

# 台指選擇權OI

日期：2023/7/12 結算日：2023/7/19					日期：2023/7/12 結算日：2023/8/16				
202307 月台指選擇權 OI 序列					202308 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
21	1,478	16,300	7,255	165	0	2	15,800	720	156
-8	412	16,400	6,892	134	2	26	15,900	706	151
-1	53	16,450	1,713	948	0	162	16,000	4,305	152
-62	795	16,500	8,728	1,943	1	7	16,100	897	104
-4	151	16,550	2,996	1,299	1	44	16,200	665	122
-71	1,305	16,600	7,933	811	0	58	16,300	1,618	152
-11	586	16,650	2,953	1,612	0	23	16,400	1,481	62
223	3,596	16,700	7,052	1,372	47	198	16,500	1,012	47
284	714	16,750	1,934	735	76	518	16,600	821	84
563	3,276	16,800	4,490	1,160	85	392	16,700	1,860	14
489	1,255	16,850	1,742	837	181	611	16,800	1,500	1,025
1,512	5,511	16,900	5,179	1,269	115	1,298	16,900	408	59
1,026	2,280	16,950	1,356	1,067	217	2,789	17,000	394	106
1,397	8,213	17,000	4,092	480	84	2,258	17,100	180	40
1,162	3,086	17,050	271	200	22	1,277	17,200	60	26
1,518	7,241	17,100	1,084	27	289	3,075	17,300	30	4
626	2,741	17,150	240	-11	400	1,668	17,400	43	0
2,130	8,753	17,200	656	22	587	2,526	17,500	31	0
910	2,082	17,250	197	0	469	1,876	17,600	1	0
587	6,681	17,300	413	12	-27	994	17,700	2	0
824	1,911	17,350	27	22	10	895	17,800	0	0
1,092	5,632	17,400	172	3	25	433	17,900	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
15,923	99,025	1.1434	113,226	17,095	2,646	27,880	0.8720	24,312	2,322
昨日 P/C	1.5718	今日增減變化	-0.4284		昨日 P/C	0.8714	今日增減變化	0.0006	

更新日期：2023年7月12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	117,944,509	117,441,961	502,548	-13,659,632	826,800	3,905,793	-3,078,993	-667,136
投信	56,285,956	41,878,566	14,407,390	1,926,550	1,445,246	0	1,445,246	33,664
自營商	20,066,367	43,056,149	-22,989,782	3,635,620	1,074,330	1,861,558	-787,228	-82,948
	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	1,810,852	1,675,192	135,660	422,654	330,532	0	330,532	5,231
投信	22,792	0	22,792	53	0	0	0	0
自營商	505,793	1,254,243	-748,450	29,533	112,199	454,585	-342,386	-6,644

## 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	30,531	11,746	18,785	-1,949	33,068	15,929	17,139	-3,150
投信	200	100	100	-100	650	113	537	150
自營商	45,894	52,280	-6,386	-7,132	51,786	38,919	12,867	16,079
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	16,673	0	16,673	1,287	5,400	20,953	-15,553	960
特定法人(全月)	20,243	3,759	16,484	2,531	10,086	26,304	-16,218	-1,055
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	35,346	36,124	-778	-5,355	39,928	56,042	-16,114	-2,751
十大交易人(全月)	63,301	60,947	2,354	-9,411	55,366	76,733	-21,367	-8,153
全市場未沖銷(近月)			102,051	17,072			116,923	18,354
全市場未沖銷(全月)			150,805	-80,677			155,460	-140,899

