

台指選擇權OI

日期：2023/7/28 結算日：2023/8/2					日期：2023/7/28 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
0	33	16,700	4,463	451	0	14	16,100	2,077	-19
2	18	16,750	3,893	739	0	40	16,200	2,540	357
-9	63	16,800	8,554	1,481	0	62	16,300	4,318	29
0	21	16,850	6,056	841	-1	35	16,400	3,033	-228
-60	249	16,900	6,919	1,425	-2	216	16,500	5,454	640 ※
-46	333	16,950	6,922	1,215	5	472	16,600	3,526	-373
-125	861	17,000	11,520	4,489 ※	-13	333	16,700	3,973	434
133	1,020	17,050	5,918	2,260	-27	3,730	16,800	3,451	288
13	1,220	17,100	7,123	2,763	16	740	16,900	3,284	262
-235	1,643	17,150	4,538	1,741	-89	4,580	17,000	3,924	154
164	3,094	17,200	5,494	2,655	393	3,530	17,100	3,446	307
435	2,898	17,250	2,759	727	27	2,609	17,200	2,050	-69
3,476	7,139	17,300	3,444	1,685 ※	663	5,397	17,300	2,010	-206
1,970	5,036	17,350	2,121	1,736	-24	3,847	17,400	1,115	482
3,168	10,522	17,400	778	414	-266	5,415	17,500	408	55
※ 3,802	9,028	17,450	369	264	27	5,103	17,600	222	72
1,887	8,685	17,500	227	122	-18	5,241	17,700	58	25
1,677	7,684	17,550	23	17	220	3,925	17,800	31	23
2,056	7,217	17,600	100	34	196	3,717	17,900	13	-2
1,340	4,763	17,650	2	0	-26	3,011	18,000	9	0
1,897	5,999	17,700	19	3	125	1,350	18,100	10	0
1,086	1,086	17,750	0	0	99	914	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
24,081	86,897	1.2372	107,509	28,122	1,335	64,510	1.0158	65,527	2,139
昨日 P/C	1.2638	今日增減變化	-0.0266		昨日 P/C	1.0034	今日增減變化	0.0124	

更新日期：2023年7月28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	119,371,322	115,797,645	3,573,677	-3,984,813	1,042,449	2,509,348	-1,466,899	-241,556
投信	41,944,035	40,040,935	1,903,100	-1,129,118	1,127,339	0	1,127,339	-303,915
自營商	18,059,297	33,896,803	-15,837,506	1,951,465	611,076	1,201,952	-590,876	425,174
	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	1,871,965	1,694,111	177,854	108,774	72,595	6,050	66,545	2,705
投信	28,543	0	28,543	-150	0	0	0	0
自營商	240,095	1,338,042	-1,097,947	-213,658	33,220	113,371	-80,151	1,927

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	31,242	11,672	19,570	1,064	24,741	12,794	11,947	268
投信	200	300	-100	0	400	102	298	0
自營商	56,902	45,523	11,379	4,078	52,327	45,035	7,292	-3,750
特定法人(週)	1,070	0	1,070	220	0	0	0	1,112
特定法人(近月)	19,038	4,723	14,315	-186	5,423	10,126	-4,703	-469
特定法人(全月)	17,486	3,299	14,187	-2,482	5,726	10,892	-5,166	4,949
十大交易人(週)	32,016	25,381	6,635	1,359	33,376	33,963	-587	1,049
十大交易人(近月)	31,312	25,895	5,417	-495	21,931	30,705	-8,774	-745
十大交易人(全月)	69,039	53,931	15,108	3,630	52,955	67,067	-14,112	1,538
全市場未沖銷(近月)			64,510	1,335			65,527	2,139
全市場未沖銷(全月)			185,998	29,174			202,573	33,824

