

台指選擇權OI匯報

日期：2023/3/27 結算日：2023/3/29					日期：2023/3/27 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	136	15,200	3,964	192	-1	44	14,500	2,903	-212
0	141	15,250	2,208	-973	0	76	14,600	2,425	-69
2	237	15,300	5,007	165	1	63	14,700	4,030	-36
-24	141	15,350	4,224	325	0	85	14,800	6,256	-107
-3	277	15,400	8,424	-258	-1	93	14,900	3,136	42
-15	415	15,450	6,064	1,508	0	157	15,000	6,320	565
-26	686	15,500	9,238	-26	-3	330	15,100	2,377	-11
8	426	15,550	7,747	630	7	1,680	15,200	3,988	169
-23	1,130	15,600	13,451	5,120	-116	1,956	15,300	3,813	450
-54	899	15,650	6,128	998	-68	1,875	15,400	4,726	257
66	1,774	15,700	10,029	3,085	-68	3,157	15,500	9,634	-35
325	1,931	15,750	6,376	1,814	6	2,454	15,600	1,651	-22
915	3,830	15,800	6,526	1,088	59	2,669	15,700	1,818	169
1,691	4,256	15,850	3,705	678	121	3,177	15,800	1,153	46
4,325	9,510	15,900	3,228	217	305	3,564	15,900	611	-23
2,518	6,537	15,950	1,271	131	-116	5,921	16,000	460	49
※ 5,081	12,773	16,000	1,270	-135	※ 1,559	6,415	16,100	204	13
3,215	7,000	16,050	289	-68	219	7,150	16,200	215	22
4,787	12,992	16,100	185	-13	-162	6,378	16,300	125	-10
2,579	7,741	16,150	86	0	3	6,055	16,400	57	-3
1,473	10,053	16,200	235	40	1,486	4,725	16,500	13	1
2,537	3,684	16,250	1	-5	184	2,361	16,600	10	0
-198	5,869	16,300	22	3	92	1,229	16,700	14	0
363	363	16,350	1	1	216	1,806	16,800	5	0
246	4,551	16,400	28	2	63	862	16,900	1	0
14	2,672	16,500	4	2	27	833	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
29,578	102,167	1.2640	129,142	13,263	3,859	77,207	1.0428	80,510	1,100
昨日 P/C	1.5964	今日增減變化	-0.3324		昨日 P/C	1.0826	今日增減變化	-0.0399	

更新日期：2023年3月27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27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	78,756,980	64,966,479	13,790,501	-26,724,762	2,166,203	1,051,467	1,114,736	-34,989	
投信	36,621,974	50,811,090	-14,189,116	1,253,558	424,805	0	424,805	-4,061	
自營商	45,583,747	18,379,052	27,204,695	2,271,546	1,876,974	656,779	1,220,195	286,424	
	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	464,263	1,414,030	-949,767	-237,435	129,929	16,619	113,310	-22,410	
投信	97,101	0	97,101	103	0	0	0	0	
自營商	206,339	226,060	-19,721	122,742	128,409	229,631	-101,222	37,513	

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27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	29,425	16,339	13,086	-866	29,572	29,062	510	1,948	
投信	150	50	100	0	200	119	81	0	
自營商	57,027	52,232	4,795	-5,527	71,341	54,183	17,158	10,480	
特定法人(週)	0	0	0	161	0	2,668	-2,668	0	
特定法人(近月)	17,090	9,409	7,681	-224	18,143	14,668	3,475	-2	
特定法人(全月)	19,930	10,355	9,575	50	19,111	19,431	-320	1,133	
十大交易人(週)	25,567	34,277	-8,710	-11,496	54,227	45,019	9,208	-6,557	
十大交易人(近月)	43,341	35,054	8,287	1,241	30,771	38,067	-7,296	-813	
十大交易人(全月)	73,946	68,342	5,604	-5,640	77,867	87,430	-9,563	-9,961	
全市場未沖銷(近月)			77,207	3,859			80,510	1,100	
全市場未沖銷(全月)			206,841	37,391			254,105	19,396	

更新日期：2023年3月27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	16100
	賣權成交最大量	15800	賣權OI最大量	15600
	整體隱含波動率	13.74%	較前一交易日	+0.28%
	買權隱含波動率	14.57%	較前一交易日	+1.43%
	賣權隱含波動率	12.90%	較前一交易日	-0.82%
電子選擇權	買權成交最大量	785	買權OI最大量	750
	賣權成交最大量	725	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1580	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27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	16100	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	15.54%	較前一交易日	+0.31%
	買權隱含波動率	13.47%	較前一交易日	-0.11%
	賣權隱含波動率	18.05%	較前一交易日	-0.06%
	成交量P/C_Ratio值	0.956	較前一交易日	-0.38
	未平倉P/C_Ratio值	1.043	較前一交易日	-0.04
電子選擇權	買權成交最大量	785	買權OI最大量	750
	賣權成交最大量	725	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1580	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27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

