

台指選擇權OI匯報

日期：2023/3/24 結算日：2023/3/29					日期：2023/3/24 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
-2	141	15,250	3,181	-381	6	76	14,600	2,494	-231
-9	235	15,300	4,842	-1,001	0	62	14,700	4,066	-349
-3	165	15,350	3,899	199	-7	85	14,800	6,363	1,004
-42	280	15,400	8,682	-2,074	-2	94	14,900	3,094	390
-10	430	15,450	4,556	1,014	1	157	15,000	5,755	850
-75	712	15,500	9,264	1,375	-2	333	15,100	2,388	153
-575	418	15,550	7,117	1,589	1	1,673	15,200	3,819	228
123	1,153	15,600	8,331	2,392	-4	2,072	15,300	3,363	717
83	953	15,650	5,130	2,181	-36	1,943	15,400	4,469	1,768
-41	1,708	15,700	6,944	1,857	-219	3,225	15,500	9,669	774
-307	1,606	15,750	4,562	1,479	-4	2,448	15,600	1,673	123
-1,025	2,915	15,800	5,438	2,492	-67	2,610	15,700	1,649	522
-98	2,565	15,850	3,027	1,817	-402	3,056	15,800	1,107	75
526	5,185	15,900	3,011	2,210	-270	3,259	15,900	634	290
872	4,019	15,950	1,140	818	-545	6,037	16,000	411	159
1,643	7,692	16,000	1,405	967	-82	4,856	16,100	191	63
1,260	3,785	16,050	357	330	509	6,931	16,200	193	79
1,702	8,205	16,100	198	103	231	6,540	16,300	135	35
3,641	5,162	16,150	86	49	440	6,052	16,400	60	41
1,395	8,580	16,200	195	82	423	3,239	16,500	12	0
1,147	1,147	16,250	6	6	493	2,177	16,600	10	9
2,157	6,067	16,300	19	16	104	1,137	16,700	14	14
2,189	4,305	16,400	26	2	486	1,590	16,800	5	2
708	2,658	16,500	2	2	43	799	16,900	1	0
278	1,222	16,600	0	0	50	806	17,000	1	0
15	822	16,700	0	0	-34	348	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
15,536	72,589	1.5964	115,879	15,368	999	73,348	1.0826	79,410	5,178
昨日 P/C	1.7617	今日增減變化	-0.1653		昨日 P/C	1.0260	今日增減變化	0.0566	

更新日期：2023年3月24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24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	97,101,491	56,586,228	40,515,263	-14,856,621	1,986,165	836,440	1,149,725	-306,204	
投信	35,456,709	50,899,383	-15,442,674	3,817,069	428,866	0	428,866	2,961	
自營商	45,357,742	20,424,593	24,933,149	-1,092,525	1,560,341	626,570	933,771	145,394	
	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	565,319	1,277,651	-712,332	-113,531	135,720	0	135,720	-23,397	
投信	96,998	0	96,998	-1,789	0	0	0	0	
自營商	171,263	313,726	-142,463	41,429	73,883	212,618	-138,735	27,886	

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24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	28,885	14,933	13,952	-2,260	27,922	29,360	-1,438	1,262	
投信	150	50	100	100	200	119	81	0	
自營商	52,599	42,277	10,322	2,037	60,480	53,802	6,678	-703	
特定法人(週)	839	1,000	-161	-940	0	2,668	-2,668	0	
特定法人(近月)	16,613	8,708	7,905	-1,687	18,143	14,666	3,477	241	
特定法人(全月)	18,861	9,336	9,525	-2,157	19,123	20,576	-1,453	-153	
十大交易人(週)	22,213	19,427	2,786	810	51,318	35,553	15,765	2,781	
十大交易人(近月)	41,378	34,332	7,046	-991	30,726	37,209	-6,483	1,238	
十大交易人(全月)	68,864	57,620	11,244	-875	75,316	74,918	398	3,247	
全市場未沖銷(近月)			73,348	999			79,410	5,178	
全市場未沖銷(全月)			169,450	18,106			234,709	25,081	

更新日期：2023年3月24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	15800	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	13.46%	較前一交易日	-1.50%
	買權隱含波動率	13.14%	較前一交易日	+0.27%
	賣權隱含波動率	13.72%	較前一交易日	-2.65%
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	715	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	1440	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年3月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

