

台指選擇權OI

日期：2023/8/10 結算日：2023/8/16					日期：2023/8/10 結算日：2023/9/20					
202308 月台指選擇權 OI 序列					202309 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	
2	28	15,900	4,129	1,844	0	74	15,600	713	99	
-1	161	16,000	11,262	4,730	※	0	15,700	574	145	
1	37	16,100	7,114	3,779		2	15,800	869	68	
6	58	16,200	7,951	3,369		1	15,900	766	251	
-2	70	16,300	10,389	2,621		0	16,000	3,638	469	
67	126	16,400	10,072	4,608		-5	16,100	1,731	911	
58	71	16,450	4,513	1,649		4	16,200	720	24	
195	443	16,500	13,462	4,246		1	16,300	1,360	-647	
469	497	16,550	3,081	770		43	16,400	716	-31	
1,938	2,583	16,600	7,640	1,015		16	16,500	1,966	-45	
2,630	2,804	16,650	2,920	749		78	16,600	3,125	1,279	※
3,059	4,035	16,700	6,002	-362		22	16,700	998	-14	
2,663	3,282	16,750	1,943	-75		138	16,800	1,730	104	
4,643	6,576	16,800	7,346	-1,124		145	16,900	1,118	390	
4,192	6,124	16,850	2,836	149		20	17,000	371	24	
6,656	10,729	16,900	5,822	780		614	17,100	117	3	
3,607	5,369	16,950	970	-40		297	17,200	166	0	
※	9,417	17,259	17,000	3,376	-132	-262	17,300	73	-1	
4,074	6,079	17,050	881	584	※	756	17,400	133	2	
4,877	12,591	17,100	1,708	-264		462	17,500	39	-1	
7,002	10,620	17,150	133	29		-33	17,600	63	1	
5,913	13,813	17,200	1,675	-17		-70	17,700	25	-1	
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	
65,007	183,143	0.7457	136,566	30,608	3,944	41,200	0.7765	31,992	4,172	
昨日 P/C	0.8969	今日增減變化	-0.1512		昨日 P/C	0.7467	今日增減變化	0.0298		

更新日期：2023年8月10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	84,651,983	97,557,057	-12,905,074	-19,298,595	806,310	2,979,296	-2,172,986	64,099
投信	42,743,804	40,207,500	2,536,304	630,717	1,010,381	0	1,010,381	-63,814
自營商	18,223,681	29,759,111	-11,535,430	6,398,268	346,259	1,664,045	-1,317,786	-168,297
	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	1,825,154	1,806,604	18,550	-236,639	97,601	47,322	50,279	1,030
投信	45,333	0	45,333	3,348	0	0	0	0
自營商	307,258	1,336,565	-1,029,307	141,155	161,201	217,402	-56,201	7,937

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	37,934	16,449	21,485	-3,533	30,978	12,748	18,230	1,392
投信	200	0	200	0	700	102	598	300
自營商	78,538	75,329	3,209	-22	61,442	41,075	20,367	10,998
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	21,852	2,800	19,052	505	2,550	15,177	-12,627	-637
特定法人(全月)	25,907	0	25,907	-2,140	2,550	21,554	-19,004	-2,236
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	64,155	63,035	1,120	-6,329	33,136	50,573	-17,437	-6,269
十大交易人(全月)	93,211	85,016	8,195	-4,317	48,758	74,523	-25,765	-7,174
全市場未沖銷(近月)			188,433	64,599			141,589	33,898
全市場未沖銷(全月)			248,670	73,790			185,983	42,317

