

台指選擇權OI

日期：2023/9/1 結算日：2023/9/6					日期：2023/9/1 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	10	16,200	3,110	979	-1	40	15,700	2,347	-122
0	22	16,250	4,402	563	0	98	15,800	4,123	717 ※
1	29	16,300	5,258	135	-2	24	15,900	3,159	21
36	52	16,350	5,860	1,510	-9	131	16,000	9,827	443
23	124	16,400	7,682	2,092	-1	156	16,100	4,674	-198
103	301	16,450	6,575	2,628	-2	929	16,200	9,275	611
530	1,016	16,500	8,444	2,896	147	1,950	16,300	7,102	275
78	833	16,550	7,359	2,956 ※	-38	1,556	16,400	2,915	396
-39	1,407	16,600	8,425	2,702	8	1,841	16,500	3,192	327
489	2,948	16,650	3,937	1,536	88	5,650	16,600	4,022	471
-17	4,199	16,700	3,734	1,039	247	3,181	16,700	1,218	13
60	3,878	16,750	1,875	402	494	6,390	16,800	2,486	250
15	5,719	16,800	748	17	331	4,984	16,900	997	39
1,638	6,663	16,850	535	141	360	9,785	17,000	987	25
1,782	10,077	16,900	359	34	122	5,587	17,100	138	11
※ 2,913	7,055	16,950	117	-31	547	8,311	17,200	182	12
958	9,443	17,000	123	0	※ 754	7,775	17,300	505	425
-330	4,474	17,050	14	4	85	4,522	17,400	224	87
142	4,184	17,100	85	13	21	4,589	17,500	111	0
82	1,525	17,150	10	1	-104	3,641	17,600	70	0
627	4,157	17,200	9	2	-44	2,764	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
8,944	72,513	1.2137	88,006	20,352	2,952	96,367	0.9583	92,346	4,569
昨日 P/C	1.0643	今日增減變化	0.1494		昨日 P/C	0.9396	今日增減變化	0.0186	

更新日期：2023年9月1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	68,654,333	88,988,743	-20,334,410	7,756,951	998,968	2,716,147	-1,717,179	59,517
投信	41,990,492	38,793,500	3,196,992	29,220	731,270	0	731,270	-1,658
自營商	14,219,648	24,136,662	-9,917,014	-4,090,621	372,132	1,240,537	-868,405	87,010
	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	1,621,335	1,537,840	83,495	-78,780	99,552	36,600	62,952	-37,050
投信	39,264	0	39,264	322	0	0	0	0
自營商	307,568	1,174,725	-867,157	153,492	70,266	147,855	-77,589	25,306

