

台指選擇權OI匯報

日期：2023/5/15					結算日：2023/5/17					日期：2023/5/15					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										
0	23	14,700	4,627	-34	0	20	14,200	985	54										
0	26	14,800	4,456	25	0	1	14,300	719	44										
-1	38	14,900	7,400	1,600	0	101	14,400	2,843	-275										
0	84	15,000	15,256	-421	0	6	14,500	1,830	10										
0	33	15,050	836	496	0	61	14,600	2,210	229										
-11	99	15,100	7,727	798	3	10	14,700	2,060	102										
0	40	15,150	4,675	120	1	128	14,800	2,779	-347										
36	432	15,200	13,069	958	0	12	14,900	2,430	222										
21	114	15,250	7,950	1,002	2	278	15,000	3,367	86										
39	876	15,300	15,769	1,993	18	69	15,100	1,641	78										
264	874	15,350	9,129	2,001	28	177	15,200	1,704	-12										
1,800	5,428	15,400	20,172	3,531	42	330	15,300	1,100	325										
1,817	4,249	15,450	7,873	108	52	865	15,400	1,850	149										
1,347	8,584	15,500	13,314	-1,097	794	1,852	15,500	1,150	90										
3,394	9,275	15,550	5,860	-13	234	1,244	15,600	424	4										
6,270	18,986	15,600	5,919	698	232	1,395	15,700	290	12										
3,742	13,911	15,650	2,107	219	229	2,551	15,800	221	3										
-867	15,692	15,700	6,499	-63	763	4,767	15,900	250	2										
-52	9,100	15,750	1,337	-99	195	4,899	16,000	150	7										
-1,059	17,370	15,800	1,301	-70	-101	3,485	16,100	33	0										
-412	10,412	15,850	392	-13	55	4,379	16,200	31	0										
-660	9,231	15,900	947	-24	85	2,494	16,300	30	1										
-307	3,613	15,950	78	-1	20	1,231	16,400	56	0										
-437	12,585	16,000	347	7	53	1,042	16,500	13	0										
-124	1,954	16,050	28	0	1	721	16,600	10	0										
-160	5,882	16,100	244	4	-15	485	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										
14,452	184,872	0.9643	178,267	11,533	2,736	43,068	1.0695	46,062	1,145										
昨日 P/C	0.9784	今日增減變化			-0.0141	昨日 P/C	1.1137	今日增減變化		-0.0442									

更新日期：2023年5月15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15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	120,838,984	84,150,398	36,688,586	15,984,835	1,288,396	864,661	423,735	5,668
投信	30,179,144	51,541,840	-21,362,696	206,902	300,245	0	300,245	-461
自營商	41,982,640	36,105,686	5,876,954	-9,428,958	1,862,385	679,642	1,182,743	554,638
	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	819,206	1,295,297	-476,091	78,323	7,567	86,258	-78,691	-9,080
投信	125,102	0	125,102	930	0	0	0	0
自營商	1,148,459	890,738	257,721	143,264	597,972	519,276	78,696	14,985

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15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	52,669	17,467	35,202	705	33,121	21,760	11,361	293
投信	100	100	0	0	450	113	337	0
自營商	73,737	67,498	6,239	2,521	49,619	59,745	-10,126	-12,499
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	35,794	8,927	26,867	-12	6,870	21,708	-14,838	-145
特定法人(全月)	43,408	11,582	31,826	-25	11,808	23,696	-11,888	-682
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	63,715	56,434	7,281	-1,905	51,819	43,152	8,667	6,875
十大交易人(全月)	112,337	81,260	31,077	264	77,108	75,256	1,852	9,268
全市場未沖銷(近月)			184,872	14,452			178,267	11,533
全市場未沖銷(全月)			262,900	23,029			249,292	19,740

更新日期：2023年5月15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	15600
	賣權成交最大量	15500	賣權OI最大量	15400
	整體隱含波動率	10.16%	較前一交易日	+0.93%
	買權隱含波動率	12.26%	較前一交易日	+3.56%
	賣權隱含波動率	8.01%	較前一交易日	-1.72%
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	700	賣權OI最大量	660
金融選擇權	買權成交最大量	1600	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1480	賣權OI最大量	1540

