

# 台指選擇權OI匯報

日期：2023/5/2 結算日：2023/5/3					日期：2023/5/2 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
-1	34	15,000	6,072	-429	0	8	14,300	1,621	10
0	1	15,050	2,393	33	0	46	14,400	4,068	13
-1	69	15,100	4,481	-1,261	0	24	14,500	2,673	-160
-11	72	15,150	3,586	-254	0	5	14,600	1,914	72
-36	199	15,200	8,067	-2,374	1	18	14,700	2,675	630
-17	348	15,250	6,748	649	0	28	14,800	2,333	-190
-200	743	15,300	8,192	-88	-8	44	14,900	2,913	24
-435	824	15,350	6,102	888	4	104	15,000	9,715	1,760 ※
-216	3,577	15,400	11,245	2,626	2	100	15,100	3,990	352
-460	1,617	15,450	9,608	4,622	0	326	15,200	5,737	545
-626	3,420	15,500	10,559	4,219	※	831	15,300	4,484	543
-885	3,370	15,550	8,869	6,212	-91	1,610	15,400	3,543	685
110	8,462	15,600	9,897	7,977 ※	-44	1,787	15,500	3,440	1,019
1,438	8,523	15,650	4,153	3,582	-3	2,121	15,600	2,474	757
※	4,800	15,700	2,756	1,837	53	3,615	15,700	5,823	205
2,861	9,687	15,750	725	484	-464	4,771	15,800	1,066	183
2,311	7,245	15,800	456	280	-230	6,068	15,900	842	40
1,395	4,073	15,850	61	24	660	7,990	16,000	351	0
411	3,346	15,900	92	35	202	4,088	16,100	108	5
52	3,818	16,000	27	2	-42	4,751	16,200	126	0
15	941	16,100	2	0	28	8,055	16,300	140	2
-8	535	16,200	4	0	-105	6,731	16,400	59	3
-2	277	16,300	20	0	77	4,035	16,500	16	0
0	287	16,400	0	0	5	2,767	16,600	13	0
0	128	16,500	0	0	-17	977	16,700	14	0
0	26	16,600	0	0	40	1,039	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
10,484	75,759	1.5502	117,439	28,056	506	70,421	1.0227	72,023	6,401
昨日 P/C	1.3693	今日增減變化	0.1809		昨日 P/C	0.9386	今日增減變化	0.0842	

更新日期：2023年5月2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5月2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	109,675,016	65,571,918	44,103,098	4,391,631	2,229,826	960,630	1,269,196	-64,068	
投信	28,784,035	52,352,234	-23,568,199	141,728	506,514	0	506,514	2,192	
自營商	41,327,272	26,334,352	14,992,920	-1,306,842	1,472,946	575,784	897,162	244,773	
	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	391,650	794,266	-402,616	-64,748	23,049	70,684	-47,635	7,485	
投信	123,761	0	123,761	189	0	0	0	0	
自營商	258,489	252,199	6,290	-40,640	265,832	221,095	44,737	-7,403	

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報								2023年5月2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	33,216	13,426	19,790	2,531	26,476	15,353	11,123	2,773	
投信	100	100	0	0	450	113	337	0	
自營商	63,204	44,070	19,134	40	45,360	56,501	-11,141	-7,399	
特定法人(週)	1,000	0	1,000	1,000	0	3,091	-3,091	0	
特定法人(近月)	23,802	11,848	11,954	530	6,009	15,322	-9,313	-1,248	
特定法人(全月)	25,135	4,843	20,292	787	4,253	16,525	-12,272	2,036	
十大交易人(週)	29,621	20,791	8,830	-824	43,626	21,899	21,727	6,210	
十大交易人(近月)	42,673	27,340	15,333	1,251	24,754	32,395	-7,641	1,582	
十大交易人(全月)	88,478	50,365	38,113	-1,020	68,156	61,695	6,461	7,196	
全市場未沖銷(近月)			70,421	506			72,023	6,401	
全市場未沖銷(全月)			193,310	19,442			232,917	41,138	

更新日期：2023年5月2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	15600	賣權OI最大量	15400
	整體隱含波動率	9.99%	較前一交易日	+0.35%
	買權隱含波動率	8.04%	較前一交易日	+0.09%
	賣權隱含波動率	11.49%	較前一交易日	+0.39%
電子選擇權	買權成交最大量	750	買權OI最大量	740
	賣權成交最大量	705	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

