

# 台指選擇權OI

日期：2023/9/8 結算日：2023/9/13					日期：2023/9/8 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
0	1	16,100	4,058	316	0	71	15,600	8,541	-68
0	0	16,150	4,449	1,553	5	44	15,700	2,524	287
4	30	16,200	7,019	1,907	1	97	15,800	4,508	185
7	55	16,250	4,804	1,766	5	31	15,900	4,736	709
43	76	16,300	7,607	2,965	11	149	16,000	12,848	1,635 ※
112	123	16,350	7,610	3,410	15	169	16,100	5,941	1,482
335	479	16,400	13,379	4,632 ※	12	922	16,200	9,928	208
280	544	16,450	7,944	2,503	370	2,797	16,300	8,769	384
833	1,560	16,500	9,475	2,082	63	1,681	16,400	4,664	236
1,719	2,845	16,550	4,730	985	55	1,653	16,500	4,594	236
2,493	5,878	16,600	4,598	58	679	6,679	16,600	4,952	180
1,601	5,196	16,650	2,213	-471	-1	3,798	16,700	1,720	-163
2,113	6,495	16,700	2,662	-280	523	7,443	16,800	3,071	136
1,805	7,135	16,750	1,952	-128	386	5,816	16,900	958	-65
※ 4,327	10,950	16,800	906	94	※ 1,009	12,866	17,000	1,085	-12
1,602	7,337	16,850	836	-52	-284	5,435	17,100	145	-15
1,330	9,503	16,900	269	-15	-260	8,012	17,200	167	-4
-160	5,747	16,950	46	-7	-1,646	6,334	17,300	503	0
-1,111	6,077	17,000	88	-9	-116	4,678	17,400	189	-2
748	4,453	17,050	10	0	-70	4,191	17,500	112	0
-421	3,255	17,100	50	-7	-50	3,590	17,600	70	0
780	3,191	17,150	8	0	-11	3,021	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
18,382	89,088	1.1245	100,183	23,348	465	101,658	1.0605	107,809	5,391
昨日 P/C	1.0457	今日增減變化		0.0788	昨日 P/C	0.9874	今日增減變化		0.0732

更新日期：2023年9月8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	73,862,524	86,737,882	-12,875,358	-2,572,655	1,090,387	2,933,661	-1,843,274	8,520
投信	42,700,148	38,814,703	3,885,445	1,271,803	577,646	0	577,646	-35,272
自營商	19,285,545	27,321,451	-8,035,906	-1,884,909	314,801	1,265,634	-950,833	-178,179
	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	1,980,226	1,652,203	328,023	-81,899	135,678	23,342	112,336	13,933
投信	27,727	0	27,727	177	0	0	0	0
自營商	425,691	1,314,810	-889,119	156,065	88,975	218,793	-129,818	-5,377

## 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	39,398	11,899	27,499	553	43,775	13,020	30,755	6,722
投信	200	0	200	0	300	120	180	0
自營商	68,359	76,690	-8,331	-2,675	66,692	70,101	-3,409	-2,412
特定法人(週)	895	0	895	895	0	1,500	-1,500	0
特定法人(近月)	24,981	1,900	23,081	-17	2,280	27,754	-25,474	-7,394
特定法人(全月)	30,264	0	30,264	667	2,940	30,419	-27,479	-7,816
十大交易人(週)	23,949	26,289	-2,340	-1,684	28,496	31,851	-3,355	-329
十大交易人(近月)	51,278	53,021	-1,743	-2,122	51,542	55,890	-4,348	799
十大交易人(全月)	89,498	80,582	8,916	513	78,915	98,367	-19,452	-2,327
全市場未沖銷(近月)			110,119	4,016			111,685	6,924
全市場未沖銷(全月)			236,515	23,092			240,248	32,553

