

# 台指選擇權OI

日期：2023/8/15 結算日：2023/8/16					日期：2023/8/15 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
0	0	15,950	108	108	4	6	15,500	1,562	214
-20	212	16,000	11,406	-515	0	69	15,600	2,172	238
0	0	16,050	798	798	0	7	15,700	896	-357
-31	64	16,100	9,447	-1,287	12	116	15,800	1,392	59
-14	56	16,150	4,228	371	-1	4	15,900	1,933	1,107 ※
-43	528	16,200	12,798	-528	-12	65	16,000	3,833	203
-348	346	16,250	7,085	1,907	11	18	16,100	1,845	301
-479	1,938	16,300	13,706	646	-11	79	16,200	1,853	150
-409	1,553	16,350	10,480	2,556	19	124	16,300	1,318	-69
-1,801	4,502	16,400	13,135	3,050 ※	5	289	16,400	727	68
1,333	6,977	16,450	8,415	2,710	77	388	16,500	1,941	26
2,372	13,258	16,500	13,992	2,934	206	874	16,600	3,189	77
3,390	9,695	16,550	4,450	382	262	828	16,700	1,019	10
※ 4,698	18,702	16,600	6,702	63	419	3,212	16,800	1,849	76
2,631	12,061	16,650	2,112	-97	368	1,623	16,900	1,051	3
-1,854	12,664	16,700	4,219	-90	891	4,019	17,000	794	-1
1,140	7,763	16,750	1,660	-35	1,090	3,559	17,100	116	-1
-1,037	12,254	16,800	5,759	-363	904	3,797	17,200	168	0
-1,433	8,085	16,850	2,943	-101	-99	3,412	17,300	69	0
-2,668	8,865	16,900	4,094	-366	128	4,102	17,400	135	2
-807	4,753	16,950	776	-19	※ 1,315	4,403	17,500	39	0
-1,373	14,184	17,000	2,931	-93	-90	2,859	17,600	63	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
-1,670	235,392	0.7484	176,166	12,659	5,523	59,188	0.7120	42,144	3,388
昨日 P/C	0.6897	今日增減變化	0.0587		昨日 P/C	0.7222	今日增減變化	-0.0101	

更新日期：2023年8月17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	80,709,417	92,479,416	-11,769,999	24,936,294	1,173,062	3,404,156	-2,231,094	16,849
投信	39,289,225	40,138,202	-848,977	-4,232,619	656,703	0	656,703	-315,825
自營商	16,127,615	32,675,046	-16,547,431	-10,436,127	275,677	1,379,045	-1,103,368	224,155
	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	1,680,204	1,496,360	183,844	-24,830	95,996	87,258	8,738	35
投信	43,978	0	43,978	-318	0	0	0	0
自營商	325,437	1,270,949	-945,512	-78,988	231,247	292,346	-61,099	-1,596

