

台指選擇權OI匯報

日期：2023/5/16 結算日：2023/5/17					日期：2023/5/16 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
1	85	15,000	11,815	-3,441	-1	100	14,400	2,270	-573
0	33	15,050	932	96	1	7	14,500	1,569	-261
-3	96	15,100	6,655	-1,072	-1	60	14,600	1,745	-465
0	40	15,150	3,628	-1,047	0	10	14,700	2,194	134
-52	380	15,200	10,041	-3,028	1	129	14,800	2,880	101
-16	98	15,250	7,060	-890	-4	8	14,900	2,818	388
-306	570	15,300	11,735	-4,034	-7	271	15,000	4,157	790
-215	659	15,350	8,397	-732	-11	58	15,100	1,997	356
-1,432	3,996	15,400	17,160	-3,012	6	183	15,200	2,425	721
-1,581	2,668	15,450	8,443	570	-20	310	15,300	1,266	166
-4,372	4,212	15,500	16,069	2,755	-13	852	15,400	2,679	829
-4,637	4,638	15,550	11,481	5,621	35	1,887	15,500	1,448	298
-9,265	9,721	15,600	16,605	10,686	363	1,607	15,600	1,416	992
-3,956	9,955	15,650	10,265	8,158	-7	1,388	15,700	876	586
646	16,338	15,700	13,899	7,400	304	2,855	15,800	269	48
2,366	11,466	15,750	3,111	1,774	32	4,799	15,900	247	-3
840	18,210	15,800	1,797	496	107	5,006	16,000	231	81
-2,613	7,799	15,850	402	10	481	3,966	16,100	85	52
-296	8,935	15,900	960	13	233	4,612	16,200	33	2
201	3,814	15,950	76	-2	237	2,731	16,300	34	4
-520	12,065	16,000	356	9	204	1,435	16,400	57	1
-103	1,851	16,050	28	0	-35	1,007	16,500	14	1
-385	5,497	16,100	232	-12	-76	645	16,600	10	0
-19	1,689	16,150	105	0	-4	481	16,700	13	0
-86	7,057	16,200	281	-13	4	342	16,800	17	0
-97	8,332	16,300	195	-4	-2	289	16,900	11	1
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
-25,945	158,927	1.2449	197,850	19,583	2,163	45,231	1.1331	51,253	5,191
昨日 P/C	0.9643	今日增減變化		0.2806	昨日 P/C	1.0695	今日增減變化		0.0636

更新日期：2023年5月16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16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	134,051,609	55,142,983	78,908,626	42,220,040	1,802,138	850,817	951,321	527,586	
投信	29,292,079	50,643,148	-21,351,069	11,627	337,258	0	337,258	37,013	
自營商	35,112,491	41,161,143	-6,048,652	-11,925,606	2,078,818	860,468	1,218,350	35,607	
	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	832,771	1,229,411	-396,640	79,451	12,211	102,445	-90,234	-11,543	
投信	126,116	0	126,116	1,014	0	0	0	0	
自營商	1,047,662	780,194	267,468	9,747	693,637	574,348	119,289	40,593	

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16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	52,395	18,876	33,519	-1,683	29,973	22,486	7,487	-3,874	
投信	100	100	0	0	450	113	337	0	
自營商	72,382	56,390	15,992	9,753	46,279	69,762	-23,483	-13,357	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	34,953	9,037	25,916	-951	6,870	16,344	-9,474	5,364	
特定法人(全月)	42,077	12,158	29,919	-1,907	12,273	18,782	-6,509	5,379	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	61,017	48,473	12,544	5,263	57,635	34,219	23,416	14,749	
十大交易人(全月)	110,357	71,326	39,031	7,954	87,101	66,419	20,682	18,830	
全市場未沖銷(近月)			158,927	-25,945			197,850	19,583	
全市場未沖銷(全月)			239,253	-23,647			282,799	33,507	

更新日期：2023年5月16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	15600	買權OI最大量	15800
	賣權成交最大量	15600	賣權OI最大量	15400
	整體隱含波動率	10.13%	較前一交易日	-0.03%
	買權隱含波動率	11.16%	較前一交易日	-1.10%
	賣權隱含波動率	9.21%	較前一交易日	+1.21%
電子選擇權	買權成交最大量	760	買權OI最大量	760
	賣權成交最大量	690	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	1600
	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1580

