

台指選擇權OI匯報

日期：2023/3/17					日期：2023/3/17				
202303W4					202304 月台指選擇權 OI 序列				
結算日：2023/3/22	Call	履約價	Put	OI 增減	結算日：2023/4/19	Call	履約價	Put	OI 增減
OI 增減	Call	履約價	Put	OI 增減	OI 增減	Call	履約價	Put	OI 增減
-4	39	14,800	6,810	-105	2	3	14,200	1,819	392
0	0	14,850	1,725	1,725	1	10	14,300	2,282	50
-52	85	14,900	8,872	1,505	1	96	14,400	2,459	218
9	67	14,950	5,130	1,330	0	44	14,500	3,234	541
-45	298	15,000	13,214	4,064	-1	53	14,600	3,021	100
-47	159	15,050	4,424	1,328	-1	57	14,700	3,472	651
-99	479	15,100	6,860	1,835	1	94	14,800	3,200	280
-36	729	15,150	4,560	1,928	-4	87	14,900	3,485	-254
-437	2,306	15,200	8,477	4,549	9	166	15,000	2,934	376
-611	1,941	15,250	4,060	2,120	22	394	15,100	1,594	241
-2,424	3,295	15,300	6,912	4,157	263	1,492	15,200	2,191	295
-511	3,012	15,350	5,910	4,460	649	2,026	15,300	3,535	1,754
-577	5,740	15,400	4,360	2,521	273	3,816	15,400	2,191	520
-143	4,756	15,450	1,832	609	-107	2,228	15,500	7,902	65
1,226	9,874	15,500	1,772	591	-28	2,704	15,600	707	83
974	7,686	15,550	908	319	173	3,907	15,700	600	40
2,233	11,464	15,600	891	217	461	3,436	15,800	606	62
1,461	6,910	15,650	462	13	622	6,075	15,900	72	11
1,112	7,821	15,700	772	53	-37	3,277	16,000	75	9
974	4,993	15,750	227	88	533	4,080	16,100	63	1
211	5,041	15,800	284	109	125	3,291	16,200	83	-5
1,076	4,308	15,900	69	6	97	3,683	16,300	68	1
42	3,654	16,000	50	-10	-679	2,297	16,400	15	0
46	1,415	16,100	1	0	-75	1,418	16,500	5	1
-15	712	16,200	2	0	-6	976	16,600	0	0
-59	862	16,300	5	0			16,700	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
4,263	91,678	1.3284	121,788	34,606	3,635	62,415	0.9724	60,690	5,850
昨日 P/C	0.9973	今日增減變化	0.3311		昨日 P/C	0.9330	今日增減變化	0.0394	

更新日期：2023年3月17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17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	80,625,538	47,748,365	32,877,173	16,488,216	1,901,831	882,263	1,019,568	-34,292	
投信	28,967,562	51,089,142	-22,121,580	1,299,053	362,254	0	362,254	5,208	
自營商	43,384,691	19,491,348	23,893,343	196,120	1,545,421	628,101	917,320	266,576	
	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	624,764	1,230,236	-605,472	8,628	53,284	10,361	42,923	44,389	
投信	100,912	0	100,912	-3,898	0	0	0	0	
自營商	320,544	425,909	-105,365	-157,036	82,886	109,526	-26,640	-58,901	

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17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	21,814	9,954	11,860	2,404	25,550	27,125	-1,575	447	
投信	0	0	0	0	200	119	81	0	
自營商	67,842	47,833	20,009	2,433	56,065	52,146	3,919	-7,500	
特定法人(週)	1,505	0	1,505	327	0	2,540	-2,540	1,604	
特定法人(近月)	11,569	4,767	6,802	-406	15,472	13,157	2,315	-511	
特定法人(全月)	13,218	4,769	8,449	2,416	18,638	21,471	-2,833	-548	
十大交易人(週)	44,815	36,094	8,721	9,023	47,020	31,368	15,652	12,256	
十大交易人(近月)	37,634	27,095	10,539	1,560	27,777	36,112	-8,335	700	
十大交易人(全月)	86,225	59,218	27,007	11,288	72,217	70,671	1,546	12,972	
全市場未沖銷(近月)			62,415	3,635			60,690	5,850	
全市場未沖銷(全月)			184,515	9,627			210,455	43,678	

更新日期：2023年3月17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	12.75%	較前一交易日	-2.92%
	買權隱含波動率	9.60%	較前一交易日	-2.62%
	賣權隱含波動率	15.33%	較前一交易日	-2.43%
電子選擇權	買權成交最大量	730	買權OI最大量	710
	賣權成交最大量	690	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1540	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1420	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年3月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

