

# 台指選擇權OI匯報

日期：2023/3/20					日期：2023/3/20				
結算日：2023/3/22					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
-2	8	14,700	4,534	-443	0	8	14,100	1,179	89
-1	38	14,800	7,390	580	0	3	14,200	2,736	917 ※
1	1	14,850	2,657	932	0	10	14,300	2,391	109
2	87	14,900	8,525	-347	0	96	14,400	2,363	-96
-3	64	14,950	5,118	-12	-2	42	14,500	3,857	623
-9	289	15,000	11,747	-1,467	0	53	14,600	3,132	111
0	159	15,050	4,952	528	0	57	14,700	3,624	152
9	488	15,100	9,193	2,333	1	95	14,800	3,608	408
-58	671	15,150	6,076	1,516	-5	82	14,900	3,229	-256
-142	2,164	15,200	10,964	2,487	6	172	15,000	3,411	477
-138	1,803	15,250	6,575	2,515 ※	-13	381	15,100	1,685	91
468	3,763	15,300	8,260	1,348	413	1,905	15,200	2,527	336
208	3,220	15,350	6,820	910	396	2,137	15,300	3,280	-255
1,006	6,746	15,400	5,988	1,628	-107	1,919	15,400	2,175	-16
1,042	5,798	15,450	2,639	807	79	3,895	15,500	7,902	0
1,939	11,813	15,500	2,110	338	252	2,480	15,600	605	-102
2,636	10,322	15,550	1,105	197	145	2,849	15,700	579	-21
※ 3,793	15,257	15,600	973	82	※ 980	4,887	15,800	626	20
1,363	8,273	15,650	494	32	288	3,724	15,900	71	-1
1,009	8,830	15,700	733	-39	352	6,427	16,000	93	18
338	5,331	15,750	270	43	132	3,409	16,100	74	11
475	5,516	15,800	414	130	333	4,413	16,200	84	1
582	2,500	15,850	145	46	187	3,478	16,300	68	0
80	4,388	15,900	70	1	60	3,743	16,400	15	0
-267	3,387	16,000	51	1	24	2,321	16,500	5	0
-6	1,409	16,100	1	0	28	1,446	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
14,358	107,954	1.2522	135,182	13,295	3,633	66,048	0.9729	64,259	3,569
昨日 P/C	1.3284	今日增減變化	-0.0762		昨日 P/C	0.9724	今日增減變化	0.0006	

更新日期：2023年3月20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20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	71,586,323	45,082,466	26,503,857	-6,373,316	1,925,088	965,461	959,627	-59,941	
投信	27,269,454	50,976,142	-23,706,688	-1,585,108	361,683	0	361,683	-571	
自營商	46,872,340	21,155,530	25,716,810	1,823,467	1,636,325	627,112	1,009,213	91,893	
	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	787,306	1,275,877	-488,571	116,901	66,510	1,478	65,032	22,109	
投信	100,069	0	100,069	-843	0	0	0	0	
自營商	310,508	554,831	-244,323	-138,958	48,774	109,371	-60,597	-33,957	

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20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	22,946	9,564	13,382	1,522	28,458	26,344	2,114	3,689	
投信	0	0	0	0	200	119	81	0	
自營商	68,181	53,433	14,748	-5,261	62,514	49,938	12,576	8,657	
特定法人(週)	2,086	0	2,086	581	0	4,369	-4,369	-1,829	
特定法人(近月)	11,818	4,732	7,086	284	15,453	13,884	1,569	-746	
特定法人(全月)	14,261	4,992	9,269	820	18,775	23,198	-4,423	-1,590	
十大交易人(週)	44,367	38,144	6,223	-2,498	47,482	35,958	11,524	-4,128	
十大交易人(近月)	38,832	28,673	10,159	-380	27,674	38,146	-10,472	-2,137	
十大交易人(全月)	87,869	63,696	24,173	-2,834	71,355	77,674	-6,319	-7,865	
全市場未沖銷(近月)			66,048	3,633			64,259	3,569	
全市場未沖銷(全月)			206,494	21,979			231,983	21,528	

更新日期：2023年3月20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	15400	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	14.31%	較前一交易日	+1.57%
	買權隱含波動率	11.40%	較前一交易日	+1.80%
	賣權隱含波動率	16.88%	較前一交易日	+1.55%
電子選擇權	買權成交最大量	760	買權OI最大量	770
	賣權成交最大量	695	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1520	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20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

