

台指選擇權OI匯報

日期：2023/4/7 結算日：2023/4/12					日期：2023/4/7 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
1	1	15,100	2,787	146	-1	43	14,500	3,429	-139
6	13	15,200	2,359	1,159	0	70	14,600	2,787	-31
0	12	15,300	3,025	1,049	0	63	14,700	3,333	-50
0	1	15,350	2,933	1,488	0	87	14,800	7,051	-78
2	16	15,400	4,663	2,689	2	90	14,900	3,395	-1,262
-3	12	15,450	3,991	2,290	-1	128	15,000	10,040	1,119 ※
41	69	15,500	4,445	1,861	3	327	15,100	4,573	832
50	89	15,550	4,227	2,689	-6	1,683	15,200	5,849	638
187	335	15,600	5,388	2,994	-14	1,909	15,300	5,109	-386
-80	231	15,650	3,743	2,452	-24	1,777	15,400	7,043	520
493	966	15,700	5,482	3,168 ※	-9	3,257	15,500	10,663	48
149	717	15,750	3,177	1,867	-71	2,729	15,600	2,725	9
1,145	3,012	15,800	4,021	2,679	-140	2,676	15,700	2,313	325
1,619	2,703	15,850	1,943	1,302	-53	3,809	15,800	2,367	26
2,449	3,970	15,900	1,007	510	-75	3,681	15,900	850	81
1,907	3,714	15,950	570	318	45	7,335	16,000	854	60
3,021	5,938	16,000	539	350	249	7,115	16,100	422	24
※ 3,953	7,528	16,050	199	163	322	6,887	16,200	355	4
2,298	6,744	16,100	72	53	※ 347	7,411	16,300	152	-17
1,834	3,379	16,150	50	1	-43	5,659	16,400	61	-9
1,871	4,274	16,200	22	1	-281	5,637	16,500	22	0
643	1,666	16,250	2	2	-8	2,836	16,600	39	1
885	2,669	16,300	26	13	15	1,234	16,700	39	0
160	2,378	16,400	24	14	11	2,331	16,800	4	0
71	673	16,500	1	-1	-19	880	16,900	1	0
-27	406	16,600	0	0	-16	1,225	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
22,729	51,868	1.2792	66,347	33,136	277	80,974	1.1865	96,076	1,608
昨日 P/C	1.6311	今日增減變化		-0.3519	昨日 P/C	1.1566	今日增減變化		0.0299

更新日期：2023年4月7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7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	93,324,308	61,970,531	31,353,777	-836,620	1,868,128	782,635	1,085,493	-158,929
投信	32,923,585	51,680,570	-18,756,985	292,968	425,801	0	425,801	1,022
自營商	43,602,945	18,311,107	25,291,838	688,827	1,817,128	770,640	1,046,488	143,099
	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	580,476	1,353,934	-773,458	26,105	172,778	112,154	60,624	-43,269
投信	98,022	0	98,022	179	0	0	0	0
自營商	245,056	217,491	27,565	7,690	274,309	334,928	-60,619	44,780

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7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	31,231	16,123	15,108	288	26,979	33,516	-6,537	-202	
投信	150	50	100	0	200	119	81	0	
自營商	52,205	42,603	9,602	4,347	58,378	42,508	15,870	9	
特定法人(週)	0	0	0	-340	0	1,947	-1,947	0	
特定法人(近月)	19,860	11,380	8,480	433	22,537	16,616	5,921	-51	
特定法人(全月)	22,705	10,483	12,222	114	28,939	22,789	6,150	228	
十大交易人(週)	17,678	15,189	2,489	286	26,581	21,364	5,217	-825	
十大交易人(近月)	42,711	35,974	6,737	442	38,354	46,419	-8,065	-562	
十大交易人(全月)	74,382	57,762	16,620	1,603	69,082	77,832	-8,750	-4,657	
全市場未沖銷(近月)			84,386	1,829			99,190	3,708	
全市場未沖銷(全月)			164,964	28,163			197,448	40,618	

更新日期：2023年4月7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	15800	買權OI最大量	16050
	賣權成交最大量	15800	賣權OI最大量	15700
	整體隱含波動率	11.11%	較前一交易日	-1.93%
	買權隱含波動率	9.91%	較前一交易日	-0.22%
	賣權隱含波動率	12.15%	較前一交易日	-3.60%
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	730	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1540	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4月7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	16300
	賣權成交最大量	15500	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	13.97%	較前一交易日	+0.62%
	買權隱含波動率	11.75%	較前一交易日	+0.07%
	賣權隱含波動率	15.77%	較前一交易日	-1.77%
	成交量P/C_Ratio值	1.197	較前一交易日	+0.32
	未平倉P/C_Ratio值	1.175	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	730	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1540	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4月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

