

台指選擇權OI匯報

日期：2023/5/29 結算日：2023/5/31					日期：2023/5/29 結算日：2023/6/21				
202305W5					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
-38	908	16,000	9,709	-4,582	0	238	15,300	3,703	-223
-278	1,139	16,050	4,049	-4,104	-1	418	15,400	3,727	-189
-222	1,338	16,100	8,021	-436	-6	1,047	15,500	4,520	179
-298	1,937	16,150	5,658	-1,737	-11	1,101	15,600	3,122	69
-329	2,114	16,200	8,426	-1,256	-12	1,271	15,700	2,825	-101
-230	2,624	16,250	5,408	-1,139	-10	1,933	15,800	4,825	478
-1,070	3,402	16,300	9,967	1,823	-162	2,540	15,900	3,463	-19
-403	2,663	16,350	6,077	2,133	-160	3,590	16,000	4,517	534
-3,198	5,570	16,400	9,713	3,650	-129	5,337	16,100	5,892	643 ※
-1,472	3,796	16,450	6,523	3,230	-798	4,014	16,200	2,130	522
-3,829	5,868	16,500	12,460	8,977 ※	-295	5,348	16,300	1,888	11
-627	5,324	16,550	5,220	3,569	-411	3,428	16,400	1,500	51
-2,447	8,136	16,600	6,407	5,862	-1,495	6,784	16,500	1,983	163
744	6,778	16,650	3,683	3,404	-12	5,434	16,600	667	503
3,220	9,036	16,700	4,078	3,671	-295	4,736	16,700	467	394
3,500	5,799	16,750	588	544	※ 2,161	6,716	16,800	215	173
5,592	11,935	16,800	499	350	-1,288	4,922	16,900	101	54
4,140	4,140	16,850	49	49	909	4,635	17,000	51	33
7,029	11,131	16,900	222	123	756	3,256	17,100	22	4
4,270	4,270	16,950	28	28	561	2,000	17,200	19	0
※ 7,460	12,062	17,000	169	169	425	2,048	17,300	26	6
3,430	5,123	17,100	23	23	314	1,450	17,400	79	3
1,980	2,794	17,200	8	8	123	1,891	17,500	22	2
1,333	2,079	17,300	0	0	131	764	17,600	33	0
1,211	1,395	17,400	0	0	88	957	17,700	12	0
103	205	17,500	0	0	-188	726	17,800	101	4
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
29,643	122,815	1.1569	142,080	17,607	1,949	88,607	1.0568	93,642	1,681
昨日 P/C	1.3359	今日增減變化		-0.1790	昨日 P/C	1.1333	今日增減變化		-0.0765

更新日期：2023年5月29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29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	181,495,243	88,041,399	93,453,844	-17,025,417	1,949,409	1,374,775	574,634	-164,259
投信	31,213,058	48,275,136	-17,062,078	1,338,619	358,775	0	358,775	3,458
自營商	12,342,459	50,405,029	-38,062,570	7,665,809	1,278,701	830,202	448,499	-203,010
	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	1,503,854	2,191,557	-687,703	-23,572	58,740	35,553	23,187	80,123
投信	96,064	0	96,064	1,062	0	0	0	0
自營商	525,603	637,261	-111,658	-25,452	521,944	581,628	-59,684	-98,782

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29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	49,548	23,185	26,363	1,055	30,365	18,284	12,081	62
投信	300	250	50	0	250	118	132	0
自營商	73,831	59,031	14,800	-12,627	68,384	76,984	-8,600	2,285
特定法人(週)	0	0	0	0	0	0	0	1,300
特定法人(近月)	29,751	13,007	16,744	-986	7,282	17,996	-10,714	1,004
特定法人(全月)	26,046	11,291	14,755	-7,448	6,509	18,614	-12,105	635
十大交易人(週)	52,229	45,298	6,931	1,703	53,796	36,061	17,735	-2,778
十大交易人(近月)	58,034	35,145	22,889	-2,909	40,552	46,351	-5,799	-980
十大交易人(全月)	107,558	79,901	27,657	-6,383	87,735	81,591	6,144	-168
全市場未沖銷(近月)			88,625	1,949			99,914	1,682
全市場未沖銷(全月)			247,810	38,325			275,882	23,883

更新日期：2023年5月29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 05W5 週 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	17000
	賣權成交最大量	16500	賣權OI最大量	16500
	整體隱含波動率	12.56%	較前一交易日	+0.94%
	買權隱含波動率	13.16%	較前一交易日	+2.44%
	賣權隱含波動率	11.96%	較前一交易日	-0.39%
電子選擇權	買權成交最大量	820	買權OI最大量	780
	賣權成交最大量	770	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	1680
	賣權成交最大量	1620	賣權OI最大量	1560

