

台指選擇權OI

日期：2023/9/12 結算日：2023/9/13					日期：2023/9/12 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	1	16,050	140	140	0	72	15,600	8,539	7
-5	10	16,100	3,874	-342	0	43	15,700	2,639	-43
0	20	16,150	4,056	-445	0	136	15,800	4,149	302
34	167	16,200	6,987	-542	3	64	15,900	5,549	831
-95	183	16,250	5,754	-189	-9	143	16,000	11,812	-619
-128	440	16,300	10,589	1,970	0	168	16,100	7,119	636
-792	514	16,350	9,196	1,220	1	930	16,200	10,922	930
-1,605	3,441	16,400	16,322	667	-250	2,145	16,300	9,398	223
-1,991	2,667	16,450	12,241	4,212	124	2,258	16,400	5,514	900
-2,402	5,754	16,500	12,792	2,877	-204	2,711	16,500	5,326	856
2,379	10,718	16,550	8,959	5,493 ※	-1,703	6,230	16,600	6,057	1,073 ※
1,420	13,472	16,600	5,559	2,438	-159	5,025	16,700	1,712	257
※ 2,497	11,005	16,650	2,923	773	※ 1,093	8,966	16,800	2,385	-185
2,346	10,689	16,700	2,493	260	-174	6,106	16,900	815	-93
186	8,020	16,750	1,931	77	-248	13,222	17,000	907	-80
-2,430	7,950	16,800	733	-131	-29	5,590	17,100	141	-1
-674	5,007	16,850	784	-7	-1,092	6,013	17,200	154	-2
-994	6,494	16,900	170	-20	-70	5,378	17,300	501	0
-639	3,971	16,950	45	-1	-32	4,468	17,400	190	1
-190	5,638	17,000	47	-6	-31	4,049	17,500	112	0
-219	3,573	17,050	10	0	8	3,582	17,600	70	0
-37	2,513	17,100	50	0	-7	3,004	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
-3,542	112,395	1.0933	122,885	18,790	-2,790	102,483	1.0913	111,840	4,993
昨日 P/C	0.8979	今日增減變化		0.1954	昨日 P/C	0.9491	今日增減變化		0.1422

更新日期：2023年9月12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	81,860,888	85,582,721	-3,721,833	17,962,549	1,059,938	2,839,466	-1,779,528	-161,688
投信	44,261,778	38,833,452	5,428,326	829,326	622,349	0	622,349	47,759
自營商	13,982,216	26,352,903	-12,370,687	-4,997,164	576,901	1,332,189	-755,288	425,923
	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	2,011,865	1,636,121	375,744	84,748	135,882	13,150	122,732	-3,383
投信	27,870	0	27,870	95	0	0	0	0
自營商	496,738	1,436,489	-939,751	-63,824	108,108	249,806	-141,698	3,266

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	45,476	12,984	32,492	3,110	46,295	15,094	31,201	107
投信	200	0	200	0	300	120	180	0
自營商	76,917	75,793	1,124	19,581	61,590	75,580	-13,990	-15,701
特定法人(週)	3,790	1,832	1,958	967	0	1,504	-1,504	0
特定法人(近月)	24,882	2,160	22,722	-782	2,680	26,771	-24,091	-2,395
特定法人(全月)	30,051	0	30,051	1,980	3,178	31,961	-28,783	-928
十大交易人(週)	32,117	30,620	1,497	12,088	35,763	26,184	9,579	14,479
十大交易人(近月)	52,763	51,397	1,366	4,538	51,618	55,975	-4,357	1,742
十大交易人(全月)	102,305	85,730	16,575	17,583	84,434	95,139	-10,705	14,372
全市場未沖銷(近月)			118,222	654			120,601	9,016
全市場未沖銷(全月)			275,107	767			277,003	30,558

