

台指選擇權OI

日期：2023/9/13 結算日：2023/9/20					日期：2023/9/13 結算日：2023/10/18				
202309 月台指選擇權 OI 序列					202310 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
5	173	16,100	7,035	-84	0	2	15,600	1,160	-198
0	6	16,150	2,275	592	2	3	15,700	781	259
-5	925	16,200	13,606	2,684	0	20	15,800	2,042	-13
1	60	16,250	4,390	2,691	0	22	15,900	777	51
-152	1,993	16,300	11,500	2,102	1	36	16,000	3,319	182
-6	365	16,350	2,131	1,007	0	29	16,100	2,075	76
32	2,290	16,400	7,147	1,633	2	25	16,200	883	15
-28	689	16,450	2,122	770	19	116	16,300	1,815	77
-32	2,679	16,500	6,488	1,162	3	151	16,400	2,431	589
629	2,080	16,550	2,246	1,002	95	775	16,500	1,492	-27
748	6,978	16,600	7,524	1,467	470	798	16,600	1,245	102
537	2,801	16,650	995	755	185	870	16,700	353	68
※ 3,031	8,056	16,700	2,335	623	55	827	16,800	231	10
924	4,175	16,750	492	397	159	2,008	16,900	78	0
910	9,876	16,800	2,310	-75	※ 1,463	2,843	17,000	55	-2
1,503	4,391	16,850	93	17	-377	3,494	17,100	5	0
1,383	7,489	16,900	810	-5	192	3,545	17,200	38	1
958	3,402	16,950	23	7	-44	2,830	17,300	15	0
14	13,236	17,000	910	3	61	3,252	17,400	3	0
654	1,981	17,050	20	16	55	1,974	17,500	10	6
152	5,742	17,100	131	-10	7	904	17,600	2	0
-480	5,533	17,200	156	2	32	495	17,700	21	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
10,477	127,738	1.0941	139,762	20,389	2,589	30,548	0.7780	23,765	1,561
昨日 P/C	1.0933	今日增減變化		0.0008	昨日 P/C	0.7942	今日增減變化		-0.0162

更新日期：2023年9月13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	82,578,358	84,790,515	-2,212,157	1,509,676	1,093,903	2,695,921	-1,602,018	177,510
投信	45,721,556	38,814,755	6,906,801	1,478,475	647,280	0	647,280	24,931
自營商	15,415,574	25,873,231	-10,457,657	1,913,030	278,250	1,294,520	-1,016,270	-260,982
	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	2,023,429	1,597,101	426,328	50,584	135,102	14,685	120,417	-2,315
投信	27,962	0	27,962	92	0	0	0	0
自營商	360,211	1,362,269	-1,002,058	-62,307	110,111	246,623	-136,512	5,186