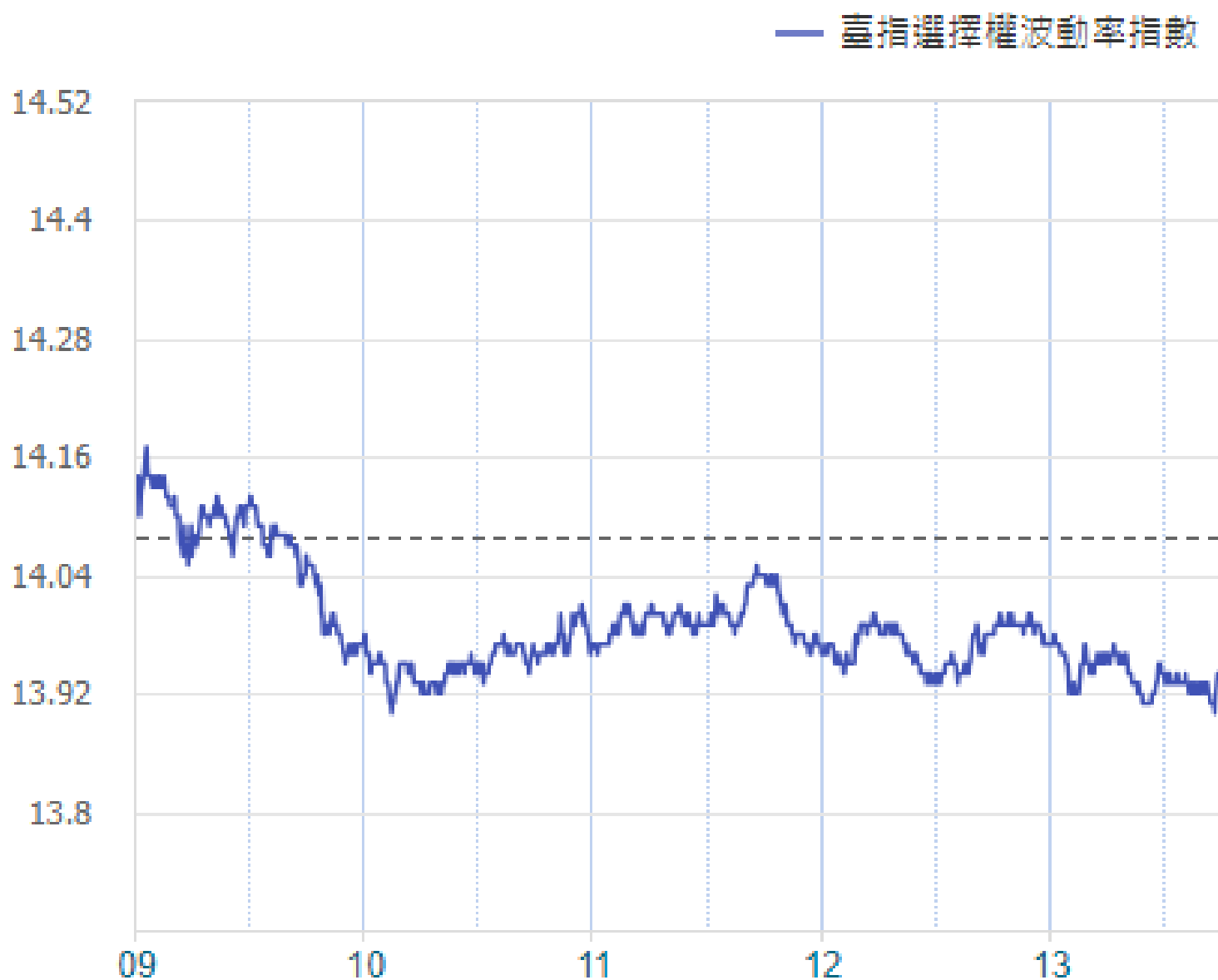
台指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數

	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	37,268	9,403	27,865	2,546	31,447	12,306	19,141	1,549
投信	200	0	200	0	300	120	180	0
自營商	62,380	66,811	-4,431	8,441	56,279	63,680	-7,401	-9,642
特定法人(週)	3,852	0	3,852	220	0	2,462	-2,462	-1,362
特定法人(近月)	22,829	1,960	20,869	1,463	2,784	17,371	-14,587	-347
特定法人(全月)	29,833	0	29,833	1,833	2,605	20,758	-18,153	-1,984
十大交易人(週)	26,384	19,833	6,551	8,073	32,690	33,167	-477	4,784
十大交易人(近月)	48,313	48,727	-414	550	39,582	45,604	-6,022	1,256
十大交易人(全月)	85,132	74,078	11,054	10,963	72,883	86,218	-13,335	6,356
全市場未沖銷(近月)			96,367	2,952			92,346	4,569
全市場未沖銷(全月)			208,233	14,806			212,099	28,115

