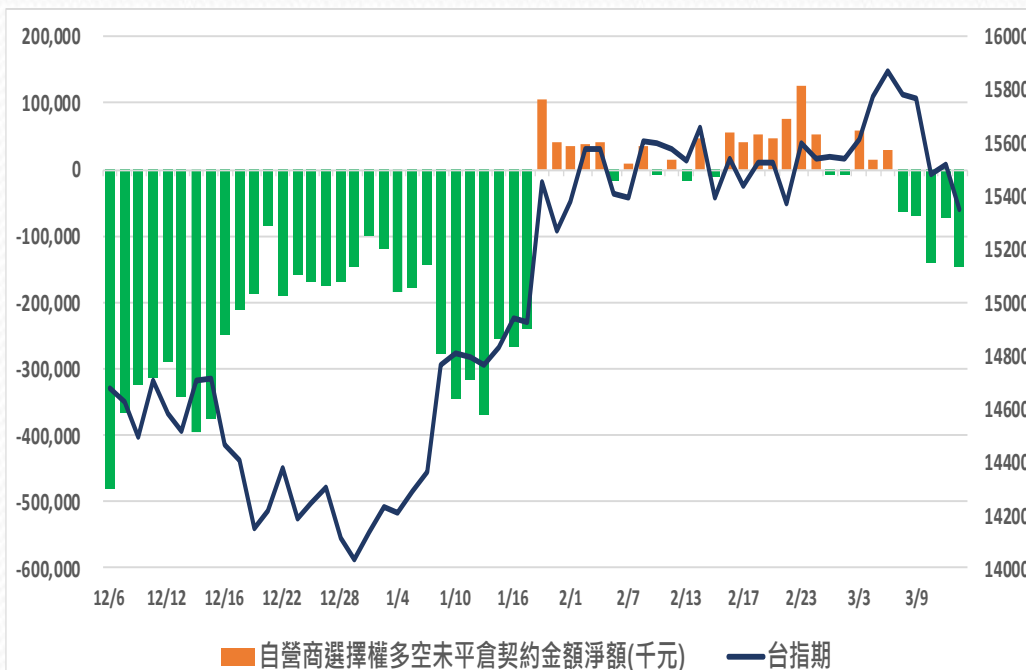
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/8	15785	12,984	+11,307	119,611	-2,431
2023/3/9	15766	11,875	-1,109	116,241	-3,370
2023/3/10	15481	12,122	+247	119,028	+2,787
2023/3/13	15519	3,295	-8,827	117,657	-1,371
2023/3/14	15354	652	-2,643	81,417	-36,240

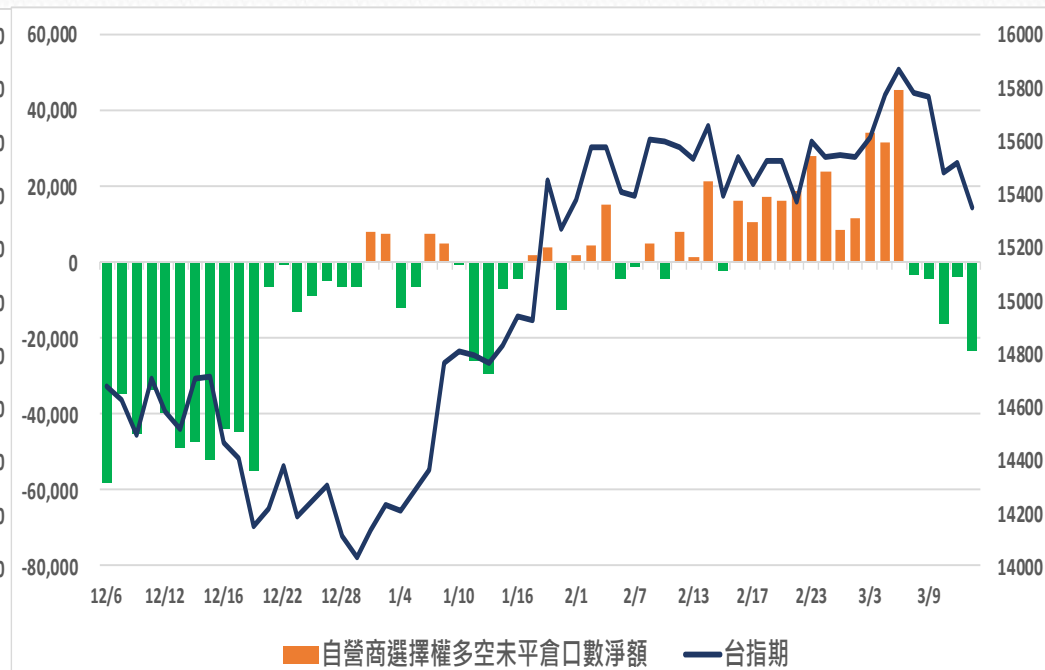
更新日期：2023年3月14日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



