

# 台指選擇權OI

日期：2023/7/31 結算日：2023/8/2					日期：2023/7/31 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
-17	18	16,500	3,458	-155	0	27	15,900	1,152	63
-2	7	16,600	3,719	216	-1	162	16,000	5,516	16
0	11	16,650	3,873	-12	0	14	16,100	2,112	35
1	34	16,700	4,698	235	-1	39	16,200	2,479	-61
-1	17	16,750	3,629	-264	0	62	16,300	4,298	-20
82	145	16,800	8,724	170	5	40	16,400	2,981	-52
0	21	16,850	5,719	-337	-10	206	16,500	5,667	213
121	370	16,900	7,541	622	-6	466	16,600	3,931	405
1	334	16,950	7,491	569	2	335	16,700	3,855	-118
268	1,129	17,000	11,393	-127	-98	3,632	16,800	3,999	548
465	1,485	17,050	6,228	310	-18	722	16,900	3,709	425
3,279	4,499	17,100	7,276	153	413	4,993	17,000	4,298	374
2,478	4,121	17,150	5,814	1,276	-142	3,388	17,100	2,668	-778
※ 4,911	8,005	17,200	5,673	179	12	2,621	17,200	2,744	694
3,291	6,189	17,250	2,835	76	106	5,503	17,300	2,630	620
2,473	9,612	17,300	2,902	-542	1,184	5,031	17,400	859	-256
4,574	9,610	17,350	1,753	-368	668	6,083	17,500	494	86
3,295	13,817	17,400	2,347	1,569	620	5,723	17,600	312	90
750	9,778	17,450	1,528	1,159	635	5,876	17,700	77	19
1,065	9,750	17,500	581	354	※ 1,510	5,435	17,800	50	19
-1,299	6,385	17,550	189	166	1,022	4,739	17,900	16	3
-177	7,040	17,600	84	-16	1,381	4,392	18,000	10	1
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
28,497	115,394	0.9739	112,385	4,876	8,322	72,832	0.9307	67,784	2,257
昨日 P/C	1.2372	今日增減變化		-0.2633	昨日 P/C	1.0158	今日增減變化		-0.0851

更新日期：2023年7月31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	109,644,937	122,595,135	-12,950,198	-16,523,875	876,233	2,491,578	-1,615,345	-148,446
投信	40,100,639	40,034,702	65,937	-1,837,163	1,103,652	0	1,103,652	-23,687
自營商	18,480,563	36,235,516	-17,754,953	-1,917,447	421,308	1,340,996	-919,688	-328,812
	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	1,906,062	1,838,710	67,352	-110,502	74,068	3,023	71,045	4,500
投信	28,625	0	28,625	82	0	0	0	0
自營商	328,341	1,518,788	-1,190,447	-92,500	31,691	117,846	-86,155	-6,004

## 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	32,951	14,571	18,380	-1,190	28,174	13,127	15,047	3,100
投信	200	300	-100	0	400	102	298	0
自營商	58,894	55,730	3,164	-8,215	58,512	47,265	11,247	3,955
特定法人(週)	2,600	0	2,600	1,530	0	2,090	-2,090	-2,090
特定法人(近月)	18,939	4,958	13,981	-334	5,607	10,400	-4,793	-90
特定法人(全月)	17,773	3,299	14,474	287	3,299	15,803	-12,504	-7,338
十大交易人(週)	31,708	35,773	-4,065	-10,700	33,621	35,905	-2,284	-1,697
十大交易人(近月)	35,031	29,624	5,407	-10	22,679	32,359	-9,680	-906
十大交易人(全月)	73,641	66,080	7,561	-7,547	54,417	73,471	-19,054	-4,942
全市場未沖銷(近月)			72,832	8,322			67,784	2,257
全市場未沖銷(全月)			229,578	43,580			216,662	14,089

