

台指選擇權OI

日期：2023/7/17 結算日：2023/7/19					日期：2023/7/17 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
-19	264	16,750	4,070	118	0	11	16,100	1,196	-221
-132	2,408	16,800	10,819	-96	0	37	16,200	979	-106
-4	1,035	16,850	7,885	259	-1	58	16,300	1,556	-452
-692	3,313	16,900	12,631	453	0	28	16,400	2,242	-50
-172	1,826	16,950	7,529	922	9	214	16,500	1,682	297
-431	4,199	17,000	15,299	1,302	-14	411	16,600	1,692	147
-320	1,823	17,050	7,300	1,106	-4	359	16,700	963	112
-646	5,413	17,100	11,748	3,000	1	400	16,800	962	99
-367	2,588	17,150	8,142	3,655	-59	433	16,900	998	109
-490	9,619	17,200	11,230	3,914	23	2,599	17,000	1,207	160
217	5,733	17,250	5,909	-1,157	12	2,525	17,100	1,651	-267
1,255	12,313	17,300	5,092	1,507	-109	1,403	17,200	821	258
2,124	8,200	17,350	4,044	2,742	-35	2,829	17,300	251	58
1,406	11,058	17,400	1,868	1,197	-72	1,786	17,400	181	41
2,708	8,858	17,450	324	143	132	3,204	17,500	160	-2
※ 4,404	16,943	17,500	439	162	11	2,947	17,600	25	1
2,498	7,634	17,550	44	-8	-405	2,086	17,700	6	4
3,208	11,582	17,600	91	-10	119	1,814	17,800	2	0
2,909	6,005	17,650	69	30	203	1,382	17,900	0	0
1,309	9,821	17,700	52	-4	14	1,281	18,000	8	3
571	571	17,750	0	0	15	411	18,100	0	0
412	5,263	17,800	10	2	20	372	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
19,174	157,553	1.3498	212,659	15,426	926	34,499	0.8471	29,225	260
昨日 P/C	1.4576	今日增減變化		-0.1078	昨日 P/C	0.8627	今日增減變化		-0.0156

更新日期：2023年7月17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	138,962,637	130,636,280	8,326,357	4,594,581	1,193,771	3,147,092	-1,953,321	119,758
投信	45,272,260	40,659,159	4,613,101	-13,891,840	1,444,697	0	1,444,697	-64,104
自營商	22,379,933	46,669,652	-24,289,719	4,123,294	1,359,925	1,580,379	-220,454	491
	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	1,837,276	1,904,905	-67,629	-74,410	145,160	0	145,160	-11,073
投信	23,111	0	23,111	45	0	0	0	0
自營商	941,145	1,670,879	-729,734	-134,845	140,239	311,049	-170,810	-5,659

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	42,760	16,577	26,183	2,164	39,021	18,642	20,379	1,918
投信	350	100	250	0	650	113	537	0
自營商	63,208	57,068	6,140	-4,128	63,118	57,884	5,234	2,395
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	21,098	0	21,098	1,703	5,195	19,707	-14,512	-1,265
特定法人(全月)	31,755	3,293	28,462	8,213	6,122	22,747	-16,625	-5,469
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	53,013	44,791	8,222	-5,436	60,662	71,798	-11,136	-4,923
十大交易人(全月)	86,487	68,100	18,387	-1,425	77,048	93,270	-16,222	-3,126
全市場未沖銷(近月)			157,572	19,174			214,460	15,309
全市場未沖銷(全月)			223,655	23,161			271,590	20,166