更新日期：2023年9月8日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

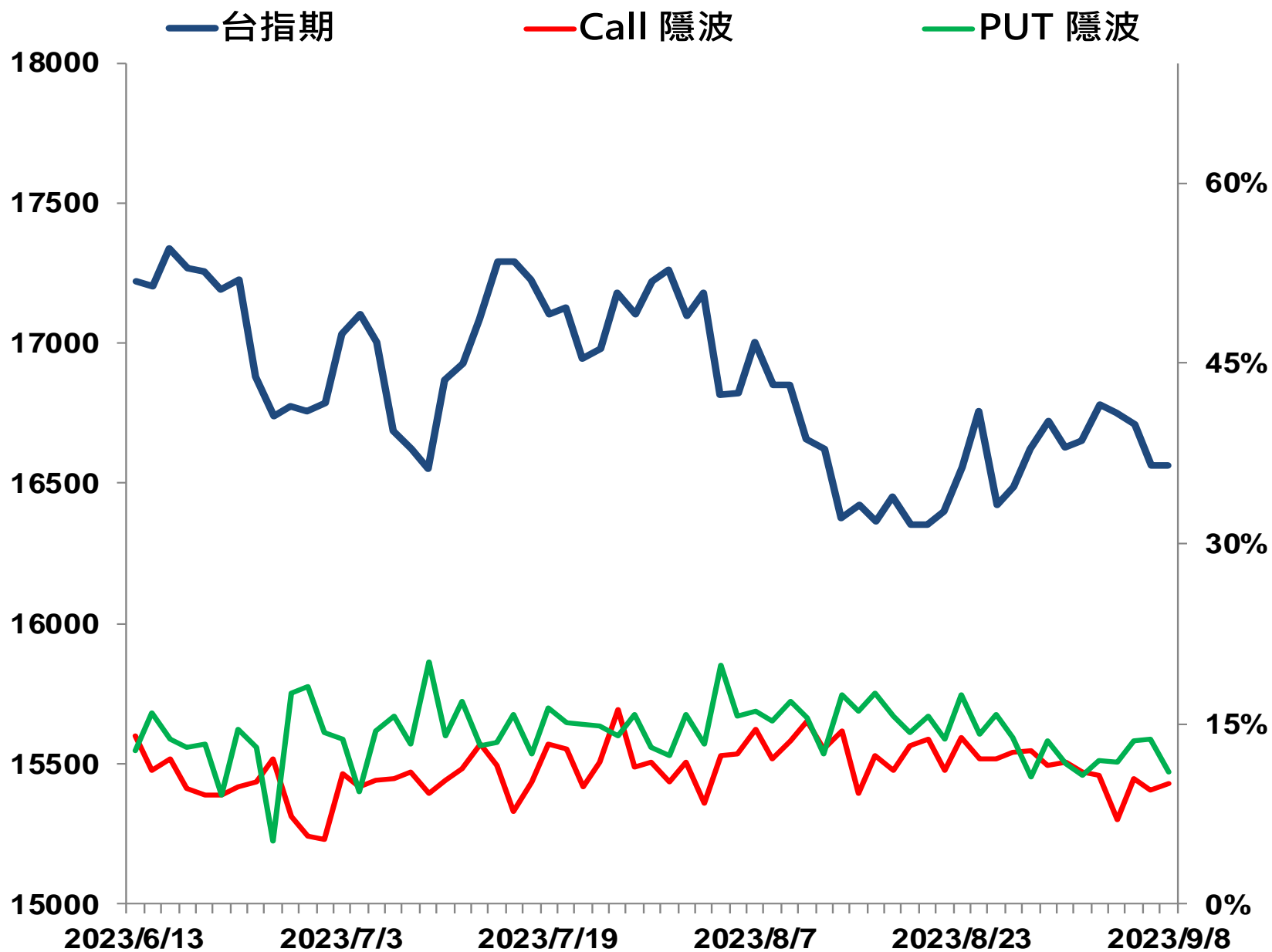
# 選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年9月8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



