

台指選擇權OI

日期：2023/8/8 結算日：2023/8/9					日期：2023/8/8 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
1	16	16,300	7,566	-160	1	17	15,700	1,253	141
0	30	16,350	1,760	856	0	12	15,800	2,234	71
-3	45	16,400	9,456	286	0	28	15,900	1,853	7
0	5	16,450	3,447	401	3	159	16,000	6,165	55
10	41	16,500	9,556	170	2	25	16,100	2,528	241
-1	53	16,550	3,208	635	3	43	16,200	3,896	509
48	273	16,600	9,638	501	3	72	16,300	5,449	613
-66	126	16,650	7,363	1,986	4	52	16,400	4,164	318
-60	745	16,700	11,476	-1,389	-8	233	16,500	7,477	453
248	1,282	16,750	7,089	-629	50	611	16,600	5,900	714
3,376	5,795	16,800	11,300	109	-86	710	16,700	4,882	247
3,487	6,251	16,850	10,732	4,546	198	1,473	16,800	6,545	1,576
3,519	7,766	16,900	6,934	705	390	2,282	16,900	4,158	81
3,619	6,623	16,950	3,425	-95	763	6,149	17,000	3,517	-143
6,206	11,834	17,000	3,079	-792	117	6,300	17,100	2,075	-155
※ 6,211	11,475	17,050	961	80	※ 1,270	6,182	17,200	1,722	-121
2,653	12,051	17,100	1,094	-350	224	7,921	17,300	1,349	-25
145	7,993	17,150	516	78	776	8,022	17,400	530	19
1,670	8,814	17,200	389	-21	-10	7,215	17,500	286	4
341	5,821	17,250	149	-15	-614	5,092	17,600	135	1
611	6,868	17,300	189	-25	464	5,914	17,700	38	-3
227	4,116	17,350	89	0	-63	5,198	17,800	36	0
732	5,300	17,400	105	23	-87	4,074	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
32,074	116,909	1.1164	130,522	7,614	3,512	87,891	0.8996	79,064	4,643
昨日 P/C	1.4488	今日增減變化		-0.3324	昨日 P/C	0.8660	今日增減變化		0.0336

更新日期：2023年8月8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	102,867,498	104,104,497	-1,236,999	-8,002,382	866,554	2,553,707	-1,687,153	45,782
投信	41,190,854	39,517,940	1,672,914	825,914	1,089,757	0	1,089,757	-12,417
自營商	18,834,630	34,107,596	-15,272,966	3,721,021	321,570	1,411,181	-1,089,611	-209,990
	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	1,796,483	1,643,764	152,719	-137,437	100,386	29,966	70,420	20,662
投信	35,188	0	35,188	-33	0	0	0	0
自營商	244,641	1,389,320	-1,144,679	133,348	100,306	173,685	-73,379	-20,647

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	38,948	12,848	26,100	1,217	31,710	15,865	15,845	1,000
投信	200	0	200	0	400	102	298	0
自營商	70,151	74,334	-4,183	-7,139	67,835	54,793	13,042	8,233
特定法人(週)	3,584	0	3,584	392	0	0	0	1,275
特定法人(近月)	24,690	3,630	21,060	-985	4,286	17,500	-13,214	-2,635
特定法人(全月)	29,794	0	29,794	5,829	0	17,448	-17,448	-3,883
十大交易人(週)	26,229	32,061	-5,832	-12,076	38,377	35,977	2,400	-7,213
十大交易人(近月)	45,349	38,733	6,616	1,624	26,443	38,205	-11,762	-2,871
十大交易人(全月)	85,091	82,977	2,114	-7,007	64,689	81,685	-16,996	-7,617
全市場未沖銷(近月)			101,472	8,021			88,166	7,237
全市場未沖銷(全月)			265,775	43,039			251,263	18,903

