

台指選擇權OI匯報

日期：2023/3/22 結算日：2023/3/29					日期：2023/3/22 結算日：2023/4/19				
202303W5					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
1	58	15,100	1,911	788	0	43	14,500	6,129	1,631 ※
5	72	15,150	1,174	618	17	70	14,600	2,789	-182
-13	147	15,200	2,604	1,723	0	56	14,700	3,468	-12
-15	143	15,250	1,116	616	-1	84	14,800	5,029	1,403
-65	252	15,300	2,215	1,137	10	92	14,900	2,599	60
-44	173	15,350	1,237	808	-12	156	15,000	4,139	509
-167	362	15,400	2,413	1,904	-22	349	15,100	1,957	235
15	482	15,450	1,754	1,416	-6	1,860	15,200	3,194	406
101	797	15,500	3,208	2,891 ※	-34	2,087	15,300	2,708	-289
-22	566	15,550	1,681	1,576	-95	1,986	15,400	2,711	178
-102	1,071	15,600	2,511	2,334	-623	3,734	15,500	8,695	722
752	1,458	15,650	1,065	1,040	57	2,676	15,600	949	332
242	1,492	15,700	2,497	2,451	216	2,977	15,700	803	222
403	1,648	15,750	417	408	-1,073	3,750	15,800	845	226
635	3,066	15,800	416	396	-209	3,558	15,900	141	63
950	1,745	15,850	118	113	342	7,083	16,000	145	50
915	2,970	15,900	202	185	862	4,571	16,100	102	30
1,257	1,257	15,950	29	29	1,111	6,050	16,200	87	9
※ 3,116	4,803	16,000	186	180	※ 1,587	5,156	16,300	70	3
2,168	2,588	16,100	76	76	1,002	4,833	16,400	18	2
1,928	2,150	16,200	123	123	-2	2,392	16,500	8	0
831	997	16,300	1	0	158	1,662	16,600	0	0
347	778	16,400	19	19	-67	853	16,700	0	0
220	733	16,500	0	0	-67	1,093	16,800	3	0
29	505	16,600	0	0	-39	578	16,900	1	0
-14	345	16,700	0	0	5	684	17,000	1	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
13,242	30,778	1.5105	46,489	27,633	2,715	70,579	1.0156	71,681	5,902
昨日 P/C	1.3840	今日增減變化	0.1265		昨日 P/C	0.9693	今日增減變化	0.0463	

更新日期：2023年3月22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22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	99,336,034	43,589,002	55,747,032	24,967,375	2,393,325	892,629	1,500,696	145,650	
投信	29,669,920	50,677,732	-21,007,812	2,761,978	422,351	0	422,351	38,128	
自營商	44,597,262	19,376,256	25,221,006	-842,383	1,545,611	655,993	889,618	-160,389	
	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	624,456	1,297,296	-672,840	15,725	116,509	0	116,509	58,723	
投信	102,816	0	102,816	1,469	0	0	0	0	
自營商	178,416	356,829	-178,413	-17,443	20,912	135,926	-115,014	-61,674	

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22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	22,512	10,222	12,290	-900	25,437	24,296	1,141	-1,500	
投信	50	50	0	0	200	119	81	0	
自營商	46,085	36,471	9,614	-7,077	43,909	37,648	6,261	2,535	
特定法人(週)	2,191	0	2,191	---	0	3,709	-3,709	---	
特定法人(近月)	12,634	7,021	5,613	-1,002	14,998	15,766	-768	-3,081	
特定法人(全月)	13,888	7,024	6,864	-2,265	18,618	23,976	-5,358	-3,879	
十大交易人(週)	12,239	12,217	22	---	25,477	16,049	9,428	---	
十大交易人(近月)	43,622	32,830	10,792	365	29,963	37,084	-7,121	1,435	
十大交易人(全月)	62,100	49,102	12,998	-11,478	58,088	59,944	-1,856	-4,198	
全市場未沖銷(近月)			70,579	2,715			71,681	5,902	
全市場未沖銷(全月)			117,556	-100,665			143,100	-119,855	

更新日期：2023年3月22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03W5週選擇權分析表

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	15500	賣權OI最大量	14500
	整體隱含波動率	16.75%	較前一交易日	+5.13%
	買權隱含波動率	13.21%	較前一交易日	+6.61%
	賣權隱含波動率	19.28%	較前一交易日	+4.19%
電子選擇權	買權成交最大量	770	買權OI最大量	770
	賣權成交最大量	705	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	1480	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年3月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

