

台指選擇權OI匯報

日期：2023/4/11 結算日：2023/4/12					日期：2023/4/11 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
-2	11	15,200	1,774	-257	0	70	14,600	2,488	-263
0	12	15,300	3,334	272	0	63	14,700	3,232	-20
0	1	15,350	2,384	-273	0	87	14,800	7,051	-76
1	26	15,400	3,928	-26	0	90	14,900	3,045	-28
0	11	15,450	4,181	459	0	127	15,000	8,734	-406
-10	49	15,500	6,632	5	0	327	15,100	3,231	-297
3	102	15,550	4,177	-262	2	1,685	15,200	5,395	-683
-23	268	15,600	7,092	313	-4	1,926	15,300	5,726	1
-3	309	15,650	8,638	1,631	-54	1,712	15,400	6,789	-219
2	1,073	15,700	8,947	1,448	-82	3,177	15,500	14,859	3,068
-116	754	15,750	9,271	3,481	-47	2,629	15,600	4,660	1,211
579	4,237	15,800	9,839	2,448	151	2,783	15,700	4,268	1,212
865	4,009	15,850	8,748	4,452	-6	3,639	15,800	3,351	269
866	6,421	15,900	12,456	9,691	58	3,680	15,900	1,826	673
2,248	7,163	15,950	6,445	5,267	-658	6,645	16,000	1,111	235
5,163	14,693	16,000	2,633	1,707	-235	8,006	16,100	483	19
1,331	11,868	16,050	554	292	773	8,627	16,200	395	19
-1,422	7,763	16,100	394	199	120	7,703	16,300	149	-18
994	5,847	16,150	114	44	343	6,077	16,400	80	16
699	5,497	16,200	35	16	-274	5,861	16,500	53	14
164	2,645	16,250	6	4	-80	2,817	16,600	46	1
-92	3,067	16,300	22	-2	14	1,279	16,700	39	0
31	31	16,350	0	0	-570	1,796	16,800	4	0
16	2,402	16,400	19	-5	-49	854	16,900	1	0
-6	658	16,500	1	0	-13	1,210	17,000	3	2
-1	388	16,600	0	0	-1	322	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
11,293	79,714	1.4588	116,289	30,984	-613	82,691	1.2327	101,933	3,915
昨日 P/C	1.2468	今日增減變化		0.2120	昨日 P/C	1.1716	今日增減變化		0.0611

更新日期：2023年4月11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11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	101,190,554	63,875,249	37,315,305	2,619,915	1,988,552	1,077,007	911,545	-78,257
投信	30,854,342	50,549,146	-19,694,804	-1,069,879	430,201	0	430,201	4,286
自營商	43,077,155	21,372,283	21,704,872	-5,363,633	2,177,996	791,209	1,386,787	208,054
	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	570,622	1,442,791	-872,169	-74,759	153,550	118,234	35,316	250
投信	98,970	0	98,970	448	0	0	0	0
自營商	284,537	262,886	21,651	-78,410	402,291	422,253	-19,962	9,001

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11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	33,567	17,900	15,667	-809	37,498	37,551	-53	4,085
投信	150	100	50	-50	400	119	281	200
自營商	59,964	48,804	11,160	683	57,792	60,210	-2,418	-18,579
特定法人(週)	900	0	900	100	0	4,119	-4,119	-1,268
特定法人(近月)	19,260	11,453	7,807	-835	24,681	20,771	3,910	-670
特定法人(全月)	20,064	11,040	9,024	-4,484	25,448	25,648	-200	-5,513
十大交易人(週)	25,294	22,410	2,884	272	46,729	30,011	16,718	8,792
十大交易人(近月)	43,834	38,045	5,789	-1,555	45,409	48,333	-2,924	4,186
十大交易人(全月)	81,775	65,460	16,315	-4,957	87,792	82,096	5,696	14,988
全市場未沖銷(近月)			89,959	2,147			109,735	6,857
全市場未沖銷(全月)			202,487	15,925			262,600	40,594

更新日期：2023年4月11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	15900	買權OI最大量	16000
	賣權成交最大量	15900	賣權OI最大量	15900
	整體隱含波動率	10.79%	較前一交易日	-0.66%
	買權隱含波動率	12.23%	較前一交易日	+2.21%
	賣權隱含波動率	9.52%	較前一交易日	-3.17%
電子選擇權	買權成交最大量	775	買權OI最大量	765
	賣權成交最大量	740	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	1660
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1540

