

# 台指選擇權OI

日期：2023/8/30 結算日：2023/9/6					日期：2023/8/30 結算日：2023/9/20				
202309W1					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	20	16,250	1,863	778	-14	98	15,800	3,765	-238
1	21	16,300	2,675	1,483	-1	26	15,900	3,162	302
5	16	16,350	1,489	856	-8	139	16,000	10,141	532
-15	87	16,400	2,737	1,584	4	156	16,100	3,603	139
18	170	16,450	1,589	603	-113	961	16,200	8,420	151
-37	231	16,500	3,462	2,143	-366	1,472	16,300	6,820	1,305 ※
-69	276	16,550	1,913	1,267	-103	1,592	16,400	2,477	-198
83	743	16,600	3,591	3,321 ※	-814	1,752	16,500	2,635	-220
130	626	16,650	1,284	1,157	-366	5,427	16,600	3,664	1,055
213	896	16,700	1,815	1,597	-289	2,102	16,700	1,185	214
516	1,132	16,750	823	755	94	5,460	16,800	2,640	451
492	1,699	16,800	500	439	17	4,389	16,900	911	8
1,301	2,065	16,850	120	85	-798	9,005	17,000	937	49
1,114	3,026	16,900	165	149	77	5,602	17,100	129	34
575	1,856	16,950	63	38	369	7,109	17,200	171	4
1,819	3,559	17,000	103	74 ※	706	6,208	17,300	82	1
1,958	3,273	17,050	9	9	511	4,721	17,400	163	0
2,241	3,298	17,100	41	38	-11	4,096	17,500	112	4
1,206	2,543	17,200	6	5	61	3,685	17,600	70	0
601	1,195	17,300	7	7	34	2,862	17,700	56	0
1,284	1,674	17,400	0	0	1	2,276	17,800	103	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
13,700	29,681	1.4060	41,731	26,322	-726	90,013	0.9771	87,951	3,032
昨日 P/C	1.0442	今日增減變化	0.3618		昨日 P/C	0.9359	今日增減變化	0.0412	

更新日期：2023年8月30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	64,602,811	86,991,902	-22,389,091	-6,243,462	1,025,118	2,828,140	-1,803,022	-153,329
投信	43,881,152	38,432,799	5,448,353	-1,054,956	738,349	0	738,349	5,152
自營商	15,333,773	25,551,544	-10,217,771	1,980,587	392,244	1,183,335	-791,091	253,064
	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	1,672,806	1,456,538	216,268	52,848	107,574	10,176	97,398	1,803
投信	44,237	0	44,237	114	0	0	0	0
自營商	176,947	1,192,764	-1,015,817	-116,998	114,732	215,032	-100,300	2,532

## 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	29,712	7,337	22,375	-408	22,524	10,543	11,981	-5,087
投信	200	0	200	0	300	120	180	0
自營商	56,222	56,462	-240	99	45,963	49,414	-3,451	-5,186
特定法人(週)	2,226	0	2,226	---	0	1,100	-1,100	---
特定法人(近月)	22,185	1,690	20,495	-1,139	3,203	11,616	-8,413	589
特定法人(全月)	25,416	0	25,416	5,162	4,666	13,366	-8,700	9,389
十大交易人(週)	17,396	11,621	5,775	---	19,299	18,479	820	---
十大交易人(近月)	46,777	46,293	484	224	36,368	43,127	-6,759	2,607
十大交易人(全月)	77,484	68,884	8,600	-1,078	58,165	69,473	-11,308	1,229
全市場未沖銷(近月)			90,013	-726			87,951	3,032
全市場未沖銷(全月)			152,000	-115,514			151,873	-107,144

