

# 台指選擇權OI

日期：2023/8/4 結算日：2023/8/9					日期：2023/8/4 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	15,800	1,345	941	0	1	15,600	1,242	68
1	1	15,900	1,246	941	0	16	15,700	1,036	106
0	1	16,000	3,384	1,926	2	12	15,800	1,215	216
1	1	16,100	3,782	2,981	1	28	15,900	1,585	347
22	27	16,200	4,960	3,495	0	171	16,000	6,087	527
15	15	16,300	6,353	5,368	-1	20	16,100	2,239	251
18	45	16,400	9,598	7,129	3	40	16,200	3,784	900
22	42	16,500	8,155	4,645	2	66	16,300	5,032	498
304	343	16,600	7,091	4,215	12	48	16,400	3,678	508
723	963	16,700	5,357	2,001	-1,215	260	16,500	7,057	362
1,132	1,251	16,750	2,931	1,074	37	513	16,600	4,552	483
1,901	2,272	16,800	5,358	1,525	316	777	16,700	3,890	28
2,220	2,858	16,850	3,266	479	-2,878	1,528	16,800	3,713	-415
4,266	5,294	16,900	2,008	269	677	2,116	16,900	2,999	-668
2,854	3,864	16,950	802	-323	732	5,543	17,000	3,081	-555
5,092	7,085	17,000	1,231	-140	1,281	4,217	17,100	1,954	-620
4,355	5,436	17,050	714	25	577	5,123	17,200	2,017	-115
5,648	8,443	17,100	1,070	-112	728	6,793	17,300	1,702	-243
3,435	5,638	17,150	533	0	191	6,215	17,400	539	-141
4,454	7,396	17,200	333	-15	-567	7,569	17,500	287	-64
1,308	4,354	17,250	178	-47	-742	5,384	17,600	143	-75
2,165	5,305	17,300	221	-51	-51	5,272	17,700	45	-2
572	2,989	17,350	70	-1	-62	5,061	17,800	36	-8
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
40,972	82,455	0.8937	73,692	37,978	646	80,926	0.8583	69,459	1,637
昨日 P/C	0.8609	今日增減變化	0.0328		昨日 P/C	0.8033	今日增減變化	0.0550	

更新日期：2023年8月4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	108,134,574	112,791,790	-4,657,216	13,263,782	970,002	2,469,096	-1,499,094	-290,545
投信	39,922,094	40,725,118	-803,024	407,052	1,084,312	0	1,084,312	3,496
自營商	19,732,814	36,353,896	-16,621,082	2,162,720	333,065	1,387,835	-1,054,770	-98,431
	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	1,809,339	1,622,074	187,265	145,265	87,505	7,544	79,961	244
投信	35,045	0	35,045	6,703	0	0	0	0
自營商	206,937	1,512,307	-1,305,370	-144,679	159,893	229,288	-69,395	-214

## 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	33,262	11,412	21,850	2,281	27,147	11,601	15,546	-155
投信	200	0	200	0	400	102	298	0
自營商	62,621	67,806	-5,185	502	55,590	39,528	16,062	6,595
特定法人(週)	2,453	0	2,453	-440	0	4,653	-4,653	0
特定法人(近月)	23,435	2,160	21,275	7,041	3,504	12,692	-9,188	-1,710
特定法人(全月)	22,828	0	22,828	7,043	2,357	19,737	-17,380	-1,831
十大交易人(週)	26,222	26,844	-622	1,803	25,789	25,120	669	1,652
十大交易人(近月)	37,637	35,564	2,073	-418	21,956	32,634	-10,678	-964
十大交易人(全月)	74,863	74,233	630	-428	47,277	68,129	-20,852	-2,485
全市場未沖銷(近月)			88,369	2,876			71,325	2,645
全市場未沖銷(全月)			211,290	49,618			178,614	48,595

