

台指選擇權OI匯報

日期 : 2023/3/31			結算日 : 2023/4/5			日期 : 2023/3/31			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		
0	28	15,200	3,089	-346	-4	70	14,600	3,056	-102		
-1	8	15,250	2,594	-193	0	63	14,700	3,880	-176		
1	29	15,300	4,381	5	0	87	14,800	7,132	-416		
18	40	15,350	4,691	2,552	-3	88	14,900	3,864	9		
11	37	15,400	6,497	1,255	-3	148	15,000	8,708	476		
1	60	15,450	2,617	-990	-4	325	15,100	3,432	-30		
-41	64	15,500	8,432	1,442	-1	1,689	15,200	4,877	189		
-21	102	15,550	5,050	1,958	-2	1,934	15,300	5,088	532		
2	326	15,600	6,966	1,807	10	1,766	15,400	5,734	696		
9	267	15,650	4,219	1,411	-81	3,337	15,500	10,112	580		
0	1,012	15,700	6,025	2,319	-27	2,779	15,600	2,263	242		
81	1,057	15,750	4,245	1,666	-159	2,722	15,700	2,179	199		
-194	2,029	15,800	6,354	3,983	※	-81	3,523	15,800	2,066	760	※
50	2,466	15,850	2,569	1,659	101	3,659	15,900	810	67		
89	3,362	15,900	1,870	1,357	-345	5,945	16,000	772	178		
480	3,935	15,950	705	522	-1,068	6,111	16,100	401	167		
1,615	6,156	16,000	850	517	-2,170	6,371	16,200	350	84		
2,013	5,088	16,050	420	371	-437	6,440	16,300	178	16		
1,554	6,419	16,100	178	91	-717	5,718	16,400	71	13		
2,279	6,564	16,150	45	34	※	187	5,544	16,500	23	7	
2,519	7,255	16,200	35	3	4	2,897	16,600	36	1		
927	3,125	16,250	1	0	65	1,254	16,700	39	0		
853	3,188	16,300	29	2	-488	1,610	16,800	4	0		
※	3,352	5,290	16,400	3	2	33	894	16,900	1	0	
1,035	2,931	16,500	1	1	106	943	17,000	1	0		
-4	1,417	16,600	0	0	4	286	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		
16,611	62,855	1.4477	90,998	20,459	-5,121	77,365	1.1768	91,044	2,464		
昨日 P/C	1.6015	今日增減變化	-0.1538		昨日 P/C	1.0739	今日增減變化	0.1029			

更新日期 : 2023年3月31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31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	84,264,401	64,059,651	20,204,750	-10,259,483	1,976,519	834,127	1,142,392	84,969	
投信	33,987,034	51,494,544	-17,507,510	-910,215	429,152	0	429,152	1,363	
自營商	44,981,224	17,809,481	27,171,743	1,052,128	1,758,906	731,372	1,027,534	-32,878	
	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	511,947	1,425,811	-913,864	-106,394	155,345	70,885	84,460	-13,495	
投信	97,805	0	97,805	666	0	0	0	0	
自營商	232,286	221,591	10,695	65,337	251,869	316,721	-64,852	36,116	

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31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	32,456	17,091	15,365	1,565	31,663	33,548	-1,885	374	
投信	150	50	100	0	200	119	81	0	
自營商	56,016	42,222	13,794	-2,378	68,415	41,542	26,873	-3,554	
特定法人(週)	3,073	0	3,073	2,491	0	5,890	-5,890	-2,100	
特定法人(近月)	17,732	11,336	6,396	-79	22,545	16,130	6,415	893	
特定法人 (全月)	22,829	10,250	12,579	1,605	22,387	23,267	-880	1,719	
十大交易人(週)	28,317	19,532	8,785	721	43,987	37,205	6,782	4,717	
十大交易人(近月)	39,723	35,225	4,498	-1,649	36,787	43,123	-6,336	684	
十大交易人(全月)	78,564	57,865	20,699	1,217	73,796	87,192	-13,396	4,004	
全市場未沖銷 (近月)			77,365	-5,121			91,044	2,464	
全市場未沖銷 (全月)			173,617	16,368			219,968	28,003	

更新日期：2023年3月31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	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	11.34%	較前一交易日	-1.11%
	買權隱含波動率	10.79%	較前一交易日	+0.01%
	賣權隱含波動率	11.83%	較前一交易日	-2.04%
電子選擇權	買權成交最大量	785	買權OI最大量	765
	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	1580
	賣權成交最大量	1480	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年3月31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	16200	買權OI最大量	16300
	賣權成交最大量	15500	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	14.78%	較前一交易日	+0.69%
	買權隱含波動率	13.15%	較前一交易日	+0.93%
	賣權隱含波動率	16.43%	較前一交易日	-1.05%
	成交量P/C_Ratio值	1.063	較前一交易日	-0.60
	未平倉P/C_Ratio值	1.177	較前一交易日	+0.10
電子選擇權	買權成交最大量	785	買權OI最大量	765
	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	1580
	賣權成交最大量	1480	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年3月31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

