

台指選擇權OI匯報

日期：2023/4/21 結算日：2023/4/26					日期：2023/4/21 結算日：2023/5/17				
202304W4					202305 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	4	14,700	262	-5	0	8	14,300	658	78
0	5	14,800	1,123	72	0	81	14,400	3,311	1,449 ※
0	0	14,900	1,636	174	0	26	14,500	1,658	105
0	13	15,000	2,472	589	1	7	14,600	1,096	137
0	6	15,100	4,263	1,355	-1	11	14,700	1,160	210
5	12	15,200	5,523	2,164	1	21	14,800	1,710	209
1	1	15,250	1,072	1,072	0	26	14,900	2,072	651
1	14	15,300	5,717	1,039	2	39	15,000	5,204	359
0	6	15,350	4,395	1,486	5	35	15,100	3,692	191
94	114	15,400	7,494	2,295 ※	32	79	15,200	3,916	1,114
93	112	15,450	5,725	1,783	31	209	15,300	2,461	26
381	621	15,500	6,808	1,218	5	217	15,400	2,051	1
287	419	15,550	4,789	567	69	266	15,500	2,077	353
1,515	2,142	15,600	7,229	765	165	422	15,600	1,495	375
2,355	2,897	15,650	4,566	1,094	1,265	1,793	15,700	6,158	-117
3,616	5,509	15,700	4,134	-217	383	1,494	15,800	1,094	-172
3,796	6,024	15,750	3,060	-217	1,133	3,651	15,900	903	-34
※ 5,634	9,306	15,800	2,644	-219	※ 1,343	6,299	16,000	389	26
5,225	9,597	15,850	1,426	-54	465	3,470	16,100	96	0
4,356	12,564	15,900	793	-14	-124	3,073	16,200	97	8
1,999	9,201	15,950	287	-84	749	6,597	16,300	79	4
-1,332	10,218	16,000	331	-36	53	7,754	16,400	14	0
-355	4,965	16,050	68	-1	-132	4,150	16,500	17	1
-1,114	5,393	16,100	161	-19	163	3,227	16,600	13	0
28	3,563	16,150	22	0	-555	1,097	16,700	14	0
-253	5,025	16,200	64	-2	-151	1,119	16,800	20	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
25,528	99,374	0.7723	76,742	14,868	5,552	53,232	0.9340	49,717	5,582
昨日 P/C	0.8379	今日增減變化	-0.0656		昨日 P/C	0.9257	今日增減變化	0.0083	

更新日期：2023年4月21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4月21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	102,838,288	59,640,186	43,198,102	3,243,054	2,105,136	499,970	1,605,166	176,800	
投信	27,093,413	52,047,708	-24,954,295	-756,871	391,789	0	391,789	-3,672	
自營商	37,667,443	20,190,099	17,477,344	1,748,259	1,315,666	765,904	549,762	-199,858	
	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	186,840	912,402	-725,562	47,174	24,314	72,941	-48,627	47,713	
投信	123,003	0	123,003	174	0	0	0	0	
自營商	253,791	135,456	118,335	32,821	259,852	212,698	47,154	-49,186	

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報								2023年4月21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	26,818	13,776	13,042	2,034	21,088	14,528	6,560	1,858	
投信	100	50	50	0	150	113	37	0	
自營商	55,981	35,361	20,620	-4,379	37,237	34,890	2,347	-700	
特定法人(週)	1,444	0	1,444	1,444	0	3,638	-3,638	1,244	
特定法人(近月)	19,712	8,039	11,673	2,572	6,676	9,875	-3,199	-2,243	
特定法人(全月)	19,390	4,779	14,611	3,632	7,658	15,632	-7,974	-1,407	
十大交易人(週)	35,130	30,503	4,627	-1,316	21,757	18,242	3,515	1,858	
十大交易人(近月)	35,337	21,011	14,326	246	19,719	24,712	-4,993	-3,345	
十大交易人(全月)	76,523	45,923	30,600	-28	42,198	47,123	-4,925	-3,070	
全市場未沖銷(近月)			53,232	5,552			49,717	5,582	
全市場未沖銷(全月)			181,102	37,874			155,202	24,812	

更新日期：2023年4月21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04W4週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15800	買權OI最大量	15900
	賣權成交最大量	15700	賣權OI最大量	15400
	整體隱含波動率	9.62%	較前一交易日	-2.55%
	買權隱含波動率	10.19%	較前一交易日	-2.44%
	賣權隱含波動率	8.84%	較前一交易日	-2.81%
電子選擇權	買權成交最大量	770	買權OI最大量	810
	賣權成交最大量	700	賣權OI最大量	720
金融選擇權	買權成交最大量	1580	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1500

