

# 台指選擇權OI

日期：2023/8/1 結算日：2023/8/2					日期：2023/8/1 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	7	16,600	3,732	13	0	162	16,000	5,566	50
0	11	16,650	3,961	88	0	14	16,100	1,902	-210
-1	33	16,700	4,780	82	-3	36	16,200	2,541	62
0	17	16,750	3,876	247	0	62	16,300	4,370	72
-1	144	16,800	10,550	1,826	0	40	16,400	3,045	64
3	24	16,850	5,802	83	0	206	16,500	6,024	357
-9	361	16,900	8,637	1,096	-18	448	16,600	4,352	421
119	453	16,950	8,480	989	15	350	16,700	4,501	646
-43	1,086	17,000	13,960	2,567	516	4,148	16,800	4,573	574
208	1,693	17,050	7,973	1,745	82	804	16,900	3,977	268
400	4,899	17,100	11,158	3,882	-53	4,940	17,000	3,974	-324
1,418	5,539	17,150	8,303	2,489	-479	2,909	17,100	2,312	-356
1,572	9,577	17,200	9,697	4,024 ※	327	2,948	17,200	3,617	873 ※
3,580	9,769	17,250	4,652	1,817	-666	4,837	17,300	2,619	-11
※ 5,521	15,133	17,300	2,590	-312	215	5,246	17,400	789	-70
2,753	12,363	17,350	1,752	-1	129	6,212	17,500	462	-32
-724	13,093	17,400	1,901	-446	229	5,952	17,600	315	3
-276	9,502	17,450	1,235	-293	-137	5,739	17,700	78	1
-1,185	8,565	17,500	541	-40	301	5,736	17,800	48	-2
-1,516	4,869	17,550	156	-33	※ 517	5,256	17,900	16	0
-1,705	5,335	17,600	80	-4	255	4,647	18,000	10	0
-1,238	3,798	17,650	1	-2	306	1,819	18,100	11	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
6,167	121,561	1.0854	131,943	19,558	1,587	74,419	0.9442	70,268	2,484
昨日 P/C	0.9739	今日增減變化		0.1115	昨日 P/C	0.9307	今日增減變化		0.0135

更新日期：2023年8月1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	112,238,320	111,118,122	1,120,198	14,070,396	871,572	2,142,056	-1,270,484	344,861
投信	39,465,323	39,870,138	-404,815	-470,752	1,112,930	0	1,112,930	9,278
自營商	17,477,964	35,781,685	-18,303,721	-548,768	428,996	1,277,063	-848,067	71,621
	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	1,863,878	1,812,626	51,252	-16,100	76,060	3,042	73,018	1,973
投信	28,907	0	28,907	282	0	0	0	0
自營商	404,699	1,544,204	-1,139,505	50,942	38,028	109,524	-71,496	14,659

## 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	33,755	14,808	18,947	567	31,368	13,812	17,556	2,509
投信	200	300	-100	0	400	102	298	0
自營商	62,502	55,892	6,610	3,446	59,324	53,814	5,510	-5,737
特定法人(週)	5,810	0	5,810	3,210	1,812	6,408	-4,596	-2,506
特定法人(近月)	18,194	4,525	13,669	-312	6,042	10,400	-4,358	435
特定法人(全月)	18,656	0	18,656	4,182	2,831	18,069	-15,238	-2,734
十大交易人(週)	33,215	35,702	-2,487	1,578	43,910	39,720	4,190	6,474
十大交易人(近月)	36,781	29,123	7,658	2,251	22,384	32,658	-10,274	-594
十大交易人(全月)	75,571	64,592	10,979	3,418	61,897	77,699	-15,802	3,252
全市場未沖銷(近月)			74,419	1,587			70,268	2,484
全市場未沖銷(全月)			242,409	12,831			246,839	30,177