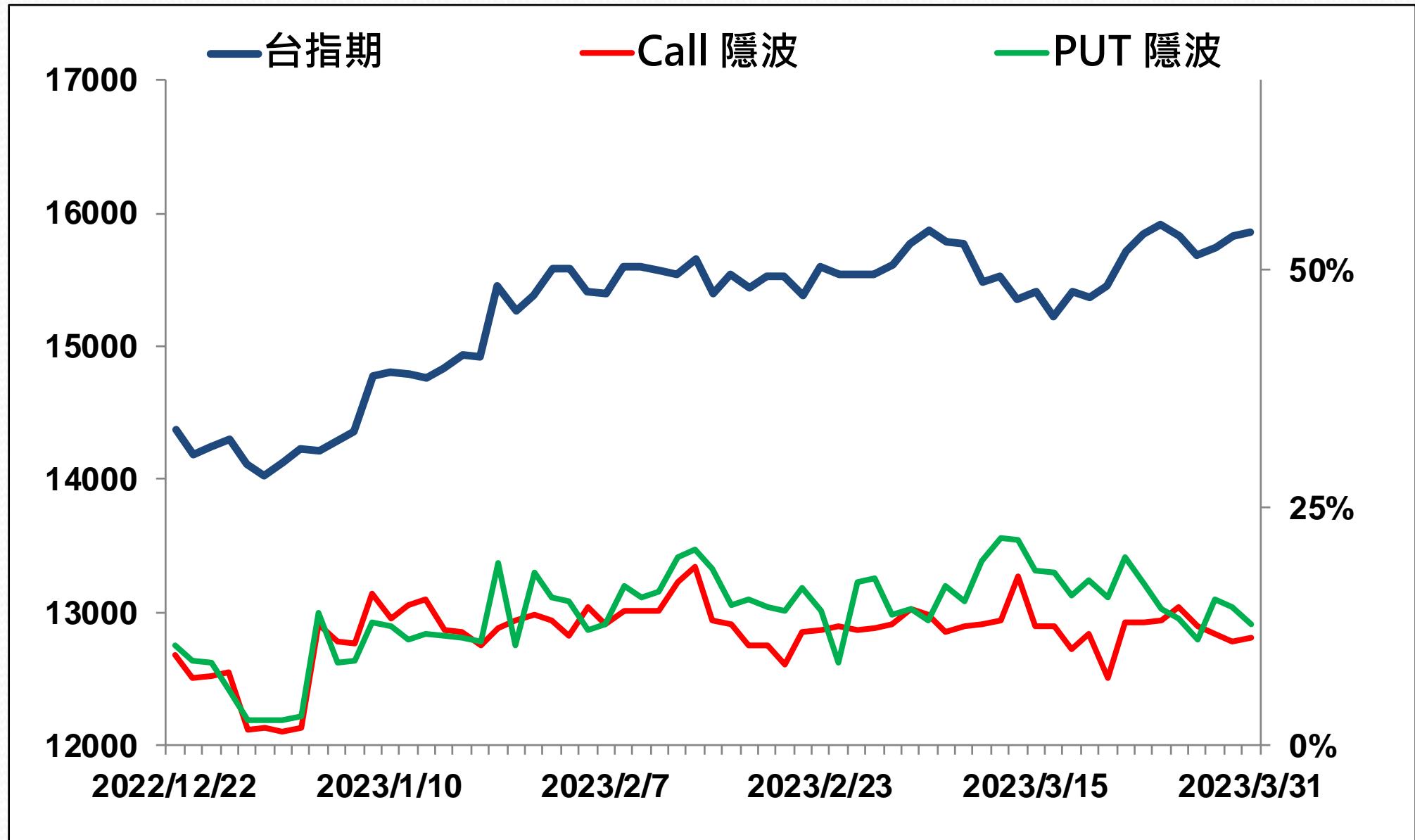
— 臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年3月31日