更新日期：2023年4月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

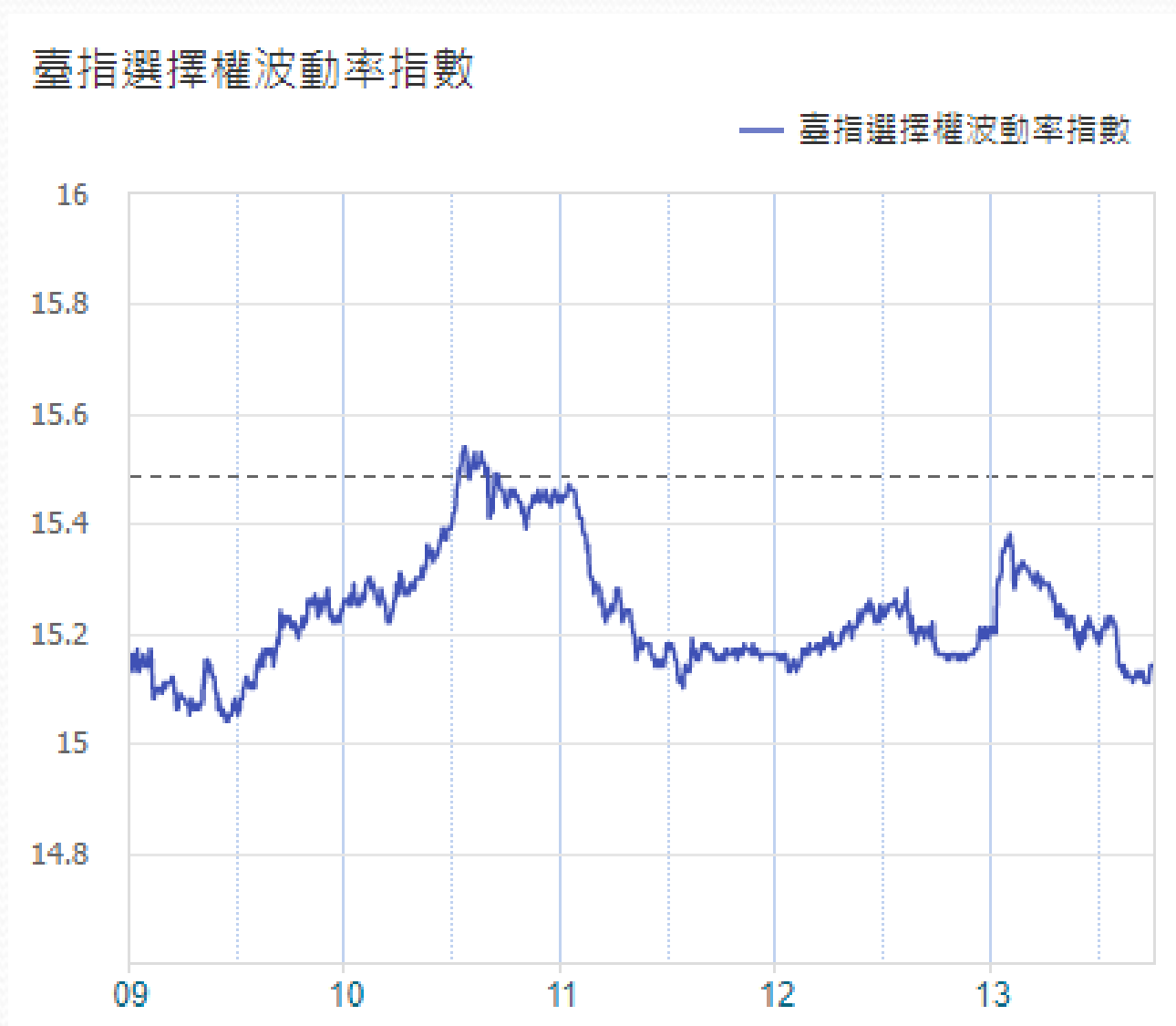
台指選擇權匯報

2023年05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	16400
	賣權成交最大量	15200	賣權OI最大量	15700
	整體隱含波動率	13.67%	較前一交易日	+0.33%
	買權隱含波動率	12.14%	較前一交易日	-0.54%
	賣權隱含波動率	15.73%	較前一交易日	-0.25%
	成交量P/C_Ratio值	0.810	較前一交易日	+0.07
	未平倉P/C_Ratio值	0.934	較前一交易日	+0.01
電子選擇權	買權成交最大量	770	買權OI最大量	810
	賣權成交最大量	700	賣權OI最大量	720
金融選擇權	買權成交最大量	1580	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1500

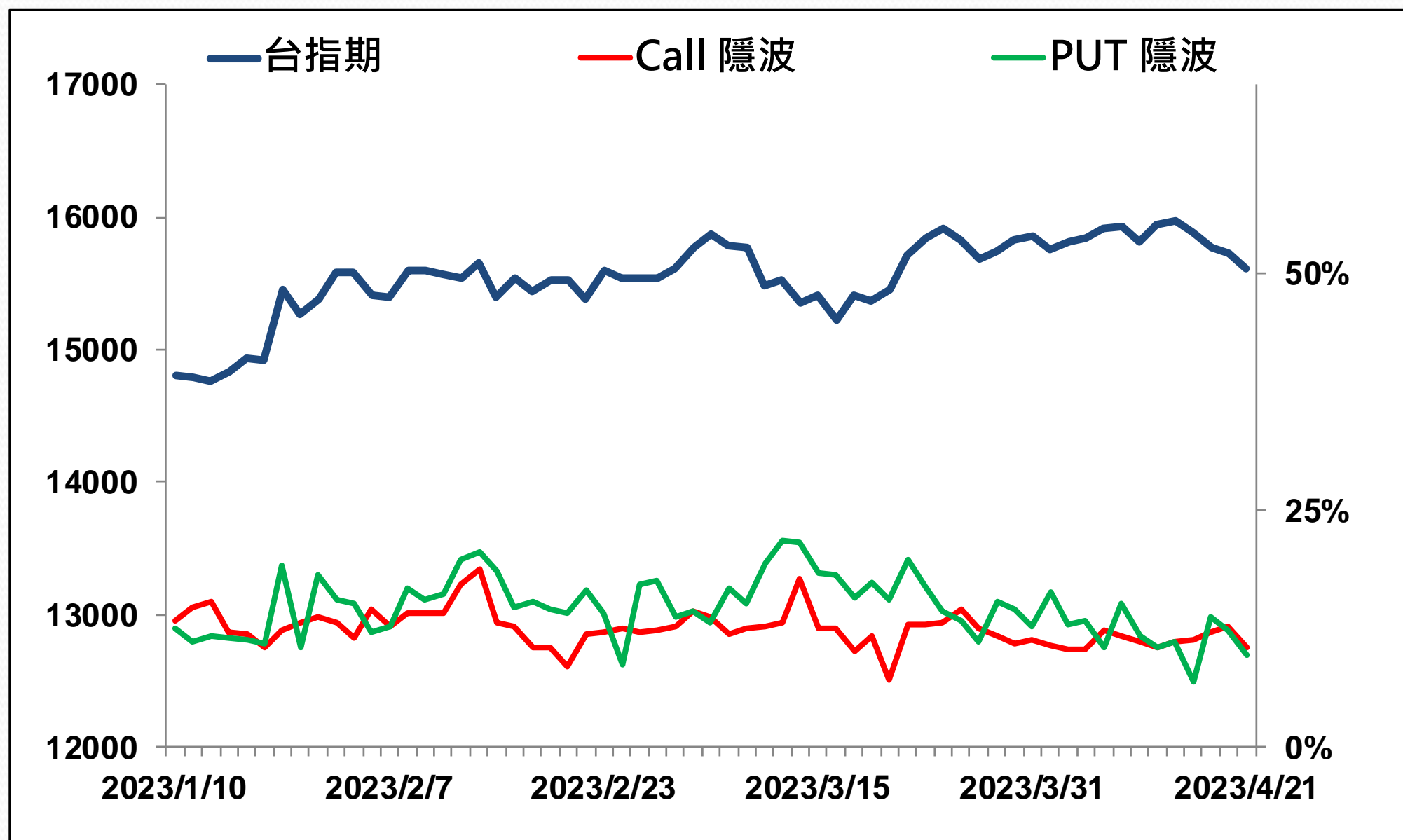
更新日期：2023年4月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



