

台指選擇權OI

日期：2023/7/14 結算日：2023/7/19					日期：2023/7/14 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
-92	3,272	16,700	9,788	-1	4	11	16,100	1,417	508
-39	283	16,750	3,952	-1,011	-3	37	16,200	1,085	149
-354	2,540	16,800	10,915	844	0	59	16,300	2,008	154
-39	1,039	16,850	7,626	349	1	28	16,400	2,292	406
-362	4,005	16,900	12,178	2,069	-4	205	16,500	1,385	161
-120	1,998	16,950	6,607	1,778	-81	425	16,600	1,545	70
-1,809	4,630	17,000	13,997	5,300 ※	-9	363	16,700	851	-605
-363	2,143	17,050	6,194	3,176	-148	399	16,800	863	-243
-826	6,059	17,100	8,748	3,504	-268	492	16,900	889	-334
-768	2,955	17,150	4,487	1,752	-136	2,576	17,000	1,047	-373
-1,863	10,109	17,200	7,316	3,244	-27	2,513	17,100	1,918	564 ※
-28	5,516	17,250	7,066	1,122	66	1,512	17,200	563	324
376	11,058	17,300	3,585	2,608	-21	2,864	17,300	193	84
-117	6,076	17,350	1,302	1,065	-11	1,858	17,400	140	88
505	9,652	17,400	671	307	208	3,072	17,500	162	125
1,737	6,150	17,450	181	127	793	2,936	17,600	24	20
※ 2,941	12,539	17,500	277	129	182	2,491	17,700	2	0
2,479	5,136	17,550	52	24	236	1,695	17,800	2	0
666	8,374	17,600	101	27	169	1,179	17,900	0	0
1,638	8,512	17,700	56	5	255	1,267	18,000	5	2
120	4,851	17,800	8	2	15	396	18,100	0	0
473	4,369	17,900	13	1	2	352	18,200	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
4,436	135,283	1.4576	197,194	23,785	2,149	33,573	0.8627	28,965	966
昨日 P/C	1.3525	今日增減變化		0.1051	昨日 P/C	0.8910	今日增減變化		-0.0283

更新日期：2023年7月14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	136,692,387	132,960,611	3,731,776	2,214,680	1,226,501	3,299,580	-2,073,079	265,448
投信	59,248,909	40,743,968	18,504,941	1,559,046	1,508,801	0	1,508,801	9,116
自營商	17,823,869	46,236,882	-28,413,013	-1,923,235	1,229,640	1,450,585	-220,945	138,121
	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	1,791,112	1,784,331	6,781	4,720	156,233	0	156,233	-156,413
投信	23,066	0	23,066	243	0	0	0	0
自營商	622,413	1,217,302	-594,889	189,812	136,312	301,463	-165,151	163,833

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	42,729	18,710	24,019	2,579	37,551	19,090	18,461	1,819
投信	350	100	250	150	650	113	537	0
自營商	61,269	51,001	10,268	-1,261	58,698	55,859	2,839	-3,895
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	21,693	2,298	19,395	405	5,149	18,396	-13,247	770
特定法人(全月)	27,736	7,487	20,249	6,243	9,835	20,991	-11,156	1,259
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	53,501	39,843	13,658	1,119	57,466	63,679	-6,213	2,756
十大交易人(全月)	84,229	64,417	19,812	905	72,822	85,918	-13,096	1,503
全市場未沖銷(近月)			138,398	5,406			199,151	22,824
全市場未沖銷(全月)			200,494	9,769			251,424	26,226

