

台指選擇權OI

日期：2023/7/11 結算日：2023/7/12					日期：2023/7/11 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
-130	724	16,500	14,368	1,843	-1	126	16,100	3,555	-132
-630	994	16,550	7,948	-58	-1	125	16,200	5,574	462
-938	2,433	16,600	14,220	3,924	※ 475	1,457	16,300	7,090	736
-1,653	2,956	16,650	9,558	2,914	-94	420	16,400	6,758	535
-3,450	3,965	16,700	15,808	8,489	-5	857	16,500	6,785	910
-3,475	3,631	16,750	10,202	5,480	-46	1,376	16,600	7,122	527
-4,144	6,317	16,800	12,899	8,498	※ -125	3,373	16,700	5,680	1,325
-3,873	6,304	16,850	8,111	6,059	-291	2,713	16,800	3,330	509
-2,207	9,184	16,900	6,583	4,920	-1,010	3,999	16,900	3,910	86
863	9,000	16,950	2,440	1,402	247	6,816	17,000	3,612	39
※ 2,313	12,532	17,000	1,743	683	-652	5,723	17,100	1,057	45
-148	5,619	17,050	773	83	52	6,623	17,200	634	-19
125	7,460	17,100	450	15	195	6,094	17,300	401	2
-401	4,707	17,150	195	-21	466	4,540	17,400	169	4
-1,355	5,092	17,200	205	-20	-27	6,517	17,500	67	-11
-242	3,344	17,250	62	0	-285	4,279	17,600	25	0
-484	3,679	17,300	117	2	-166	3,551	17,700	8	0
-9	4,166	17,350	15	0	-16	3,645	17,800	5	0
-1,042	3,026	17,400	35	0	-31	1,863	17,900	11	0
-40	1,685	17,450	0	0	-27	2,619	18,000	1	0
-13	1,776	17,500	1	0	-1	1,445	18,100	0	0
-142	495	17,550	0	0	-10	766	18,200	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
-21,344	103,383	1.5718	162,495	40,853	-1,649	73,548	1.2157	89,411	5,265
昨日 P/C	0.9753	今日增減變化		0.5965	昨日 P/C	1.0357	今日增減變化		0.1800

更新日期：2023年7月11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	125,742,900	111,580,720	14,162,180	6,818,460	819,310	3,231,167	-2,411,857	-252,742
投信	54,581,749	42,100,909	12,480,840	2,330,540	1,411,582	0	1,411,582	125,094
自營商	16,784,943	43,410,345	-26,625,402	-1,550,199	1,016,185	1,720,465	-704,280	-107,475
	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	1,778,988	2,065,982	-286,994	-25,746	325,301	0	325,301	26,004
投信	22,739	0	22,739	370	0	0	0	0
自營商	348,693	1,126,676	-777,983	70,878	135,282	471,024	-335,742	5,588

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	34,884	14,150	20,734	2,637	41,761	21,472	20,289	2,703
投信	200	0	200	0	500	113	387	0
自營商	66,156	65,410	746	-484	64,443	67,655	-3,212	-8,953
特定法人(週)	4,474	2,911	1,563	167	2,434	5,533	-3,099	-1,771
特定法人(近月)	17,164	1,778	15,386	2,032	5,400	21,913	-16,513	-1,400
特定法人(全月)	17,712	3,759	13,953	-2,762	10,086	25,249	-15,163	-2,257
十大交易人(週)	32,637	34,444	-1,807	-1,328	49,036	39,585	9,451	1,430
十大交易人(近月)	36,460	31,883	4,577	368	39,427	52,790	-13,363	694
十大交易人(全月)	85,340	73,575	11,765	-1,819	86,484	99,698	-13,214	3,705
全市場未沖銷(近月)			84,979	-543			98,569	9,993
全市場未沖銷(全月)			231,482	-18,463			296,359	52,610

