

# 台指選擇權OI

日期：2023/7/27 結算日：2023/8/2					日期：2023/7/27 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
1	12	16,650	3,235	1,215	0	163	16,000	5,536	803
0	33	16,700	4,012	2,024	0	14	16,100	2,096	-206
2	16	16,750	3,154	1,831	1	40	16,200	2,183	-10
12	72	16,800	7,073	4,617	0	62	16,300	4,289	249
3	21	16,850	5,215	3,172	4	36	16,400	3,261	-319
23	309	16,900	5,494	2,574	1	218	16,500	4,814	572
-67	379	16,950	5,707	4,069	-22	467	16,600	3,899	-90
196	986	17,000	7,031	4,645	27	346	16,700	3,539	590
429	887	17,050	3,658	1,986	2,957	3,757	16,800	3,163	570
475	1,207	17,100	4,360	2,773	-161	724	16,900	3,022	720
800	1,878	17,150	2,797	1,578	-21	4,669	17,000	3,770	1,084
1,056	2,930	17,200	2,839	1,733	319	3,137	17,100	3,139	172
1,269	2,463	17,250	2,032	1,652	-73	2,582	17,200	2,119	-920
1,283	3,663	17,300	1,759	1,424	-293	4,734	17,300	2,216	1,483
1,414	3,066	17,350	385	333	12	3,871	17,400	633	343
4,016	7,354	17,400	364	243	-22	5,681	17,500	353	71
2,871	5,226	17,450	105	91	-68	5,076	17,600	150	61
2,978	6,798	17,500	105	73	-615	5,259	17,700	33	10
2,761	6,007	17,550	6	4	22	3,705	17,800	8	0
2,516	5,161	17,600	66	23	253	3,521	17,900	15	6
2,109	3,423	17,650	2	-5	289	3,037	18,000	9	0
2,135	4,102	17,700	16	13	-211	1,225	18,100	10	6
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
28,528	62,816	1.2638	79,387	44,874	2,157	63,175	1.0034	63,388	5,365
昨日 P/C	0.9480	今日增減變化		0.3158	昨日 P/C	0.9509	今日增減變化		0.0525

更新日期：2023年7月27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	118,985,126	111,426,636	7,558,490	2,020,960	962,046	2,187,389	-1,225,343	-37,178
投信	42,986,133	39,953,915	3,032,218	749,983	1,431,254	0	1,431,254	8,140
自營商	18,077,681	35,866,652	-17,788,971	3,798,618	374,613	1,390,663	-1,016,050	64,696
	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	1,831,143	1,762,063	69,080	-119,150	71,440	7,600	63,840	32,201
投信	28,693	0	28,693	303	0	0	0	0
自營商	388,192	1,272,481	-884,289	68,806	25,811	107,889	-82,078	-18,801

## 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	29,712	11,206	18,506	-139	23,215	11,536	11,679	1,075
投信	200	300	-100	0	400	102	298	0
自營商	48,133	40,832	7,301	4,578	47,036	35,994	11,042	3,202
特定法人(週)	850	0	850	-495	1,138	2,250	-1,112	865
特定法人(近月)	19,141	4,640	14,501	-3	5,392	9,626	-4,234	2,164
特定法人(全月)	19,968	3,299	16,669	-2,553	5,726	15,841	-10,115	1,991
十大交易人(週)	22,817	17,541	5,276	5,437	23,115	24,751	-1,636	-1,114
十大交易人(近月)	31,331	25,419	5,912	-1,368	21,727	29,756	-8,029	983
十大交易人(全月)	61,106	49,628	11,478	2,774	43,946	59,596	-15,650	-2,866
全市場未沖銷(近月)			63,175	2,157			63,388	5,365
全市場未沖銷(全月)			156,824	34,017			168,749	55,664