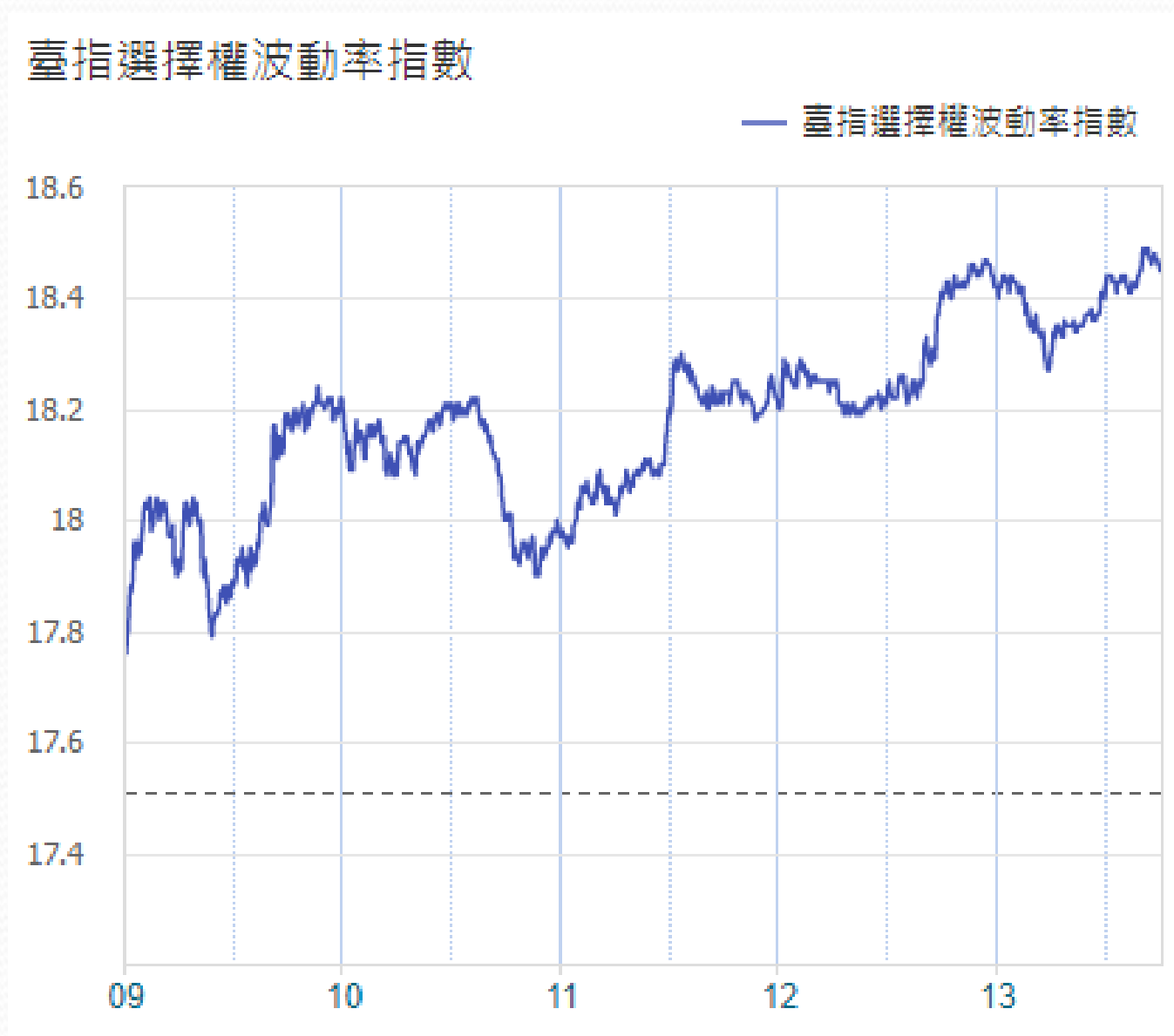
# 台指選擇權匯報

## 2023年04月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15800	買權OI最大量	16000
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	18.33%	較前一交易日	-1.17%
	買權隱含波動率	14.02%	較前一交易日	+0.37%
	賣權隱含波動率	21.91%	較前一交易日	+1.55%
	成交量P/C_Ratio值	1.291	較前一交易日	+0.10
	未平倉P/C_Ratio值	0.973	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	770
	賣權成交最大量	695	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1520	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1420	賣權OI最大量	1540

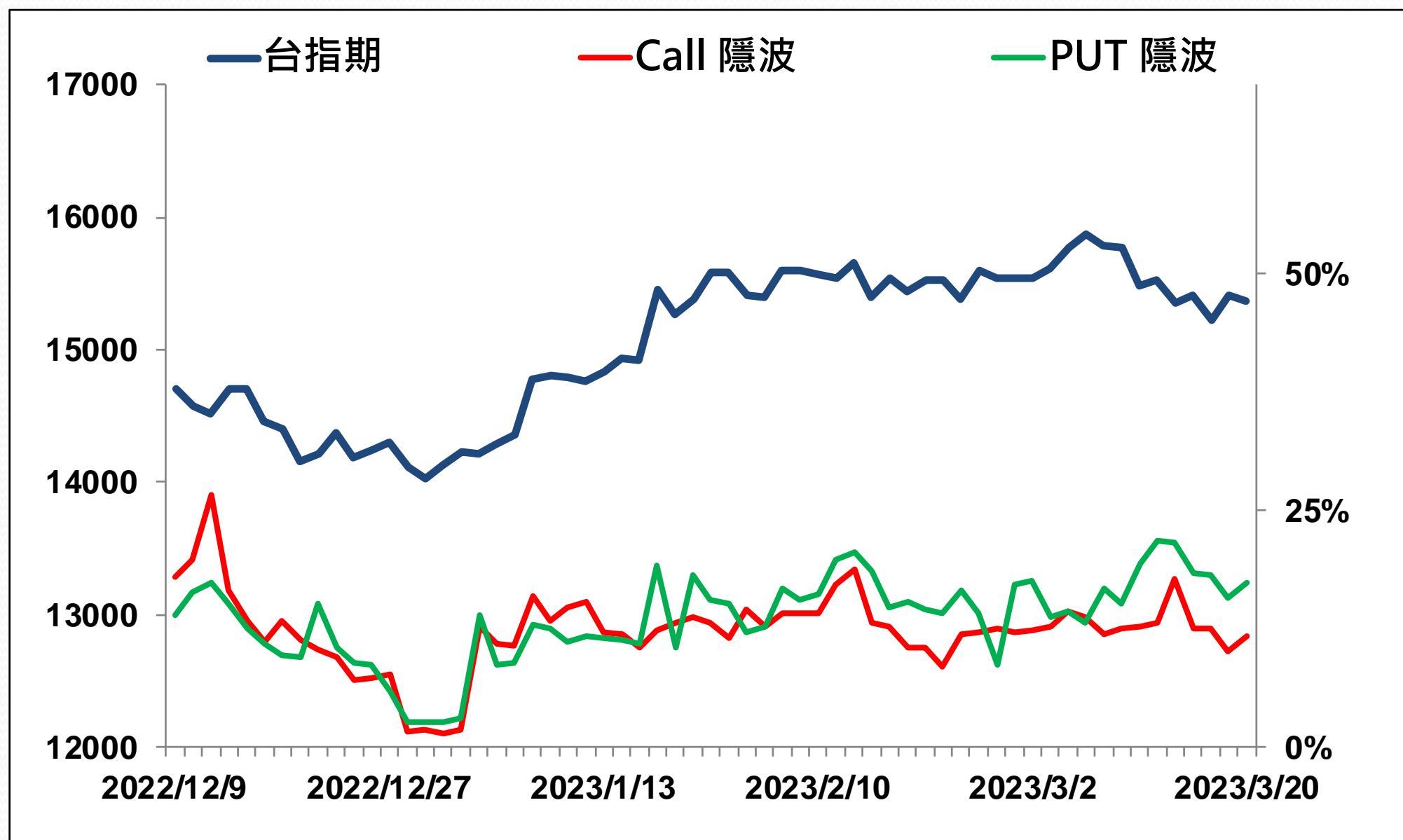
更新日期：2023年3月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權當日波動率指數



