

# 台指選擇權OI匯報

日期：2023/5/17 結算日：2023/5/24					日期：2023/5/17 結算日：2023/6/21				
202305W4					202306 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
-28	178	15,300	2,228	364	0	60	14,600	1,563	-182
-60	140	15,350	1,605	420	5	15	14,700	2,197	3
-72	269	15,400	3,783	118	-1	128	14,800	2,800	-80
2	408	15,450	2,902	1,571	20	28	14,900	2,914	96
5	547	15,500	4,011	1,189	-4	267	15,000	4,038	-119
140	404	15,550	3,073	1,652	8	66	15,100	2,099	102
14	817	15,600	4,828	3,015	-30	153	15,200	2,605	180
6	908	15,650	3,154	2,275	-57	253	15,300	1,672	406
-921	1,762	15,700	4,488	3,587	-328	524	15,400	3,130	451
-572	1,505	15,750	2,391	1,709	-369	1,518	15,500	1,583	135
-1,580	2,527	15,800	2,909	2,627	-212	1,395	15,600	1,477	61
-18	1,685	15,850	3,916	3,873	320	1,708	15,700	1,595	719
649	2,724	15,900	4,153	4,030	-285	2,570	15,800	1,232	963
546	2,356	15,950	1,071	1,066	-447	4,352	15,900	471	224
1,740	2,996	16,000	601	545	-293	4,713	16,000	401	170
1,136	1,711	16,050	174	133	102	4,068	16,100	207	122
2,155	3,175	16,100	233	211	786	5,398	16,200	103	70
2,922	3,252	16,200	38	36	1,919	4,650	16,300	47	13
3,309	3,524	16,300	12	8	1,014	2,449	16,400	62	5
2,259	2,285	16,400	4	4	346	1,353	16,500	14	0
236	304	16,500	0	0	221	866	16,600	11	1
805	906	16,600	0	0	103	584	16,700	13	0
283	363	16,700	0	0	254	596	16,800	17	0
236	236	16,800	0	0	201	490	16,900	11	0
50	50	16,900	0	0	133	799	17,000	16	0
0	0	17,000	0	0	61	385	17,100	10	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
13,255	35,112	1.6102	56,536	31,853	3,755	48,986	1.1208	54,905	3,652
昨日 P/C	1.2449	今日增減變化	0.3653	昨日 P/C	1.1331	今日增減變化	-0.0123		

更新日期：2023年5月17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17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	153,932,926	51,418,814	102,514,112	23,605,486	2,085,108	677,290	1,407,818	456,497	
投信	29,749,750	50,530,125	-20,780,375	570,694	343,082	0	343,082	5,824	
自營商	11,127,696	43,772,716	-32,645,020	-26,596,368	1,682,874	612,223	1,070,651	-147,699	
	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	682,208	644,044	38,164	434,804	7,745	30,980	-23,235	66,999	
投信	127,838	0	127,838	1,722	0	0	0	0	
自營商	608,443	648,226	-39,783	-307,251	571,581	545,248	26,333	-92,956	

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17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	14,006	8,872	5,134	-28,385	10,944	10,652	292	-7,195	
投信	0	50	-50	-50	250	118	132	-205	
自營商	52,664	29,332	23,332	7,340	35,509	48,806	-13,297	10,186	
特定法人(週)	1,231	0	1,231	---	0	3,850	-3,850	---	
特定法人(近月)	8,349	7,832	517	---	6,339	5,702	637	---	
特定法人(全月)	7,606	6,919	687	-29,232	5,204	9,811	-4,607	1,902	
十大交易人(週)	18,478	14,851	3,627	---	36,713	15,128	21,585	---	
十大交易人(近月)	34,239	22,206	12,033	---	23,747	24,872	-1,125	---	
十大交易人(全月)	60,226	42,161	18,065	-20,966	57,297	42,621	14,676	-6,006	
全市場未沖銷(近月)			48,986	---			54,905	---	
全市場未沖銷(全月)			103,870	-135,383			126,006	-156,793	

更新日期：2023年5月17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05W4週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16000	買權OI最大量	16300
	賣權成交最大量	15600	賣權OI最大量	15600
	整體隱含波動率	12.73%	較前一交易日	+2.60%
	買權隱含波動率	12.53%	較前一交易日	+1.37%
	賣權隱含波動率	12.89%	較前一交易日	+3.67%
電子選擇權	買權成交最大量	730	買權OI最大量	730
	賣權成交最大量	710	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1620	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1620	賣權OI最大量	1580

更新日期：2023年5月17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06月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16200	買權OI最大量	16200
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	10000
	整體隱含波動率	13.22%	較前一交易日	-0.35%
	買權隱含波動率	10.73%	較前一交易日	+1.18%
	賣權隱含波動率	16.22%	較前一交易日	+1.05%
	成交量P/C_Ratio值	0.888	較前一交易日	-0.51
	未平倉P/C_Ratio值	1.121	較前一交易日	-0.01
電子選擇權	買權成交最大量	730	買權OI最大量	730
	賣權成交最大量	710	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1620	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1620	賣權OI最大量	1580

