

# 台指選擇權OI

日期：2023/9/15 結算日：2023/9/20					日期：2023/9/15 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
-113	1,973	16,400	11,447	-1,055	0	23	15,900	1,281	31
-44	735	16,450	6,884	1,451	0	35	16,000	3,729	299
-50	2,217	16,500	11,254	-606	2	31	16,100	2,196	108
-141	1,732	16,550	6,830	670	0	27	16,200	1,117	103
-87	6,238	16,600	15,117	2,931	-19	86	16,300	2,168	139
-510	2,633	16,650	7,469	3,199	-11	134	16,400	4,201	1,106 ※
-1,007	4,004	16,700	10,550	3,990 ※	-5	744	16,500	1,610	-23
-595	3,397	16,750	8,214	1,286	-59	727	16,600	866	-584
-462	11,378	16,800	7,878	2,916	-9	904	16,700	545	-69
-545	4,955	16,850	4,328	1,654	43	965	16,800	484	114
-283	10,008	16,900	3,992	2,482	280	2,469	16,900	299	52
529	7,835	16,950	1,165	952	492	3,436	17,000	220	104
405	16,826	17,000	1,767	538	-609	3,042	17,100	17	7
1,479	7,606	17,050	252	205	162	3,855	17,200	87	37
※ 5,346	13,239	17,100	331	165	267	3,264	17,300	20	5
2,115	3,968	17,150	34	16	93	3,594	17,400	4	1
1,530	8,117	17,200	187	24	※ 725	3,014	17,500	4	0
1,067	1,981	17,250	1	-1	107	1,423	17,600	3	0
603	7,221	17,300	502	-5	41	550	17,700	21	0
1,046	7,082	17,400	207	11	15	662	17,800	3	0
283	4,931	17,500	110	0	16	364	17,900	2	0
61	3,441	17,600	70	0	97	603	18,000	0	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
10,468	159,966	1.2752	203,983	13,357	1,770	34,989	0.8079	28,267	1,940
昨日 P/C	1.3011	今日增減變化	-0.0259		昨日 P/C	0.7925	今日增減變化	0.0154	

更新日期：2023年9月15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	98,740,944	103,705,876	-4,964,932	-11,482,453	1,222,107	3,111,428	-1,889,321	-149,144
投信	44,423,797	37,834,549	6,589,248	-2,027,398	650,838	0	650,838	-8,322
自營商	19,522,234	26,794,807	-7,272,573	6,108,277	564,606	1,052,728	-488,122	177,623
	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	2,117,565	1,779,694	337,871	-65,363	136,289	45,923	90,366	-3,019
投信	28,169	0	28,169	-105	0	0	0	0
自營商	425,863	1,391,844	-965,981	12,783	108,143	219,252	-111,109	11

## 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	49,241	12,100	37,141	2,769	46,638	15,032	31,606	1,955
投信	300	100	200	0	400	120	280	100
自營商	64,115	68,531	-4,416	-6,068	64,611	69,551	-4,940	9,059
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	26,765	0	26,765	1,680	3,340	21,906	-18,566	100
特定法人(全月)	39,512	3,674	35,838	1,406	7,156	32,475	-25,319	-1,039
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	62,762	53,056	9,706	-3,178	66,048	73,437	-7,389	-10,969
十大交易人(全月)	97,214	78,663	18,551	-3,279	78,969	99,547	-20,578	-11,353
全市場未沖銷(近月)			159,977	10,469			210,328	12,648
全市場未沖銷(全月)			221,675	15,360			261,610	18,071

