

台指選擇權OI匯報

日期：2023/5/8 結算日：2023/5/10					日期：2023/5/8 結算日：2023/5/17				
202305W2					202305 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
-1	44	15,200	5,793	-1,012	0	21	14,700	3,367	-250
-5	48	15,250	2,980	-4,786	2	30	14,800	2,764	43
-45	182	15,300	5,195	-2,172	0	46	14,900	3,032	3
-88	175	15,350	4,167	-297	-5	100	15,000	16,016	2,455 ※
-258	434	15,400	7,766	-2,997	-1	103	15,100	3,824	-1,515
-79	327	15,450	10,198	4,702	-22	338	15,200	8,135	-34
-179	1,314	15,500	10,261	3,437	-48	758	15,300	4,712	241
-510	1,366	15,550	6,887	3,341	-53	1,516	15,400	6,642	2,057
-1,069	4,435	15,600	8,756	4,100	-145	1,790	15,500	4,072	968
-353	3,799	15,650	6,154	4,179	-182	2,488	15,600	3,385	609
-79	6,809	15,700	6,984	4,867 ※	366	4,880	15,700	6,707	836
1,085	8,314	15,750	4,857	4,095	572	5,999	15,800	1,335	217
※ 4,228	13,473	15,800	1,989	1,112	213	6,150	15,900	946	54
3,739	12,463	15,850	708	579	※ 1,303	12,288	16,000	404	26
4,043	12,894	15,900	436	248	852	6,787	16,100	122	-5
1,513	5,140	15,950	204	63	332	5,286	16,200	299	18
1,427	6,901	16,000	82	74	35	8,625	16,300	205	58
222	1,854	16,050	121	0	-43	6,846	16,400	68	0
194	4,492	16,100	25	0	-47	3,852	16,500	18	1
-250	1,811	16,200	20	0	-16	2,652	16,600	13	0
5	618	16,300	1	0	8	970	16,700	14	0
2	67	16,400	0	0	-6	1,082	16,800	20	0
0	823	16,500	0	0	-7	534	16,900	0	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
13,541	88,171	1.2076	106,477	16,833	2,685	78,100	1.1010	85,992	4,799
昨日 P/C	1.2012	今日增減變化	0.0064		昨日 P/C	1.0642	今日增減變化	0.0369	

更新日期：2023年5月8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8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	104,267,744	54,558,921	49,708,823	-5,838,297	2,052,767	724,352	1,328,415	63,529	
投信	29,593,831	51,637,477	-22,043,646	496,476	510,272	0	510,272	3,132	
自營商	38,482,093	23,735,494	14,746,599	294,161	1,439,775	655,873	783,902	13,629	
	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	525,091	868,291	-343,200	-33,206	23,076	70,766	-47,690	-4,769	
投信	124,946	0	124,946	632	0	0	0	0	
自營商	314,728	324,196	-9,468	31,426	319,960	252,031	67,929	242	

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8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	36,704	14,338	22,366	1,950	32,956	17,906	15,050	3,297	
投信	100	100	0	0	450	113	337	0	
自營商	66,298	50,510	15,788	-2,962	61,794	58,087	3,707	-6,764	
特定法人(週)	1,800	0	1,800	1,200	0	3,414	-3,414	-284	
特定法人(近月)	26,378	10,386	15,992	1,413	7,105	20,009	-12,904	-1,177	
特定法人(全月)	26,924	8,340	18,584	-1,212	8,995	25,975	-16,980	-3,294	
十大交易人(週)	25,390	22,820	2,570	-4,342	32,053	21,886	10,167	6,206	
十大交易人(近月)	47,344	31,819	15,525	-1,763	34,996	47,196	-12,200	-284	
十大交易人(全月)	92,870	56,220	36,650	-3,841	69,986	82,270	-12,284	6,967	
全市場未沖銷(近月)			86,283	4,215			95,904	8,570	
全市場未沖銷(全月)			212,421	20,348			244,887	28,538	

更新日期：2023年5月8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05W2週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15800	買權OI最大量	15800
	賣權成交最大量	15700	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	10.01%	較前一交易日	-0.32%
	買權隱含波動率	10.53%	較前一交易日	+0.43%
	賣權隱含波動率	9.57%	較前一交易日	-0.98%
電子選擇權	買權成交最大量	750	買權OI最大量	750
	賣權成交最大量	705	賣權OI最大量	725
金融選擇權	買權成交最大量	1580	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1500

