

台指選擇權OI匯報

日期：2023/3/29 結算日：2023/4/5					日期：2023/3/29 結算日：2023/4/19				
202304W1					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
6	7	15,000	2,294	557	1	44	14,500	3,022	41
1	2	15,100	961	529	4	80	14,600	2,413	38
6	20	15,200	1,510	691	0	63	14,700	4,088	89
8	9	15,250	871	363	0	87	14,800	7,591	1,312
9	28	15,300	2,401	1,197	1	92	14,900	3,961	620
0	22	15,350	965	390	2	154	15,000	7,765	688
20	29	15,400	1,906	1,033	0	329	15,100	3,156	158
4	24	15,450	2,434	1,738	-24	1,684	15,200	4,858	633
86	112	15,500	1,755	686	-22	1,953	15,300	4,368	243
14	40	15,550	861	511	-78	1,751	15,400	4,948	52
257	358	15,600	2,678	1,322	※ 489	3,601	15,500	9,590	183
169	234	15,650	816	475	29	2,907	15,600	2,032	470
607	859	15,700	1,110	612	-17	2,972	15,700	1,858	104
491	759	15,750	1,056	574	-48	3,505	15,800	1,065	-44
1,331	1,660	15,800	798	497	-247	3,469	15,900	567	-21
490	1,017	15,850	195	113	-15	6,653	16,000	509	51
1,163	1,947	15,900	207	71	54	7,272	16,100	200	10
1,209	1,722	15,950	54	3	348	8,419	16,200	220	-13
※ 1,852	3,029	16,000	76	55	320	6,730	16,300	124	-2
1,145	1,852	16,050	36	0	-174	6,241	16,400	56	0
906	2,597	16,100	27	0	63	5,094	16,500	14	2
1,077	1,761	16,150	2	0	-66	2,326	16,600	36	1
1,231	2,174	16,200	17	8	62	1,135	16,700	39	0
326	1,081	16,300	24	20	474	2,241	16,800	5	0
932	1,606	16,400	1	0	-24	873	16,900	1	0
200	713	16,500	0	0	8	862	17,000	1	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
13,675	25,079	1.4360	36,014	12,800	403	82,172	1.0565	86,814	4,345
昨日 P/C	1.0702	今日增減變化		0.3658	昨日 P/C	1.0086	今日增減變化		0.0479

更新日期：2023年3月29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29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	84,205,807	60,164,415	24,041,392	9,180,831	2,070,757	972,719	1,098,038	74,706
投信	37,107,056	51,680,444	-14,573,388	-202,264	420,716	0	420,716	1,269
自營商	43,594,018	18,417,817	25,176,201	-213,209	1,691,794	632,566	1,059,228	12,112
	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	573,024	1,452,372	-879,348	140,614	143,384	63,391	79,993	40,897
投信	97,536	0	97,536	397	0	0	0	0
自營商	275,844	213,354	62,490	-45,272	203,747	273,172	-69,425	-27,324

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29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	27,852	14,879	12,973	-608	27,694	31,545	-3,851	-3,453
投信	150	50	100	0	200	119	81	0
自營商	47,739	36,422	11,317	9,443	51,514	25,606	25,908	6,587
特定法人(週)	1,015	0	1,015	---	0	3,543	-3,543	---
特定法人(近月)	16,918	11,276	5,642	-175	21,667	13,671	7,996	2,389
特定法人(全月)	19,475	9,420	10,055	-19	21,617	23,871	-2,254	-2,230
十大交易人(週)	13,890	10,892	2,998	---	20,144	18,917	1,227	---
十大交易人(近月)	44,844	37,809	7,035	-153	35,184	40,814	-5,630	2,507
十大交易人(全月)	68,191	54,304	13,887	11,716	53,472	68,858	-15,386	-4,790
全市場未沖銷(近月)			82,172	403			86,814	4,345
全市場未沖銷(全月)			132,514	-102,747			148,921	-112,106

更新日期：2023年3月29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 04W1 週 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	15600	賣權OI最大量	14900
	整體隱含波動率	13.36%	較前一交易日	+1.79%
	買權隱含波動率	11.31%	較前一交易日	-1.11%
	賣權隱含波動率	15.26%	較前一交易日	+4.88%
電子選擇權	買權成交最大量	770	買權OI最大量	770
	賣權成交最大量	710	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1580	買權OI最大量	1580
	賣權成交最大量	1440	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年3月29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	16200
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	12.63%	較前一交易日	+2.64%
	買權隱含波動率	12.63%	較前一交易日	-0.66%
	賣權隱含波動率	#DIV/0!	較前一交易日	#DIV/0!
	成交量P/C_Ratio值	1.190	較前一交易日	+0.34
	未平倉P/C_Ratio值	1.056	較前一交易日	+0.05
電子選擇權	買權成交最大量	770	買權OI最大量	770
	賣權成交最大量	710	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1580	買權OI最大量	1580
	賣權成交最大量	1440	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年3月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

