

台指選擇權OI

日期：2023/7/5 結算日：2023/7/12					日期：2023/7/5 結算日：2023/7/19				
202307W2					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	0	16,100	678	438	0	84	15,700	2,891	-31
0	16	16,200	2,257	1,000	0	76	15,800	2,731	208
0	0	16,300	1,050	422	0	74	15,900	2,546	-18
0	5	16,400	897	86	-1	147	16,000	3,796	-201
2	12	16,500	1,608	926	0	105	16,100	3,348	342
0	32	16,600	3,070	1,131	-6	118	16,200	3,950	-355
2	53	16,650	1,393	589	-77	508	16,300	5,010	-259
-1	73	16,700	3,170	2,108	13	247	16,400	5,201	1,841
1	40	16,750	2,509	1,743	2	606	16,500	4,593	-328
67	241	16,800	3,593	2,004	-35	760	16,600	7,022	1,457
61	160	16,850	1,959	1,146	-13	3,158	16,700	6,219	116
254	452	16,900	2,547	1,675	-10	2,079	16,800	4,597	417
121	279	16,950	1,807	1,169	-1	2,443	16,900	4,566	2,150
661	1,303	17,000	2,042	1,534	-24	3,431	17,000	3,992	1,891
1,104	1,477	17,050	890	630	119	4,074	17,100	1,261	44
1,373	2,075	17,100	896	411	379	5,181	17,200	702	96
1,287	1,893	17,150	398	186	-185	6,030	17,300	517	42
1,390	2,421	17,200	265	169	37	5,742	17,400	258	16
1,607	2,282	17,250	96	26	418	7,153	17,500	103	12
2,380	3,405	17,300	211	75	-39	6,844	17,600	38	16
2,517	3,246	17,350	27	3	188	5,178	17,700	8	2
2,239	3,811	17,400	33	16	348	4,494	17,800	5	0
897	1,485	17,450	2	1	84	2,136	17,900	11	0
1,135	2,008	17,500	2	0	79	2,559	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
20,416	31,724	1.1171	35,439	20,448	941	70,926	1.1331	80,363	7,365
昨日 P/C	1.5865	今日增減變化		-0.4694	昨日 P/C	1.0431	今日增減變化		0.0900

更新日期：2023年7月5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

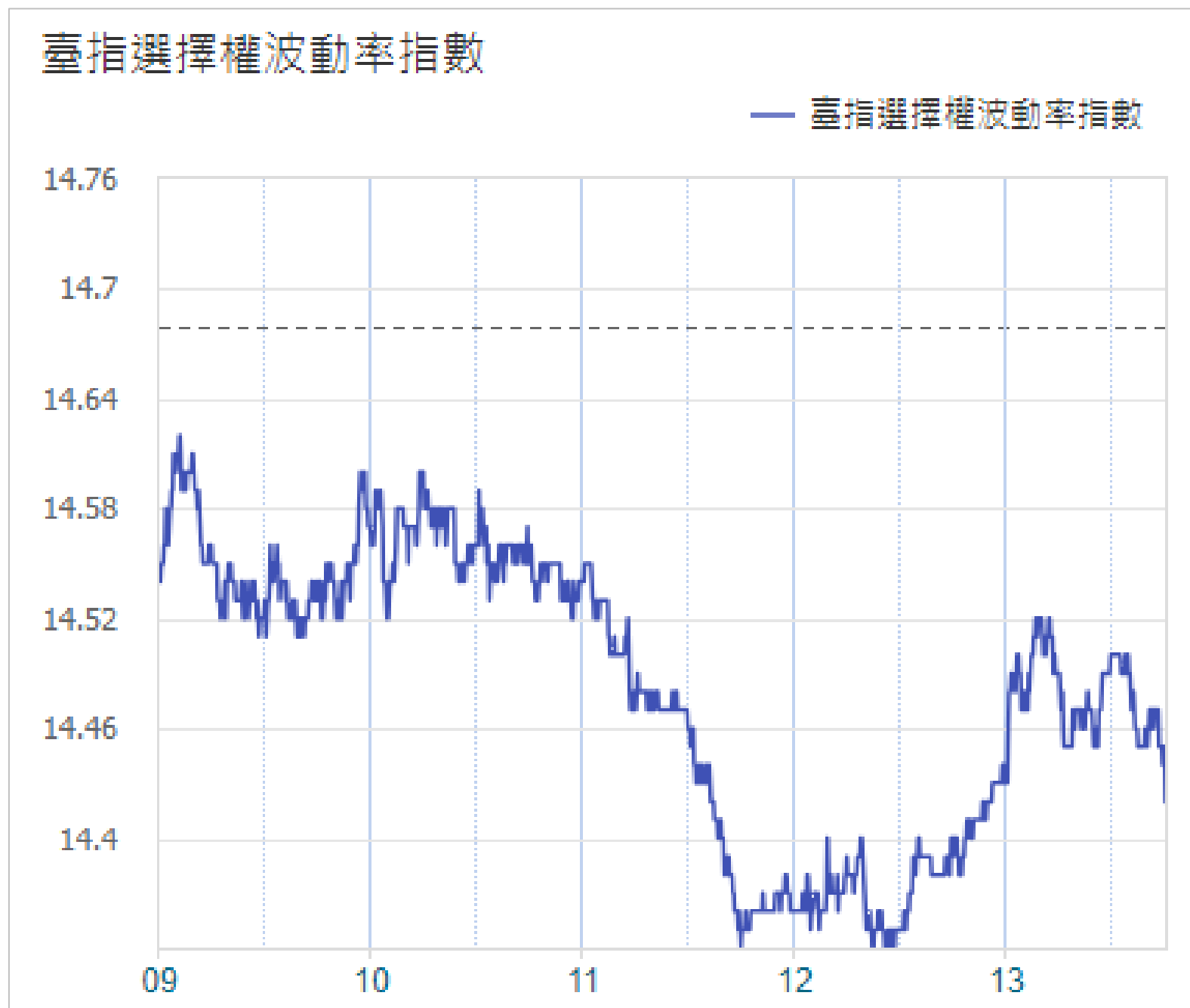
單位：千元	臺股期貨				電子期貨			
	買方金額	賣方金額	淨部位	淨部位增減	買方金額	賣方金額	淨部位	淨部位增減
外資	128,824,760	127,506,868	1,317,892	-16,164,991	922,486	2,655,036	-1,732,550	191,494
投信	52,195,147	41,478,596	10,716,551	-195,163	1,279,577	0	1,279,577	-2,011
自營商	17,637,272	49,609,891	-31,972,619	-17,626	661,008	1,074,404	-413,396	-273,521
	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	1,764,778	2,220,281	-455,503	-61,671	102,069	7,733	94,336	-3,598
投信	22,739	0	22,739	-3	0	0	0	0
自營商	244,784	921,842	-677,058	128,721	162,208	284,286	-122,078	-8,704