更新日期：2023年9月15日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

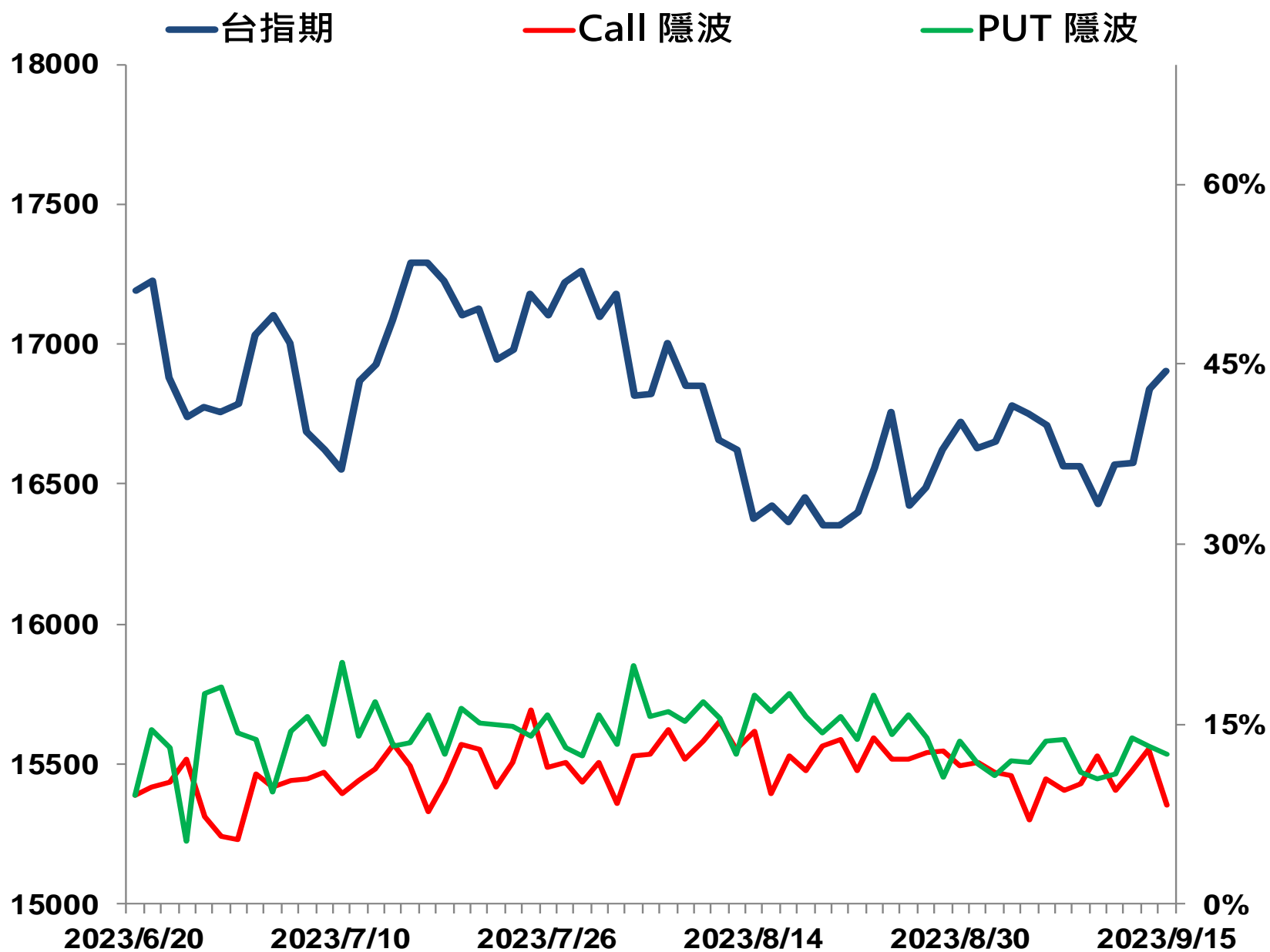
# 選擇權當日波動率

## 臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年9月15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



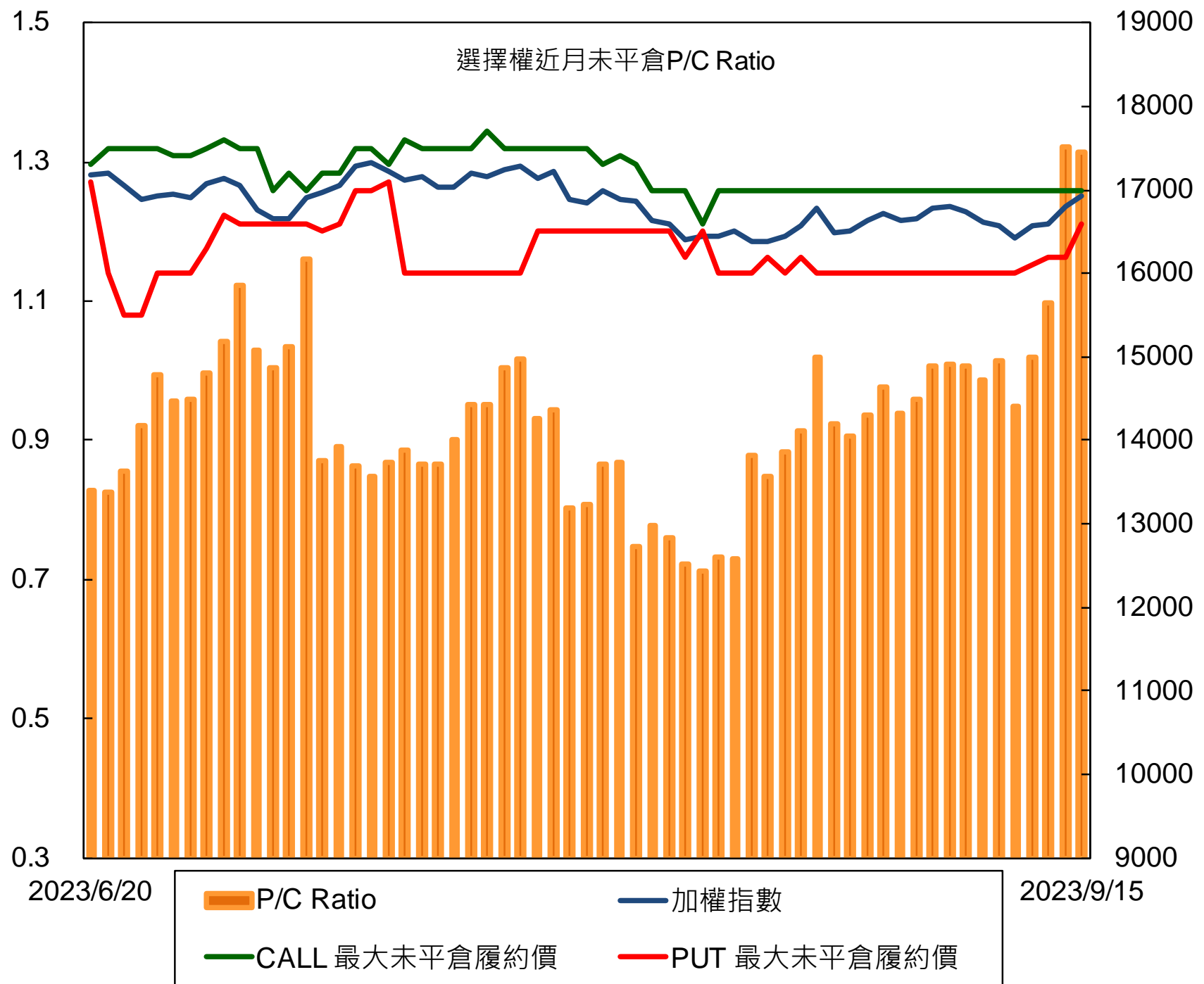
更新日期：2023年9月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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>	9月14日	65,315	63,663	1,652
	9月15日	64,115	68,531	-4,416