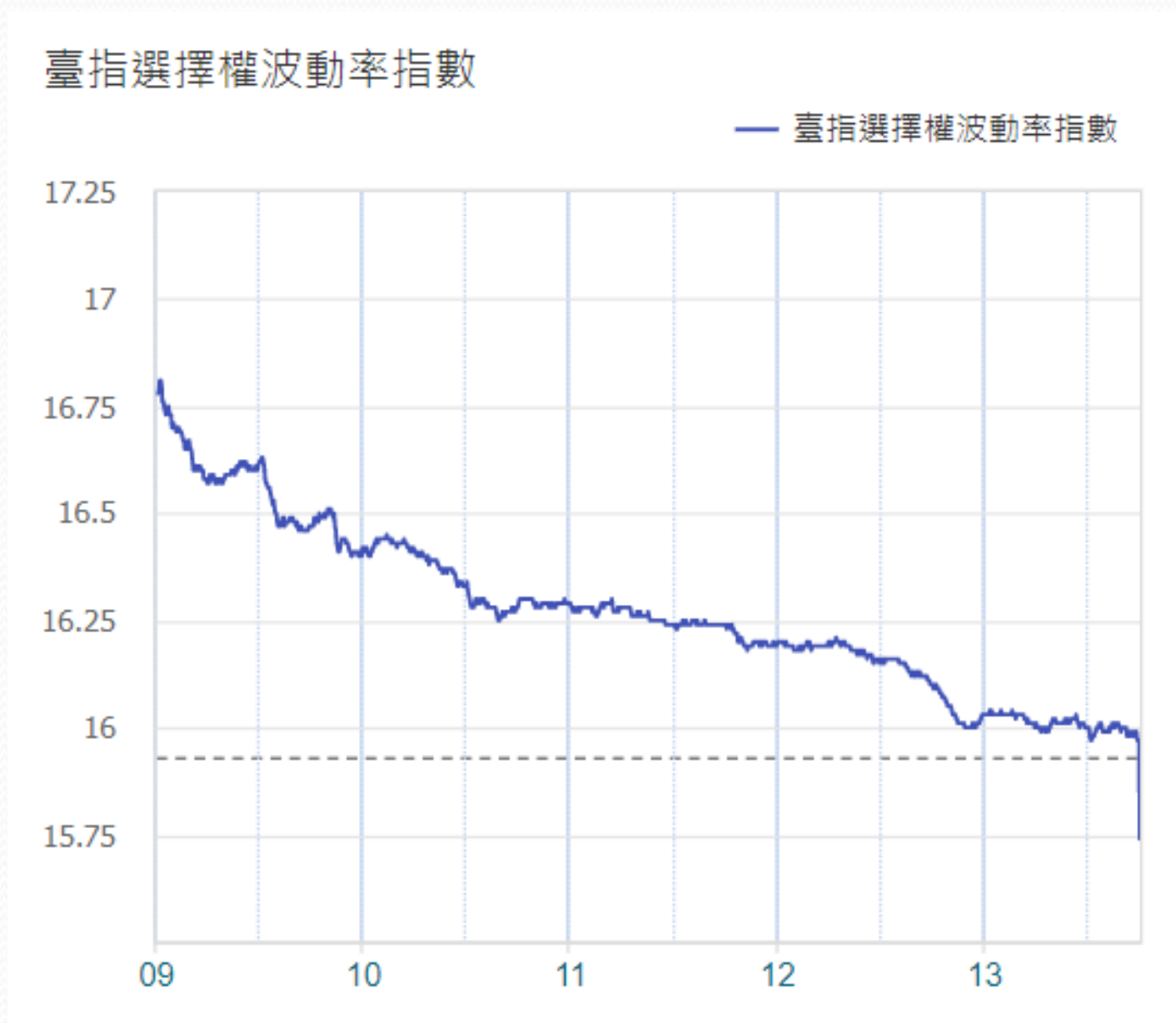
更新日期：2023年5月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	16800	買權OI最大量	16500
	賣權成交最大量	16000	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	14.46%	較前一交易日	+0.50%
	買權隱含波動率	11.70%	較前一交易日	-0.17%
	賣權隱含波動率	17.86%	較前一交易日	-0.12%
	成交量P/C_Ratio值	0.777	較前一交易日	-0.19
	未平倉P/C_Ratio值	1.127	較前一交易日	-0.01
電子選擇權	買權成交最大量	820	買權OI最大量	780
	賣權成交最大量	770	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	1680
	賣權成交最大量	1620	賣權OI最大量	1560

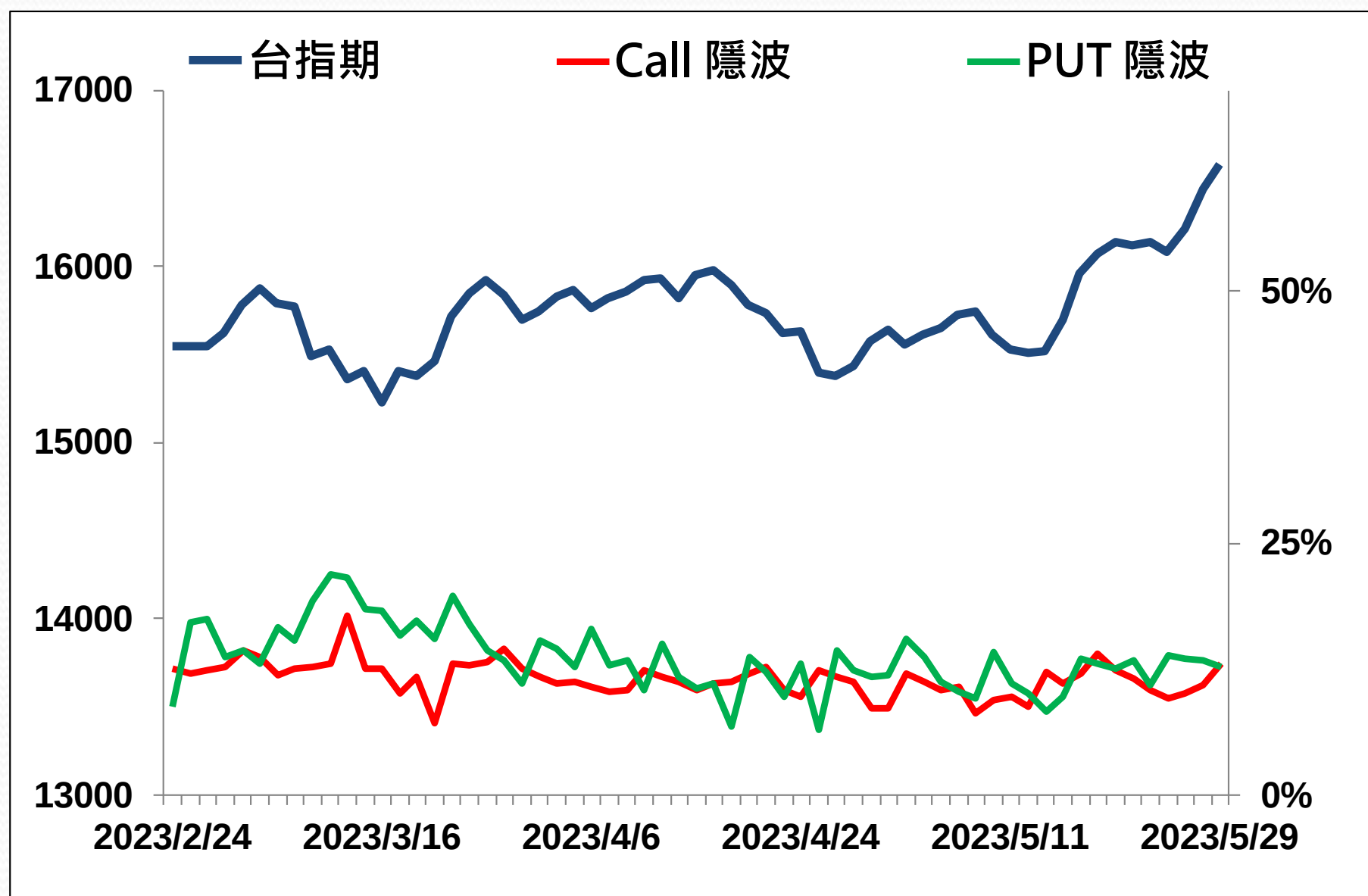
更新日期：2023年5月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