更新日期：2023年7月28日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

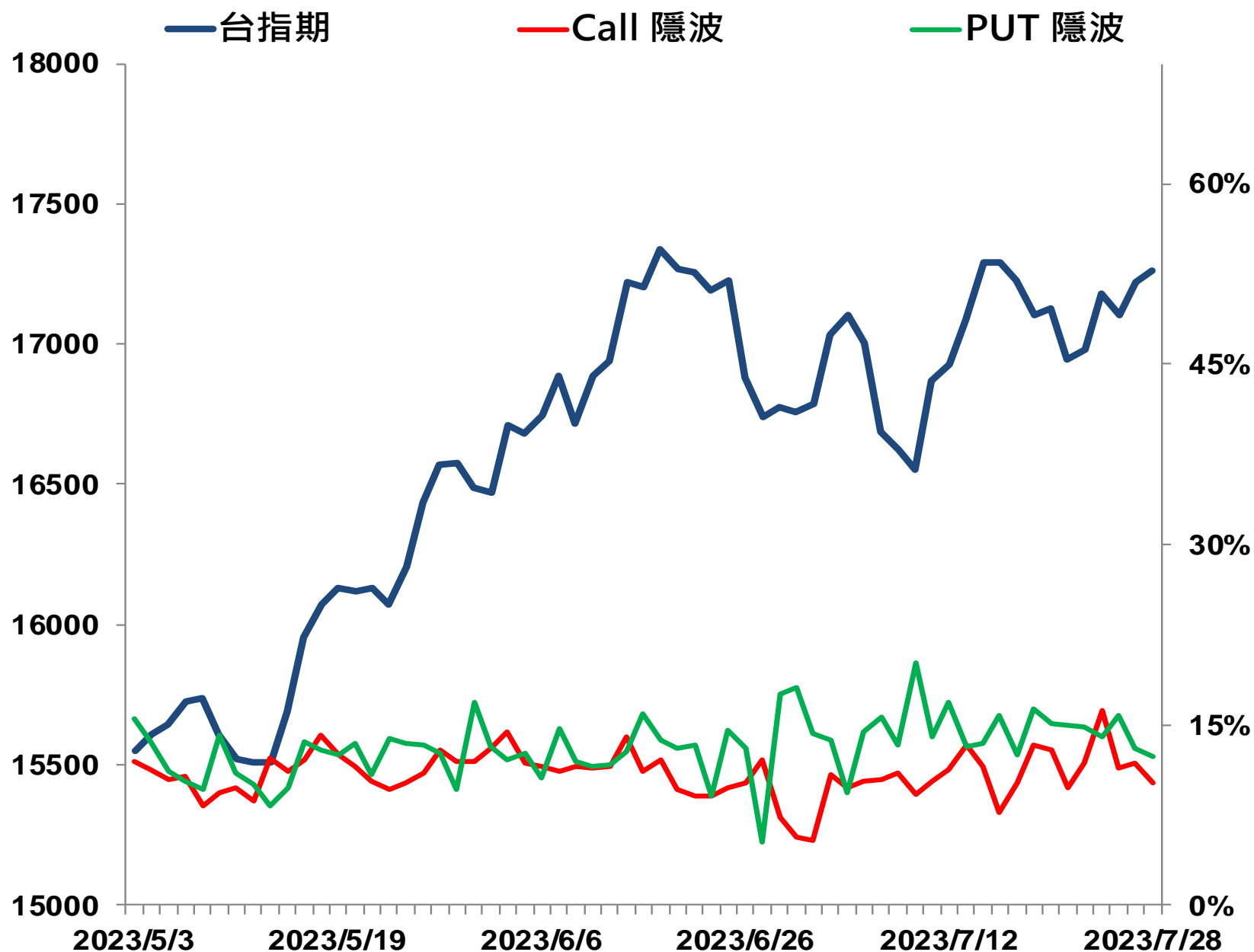
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年7月28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28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

