

台指選擇權OI

日期：2023/7/24 結算日：2023/7/26					日期：2023/7/24 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	16,400	3,564	292	0	9	15,800	1,056	-117
0	3	16,500	6,489	1,485	0	27	15,900	1,135	125
0	4	16,550	4,245	58	-1	163	16,000	4,784	119
-2	10	16,600	5,800	-149	0	14	16,100	2,215	224
6	60	16,650	6,182	849	0	38	16,200	2,145	203
67	185	16,700	8,779	240	0	60	16,300	2,747	94
-25	110	16,750	6,345	855	0	31	16,400	3,237	223
134	749	16,800	8,894	816	-4	230	16,500	3,031	110
-50	493	16,850	8,577	2,031	8	568	16,600	2,456	48
284	1,496	16,900	8,184	1,852	-26	311	16,700	2,165	632
668	2,015	16,950	6,561	1,943	1	770	16,800	2,087	630
797	5,118	17,000	8,018	1,220	22	1,293	16,900	2,180	222
1,828	6,620	17,050	4,064	1,273	10	4,805	17,000	2,112	125
1,792	10,380	17,100	3,459	-533	105	2,777	17,100	2,989	268
524	7,176	17,150	958	-232	174	3,034	17,200	1,365	57
2,133	11,964	17,200	751	-162	292	4,864	17,300	558	62
2,193	10,011	17,250	519	-90	210	3,617	17,400	237	27
437	10,742	17,300	374	-87	457	5,438	17,500	130	7
829	8,005	17,350	168	-20	324	5,078	17,600	48	-5
-139	8,914	17,400	195	-6	133	3,423	17,700	7	0
17	5,322	17,450	62	-8	-64	2,976	17,800	2	0
504	5,612	17,500	51	-2	-223	2,041	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
11,711	114,840	0.9173	105,339	11,521	1,535	55,022	0.9001	49,524	3,202
昨日 P/C	0.8691	今日增減變化		0.0482	昨日 P/C	0.8660	今日增減變化		0.0340

更新日期：2023年7月24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	122,250,669	107,716,063	14,534,606	12,720,737	930,744	1,998,756	-1,068,012	-161,052
投信	43,097,244	41,472,905	1,624,339	-98,691	1,426,248	0	1,426,248	177,101
自營商	11,045,845	36,479,332	-25,433,487	-985,091	398,379	1,362,577	-964,198	2,557
	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	1,742,562	1,546,946	195,616	175,705	32,789	1,490	31,299	22,297
投信	27,741	0	27,741	-183	0	0	0	0
自營商	81,589	1,168,170	-1,086,581	-90,969	10,422	81,961	-71,539	-25,027

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	29,709	12,270	17,439	897	22,041	12,629	9,412	-1,343
投信	200	200	0	-150	350	102	248	250
自營商	65,404	52,909	12,495	6,274	49,609	39,087	10,522	2,085
特定法人(週)	3,515	0	3,515	1,558	0	1,438	-1,438	1,537
特定法人(近月)	16,788	4,528	12,260	195	4,536	7,744	-3,208	231
特定法人(全月)	16,240	3,299	12,941	-2,269	3,299	14,805	-11,506	-1,218
十大交易人(週)	44,942	37,189	7,753	7,061	29,785	28,414	1,371	-1,701
十大交易人(近月)	26,890	27,646	-756	-888	18,420	24,260	-5,840	443
十大交易人(全月)	76,591	60,439	16,152	6,673	47,419	58,814	-11,395	-3,001
全市場未沖銷(近月)			55,022	1,535			49,524	3,202
全市場未沖銷(全月)			210,717	19,956			186,669	20,195

