

台指選擇權OI

日期：2023/7/25 結算日：2023/7/26					日期：2023/7/25 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	10	16,600	5,745	-55	0	163	16,000	4,754	-30
0	60	16,650	4,887	-1,295	0	14	16,100	2,315	100
-2	183	16,700	7,607	-1,172	1	39	16,200	2,064	-81
-8	102	16,750	4,459	-1,886	5	65	16,300	3,907	1,160
-279	470	16,800	8,578	-316	0	31	16,400	3,454	217
-95	398	16,850	7,740	-837	-9	221	16,500	3,351	320
-247	1,249	16,900	8,759	575	-67	501	16,600	3,115	659
-808	1,207	16,950	8,109	1,548	0	311	16,700	2,539	374
-2,488	2,630	17,000	11,054	3,036	92	862	16,800	2,363	276
-1,797	4,823	17,050	8,546	4,482	-334	959	16,900	2,384	204
-4,439	5,941	17,100	11,427	7,968	-56	4,749	17,000	2,697	585
-1,201	5,975	17,150	7,032	6,074	-40	2,737	17,100	3,187	198
-2,596	9,368	17,200	6,117	5,366	-471	2,563	17,200	2,940	1,575
-2,123	7,888	17,250	5,059	4,540	96	4,960	17,300	598	40
-466	10,276	17,300	2,238	1,864	236	3,853	17,400	288	51
※ 2,100	10,105	17,350	482	314	157	5,595	17,500	214	84
185	9,099	17,400	331	136	-307	4,771	17,600	71	23
459	5,781	17,450	133	71	※ 2,005	5,428	17,700	15	8
350	5,962	17,500	54	3	475	3,451	17,800	4	2
816	3,632	17,550	13	-2	-285	1,756	17,900	5	5
30	4,289	17,600	26	0	761	2,944	18,000	9	0
79	2,152	17,650	29	-1	18	1,225	18,100	3	3
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
-12,815	102,025	1.3123	133,884	28,545	3,204	58,226	0.9506	55,350	5,826
昨日 P/C	0.9173	今日增減變化		0.3950	昨日 P/C	0.9001	今日增減變化		0.0505

更新日期：2023年7月25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	130,928,476	113,976,113	16,952,363	2,417,757	962,249	1,873,675	-911,426	156,586
投信	43,832,093	40,126,843	3,705,250	2,080,911	1,436,597	0	1,436,597	10,349
自營商	14,377,804	37,990,879	-23,613,075	1,820,412	508,165	1,287,408	-779,243	184,955
	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	1,792,654	1,536,056	256,598	60,982	33,176	6,032	27,144	-4,155
投信	27,958	0	27,958	217	0	0	0	0
自營商	116,767	1,238,424	-1,121,657	-35,076	22,584	87,428	-64,844	6,695