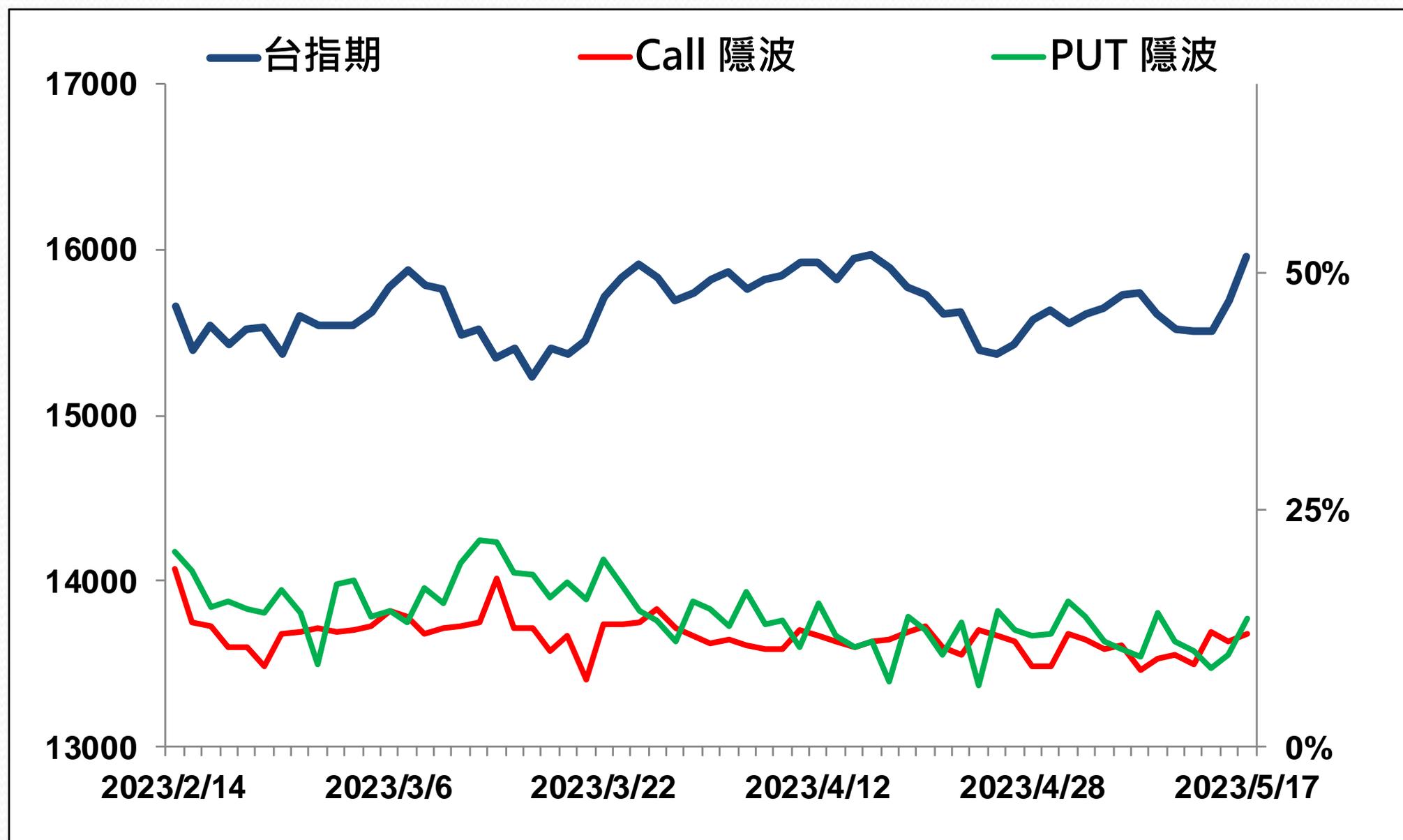
更新日期：2023年5月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權當日波動率指數