更新日期：2023年8月8日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

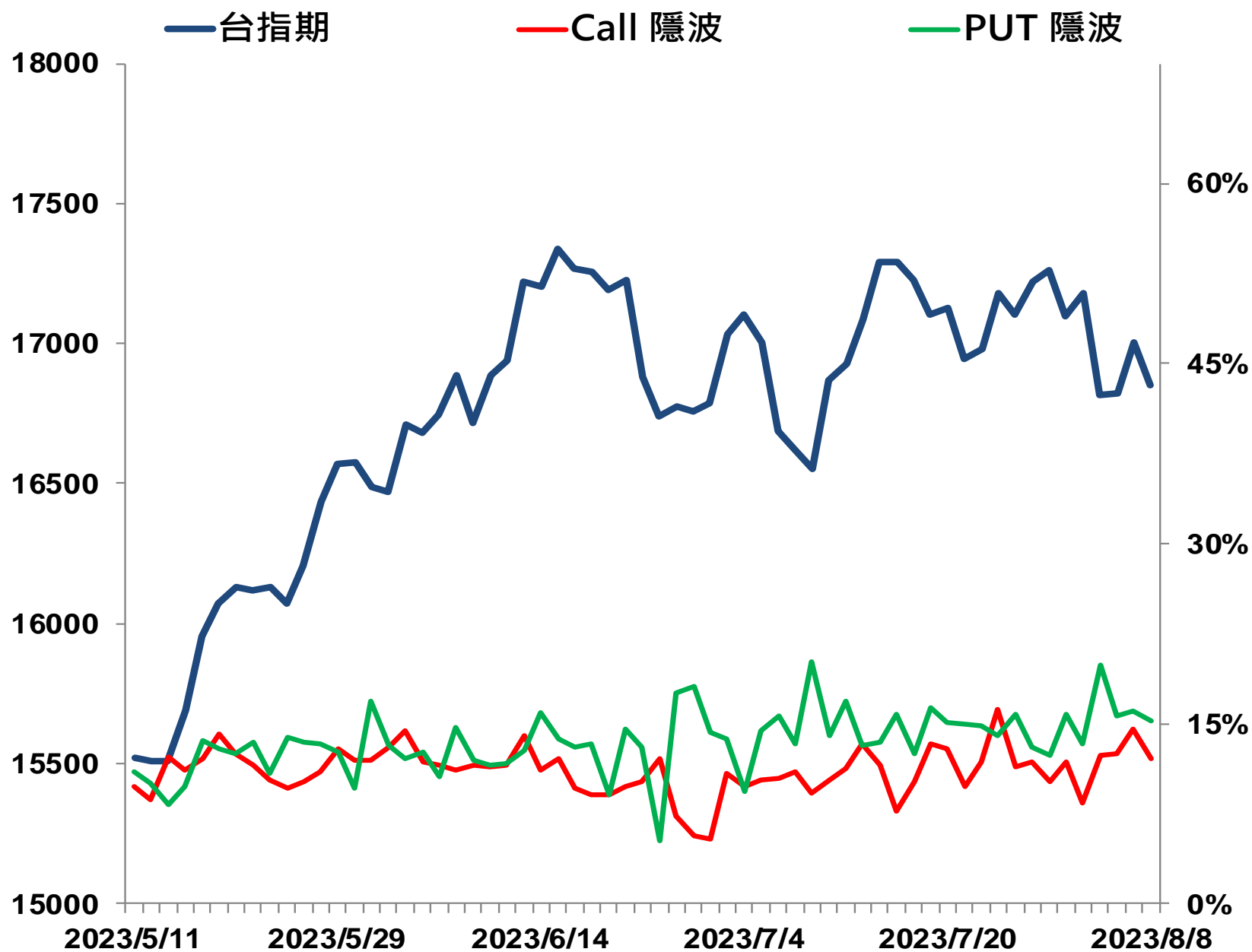
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月8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8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

