

台指選擇權OI

日期：2023/7/7 結算日：2023/7/12					日期：2023/7/7 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
-1	10	16,200	7,345	2,567	-3	72	15,900	2,651	291
14	18	16,300	6,655	2,082	1	139	16,000	5,520	600 ※
8	8	16,350	2,576	2,576	26	132	16,100	3,668	324
100	127	16,400	8,313	4,915 ※	5	123	16,200	4,945	599
205	213	16,450	4,855	1,353	27	496	16,300	5,653	452
495	640	16,500	10,545	4,813	126	390	16,400	5,756	231
1,027	1,235	16,550	5,313	1,346	223	855	16,500	5,481	283
2,007	2,178	16,600	9,213	3,100	421	1,159	16,600	6,212	-4
1,909	2,338	16,650	4,638	-288	91	3,297	16,700	4,368	-834
4,465	5,254	16,700	7,530	-223	555	2,981	16,800	2,768	-231
3,039	5,228	16,750	2,938	-950	1,091	4,620	16,900	3,936	-68
3,181	7,818	16,800	4,111	-802	※ 1,563	6,456	17,000	3,803	10
1,892	5,631	16,850	1,947	-398	1,232	5,972	17,100	984	-144
※ 4,553	9,606	16,900	1,631	-1,113	-6	6,236	17,200	586	-74
3,356	8,109	16,950	1,202	-328	-21	6,176	17,300	414	-72
1,238	8,890	17,000	1,108	-302	-1,130	4,920	17,400	177	-39
384	7,446	17,050	699	-202	-1,138	6,437	17,500	79	3
-489	7,672	17,100	485	-275	-357	4,788	17,600	26	-10
54	5,693	17,150	237	-78	-207	3,851	17,700	8	0
93	8,182	17,200	242	-123	-75	4,182	17,800	5	0
-2,795	3,942	17,250	64	-54	-9	1,995	17,900	11	0
-1,100	4,199	17,300	118	-50	2	2,642	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
21,790	111,918	0.9054	101,325	27,559	2,312	75,339	1.0808	81,430	2,008
昨日 P/C	0.7797	今日增減變化		0.1257	昨日 P/C	1.0304	今日增減變化		0.0504

更新日期：2023年7月7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	115,875,523	116,691,063	-815,540	4,989,759	764,325	2,950,872	-2,186,547	-380,865
投信	52,043,094	42,630,586	9,412,508	-63,506	1,225,500	0	1,225,500	-32,318
自營商	18,320,940	42,282,529	-23,961,589	5,527,599	993,027	1,399,449	-406,422	212,784
	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	1,811,331	2,008,523	-197,192	154,914	271,597	6,069	265,528	55,478
投信	22,352	0	22,352	-3	0	0	0	0
自營商	258,048	1,146,505	-888,457	-152,822	113,658	419,912	-306,254	-61,326

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	30,673	12,093	18,580	1,863	34,715	16,960	17,755	1,809
投信	200	0	200	0	500	113	387	0
自營商	62,872	68,607	-5,735	-4,895	62,466	52,640	9,826	2,998
特定法人(週)	1,401	0	1,401	555	0	0	0	0
特定法人(近月)	15,308	1,954	13,354	853	5,400	21,630	-16,230	-1,459
特定法人(全月)	16,267	0	16,267	1,472	8,675	24,958	-16,283	633
十大交易人(週)	30,736	39,090	-8,354	-1,559	36,411	31,761	4,650	1,165
十大交易人(近月)	36,472	31,335	5,137	-450	33,169	49,025	-15,856	-587
十大交易人(全月)	80,940	75,044	5,896	-3,874	69,765	91,835	-22,070	-790
全市場未沖銷(近月)			83,559	4,827			83,998	2,870
全市場未沖銷(全月)			231,488	28,220			216,158	32,410