更新日期：2023年7月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

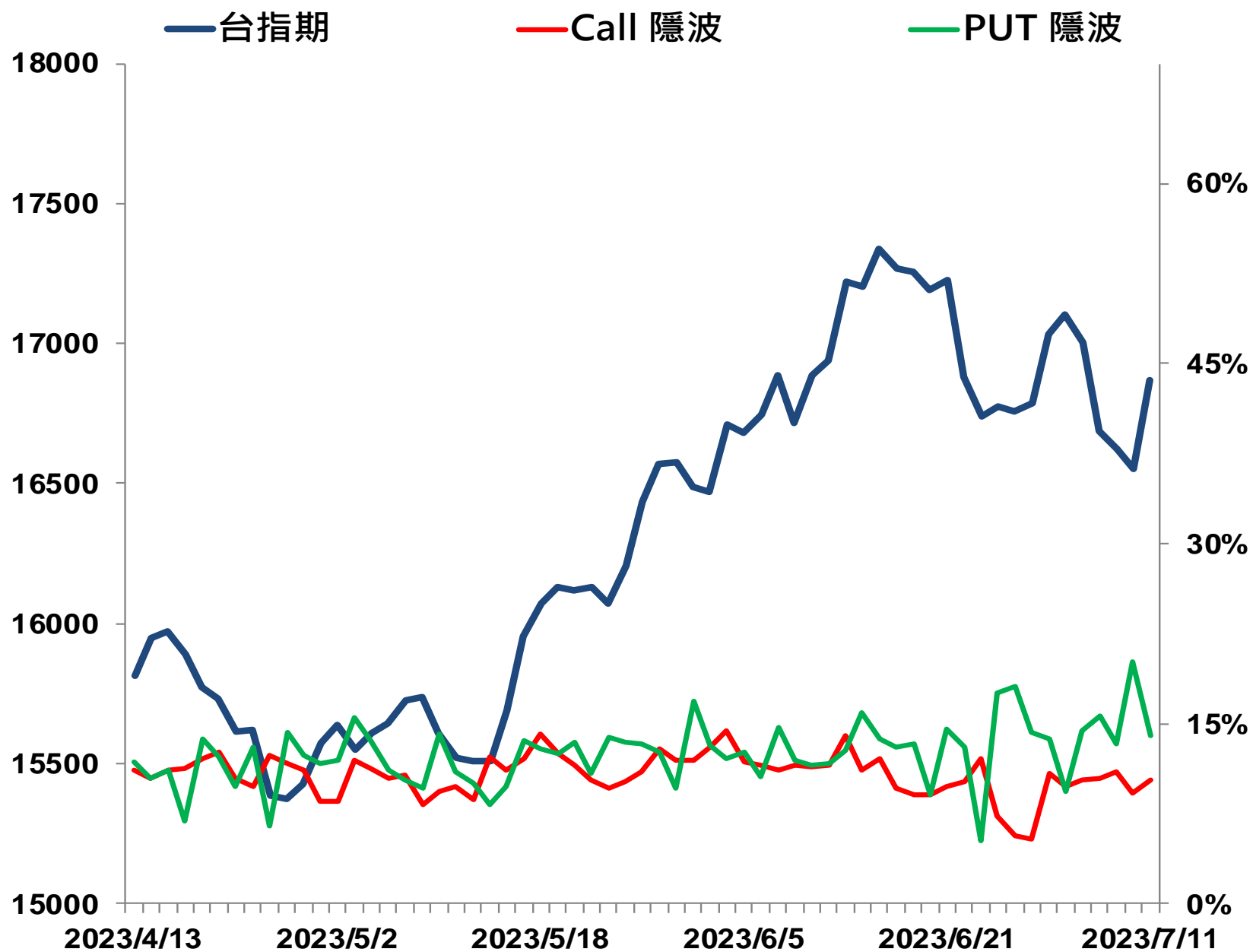
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年7月11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11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