更新日期：2023年7月12日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

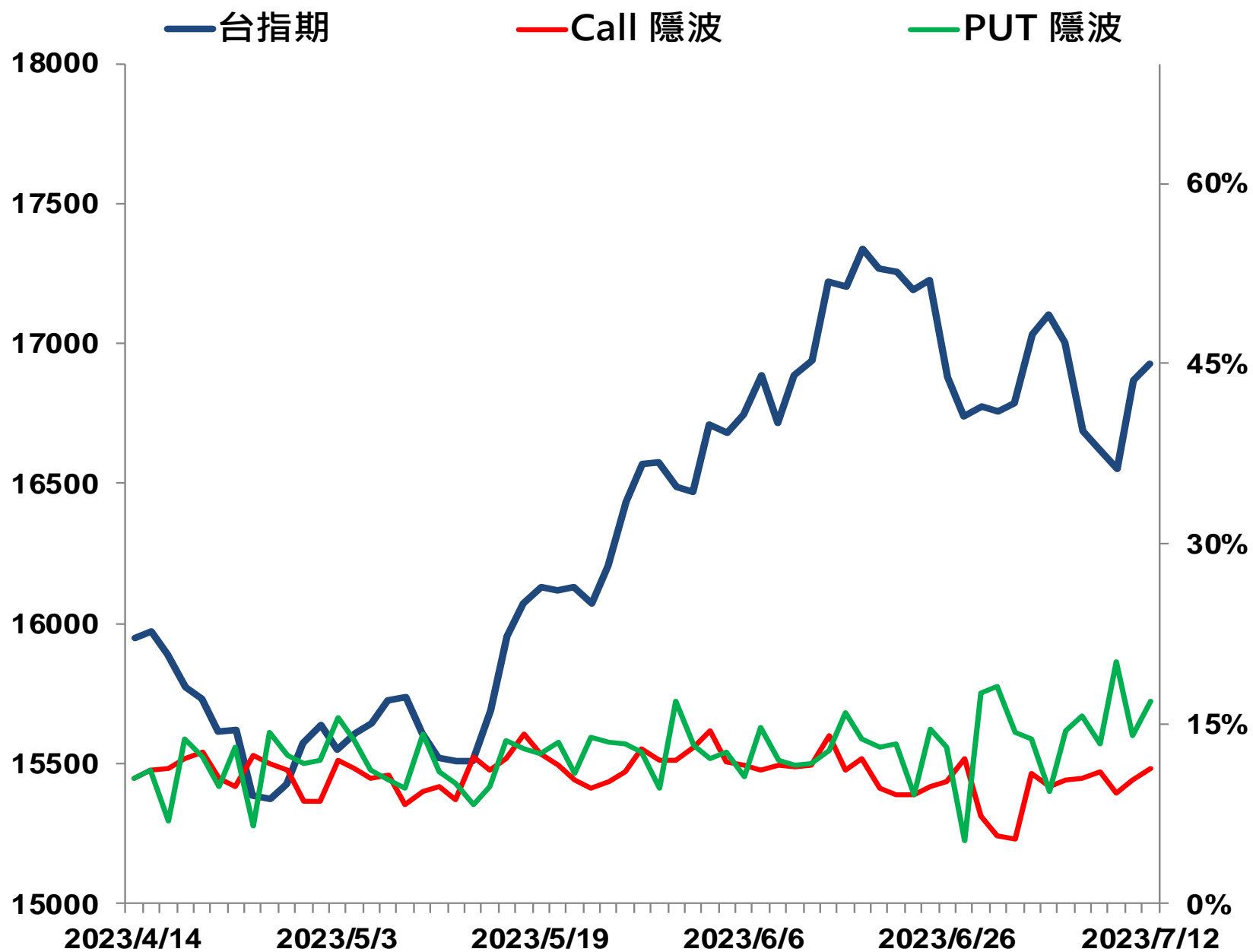
# 選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年7月12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12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

