

台指選擇權OI匯報

日期 : 2023/3/30					結算日 : 2023/4/5			日期 : 2023/3/30					結算日 : 2023/4/19		
202304W1					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	OI 增減	Call	履約價	Put	OI 增減	
8	28	15,200	3,435	1,925	0	44	14,500	3,795	773	※					
0	9	15,250	2,787	1,916	-6	74	14,600	3,158	745						
0	28	15,300	4,376	1,975	0	63	14,700	4,056	-32						
0	22	15,350	2,139	1,174	0	87	14,800	7,548	-43						
-3	26	15,400	5,242	3,336	-1	91	14,900	3,855	-106						
35	59	15,450	3,607	1,173	-3	151	15,000	8,232	467						
-7	105	15,500	6,990	5,235	※	0	329	15,100	3,462	306					
83	123	15,550	3,092	2,231	6	1,690	15,200	4,688	-170						
-34	324	15,600	5,159	2,481	-17	1,936	15,300	4,556	188						
24	258	15,650	2,808	1,992	5	1,756	15,400	5,038	90						
153	1,012	15,700	3,706	2,596	-183	3,418	15,500	9,532	-58						
217	976	15,750	2,579	1,523	-101	2,806	15,600	2,021	-11						
563	2,223	15,800	2,371	1,573	-91	2,881	15,700	1,980	122						
1,399	2,416	15,850	910	715	99	3,604	15,800	1,306	241						
1,326	3,273	15,900	513	306	89	3,558	15,900	743	176						
1,733	3,455	15,950	183	129	-363	6,290	16,000	594	85						
1,512	4,541	16,000	333	257	-93	7,179	16,100	234	34						
1,223	3,075	16,050	49	13	122	8,541	16,200	266	46						
2,268	4,865	16,100	87	60	147	6,877	16,300	162	38						
2,524	4,285	16,150	11	9	194	6,435	16,400	58	2						
※	2,562	4,736	16,200	32	15	263	5,357	16,500	16	2					
1,254	2,335	16,300	27	3	※	567	2,893	16,600	35	-1					
332	1,938	16,400	1	0	54	1,189	16,700	39	0						
1,183	1,896	16,500	0	0	-143	2,098	16,800	4	-1						
619	1,421	16,600	0	0	-12	861	16,900	1	0						
-14	275	16,700	1	0	-25	837	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				
18,967	44,046	1.6015	70,538	34,524		314	82,486	1.0739	88,580	1,766					
昨日 P/C	1.4360	今日增減變化		0.1655		昨日 P/C	1.0565	今日增減變化		0.0174					

更新日期 : 2023年3月30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30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	87,746,022	57,281,789	30,464,233	6,422,841	1,967,228	909,805	1,057,423	-40,615
投信	34,472,765	51,070,060	-16,597,295	-2,023,907	427,789	0	427,789	7,073
自營商	43,554,182	17,434,567	26,119,615	943,414	1,759,335	698,923	1,060,412	1,184
	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	567,657	1,375,127	-807,470	71,878	156,728	58,773	97,955	17,962
投信	97,139	0	97,139	-397	0	0	0	0
自營商	210,974	265,616	-54,642	-117,132	201,938	302,906	-100,968	-31,543

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30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	29,408	15,608	13,800	827	29,920	32,179	-2,259	1,592
投信	150	50	100	0	200	119	81	0
自營商	54,217	38,045	16,172	4,855	63,130	32,703	30,427	4,519
特定法人(週)	582	0	582	-433	0	3,790	-3,790	-247
特定法人(近月)	17,782	11,307	6,475	833	21,702	16,180	5,522	-2,474
特定法人 (全月)	20,444	9,470	10,974	919	21,750	24,349	-2,599	-345
十大交易人(週)	20,499	12,435	8,064	5,066	33,179	31,114	2,065	838
十大交易人(近月)	44,465	38,318	6,147	-888	35,748	42,768	-7,020	-1,390
十大交易人(全月)	75,437	55,955	19,482	5,595	63,250	80,650	-17,400	-2,014
全市場未沖銷 (近月)			82,486	314			88,580	1,766
全市場未沖銷 (全月)			157,249	24,735			191,965	43,044

更新日期：2023年3月30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 04W1 週 選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15850	買權OI最大量	16100
	賣權成交最大量	15700	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	12.46%	較前一交易日	-0.90%
	買權隱含波動率	10.78%	較前一交易日	-0.53%
	賣權隱含波動率	13.87%	較前一交易日	-1.39%
電子選擇權	買權成交最大量	765	買權OI最大量	765
	賣權成交最大量	720	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1560	買權OI最大量	1580
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年3月30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	16200
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	15.47%	較前一交易日	-2.84%
	買權隱含波動率	12.22%	較前一交易日	-0.41%
	賣權隱含波動率	17.48%	較前一交易日	#DIV/0!
	成交量P/C_Ratio值	1.659	較前一交易日	+0.47
	未平倉P/C_Ratio值	1.074	較前一交易日	+0.02
電子選擇權	買權成交最大量	765	買權OI最大量	765
	賣權成交最大量	720	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1560	買權OI最大量	1580
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年3月30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