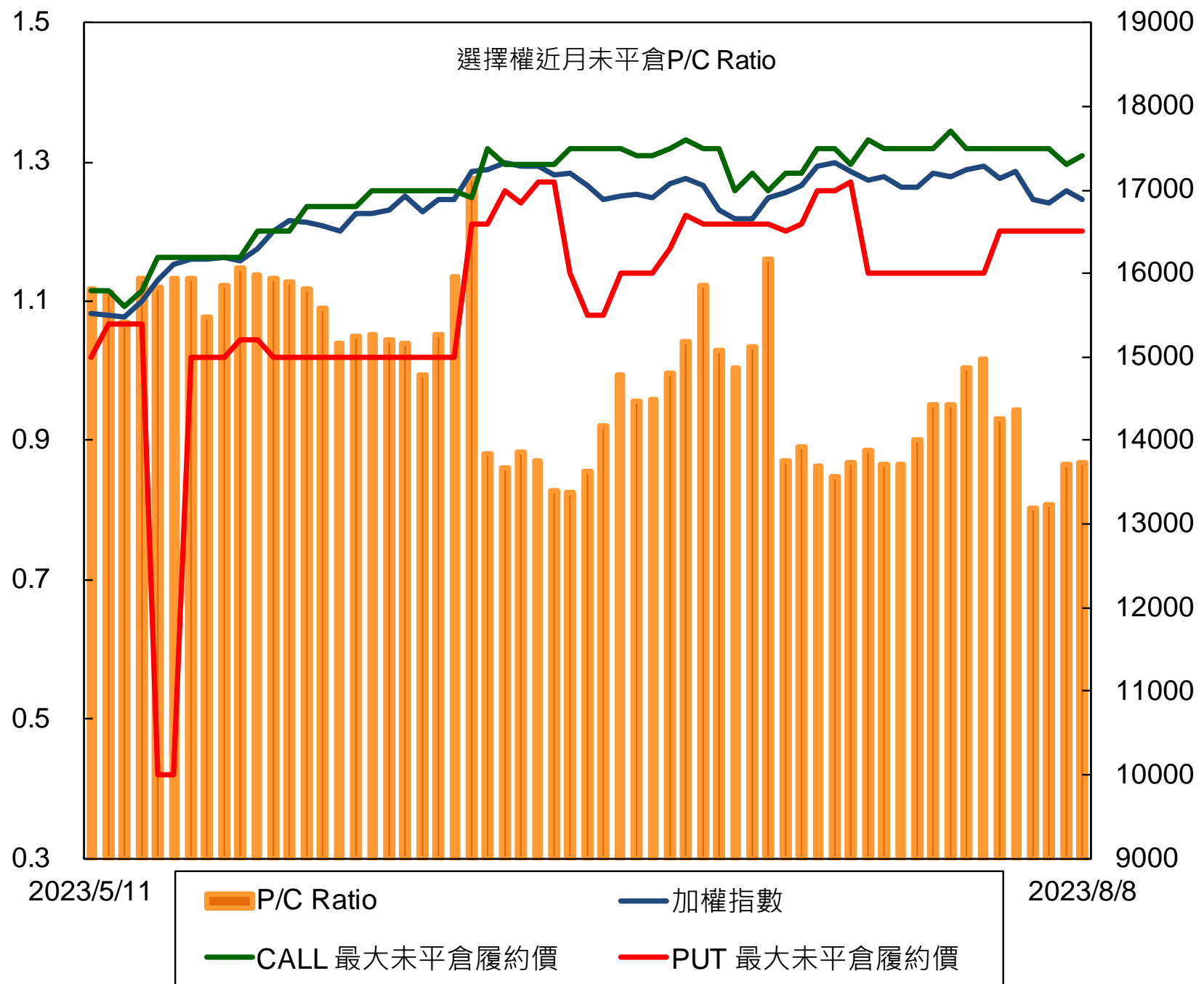
自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	8月7日	70,058	67,102	2,956
	8月8日	70,151	74,334	-4,183
Put	8月7日	56,942	52,133	4,809
	8月8日	67,835	54,793	13,042