更新日期：2023年5月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

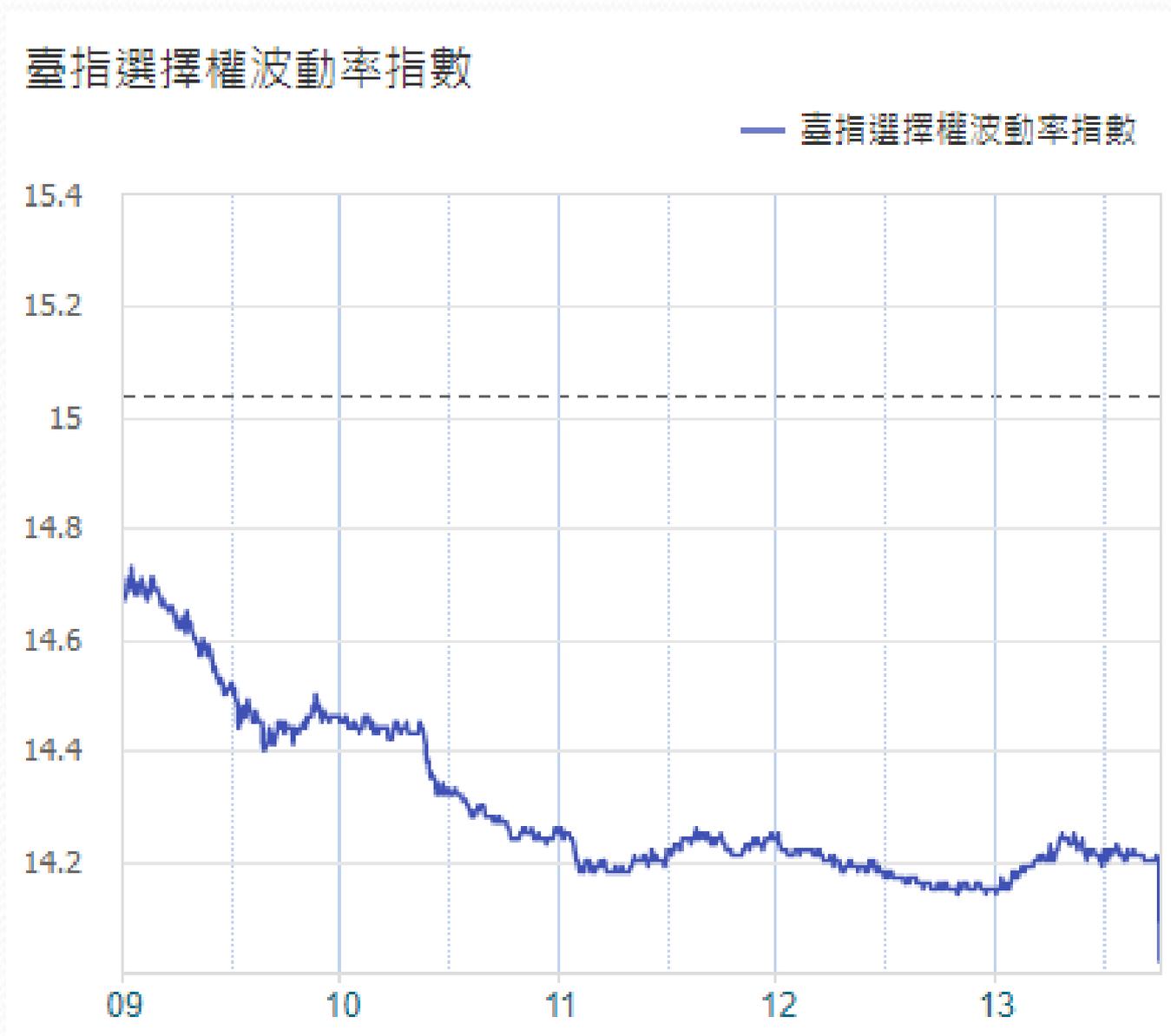
台指選擇權匯報

2023年05月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16000	買權OI最大量	16000
	賣權成交最大量	15400	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	12.37%	較前一交易日	+0.36%
	買權隱含波動率	11.63%	較前一交易日	-0.05%
	賣權隱含波動率	12.94%	較前一交易日	-0.61%
	成交量P/C_Ratio值	1.393	較前一交易日	+0.15
	未平倉P/C_Ratio值	1.112	較前一交易日	+0.05
電子選擇權	買權成交最大量	750	買權OI最大量	750
	賣權成交最大量	705	賣權OI最大量	725
金融選擇權	買權成交最大量	1580	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1500

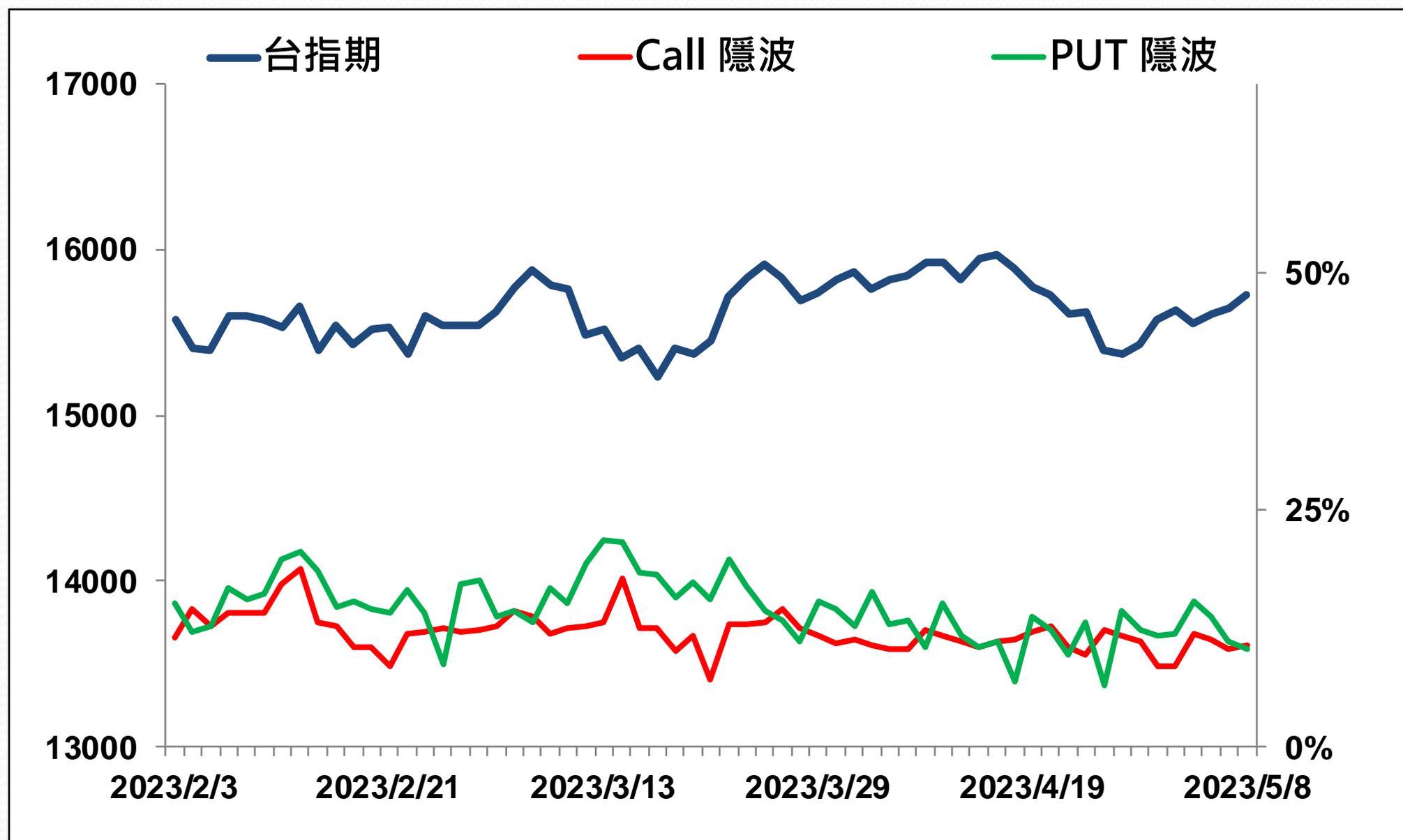
更新日期：2023年5月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