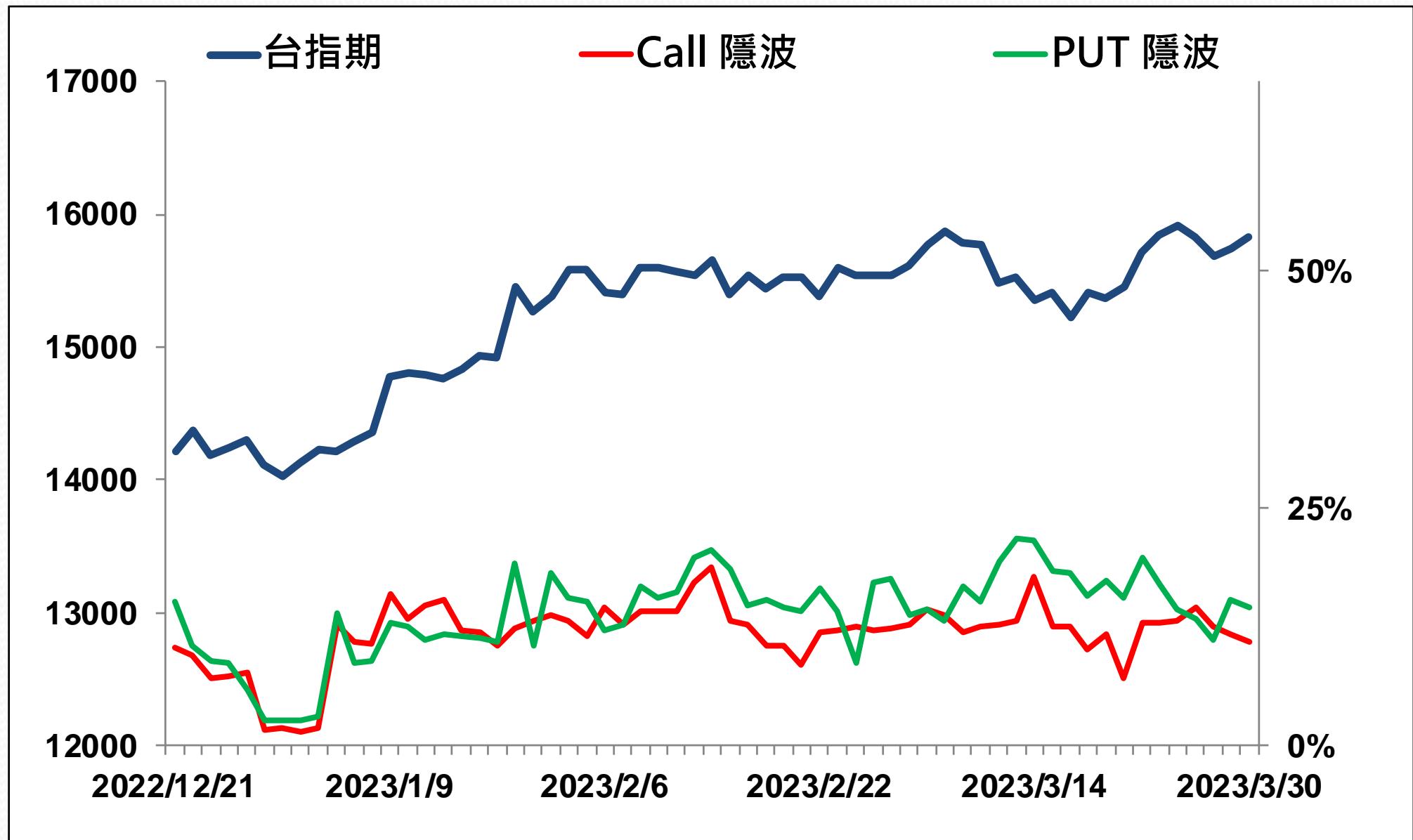
— 臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年3月30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