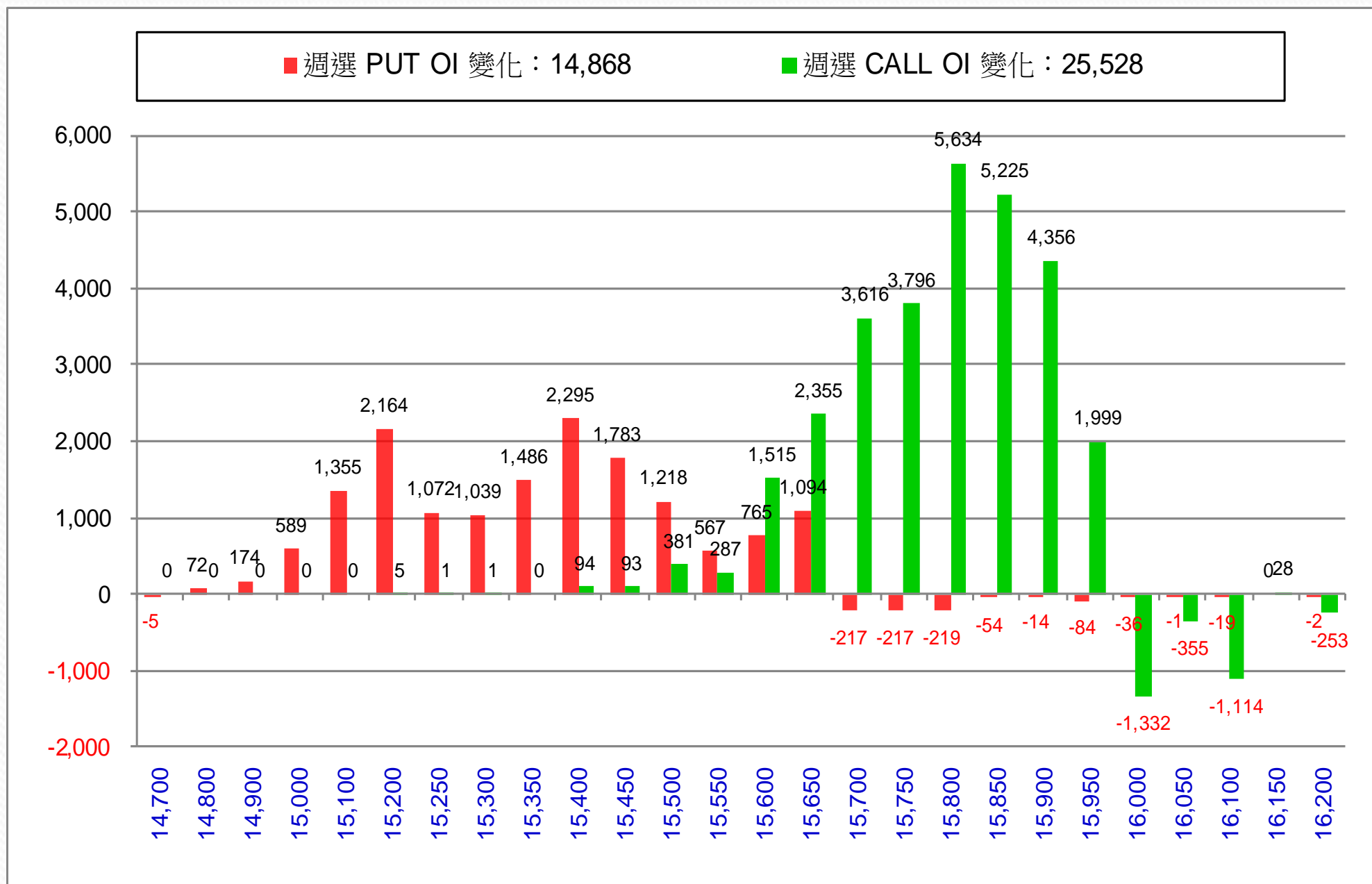
更新日期：2023年4月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年4月21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

