

台指選擇權OI

日期：2023/7/20 結算日：2023/7/26					日期：2023/7/20 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	2	16,500	2,380	1,382	1	163	16,000	4,029	110
0	7	16,600	3,748	2,456	0	13	16,100	1,737	78
1	14	16,650	4,432	3,421	0	36	16,200	1,631	353
6	50	16,700	6,860	4,266	0	57	16,300	1,973	-246
2	8	16,750	3,339	2,056	3	34	16,400	2,582	76
15	61	16,800	6,813	4,358	6	244	16,500	2,838	917
13	34	16,850	5,127	3,236	-7	475	16,600	2,346	73
21	148	16,900	5,007	2,897	-2	311	16,700	1,547	252
177	237	16,950	3,882	2,300	122	561	16,800	1,499	132
439	898	17,000	6,439	3,402	12	390	16,900	1,350	-84
396	701	17,050	3,771	2,133	144	2,883	17,000	2,005	79
1,912	2,920	17,100	4,919	2,481	285	2,279	17,100	2,815	597
1,114	2,097	17,150	1,348	494	263	1,800	17,200	1,325	202
1,334	3,100	17,200	1,645	580	304	3,160	17,300	510	182
1,141	2,673	17,250	542	75	334	2,857	17,400	248	45
2,382	4,212	17,300	720	331	528	4,319	17,500	123	3
1,369	3,946	17,350	256	90	27	4,289	17,600	41	1
※ 6,421	8,892	17,400	226	63	※ 326	3,442	17,700	6	1
4,004	6,197	17,450	89	8	744	3,147	17,800	2	0
4,422	8,404	17,500	56	-9	345	2,229	17,900	0	0
1,643	4,008	17,550	19	3	389	1,967	18,000	8	0
2,508	5,798	17,600	29	15	182	862	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
30,111	67,279	1.0931	73,541	40,610	4,948	45,687	0.8657	39,553	3,437
昨日 P/C	0.8591	今日增減變化		0.2340	昨日 P/C	0.8865	今日增減變化		-0.0208

更新日期：2023年7月20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	121,823,066	103,079,418	18,743,648	8,049,587	982,872	1,901,790	-918,918	-147,325
投信	43,443,437	41,314,762	2,128,675	-1,361,332	1,295,910	0	1,295,910	-125,977
自營商	9,661,386	39,422,426	-29,761,040	-1,163,674	336,600	1,201,662	-865,062	-36,186
	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	1,744,563	1,619,156	125,407	153,961	9,049	0	9,049	9,049
投信	28,087	0	28,087	5,099	0	0	0	0
自營商	147,046	1,062,207	-915,161	-37,331	21,101	63,328	-42,227	16,234

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	23,419	10,512	12,907	4,145	18,486	9,387	9,099	3,193
投信	200	250	-50	-50	150	102	48	150
自營商	50,883	36,720	14,163	5,692	38,816	36,372	2,444	-988
特定法人(週)	1,512	0	1,512	1,512	0	2,477	-2,477	-910
特定法人(近月)	13,987	4,442	9,545	2,185	4,542	6,934	-2,392	-1,581
特定法人(全月)	14,547	3,299	11,248	3,305	3,299	11,791	-8,492	-4,217
十大交易人(週)	30,813	25,361	5,452	4,553	27,656	23,678	3,978	1,396
十大交易人(近月)	23,340	22,112	1,228	617	15,949	18,682	-2,733	1,941
十大交易人(全月)	60,327	49,088	11,239	6,655	43,654	47,001	-3,347	1,463
全市場未沖銷(近月)			45,687	4,948			39,553	3,437
全市場未沖銷(全月)			142,023	40,820			137,618	50,904