更新日期：2023年8月30日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

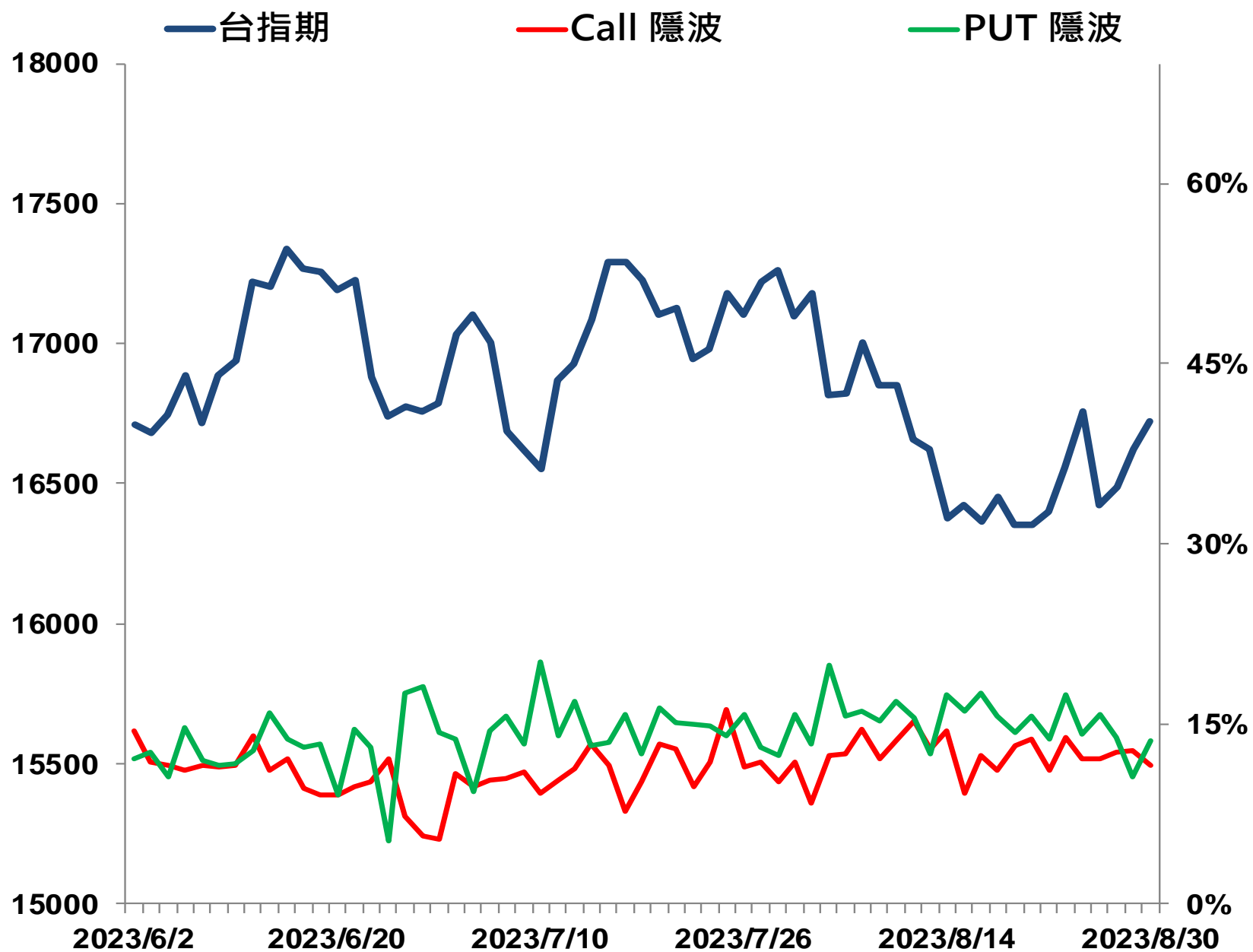
# 選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月30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30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

