

台指選擇權OI匯報

日期：2023/4/24 結算日：2023/4/26					日期：2023/4/24 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	0	14,900	1,668	32	0	8	14,300	688	30
0	13	15,000	3,056	584	0	81	14,400	3,352	41
-1	5	15,100	3,874	-389	0	26	14,500	1,684	26
0	0	15,150	603	603	0	7	14,600	1,186	90
0	12	15,200	6,377	854	0	11	14,700	1,185	25
0	1	15,250	1,324	252	0	21	14,800	1,744	34
2	16	15,300	8,607	2,890	3	29	14,900	2,236	164
2	8	15,350	6,761	2,366	2	41	15,000	6,201	997
73	187	15,400	8,492	998	7	42	15,100	3,996	304
236	348	15,450	8,135	2,410	17	96	15,200	3,923	7
374	995	15,500	10,000	3,192	16	225	15,300	2,592	131
838	1,257	15,550	7,102	2,313	47	264	15,400	2,267	216
3,105	5,247	15,600	13,103	5,874	66	332	15,500	2,135	58
2,542	5,439	15,650	5,497	931	391	813	15,600	1,584	89
3,424	8,933	15,700	4,417	283	312	2,105	15,700	6,304	146
5,133	11,157	15,750	3,208	148	1,145	2,639	15,800	1,097	3
3,709	13,015	15,800	2,399	-245	244	3,895	15,900	856	-47
727	10,324	15,850	1,191	-235	602	6,901	16,000	355	-34
-2,240	10,324	15,900	833	40	108	3,578	16,100	101	5
-1,511	7,690	15,950	253	-34	1,245	4,318	16,200	104	7
-912	9,306	16,000	280	-51	1,454	8,051	16,300	79	0
-456	4,509	16,050	55	-13	159	7,913	16,400	14	0
-590	4,803	16,100	141	-20	-217	3,933	16,500	17	0
-369	3,194	16,150	22	0	-322	2,905	16,600	13	0
-456	4,569	16,200	65	1	-4	1,093	16,700	14	0
-153	2,716	16,250	39	0	17	1,136	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
13,268	112,642	0.8841	99,591	22,849	4,931	58,163	0.8994	52,311	2,594
昨日 P/C	0.7723	今日增減變化	0.1118	昨日 P/C	0.9340	今日增減變化	-0.0346		

更新日期：2023年4月24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24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	108,709,873	59,735,475	48,974,398	5,776,296	2,337,670	550,897	1,786,773	181,607	
投信	27,256,900	52,083,328	-24,826,428	127,867	390,583	0	390,583	-1,206	
自營商	38,633,599	22,767,063	15,866,536	-1,610,808	1,419,471	824,742	594,729	44,967	
	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	220,073	981,743	-761,670	-36,108	18,371	73,483	-55,112	-6,485	
投信	123,303	0	123,303	300	0	0	0	0	
自營商	257,532	143,582	113,950	-4,385	270,969	220,326	50,643	3,489	

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24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	29,729	14,232	15,497	2,455	21,875	14,764	7,111	551	
投信	100	0	100	50	150	113	37	0	
自營商	60,922	42,314	18,608	-2,012	37,580	42,919	-5,339	-7,686	
特定法人(週)	1,571	0	1,571	127	0	3,638	-3,638	0	
特定法人(近月)	22,573	9,124	13,449	1,776	6,691	11,287	-4,596	-1,397	
特定法人(全月)	22,251	5,802	16,449	1,838	5,947	15,632	-9,685	-1,711	
十大交易人(週)	39,421	33,540	5,881	1,254	30,321	19,181	11,140	7,625	
十大交易人(近月)	38,160	23,753	14,407	81	20,392	24,857	-4,465	528	
十大交易人(全月)	83,149	51,703	31,446	846	51,109	47,262	3,847	8,772	
全市場未沖銷(近月)			58,163	4,931			52,311	2,594	
全市場未沖銷(全月)			203,380	22,278			183,386	28,184	

更新日期：2023年4月24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	15700	買權OI最大量	15800
	賣權成交最大量	15600	賣權OI最大量	15600
	整體隱含波動率	11.05%	較前一交易日	+1.43%
	買權隱含波動率	9.40%	較前一交易日	-0.78%
	賣權隱含波動率	12.74%	較前一交易日	+3.90%
電子選擇權	買權成交最大量	780	買權OI最大量	760
	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	1600	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1500

更新日期：2023年4月24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	16000	買權OI最大量	16300
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	15700
	整體隱含波動率	13.43%	較前一交易日	+0.23%
	買權隱含波動率	11.68%	較前一交易日	-0.46%
	賣權隱含波動率	16.00%	較前一交易日	+0.28%
	成交量P/C_Ratio值	0.720	較前一交易日	-0.09
	未平倉P/C_Ratio值	0.899	較前一交易日	-0.03
電子選擇權	買權成交最大量	780	買權OI最大量	760
	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	1600	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1500