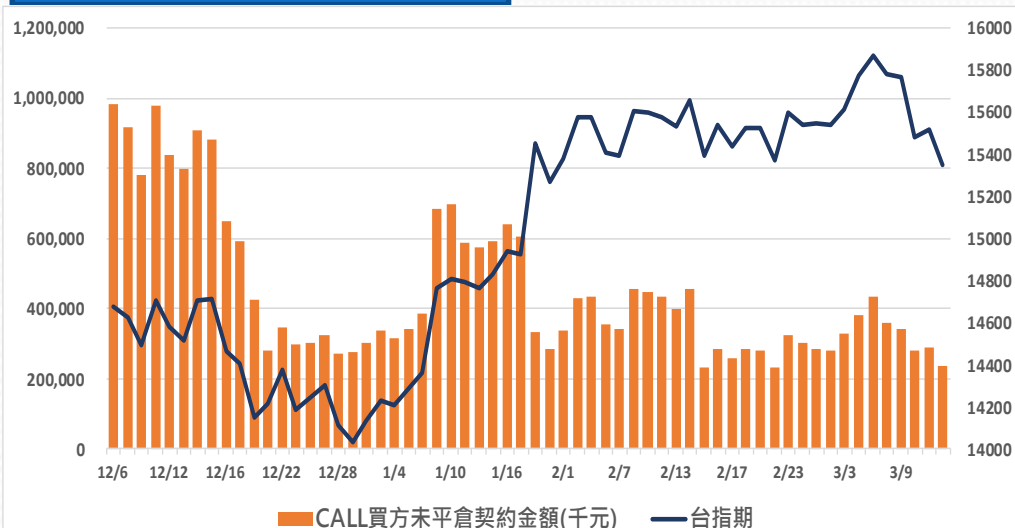
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/8	15785	-3,362	-48,740	-64,411	-94,556
2023/3/9	15766	-4,258	-896	-70,513	-6,102
2023/3/10	15481	-16,164	-11,906	-138,817	-68,304
2023/3/13	15519	-3,760	+12,404	-71,997	+66,820
2023/3/14	15354	-23,340	-19,580	-145,525	-73,528

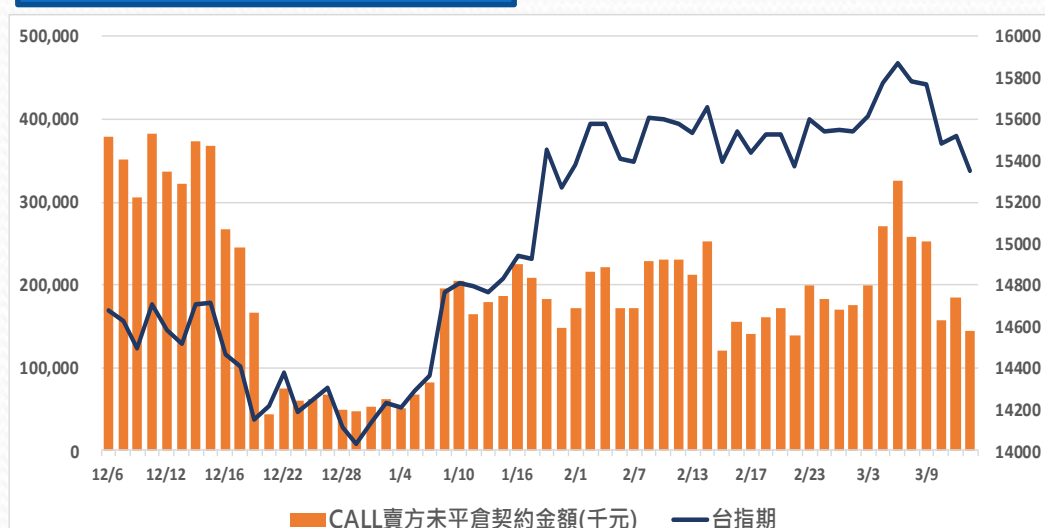
更新日期：2023年3月14日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