更新日期：2023年9月1日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

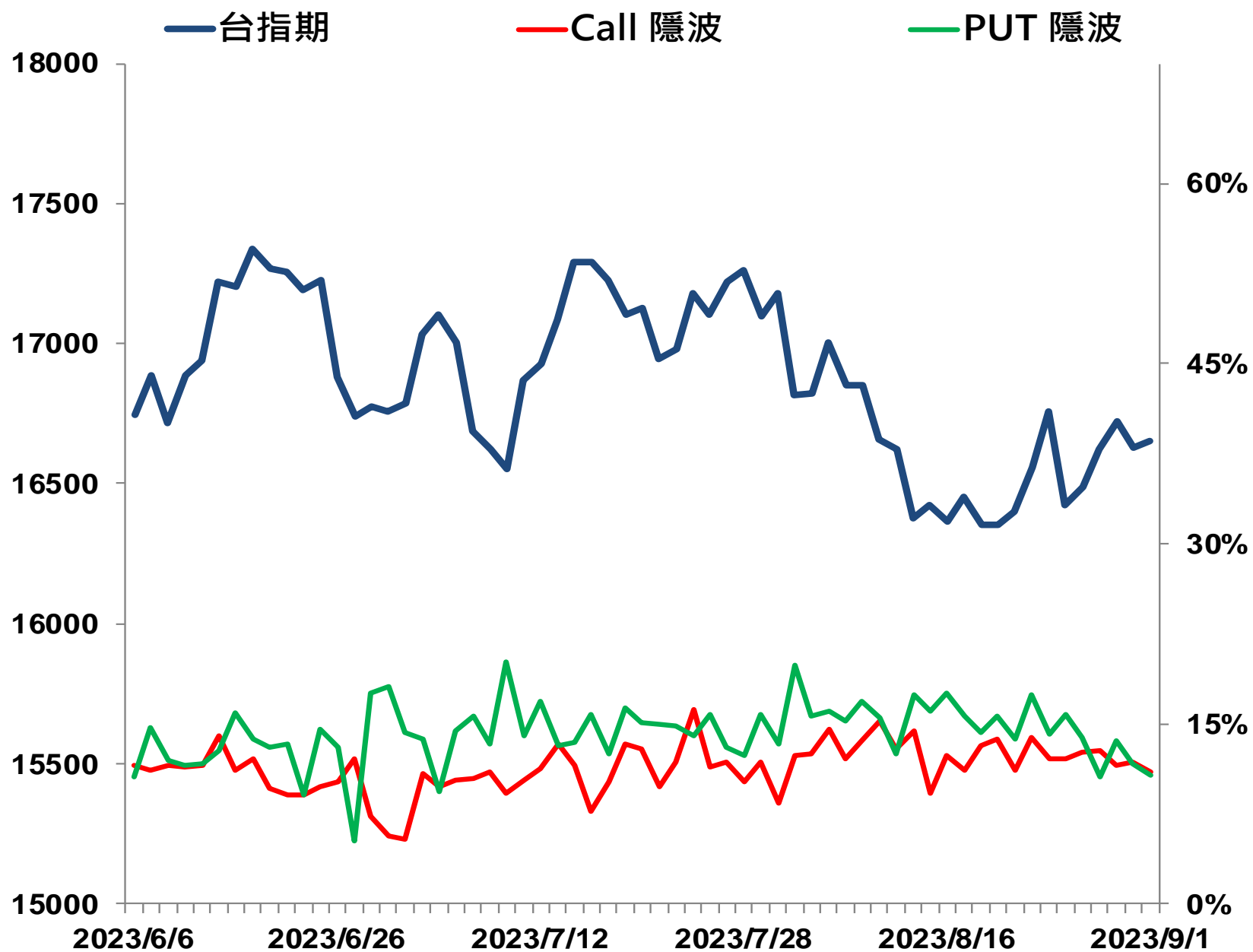
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年9月1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