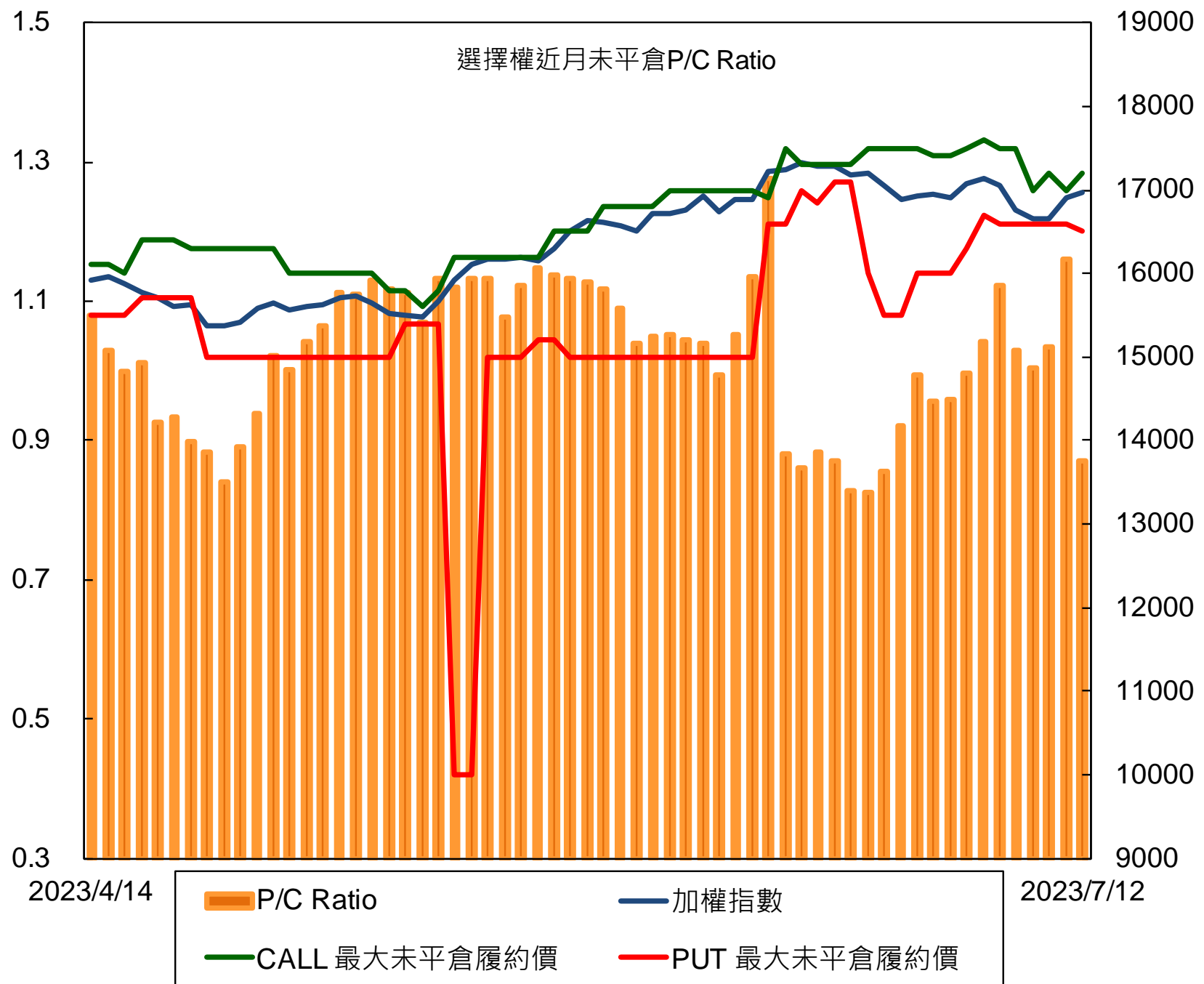
# 自營商選擇權OI部位統計

	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11日	66,156	65,410	746
	7月12日	45,894	52,280	-6,386
<b>Put</b>	7月11日	64,443	67,655	-3,212
	7月12日	51,786	38,919	12,867

更新日期：2023年7月12日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



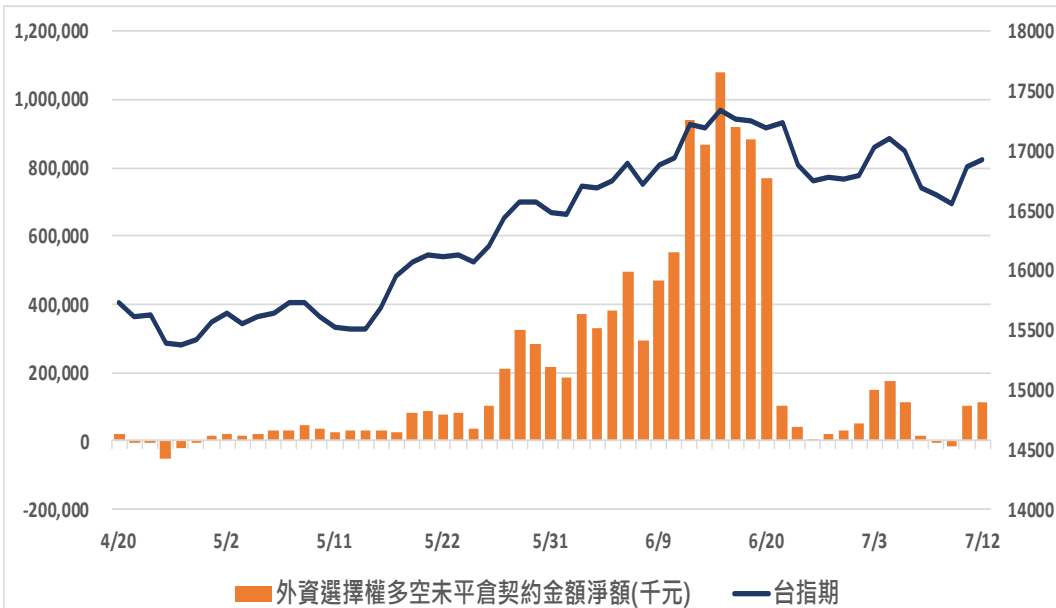
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



