

台指選擇權OI匯報

日期：2023/5/11 結算日：2023/5/17					日期：2023/5/11 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
-4	19	14,500	3,116	926	0	20	14,200	720	105
0	5	14,600	2,379	382	1	1	14,300	607	38
0	23	14,700	3,880	165	5	101	14,400	3,163	-161
-5	27	14,800	3,507	737	0	6	14,500	1,616	155
-4	41	14,900	4,823	1,359	1	61	14,600	1,674	67
6	95	15,000	21,327	4,567	0	2	14,700	1,804	106
-5	96	15,100	5,791	1,470	0	125	14,800	2,885	1,267 ※
4	299	15,200	11,197	2,943	3	7	14,900	2,062	83
13	25	15,250	5,525	1,244	4	270	15,000	2,955	594
56	753	15,300	9,198	3,801	16	62	15,100	1,512	132
332	383	15,350	4,844	2,204	12	141	15,200	1,526	172
297	1,815	15,400	12,409	4,930	48	223	15,300	655	98
206	626	15,450	6,964	3,737	84	299	15,400	1,616	175
1,057	3,178	15,500	11,592	5,000 ※	119	1,070	15,500	965	-36
2,039	2,671	15,550	4,767	2,151	189	808	15,600	457	30
4,840	8,807	15,600	5,935	976	239	752	15,700	287	40
4,538	6,725	15,650	2,291	930	※ 980	2,040	15,800	198	6
3,680	12,456	15,700	7,457	209	235	2,555	15,900	263	-4
※ 6,550	9,307	15,750	1,678	795	497	3,654	16,000	142	-2
5,240	19,369	15,800	1,524	-4	-66	4,062	16,100	36	3
5,227	9,872	15,850	452	-359	276	4,425	16,200	31	0
2,936	11,664	15,900	981	-98	88	2,422	16,300	29	0
-864	3,895	15,950	77	1	125	1,371	16,400	56	0
-1,849	12,588	16,000	343	-5	60	1,118	16,500	13	0
-613	2,430	16,050	25	0	-167	795	16,600	10	0
-58	6,236	16,100	245	73	-18	678	16,700	13	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
33,367	150,486	0.9826	147,874	37,983	3,079	37,293	1.1184	41,709	3,060
昨日 P/C	0.9018	今日增減變化	0.0808		昨日 P/C	1.1296	今日增減變化	-0.0112	

更新日期：2023年5月11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11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	87,356,912	68,143,147	19,213,765	-494,372	1,320,017	534,783	785,234	-72,161		
投信	30,047,888	51,678,270	-21,630,382	-126,046	303,555	0	303,555	-1,638		
自營商	39,371,443	24,241,604	15,129,839	-5,656,219	1,129,965	724,341	405,624	44,096		
	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	743,452	1,289,301	-545,849	-3,427	7,558	75,580	-68,022	-2,331		
投信	125,436	0	125,436	79	0	0	0	0		
自營商	805,038	532,237	272,801	131,842	390,877	324,008	66,869	3,875		

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11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	45,616	16,767	28,849	783	32,587	20,733	11,854	167		
投信	100	100	0	0	450	113	337	0		
自營商	61,327	51,763	9,564	7,934	55,369	51,224	4,145	-10,017		
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---		
特定法人(近月)	35,455	8,908	26,547	706	7,291	21,986	-14,695	-136		
特定法人(全月)	37,644	11,300	26,344	3,484	11,766	22,511	-10,745	807		
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---		
十大交易人(近月)	58,667	41,350	17,317	2,025	48,464	50,877	-2,413	10,108		
十大交易人(全月)	97,657	60,342	37,315	7,102	69,291	80,121	-10,830	11,727		
全市場未沖銷(近月)			150,486	33,367			151,600	39,243		
全市場未沖銷(全月)			207,558	42,046			206,831	47,018		

更新日期：2023年5月11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	15700	買權OI最大量	15800
	賣權成交最大量	15500	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	10.25%	較前一交易日	-1.19%
	買權隱含波動率	9.75%	較前一交易日	+0.35%
	賣權隱含波動率	10.80%	較前一交易日	-3.12%
電子選擇權	買權成交最大量	425	買權OI最大量	425
	賣權成交最大量	670	賣權OI最大量	660
金融選擇權	買權成交最大量	490	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年5月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

