

台指選擇權OI匯報

日期：2023/5/22 結算日：2023/5/24					日期：2023/5/22 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
-43	243	15,550	3,365	-82	0	28	14,900	2,417	26
-45	541	15,600	5,306	-1,499	-3	259	15,000	6,049	265
-14	686	15,650	5,412	-764	-3	60	15,100	2,672	-11
-80	1,298	15,700	7,115	-3,794	3	165	15,200	4,656	280
-26	1,281	15,750	5,533	-1,143	8	243	15,300	2,990	153
-33	1,580	15,800	9,316	235	-2	466	15,400	3,521	164
-52	1,239	15,850	8,353	-524	-66	1,177	15,500	2,552	101
-26	1,777	15,900	12,614	2,829	-37	1,244	15,600	2,338	64
-61	1,806	15,950	9,061	1,629	-27	1,375	15,700	2,177	-111
-80	2,648	16,000	11,964	3,155	-108	2,152	15,800	3,063	-232
67	1,918	16,050	7,716	2,811	-37	2,966	15,900	1,456	-362
-364	5,126	16,100	10,205	2,479	-38	3,955	16,000	1,599	69
331	5,769	16,150	5,012	2,006	189	4,058	16,100	1,760	159
1,095	7,505	16,200	4,543	1,620	331	5,597	16,200	382	39
1,958	5,032	16,250	1,540	421	452	5,492	16,300	153	33
2,581	13,427	16,300	1,030	505	18	3,613	16,400	111	9
2,312	6,816	16,350	237	69	347	3,598	16,500	122	10
1,186	13,862	16,400	229	-38	233	4,165	16,600	24	0
※ 2,922	5,131	16,450	66	43	183	3,523	16,700	16	0
-521	9,414	16,500	140	73	331	2,795	16,800	27	0
1,069	3,076	16,550	21	19	※ 489	1,913	16,900	35	1
-172	7,744	16,600	105	105	421	2,238	17,000	16	0
472	472	16,650	20	20	117	916	17,100	11	0
-57	5,444	16,700	21	0	182	954	17,200	16	0
-28	3,572	16,800	0	0	482	1,494	17,300	12	0
-43	1,286	16,900	0	0	41	807	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
12,027	112,486	1.2181	137,015	9,972	3,574	66,096	1.0773	71,208	388
昨日 P/C	1.2646	今日增減變化	-0.0465		昨日 P/C	1.1327	今日增減變化	-0.0554	

更新日期：2023年5月22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22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	162,317,748	63,012,094	99,305,654	-1,731,299	2,788,886	731,867	2,057,019	207,520	
投信	30,096,374	50,317,476	-20,221,102	969,776	349,369	0	349,369	-626	
自營商	11,092,200	51,521,801	-40,429,601	-2,275,400	1,430,605	957,670	472,935	-91,236	
	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	772,111	1,338,566	-566,455	-117,697	3,125	57,813	-54,688	-1,604	
投信	129,592	0	129,592	364	0	0	0	0	
自營商	725,057	557,219	167,838	96,950	570,313	512,500	57,813	4,729	

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22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	30,100	15,828	14,272	-142	18,839	15,624	3,215	-2,667	
投信	300	250	50	0	250	118	132	0	
自營商	68,935	41,835	27,100	4,681	53,035	68,500	-15,465	2,602	
特定法人(週)	2,380	2,155	225	-212	0	3,650	-3,650	1,200	
特定法人(近月)	16,404	8,657	7,747	2,021	7,722	7,085	637	1,466	
特定法人(全月)	18,411	10,812	7,599	1,930	5,422	11,174	-5,752	-380	
十大交易人(週)	44,351	33,000	11,351	4,257	54,576	28,956	25,620	-1,867	
十大交易人(近月)	43,476	28,579	14,897	650	29,330	30,726	-1,396	2,147	
十大交易人(全月)	90,602	61,630	28,972	4,721	78,340	59,361	18,979	835	
全市場未沖銷(近月)			66,096	3,574			71,208	388	
全市場未沖銷(全月)			206,215	19,493			233,973	12,477	

更新日期：2023年5月22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	16200	買權OI最大量	16400
	賣權成交最大量	16100	賣權OI最大量	15900
	整體隱含波動率	12.34%	較前一交易日	+0.00%
	買權隱含波動率	11.63%	較前一交易日	-0.92%
	賣權隱含波動率	12.96%	較前一交易日	+0.85%
電子選擇權	買權成交最大量	780	買權OI最大量	780
	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	1700	買權OI最大量	1700
	賣權成交最大量	1600	賣權OI最大量	1560

更新日期：2023年5月22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	15700	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	14.14%	較前一交易日	-0.49%
	買權隱含波動率	10.60%	較前一交易日	-0.92%
	賣權隱含波動率	17.46%	較前一交易日	+0.55%
	成交量P/C_Ratio值	1.022	較前一交易日	+0.29
	未平倉P/C_Ratio值	1.077	較前一交易日	-0.06
電子選擇權	買權成交最大量	780	買權OI最大量	780
	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	1700	買權OI最大量	1700
	賣權成交最大量	1600	賣權OI最大量	1560