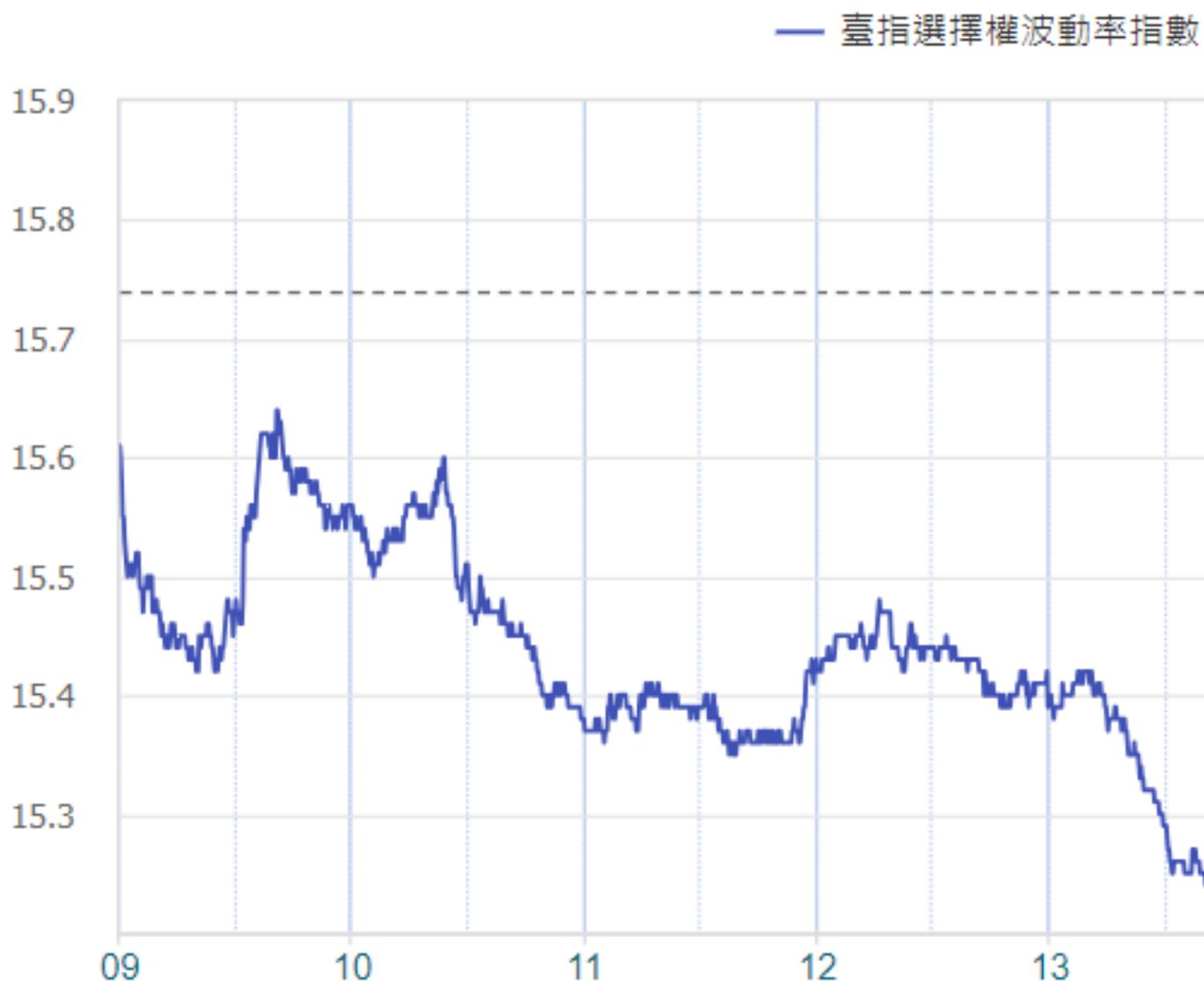
台指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數

	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	33,304	13,785	19,519	2,080	25,562	14,694	10,868	1,456
投信	200	300	-100	-100	400	102	298	50
自營商	62,051	46,744	15,307	2,812	52,200	49,968	2,232	-8,290
特定法人(週)	4,578	0	4,578	1,063	2,511	4,537	-2,026	-588
特定法人(近月)	19,267	4,637	14,630	2,370	3,815	8,093	-4,278	-1,070
特定法人(全月)	17,919	3,299	14,620	1,679	5,810	16,137	-10,327	1,179
十大交易人(週)	42,159	34,442	7,717	-36	42,202	32,305	9,897	8,526
十大交易人(近月)	30,148	25,131	5,017	5,773	19,621	26,381	-6,760	-920
十大交易人(全月)	76,362	57,679	18,683	2,531	59,344	61,971	-2,627	8,768
全市場未沖銷(近月)			58,226	3,204			55,350	5,826
全市場未沖銷(全月)			203,340	-7,377			227,995	41,326