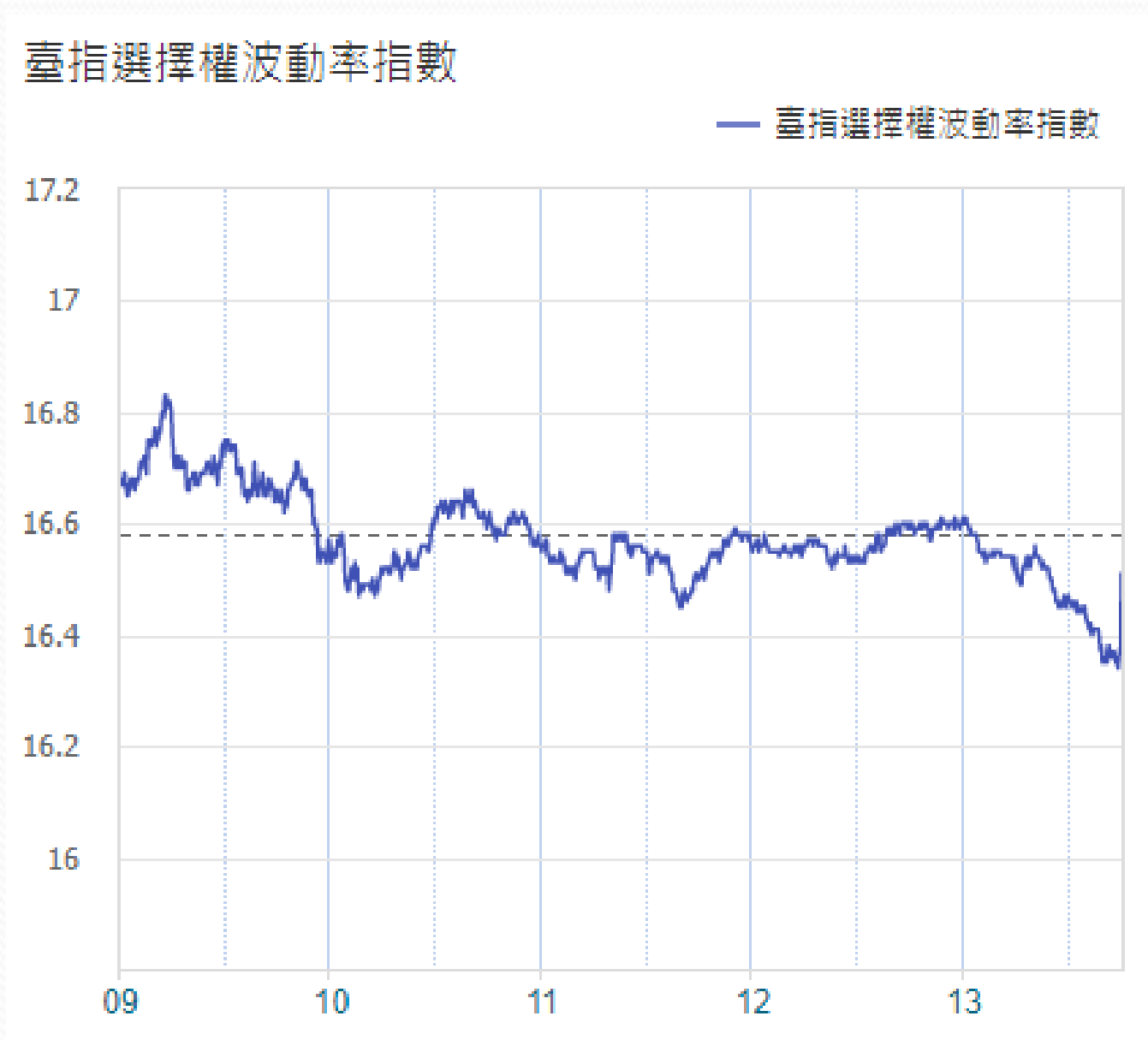
台指選擇權匯報

2023年04月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16500	買權OI最大量	16200
	賣權成交最大量	15500	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	15.85%	較前一交易日	+0.91%
	買權隱含波動率	13.58%	較前一交易日	+0.36%
	賣權隱含波動率	18.10%	較前一交易日	-1.59%
	成交量P/C_Ratio值	1.333	較前一交易日	+0.27
	未平倉P/C_Ratio值	1.083	較前一交易日	+0.06
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	715	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	1440	賣權OI最大量	1540

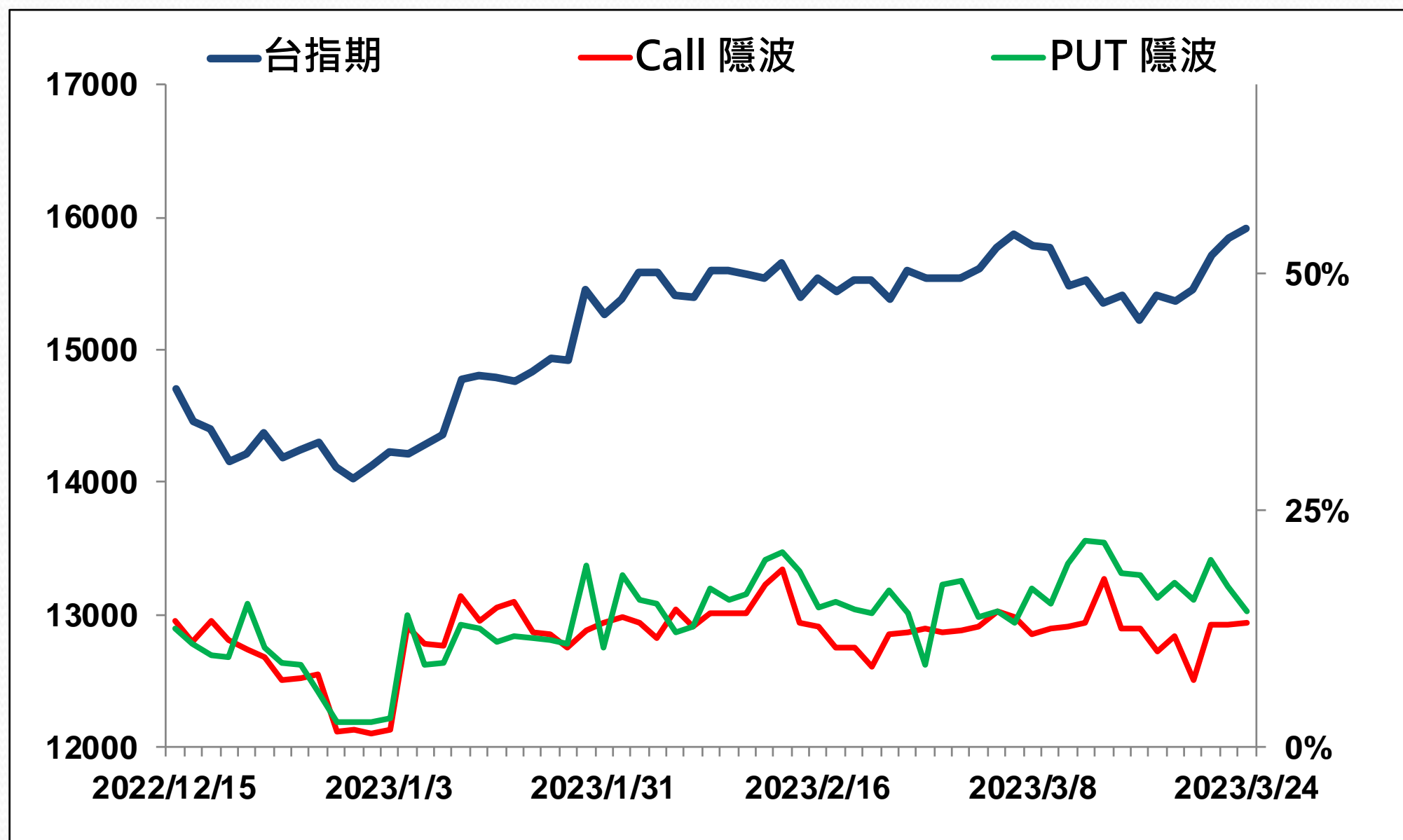
更新日期：2023年3月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



