

台指選擇權OI

日期：2023/7/18 結算日：2023/7/19					日期：2023/7/18 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
-10	553	16,650	5,432	225	0	162	16,000	3,828	252
-10	3,166	16,700	8,168	-127	0	11	16,100	1,226	30
-7	257	16,750	3,740	-330	0	37	16,200	1,048	69
58	2,466	16,800	9,540	-1,279	-1	57	16,300	1,677	121
-218	817	16,850	6,958	-927	4	32	16,400	2,281	39
-85	3,228	16,900	11,066	-1,565	0	214	16,500	1,547	-135
-193	1,633	16,950	6,427	-1,102	0	411	16,600	1,990	298
-125	4,074	17,000	13,997	-1,302	-40	319	16,700	1,037	74
-90	1,733	17,050	7,853	553	48	448	16,800	1,132	170
-223	5,190	17,100	14,305	2,557 ※	-39	394	16,900	1,236	238
587	3,175	17,150	9,735	1,593	-37	2,562	17,000	1,862	655 ※
2,308	11,927	17,200	11,426	196	31	2,556	17,100	1,946	295
2,378	8,111	17,250	4,599	-1,310	-306	1,097	17,200	955	134
4,873	17,186	17,300	6,245	1,153	-103	2,726	17,300	323	72
※ 6,049	14,249	17,350	3,443	-601	329	2,115	17,400	200	19
4,653	15,711	17,400	2,613	745	128	3,332	17,500	154	-6
1,091	9,949	17,450	546	222	165	3,112	17,600	51	26
-2,994	13,949	17,500	393	-46 ※	392	2,478	17,700	4	-2
-1,428	6,206	17,550	89	45	359	2,173	17,800	4	2
-1,776	9,806	17,600	107	16	294	1,676	17,900	0	0
-593	5,412	17,650	69	0	318	1,599	18,000	8	0
-451	9,370	17,700	78	26	85	496	18,100	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
13,984	171,537	1.2178	208,899	-3,760	2,317	36,816	0.8696	32,016	2,791
昨日 P/C	1.3000	今日增減變化		-0.0822	昨日 P/C	0.8471	今日增減變化		0.0225

更新日期：2023年7月18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	119,345,633	109,666,885	9,678,748	1,352,391	1,208,632	2,592,323	-1,383,691	569,630
投信	44,540,546	40,704,512	3,836,034	-777,067	1,428,575	0	1,428,575	-16,122
自營商	22,376,214	47,973,030	-25,596,816	-1,307,097	771,497	1,777,214	-1,005,717	-785,263
	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	1,852,841	1,931,889	-79,048	-11,419	151,570	0	151,570	6,410
投信	23,164	0	23,164	53	0	0	0	0
自營商	666,472	1,447,037	-780,565	-50,831	69,722	245,123	-175,401	-4,591

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	43,077	16,237	26,840	657	39,508	20,396	19,112	-1,267
投信	350	100	250	0	800	113	687	150
自營商	67,089	62,448	4,641	-1,499	61,902	55,680	6,222	988
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	20,728	0	20,728	-370	5,495	17,950	-12,455	2,057
特定法人(全月)	31,446	0	31,446	2,984	6,422	21,906	-15,484	1,141
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	54,659	53,583	1,076	-7,146	56,889	68,217	-11,328	-192
十大交易人(全月)	89,971	77,955	12,016	-6,371	75,834	90,599	-14,765	1,457
全市場未沖銷(近月)			171,556	13,984			210,571	-3,889
全市場未沖銷(全月)			244,302	20,647			275,790	4,200