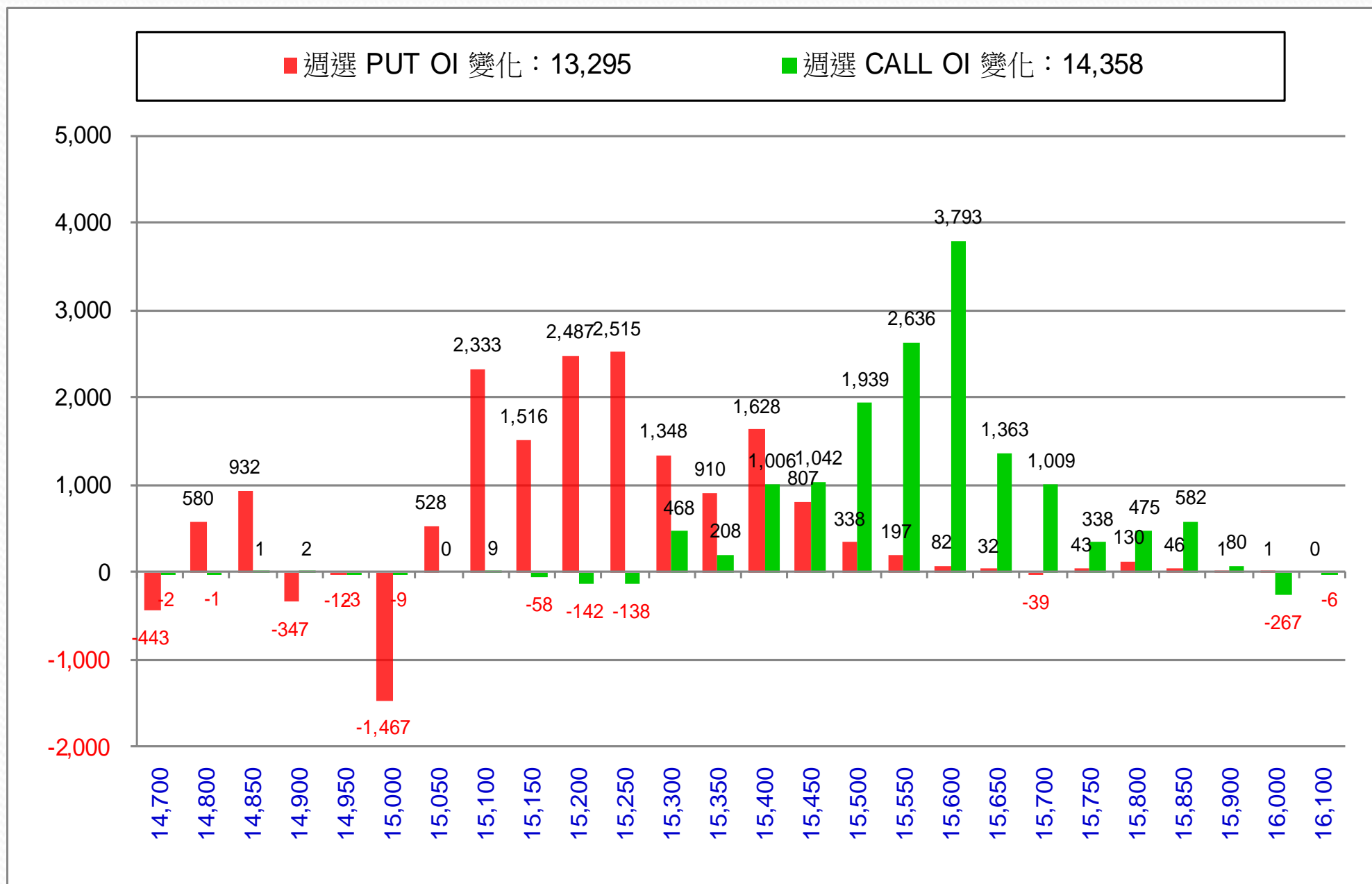
更新日期：2023年3月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2023年3月20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

