

台指選擇權OI

日期：2023/8/2 結算日：2023/8/9					日期：2023/8/2 結算日：2023/8/16				
202308W2					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	0	15,900	305	143	2	16	15,700	930	-75
0	1	16,000	1,458	1,244	0	10	15,800	999	-28
0	0	16,100	801	512	0	27	15,900	1,238	-35
5	5	16,200	1,465	1,282	9	171	16,000	5,560	-6
0	0	16,300	985	832	7	21	16,100	1,988	86
27	27	16,400	2,469	1,184	1	37	16,200	2,884	343
18	20	16,500	3,510	2,356	2	64	16,300	4,534	164
34	39	16,600	2,876	1,956	-4	36	16,400	3,170	125
239	240	16,700	3,356	2,170	1,269	1,475	16,500	6,695	671
94	119	16,750	1,857	916	28	476	16,600	4,069	-283
357	371	16,800	3,833	1,169	111	461	16,700	3,862	-639
636	638	16,850	2,787	730	258	4,406	16,800	4,128	-445
1,015	1,028	16,900	1,739	401	635	1,439	16,900	3,667	-310
972	1,010	16,950	1,125	430	-129	4,811	17,000	3,636	-338
1,914	1,993	17,000	1,371	259	27	2,936	17,100	2,574	262
934	1,081	17,050	689	93	1,598	4,546	17,200	2,132	-1,485
2,428	2,795	17,100	1,182	351	1,228	6,065	17,300	1,945	-674
1,892	2,203	17,150	533	-102	778	6,024	17,400	680	-109
2,294	2,942	17,200	348	-180	1,924	8,136	17,500	351	-111
2,624	3,046	17,250	225	6	174	6,126	17,600	218	-97
2,489	3,140	17,300	272	43	-416	5,323	17,700	47	-31
1,729	2,417	17,350	71	-14	-613	5,123	17,800	44	-4
2,602	3,429	17,400	80	2	-785	4,471	17,900	16	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
27,400	41,483	0.8609	35,714	17,767	5,861	80,280	0.8448	67,822	-2,446
昨日 P/C	1.0854	今日增減變化		-0.2245	昨日 P/C	0.9442	今日增減變化		-0.0994

更新日期：2023年8月2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	100,297,216	118,218,214	-17,920,998	-19,041,196	1,031,688	2,240,237	-1,208,549	61,935
投信	39,174,744	40,384,820	-1,210,076	-805,261	1,080,816	0	1,080,816	-32,114
自營商	19,439,736	38,223,538	-18,783,802	-480,081	330,784	1,287,123	-956,339	-108,272
	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	1,769,219	1,727,219	42,000	-9,252	87,238	7,521	79,717	6,699
投信	28,342	0	28,342	-565	0	0	0	0
自營商	275,093	1,435,784	-1,160,691	-21,186	45,082	114,263	-69,181	2,315

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	29,648	10,079	19,569	622	25,272	9,571	15,701	-1,855
投信	200	0	200	300	400	102	298	0
自營商	52,141	57,828	-5,687	-12,297	44,483	35,016	9,467	3,957
特定法人(週)	2,893	0	2,893	---	0	4,653	-4,653	---
特定法人(近月)	18,283	4,049	14,234	565	5,393	12,871	-7,478	-3,120
特定法人(全月)	18,608	2,823	15,785	-2,871	6,327	21,876	-15,549	-311
十大交易人(週)	15,744	18,169	-2,425	---	15,225	16,208	-983	---
十大交易人(近月)	40,155	37,664	2,491	-5,167	22,448	32,162	-9,714	560
十大交易人(全月)	66,819	65,761	1,058	-9,921	40,070	58,437	-18,367	-2,565
全市場未沖銷(近月)			85,493	11,074			68,680	-1,588
全市場未沖銷(全月)			161,672	-80,737			130,019	-116,820