更新日期：2023年8月10日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

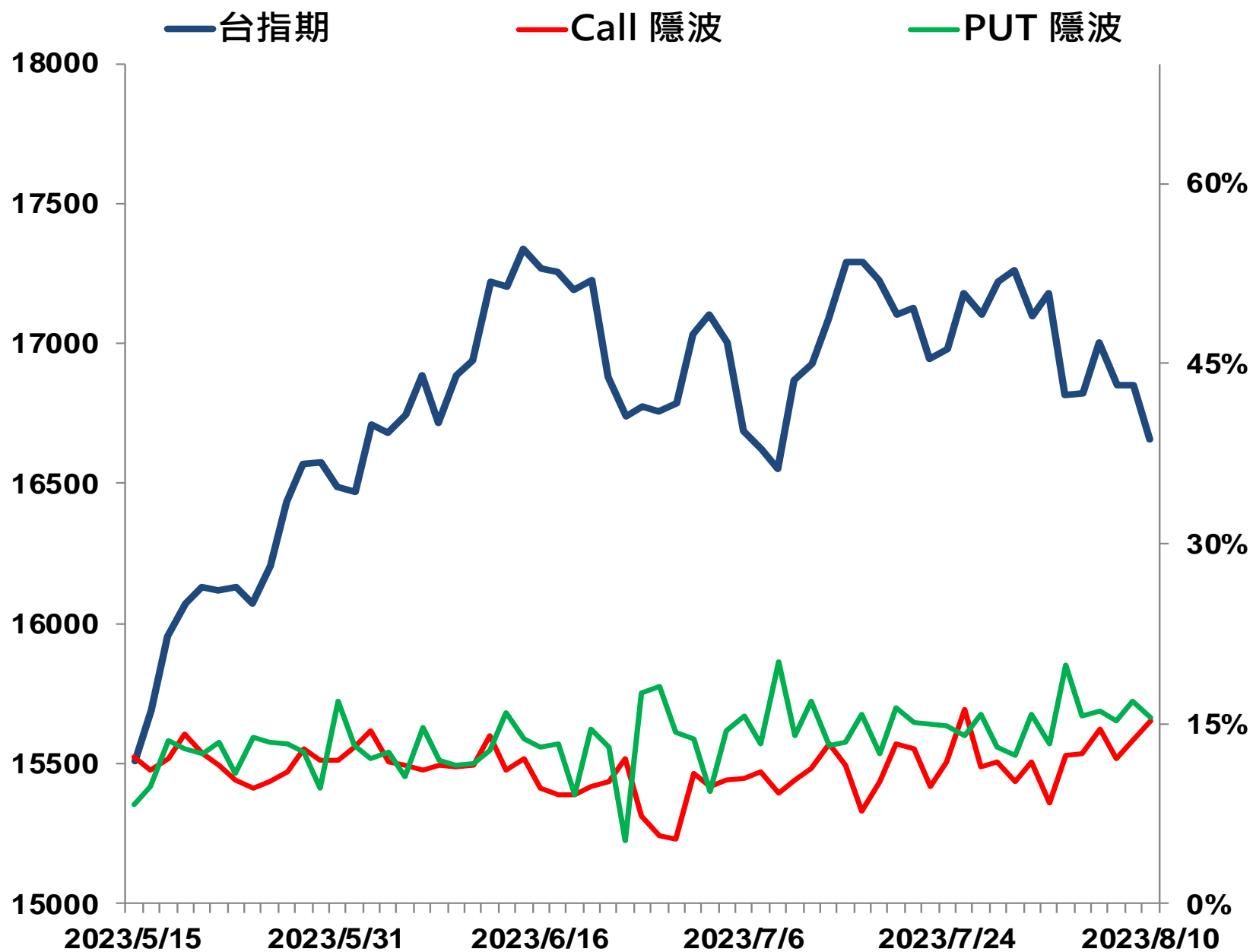
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月10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10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