更新日期：2023年7月31日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

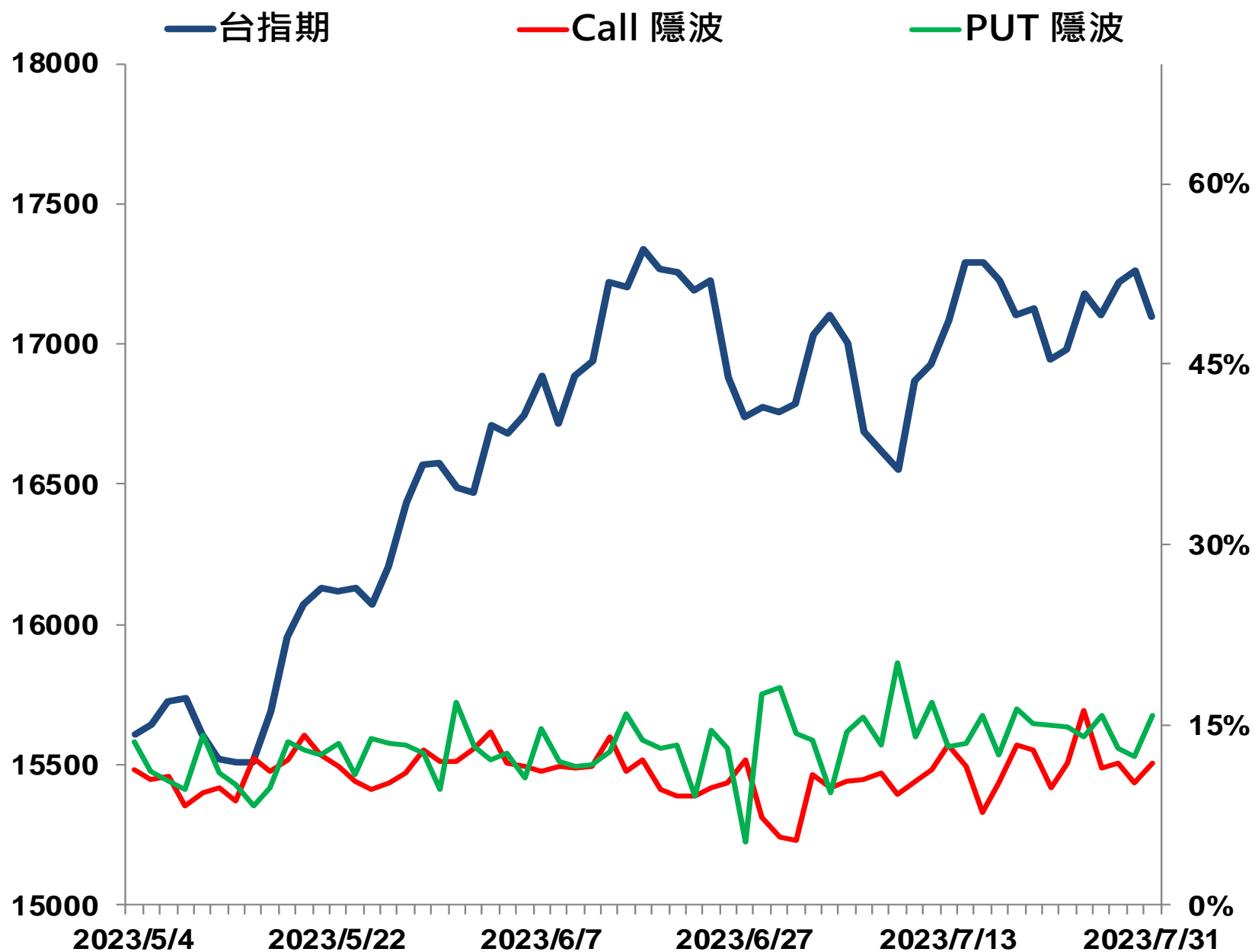
# 選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年7月31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31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

