

台指選擇權OI

日期：2023/8/7 結算日：2023/8/9					日期：2023/8/7 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
3	48	16,400	9,170	-428	0	12	15,800	2,163	948
3	5	16,450	3,046	746	0	28	15,900	1,846	261
-11	31	16,500	9,386	1,231	-15	156	16,000	6,110	23
30	54	16,550	2,573	961	3	23	16,100	2,287	48
-118	225	16,600	9,137	2,046	0	40	16,200	3,387	-397
-262	192	16,650	5,377	1,843	3	69	16,300	4,836	-196
-158	805	16,700	12,865	7,508	0	48	16,400	3,846	168
-217	1,034	16,750	7,718	4,787	-19	241	16,500	7,024	-33
147	2,419	16,800	11,191	5,833	48	561	16,600	5,186	634
-94	2,764	16,850	6,186	2,920	19	796	16,700	4,635	745
-1,047	4,247	16,900	6,229	4,221	-253	1,275	16,800	4,969	1,256
-860	3,004	16,950	3,520	2,718	-224	1,892	16,900	4,077	1,078
-1,457	5,628	17,000	3,871	2,640	-157	5,386	17,000	3,660	579
-172	5,264	17,050	881	167	1,966	6,183	17,100	2,230	276
955	9,398	17,100	1,444	374	-211	4,912	17,200	1,843	-174
2,210	7,848	17,150	438	-95	904	7,697	17,300	1,374	-328
-252	7,144	17,200	410	77	1,031	7,246	17,400	511	-28
1,126	5,480	17,250	164	-14	-344	7,225	17,500	282	-5
952	6,257	17,300	214	-7	322	5,706	17,600	134	-9
900	3,889	17,350	89	19	178	5,450	17,700	41	-4
425	4,568	17,400	82	3	200	5,261	17,800	36	0
-5	1,883	17,450	25	0	156	4,161	17,900	16	0
-407	2,160	17,500	32	-4	-121	6,253	18,000	10	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
1,900	84,835	1.4488	122,908	41,770	3,453	84,379	0.8820	74,421	4,962
昨日 P/C	0.8937	今日增減變化	0.5551		昨日 P/C	0.8071	今日增減變化	0.0749	

更新日期：2023年8月7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	113,898,833	107,133,450	6,765,383	11,422,599	902,986	2,635,921	-1,732,935	-233,841
投信	40,698,400	39,851,400	847,000	1,650,024	1,102,174	0	1,102,174	17,862
自營商	16,043,515	35,037,502	-18,993,987	-2,372,905	448,047	1,327,668	-879,621	175,149
	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	1,861,692	1,571,536	290,156	102,891	54,281	4,523	49,758	-30,203
投信	35,221	0	35,221	176	0	0	0	0
自營商	194,555	1,472,582	-1,278,027	27,343	129,560	182,292	-52,732	16,663

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	36,296	11,413	24,883	3,033	27,301	12,456	14,845	-701
投信	200	0	200	0	400	102	298	0
自營商	70,058	67,102	2,956	8,141	56,942	52,133	4,809	-11,253
特定法人(週)	3,192	0	3,192	739	0	1,275	-1,275	3,378
特定法人(近月)	24,209	2,164	22,045	770	4,392	14,971	-10,579	-1,391
特定法人(全月)	23,965	0	23,965	1,137	2,656	16,221	-13,565	3,815
十大交易人(週)	25,993	19,749	6,244	6,866	36,401	26,788	9,613	8,944
十大交易人(近月)	42,614	37,622	4,992	2,919	24,989	33,880	-8,891	1,787
十大交易人(全月)	81,443	72,322	9,121	8,491	59,385	68,764	-9,379	11,473
全市場未沖銷(近月)			93,451	5,082			80,929	9,604
全市場未沖銷(全月)			222,736	11,446			232,360	53,746

