

台指選擇權OI匯報

日期：2023/3/23 結算日：2023/3/29					日期：2023/3/23 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
0	147	15,200	4,453	1,849	0	70	14,600	2,725	-64
0	143	15,250	3,562	2,446	6	62	14,700	4,415	947 ※
-8	244	15,300	5,843	3,628	8	92	14,800	5,359	330
-5	168	15,350	3,700	2,463	4	96	14,900	2,704	105
-40	322	15,400	10,756	8,343 ※	0	156	15,000	4,905	766
-42	440	15,450	3,542	1,788	-14	335	15,100	2,235	278
-10	787	15,500	7,889	4,681	-188	1,672	15,200	3,591	397
427	993	15,550	5,528	3,847	-11	2,076	15,300	2,646	-62
-41	1,030	15,600	5,939	3,428	-7	1,979	15,400	2,701	-10
-588	870	15,650	2,949	1,884	-290	3,444	15,500	8,895	200
257	1,749	15,700	5,087	2,590	-224	2,452	15,600	1,550	601
265	1,913	15,750	3,083	2,666	-300	2,677	15,700	1,127	324
874	3,940	15,800	2,946	2,530	-292	3,458	15,800	1,032	187
918	2,663	15,850	1,210	1,092	-29	3,529	15,900	344	203
1,689	4,659	15,900	801	599	-501	6,582	16,000	252	107
1,890	3,147	15,950	322	293	367	4,938	16,100	128	26
1,246	6,049	16,000	438	252	372	6,422	16,200	114	27
2,525	2,525	16,050	27	27	※ 1,153	6,309	16,300	100	30
3,915	6,503	16,100	95	19	779	5,612	16,400	19	1
1,521	1,521	16,150	37	37	424	2,816	16,500	12	4
※ 5,035	7,185	16,200	113	-10	22	1,684	16,600	1	1
2,913	3,910	16,300	3	2	180	1,033	16,700	0	0
1,338	2,116	16,400	24	5	11	1,104	16,800	3	0
1,217	1,950	16,500	0	0	178	756	16,900	1	0
439	944	16,600	0	0	72	756	17,000	1	0
462	807	16,700	0	0	-45	382	17,100	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
26,275	57,053	1.7617	100,511	54,022	1,770	72,349	1.0260	74,232	2,551
昨日 P/C	1.5105	今日增減變化		0.2512	昨日 P/C	1.0156	今日增減變化		0.0104

更新日期：2023年3月23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23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	106,929,341	51,557,457	55,371,884	-375,148	2,259,409	803,480	1,455,929	-44,767	
投信	32,045,730	51,305,473	-19,259,743	1,748,069	425,905	0	425,905	3,554	
自營商	44,966,422	18,940,748	26,025,674	804,668	1,428,744	640,367	788,377	-101,241	
	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	615,519	1,214,320	-598,801	74,039	159,117	0	159,117	42,608	
投信	98,787	0	98,787	-4,029	0	0	0	0	
自營商	147,421	331,313	-183,892	-5,479	30,013	196,634	-166,621	-51,607	

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23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	27,725	11,513	16,212	3,922	23,576	26,276	-2,700	-3,841	
投信	50	50	0	0	200	119	81	0	
自營商	50,129	41,844	8,285	-1,329	58,596	51,215	7,381	1,120	
特定法人(週)	779	0	779	-1,412	0	2,668	-2,668	1,041	
特定法人(近月)	16,613	7,021	9,592	3,979	15,502	12,266	3,236	4,004	
特定法人(全月)	18,801	7,119	11,682	4,818	19,122	20,422	-1,300	4,058	
十大交易人(週)	18,959	16,983	1,976	1,954	46,732	33,748	12,984	3,556	
十大交易人(近月)	42,103	34,066	8,037	-2,755	28,091	35,812	-7,721	-600	
十大交易人(全月)	67,642	55,523	12,119	-879	70,257	73,106	-2,849	-993	
全市場未沖銷(近月)			72,349	1,770			74,232	2,551	
全市場未沖銷(全月)			151,344	33,788			209,628	66,528	

更新日期：2023年3月23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	16200
	賣權成交最大量	15400	賣權OI最大量	15400
	整體隱含波動率	14.95%	較前一交易日	-1.80%
	買權隱含波動率	12.87%	較前一交易日	-0.34%
	賣權隱含波動率	16.37%	較前一交易日	-2.91%
電子選擇權	買權成交最大量	775	買權OI最大量	750
	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	1600	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23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