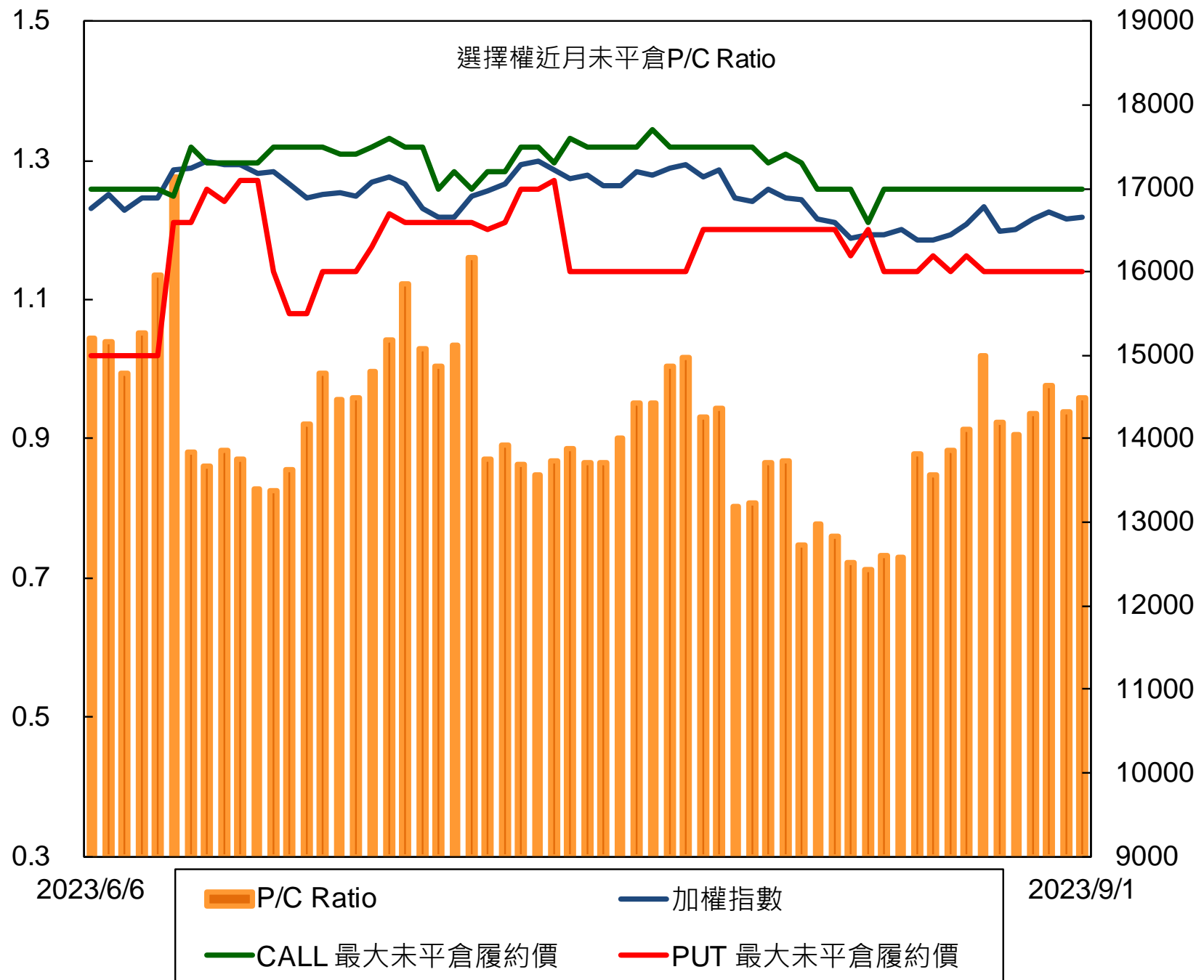
更新日期：2023年9月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考

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31日	56,496	69,368	-12,872
	9月1日	62,380	66,811	-4,431
Put	8月31日	56,292	54,051	2,241
	9月1日	56,279	63,680	-7,401