更新日期：2023年7月20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

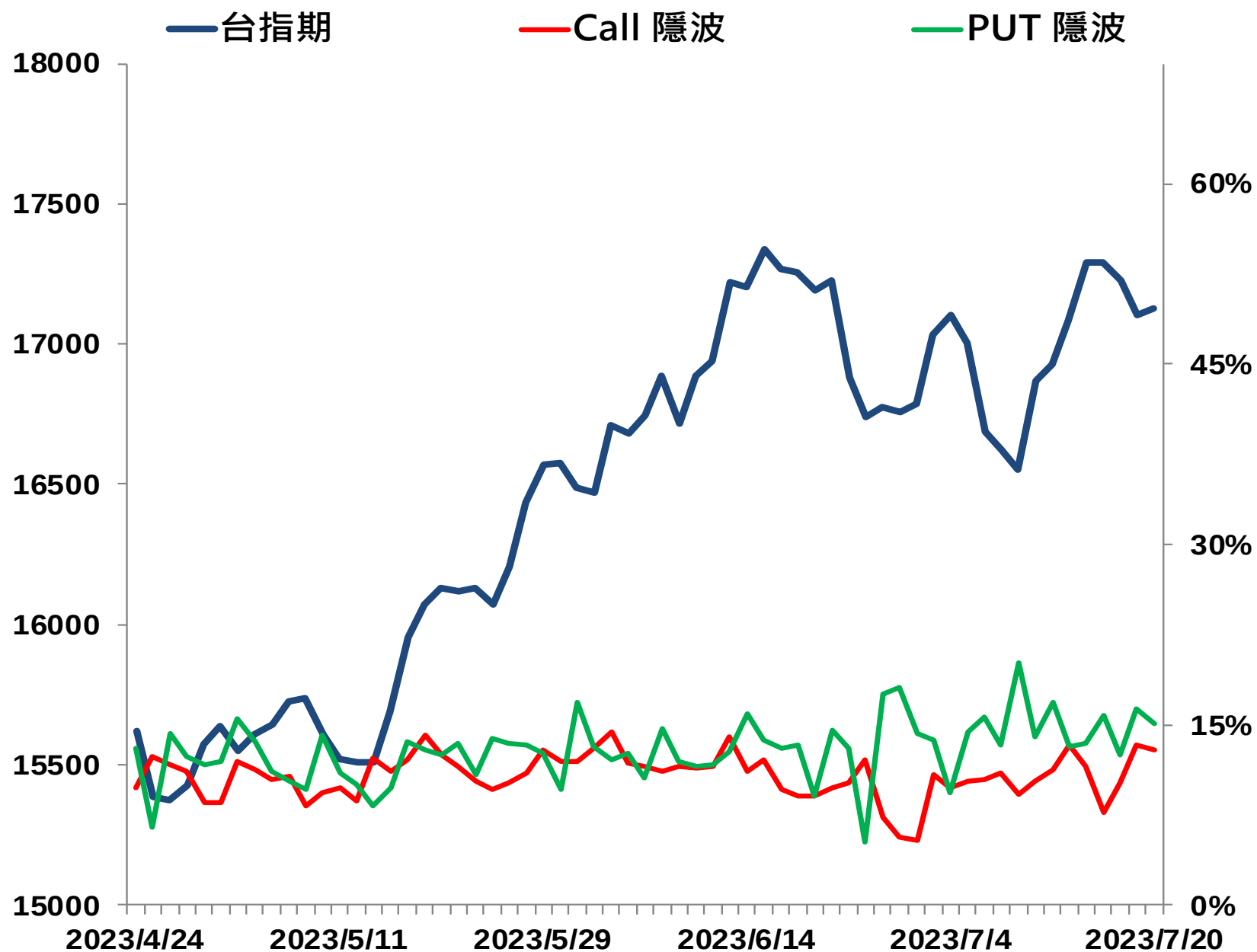


更新日期：2023年7月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考



凱基期貨
KGI FUTURES

台指近月隱含波動度



