

台指選擇權OI匯報

日期：2023/5/3 結算日：2023/5/10					日期：2023/5/3 結算日：2023/5/17				
202305W2					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	1,557	1,335	0	8	14,300	1,595	-26
0	0	14,700	589	333	0	46	14,400	4,012	-56
1	2	14,800	1,512	1,082	0	24	14,500	2,718	45
1	1	14,900	1,549	843	0	5	14,600	1,869	-45
3	6	15,000	1,854	892	3	21	14,700	2,746	71
6	11	15,100	1,547	543	0	28	14,800	2,464	131
13	19	15,200	2,211	1,087	2	46	14,900	3,117	204
1	25	15,250	1,455	816	5	109	15,000	10,486	771 ※
7	41	15,300	1,835	768	25	125	15,100	4,071	81
205	259	15,350	1,345	774	23	349	15,200	5,860	123
86	249	15,400	2,108	1,338 ※	-48	2,399	15,300	4,171	-313
60	177	15,450	1,314	895	-53	1,557	15,400	4,038	495
721	906	15,500	1,716	1,188	98	1,885	15,500	3,122	-318
802	972	15,550	849	475	263	2,384	15,600	2,511	37
992	1,438	15,600	1,290	529	209	3,824	15,700	5,802	-21
816	1,210	15,650	465	347	67	4,838	15,800	1,007	-59
1,139	1,855	15,700	206	25	348	6,416	15,900	841	-1
1,259	1,891	15,750	107	75 ※	1,058	9,048	16,000	314	-37
1,772	2,972	15,800	119	4	736	4,824	16,100	113	5
2,341	3,016	15,850	13	6	-67	4,684	16,200	124	-2
※ 2,470	4,585	15,900	24	11	149	8,204	16,300	140	0
1,096	1,969	15,950	26	14	-22	6,709	16,400	59	0
1,326	2,968	16,000	8	5	-87	3,948	16,500	16	0
566	566	16,050	40	40	2	2,769	16,600	13	0
657	1,558	16,100	23	2	-4	973	16,700	14	0
1,155	1,373	16,200	20	0	86	1,125	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
17,625	29,601	0.8858	26,220	14,881	2,034	72,455	1.0110	73,249	1,226
昨日 P/C	1.5502	今日增減變化	-0.6644		昨日 P/C	1.0227	今日增減變化	-0.0118	

更新日期：2023年5月3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3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	106,840,740	64,260,778	42,579,962	-1,523,136	2,295,101	966,663	1,328,438	59,242	
投信	28,647,478	52,655,134	-24,007,656	-439,457	503,591	0	503,591	-2,923	
自營商	39,239,168	23,618,536	15,620,632	627,712	1,183,691	560,794	622,897	-274,265	
	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	337,694	756,686	-418,992	-16,376	24,438	73,315	-48,877	-1,242	
投信	123,509	0	123,509	-252	0	0	0	0	
自營商	281,412	220,431	60,981	54,691	285,602	238,073	47,529	2,792	

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3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	30,746	12,099	18,647	-1,143	22,764	14,611	8,153	-2,970	
投信	100	100	0	0	450	113	337	0	
自營商	53,485	41,257	12,228	-6,906	40,271	33,362	6,909	18,050	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	24,165	11,501	12,664	710	6,562	15,708	-9,146	167	
特定法人(全月)	24,984	6,393	18,591	-1,701	6,562	18,627	-12,065	207	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	43,666	27,348	16,318	985	24,671	33,252	-8,581	-940	
十大交易人(全月)	78,726	45,340	33,386	-4,727	43,836	55,722	-11,886	-18,347	
全市場未沖銷(近月)			74,093	3,672			74,142	2,119	
全市場未沖銷(全月)			135,190	-58,120			134,591	-98,326	

更新日期：2023年5月3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05W2週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15900	買權OI最大量	15900
	賣權成交最大量	15400	賣權OI最大量	15200
	整體隱含波動率	13.56%	較前一交易日	+3.58%
	買權隱含波動率	11.65%	較前一交易日	+3.61%
	賣權隱含波動率	15.47%	較前一交易日	+3.98%
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	700	賣權OI最大量	705
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5月3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	16000
	賣權成交最大量	15200	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	13.95%	較前一交易日	-0.26%
	買權隱含波動率	12.54%	較前一交易日	+0.57%
	賣權隱含波動率	15.40%	較前一交易日	+0.40%
	成交量P/C_Ratio值	1.063	較前一交易日	-0.24
	未平倉P/C_Ratio值	1.001	較前一交易日	-0.02
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	700	賣權OI最大量	705
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

