

台指選擇權 OI 匯報

日期：2023/4/27 結算日：2023/5/3					日期：2023/4/27 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	0	14,600	1,287	892	0	5	14,100	641	211
0	1	14,700	1,886	1,046	0	2	14,200	3,266	1,755 ※
3	7	14,800	3,551	1,791	0	8	14,300	1,651	99
0	4	14,900	3,620	1,610	0	74	14,400	4,240	640
-7	1	14,950	1,262	777	2	24	14,500	2,666	353
30	39	15,000	5,356	2,075	0	5	14,600	2,043	-146
0	3	15,050	2,744	2,046	-1	17	14,700	2,086	-22
54	77	15,100	5,619	2,980 ※	0	28	14,800	2,661	214
66	112	15,150	3,796	2,466	10	54	14,900	2,817	521
102	366	15,200	6,030	2,816	-38	94	15,000	7,297	414
165	401	15,250	4,396	2,581	11	97	15,100	3,326	315
418	1,030	15,300	4,507	2,159	0	316	15,200	4,150	14
898	1,683	15,350	3,260	1,586	11	1,548	15,300	3,507	280
1,826	4,573	15,400	4,333	2,029 ※	724	1,714	15,400	2,544	17
1,250	2,754	15,450	1,373	757	262	1,666	15,500	1,961	-25
2,155	5,083	15,500	1,378	343	192	2,167	15,600	1,449	-39
2,351	4,594	15,550	543	8	54	4,060	15,700	5,489	-334
※ 4,528	8,354	15,600	635	96	425	4,666	15,800	830	-11
2,365	6,019	15,650	234	19	-116	4,943	15,900	800	-8
1,814	6,992	15,700	489	15	-227	6,693	16,000	351	-9
624	3,526	15,750	133	1	-79	4,024	16,100	100	3
374	3,747	15,800	128	-23	-7	4,713	16,200	99	-3
-64	2,595	15,900	57	-2	54	7,993	16,300	76	-1
248	2,153	16,000	37	10	-327	7,091	16,400	36	2
13	1,250	16,100	2	-1	9	3,926	16,500	16	0
-64	595	16,200	4	1	8	2,747	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
19,111	56,948	1.0655	60,677	29,011	819	68,037	0.8915	60,657	4,214
昨日 P/C	0.8369	今日增減變化		0.2286	昨日 P/C	0.8397	今日增減變化		0.0518

更新日期：2023年4月27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27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	100,581,472	72,037,775	28,543,697	11,427,111	2,215,331	711,661	1,503,670	-223,066	
投信	28,467,140	53,343,108	-24,875,968	159,236	505,050	0	505,050	203,014	
自營商	37,697,682	20,665,991	17,031,691	67,019	1,222,372	668,289	554,083	115,121	
	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	335,362	689,354	-353,992	189,052	16,698	71,346	-54,648	3,131	
投信	122,655	0	122,655	-269	0	0	0	0	
自營商	263,942	246,845	17,097	-143,189	285,384	230,621	54,763	-6,194	

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27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	29,514	13,844	15,670	1,143	22,560	14,924	7,636	-103	
投信	100	100	0	0	450	113	337	0	
自營商	51,063	37,943	13,120	6,755	40,208	35,052	5,156	901	
特定法人(週)	514	0	514	0	0	2,171	-2,171	0	
特定法人(近月)	23,434	10,460	12,974	-1,051	6,790	13,813	-7,023	-201	
特定法人(全月)	25,828	5,587	20,241	2,069	7,861	15,986	-8,125	1,464	
十大交易人(週)	23,456	17,028	6,428	6,846	19,107	15,533	3,574	3,299	
十大交易人(近月)	39,202	26,683	12,519	-469	20,073	29,852	-9,779	-1,997	
十大交易人(全月)	75,649	44,588	31,061	5,904	44,731	53,771	-9,040	1,014	
全市場未沖銷(近月)			68,037	819			60,657	4,214	
全市場未沖銷(全月)			160,116	26,137			153,820	37,645	

更新日期：2023年4月27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	15400	買權OI最大量	15600
	賣權成交最大量	15300	賣權OI最大量	15200
	整體隱含波動率	11.29%	較前一交易日	-1.05%
	買權隱含波動率	10.89%	較前一交易日	-0.38%
	賣權隱含波動率	11.68%	較前一交易日	-1.84%
電子選擇權	買權成交最大量	705	買權OI最大量	745
	賣權成交最大量	685	賣權OI最大量	680
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