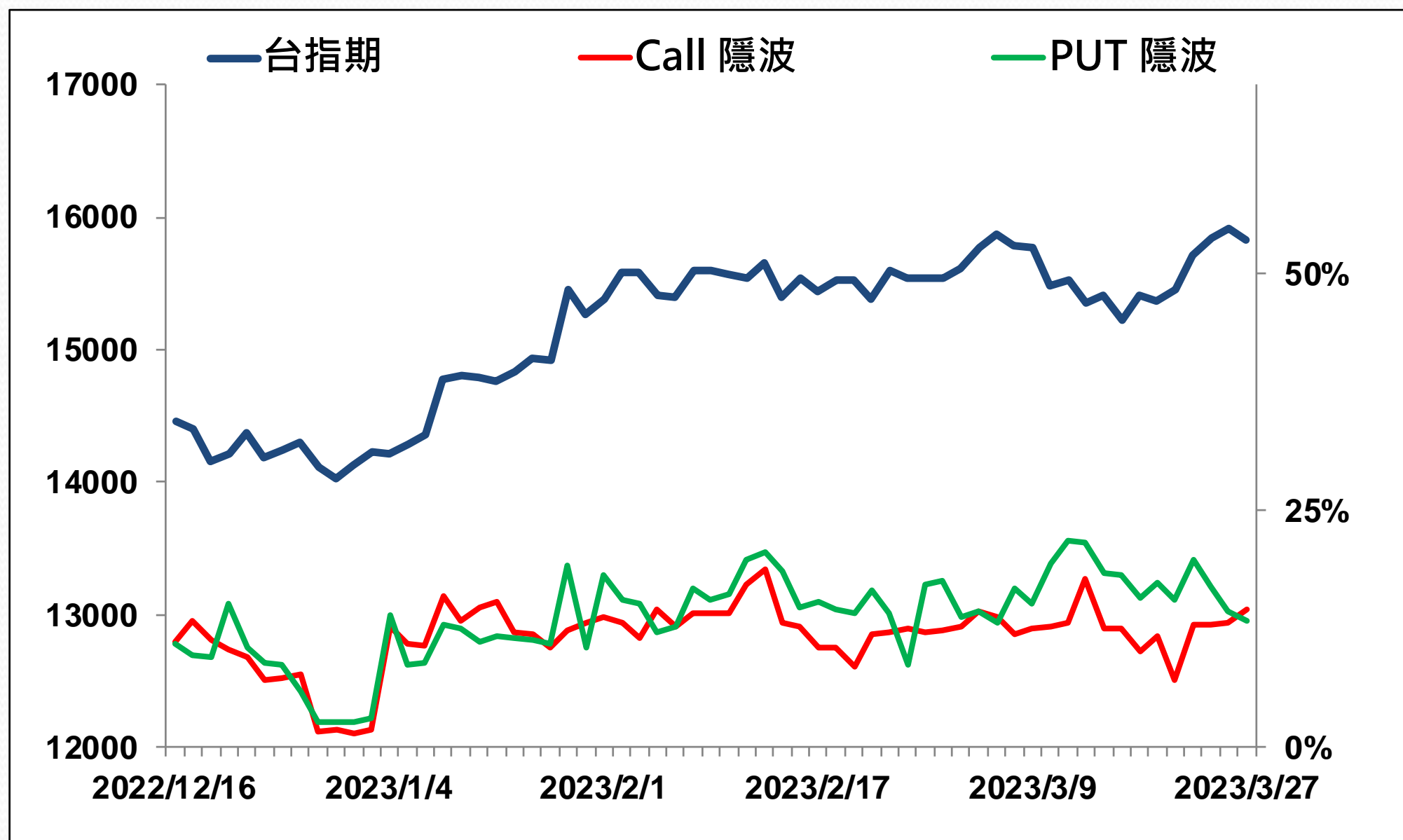
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



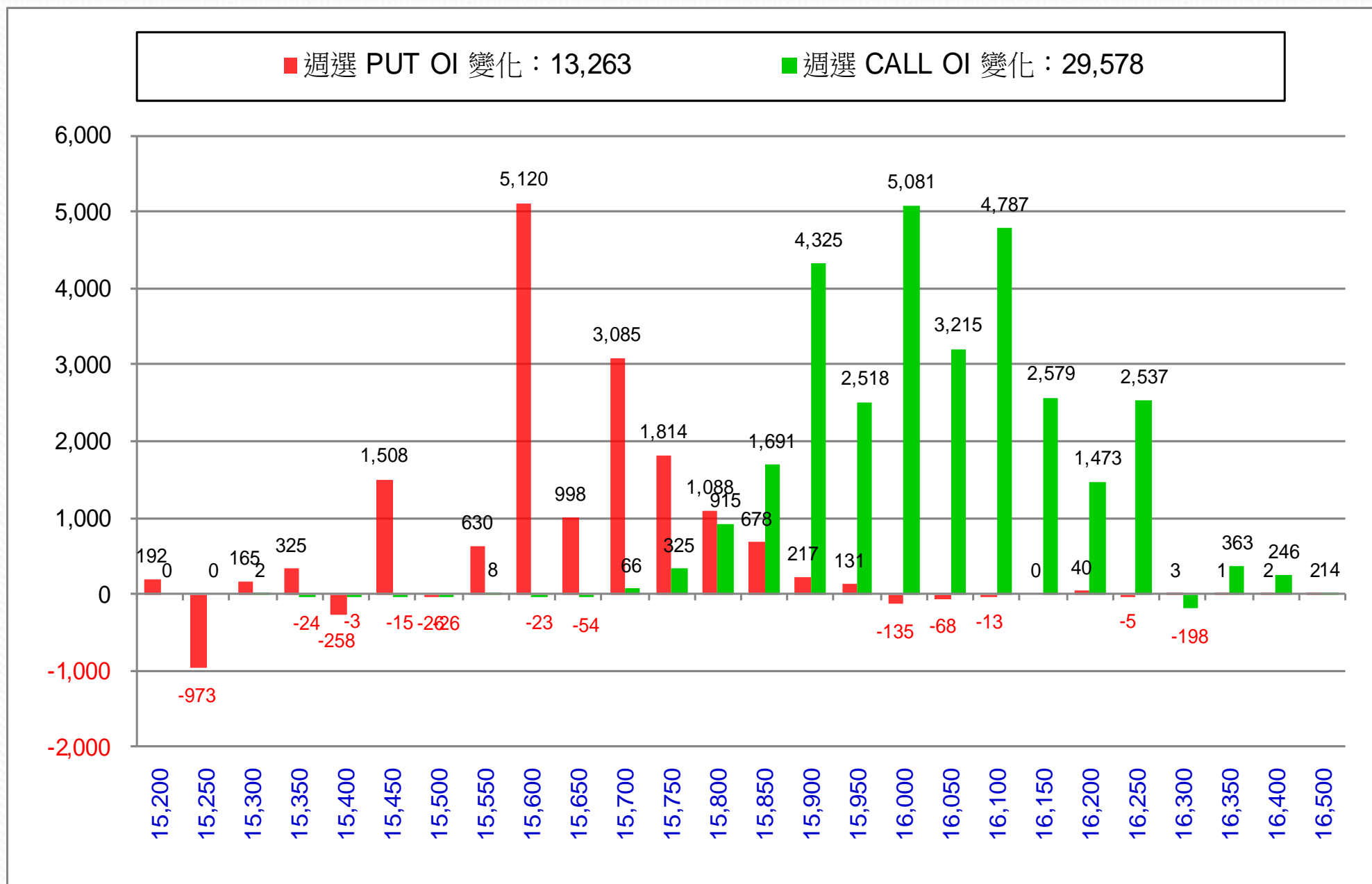
更新日期：2023年3月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年3月27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

