

# 台指選擇權OI

日期：2023/8/23 結算日：2023/8/30					日期：2023/8/23 結算日：2023/9/20				
202308W5					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	95	16,100	3,651	2,617	0	72	15,600	3,762	768
5	33	16,150	1,612	832	2	37	15,700	2,168	117
12	42	16,200	2,798	1,547	2	126	15,800	3,215	343
-22	41	16,250	1,928	1,203	4	20	15,900	2,254	-289
-52	247	16,300	3,569	2,089	-2	137	16,000	7,193	-877
-66	244	16,350	1,595	662	7	136	16,100	1,696	70
37	387	16,400	2,307	1,263	164	1,052	16,200	7,478	1,527 ※
125	575	16,450	2,156	1,773	392	1,065	16,300	4,906	-45
175	880	16,500	1,937	1,133	※ 731	1,998	16,400	2,164	674
661	1,339	16,550	949	841	-285	1,751	16,500	2,384	185
1,419	2,385	16,600	1,189	1,026	-578	3,765	16,600	2,977	-461
819	1,420	16,650	225	212	13	1,997	16,700	1,192	72
1,318	2,477	16,700	131	37	50	4,099	16,800	2,115	119
1,141	2,092	16,750	61	55	641	3,861	16,900	848	10
1,857	2,802	16,800	187	158	-12	7,297	17,000	828	35
1,318	2,092	16,850	5	2	-62	4,494	17,100	91	0
1,283	3,216	16,900	19	4	338	5,541	17,200	163	-14
※ 2,103	3,431	17,000	24	22	-5	3,925	17,300	80	0
1,382	2,431	17,100	2	0	134	4,519	17,400	168	0
355	1,653	17,200	0	0	-894	3,856	17,500	85	1
450	617	17,300	0	0	62	3,083	17,600	67	0
55	212	17,400	1	0	17	2,035	17,700	28	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
14,447	29,336	1.7300	50,750	32,003	679	79,248	0.9145	72,470	3,032
昨日 P/C	1.0786	今日增減變化		0.6514	昨日 P/C	0.8838	今日增減變化		0.0307

更新日期：2023年8月23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	76,003,145	85,958,156	-9,955,011	6,694,503	1,035,385	2,230,815	-1,195,430	166,448
投信	41,606,942	39,818,678	1,788,264	1,148,664	705,499	0	705,499	-4,485
自營商	15,364,270	32,269,570	-16,905,300	-2,785,818	365,808	1,290,149	-924,341	298,768
	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	1,578,584	1,069,571	509,013	48,033	97,920	14,400	83,520	-5,351
投信	43,492	0	43,492	125	0	0	0	0
自營商	43,492	1,183,959	-1,140,467	-12,894	61,888	142,525	-80,637	9,667

## 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	22,368	5,561	16,807	-143	21,323	7,785	13,538	2,505
投信	200	0	200	0	300	120	180	0
自營商	46,311	49,769	-3,458	-10,892	47,569	48,373	-804	-11,108
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	13,349	0	13,349	390	2,309	9,991	-7,682	-774
特定法人(全月)	13,245	0	13,245	-2,369	3,985	14,096	-10,111	-1,356
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	39,863	42,322	-2,459	2,002	31,529	37,128	-5,599	1,284
十大交易人(全月)	59,194	59,202	-8	-7,959	56,055	61,721	-5,666	1,032
全市場未沖銷(近月)			79,248	679			72,470	3,032
全市場未沖銷(全月)			132,639	-109,275			137,693	-95,272

