

台指選擇權OI匯報

日期：2023/5/18 結算日：2023/5/24					日期：2023/5/18 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
-103	305	15,450	3,675	773	0	128	14,800	2,822	22
-110	437	15,500	4,311	300	0	28	14,900	2,303	-611
-86	318	15,550	4,110	1,037	1	268	15,000	4,797	759
-131	686	15,600	6,770	1,942	-2	64	15,100	2,702	603
-158	750	15,650	6,372	3,218	8	161	15,200	4,049	1,444
-220	1,542	15,700	10,120	5,632	-14	239	15,300	2,573	901
-172	1,333	15,750	5,288	2,897	-57	467	15,400	2,919	-211
-598	1,929	15,800	7,877	4,968	-253	1,265	15,500	2,233	650
-201	1,484	15,850	7,355	3,439	-54	1,341	15,600	2,107	630
-675	2,049	15,900	8,354	4,201	-120	1,588	15,700	2,101	506
-252	2,104	15,950	4,643	3,572	-105	2,465	15,800	2,824	1,592
491	3,487	16,000	5,724	5,123	-1,332	3,020	15,900	1,527	1,056
322	2,033	16,050	3,049	2,875	-476	4,237	16,000	1,276	875
2,913	6,088	16,100	4,072	3,839	99	4,167	16,100	1,345	1,138
1,545	4,514	16,150	1,192	1,134	143	5,541	16,200	133	30
2,153	5,405	16,200	860	822	557	5,207	16,300	89	42
1,882	1,882	16,250	191	191	1,008	3,457	16,400	89	27
3,498	7,022	16,300	228	216	1,483	2,836	16,500	50	36
2,919	2,919	16,350	56	56	1,772	2,638	16,600	18	7
7,053	9,338	16,400	91	87	1,653	2,237	16,700	15	2
4,656	4,960	16,500	82	82	929	1,525	16,800	17	0
2,887	3,793	16,600	20	20	522	1,012	16,900	11	0
2,017	2,380	16,700	20	20	634	1,433	17,000	16	0
1,376	1,612	16,800	0	0	226	611	17,100	11	1
871	921	16,900	0	0	7	595	17,200	11	0
1,238	1,238	17,000	1	1	184	745	17,300	12	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
33,340	71,421	1.4665	104,736	48,142	9,058	58,044	1.1335	65,793	10,888
昨日 P/C	1.6102	今日增減變化		-0.1437	昨日 P/C	1.1208	今日增減變化		0.0127

更新日期：2023年5月18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18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	161,244,699	57,713,332	103,531,367	1,017,255	2,184,146	636,042	1,548,104	140,286
投信	29,660,160	50,594,853	-20,934,693	-154,318	348,023	0	348,023	4,941
自營商	12,352,043	46,913,751	-34,561,708	-1,916,688	1,656,110	903,060	753,050	-317,601
	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	636,854	990,356	-353,502	-391,666	3,125	29,684	-26,559	-3,324
投信	128,470	0	128,470	632	0	0	0	0
自營商	617,956	562,049	55,907	95,690	570,240	543,680	26,560	227

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18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	25,522	10,889	14,633	9,499	17,957	12,384	5,573	5,281	
投信	300	250	50	100	250	118	132	0	
自營商	55,249	35,030	20,219	-3,113	46,746	58,134	-11,388	1,909	
特定法人(週)	2,980	0	2,980	1,749	0	4,750	-4,750	-900	
特定法人(近月)	13,492	7,832	5,660	5,143	6,204	6,519	-315	-952	
特定法人(全月)	13,220	7,126	6,094	5,407	5,204	10,366	-5,162	-555	
十大交易人(週)	29,137	22,024	7,113	3,486	45,997	23,220	22,777	1,192	
十大交易人(近月)	37,496	25,086	12,410	377	26,539	30,642	-4,103	-2,978	
十大交易人(全月)	71,048	48,547	22,501	4,436	67,568	55,934	11,634	-3,042	
全市場未沖銷(近月)			58,044	9,058			65,793	10,888	
全市場未沖銷(全月)			149,437	45,567			191,723	65,717	

更新日期：2023年5月18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	16100	買權OI最大量	16400
	賣權成交最大量	15900	賣權OI最大量	15700
	整體隱含波動率	13.38%	較前一交易日	+0.65%
	買權隱含波動率	14.46%	較前一交易日	+1.93%
	賣權隱含波動率	12.35%	較前一交易日	-0.54%
電子選擇權	買權成交最大量	775	買權OI最大量	775
	賣權成交最大量	715	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1660	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1560	賣權OI最大量	1560

更新日期：2023年5月18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	15400	賣權OI最大量	10000
	整體隱含波動率	14.22%	較前一交易日	-1.00%
	買權隱含波動率	12.42%	較前一交易日	+1.70%
	賣權隱含波動率	16.68%	較前一交易日	+0.45%
	成交量P/C_Ratio值	0.849	較前一交易日	-0.04
	未平倉P/C_Ratio值	1.134	較前一交易日	+0.01
電子選擇權	買權成交最大量	775	買權OI最大量	775
	賣權成交最大量	715	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1660	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1560	賣權OI最大量	1560