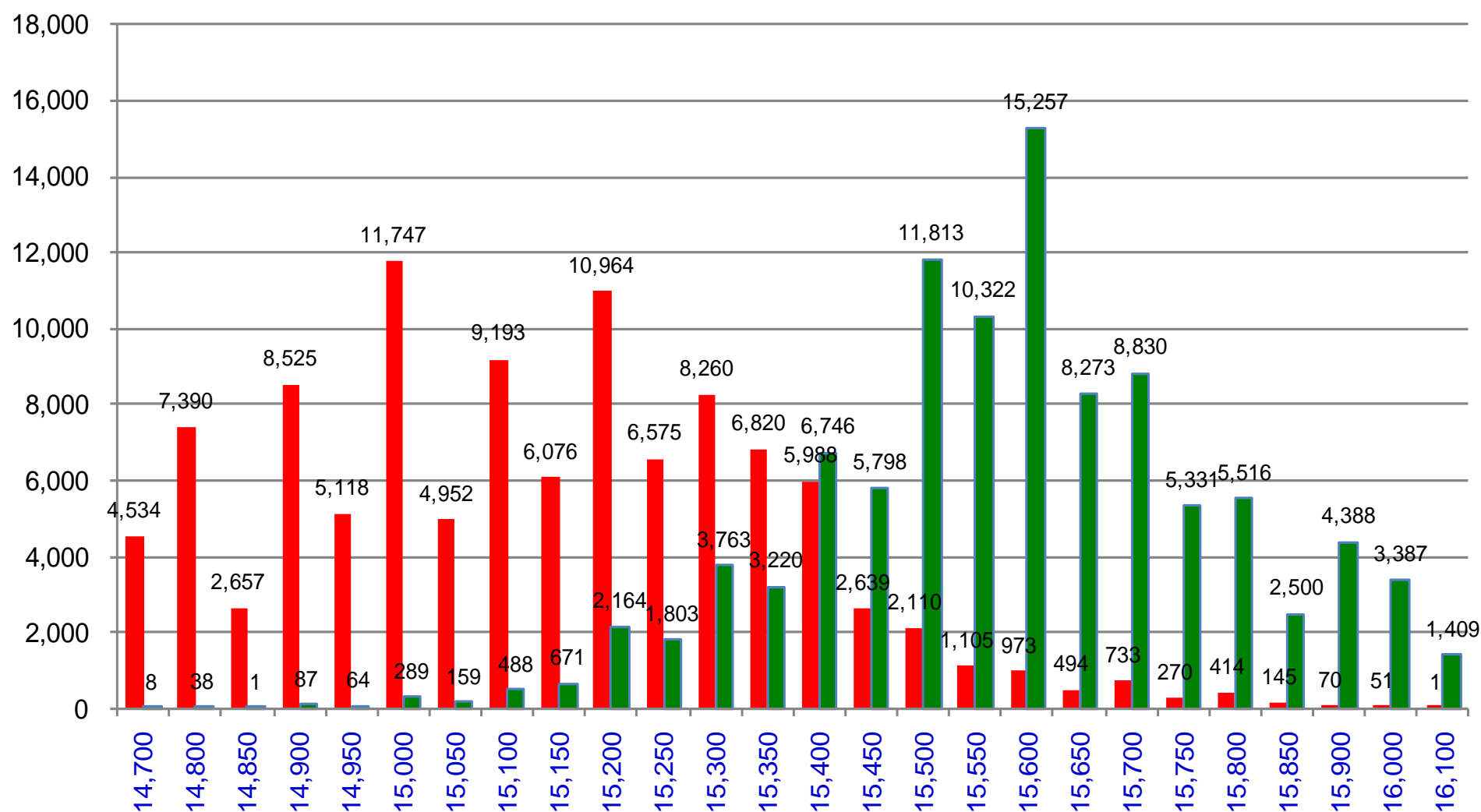


更新日期：2023年3月20日    資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：135,182

■ 週選 CALL OI 總額：107,954



更新日期：2023年3月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

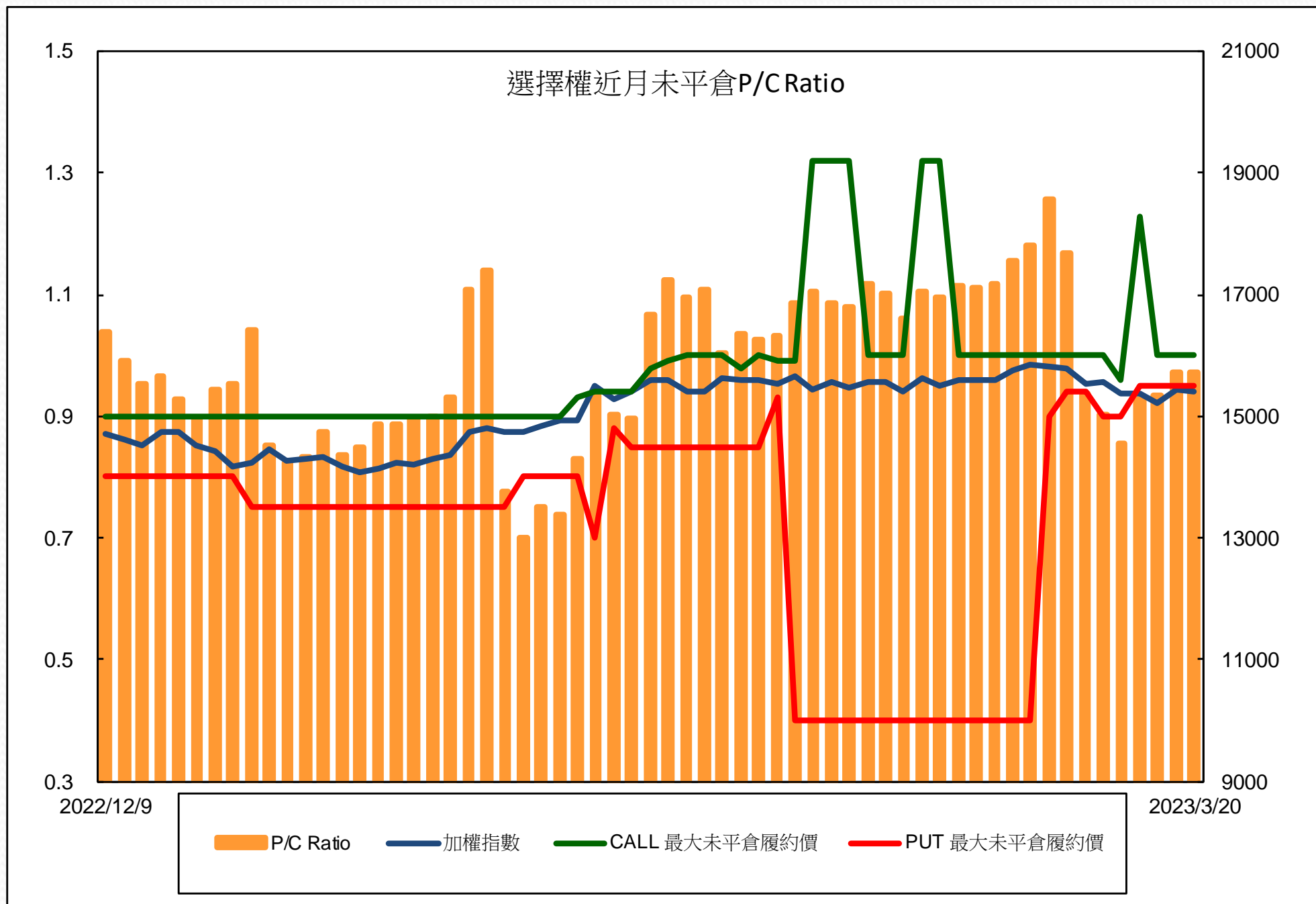


# 自營商選擇權OI部位統計

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17日	67,842	47,833	20,009
	3月20日	68,181	53,433	14,748
Put	3月17日	56,065	52,146	3,919
	3月20日	62,514	49,938	12,576

