

台指選擇權OI匯報

日期：2023/5/19 結算日：2023/5/24					日期：2023/5/19 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
-9	428	15,500	5,300	989	0	28	14,900	2,391	88
-32	286	15,550	3,447	-663	-6	262	15,000	5,784	987 ※
-100	586	15,600	6,805	35	-1	63	15,100	2,683	-19
-50	700	15,650	6,176	-196	1	162	15,200	4,376	327
-164	1,378	15,700	10,909	789	-4	235	15,300	2,837	264
-26	1,307	15,750	6,676	1,388	1	468	15,400	3,357	438
-316	1,613	15,800	9,081	1,204	-22	1,243	15,500	2,451	218
-193	1,291	15,850	8,877	1,522	-60	1,281	15,600	2,274	167
-246	1,803	15,900	9,785	1,431	-186	1,402	15,700	2,288	187
-237	1,867	15,950	7,432	2,789	-205	2,260	15,800	3,295	471
-759	2,728	16,000	8,809	3,085	-17	3,003	15,900	1,818	291
-182	1,851	16,050	4,905	1,856	-244	3,993	16,000	1,530	254
-598	5,490	16,100	7,726	3,654 ※	-298	3,869	16,100	1,601	256
924	5,438	16,150	3,006	1,814	-275	5,266	16,200	343	210
1,005	6,410	16,200	2,923	2,063	-167	5,040	16,300	120	31
1,192	3,074	16,250	1,119	928	138	3,595	16,400	102	13
3,824	10,846	16,300	525	297	415	3,251	16,500	112	62
1,585	4,504	16,350	168	112 ※	1,294	3,932	16,600	24	6
3,338	12,676	16,400	267	176	1,103	3,340	16,700	16	1
2,209	2,209	16,450	23	23	939	2,464	16,800	27	10
※ 4,975	9,935	16,500	67	-15	412	1,424	16,900	34	23
2,007	2,007	16,550	2	2	384	1,817	17,000	16	0
4,123	7,916	16,600	0	-20	188	799	17,100	11	0
3,121	5,501	16,700	21	1	177	772	17,200	16	5
1,988	3,600	16,800	0	0	267	1,012	17,300	12	0
408	1,329	16,900	0	0	238	766	17,400	76	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
29,038	100,459	1.2646	127,043	22,307	4,478	62,522	1.1327	70,820	5,027
昨日 P/C	1.4665	今日增減變化		-0.2019	昨日 P/C	1.1335	今日增減變化		-0.0008

更新日期：2023年5月19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19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	161,470,769	60,433,816	101,036,953	-2,494,414	2,561,558	712,059	1,849,499	301,395
投信	29,164,067	50,354,945	-21,190,878	-256,185	349,995	0	349,995	1,972
自營商	11,606,019	49,760,220	-38,154,201	-3,592,493	1,583,985	1,019,814	564,171	-188,879
	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	686,487	1,135,245	-448,758	-95,256	0	53,084	-53,084	-26,525
投信	129,228	0	129,228	758	0	0	0	0
自營商	651,048	580,160	70,888	14,981	572,997	519,913	53,084	26,524

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19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	28,100	13,686	14,414	-219	19,474	13,592	5,882	309
投信	300	250	50	0	250	118	132	0
自營商	63,500	41,081	22,419	2,200	51,827	69,894	-18,067	-6,679
特定法人(週)	2,380	1,943	437	-2,543	0	4,850	-4,850	-100
特定法人(近月)	14,304	8,578	5,726	66	6,451	7,280	-829	-514
特定法人(全月)	15,277	9,608	5,669	-425	5,235	10,607	-5,372	-210
十大交易人(週)	37,959	30,865	7,094	-19	54,613	27,126	27,487	4,710
十大交易人(近月)	41,529	27,282	14,247	1,837	28,829	32,372	-3,543	560
十大交易人(全月)	82,864	58,613	24,251	1,750	77,659	59,515	18,144	6,510
全市場未沖銷(近月)			62,522	4,478			70,820	5,027
全市場未沖銷(全月)			186,722	37,285			221,496	29,773

更新日期：2023年5月19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	16300	買權OI最大量	16400
	賣權成交最大量	16000	賣權OI最大量	15700
	整體隱含波動率	12.34%	較前一交易日	-1.04%
	買權隱含波動率	12.55%	較前一交易日	-1.91%
	賣權隱含波動率	12.11%	較前一交易日	-0.23%
電子選擇權	買權成交最大量	740	買權OI最大量	790
	賣權成交最大量	720	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1680	買權OI最大量	1680
	賣權成交最大量	1620	賣權OI最大量	1560