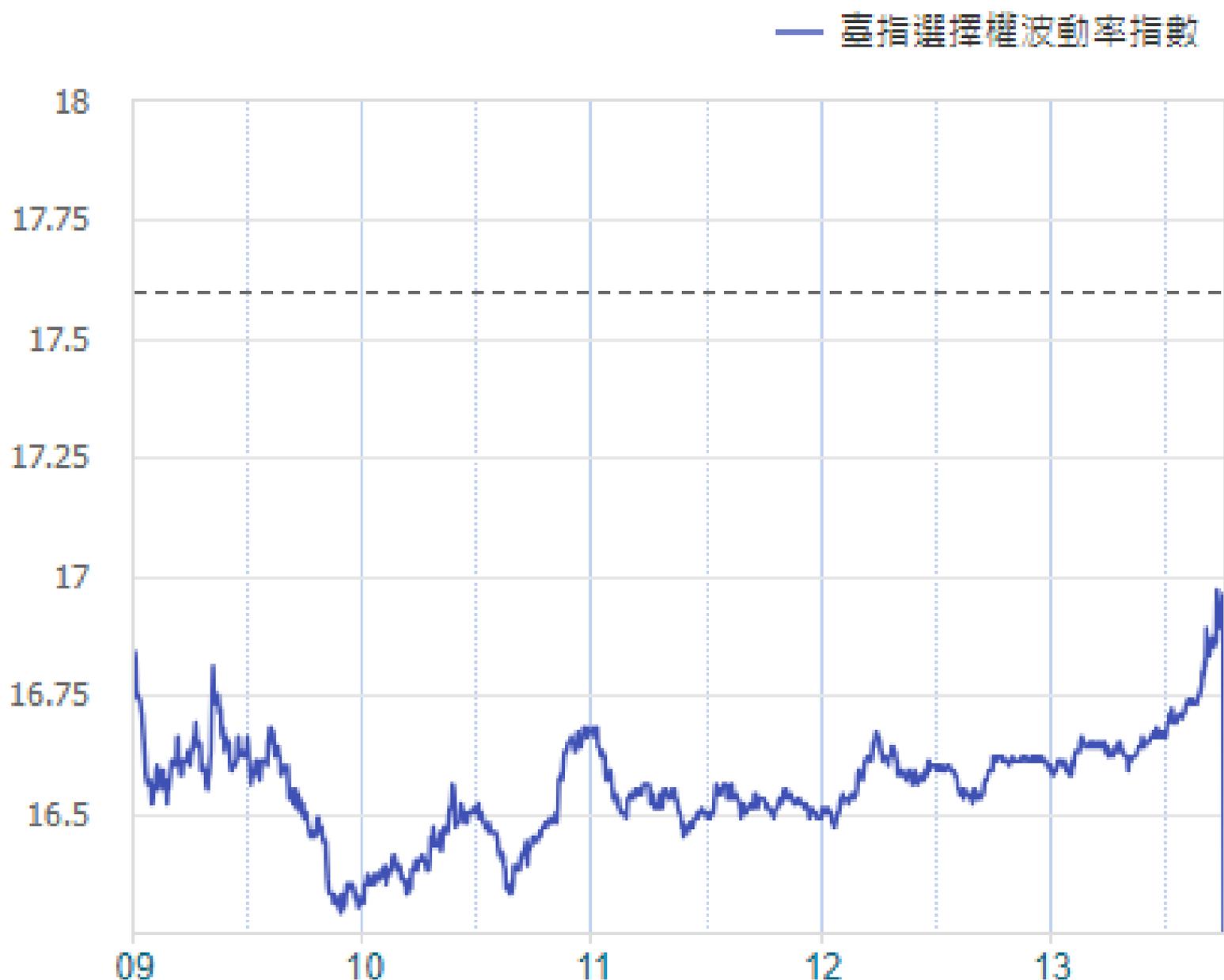
## 台指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數

	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	43,431	21,400	22,031	3,336	34,111	15,762	18,349	-1,881
投信	400	0	400	200	1,000	102	898	150
自營商	87,577	103,361	-15,784	6,222	57,566	53,864	3,702	-23,376
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	22,400	7,297	15,103	419	2,668	14,714	-12,046	664
特定法人(全月)	30,701	7,297	23,404	2,459	4,528	21,513	-16,985	1,274
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	63,956	82,118	-18,162	5,708	41,479	42,312	-833	22,296
十大交易人(全月)	105,028	115,538	-10,510	8,748	63,731	72,158	-8,427	24,513
全市場未沖銷(近月)			239,049	-2,071			176,209	12,659
全市場未沖銷(全月)			335,781	10,057			243,921	23,223