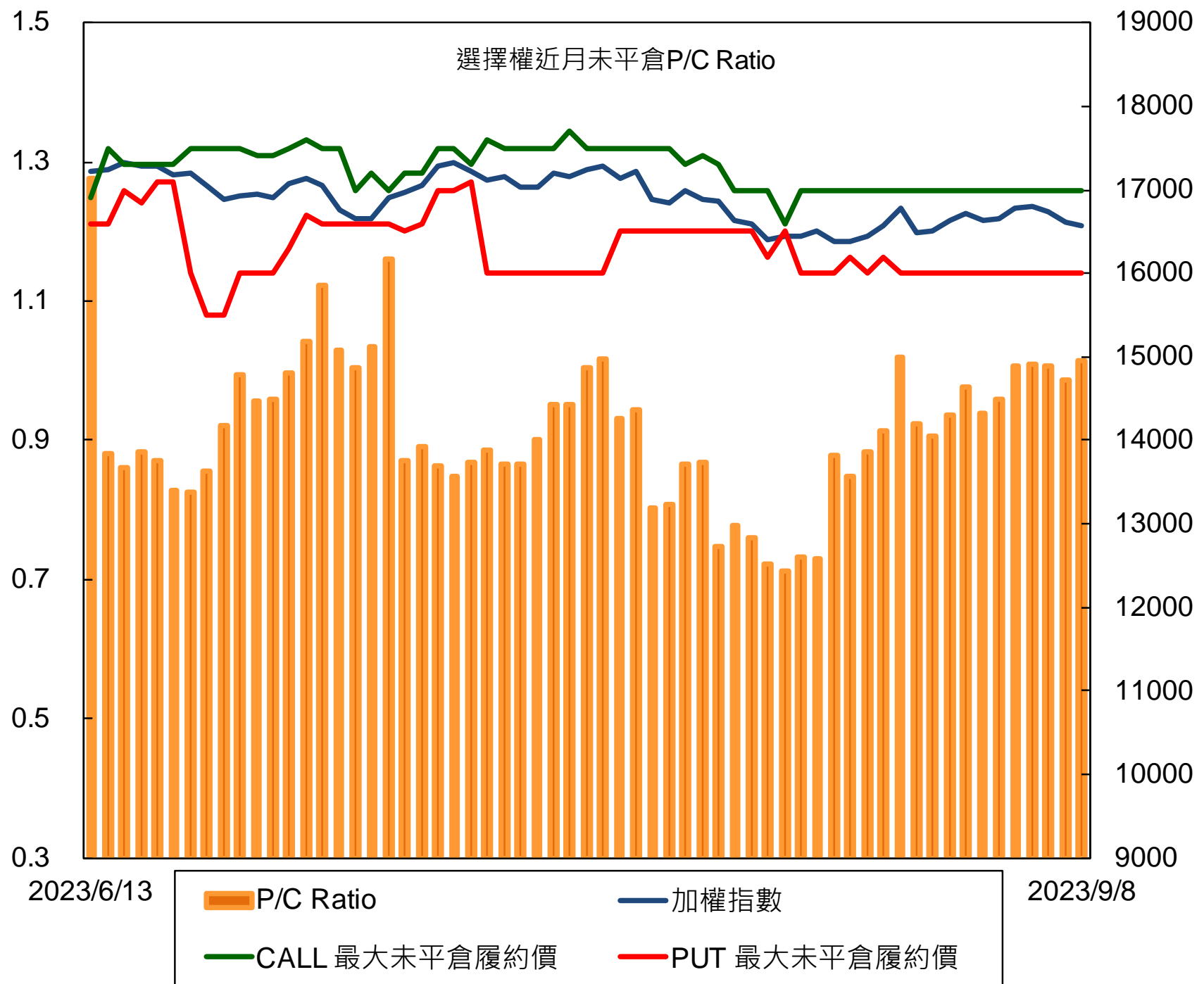
更新日期：2023年9月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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7日	67,046	72,702	-5,656
	9月8日	68,359	76,690	-8,331
<b>Put</b>	9月7日	61,345	62,342	-997
	9月8日	66,692	70,101	-3,409

更新日期：2023年9月8日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

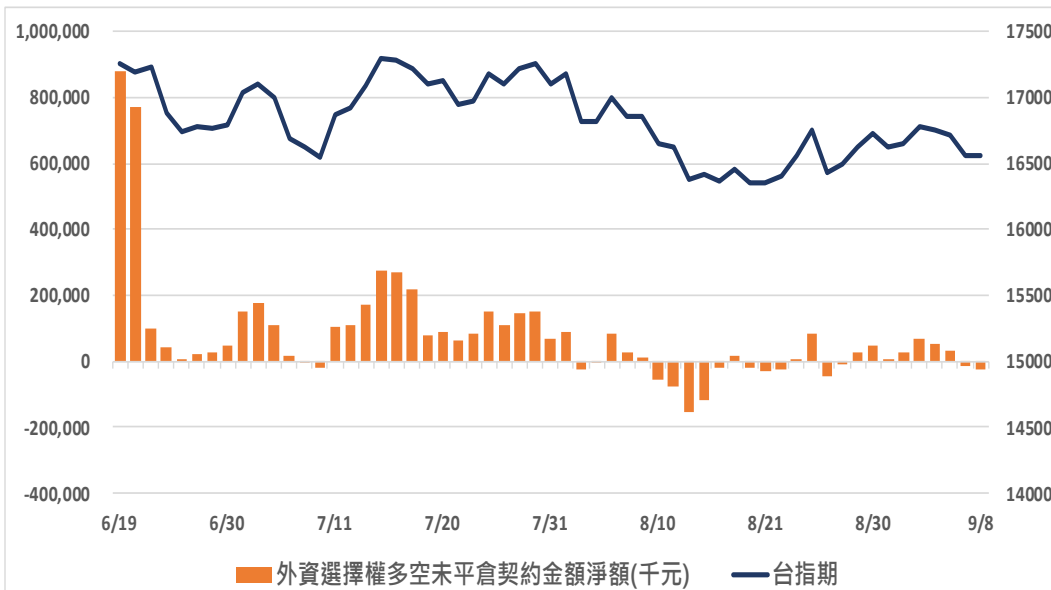
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



