

台指選擇權 OI 匯報

日期：2023/3/13 結算日：2023/3/15					日期：2023/3/13 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	0	10,200	1,437	-1	0	0	9,000	0	0
-5	82	14,700	4,583	222	0	0	14,300	763	49
-3	232	14,800	7,099	1,017	24	33	14,400	1,019	150
16	110	14,900	6,784	743	1	17	14,500	1,462	67
-16	436	15,000	16,735	5,643	2	16	14,600	965	133
6	248	15,100	8,582	3,512	3	11	14,700	1,596	470
20	36	15,150	6,073	1,958	3	31	14,800	2,465	100
58	3,416	15,200	11,236	2,060	0	21	14,900	3,007	142
275	337	15,250	6,583	1,803	-4	59	15,000	2,248	152
648	1,574	15,300	11,077	2,710	248	279	15,100	1,085	62
326	584	15,350	7,172	1,936	29	76	15,200	1,380	113
1,693	4,001	15,400	11,984	854	60	141	15,300	940	124
806	1,817	15,450	6,919	1,202	58	245	15,400	1,337	99
2,811	7,642	15,500	11,306	820	686	1,486	15,500	7,920	135
1,464	6,983	15,550	4,727	953	127	1,008	15,600	542	-1
3,507	12,157	15,600	4,854	-477	201	1,168	15,700	559	-28
2,575	8,441	15,650	2,488	-133	540	1,506	15,800	549	-5
※ 4,926	16,109	15,700	3,011	-449	-26	1,544	15,900	65	-8
3,619	13,366	15,750	1,828	-209	-145	2,797	16,000	70	10
2,077	16,359	15,800	2,286	-290	339	3,791	16,100	56	0
-890	12,977	15,850	600	-132	414	2,929	16,200	63	0
-1,894	12,324	15,900	741	-150	-221	2,485	16,300	55	0
-556	6,742	15,950	404	-14	444	2,657	16,400	2	0
-674	17,307	16,000	432	-42	71	2,349	16,500	3	0
-877	4,650	16,050	140	-54	174	1,547	16,600	0	0
-1,379	12,641	16,100	237	5	63	836	16,700	0	0
-538	2,860	16,150	10	0	107	868	16,800	2	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
14,643	229,995	0.8878	204,179	24,140	4,058	40,161	0.9029	36,263	2,410
昨日 P/C	0.7950	今日增減變化	0.0928		昨日 P/C	0.9377	今日增減變化	-0.0347	

更新日期：2023年3月13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13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	92,969,593	59,564,489	33,405,104	14,207,746	3,735,688	2,095,098	1,640,590	243,368	
投信	22,855,226	49,979,089	-27,123,863	1,844,754	382,927	0	382,927	-15,907	
自營商	47,695,192	22,313,316	25,381,876	-3,414,948	1,290,179	1,161,757	128,422	-209,501	
	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	724,080	1,820,600	-1,096,520	193,313	250,530	1,500	249,030	-80,112	
投信	128,270	0	128,270	-1,023	0	0	0	0	
自營商	487,137	501,335	-14,198	-137,315	128,641	357,922	-229,281	84,789	

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13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	43,333	24,084	19,249	-1,484	53,979	38,025	15,954	7,343	
投信	100	0	100	0	500	113	387	0	
自營商	84,055	85,085	-1,030	8,152	68,298	65,568	2,730	-4,252	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	26,050	8,163	17,887	1,827	10,209	25,851	-15,642	-6,667	
特定法人(全月)	28,991	11,801	17,190	-2,543	22,080	38,260	-16,180	-9,595	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	82,148	84,901	-2,753	2,866	74,843	71,588	3,255	-4,786	
十大交易人(全月)	122,119	109,079	13,040	4,722	96,424	105,669	-9,245	-1,422	
全市場未沖銷(近月)			230,001	14,643			208,514	25,828	
全市場未沖銷(全月)			298,830	23,594			276,590	33,430	

更新日期：2023年3月13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	16000
	賣權成交最大量	15400	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	17.18%	較前一交易日	+1.74%
	買權隱含波動率	13.06%	較前一交易日	+0.39%
	賣權隱含波動率	21.82%	較前一交易日	+2.58%
電子選擇權	買權成交最大量	435	買權OI最大量	730
	賣權成交最大量	650	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	1480	賣權OI最大量	1540

