

台指選擇權OI

日期：2023/7/3 結算日：2023/7/5					日期：2023/7/3 結算日：2023/7/19				
202307W1					202307 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
-3	34	16,400	11,803	-4,013	0	84	15,700	2,508	-73
13	37	16,450	3,573	-1,278	0	76	15,800	2,604	-46
-13	48	16,500	7,973	-804	0	74	15,900	2,517	54
98	176	16,550	4,464	-1,859	-2	148	16,000	4,146	-1,197
-137	490	16,600	11,463	163	1	104	16,100	2,886	-369
-105	804	16,650	6,821	-1,897	-4	124	16,200	4,257	-401
-349	1,174	16,700	6,805	1,060	-28	596	16,300	5,427	169
-338	1,335	16,750	6,599	1,837	-8	238	16,400	3,302	58
-1,645	5,400	16,800	11,444	4,470	4	606	16,500	4,805	1,463
-1,779	2,152	16,850	8,705	6,401	-61	862	16,600	5,039	779
-2,495	4,550	16,900	11,063	5,205	-1	3,178	16,700	4,480	784
-2,048	4,842	16,950	8,110	6,791	-91	2,123	16,800	2,707	907
-2,564	6,590	17,000	9,542	8,138	102	2,610	16,900	1,802	187
-547	6,443	17,050	6,020	5,639	-287	3,640	17,000	1,788	349
-409	11,263	17,100	3,341	2,849	-119	4,274	17,100	991	156
1,363	7,279	17,150	772	688	-67	4,827	17,200	569	123
4,200	9,599	17,200	519	448	-741	6,028	17,300	435	57
5,110	9,718	17,250	206	186	-1,492	5,894	17,400	160	11
1,292	5,281	17,300	78	67	305	6,552	17,500	75	16
47	2,525	17,350	17	16	1,304	6,506	17,600	20	14
370	3,177	17,400	14	6	236	3,237	17,700	5	2
1,035	2,776	17,450	1	1	86	4,107	17,800	5	0
358	1,224	17,500	1	-2	97	2,009	17,900	11	0
51	1,012	17,600	2	0	578	2,390	18,000	1	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
1,543	88,862	1.5946	141,696	34,240	11	68,253	0.9970	68,047	2,647
昨日 P/C	1.2306	今日增減變化		0.3640	昨日 P/C	0.9584	今日增減變化		0.0386

更新日期：2023年7月3日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

台指期貨、選擇權籌碼

期貨三大法人未平倉金額

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	137,265,078	125,455,896	11,809,182	2,971,999	993,360	2,735,860	-1,742,500	-227,556
投信	49,875,073	41,534,737	8,340,336	6,601,203	1,230,975	0	1,230,975	137,747
自營商	17,565,848	49,479,363	-31,913,515	2,107,070	943,593	1,092,204	-148,611	179,087
	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	1,777,839	2,052,422	-274,583	-6,608	88,994	1,561	87,433	5,649
投信	22,823	0	22,823	149	0	0	0	0
自營商	188,783	937,902	-749,119	-160,249	213,629	335,296	-121,667	-30,700

台指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數

	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	27,377	9,508	17,869	763	38,329	14,780	23,549	425
投信	200	100	100	-100	350	113	237	200
自營商	62,958	54,946	8,012	982	60,354	60,231	123	-8,796
特定法人(週)	849	0	849	-7	0	8,740	-8,740	0
特定法人(近月)	15,395	0	15,395	0	6,313	16,846	-10,533	16
特定法人(全月)	17,286	0	17,286	-2	7,721	25,415	-17,694	0
十大交易人(週)	35,145	30,075	5,070	5,259	49,522	53,925	-4,403	1,374
十大交易人(近月)	31,660	29,513	2,147	-2,538	24,324	39,744	-15,420	-720
十大交易人(全月)	83,675	65,537	18,138	1,772	72,321	96,576	-24,255	2,360
全市場未沖銷(近月)			68,253	11			68,047	2,647
全市場未沖銷(全月)			195,676	4,014			243,753	43,378

