

台指選擇權OI

日期：2023/9/6 結算日：2023/9/13					日期：2023/9/6 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	27	16,200	1,807	981	0	39	15,700	2,214	-7
9	17	16,300	2,049	587	0	96	15,800	4,207	-12
1	7	16,350	1,667	650	1	25	15,900	3,899	-61
11	40	16,400	3,047	1,630	0	132	16,000	10,795	961 ※
1	26	16,450	2,663	1,740	0	152	16,100	4,192	-188
73	198	16,500	4,312	3,119 ※	-18	908	16,200	9,590	222
21	67	16,550	1,826	1,130	397	1,879	16,300	8,387	181
84	181	16,600	2,798	1,560	-38	1,805	16,400	4,414	105
58	328	16,650	2,021	750	26	1,614	16,500	4,021	-7
496	945	16,700	3,101	1,656	182	5,588	16,600	5,280	263
1,086	1,504	16,750	1,532	906	-86	3,304	16,700	2,364	-5
1,593	2,521	16,800	671	369	-91	6,522	16,800	2,885	74
903	1,488	16,850	801	118	-51	5,636	16,900	1,064	-15
1,390	2,135	16,900	238	106 ※	691	11,607	17,000	1,163	78
1,299	2,195	16,950	43	37	166	5,857	17,100	176	21
2,074	3,407	17,000	62	36	225	8,946	17,200	173	-11
※ 2,293	3,297	17,050	8	6	352	8,772	17,300	503	-2
2,145	3,817	17,100	15	4	83	4,908	17,400	196	-2
1,216	1,711	17,150	6	6	-432	4,196	17,500	112	-2
1,307	2,597	17,200	6	6	-16	3,736	17,600	70	0
411	432	17,250	0	0	26	3,024	17,700	56	0
871	1,318	17,300	5	5	-19	2,273	17,800	103	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
18,125	30,274	1.2394	37,521	22,227	1,428	101,141	1.0072	101,873	1,189
昨日 P/C	1.2023	今日增減變化		0.0371	昨日 P/C	1.0097	今日增減變化		-0.0025

更新日期：2023年9月6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	66,985,137	84,139,126	-17,153,989	3,719,228	1,087,152	3,030,848	-1,943,696	-116,192
投信	41,642,111	38,225,974	3,416,137	-396,618	619,347	0	619,347	-72,141
自營商	19,648,042	25,467,868	-5,819,826	-1,487,381	494,111	1,073,967	-579,856	-6,872
	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	1,892,242	1,455,472	436,770	224,193	134,108	34,985	99,123	33,072
投信	38,942	0	38,942	-245	0	0	0	0
自營商	285,578	1,382,787	-1,097,209	-43,689	64,132	193,857	-129,725	-44,602

