

# 台指選擇權OI匯報

日期：2023/4/28 結算日：2023/5/3					日期：2023/4/28 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	1	14,950	1,446	184	0	8	14,300	1,611	-40
-4	35	15,000	6,501	1,145	-28	46	14,400	4,055	-185
-2	1	15,050	2,360	-384	0	24	14,500	2,833	167
-7	70	15,100	5,742	123	0	5	14,600	1,842	-201
-29	83	15,150	3,840	44	0	17	14,700	2,045	-41
-131	235	15,200	10,441	4,411	0	28	14,800	2,523	-138
-36	365	15,250	6,099	1,703	-2	52	14,900	2,889	72
-87	943	15,300	8,280	3,773	6	100	15,000	7,955	658
-424	1,259	15,350	5,214	1,954	1	98	15,100	3,638	312
-780	3,793	15,400	8,619	4,286	10	326	15,200	5,192	1,042 ※
-677	2,077	15,450	4,986	3,613	68	1,616	15,300	3,941	434
-1,037	4,046	15,500	6,340	4,962 ※	-13	1,701	15,400	2,858	314
-339	4,255	15,550	2,657	2,114	165	1,831	15,500	2,421	460
-2	8,352	15,600	1,920	1,285	-43	2,124	15,600	1,717	268
1,066	7,085	15,650	571	337	-498	3,562	15,700	5,618	129
2,091	9,083	15,700	919	430	569	5,235	15,800	883	53
※ 3,300	6,826	15,750	241	108	※ 1,355	6,298	15,900	802	2
1,187	4,934	15,800	176	48	637	7,330	16,000	351	0
968	2,678	15,850	37	-3	-138	3,886	16,100	103	3
340	2,935	15,900	57	0	80	4,793	16,200	126	27
1,613	3,766	16,000	25	-12	34	8,027	16,300	138	62
-324	926	16,100	2	0	-255	6,836	16,400	56	20
-52	543	16,200	4	0	32	3,958	16,500	16	0
-18	279	16,300	20	0	15	2,762	16,600	13	0
-5	287	16,400	0	0	-5	994	16,700	14	0
0	128	16,500	0	0	13	999	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
6,617	65,275	1.3693	89,383	28,666	1,878	69,915	0.9386	65,622	4,965
昨日 P/C	1.0655	今日增減變化		0.3038	昨日 P/C	0.8915	今日增減變化		0.0471

更新日期：2023年4月28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28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	107,389,048	67,677,581	39,711,467	11,167,770	2,165,105	831,841	1,333,264	-170,406	
投信	28,773,942	52,483,869	-23,709,927	1,166,041	504,322	0	504,322	-728	
自營商	38,138,617	21,838,855	16,299,762	-731,929	1,176,672	524,283	652,389	98,306	
	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	378,536	716,404	-337,868	16,124	16,842	71,962	-55,120	-472	
投信	123,572	0	123,572	917	0	0	0	0	
自營商	320,661	273,731	46,930	29,833	261,818	209,678	52,140	-2,623	

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28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	31,362	14,103	17,259	1,589	23,319	14,969	8,350	714	
投信	100	100	0	0	450	113	337	0	
自營商	57,729	38,635	19,094	5,974	42,485	46,227	-3,742	-8,898	
特定法人(週)	0	0	0	-514	0	3,091	-3,091	-920	
特定法人(近月)	23,739	12,315	11,424	-1,550	5,748	13,813	-8,065	-1,042	
特定法人(全月)	25,092	5,587	19,505	-736	4,253	18,561	-14,308	-6,183	
十大交易人(週)	27,280	17,626	9,654	3,226	32,375	16,858	15,517	11,943	
十大交易人(近月)	41,819	27,737	14,082	1,563	21,770	30,993	-9,223	556	
十大交易人(全月)	83,432	44,299	39,133	8,072	55,668	56,403	-735	8,305	
全市場未沖銷(近月)			69,915	1,878			65,622	4,965	
全市場未沖銷(全月)			173,868	13,752			191,779	37,959	

更新日期：2023年4月28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	15400	賣權OI最大量	15200
	整體隱含波動率	9.64%	較前一交易日	-1.65%
	買權隱含波動率	7.95%	較前一交易日	-2.95%
	賣權隱含波動率	11.11%	較前一交易日	-0.58%
電子選擇權	買權成交最大量	720	買權OI最大量	745
	賣權成交最大量	695	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	1500	賣權OI最大量	1500

更新日期：2023年4月28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	13.20%	較前一交易日	+0.97%
	買權隱含波動率	11.44%	較前一交易日	-1.19%
	賣權隱含波動率	14.87%	較前一交易日	-0.78%
	成交量P/C_Ratio值	1.032	較前一交易日	+0.05
	未平倉P/C_Ratio值	0.939	較前一交易日	+0.05
電子選擇權	買權成交最大量	720	買權OI最大量	745
	賣權成交最大量	695	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	1500	賣權OI最大量	1500

