

台指選擇權OI匯報

日期：2023/4/6 結算日：2023/4/12					日期：2023/4/6 結算日：2023/4/19				
202304W2					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	0	14,950	0	0	0	9	14,100	783	-22
4	5	15,000	3,089	2,531 ※	0	4	14,200	2,079	185
0	0	15,050	0	0	0	13	14,300	2,083	-85
0	0	15,100	2,641	2,226	0	95	14,400	2,225	17
0	0	15,150	0	0	1	44	14,500	3,568	-13
0	7	15,200	1,200	655	0	70	14,600	2,818	-238
1	1	15,250	561	228	0	63	14,700	3,383	-497
11	12	15,300	1,976	1,418	0	87	14,800	7,129	-3
0	1	15,350	1,445	1,090	0	88	14,900	4,657	793 ※
4	14	15,400	1,974	1,500	-19	129	15,000	8,921	213
8	15	15,450	1,701	1,449	-1	324	15,100	3,741	309
20	28	15,500	2,584	2,096	0	1,689	15,200	5,211	334
34	39	15,550	1,538	1,247	-11	1,923	15,300	5,495	407
138	148	15,600	2,394	1,482	35	1,801	15,400	6,523	789
263	311	15,650	1,291	954	-71	3,266	15,500	10,615	503
416	473	15,700	2,314	1,737	21	2,800	15,600	2,716	453
517	568	15,750	1,310	1,042	94	2,816	15,700	1,988	-191
1,671	1,867	15,800	1,342	929	339	3,862	15,800	2,341	275
1,234	1,521	15,900	497	231	97	3,756	15,900	769	-41
2,167	2,917	16,000	189	83	※ 1,345	7,290	16,000	794	22
※ 3,261	4,446	16,100	19	9	755	6,866	16,100	398	-3
1,267	2,403	16,200	21	4	194	6,565	16,200	351	1
890	1,784	16,300	13	8	624	7,064	16,300	169	-9
1,763	2,218	16,400	10	2	-16	5,702	16,400	70	-1
132	602	16,500	2	1	374	5,918	16,500	22	-1
14	433	16,600	0	0	-53	2,844	16,600	38	2
38	138	16,700	0	0	-35	1,219	16,700	39	0
-2	3	16,800	0	0	710	2,320	16,800	4	0
-168	7	16,900	0	0	5	899	16,900	1	0
-30	145	17,000	0	0	298	1,241	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
13,653	20,106	1.6311	32,794	24,313	3,332	80,697	1.1707	94,468	3,424
昨日 P/C	1.4477	今日增減變化	0.1834		昨日 P/C	1.1768	今日增減變化	-0.0062	

更新日期：2023年4月6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6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	93,564,468	61,374,071	32,190,397	11,985,647	2,058,083	813,661	1,244,422	102,030	
投信	32,791,265	51,841,218	-19,049,953	-1,542,443	424,779	0	424,779	-4,373	
自營商	43,198,664	18,595,653	24,603,011	-2,568,732	1,609,359	705,970	903,389	-124,145	
	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	547,310	1,346,873	-799,563	114,301	165,627	61,734	103,893	19,433	
投信	97,843	0	97,843	38	0	0	0	0	
自營商	226,262	206,387	19,875	9,180	228,866	334,265	-105,399	-40,547	

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6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	30,343	15,523	14,820	-545	26,490	32,825	-6,335	-4,450	
投信	150	50	100	0	200	119	81	0	
自營商	46,984	41,729	5,255	-8,539	50,728	34,867	15,861	-11,012	
特定法人(週)	340	0	340	---	0	1,947	-1,947	---	
特定法人(近月)	19,427	11,380	8,047	1,651	22,588	16,616	5,972	-443	
特定法人(全月)	22,272	10,164	12,108	-471	28,711	22,789	5,922	6,802	
十大交易人(週)	14,505	12,302	2,203	---	17,998	11,956	6,042	---	
十大交易人(近月)	42,630	36,335	6,295	1,797	37,772	45,275	-7,503	-1,167	
十大交易人(全月)	69,898	54,881	15,017	-5,682	62,273	66,366	-4,093	9,303	
全市場未沖銷(近月)			82,557	5,192			95,482	4,438	
全市場未沖銷(全月)			136,801	-36,816			156,830	-63,138	

更新日期：2023年4月6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04W2週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16100	買權OI最大量	16100
	賣權成交最大量	15700	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	13.04%	較前一交易日	+1.69%
	買權隱含波動率	10.13%	較前一交易日	-0.66%
	賣權隱含波動率	15.75%	較前一交易日	+3.93%
電子選擇權	買權成交最大量	770	買權OI最大量	770
	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	1560	買權OI最大量	1580
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年4月6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	16000
	賣權成交最大量	15600	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	14.60%	較前一交易日	+0.19%
	買權隱含波動率	11.68%	較前一交易日	-1.47%
	賣權隱含波動率	17.54%	較前一交易日	+1.11%
	成交量P/C_Ratio值	0.880	較前一交易日	-0.18
	未平倉P/C_Ratio值	1.157	較前一交易日	-0.02
電子選擇權	買權成交最大量	770	買權OI最大量	770
	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	1560	買權OI最大量	1580
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年4月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

