

台指選擇權OI匯報

日期：2023/4/10 結算日：2023/4/12					日期：2023/4/10 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	13	15,200	2,031	-328	0	70	14,600	2,751	-36
0	12	15,300	3,062	37	0	63	14,700	3,252	-81
0	1	15,350	2,657	-276	0	87	14,800	7,127	76
9	25	15,400	3,954	-709	0	90	14,900	3,073	-322
-1	11	15,450	3,722	-269	-1	127	15,000	9,140	-900
-10	59	15,500	6,627	2,182	0	327	15,100	3,528	-1,045
10	99	15,550	4,439	212	0	1,683	15,200	6,078	229
-44	291	15,600	6,779	1,391	21	1,930	15,300	5,725	616
81	312	15,650	7,007	3,264	-11	1,766	15,400	7,008	-35
105	1,071	15,700	7,499	2,017	2	3,259	15,500	11,791	1,128 ※
153	870	15,750	5,790	2,613	-53	2,676	15,600	3,449	724
646	3,658	15,800	7,391	3,370 ※	-44	2,632	15,700	3,056	743
441	3,144	15,850	4,296	2,353	-164	3,645	15,800	3,082	715
1,585	5,555	15,900	2,765	1,758	-59	3,622	15,900	1,153	303
1,201	4,915	15,950	1,178	608	-32	7,303	16,000	876	22
※ 3,592	9,530	16,000	926	387	※ 1,126	8,241	16,100	464	42
3,009	10,537	16,050	262	63	967	7,854	16,200	376	21
2,441	9,185	16,100	195	123	172	7,583	16,300	167	15
1,474	4,853	16,150	70	20	75	5,734	16,400	64	3
524	4,798	16,200	19	-3	498	6,135	16,500	39	17
815	2,481	16,250	2	0	61	2,897	16,600	45	6
490	3,159	16,300	24	-2	31	1,265	16,700	39	0
8	2,386	16,400	24	0	35	2,366	16,800	4	0
-9	664	16,500	1	0	23	903	16,900	1	0
-17	389	16,600	0	0	-2	1,223	17,000	1	0
0	187	16,700	0	0	-5	323	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
16,553	68,421	1.2468	85,305	18,958	2,330	83,304	1.1766	98,018	1,942
昨日 P/C	1.2792	今日增減變化		-0.0324	昨日 P/C	1.1754	今日增減變化		0.0012

更新日期：2023年4月10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10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	98,128,058	63,432,668	34,695,390	3,341,613	1,958,608	968,806	989,802	-95,691	
投信	33,157,122	51,782,047	-18,624,925	132,060	425,915	0	425,915	114	
自營商	44,711,293	17,642,788	27,068,505	1,776,667	1,991,570	812,837	1,178,733	132,245	
	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	586,511	1,383,921	-797,410	-23,952	155,509	120,443	35,066	-25,558	
投信	98,522	0	98,522	500	0	0	0	0	
自營商	301,722	201,661	100,061	72,496	307,954	336,917	-28,963	31,656	

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10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	33,267	16,791	16,476	1,368	31,349	35,487	-4,138	2,399	
投信	150	50	100	0	200	119	81	0	
自營商	57,200	46,723	10,477	875	61,409	45,248	16,161	291	
特定法人(週)	800	0	800	800	0	2,851	-2,851	-904	
特定法人(近月)	20,060	11,418	8,642	162	23,453	18,873	4,580	-1,341	
特定法人(全月)	24,105	10,597	13,508	1,286	30,005	24,692	5,313	-837	
十大交易人(週)	22,576	19,964	2,612	123	31,437	23,511	7,926	2,709	
十大交易人(近月)	44,441	37,097	7,344	607	40,809	47,919	-7,110	955	
十大交易人(全月)	80,877	59,605	21,272	4,652	72,146	81,438	-9,292	-542	
全市場未沖銷(近月)			87,812	3,426			102,878	3,688	
全市場未沖銷(全月)			186,562	21,598			222,006	24,558	

更新日期：2023年4月10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	16000	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	11.45%	較前一交易日	+0.34%
	買權隱含波動率	10.02%	較前一交易日	+0.10%
	賣權隱含波動率	12.70%	較前一交易日	+0.54%
電子選擇權	買權成交最大量	745	買權OI最大量	770
	賣權成交最大量	750	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	1460	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年4月10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	16100
	賣權成交最大量	15500	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	14.14%	較前一交易日	-0.17%
	買權隱含波動率	11.61%	較前一交易日	-0.14%
	賣權隱含波動率	16.24%	較前一交易日	+0.48%
	成交量P/C_Ratio值	1.242	較前一交易日	+0.05
	未平倉P/C_Ratio值	1.172	較前一交易日	-0.00
電子選擇權	買權成交最大量	745	買權OI最大量	770
	賣權成交最大量	750	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	1460	賣權OI最大量	1540