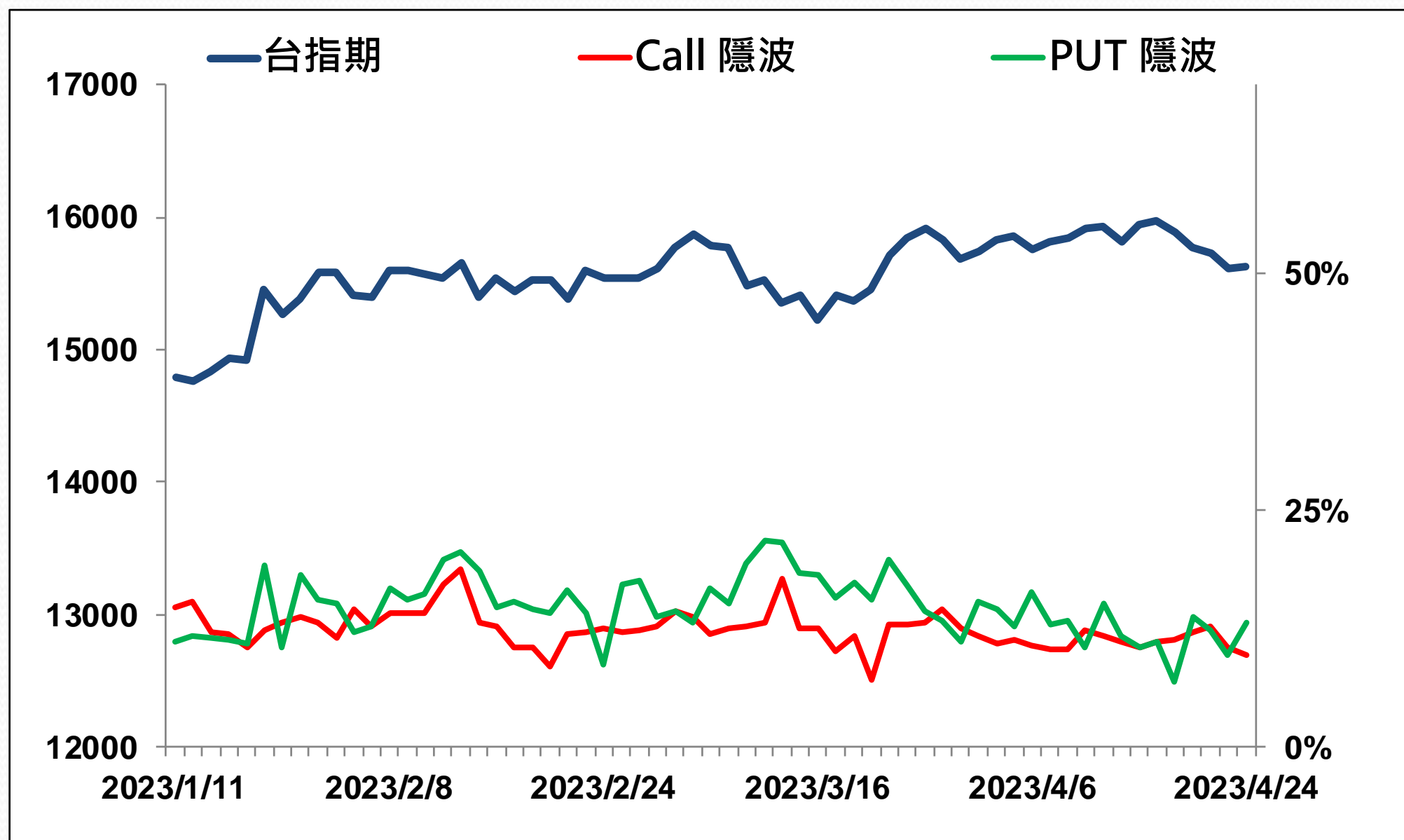
更新日期：2023年4月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