更新日期：2023年5月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

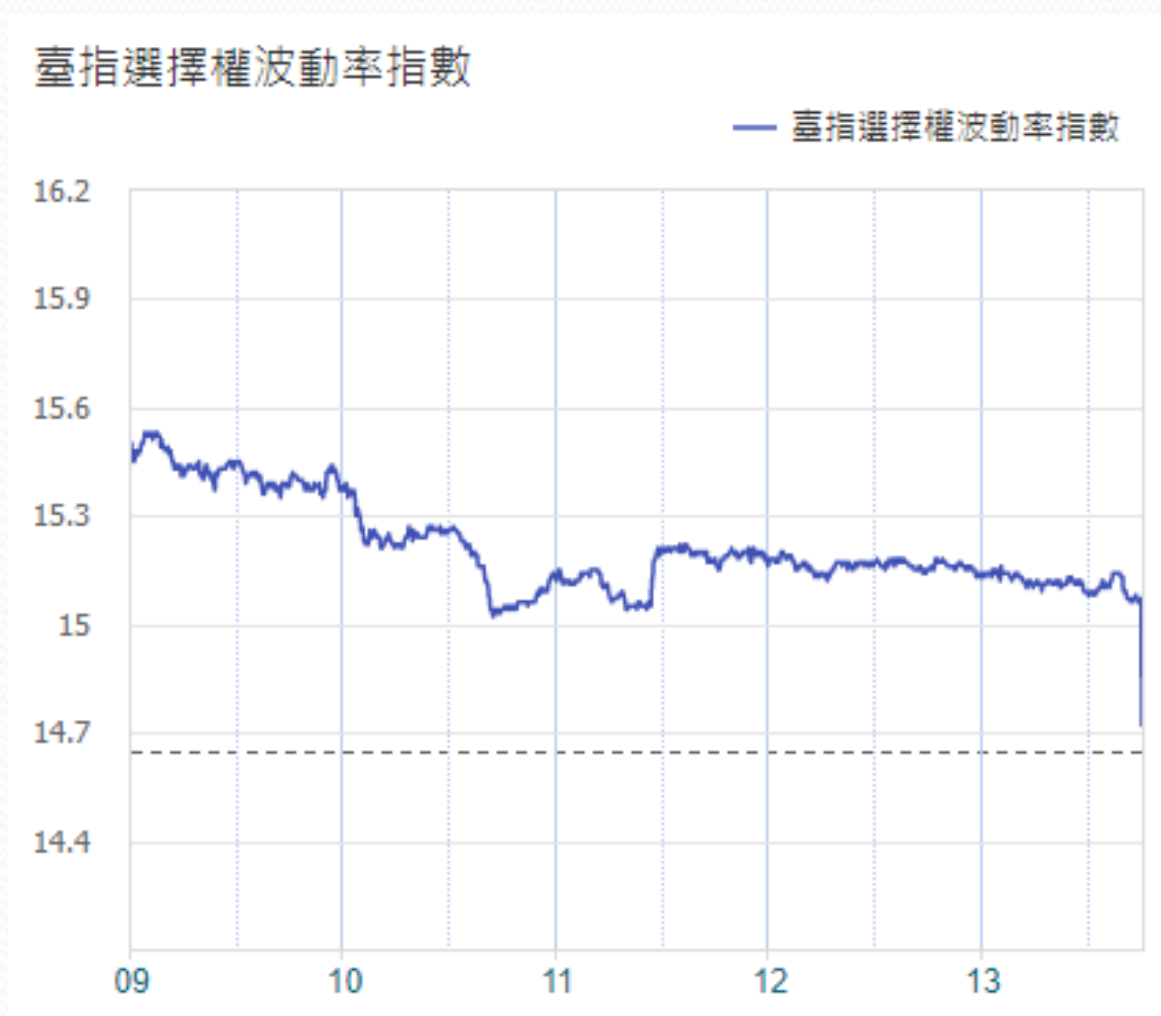
台指選擇權匯報

2023 年 06 月 選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16600	買權OI最大量	16200
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	13.65%	較前一交易日	+0.57%
	買權隱含波動率	11.52%	較前一交易日	-0.90%
	賣權隱含波動率	16.91%	較前一交易日	+0.23%
	成交量P/C_Ratio值	0.728	較前一交易日	-0.12
	未平倉P/C_Ratio值	1.133	較前一交易日	-0.00
電子選擇權	買權成交最大量	740	買權OI最大量	790
	賣權成交最大量	720	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1680	買權OI最大量	1680
	賣權成交最大量	1620	賣權OI最大量	1560

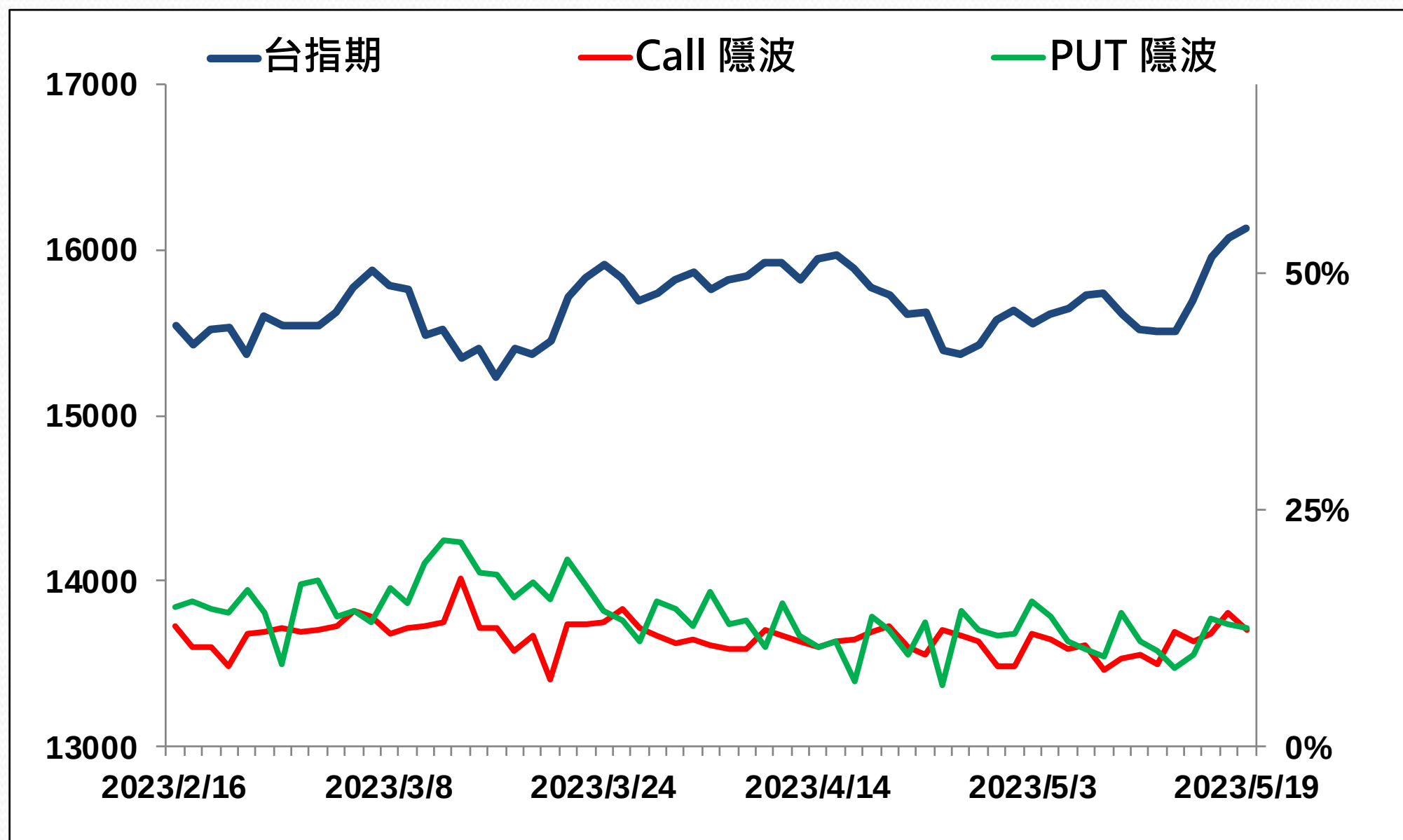
更新日期：2023年5月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