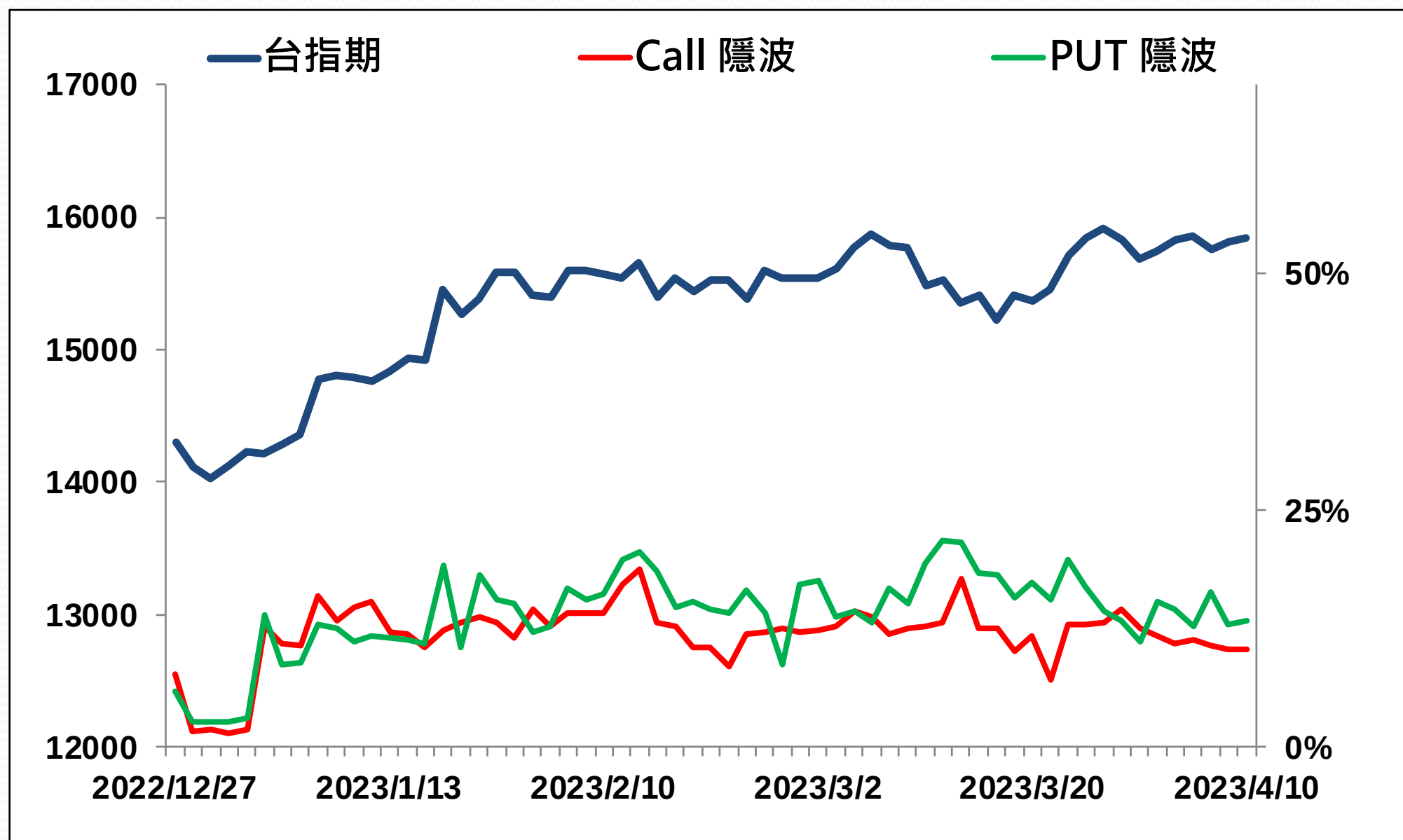
更新日期：2023年4月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



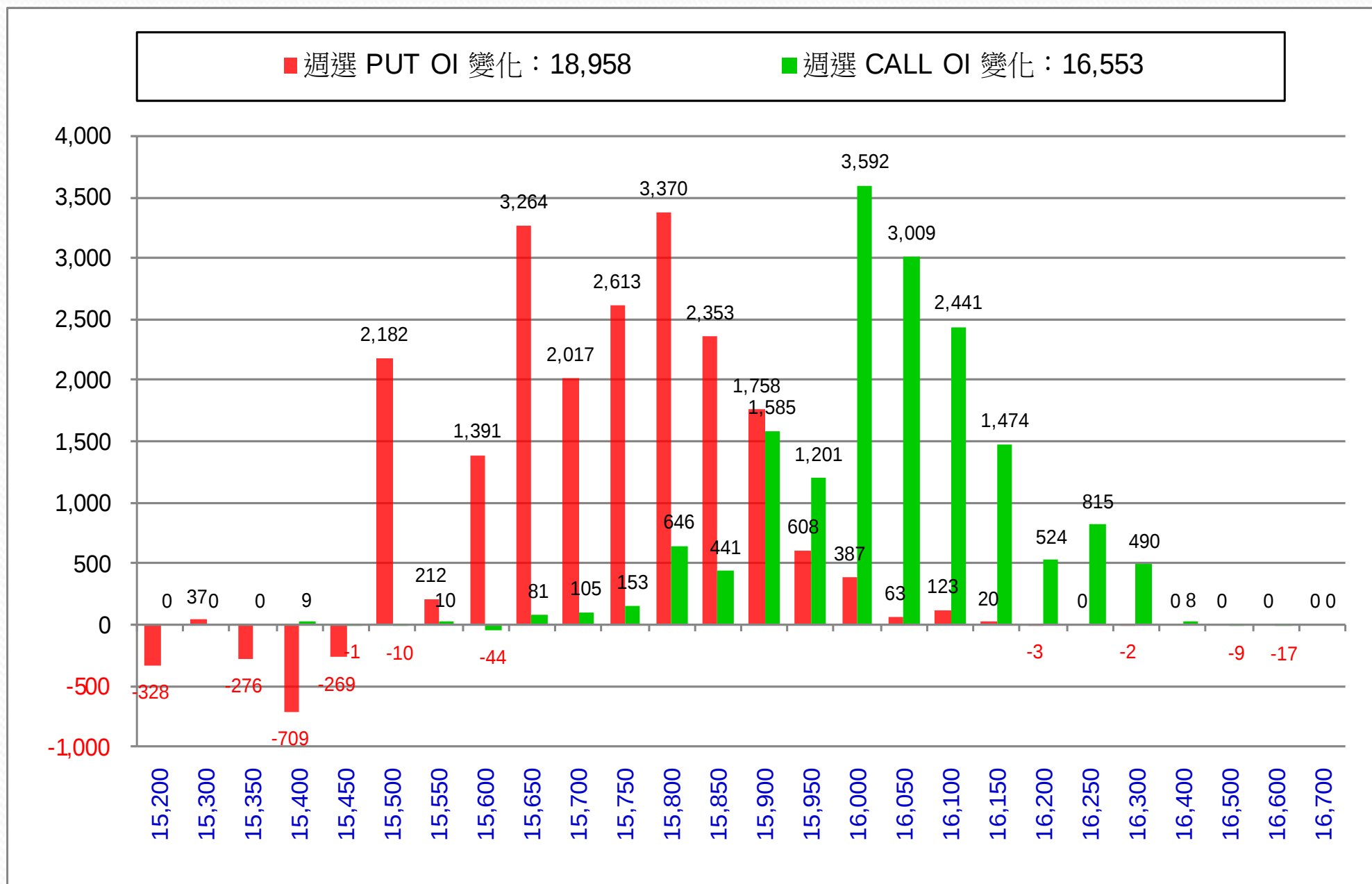
更新日期：2023年4月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年4月10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

