

台指選擇權 OI

日期：2023/7/21 結算日：2023/7/26					日期：2023/7/21 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	
2	13	16,300	3,460	1,212	2	9	15,800	1,173	93	
2	2	16,400	3,272	1,335	1	27	15,900	1,010	183	
1	3	16,500	5,004	2,624	※	1	164	16,000	4,665	636
5	12	16,600	5,949	2,201	1	14	16,100	1,991	254	
40	54	16,650	5,333	901	2	38	16,200	1,942	311	
68	118	16,700	8,539	1,679	3	60	16,300	2,653	680	
127	135	16,750	5,490	2,151	-3	31	16,400	3,014	432	
554	615	16,800	8,078	1,265	-10	234	16,500	2,921	83	
509	543	16,850	6,546	1,419	85	560	16,600	2,408	62	
1,064	1,212	16,900	6,332	1,325	26	337	16,700	1,533	-14	
1,110	1,347	16,950	4,618	736	208	769	16,800	1,457	-42	
3,423	4,321	17,000	6,798	359	881	1,271	16,900	1,958	608	
4,091	4,792	17,050	2,791	-980	※	1,912	4,795	17,000	1,987	-18
5,668	8,588	17,100	3,992	-927	393	2,672	17,100	2,721	-94	
4,555	6,652	17,150	1,190	-158	1,060	2,860	17,200	1,308	-17	
※	6,731	17,200	913	-732	1,412	4,572	17,300	496	-14	
5,145	7,818	17,250	609	67	550	3,407	17,400	210	-38	
6,093	10,305	17,300	461	-259	662	4,981	17,500	123	0	
3,230	7,176	17,350	188	-68	465	4,754	17,600	53	12	
161	9,053	17,400	201	-25	-152	3,290	17,700	7	1	
-892	5,305	17,450	70	-19	-107	3,040	17,800	2	0	
-3,296	5,108	17,500	53	-3	35	2,264	17,900	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	
35,846	103,125	0.8691	89,631	16,090	7,800	53,487	0.8660	46,322	6,769	
昨日 P/C	1.0931	今日增減變化	-0.2240		昨日 P/C	0.8657	今日增減變化	0.0003		

更新日期：2023年7月21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	116,302,452	114,488,583	1,813,869	-16,929,779	873,739	1,780,699	-906,960	11,958
投信	43,124,551	41,401,521	1,723,030	-405,645	1,249,147	0	1,249,147	-46,763
自營商	12,437,951	36,886,347	-24,448,396	5,312,644	259,126	1,225,881	-966,755	-101,693
	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	1,687,150	1,667,239	19,911	-105,496	9,002	0	9,002	-47
投信	27,924	0	27,924	-163	0	0	0	0
自營商	128,123	1,123,735	-995,612	-80,451	0	46,512	-46,512	-4,285

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	28,462	11,920	16,542	3,635	21,299	10,544	10,755	1,656
投信	200	50	150	200	100	102	-2	-50
自營商	57,264	51,043	6,221	-7,942	46,684	38,247	8,437	5,993
特定法人(週)	1,957	0	1,957	445	0	2,975	-2,975	-498
特定法人(近月)	16,507	4,442	12,065	2,520	4,536	7,975	-3,439	-1,047
特定法人(全月)	18,509	3,299	15,210	3,962	3,299	13,587	-10,288	-1,796
十大交易人(週)	38,016	37,324	692	-4,760	29,884	26,812	3,072	-906
十大交易人(近月)	27,210	27,078	132	-1,096	17,275	23,558	-6,283	-3,550
十大交易人(全月)	69,434	59,955	9,479	-1,760	47,072	55,466	-8,394	-5,047
全市場未沖銷(近月)			53,487	7,800			46,322	6,769
全市場未沖銷(全月)			190,761	48,738			166,474	28,856

