

台指選擇權OI

日期：2023/8/17 結算日：2023/8/23					日期：2023/8/17 結算日：2023/9/20				
202308W4					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
61	88	16,000	9,447	6,540 ※	7	19	15,500	2,575	685
13	21	16,050	6,694	5,520	1	71	15,600	2,988	153
44	61	16,100	7,108	4,756	23	29	15,700	1,511	220
184	224	16,150	4,341	2,867	-24	129	15,800	2,085	301
158	445	16,200	7,254	5,139	15	20	15,900	2,248	257
405	556	16,250	4,601	3,136	17	93	16,000	4,655	136
557	1,046	16,300	6,409	3,998	-4	48	16,100	1,590	241
788	1,909	16,350	2,955	2,146	172	270	16,200	2,268	148
1,423	3,606	16,400	4,992	3,266	142	418	16,300	1,789	351
1,064	3,065	16,450	3,159	2,526	651	1,133	16,400	1,078	236
2,028	4,596	16,500	2,603	1,895	443	1,311	16,500	2,092	143
2,153	4,540	16,550	741	371	676	2,080	16,600	3,399	196
1,528	5,005	16,600	1,506	951	75	1,288	16,700	1,090	49
1,928	4,319	16,650	559	99	※ 1,279	5,551	16,800	1,954	58
2,876	5,614	16,700	806	456	620	2,607	16,900	961	-105
2,855	5,029	16,750	49	-1	749	5,602	17,000	813	20
※ 7,926	10,962	16,800	194	-36	986	3,843	17,100	94	-5
1,482	3,821	16,850	289	2	499	5,158	17,200	183	6
1,711	5,676	16,900	300	-1	-43	3,324	17,300	74	5
1,198	3,290	17,000	56	1	307	4,437	17,400	137	-3
390	2,154	17,100	36	1	217	4,909	17,500	38	0
167	1,110	17,200	3	0	-2	2,932	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
30,933	69,702	1.2207	85,088	53,585	8,312	72,265	0.7296	52,727	5,907
昨日 P/C	0.8126	今日增減變化		0.4081	昨日 P/C	0.7321	今日增減變化		-0.0025

更新日期：2023年8月18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	80,024,853	76,911,312	3,113,541	10,874,072	833,245	2,075,008	-1,241,763	-258,585
投信	41,209,115	40,264,541	944,574	780,844	677,620	0	677,620	18,955
自營商	15,988,326	27,994,008	-12,005,682	2,120,260	314,493	1,322,818	-1,008,325	-179,371
	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	1,529,026	938,848	590,178	52,235	99,263	8,632	90,631	64,698
投信	43,184	0	43,184	-173	0	0	0	0
自營商	44,789	1,141,982	-1,097,193	-106,414	57,545	161,124	-103,579	-66,121

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	21,397	6,812	14,585	1,104	16,652	10,048	6,604	-597
投信	200	0	200	200	300	120	180	300
自營商	57,897	58,468	-571	8,324	53,136	36,334	16,802	8,878
特定法人(週)	2,494	0	2,494	1,784	0	902	-902	-300
特定法人(近月)	13,692	0	13,692	1,908	3,772	8,421	-4,649	847
特定法人(全月)	12,084	0	12,084	2,934	0	5,802	-5,802	-1,104
十大交易人(週)	26,323	26,227	96	5,777	30,892	27,624	3,268	1,499
十大交易人(近月)	37,914	41,957	-4,043	-816	21,437	28,638	-7,201	-2,067
十大交易人(全月)	67,530	67,381	149	7,666	45,299	56,319	-11,020	-3,868
全市場未沖銷(近月)			72,265	8,312			52,727	5,907
全市場未沖銷(全月)			170,839	47,588			155,979	64,683

