

台指選擇權OI匯報

日期：2023/3/15 結算日：2023/3/22					日期：2023/3/15 結算日：2023/4/19				
202303W4					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	2	14,600	1,102	550	6	7	14,100	816	143
0	6	14,700	1,816	849	0	0	14,200	1,136	192
4	6	14,800	2,345	1,257	0	4	14,300	1,909	942
4	16	14,900	4,147	2,353	6	95	14,400	1,460	162
0	0	14,950	1,363	1,363	3	26	14,500	1,815	308
42	52	15,000	4,054	2,535	7	27	14,600	2,027	574
9	9	15,050	1,232	1,232	17	35	14,700	2,130	547
50	156	15,100	2,365	1,145	9	58	14,800	3,207	712
34	45	15,150	1,430	716	21	48	14,900	3,795	730
170	323	15,200	2,430	800	39	120	15,000	2,609	504
77	141	15,250	1,127	353	2	325	15,100	1,174	95
679	953	15,300	2,695	911	33	153	15,200	1,864	448
469	767	15,350	1,305	303	3	226	15,300	1,277	359
872	1,387	15,400	2,298	1,238	372	789	15,400	1,651	338
623	959	15,450	1,263	404	-32	2,541	15,500	7,959	221
1,180	1,861	15,500	1,127	451	304	1,587	15,600	575	39
1,675	2,418	15,550	509	76	150	1,894	15,700	548	6
2,706	3,690	15,600	662	129	390	2,240	15,800	553	7
2,787	3,257	15,650	394	45	692	2,391	15,900	61	-4
4,481	5,679	15,700	626	52	740	3,533	16,000	68	4
1,754	3,285	15,750	134	10	206	3,114	16,100	60	2
3,127	5,050	15,800	132	12	459	3,526	16,200	90	27
649	2,605	15,900	63	26	151	2,959	16,300	67	12
569	2,038	16,000	60	1	358	3,420	16,400	16	14
724	1,417	16,100	1	-1	792	3,188	16,500	4	0
-142	728	16,200	2	0	1	1,676	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
21,376	42,408	1.0515	44,592	22,731	4,624	48,963	0.9280	45,440	7,569
昨日 P/C	0.8476	今日增減變化	0.2039		昨日 P/C	0.8541	今日增減變化	0.0739	

更新日期：2023年3月15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15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	72,396,737	51,134,136	21,262,601	-2,037,218	1,635,966	534,724	1,101,242	-261,192	
投信	27,943,524	51,462,810	-23,519,286	5,128,451	369,971	0	369,971	9,986	
自營商	43,268,843	19,284,552	23,984,291	-6,509,877	716,819	751,504	-34,685	-182,102	
	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	347,907	1,283,658	-935,751	-11,838	20,726	4,441	16,285	-217,199	
投信	110,970	0	110,970	-578	0	0	0	0	
自營商	316,416	184,451	131,965	231,463	119,912	106,589	13,323	240,247	

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15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	13,429	6,852	6,577	-12,256	20,933	23,563	-2,630	-20,811	
投信	0	0	0	-100	200	119	81	-306	
自營商	51,289	38,382	12,907	23,563	36,785	30,064	6,721	-5,963	
特定法人(週)	595	0	595	---	800	3,964	-3,164	---	
特定法人(近月)	9,335	4,207	5,128	---	14,931	11,952	2,979	---	
特定法人(全月)	8,160	4,207	3,953	-12,685	19,354	20,076	-722	17,424	
十大交易人(週)	28,254	25,699	2,555	---	22,457	20,107	2,350	---	
十大交易人(近月)	30,162	24,561	5,601	---	23,067	28,367	-5,300	---	
十大交易人(全月)	62,114	49,454	12,660	9,119	47,501	53,993	-6,492	13,935	
全市場未沖銷(近月)			48,963	---			45,440	---	
全市場未沖銷(全月)			112,427	-212,488			109,266	-180,260	

更新日期：2023年3月15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03W4週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15700	買權OI最大量	15700
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	14900
	整體隱含波動率	15.10%	較前一交易日	-4.52%
	買權隱含波動率	12.23%	較前一交易日	-5.75%
	賣權隱含波動率	17.77%	較前一交易日	-3.72%
電子選擇權	買權成交最大量	425	買權OI最大量	710
	賣權成交最大量	670	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1560	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15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