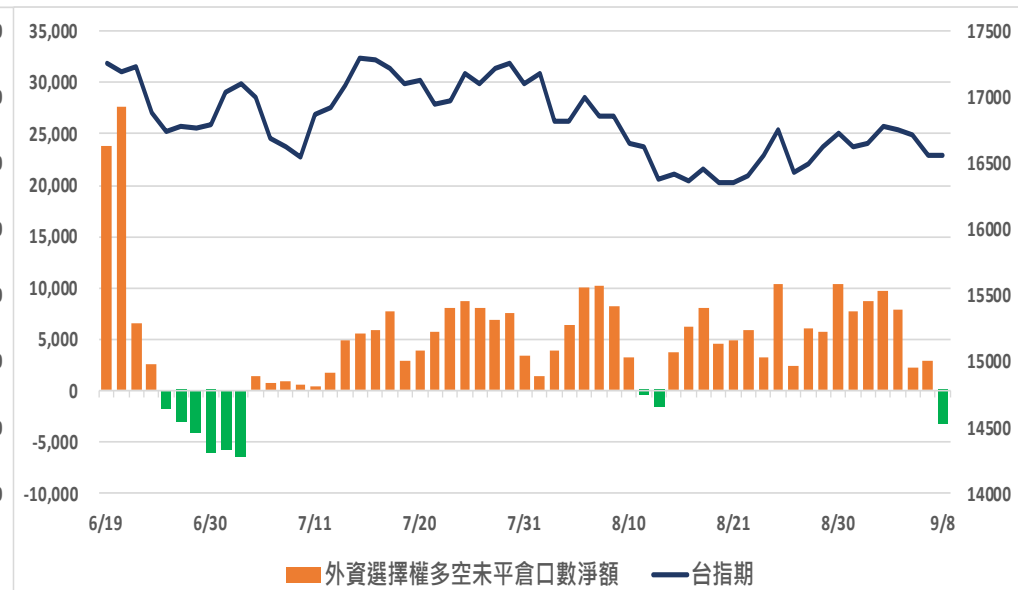
更新日期：2023年9月8日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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



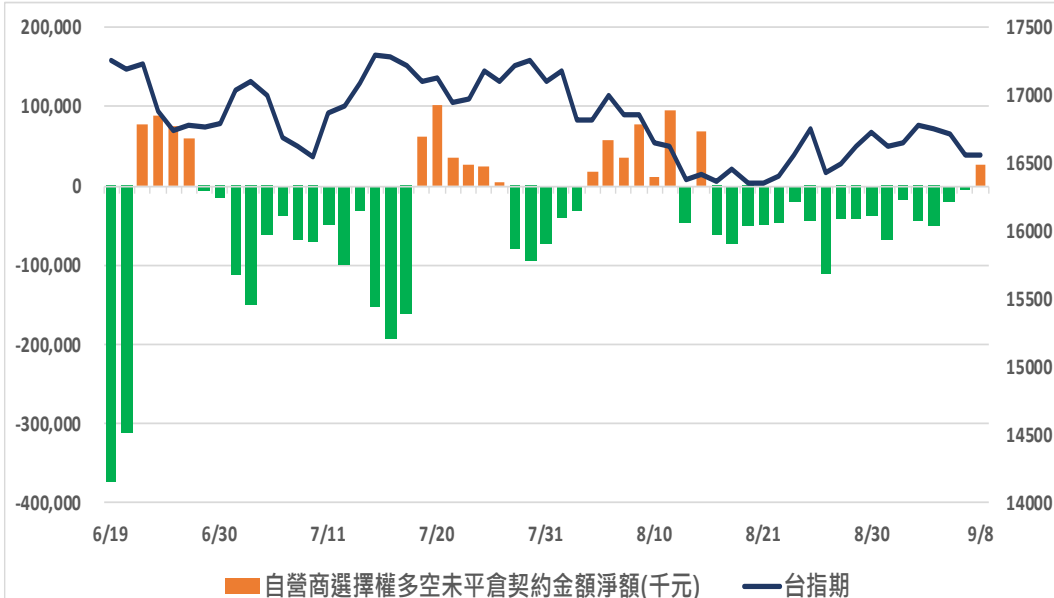
## 外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/9/4	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
2023/9/8	16562	-3,256	-6,169	-26,130	-9,346