更新日期：2023年7月20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

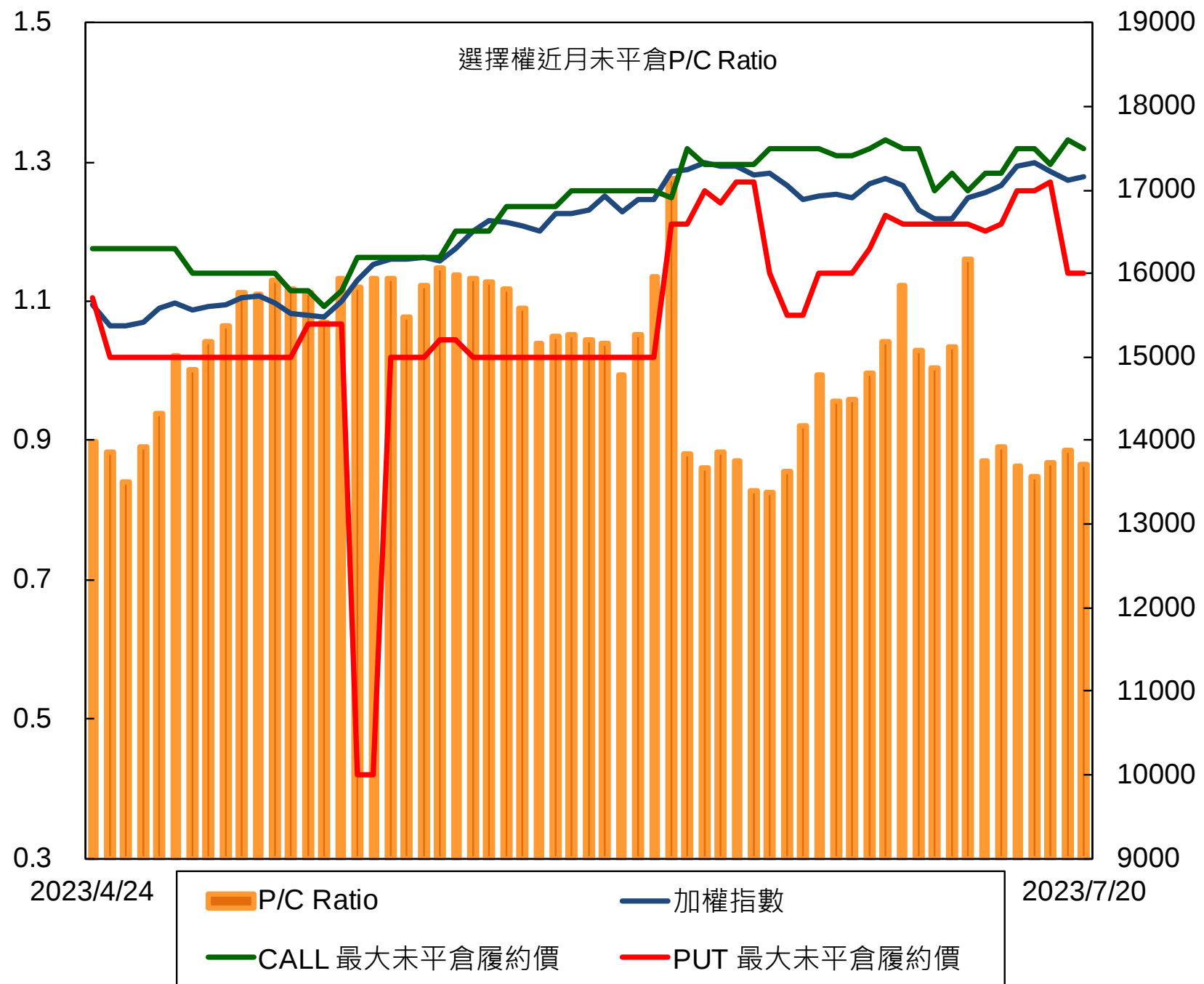
	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	7月19日	41,039	32,568	8,471
	7月20日	50,883	36,720	14,163
Put	7月19日	30,076	26,644	3,432
	7月20日	38,816	36,372	2,444