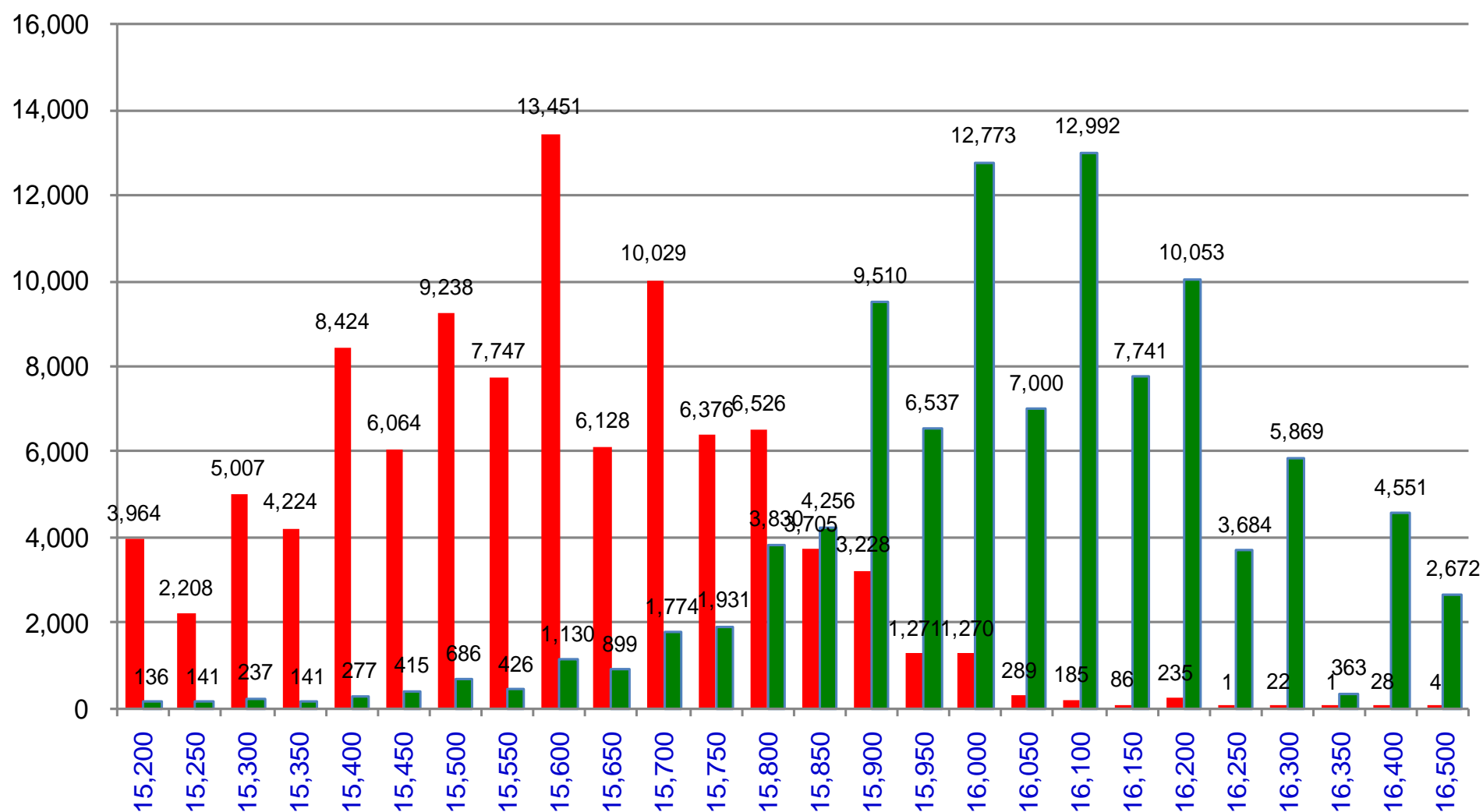


更新日期：2023年3月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：129,142

週選 CALL OI 總額：102,167



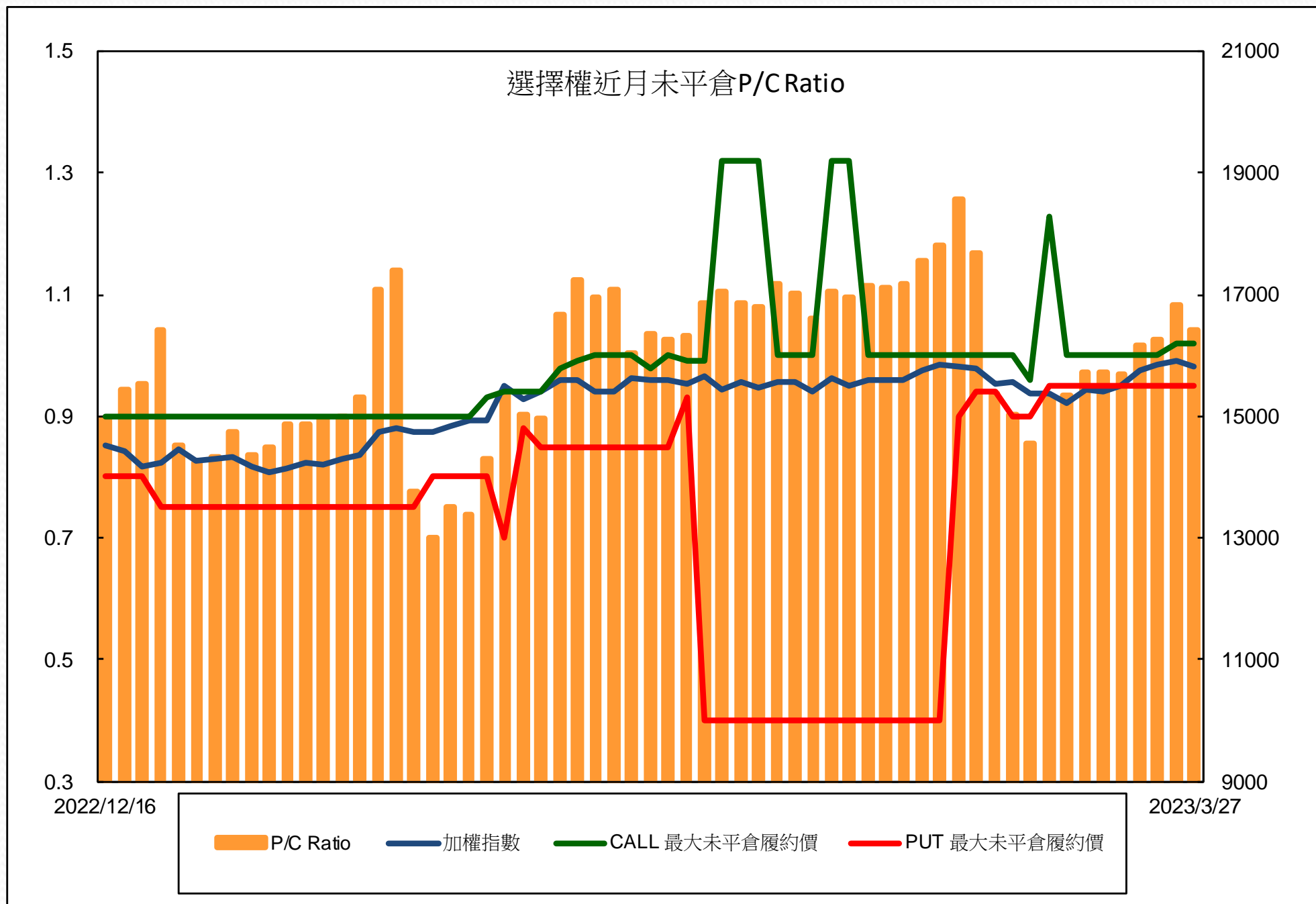
更新日期：2023年3月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