更新日期：2023年9月12日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

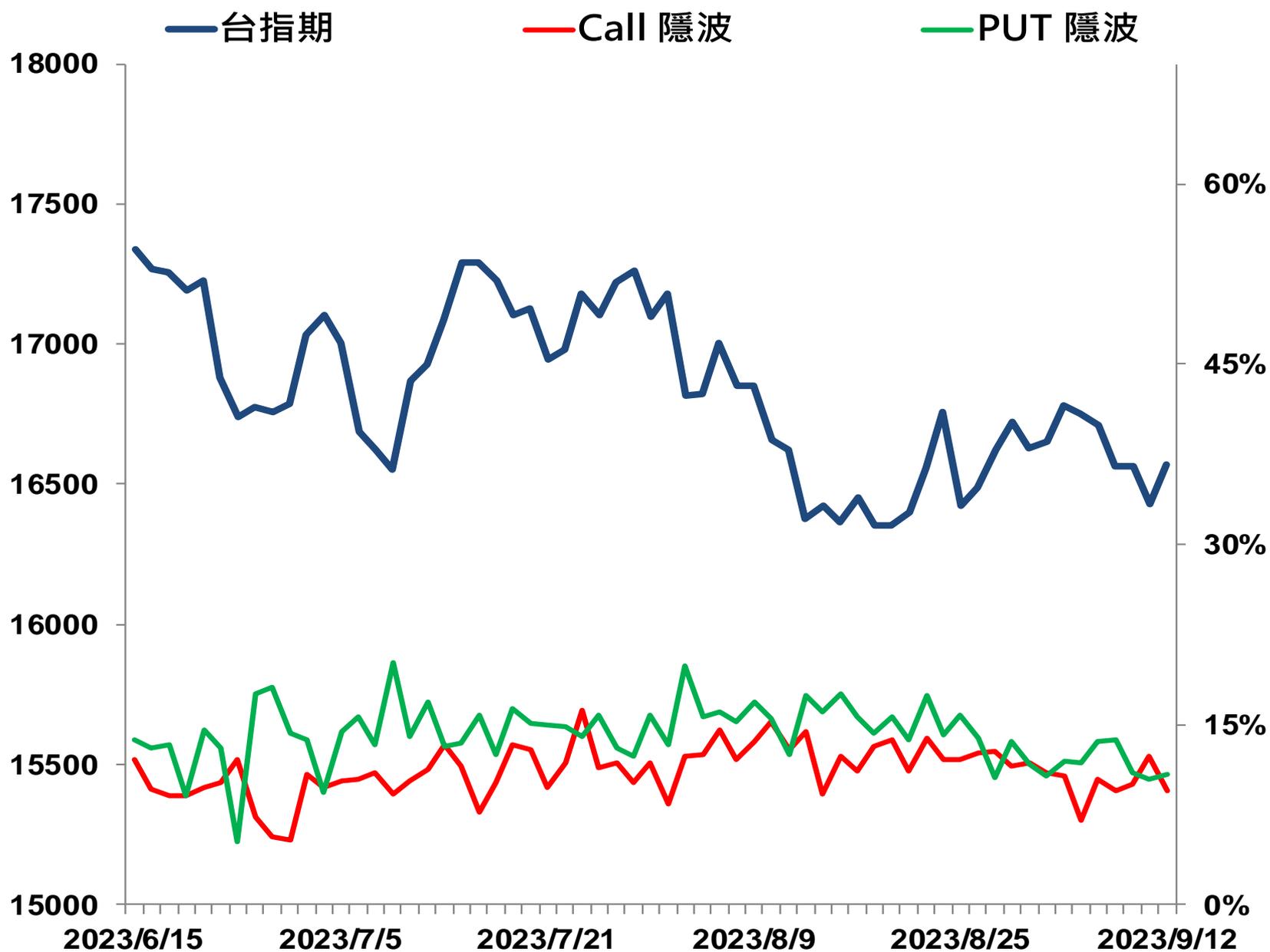
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年9月12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