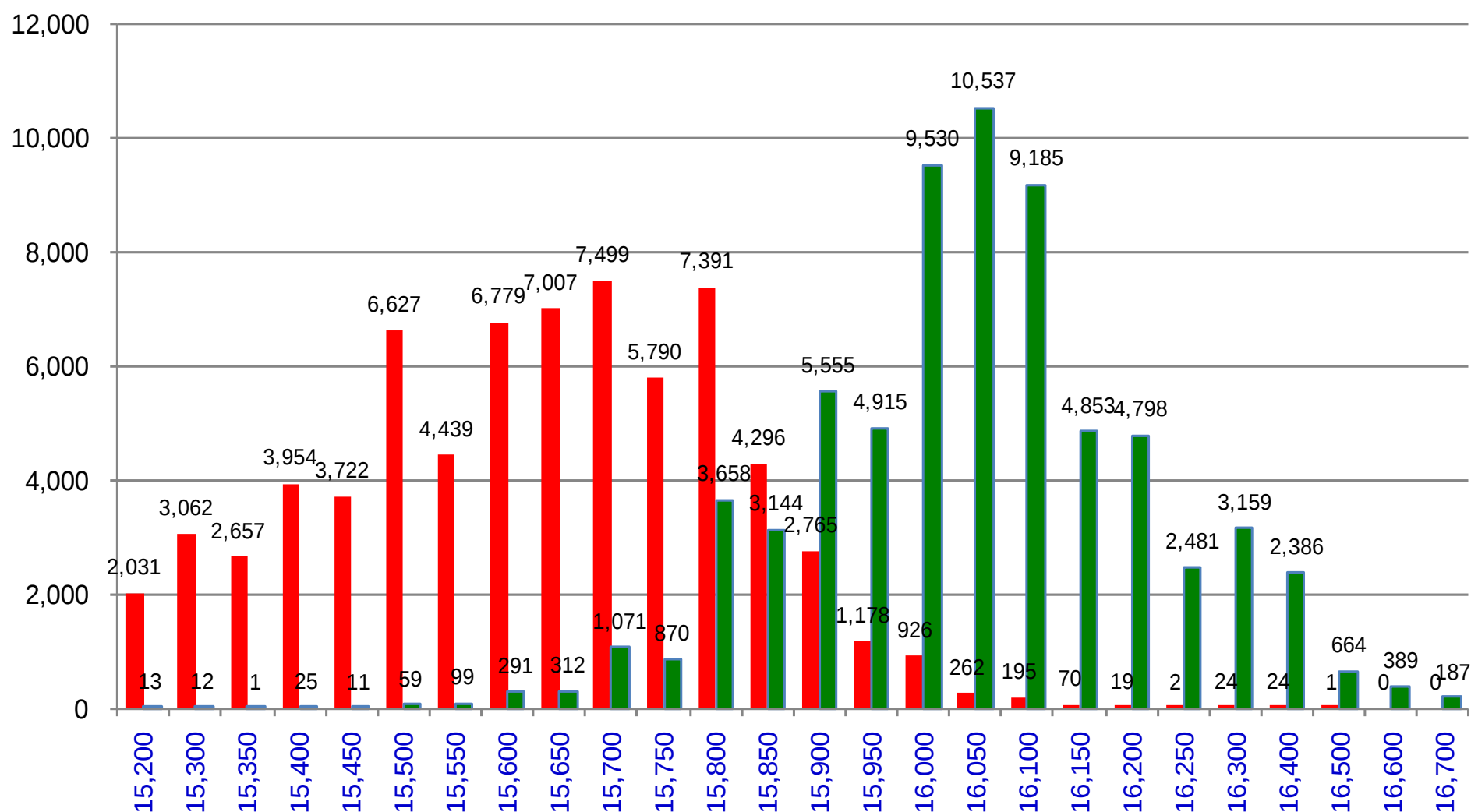


更新日期：2023年4月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：85,305

週選 CALL OI 總額：68,421



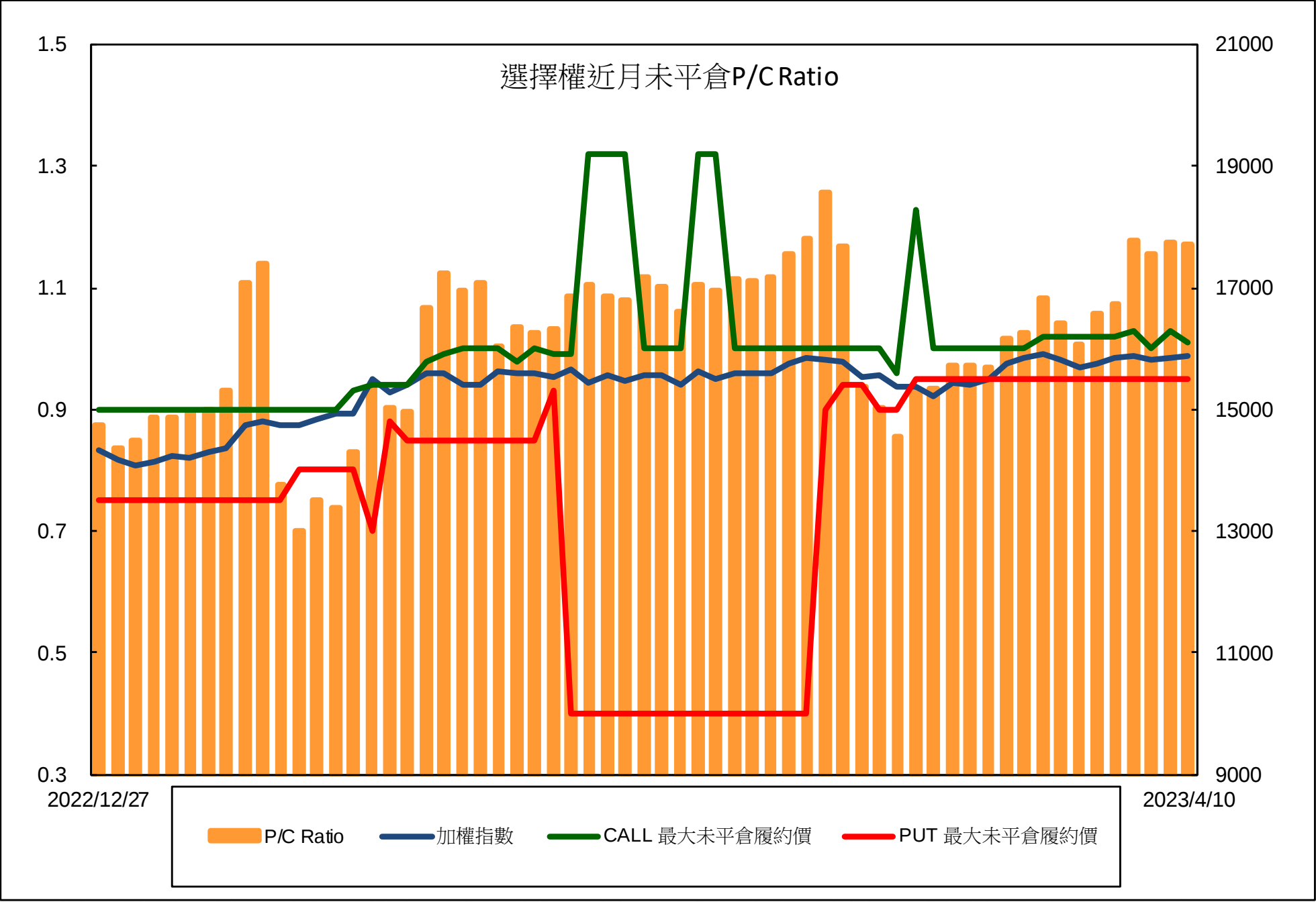
更新日期：2023年4月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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7日	52,205	42,603	9,602
	4月10日	57,200	46,723	10,477
Put	4月7日	58,378	42,508	15,870
	4月10日	61,409	45,248	16,161

更新日期：2023年4月10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10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