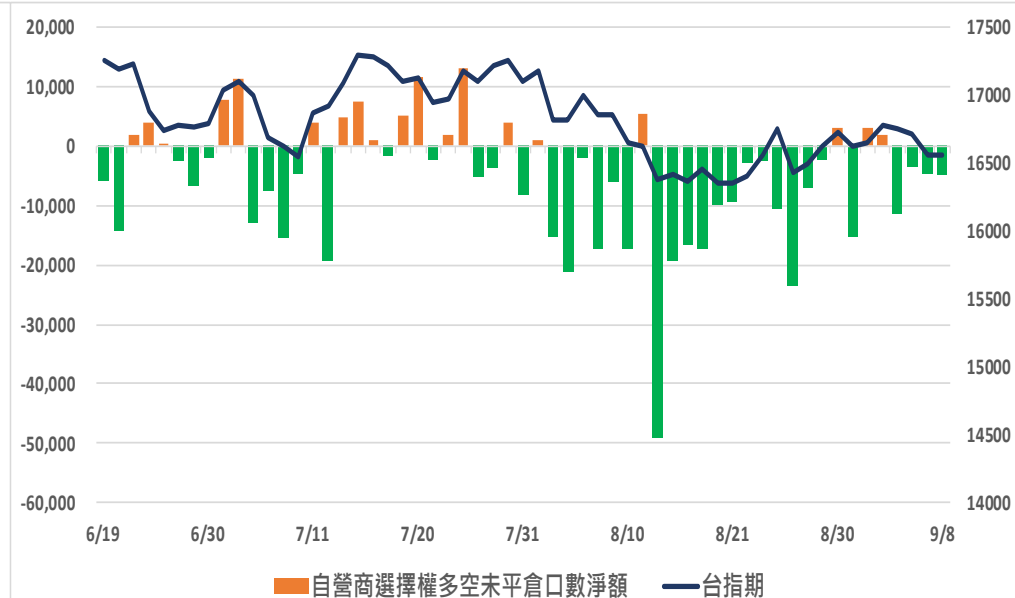
更新日期：2023年9月8日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 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
2023/9/4	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
2023/9/8	16562	-4,922	-263	26,925	+31,077