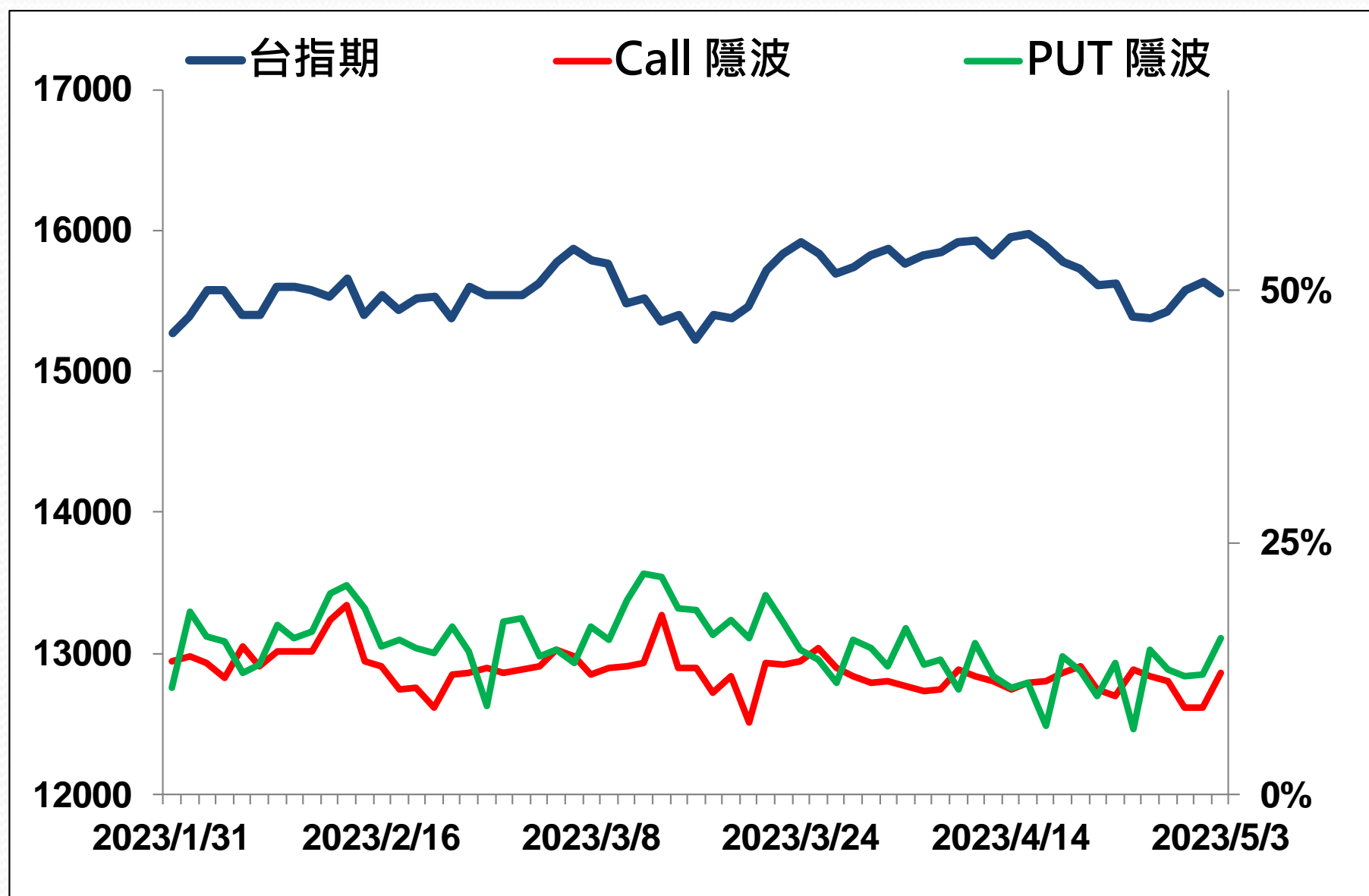
更新日期：2023年5月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



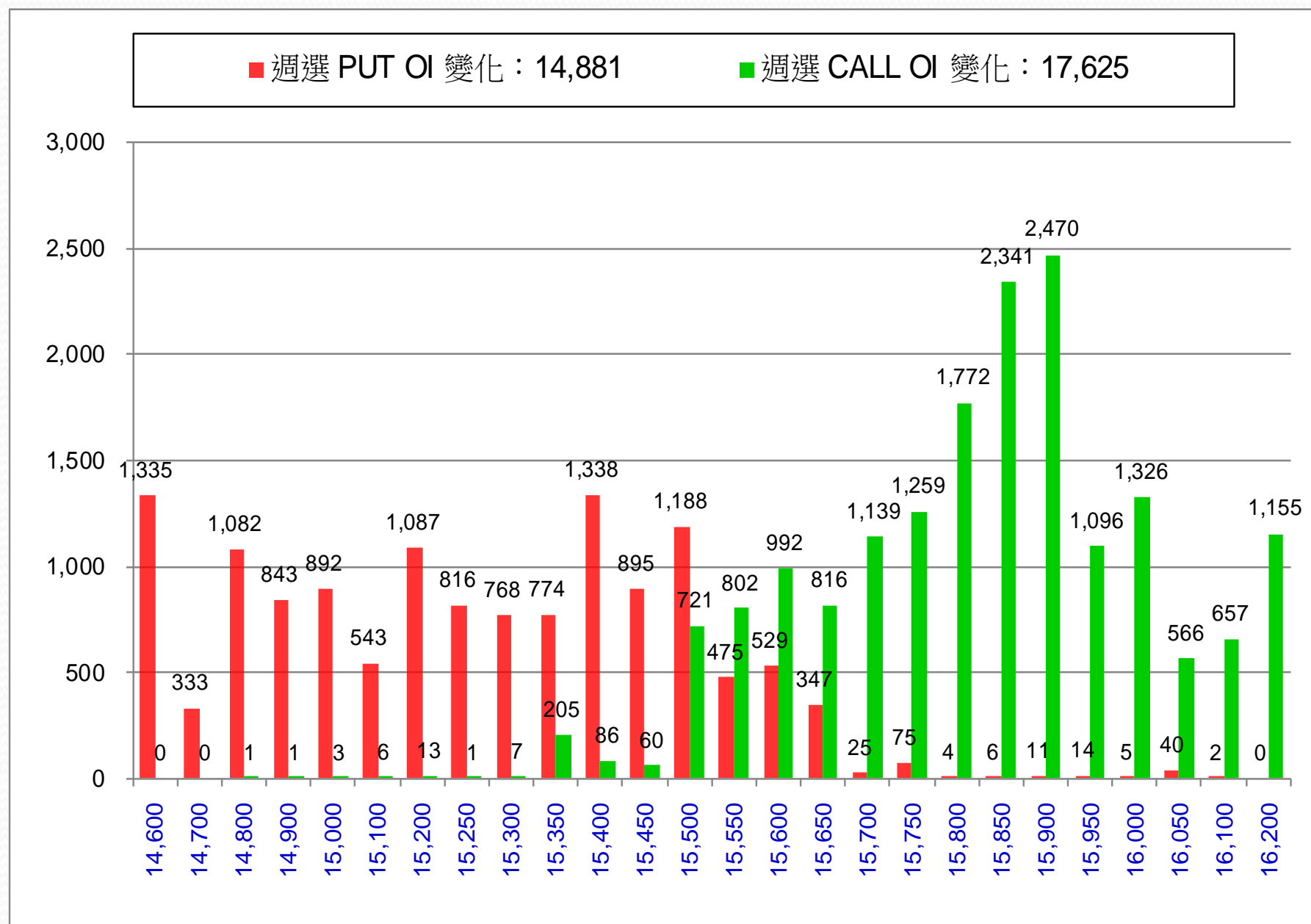
更新日期：2023年5月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