更新日期：2023年5月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

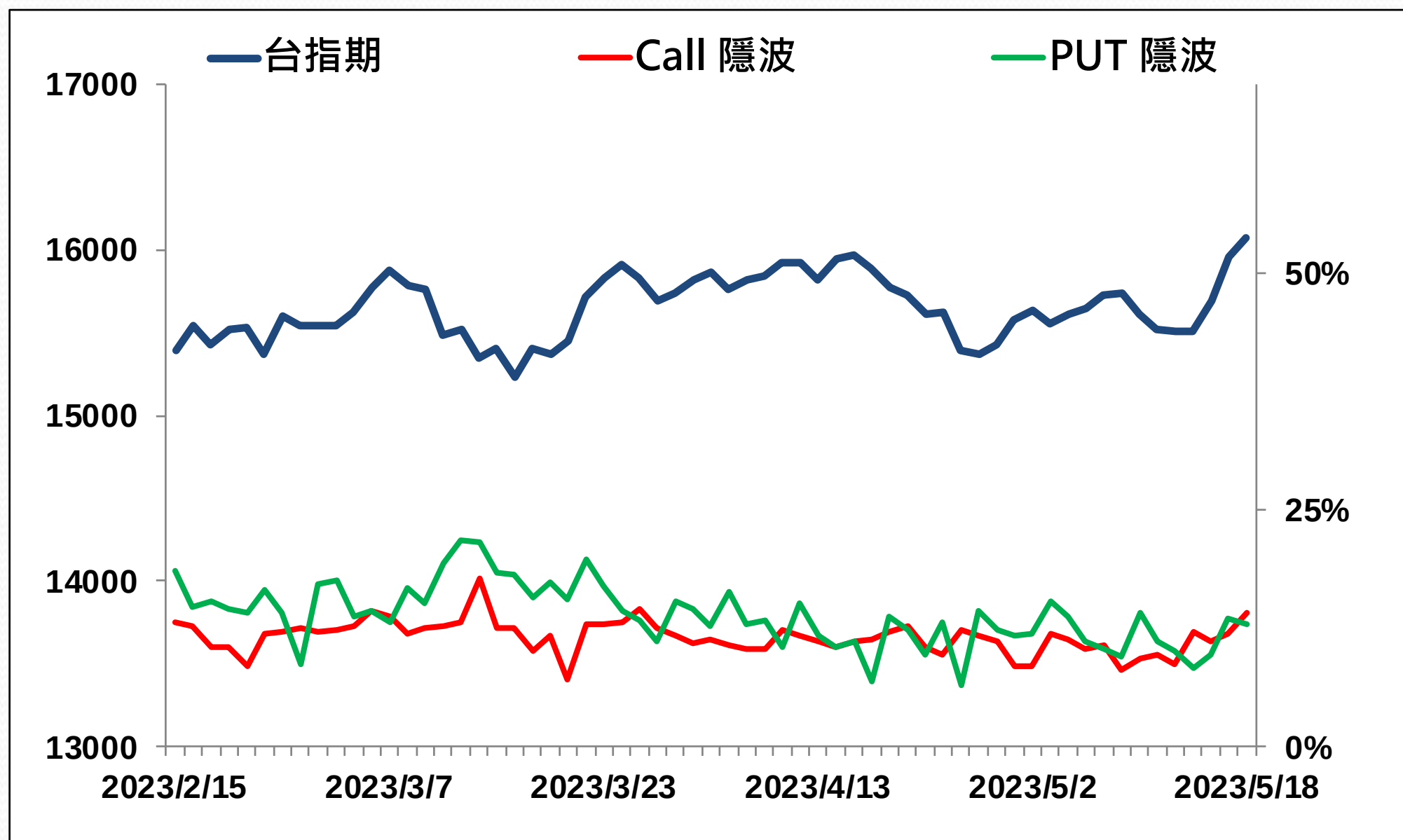
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年5月18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