更新日期：2023年7月27日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

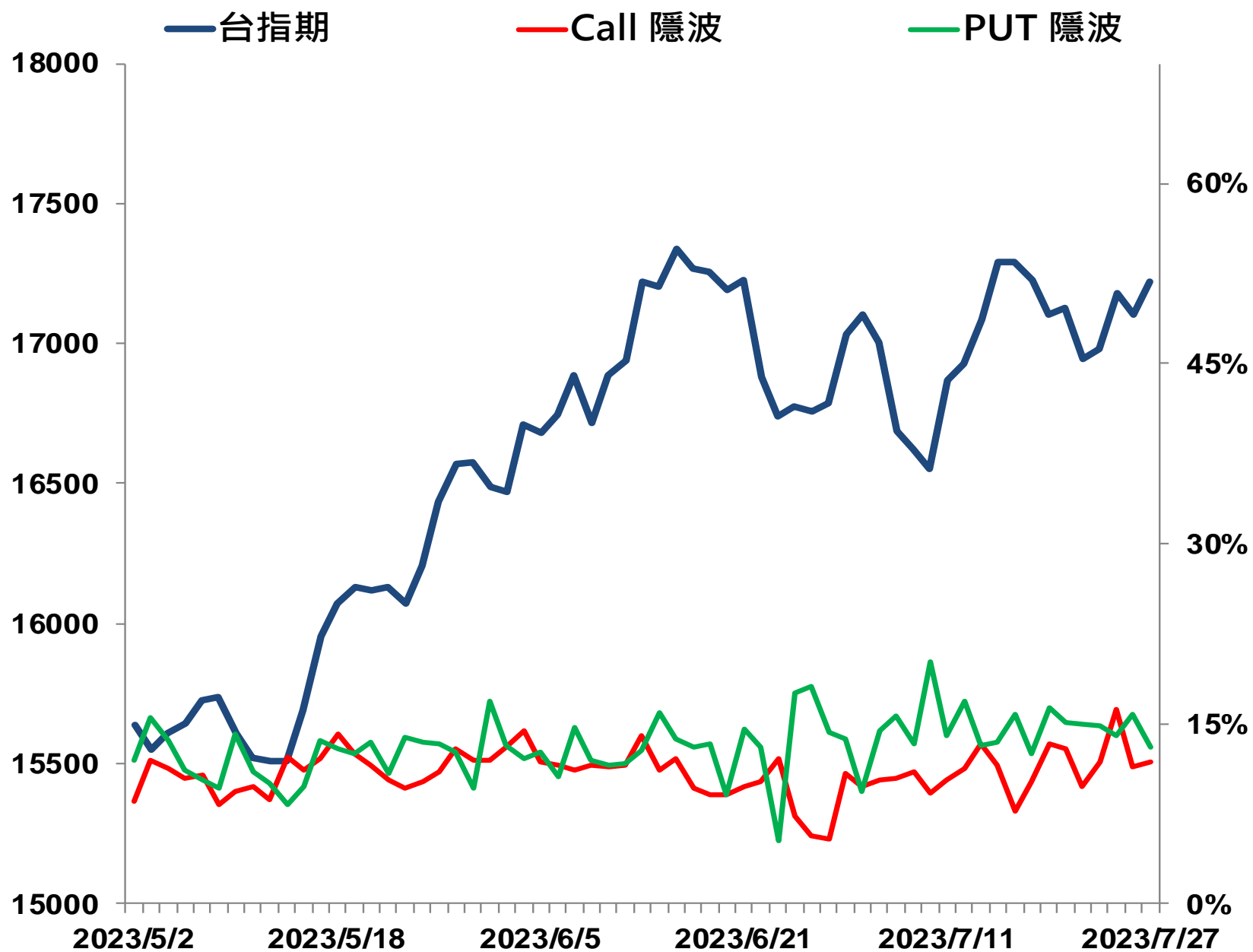
# 選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年7月27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27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