更新日期：2023年4月24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

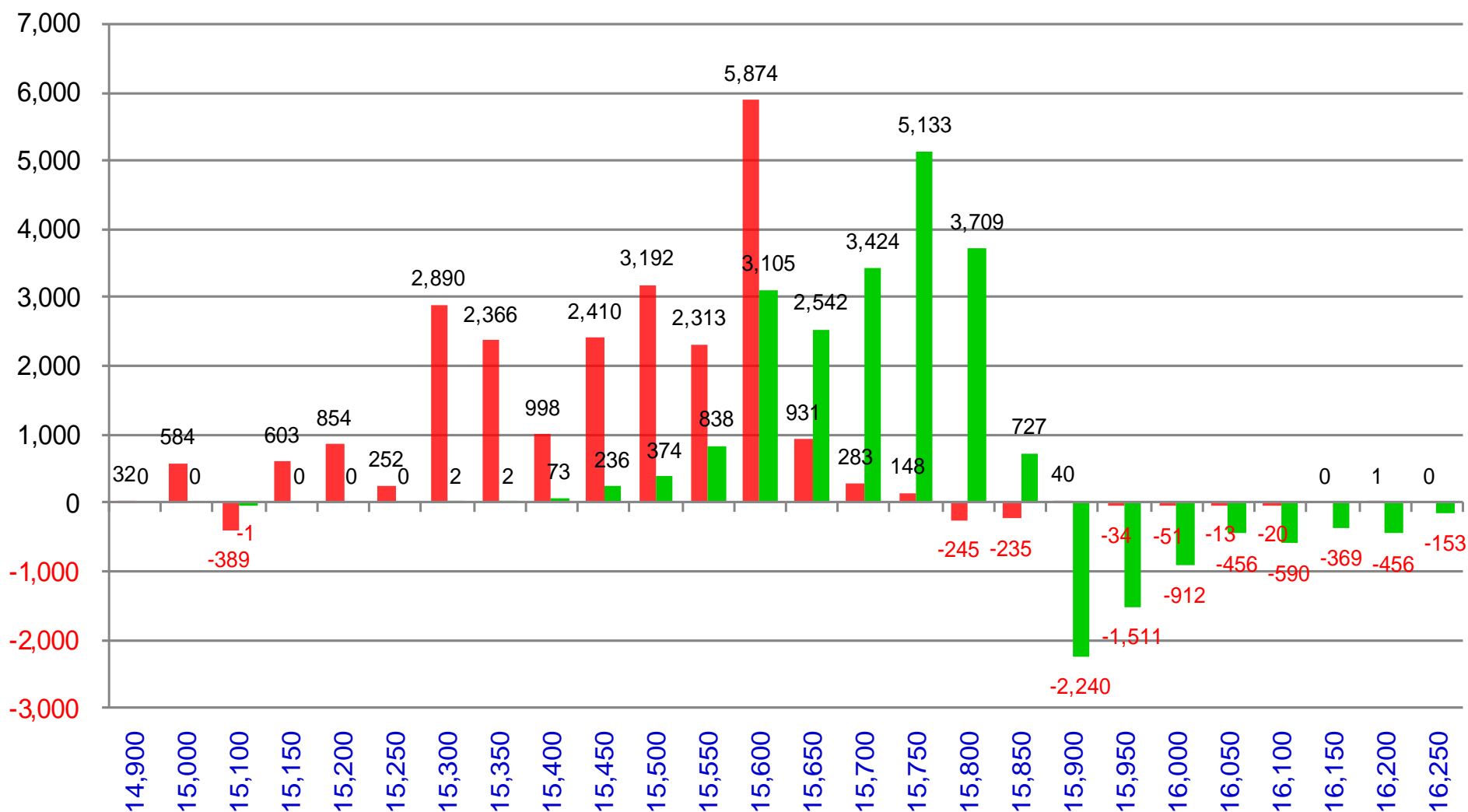


更新日期：2023年4月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：22,849

週選 CALL OI 變化：13,268

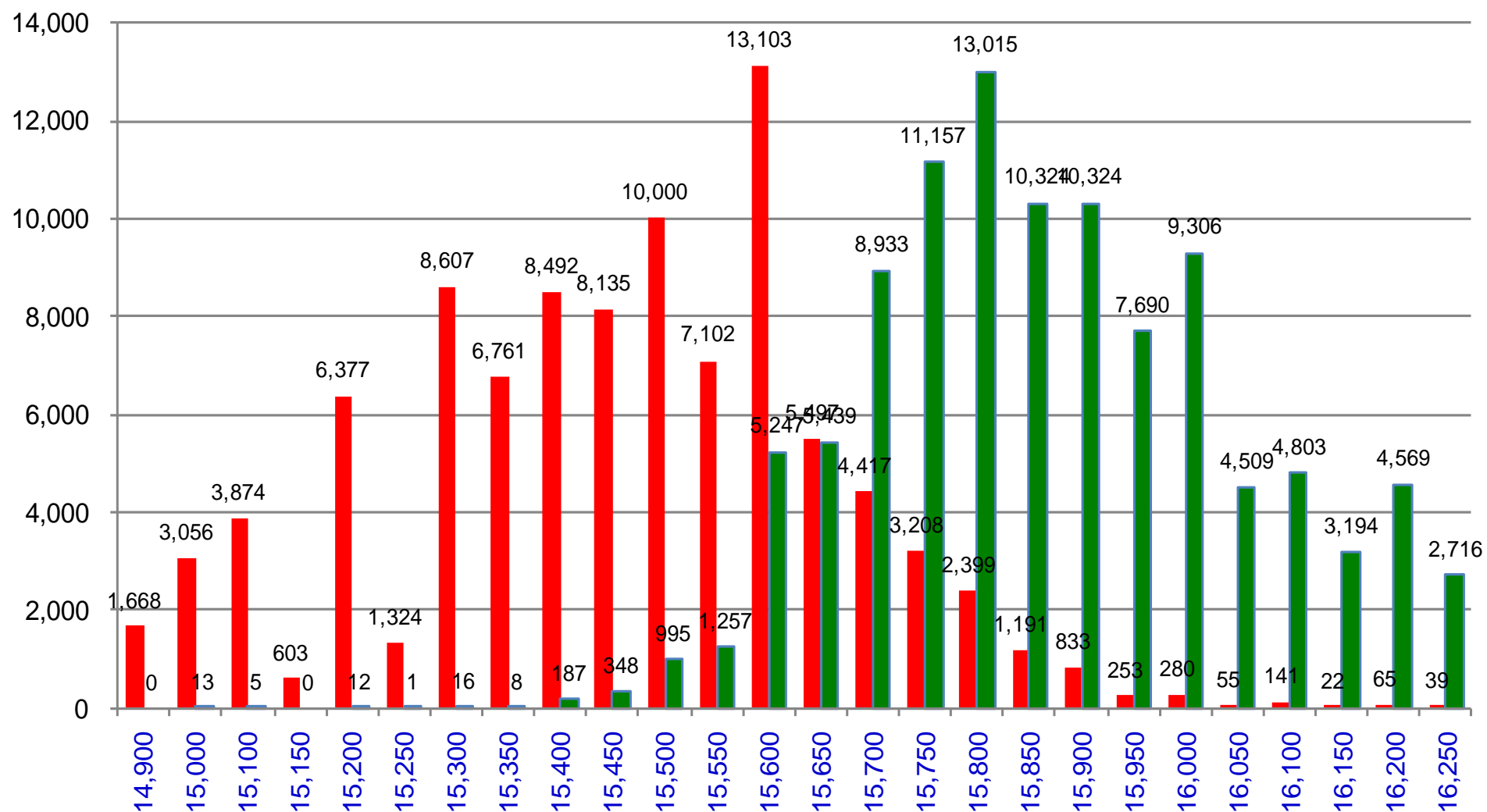


更新日期：2023年4月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：99,591