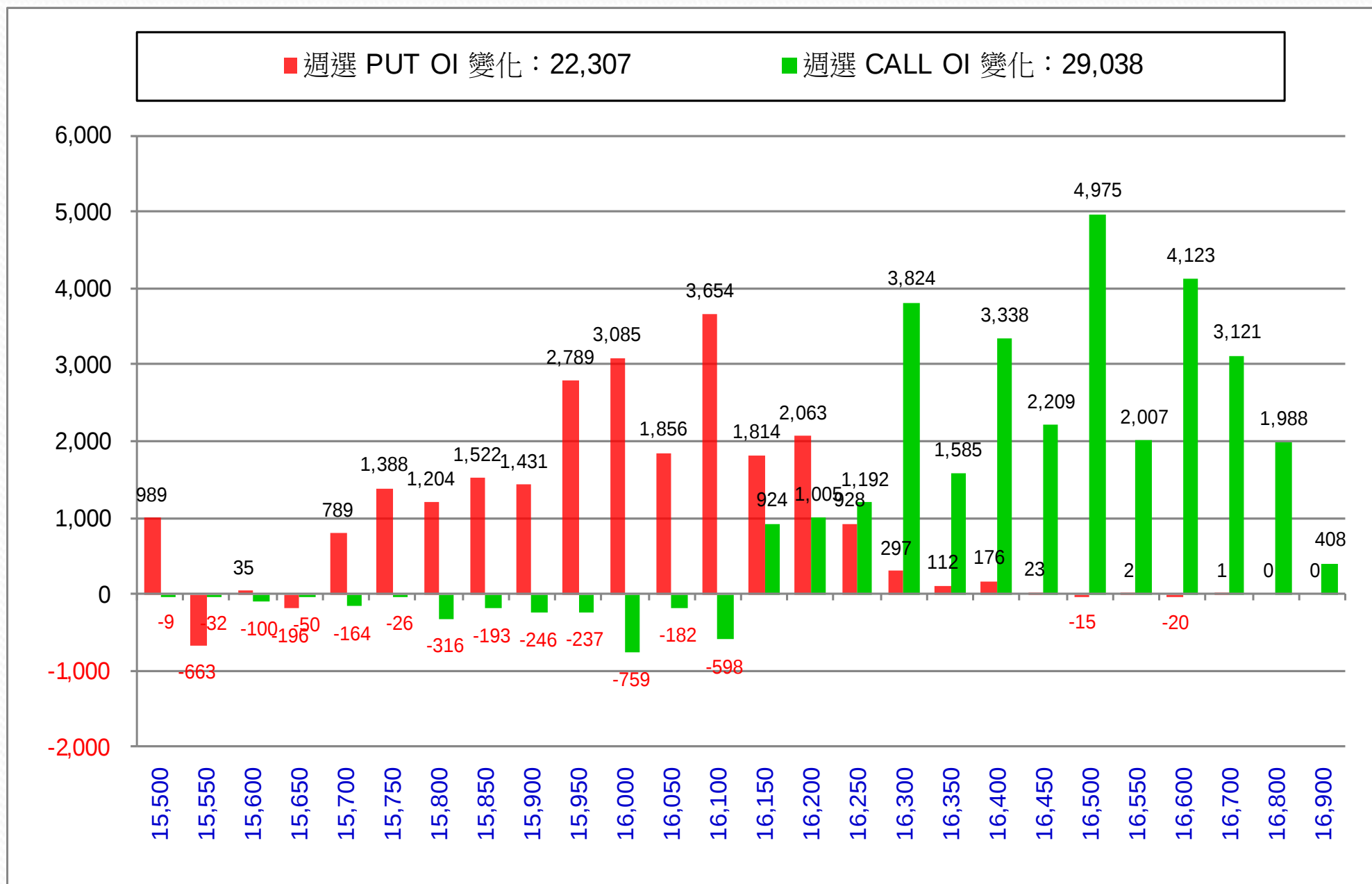
更新日期：2023年5月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年5月19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