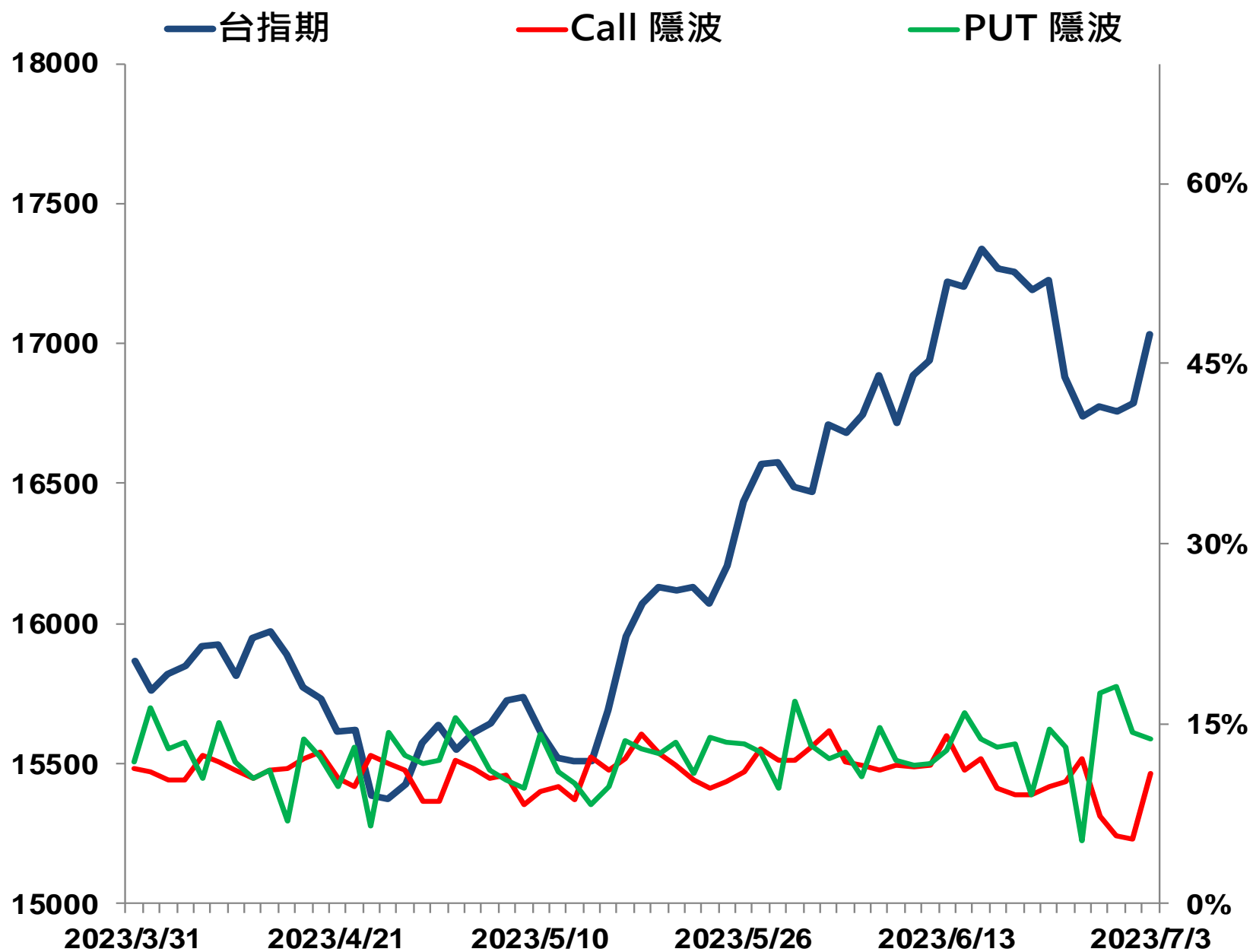
更新日期：2023年7月3日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