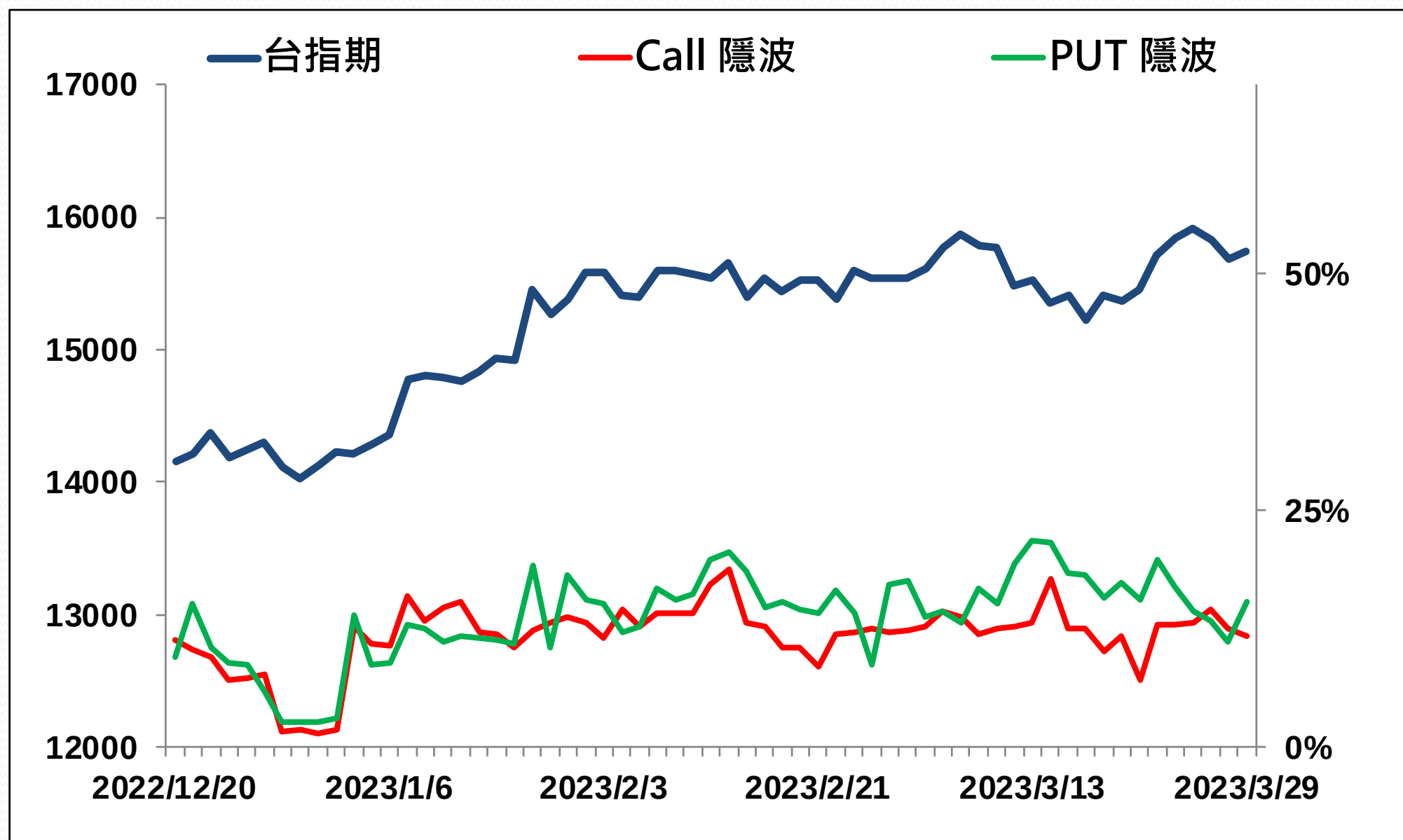
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



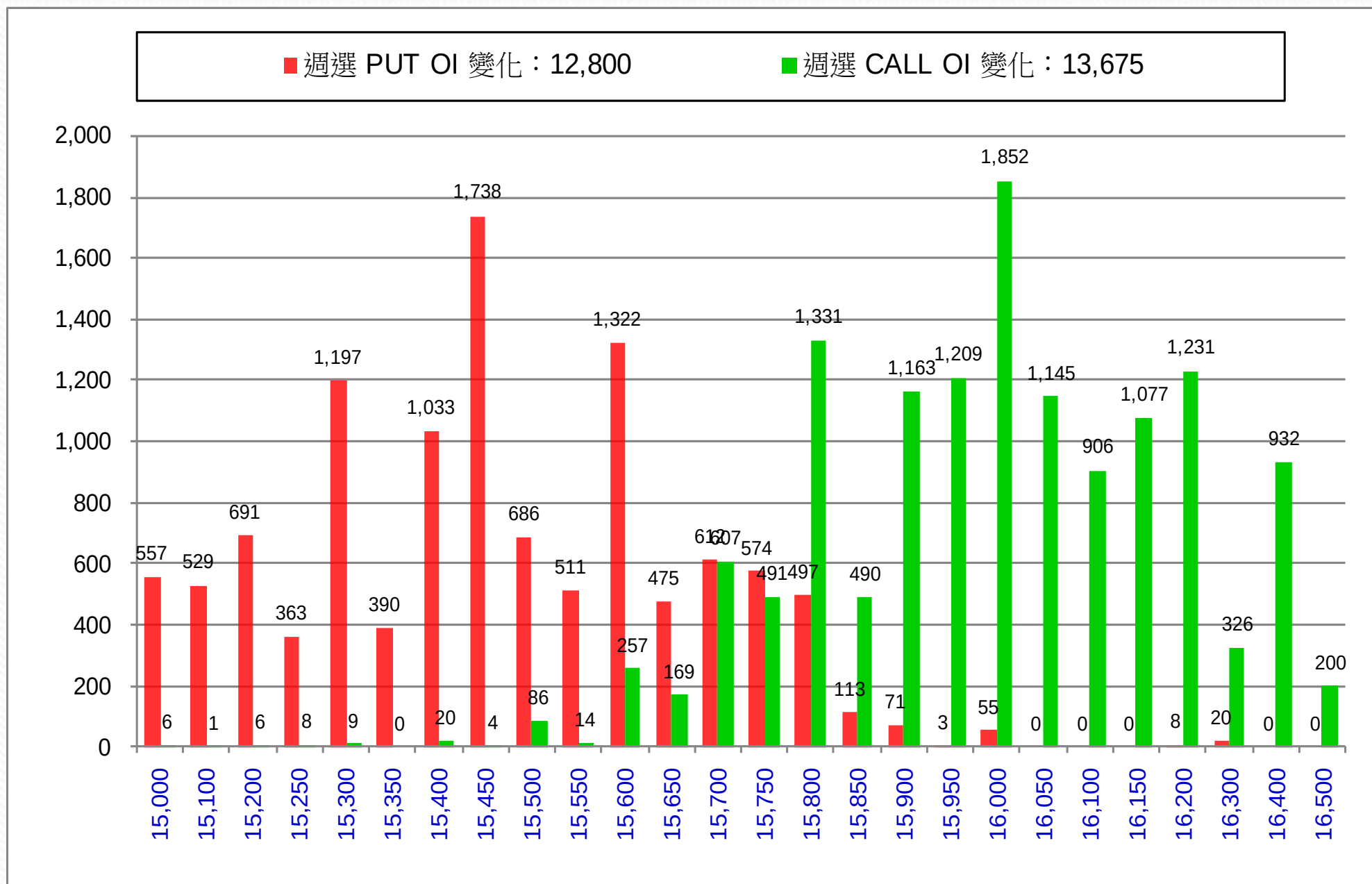
更新日期：2023年3月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年3月29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

