

台指選擇權OI

日期：2023/7/19 結算日：2023/7/26					日期：2023/7/19 結算日：2023/8/16				
202307W4					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
0	11	16,300	1,182	886	-1	26	15,900	641	-1
0	0	16,400	1,221	775	0	162	16,000	3,919	91
0	2	16,500	998	467	2	13	16,100	1,659	433
5	7	16,600	1,292	446	-1	36	16,200	1,278	230
0	44	16,700	2,594	1,330	0	57	16,300	2,219	542
0	6	16,750	1,283	551	-1	31	16,400	2,506	225
31	46	16,800	2,455	1,253	24	238	16,500	1,921	374
5	21	16,850	1,891	1,140	71	482	16,600	2,273	283
59	127	16,900	2,110	1,127	-6	313	16,700	1,295	258
-2	60	16,950	1,582	682	-9	439	16,800	1,367	235
360	459	17,000	3,037	589	-16	378	16,900	1,434	198
220	305	17,050	1,638	878	177	2,739	17,000	1,926	64
634	1,008	17,100	2,438	928	-562	1,994	17,100	2,218	272
763	983	17,150	854	270	440	1,537	17,200	1,123	168
1,154	1,766	17,200	1,065	120	130	2,856	17,300	328	5
862	1,532	17,250	467	231	408	2,523	17,400	203	3
1,153	1,830	17,300	389	73	459	3,791	17,500	120	-34
1,891	2,577	17,350	166	53	※ 1,150	4,262	17,600	40	-11
1,610	2,471	17,400	163	-13	638	3,116	17,700	5	1
1,105	2,193	17,450	81	4	230	2,403	17,800	2	-2
2,599	3,982	17,500	65	6	208	1,884	17,900	0	0
1,829	2,365	17,550	16	0	-21	1,578	18,000	8	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
21,869	37,155	0.8591	31,920	15,306	3,923	40,739	0.8865	36,116	4,100
昨日 P/C	1.2178	今日增減變化		-0.3587	昨日 P/C	0.8696	今日增減變化		0.0169

更新日期：2023年7月19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	109,188,174	98,494,113	10,694,061	1,015,313	862,566	1,634,159	-771,593	612,098
投信	44,371,672	40,881,665	3,490,007	-346,027	1,421,887	0	1,421,887	-6,688
自營商	8,560,114	37,157,480	-28,597,366	-3,000,550	249,332	1,078,208	-828,876	176,841
	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	1,677,484	1,706,038	-28,554	50,494	0	0	0	-151,570
投信	22,988	0	22,988	-176	0	0	0	0
自營商	144,496	1,022,326	-877,830	-97,265	0	58,461	-58,461	116,940

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	17,409	8,647	8,762	-18,078	13,121	7,215	5,906	-13,206
投信	0	0	0	-250	0	102	-102	-789
自營商	41,039	32,568	8,471	3,830	30,076	26,644	3,432	-2,790
特定法人(週)	0	0	0	---	0	1,567	-1,567	---
特定法人(近月)	12,262	4,902	7,360	---	5,649	6,460	-811	---
特定法人(全月)	11,236	3,293	7,943	-23,503	4,220	8,495	-4,275	11,209
十大交易人(週)	19,481	18,582	899	---	14,530	11,948	2,582	---
十大交易人(近月)	22,397	21,786	611	---	15,495	20,169	-4,674	---
十大交易人(全月)	48,864	44,280	4,584	-7,432	32,335	37,145	-4,810	9,955
全市場未沖銷(近月)			40,739	---			36,116	---
全市場未沖銷(全月)			101,203	-143,099			86,714	-189,076