更新日期：2023年8月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

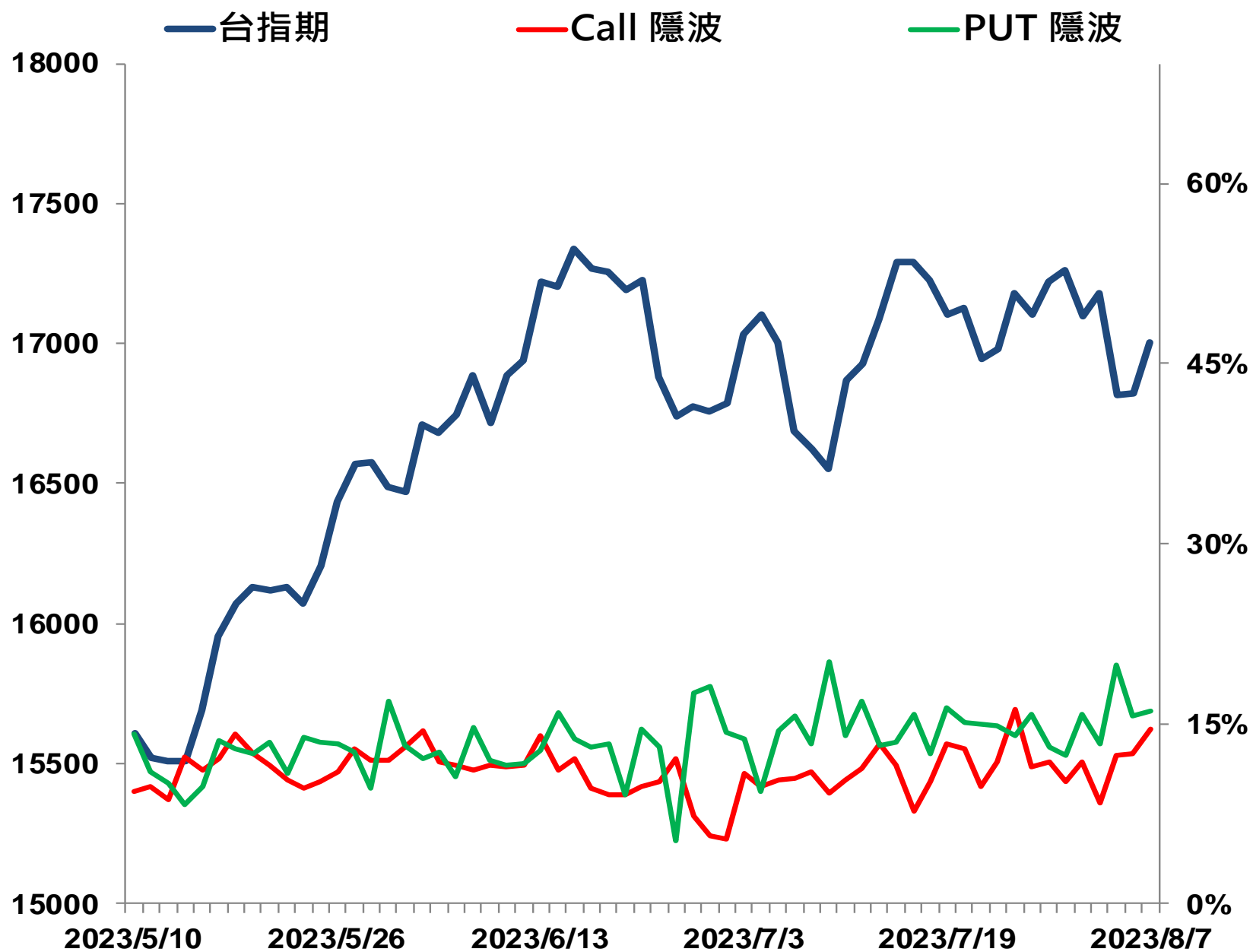
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月7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7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