更新日期：2023年5月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

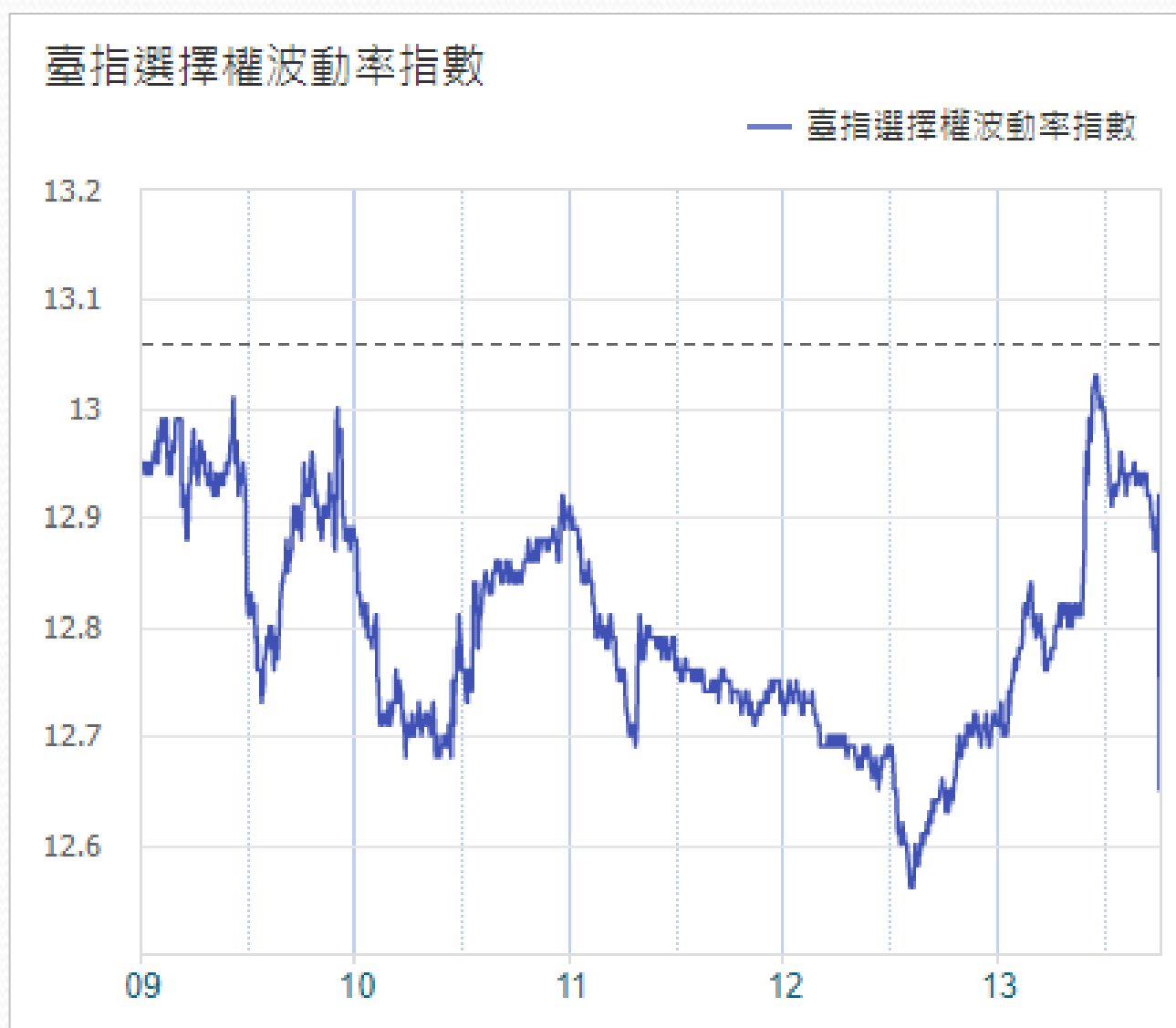
台指選擇權匯報

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	16000
	賣權成交最大量	15500	賣權OI最大量	10000
	整體隱含波動率	12.87%	較前一交易日	-0.30%
	買權隱含波動率	9.55%	較前一交易日	-0.50%
	賣權隱含波動率	15.17%	較前一交易日	+0.19%
	成交量P/C_Ratio值	1.396	較前一交易日	+0.33
	未平倉P/C_Ratio值	1.133	較前一交易日	+0.06
電子選擇權	買權成交最大量	760	買權OI最大量	760
	賣權成交最大量	690	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	1600
	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1580

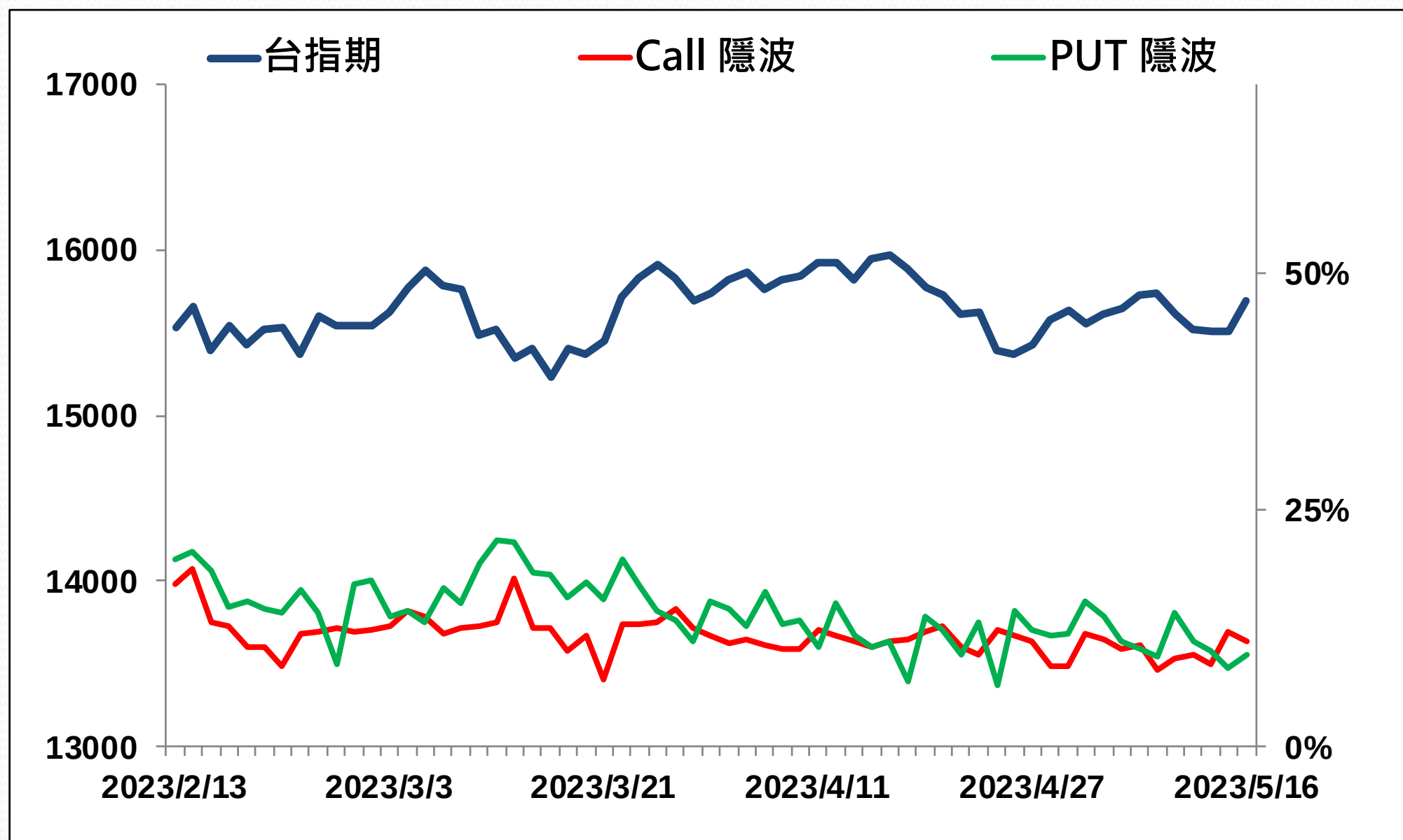
更新日期：2023年5月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