更新日期：2023年4月28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

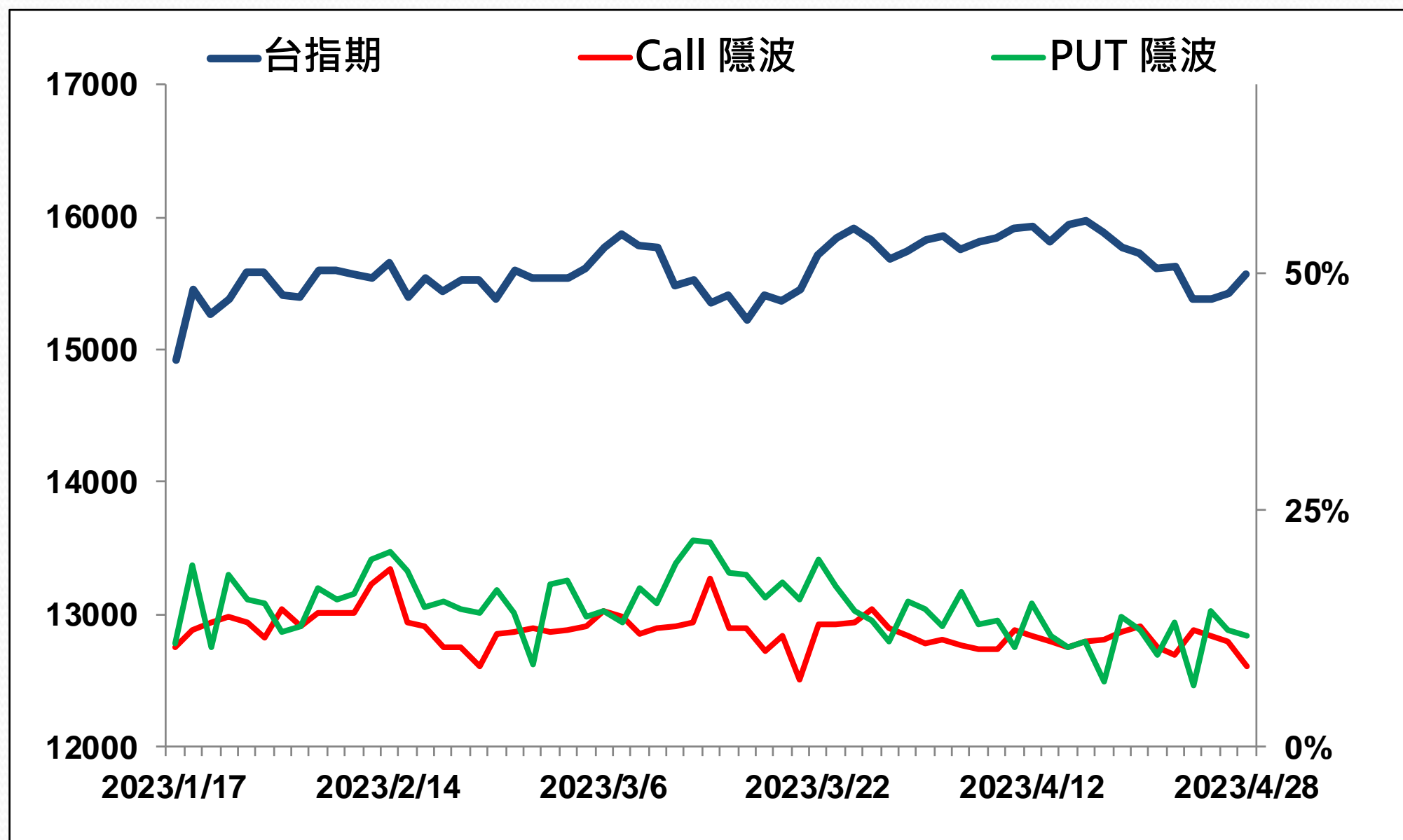
臺指選擇權波動率指數

— 臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年4月28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