資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

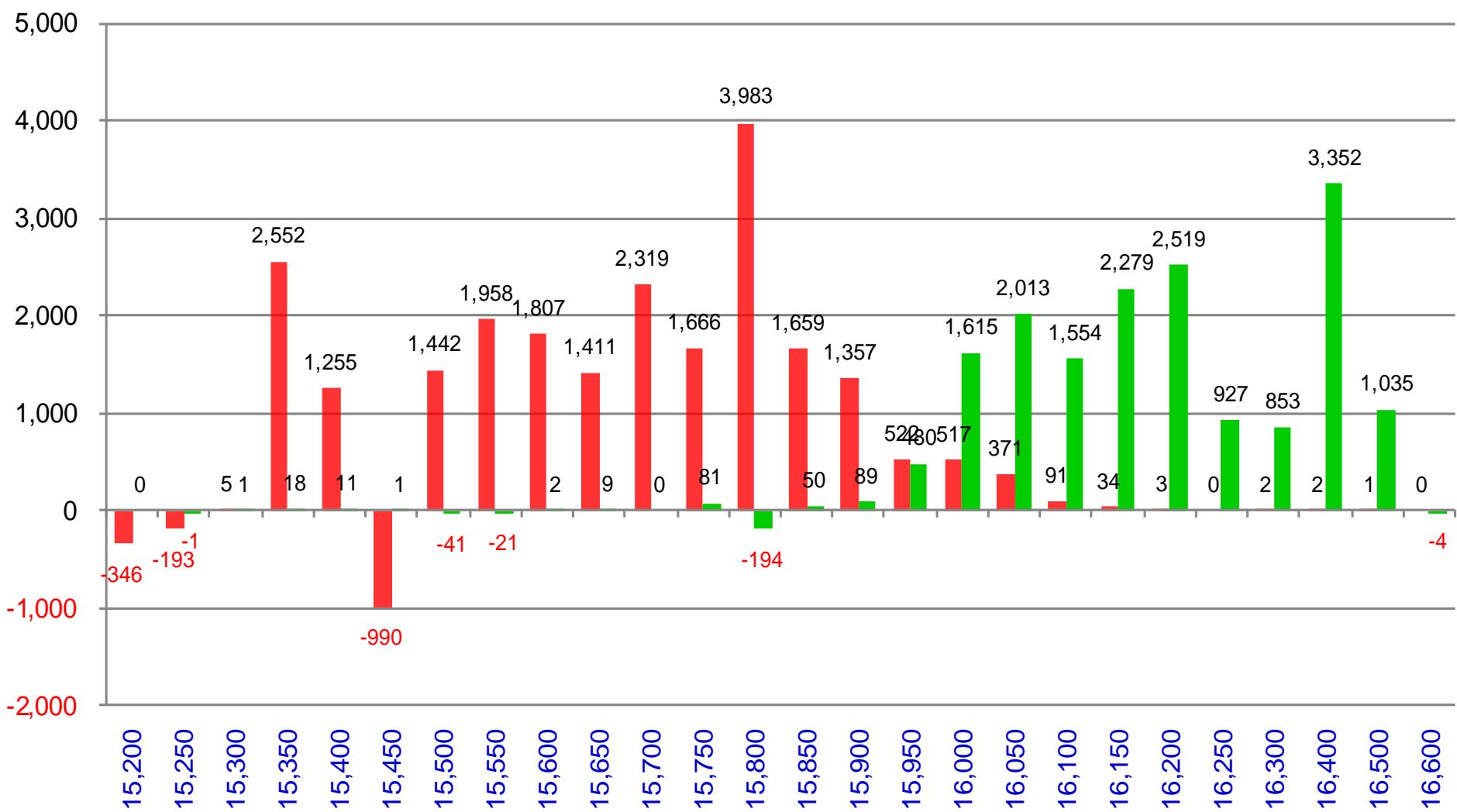
台指近月隱含波動度



更新日期：2023年3月31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 : 20,459 ■ 週選 CALL OI 變化 : 16,611

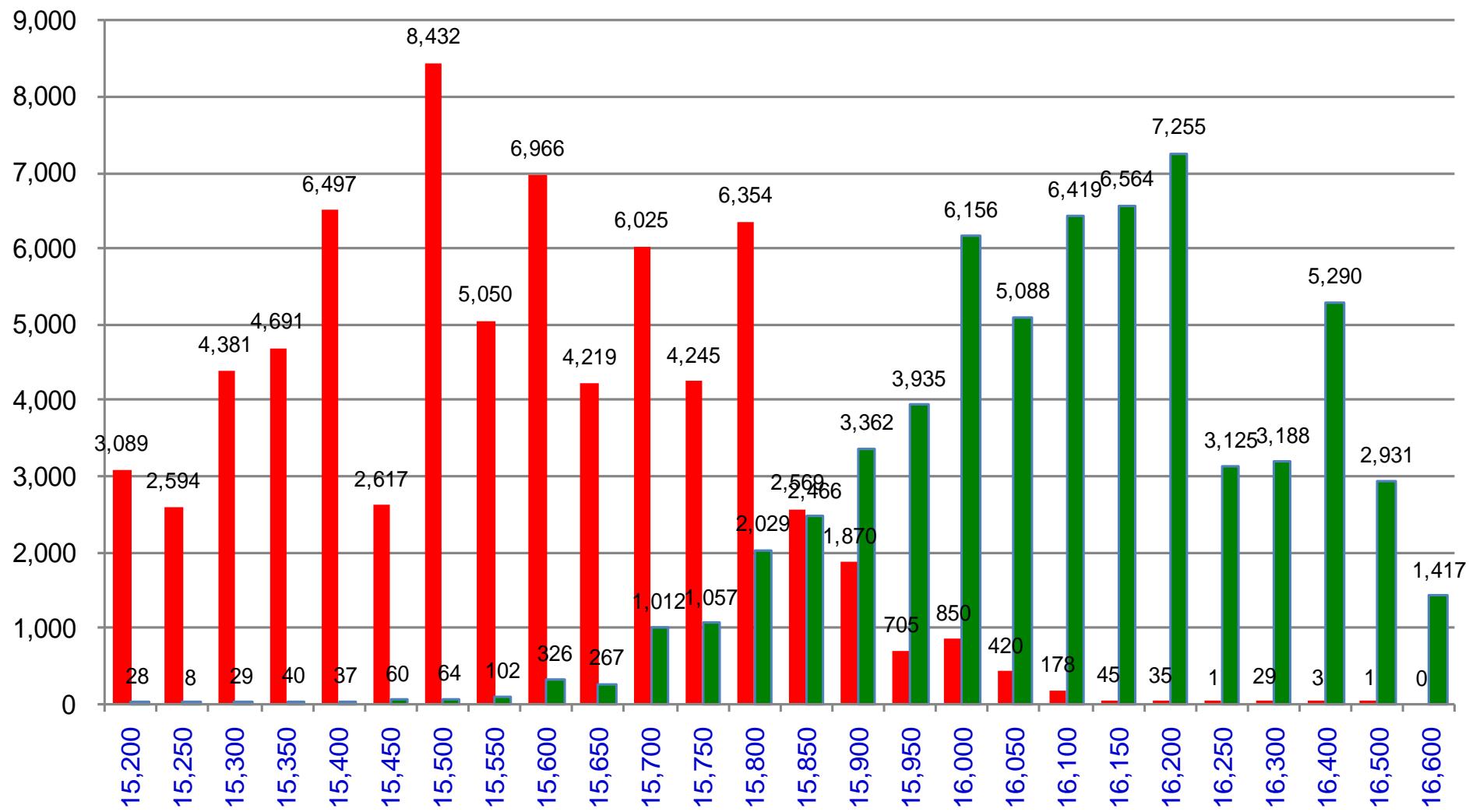


更新日期：2023年3月31日 資料來源：台灣期貨交易所 · 凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：90,998