更新日期：2023年7月21日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

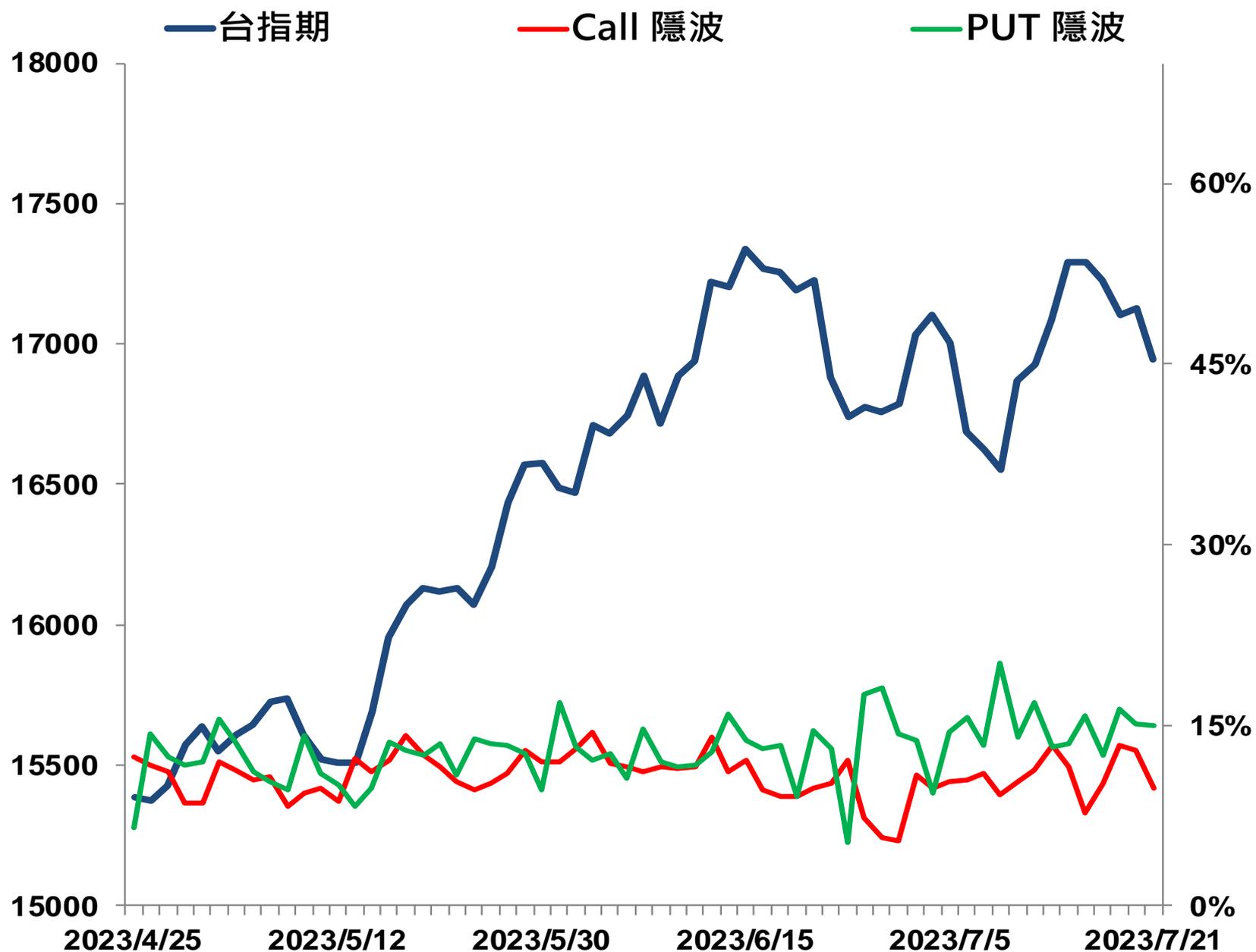
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年7月21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21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