更新日期：2023年5月8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

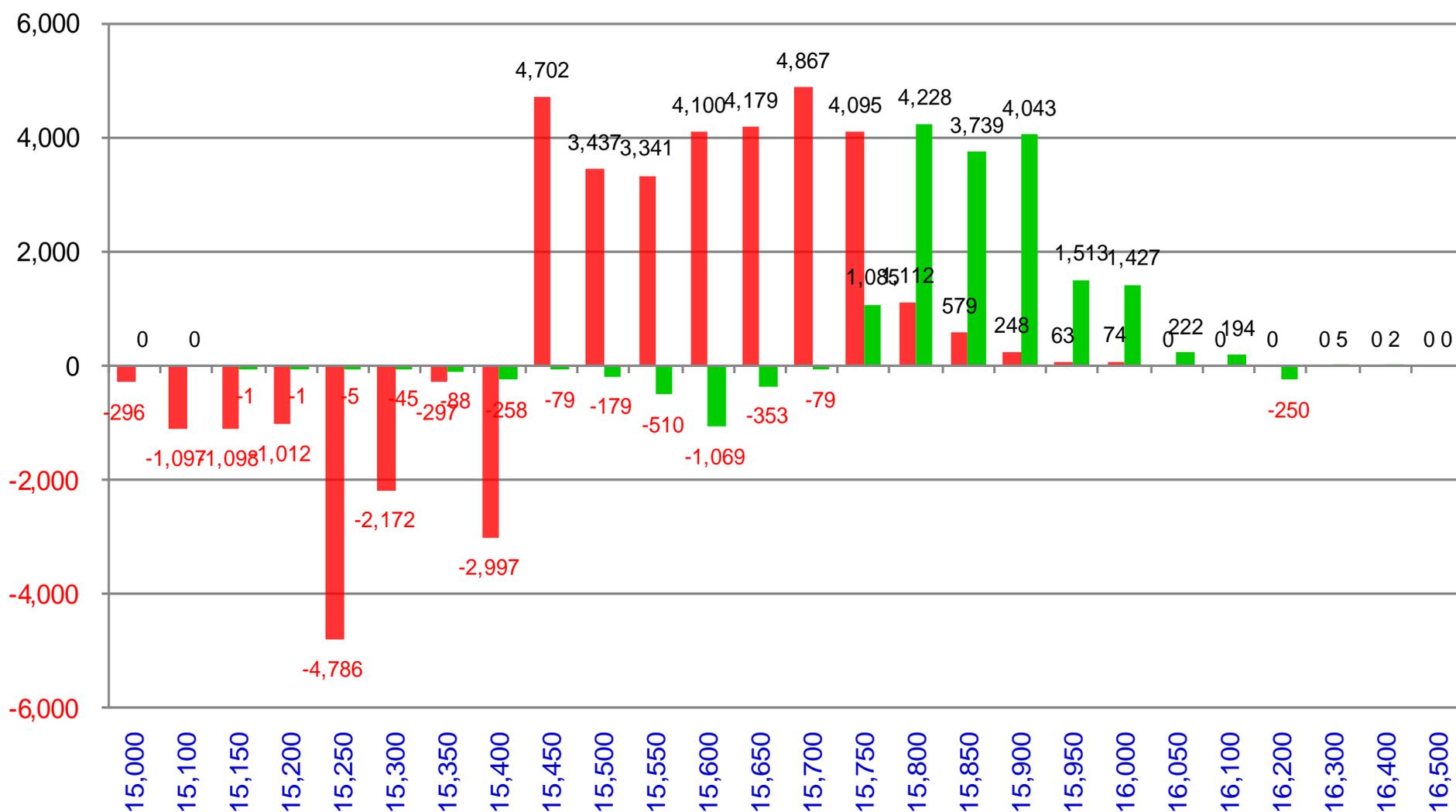


更新日期：2023年5月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：16,833

週選 CALL OI 變化：13,541

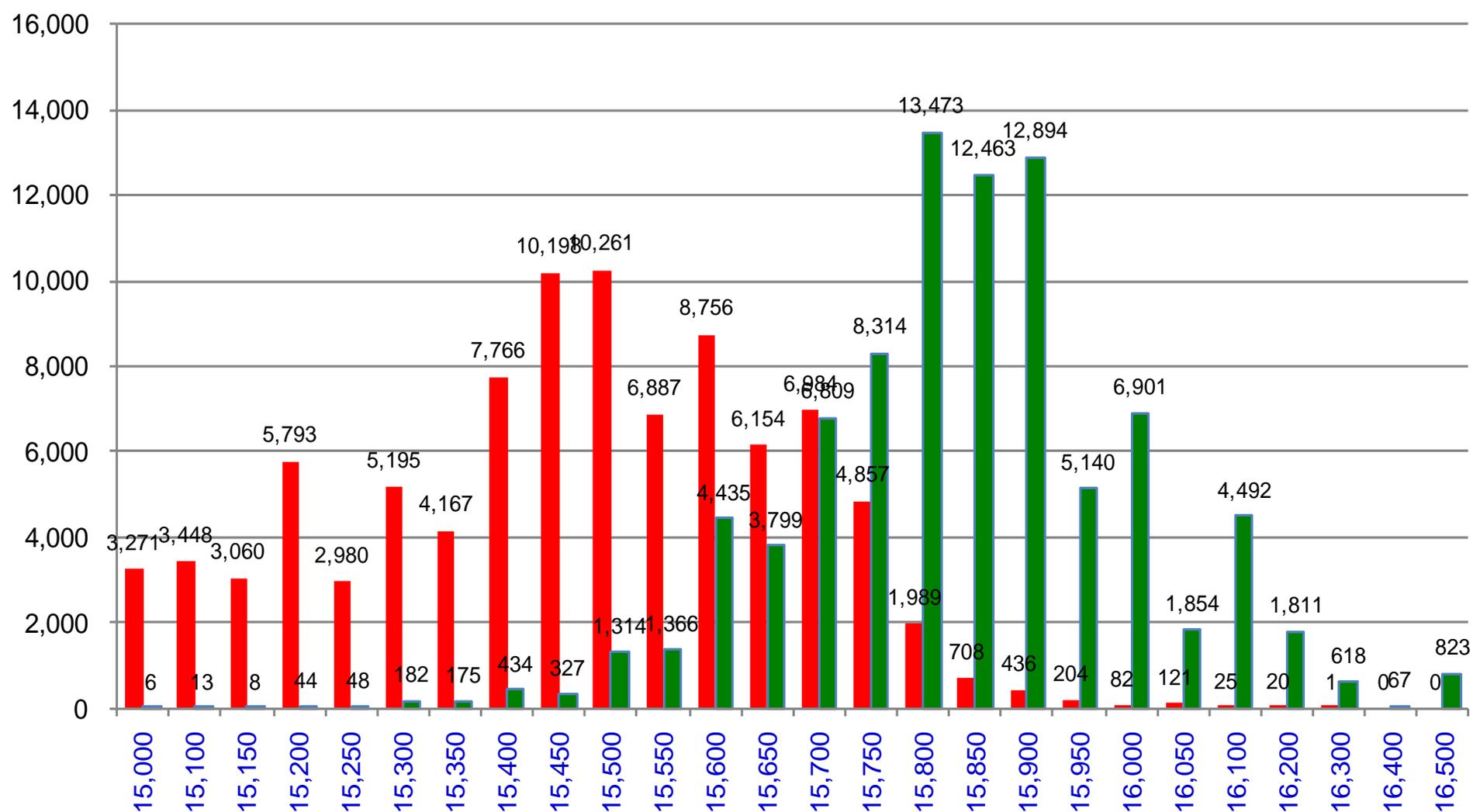


更新日期：2023年5月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：106,477