更新日期：2023年5月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

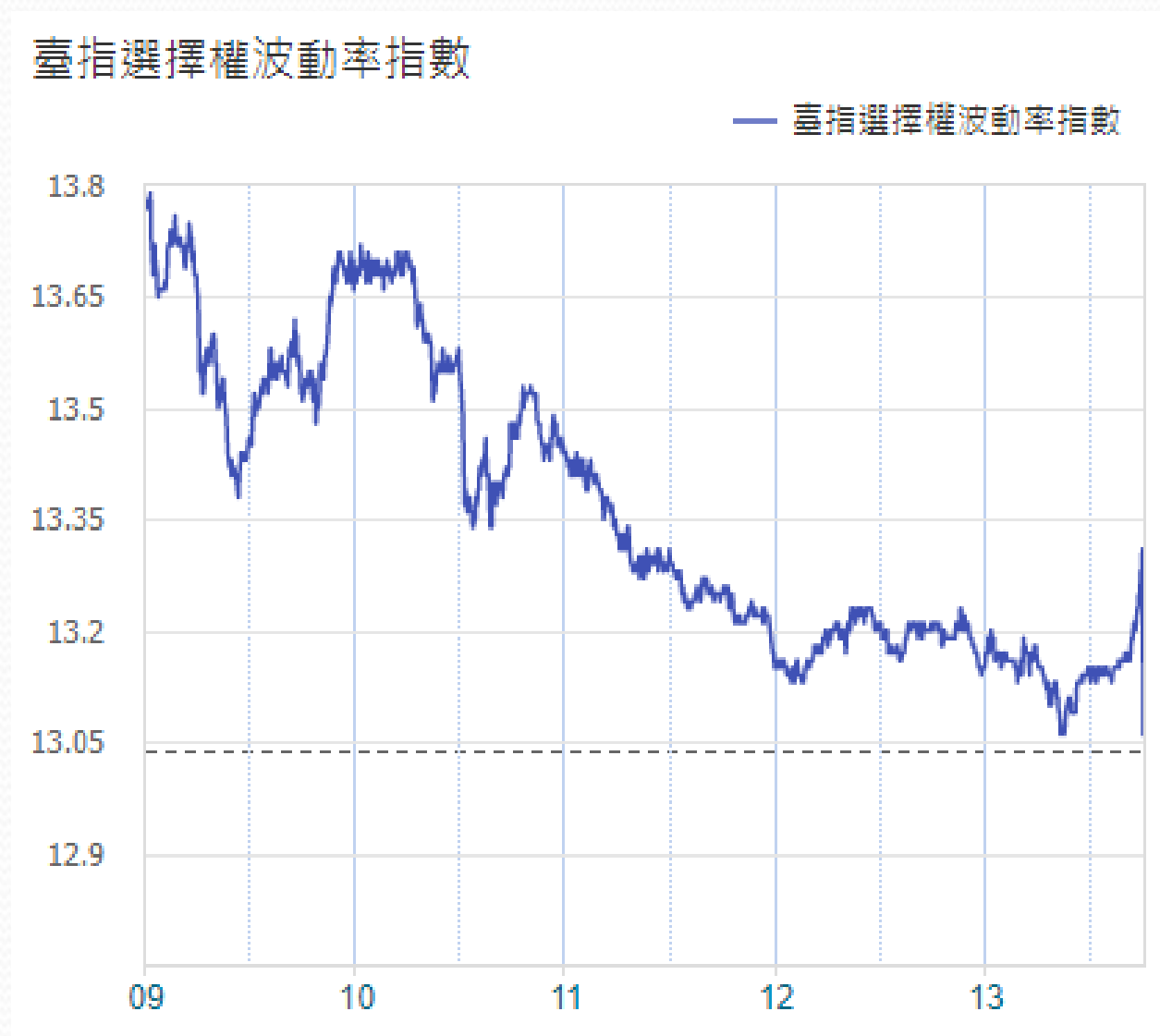
台指選擇權匯報

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	14800	賣權OI最大量	10000
	整體隱含波動率	12.56%	較前一交易日	+0.06%
	買權隱含波動率	10.04%	較前一交易日	+1.08%
	賣權隱含波動率	14.98%	較前一交易日	-1.60%
	成交量P/C_Ratio值	1.062	較前一交易日	+0.16
	未平倉P/C_Ratio值	1.070	較前一交易日	-0.04
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	700	賣權OI最大量	660
金融選擇權	買權成交最大量	1600	買權OI最大量	1620
	賣權成交最大量	1480	賣權OI最大量	1540

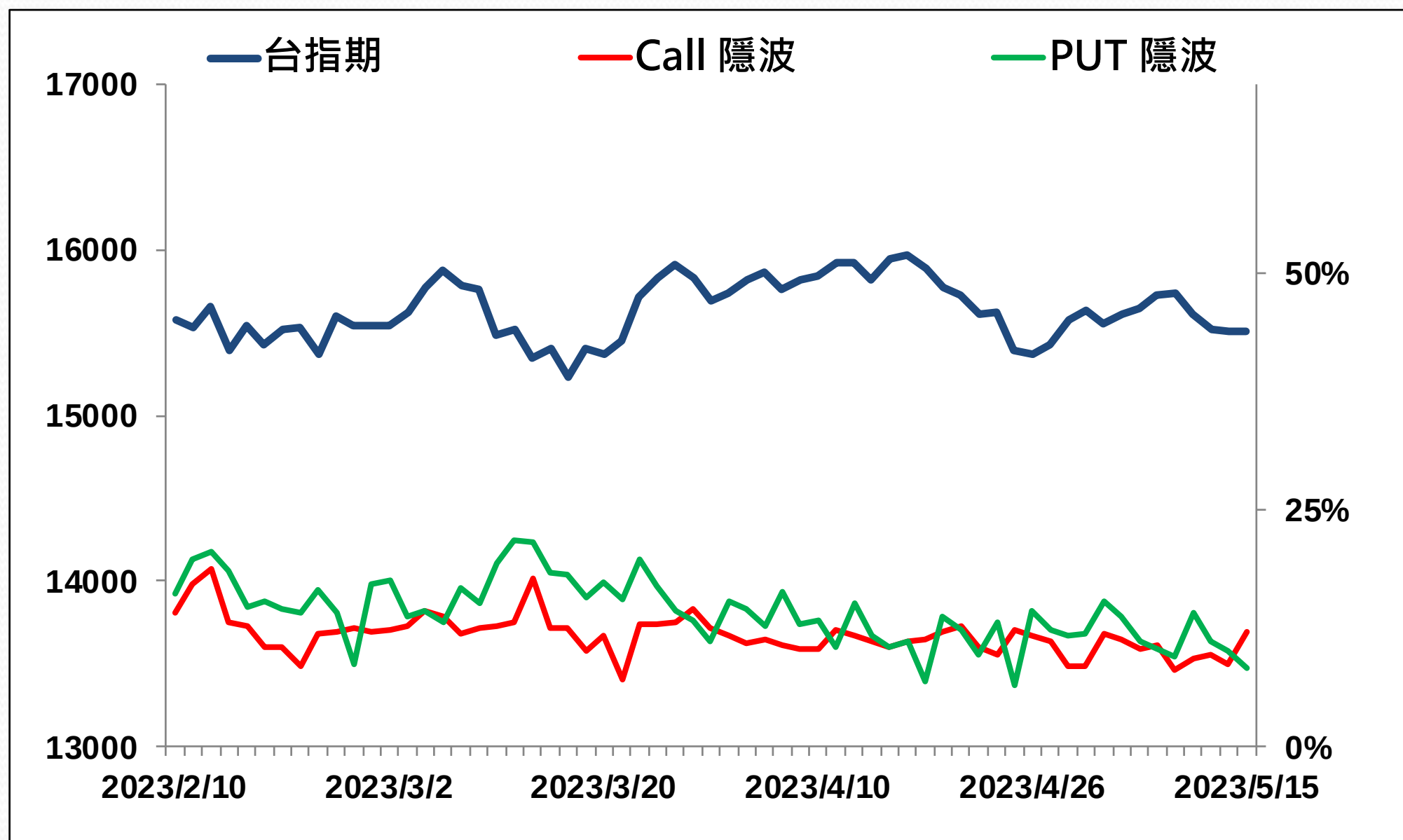
更新日期：2023年5月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