更新日期：2023年8月18日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

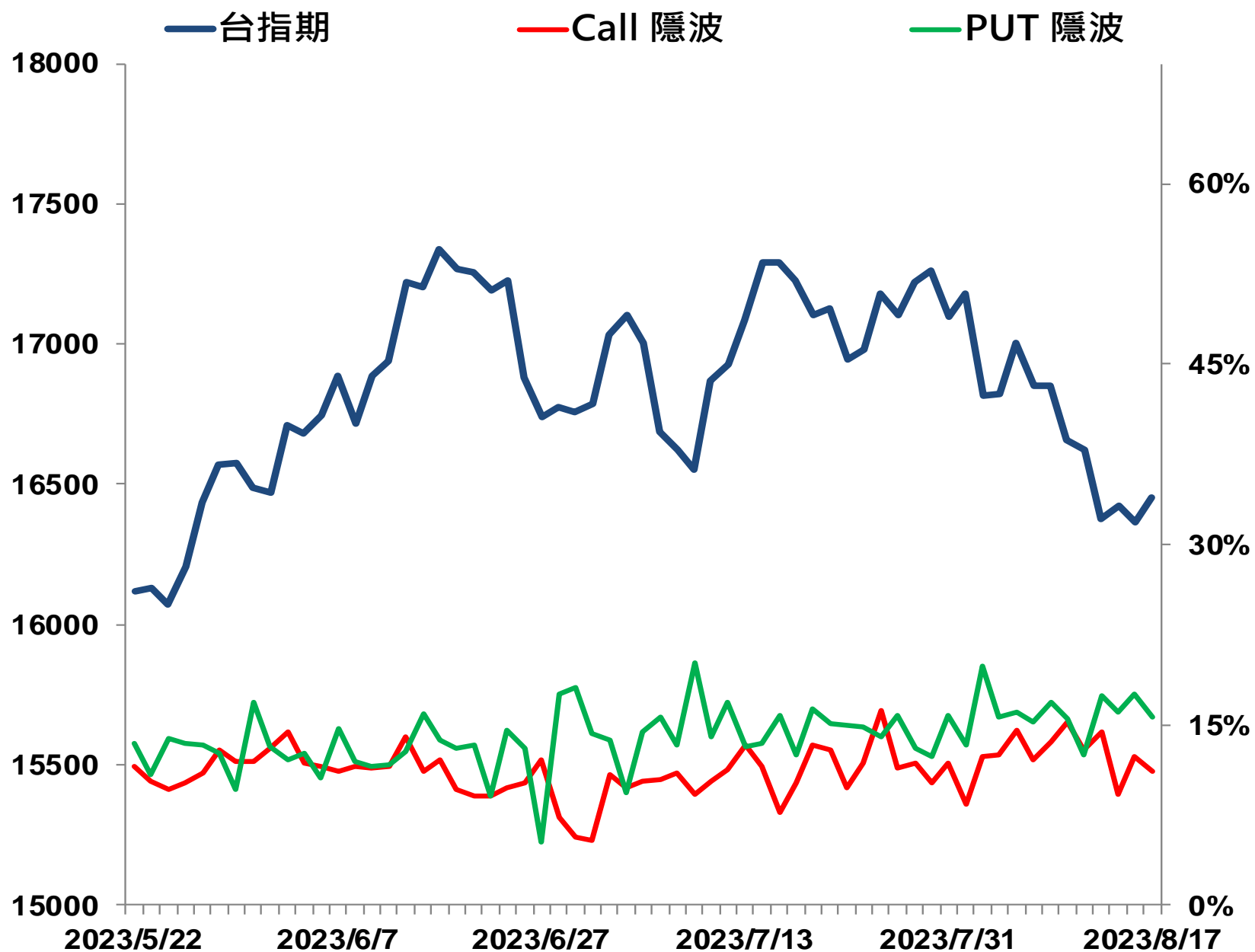
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月18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