週選 CALL OI 總額：88,171



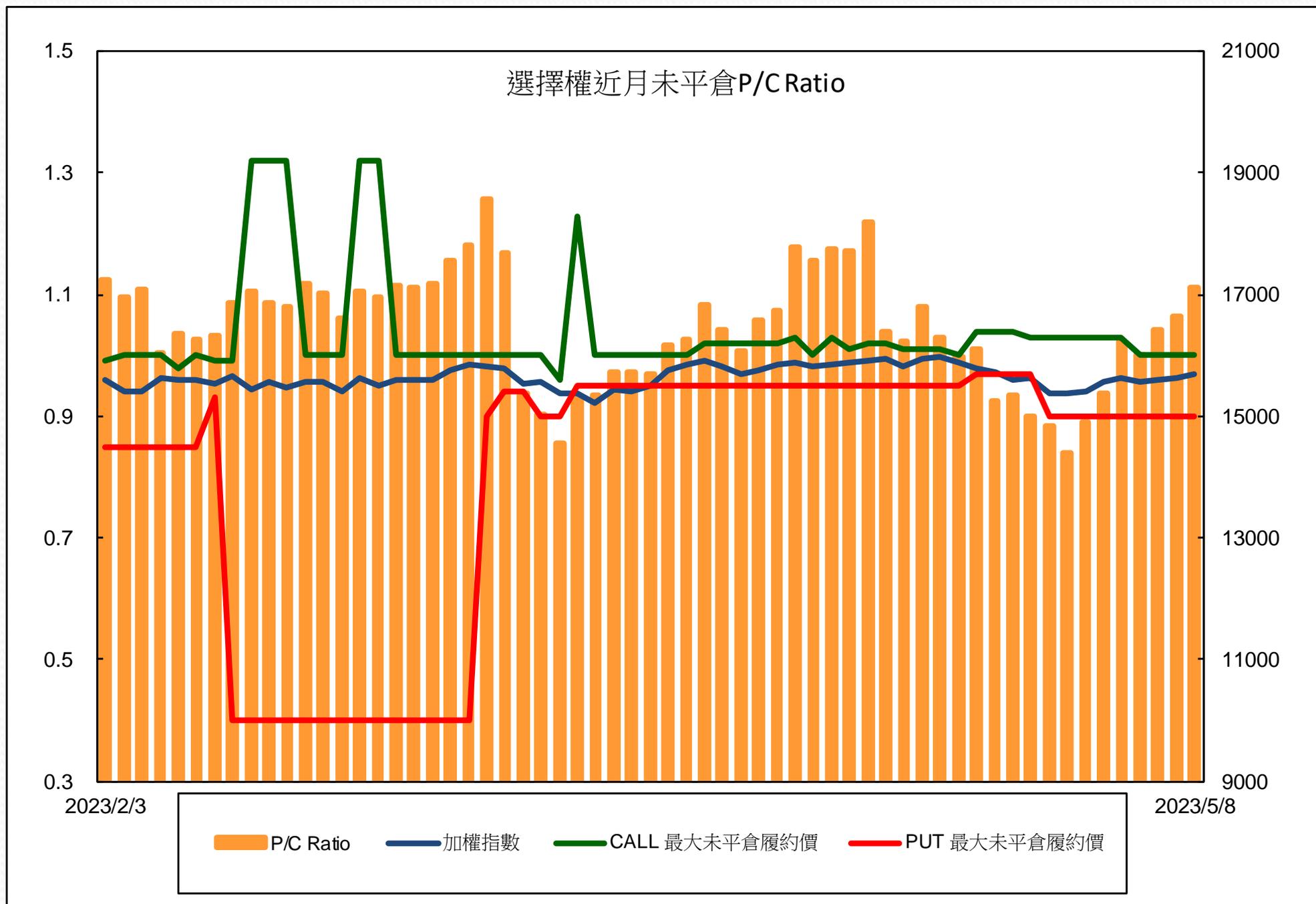
更新日期：2023年5月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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5日	67,225	48,475	18,750
	5月8日	66,298	50,510	15,788
Put	5月5日	62,449	51,978	10,471
	5月8日	61,794	58,087	3,707