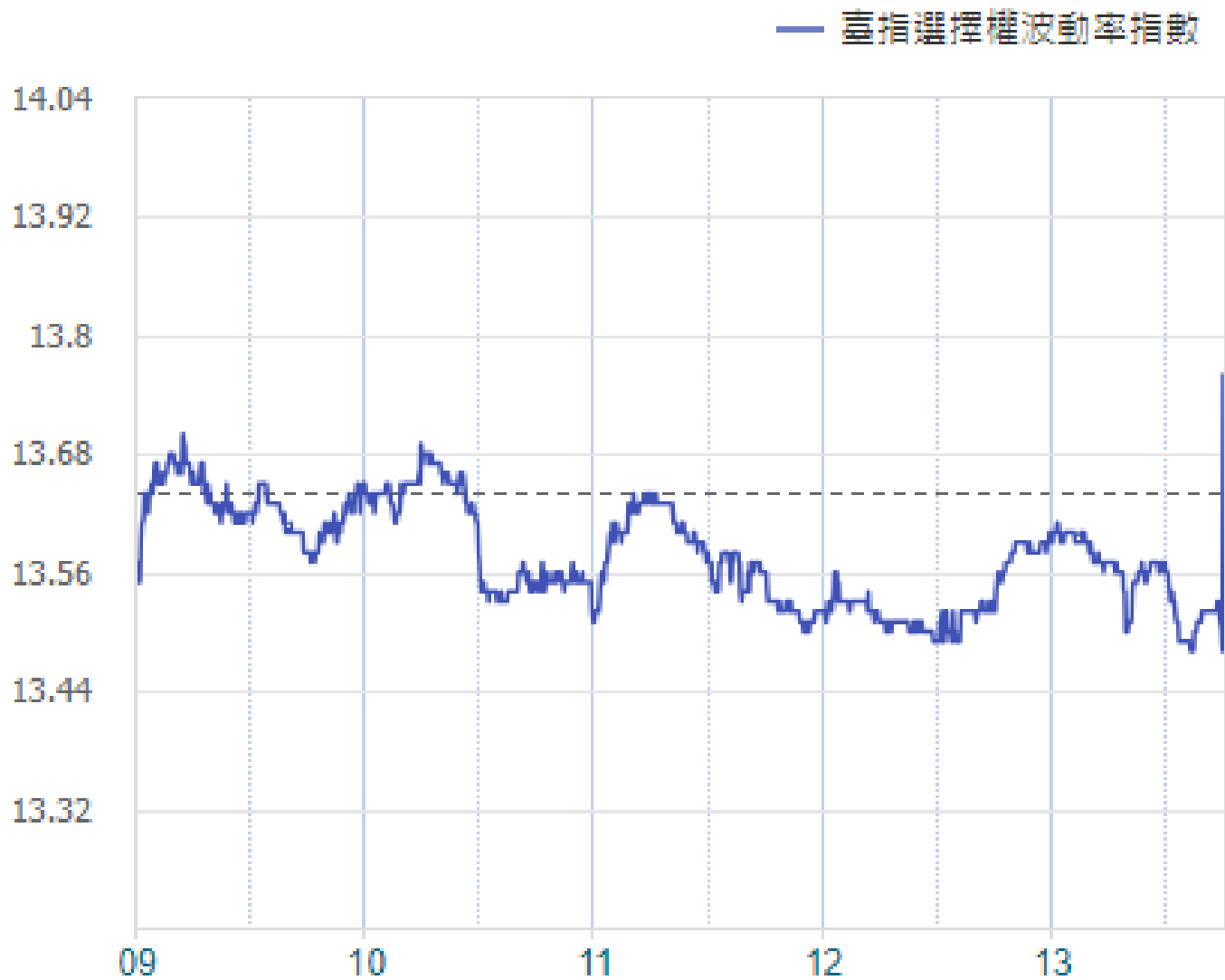
台指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數

	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	34,544	9,094	25,450	-5,608	34,637	11,479	23,158	-45
投信	200	0	200	0	300	120	180	0
自營商	57,627	65,108	-7,481	5,123	53,356	57,473	-4,117	-2,885
特定法人(週)	913	0	913	---	0	1,575	-1,575	---
特定法人(近月)	24,025	2,100	21,925	40	3,387	21,074	-17,687	-956
特定法人(全月)	27,503	0	27,503	-6,641	7,048	24,614	-17,566	3,405
十大交易人(週)	14,029	11,606	2,423	---	17,718	18,780	-1,062	---
十大交易人(近月)	49,618	50,343	-725	850	46,172	50,706	-4,534	515
十大交易人(全月)	78,927	73,936	4,991	1,987	67,035	80,170	-13,135	3,519
全市場未沖銷(近月)			102,035	2,322			102,869	2,185
全市場未沖銷(全月)			166,136	-74,757			166,813	-93,095