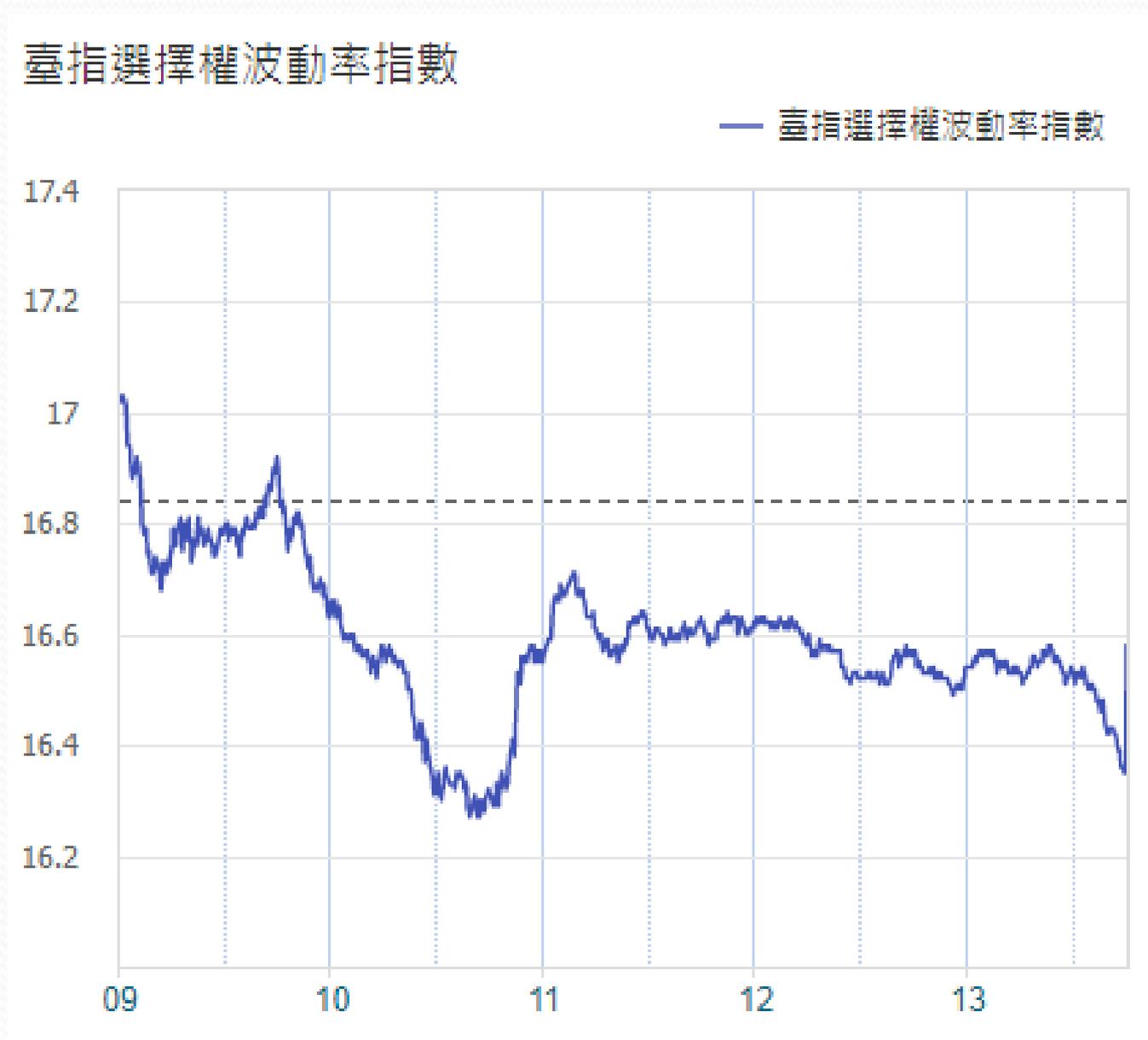
台指選擇權匯報

2023年04月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16300	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	16.76%	較前一交易日	+0.04%
	買權隱含波動率	13.22%	較前一交易日	+0.63%
	賣權隱含波動率	19.69%	較前一交易日	-0.93%
	成交量P/C_Ratio值	1.066	較前一交易日	-0.14
	未平倉P/C_Ratio值	1.026	較前一交易日	+0.01
電子選擇權	買權成交最大量	775	買權OI最大量	750
	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	1600	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1480	賣權OI最大量	1540