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	24,492	8,389	16,103	-1,700	27,305	12,669	14,636	-9,633
投信	200	100	100	0	600	113	487	0
自營商	45,241	47,814	-2,573	-10,622	52,560	42,377	10,183	13,652
特定法人(週)	363	0	363	---	0	0	0	---
特定法人(近月)	15,390	1,954	13,436	-1,112	6,568	17,420	-10,852	-1,119
特定法人(全月)	18,194	2,562	15,632	-1,688	7,976	22,893	-14,917	1,668
十大交易人(週)	12,853	14,139	-1,286	---	15,061	17,612	-2,551	---
十大交易人(近月)	32,677	29,272	3,405	1,213	33,085	48,739	-15,654	-623
十大交易人(全月)	60,948	56,210	4,738	-10,657	53,856	79,512	-25,656	-5,199
全市場未沖銷(近月)			72,159	2,174			81,091	8,093
全市場未沖銷(全月)			134,759	-74,193			146,164	-122,002

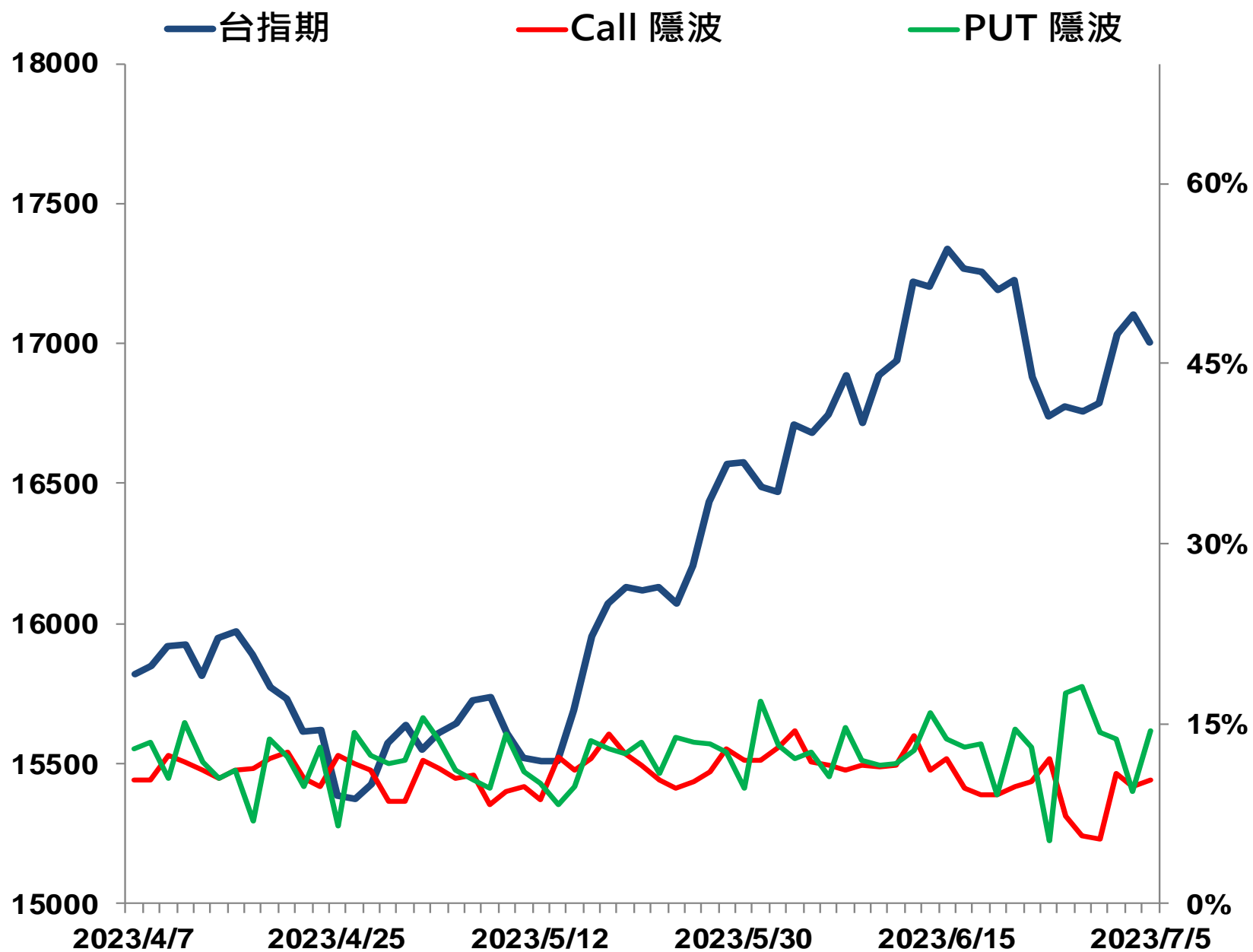
更新日期：2023年7月5日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

選擇權當日波動率



更新日期：2023年7月5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5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

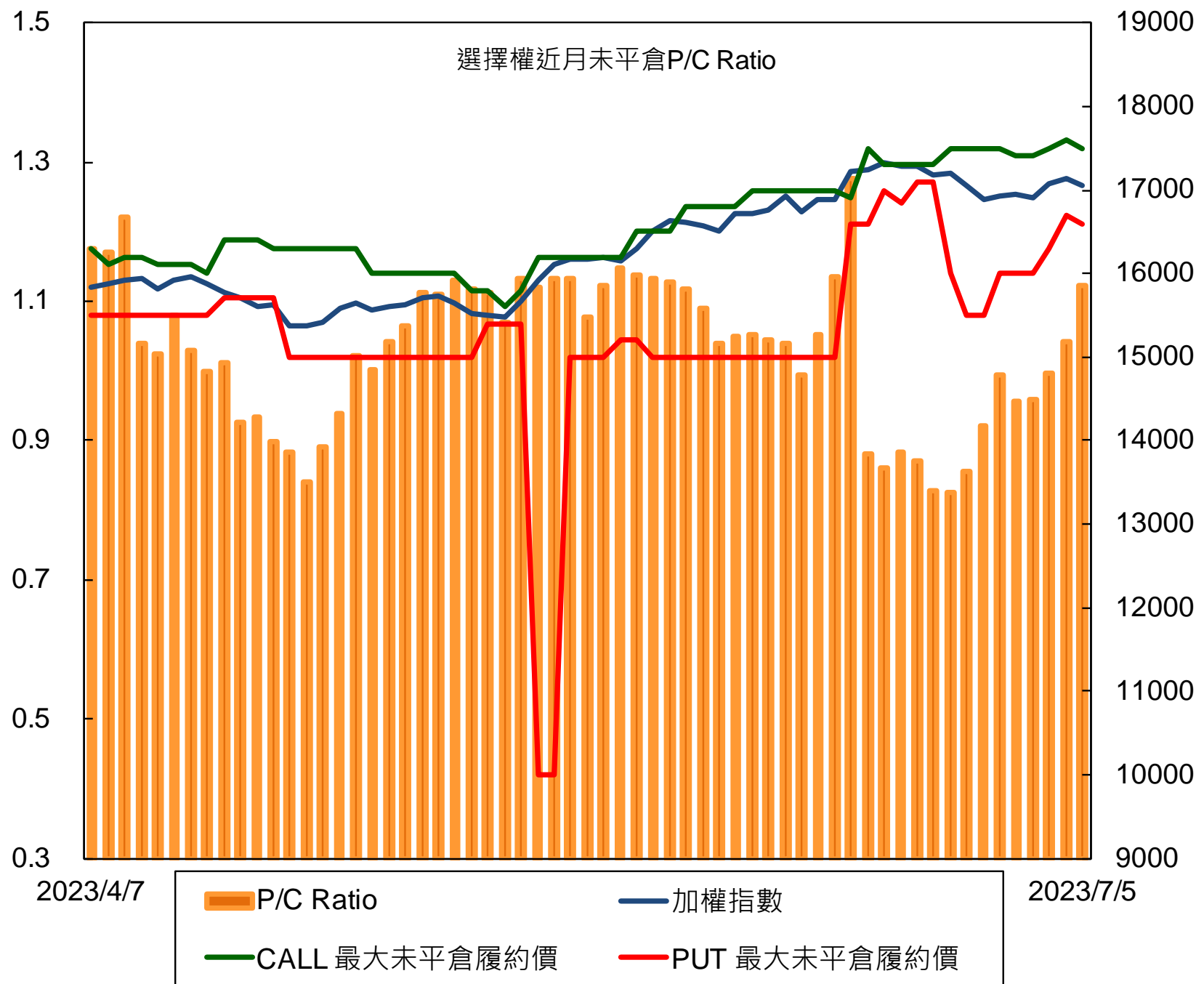
自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	7月4日	63,749	55,700	8,049
	7月5日	45,241	47,814	-2,573
Put	7月4日	62,752	66,221	-3,469
	7月5日	52,560	42,377	10,183