更新日期：2023年5月17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

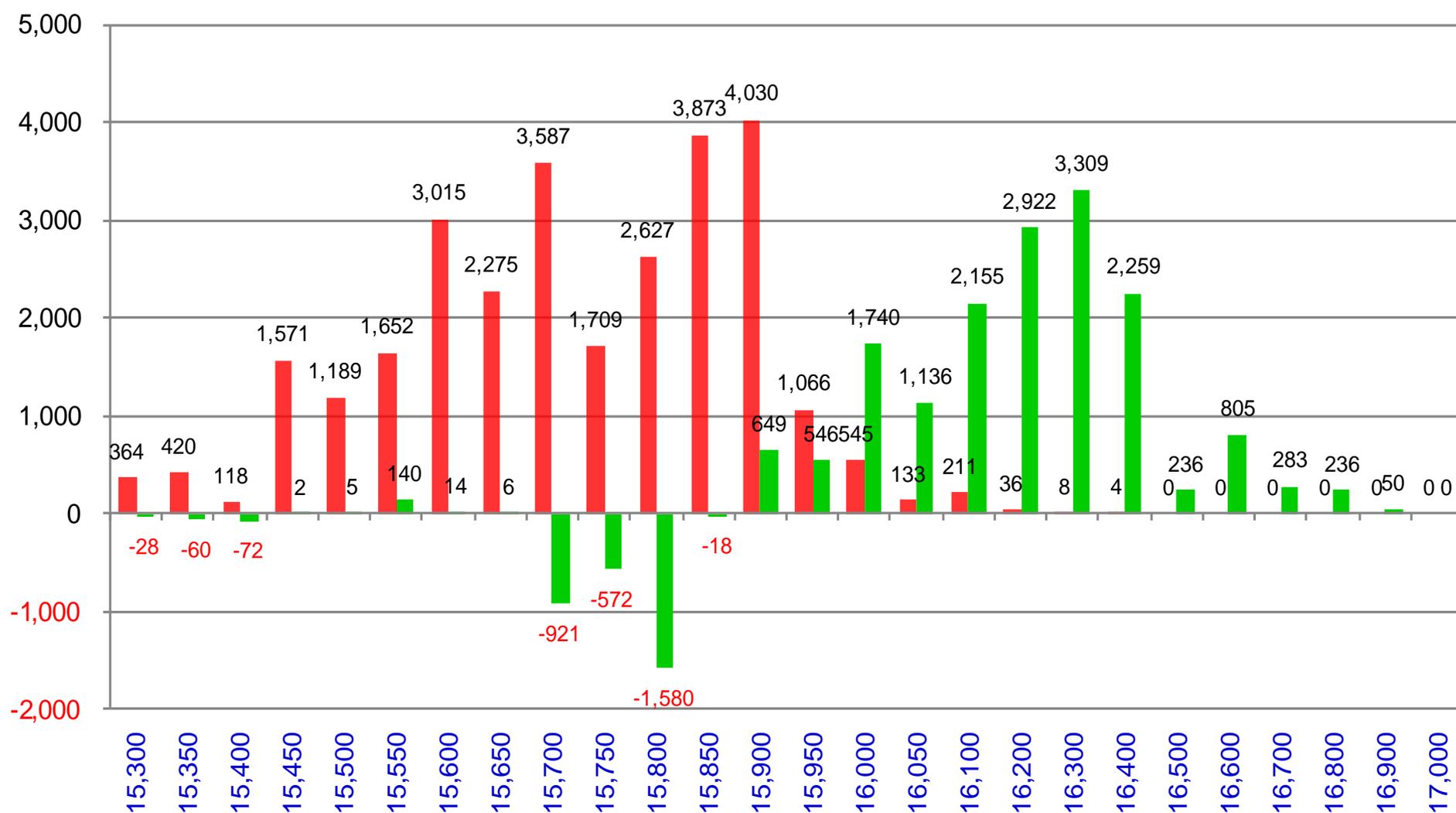


更新日期：2023年5月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI每日變化量

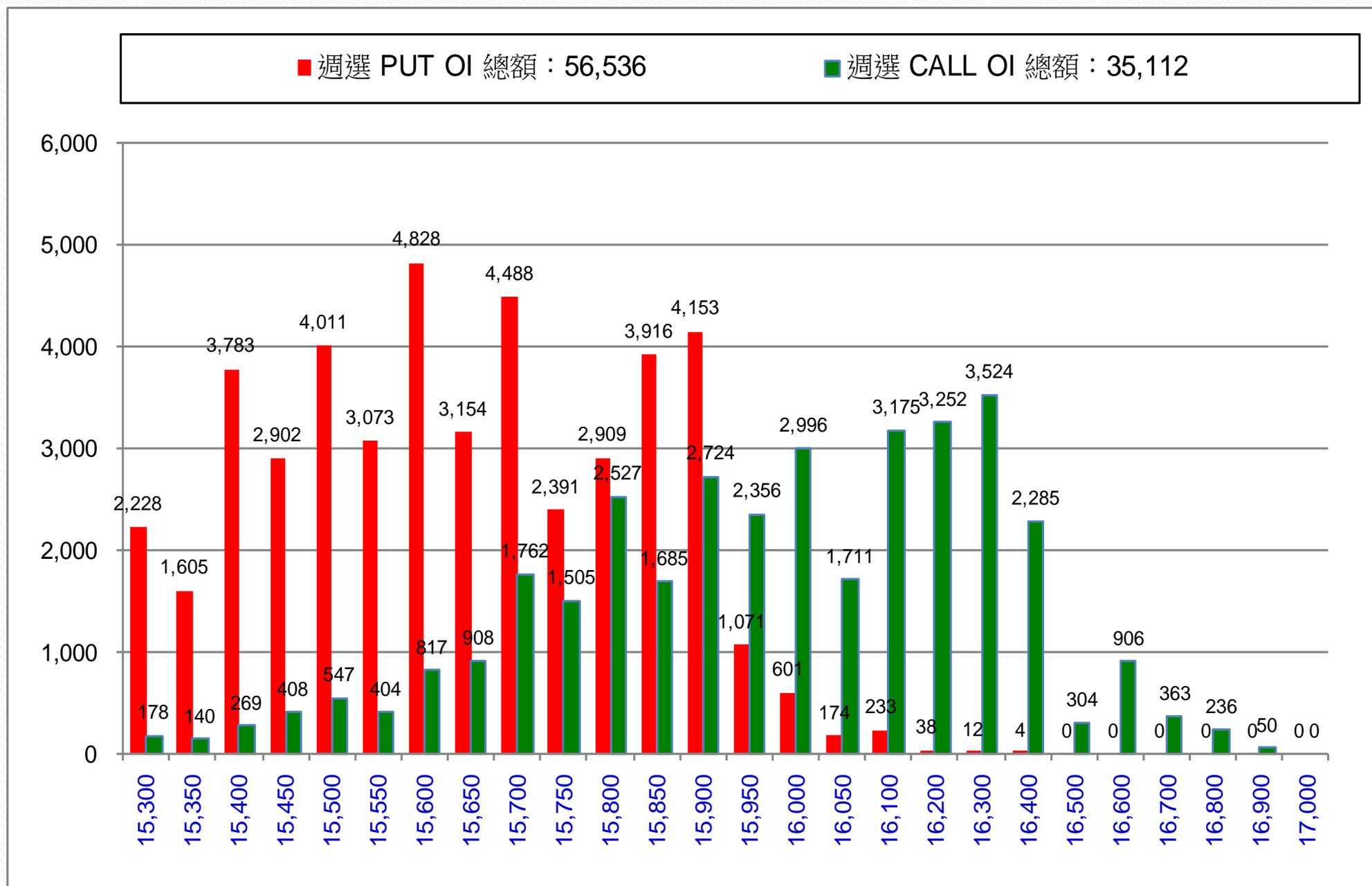
週選 PUT OI 變化：31,853

週選 CALL OI 變化：13,255



更新日期：2023年5月17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