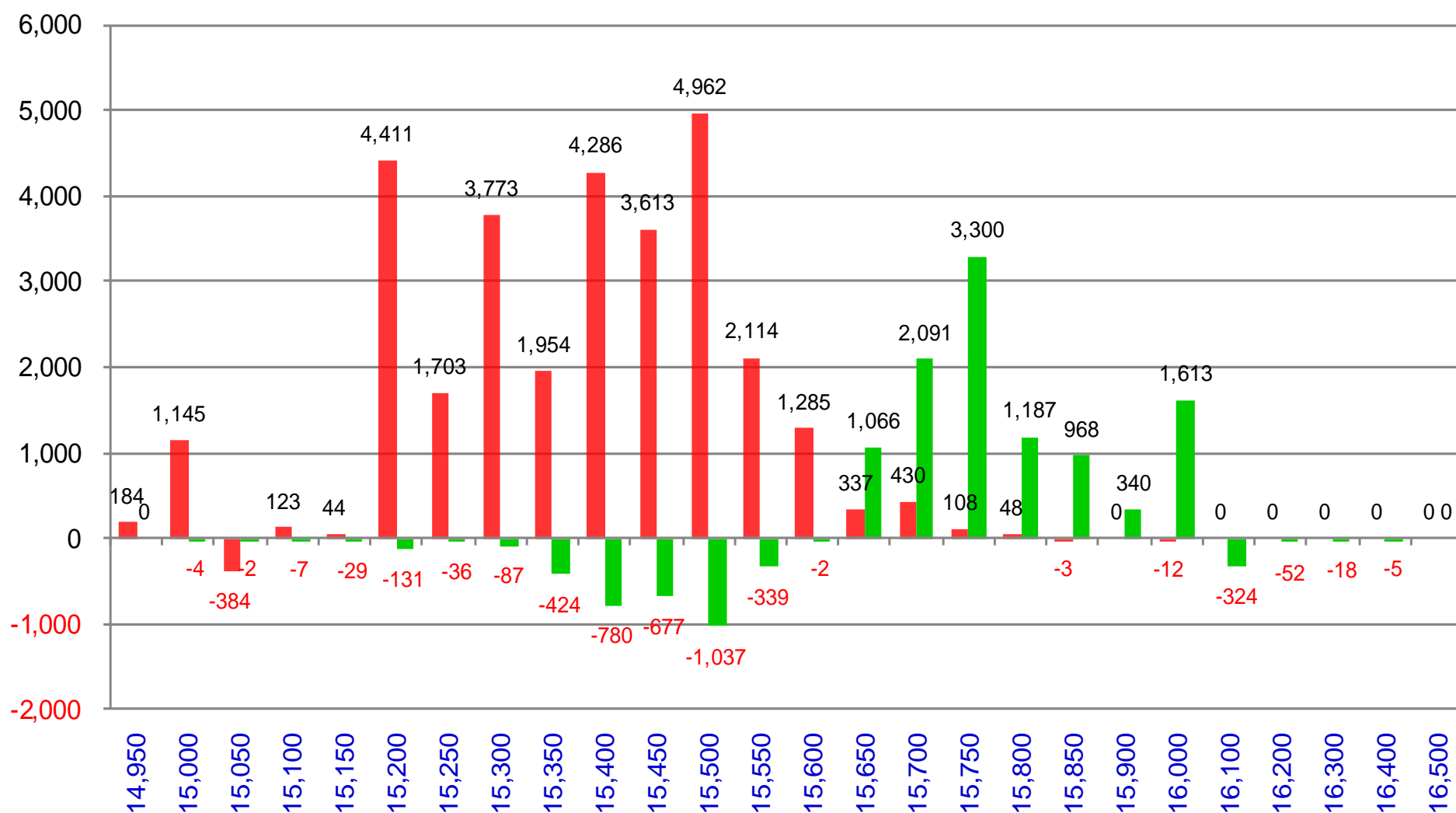


更新日期：2023年4月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：28,666

週選 CALL OI 變化：6,617

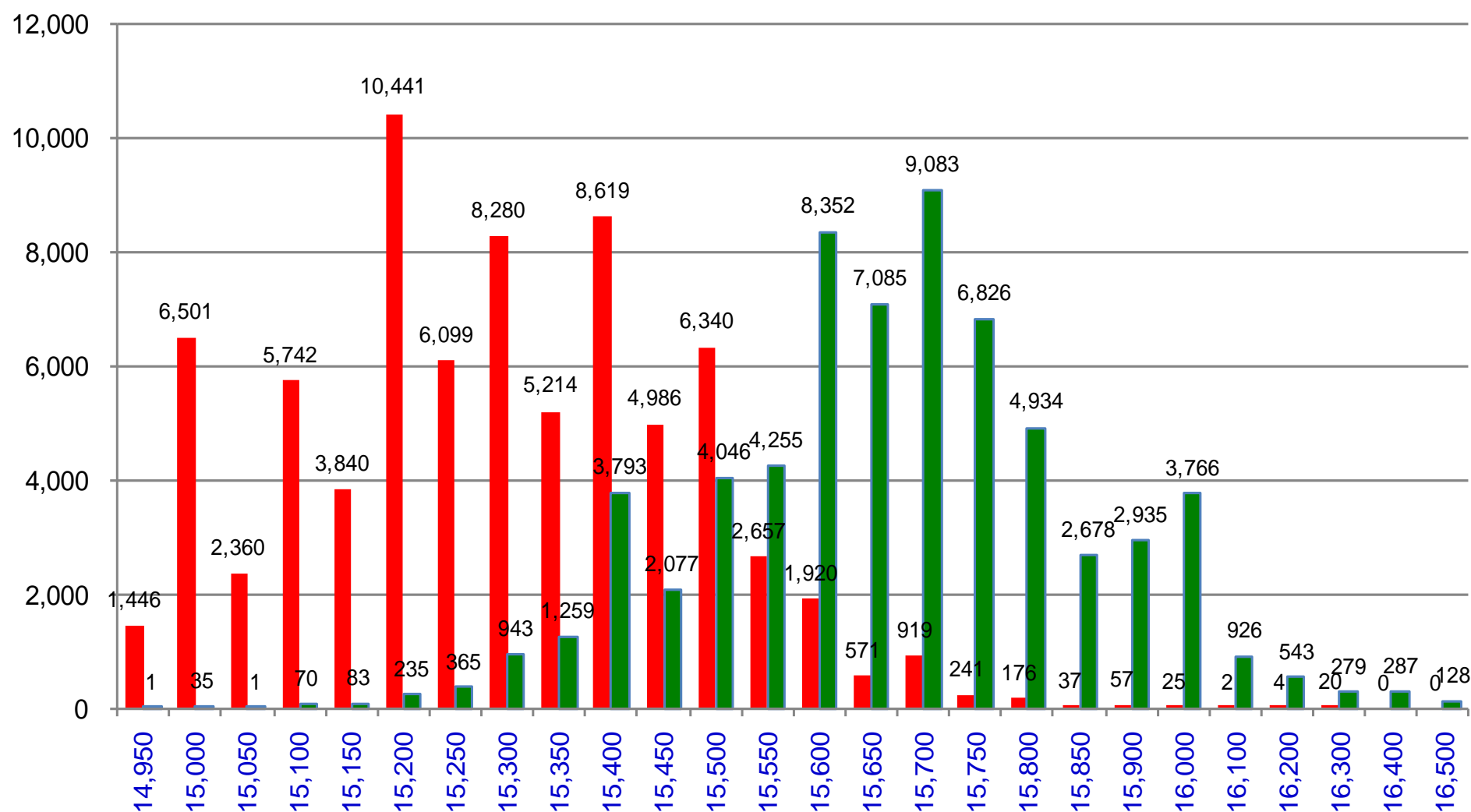


更新日期：2023年4月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：89,383

週選 CALL OI 總額：65,275



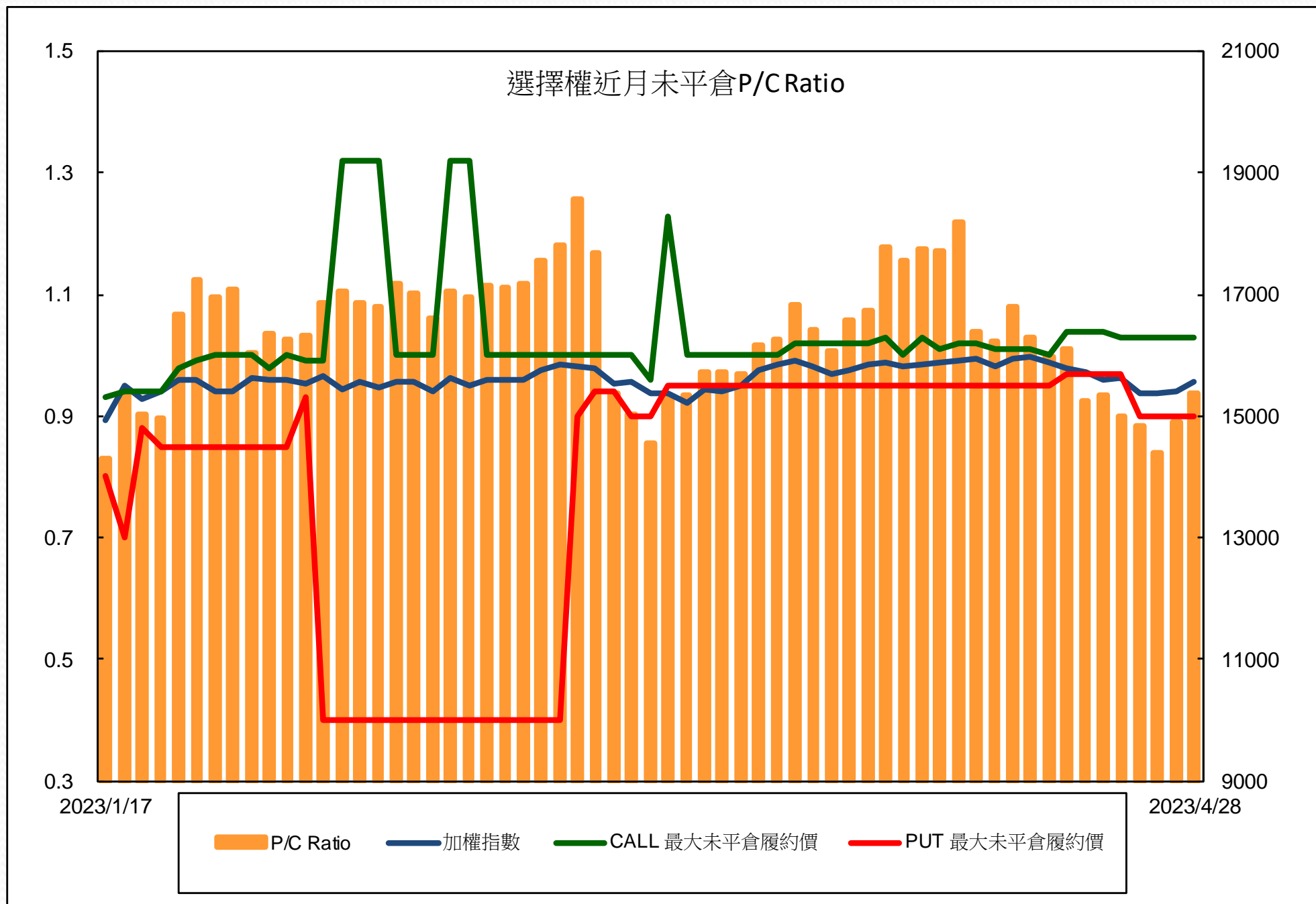
