

台指選擇權OI

日期：2023/9/11 結算日：2023/9/13					日期：2023/9/11 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	0	15,800	3,252	-11	0	90	15,400	1,558	8
0	0	15,900	4,646	733	0	22	15,500	2,786	28
-1	19	16,000	5,580	643	1	72	15,600	8,532	-9
14	15	16,100	4,216	158	-1	43	15,700	2,682	158
20	20	16,150	4,501	52	39	136	15,800	3,847	-661
103	133	16,200	7,529	510	30	61	15,900	4,718	-18
223	278	16,250	5,943	1,139	3	152	16,000	12,431	-417
492	568	16,300	8,619	1,012	-1	168	16,100	6,483	542 ※
1,183	1,306	16,350	7,976	366	7	929	16,200	9,992	64
4,567	5,046	16,400	15,655	2,276 ※	-402	2,395	16,300	9,175	406
4,114	4,658	16,450	8,029	85	453	2,134	16,400	4,614	-50
※ 6,596	8,156	16,500	9,915	440	1,262	2,915	16,500	4,470	-124
5,494	8,339	16,550	3,466	-1,264	1,254	7,933	16,600	4,984	32
6,174	12,052	16,600	3,121	-1,477 ※	※ 1,386	5,184	16,700	1,455	-265
3,312	8,508	16,650	2,150	-63	430	7,873	16,800	2,570	-501
1,848	8,343	16,700	2,233	-429	464	6,280	16,900	908	-50
699	7,834	16,750	1,854	-98	604	13,470	17,000	987	-98
-570	10,380	16,800	864	-42	184	5,619	17,100	142	-3
-1,656	5,681	16,850	791	-45	-907	7,105	17,200	156	-11
-2,015	7,488	16,900	190	-79	-886	5,448	17,300	501	-2
-1,137	4,610	16,950	46	0	-178	4,500	17,400	189	0
-249	5,828	17,000	53	-35	-111	4,080	17,500	112	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
26,849	115,937	0.8979	104,095	3,912	3,615	105,273	1.0150	106,847	-962
昨日 P/C	1.1245	今日增減變化	-0.2266		昨日 P/C	1.0142	今日增減變化	0.0007	

更新日期：2023年9月11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	69,989,419	91,673,801	-21,684,382	-8,809,024	1,184,490	2,802,330	-1,617,840	225,434
投信	43,973,010	39,374,010	4,599,000	713,555	574,590	0	574,590	-3,056
自營商	18,949,545	26,323,068	-7,373,523	662,383	372,481	1,553,692	-1,181,211	-230,378
	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	1,972,176	1,681,180	290,996	-37,027	134,813	8,698	126,115	13,779
投信	27,775	0	27,775	48	0	0	0	0
自營商	490,140	1,366,067	-875,927	13,192	107,273	252,237	-144,964	-15,146

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	42,019	12,637	29,382	1,883	44,530	13,436	31,094	339
投信	200	0	200	0	300	120	180	0
自營商	68,215	86,672	-18,457	-10,126	72,269	70,558	1,711	5,120
特定法人(週)	2,380	1,389	991	96	0	1,504	-1,504	-4
特定法人(近月)	25,704	2,200	23,504	423	3,848	25,544	-21,696	3,778
特定法人(全月)	28,071	0	28,071	-2,193	3,125	30,980	-27,855	-376
十大交易人(週)	22,998	33,589	-10,591	-8,251	30,554	35,454	-4,900	-1,545
十大交易人(近月)	52,305	55,477	-3,172	-1,429	49,603	55,702	-6,099	-1,751
十大交易人(全月)	91,247	92,255	-1,008	-9,924	78,494	103,571	-25,077	-5,625
全市場未沖銷(近月)			117,568	7,449			111,585	-100
全市場未沖銷(全月)			274,340	37,825			246,445	6,197