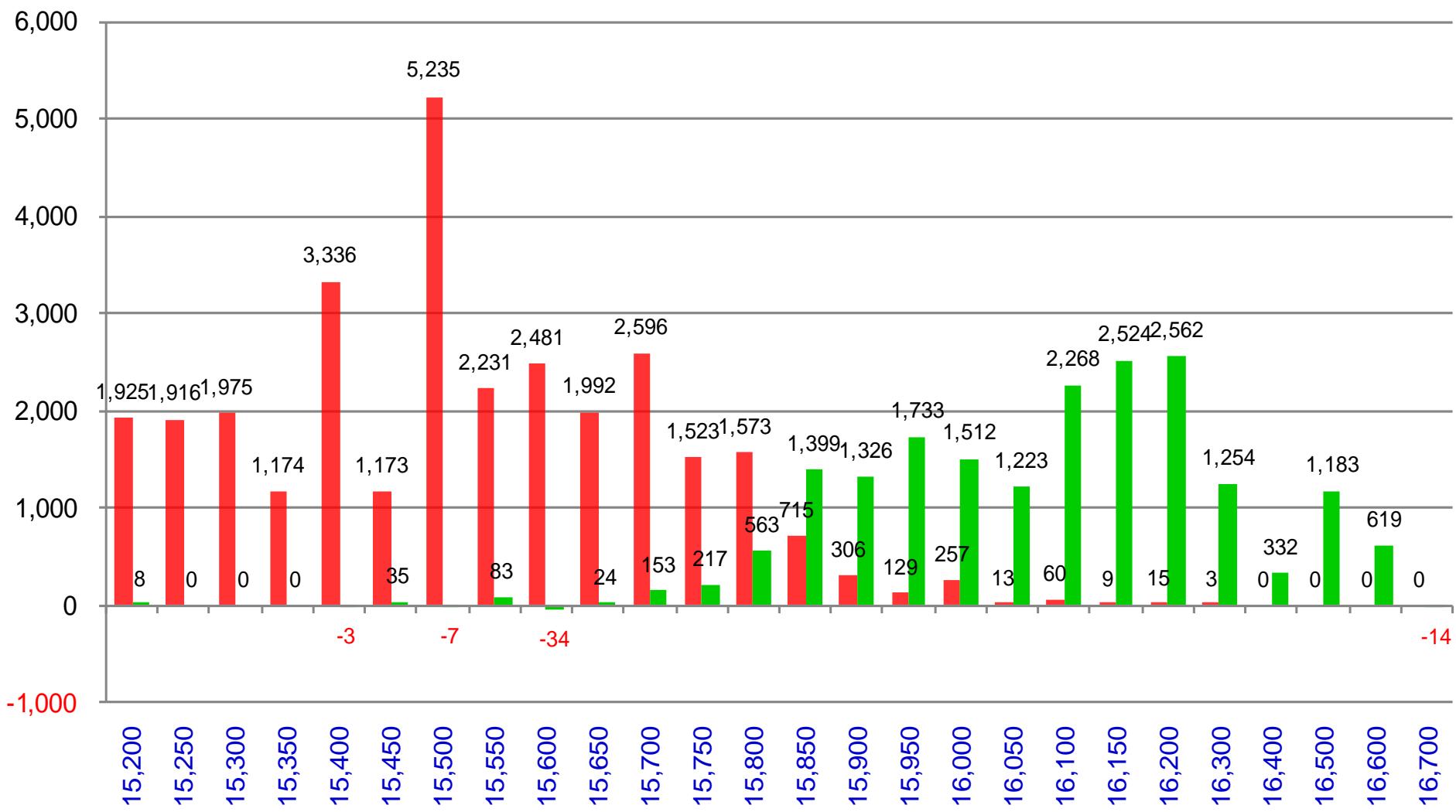


更新日期：2023年3月30日

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

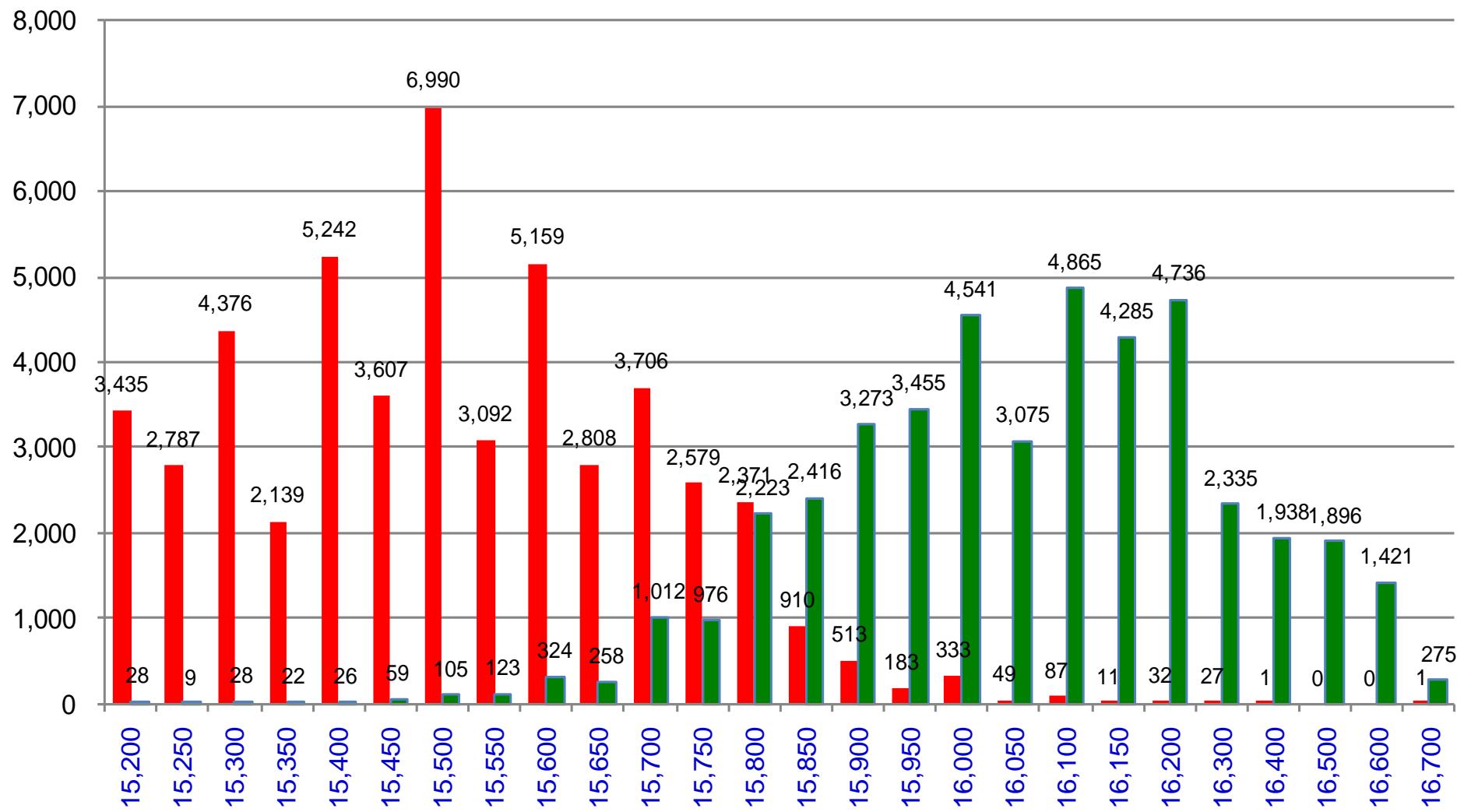
■ 週選 PUT OI 變化 : 34,524 ■ 週選 CALL OI 變化 : 18,967



