

台指選擇權OI

日期：2023/9/4 結算日：2023/9/6					日期：2023/9/4 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
4	56	16,350	5,135	-725	0	24	15,900	3,876	717
38	162	16,400	7,062	-620	1	132	16,000	9,695	-132
-7	294	16,450	6,226	-349	-4	152	16,100	4,518	-156
-63	953	16,500	9,513	1,069	-7	922	16,200	9,482	207
85	918	16,550	9,532	2,173	-406	1,544	16,300	7,597	495
890	2,297	16,600	12,721	4,296	11	1,567	16,400	3,444	529
-262	2,686	16,650	7,530	3,593	-229	1,612	16,500	3,503	311
823	5,022	16,700	6,824	3,090	-99	5,551	16,600	4,460	438
1,436	5,314	16,750	6,761	4,886	87	3,268	16,700	1,917	699
1,860	7,579	16,800	3,919	3,171	198	6,588	16,800	2,687	201
2,153	8,816	16,850	974	439	256	5,240	16,900	1,061	64
※ 2,226	12,303	16,900	736	377	※ 563	10,348	17,000	1,049	62
1,021	8,076	16,950	214	97	-360	5,227	17,100	142	4
223	9,666	17,000	126	3	-143	8,168	17,200	183	1
491	4,965	17,050	15	1	-254	7,521	17,300	508	3
-321	3,863	17,100	93	8	317	4,839	17,400	200	-24
161	1,686	17,150	10	0	-6	4,583	17,500	115	4
-129	4,028	17,200	9	0	213	3,854	17,600	70	0
-76	1,811	17,300	4	0	233	2,997	17,700	56	0
-83	1,822	17,400	0	0	3	2,341	17,800	103	0
-44	267	17,500	0	0	-6	1,662	17,900	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
10,424	82,937	1.2969	107,560	19,554	370	96,737	1.0069	97,405	5,059
昨日 P/C	1.2137	今日增減變化		0.0832	昨日 P/C	0.9583	今日增減變化		0.0486

更新日期：2023年9月4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	74,395,498	86,106,996	-11,711,498	8,622,912	1,015,599	2,891,820	-1,876,221	-159,042
投信	42,458,407	38,371,286	4,087,121	890,129	738,618	0	738,618	7,348
自營商	17,146,022	25,817,144	-8,671,122	1,245,892	567,110	1,137,596	-570,486	297,919
	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	1,662,860	1,503,868	158,992	75,497	101,451	35,287	66,164	3,212
投信	39,317	0	39,317	53	0	0	0	0
自營商	267,027	1,248,416	-981,389	-114,232	72,038	152,894	-80,856	-3,267

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	40,138	10,235	29,903	2,038	32,827	12,705	20,122	981
投信	200	0	200	0	300	120	180	0
自營商	64,383	71,201	-6,818	-2,387	59,466	68,165	-8,699	-1,298
特定法人(週)	6,741	0	6,741	2,889	0	1,100	-1,100	1,362
特定法人(近月)	24,029	1,960	22,069	1,200	3,157	18,911	-15,754	-1,167
特定法人(全月)	33,986	0	33,986	4,153	2,605	22,298	-19,693	-1,540
十大交易人(週)	29,555	25,170	4,385	-2,166	39,365	35,262	4,103	4,580
十大交易人(近月)	48,000	49,095	-1,095	-681	43,374	48,219	-4,845	1,177
十大交易人(全月)	89,236	79,787	9,449	-1,605	81,228	90,817	-9,589	3,746
全市場未沖銷(近月)			96,737	370			97,405	5,059
全市場未沖銷(全月)			222,804	14,571			242,994	30,895