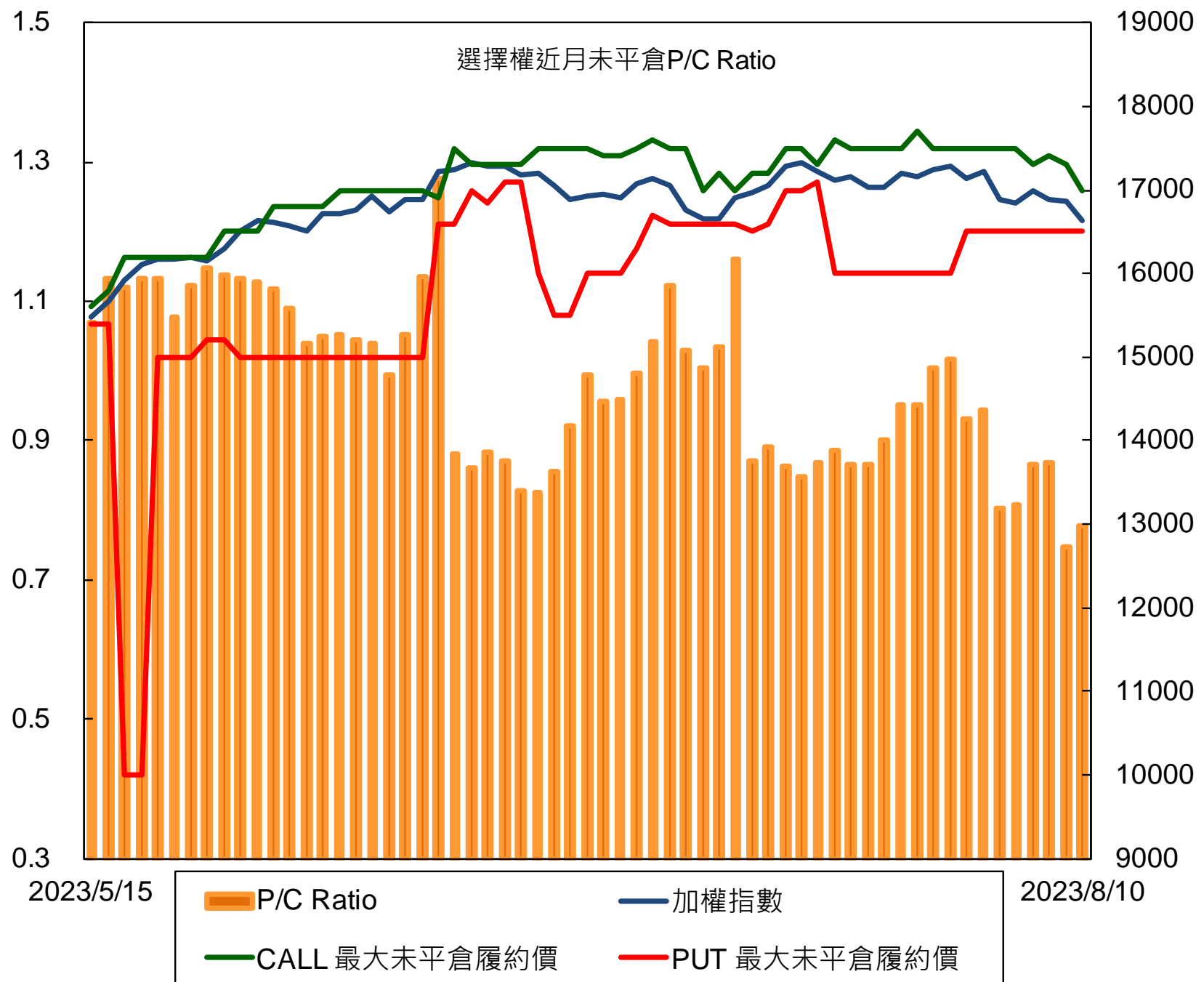
自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	8月9日	64,869	61,638	3,231
	8月10日	78,538	75,329	3,209
Put	8月9日	47,314	37,945	9,369
	8月10日	61,442	41,075	20,367