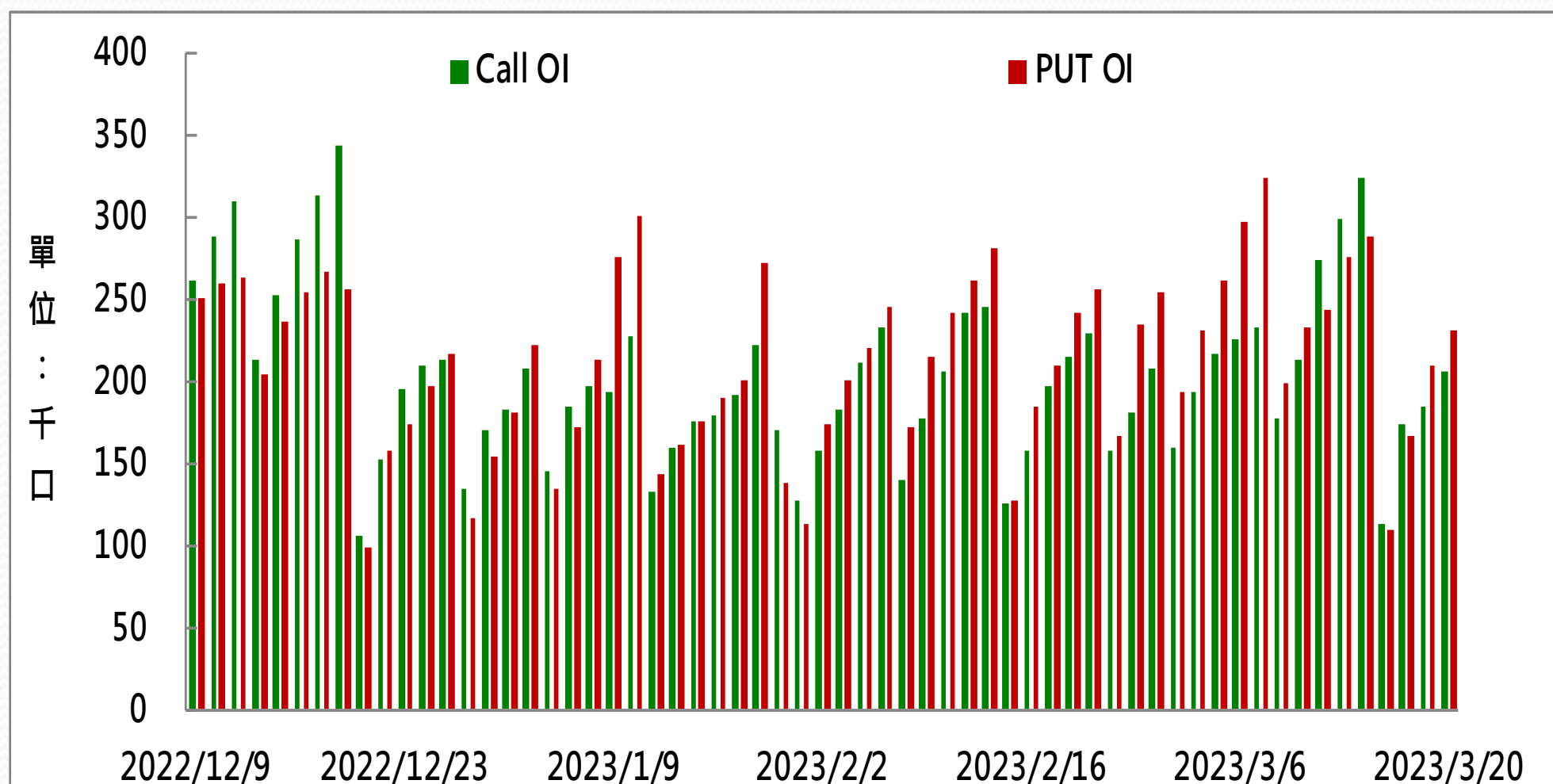
更新日期：2023年3月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