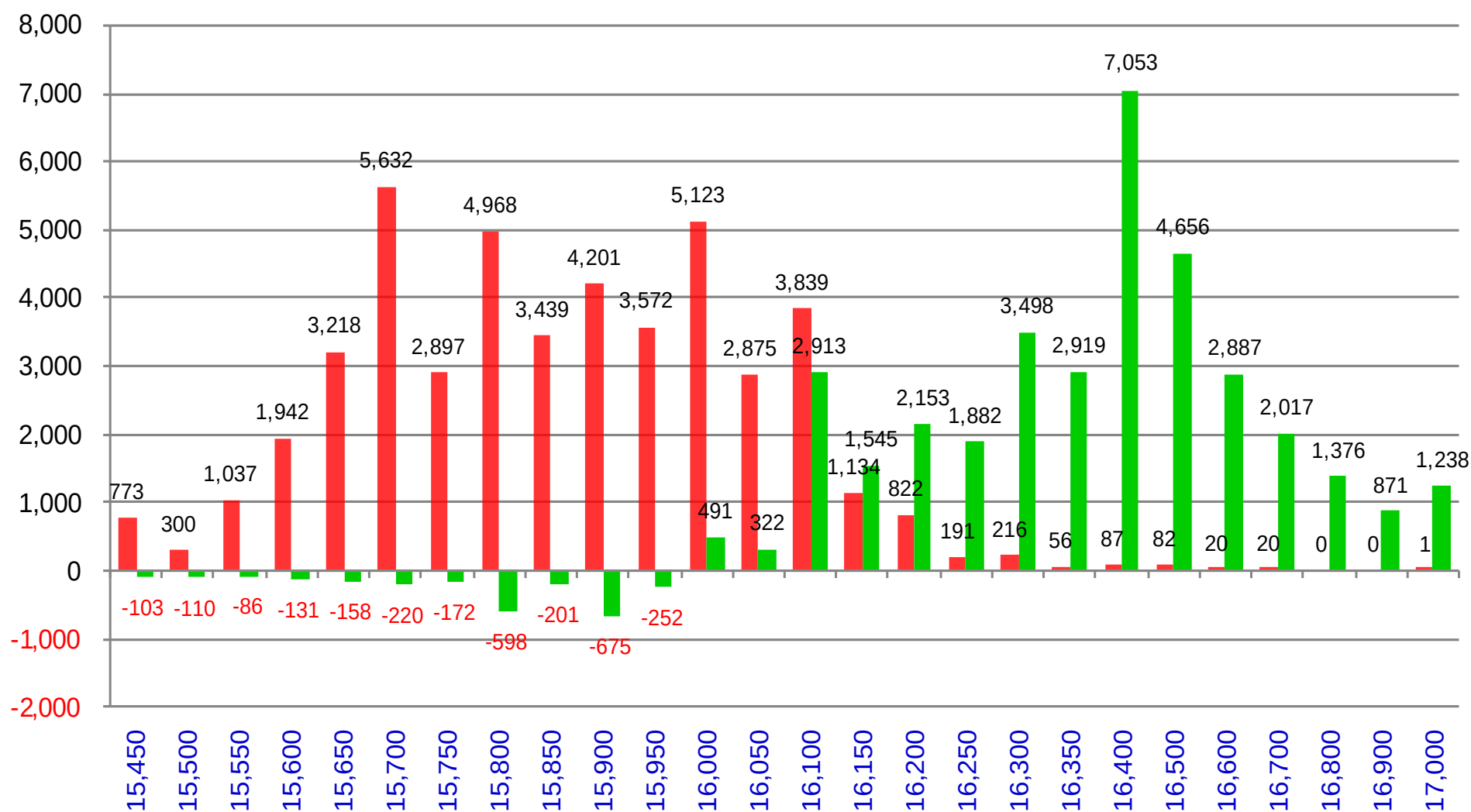


更新日期：2023年5月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：48,142

週選 CALL OI 變化：33,340

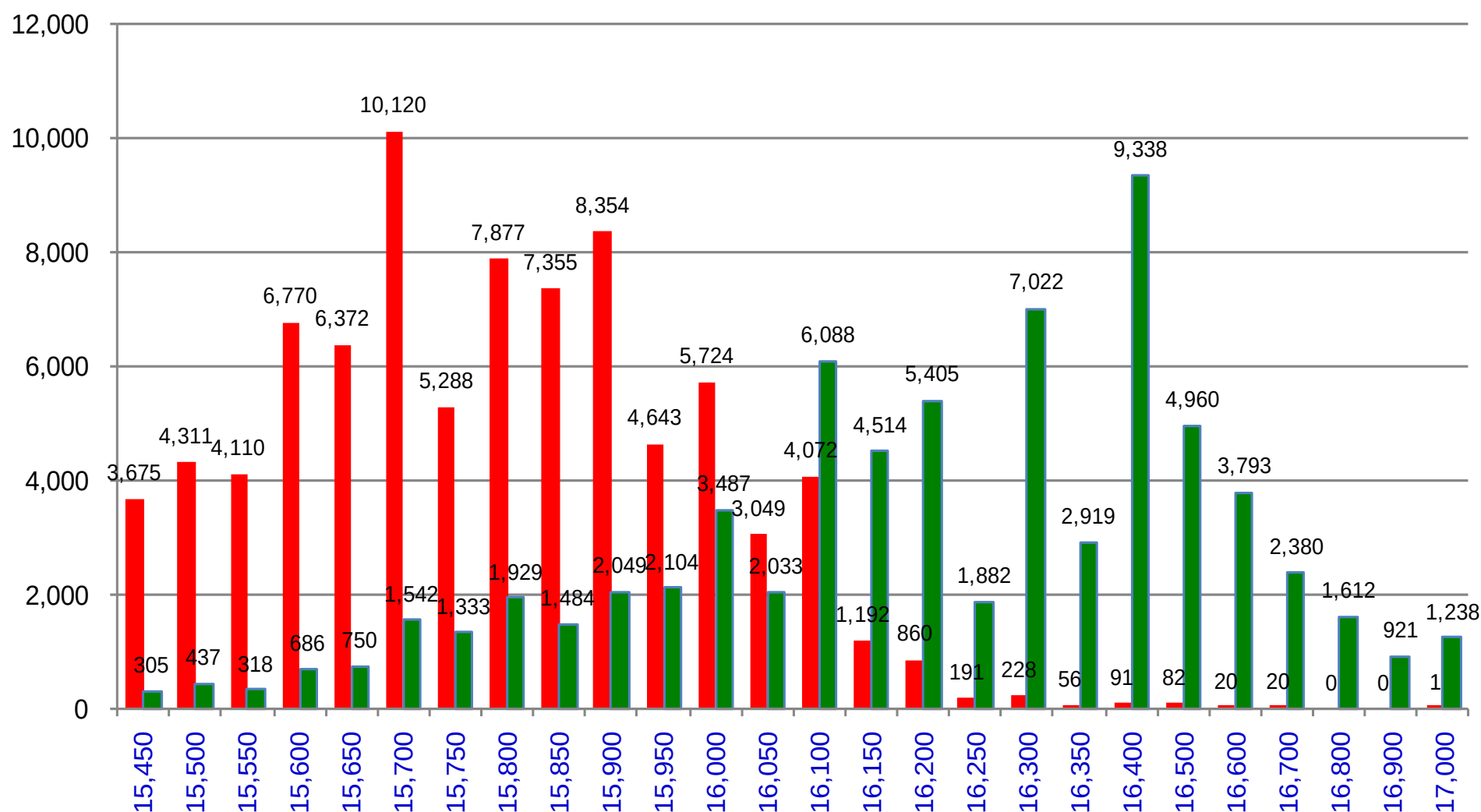


更新日期：2023年5月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：104,736

週選 CALL OI 總額：71,421



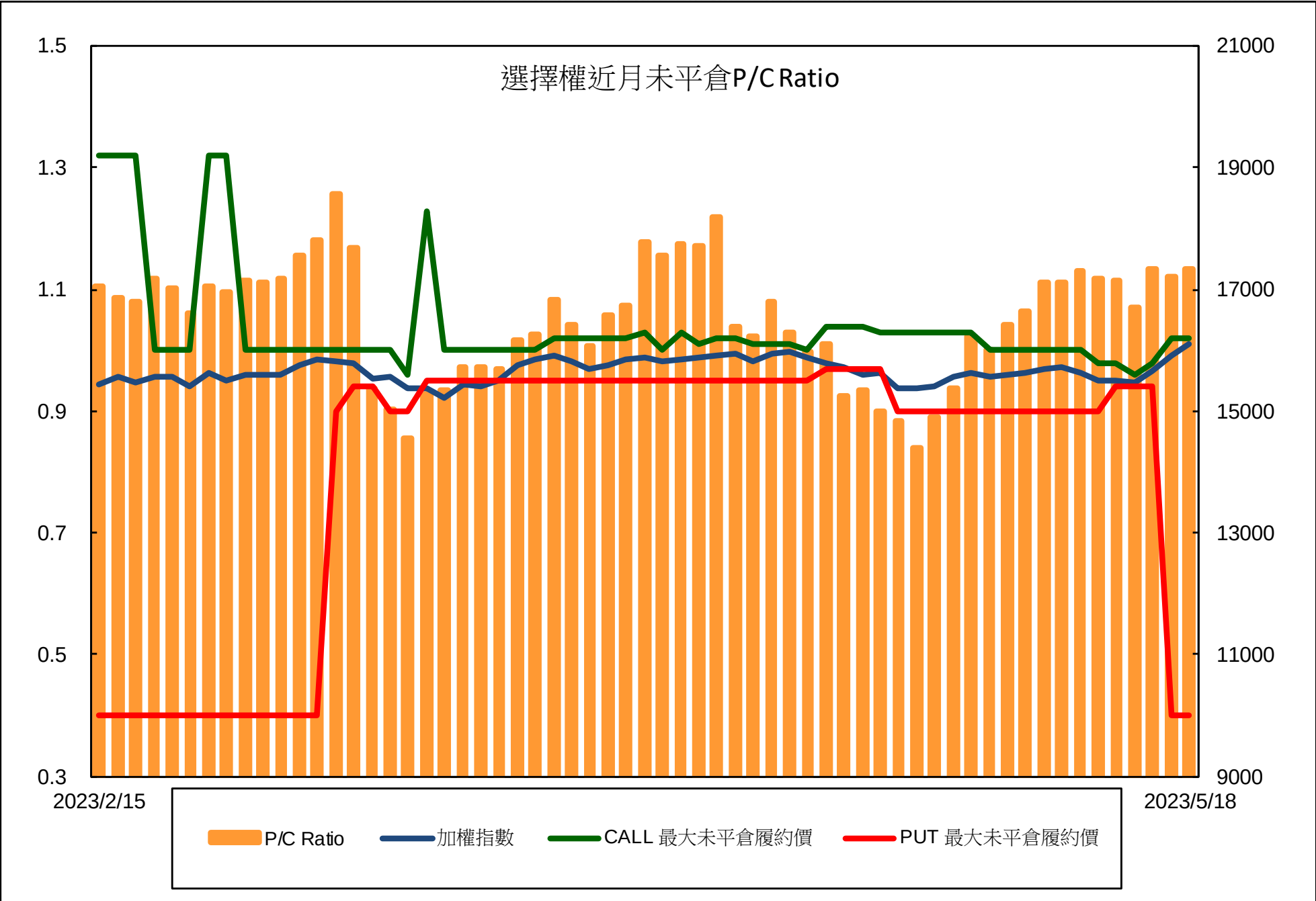
更新日期：2023年5月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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17日	