

台指選擇權OI匯報

日期：2023/5/5 結算日：2023/5/10					日期：2023/5/5 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	3	14,900	3,133	147	0	8	14,300	1,611	-7
0	6	15,000	3,567	0	0	46	14,400	3,109	-843
3	13	15,100	4,545	212	0	23	14,500	2,750	-59
-1	9	15,150	4,158	-526	0	5	14,600	2,142	40
16	45	15,200	6,805	-233	0	21	14,700	3,617	-32
-2	53	15,250	7,766	4,073	0	28	14,800	2,721	203
44	227	15,300	7,367	1,989	0	46	14,900	3,029	-271
-4	263	15,350	4,464	546	-8	105	15,000	13,561	384
197	692	15,400	10,763	6,373	-23	104	15,100	5,339	598
-71	406	15,450	5,496	1,971	2	360	15,200	8,169	1,988
-243	1,493	15,500	6,824	2,242	-148	806	15,300	4,471	329
-49	1,876	15,550	3,546	1,059	-1	1,569	15,400	4,585	18
1,999	5,504	15,600	4,656	1,394	-114	1,935	15,500	3,104	-128
1,004	4,152	15,650	1,975	932	111	2,670	15,600	2,776	352
774	6,888	15,700	2,117	1,430	337	4,514	15,700	5,871	21
2,366	7,229	15,750	762	468	158	5,427	15,800	1,118	131
2,180	9,245	15,800	877	582	-996	5,937	15,900	892	19
※ 3,252	8,724	15,850	129	84	※ 1,167	10,985	16,000	378	15
1,794	8,851	15,900	188	131	702	5,935	16,100	127	8
642	3,627	15,950	141	86	113	4,954	16,200	281	138
1,373	5,474	16,000	8	-3	84	8,590	16,300	147	6
329	1,632	16,050	121	80	55	6,889	16,400	68	0
2,217	4,298	16,100	25	1	-48	3,899	16,500	17	1
442	2,061	16,200	20	0	-101	2,668	16,600	13	0
46	613	16,300	1	1	-10	962	16,700	14	0
0	65	16,400	0	0	-100	1,088	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
18,308	74,630	1.2012	89,644	23,683	1,088	75,415	1.0766	81,193	2,728
昨日 P/C	1.1711	今日增減變化		0.0301	昨日 P/C	1.0410	今日增減變化		0.0357

更新日期：2023年5月5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5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	109,584,974	54,037,854	55,547,120	-1,931,002	2,200,473	935,587	1,264,886	-100,276
投信	29,372,548	51,912,670	-22,540,122	1,251,189	507,140	0	507,140	1,740
自營商	38,722,932	24,270,494	14,452,438	-901,519	1,398,859	628,586	770,273	92,745
	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	483,095	793,089	-309,994	16,483	27,592	70,513	-42,921	4,633
投信	124,314	0	124,314	316	0	0	0	0
自營商	305,270	346,164	-40,894	15,592	315,750	248,063	67,687	16,836

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5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	33,775	13,359	20,416	1,275	28,637	16,884	11,753	2,035	
投信	100	100	0	0	450	113	337	0	
自營商	67,225	48,475	18,750	5,786	62,449	51,978	10,471	-348	
特定法人(週)	600	0	600	0	0	3,130	-3,130	-1,920	
特定法人(近月)	25,747	11,168	14,579	2,446	7,055	18,782	-11,727	-961	
特定法人(全月)	27,005	7,209	19,796	1,609	8,119	21,805	-13,686	-1,715	
十大交易人(週)	25,118	18,206	6,912	2,430	31,846	27,885	3,961	1,995	
十大交易人(近月)	46,086	28,798	17,288	379	29,797	41,713	-11,916	-1,637	
十大交易人(全月)	91,302	50,811	40,491	5,367	61,872	81,123	-19,251	-2,032	
全市場未沖銷(近月)			82,068	3,955			87,334	6,022	
全市場未沖銷(全月)			192,073	24,853			216,349	32,145	

更新日期：2023年5月5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	15700	買權OI最大量	15800
	賣權成交最大量	15500	賣權OI最大量	15400
	整體隱含波動率	10.33%	較前一交易日	-2.03%
	買權隱含波動率	10.10%	較前一交易日	-1.02%
	賣權隱含波動率	10.55%	較前一交易日	-2.89%
電子選擇權	買權成交最大量	740	買權OI最大量	740
	賣權成交最大量	710	賣權OI最大量	705
金融選擇權	買權成交最大量	1600	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1500

更新日期：2023年5月5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	16000
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	12.73%	較前一交易日	+0.80%
	買權隱含波動率	11.69%	較前一交易日	-0.49%
	賣權隱含波動率	13.55%	較前一交易日	-1.34%
	成交量P/C_Ratio值	1.240	較前一交易日	-0.07
	未平倉P/C_Ratio值	1.064	較前一交易日	+0.02
電子選擇權	買權成交最大量	740	買權OI最大量	740
	賣權成交最大量	710	賣權OI最大量	705
金融選擇權	買權成交最大量	1600	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1500