更新日期：2023年8月8日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



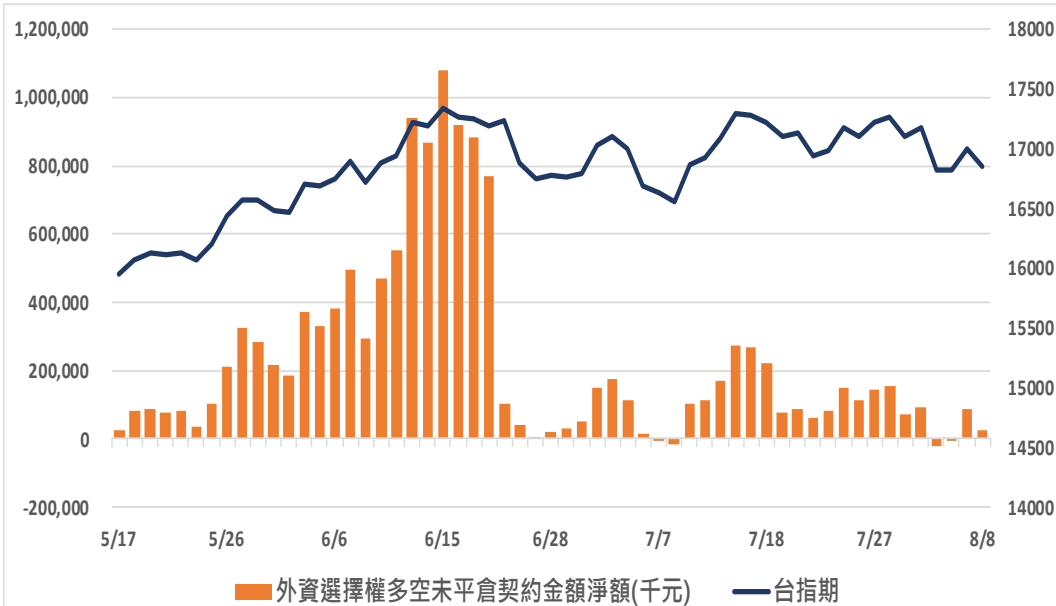
選擇權近月未平倉P/C Ratio



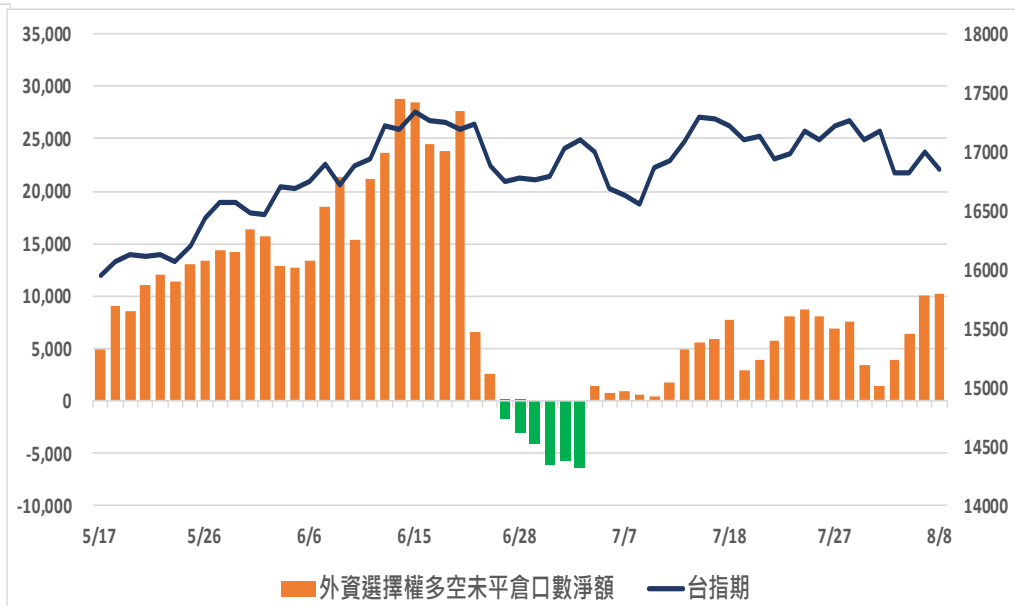
更新日期：2023年8月8日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