<b>Put</b>	9月14日	56,614	70,613	-13,999
	9月15日	64,611	69,551	-4,940

更新日期：2023年9月15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15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



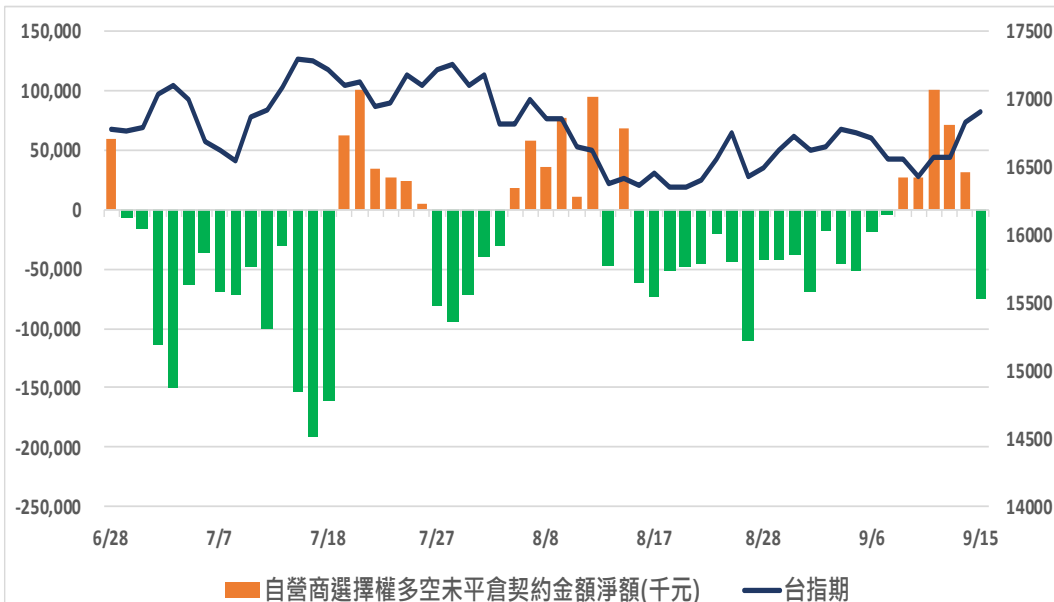
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/9/11	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
2023/9/14	16836	4,721	+4,829	138,780	+141,087
2023/9/15	16904	5,535	+814	182,860	+44,080