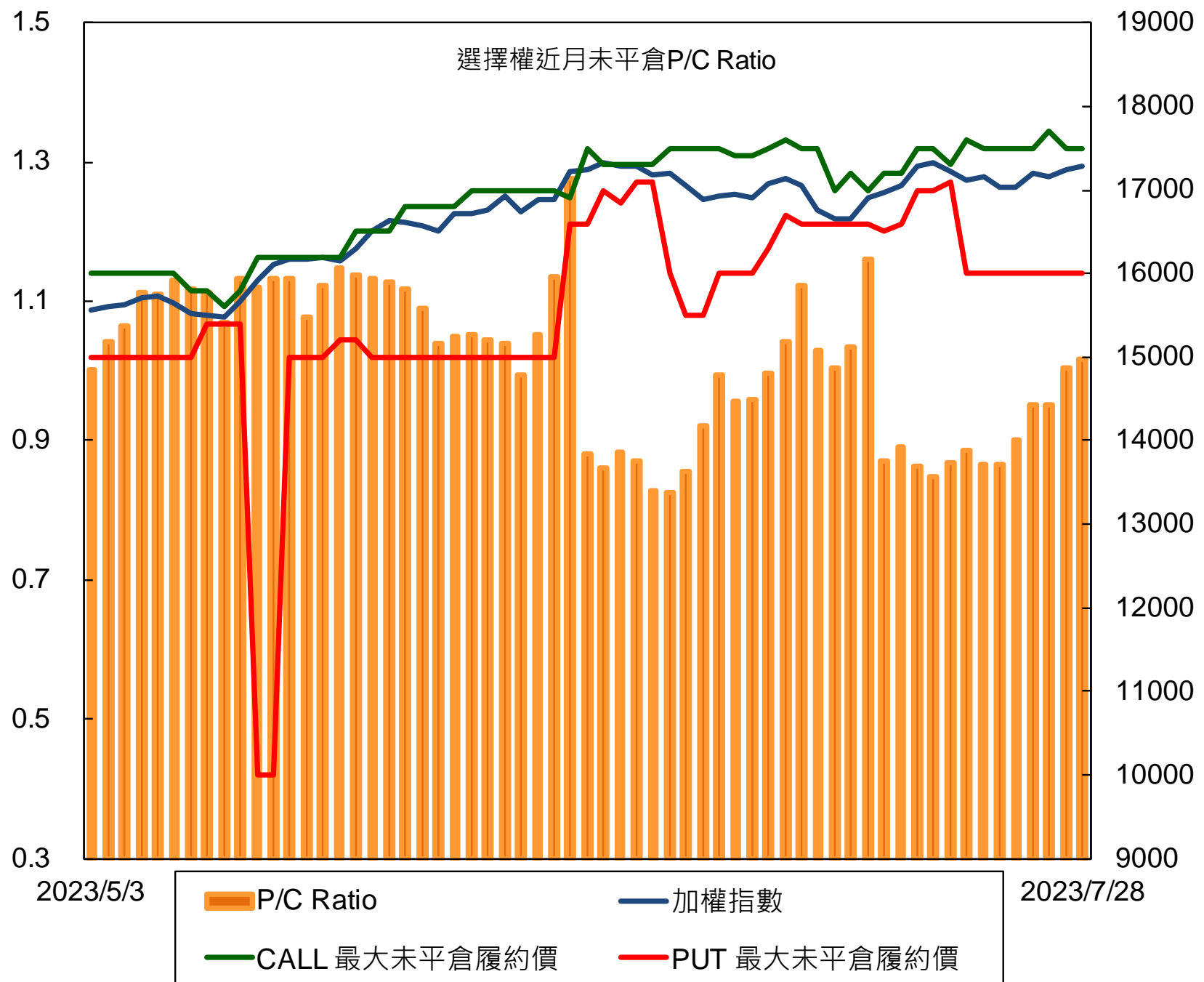
自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	7月27日	48,133	40,832	7,301
	7月28日	56,902	45,523	11,379
Put	7月27日	47,036	35,994	11,042
	7月28日	52,327	45,035	7,292