更新日期：2023年7月17日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

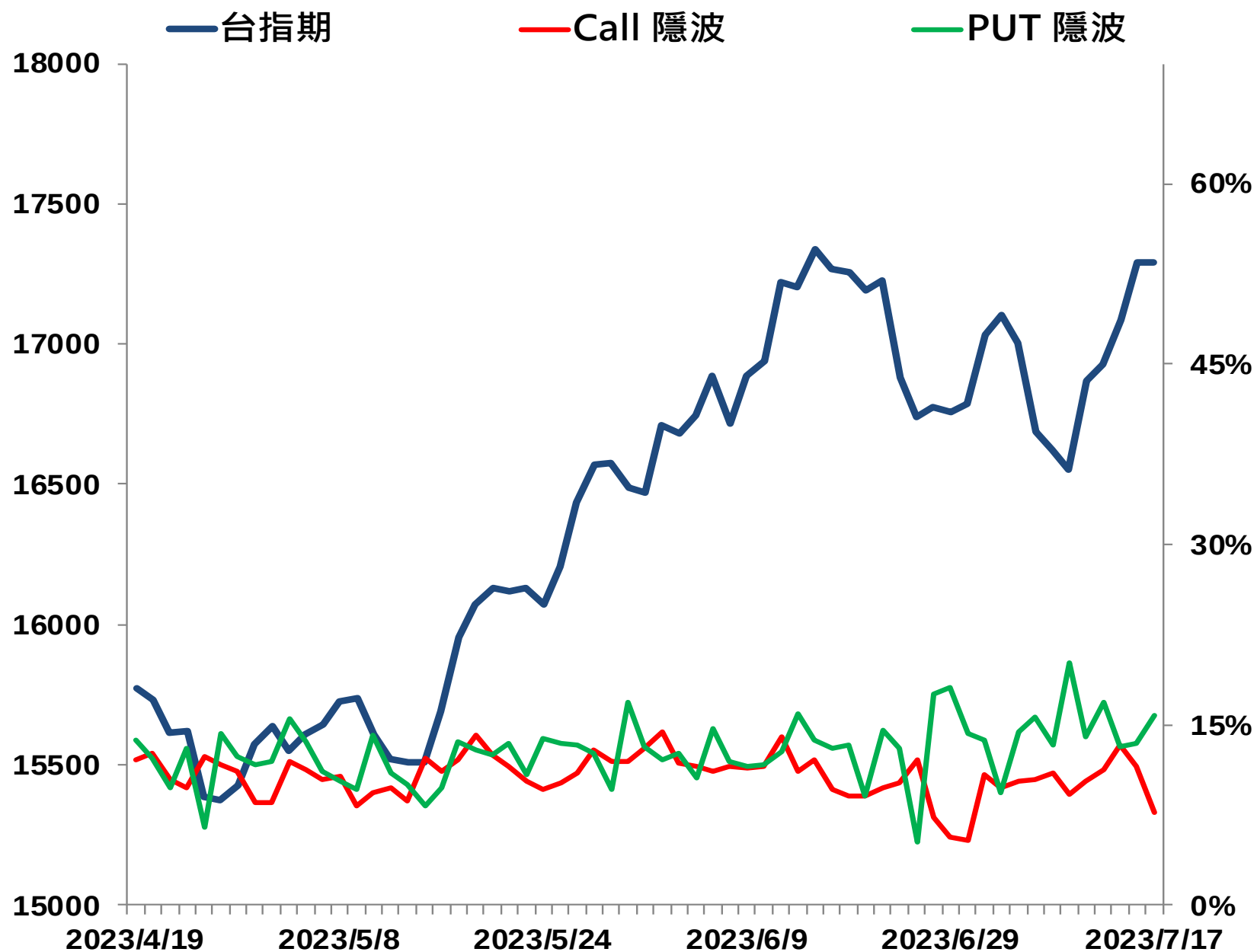
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年7月17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17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