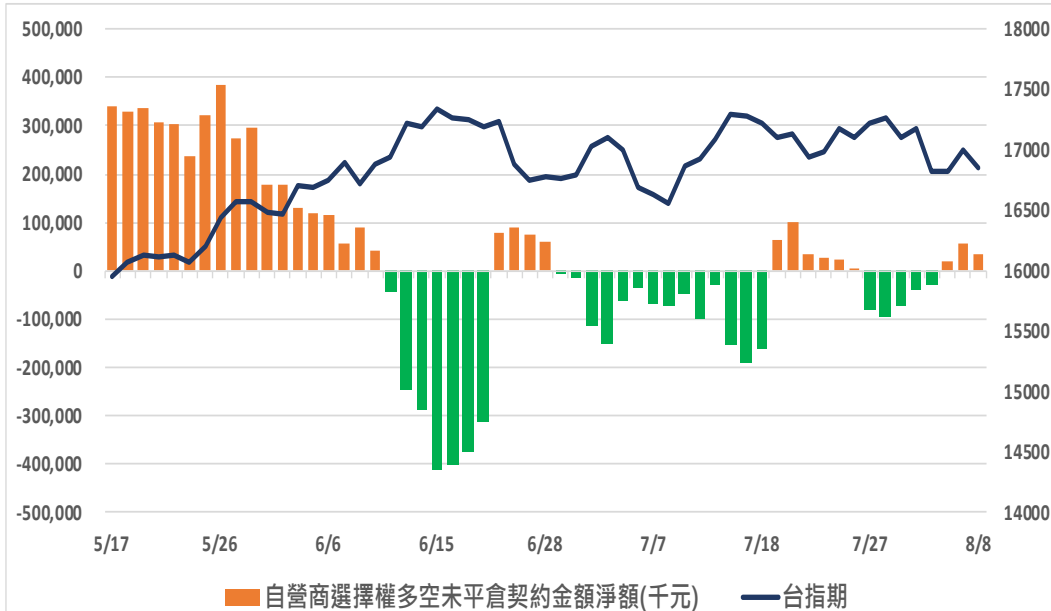
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/1	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
2023/8/8	16852	10,255	+217	27,237	-58,105

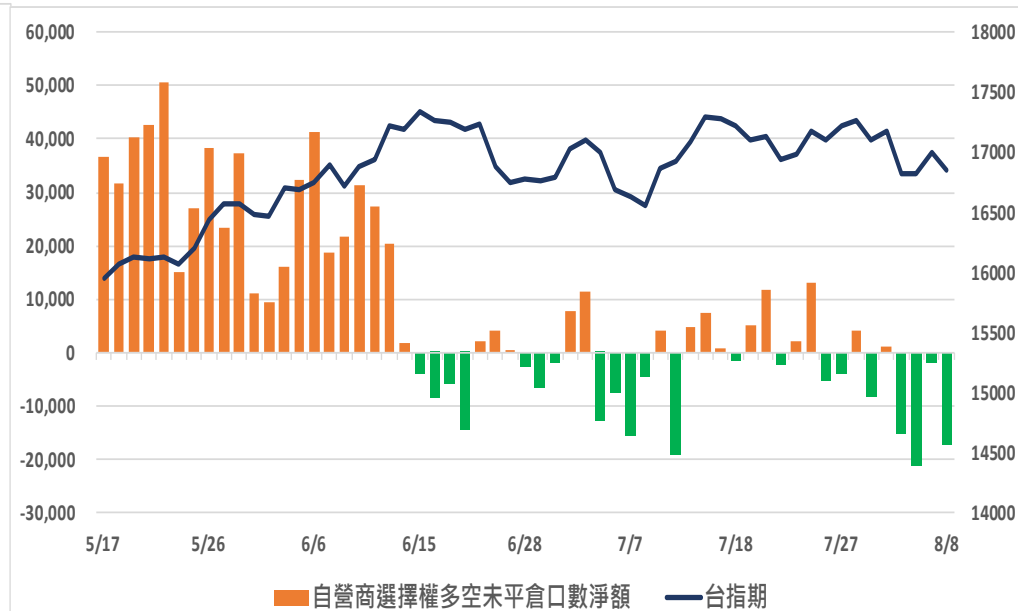
更新日期：2023年8月8日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



