

台指選擇權 OI

日期：2023/8/24 結算日：2023/8/30					日期：2023/8/24 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
4	45	16,250	4,342	2,414	-3	123	15,800	3,200	-15
0	247	16,300	5,908	2,339	2	22	15,900	2,305	51
60	304	16,350	3,634	2,039	-1	136	16,000	8,842	1,649 ※
-50	337	16,400	7,653	5,346 ※	5	141	16,100	2,700	1,004
-11	564	16,450	5,261	3,105	-1	1,051	16,200	7,754	276
-172	708	16,500	6,136	4,199	40	1,105	16,300	5,454	548
204	1,543	16,550	4,168	3,219	-89	1,909	16,400	2,327	163
-544	1,841	16,600	4,654	3,465	-243	1,508	16,500	2,403	19
491	1,911	16,650	2,430	2,205	-507	3,258	16,600	2,641	-336
211	2,688	16,700	3,792	3,661	-375	1,622	16,700	1,141	-51
518	2,610	16,750	1,873	1,812	-215	3,884	16,800	2,150	35
2,744	5,546	16,800	2,028	1,841	-223	3,638	16,900	848	0
2,970	5,062	16,850	712	707	136	7,433	17,000	1,014	186
2,094	5,310	16,900	382	363	298	4,792	17,100	133	42
4,560	7,583	16,950	130	123	※ 477	6,018	17,200	175	12
5,005	8,436	17,000	117	93	145	4,070	17,300	85	5
1,769	1,769	17,050	8	8	-501	4,018	17,400	168	0
※ 7,025	9,456	17,100	6	4	71	3,927	17,500	87	2
3,329	4,982	17,200	3	3	196	3,279	17,600	67	0
2,090	2,707	17,300	0	0	3	2,038	17,700	56	28
2,570	2,782	17,400	21	20	-5	2,242	17,800	103	0
1,504	1,595	17,500	0	0	27	1,160	17,900	0	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
36,389	68,748	1.4350	98,654	47,897	-1,464	77,784	1.0195	79,300	6,830
昨日 P/C	1.7300	今日增減變化	-0.2950		昨日 P/C	0.9145	今日增減變化	0.1050	

更新日期：2023年8月24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	73,158,690	78,648,134	-5,489,444	4,465,567	1,078,596	2,589,962	-1,511,366	-315,936
投信	43,153,402	38,870,569	4,282,833	2,494,569	742,367	0	742,367	36,868
自營商	15,969,753	30,862,611	-14,892,858	2,012,442	299,596	1,484,724	-1,185,128	-260,787
	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	1,572,502	1,177,758	394,744	-114,269	97,770	15,816	81,954	-1,566
投信	43,681	0	43,681	189	0	0	0	0
自營商	67,948	1,155,133	-1,087,185	53,282	87,695	172,525	-84,830	-4,193

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	30,554	7,256	23,298	6,491	24,863	11,948	12,915	-623
投信	200	0	200	0	300	120	180	0
自營商	51,434	52,616	-1,182	2,276	57,557	48,229	9,328	10,132
特定法人(週)	4,108	0	4,108	2,530	0	2,866	-2,866	-7
特定法人(近月)	18,321	0	18,321	4,972	4,810	10,106	-5,296	2,386
特定法人(全月)	19,991	0	19,991	6,746	0	12,701	-12,701	-2,590
十大交易人(週)	21,528	20,650	878	1,615	32,231	31,631	600	-2,211
十大交易人(近月)	39,469	40,696	-1,227	1,232	31,735	38,979	-7,244	-1,645
十大交易人(全月)	67,135	61,888	5,247	5,255	58,932	71,807	-12,875	-7,209
全市場未沖銷(近月)			77,784	-1,464			79,300	6,830
全市場未沖銷(全月)			171,281	38,642			197,773	60,080