更新日期：2023年7月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

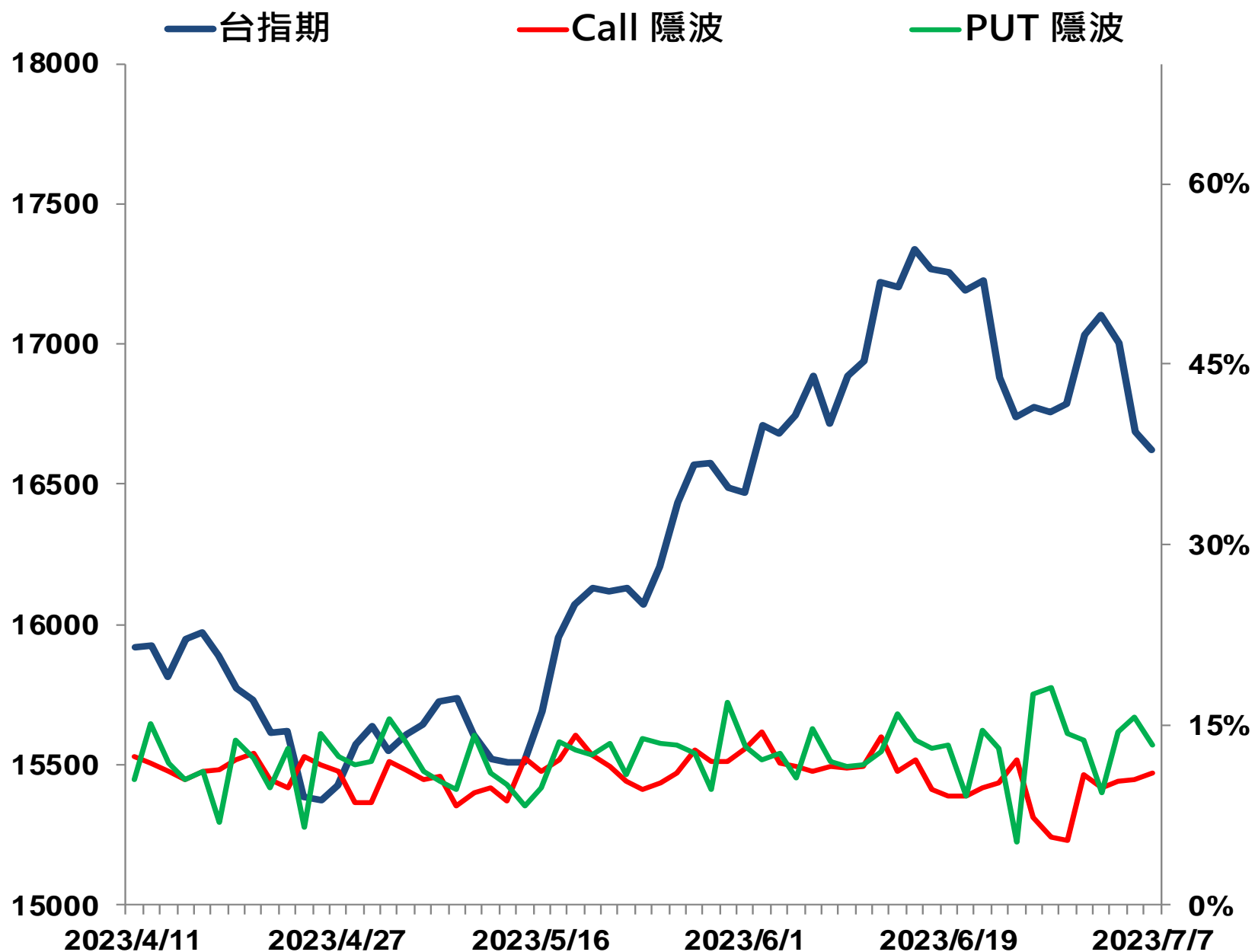
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年7月7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7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