更新日期：2023年5月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

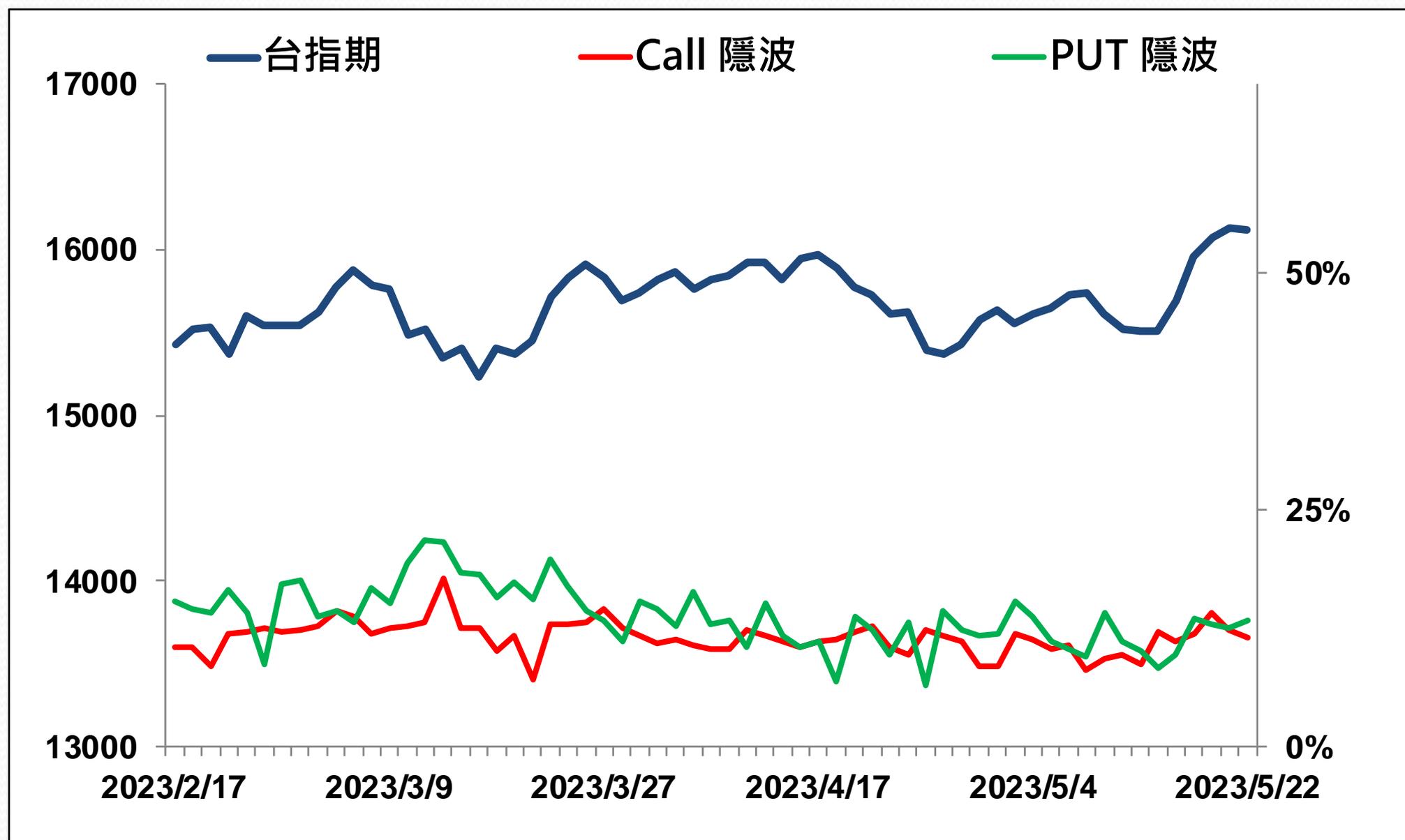
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年5月22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