更新日期：2023年8月17日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

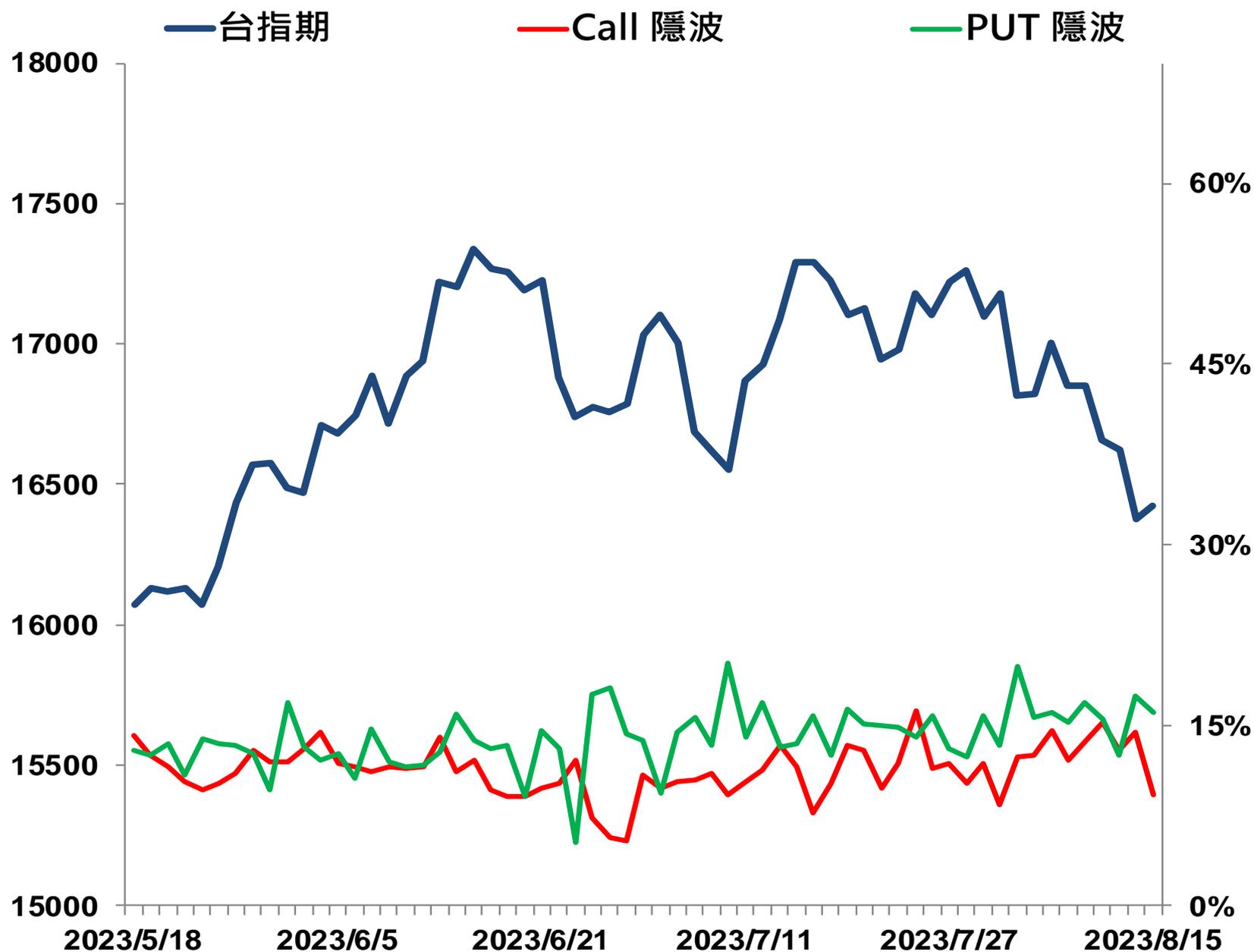
# 選擇權當日波動率

## 臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月17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17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

