

台指選擇權OI匯報

日期：2023/4/26					日期：2023/4/26				
結算日：2023/5/3					結算日：2023/5/17				
202305W1					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	12	14,500	715	456	0	5	14,100	430	5
0	0	14,600	395	161	0	2	14,200	1,511	57
0	1	14,700	840	563	0	8	14,300	1,552	-21
4	4	14,800	1,760	1,326	0	74	14,400	3,600	92
1	4	14,900	2,010	1,510	0	22	14,500	2,313	289
8	8	14,950	485	485	0	5	14,600	2,189	605
7	9	15,000	3,281	1,479	8	18	14,700	2,108	468
3	3	15,050	698	698	0	28	14,800	2,447	510
19	23	15,100	2,639	1,557	13	44	14,900	2,296	303
43	46	15,150	1,330	778	53	132	15,000	6,883	80
133	264	15,200	3,214	1,937	29	86	15,100	3,011	-106
128	236	15,250	1,815	1,017	151	316	15,200	4,136	242
507	612	15,300	2,348	688	668	1,537	15,300	3,227	612
728	785	15,350	1,674	1,097	392	990	15,400	2,527	-418
2,378	2,747	15,400	2,304	-298	351	1,404	15,500	1,986	-290
1,229	1,504	15,450	616	186	504	1,975	15,600	1,488	-38
1,757	2,928	15,500	1,035	-14	1,020	4,006	15,700	5,823	-190
1,606	2,243	15,550	535	-83	1,058	4,241	15,800	841	-113
2,095	3,826	15,600	539	-198	362	5,059	15,900	808	-25
2,499	3,654	15,650	215	-13	-172	6,920	16,000	360	18
3,202	5,178	15,700	474	-67	412	4,103	16,100	97	-5
1,443	2,902	15,750	132	-145	819	4,720	16,200	102	0
1,641	3,373	15,800	151	1	-17	7,939	16,300	77	0
934	2,659	15,900	59	0	-7	7,418	16,400	34	0
552	1,905	16,000	27	1	-19	3,917	16,500	16	0
-23	1,237	16,100	3	0	-6	2,739	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
20,913	37,837	0.8369	31,666	15,220	5,339	67,218	0.8397	56,443	1,811
昨日 P/C	0.8841	今日增減變化	-0.0472		昨日 P/C	0.8829	今日增減變化	-0.0432	

更新日期：2023年4月26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26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	99,665,168	82,548,582	17,116,586	-3,110,654	2,467,580	740,844	1,726,736	-59,027	
投信	27,898,214	52,933,418	-25,035,204	-108,101	302,036	0	302,036	-1,315	
自營商	38,375,222	21,410,550	16,964,672	-1,268,753	1,182,487	743,525	438,962	-213,683	
	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	294,084	837,128	-543,044	283,152	12,164	69,943	-57,779	-12,416	
投信	122,924	0	122,924	237	0	0	0	0	
自營商	367,216	206,930	160,286	-35,404	320,826	259,869	60,957	12,446	

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26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	27,811	13,284	14,527	1,001	21,320	13,581	7,739	-2,919	
投信	100	100	0	-100	450	113	337	300	
自營商	47,293	40,928	6,365	7,855	35,525	31,270	4,255	5,586	
特定法人(週)	514	0	514	---	0	2,171	-2,171	---	
特定法人(近月)	23,115	9,090	14,025	-660	6,573	13,395	-6,822	-288	
特定法人(全月)	23,859	5,687	18,172	4,488	7,514	17,103	-9,589	3,891	
十大交易人(週)	19,181	19,599	-418	---	12,944	12,669	275	---	
十大交易人(近月)	39,958	26,970	12,988	-1,259	19,894	27,676	-7,782	-119	
十大交易人(全月)	71,338	46,181	25,157	13,423	39,049	49,103	-10,054	-8,644	
全市場未沖銷(近月)			67,218	5,339			56,443	1,811	
全市場未沖銷(全月)			133,979	-114,254			116,175	-68,783	

更新日期：2023年4月26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05W1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	15700
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	12.34%	較前一交易日	+3.16%
	買權隱含波動率	11.27%	較前一交易日	-1.07%
	賣權隱含波動率	13.53%	較前一交易日	+8.28%
電子選擇權	買權成交最大量	740	買權OI最大量	810
	賣權成交最大量	680	賣權OI最大量	720
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	1540	賣權OI最大量	1500