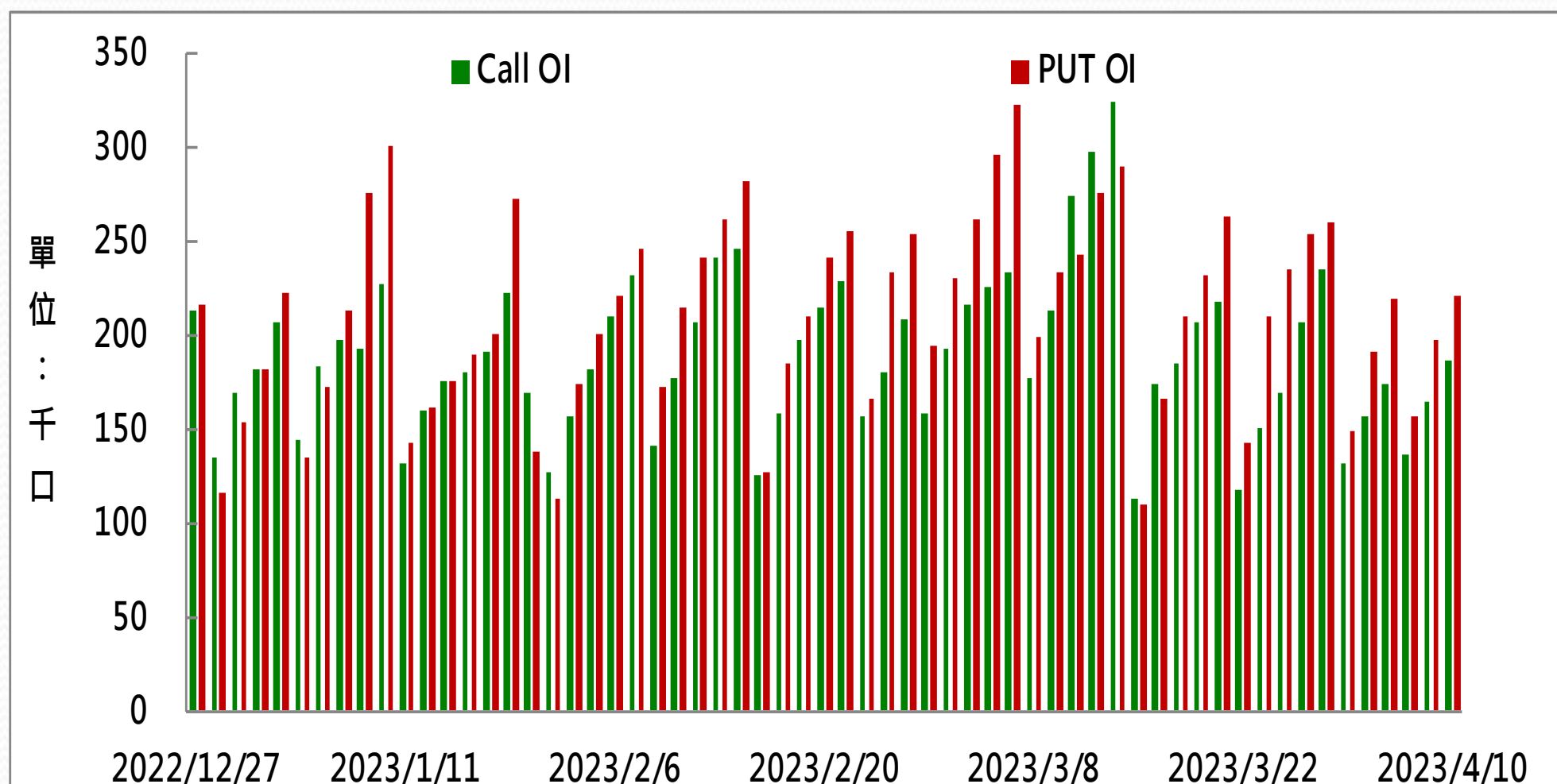


中華開發金控
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL



凱基期貨
KGI FUTURES

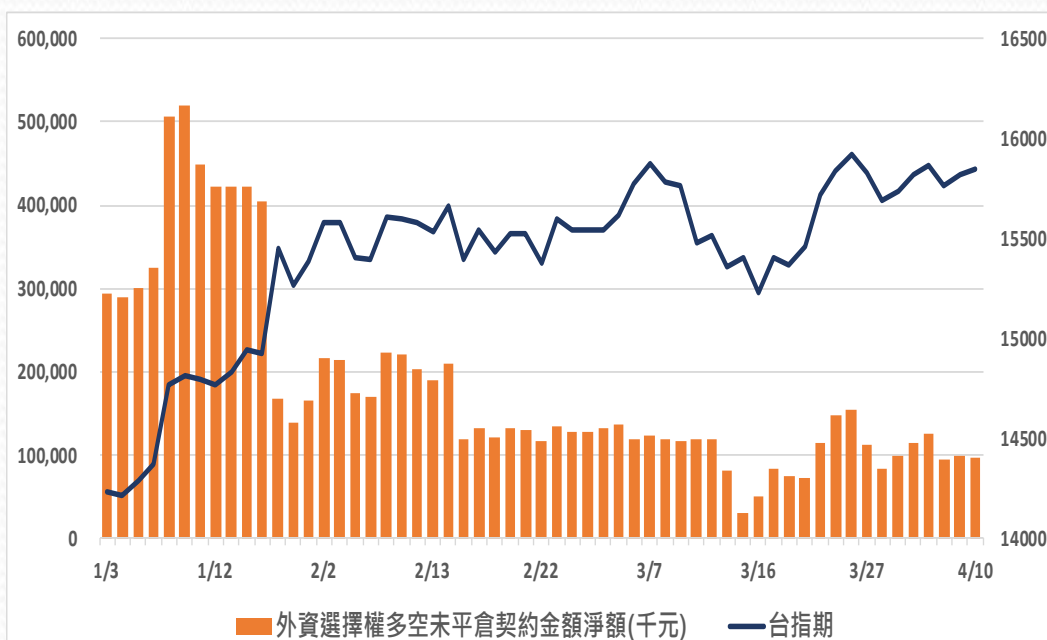