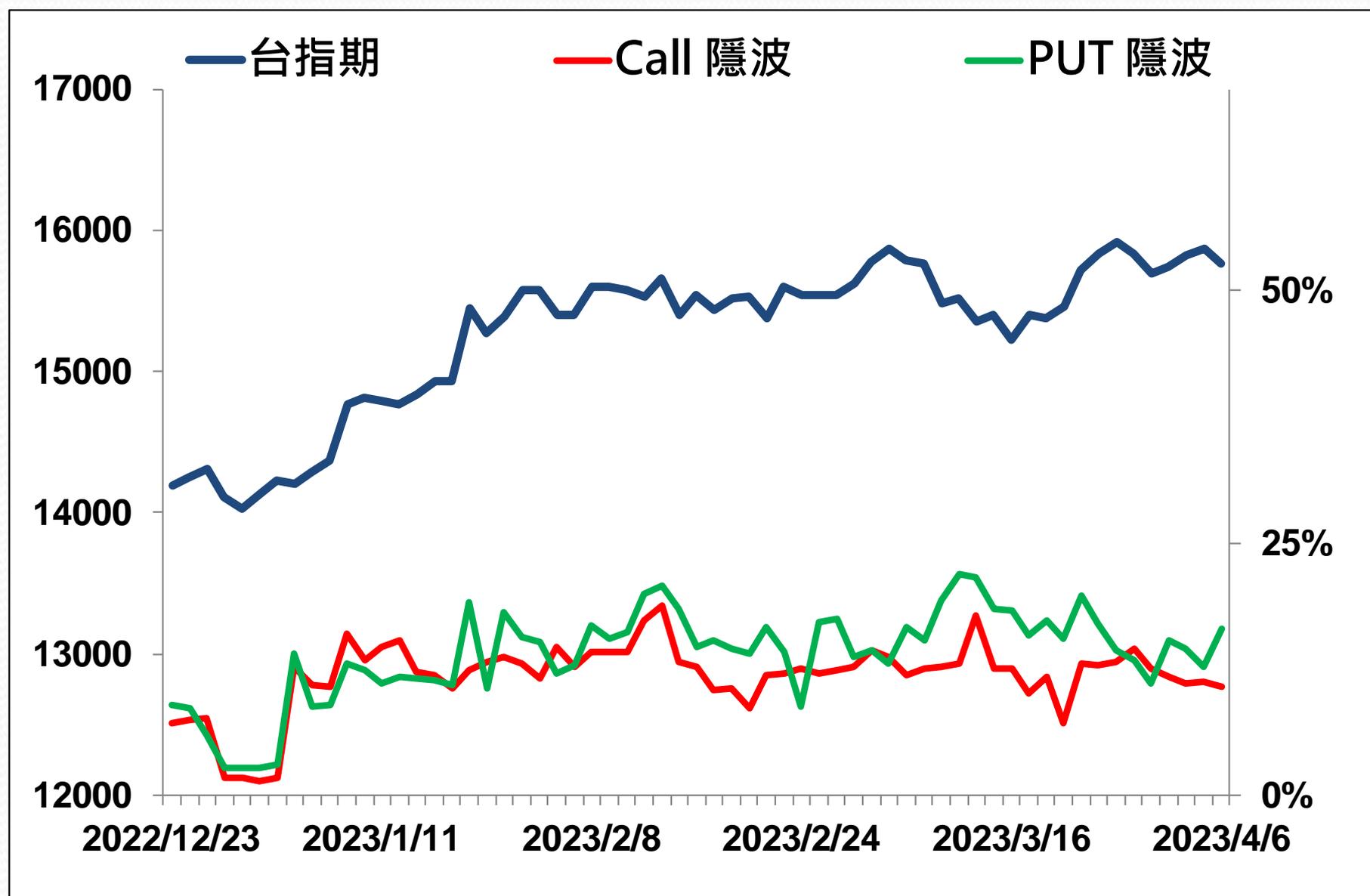
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