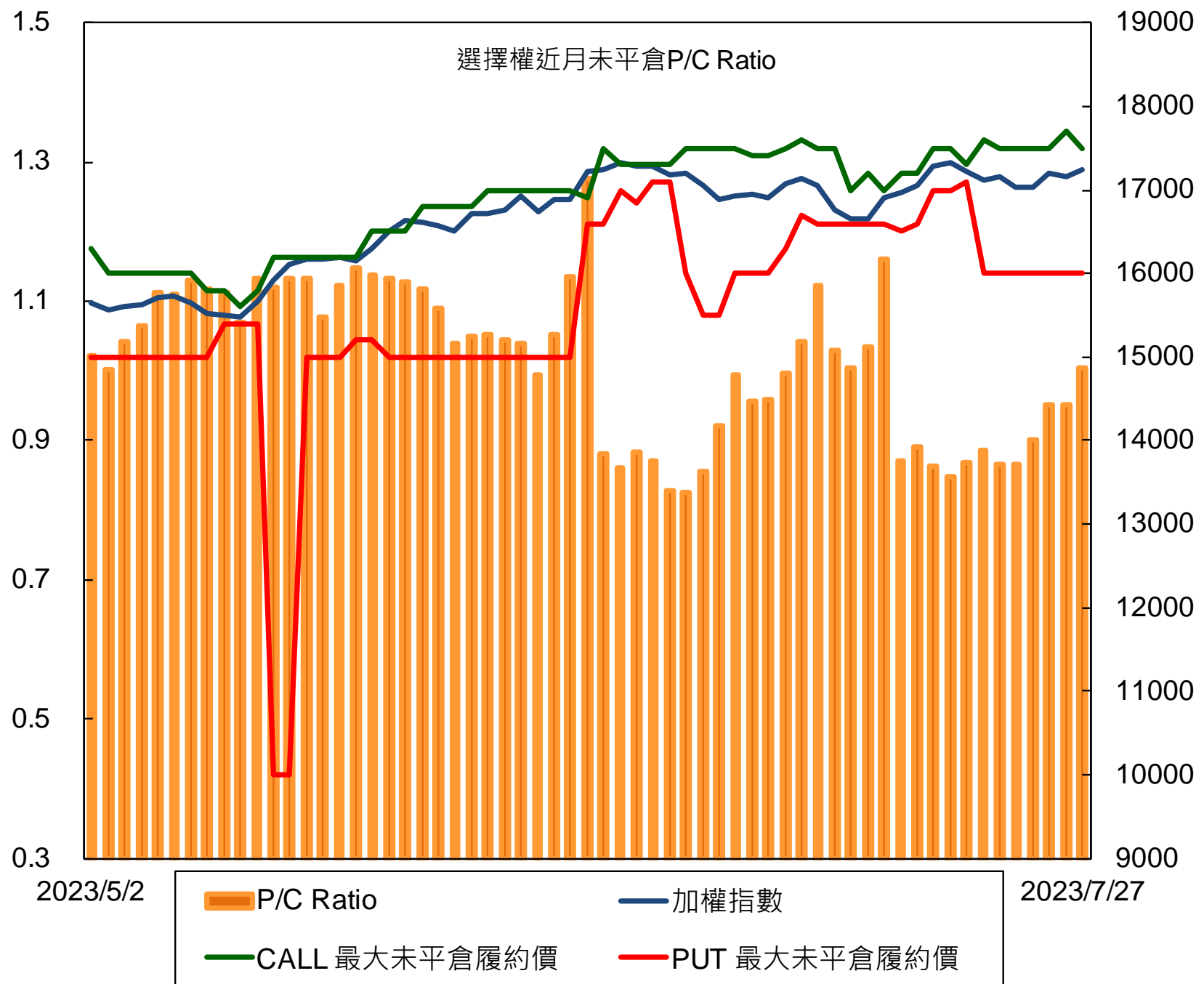
# 自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
<b>Call</b>	7月26日	41,140	38,417	2,723
	7月27日	48,133	40,832	7,301
<b>Put</b>	7月26日	37,740	29,900	7,840
	7月27日	47,036	35,994	11,042

更新日期：2023年7月27日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



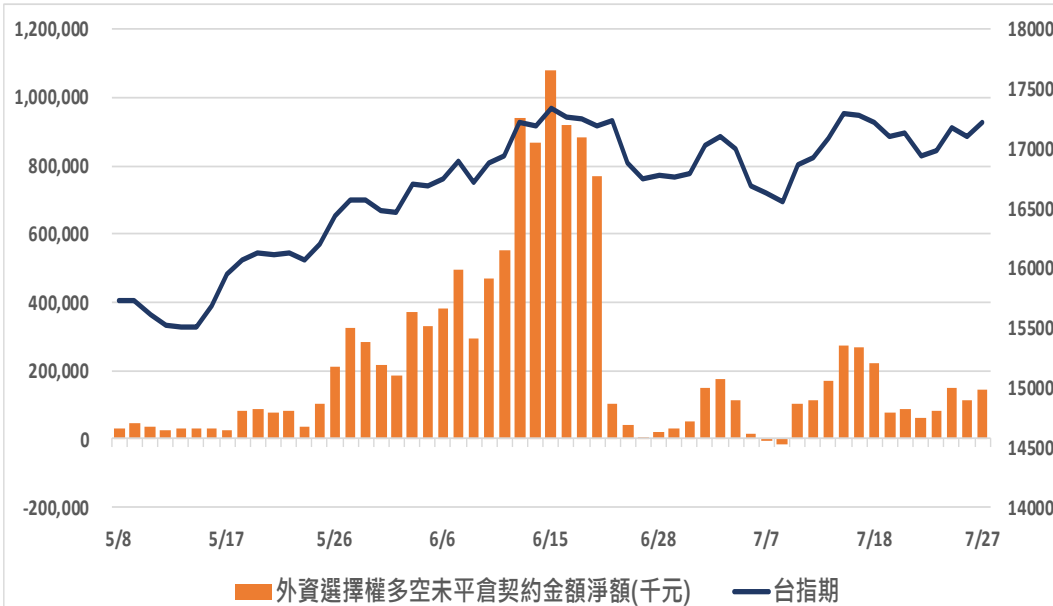
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