更新日期：2023年8月1日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

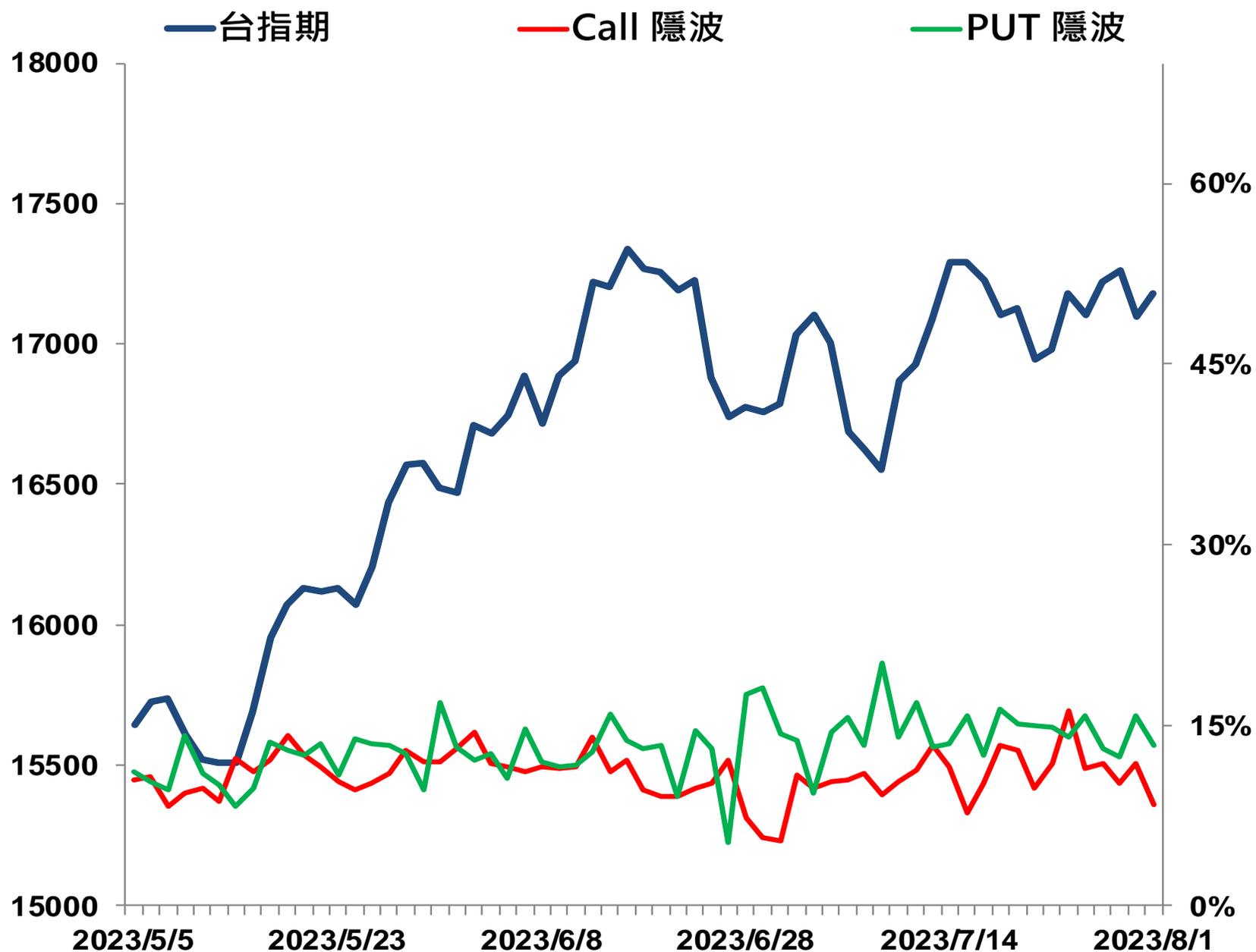
# 選擇權當日波動率

## 臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月1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



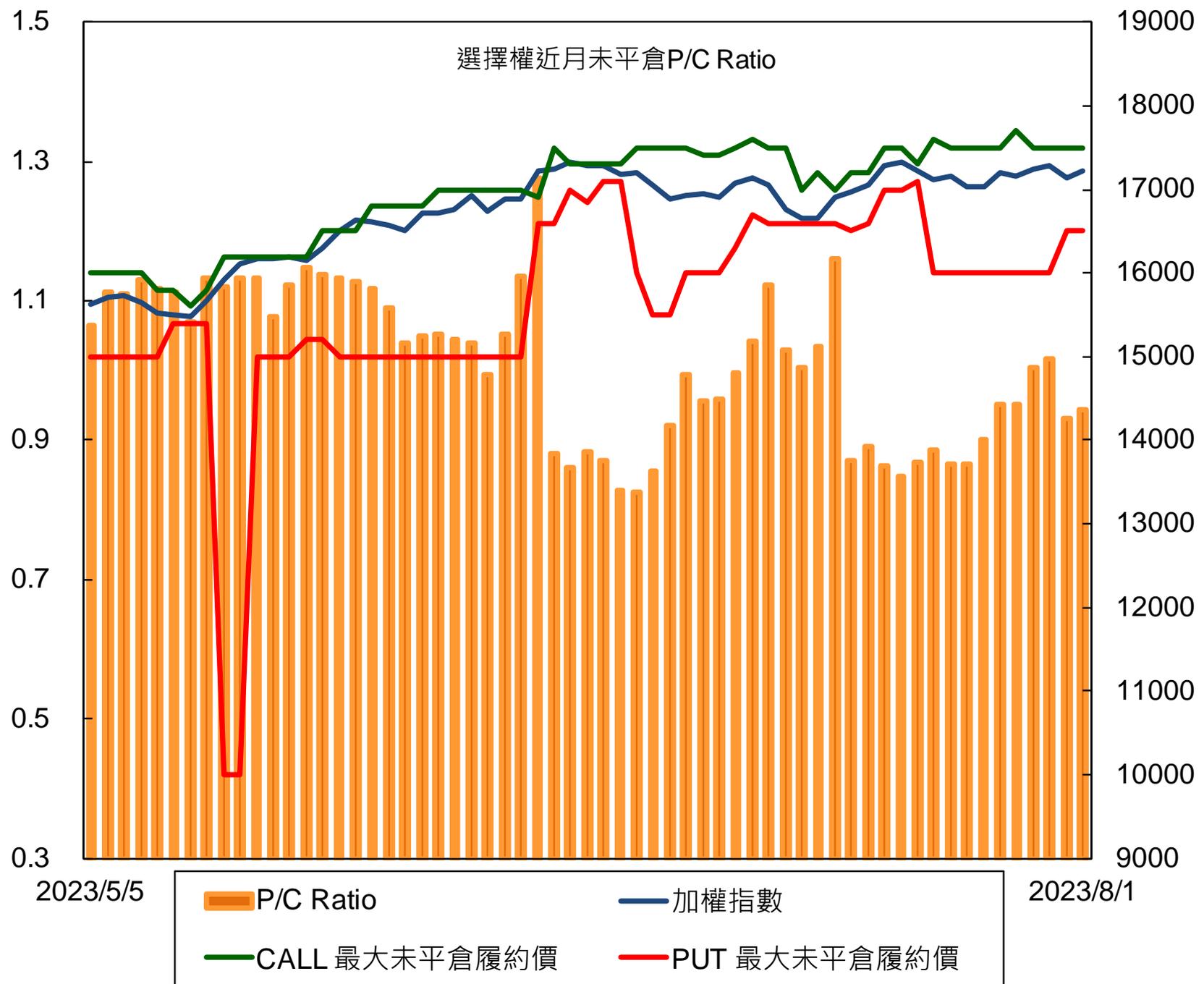
更新日期：2023年8月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