更新日期：2023年7月25日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

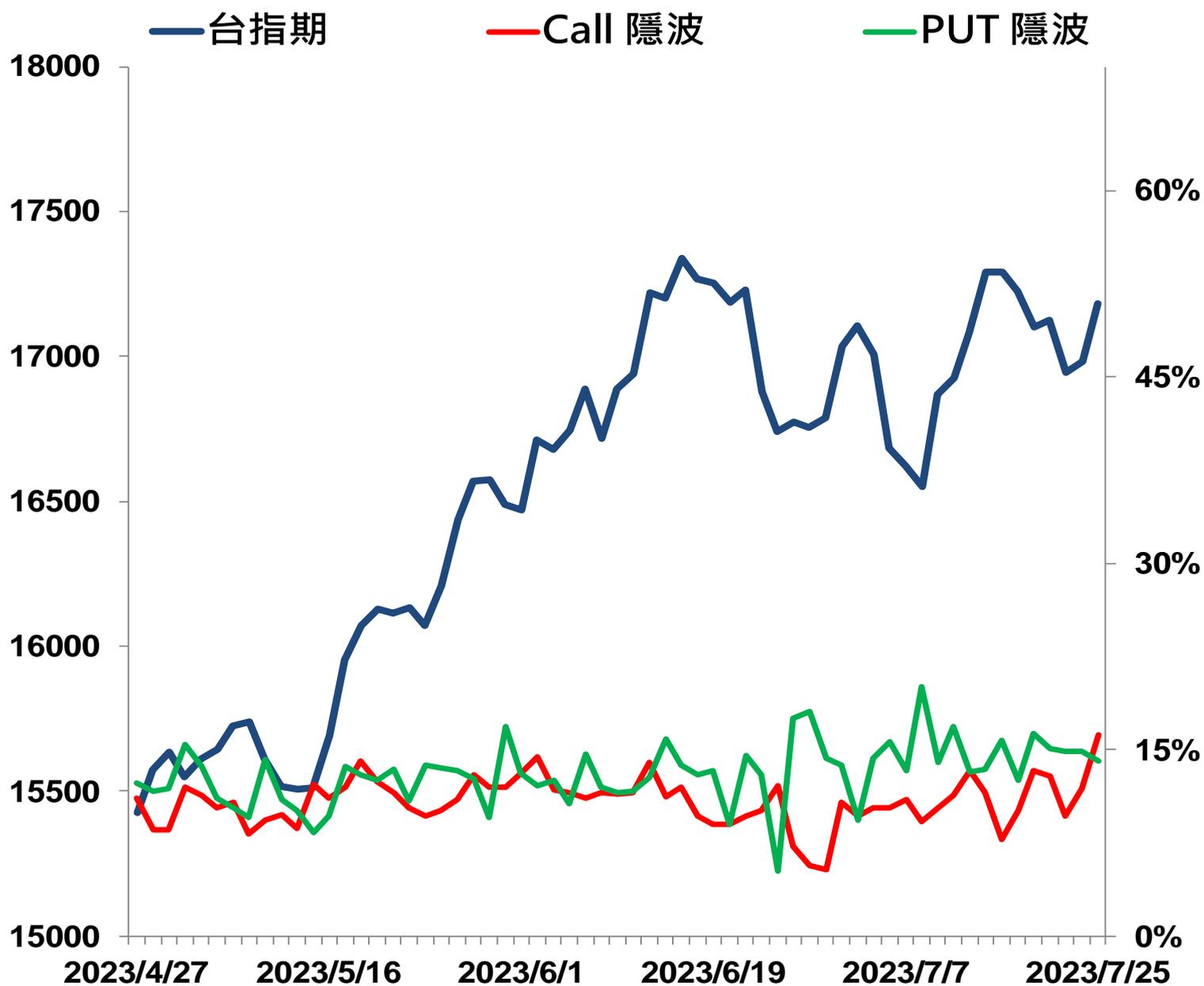
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年7月25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



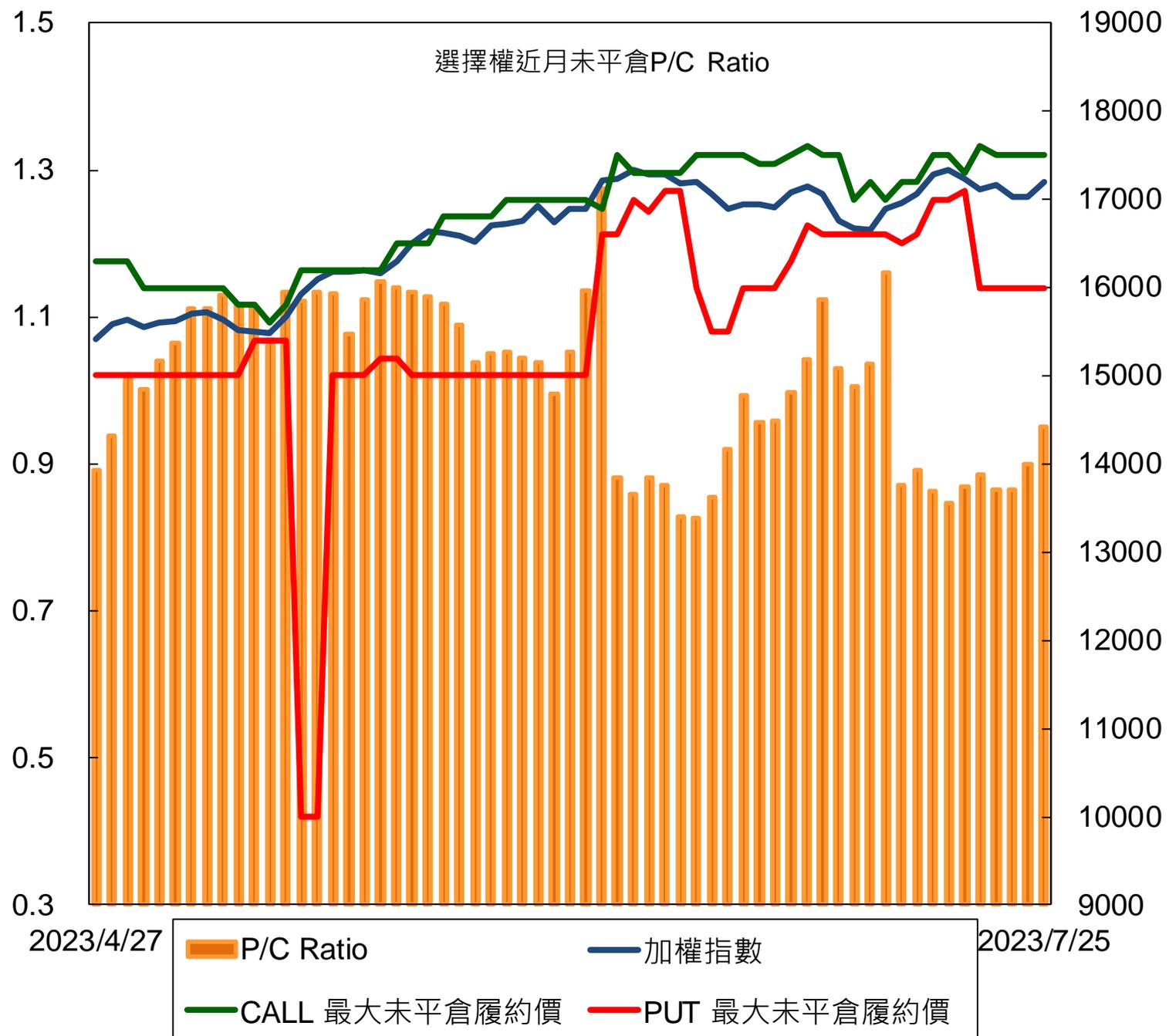
更新日期：2023年7月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考