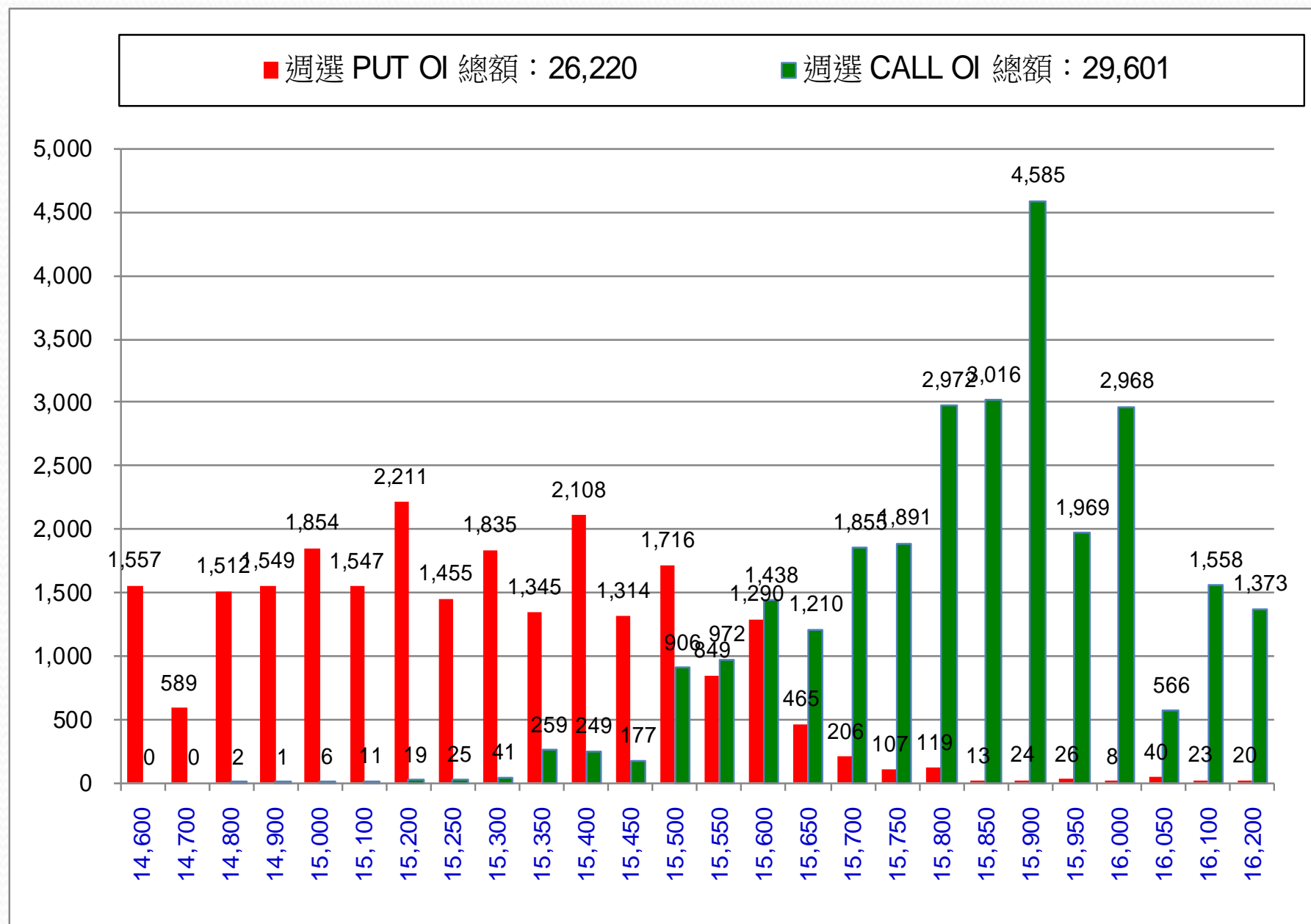
更新日期：2023年5月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年5月3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