更新日期：2023年7月19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

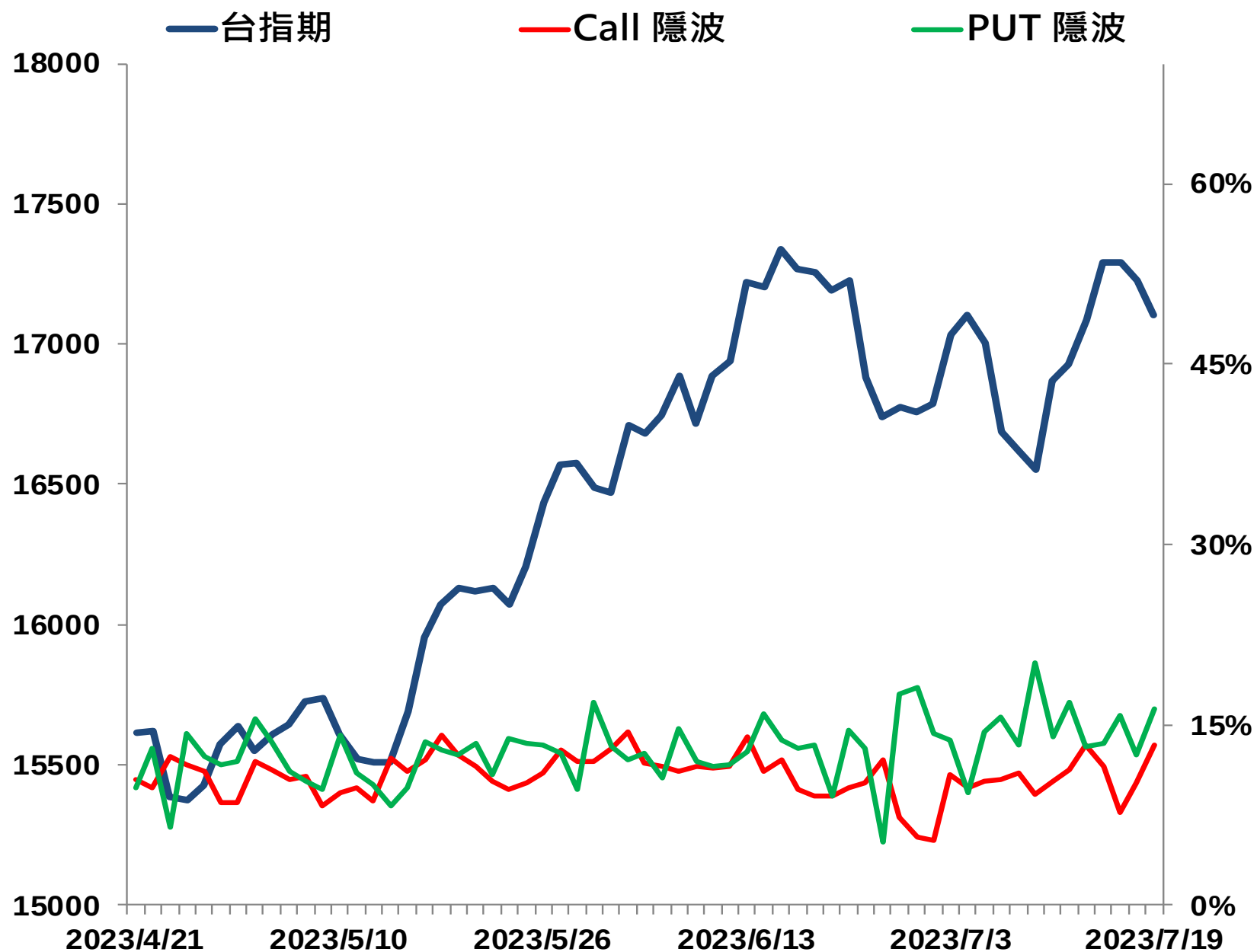


更新日期：2023年7月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考



凱基期貨
KGI FUTURES

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年7月19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