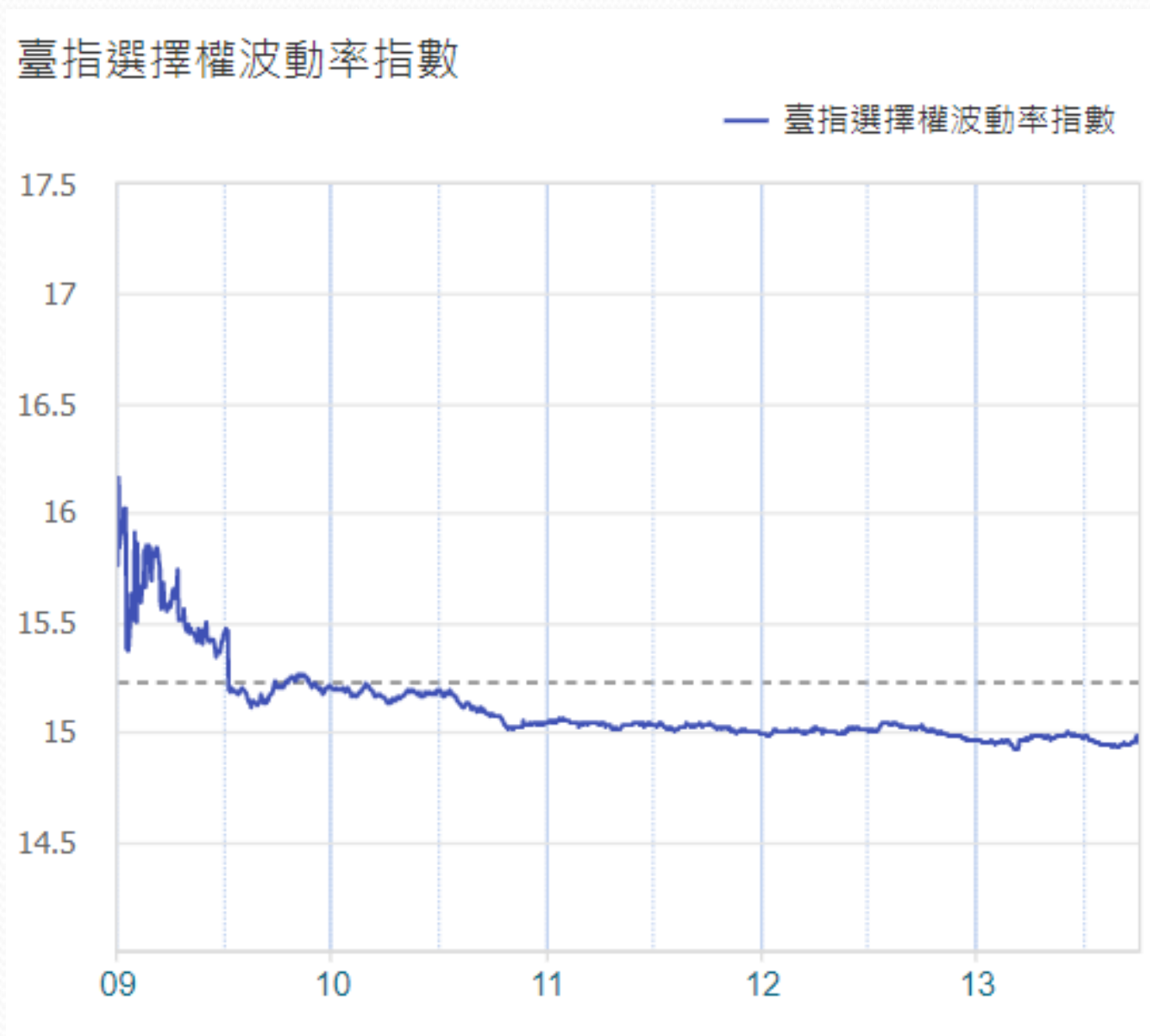
更新日期：2023年5月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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	15900	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	13.70%	較前一交易日	-0.50%
	買權隱含波動率	11.96%	較前一交易日	+0.54%
	賣權隱含波動率	15.01%	較前一交易日	+0.13%
	成交量P/C_Ratio值	1.306	較前一交易日	+0.27
	未平倉P/C_Ratio值	1.023	較前一交易日	+0.08
電子選擇權	買權成交最大量	750	買權OI最大量	740
	賣權成交最大量	705	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

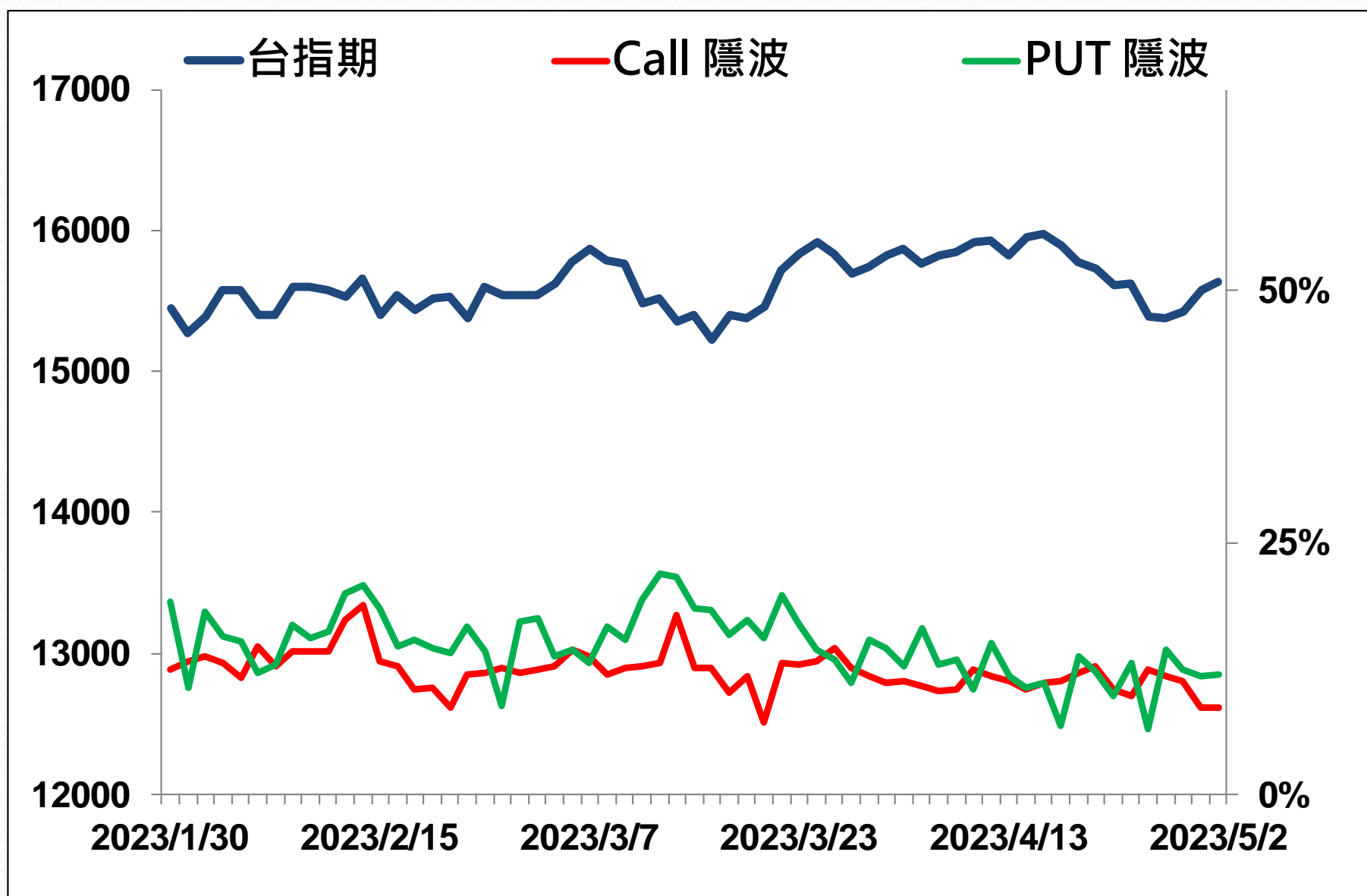
更新日期：2023年5月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權當日波動率指數