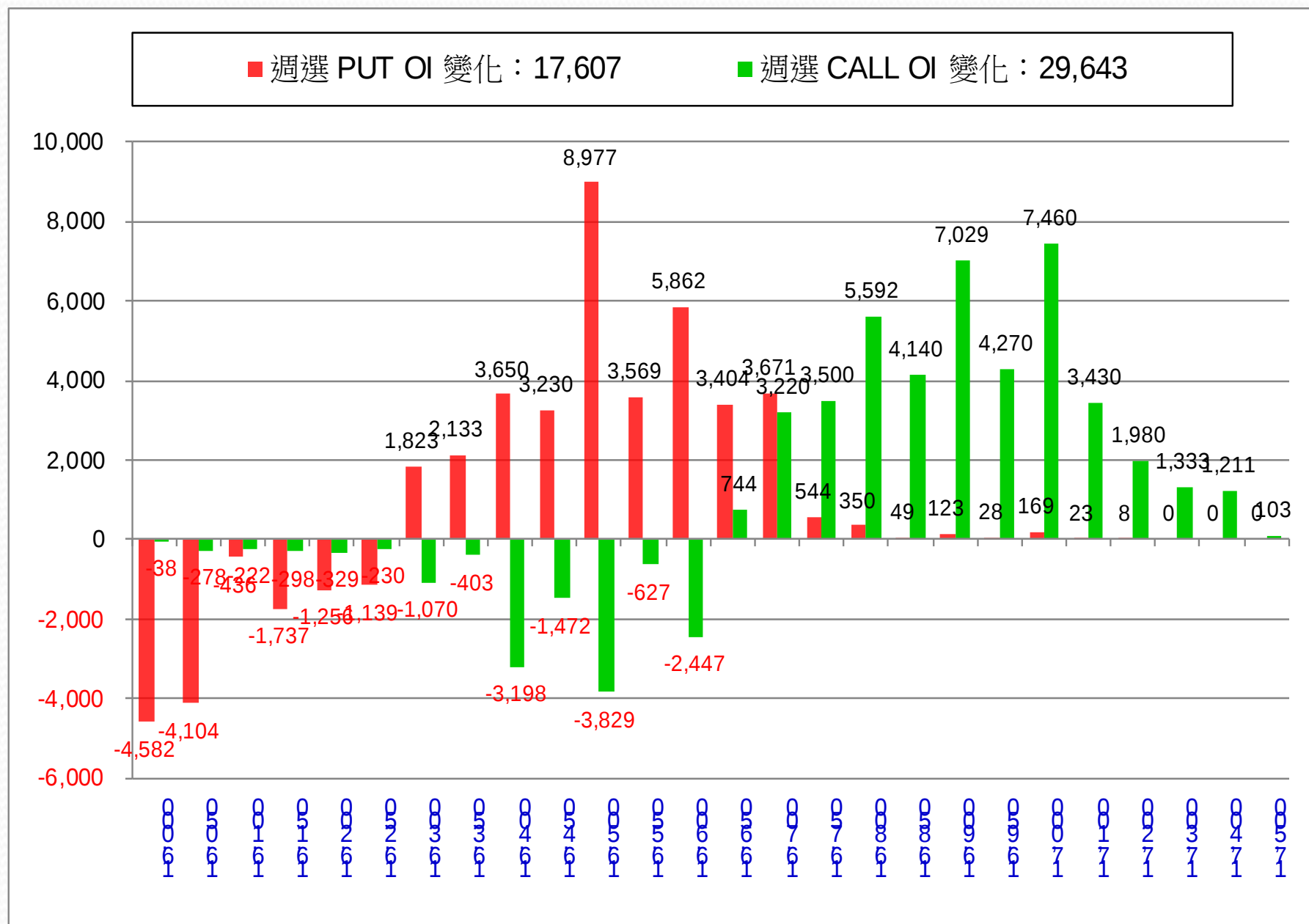
更新日期：2023年5月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



