

台指選擇權OI

日期：2023/8/11 結算日：2023/8/16					日期：2023/8/11 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	39	16,100	8,059	945	0	74	15,600	989	276
0	0	16,150	956	956	2	4	15,700	650	76
3	61	16,200	10,998	3,047	-9	81	15,800	725	-144
6	6	16,250	837	837	-1	9	15,900	820	54
38	108	16,300	14,031	3,642	-1	66	16,000	3,830	192
10	30	16,350	7,361	2,382	0	5	16,100	1,752	21
33	159	16,400	11,116	1,044	13	61	16,200	840	120
28	99	16,450	5,207	694	5	14	16,300	1,358	-2
390	833	16,500	14,968	1,506	-18	89	16,400	813	97
90	587	16,550	4,621	1,540	11	85	16,500	2,006	40
404	2,987	16,600	9,121	1,481	79	446	16,600	3,200	75
196	3,000	16,650	3,843	923	20	159	16,700	1,025	27
1,552	5,587	16,700	5,997	-5	258	741	16,800	1,746	16
1,470	4,752	16,750	2,548	605	112	505	16,900	1,063	-55
5,118	11,694	16,800	7,227	-119	611	1,945	17,000	825	454
2,618	8,742	16,850	3,217	381	562	2,361	17,100	119	2
3,791	14,520	16,900	5,976	154	131	1,763	17,200	170	4
3,280	8,649	16,950	892	-78	403	2,180	17,300	73	0
828	18,087	17,000	3,291	-85	896	3,688	17,400	133	0
1,080	7,159	17,050	518	-363	785	2,823	17,500	39	0
1,296	13,887	17,100	1,703	-5	21	3,507	17,600	63	0
-781	9,839	17,150	122	-11	193	2,350	17,700	26	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
13,531	196,694	0.8297	163,188	21,643	4,336	45,536	0.7602	34,618	2,626
昨日 P/C	0.7457	今日增減變化	0.0840		昨日 P/C	0.7765	今日增減變化	-0.0163	

更新日期：2023年8月11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	88,526,860	92,233,046	-3,706,186	9,198,888	790,438	2,850,023	-2,059,585	113,401
投信	42,860,257	40,461,841	2,398,416	-137,888	987,707	0	987,707	-22,674
自營商	16,075,037	32,271,984	-16,196,947	-4,661,517	471,037	1,900,521	-1,429,484	-111,698
	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	1,768,794	1,672,855	95,939	77,389	99,154	51,839	47,315	-2,964
投信	45,166	0	45,166	-167	0	0	0	0
自營商	257,627	1,255,154	-997,527	31,780	202,820	266,385	-63,565	-7,364

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	39,506	21,001	18,505	-2,980	31,662	12,735	18,927	697
投信	200	0	200	0	700	102	598	0
自營商	86,532	68,690	17,842	14,633	60,196	47,777	12,419	-7,948
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	21,941	7,297	14,644	-4,408	2,550	14,637	-12,087	540
特定法人(全月)	27,932	7,297	20,635	-5,272	2,550	19,466	-16,916	2,088
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	69,887	62,706	7,181	6,061	37,399	49,378	-11,979	5,458
十大交易人(全月)	102,976	82,447	20,529	12,334	55,130	73,408	-18,278	7,487
全市場未沖銷(近月)			200,863	12,430			163,232	21,643
全市場未沖銷(全月)			268,355	19,685			213,757	27,774