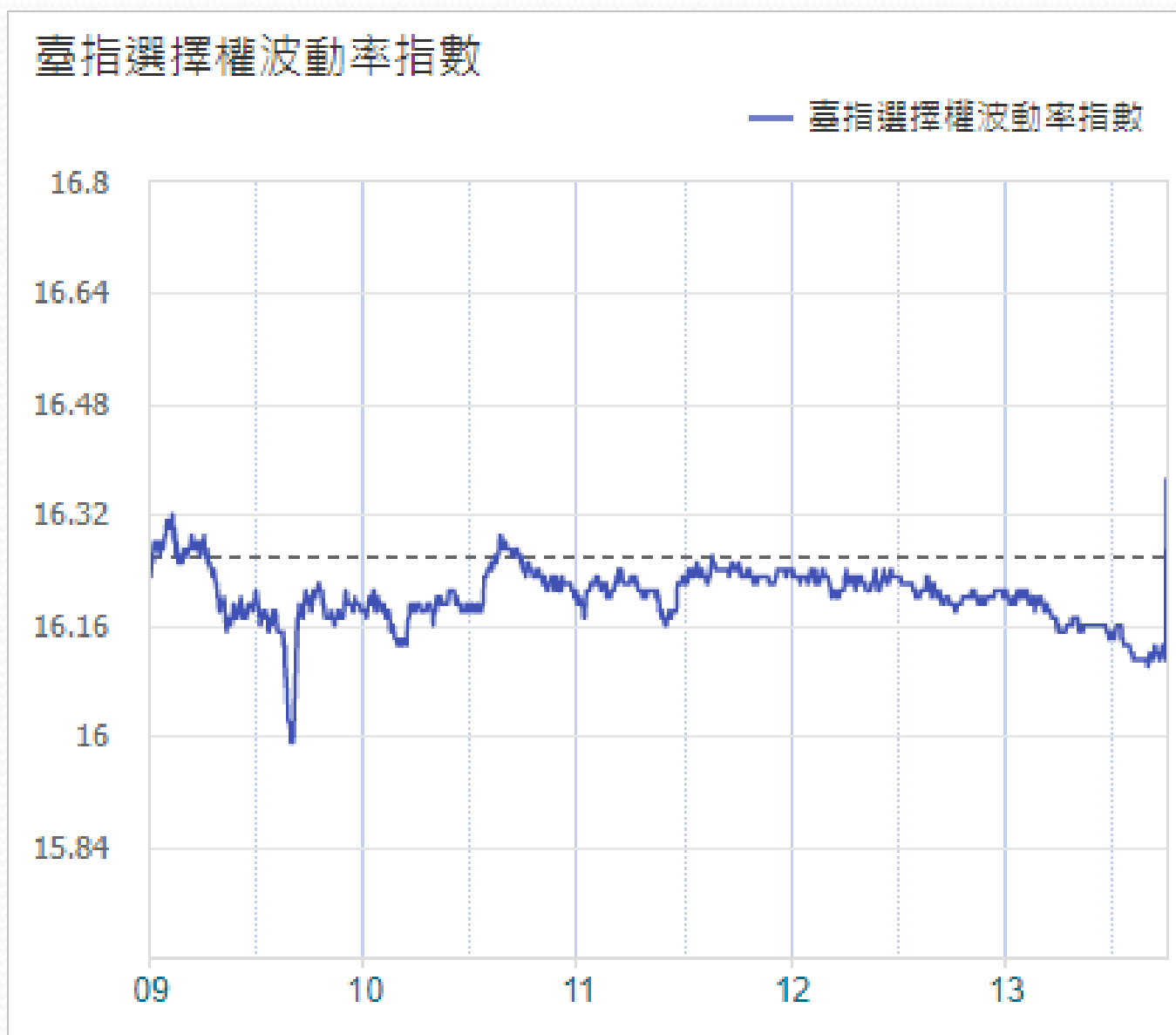
更新日期：2023年4月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	16200
	賣權成交最大量	15500	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	13.77%	較前一交易日	+0.37%
	買權隱含波動率	12.75%	較前一交易日	+1.14%
	賣權隱含波動率	14.62%	較前一交易日	-1.62%
	成交量P/C_Ratio值	1.088	較前一交易日	-0.15
	未平倉P/C_Ratio值	1.220	較前一交易日	+0.05
電子選擇權	買權成交最大量	775	買權OI最大量	765
	賣權成交最大量	740	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	1660
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1540

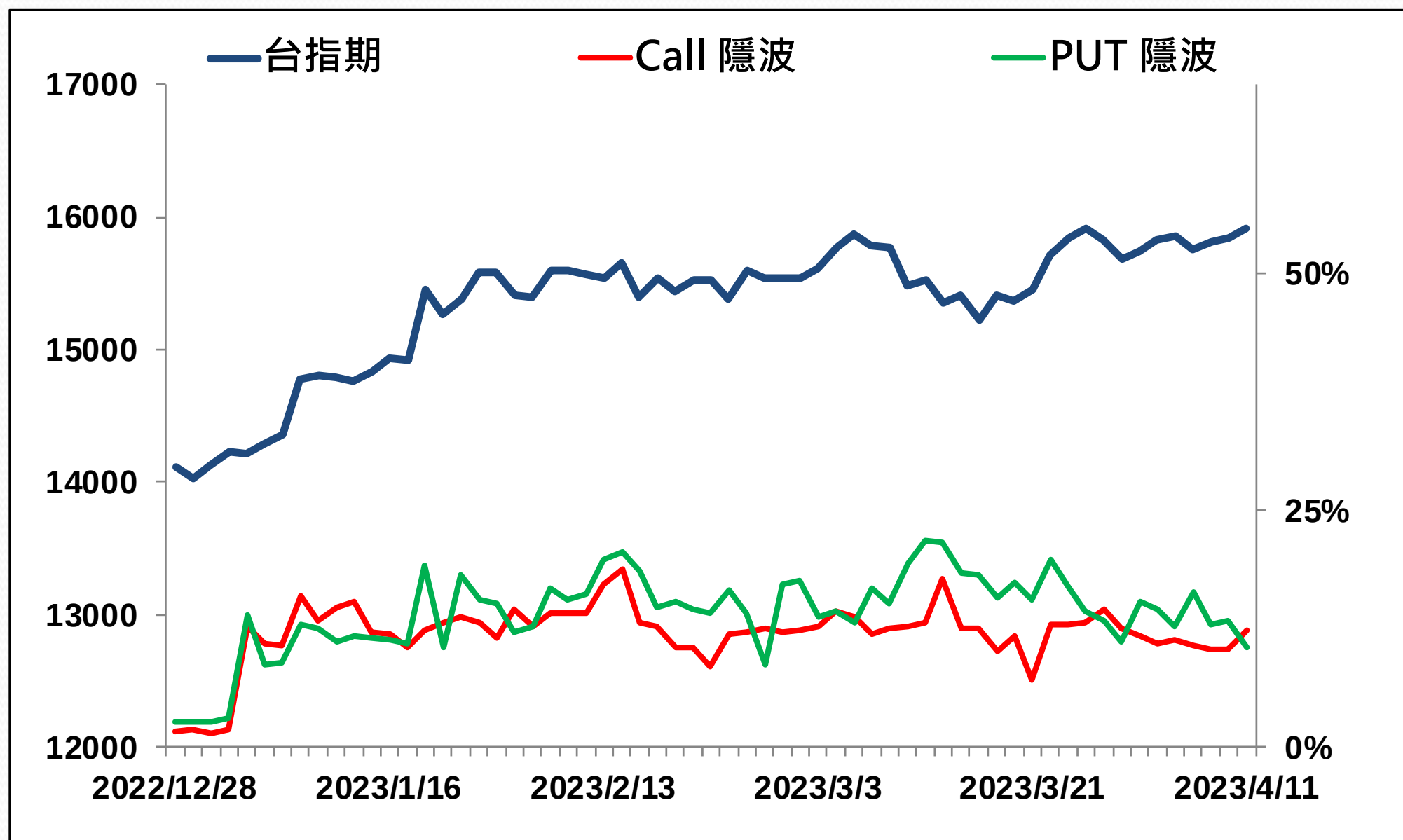
更新日期：2023年4月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