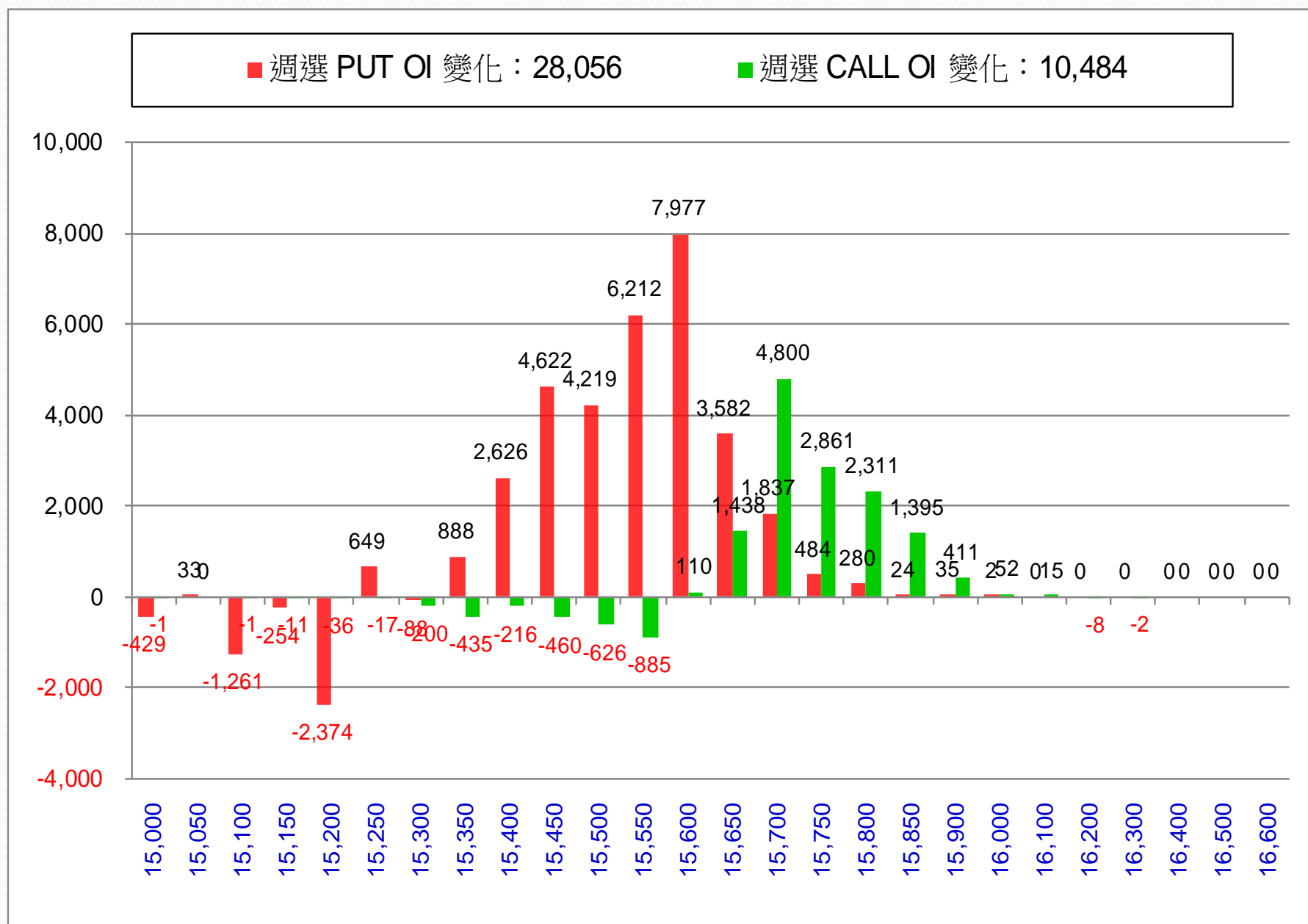
更新日期：2023年5月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



