

台指選擇權OI

日期：2023/8/28 結算日：2023/8/30					日期：2023/8/28 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
0	2	16,050	5,140	474	0	69	15,600	5,136	124
1	41	16,100	6,244	978	7	45	15,700	3,052	589 ※
9	41	16,150	6,058	1,155	-15	108	15,800	3,799	512
16	109	16,200	9,827	1,386	-1	27	15,900	2,554	239
33	85	16,250	7,325	1,364	2	152	16,000	8,511	-1,236
137	566	16,300	11,382	3,485 ※	2	146	16,100	3,217	79
249	626	16,350	8,155	1,709	28	1,139	16,200	6,612	-38
658	1,450	16,400	10,631	30	529	1,684	16,300	5,361	-26
313	3,123	16,450	8,082	2,850	31	1,912	16,400	2,469	425
694	4,626	16,500	7,845	2,690	96	2,739	16,500	2,763	73
879	6,598	16,550	4,459	794	30	5,620	16,600	2,553	-298
1,600	8,023	16,600	3,108	-342	-199	2,112	16,700	926	-22
1,913	6,769	16,650	1,835	282 ※	1,228	5,434	16,800	2,215	19
2,703	10,436	16,700	3,872	548	396	4,526	16,900	867	13
3,174	10,787	16,750	1,492	-160	705	9,779	17,000	901	-15
2,969	12,543	16,800	1,091	-78	240	5,070	17,100	127	-1
-2,185	16,835	16,850	540	-96	32	6,504	17,200	170	2
500	9,778	16,900	335	-49	67	5,162	17,300	80	0
-354	8,719	16,950	140	-57	-30	4,028	17,400	168	0
-49	9,330	17,000	111	-34	-20	4,119	17,500	108	21
-1,484	4,296	17,050	4	0	-6	3,616	17,600	70	4
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
8,292	135,217	0.9822	132,815	20,763	2,534	89,982	0.9063	81,549	716
昨日 P/C	0.8828	今日增減變化	0.0994		昨日 P/C	0.9244	今日增減變化	-0.0181	

更新日期：2023年8月28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	62,048,669	89,392,481	-27,343,812	11,539,639	942,442	2,560,842	-1,618,400	-38,158
投信	46,372,206	40,392,206	5,980,000	1,236,172	727,955	0	727,955	5,836
自營商	15,819,385	28,560,226	-12,740,841	-1,827,978	227,483	1,429,910	-1,202,427	105,808
	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	1,661,557	1,599,837	61,720	-310,919	108,893	11,462	97,431	-2,599
投信	43,853	0	43,853	486	0	0	0	0
自營商	219,267	1,097,984	-878,717	147,684	103,113	204,839	-101,726	6,880