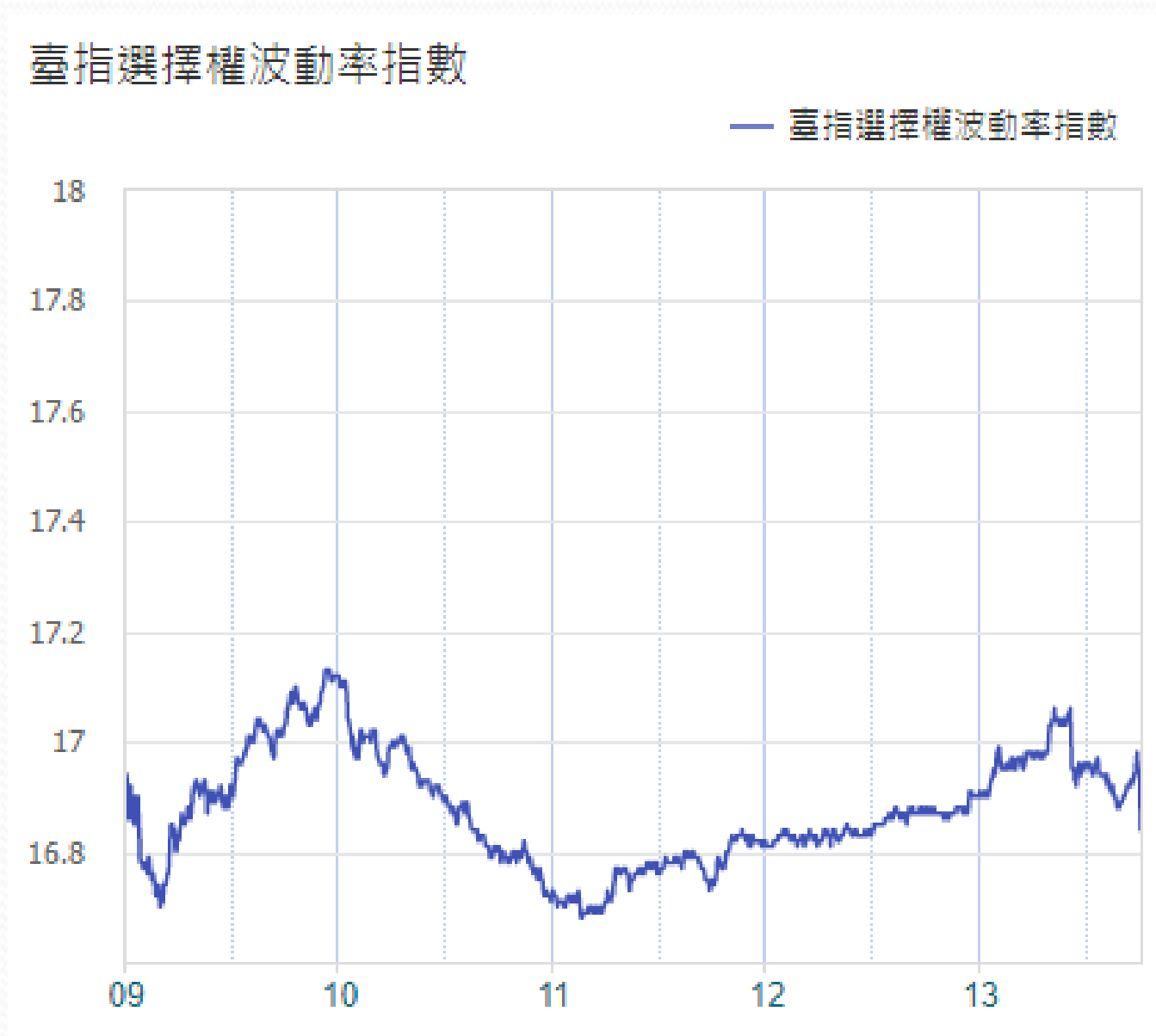
台指選擇權匯報

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	14500	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	16.79%	較前一交易日	+0.82%
	買權隱含波動率	12.59%	較前一交易日	-0.54%
	賣權隱含波動率	20.62%	較前一交易日	-0.14%
	成交量P/C_Ratio值	1.209	較前一交易日	-0.10
	未平倉P/C_Ratio值	1.016	較前一交易日	+0.05
電子選擇權	買權成交最大量	770	買權OI最大量	770
	賣權成交最大量	705	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	1480	賣權OI最大量	1540

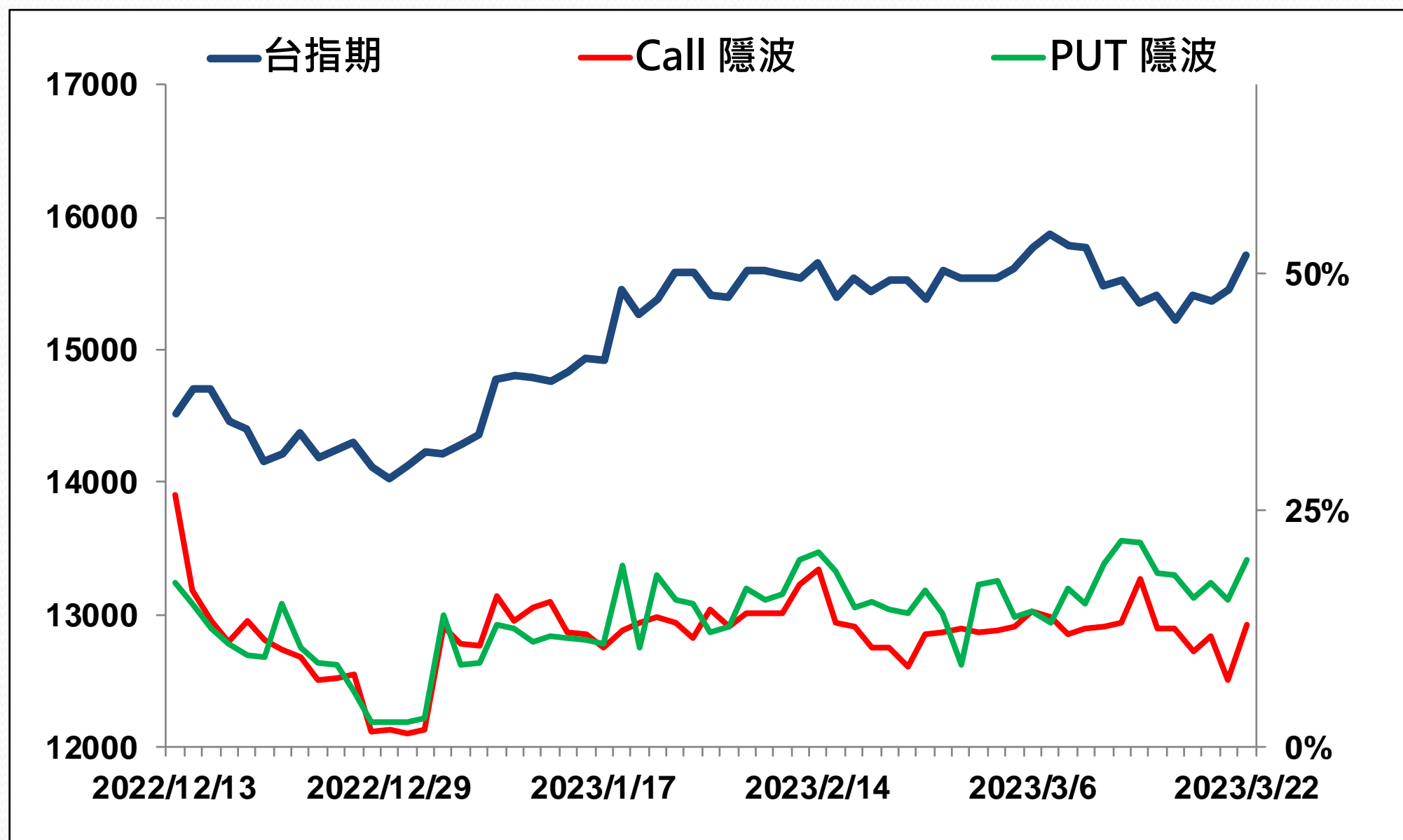
更新日期：2023年3月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



