

台指選擇權OI匯報

日期：2023/3/16 結算日：2023/3/22					日期：2023/3/16 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	1	14,200	3,819	1,592	0	4	13,900	732	199
1	1	14,300	3,179	1,435	3	5	14,000	3,877	2,292 ※
0	0	14,400	3,714	2,376	1	8	14,100	1,055	239
0	0	14,500	4,640	2,592	1	1	14,200	1,427	291
0	2	14,600	4,391	3,289	5	9	14,300	2,232	323
8	14	14,700	5,149	3,333	0	95	14,400	2,241	781
37	43	14,800	6,915	4,570	18	44	14,500	2,693	878
121	137	14,900	7,367	3,220	27	54	14,600	2,921	894
58	58	14,950	3,800	2,437	23	58	14,700	2,821	691
291	343	15,000	9,150	5,096 ※	35	93	14,800	2,920	-287
197	206	15,050	3,096	1,864	43	91	14,900	3,739	-56
422	578	15,100	5,025	2,660	37	157	15,000	2,558	-51
720	765	15,150	2,632	1,202	47	372	15,100	1,353	179
2,420	2,743	15,200	3,928	1,498	282	435	15,200	1,896	32
2,411	2,552	15,250	1,940	813	1,252	1,478	15,300	1,781	504
4,766	5,719	15,300	2,755	60	588	1,377	15,400	1,671	20
2,756	3,523	15,350	1,450	145	1,002	3,543	15,500	7,837	-122
4,930	6,317	15,400	1,839	-459	748	2,335	15,600	624	49
3,940	4,899	15,450	1,223	-40	838	2,732	15,700	560	12
6,787 ※	8,648	15,500	1,181	54	1,494	3,734	15,800	544	-9
4,294	6,712	15,550	589	80	584	2,975	15,900	61	0
5,541	9,231	15,600	674	12	1,920 ※	5,453	16,000	66	-2
2,192	5,449	15,650	449	55	200	3,314	16,100	62	2
1,030	6,709	15,700	719	93	21	3,547	16,200	88	-2
734	4,019	15,750	139	5	207	3,166	16,300	67	0
-220	4,830	15,800	175	43	166	3,586	16,400	15	-1
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
45,007	87,415	0.9973	87,182	42,590	9,817	58,780	0.9330	54,840	9,400
昨日 P/C	1.0515	今日增減變化	-0.0542		昨日 P/C	0.9280	今日增減變化	0.0049	

更新日期：2023年3月16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16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	67,696,827	51,307,870	16,388,957	-4,873,644	1,909,042	855,182	1,053,860	-47,382	
投信	28,299,044	51,719,677	-23,420,633	98,653	357,046	0	357,046	-12,925	
自營商	43,978,606	20,281,383	23,697,223	-287,068	1,448,338	797,594	650,744	685,429	
	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	652,480	1,266,580	-614,100	321,651	13,198	14,664	-1,466	-17,751	
投信	104,810	0	104,810	-6,160	0	0	0	0	
自營商	352,812	301,141	51,671	-80,294	136,375	104,114	32,261	18,938	

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16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	18,508	9,052	9,456	2,879	23,996	26,018	-2,022	608	
投信	0	0	0	0	200	119	81	0	
自營商	63,186	45,610	17,576	4,669	49,289	37,870	11,419	4,698	
特定法人(週)	1,178	0	1,178	583	0	4,144	-4,144	-980	
特定法人(近月)	11,967	4,759	7,208	2,080	15,483	12,657	2,826	-153	
特定法人(全月)	10,792	4,759	6,033	2,080	18,506	20,791	-2,285	-1,563	
十大交易人(週)	36,554	36,856	-302	-2,857	30,485	27,089	3,396	1,046	
十大交易人(近月)	35,883	26,904	8,979	3,378	25,597	34,632	-9,035	-3,735	
十大交易人(全月)	75,526	59,807	15,719	3,059	55,422	66,848	-11,426	-4,934	
全市場未沖銷(近月)			58,780	9,817			54,840	9,400	
全市場未沖銷(全月)			174,888	62,461			166,777	57,511	

更新日期：2023年3月16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	15500	買權OI最大量	15600
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	15.67%	較前一交易日	+0.57%
	買權隱含波動率	12.25%	較前一交易日	+0.03%
	賣權隱含波動率	17.77%	較前一交易日	-0.00%
電子選擇權	買權成交最大量	760	買權OI最大量	760
	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	1500	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1440	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年3月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