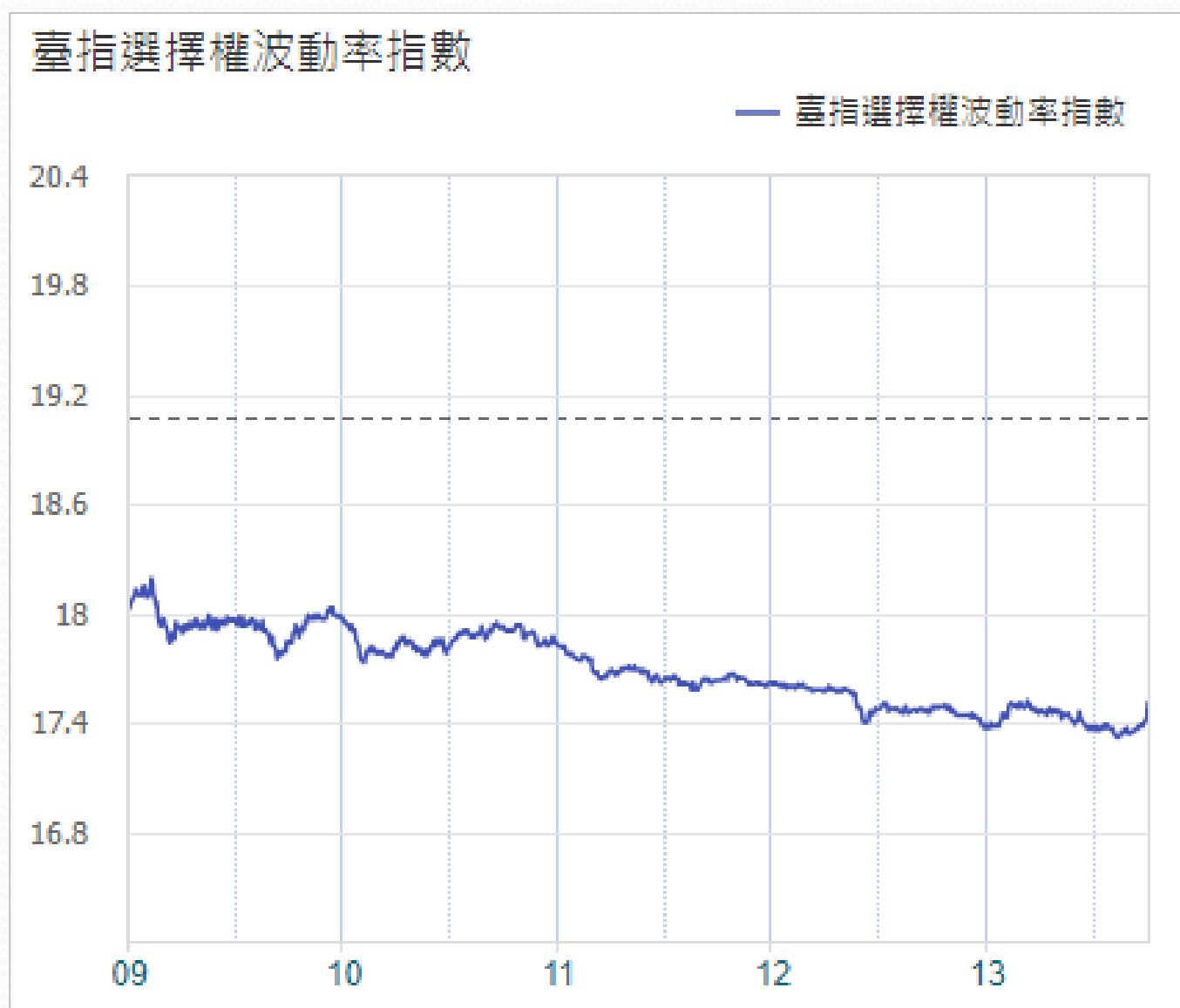
台指選擇權匯報

2023年04月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15400	買權OI最大量	16000
	賣權成交最大量	15300	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	17.16%	較前一交易日	+0.28%
	買權隱含波動率	13.65%	較前一交易日	+0.01%
	賣權隱含波動率	20.36%	較前一交易日	-0.74%
	成交量P/C_Ratio值	1.193	較前一交易日	+0.24
	未平倉P/C_Ratio值	0.972	較前一交易日	+0.04
電子選擇權	買權成交最大量	730	買權OI最大量	710
	賣權成交最大量	690	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1540	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1420	賣權OI最大量	1540

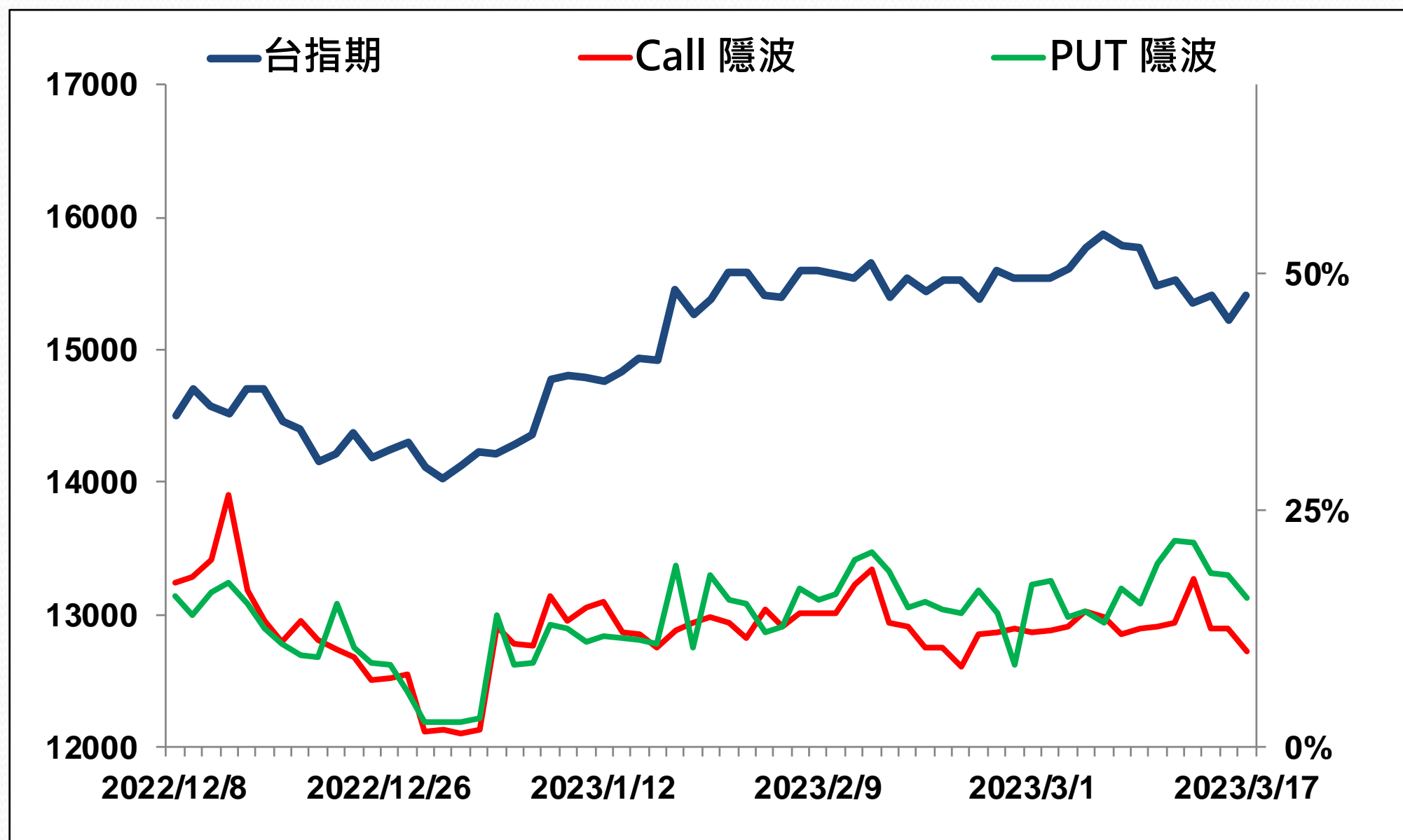
更新日期：2023年3月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