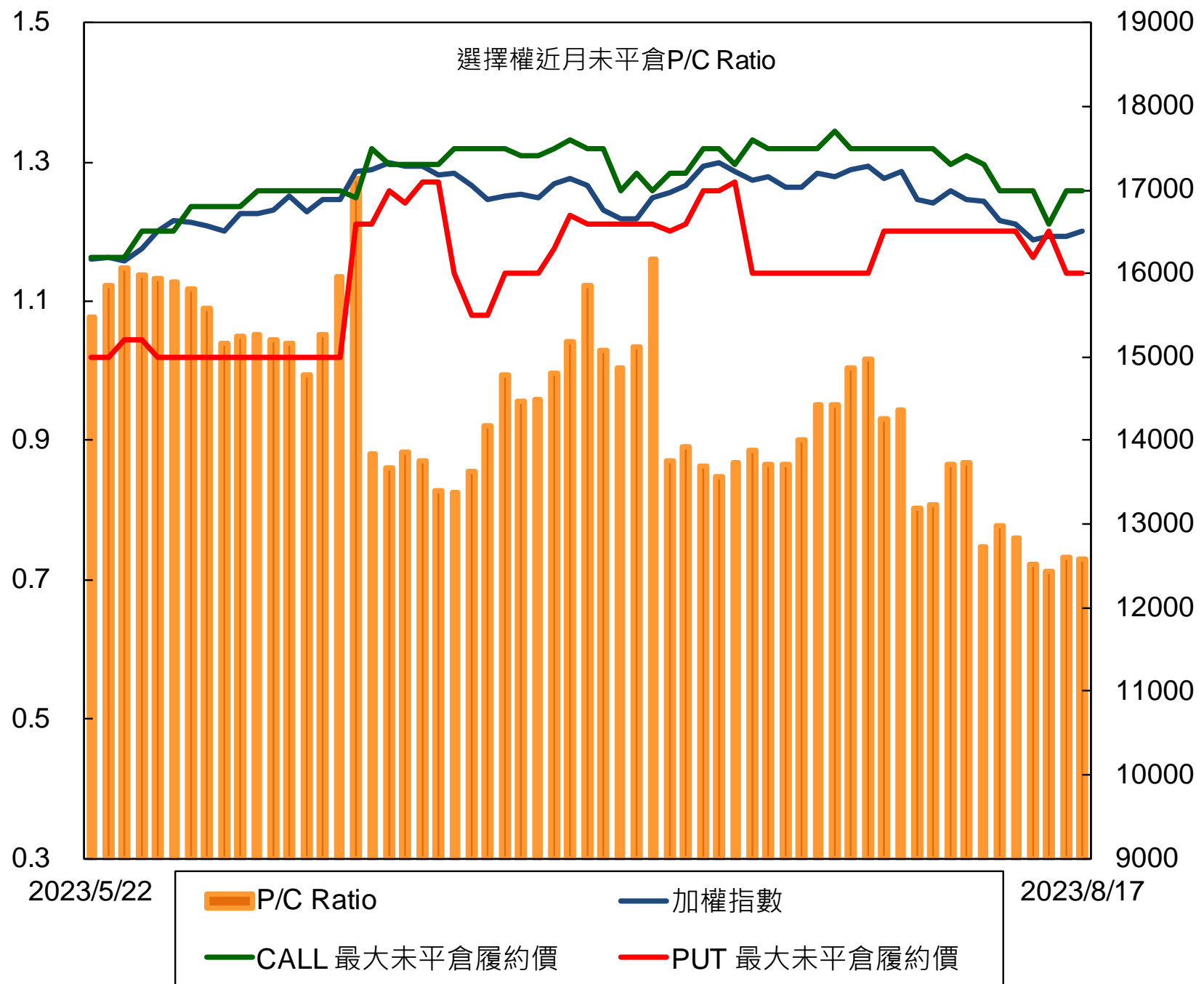
更新日期：2023年8月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考

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16日	44,718	53,613	-8,895
	8月17日	57,897	58,468	-571
Put	8月16日	36,028	28,104	7,924
	8月17日	53,136	36,334	16,802