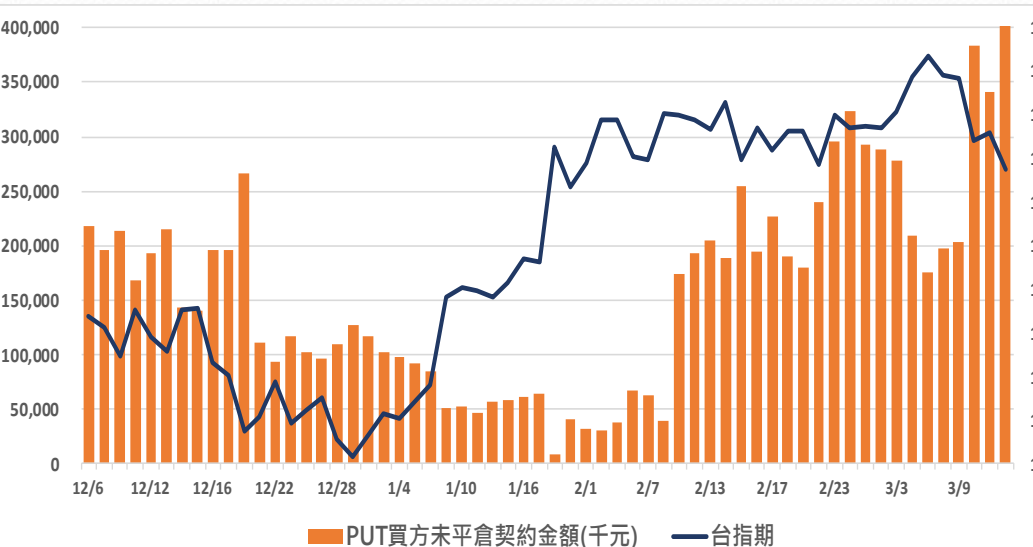
CALL買方未平倉金額



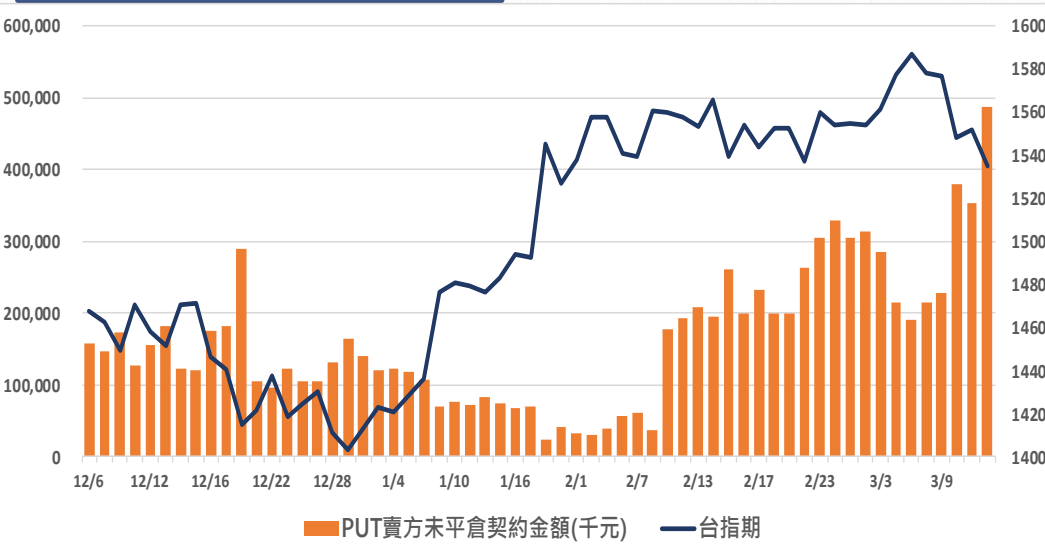
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