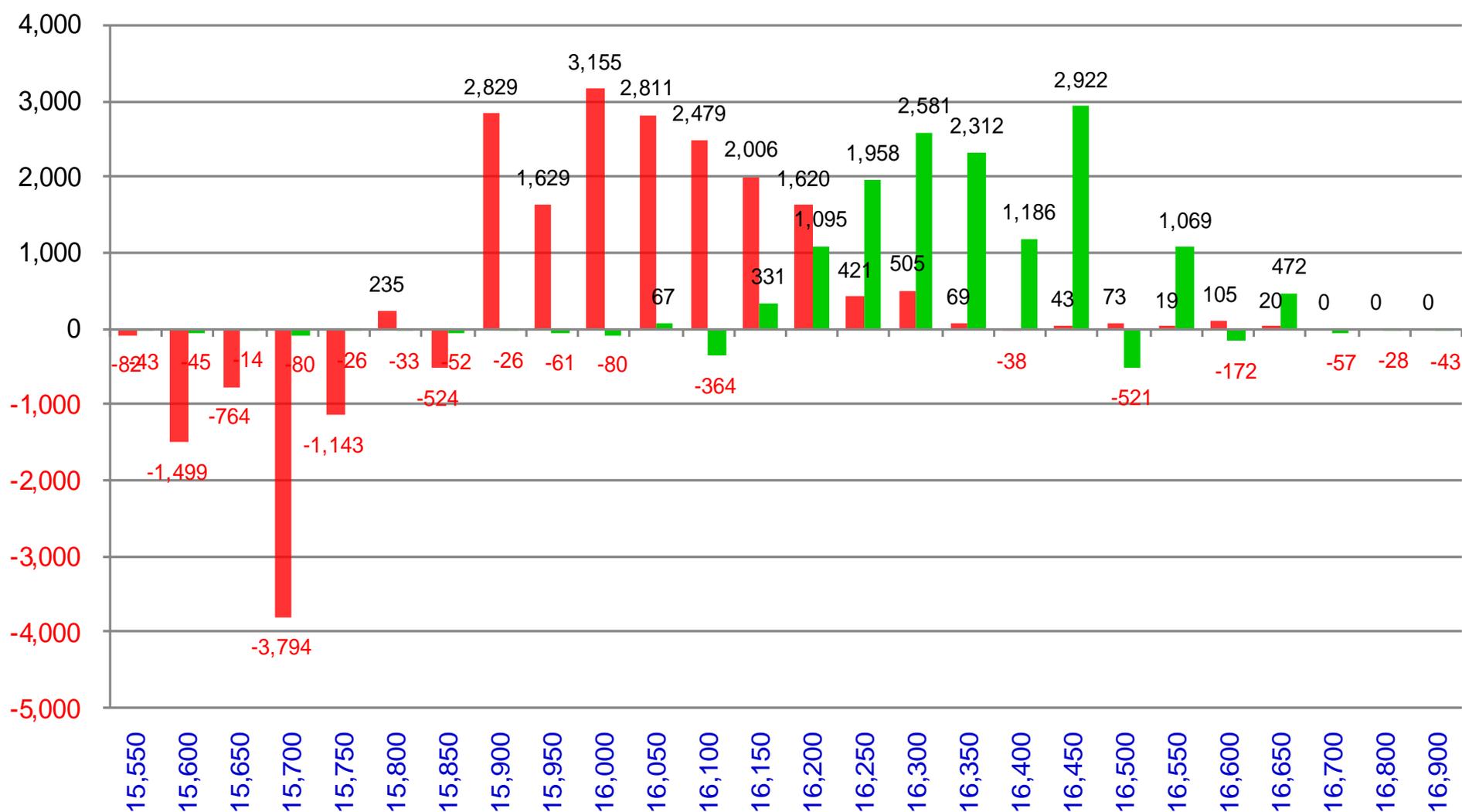


更新日期：2023年5月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：9,972

週選 CALL OI 變化：12,027

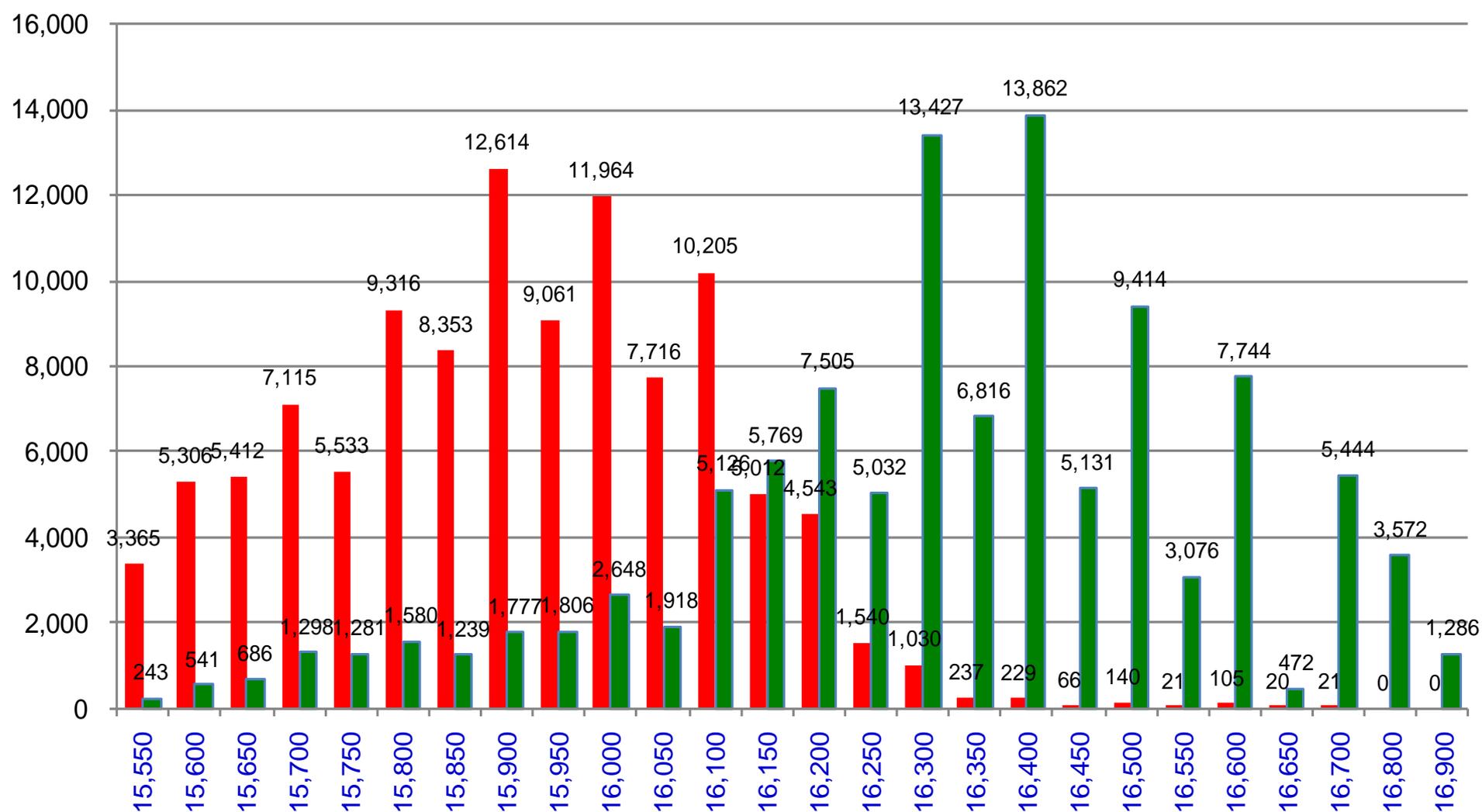


更新日期：2023年5月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：137,015

週選 CALL OI 總額：112,486