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24日	65,404	52,909	12,495
	7月25日	62,051	46,744	15,307
Put	7月24日	49,609	39,087	10,522
	7月25日	52,200	49,968	2,232

更新日期：2023年7月25日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

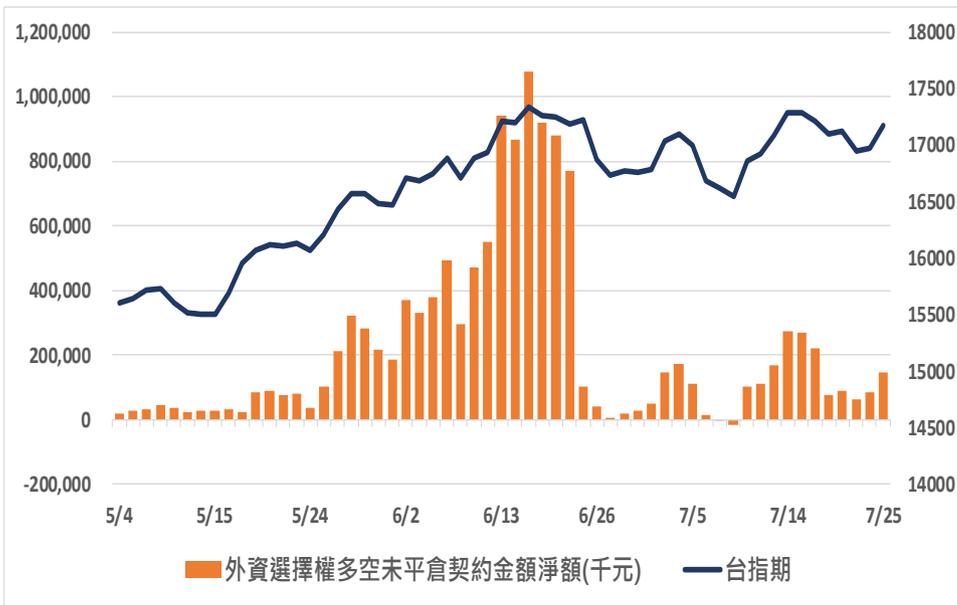
選擇權近月未平倉P/C Ratio



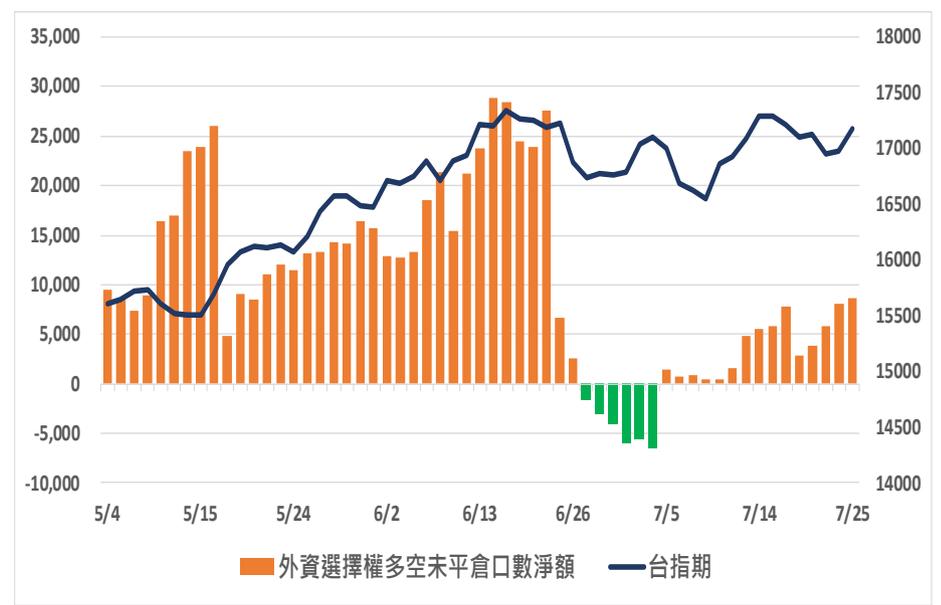
