

台指選擇權OI

日期：2023/9/7 結算日：2023/9/13					日期：2023/9/7 結算日：2023/9/20				
202309W2					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
1	2	16,000	3,492	2,360	1	71	15,600	8,609	5
0	1	16,100	3,742	2,212	0	39	15,700	2,237	23
-1	26	16,200	5,112	3,305	0	96	15,800	4,323	116
1	48	16,250	3,038	1,877	1	26	15,900	4,027	128
16	33	16,300	4,642	2,593	6	138	16,000	11,213	418 ※
4	11	16,350	4,200	2,533	2	154	16,100	4,459	267
104	144	16,400	8,747	5,700 ※	2	910	16,200	9,720	130
238	264	16,450	5,441	2,778	※ 548	2,427	16,300	8,385	-2
529	727	16,500	7,393	3,081	-187	1,618	16,400	4,428	14
1,059	1,126	16,550	3,745	1,919	-16	1,598	16,500	4,358	337
3,204	3,385	16,600	4,540	1,742	412	6,000	16,600	4,772	-508
3,267	3,595	16,650	2,684	663	495	3,799	16,700	1,883	-481
3,437	4,382	16,700	2,942	-159	398	6,920	16,800	2,935	50
3,826	5,330	16,750	2,080	548	-206	5,430	16,900	1,023	-41
4,102	6,623	16,800	812	141	250	11,857	17,000	1,097	-66
4,247	5,735	16,850	888	87	-138	5,719	17,100	160	-16
※ 6,038	8,173	16,900	284	46	-674	8,272	17,200	171	-2
3,712	5,907	16,950	53	10	-792	7,980	17,300	503	0
3,781	7,188	17,000	97	35	-114	4,794	17,400	191	-5
408	3,705	17,050	10	2	65	4,261	17,500	112	0
-141	3,676	17,100	57	42	-96	3,640	17,600	70	0
700	2,411	17,150	8	2	8	3,032	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
40,385	70,706	1.0457	73,939	35,257	52	#####	1.0121	#####	545
昨日 P/C	1.2394	今日增減變化	-0.1937		昨日 P/C	1.0082	今日增減變化	0.0039	

更新日期：2023年9月7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	70,457,829	80,760,532	-10,302,703	6,851,286	1,033,483	2,885,277	-1,851,794	91,902
投信	41,400,875	38,787,233	2,613,642	-802,495	612,918	0	612,918	-6,429
自營商	20,038,715	26,189,712	-6,150,997	-331,171	326,039	1,098,693	-772,654	-192,798
	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	1,904,115	1,494,193	409,922	-26,848	133,133	34,730	98,403	-720
投信	27,550	0	27,550	-11,392	0	0	0	0
自營商	309,535	1,354,719	-1,045,184	52,025	85,372	209,813	-124,441	5,284

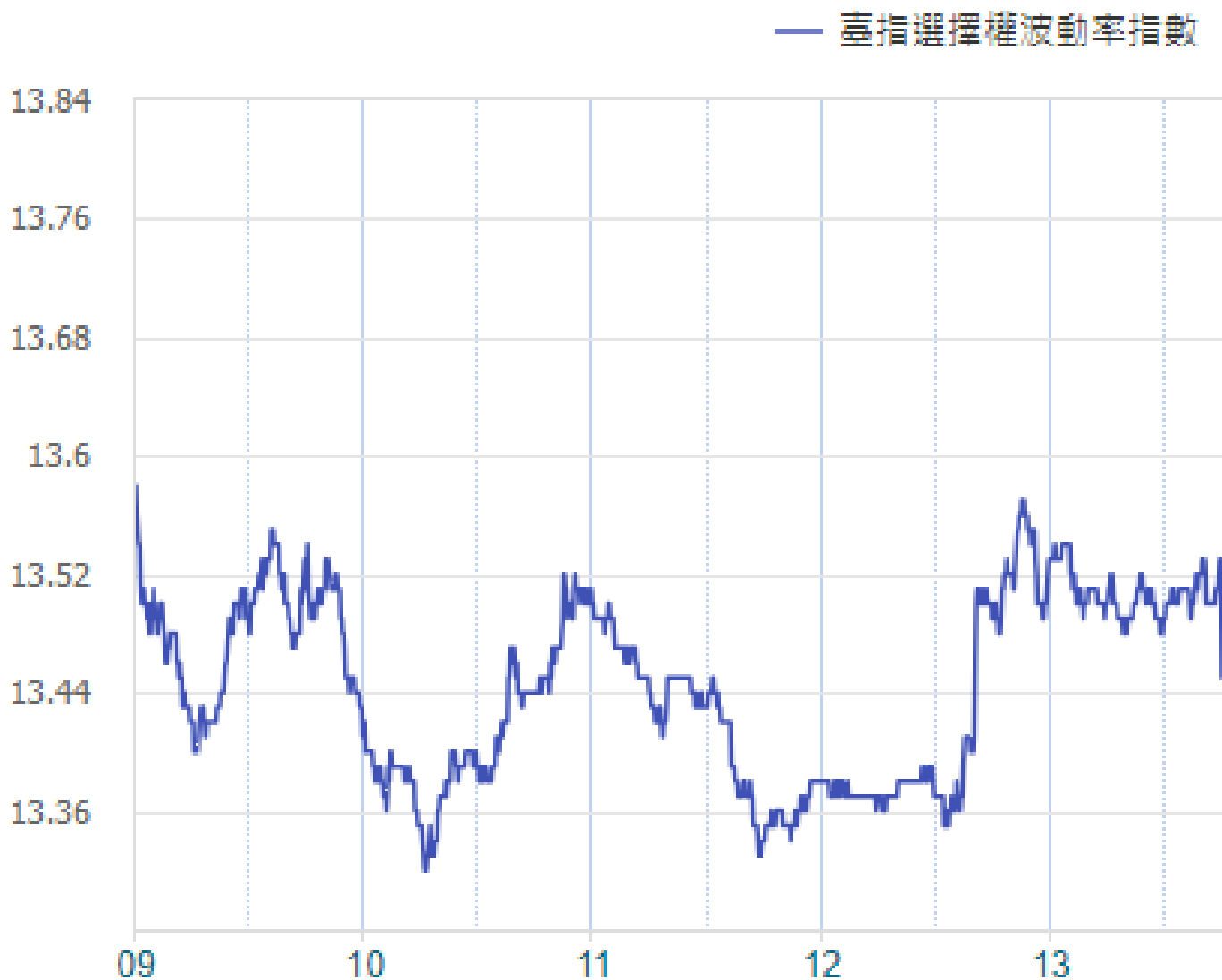
台指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數