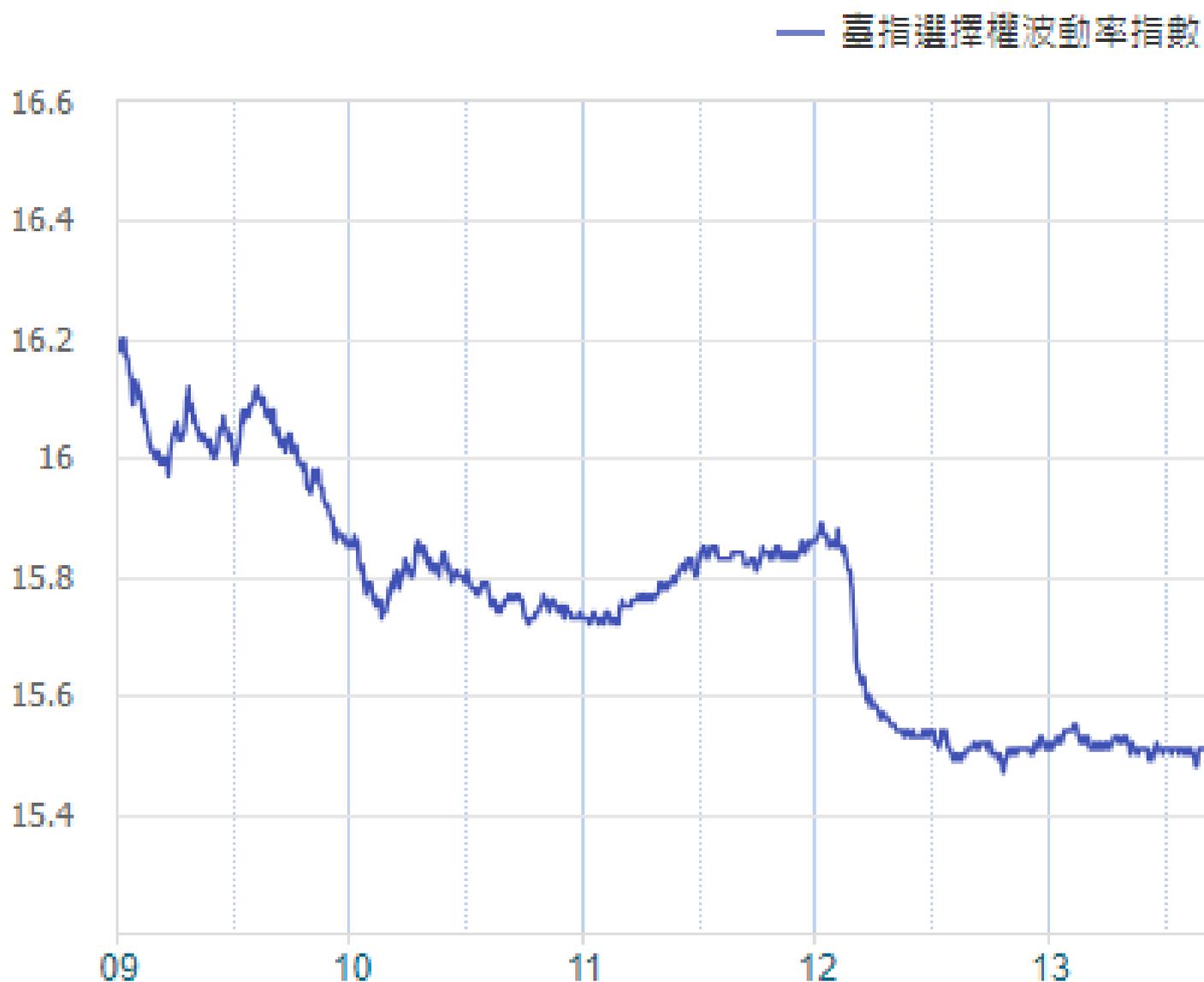
台指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數

	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	33,807	11,634	22,173	2,256	28,320	12,255	16,065	-1,393
投信	200	0	200	0	300	120	180	0
自營商	71,147	74,223	-3,076	7,759	62,932	58,936	3,996	-8,582
特定法人(週)	4,901	2,696	2,205	1,709	0	5,668	-5,668	21
特定法人(近月)	21,916	0	21,916	2,638	3,077	10,616	-7,539	1,223
特定法人(全月)	23,534	0	23,534	6,874	0	16,736	-16,736	1,230
十大交易人(週)	48,063	42,799	5,264	5,635	47,013	43,434	3,579	8,513
十大交易人(近月)	46,269	46,187	82	2,884	31,976	40,810	-8,834	-1,642
十大交易人(全月)	96,894	84,256	12,638	7,596	73,053	86,719	-13,666	6,088
全市場未沖銷(近月)			89,982	2,534			81,549	716
全市場未沖銷(全月)			260,914	16,383			241,548	25,510