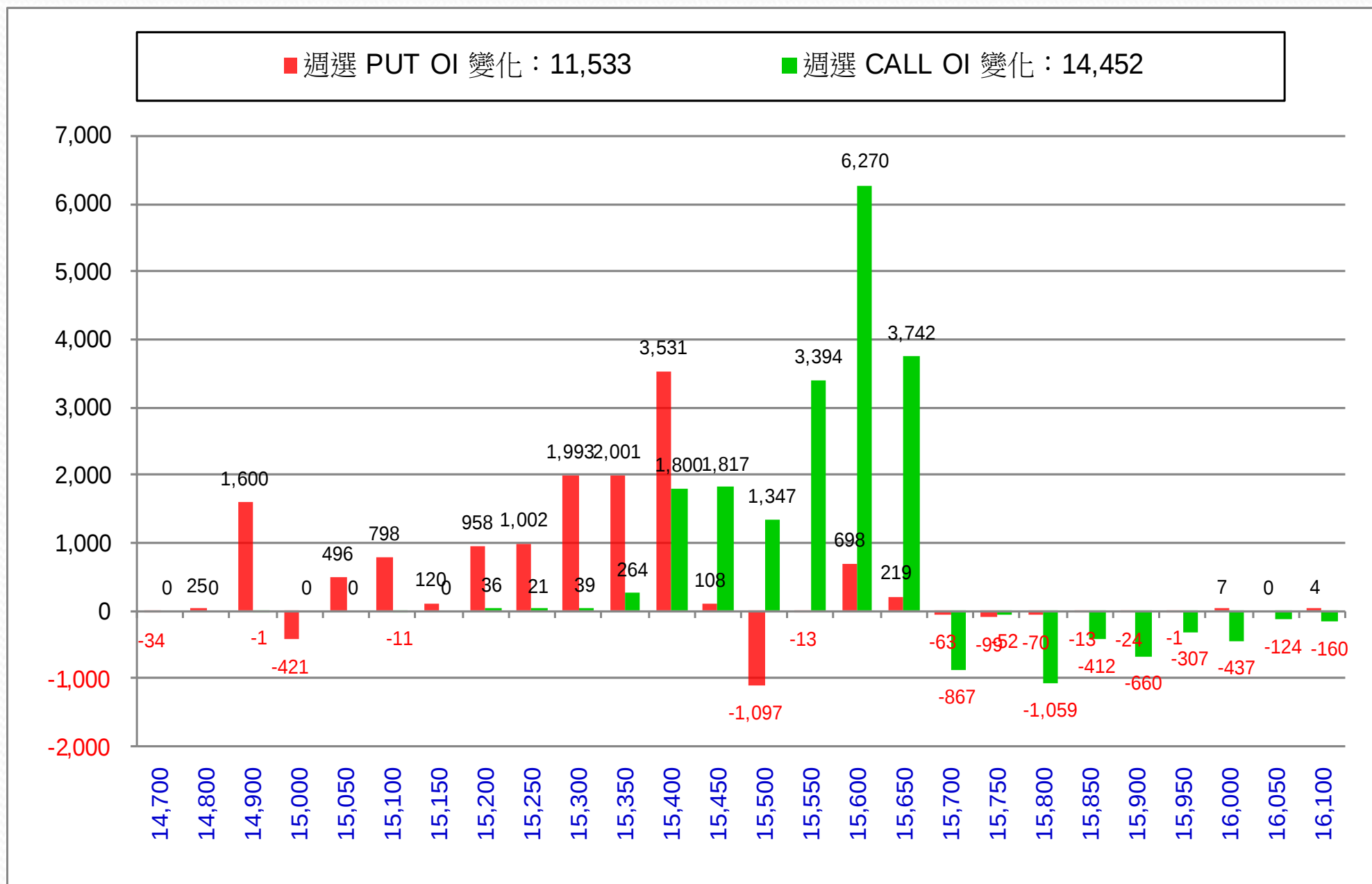
更新日期：2023年5月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年5月15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