更新日期：2023年9月8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

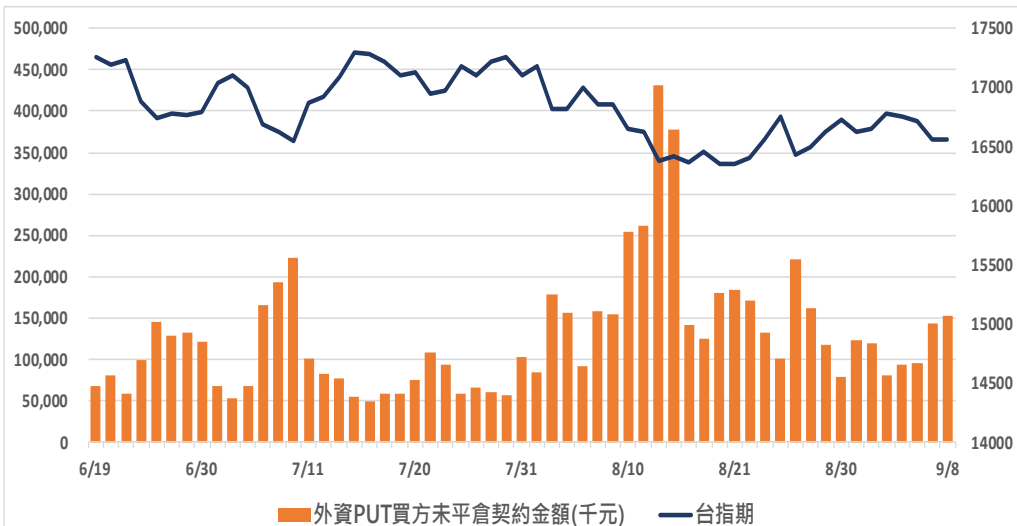
## Buy Call未平倉金額



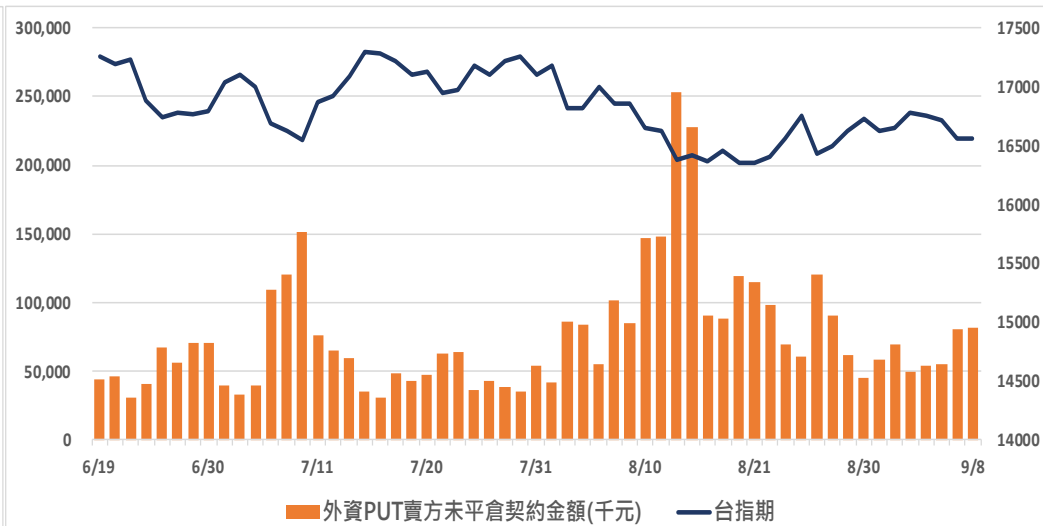