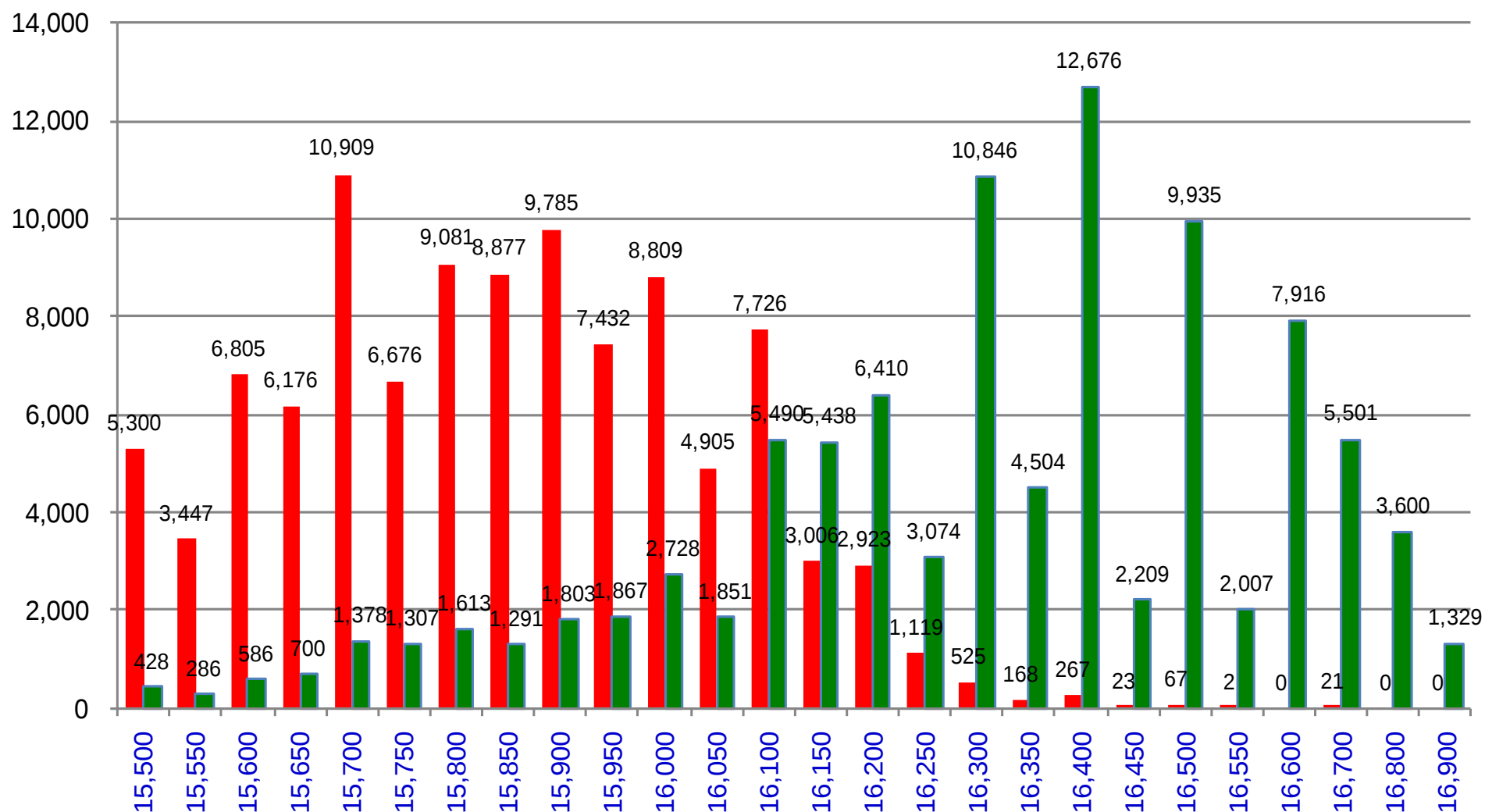


更新日期：2023年5月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：127,043

週選 CALL OI 總額：100,459



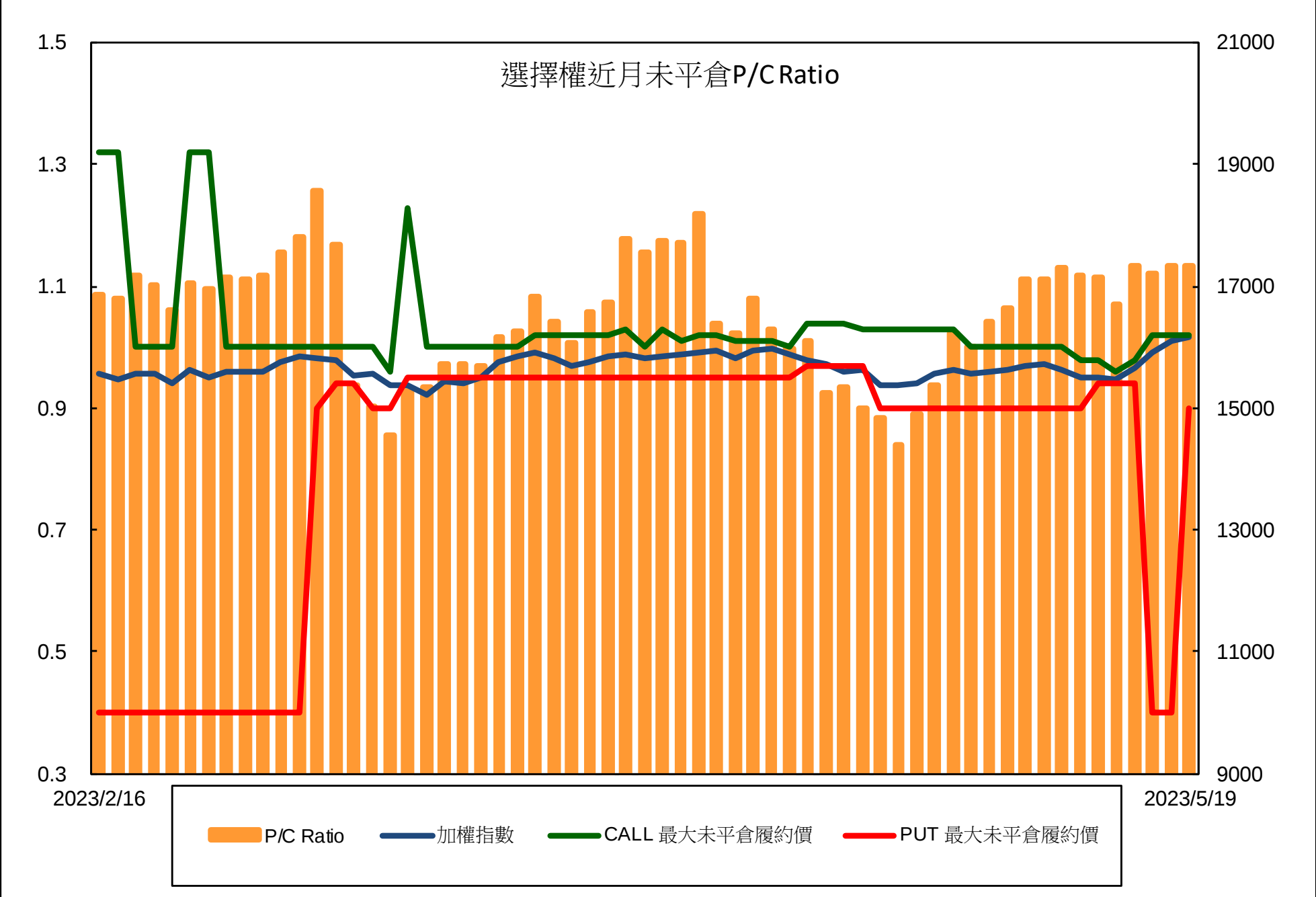
更新日期：2023年5月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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18日	55,249	35,030	20,219
	5月19日	63,500	41,081	22,419
Put	5月18日	46,746	58,134	-11,388
	5月19日	51,827	69,894	-18,067