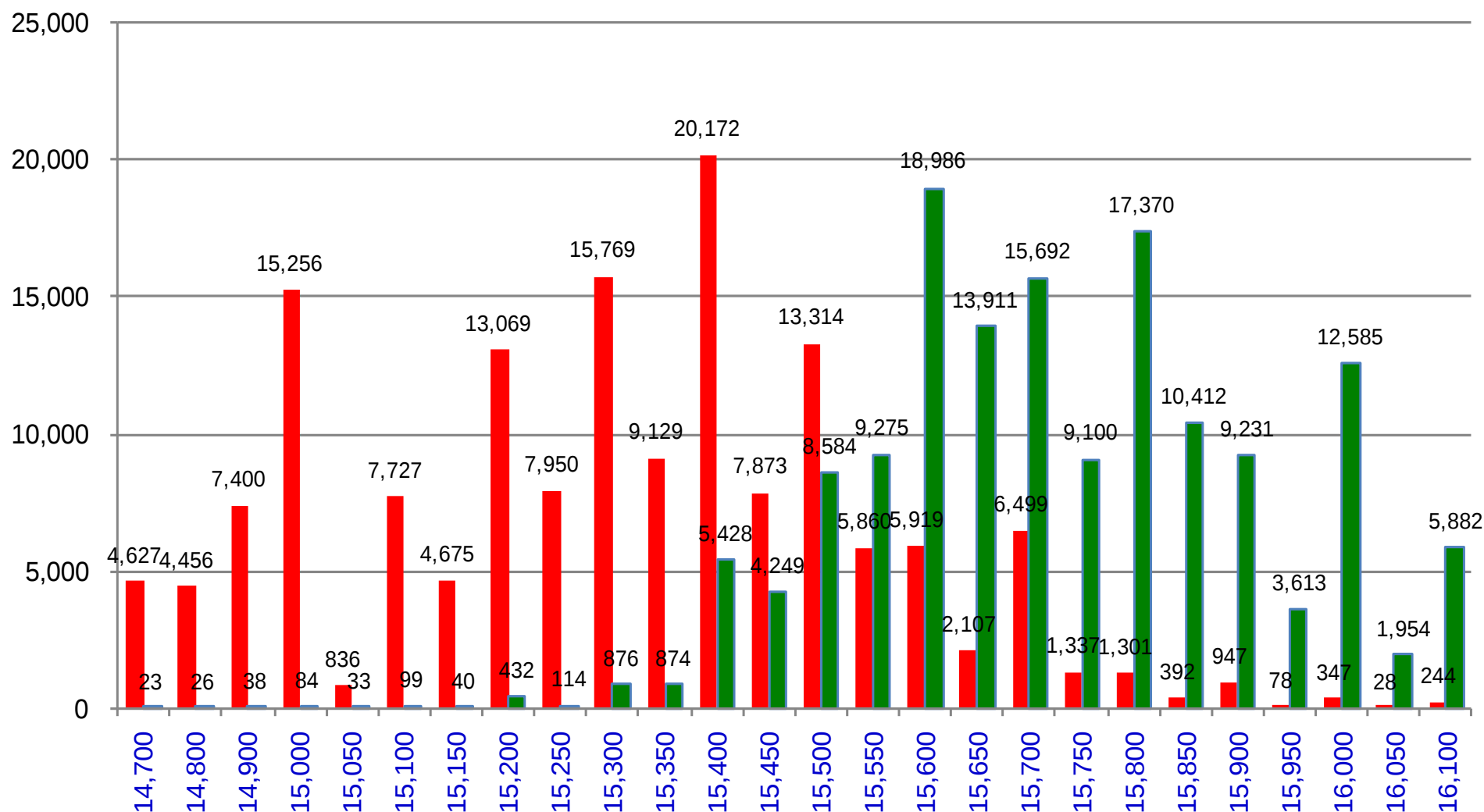


更新日期：2023年5月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：178,267

週選 CALL OI 總額：184,872



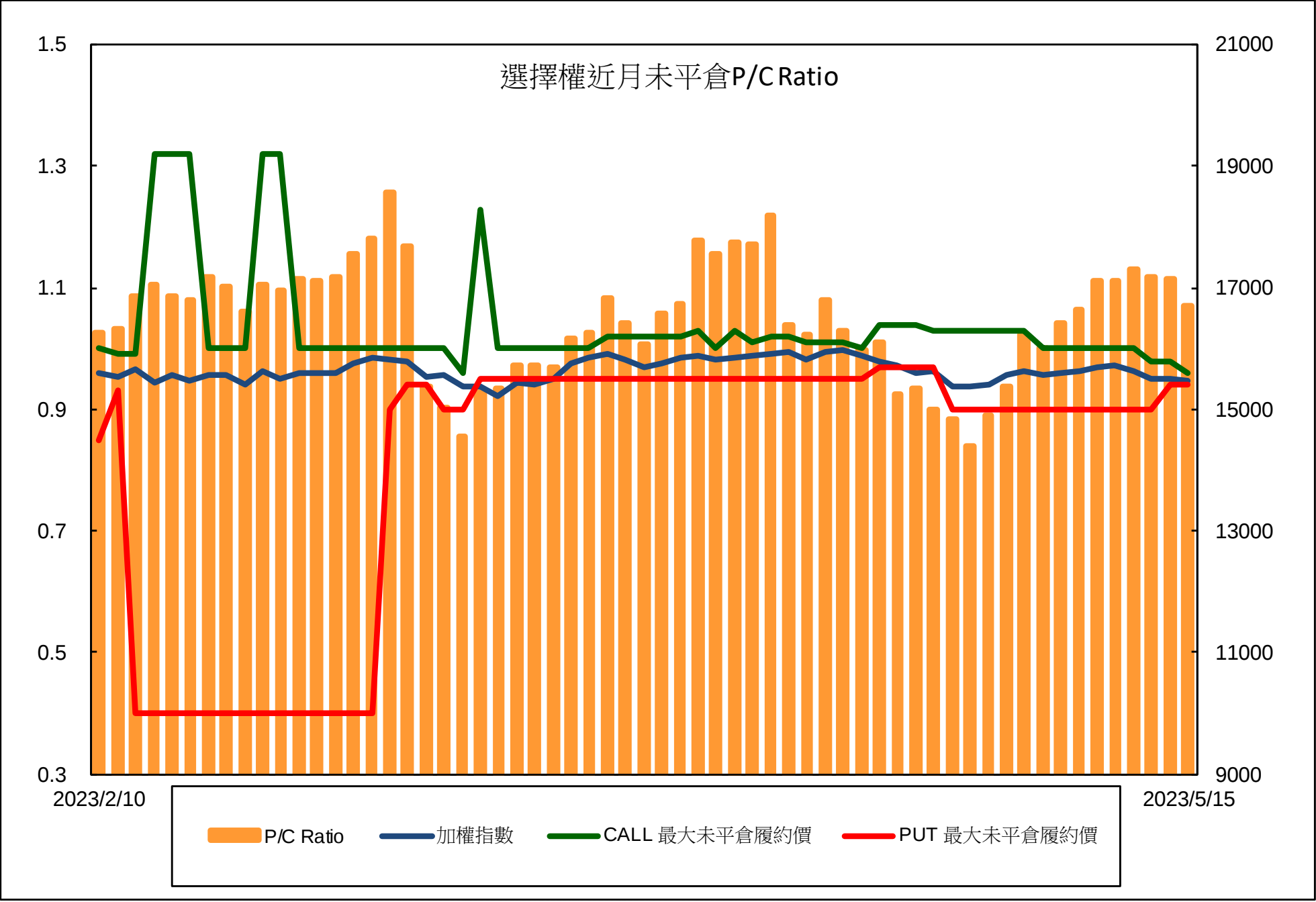
更新日期：2023年5月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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12日	66,385	62,667	3,718
	5月15日	73,737	67,498	6,239
Put	5月12日	55,747	53,374	2,373
	5月15日	49,619	59,745	-10,126