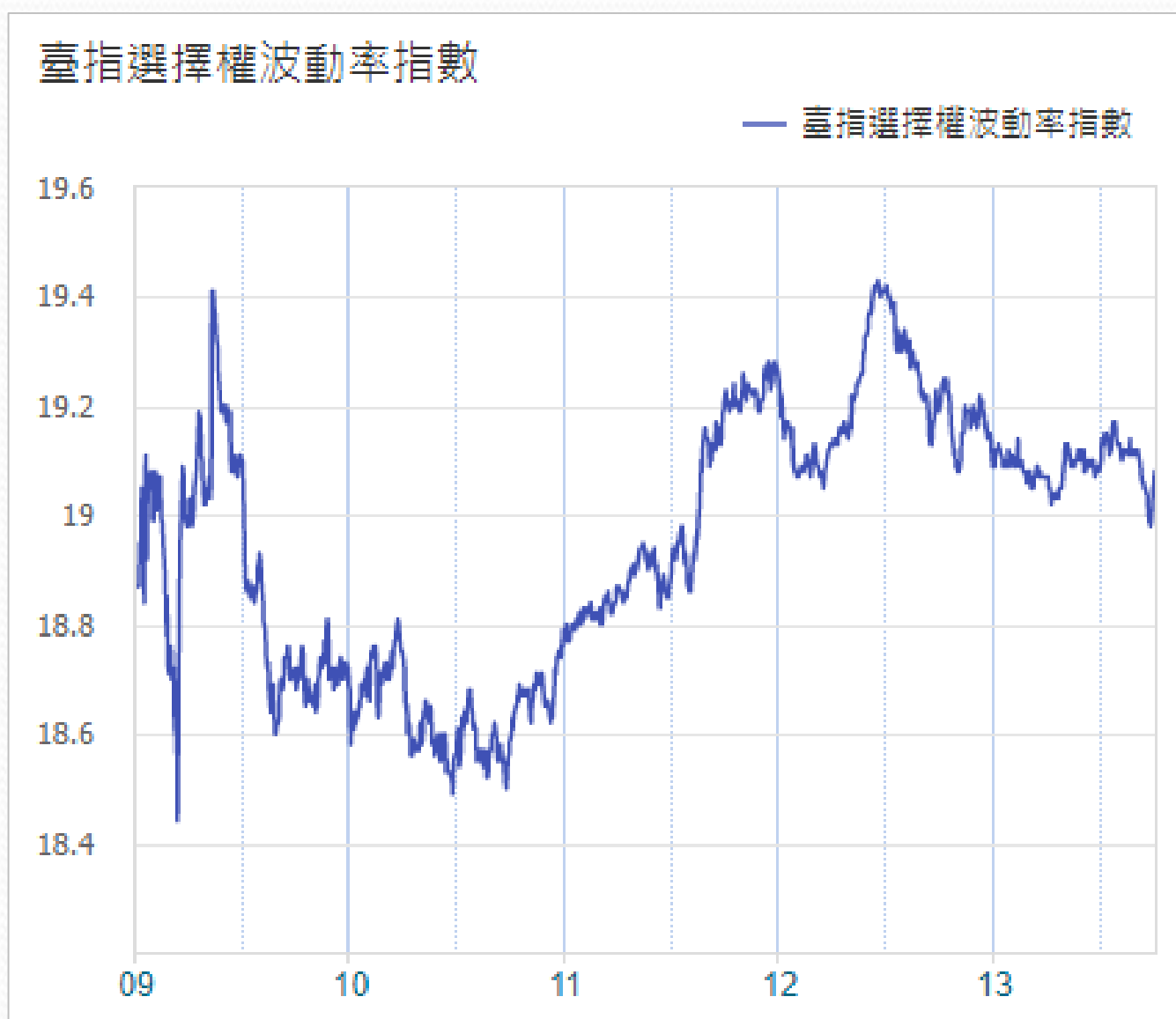
台指選擇權匯報

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	16000
	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	+0.00%
	買權隱含波動率	13.64%	較前一交易日	+0.00%
	賣權隱含波動率	21.09%	較前一交易日	+0.00%
	成交量P/C_Ratio值	0.956	較前一交易日	-0.08
	未平倉P/C_Ratio值	0.933	較前一交易日	+0.00
電子選擇權	買權成交最大量	760	買權OI最大量	760
	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	1500	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1440	賣權OI最大量	1540

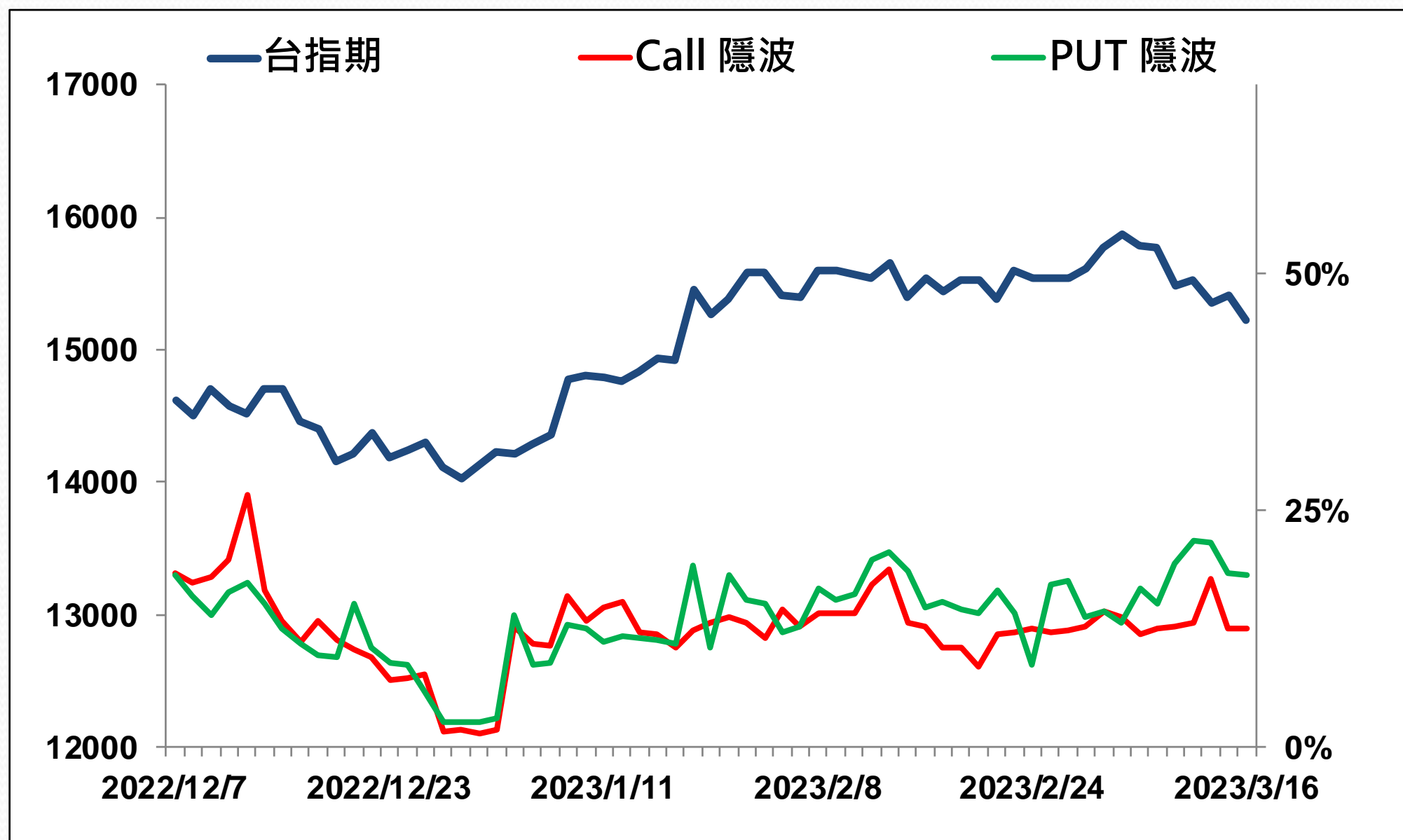
更新日期：2023年3月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