更新日期：2023年5月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

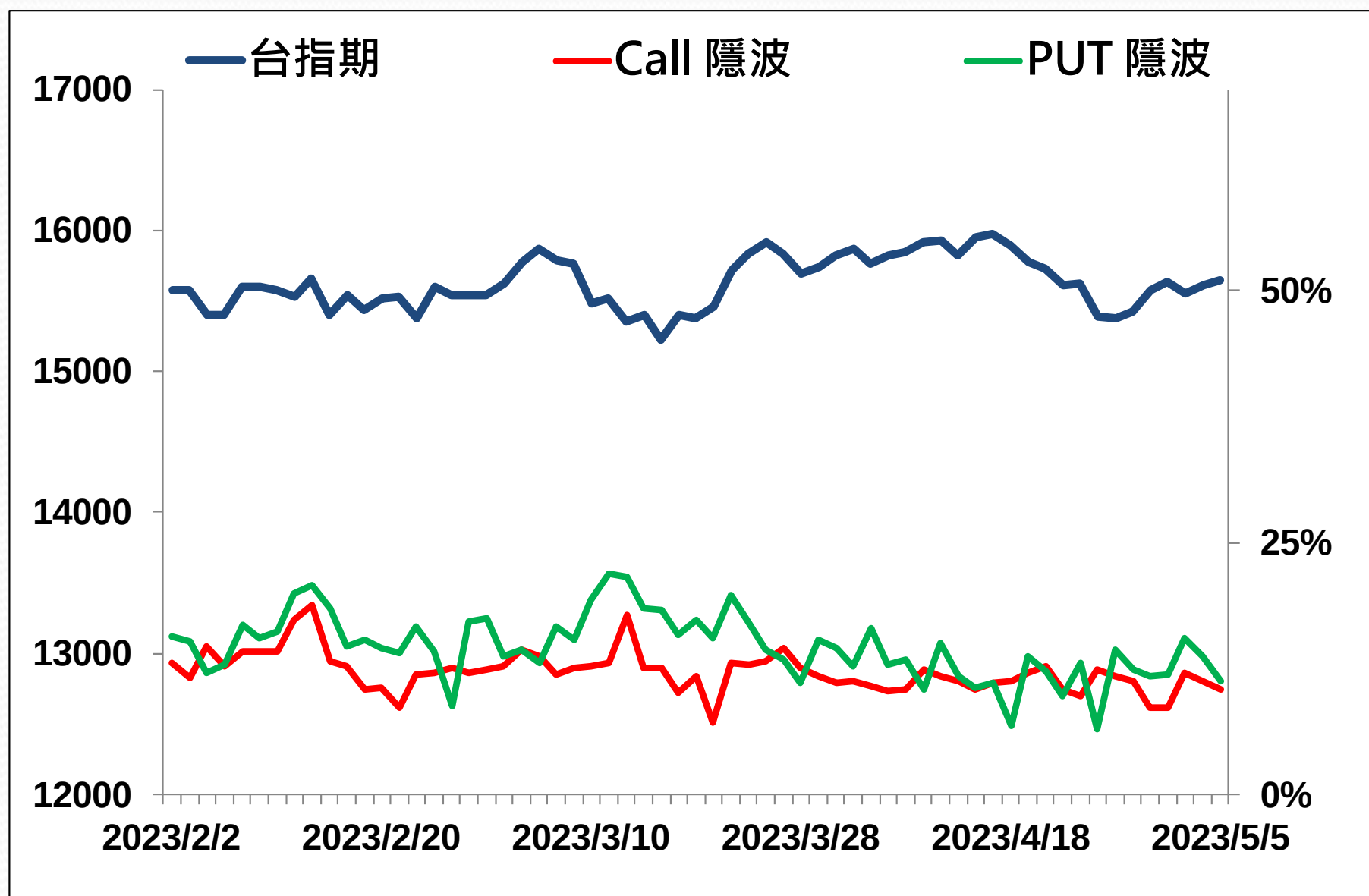
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



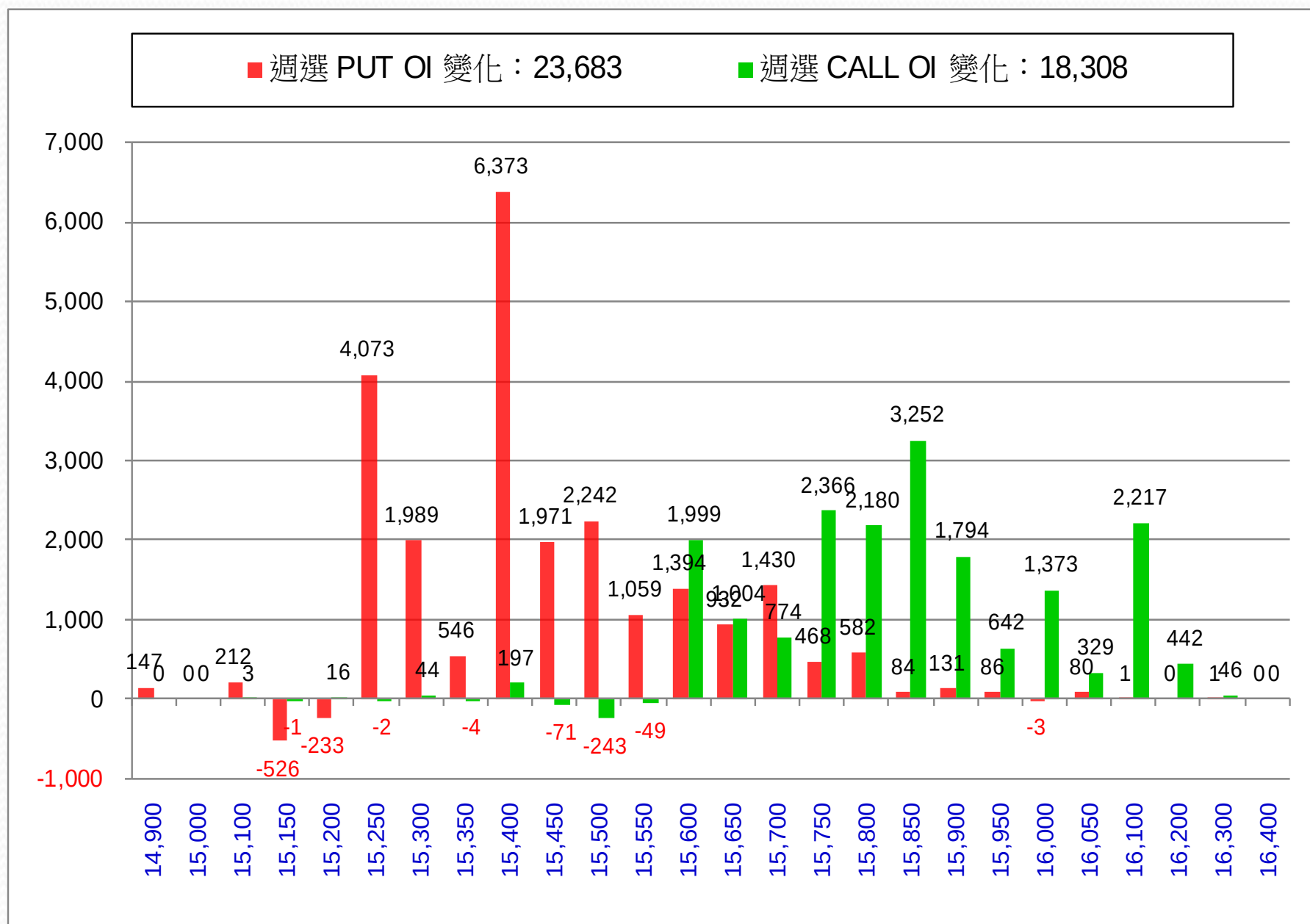
更新日期：2023年5月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