更新日期：2023年8月2日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

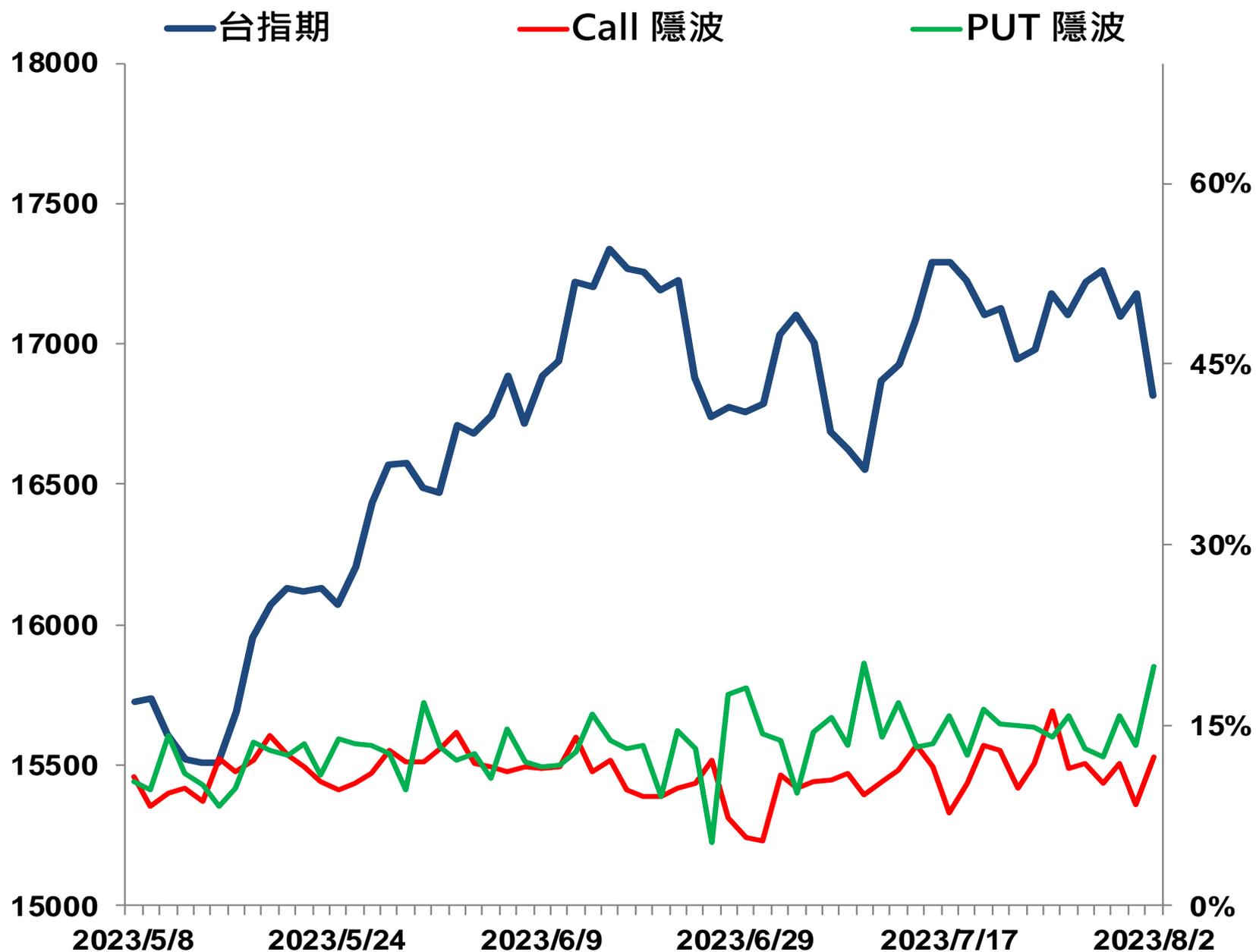
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月2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2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