52,664	29,332	23,332
	5月18日	55,249	35,030	20,219
Put	5月17日	35,509	48,806	-13,297
	5月18日	46,746	58,134	-11,388

更新日期：2023年5月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

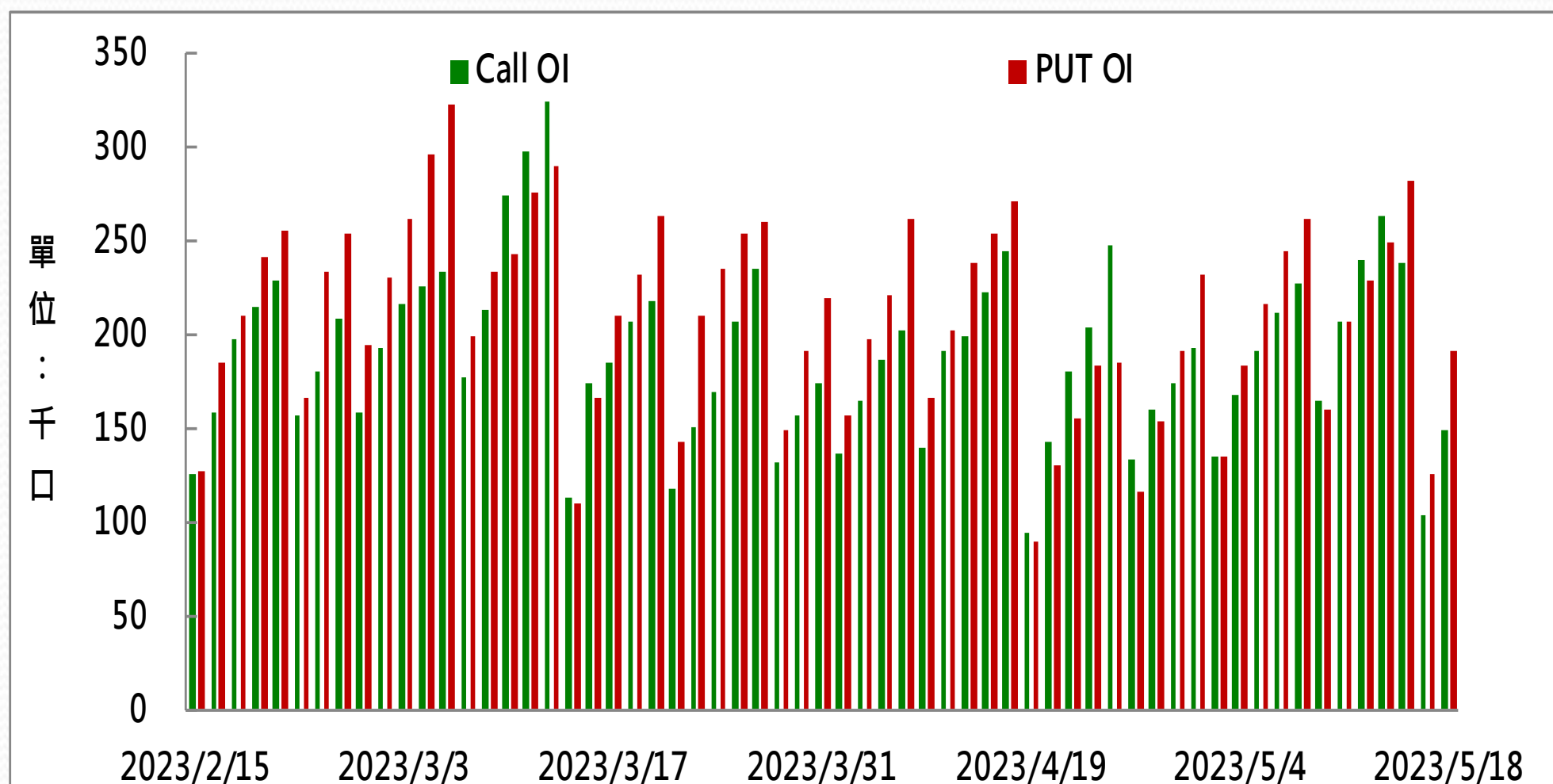
選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年5月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理