更新日期：2023年3月16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

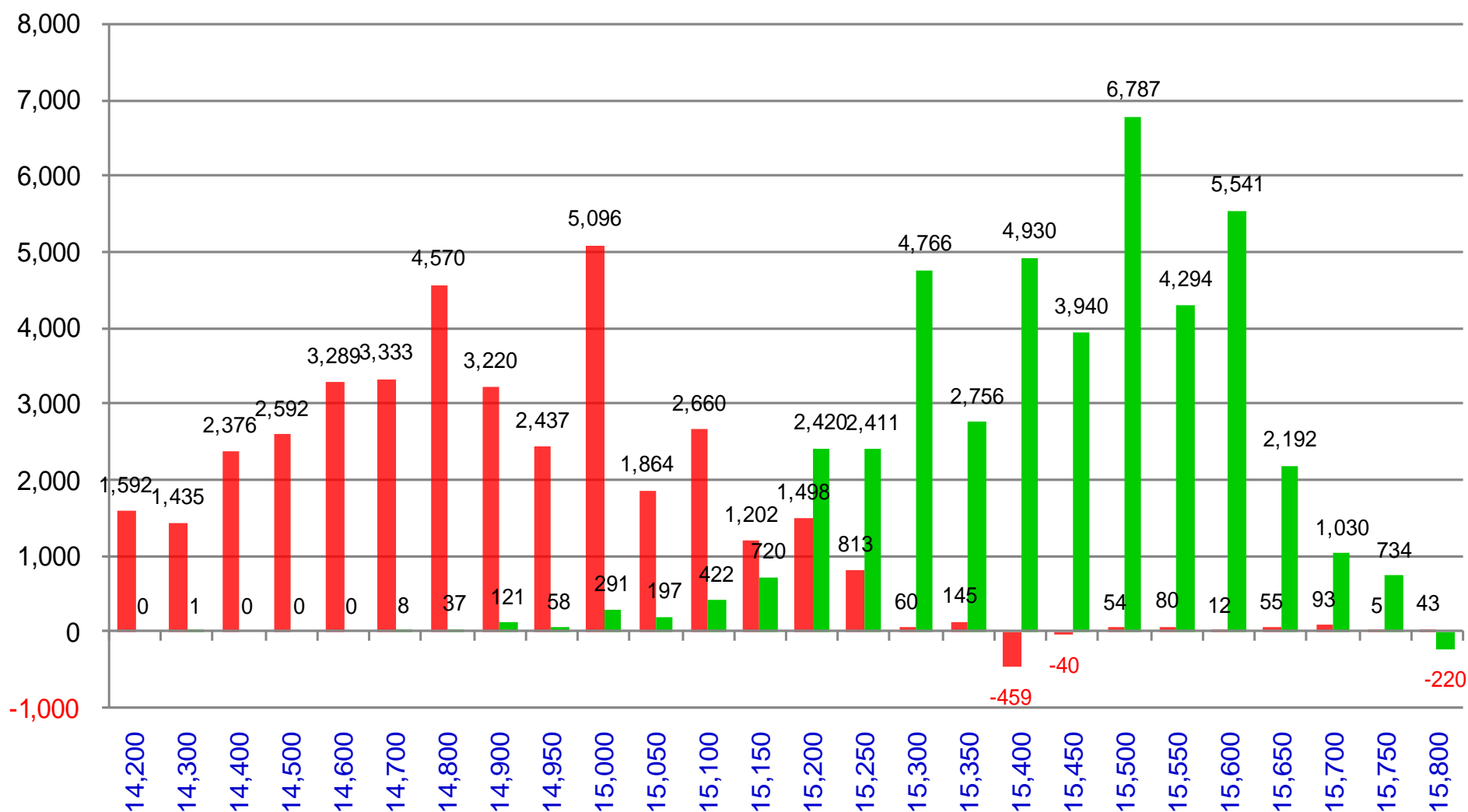


更新日期：2023年3月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：42,590

週選 CALL OI 變化：45,007

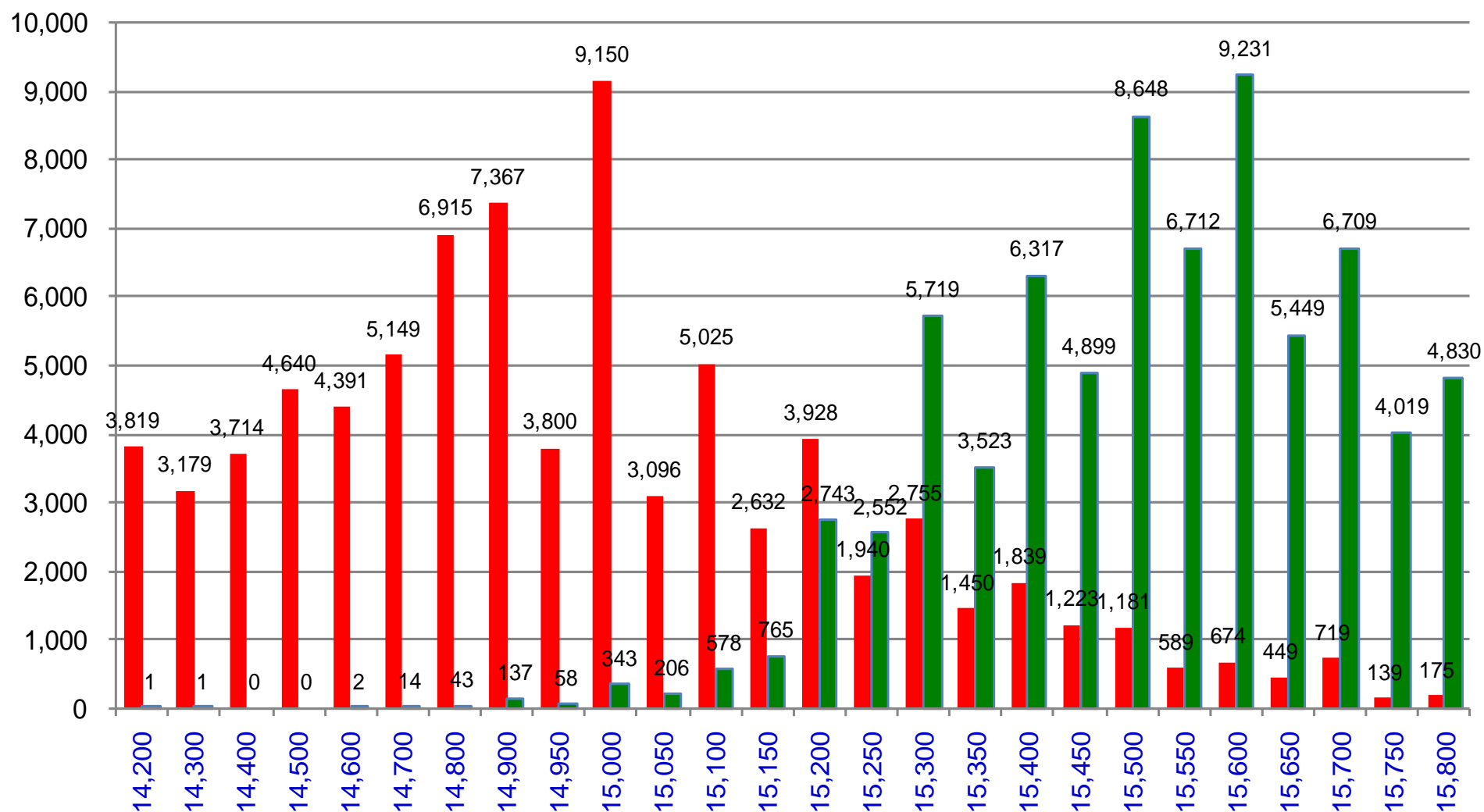


更新日期：2023年3月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：87,182