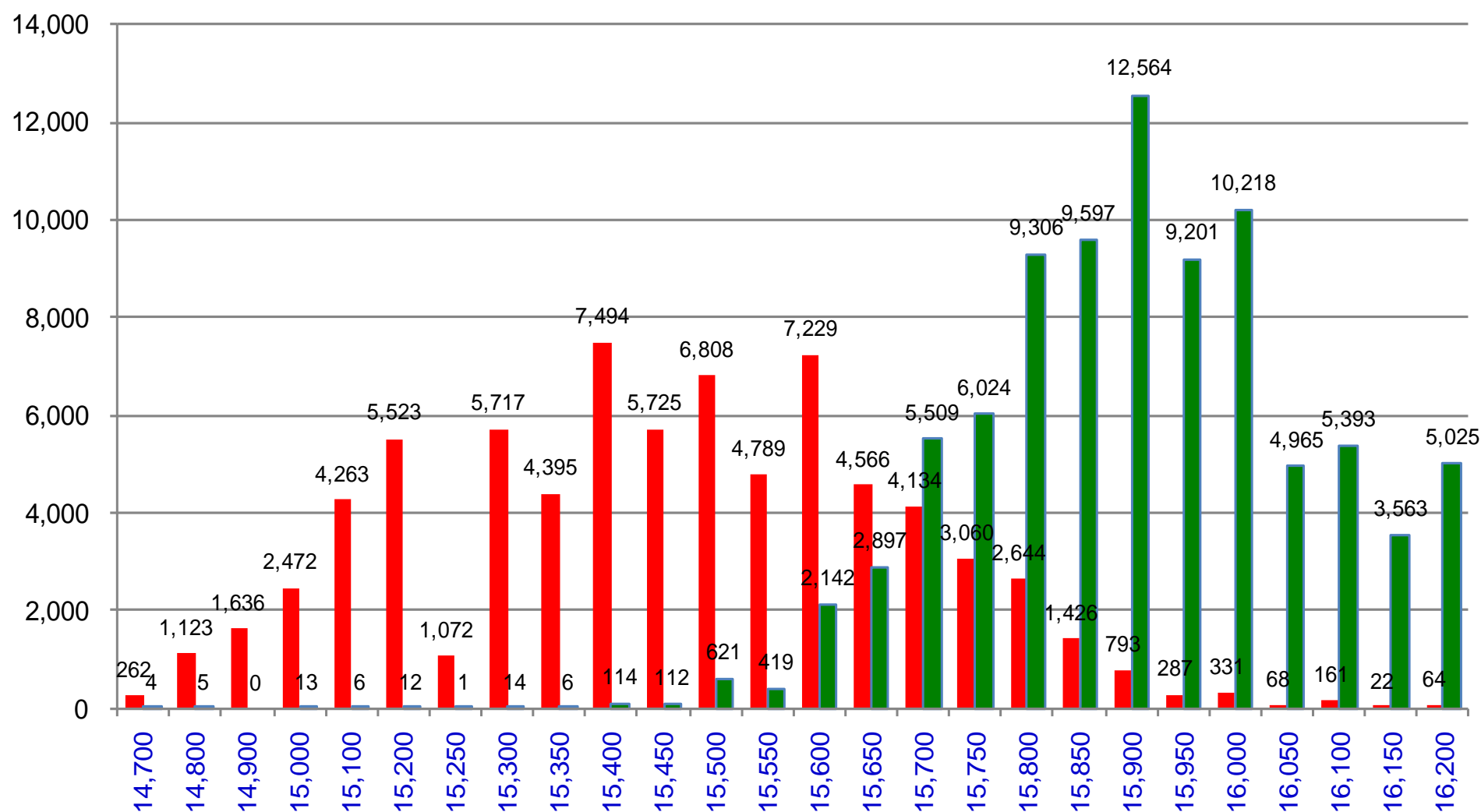


更新日期：2023年4月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：76,742

週選 CALL OI 總額：99,374



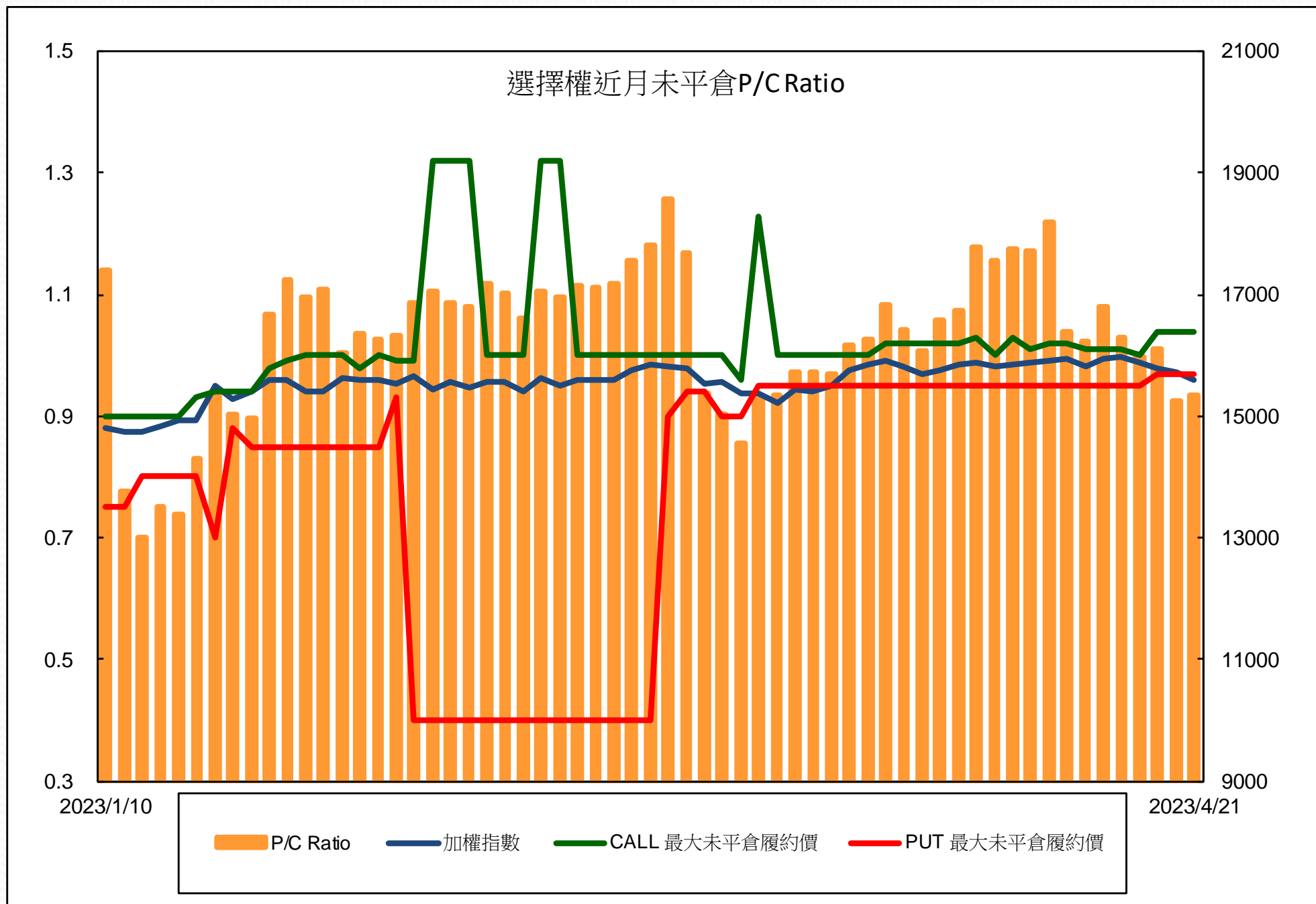
更新日期：2023年4月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	4月20日	52,379	27,380	24,999
	4月21日	55,981	35,361	20,620
Put	4月20日	32,692	29,645	3,047
	4月21日	37,237	34,890	2,347