更新日期：2023年8月18日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

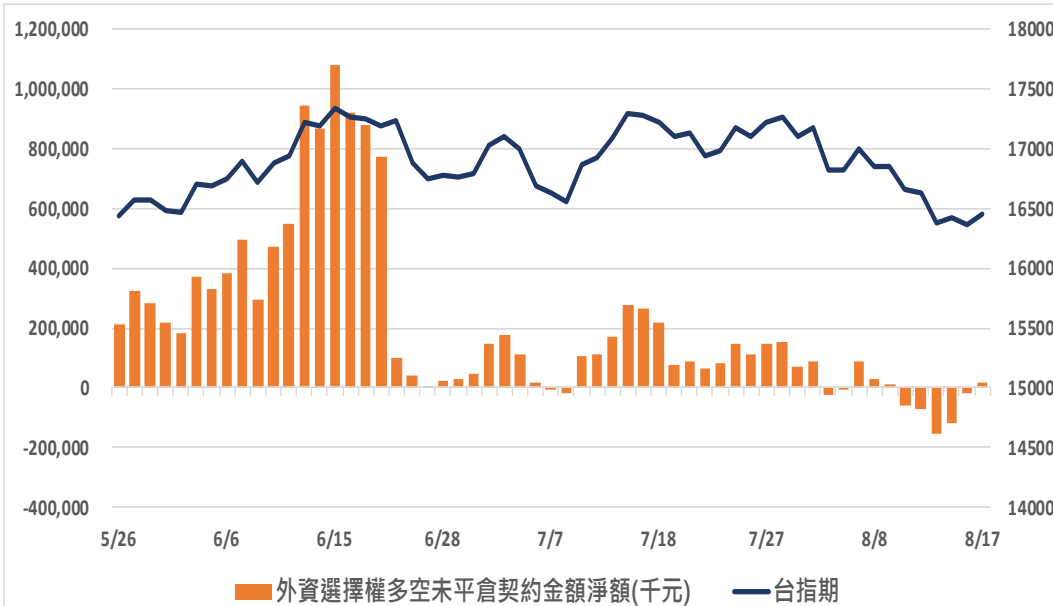
選擇權近月未平倉P/C Ratio



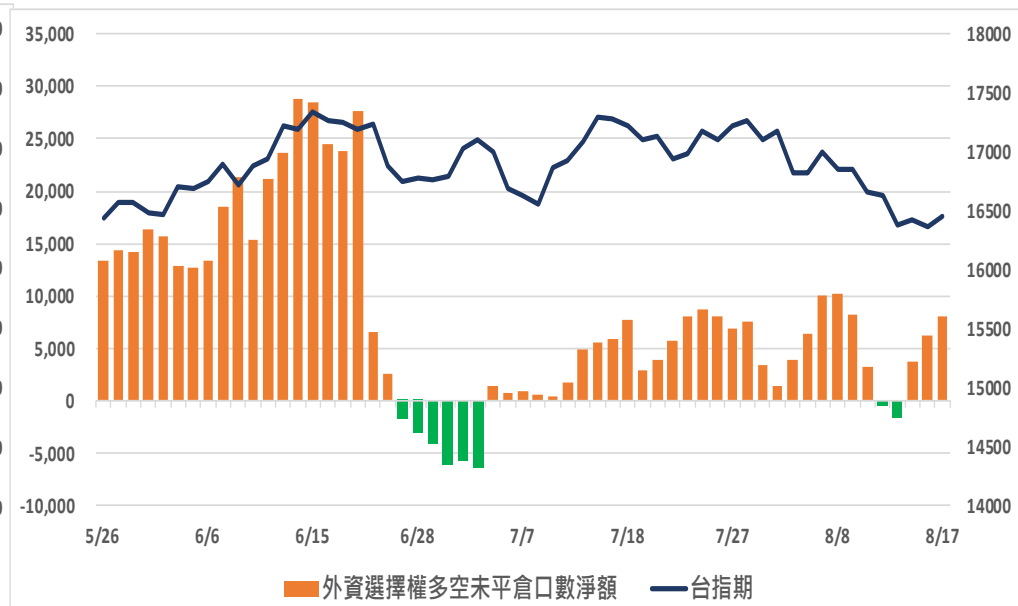
更新日期：2023年8月18日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