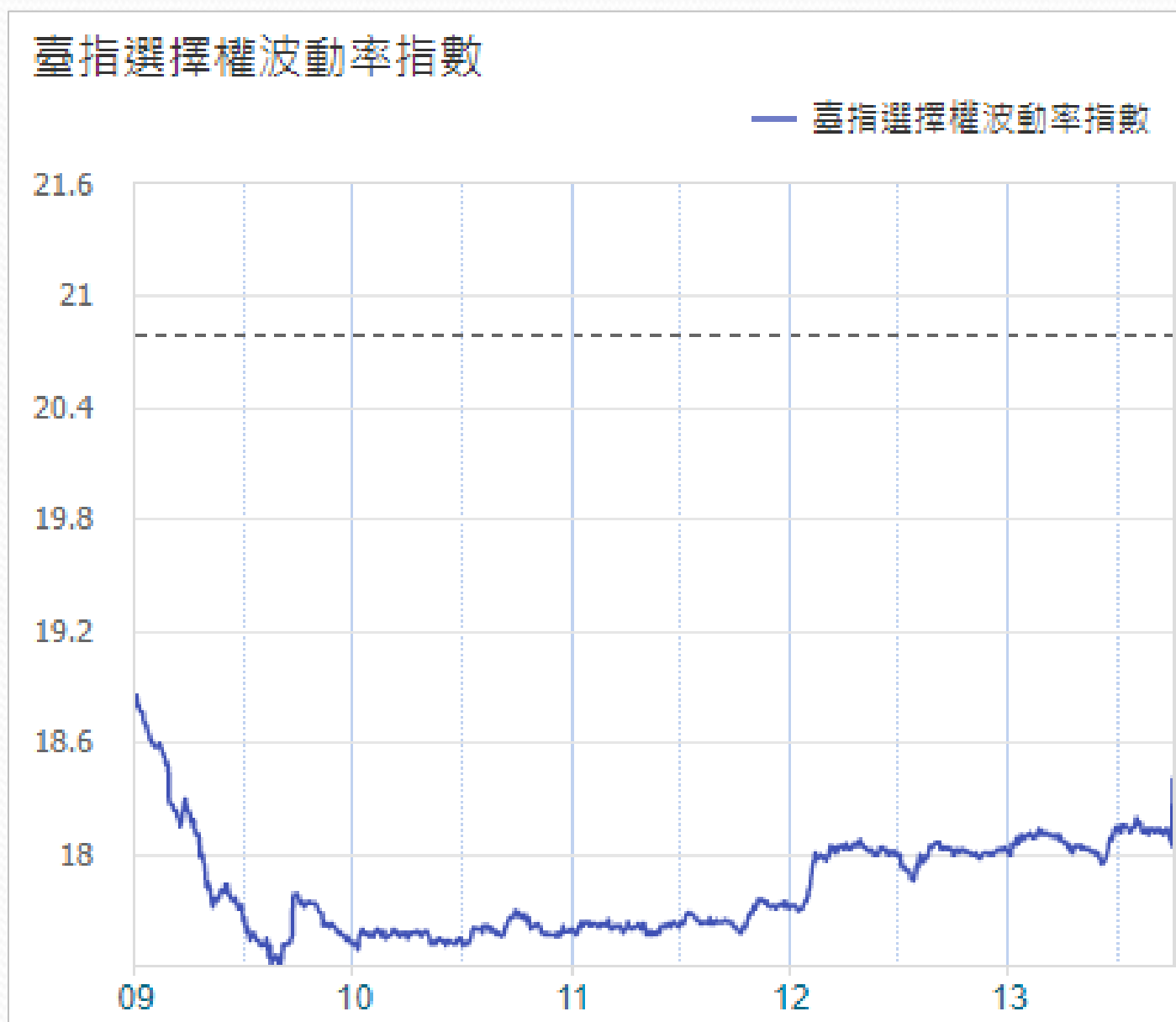
台指選擇權匯報

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	14000	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	17.44%	較前一交易日	+1.59%
	買權隱含波動率	13.64%	較前一交易日	-1.51%
	賣權隱含波動率	21.09%	較前一交易日	-2.33%
	成交量P/C_Ratio值	1.041	較前一交易日	+0.15
	未平倉P/C_Ratio值	0.928	較前一交易日	+0.07
電子選擇權	買權成交最大量	495	買權OI最大量	710
	賣權成交最大量	670	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1560	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1540

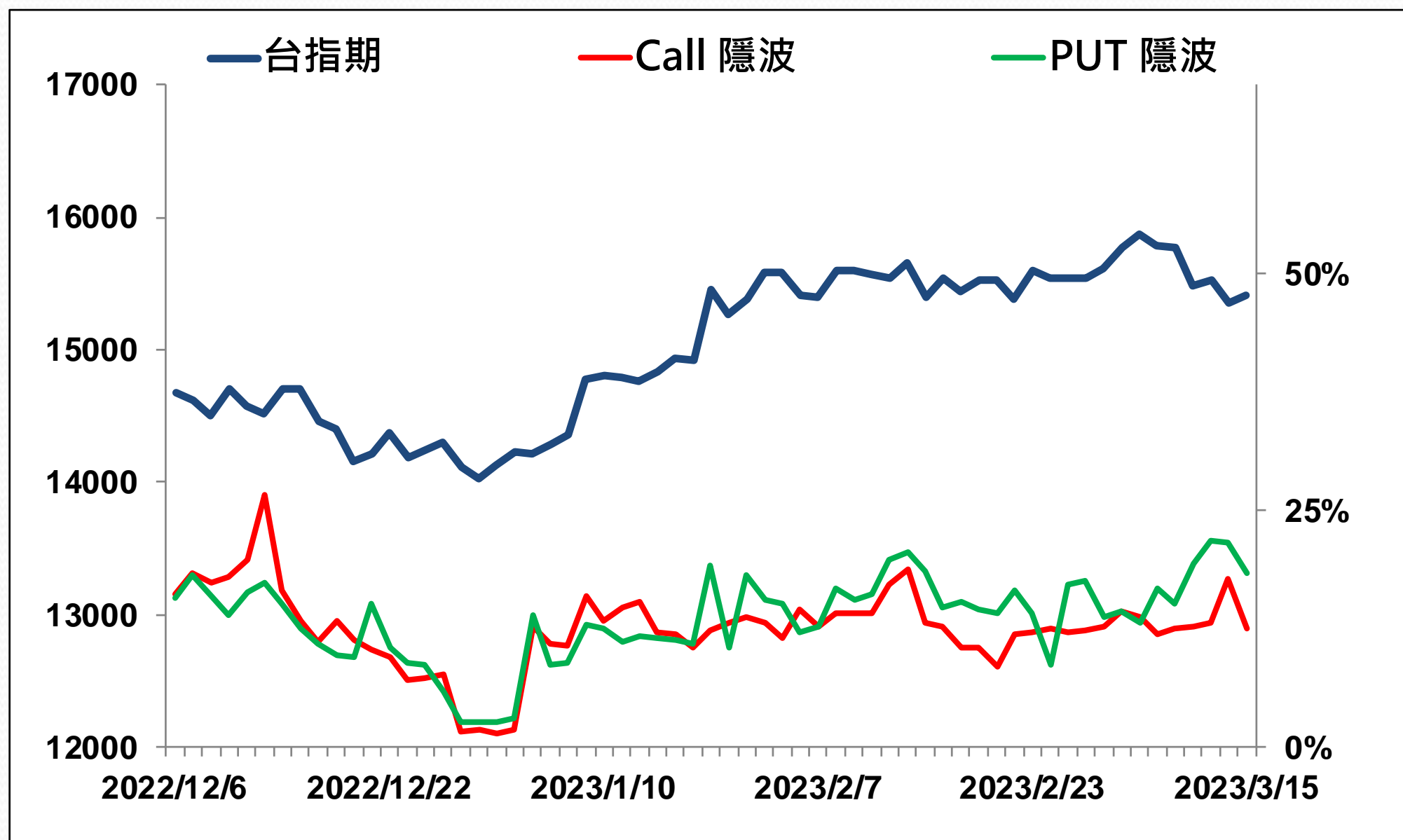
更新日期：2023年3月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