更新日期：2023年7月24日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

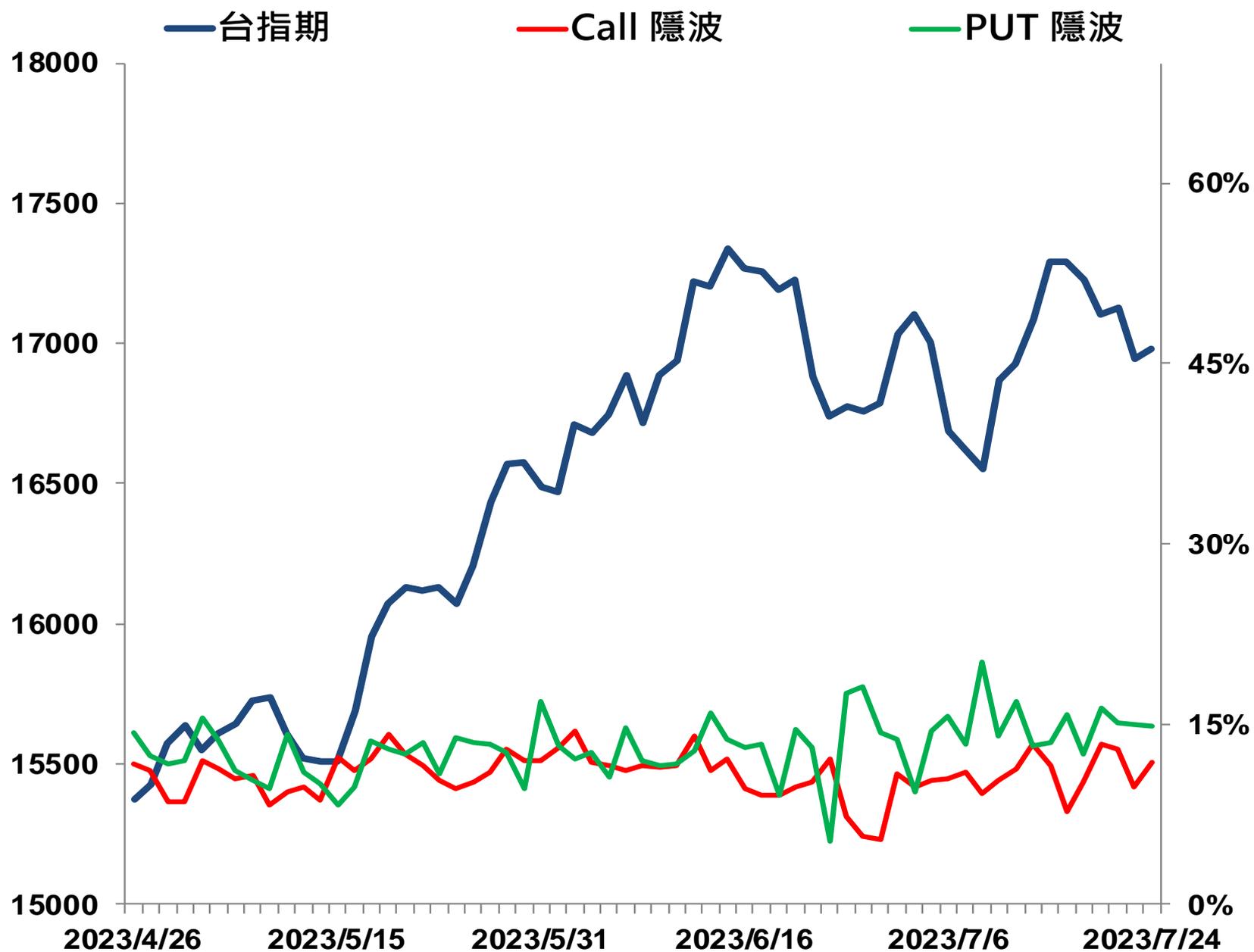
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年7月24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24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