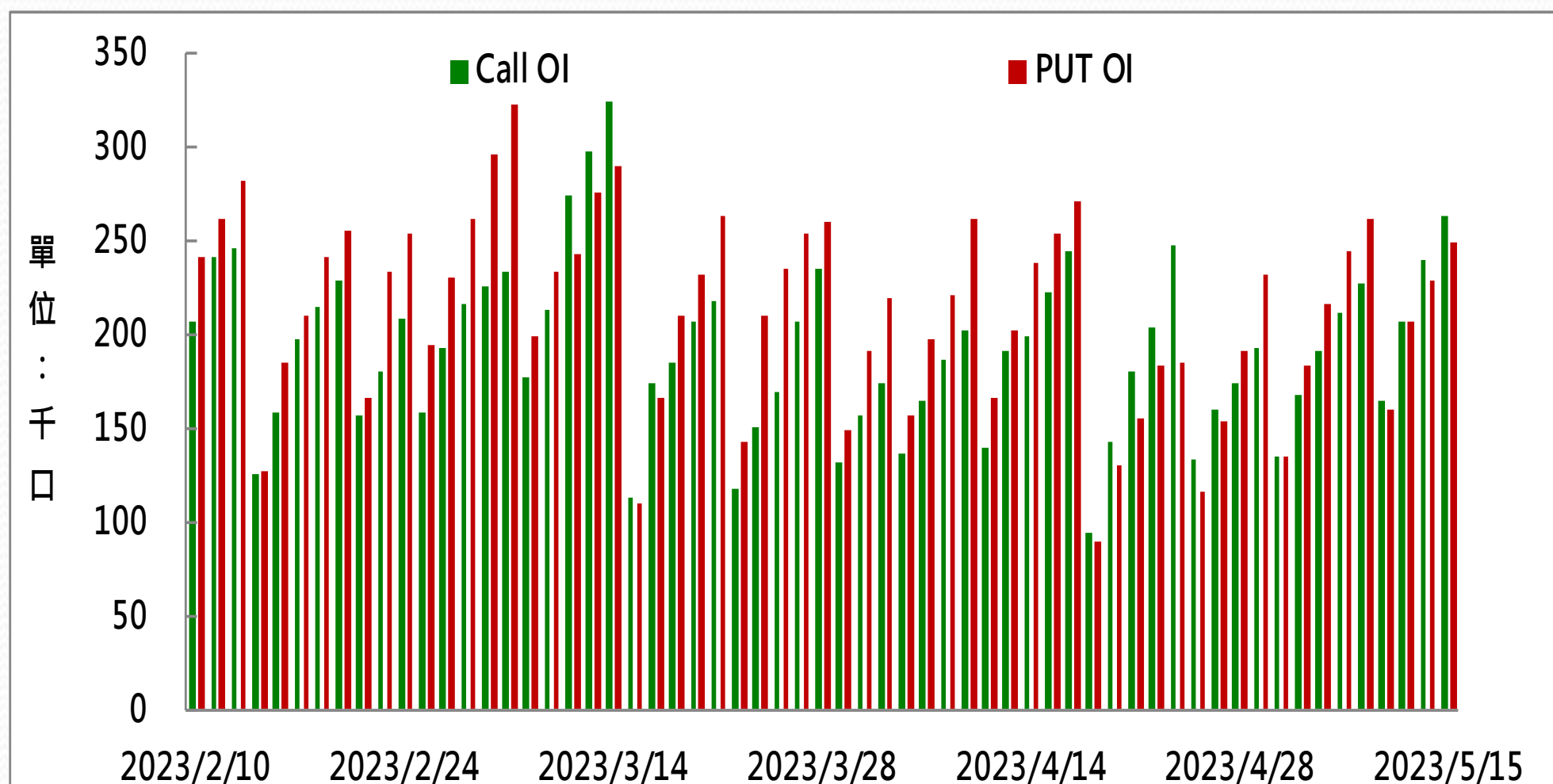
更新日期：2023年5月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年5月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