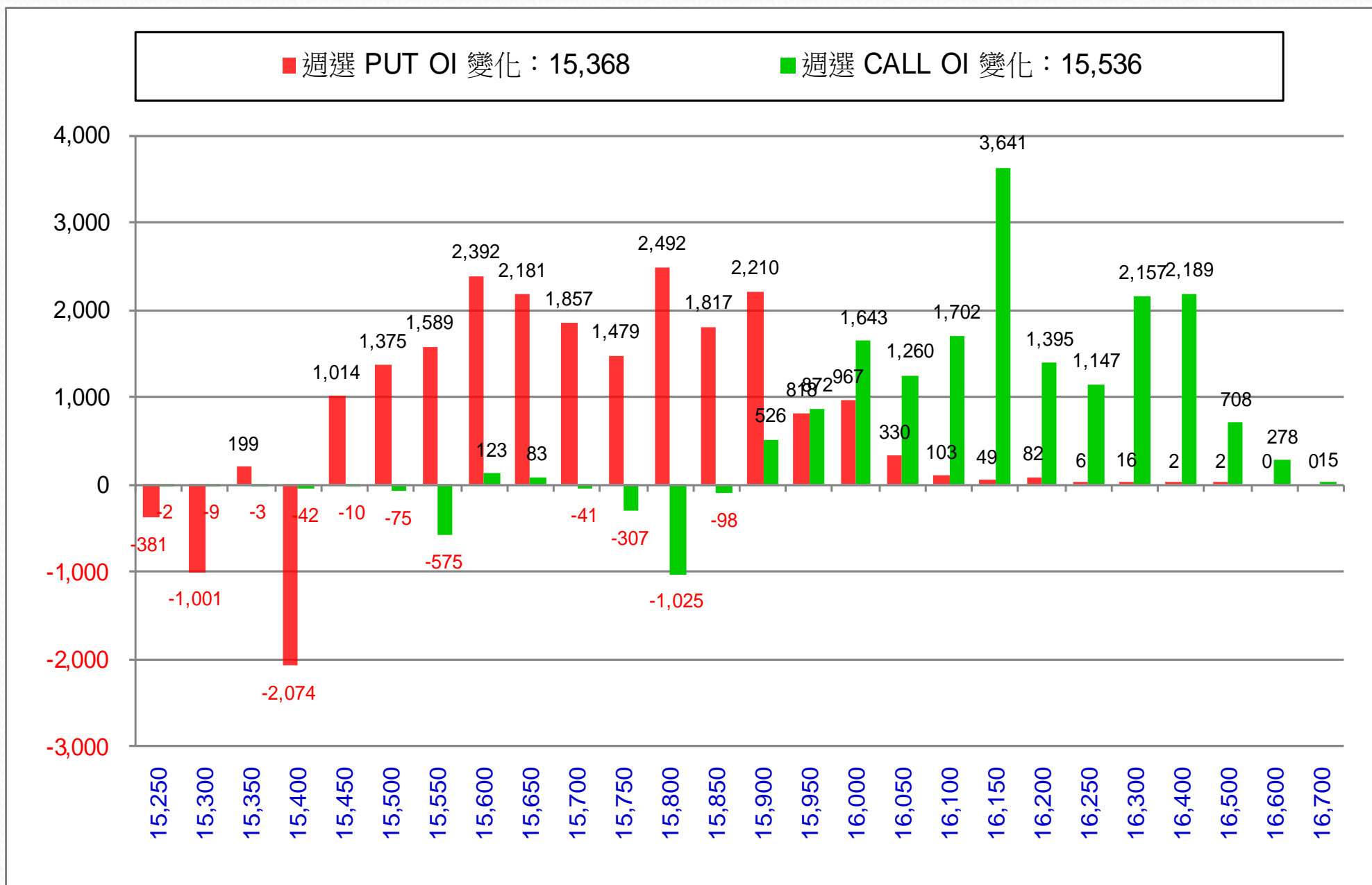
更新日期：2023年3月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年3月24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