選擇權當日波動率



更新日期：2023年7月3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

台指近月隱含波動度



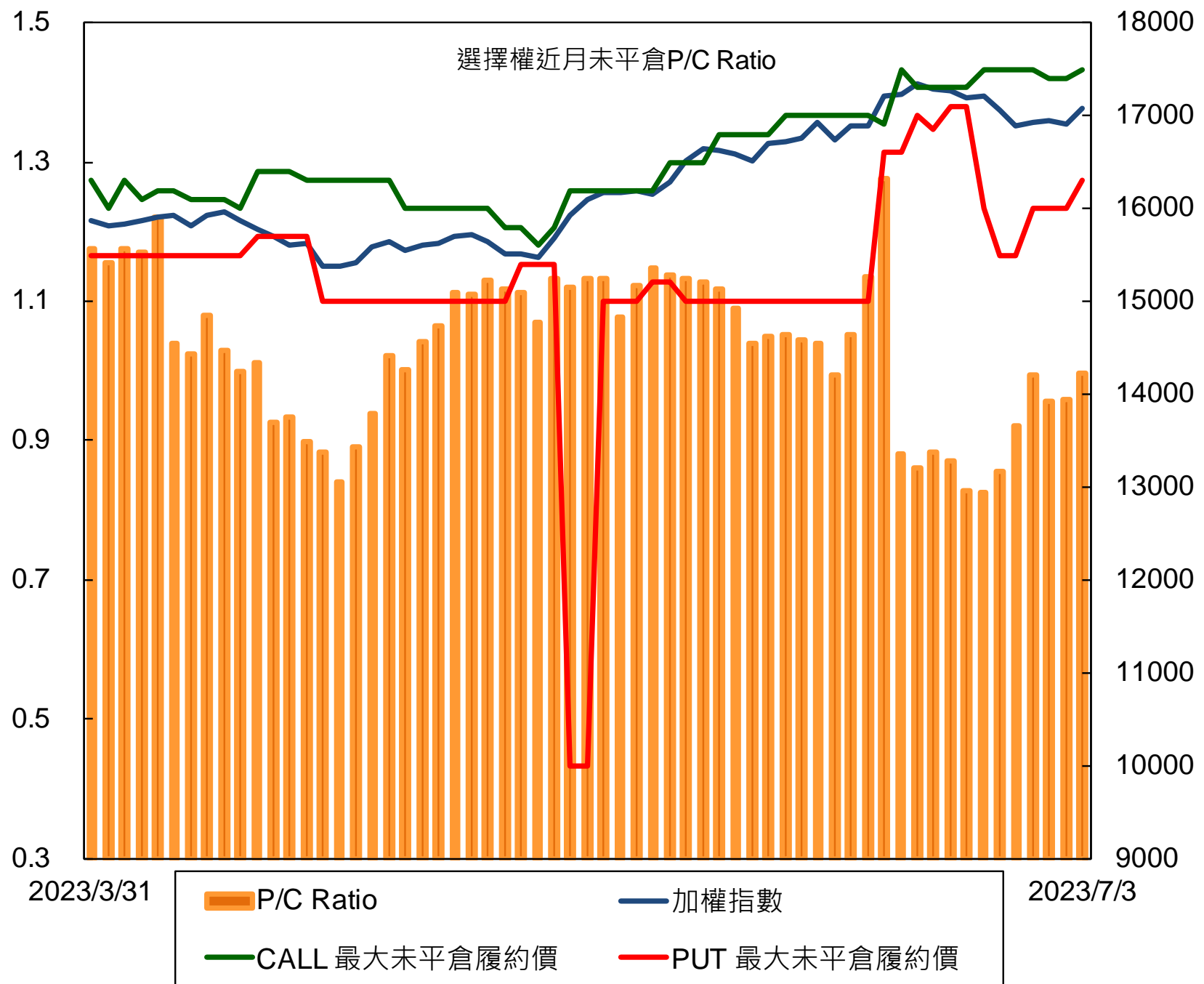
更新日期：2023年7月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考

自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	6月30日	61,018	53,988	7,030
	7月3日	62,958	54,946	8,012
Put	6月30日	57,649	48,730	8,919
	7月3日	60,354	60,231	123