	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	37,866	10,920	26,946	1,496	37,139	13,106	24,033	875
投信	200	0	200	0	300	120	180	0
自營商	67,046	72,702	-5,656	1,825	61,345	62,342	-997	3,120
特定法人(週)	0	0	0	-913	0	1,500	-1,500	75
特定法人(近月)	24,998	1,900	23,098	1,173	3,290	21,370	-18,080	-393
特定法人(全月)	29,597	0	29,597	2,094	5,397	25,060	-19,663	-2,097
十大交易人(週)	22,331	22,987	-656	-3,079	23,838	26,864	-3,026	-1,964
十大交易人(近月)	51,918	51,539	379	1,104	46,255	51,402	-5,147	-613
十大交易人(全月)	88,186	79,783	8,403	3,412	71,114	88,239	-17,125	-3,990
全市場未沖銷(近月)			106,103	4,068			104,761	1,892
全市場未沖銷(全月)			213,423	47,287			207,695	40,882

更新日期：2023年9月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

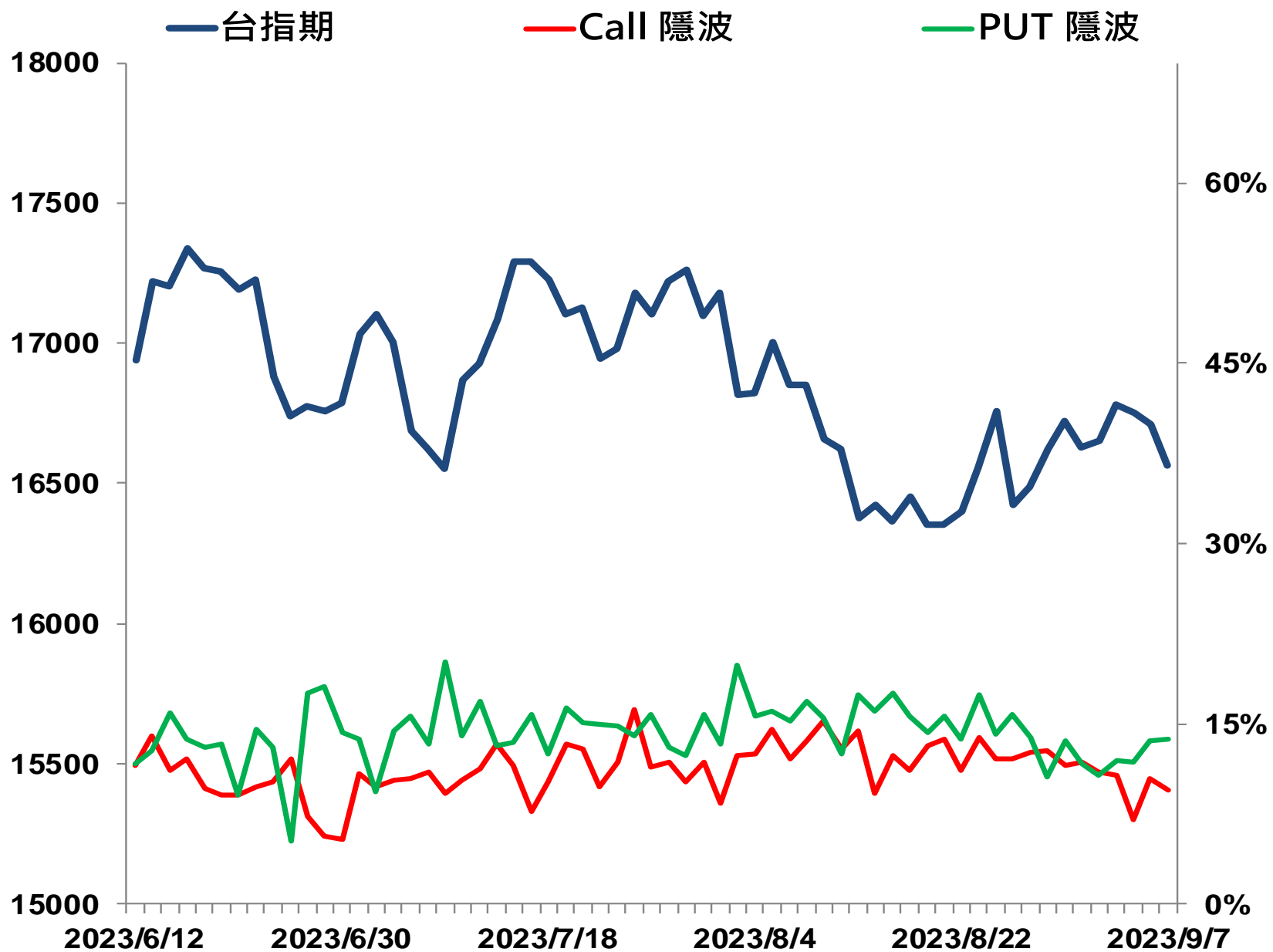
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年9月7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7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