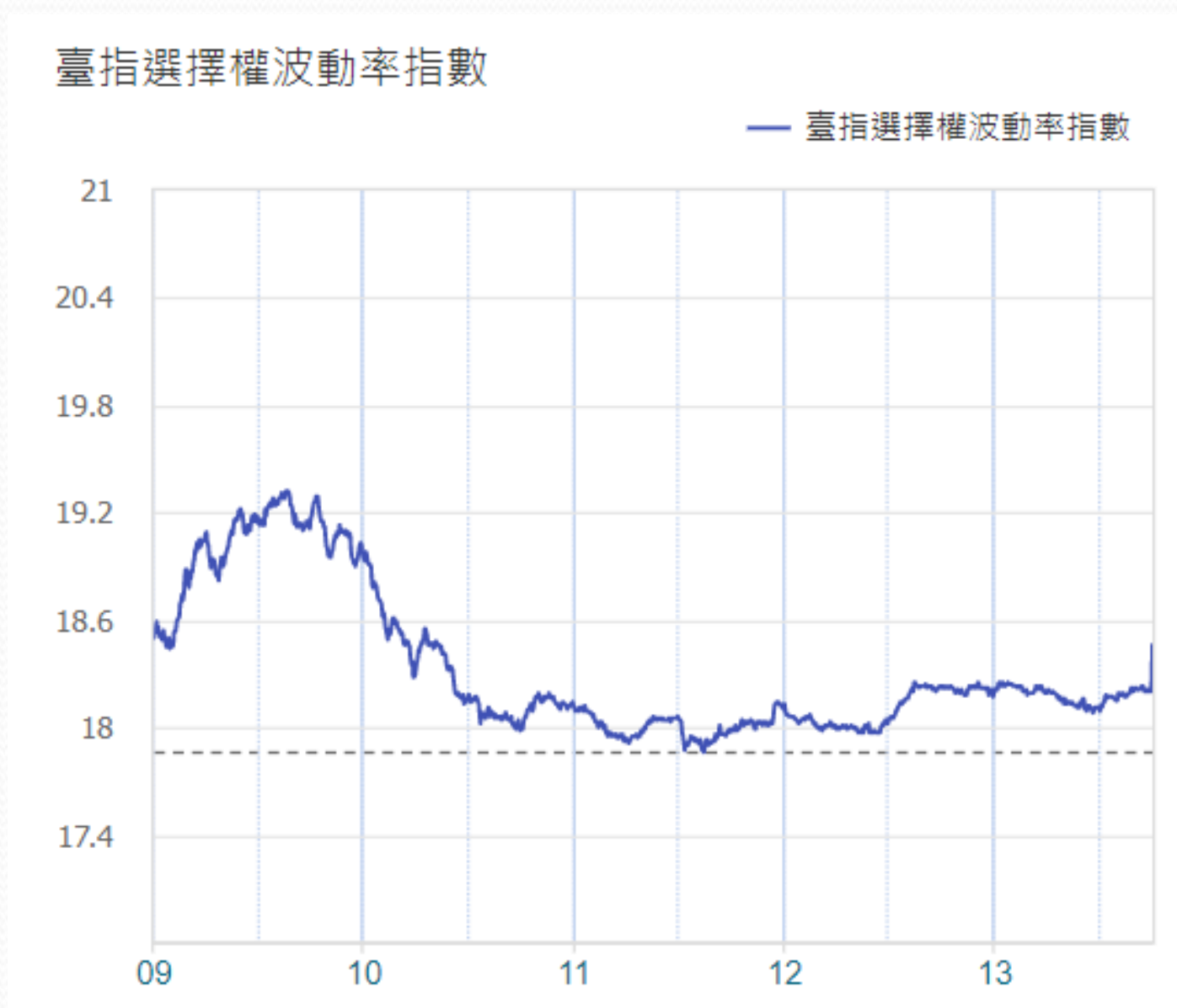
更新日期：2023年3月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	17.32%	較前一交易日	-1.38%
	買權隱含波動率	13.30%	較前一交易日	-0.32%
	賣權隱含波動率	21.86%	較前一交易日	+1.41%
	成交量P/C_Ratio值	0.869	較前一交易日	+0.32
	未平倉P/C_Ratio值	0.903	較前一交易日	-0.03
電子選擇權	買權成交最大量	505	買權OI最大量	730
	賣權成交最大量	650	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	1480	賣權OI最大量	1540

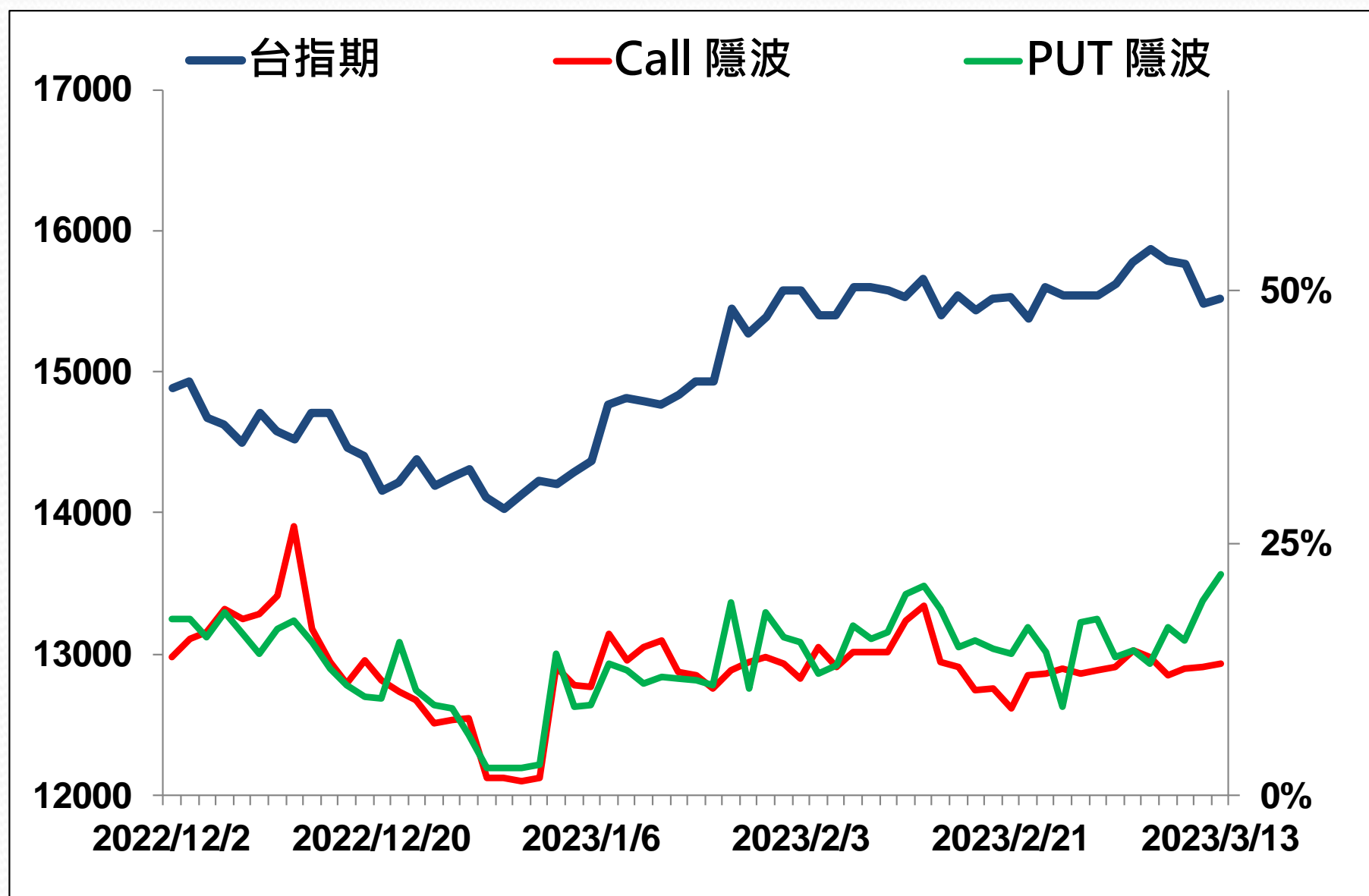
更新日期：2023年3月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