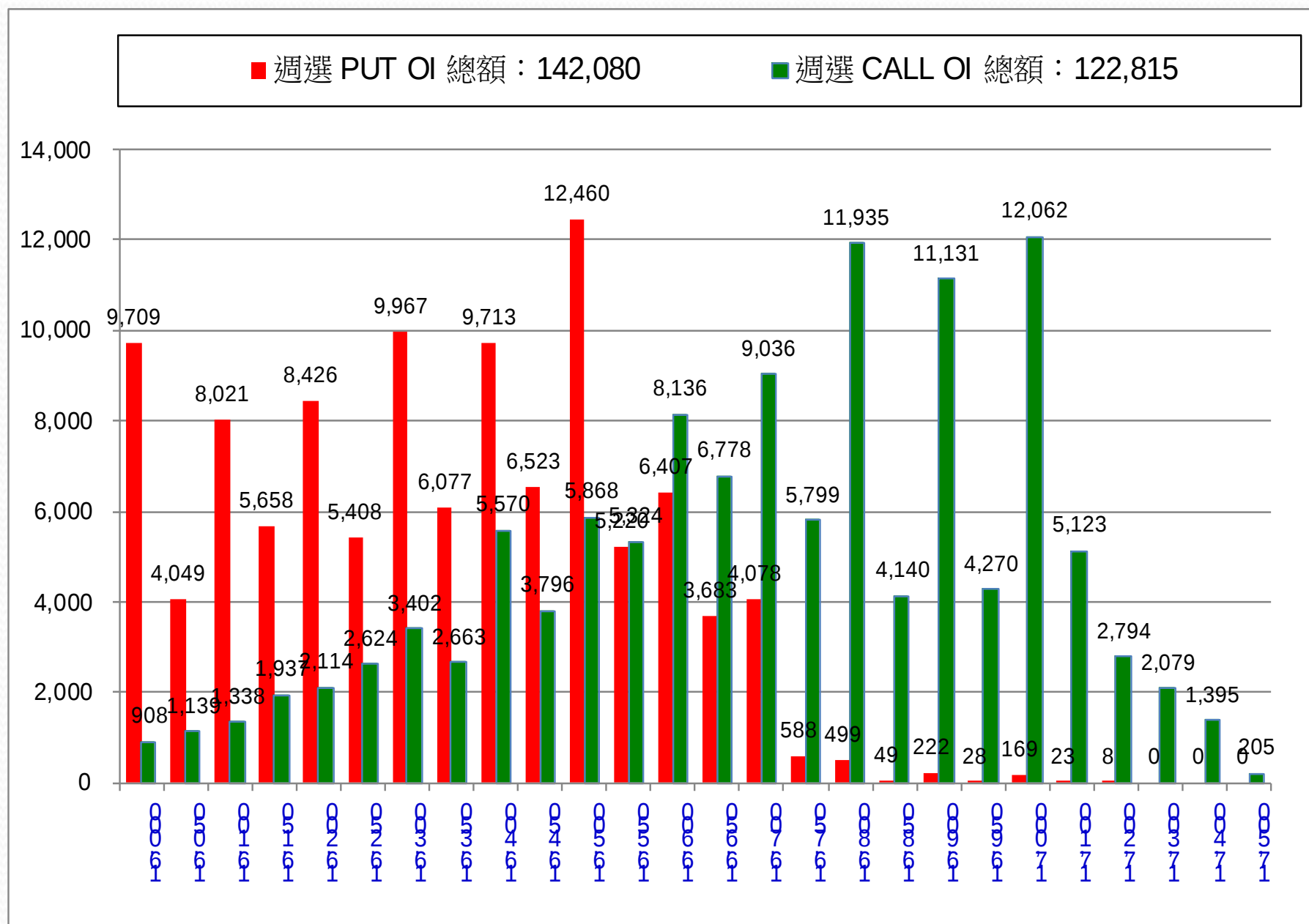
更新日期：2023年5月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2023年5月29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



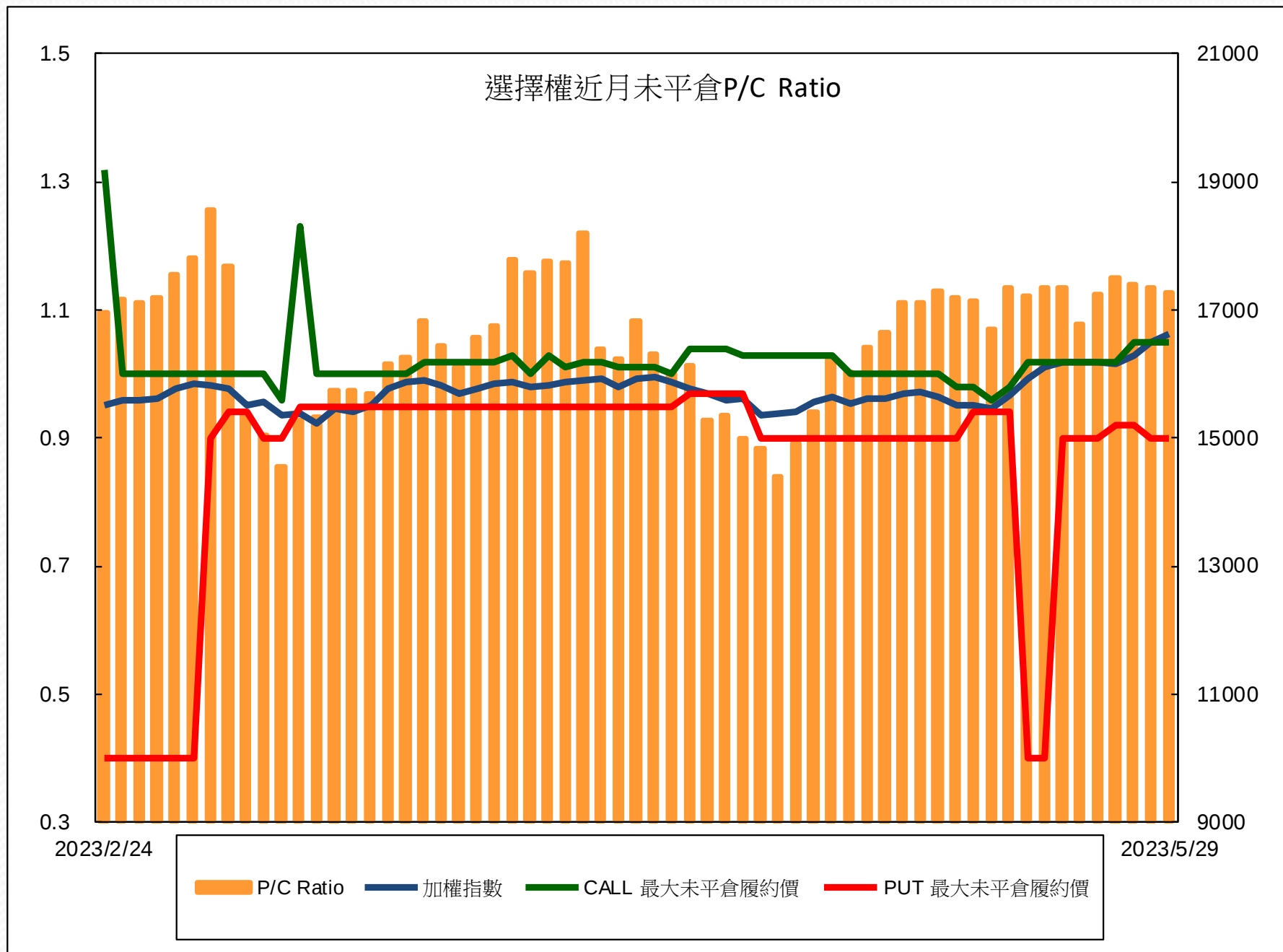
更新日期：2023年5月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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26日	69,237	41,810	27,427
	5月29日	73,831	59,031	14,800
Put	5月26日	61,175	72,060	-10,885
	5月29日	68,384	76,984	-8,600