更新日期：2023年7月18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

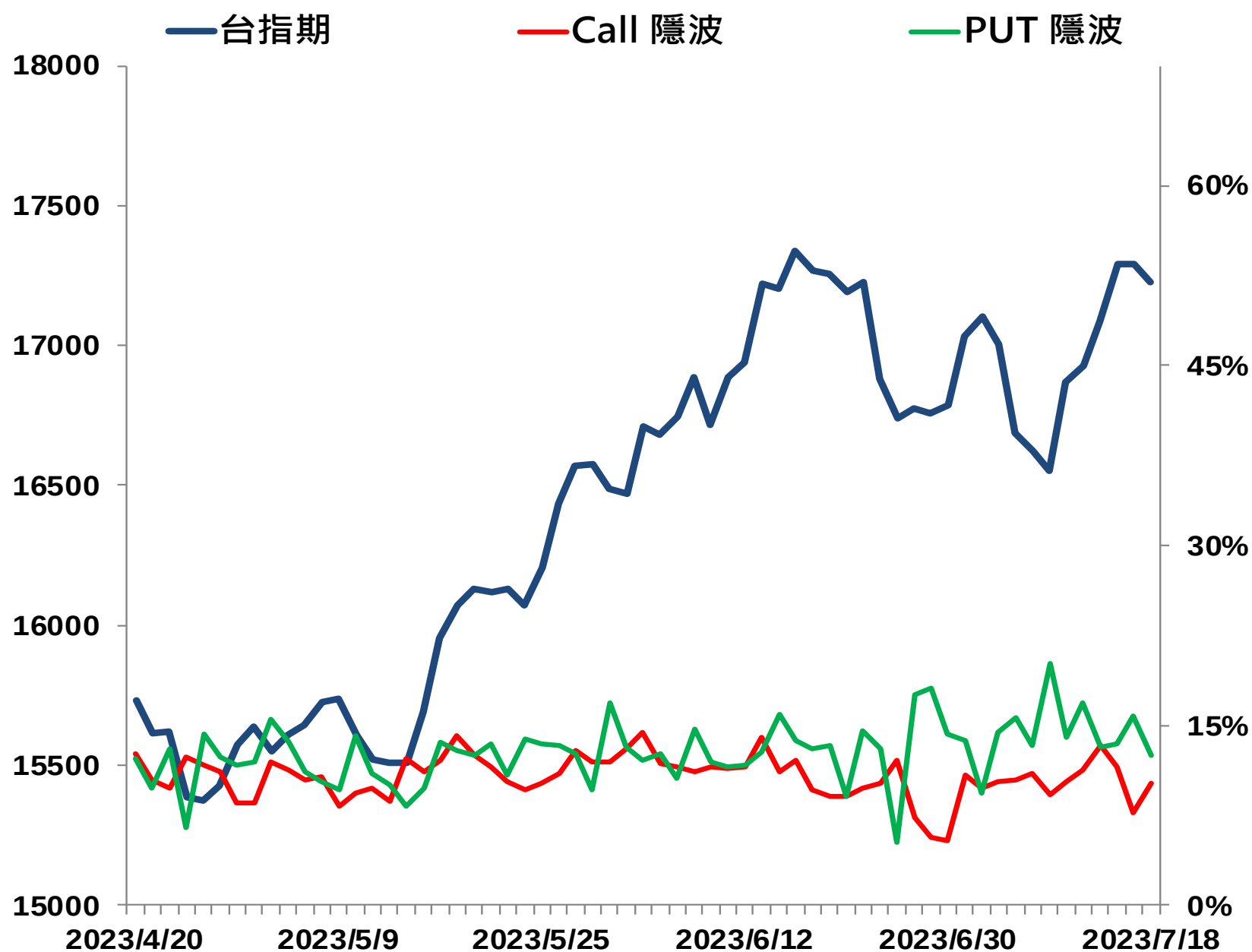


更新日期：2023年7月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考



凱基期貨
KGI FUTURES

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年7月18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