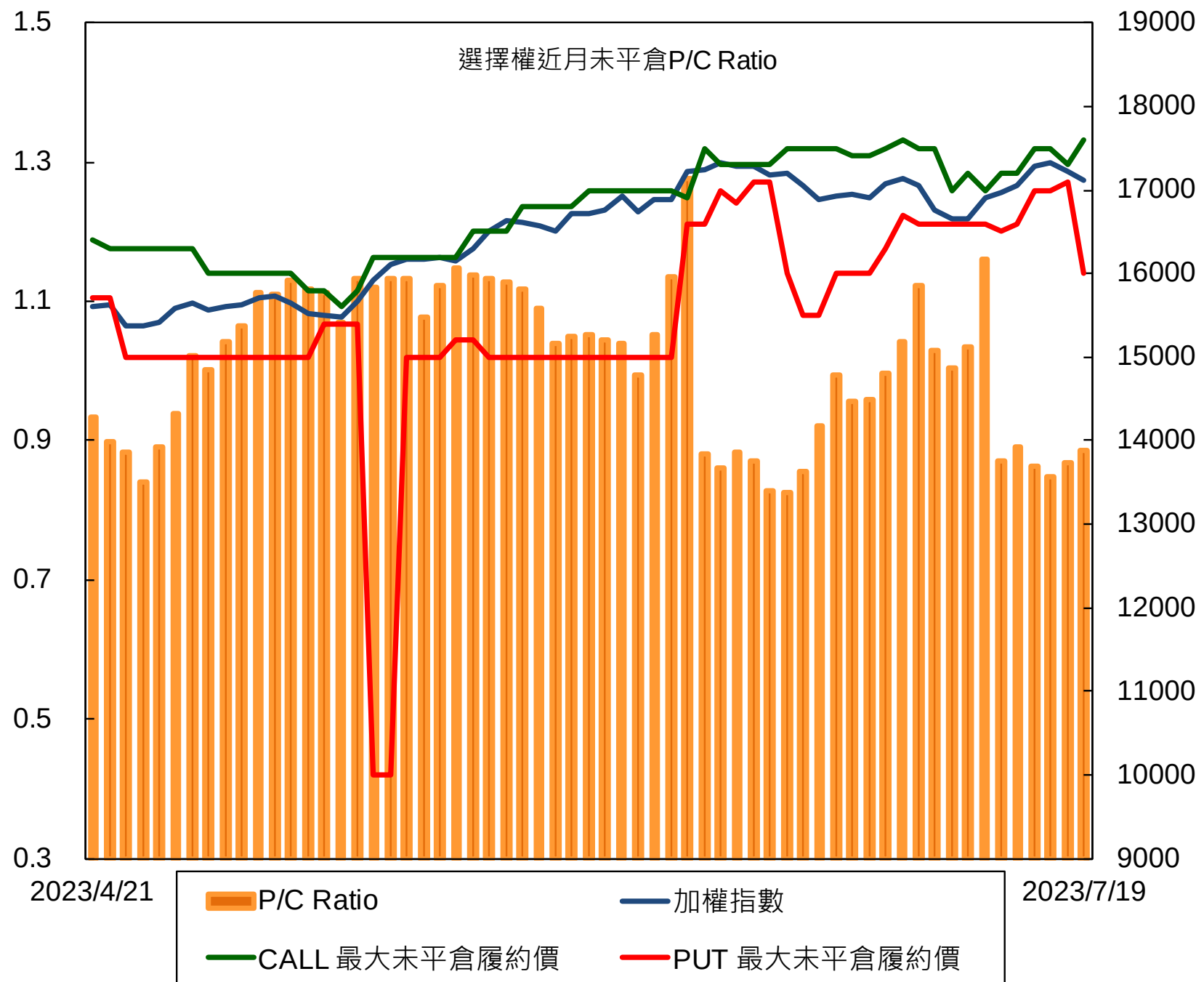
	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	7月18日	67,089	62,448	4,641
	7月19日	41,039	32,568	8,471
Put	7月18日	61,902	55,680	6,222
	7月19日	30,076	26,644	3,432