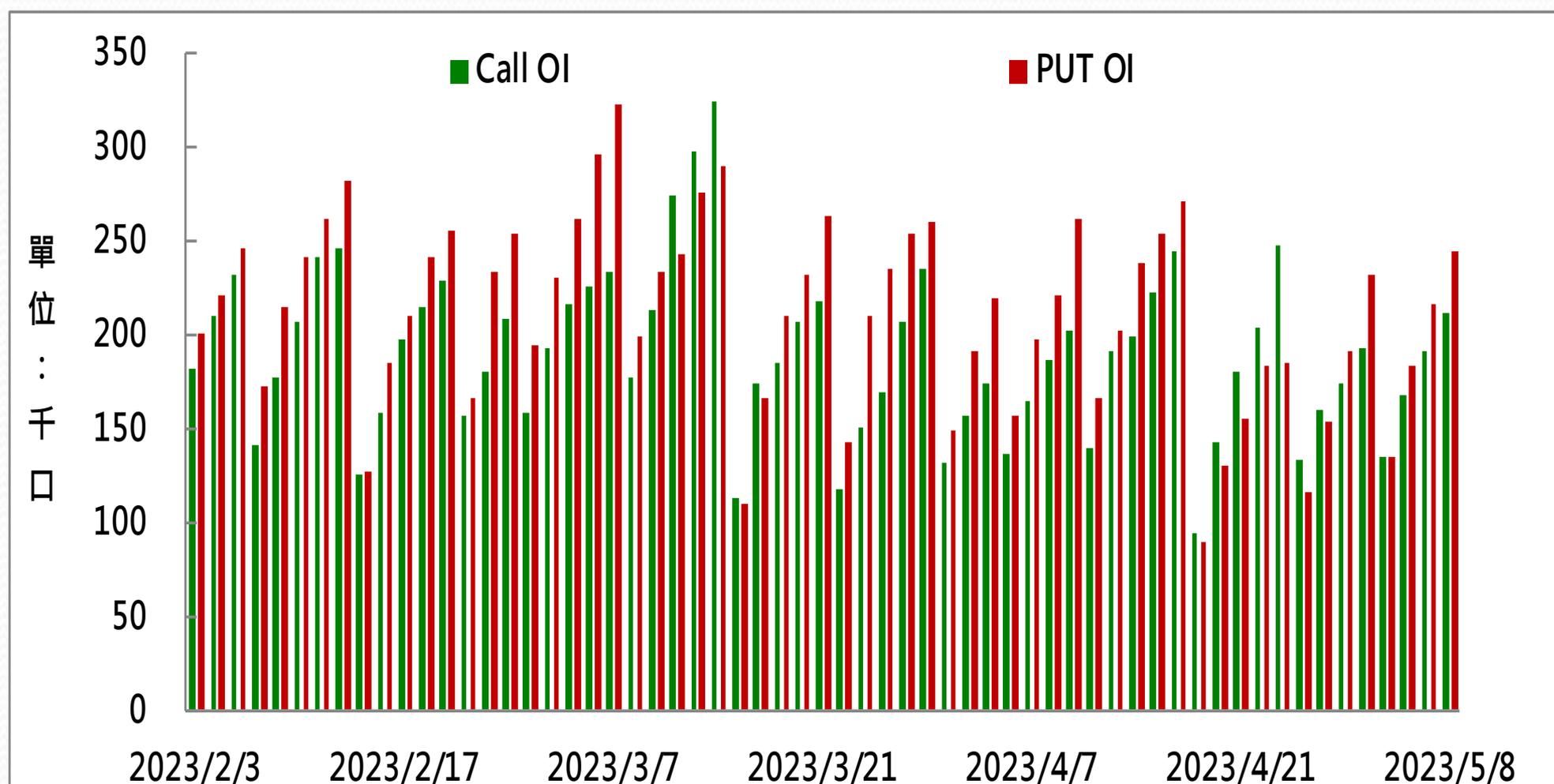
更新日期：2023年5月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年5月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