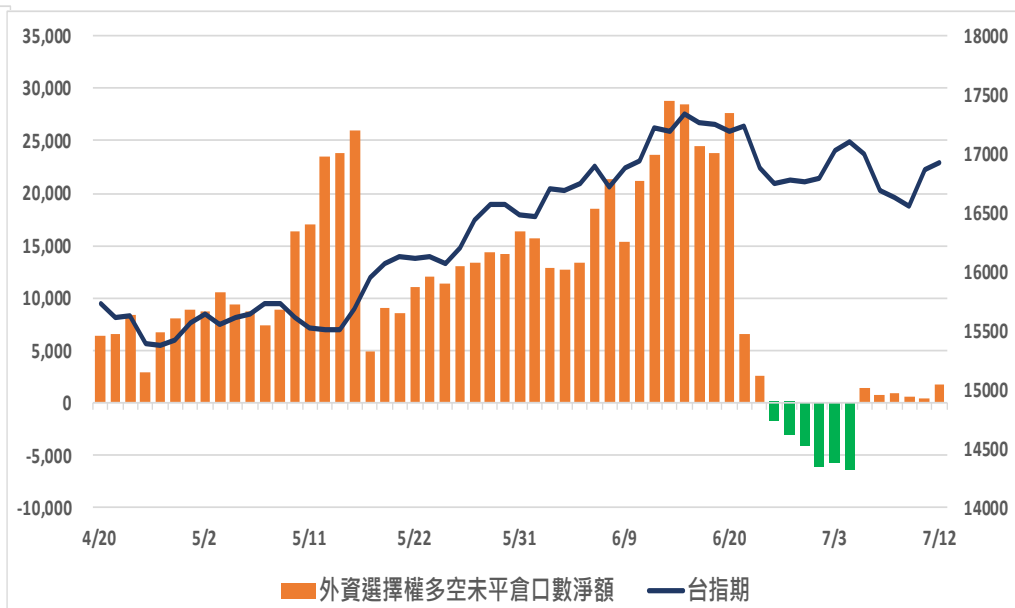
更新日期：2023年7月12日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



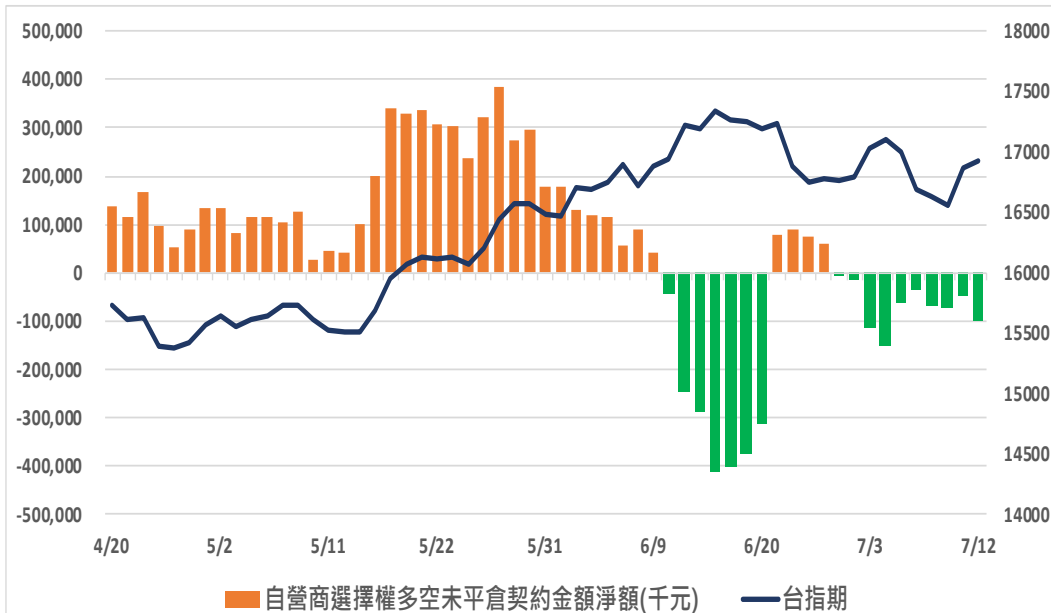
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/6	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
2023/7/12	16922	1,646	+1,201	111,510	+8,379