更新日期：2023年9月6日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

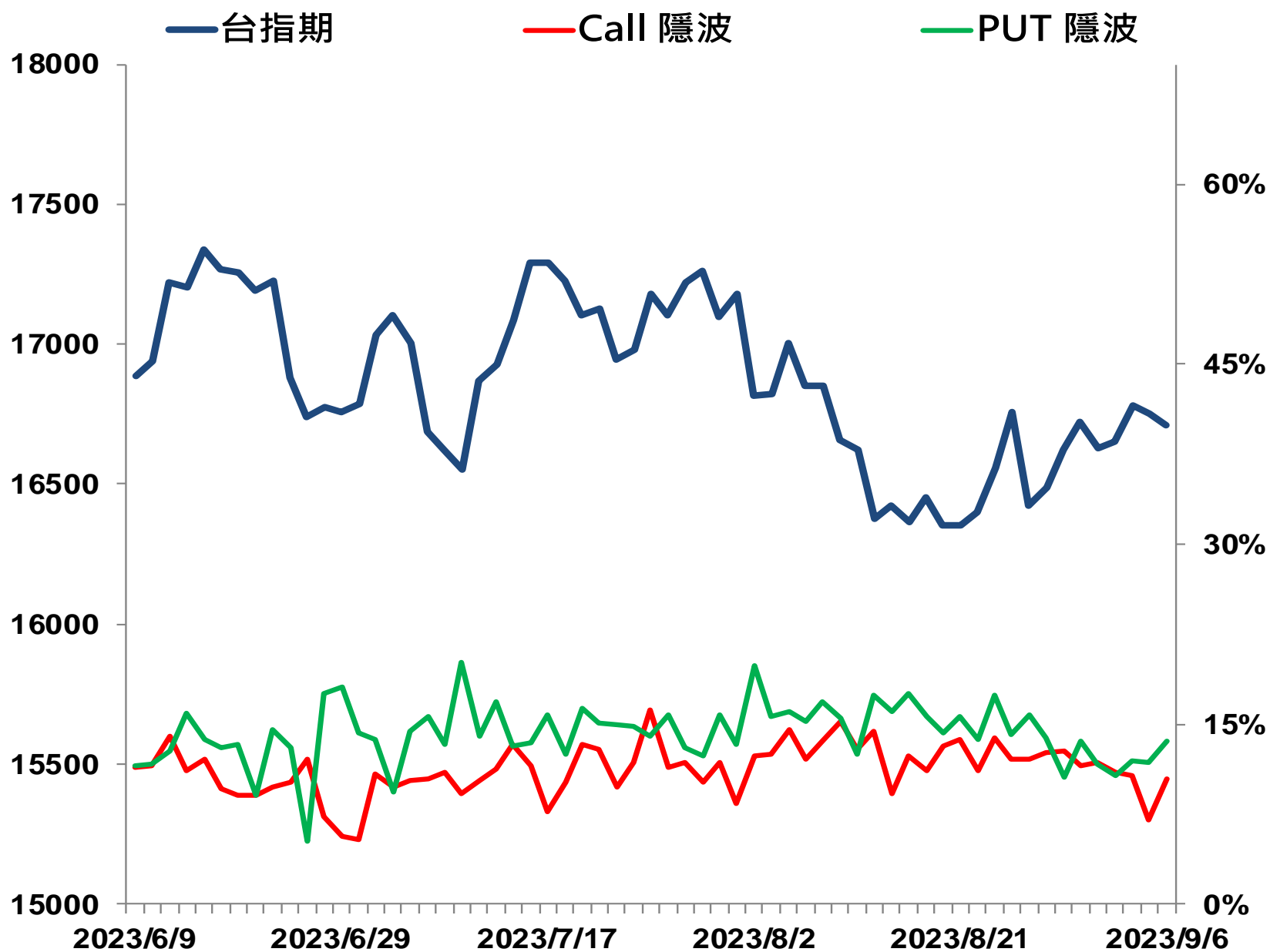
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年9月6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