更新日期：2023年8月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

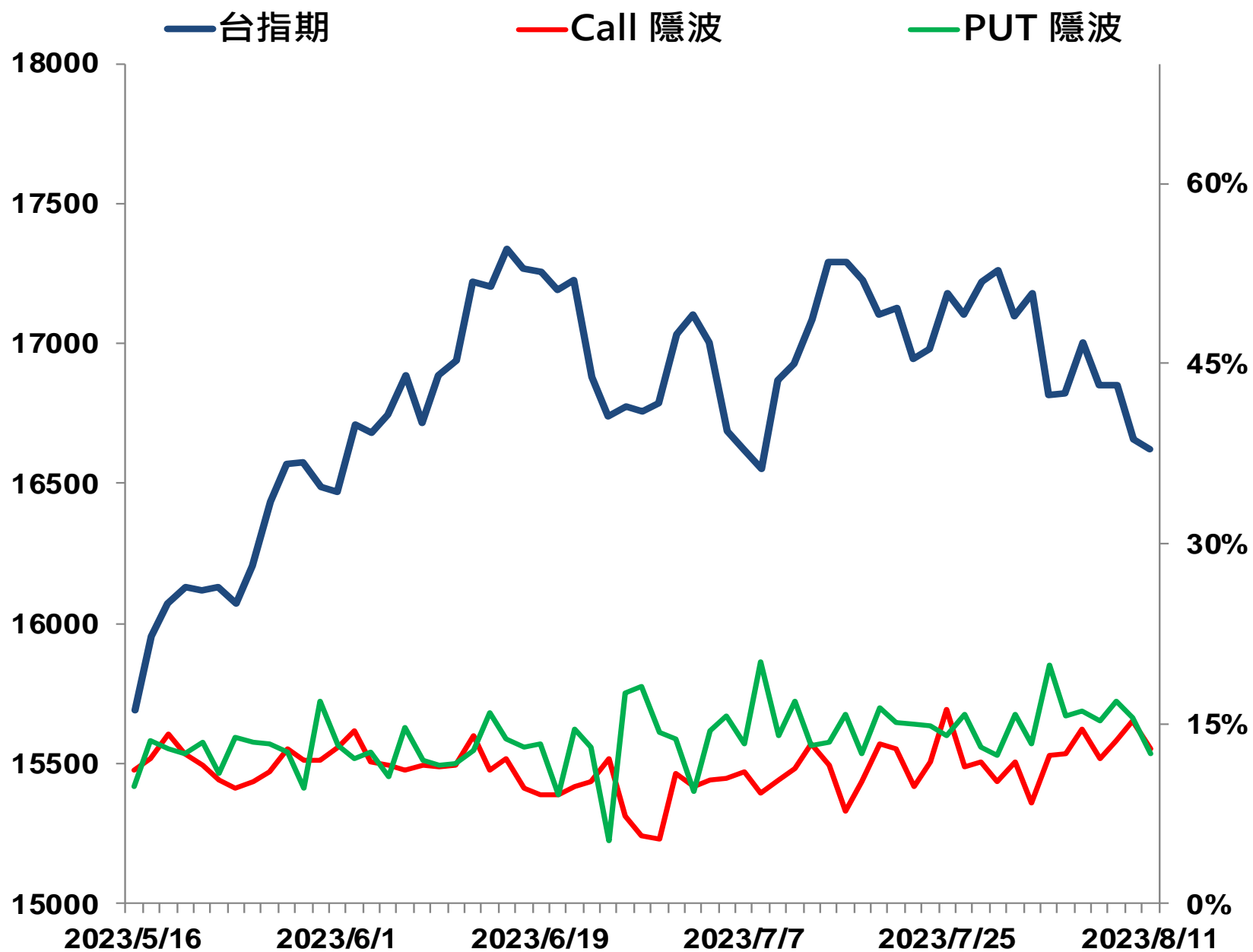
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月11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11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