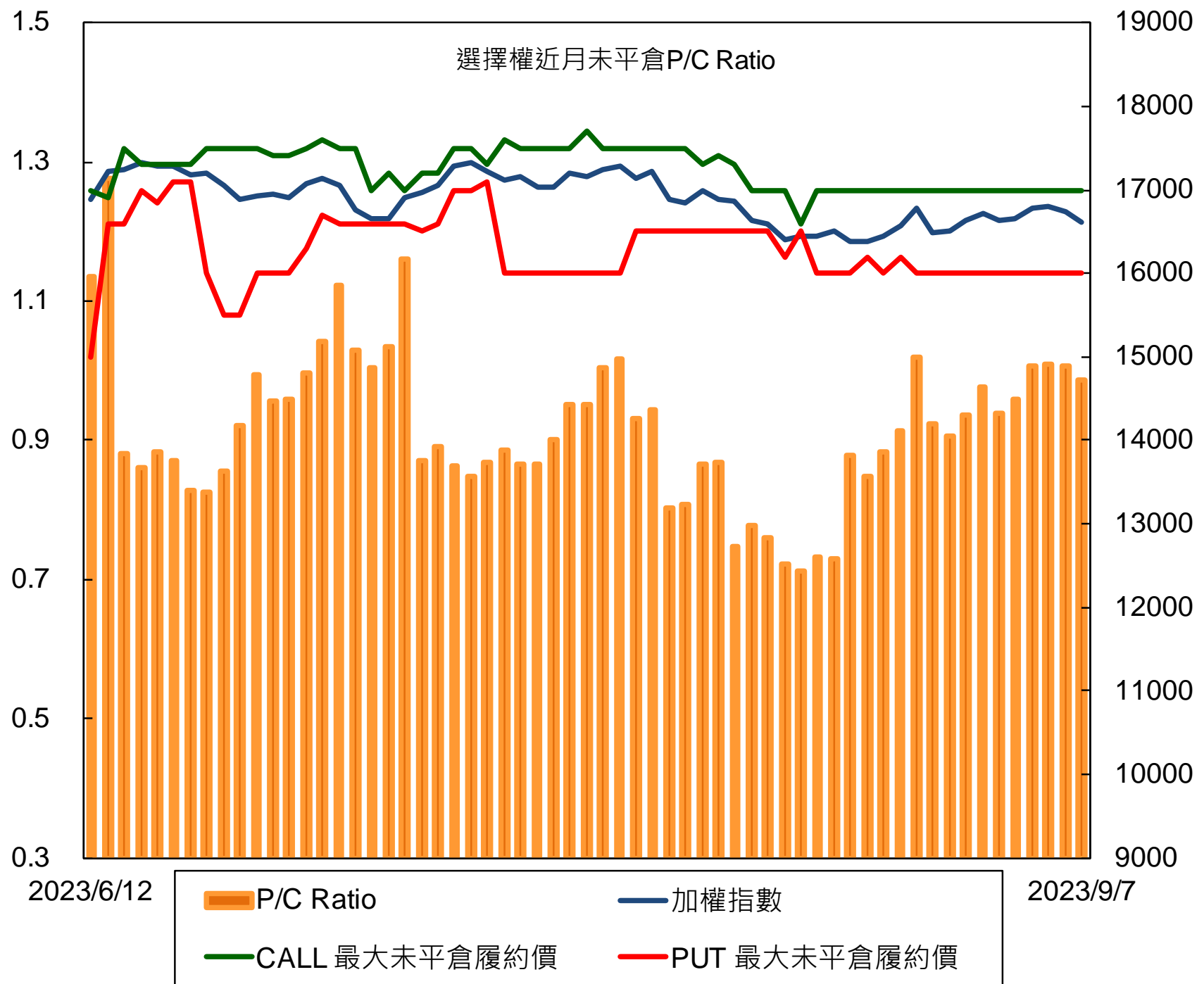
自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	9月6日	57,627	65,108	-7,481
	9月7日	67,046	72,702	-5,656
Put	9月6日	53,356	57,473	-4,117
	9月7日	61,345	62,342	-997

