

台指選擇權OI匯報

日期：2023/5/12					結算日：2023/5/17					日期：2023/5/12					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	OI 增減		Call	履約價	Put	OI 增減		
0	23	14,700	4,661	781		0	20	14,200	931	211		0	1	14,300	675	68			
-1	26	14,800	4,431	924		0	101	14,400	3,118	-45		0	6	14,500	1,820	204			
-2	39	14,900	5,800	977		0	61	14,600	1,981	307		5	7	14,700	1,958	154			
-11	84	15,000	15,677	-5,650		0	127	14,800	3,126	241		2	12	14,900	2,208	146			
33	33	15,050	340	340		6	276	15,000	3,281	326	※	6	51	15,100	1,563	51			
14	110	15,100	6,929	1,138		8	149	15,200	1,716	190		8	149	15,200	1,716	190			
40	40	15,150	4,555	829		65	288	15,300	775	120		65	288	15,300	775	120			
97	396	15,200	12,111	914		514	813	15,400	1,701	85		514	813	15,400	1,701	85			
68	93	15,250	6,948	1,423		-12	1,058	15,500	1,060	95		-12	1,058	15,500	1,060	95			
84	837	15,300	13,776	4,578	※	202	1,010	15,600	420	-37		202	1,010	15,600	420	-37			
227	610	15,350	7,128	2,284		411	1,163	15,700	278	-9		411	1,163	15,700	278	-9			
1,813	3,628	15,400	16,641	4,232		282	2,322	15,800	218	20		282	2,322	15,800	218	20			
1,806	2,432	15,450	7,765	801		※ 1,449	4,004	15,900	248	-15	※	※ 1,449	4,004	15,900	248	-15			
4,059	7,237	15,500	14,411	2,819		1,050	4,704	16,000	143	1		1,050	4,704	16,000	143	1			
3,210	5,881	15,550	5,873	1,106		-476	3,586	16,100	33	-3		-476	3,586	16,100	33	-3			
3,909	12,716	15,600	5,221	-714		-101	4,324	16,200	31	0		-101	4,324	16,200	31	0			
3,444	10,169	15,650	1,888	-403		-13	2,409	16,300	29	0		-13	2,409	16,300	29	0			
※ 4,103	16,559	15,700	6,562	-895		-160	1,211	16,400	56	0		-160	1,211	16,400	56	0			
-155	9,152	15,750	1,436	-242		-129	989	16,500	13	0		-129	989	16,500	13	0			
-940	18,429	15,800	1,371	-153		-75	720	16,600	10	0		-75	720	16,600	10	0			
952	10,824	15,850	405	-47		-178	500	16,700	13	0		-178	500	16,700	13	0			
-1,773	9,891	15,900	971	-10															
25	3,920	15,950	79	2															
434	13,022	16,000	340	-3															
-352	2,078	16,050	28	3															
-194	6,042	16,100	240	-5															
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		增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計			
19,934	170,420	0.9784	166,734	15,134		3,039	40,332	1.1137	44,917	3,208		3,039	40,332	1.1137	44,917	3,208			
昨日 P/C	0.9826	今日增減變化			-0.0042	昨日 P/C	1.1184	今日增減變化			-0.0047	昨日 P/C	1.1184	今日增減變化			-0.0047		

更新日期：2023年5月12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12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	90,444,130	69,740,379	20,703,751	1,489,986	1,126,408	708,341	418,067	-367,167
投信	30,067,117	51,636,715	-21,569,598	60,784	300,706	0	300,706	-2,849
自營商	39,335,026	24,029,114	15,305,912	176,073	1,309,314	681,209	628,105	222,481
	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	761,193	1,315,607	-554,414	-8,565	7,567	77,178	-69,611	-1,589
投信	124,172	0	124,172	-1,264	0	0	0	0
自營商	807,974	693,517	114,457	-158,344	394,697	330,986	63,711	-3,158

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12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	51,903	17,406	34,497	5,648	32,111	21,043	11,068	-786
投信	100	100	0	0	450	113	337	0
自營商	66,385	62,667	3,718	-5,846	55,747	53,374	2,373	-1,772
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	35,794	8,915	26,879	332	6,854	21,547	-14,693	2
特定法人(全月)	43,158	11,307	31,851	5,507	11,529	22,735	-11,206	-461
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	61,602	52,416	9,186	-8,131	50,435	48,643	1,792	4,205
十大交易人(全月)	105,588	74,775	30,813	-6,502	72,552	79,968	-7,416	3,414
全市場未沖銷(近月)			170,420	19,934			166,734	15,134
全市場未沖銷(全月)			239,871	32,313			229,552	22,721

更新日期：2023年5月12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	15500	買權OI最大量	15800
	賣權成交最大量	15400	賣權OI最大量	15400
	整體隱含波動率	9.23%	較前一交易日	-1.02%
	買權隱含波動率	8.70%	較前一交易日	-1.05%
	賣權隱含波動率	9.73%	較前一交易日	-1.08%
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	670	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	1560	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年5月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