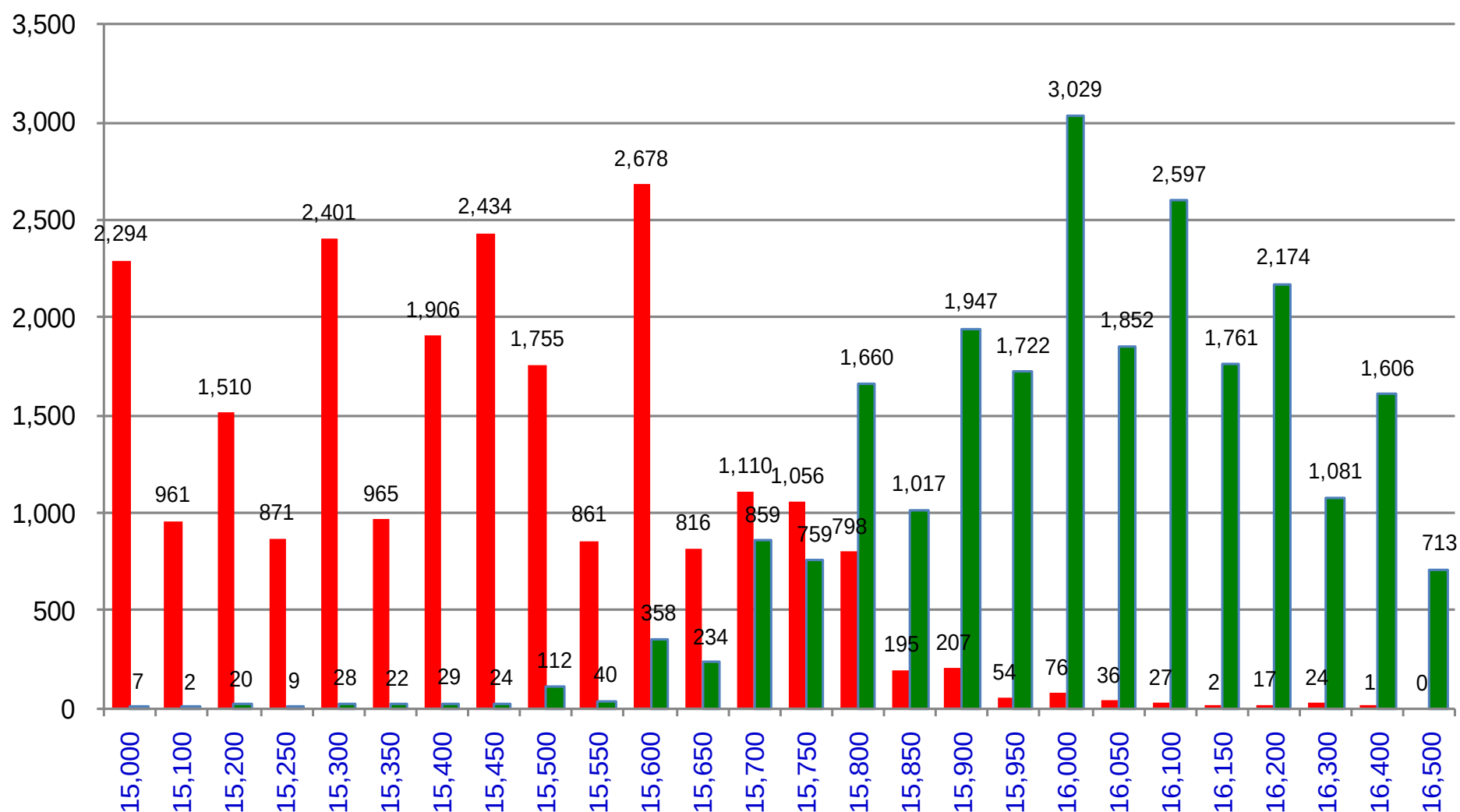


更新日期：2023年3月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：36,014

週選 CALL OI 總額：25,079



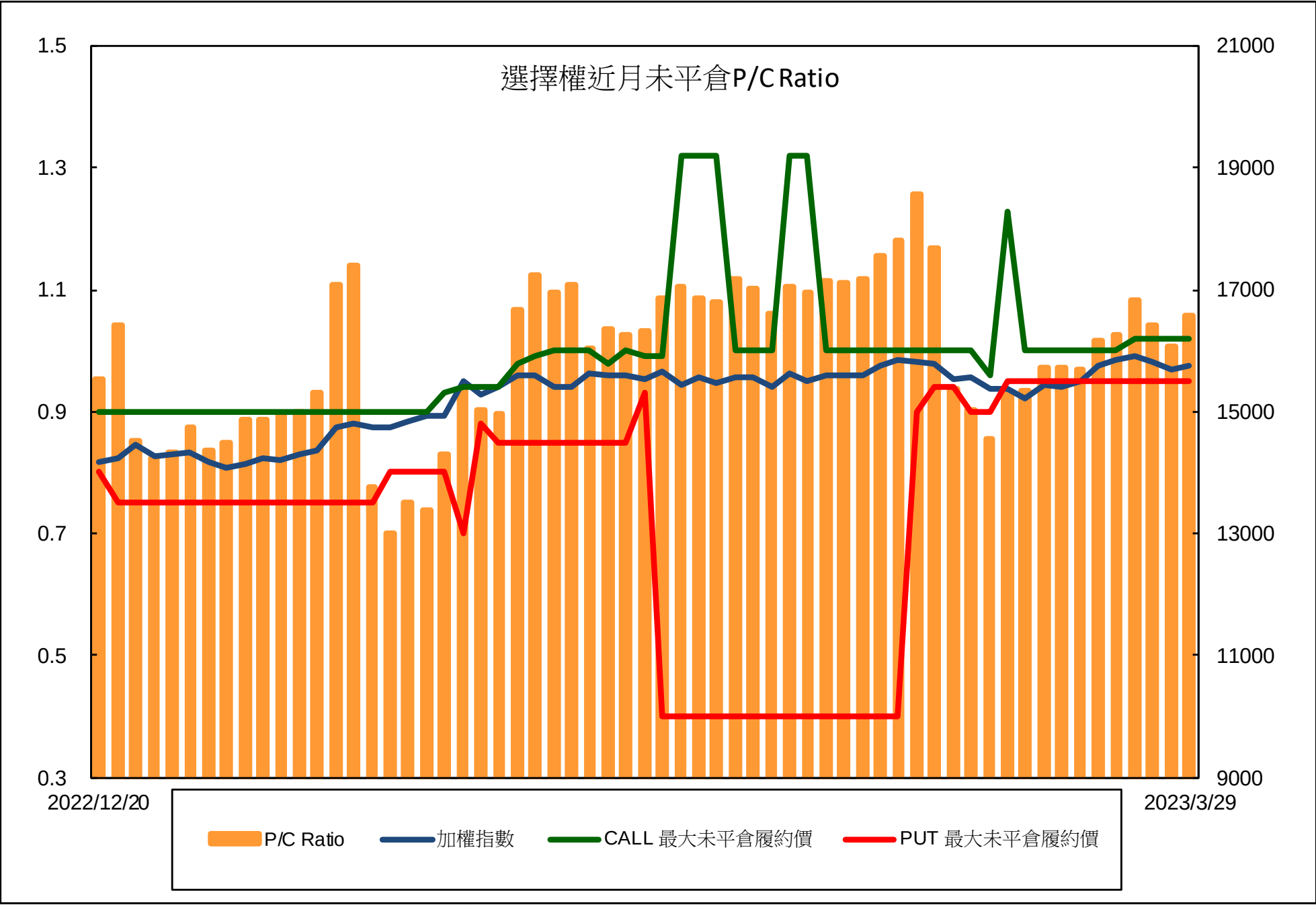
更新日期：2023年3月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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28日	61,004	59,130	1,874
	3月29日	47,739	36,422	11,317
Put	3月28日	71,750	52,429	19,321
	3月29日	51,514	25,606	25,908

更新日期：2023年3月29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29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