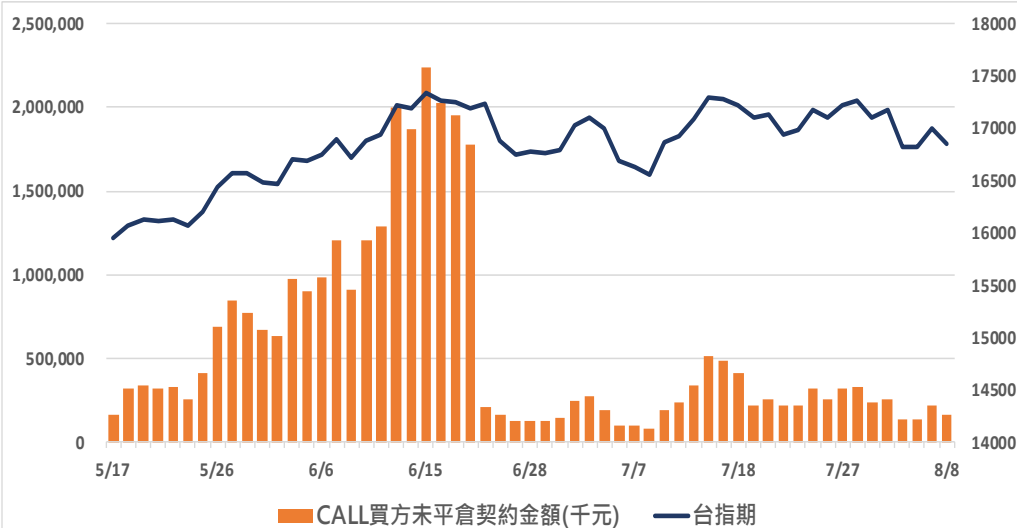
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千萬元)	金額增減
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
2023/8/8	16852	-17,225	-15,372	35,210	-22,246

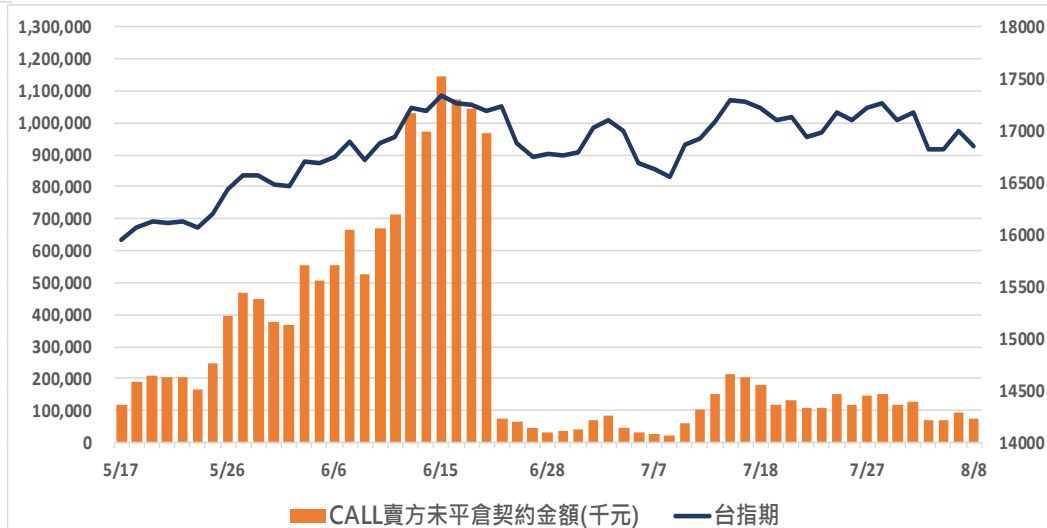
更新日期：2023年8月8日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