更新日期：2023年8月23日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

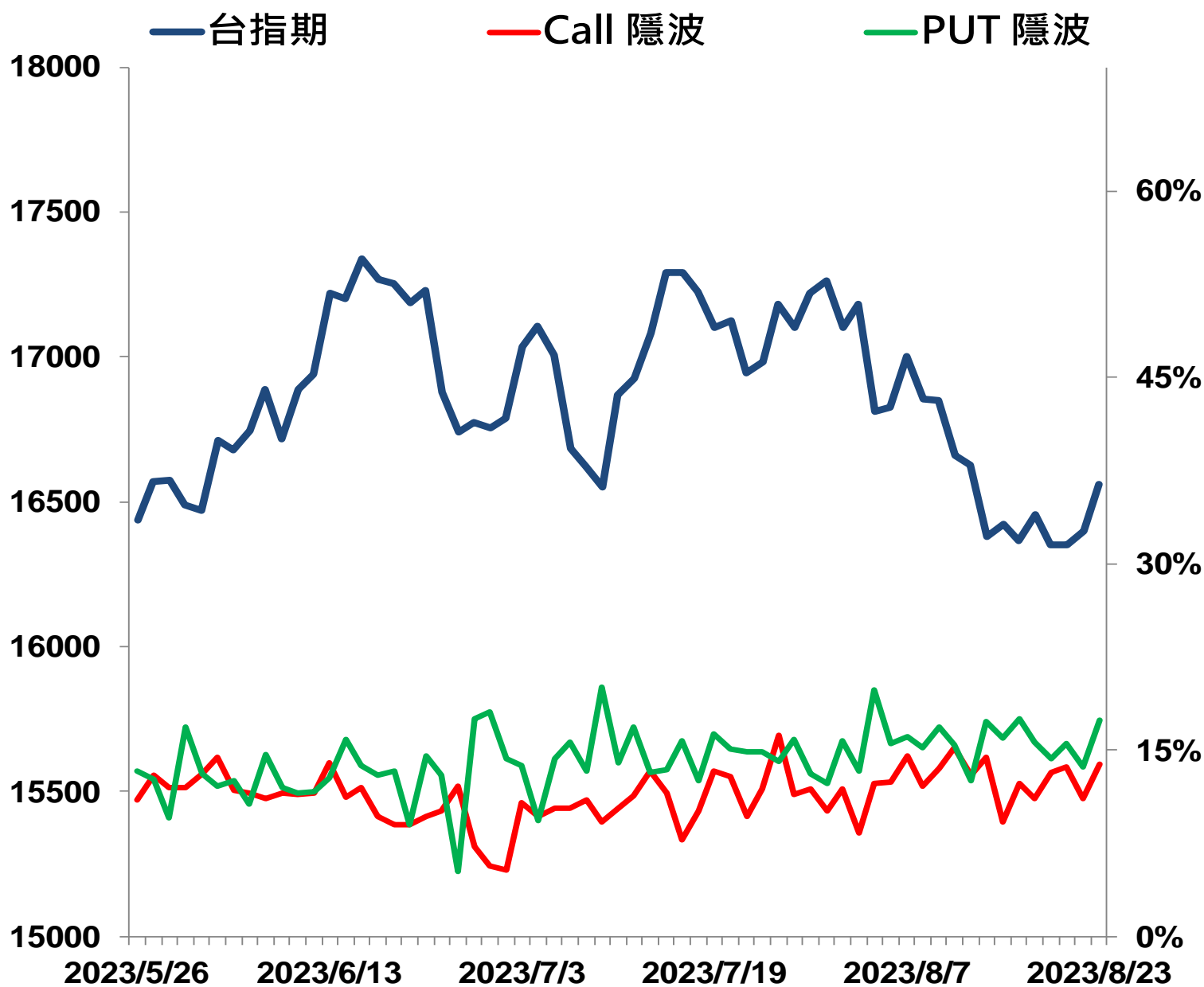
# 選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月23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