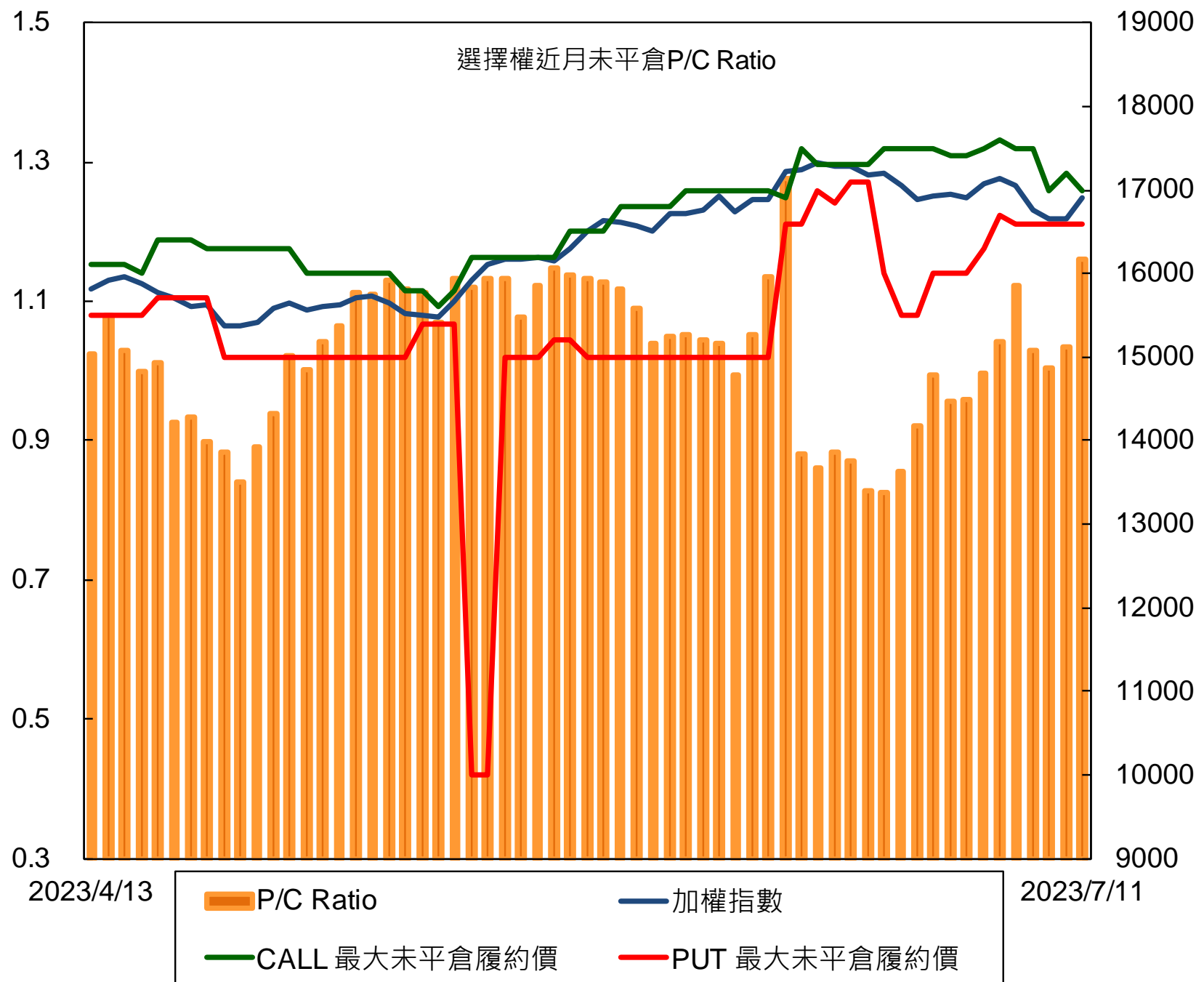
自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	7月10日	69,352	68,122	1,230
	7月11日	66,156	65,410	746
Put	7月10日	63,907	58,166	5,741
	7月11日	64,443	67,655	-3,212