週選 CALL OI 總額：87,415



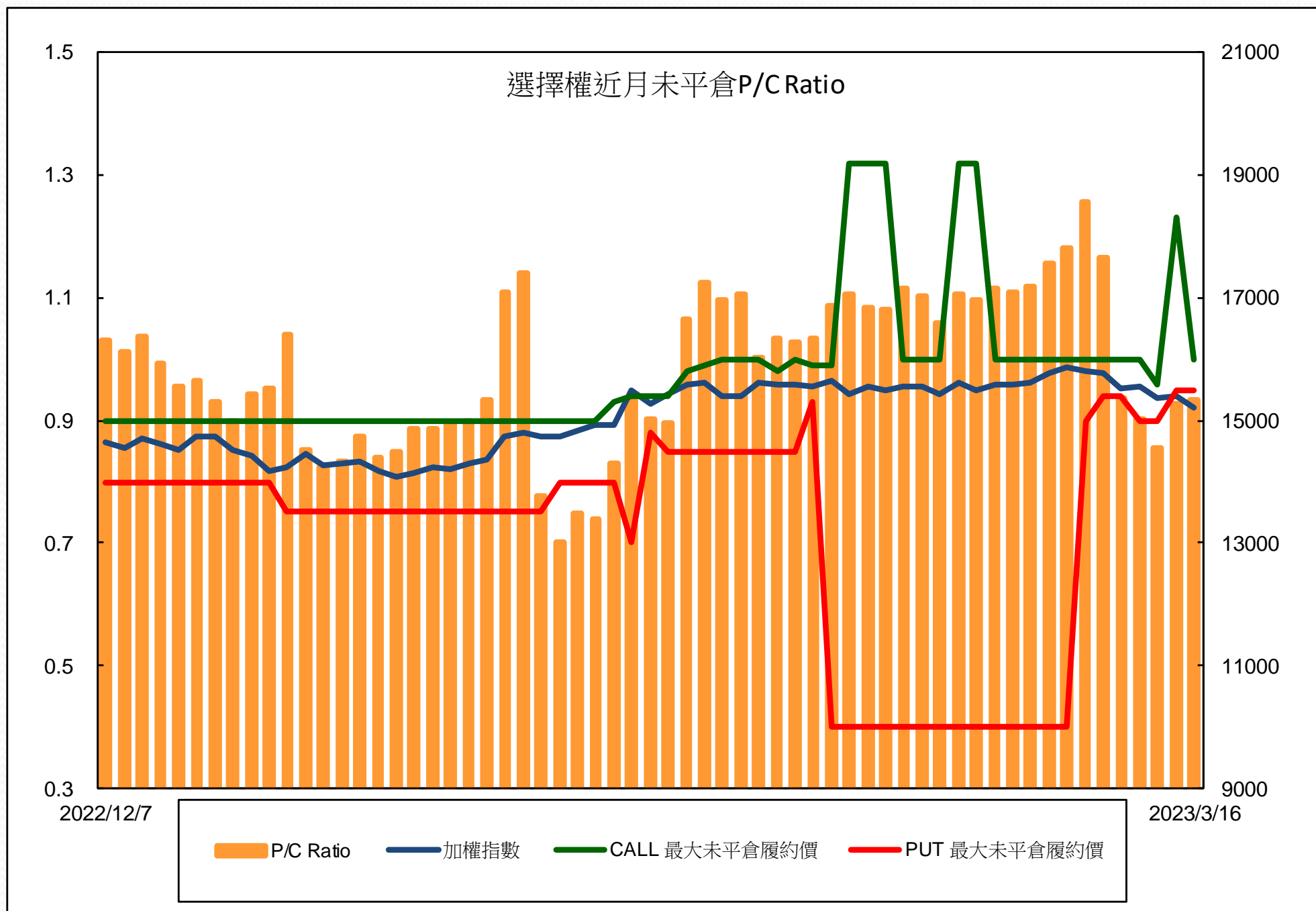
更新日期：2023年3月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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15日	51,289	38,382	12,907
	3月16日	63,186	45,610	17,576
Put	3月15日	36,785	30,064	6,721
	3月16日	49,289	37,870	11,419