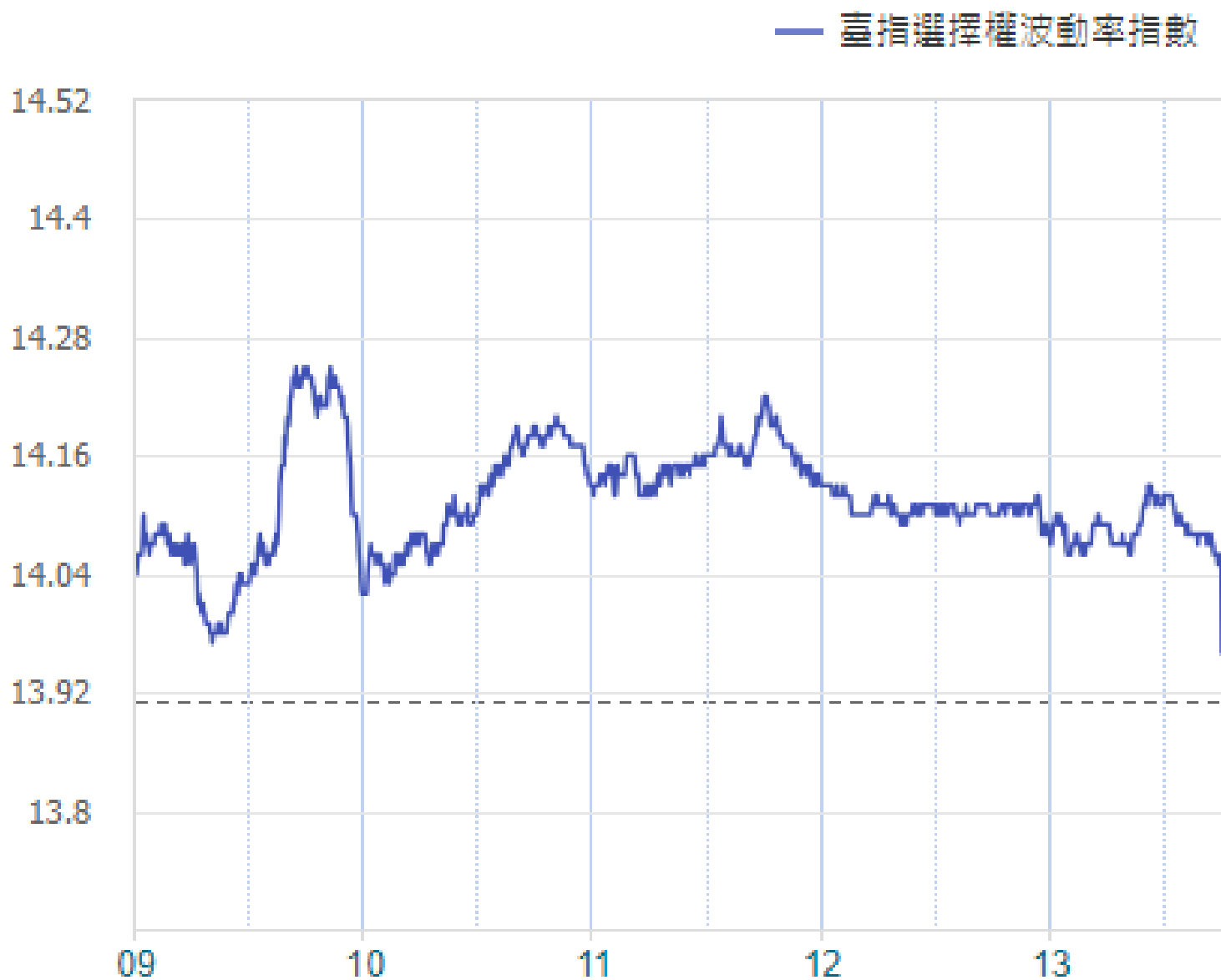
台指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數

	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	40,542	10,540	30,002	-2,490	42,425	12,315	30,110	-1,091
投信	200	0	200	0	300	120	180	0
自營商	58,595	60,908	-2,313	-3,437	48,745	61,249	-12,504	1,486
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	24,415	0	24,415	1,693	2,740	21,906	-19,166	4,925
特定法人(全月)	33,407	2,880	30,527	476	6,016	31,078	-25,062	3,721
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	55,121	49,500	5,621	4,255	58,982	58,893	89	4,446
十大交易人(全月)	86,092	71,380	14,712	-1,863	71,390	80,985	-9,595	1,110
全市場未沖銷(近月)			129,119	10,897			141,578	20,977
全市場未沖銷(全月)			178,957	-96,150			179,325	-97,678