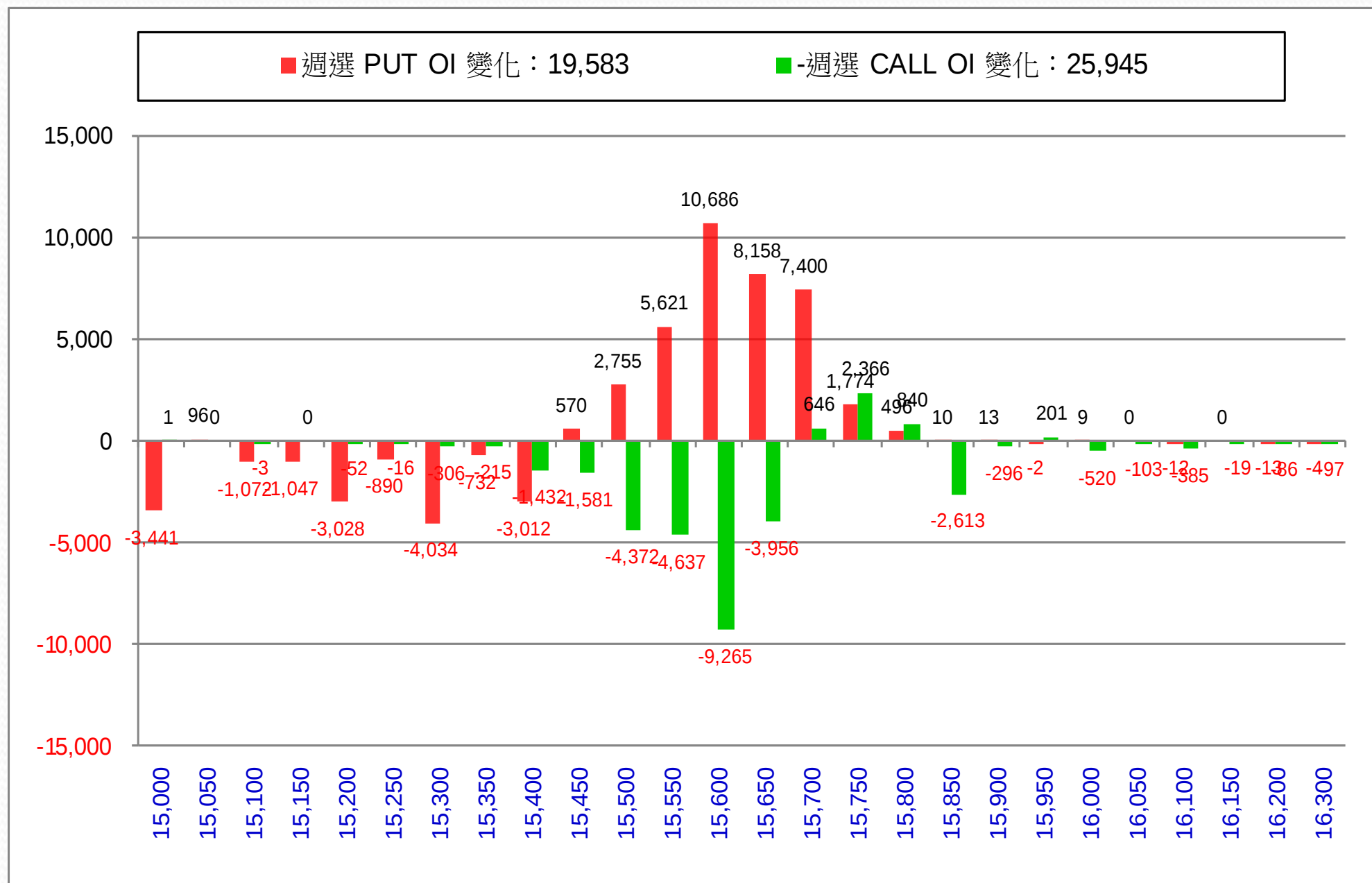
更新日期：2023年5月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年5月16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