選擇權全月Put Call OI



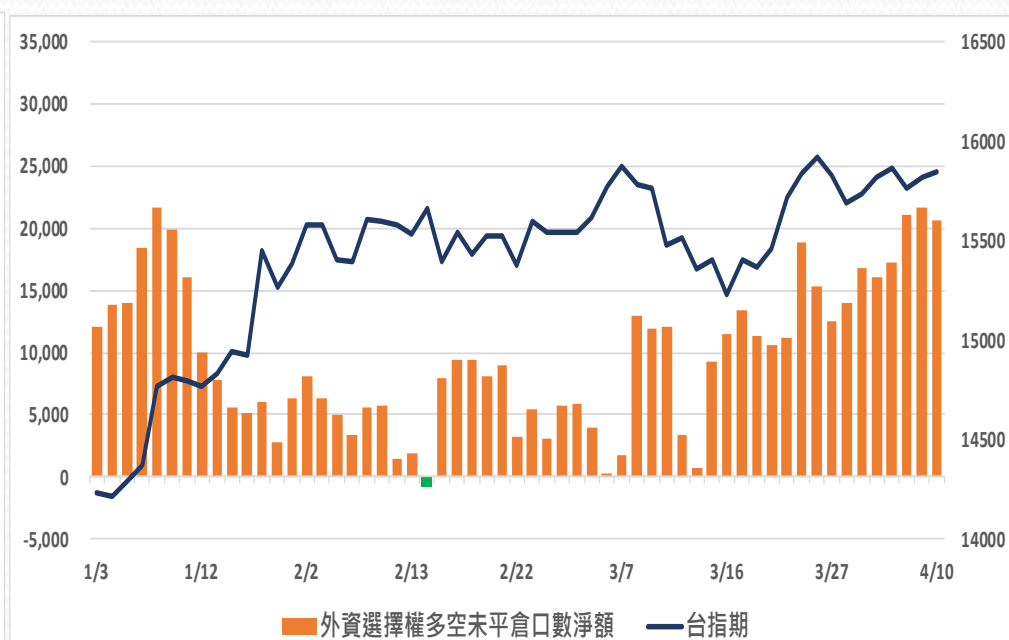
更新日期：2023年4月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