更新日期：2023年7月5日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

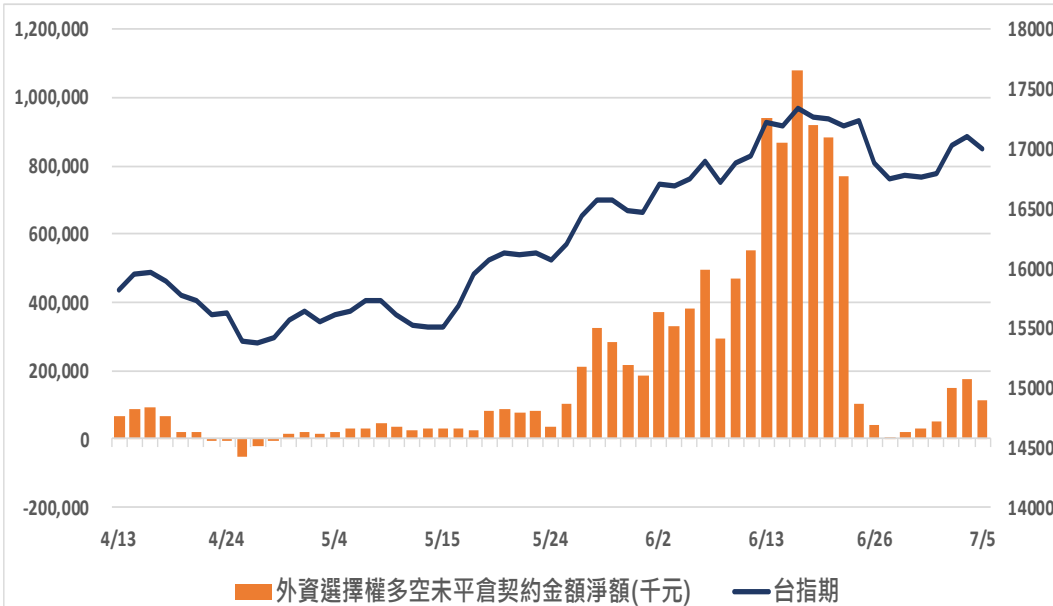


選擇權近月未平倉P/C Ratio

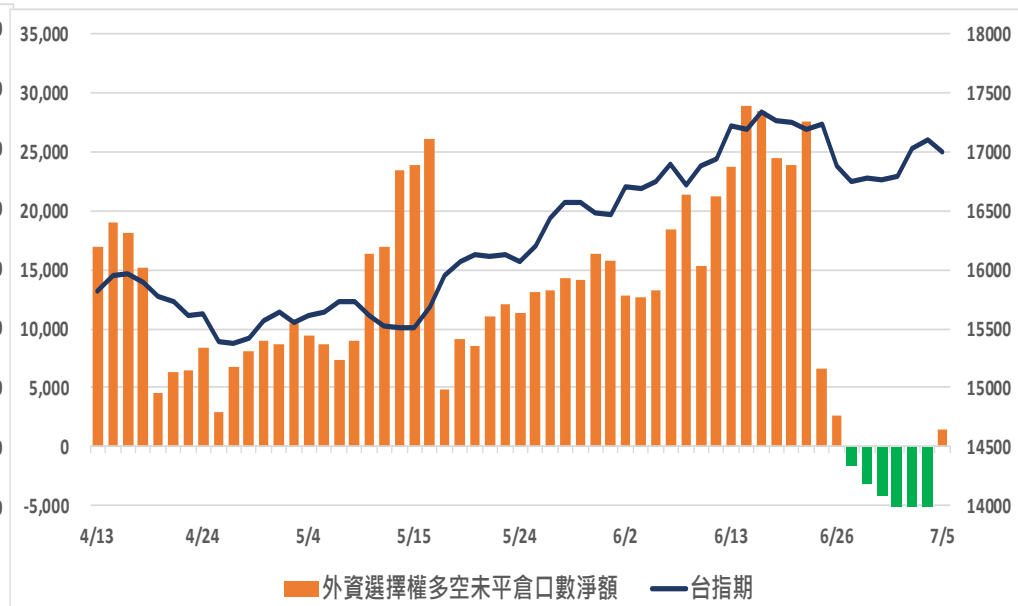


外資選擇權多空未平倉淨額

多空未平倉金額淨額



多空未平倉口數淨額



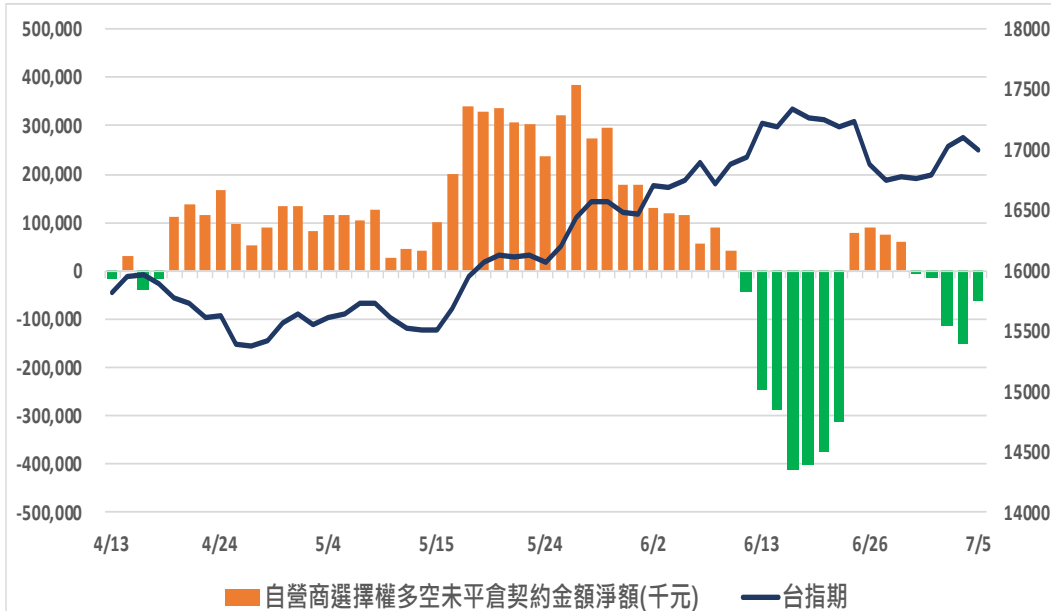
