

台指選擇權OI匯報

日期：2023/4/25 結算日：2023/4/26					日期：2023/4/25 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	1	14,300	51	0	0	5	14,100	425	-9
0	0	14,400	62	0	0	2	14,200	1,454	-14
0	0	14,500	165	12	0	8	14,300	1,573	885
0	0	14,600	154	-4	-7	74	14,400	3,508	156
0	4	14,700	270	-35	-4	22	14,500	2,024	340
0	5	14,800	1,228	56	-2	5	14,600	1,584	398
0	0	14,900	1,802	134	-1	10	14,700	1,640	455
0	13	15,000	3,740	684	7	28	14,800	1,937	193
2	7	15,100	4,404	530	2	31	14,900	1,993	-243
9	9	15,150	1,530	927	38	79	15,000	6,803	602
68	80	15,200	7,281	904	15	57	15,100	3,117	-879
135	136	15,250	3,489	2,165	69	165	15,200	3,894	-29
1,231	1,247	15,300	9,134	527	644	869	15,300	2,615	23
2,234	2,242	15,350	7,613	852	334	598	15,400	2,945	678
6,231	6,418	15,400	7,943	-549	721	1,053	15,500	2,276	141
7,211	7,559	15,450	7,942	-193	658	1,471	15,600	1,526	-58
※ 10,903	11,898	15,500	8,456	-1,544	※ 881	2,986	15,700	6,013	-291
8,658	9,915	15,550	4,240	-2,862	544	3,183	15,800	954	-143
6,571	11,818	15,600	7,038	-6,065	802	4,697	15,900	833	-23
4,493	9,932	15,650	2,883	-2,614	191	7,092	16,000	342	-13
1,286	10,219	15,700	2,396	-2,021	113	3,691	16,100	102	1
-3,699	7,458	15,750	3,220	12	-417	3,901	16,200	102	-2
-4,333	8,682	15,800	2,243	-156	-95	7,956	16,300	77	-2
-3,337	6,987	15,850	1,181	-10	-488	7,425	16,400	34	20
-2,562	7,762	15,900	748	-85	3	3,936	16,500	16	-1
-412	7,278	15,950	246	-7	-160	2,745	16,600	13	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
31,738	144,380	0.6248	90,207	-9,384	3,716	61,879	0.8829	54,632	2,321
昨日 P/C	0.8841	今日增減變化	-0.2593		昨日 P/C	0.8994	今日增減變化	-0.0165	

更新日期：2023年4月25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25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	98,253,554	78,026,314	20,227,240	-28,747,158	2,532,693	746,930	1,785,763	-1,010		
投信	27,924,879	52,851,982	-24,927,103	-100,675	303,351	0	303,351	-87,232		
自營商	39,108,580	20,875,155	18,233,425	2,366,889	1,433,748	781,103	652,645	57,916		
	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	173,936	1,000,132	-826,196	-64,526	25,706	71,069	-45,363	9,749		
投信	122,687	0	122,687	-616	0	0	0	0		
自營商	354,084	158,394	195,690	81,740	300,908	252,397	48,511	-2,132		

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25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	31,622	18,096	13,526	-1,971	25,481	14,823	10,658	3,547		
投信	100	0	100	0	150	113	37	0		
自營商	57,118	58,608	-1,490	-20,098	42,748	44,079	-1,331	4,008		
特定法人(週)	1,947	2,825	-878	-2,449	0	3,858	-3,858	-220		
特定法人(近月)	23,775	9,090	14,685	1,236	6,861	13,395	-6,534	-1,938		
特定法人(全月)	23,852	10,168	13,684	-2,765	6,100	19,580	-13,480	-3,795		
十大交易人(週)	35,069	51,182	-16,113	-21,994	29,632	21,065	8,567	-2,573		
十大交易人(近月)	38,607	24,360	14,247	-160	20,395	28,058	-7,663	-3,198		
十大交易人(全月)	81,267	69,533	11,734	-19,712	52,315	53,725	-1,410	-5,257		
全市場未沖銷(近月)			61,879	3,716			54,632	2,321		
全市場未沖銷(全月)			248,233	44,853			184,958	1,572		

更新日期：2023年4月25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	15600	買權OI最大量	15500
	賣權成交最大量	15500	賣權OI最大量	15300
	整體隱含波動率	9.18%	較前一交易日	-1.87%
	買權隱含波動率	12.34%	較前一交易日	+2.93%
	賣權隱含波動率	5.24%	較前一交易日	-7.49%
電子選擇權	買權成交最大量	745	買權OI最大量	745
	賣權成交最大量	680	賣權OI最大量	680
金融選擇權	買權成交最大量	1580	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1500

更新日期：2023年4月25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	15000
	整體隱含波動率	14.35%	較前一交易日	-0.92%
	買權隱含波動率	13.17%	較前一交易日	+1.49%
	賣權隱含波動率	15.64%	較前一交易日	-0.36%
	成交量P/C_Ratio值	0.944	較前一交易日	+0.22
	未平倉P/C_Ratio值	0.883	較前一交易日	-0.02
電子選擇權	買權成交最大量	745	買權OI最大量	745
	賣權成交最大量	680	賣權OI最大量	680
金融選擇權	買權成交最大量	1580	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1500