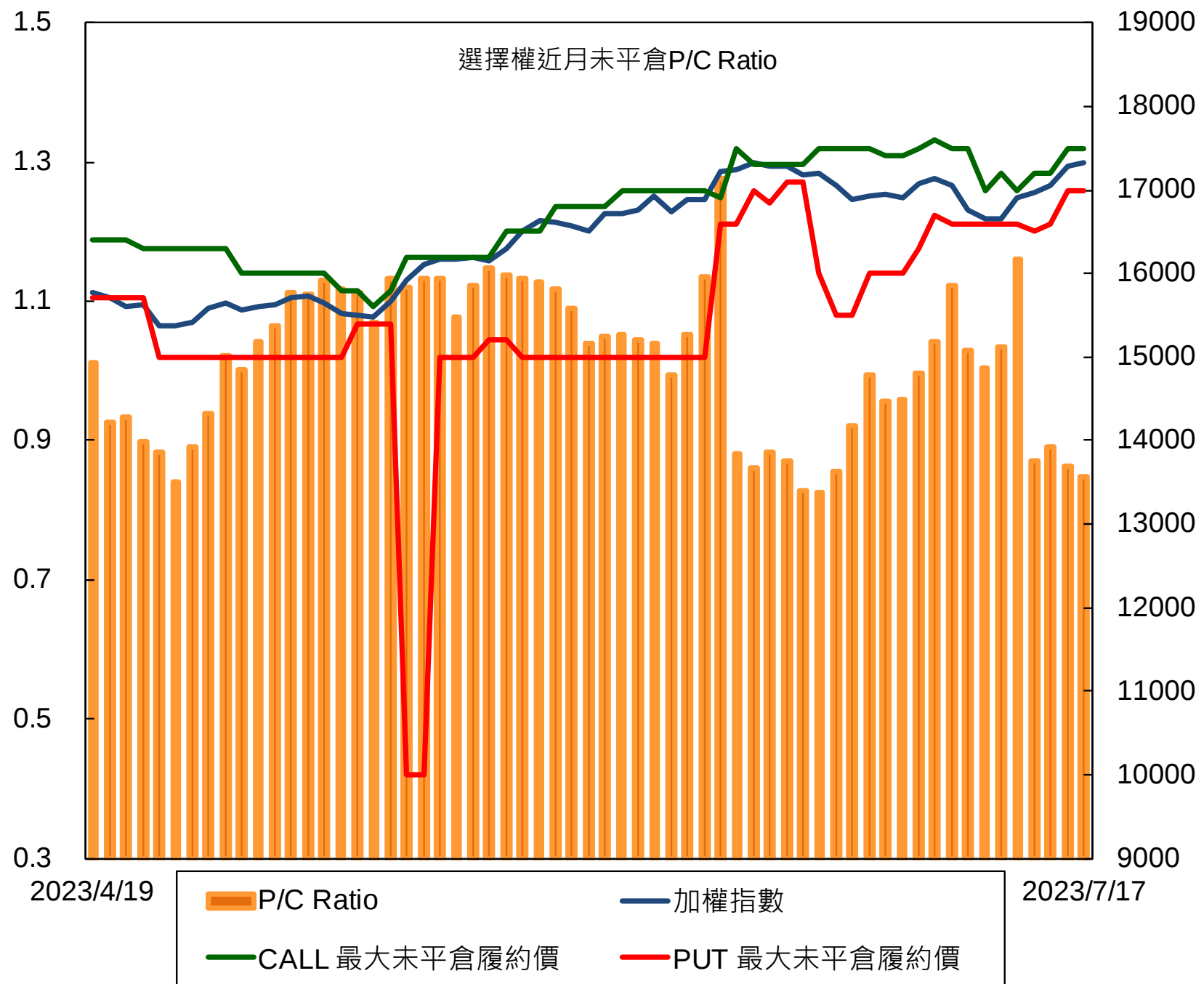
	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	7月14日	61,269	51,001	10,268
	7月17日	63,208	57,068	6,140
Put	7月14日	58,698	55,859	2,839
	7月17日	63,118	57,884	5,234