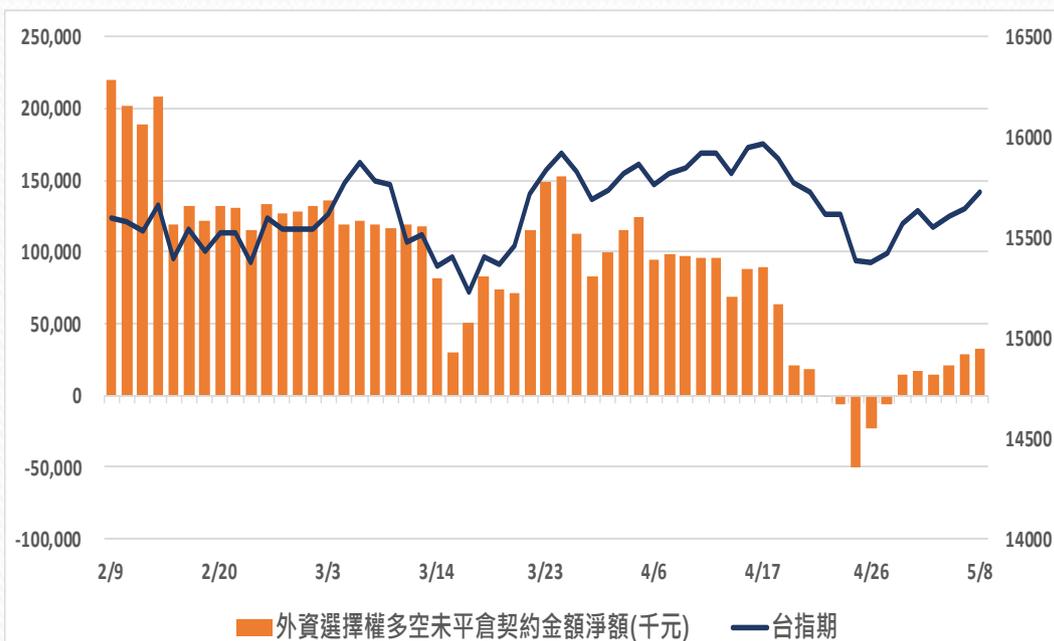
選擇權全月Put Call OI



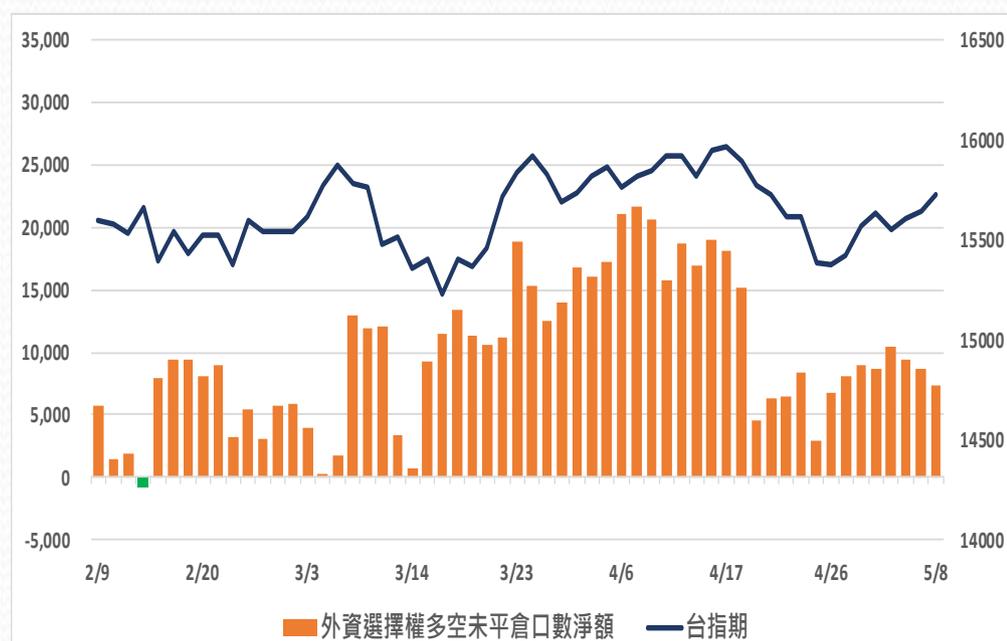
更新日期：2023年5月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



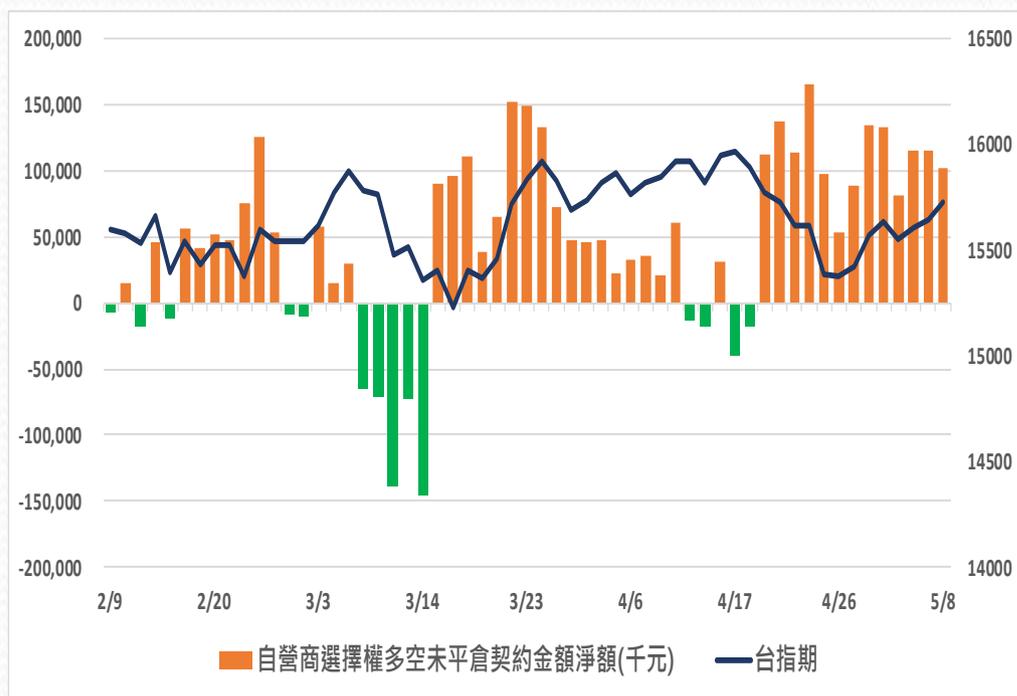
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/2	15635	8,667	-242	17,496	+3,620
2023/5/3	15549	10,494	+1,827	14,740	-2,756
2023/5/4	15607	9,423	-1,071	20,786	+6,046
2023/5/5	15642	8,663	-760	28,656	+7,870
2023/5/8	15723	7,316	-1,347	32,050	+3,394