更新日期：2023年9月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

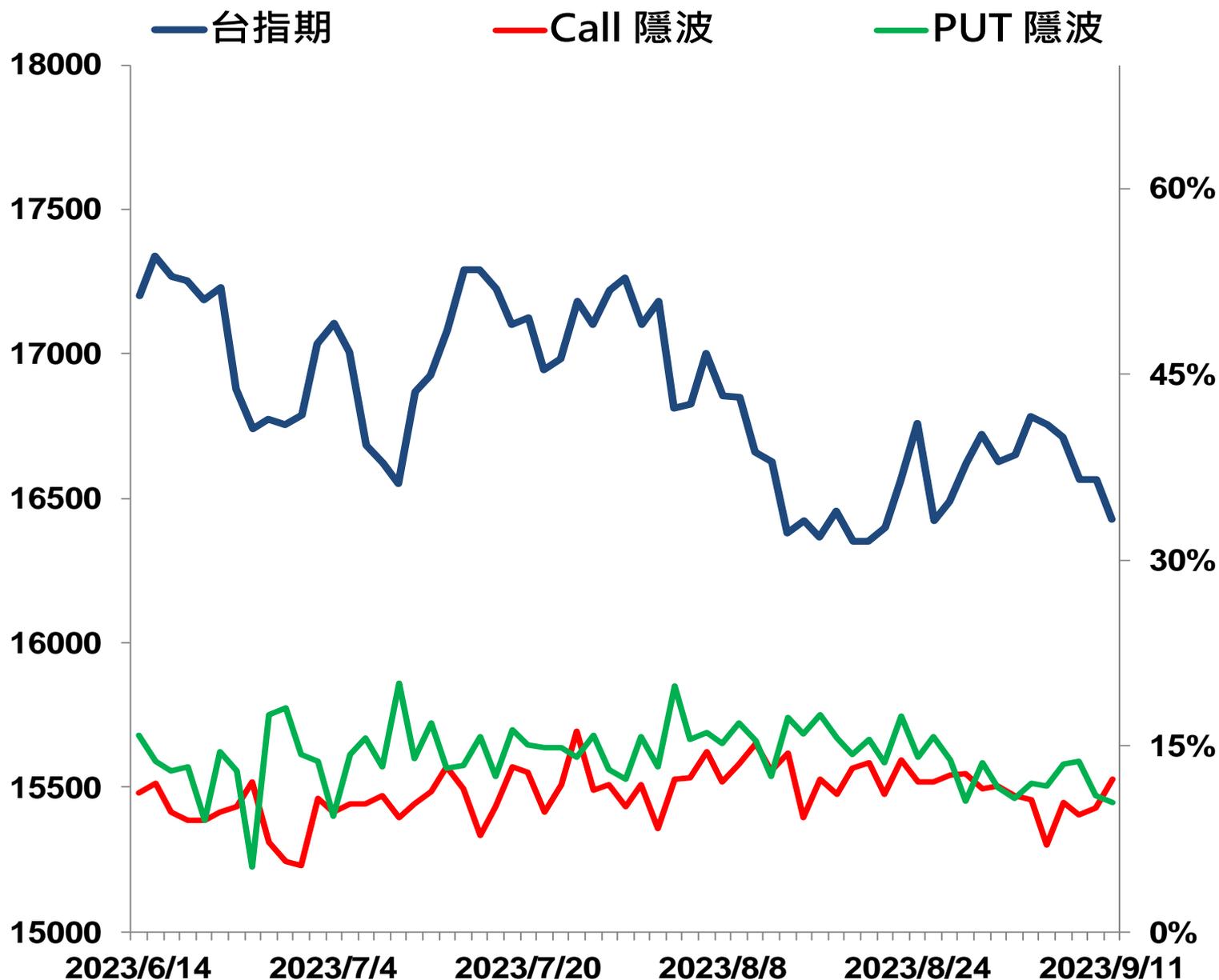
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年9月11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11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