更新日期：2023年7月17日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



凱基期貨
KGI FUTURES

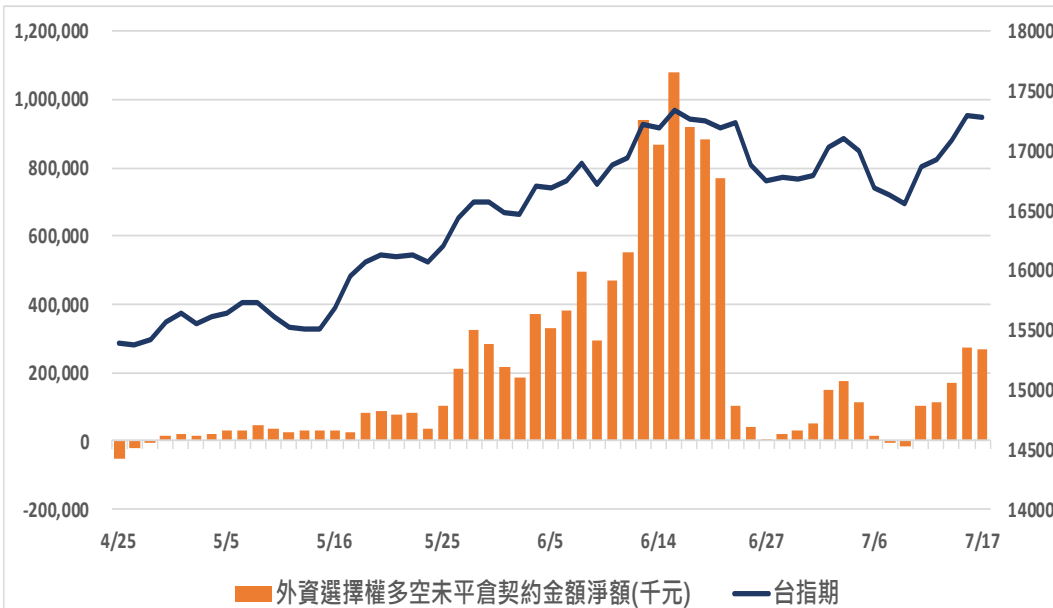
選擇權近月未平倉P/C Ratio



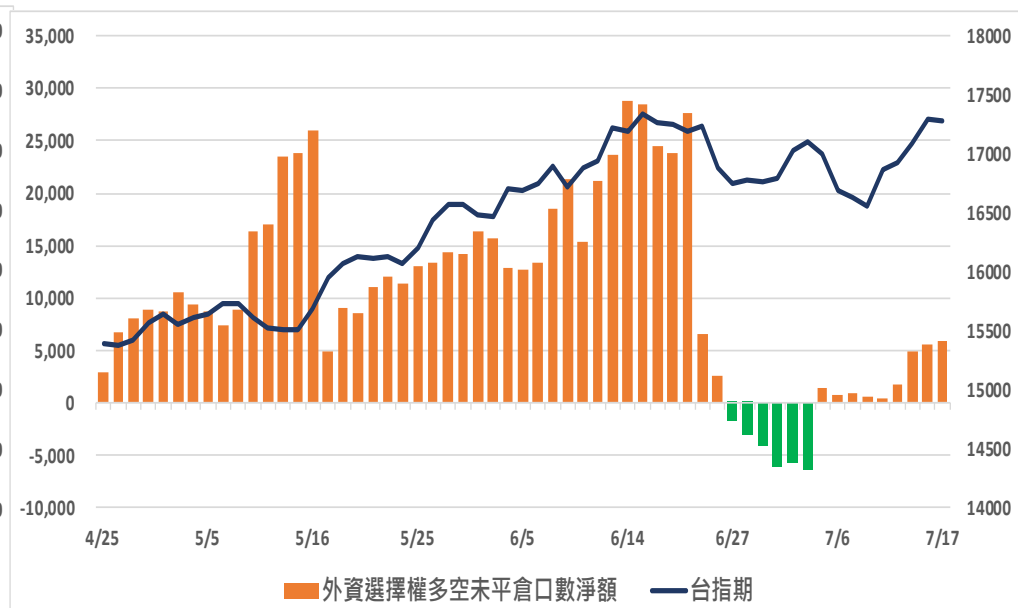
更新日期：2023年7月17日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



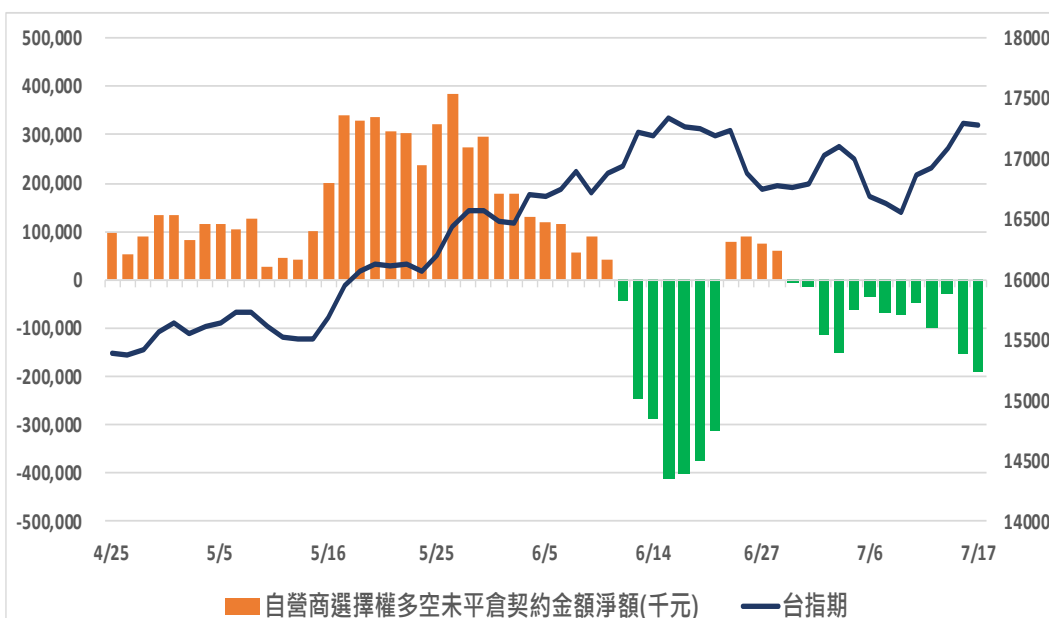
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/11	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
2023/7/17	17287	5,804	+246	267,914	-7,768

