

# 台指選擇權OI

日期：2023/7/4 結算日：2023/7/5					日期：2023/7/4 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
0	37	16,450	3,561	-12	0	84	15,700	2,922	414
-1	47	16,500	7,844	-129	0	76	15,800	2,523	-81
-5	171	16,550	4,364	-100	0	74	15,900	2,564	47
45	535	16,600	10,804	-659	0	148	16,000	3,997	-149
-36	768	16,650	5,560	-1,261	1	105	16,100	3,006	120
-123	1,051	16,700	5,889	-916	0	124	16,200	4,305	48
-98	1,237	16,750	5,774	-825	-11	585	16,300	5,269	-158
-1,035	4,365	16,800	9,730	-1,714	-4	234	16,400	3,360	58
-484	1,668	16,850	6,921	-1,784	-2	604	16,500	4,921	116
-1,302	3,248	16,900	10,630	-433	-67	795	16,600	5,565	526
-1,439	3,403	16,950	7,692	-418	-7	3,171	16,700	6,103	1,623 ※
-976	5,614	17,000	12,628	3,086	-34	2,089	16,800	4,180	1,473
-522	5,921	17,050	10,683	4,663	-166	2,444	16,900	2,416	614
-681	10,582	17,100	8,552	5,211	-185	3,455	17,000	2,101	313
1,504	8,783	17,150	6,407	5,635 ※	-319	3,955	17,100	1,217	226
※ 5,371	14,970	17,200	3,084	2,565	-25	4,802	17,200	606	37
1,761	11,479	17,250	664	458	187	6,215	17,300	475	40
1,724	7,005	17,300	342	264	-189	5,705	17,400	242	82
1,410	3,935	17,350	49	32	183	6,735	17,500	91	16
1,313	4,490	17,400	26	12	377	6,883	17,600	22	2
295	3,071	17,450	1	0	※ 1,753	4,990	17,700	6	1
388	1,612	17,500	1	0	39	4,146	17,800	5	0
33	1,222	17,550	0	0	43	2,052	17,900	11	0
13	1,025	17,600	2	0	90	2,480	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
7,179	97,230	1.5865	154,260	12,564	1,732	69,985	1.0431	72,998	4,951
昨日 P/C	1.5946	今日增減變化		-0.0081	昨日 P/C	0.9970	今日增減變化		0.0461

更新日期：2023年7月4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	139,410,131	121,927,248	17,482,883	5,673,701	912,091	2,836,135	-1,924,044	-181,544
投信	52,253,086	41,341,372	10,911,714	2,571,378	1,281,588	0	1,281,588	50,613
自營商	18,313,600	50,268,593	-31,954,993	-41,478	985,142	1,125,017	-139,875	8,736
	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	1,701,644	2,095,476	-393,832	-119,249	104,152	6,218	97,934	10,501
投信	22,742	0	22,742	-81	0	0	0	0
自營商	181,544	987,323	-805,779	-56,660	195,657	309,031	-113,374	8,293

