

台指選擇權OI

日期：2023/8/25 結算日：2023/8/30					日期：2023/8/25 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	13	16,000	6,534	916	1	22	15,500	3,586	241
0	2	16,050	4,666	827	0	69	15,600	5,012	60
-3	40	16,100	5,266	416	2	38	15,700	2,463	46
-1	32	16,150	4,903	1,785	0	123	15,800	3,287	87
46	93	16,200	8,441	2,048	6	28	15,900	2,315	10
7	52	16,250	5,961	1,619	14	150	16,000	9,747	905 ※
182	429	16,300	7,897	1,989	3	144	16,100	3,138	438
73	377	16,350	6,446	2,812	60	1,111	16,200	6,650	-1,104
455	792	16,400	10,601	2,948 ※	50	1,155	16,300	5,387	-67
2,246	2,810	16,450	5,232	-29	-28	1,881	16,400	2,044	-283
3,224	3,932	16,500	5,155	-981	1,135	2,643	16,500	2,690	287
4,176	5,719	16,550	3,665	-503	※ 2,332	5,590	16,600	2,851	210
4,582	6,423	16,600	3,450	-1,204	689	2,311	16,700	948	-193
2,945	4,856	16,650	1,553	-877	322	4,206	16,800	2,196	46
5,045	7,733	16,700	3,324	-468	492	4,130	16,900	854	6
5,003	7,613	16,750	1,652	-221	1,641	9,074	17,000	916	-98
4,028	9,574	16,800	1,169	-859	38	4,830	17,100	128	-5
※ 13,958	19,020	16,850	636	-76	454	6,472	17,200	168	-7
3,968	9,278	16,900	384	2	1,025	5,095	17,300	80	-5
1,490	9,073	16,950	197	67	40	4,058	17,400	168	0
943	9,379	17,000	145	28	212	4,139	17,500	87	0
4,011	5,780	17,050	4	-4	343	3,622	17,600	66	-1
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
58,177	126,925	0.8828	112,052	13,398	9,664	87,448	0.9244	80,833	1,533
昨日 P/C	1.4350	今日增減變化	-0.5522		昨日 P/C	1.0195	今日增減變化	#####	

更新日期：2023年8月25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	55,732,952	94,616,403	-38,883,451	-33,394,007	1,023,271	2,603,513	-1,580,242	-68,876
投信	44,948,106	40,204,278	4,743,828	460,995	722,119	0	722,119	-20,248
自營商	19,494,726	30,407,589	-10,912,863	3,979,995	110,092	1,418,327	-1,308,235	-123,107
	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	1,588,532	1,215,893	372,639	-22,105	110,033	10,003	100,030	18,076
投信	43,367	0	43,367	-314	0	0	0	0
自營商	73,885	1,100,286	-1,026,401	60,784	91,488	200,094	-108,606	-23,776

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	31,081	11,164	19,917	-3,381	29,717	12,259	17,458	4,543
投信	200	0	200	0	300	120	180	0
自營商	67,106	77,941	-10,835	-9,653	65,421	52,843	12,578	3,250
特定法人(週)	3,367	2,871	496	-3,612	0	5,689	-5,689	-2,823
特定法人(近月)	19,278	0	19,278	957	2,951	11,713	-8,762	-3,466
特定法人(全月)	16,660	0	16,660	-3,331	0	17,966	-17,966	-5,265
十大交易人(週)	45,452	45,823	-371	-1,249	38,172	43,106	-4,934	-5,534
十大交易人(近月)	43,916	46,718	-2,802	-1,575	32,879	40,071	-7,192	52
十大交易人(全月)	92,902	87,860	5,042	-205	66,217	85,971	-19,754	-6,879
全市場未沖銷(近月)			87,448	9,664			80,833	1,533
全市場未沖銷(全月)			244,531	73,250			216,038	18,265