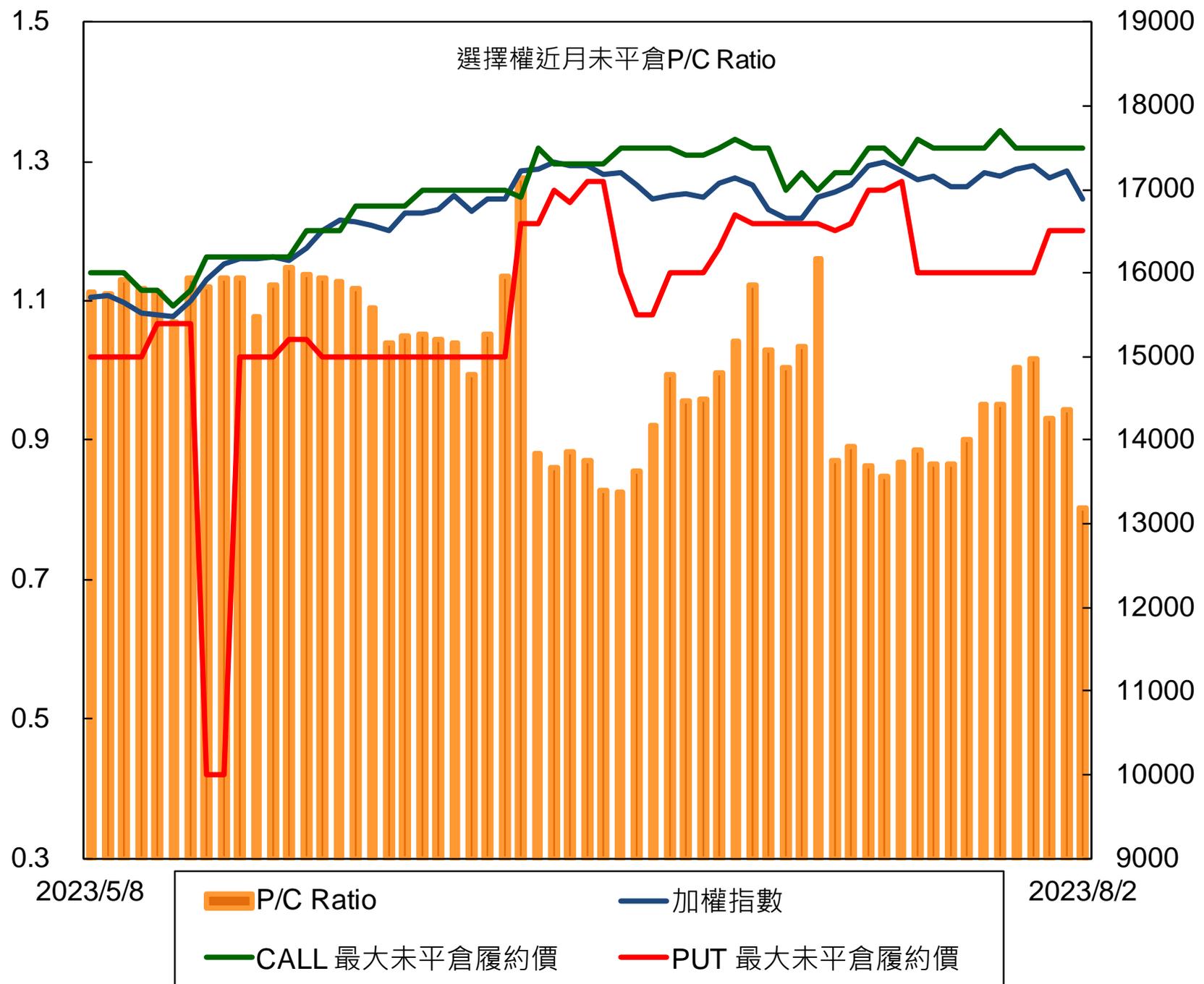
自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	8月1日	62,502	55,892	6,610
	8月2日	52,141	57,828	-5,687
Put	8月1日	59,324	53,814	5,510
	8月2日	44,483	35,016	9,467