更新日期：2023年8月24日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

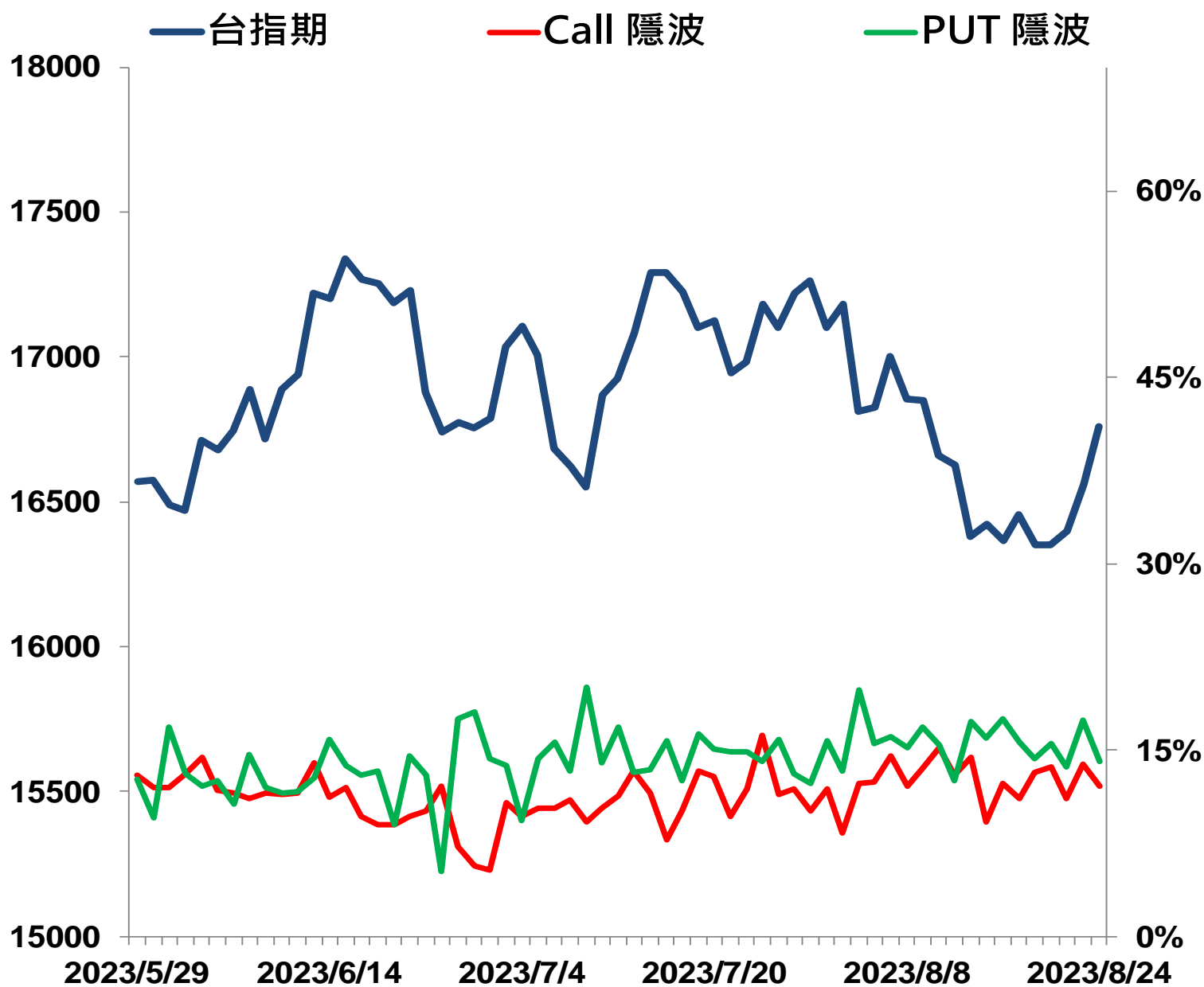
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月24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