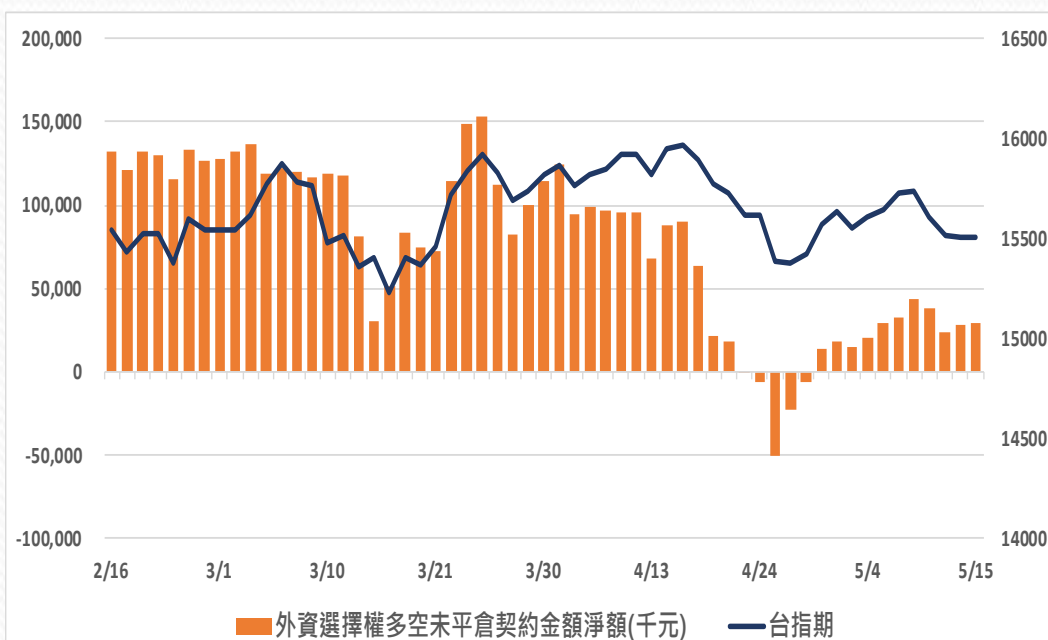
選擇權全月Put Call OI



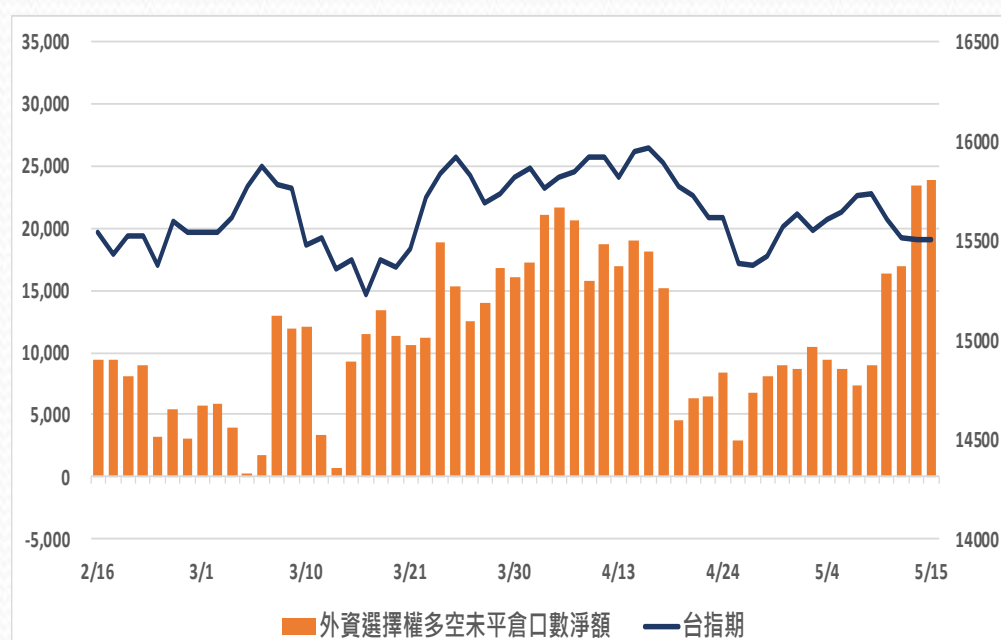
更新日期：2023年5月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



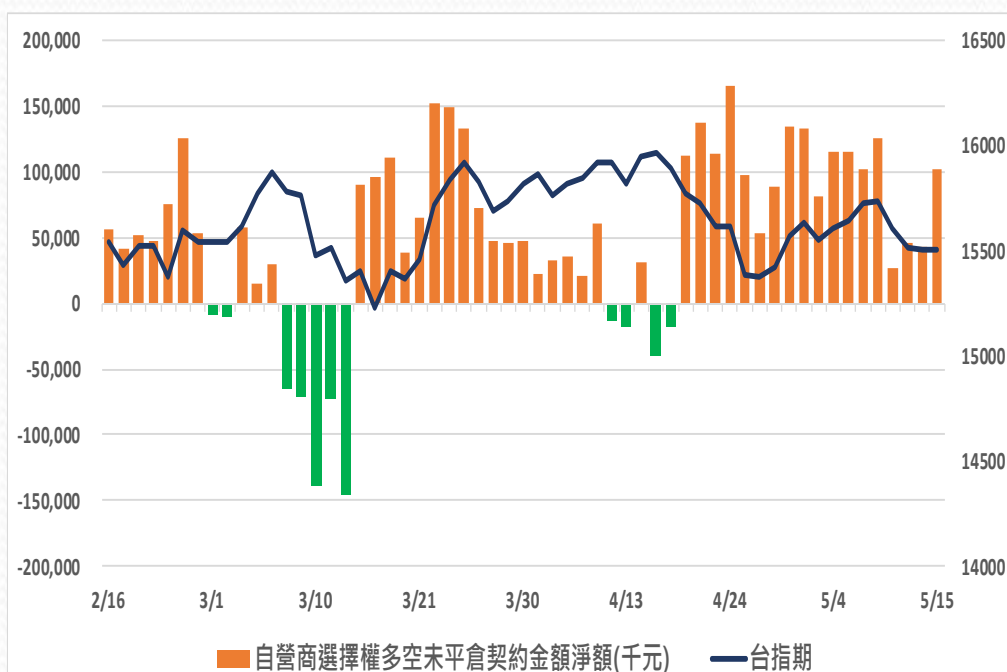
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/9	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
2023/5/15	15510	23,841	+412	29,265	+1,390

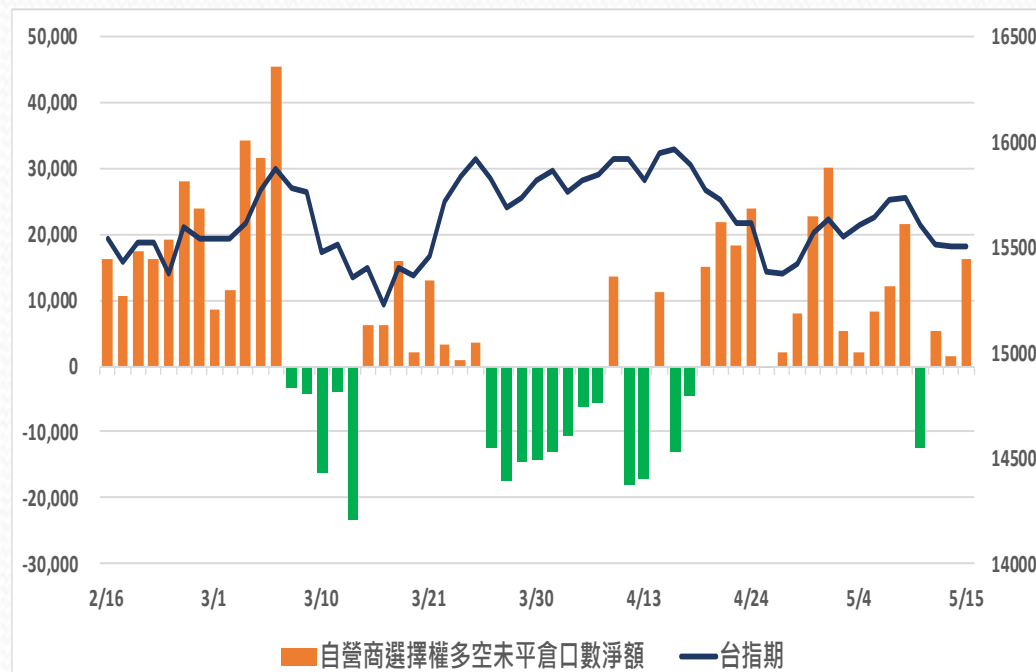
更新日期：2023年5月15日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