更新日期：2023年8月25日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

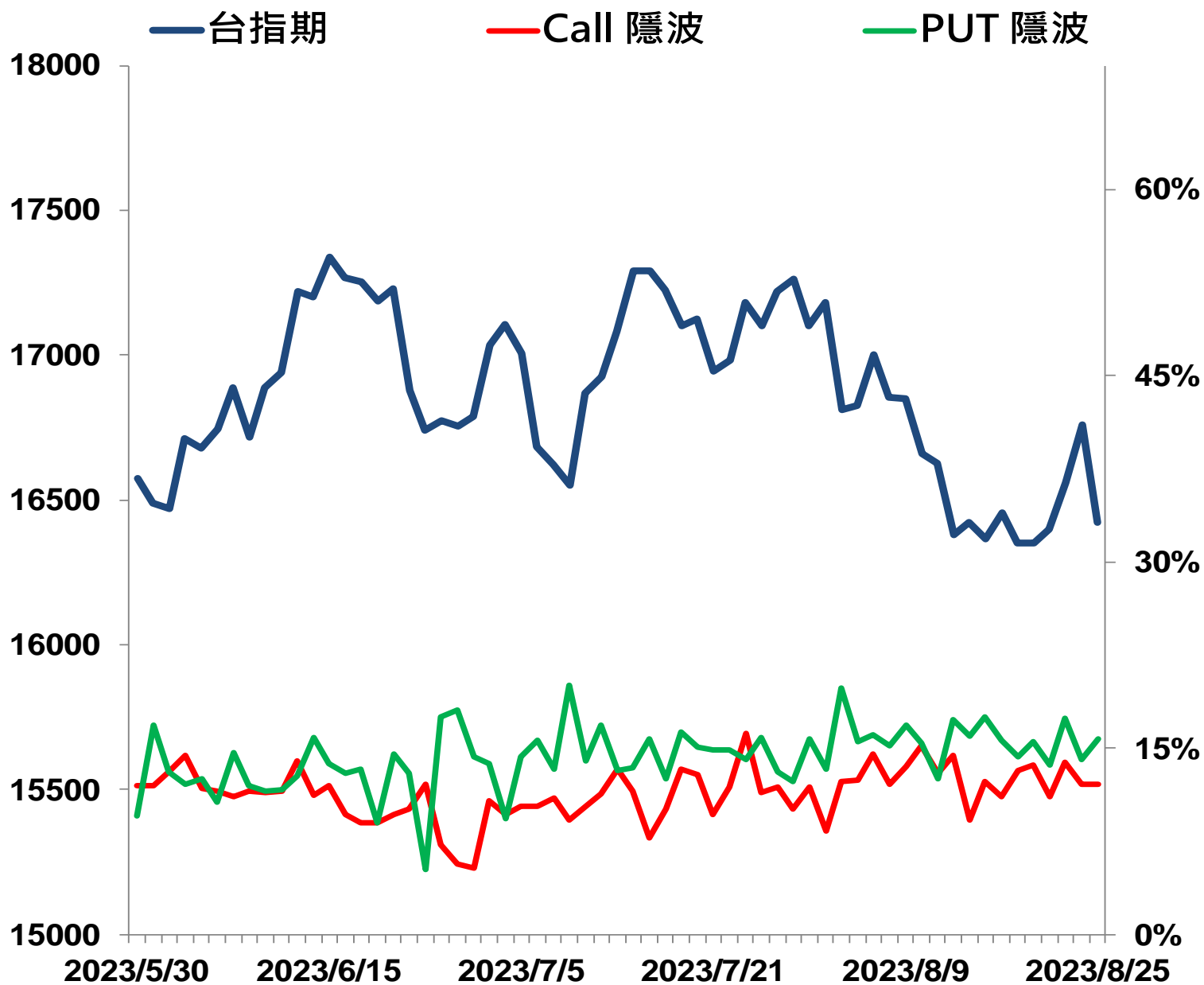
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月25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



