

台指選擇權OI

日期：2023/7/26 結算日：2023/8/2					日期：2023/7/26 結算日：2023/8/16				
202308W1					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	14	16,600	1,814	735	0	39	16,200	2,193	129
2	33	16,700	1,988	818	-3	62	16,300	4,040	133
-10	14	16,750	1,323	516	1	32	16,400	3,580	126
5	60	16,800	2,456	1,062	-4	217	16,500	4,242	891
5	18	16,850	2,043	1,204	-12	489	16,600	3,989	874
-78	286	16,900	2,920	1,849	8	319	16,700	2,949	410
-36	446	16,950	1,638	835	-62	800	16,800	2,593	230
103	790	17,000	2,386	1,179	-74	885	16,900	2,302	-82
158	458	17,050	1,672	1,196	-59	4,690	17,000	2,686	-11
326	732	17,100	1,587	795	81	2,818	17,100	2,967	-220
624	1,078	17,150	1,219	717	92	2,655	17,200	3,039	99
1,277	1,874	17,200	1,106	631	67	5,027	17,300	733	135
743	1,194	17,250	380	139	6	3,859	17,400	290	2
1,336	2,380	17,300	335	98	108	5,703	17,500	282	68
621	1,652	17,350	52	37	373	5,144	17,600	89	18
1,262	3,338	17,400	121	100	446	5,874	17,700	23	8
1,544	2,355	17,450	14	13	232	3,683	17,800	8	4
※ 2,513	3,820	17,500	32	20	※ 1,512	3,268	17,900	9	4
2,441	3,246	17,550	2	0	-196	2,748	18,000	9	0
1,327	2,645	17,600	43	18	211	1,436	18,100	4	1
920	1,314	17,650	7	2	-46	946	18,200	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
19,618	34,277	0.9480	32,493	15,284	2,792	61,018	0.9509	58,023	2,673
昨日 P/C	1.3123	今日增減變化	-0.3643		昨日 P/C	0.9506	今日增減變化	0.0003	

更新日期：2023年7月26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	121,514,403	115,976,873	5,537,530	-11,414,833	996,851	2,185,016	-1,188,165	-276,739
投信	42,590,355	40,308,120	2,282,235	-1,423,015	1,423,114	0	1,423,114	-13,483
自營商	14,303,310	35,890,899	-21,587,589	2,025,486	302,034	1,382,780	-1,080,746	-301,503
	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	1,833,180	1,644,950	188,230	-68,368	37,665	6,026	31,639	4,495
投信	28,390	0	28,390	432	0	0	0	0
自營商	300,593	1,253,688	-953,095	168,562	28,556	91,833	-63,277	1,567