更新日期：2023年4月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

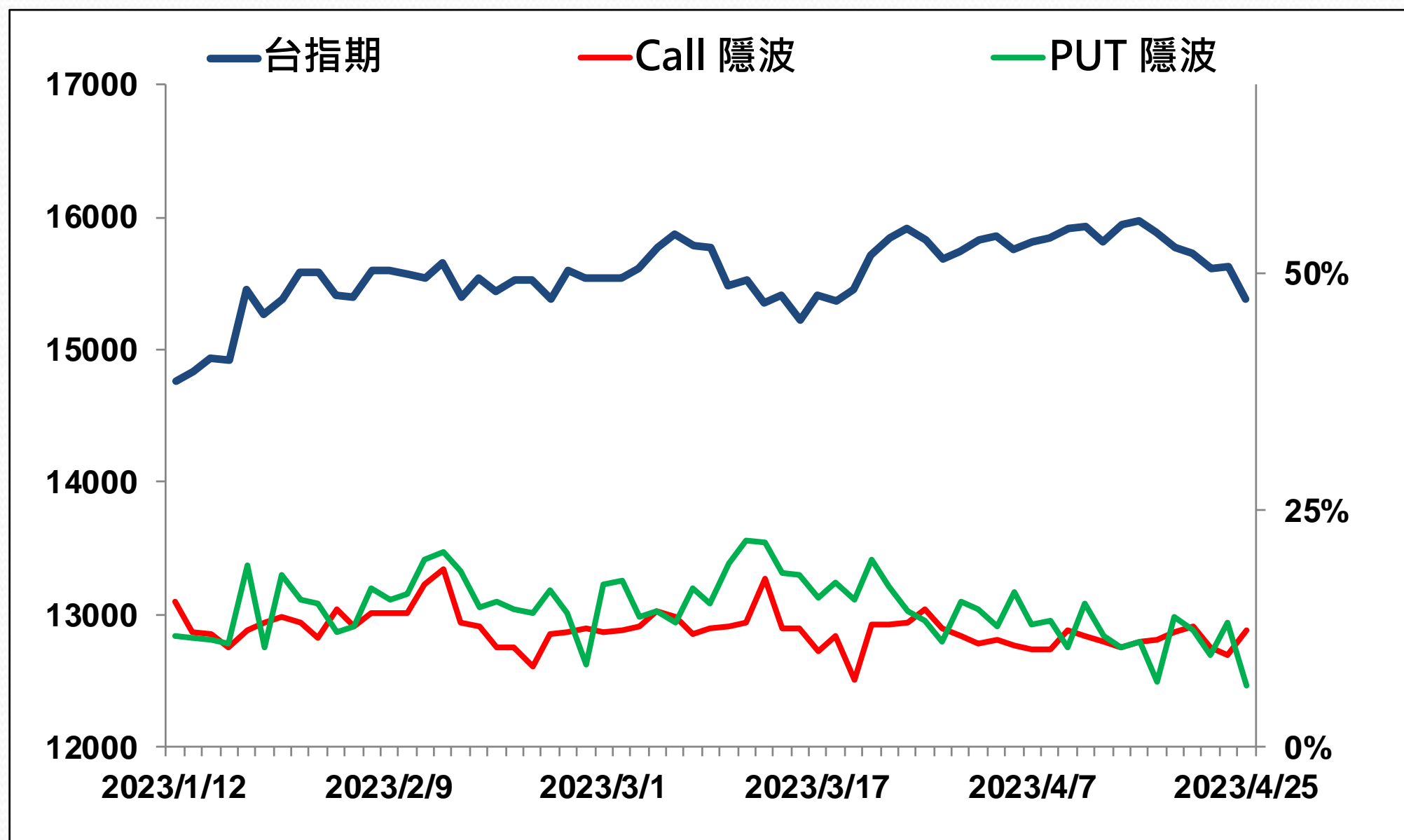
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



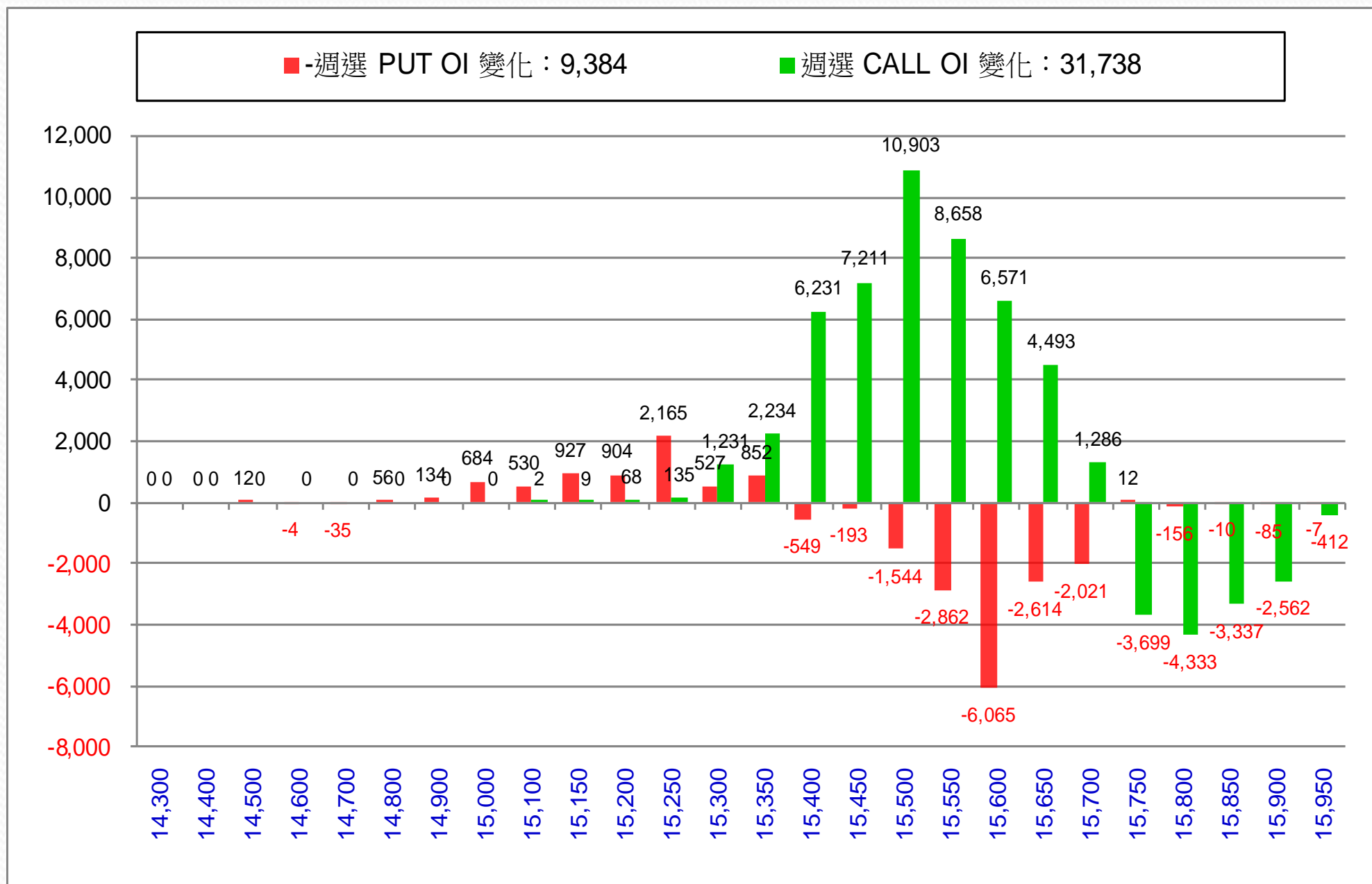
更新日期：2023年4月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年4月25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