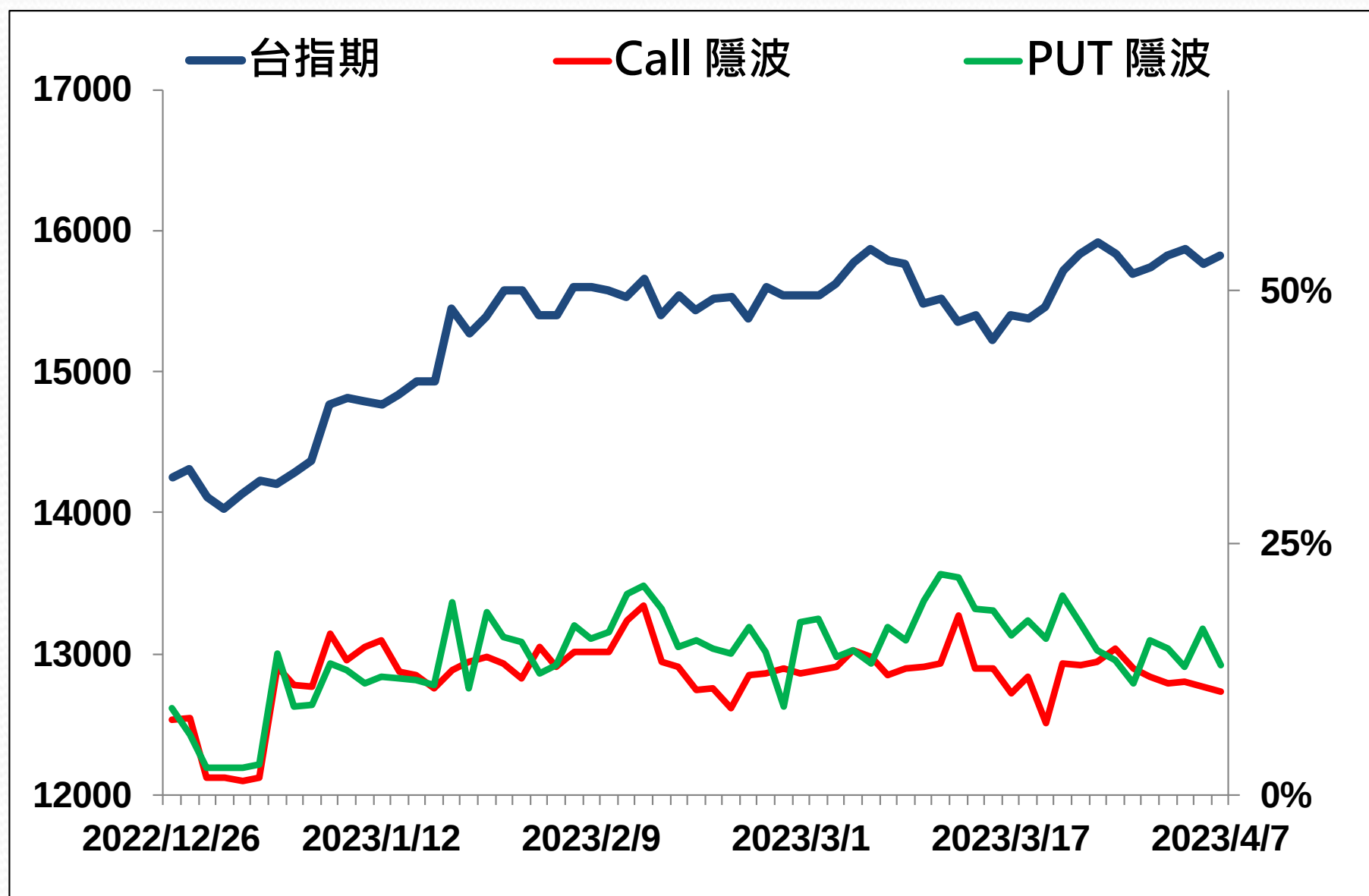
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



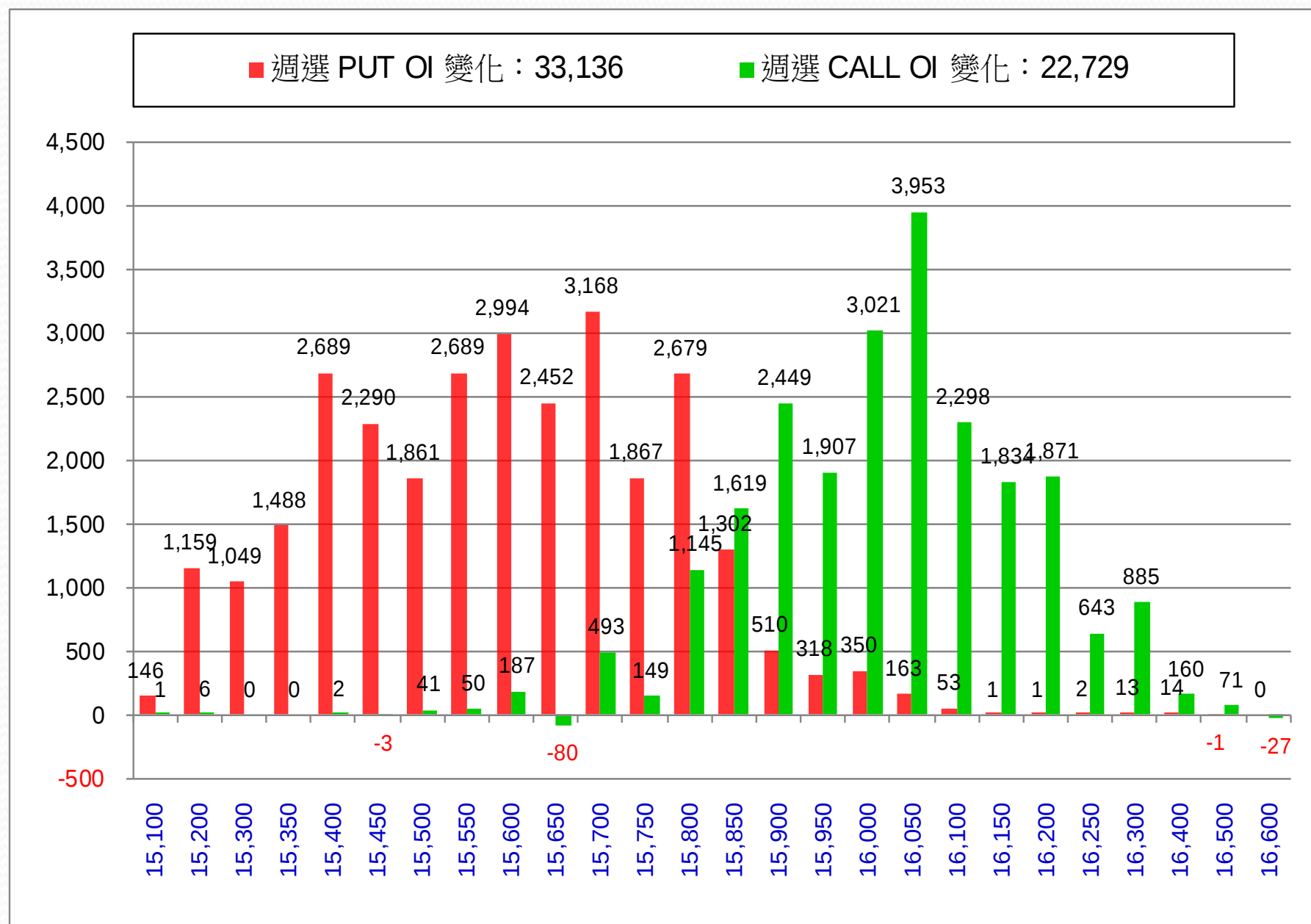
更新日期：2023年4月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