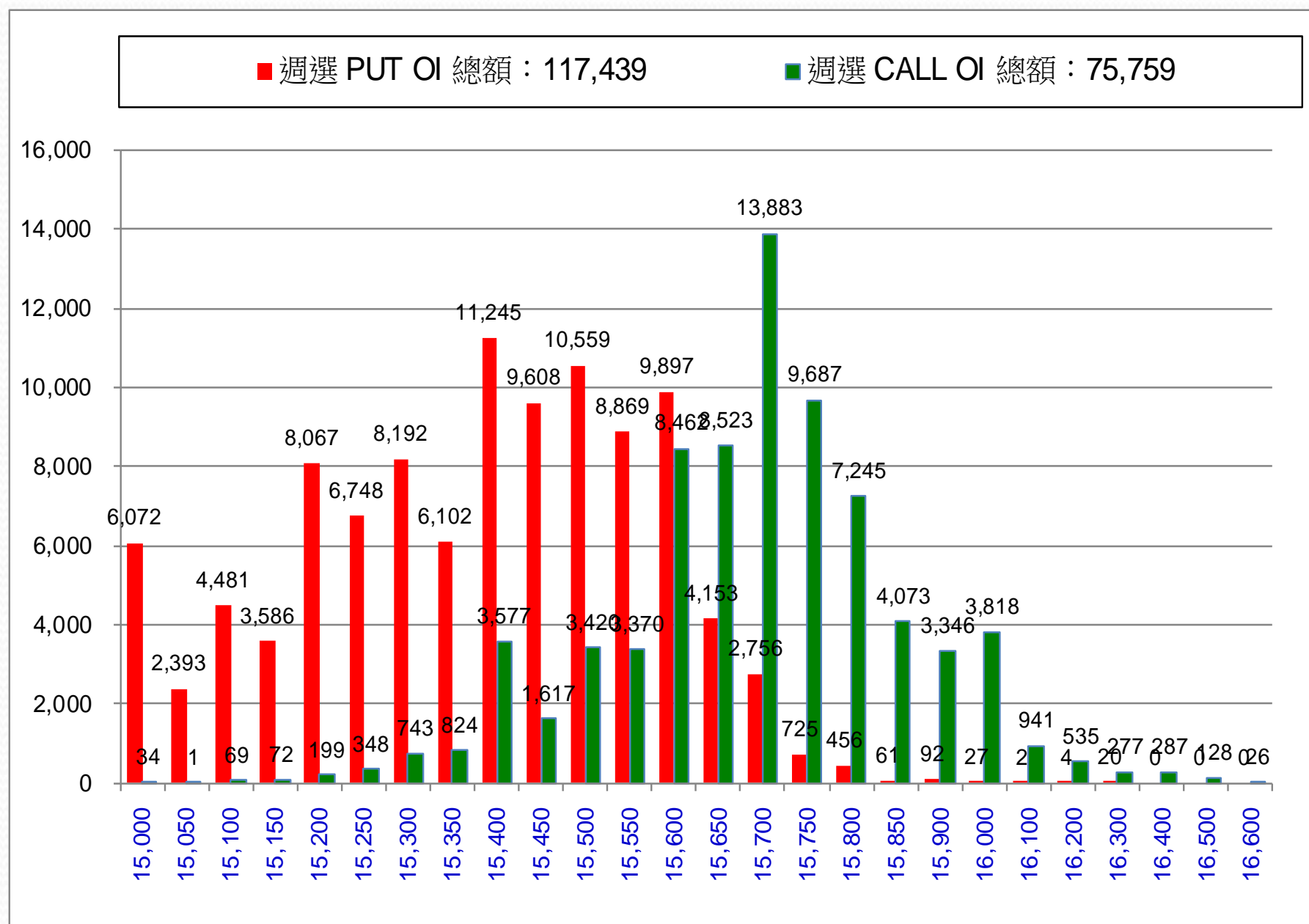
更新日期：2023年5月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年5月2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



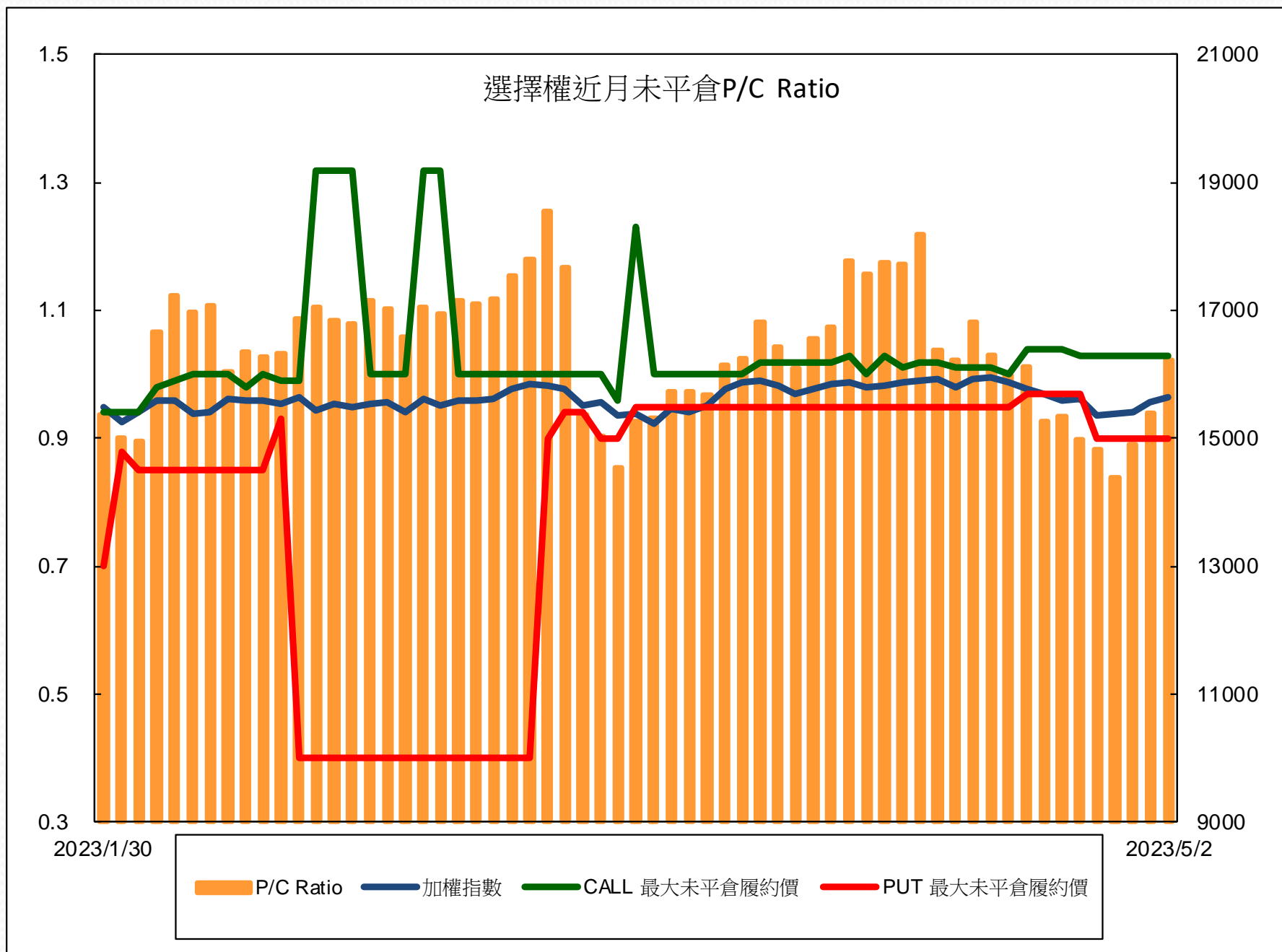
更新日期：2023年5月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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28日	57,729	38,635	19,094
	5月2日	63,204	44,070	19,134
Put	4月28日	42,485	46,227	-3,742
	5月2日	45,360	56,501	-11,141