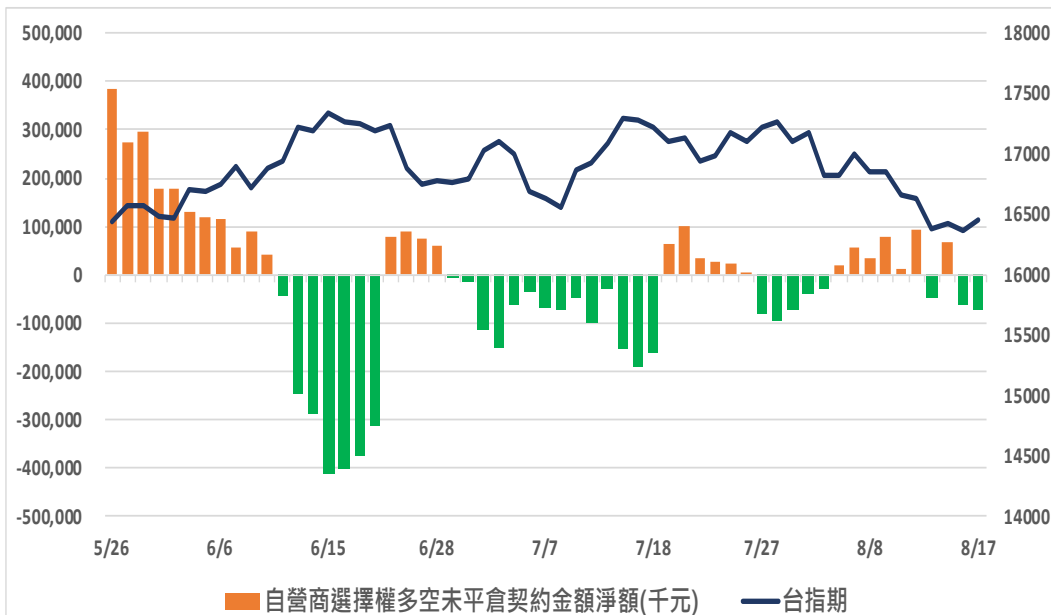
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/11	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
2023/8/16	16364	6,280	+2,598	-17,597	+100,614
2023/8/17	16456	7,981	+1,701	15,193	+32,790

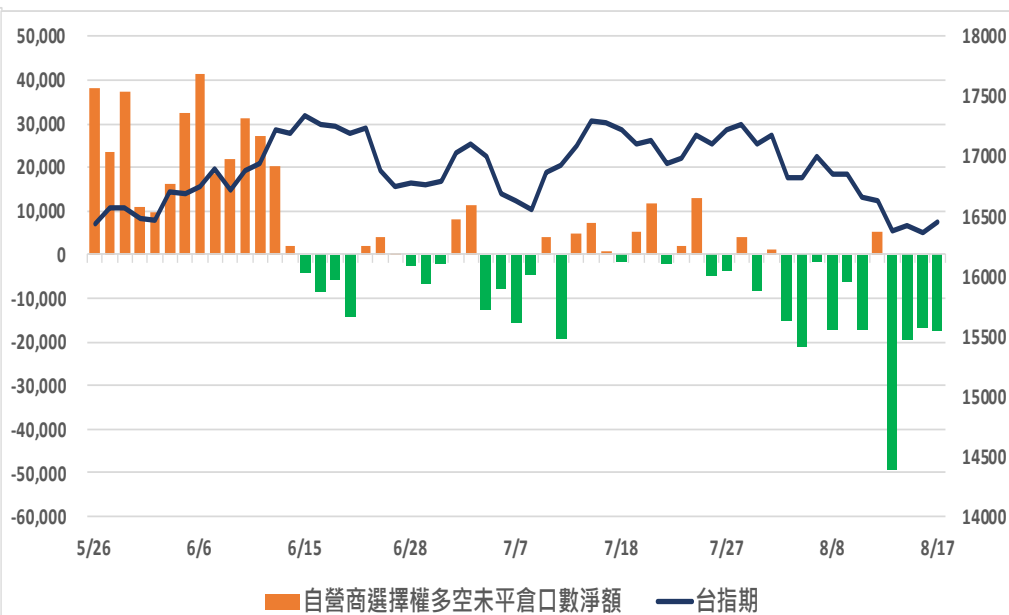
更新日期：2023年8月18日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



