

台指選擇權OI

日期：2023/8/31 結算日：2023/9/6					日期：2023/8/31 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
-9	10	16,200	2,131	204	0	41	15,700	2,469	49
2	22	16,250	3,839	1,976	0	98	15,800	3,406	-359
7	28	16,300	5,123	2,448	0	26	15,900	3,138	-24
0	16	16,350	4,350	2,861	1	140	16,000	9,384	-757
14	101	16,400	5,590	2,853	1	157	16,100	4,872	1,269
28	198	16,450	3,947	2,358	-30	931	16,200	8,664	244
255	486	16,500	5,548	2,086	331	1,803	16,300	6,827	7
479	755	16,550	4,403	2,490	2	1,594	16,400	2,519	42
703	1,446	16,600	5,723	2,132	81	1,833	16,500	2,865	230
1,833	2,459	16,650	2,401	1,117	135	5,562	16,600	3,551	-113
3,320	4,216	16,700	2,695	880	832	2,934	16,700	1,205	20
2,686	3,818	16,750	1,473	650	436	5,896	16,800	2,236	-404
4,005	5,704	16,800	731	231	264	4,653	16,900	958	47
2,960	5,025	16,850	394	274	420	9,425	17,000	962	25
5,269	8,295	16,900	325	160	-137	5,465	17,100	127	-2
2,286	4,142	16,950	148	85	655	7,764	17,200	170	-1
4,926	8,485	17,000	123	20	813	7,021	17,300	80	-2
1,531	4,804	17,050	10	1	-284	4,437	17,400	137	-26
744	4,042	17,100	72	31	472	4,568	17,500	111	-1
189	1,443	17,150	9	1	60	3,745	17,600	70	0
987	3,530	17,200	7	1	-54	2,808	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
32,634	63,569	1.0643	67,654	25,915	3,402	93,415	0.9396	87,777	-174
昨日 P/C	1.4060	今日增減變化	-0.3417		昨日 P/C	0.9771	今日增減變化	-0.0374	

更新日期：2023年8月31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	59,525,079	87,616,440	-28,091,361	-5,702,270	991,416	2,768,112	-1,776,696	26,326
投信	41,895,696	38,727,924	3,167,772	-2,280,581	732,928	0	732,928	-5,421
自營商	19,215,672	25,042,065	-5,826,393	4,391,378	323,942	1,279,357	-955,415	-164,324
	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	1,617,747	1,455,472	162,275	-53,993	108,698	8,696	100,002	2,604
投信	38,942	0	38,942	-5,295	0	0	0	0
自營商	175,241	1,195,890	-1,020,649	-4,832	125,979	228,874	-102,895	-2,595

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	33,906	8,587	25,319	2,944	28,581	10,989	17,592	5,611
投信	200	0	200	0	300	120	180	0
自營商	56,496	69,368	-12,872	-12,632	56,292	54,051	2,241	5,692
特定法人(週)	3,632	0	3,632	1,406	0	1,100	-1,100	0
特定法人(近月)	21,226	1,820	19,406	-1,089	1,440	15,680	-14,240	-5,827
特定法人(全月)	28,000	0	28,000	2,584	2,843	19,012	-16,169	-7,469
十大交易人(週)	20,678	22,200	-1,522	-7,297	27,098	32,359	-5,261	-6,081
十大交易人(近月)	46,670	47,634	-964	-1,448	36,283	43,561	-7,278	-519
十大交易人(全月)	78,890	78,799	91	-8,509	64,273	83,964	-19,691	-8,383
全市場未沖銷(近月)			93,415	3,402			87,777	-174
全市場未沖銷(全月)			193,427	41,427			183,984	32,111