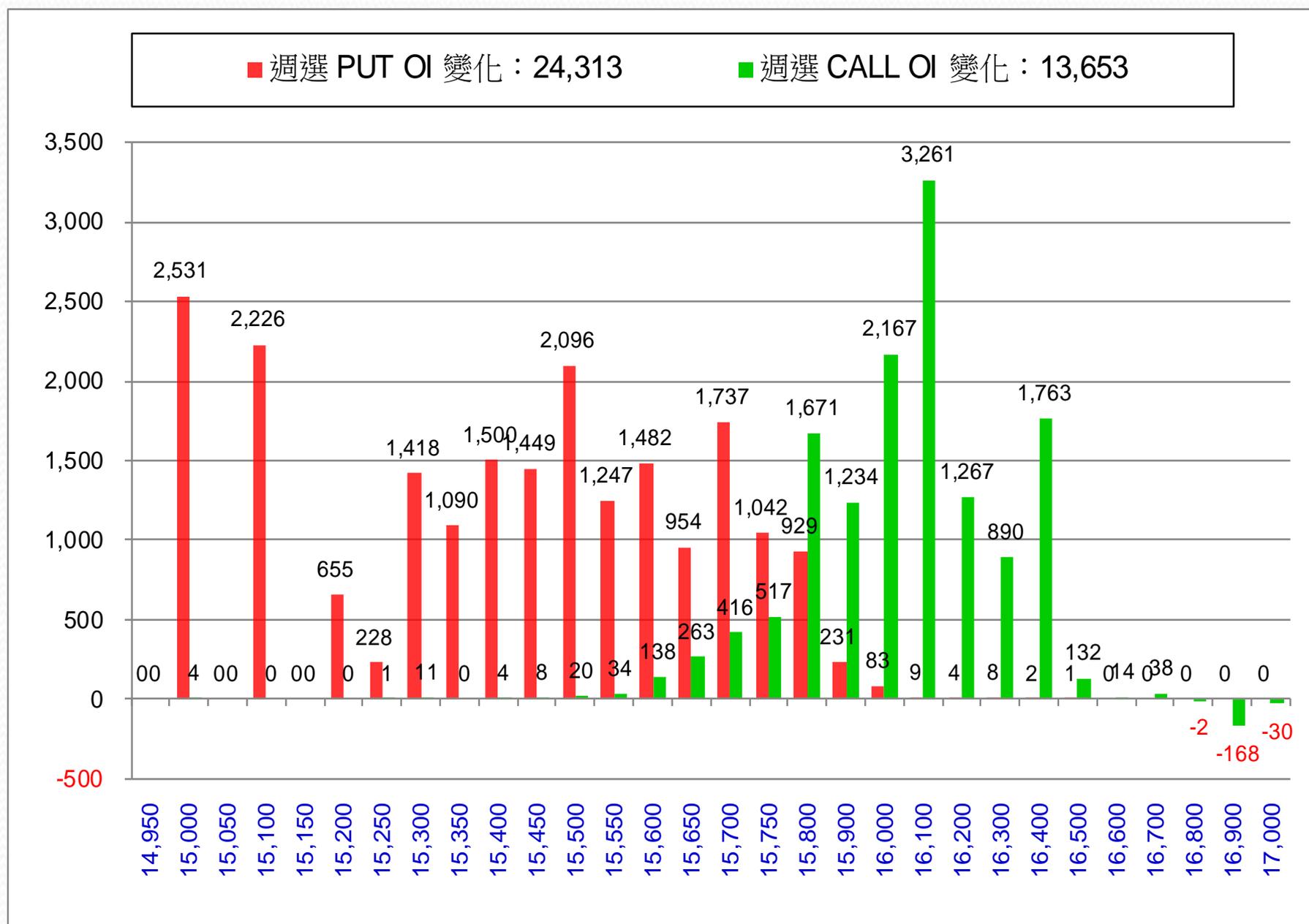
更新日期：2023年4月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



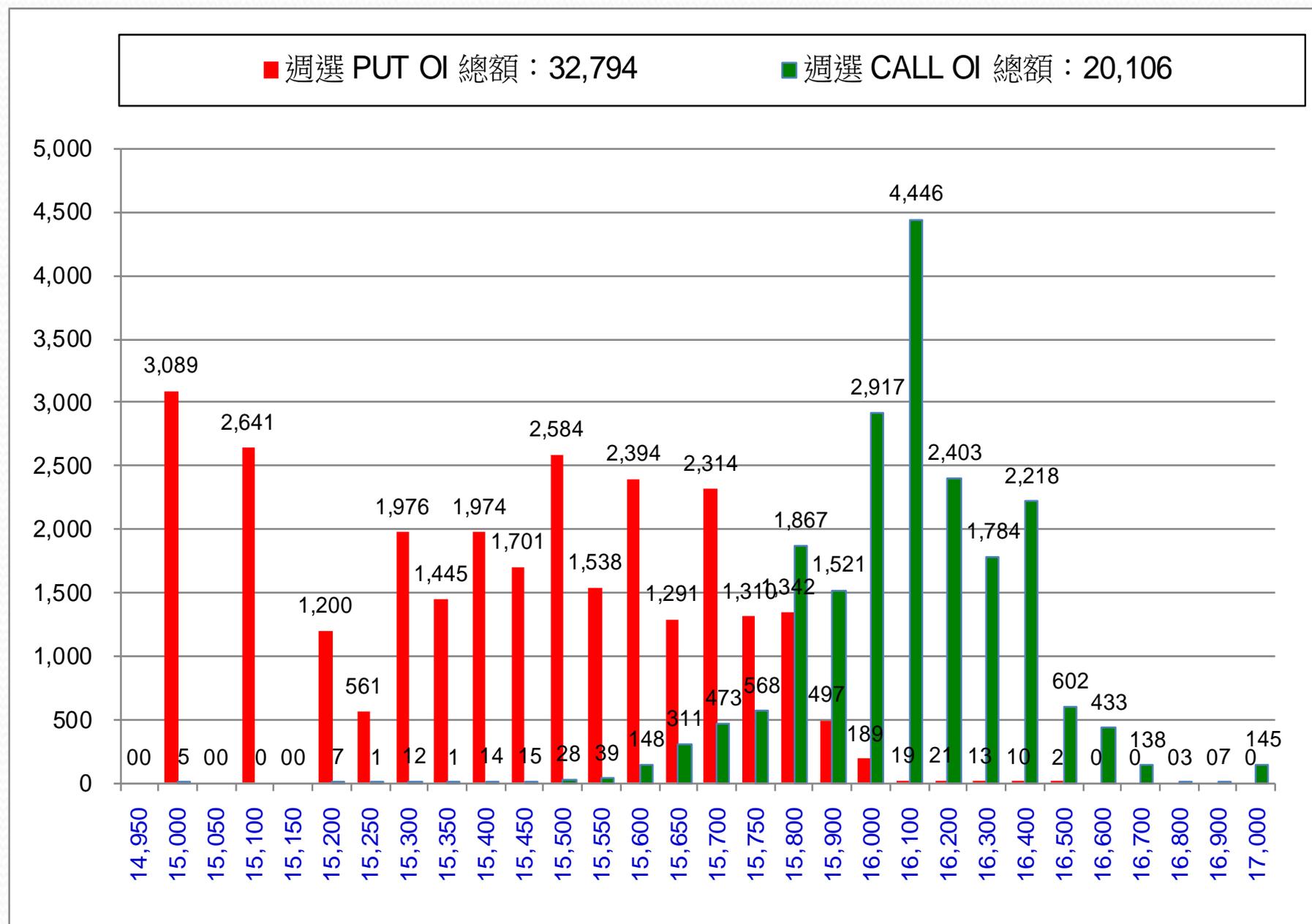
更新日期：2023年4月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年4月6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