更新日期：2023年3月30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：70,538 ■ 週選 CALL OI 總額：44,046



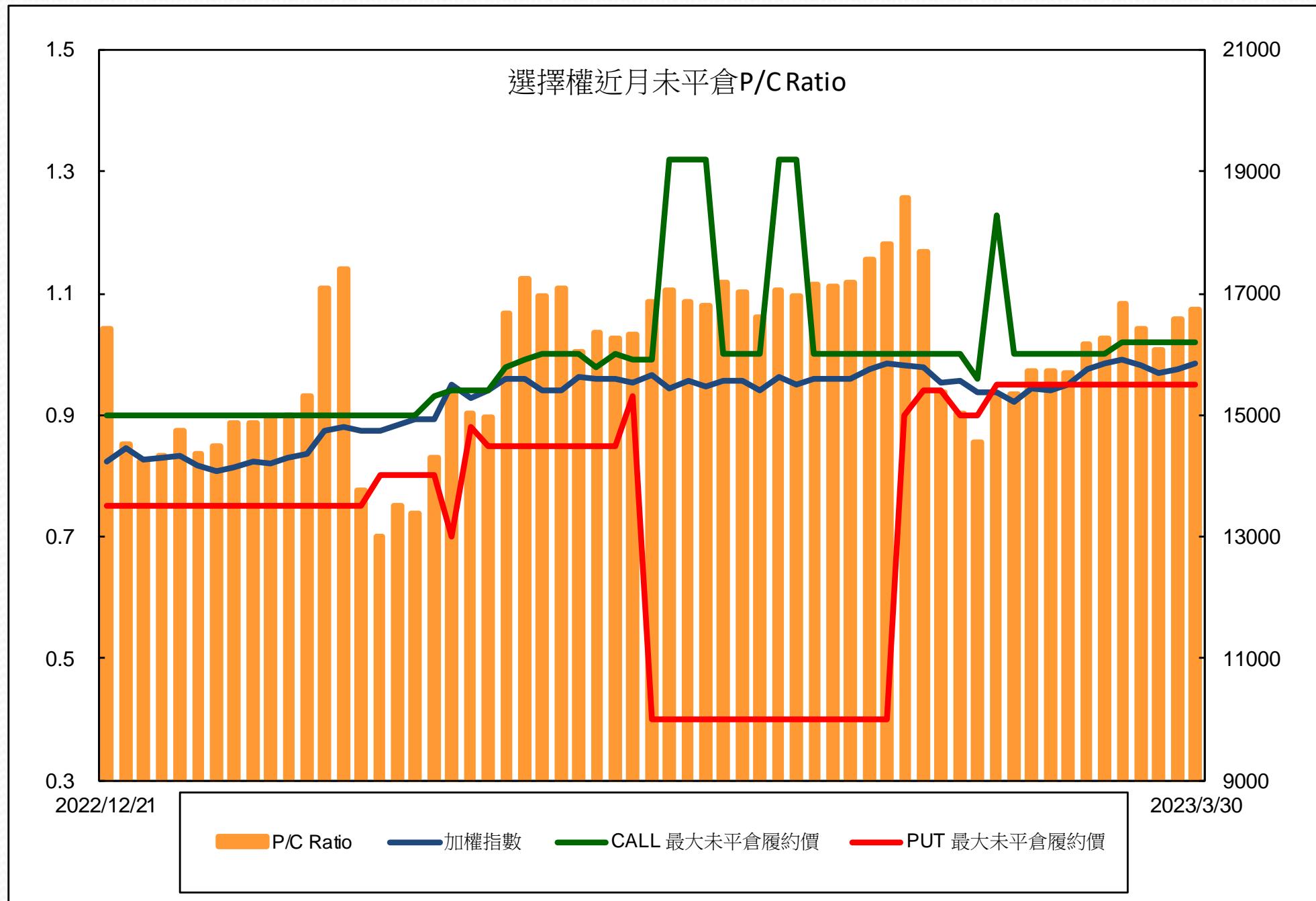
更新日期：2023年3月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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29日	47,739	36,422	11,317
	3月30日	54,217	38,045	16,172
Put	3月29日	51,514	25,606	25,908
	3月30日	63,130	32,703	30,427

