

# 台指選擇權OI

日期：2023/8/22 結算日：2023/8/23					日期：2023/8/22 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
0	5	15,950	3,299	-527	1	83	15,400	1,968	-15
3	41	16,000	10,973	-1,010	0	21	15,500	3,043	137
7	36	16,050	9,244	-981	1	72	15,600	2,994	-275
-15	62	16,100	9,491	-347	1	35	15,700	2,051	231
-23	233	16,150	6,996	-13	-1	124	15,800	2,872	74
-83	494	16,200	10,165	218	-3	16	15,900	2,543	57
-128	778	16,250	10,133	1,884	17	139	16,000	8,070	3,113 ※
-81	2,047	16,300	12,271	3,247 ※	-13	129	16,100	1,626	53
-821	2,896	16,350	7,140	2,529	-3	888	16,200	5,951	-229
-921	7,995	16,400	9,119	1,941	114	673	16,300	4,951	-26
895	7,486	16,450	5,202	1,698	-23	1,267	16,400	1,490	78
632	10,164	16,500	5,710	2,893	-276	2,036	16,500	2,199	-5
2,159	9,300	16,550	2,588	689	3	4,343	16,600	3,438	-2
※ 3,362	15,448	16,600	1,869	-300	-18	1,984	16,700	1,120	44
734	10,232	16,650	783	-816	286	4,049	16,800	1,996	40
-604	11,207	16,700	883	-28	118	3,220	16,900	838	1
-928	8,272	16,750	62	-2	※ 453	7,309	17,000	793	-18
370	12,139	16,800	152	-11	281	4,556	17,100	91	0
829	4,830	16,850	280	-1	-114	5,203	17,200	177	-5
-832	5,136	16,900	298	0	387	3,930	17,300	80	0
-133	4,174	16,950	28	-1	-262	4,385	17,400	168	22
-182	3,747	17,000	57	0	265	4,750	17,500	84	22
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
3,761	122,857	1.0786	132,515	11,411	1,383	78,569	0.8838	69,438	4,059
昨日 P/C	1.0169	今日增減變化	0.0617		昨日 P/C	0.8470	今日增減變化	0.0368	

更新日期：2023年8月22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	69,023,498	85,673,012	-16,649,514	3,252,910	1,042,386	2,404,264	-1,361,878	-232,984
投信	41,160,720	40,521,120	639,600	-50,285	709,984	0	709,984	32,008
自營商	16,091,853	30,211,335	-14,119,482	500,858	183,950	1,407,059	-1,223,109	215,991
	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	1,562,833	1,101,853	460,980	40,664	98,905	10,034	88,871	5,334
投信	43,367	0	43,367	-281	0	0	0	0
自營商	28,912	1,156,485	-1,127,573	-112,336	68,805	159,109	-90,304	-5,326

## 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	24,303	7,353	16,950	1,455	21,930	10,897	11,033	498
投信	200	0	200	0	300	120	180	0
自營商	69,136	61,702	7,434	2,444	62,714	52,410	10,304	-3,897
特定法人(週)	2,693	0	2,693	681	0	0	0	1,303
特定法人(近月)	12,959	0	12,959	333	3,253	10,161	-6,908	-1,217
特定法人(全月)	15,614	0	15,614	3,154	0	8,755	-8,755	-533
十大交易人(週)	42,498	40,577	1,921	-1,520	42,873	37,871	5,002	565
十大交易人(近月)	38,275	42,736	-4,461	465	30,680	37,563	-6,883	1,725
十大交易人(全月)	82,841	74,890	7,951	-221	66,229	72,927	-6,698	4,508
全市場未沖銷(近月)			78,569	1,383			69,438	4,059
全市場未沖銷(全月)			241,914	10,371			232,965	20,424