更新日期：2023年8月10日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



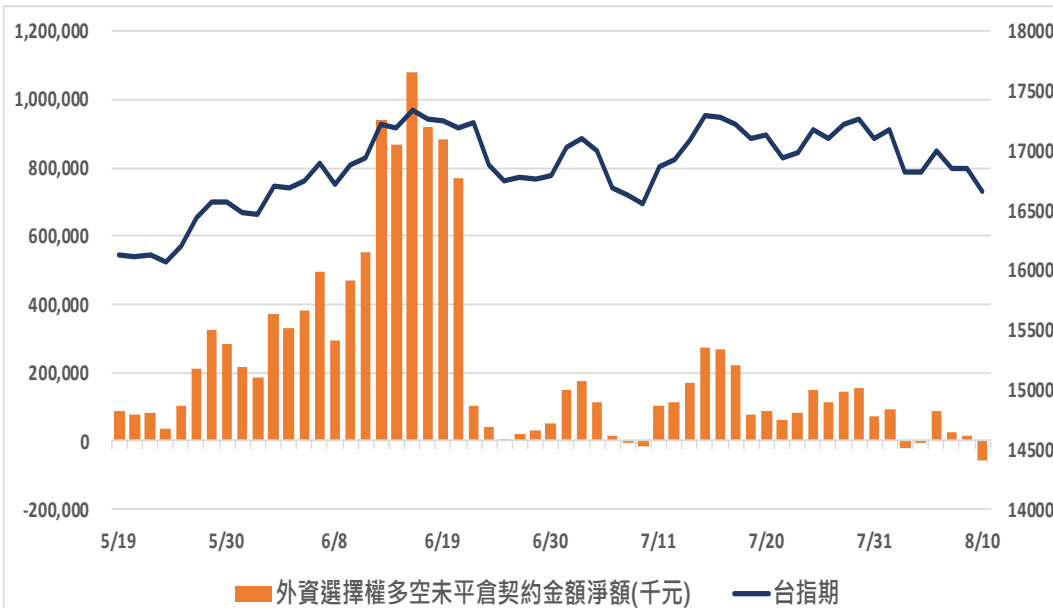
選擇權近月未平倉P/C Ratio



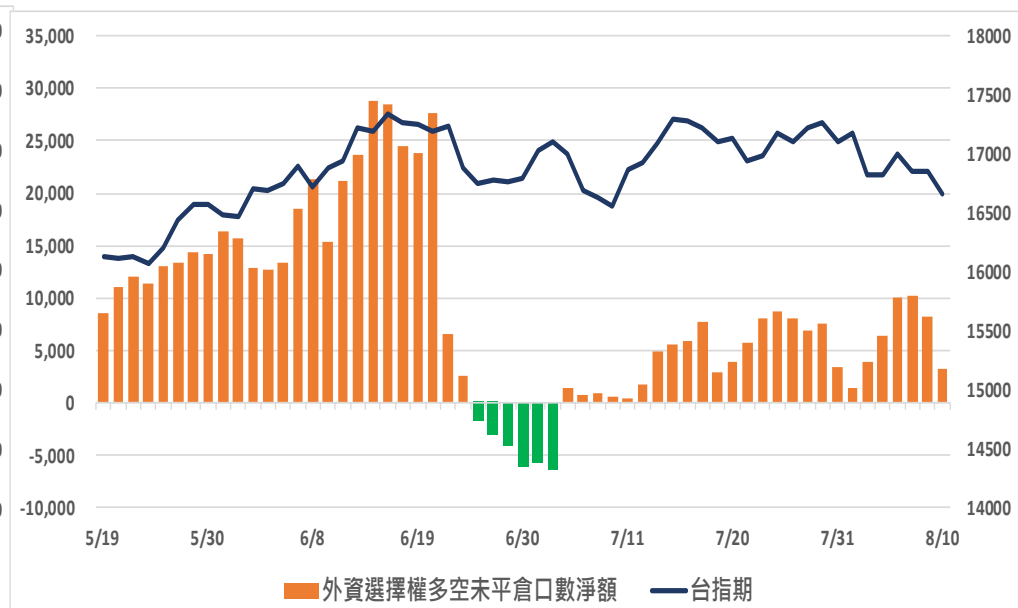
更新日期：2023年8月10日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



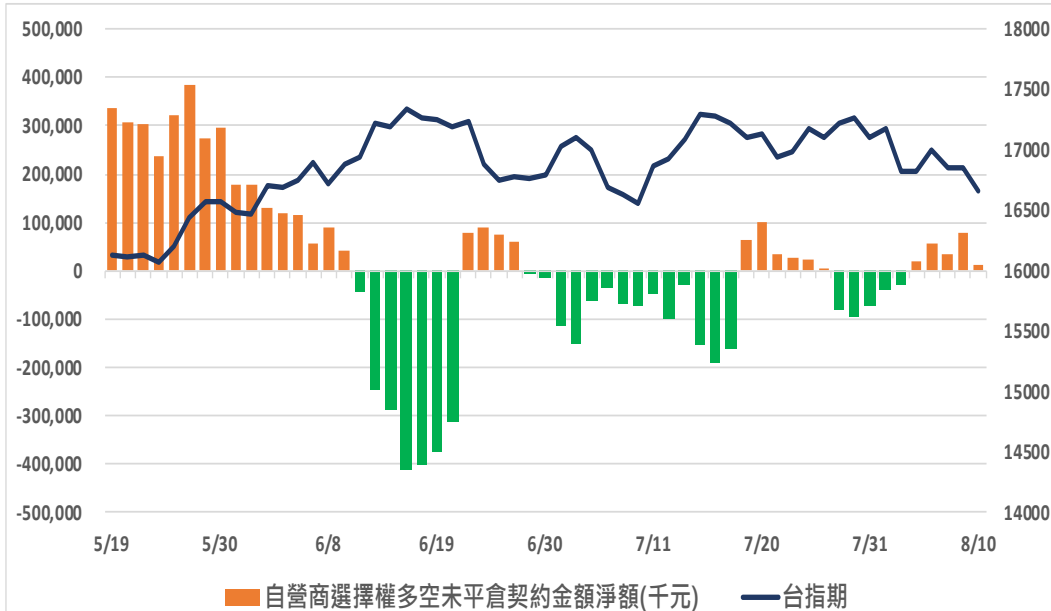
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/4	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
2023/8/9	16853	8,180	-2,075	13,516	-13,721
2023/8/10	16656	3,255	-4,925	-57,714	-71,230