更新日期：2023年7月14日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

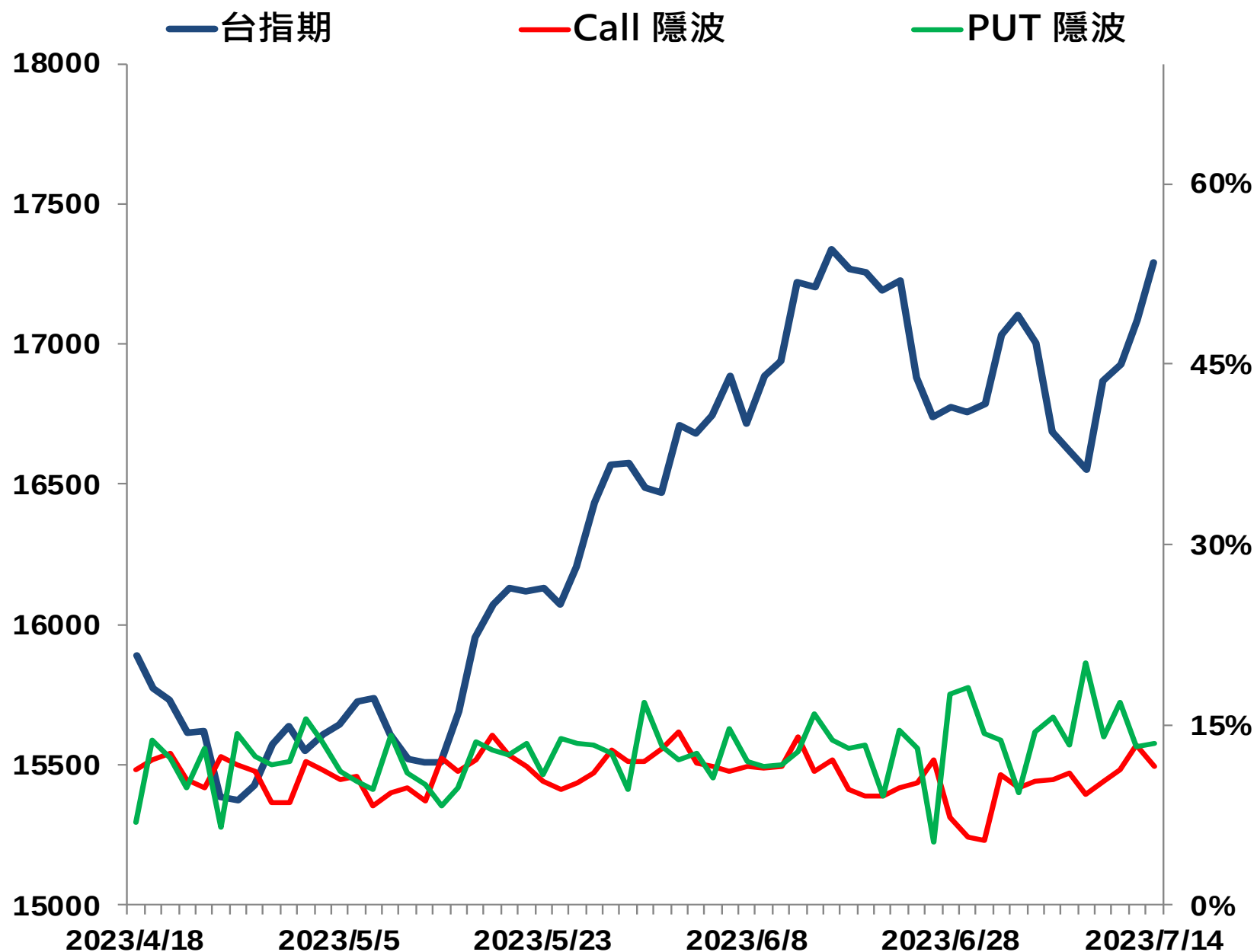
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年7月14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14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