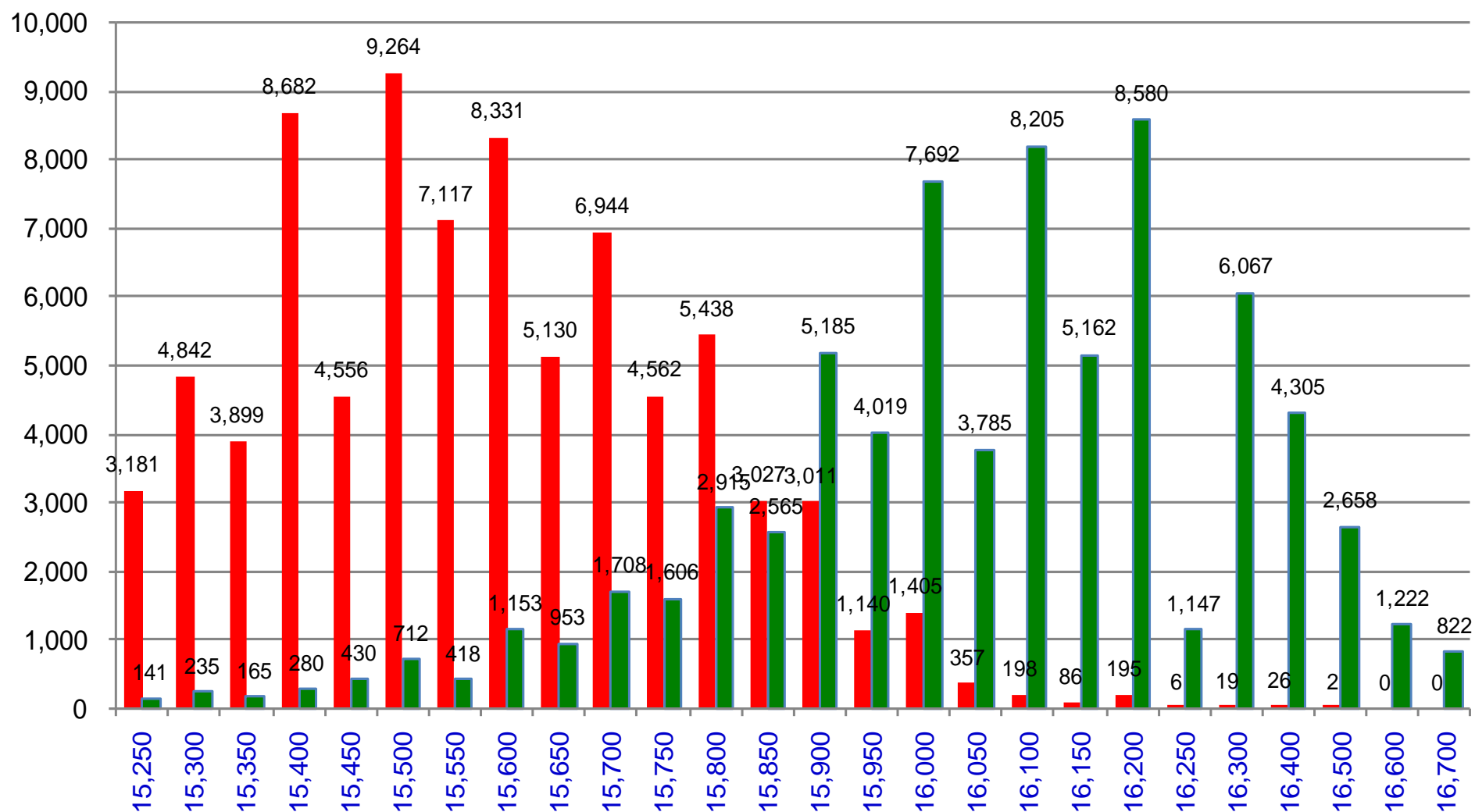


更新日期：2023年3月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：115,879

週選 CALL OI 總額：72,589



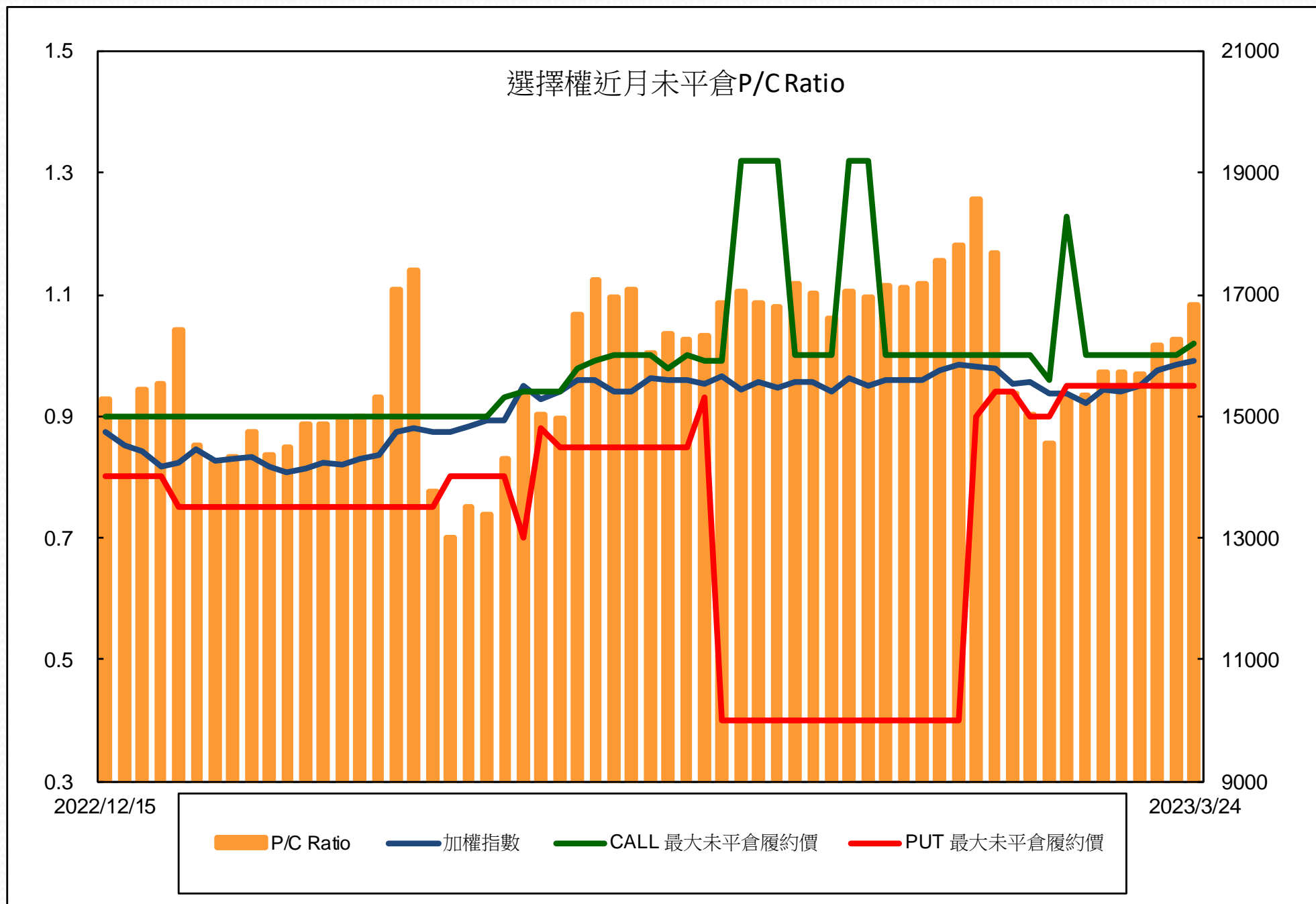
更新日期：2023年3月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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23日	50,129	41,844	8,285
	3月24日	52,599	42,277	10,322
Put	3月23日	58,596	51,215	7,381
	3月24日	60,480	53,802	6,678