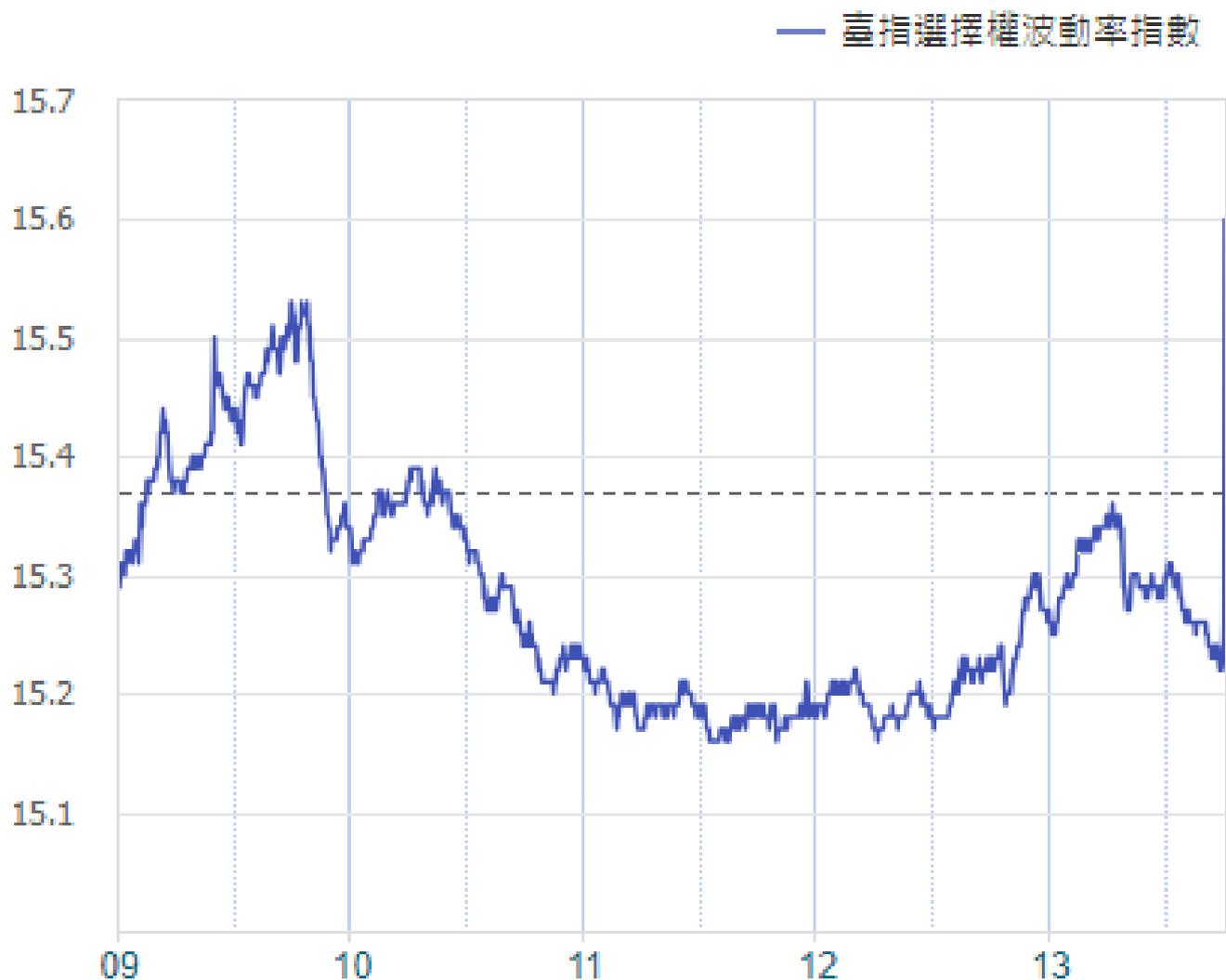
台指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數

	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	28,156	9,511	18,645	-874	20,200	9,596	10,604	-264
投信	200	300	-100	0	400	102	298	0
自營商	41,140	38,417	2,723	-12,584	37,740	29,900	7,840	5,608
特定法人(週)	2,047	702	1,345	---	1,138	3,115	-1,977	---
特定法人(近月)	19,141	4,637	14,504	-126	3,986	10,384	-6,398	-2,120
特定法人(全月)	22,521	3,299	19,222	4,602	5,156	17,262	-12,106	-1,779
十大交易人(週)	14,885	15,046	-161	---	13,333	13,855	-522	---
十大交易人(近月)	31,185	23,905	7,280	2,263	19,371	28,383	-9,012	-2,252
十大交易人(全月)	55,920	47,216	8,704	-9,979	36,949	49,733	-12,784	-10,157
全市場未沖銷(近月)			61,018	2,792			58,023	2,673
全市場未沖銷(全月)			122,807	-80,533			113,085	-114,910