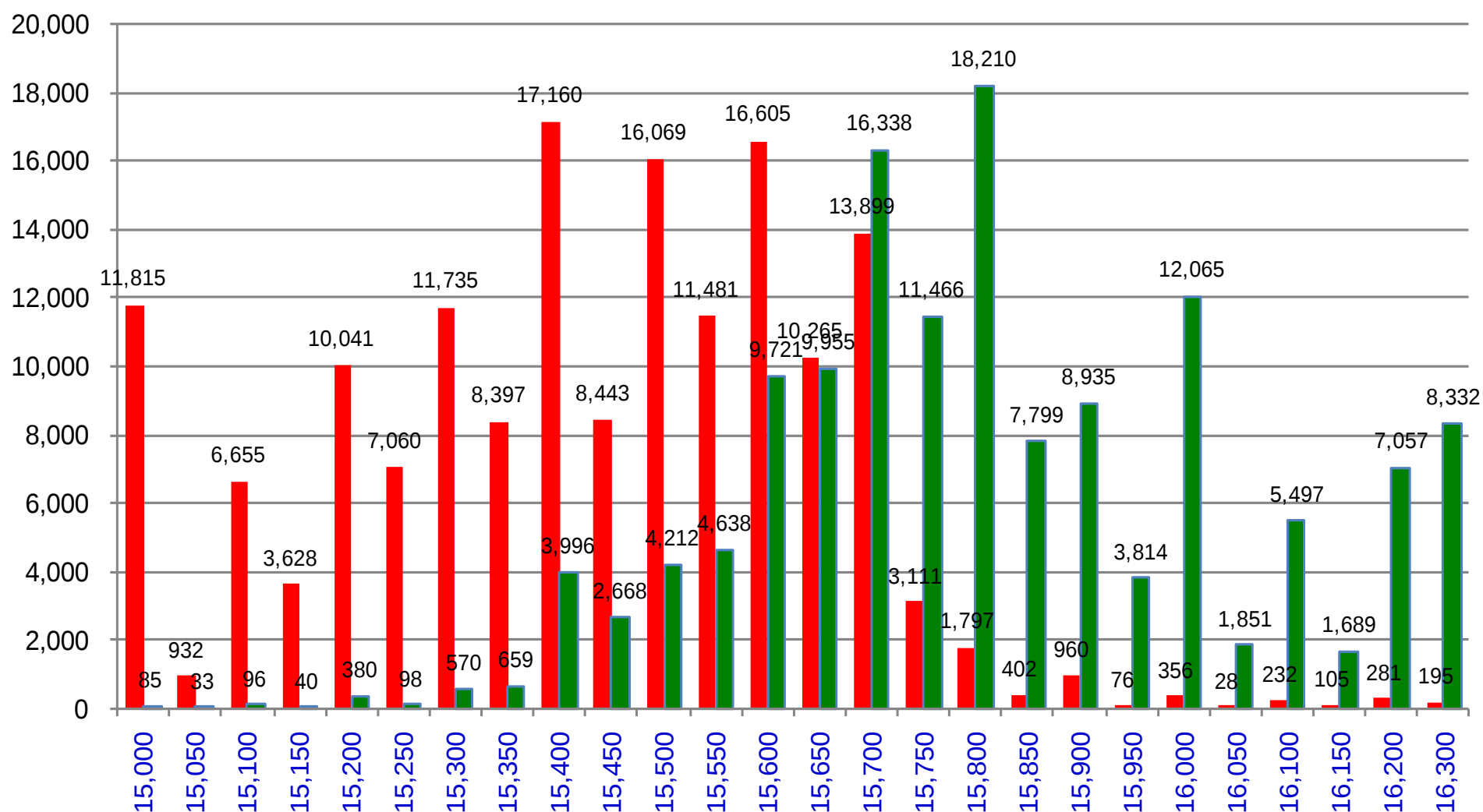


更新日期：2023年5月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：197,850

週選 CALL OI 總額：158,927



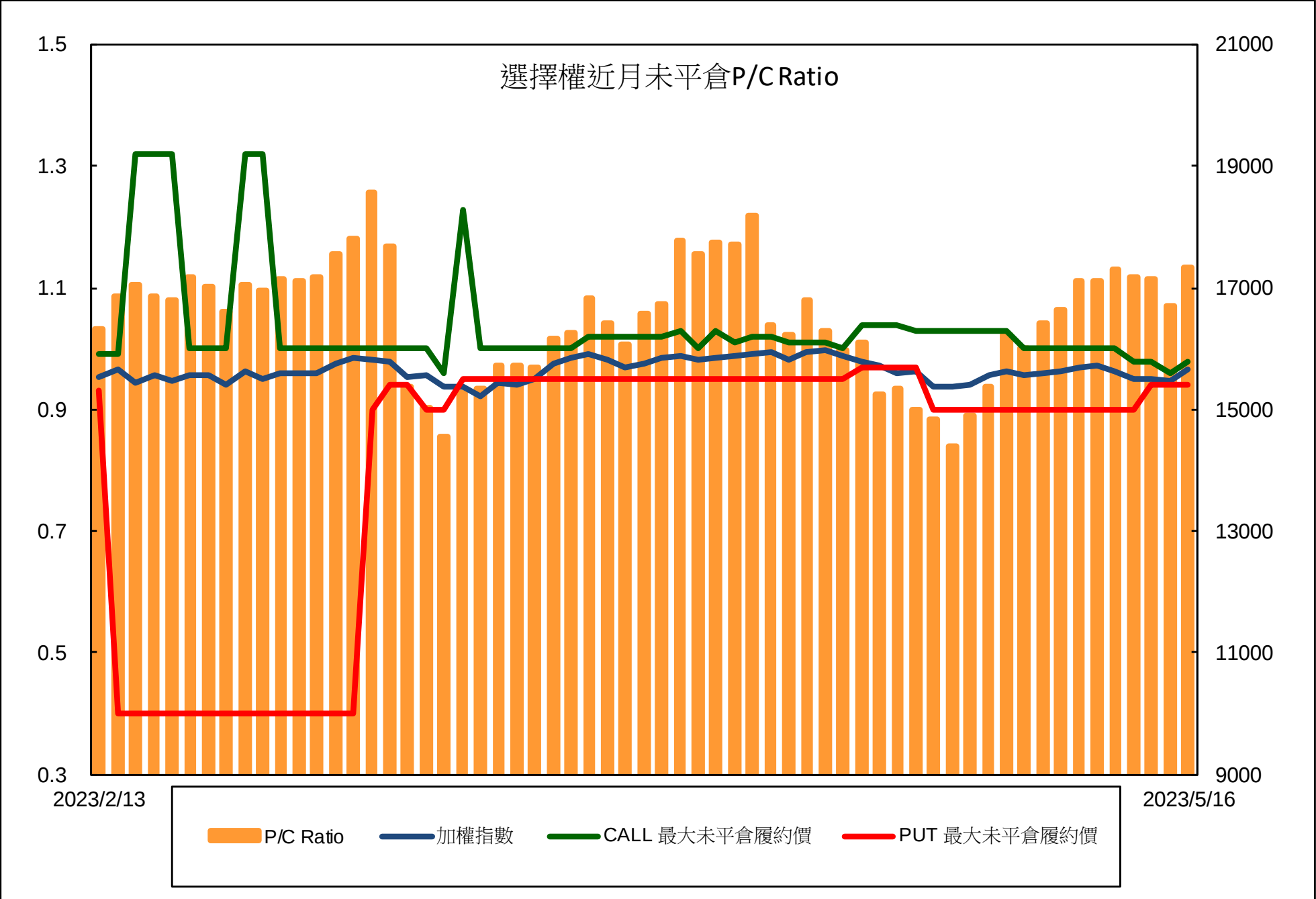
更新日期：2023年5月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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15日	73,737	67,498	6,239
	5月16日	72,382	56,390	15,992
Put	5月15日	49,619	59,745	-10,126
	5月16日	46,279	69,762	-23,483

更新日期：2023年5月16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16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