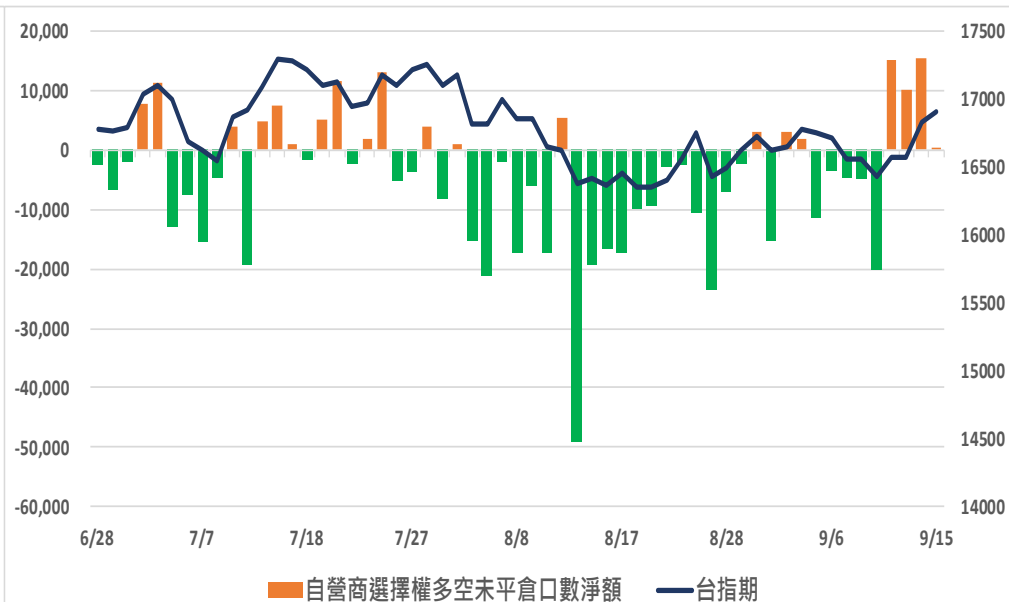
更新日期：2023年9月15日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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

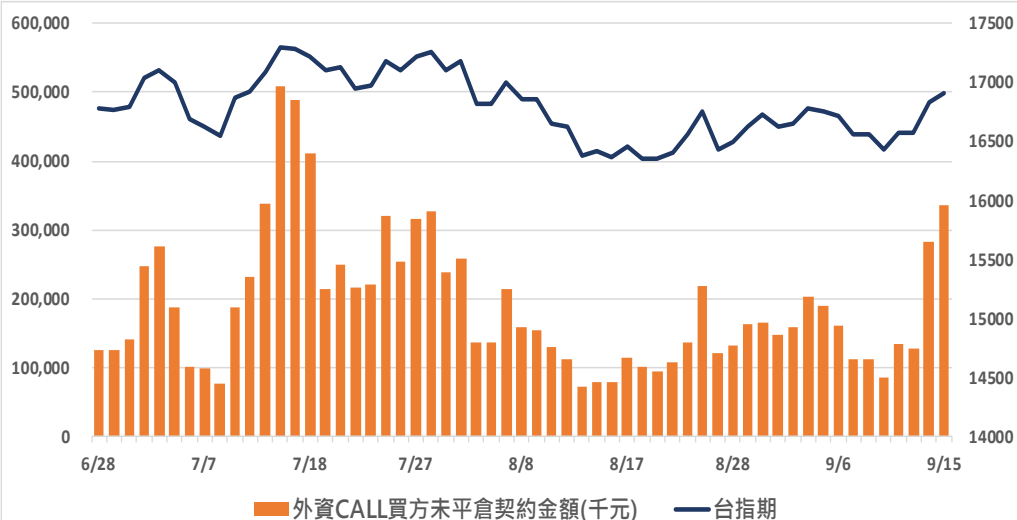
日期	台指期	未平倉口數淨額	口數增減	金額淨額(千元)	金額增減
2023/9/11	16425	-20,168	-15,246	27,703	+778
2023/9/12	16570	15,114	+35,282	100,504	+72,801
2023/9/13	16579	10,191	-4,923	70,925	-29,579
2023/9/14	16836	15,651	+5,460	31,198	-39,727
2023/9/15	16904	524	-15,127	-75,378	-106,576