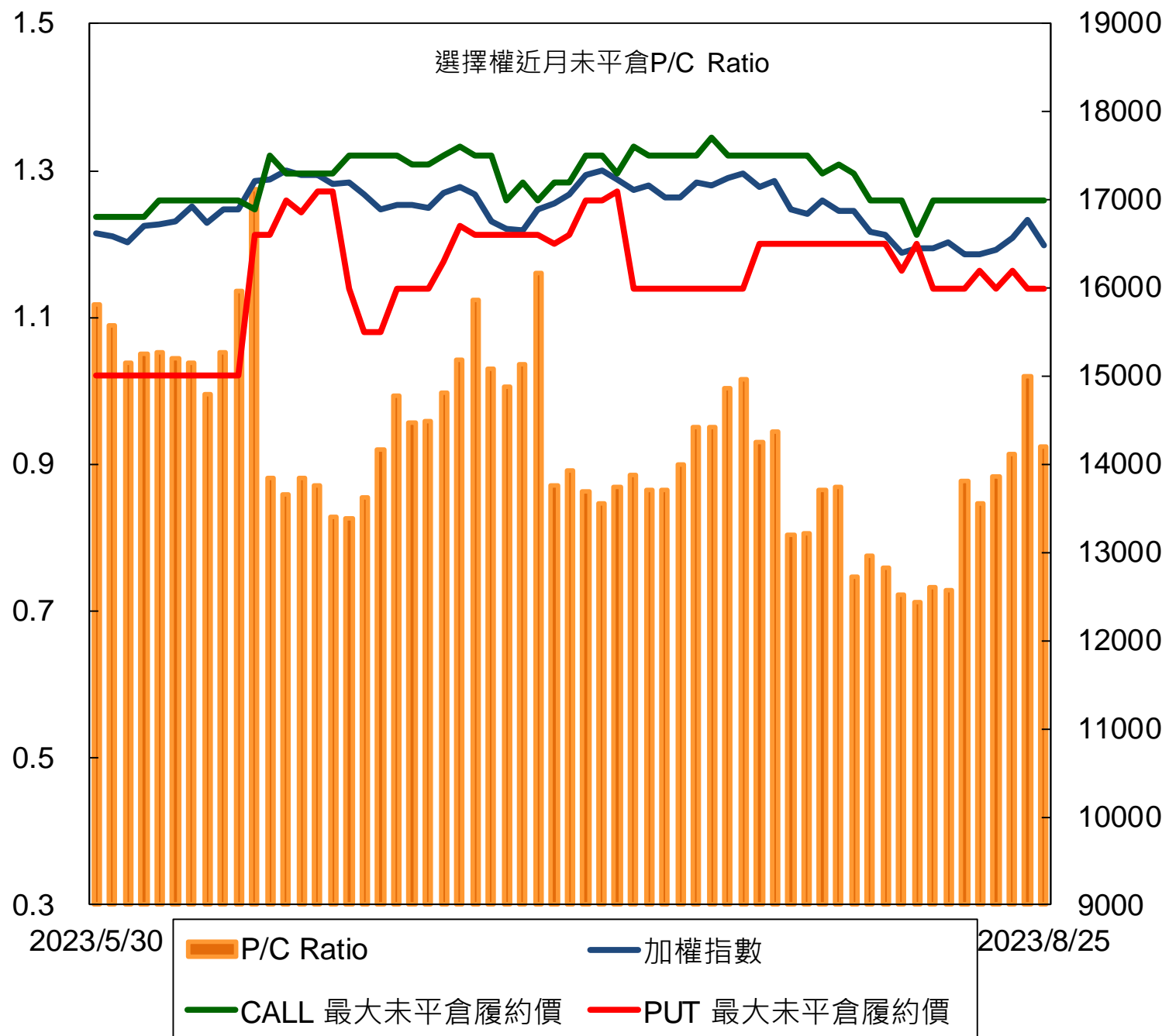
更新日期：2023年8月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考

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24日	51,434	52,616	-1,182
	8月25日	67,106	77,941	-10,835
Put	8月24日	57,557	48,229	9,328
	8月25日	65,421	52,843	12,578