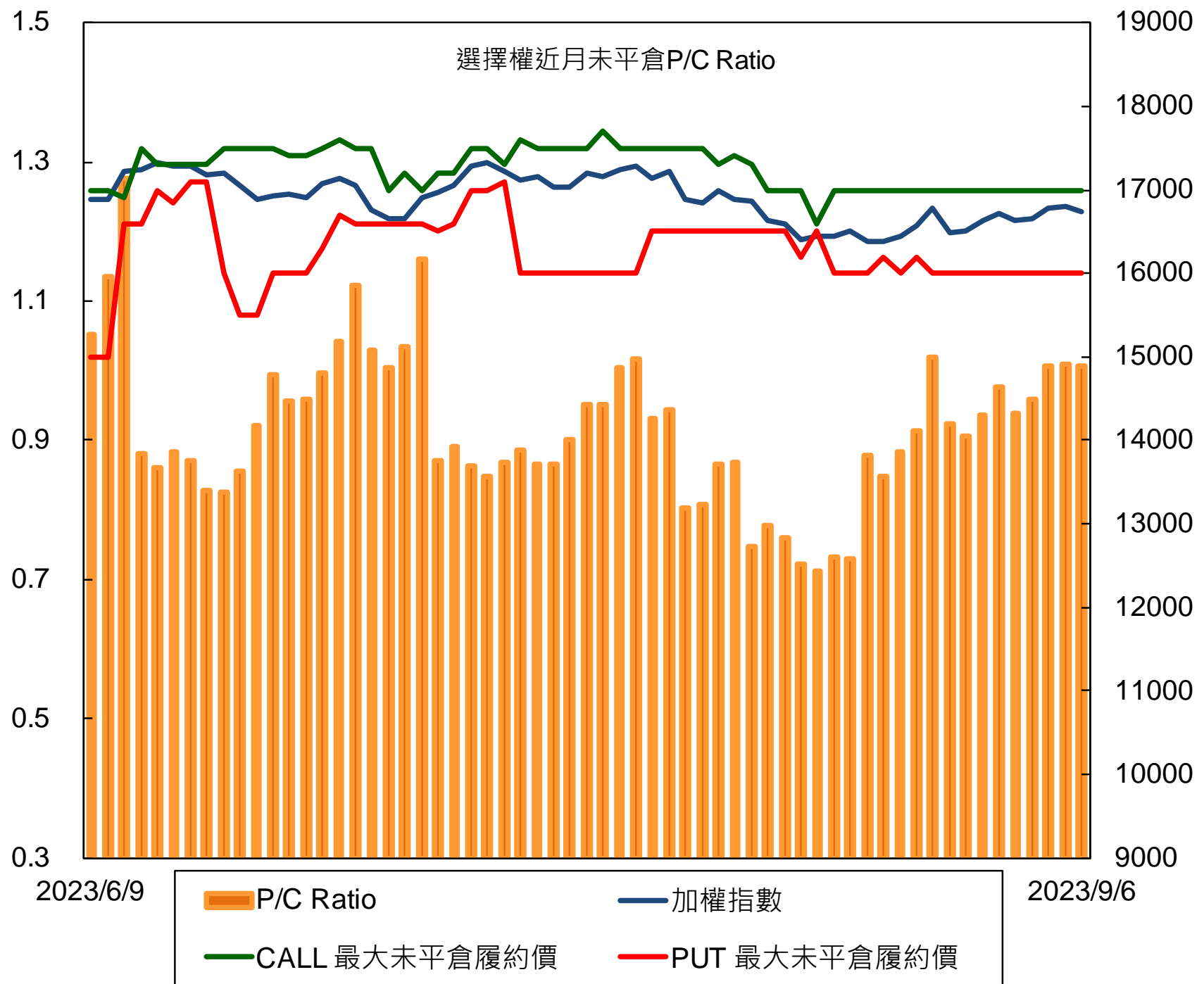
更新日期：2023年9月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考

