

台指選擇權OI匯報

日期：2023/5/10 結算日：2023/5/17					日期：2023/5/10 結算日：2023/6/21				
202305 月台指選擇權 OI 序列					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
2	23	14,700	3,715	539	0	0	14,300	569	36
2	32	14,800	2,770	144	2	96	14,400	3,324	169
-1	45	14,900	3,464	426	0	6	14,500	1,461	252
-5	89	15,000	16,760	280	0	60	14,600	1,607	468
0	101	15,100	4,321	727	0	2	14,700	1,698	157
19	295	15,200	8,254	420	0	125	14,800	1,618	128
-34	697	15,300	5,397	642	1	4	14,900	1,979	1,438
15	51	15,350	2,640	1,054	7	266	15,000	2,361	292
73	1,518	15,400	7,479	577	11	46	15,100	1,380	33
348	420	15,450	3,227	1,511	19	129	15,200	1,354	-25
309	2,121	15,500	6,592	1,532	10	175	15,300	557	56
412	632	15,550	2,616	796	36	215	15,400	1,441	48
1,524	3,967	15,600	4,959	758	288	951	15,500	1,001	39
1,841	2,187	15,650	1,361	10	142	619	15,600	427	42
3,763	8,776	15,700	7,248	-380	106	513	15,700	247	2
1,659	2,757	15,750	883	325	238	1,060	15,800	192	-1
6,044	14,129	15,800	1,528	-38	229	2,320	15,900	267	-2
2,229	4,645	15,850	811	-406	327	3,157	16,000	144	4
1,976	8,728	15,900	1,079	89	813	4,128	16,100	33	-1
1,454	4,759	15,950	76	25	1,177	4,149	16,200	31	0
408	14,437	16,000	348	-30	149	2,334	16,300	29	0
463	3,043	16,050	25	0	-20	1,246	16,400	56	0
-354	6,294	16,100	172	-45	36	1,058	16,500	13	0
1,044	1,209	16,150	101	-9	86	962	16,600	10	0
2,355	7,745	16,200	286	-9	-16	696	16,700	13	0
417	9,187	16,300	203	-2	-12	421	16,800	17	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
25,386	117,107	0.9018	105,610	8,863	3,091	34,214	1.1296	38,649	3,453
昨日 P/C	1.2115	今日增減變化	-0.3097		昨日 P/C	1.1309	今日增減變化	-0.0012	

更新日期：2023年5月10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10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	82,929,734	63,221,597	19,708,137	-33,588,030	1,453,248	595,853	857,395	-4,619	
投信	30,283,400	51,787,736	-21,504,336	-260,736	305,193	0	305,193	-3,738	
自營商	41,821,530	21,035,472	20,786,058	7,056,805	1,139,284	777,756	361,528	-239,530	
	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	646,091	1,188,513	-542,422	-161,545	9,166	74,857	-65,691	-1,507	
投信	125,357	0	125,357	-16	0	0	0	0	
自營商	706,124	565,165	140,959	117,148	381,298	318,304	62,994	-4,474	

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10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	42,819	14,753	28,066	2,541	30,183	18,496	11,687	-4,893	
投信	100	100	0	0	450	113	337	0	
自營商	58,655	57,025	1,630	-15,010	53,795	39,633	14,162	19,071	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	34,578	8,737	25,841	6,833	7,274	21,833	-14,559	-1,683	
特定法人(全月)	36,187	13,327	22,860	2,733	10,959	22,511	-11,552	7,100	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	59,410	44,118	15,292	-4,274	37,231	49,752	-12,521	-3,076	
十大交易人(全月)	93,451	63,238	30,213	-7,656	54,092	76,649	-22,557	-18,283	
全市場未沖銷(近月)			117,119	25,379			112,357	10,400	
全市場未沖銷(全月)			165,512	-61,837			159,813	-102,732	

更新日期：2023年5月10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	15800	買權OI最大量	16000
	賣權成交最大量	15600	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	11.44%	較前一交易日	+3.08%
	買權隱含波動率	9.40%	較前一交易日	+1.77%
	賣權隱含波動率	13.92%	較前一交易日	+4.85%
電子選擇權	買權成交最大量	740	買權OI最大量	760
	賣權成交最大量	660	賣權OI最大量	660
金融選擇權	買權成交最大量	1620	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1640	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年5月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