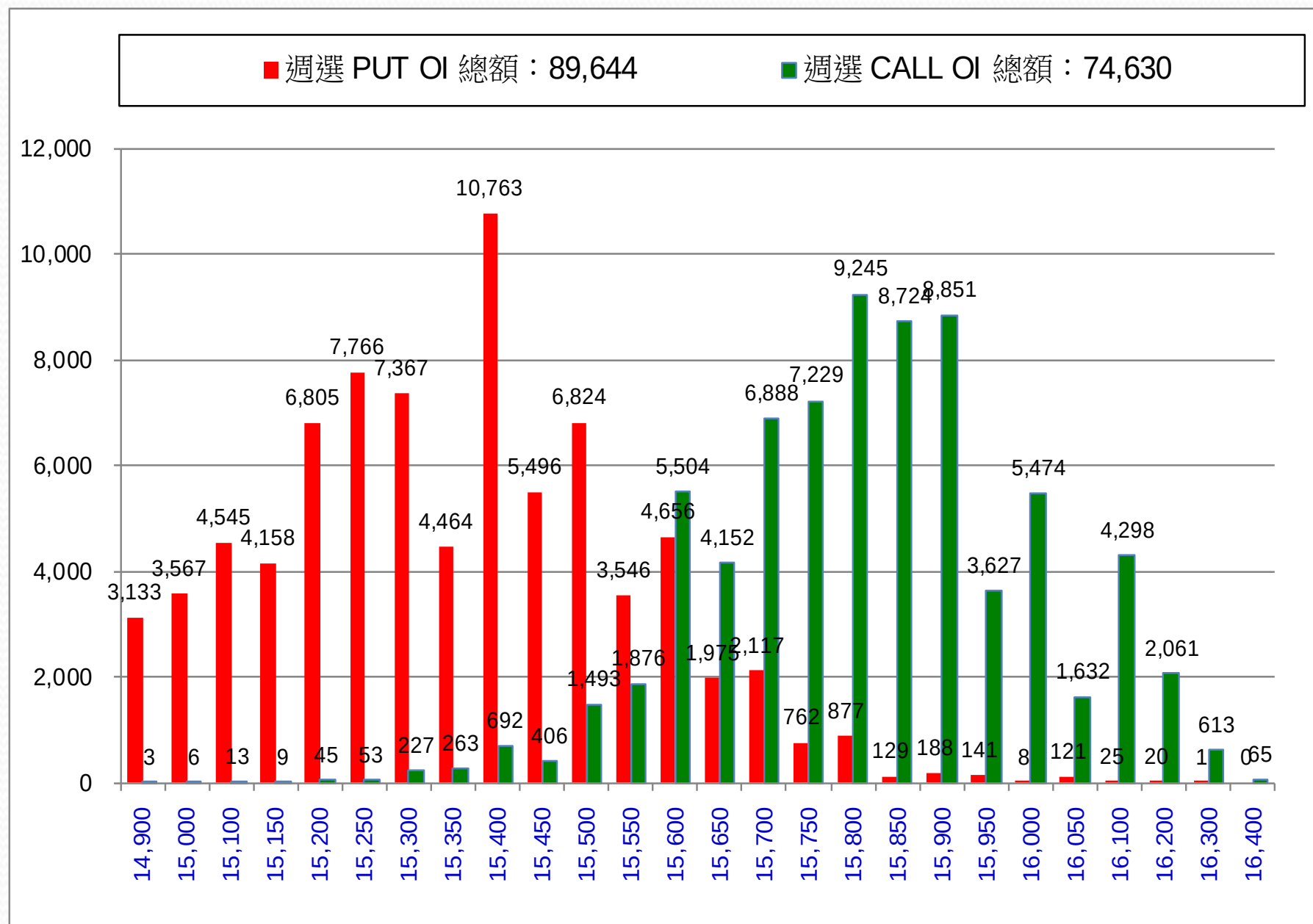
更新日期：2023年5月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年5月5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