更新日期：2023年9月4日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

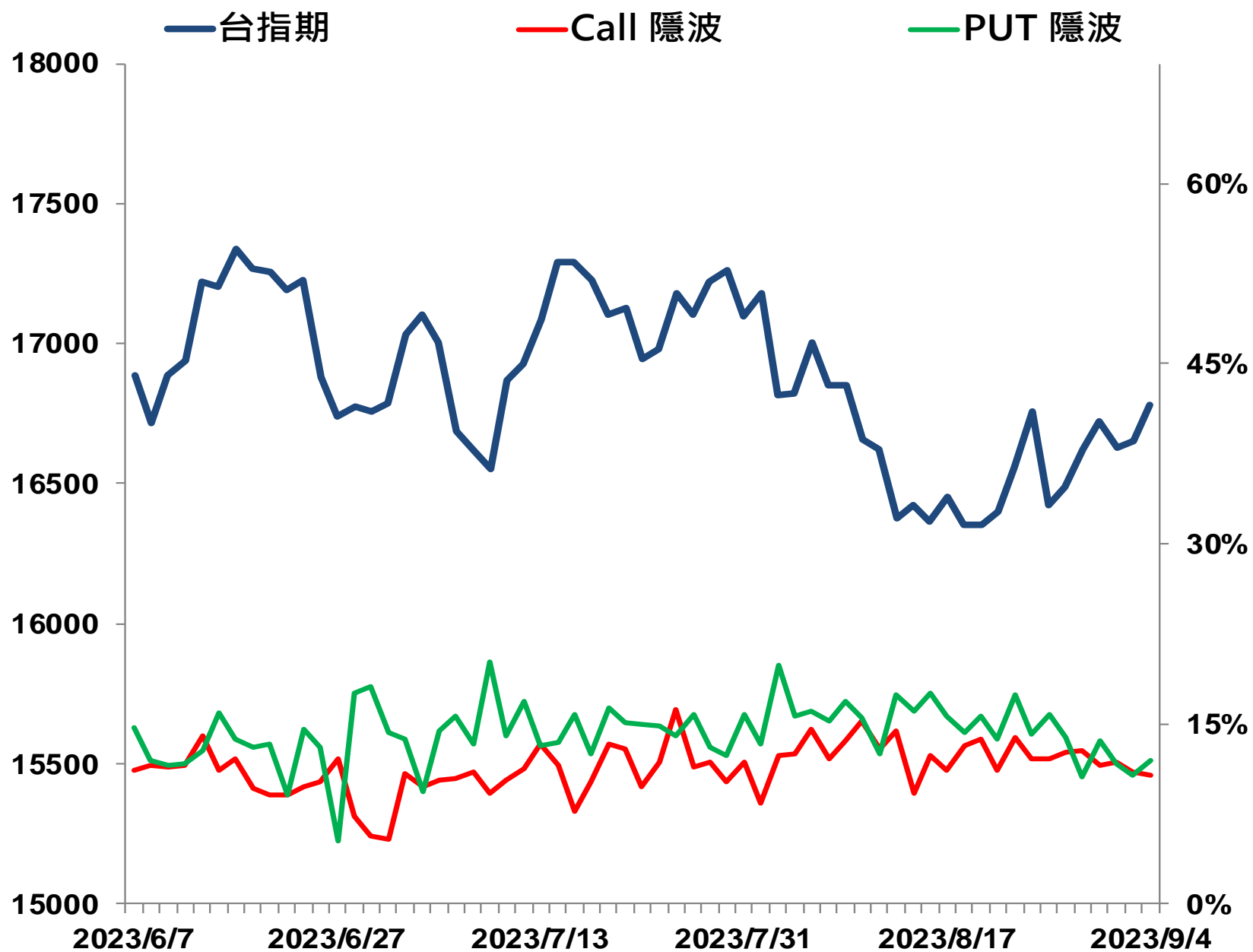
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年9月4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4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