更新日期：2023年8月25日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

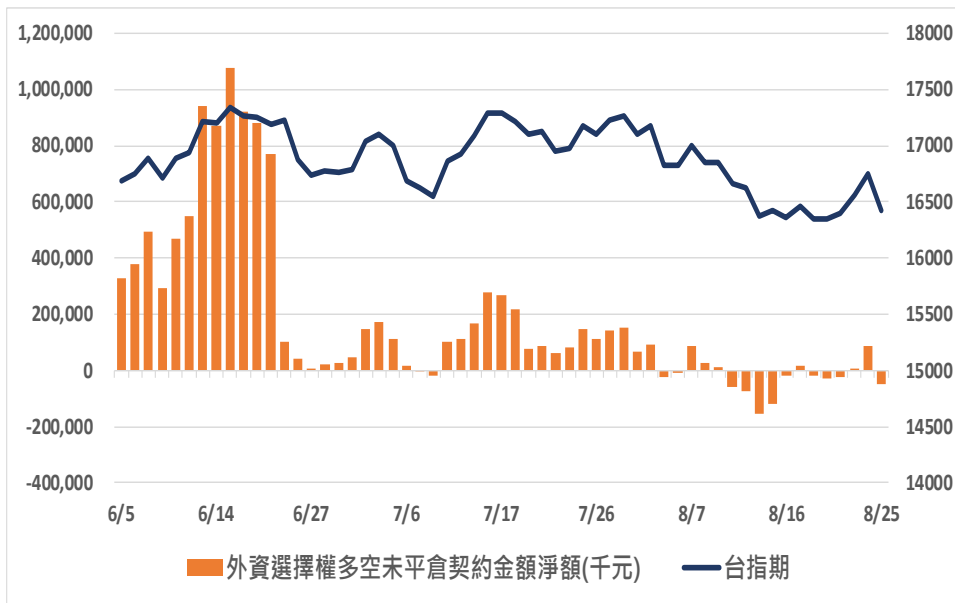
選擇權近月未平倉P/C Ratio



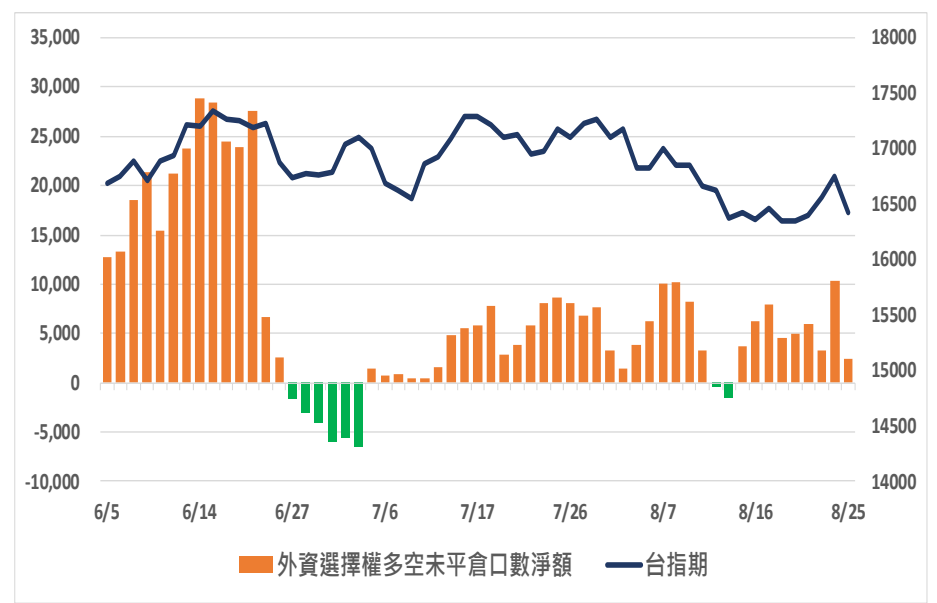
更新日期：2023年8月25日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