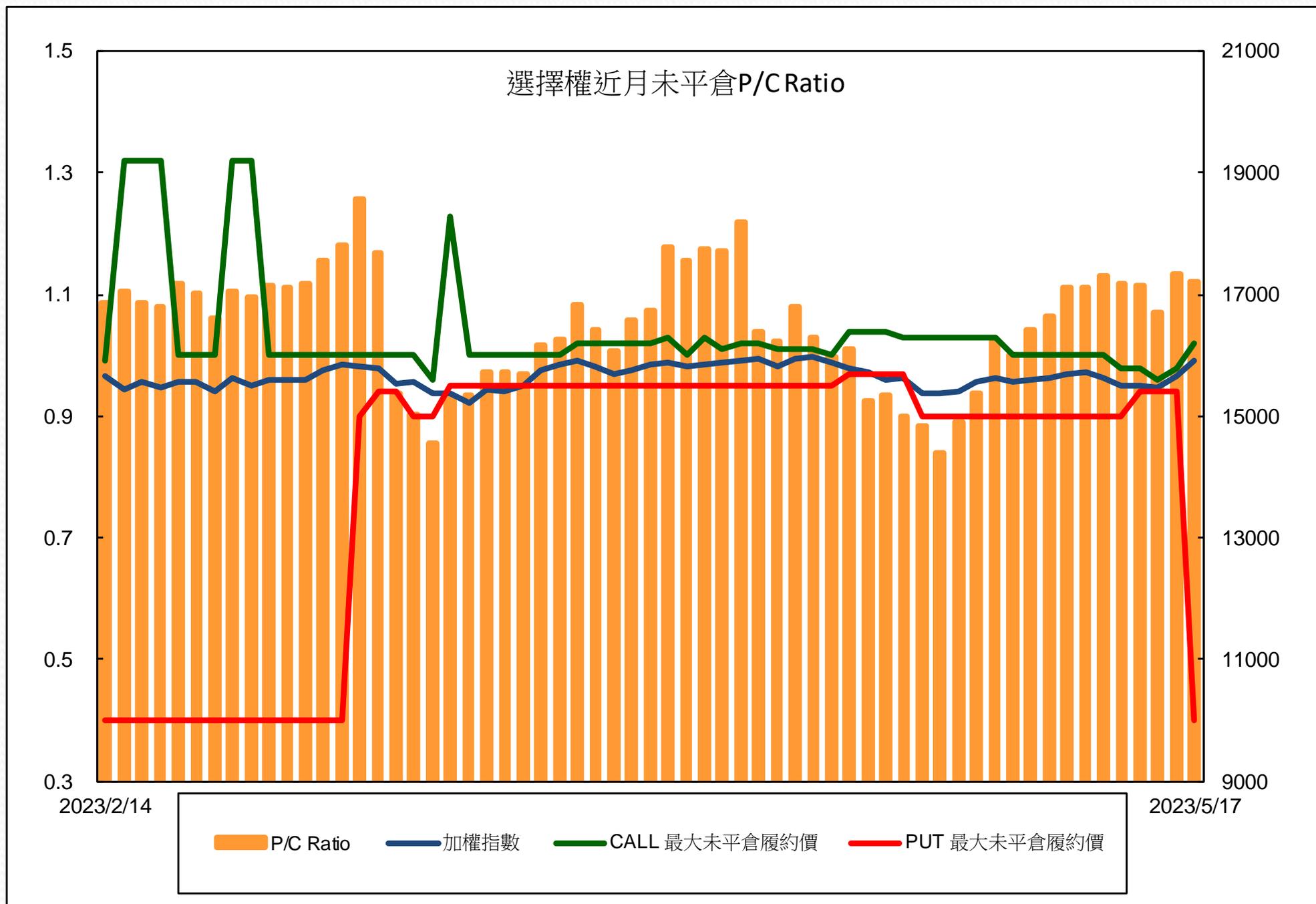
更新日期：2023年5月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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16日	72,382	56,390	15,992
	5月17日	52,664	29,332	23,332
Put	5月16日	46,279	69,762	-23,483
	5月17日	35,509	48,806	-13,297