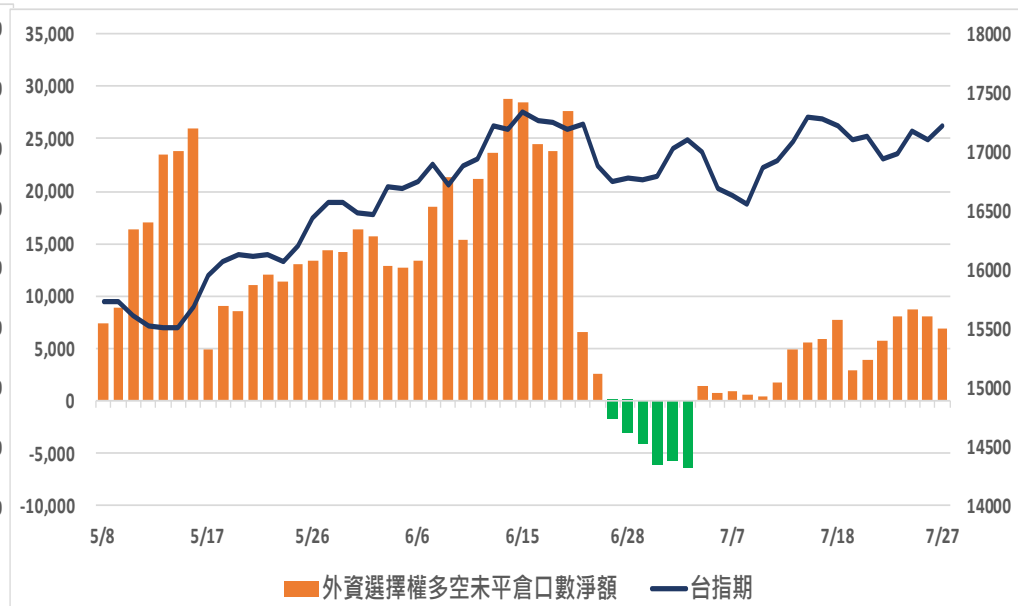
更新日期：2023年7月27日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



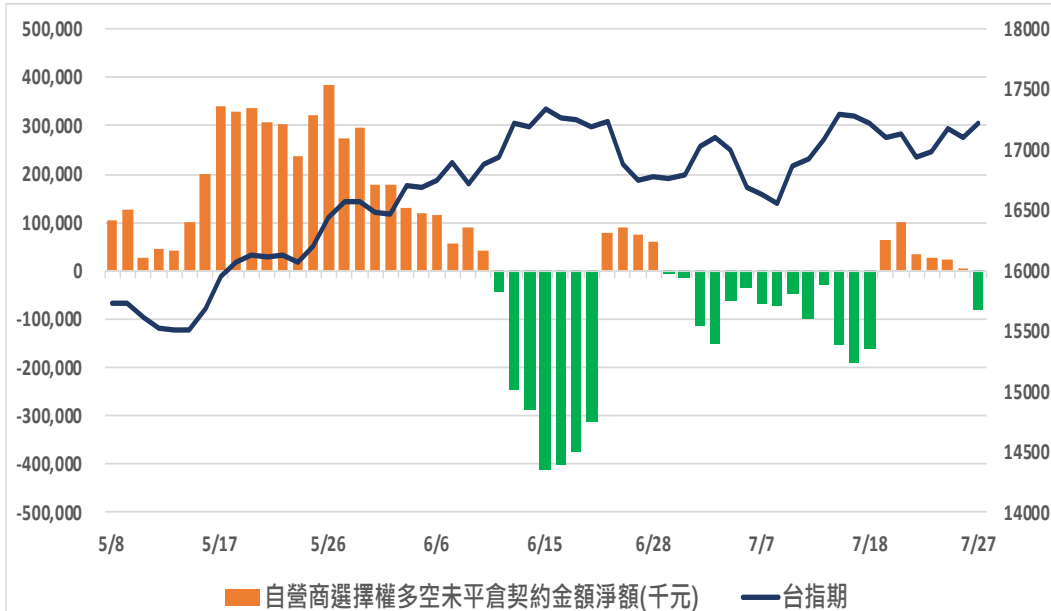
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/21	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
2023/7/27	17223	6,827	-1,214	144,271	+33,459