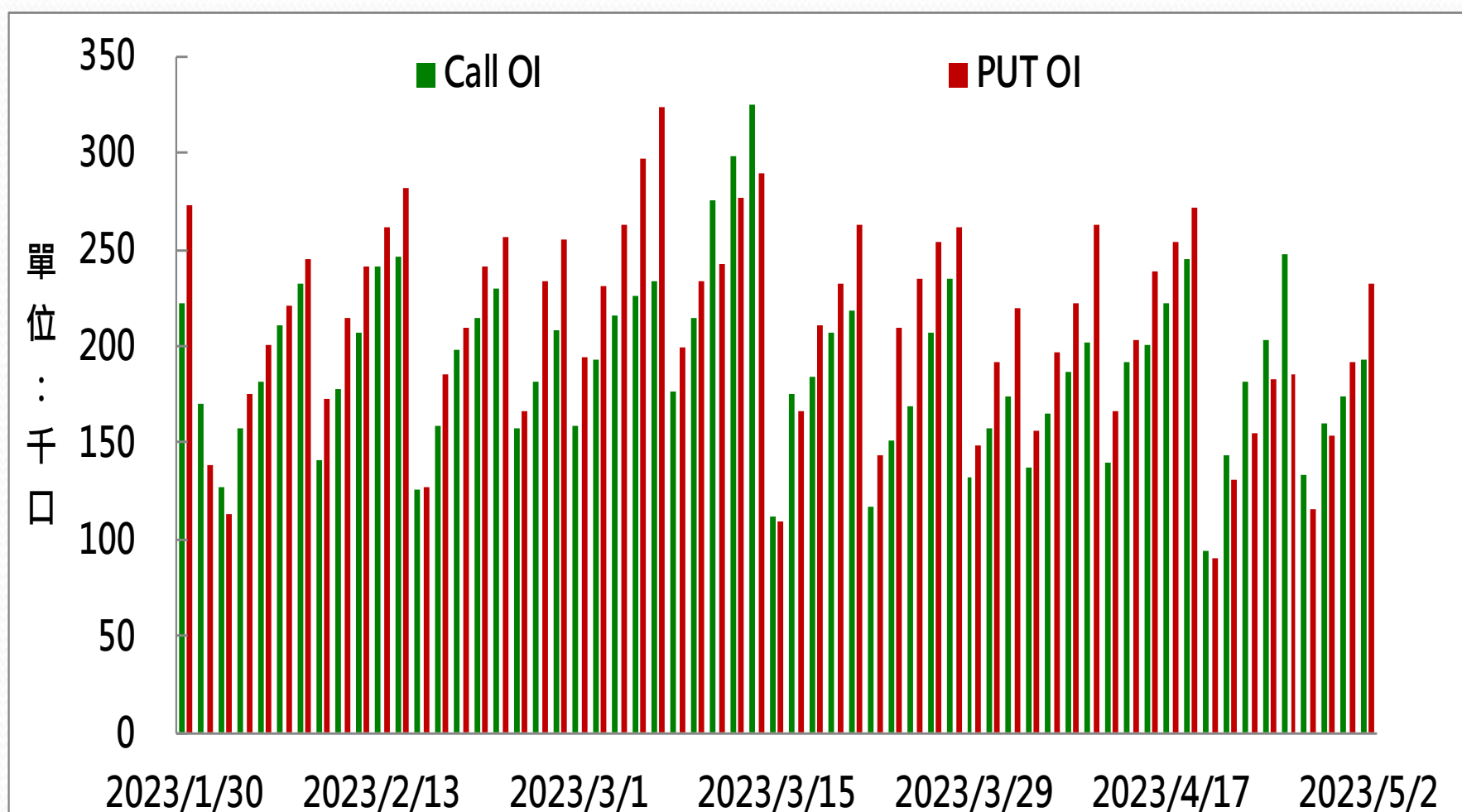
更新日期：2023年5月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年5月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