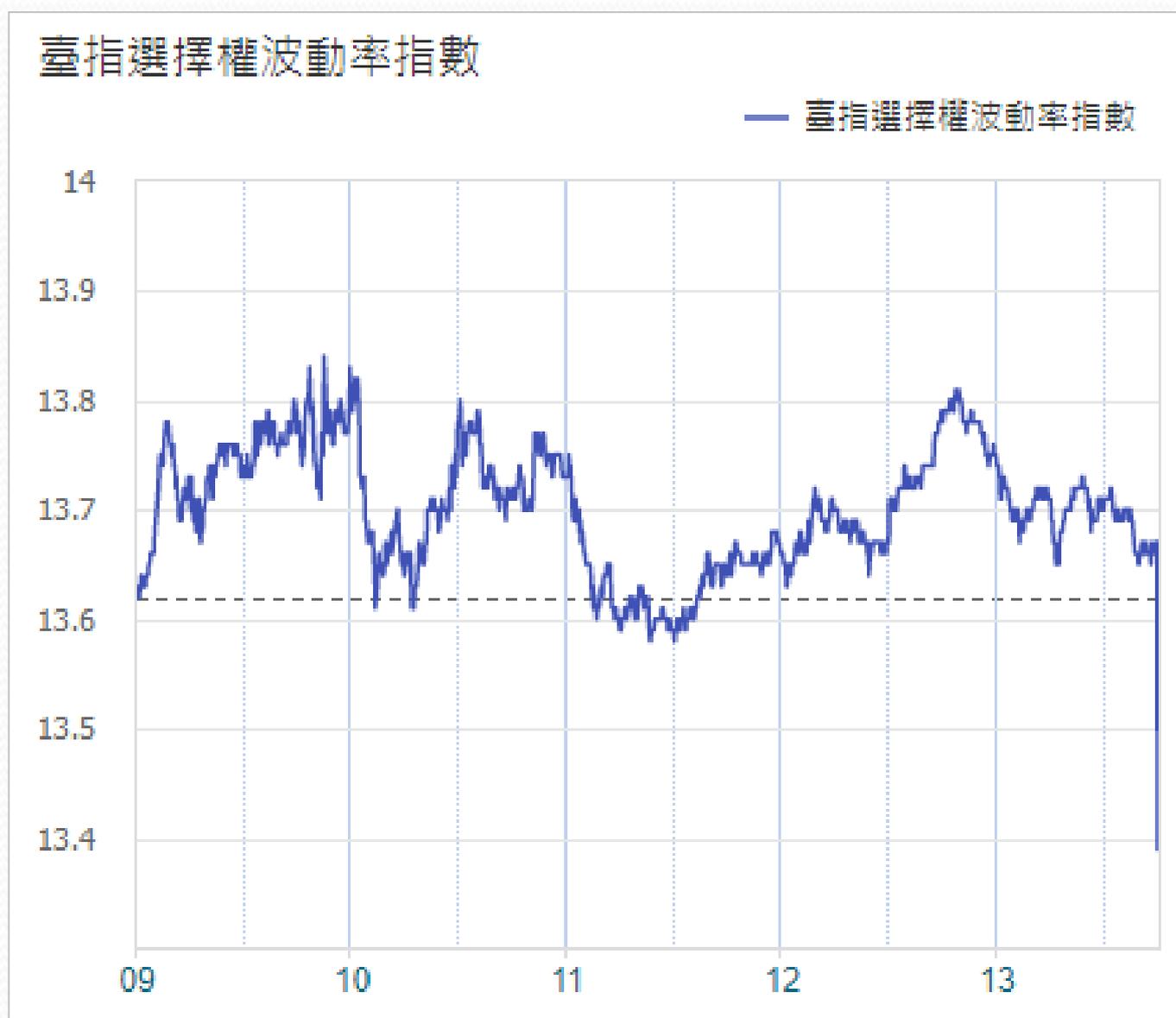
台指選擇權匯報

2023年06月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16000	買權OI最大量	16200
	賣權成交最大量	14800	賣權OI最大量	10000
	整體隱含波動率	12.53%	較前一交易日	-0.04%
	買權隱含波動率	9.33%	較前一交易日	+0.13%
	賣權隱含波動率	16.18%	較前一交易日	-0.93%
	成交量P/C_Ratio值	0.908	較前一交易日	+0.15
	未平倉P/C_Ratio值	1.118	較前一交易日	-0.01
電子選擇權	買權成交最大量	495	買權OI最大量	495
	賣權成交最大量	670	賣權OI最大量	660
金融選擇權	買權成交最大量	660	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1540

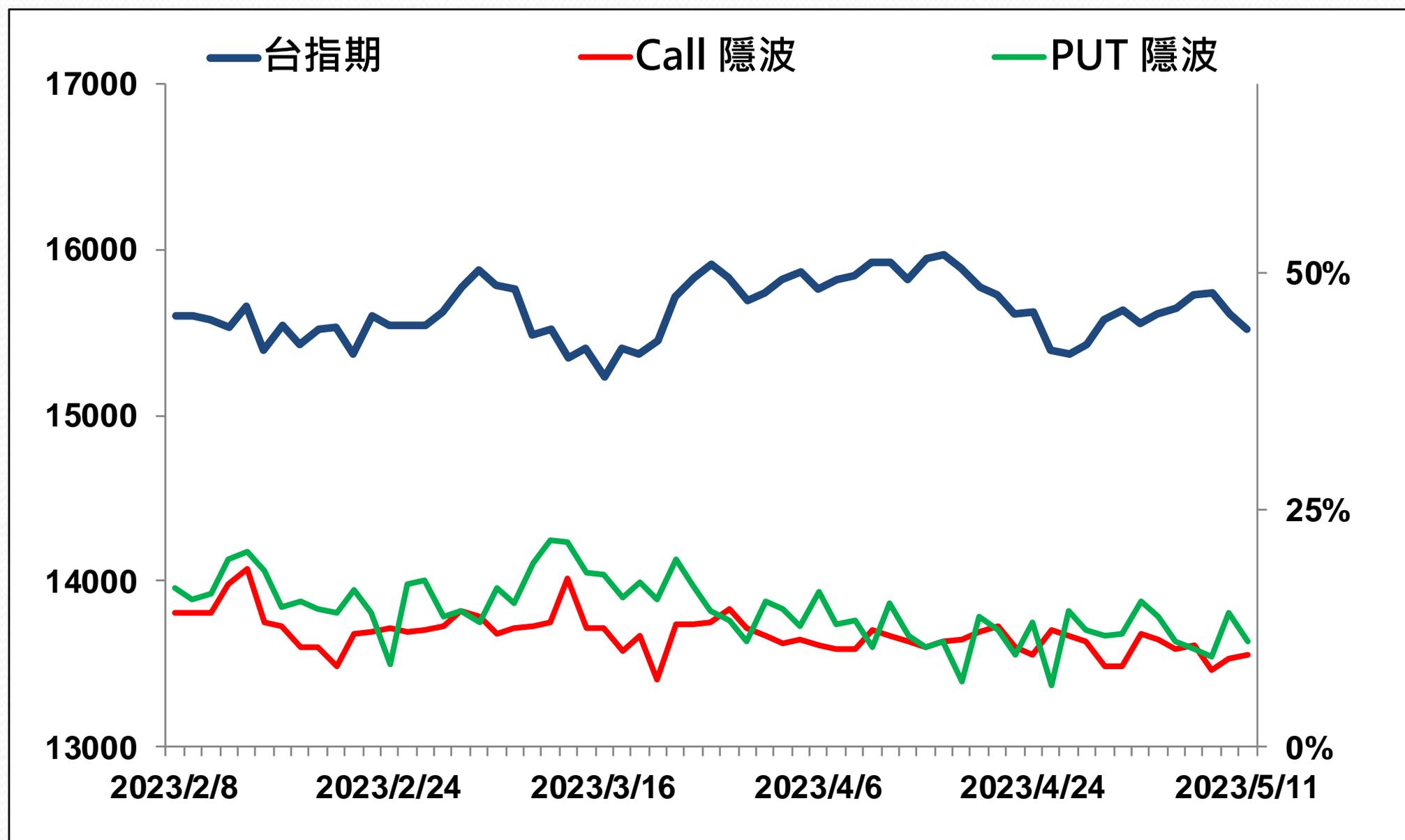
更新日期：2023年5月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