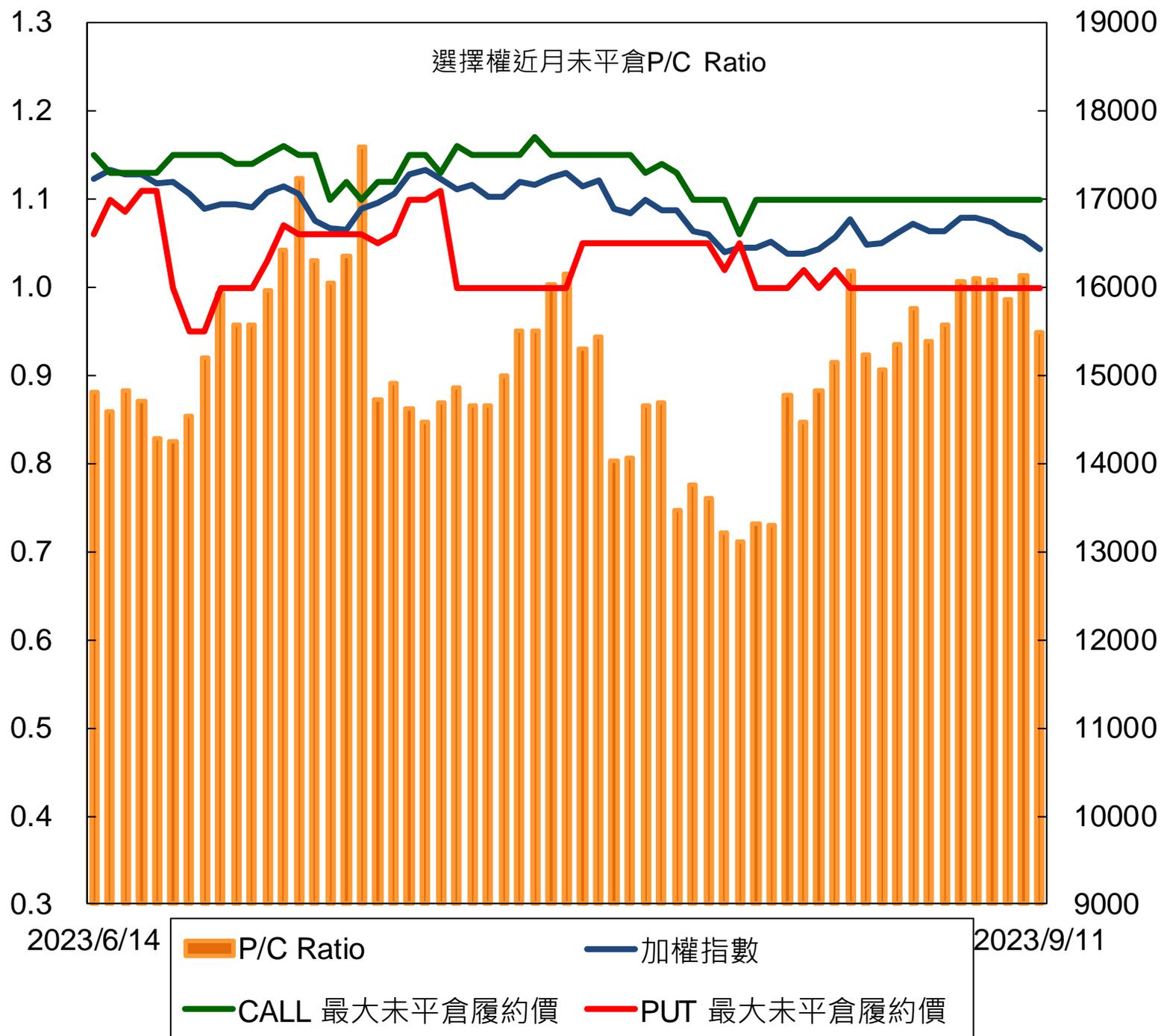
自營商選擇權OI部位統計

	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	9月8日	68,359	76,690	-8,331
	9月11日	68,215	86,672	-18,457
Put	9月8日	66,692	70,101	-3,409
	9月11日	72,269	70,558	1,711