更新日期：2023年4月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

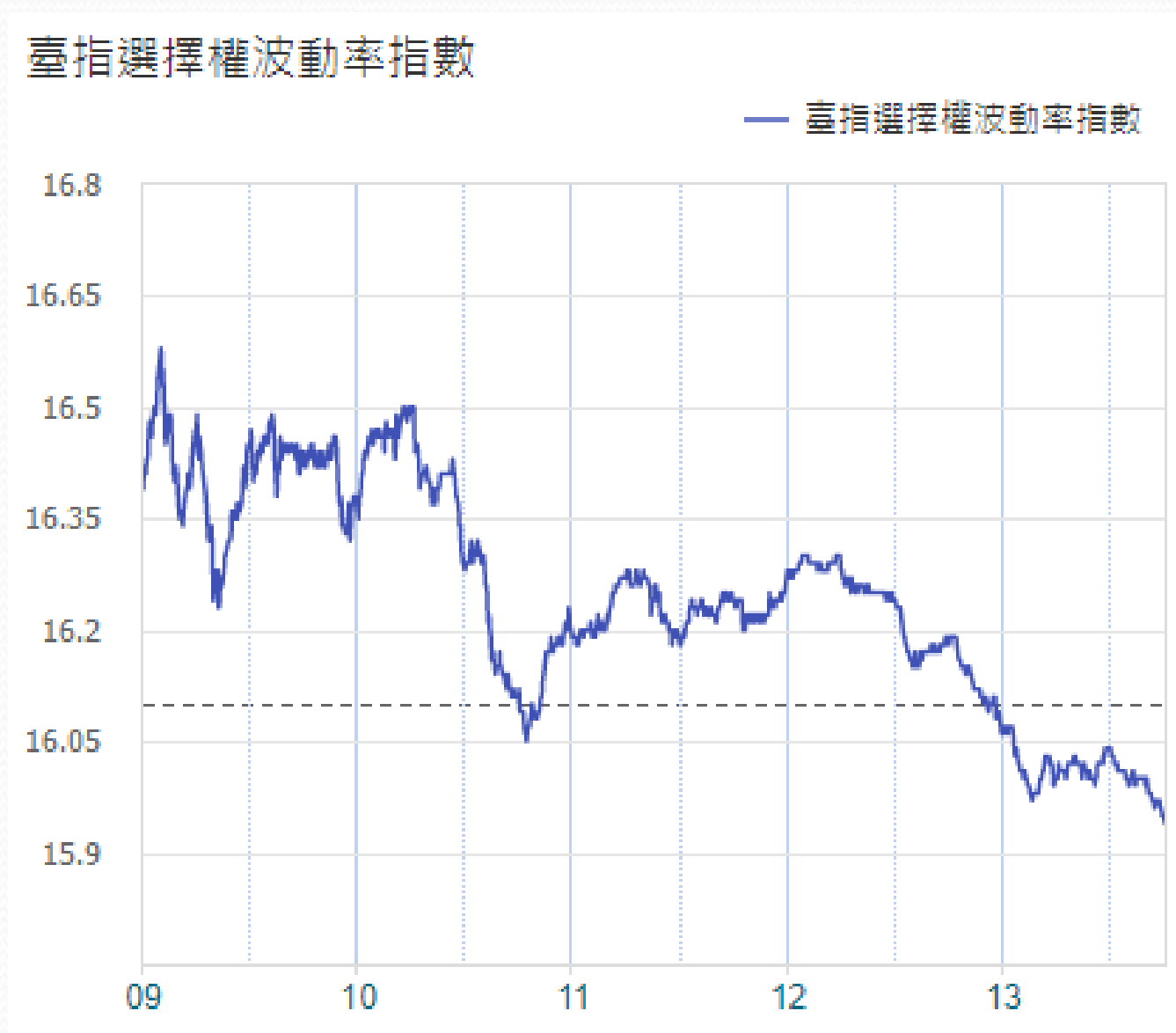
台指選擇權匯報

2023年05月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15700	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	14.26%	較前一交易日	+0.09%
	買權隱含波動率	12.57%	較前一交易日	-0.59%
	賣權隱含波動率	15.95%	較前一交易日	+0.30%
	成交量P/C_Ratio值	0.941	較前一交易日	-0.00
	未平倉P/C_Ratio值	0.840	較前一交易日	-0.04
電子選擇權	買權成交最大量	740	買權OI最大量	810
	賣權成交最大量	680	賣權OI最大量	720
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	1540	賣權OI最大量	1500

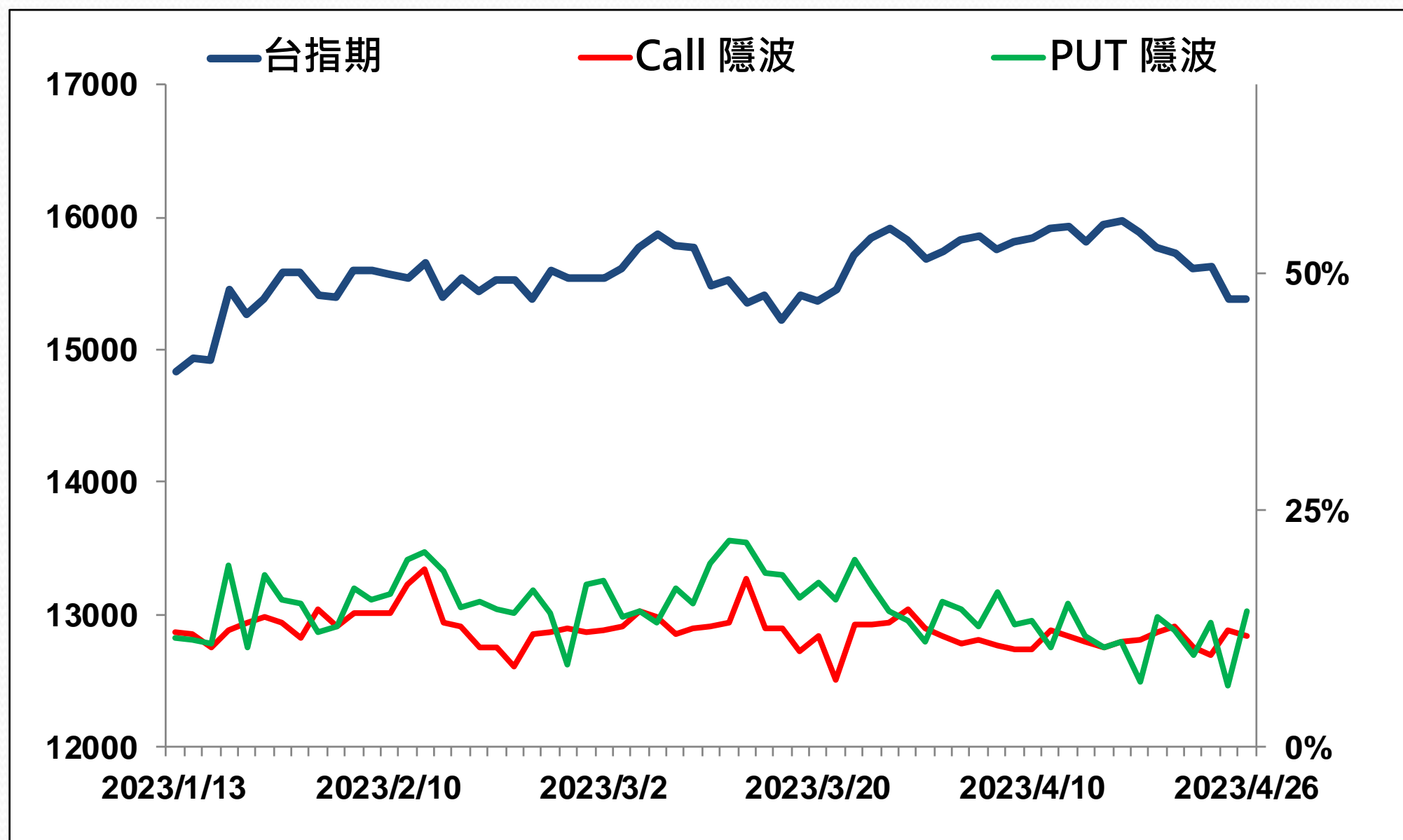
更新日期：2023年4月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