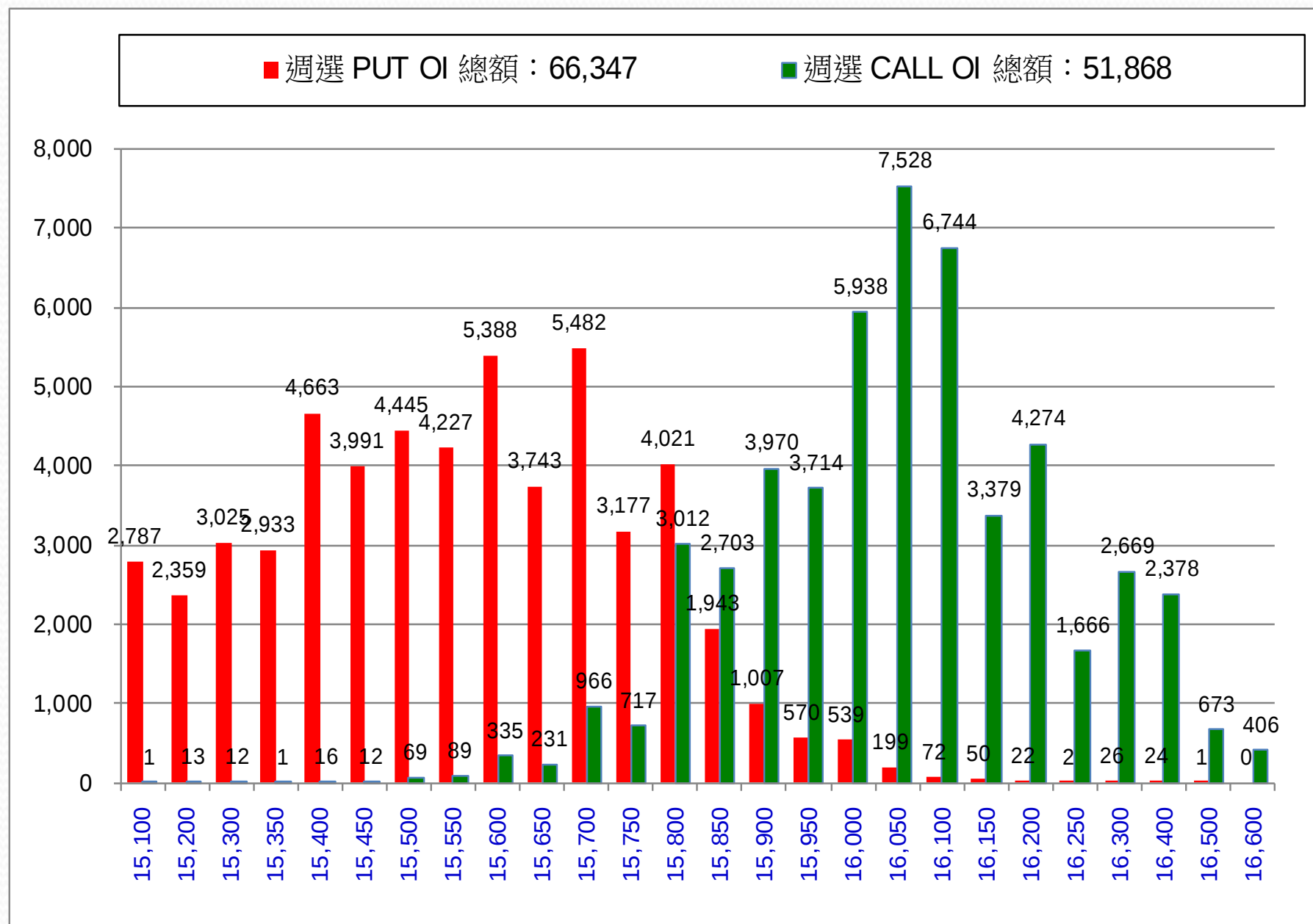
更新日期：2023年4月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年4月7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