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/6/29	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
2023/7/5	17005	1,467	+7,933	111,912	-62,684

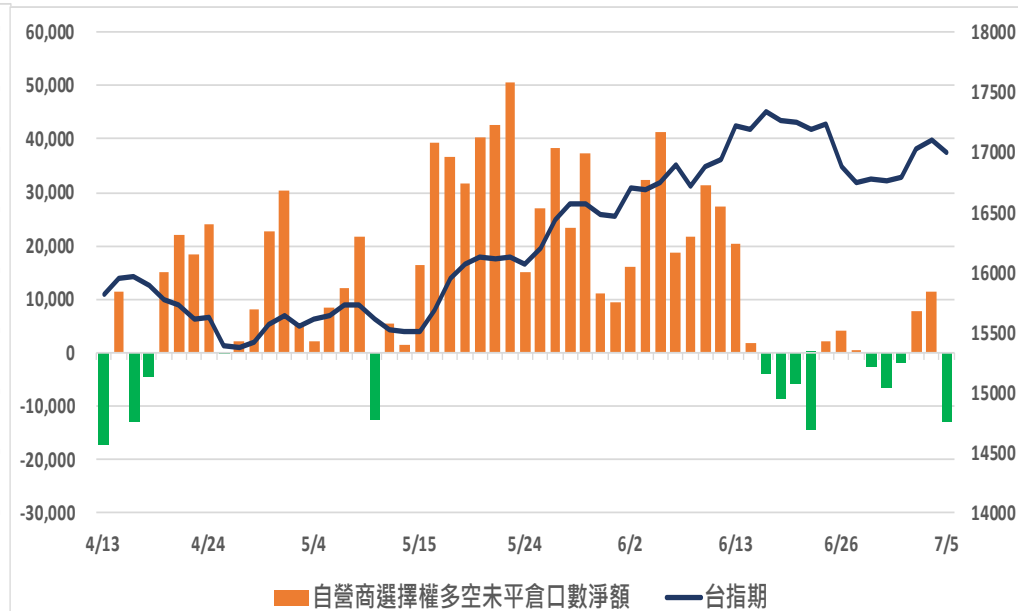
更新日期：2023年7月5日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