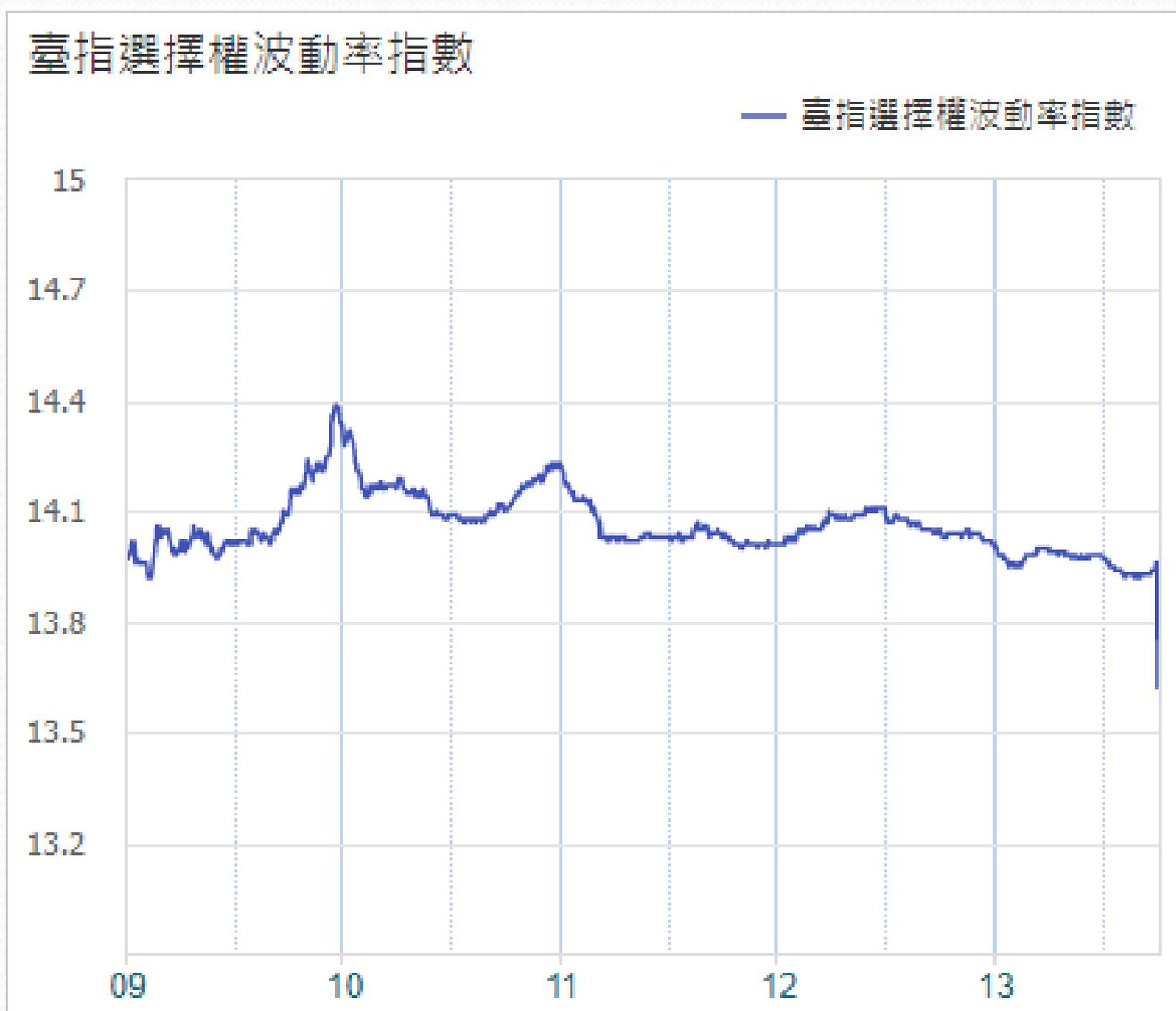
台指選擇權匯報

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	14900	賣權OI最大量	10000
	整體隱含波動率	12.49%	較前一交易日	-1.18%
	買權隱含波動率	9.20%	較前一交易日	-1.42%
	賣權隱含波動率	17.12%	較前一交易日	+5.06%
	成交量P/C_Ratio值	0.759	較前一交易日	-0.19
	未平倉P/C_Ratio值	1.130	較前一交易日	+0.02
電子選擇權	買權成交最大量	740	買權OI最大量	760
	賣權成交最大量	660	賣權OI最大量	660
金融選擇權	買權成交最大量	1620	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1640	賣權OI最大量	1540

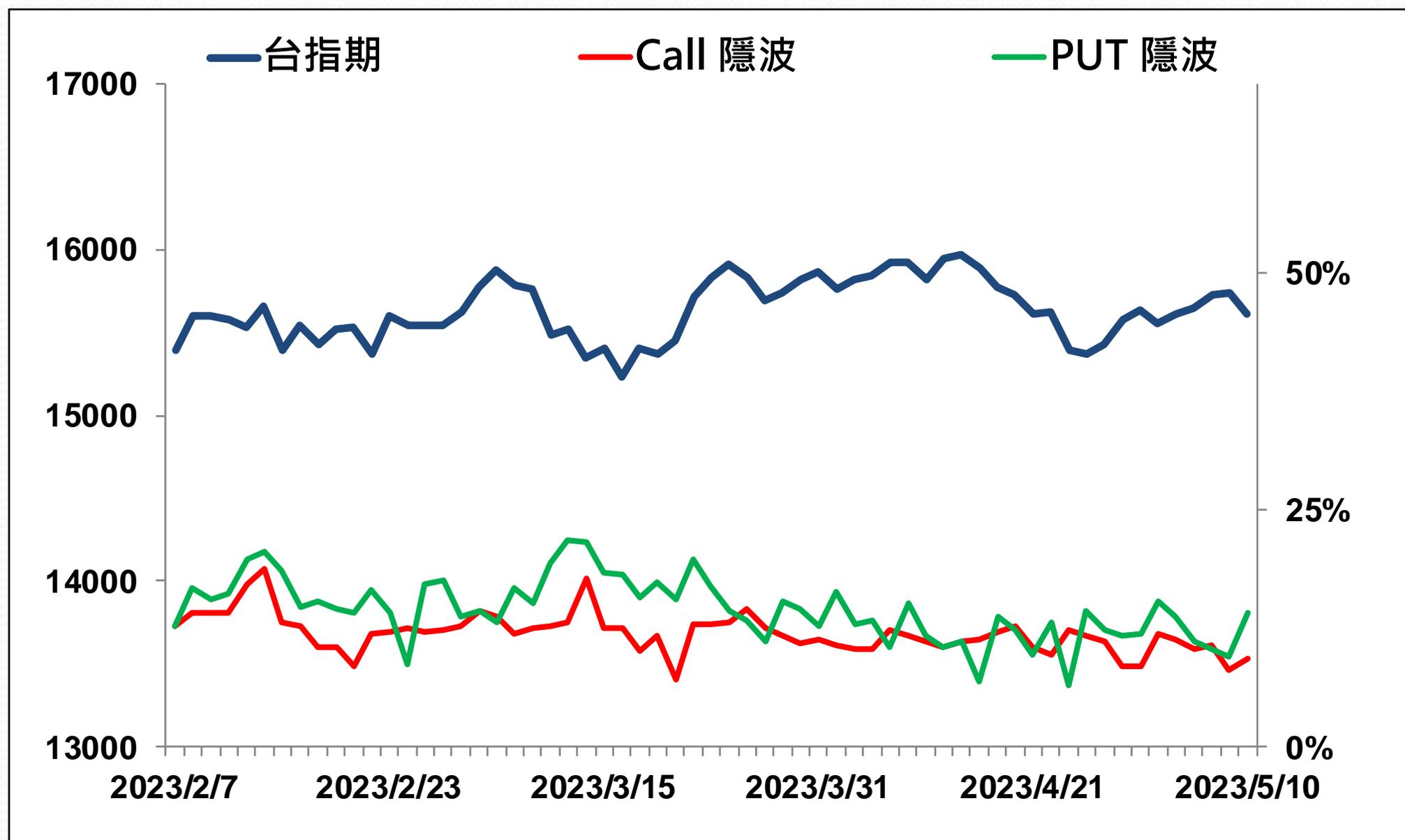
更新日期：2023年5月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