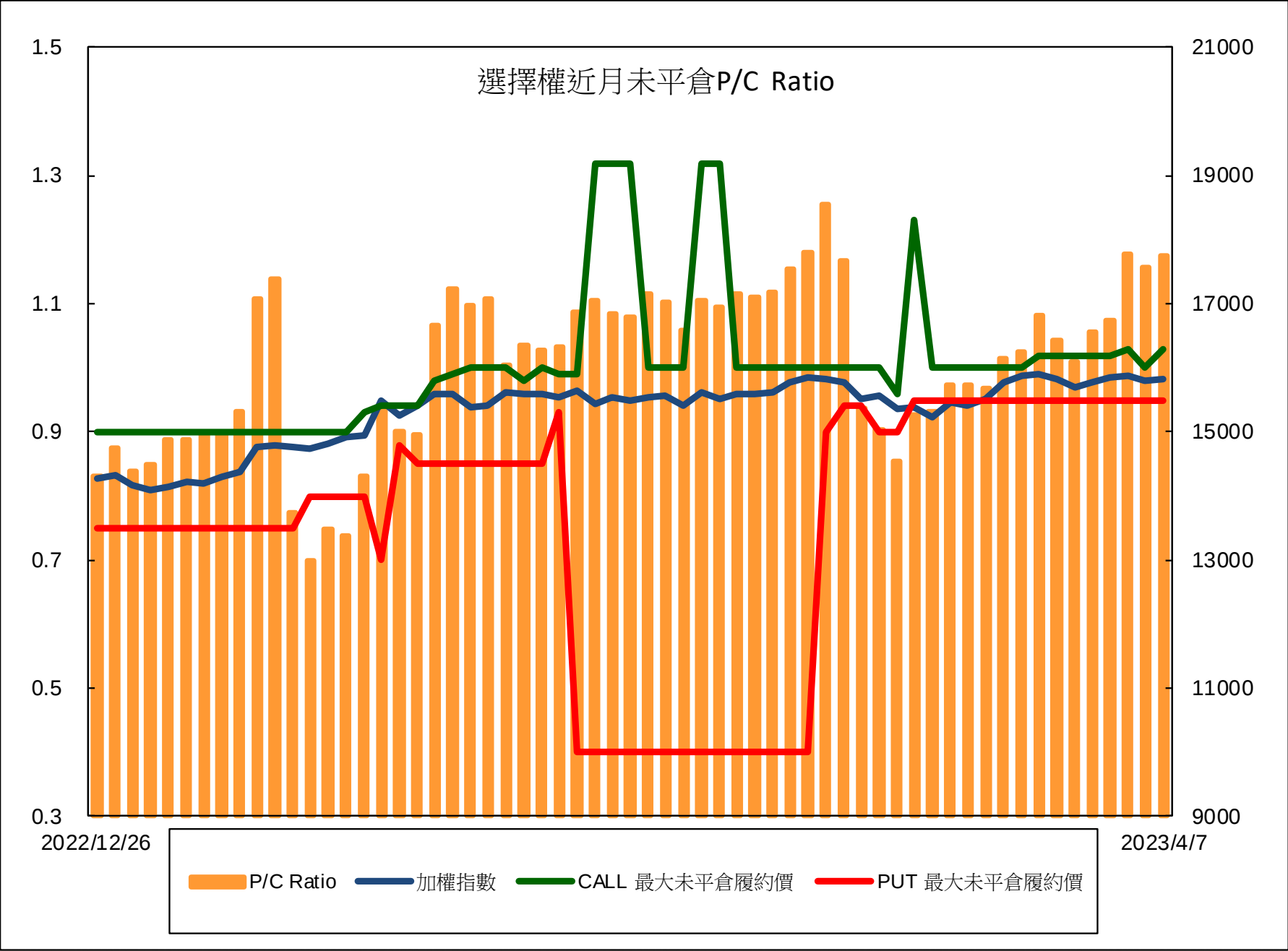
更新日期：2023年4月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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6日	46,984	41,729	5,255
	4月7日	52,205	42,603	9,602
Put	4月6日	50,728	34,867	15,861
	4月7日	58,378	42,508	15,870

更新日期：2023年4月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

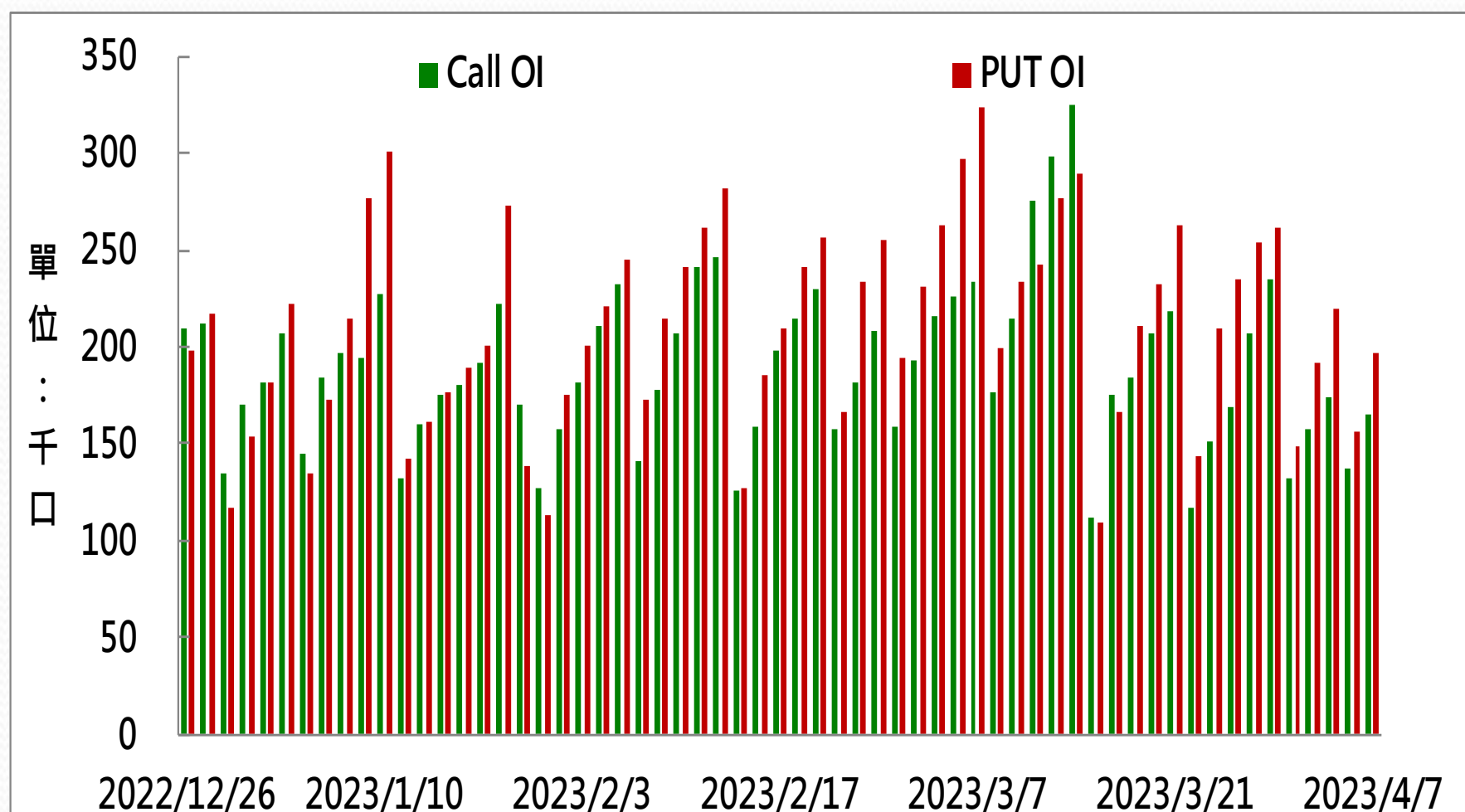
選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年4月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理