更新日期：2023年7月3日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

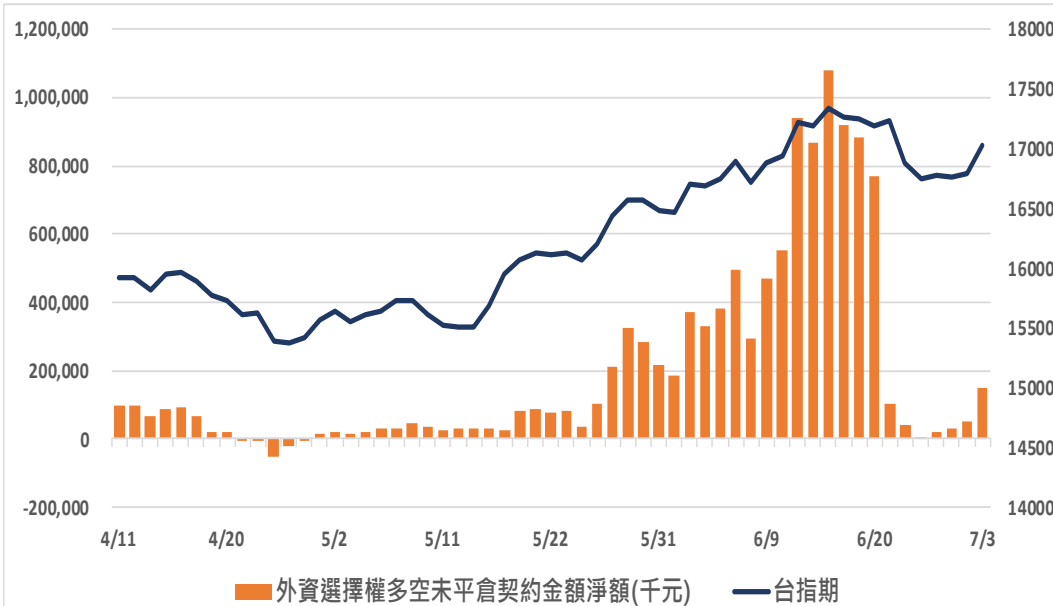
選擇權近月未平倉P/C Ratio



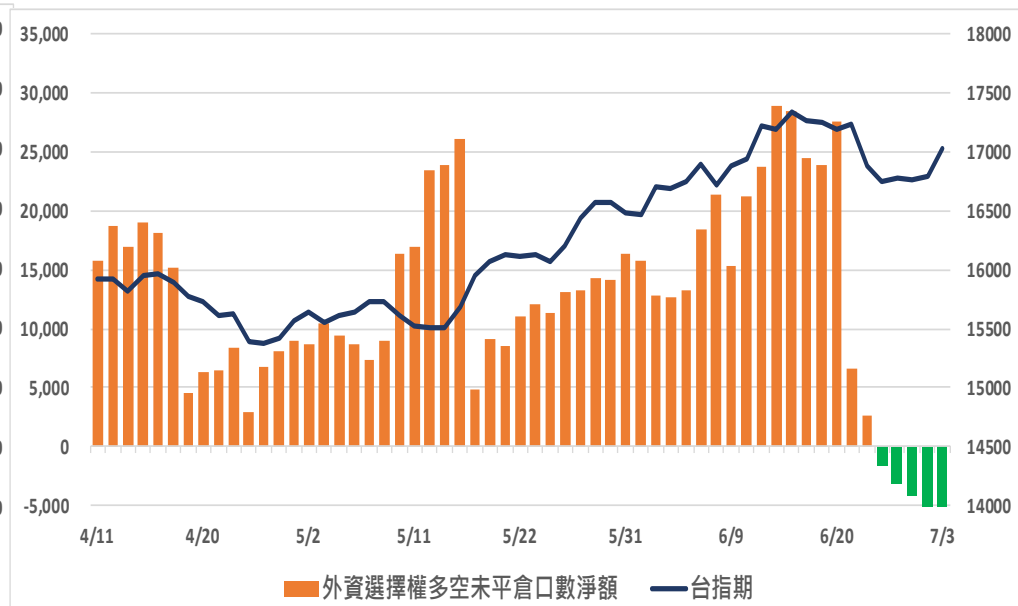
更新日期：2023年7月3日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



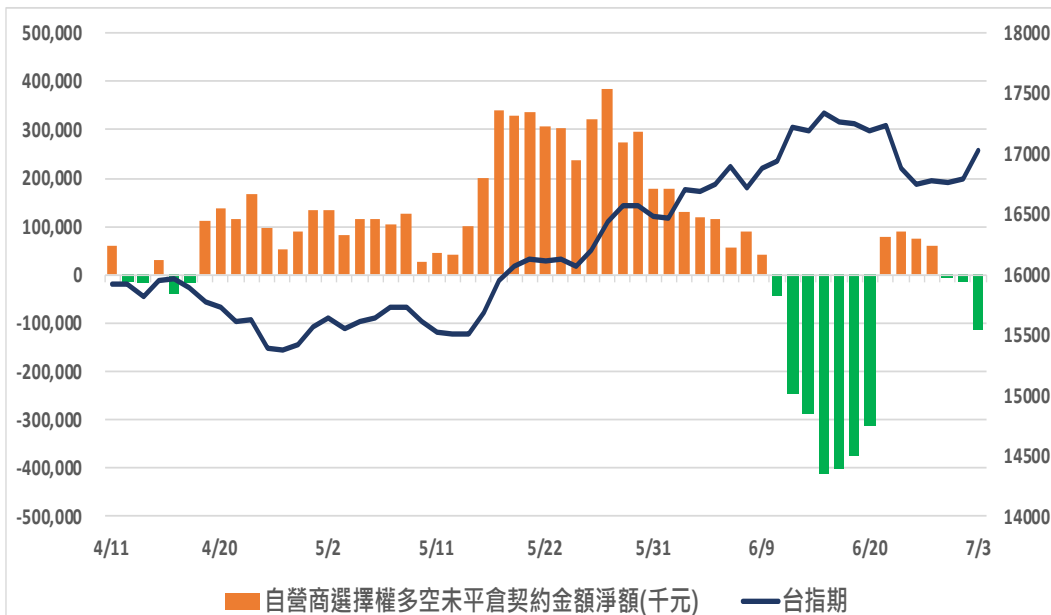
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/6/27	16742	-1,685	-4,291	2,132	-40,984
2023/6/28	16775	-3,099	-1,414	21,472	+19,340
2023/6/29	16762	-4,114	-1,015	28,357	+6,885
2023/6/30	16787	-6,018	-1,904	48,687	+20,330
2023/7/3	17035	-5,680	+338	148,355	+99,668