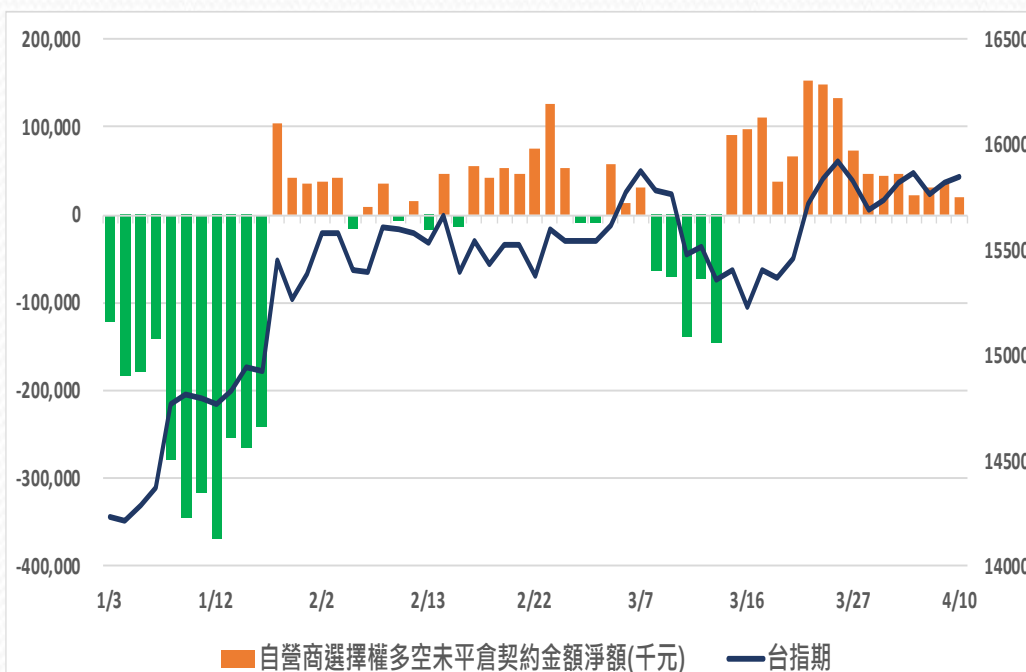
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/30	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
2023/4/10	15851	20,614	-1,031	97,077	-2,050

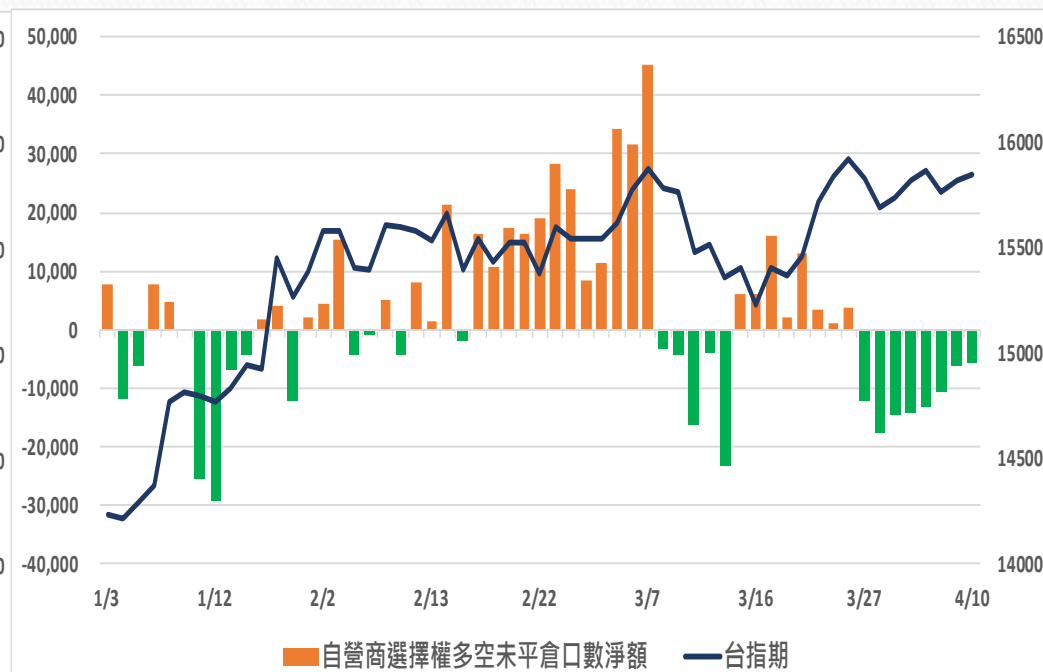
更新日期：2023年4月10日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