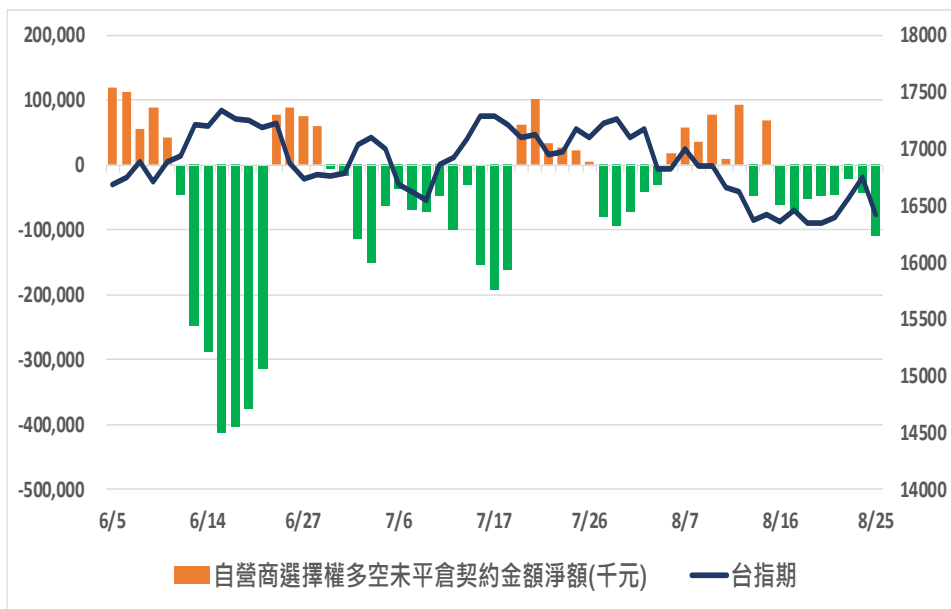
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/21	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
2023/8/25	16426	2,459	-7,924	-46,288	-131,931

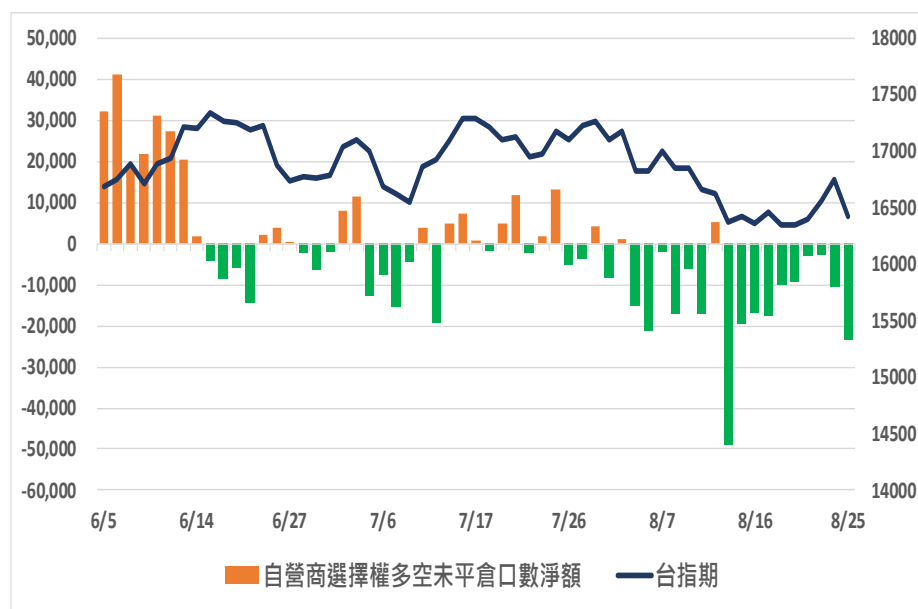
更新日期：2023年8月25日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



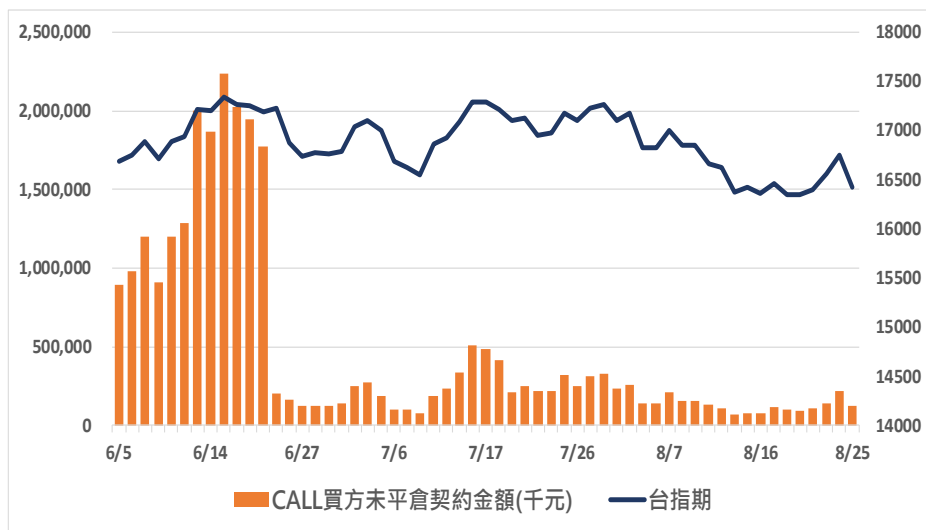
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/21	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
2023/8/25	16426	-23,413	-12,903	-109,762	-66,407