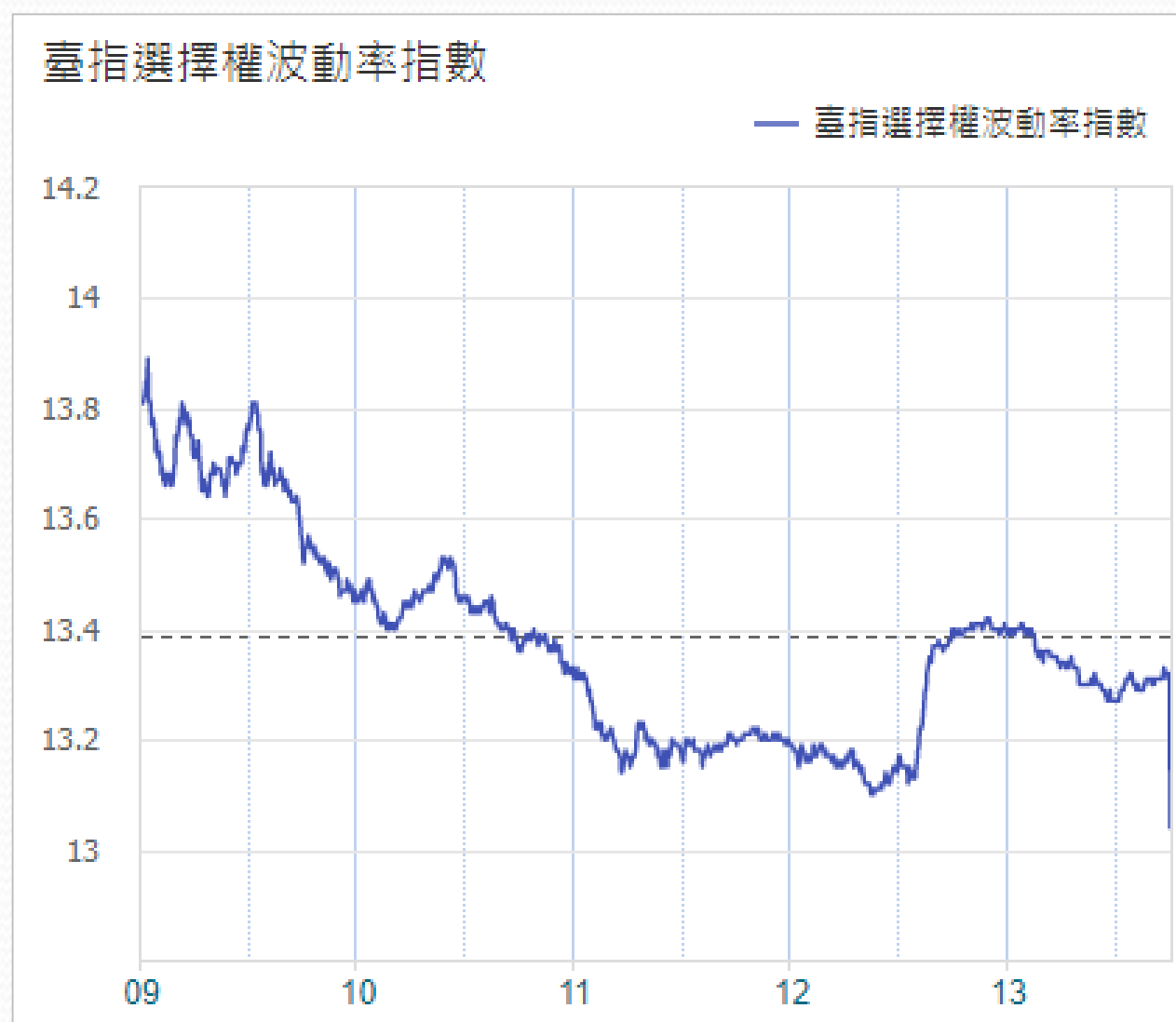
台指選擇權匯報

2023 年 06 月 選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15900	買權OI最大量	16000
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	10000
	整體隱含波動率	12.63%	較前一交易日	-0.10%
	買權隱含波動率	8.97%	較前一交易日	-0.36%
	賣權隱含波動率	16.58%	較前一交易日	+0.40%
	成交量P/C_Ratio值	0.897	較前一交易日	-0.01
	未平倉P/C_Ratio值	1.114	較前一交易日	-0.00
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	670	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	1560	賣權OI最大量	1540

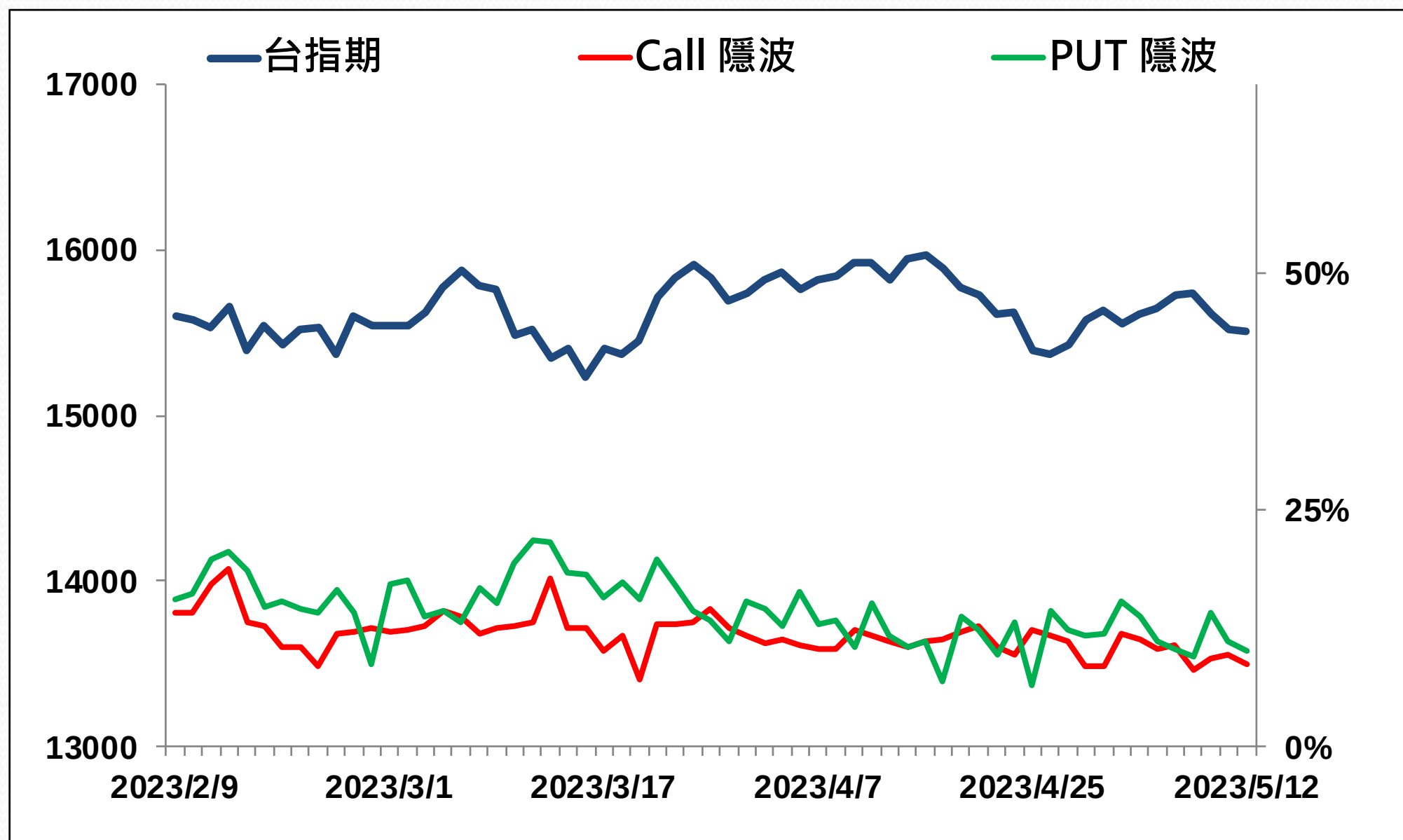
更新日期：2023年5月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