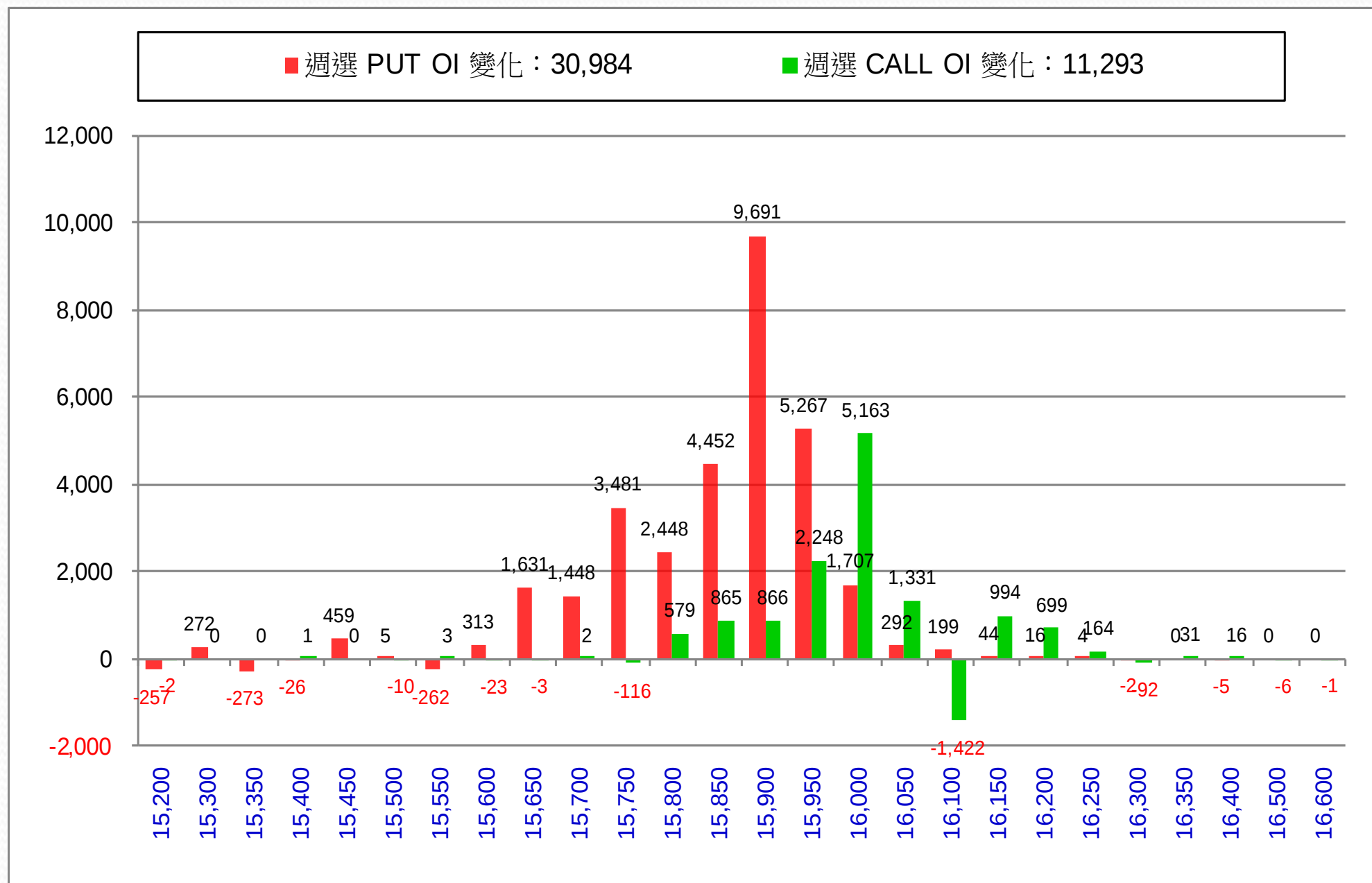
更新日期：2023年4月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年4月11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