更新日期：2023年8月4日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

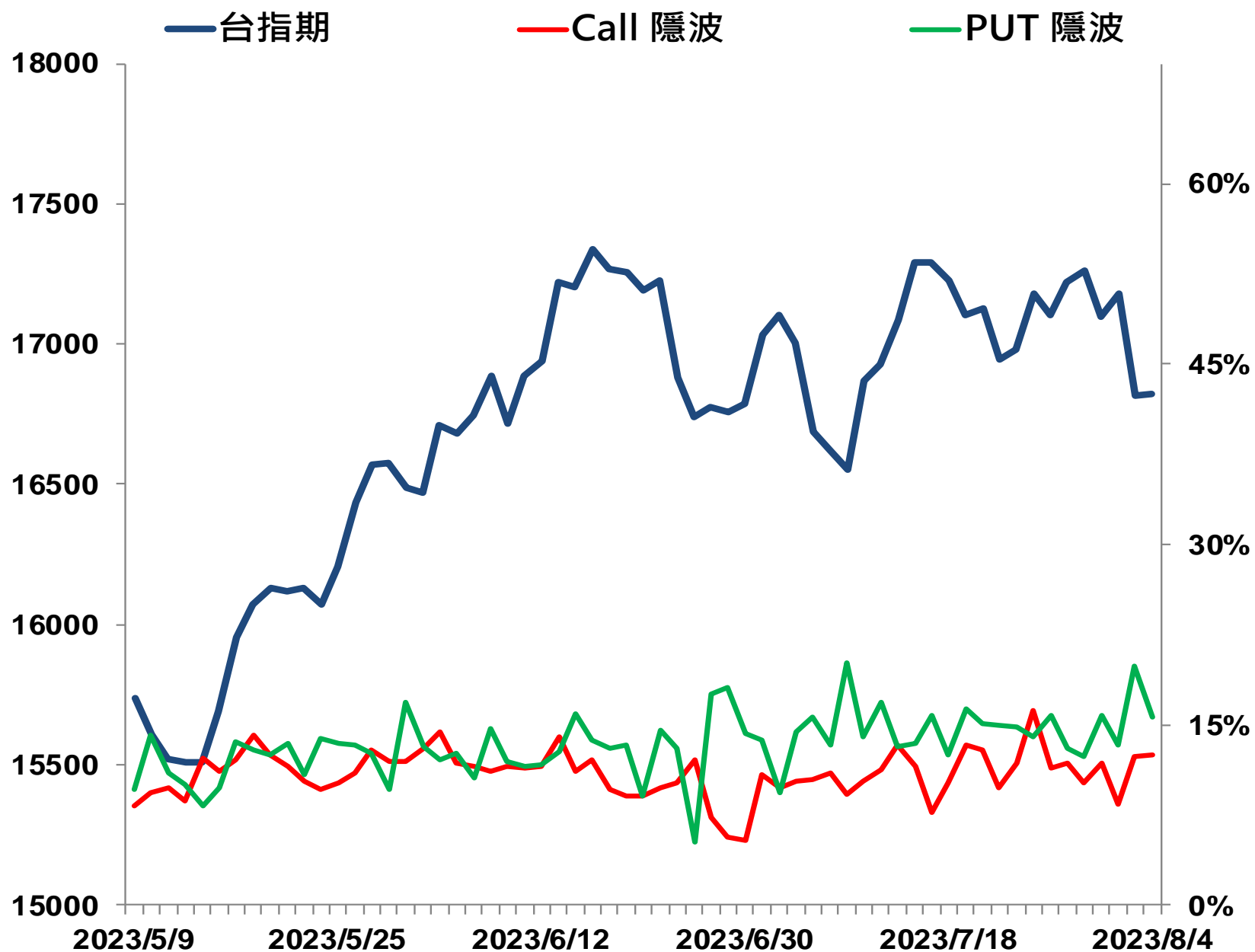
# 選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月4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4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