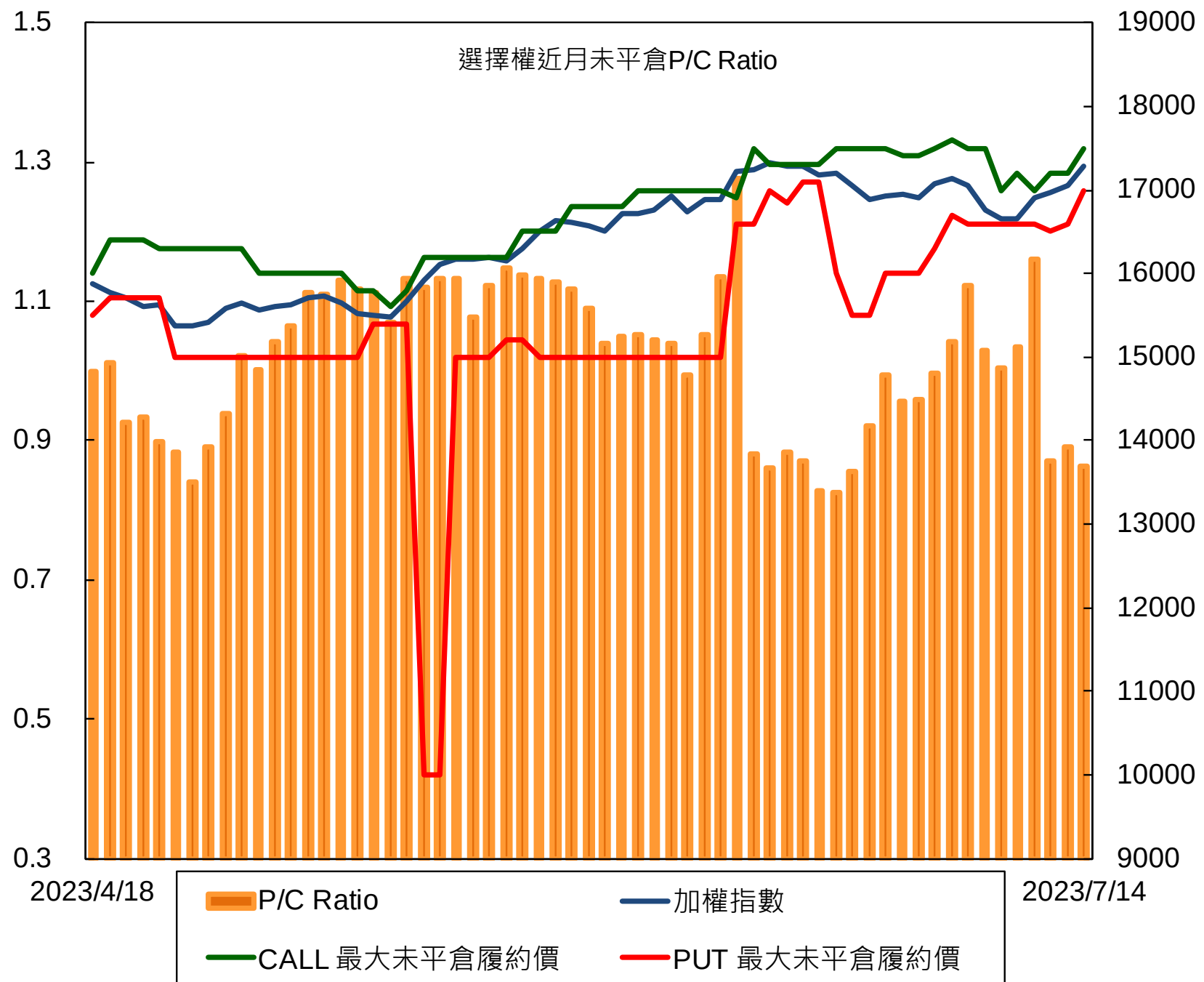
	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	7月13日	62,374	50,845	11,529
	7月14日	61,269	51,001	10,268
Put	7月13日	61,827	55,093	6,734
	7月14日	58,698	55,859	2,839