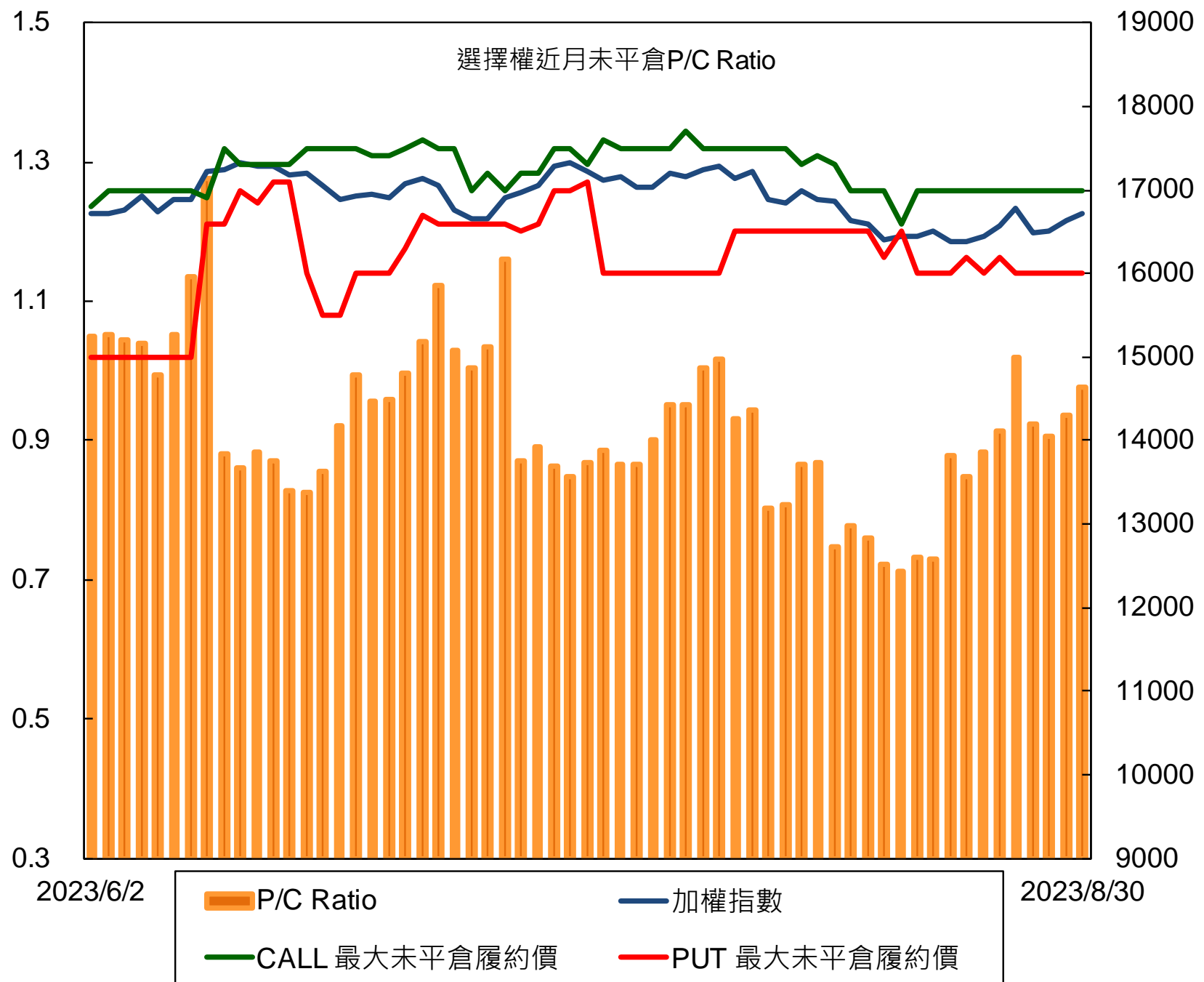
# 自營商選擇權OI部位統計

	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29日	74,035	74,374	<b>-339</b>
	8月30日	56,222	56,462	<b>-240</b>
<b>Put</b>	8月29日	63,155	61,420	1,735
	8月30日	45,963	49,414	<b>-3,451</b>