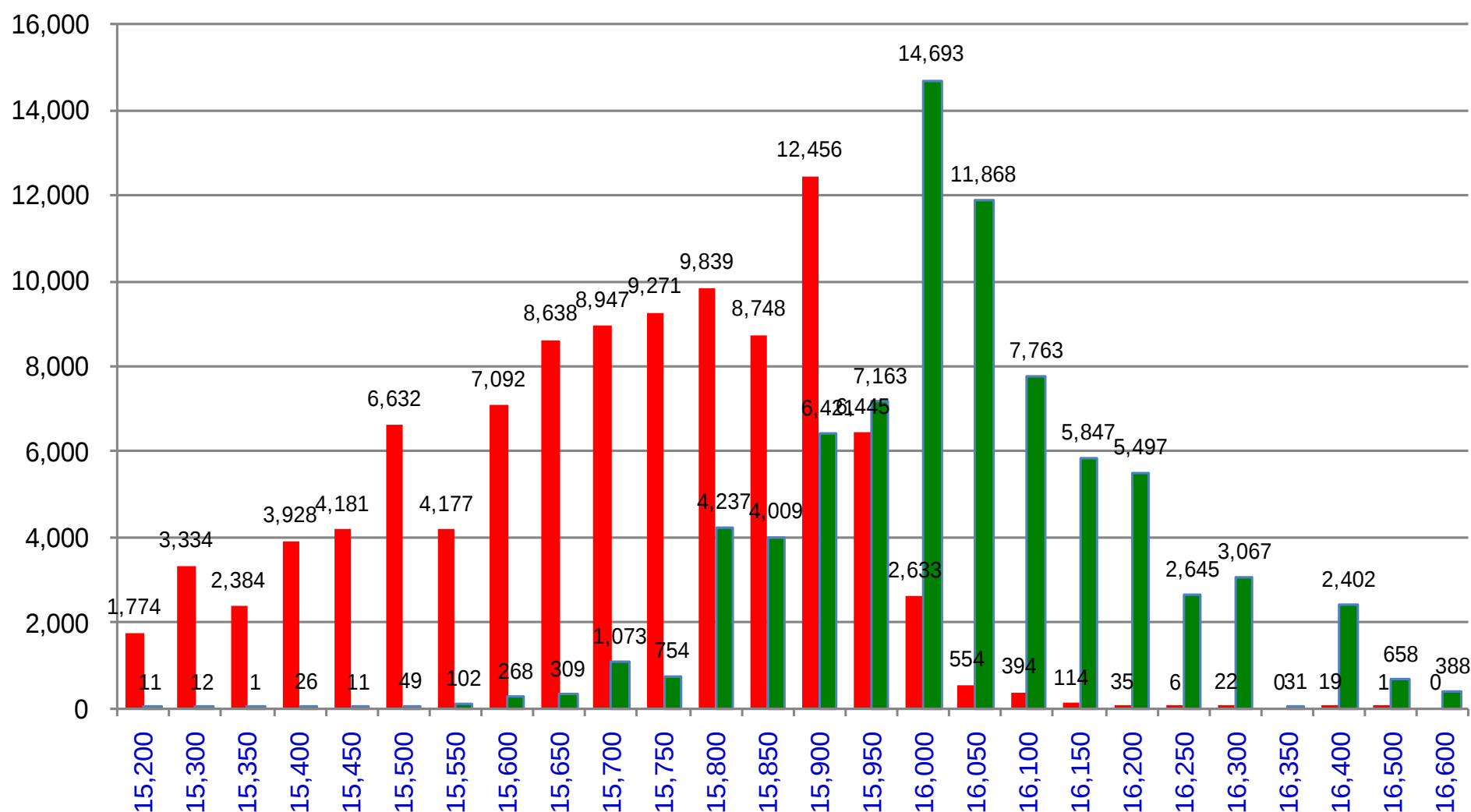


更新日期：2023年4月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：116,289

週選 CALL OI 總額：79,714



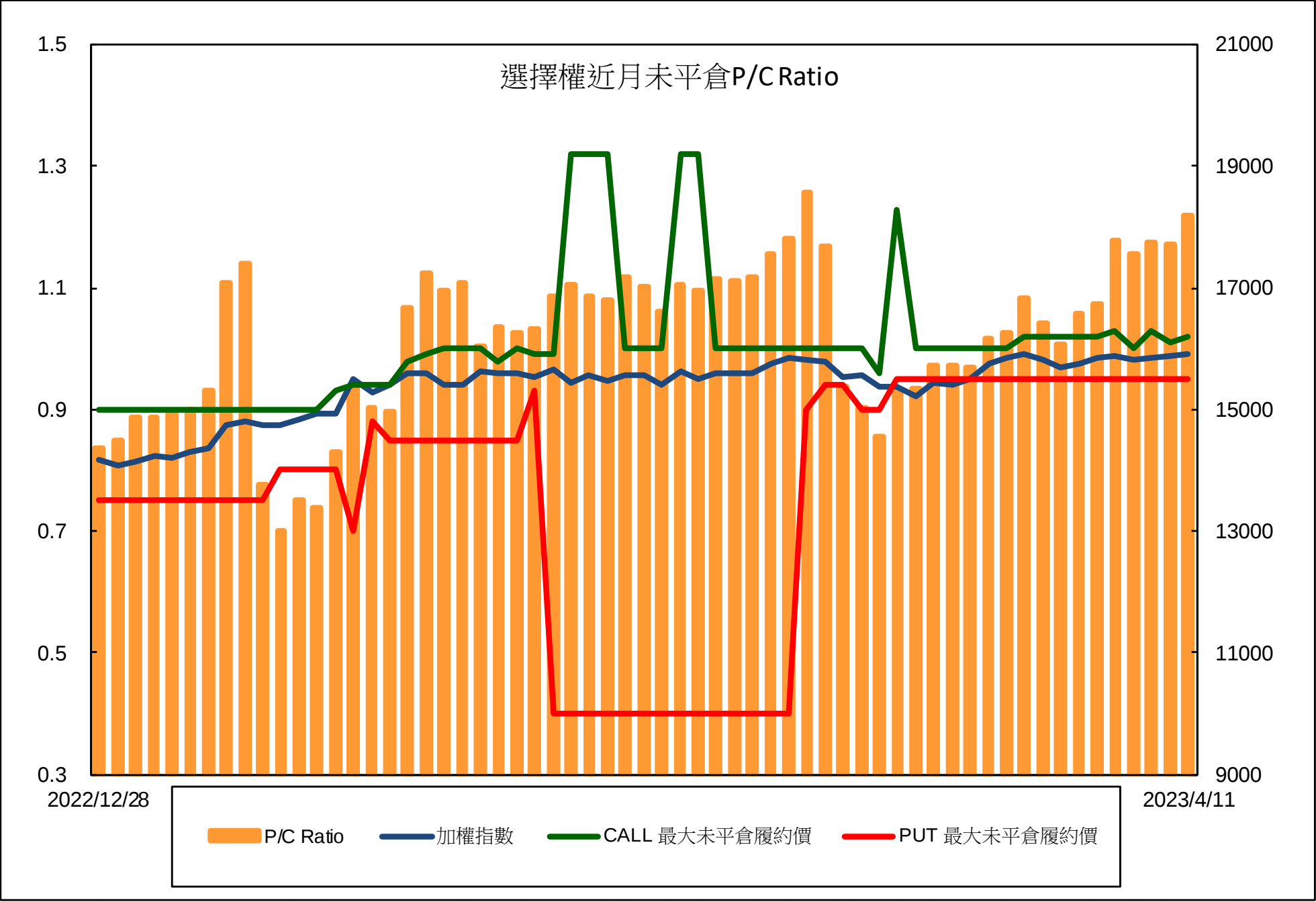
更新日期：2023年4月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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10日	57,200	46,723	10,477
	4月11日	59,964	48,804	11,160
Put	4月10日	61,409	45,248	16,161
	4月11日	57,792	60,210	-2,418