週選 CALL OI 總額：112,642



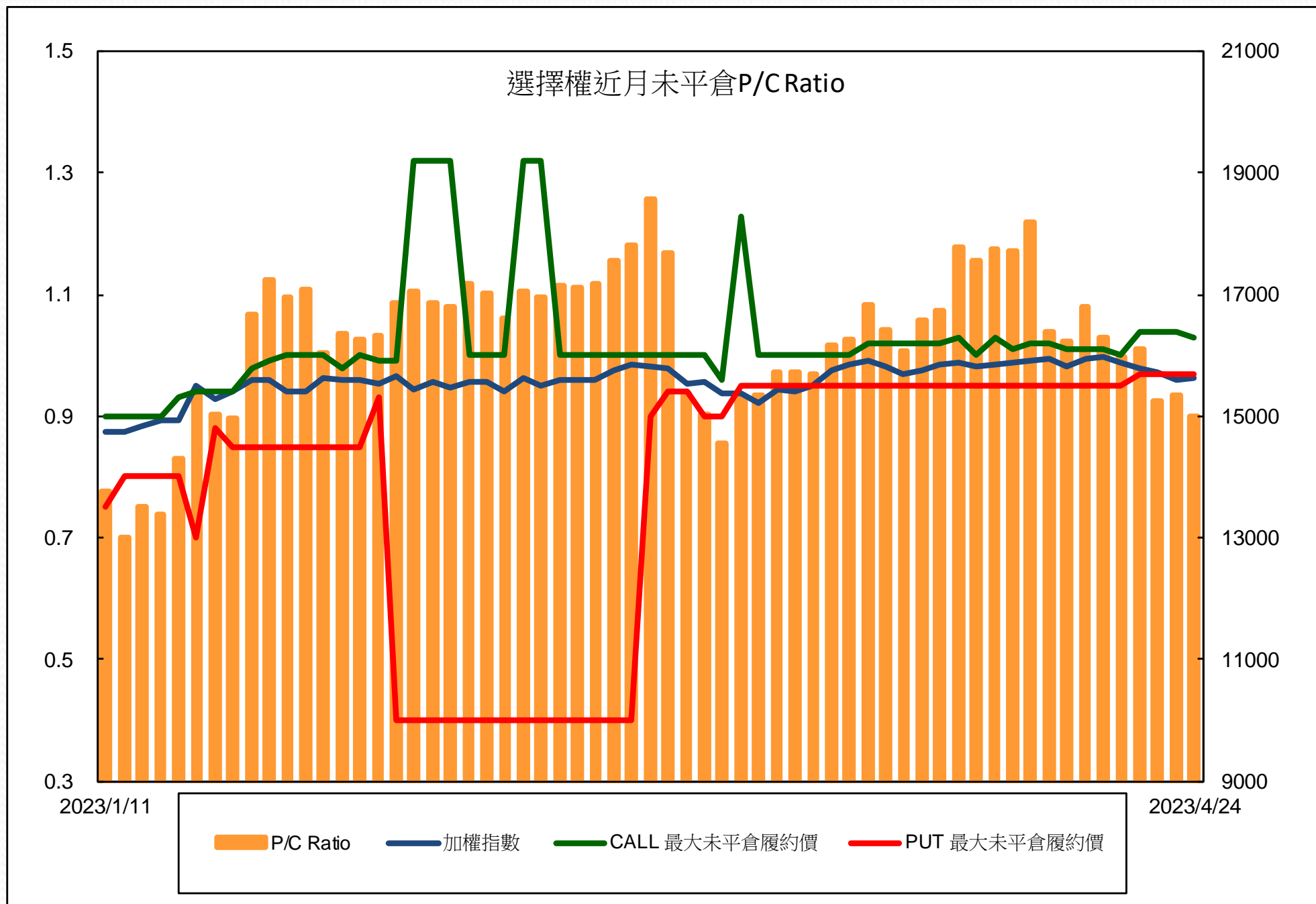
更新日期：2023年4月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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21日	55,981	35,361	20,620
	4月24日	60,922	42,314	18,608
Put	4月21日	37,237	34,890	2,347
	4月24日	37,580	42,919	-5,339