更新日期：2023年3月17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

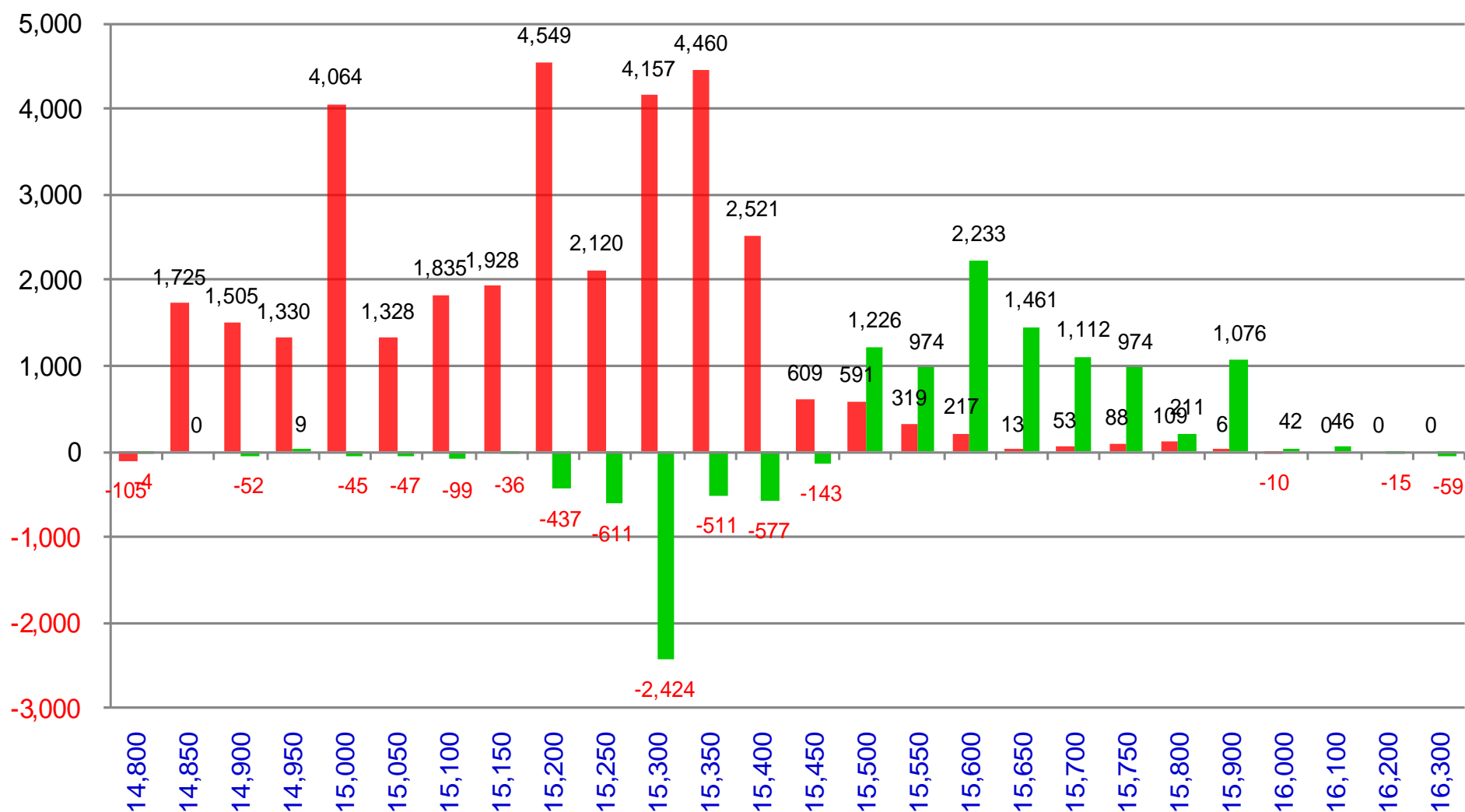


更新日期：2023年3月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：34,606

週選 CALL OI 變化：4,263

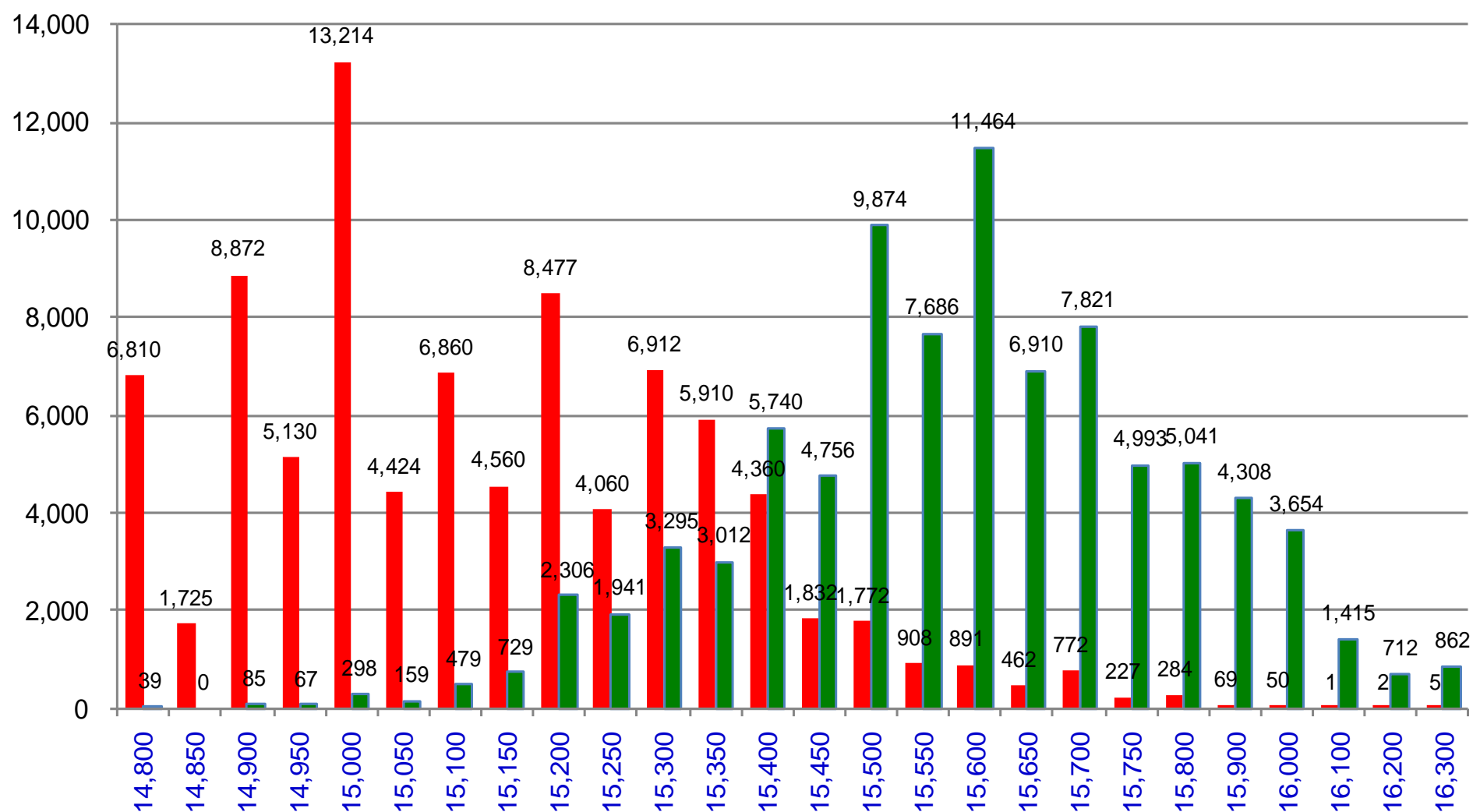


更新日期：2023年3月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：121,788