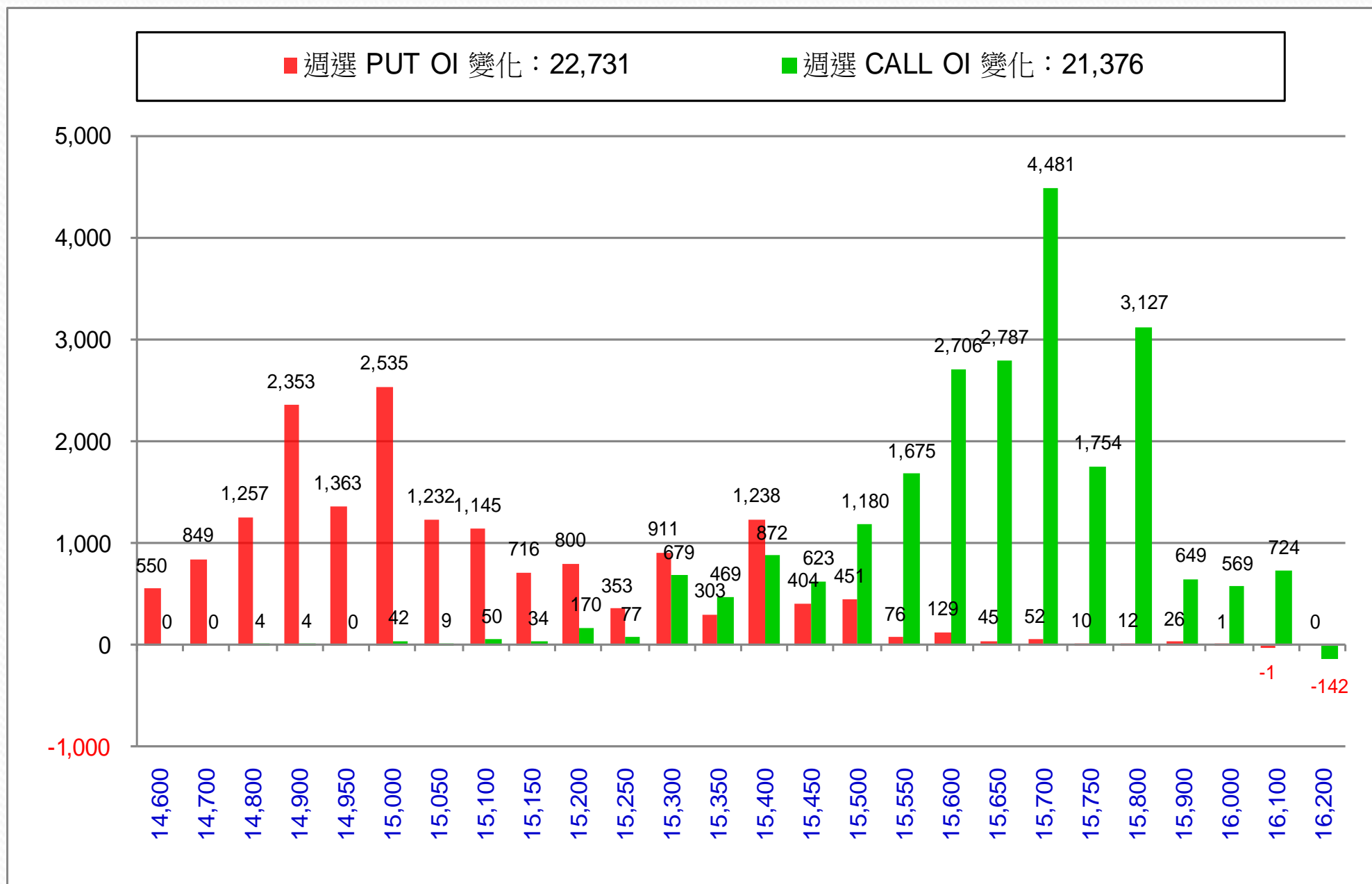
更新日期：2023年3月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年3月15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