更新日期：2023年7月14日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



凱基期貨
KGI FUTURES

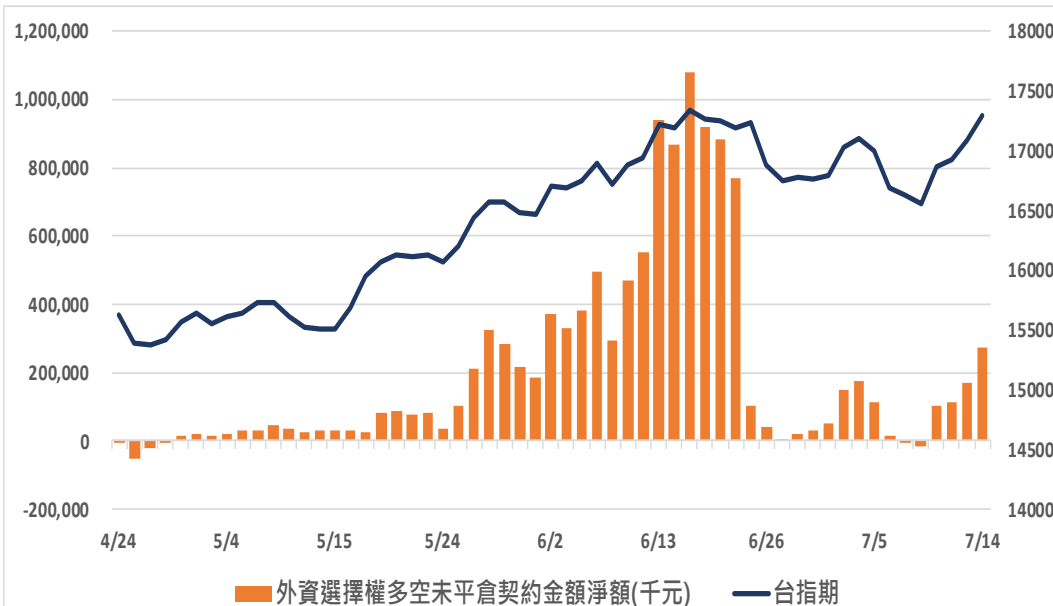
選擇權近月未平倉P/C Ratio



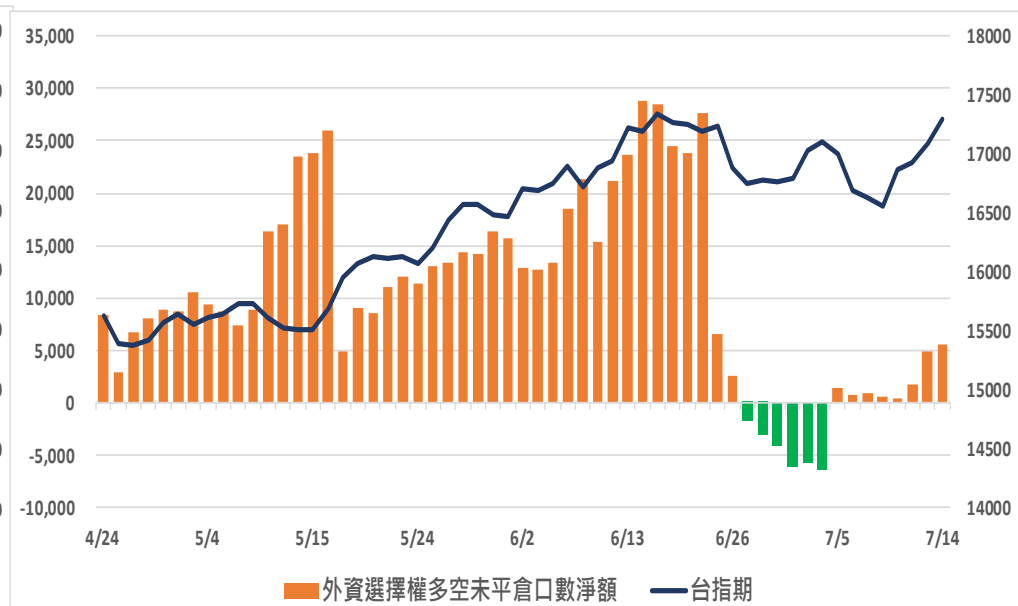
更新日期：2023年7月14日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



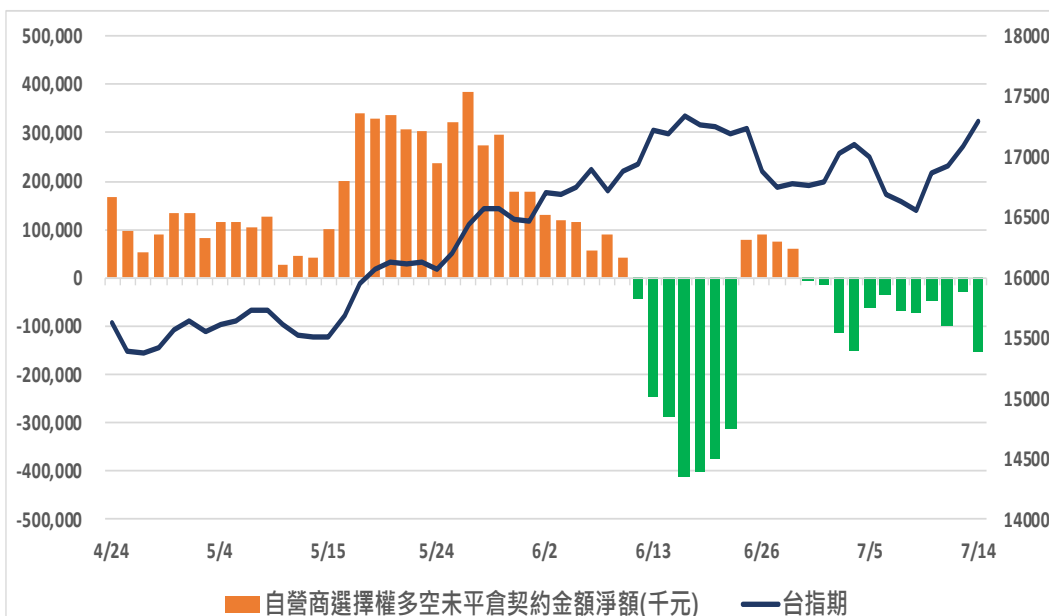
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/10	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
2023/7/13	17086	4,798	+3,152	169,782	+58,272
2023/7/14	17291	5,558	+760	275,682	+105,900