更新日期：2023年8月28日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

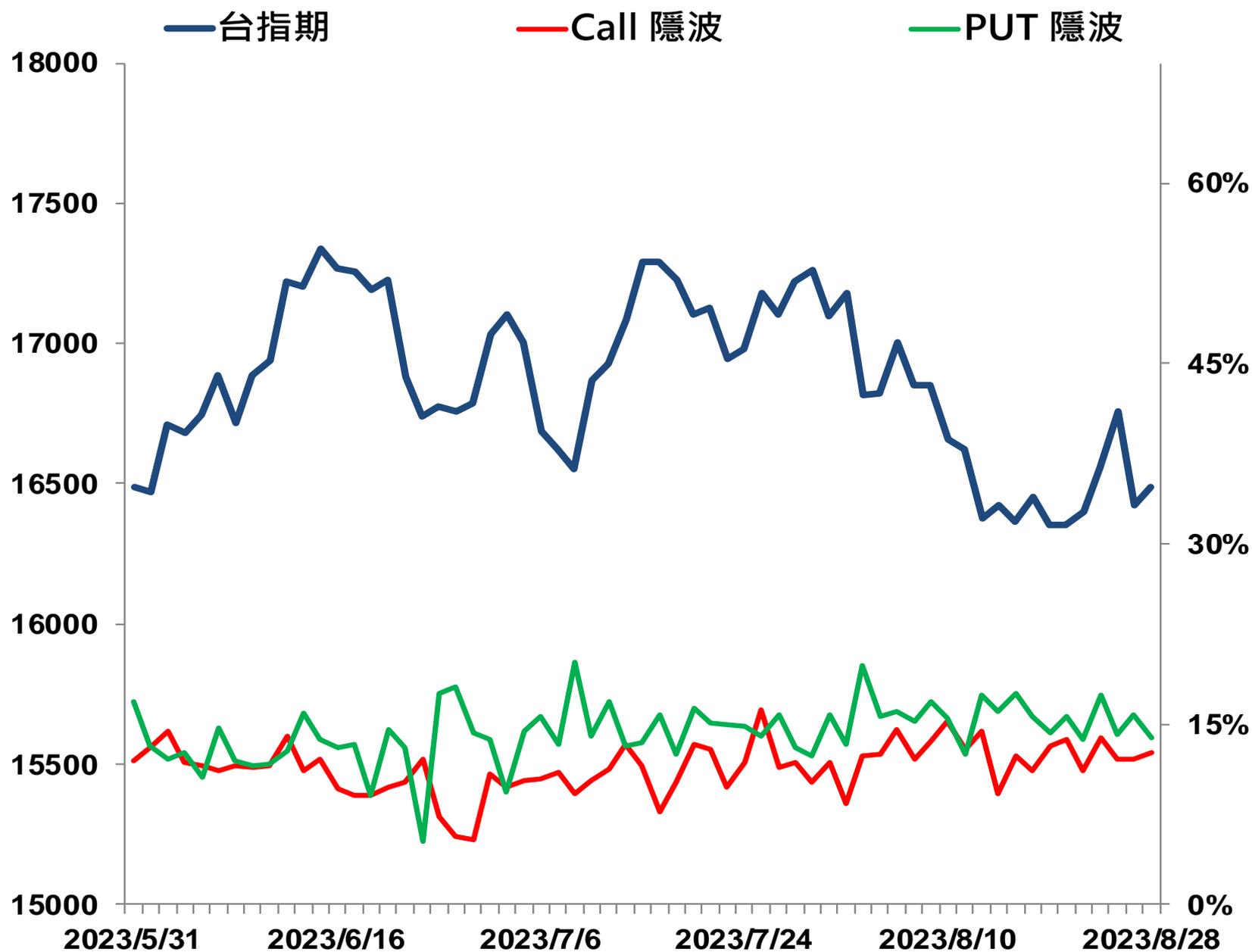
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月28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