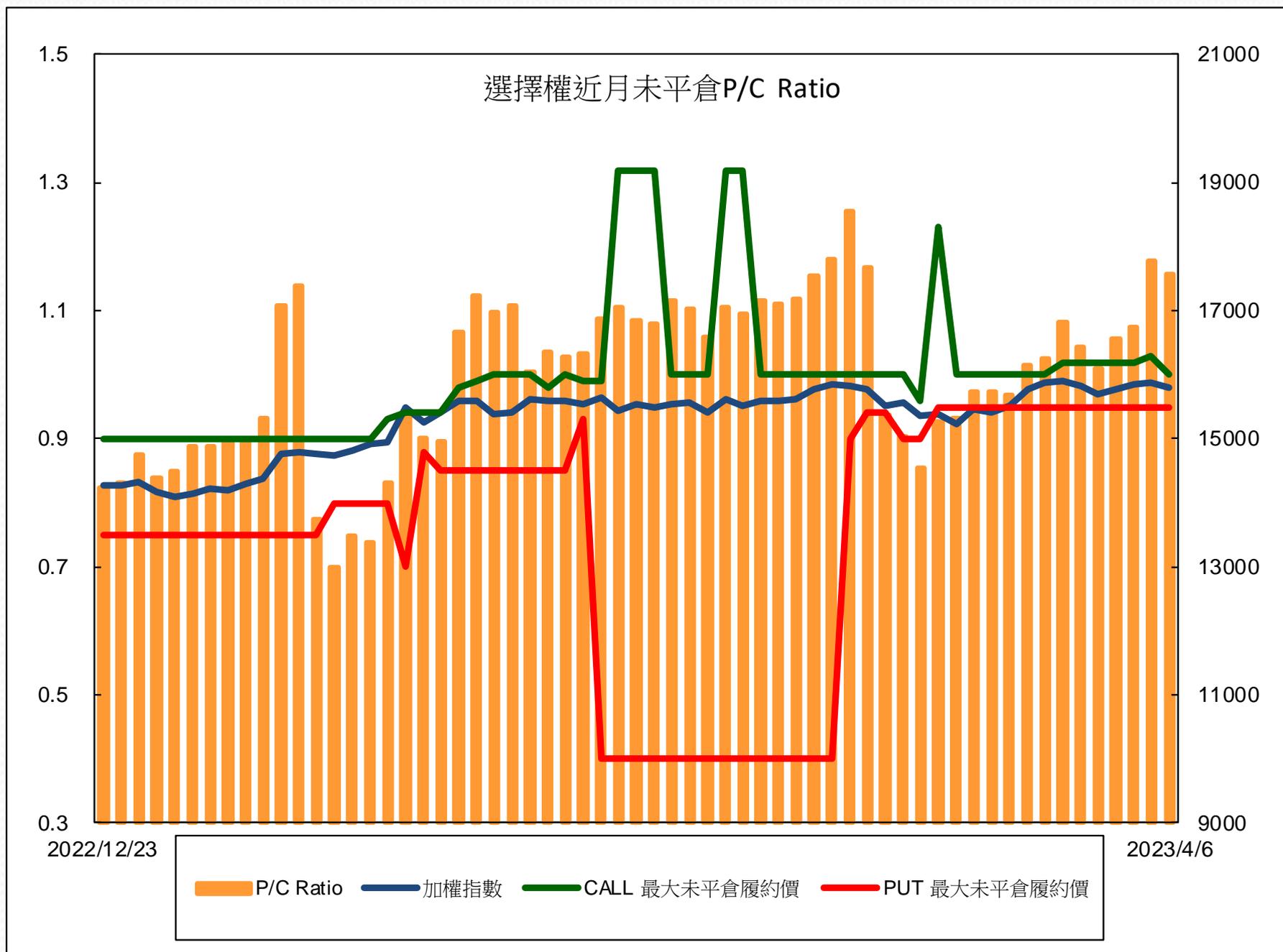
更新日期：2023年4月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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31日	56,016	42,222	13,794
	4月6日	46,984	41,729	5,255
Put	3月31日	68,415	41,542	26,873
	4月6日	50,728	34,867	15,861