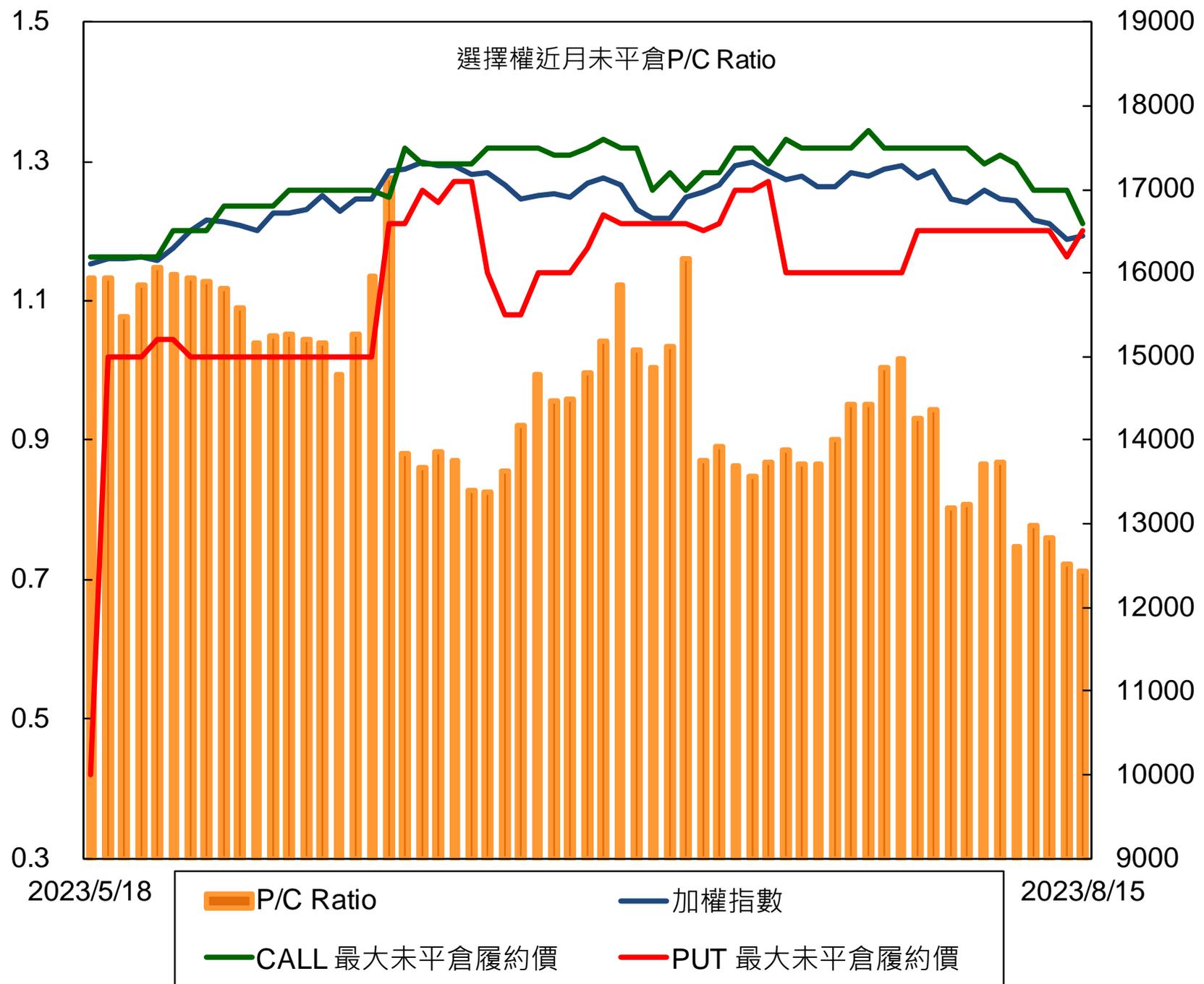
# 自營商選擇權OI部位統計

	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14日	78,005	100,011	<b>-22,006</b>
	8月15日	87,577	103,361	<b>-15,784</b>
<b>Put</b>	8月14日	74,772	47,694	27,078
	8月15日	57,566	53,864	3,702

更新日期：2023年8月17日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



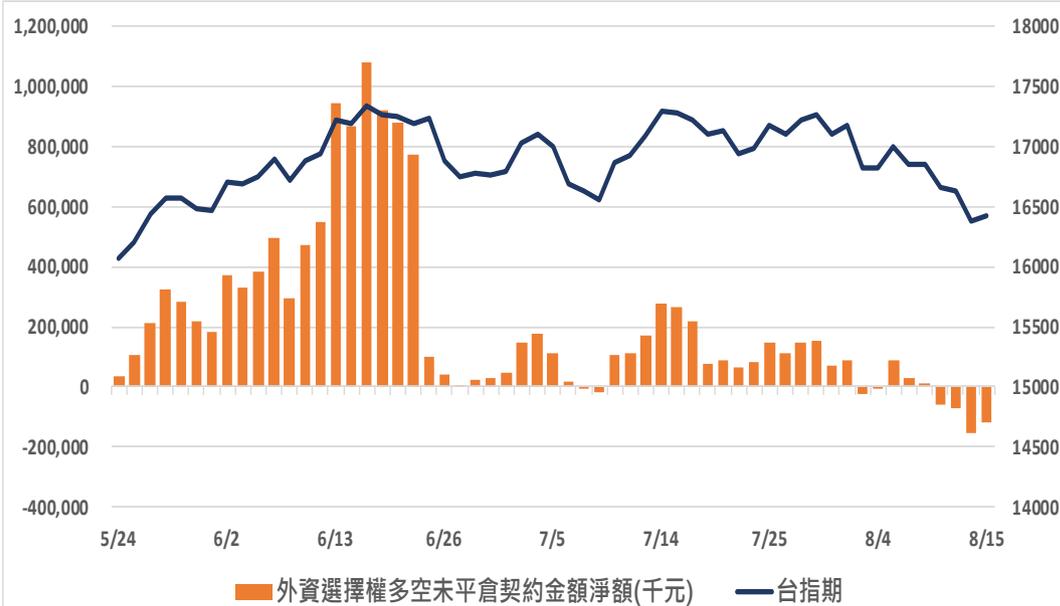
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