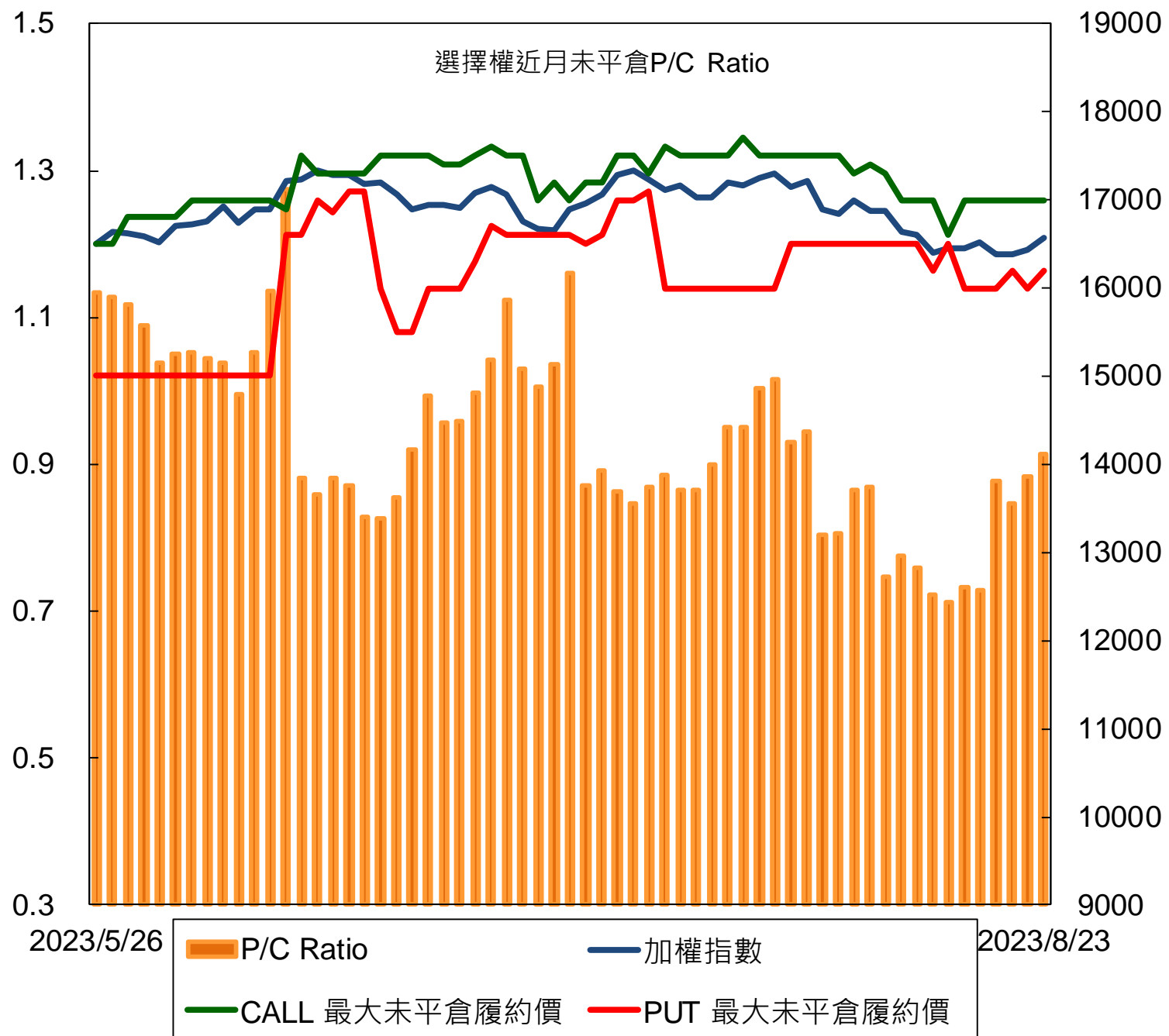
更新日期：2023年8月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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22日	69,136	61,702	7,434
	8月23日	46,311	49,769	-3,458
<b>Put</b>	8月22日	62,714	52,410	10,304
	8月23日	47,569	48,373	-804