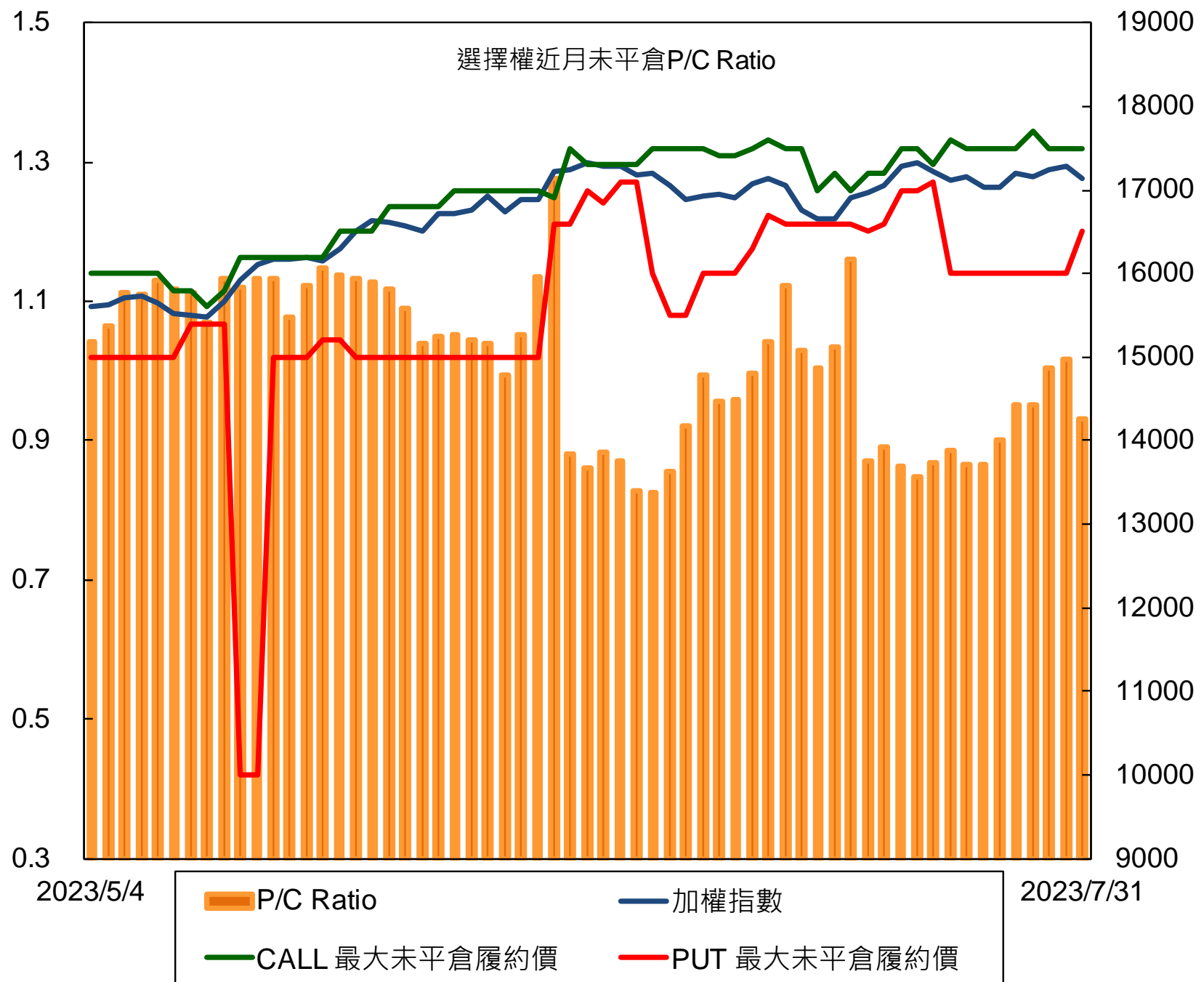
# 自營商選擇權OI部位統計

	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28日	56,902	45,523	11,379
	7月31日	58,894	55,730	3,164
<b>Put</b>	7月28日	52,327	45,035	7,292
	7月31日	58,512	47,265	11,247

更新日期：2023年7月31日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



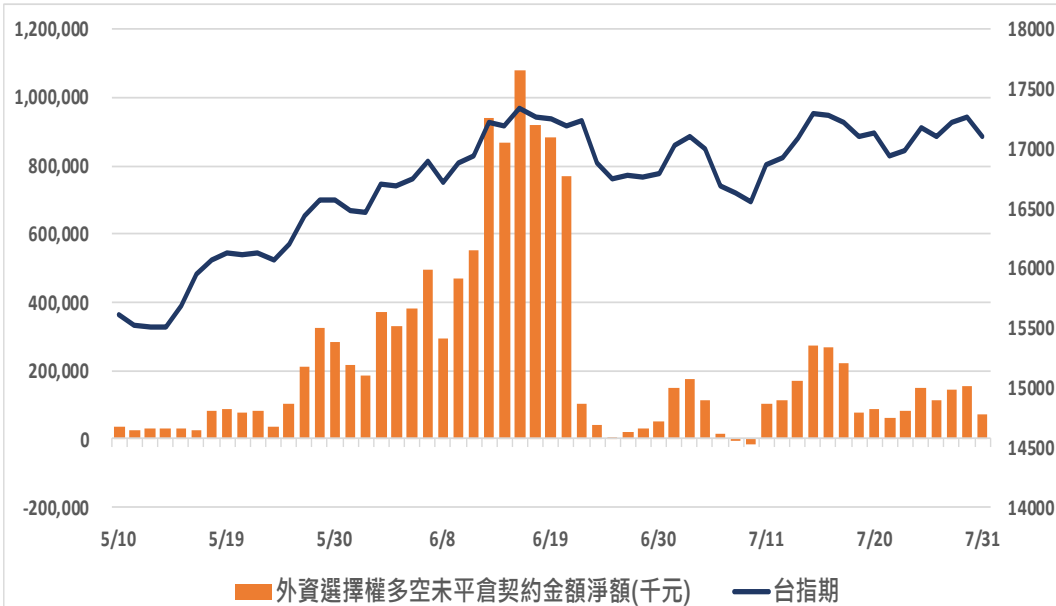
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