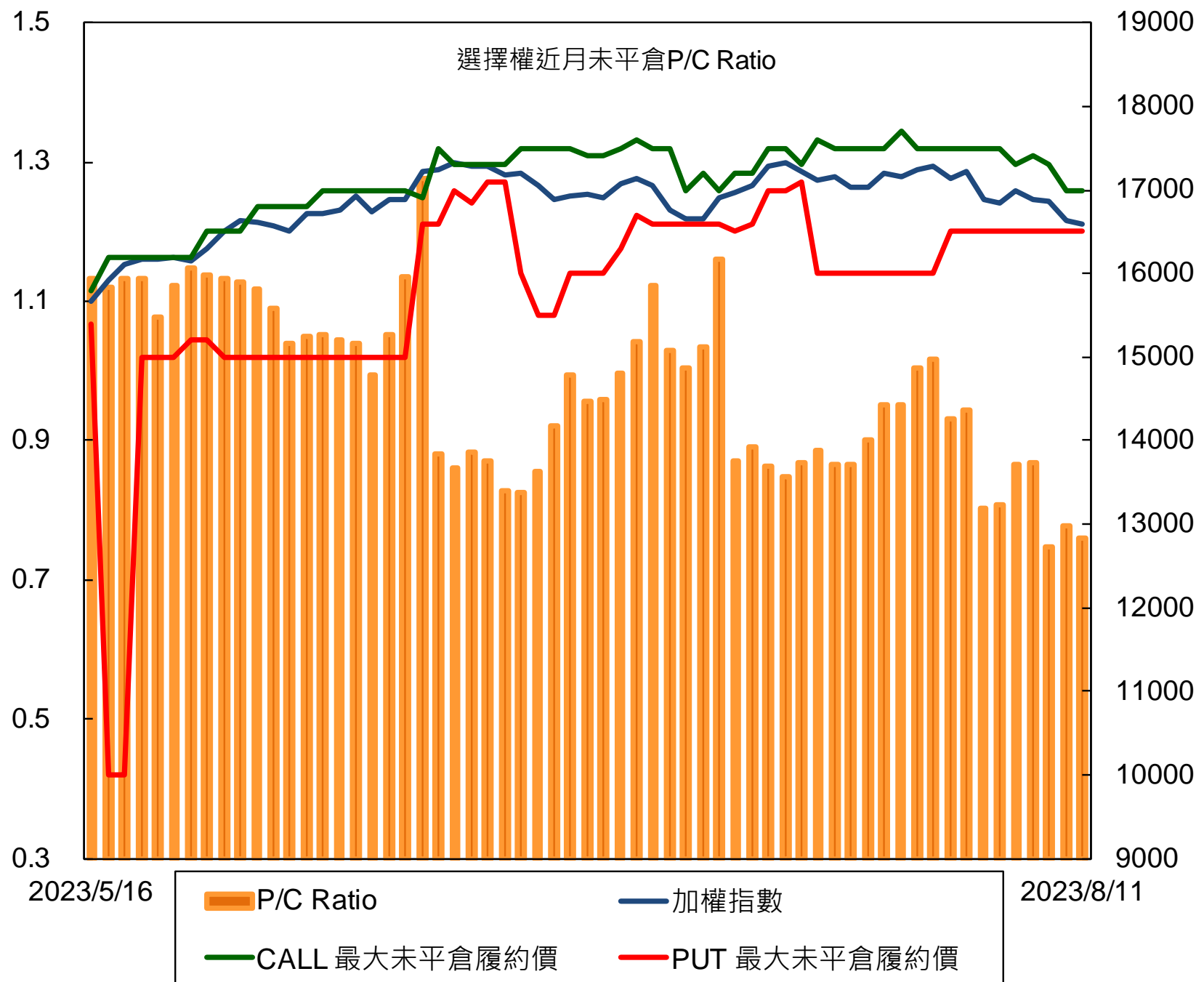
自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	8月10日	78,538	75,329	3,209
	8月11日	86,532	68,690	17,842
Put	8月10日	61,442	41,075	20,367
	8月11日	60,196	47,777	12,419