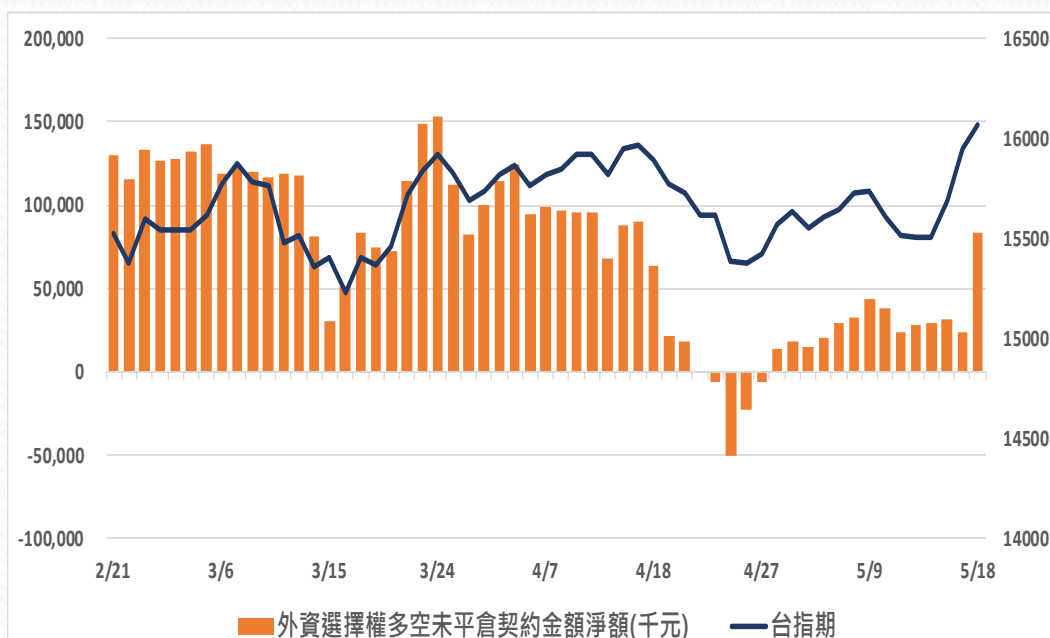
選擇權全月Put Call OI



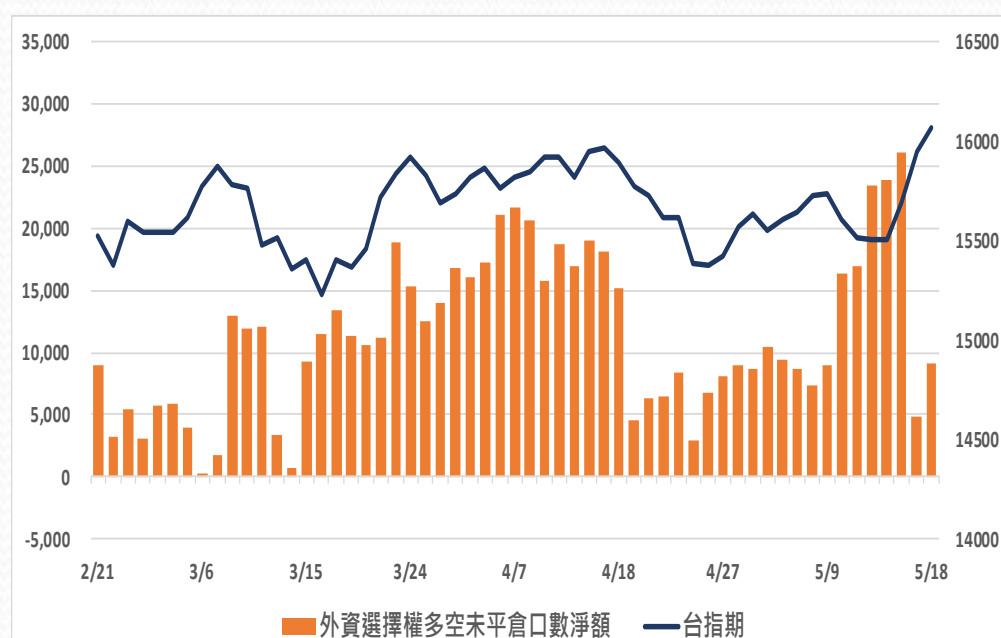
更新日期：2023年5月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