更新日期：2023年9月15日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

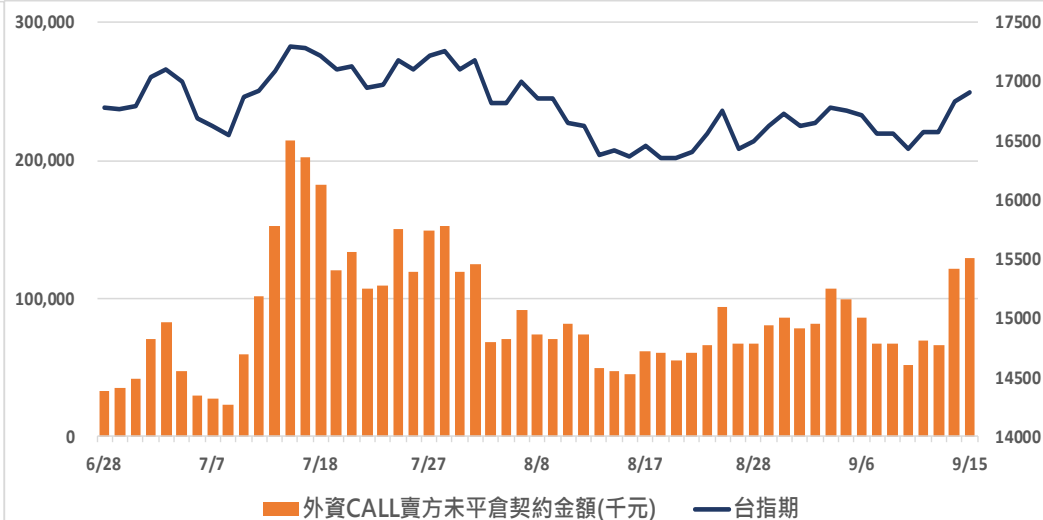


# 外資選擇權未平倉金額

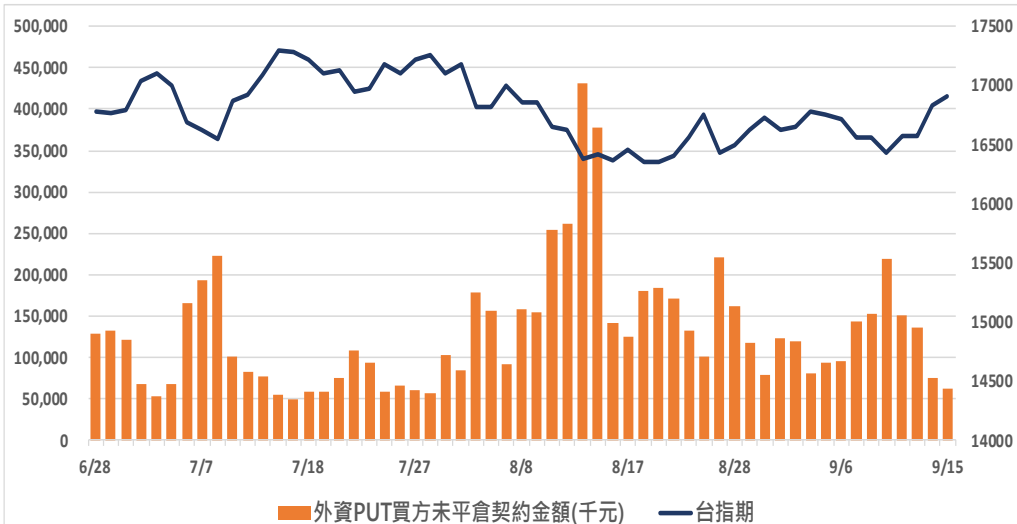