更新日期：2023年5月11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

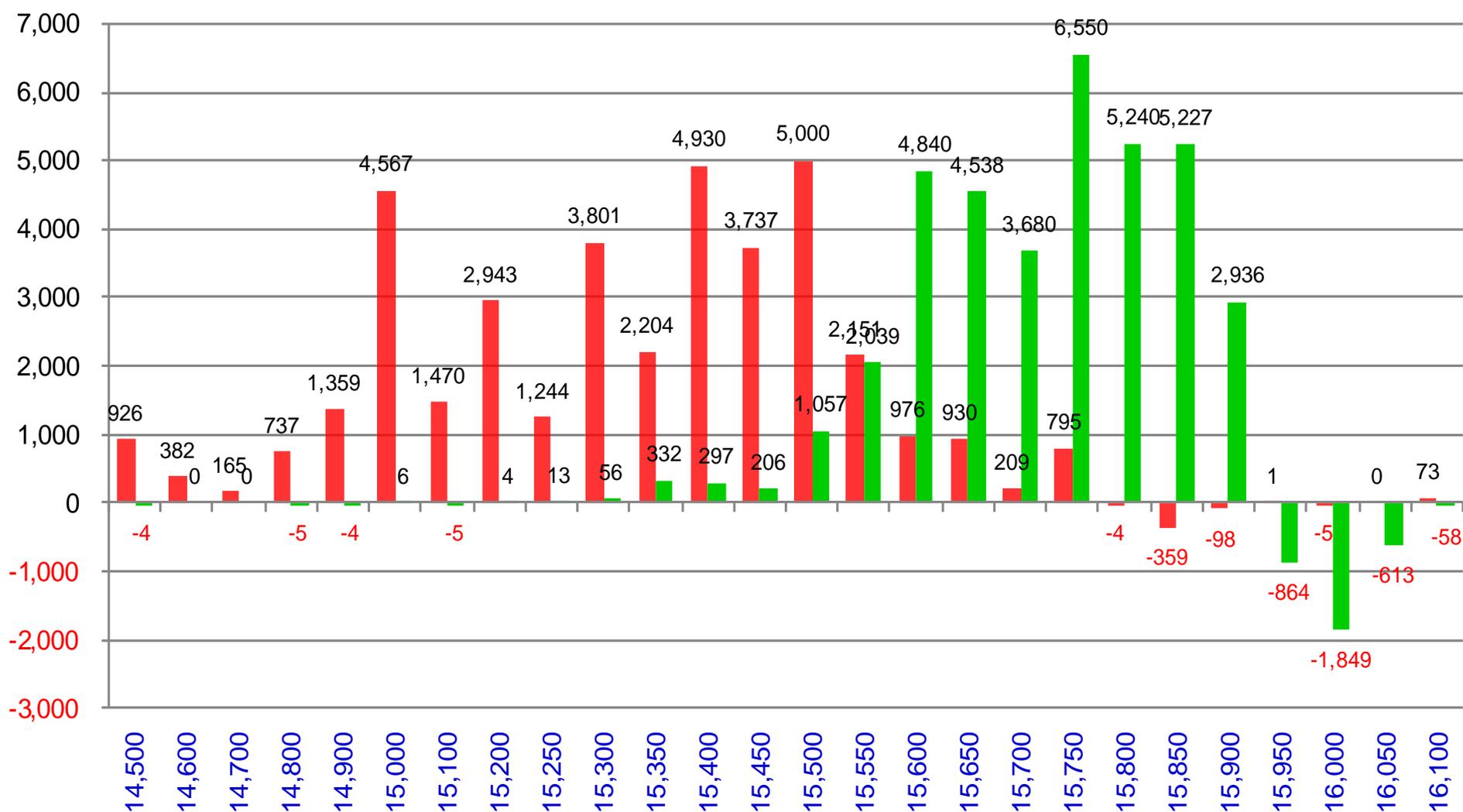


更新日期：2023年5月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：37,983

週選 CALL OI 變化：33,367

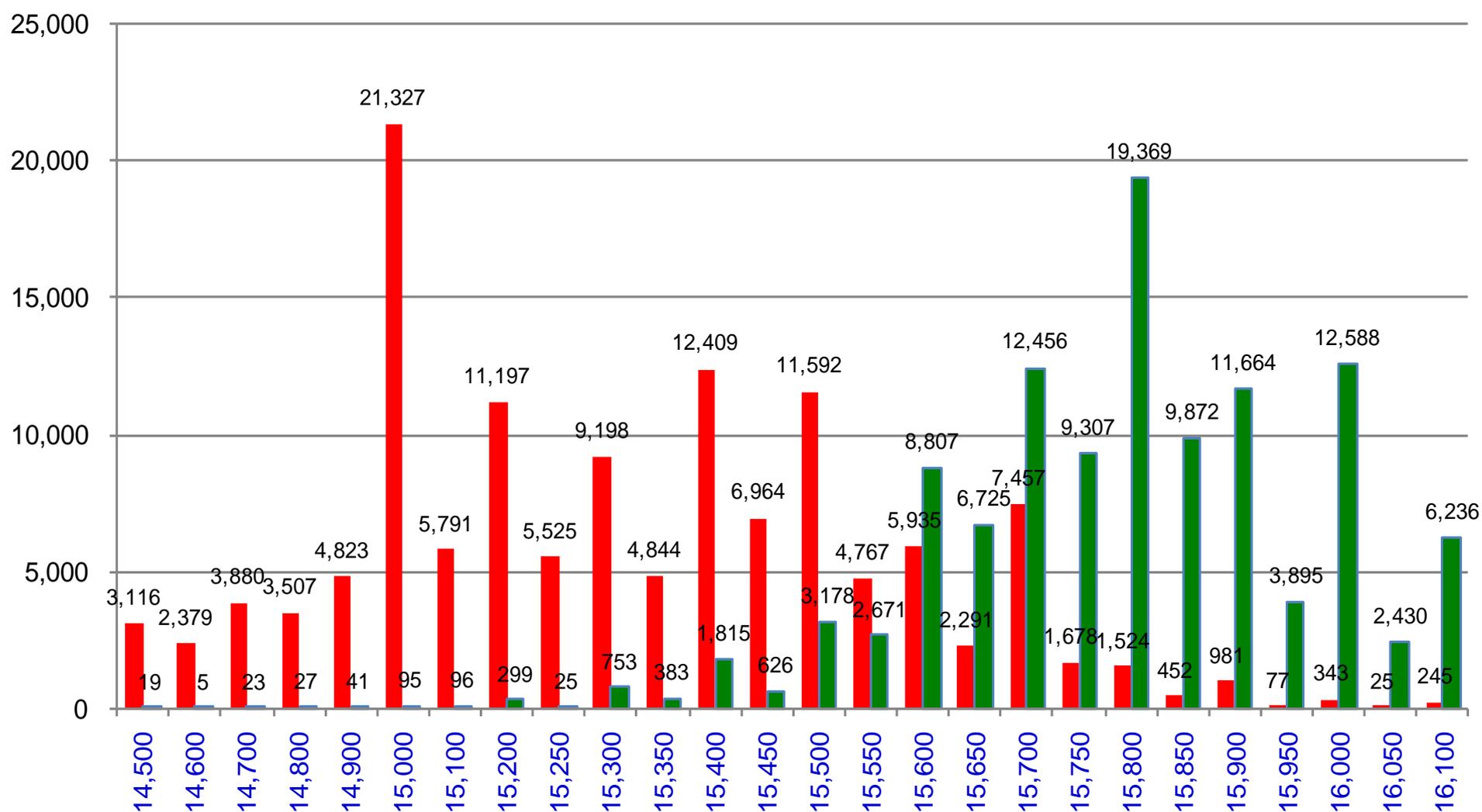


更新日期：2023年5月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：147,874