更新日期：2023年7月26日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

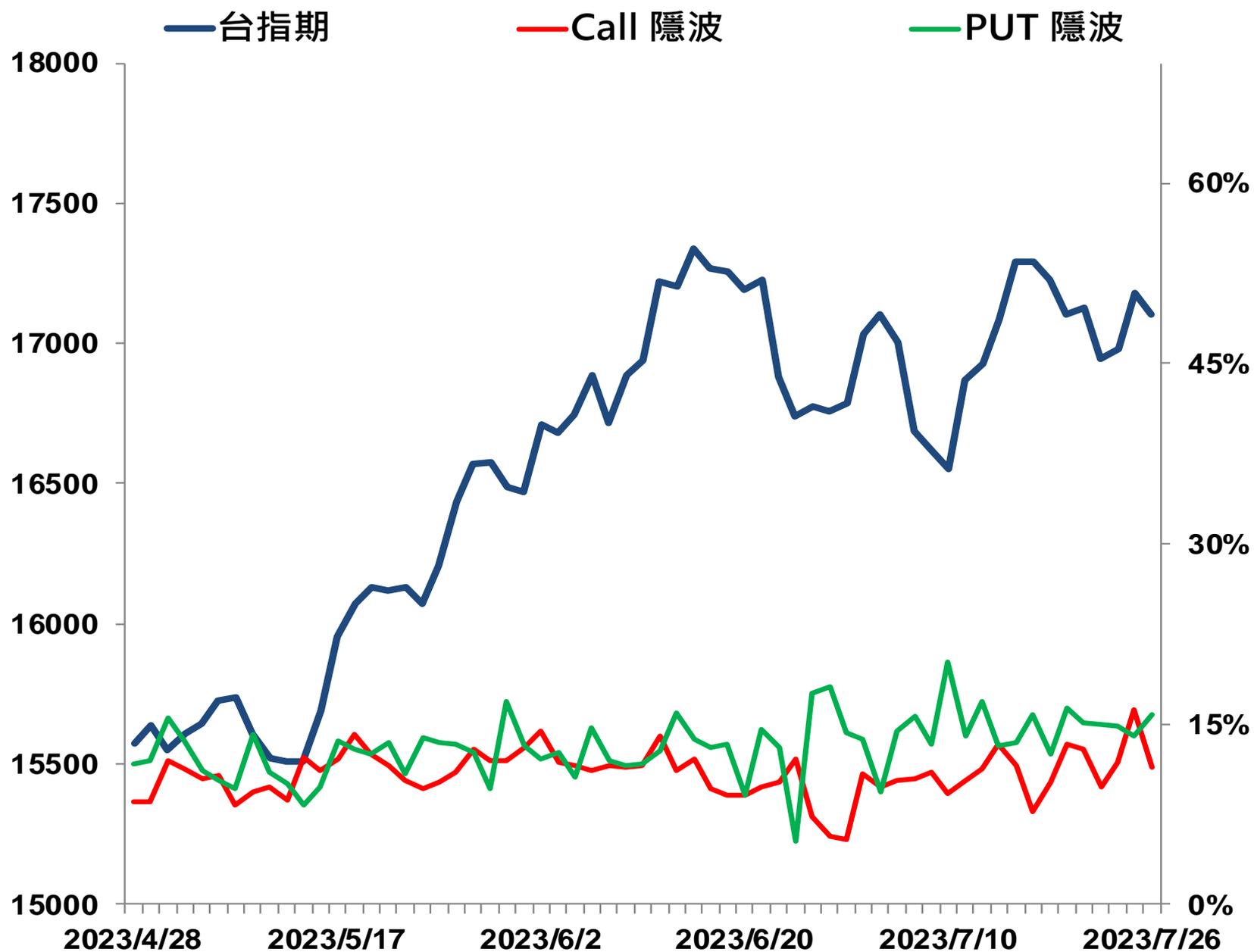
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年7月26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