更新日期：2023年9月1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



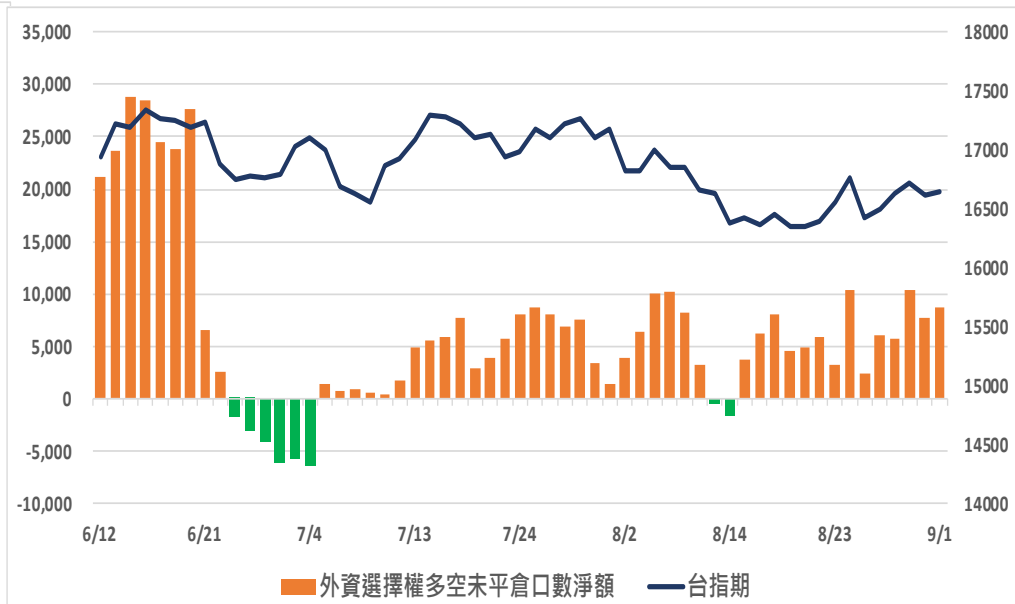
更新日期：2023年9月1日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



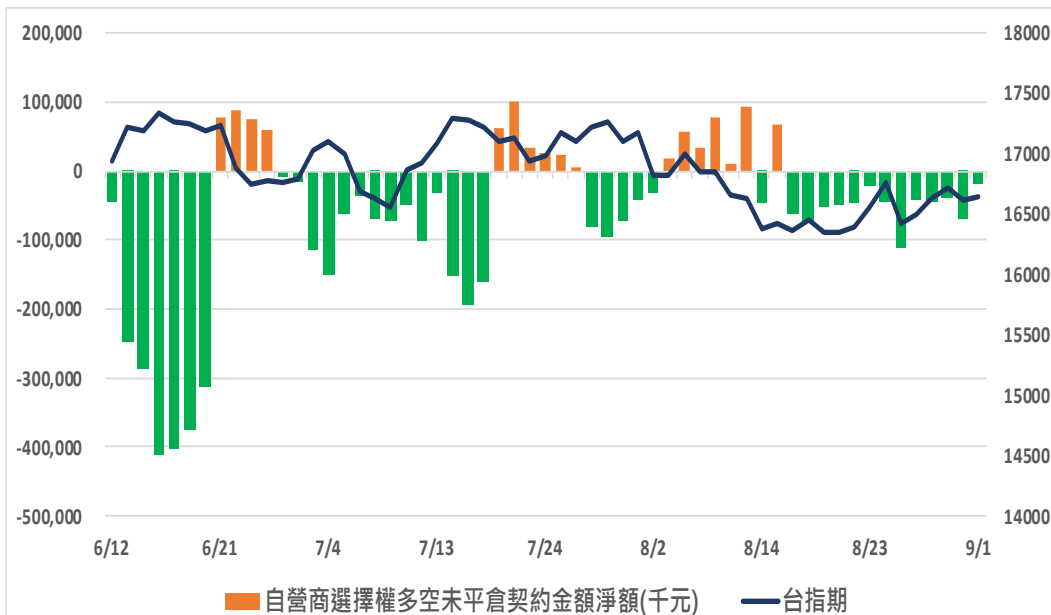
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/28	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
2023/9/1	16651	8,724	+997	26,316	+21,467