Buy Call未平倉金額



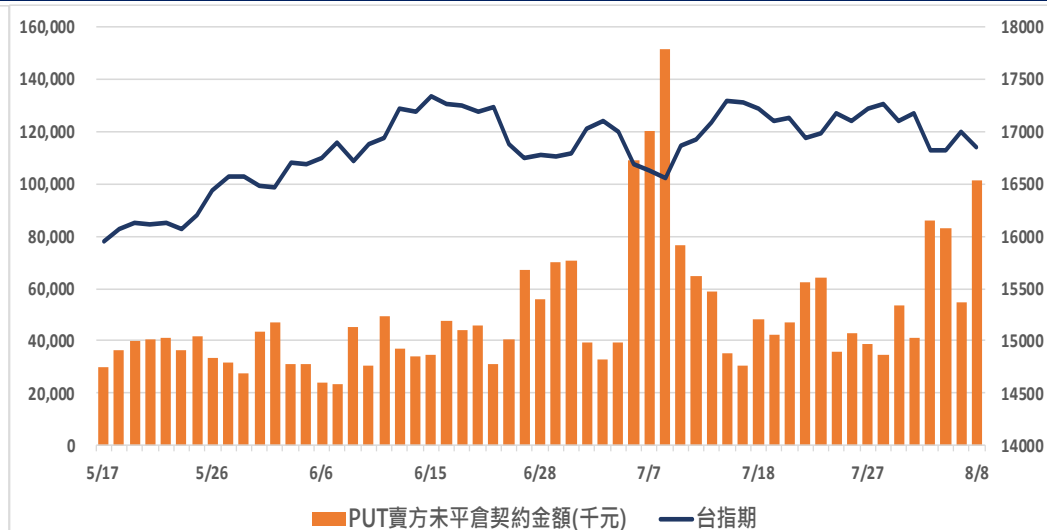
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