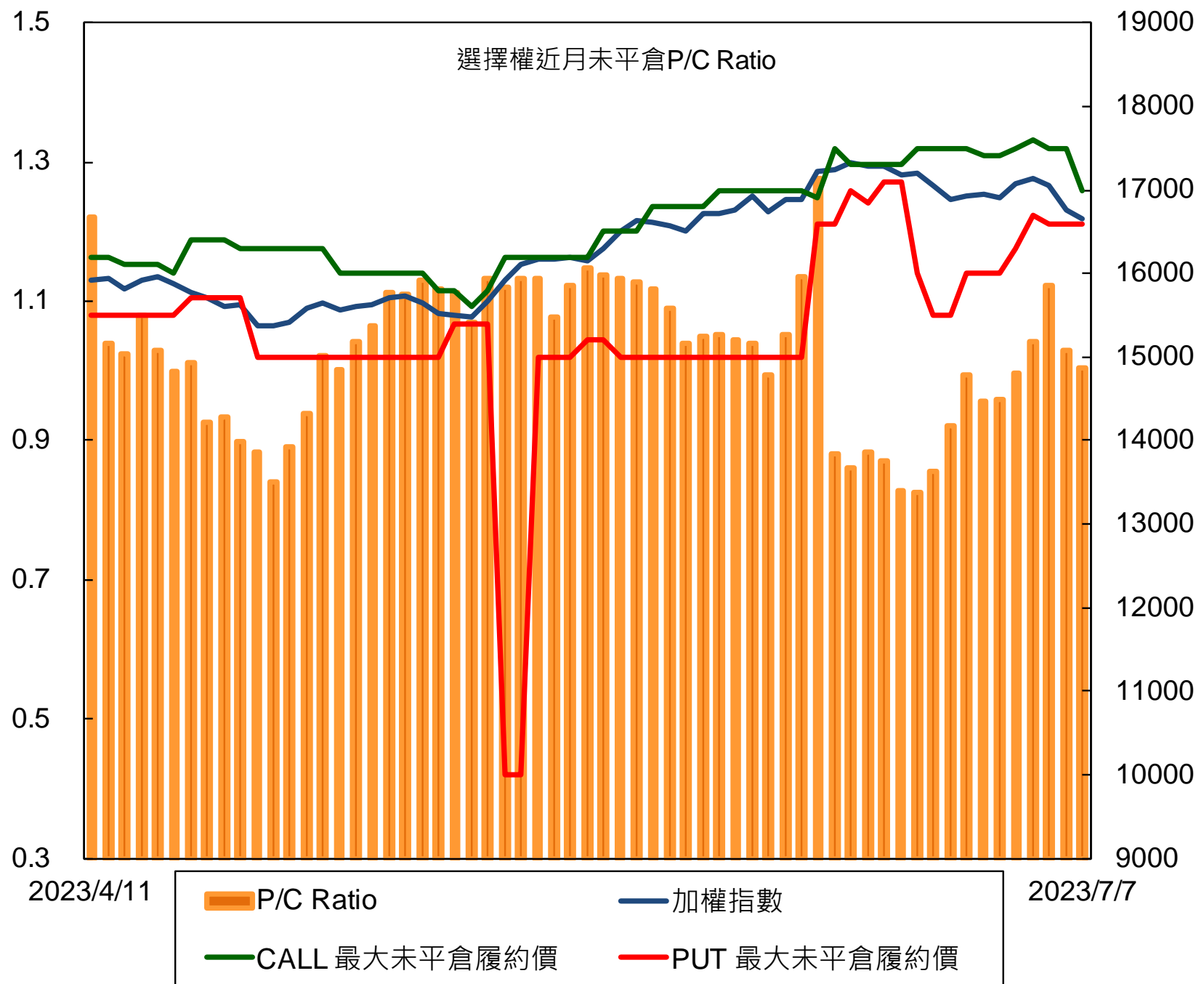
自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	7月6日	58,746	59,586	-840
	7月7日	62,872	68,607	-5,735
Put	7月6日	55,838	49,010	6,828
	7月7日	62,466	52,640	9,826