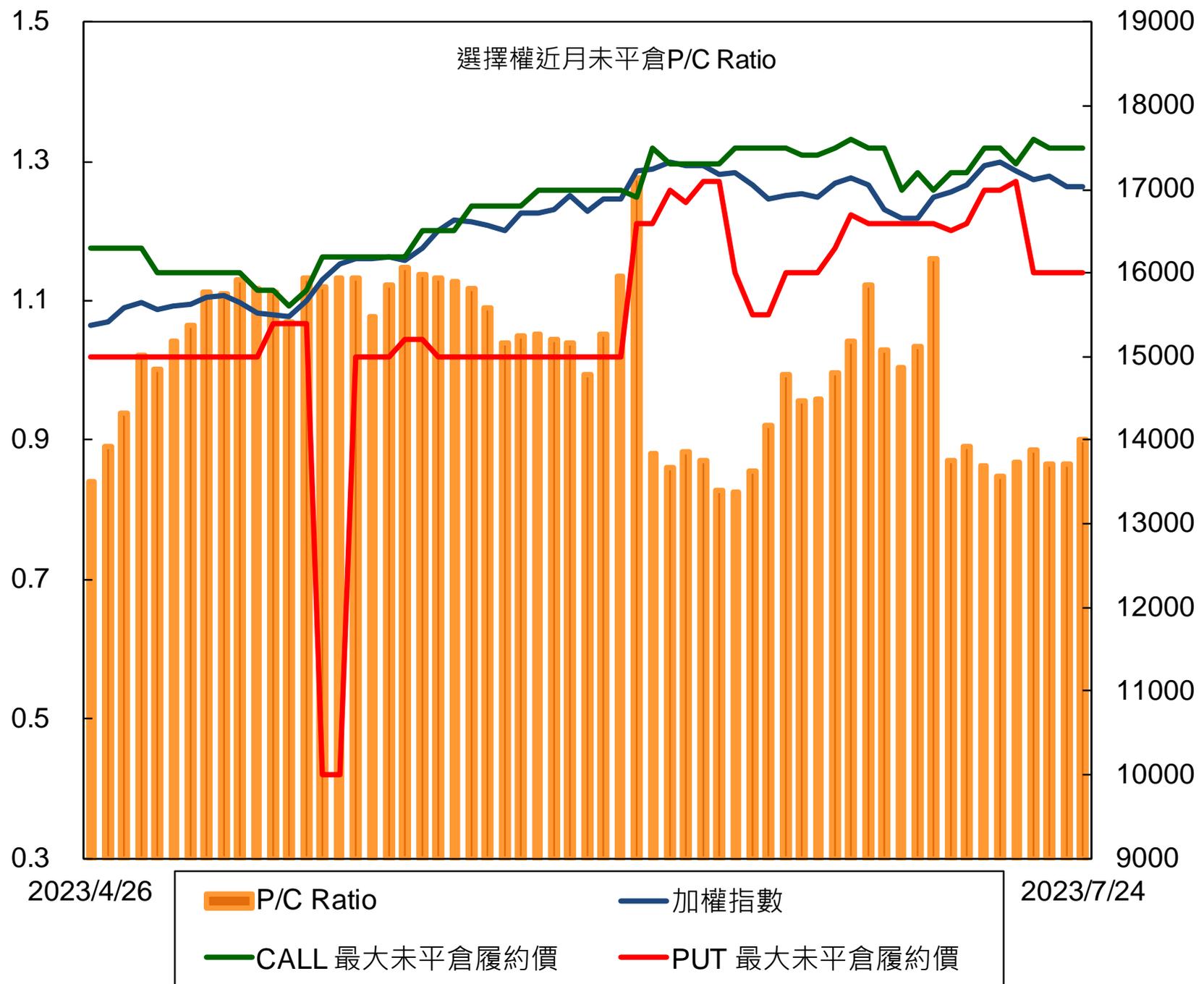
自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	7月21日	57,264	51,043	6,221
	7月24日	65,404	52,909	12,495
Put	7月21日	46,684	38,247	8,437
	7月24日	49,609	39,087	10,522

