

台指選擇權OI

日期：2023/7/6 結算日：2023/7/12					日期：2023/7/6 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
-5	11	16,200	4,778	2,521	-9	138	16,000	4,920	1,124 ※
4	4	16,300	4,573	3,523	1	106	16,100	3,344	-4
22	27	16,400	3,398	2,501	0	118	16,200	4,346	396
133	145	16,500	5,732	4,124	-39	469	16,300	5,201	191
203	208	16,550	3,967	2,312	17	264	16,400	5,525	324
139	171	16,600	6,113	3,043	26	632	16,500	5,198	605
376	429	16,650	4,926	3,533	-22	738	16,600	6,216	-806
716	789	16,700	7,753	4,583 ※	48	3,206	16,700	5,202	-1,017
2,149	2,189	16,750	3,888	1,379	347	2,426	16,800	2,999	-1,598
4,396	4,637	16,800	4,913	1,320	1,086	3,529	16,900	4,004	-562
3,579	3,739	16,850	2,345	386 ※	1,462	4,893	17,000	3,793	-199
4,601	5,053	16,900	2,744	197	666	4,740	17,100	1,128	-133
4,474	4,753	16,950	1,530	-277	1,061	6,242	17,200	660	-42
6,349 ※	7,652	17,000	1,410	-632	167	6,197	17,300	486	-31
5,585	7,062	17,050	901	11	308	6,050	17,400	216	-42
6,086	8,161	17,100	760	-136	422	7,575	17,500	76	-27
3,746	5,639	17,150	315	-83	-1,699	5,145	17,600	36	-2
5,668	8,089	17,200	365	100	-1,120	4,058	17,700	8	0
4,455	6,737	17,250	118	22	-237	4,257	17,800	5	0
1,894	5,299	17,300	168	-43	-132	2,004	17,900	11	0
1,944	5,190	17,350	15	-12	81	2,640	18,000	1	0
408	4,219	17,400	41	8	-29	1,448	18,100	0	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
58,391	90,120	0.7797	70,264	33,170	2,101	73,027	1.0876	79,422	-941
昨日 P/C	1.1171	今日增減變化		-0.3374	昨日 P/C	1.1238	今日增減變化		-0.0362

更新日期：2023年7月6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	116,660,686	122,465,985	-5,805,299	-7,123,191	839,626	2,645,308	-1,805,682	-73,132
投信	51,849,385	42,373,371	9,476,014	-1,240,537	1,257,818	0	1,257,818	-21,759
自營商	18,359,624	47,848,812	-29,489,188	2,483,431	839,548	1,458,754	-619,206	-205,810
	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	1,798,784	2,150,890	-352,106	103,397	214,616	4,566	210,050	115,714
投信	22,355	0	22,355	-384	0	0	0	0
自營商	264,498	1,000,133	-735,635	-58,577	156,611	401,539	-244,928	-122,850

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	27,790	11,073	16,717	614	32,012	16,066	15,946	1,310
投信	200	0	200	100	500	113	387	-100
自營商	58,746	59,586	-840	1,733	55,838	49,010	6,828	-3,355
特定法人(週)	846	0	846	483	0	0	0	0
特定法人(近月)	14,455	1,954	12,501	-935	5,400	20,171	-14,771	-3,919
特定法人(全月)	14,795	0	14,795	-837	8,675	25,591	-16,916	-1,999
十大交易人(週)	25,060	31,855	-6,795	-5,509	26,398	22,913	3,485	6,036
十大交易人(近月)	35,680	30,093	5,587	2,182	34,675	49,944	-15,269	385
十大交易人(全月)	76,082	66,312	9,770	5,032	63,377	84,657	-21,280	4,376
全市場未沖銷(近月)			78,732	6,573			81,128	37
全市場未沖銷(全月)			203,268	68,509			183,748	37,584