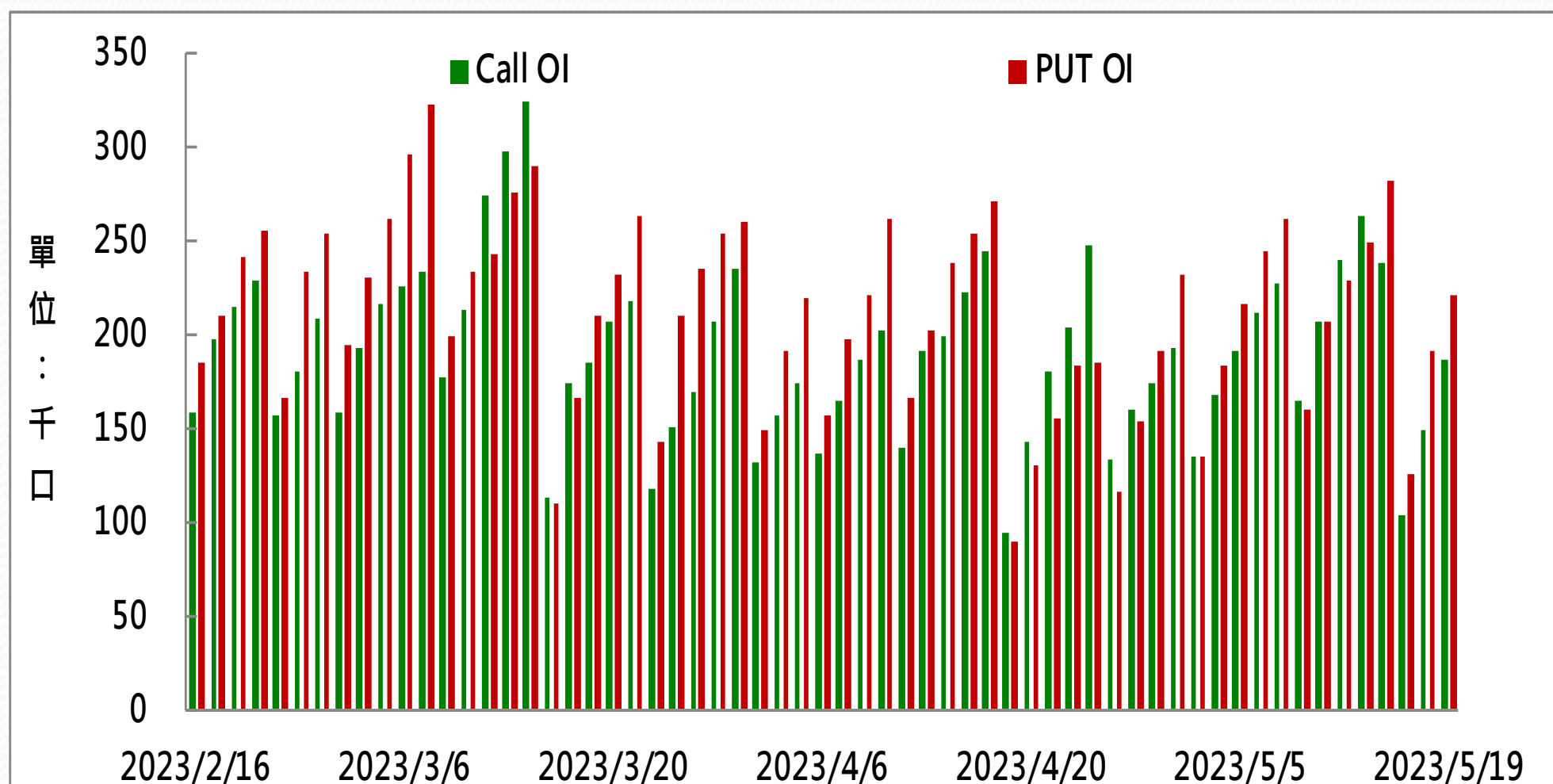
更新日期：2023年5月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年5月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