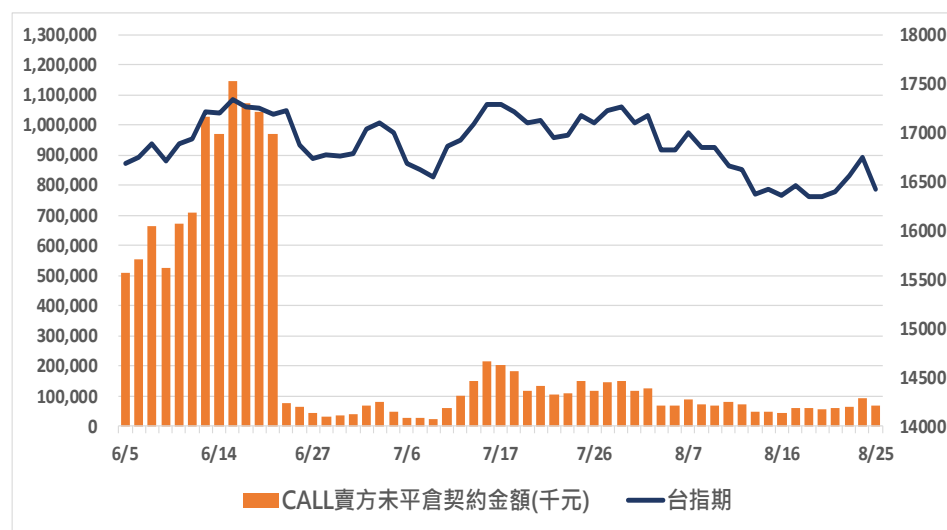
更新日期：2023年8月25日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