週選 CALL OI 總額：91,678



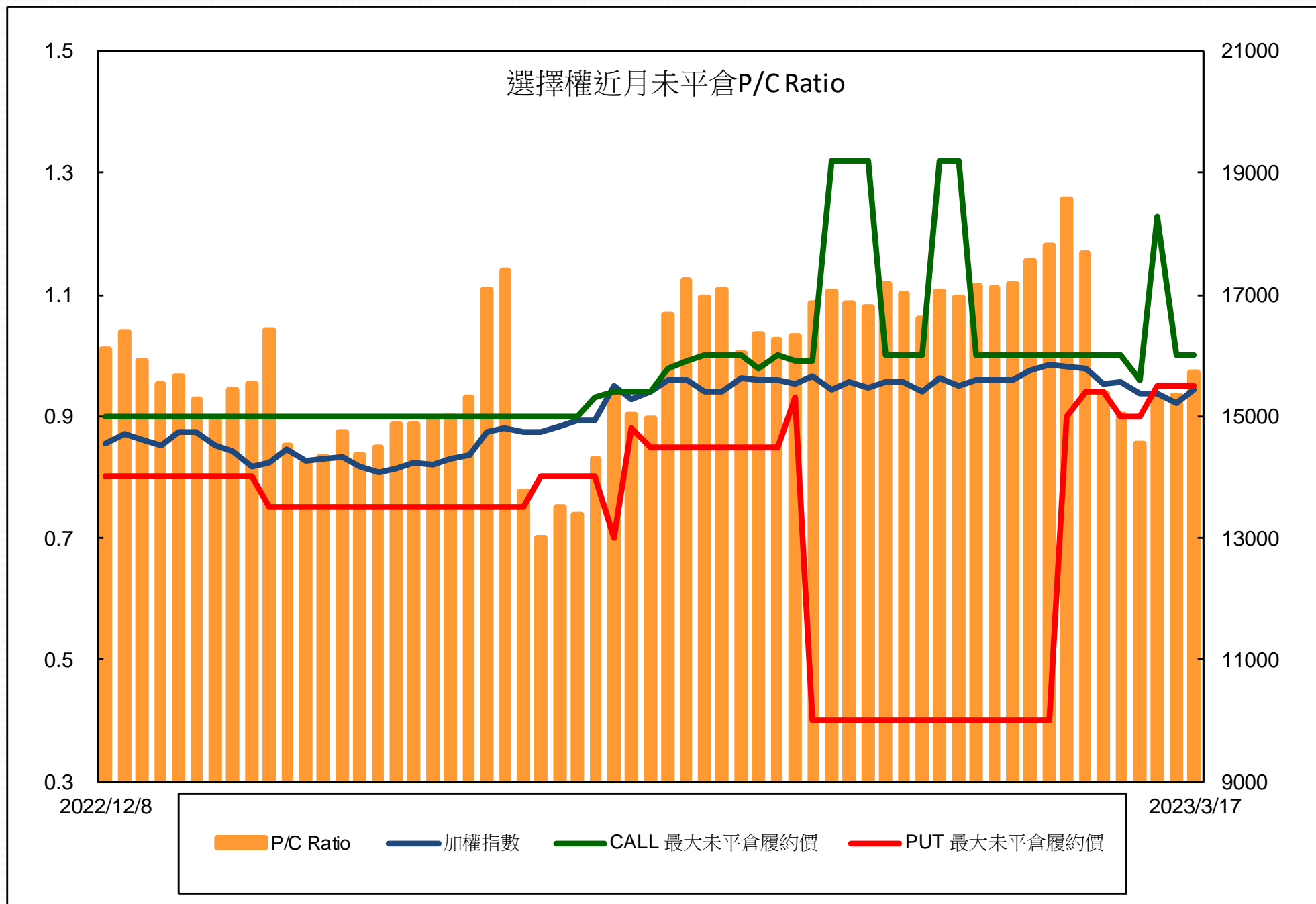
更新日期：2023年3月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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16日	63,186	45,610	17,576
	3月17日	67,842	47,833	20,009
Put	3月16日	49,289	37,870	11,419
	3月17日	56,065	52,146	3,919