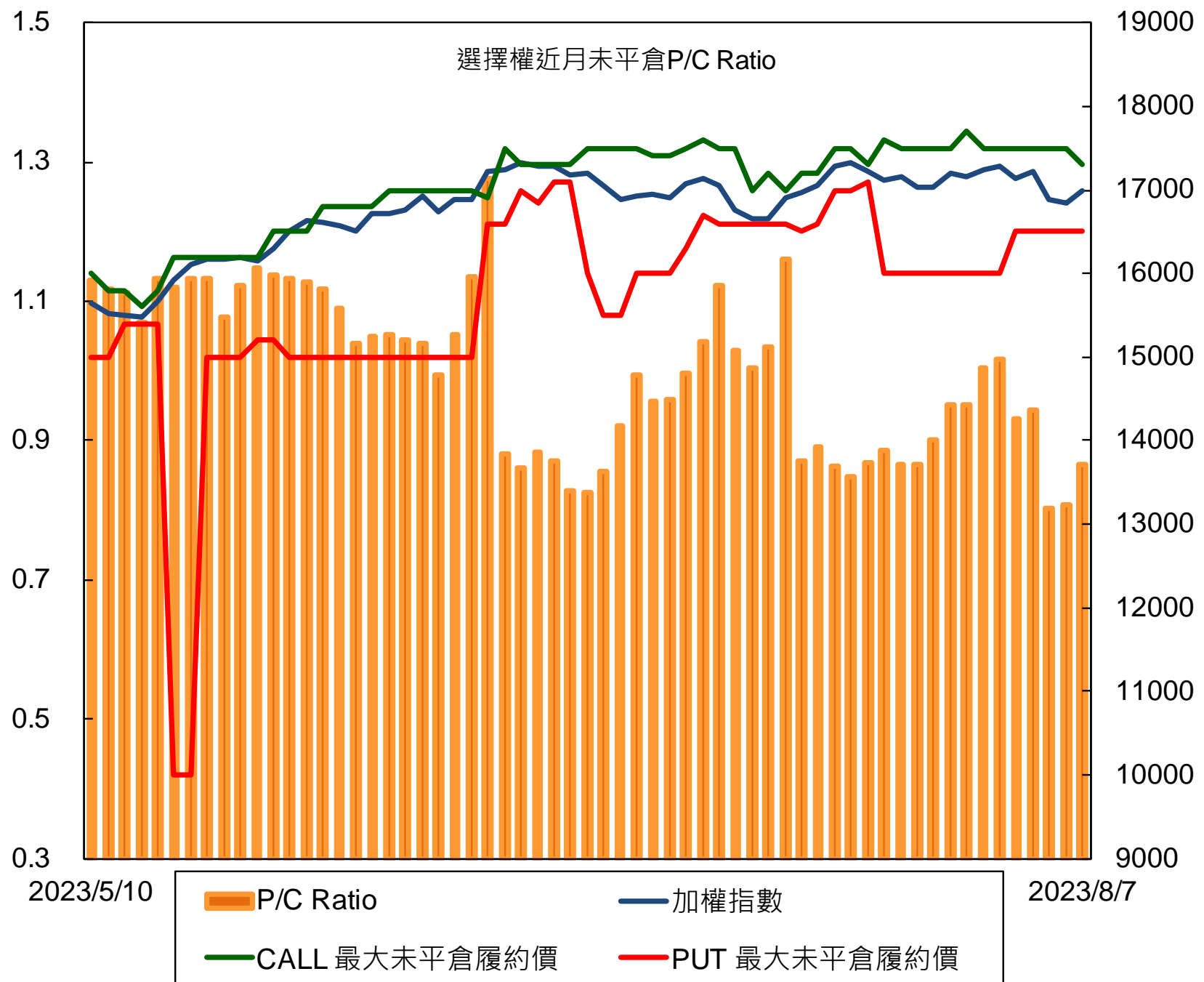
自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	8月4日	62,621	67,806	-5,185
	8月7日	70,058	67,102	2,956
Put	8月4日	55,590	39,528	16,062
	8月7日	56,942	52,133	4,809