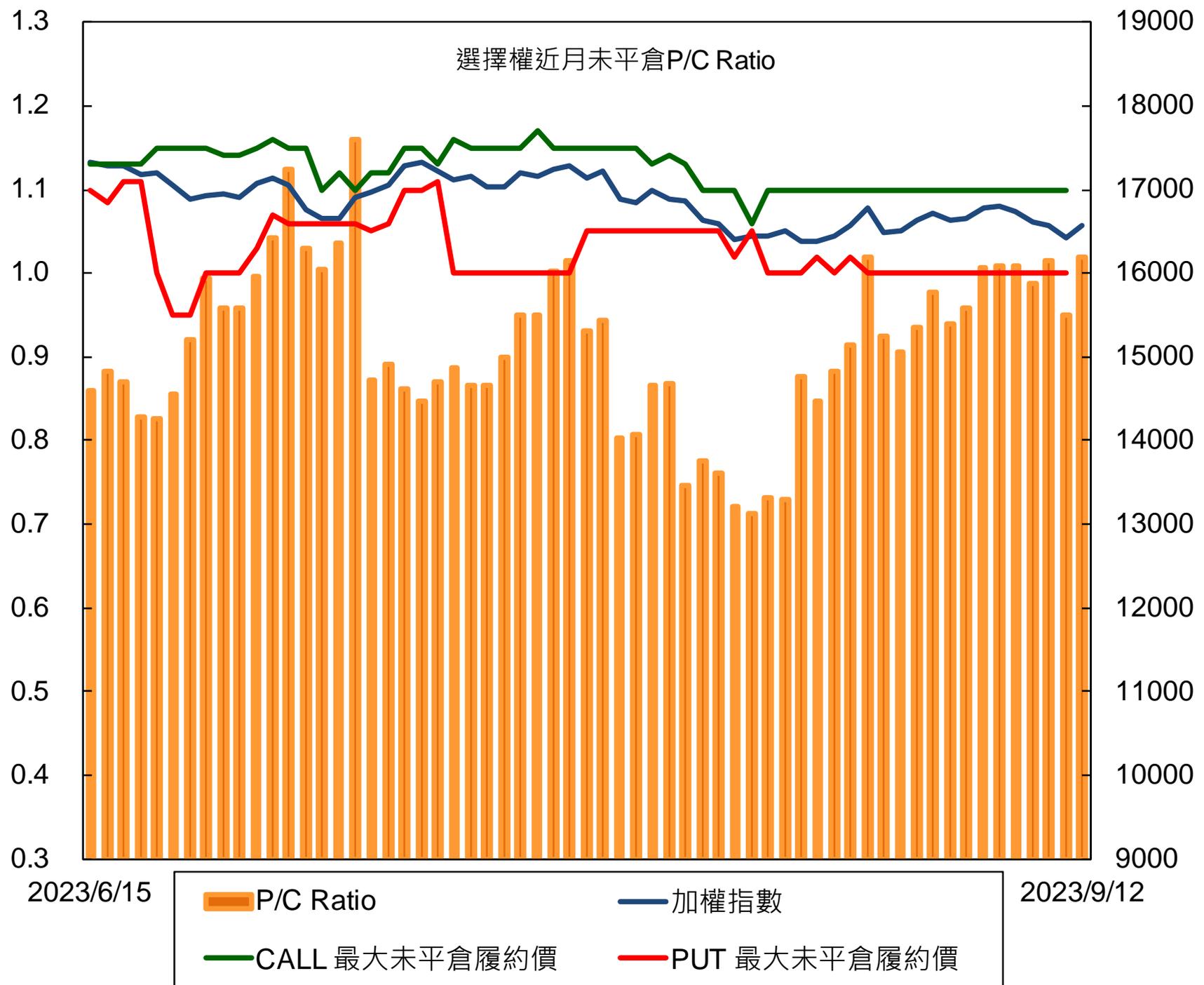
更新日期：2023年9月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考

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11日	68,215	86,672	-18,457
	9月12日	76,917	75,793	1,124
Put	9月11日	72,269	70,558	1,711
	9月12日	61,590	75,580	-13,990