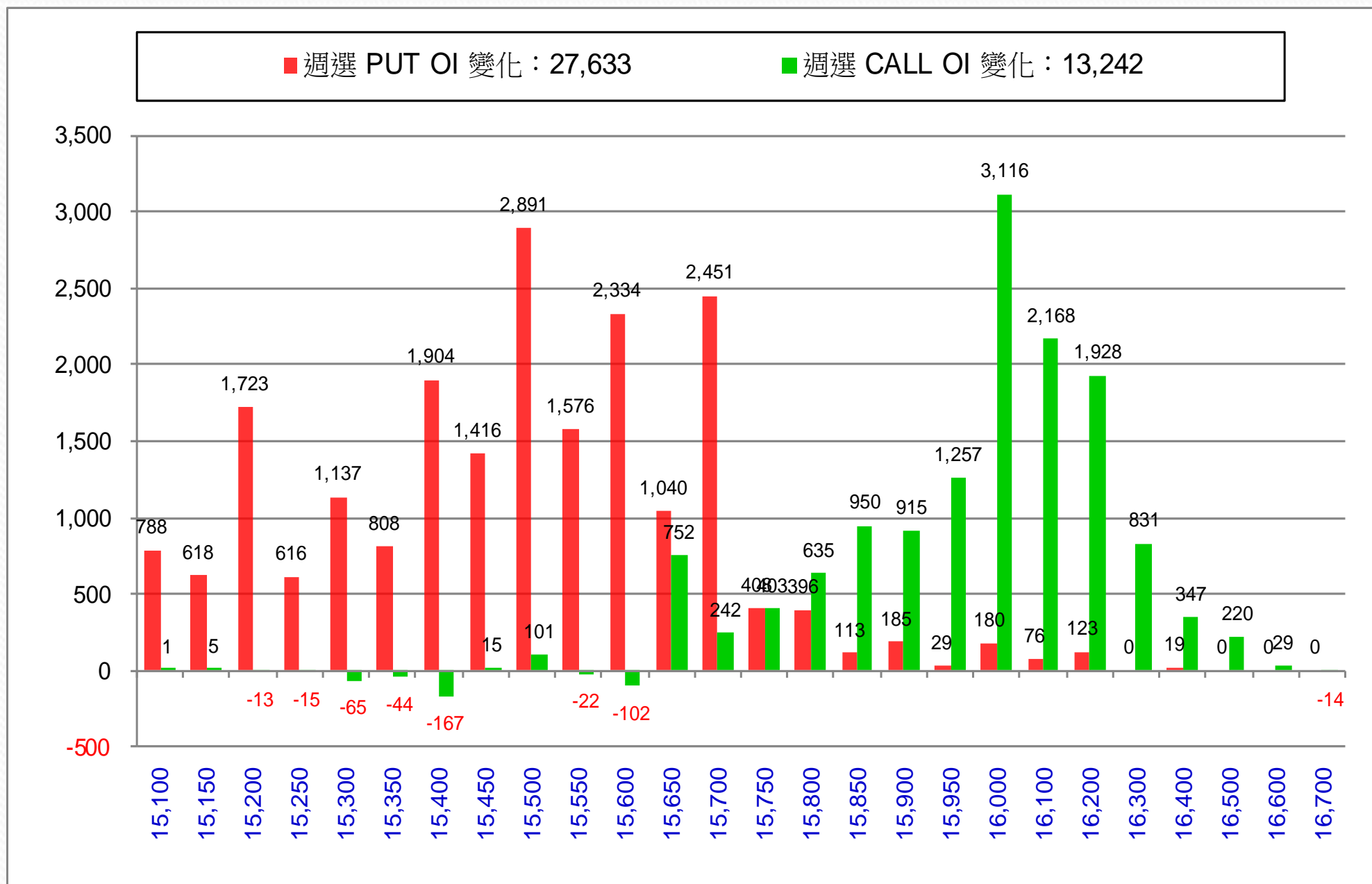
更新日期：2023年3月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