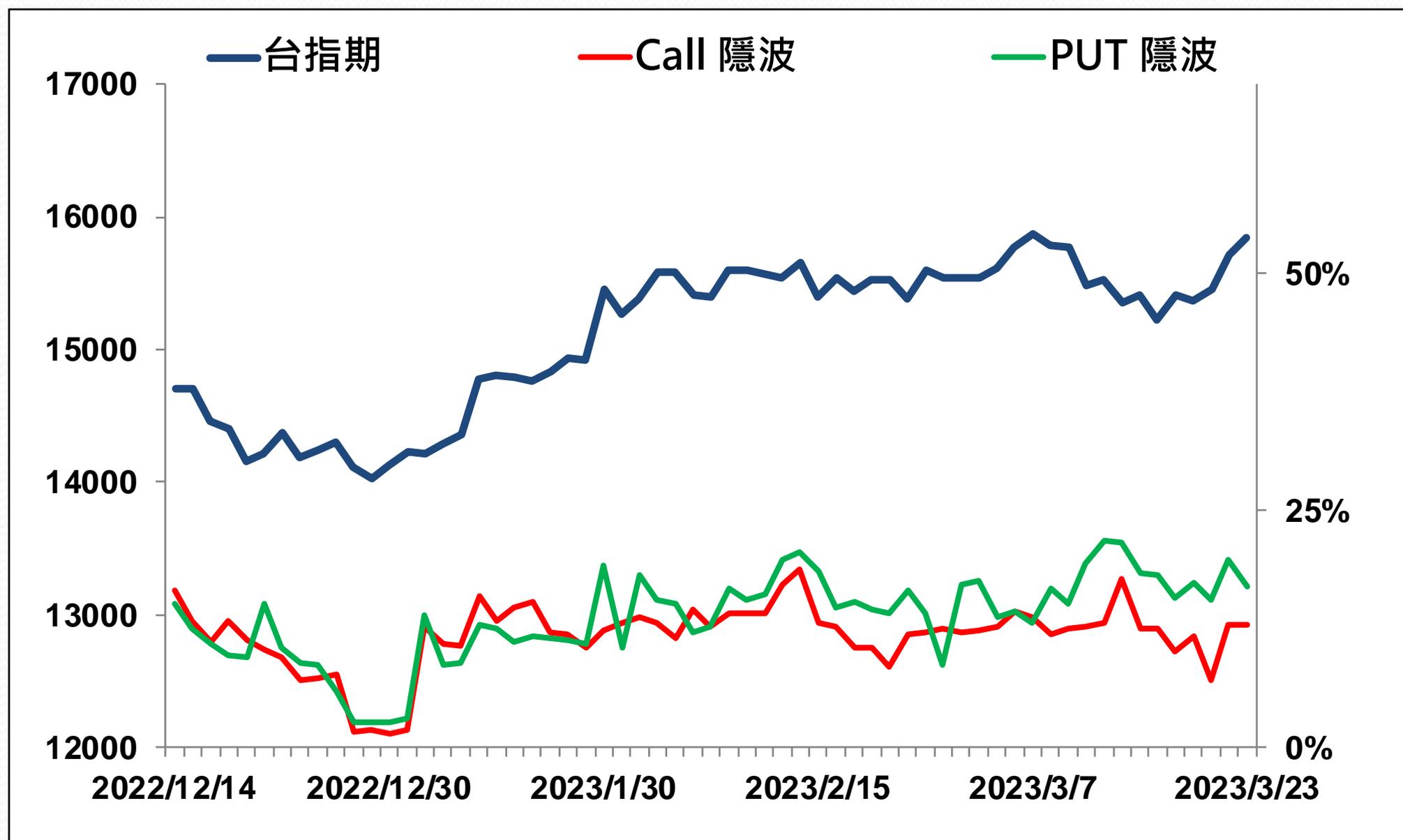
更新日期：2023年3月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