## Buy Call未平倉金額



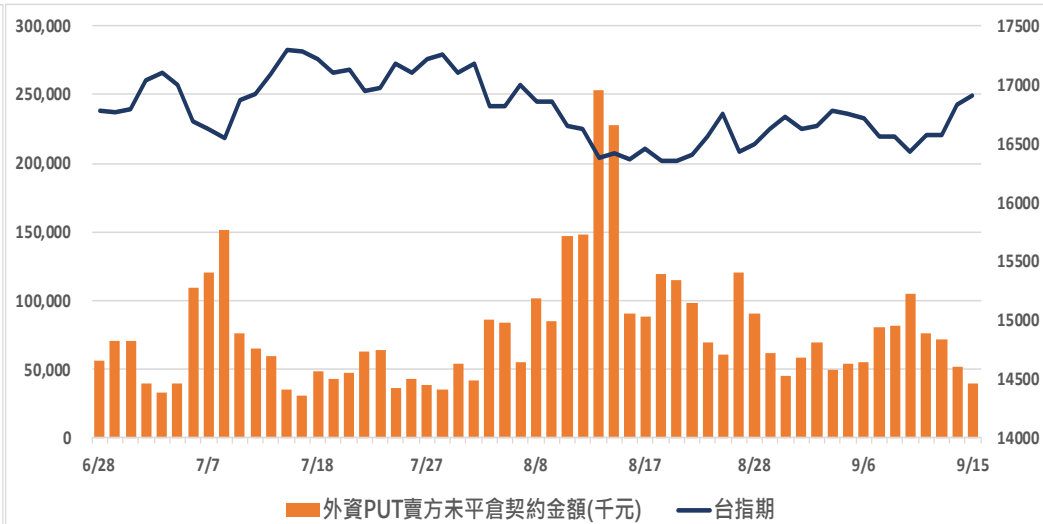
## Sell Call未平倉金額



## Buy Put未平倉金額



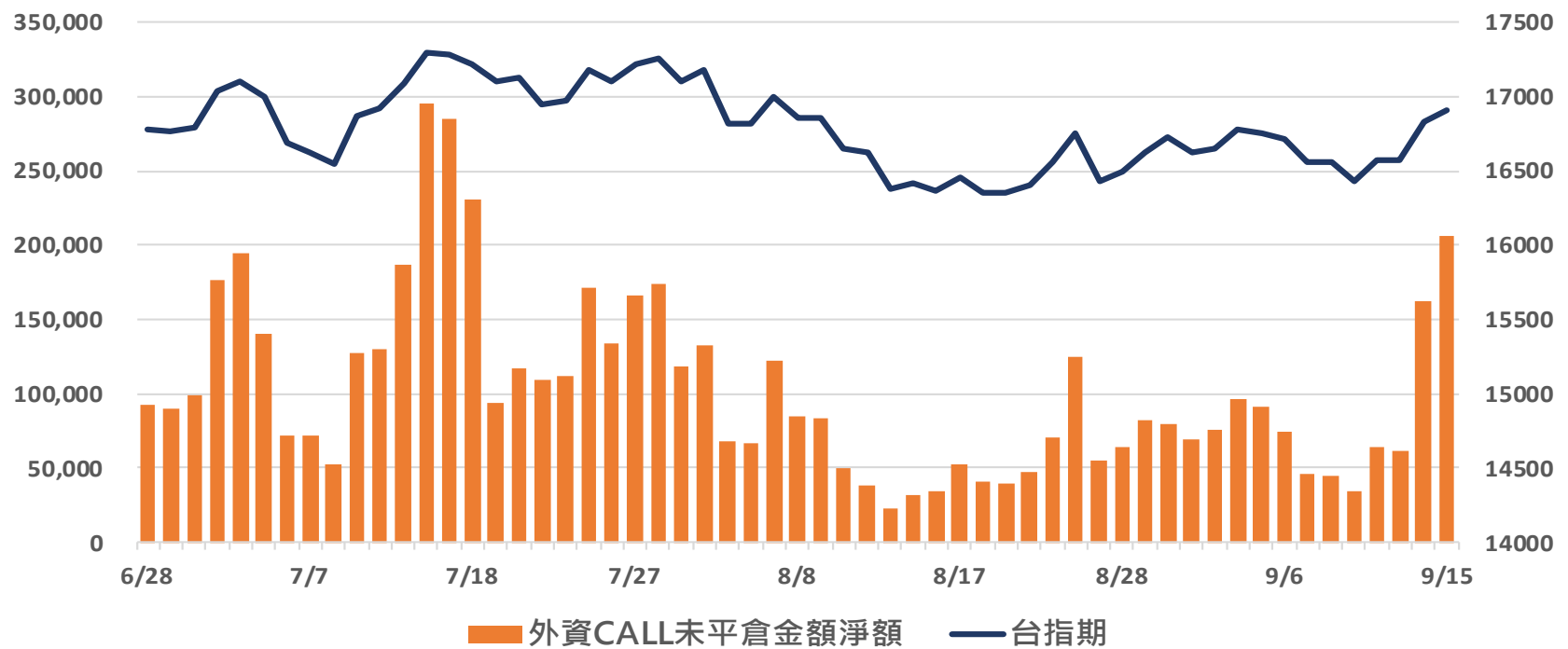
