

台指選擇權OI

日期：2023/8/29 結算日：2023/8/30					日期：2023/8/29 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	39	16,150	5,626	-432	-3	42	15,700	2,754	-298
-14	95	16,200	8,445	-1,382	4	112	15,800	4,003	204
-24	61	16,250	6,114	-1,211	0	27	15,900	2,860	306
-111	455	16,300	9,983	-1,399	-5	147	16,000	9,609	1,098
-12	614	16,350	8,503	348	6	152	16,100	3,464	247
-162	1,288	16,400	11,872	1,241	-65	1,074	16,200	8,269	1,657
7	3,130	16,450	10,267	2,185	154	1,838	16,300	5,515	154
-250	4,376	16,500	9,904	2,059	-217	1,695	16,400	2,675	206
-490	6,108	16,550	6,578	2,119	-173	2,566	16,500	2,855	92
-522	7,501	16,600	6,778	3,670	173	5,793	16,600	2,609	56
1,861	8,630	16,650	3,509	1,674	279	2,391	16,700	971	45
2,597	13,033	16,700	5,098	1,226	-68	5,366	16,800	2,189	-26
1,595	12,382	16,750	1,481	-11	-154	4,372	16,900	903	36
-775	11,768	16,800	962	-129	24	9,803	17,000	888	-13
-428	16,407	16,850	500	-40	455	5,525	17,100	95	-32
-953	8,825	16,900	315	-20	236	6,740	17,200	167	-3
-472	8,247	16,950	122	-18	340	5,502	17,300	81	1
-399	8,931	17,000	90	-21	182	4,210	17,400	163	-5
-383	3,913	17,050	4	0	-12	4,107	17,500	108	0
-607	4,929	17,100	17	3	8	3,624	17,600	70	0
-10	618	17,150	0	0	28	2,828	17,700	56	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
-29	135,188	1.0442	141,158	8,343	757	90,739	0.9359	84,919	3,370
昨日 P/C	0.9822	今日增減變化		0.0620	昨日 P/C	0.9063	今日增減變化		0.0296

更新日期：2023年8月29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	68,422,976	84,568,605	-16,145,629	11,198,183	955,774	2,605,467	-1,649,693	-31,293
投信	46,131,600	39,628,291	6,503,309	523,309	733,197	0	733,197	5,242
自營商	14,215,885	26,414,243	-12,198,358	542,483	301,125	1,345,280	-1,044,155	158,272
	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	1,670,152	1,506,732	163,420	101,700	107,182	11,587	95,595	-1,836
投信	44,123	0	44,123	270	0	0	0	0
自營商	227,154	1,125,973	-898,819	-20,102	117,210	220,042	-102,832	-1,106

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	34,497	11,714	22,783	610	29,770	12,702	17,068	1,003
投信	200	0	200	0	300	120	180	0
自營商	74,035	74,374	-339	2,737	63,155	61,420	1,735	-2,261
特定法人(週)	5,601	2,657	2,944	739	0	5,676	-5,676	-8
特定法人(近月)	21,634	0	21,634	-282	3,222	12,224	-9,002	-1,463
特定法人(全月)	20,254	0	20,254	-3,280	0	18,089	-18,089	-1,353
十大交易人(週)	51,095	46,263	4,832	-432	48,831	42,622	6,209	2,630
十大交易人(近月)	46,589	46,329	260	178	33,655	43,021	-9,366	-532
十大交易人(全月)	99,798	90,120	9,678	-2,960	76,189	88,726	-12,537	1,129
全市場未沖銷(近月)			90,739	757			84,919	3,370
全市場未沖銷(全月)			267,514	6,600			259,017	17,469