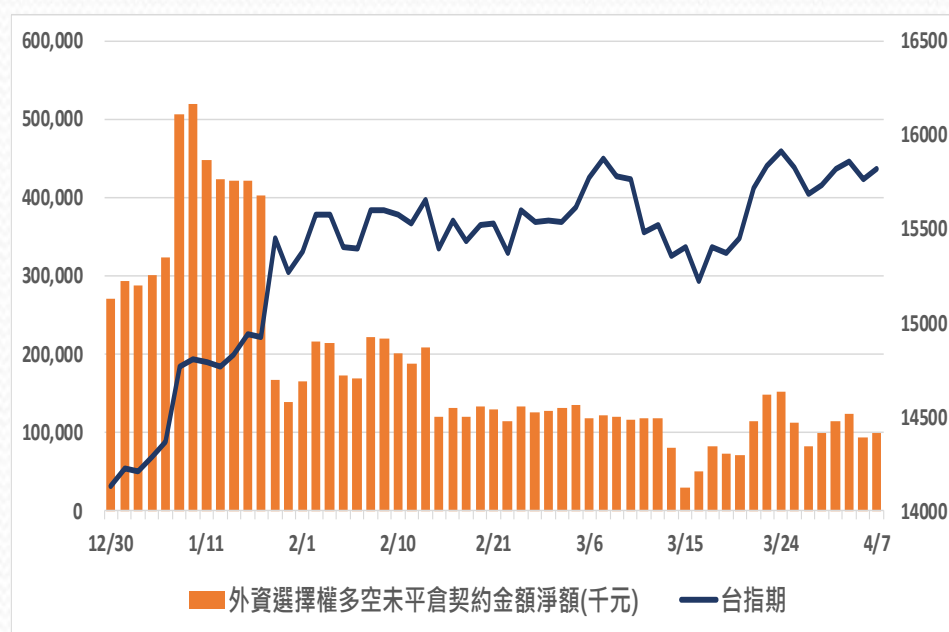
選擇權全月Put Call OI



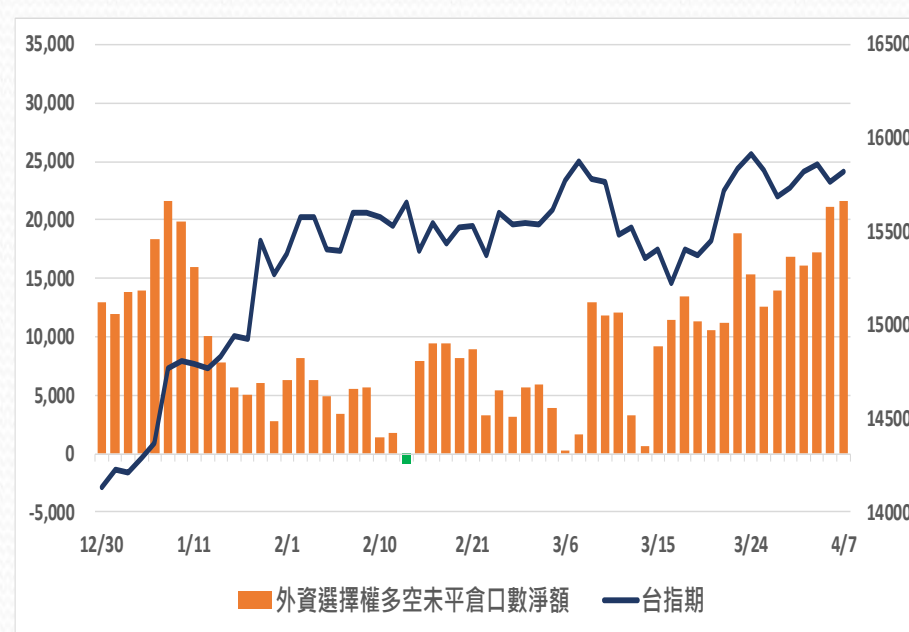
更新日期：2023年4月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