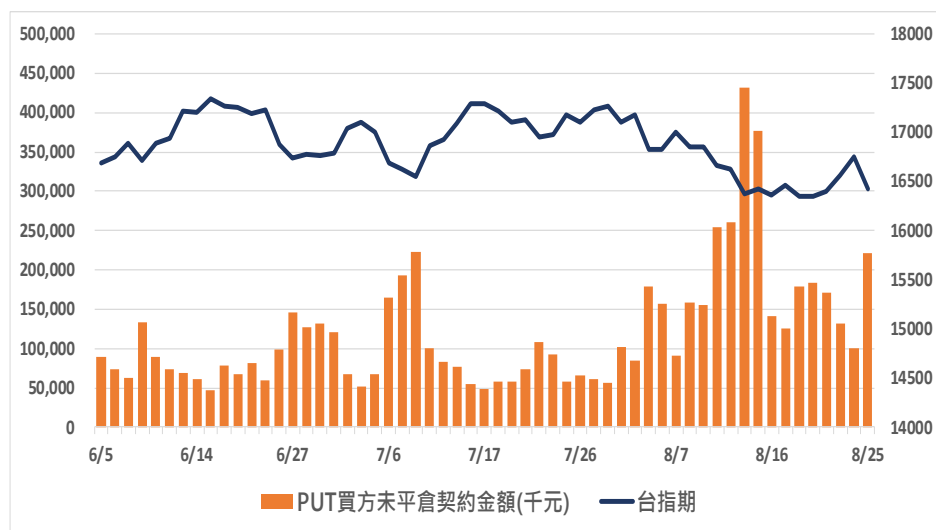
Buy Call未平倉金額



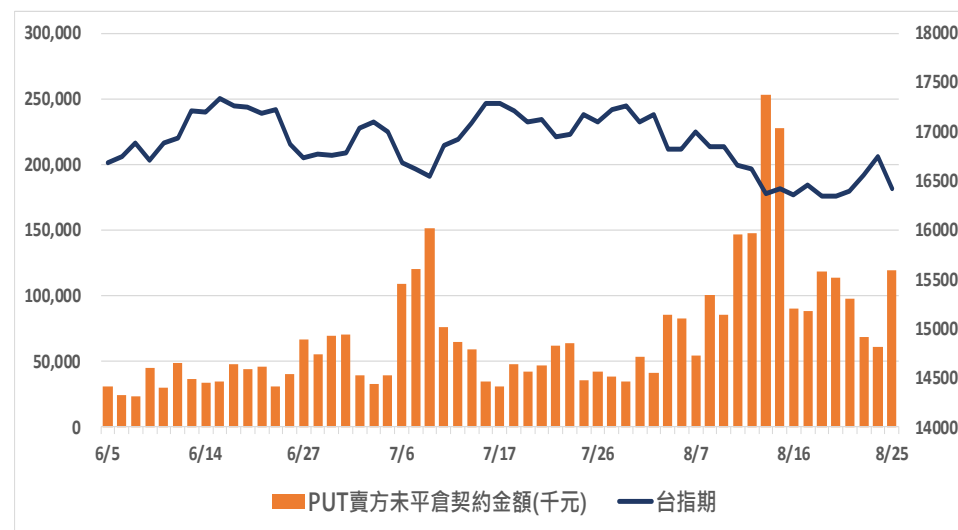
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