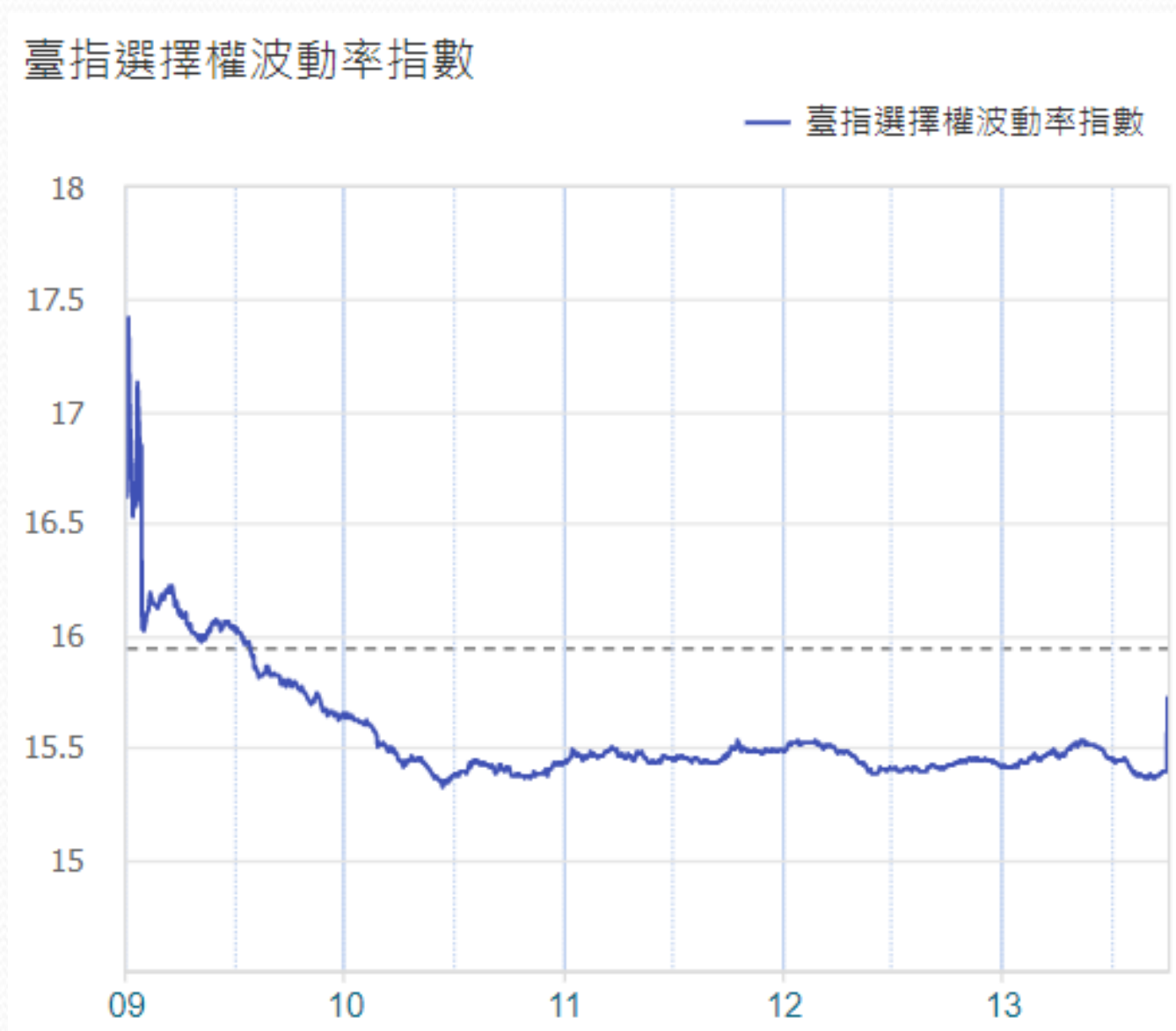
更新日期：2023年4月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	15800	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	14.17%	較前一交易日	+0.09%
	買權隱含波動率	12.63%	較前一交易日	+0.06%
	賣權隱含波動率	15.65%	較前一交易日	-0.29%
	成交量P/C_Ratio值	0.986	較前一交易日	+0.04
	未平倉P/C_Ratio值	0.892	較前一交易日	+0.05
電子選擇權	買權成交最大量	705	買權OI最大量	745
	賣權成交最大量	685	賣權OI最大量	680
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

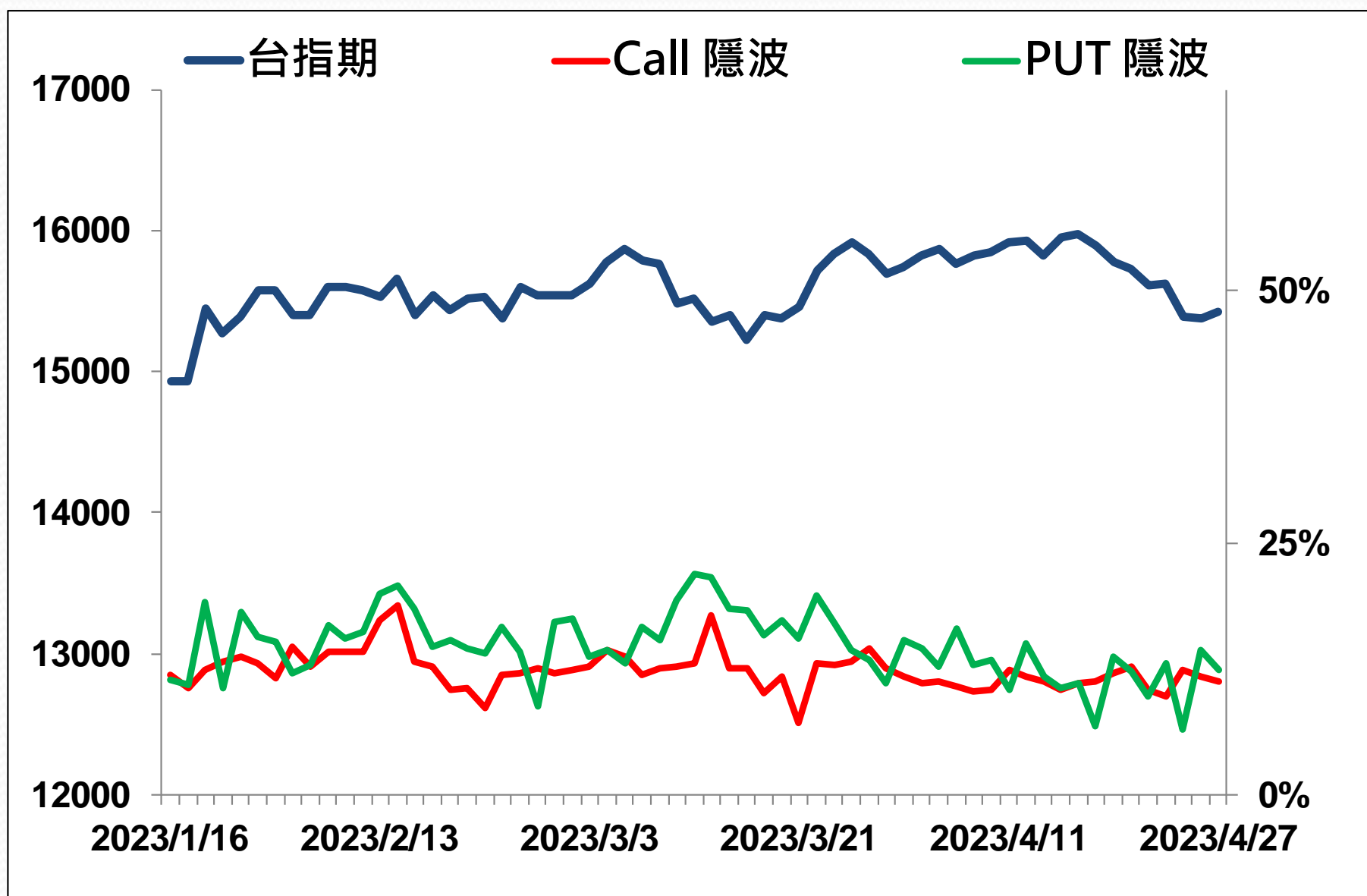
更新日期：2023年4月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



