

# 台指選擇權 OI

日期：2023/8/14 結算日：2023/8/16					日期：2023/8/14 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
1	22	15,700	2,884	732	0	82	15,400	591	152
0	12	15,800	4,750	1,310	0	2	15,500	1,348	125
3	37	15,900	6,535	1,194	-5	69	15,600	1,934	945
71	232	16,000	11,921	148	3	7	15,700	1,253	603
56	95	16,100	10,734	2,675	23	104	15,800	1,333	608
70	70	16,150	3,857	2,901	-4	5	15,900	826	6
510	571	16,200	13,326	2,328	11	77	16,000	3,630	-200
688	694	16,250	5,178	4,341	2	7	16,100	1,544	-208
2,309	2,417	16,300	13,060	-971	29	90	16,200	1,703	863
1,932	1,962	16,350	7,924	563	91	105	16,300	1,387	29
6,144	6,303	16,400	10,085	-1,031	195	284	16,400	659	-154
5,545	5,644	16,450	5,705	498	226	311	16,500	1,915	-91
10,053	10,886	16,500	11,058	-3,910	222	668	16,600	3,112	-88
5,718	6,305	16,550	4,068	-553	407	566	16,700	1,009	-16
※ 11,017	14,004	16,600	6,639	-2,482	※ 2,052	2,793	16,800	1,773	27
6,430	9,430	16,650	2,209	-1,634	750	1,255	16,900	1,048	-15
8,931	14,518	16,700	4,309	-1,688	1,183	3,128	17,000	795	-30
1,871	6,623	16,750	1,695	-853	108	2,469	17,100	117	-2
1,597	13,291	16,800	6,122	-1,105	1,130	2,893	17,200	168	-2
776	9,518	16,850	3,044	-173	1,331	3,511	17,300	69	-4
-2,987	11,533	16,900	4,460	-1,516	286	3,974	17,400	133	0
-3,089	5,560	16,950	795	-97	265	3,088	17,500	39	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
40,368	237,062	0.6897	163,507	319	8,129	53,665	0.7222	38,756	4,138
昨日 P/C	0.8297	今日增減變化	-0.1400		昨日 P/C	0.7602	今日增減變化	-0.0380	

更新日期：2023年8月14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	73,709,724	110,416,017	-36,706,293	-33,000,107	1,068,171	3,316,114	-2,247,943	-188,358
投信	43,778,865	40,395,223	3,383,642	985,226	972,528	0	972,528	-15,179
自營商	26,990,888	33,102,192	-6,111,304	10,085,643	200,714	1,528,237	-1,327,523	101,961
	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	1,716,546	1,507,872	208,674	112,735	95,793	87,090	8,703	-38,612
投信	44,296	0	44,296	-870	0	0	0	0
自營商	375,669	1,242,193	-866,524	131,003	248,197	307,700	-59,503	4,062

## 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	40,651	21,956	18,695	190	35,210	14,980	20,230	1,303
投信	200	0	200	0	850	102	748	150
自營商	78,005	100,011	-22,006	-39,848	74,772	47,694	27,078	14,659
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	21,981	7,297	14,684	40	2,550	15,260	-12,710	-623
特定法人(全月)	28,242	7,297	20,945	310	3,850	22,109	-18,259	-1,343
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	58,945	82,815	-23,870	-31,051	39,076	62,205	-23,129	-11,150
十大交易人(全月)	94,232	113,490	-19,258	-39,787	57,718	90,658	-32,940	-14,662
全市場未沖銷(近月)			241,120	40,257			163,550	318
全市場未沖銷(全月)			325,724	57,369			220,698	6,941