更新日期：2023年7月24日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



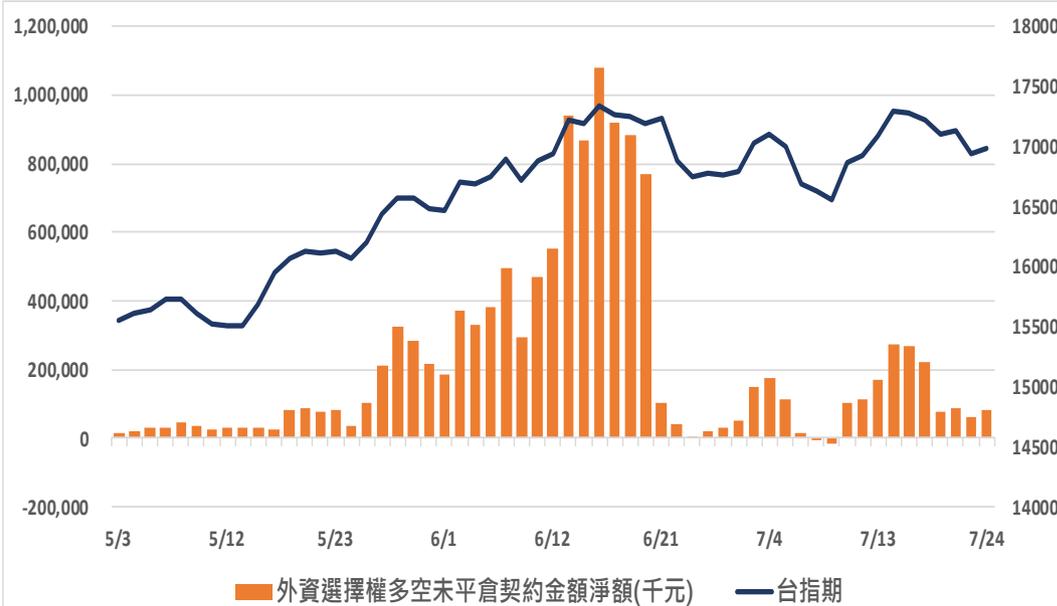
選擇權近月未平倉P/C Ratio



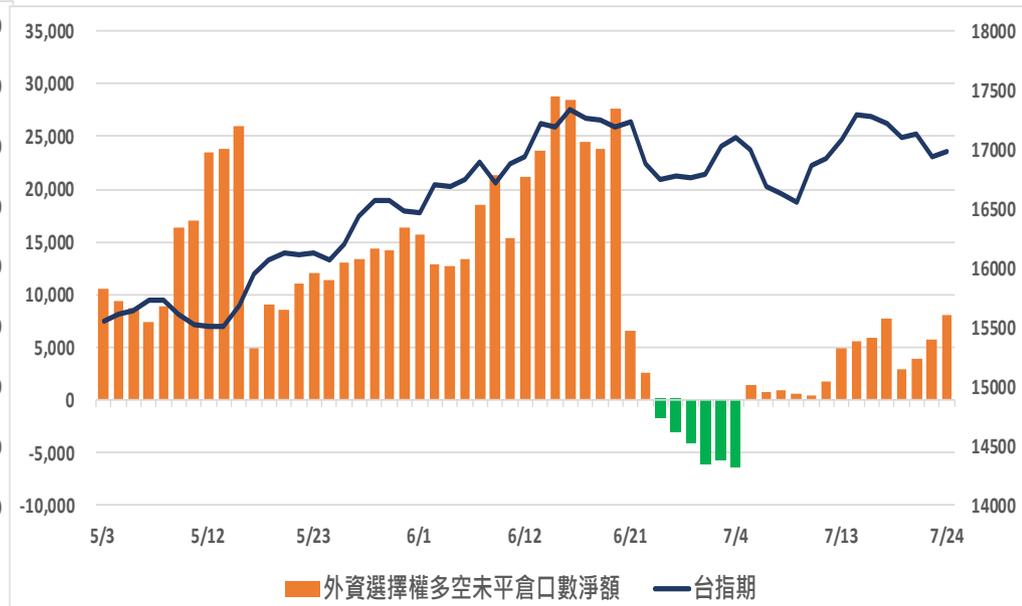
更新日期：2023年7月24日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