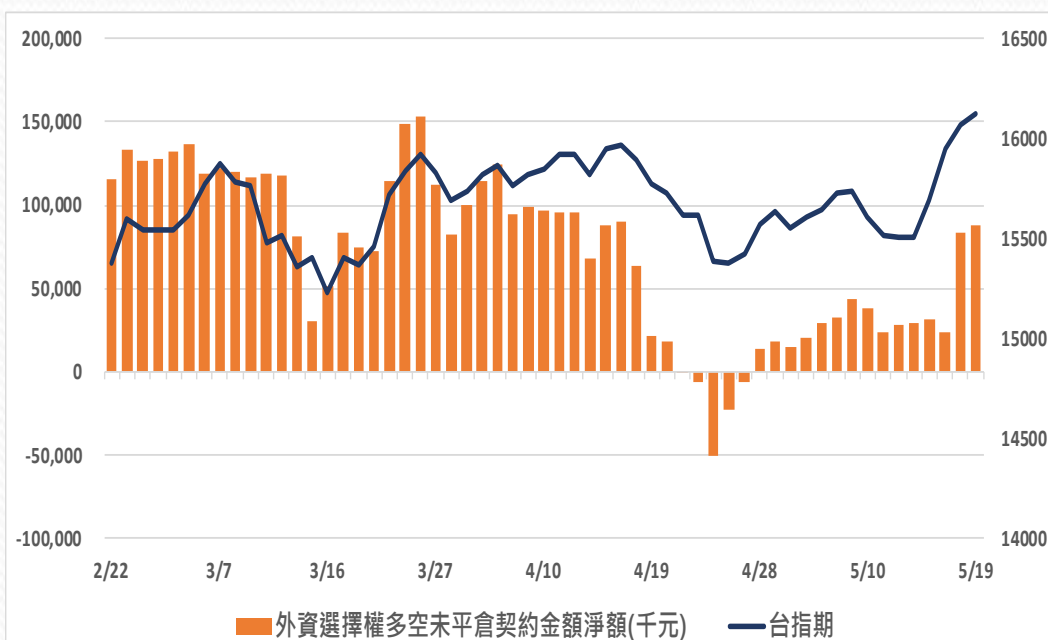
選擇權全月Put Call OI



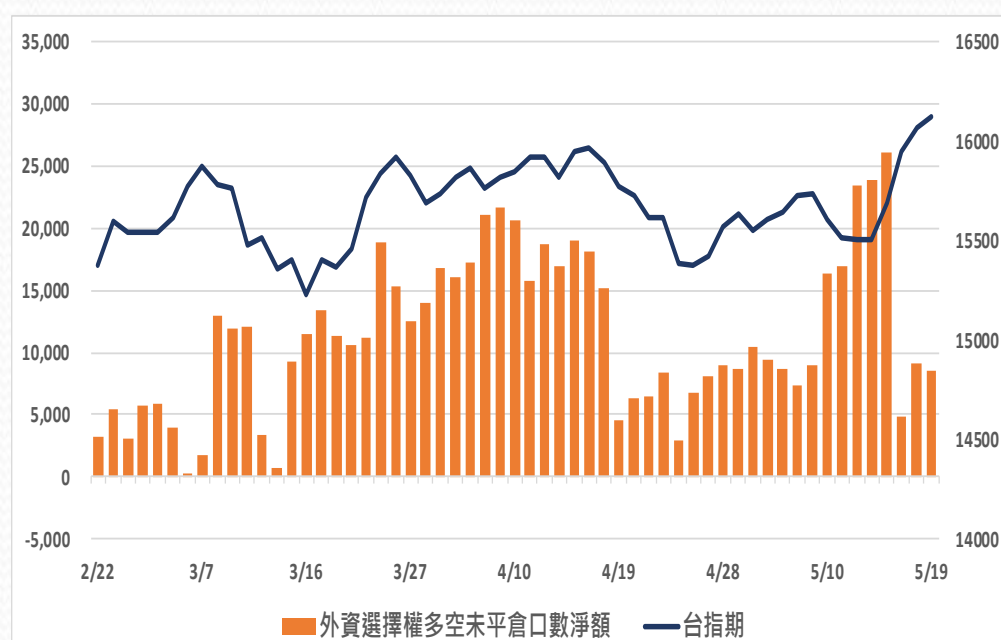
更新日期：2023年5月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



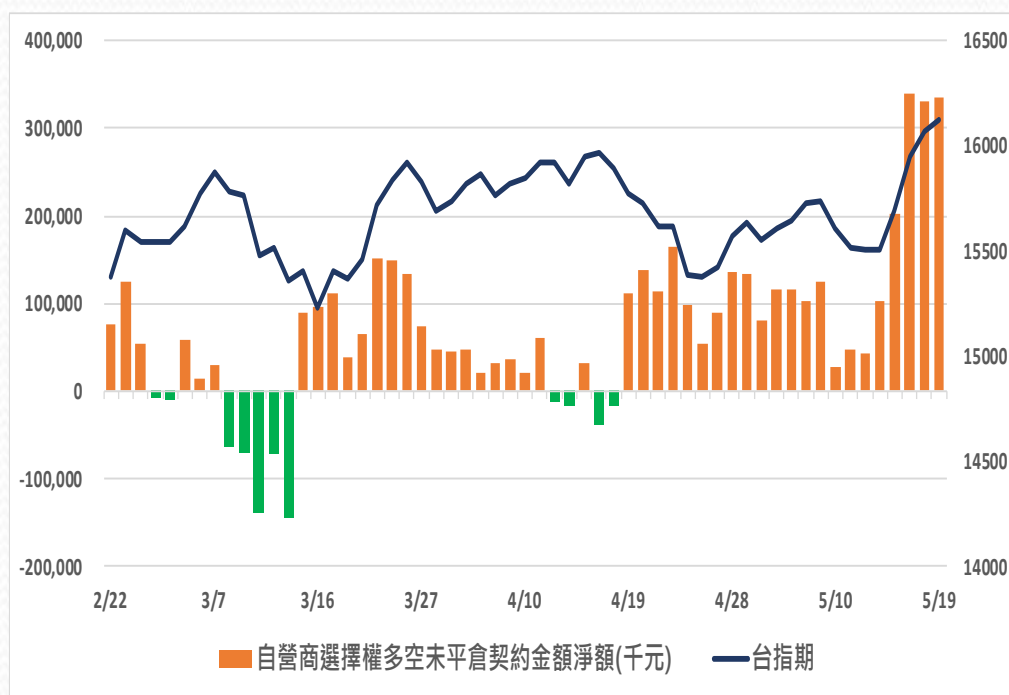
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/15	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
2023/5/19	16127	8,532	-528	87,748	+4,519

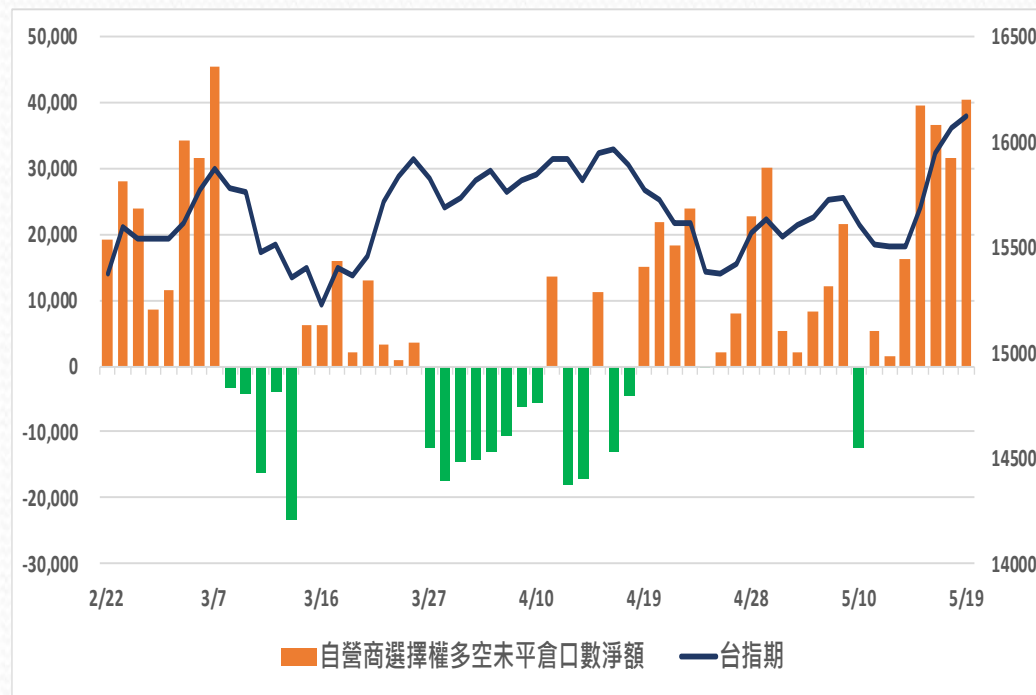
更新日期：2023年5月19日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