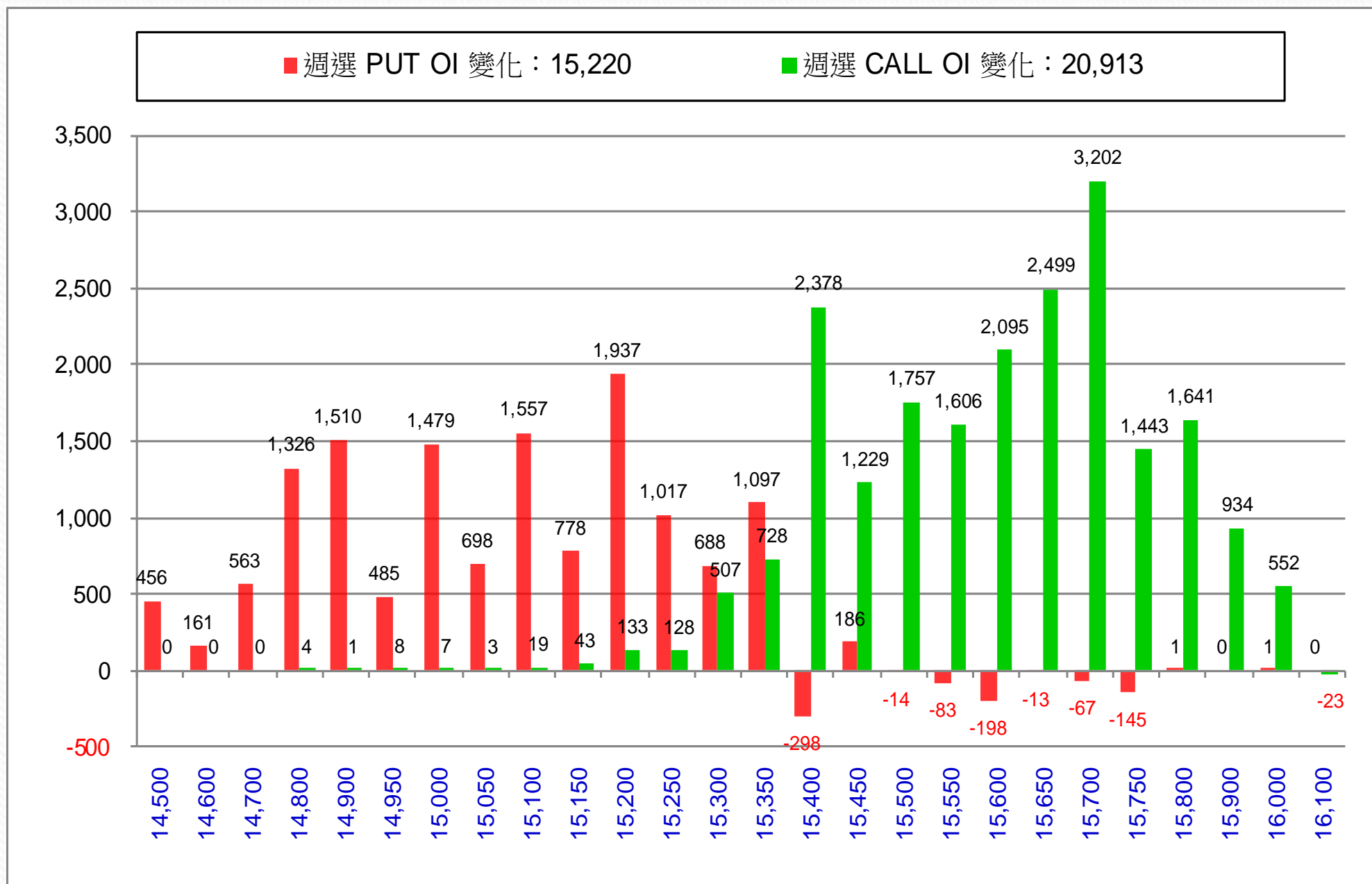
更新日期：2023年4月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年4月26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