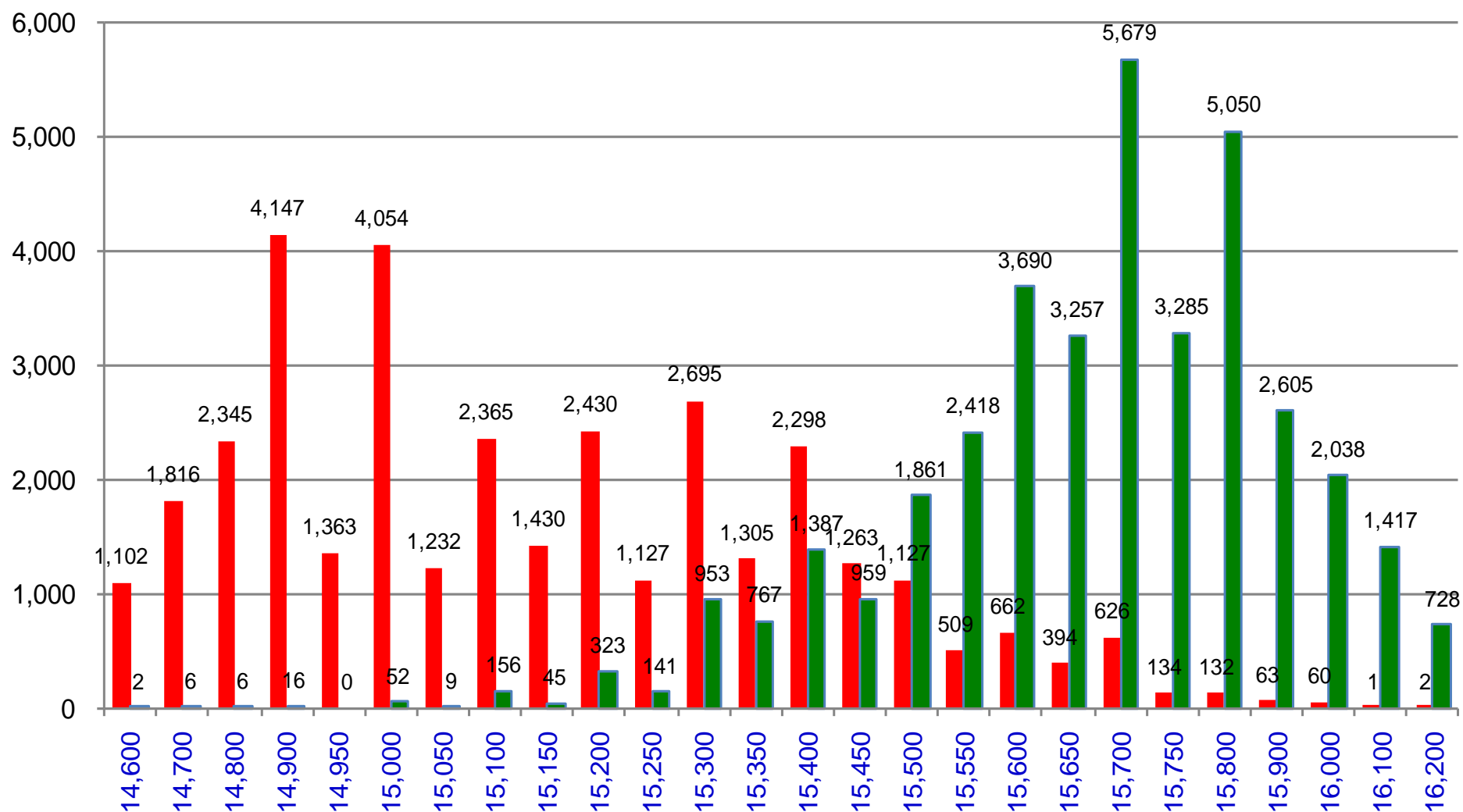


更新日期：2023年3月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：44,592

週選 CALL OI 總額：42,408



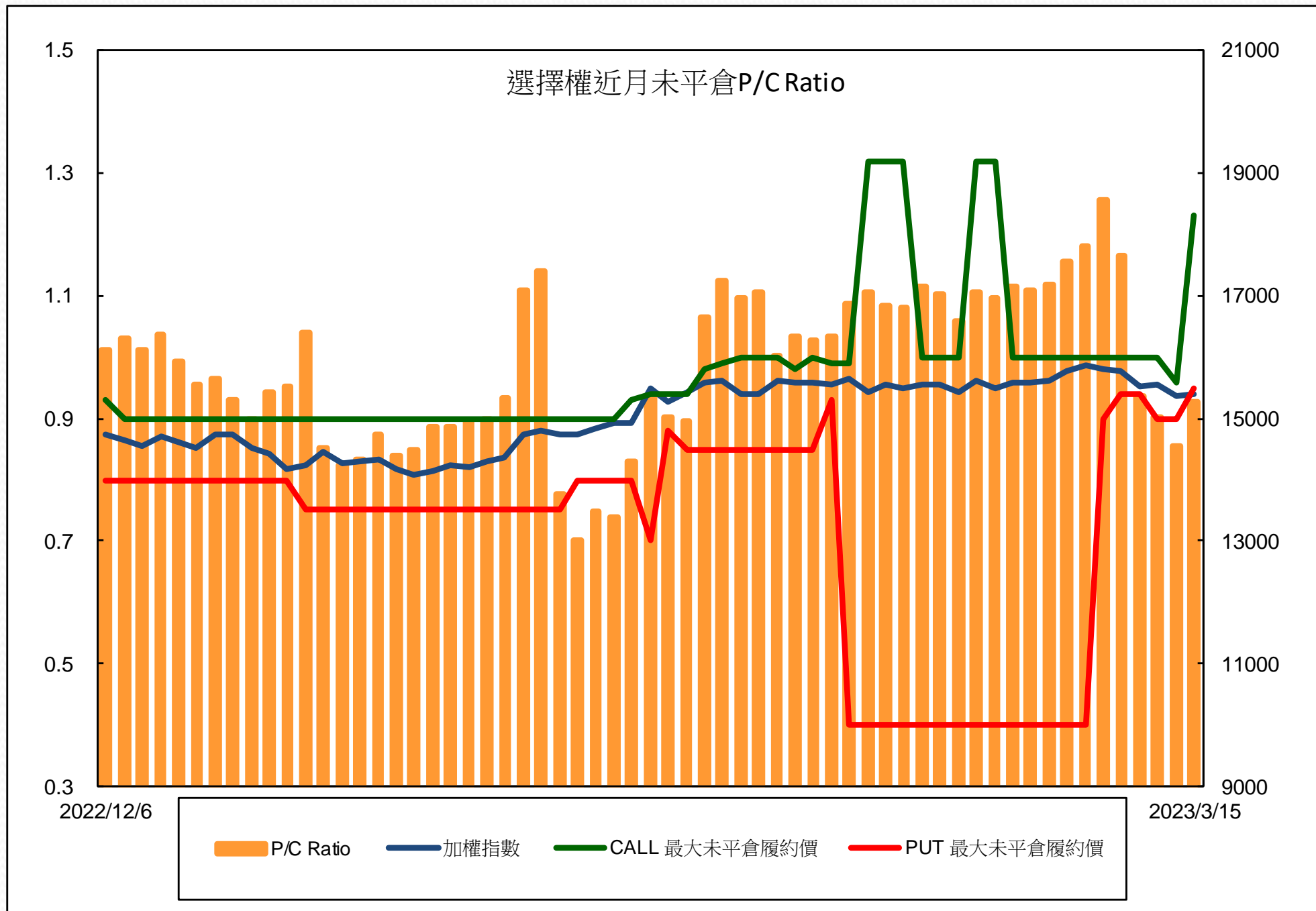
更新日期：2023年3月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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14日	84,266	94,922	-10,656
	3月15日	51,289	38,382	12,907
Put	3月14日	76,412	63,728	12,684
	3月15日	36,785	30,064	6,721