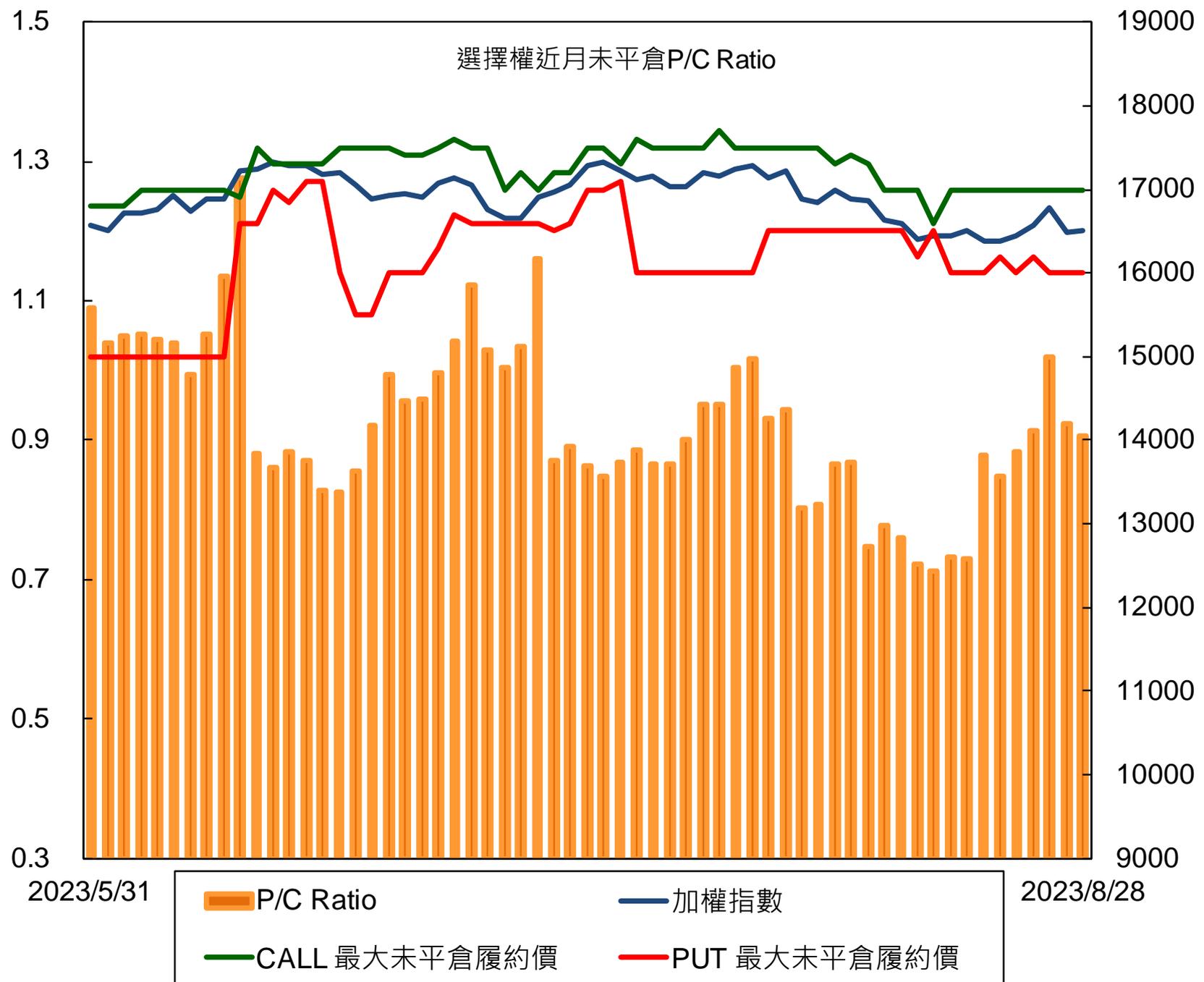
更新日期：2023年8月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考

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25日	67,106	77,941	-10,835
	8月28日	71,147	74,223	-3,076
Put	8月25日	65,421	52,843	12,578
	8月28日	62,932	58,936	3,996