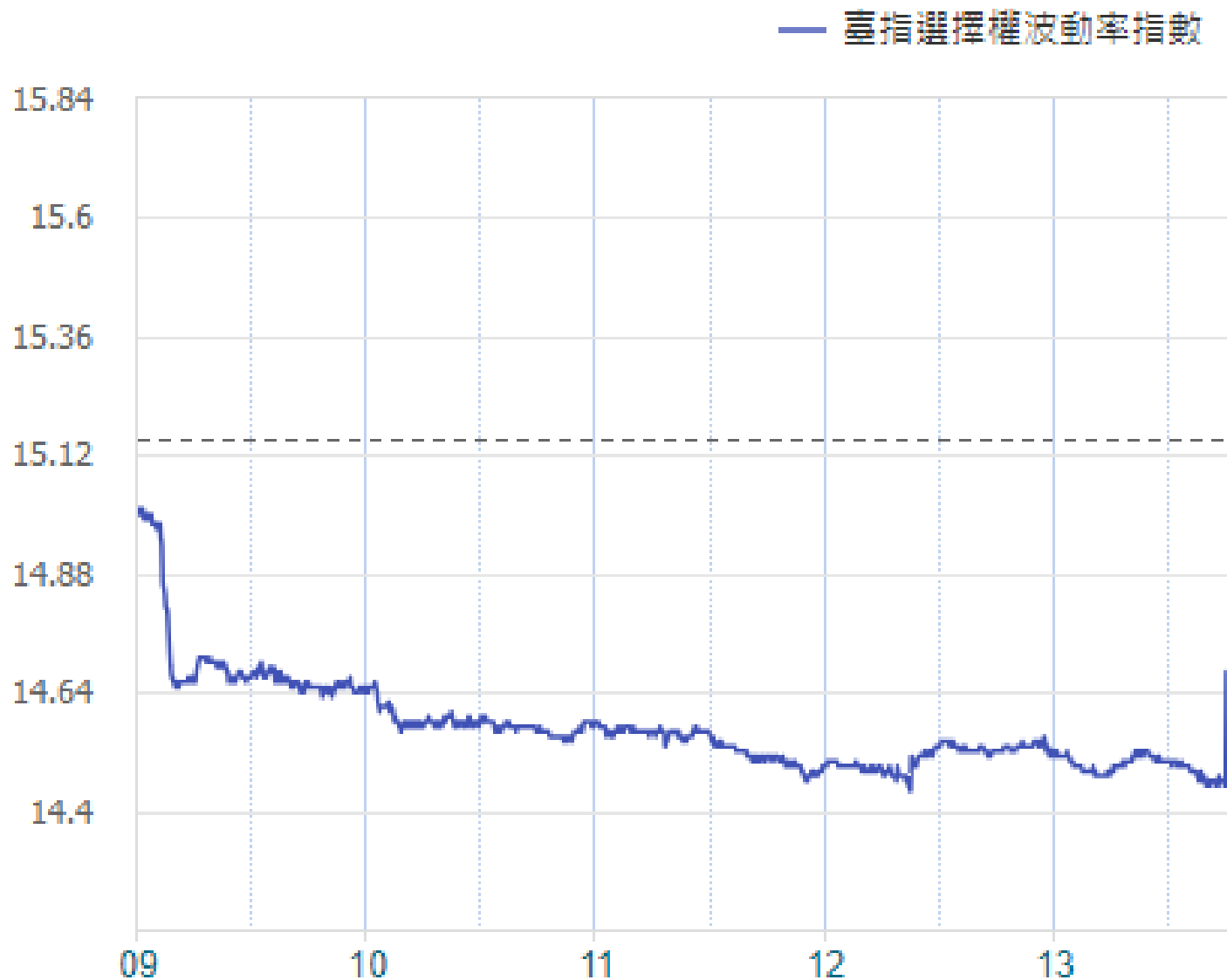
## 台指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數

	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	28,898	11,095	17,803	-66	40,618	16,349	24,269	720
投信	200	100	100	0	600	113	487	250
自營商	63,749	55,700	8,049	37	62,752	66,221	-3,469	-3,592
特定法人(週)	1,107	0	1,107	258	2,311	8,740	-6,429	2,311
特定法人(近月)	16,502	1,954	14,548	-847	7,113	16,846	-9,733	800
特定法人(全月)	17,320	0	17,320	34	5,959	22,544	-16,585	1,109
十大交易人(週)	36,741	33,209	3,532	-1,538	56,080	55,933	147	4,550
十大交易人(近月)	31,956	29,764	2,192	45	26,749	41,780	-15,031	389
十大交易人(全月)	83,760	68,365	15,395	-2,743	79,995	100,452	-20,457	3,798
全市場未沖銷(近月)			69,985	1,732			72,998	4,951
全市場未沖銷(全月)			208,952	13,276			268,166	24,413