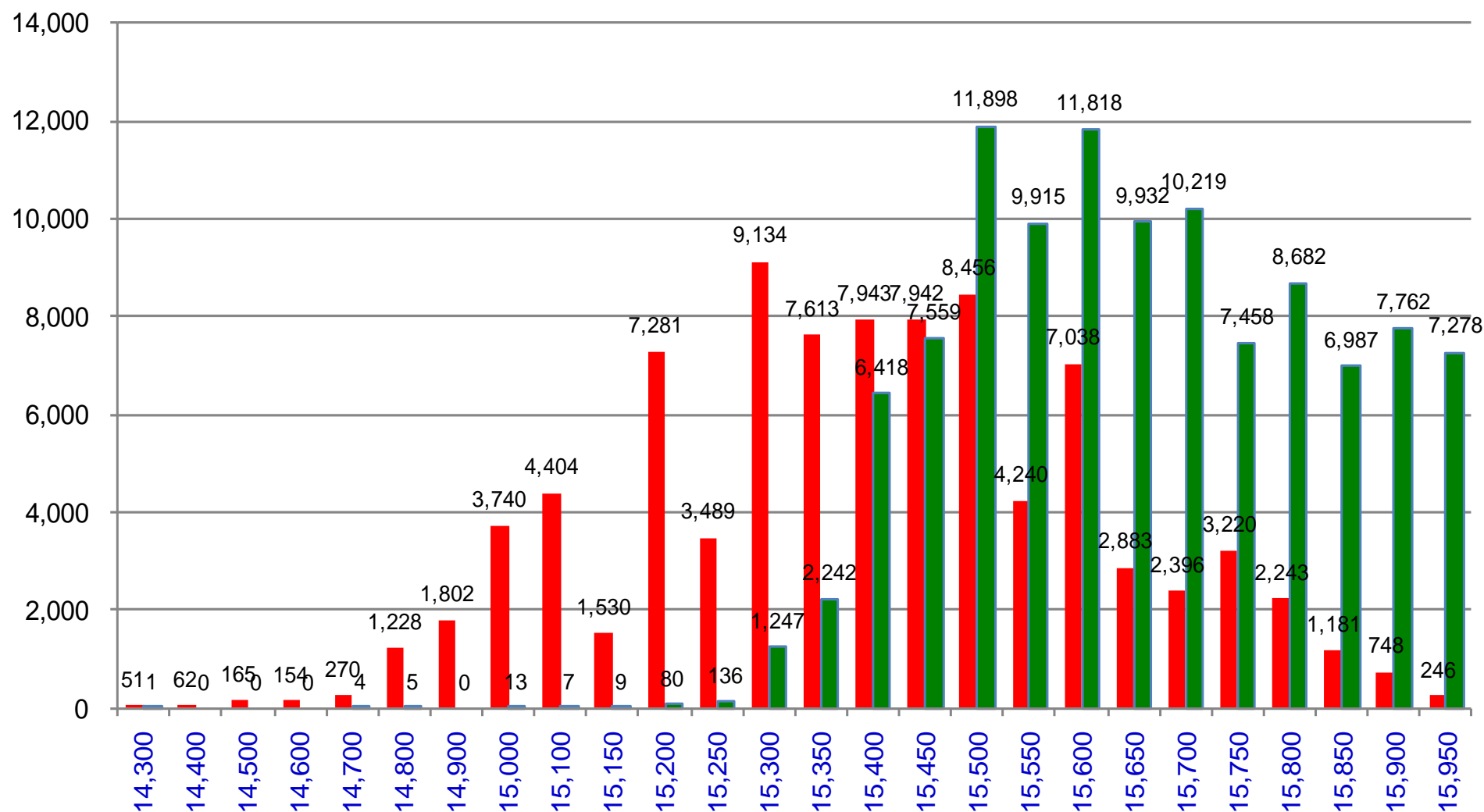


更新日期：2023年4月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：90,207

週選 CALL OI 總額：144,380



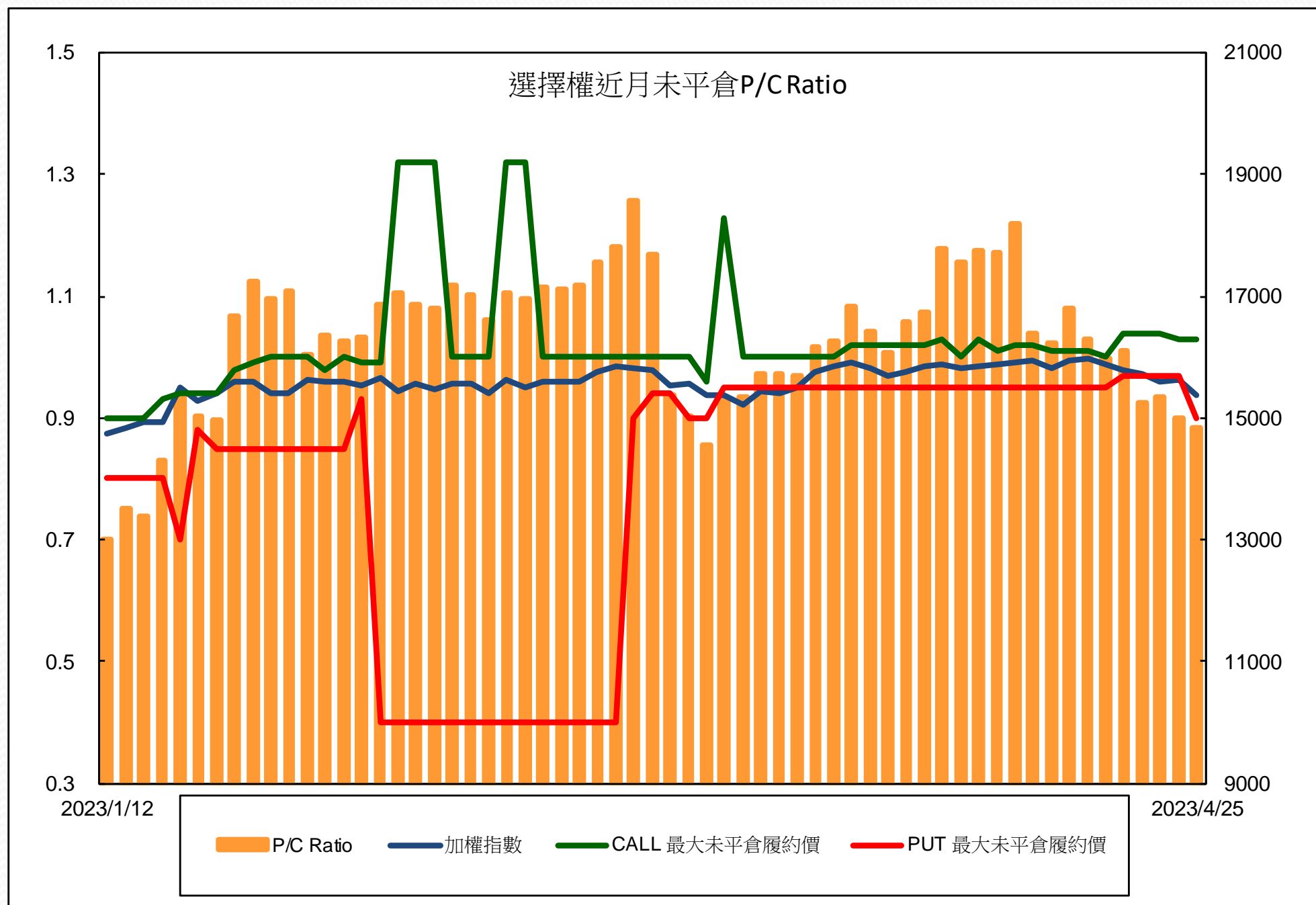
更新日期：2023年4月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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24日	60,922	42,314	18,608
	4月25日	57,118	58,608	-1,490
Put	4月24日	37,580	42,919	-5,339
	4月25日	42,748	44,079	-1,331