更新日期：2023年7月20日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



凱基期貨
KGI FUTURES

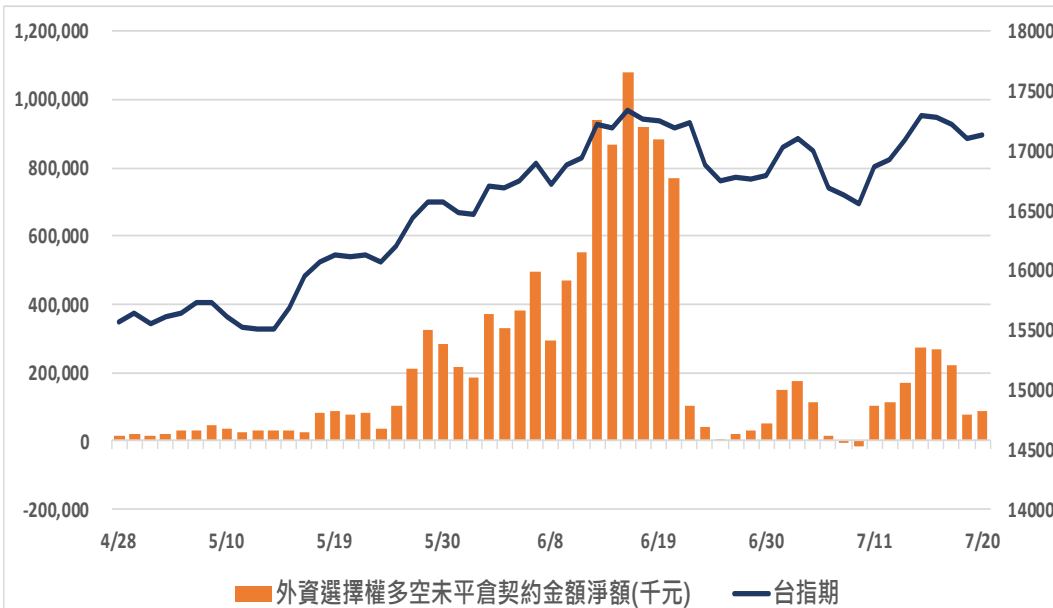
選擇權近月未平倉P/C Ratio



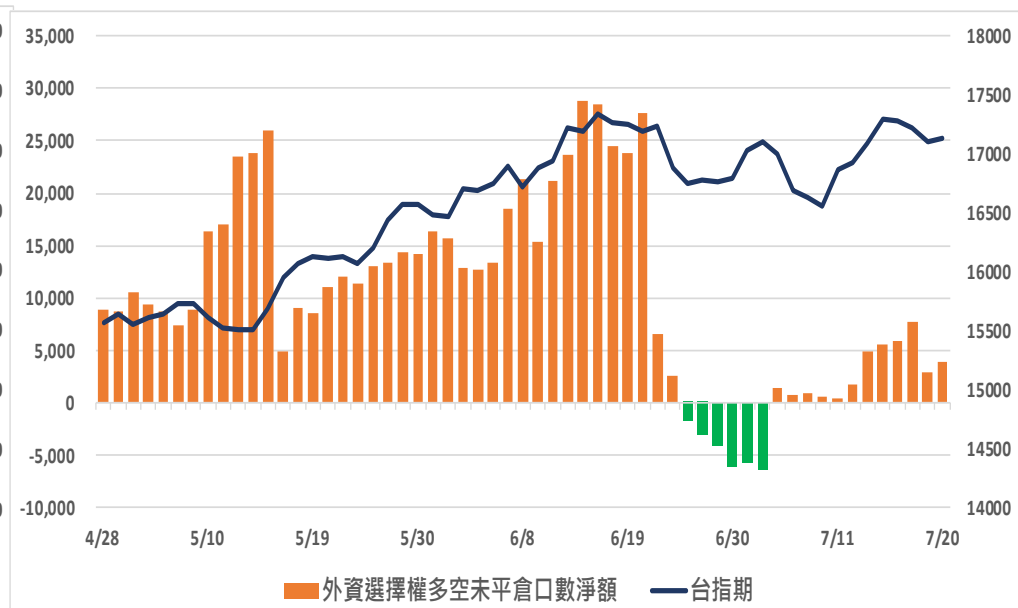
更新日期：2023年7月20日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



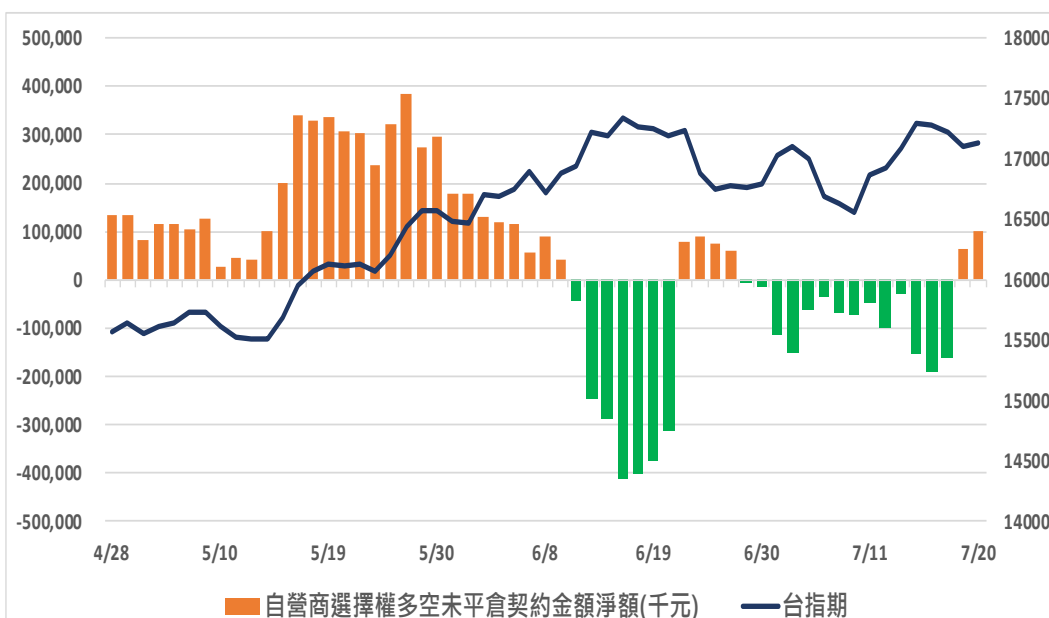
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/14	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
2023/7/20	17126	3,808	+952	89,223	+11,362