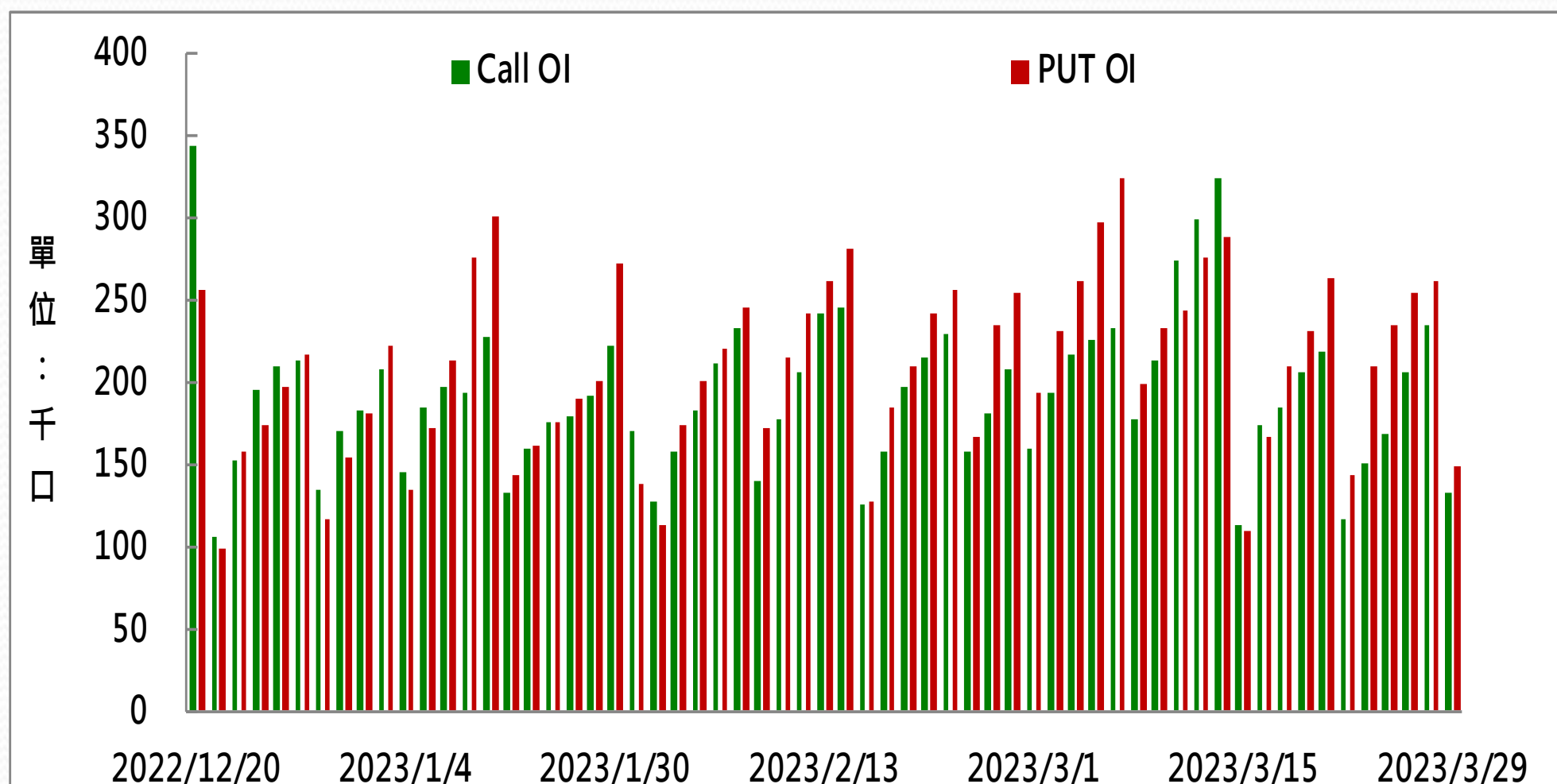


中華開發金控
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL



凱基期貨
KGI FUTURES

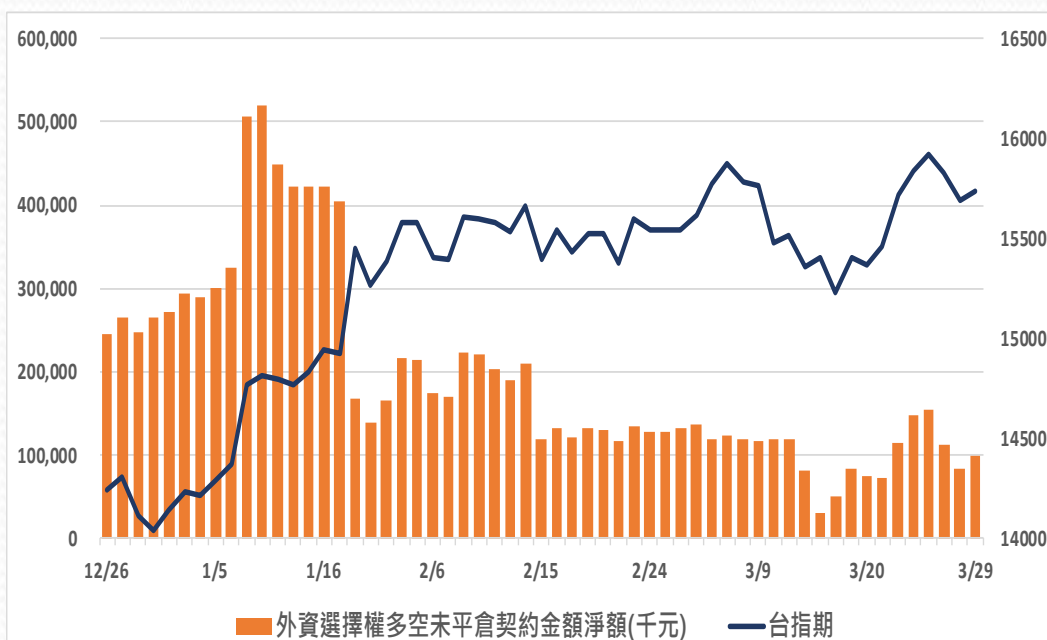