更新日期：2023年7月19日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



凱基期貨
KGI FUTURES

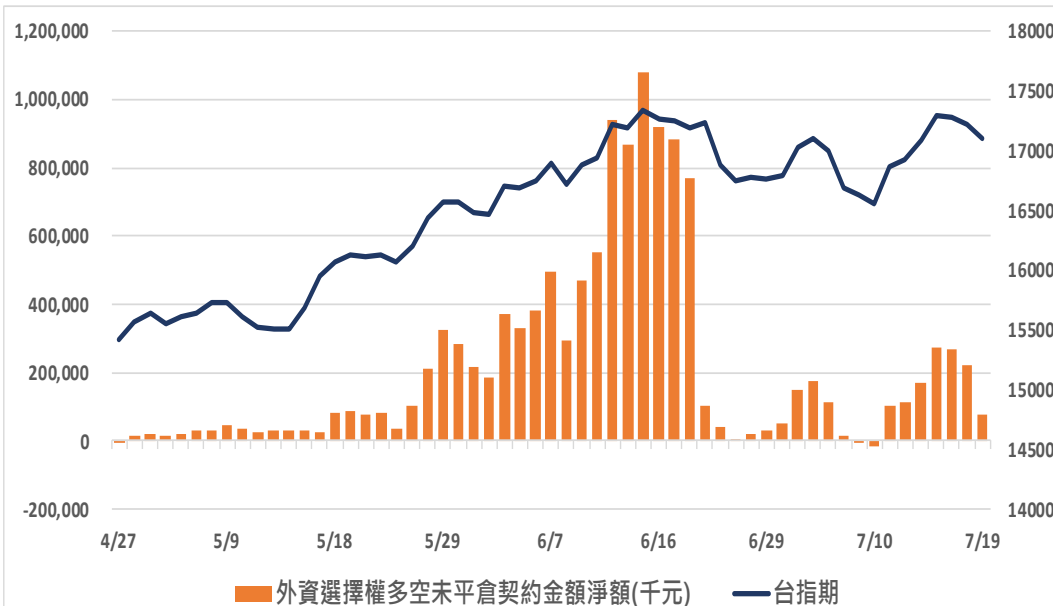
選擇權近月未平倉P/C Ratio



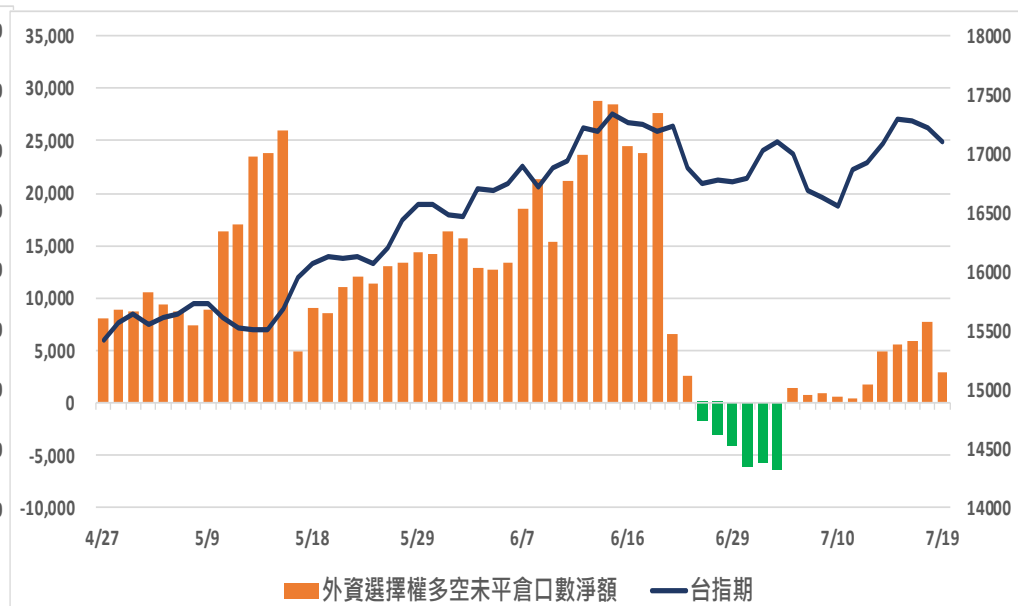
更新日期：2023年7月19日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