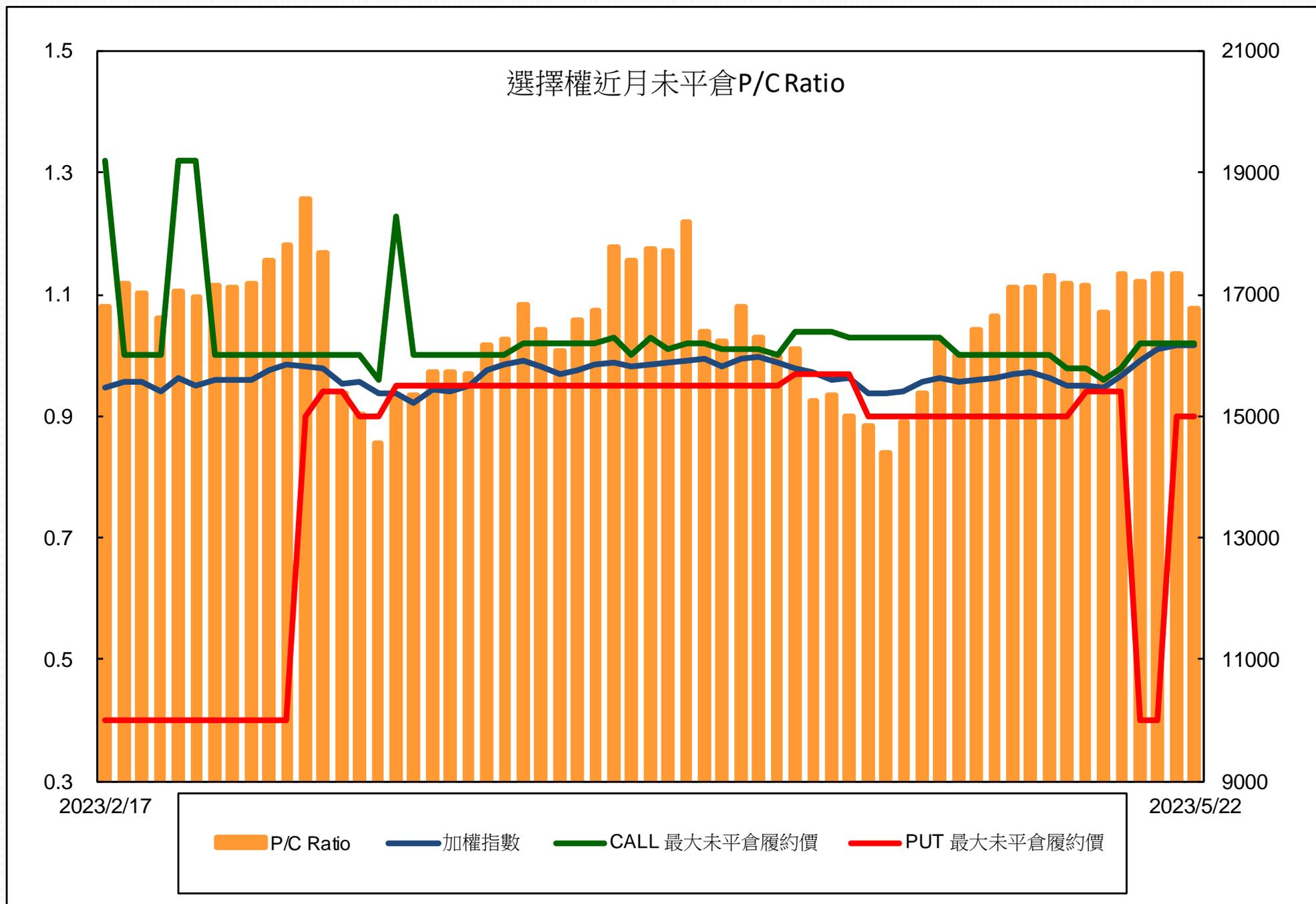
更新日期：2023年5月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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19日	63,500	41,081	22,419
	5月22日	68,935	41,835	27,100
Put	5月19日	51,827	69,894	-18,067
	5月22日	53,035	68,500	-15,465