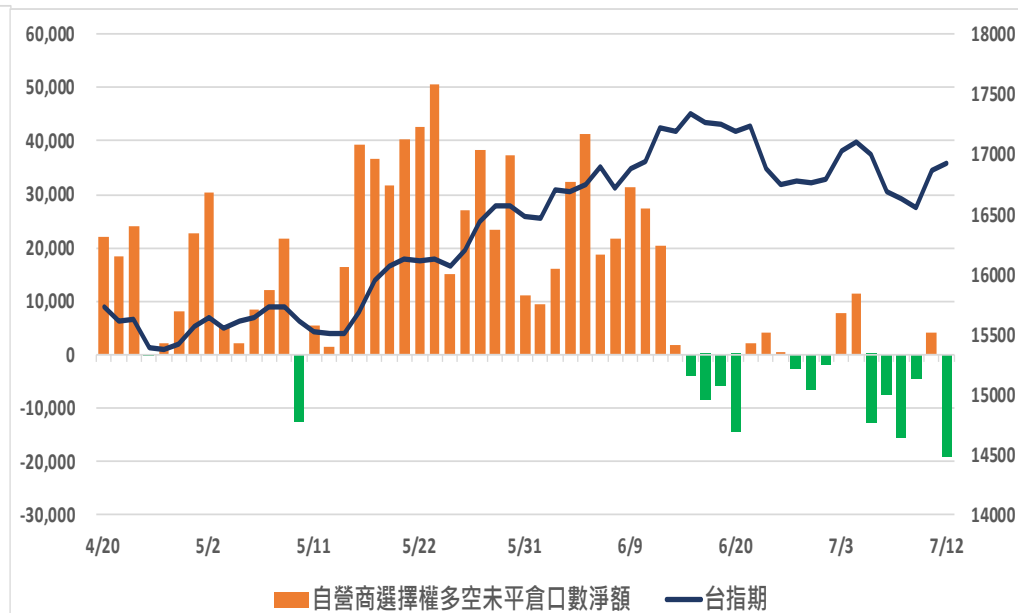
更新日期：2023年7月12日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



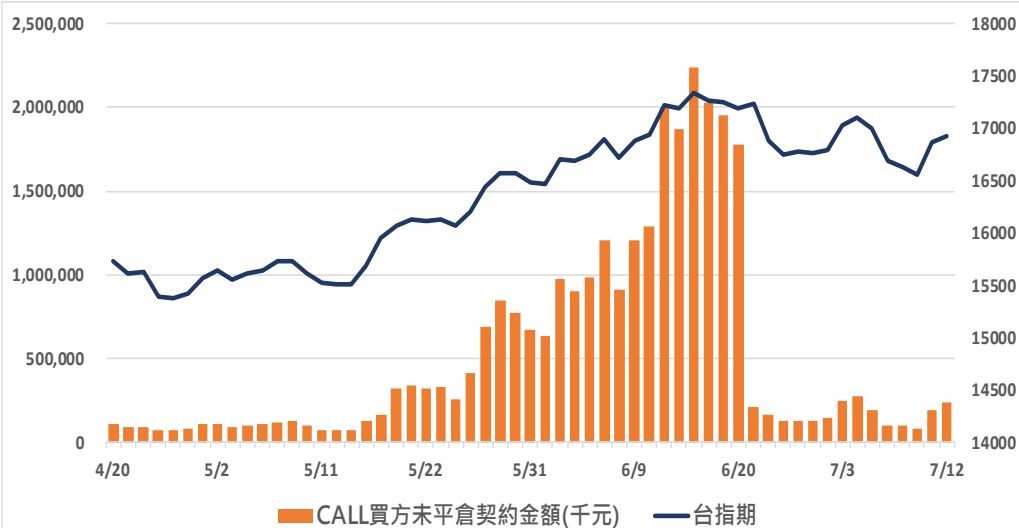
## 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/6	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
2023/7/12	16922	-19,253	-23,211	-99,932	-52,219