更新日期：2023年8月2日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



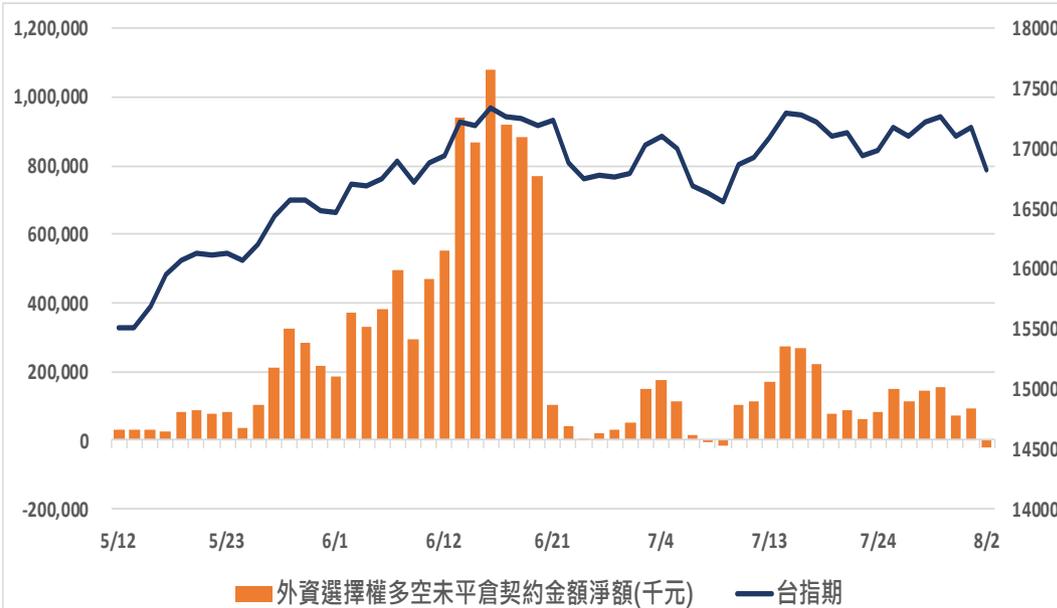
選擇權近月未平倉P/C Ratio



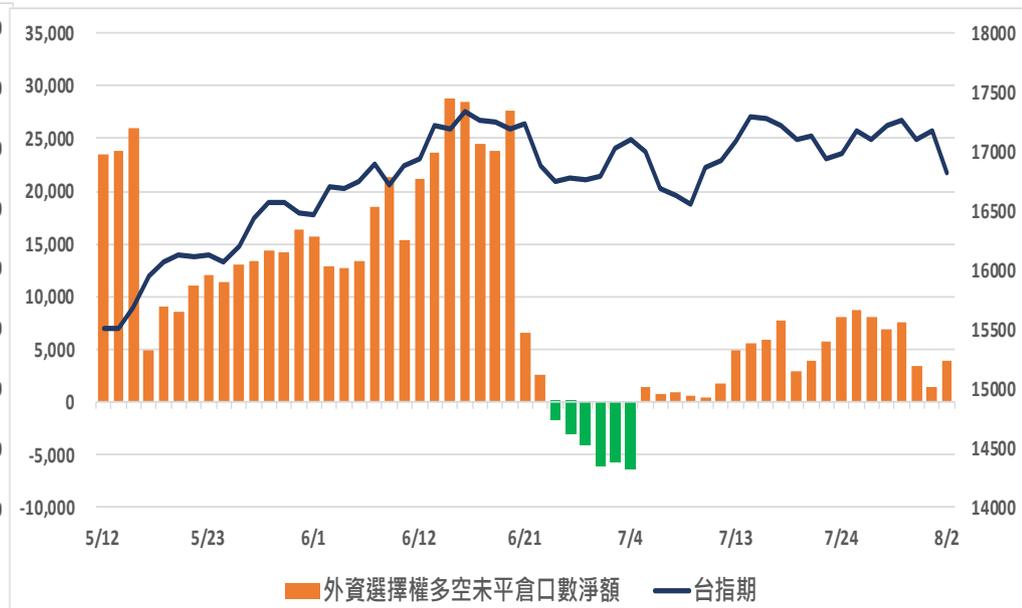
更新日期：2023年8月2日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