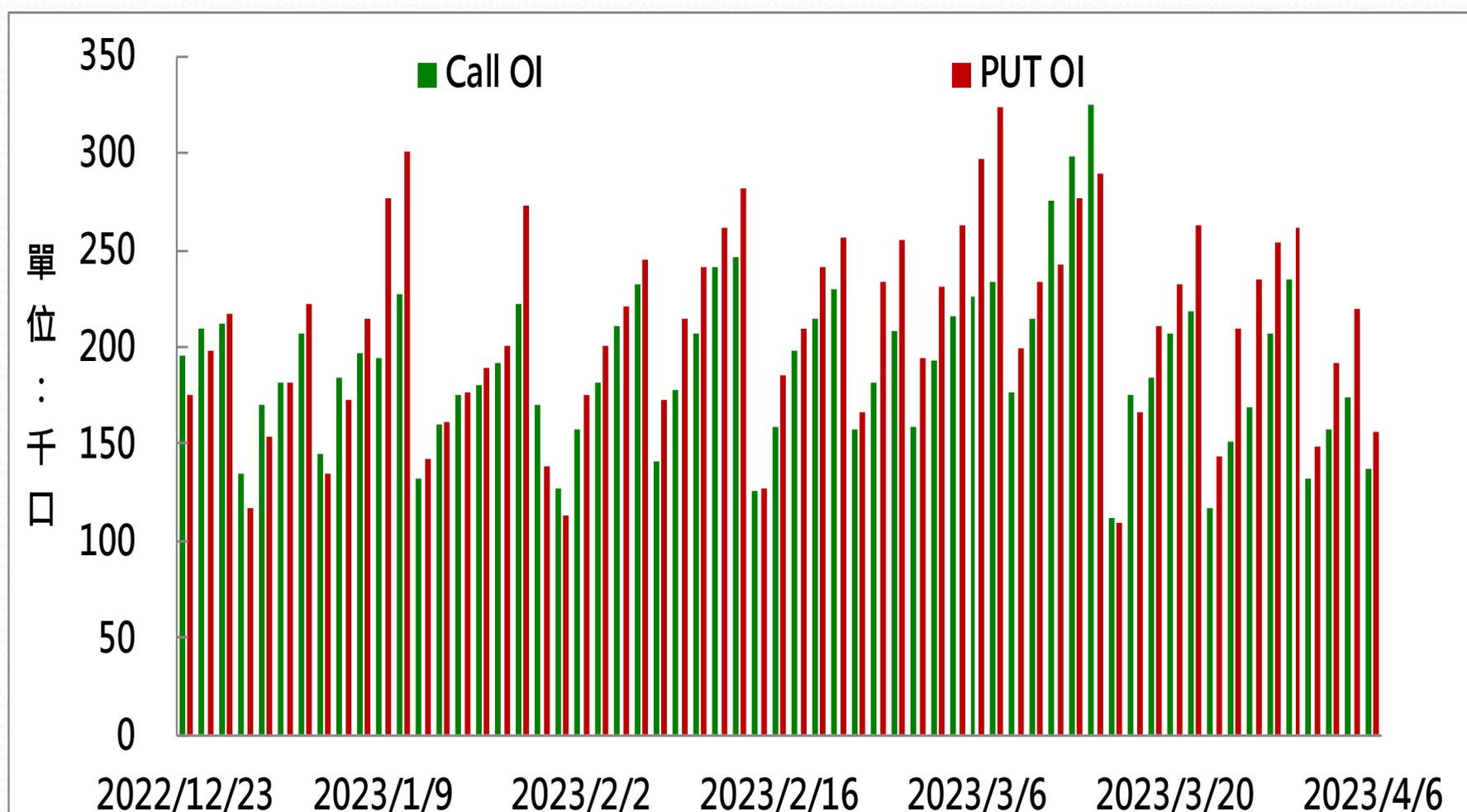
更新日期：2023年4月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年4月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