選擇權全月Put Call OI



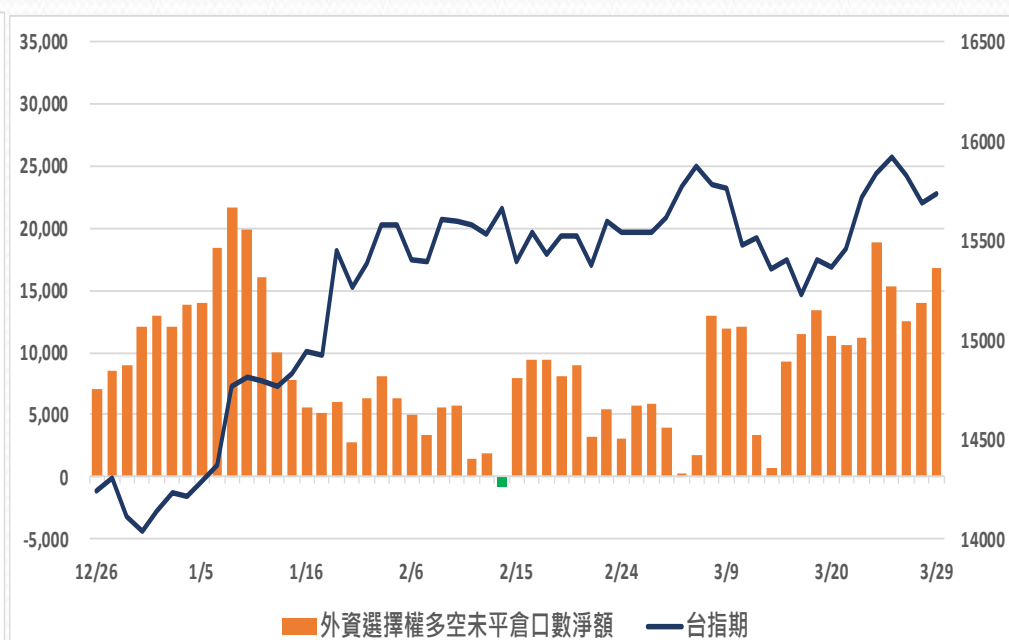
更新日期：2023年3月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