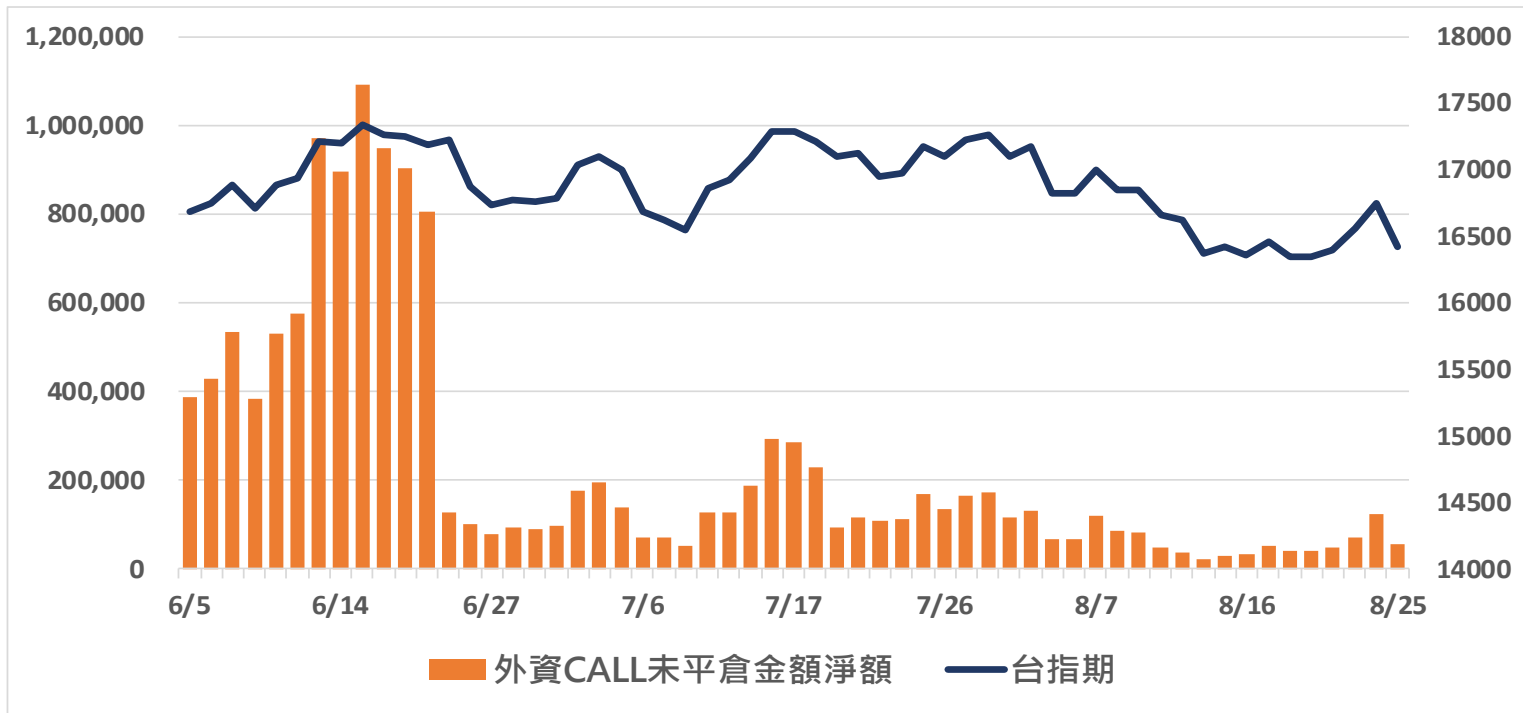
Sell Put未平倉金額



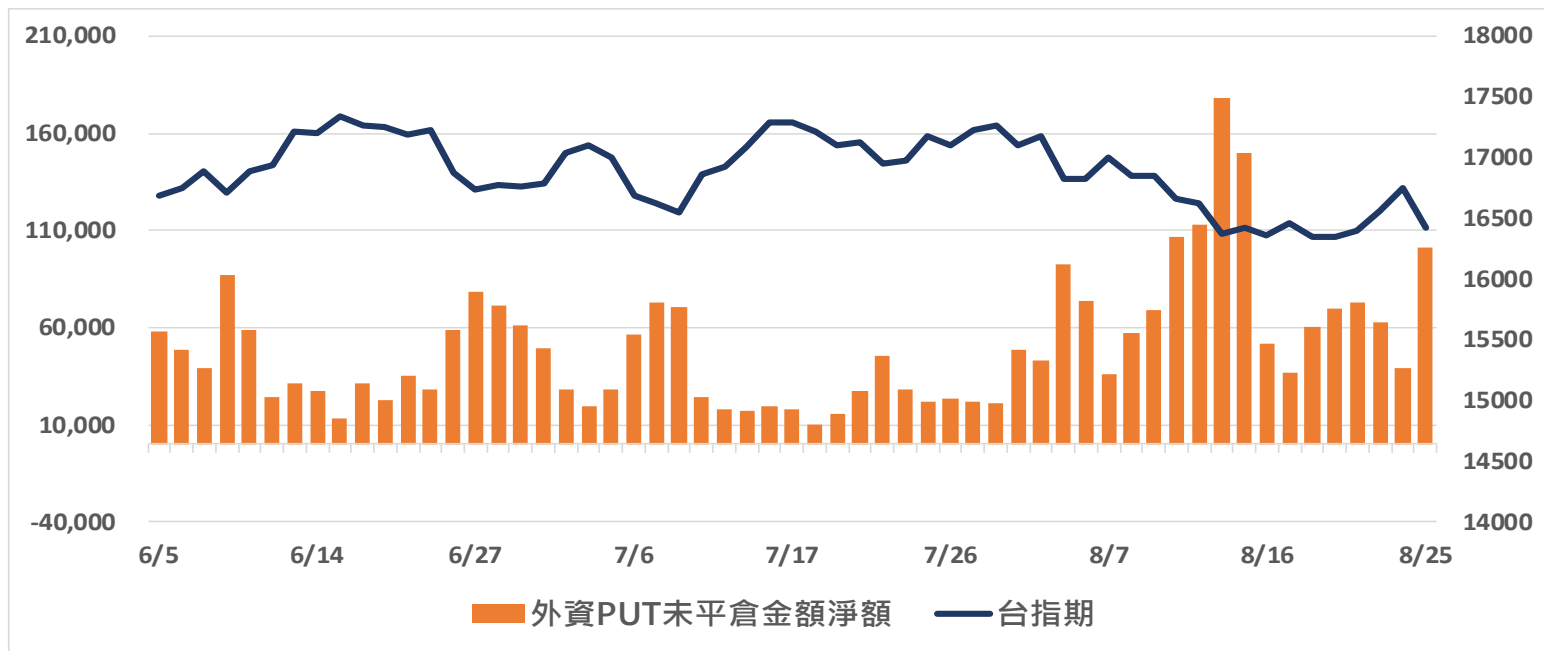
更新日期：2023年8月25日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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25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