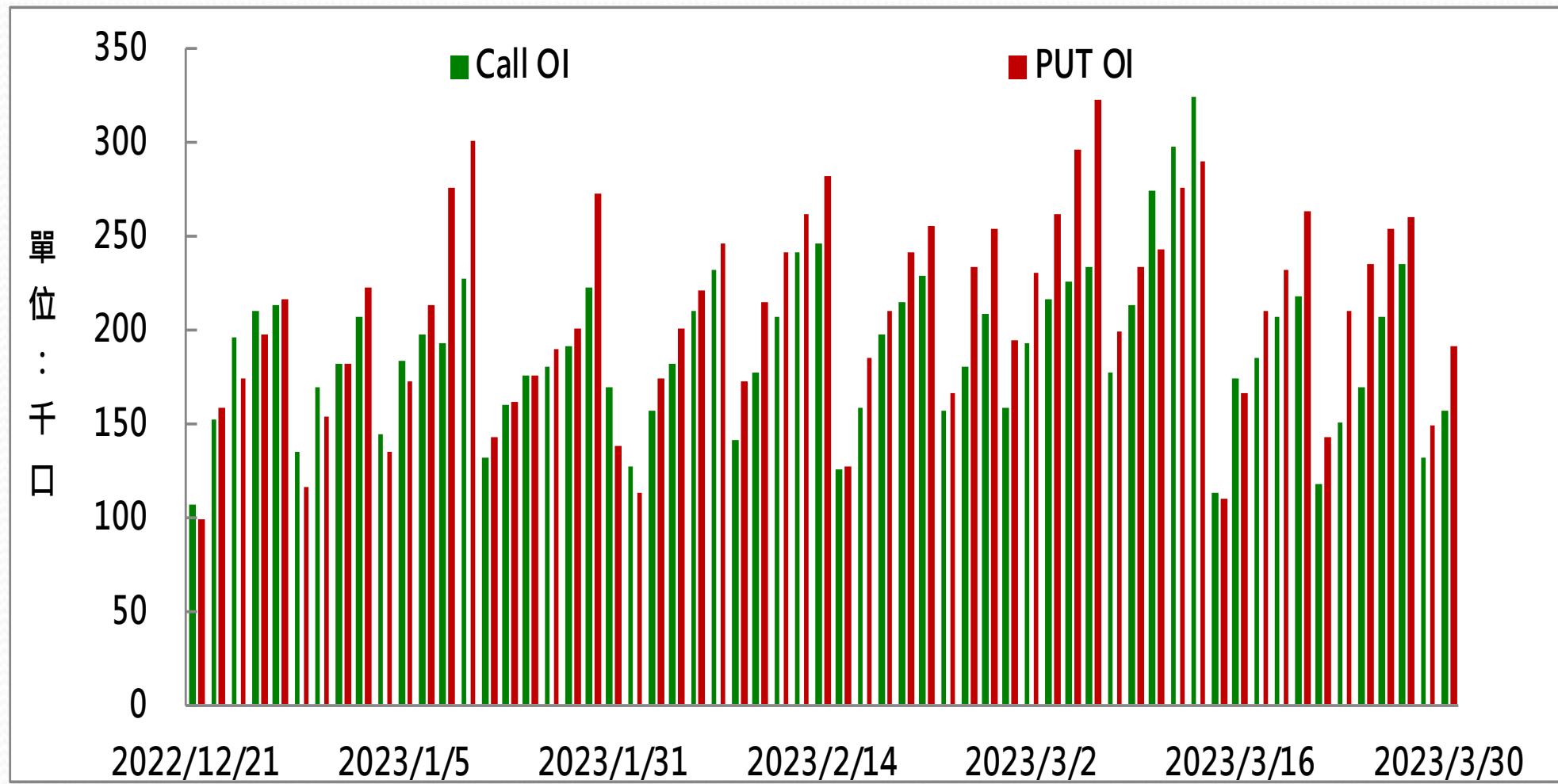
更新日期：2023年3月30日 資料來源：台灣期貨交易所 · 凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