更新日期：2023年8月31日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

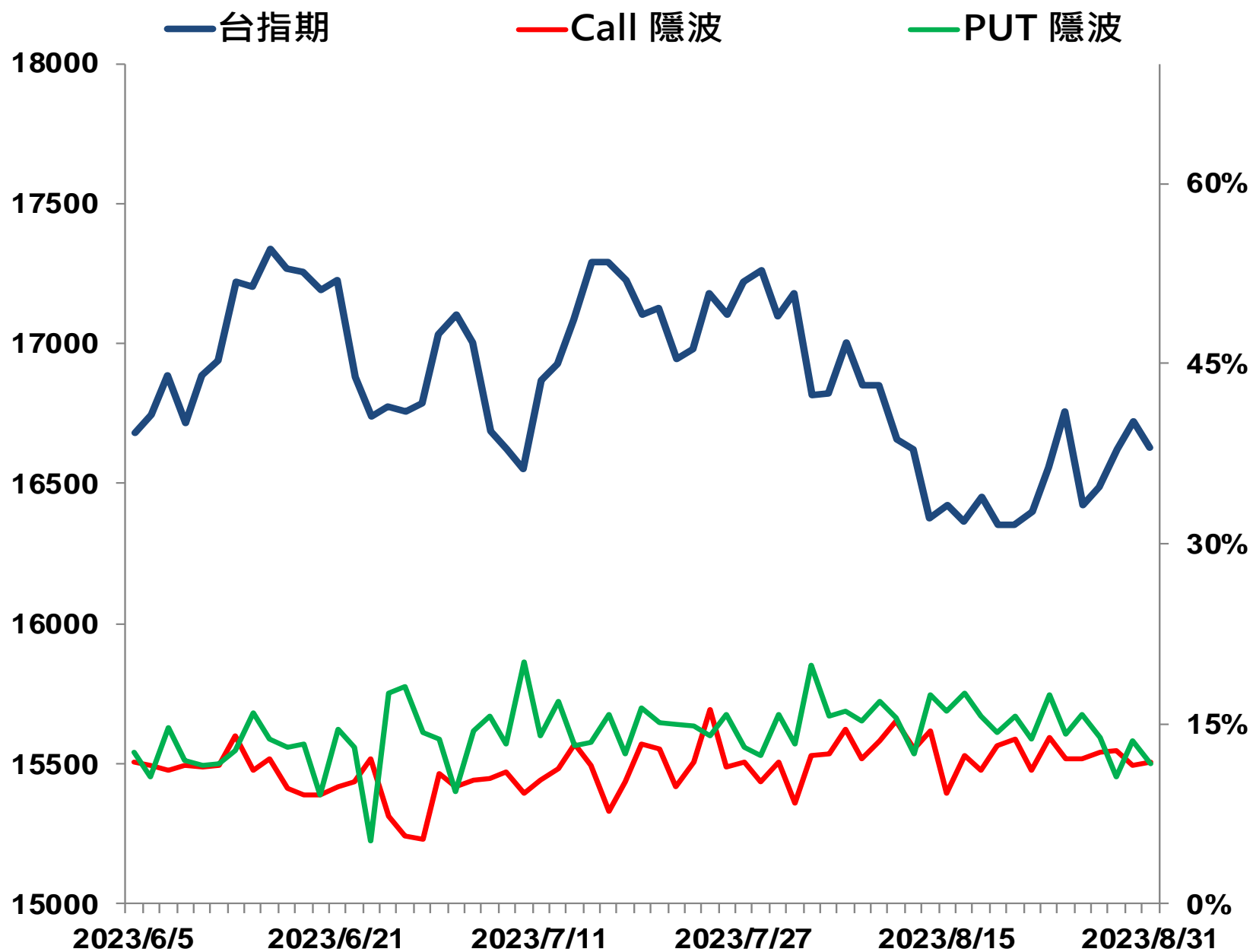
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年8月31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31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