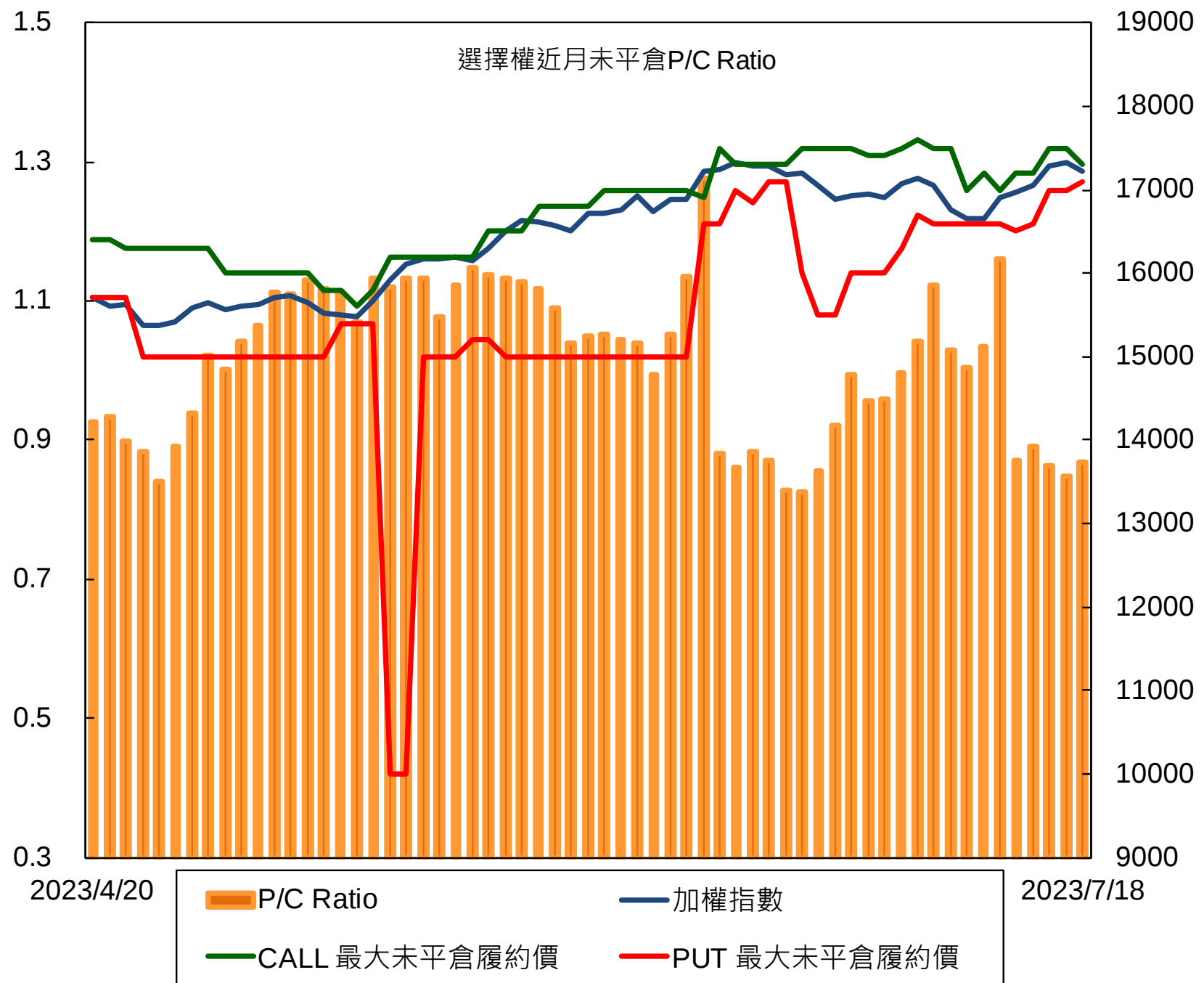
	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	7月17日	63,208	57,068	6,140
	7月18日	67,089	62,448	4,641
Put	7月17日	63,118	57,884	5,234
	7月18日	61,902	55,680	6,222