更新日期：2023年7月6日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

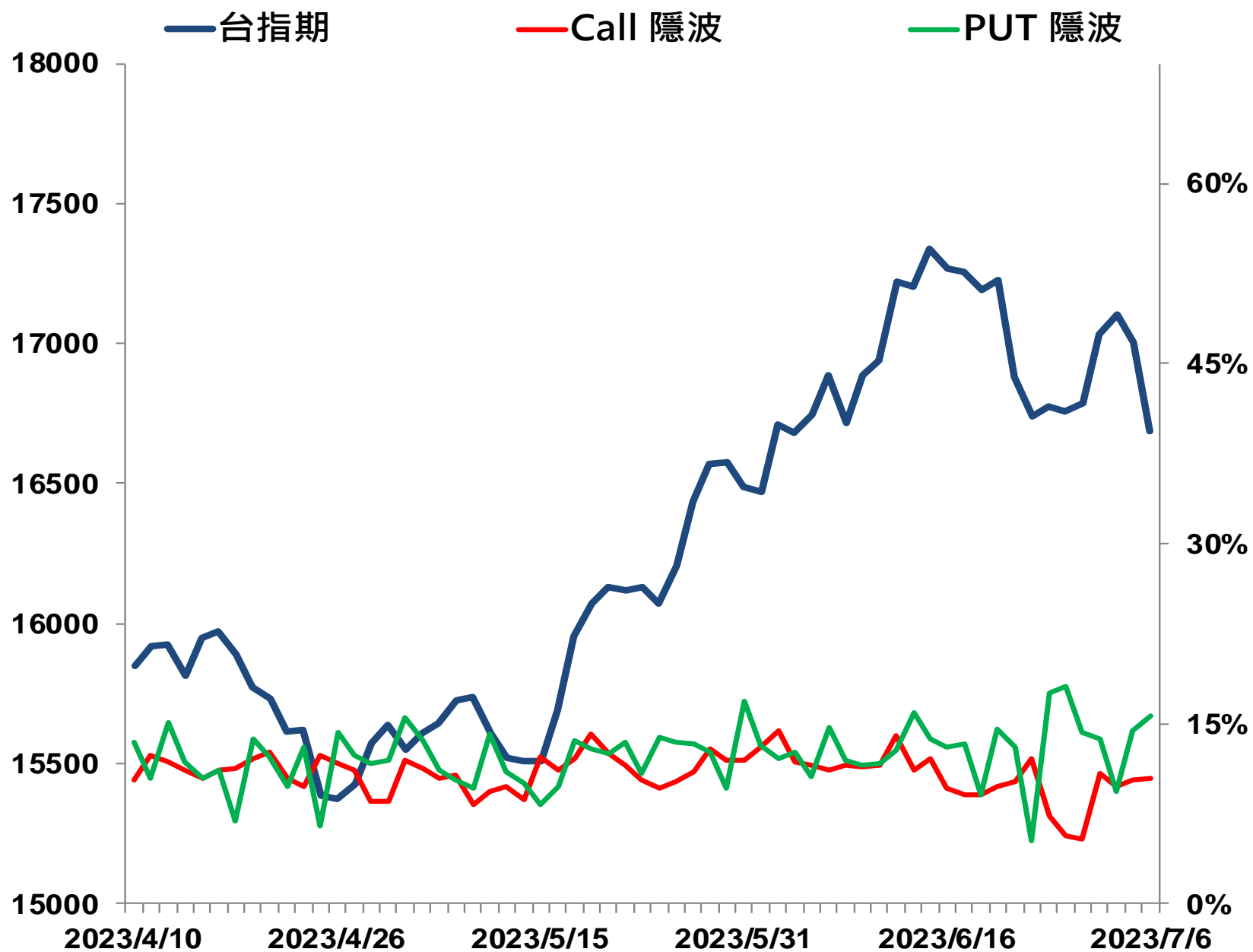
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年7月6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6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