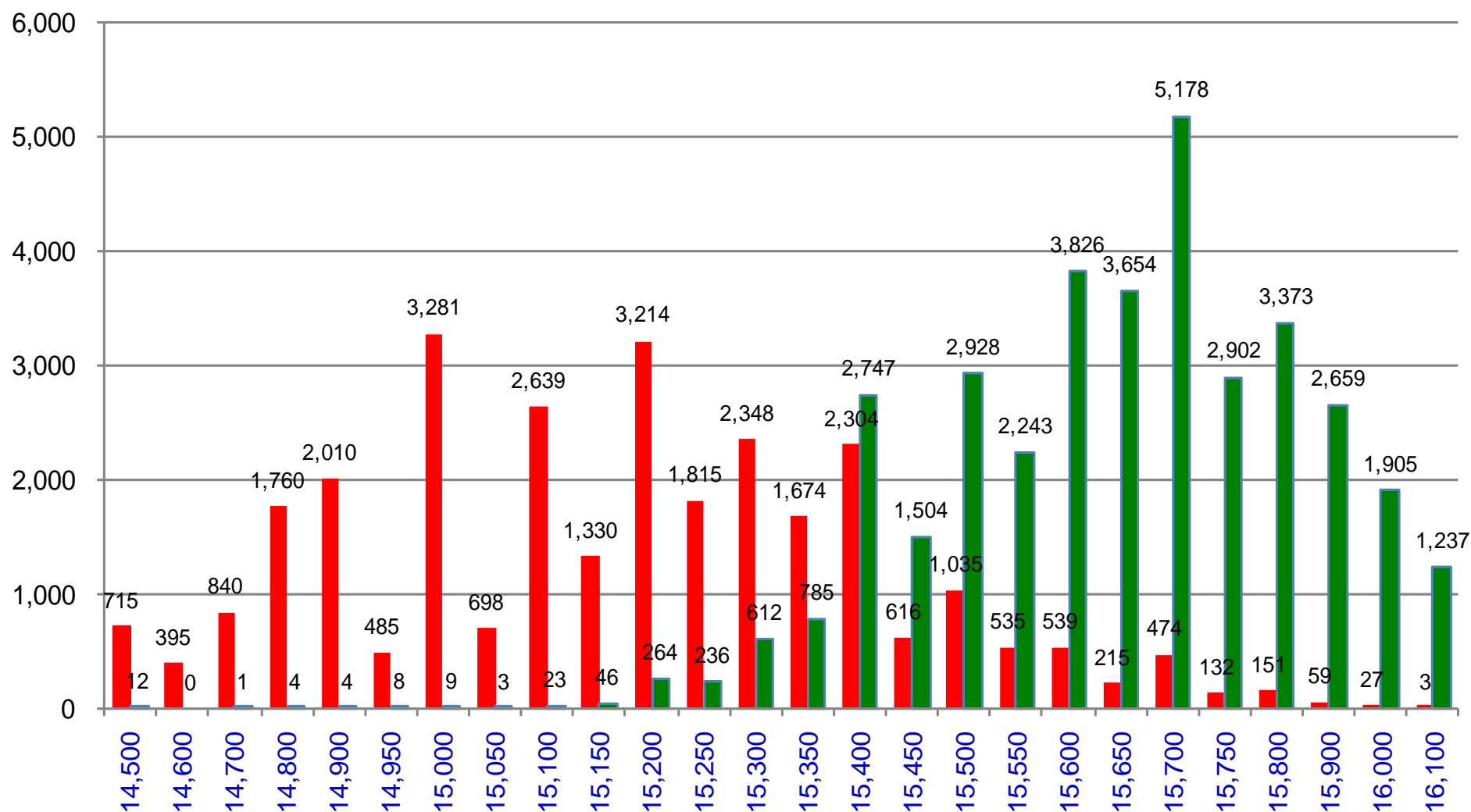


更新日期：2023年4月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：31,666

週選 CALL OI 總額：37,837



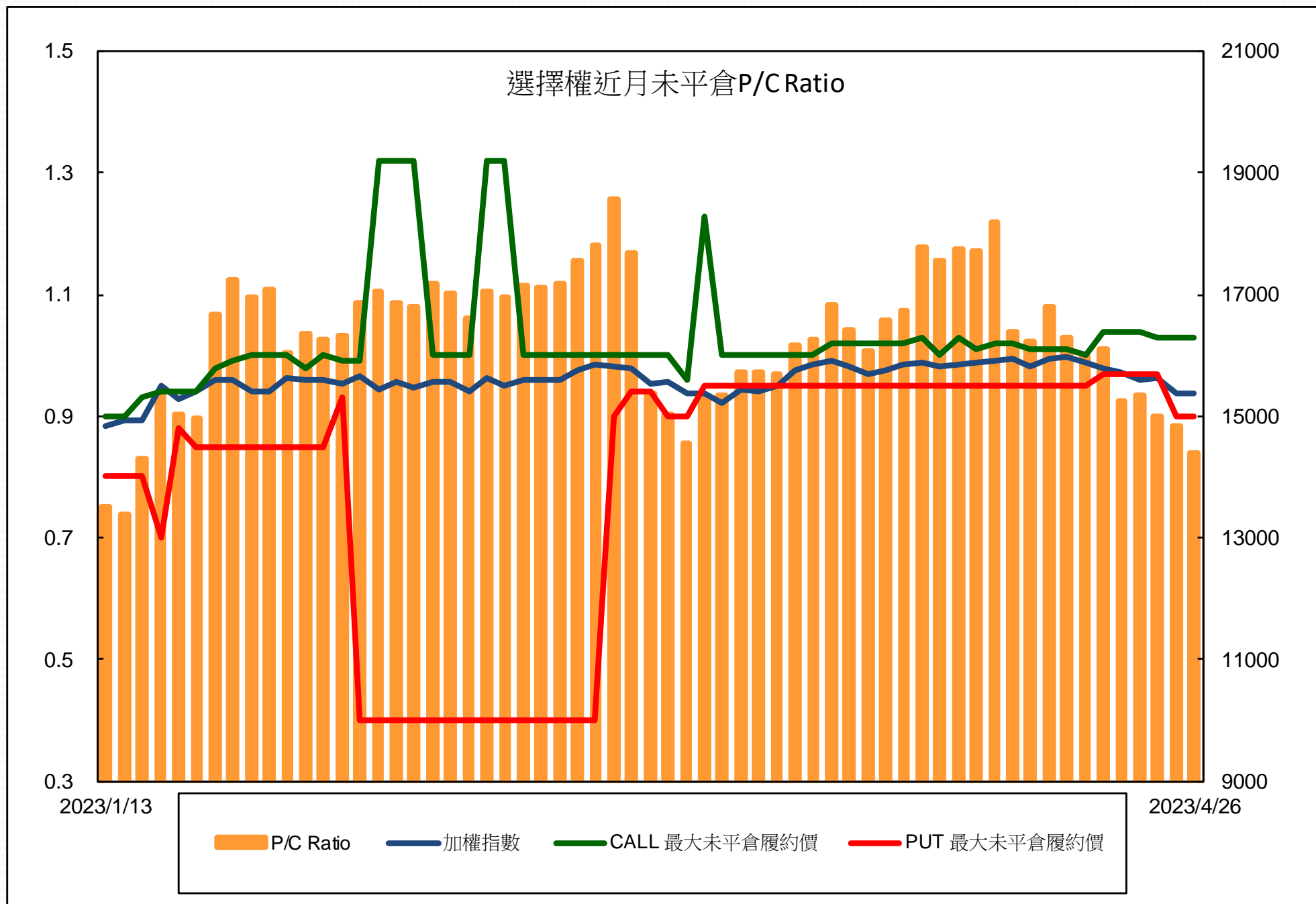
更新日期：2023年4月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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25日	57,118	58,608	-1,490
	4月26日	47,293	40,928	6,365
Put	4月25日	42,748	44,079	-1,331
	4月26日	35,525	31,270	4,255