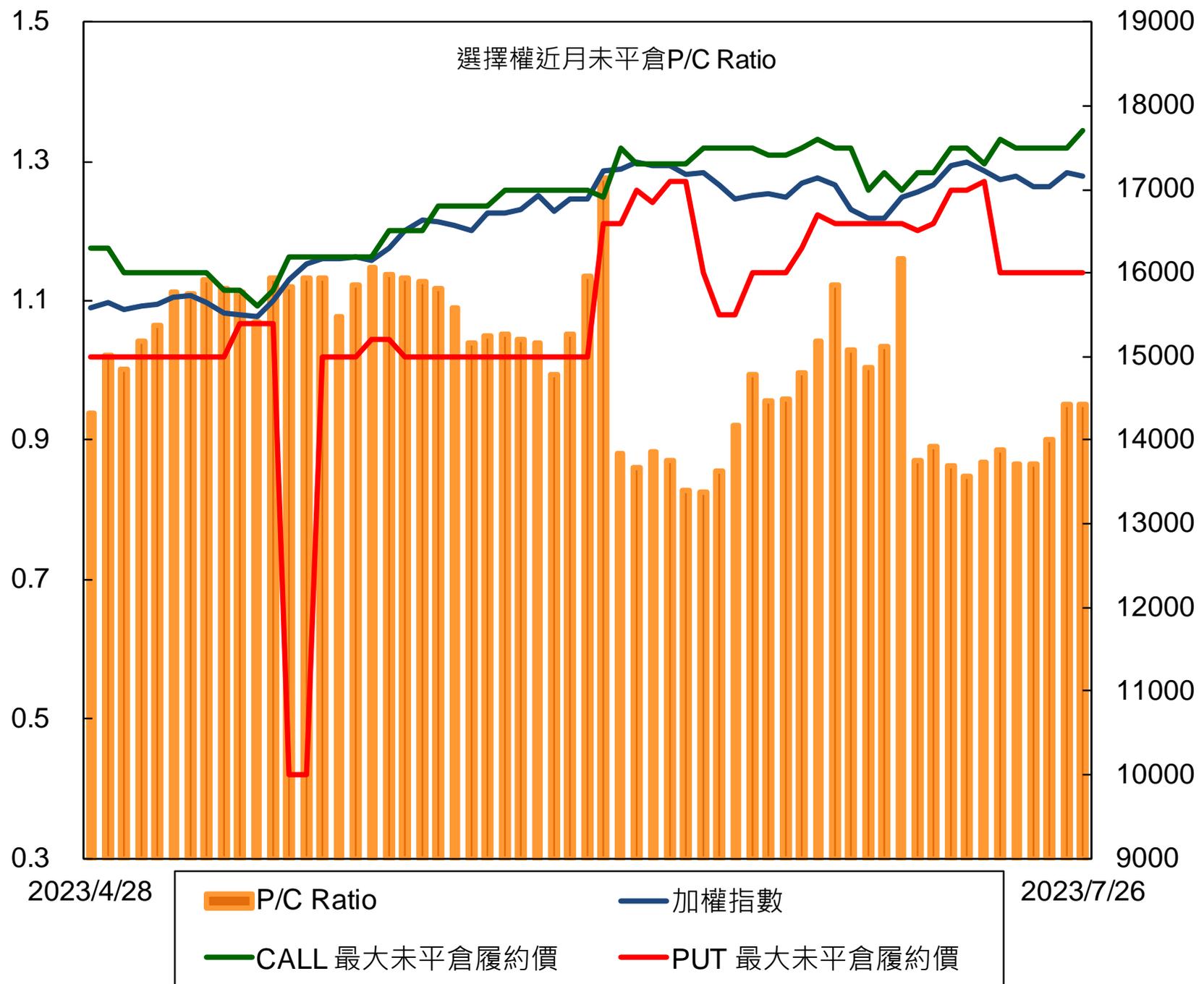
更新日期：2023年7月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考

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25日	62,051	46,744	15,307
	7月26日	41,140	38,417	2,723
Put	7月25日	52,200	49,968	2,232
	7月26日	37,740	29,900	7,840