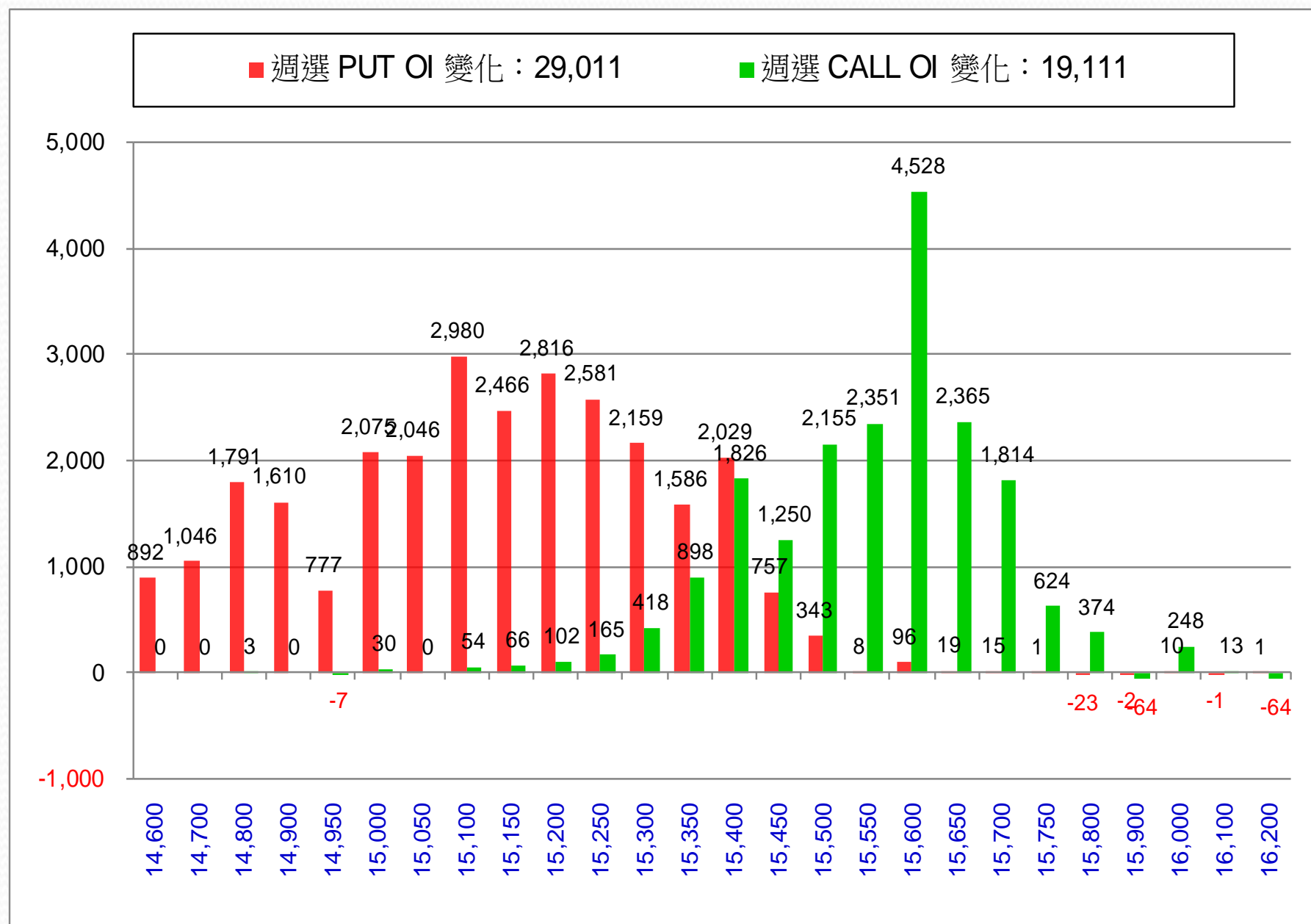
更新日期：2023年4月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