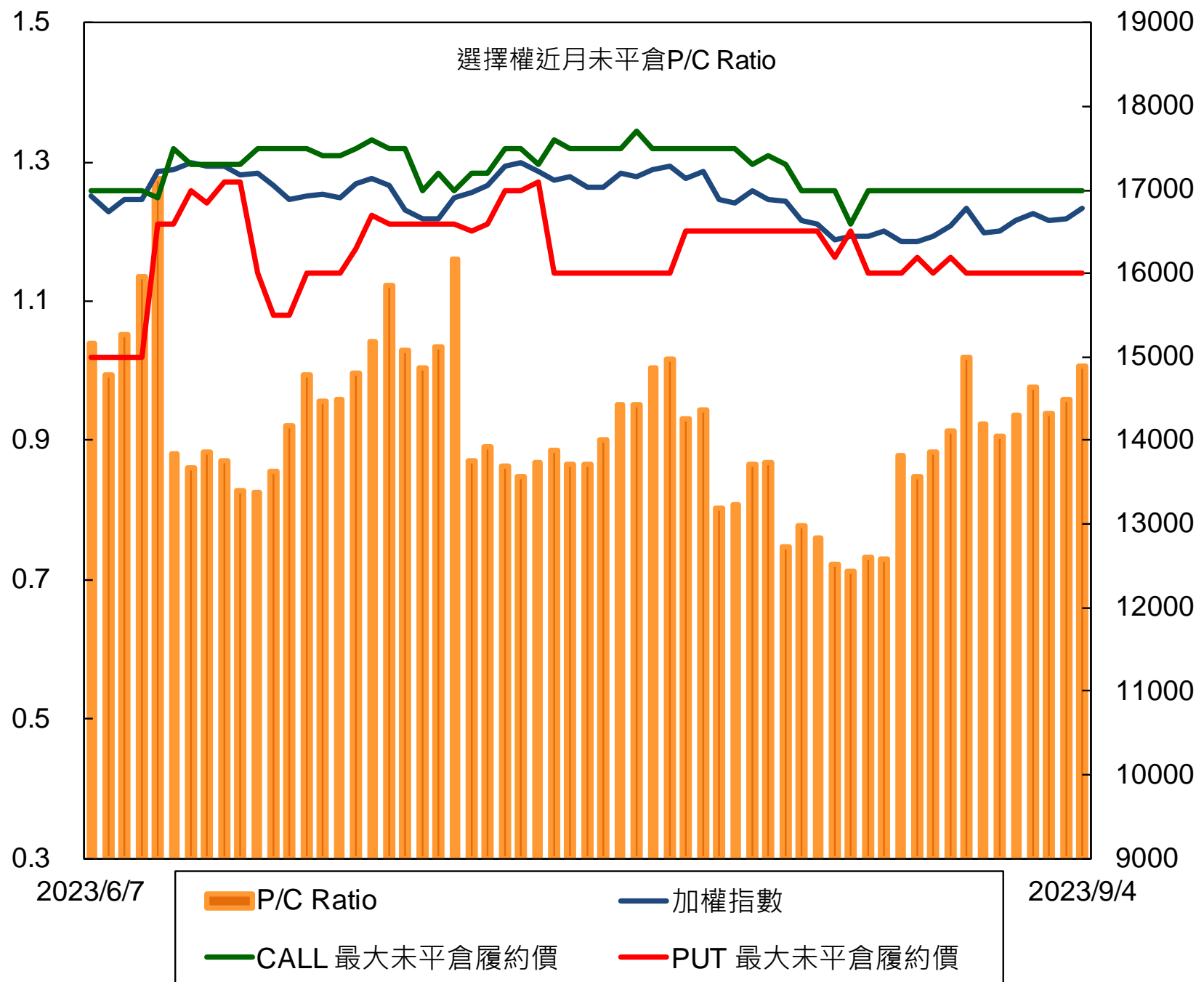
自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	9月1日	62,380	66,811	-4,431
	9月4日	64,383	71,201	-6,818
Put	9月1日	56,279	63,680	-7,401
	9月4日	59,466	68,165	-8,699