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24日	52,599	42,277	10,322
	3月27日	57,027	52,232	4,795
Put	3月24日	60,480	53,802	6,678
	3月27日	71,341	54,183	17,158

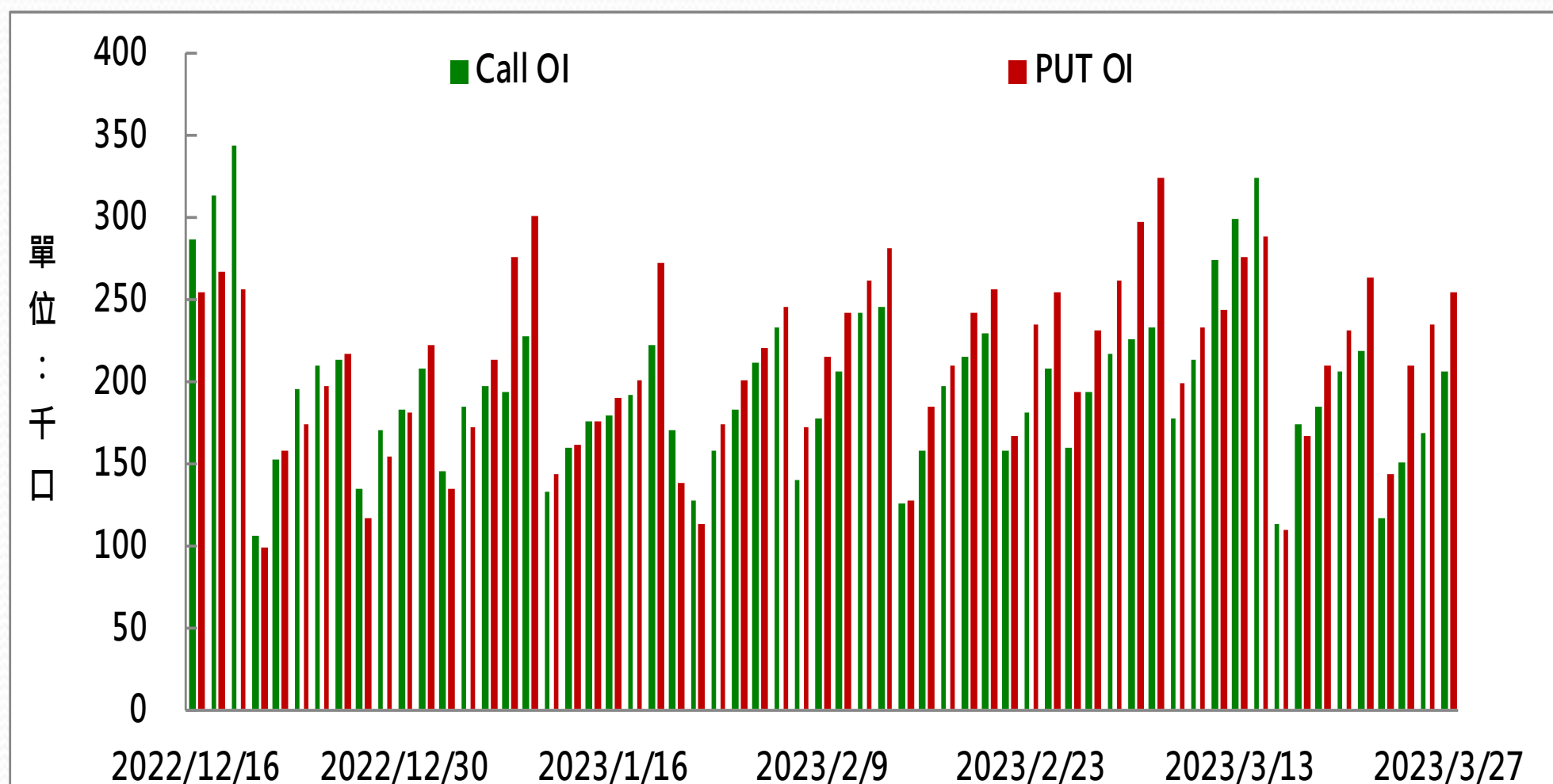
更新日期：2023年3月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