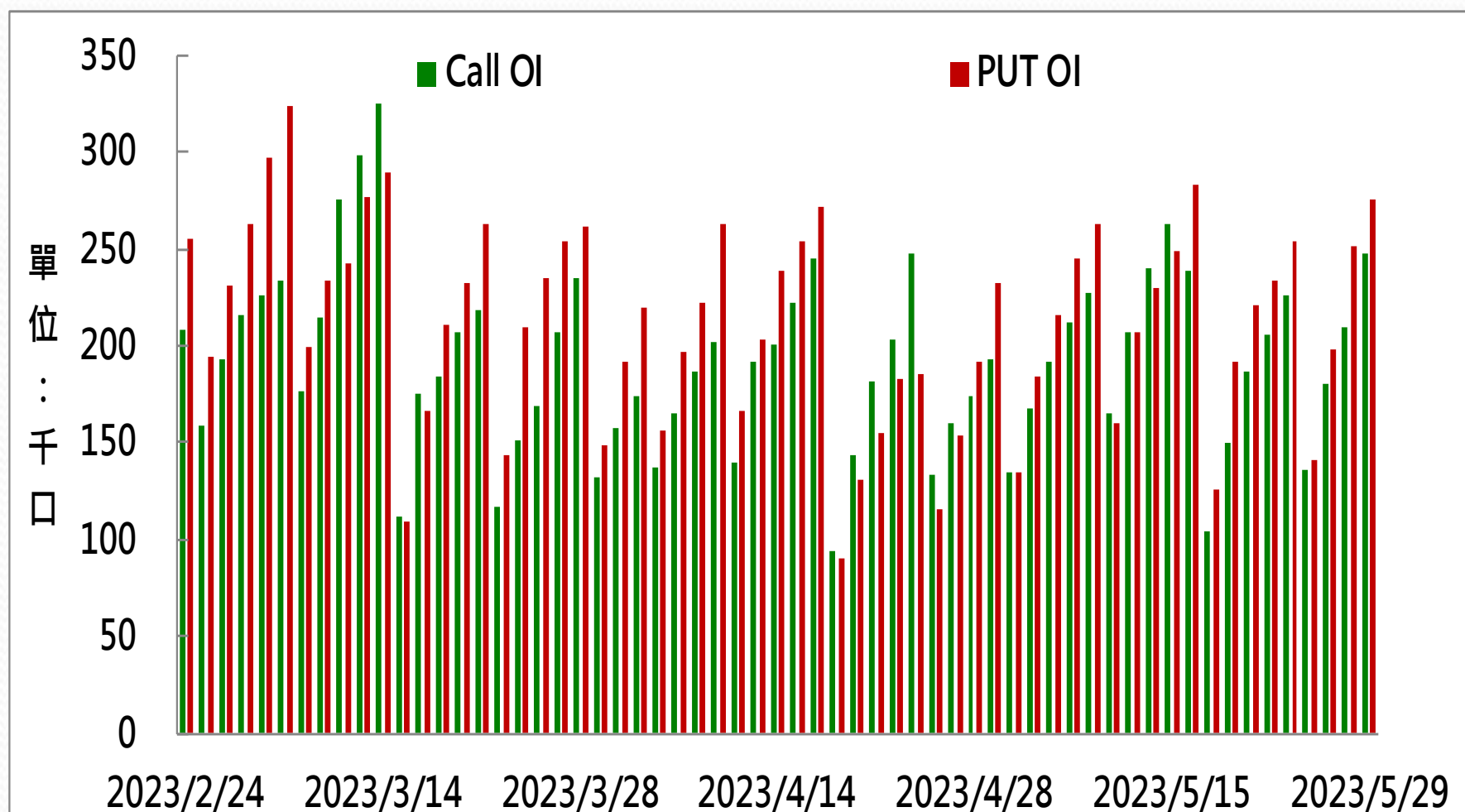
更新日期：2023年5月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年5月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