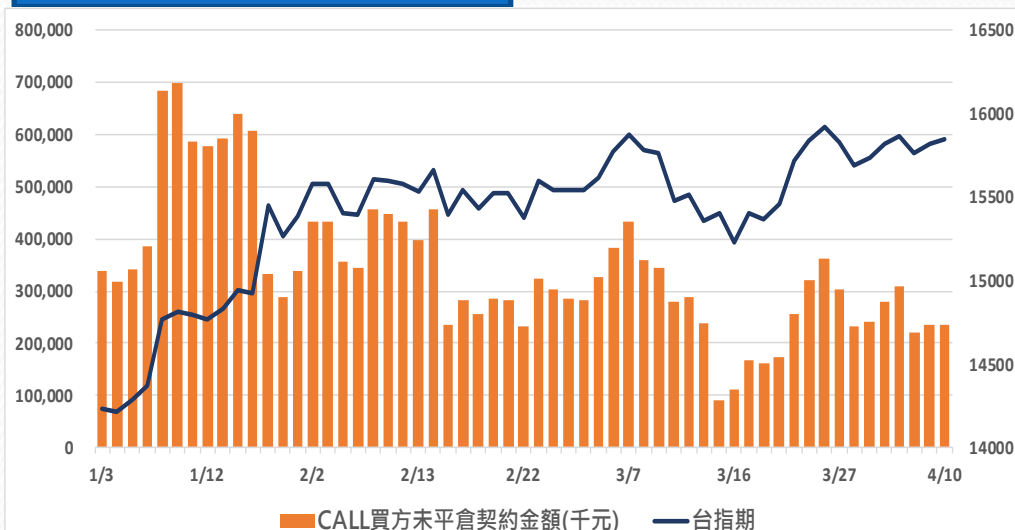
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/30	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
2023/4/10	15851	-5,684	+584	20,883	-14,769

更新日期：2023年4月10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

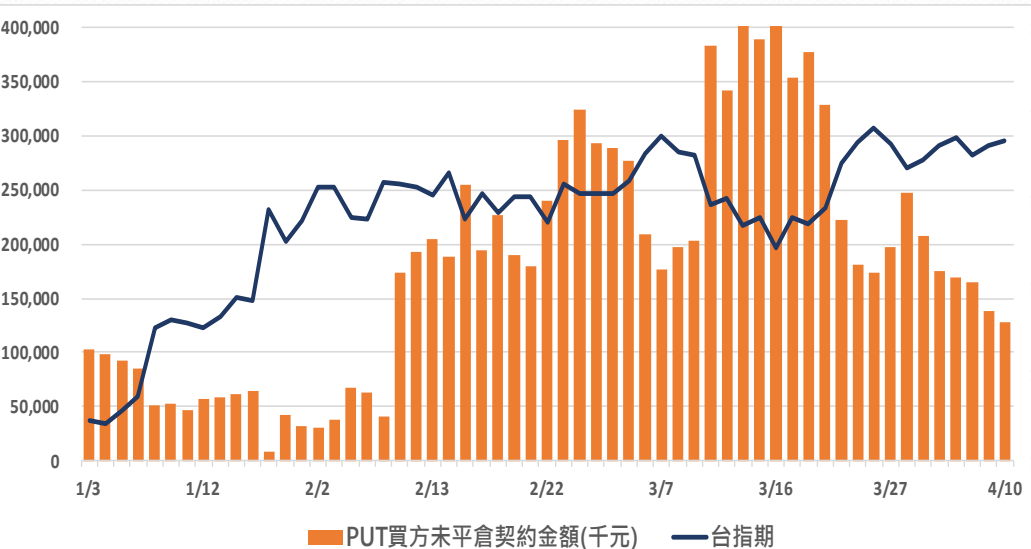
CALL買方未平倉金額



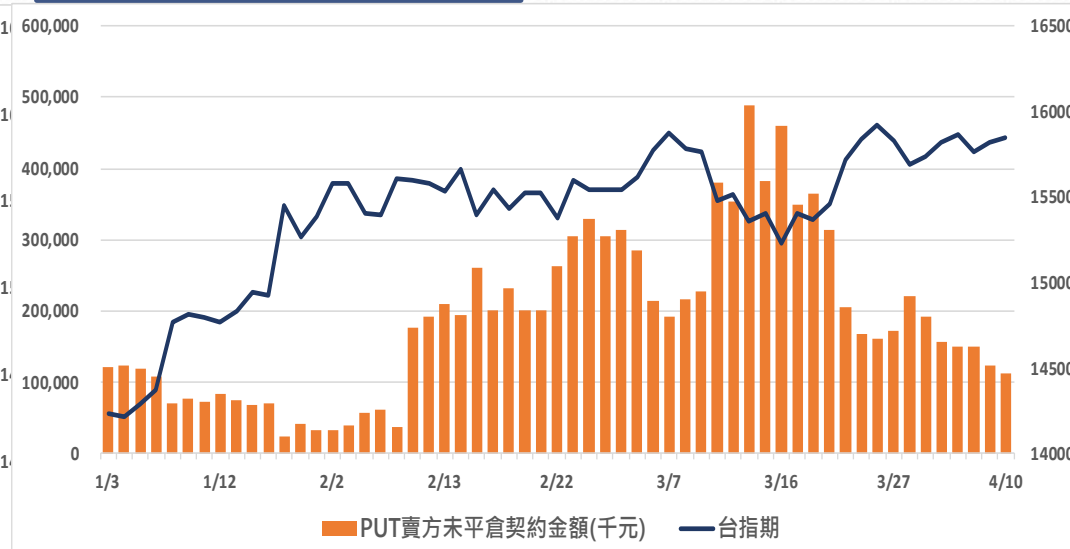
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