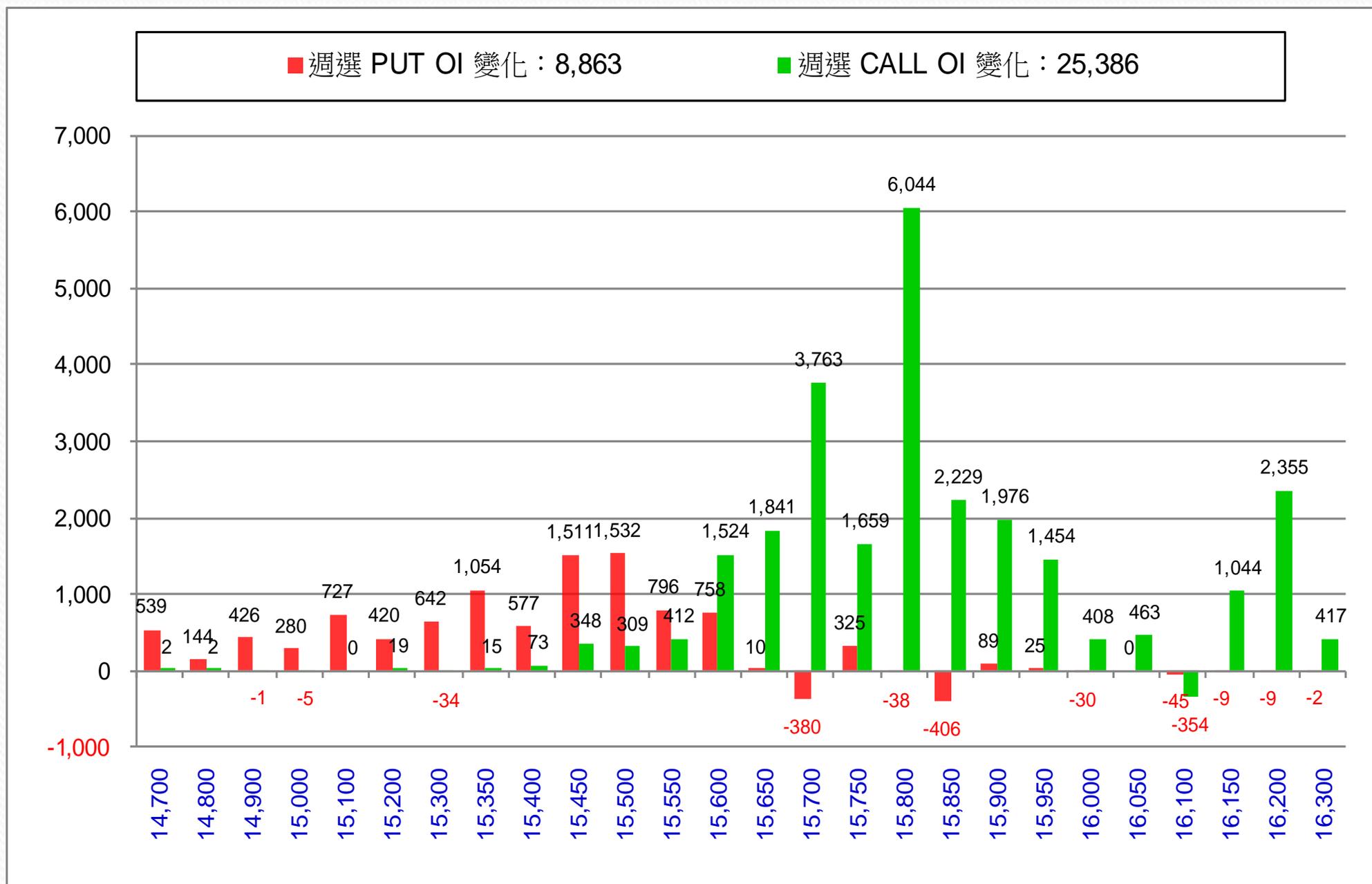
更新日期：2023年5月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年5月10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