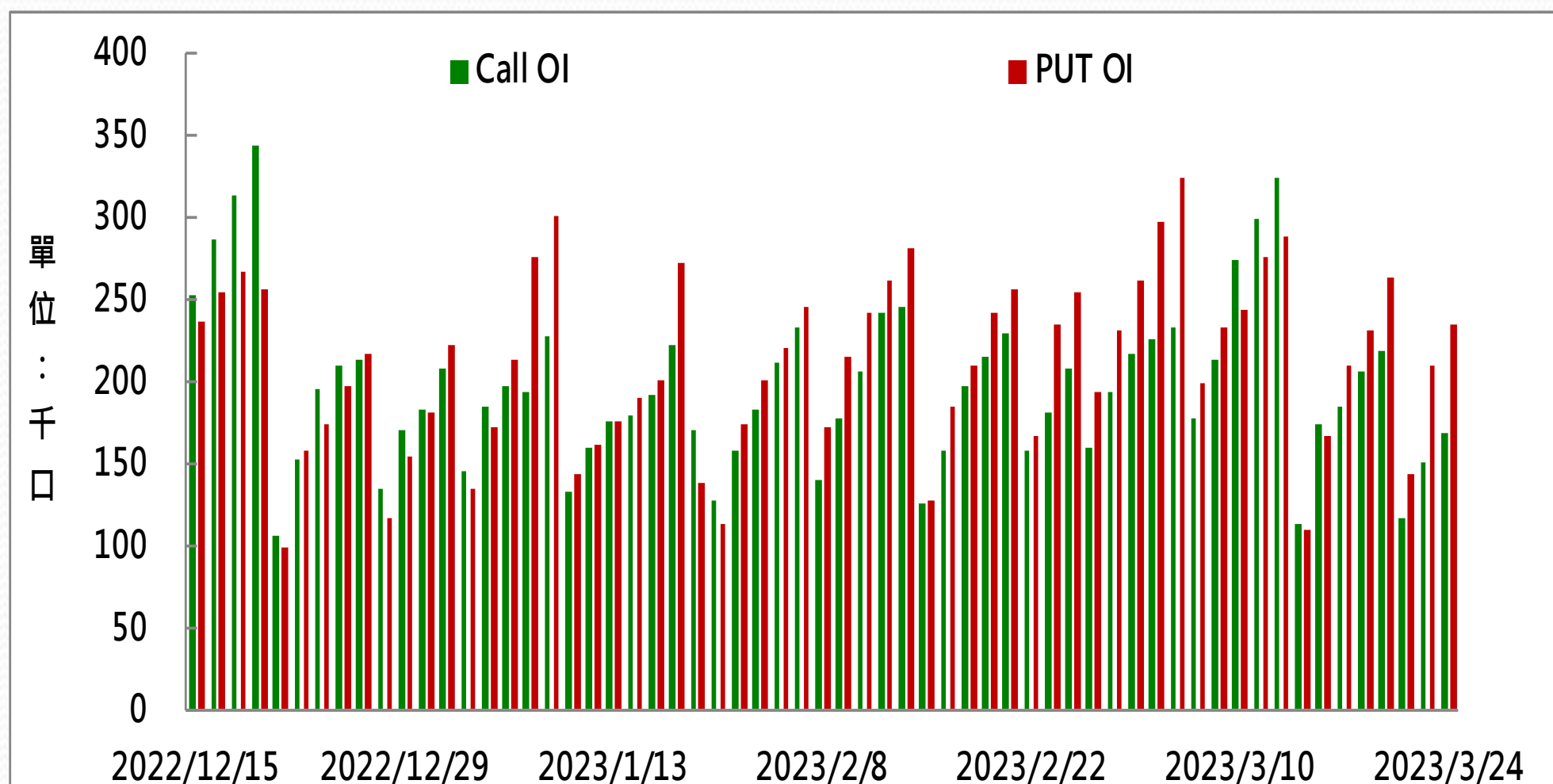
更新日期：2023年3月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