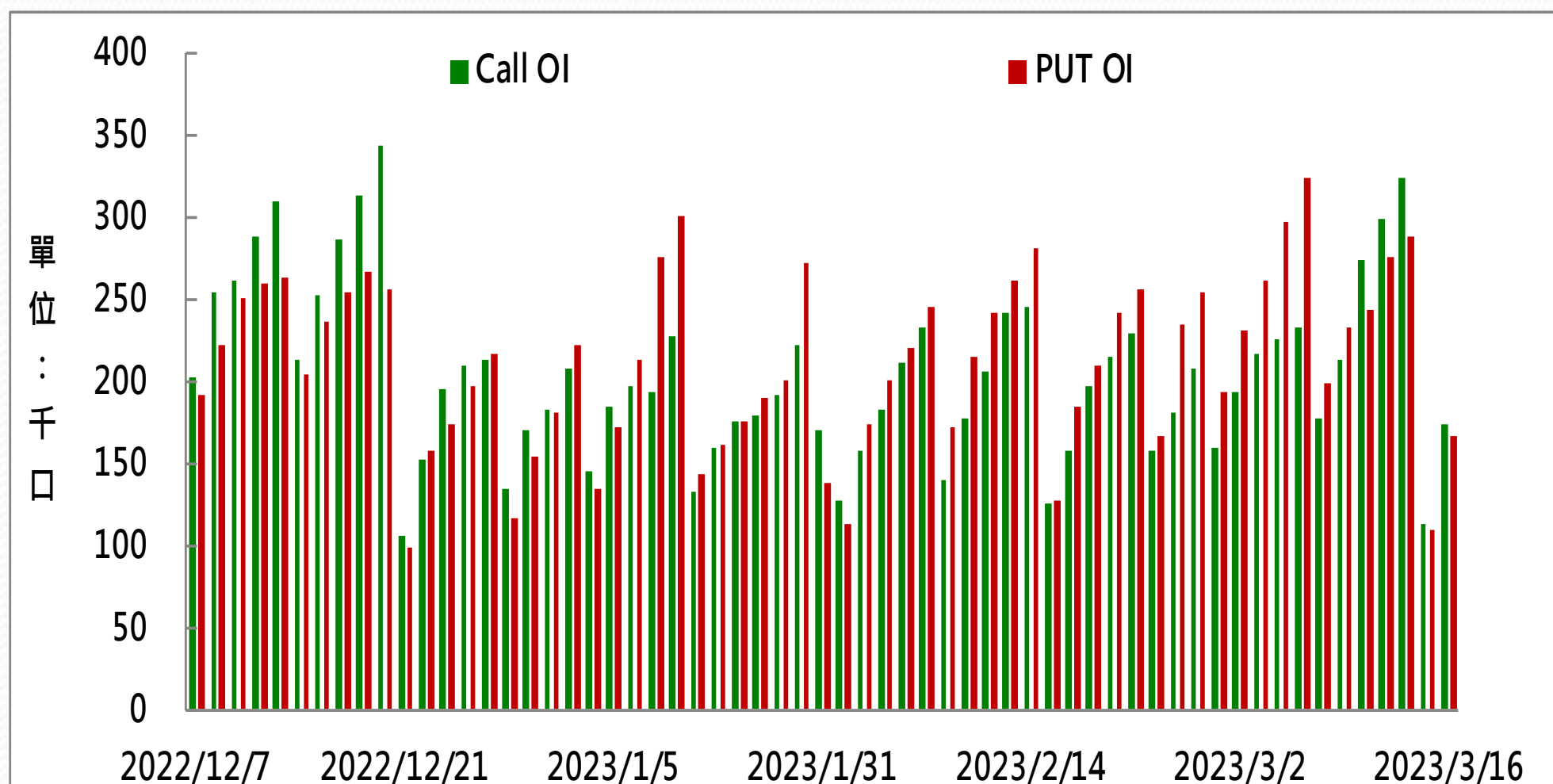
更新日期：2023年3月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