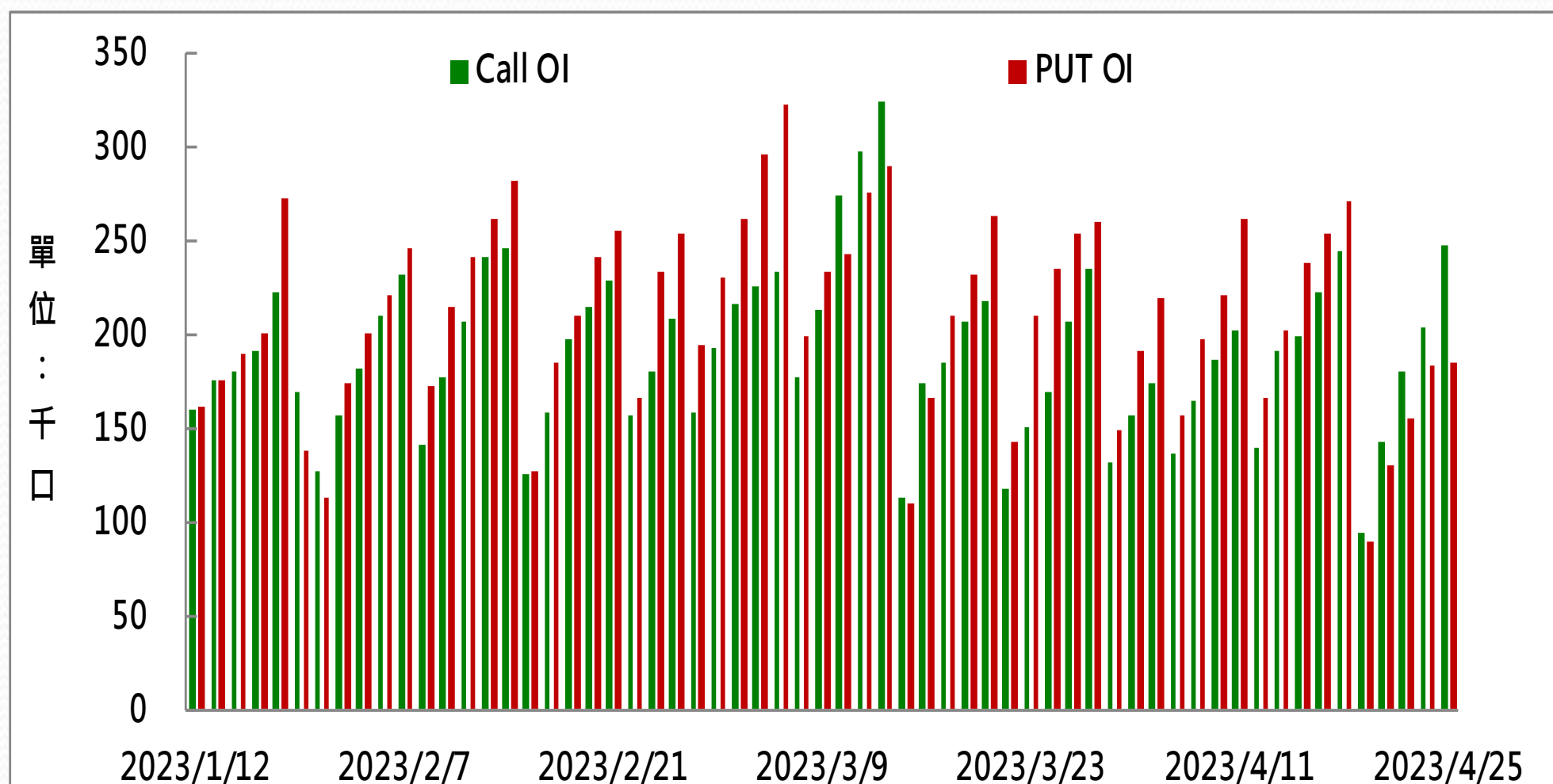
更新日期：2023年4月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年4月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

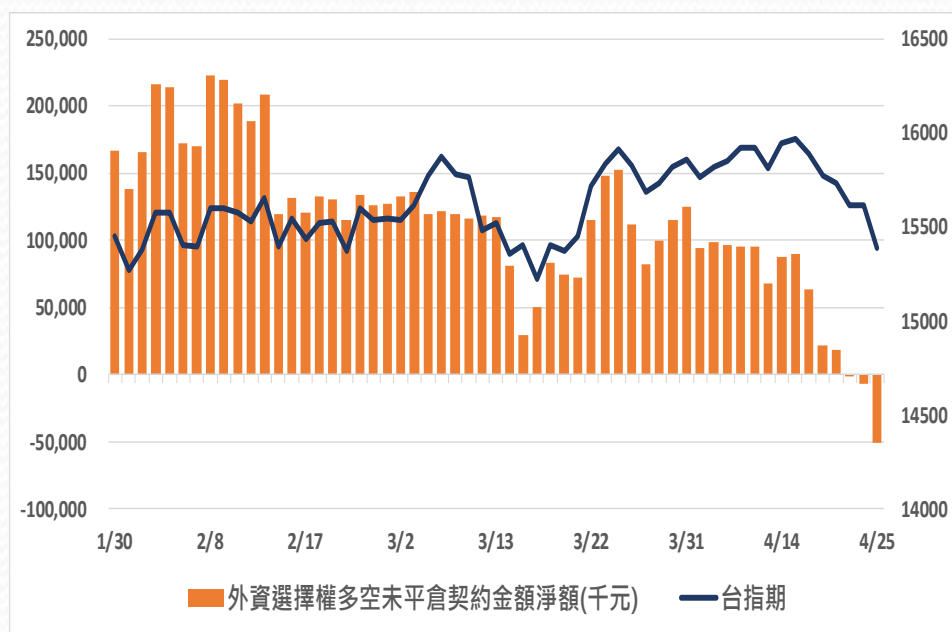
選擇權全月Put Call OI



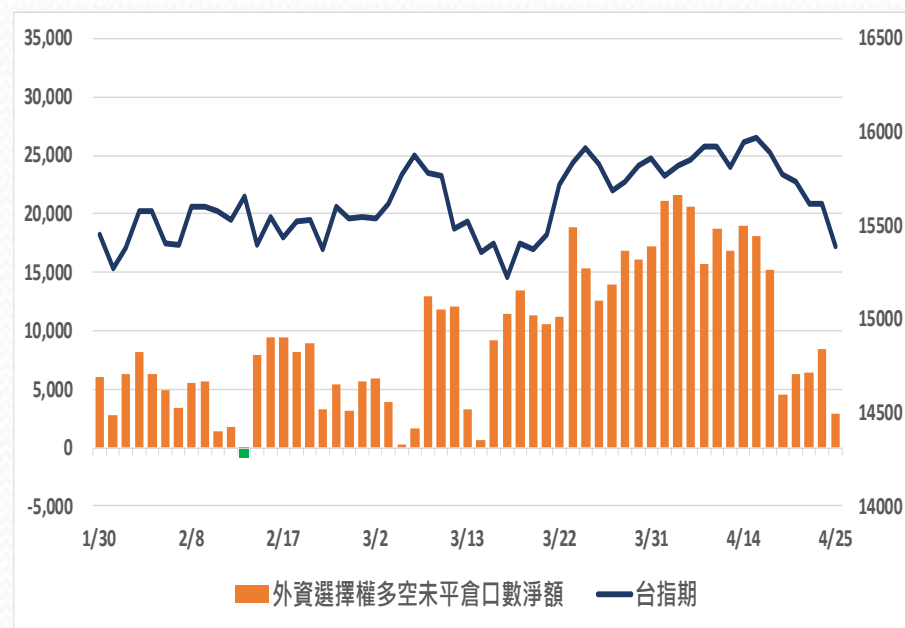
更新日期：2023年4月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