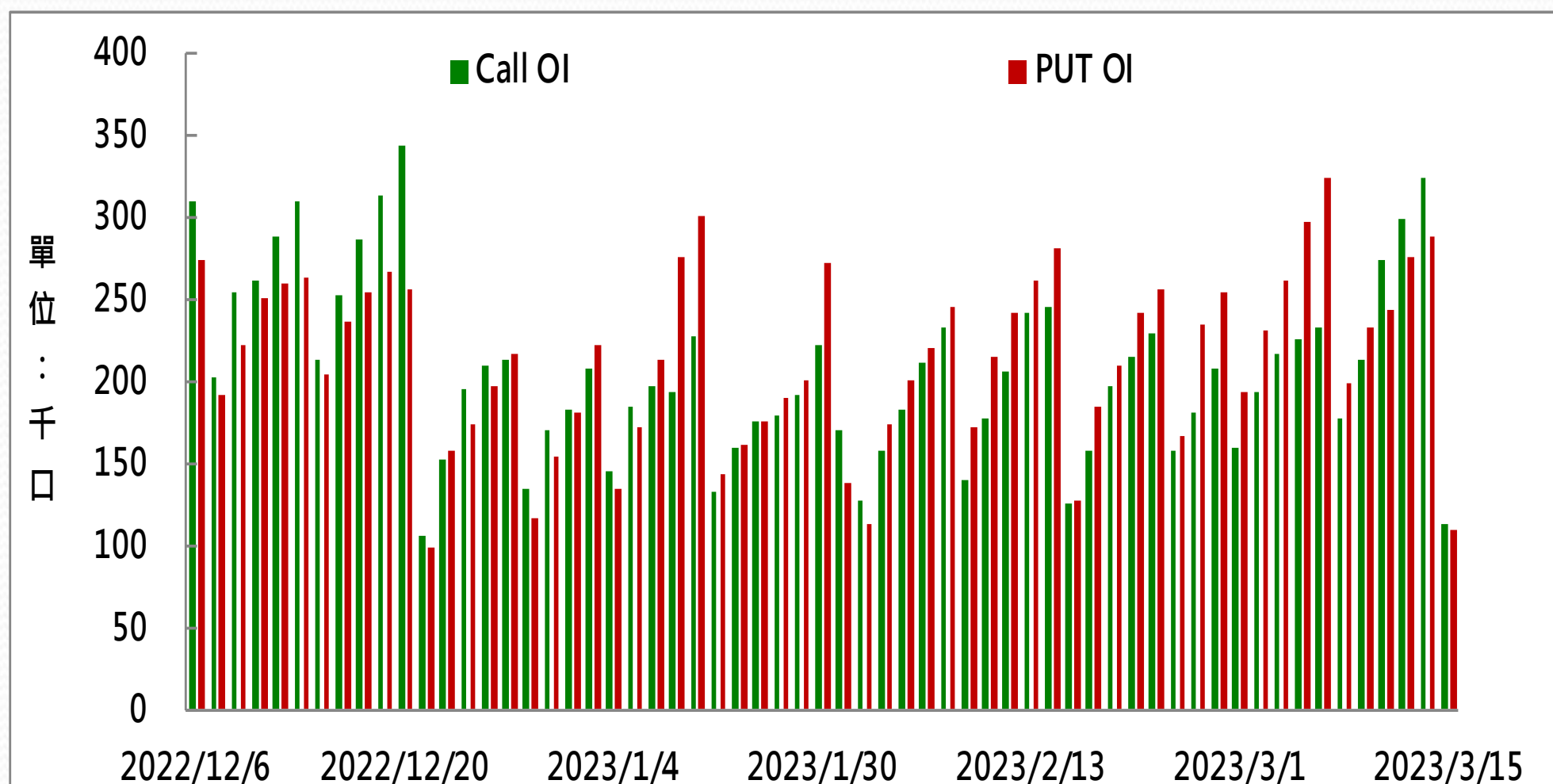
更新日期：2023年3月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