更新日期：2023年9月7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



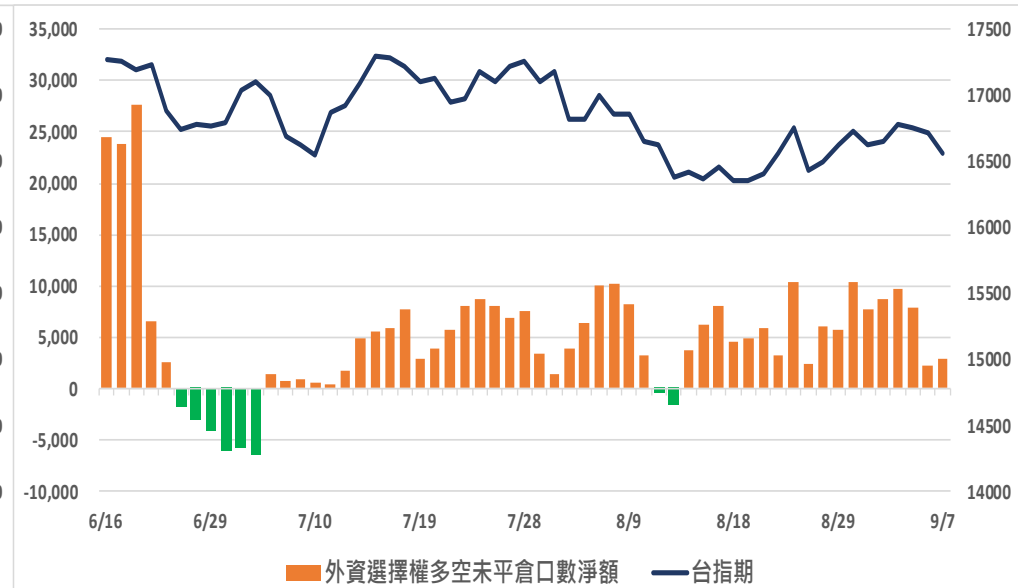
更新日期：2023年9月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



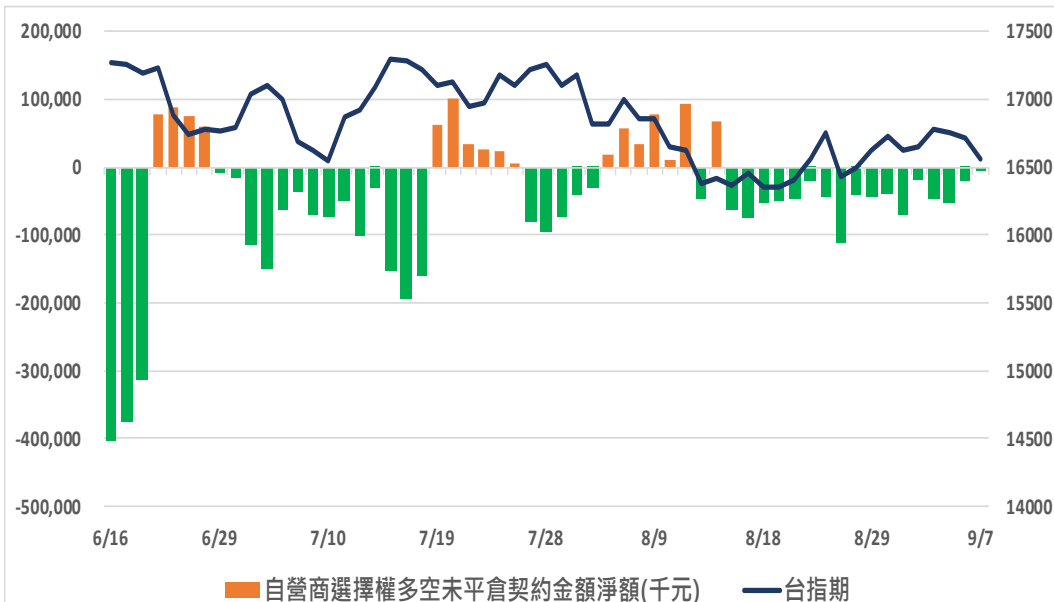
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/9/1	16651	8,724	+997	26,316	+21,467
2023/9/4	16778	9,781	+1,057	65,566	+39,250
2023/9/5	16752	7,855	-1,926	51,273	-14,293
2023/9/6	16713	2,292	-5,563	34,205	-17,068
2023/9/7	16563	2,913	+621	-16,784	-50,989

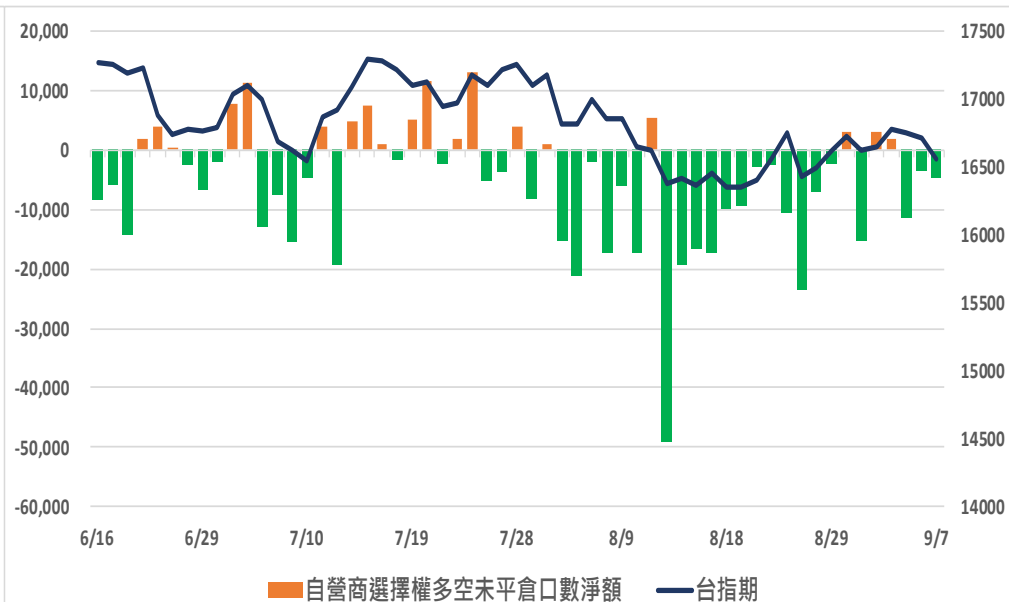
更新日期：2023年9月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