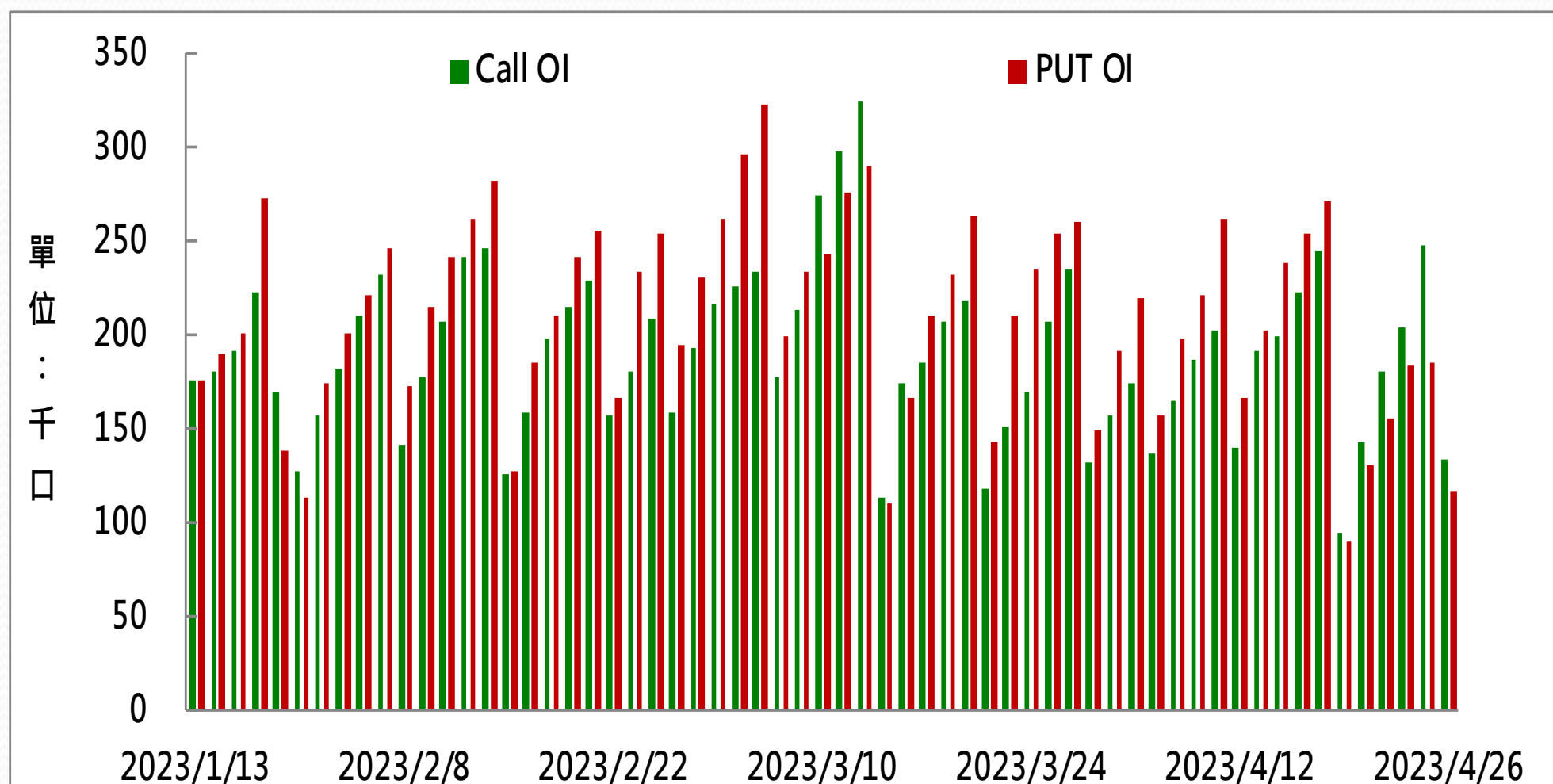
更新日期：2023年4月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年4月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