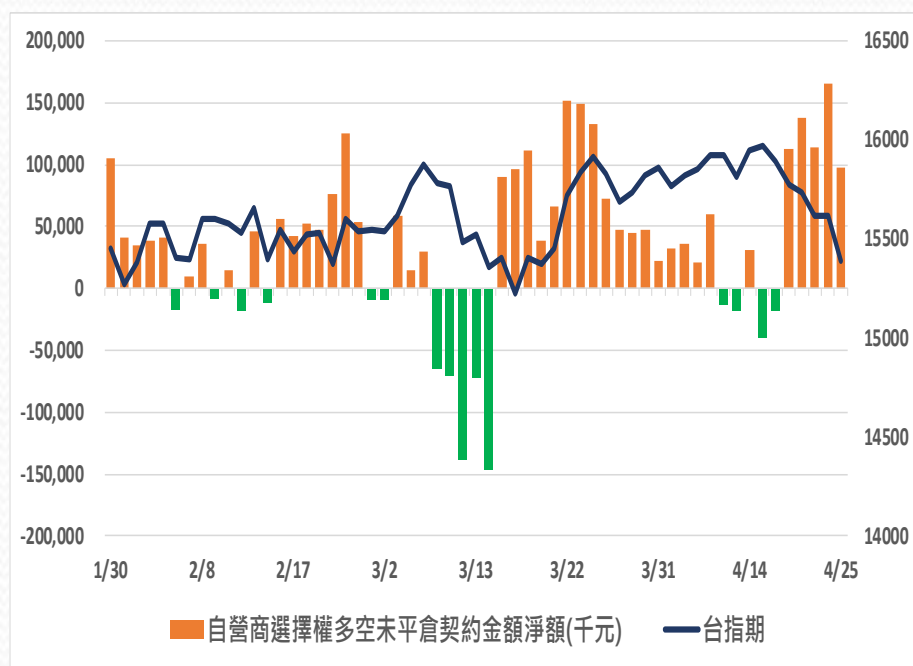
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/19	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
2023/4/25	15389	2,868	-5,518	-50,683	-44,051

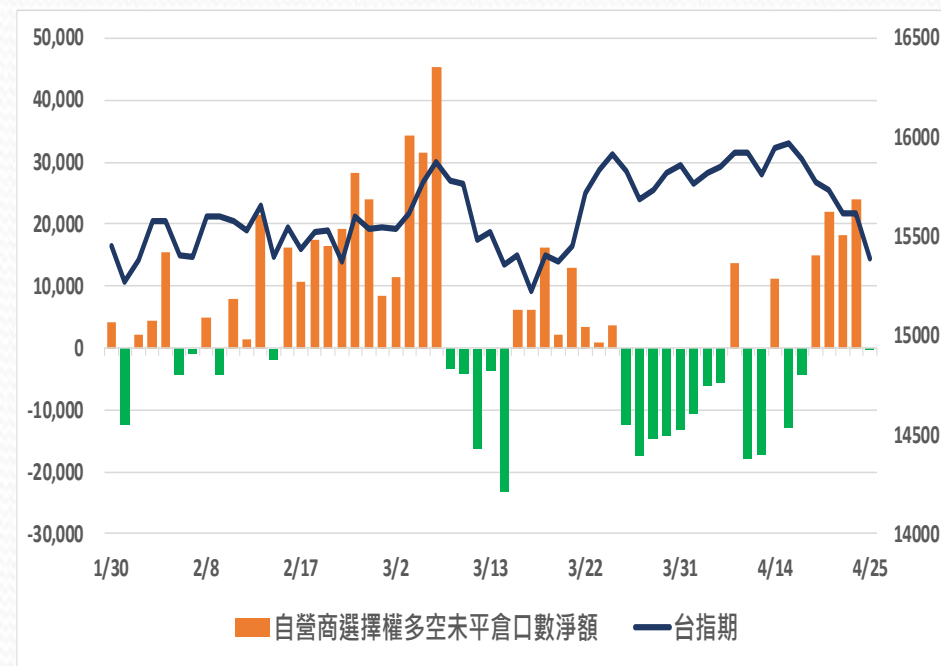
更新日期：2023年4月25日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



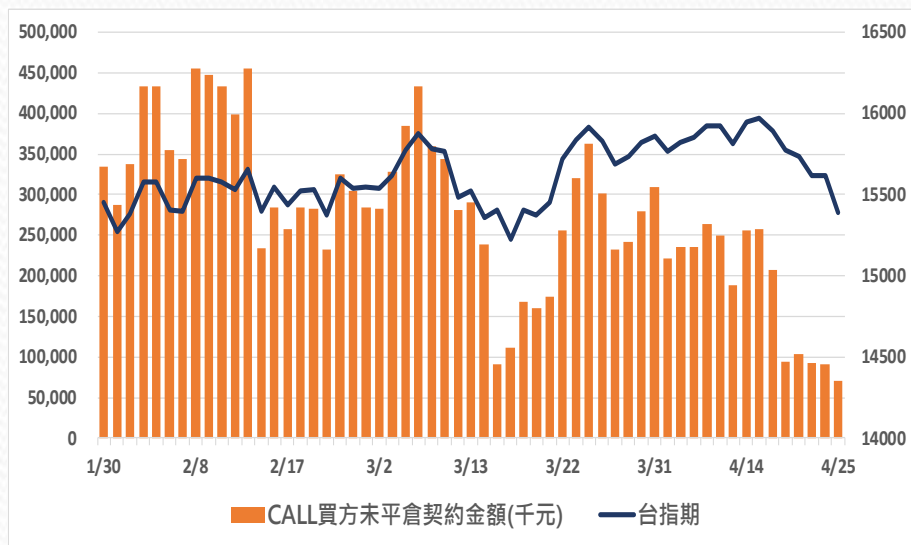
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/19	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
2023/4/25	15389	-159	-24,106	97,333	-68,369