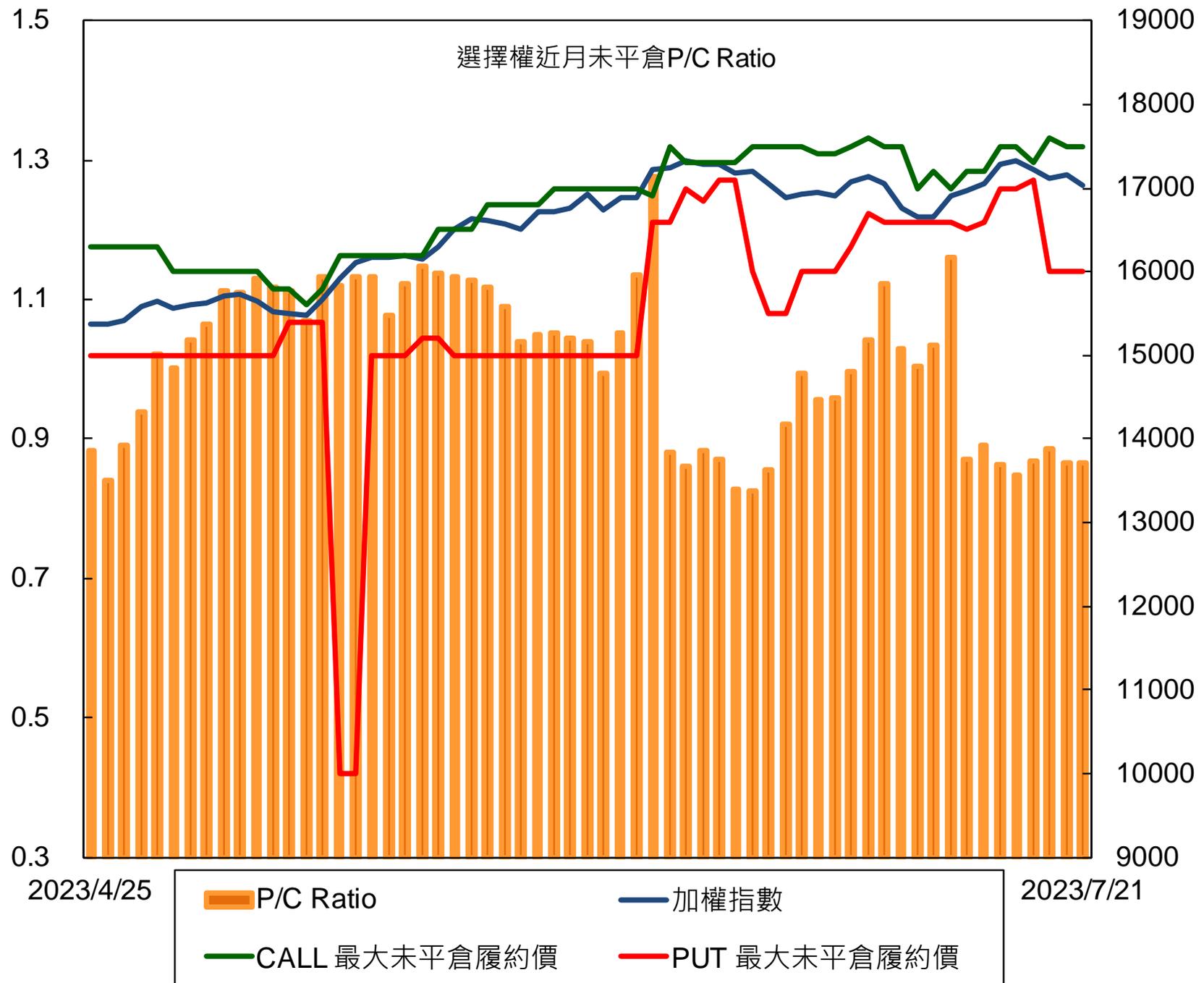
自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	7月20日	50,883	36,720	14,163
	7月21日	57,264	51,043	6,221
Put	7月20日	38,816	36,372	2,444
	7月21日	46,684	38,247	8,437