■ 週選 CALL OI 總額：150,486



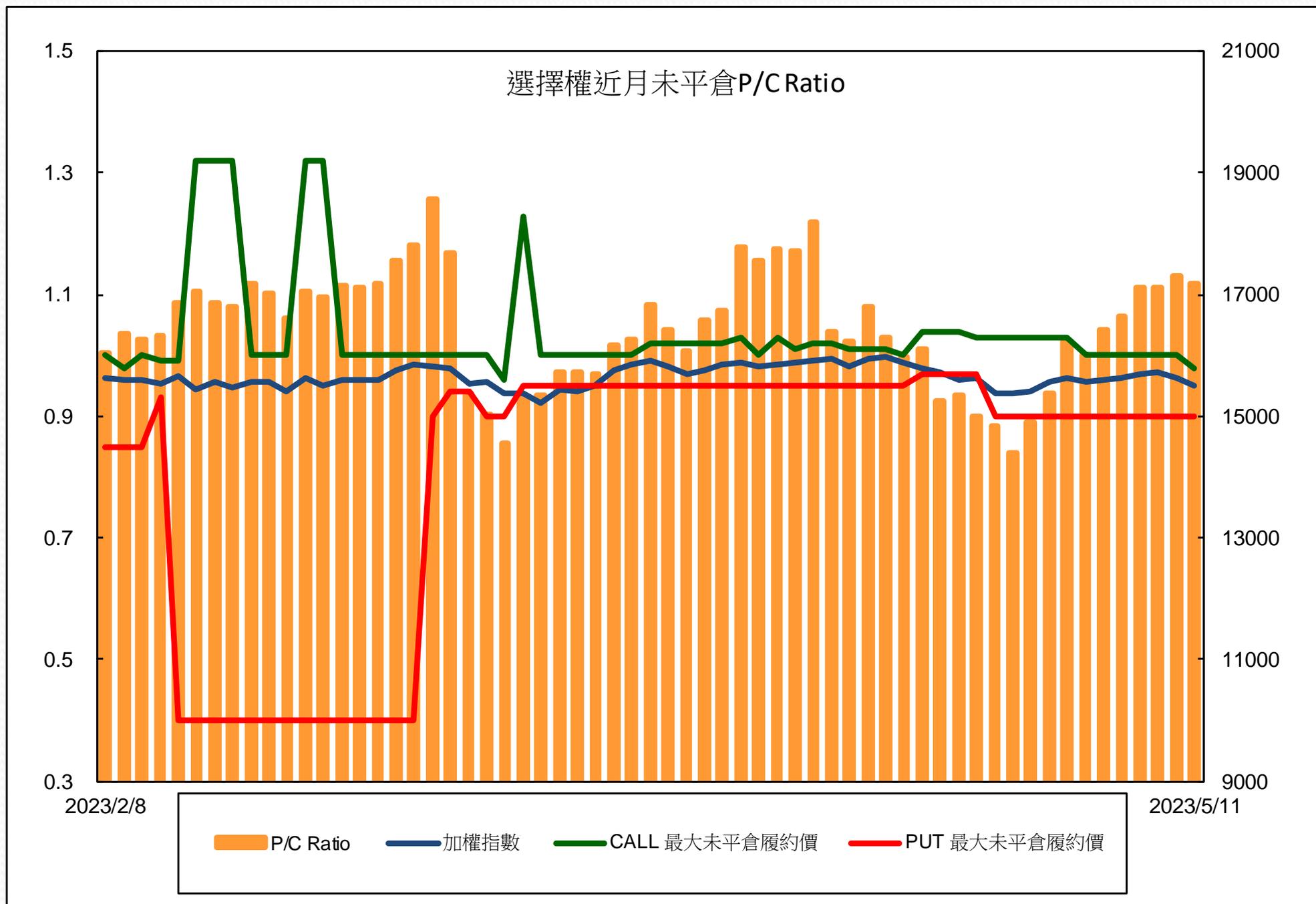
更新日期：2023年5月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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10日	58,655	57,025	1,630
	5月11日	61,327	51,763	9,564
Put	5月10日	53,795	39,633	14,162
	5月11日	55,369	51,224	4,145