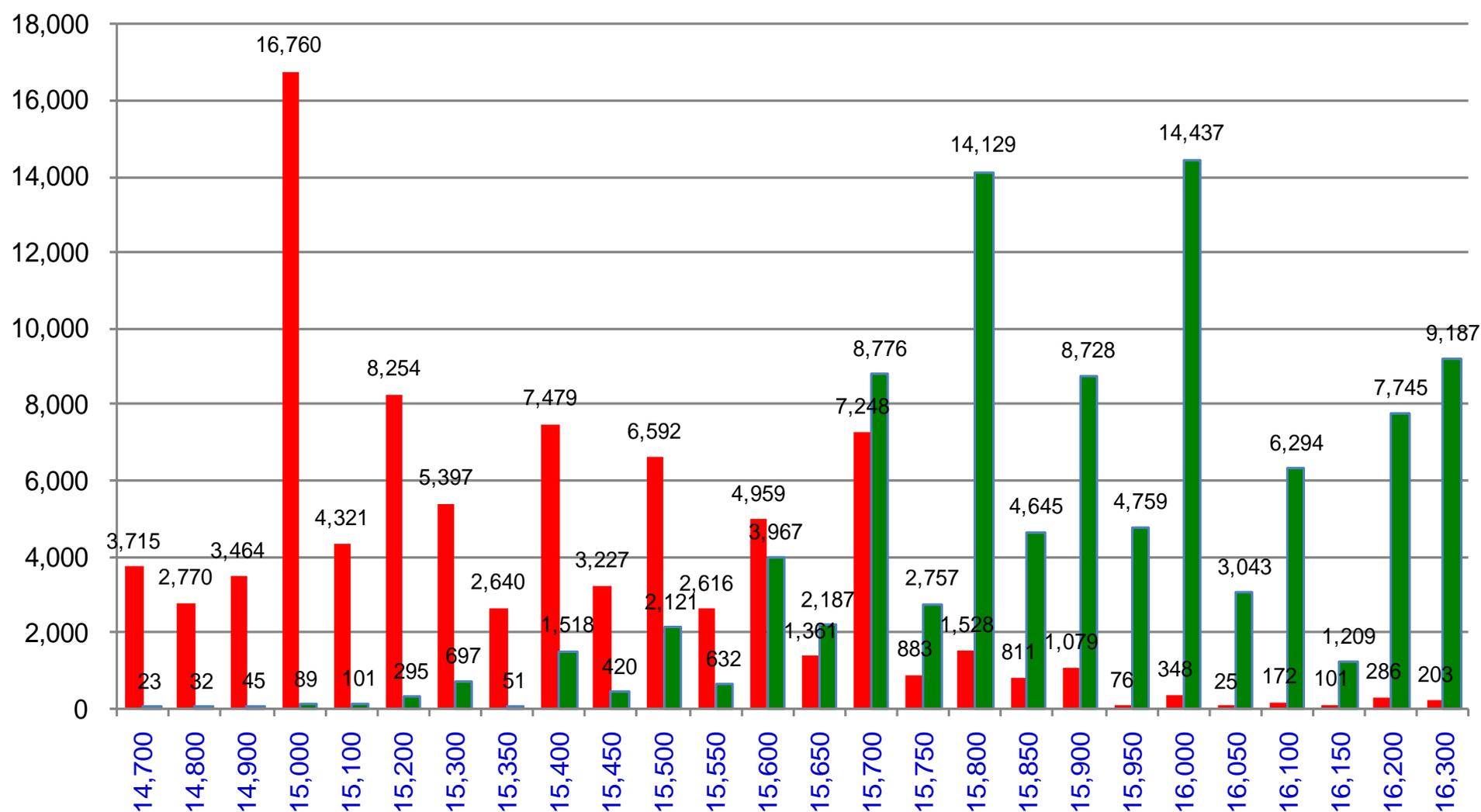


更新日期：2023年5月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：105,610

■ 週選 CALL OI 總額：117,107



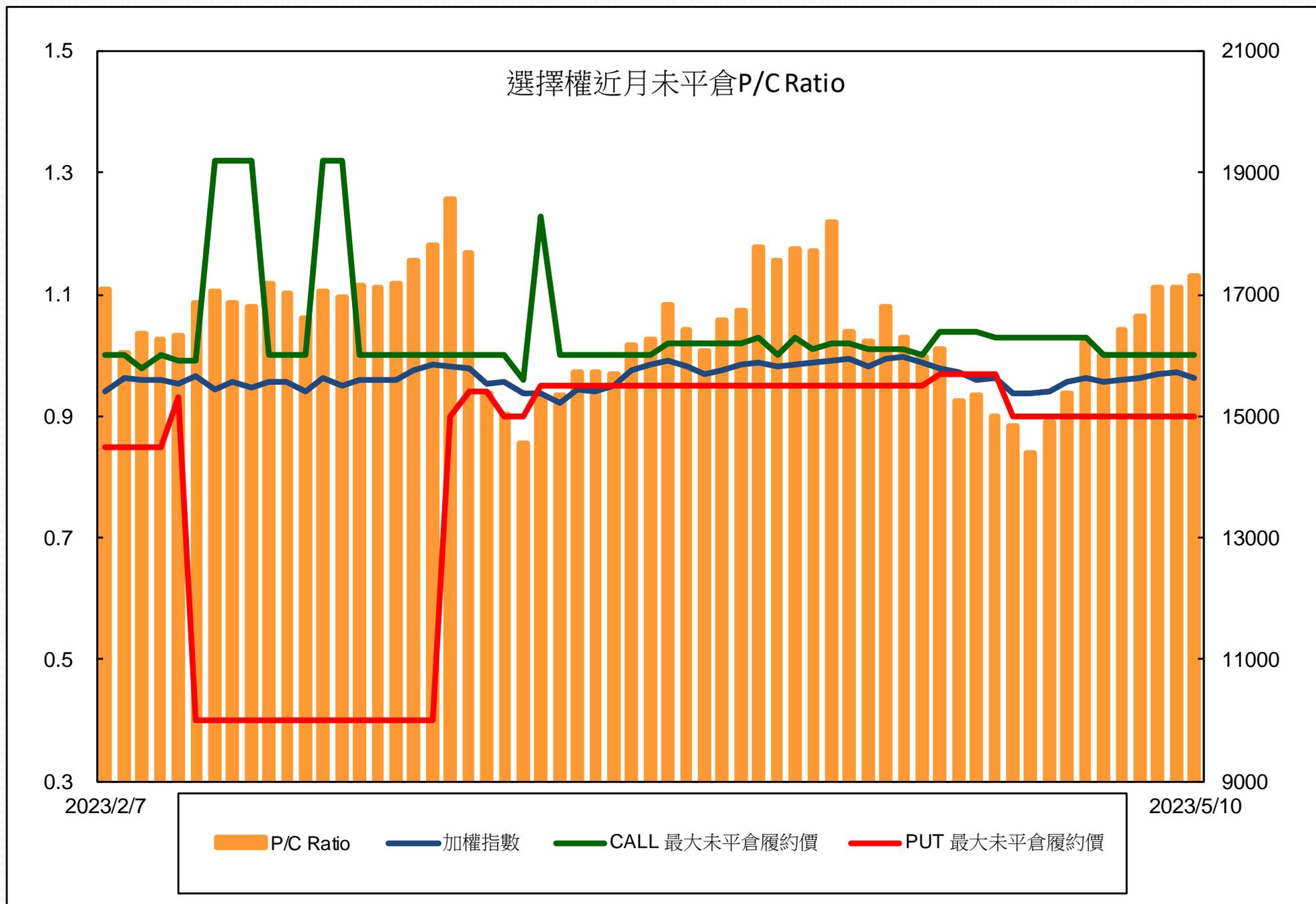
更新日期：2023年5月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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9日	67,911	51,271	16,640
	5月10日	58,655	57,025	1,630
Put	5月9日	59,484	64,393	-4,909
	5月10日	53,795	39,633	14,162