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31日	58,894	55,730	3,164
	8月1日	62,502	55,892	6,610
<b>Put</b>	7月31日	58,512	47,265	11,247
	8月1日	59,324	53,814	5,510

更新日期：2023年8月1日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

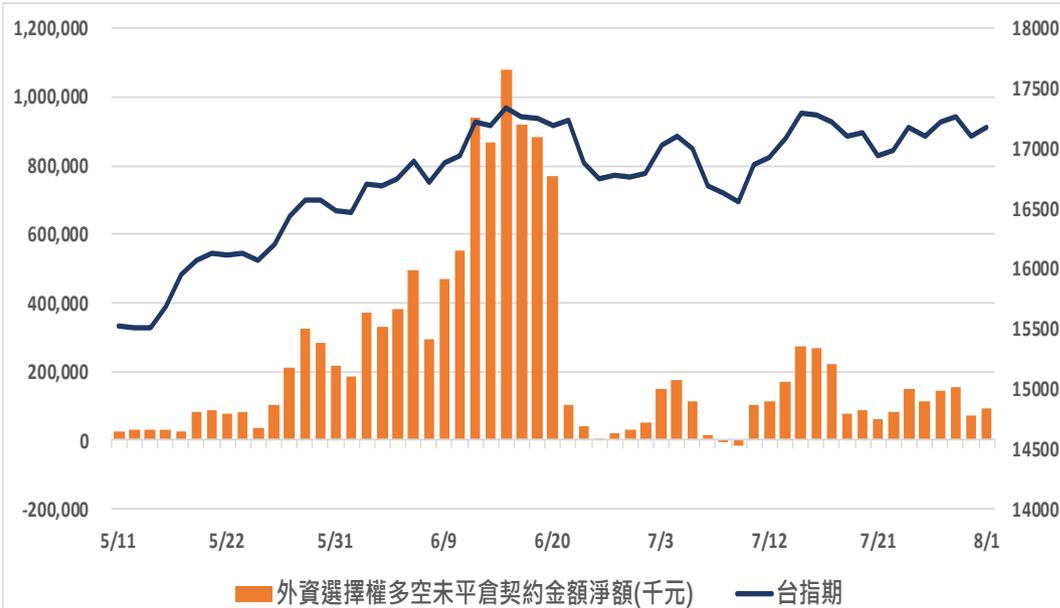
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