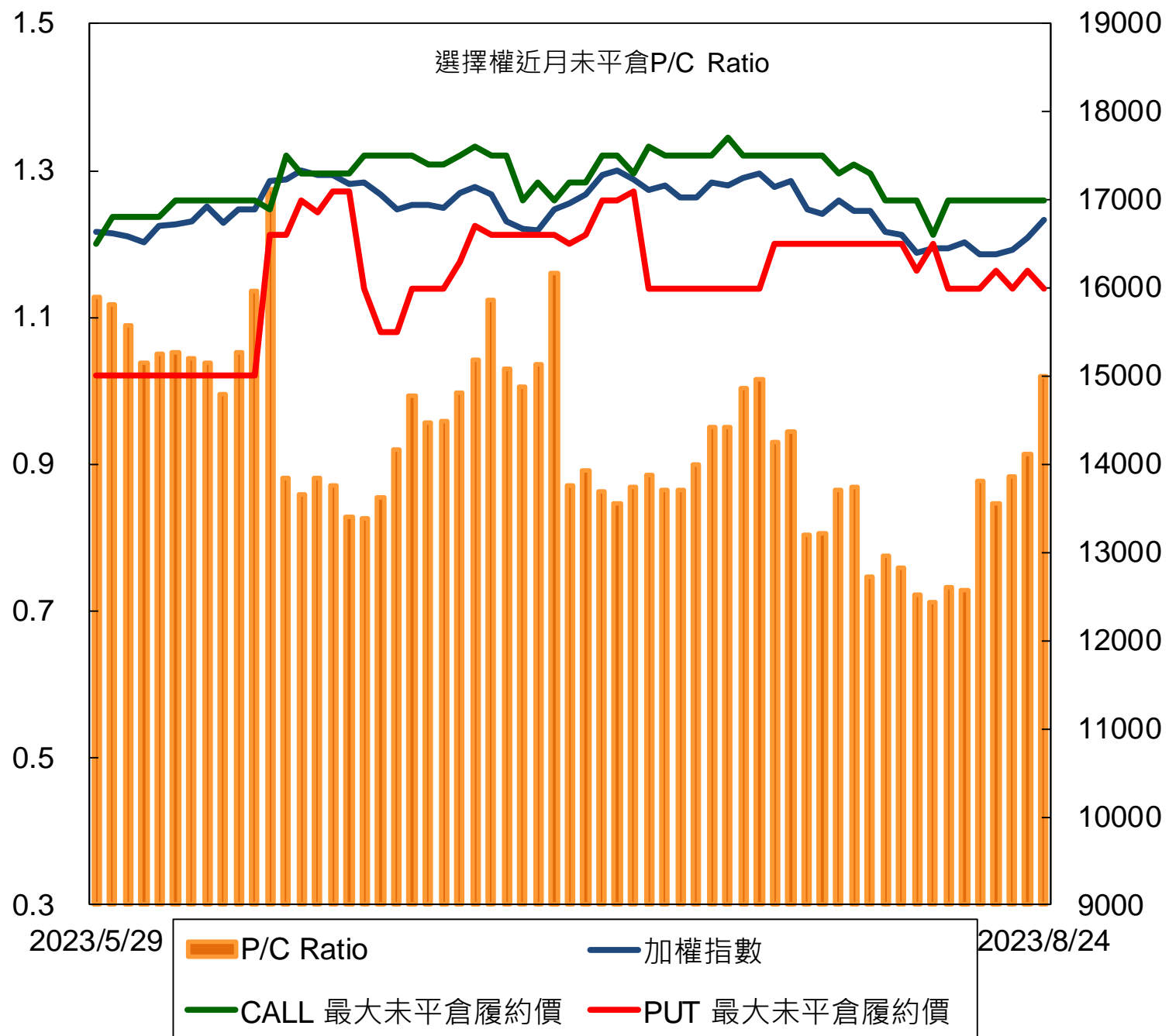
更新日期：2023年8月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考

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23日	46,311	49,769	-3,458
	8月24日	51,434	52,616	-1,182
Put	8月23日	47,569	48,373	-804
	8月24日	57,557	48,229	9,328