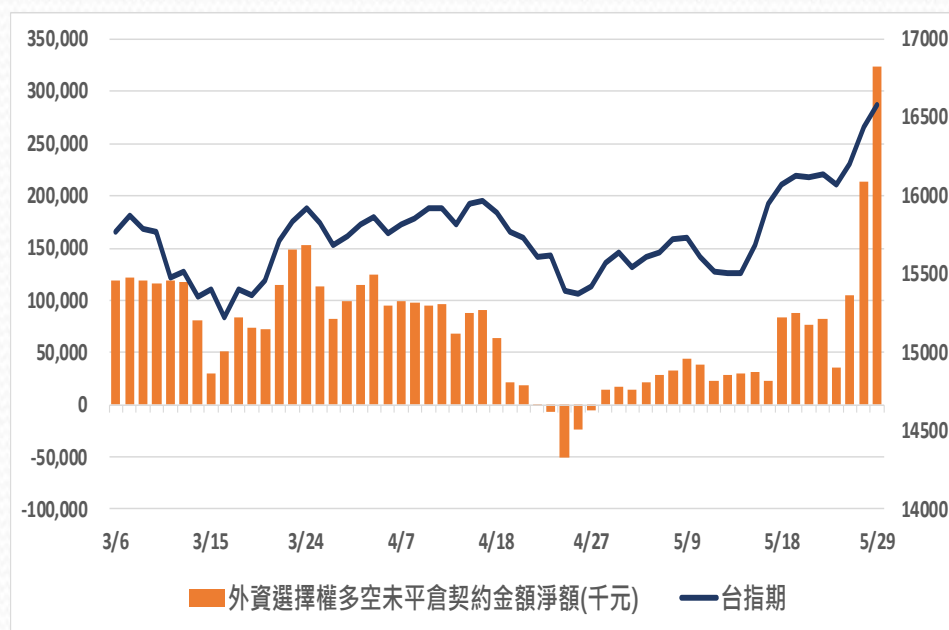
選擇權全月Put Call OI



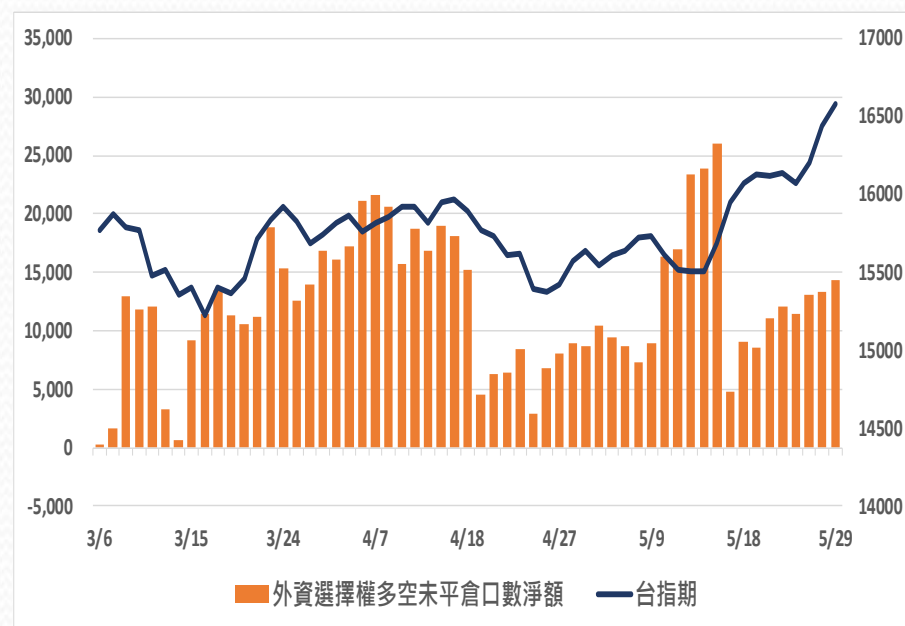
更新日期：2023年5月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



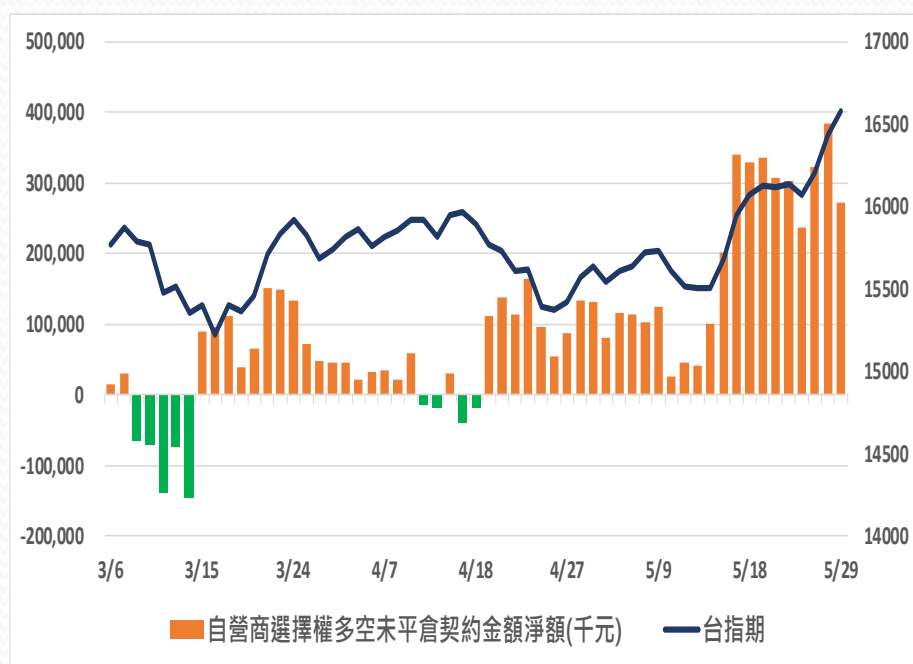
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/23	16135	12,013	+956	82,757	+5,738
2023/5/24	16069	11,402	-611	35,974	-46,783
2023/5/25	16205	13,097	+1,695	104,258	+68,284
2023/5/26	16438	13,289	+192	213,768	+109,510
2023/5/29	16578	14,282	+993	323,960	+110,192

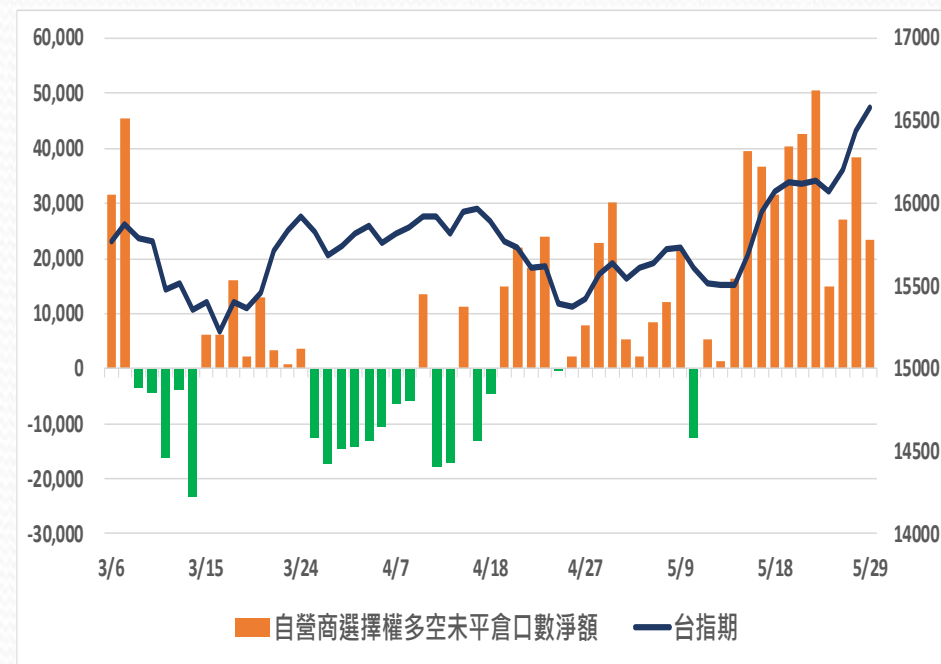
更新日期：2023年5月29日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