更新日期：2023年7月26日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

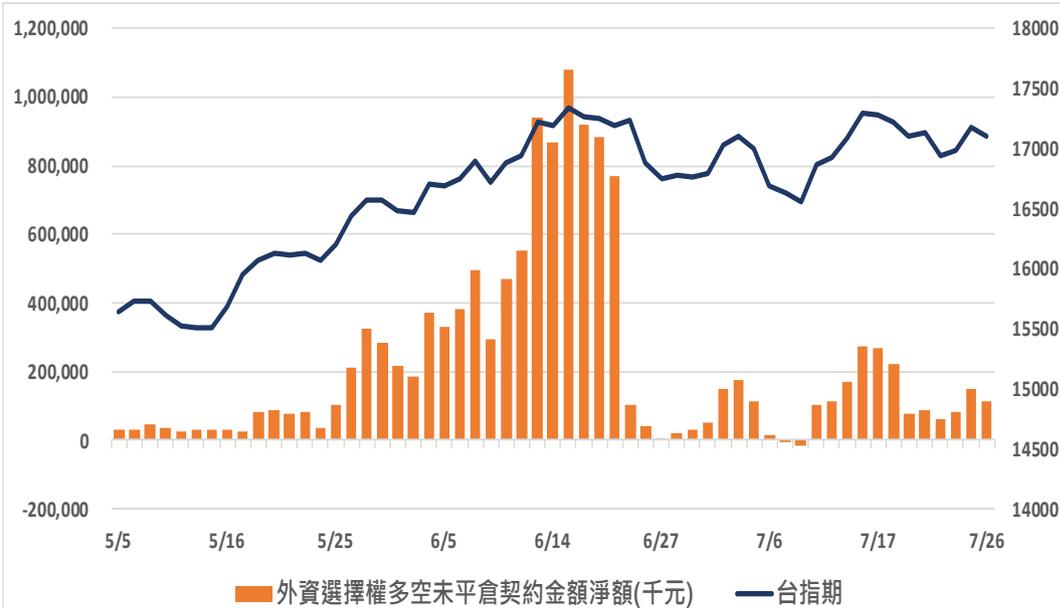
選擇權近月未平倉P/C Ratio



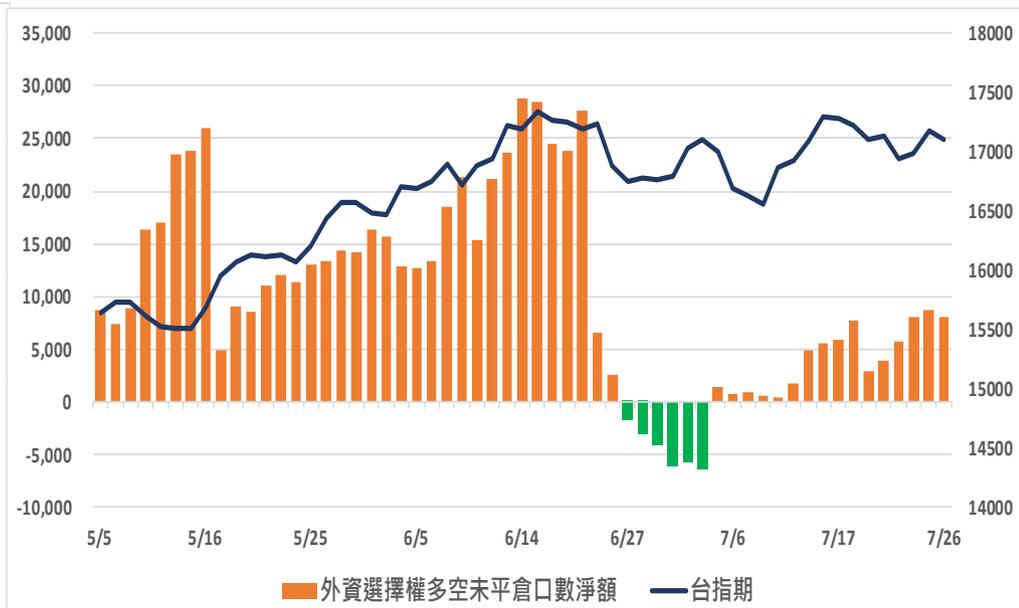
更新日期：2023年7月26日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



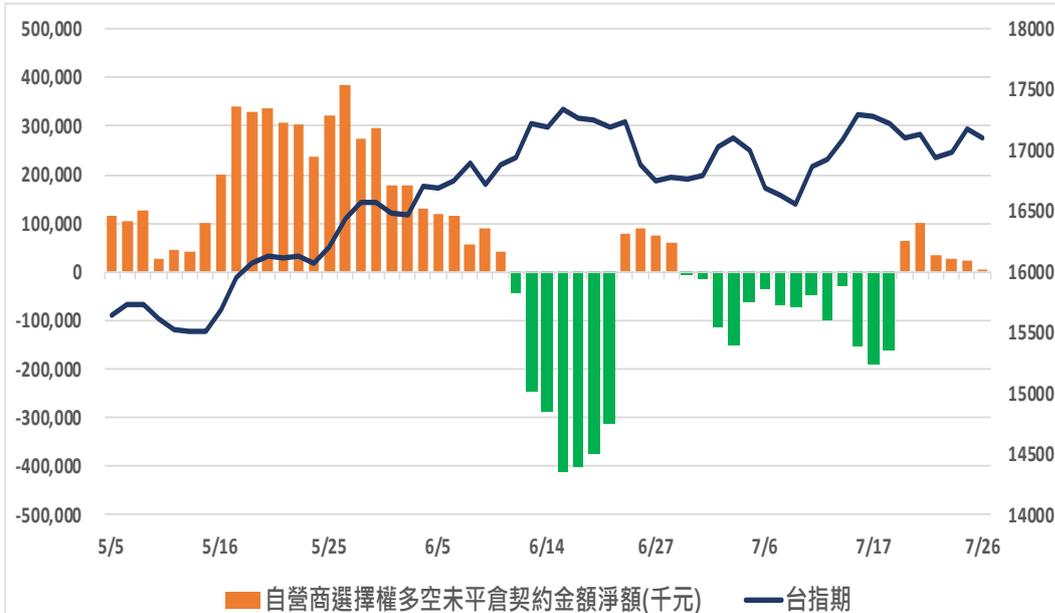
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/20	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
2023/7/26	17100	8,041	-610	110,812	-37,850