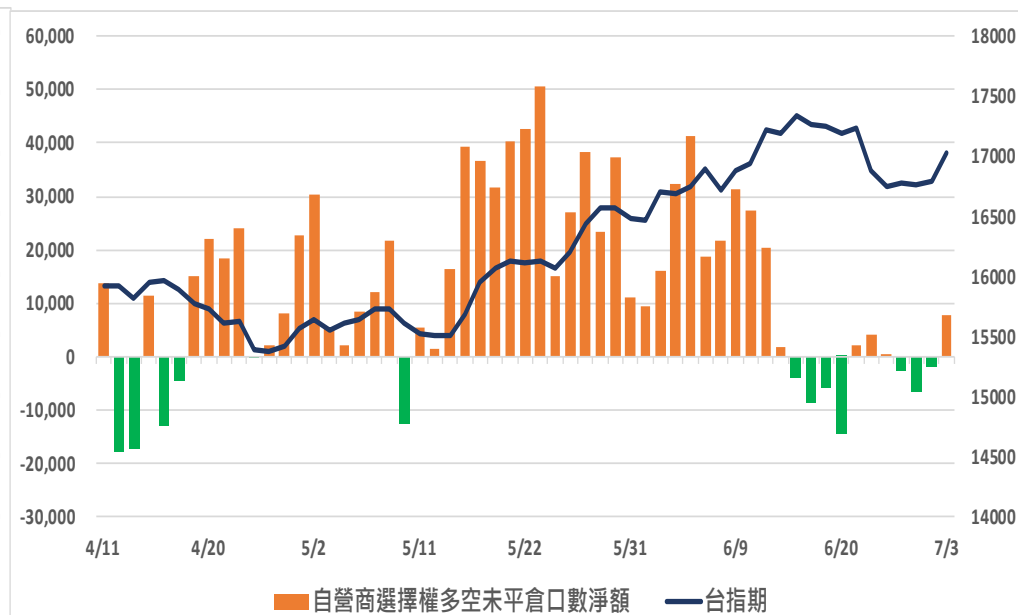
更新日期：2023年7月3日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



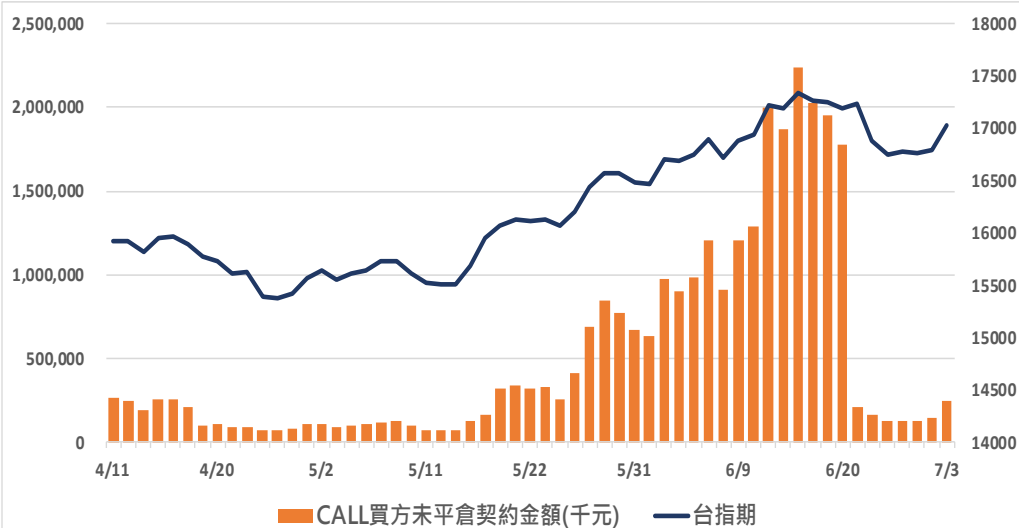
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/6/27	16742	247	-3,801	75,196	-13,361
2023/6/28	16775	-2,406	-2,653	59,638	-15,558
2023/6/29	16762	-6,655	-4,249	-6,282	-65,920
2023/6/30	16787	-1,889	+4,766	-15,584	-9,302
2023/7/3	17035	7,889	+9,778	-112,732	-97,148