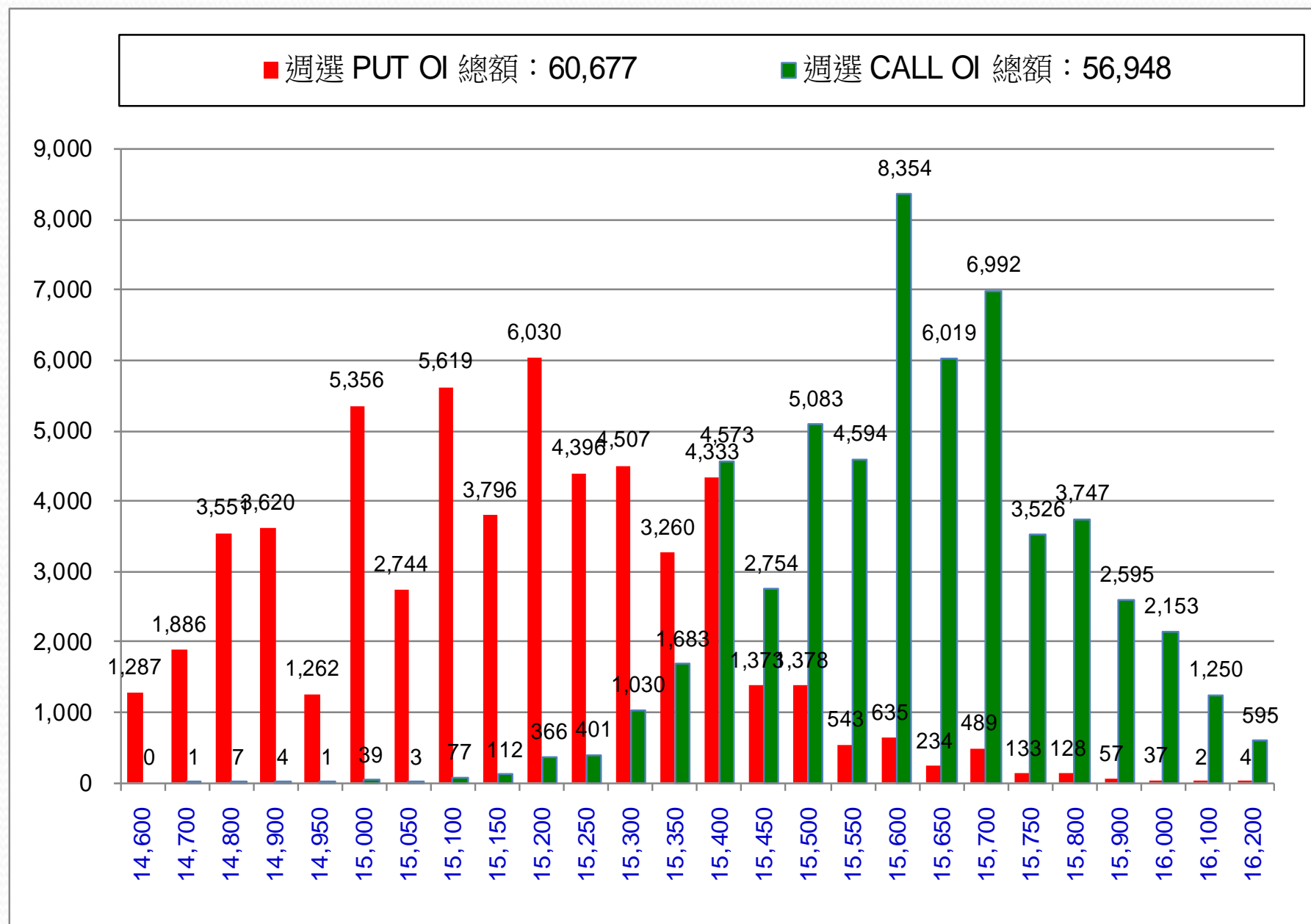
更新日期：2023年4月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年4月27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



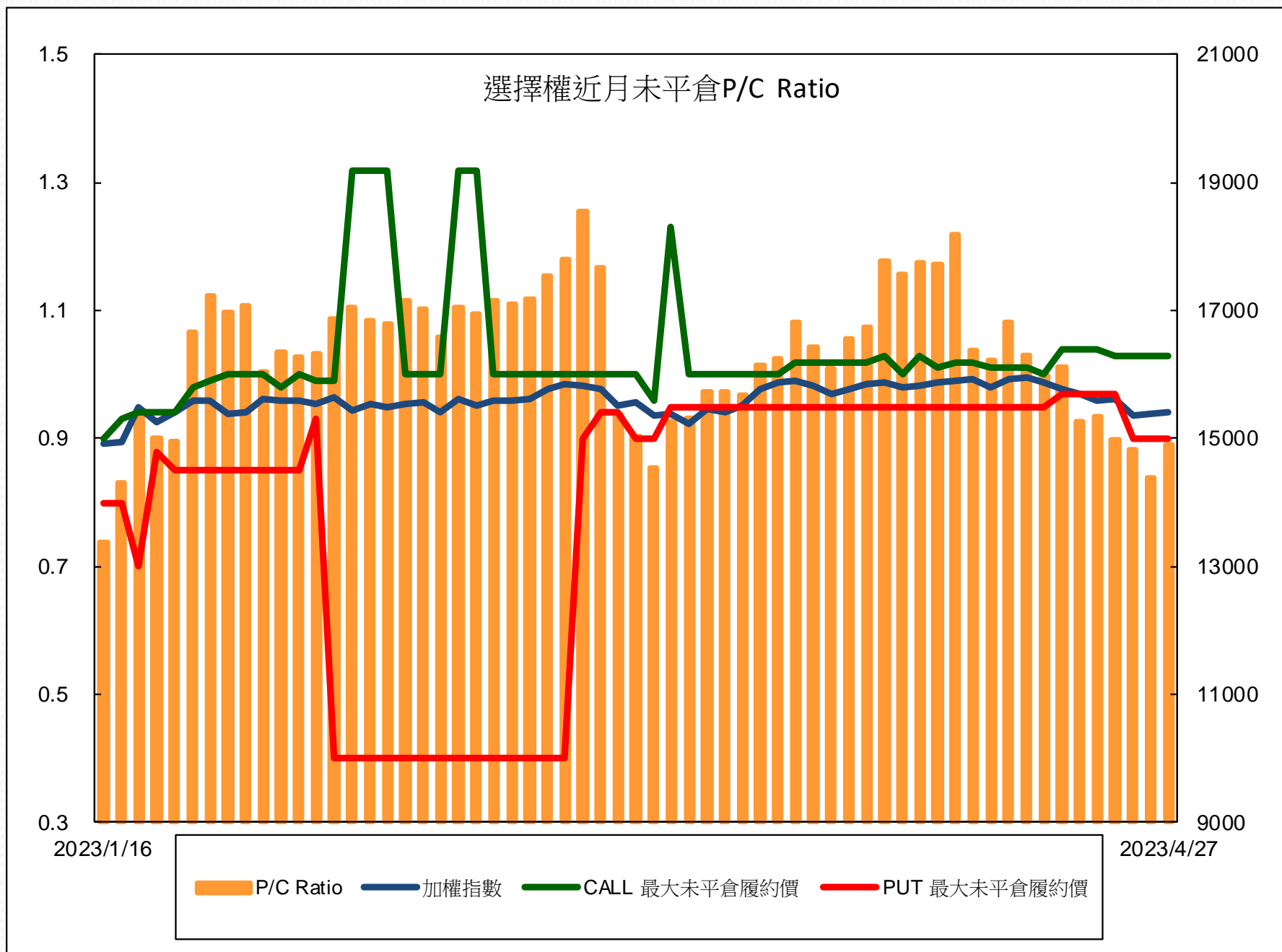
更新日期：2023年4月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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26日	47,293	40,928	6,365
	4月27日	51,063	37,943	13,120
Put	4月26日	35,525	31,270	4,255
	4月27日	40,208	35,052	5,156