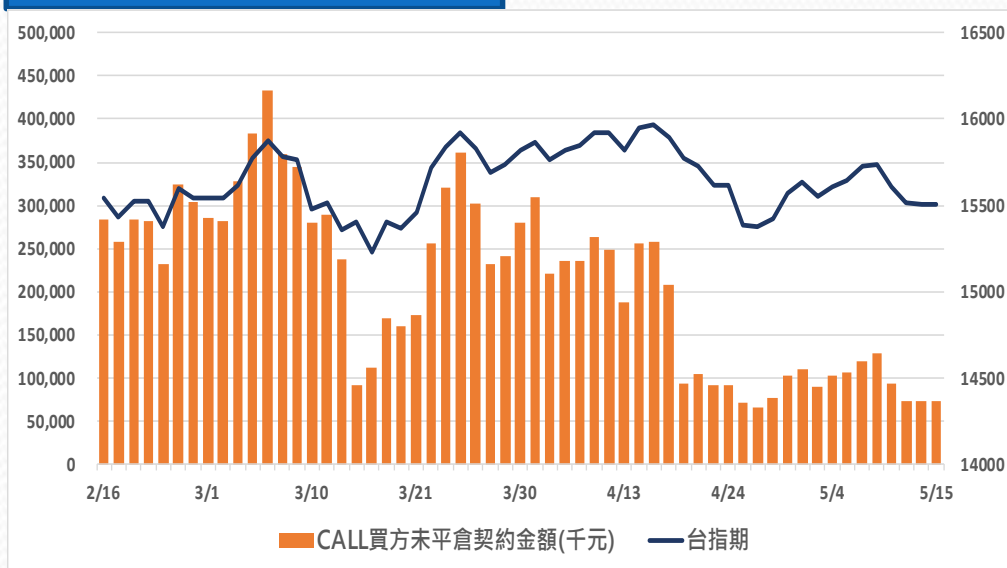
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/9	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
2023/5/15	15510	16,365	+15,020	102,065	+59,569

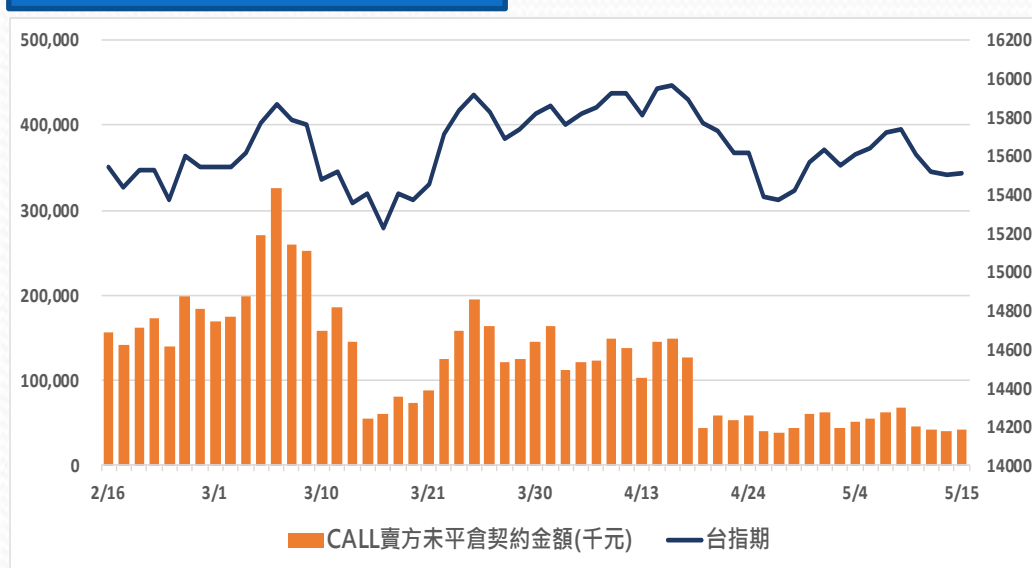
更新日期：2023年5月15日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