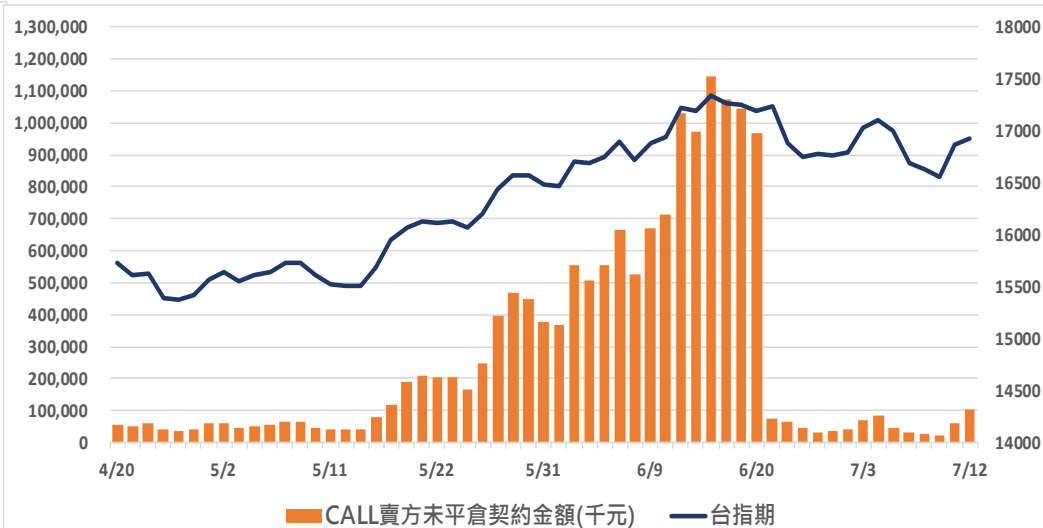
更新日期：2023年7月12日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 外資選擇權未平倉金額