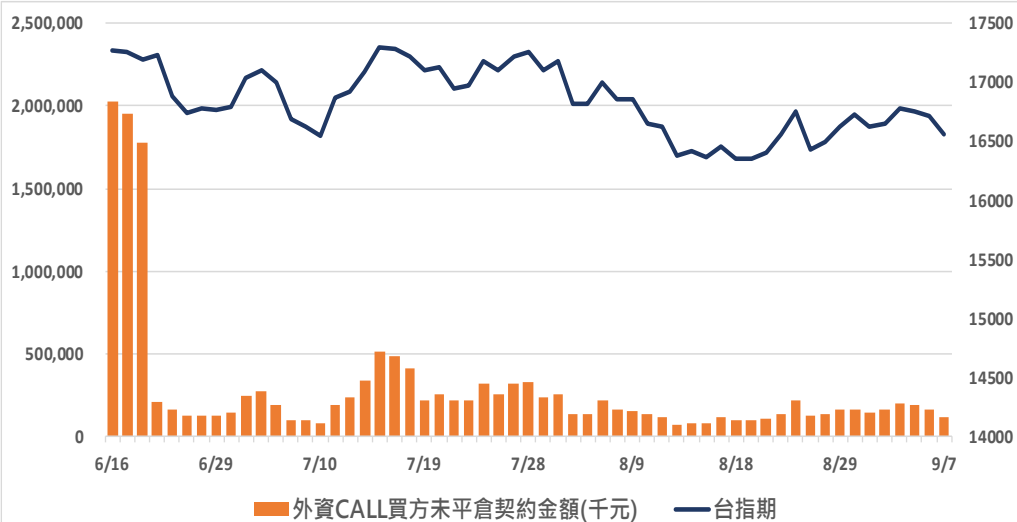
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/9/1	16651	2,970	+18,083	-16,978	+52,226
2023/9/4	16778	1,881	-1,089	-45,141	-28,163
2023/9/5	16752	-11,372	-13,253	-51,404	-6,263
2023/9/6	16713	-3,364	+8,008	-19,260	+32,144
2023/9/7	16563	-4,659	-1,295	-4,152	+15,108

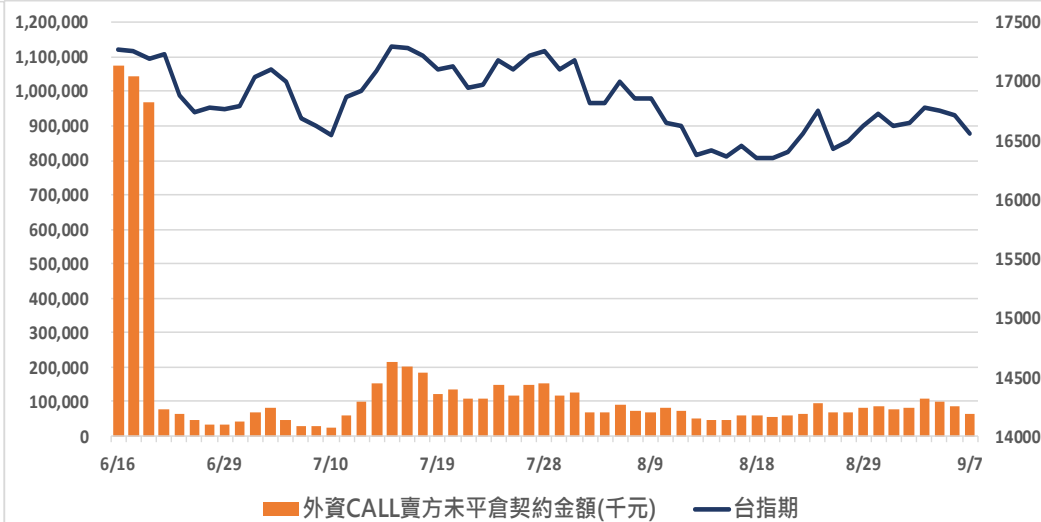
更新日期：2023年9月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