更新日期：2023年8月29日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

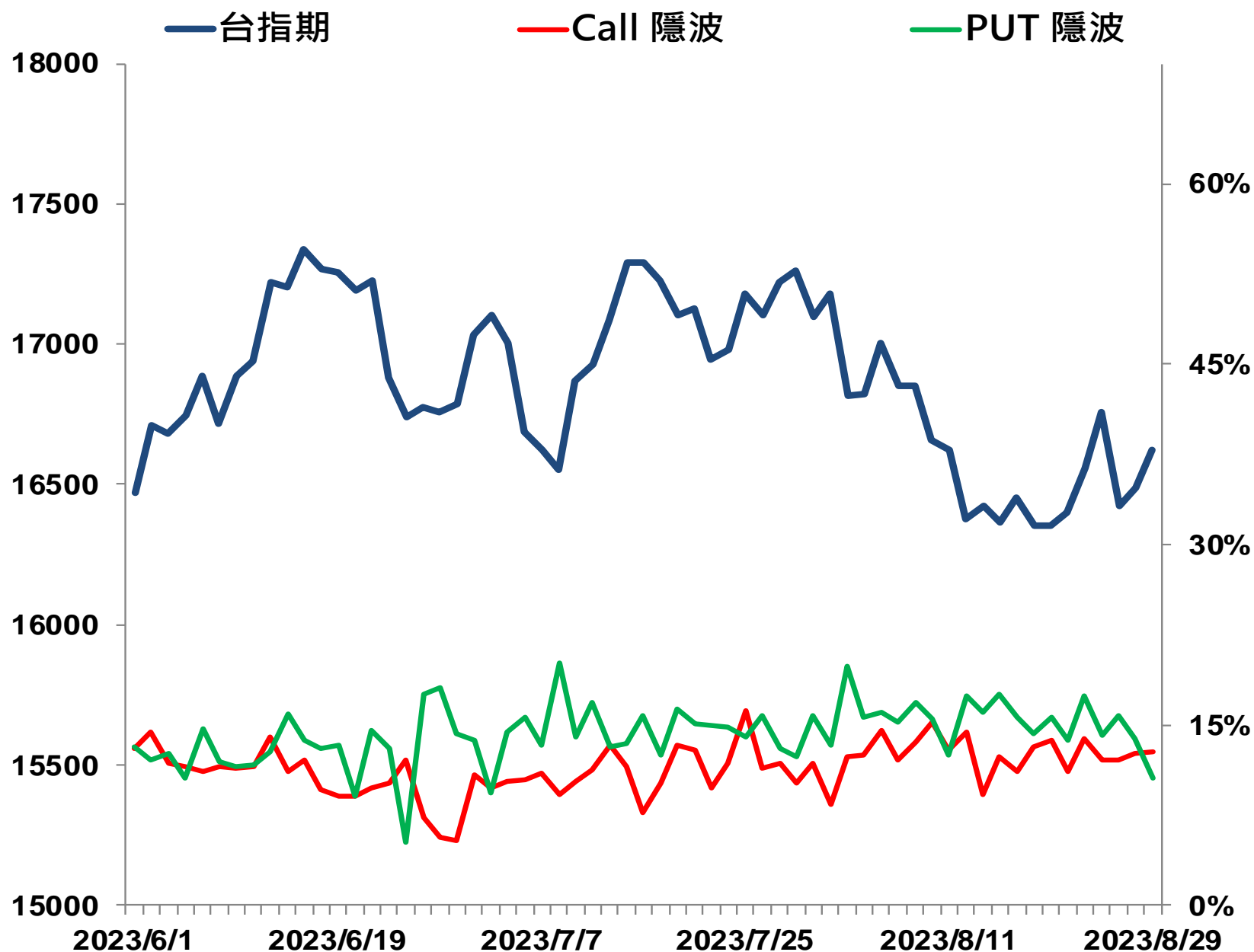
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月29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29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