更新日期：2023年7月18日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



凱基期貨
KGI FUTURES

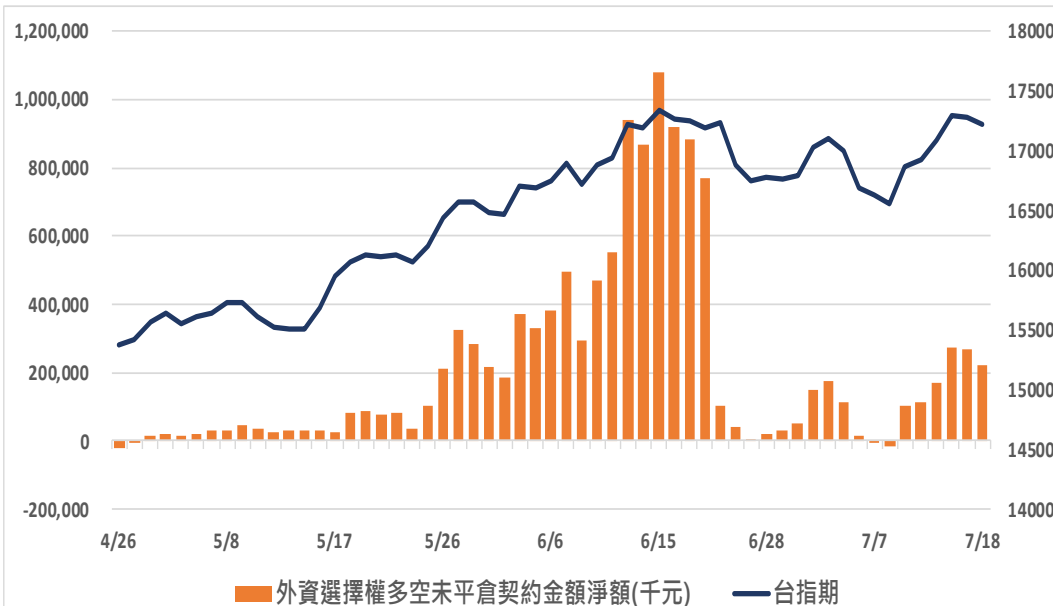
選擇權近月未平倉P/C Ratio



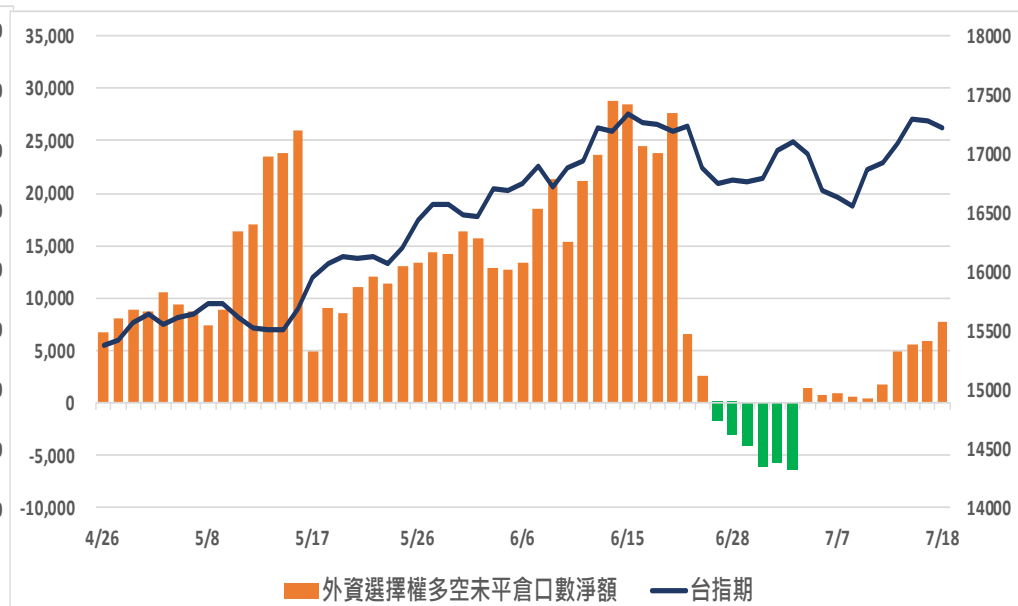
更新日期：2023年7月18日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



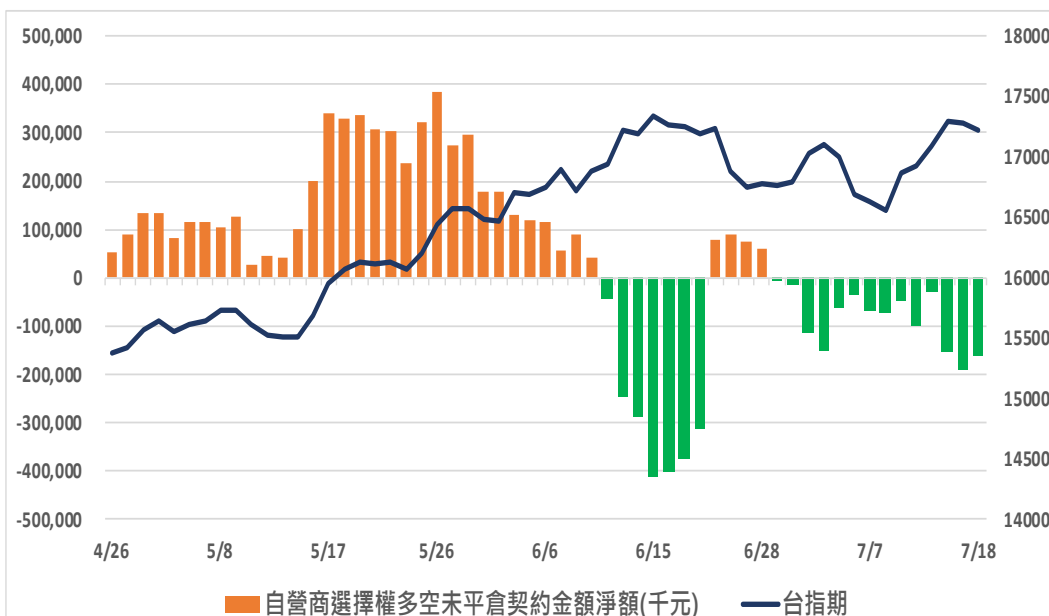
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/12	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
2023/7/18	17220	7,728	+1,924	219,752	-48,162