更新日期：2023年9月13日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

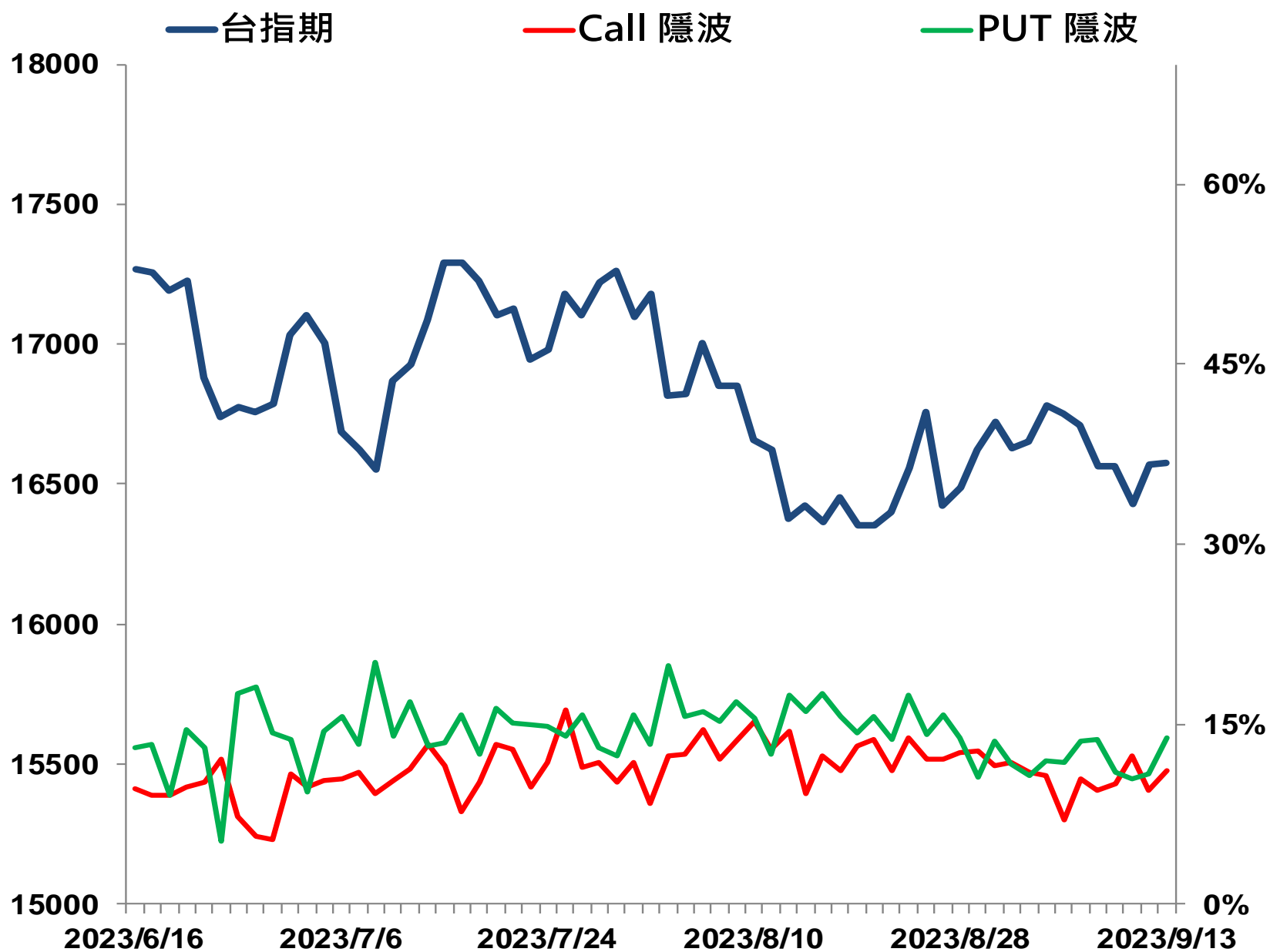
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年9月13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