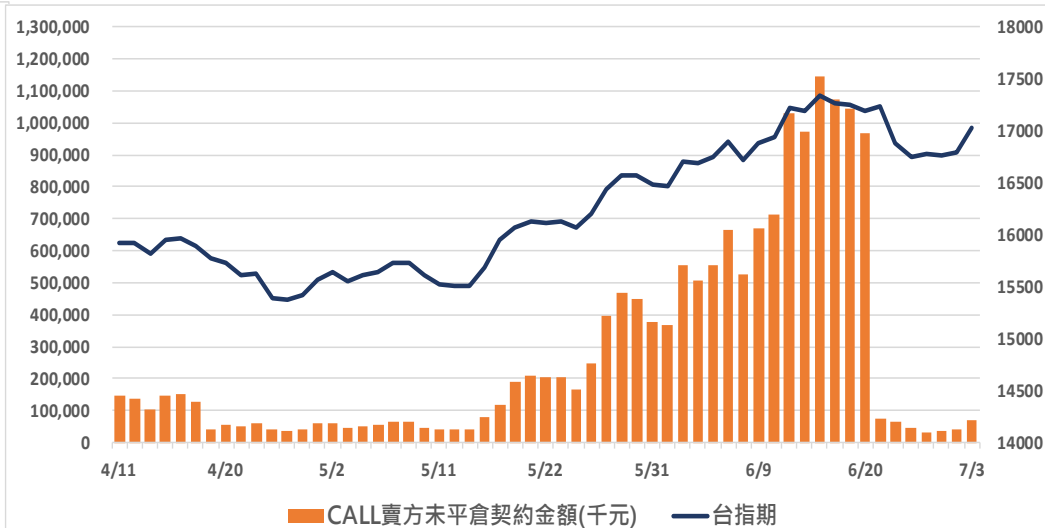
更新日期：2023年7月3日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