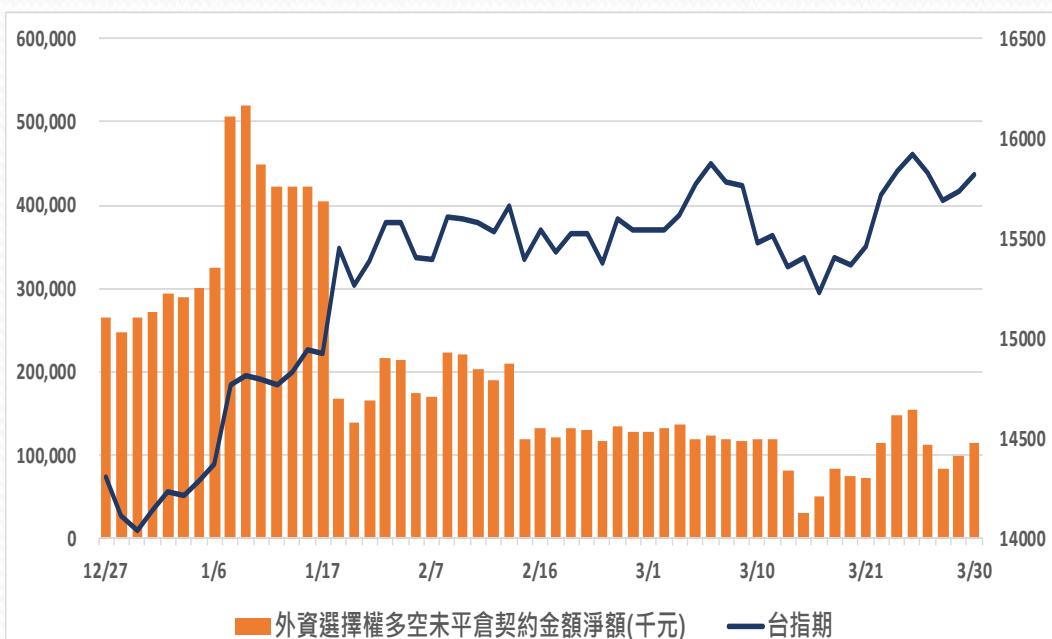
選擇權全月Put Call OI



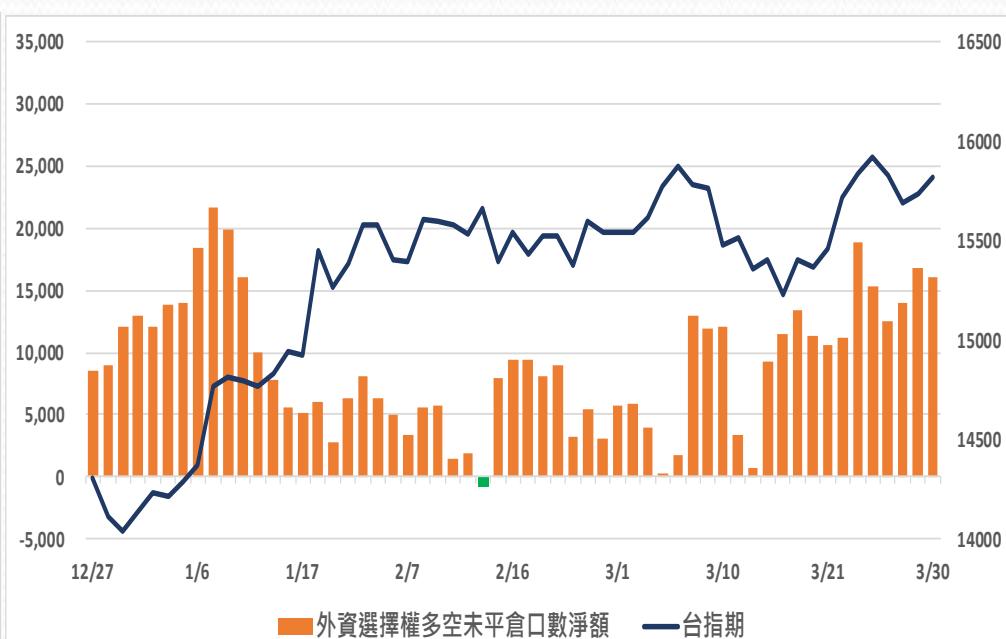
更新日期：2023年3月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



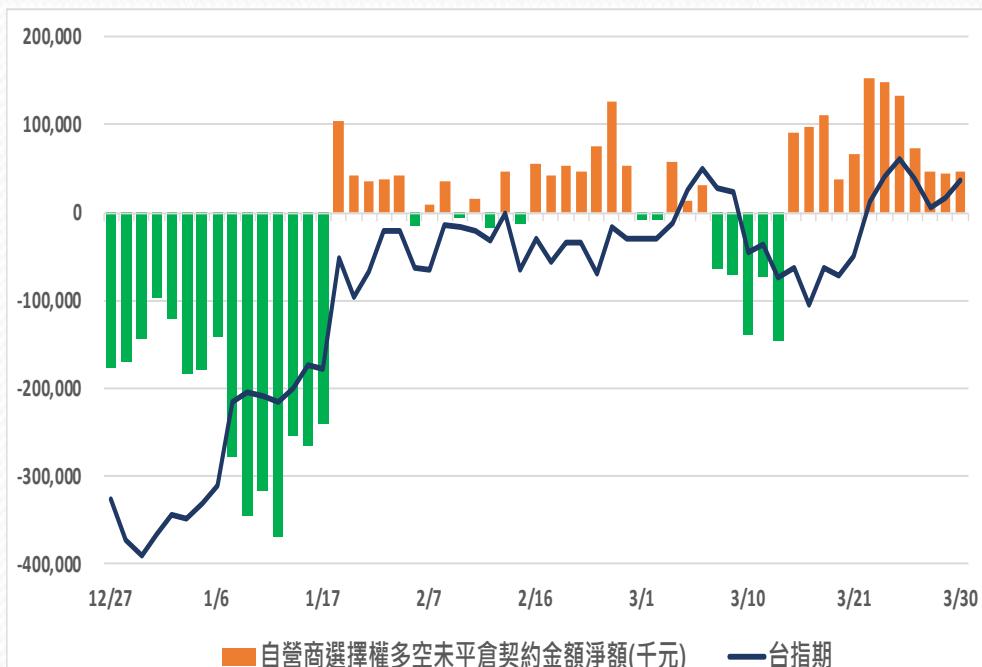
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/24	15917	15,390	-3,522	153,268	+4,986
2023/3/27	15829	12,576	-2,814	112,581	-40,687
2023/3/28	15689	13,979	+1,403	82,470	-30,111
2023/3/29	15738	16,824	+2,845	99,659	+17,189
2023/3/30	15819	16,059	-765	114,816	+15,157