更新日期：2023年8月28日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

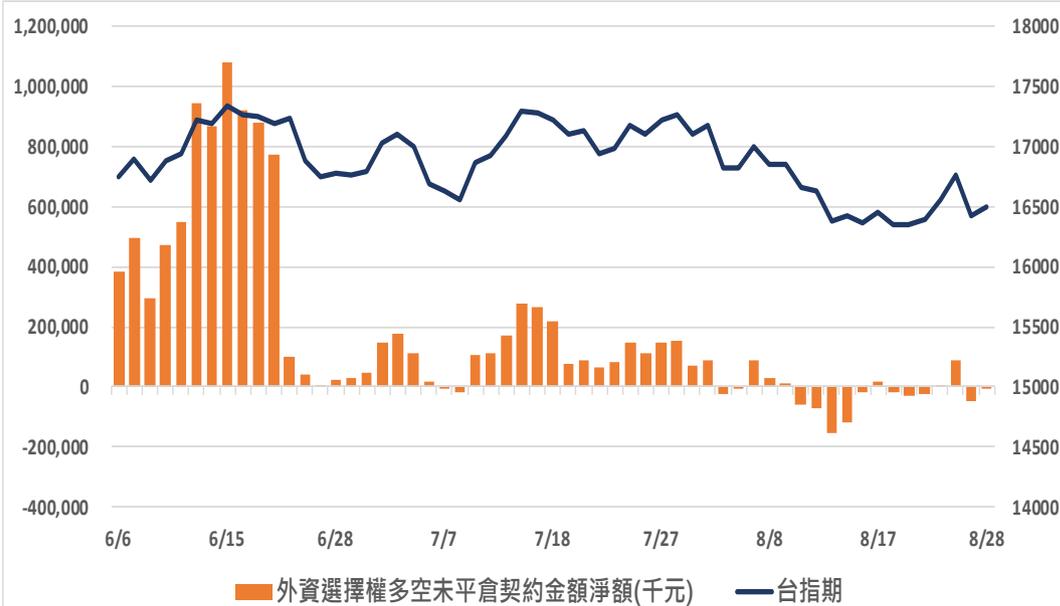
選擇權近月未平倉P/C Ratio



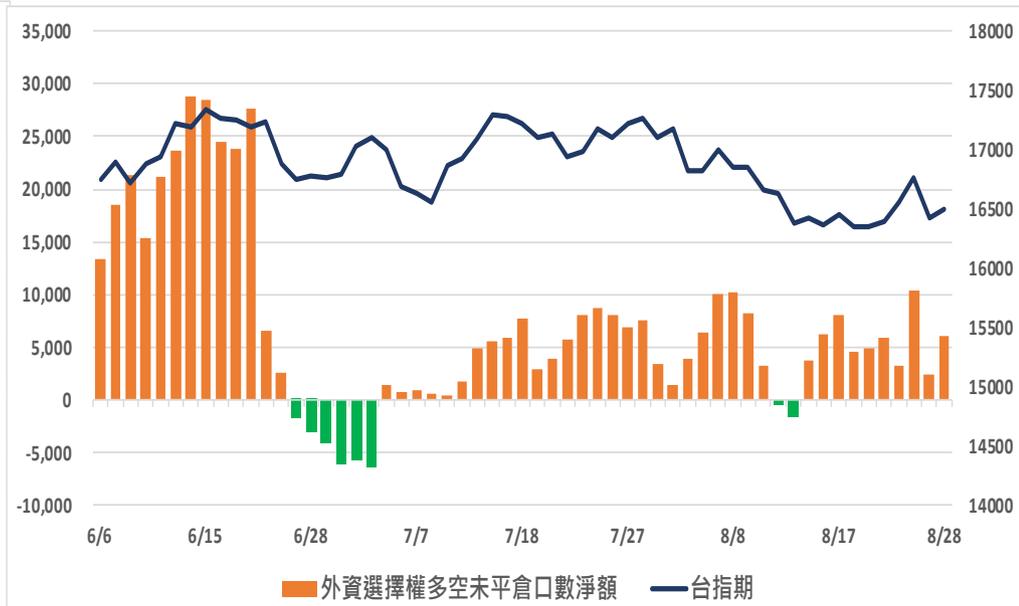
更新日期：2023年8月28日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