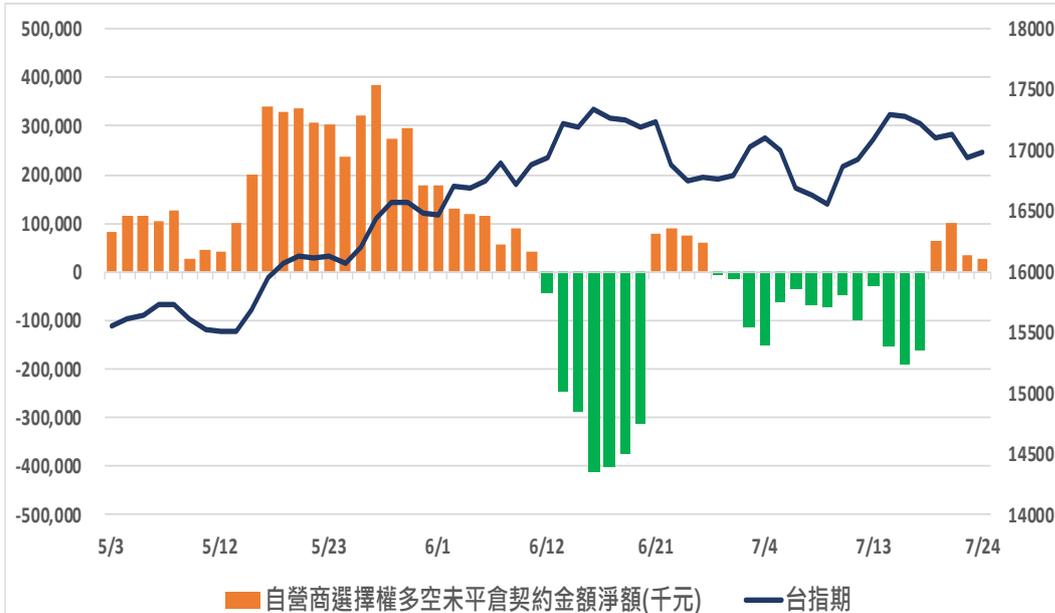
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/18	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
2023/7/24	16979	8,027	+2,240	83,205	+19,529

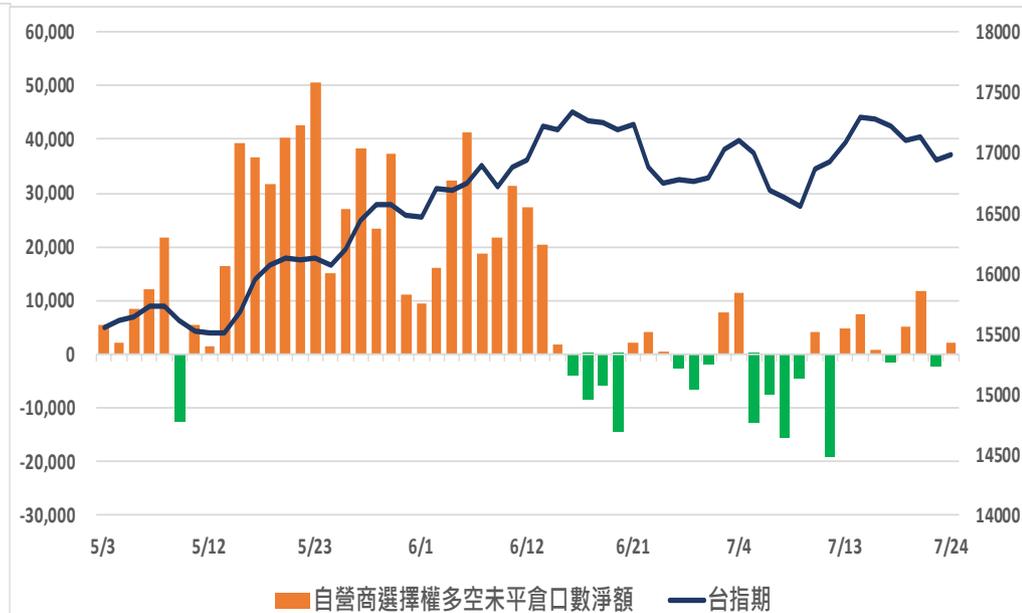
更新日期：2023年7月24日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