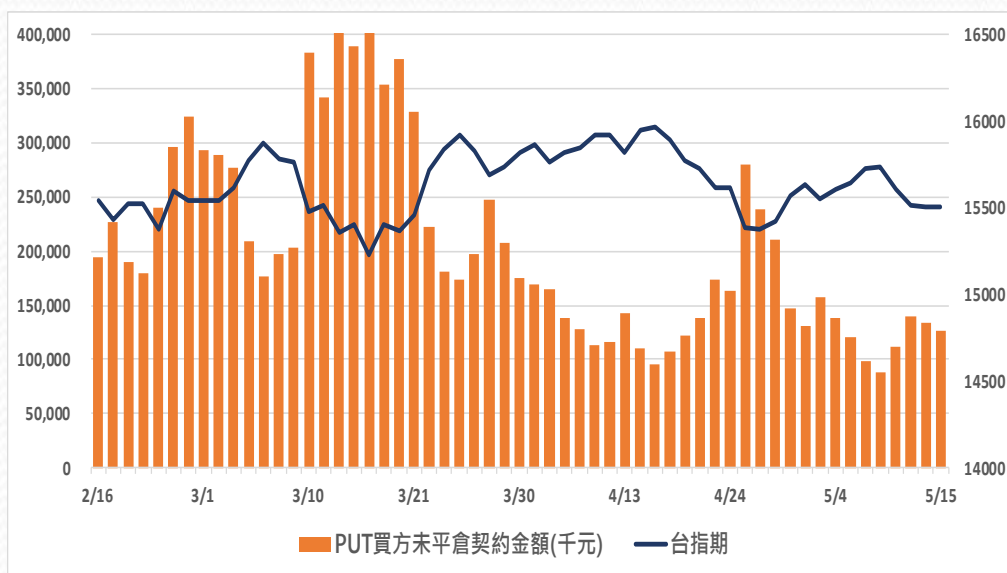
CALL買方未平倉金額



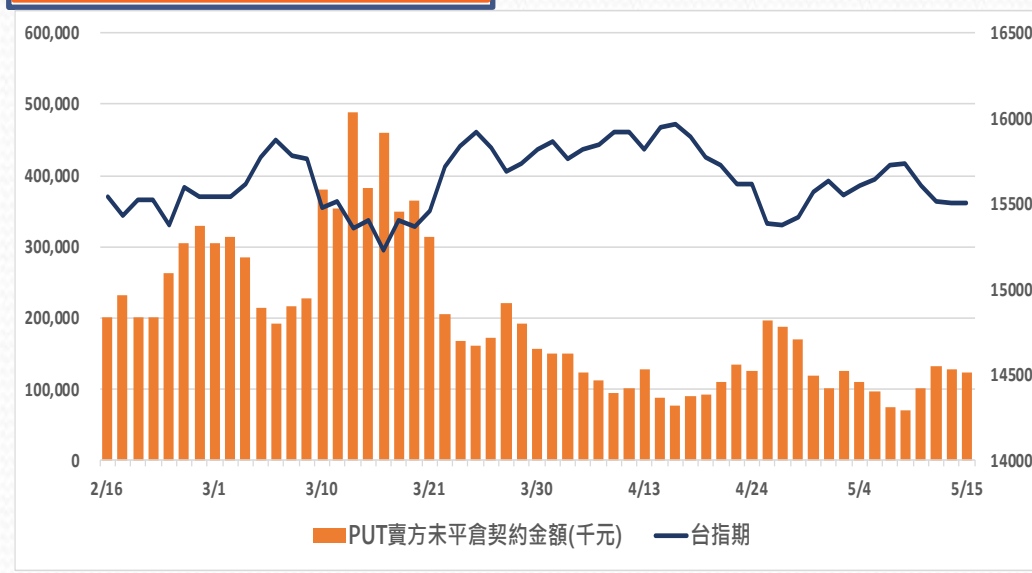
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



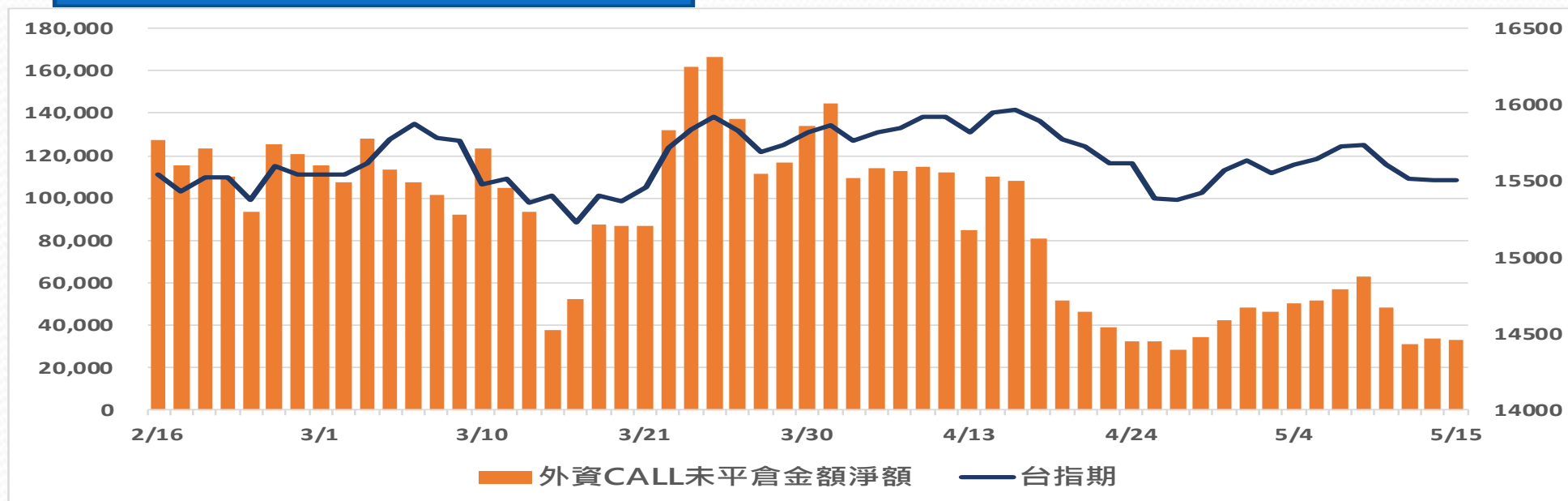
PUT賣方未平倉金額



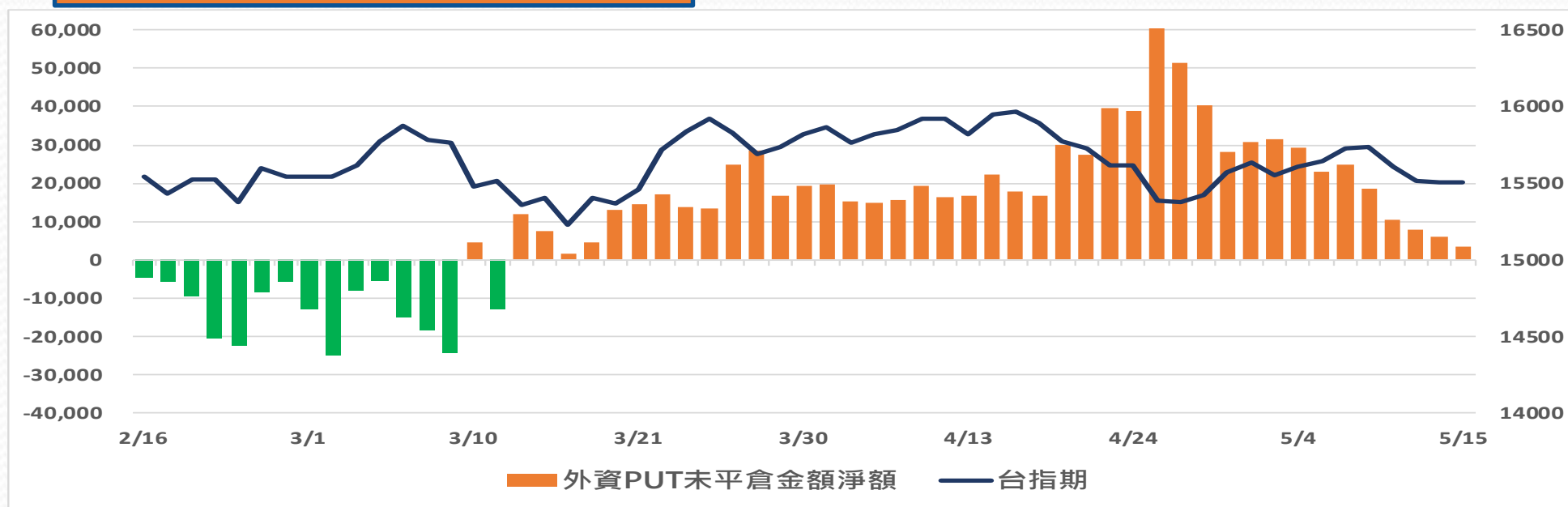
更新日期：2023年5月15日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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15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15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