更新日期：2023年8月23日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

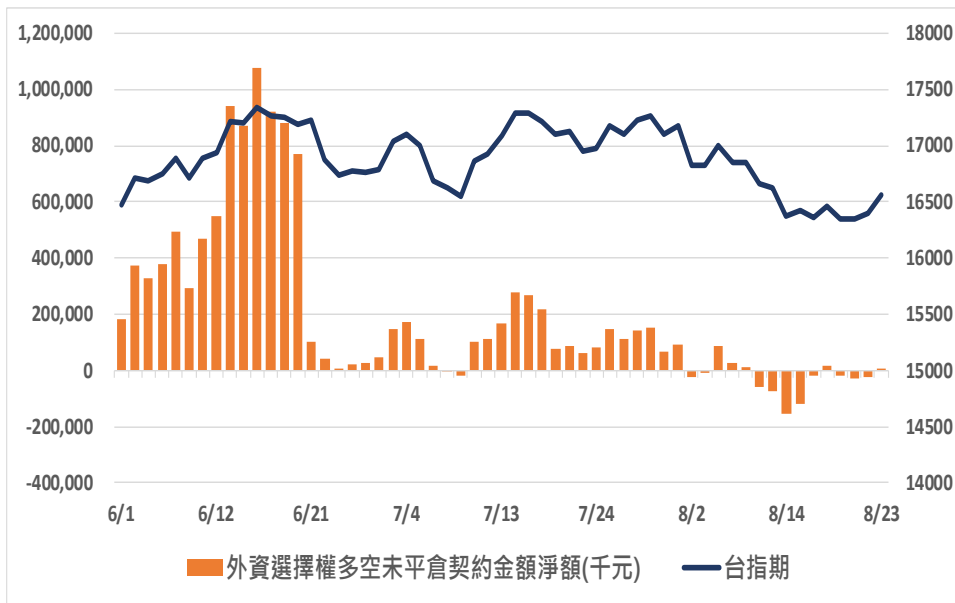
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



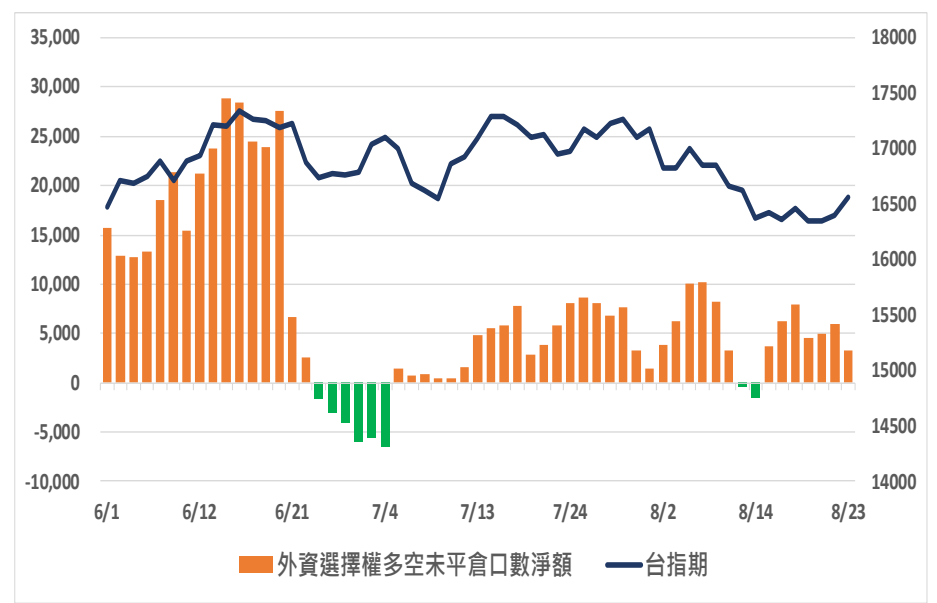
更新日期：2023年8月23日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



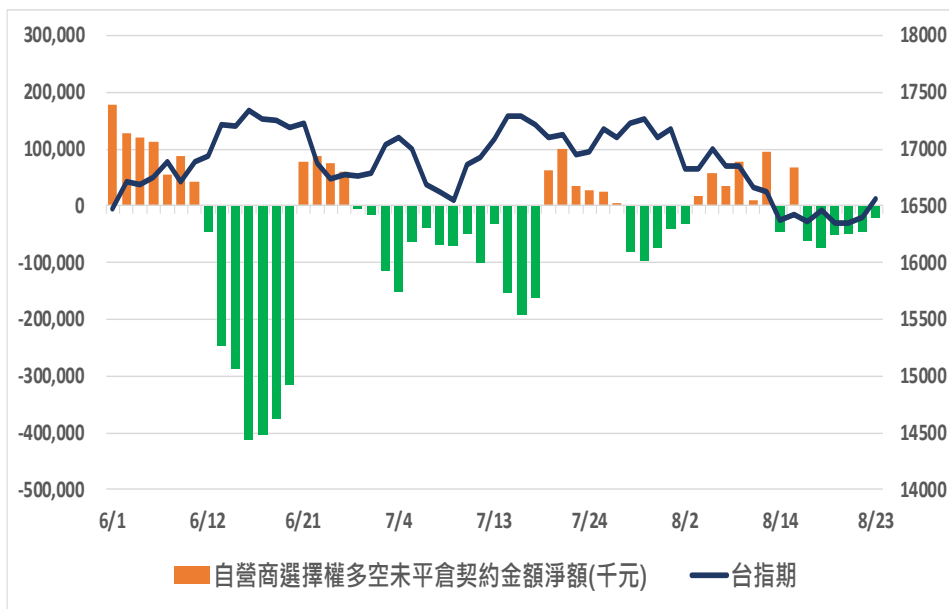
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/17	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
2023/8/23	16558	3,269	-2,648	7,787	+33,485