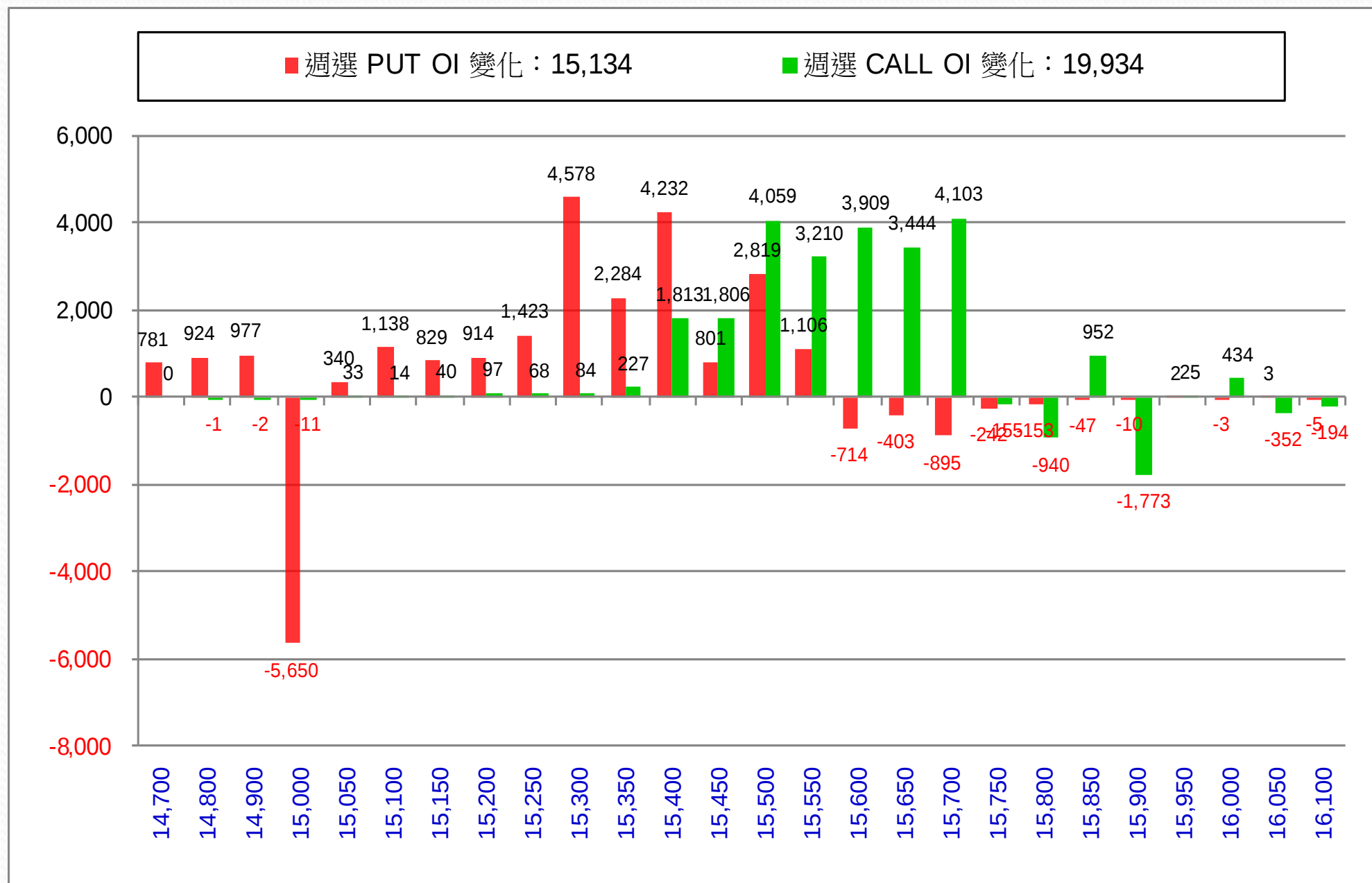
更新日期：2023年5月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年5月12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