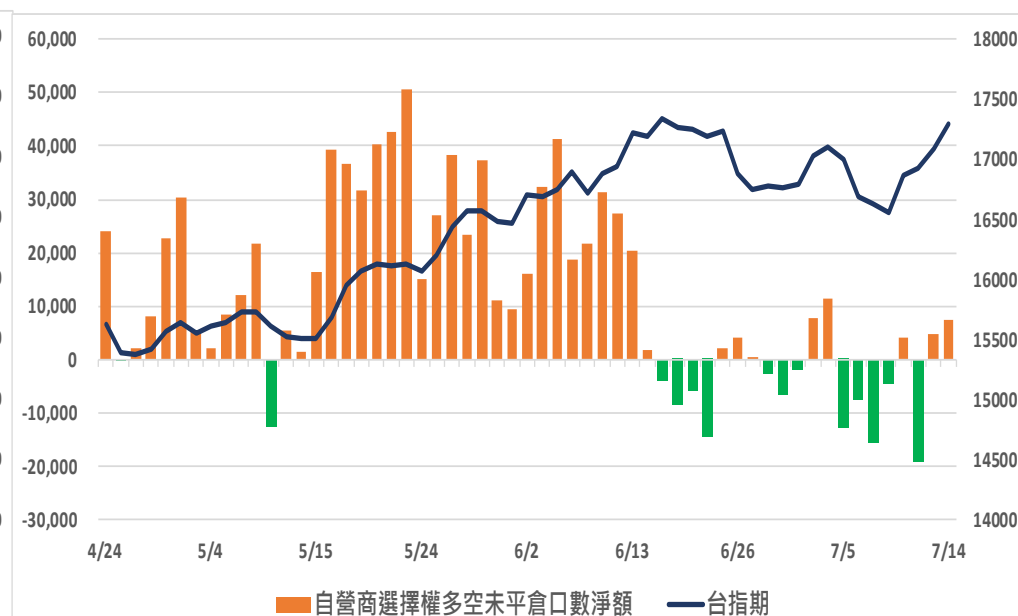
更新日期：2023年7月14日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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
2023/7/10	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
2023/7/13	17086	4,795	+24,048	-30,355	+69,577
2023/7/14	17291	7,429	+2,634	-153,243	-122,888

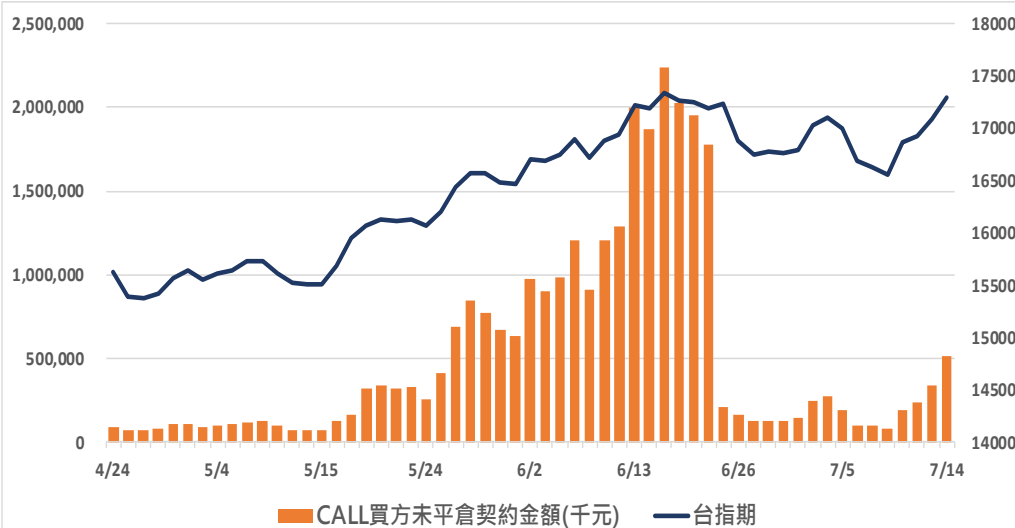
更新日期：2023年7月14日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