更新日期：2023年8月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



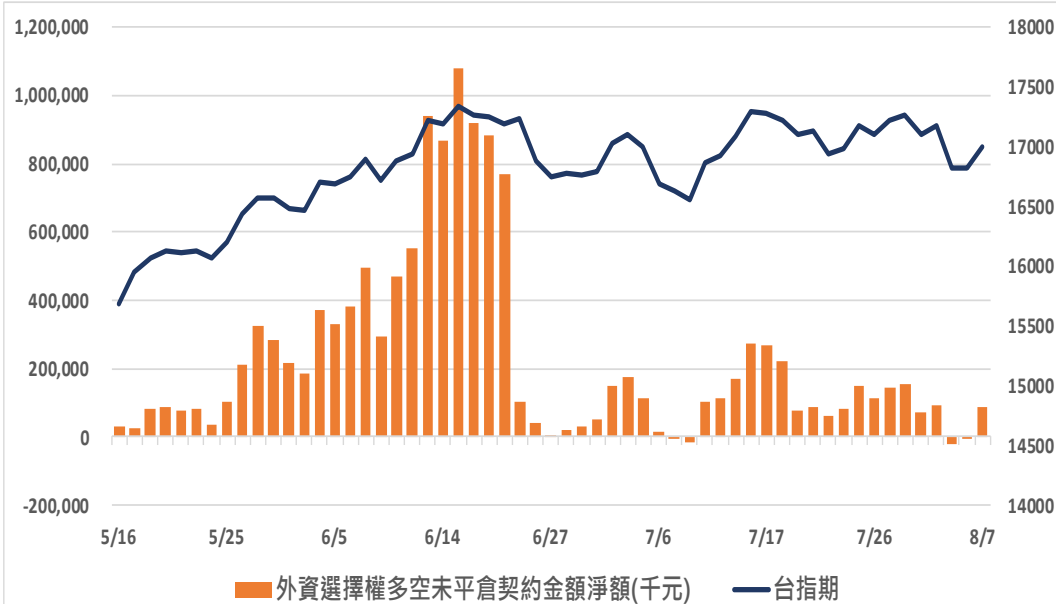
選擇權近月未平倉P/C Ratio



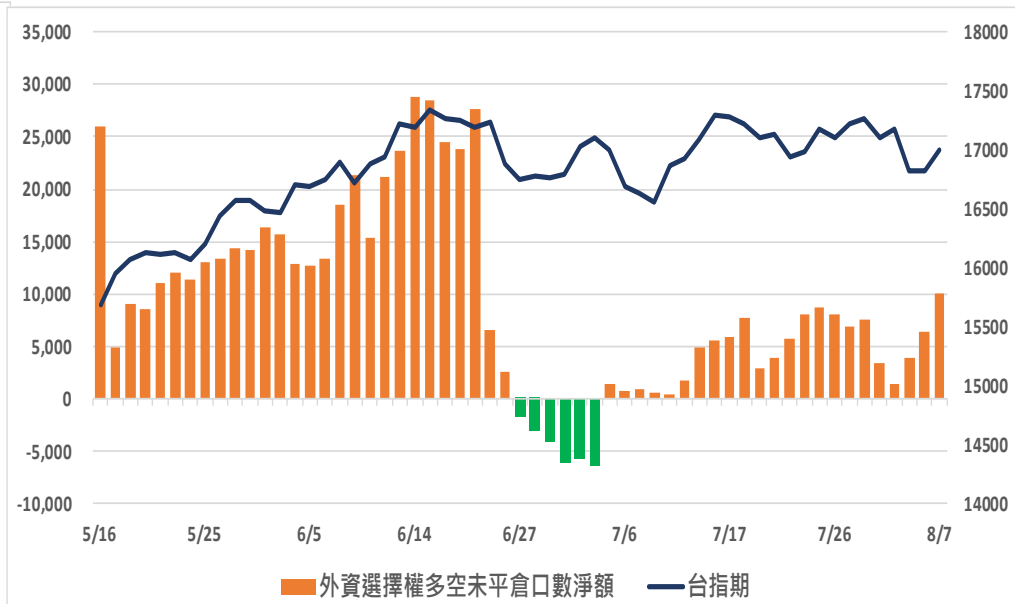
更新日期：2023年8月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