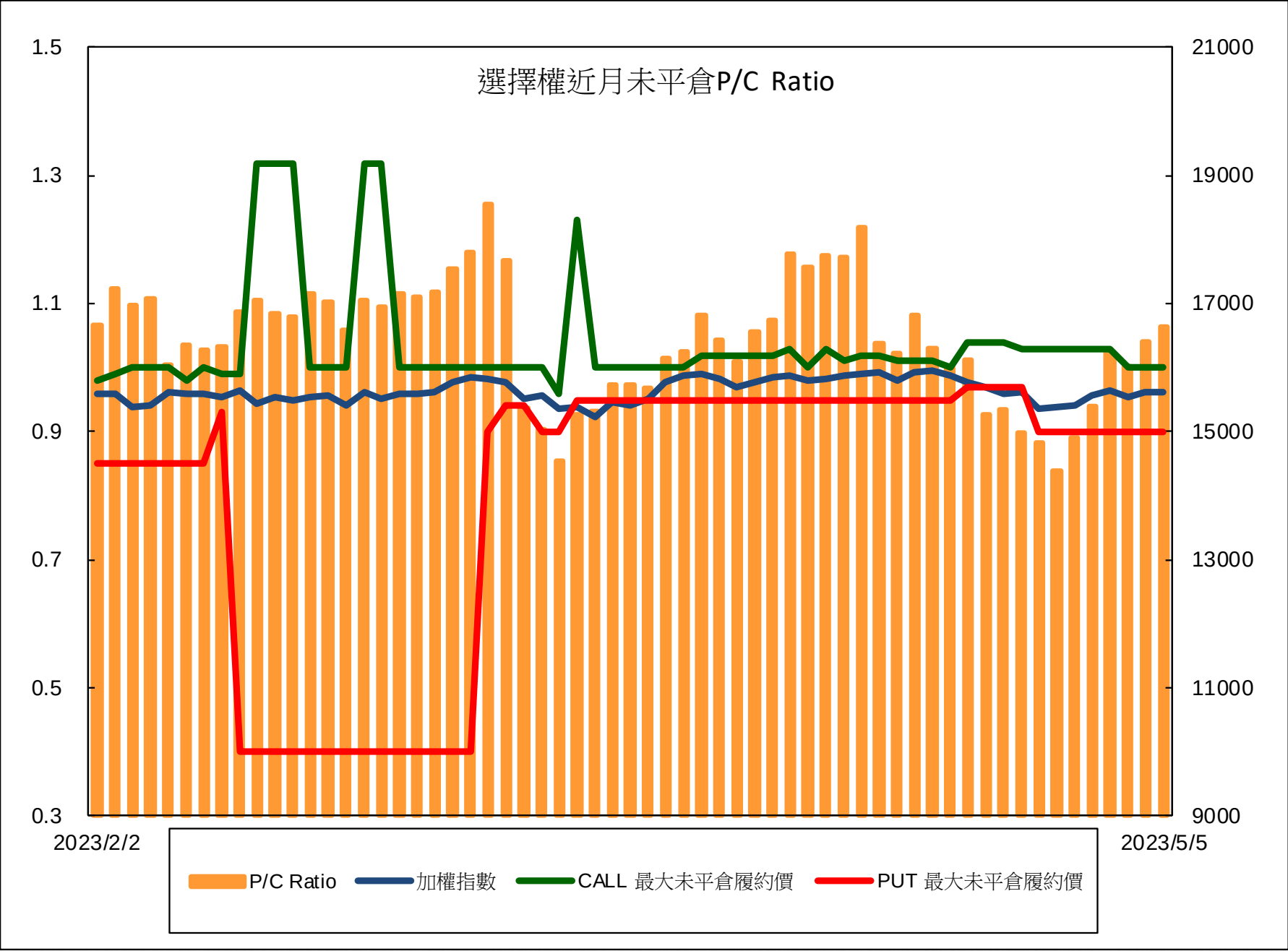
更新日期：2023年5月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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4日	57,718	44,754	12,964
	5月5日	67,225	48,475	18,750
Put	5月4日	52,645	41,826	10,819
	5月5日	62,449	51,978	10,471