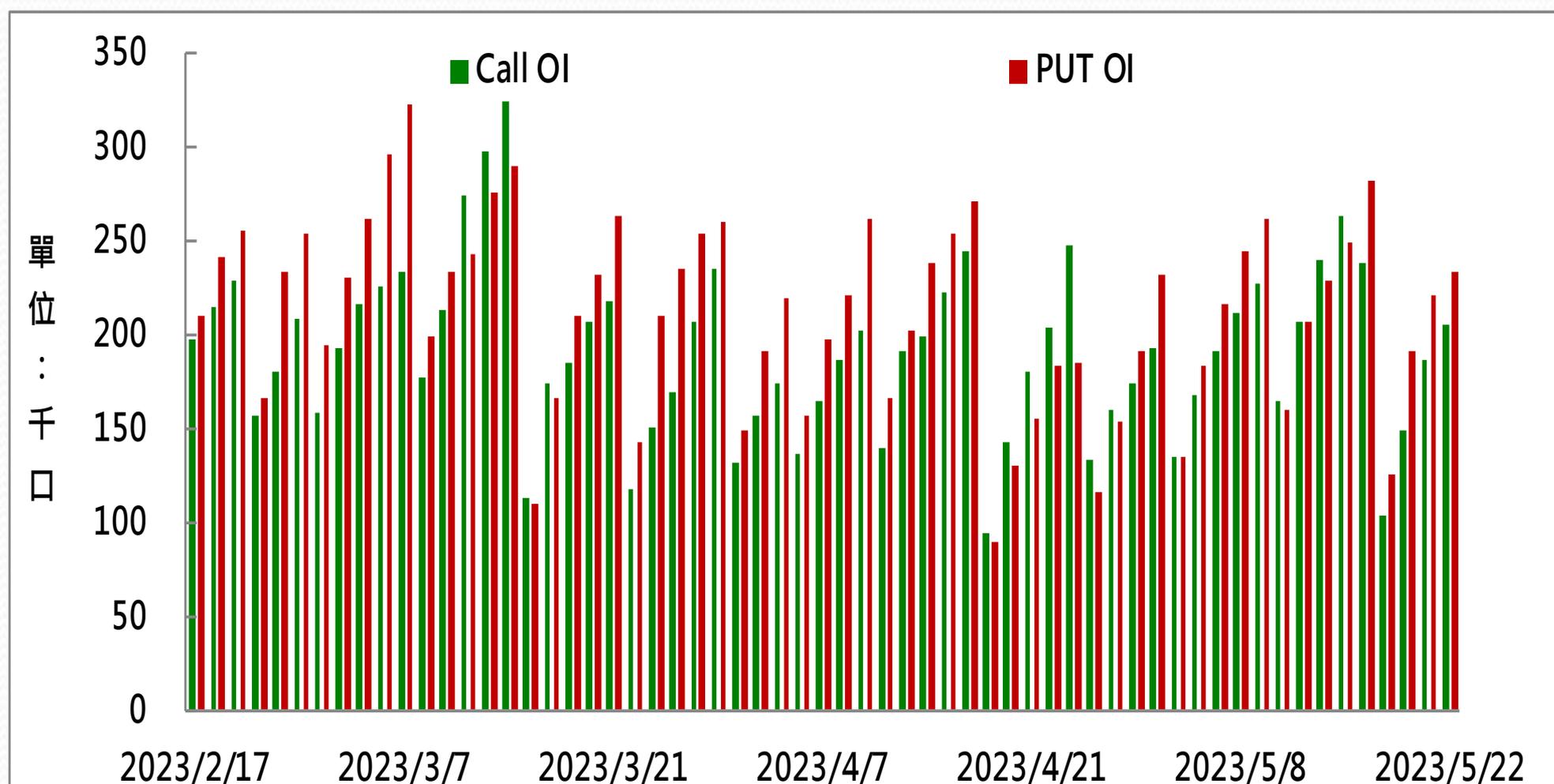
更新日期：2023年5月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年5月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