更新日期：2023年8月24日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

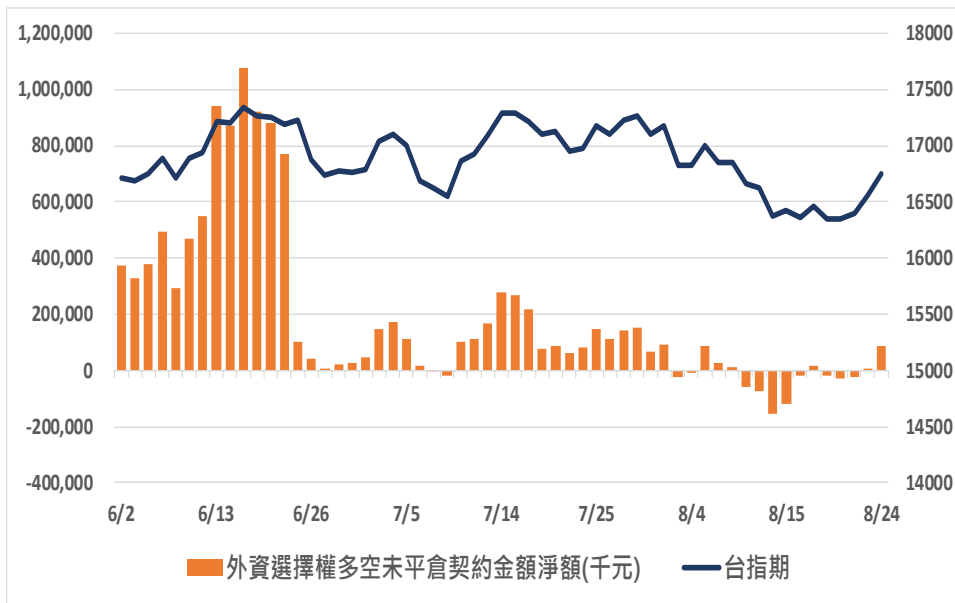
選擇權近月未平倉P/C Ratio



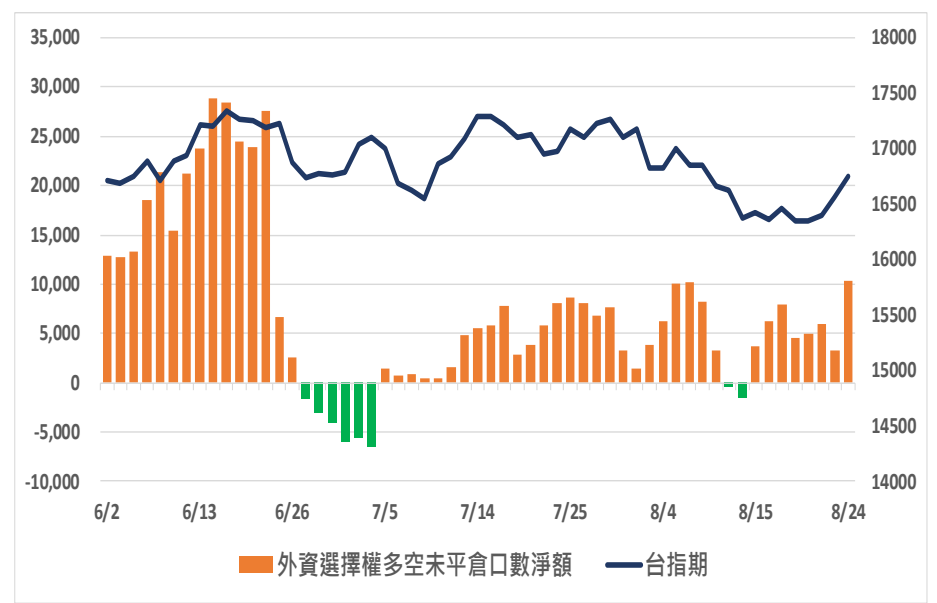
更新日期：2023年8月24日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