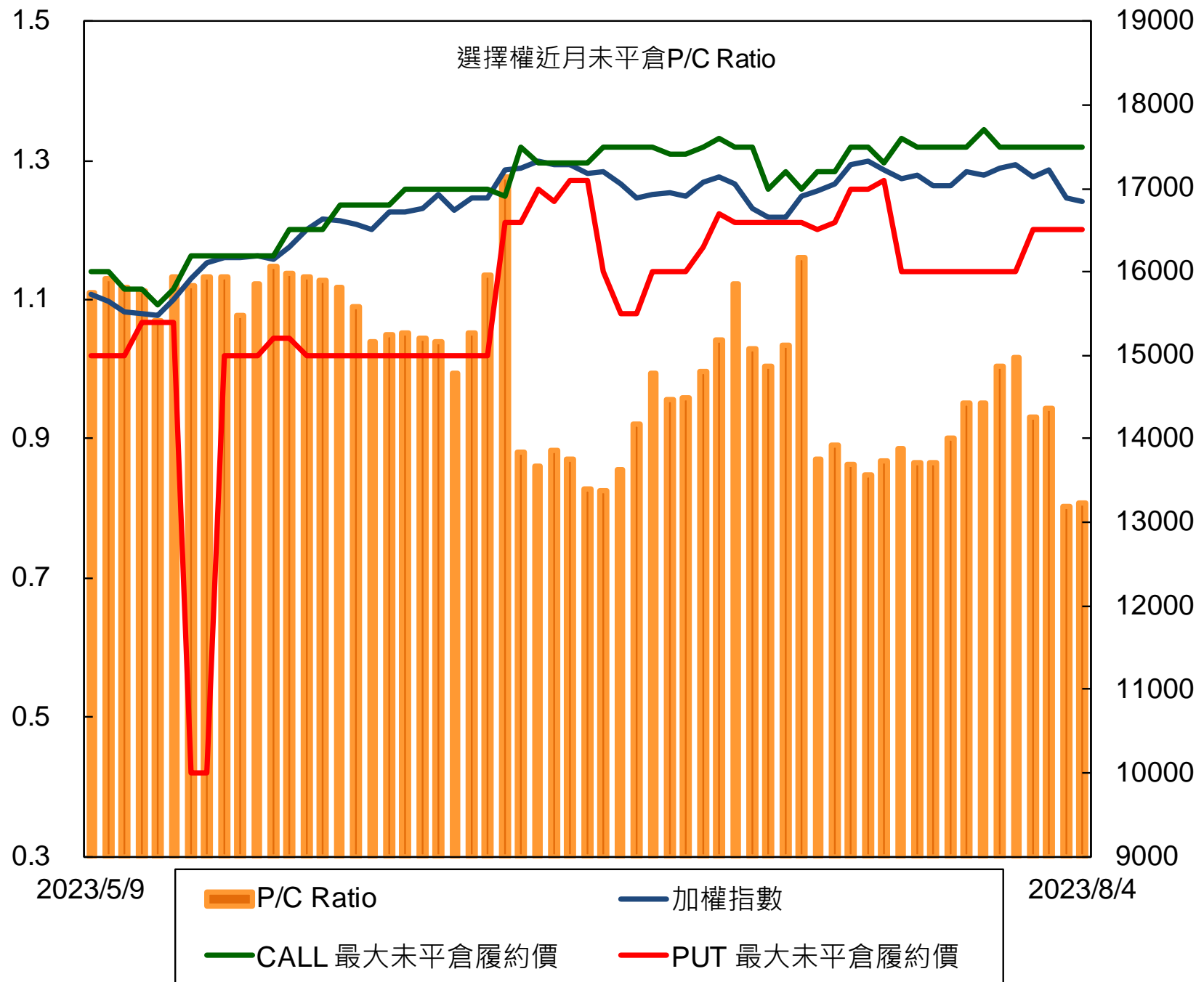
# 自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
<b>Call</b>	8月2日	52,141	57,828	<b>-5,687</b>
	8月4日	62,621	67,806	<b>-5,185</b>
<b>Put</b>	8月2日	44,483	35,016	9,467
	8月4日	55,590	39,528	16,062

更新日期：2023年8月4日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



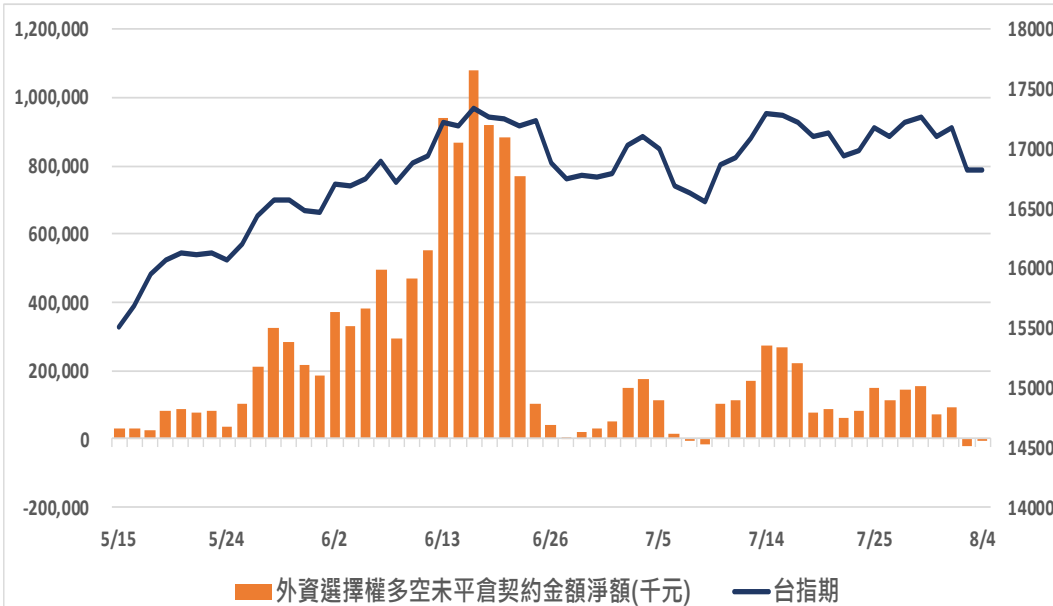
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