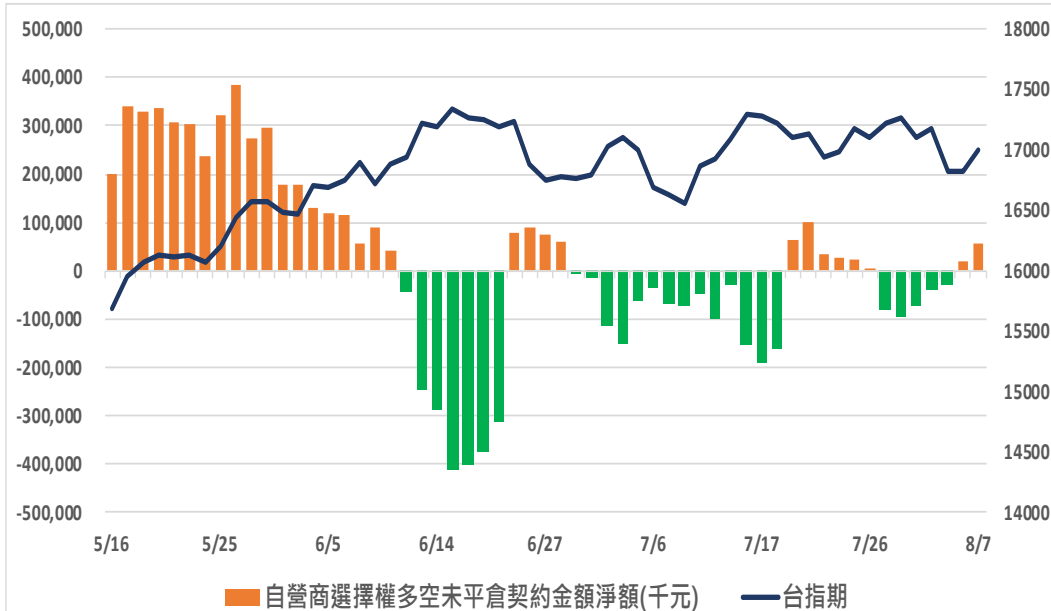
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/31	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
2023/8/7	17000	10,038	+3,734	85,342	+92,123

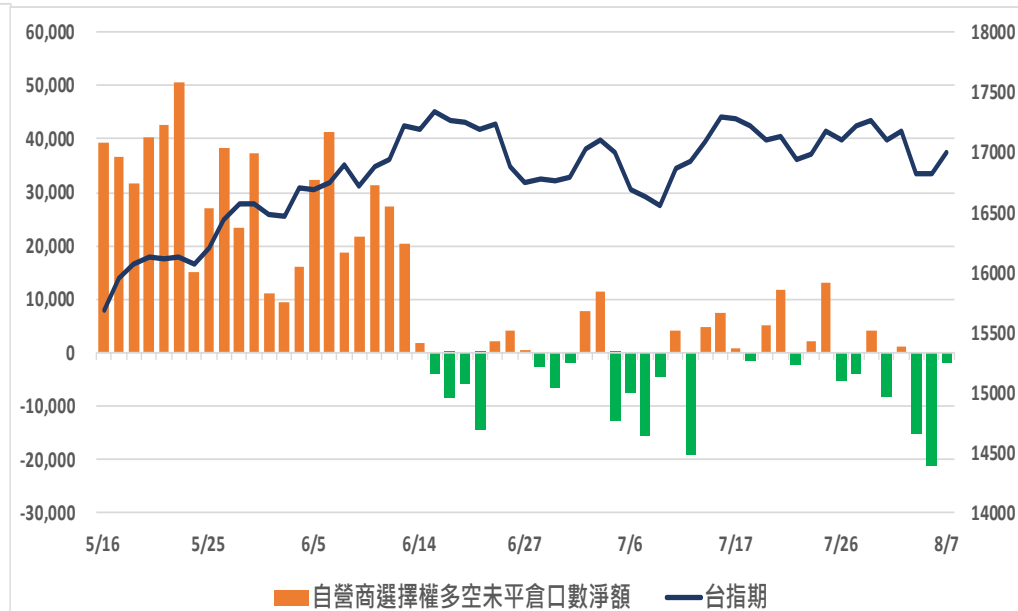
更新日期：2023年8月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



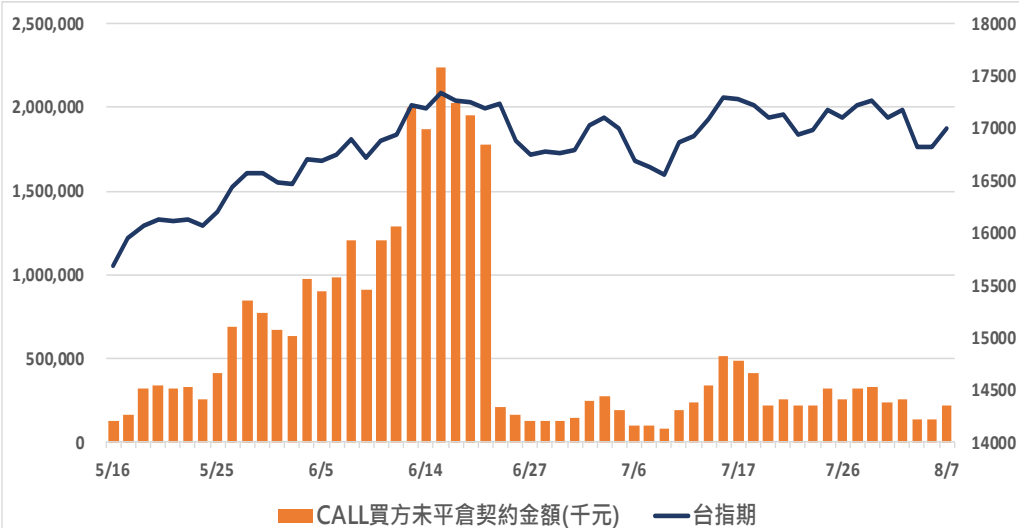
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/7/31	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
2023/8/7	17000	-1,853	+19,394	57,456	+38,968