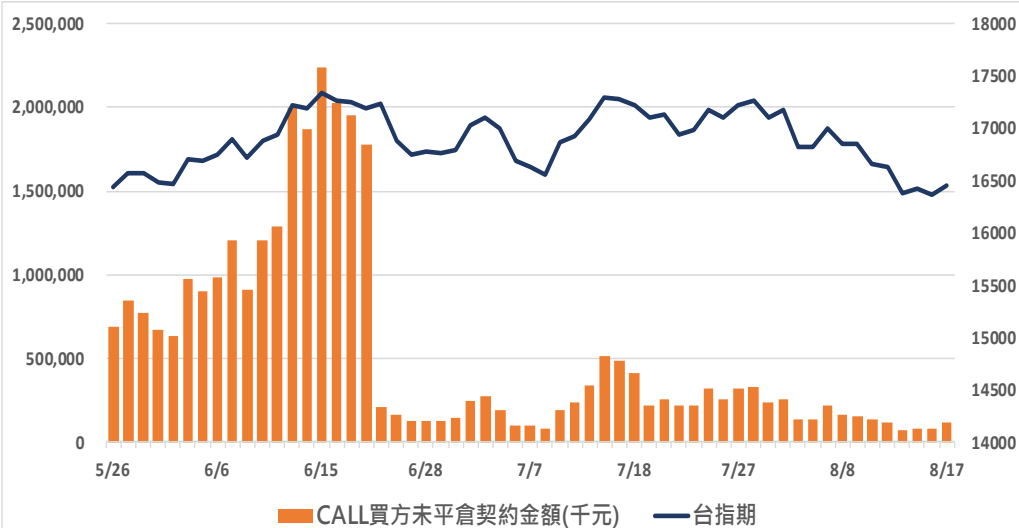
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/11	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
2023/8/16	16364	-16,819	+2,667	-61,041	-129,368
2023/8/17	16456	-17,373	-554	-73,475	-12,434

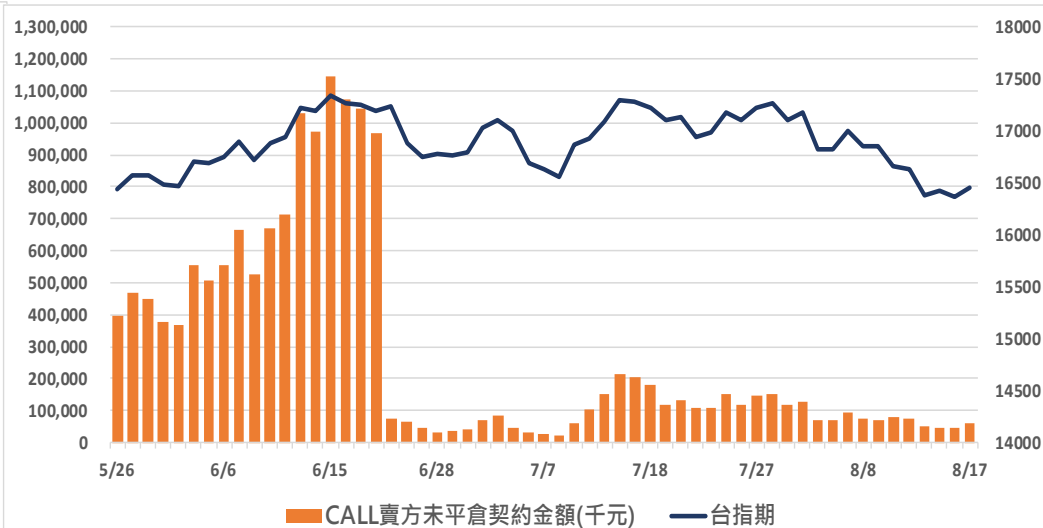
更新日期：2023年8月18日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