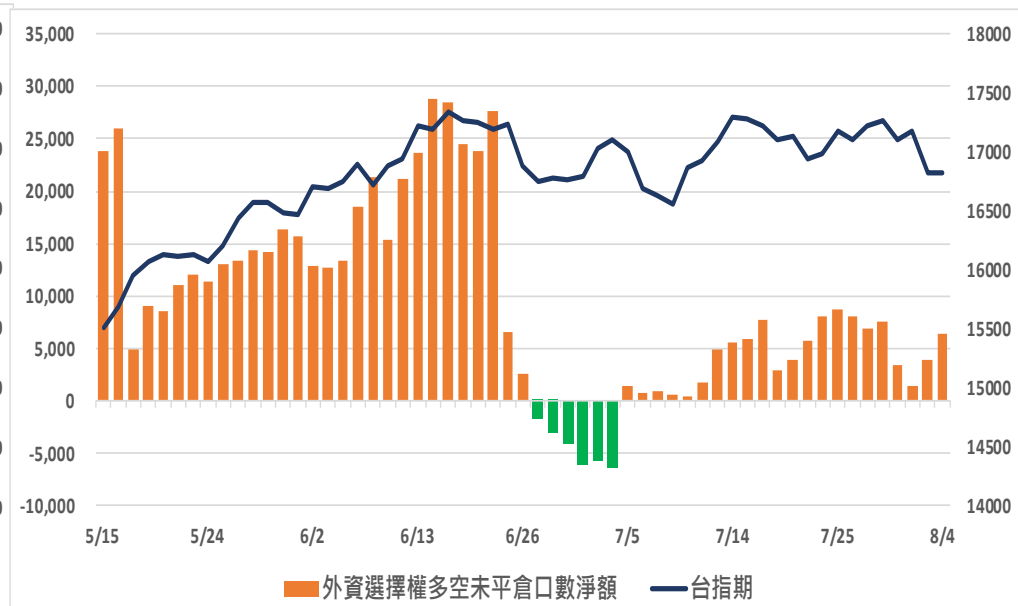
更新日期：2023年8月4日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



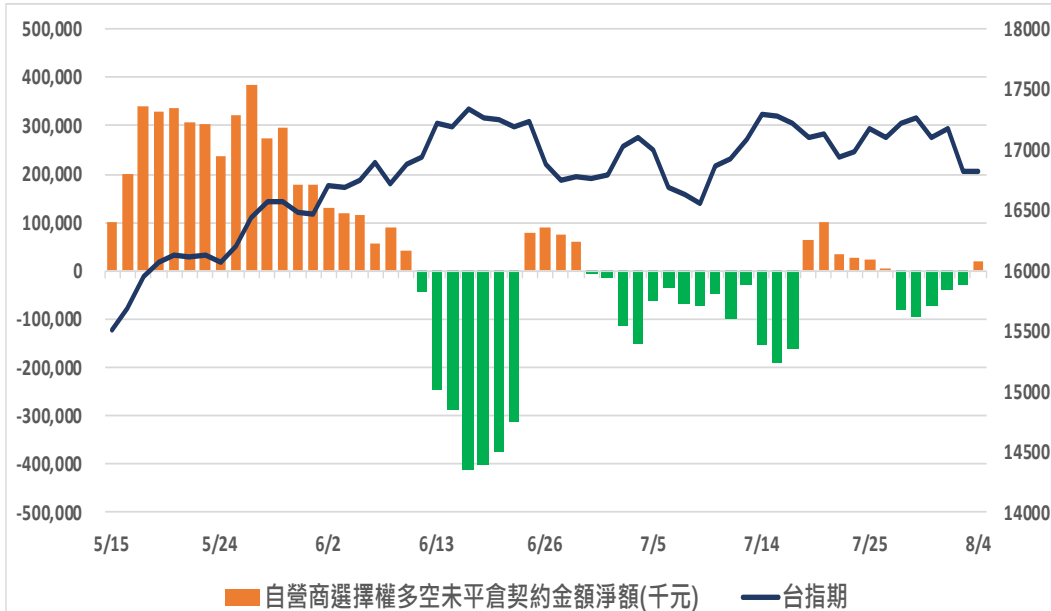
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/28	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
2023/8/4	16823	6,304	+2,436	-6,781	+17,238