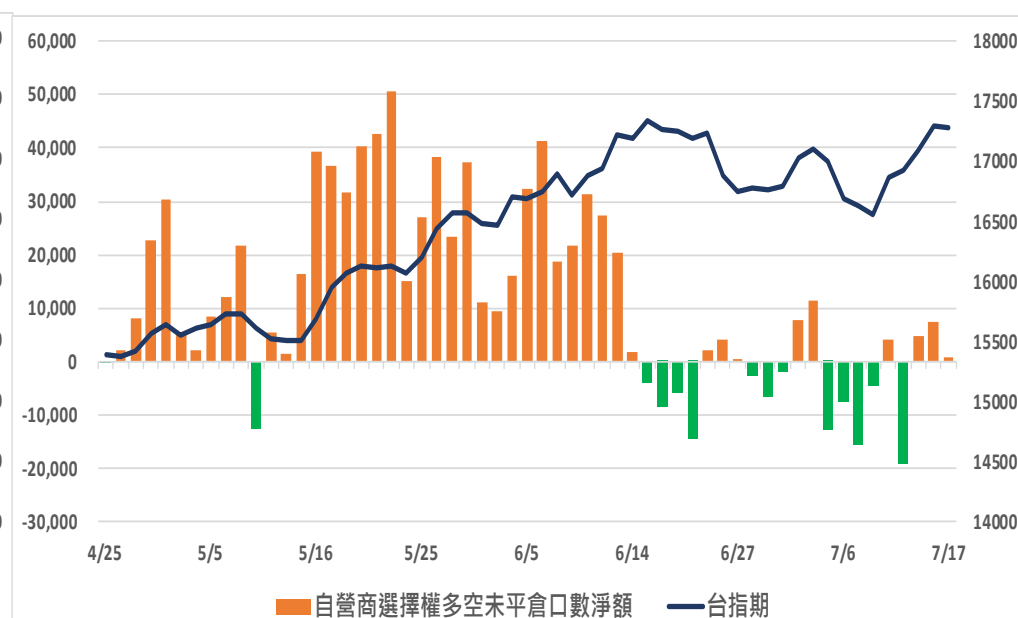
更新日期：2023年7月17日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



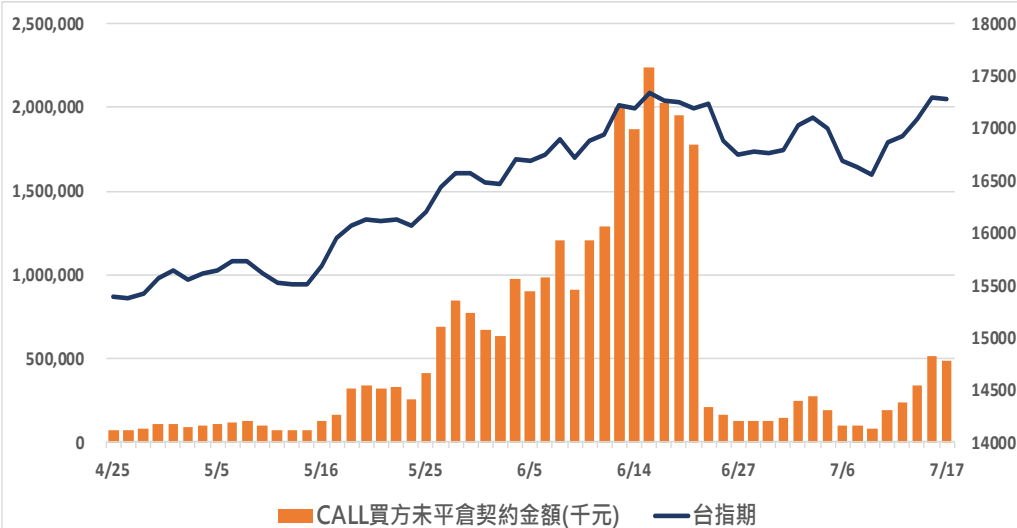
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/11	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
2023/7/17	17287	906	-6,523	-192,318	-39,075