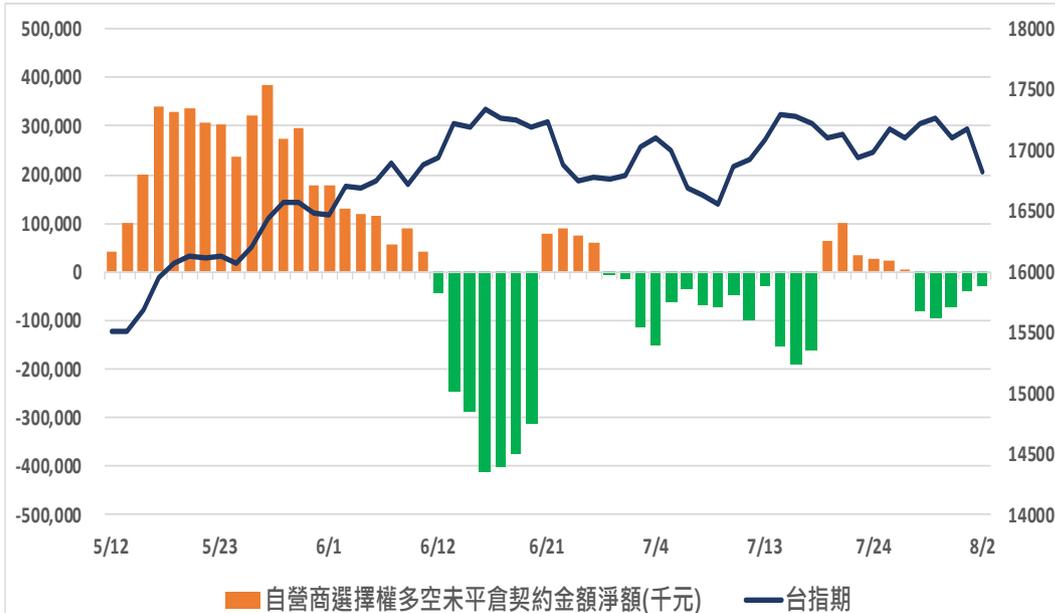
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/27	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
2023/8/2	16820	3,868	+2,477	-24,019	-113,838

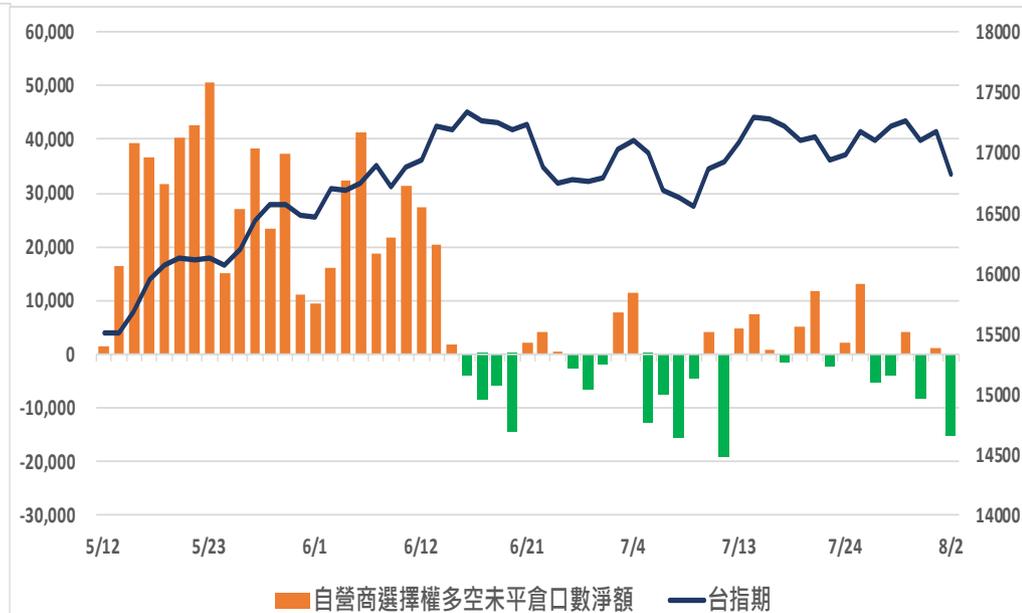
更新日期：2023年8月2日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