更新日期：2023年8月14日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

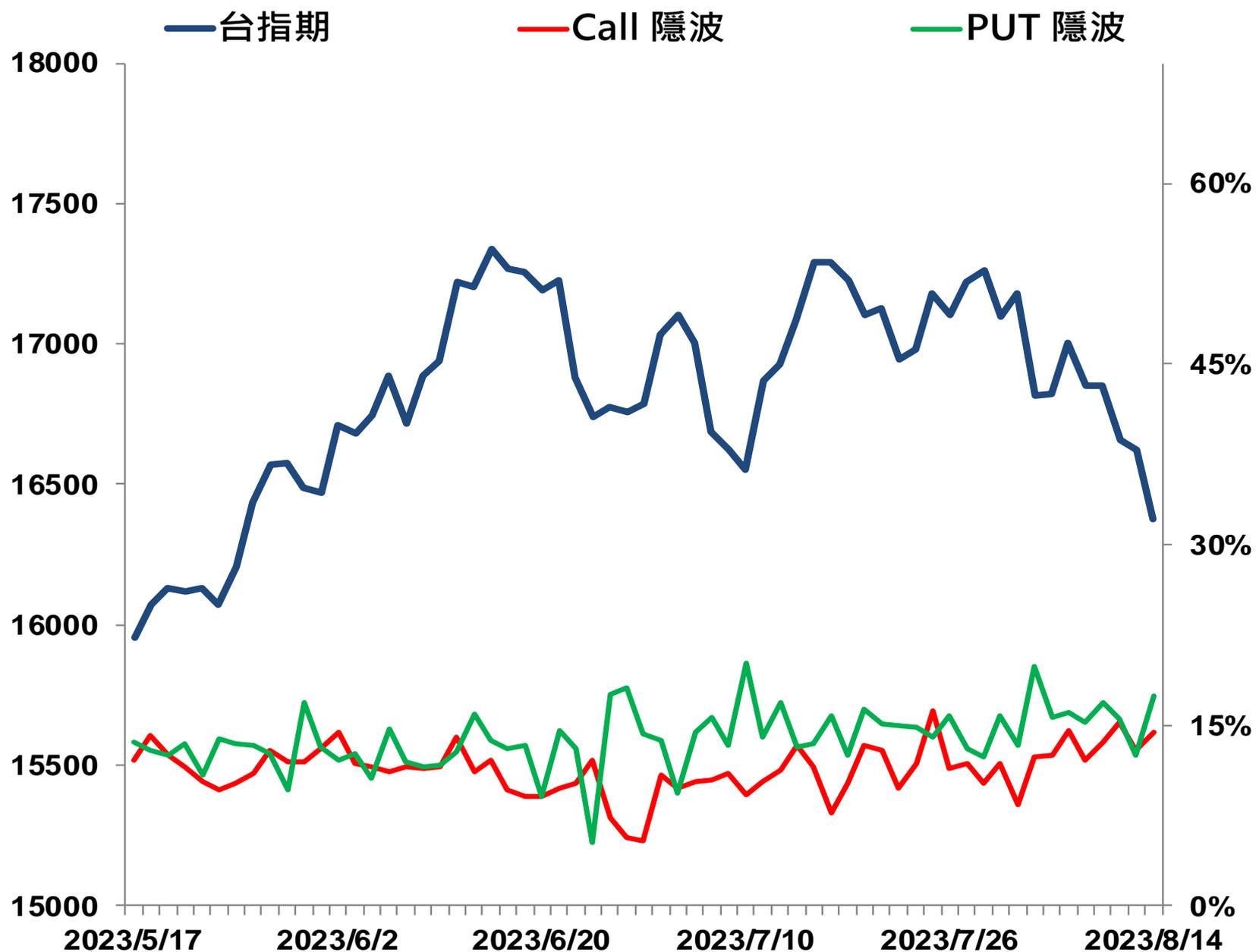
# 選擇權當日波動率

## 臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月14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14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