更新日期：2023年7月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



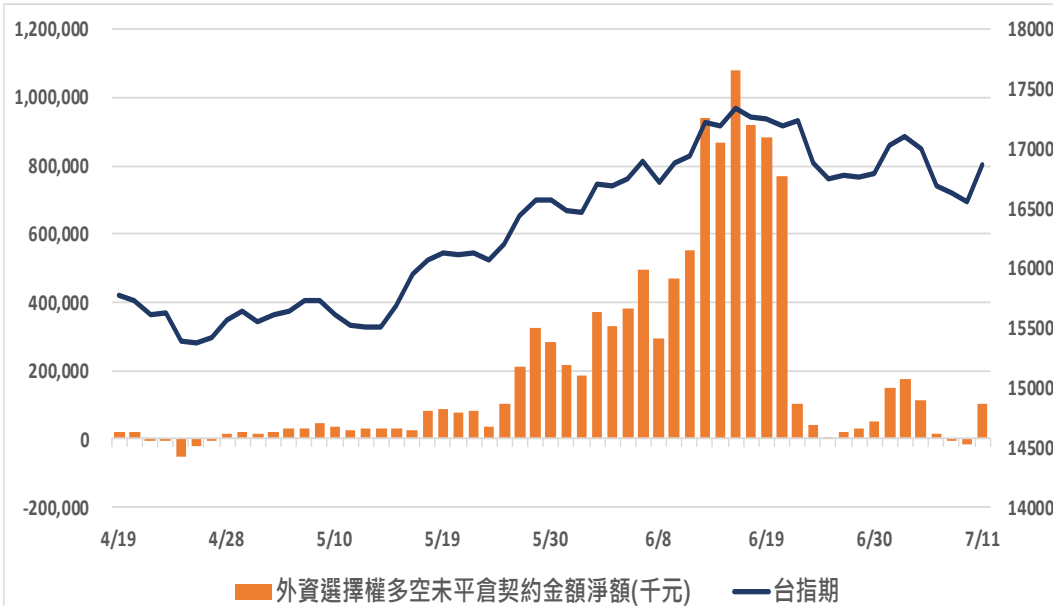
選擇權近月未平倉P/C Ratio



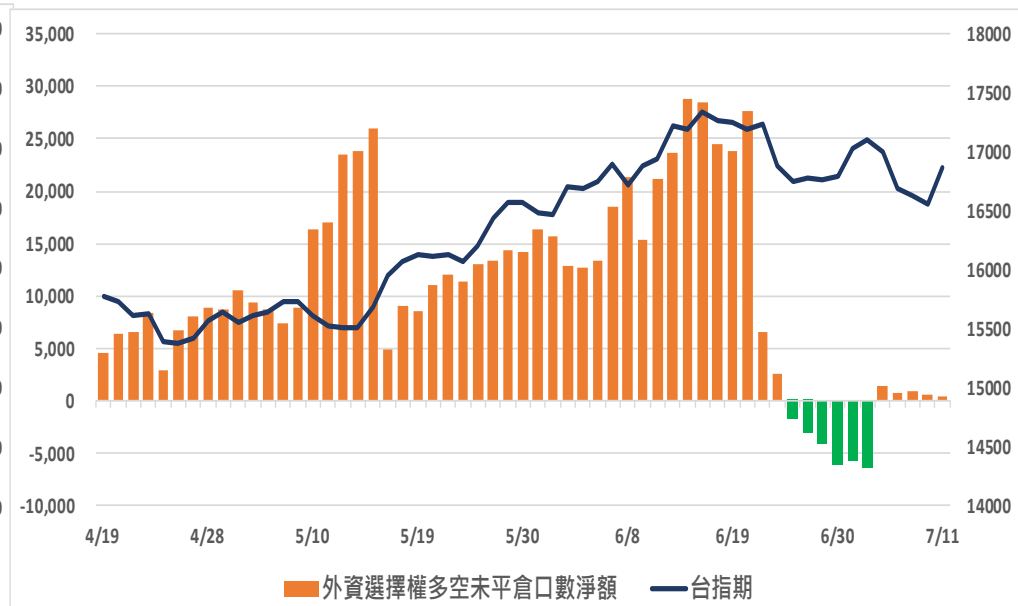
更新日期：2023年7月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