更新日期：2023年5月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

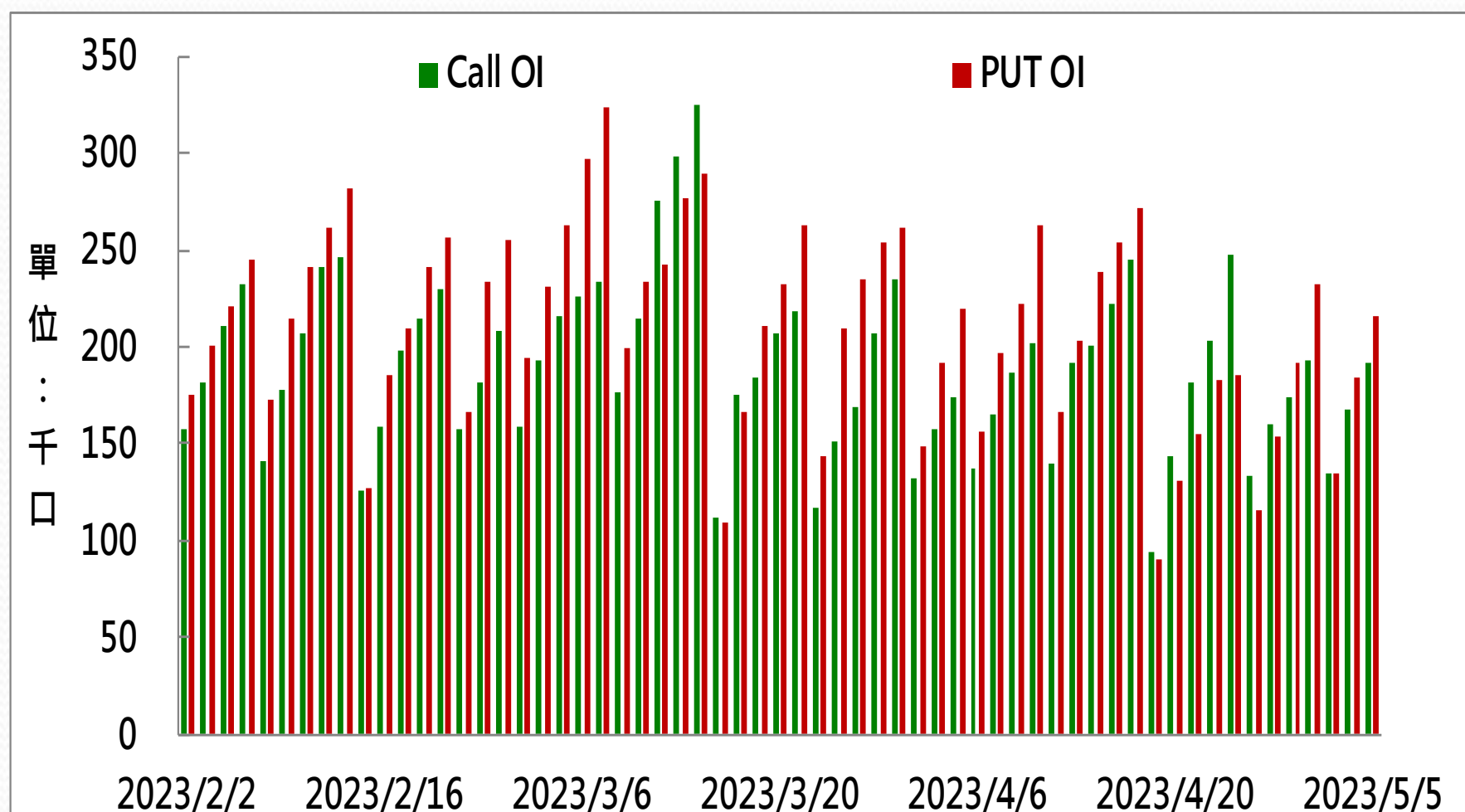
選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年5月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理



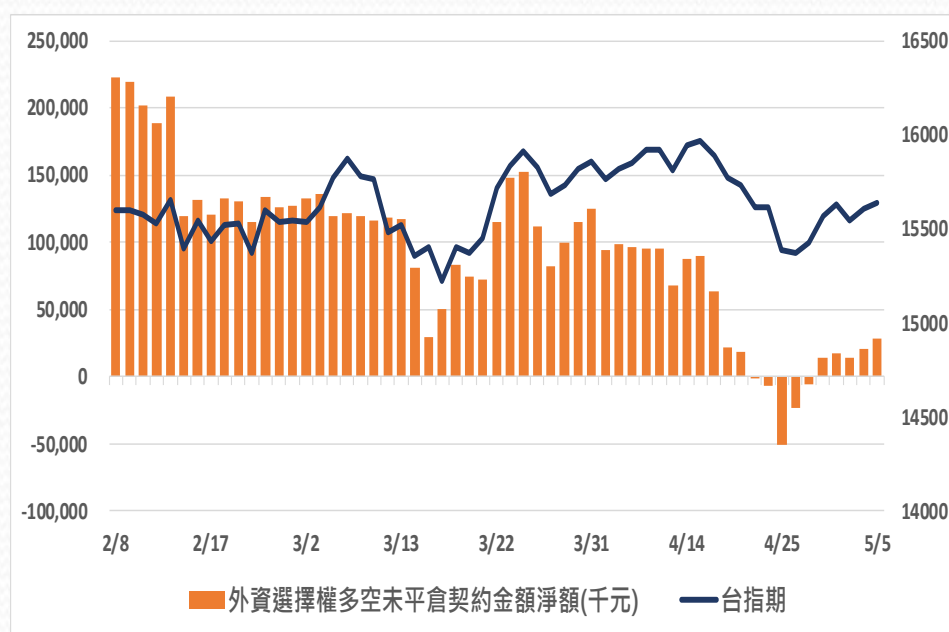
選擇權全月Put Call OI



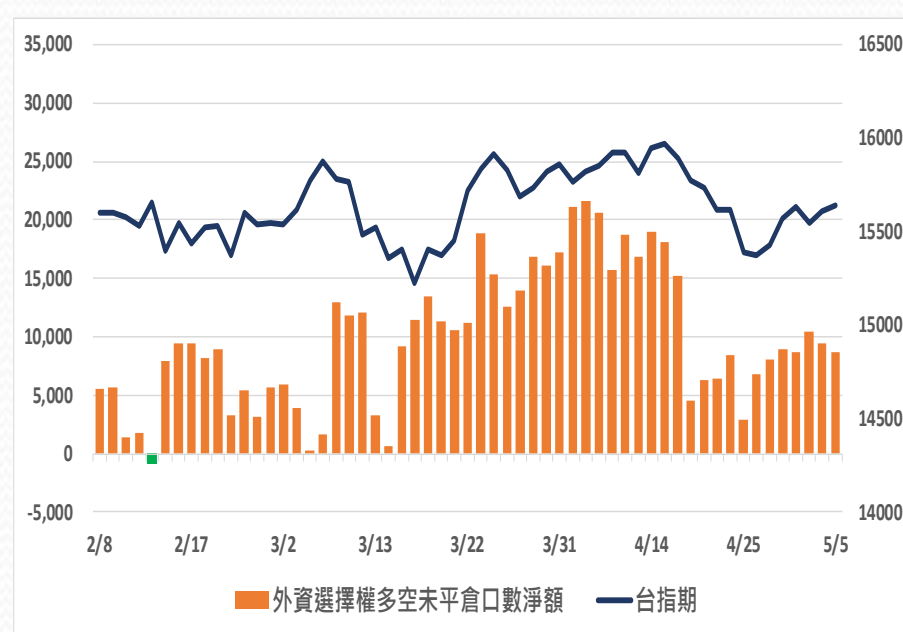
更新日期：2023年5月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