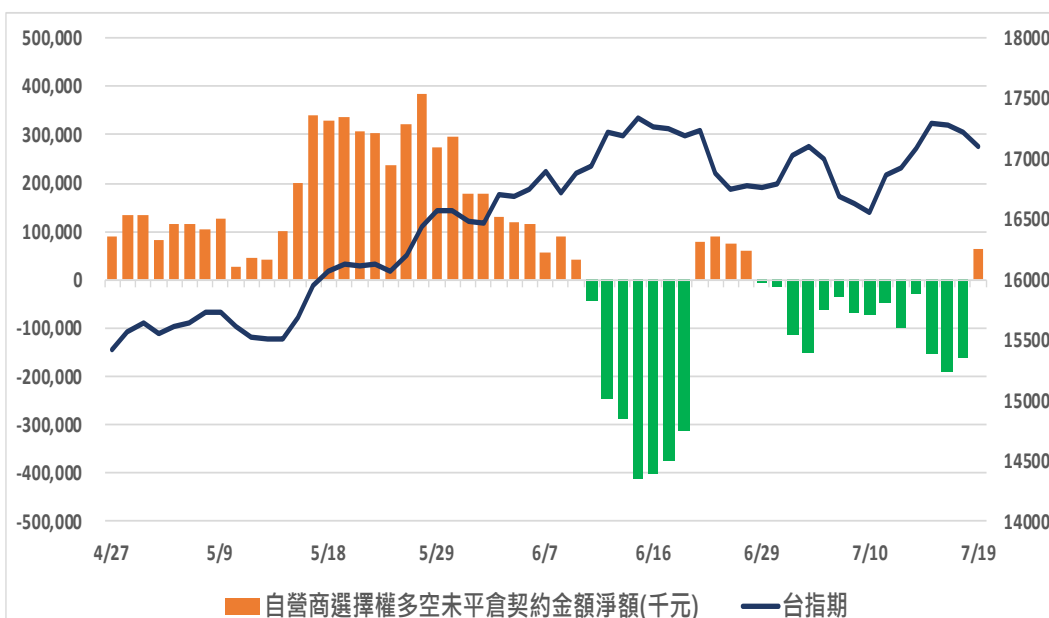
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/13	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
2023/7/19	17102	2,856	-4,872	77,861	-141,891

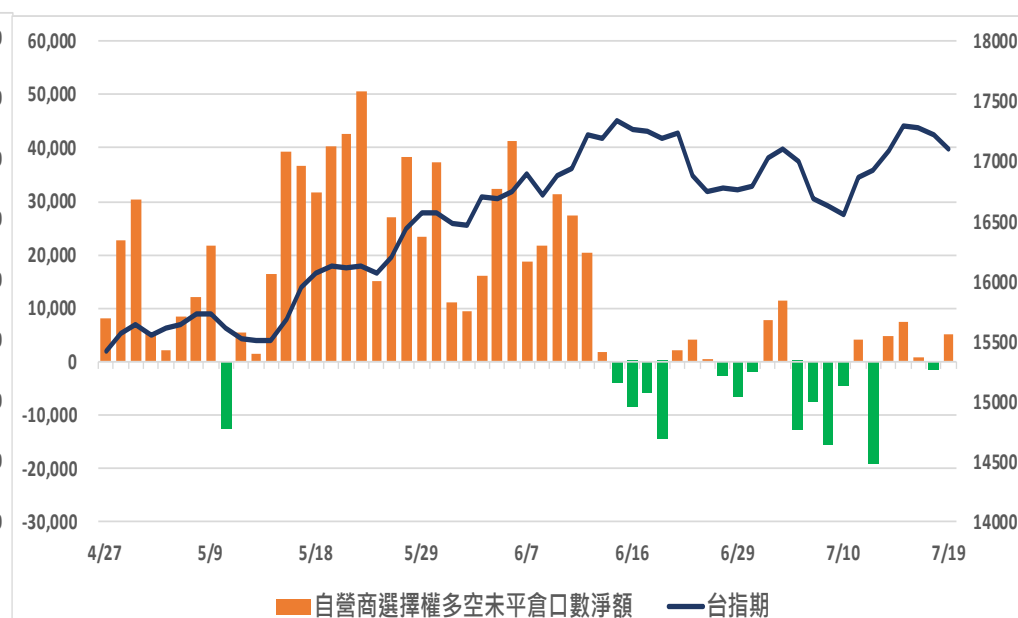
更新日期：2023年7月19日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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
2023/7/13	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
2023/7/19	17102	5,039	+6,620	62,606	+223,195