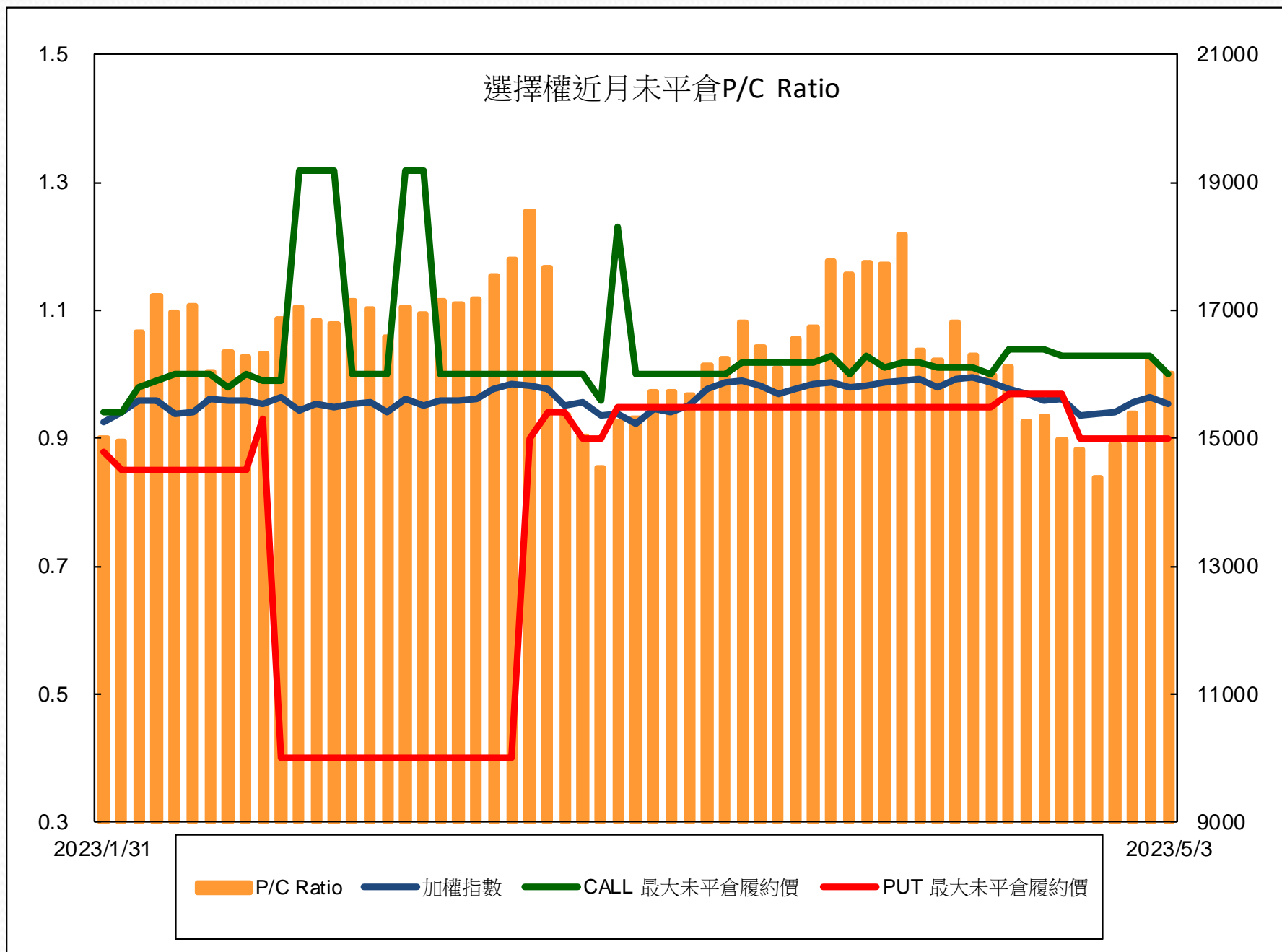
更新日期：2023年5月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	5月2日	63,204	44,070	19,134
	5月3日	53,485	41,257	12,228
Put	5月2日	45,360	56,501	-11,141
	5月3日	40,271	33,362	6,909

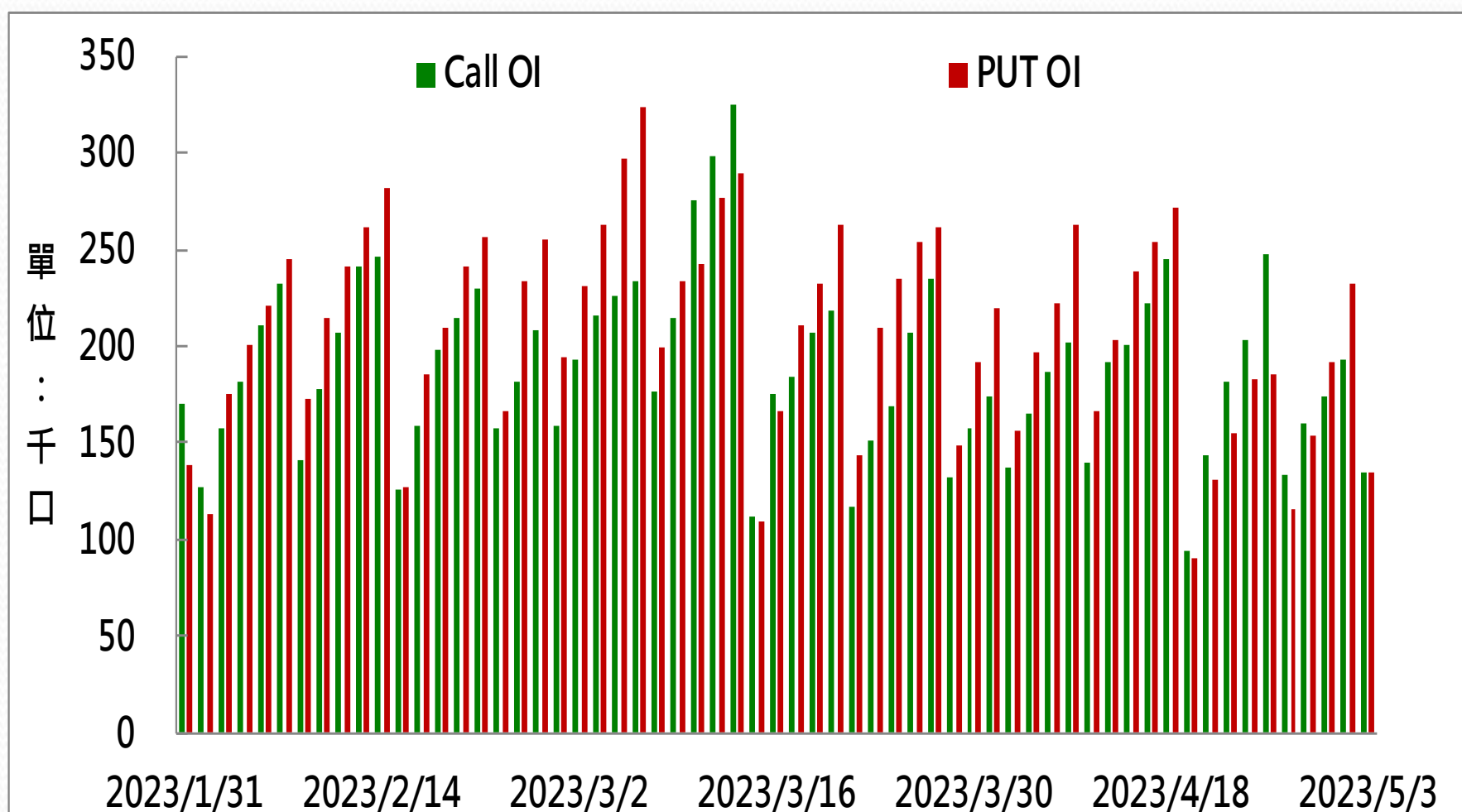
更新日期：2023年5月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年5月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