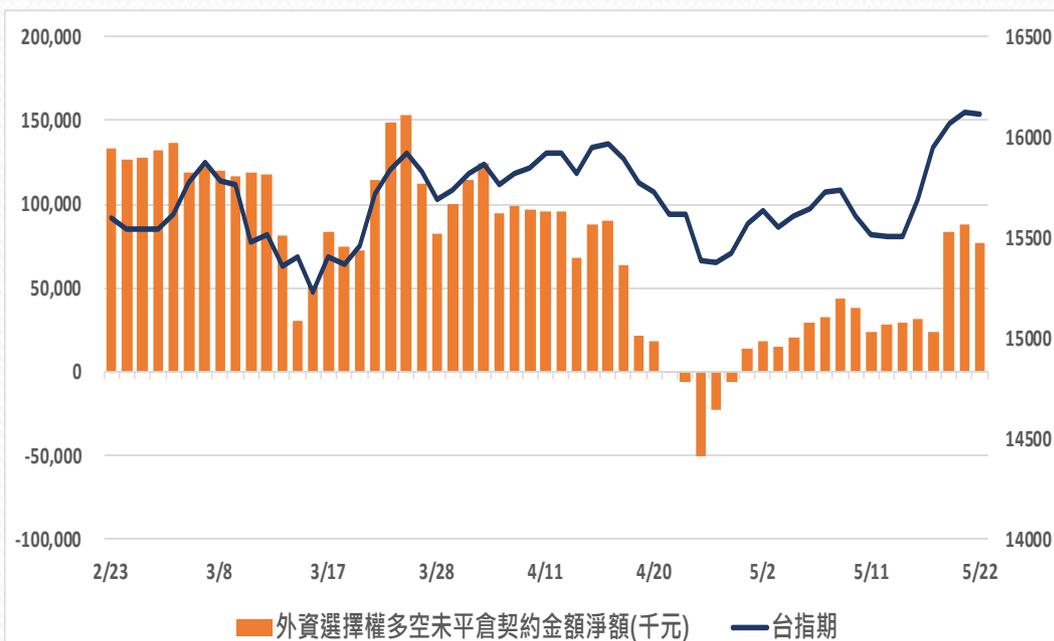
選擇權全月Put Call OI



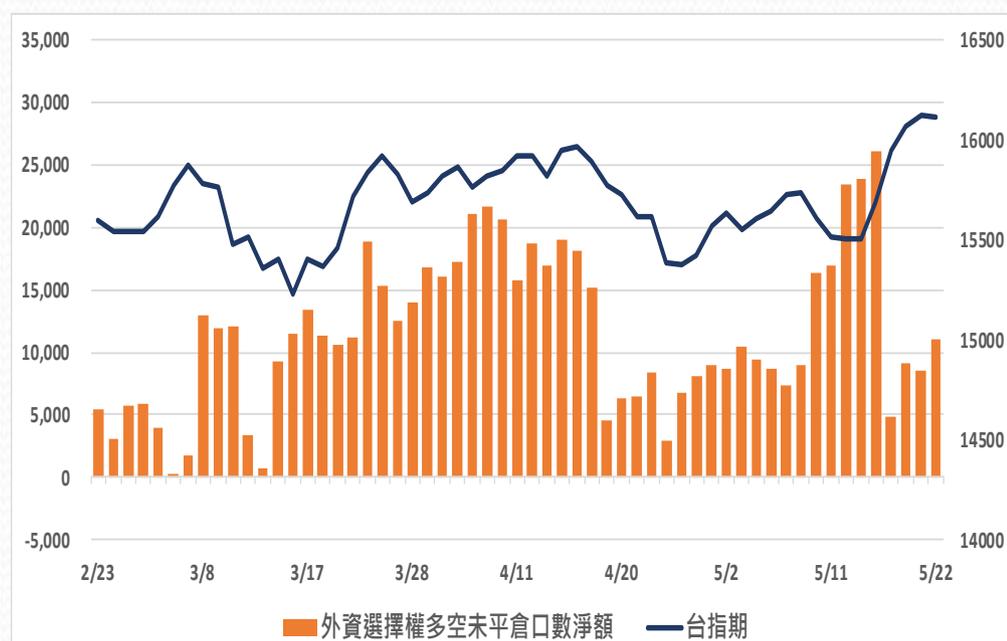
更新日期：2023年5月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



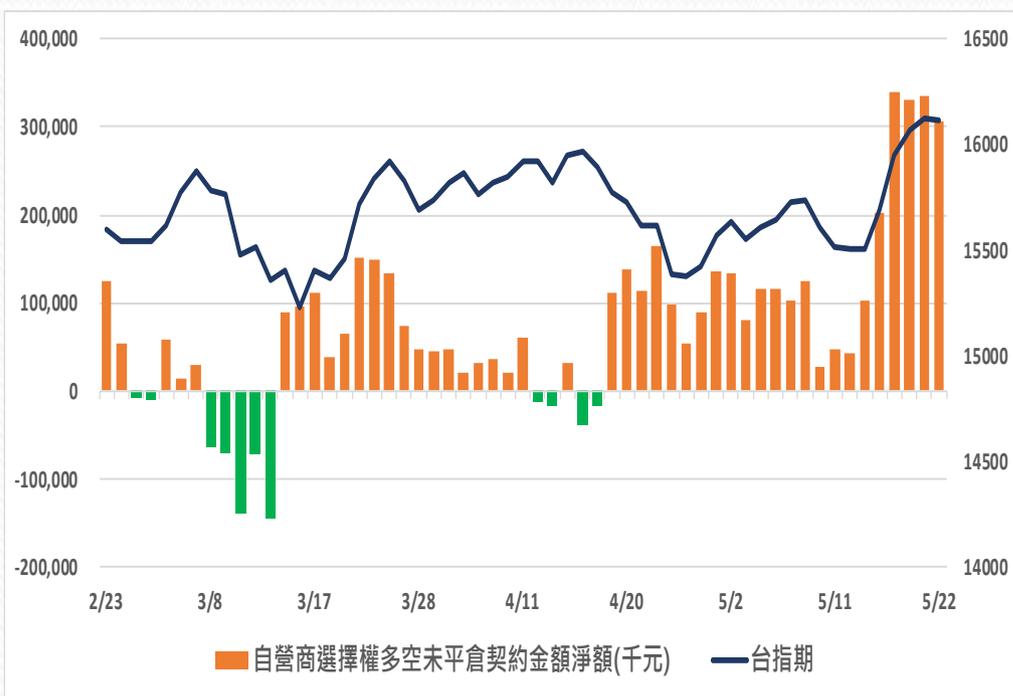
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/16	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
2023/5/22	16115	11,057	+2,525	77,019	-10,729