更新日期：2023年7月21日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



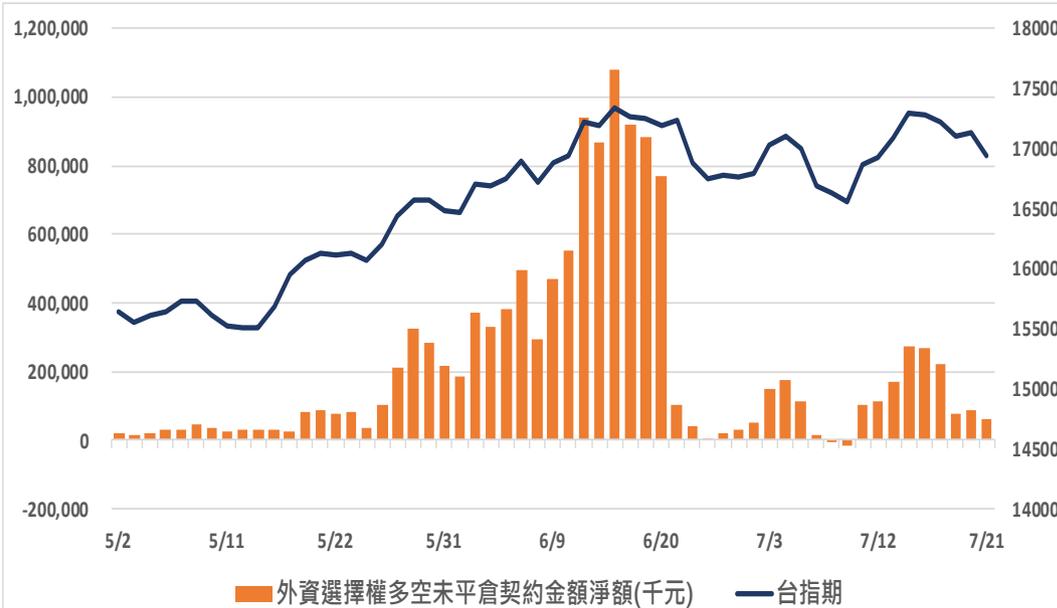
選擇權近月未平倉P/C Ratio



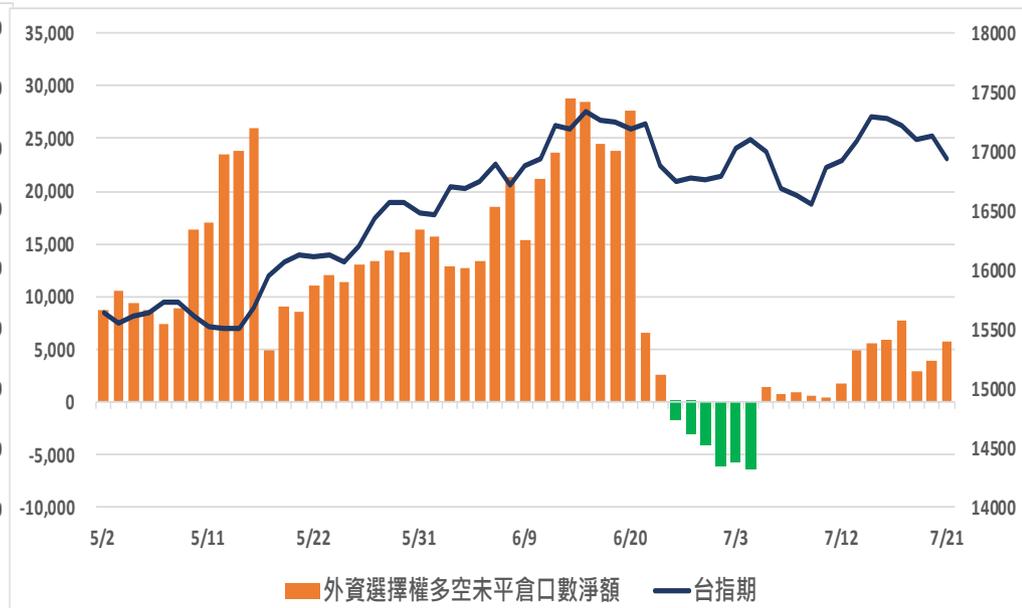
更新日期：2023年7月21日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