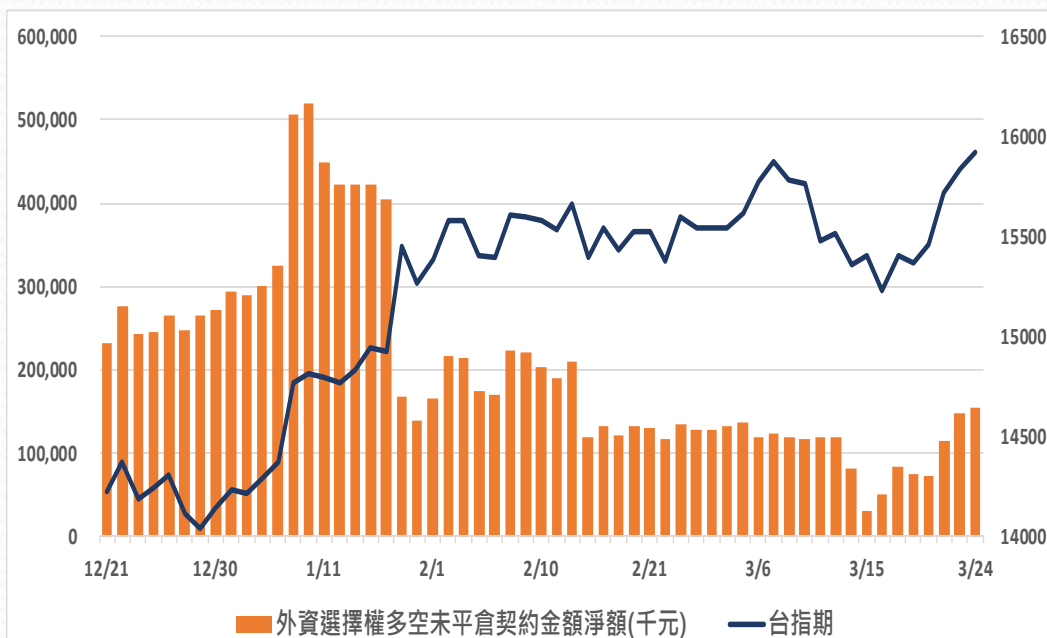
選擇權全月Put Call OI



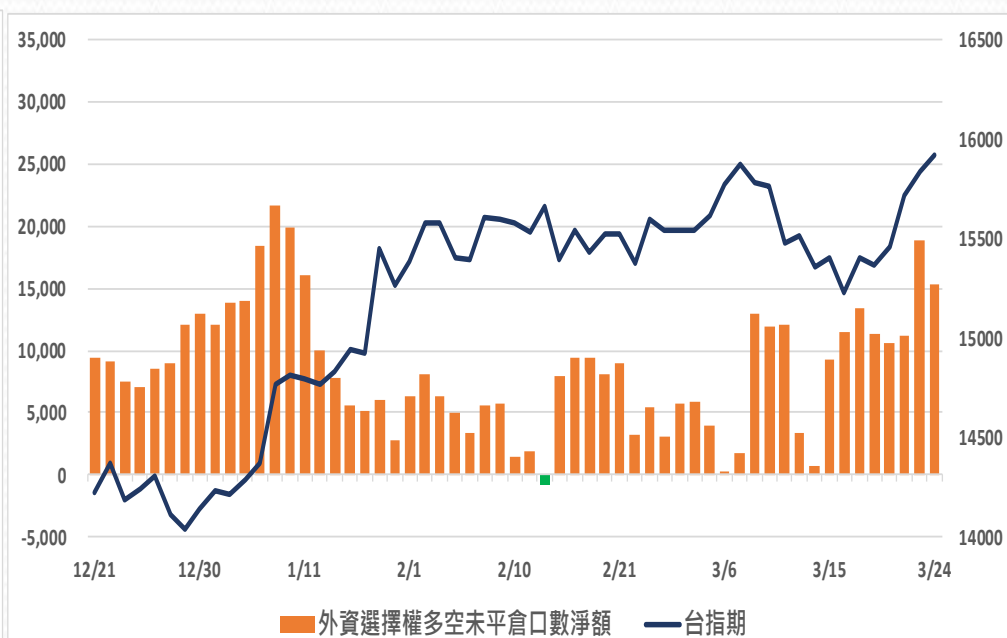
更新日期：2023年3月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



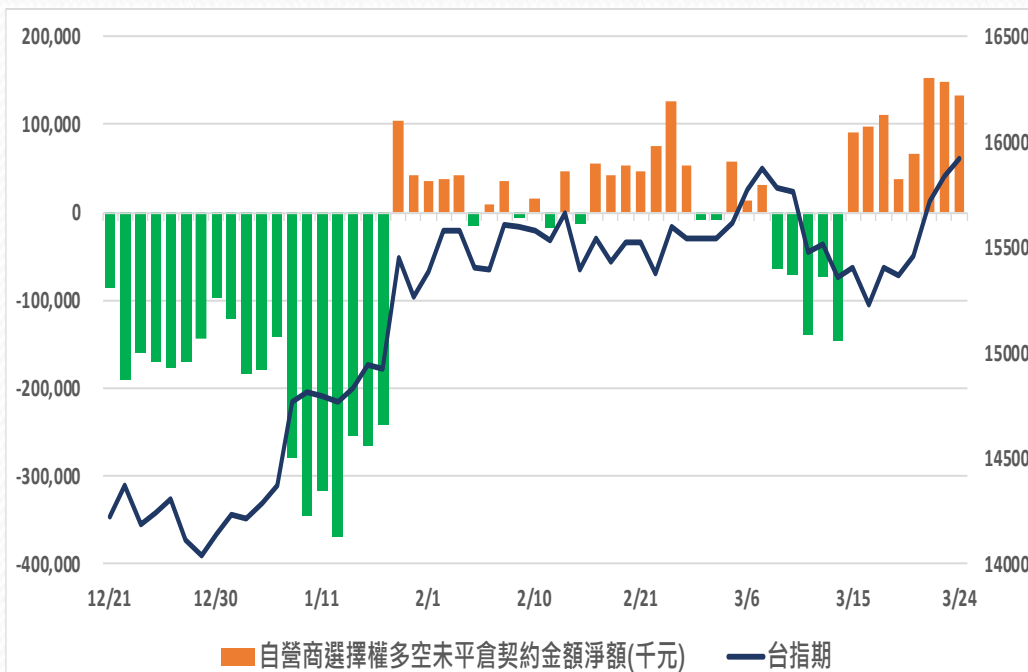
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/20	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
2023/3/24	15917	15,390	-3,522	153,268	+4,986

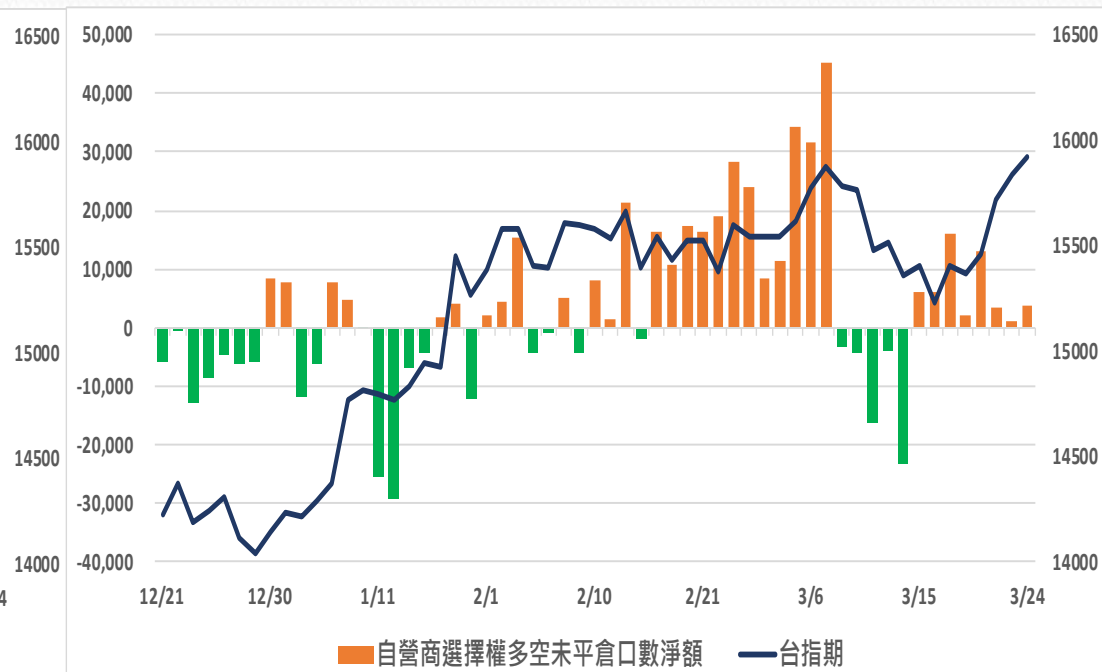
更新日期：2023年3月24日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