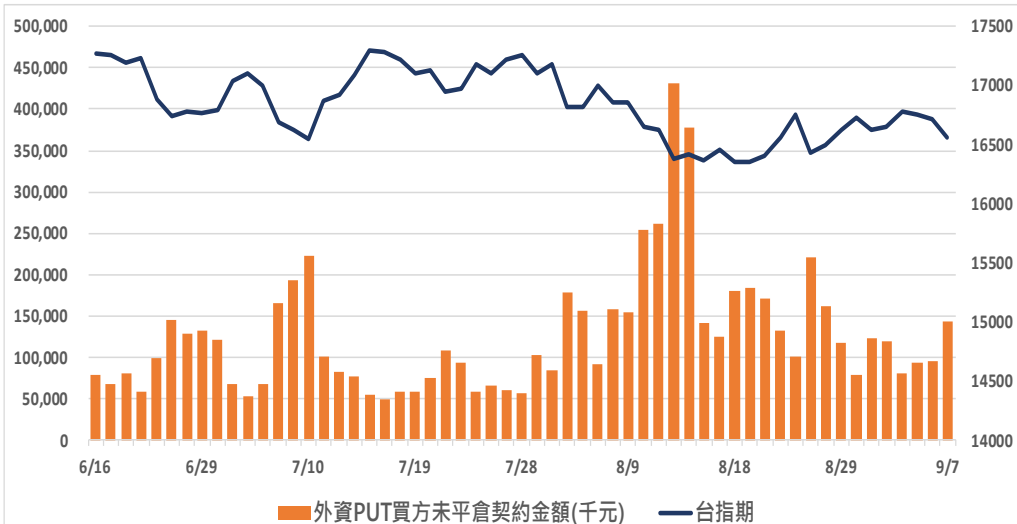
Buy Call未平倉金額



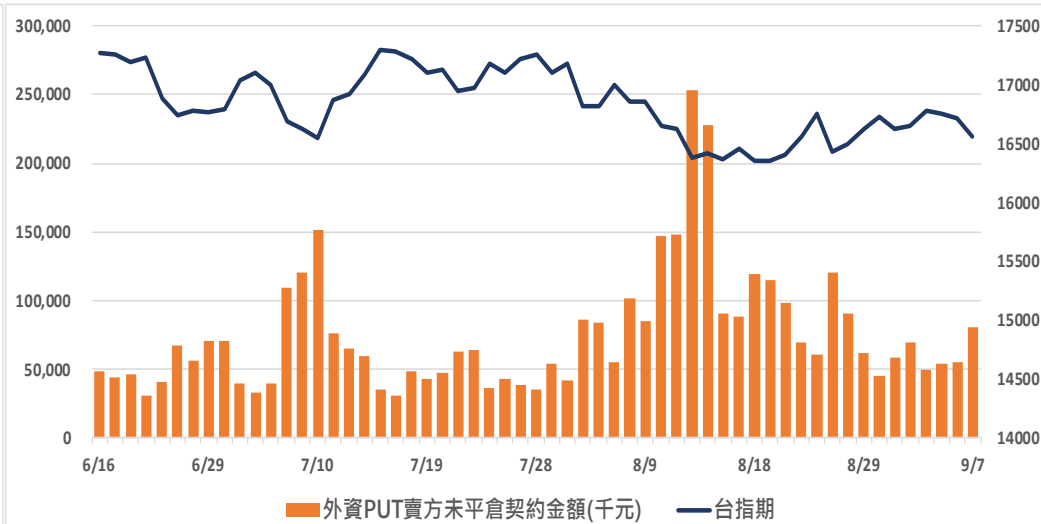
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