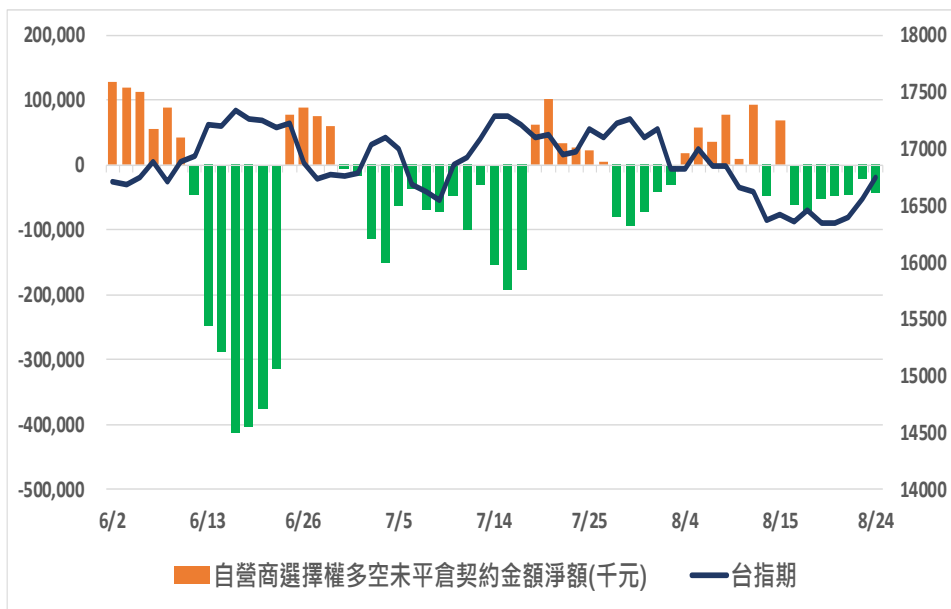
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/18	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
2023/8/24	16756	10,383	+7,114	85,643	+77,856

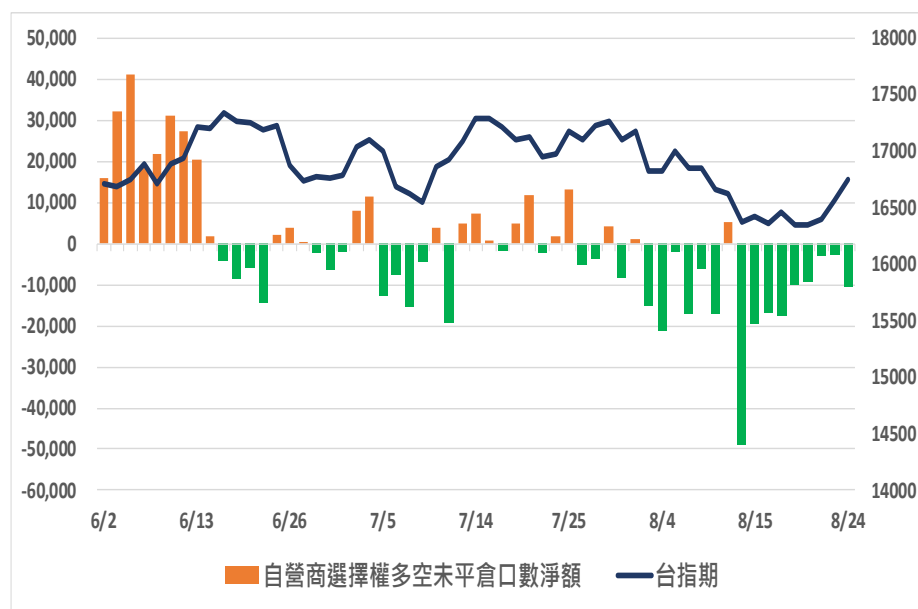
更新日期：2023年8月24日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



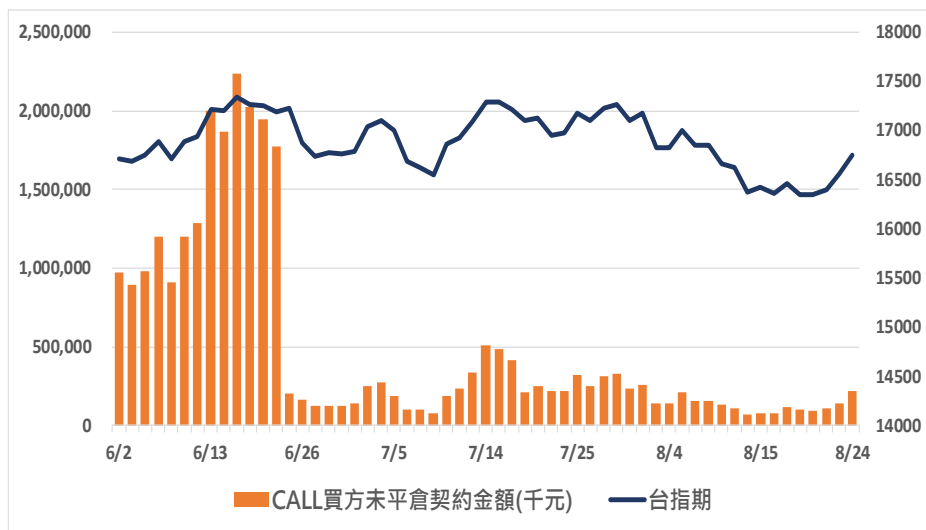
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/18	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
2023/8/24	16756	-10,510	-7,856	-43,355	-22,427