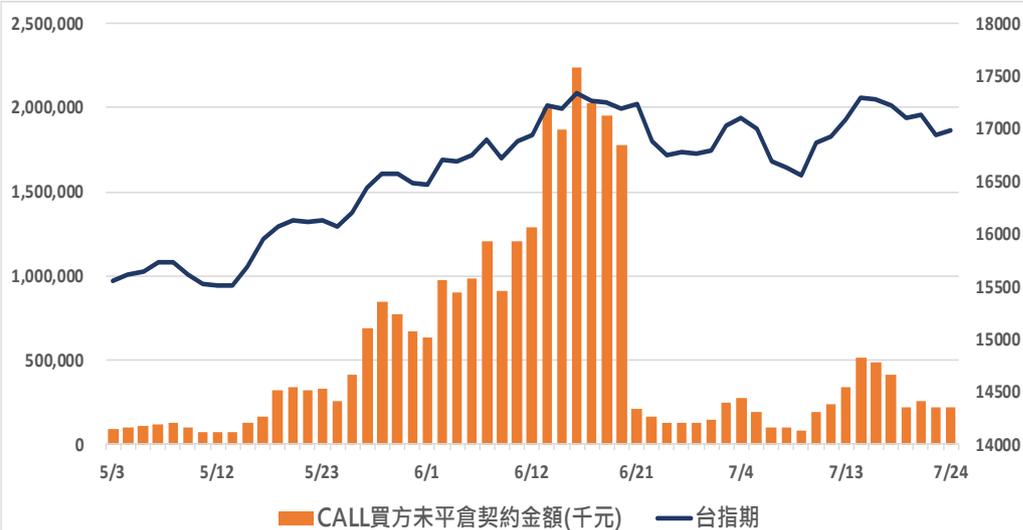
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/18	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
2023/7/24	16979	1,973	+4,189	26,807	-7,823