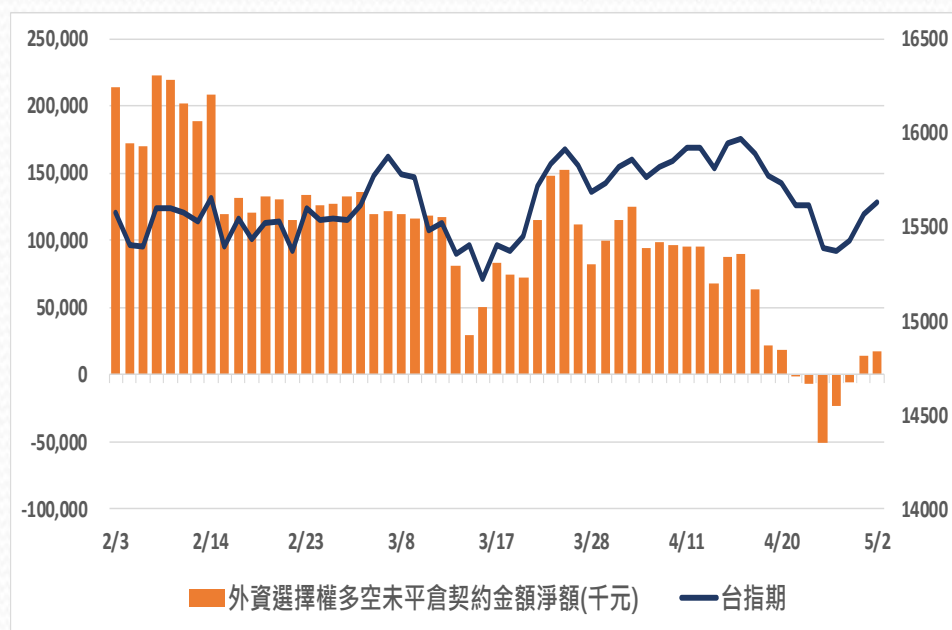
# 選擇權全月Put Call OI



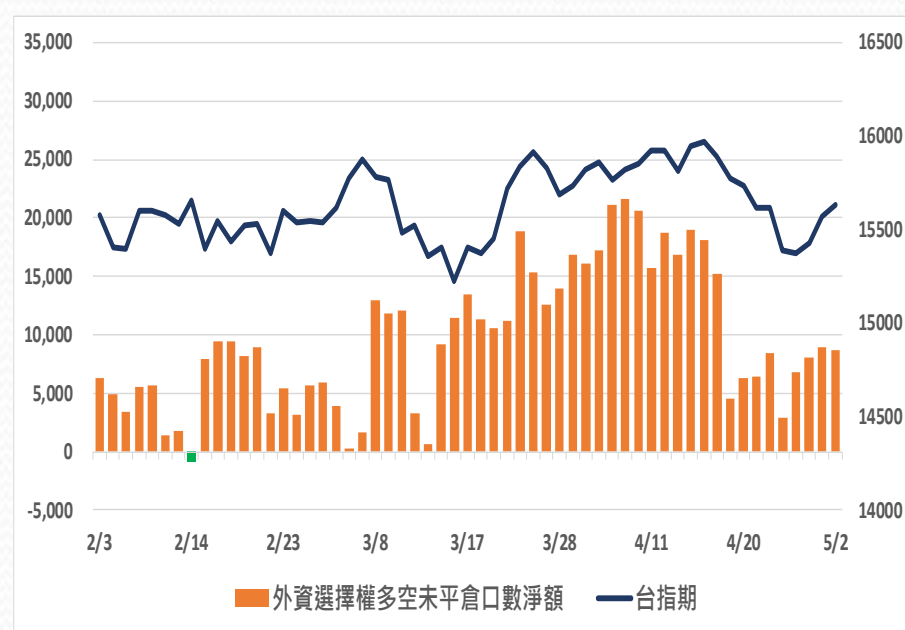
更新日期：2023年5月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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



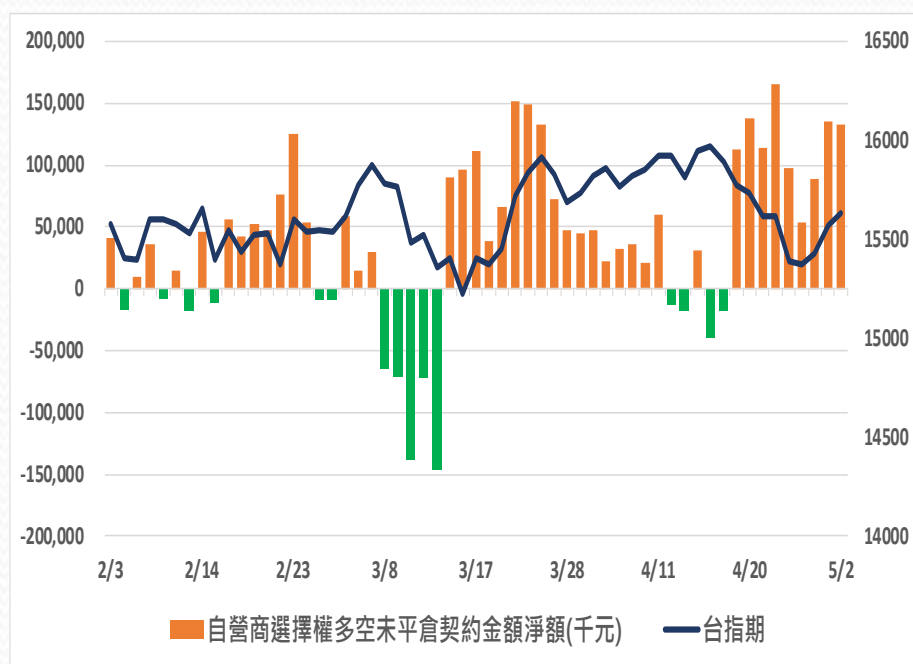
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/25	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
2023/5/2	15635	8,667	-242	17,496	+3,620

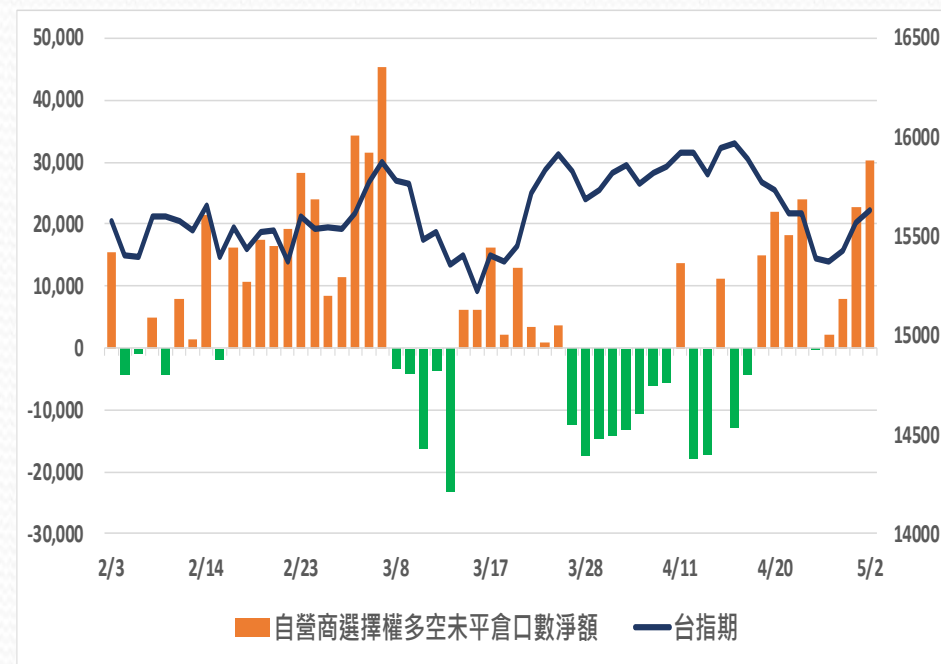
更新日期：2023年5月2日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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