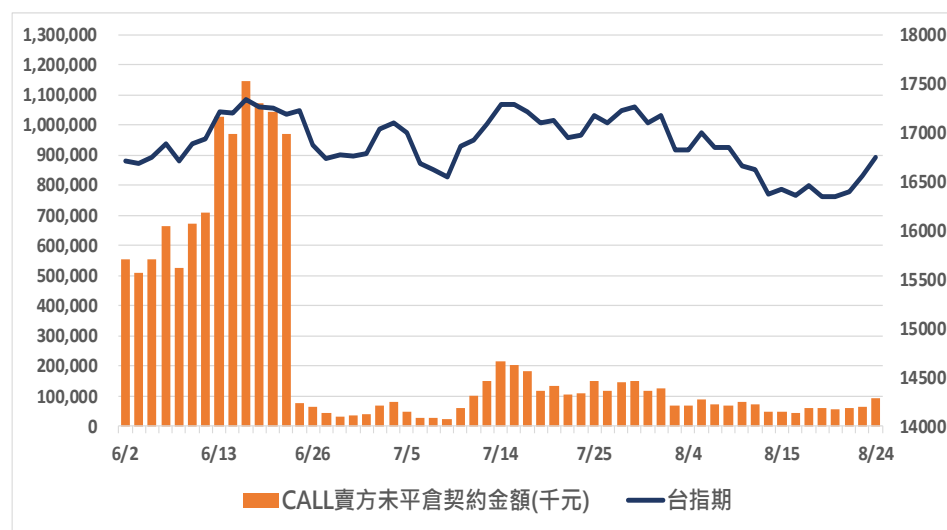
更新日期：2023年8月24日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