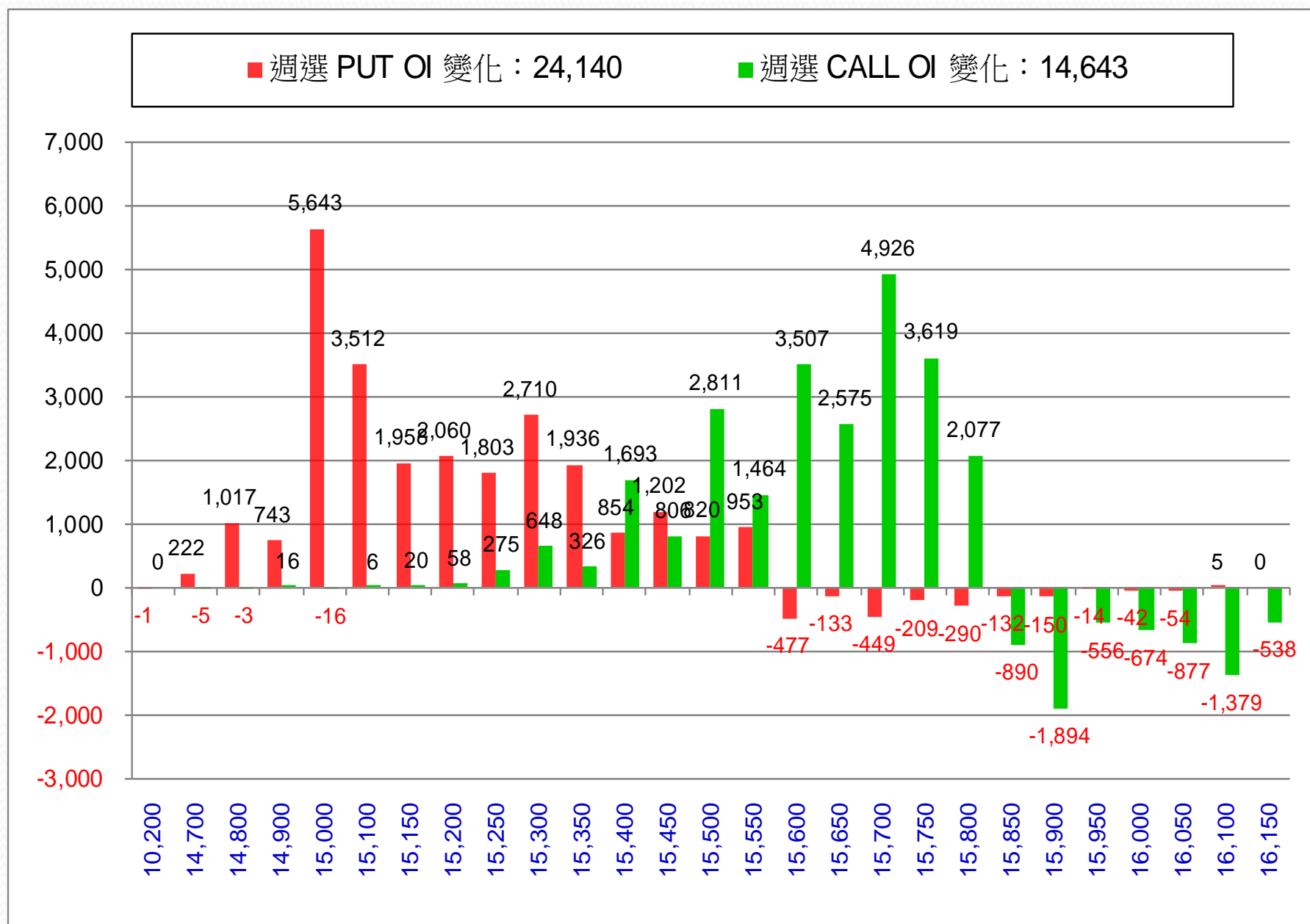
更新日期：2023年3月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



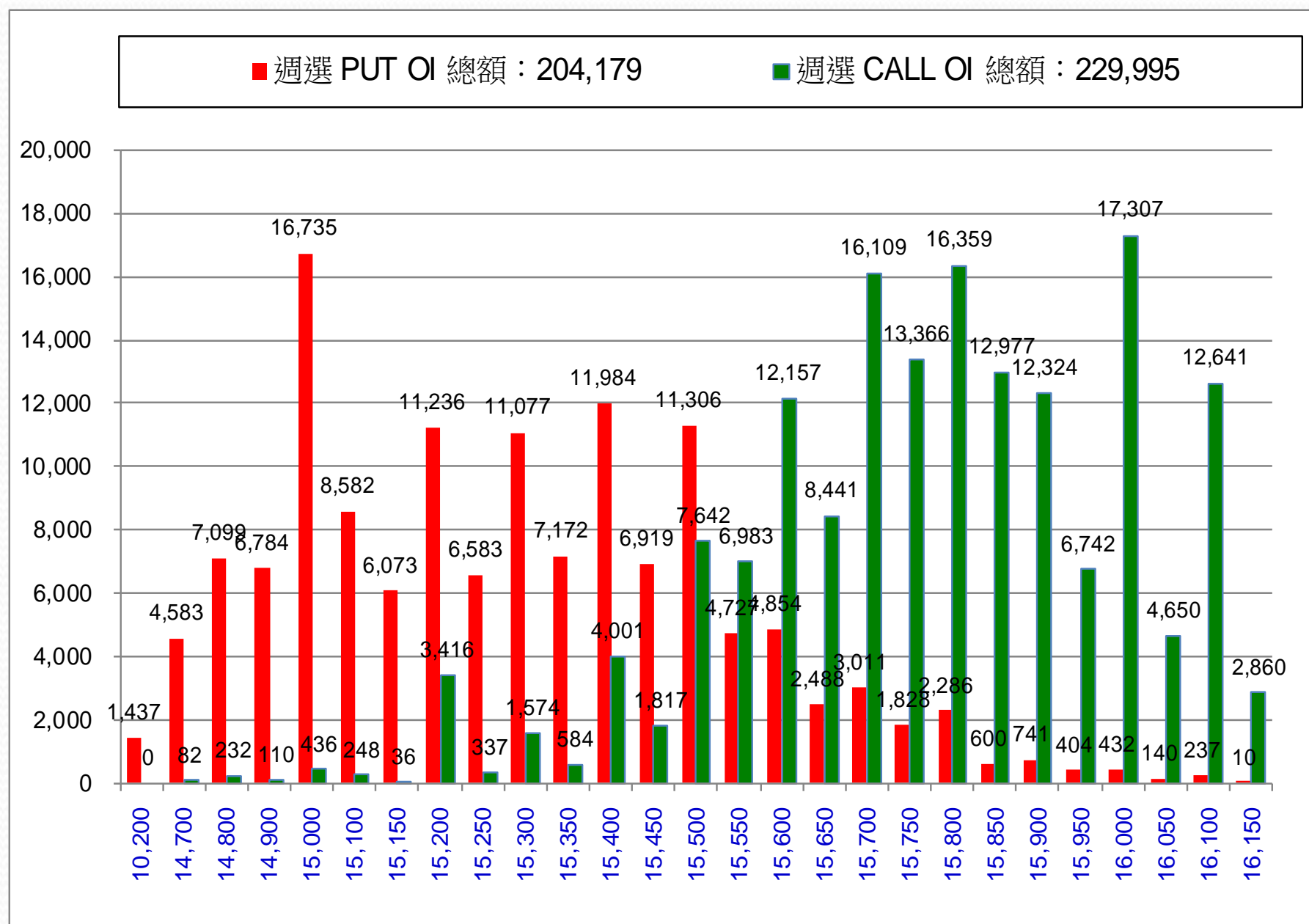
更新日期：2023年3月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年3月13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