■ 週選 CALL OI 總額：62,855



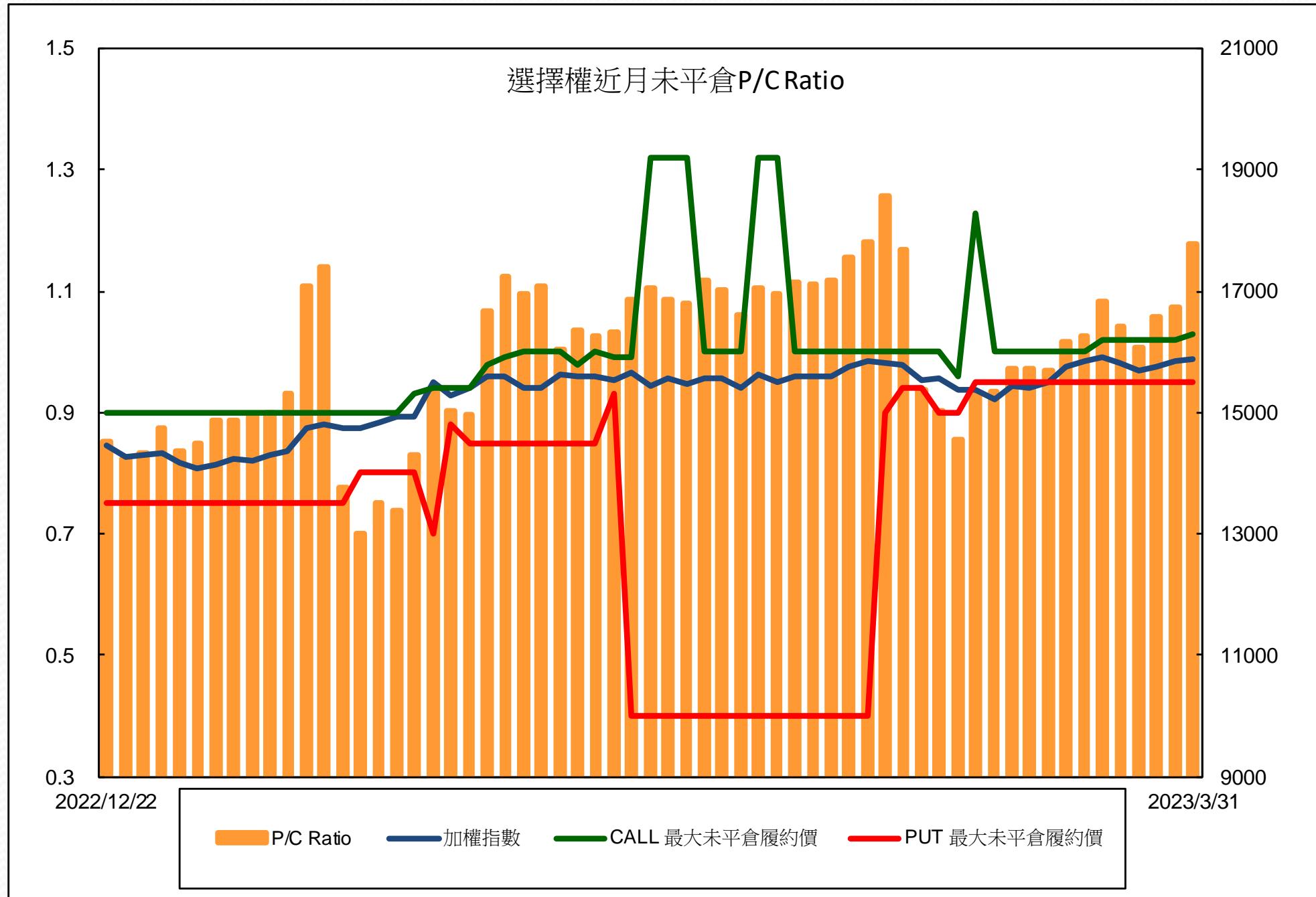
更新日期：2023年3月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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30日	54,217	38,045	16,172
	3月31日	56,016	42,222	13,794
Put	3月30日	63,130	32,703	30,427
	3月31日	68,415	41,542	26,873

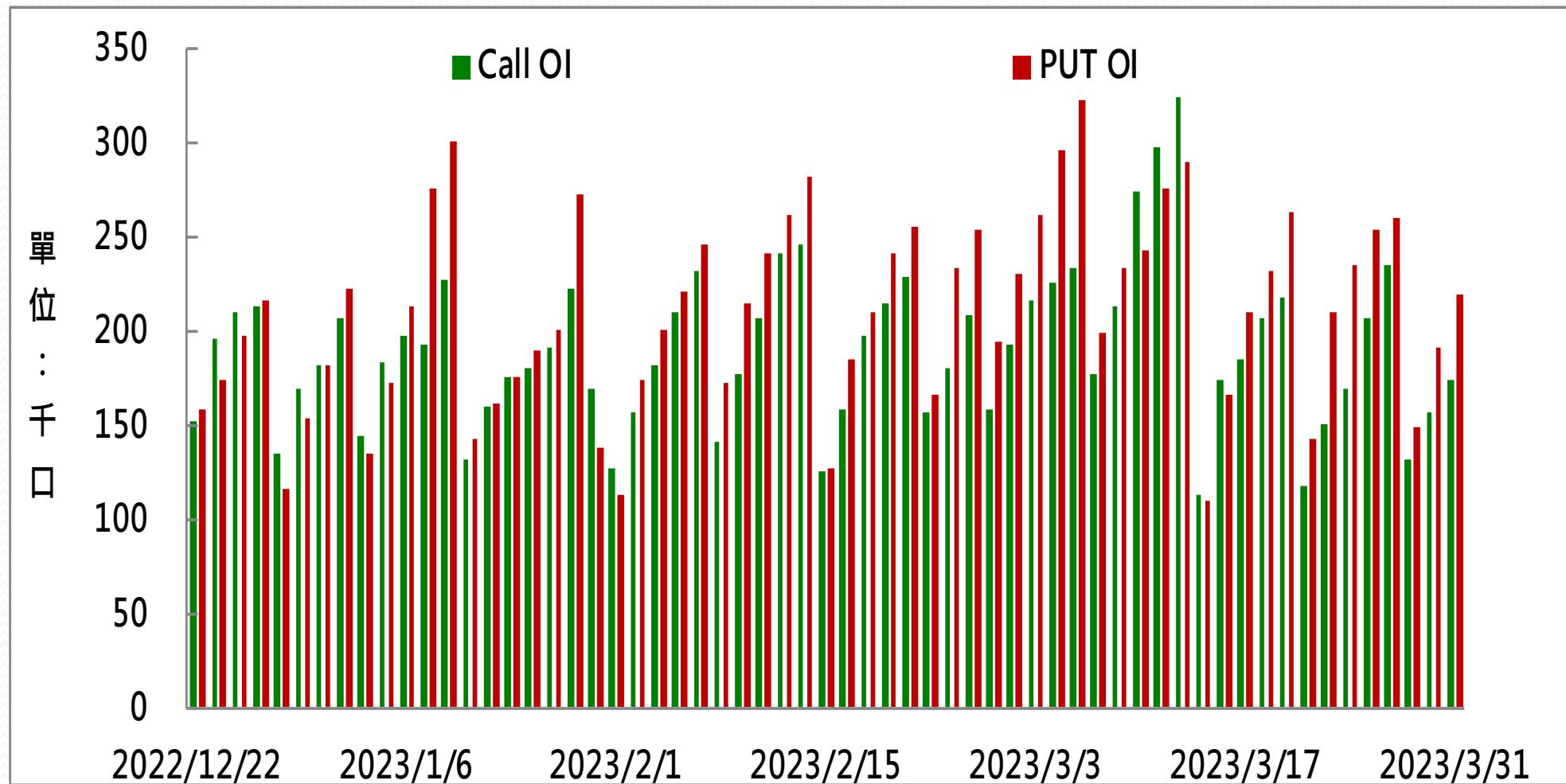
更新日期：2023年3月31日 資料來源：台灣期貨交易所 · 凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年3月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