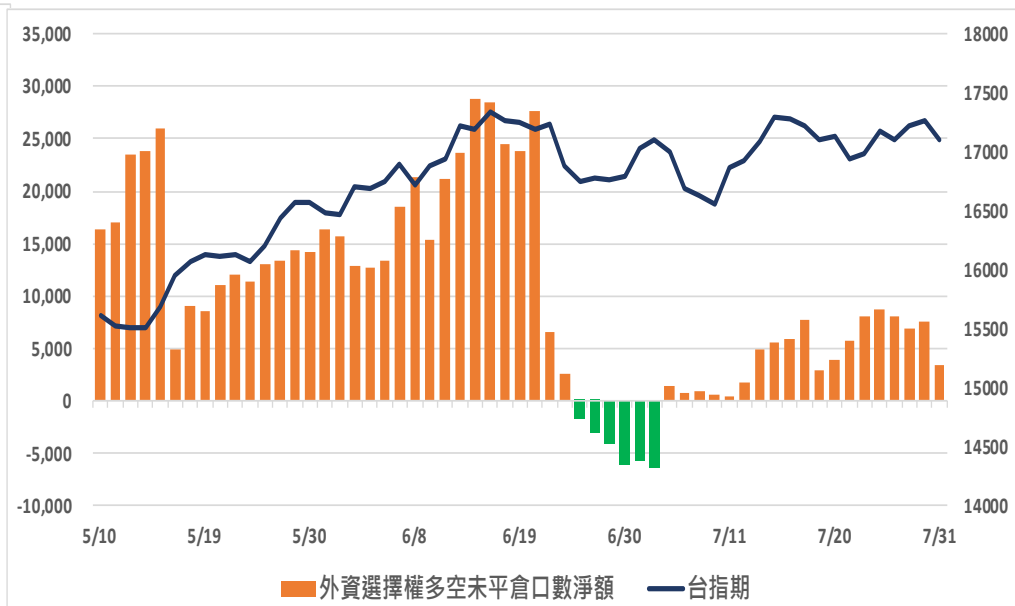
更新日期：2023年7月31日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



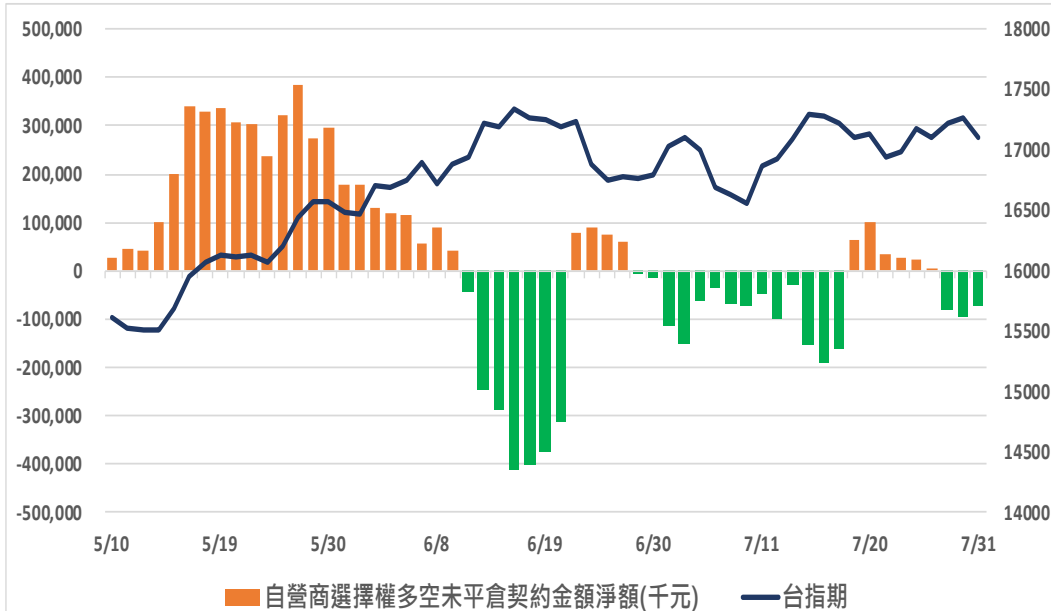
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/25	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
2023/7/31	17103	3,333	-4,290	69,251	-83,481