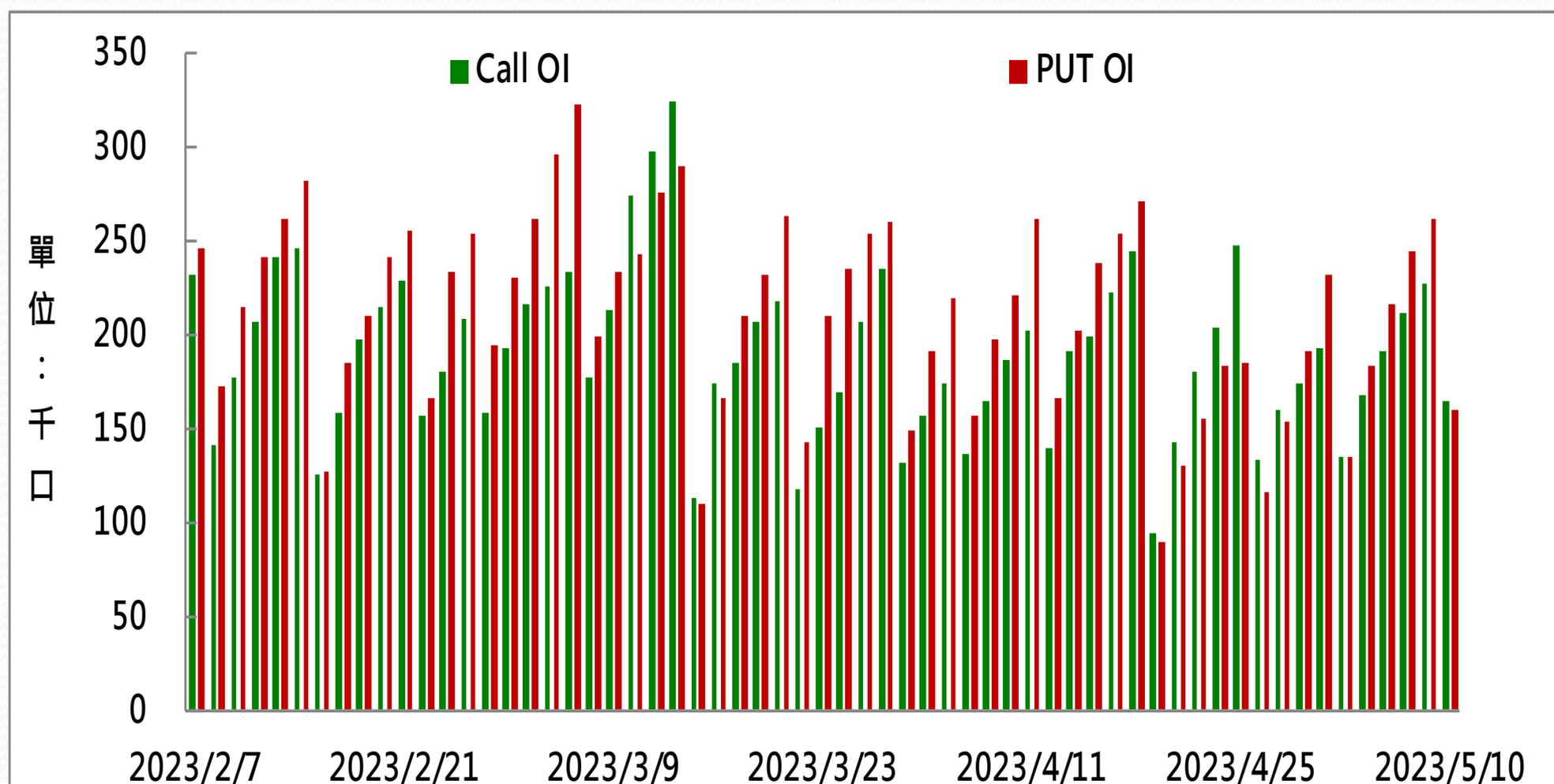
更新日期：2023年5月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年5月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

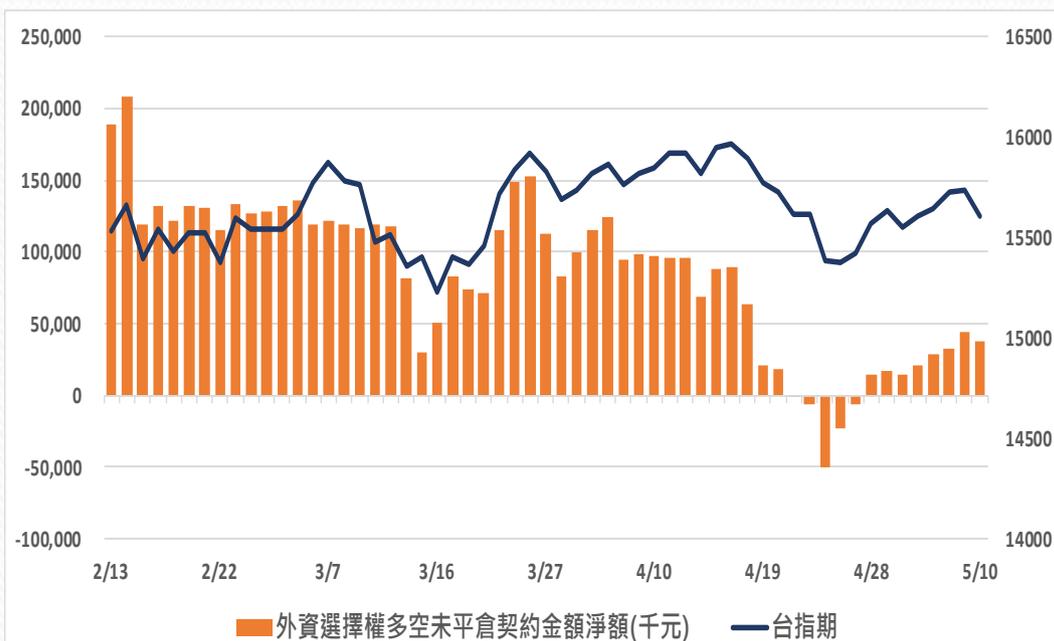
選擇權全月Put Call OI



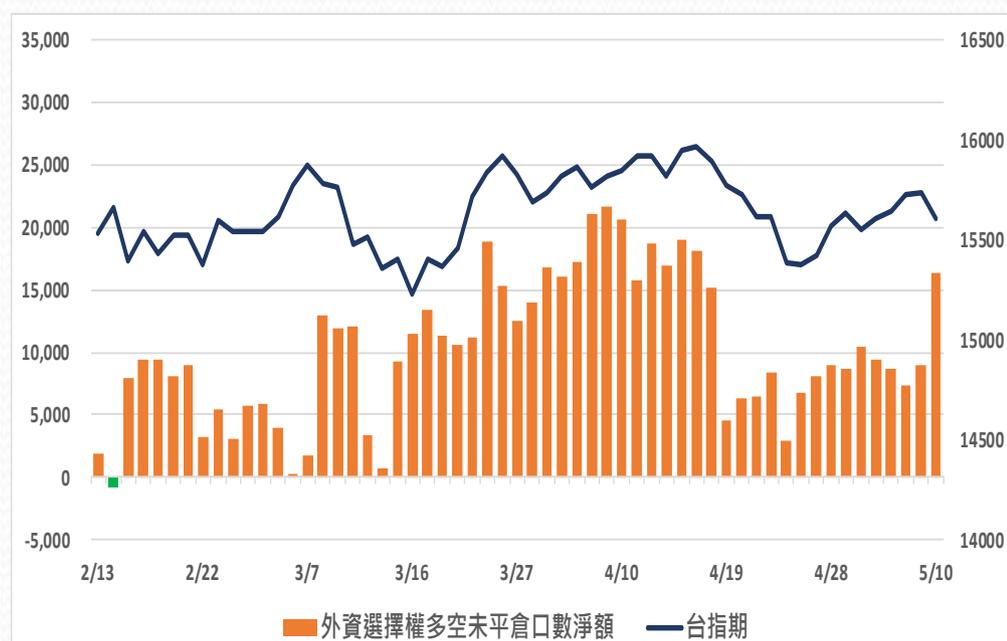
更新日期：2023年5月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