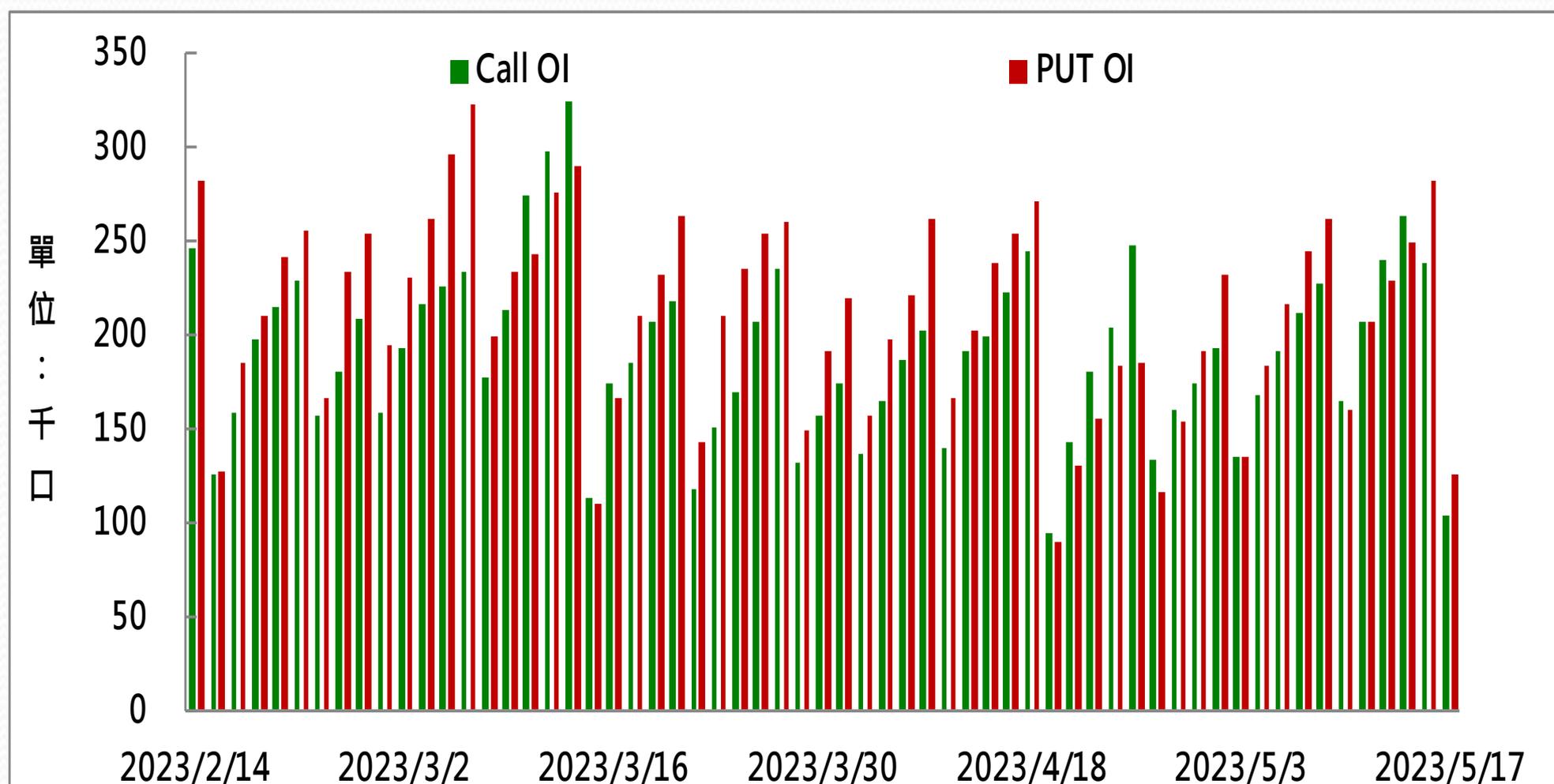
更新日期：2023年5月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年5月17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