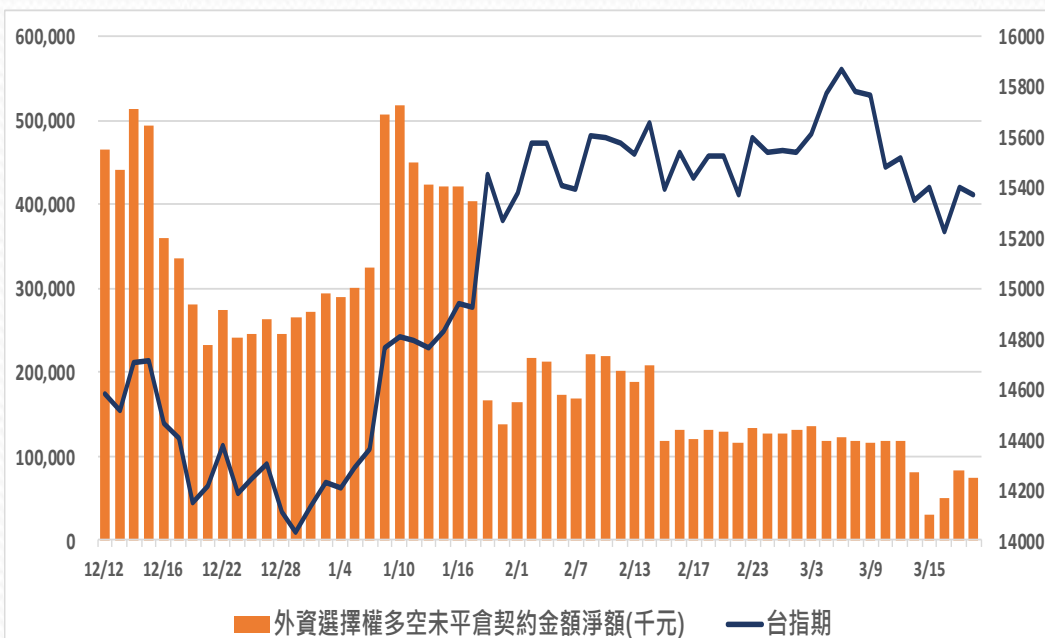
# 選擇權全月Put Call OI



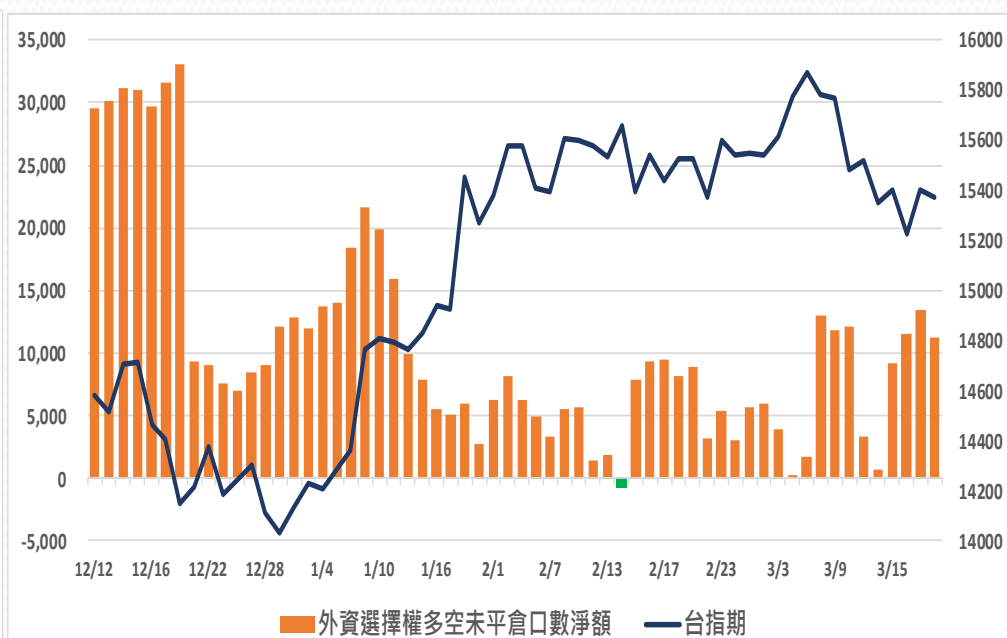
更新日期：2023年3月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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



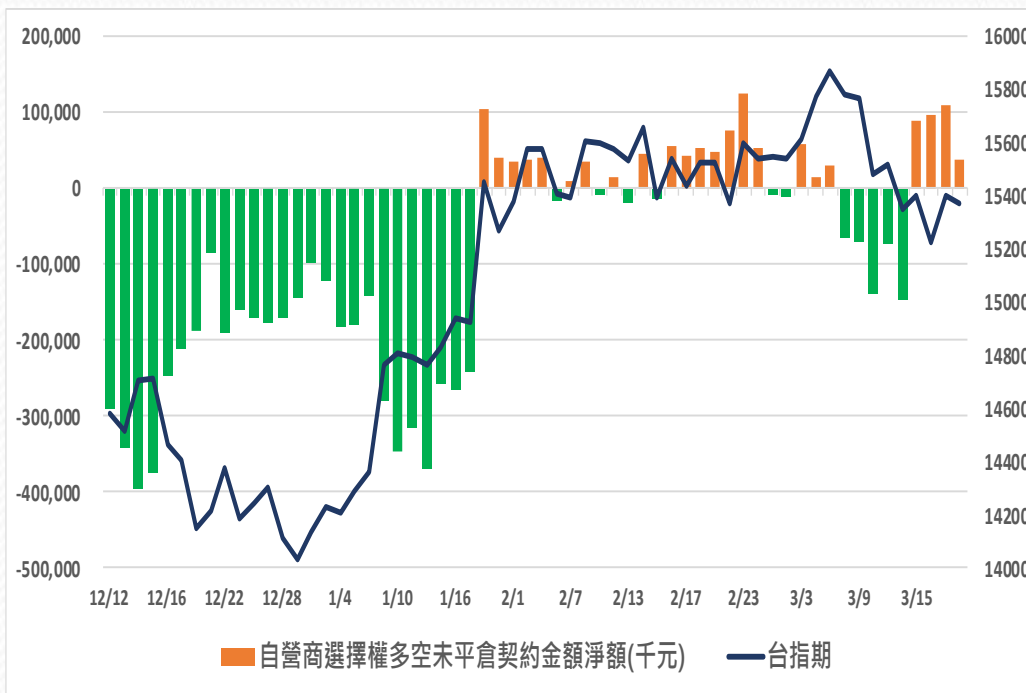
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/14	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
2023/3/20	15370	11,268	-2,167	74,204	-8,911

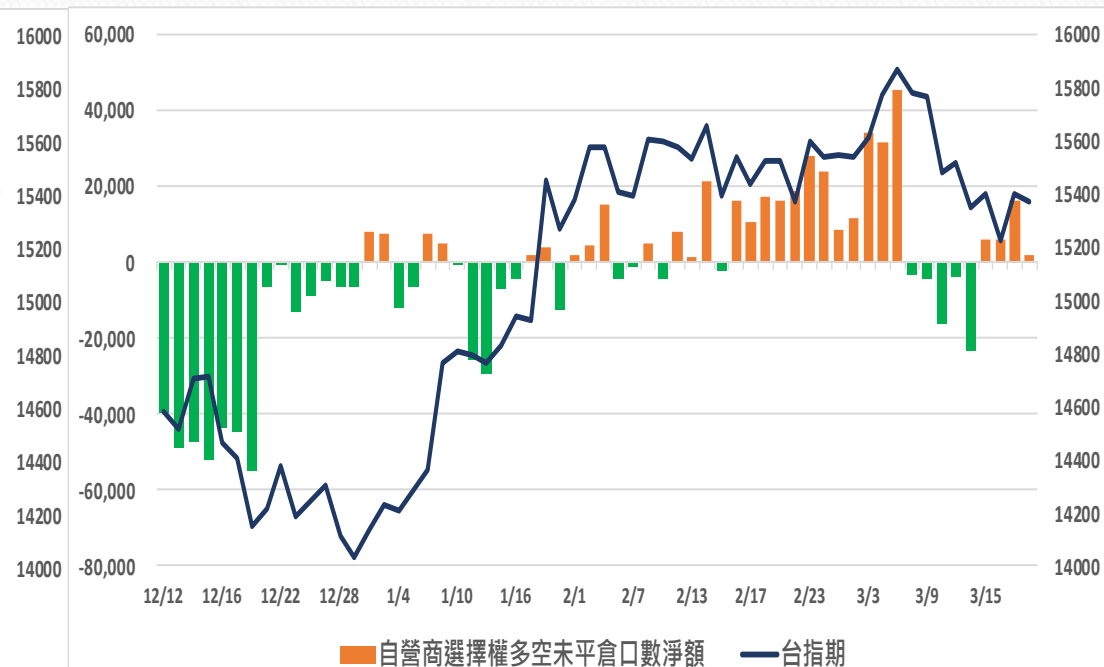
更新日期：2023年3月20日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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