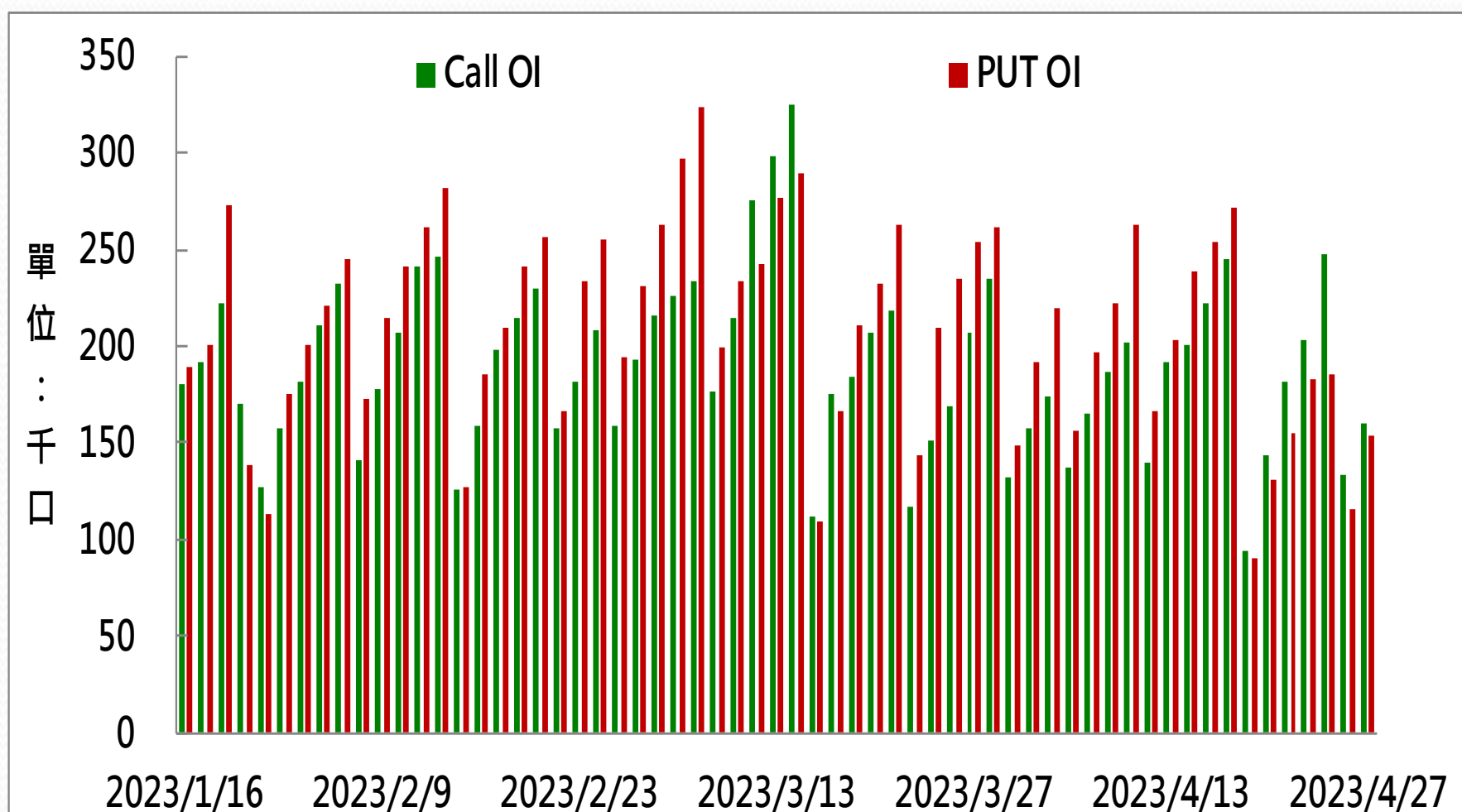
更新日期：2023年4月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年4月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