更新日期：2023年7月25日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



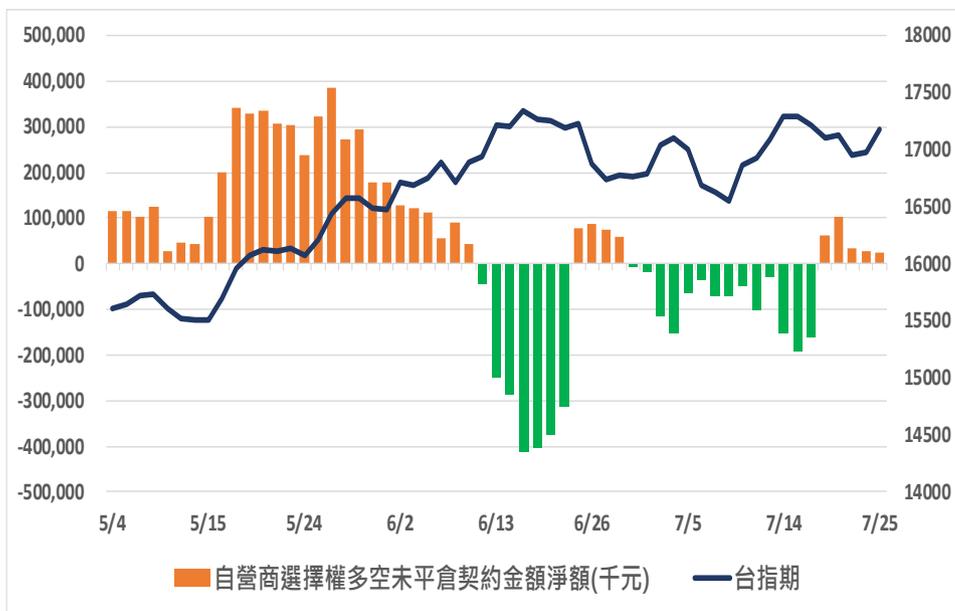
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/19	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
2023/7/25	17182	8,651	+624	148,662	+65,457

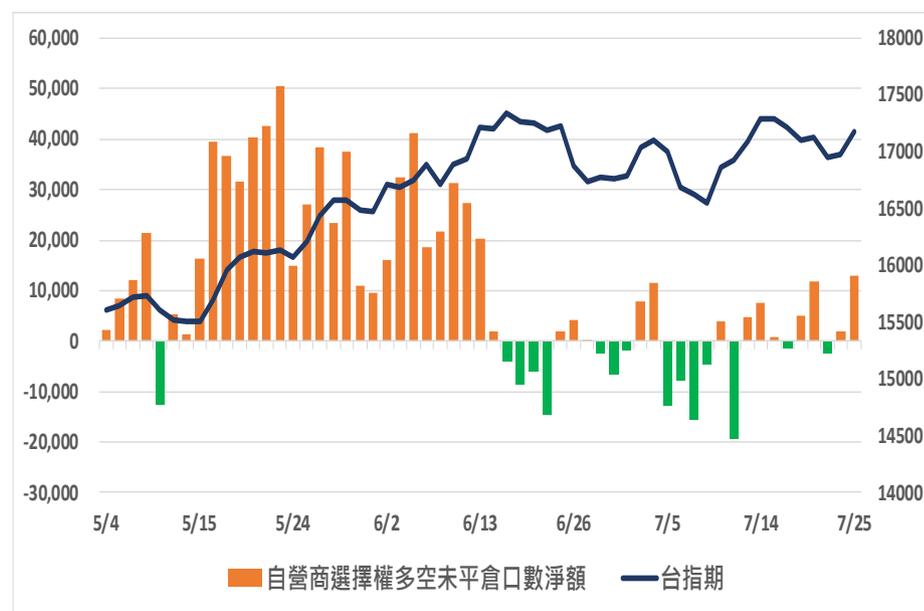
更新日期：2023年7月25日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