更新日期：2023年7月4日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

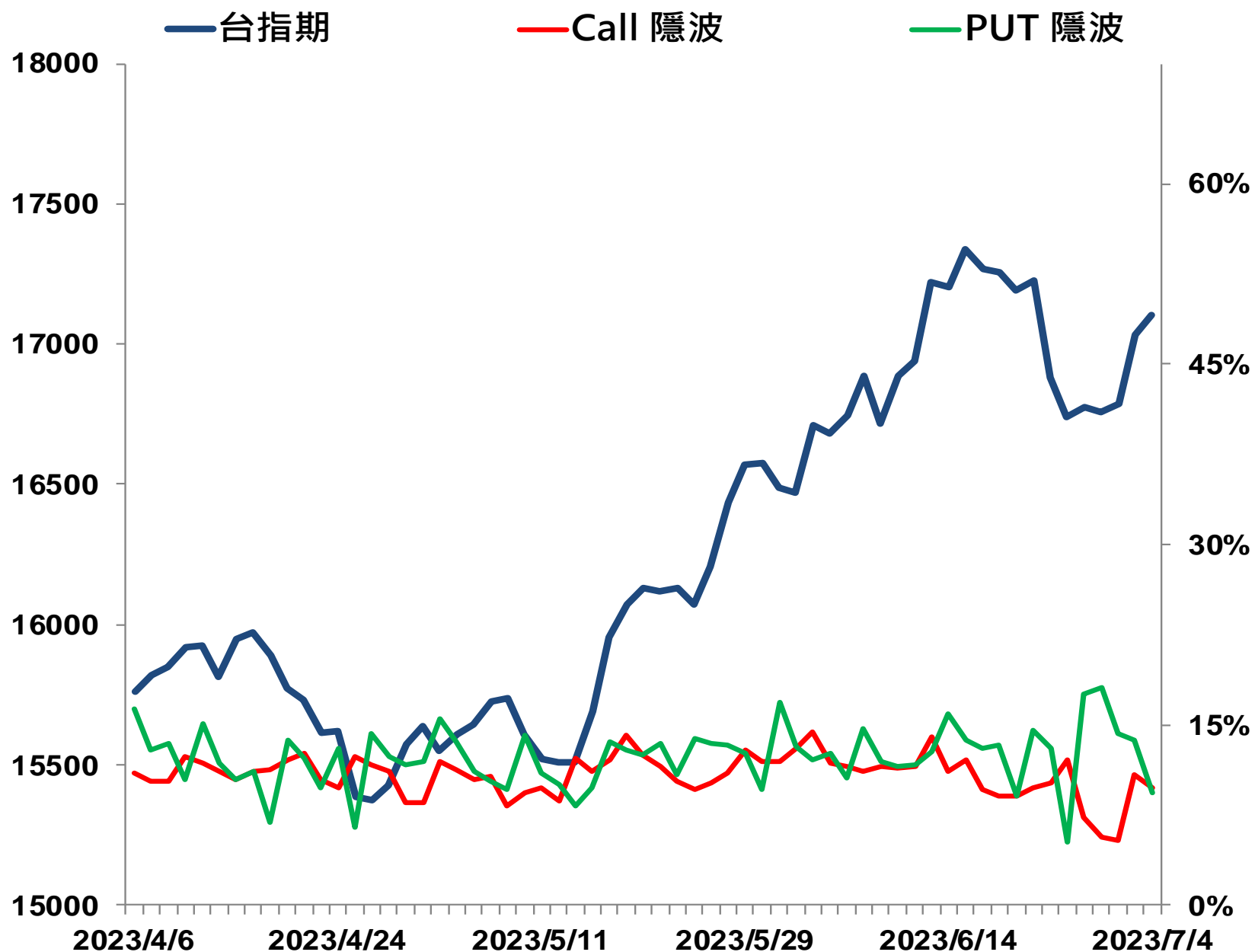
# 選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年7月4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4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

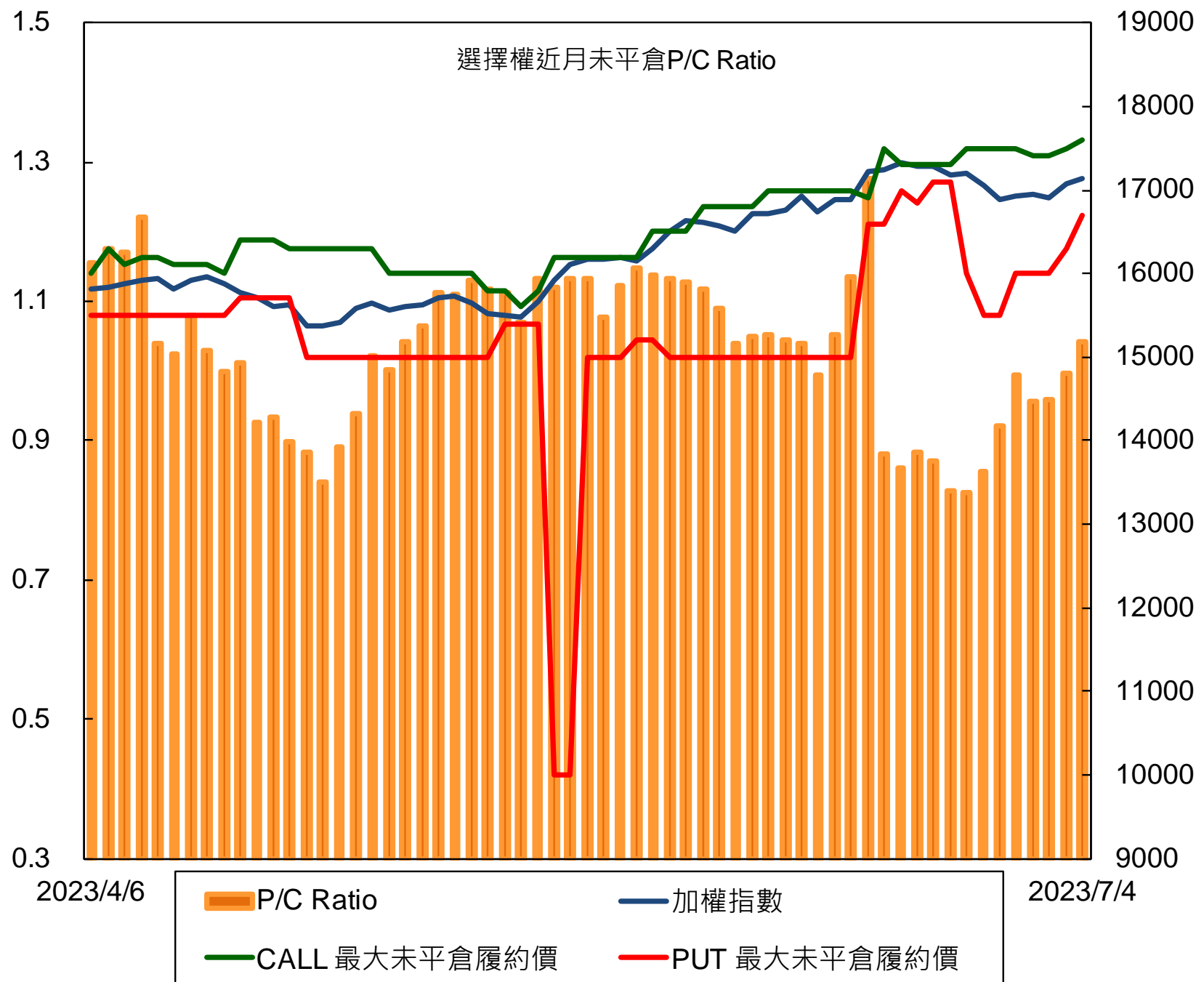
# 自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
<b>Call</b>	7月3日	62,958	54,946	8,012
	7月4日	63,749	55,700	8,049
<b>Put</b>	7月3日	60,354	60,231	123
	7月4日	62,752	66,221	-3,469