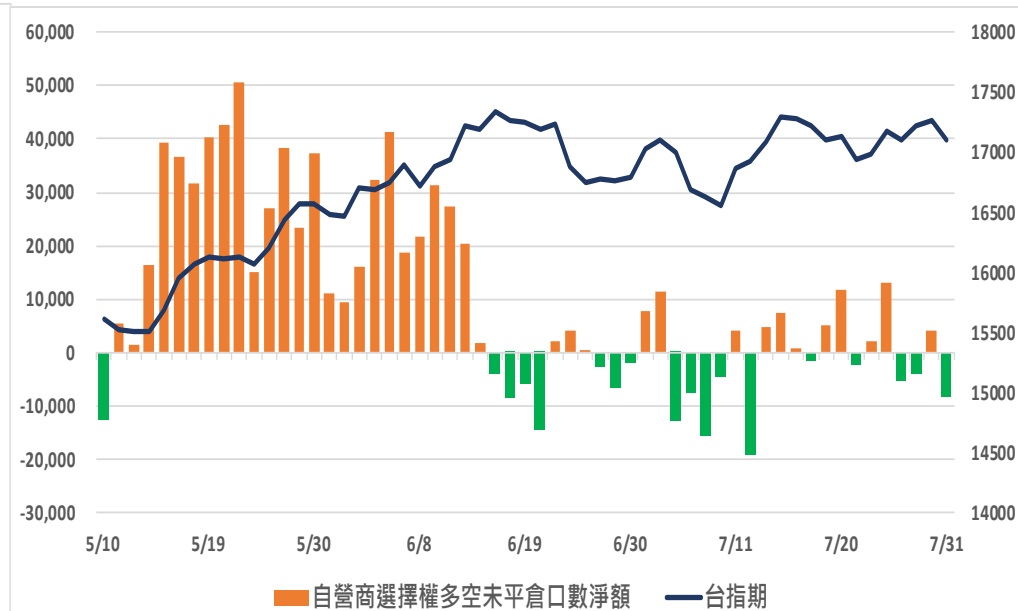
更新日期：2023年7月31日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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

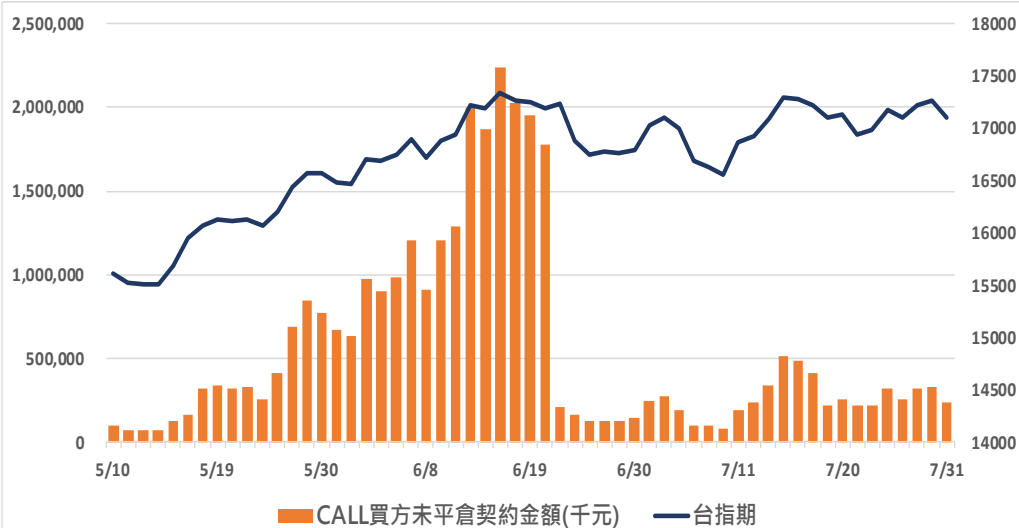
日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/7/25	17182	13,075	+11,102	23,695	-3,112
2023/7/26	17100	-5,117	-18,192	4,678	-19,017
2023/7/27	17223	-3,741	+1,376	-80,356	-85,034
2023/7/28	17262	4,087	+7,828	-94,522	-14,166
2023/7/31	17103	-8,083	-12,170	-72,324	+22,198