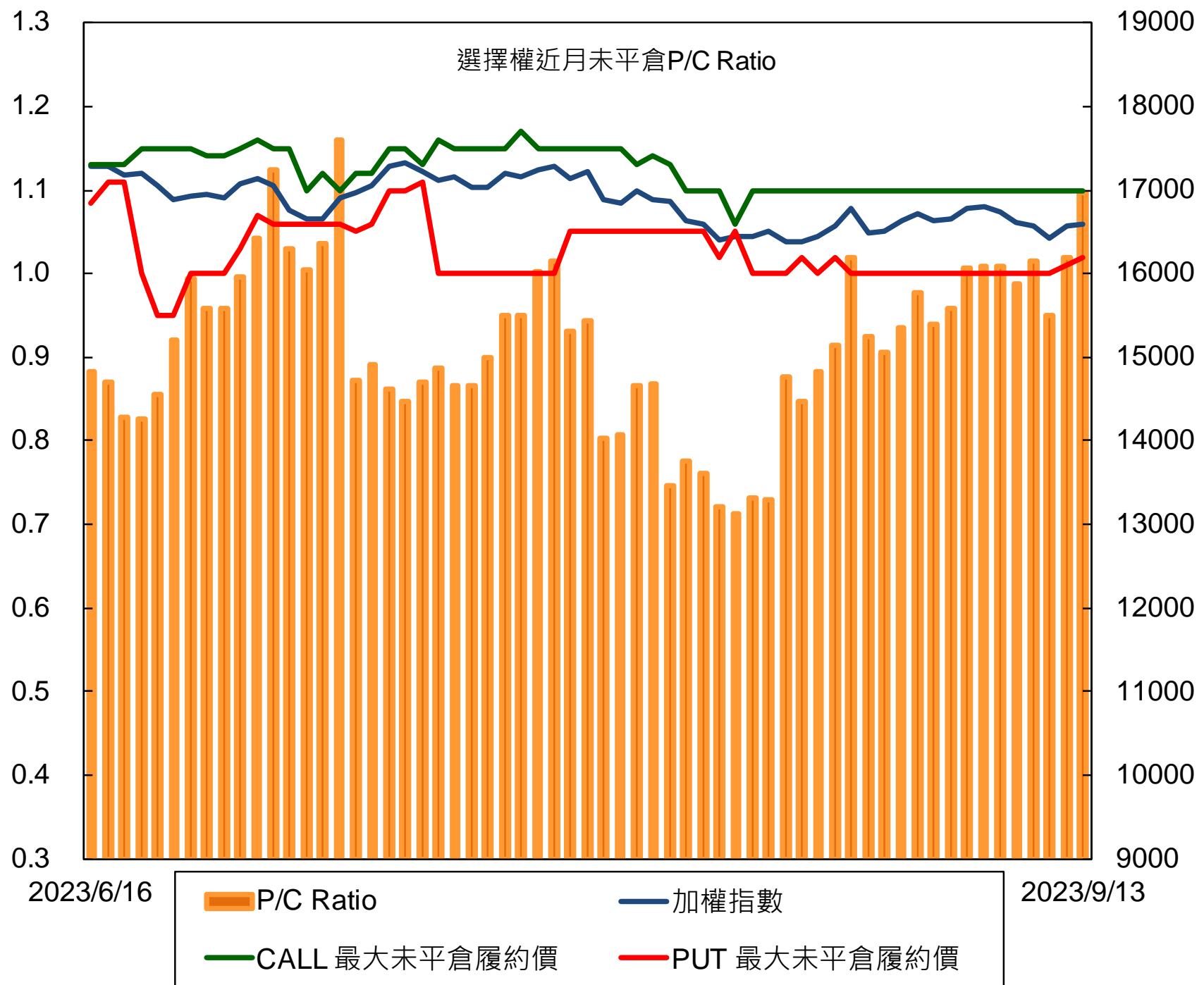
更新日期：2023年9月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考

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12日	76,917	75,793	1,124
	9月13日	58,595	60,908	-2,313
Put	9月12日	61,590	75,580	-13,990
	9月13日	48,745	61,249	-12,504

更新日期：2023年9月13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13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



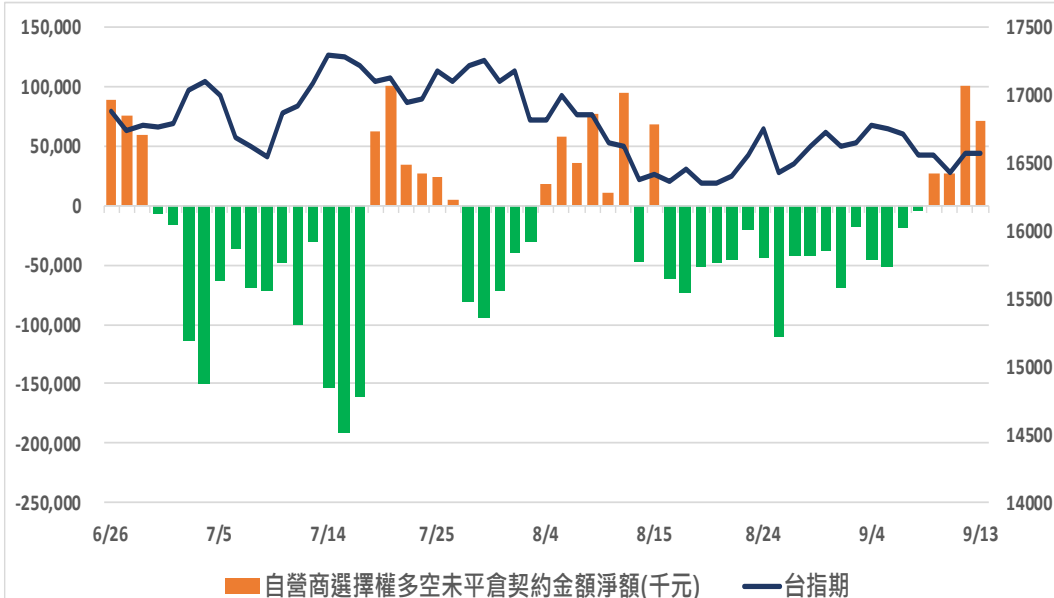
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/9/7	16563	2,913	+621	-16,784	-50,989
2023/9/8	16562	-3,256	-6,169	-26,130	-9,346
2023/9/11	16425	-1,712	+1,544	-80,596	-54,466
2023/9/12	16570	1,291	+3,003	-9,444	+71,152
2023/9/13	16579	-108	-1,399	-2,307	+7,137