更新日期：2023年9月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考



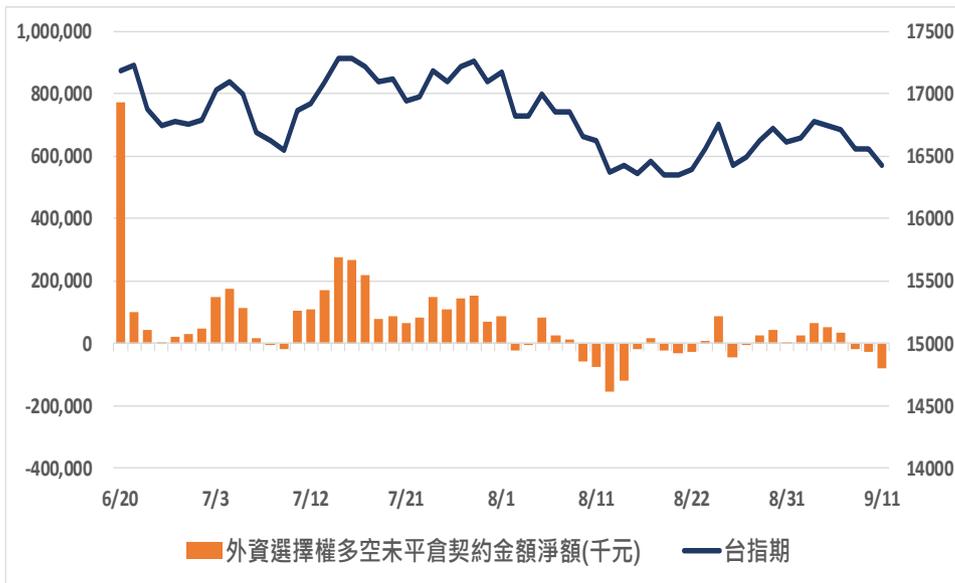
選擇權近月未平倉P/C Ratio



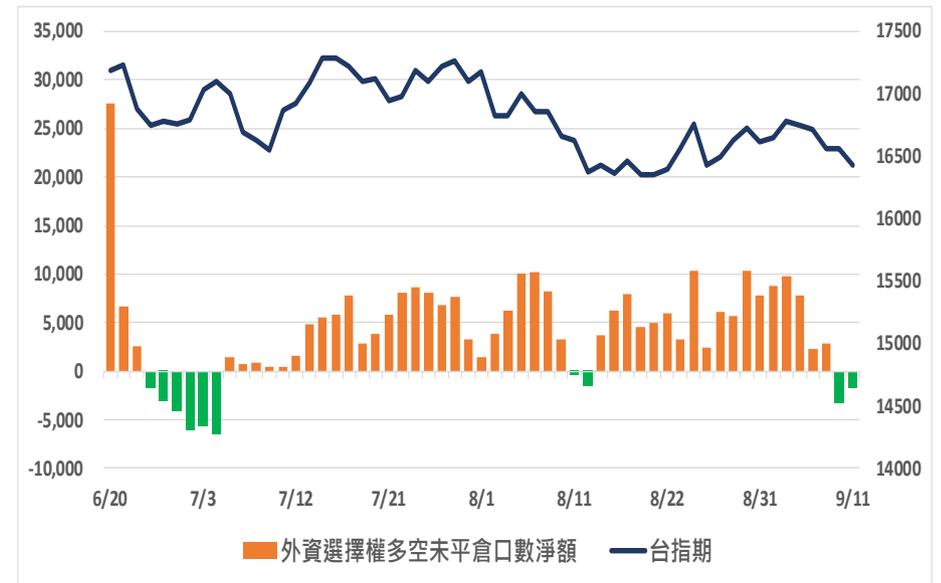
更新日期：2023年9月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



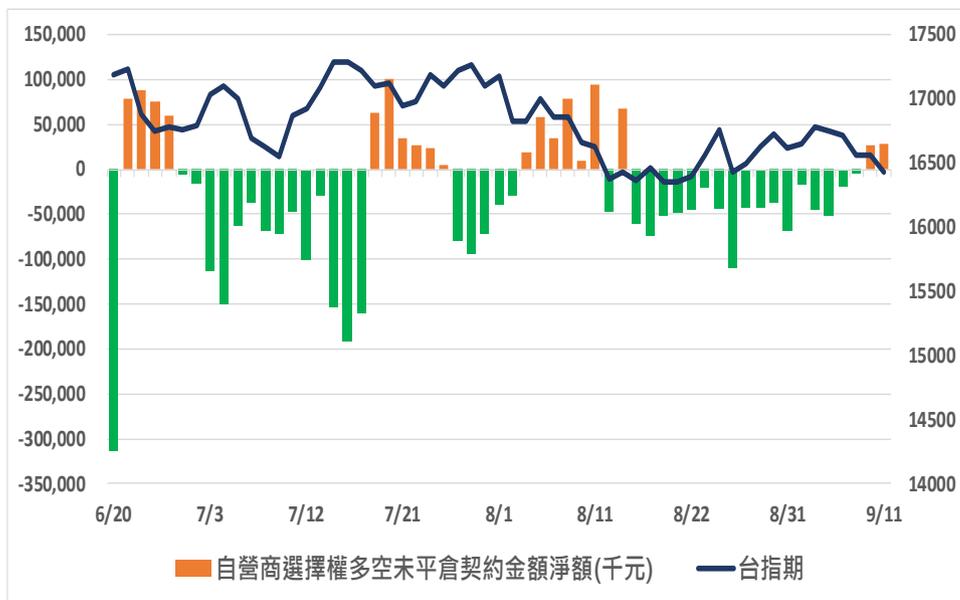
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/9/5	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
2023/9/11	16425	-1,712	+1,544	-80,596	-54,466