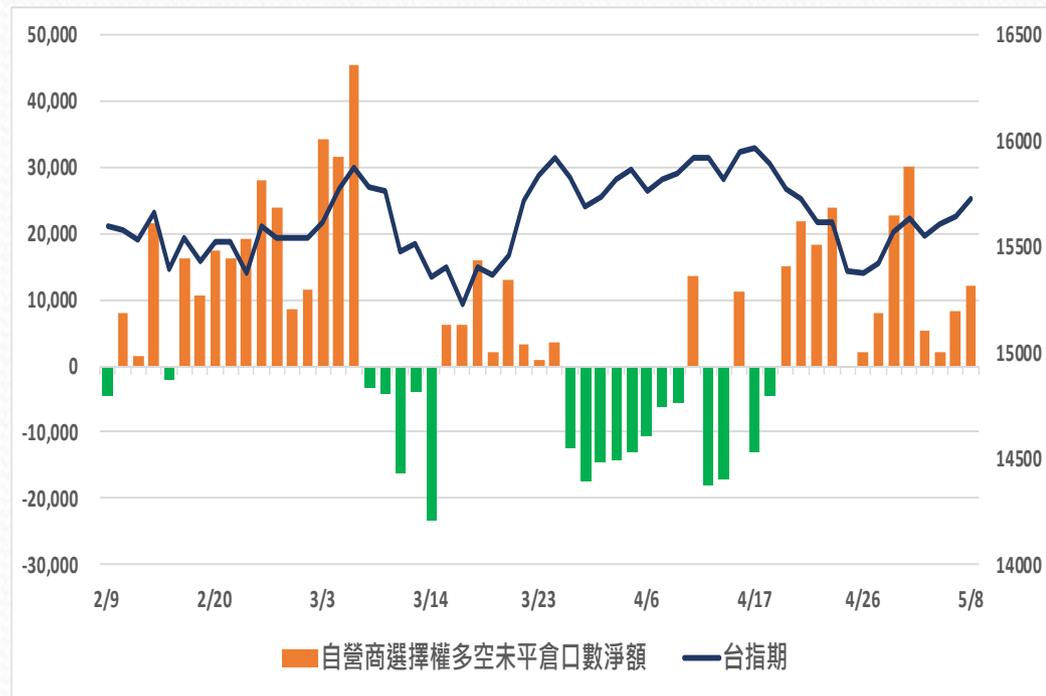
更新日期：2023年5月8日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



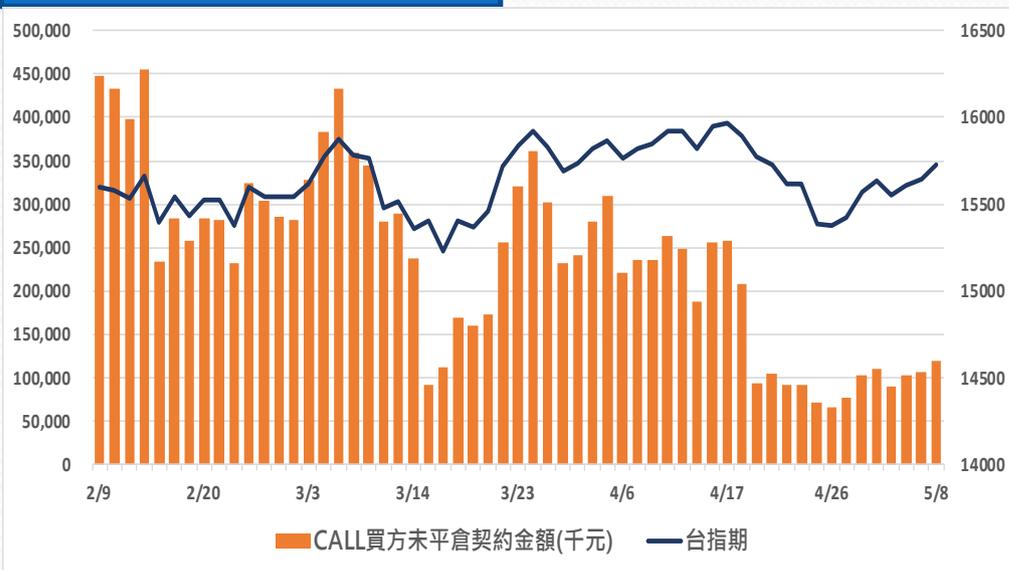
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/2	15635	30,275	+7,439	132,568	-2,438
2023/5/3	15549	5,319	-24,956	81,239	-51,329
2023/5/4	15607	2,145	-3,174	116,030	+34,791
2023/5/5	15642	8,279	+6,134	114,791	-1,239
2023/5/8	15723	12,081	+3,802	102,854	-11,937