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5日	62,023	74,627	-12,604
	9月6日	57,627	65,108	-7,481
Put	9月5日	69,133	70,365	-1,232
	9月6日	53,356	57,473	-4,117

更新日期：2023年9月6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



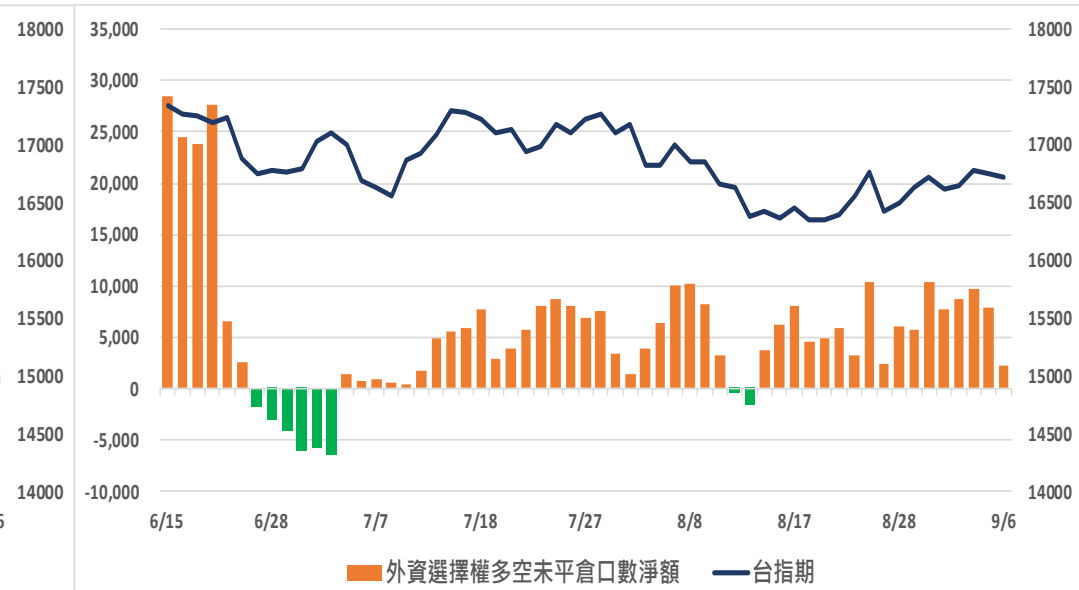
更新日期：2023年9月6日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



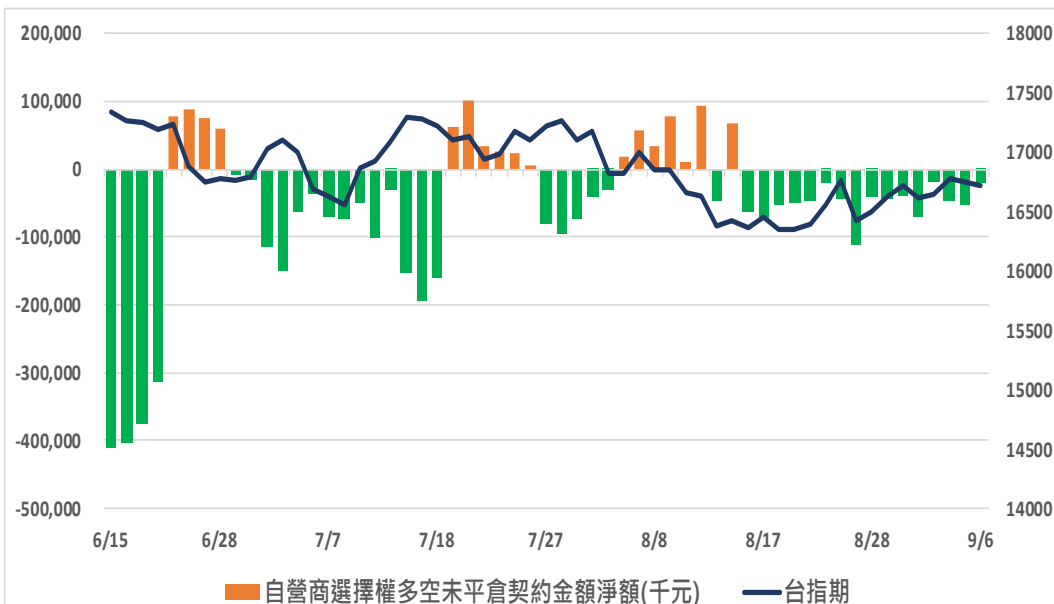
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/8/31	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
2023/9/5	16752	7,855	-1,926	51,273	-14,293
2023/9/6	16713	2,292	-5,563	34,205	-17,068