更新日期：2023年4月11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11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

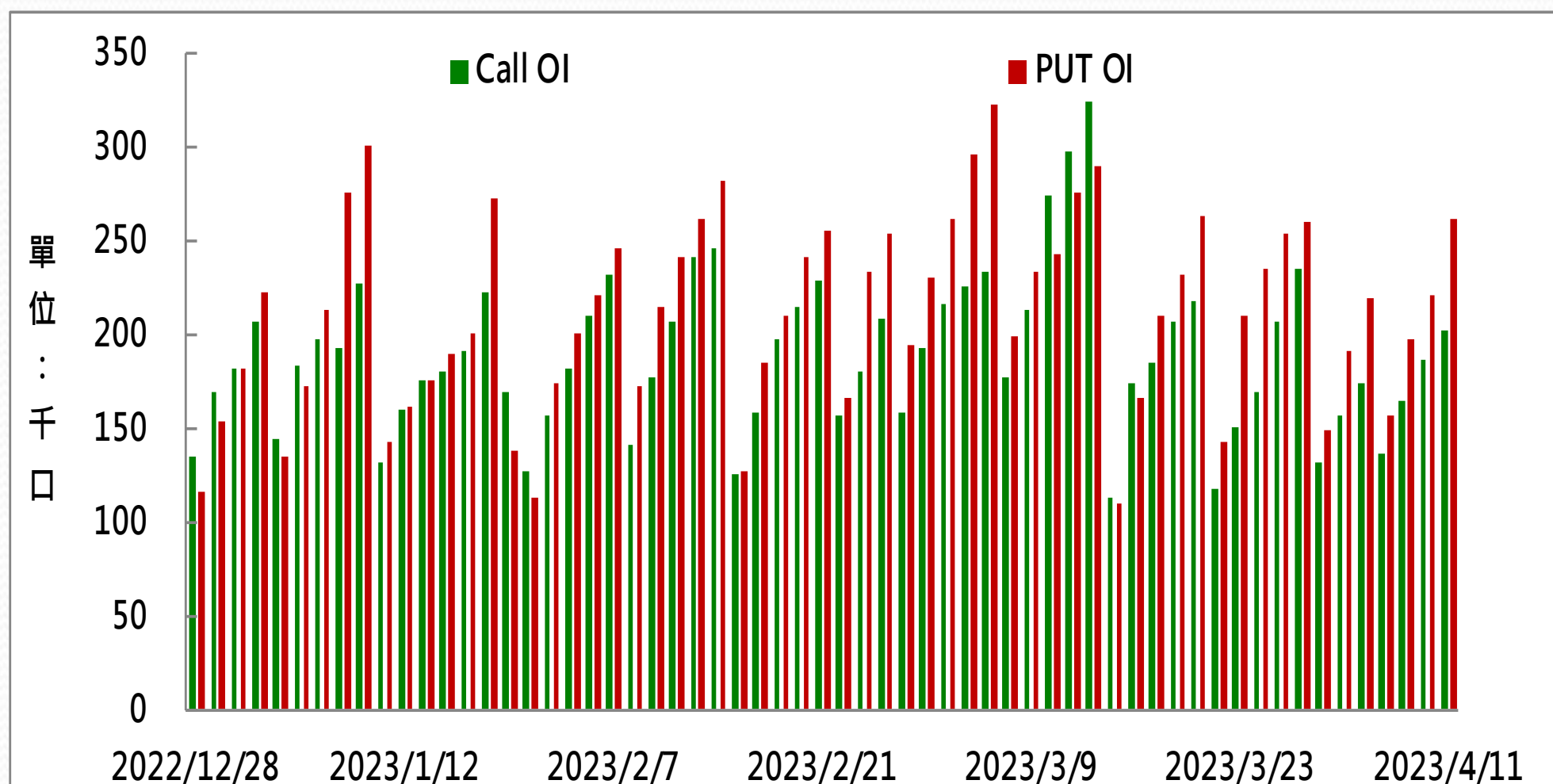


中華開發金控
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL



凱基期貨
KGI FUTURES

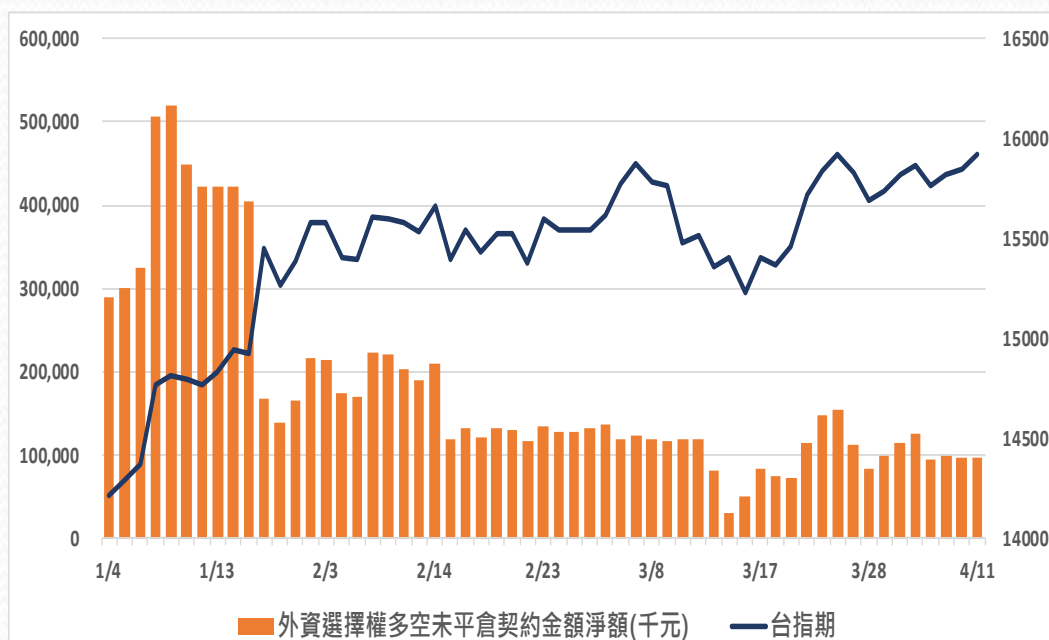
選擇權全月Put Call OI



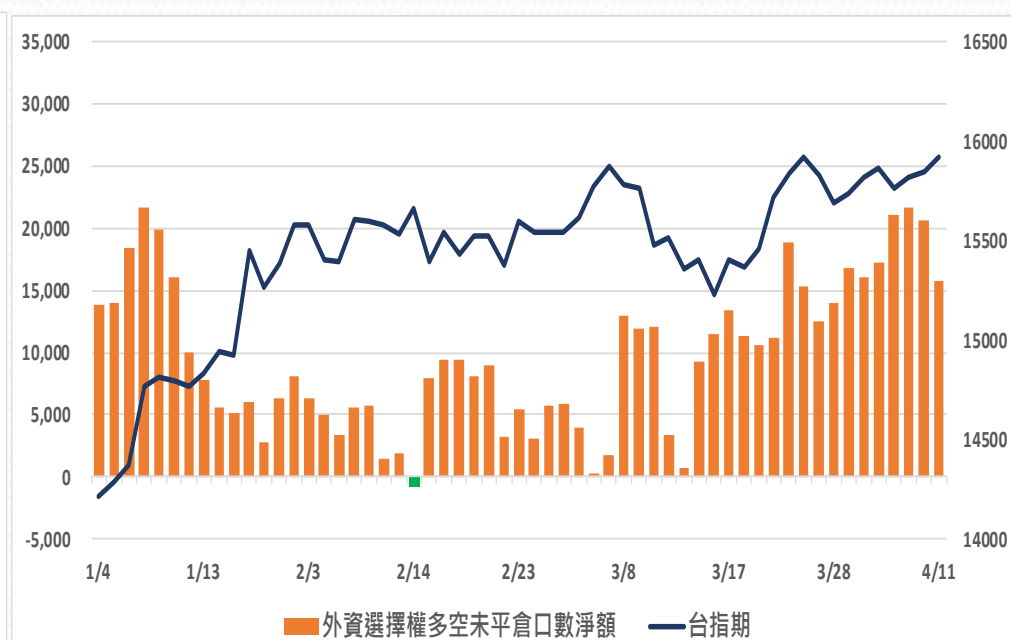