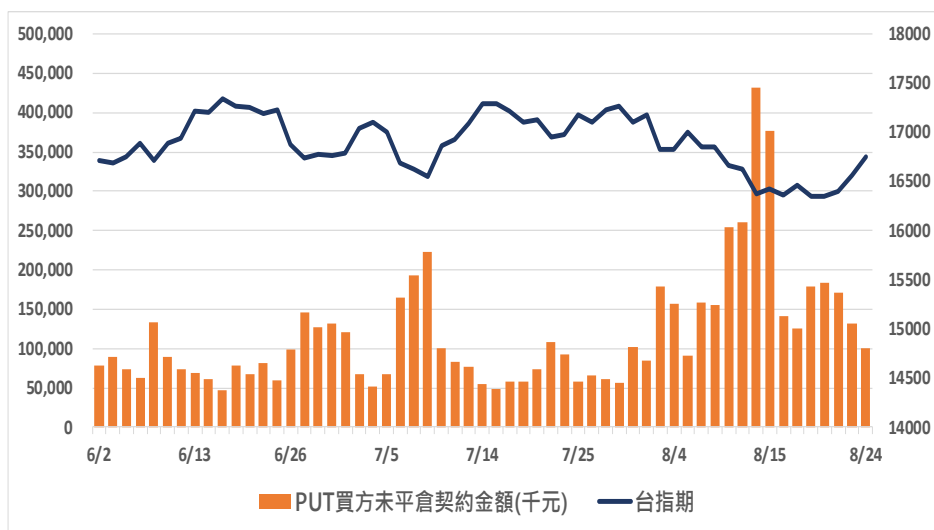
Buy Call未平倉金額



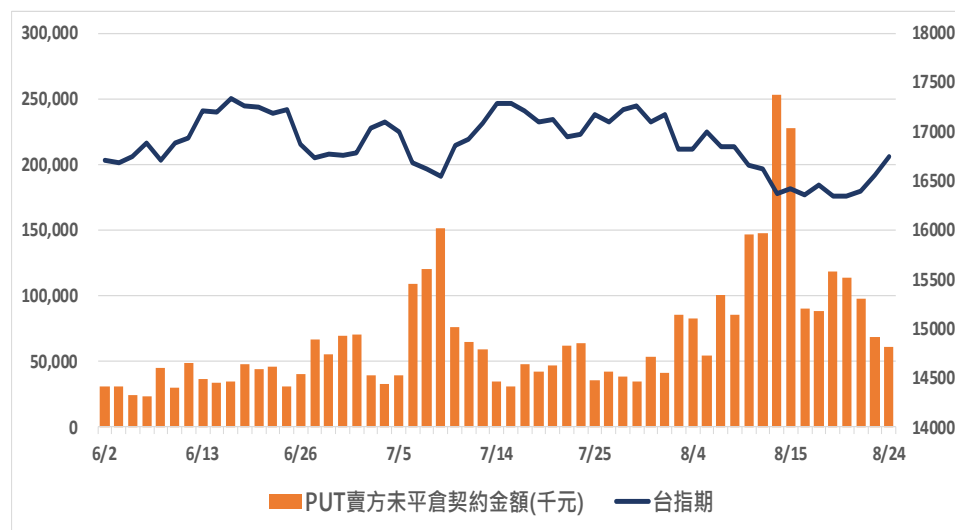
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