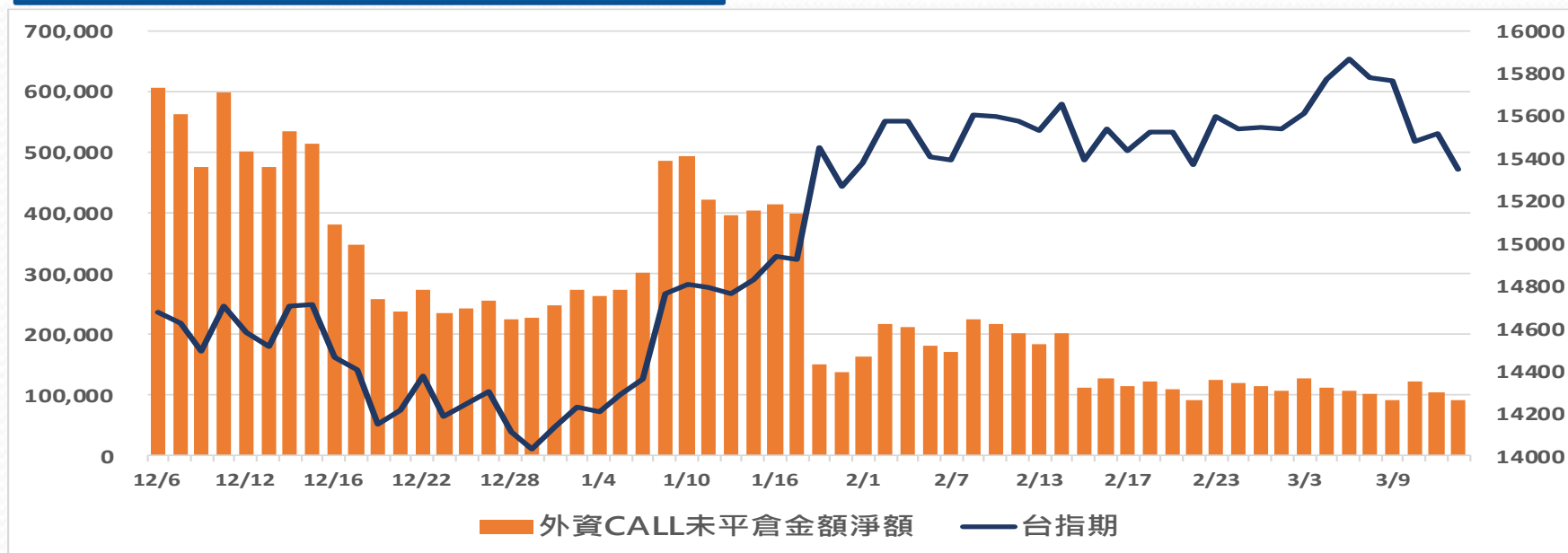
PUT賣方未平倉金額



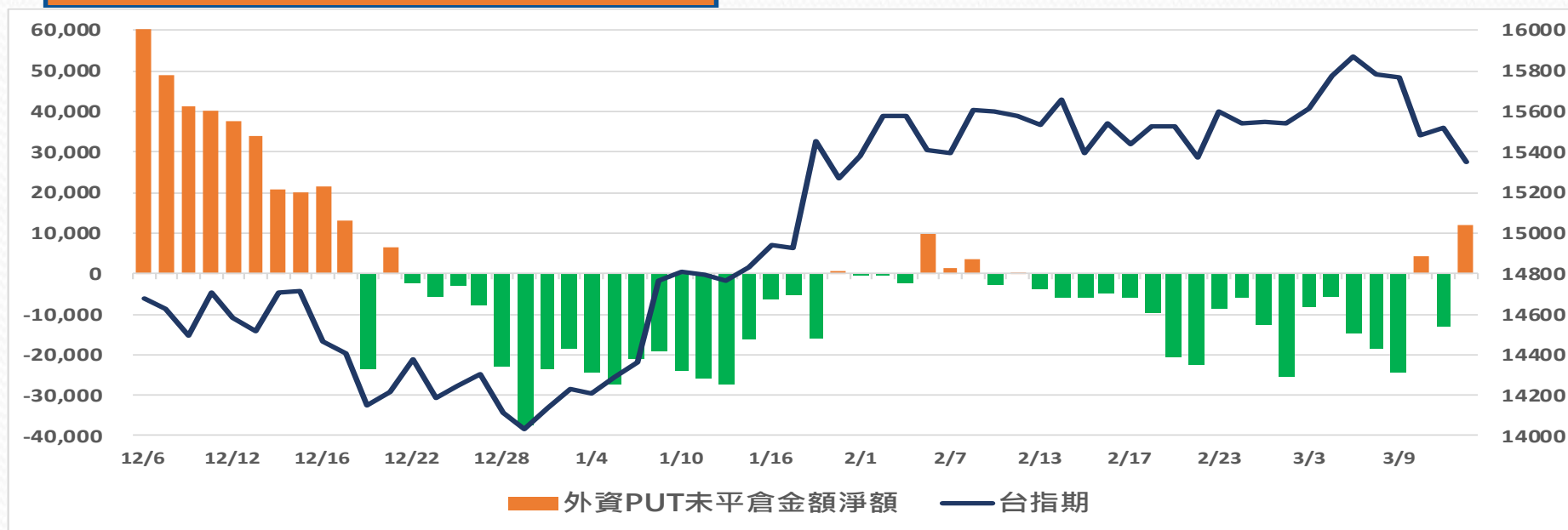
更新日期：2023年3月14日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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14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14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