更新日期：2023年7月28日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



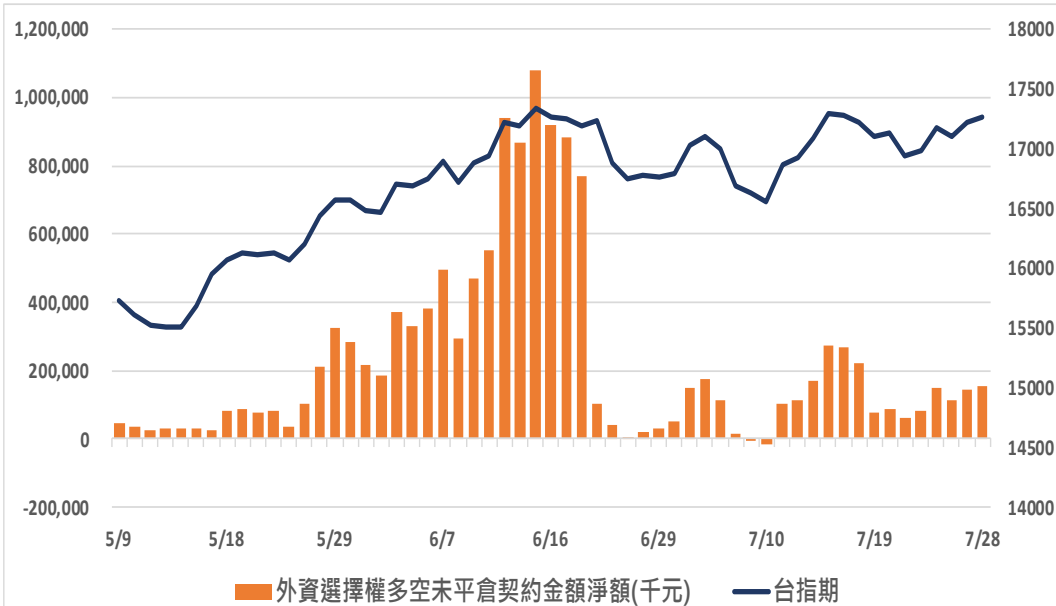
選擇權近月未平倉P/C Ratio



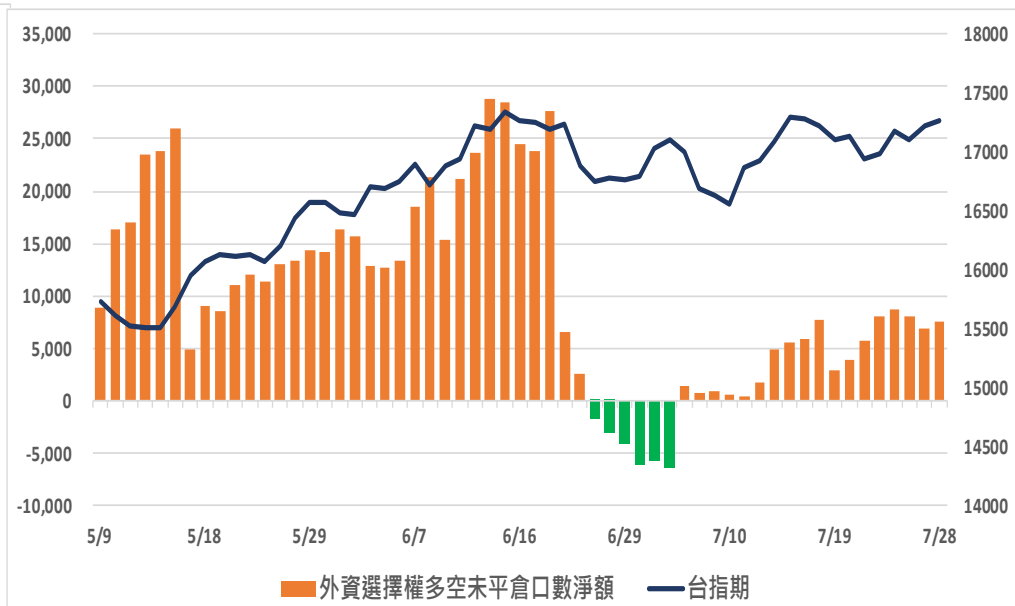
更新日期：2023年7月28日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



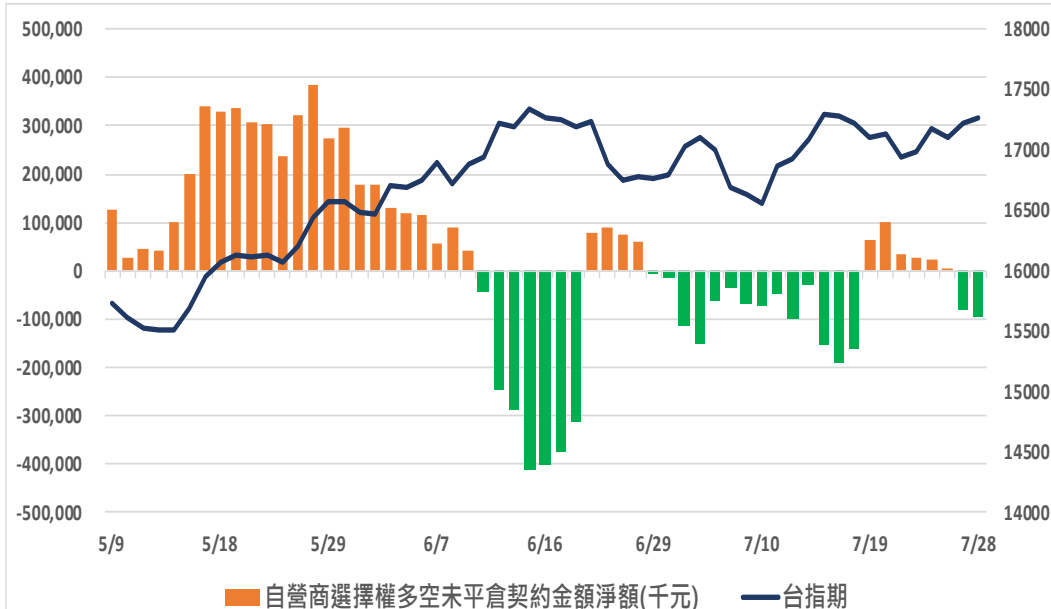
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/24	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
2023/7/27	17223	6,827	-1,214	144,271	+33,459
2023/7/28	17262	7,623	+796	152,732	+8,461