更新日期：2023年8月22日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

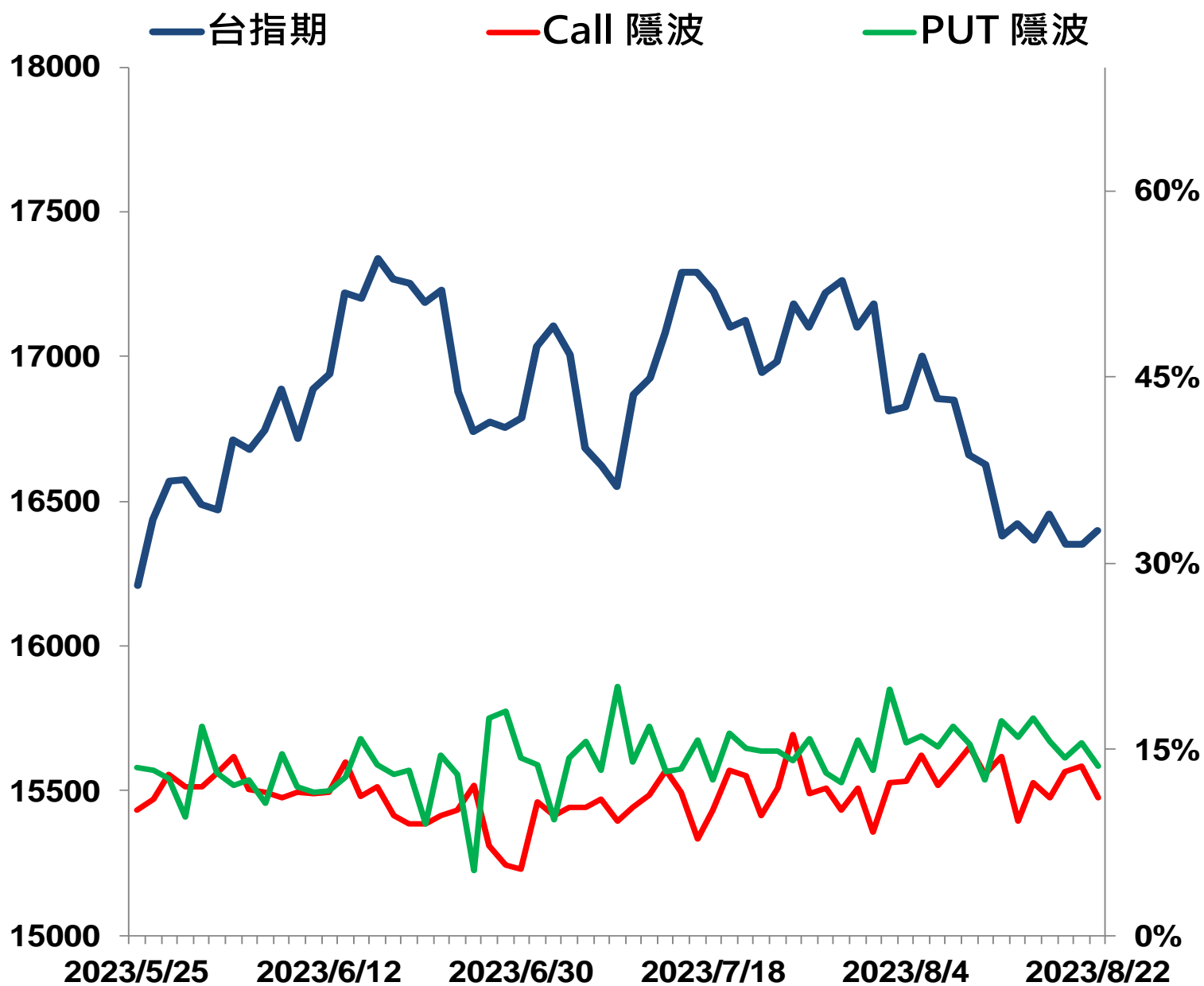
# 選擇權當日波動率

## 臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月22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



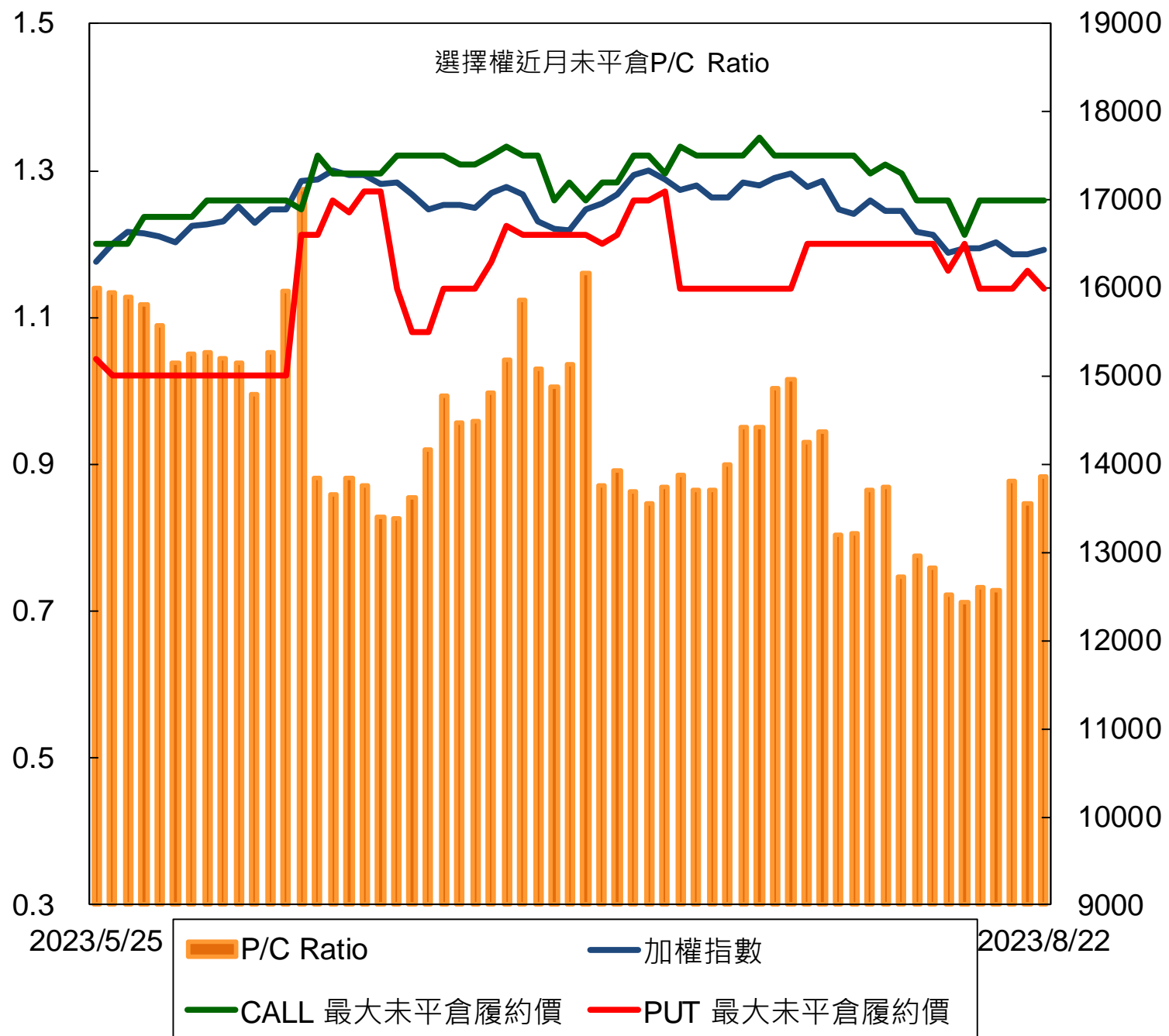
更新日期：2023年8月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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21日	67,986	62,996	4,990
	8月22日	69,136	61,702	7,434
<b>Put</b>	8月21日	62,002	47,801	14,201
	8月22日	62,714	52,410	10,304