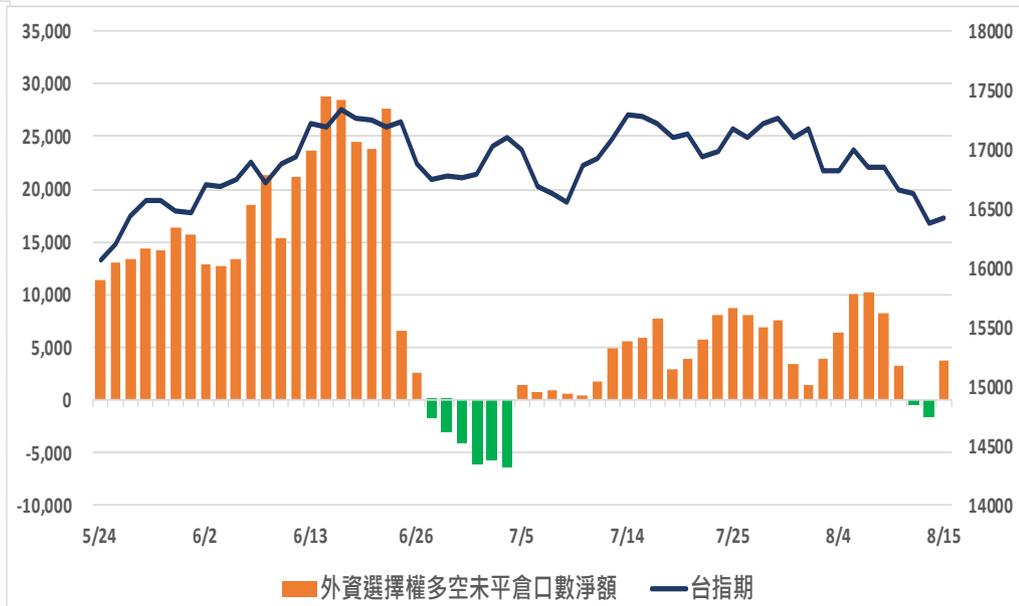
更新日期：2023年8月17日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



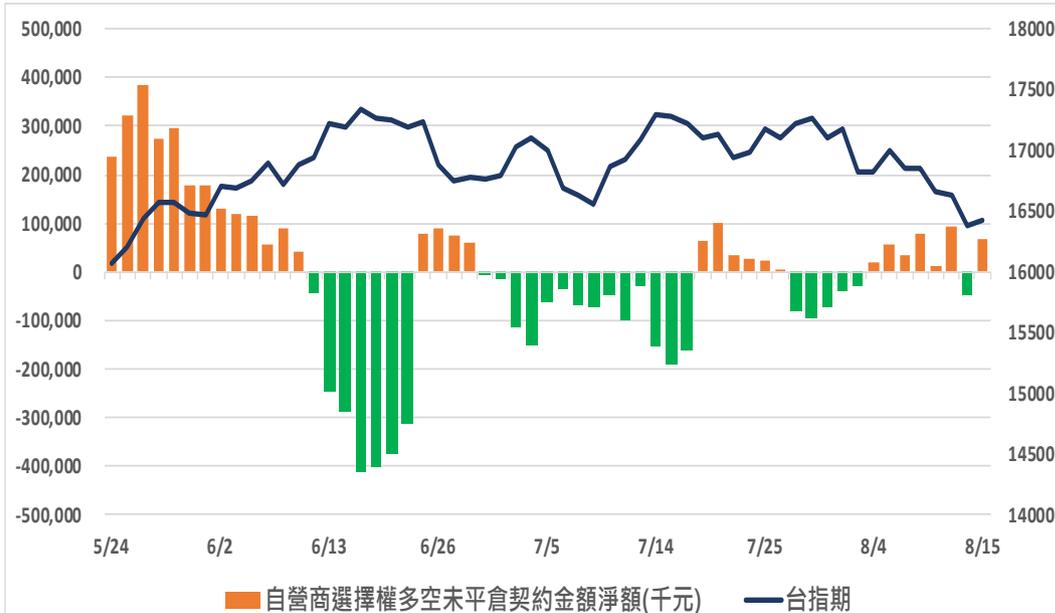
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/9	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
2023/8/15	16423	3,682	+5,217	-118,211	+36,974