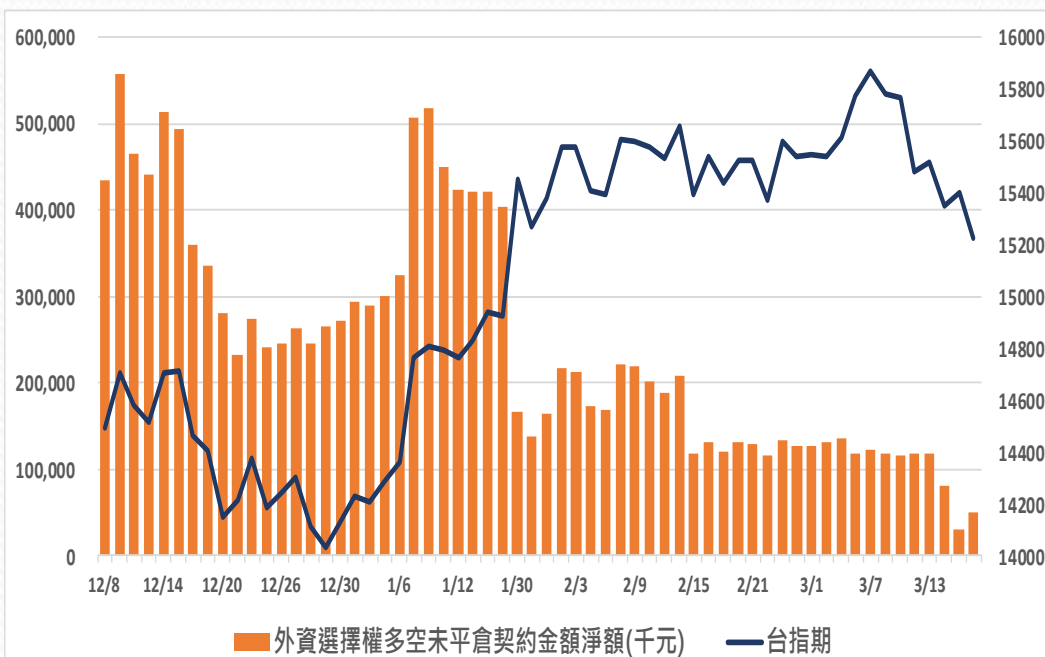
選擇權全月Put Call OI



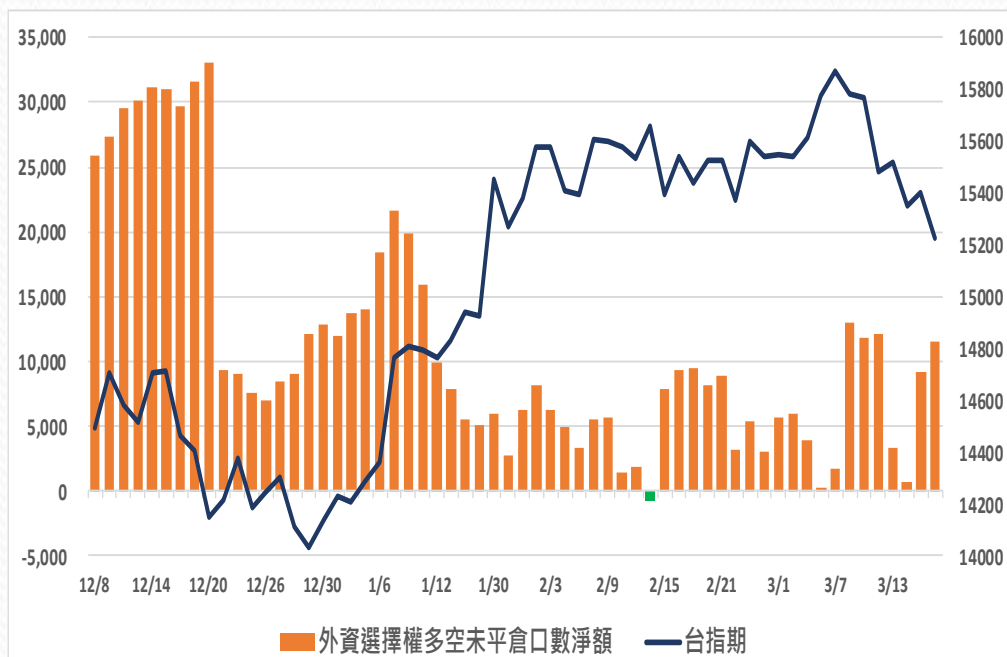
更新日期：2023年3月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



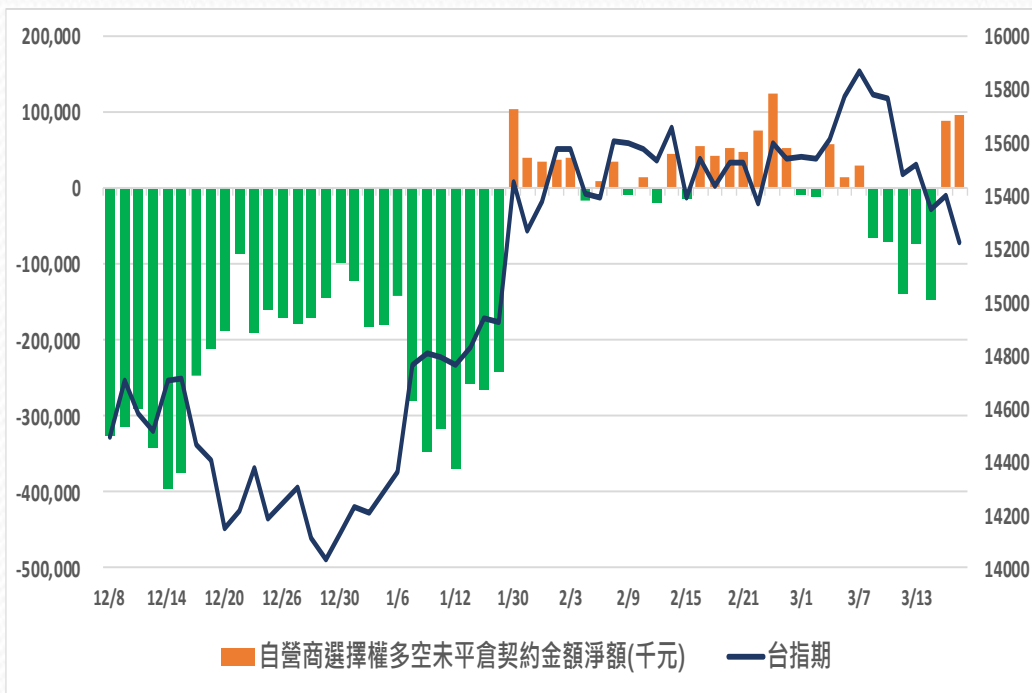
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/10	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
2023/3/16	15226	11,478	+2,271	50,910	+21,176

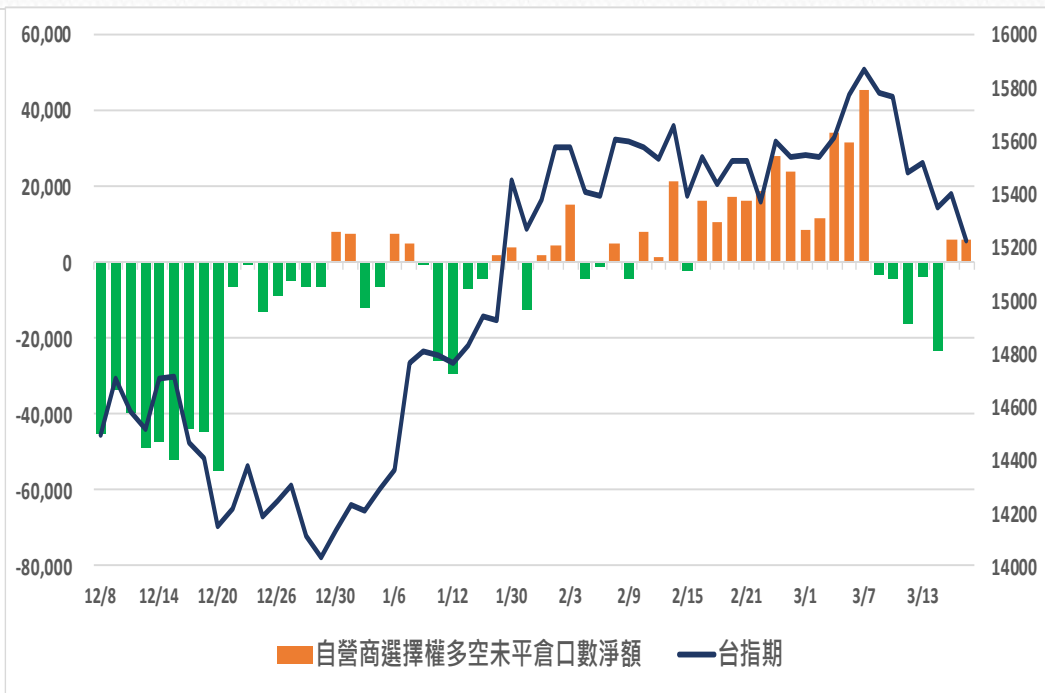
更新日期：2023年3月16日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