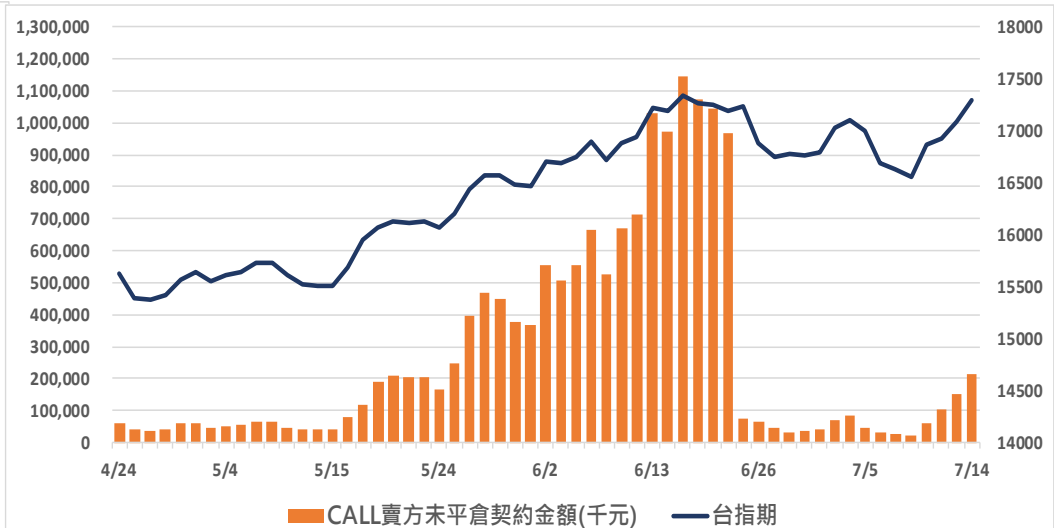
凱基期貨
KGI FUTURES

外資選擇權未平倉金額

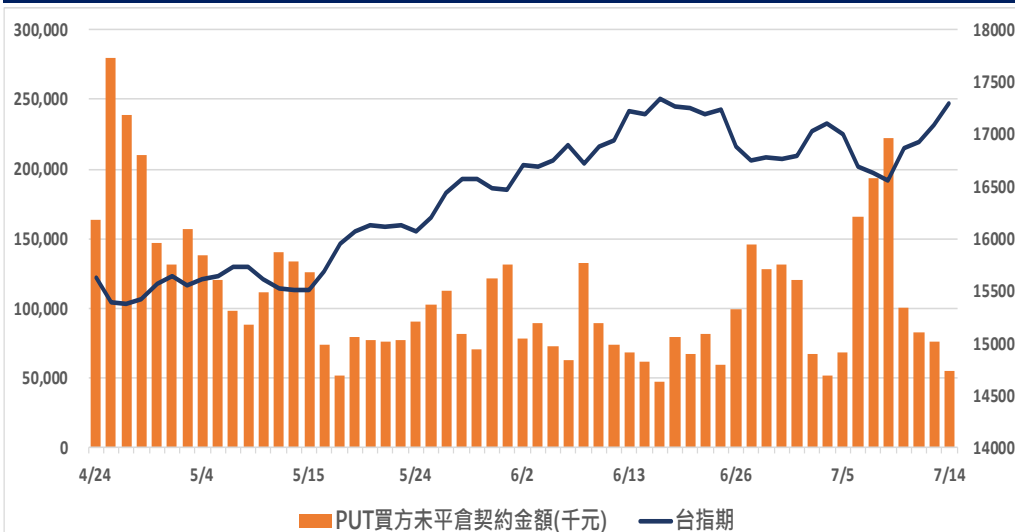
Buy Call未平倉金額



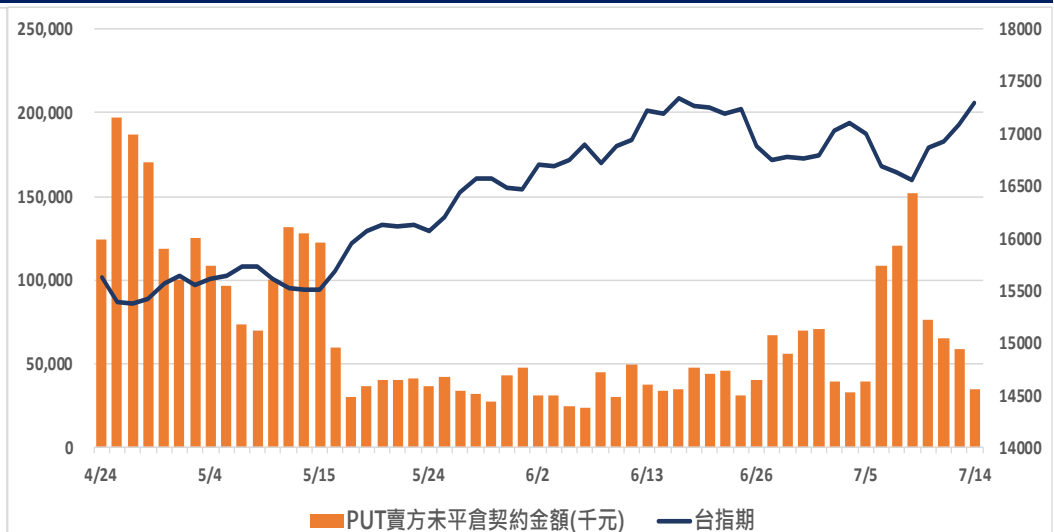