## Sell Call未平倉金額



## Buy Put未平倉金額



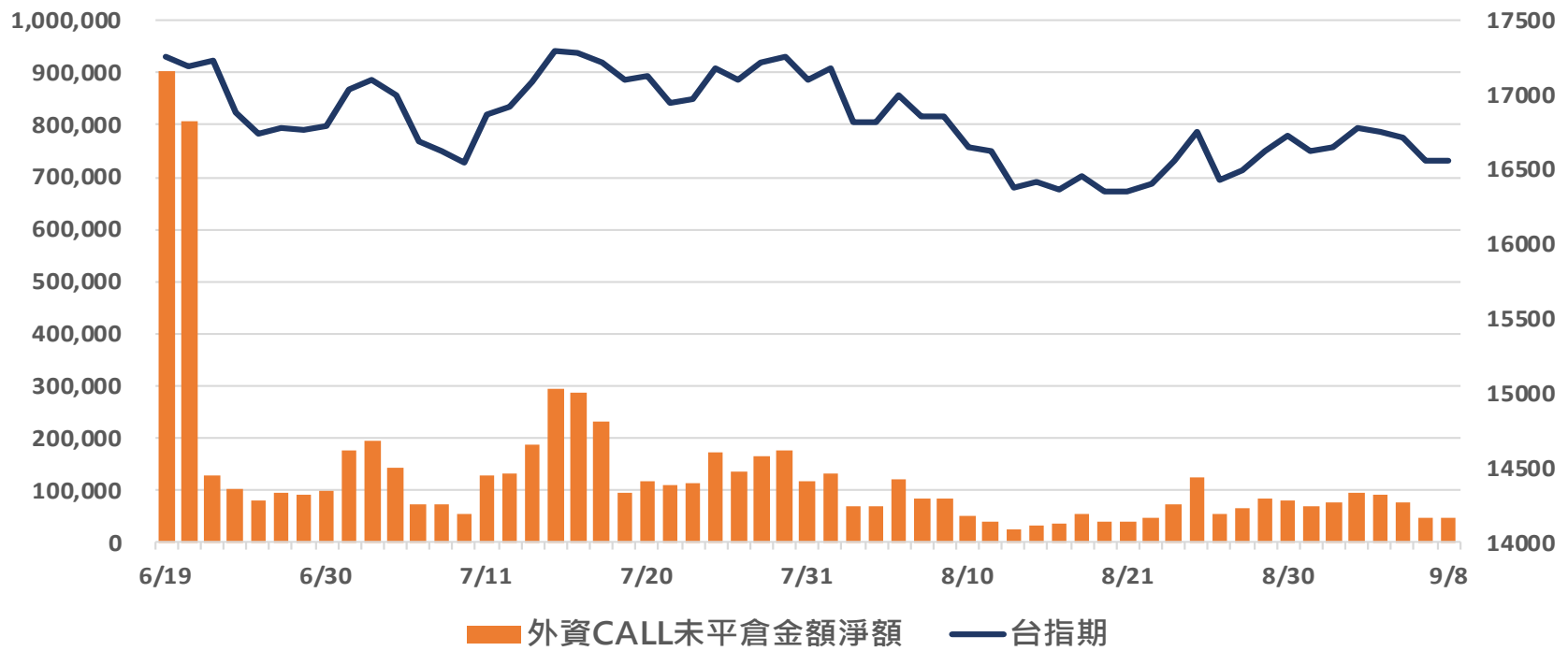
## Sell Put未平倉金額



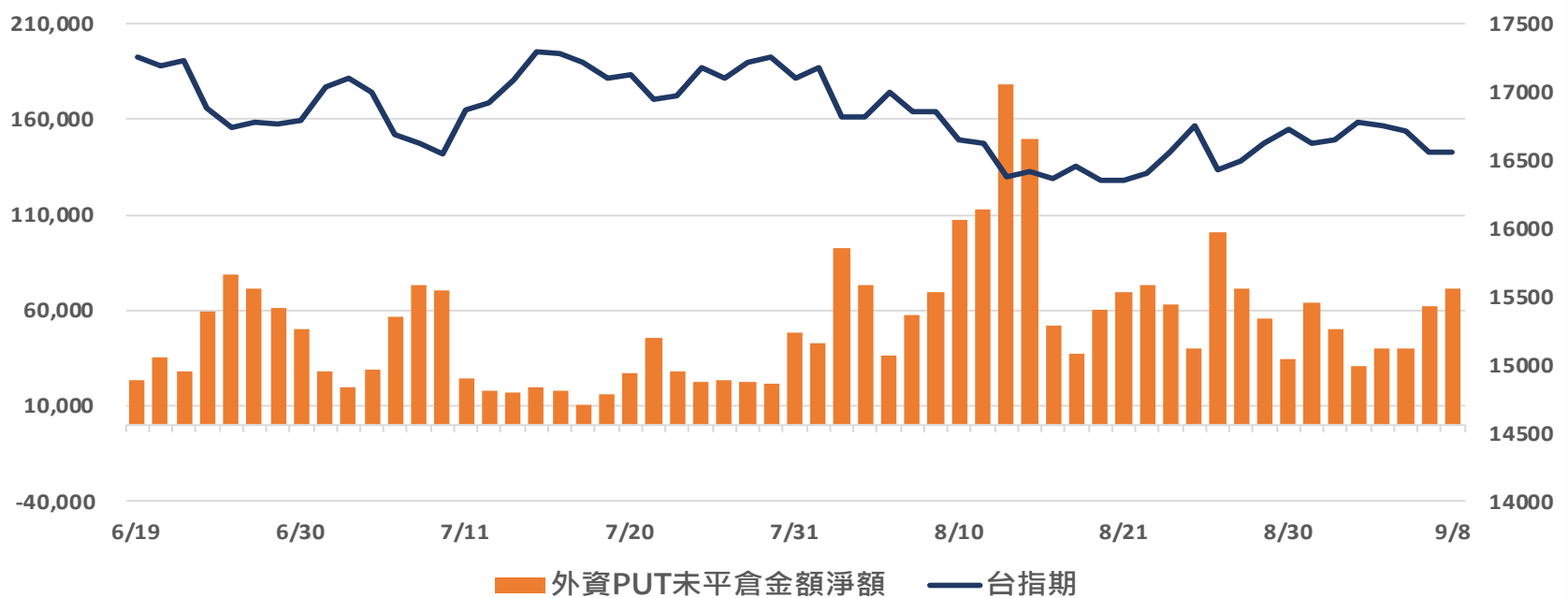
更新日期：2023年9月8日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