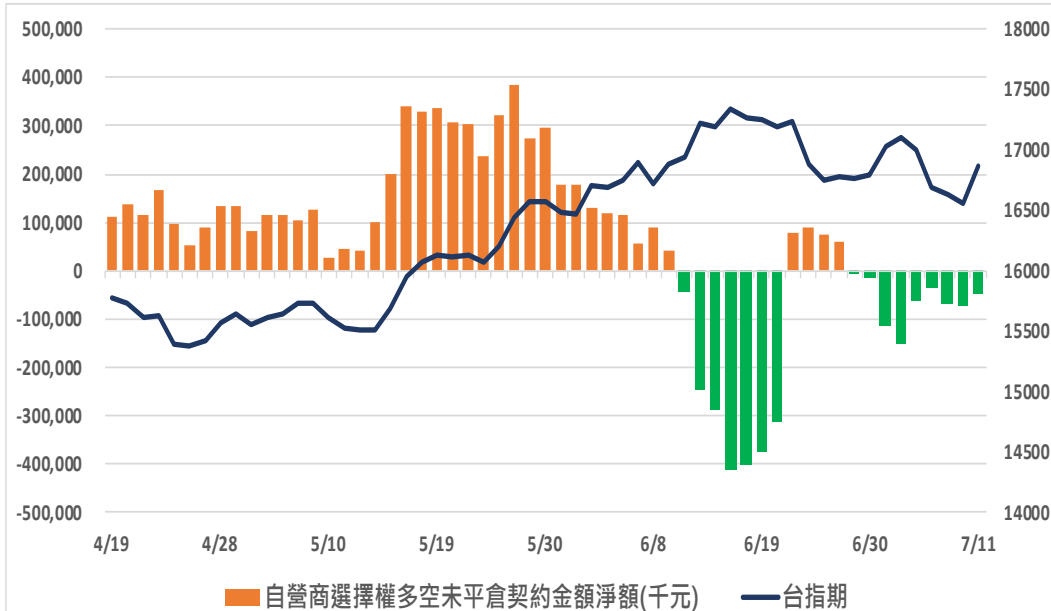
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/5	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
2023/7/10	16553	511	-314	-17,268	-15,812
2023/7/11	16866	445	-66	103,131	+120,399

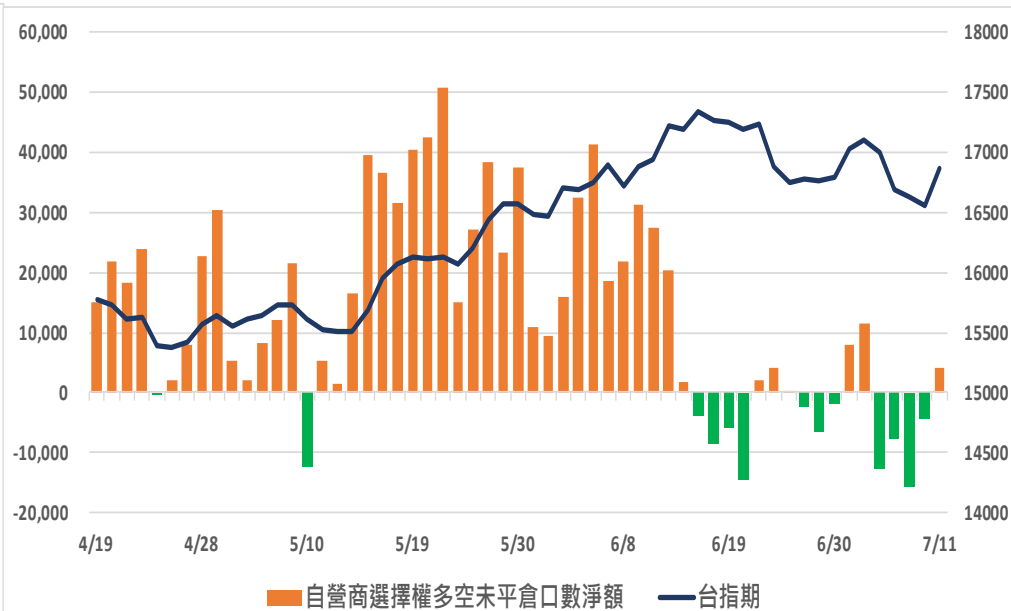
更新日期：2023年7月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



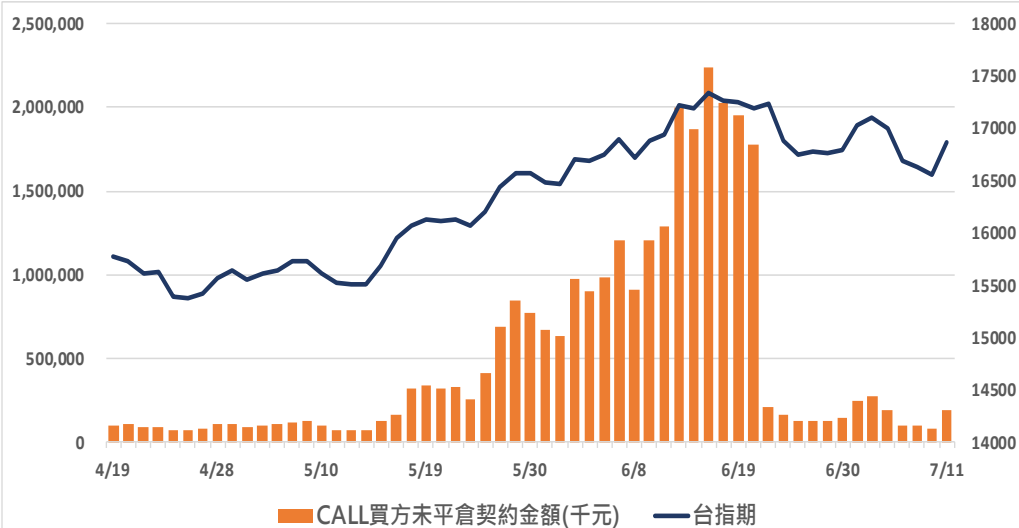
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/5	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
2023/7/10	16553	-4,511	+11,050	-71,452	-2,886
2023/7/11	16866	3,958	+8,469	-47,713	+23,739