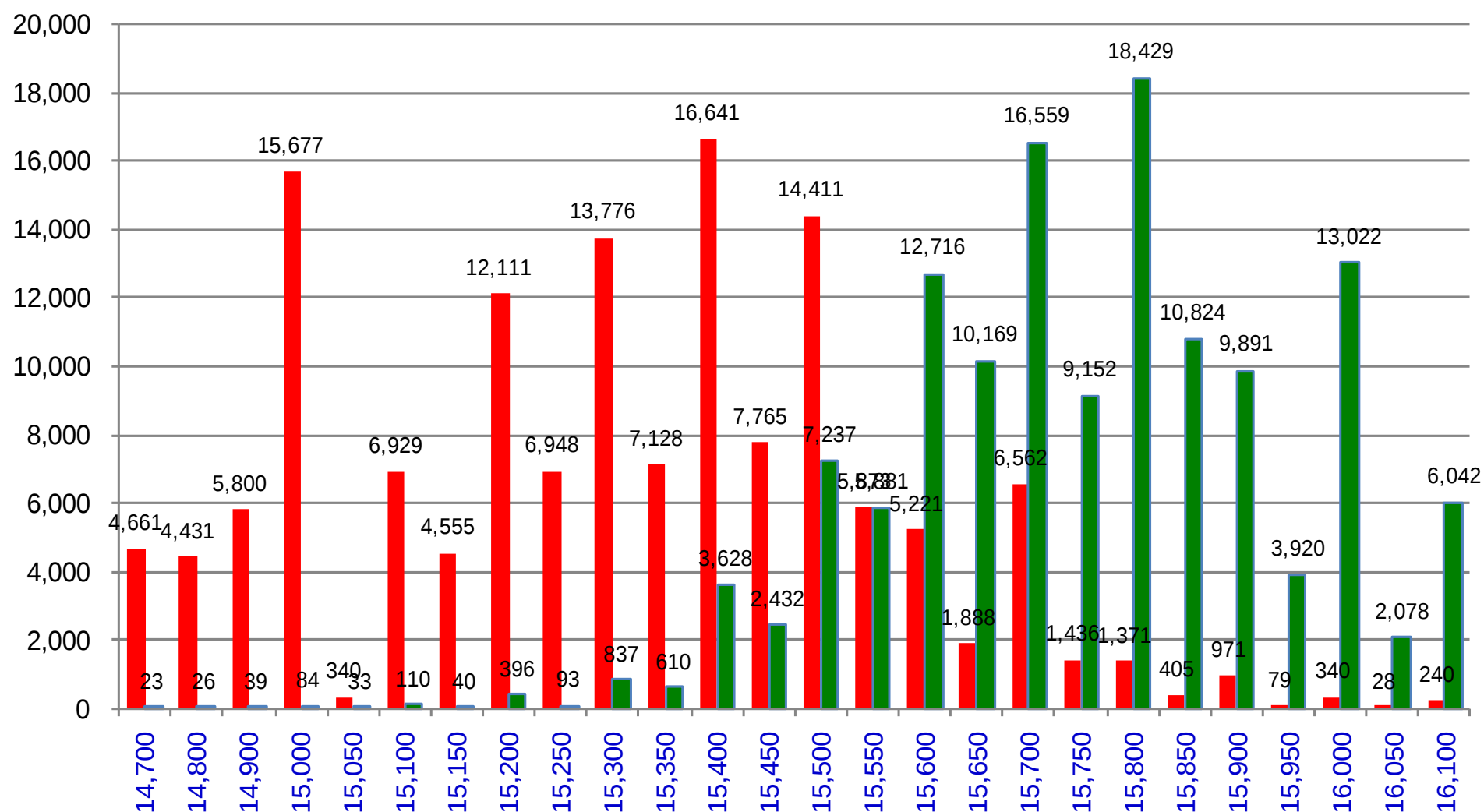


更新日期：2023年5月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：166,734

週選 CALL OI 總額：170,420



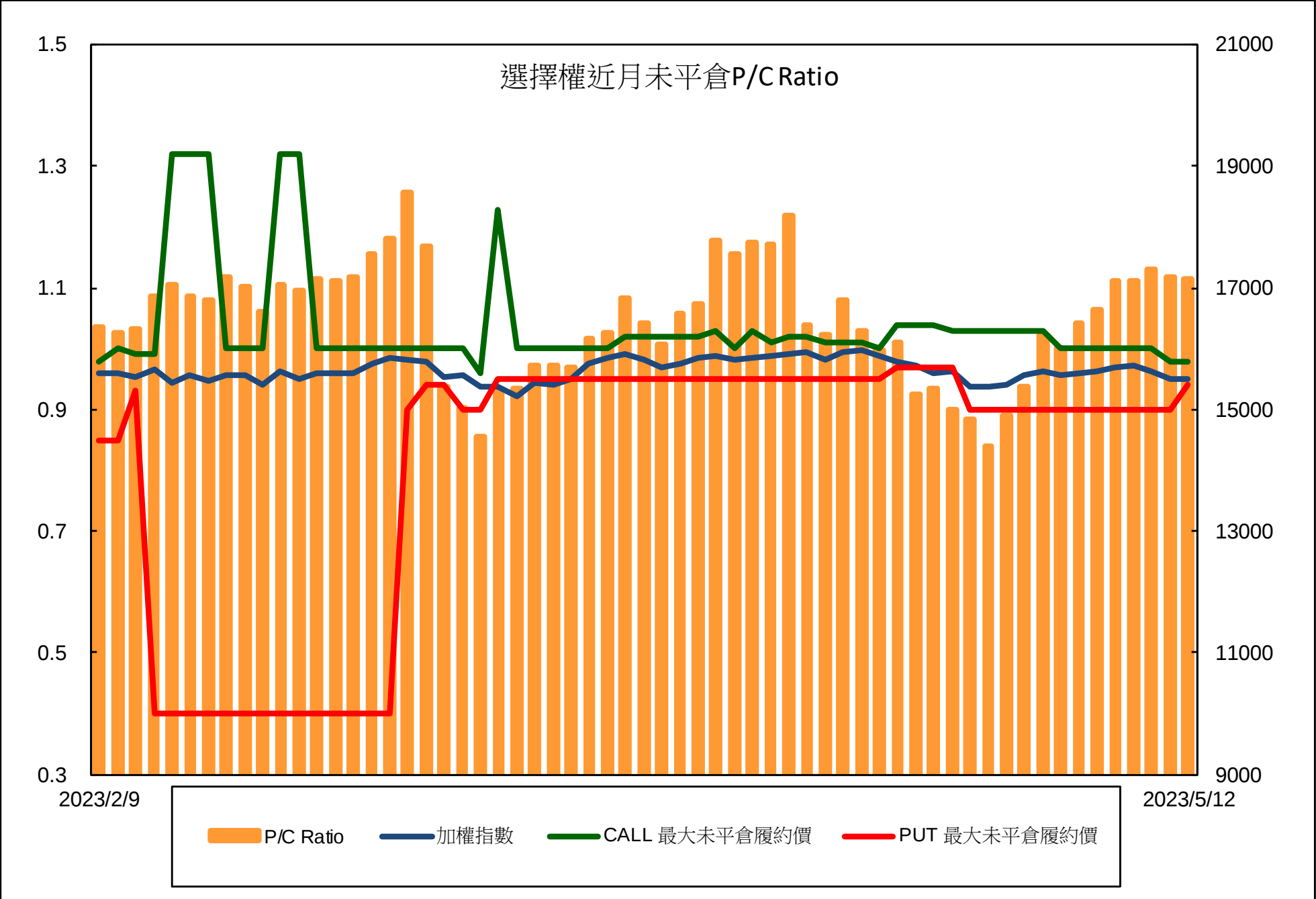
更新日期：2023年5月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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11日	61,327	51,763	9,564
	5月12日	66,385	62,667	3,718
Put	5月11日	55,369	51,224	4,145
	5月12日	55,747	53,374	2,373