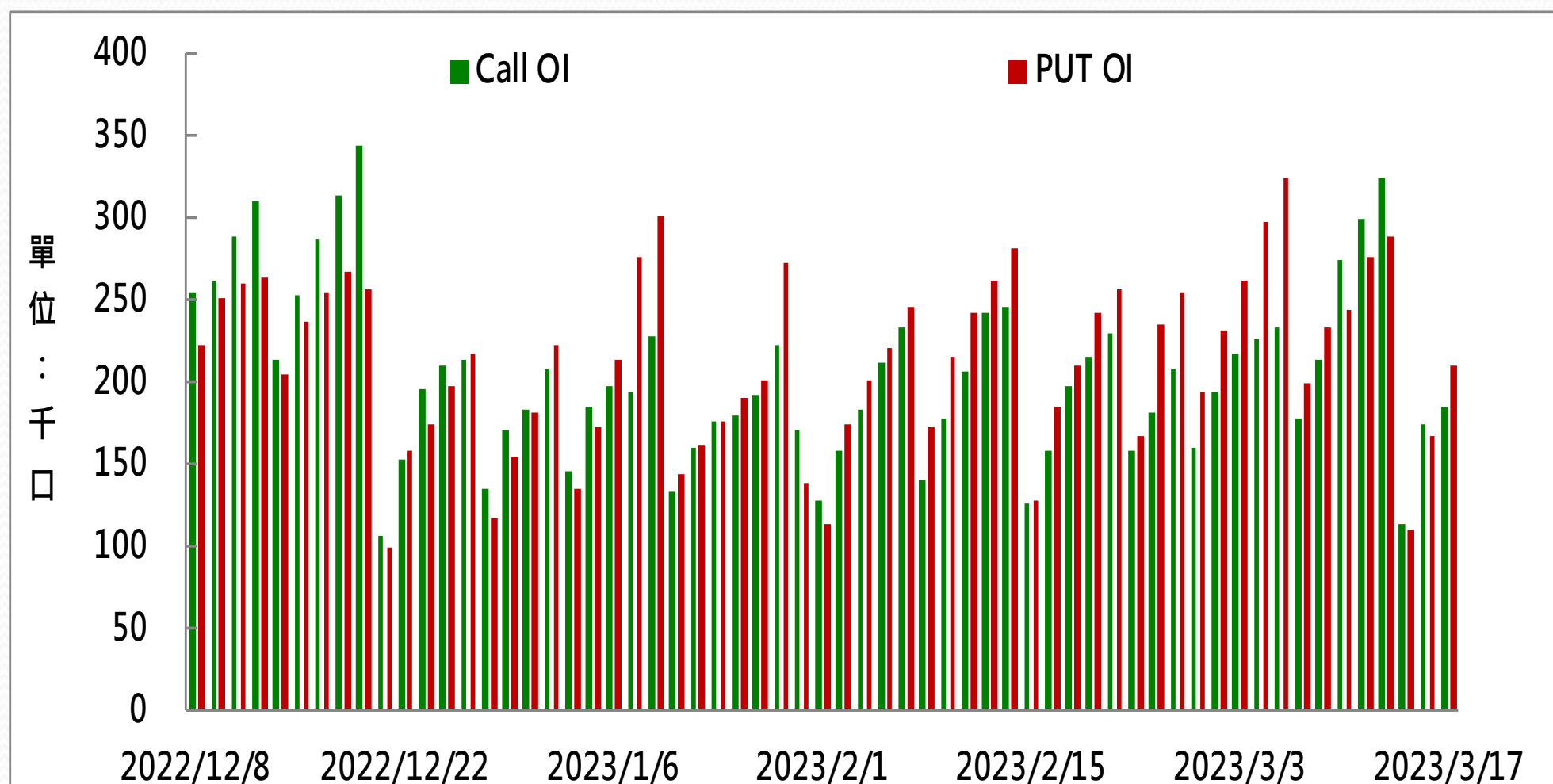
更新日期：2023年3月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