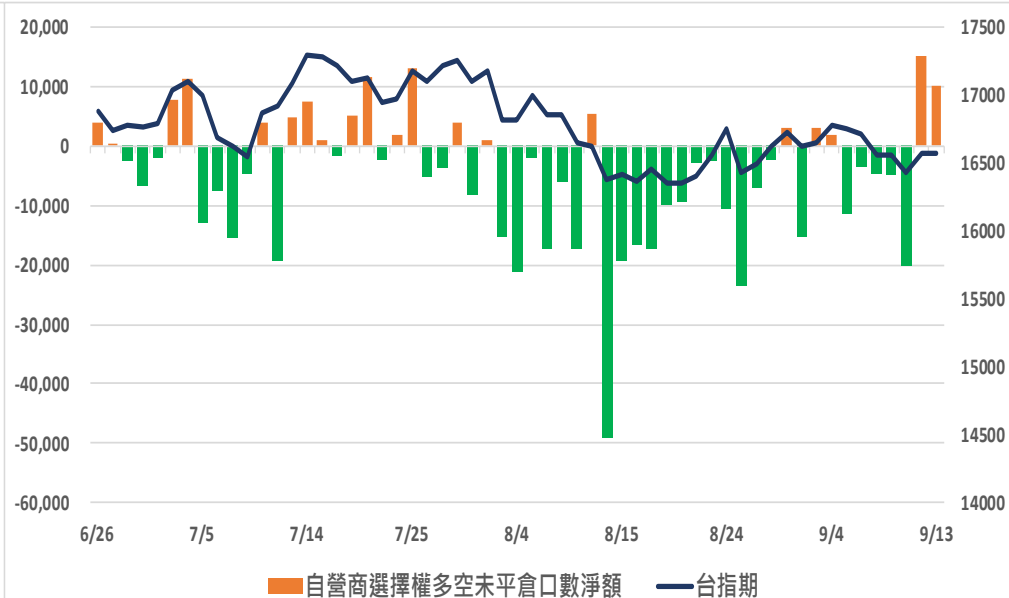
更新日期：2023年9月13日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



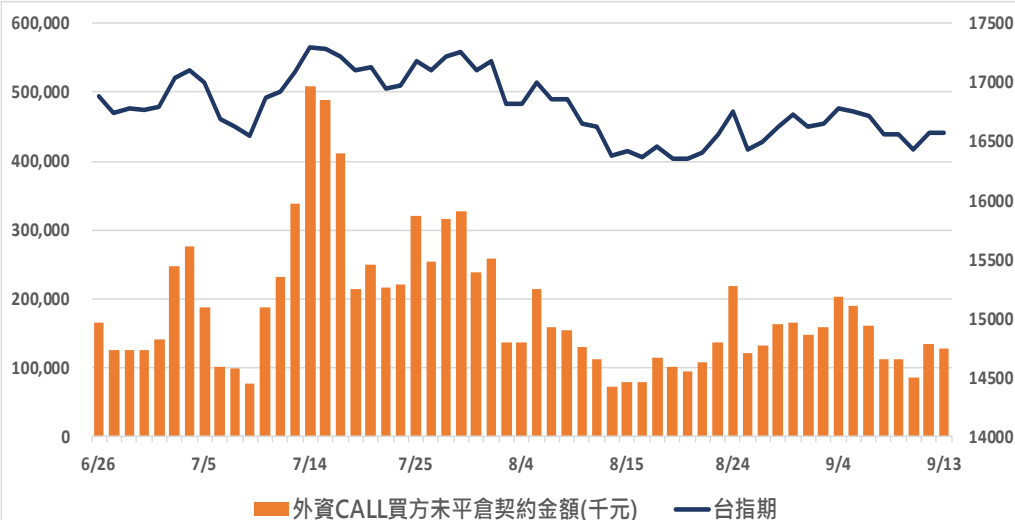
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/9/7	16563	-4,659	-1,295	-4,152	+15,108
2023/9/8	16562	-4,922	-263	26,925	+31,077
2023/9/11	16425	-20,168	-15,246	27,703	+778
2023/9/12	16570	15,114	+35,282	100,504	+72,801
2023/9/13	16579	10,191	-4,923	70,925	-29,579