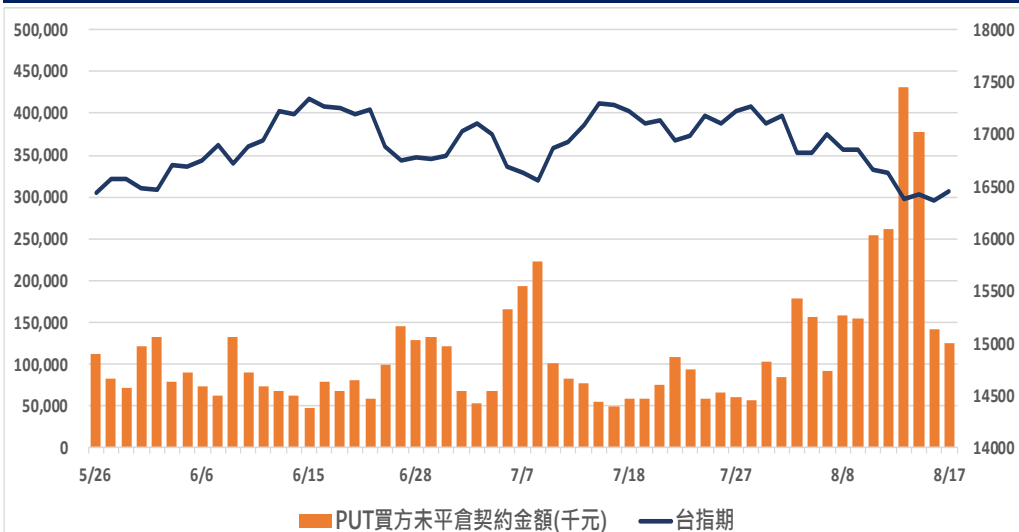
Buy Call未平倉金額



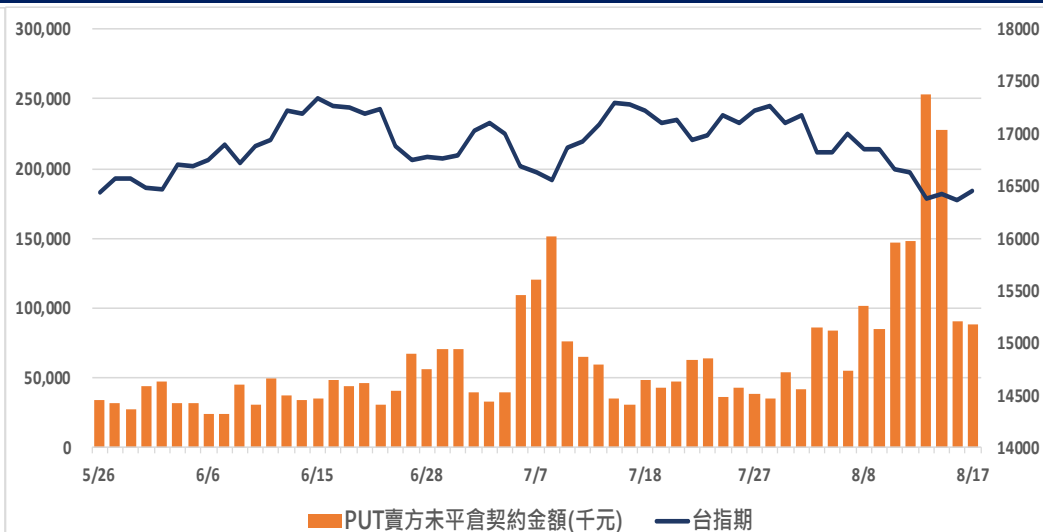
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