更新日期：2023年4月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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27日	51,063	37,943	13,120
	4月28日	57,729	38,635	19,094
Put	4月27日	40,208	35,052	5,156
	4月28日	42,485	46,227	-3,742

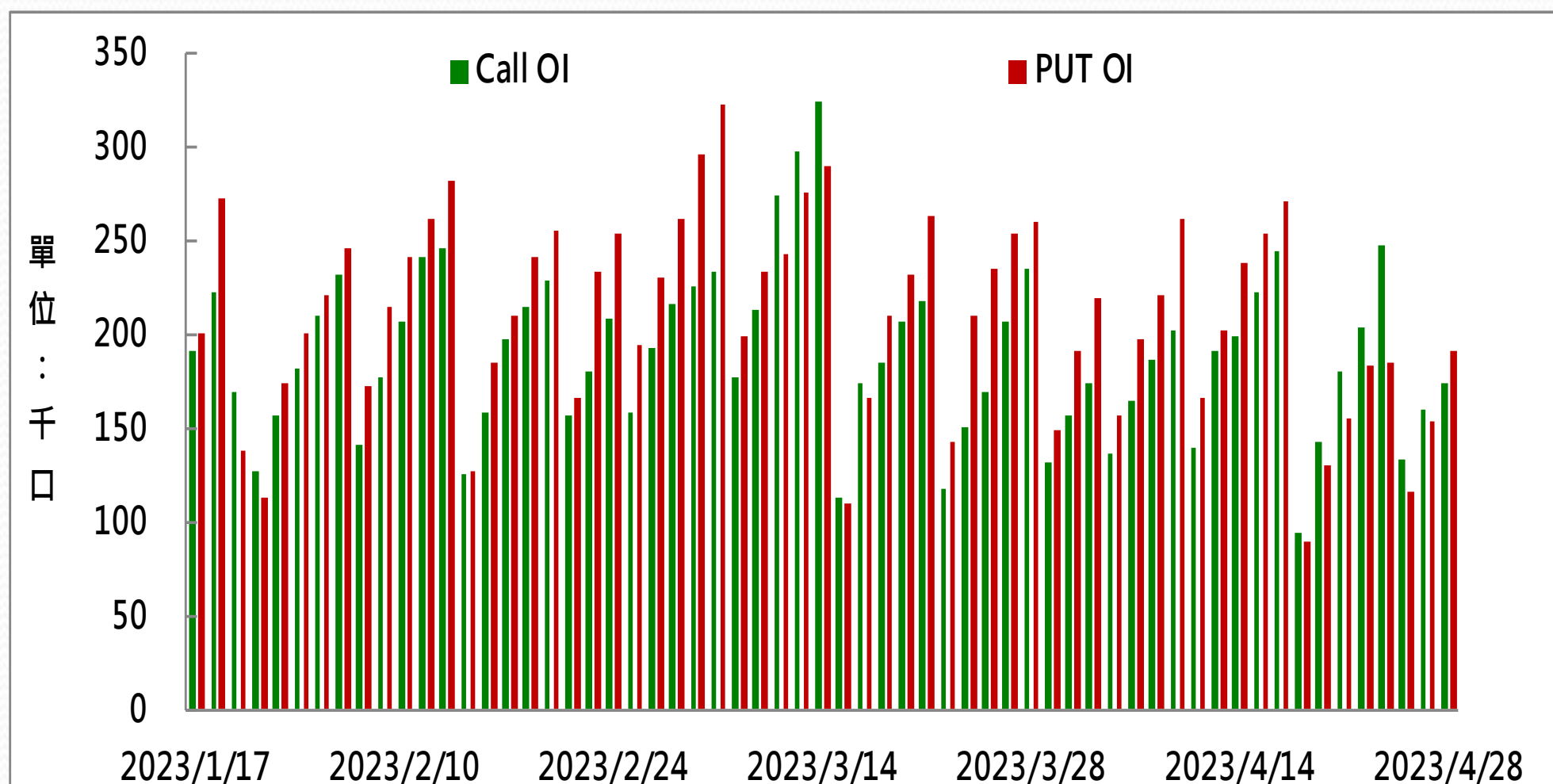
更新日期：2023年4月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年4月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