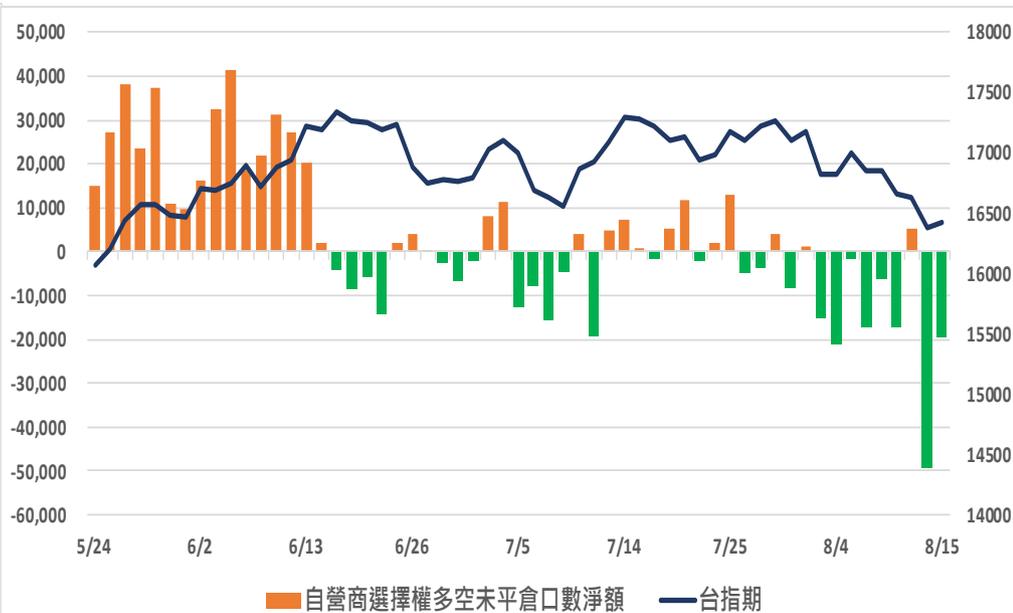
更新日期：2023年8月17日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



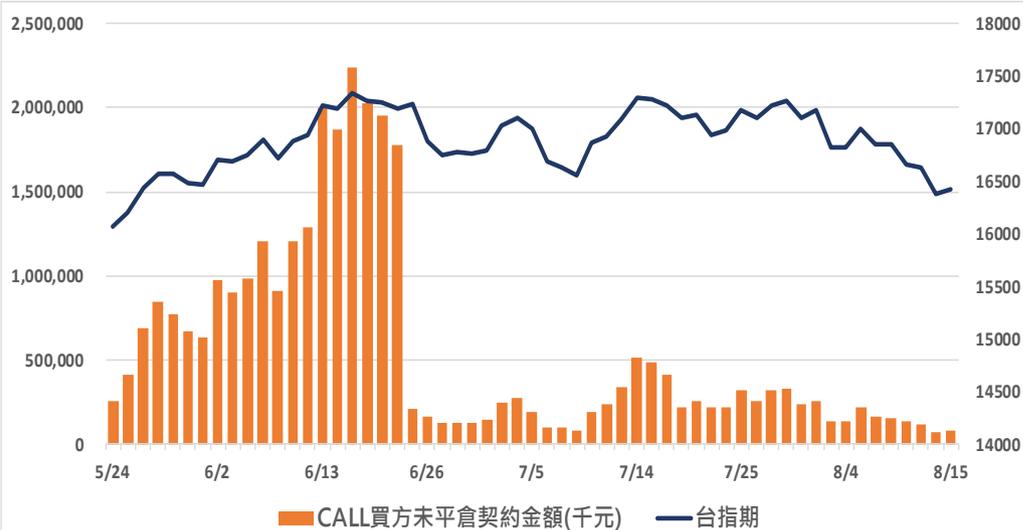
## 自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/9	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
2023/8/15	16423	-19,486	+29,598	68,327	+114,783