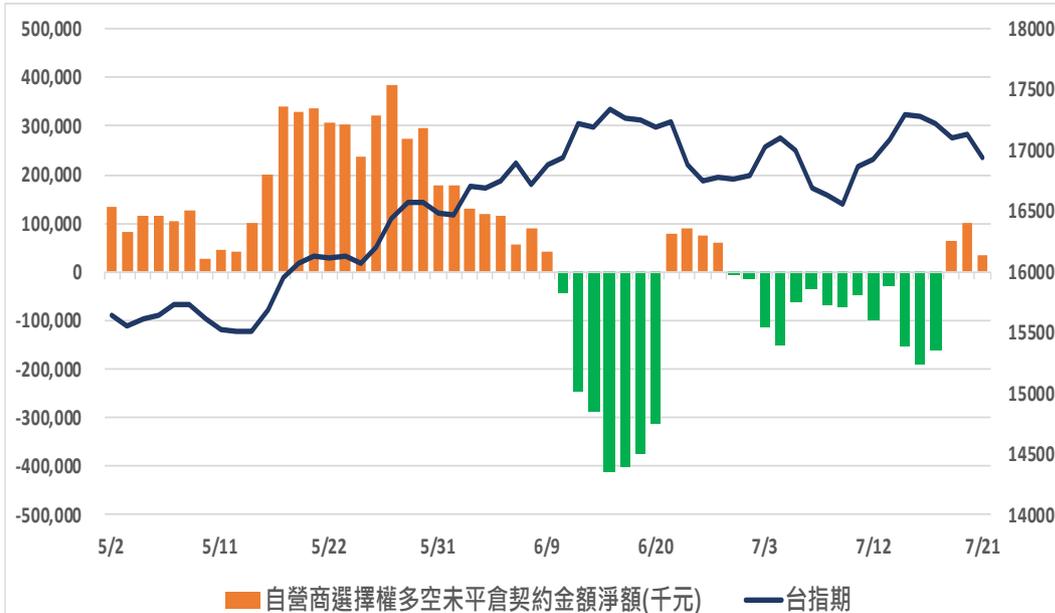
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/17	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
2023/7/21	16947	5,787	+1,979	63,676	-25,547

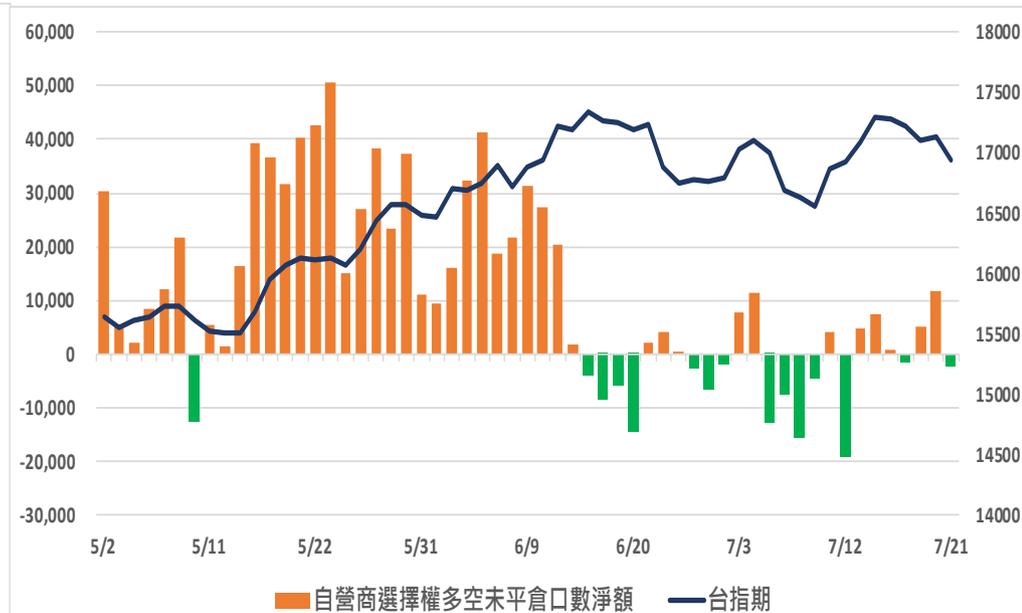
更新日期：2023年7月21日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