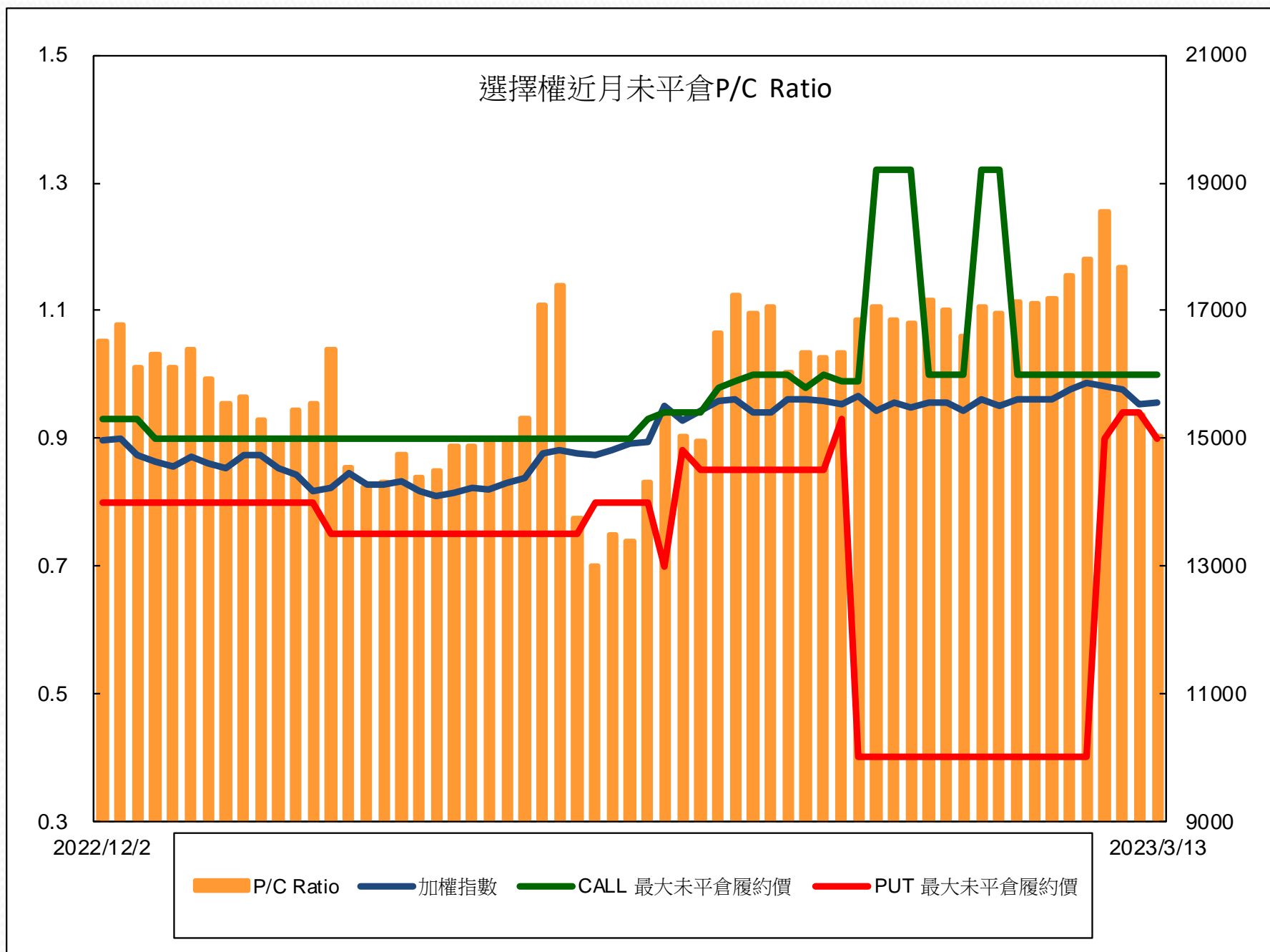
更新日期：2023年3月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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10日	74,719	83,901	-9,182
	3月13日	84,055	85,085	-1,030
Put	3月10日	64,848	57,866	6,982
	3月13日	68,298	65,568	2,730