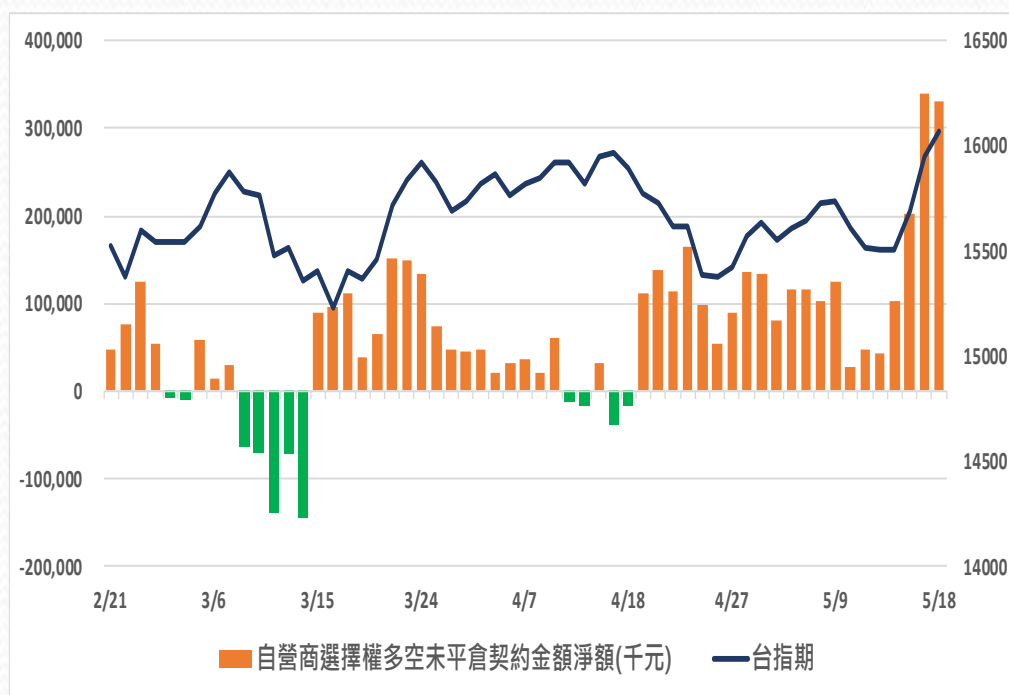
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/12	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	15953	4,842	-21,190	23,408	-7,823
2023/5/18	16069	9,060	+4,218	83,229	+59,821

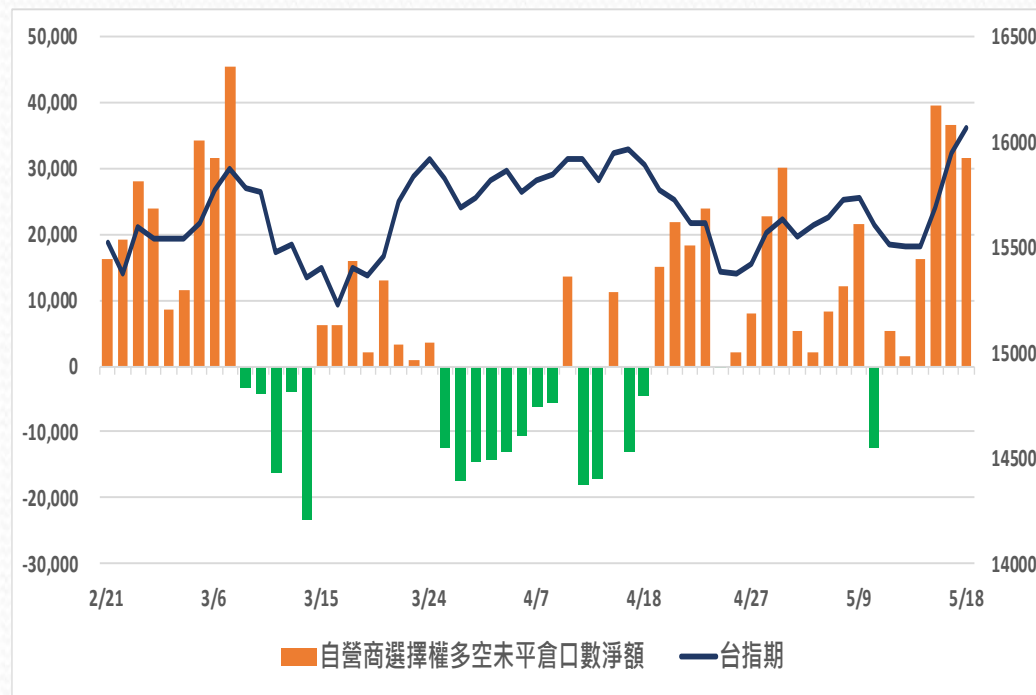
更新日期：2023年5月18日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



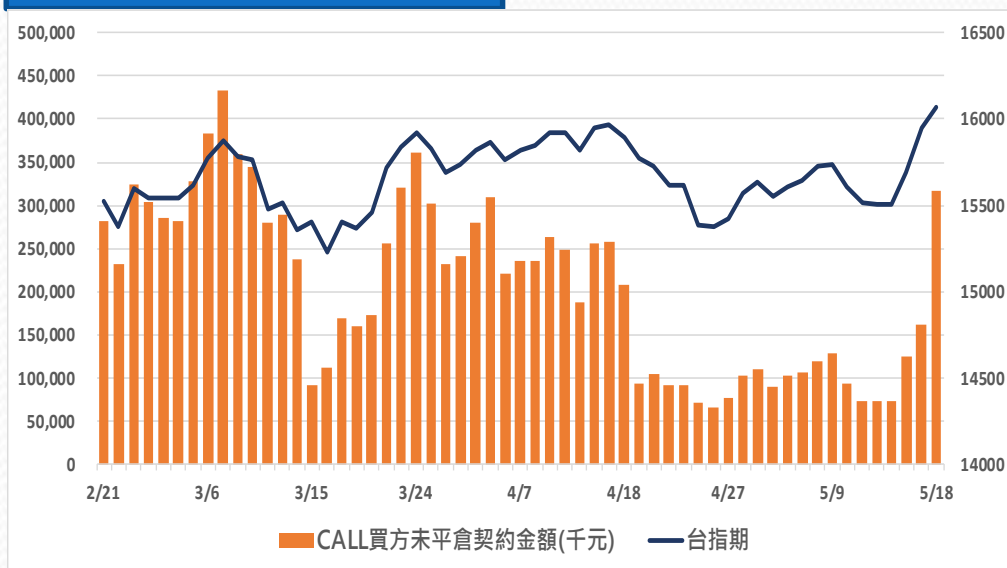
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/12	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	15953	36,629	-2,846	340,497	+139,073
2023/5/18	16069	31,607	-5,022	330,093	-10,404