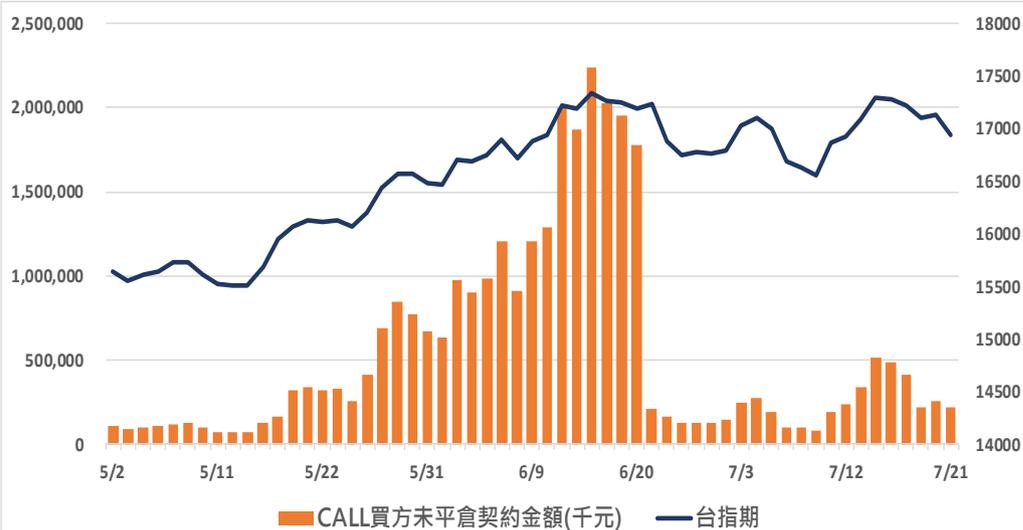
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/17	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
2023/7/21	16947	-2,216	-13,935	34,630	-66,547

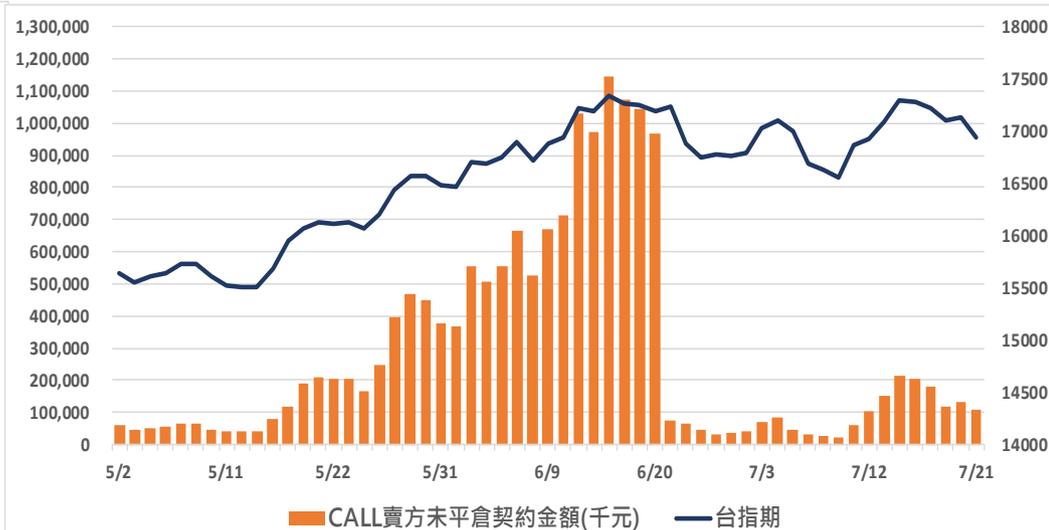
更新日期：2023年7月21日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