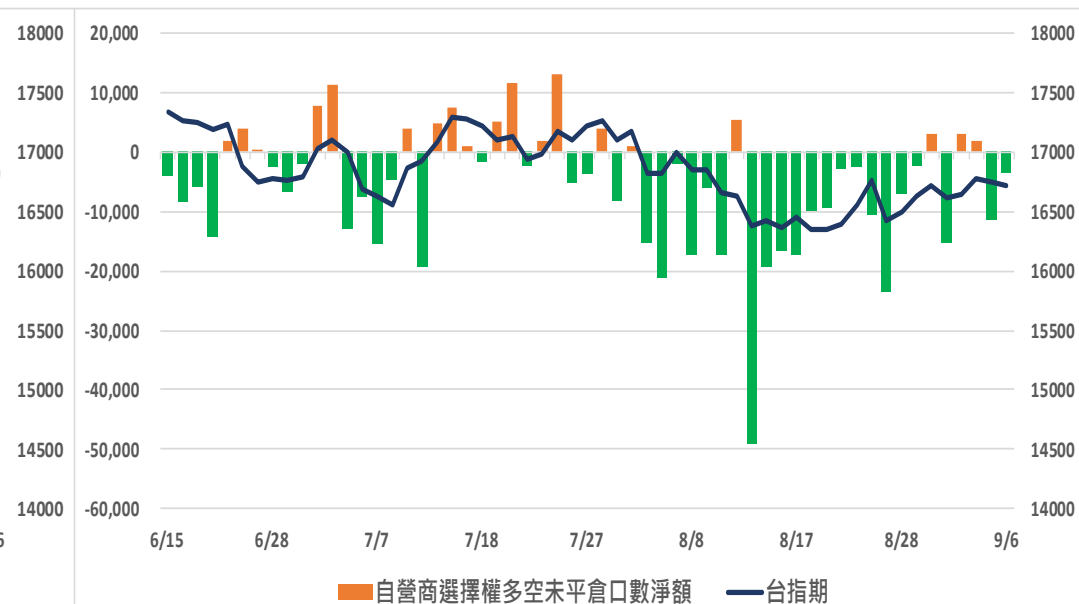
更新日期：2023年9月6日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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
2023/8/31	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
2023/9/5	16752	-11,372	-13,253	-51,404	-6,263
2023/9/6	16713	-3,364	+8,008	-19,260	+32,144