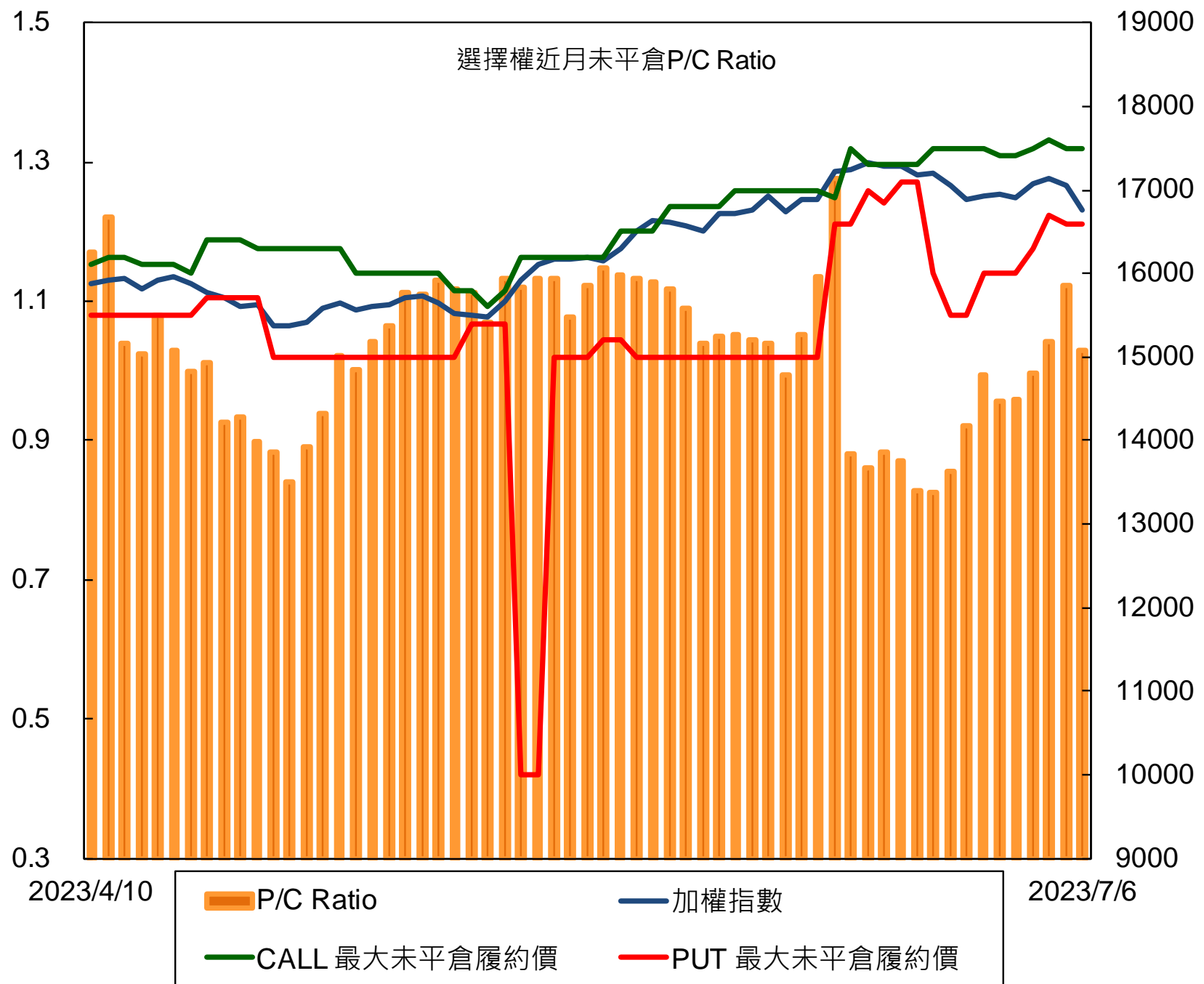
自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	7月5日	45,241	47,814	-2,573
	7月6日	58,746	59,586	-840
Put	7月5日	52,560	42,377	10,183
	7月6日	55,838	49,010	6,828