更新日期：2023年9月4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



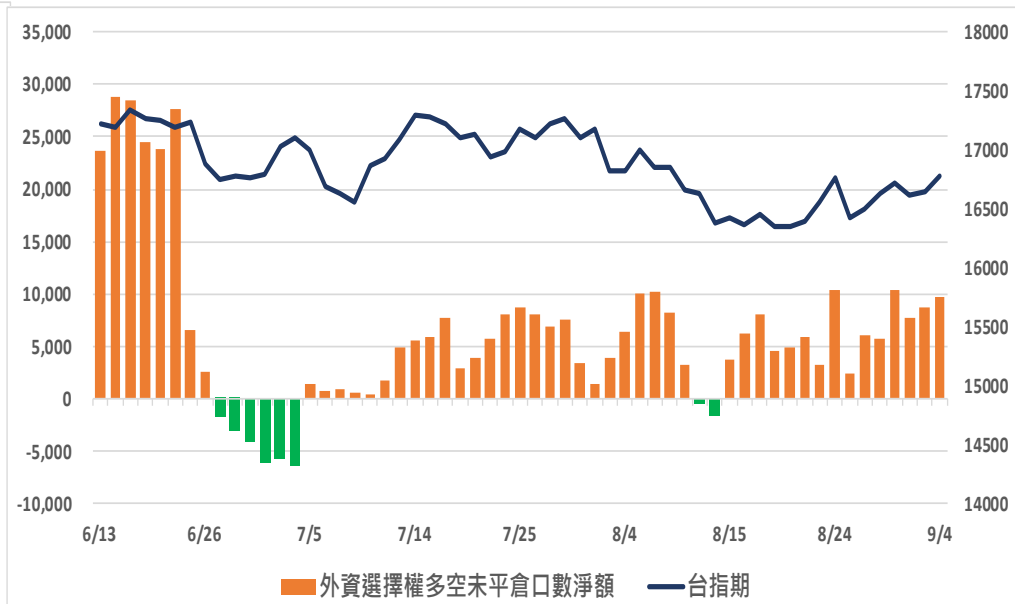
更新日期：2023年9月4日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



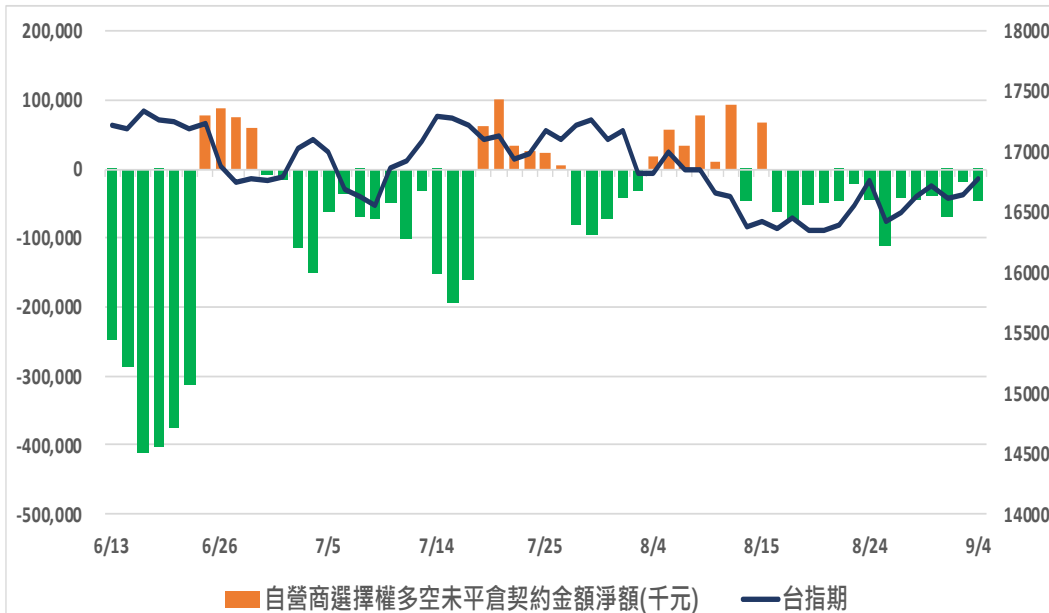
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/29	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
2023/9/4	16778	9,781	+1,057	65,566	+39,250