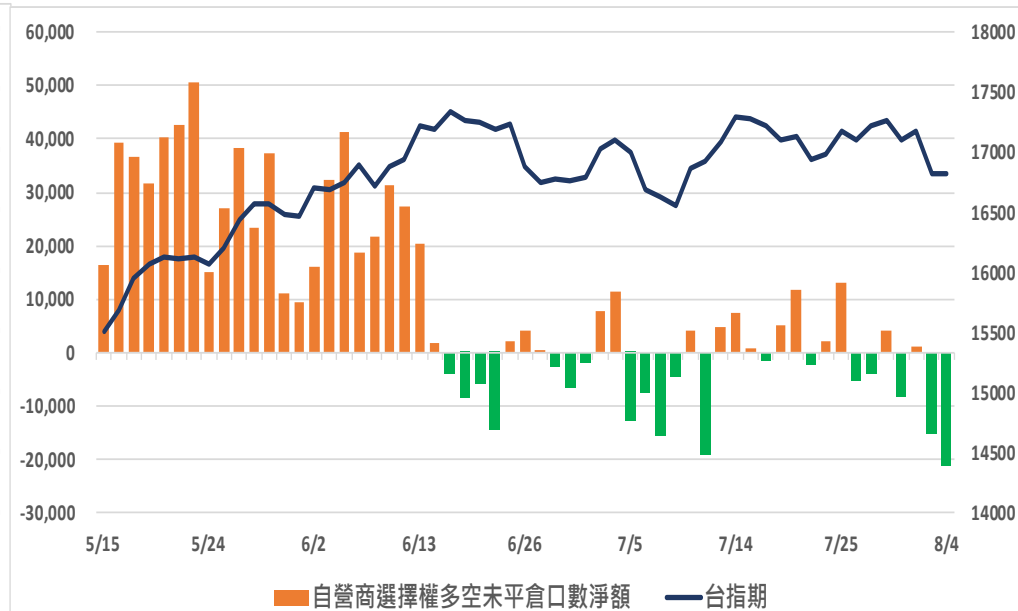
更新日期：2023年8月4日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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

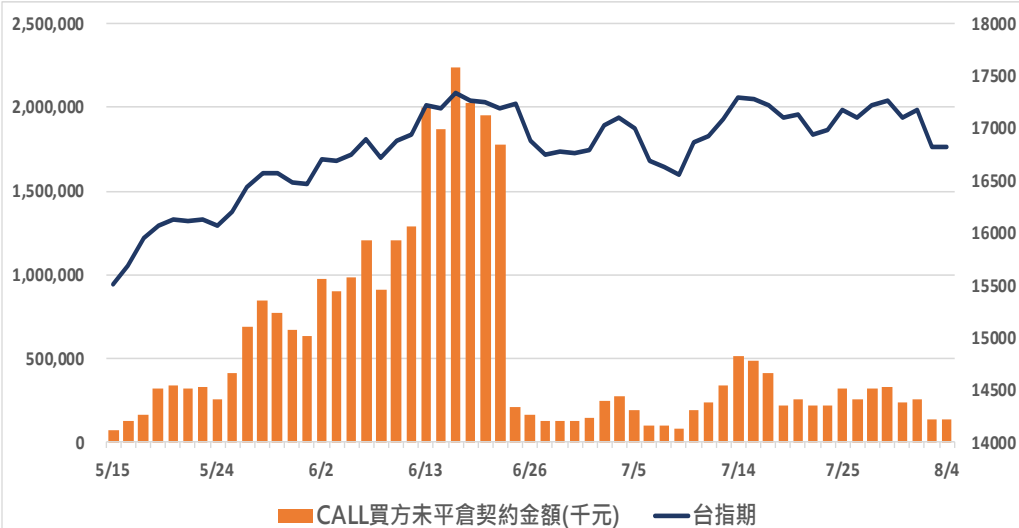
日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/7/28	17262	4,087	+7,828	-94,522	-14,166
2023/7/31	17103	-8,083	-12,170	-72,324	+22,198
2023/8/1	17178	1,100	+9,183	-39,731	+32,593
2023/8/2	16820	-15,154	-16,254	-30,225	+9,506
2023/8/4	16823	-21,247	-6,093	18,488	+48,713