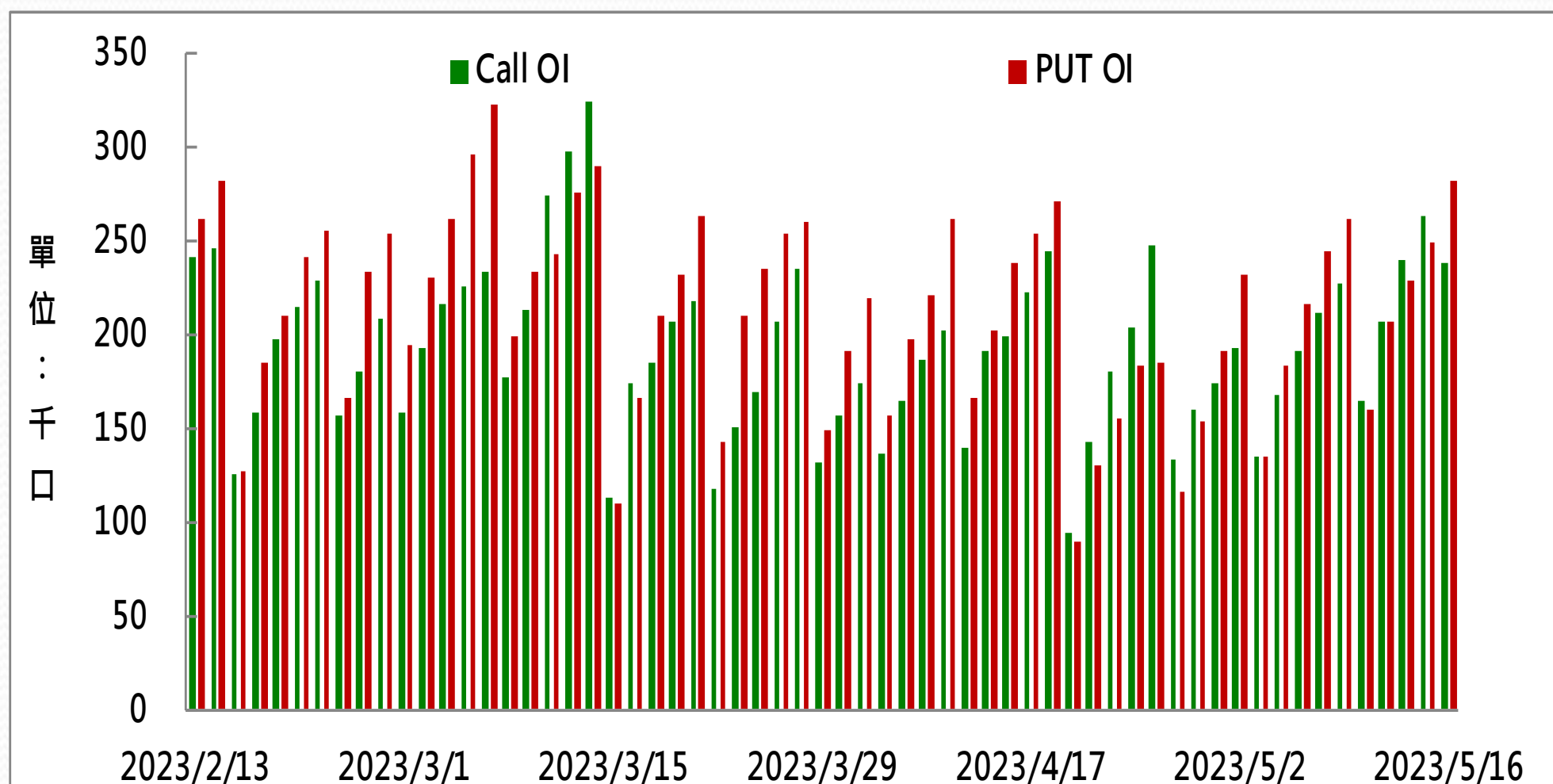


中華開發金控
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL



凱基期貨
KGI FUTURES

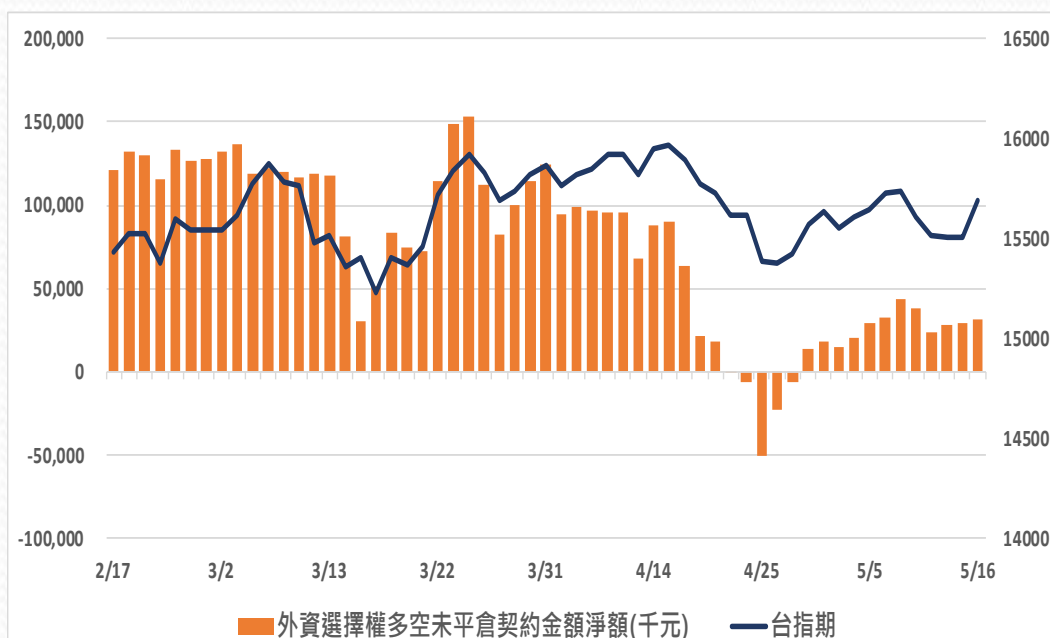
選擇權全月Put Call OI



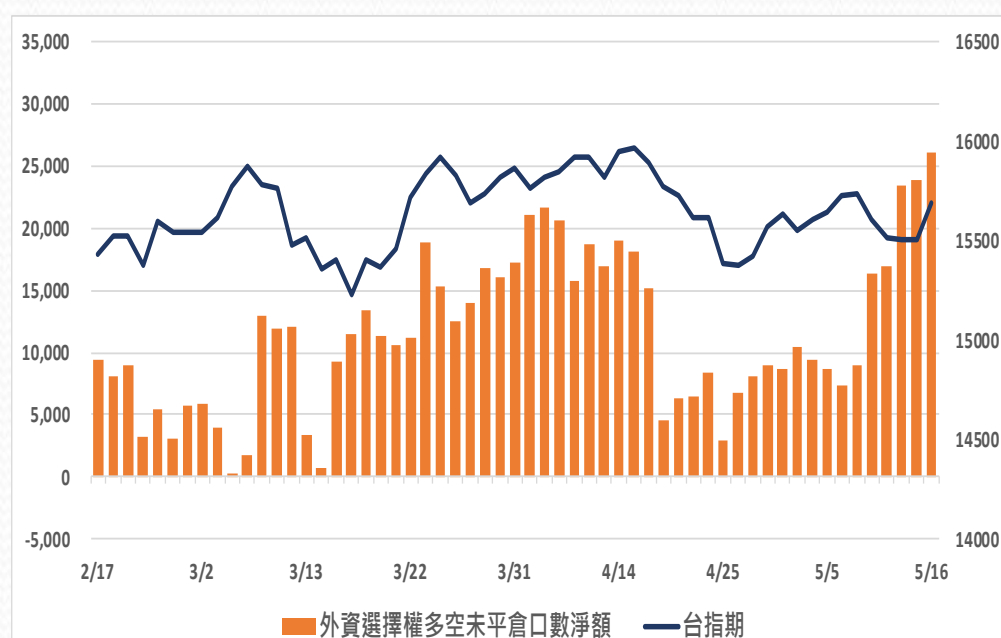
更新日期：2023年5月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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