更新日期：2023年7月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



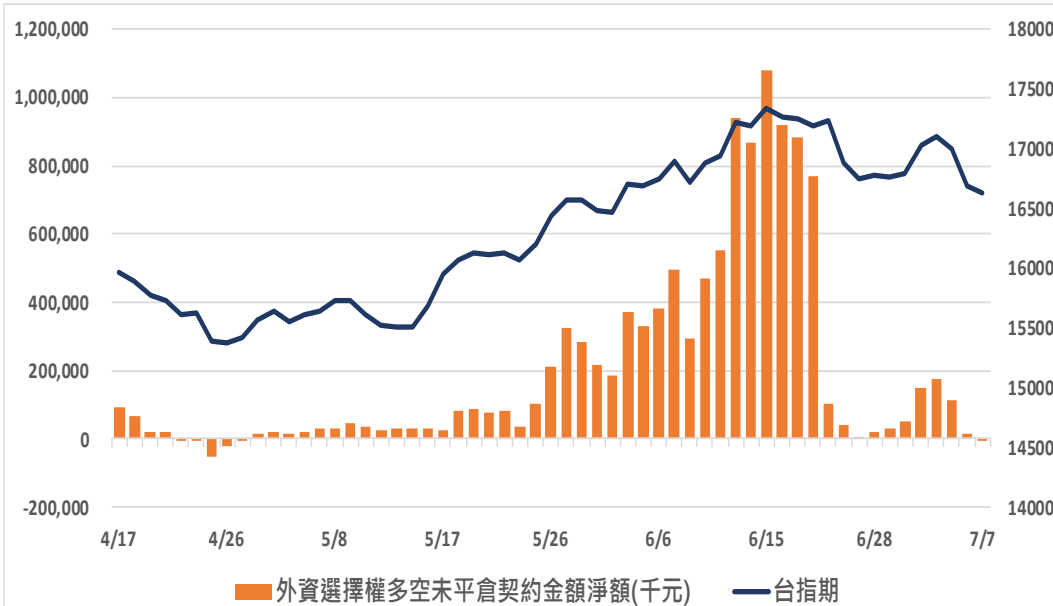
選擇權近月未平倉P/C Ratio



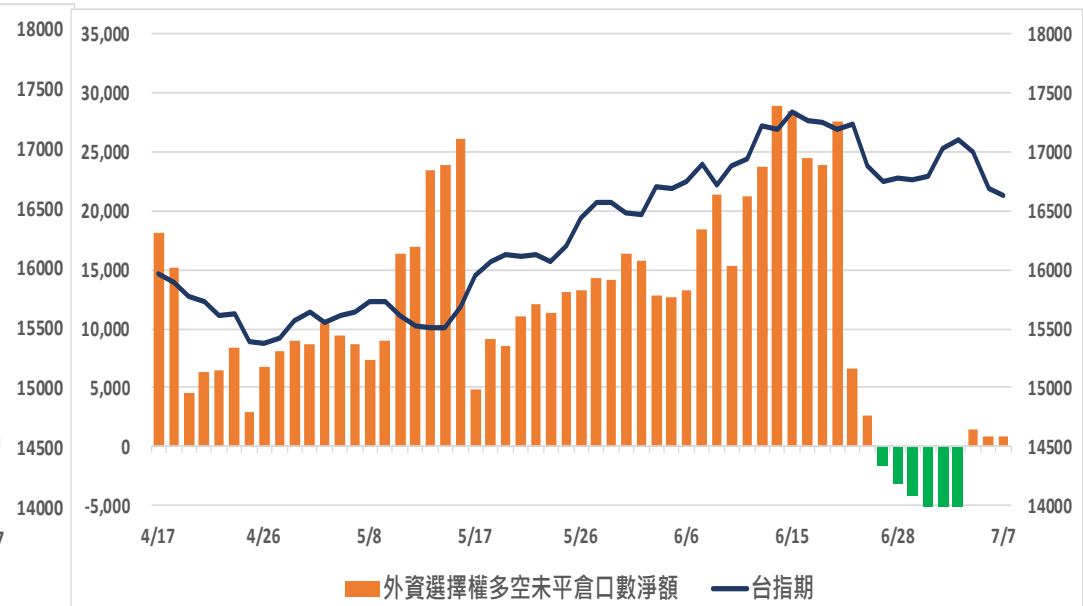
更新日期：2023年7月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