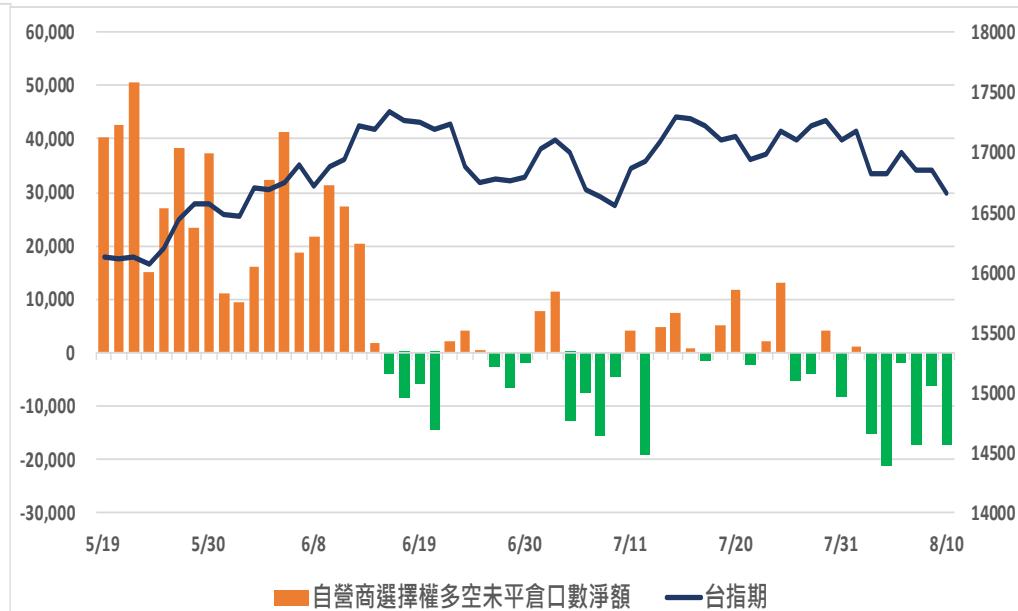
更新日期：2023年8月10日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



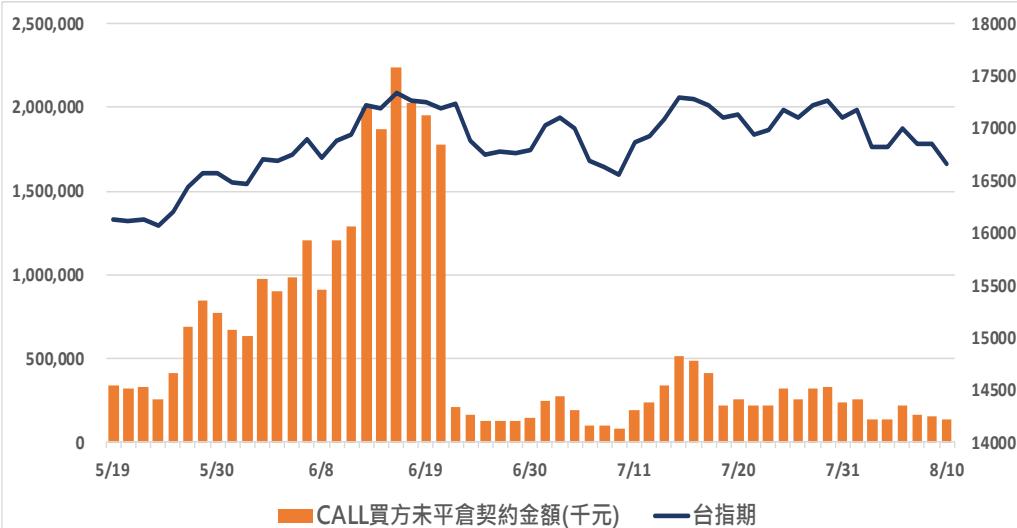
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/4	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
2023/8/9	16853	-6,138	+11,087	78,030	+42,820
2023/8/10	16656	-17,158	-11,020	10,164	-67,866