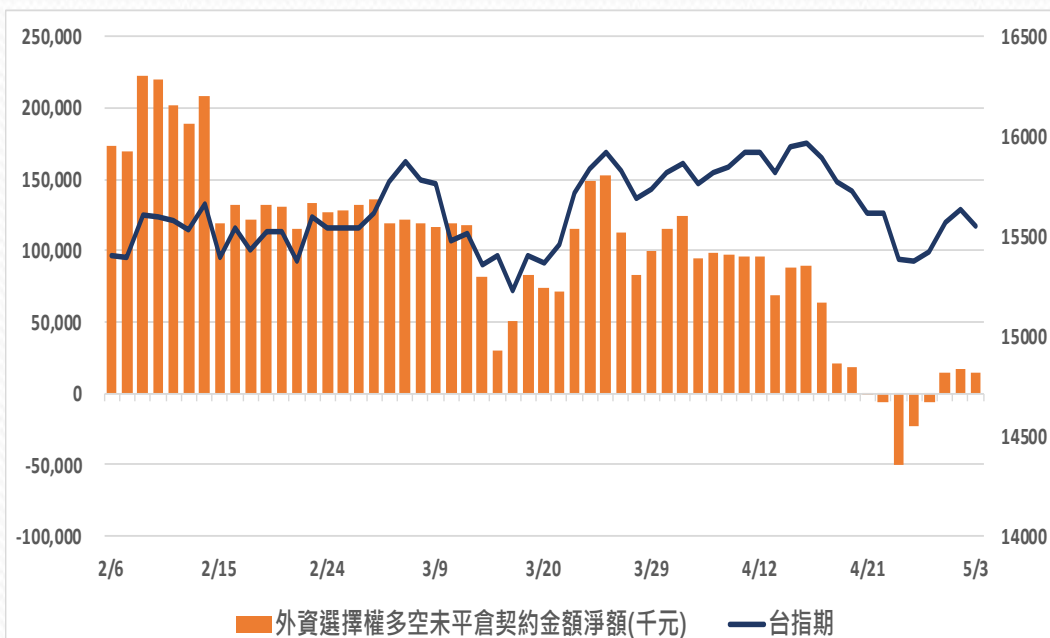
選擇權全月Put Call OI



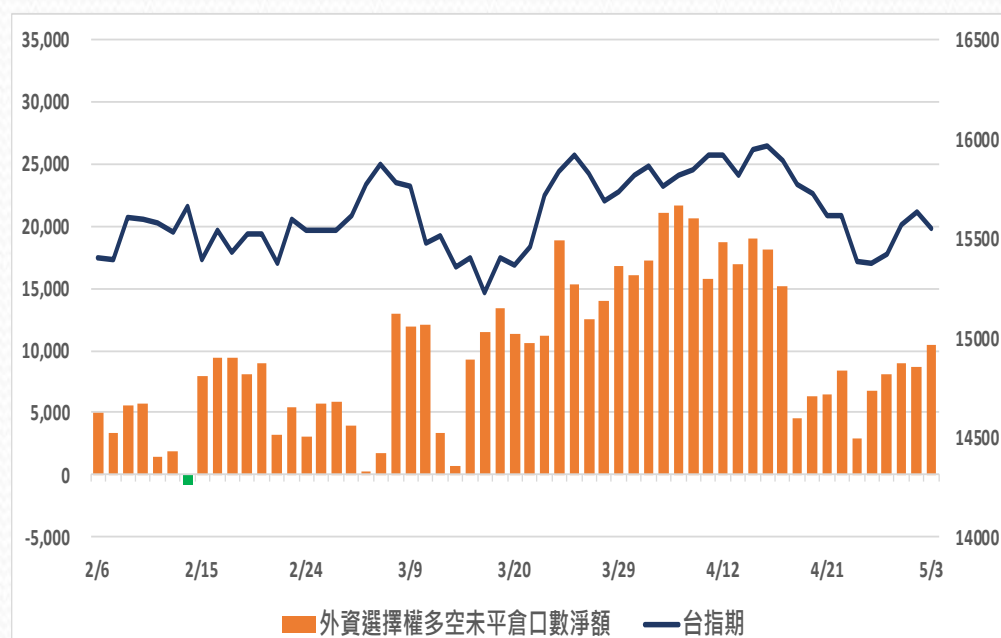
更新日期：2023年5月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