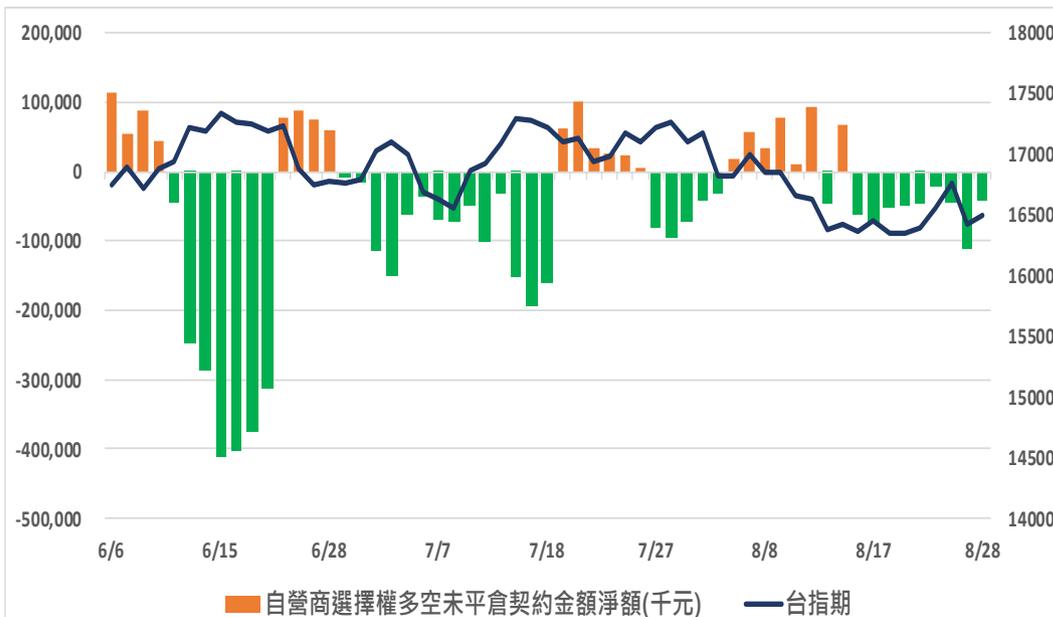
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/22	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
2023/8/28	16492	6,108	+3,649	-6,887	+39,401

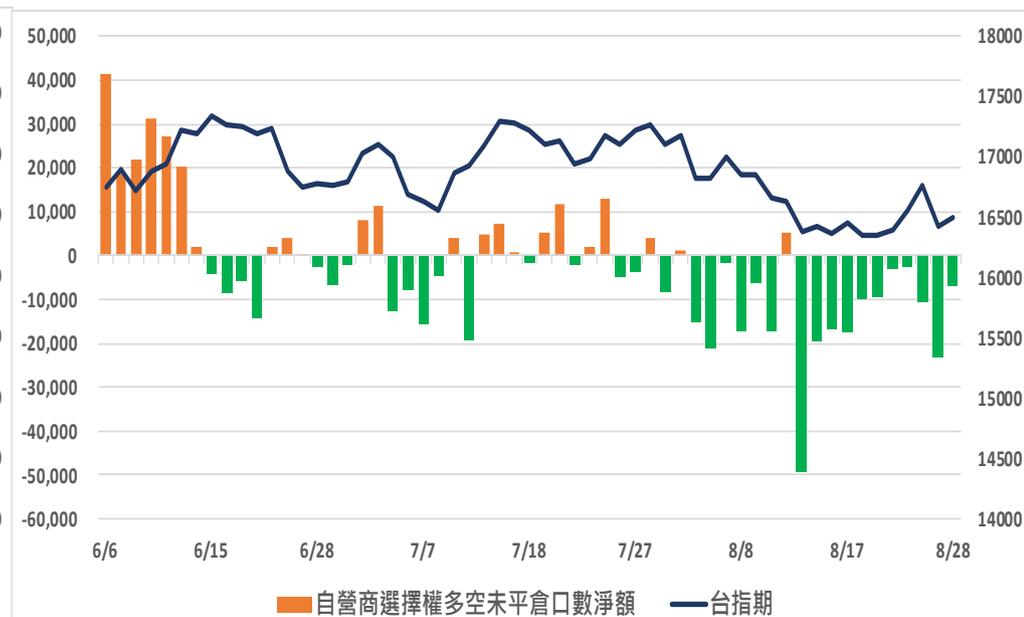
更新日期：2023年8月28日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