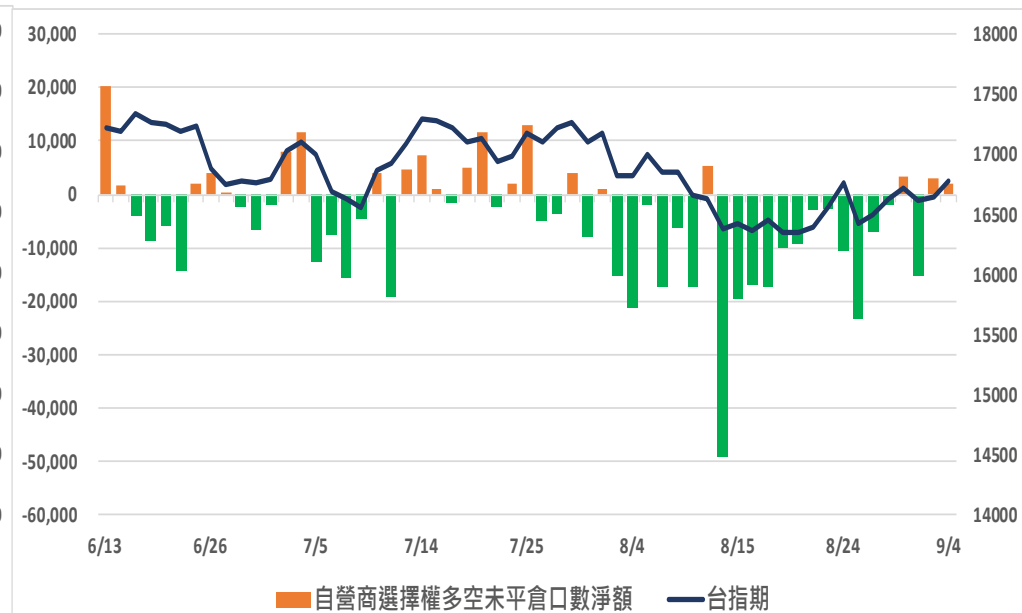
更新日期：2023年9月4日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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(千萬元)	金額增減
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
2023/9/4	16778	1,881	-1,089	-45,141	-28,163