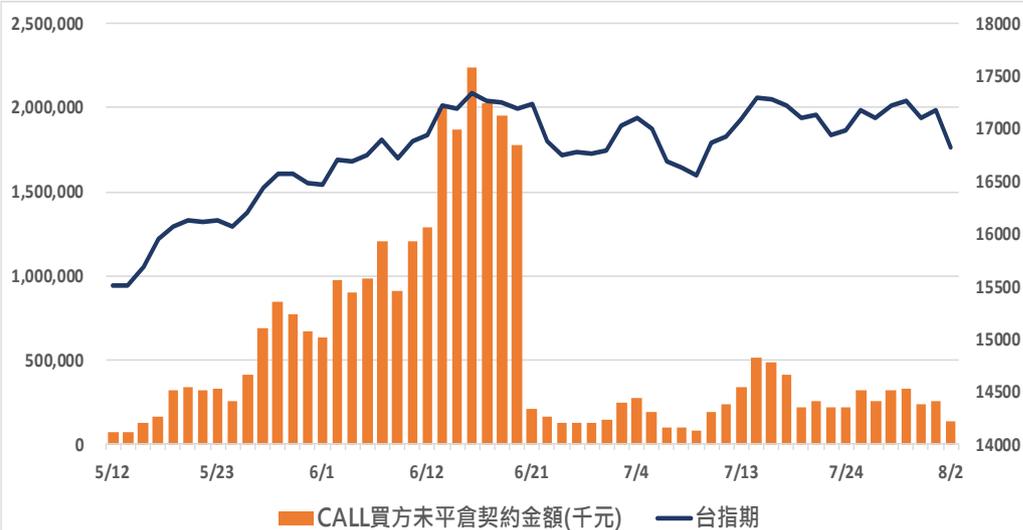
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/27	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
2023/8/2	16820	-15,154	-16,254	-30,225	+9,506

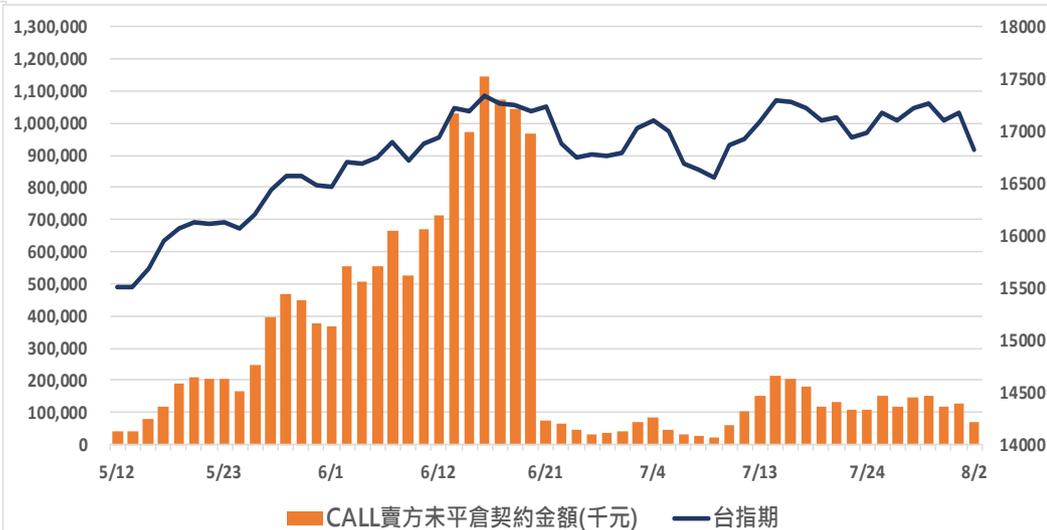
更新日期：2023年8月2日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