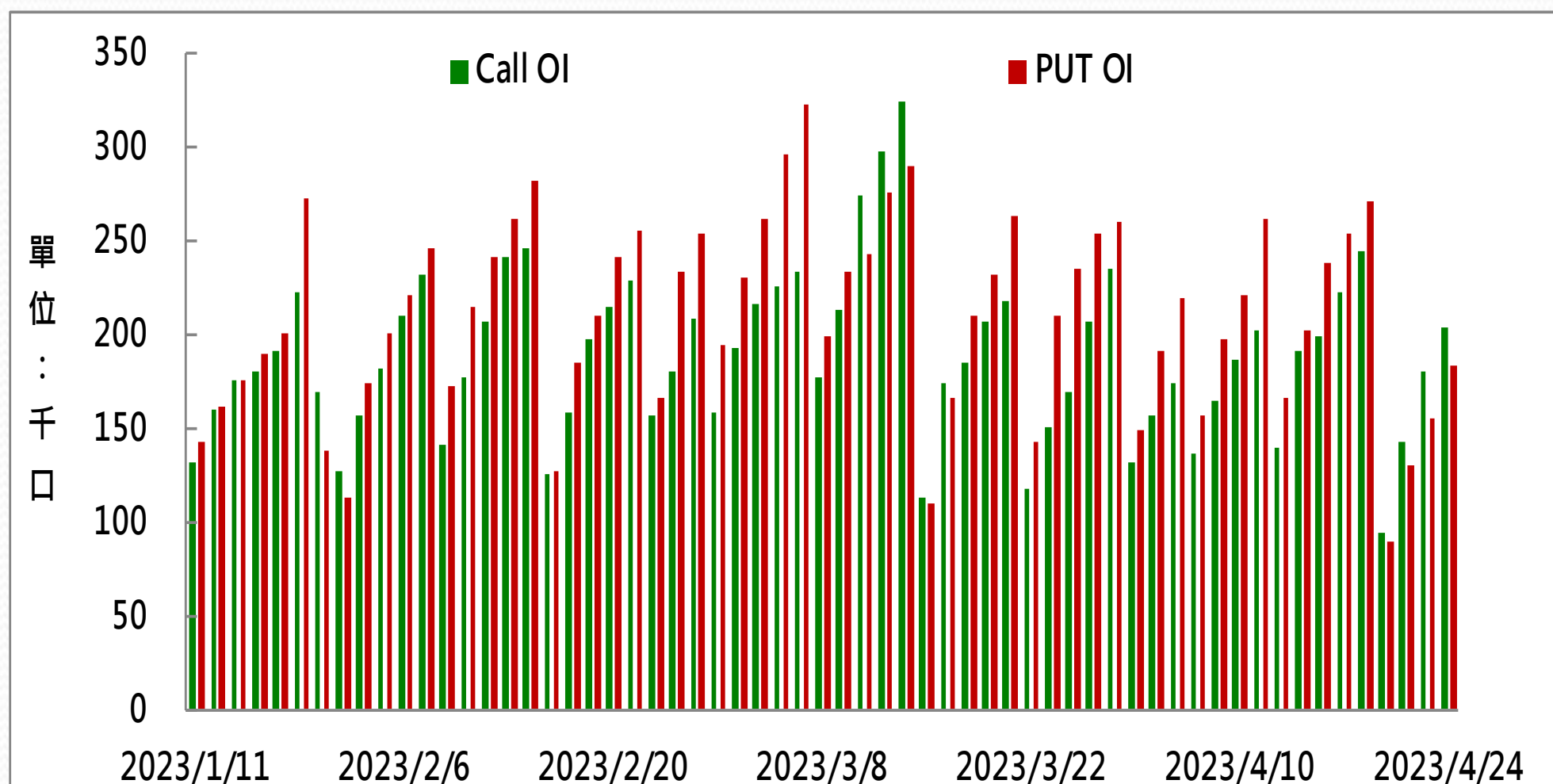
更新日期：2023年4月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年4月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