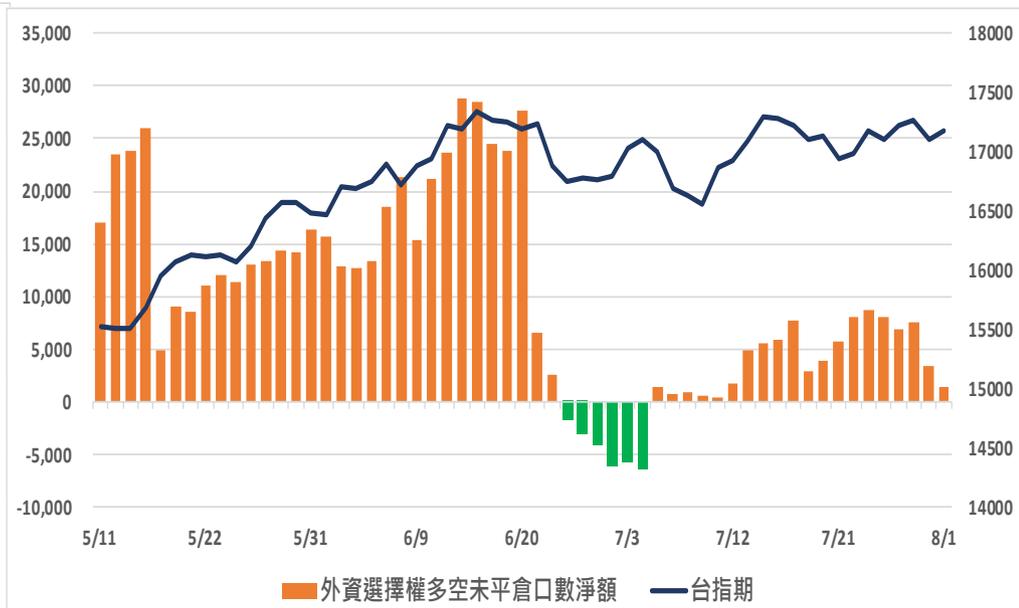
更新日期：2023年8月1日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



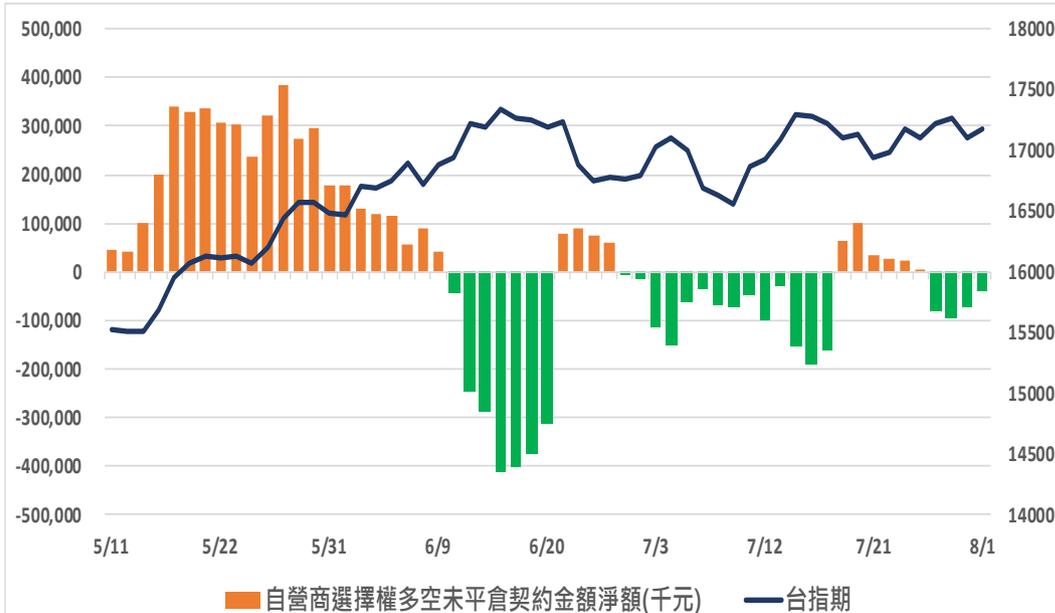
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/26	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
2023/8/1	17178	1,391	-1,942	89,819	+20,568