更新日期：2023年8月4日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

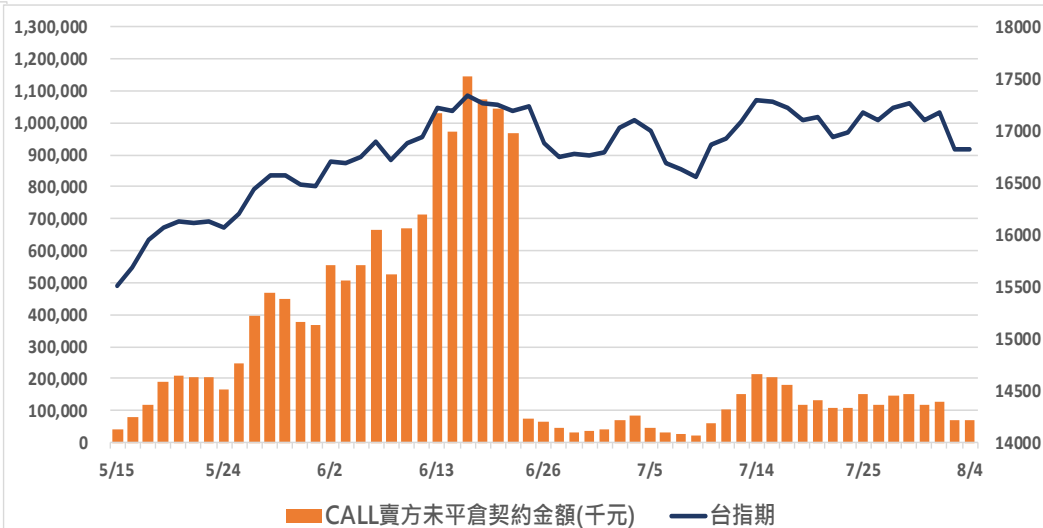


# 外資選擇權未平倉金額

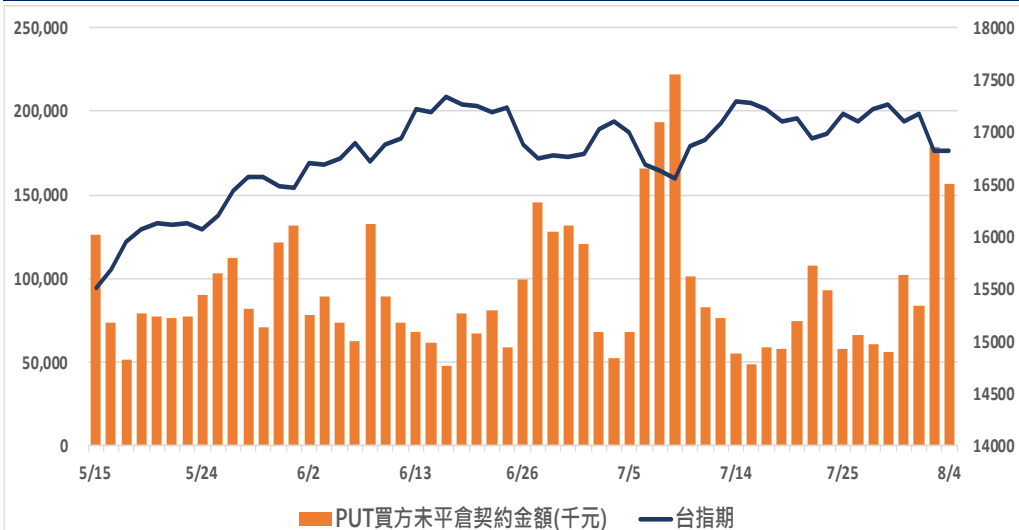