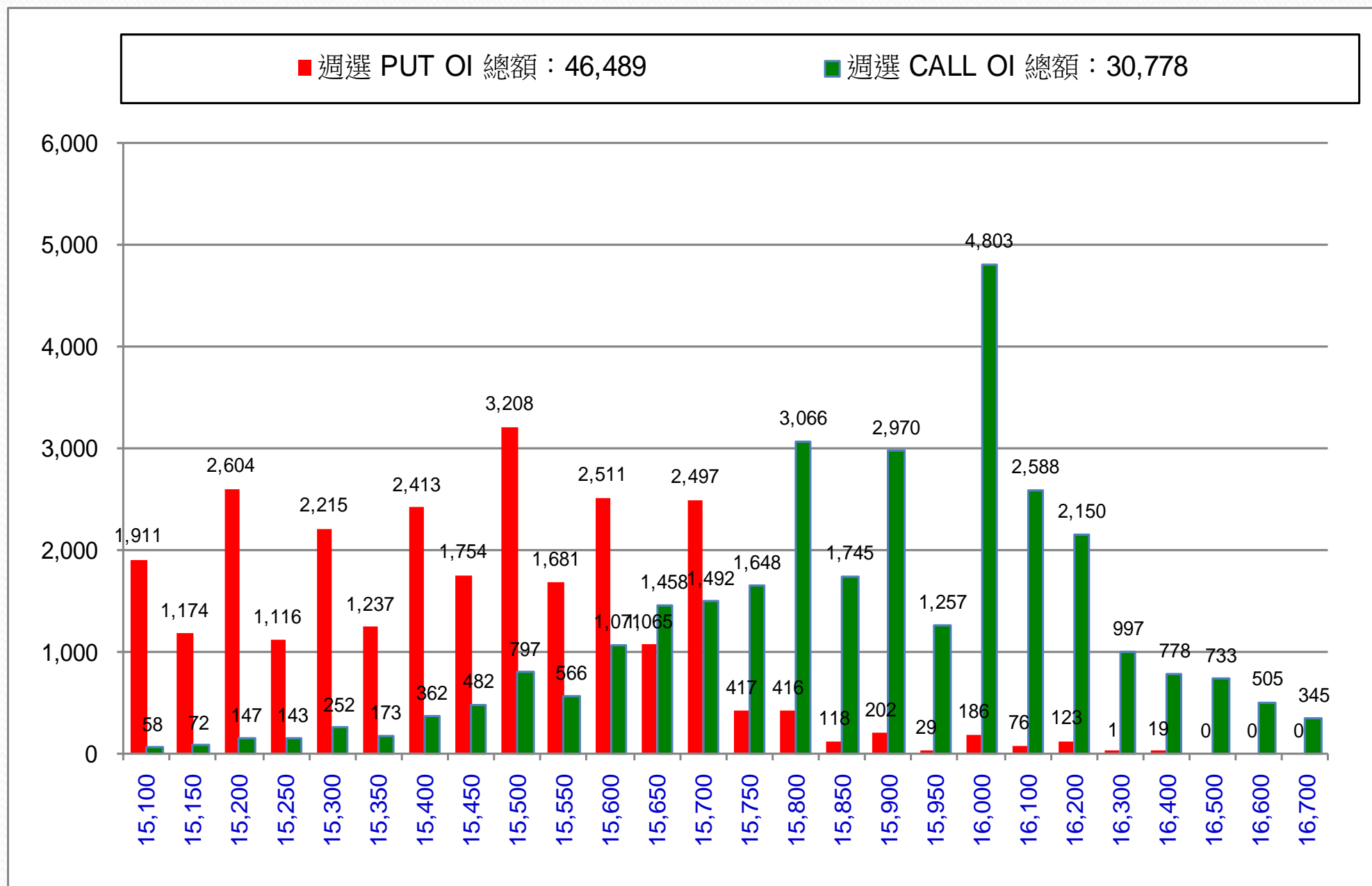
更新日期：2023年3月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年3月22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



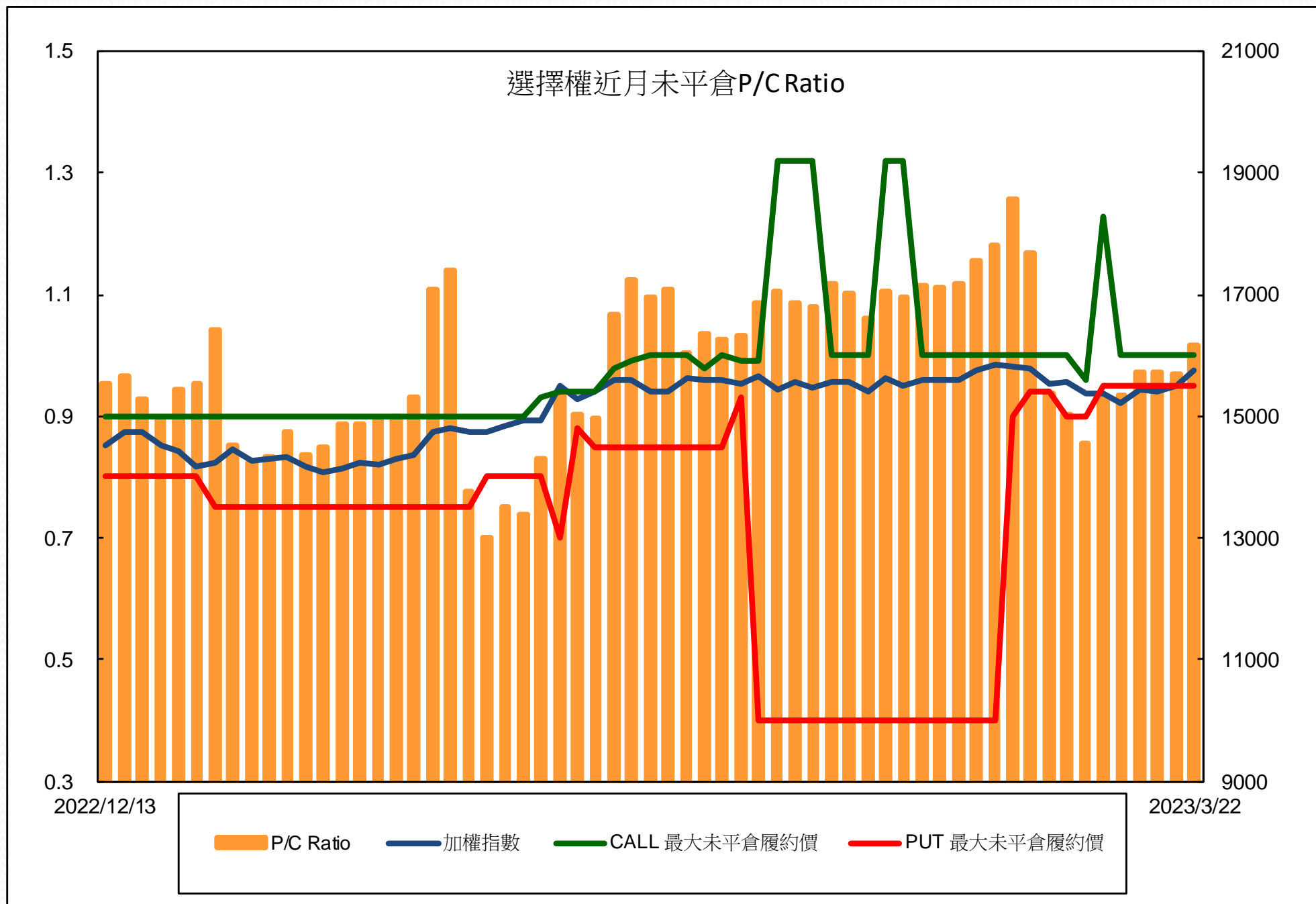
更新日期：2023年3月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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21日	71,005	54,314	16,691
	3月22日	46,085	36,471	9,614
Put	3月21日	64,726	61,000	3,726
	3月22日	43,909	37,648	6,261