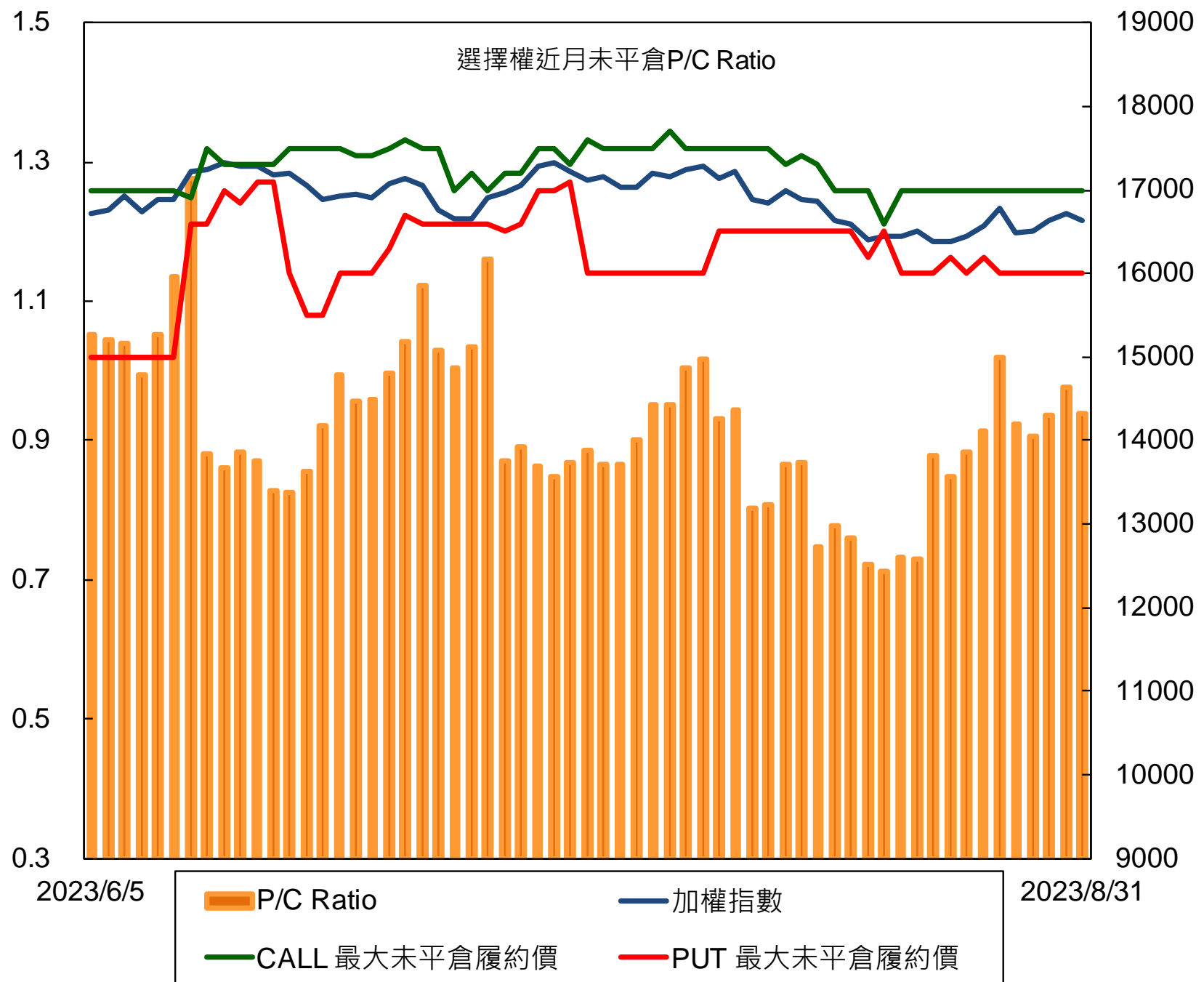
自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	8月30日	56,222	56,462	-240
	8月31日	56,496	69,368	-12,872
Put	8月30日	45,963	49,414	-3,451
	8月31日	56,292	54,051	2,241

更新日期：2023年8月31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



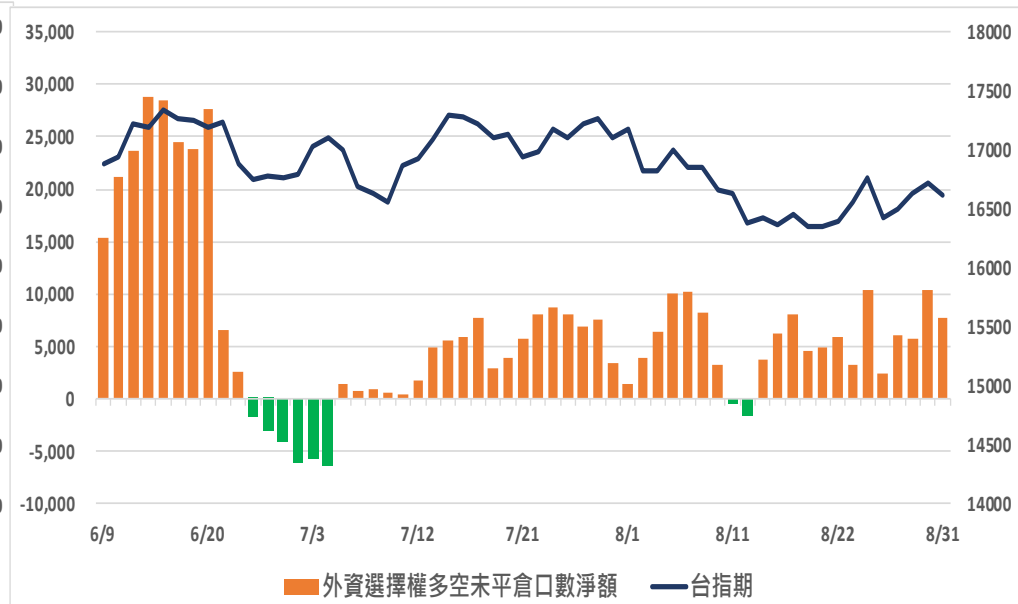
更新日期：2023年8月31日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