更新日期：2023年4月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



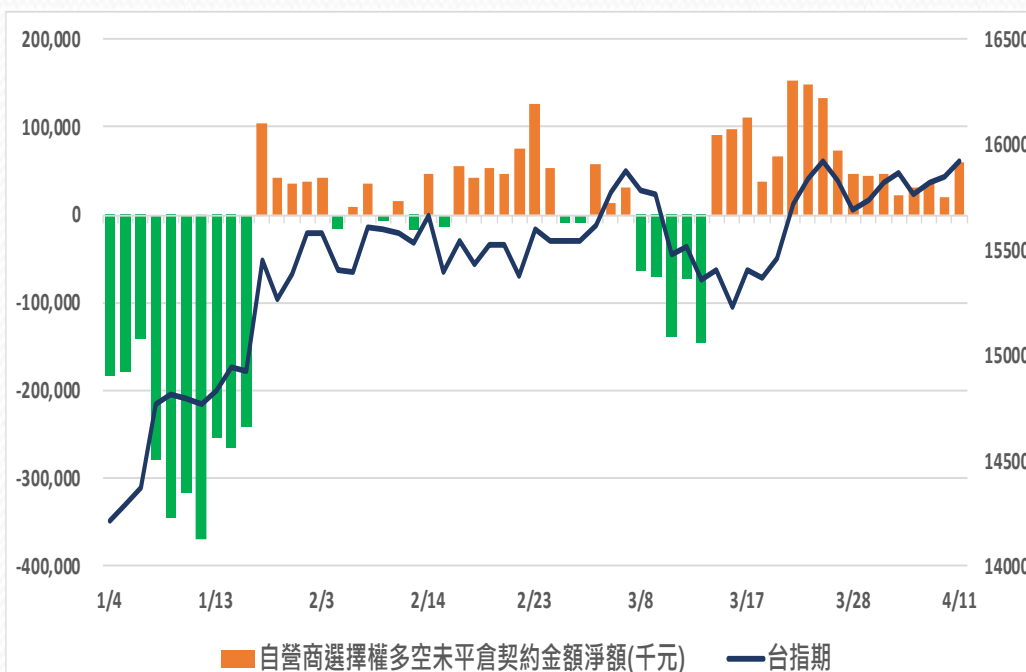
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/31	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
2023/4/11	15924	15,720	-4,894	95,362	-1,715

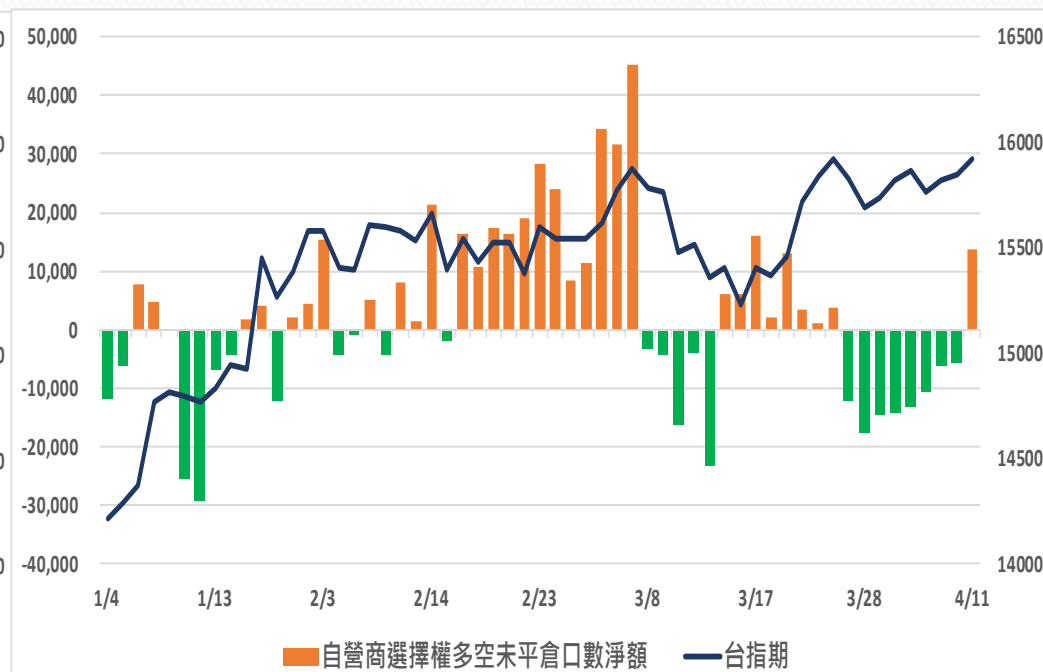
更新日期：2023年4月11日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