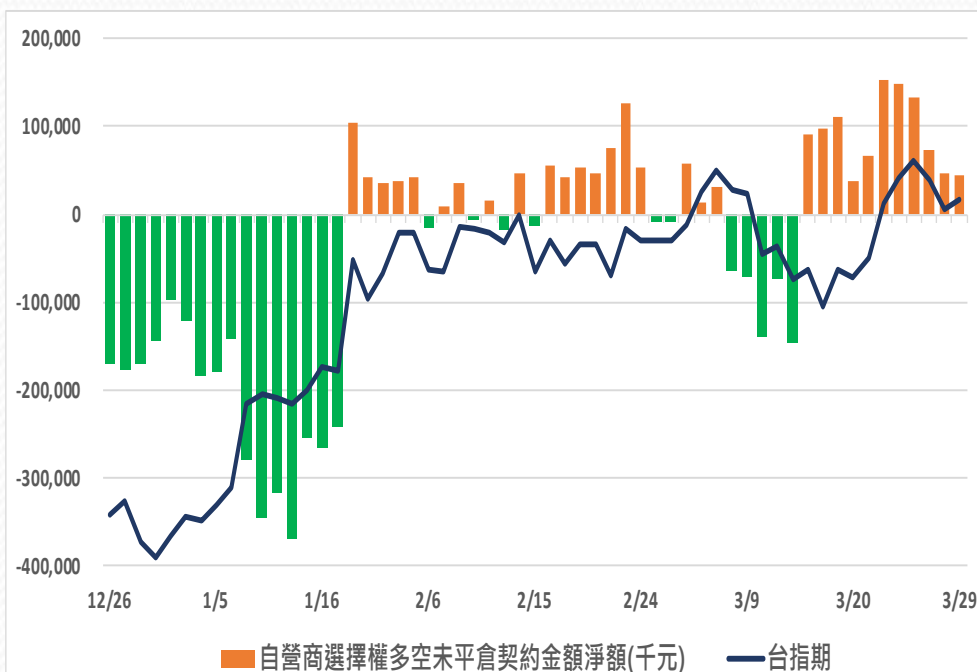
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/23	15836	18,912	+7,763	148,282	+33,308
2023/3/24	15917	15,390	-3,522	153,268	+4,986
2023/3/27	15829	12,576	-2,814	112,581	-40,687
2023/3/28	15689	13,979	+1,403	82,470	-30,111
2023/3/29	15738	16,824	+2,845	99,659	+17,189

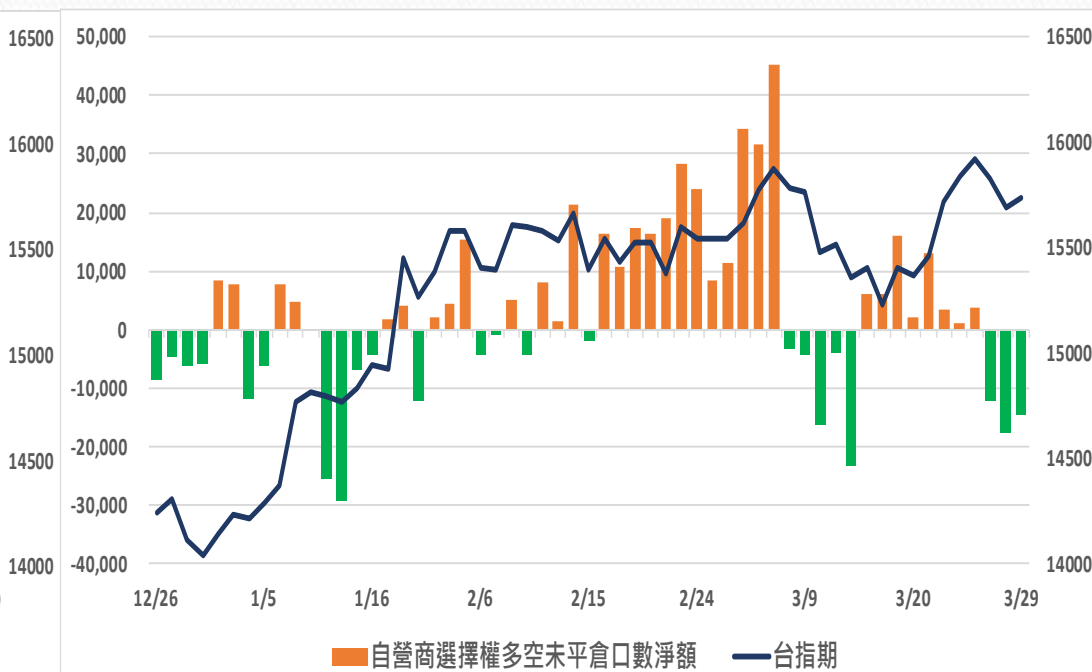
更新日期：2023年3月29日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



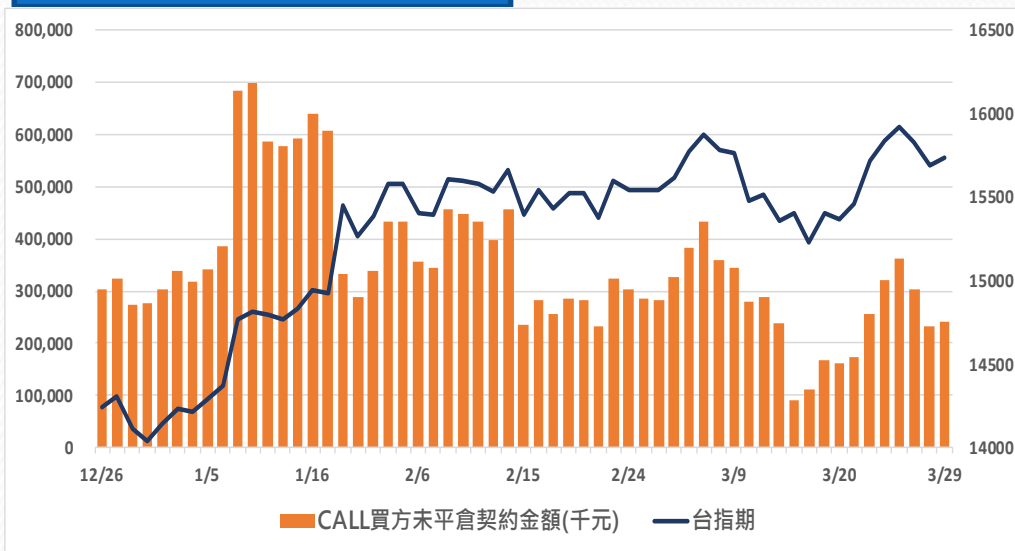
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/23	15836	904	-2,449	149,600	-2,363
2023/3/24	15917	3,644	+2,740	133,372	-16,228
2023/3/27	15829	-12,363	-16,007	72,953	-60,419
2023/3/28	15689	-17,447	-5,084	47,205	-25,748
2023/3/29	15738	-14,591	+2,856	45,379	-1,826