更新日期：2023年7月4日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



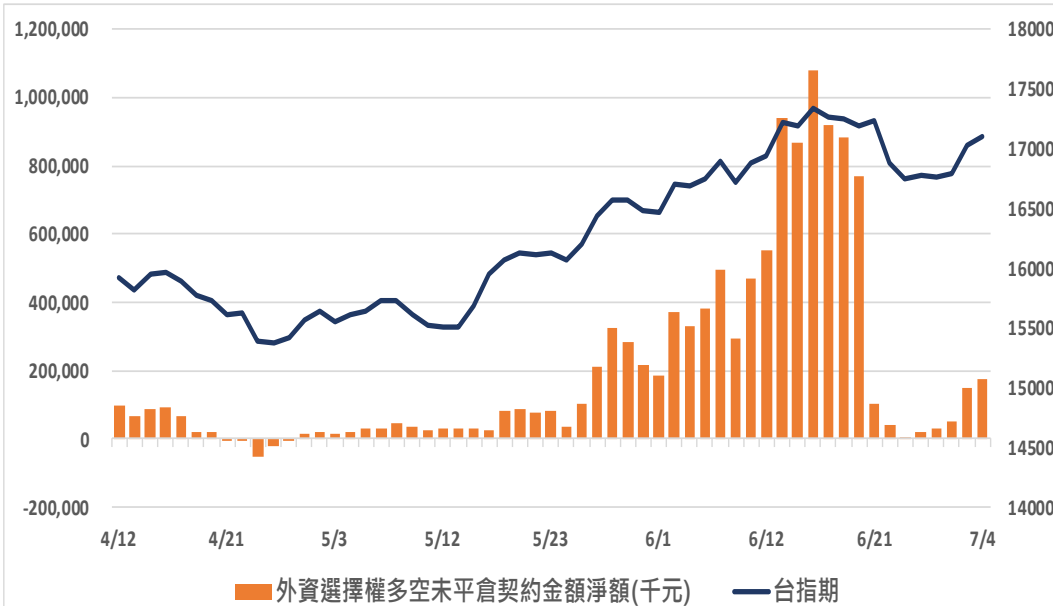
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



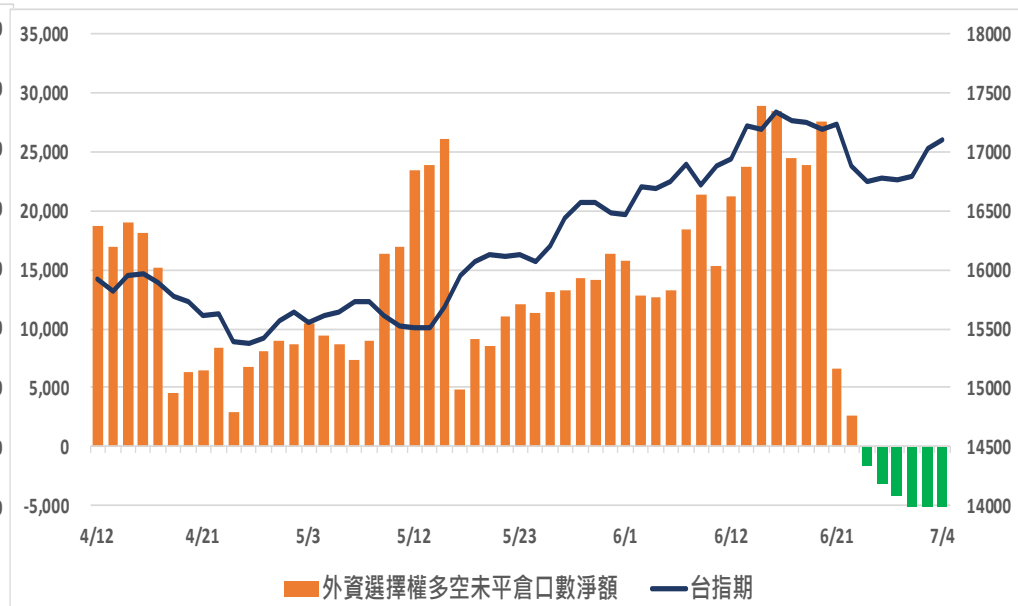
更新日期：2023年7月4日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