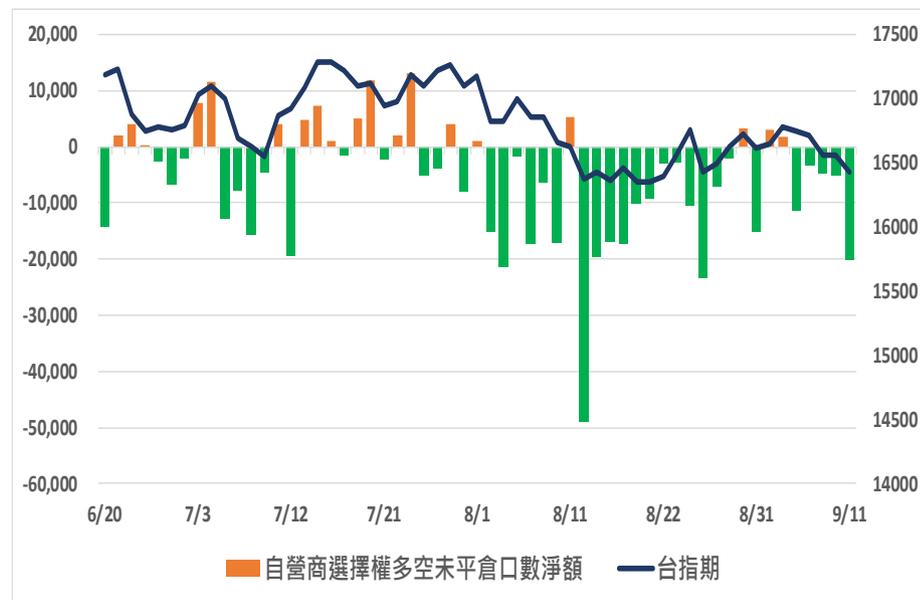
更新日期：2023年9月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



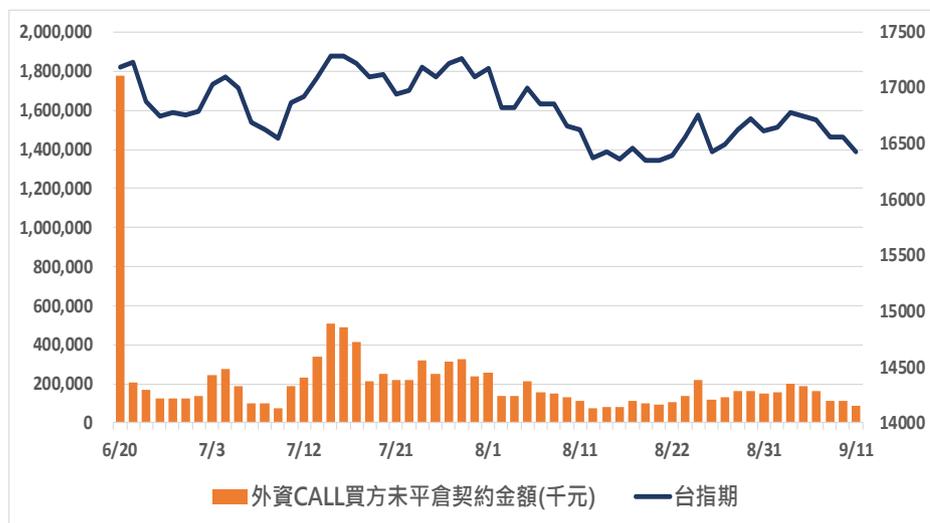
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/9/5	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
2023/9/11	16425	-20,168	-15,246	27,703	+778