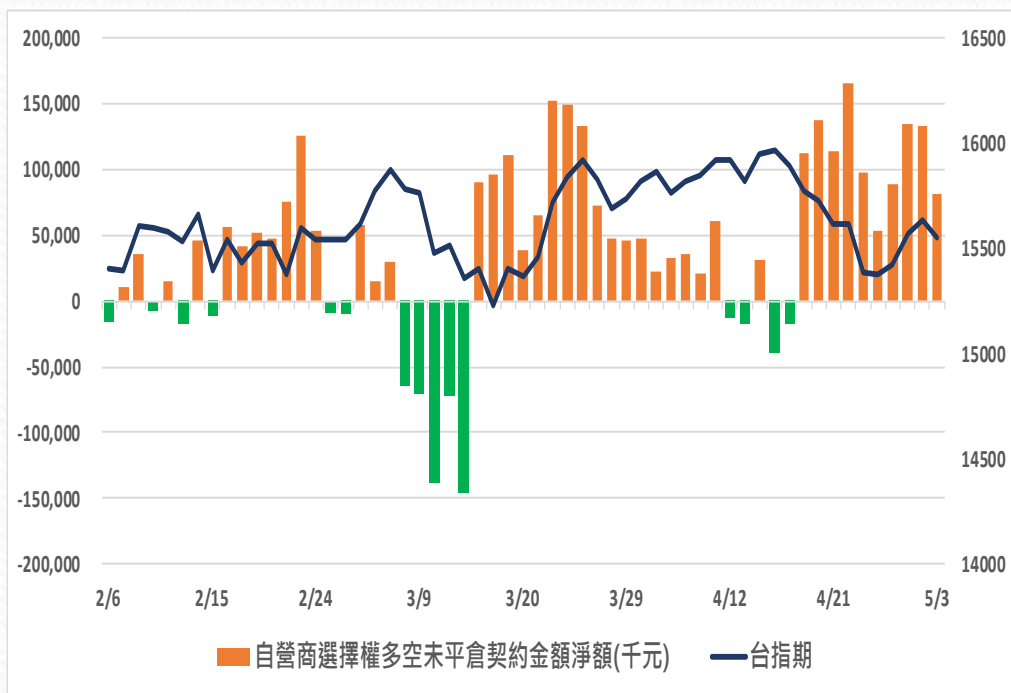
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/26	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
2023/5/3	15549	10,494	+1,827	14,740	-2,756

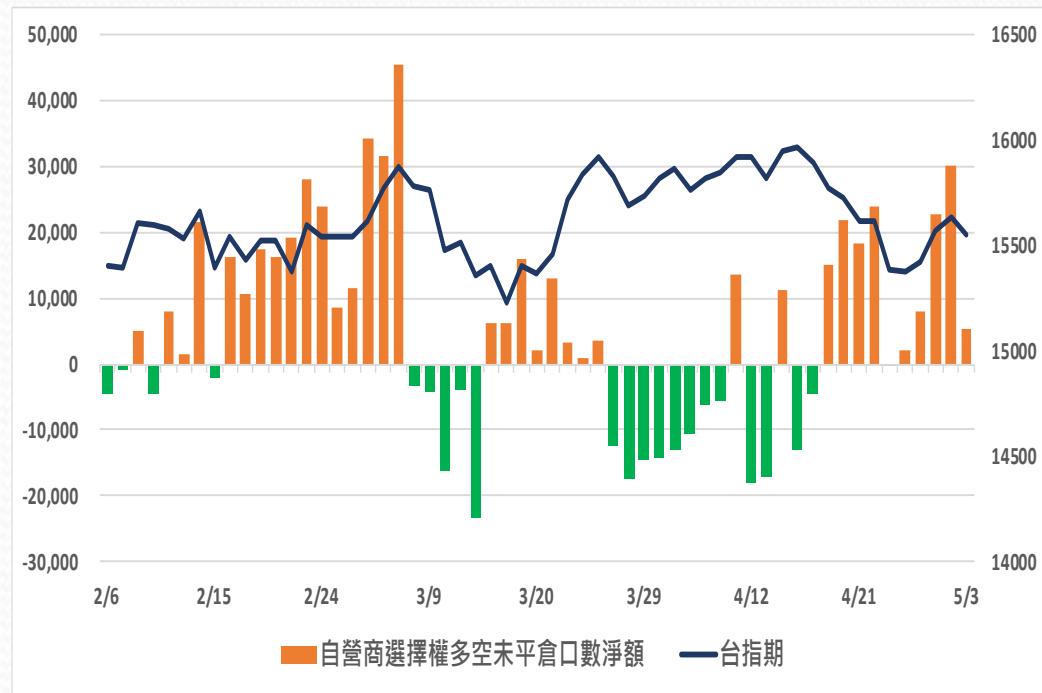
更新日期：2023年5月3日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



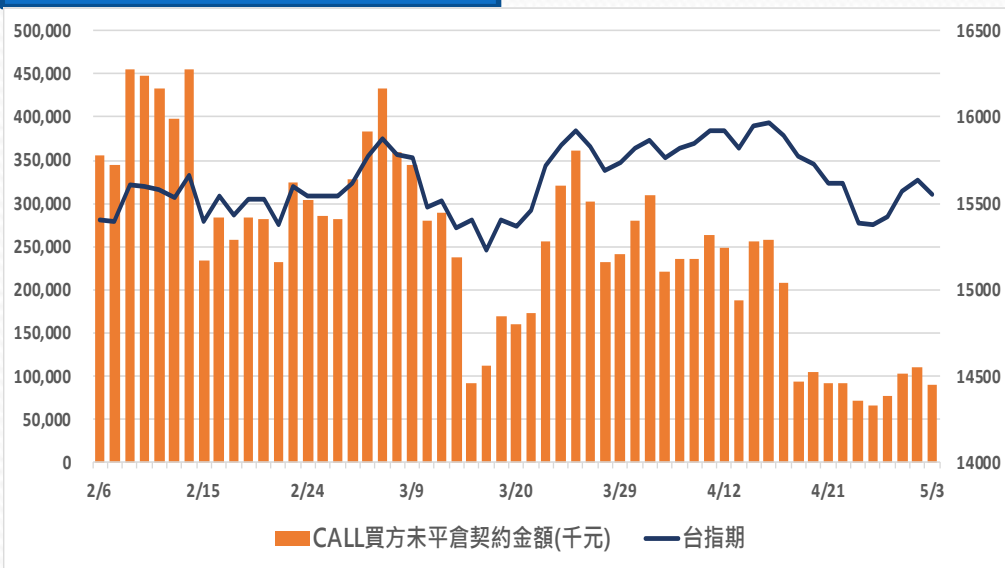
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/26	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
2023/5/3	15549	5,319	-24,956	81,239	-51,329