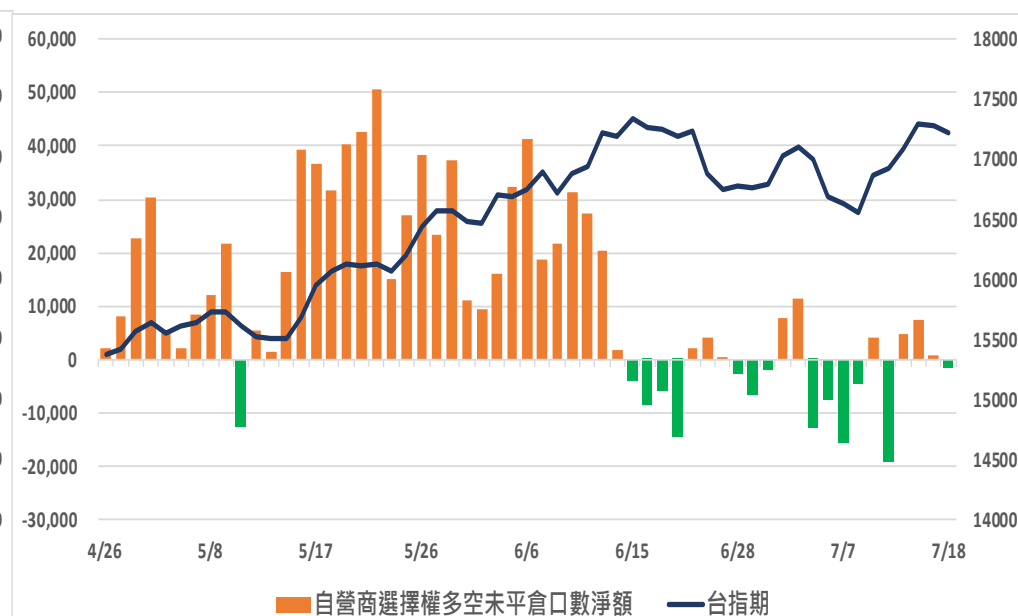
更新日期：2023年7月18日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



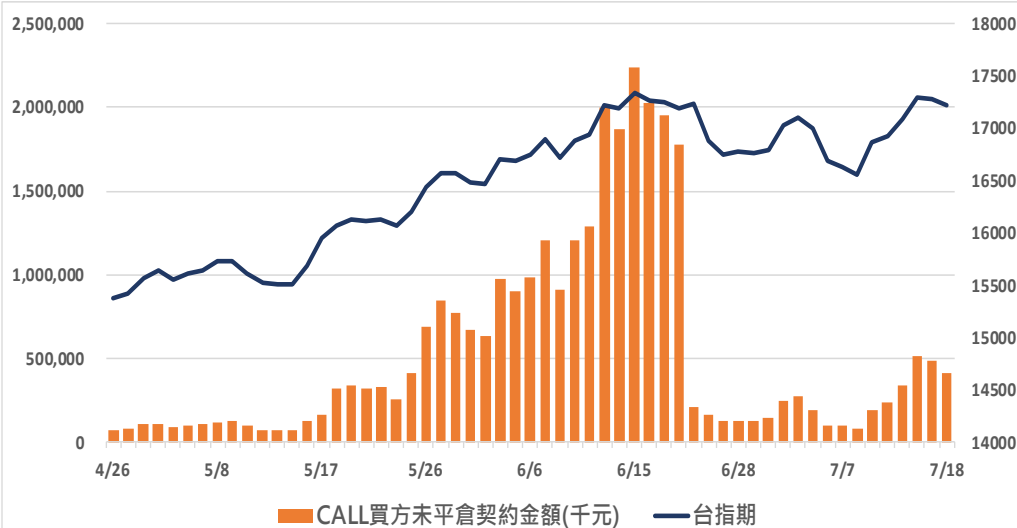
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/12	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
2023/7/18	17220	-1,581	-2,487	-160,589	+31,729