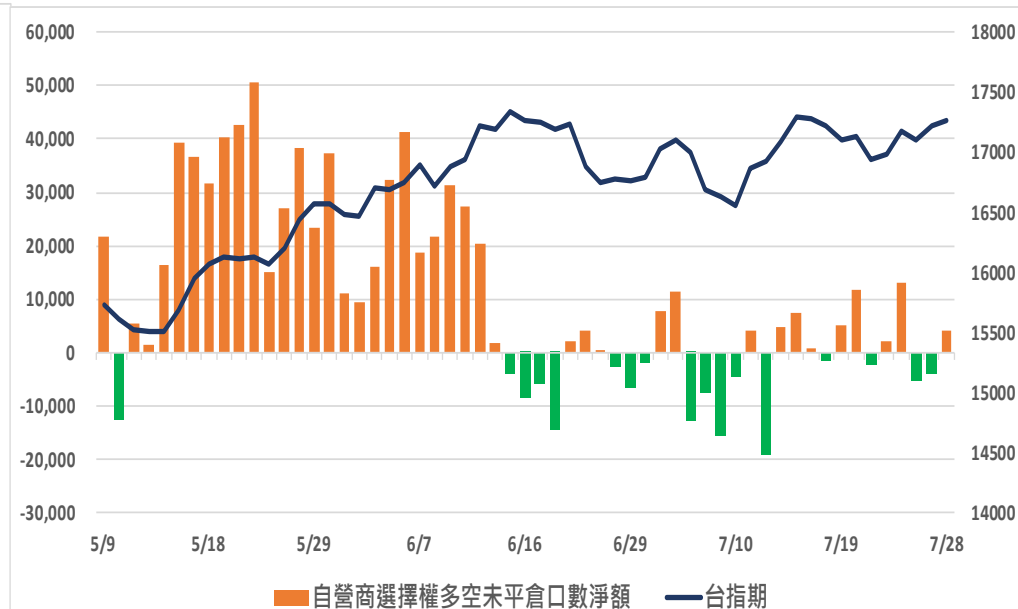
更新日期：2023年7月28日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



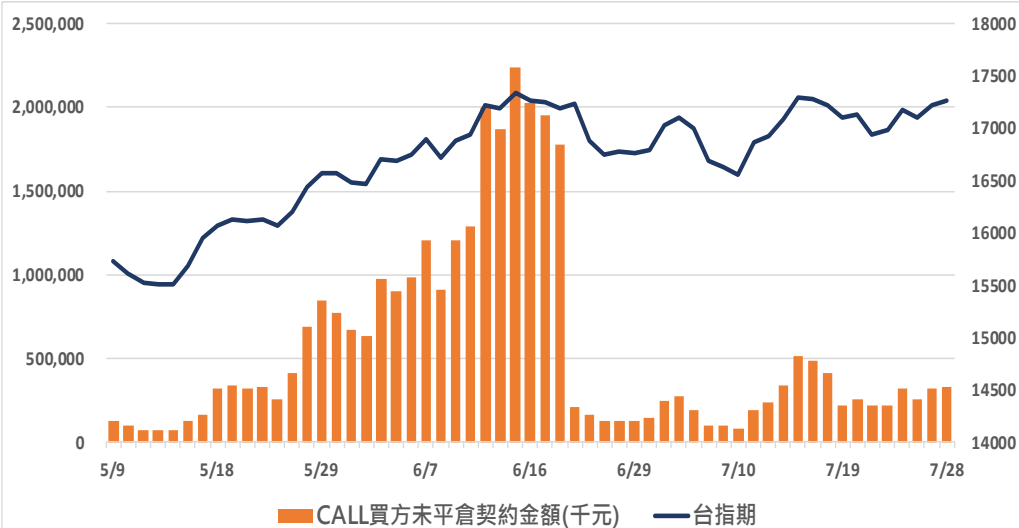
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/24	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
2023/7/27	17223	-3,741	+1,376	-80,356	-85,034
2023/7/28	17262	4,087	+7,828	-94,522	-14,166