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



Sell Put未平倉金額



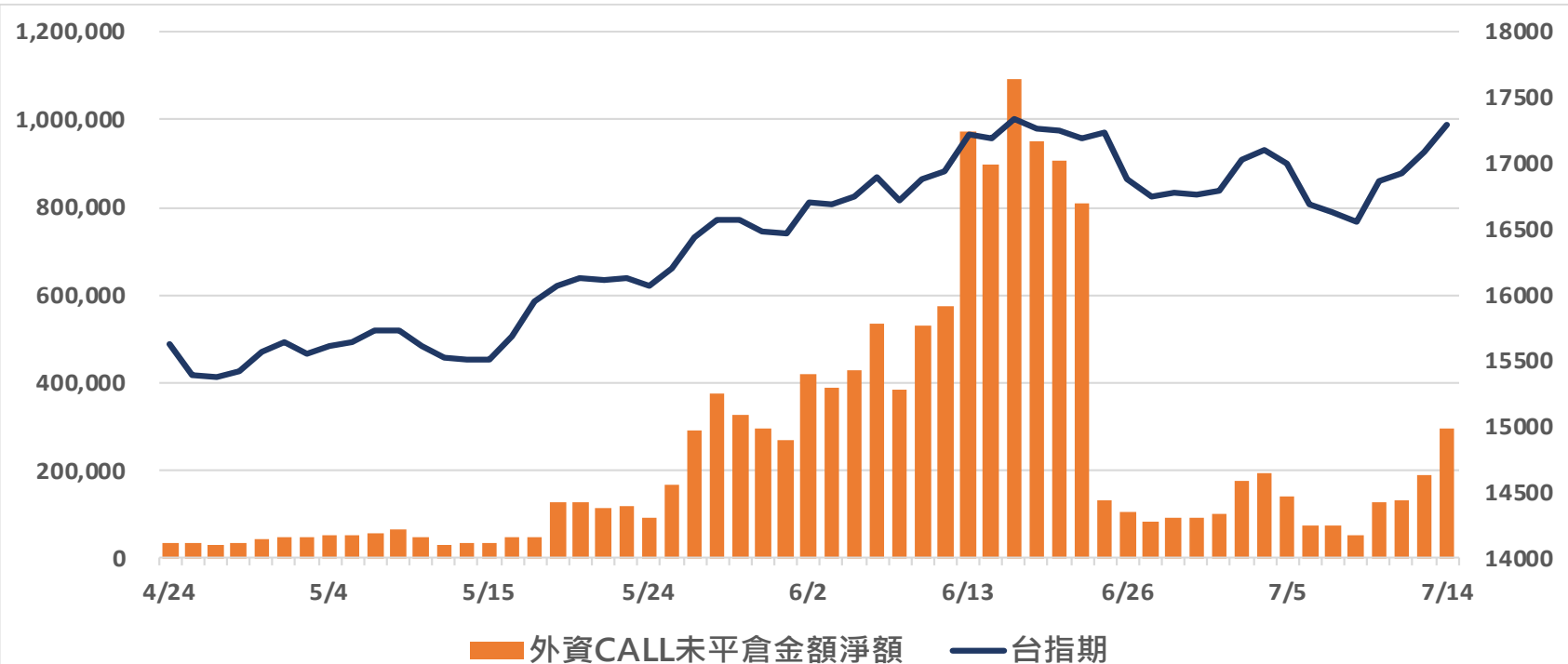
更新日期：2023年7月14日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