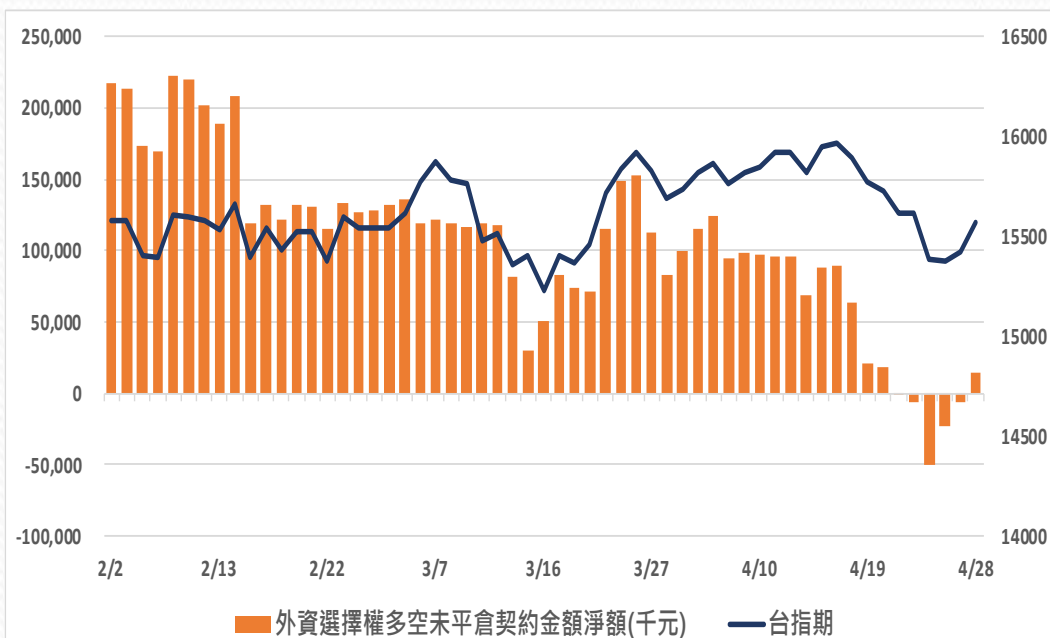
# 選擇權全月Put Call OI



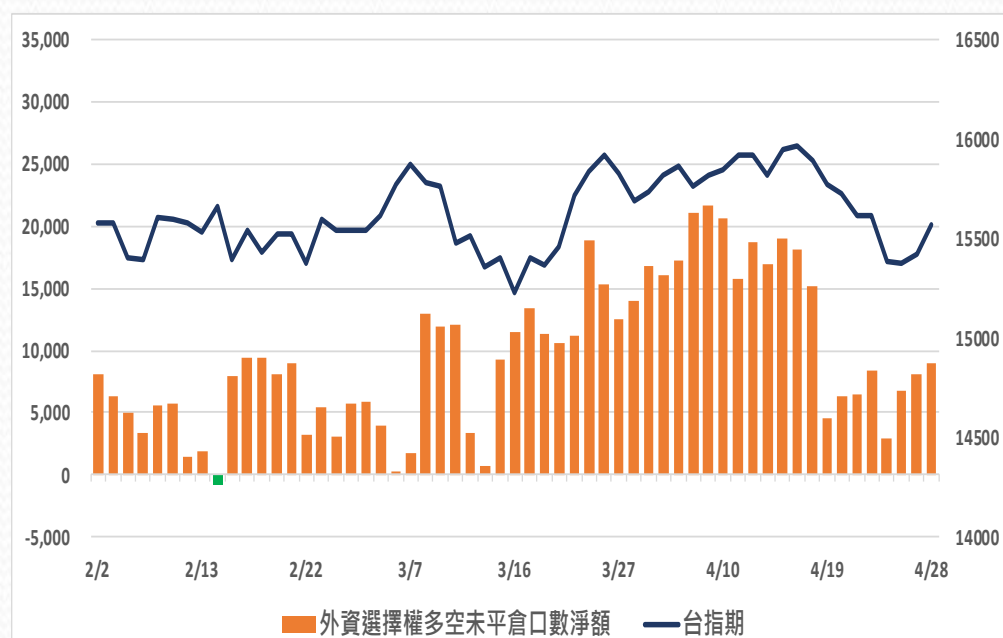
更新日期：2023年4月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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