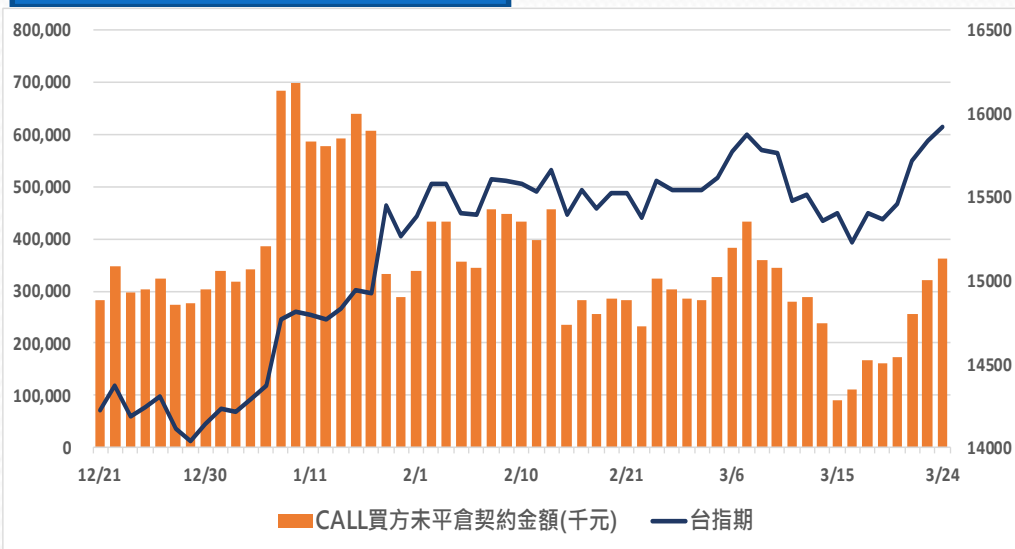
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/20	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
2023/3/24	15917	3,644	+2,740	133,372	-16,228

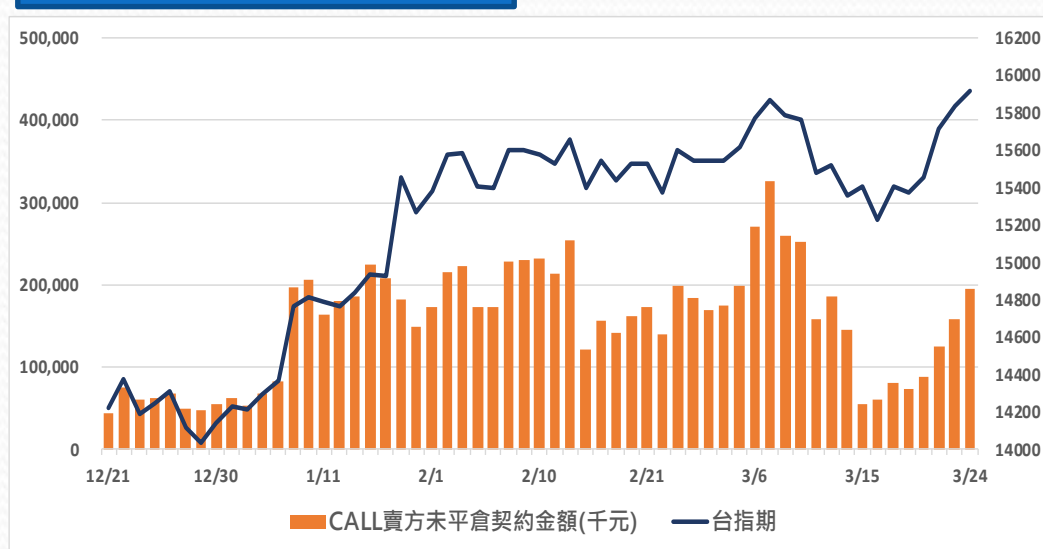
更新日期：2023年3月24日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

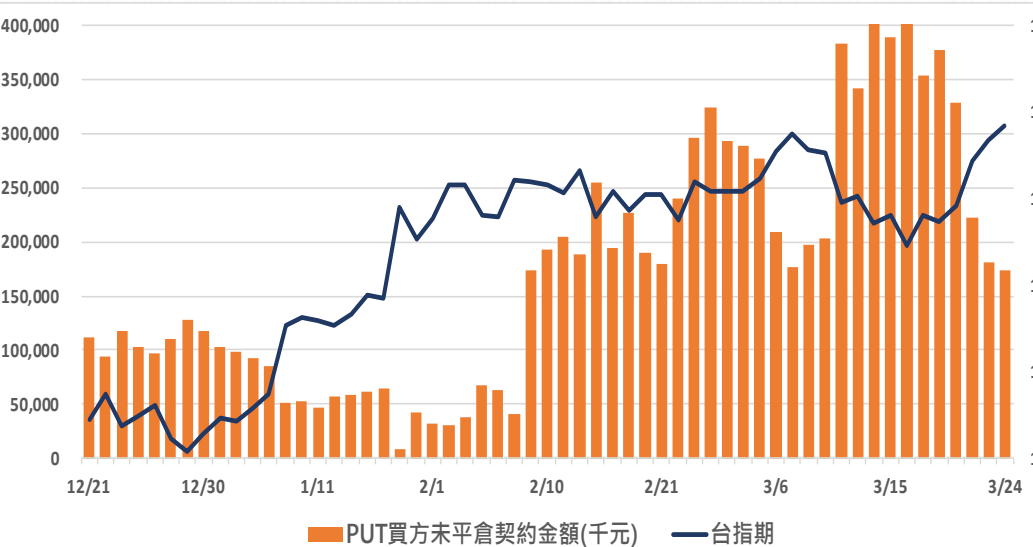
CALL買方未平倉金額



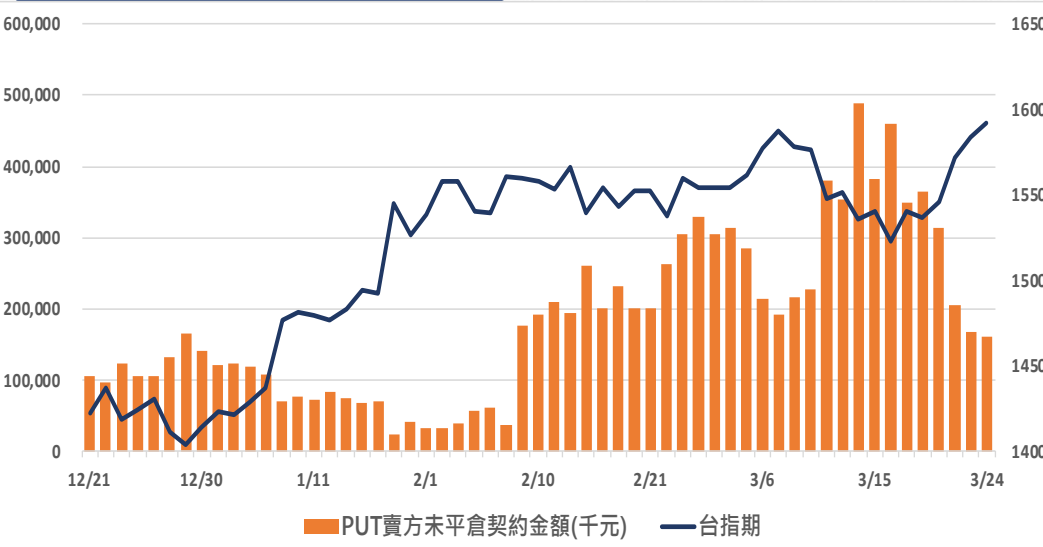
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