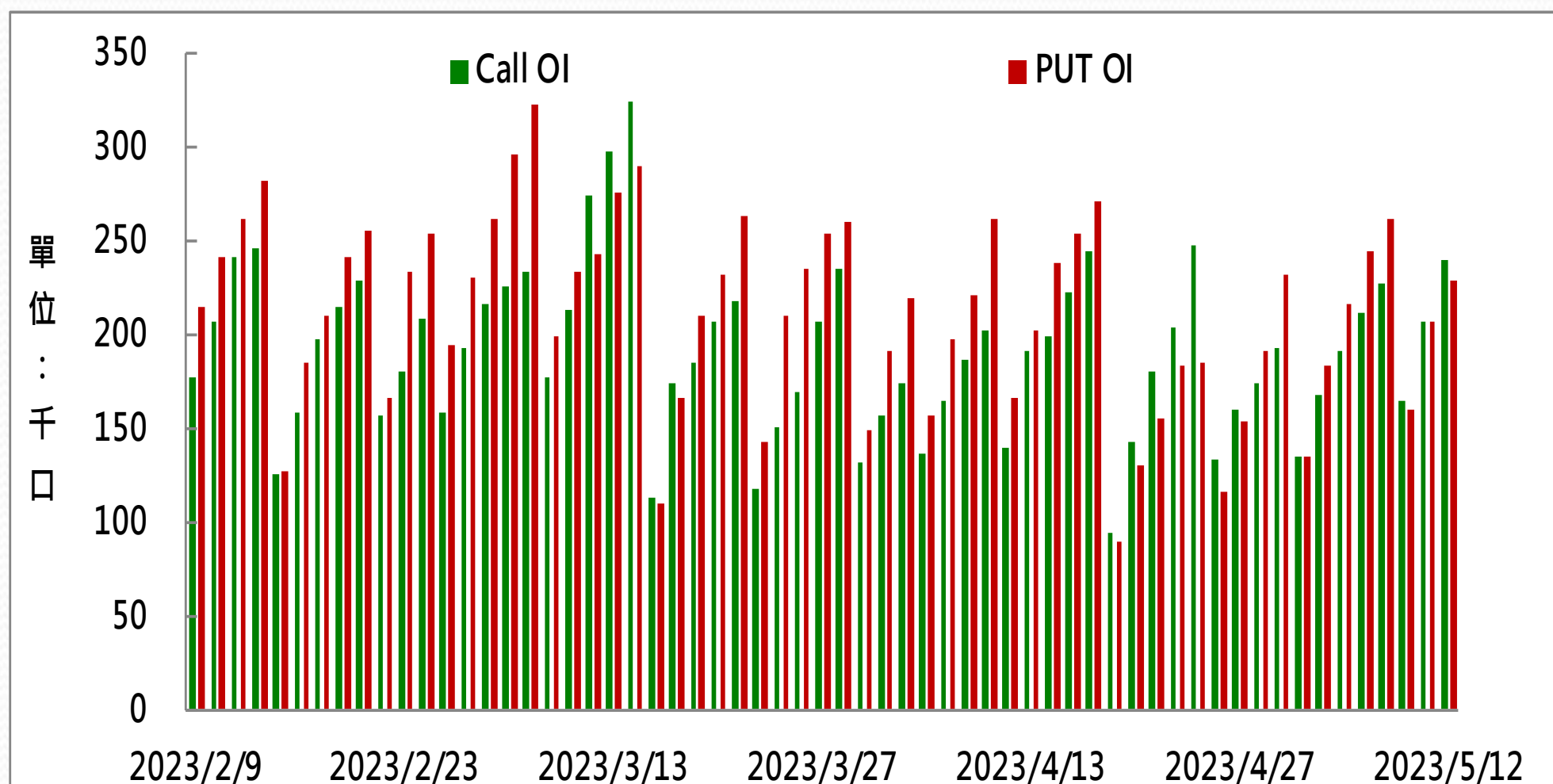
更新日期：2023年5月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年5月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