# 外資買賣權未平倉金額淨額

## Buy Call – Sell Call 未平倉金額

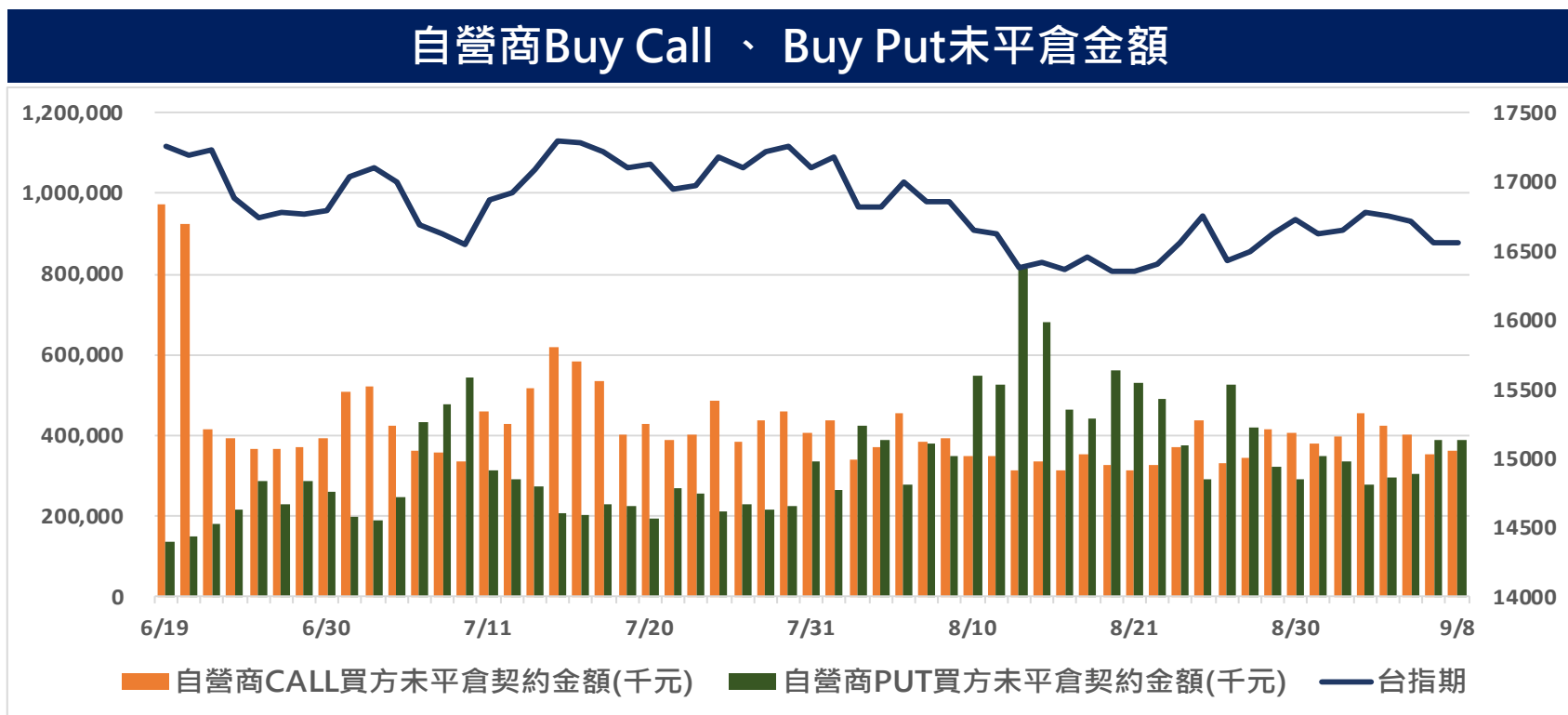
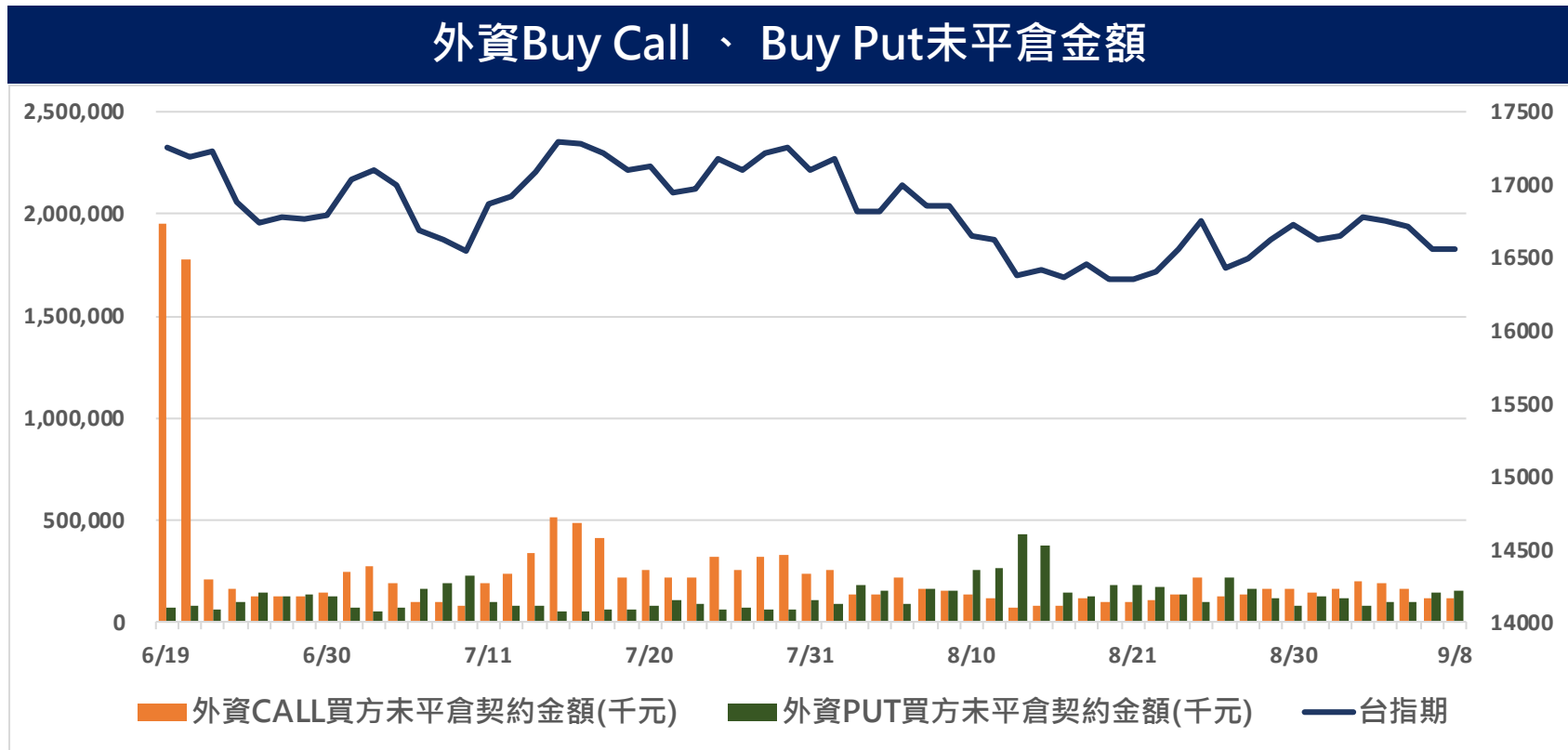


## Buy Put – Sell Put 未平倉金額



更新日期：2023年9月8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8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