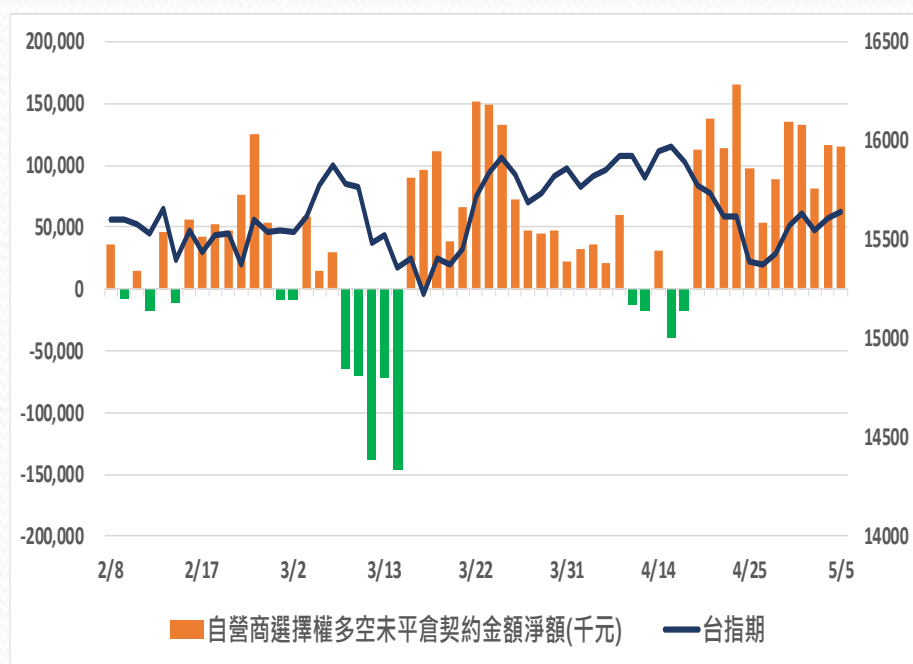
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/28	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
2023/5/4	15607	9,423	-1,071	20,786	+6,046
2023/5/5	15642	8,663	-760	28,656	+7,870

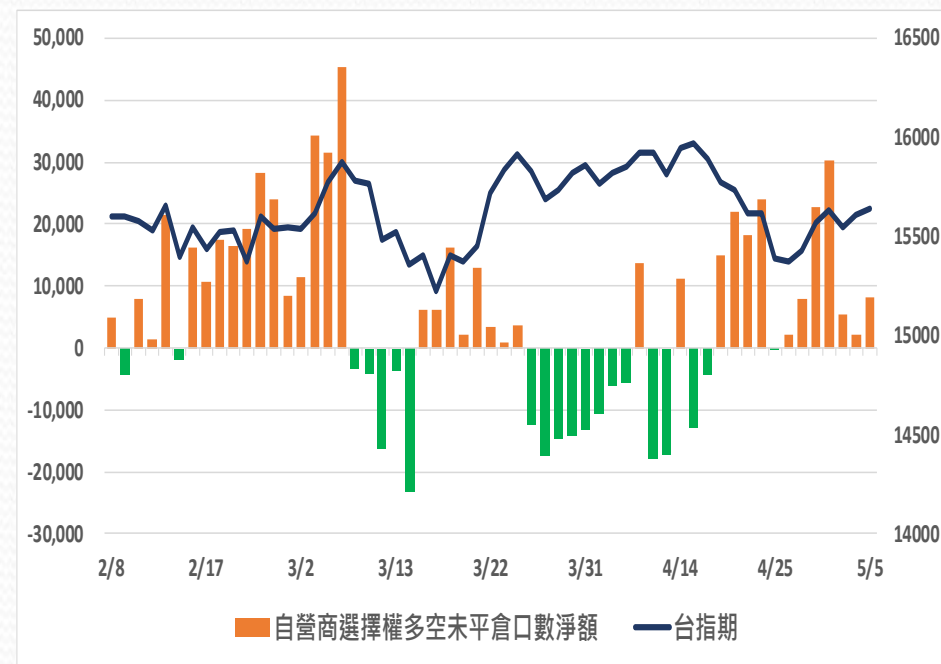
更新日期：2023年5月5日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



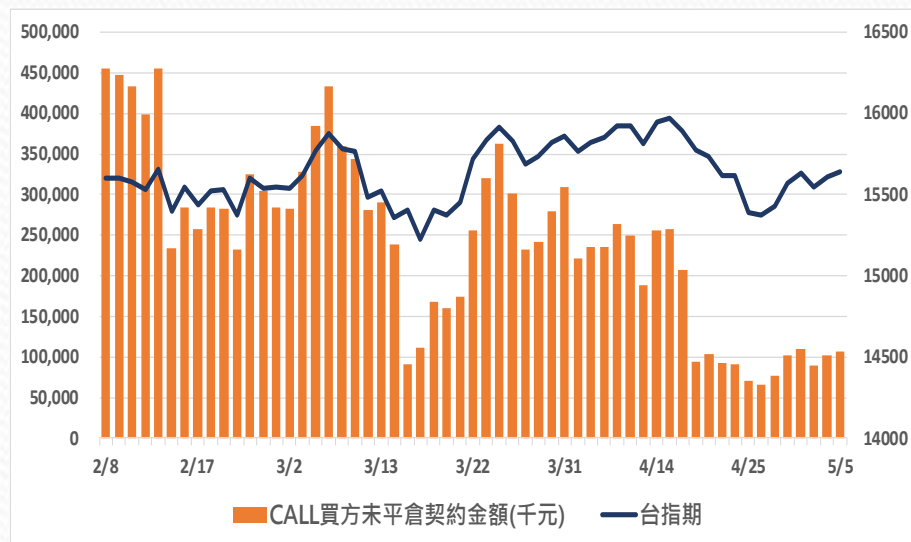
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/4/28	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
2023/5/4	15607	2,145	-3,174	116,030	+34,791
2023/5/5	15642	8,279	+6,134	114,791	-1,239