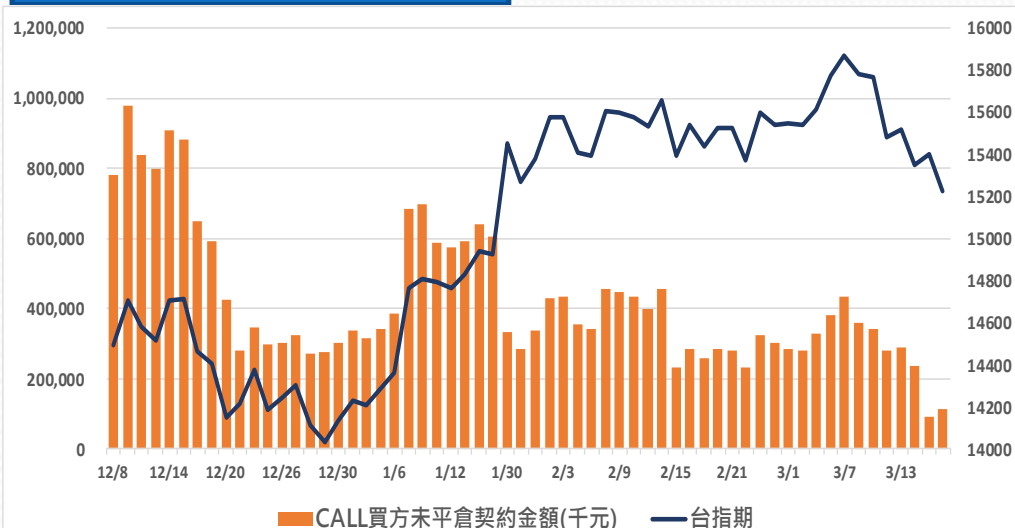
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/10	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
2023/3/16	15226	6,157	-29	96,613	+6,733

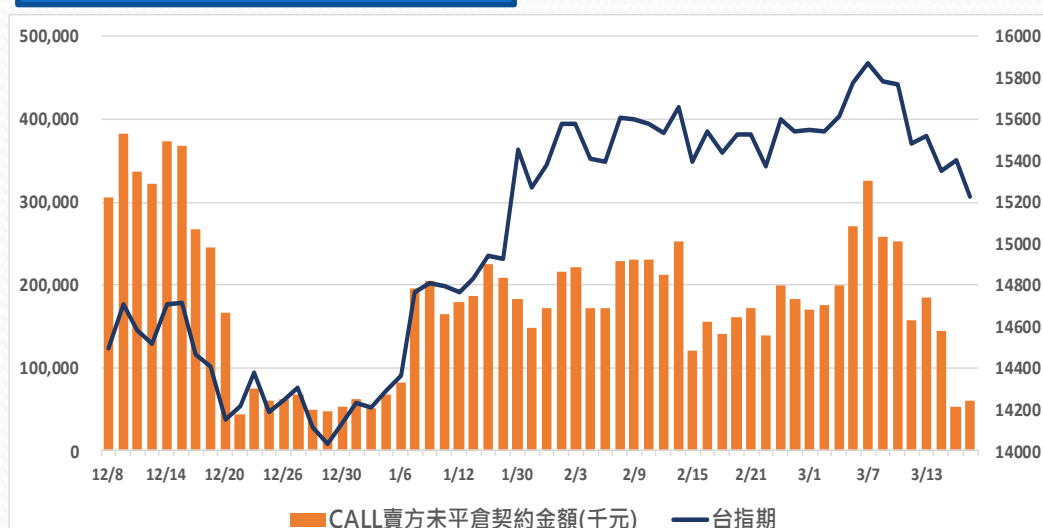
更新日期：2023年3月16日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

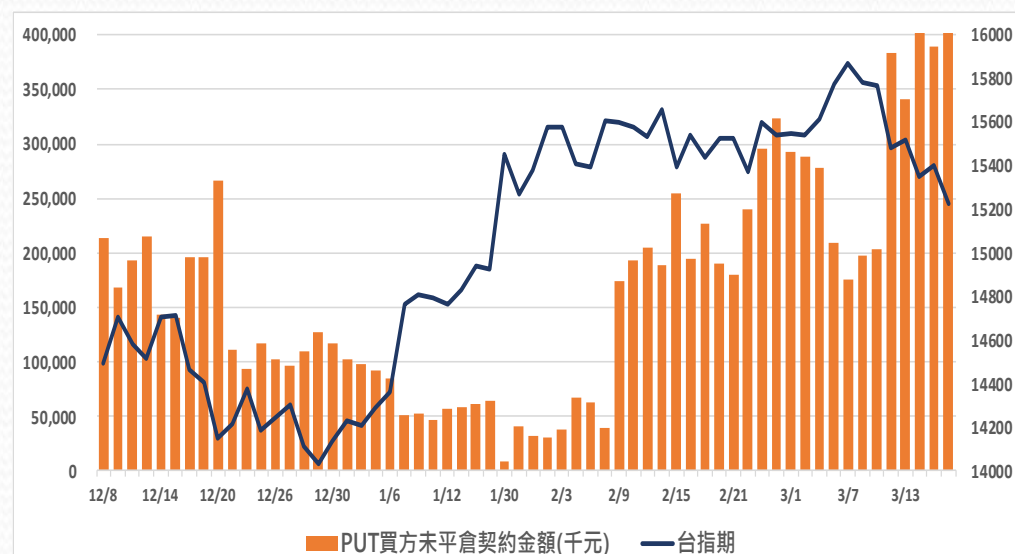
CALL買方未平倉金額



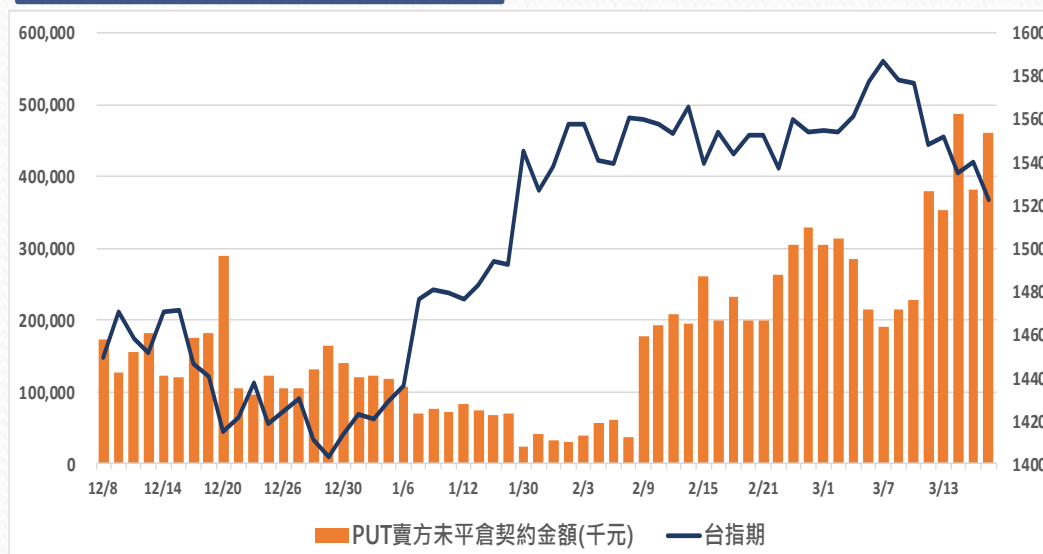
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