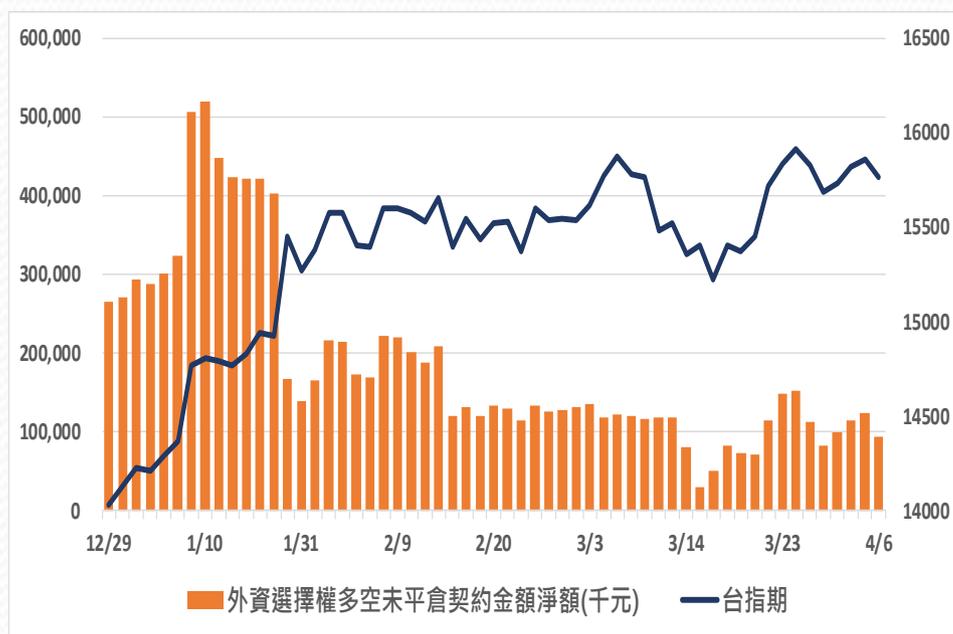
選擇權全月Put Call OI



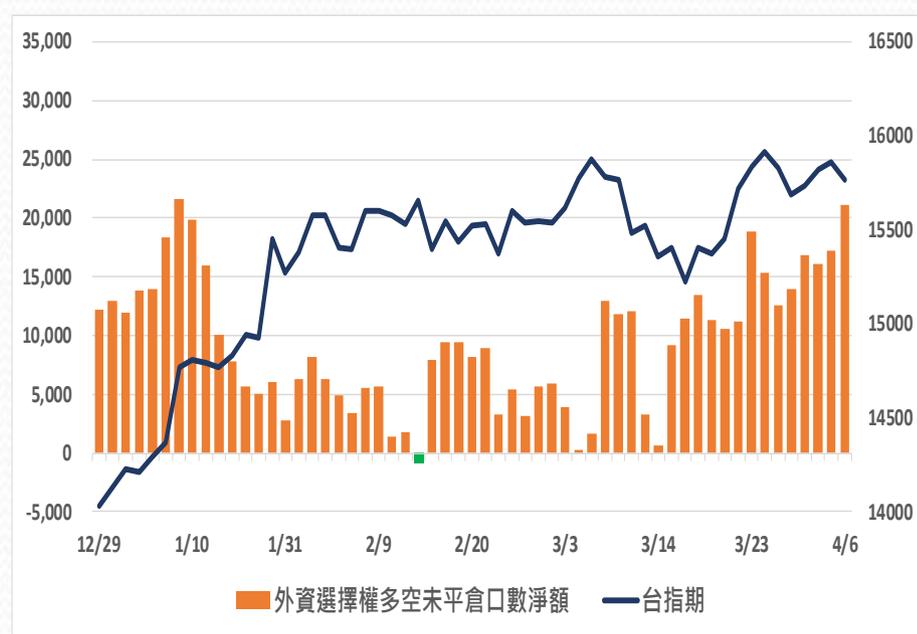
更新日期：2023年4月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



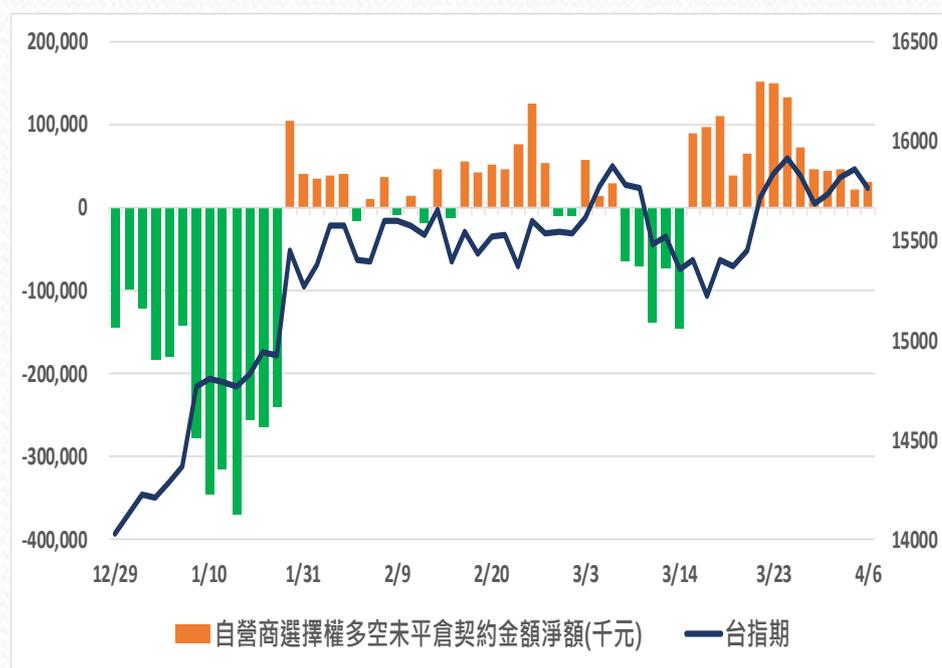
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/28	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
2023/4/6	15762	21,155	+3,905	94,380	-30,392