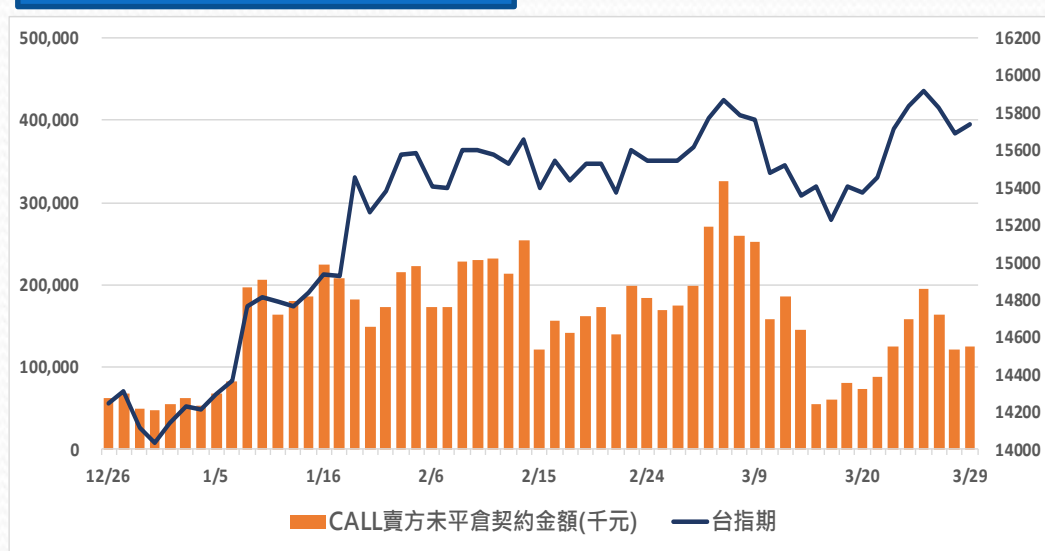
更新日期：2023年3月29日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

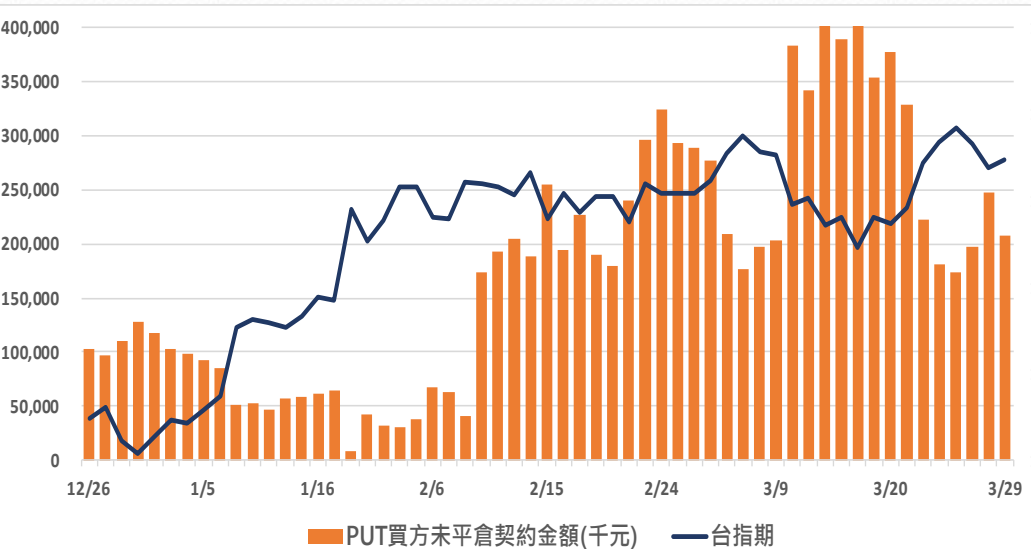
CALL買方未平倉金額



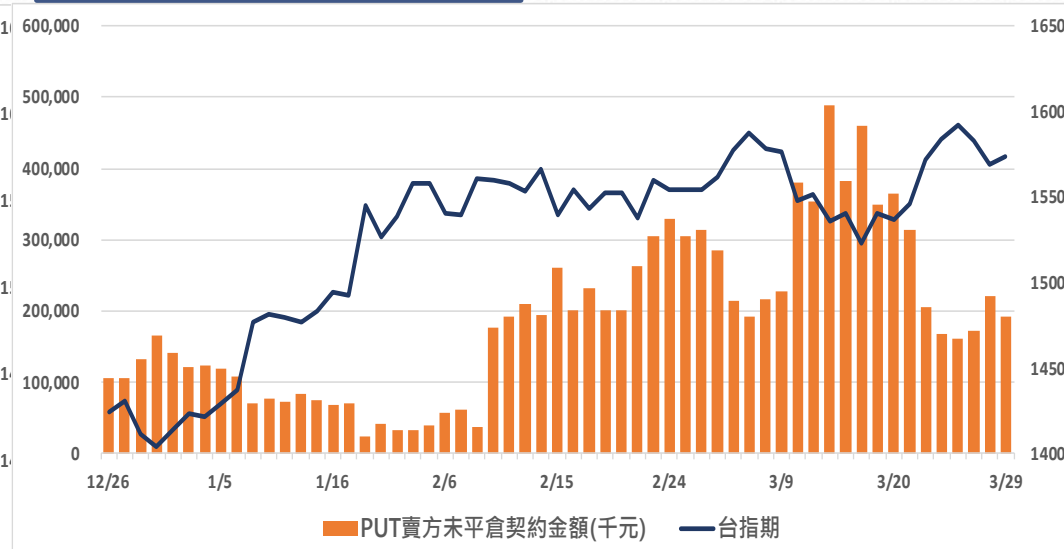
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