更新日期：2023年9月4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

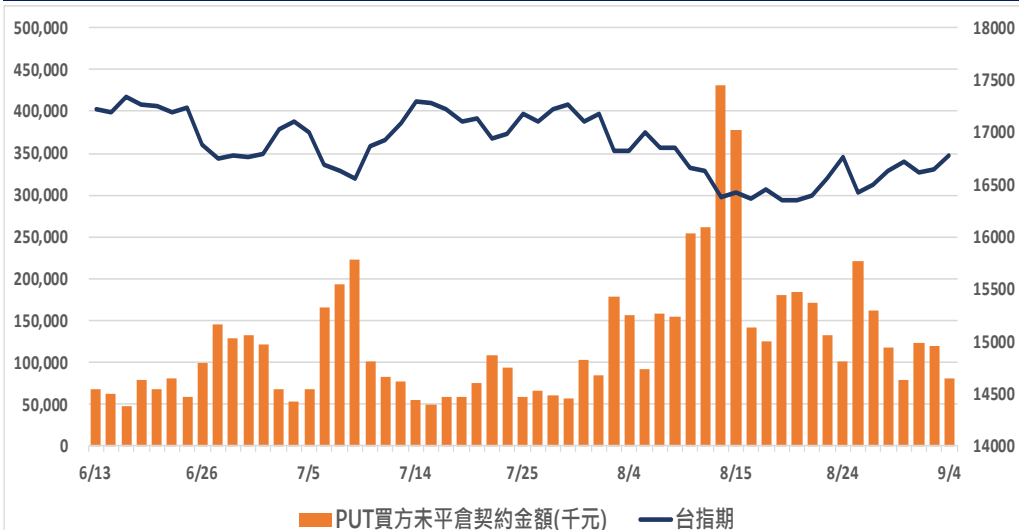
Buy Call未平倉金額



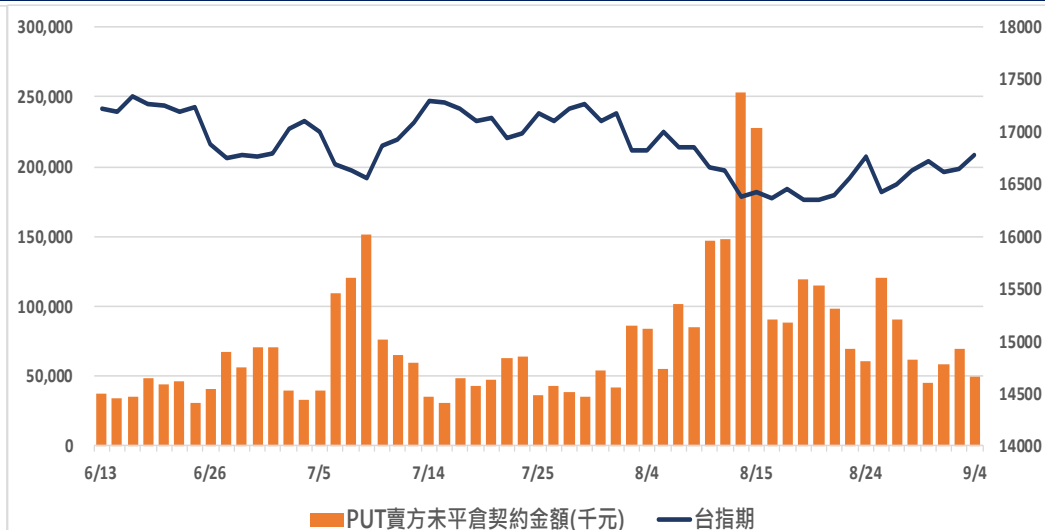
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