更新日期：2023年3月23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

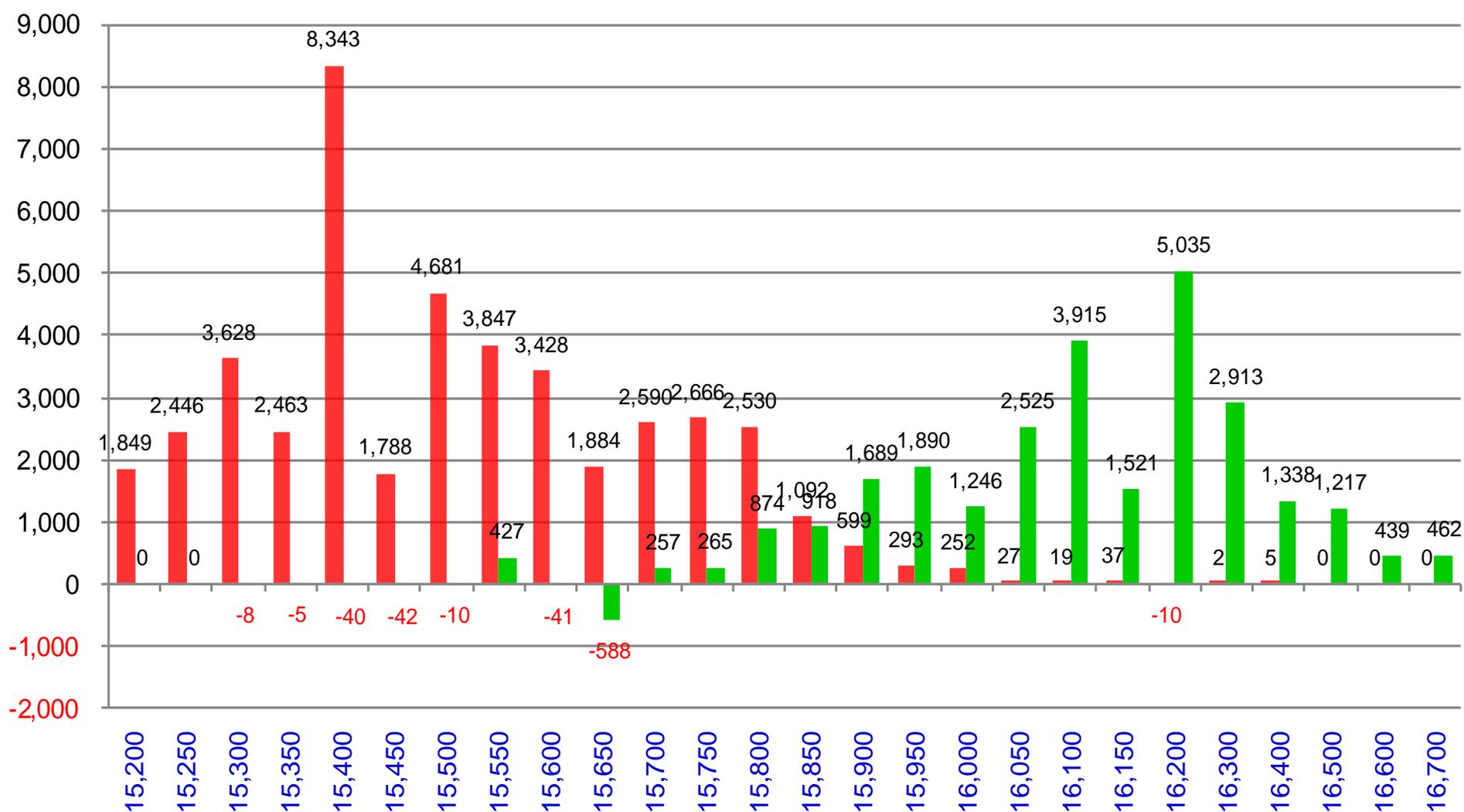


更新日期：2023年3月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：54,022

週選 CALL OI 變化：26,275

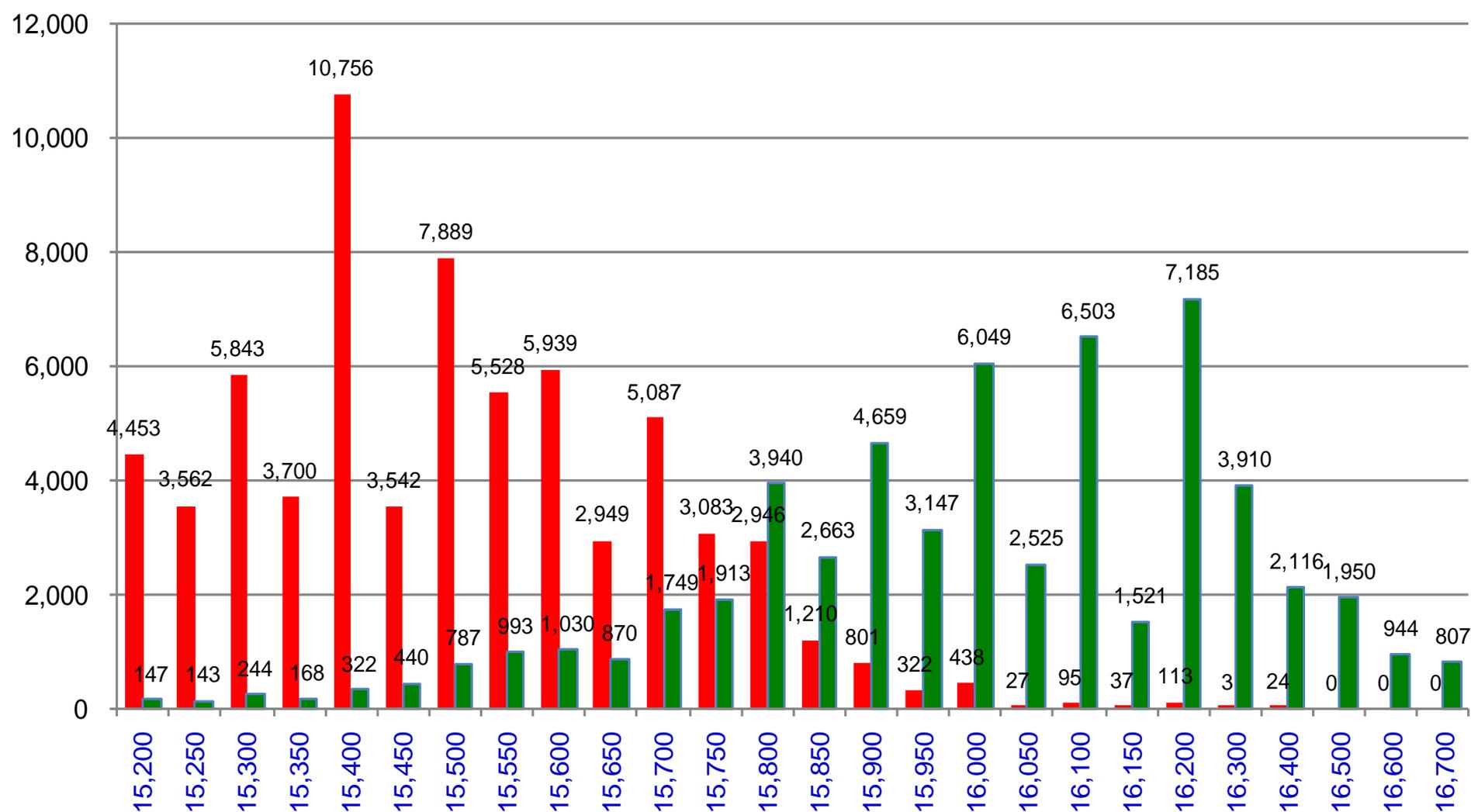


更新日期：2023年3月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：100,511