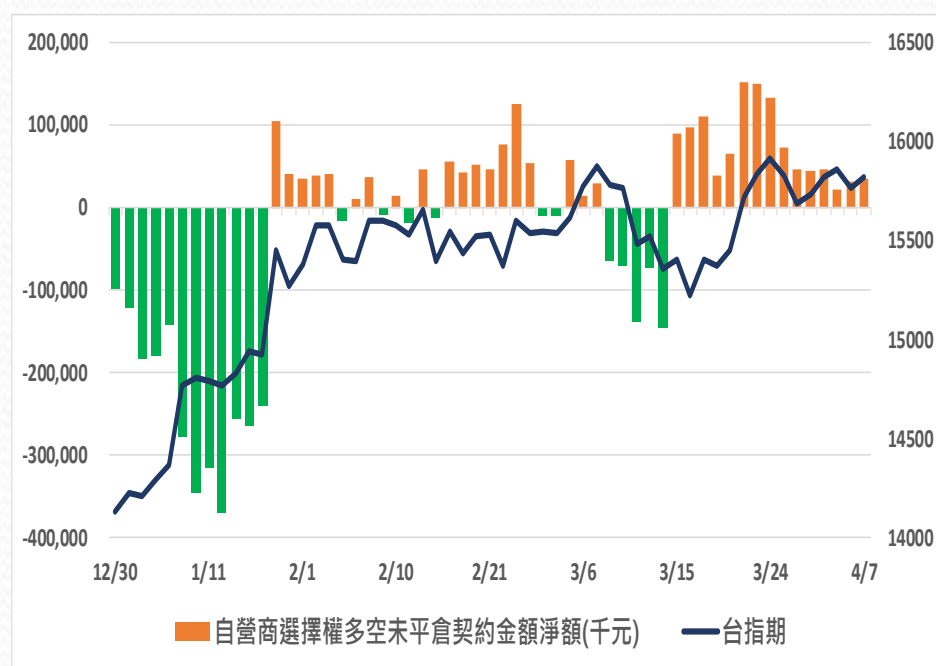
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/29	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
2023/4/7	15818	21,645	+490	99,127	+4,747

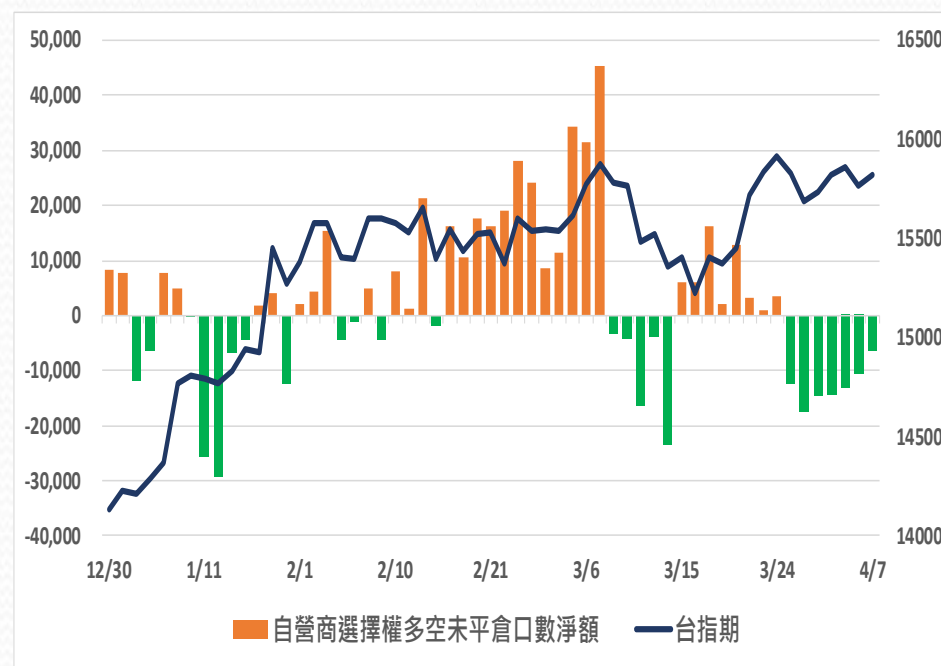
更新日期：2023年4月7日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



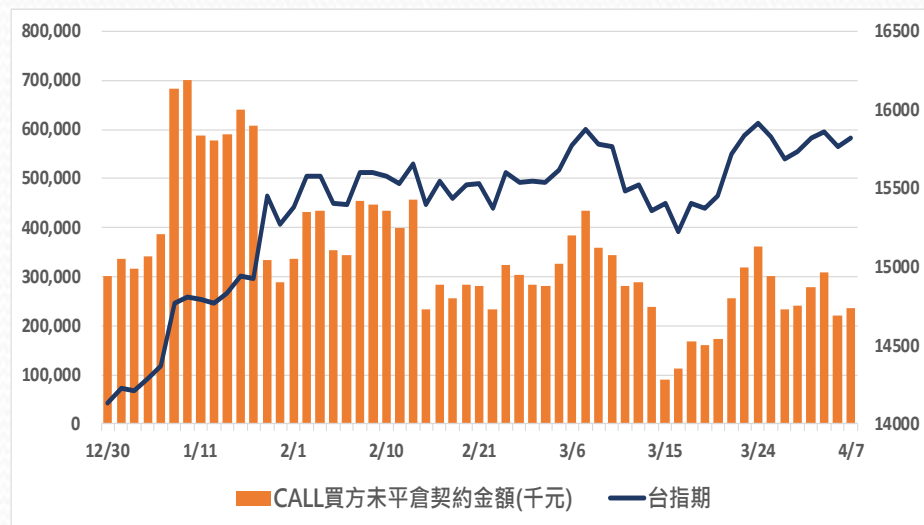
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/29	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
2023/4/7	15818	-6,268	+4,338	35,652	+3,527