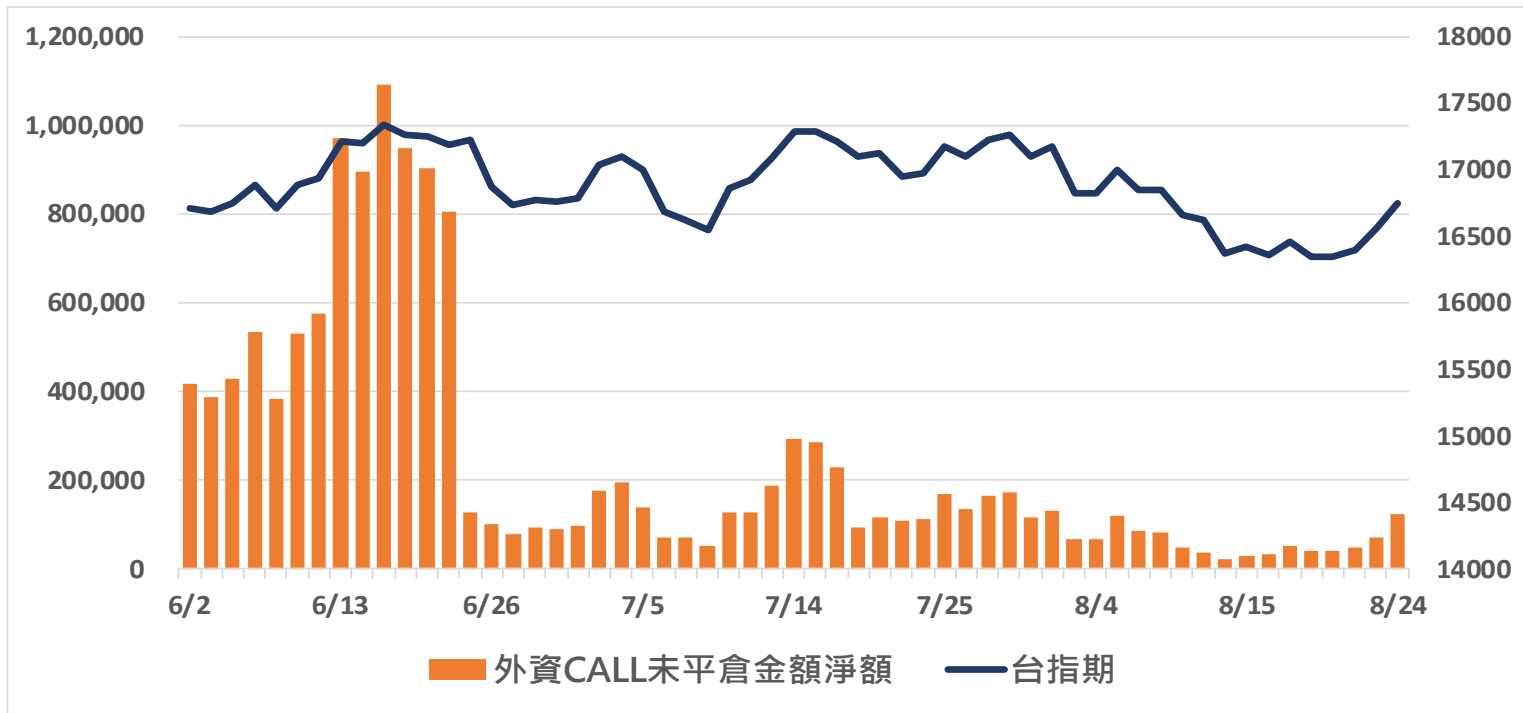
Sell Put未平倉金額



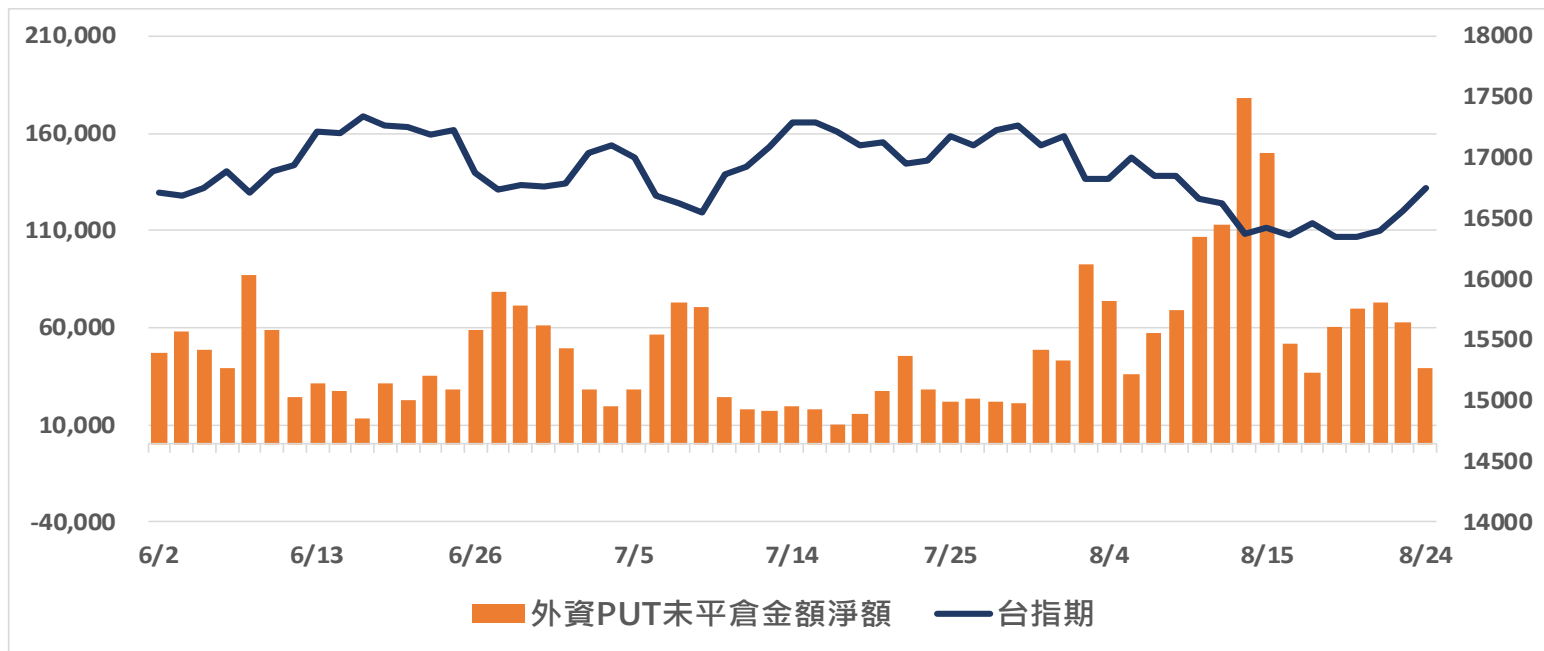
更新日期：2023年8月24日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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24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