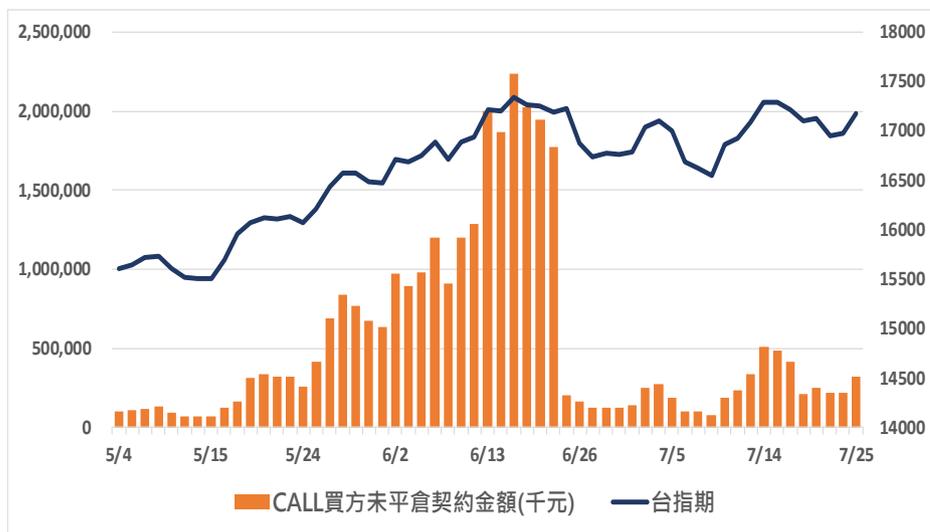
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/19	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
2023/7/25	17182	13,075	+11,102	23,695	-3,112

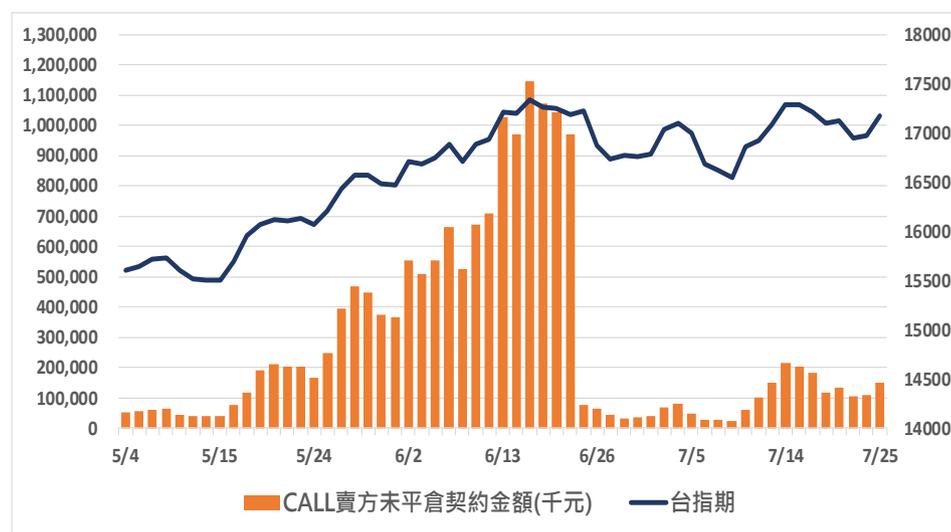
更新日期：2023年7月25日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