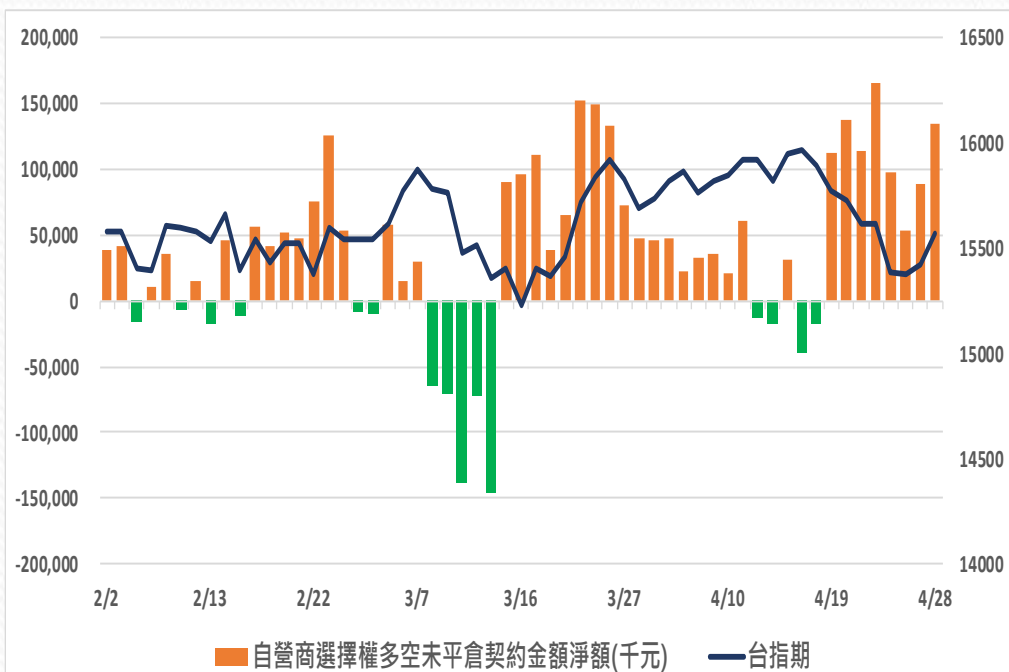
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/24	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
2023/4/28	15572	8,909	+875	13,876	+19,898

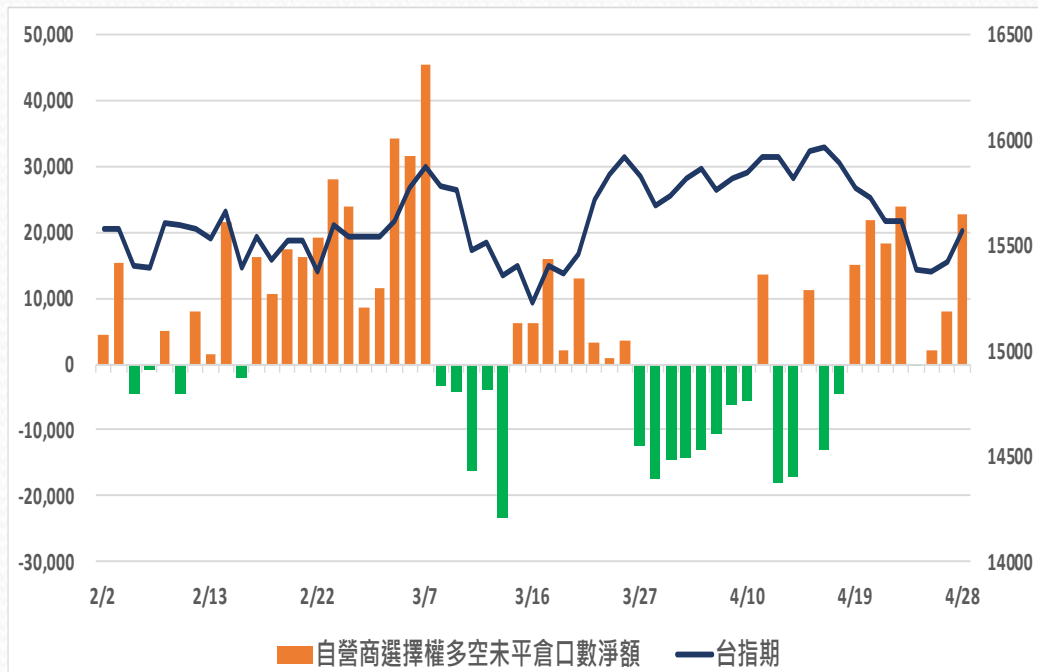
更新日期：2023年4月28日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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



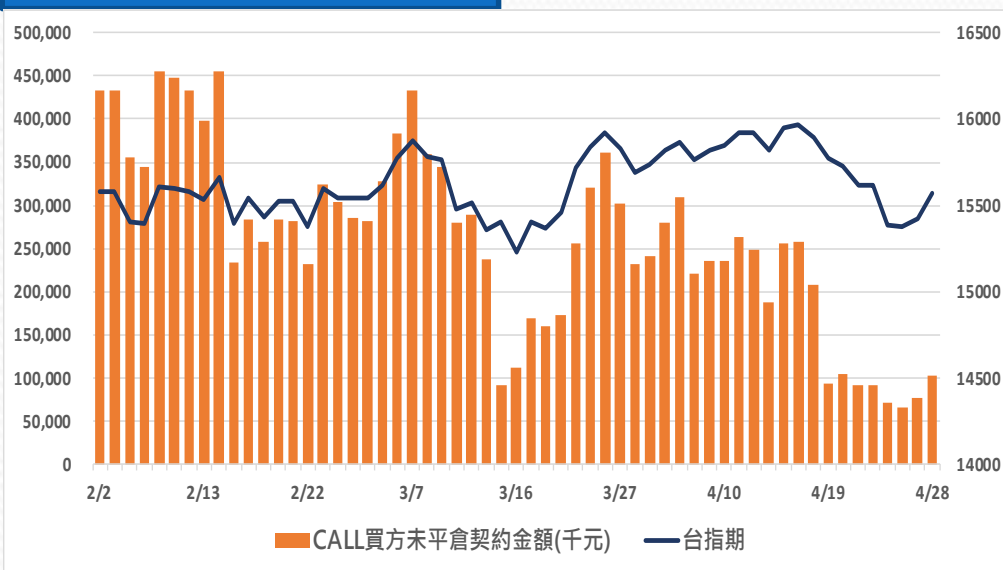
## 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/24	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
2023/4/28	15572	22,836	+14,872	135,006	+46,355