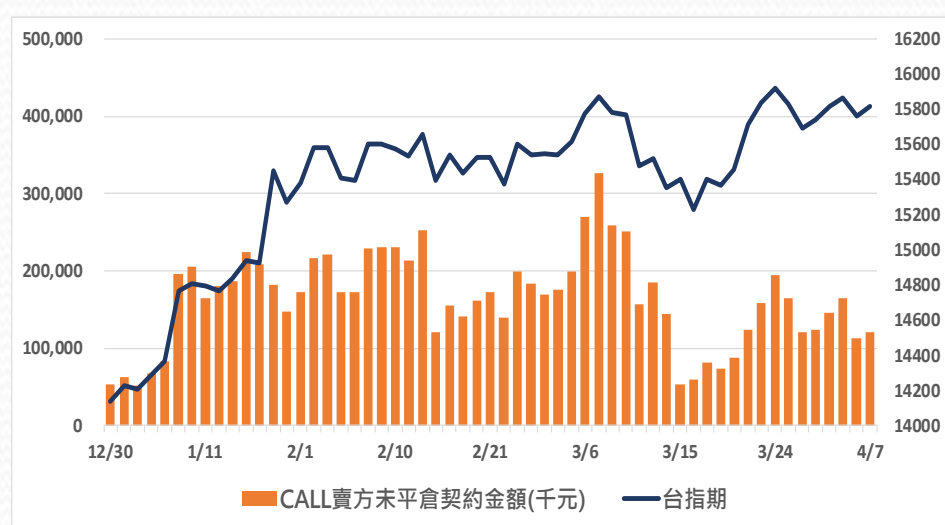
更新日期：2023年4月7日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

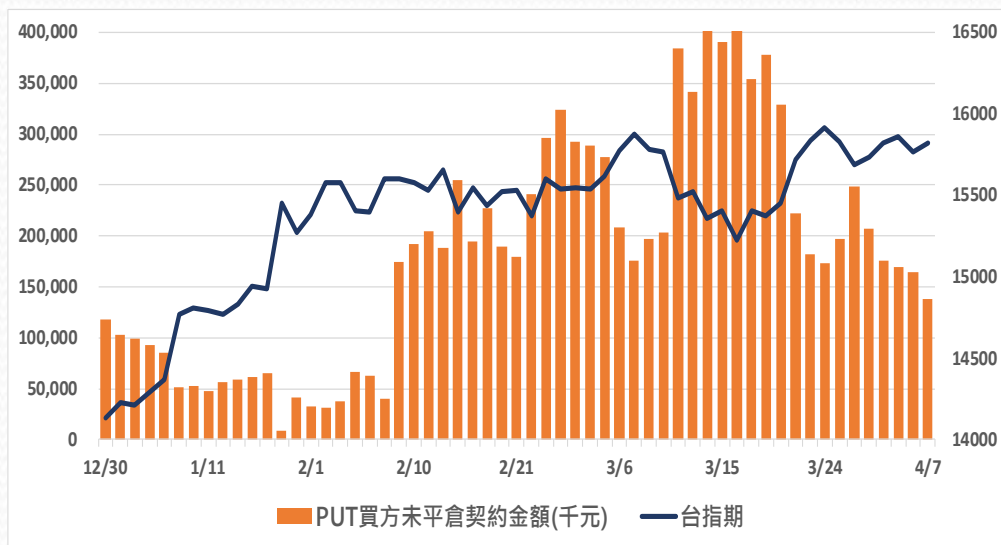
CALL買方未平倉金額



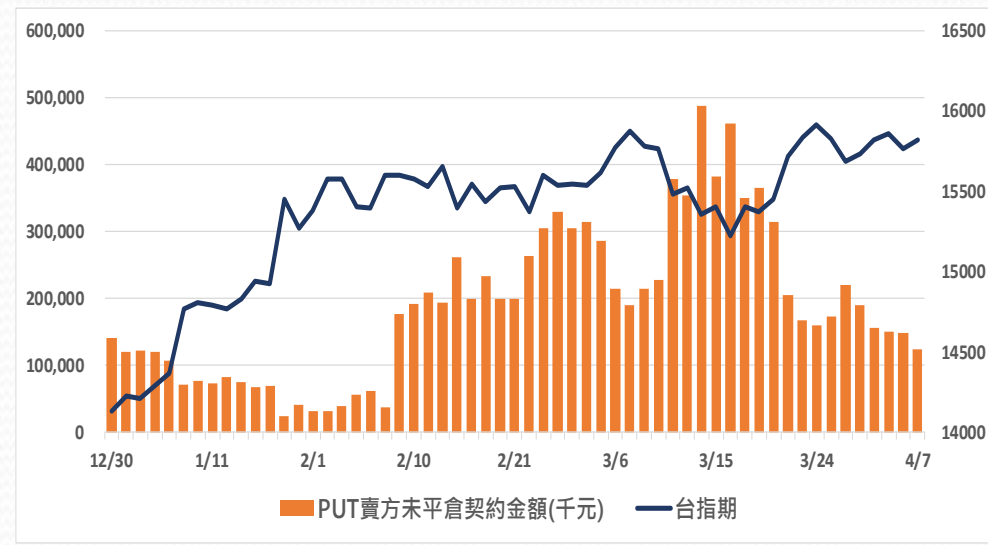
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