更新日期：2023年8月30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



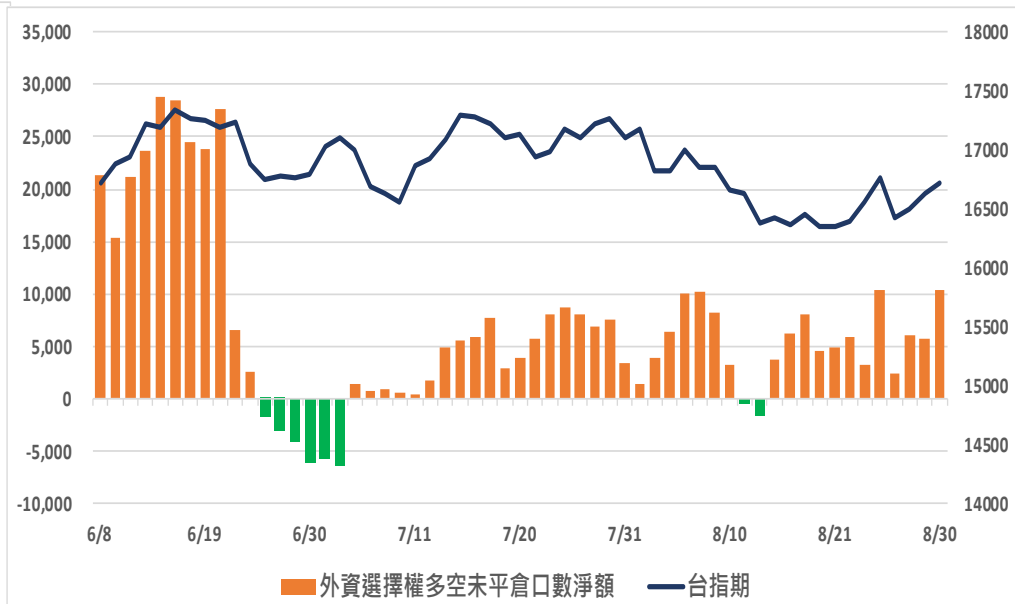
更新日期：2023年8月30日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



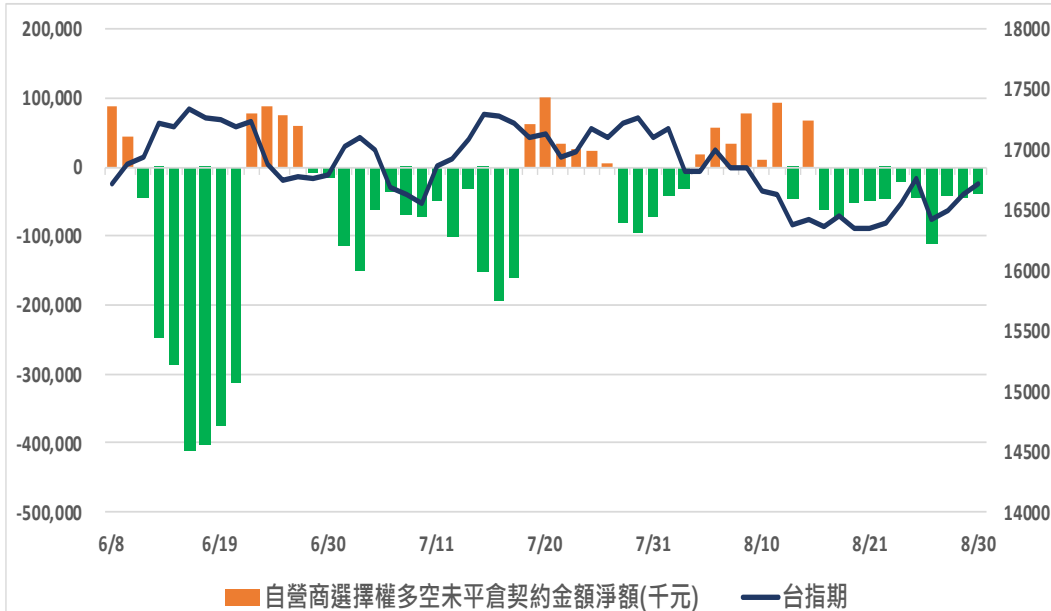
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/24	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
2023/8/30	16723	10,394	+4,679	44,983	+18,400