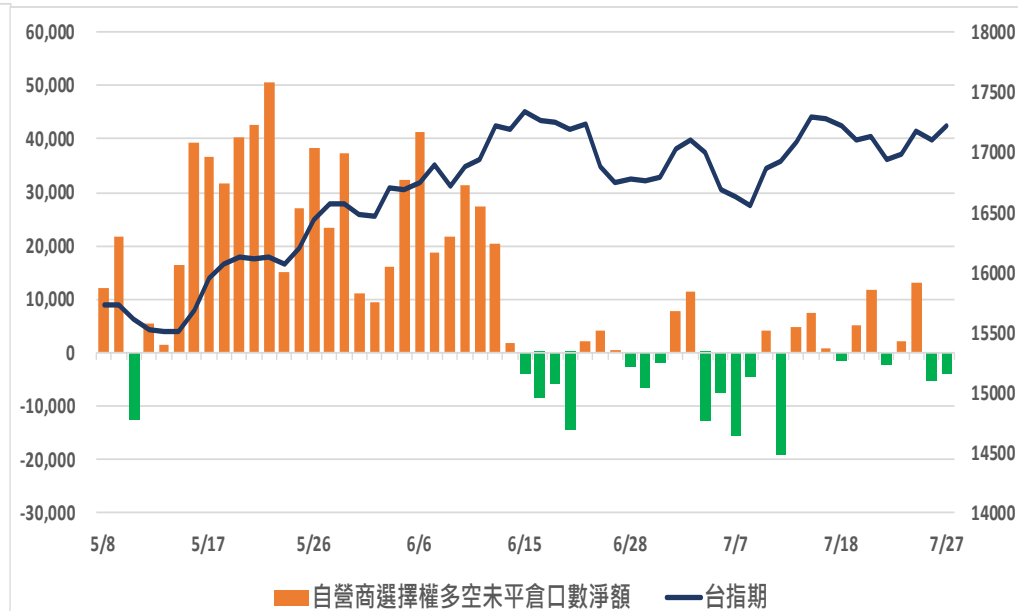
更新日期：2023年7月27日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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

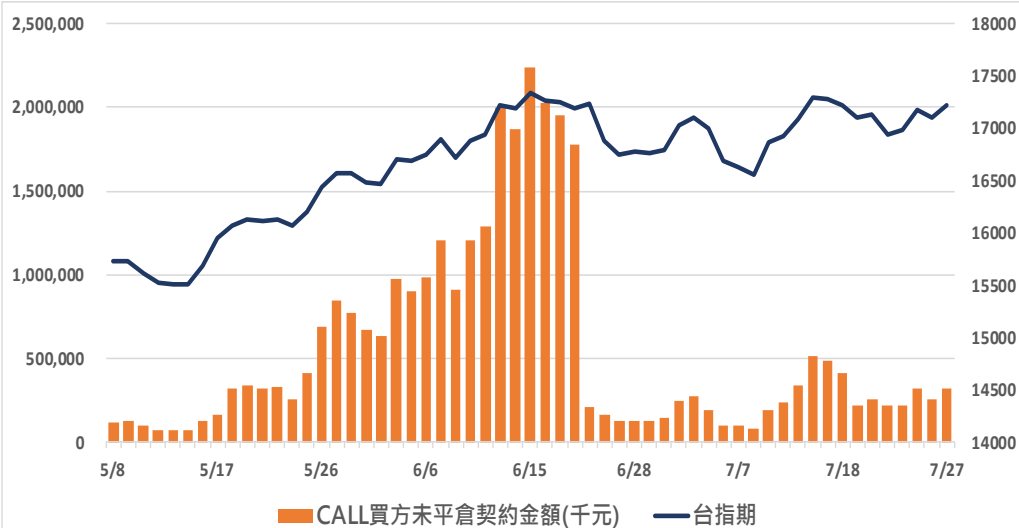
日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/7/21	16947	-2,216	-13,935	34,630	-66,547
2023/7/24	16979	1,973	+4,189	26,807	-7,823
2023/7/25	17182	13,075	+11,102	23,695	-3,112
2023/7/26	17100	-5,117	-18,192	4,678	-19,017
2023/7/27	17223	-3,741	+1,376	-80,356	-85,034