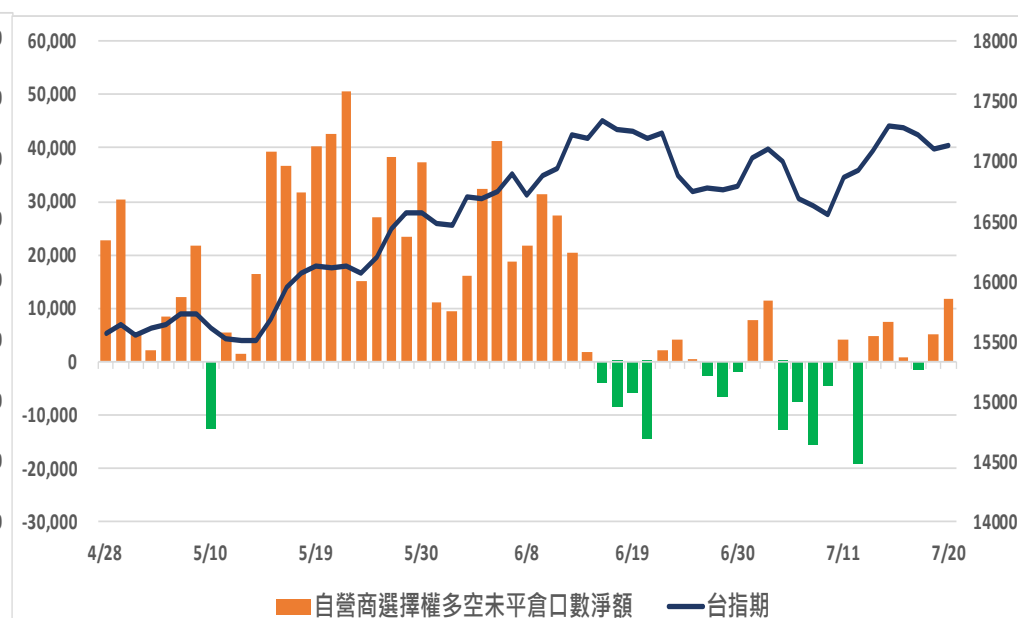
更新日期：2023年7月20日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



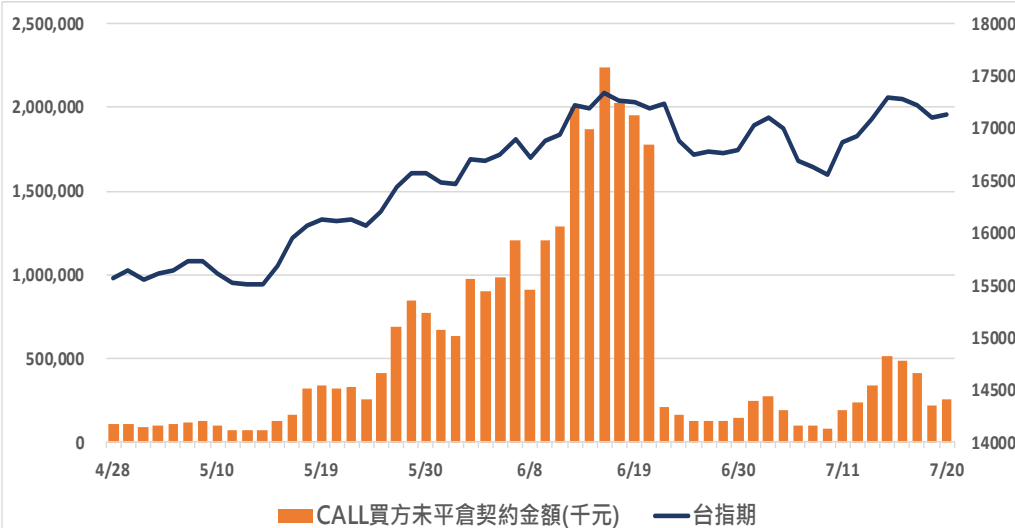
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/14	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
2023/7/20	17126	11,719	+6,680	101,177	+38,571