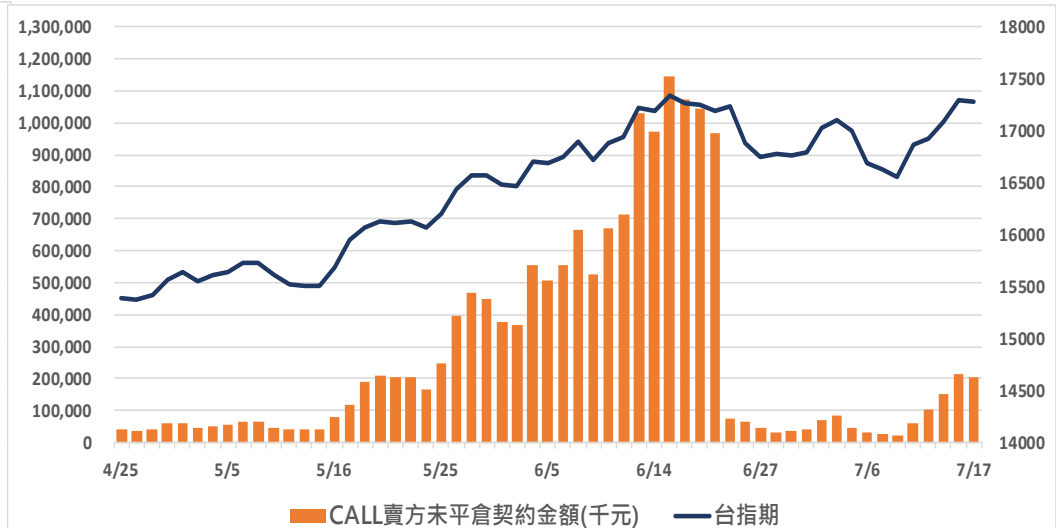
更新日期：2023年7月17日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