更新日期：2023年9月11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

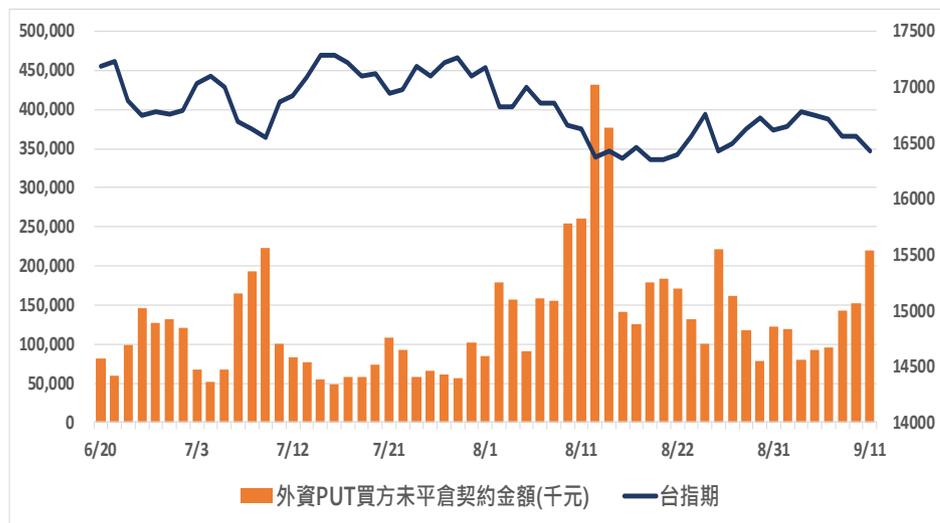
Buy Call未平倉金額



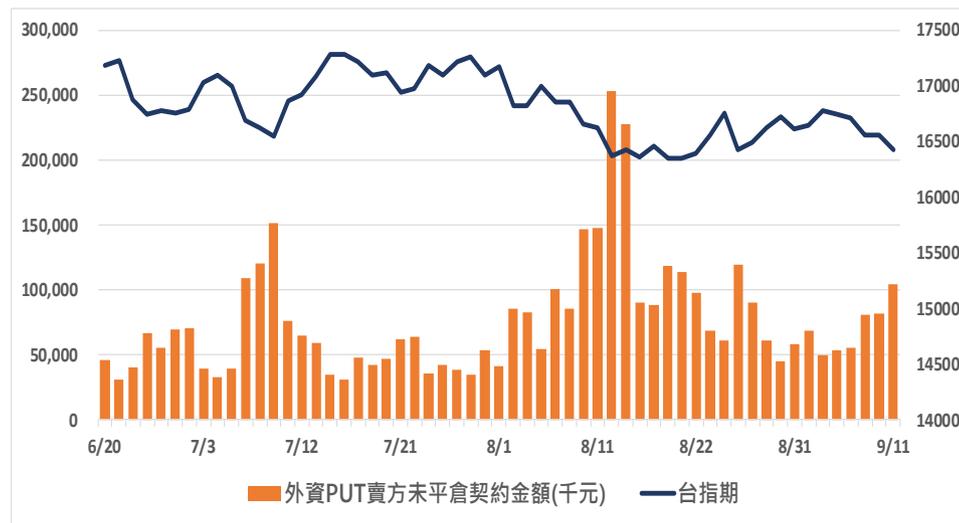
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