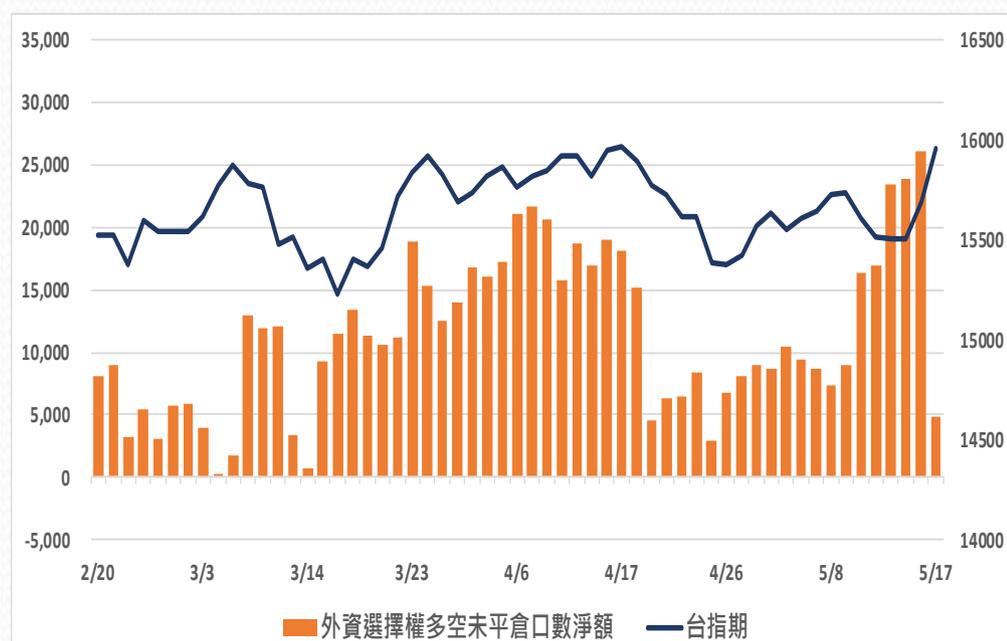
更新日期：2023年5月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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



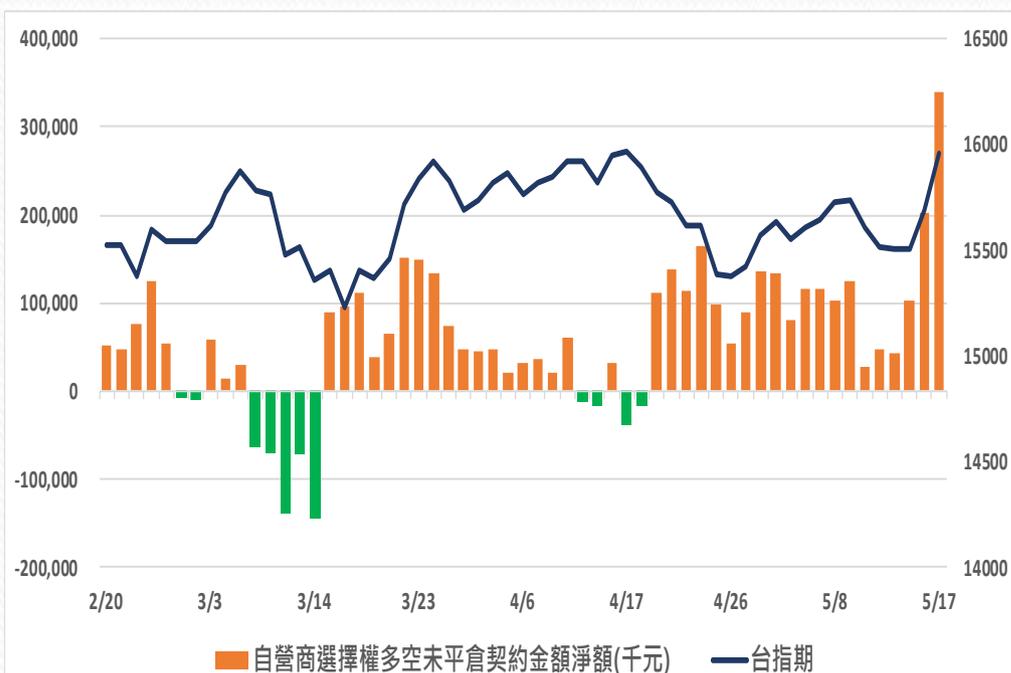
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/11	15519	16,995	+616	23,159	-14,568
2023/5/12	15506	23,429	+6,434	27,875	+4,716
2023/5/15	15510	23,841	+412	29,265	+1,390
2023/5/16	15690	26,032	+2,191	31,231	+1,966
2023/5/17	15954	4,842	-21,190	23,408	-7,823