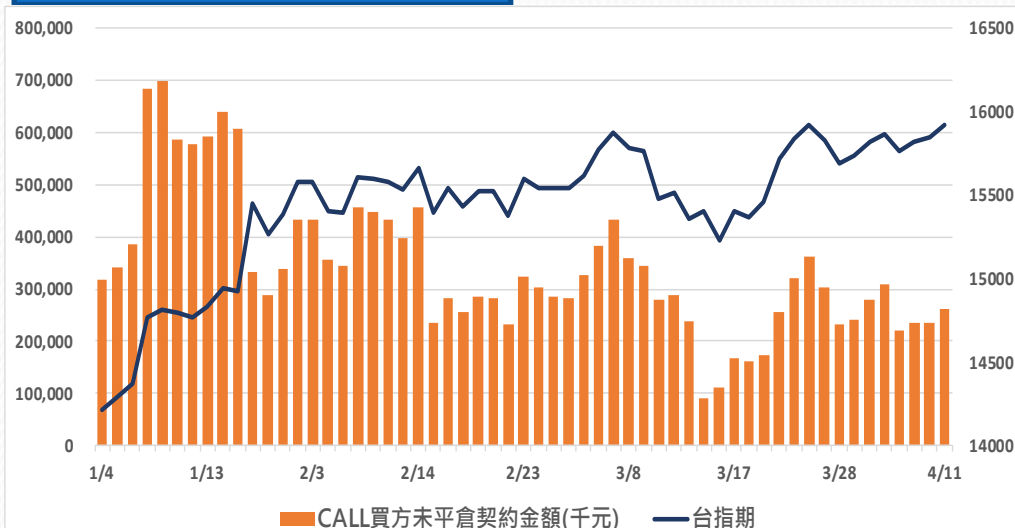
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/3/31	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
2023/4/11	15924	13,578	+19,262	60,165	+39,282

更新日期：2023年4月11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

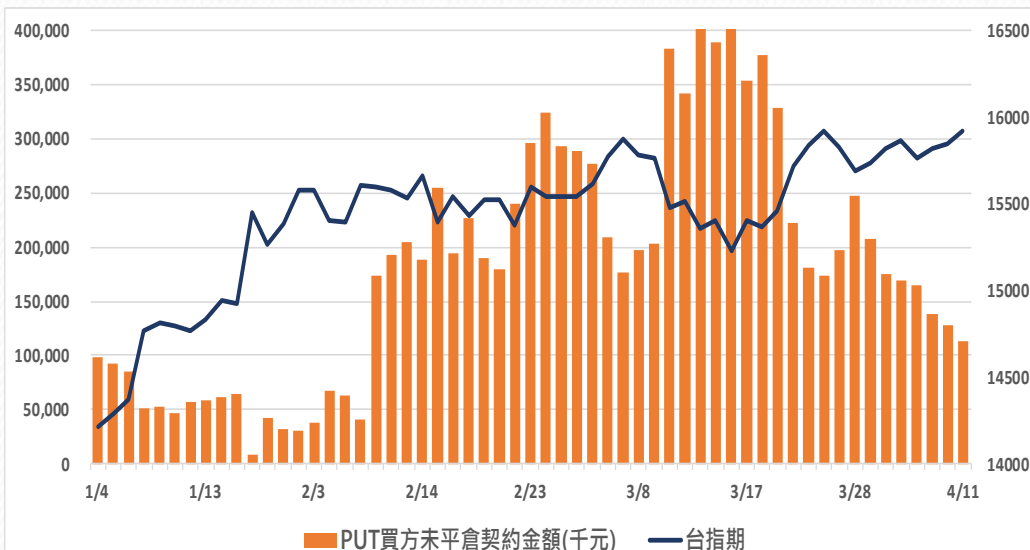
CALL買方未平倉金額



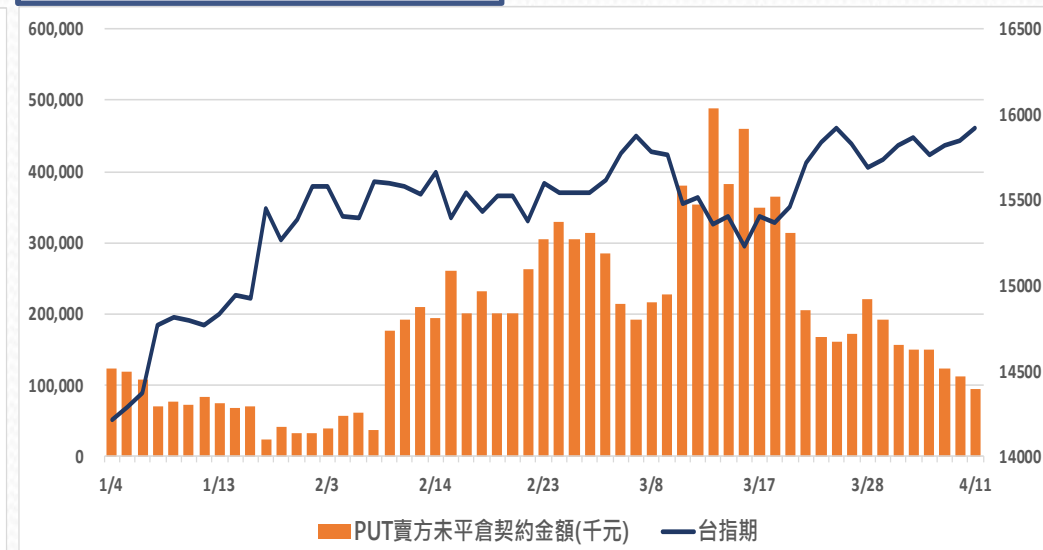
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