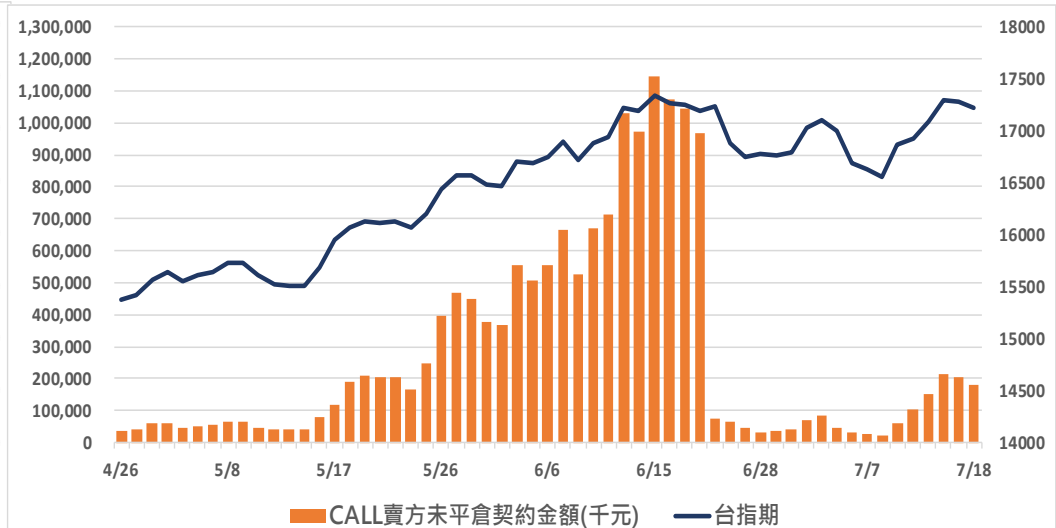
更新日期：2023年7月18日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