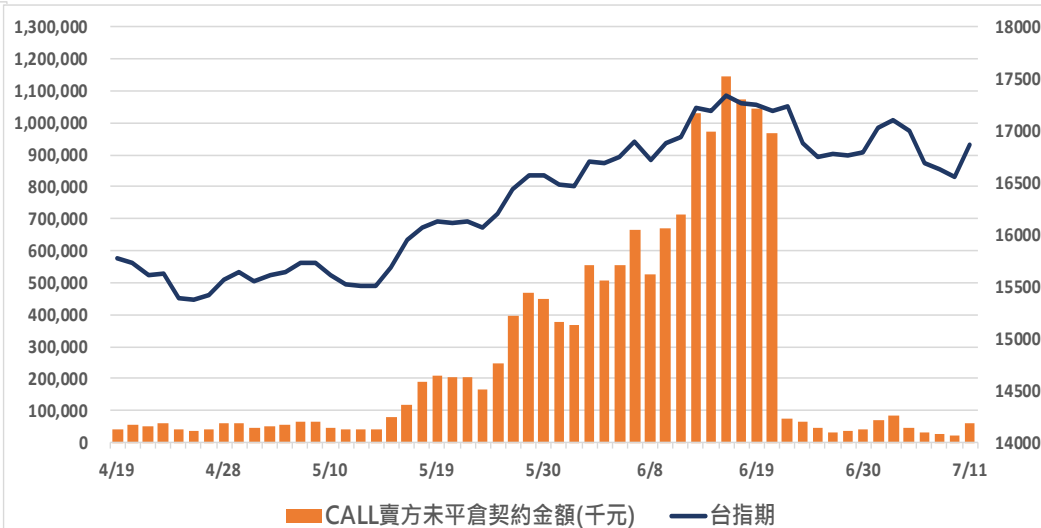
更新日期：2023年7月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