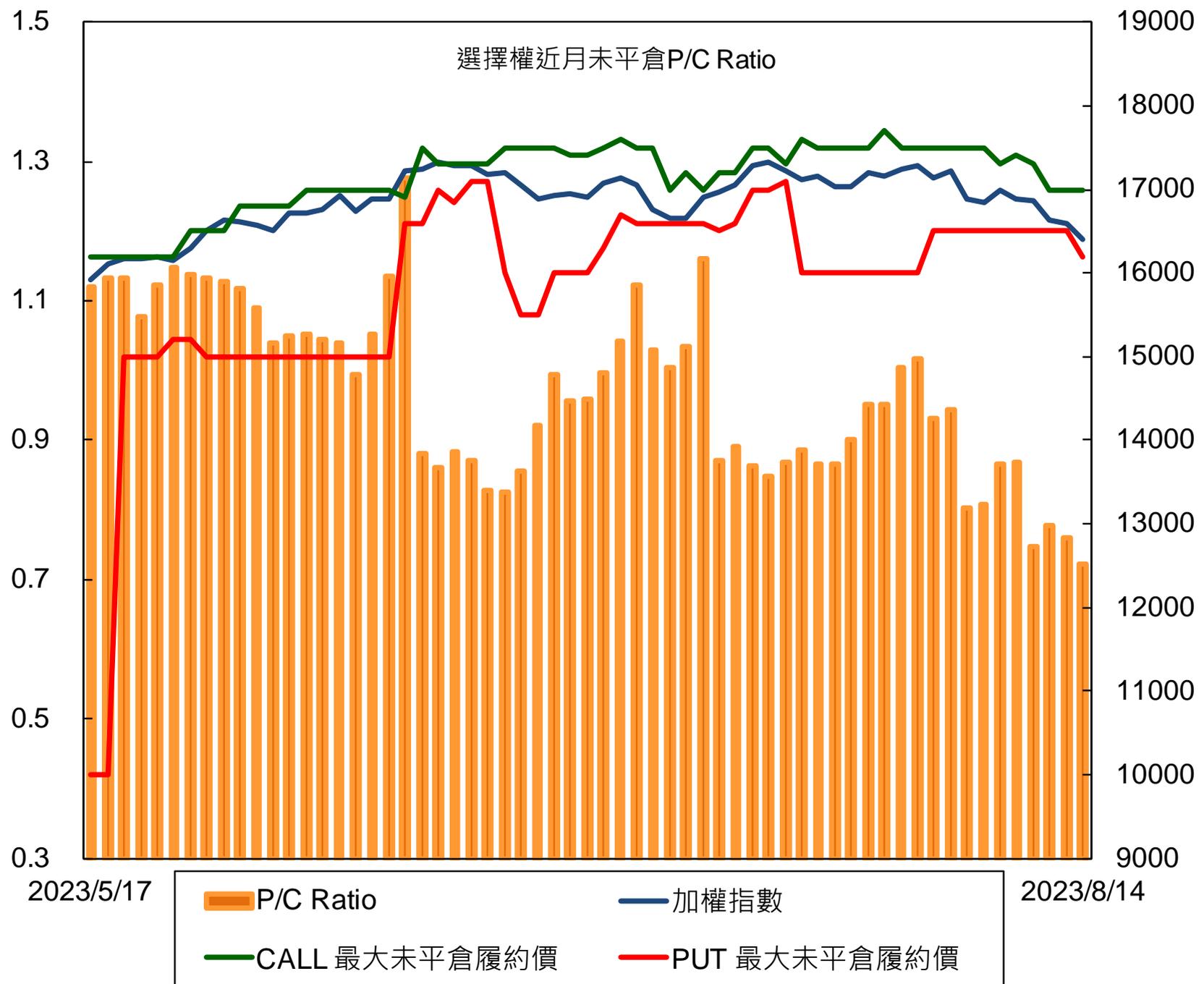
# 自營商選擇權OI部位統計

	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11日	86,532	68,690	17,842
	8月14日	78,005	100,011	<b>-22,006</b>
<b>Put</b>	8月11日	60,196	47,777	12,419
	8月14日	74,772	47,694	27,078