更新日期：2023年8月22日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

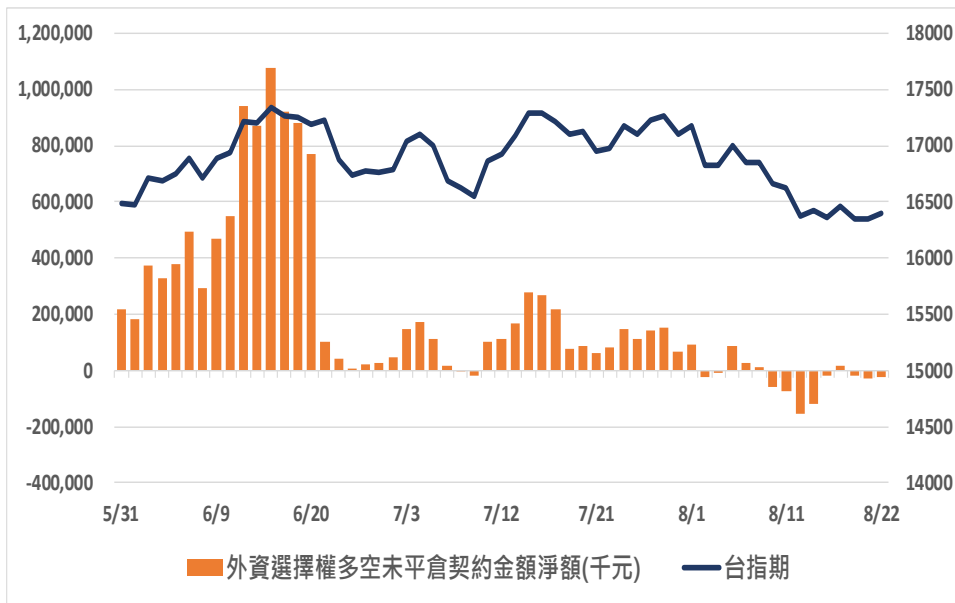
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



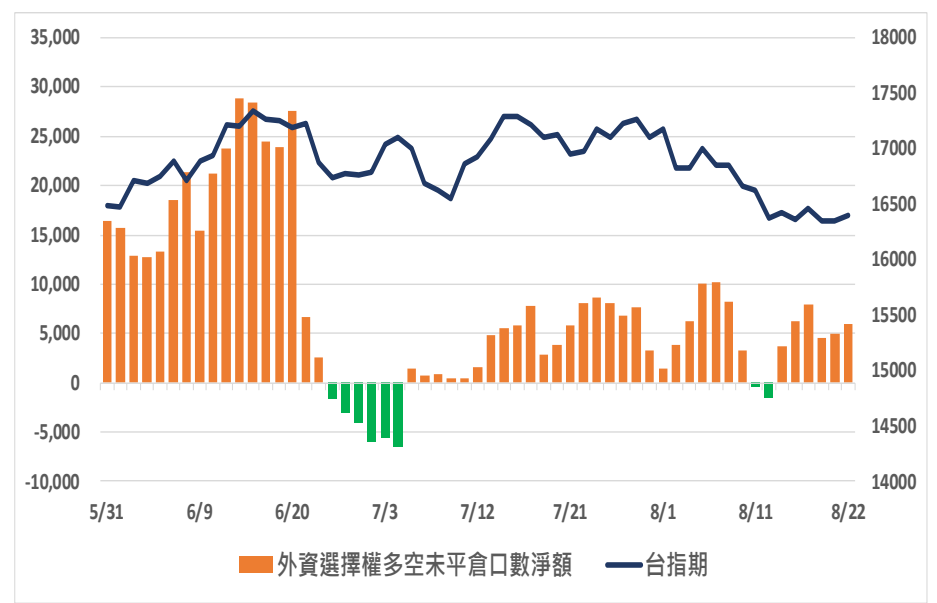
更新日期：2023年8月22日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



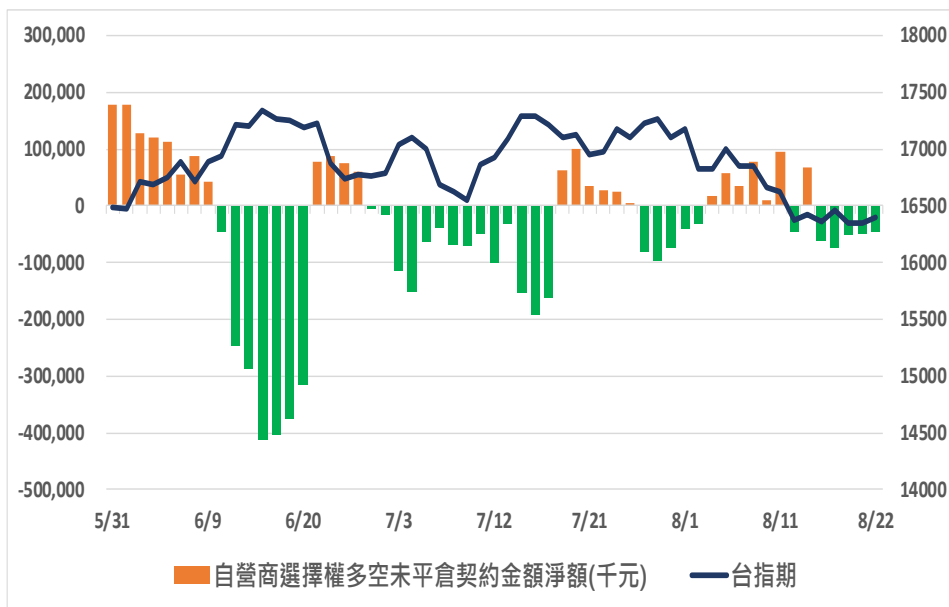
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/16	16364	6,280	+2,598	-17,597	+100,614
2023/8/17	16456	7,981	+1,701	15,193	+32,790
2023/8/18	16353	4,614	-3,367	-20,264	-35,457
2023/8/21	16348	4,960	+346	-29,917	-9,653
2023/8/22	16400	5,917	+957	-25,698	+4,219