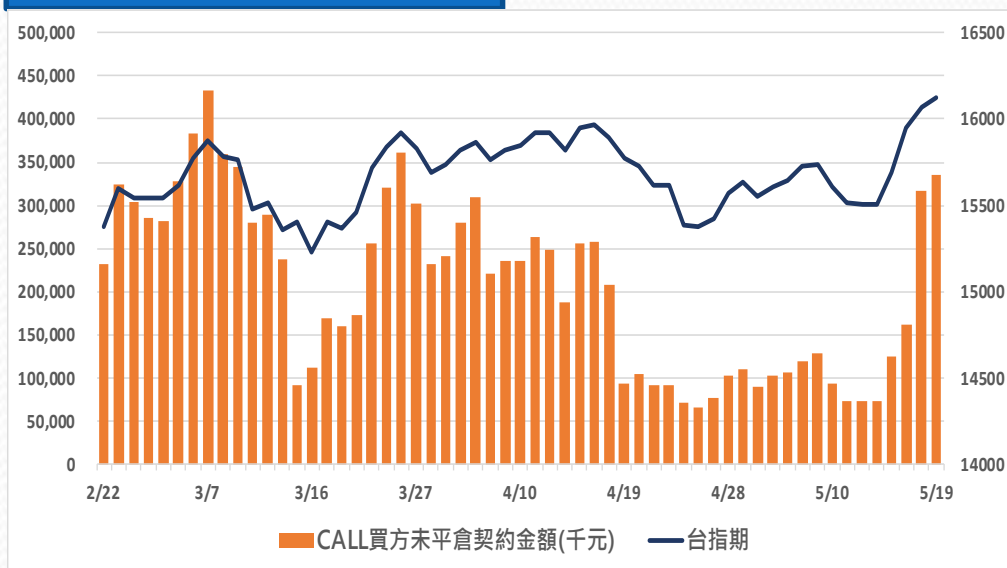
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/15	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
2023/5/19	16127	40,486	+8,879	336,106	+6,013

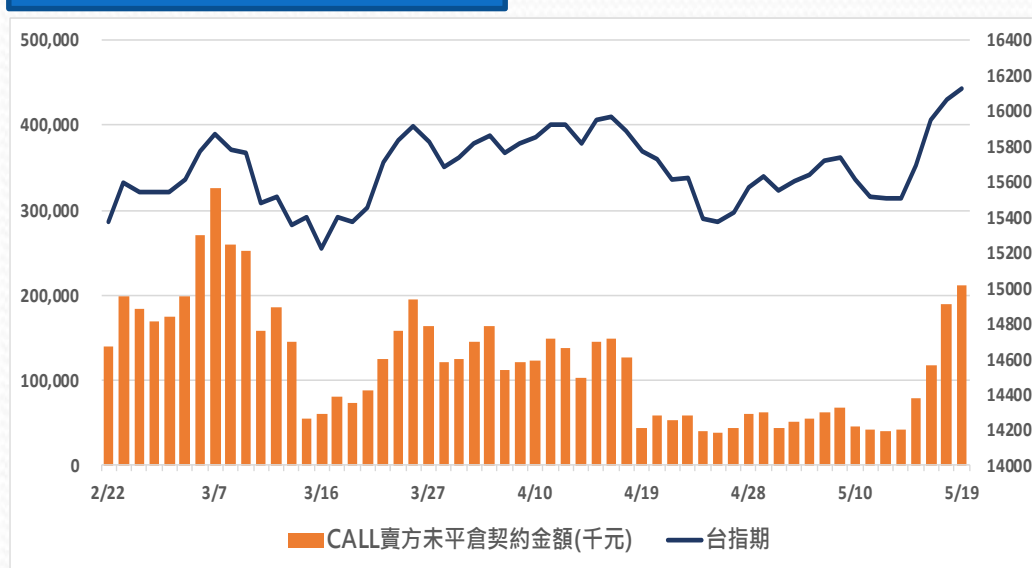
更新日期：2023年5月19日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