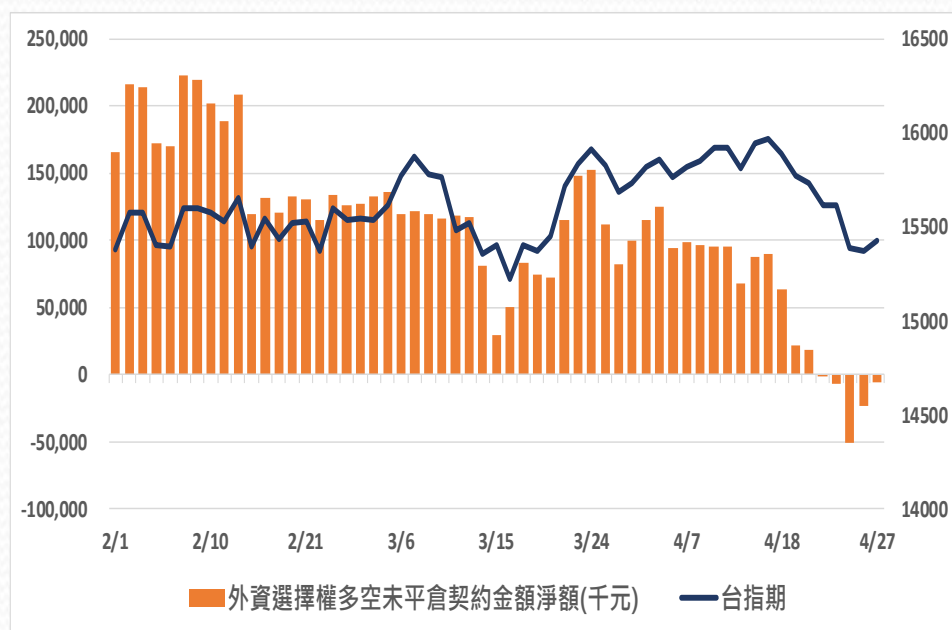
選擇權全月Put Call OI



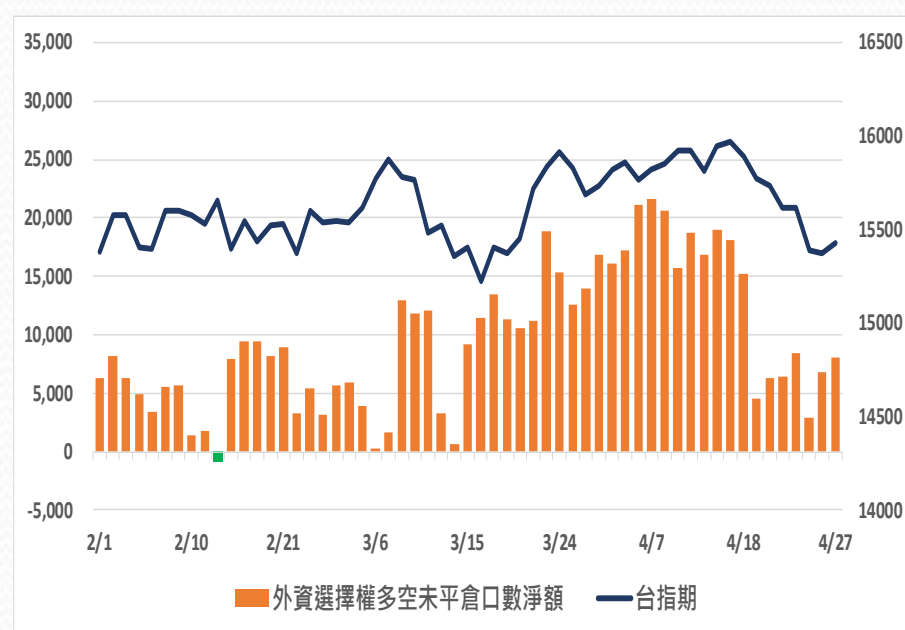
更新日期：2023年4月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



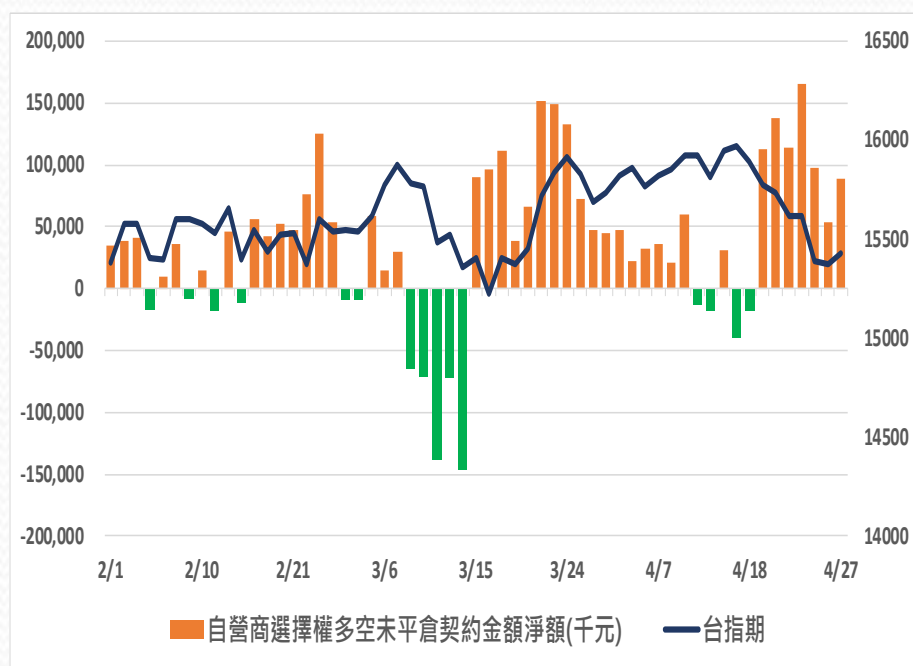
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/21	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
2023/4/27	15426	8,034	+1,246	-6,022	+17,369

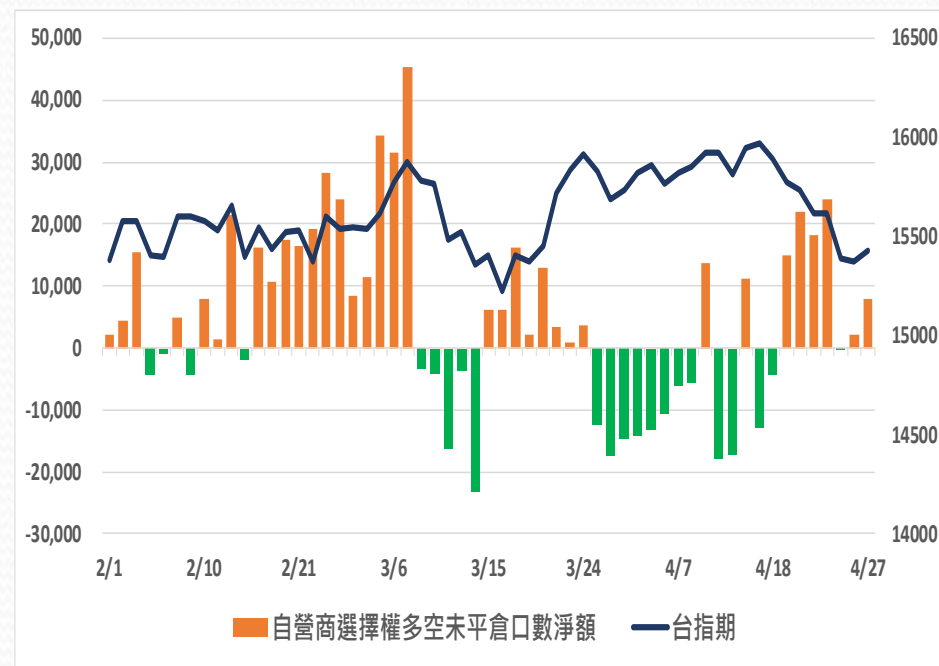
更新日期：2023年4月27日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