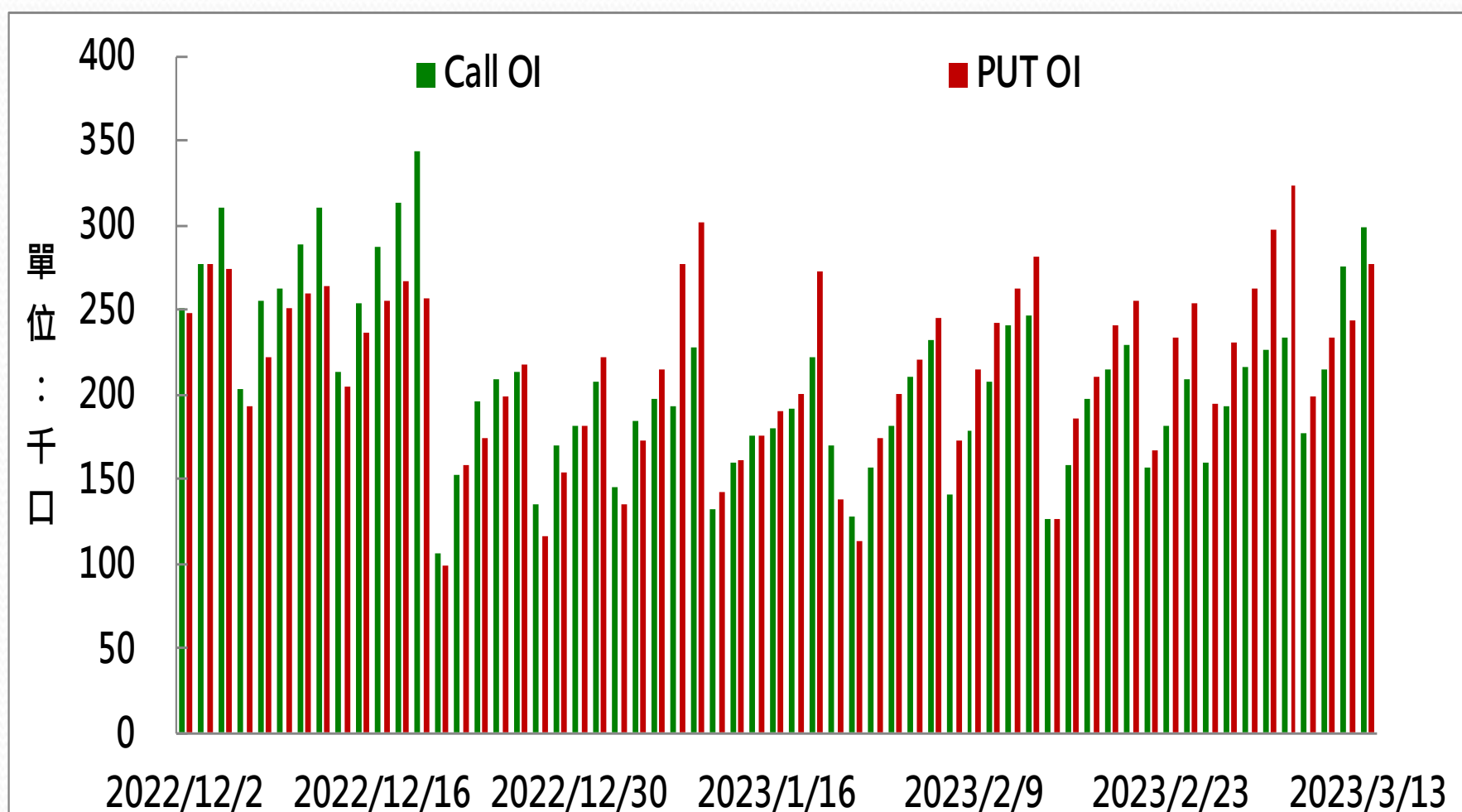
更新日期：2023年3月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