更新日期：2023年7月24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



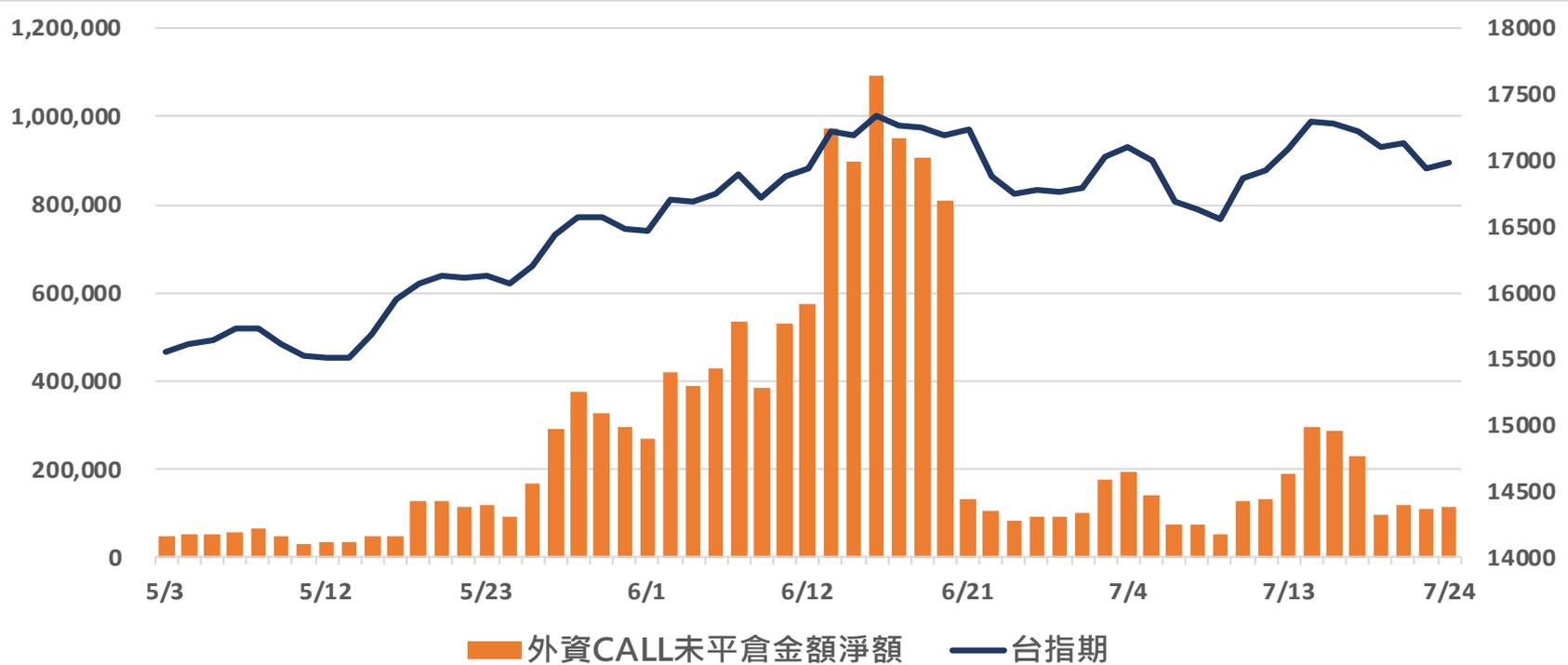
Sell Put未平倉金額



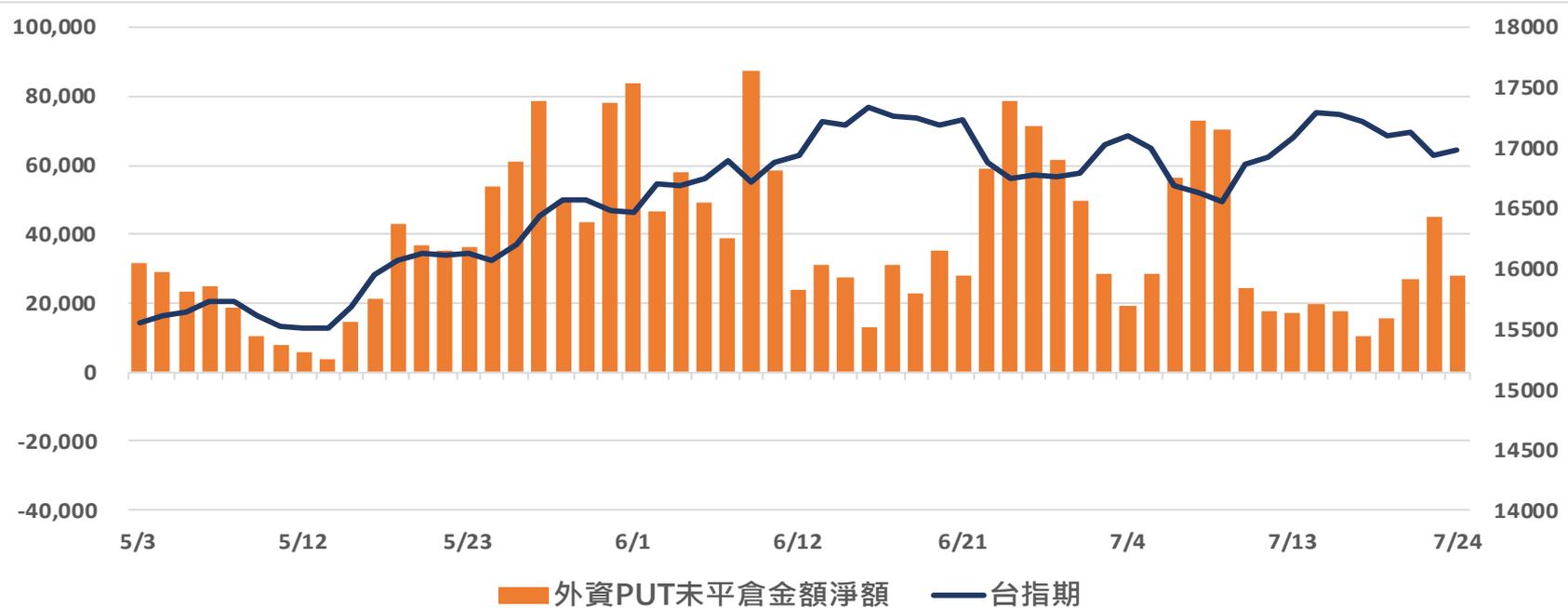
更新日期：2023年7月24日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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24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