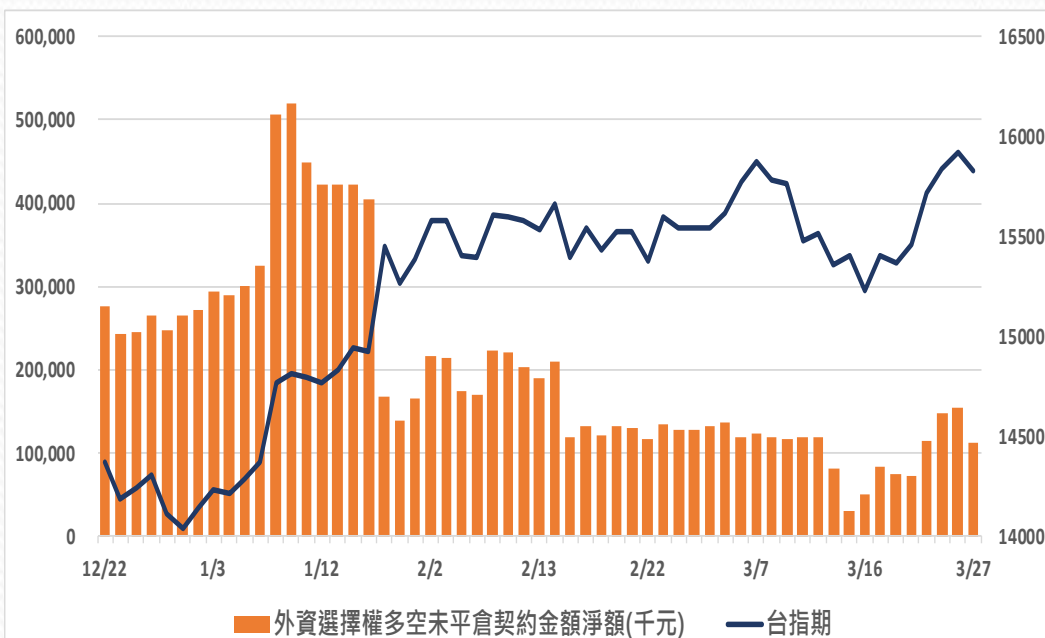
選擇權全月Put Call OI



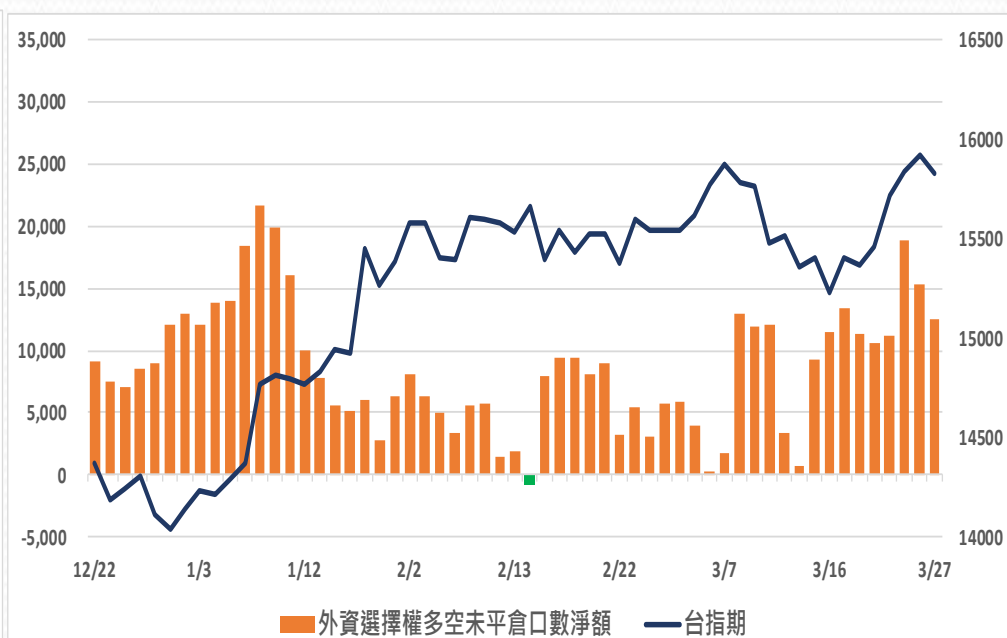
更新日期：2023年3月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