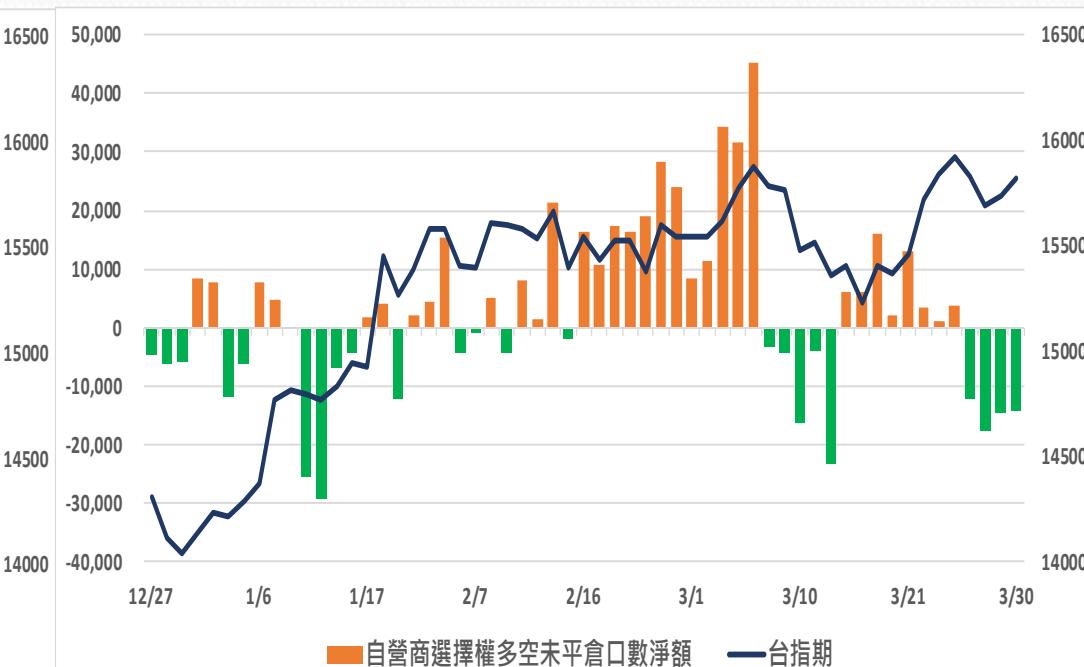
更新日期：2023年3月30日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



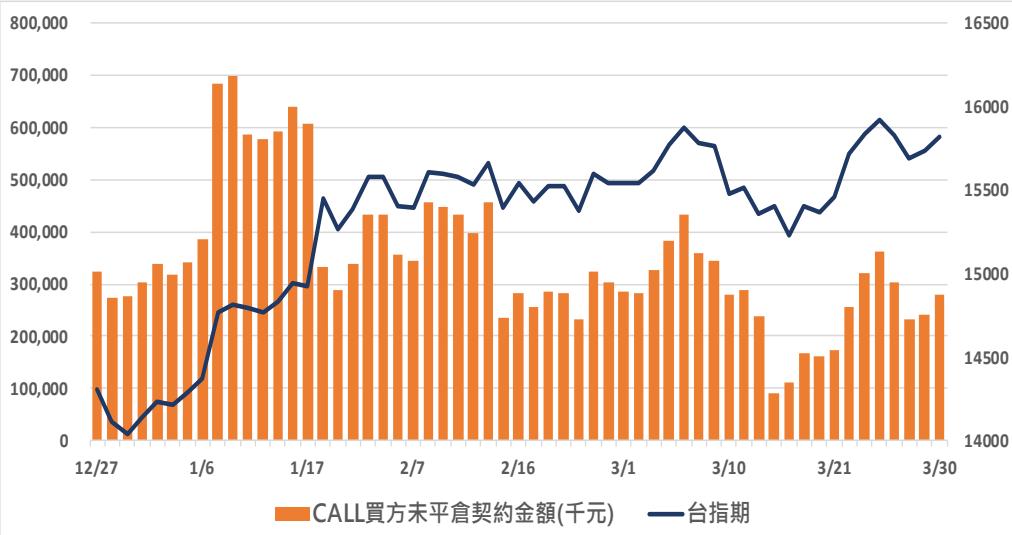
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/24	15917	3,644	+2,740	133,372	-16,228
2023/3/27	15829	-12,363	-16,007	72,953	-60,419
2023/3/28	15689	-17,447	-5,084	47,205	-25,748
2023/3/29	15738	-14,591	+2,856	45,379	-1,826
2023/3/30	15819	-14,255	+336	46,814	+1,435