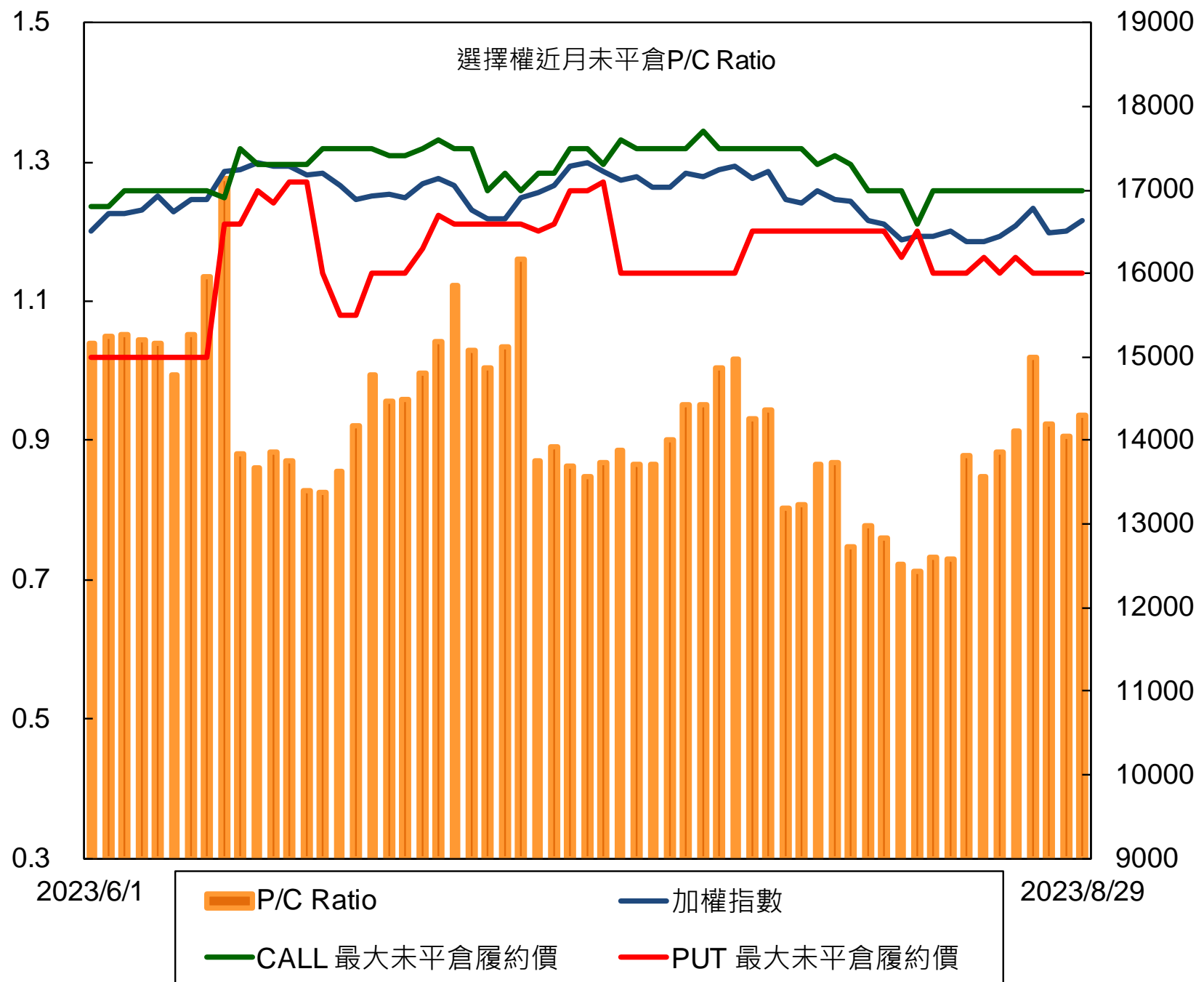
自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	8月28日	71,147	74,223	-3,076
	8月29日	74,035	74,374	-339
Put	8月28日	62,932	58,936	3,996
	8月29日	63,155	61,420	1,735