更新日期：2023年7月31日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

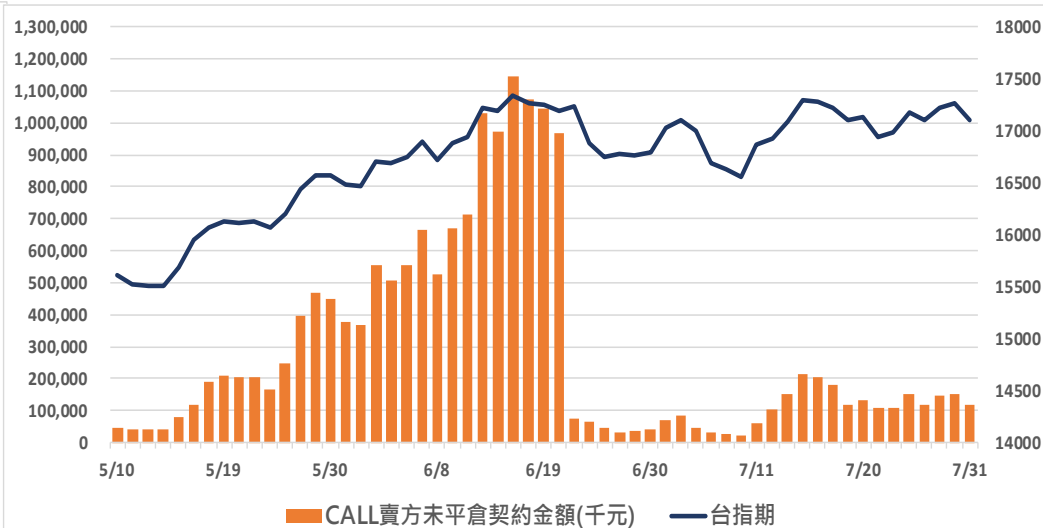


# 外資選擇權未平倉金額

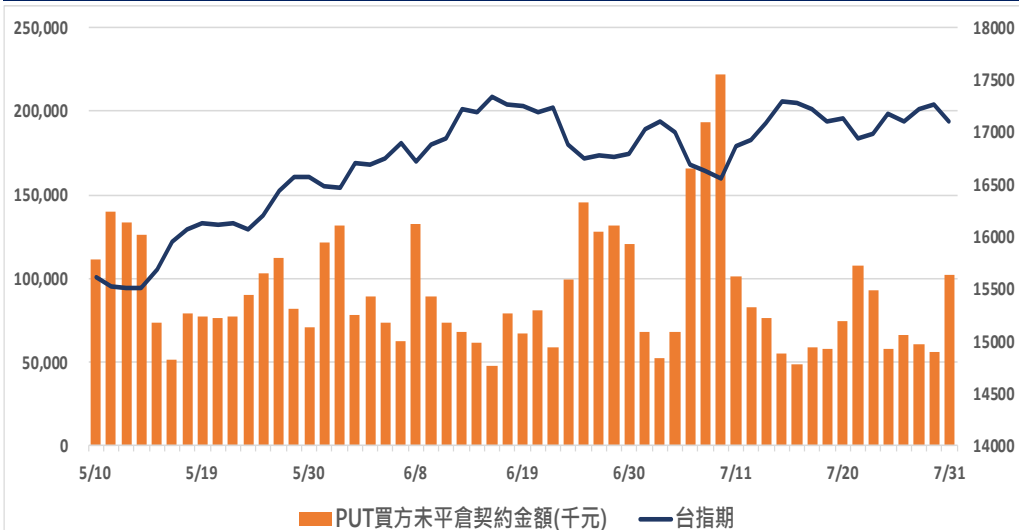