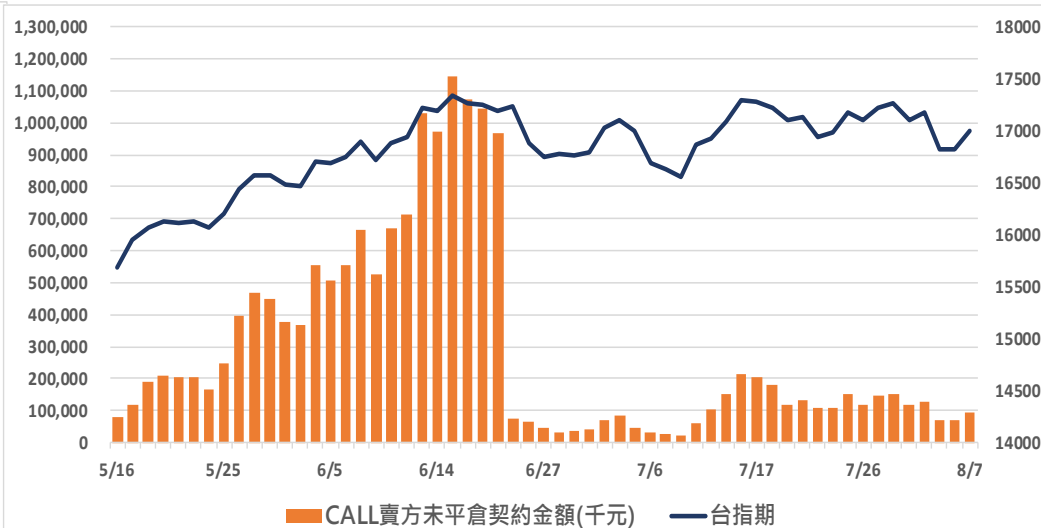
更新日期：2023年8月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