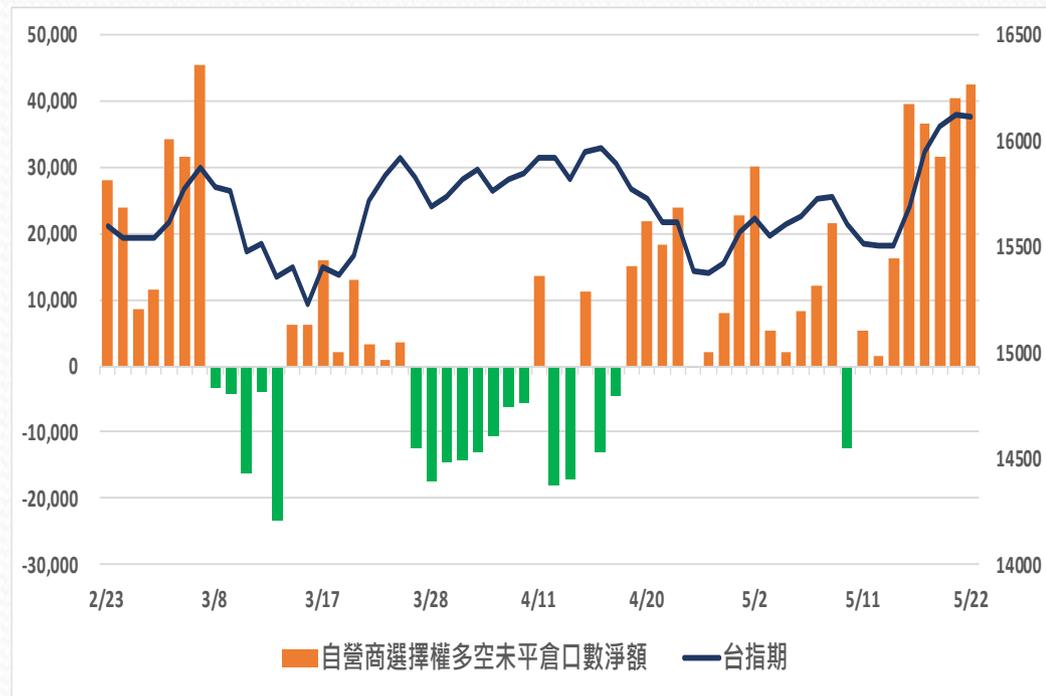
更新日期：2023年5月22日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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
2023/5/16	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
2023/5/22	16115	42,565	+2,079	307,020	-29,086

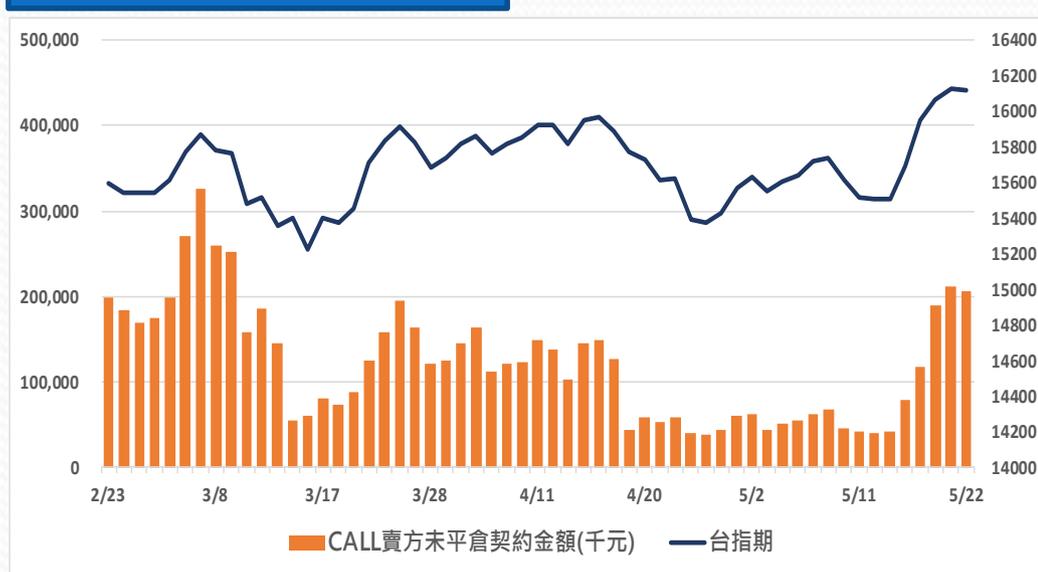
更新日期：2023年5月22日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