更新日期：2023年8月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



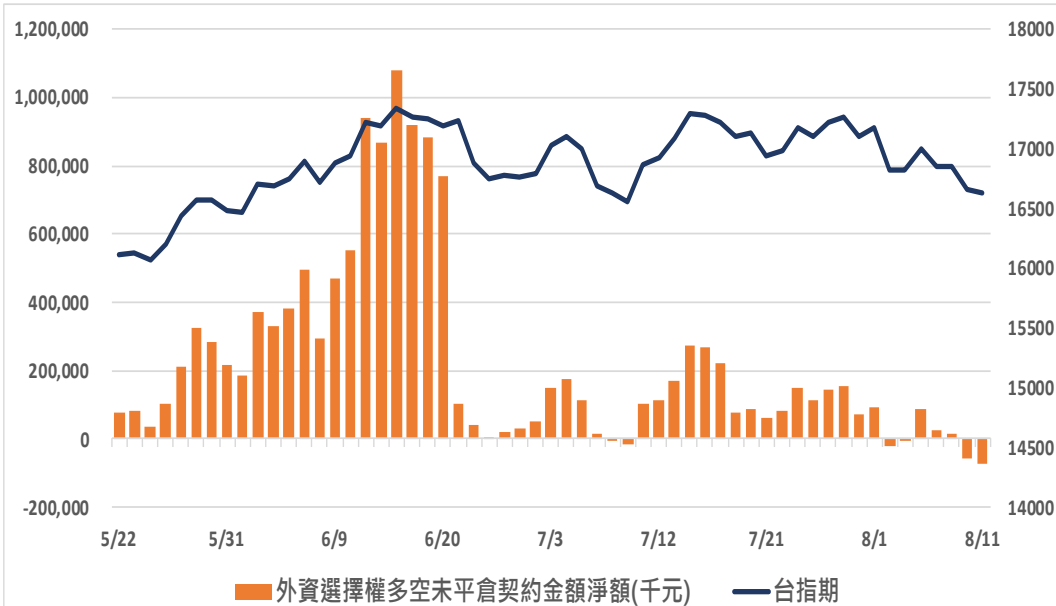
選擇權近月未平倉P/C Ratio



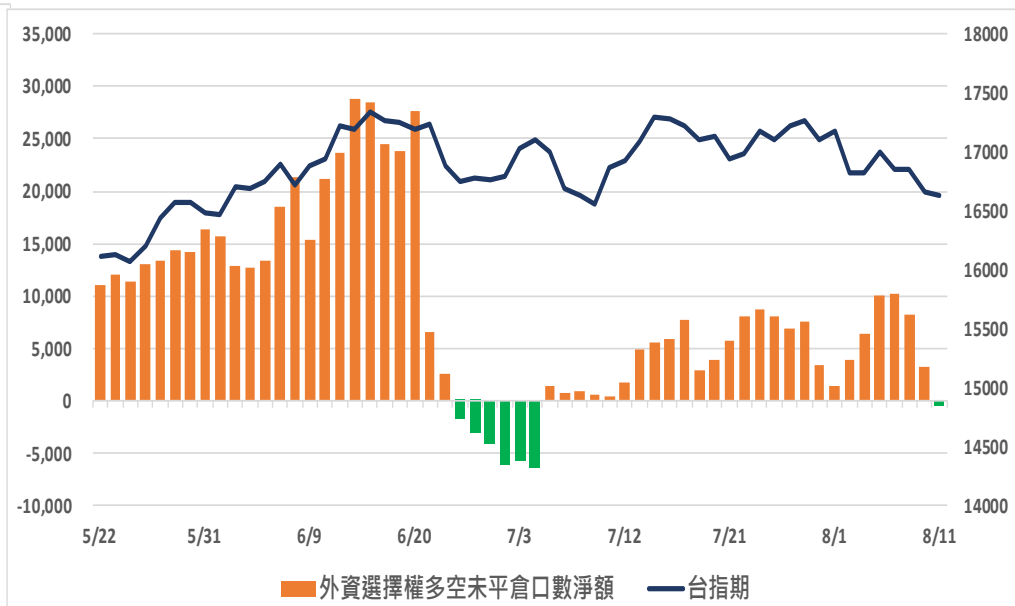
更新日期：2023年8月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



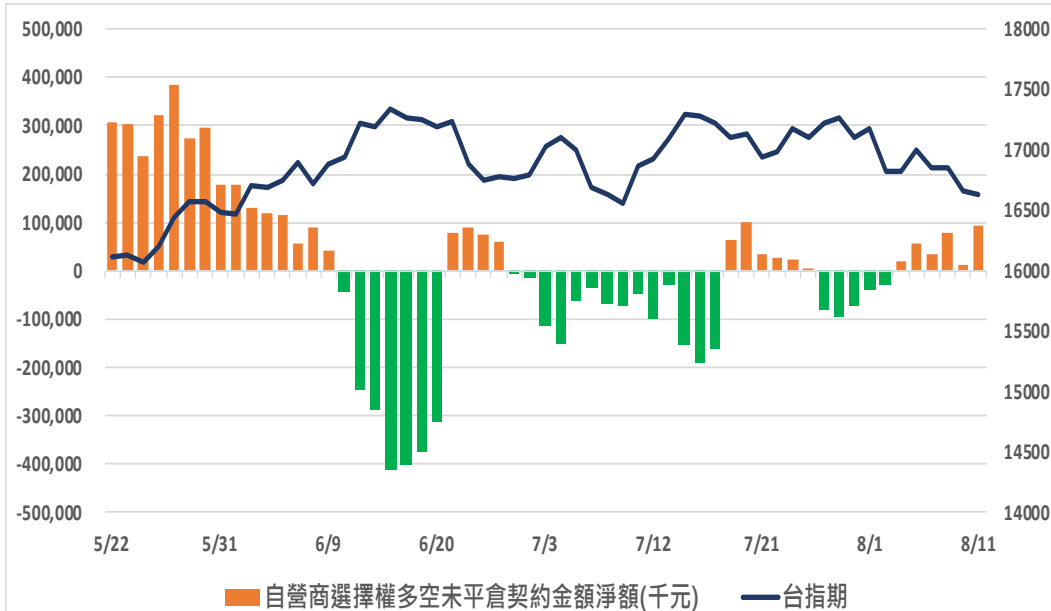
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/7	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
2023/8/11	16625	-422	-3,677	-74,433	-16,719