更新日期：2023年7月27日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

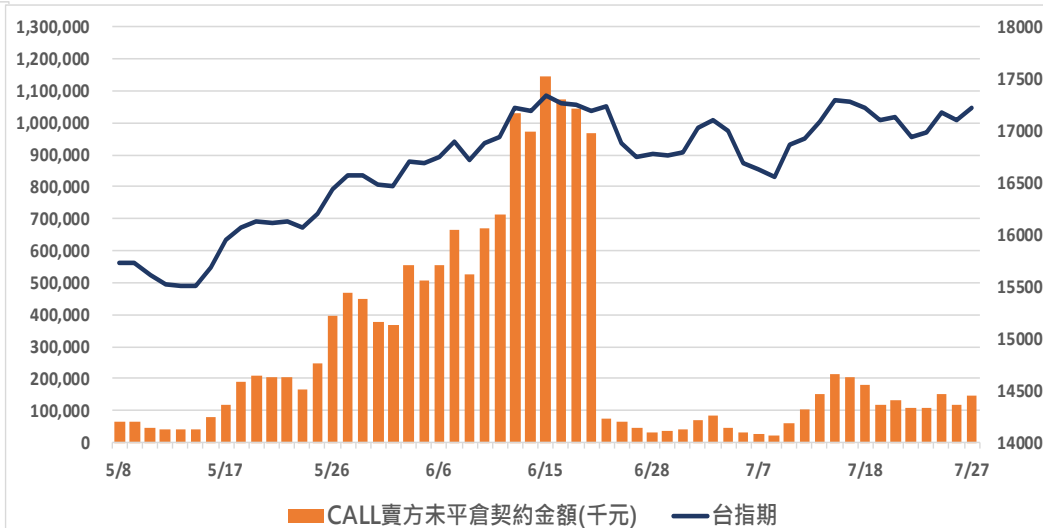


# 外資選擇權未平倉金額

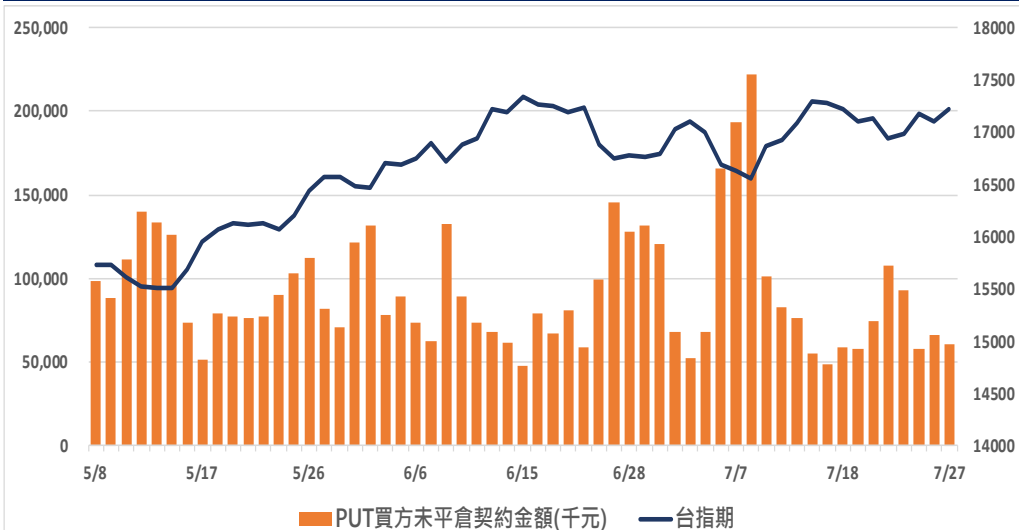