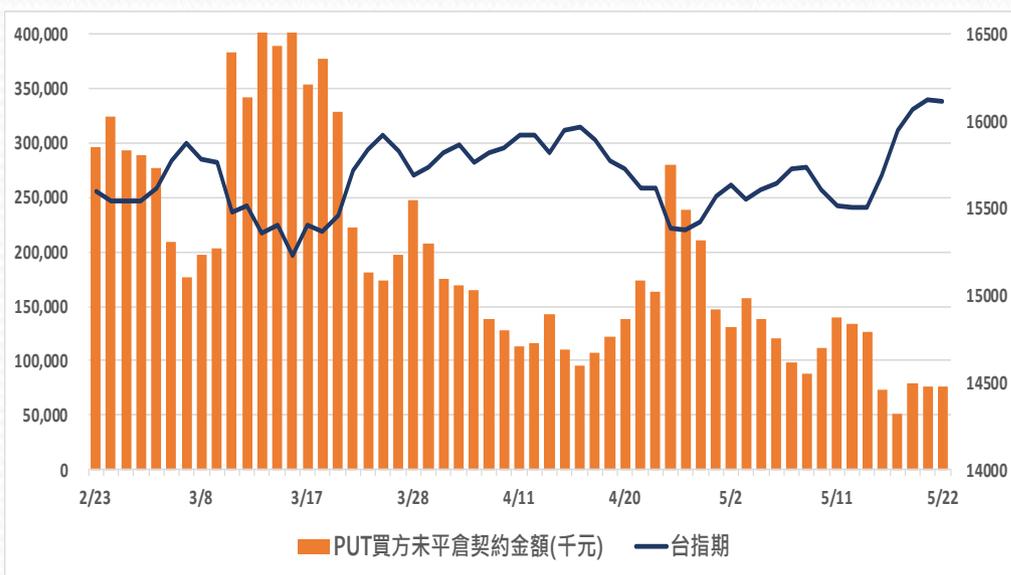
CALL買方未平倉金額



CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



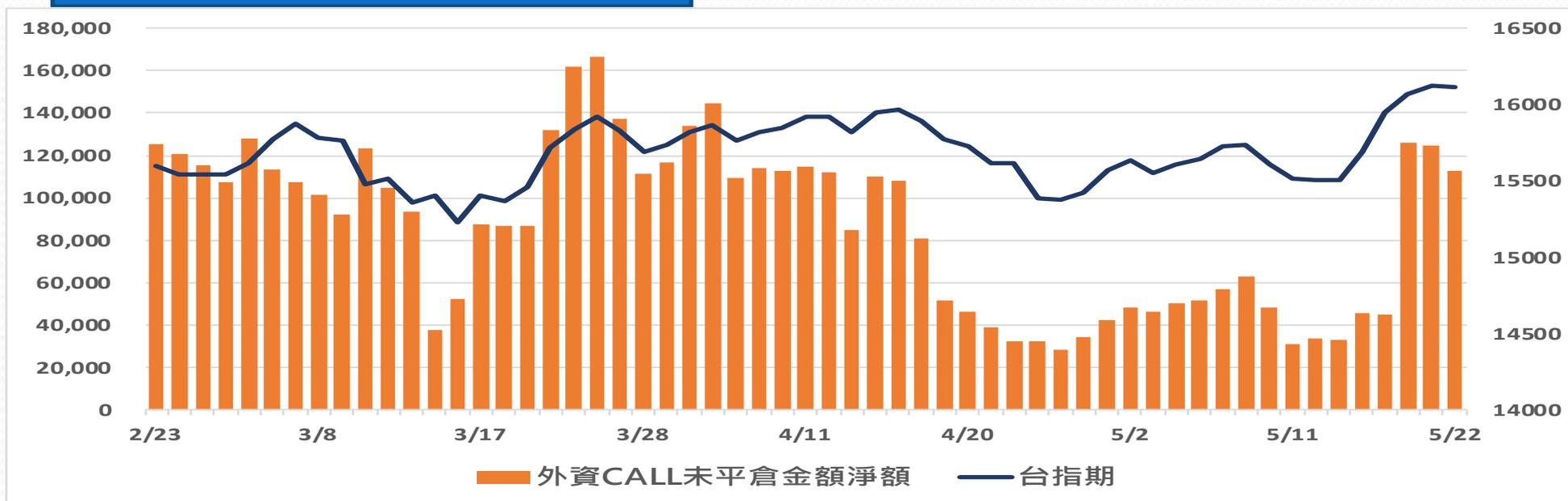
PUT賣方未平倉金額



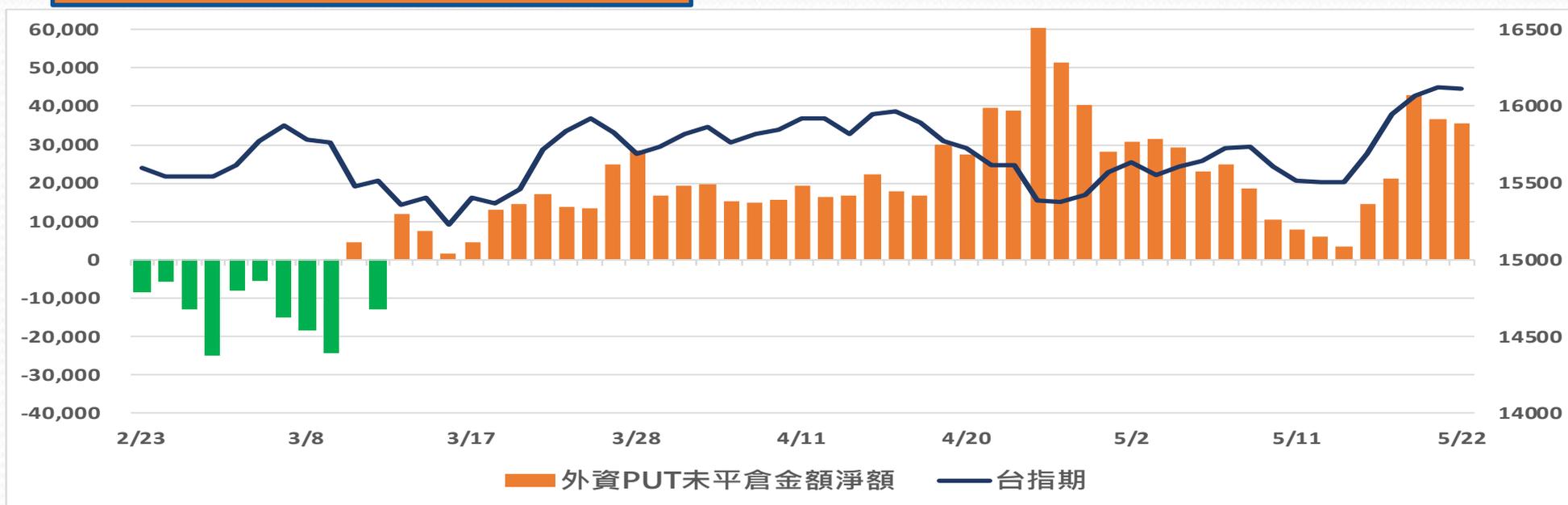
更新日期：2023年5月22日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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22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22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