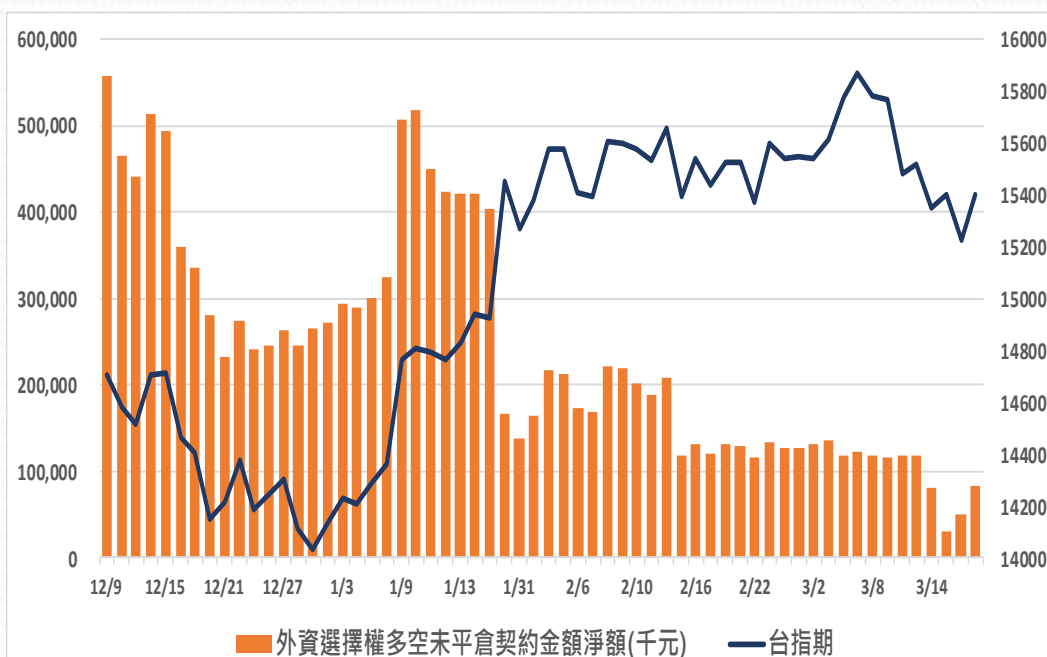
選擇權全月Put Call OI



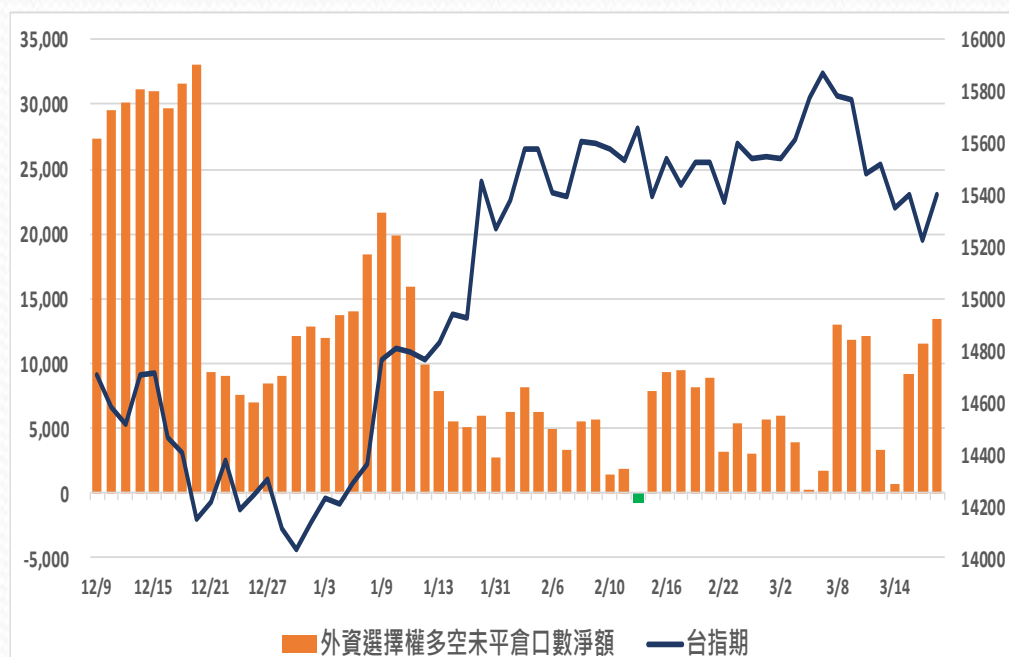
更新日期：2023年3月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



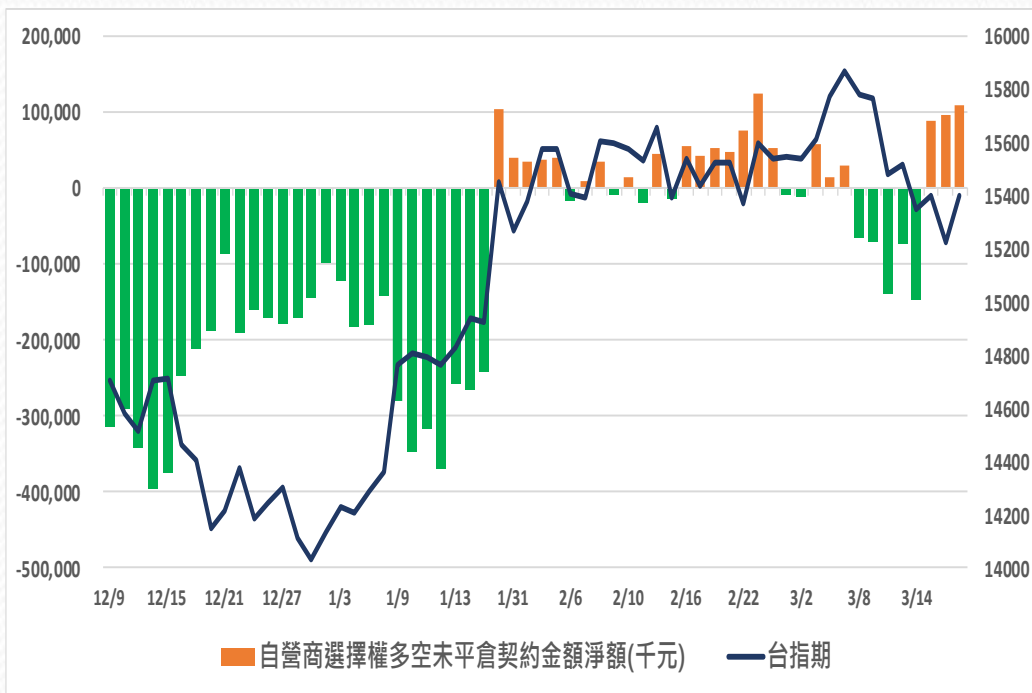
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/13	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
2023/3/17	15405	13,435	+1,957	83,115	+32,205

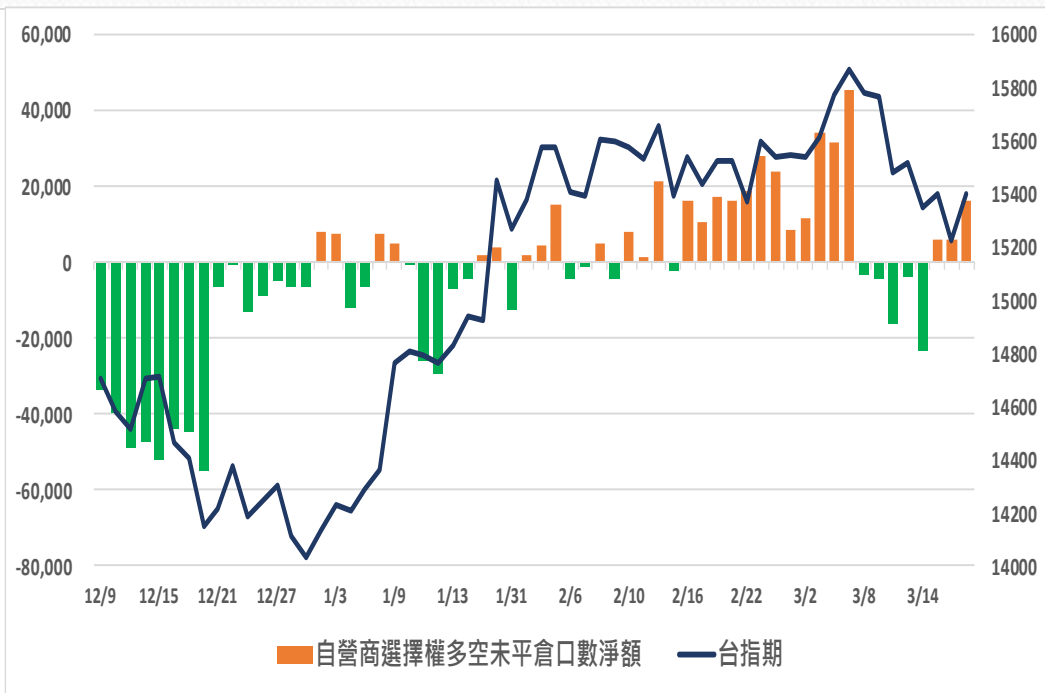
更新日期：2023年3月17日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