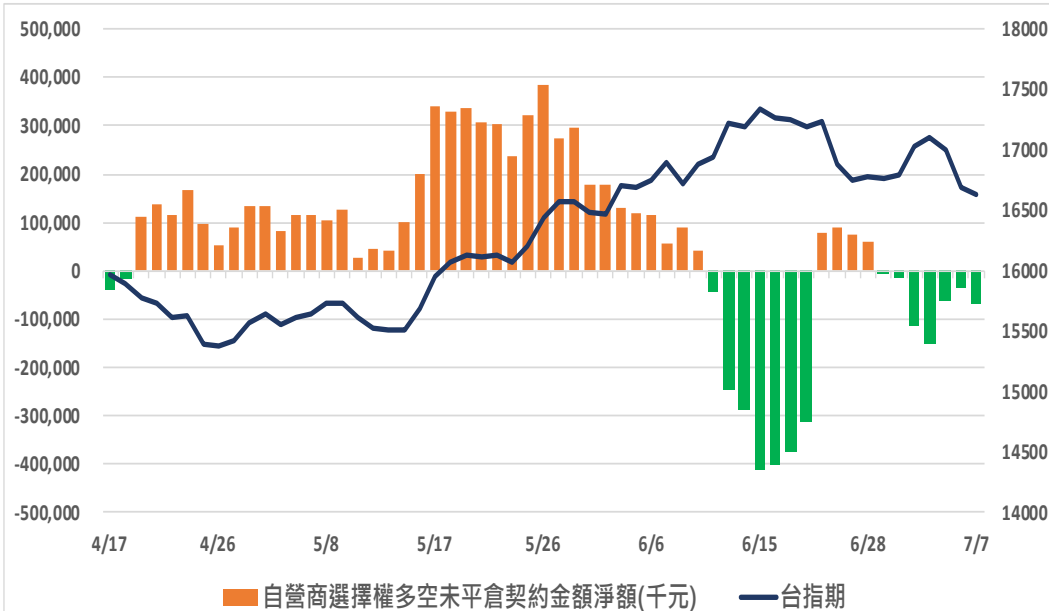
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/3	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
2023/7/7	16624	825	+54	-1,456	-17,349

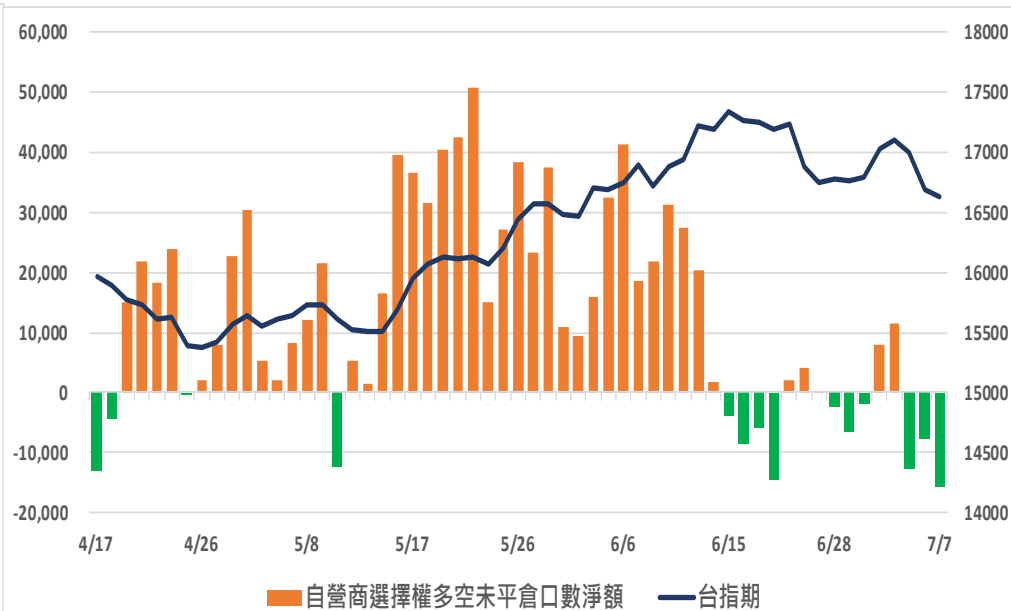
更新日期：2023年7月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



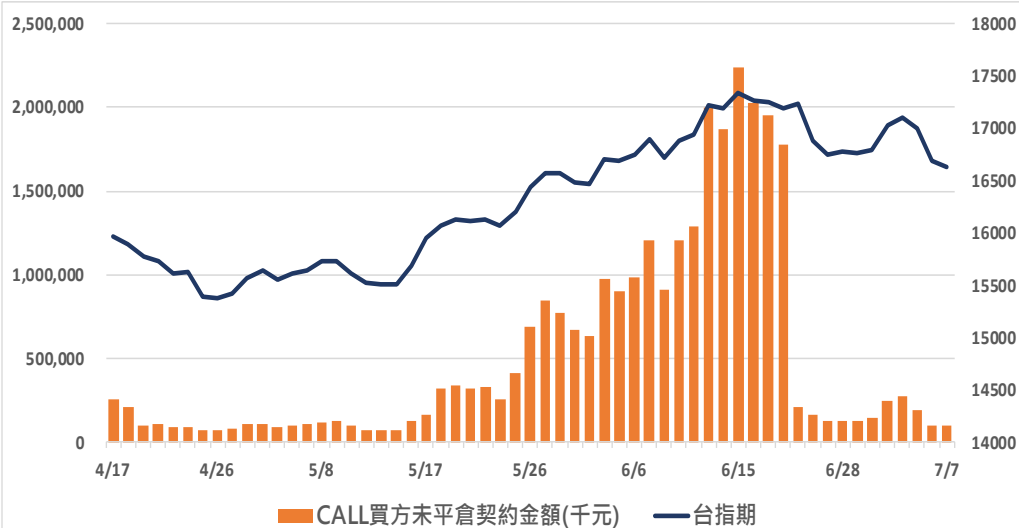
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/3	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
2023/7/7	16624	-15,561	-7,893	-68,566	-31,594