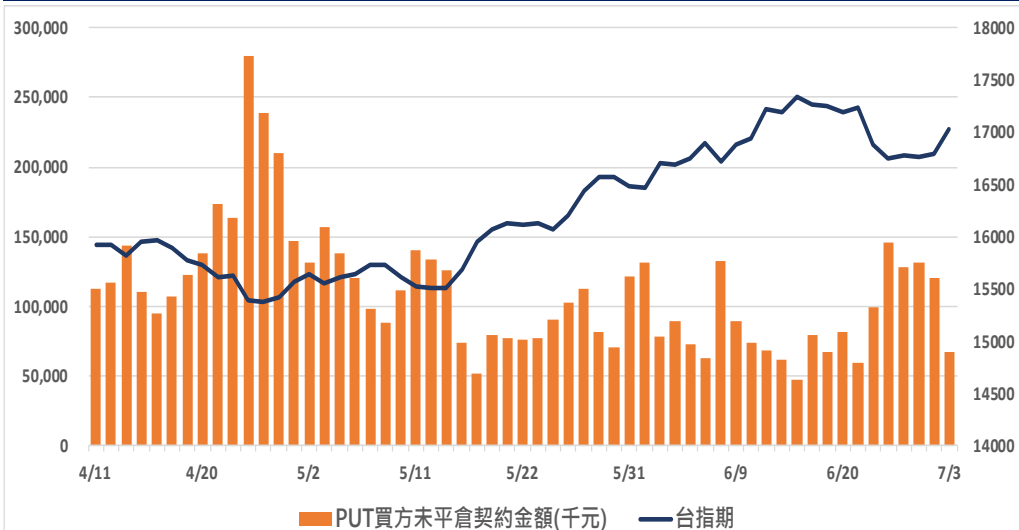
Buy Call未平倉金額



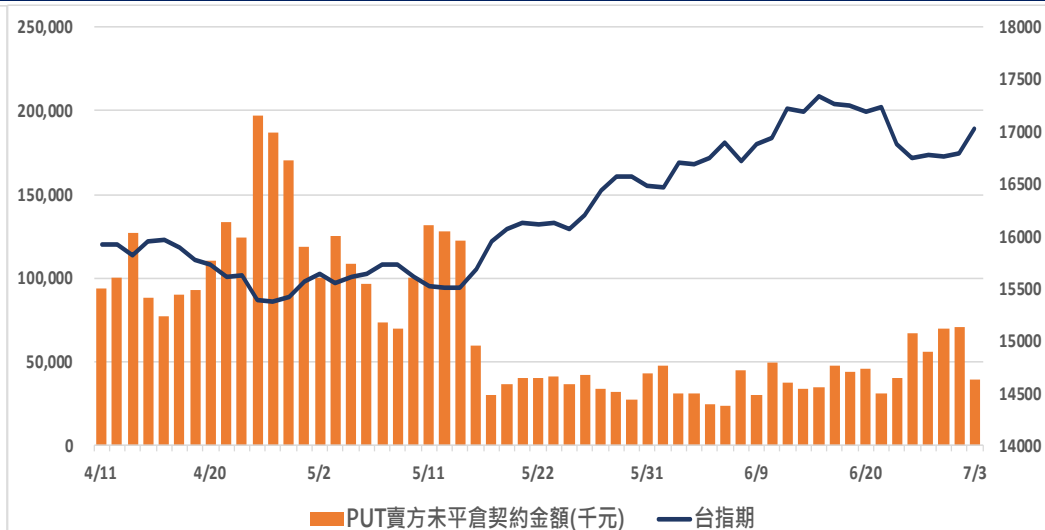
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