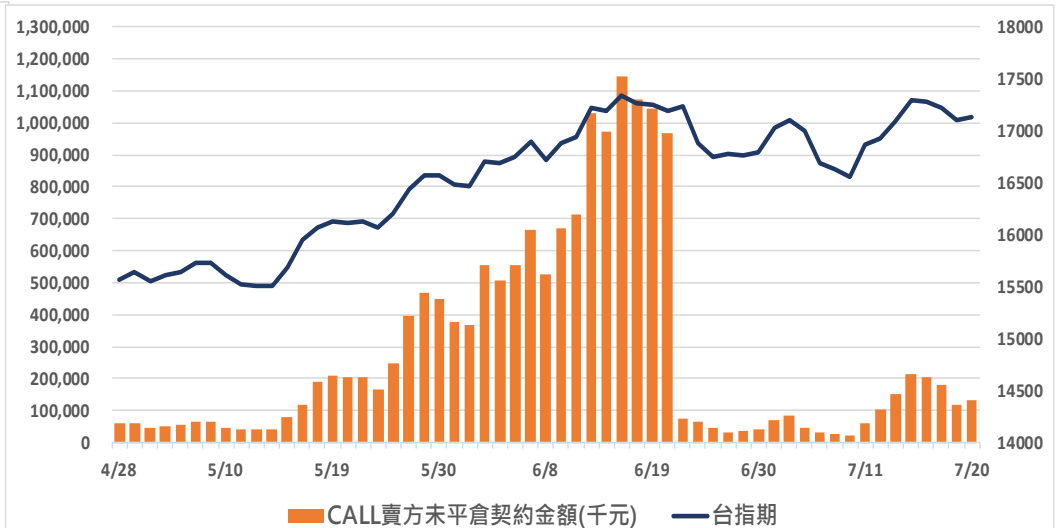
更新日期：2023年7月20日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