週選 CALL OI 總額：57,053



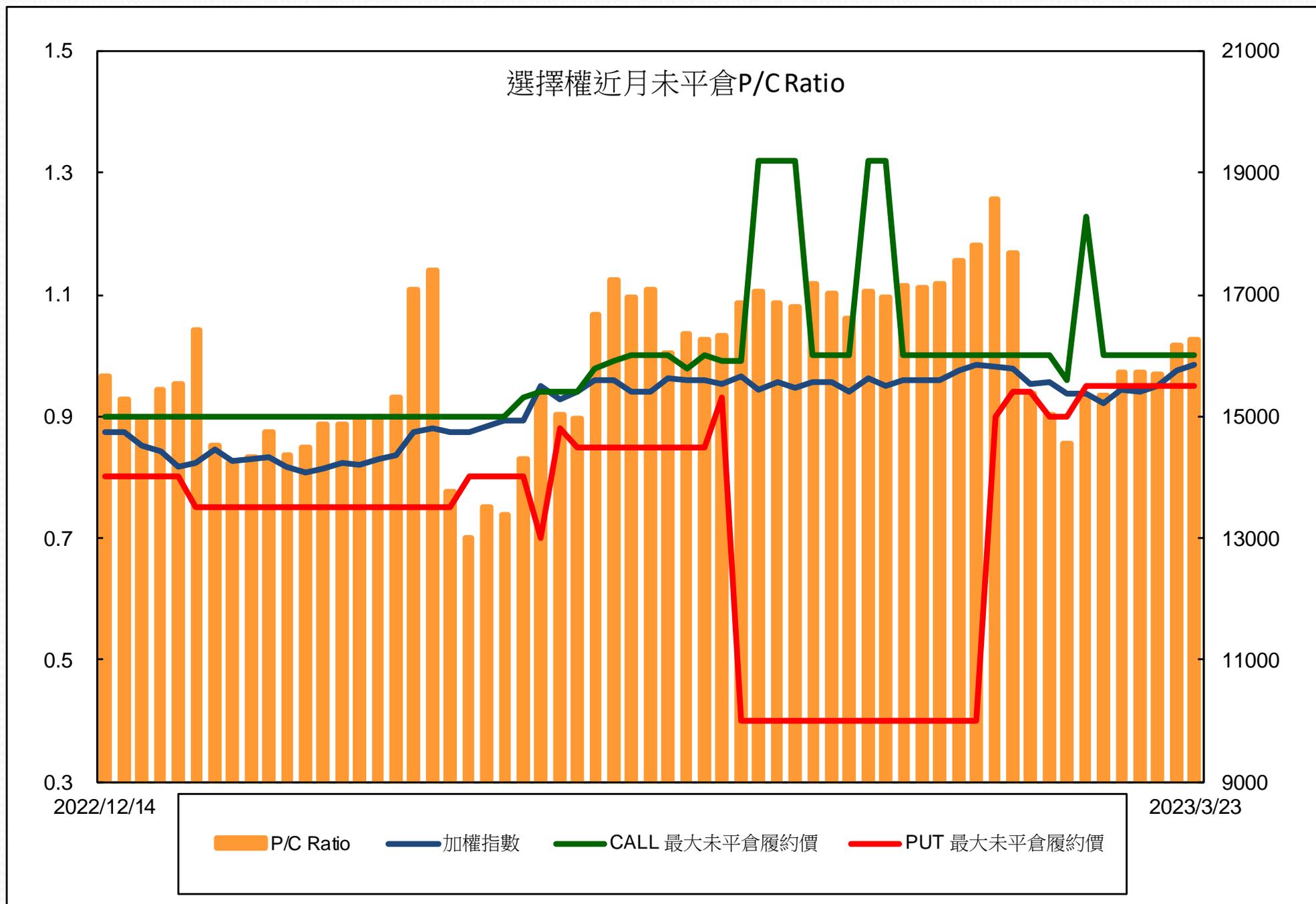
更新日期：2023年3月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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22日	46,085	36,471	9,614
	3月23日	50,129	41,844	8,285
Put	3月22日	43,909	37,648	6,261
	3月23日	58,596	51,215	7,381