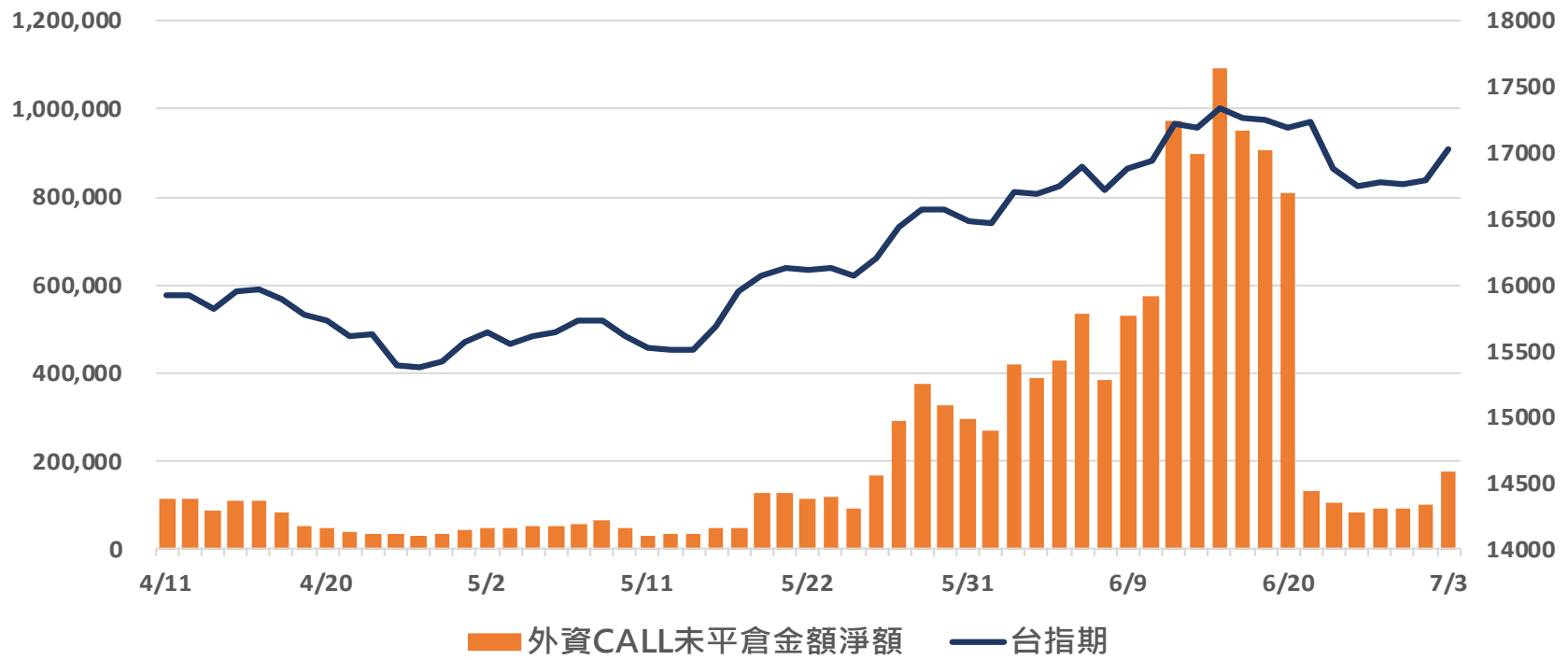
Sell Put未平倉金額



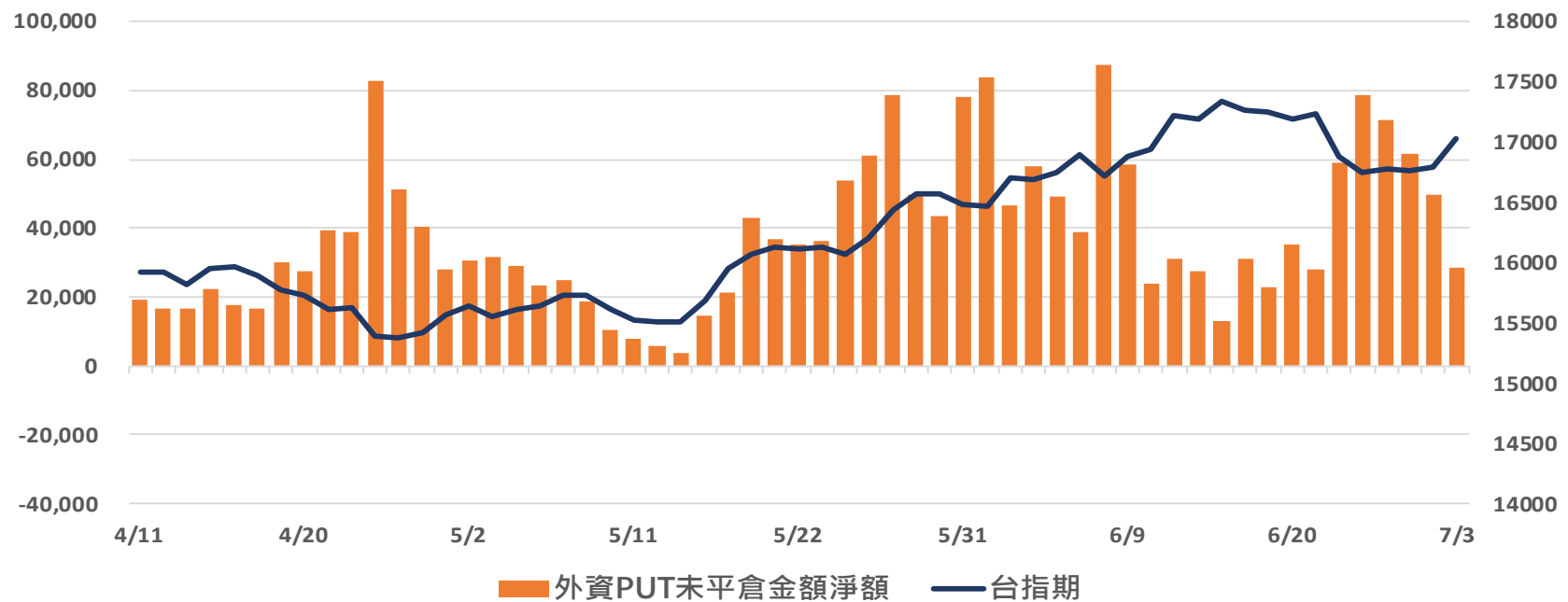
更新日期：2023年7月3日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額淨額

Buy Call – Sell Call 未平倉金額



Buy Put – Sell Put 未平倉金額



更新日期：2023年7月3日 資料來源：凱基期貨整理，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