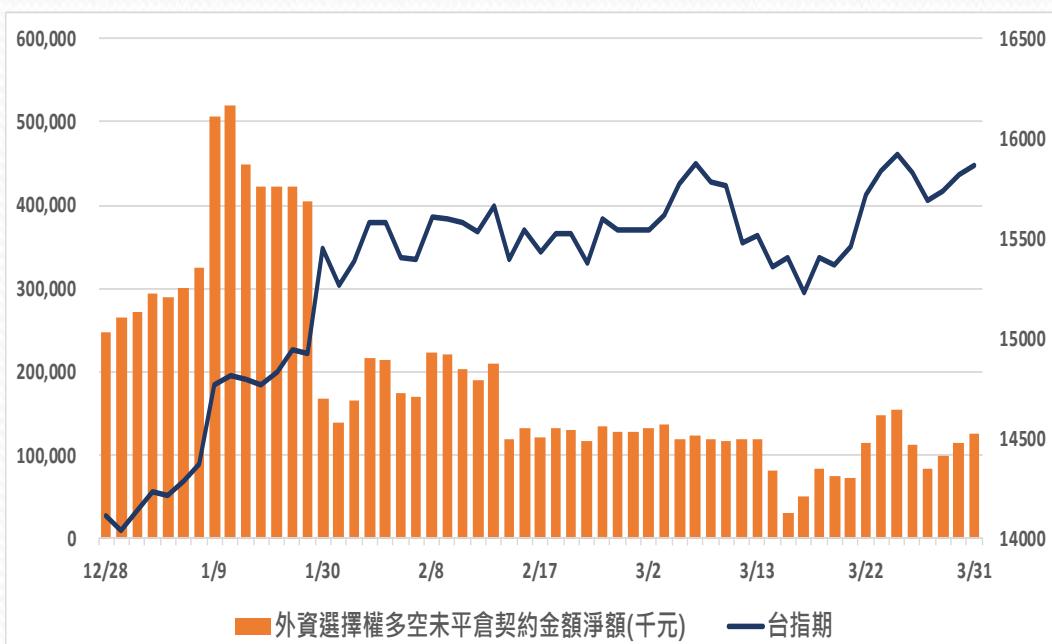
選擇權全月Put Call OI



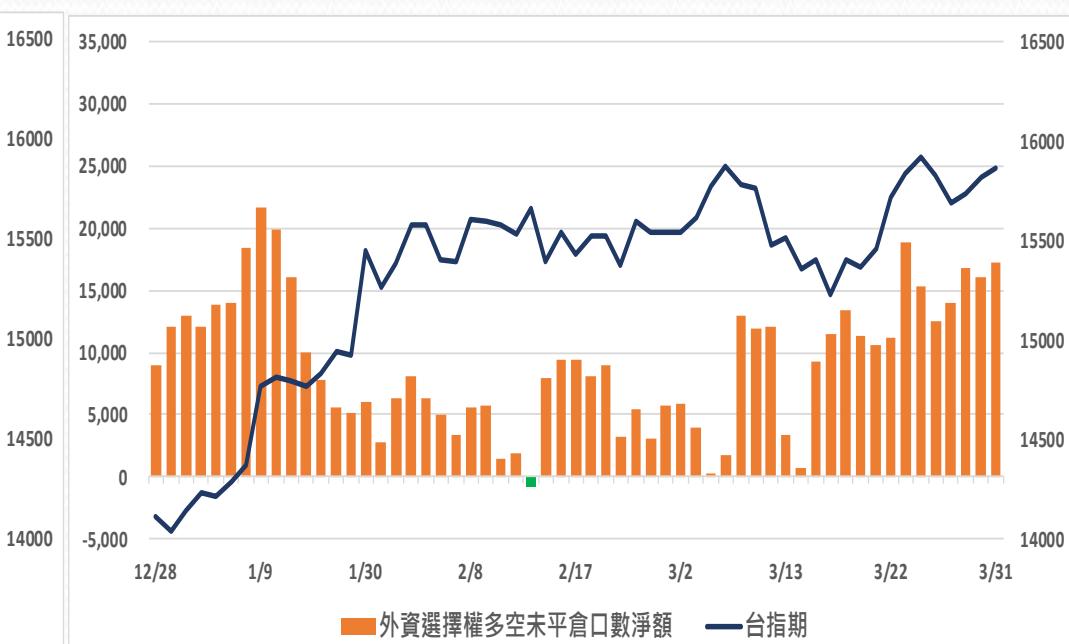
更新日期：2023年3月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