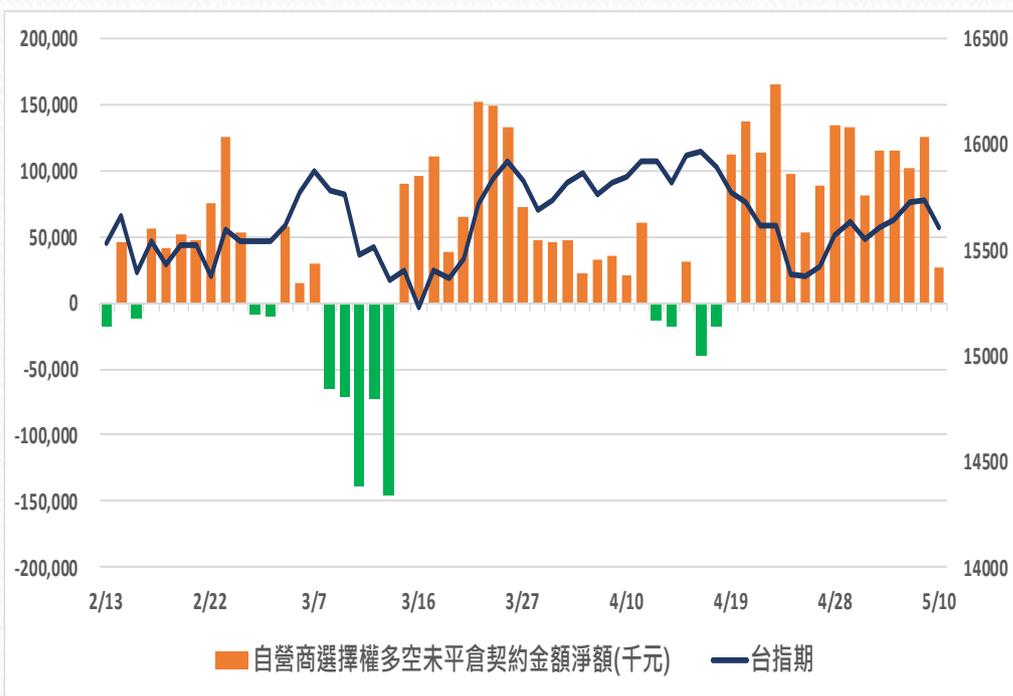
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/4	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
2023/5/9	15736	8,945	+1,629	44,021	+11,971
2023/5/10	15610	16,379	+7,434	37,727	-6,294

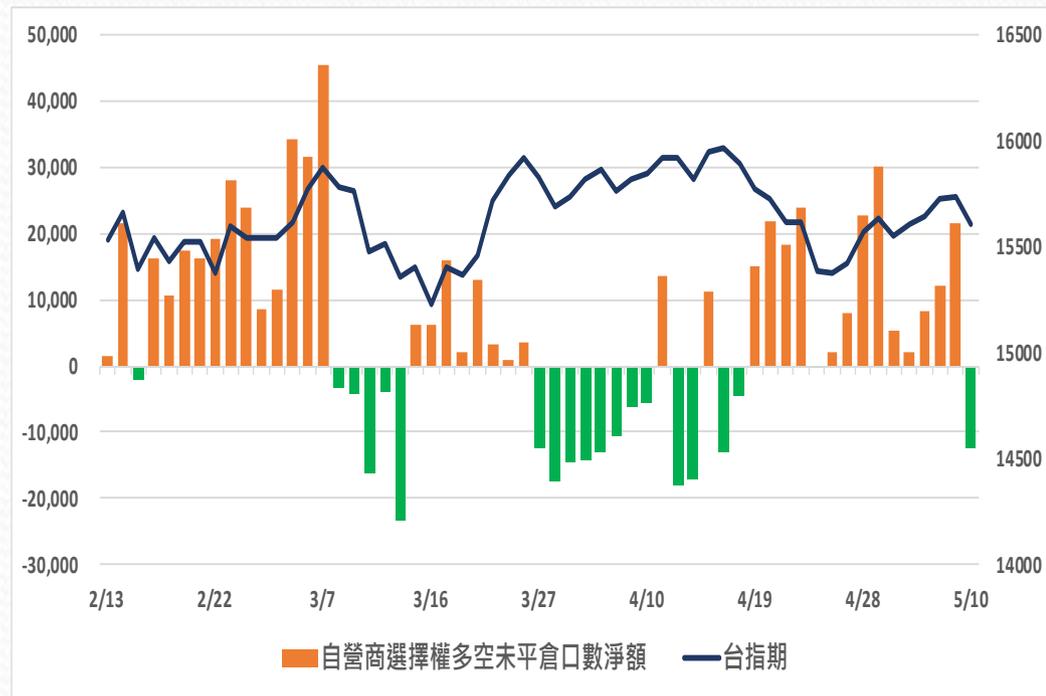
更新日期：2023年5月10日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