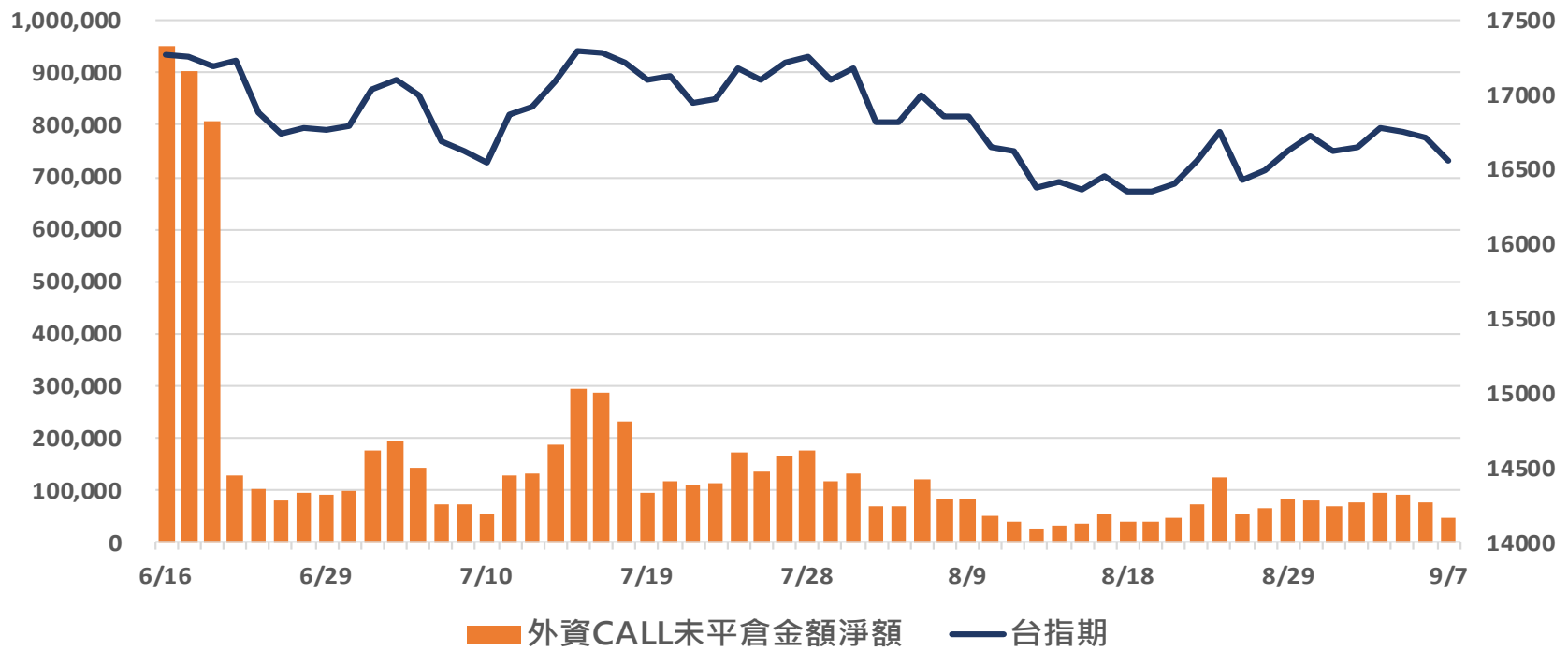
Sell Put未平倉金額



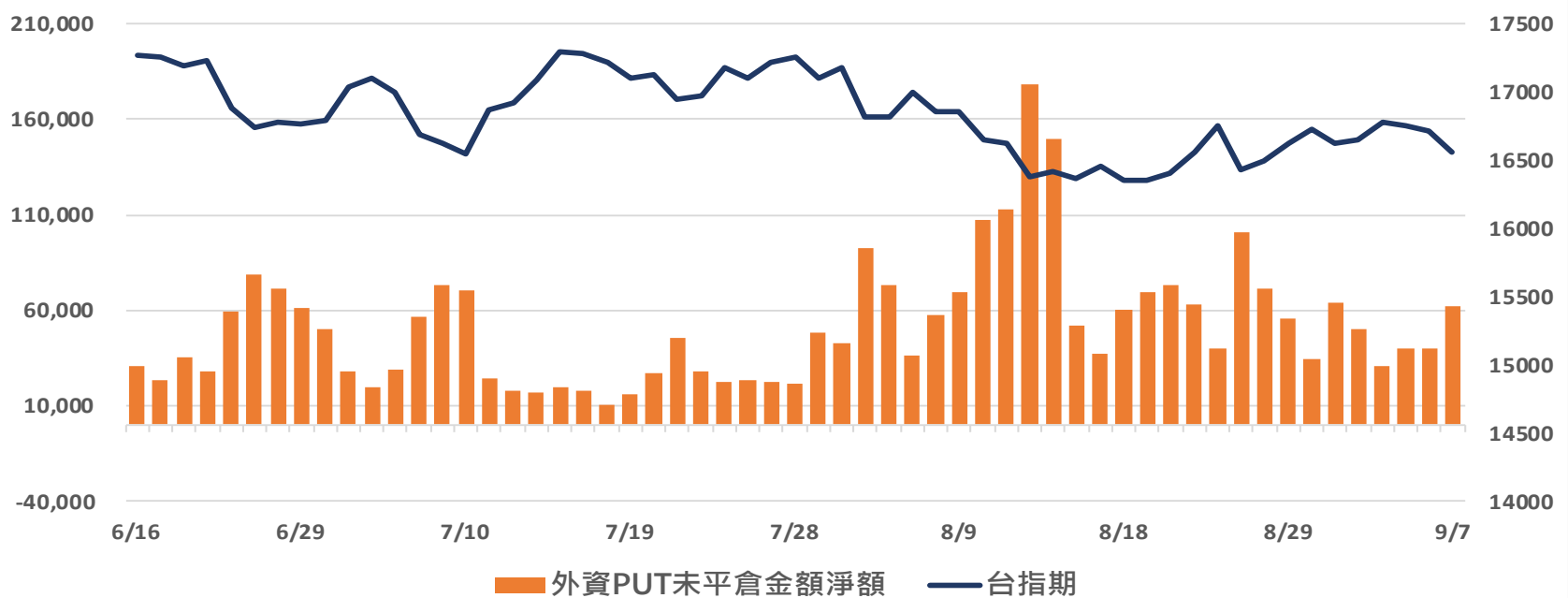
更新日期：2023年9月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額淨額