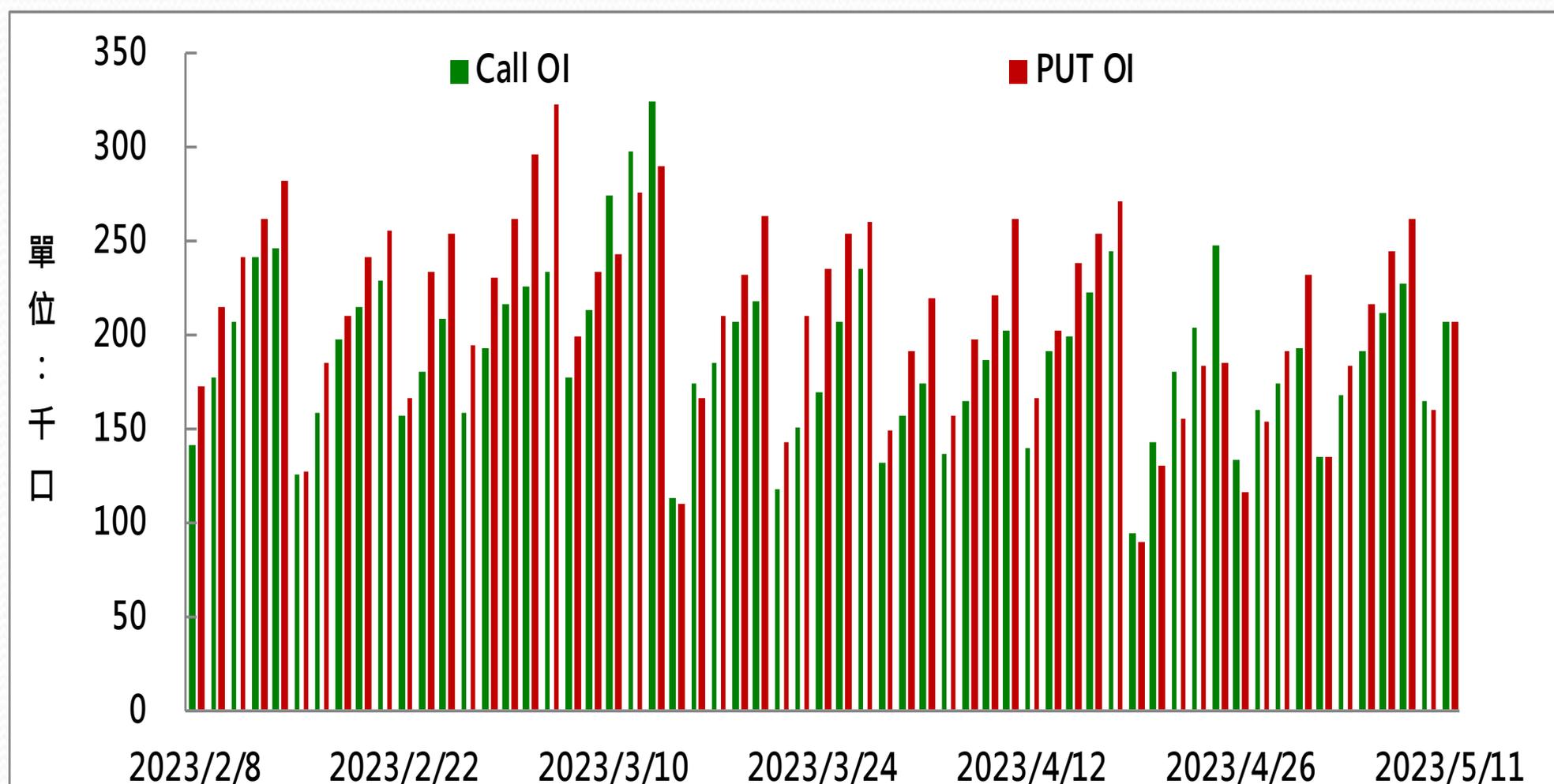
更新日期：2023年5月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年5月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