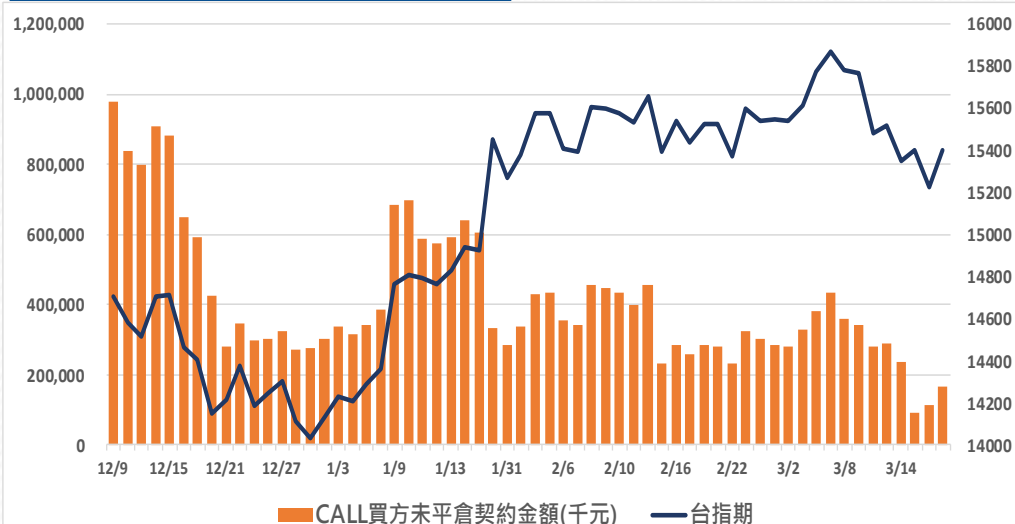
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/13	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
2023/3/17	15405	16,090	+9,933	110,913	+14,300

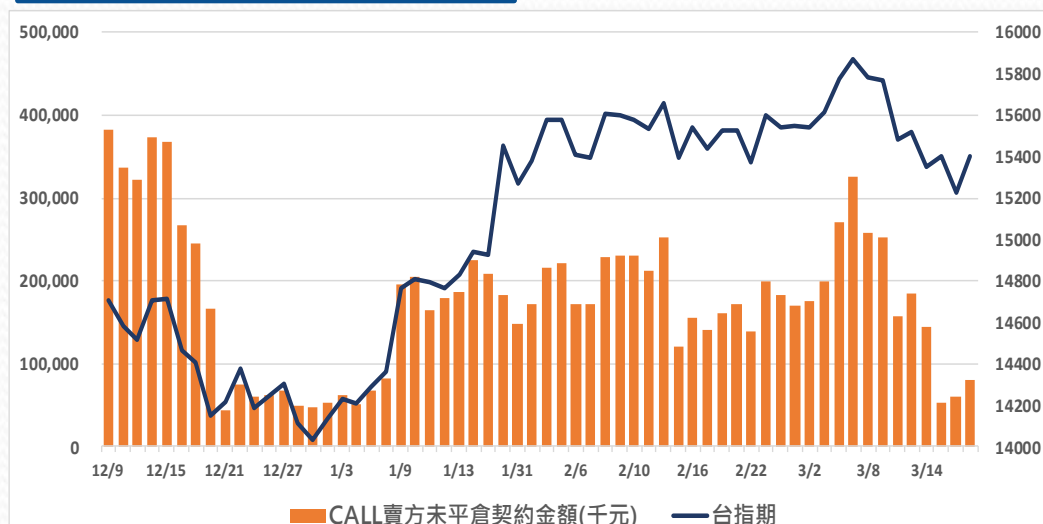
更新日期：2023年3月17日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

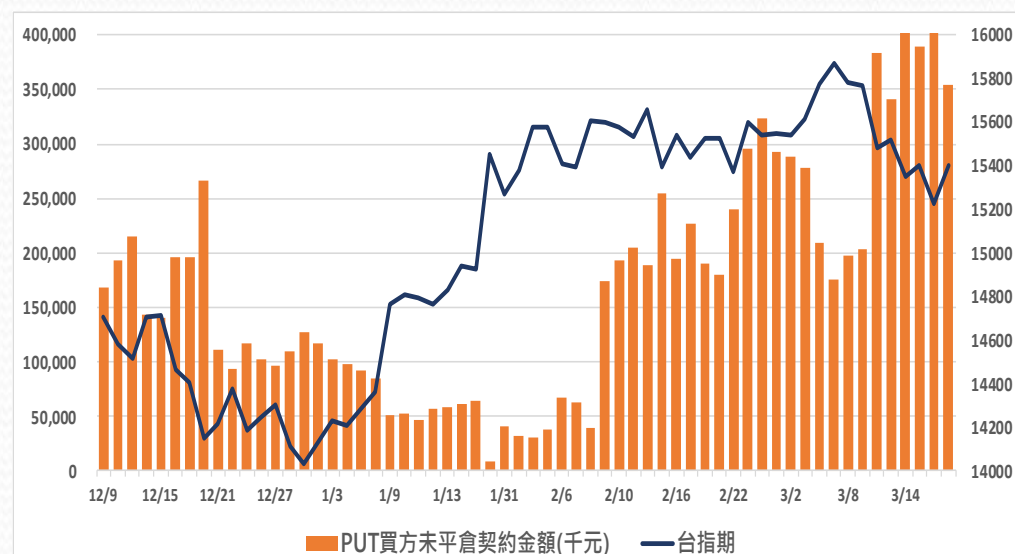
CALL買方未平倉金額



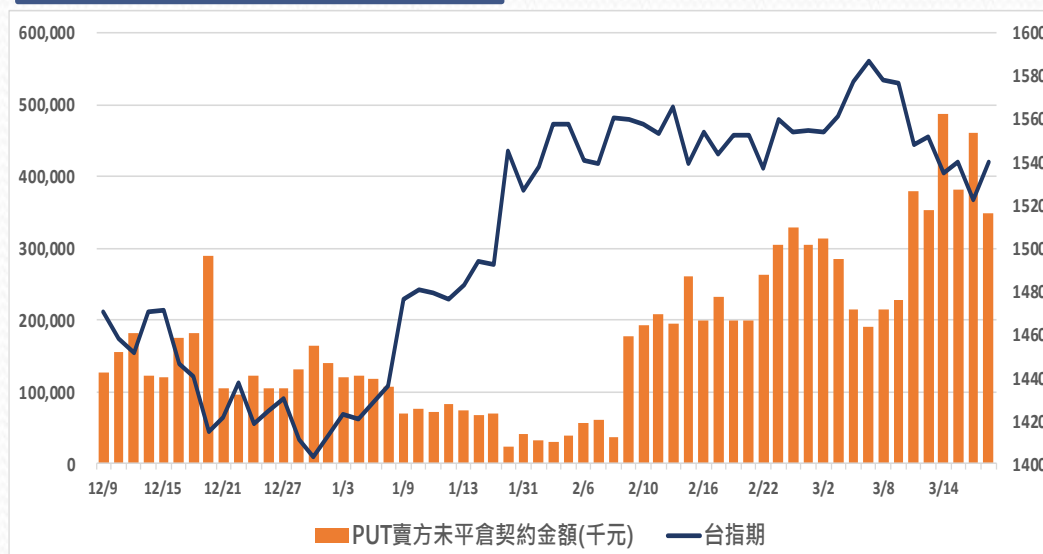
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