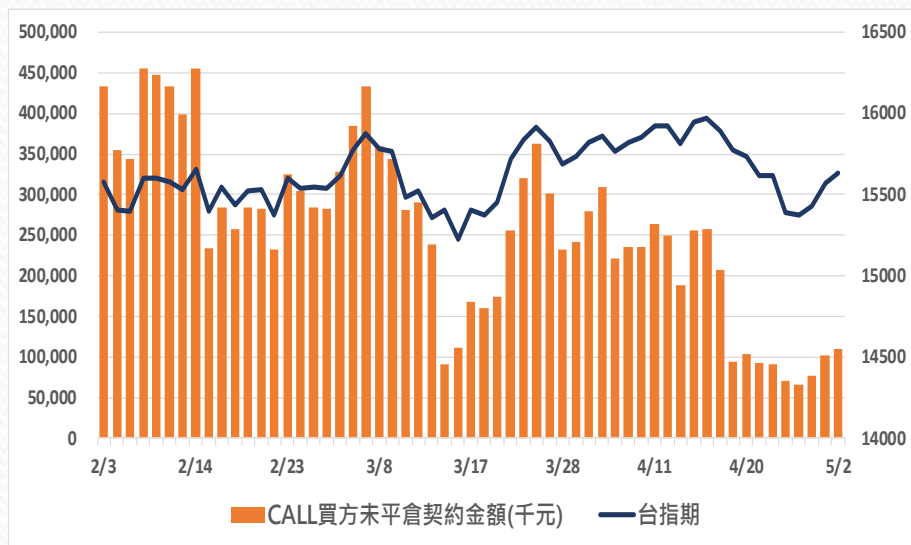
## 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/25	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
2023/5/2	15635	30,275	+7,439	132,568	-2,438

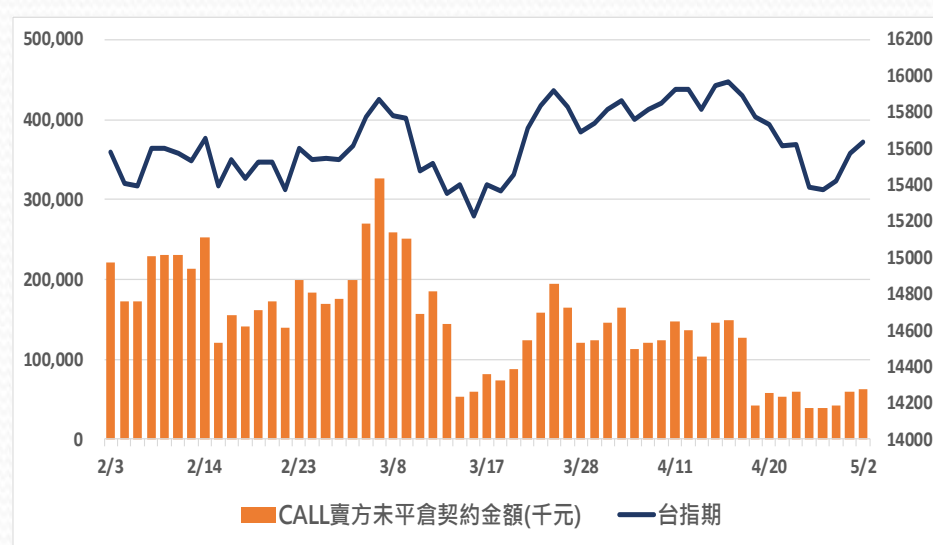
更新日期：2023年5月2日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 外資買賣權未平倉金額