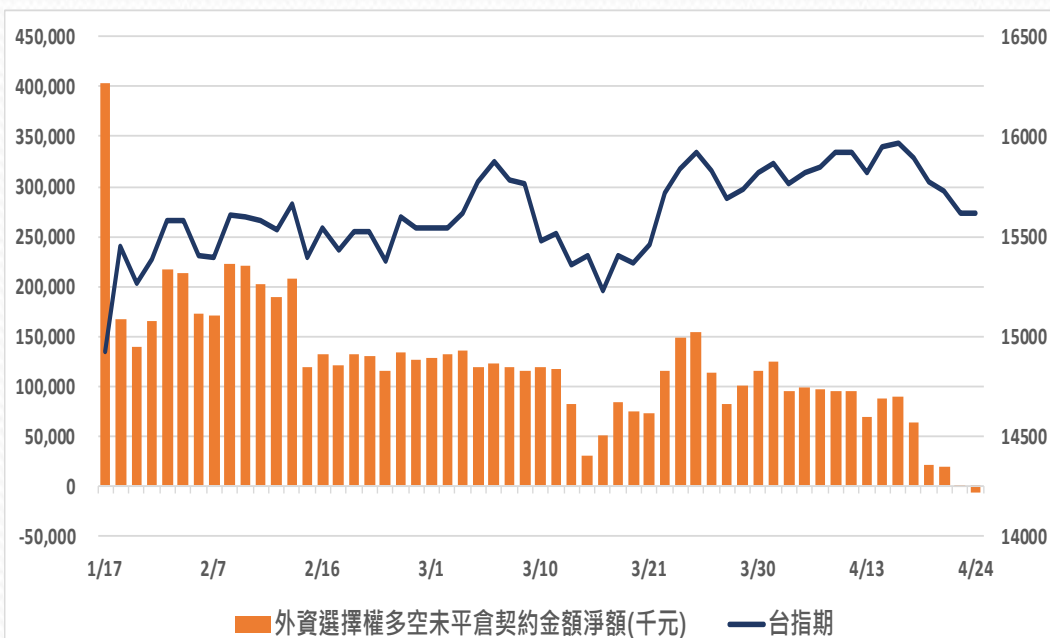
選擇權全月Put Call OI



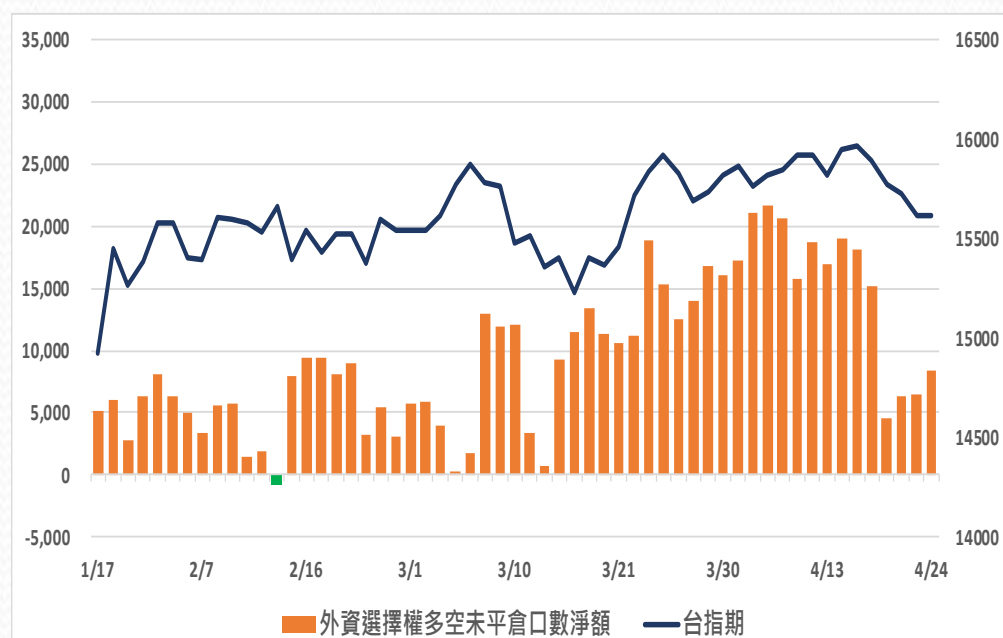
更新日期：2023年4月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



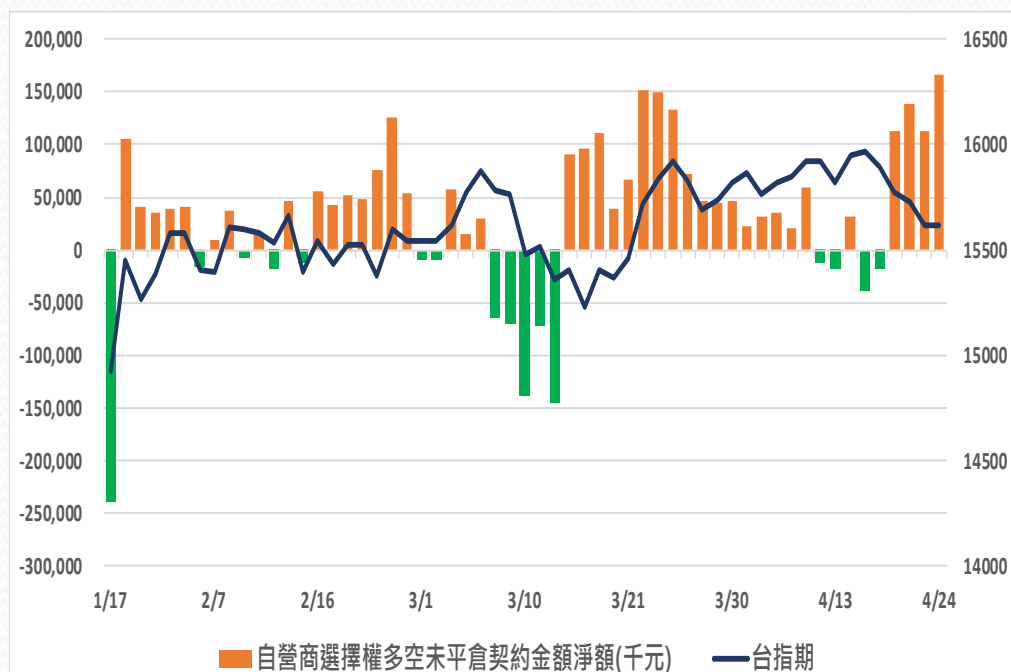
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/18	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
2023/4/24	15620	8,386	+1,904	-6,632	-6,127

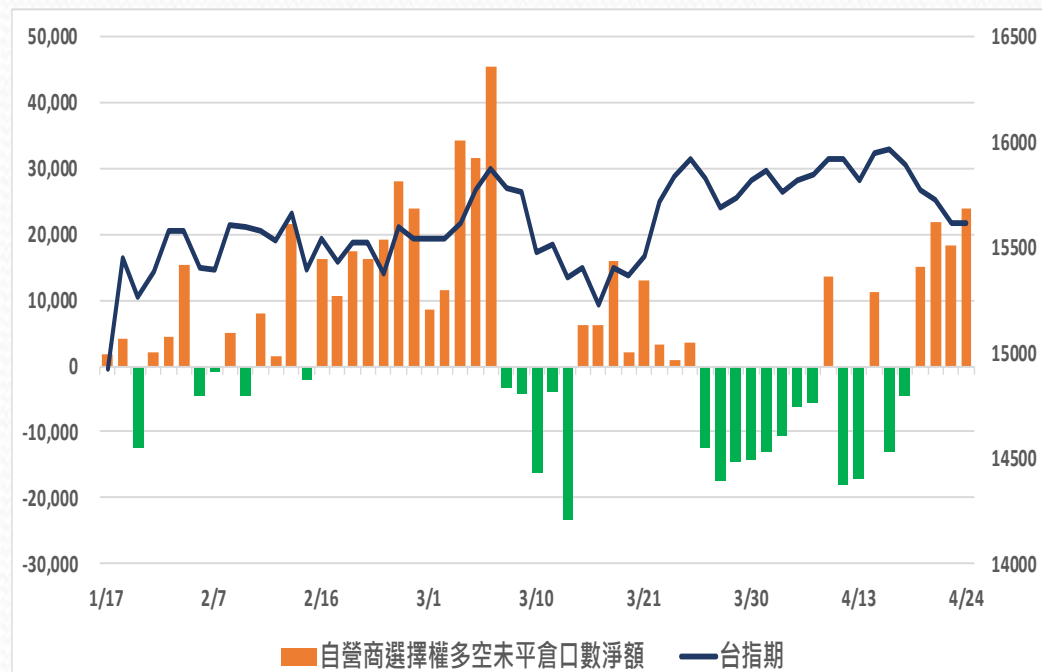
更新日期：2023年4月24日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