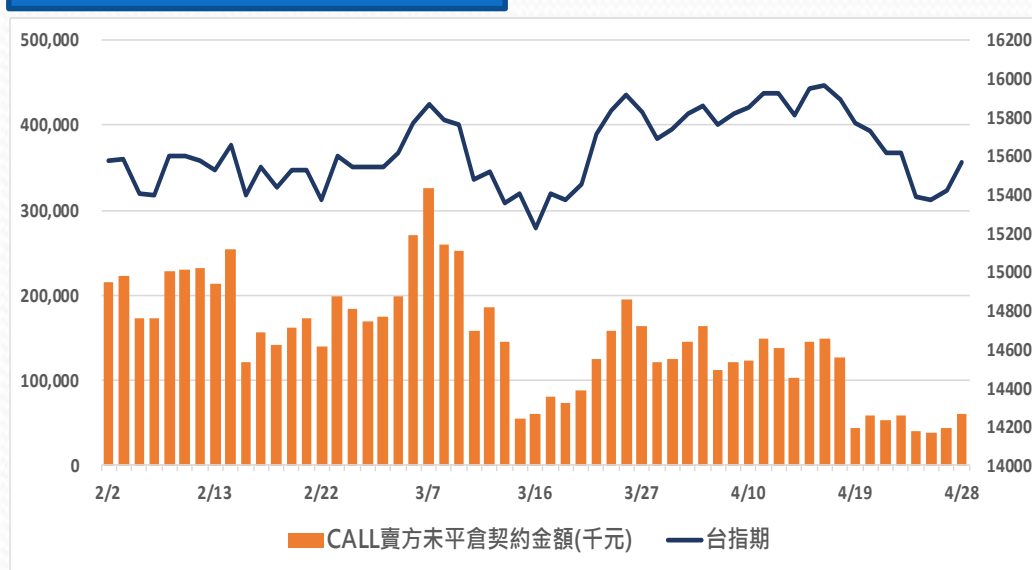
更新日期：2023年4月28日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 外資買賣權未平倉金額