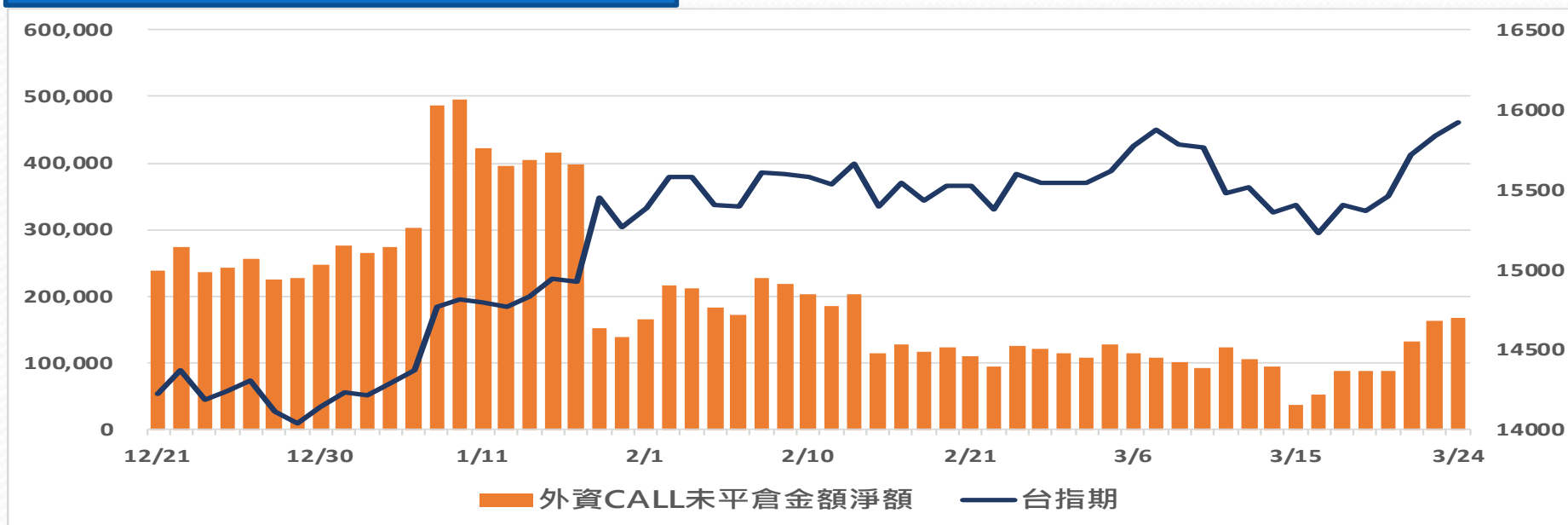
PUT賣方未平倉金額



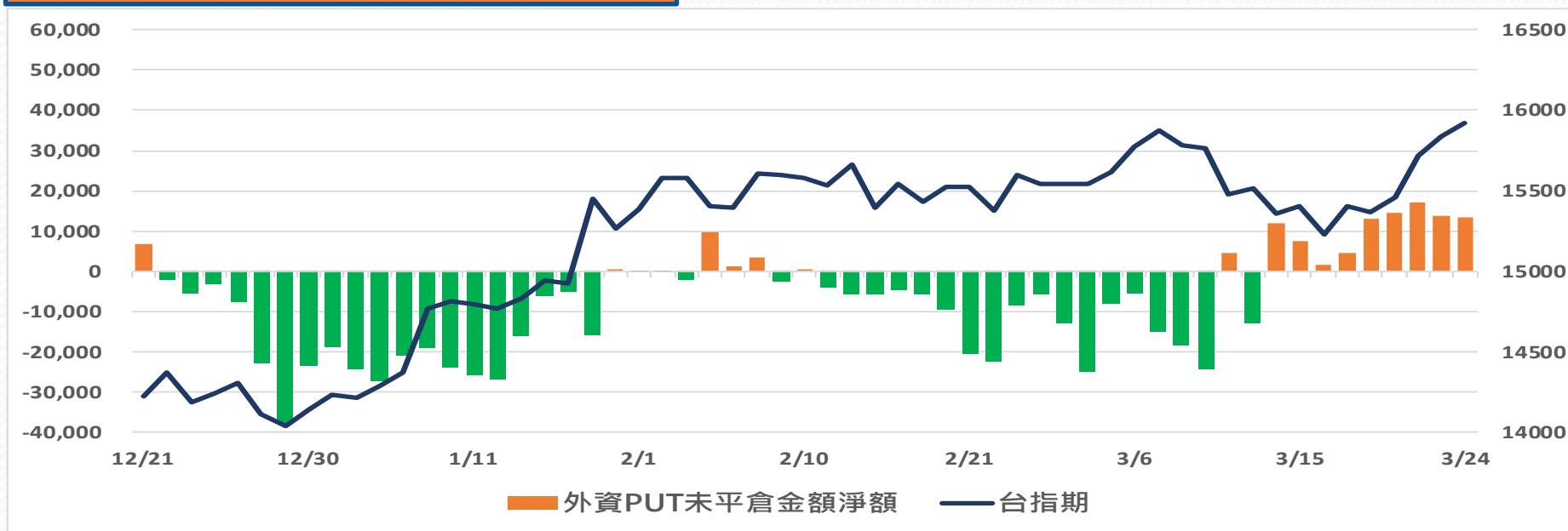
更新日期：2023年3月24日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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24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24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