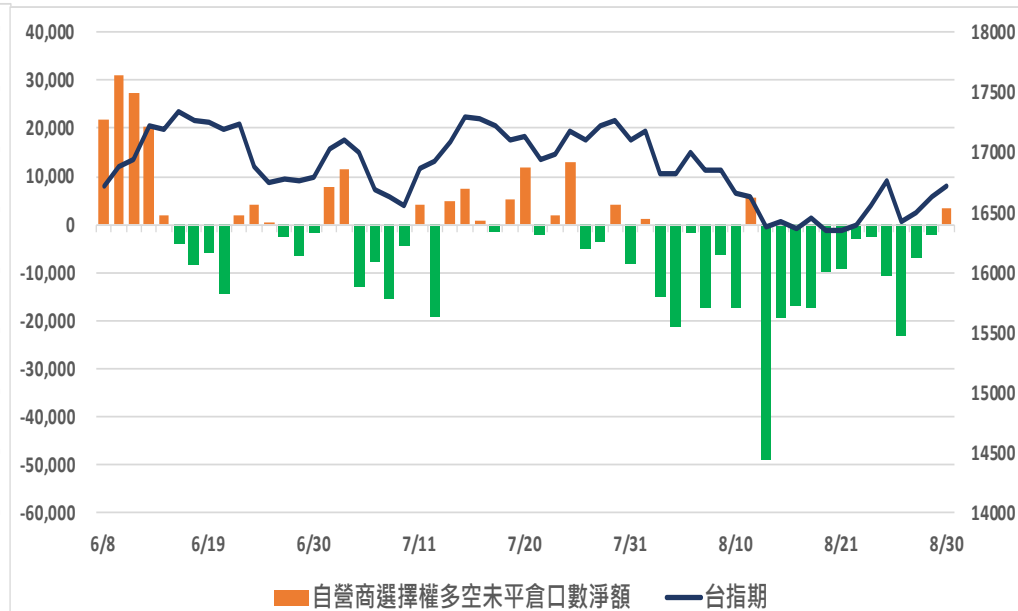
更新日期：2023年8月30日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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
2023/8/24	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
2023/8/30	16723	3,211	+5,285	-37,865	+5,159