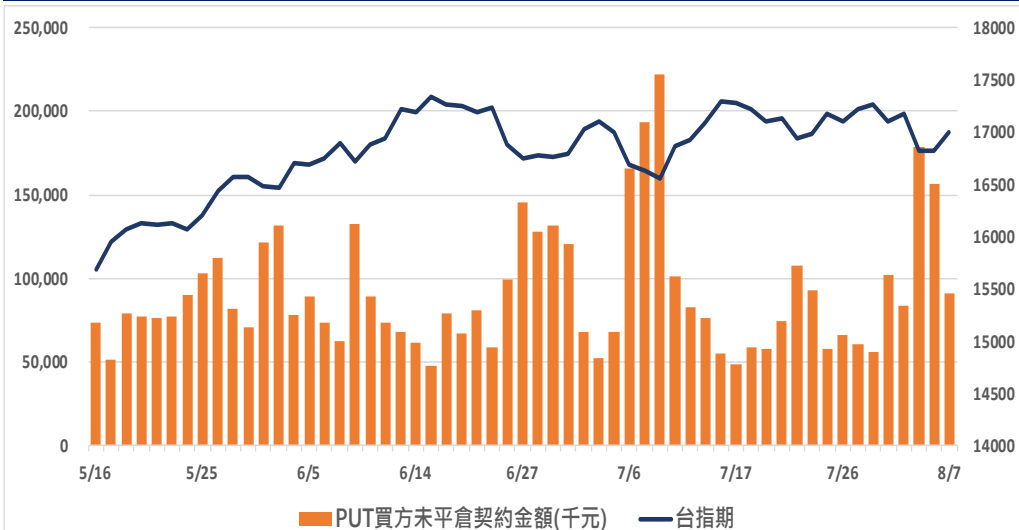
Buy Call未平倉金額



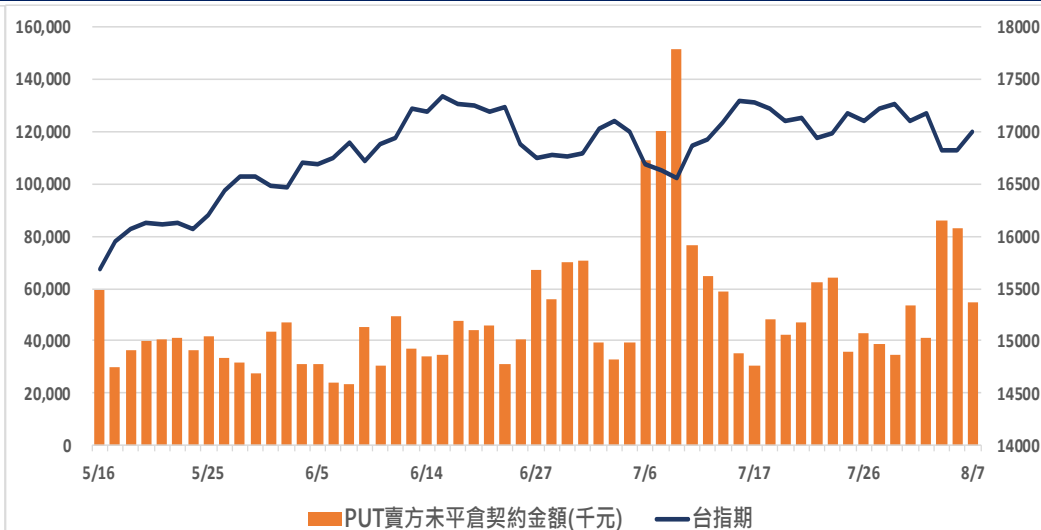
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