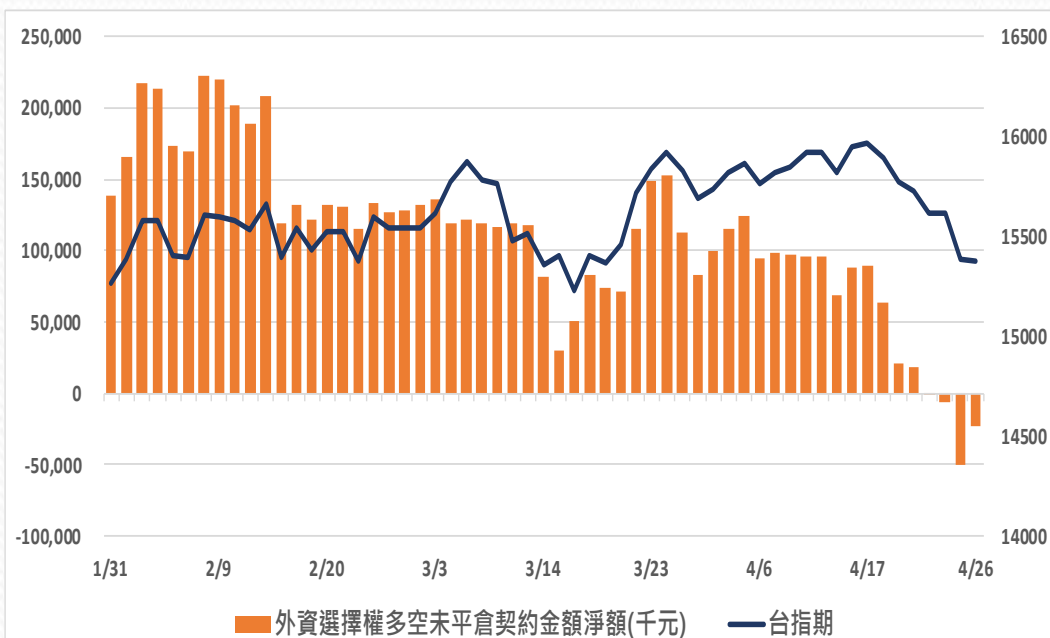
選擇權全月Put Call OI



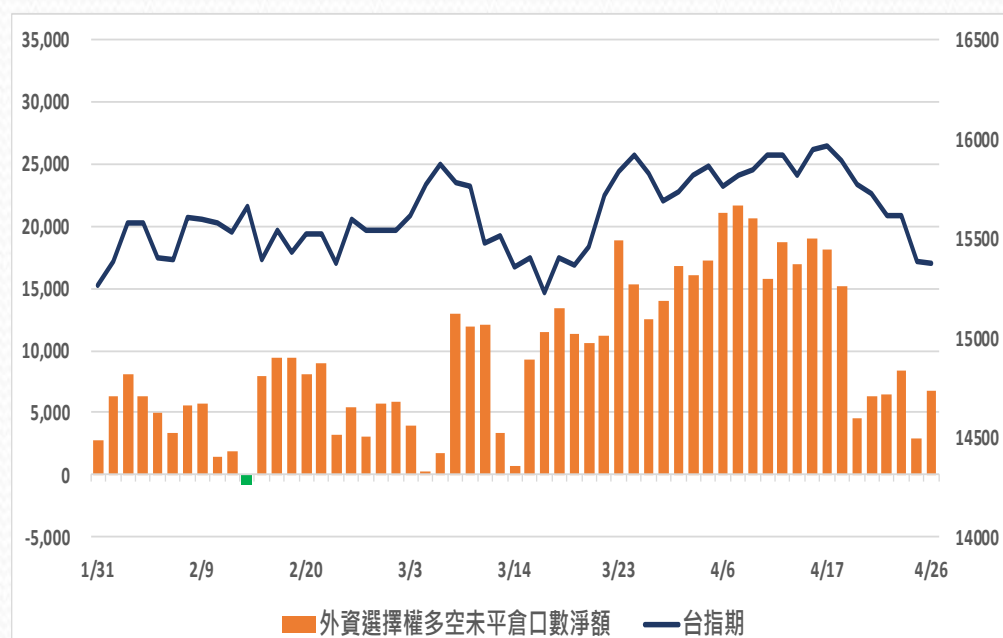
更新日期：2023年4月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



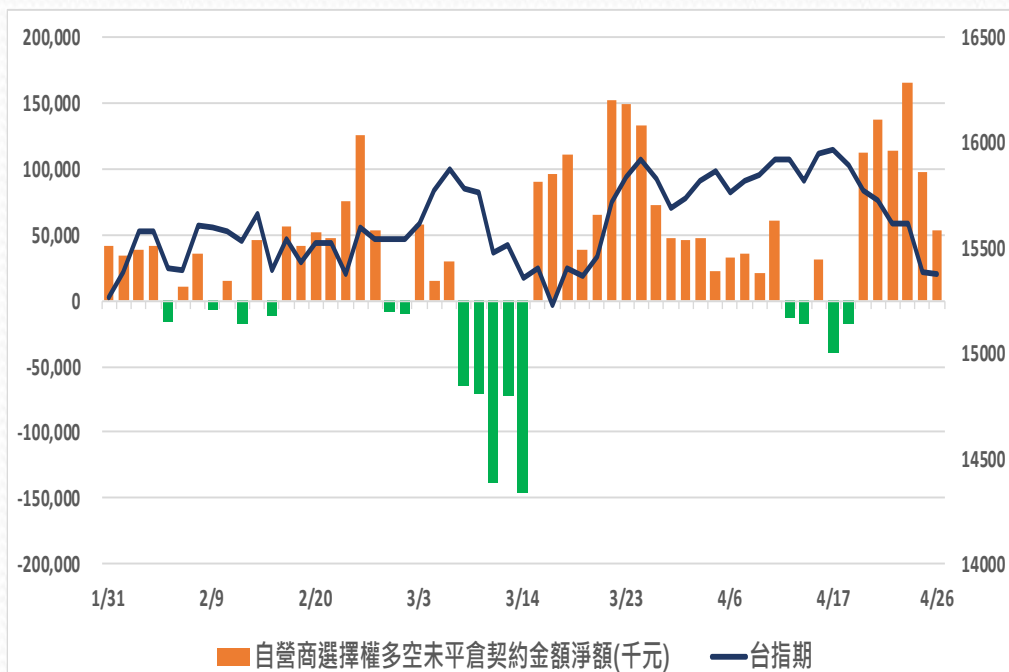
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/20	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
2023/4/26	15376	6,788	+3,920	-23,391	+27,292

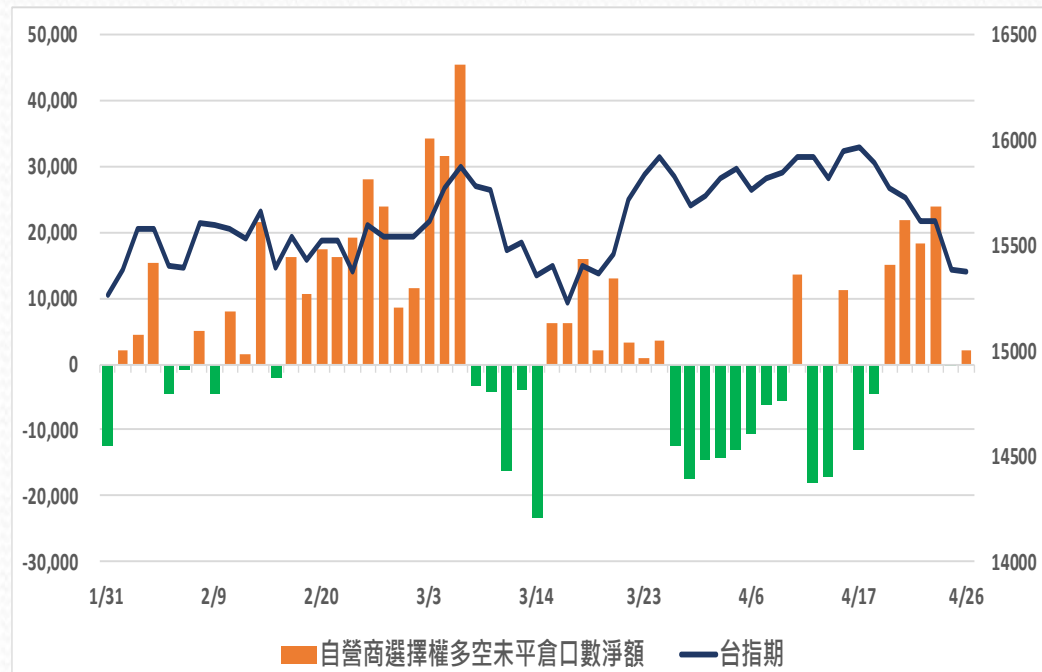
更新日期：2023年4月26日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