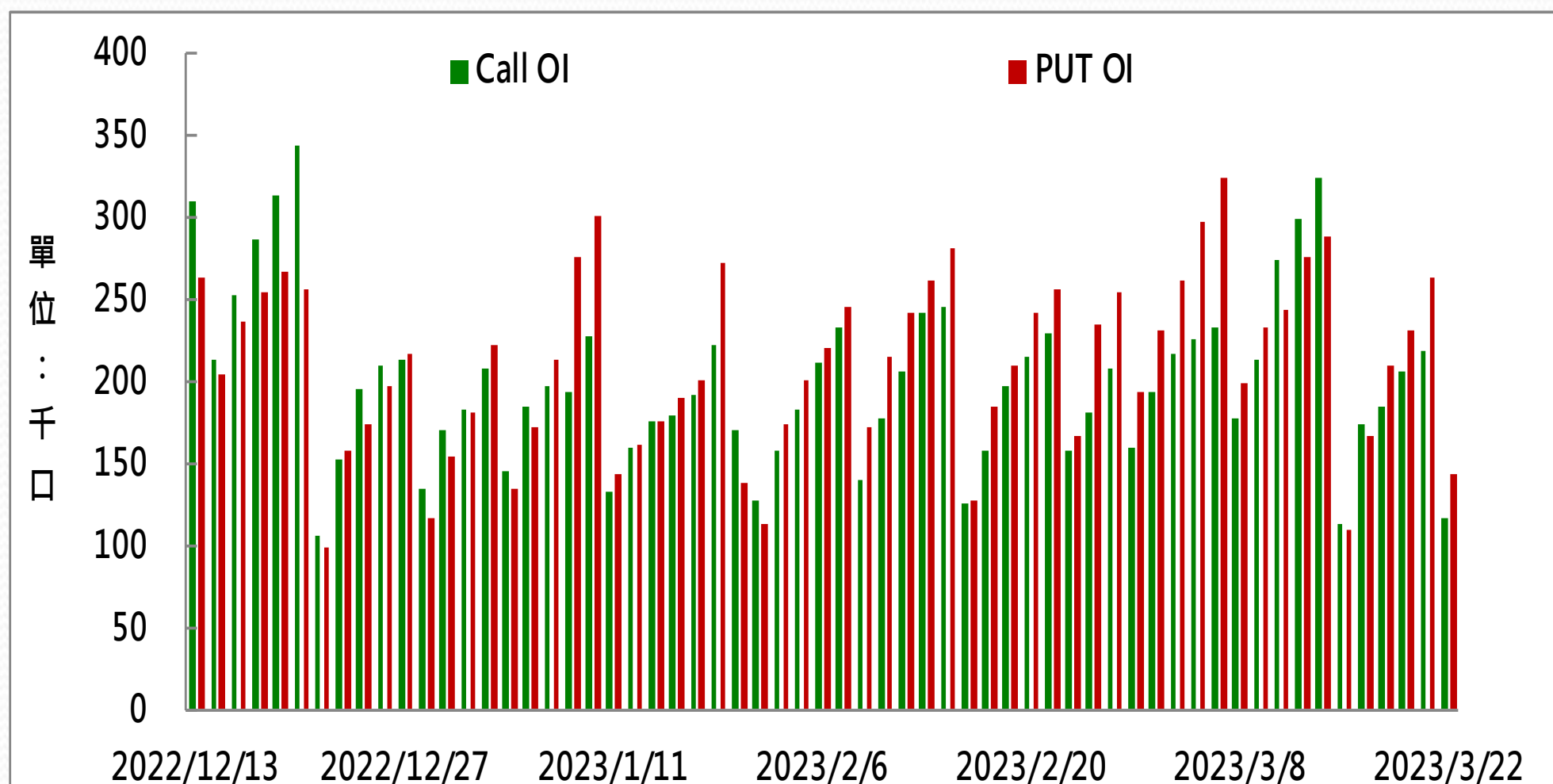
更新日期：2023年3月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