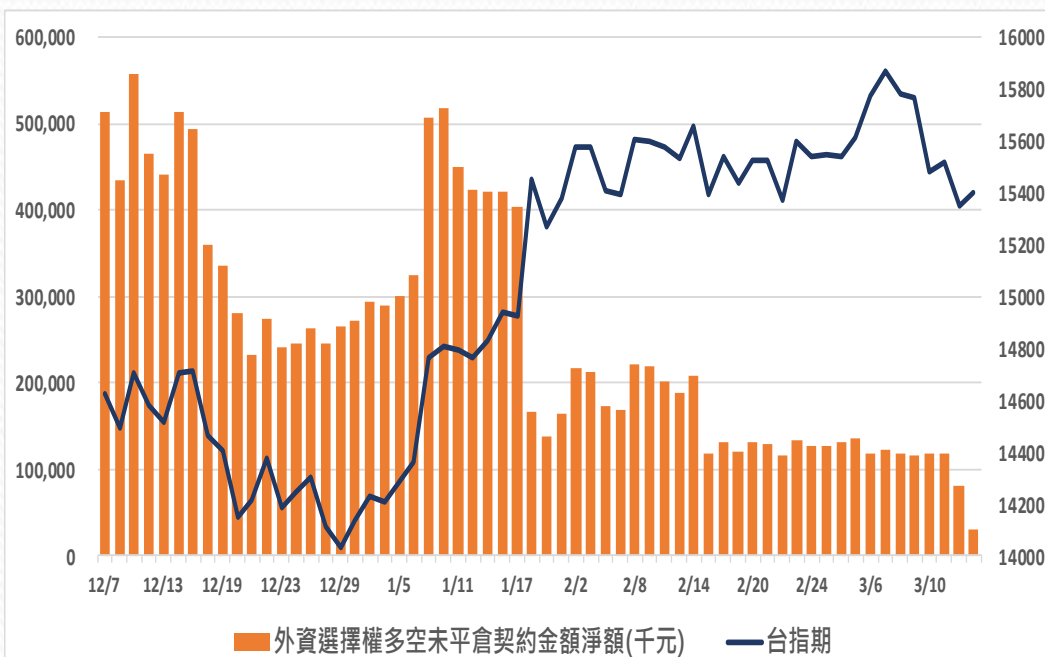
選擇權全月Put Call OI



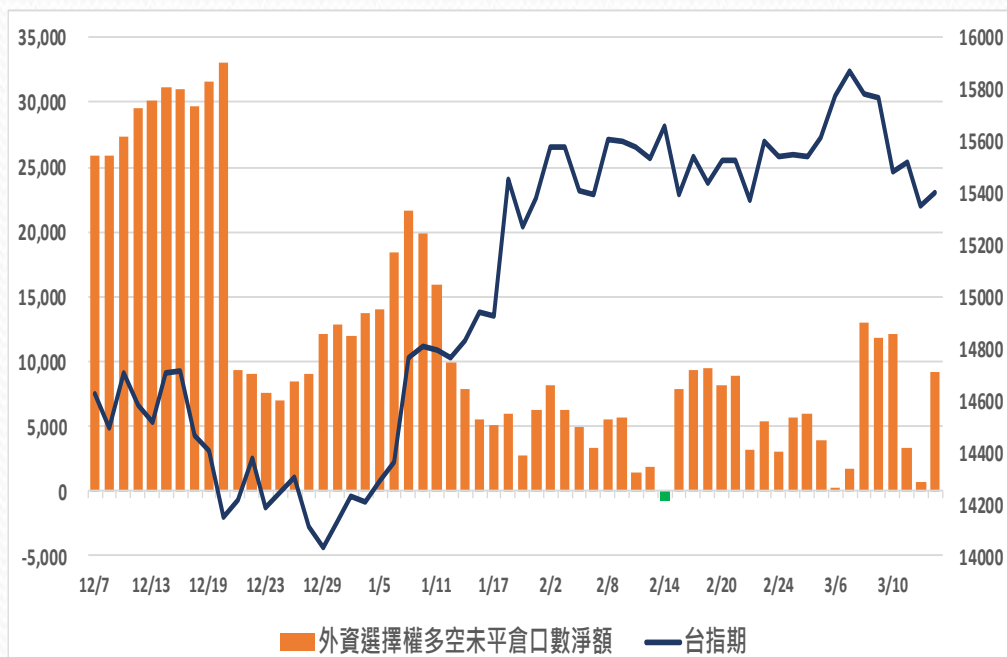
更新日期：2023年3月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



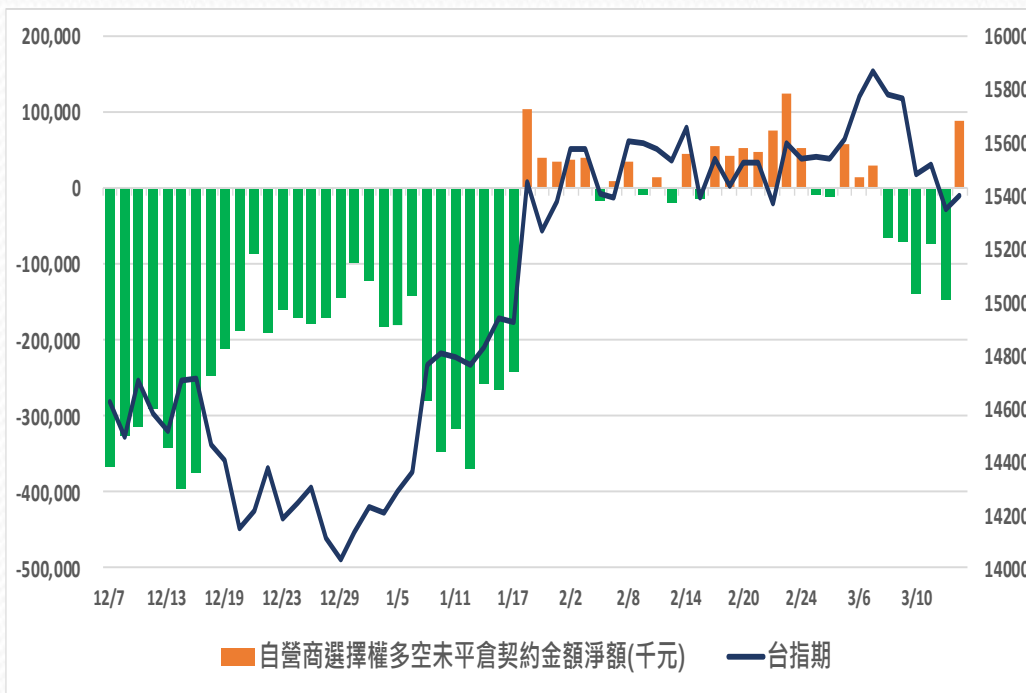
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/9	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
2023/3/15	15404	9,207	+8,555	29,734	-51,683

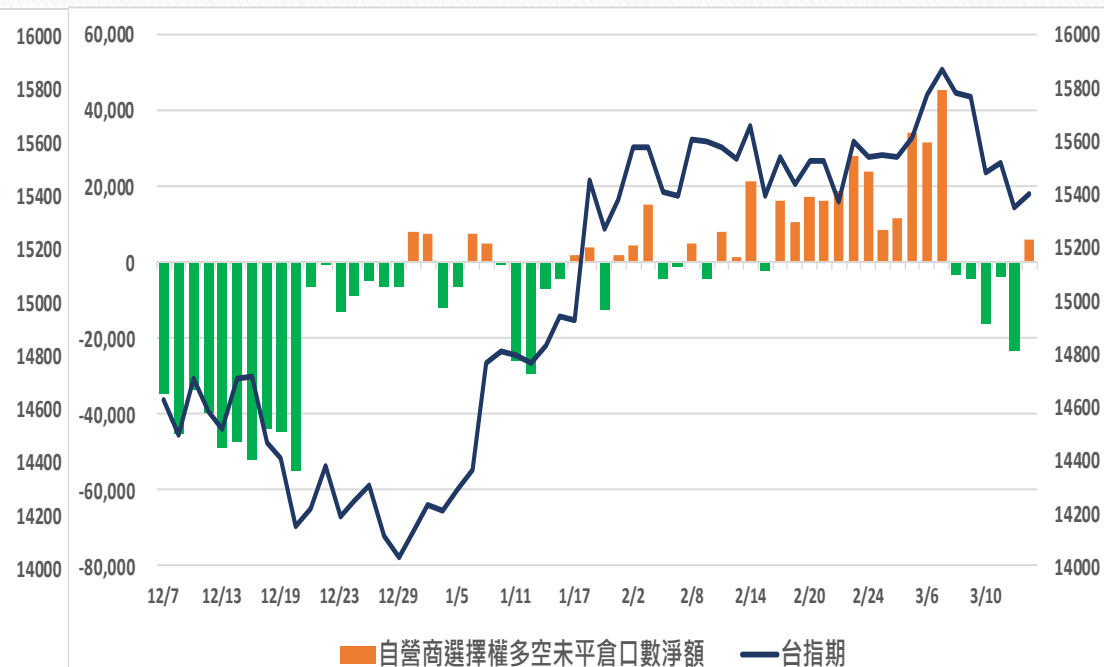
更新日期：2023年3月15日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