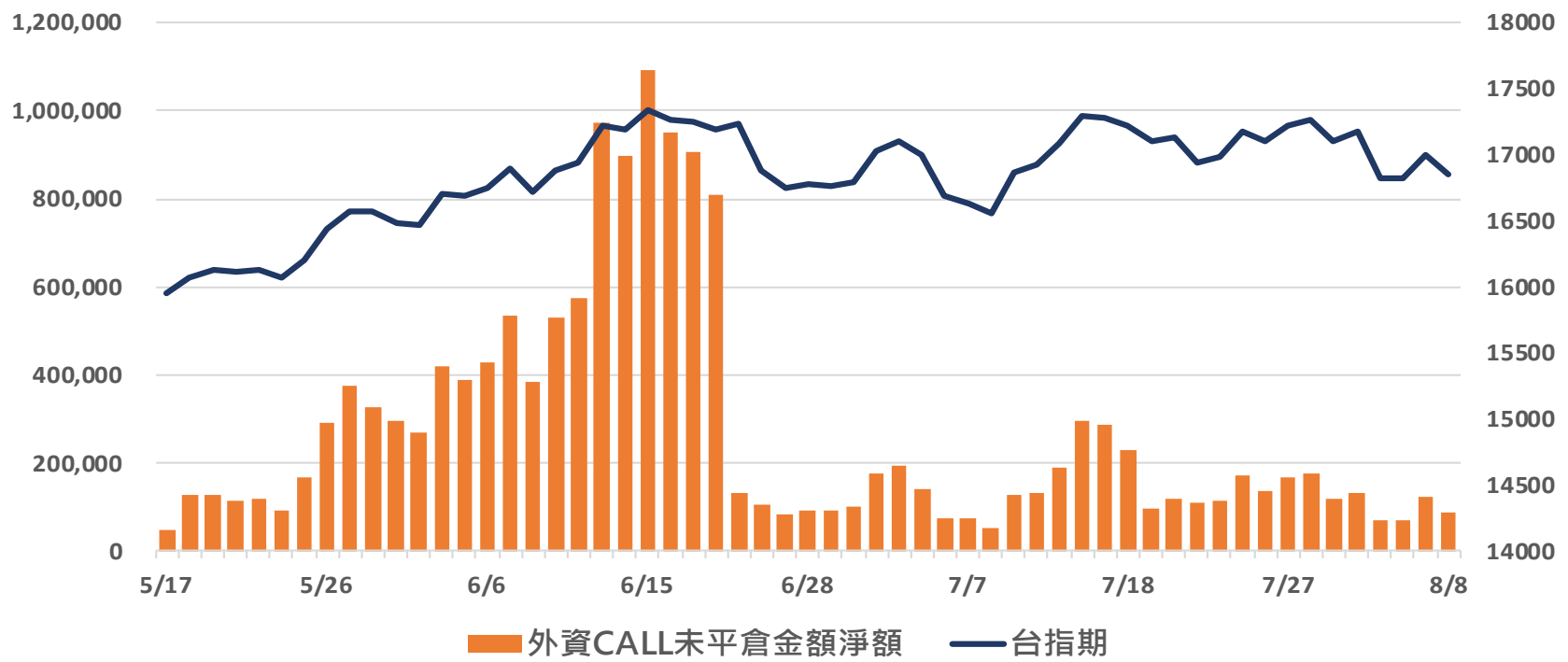
Sell Put未平倉金額



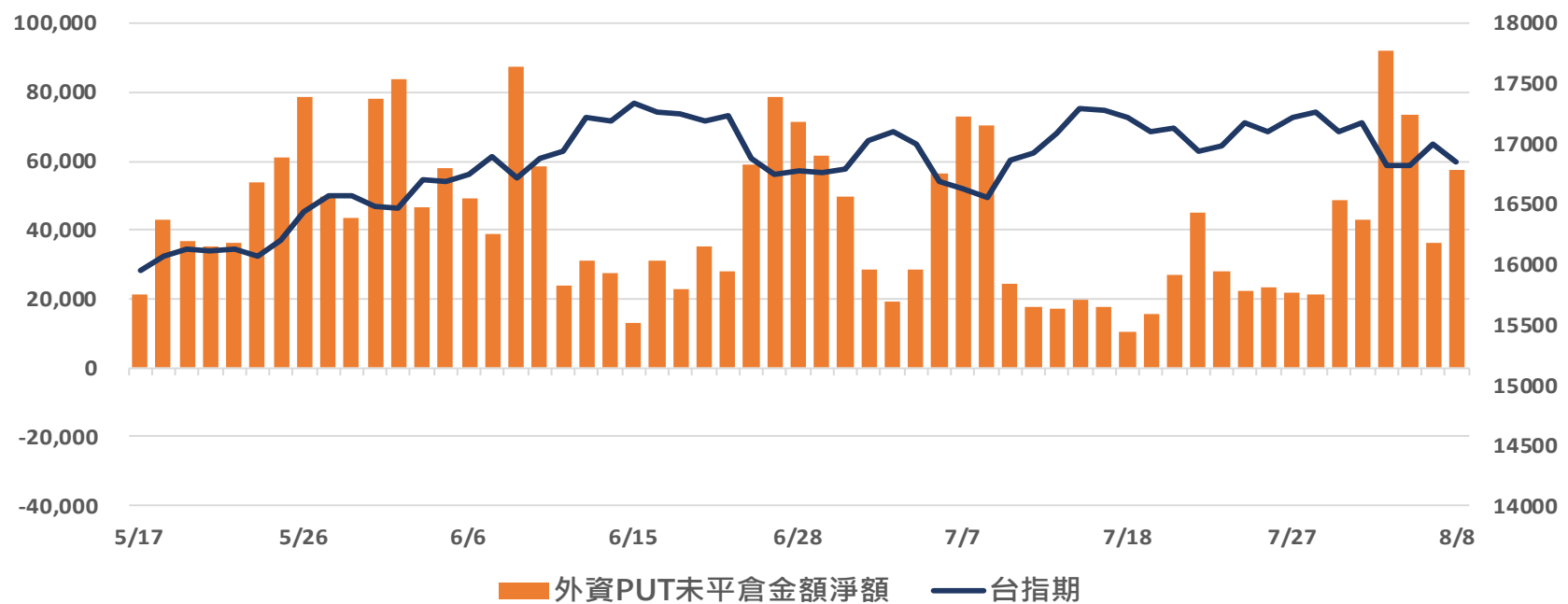
更新日期：2023年8月8日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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8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