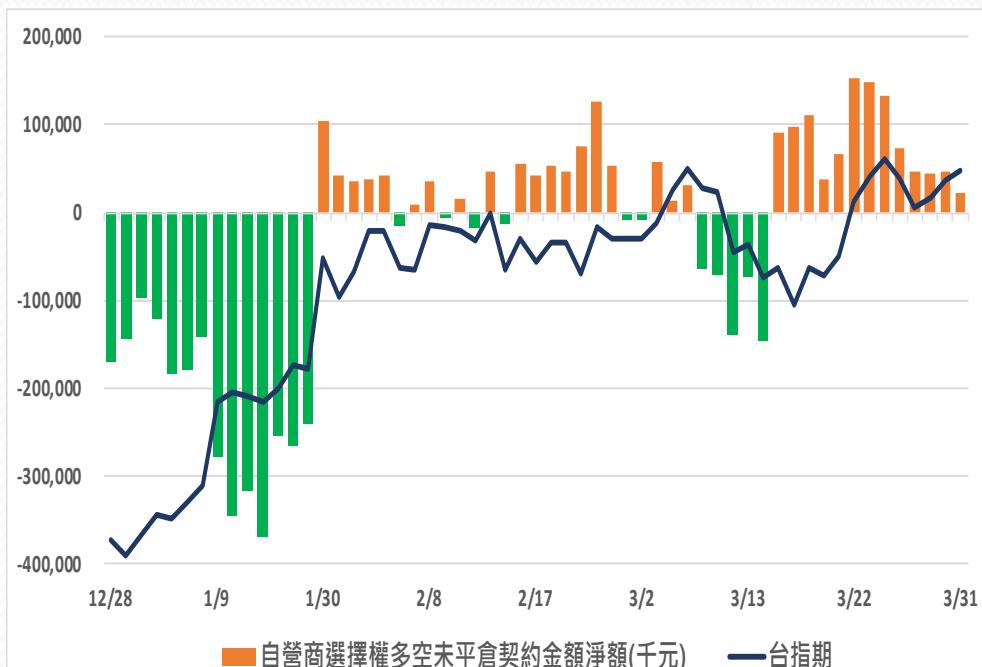
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/27	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
2023/3/31	15864	17,250	+1,191	124,772	+9,956

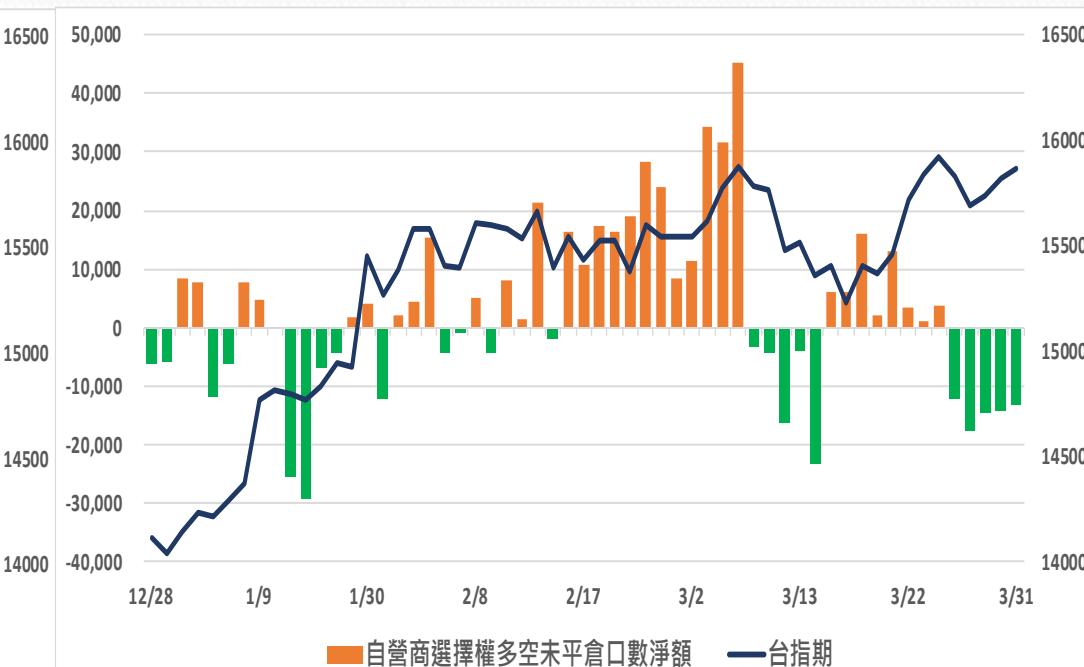
更新日期：2023年3月31日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



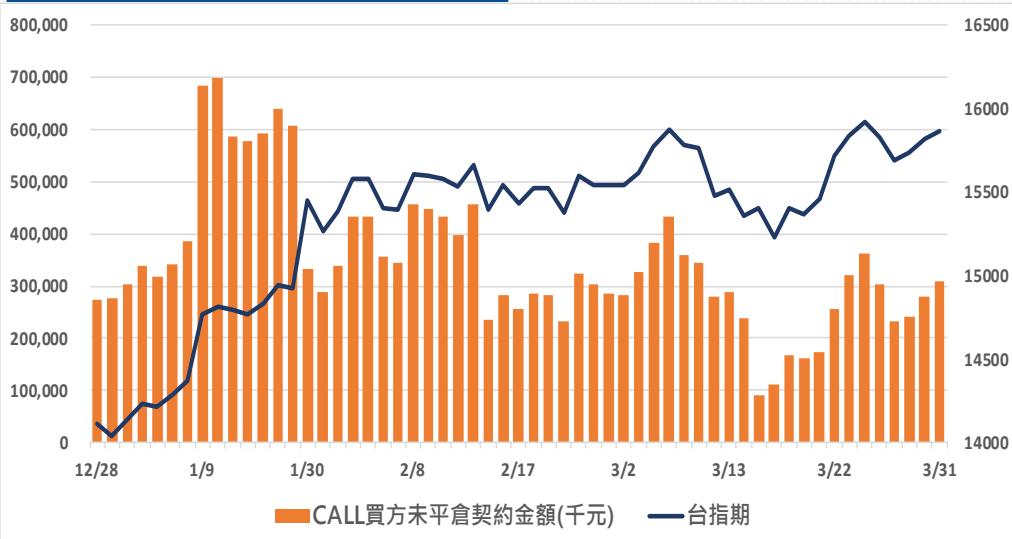
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/27	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
2023/3/31	15864	-13,079	+1,176	21,681	-25,133