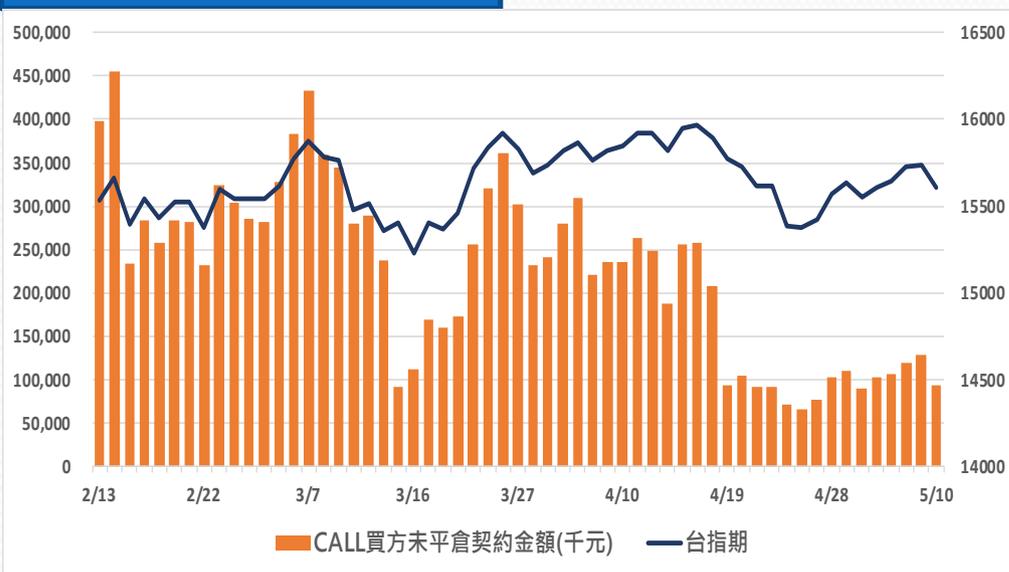
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/4	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
2023/5/9	15736	21,549	+9,468	125,201	+22,347
2023/5/10	15610	-12,532	-34,081	26,478	-98,723

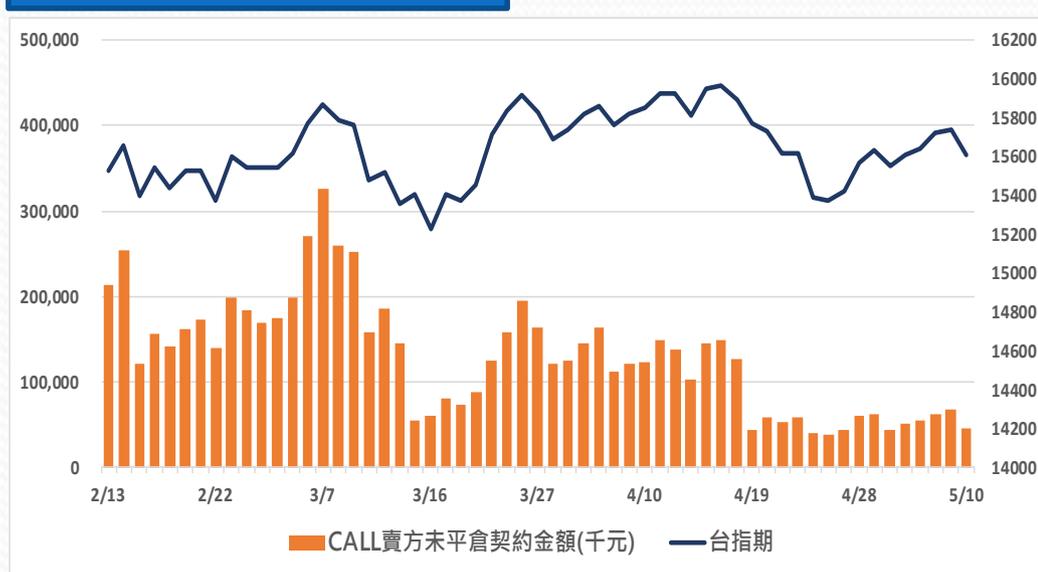
更新日期：2023年5月10日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