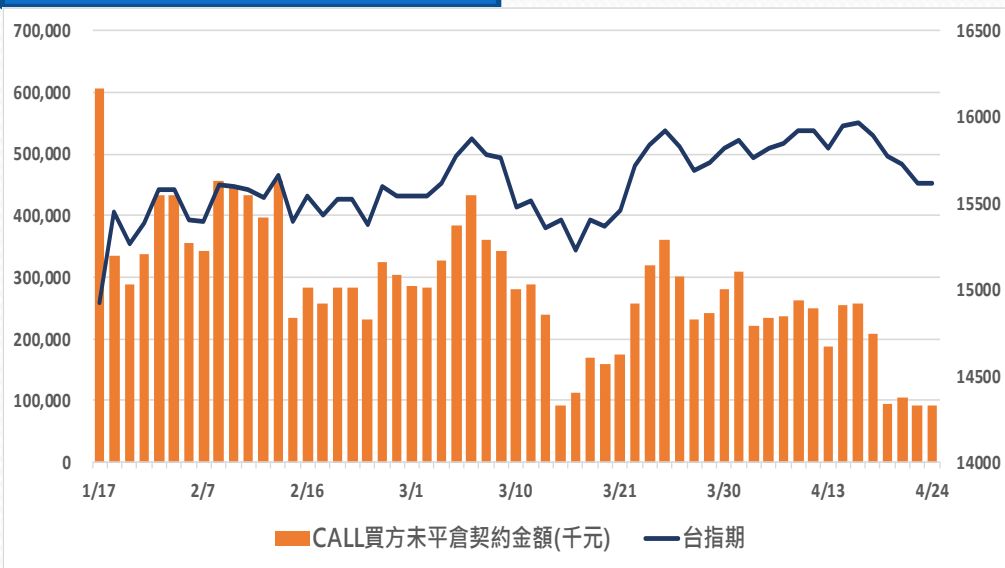
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/18	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
2023/4/24	15620	23,947	+5,674	165,702	+52,062

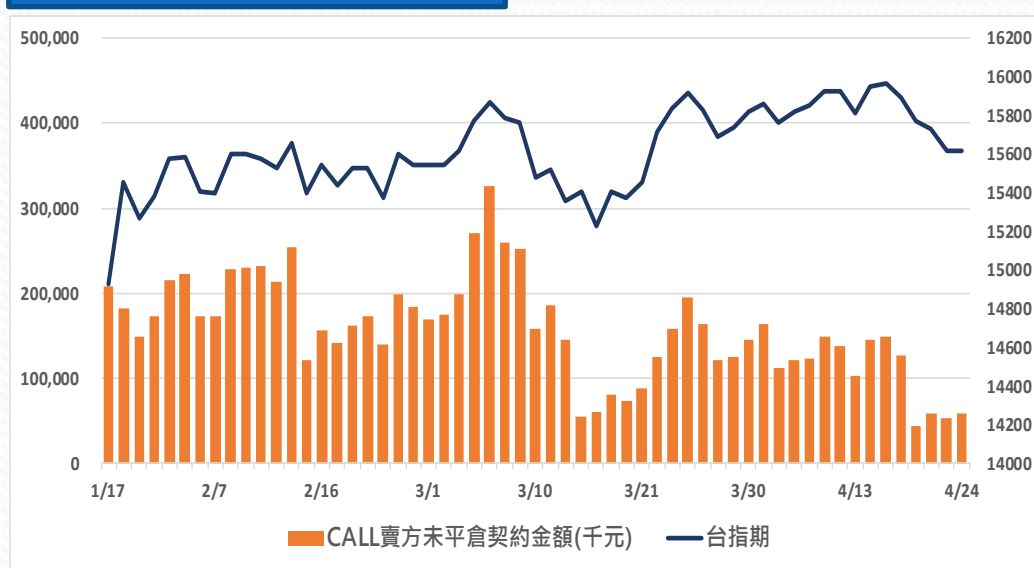
更新日期：2023年4月24日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