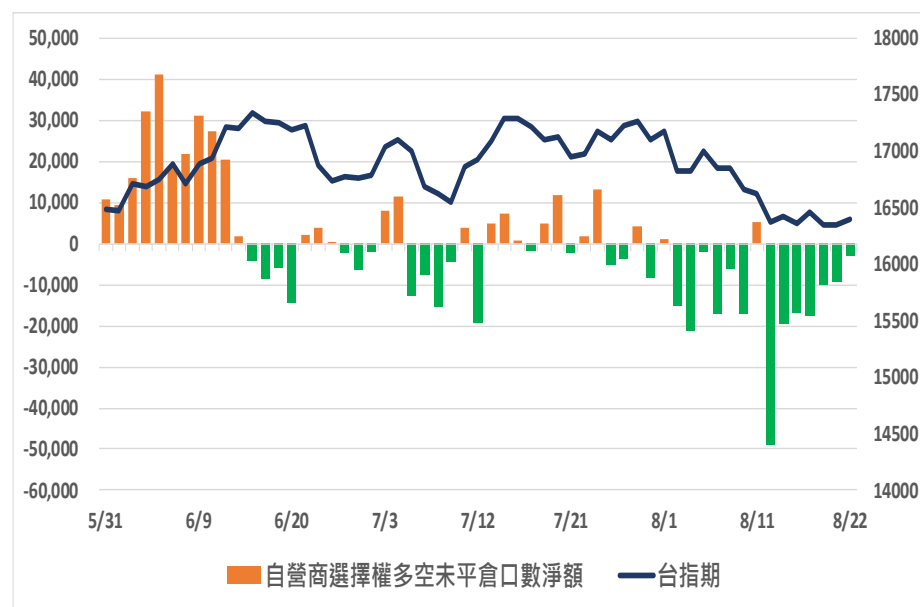
更新日期：2023年8月22日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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

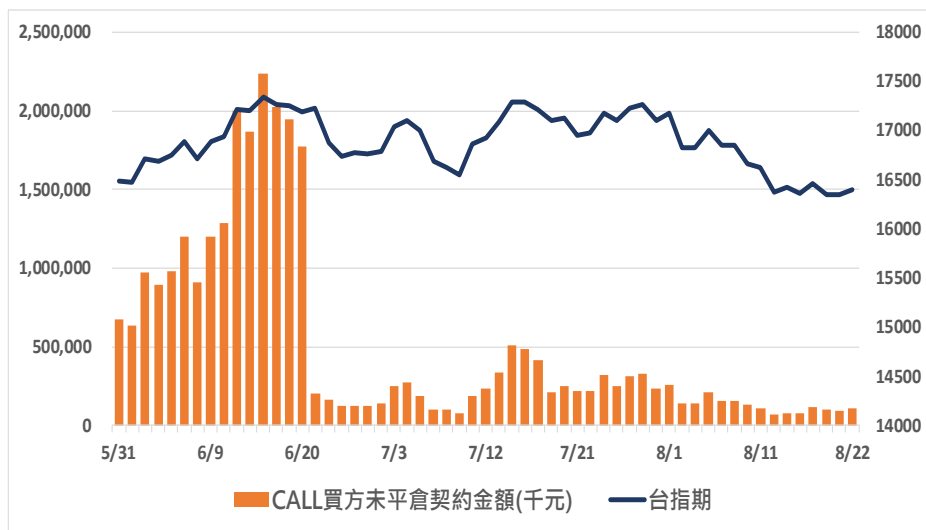
日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/8/16	16364	-16,819	+2,667	-61,041	-129,368
2023/8/17	16456	-17,373	-554	-73,475	-12,434
2023/8/18	16353	-9,996	+7,377	-51,629	+21,846
2023/8/21	16348	-9,211	+785	-47,950	+3,679
2023/8/22	16400	-2,870	+6,341	-45,950	+2,000