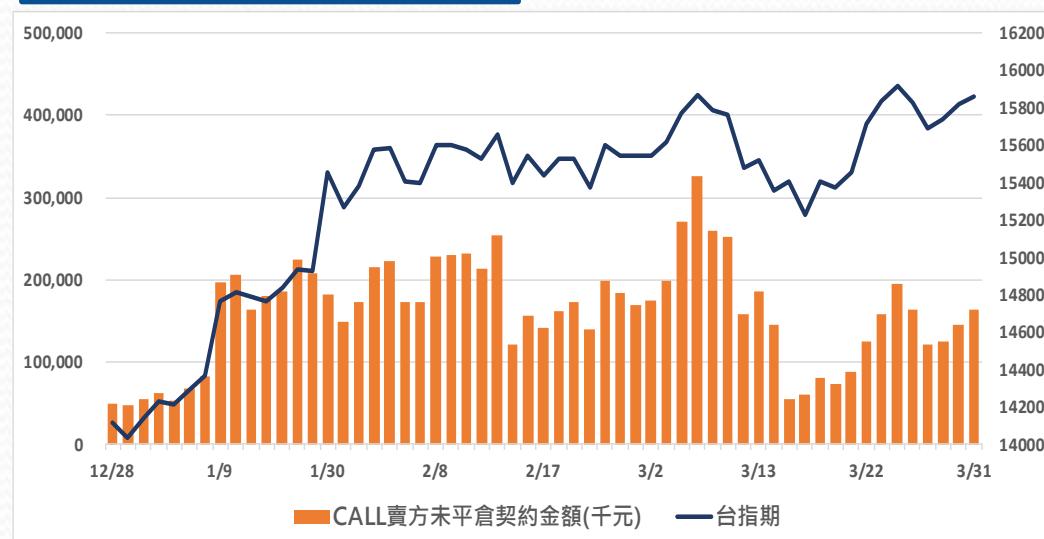
更新日期：2023年3月31日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

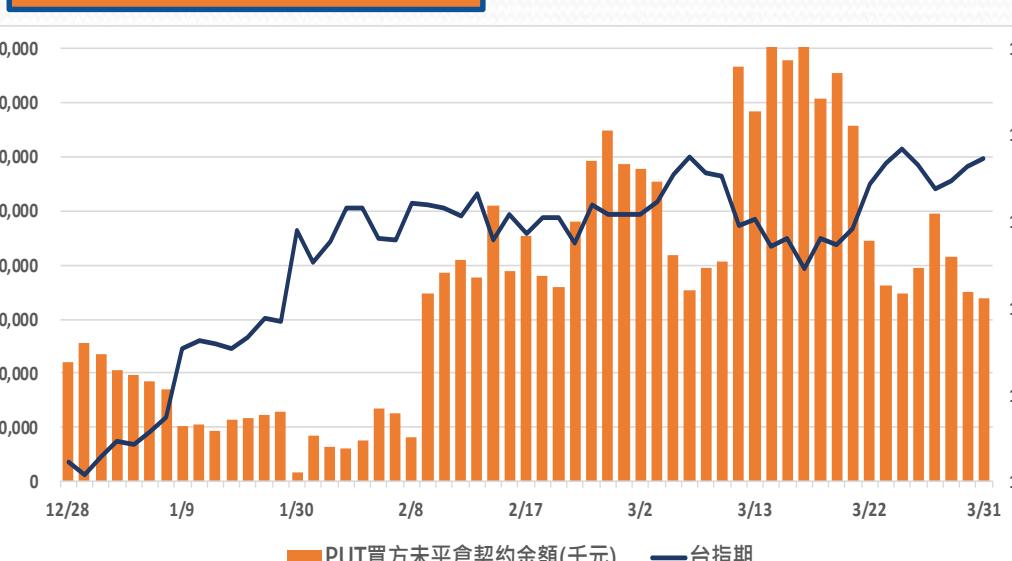
CALL買方未平倉金額



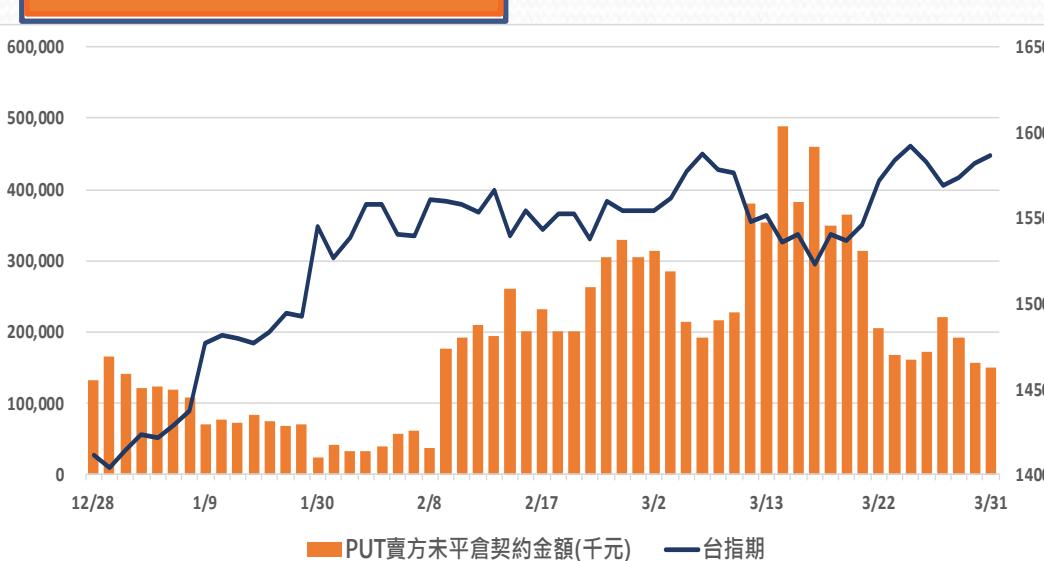
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