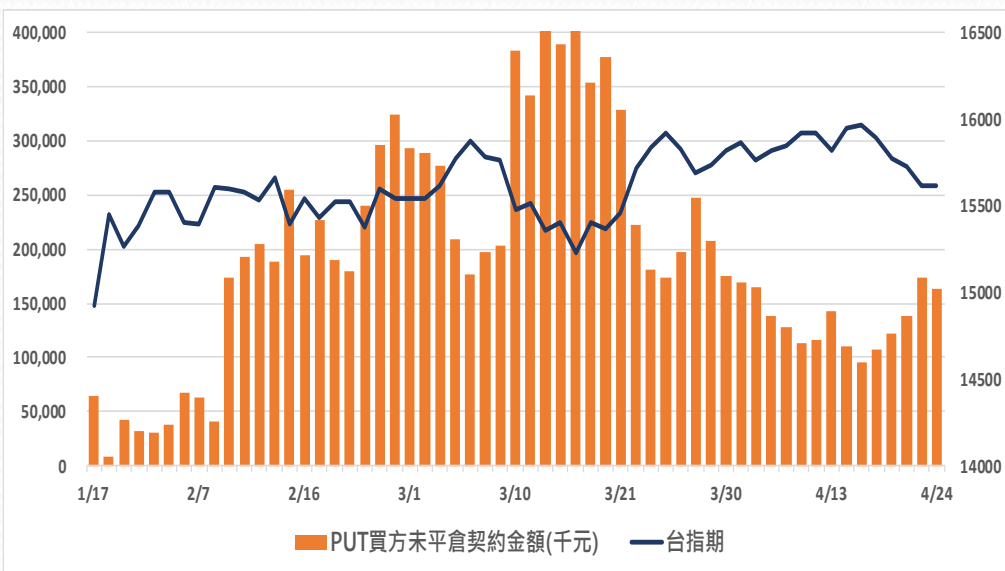
CALL買方未平倉金額



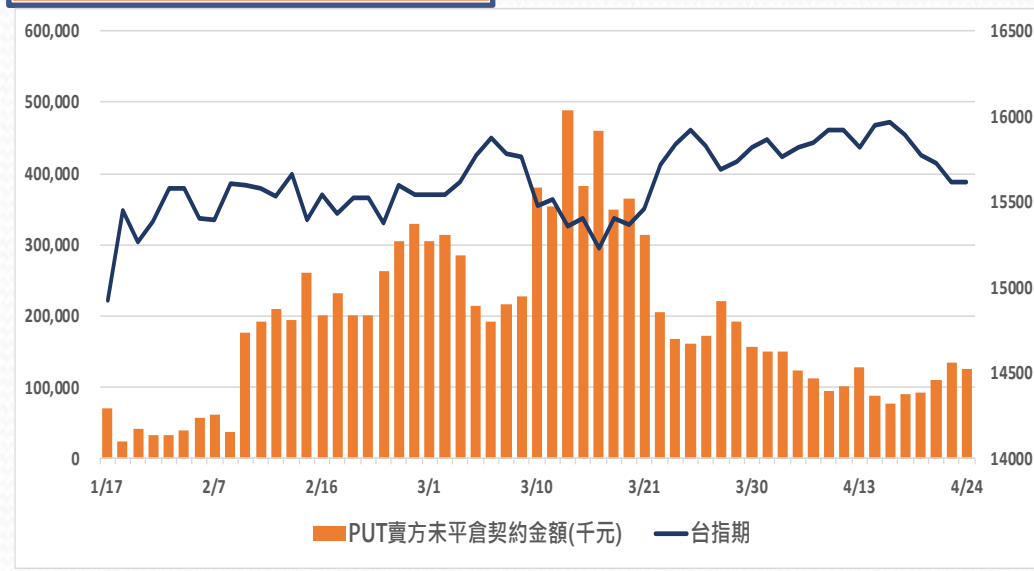
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



PUT賣方未平倉金額



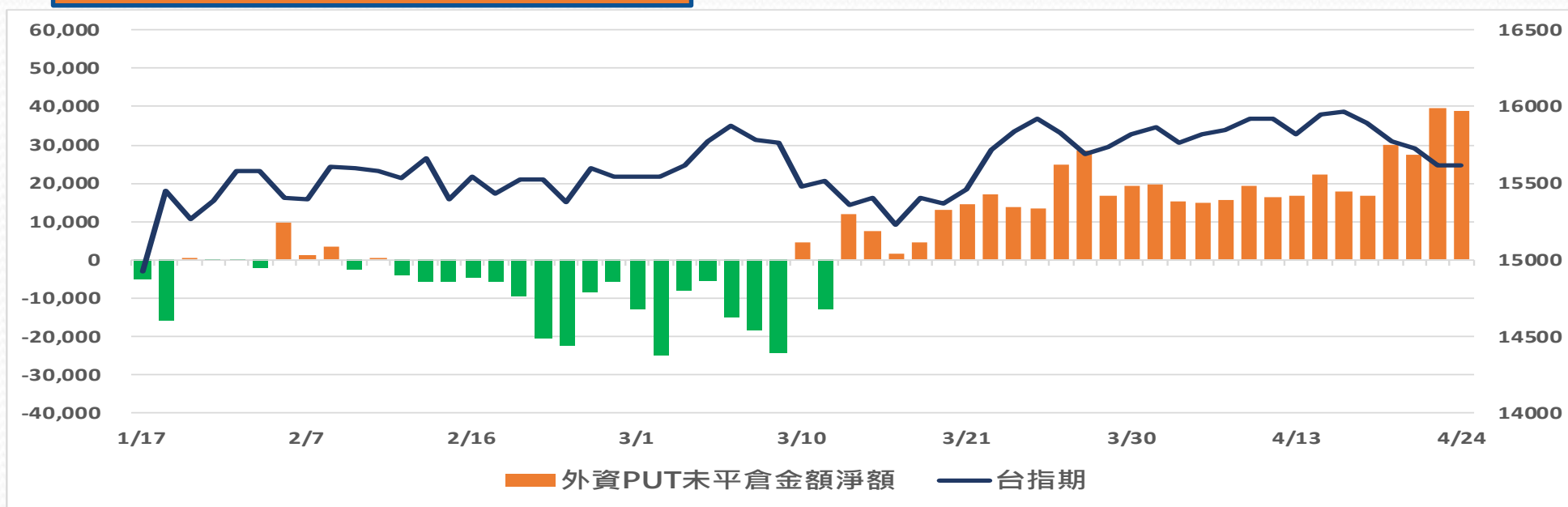
更新日期：2023年4月24日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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24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24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