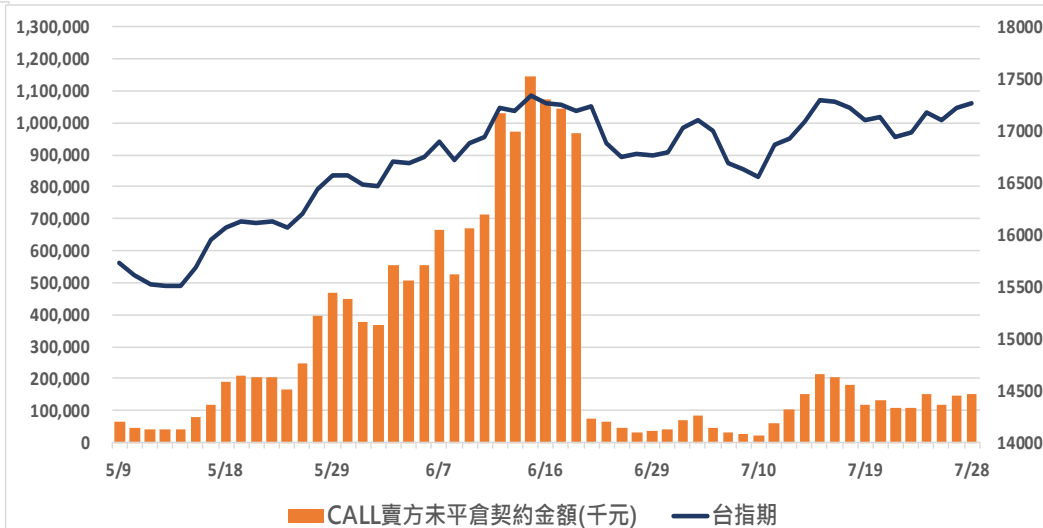
更新日期：2023年7月28日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