更新日期：2023年9月6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



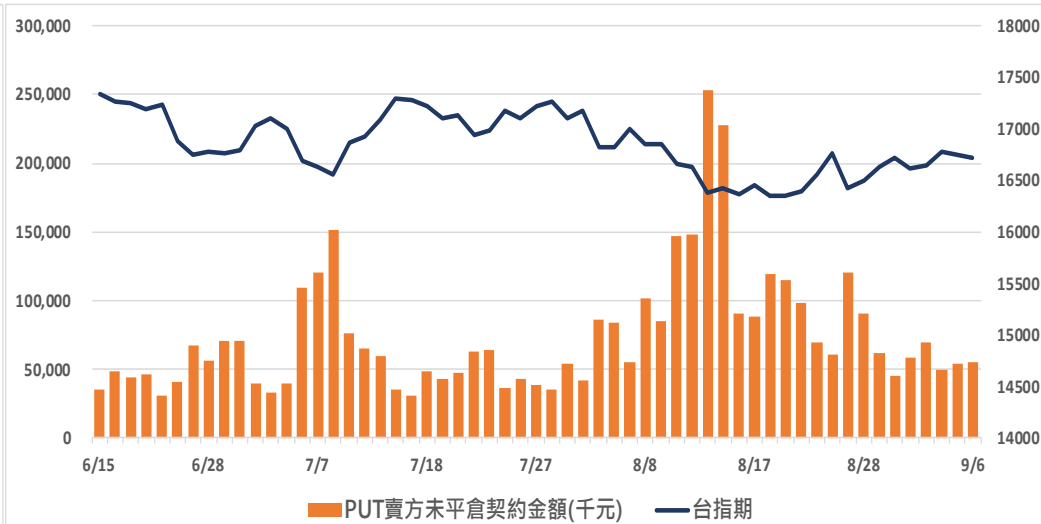
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