更新日期：2023年7月6日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



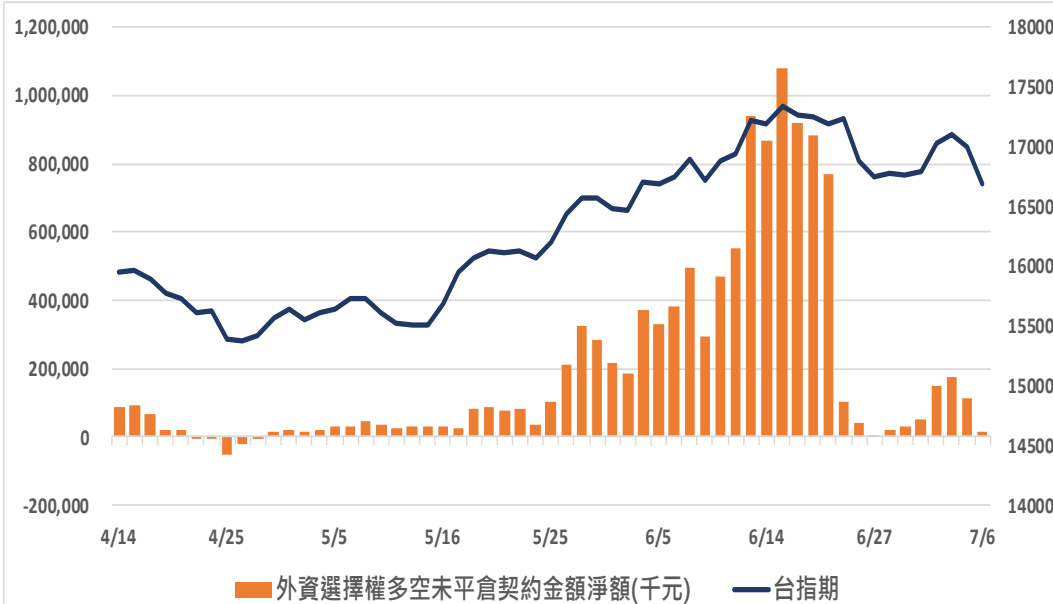
選擇權近月未平倉P/C Ratio



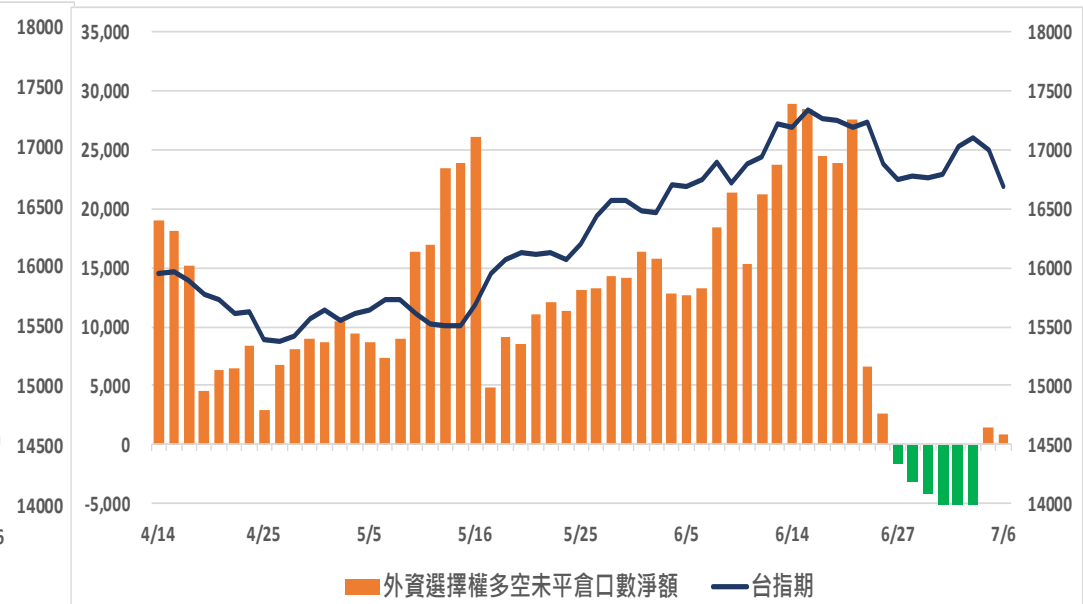
更新日期：2023年7月6日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