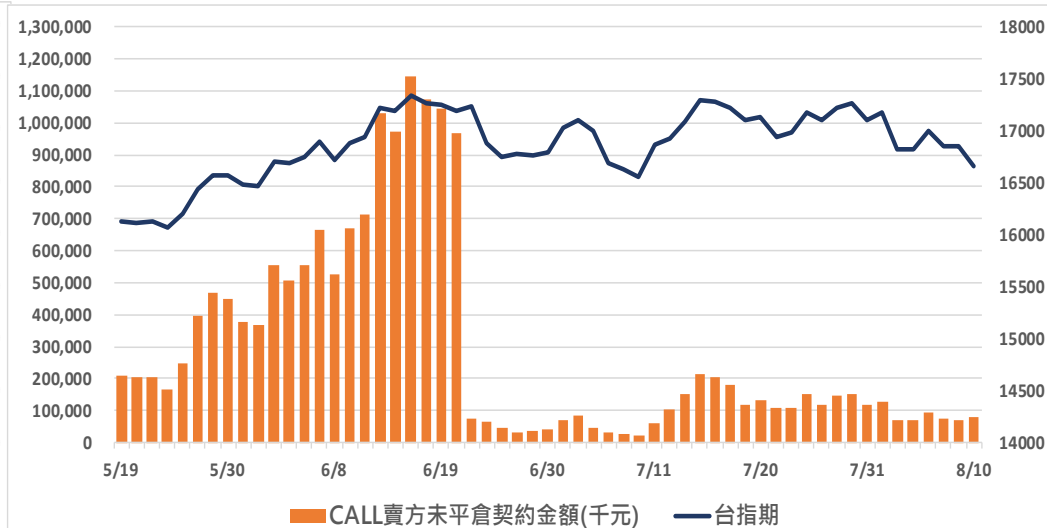
更新日期：2023年8月10日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