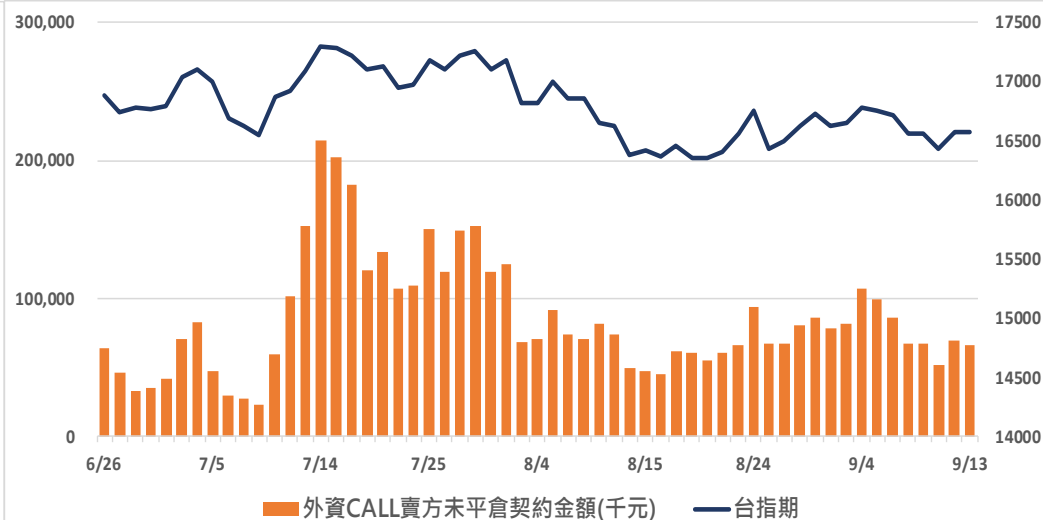
更新日期：2023年9月13日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