Sell Put未平倉金額



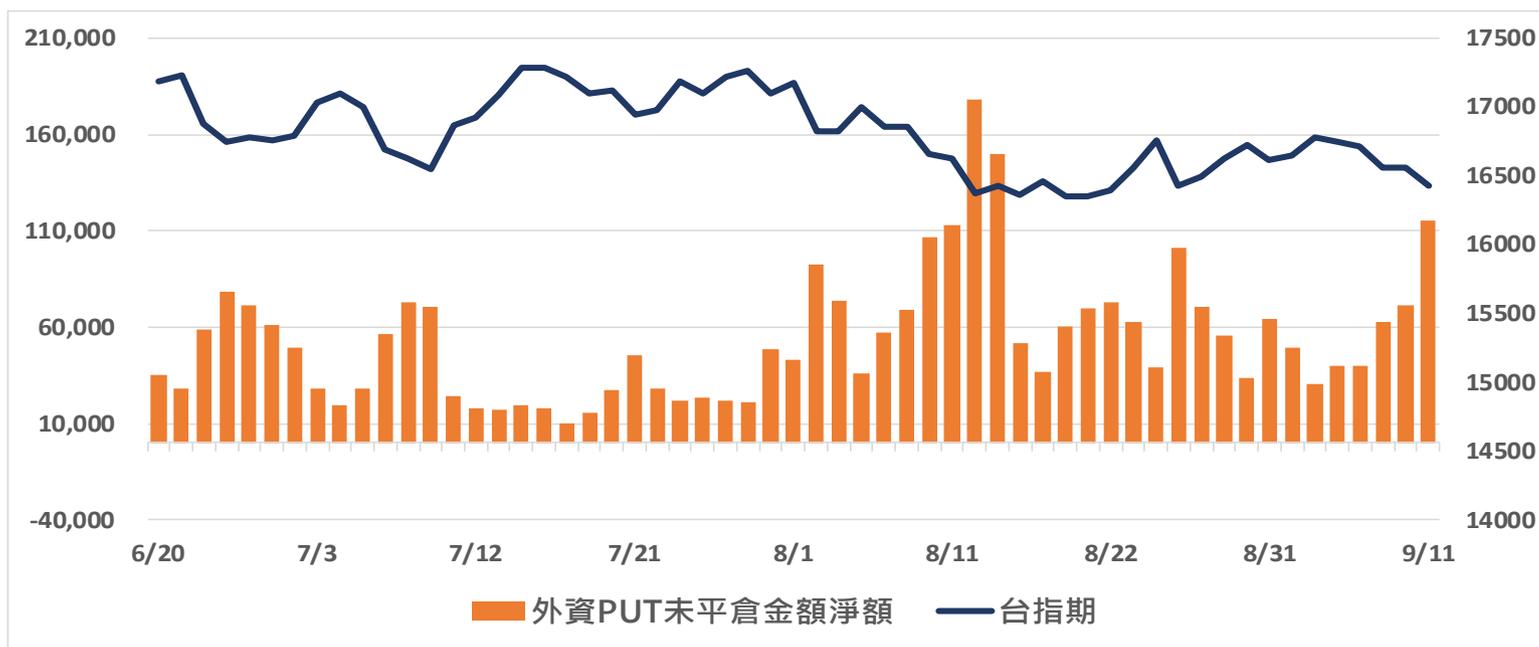
更新日期：2023年9月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額淨額