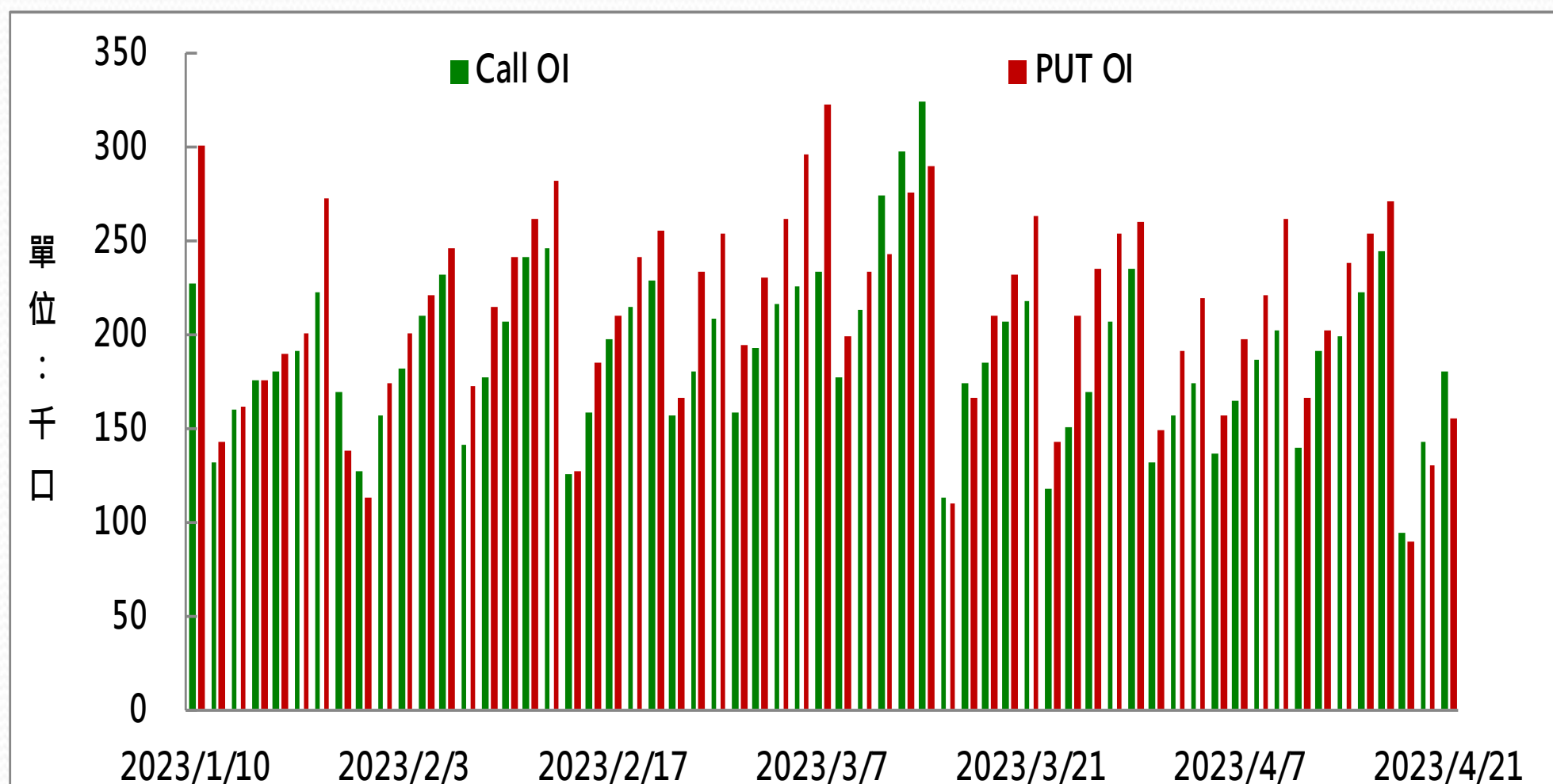
更新日期：2023年4月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年4月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

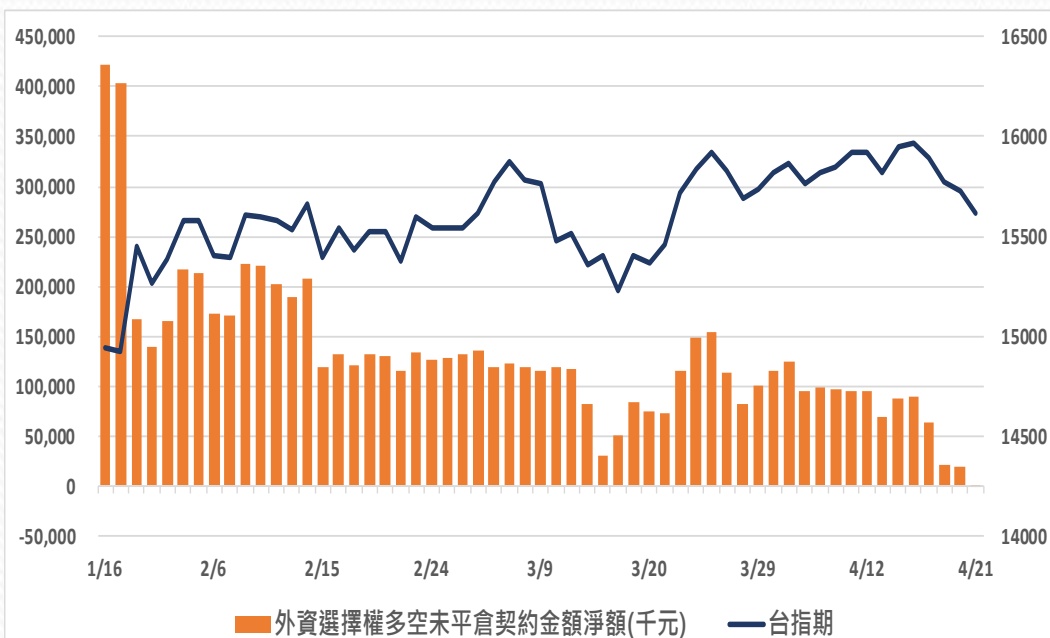
選擇權全月Put Call OI



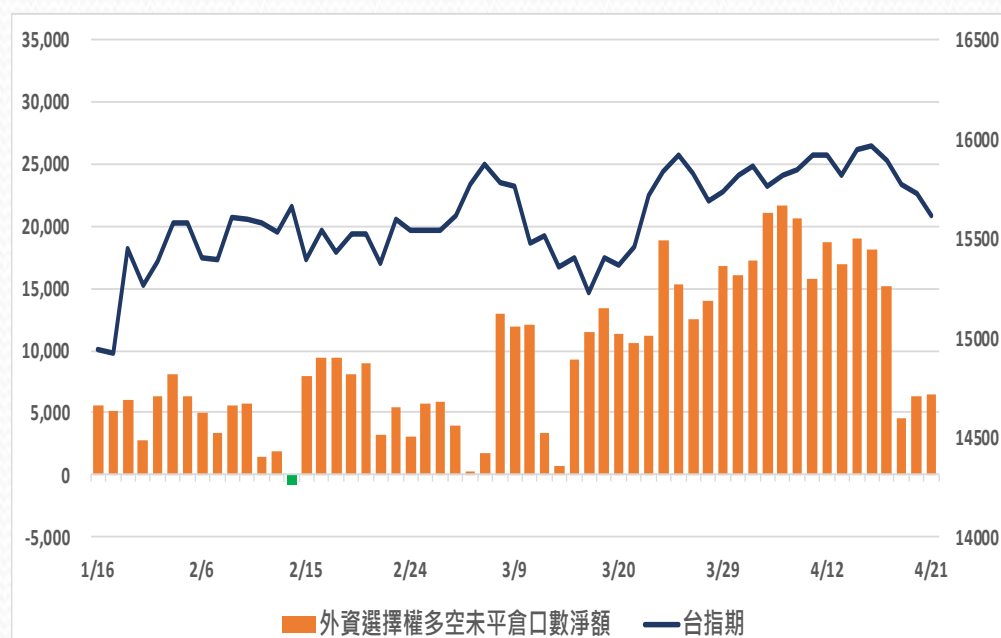
更新日期：2023年4月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