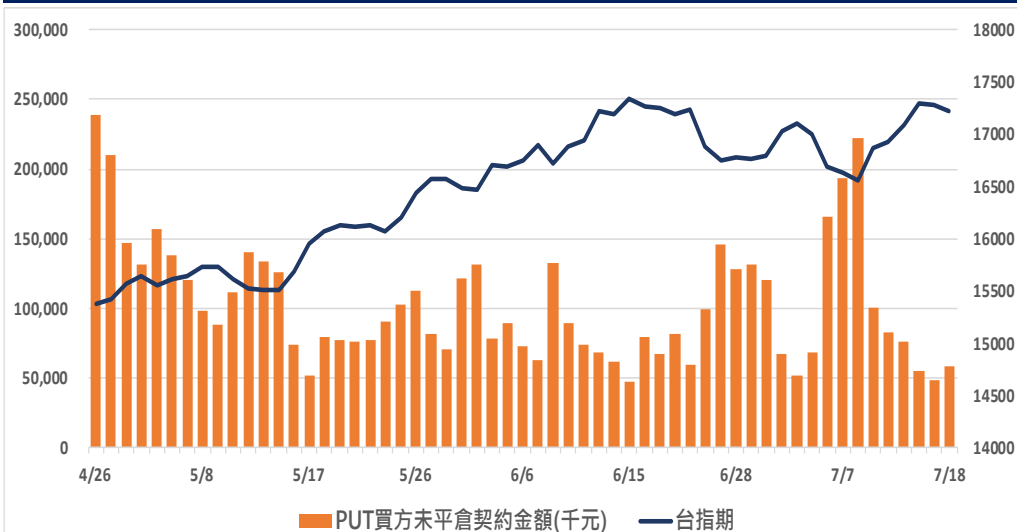
Buy Call未平倉金額



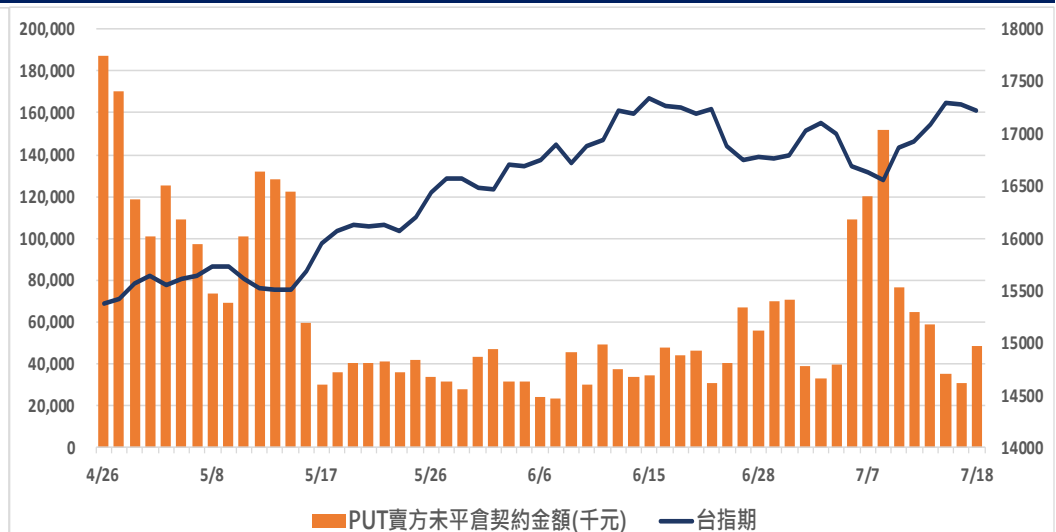
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



Sell Put未平倉金額



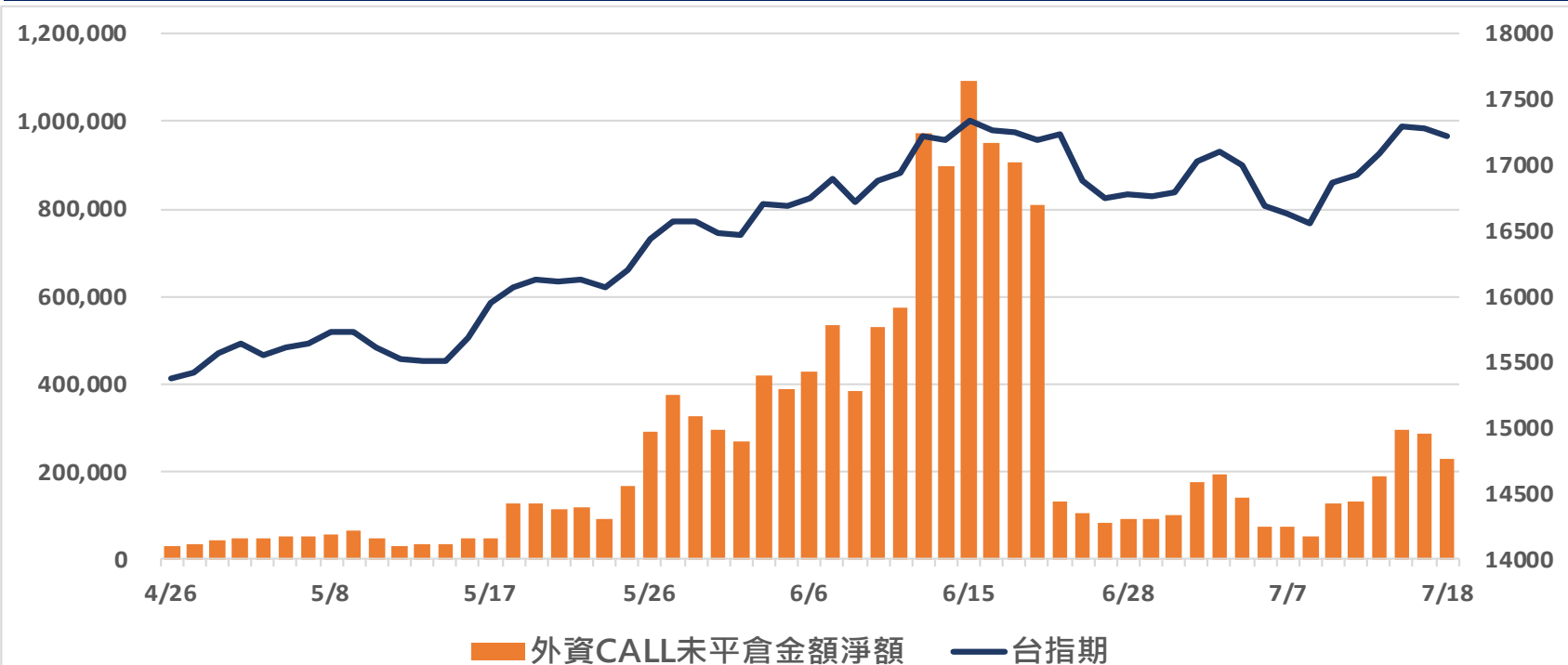
更新日期：2023年7月18日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