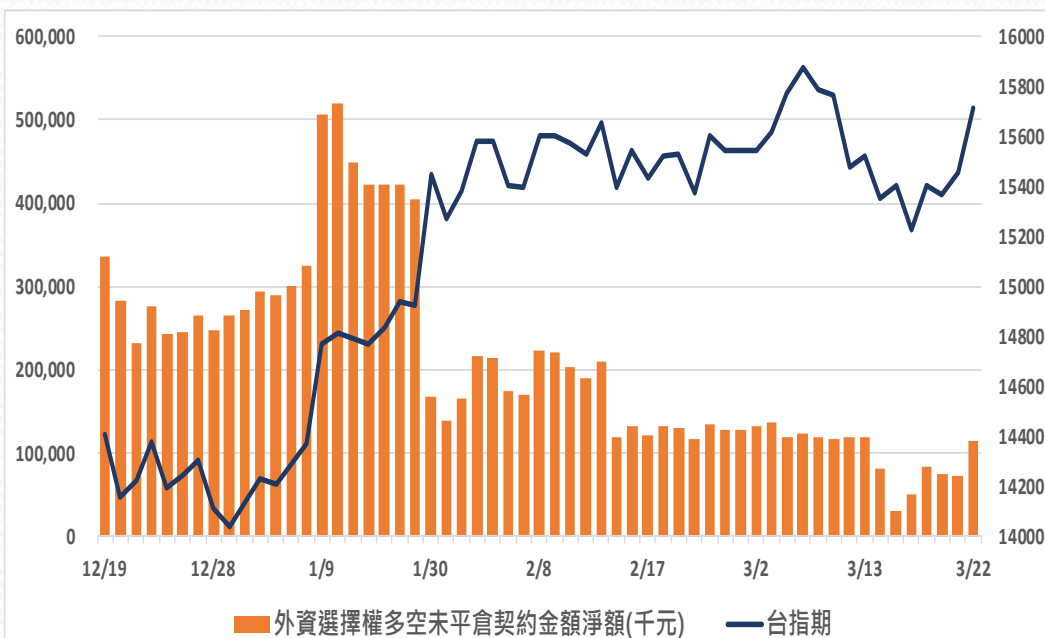
選擇權全月Put Call OI



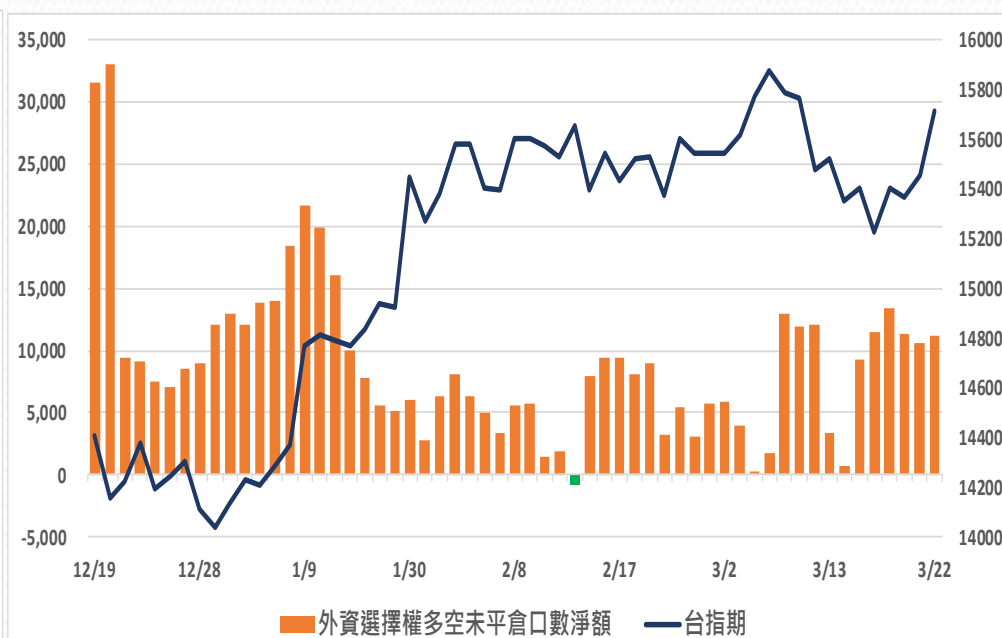
更新日期：2023年3月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



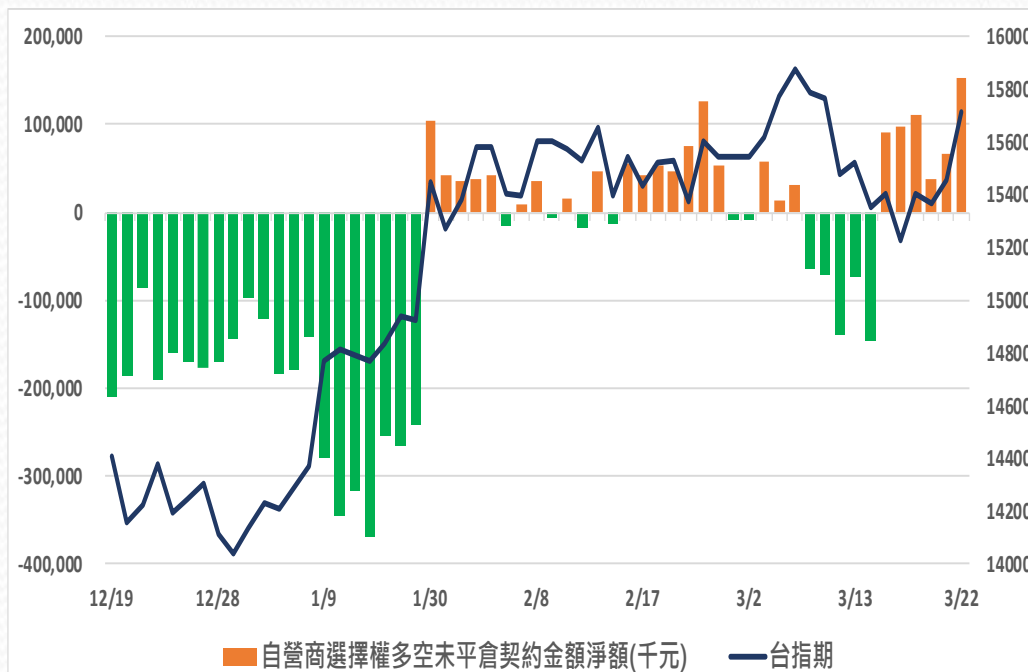
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/16	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
2023/3/21	15455	10,549	-719	71,969	-2,235
2023/3/22	15715	11,149	+600	114,974	+43,005