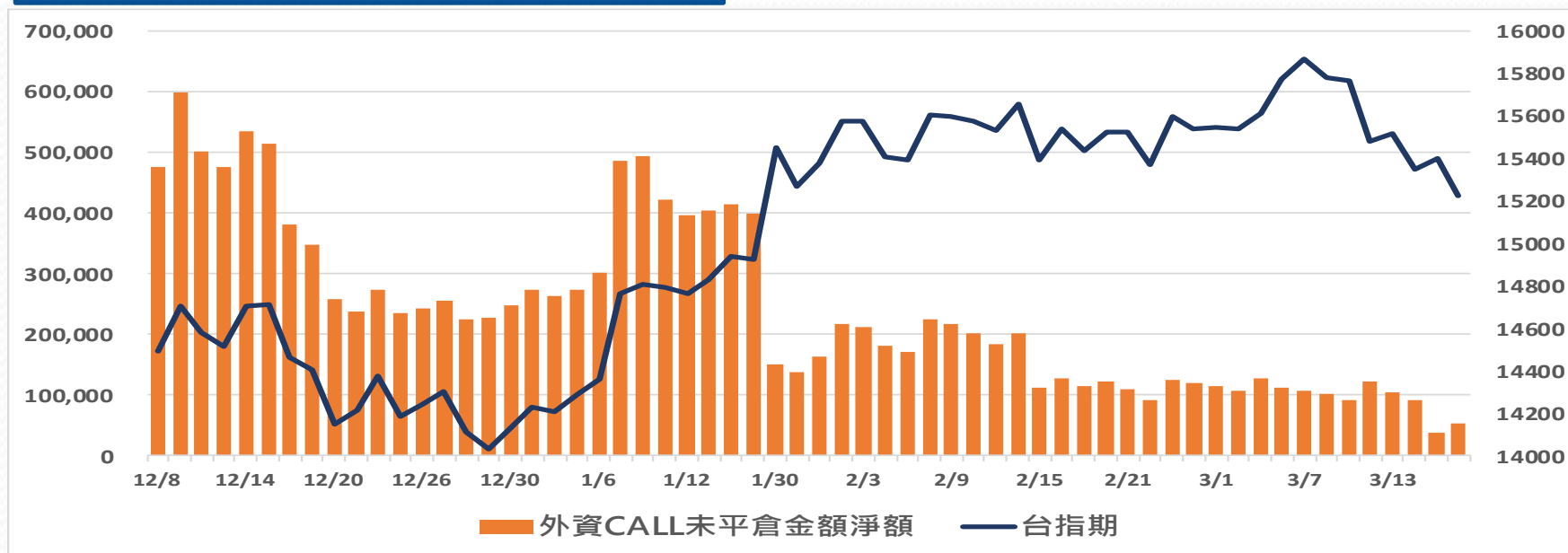
PUT賣方未平倉金額



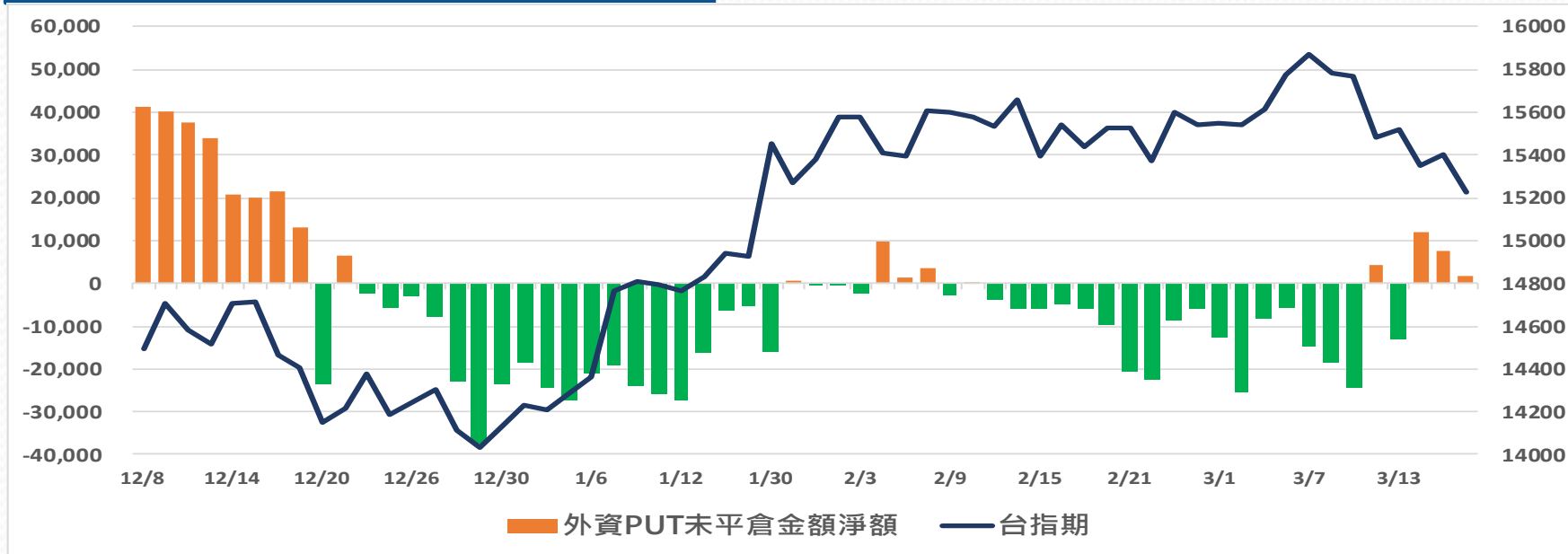
更新日期：2023年3月16日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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16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16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