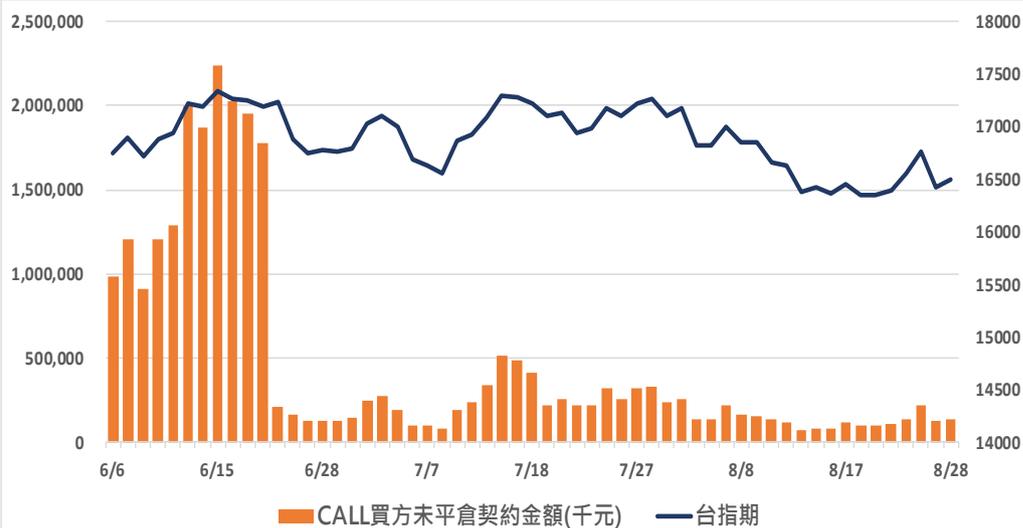
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/22	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
2023/8/28	16492	-7,072	+16,341	-41,899	+67,863

更新日期：2023年8月28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



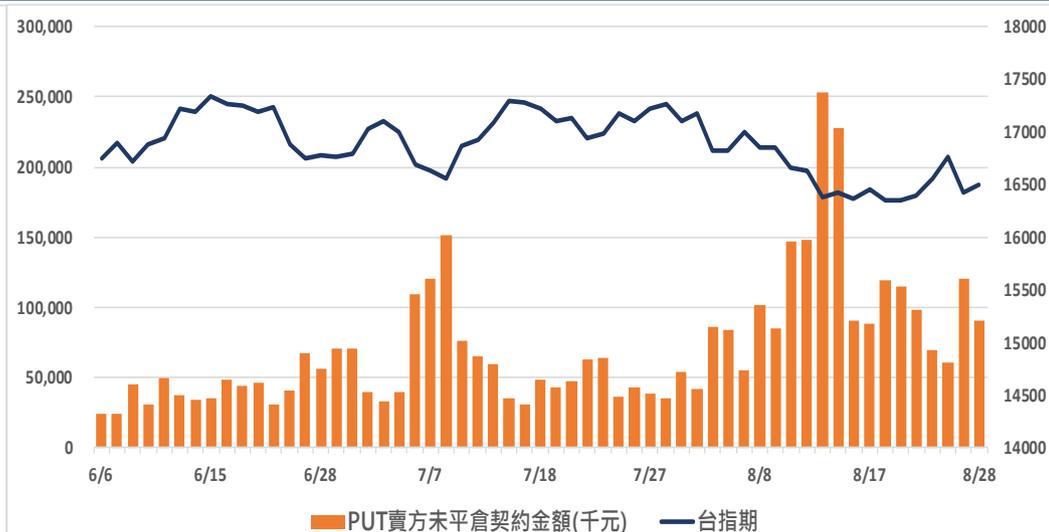
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