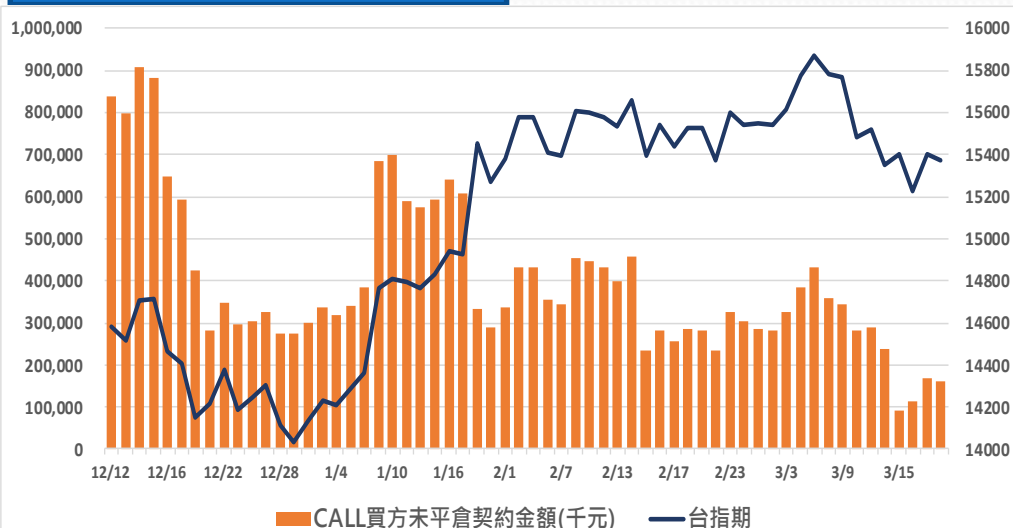
## 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/14	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
2023/3/20	15370	2,172	-13,918	38,790	-72,123