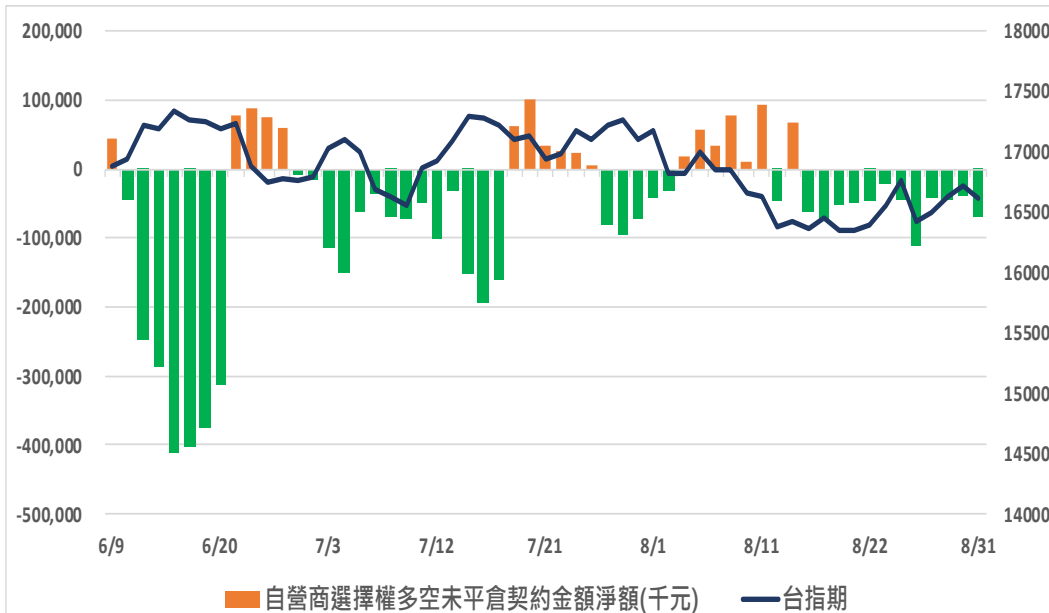
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/25	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
2023/8/31	16620	7,727	-2,667	4,849	-40,134

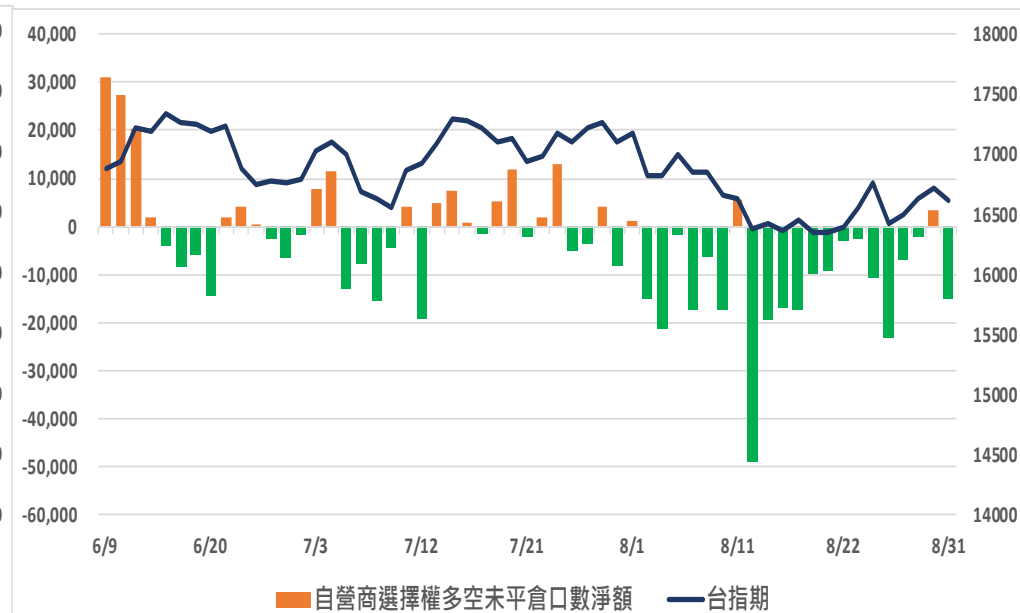
更新日期：2023年8月31日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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
2023/8/25	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
2023/8/31	16620	-15,113	-18,324	-69,204	-31,339