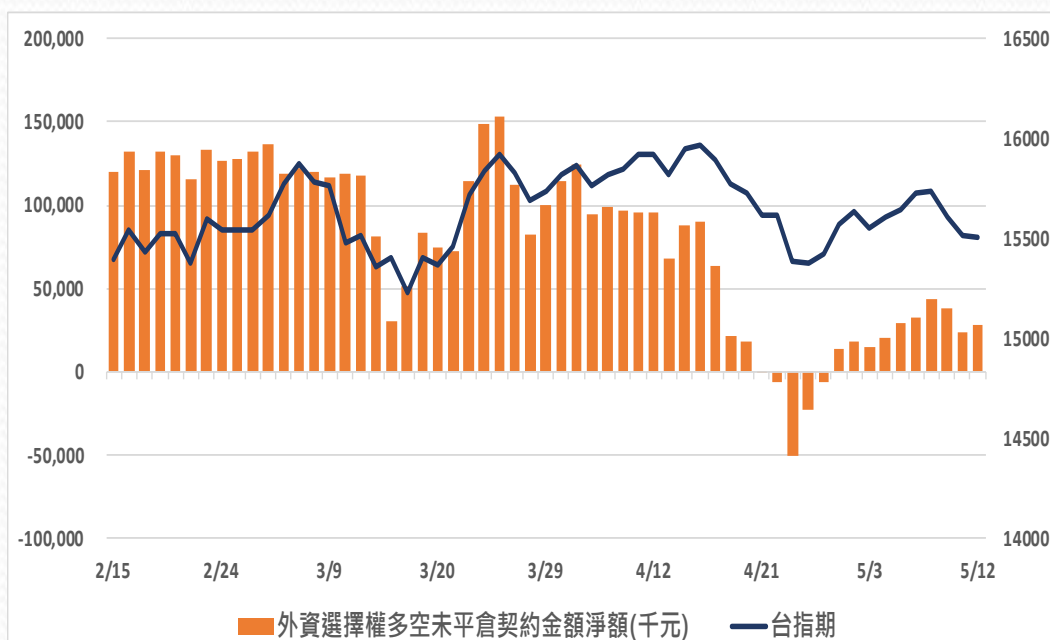
選擇權全月Put Call OI



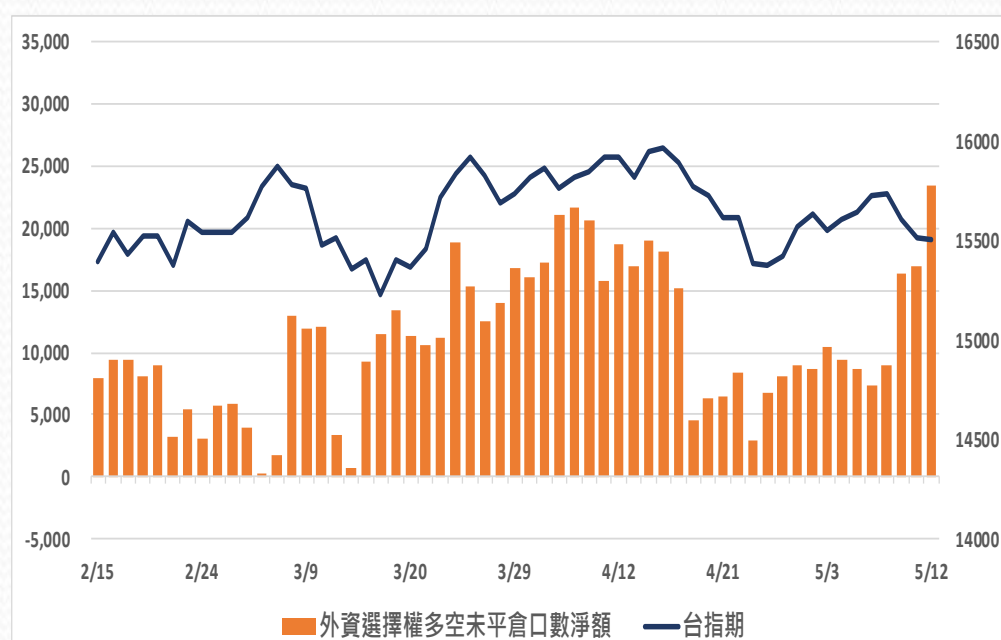
更新日期：2023年5月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



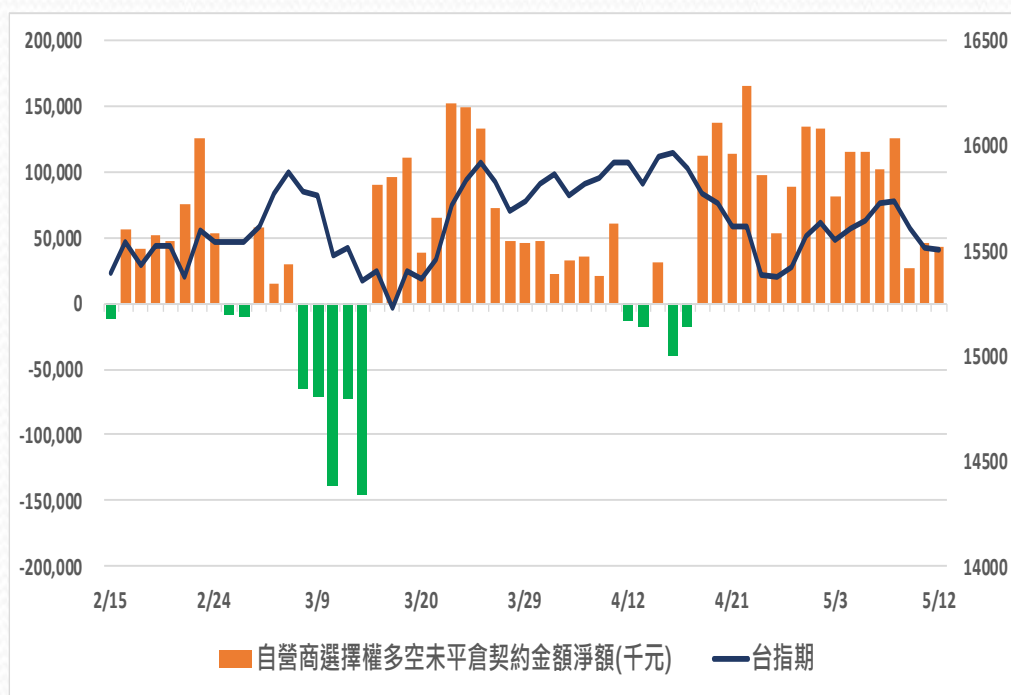
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/8	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
2023/5/12	15506	23,429	+6,434	27,875	+4,716

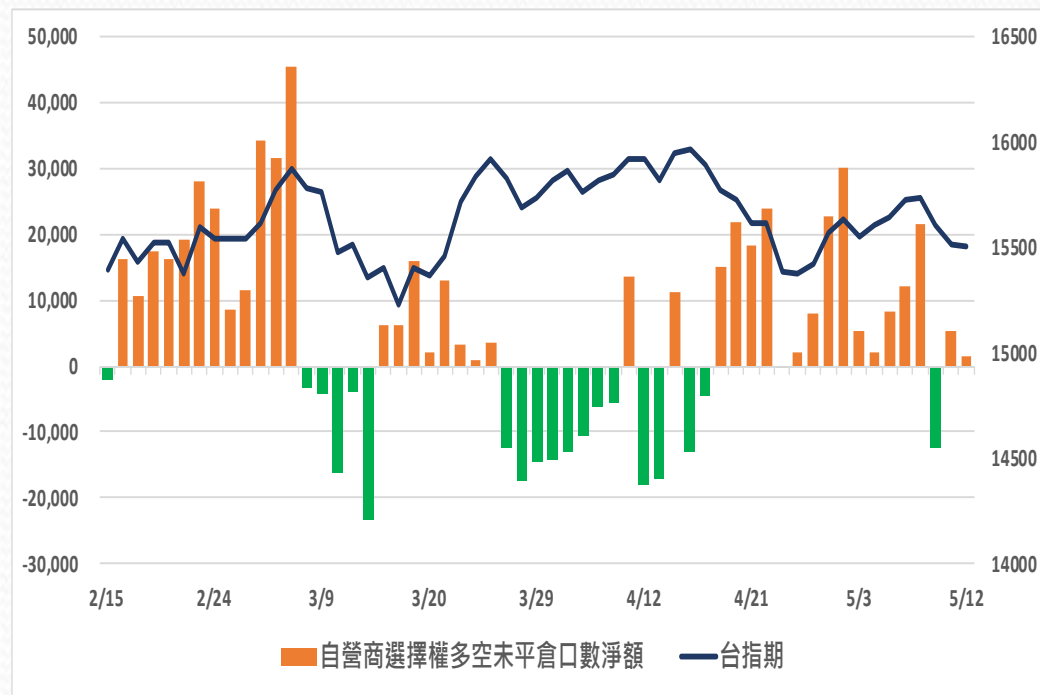
更新日期：2023年5月12日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