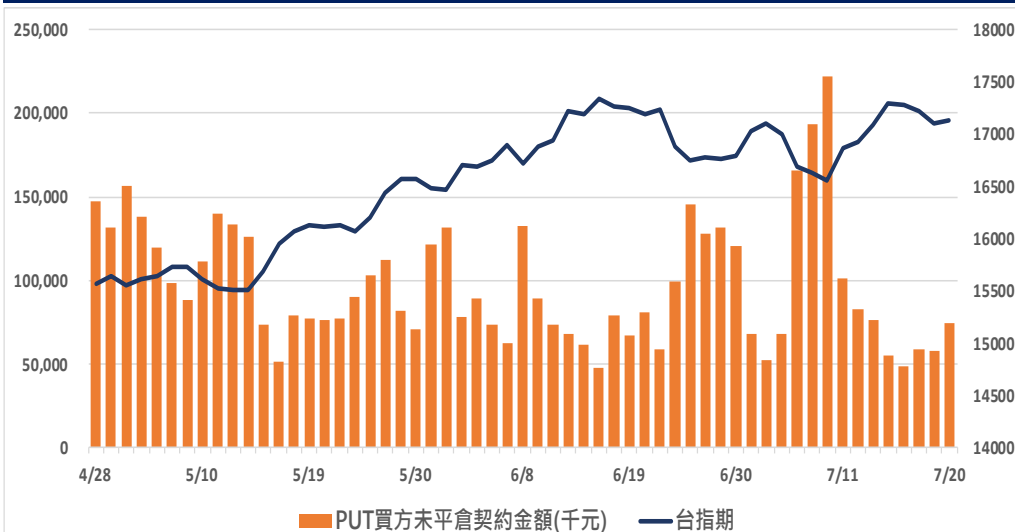
Buy Call未平倉金額



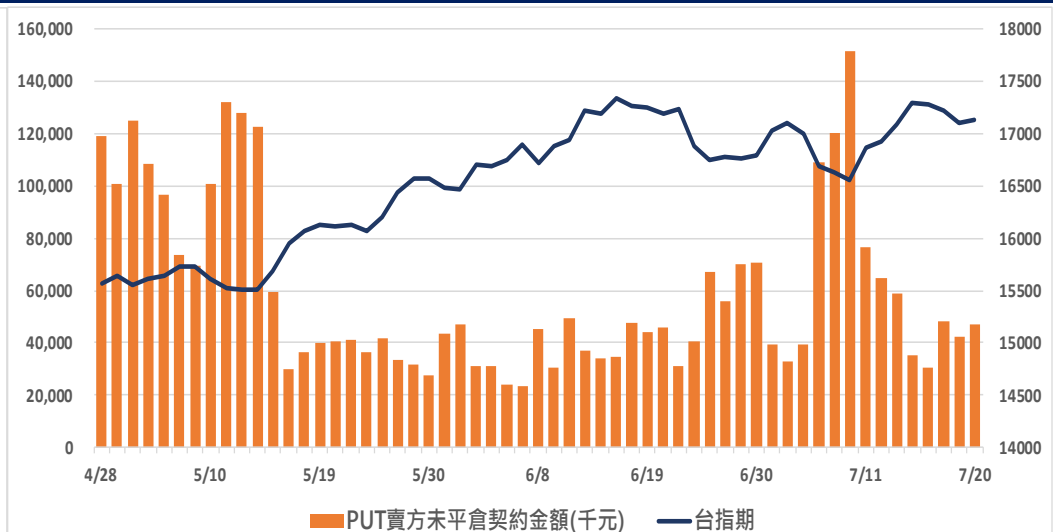
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



Sell Put未平倉金額



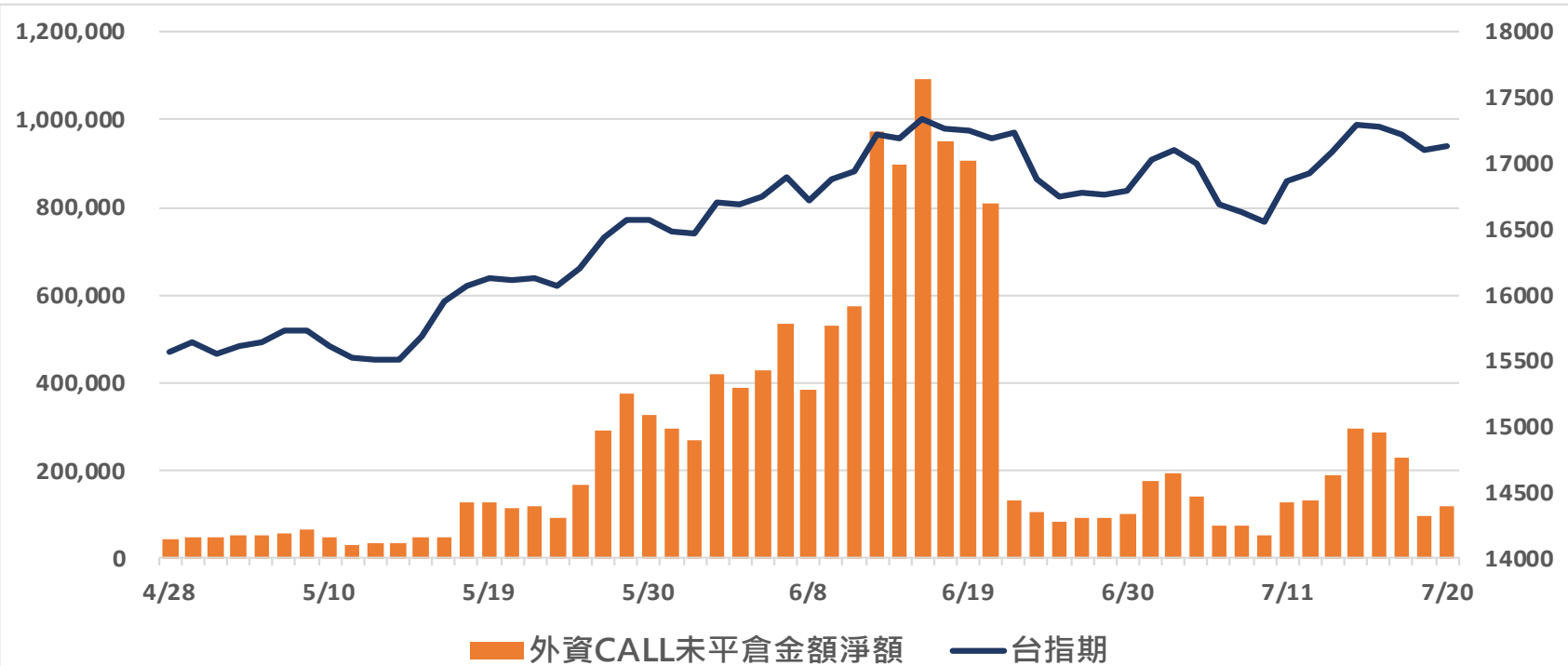
更新日期：2023年7月20日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