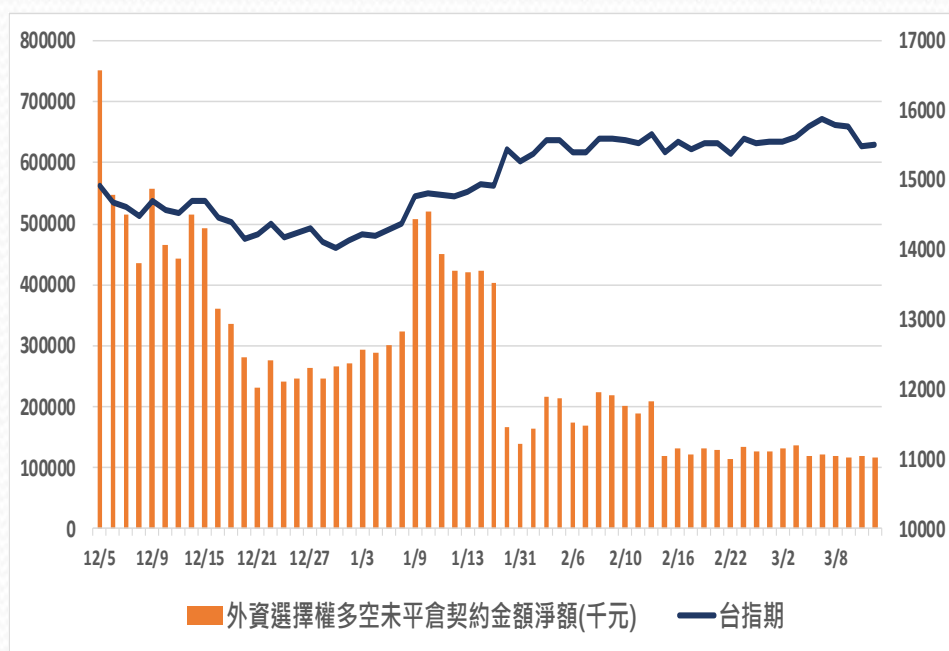
選擇權全月Put Call OI



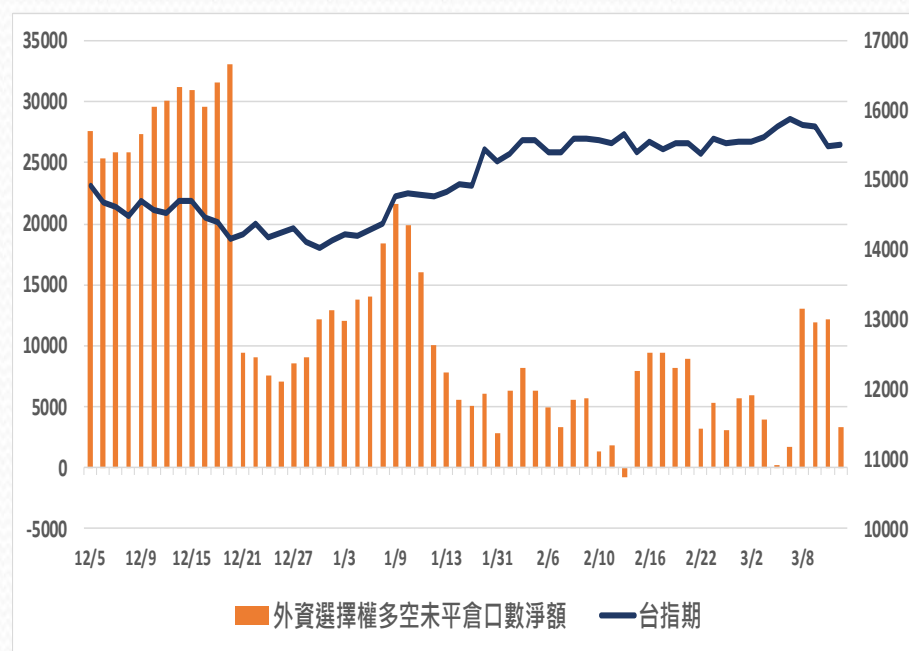
更新日期：2023年3月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



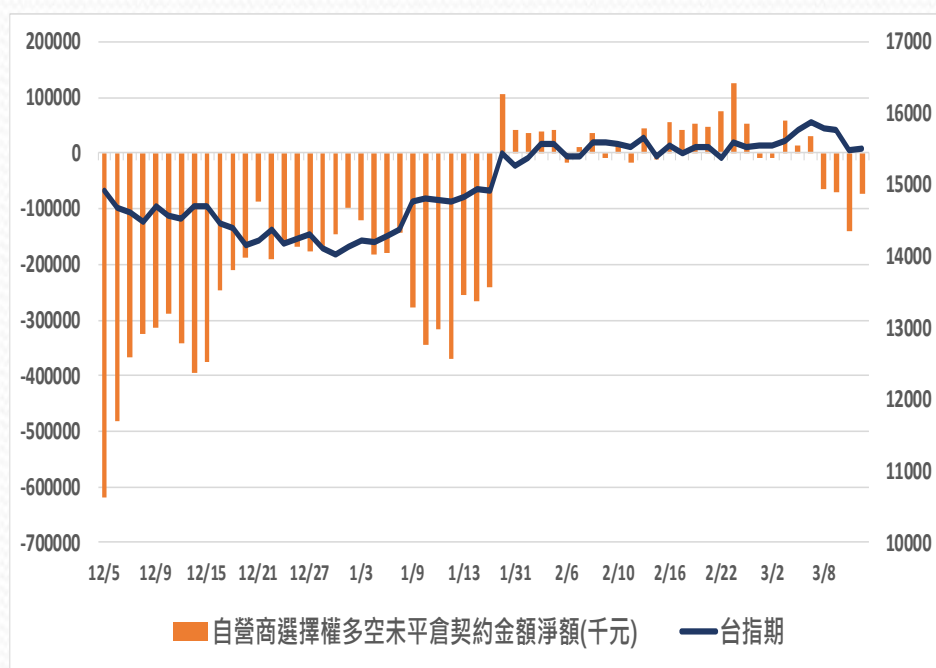
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/7	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
2023/3/13	15519	3295	-8827	117657	-1371

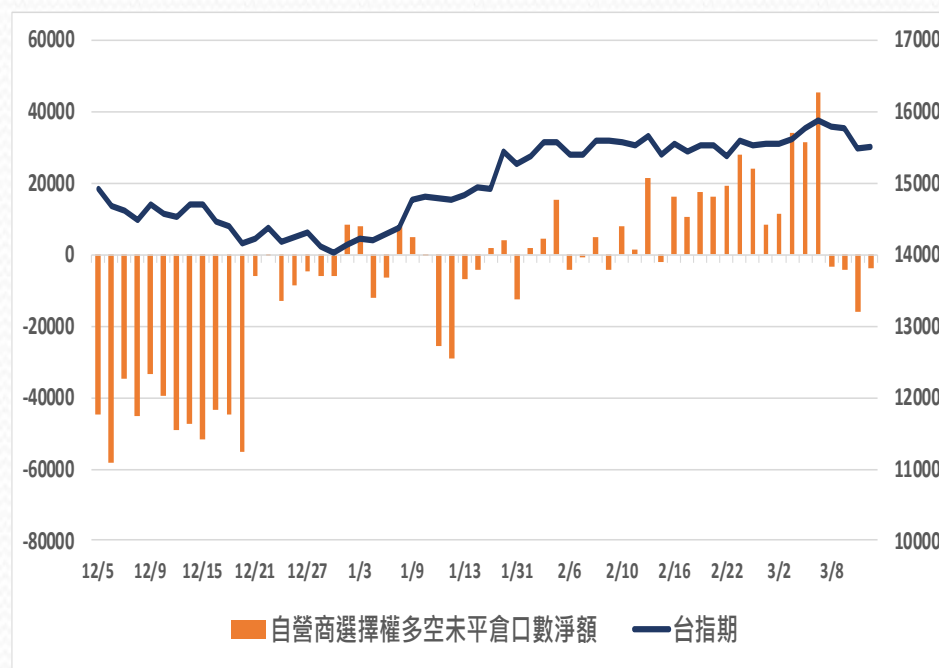
更新日期：2023年3月13日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