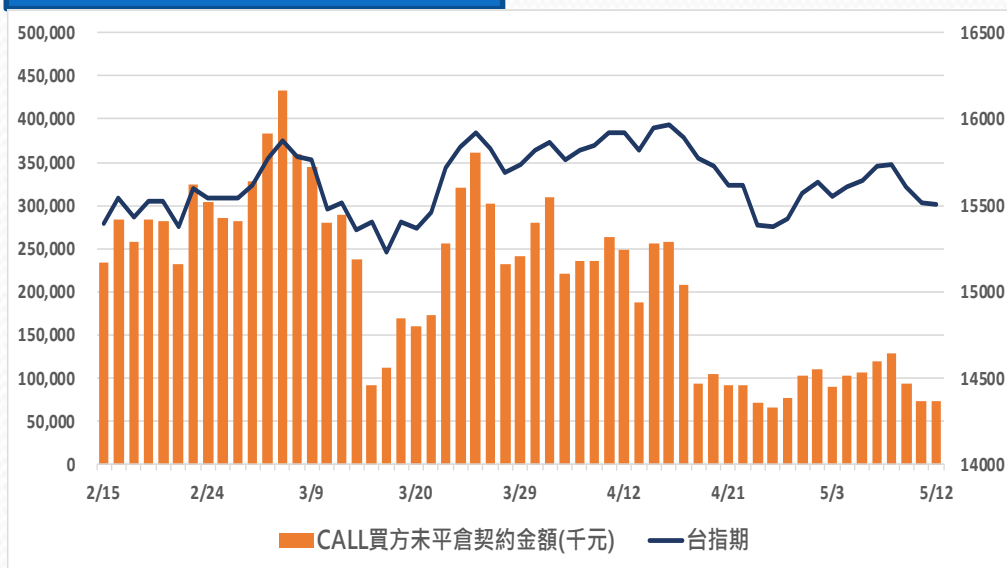
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/8	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
2023/5/12	15506	1,345	-4,074	42,496	-4,026

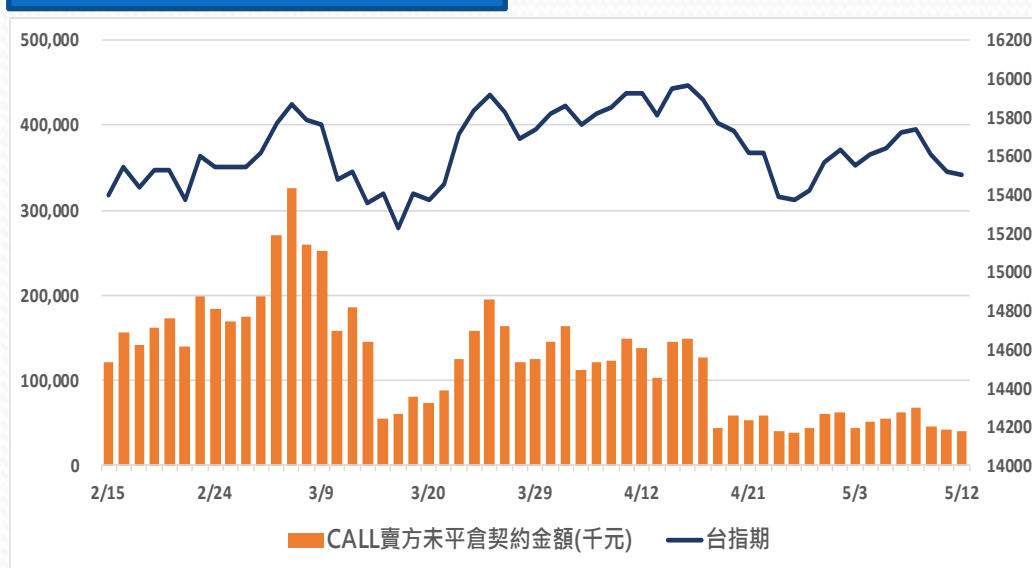
更新日期：2023年5月12日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