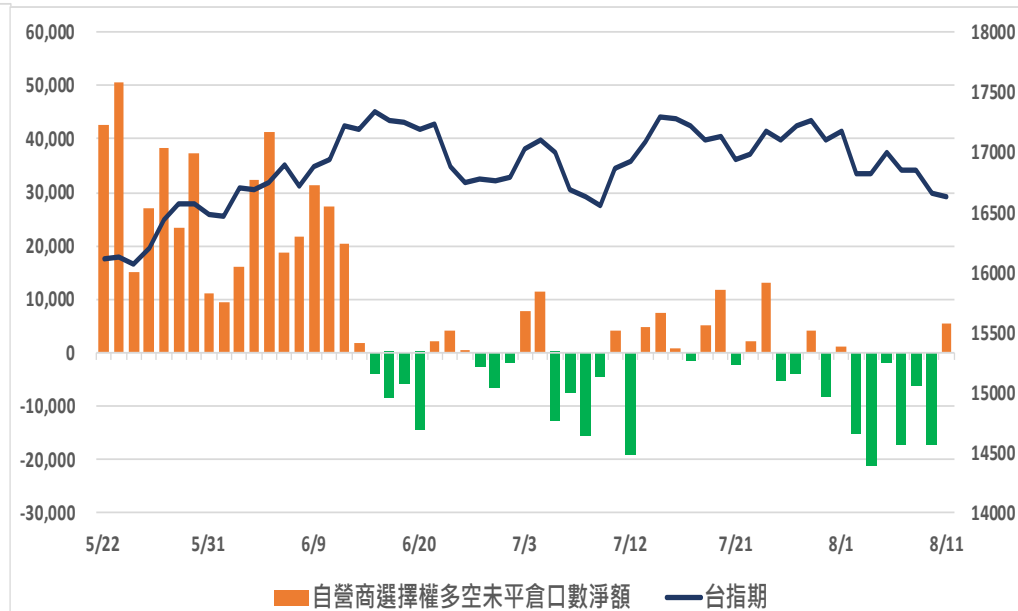
更新日期：2023年8月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



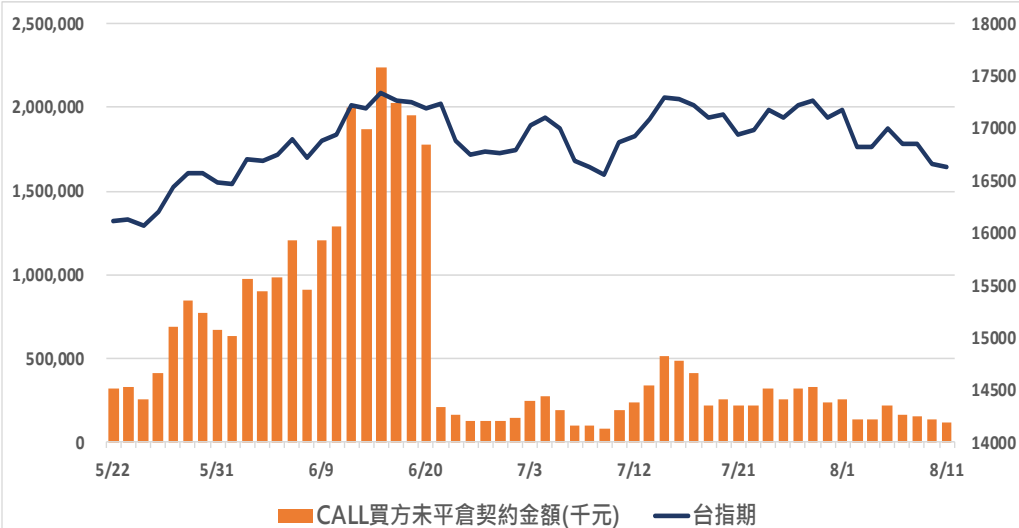
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/7	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
2023/8/11	16625	5,423	+22,581	94,383	+84,219