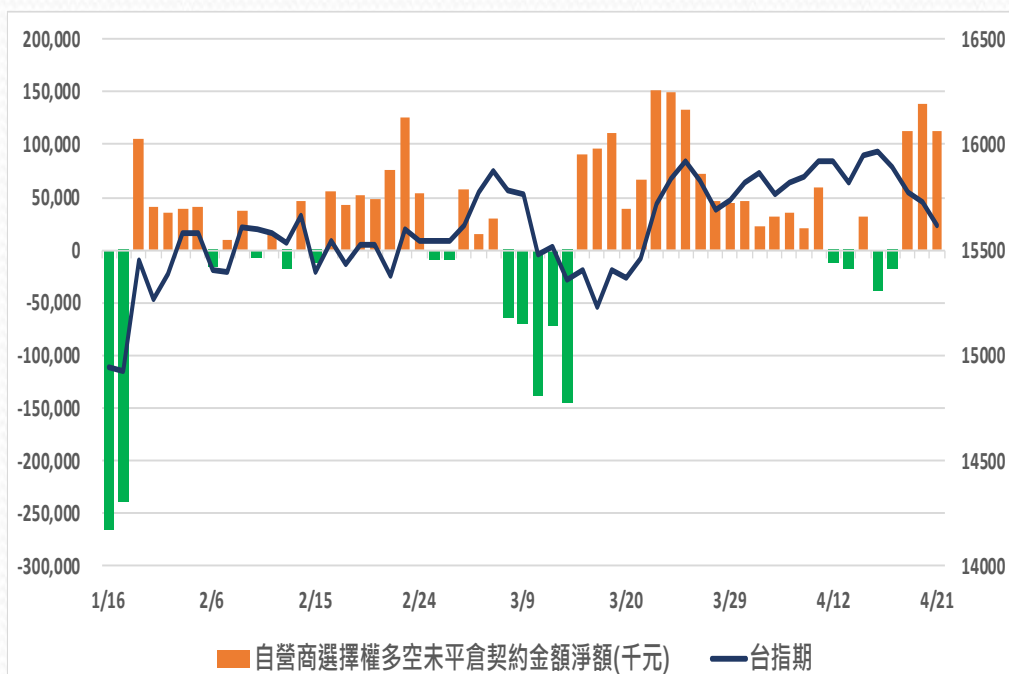
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/17	15970	18,063	-892	90,039	+2,089
2023/4/18	15891	15,171	-2,892	63,968	-26,071
2023/4/19	15775	4,544	-10,627	21,451	-42,517
2023/4/20	15731	6,306	+1,762	18,449	-3,002
2023/4/21	15614	6,482	+176	-505	-18,954

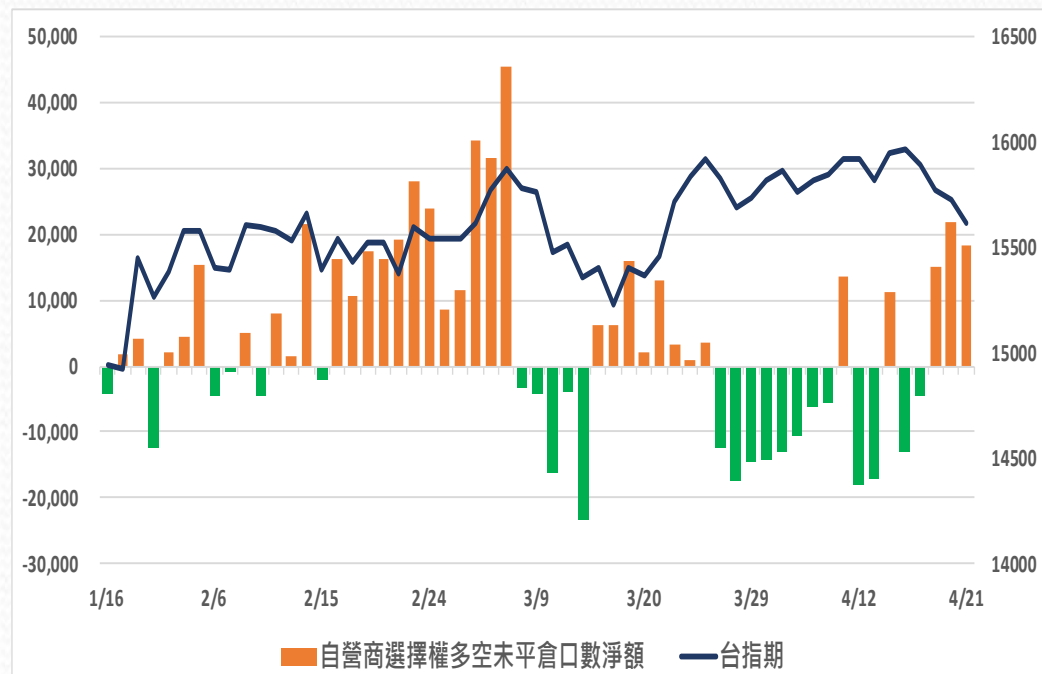
更新日期：2023年4月21日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