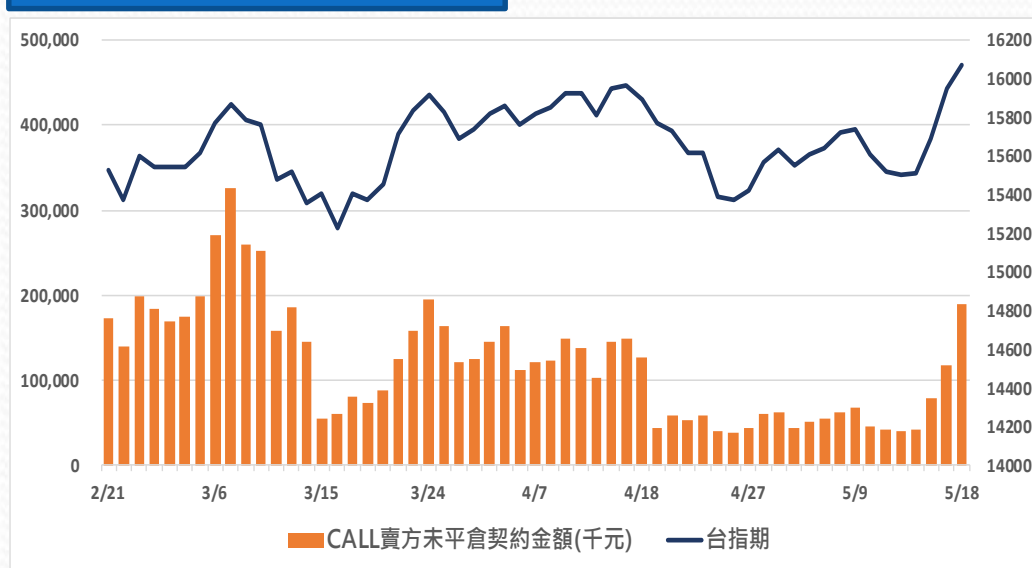
更新日期：2023年5月18日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

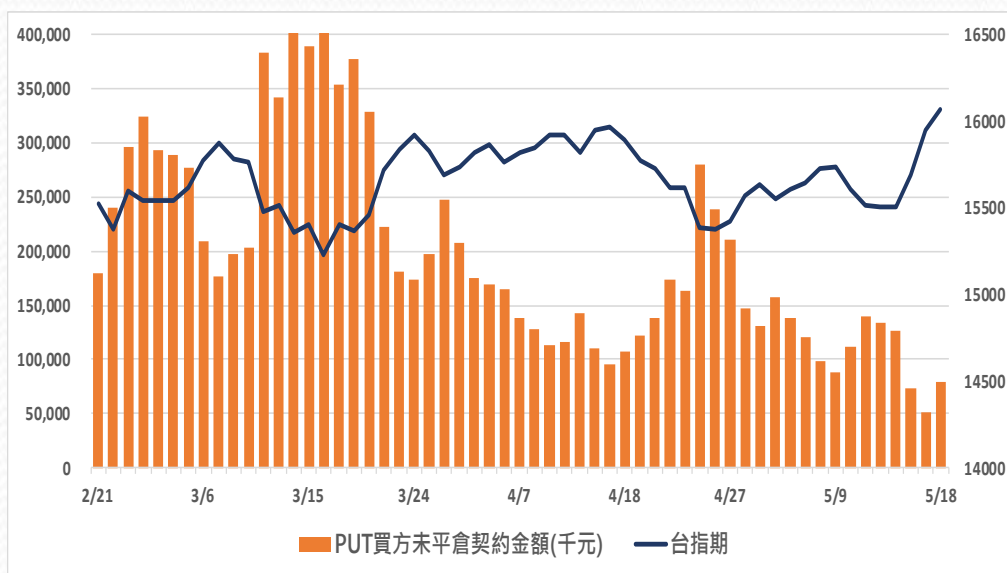
CALL買方未平倉金額



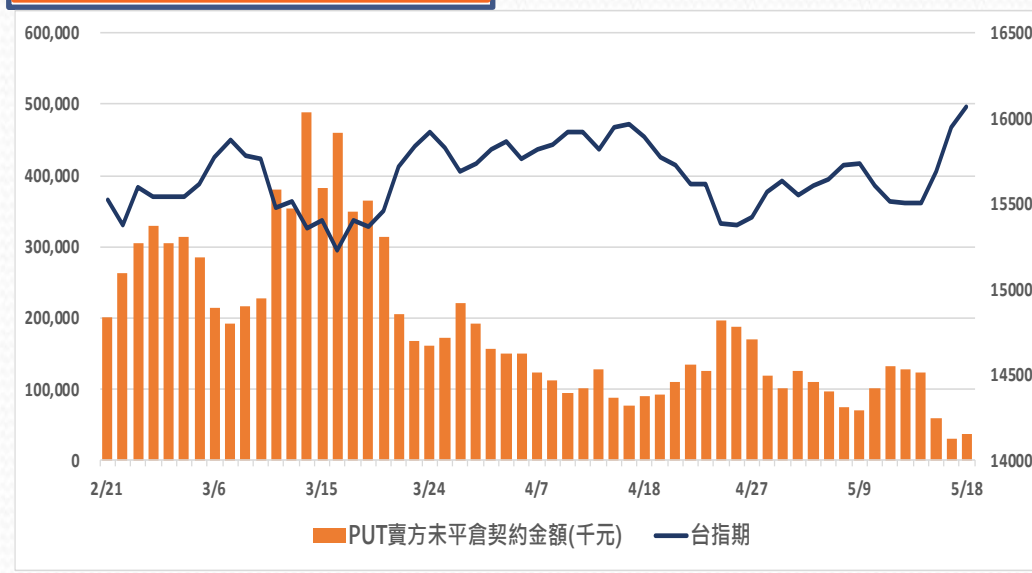
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