## Buy Call未平倉金額



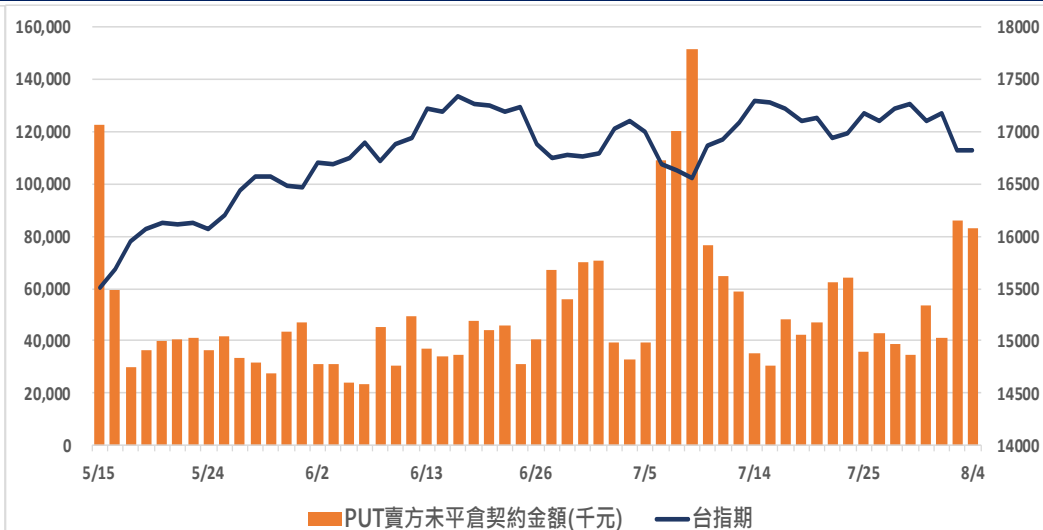
## Sell Call未平倉金額



## Buy Put未平倉金額



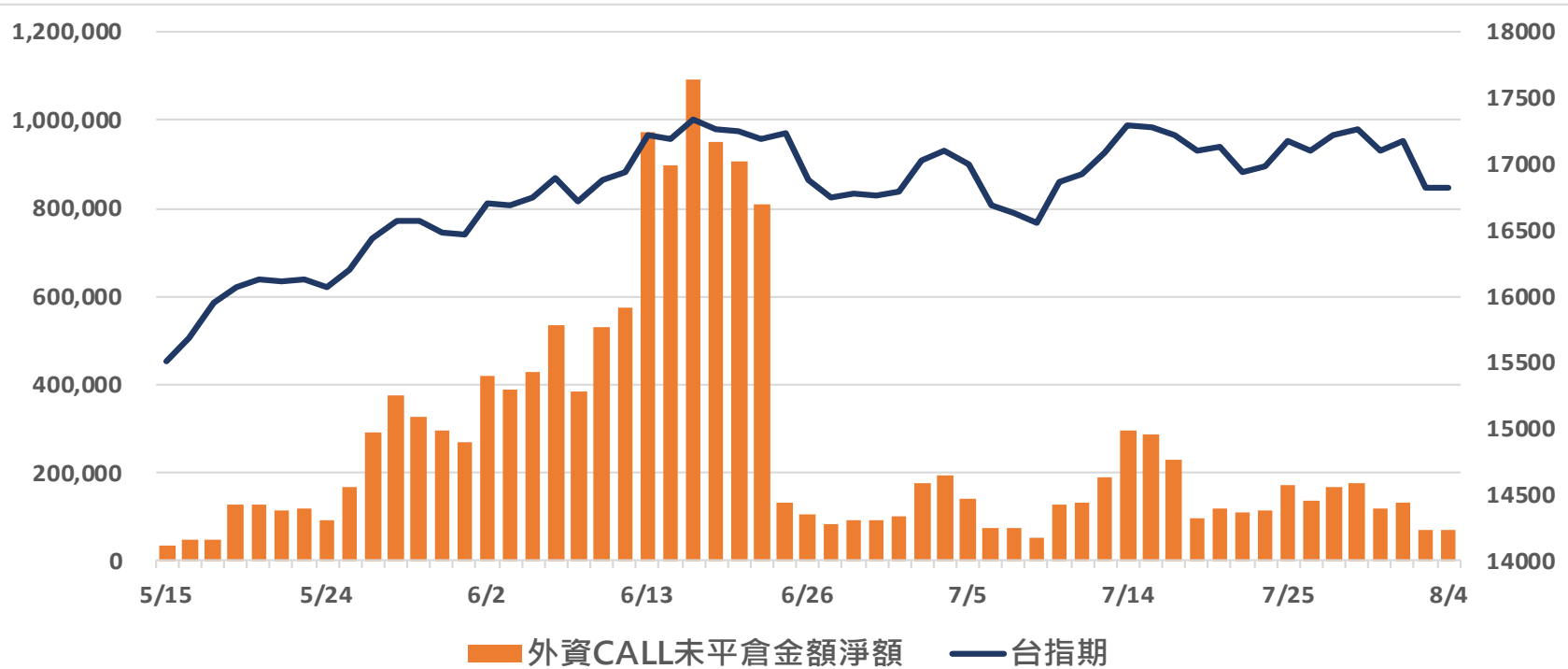
## Sell Put未平倉金額



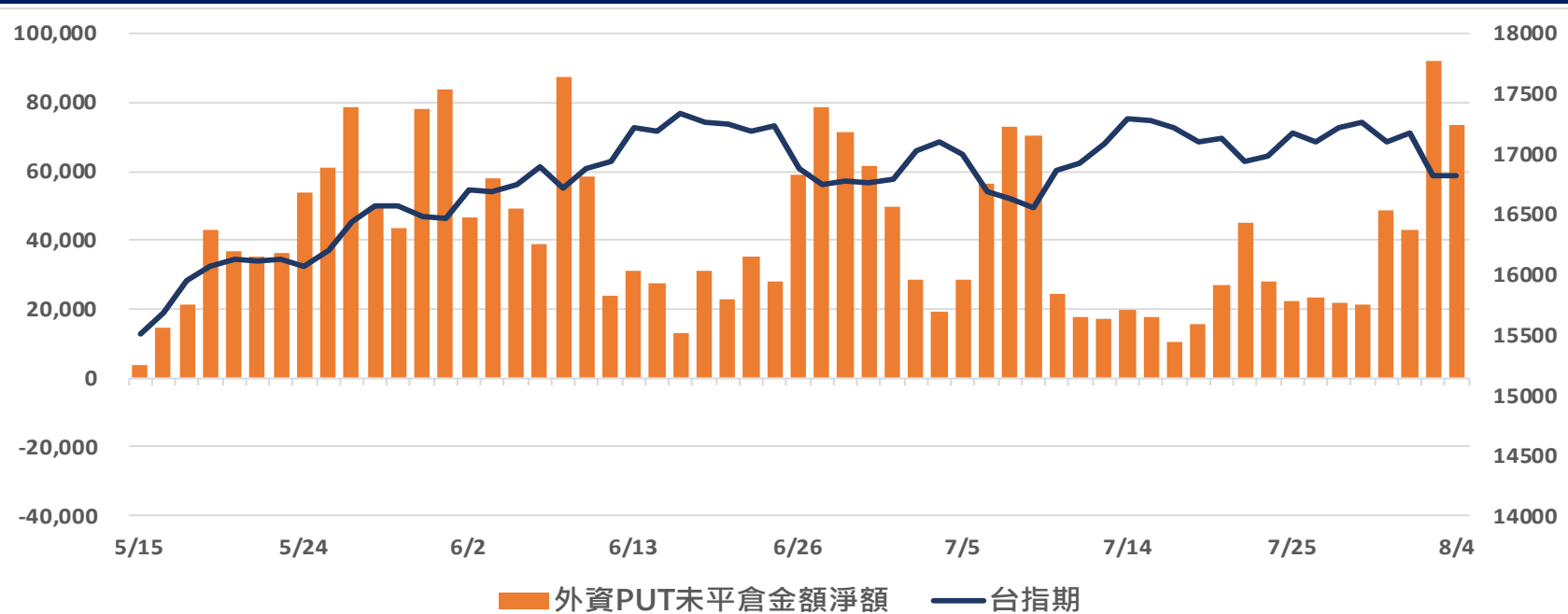
更新日期：2023年8月4日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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4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