更新日期：2023年8月14日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



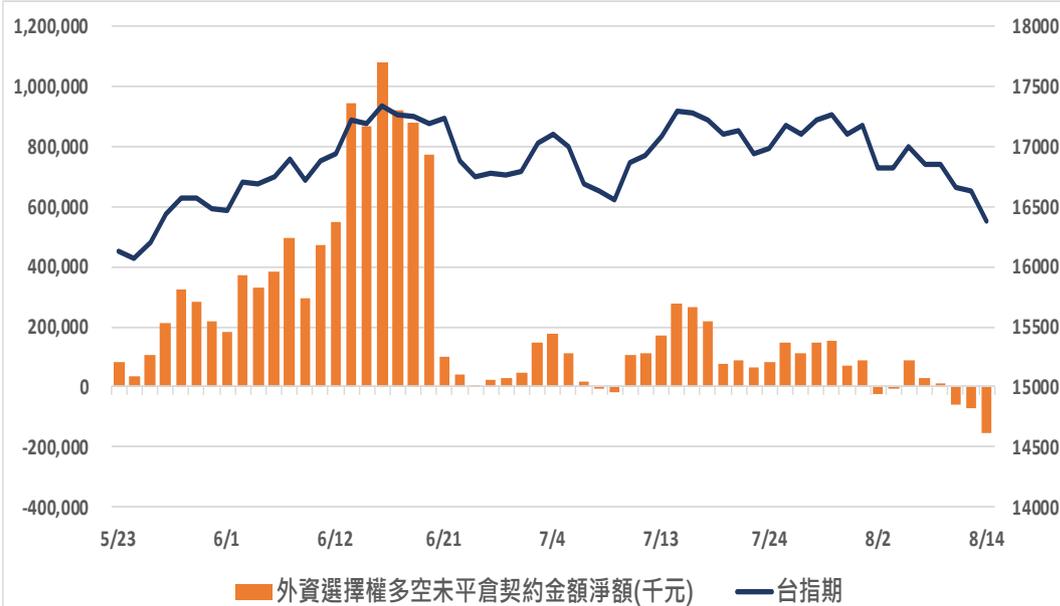
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



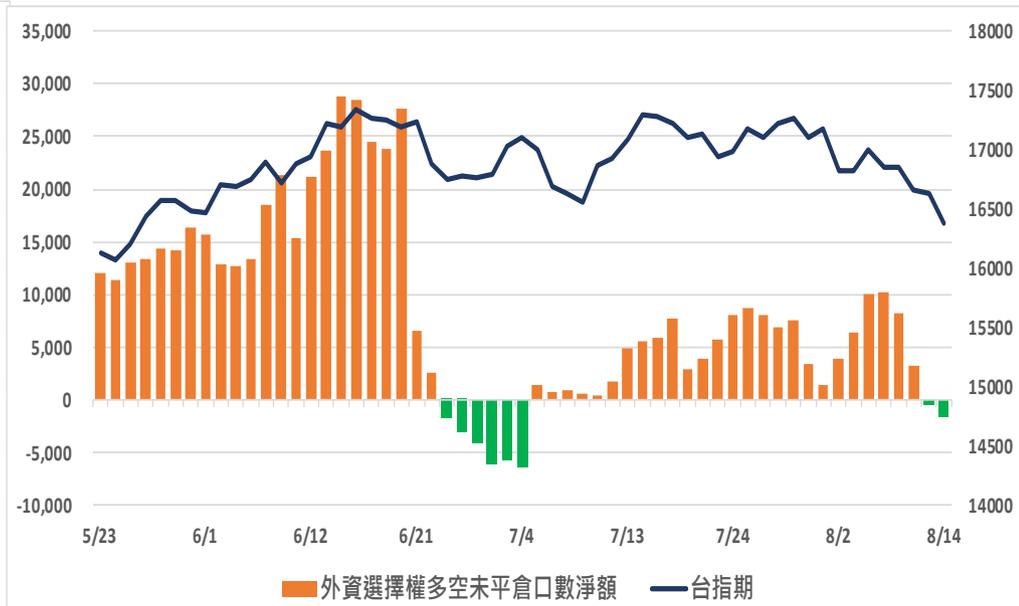
更新日期：2023年8月14日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