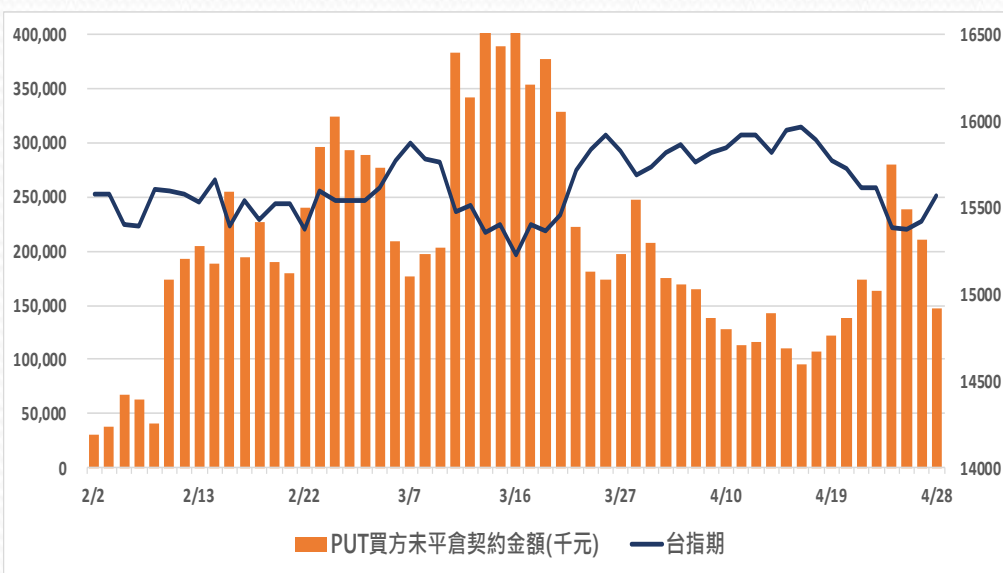
## CALL買方未平倉金額



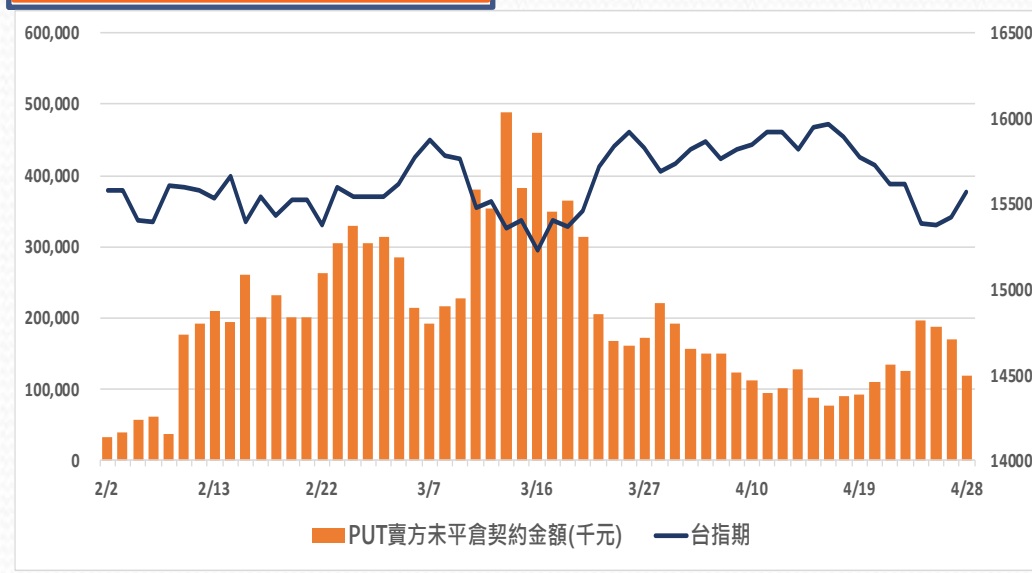
## CALL賣方未平倉金額



## PUT買方未平倉金額



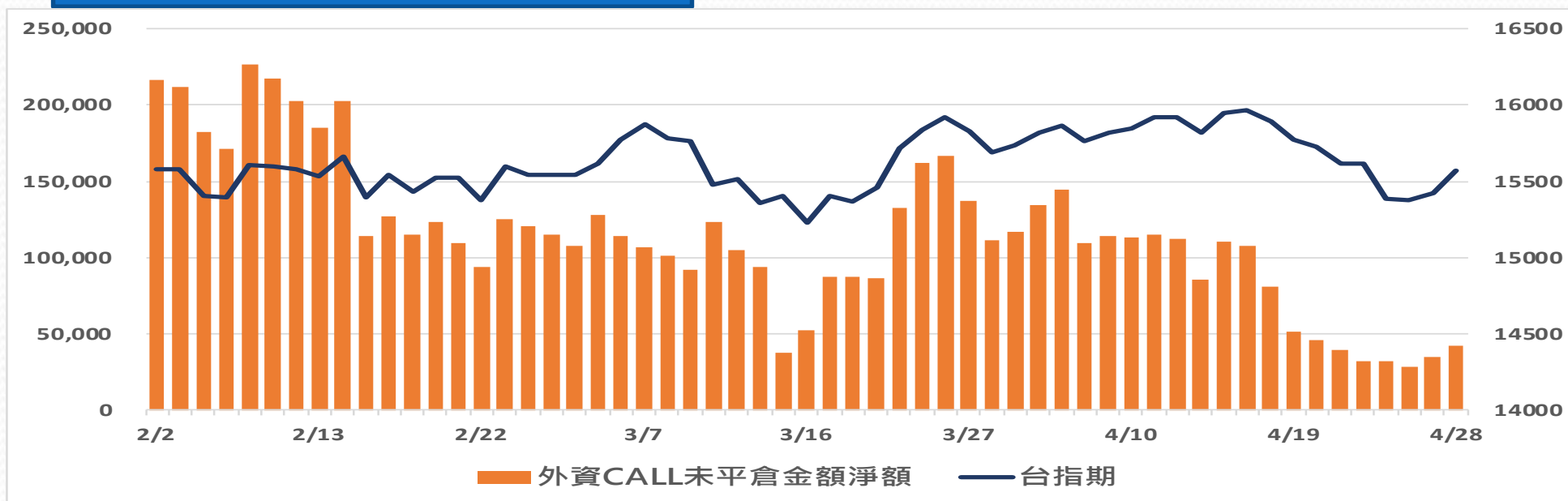
## PUT賣方未平倉金額



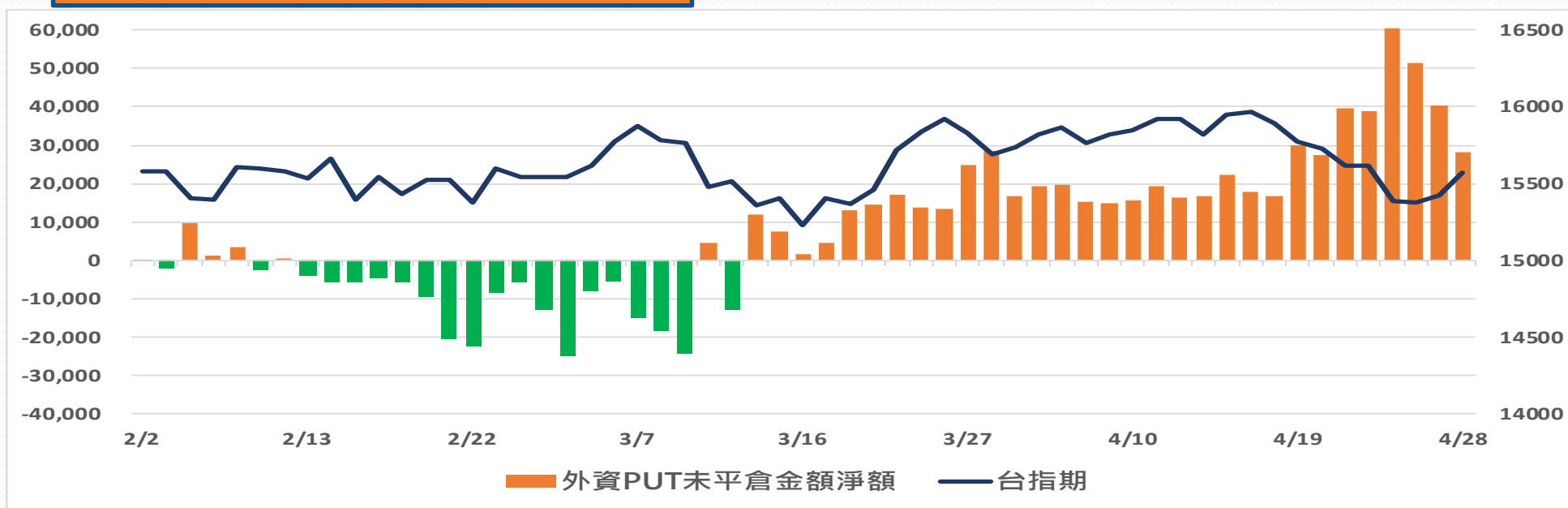
更新日期：2023年4月28日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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28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28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