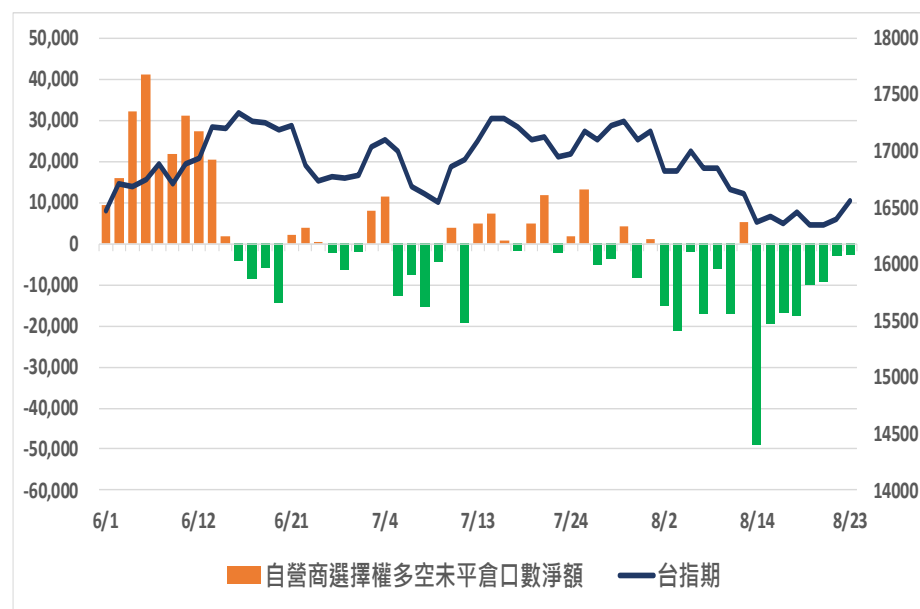
更新日期：2023年8月23日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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

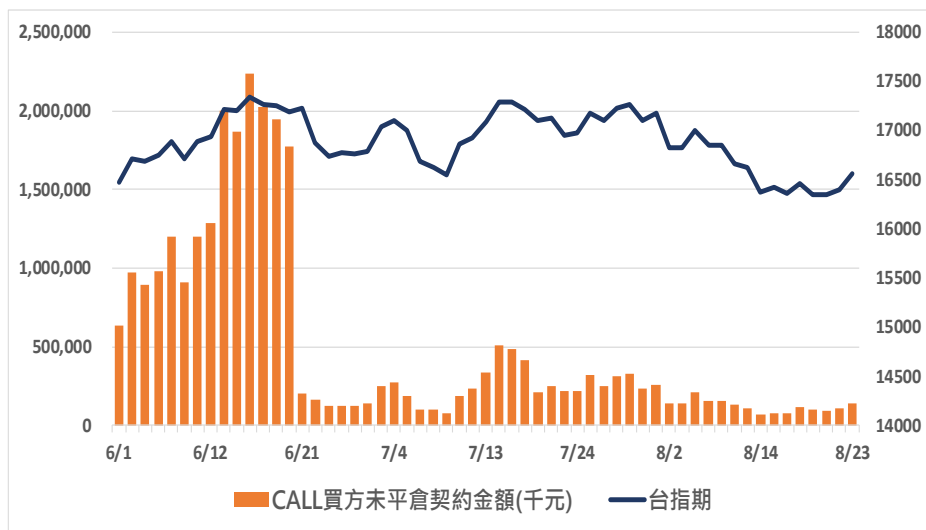
日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/8/17	16456	-17,373	-554	-73,475	-12,434
2023/8/18	16353	-9,996	+7,377	-51,629	+21,846
2023/8/21	16348	-9,211	+785	-47,950	+3,679
2023/8/22	16400	-2,870	+6,341	-45,950	+2,000
2023/8/23	16558	-2,654	+216	-20,928	+25,022