更新日期：2023年3月22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



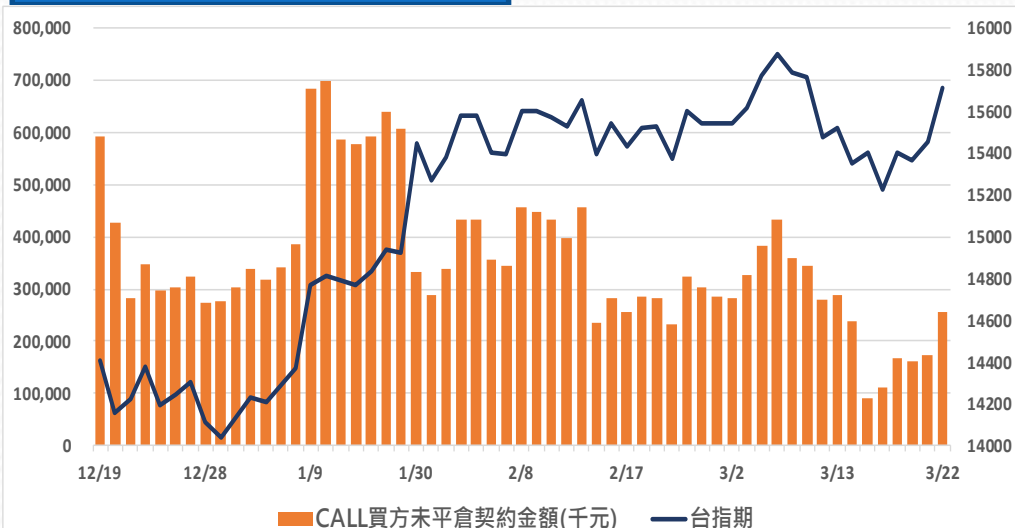
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/16	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
2023/3/21	15455	12,965	+10,793	65,829	+27,039
2023/3/22	15715	3,353	-9,612	151,963	+86,134

更新日期：2023年3月22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

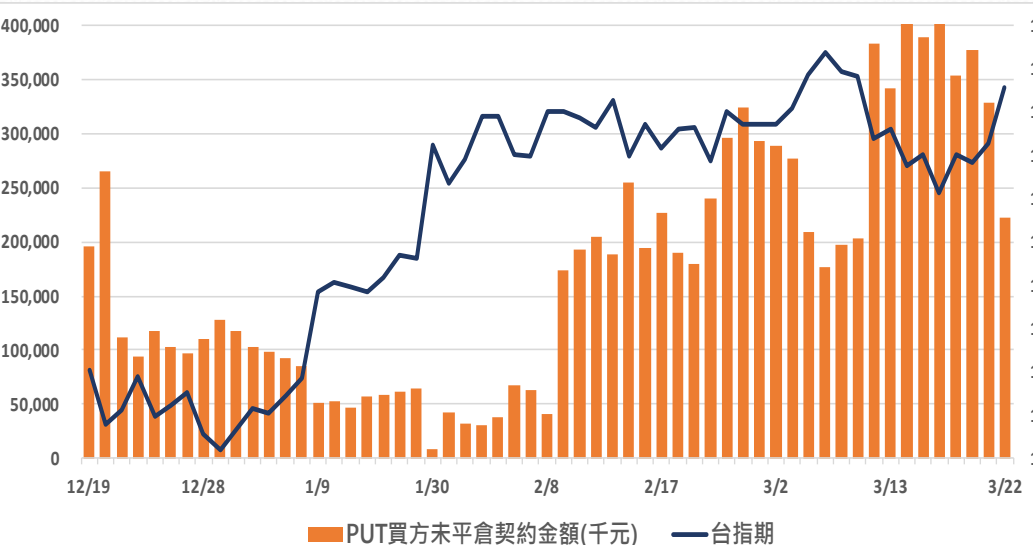
CALL買方未平倉金額



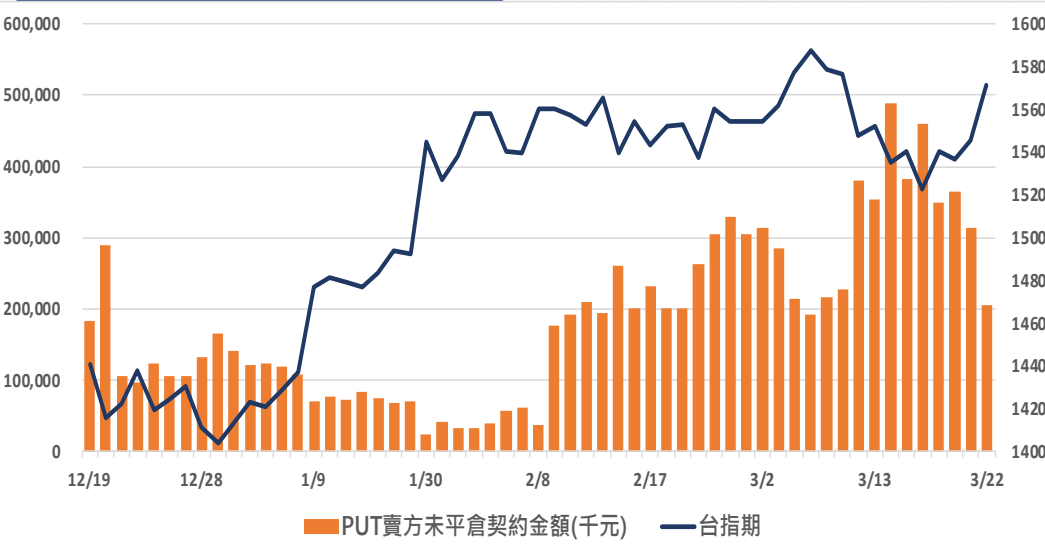
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