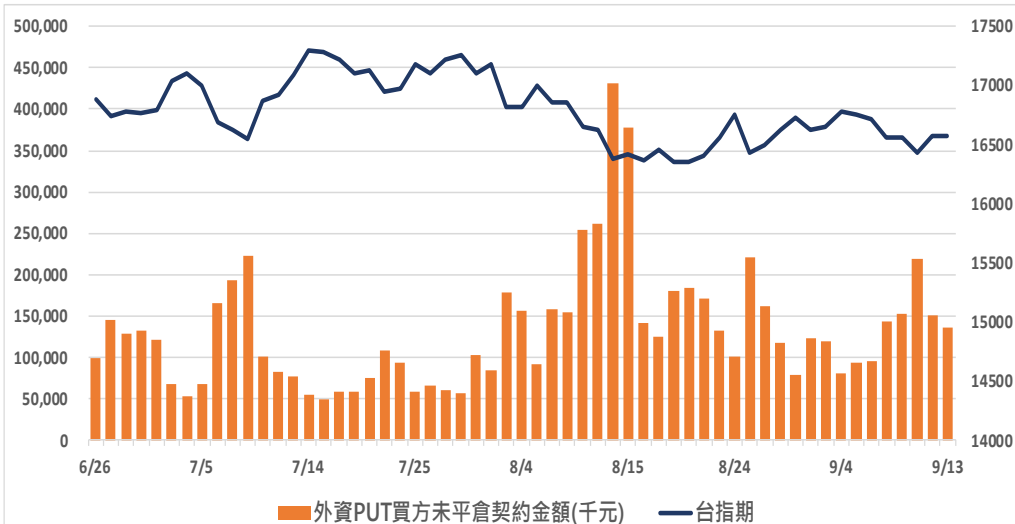
Buy Call未平倉金額



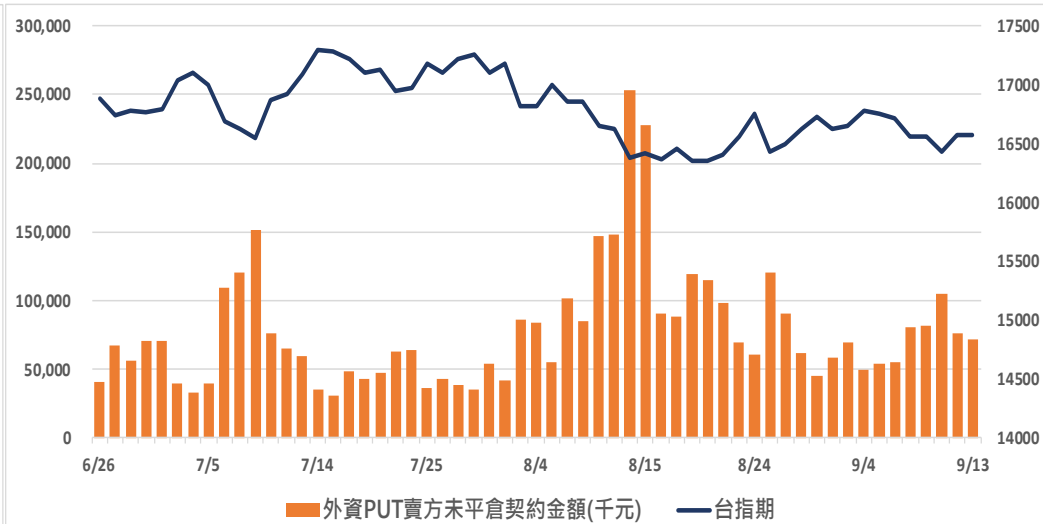
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