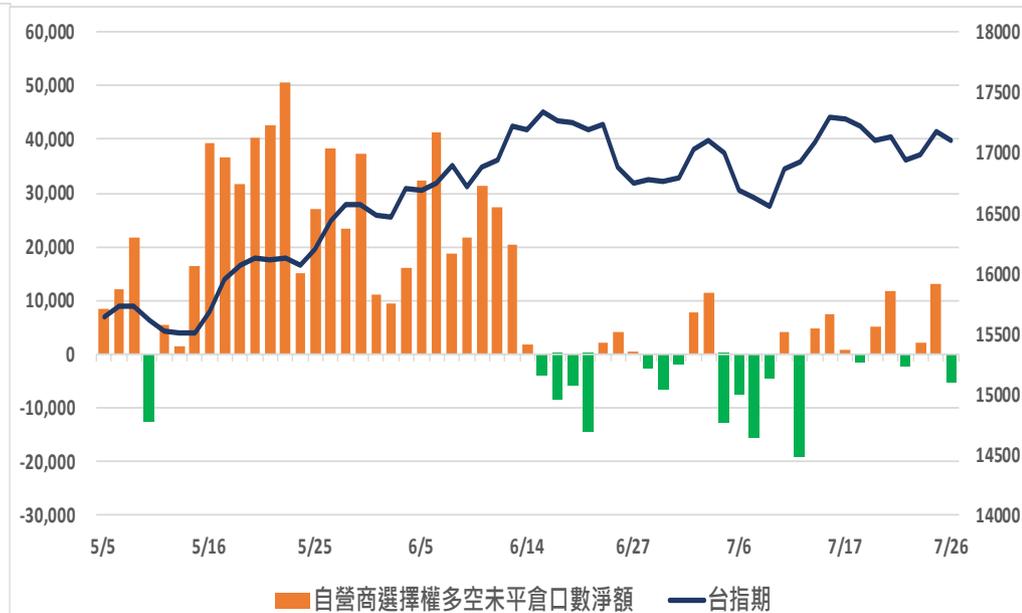
更新日期：2023年7月26日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



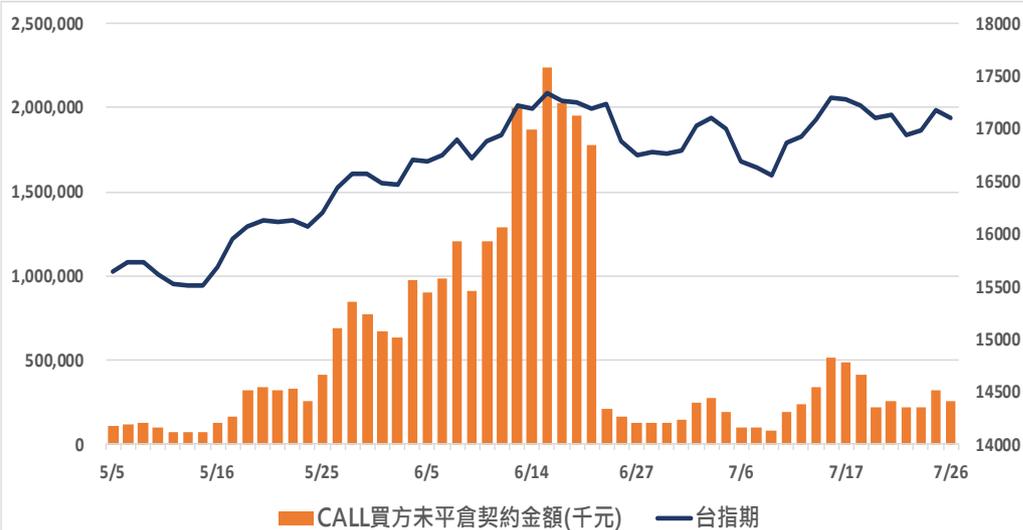
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/20	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
2023/7/26	17100	-5,117	-18,192	4,678	-19,017