## Buy Call未平倉金額



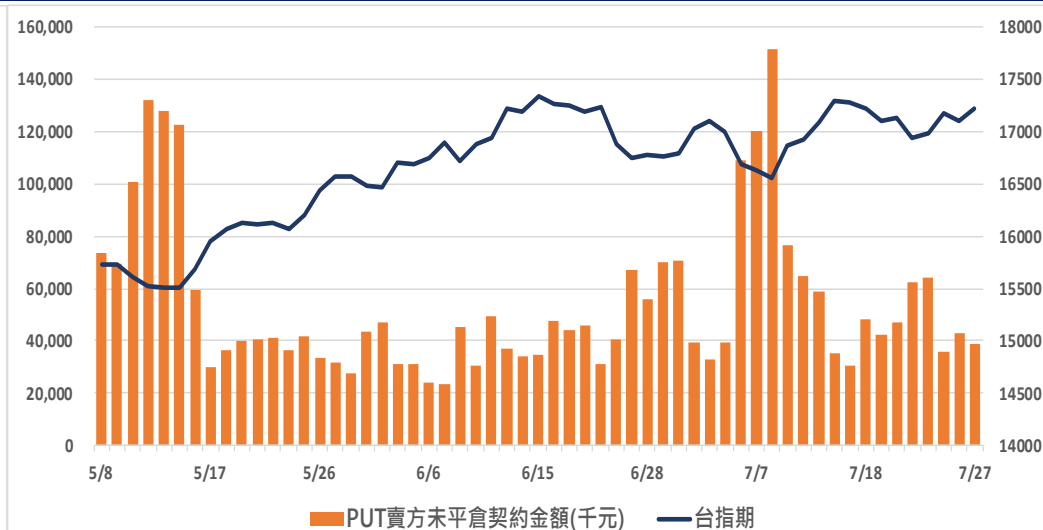
## Sell Call未平倉金額



## Buy Put未平倉金額



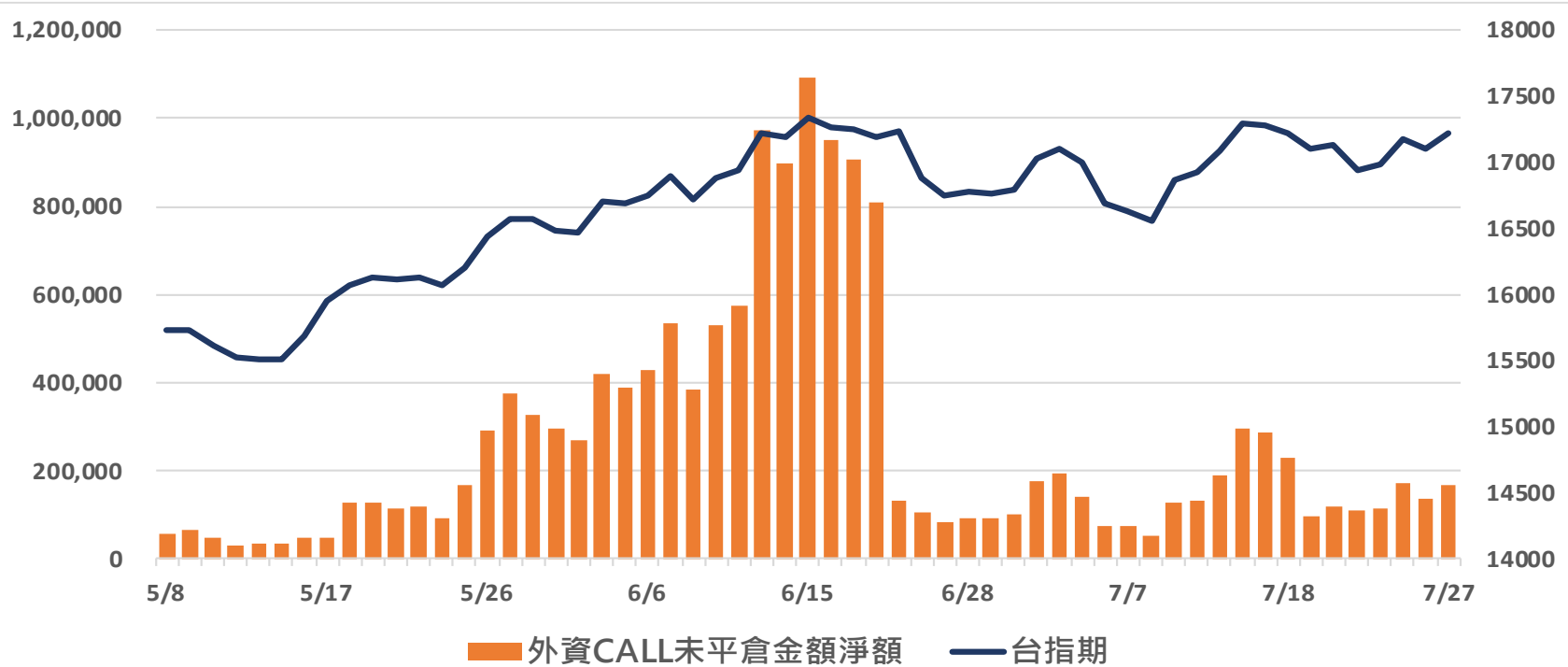
## Sell Put未平倉金額



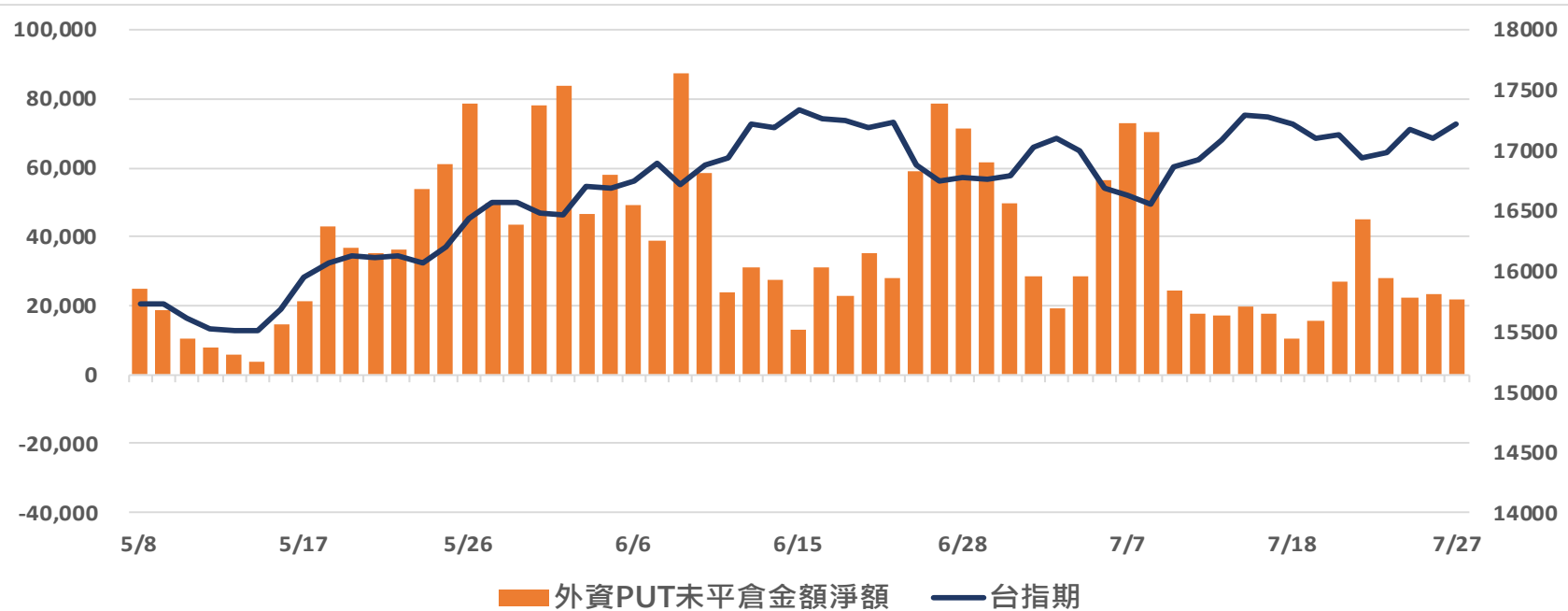
更新日期：2023年7月27日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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27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