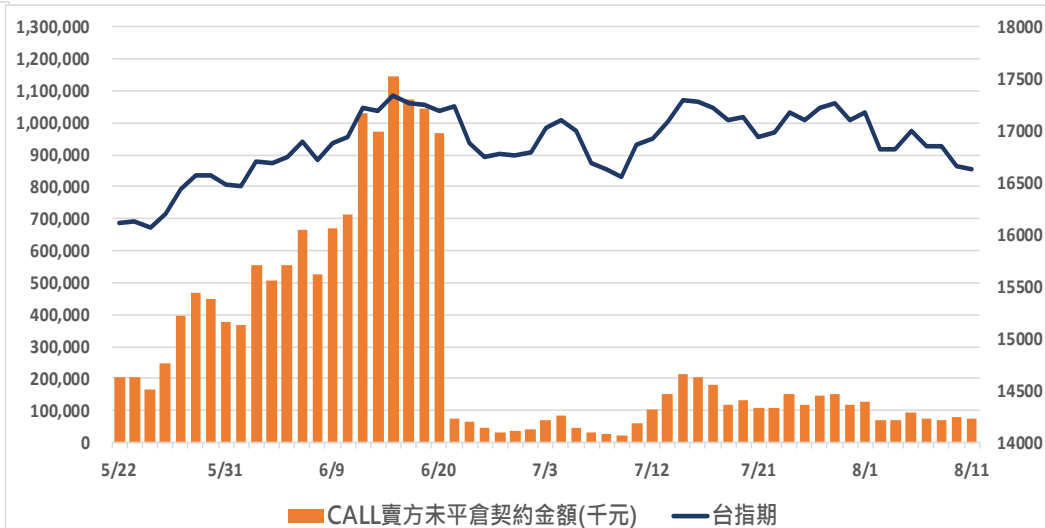
更新日期：2023年8月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