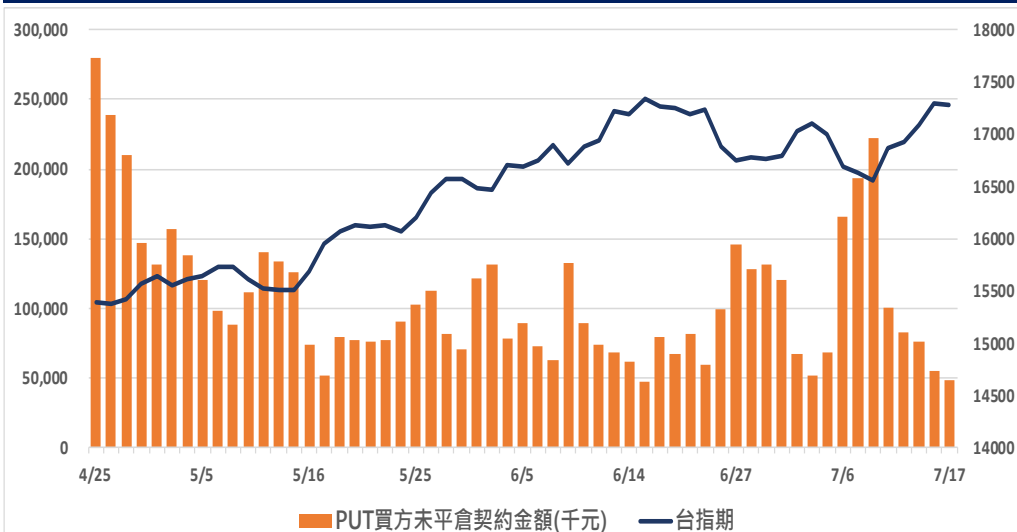
Buy Call未平倉金額



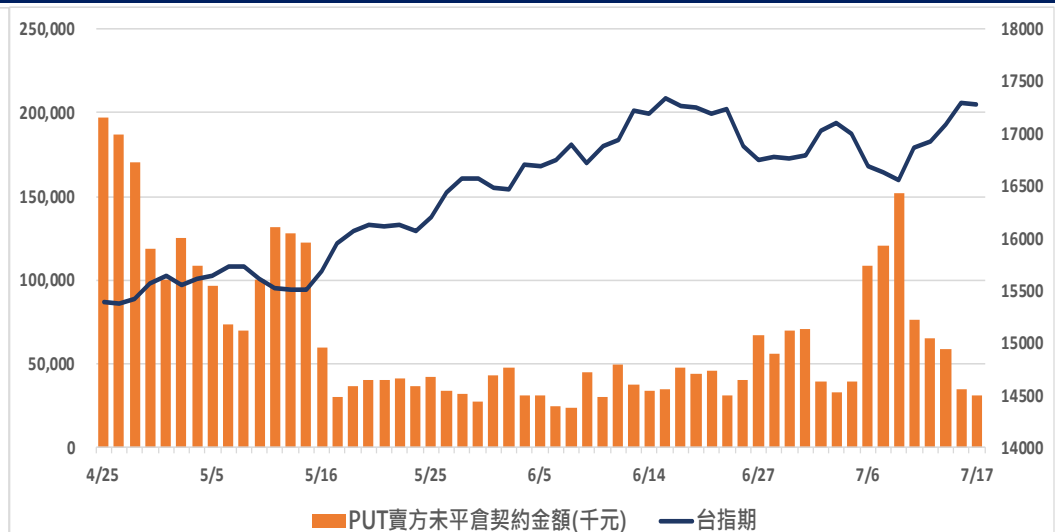
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



Sell Put未平倉金額



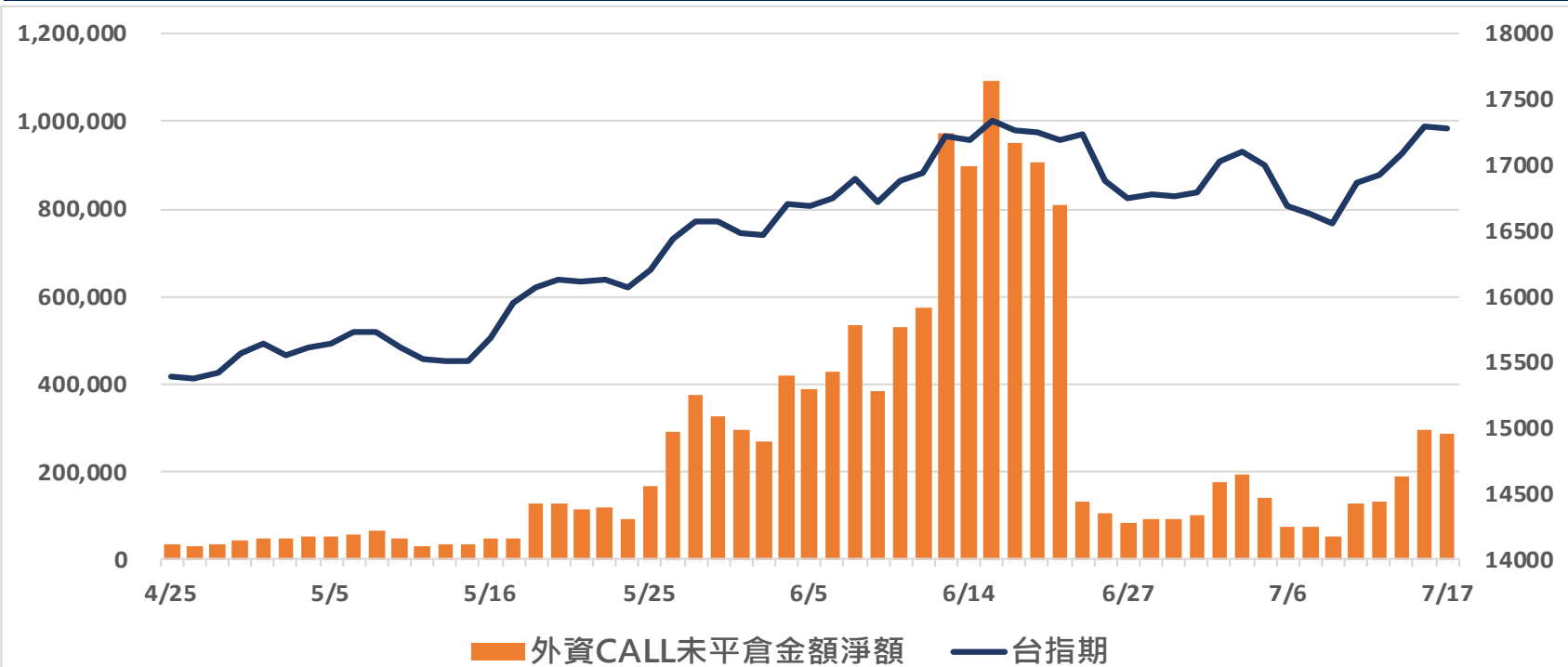
更新日期：2023年7月17日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