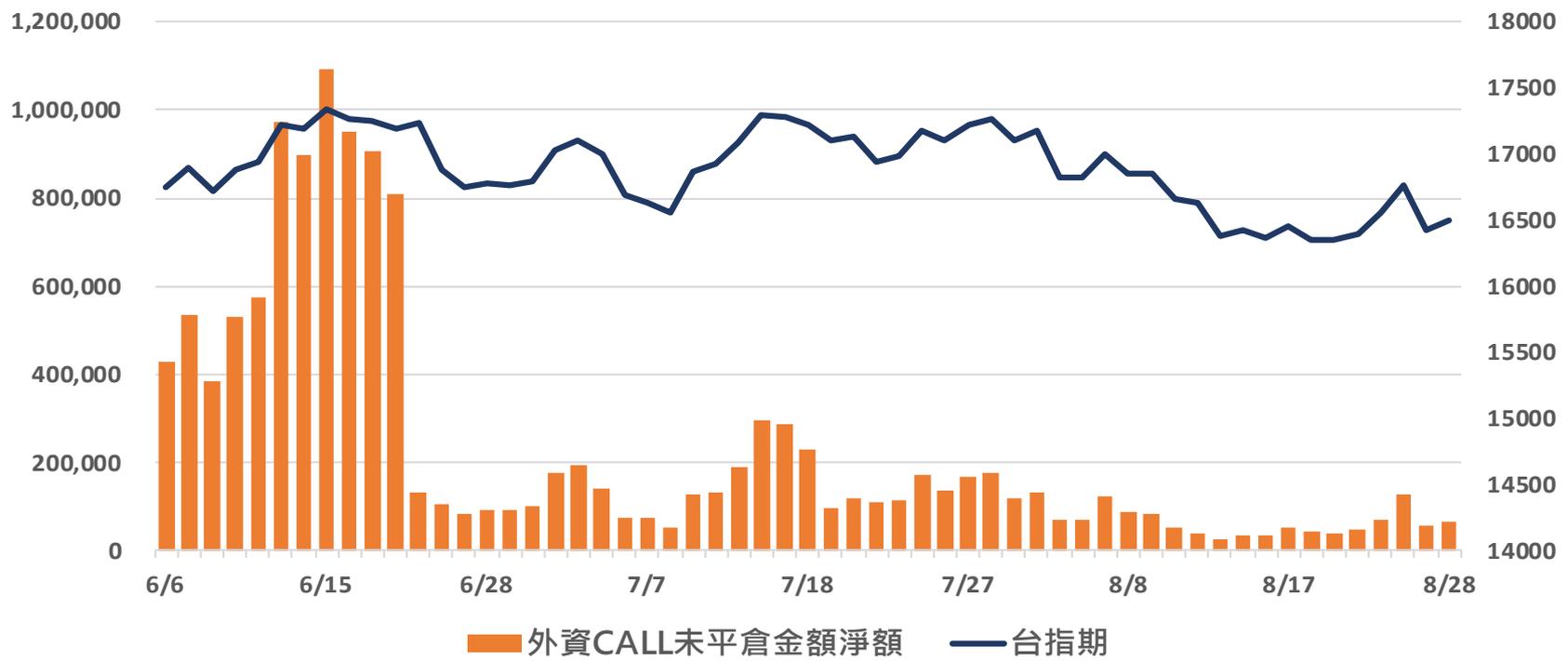
Sell Put未平倉金額



更新日期：2023年8月28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28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