更新日期：2023年8月22日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

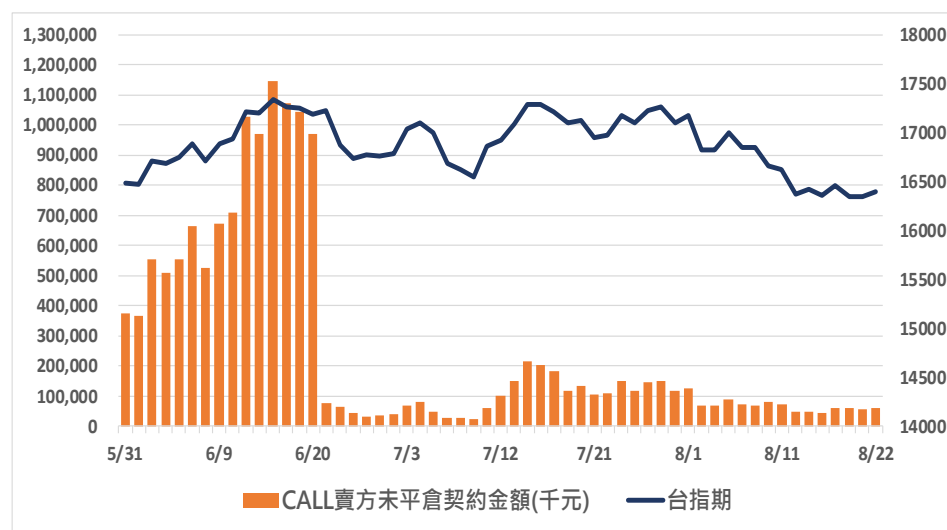


# 外資選擇權未平倉金額

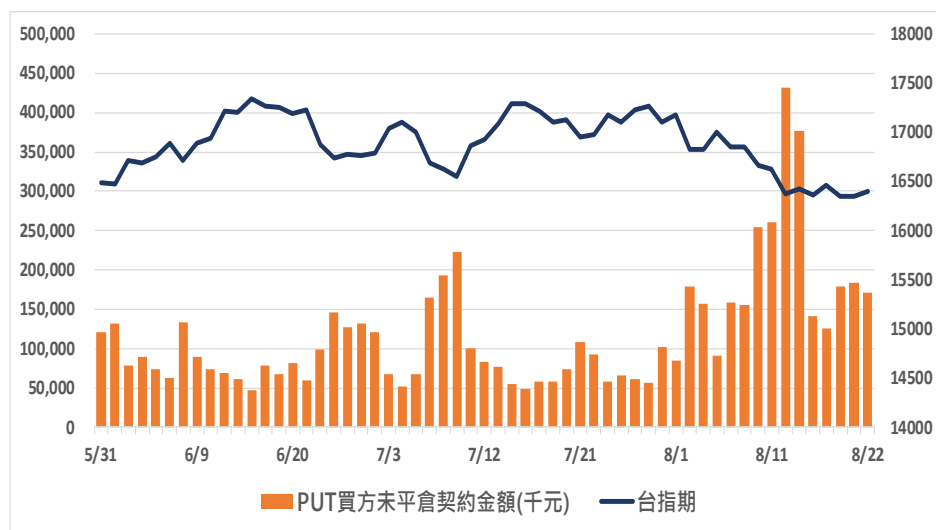