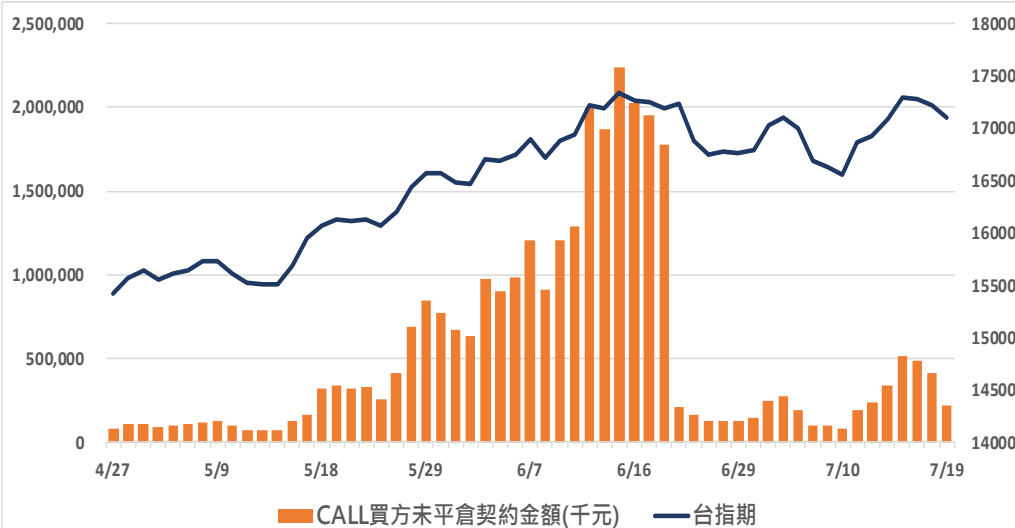
更新日期：2023年7月19日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