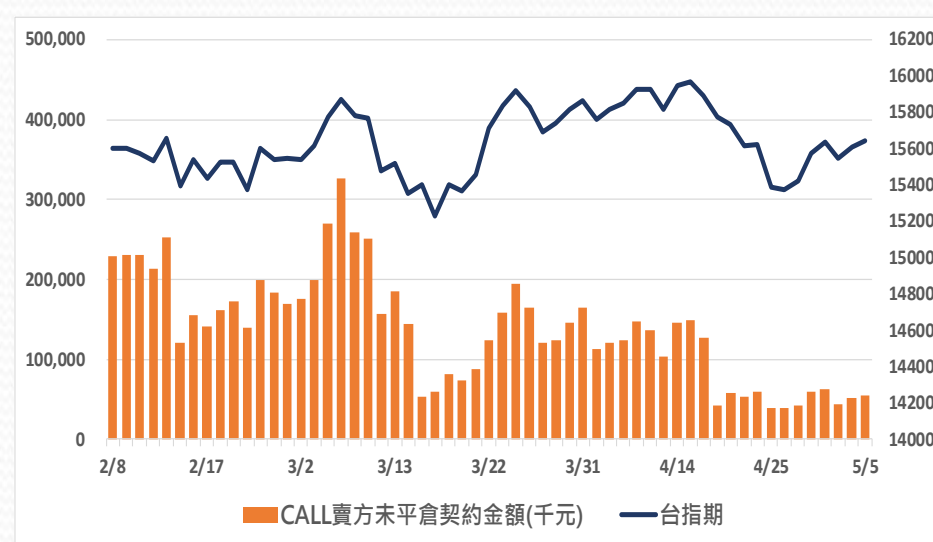
更新日期：2023年5月5日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

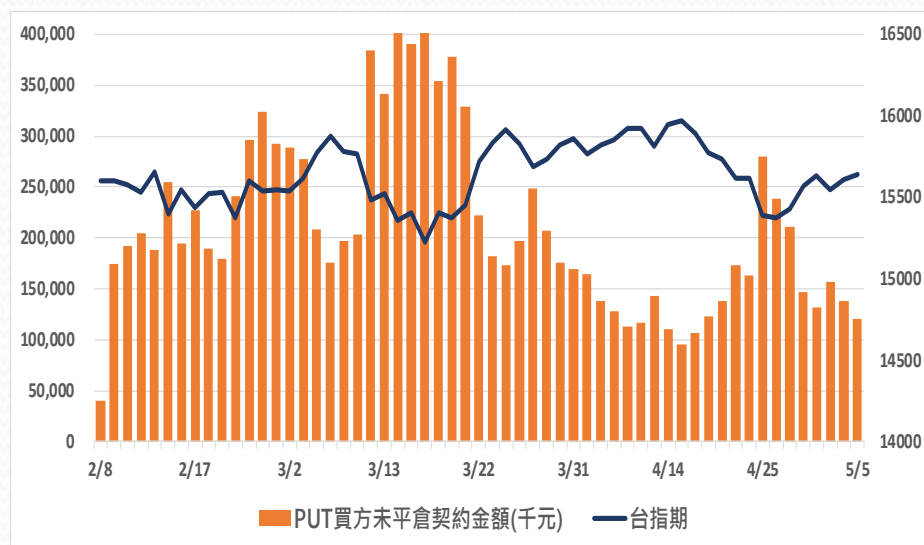
CALL買方未平倉金額



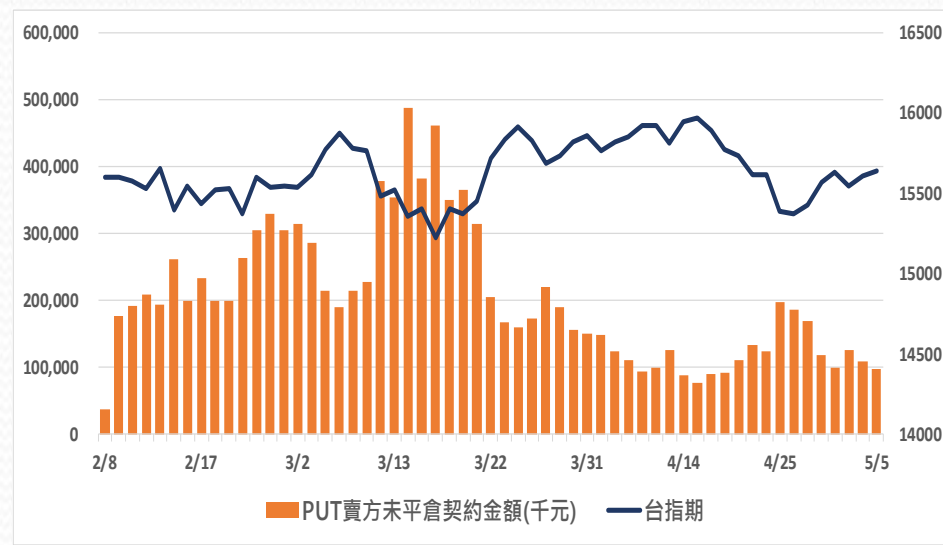
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