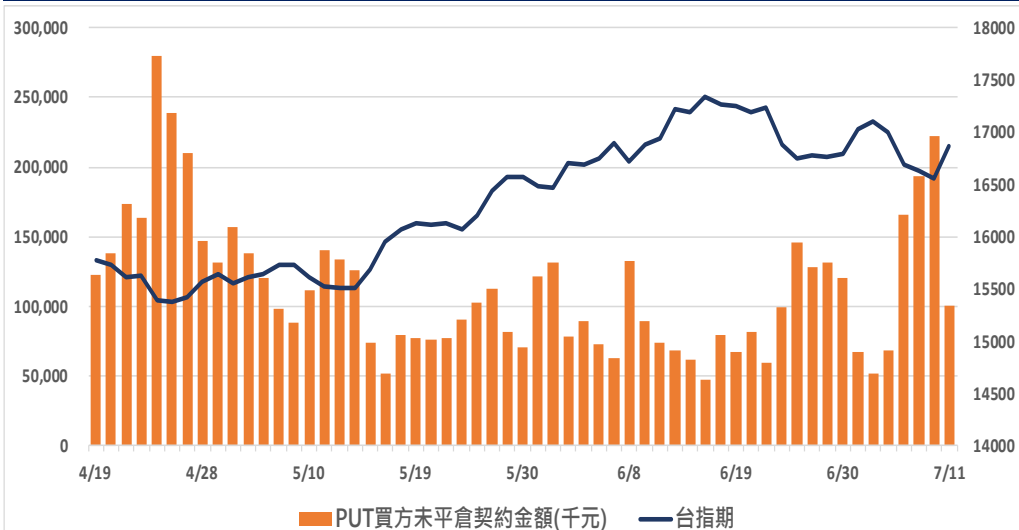
Buy Call未平倉金額



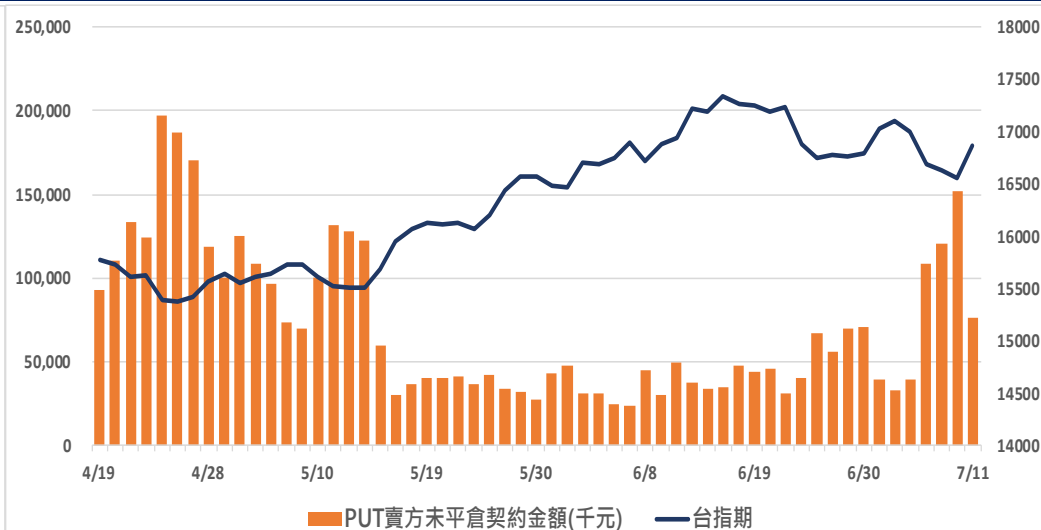
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