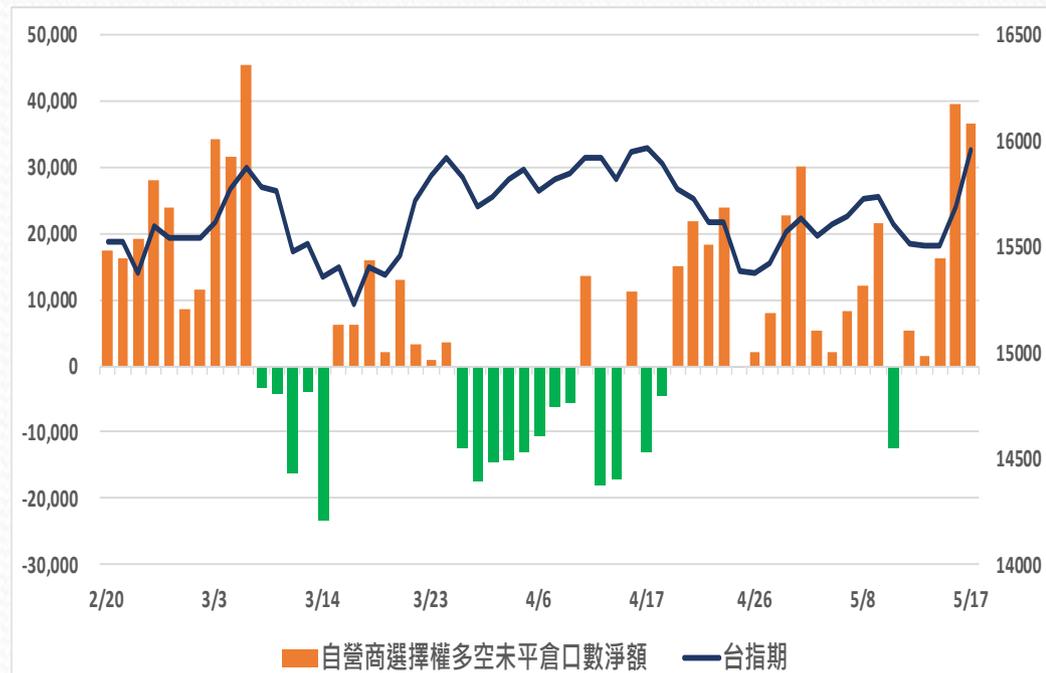
更新日期：2023年5月17日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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
2023/5/11	15519	5,419	+17,951	46,522	+20,044
2023/5/12	15506	1,345	-4,074	42,496	-4,026
2023/5/15	15510	16,365	+15,020	102,065	+59,569
2023/5/16	15690	39,475	+23,110	201,424	+99,359
2023/5/17	15954	36,629	-2,846	340,497	+139,073

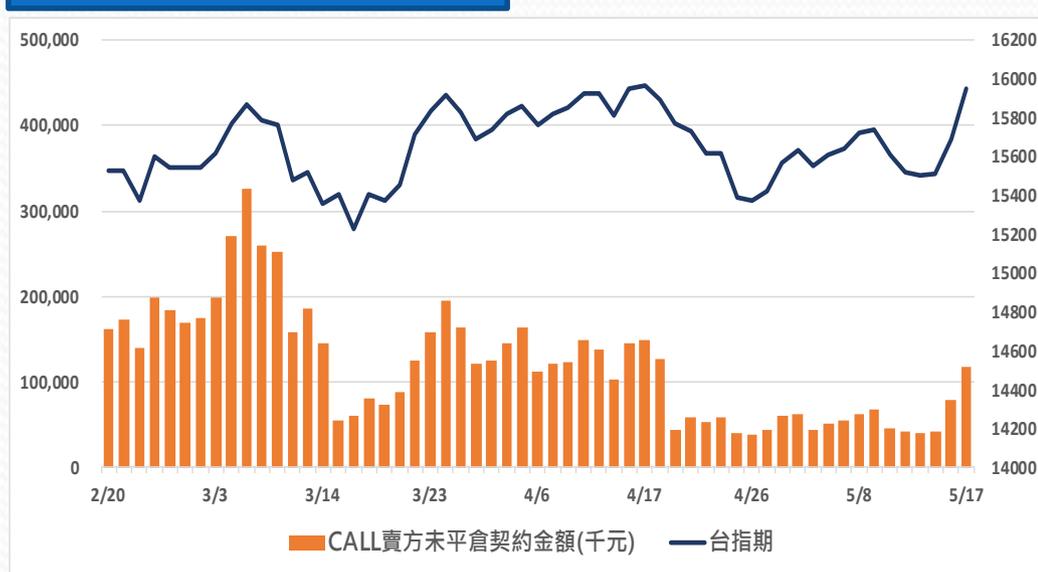
更新日期：2023年5月17日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 外資買賣權未平倉金額