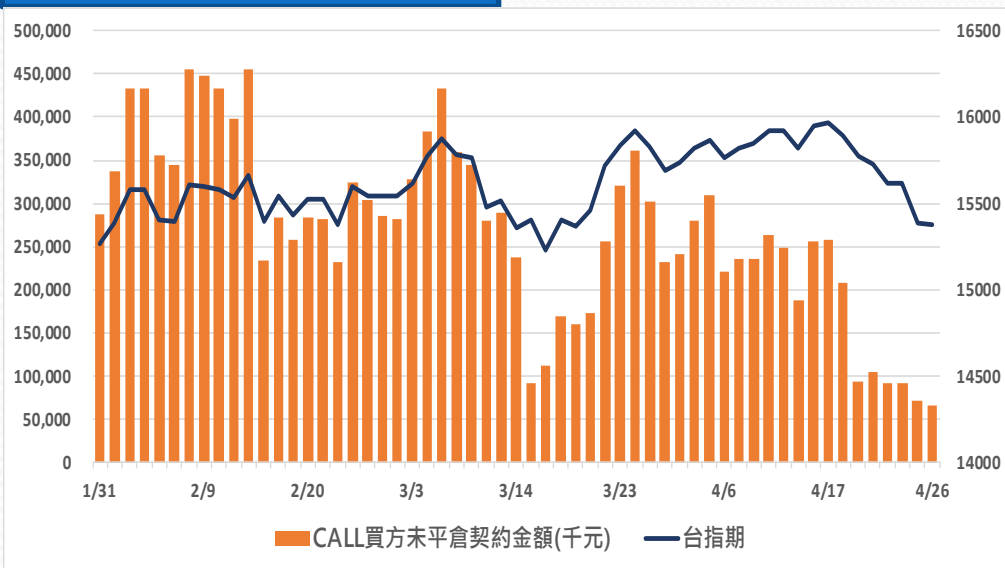
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/20	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
2023/4/26	15376	2,110	+2,269	54,089	-43,244

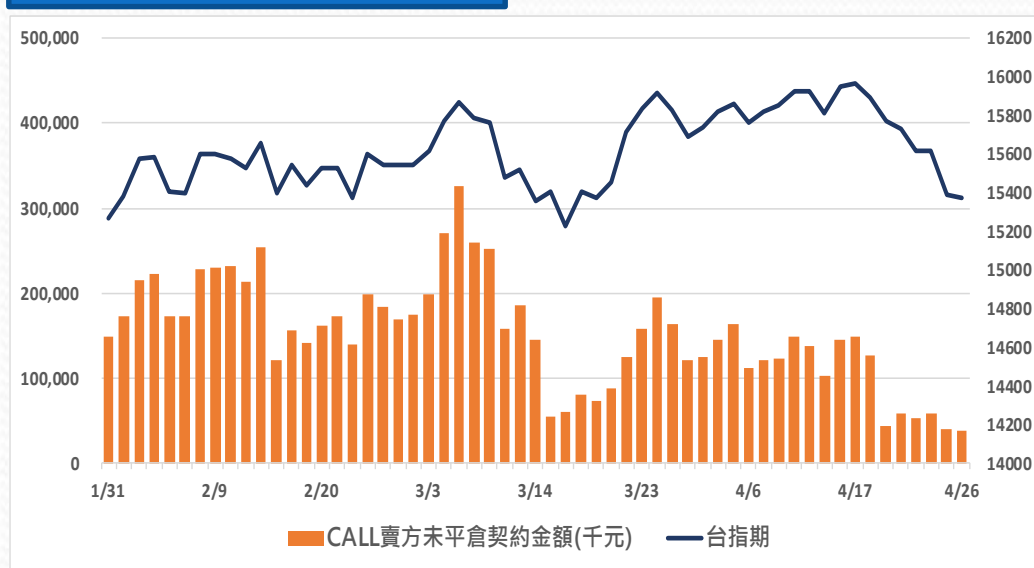
更新日期：2023年4月26日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