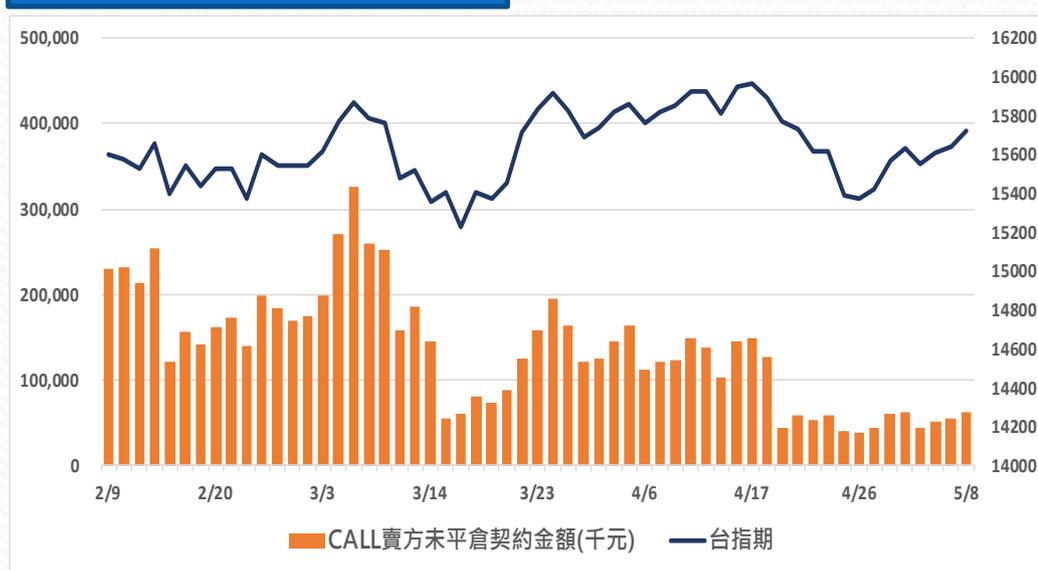
更新日期：2023年5月8日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

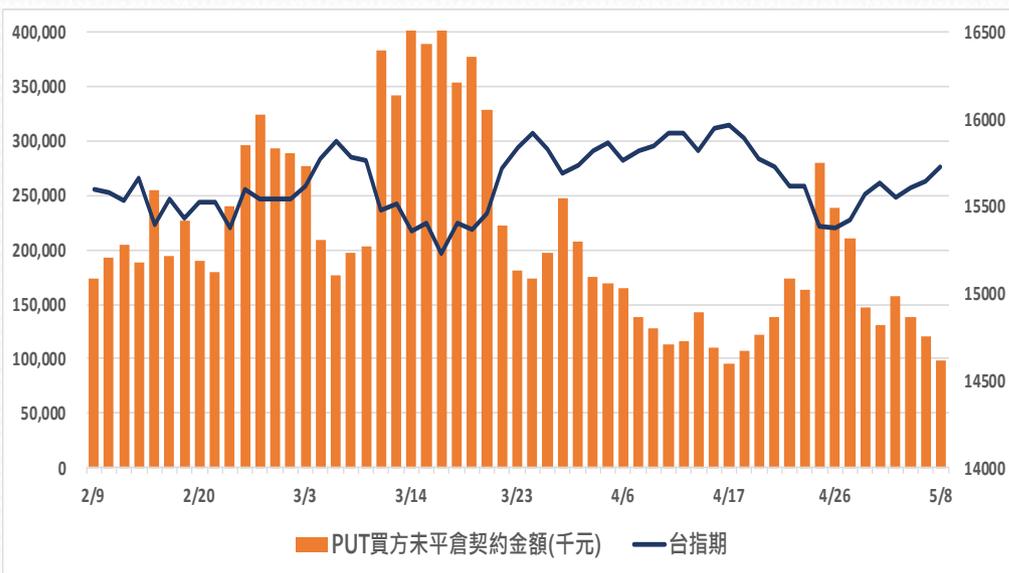
CALL買方未平倉金額



CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



PUT賣方未平倉金額



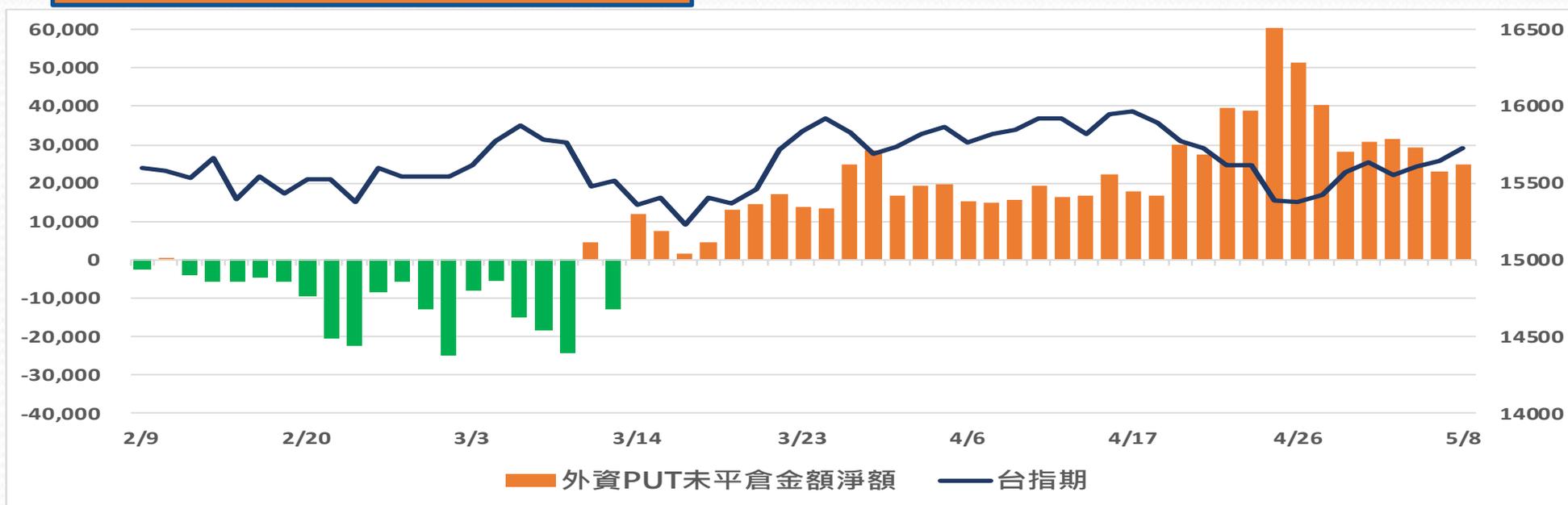
更新日期：2023年5月8日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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8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8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