更新日期：2023年8月23日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

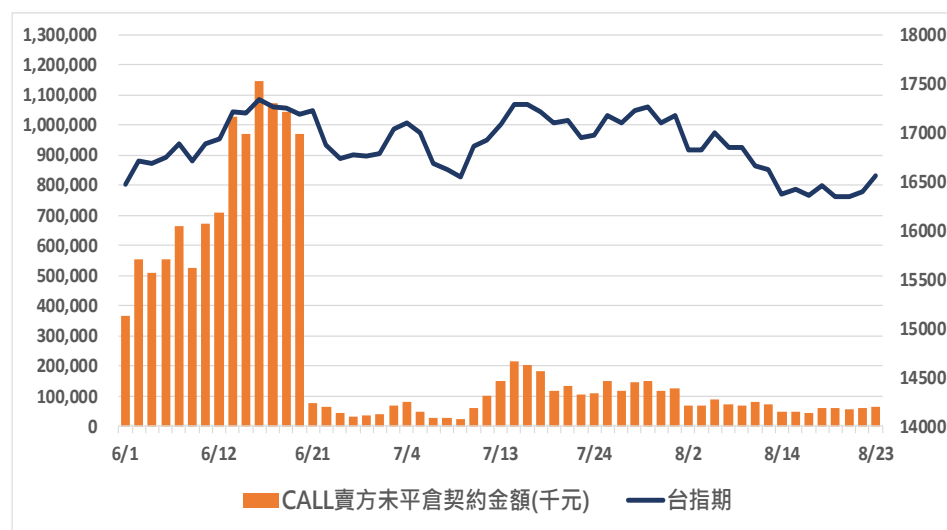


# 外資選擇權未平倉金額

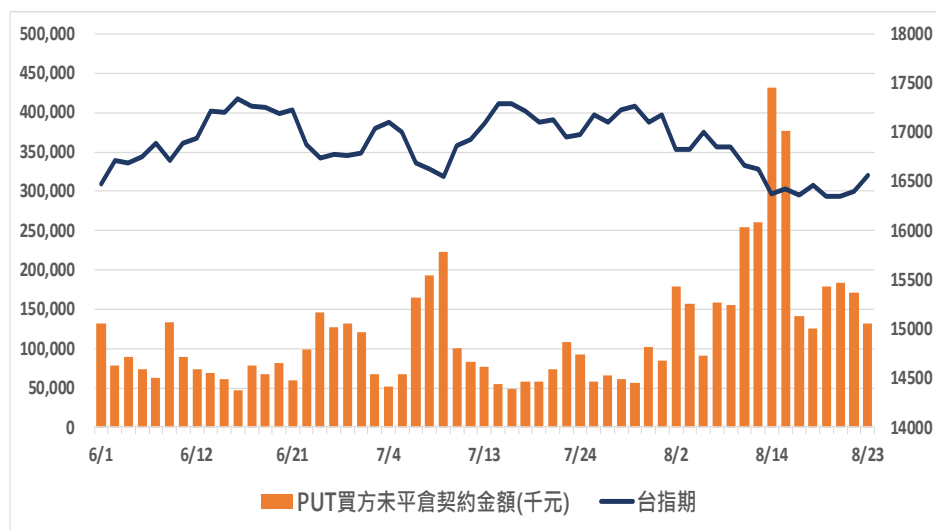