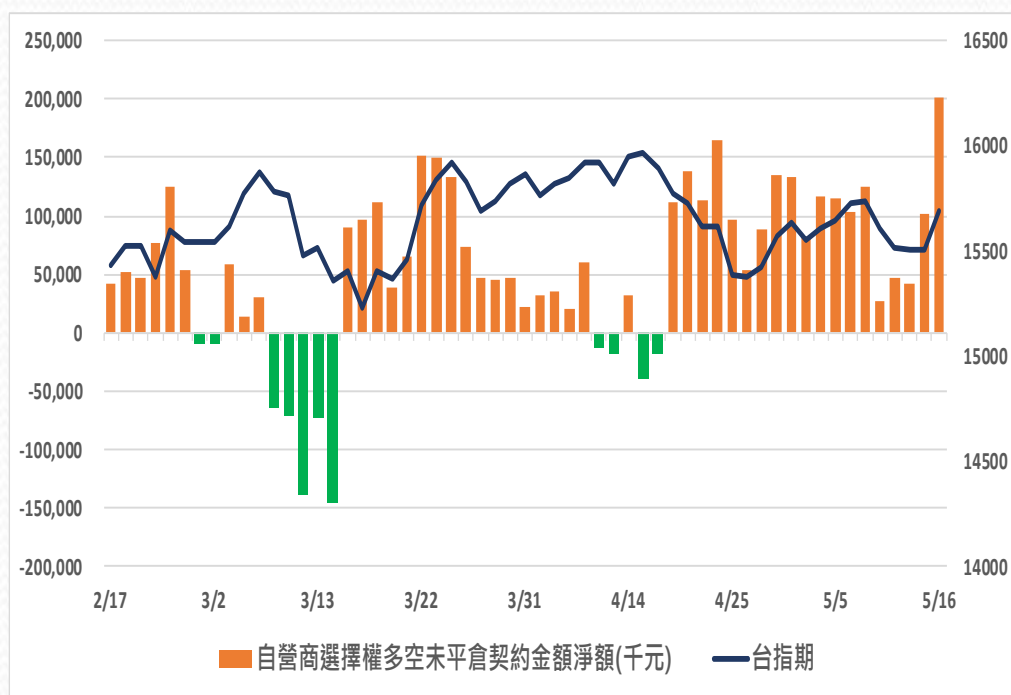
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/10	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
2023/5/16	15690	26,032	+2,191	31,231	+1,966

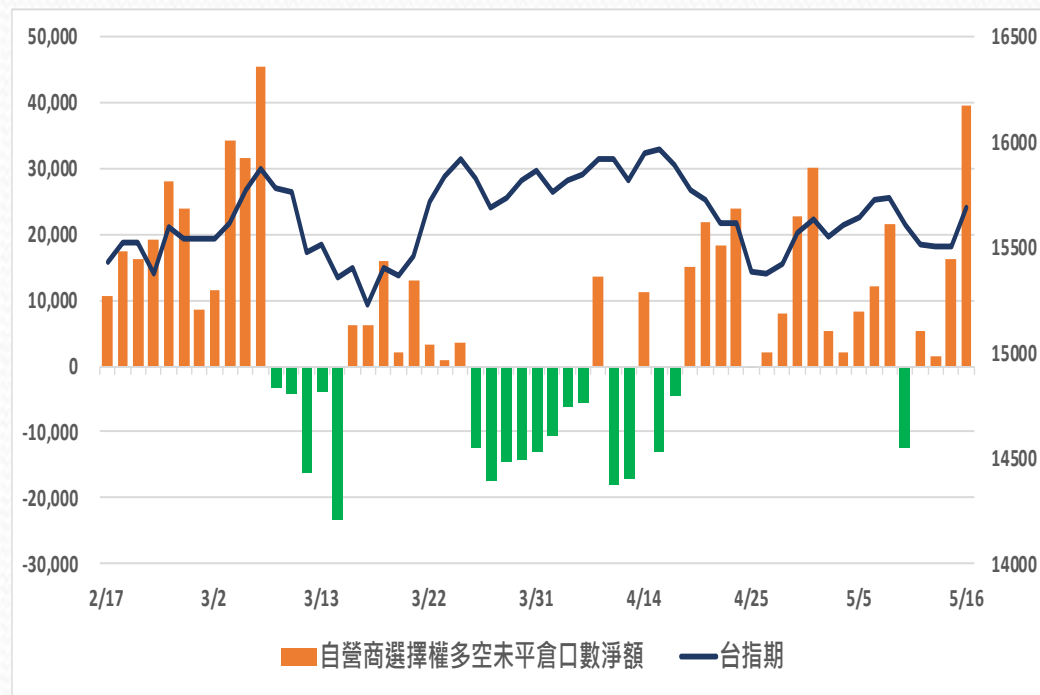
更新日期：2023年5月16日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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