更新日期：2023年9月12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



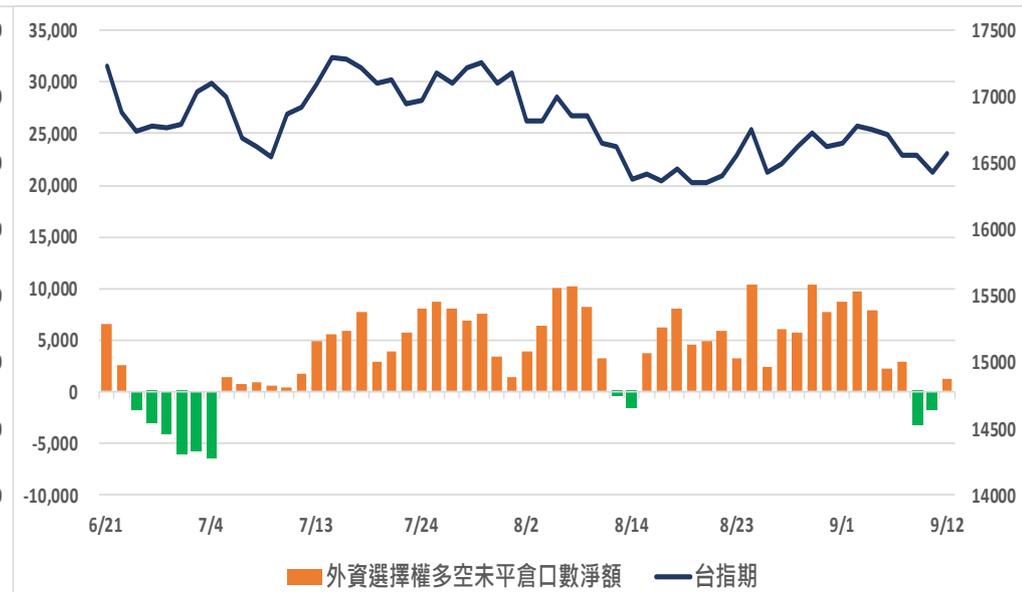
更新日期：2023年9月12日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



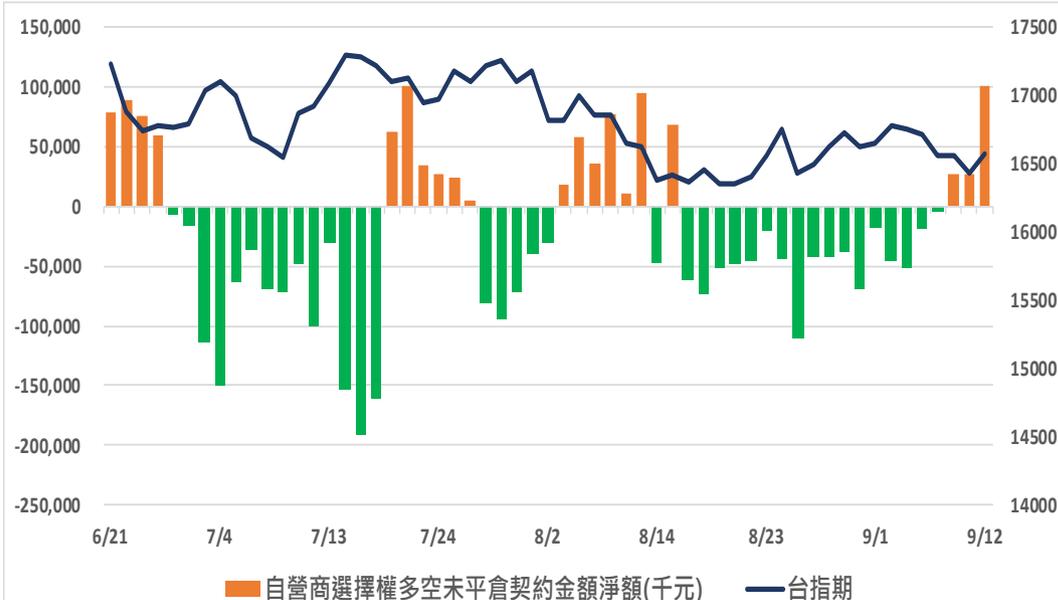
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/9/6	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
2023/9/12	16570	1,291	+3,003	-9,444	+71,152