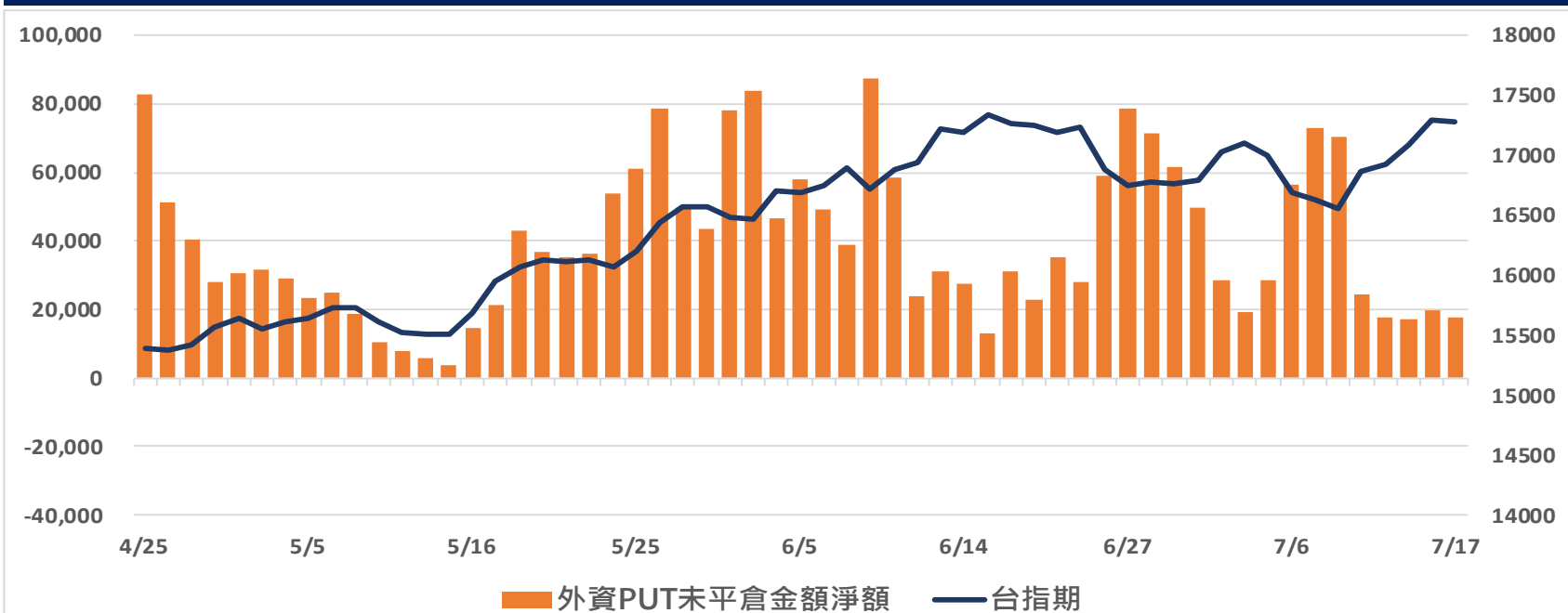
凱基期貨
KGI FUTURES

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17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