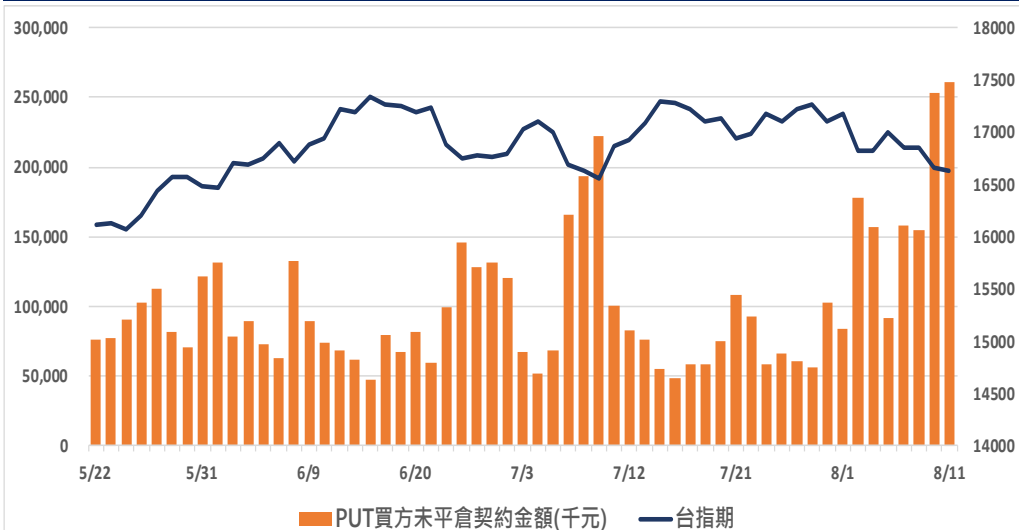
Buy Call未平倉金額



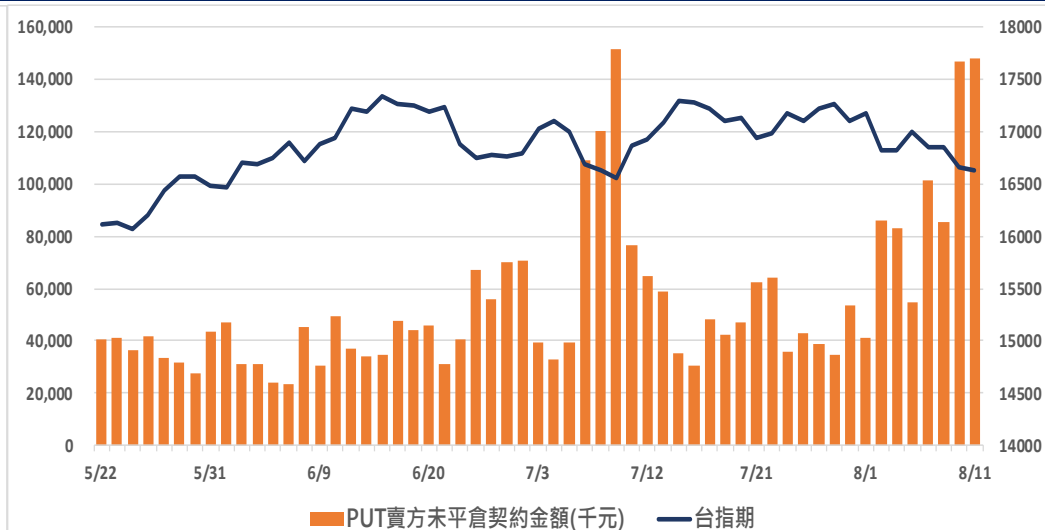
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