更新日期：2023年8月29日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



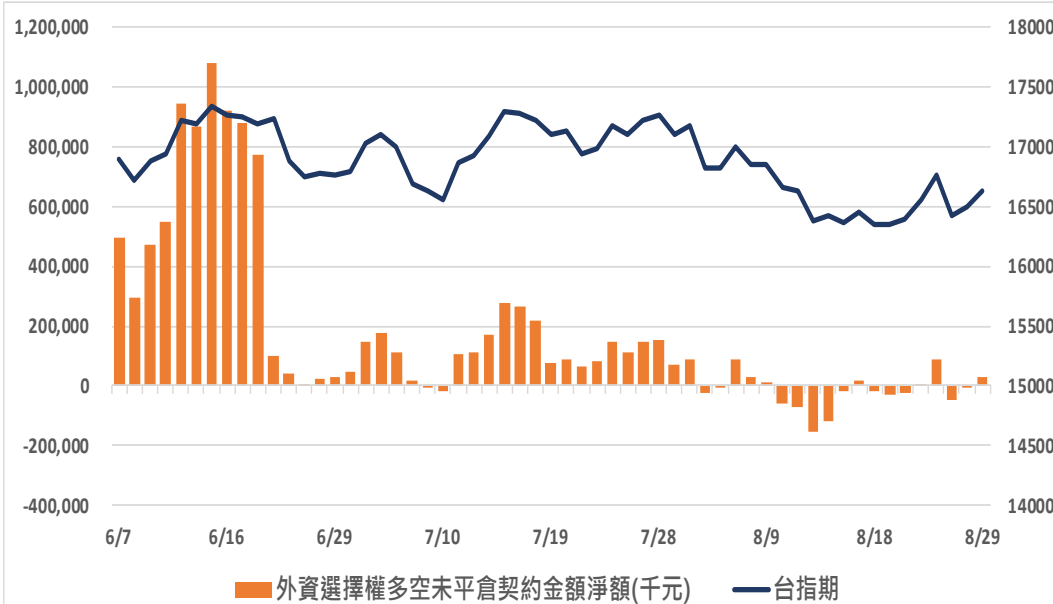
選擇權近月未平倉P/C Ratio



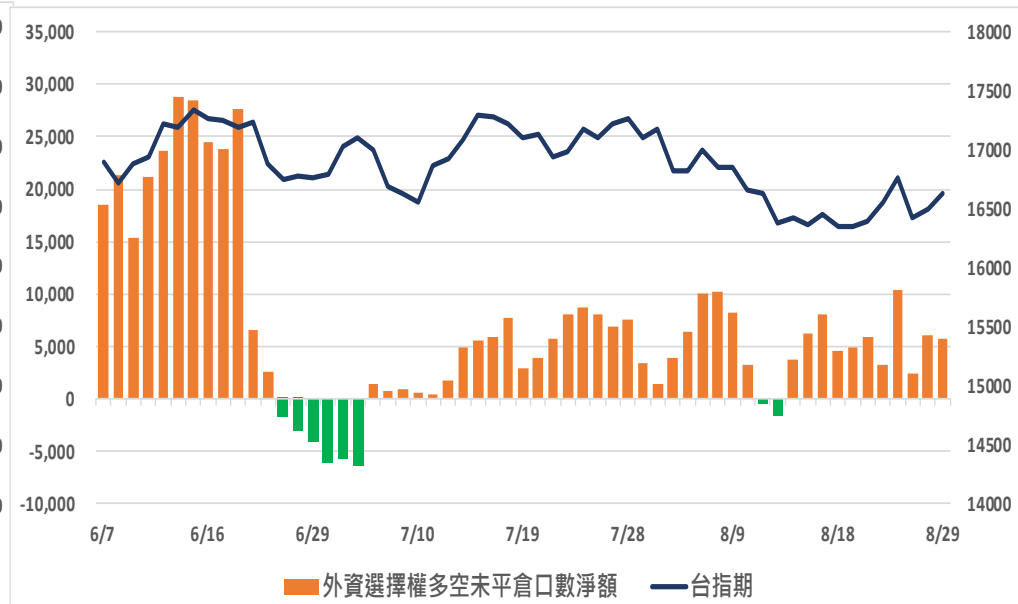
更新日期：2023年8月29日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