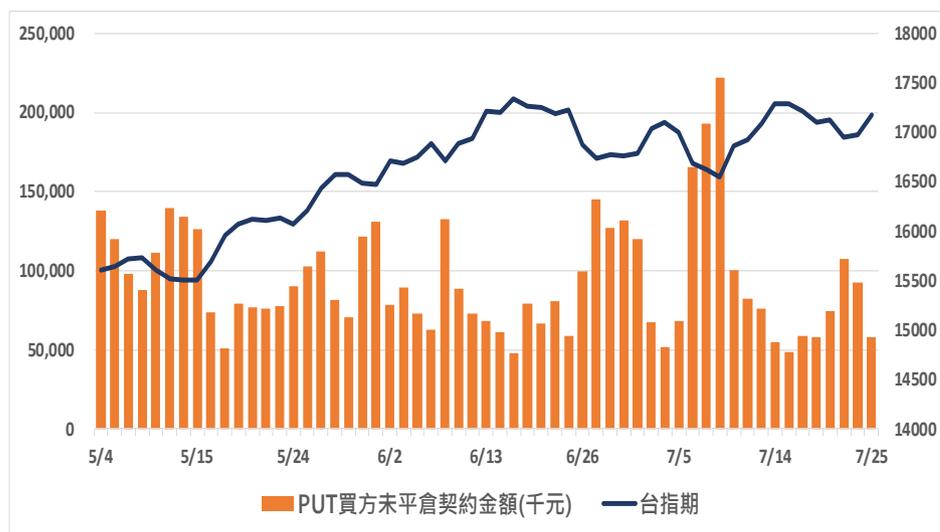
Buy Call未平倉金額



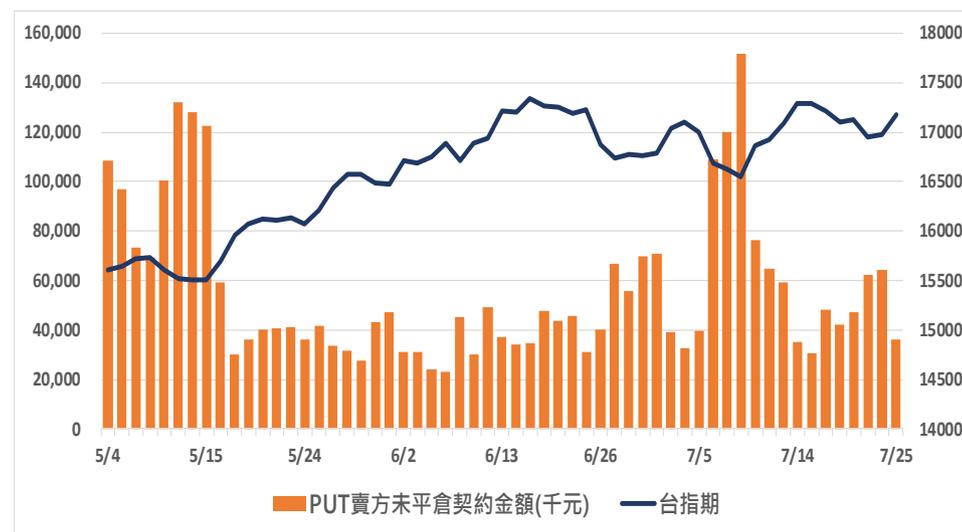
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