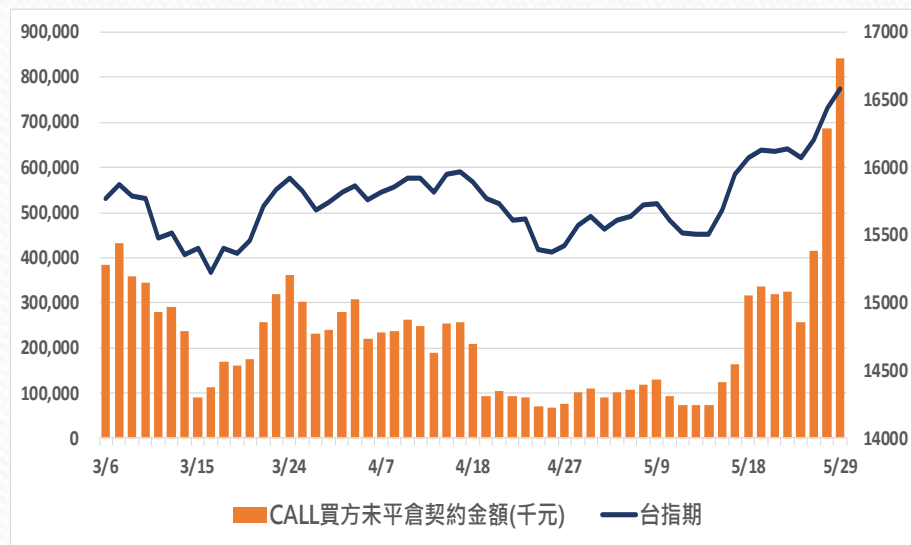
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/23	16135	50,646	+8,081	303,875	-3,145
2023/5/24	16069	14,911	-35,735	237,051	-66,824
2023/5/25	16205	27,126	+12,215	323,250	+86,199
2023/5/26	16438	38,312	+11,186	384,918	+61,668
2023/5/29	16578	23,400	-14,912	272,430	-112,488

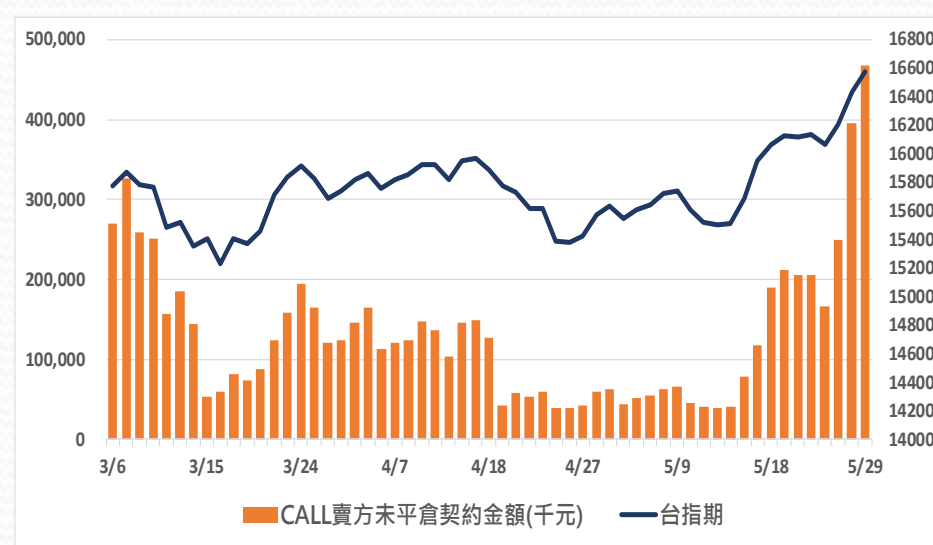
更新日期：2023年5月29日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

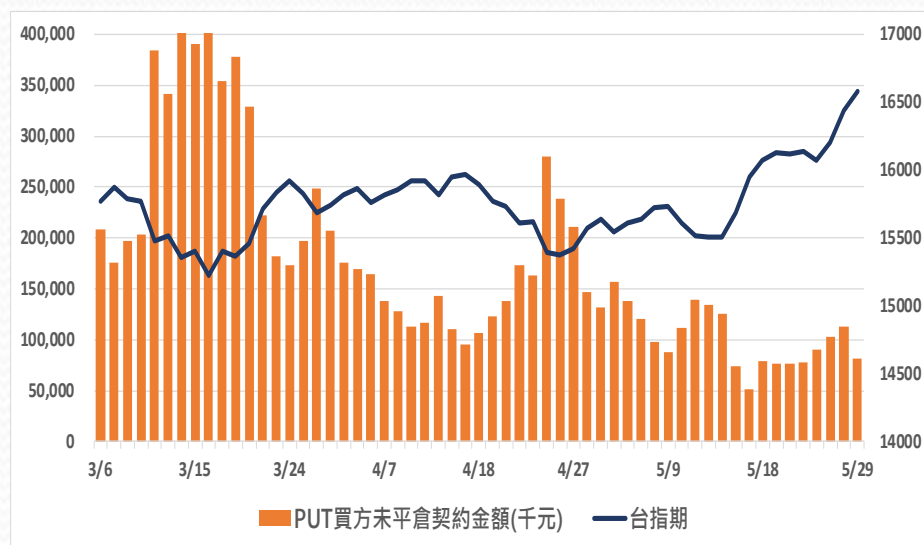
CALL買方未平倉金額



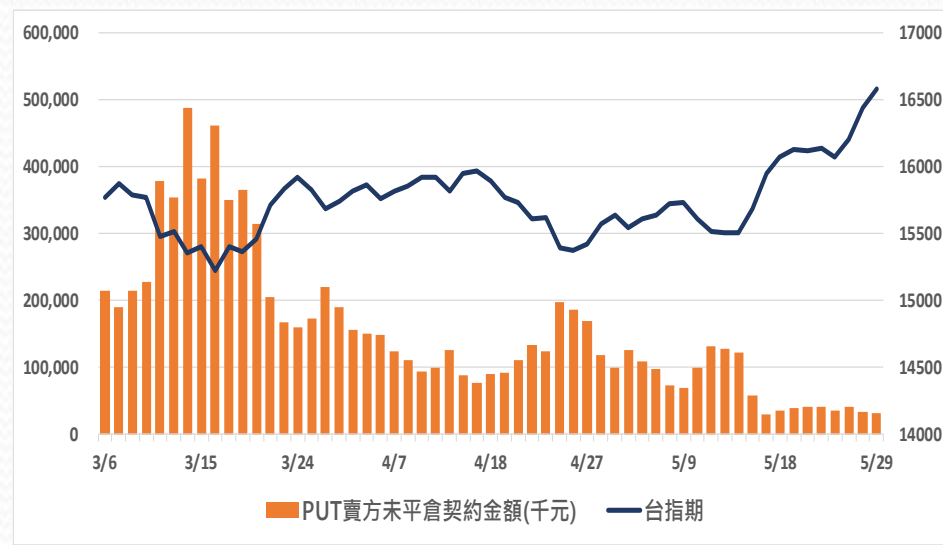
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