## Sell Put未平倉金額



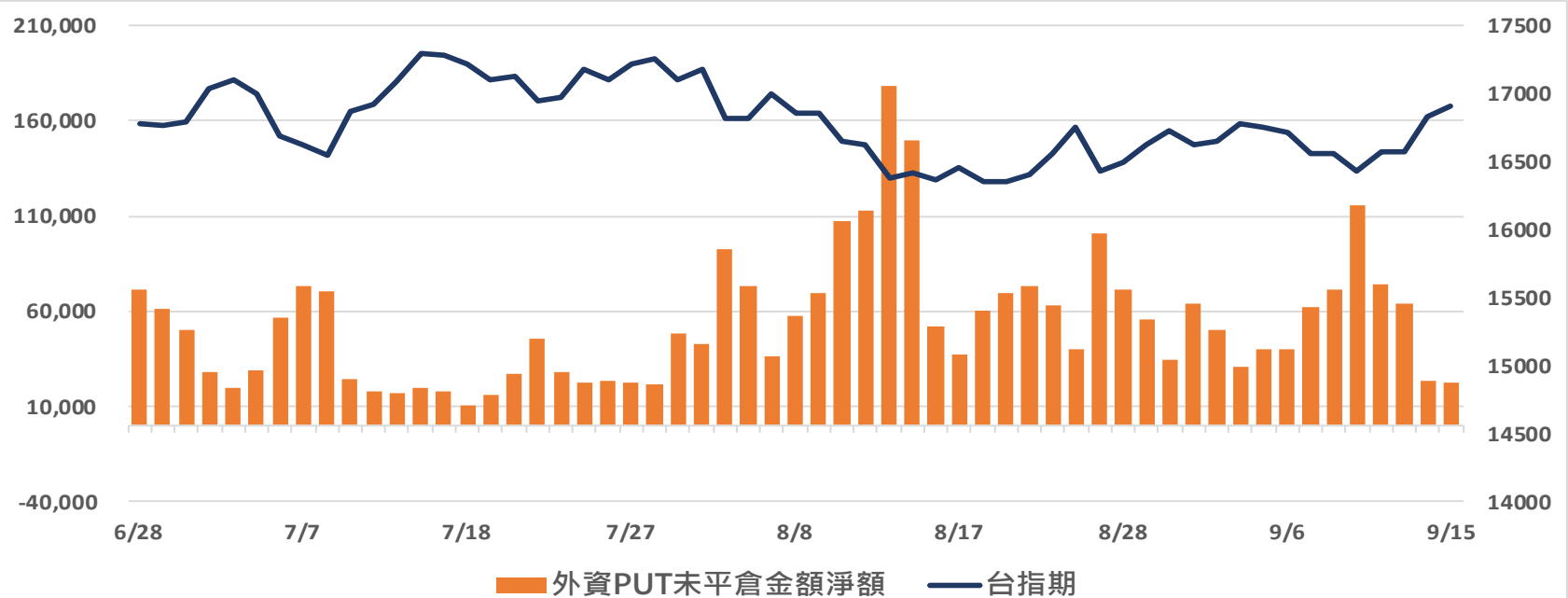
更新日期：2023年9月15日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 外資買賣權未平倉金額淨額