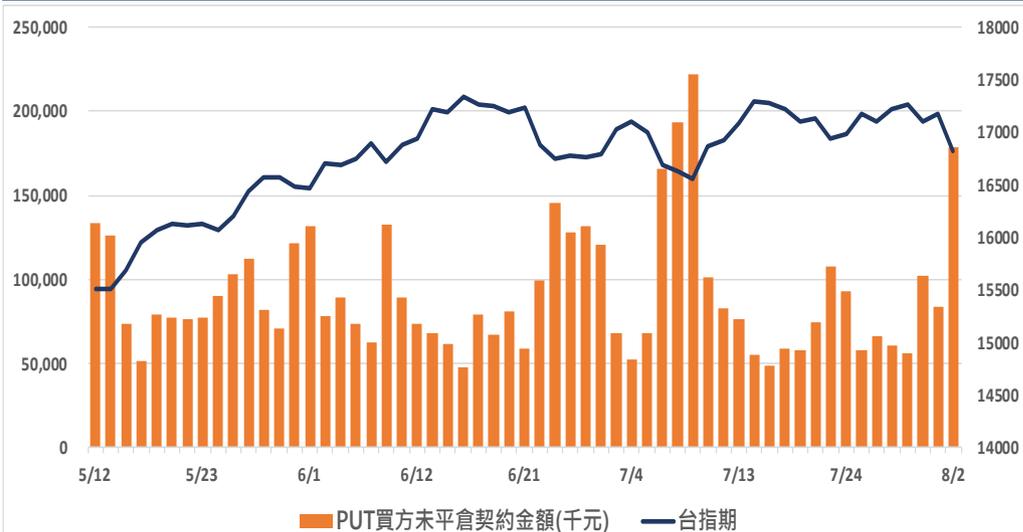
Buy Call未平倉金額



Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



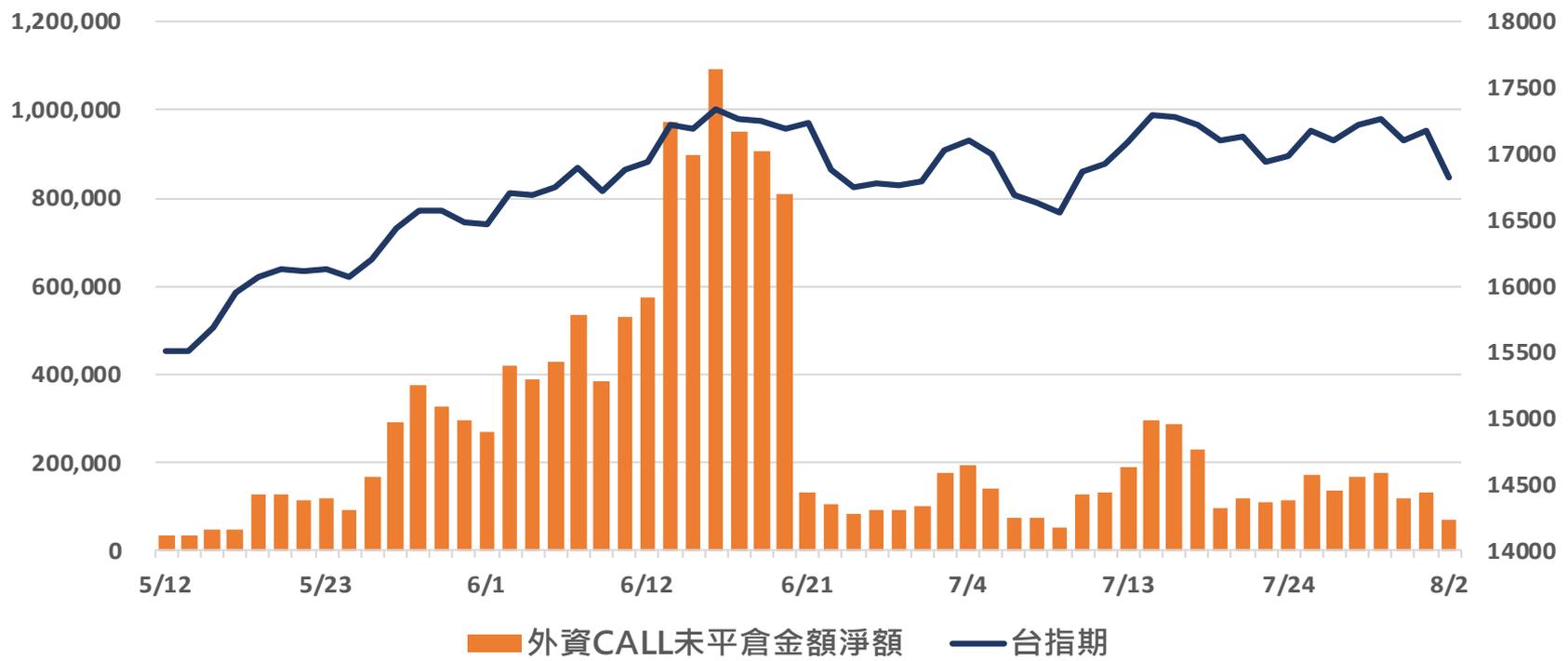
Sell Put未平倉金額



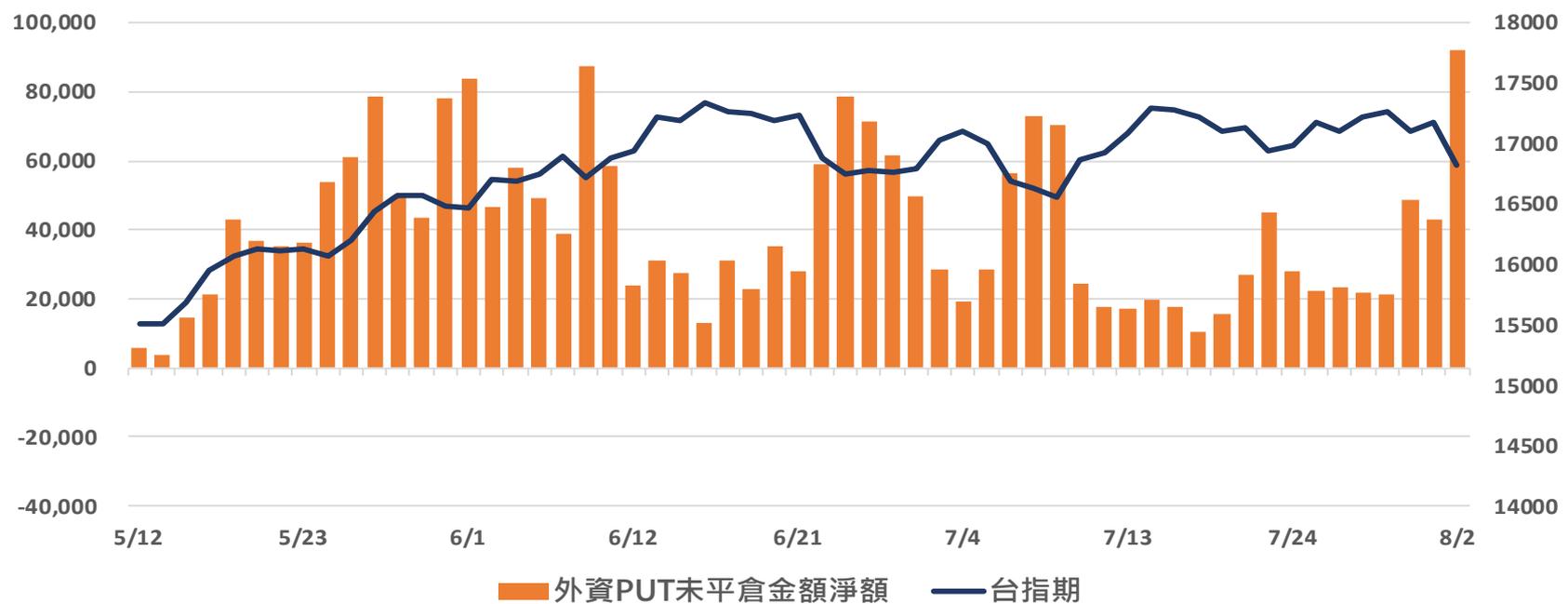
更新日期：2023年8月2日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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2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