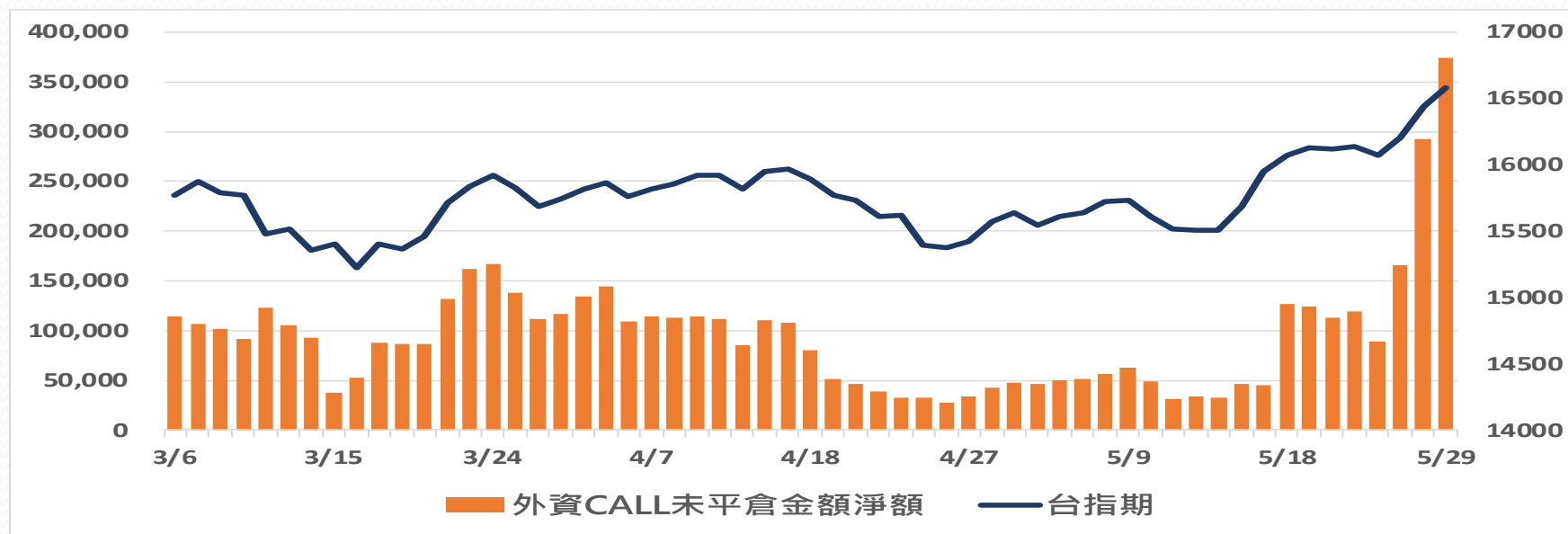
PUT賣方未平倉金額



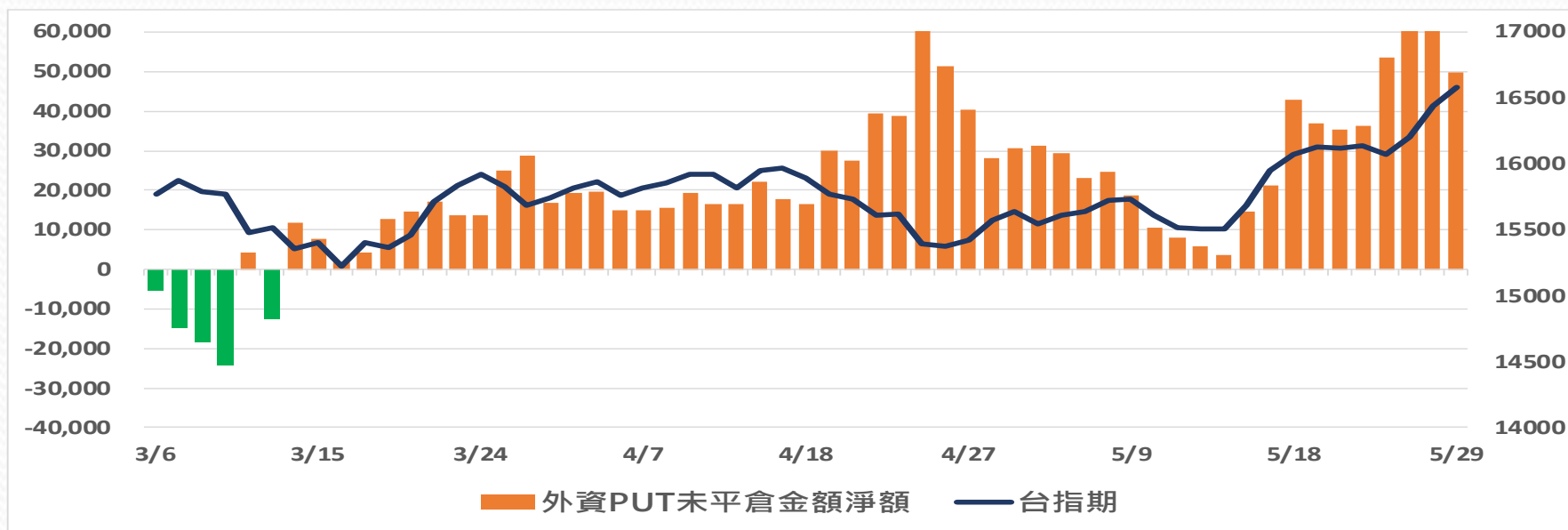
更新日期：2023年5月29日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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29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29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