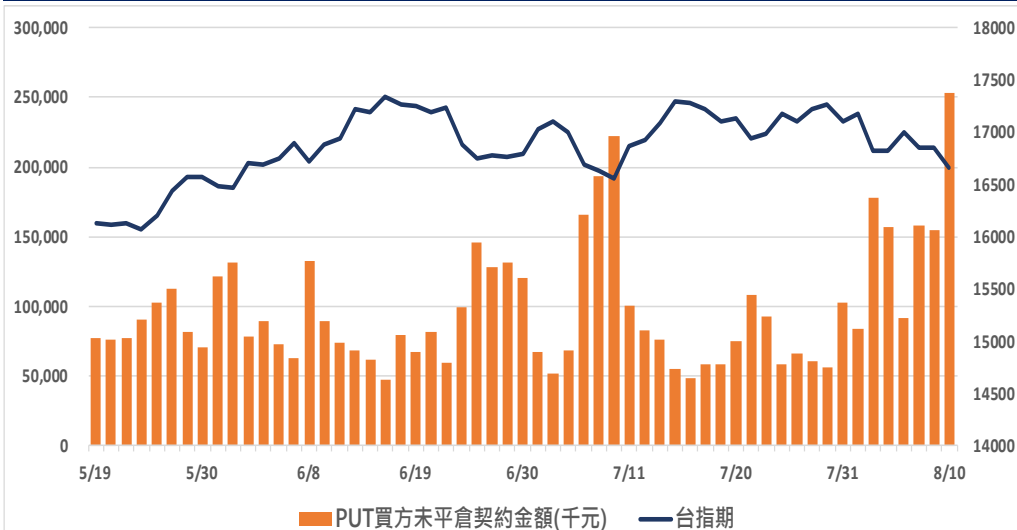
Buy Call未平倉金額



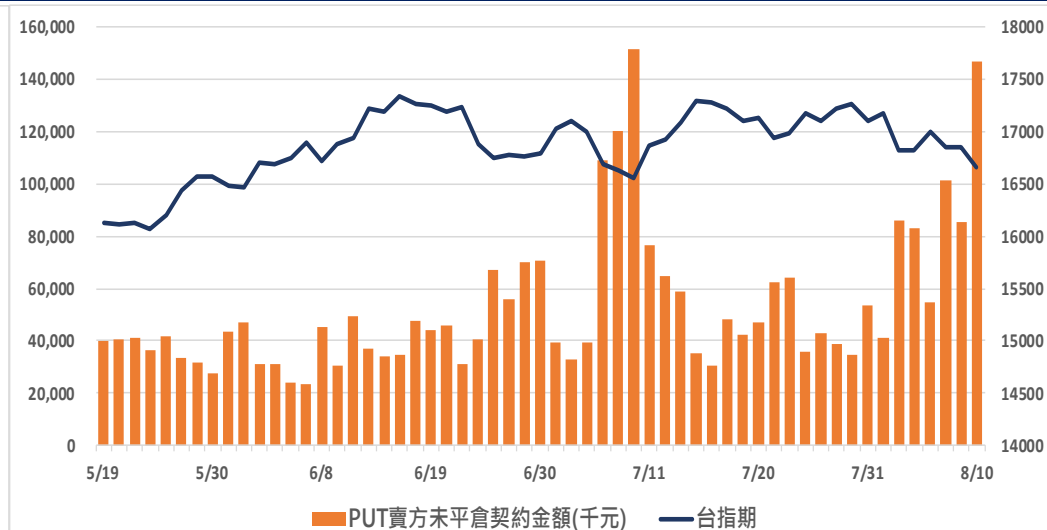
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