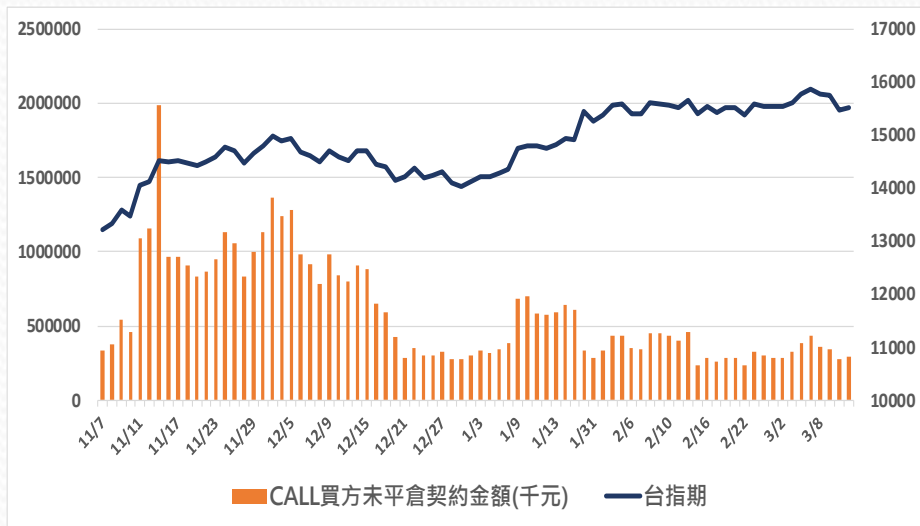
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/7	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
2023/3/13	15519	-3760	12404	-71997	66820

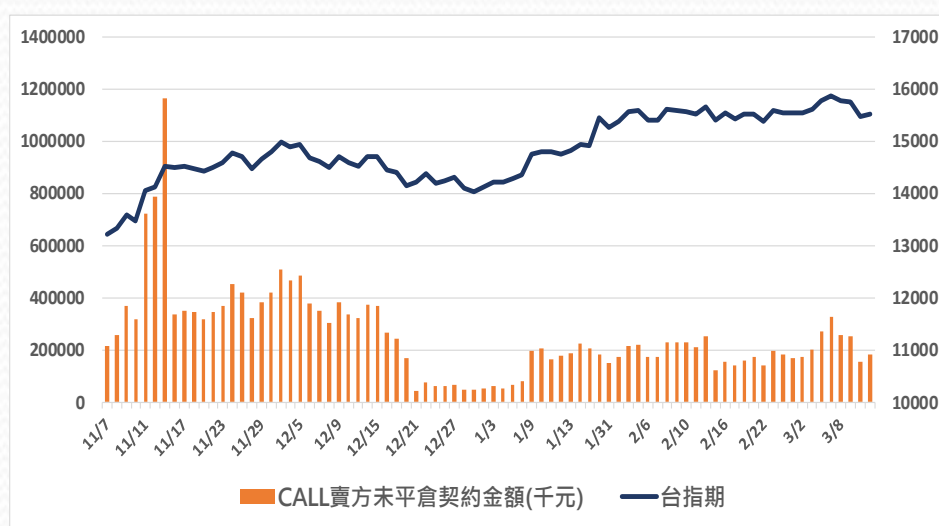
更新日期：2023年3月13日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

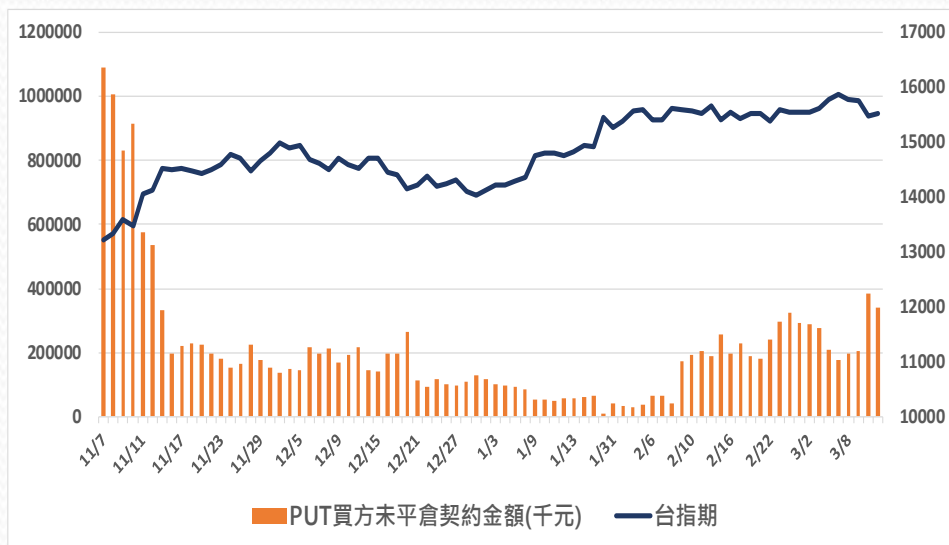
CALL買方未平倉金額



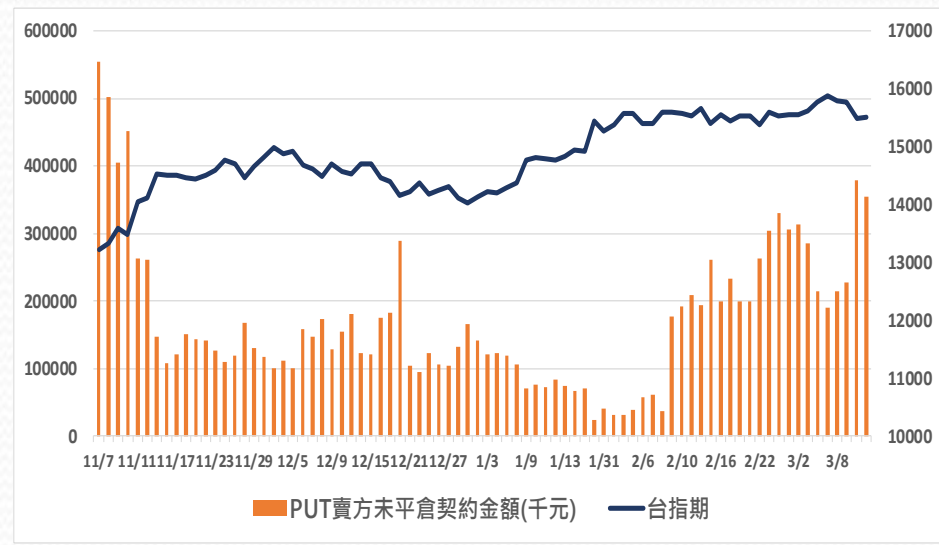
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