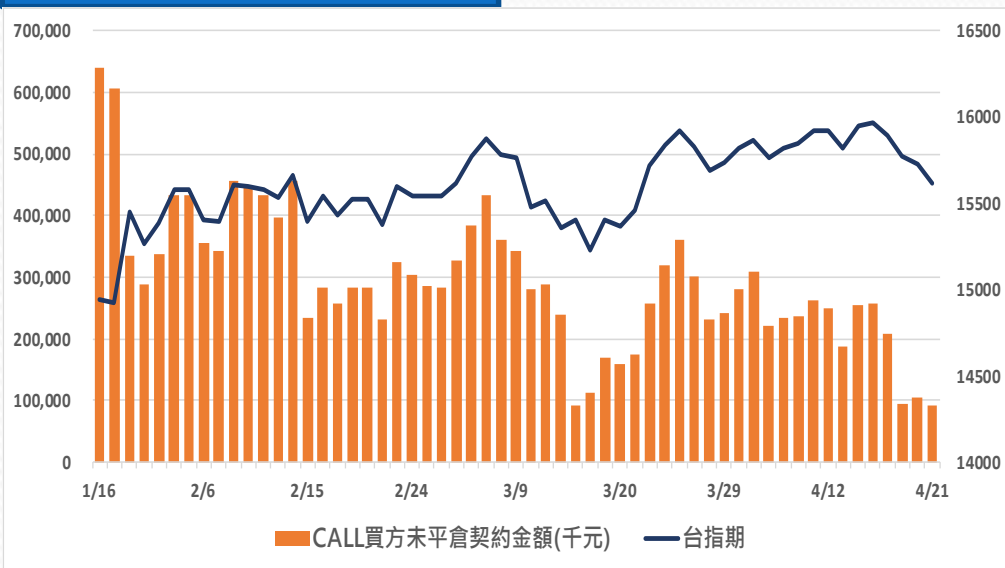
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/17	15970	-12,992	-24,247	-39,423	-70,604
2023/4/18	15891	-4,483	+8,509	-18,182	+21,241
2023/4/19	15775	14,993	+19,476	112,281	+130,463
2023/4/20	15731	21,952	+6,959	138,385	+26,104
2023/4/21	15614	18,273	-3,679	113,640	-24,745

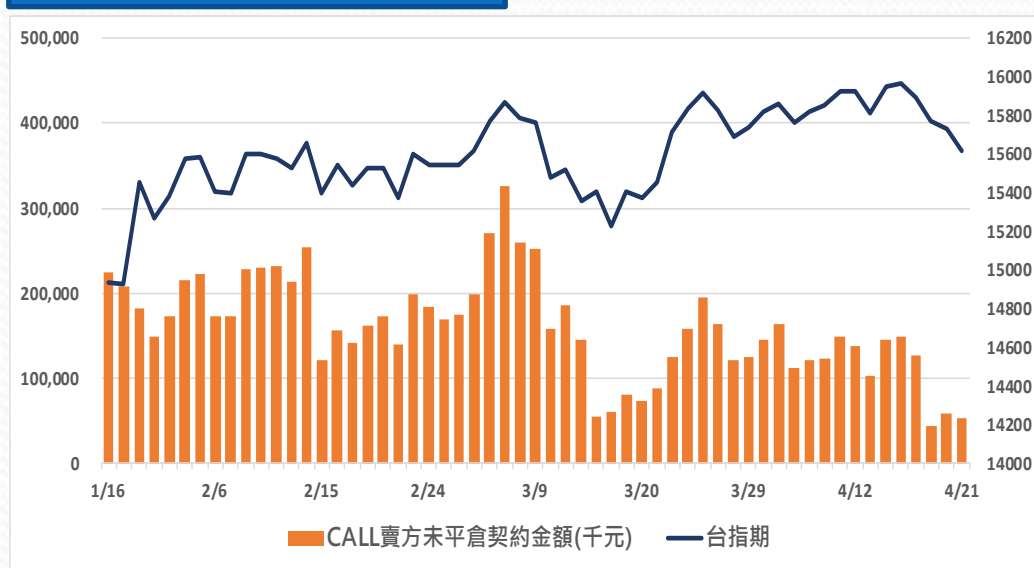
更新日期：2023年4月21日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