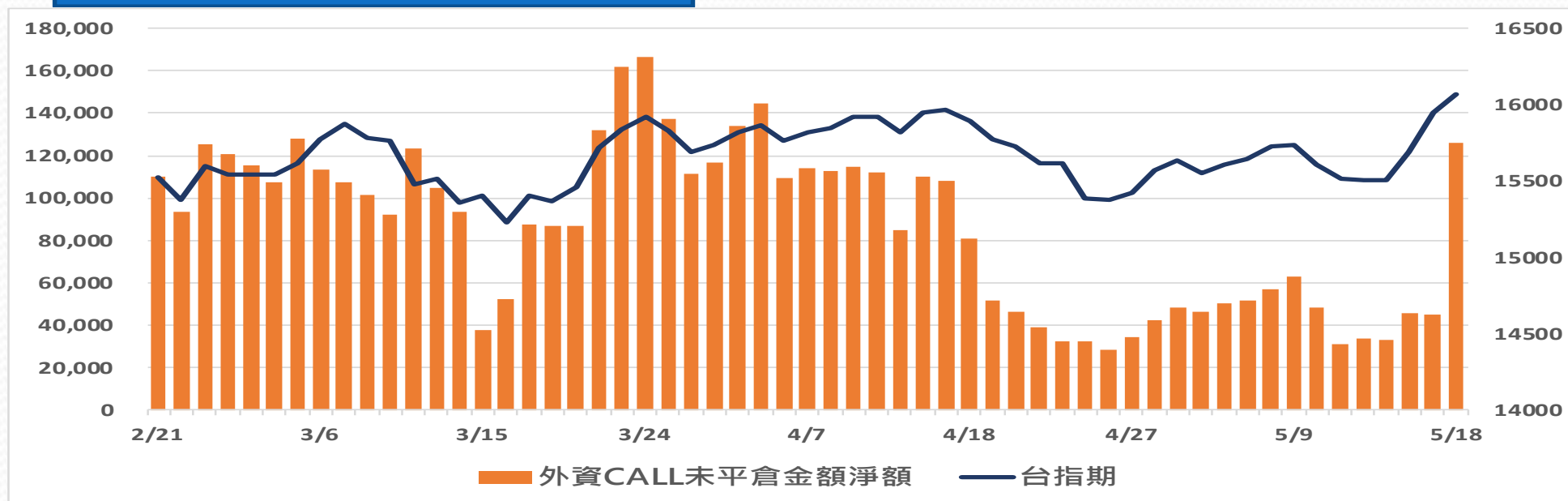
PUT賣方未平倉金額



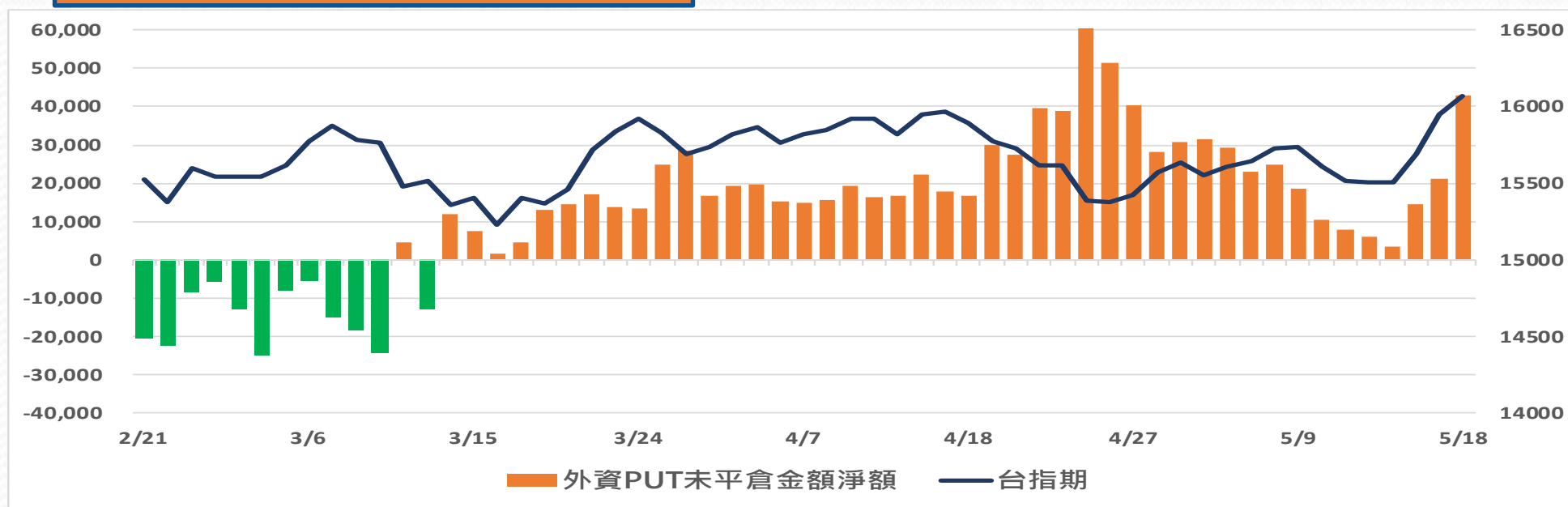
更新日期：2023年5月18日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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18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18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