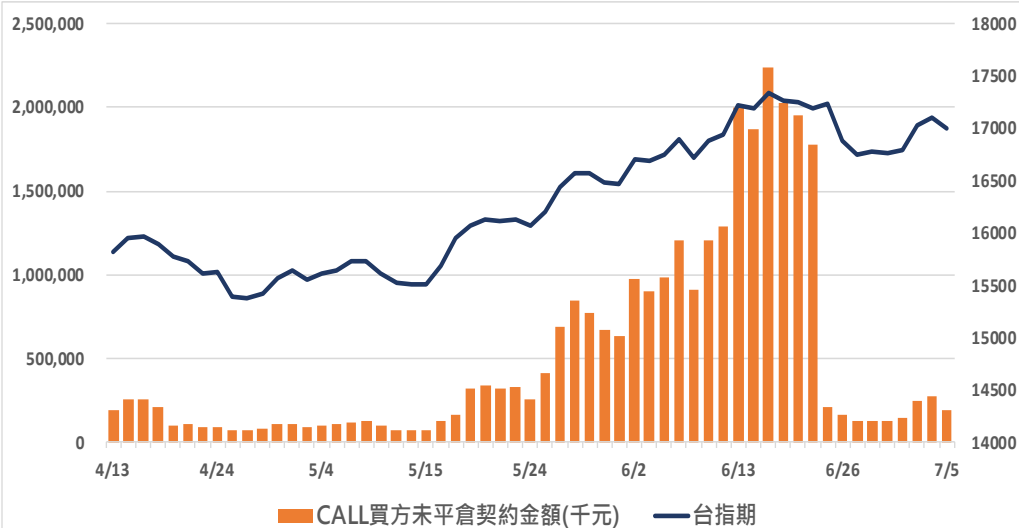
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/6/29	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
2023/7/5	17005	-12,756	-24,274	-62,522	+87,910

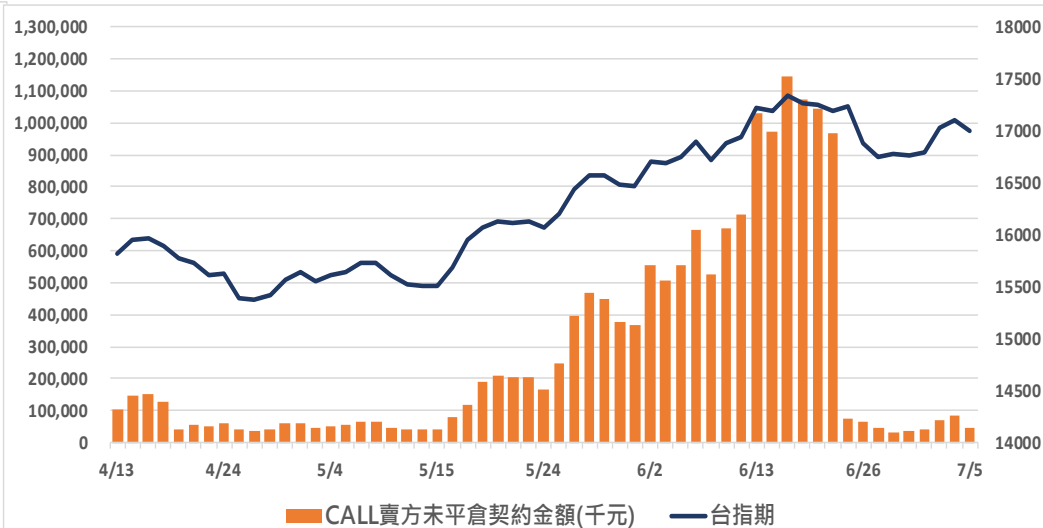
更新日期：2023年7月5日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