Buy Call – Sell Call 未平倉金額

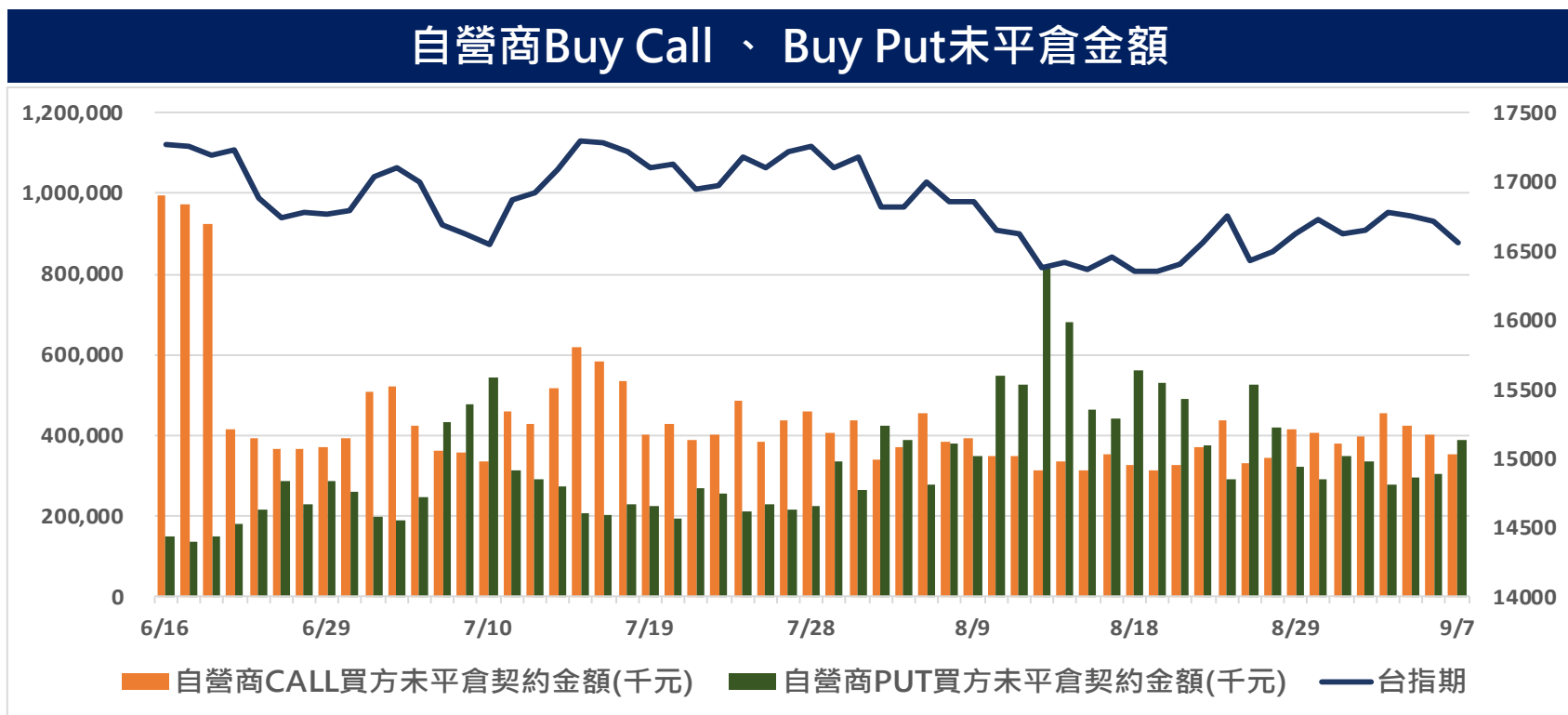
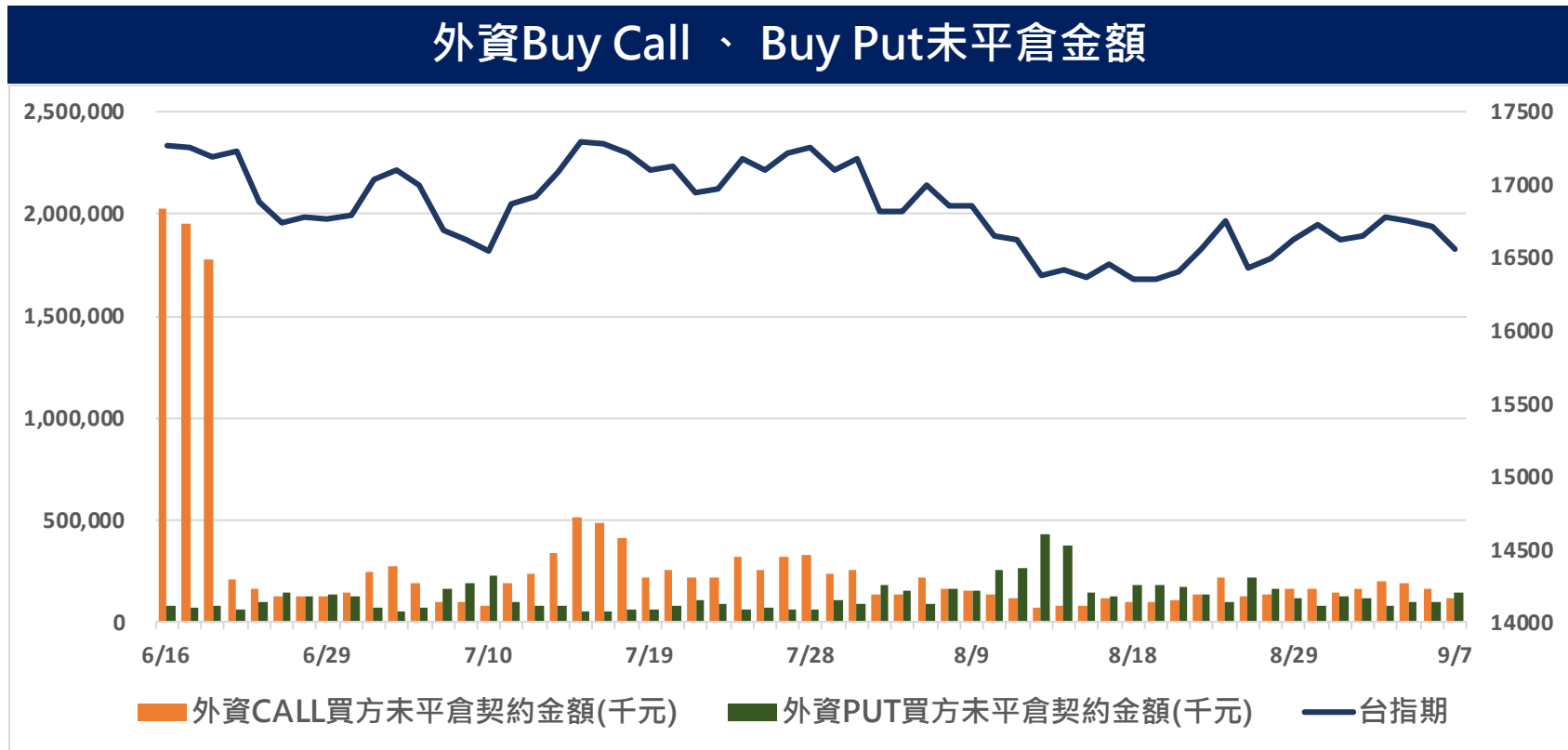


Buy Put – Sell Put 未平倉金額



更新日期：2023年9月7日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

法人選擇權買方未平倉金額



更新日期：2023年9月7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