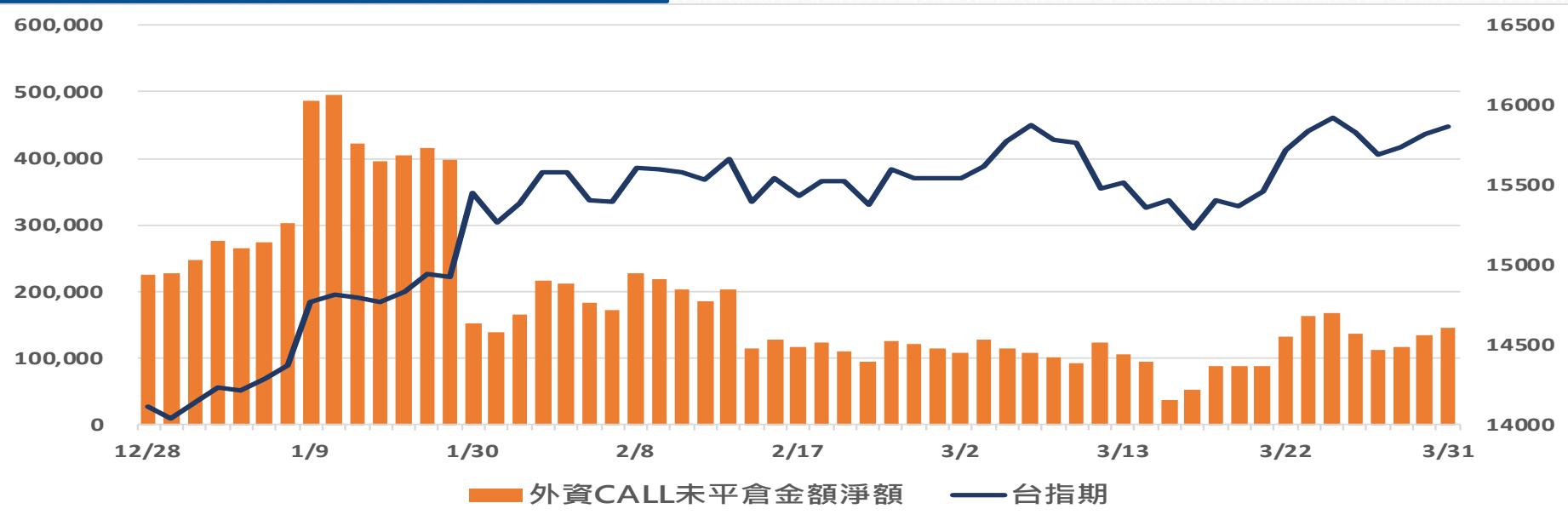
PUT賣方未平倉金額



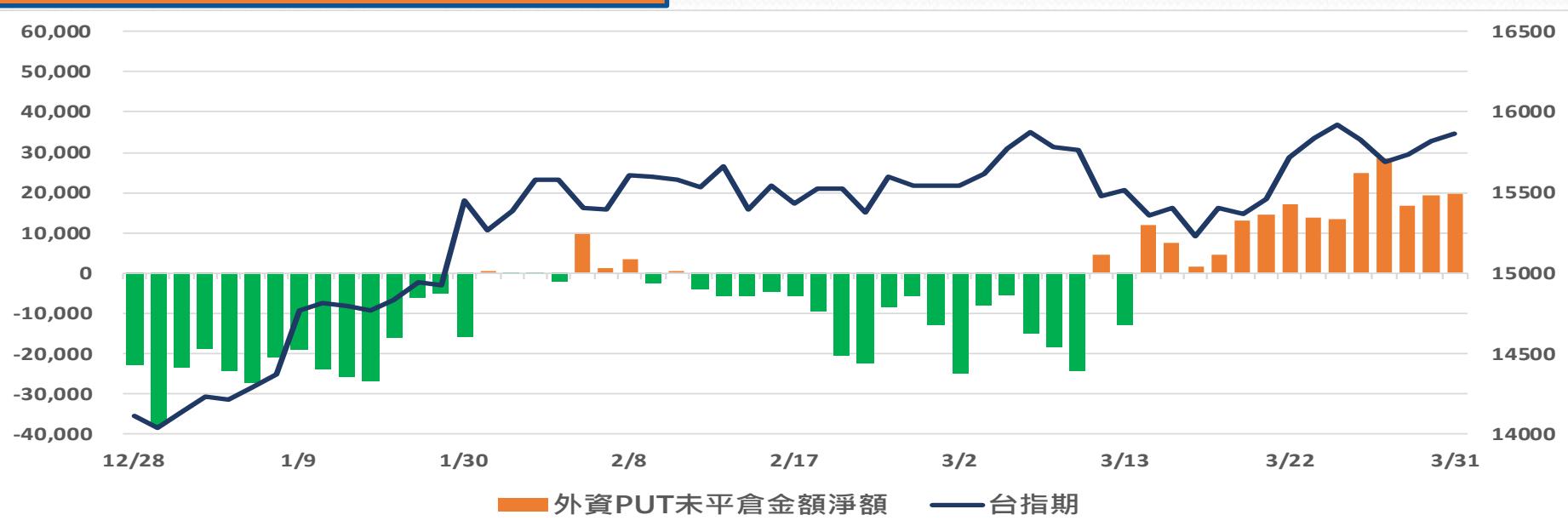
更新日期：2023年3月31日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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31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31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