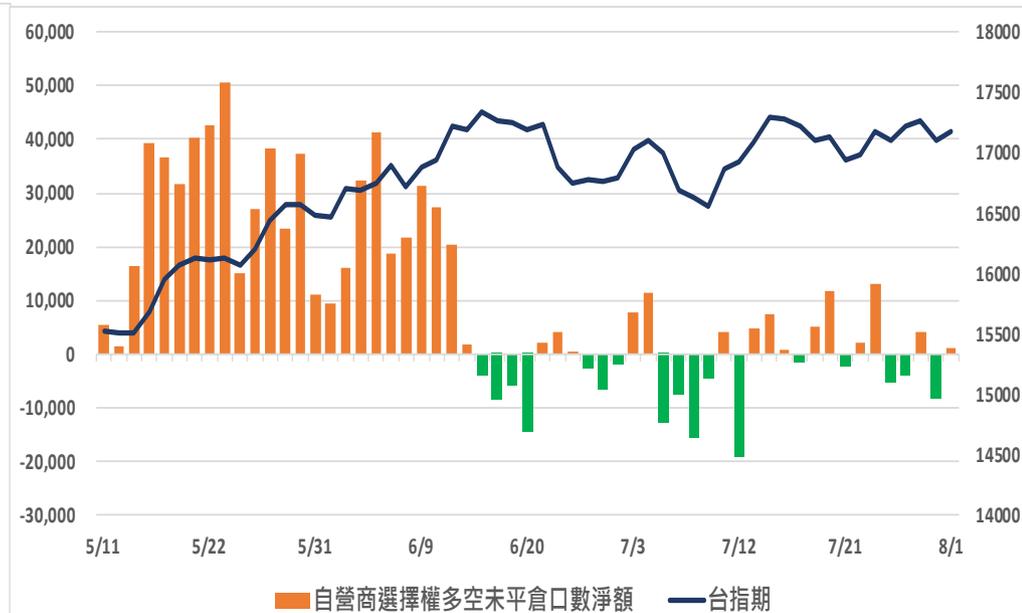
更新日期：2023年8月1日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



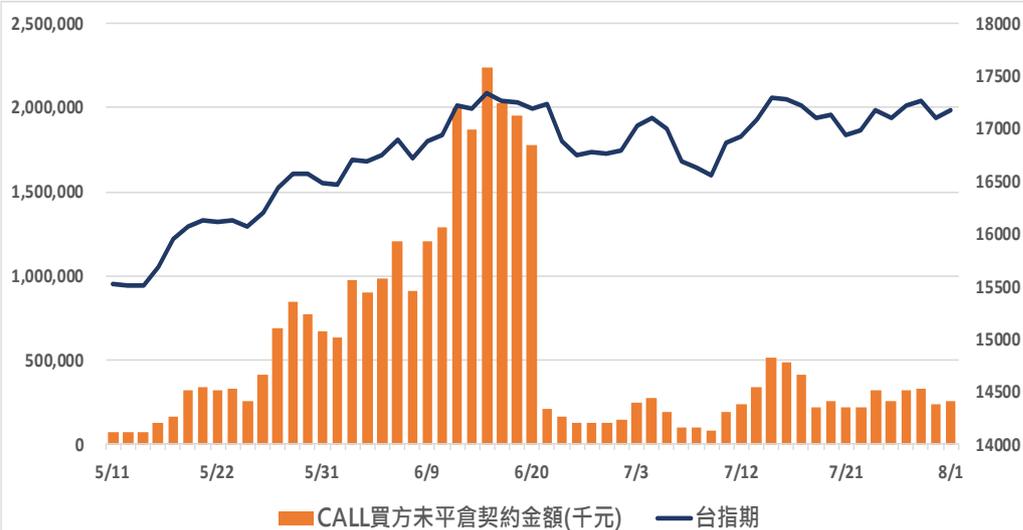
## 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/26	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
2023/8/1	17178	1,100	+9,183	-39,731	+32,593