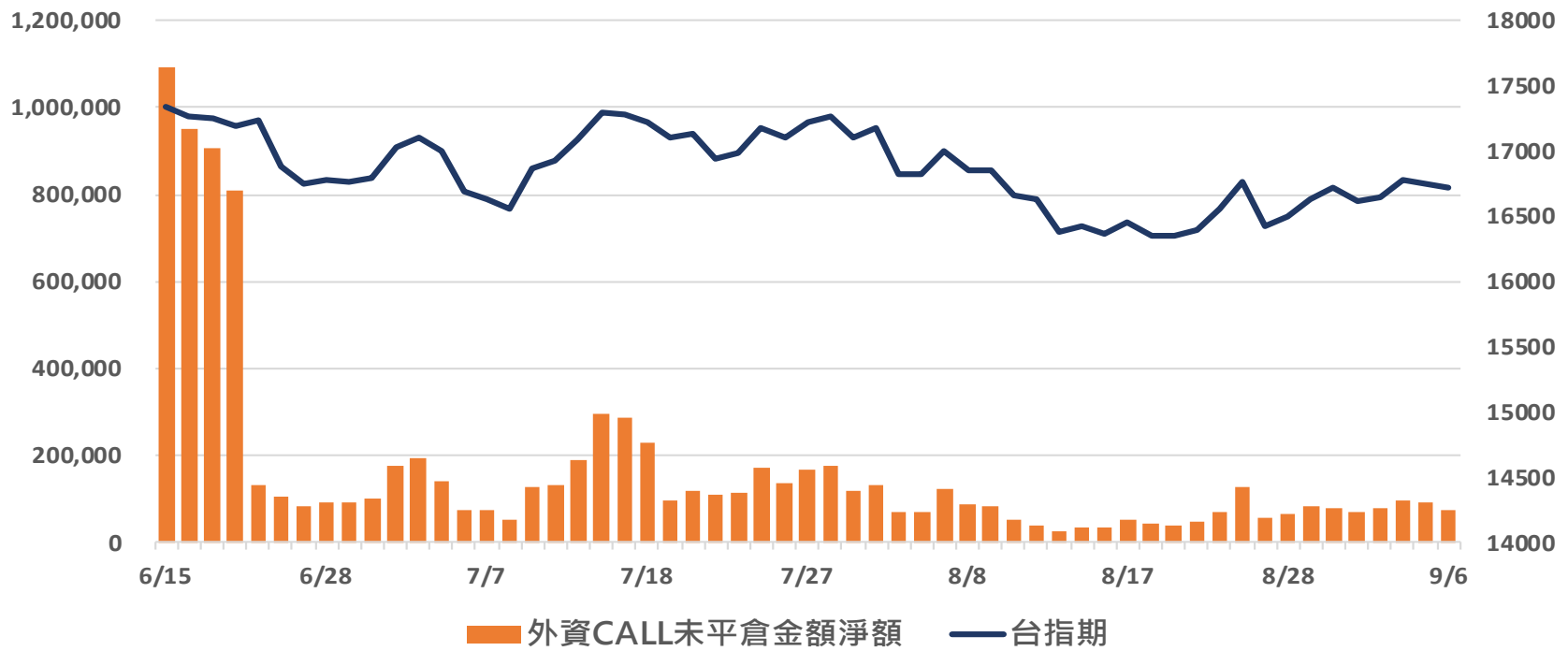
Sell Put未平倉金額



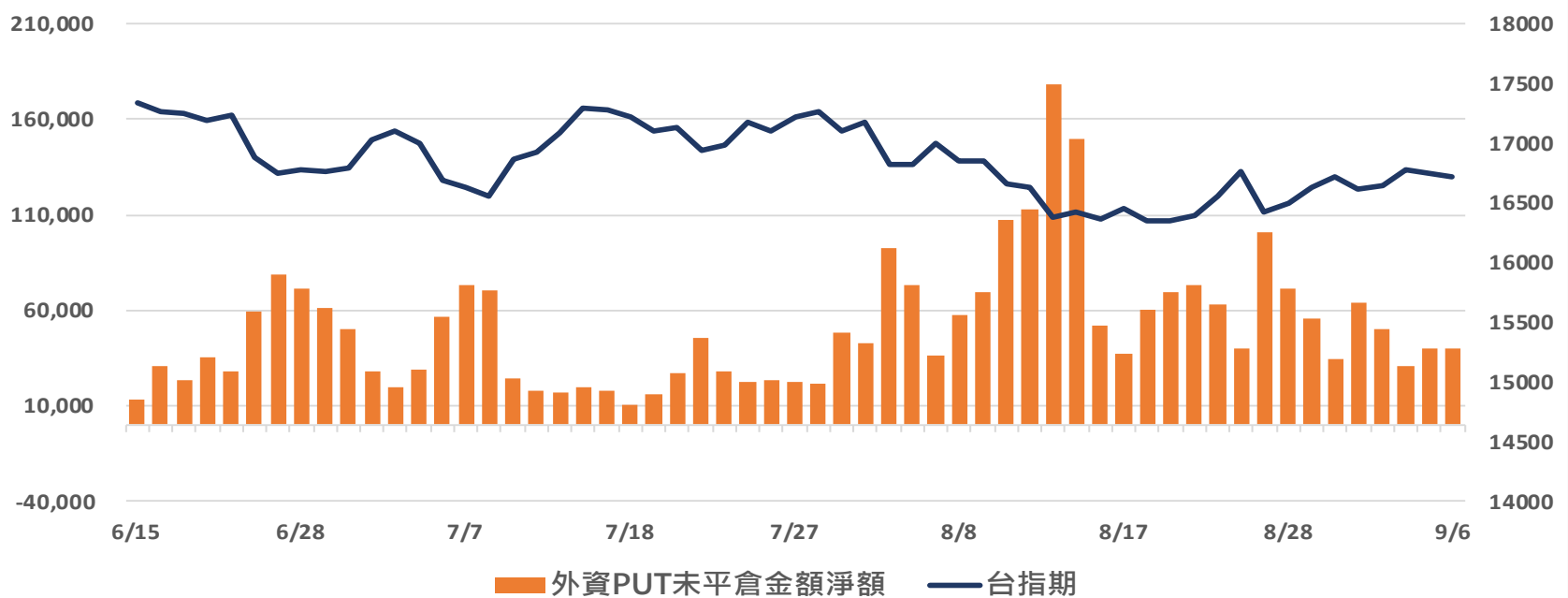
更新日期：2023年9月6日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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6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