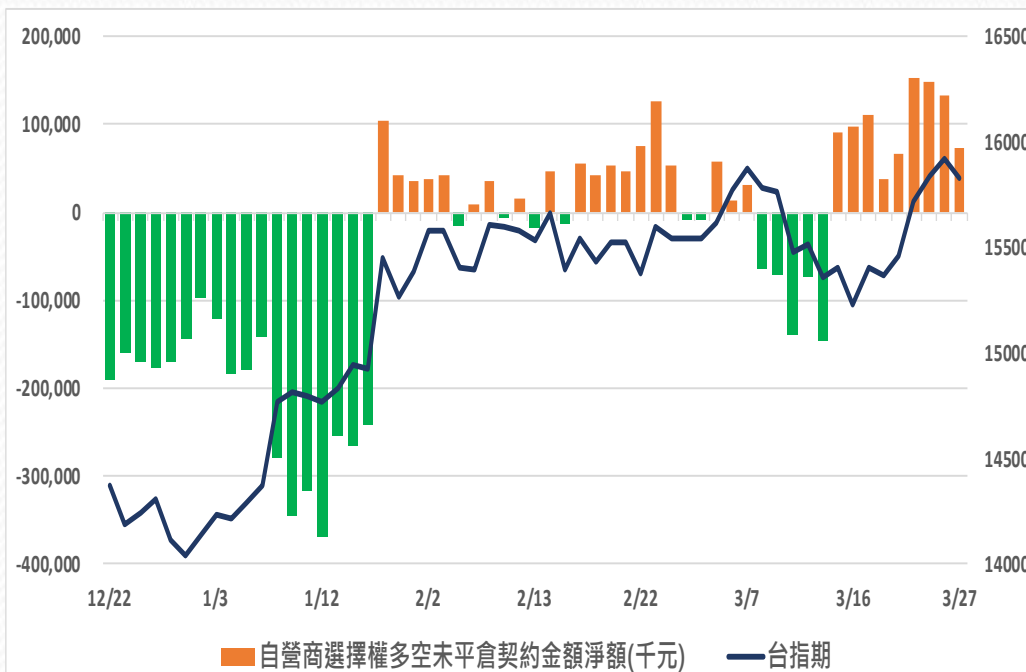
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/21	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
2023/3/27	15829	12,576	-2,814	112,581	-40,687

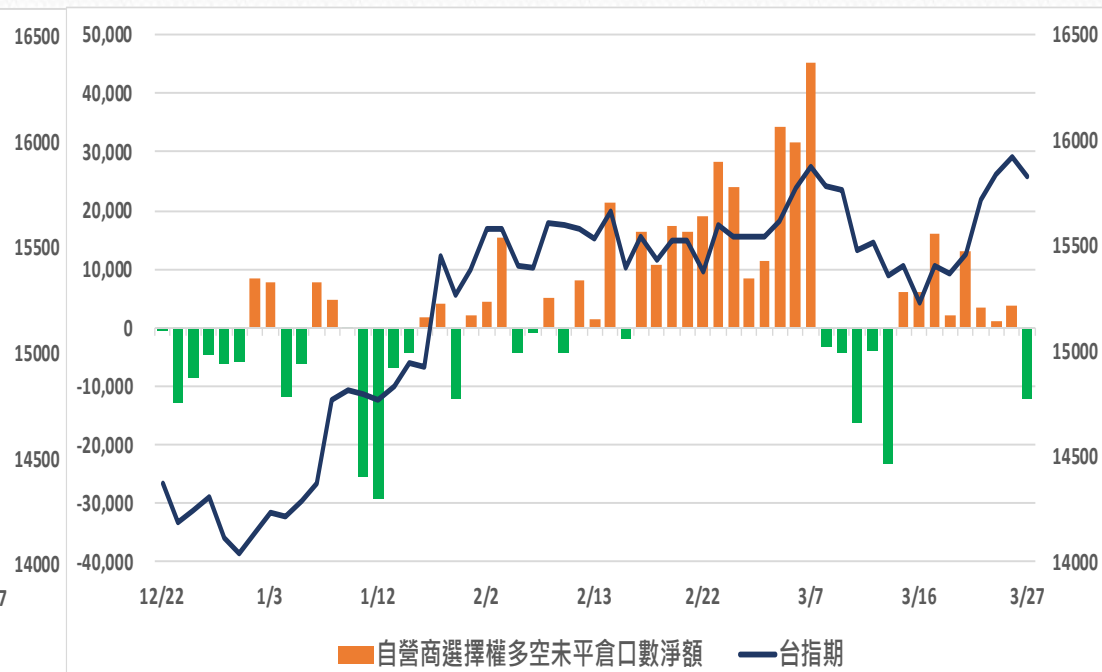
更新日期：2023年3月27日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



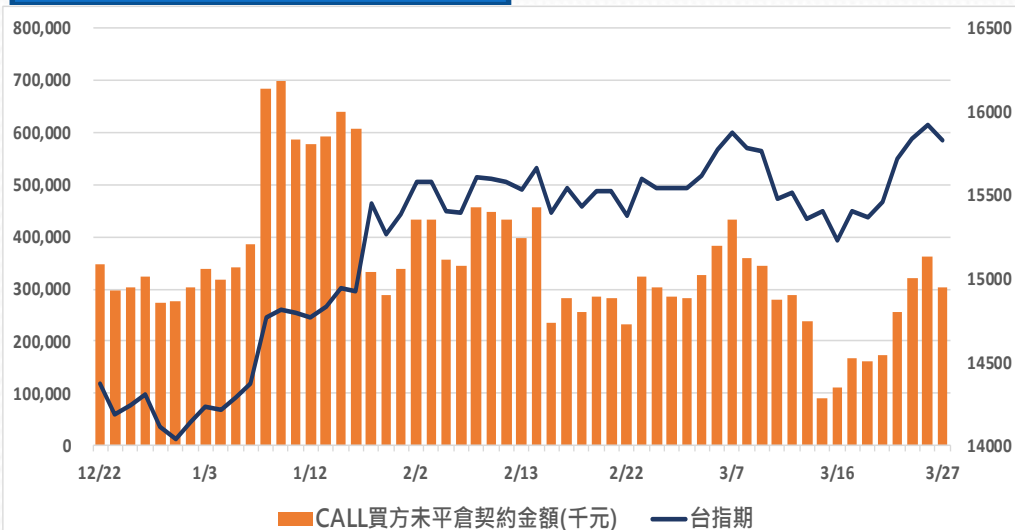
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/21	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
2023/3/27	15829	-12,363	-16,007	72,953	-60,419