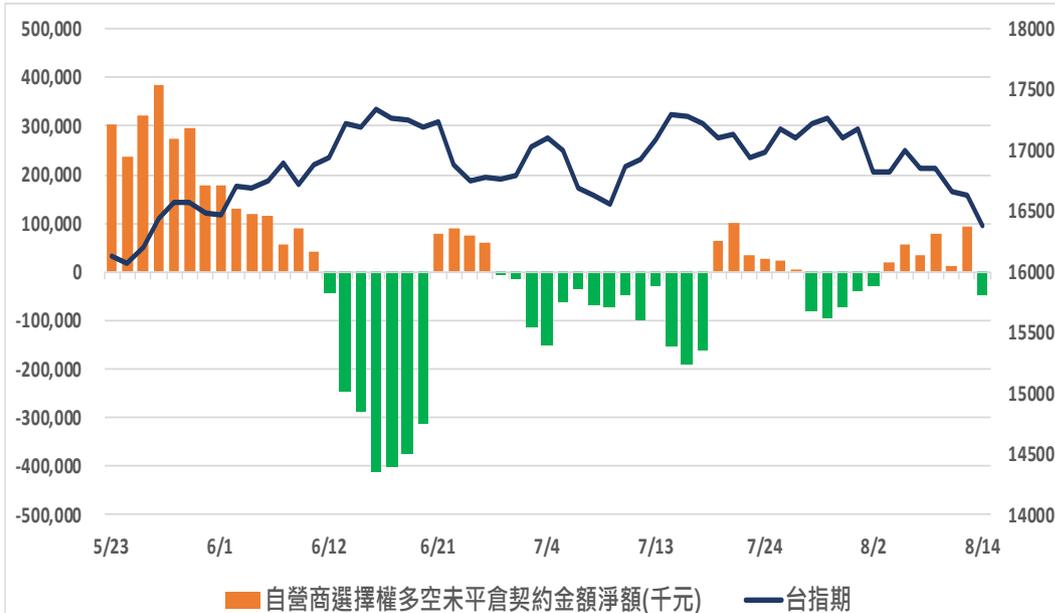
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/8	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
2023/8/14	16377	-1,535	-1,113	-155,185	-80,752

更新日期：2023年8月14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



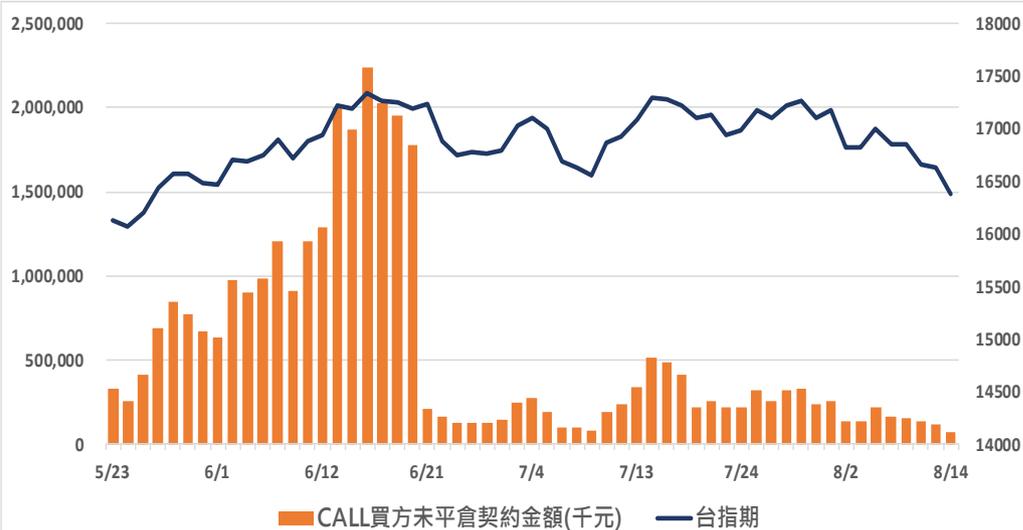
## 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/8	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
2023/8/14	16377	-49,084	-54,507	-46,456	-140,839

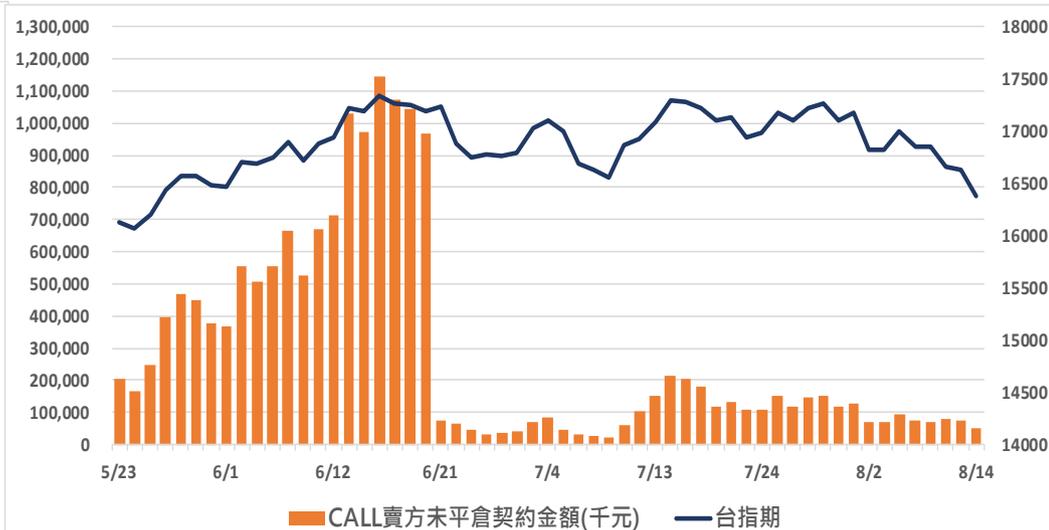
更新日期：2023年8月14日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