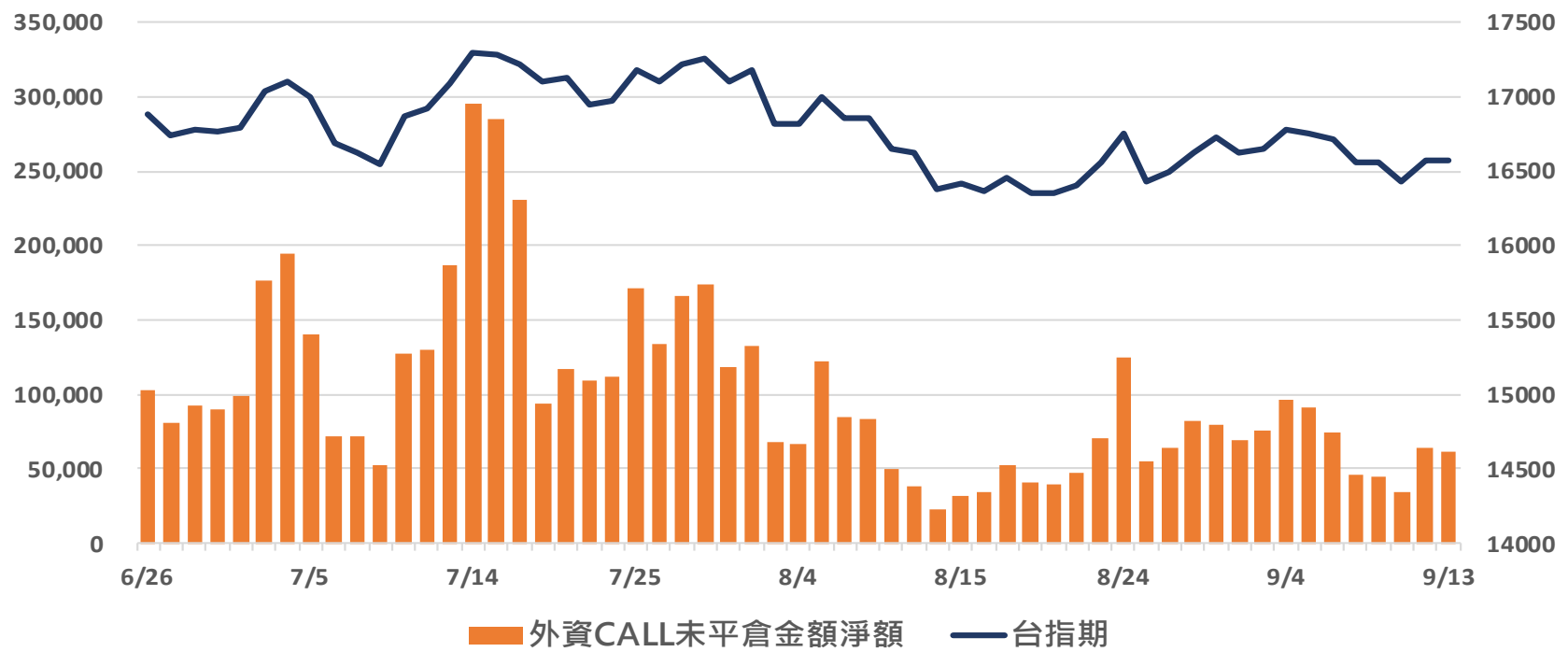
Sell Put未平倉金額



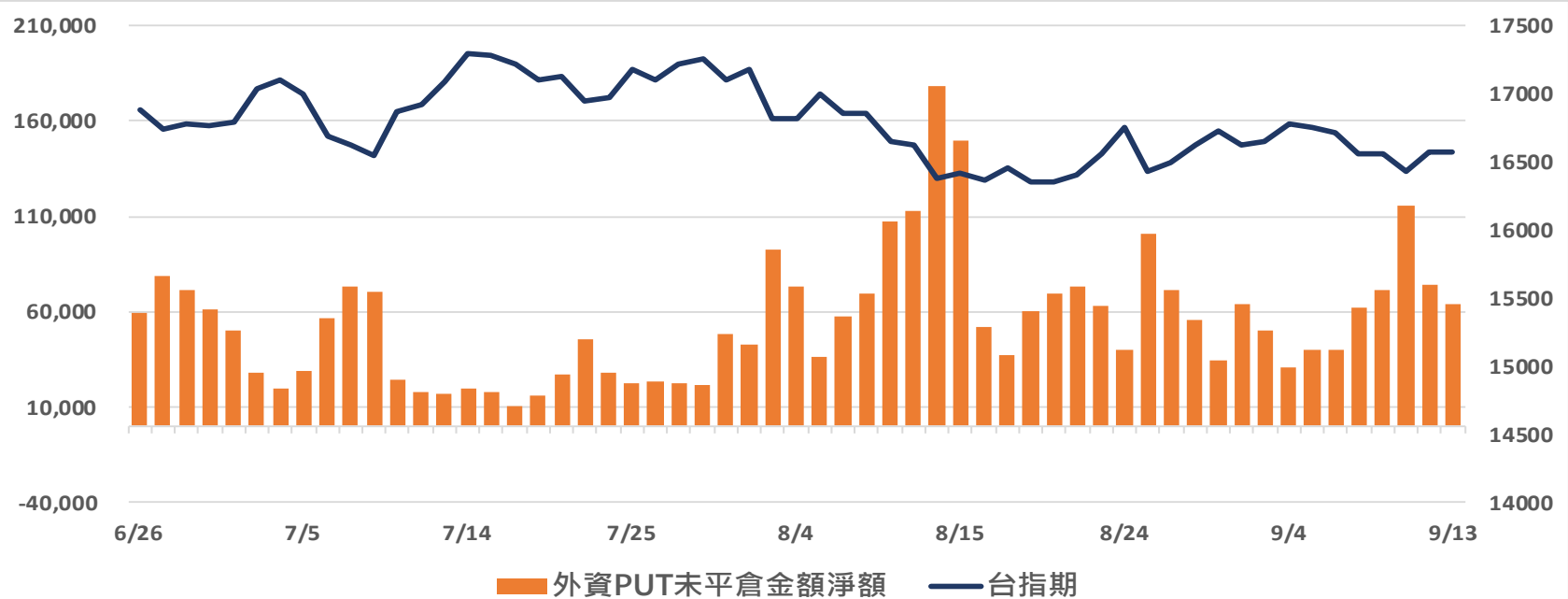
更新日期：2023年9月13日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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13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