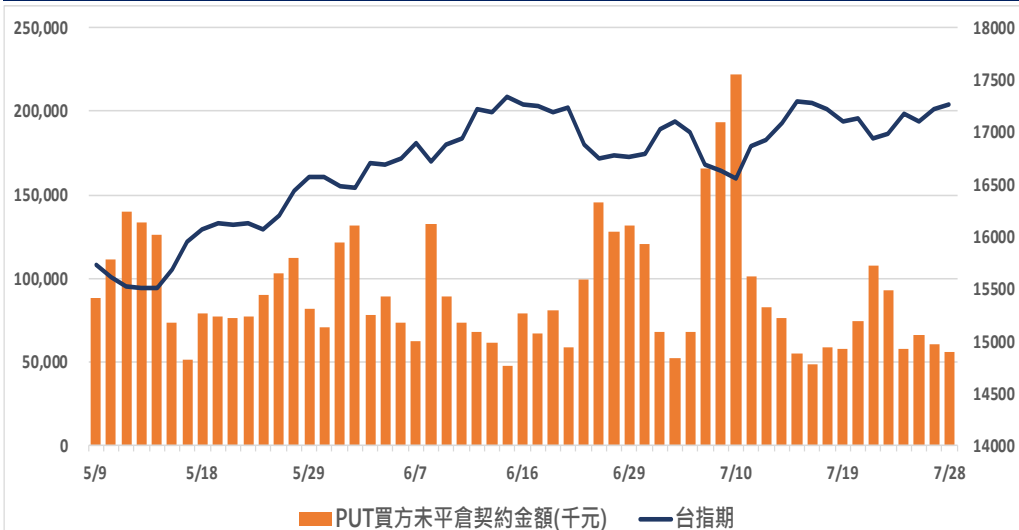
Buy Call未平倉金額



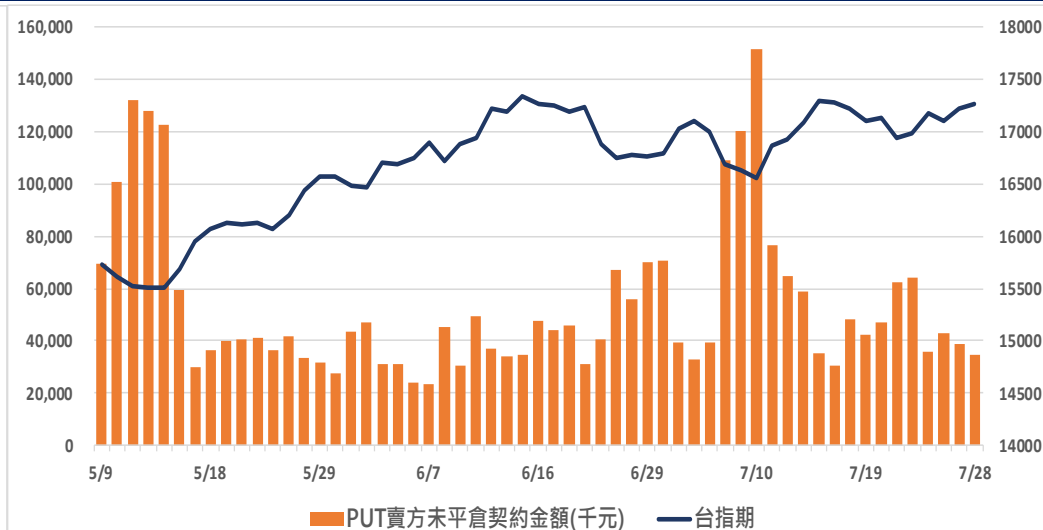
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