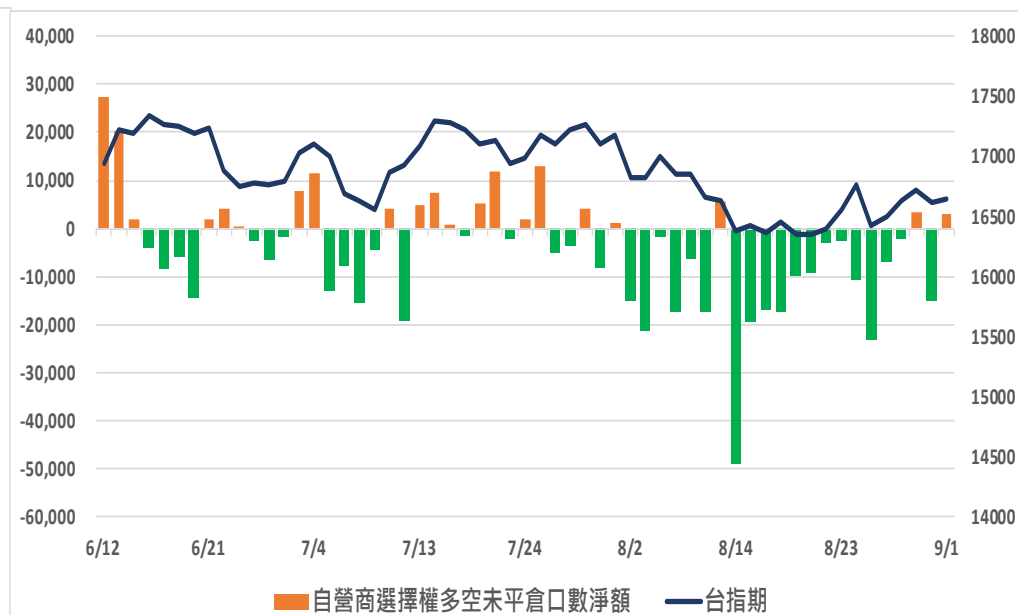
更新日期：2023年9月1日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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
2023/8/28	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
2023/9/1	16651	2,970	+18,083	-16,978	+52,226