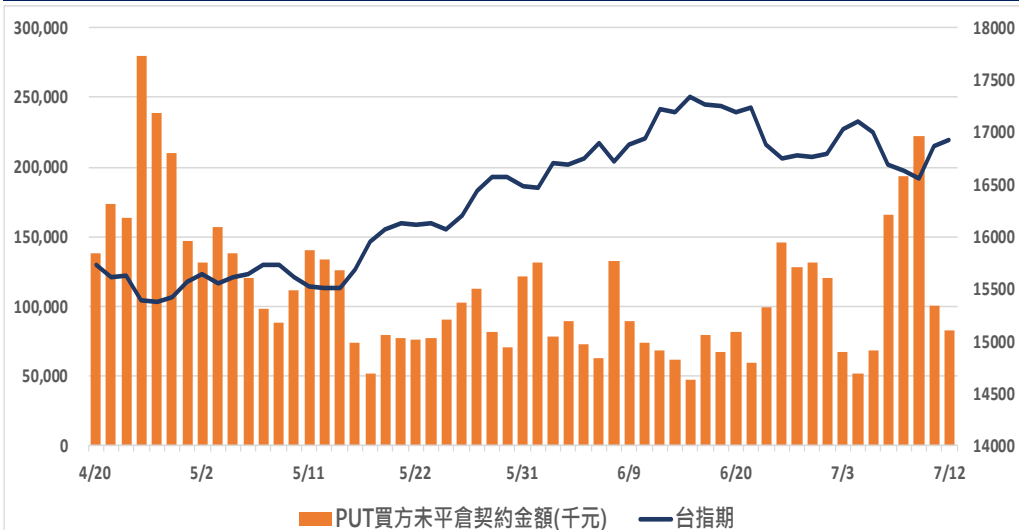
## Buy Call未平倉金額



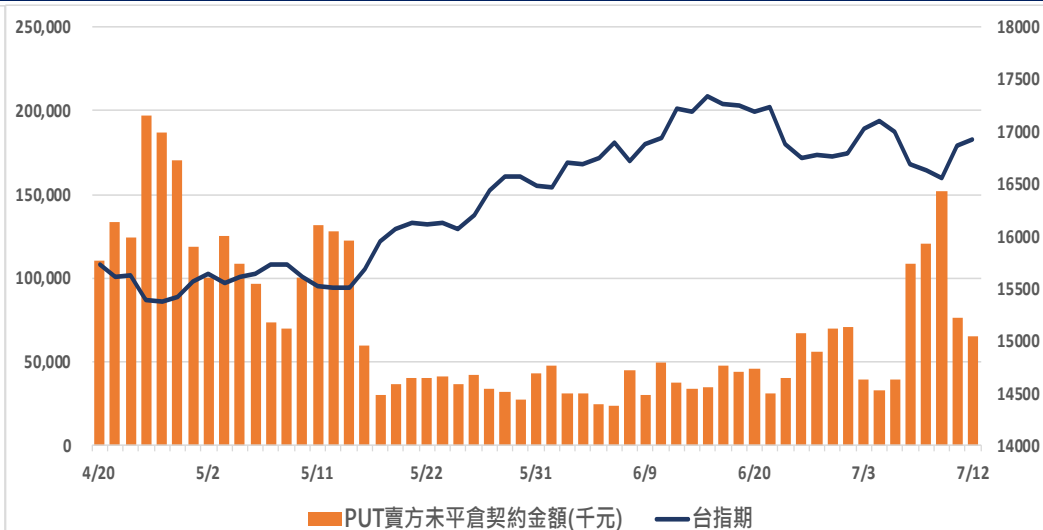
## Sell Call未平倉金額



## Buy Put未平倉金額



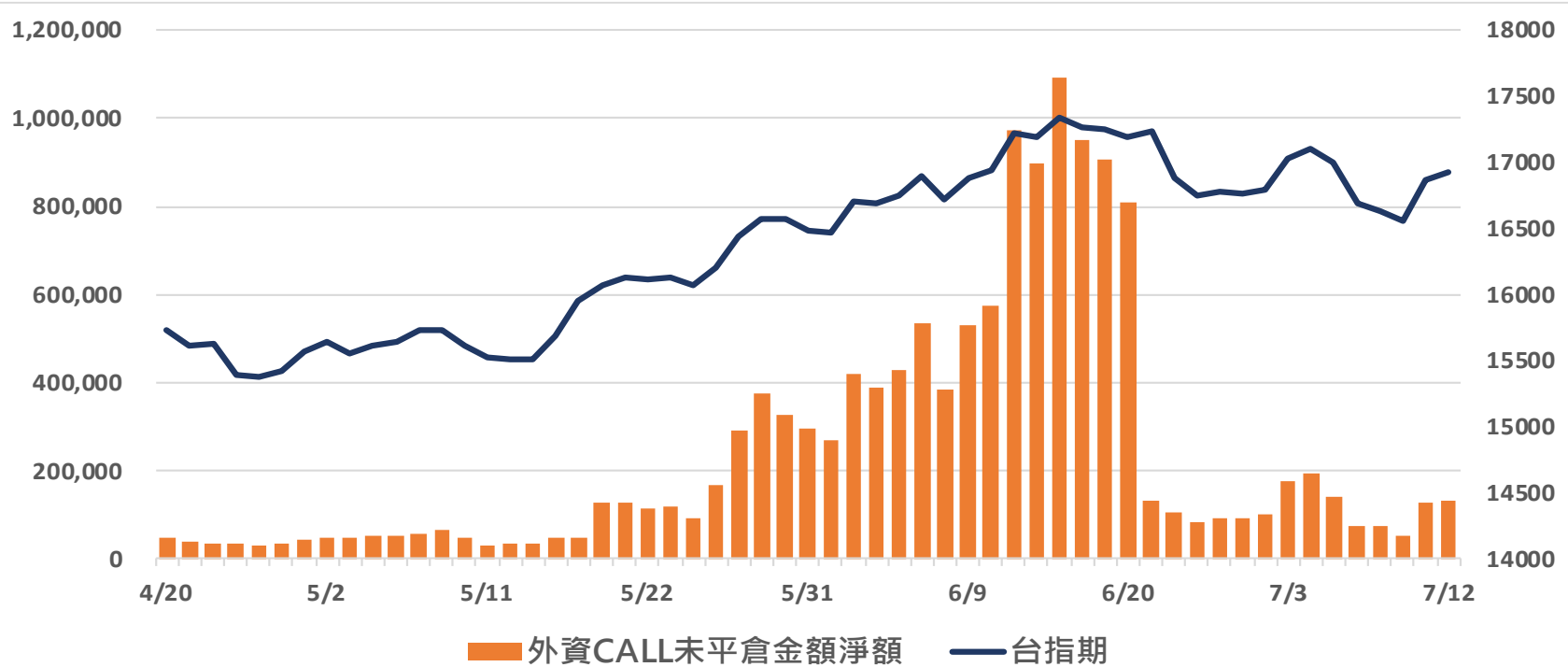