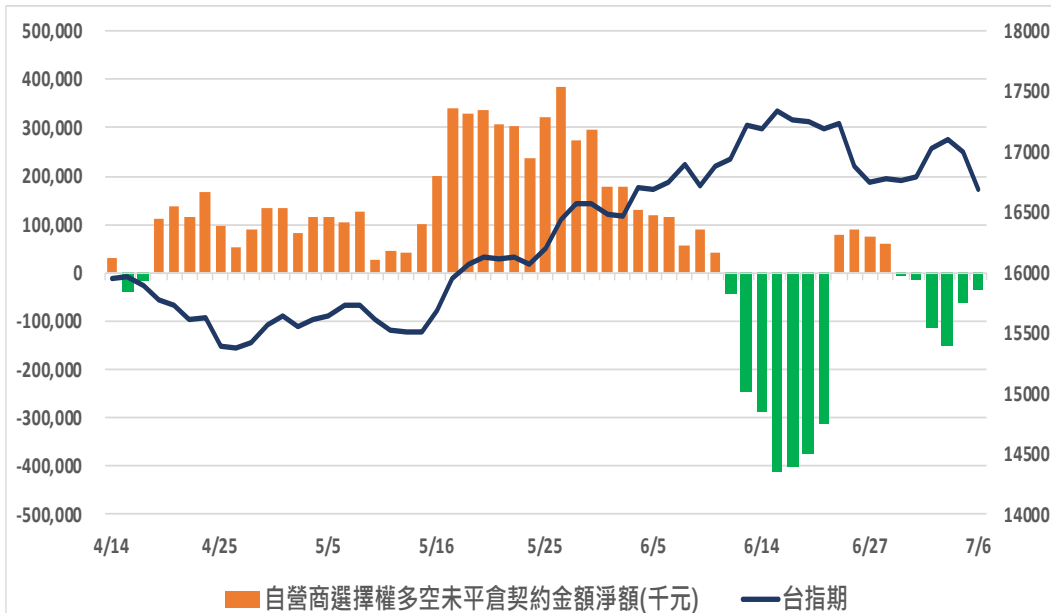
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/6/30	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
2023/7/6	16689	771	-696	15,893	-96,019

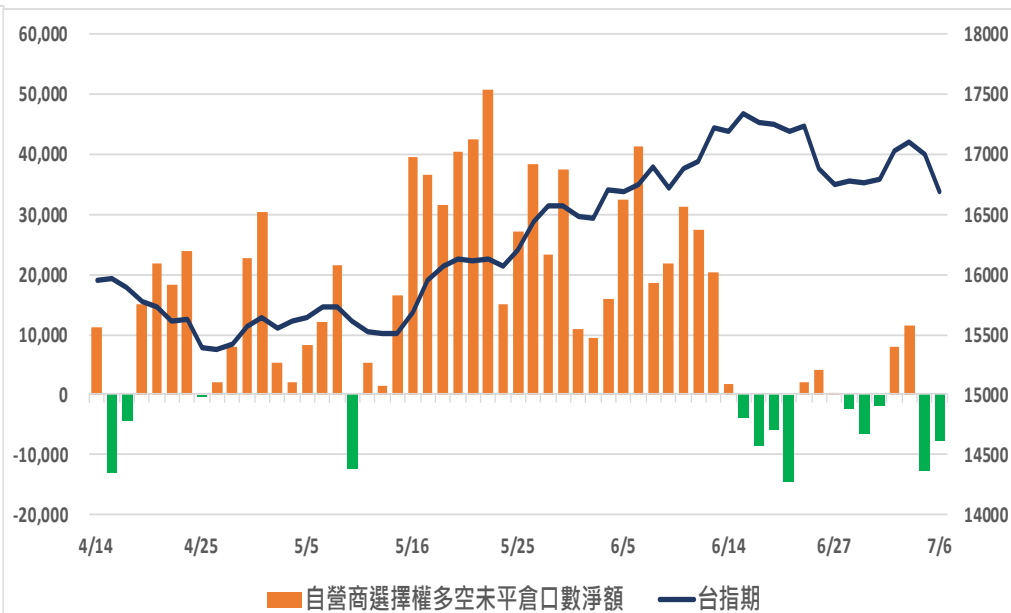
更新日期：2023年7月6日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



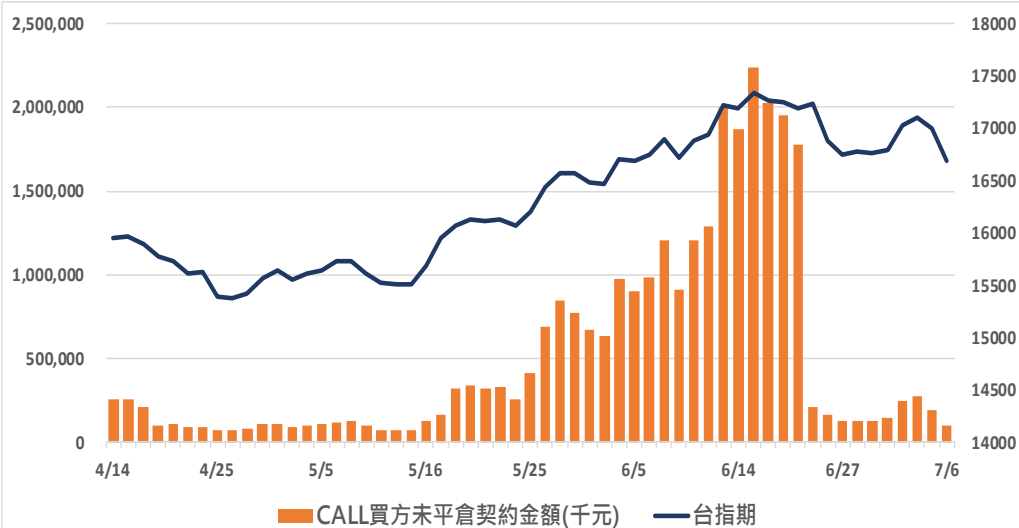
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/6/30	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
2023/7/6	16689	-7,668	+5,088	-36,972	+25,550