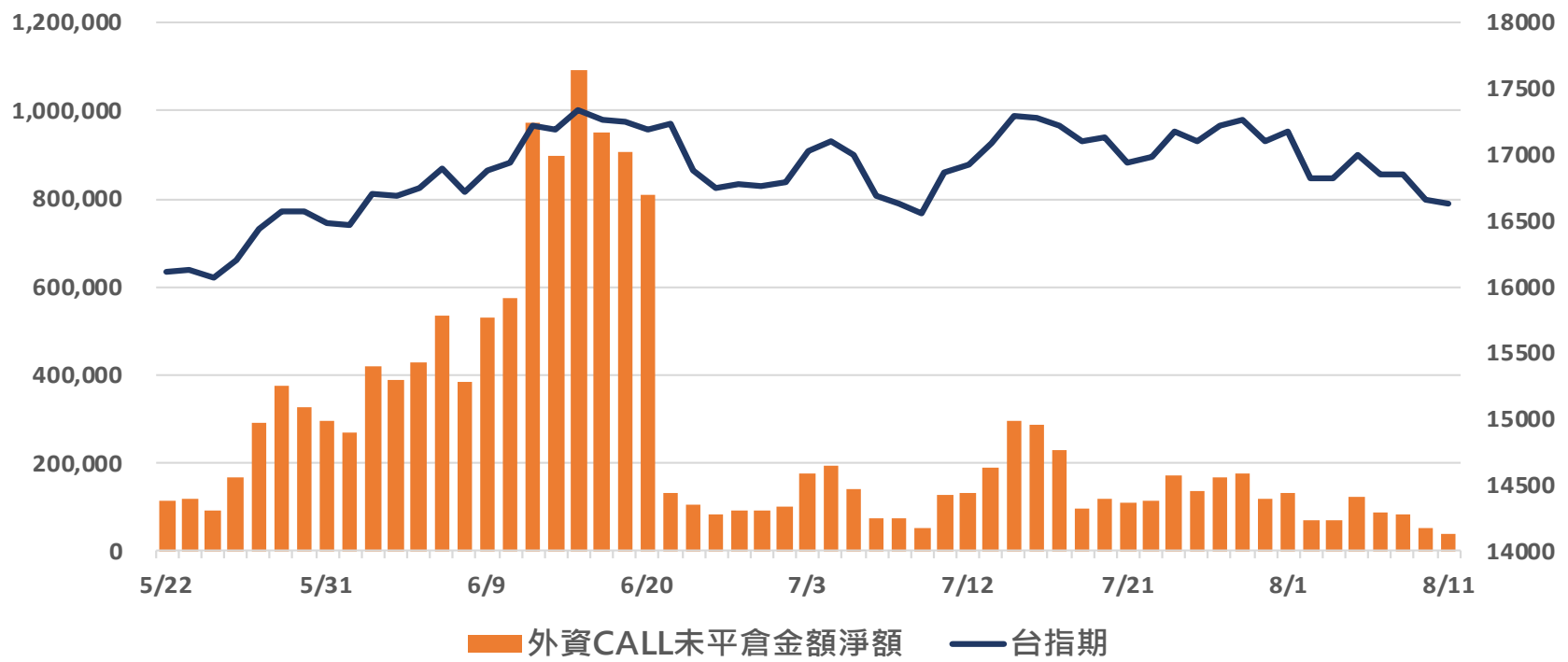
Sell Put未平倉金額



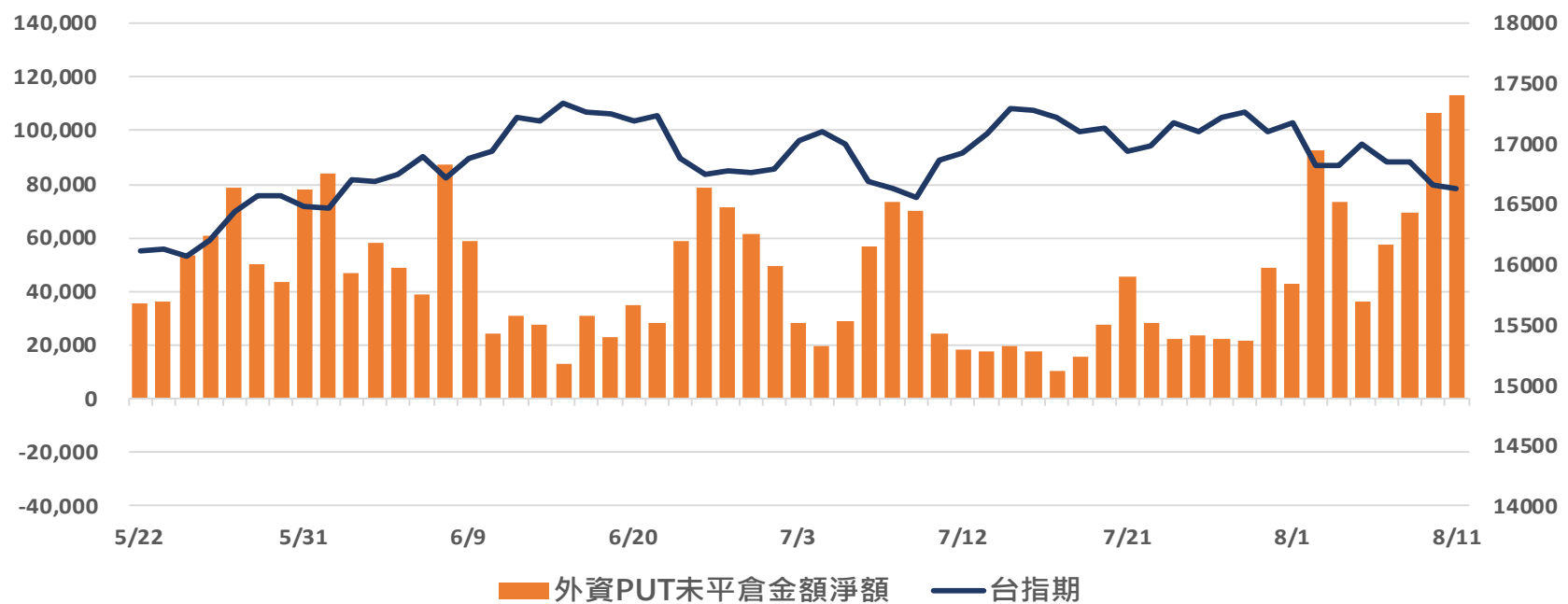
更新日期：2023年8月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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11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