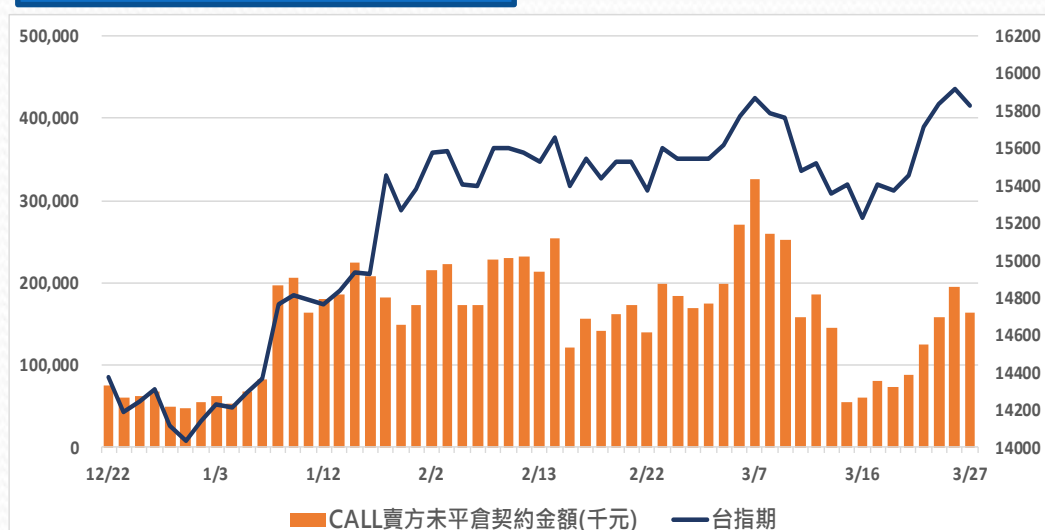
更新日期：2023年3月27日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

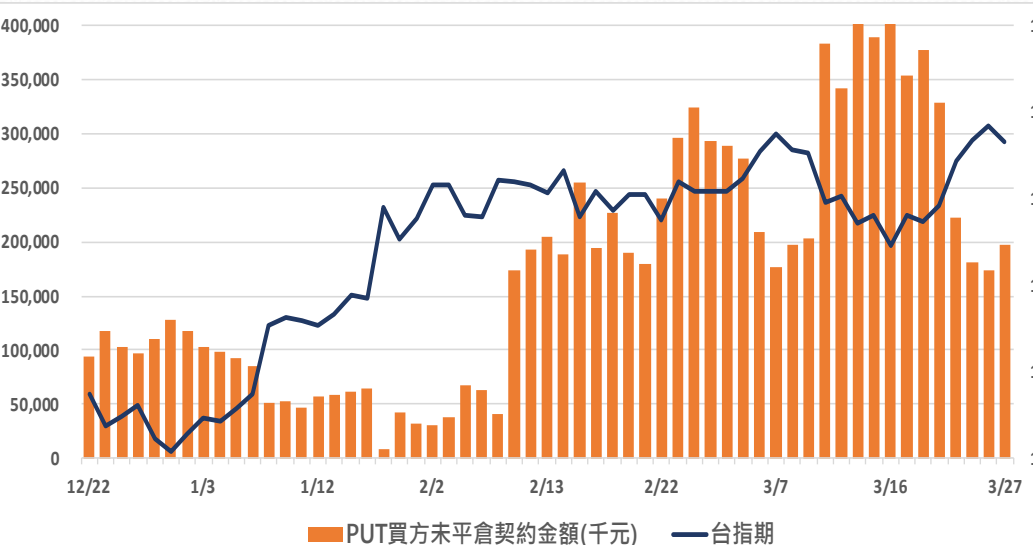
CALL買方未平倉金額



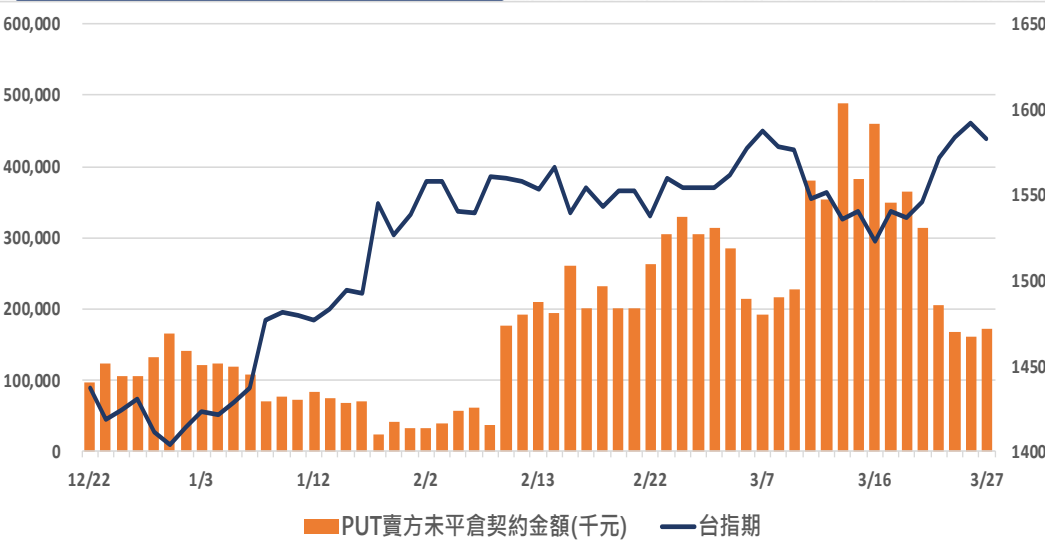
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