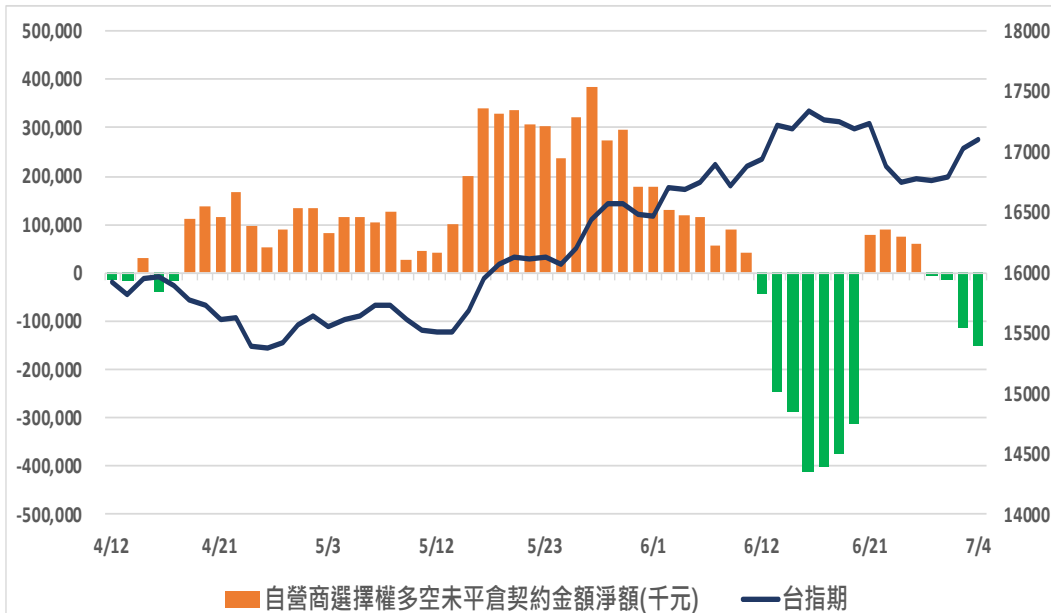
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/6/28	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
2023/7/4	17103	-6,466	-786	174,596	+26,241

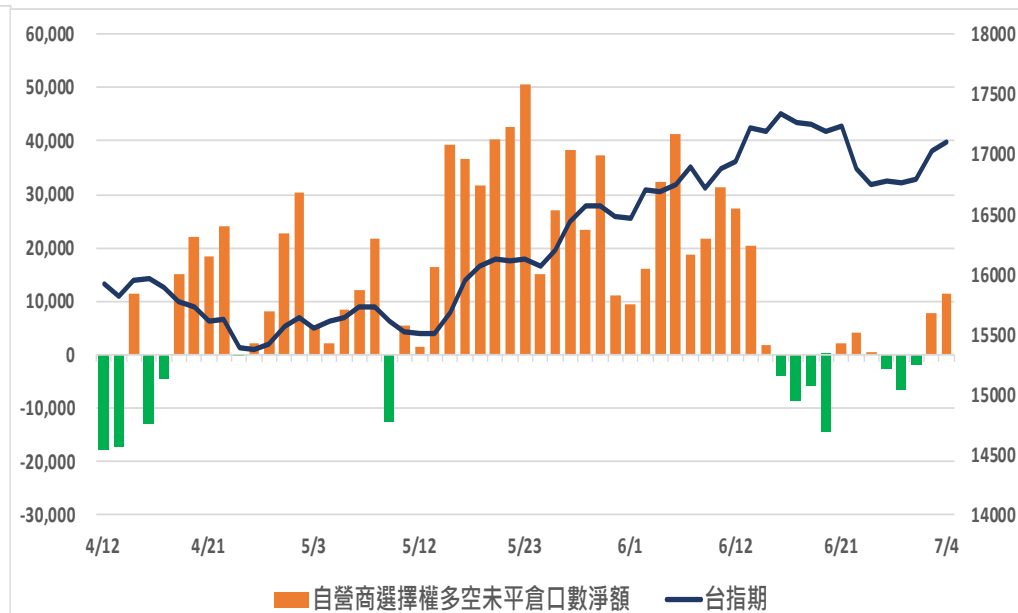
更新日期：2023年7月4日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