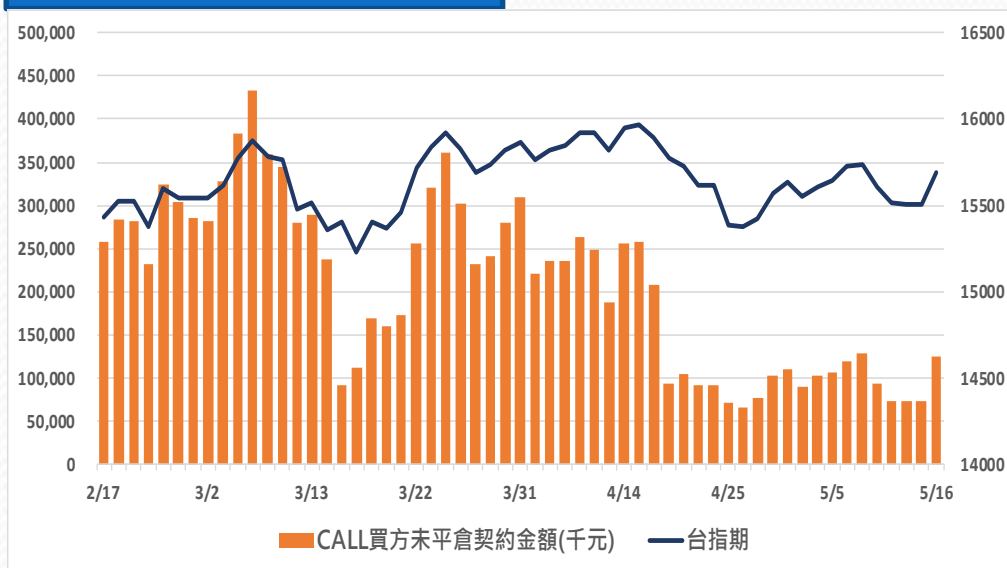
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/5/10	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
2023/5/16	15690	39,475	+23,110	201,424	+99,359

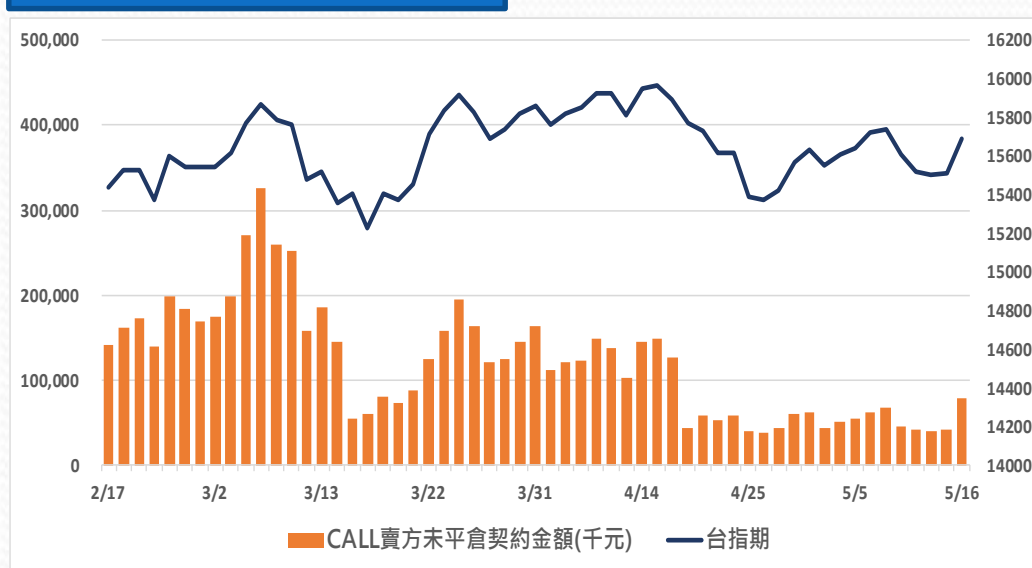
更新日期：2023年5月16日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額