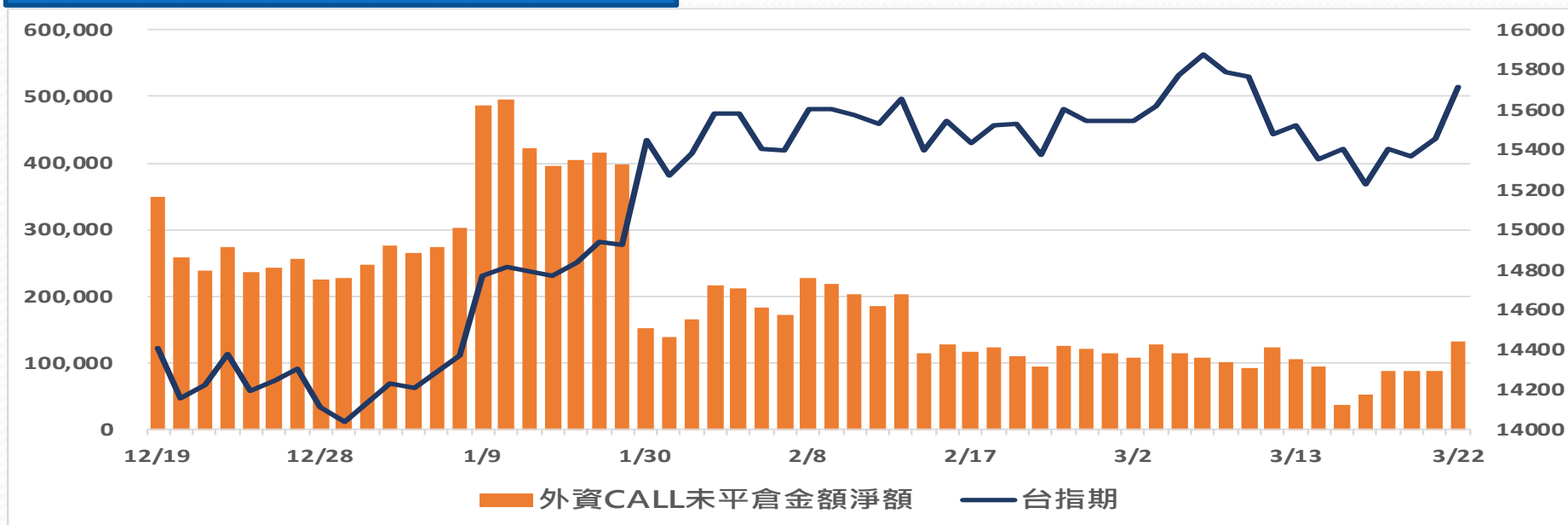
PUT賣方未平倉金額



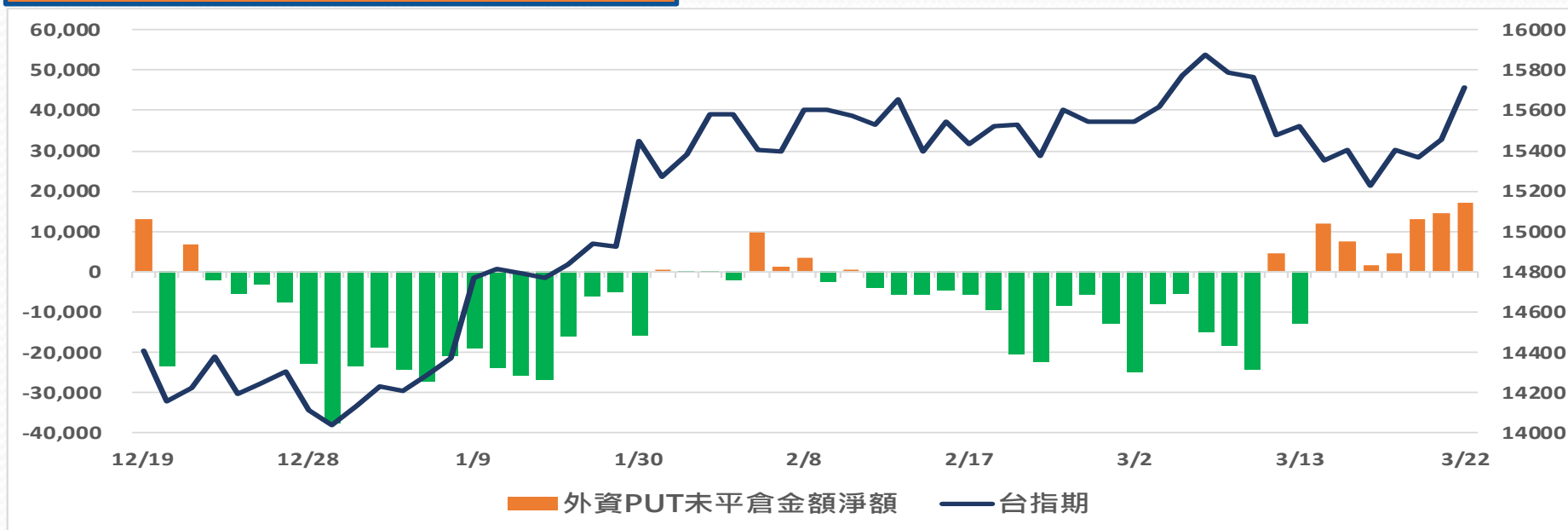
更新日期：2023年3月22日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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22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22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