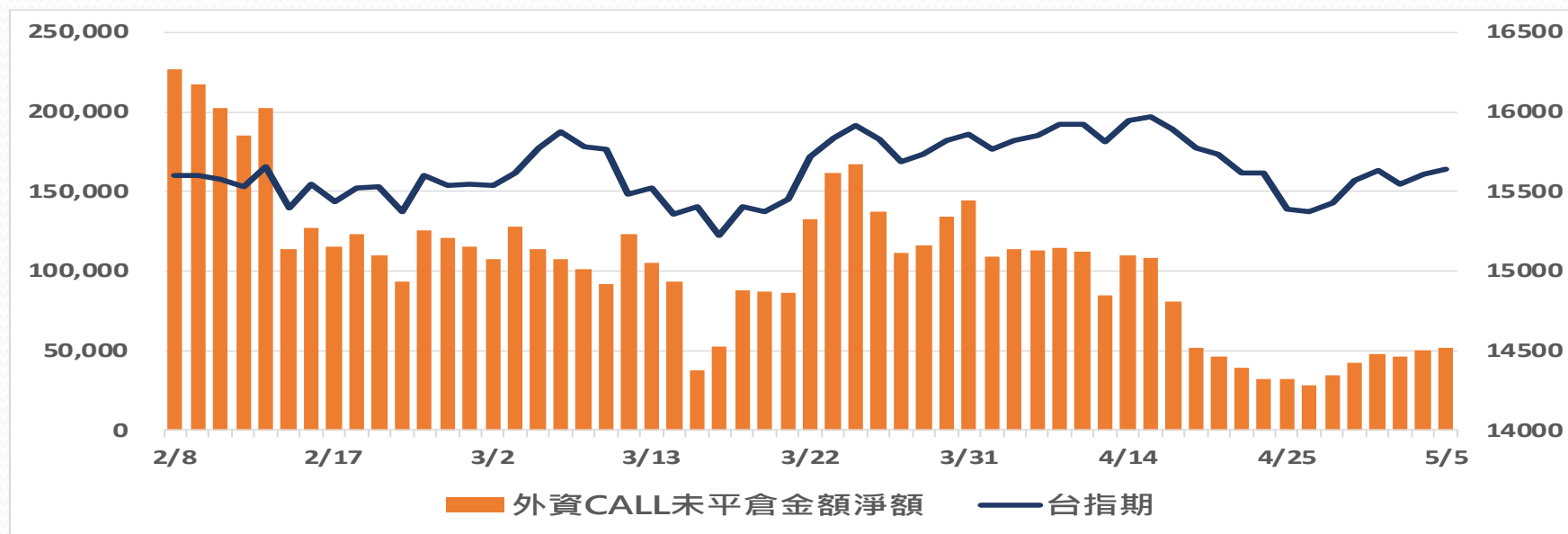
PUT賣方未平倉金額



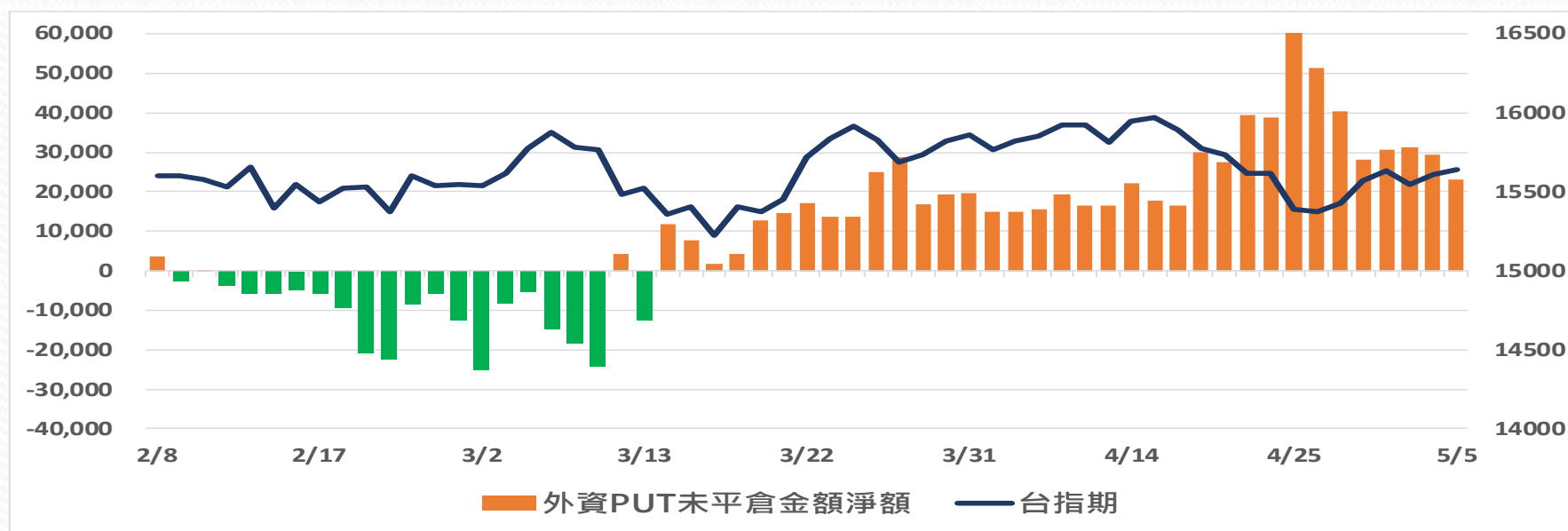
更新日期：2023年5月5日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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5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5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