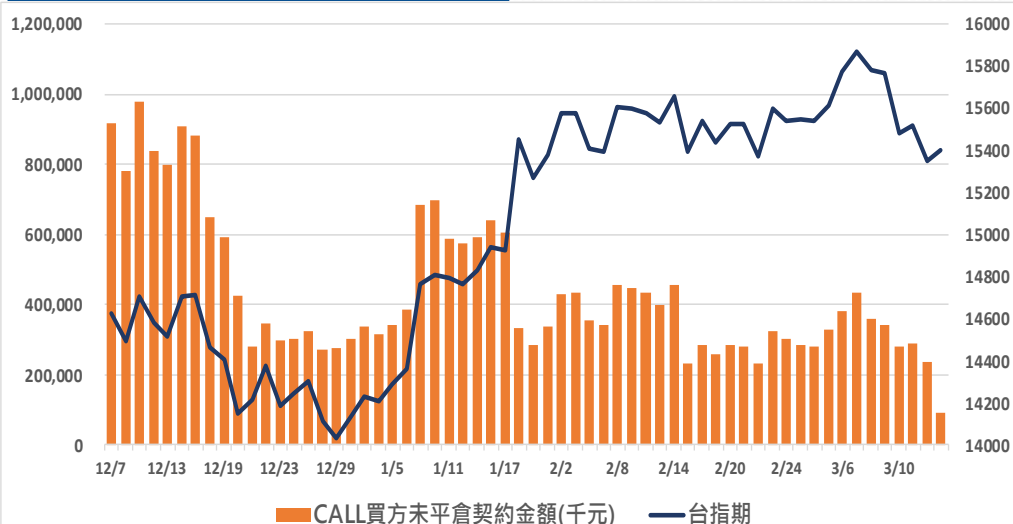
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/9	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
2023/3/15	15404	6,186	+29,526	89,880	+235,405

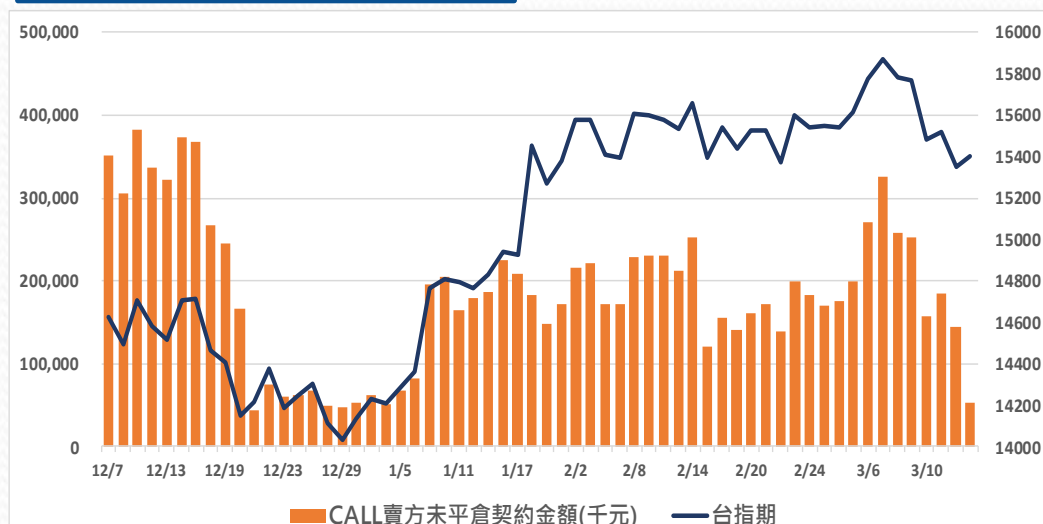
更新日期：2023年3月15日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

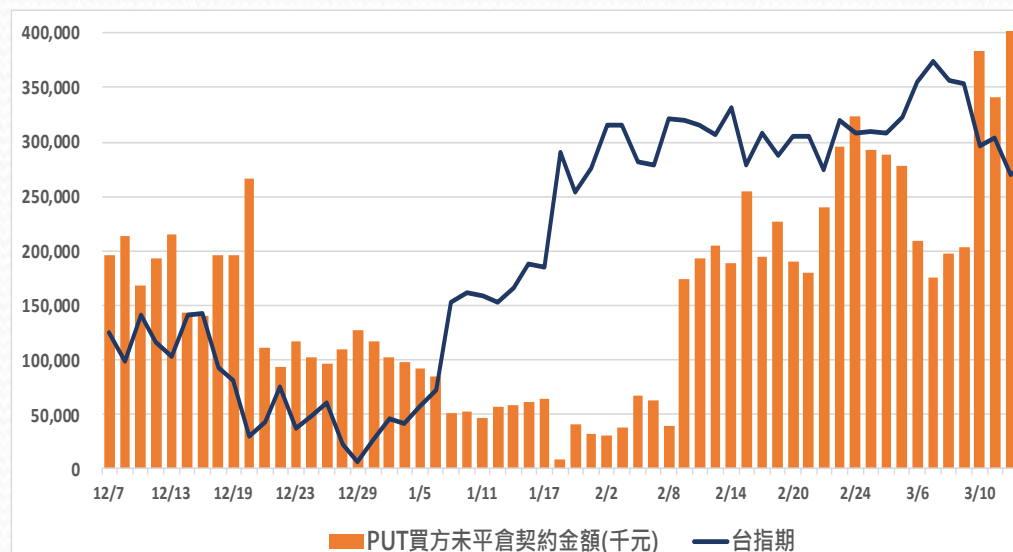
CALL買方未平倉金額



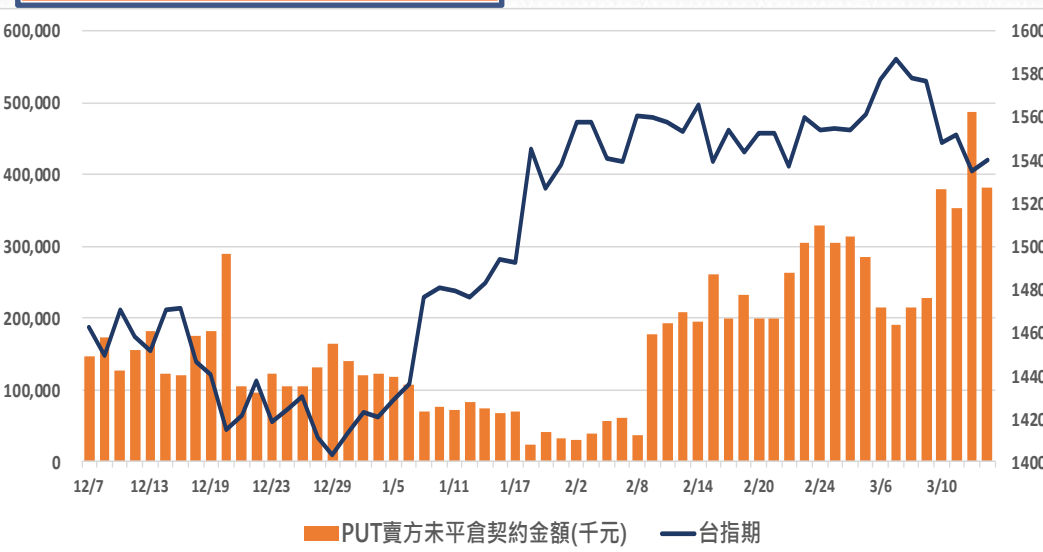
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