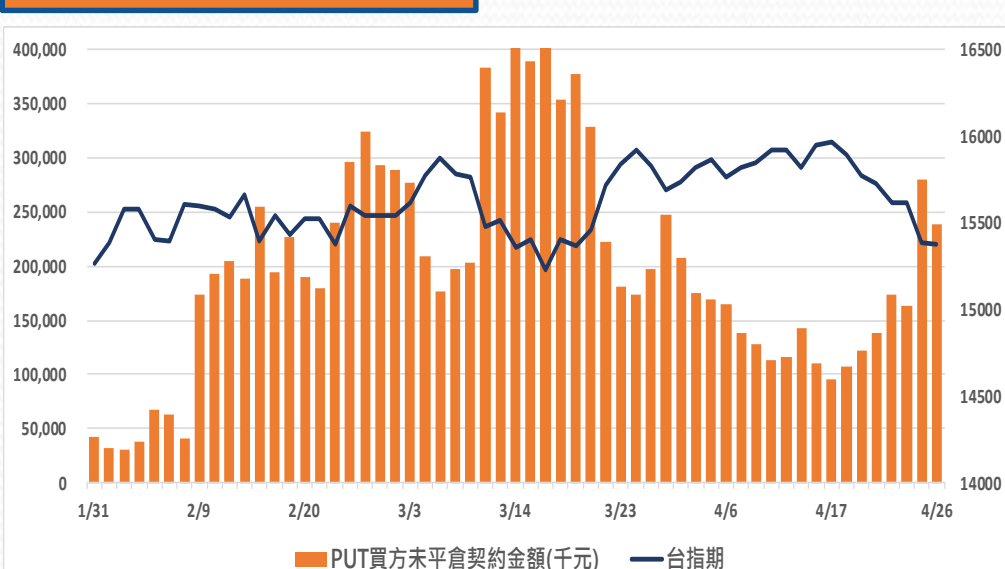
CALL買方未平倉金額



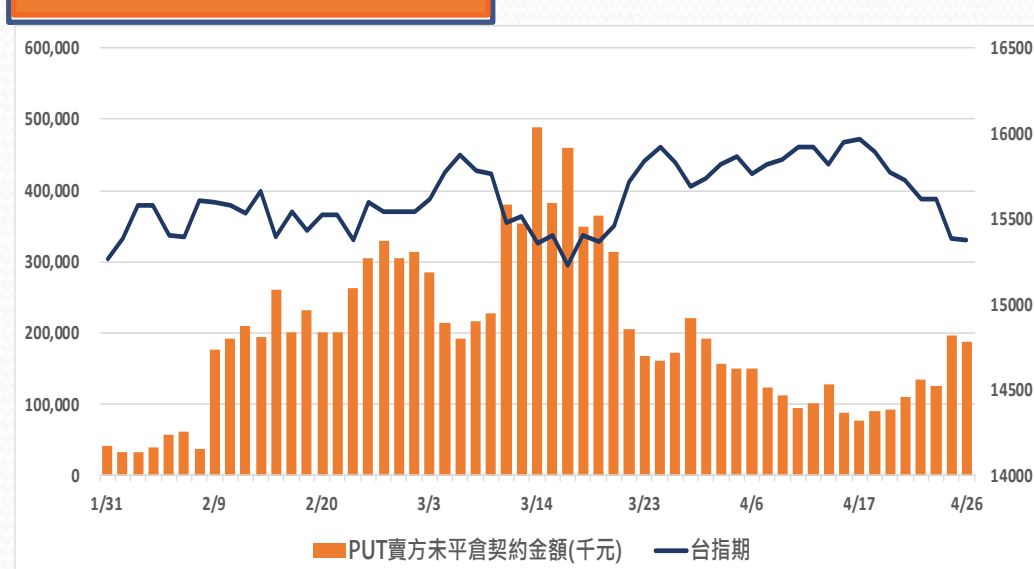
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



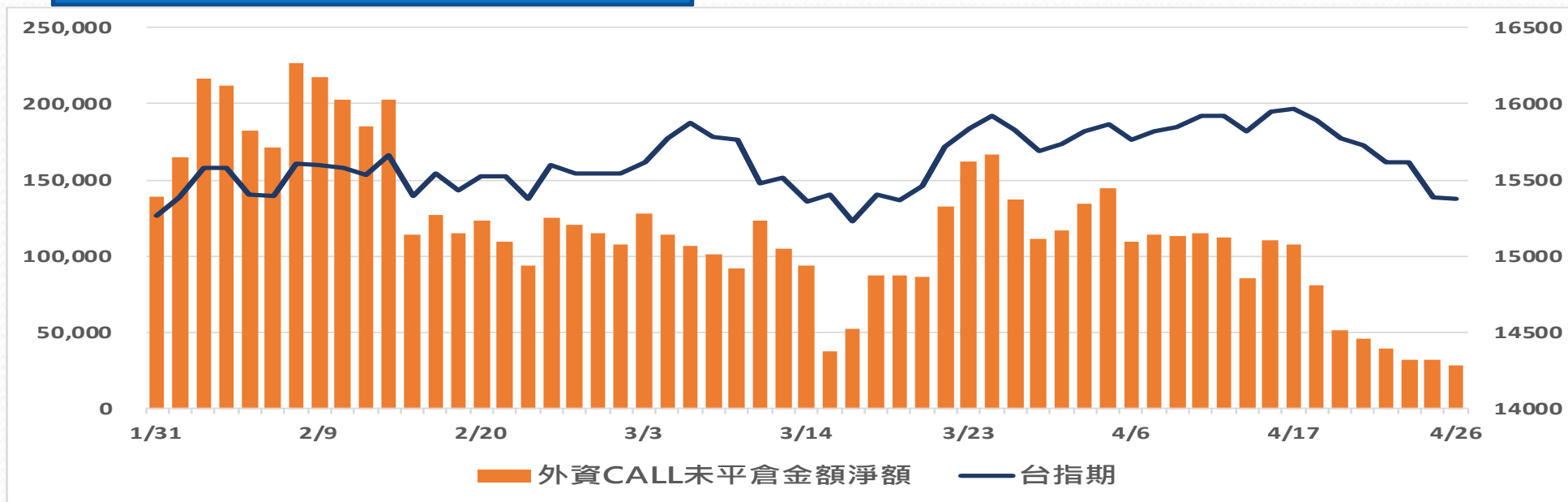
PUT賣方未平倉金額



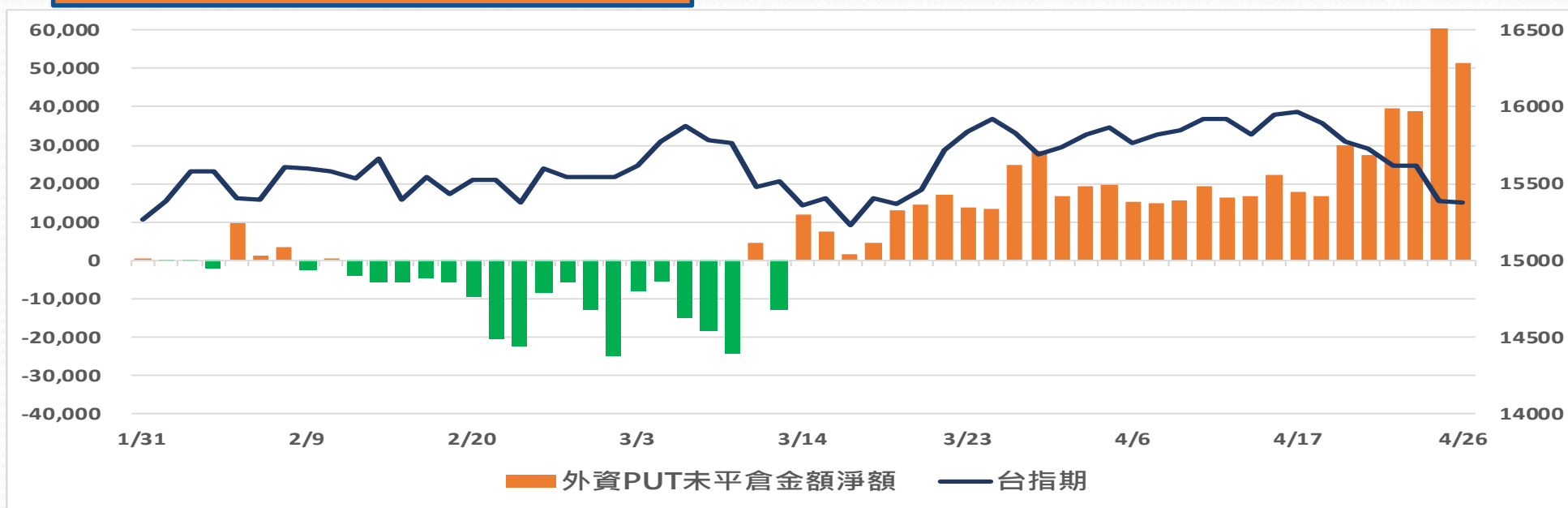
更新日期：2023年4月26日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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26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26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