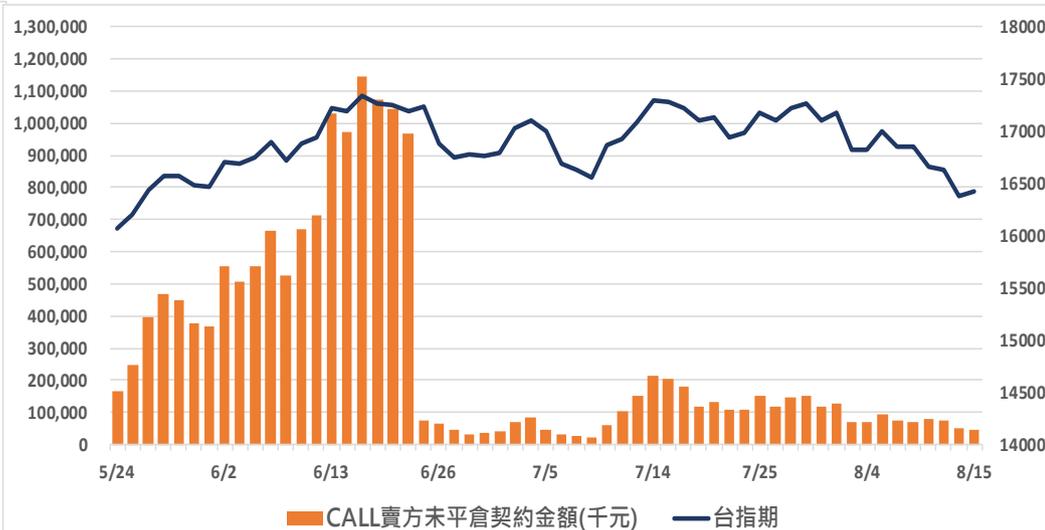
更新日期：2023年8月17日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