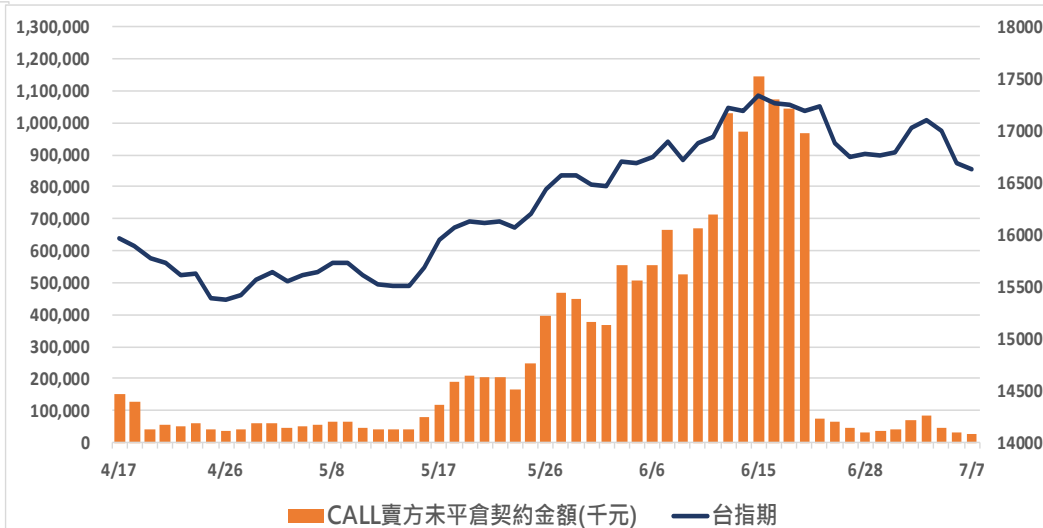
更新日期：2023年7月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