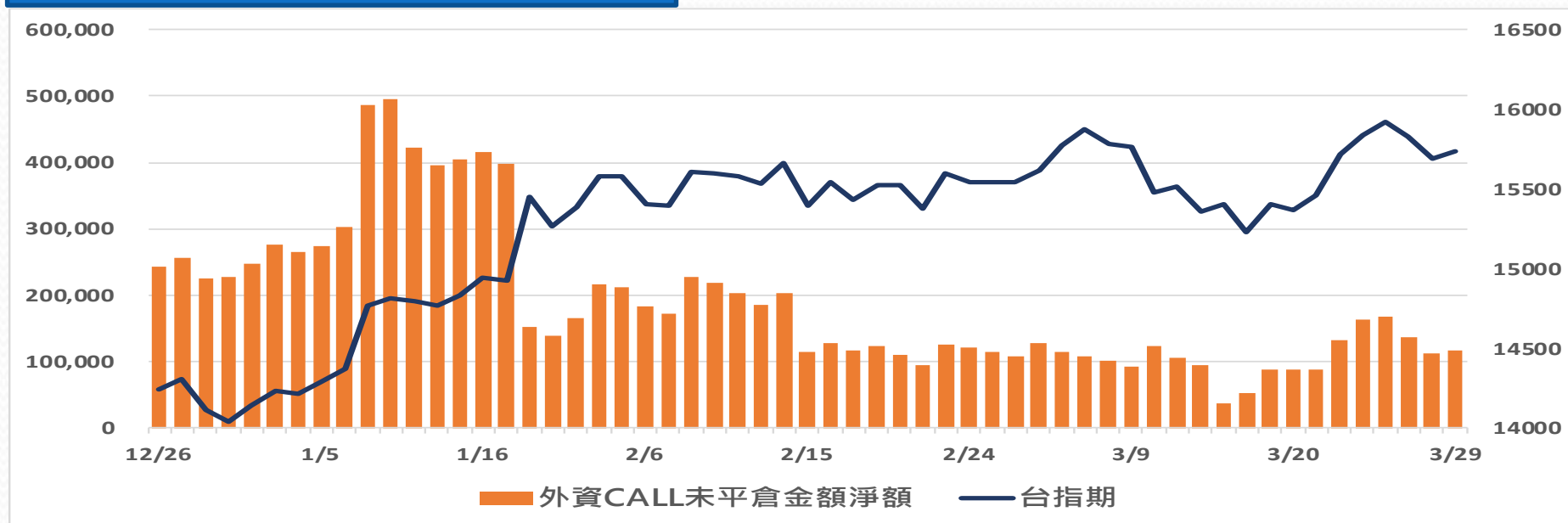
PUT賣方未平倉金額



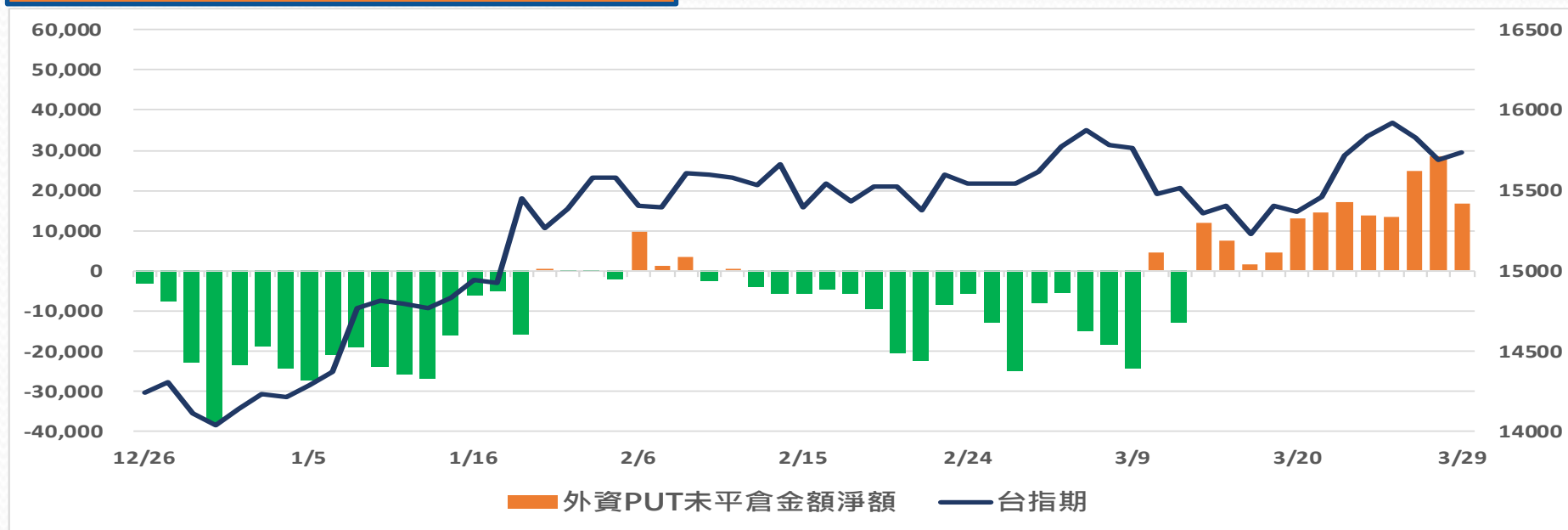
更新日期：2023年3月29日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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29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29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