更新日期：2023年8月30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



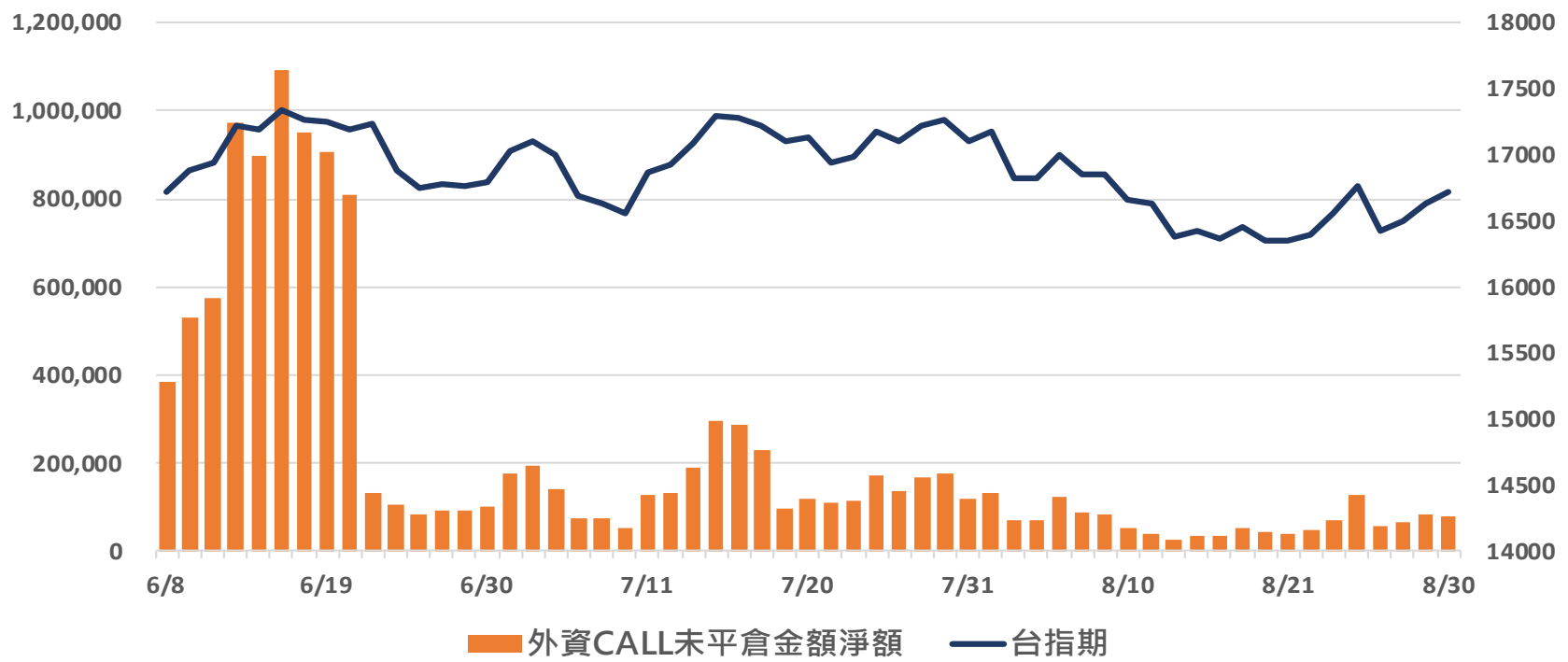
## Sell Put未平倉金額



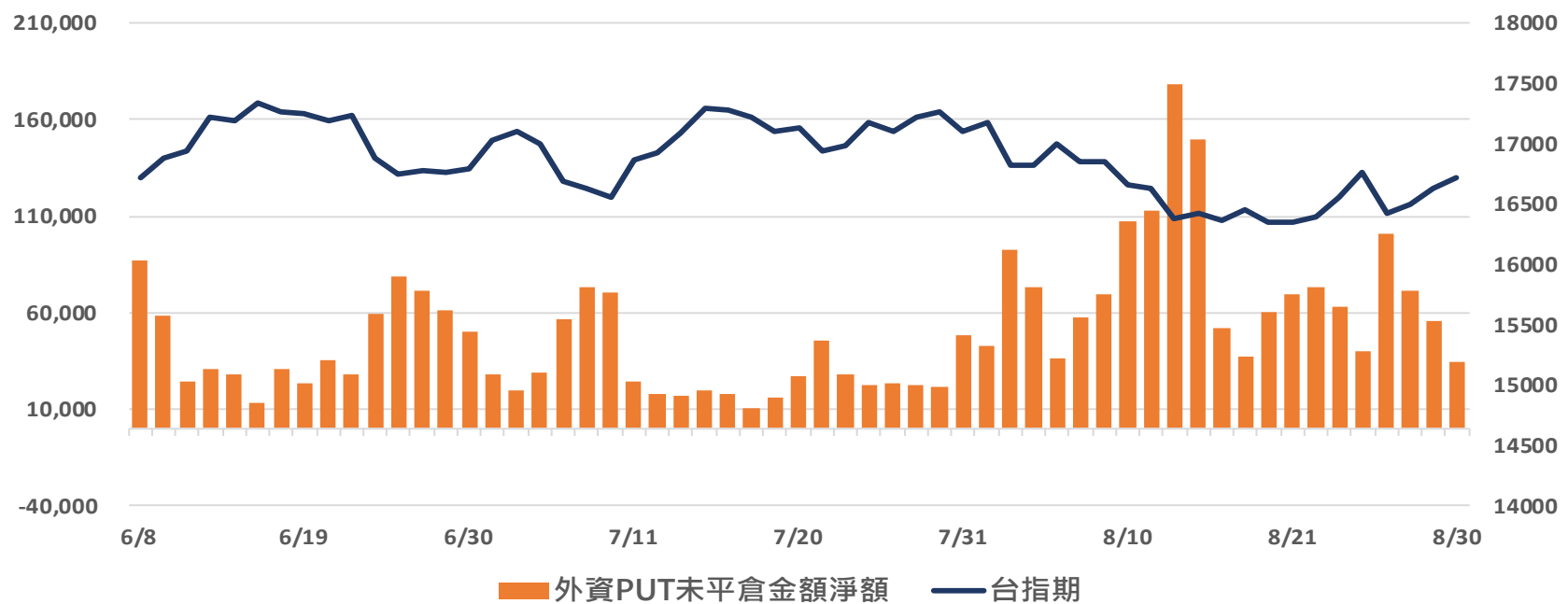
更新日期：2023年8月30日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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30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