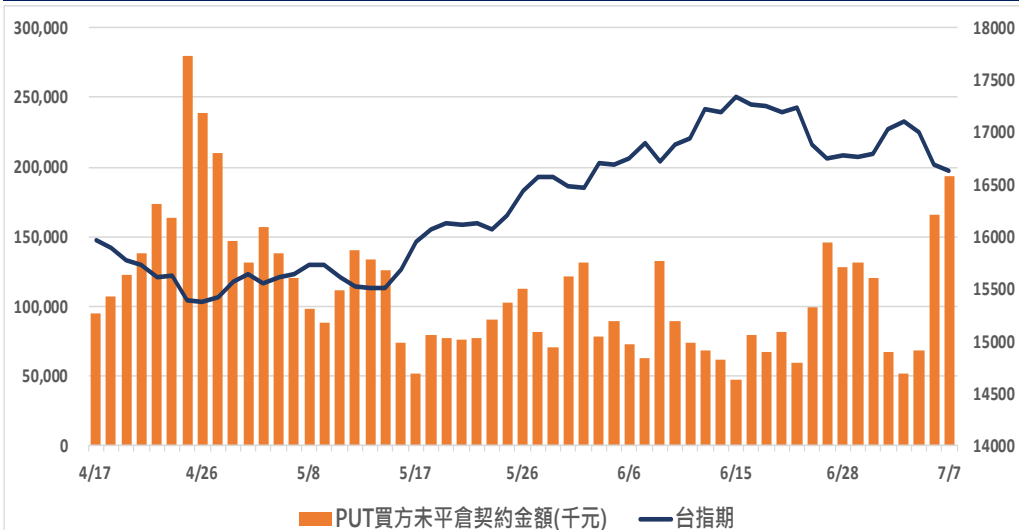
Buy Call未平倉金額



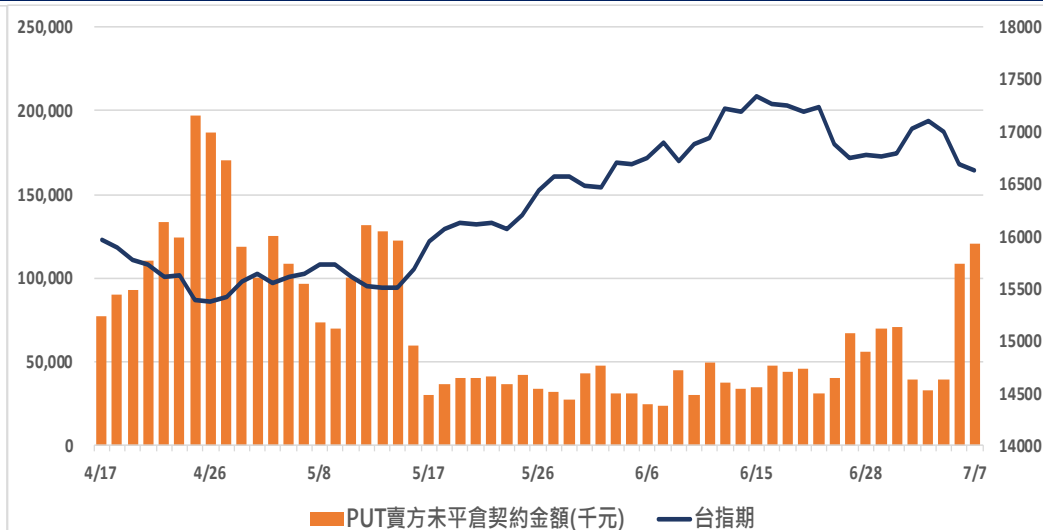
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