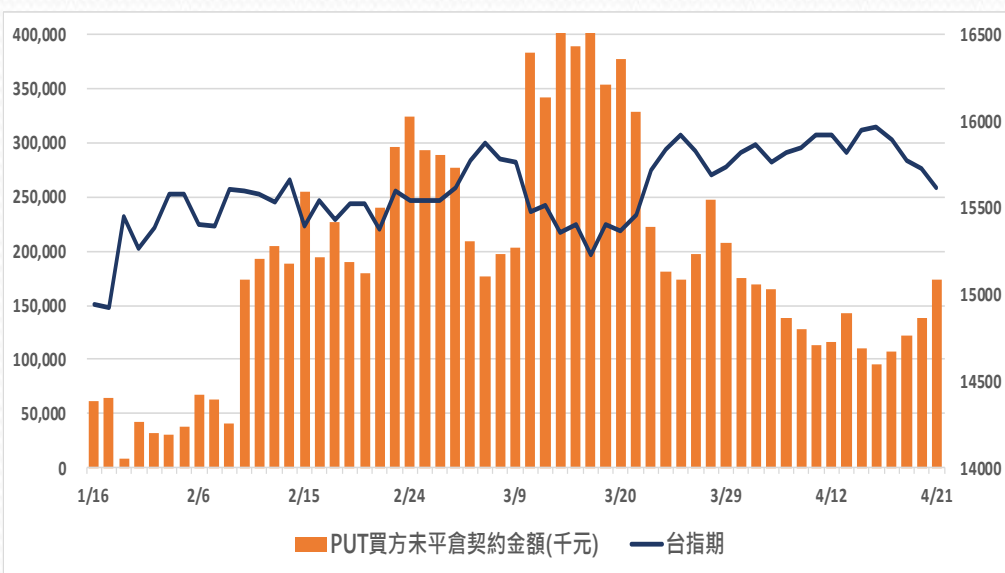
CALL買方未平倉金額



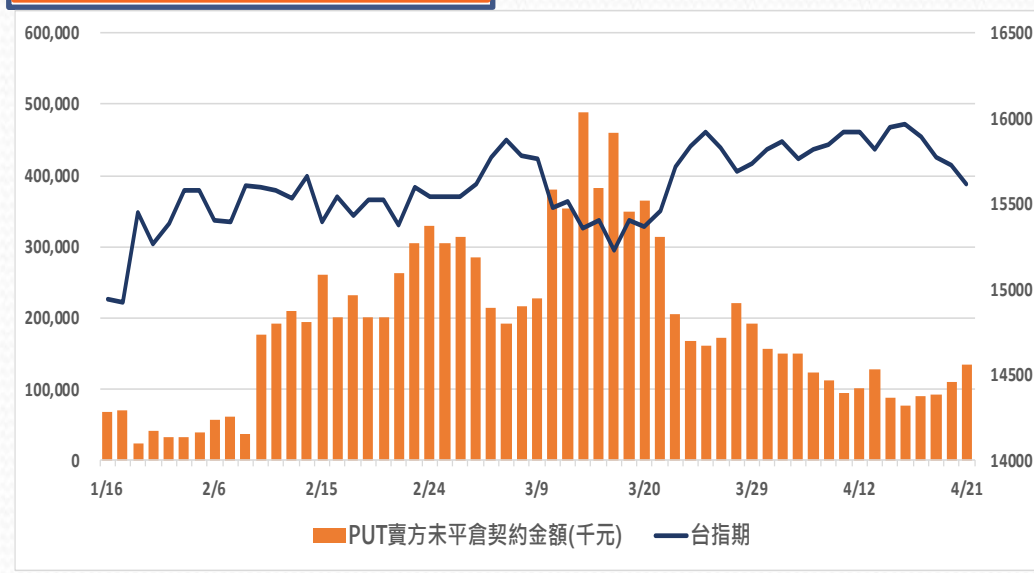
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



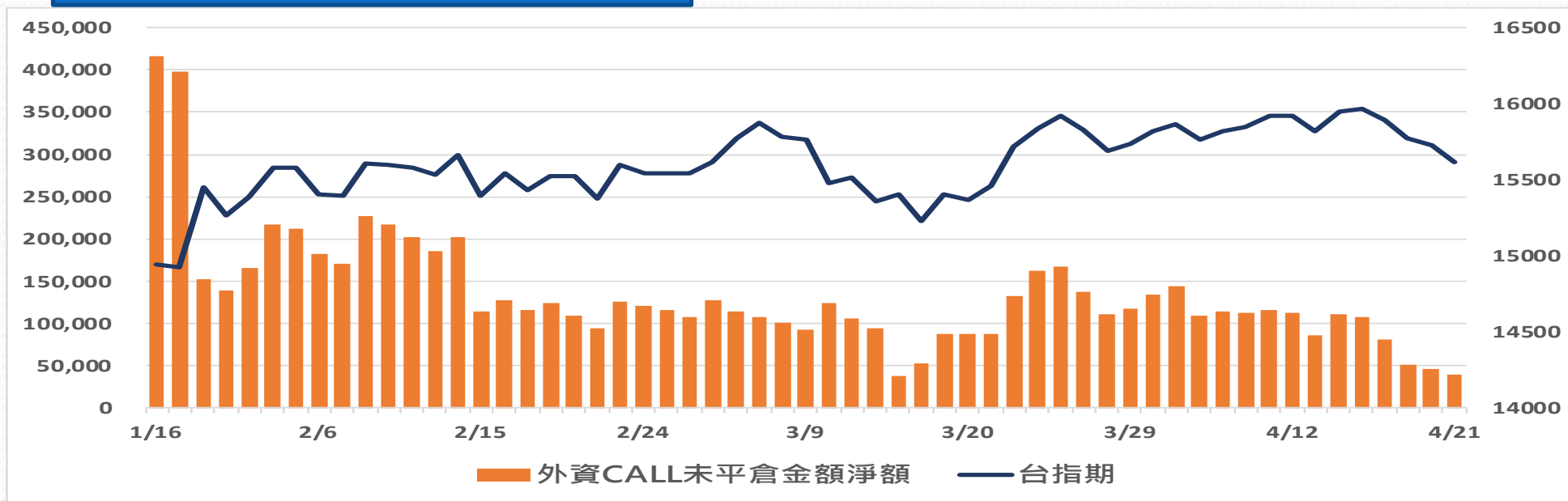
PUT賣方未平倉金額



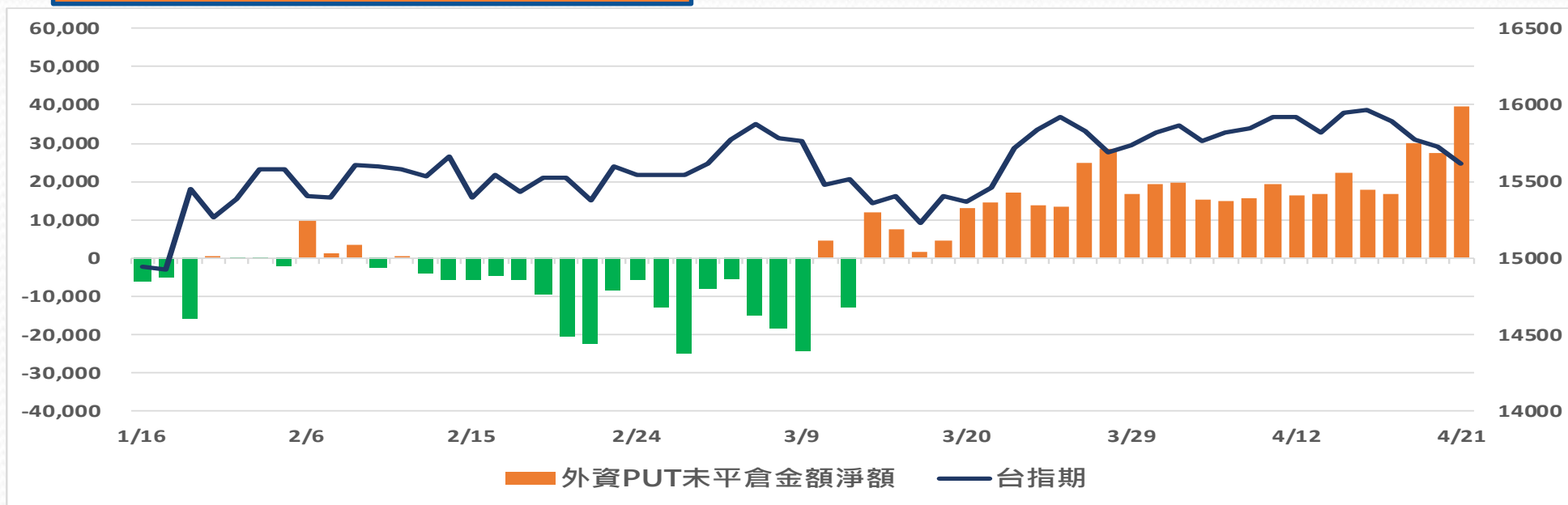
更新日期：2023年4月21日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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4月21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4月21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