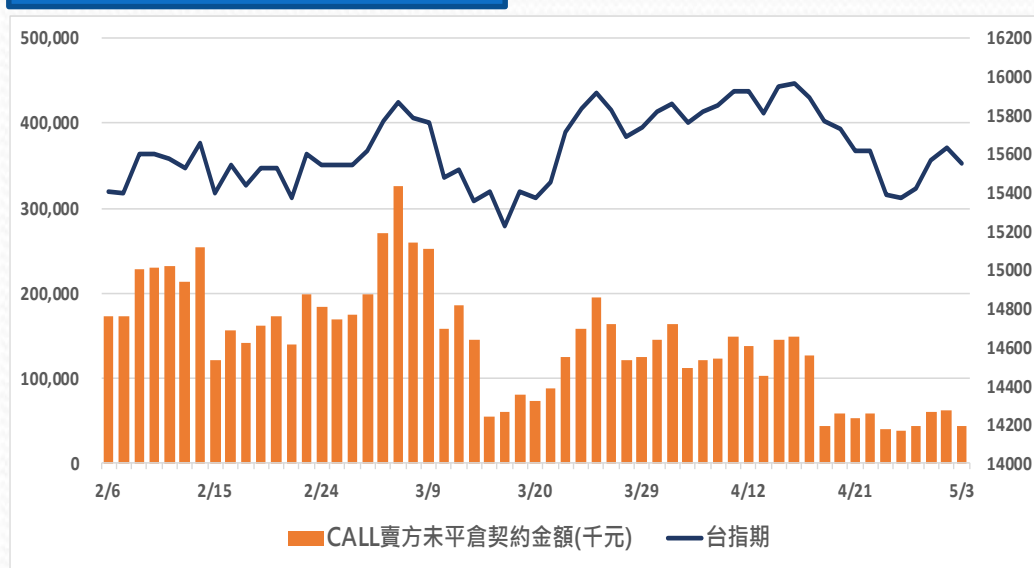
更新日期：2023年5月3日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

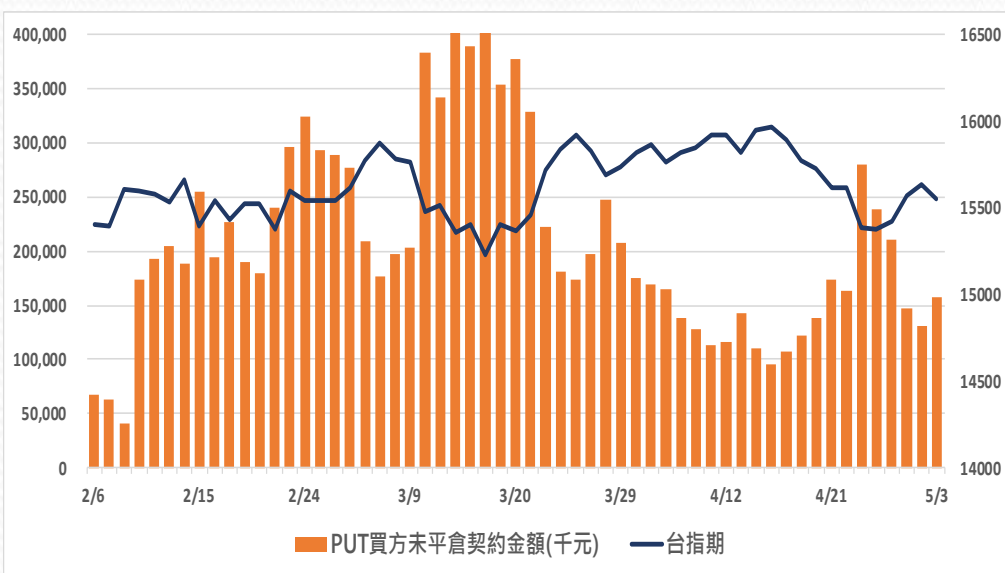
CALL買方未平倉金額



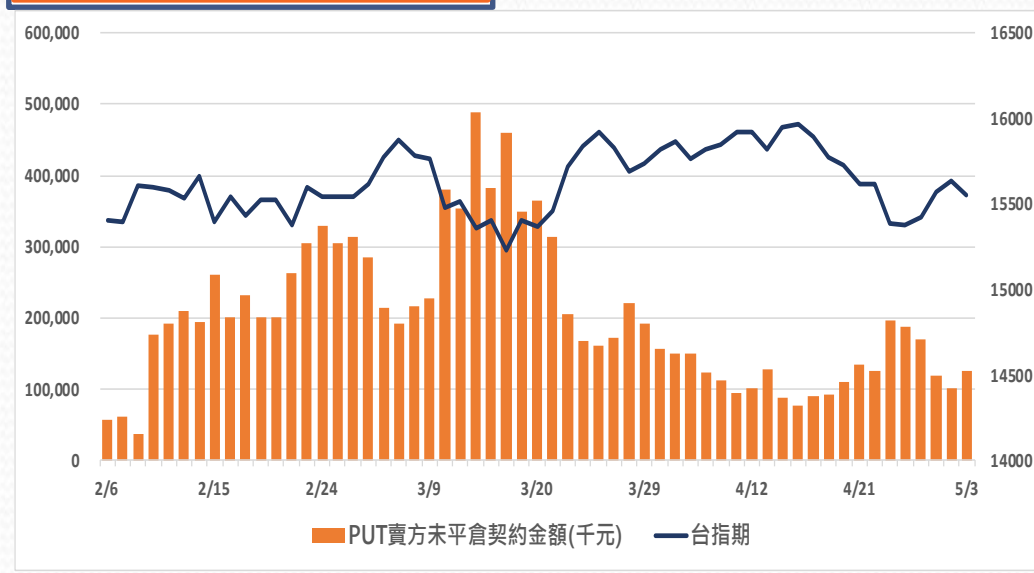
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