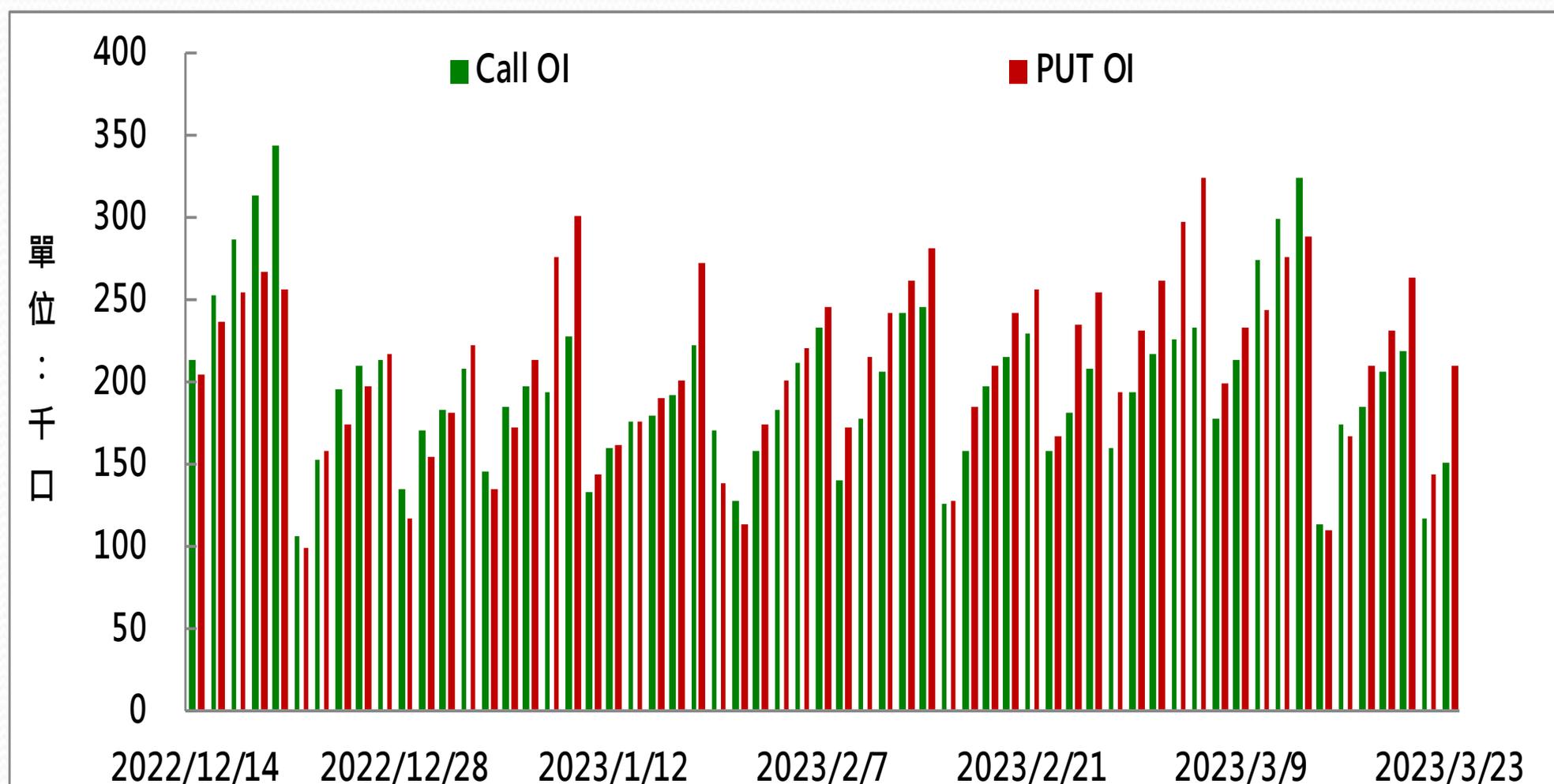
更新日期：2023年3月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