## Sell Put未平倉金額



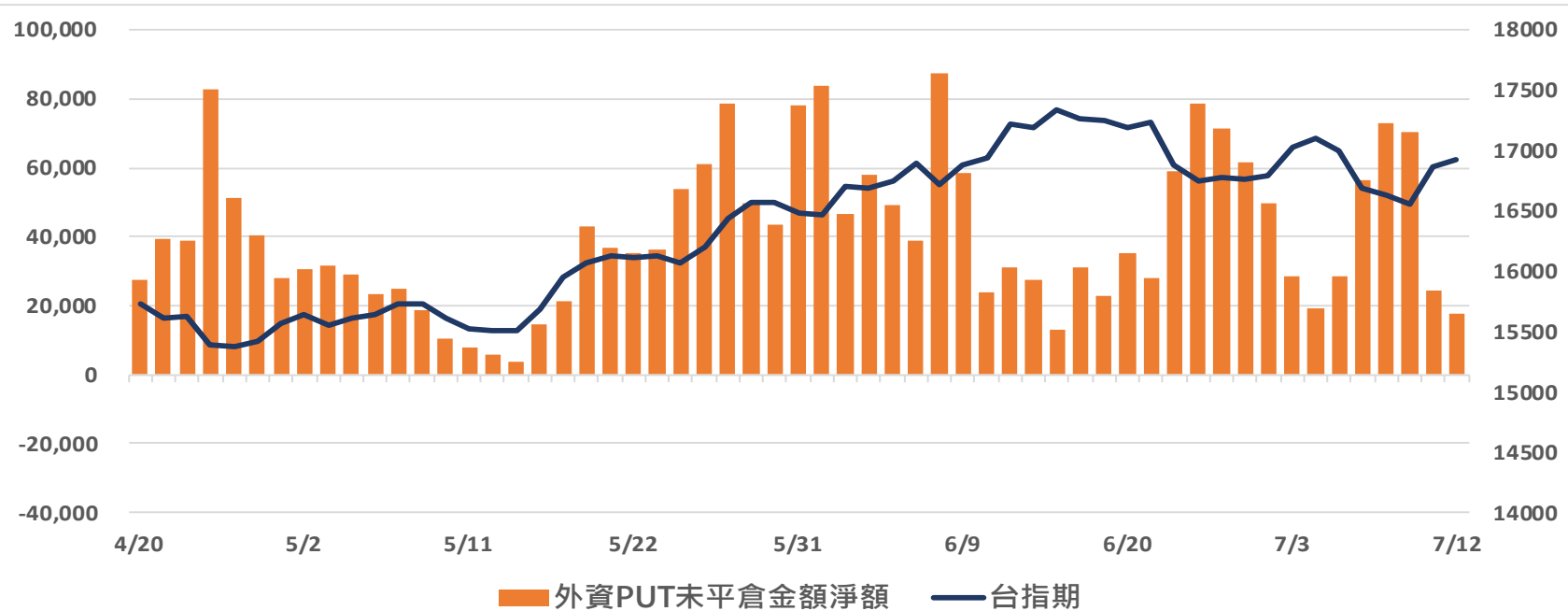
更新日期：2023年7月12日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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12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