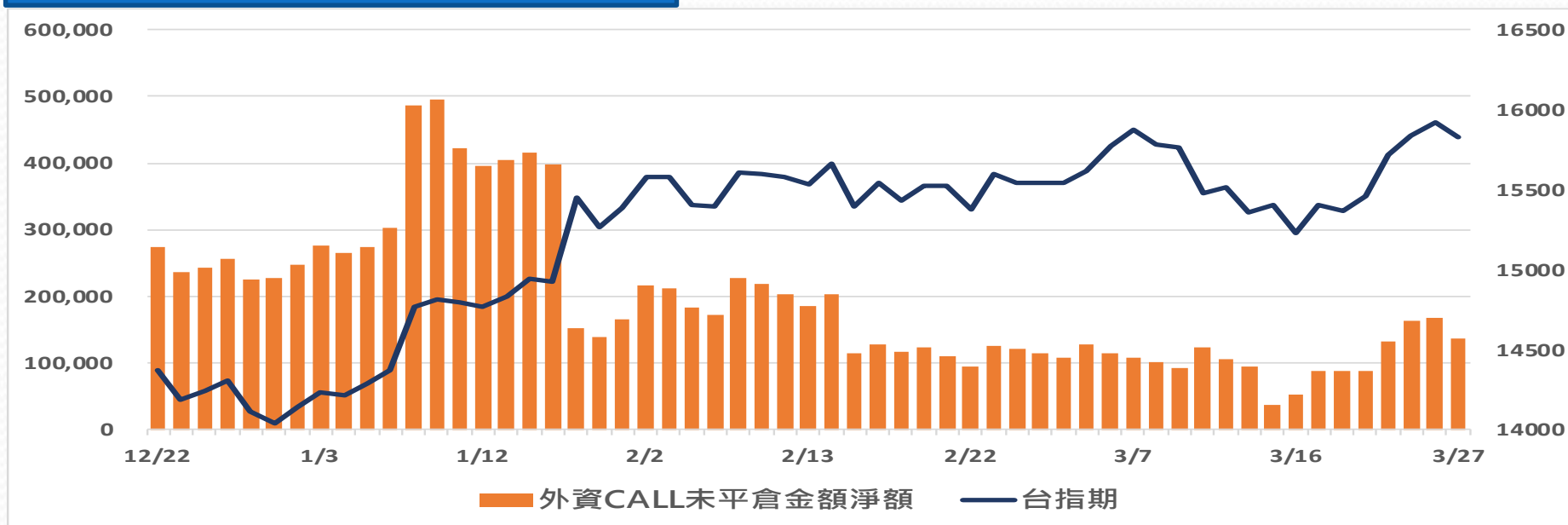
PUT賣方未平倉金額



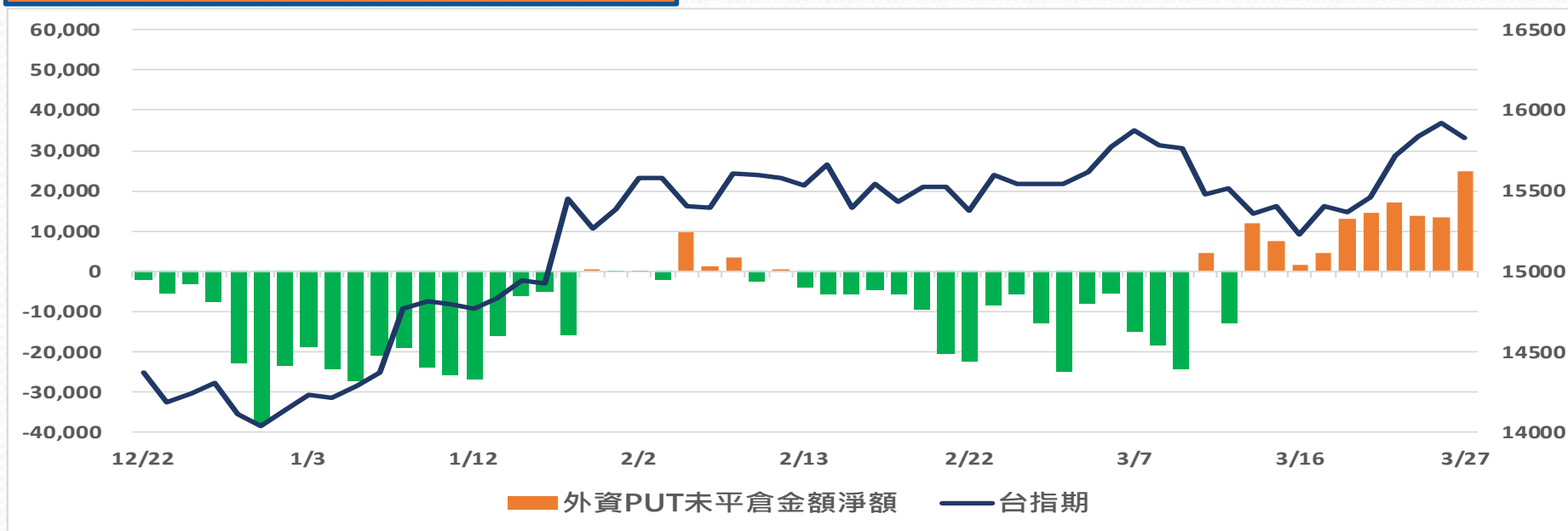
更新日期：2023年3月27日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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27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27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