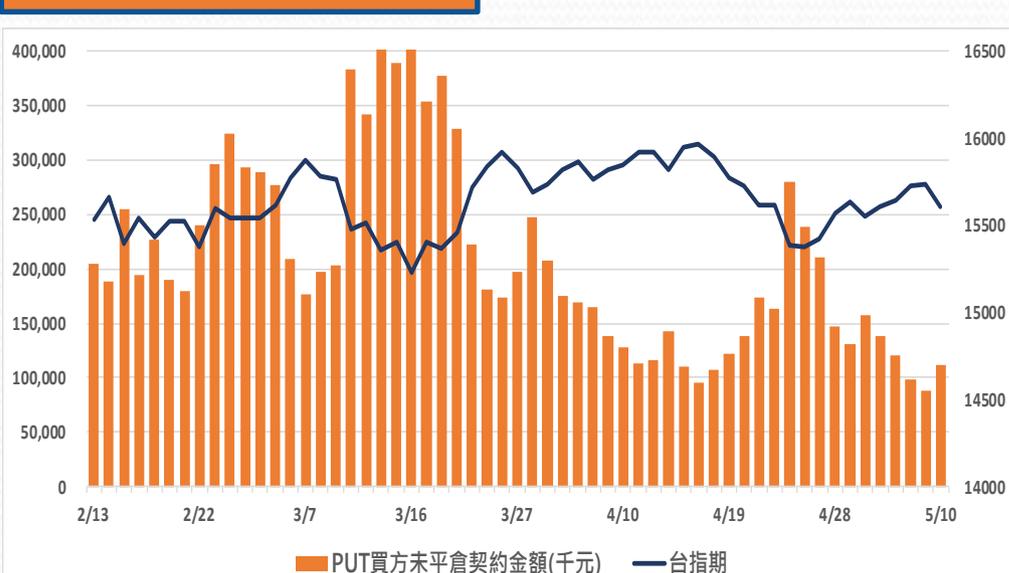
CALL買方未平倉金額



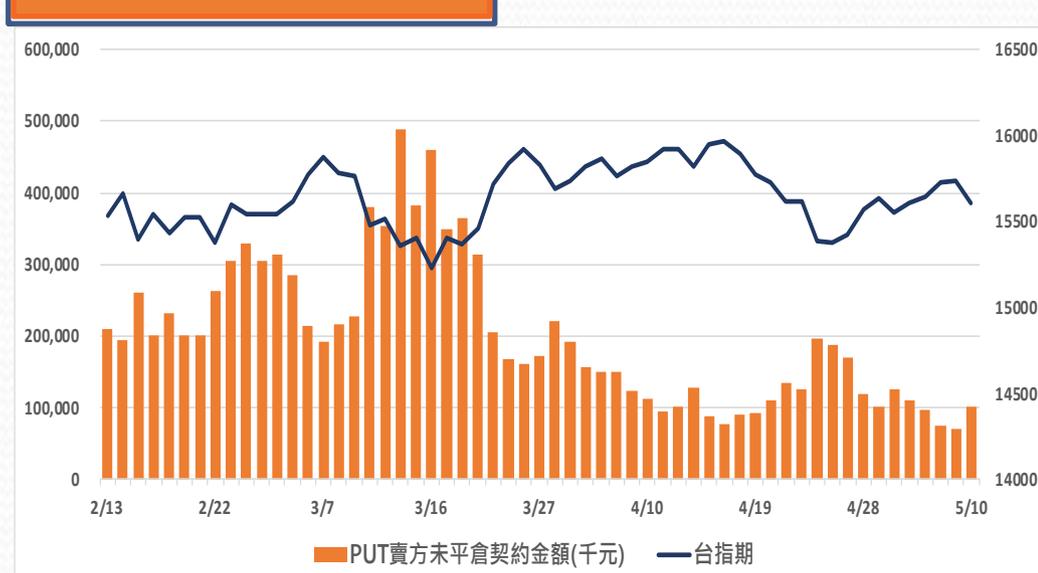
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



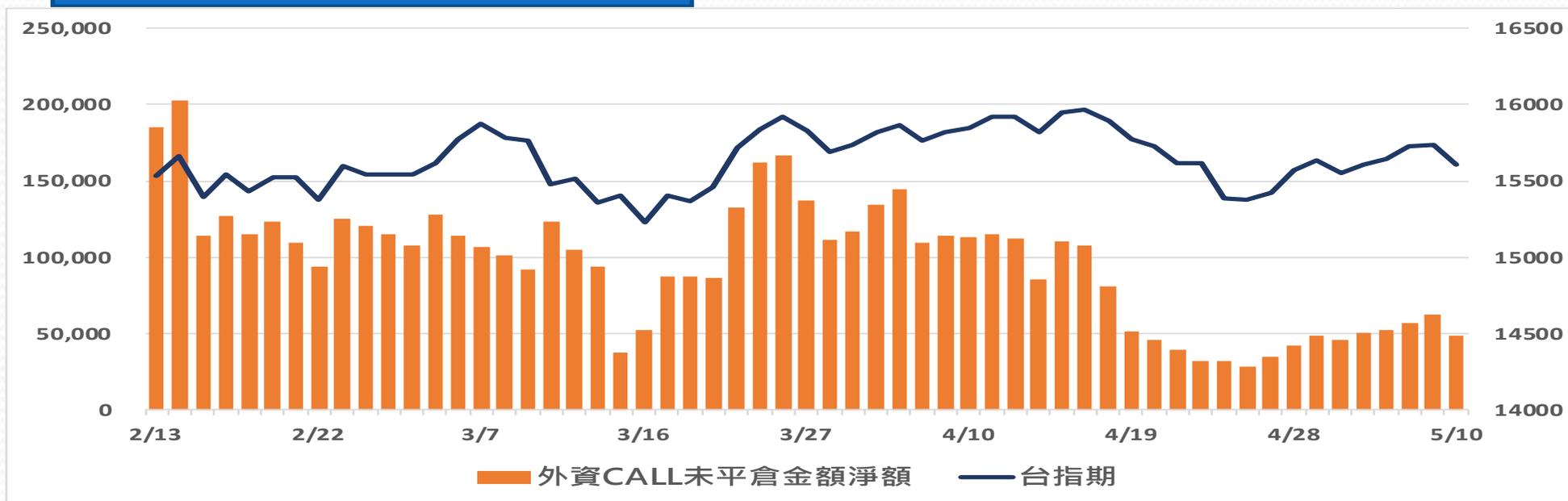
PUT賣方未平倉金額



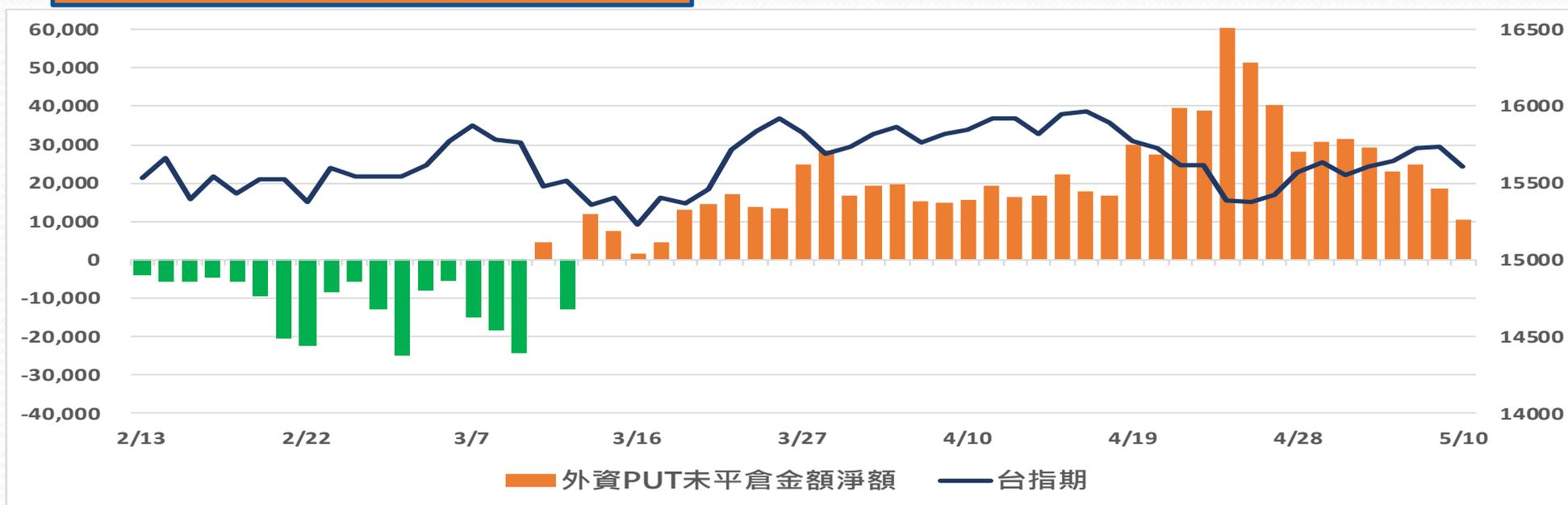
更新日期：2023年5月10日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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10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10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