## Buy Call未平倉金額



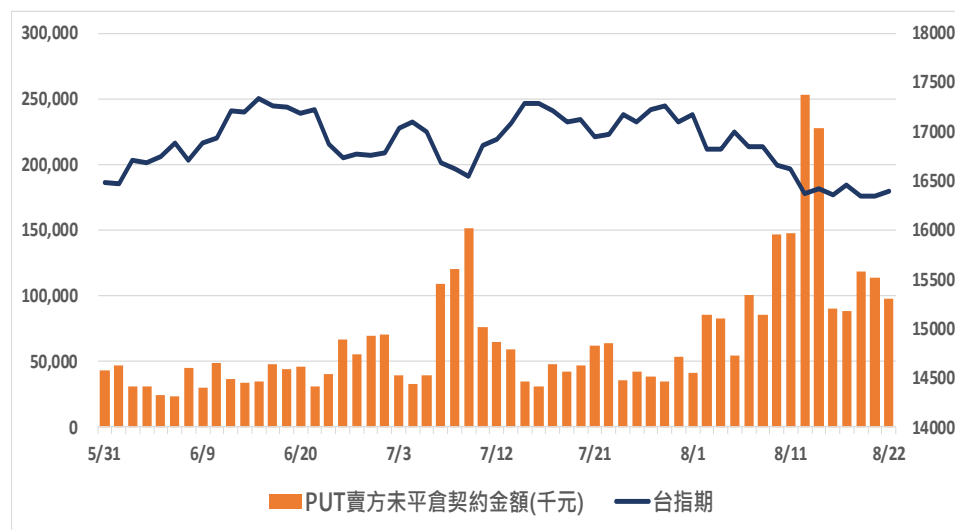
## Sell Call未平倉金額



## Buy Put未平倉金額



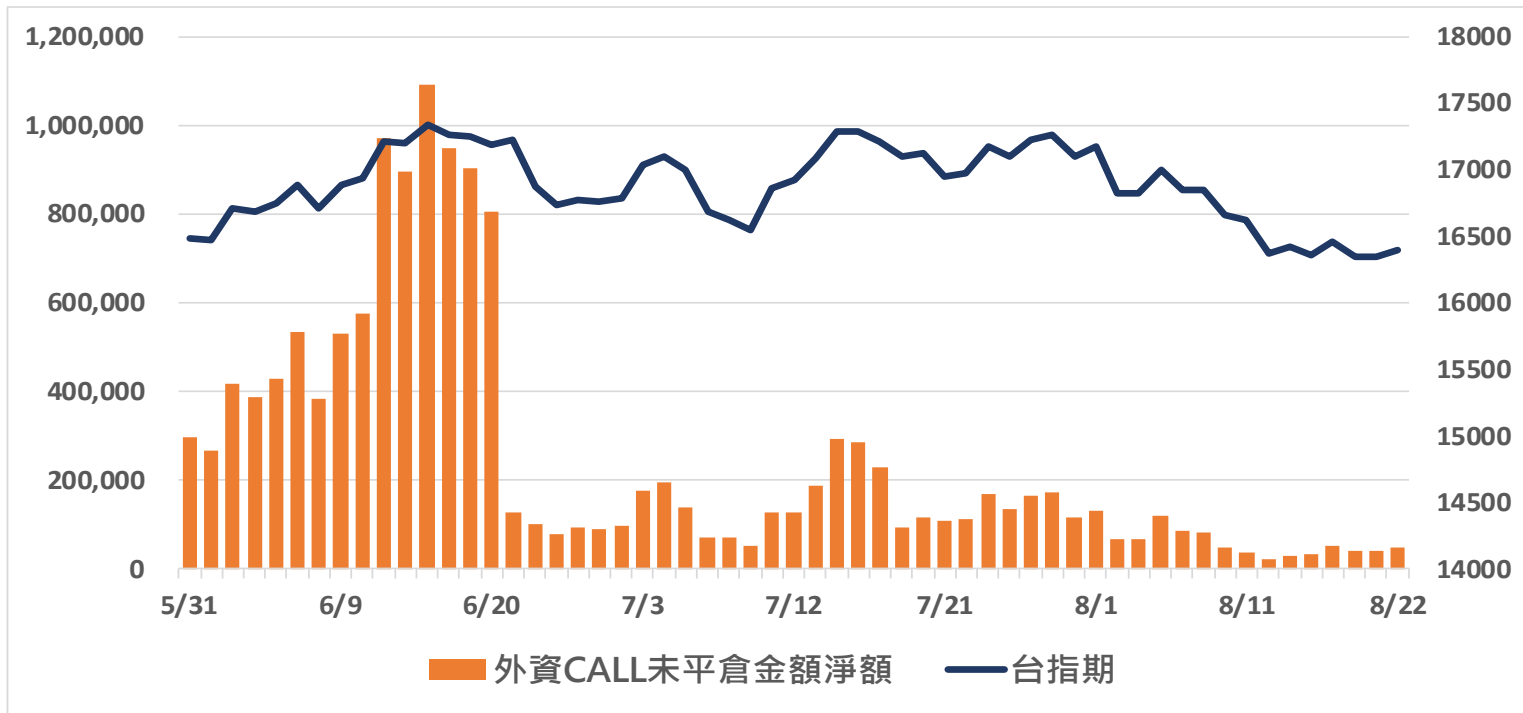
## Sell Put未平倉金額



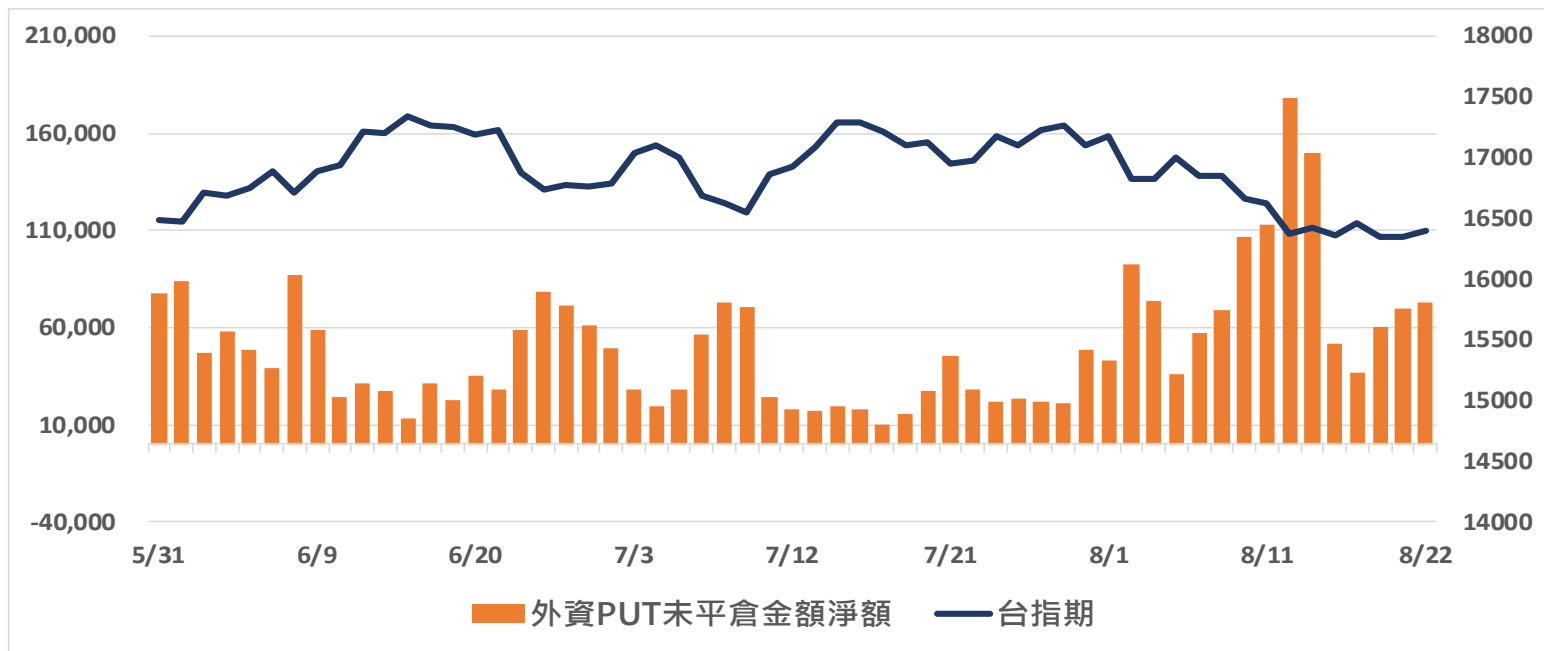
更新日期：2023年8月22日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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22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