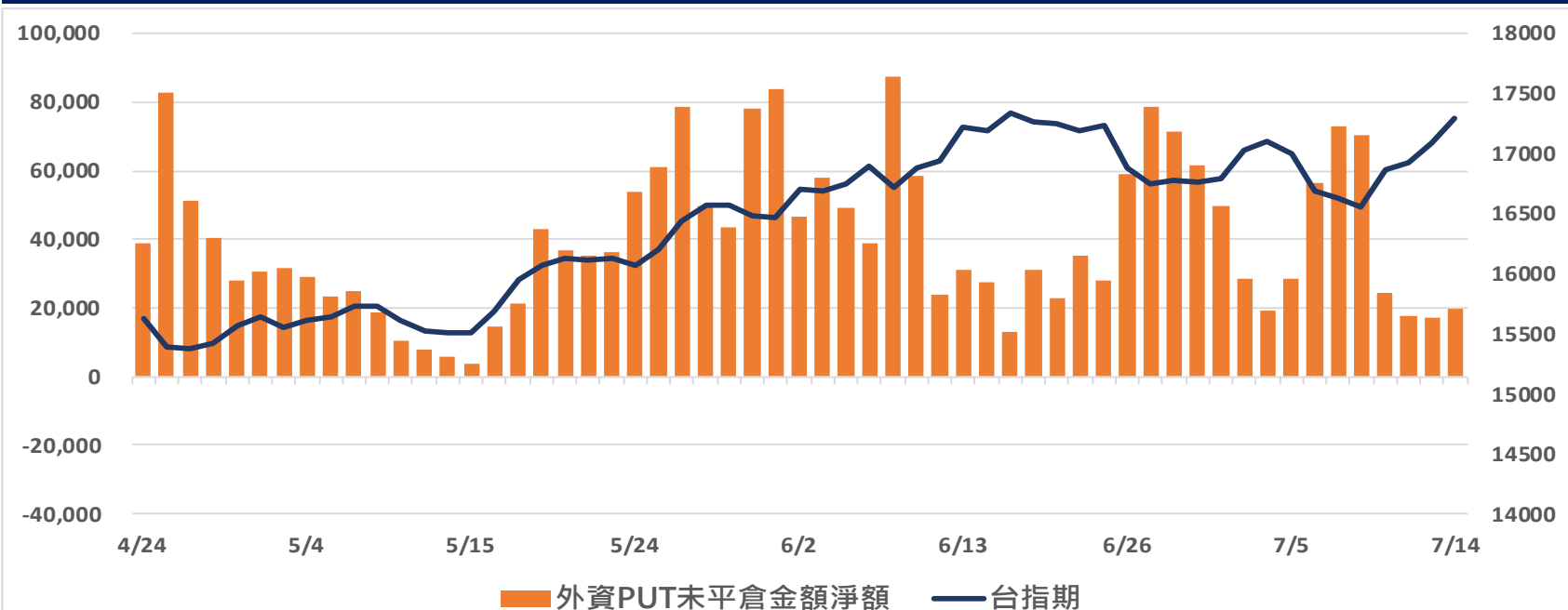
凱基期貨
KGI FUTURES

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14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



凱基期貨
KGI FUTURES