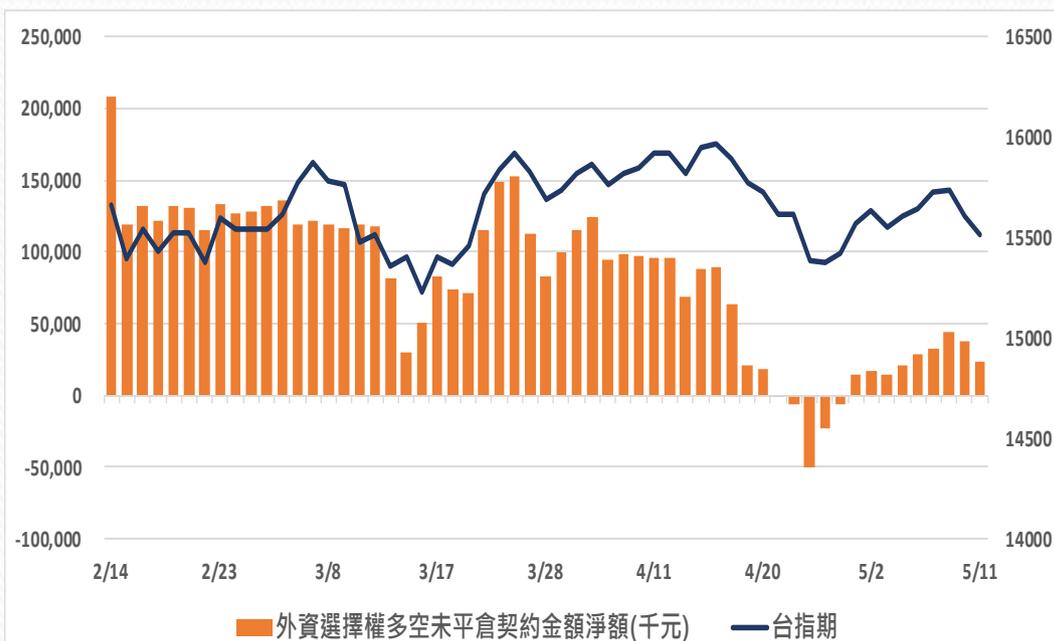
選擇權全月Put Call OI



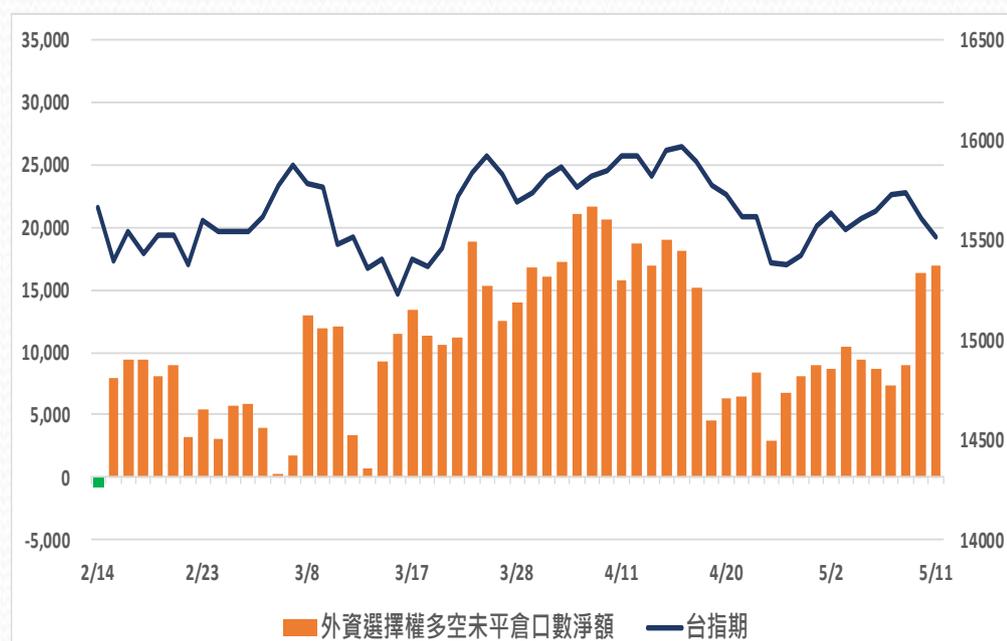
更新日期：2023年5月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



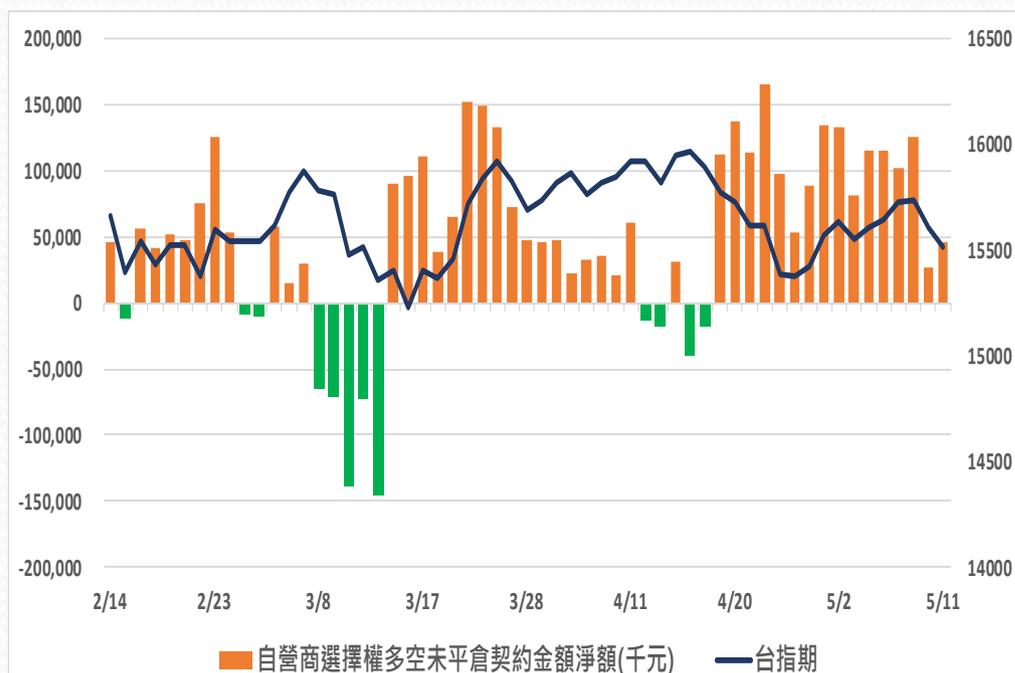
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/5	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
2023/5/11	15519	16,995	+616	23,159	-14,568