Buy Call未平倉金額



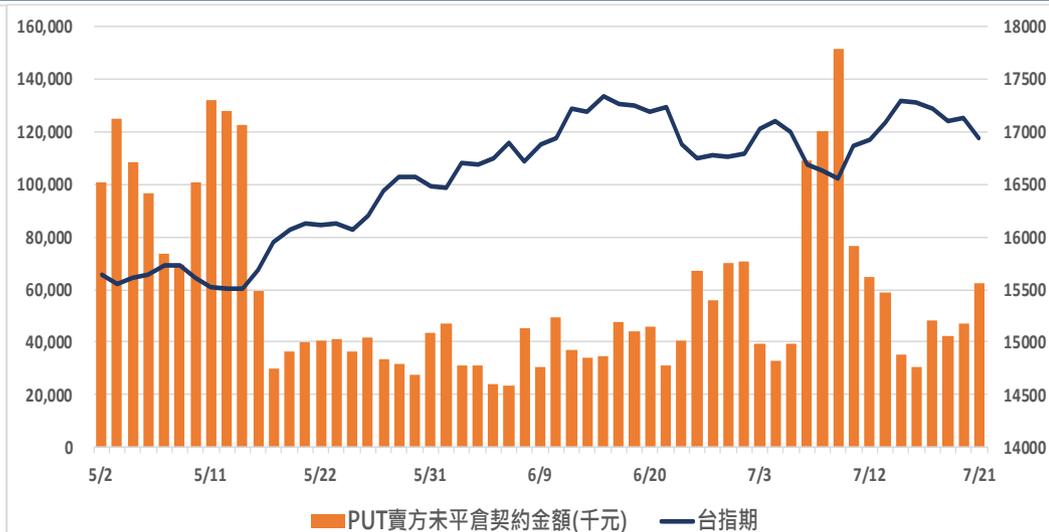
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