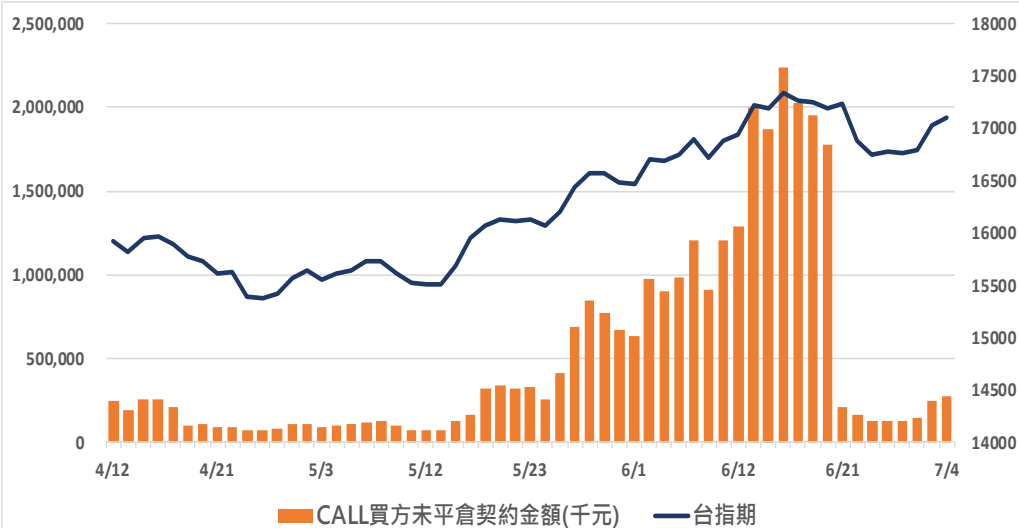
## 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/6/28	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
2023/7/4	17103	11,518	+3,629	-150,432	-37,700

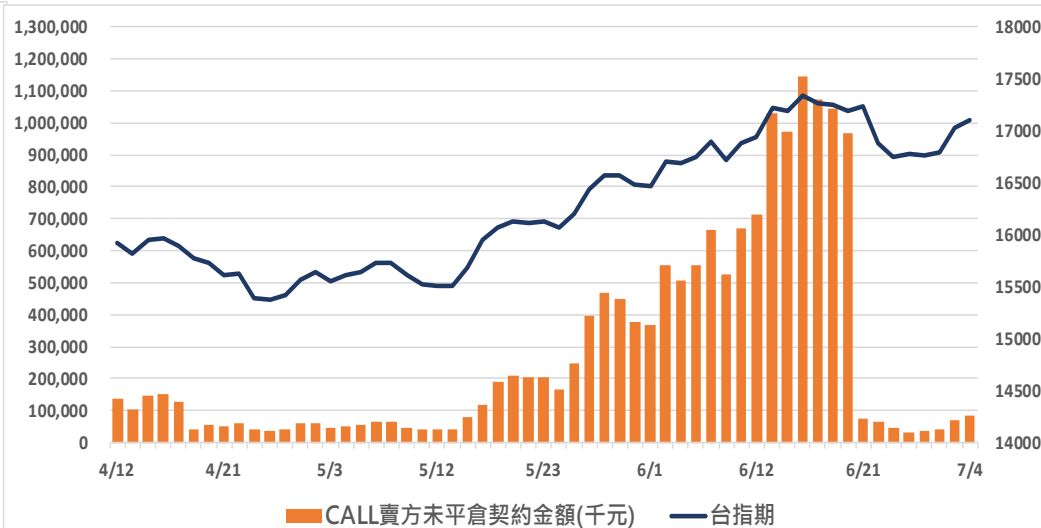
更新日期：2023年7月4日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 外資選擇權未平倉金額