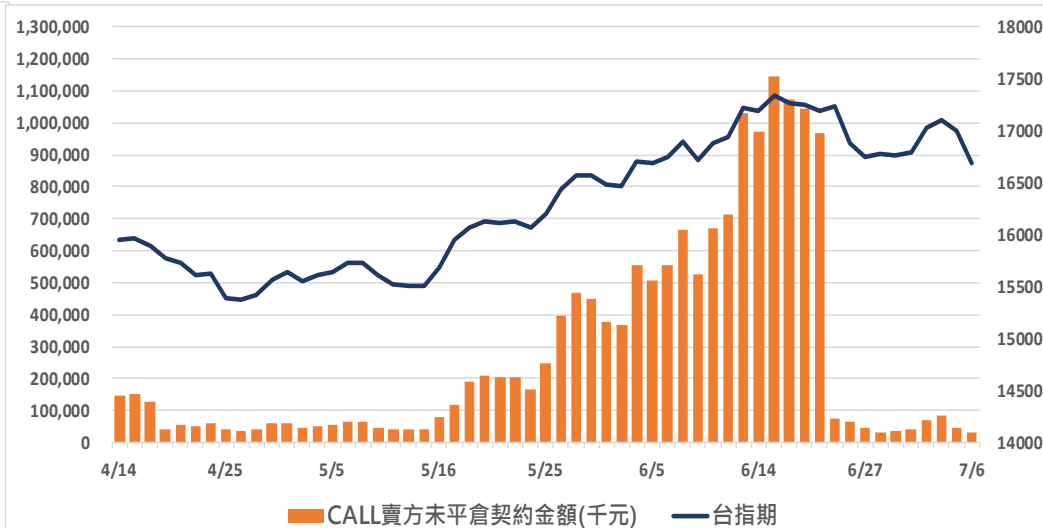
更新日期：2023年7月6日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