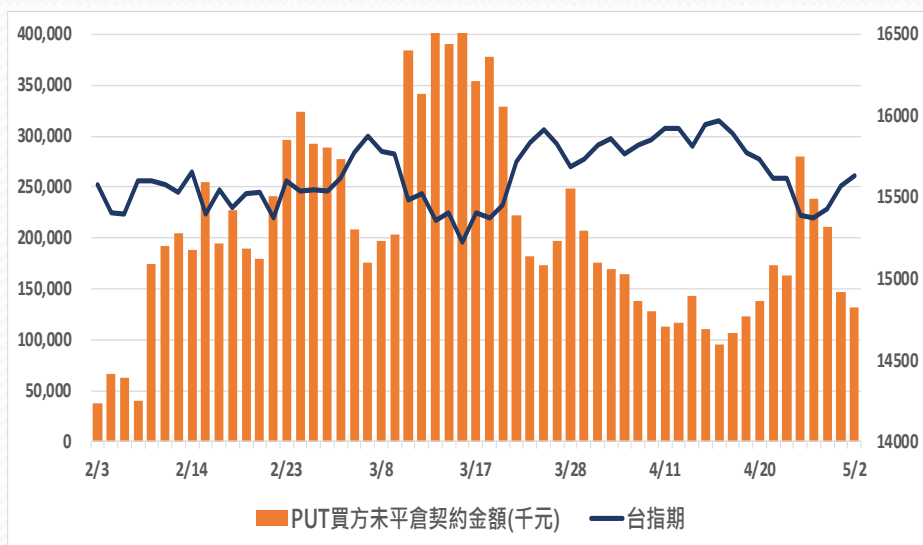
## CALL買方未平倉金額



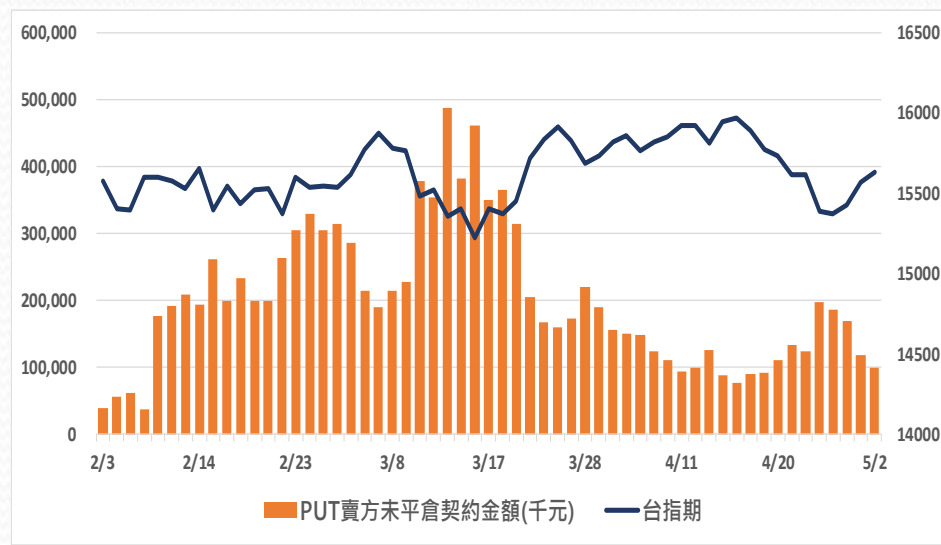
## CALL賣方未平倉金額



## PUT買方未平倉金額



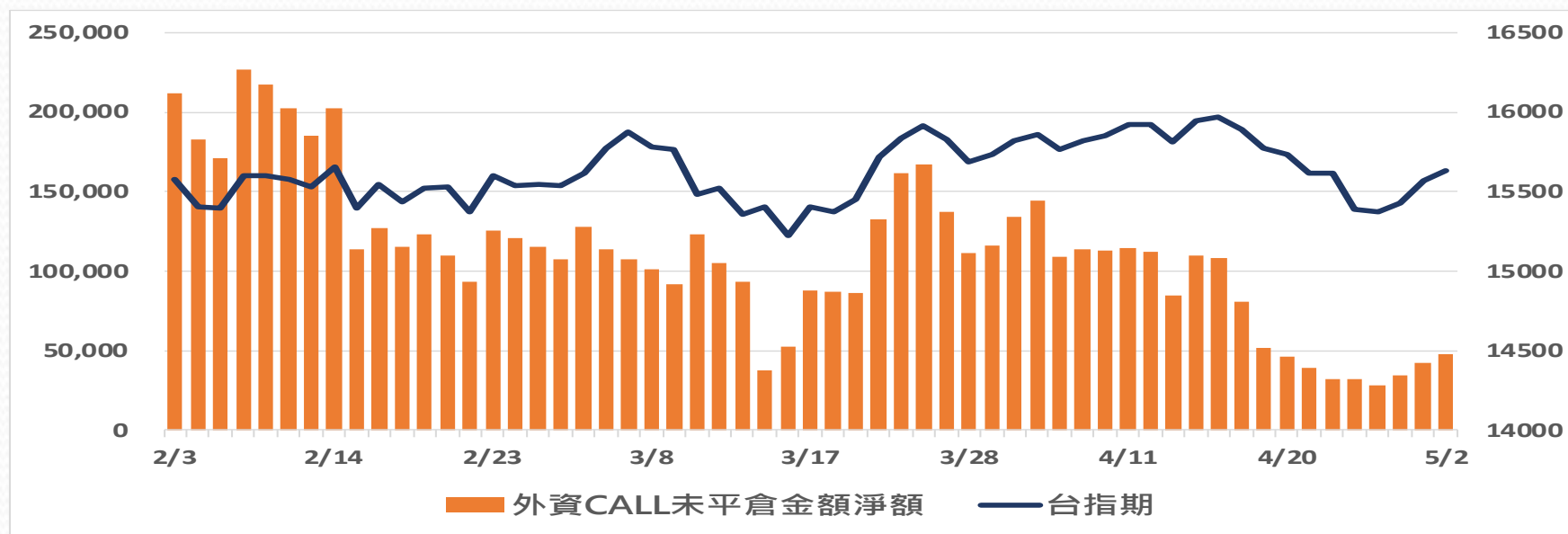
## PUT賣方未平倉金額



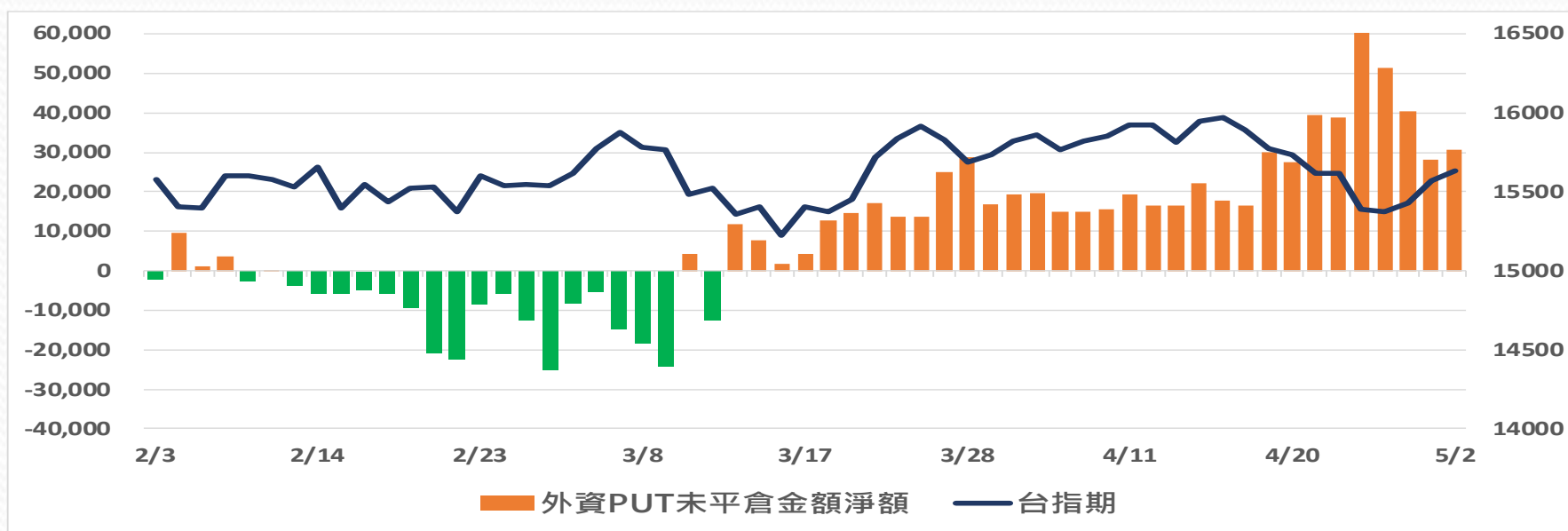
更新日期：2023年5月2日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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5月2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5月2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