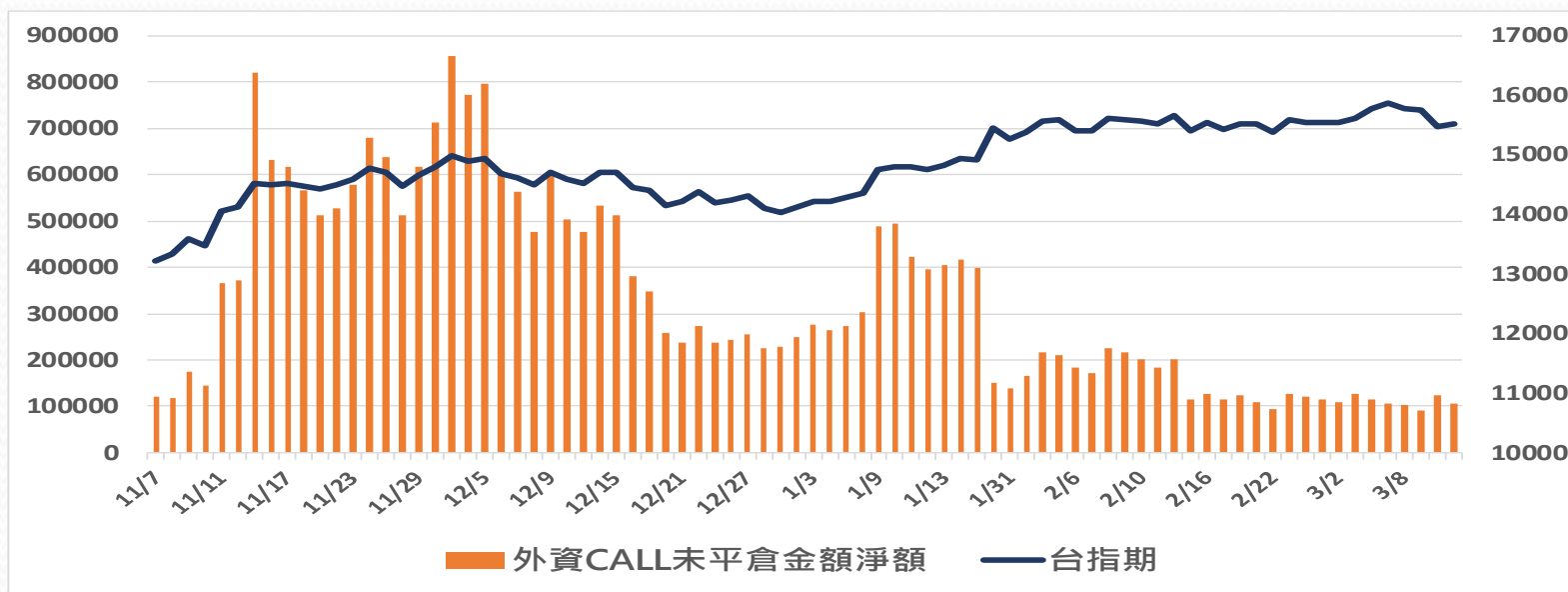
PUT賣方未平倉金額



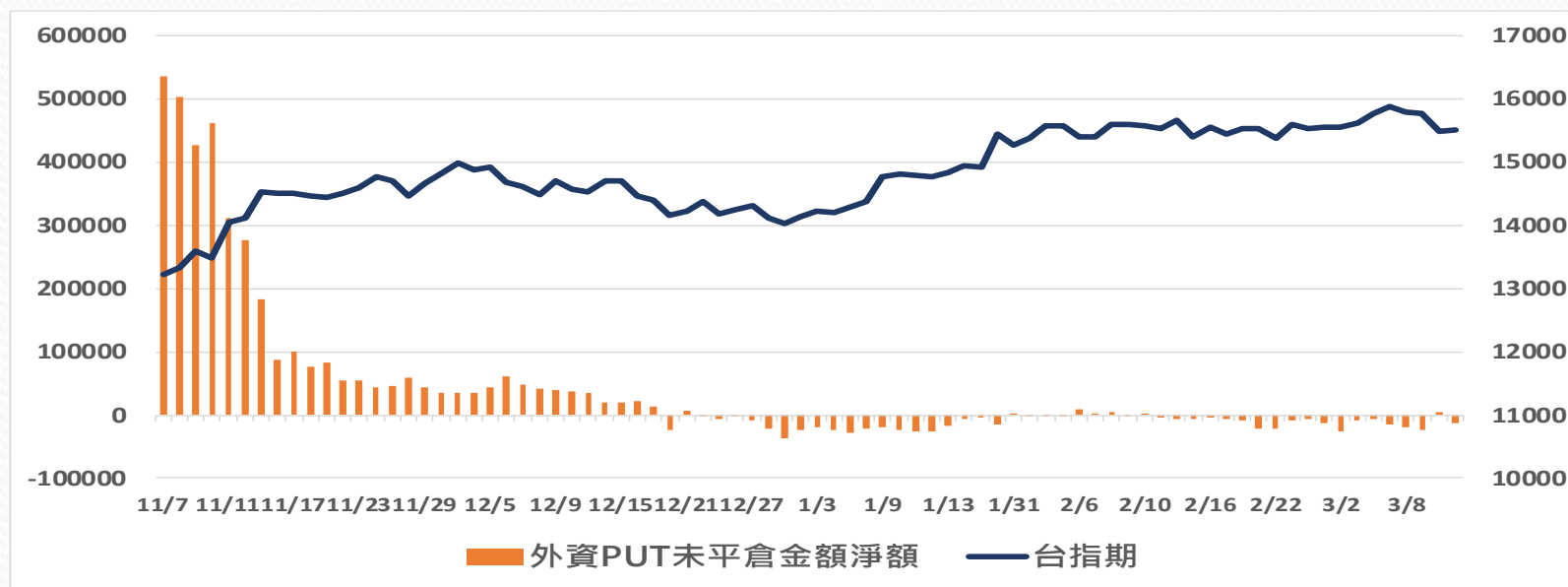
更新日期：2023年3月13日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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13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13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