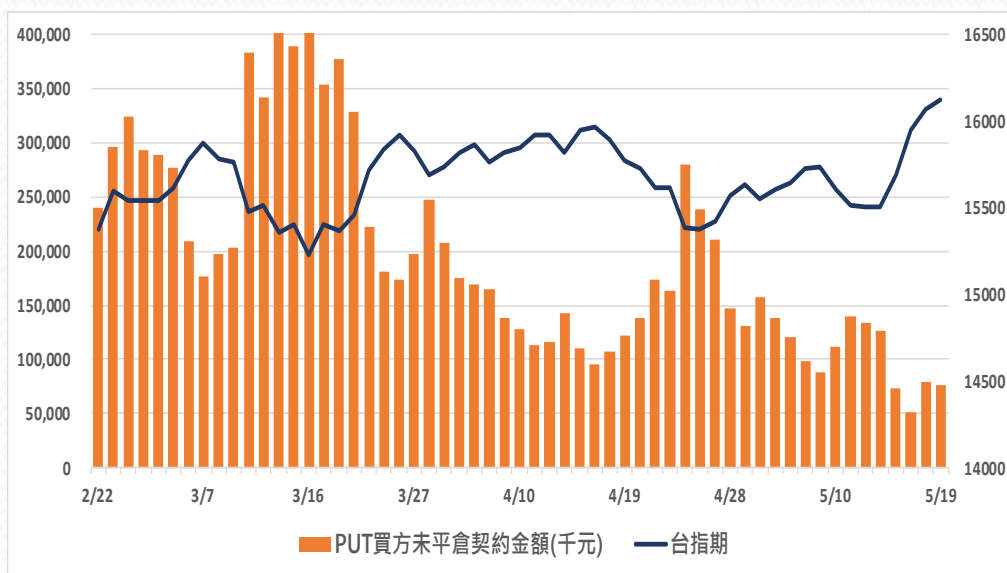
CALL買方未平倉金額



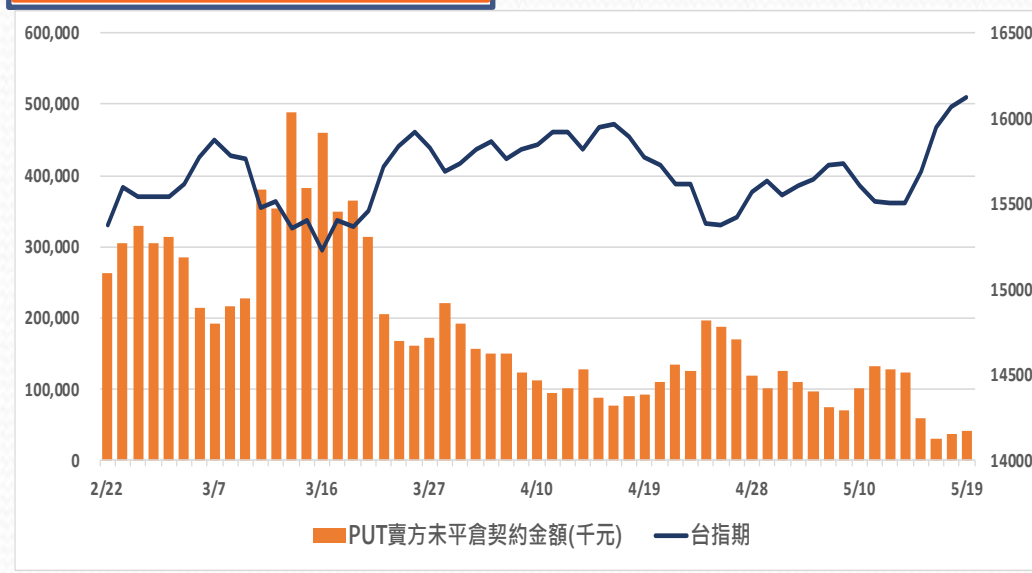
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



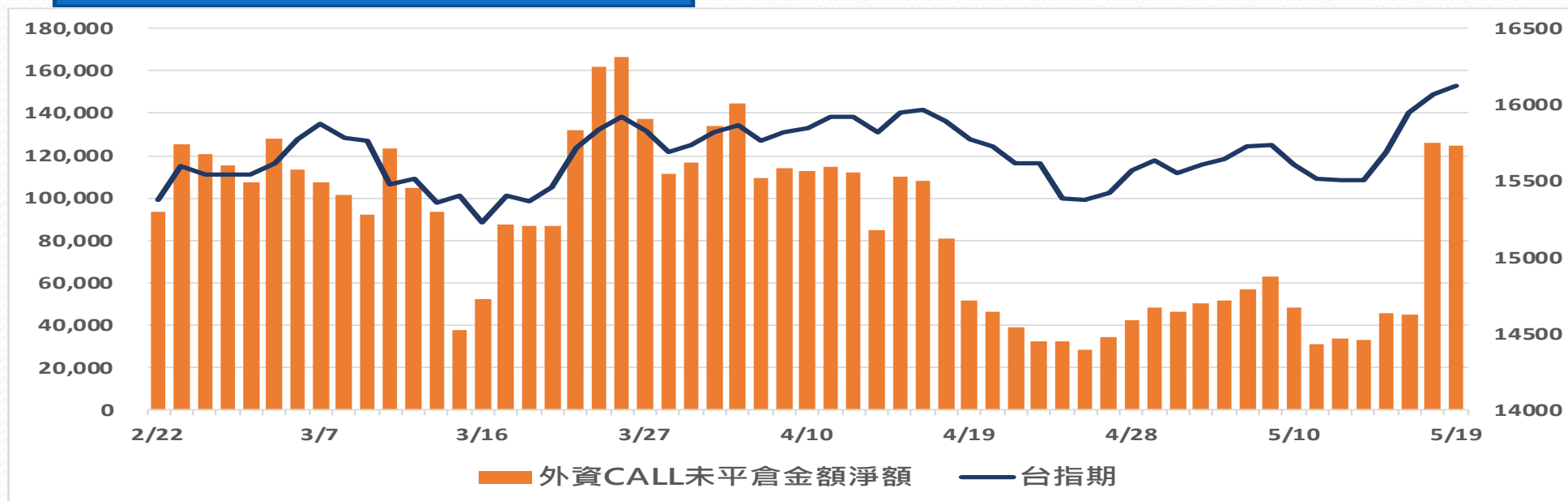
PUT賣方未平倉金額



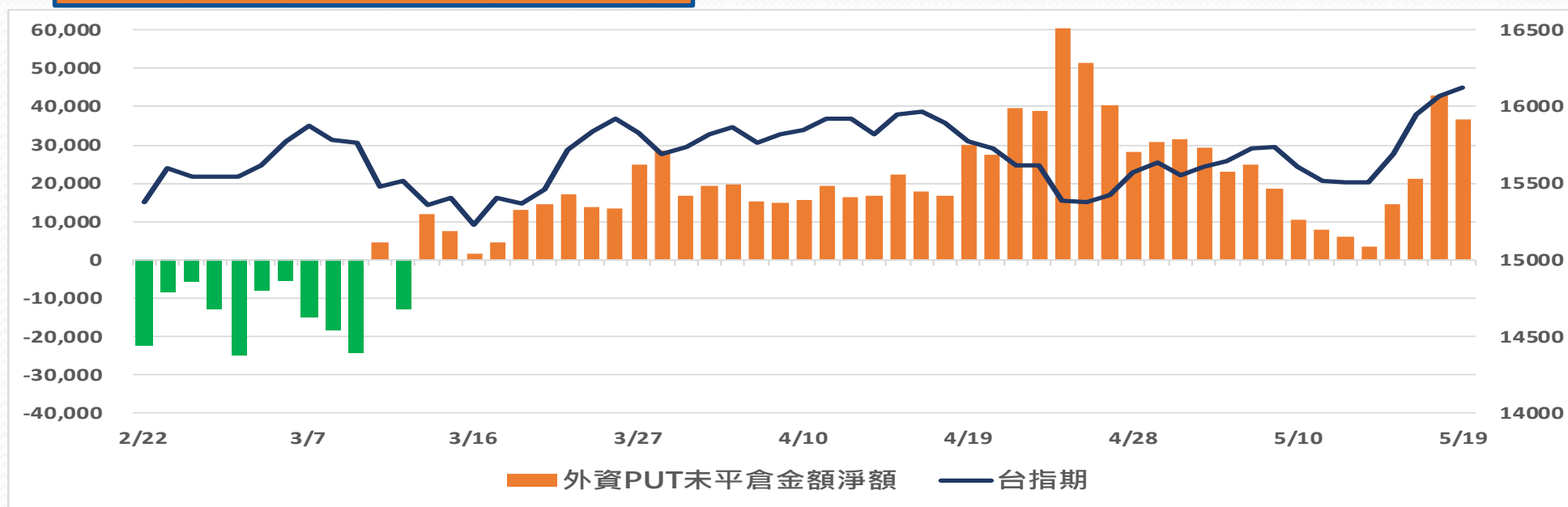
更新日期：2023年5月19日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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19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19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