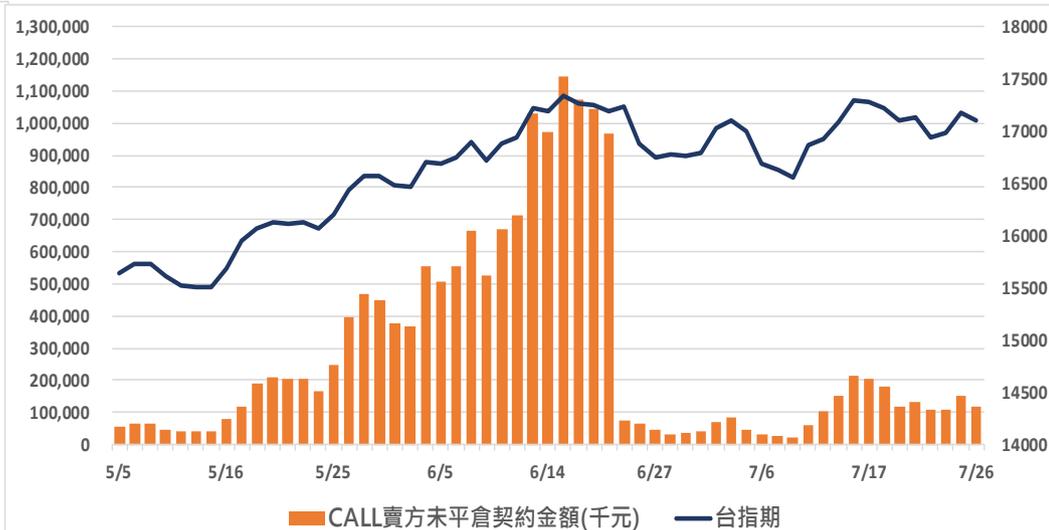
更新日期：2023年7月26日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