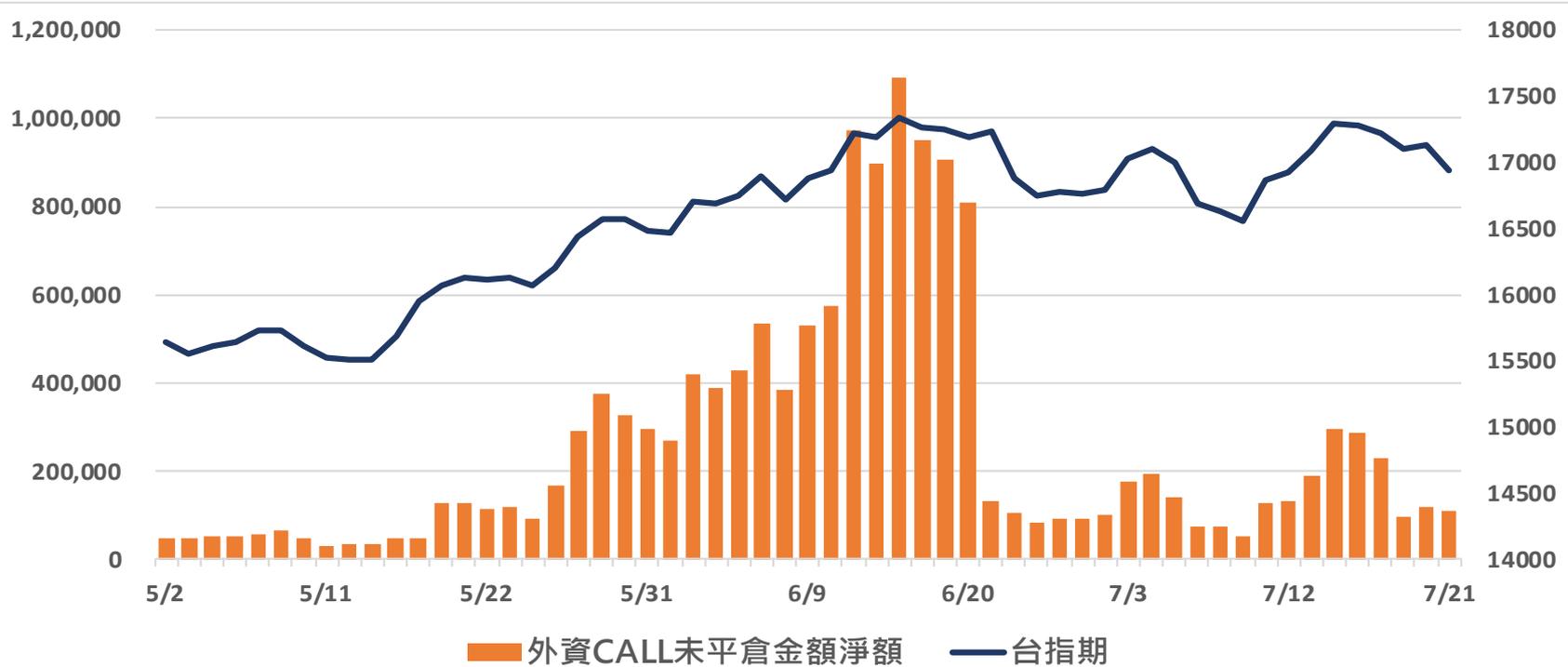
Sell Put未平倉金額



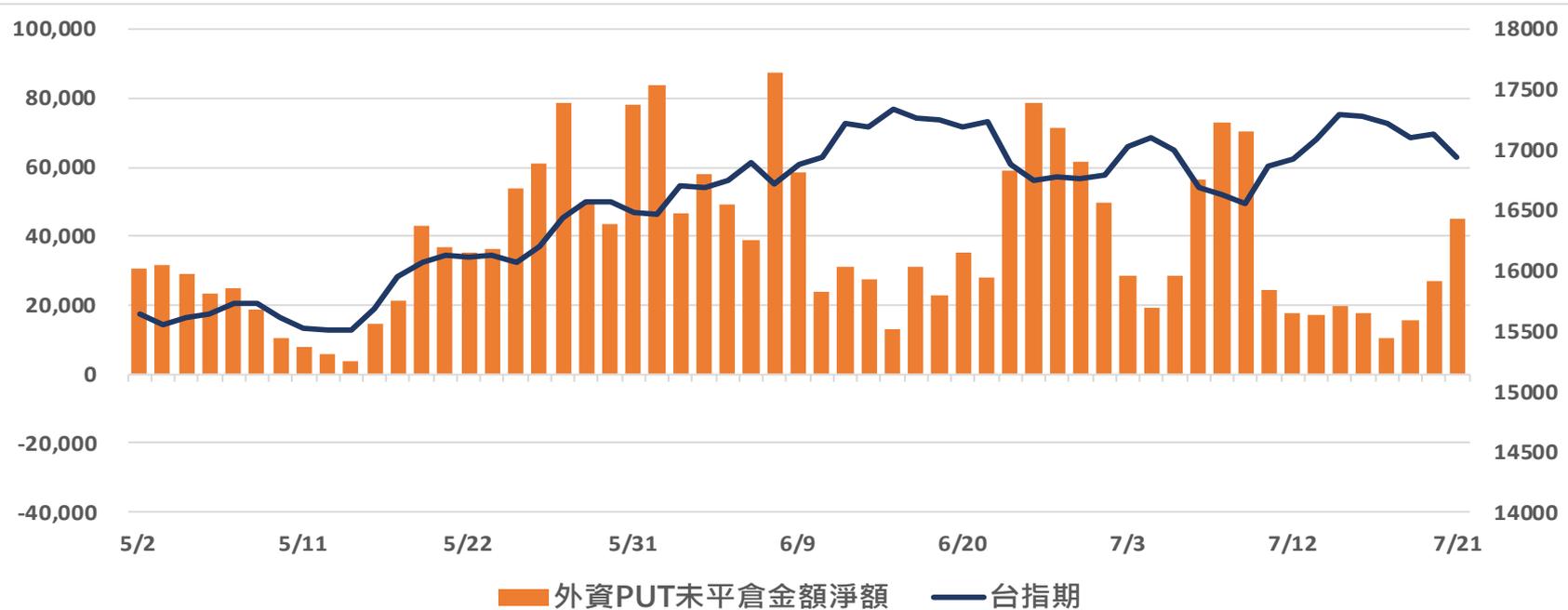
更新日期：2023年7月21日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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21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