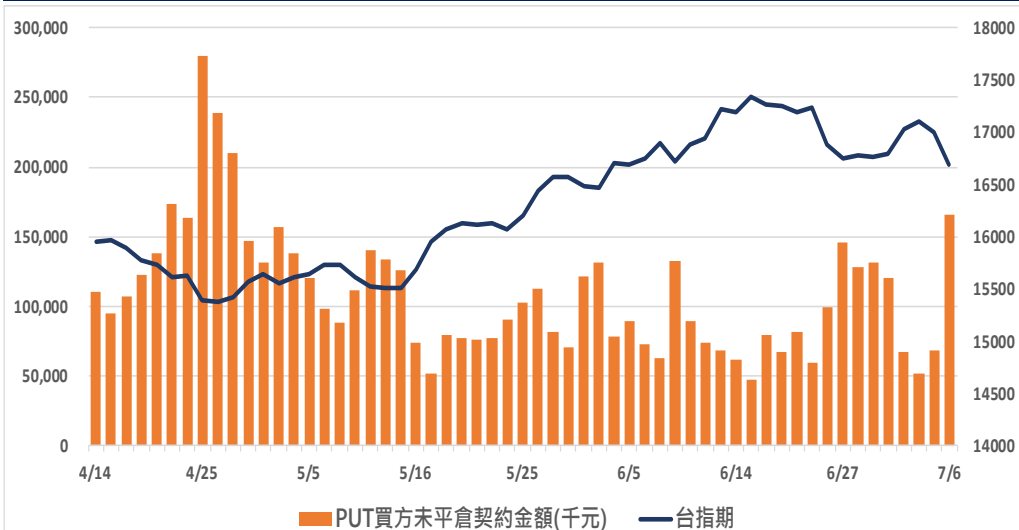
Buy Call未平倉金額



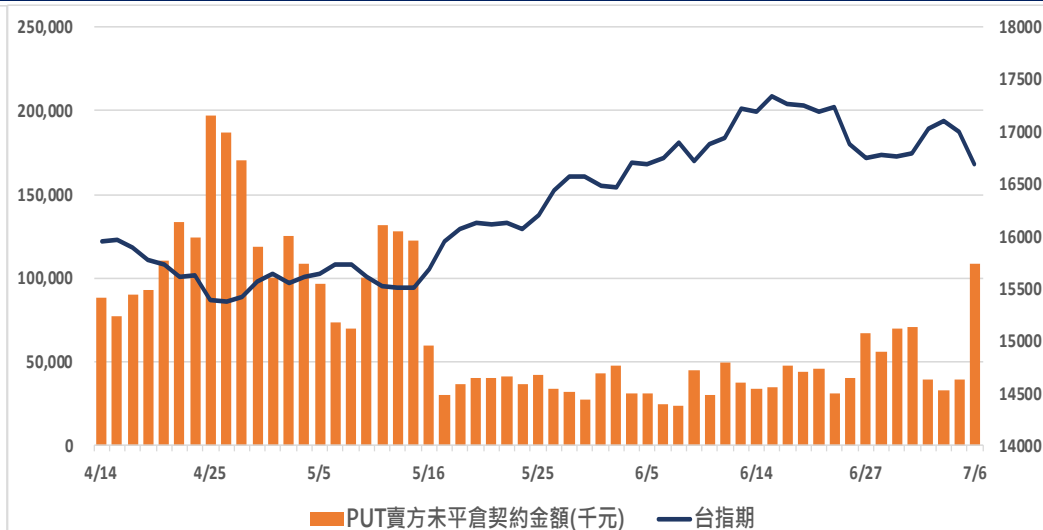
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