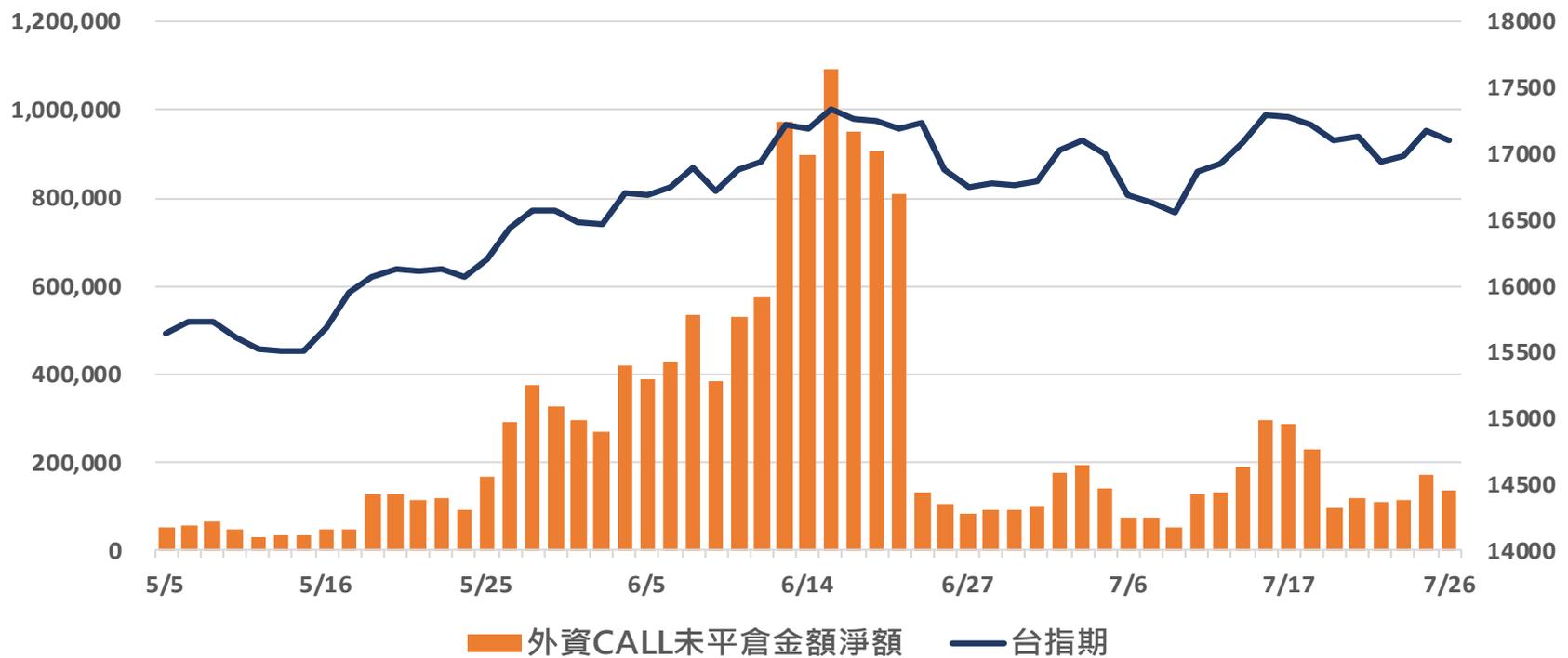
Sell Put未平倉金額



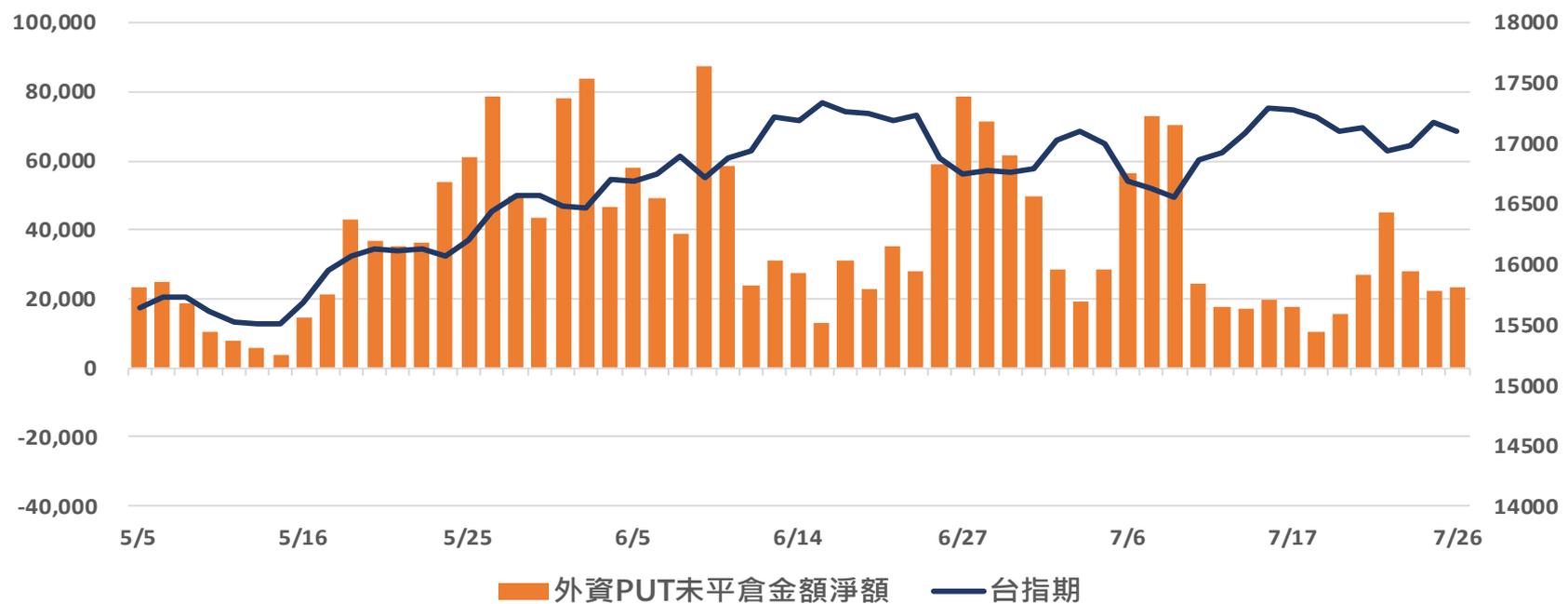
更新日期：2023年7月26日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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26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