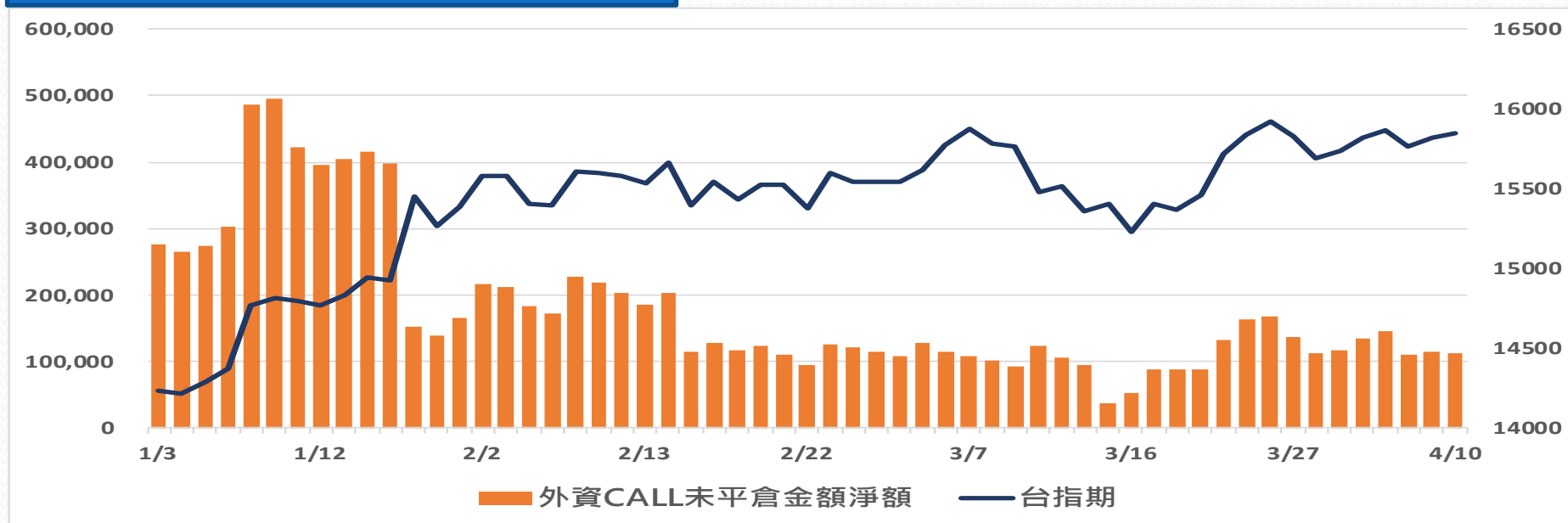
PUT賣方未平倉金額



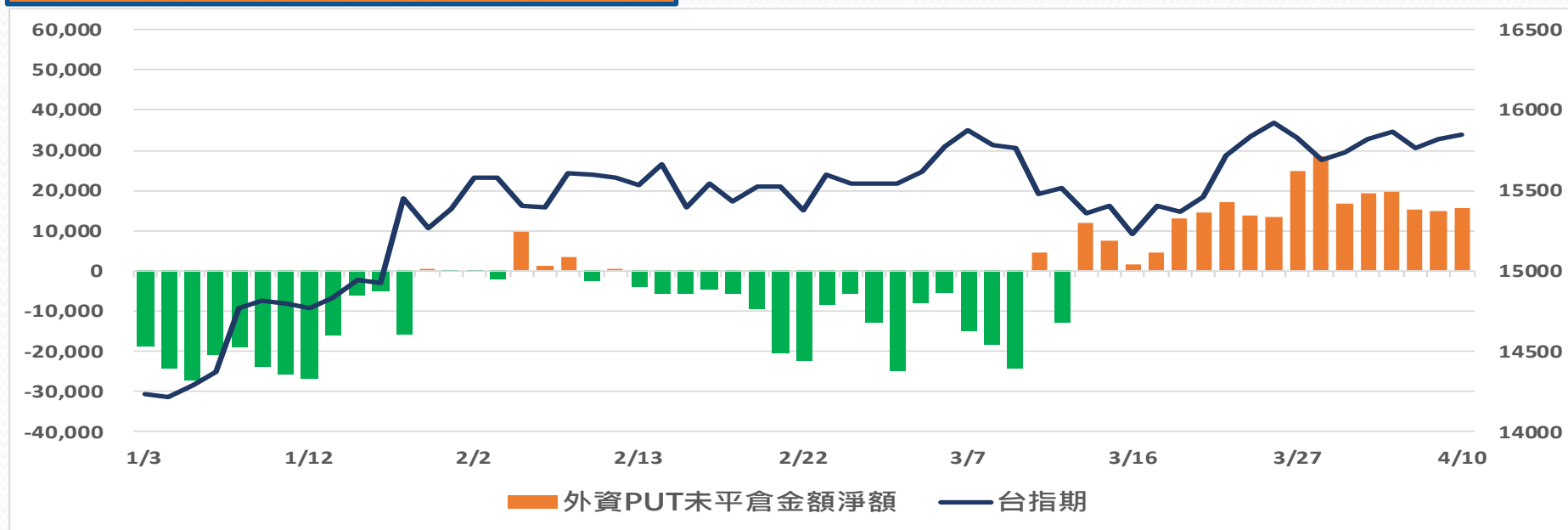
更新日期：2023年4月10日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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10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10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