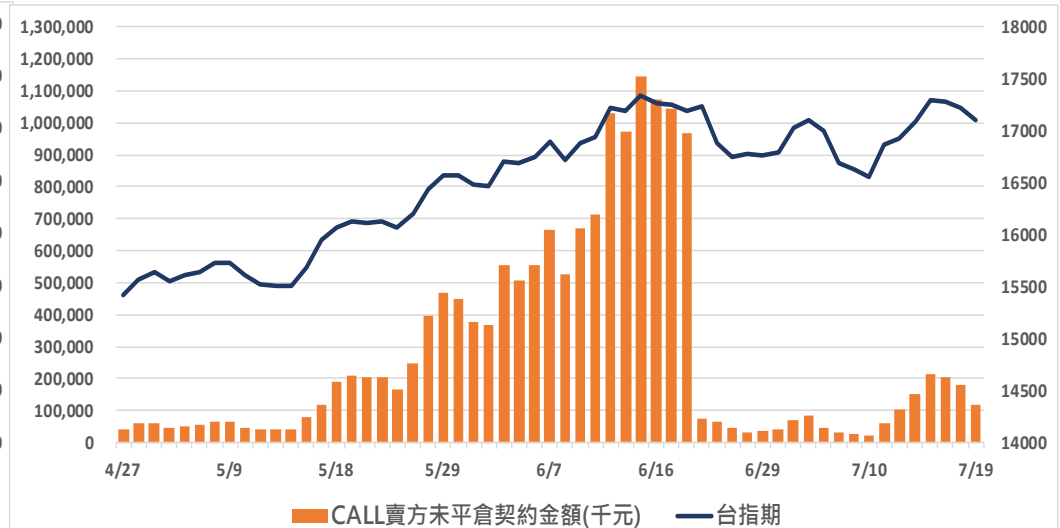
凱基期貨
KGI FUTURES

外資選擇權未平倉金額

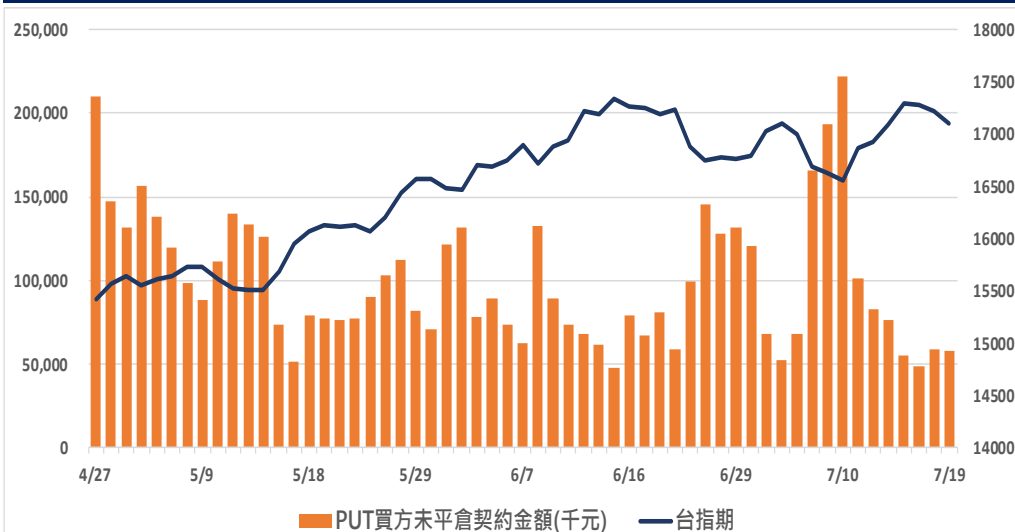
Buy Call未平倉金額



Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



Sell Put未平倉金額



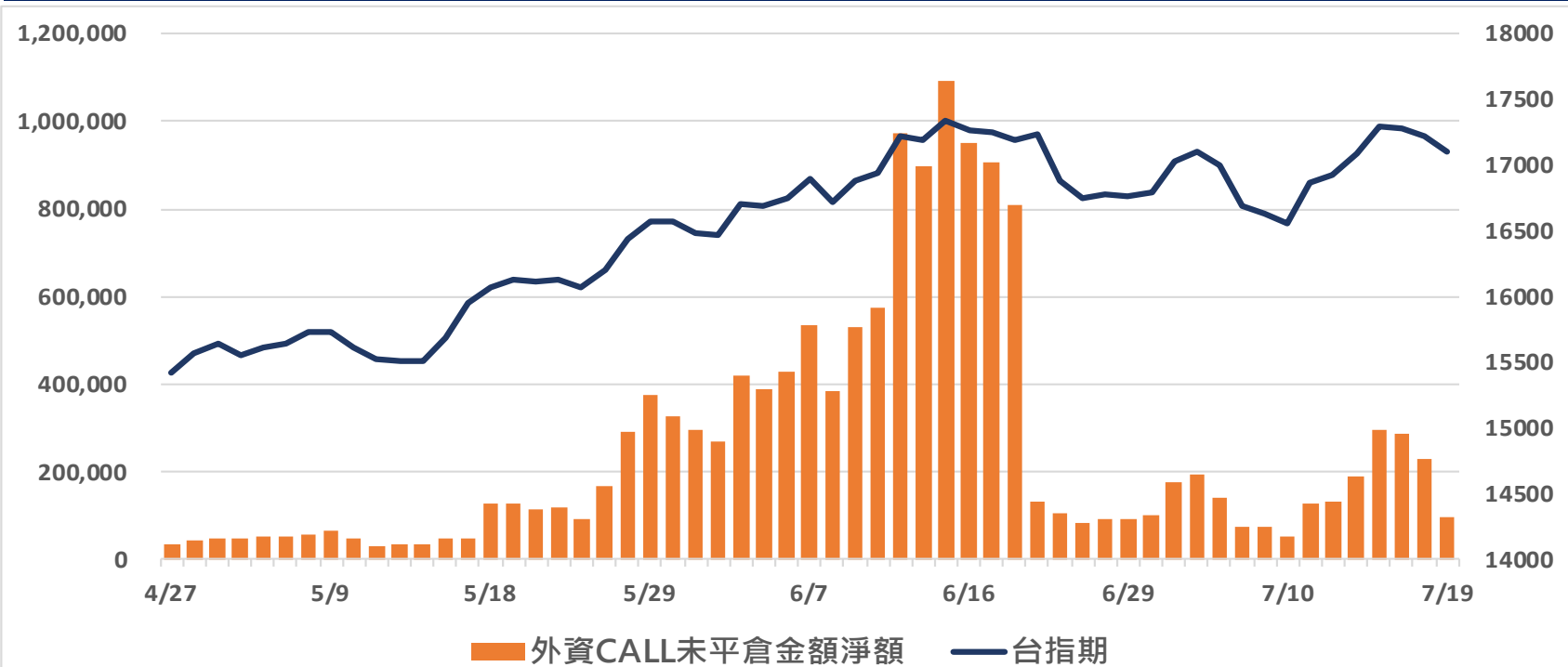
更新日期：2023年7月19日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