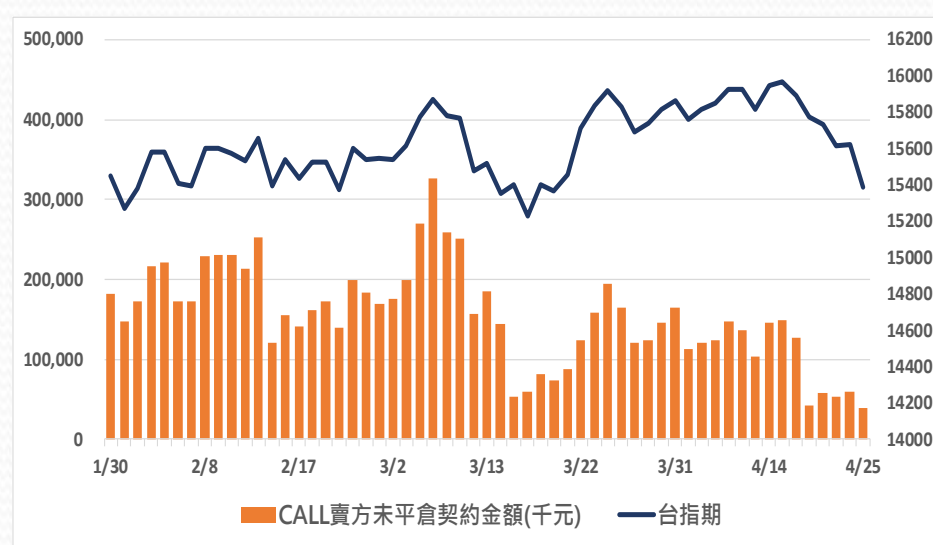
更新日期：2023年4月25日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

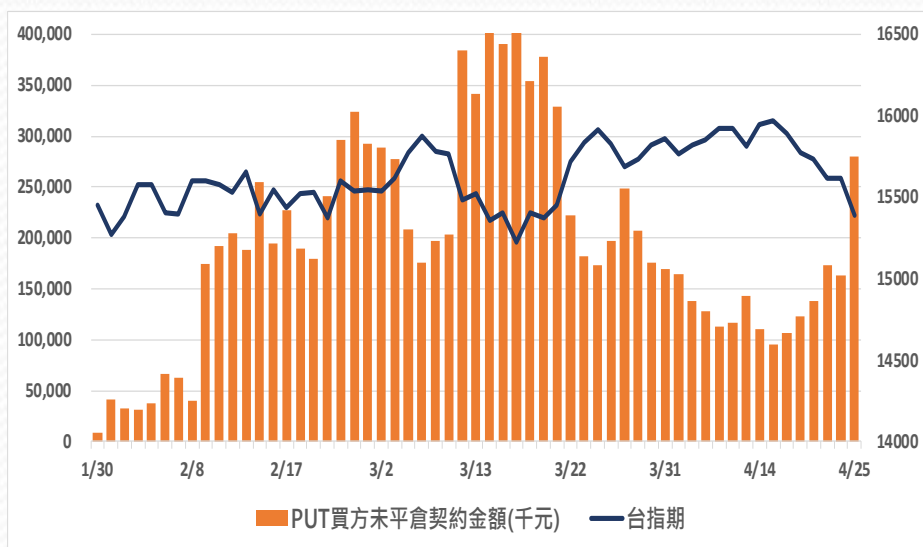
CALL買方未平倉金額



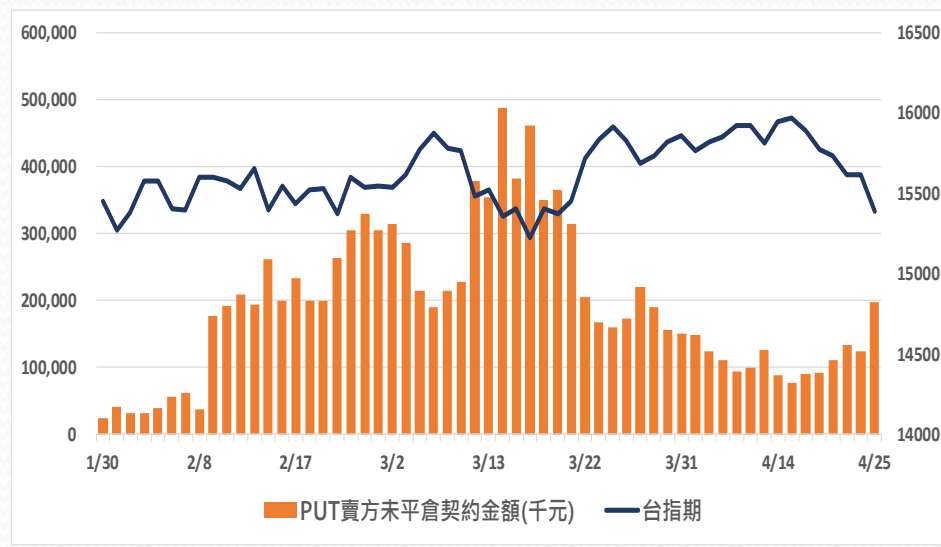
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