更新日期：2023年8月31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



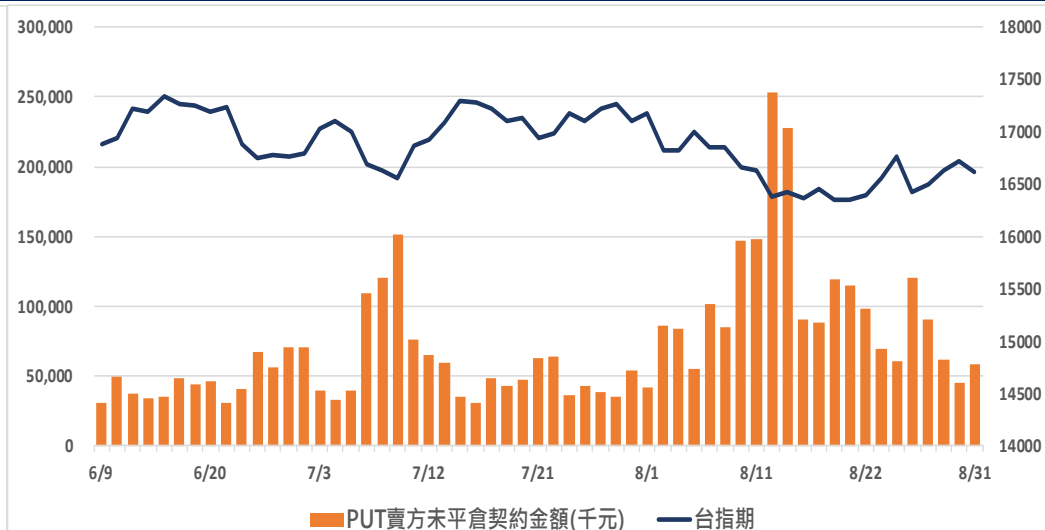
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