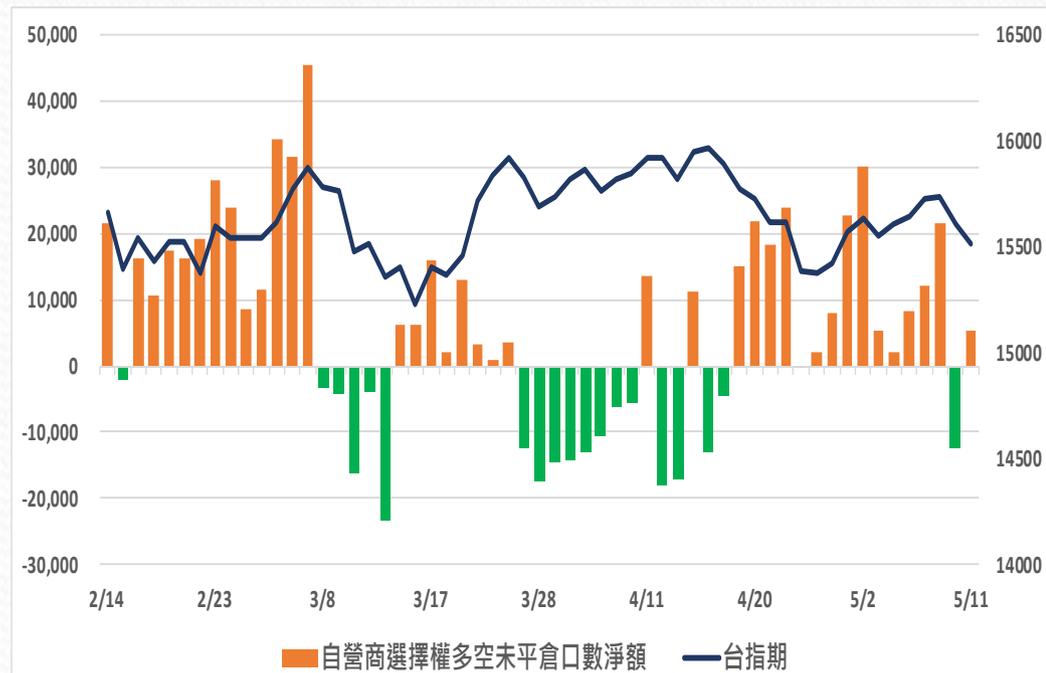
更新日期：2023年5月11日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



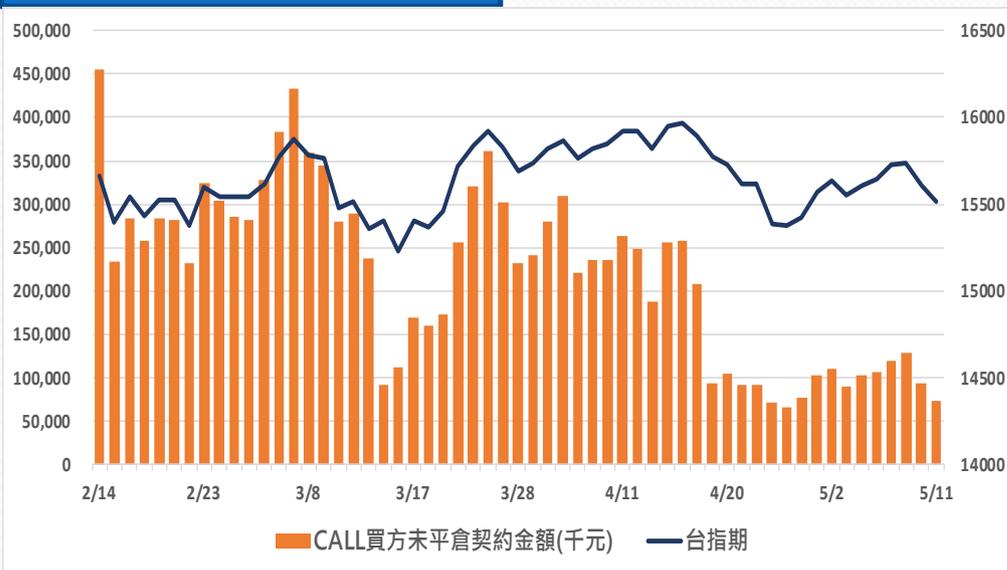
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/5	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
2023/5/11	15519	5,419	+17,951	46,522	+20,044