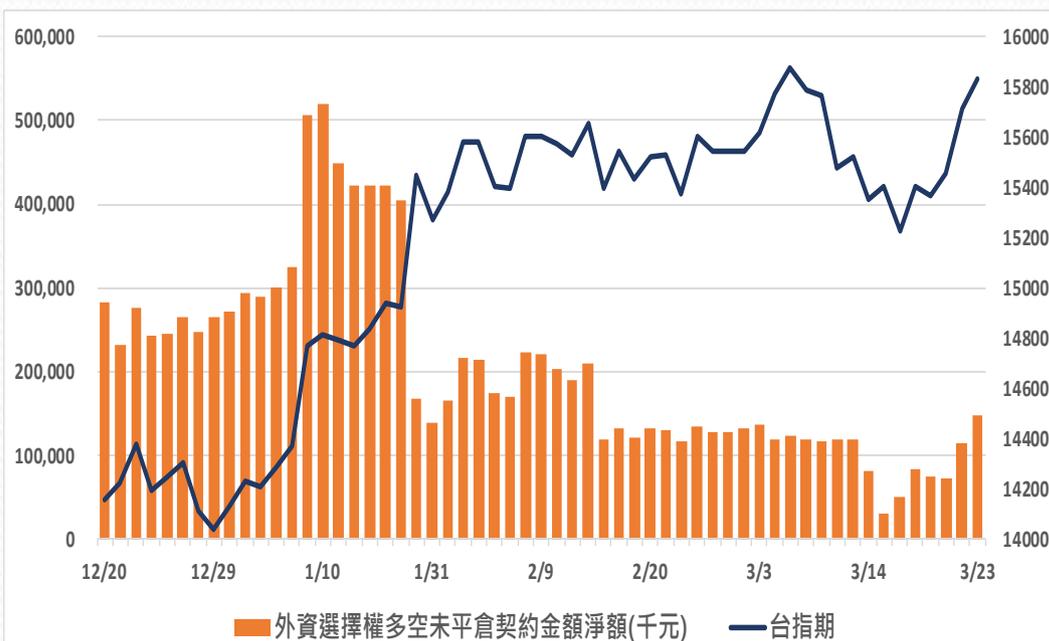
選擇權全月Put Call OI



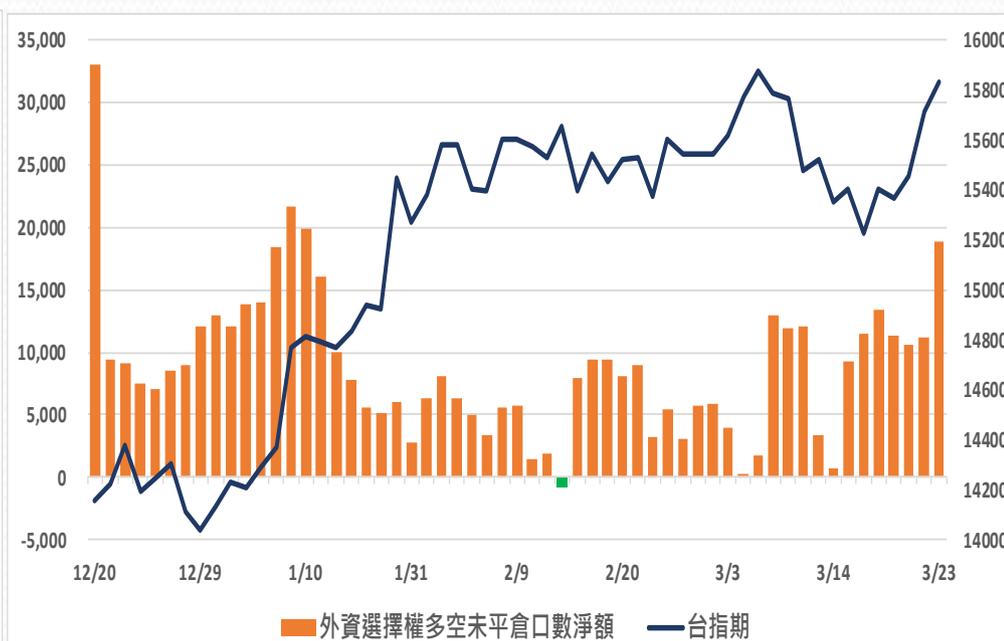
更新日期：2023年3月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



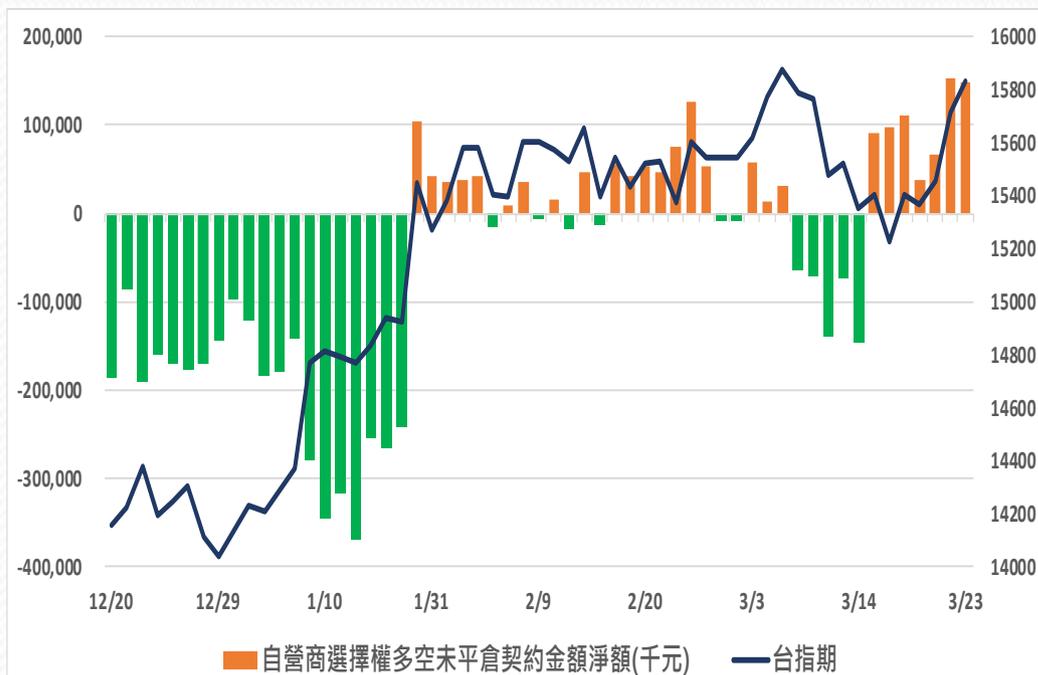
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/17	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
2023/3/23	15836	18,912	+7,763	148,282	+33,308

更新日期：2023年3月23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
2023/3/17	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
2023/3/23	15836	904	-2,449	149,600	-2,363