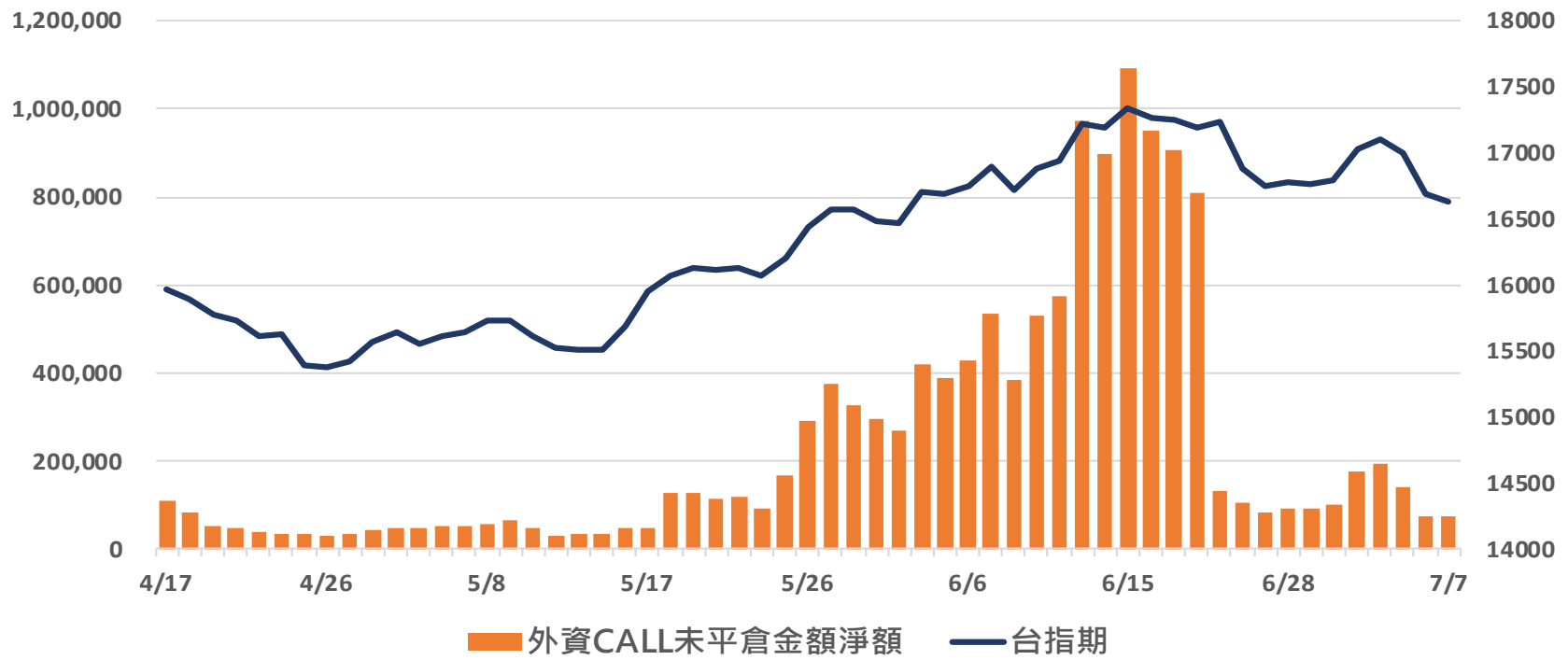
Sell Put未平倉金額



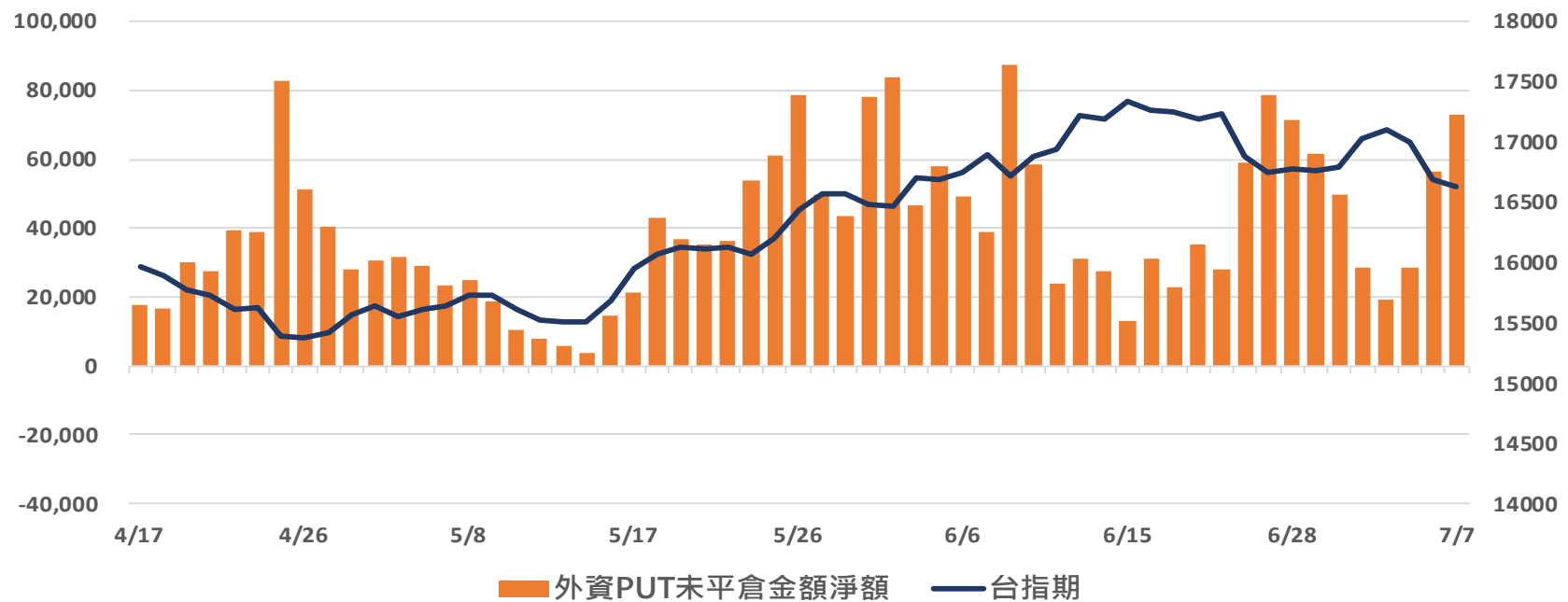
更新日期：2023年7月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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7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