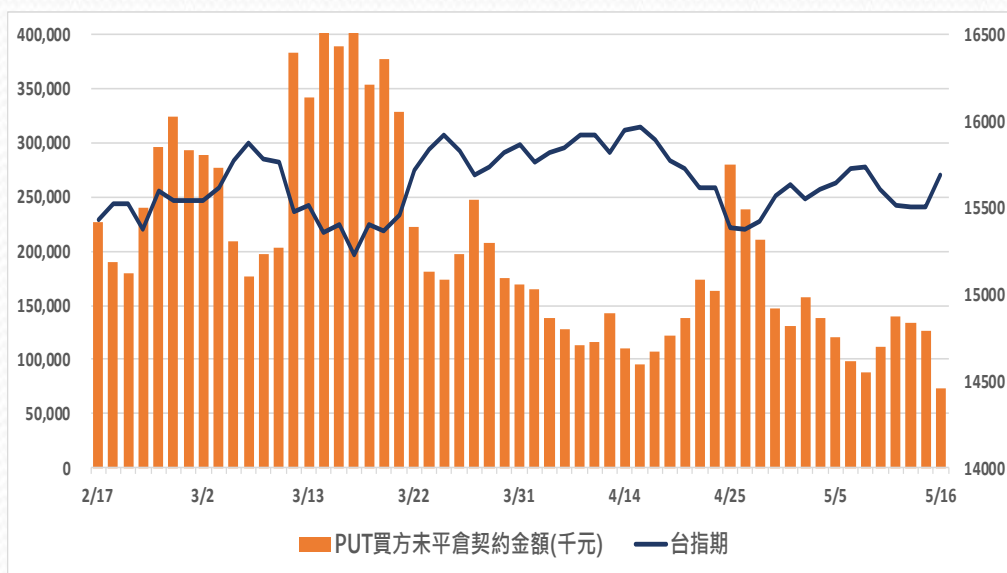
CALL買方未平倉金額



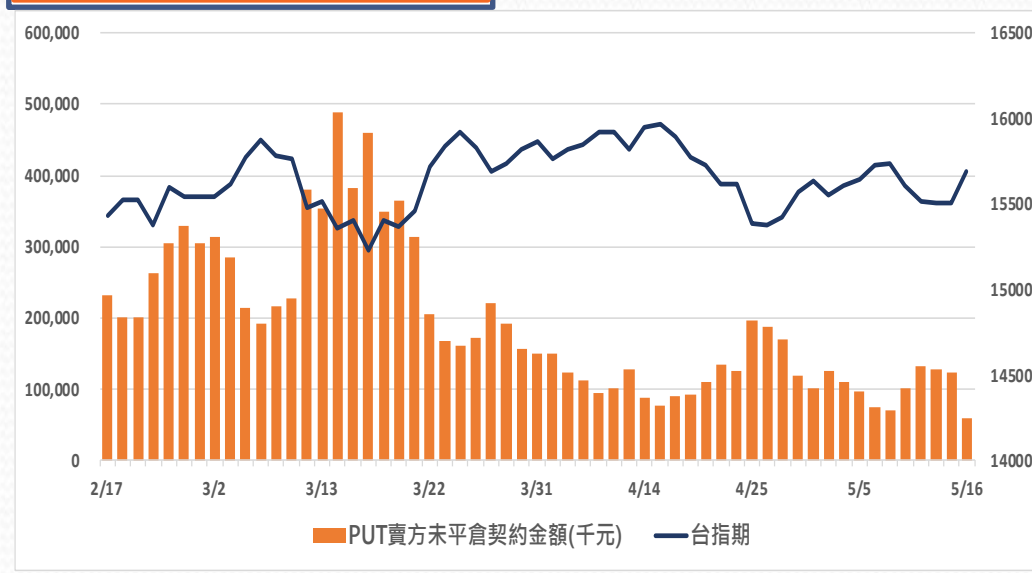
CALL賣方未平倉金額



PUT買方未平倉金額



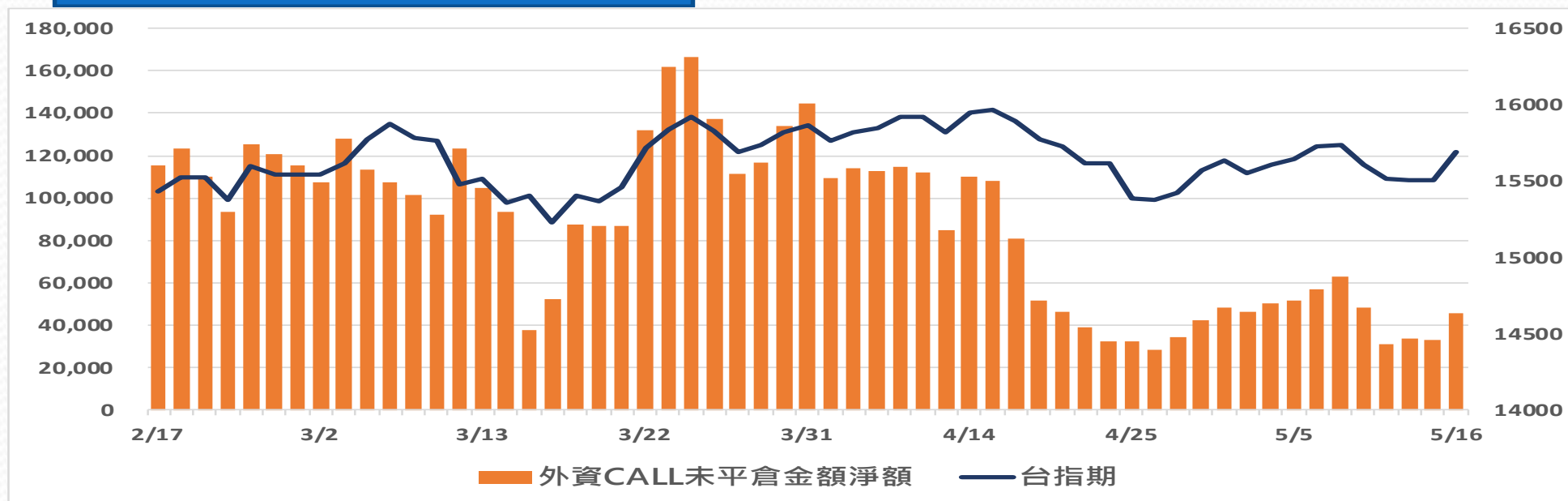
PUT賣方未平倉金額



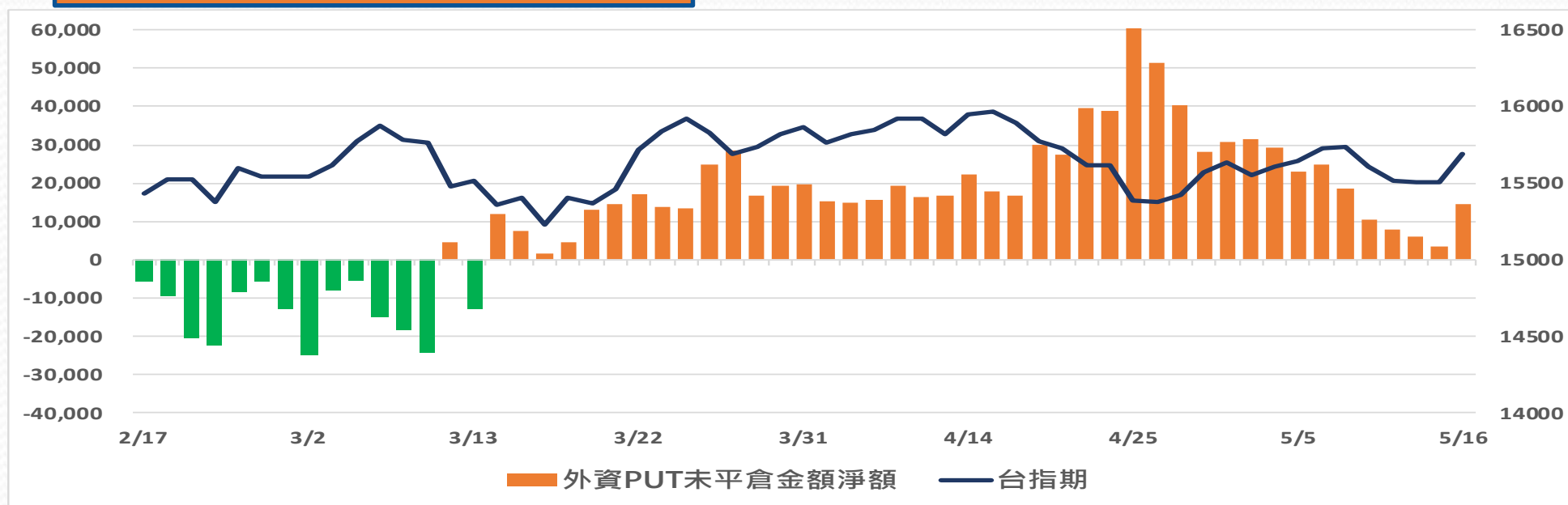
更新日期：2023年5月16日 資料來源：凱基期貨整理，期貨交易所。本資料僅供參考

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16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16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