更新日期：2023年9月1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

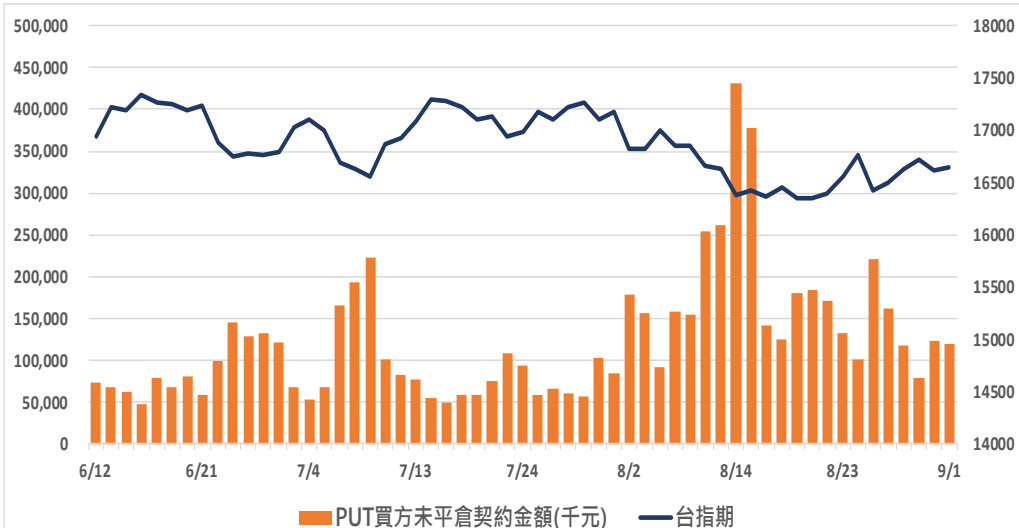
Buy Call未平倉金額



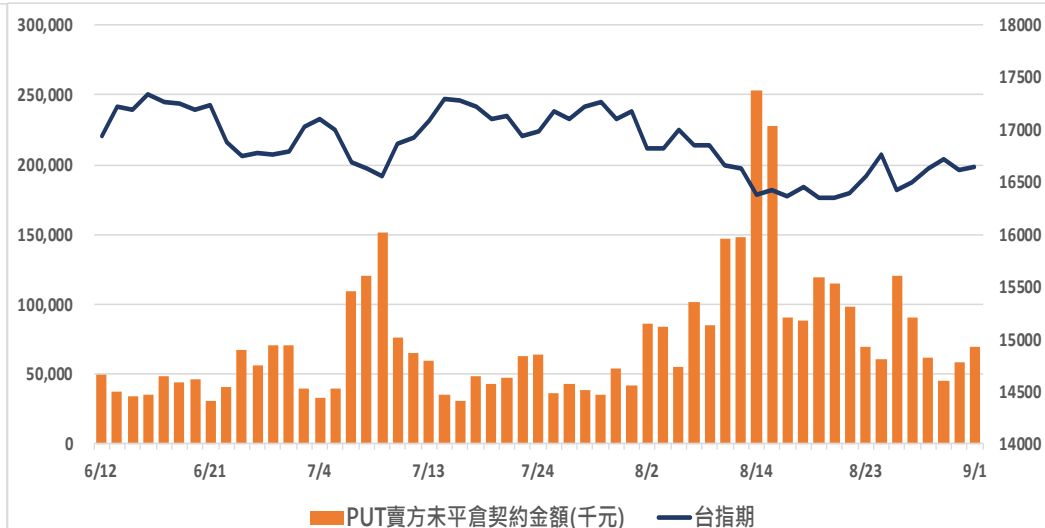
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