## Buy Call未平倉金額



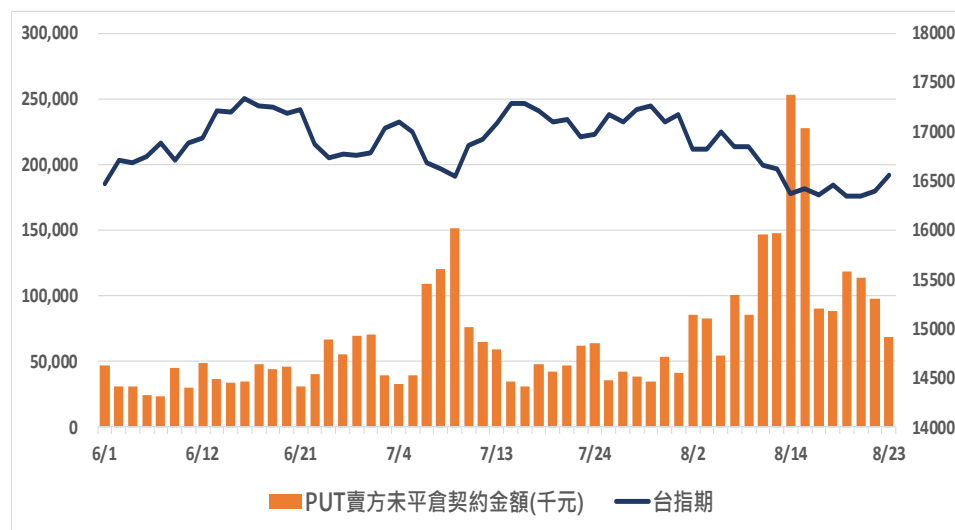
## Sell Call未平倉金額



## Buy Put未平倉金額



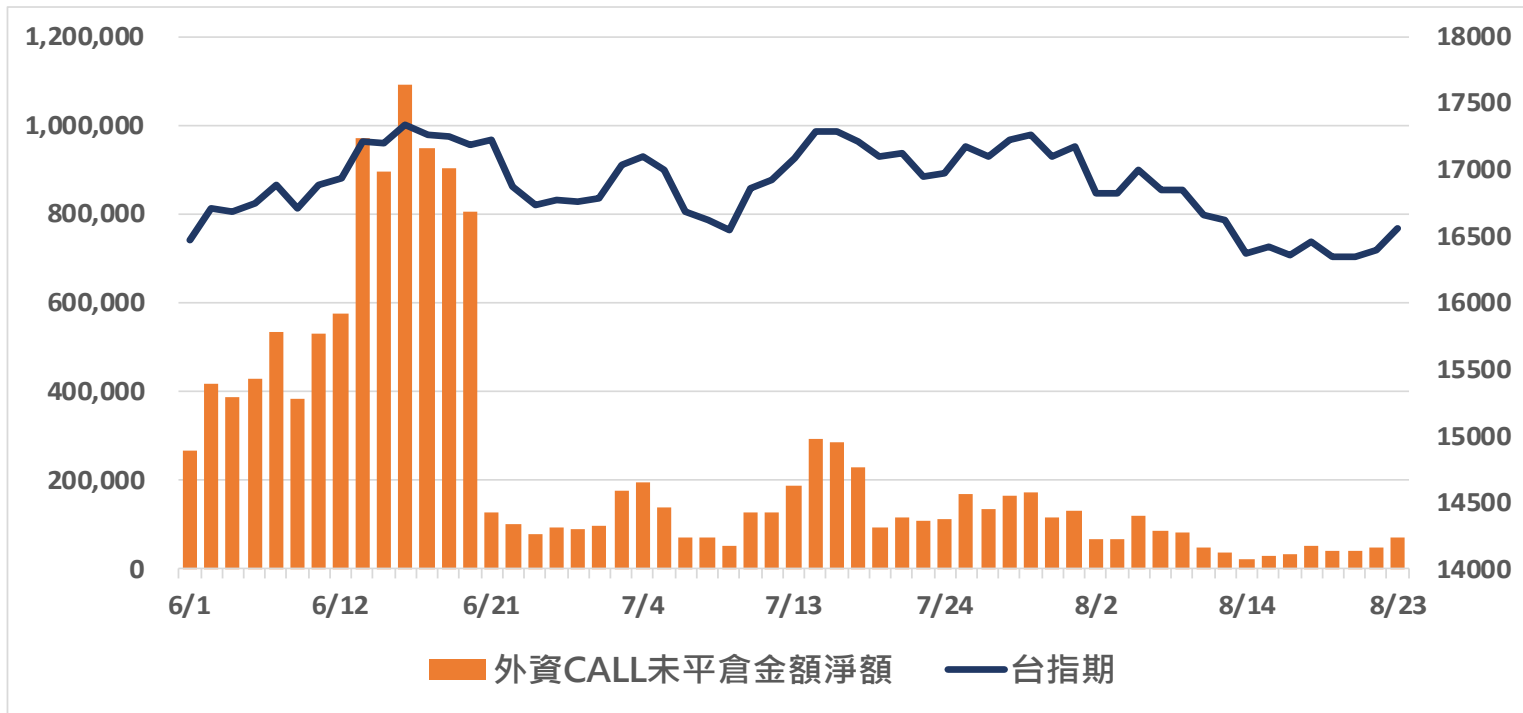
## Sell Put未平倉金額



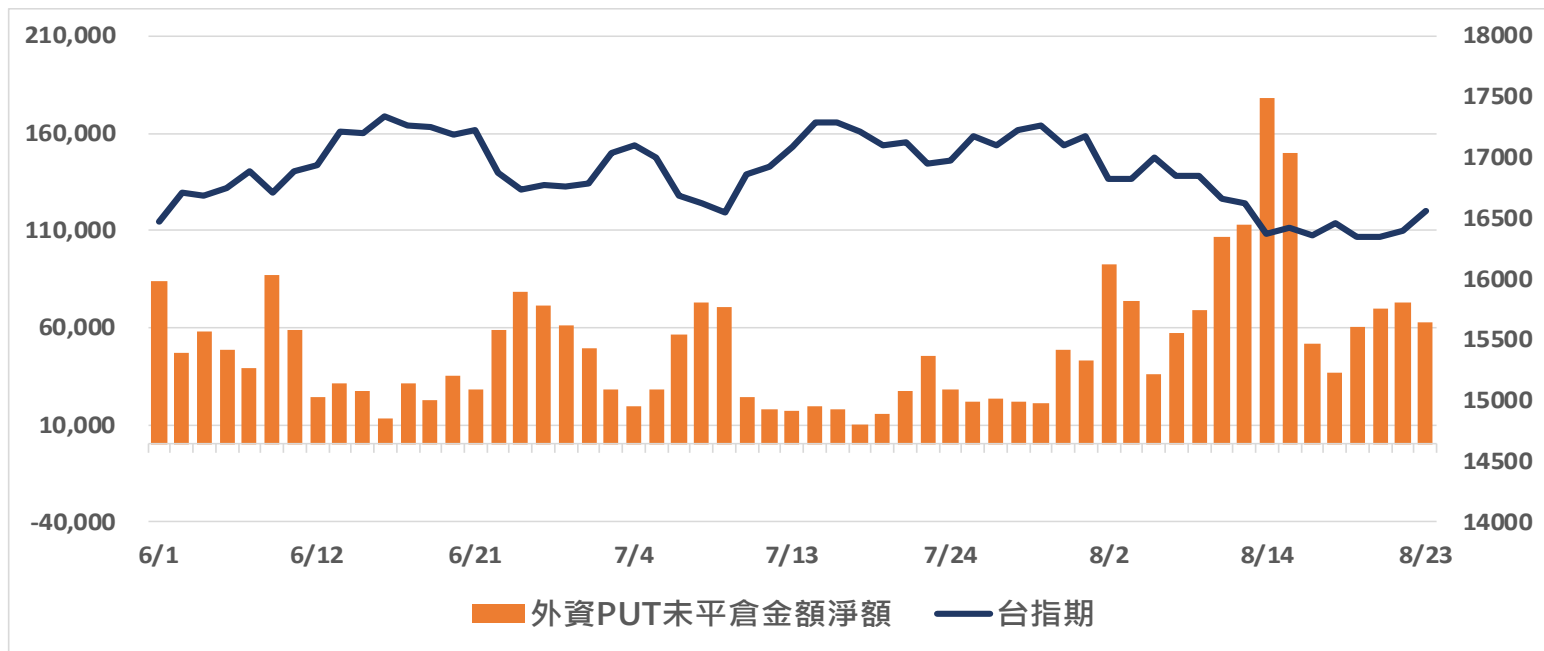
更新日期：2023年8月23日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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23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