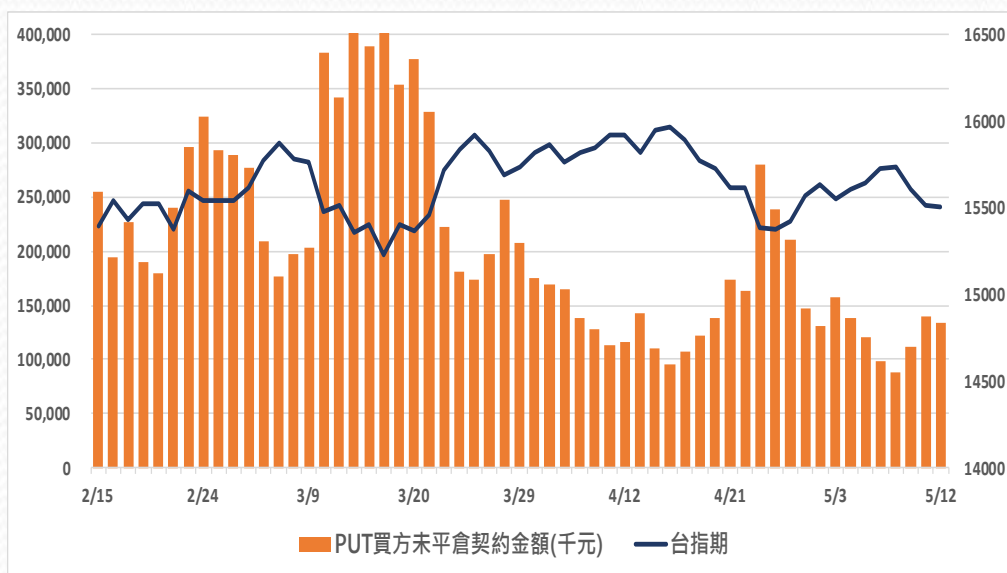
CALL買方未平倉金額



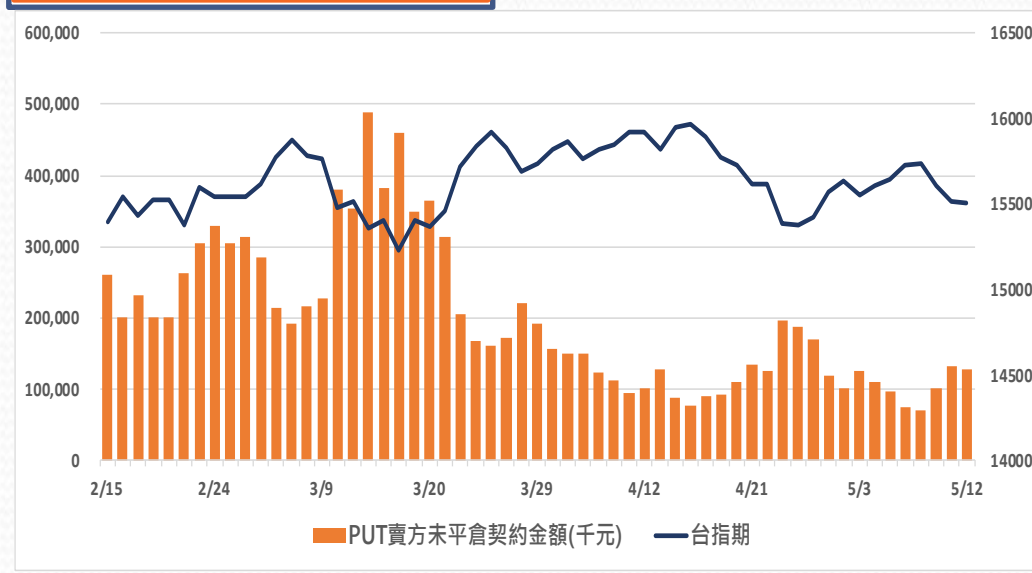
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



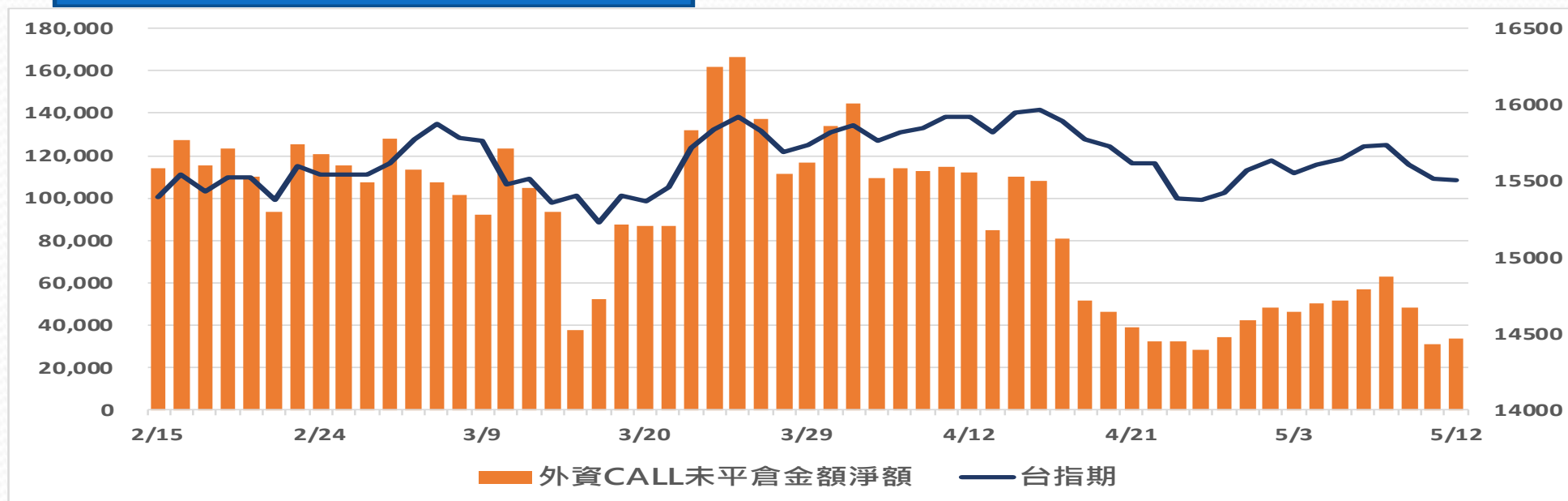
PUT賣方未平倉金額



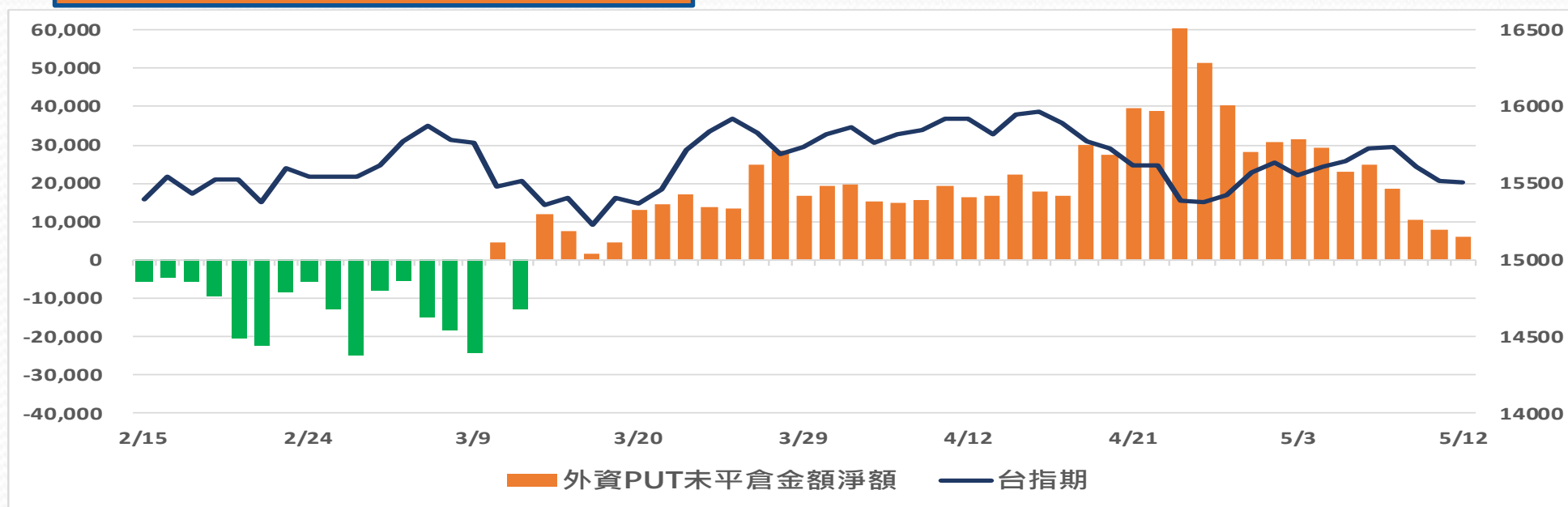
更新日期：2023年5月12日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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12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12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