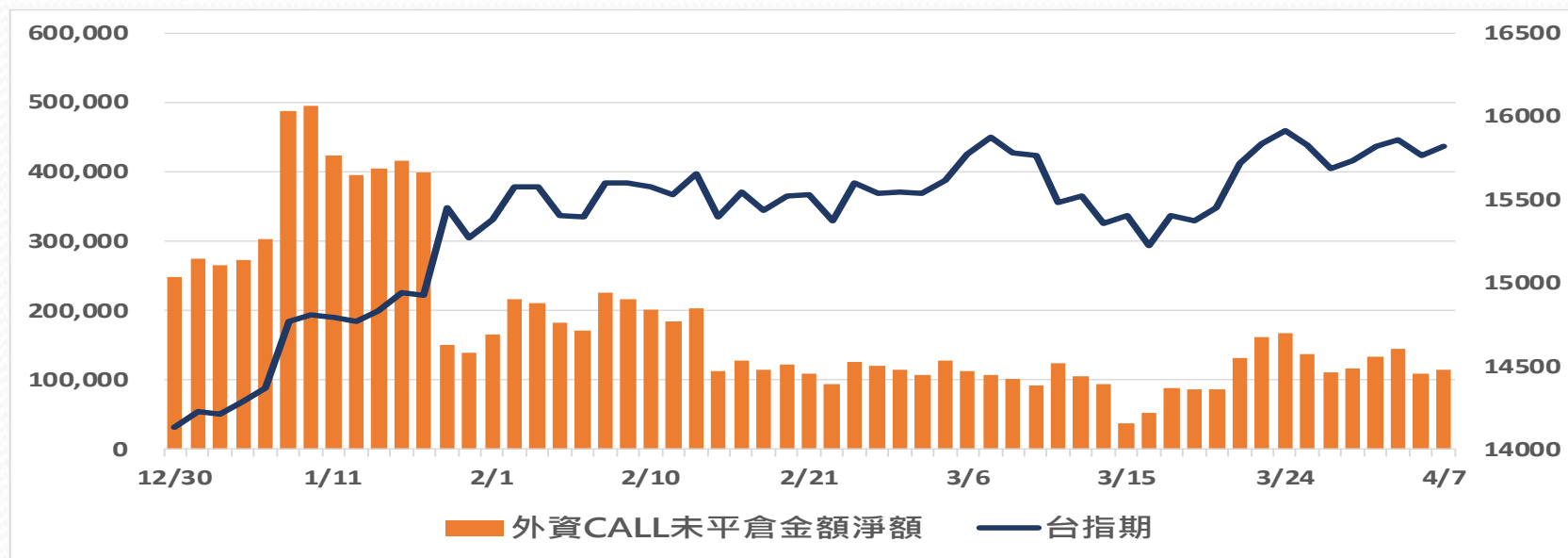
PUT賣方未平倉金額



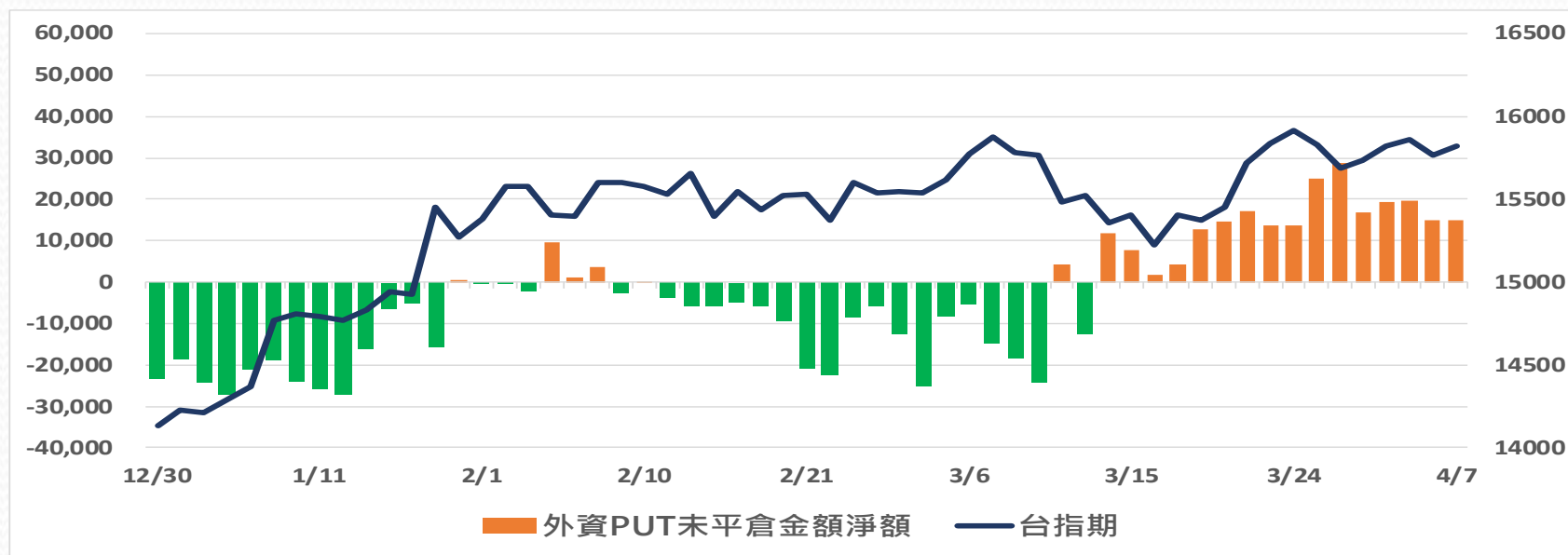
更新日期：2023年4月7日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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7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7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