## Buy Call未平倉金額



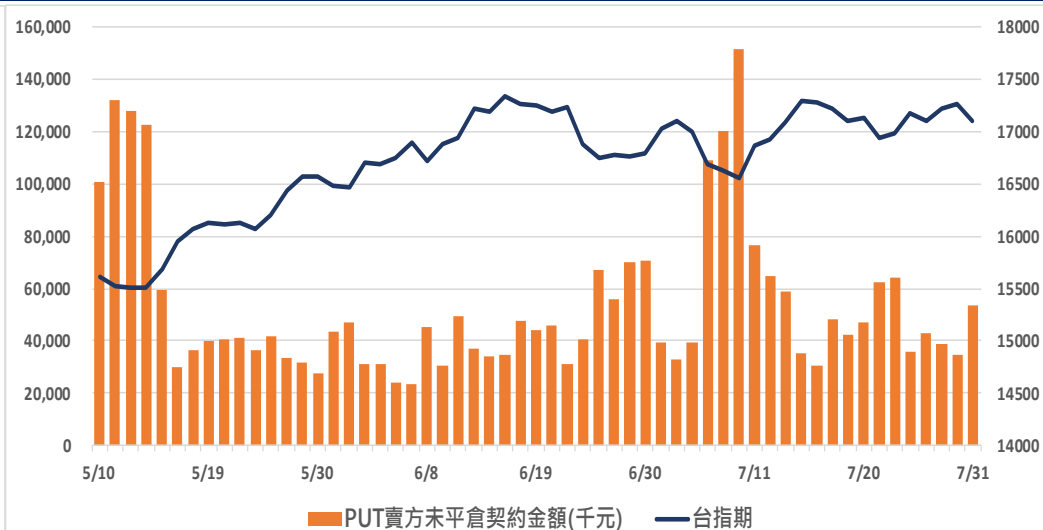
## Sell Call未平倉金額



## Buy Put未平倉金額



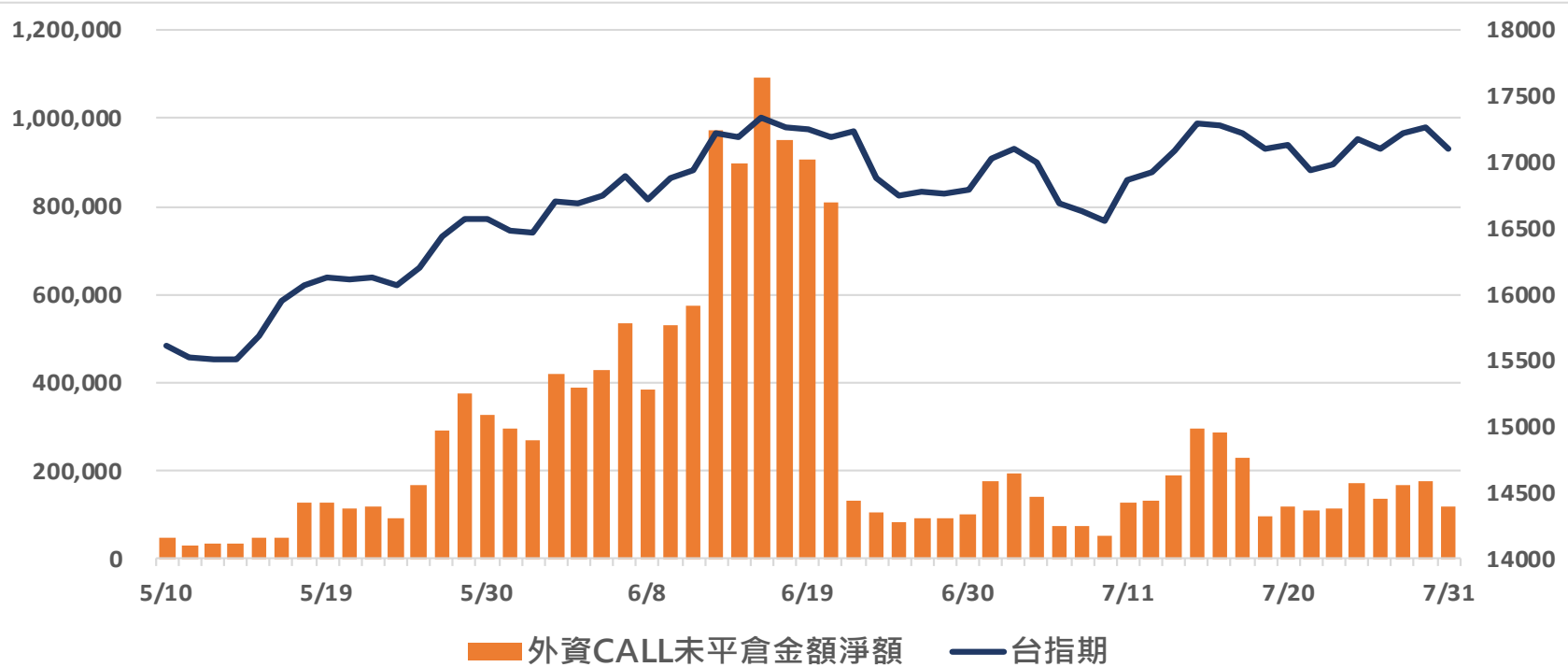
## Sell Put未平倉金額



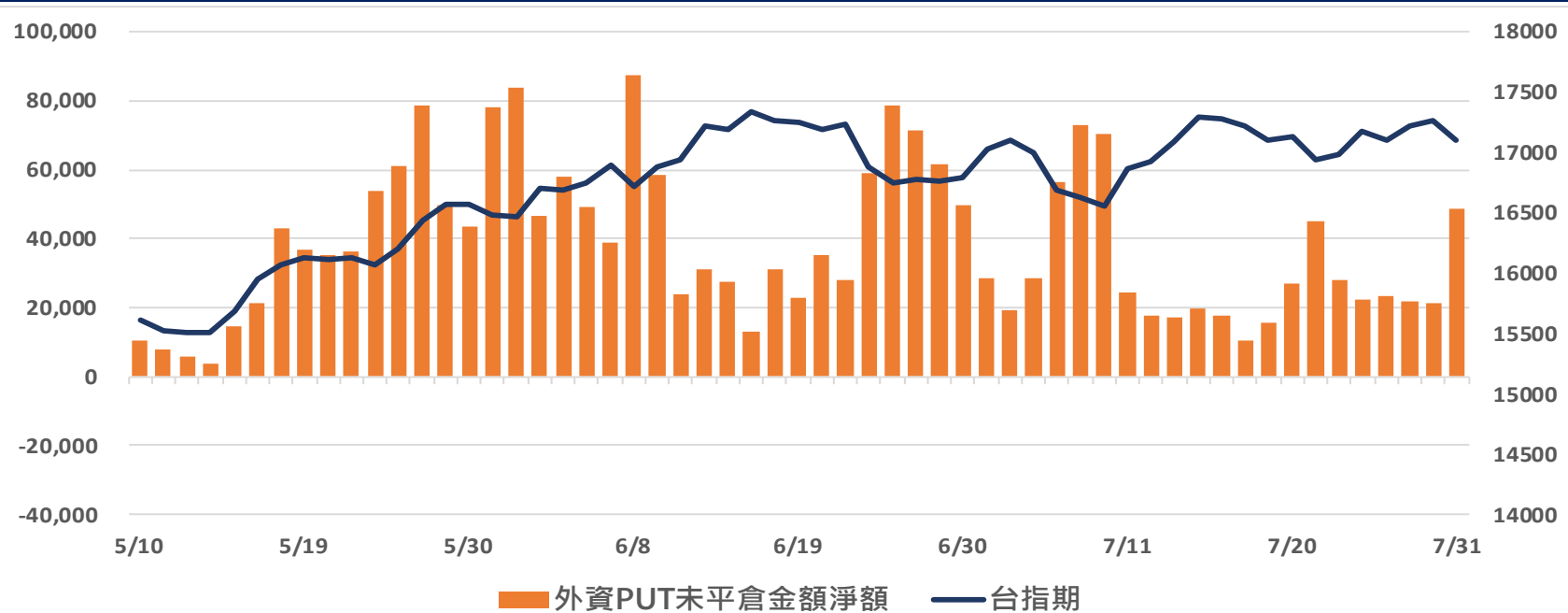
更新日期：2023年7月31日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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31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