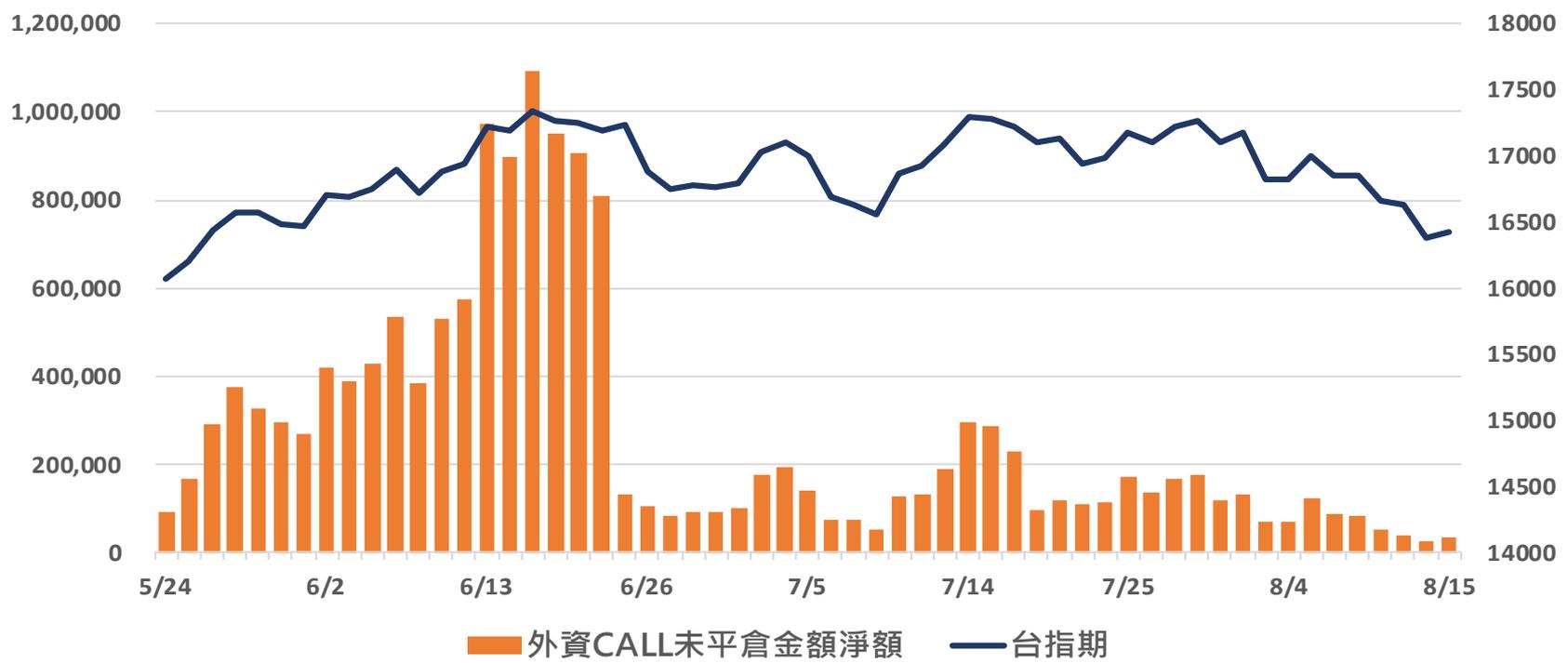
## Sell Put未平倉金額



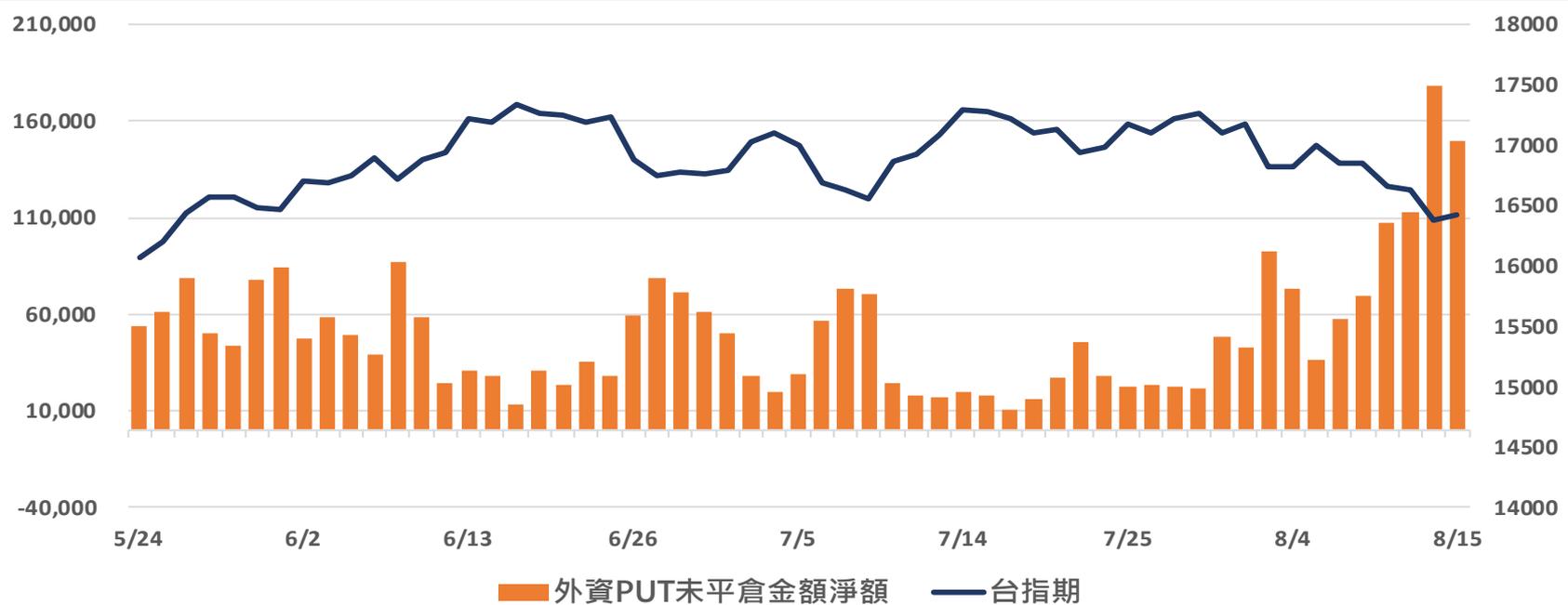
更新日期：2023年8月17日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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17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