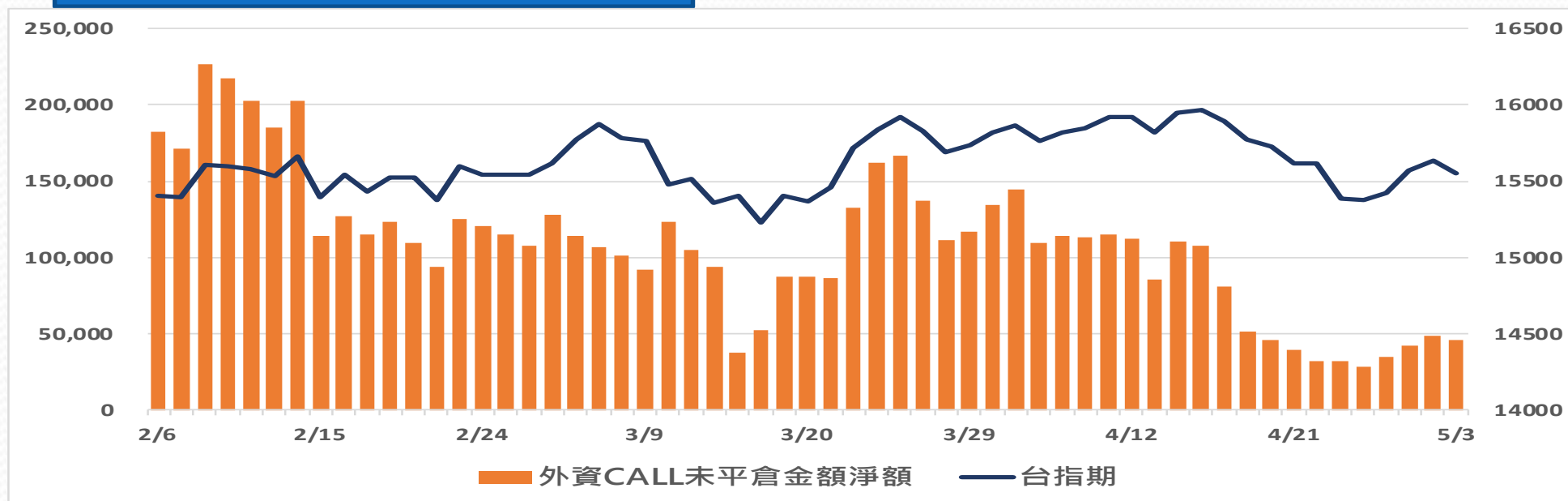
PUT賣方未平倉金額



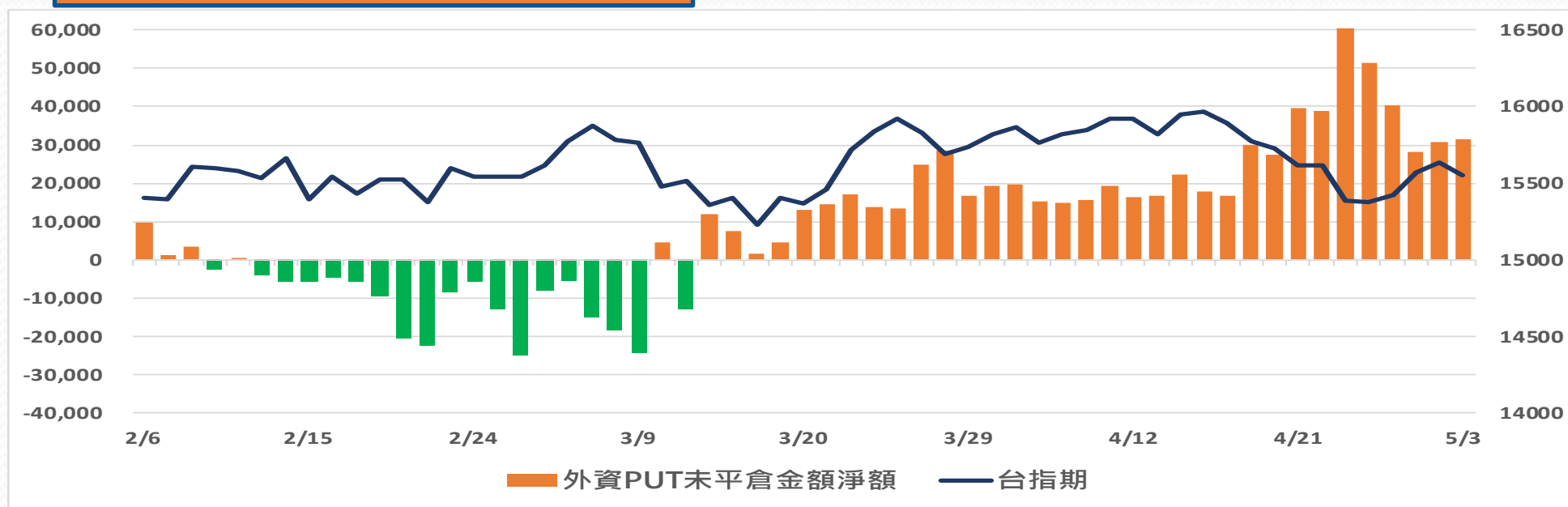
更新日期：2023年5月3日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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3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3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