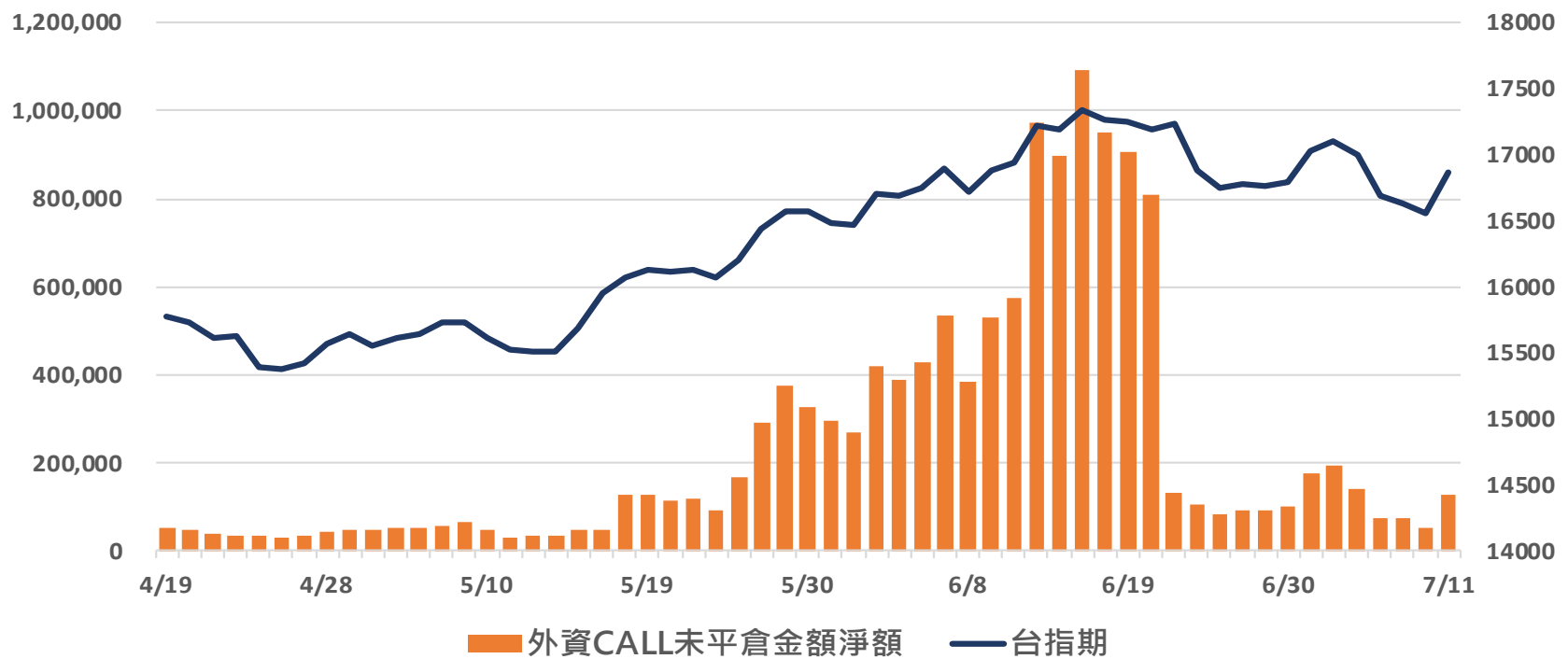
Sell Put未平倉金額



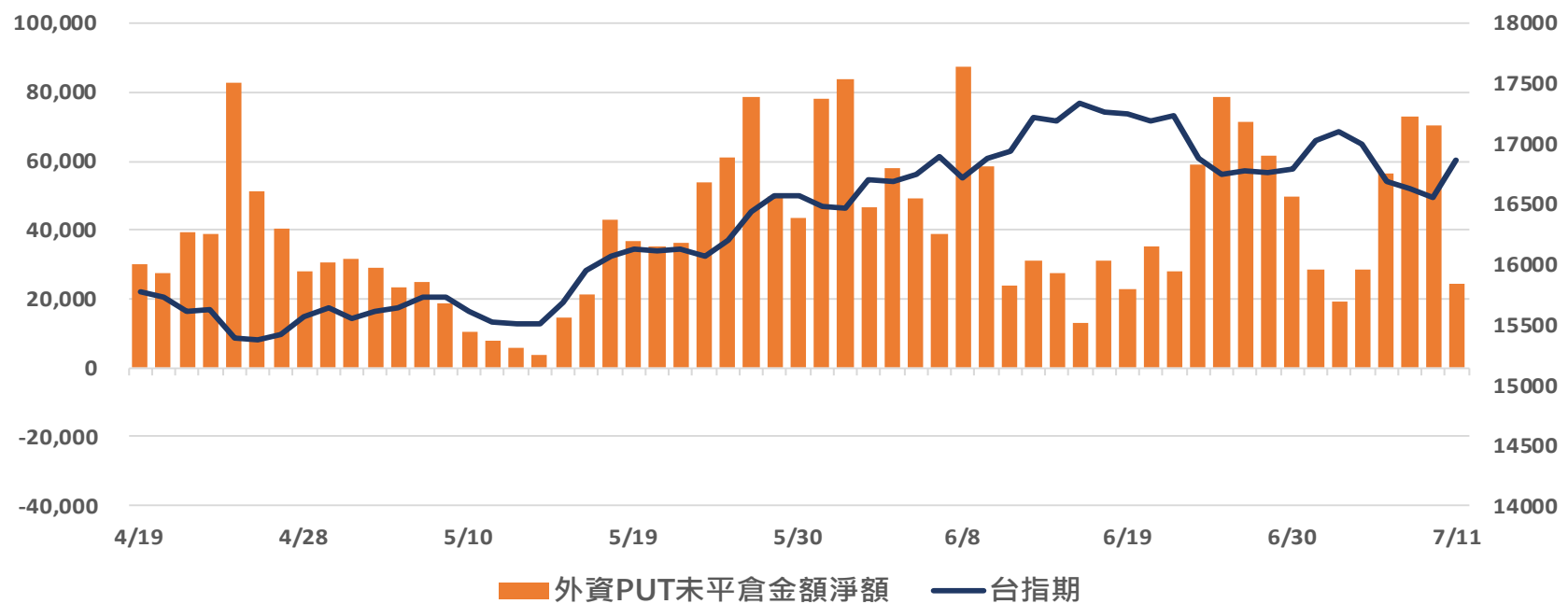
更新日期：2023年7月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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11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