## Buy Call – Sell Call 未平倉金額



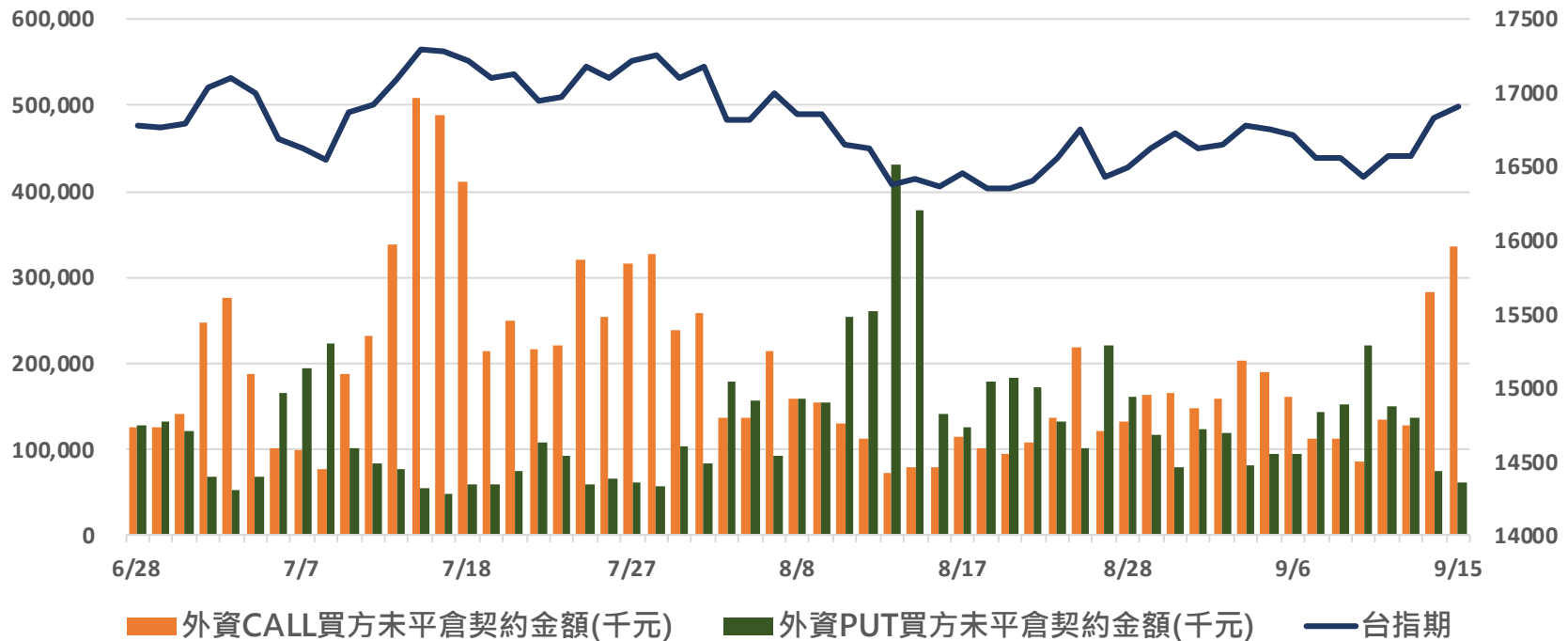
## Buy Put – Sell Put 未平倉金額



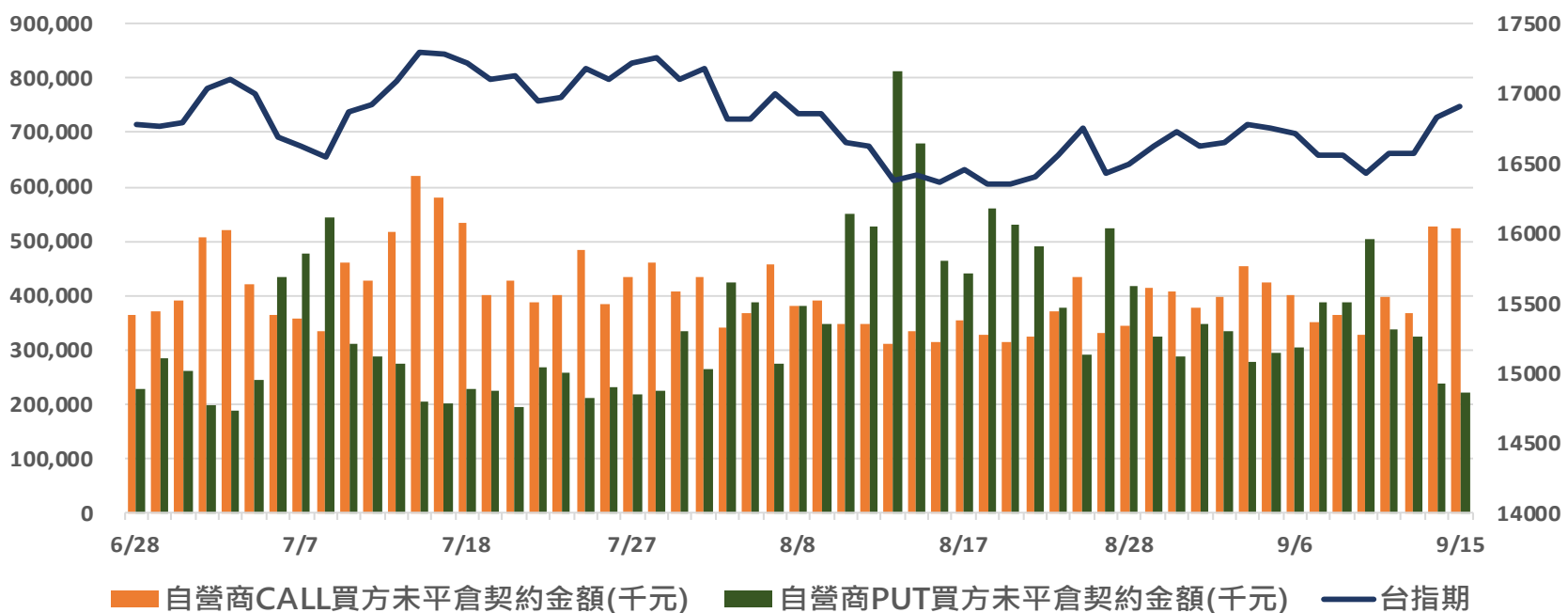
更新日期：2023年9月15日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 法人選擇權買方未平倉金額

## 外資Buy Call、Buy Put未平倉金額



## 自營商Buy Call、Buy Put未平倉金額



更新日期：2023年9月15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