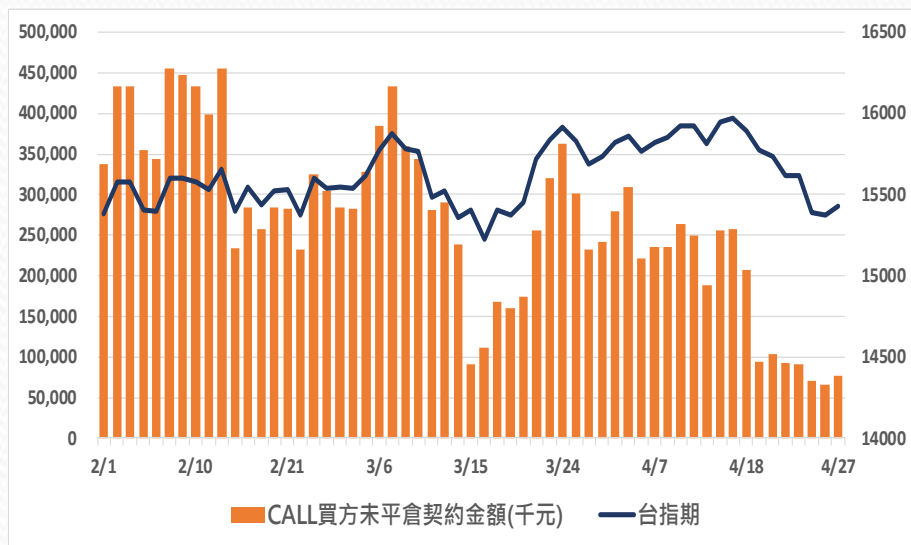
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/21	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
2023/4/27	15426	7,964	+5,854	88,651	+34,562

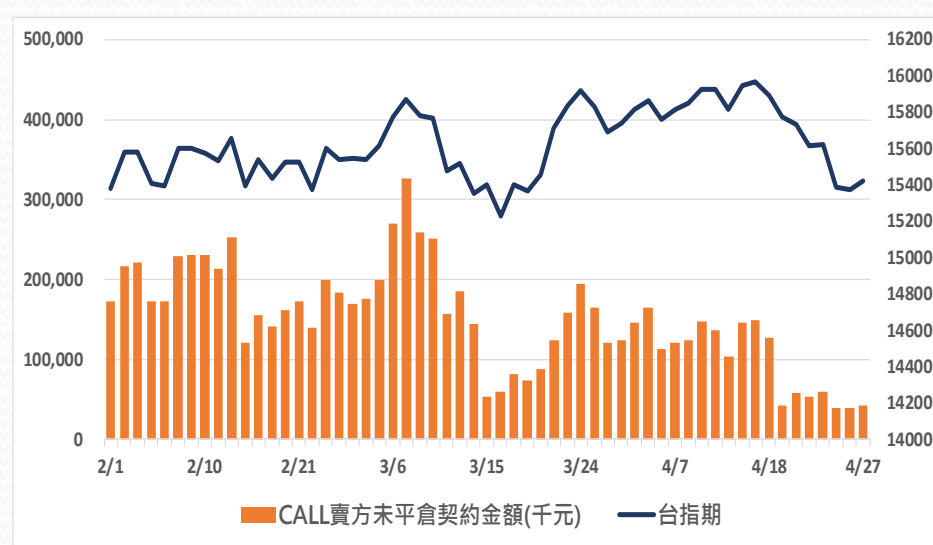
更新日期：2023年4月27日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

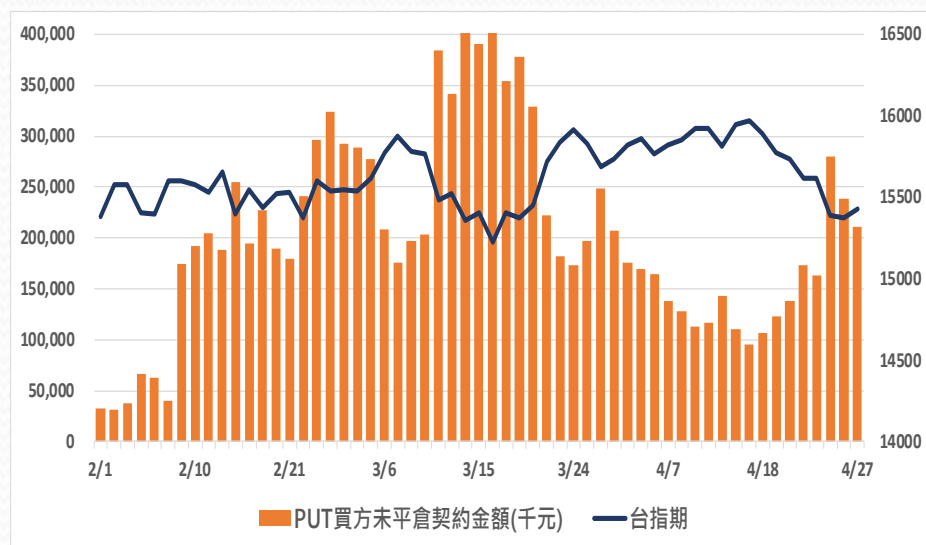
CALL買方未平倉金額



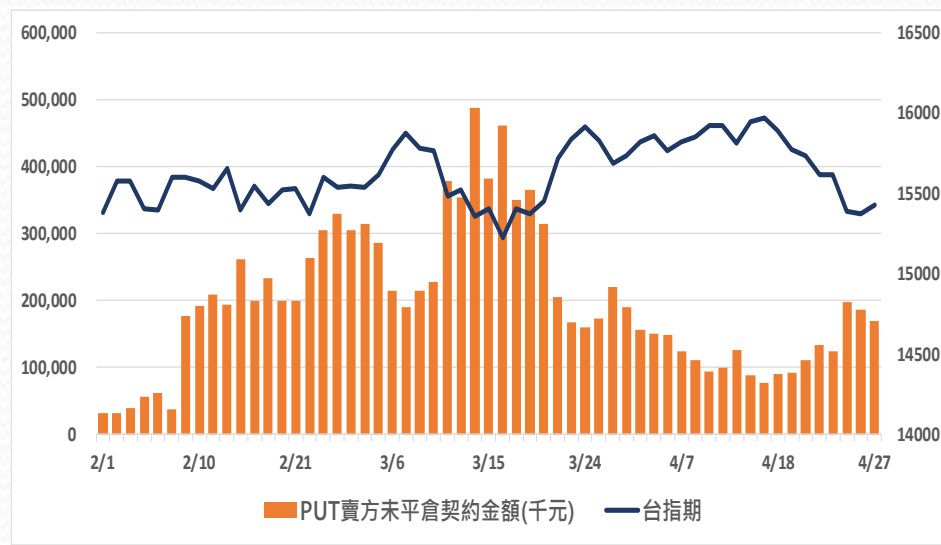
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