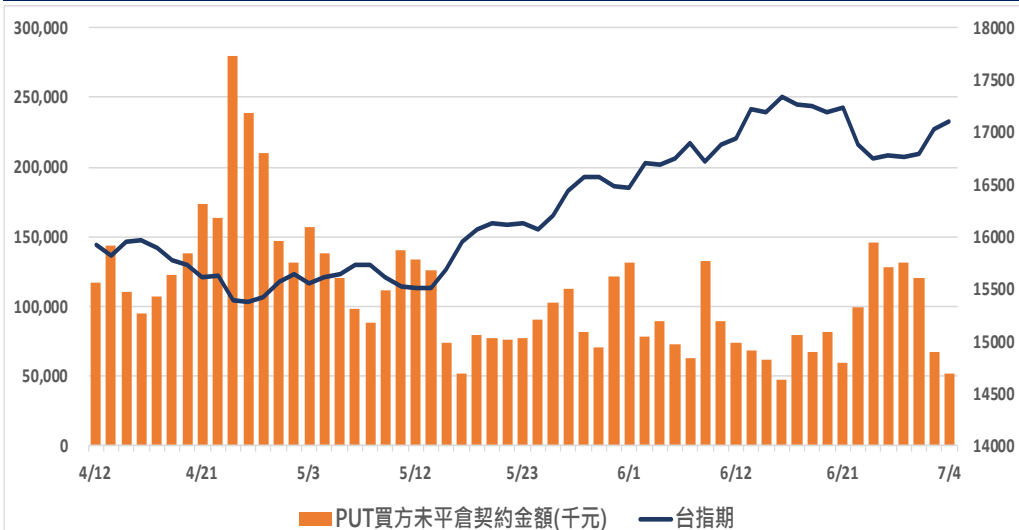
## Buy Call未平倉金額



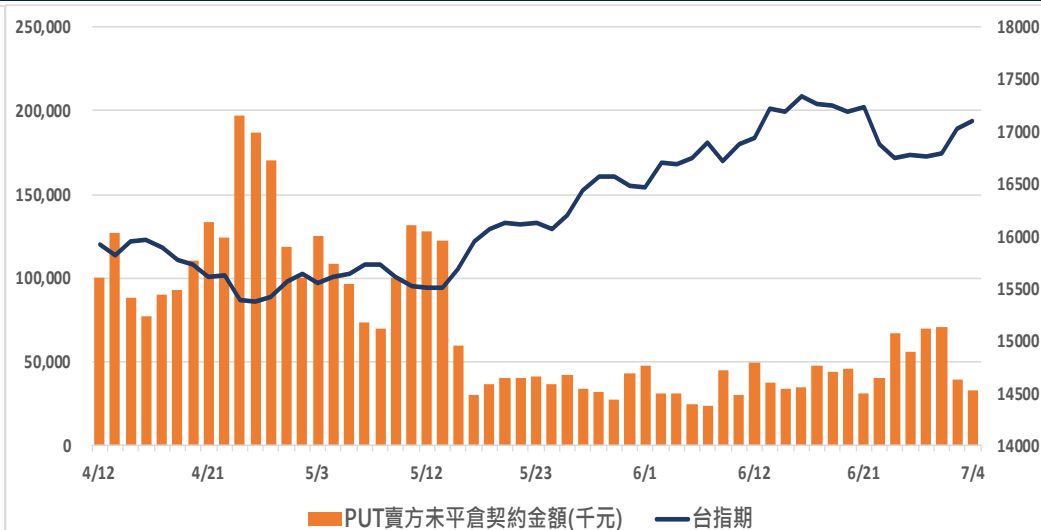
## Sell Call未平倉金額



## Buy Put未平倉金額



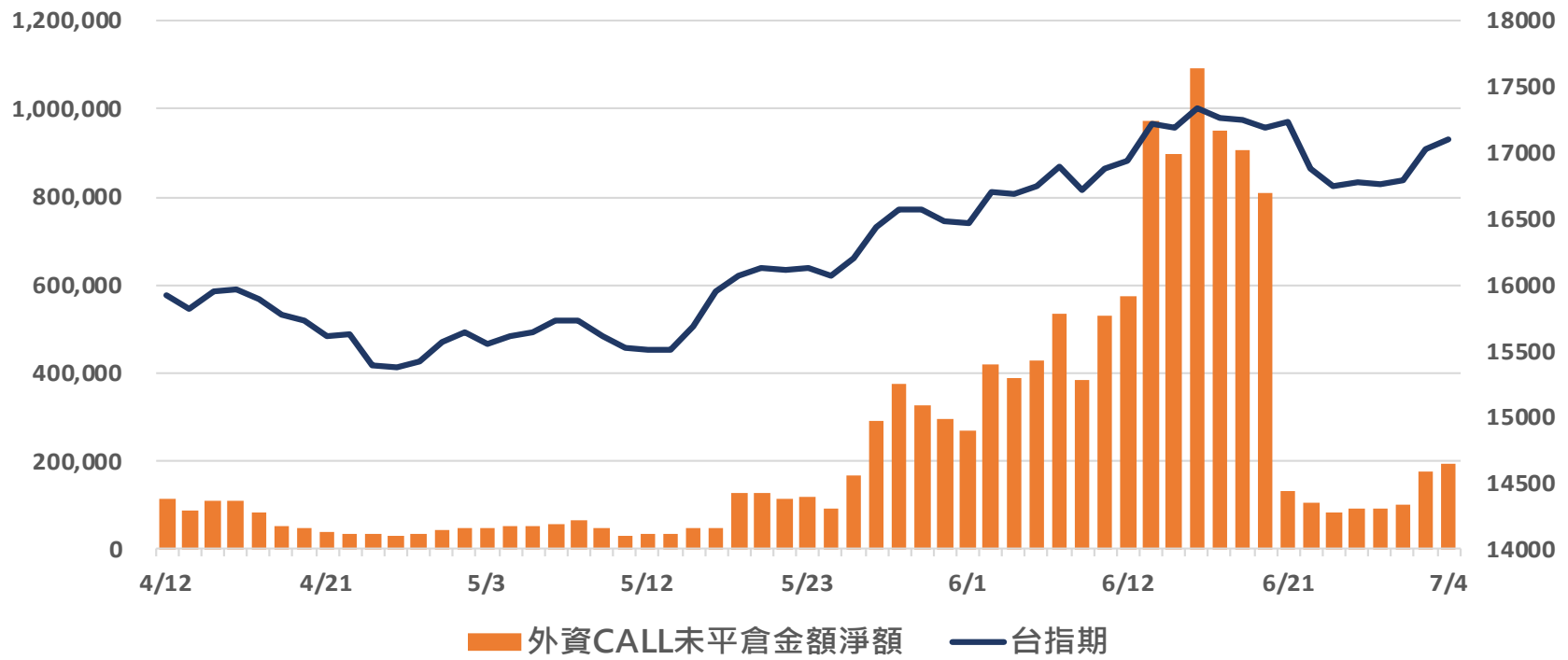