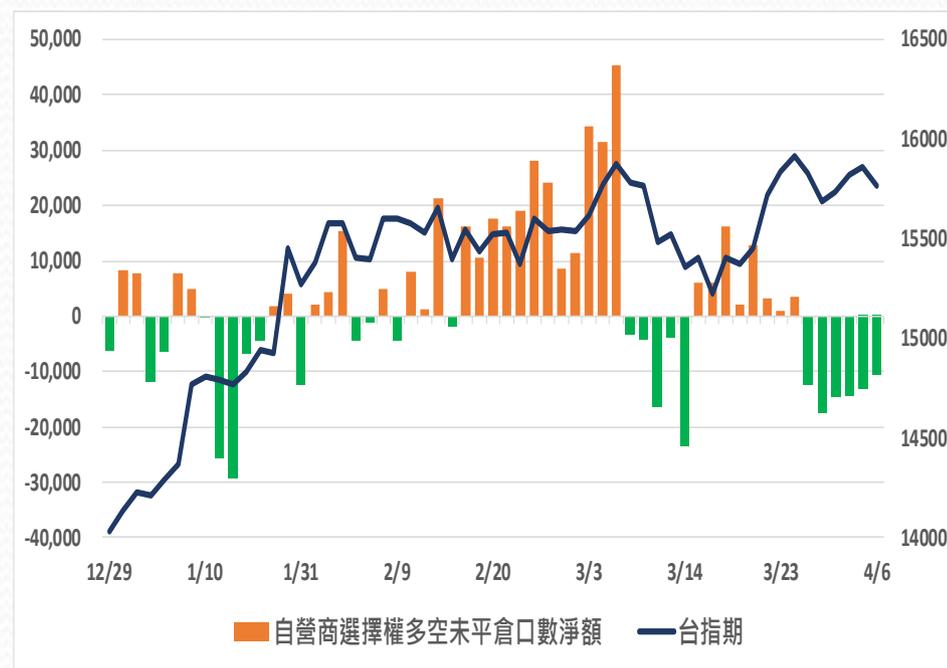
更新日期：2023年4月6日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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
2023/3/28	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
2023/4/6	15762	-10,606	+2,473	32,125	+10,444

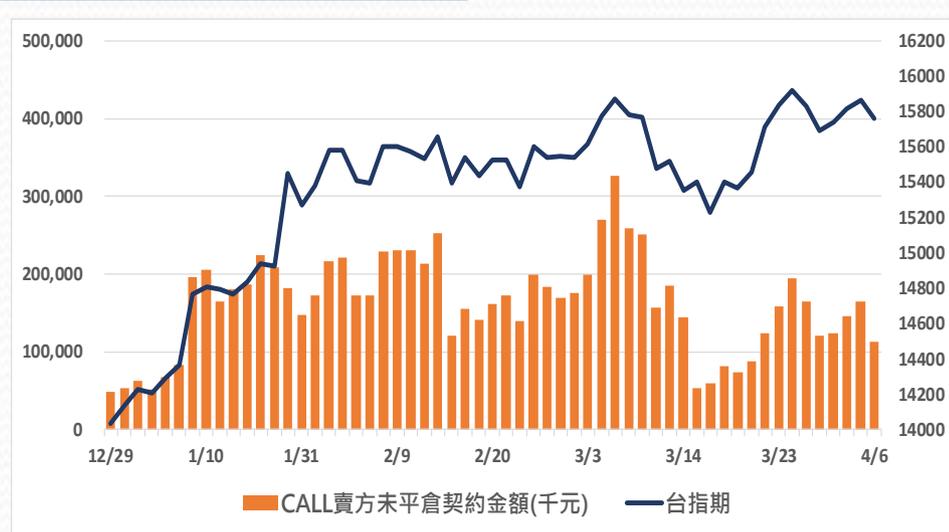
更新日期：2023年4月6日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