更新日期：2023年3月20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

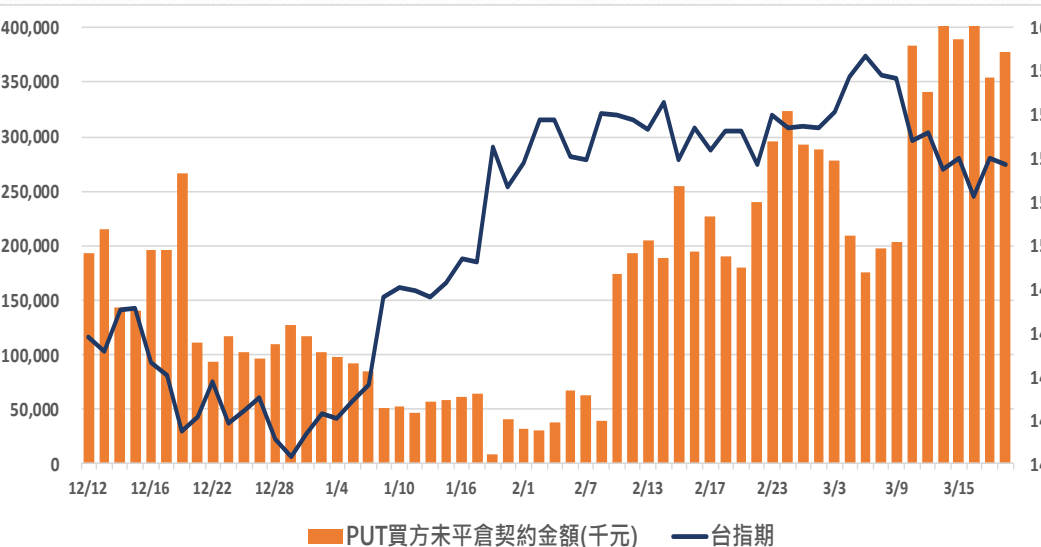
## CALL買方未平倉金額



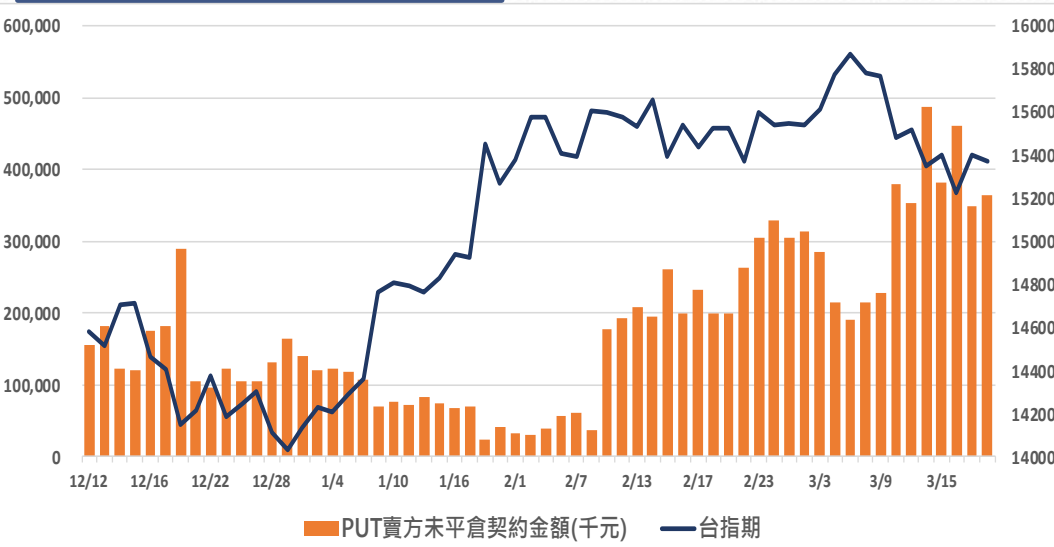
## CALL賣方未平倉金額



## PUT買方未平倉金額



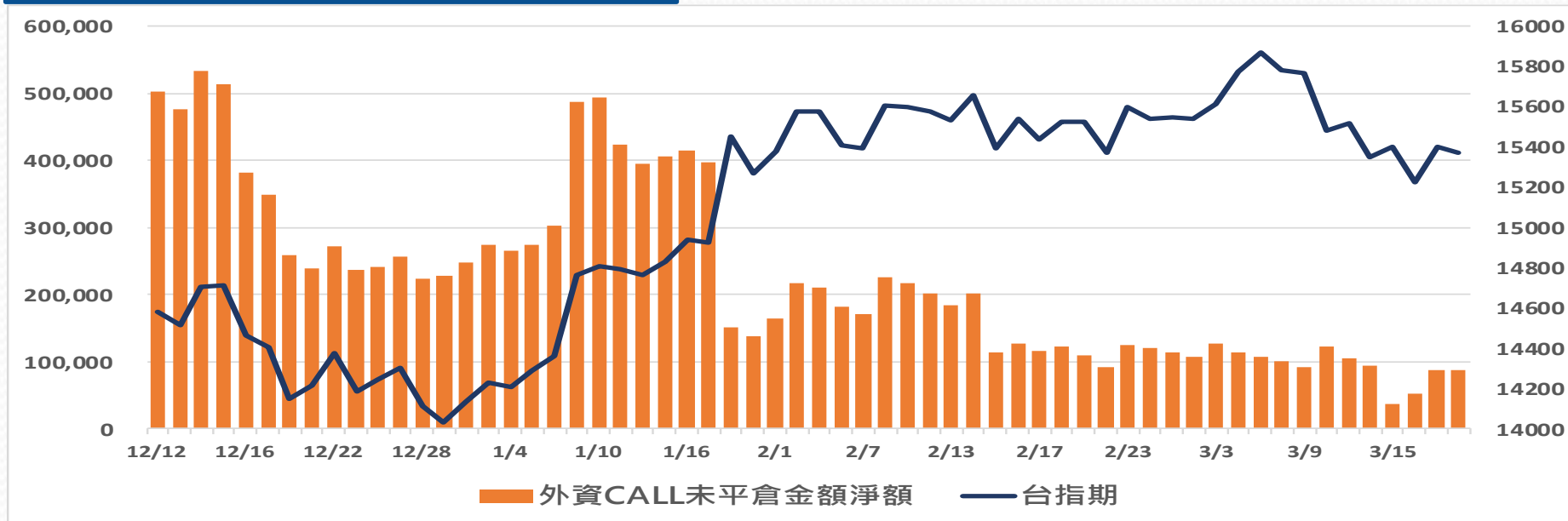
## PUT賣方未平倉金額



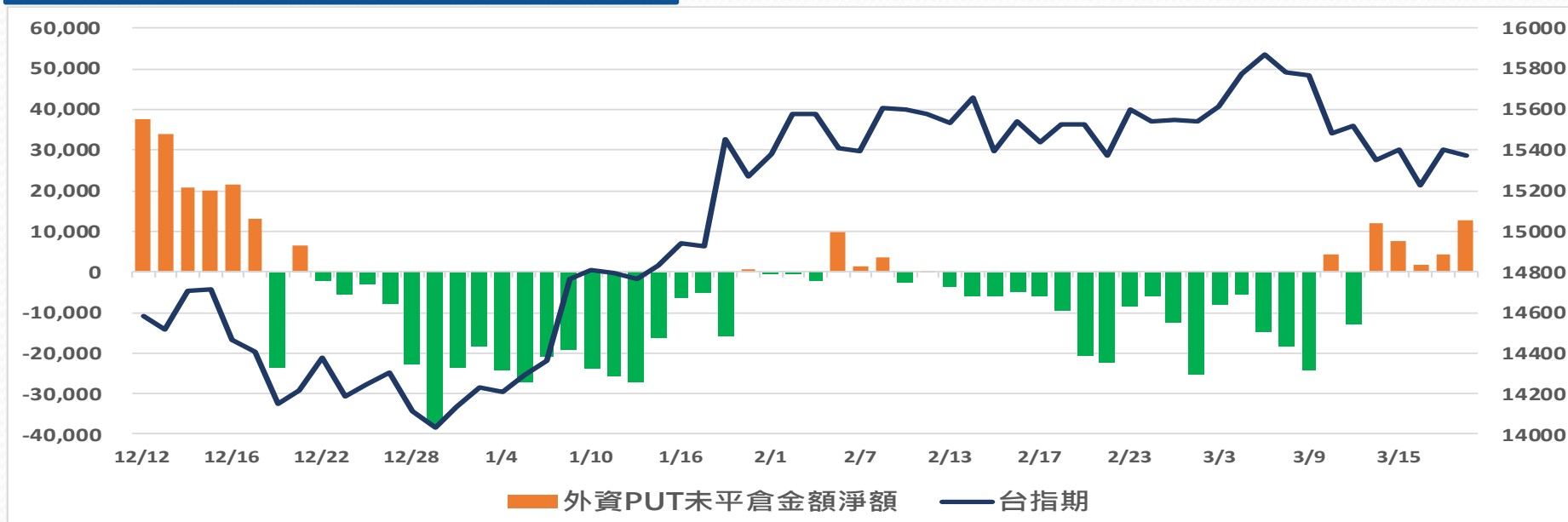
更新日期：2023年3月20日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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20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20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