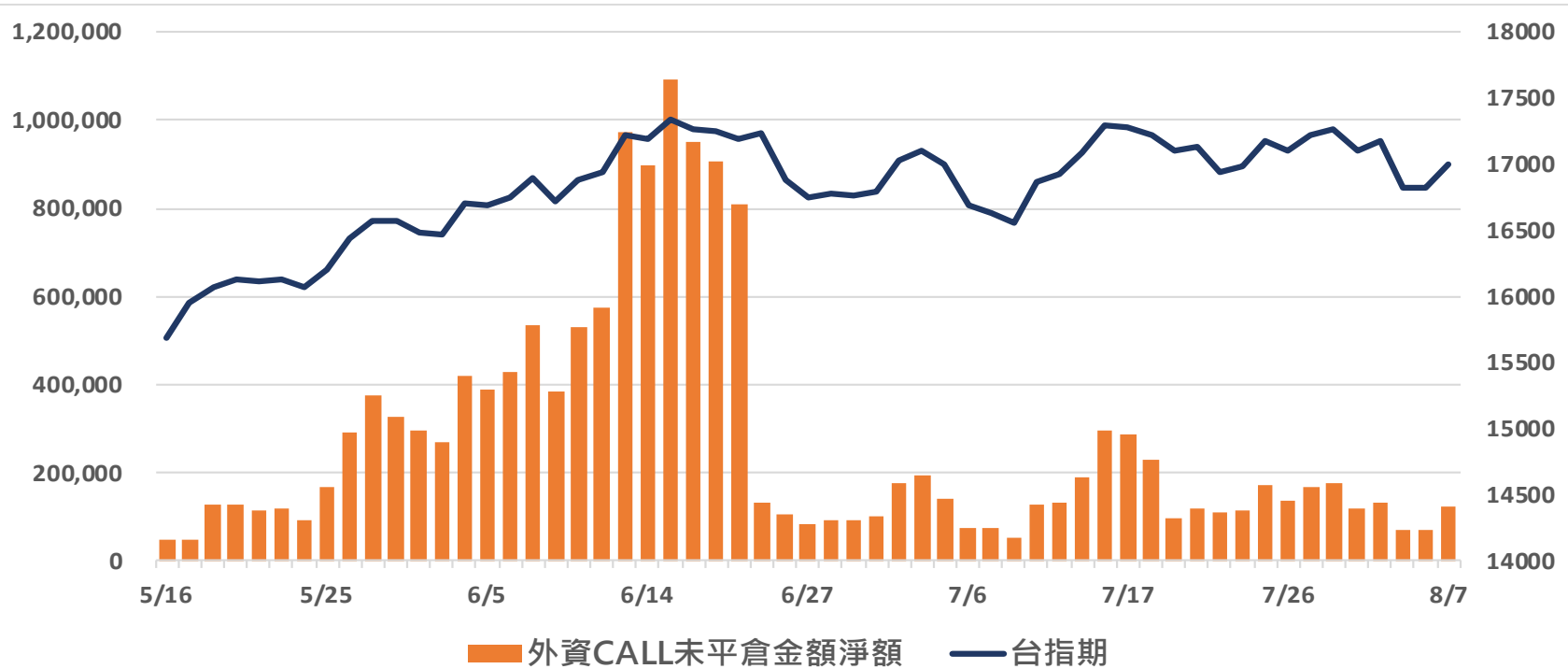
Sell Put未平倉金額



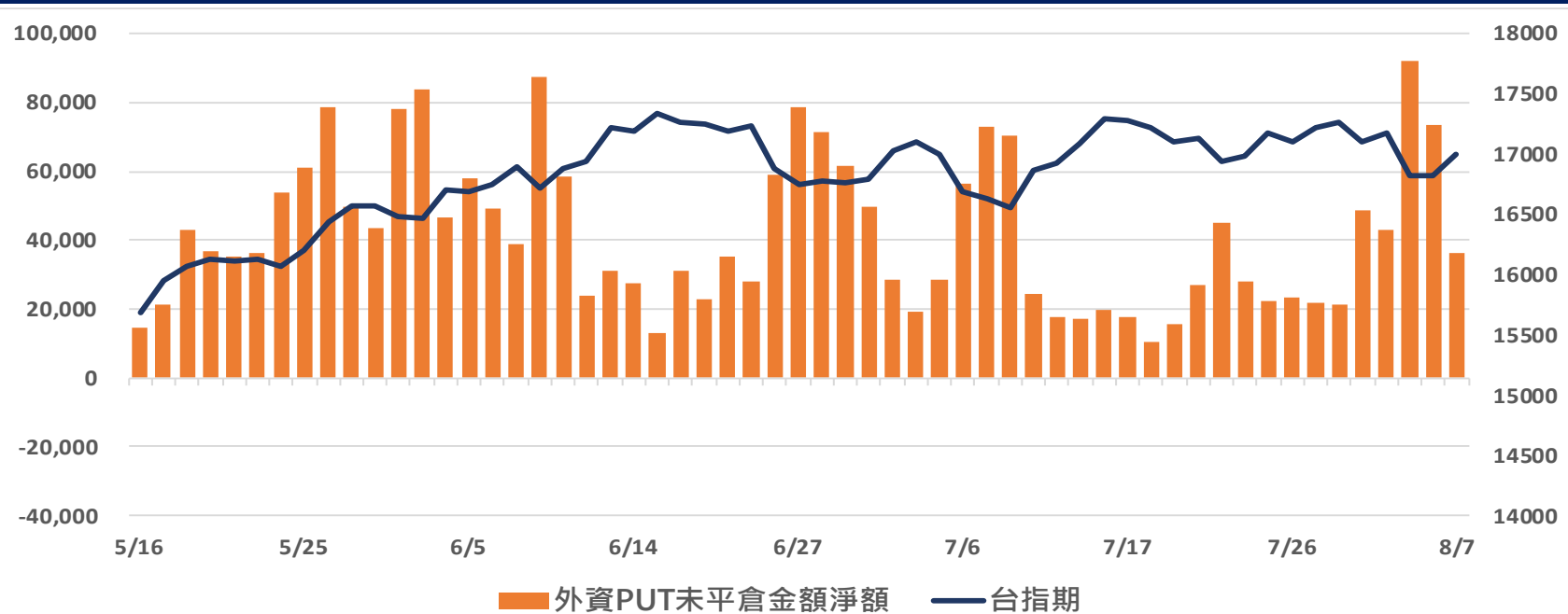
更新日期：2023年8月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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7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