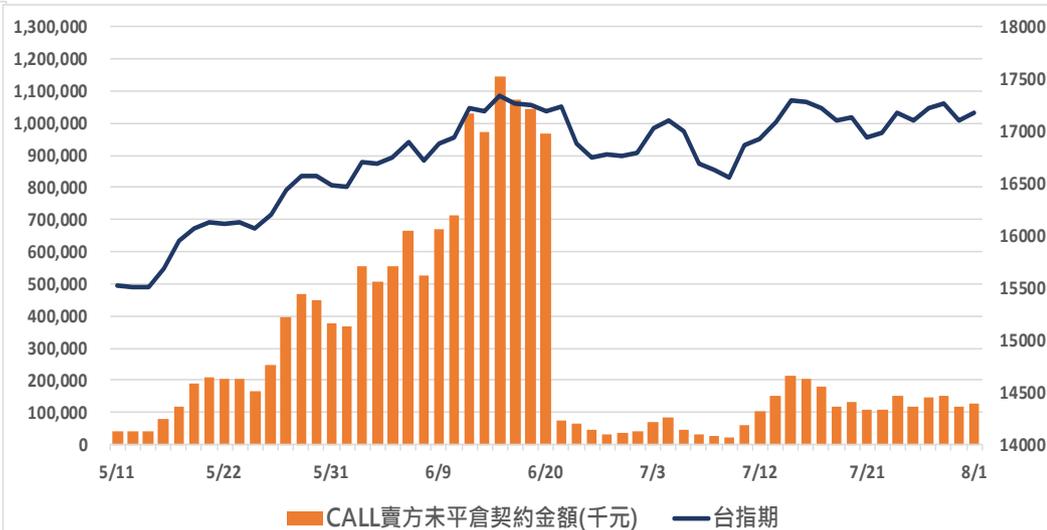
更新日期：2023年8月1日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