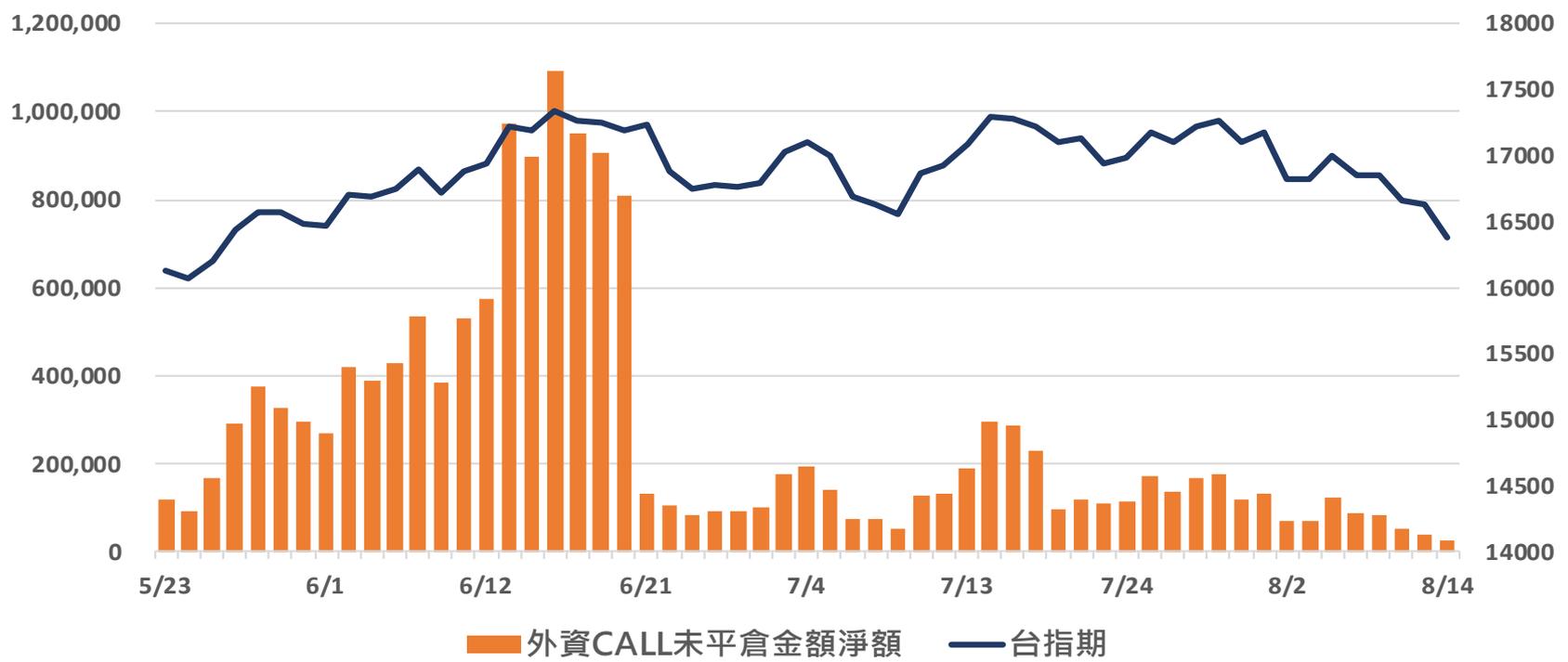
## Sell Put未平倉金額



更新日期：2023年8月14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14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