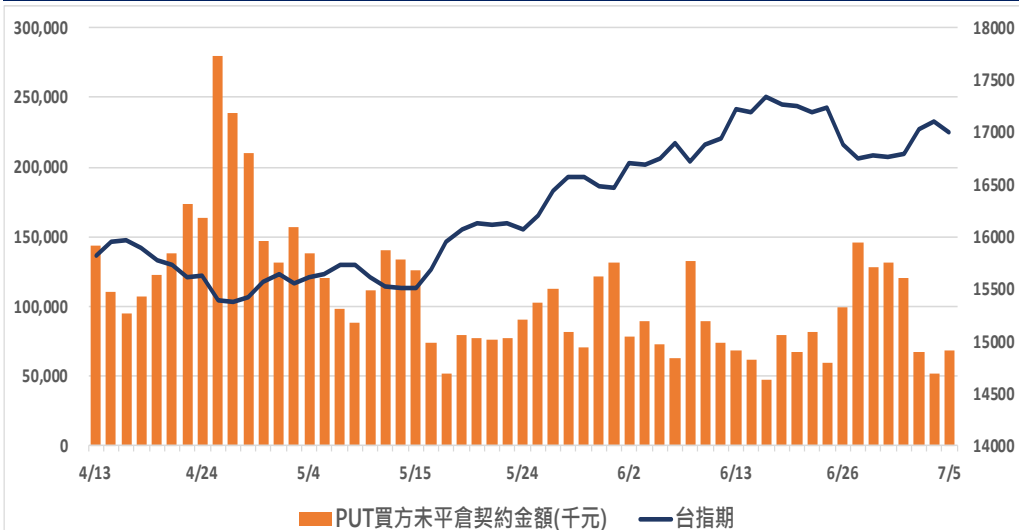
Buy Call未平倉金額



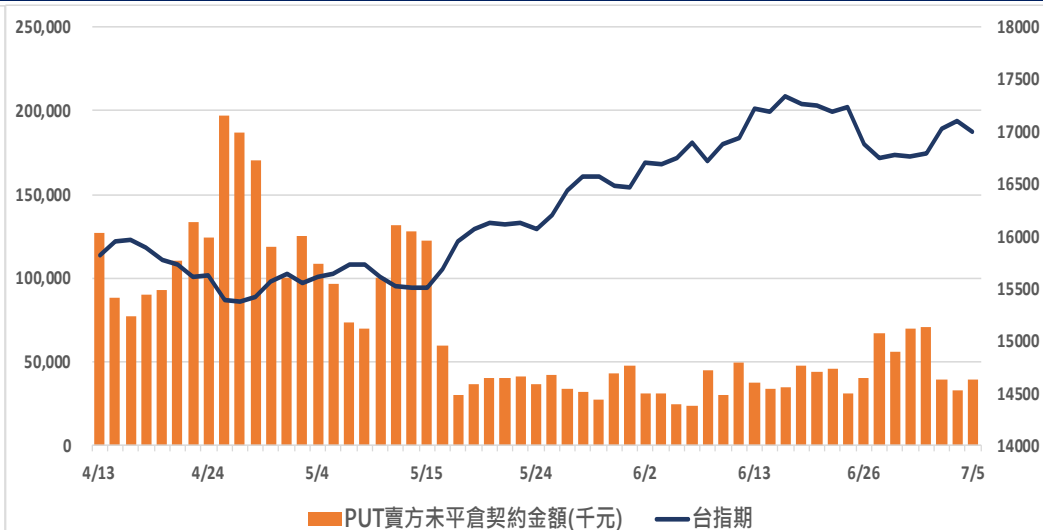
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