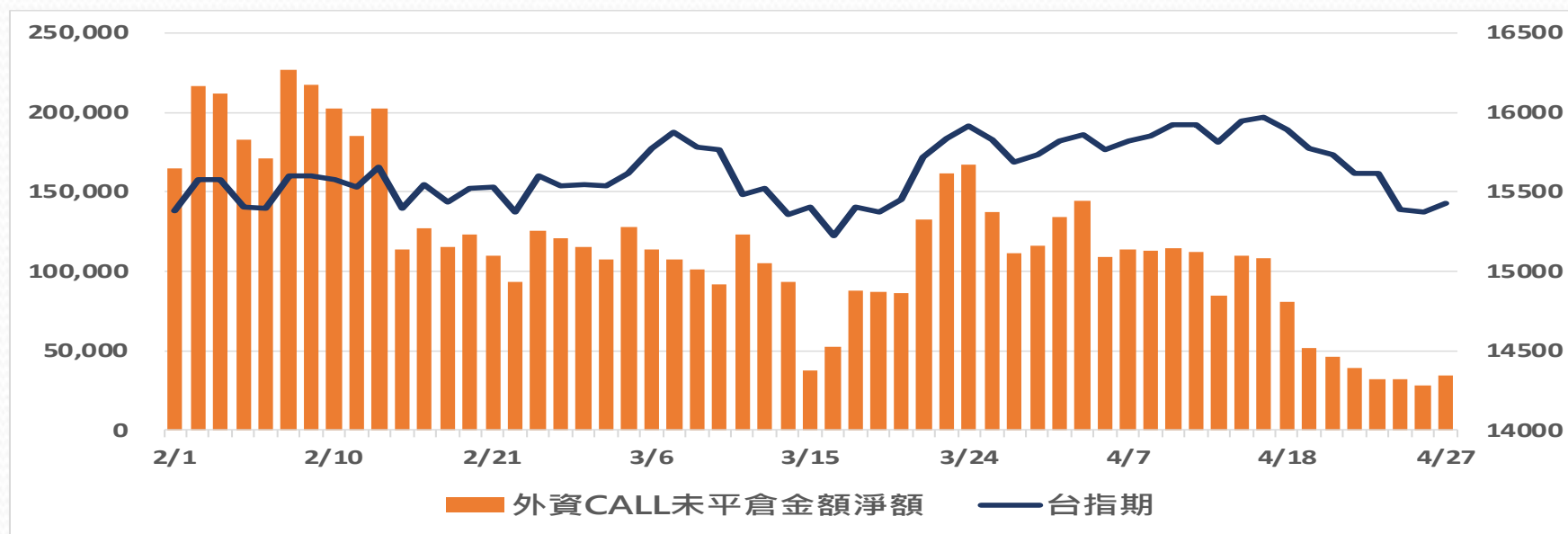
PUT賣方未平倉金額



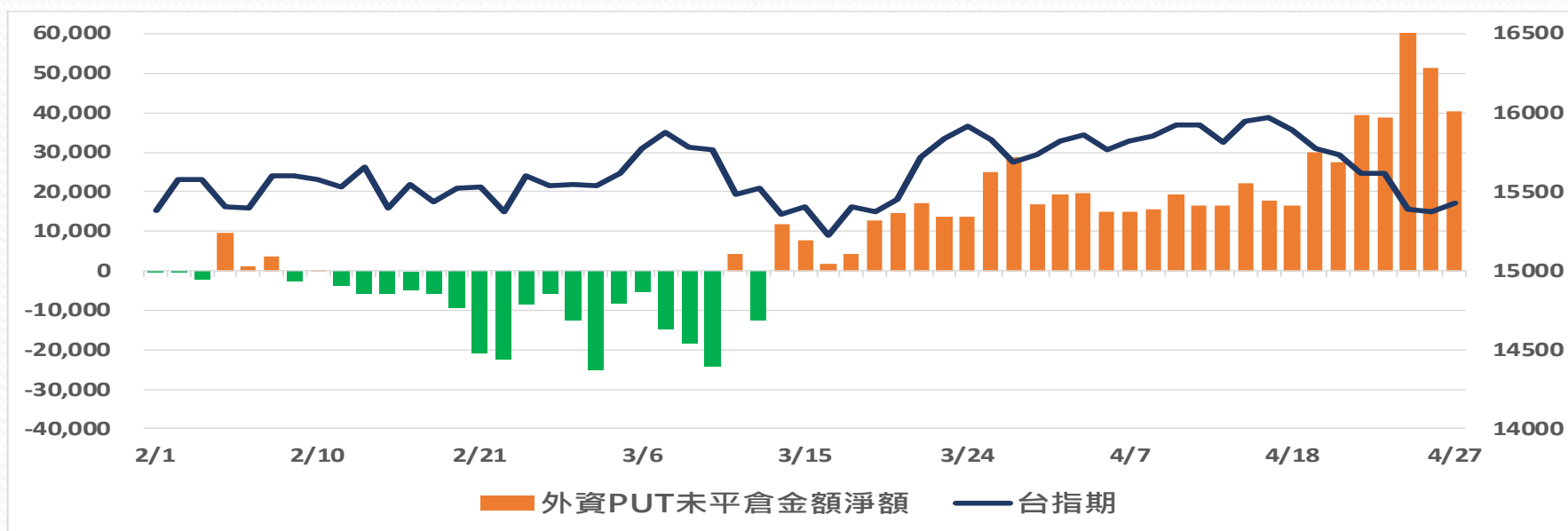
更新日期：2023年4月27日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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27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27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