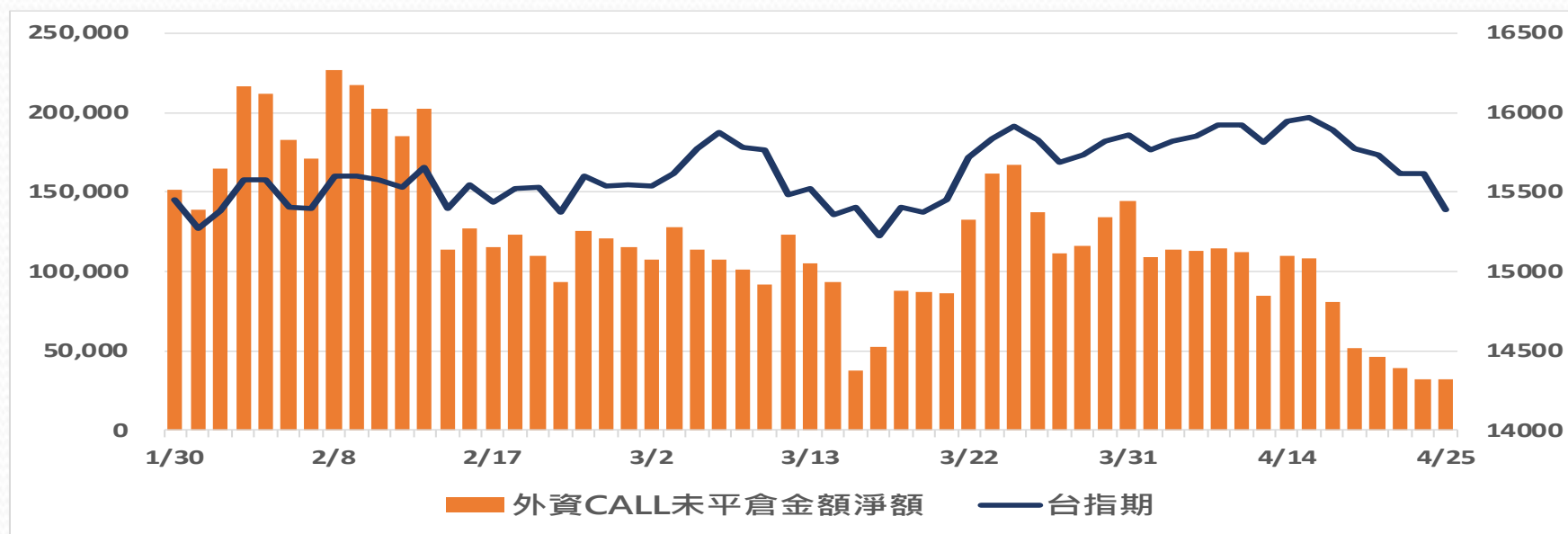
PUT賣方未平倉金額



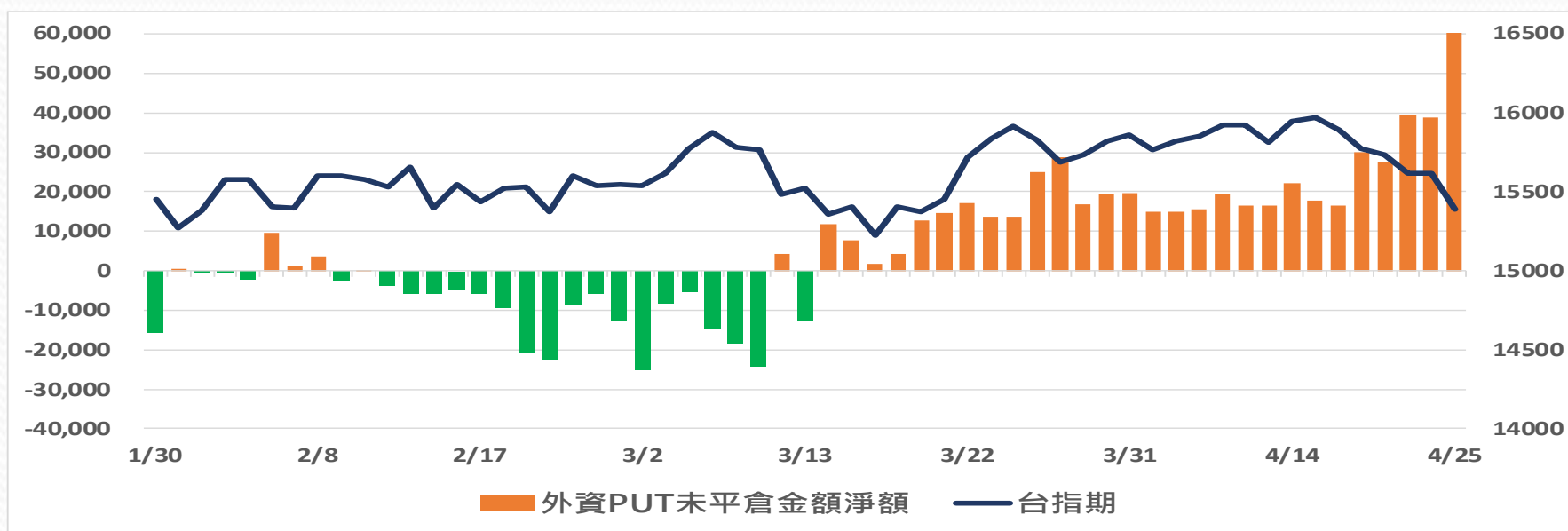
更新日期：2023年4月25日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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25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25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