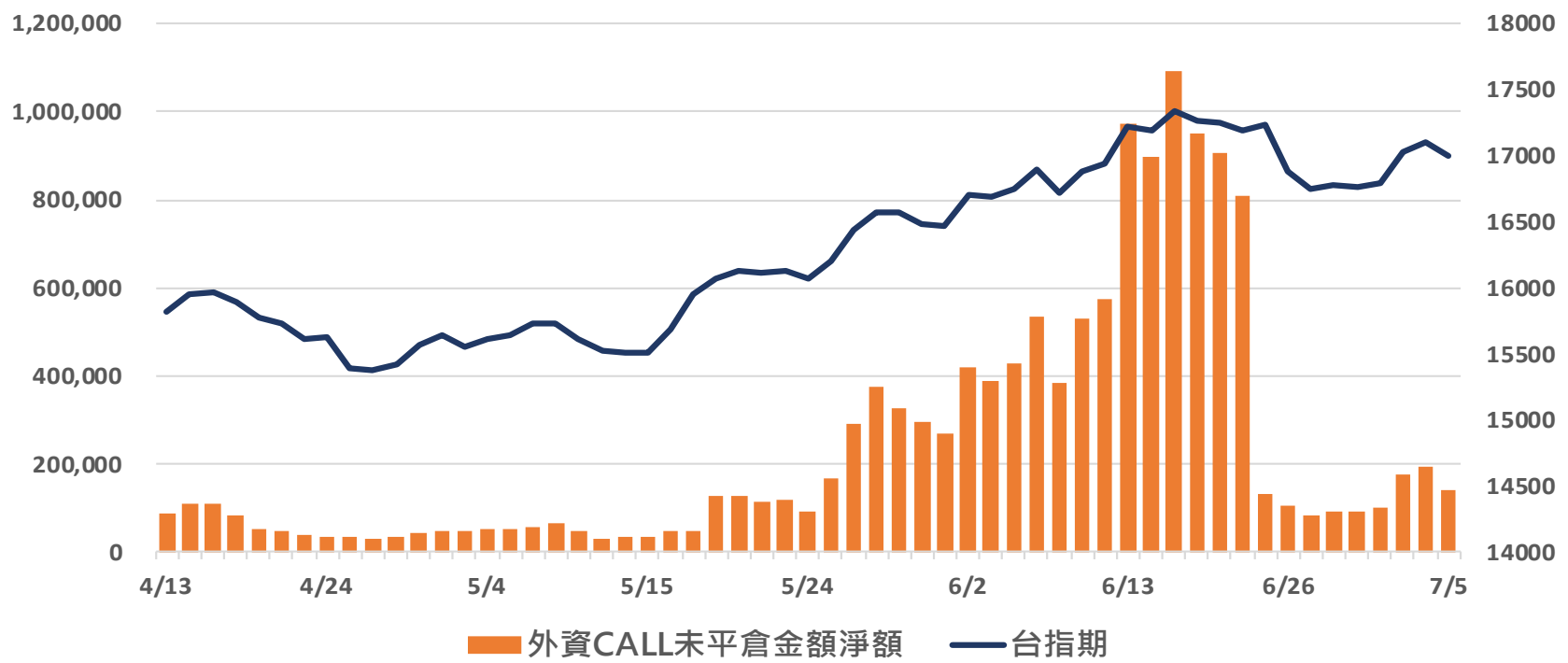
Sell Put未平倉金額



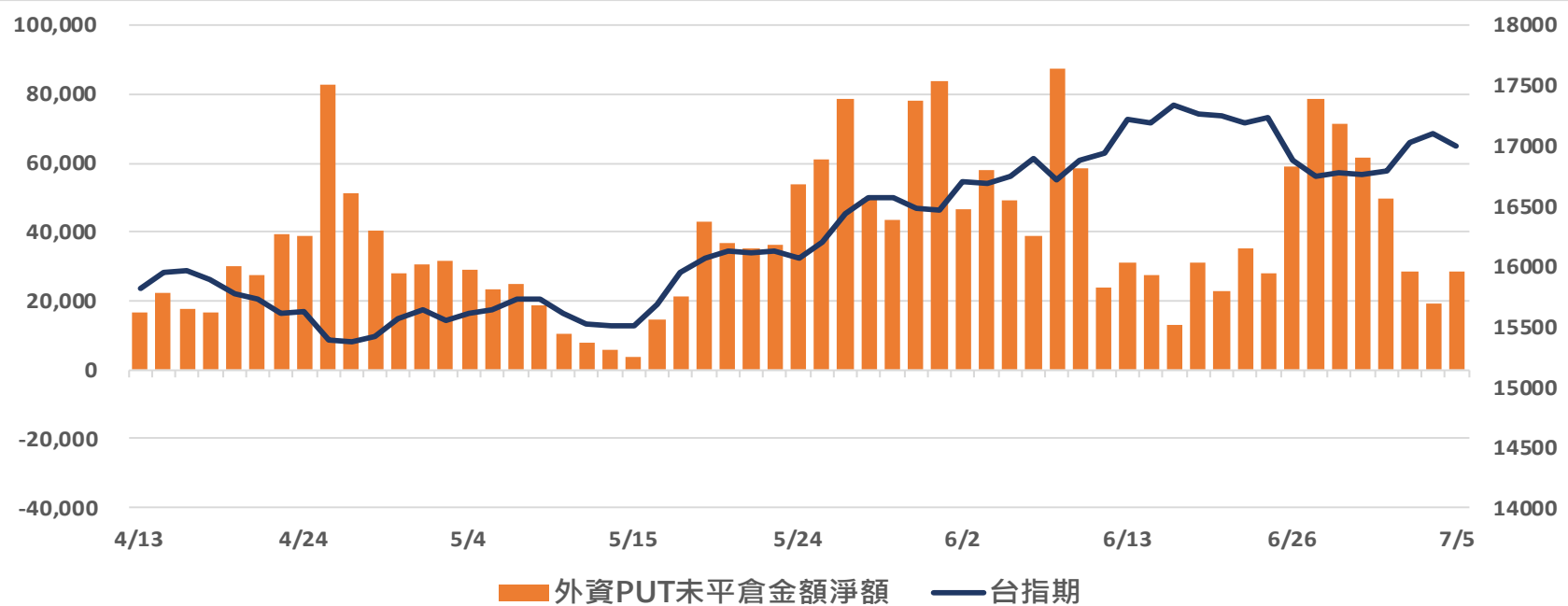
更新日期：2023年7月5日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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5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