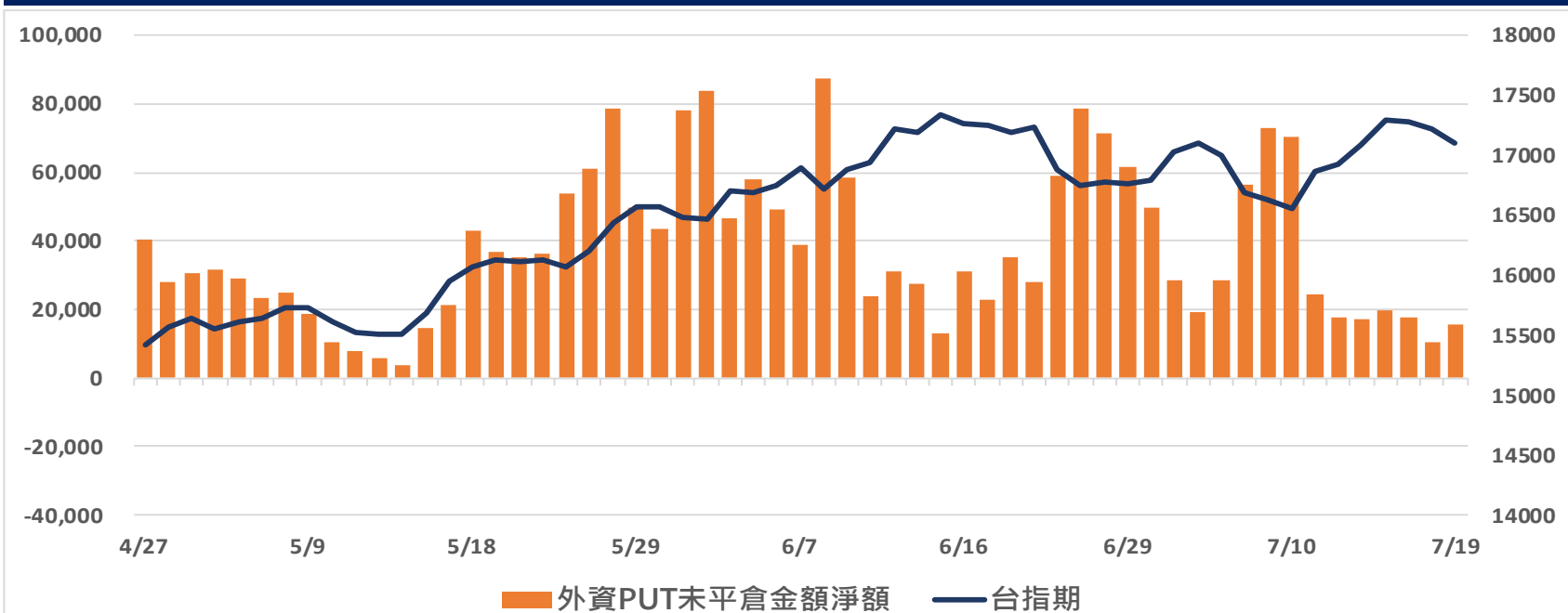
凱基期貨
KGI FUTURES

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19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