更新日期：2023年3月23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

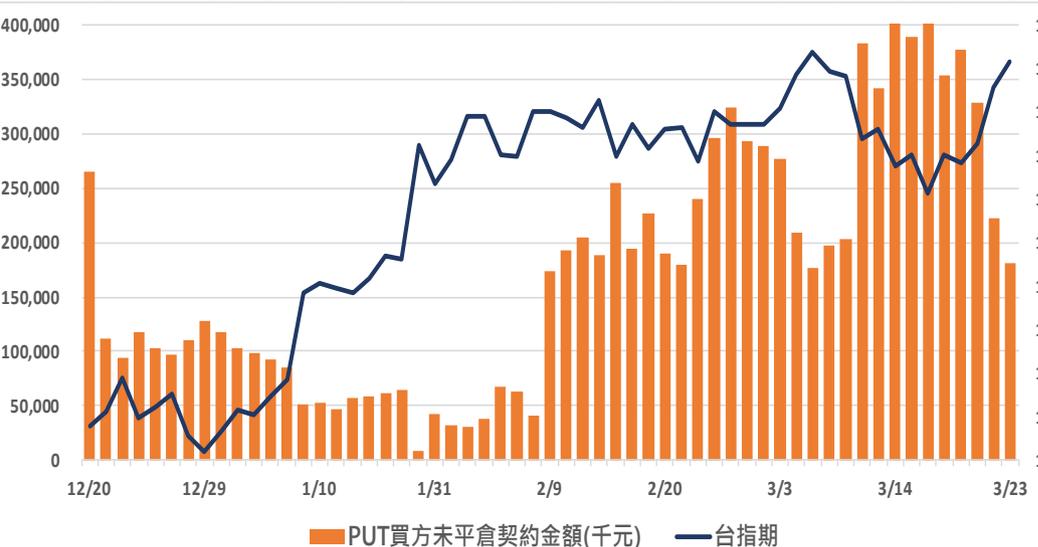
CALL買方未平倉金額



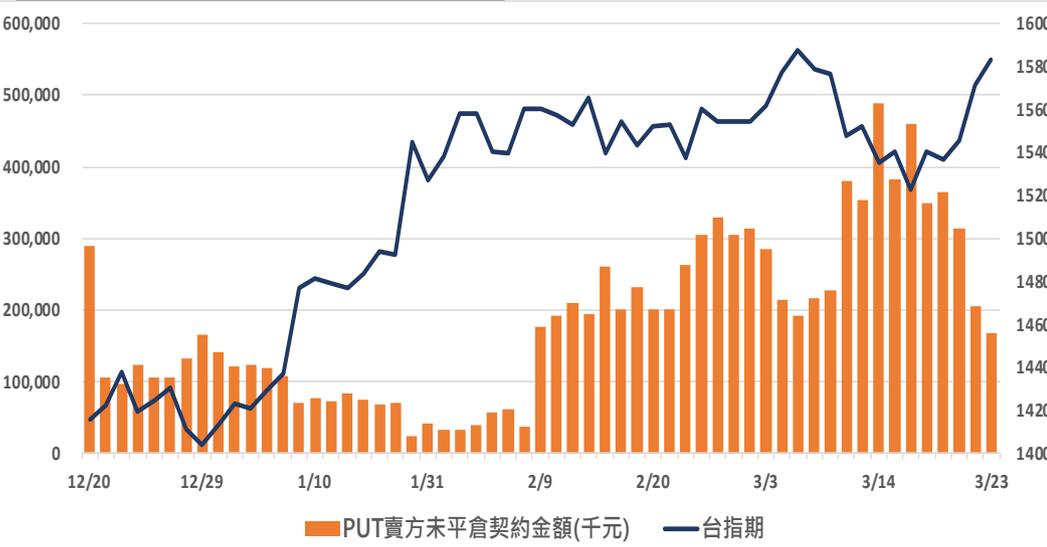
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



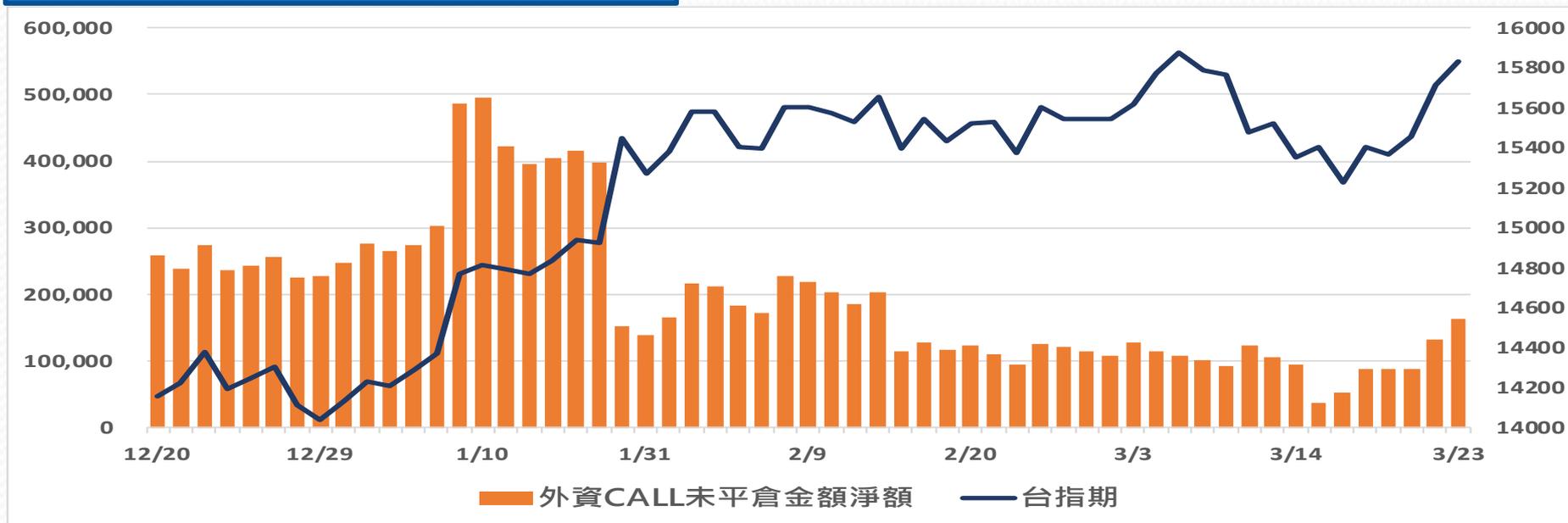
PUT賣方未平倉金額



更新日期：2023年3月23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23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23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