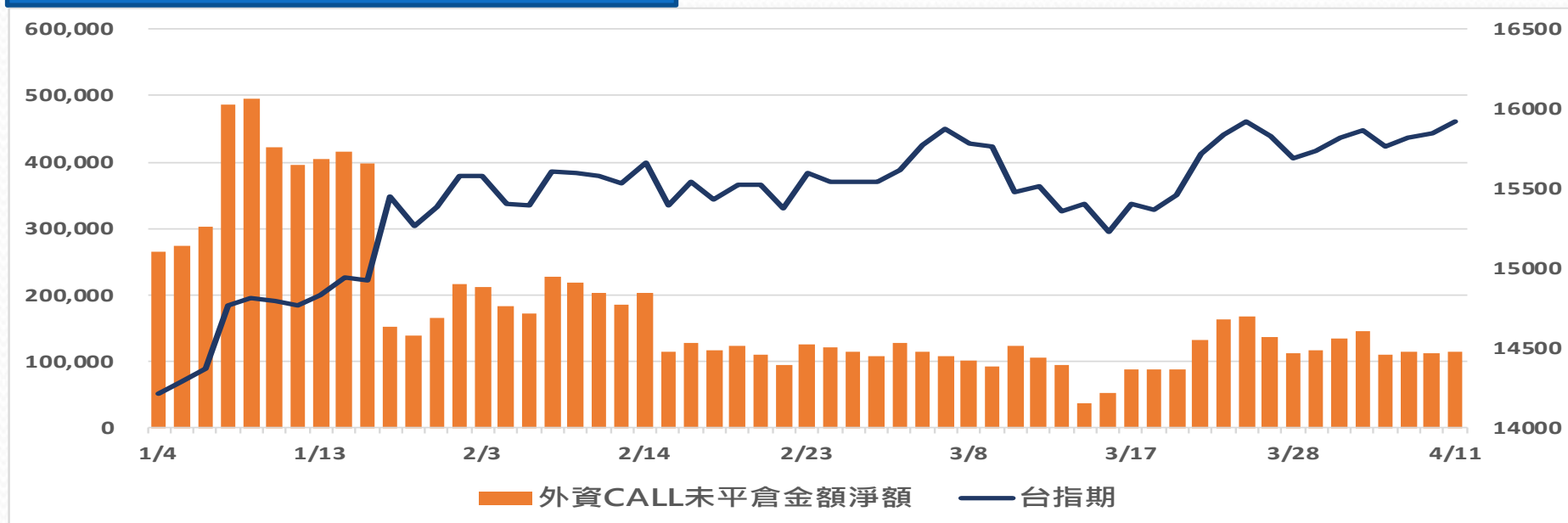
PUT賣方未平倉金額



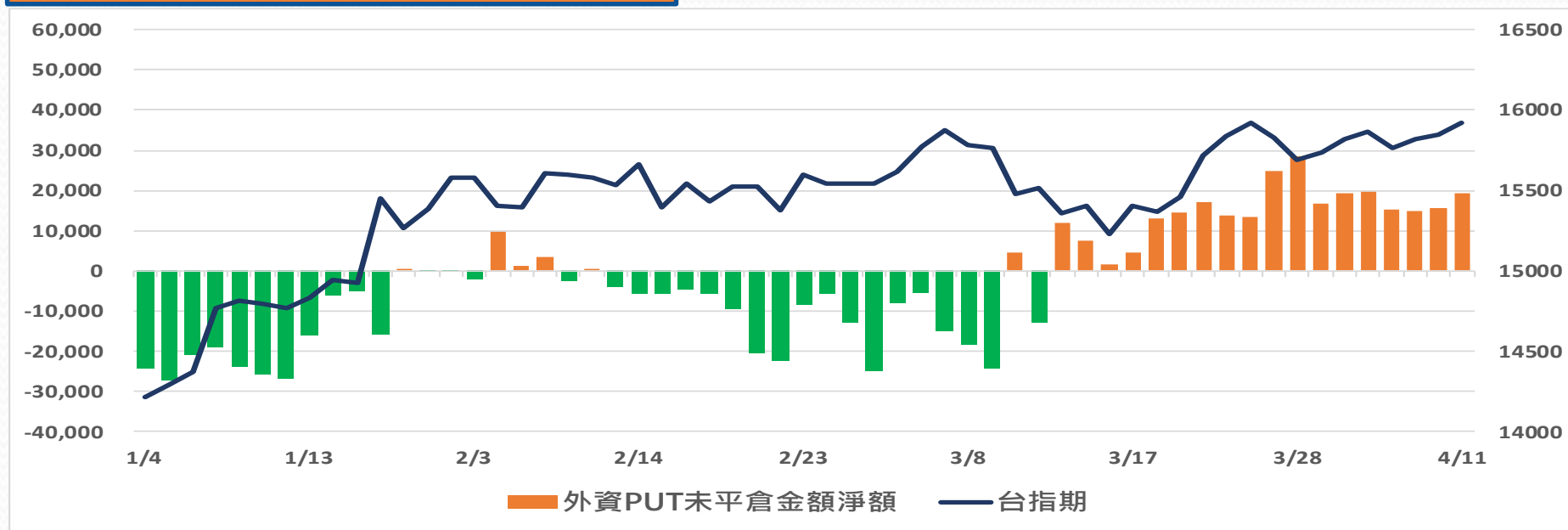
更新日期：2023年4月11日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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11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11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