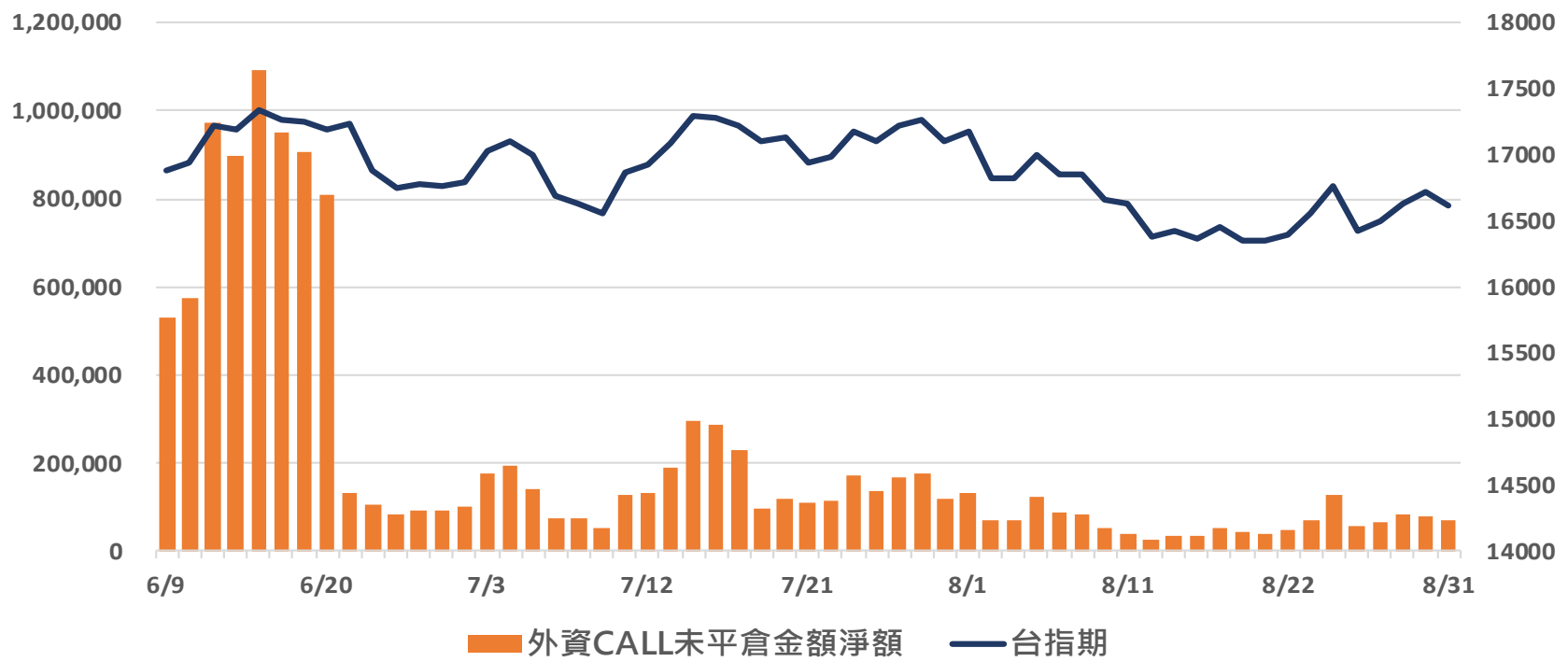
Sell Put未平倉金額



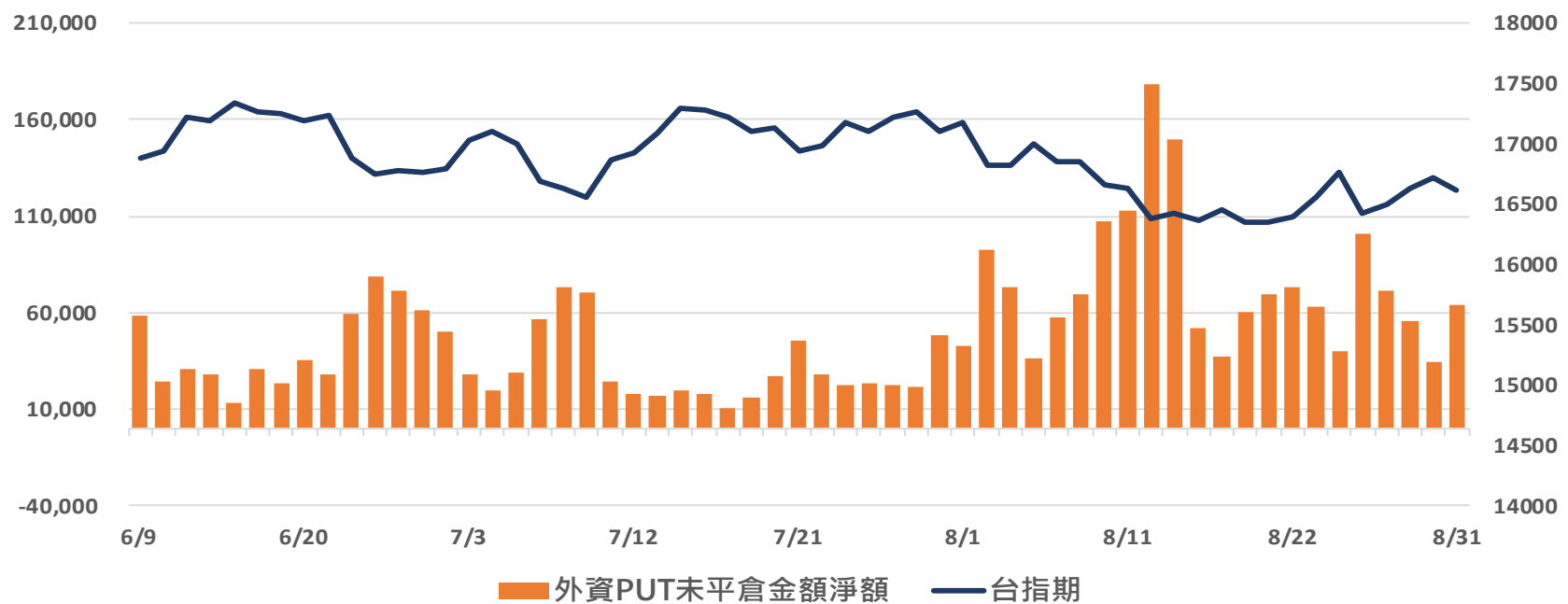
更新日期：2023年8月31日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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31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