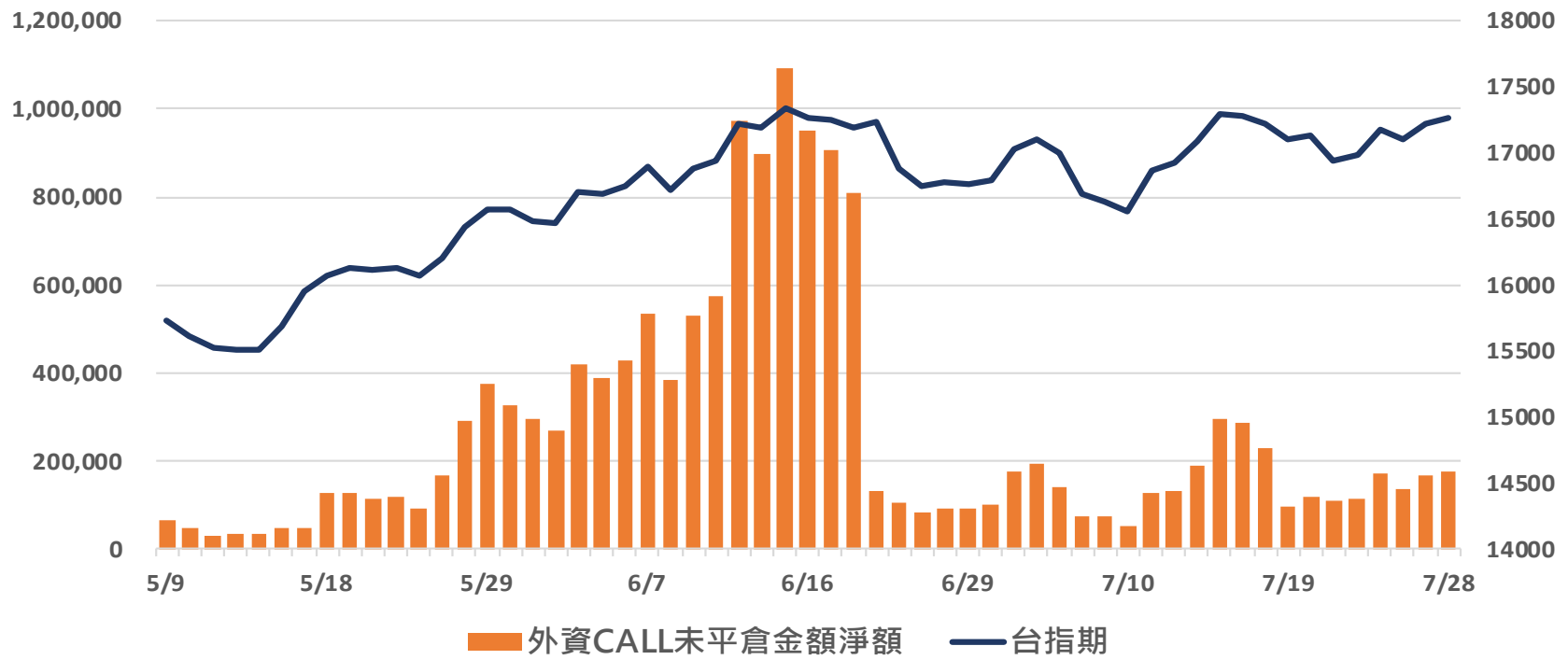
Sell Put未平倉金額



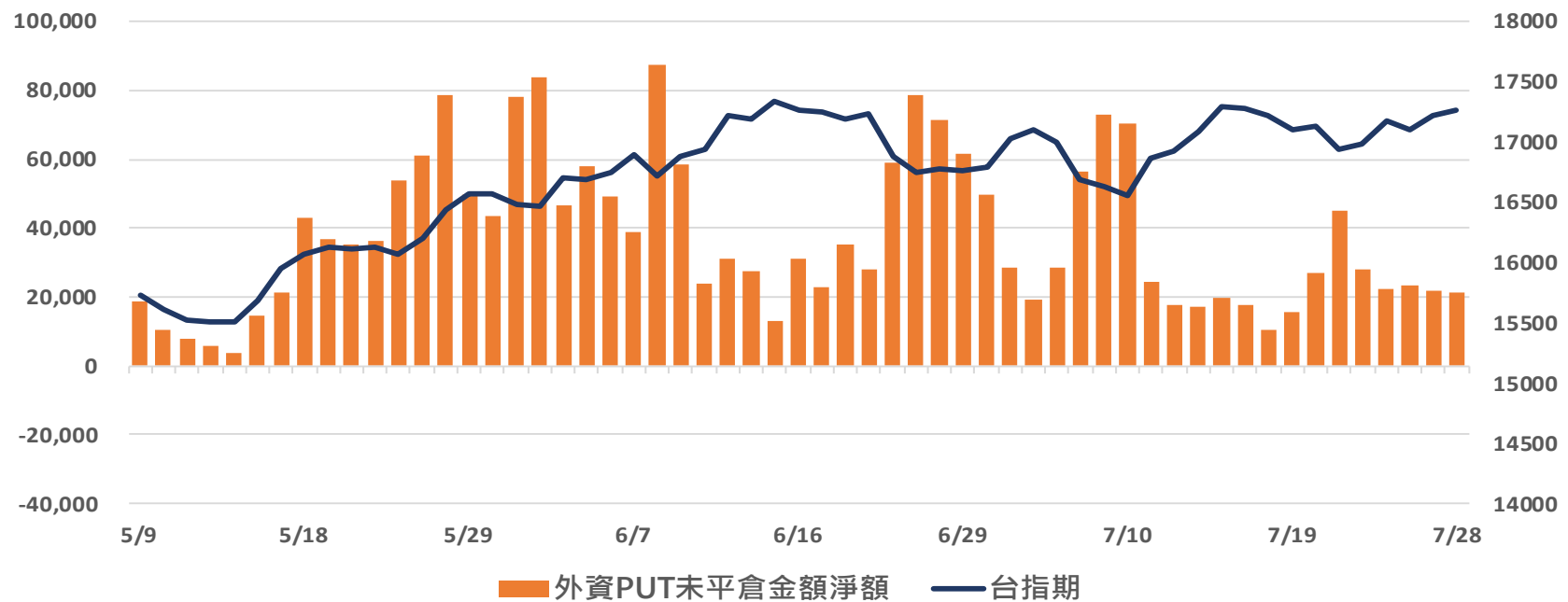
更新日期：2023年7月28日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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28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