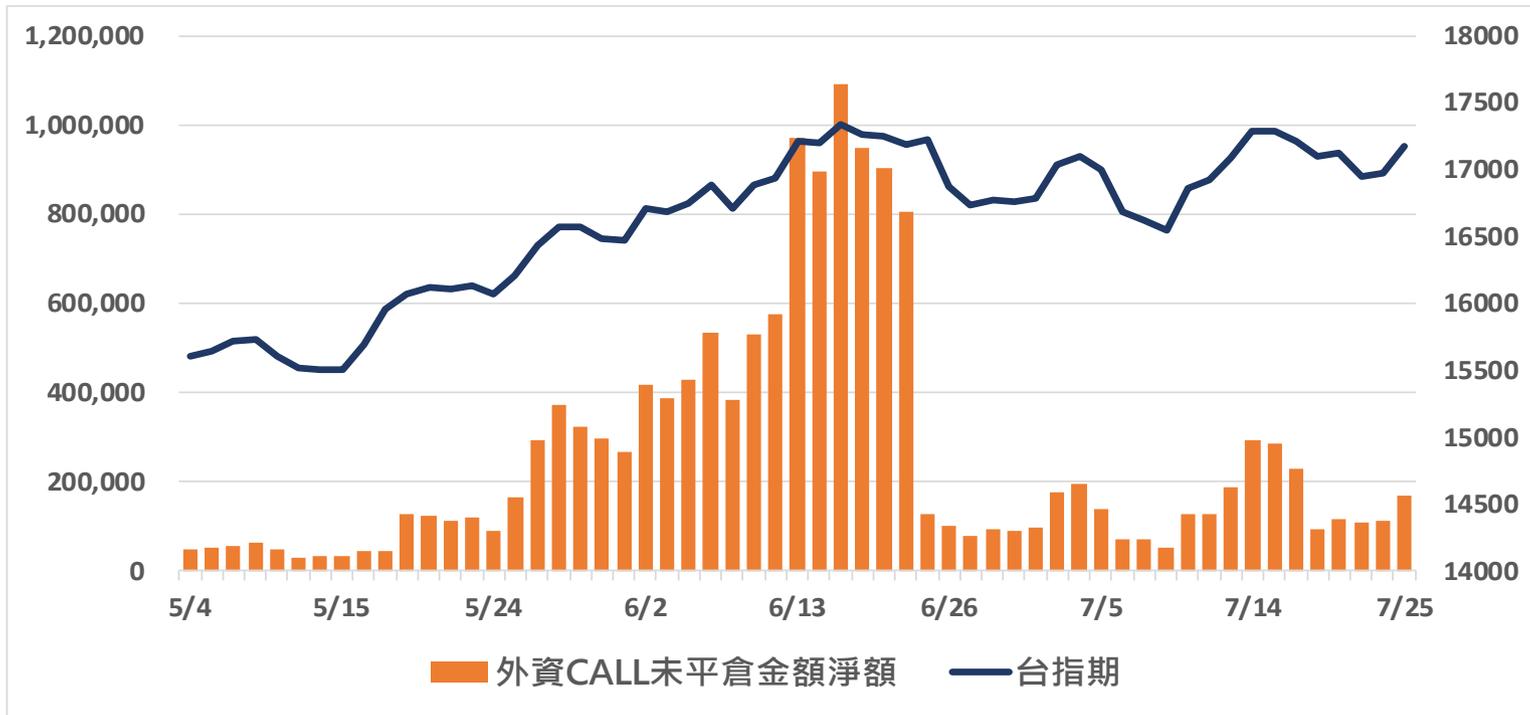
Sell Put未平倉金額



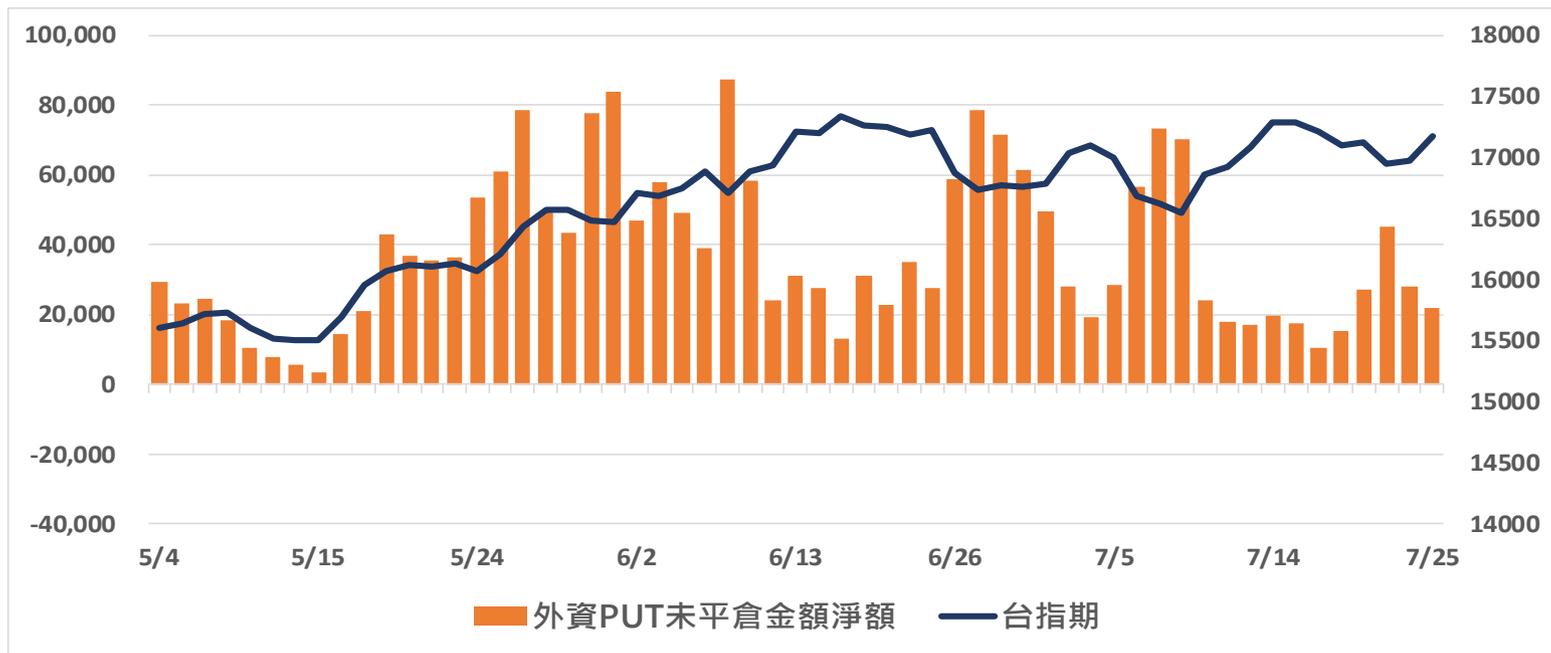
更新日期：2023年7月25日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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25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