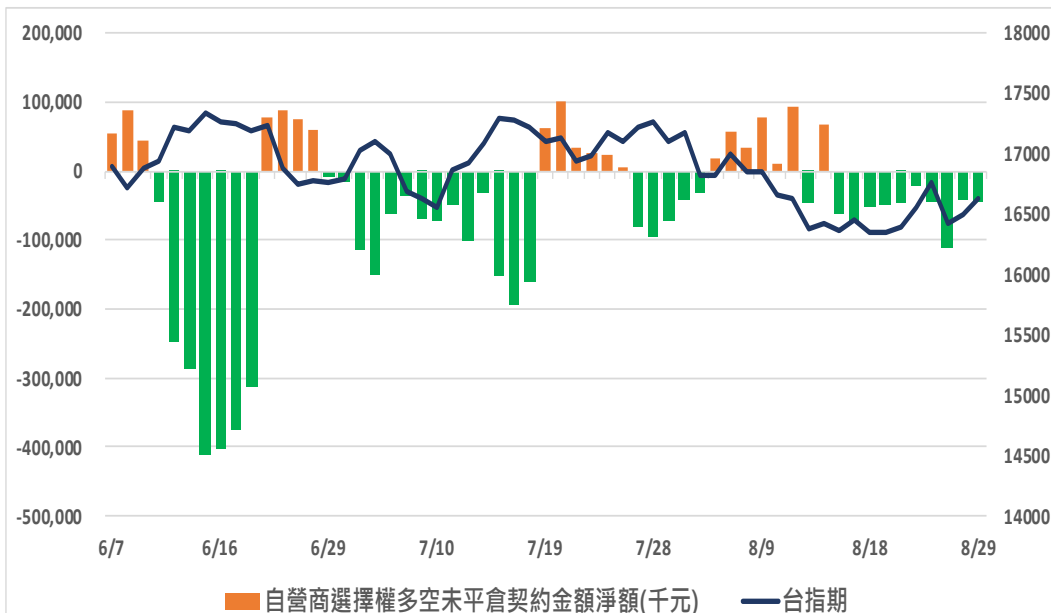
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/23	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
2023/8/29	16624	5,715	-393	26,583	+33,470

更新日期：2023年8月29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



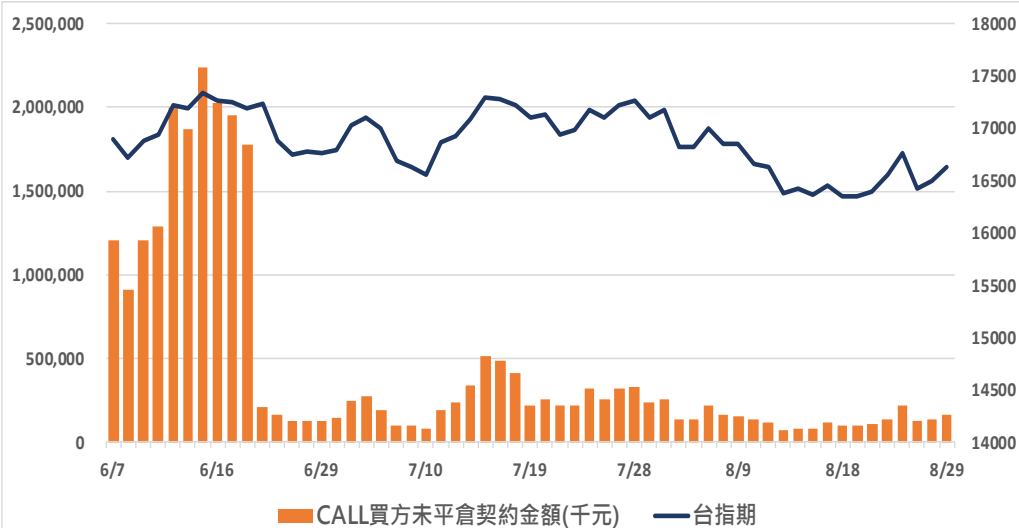
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/23	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
2023/8/29	16624	-2,074	+4,998	-43,024	-1,125

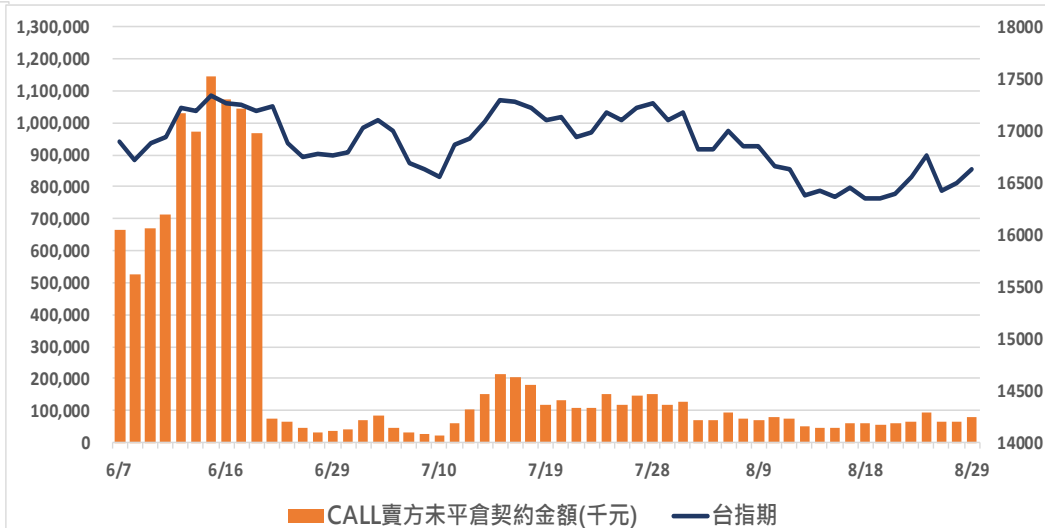
更新日期：2023年8月29日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