更新日期：2023年3月30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



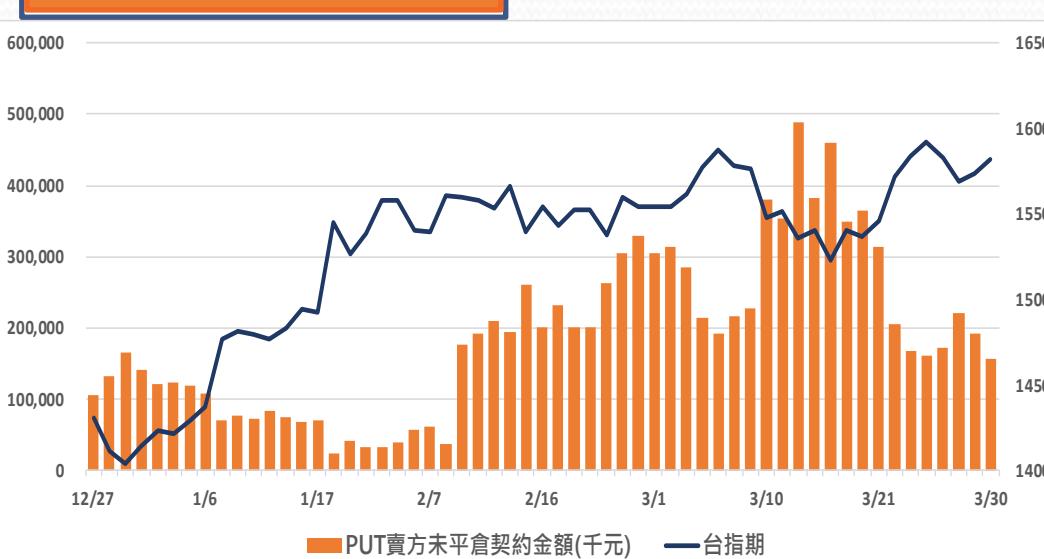
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



PUT賣方未平倉金額



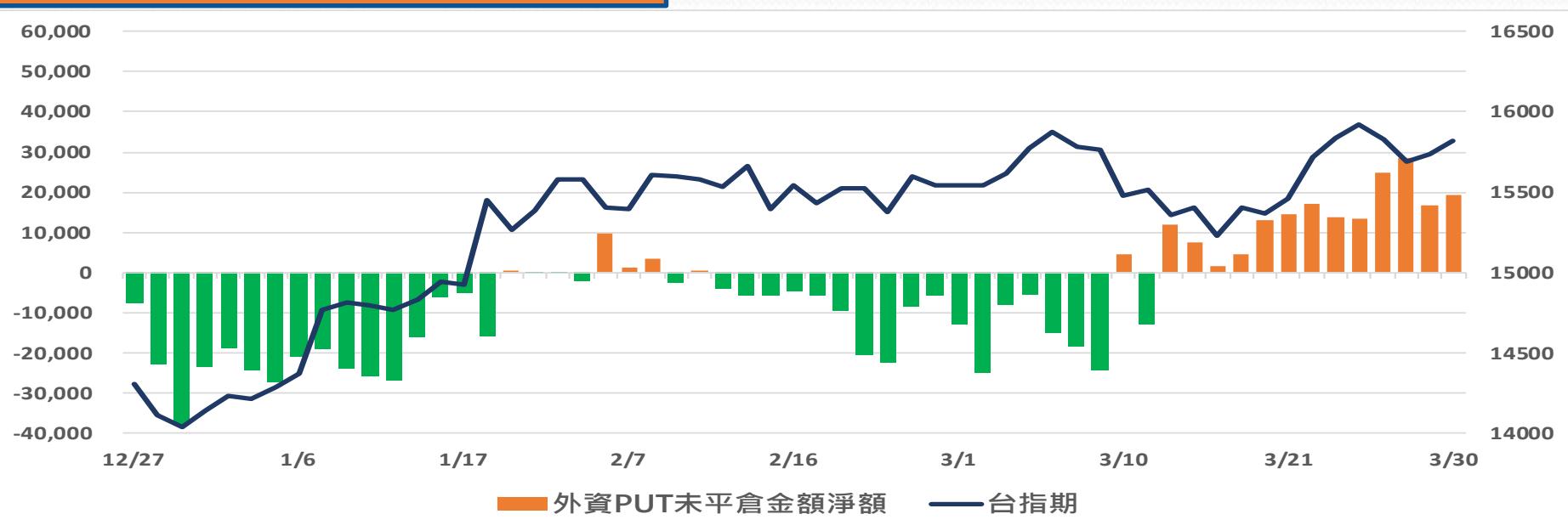
更新日期：2023年3月30日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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30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30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