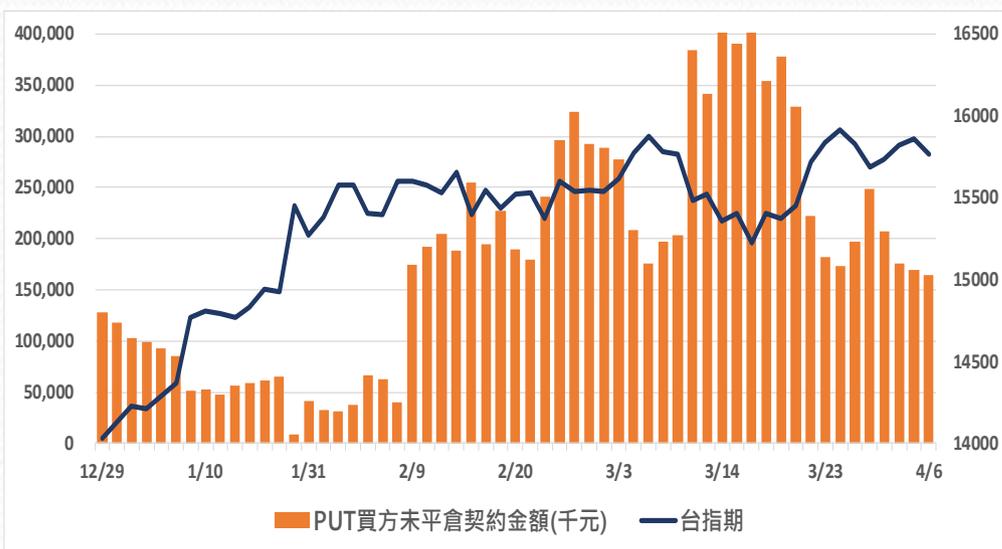
CALL買方未平倉金額



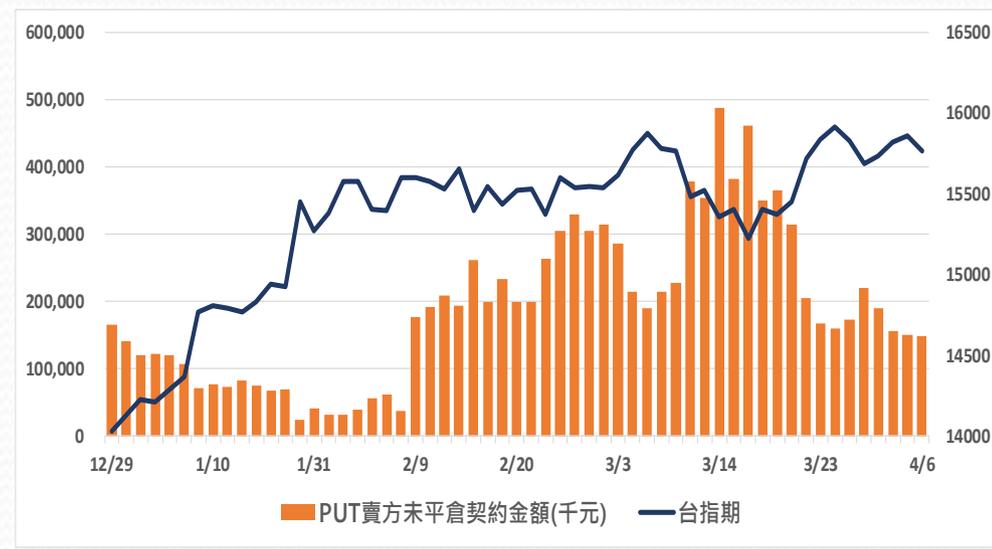
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



PUT賣方未平倉金額



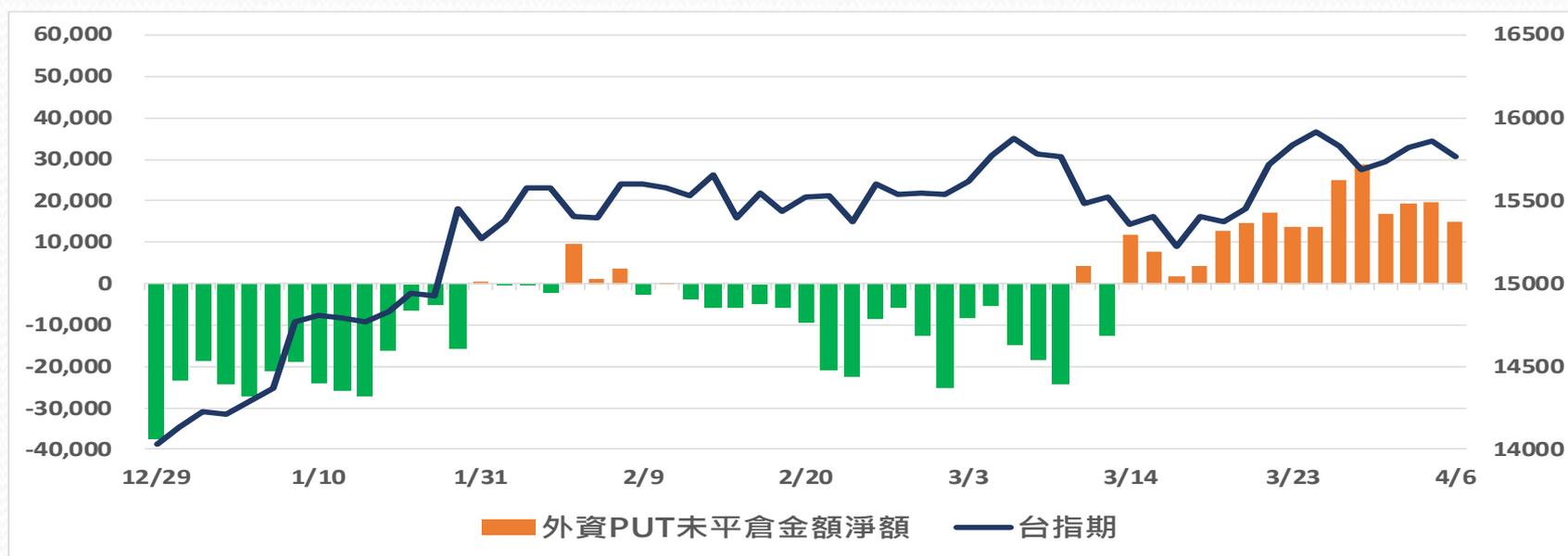
更新日期：2023年4月6日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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6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6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