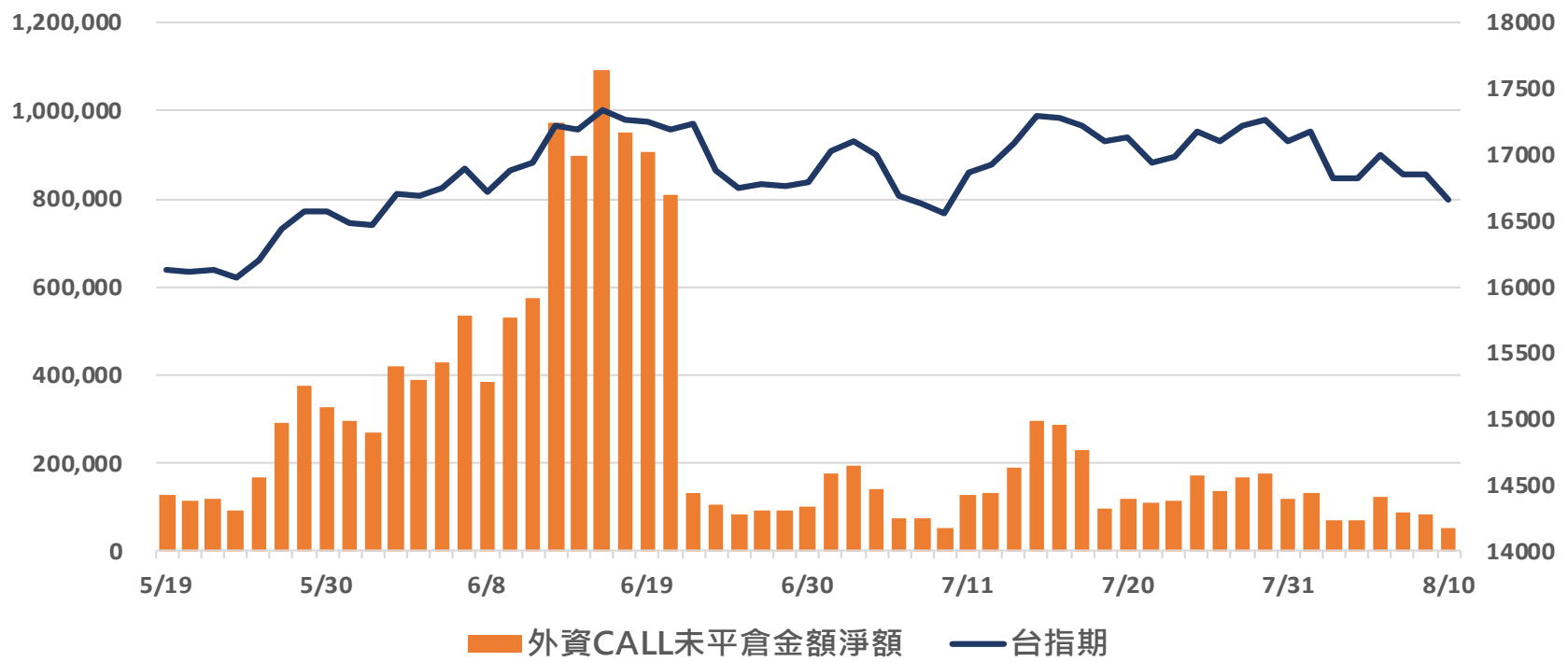
Sell Put未平倉金額



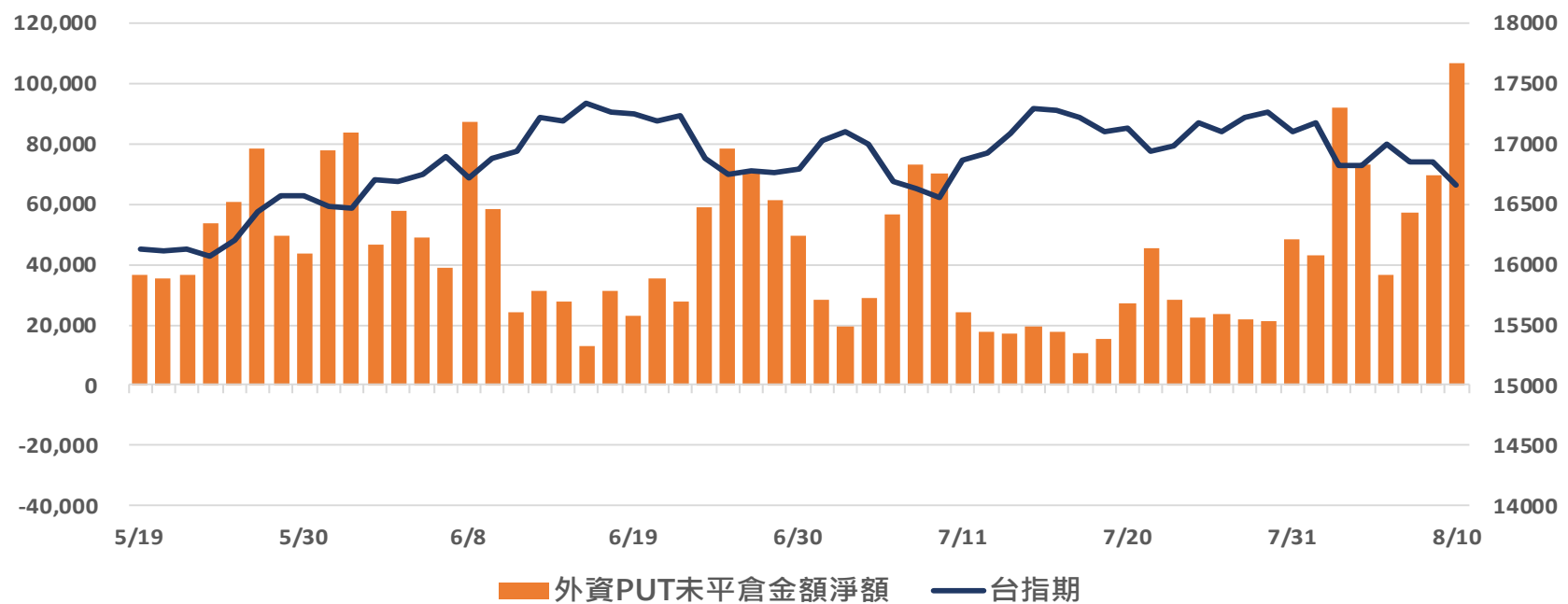
更新日期：2023年8月10日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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10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