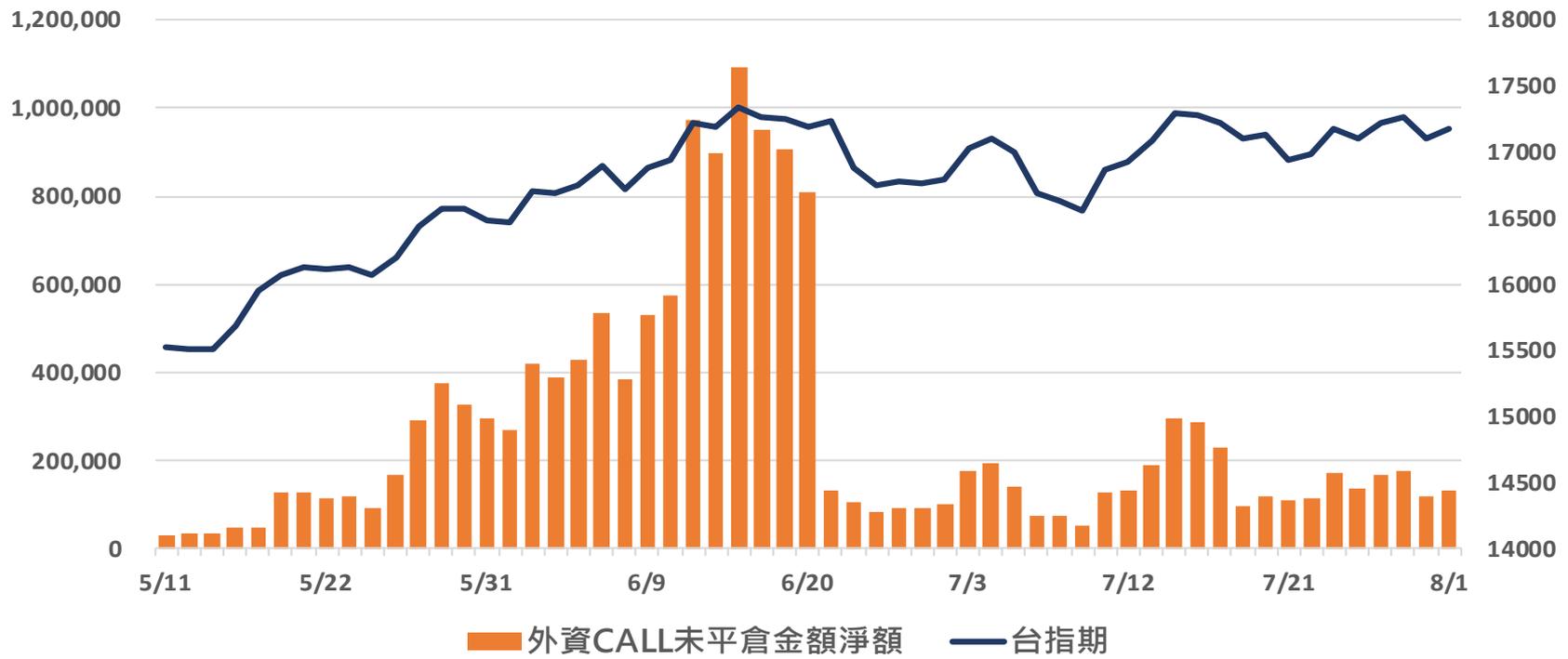
## Sell Put未平倉金額



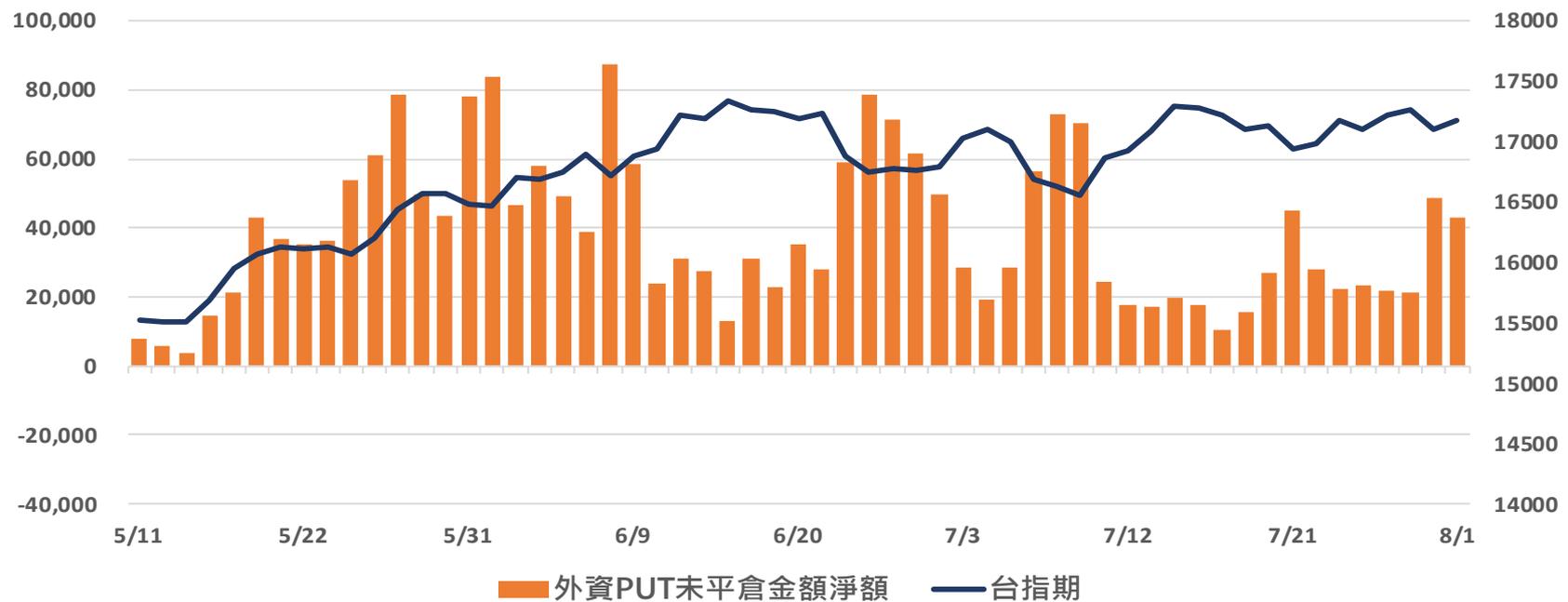
更新日期：2023年8月1日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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8月1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