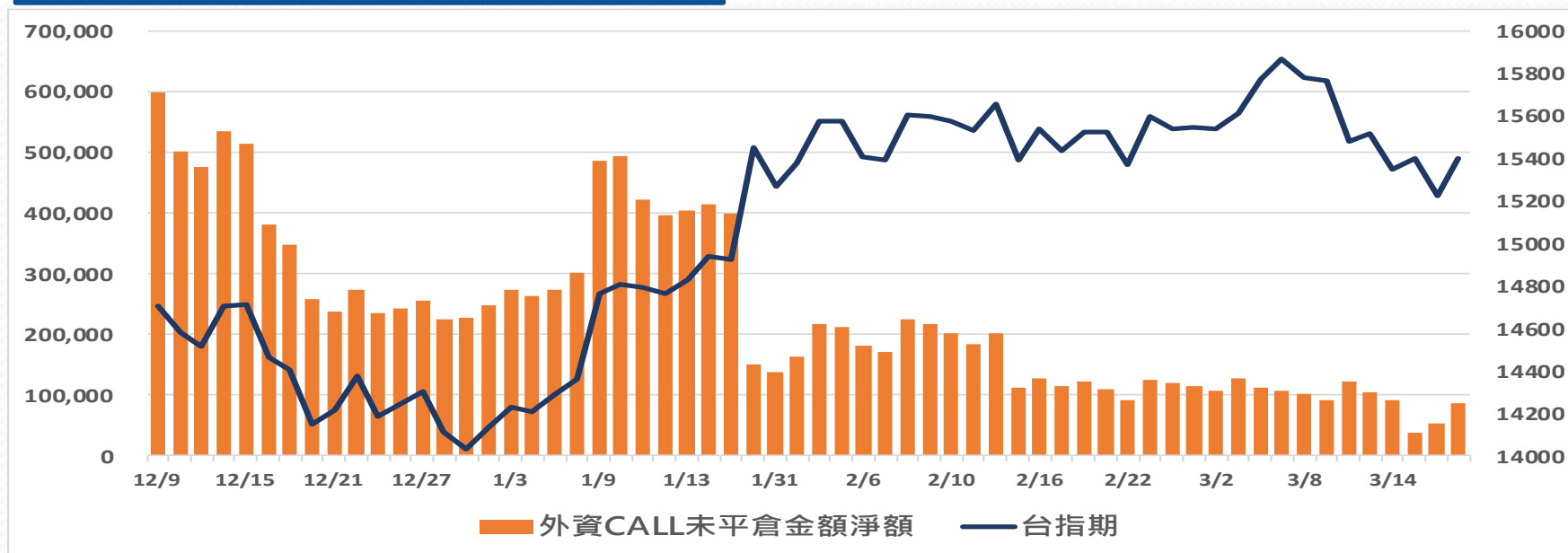
PUT賣方未平倉金額



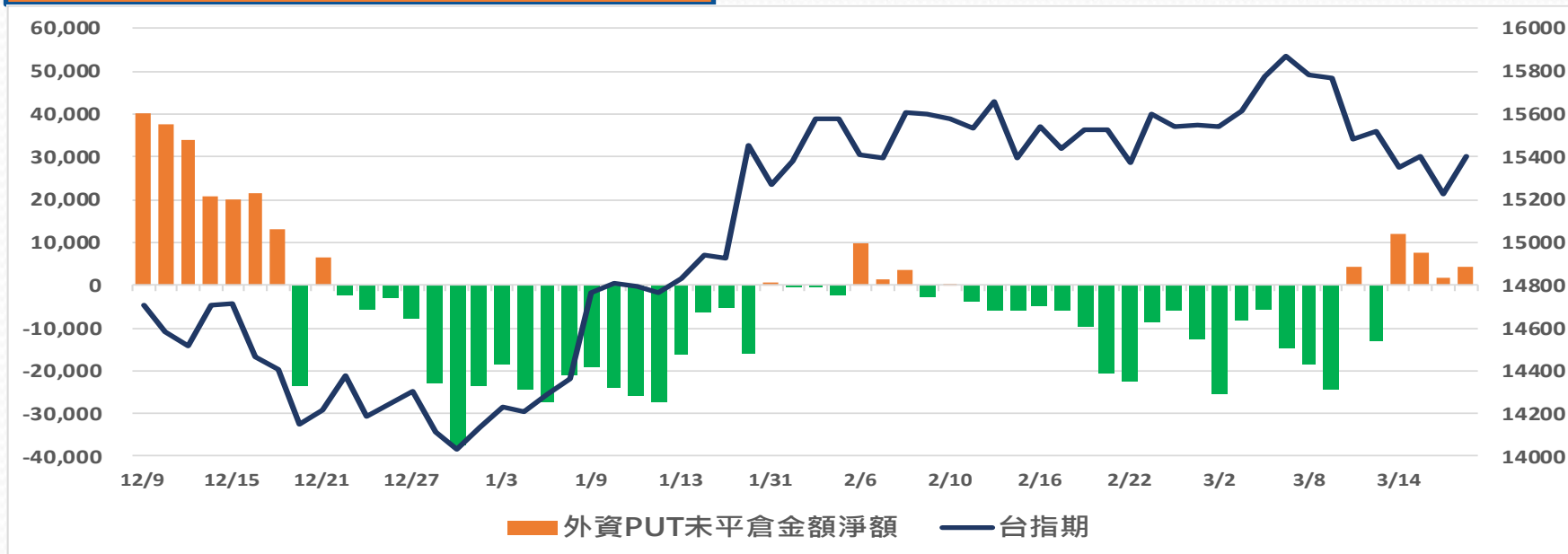
更新日期：2023年3月17日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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17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17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