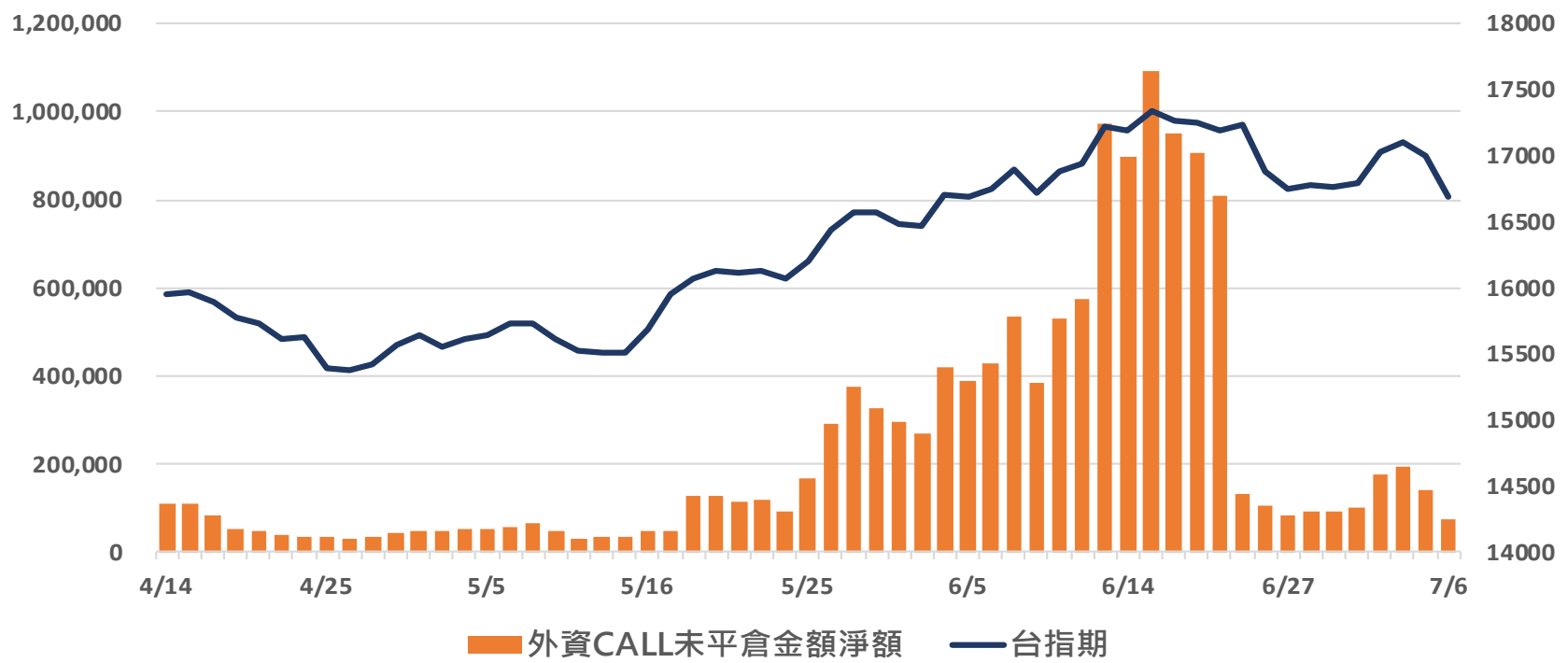
Sell Put未平倉金額



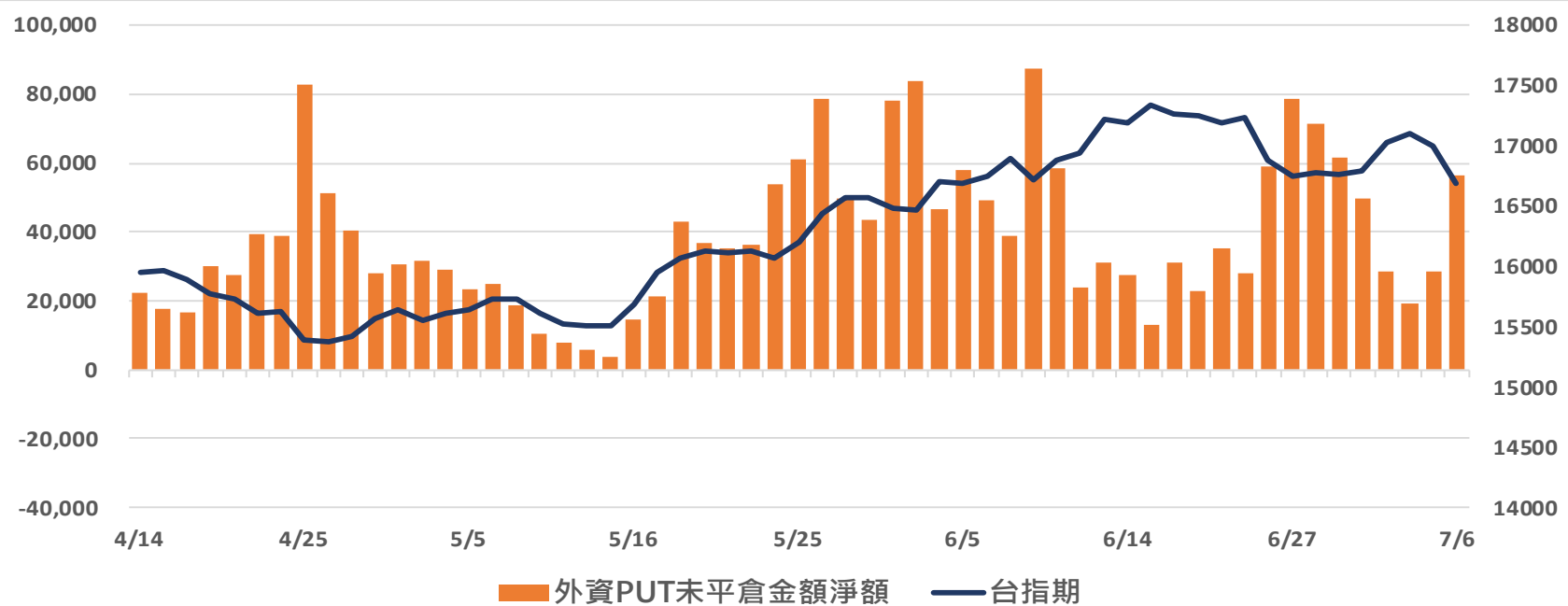
更新日期：2023年7月6日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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6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