## Sell Put未平倉金額



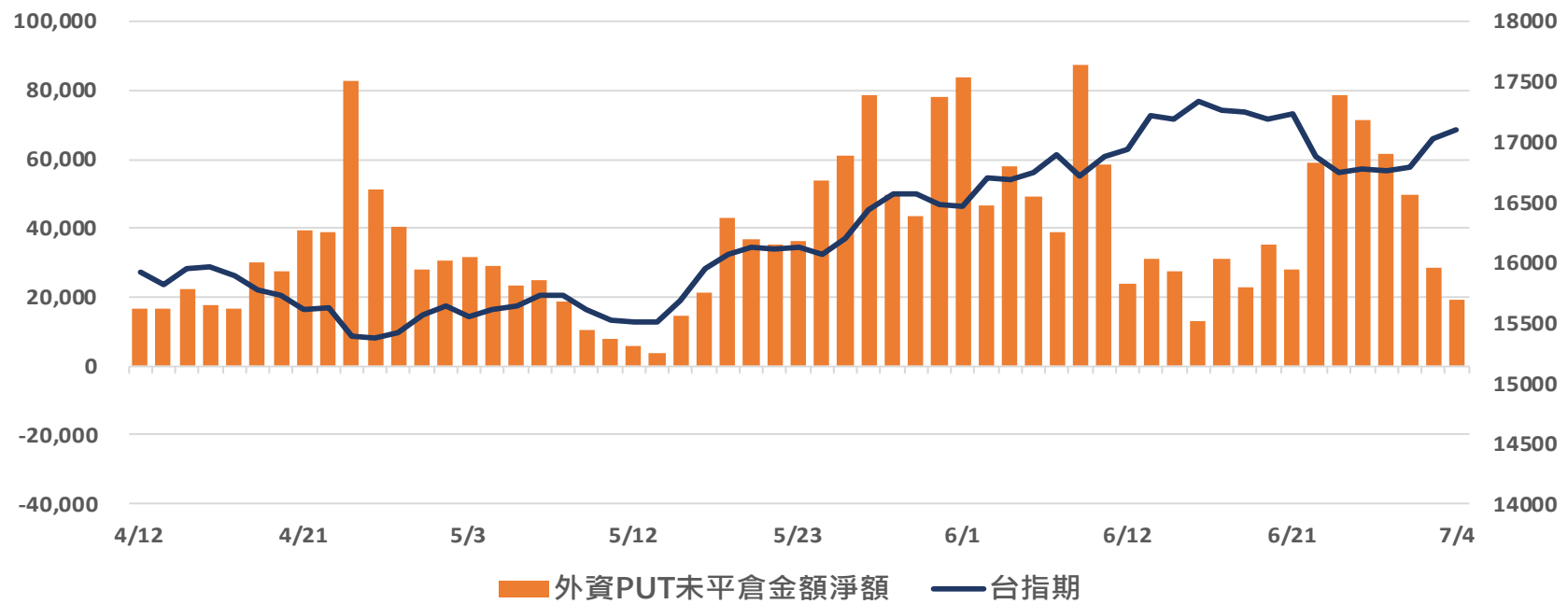
更新日期：2023年7月4日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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4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