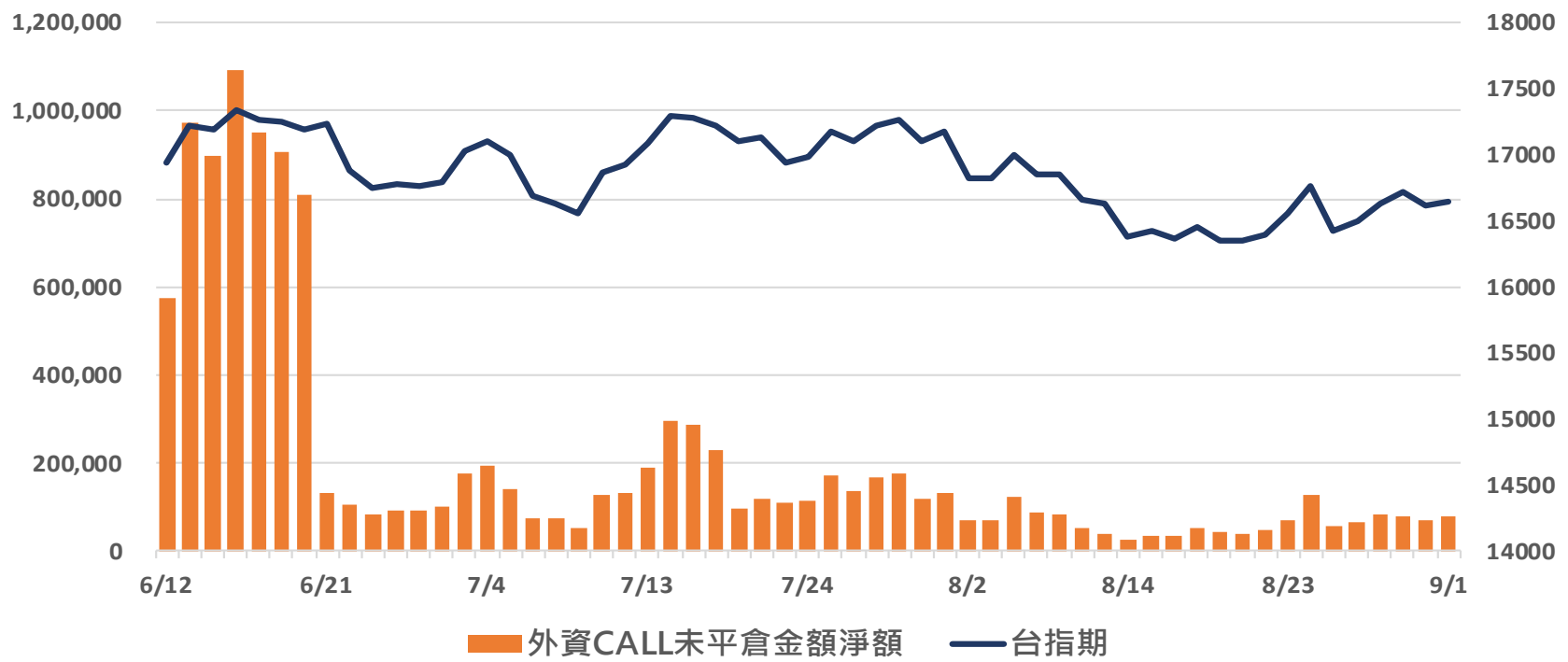
Sell Put未平倉金額



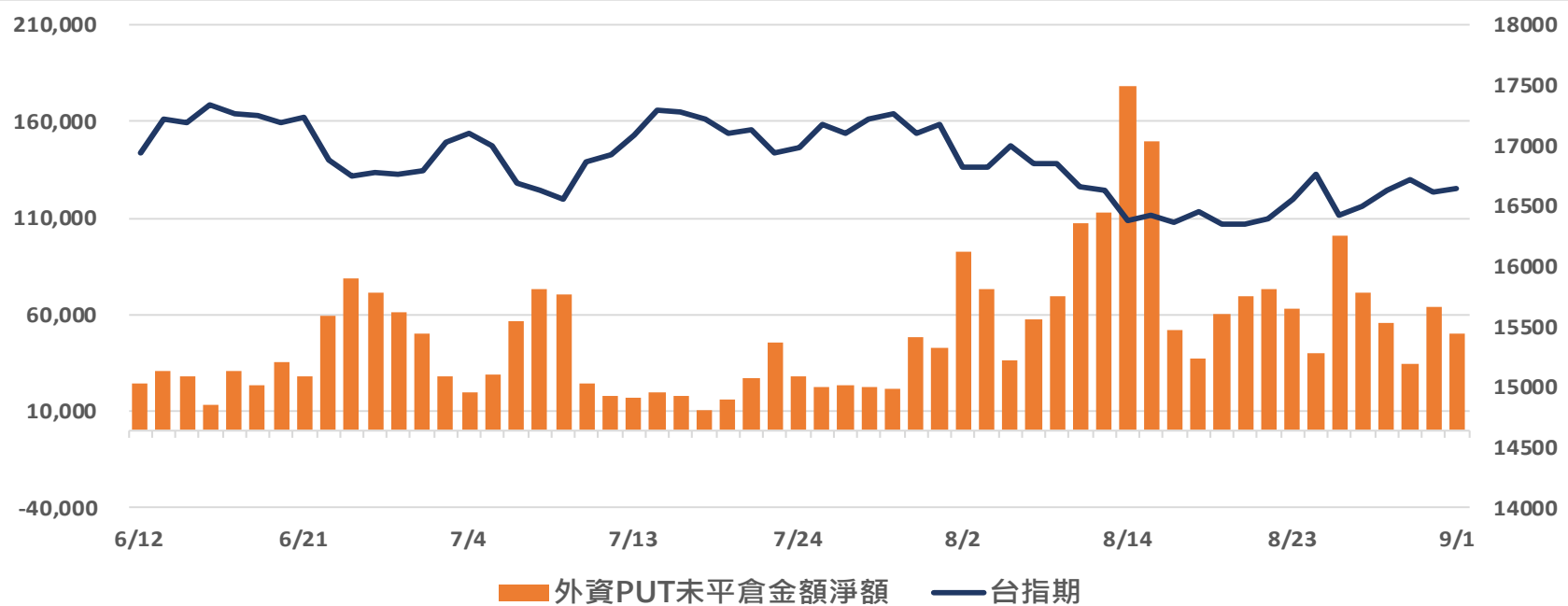
更新日期：2023年9月1日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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9月1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