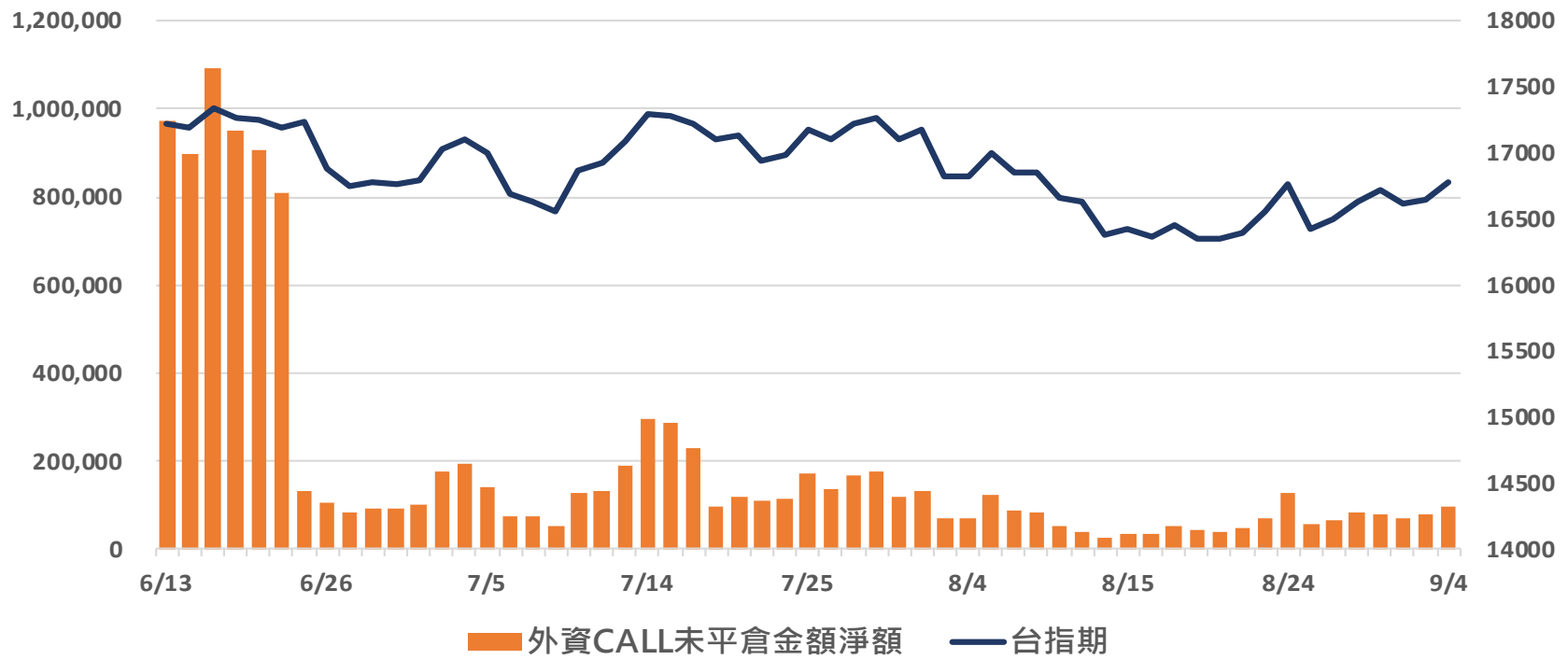
Sell Put未平倉金額



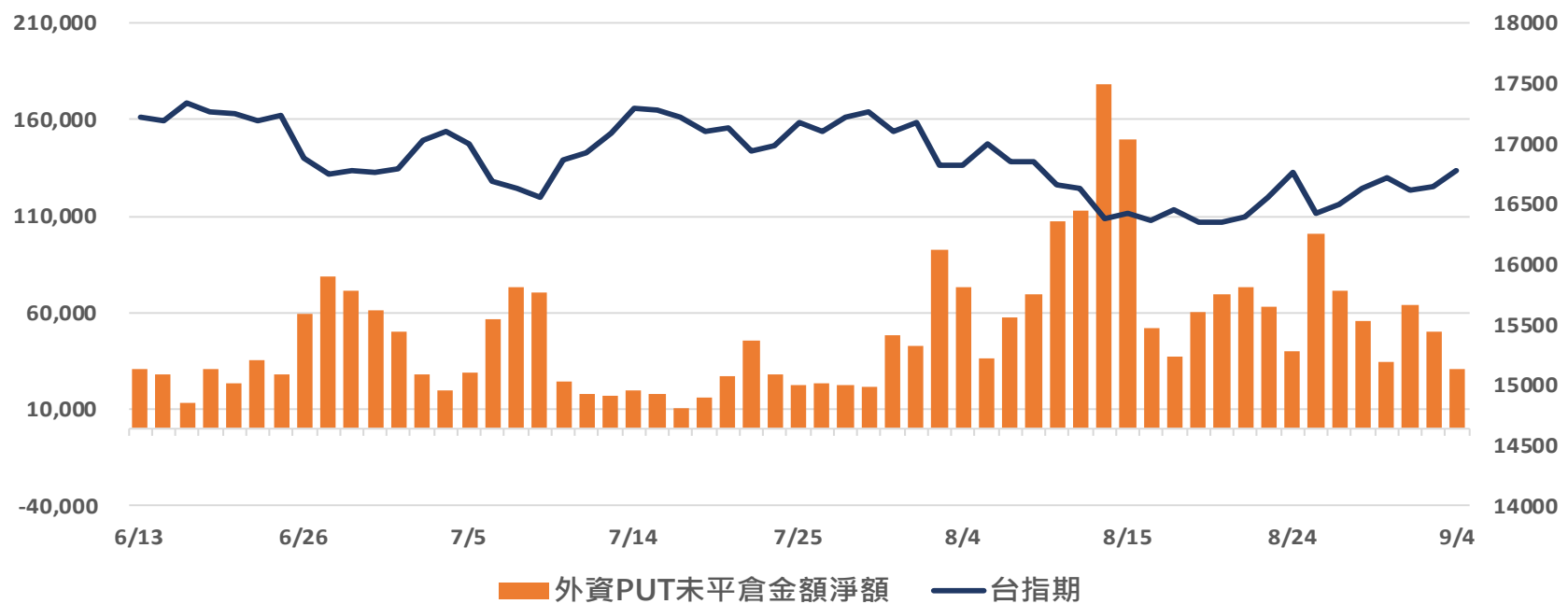
更新日期：2023年9月4日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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4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