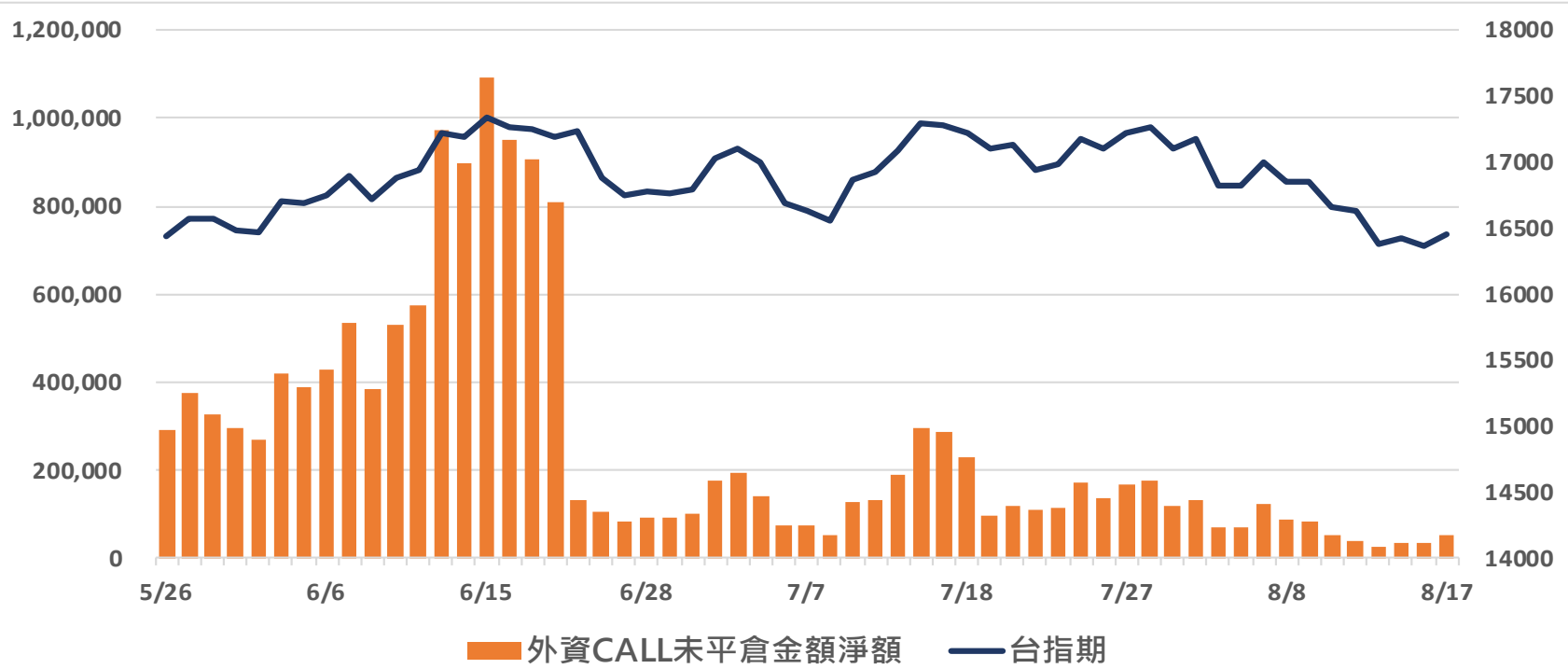
Sell Put未平倉金額



更新日期：2023年8月18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18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