Buy Call – Sell Call 未平倉金額



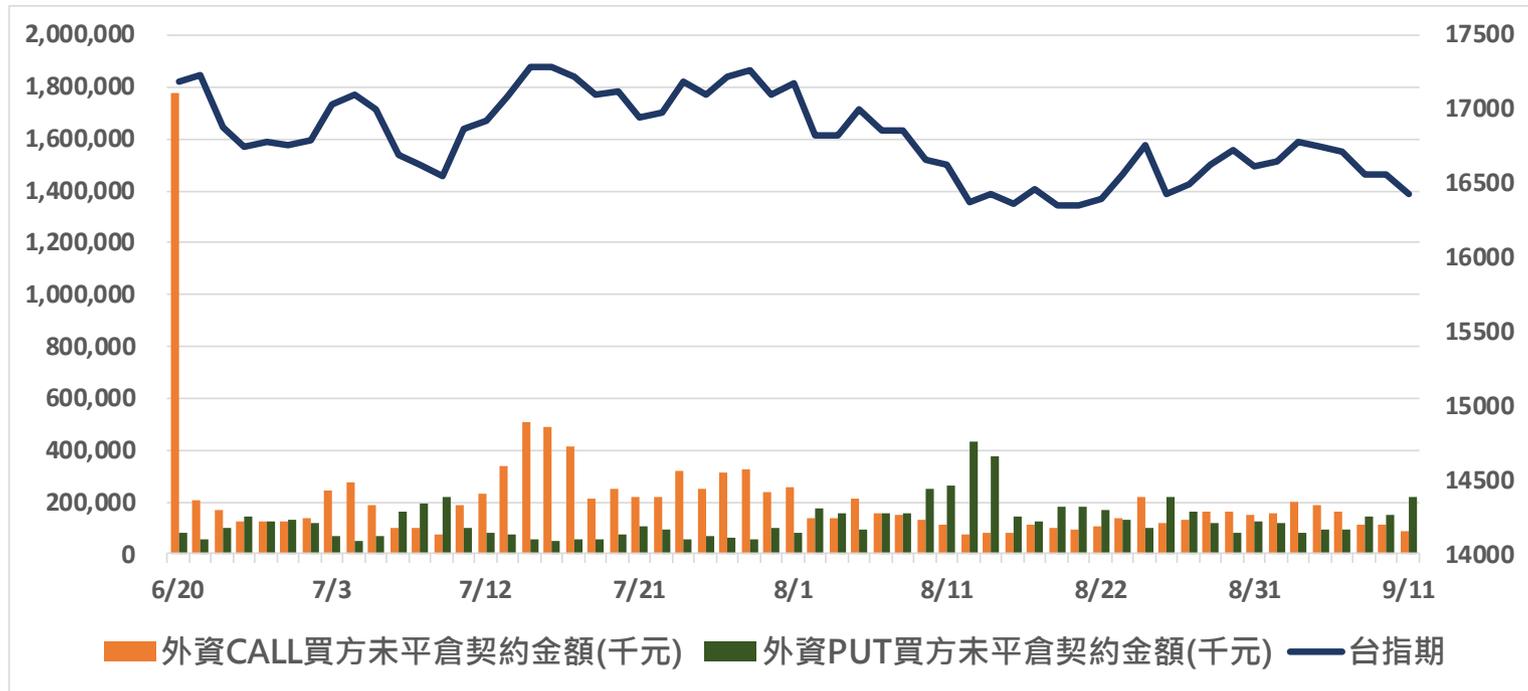
Buy Put – Sell Put 未平倉金額



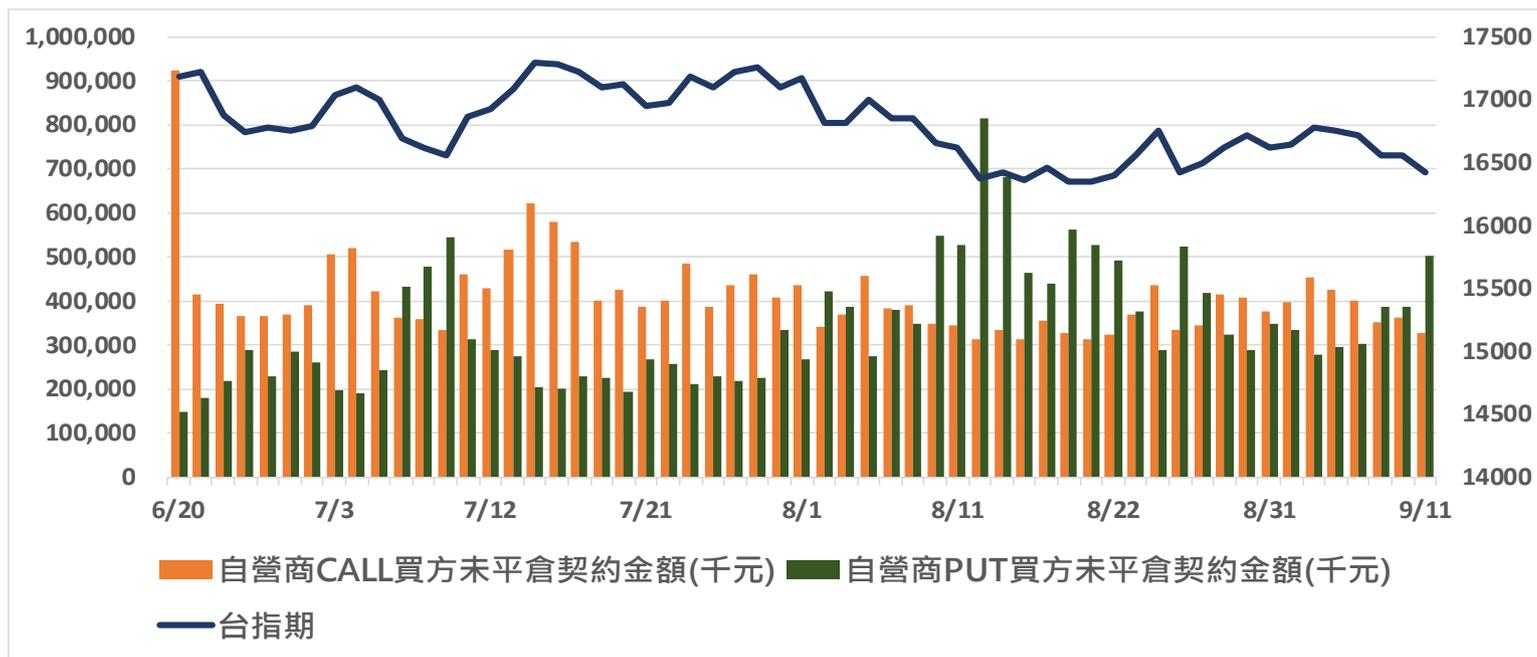
更新日期：2023年9月11日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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11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