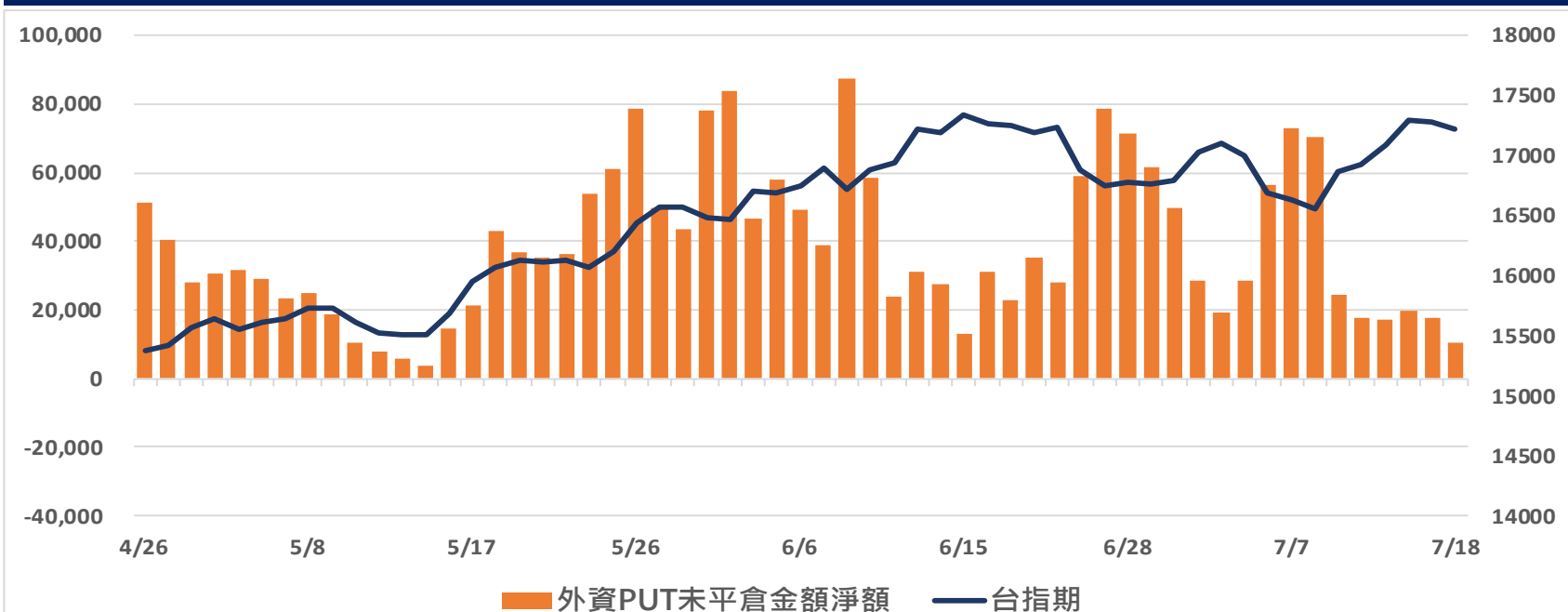
凱基期貨
KGI FUTURES

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18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