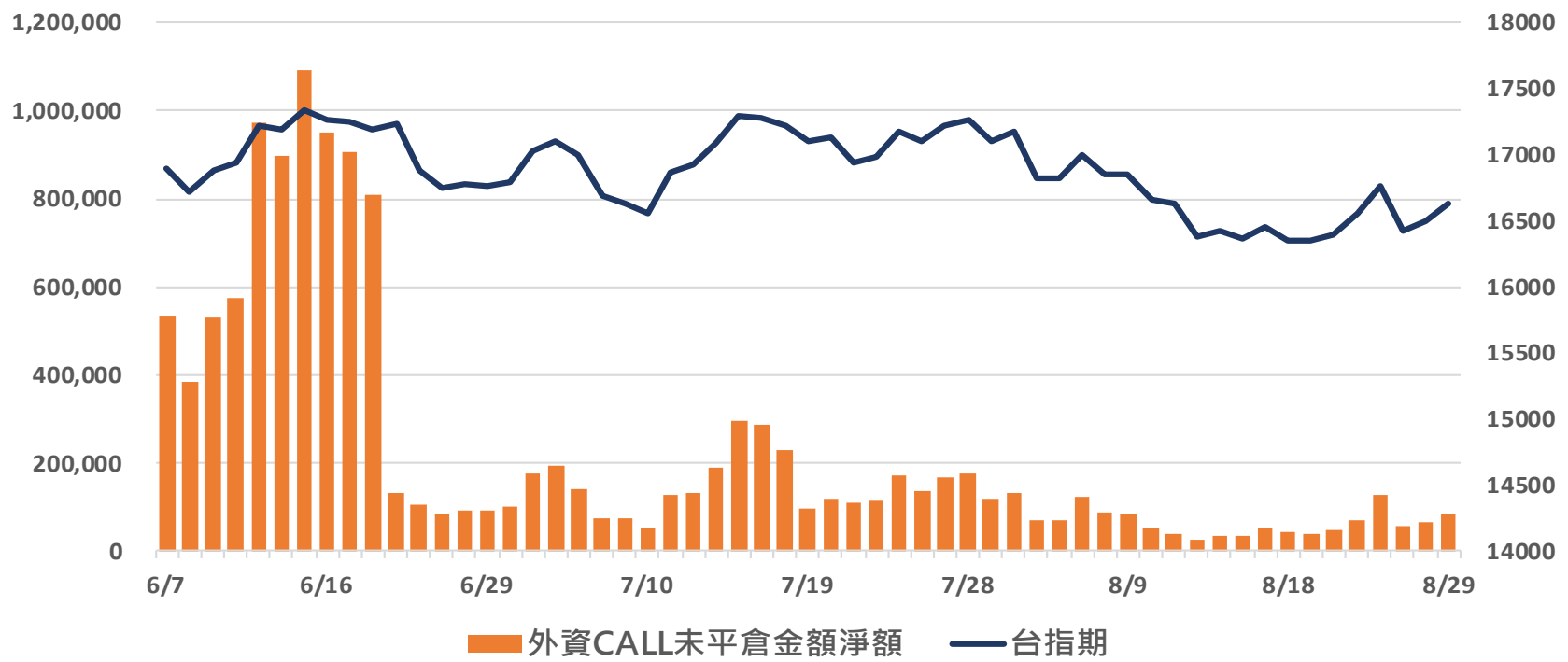
Sell Put未平倉金額



更新日期：2023年8月29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29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