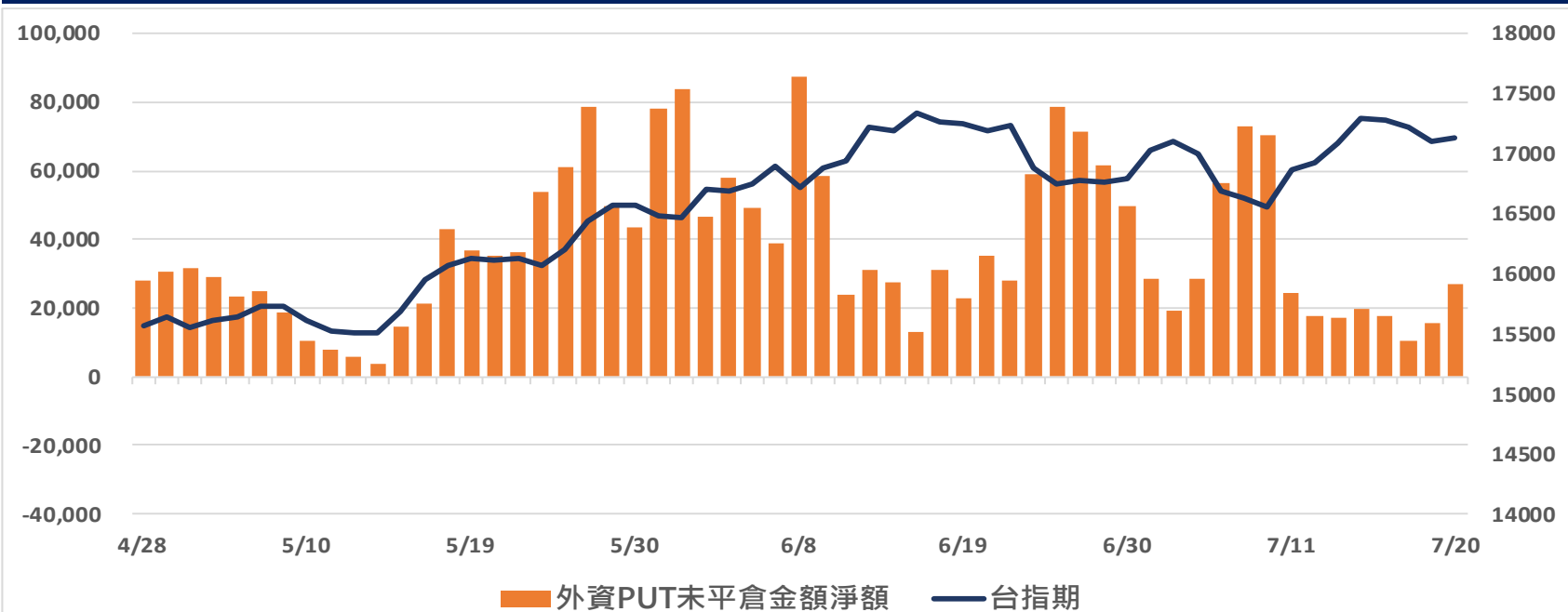
凱基期貨
KGI FUTURES

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20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