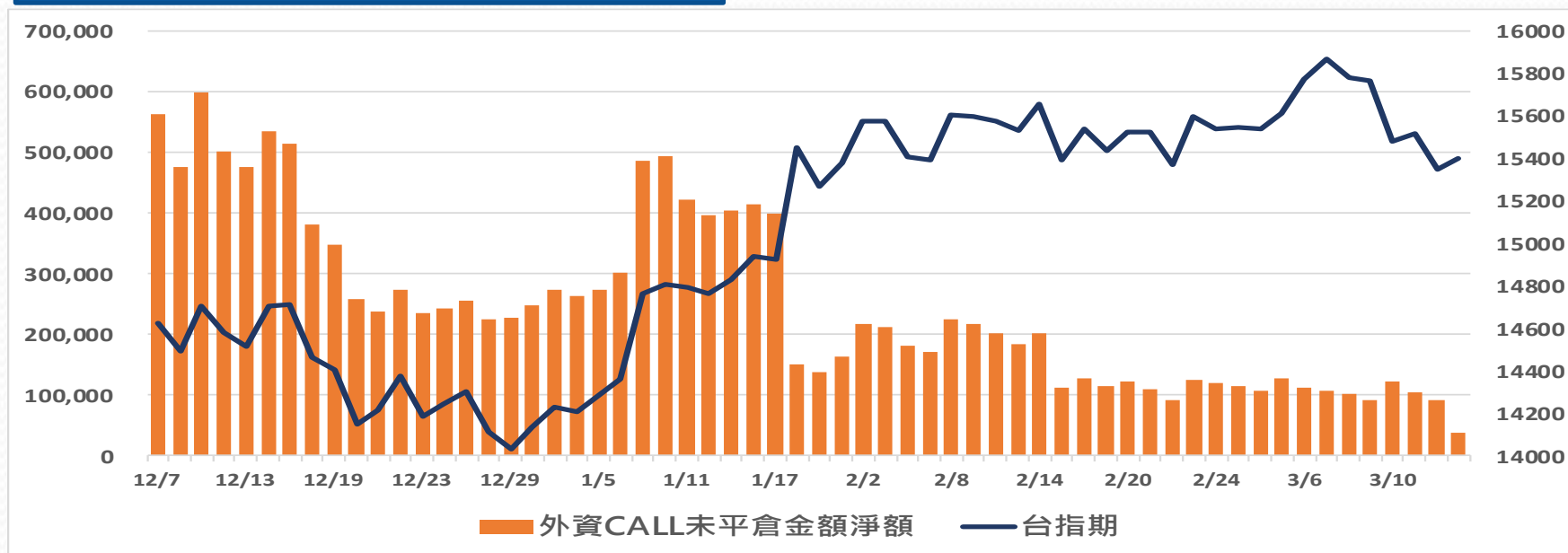
PUT賣方未平倉金額



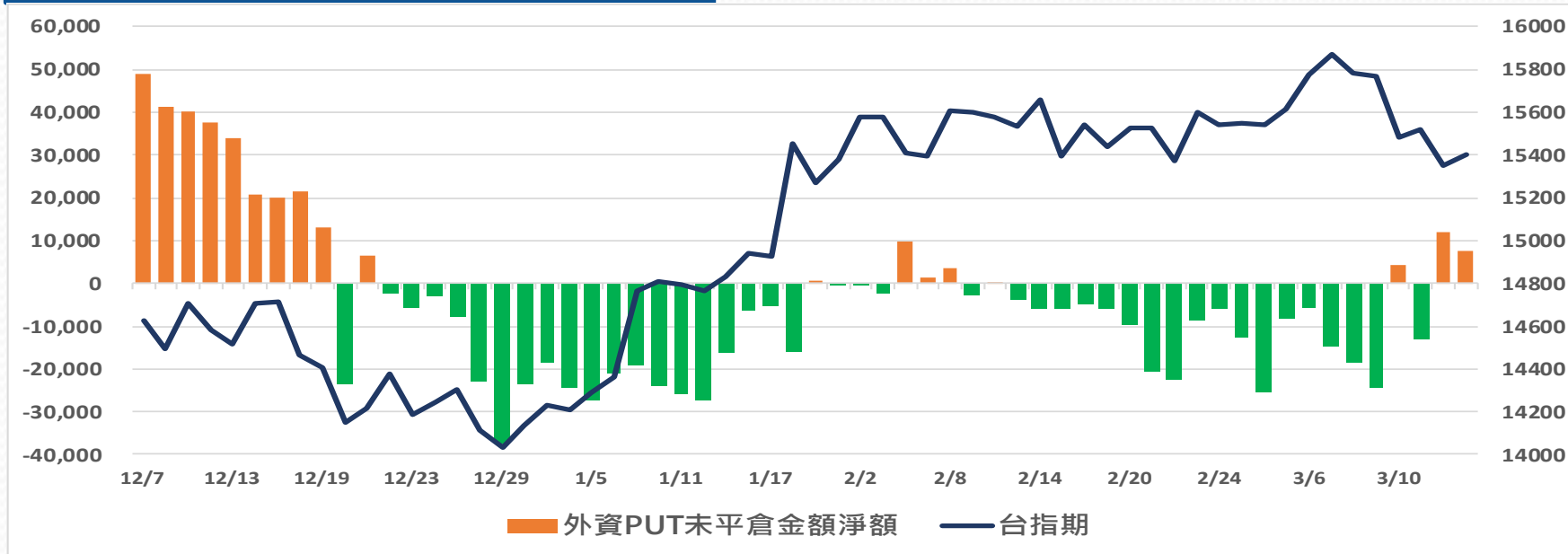
更新日期：2023年3月15日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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15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15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