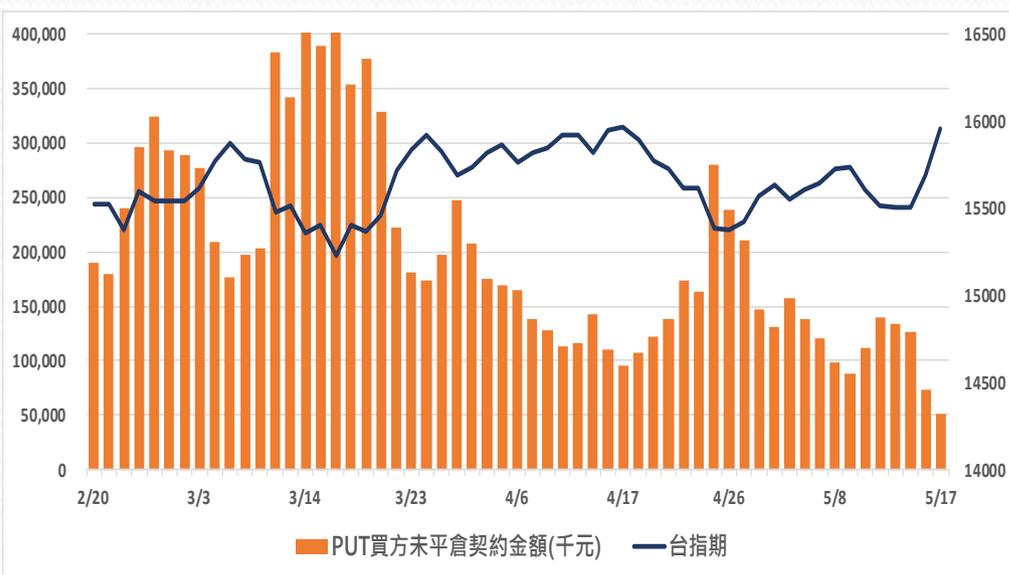
## CALL買方未平倉金額



## CALL賣方未平倉金額



## PUT買方未平倉金額



## PUT賣方未平倉金額



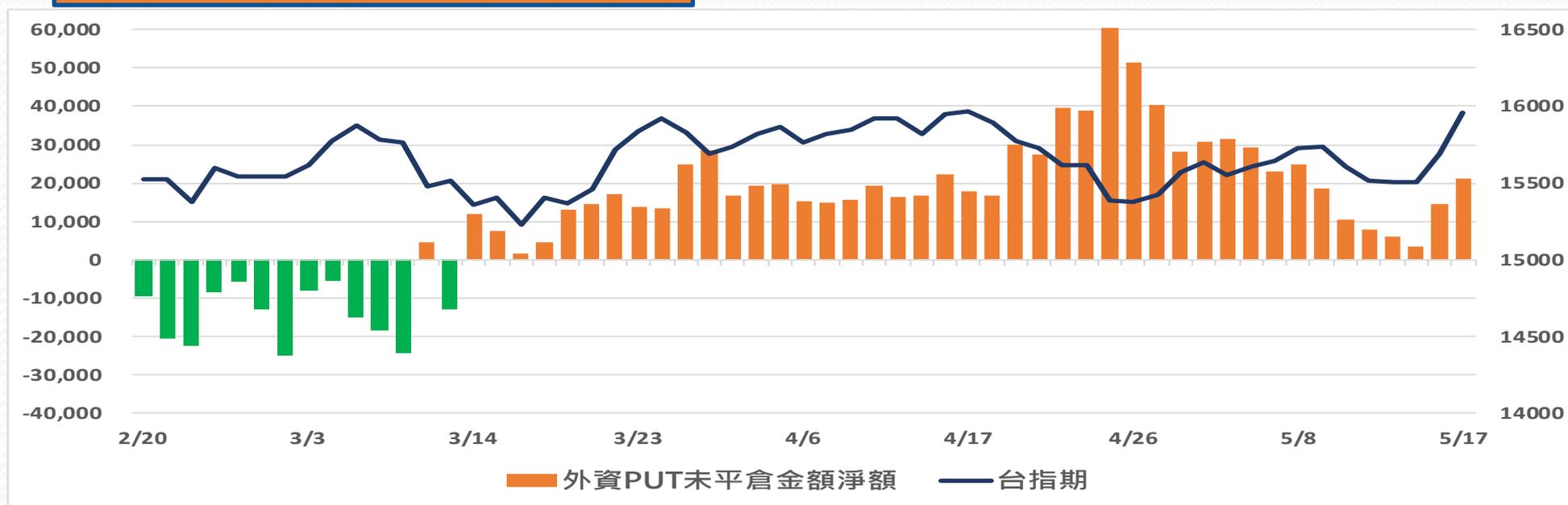
更新日期：2023年5月17日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

# 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17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17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