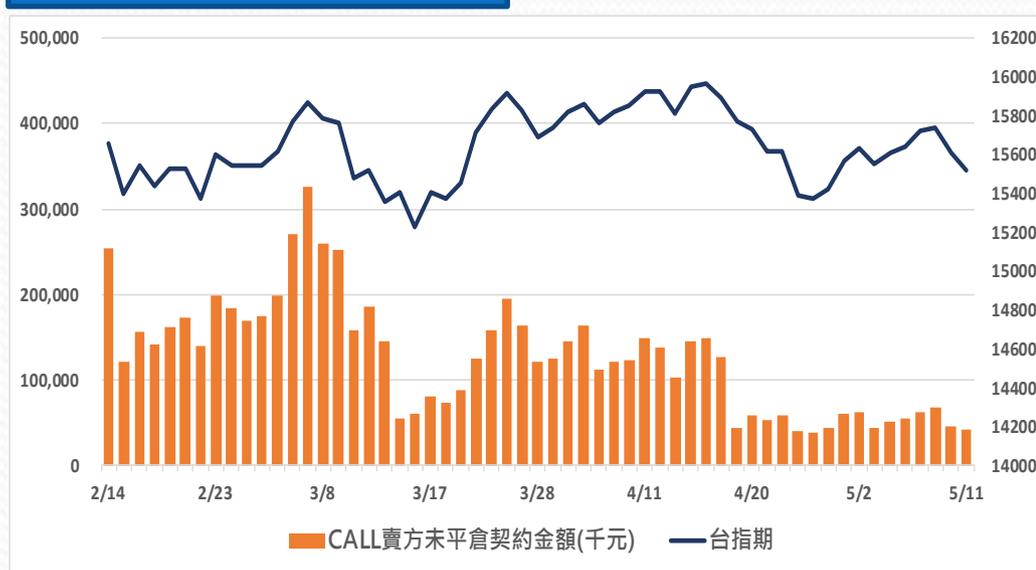
更新日期：2023年5月11日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

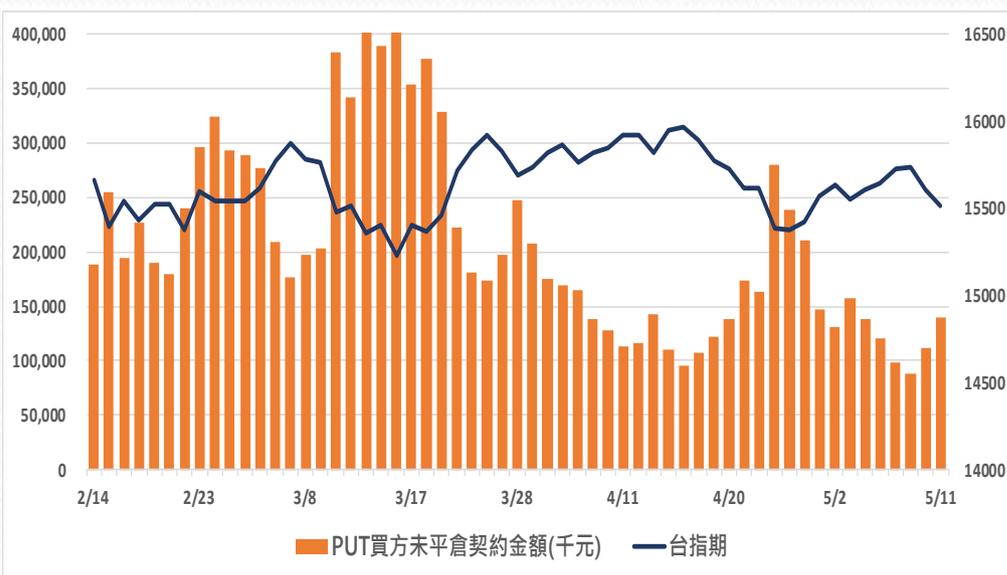
CALL買方未平倉金額



CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



PUT賣方未平倉金額



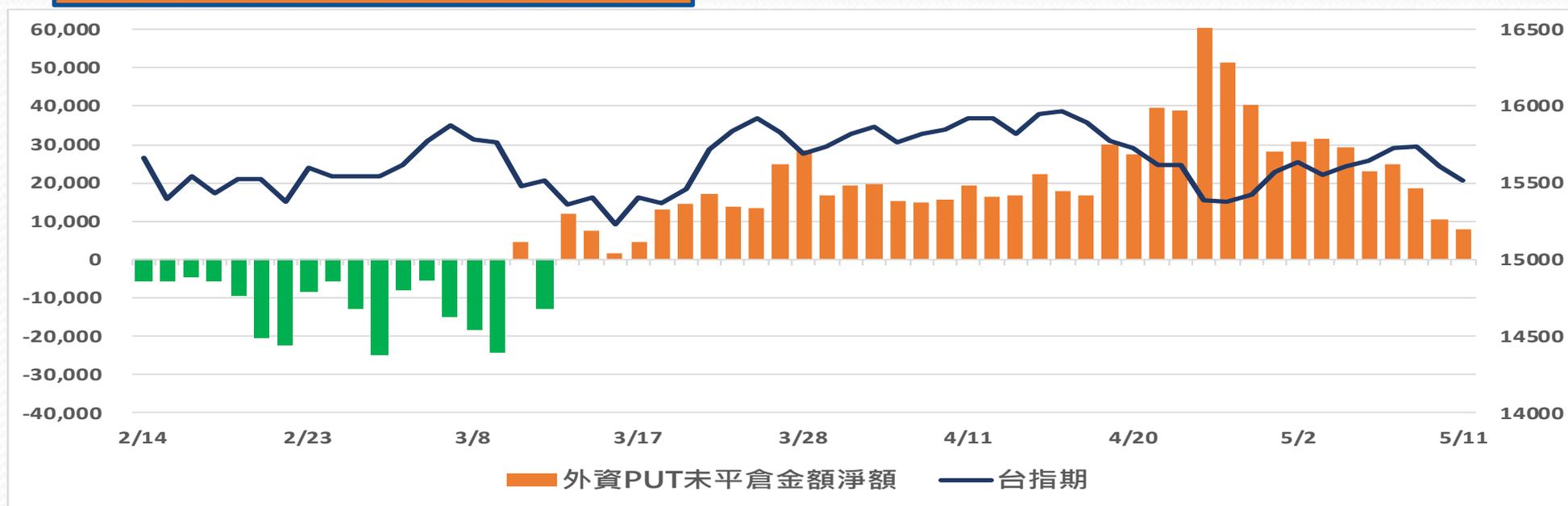
更新日期：2023年5月11日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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11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11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