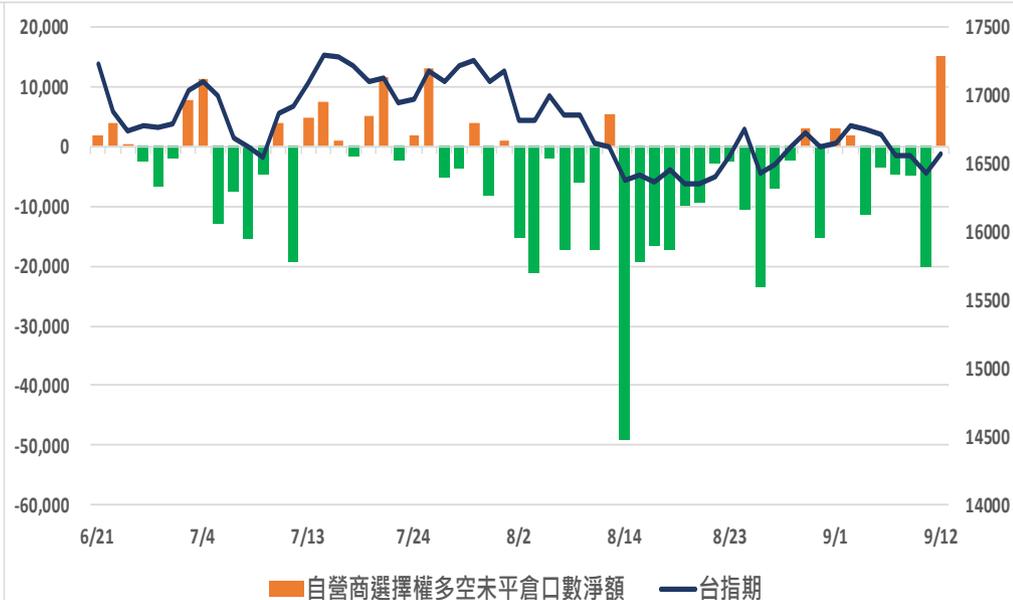
更新日期：2023年9月12日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



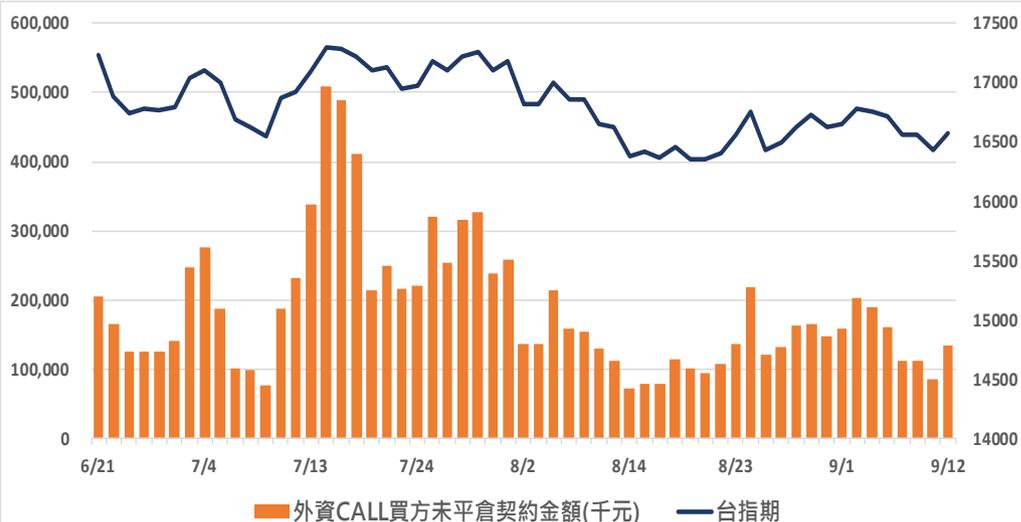
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/9/6	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
2023/9/12	16570	15,114	+35,282	100,504	+72,801

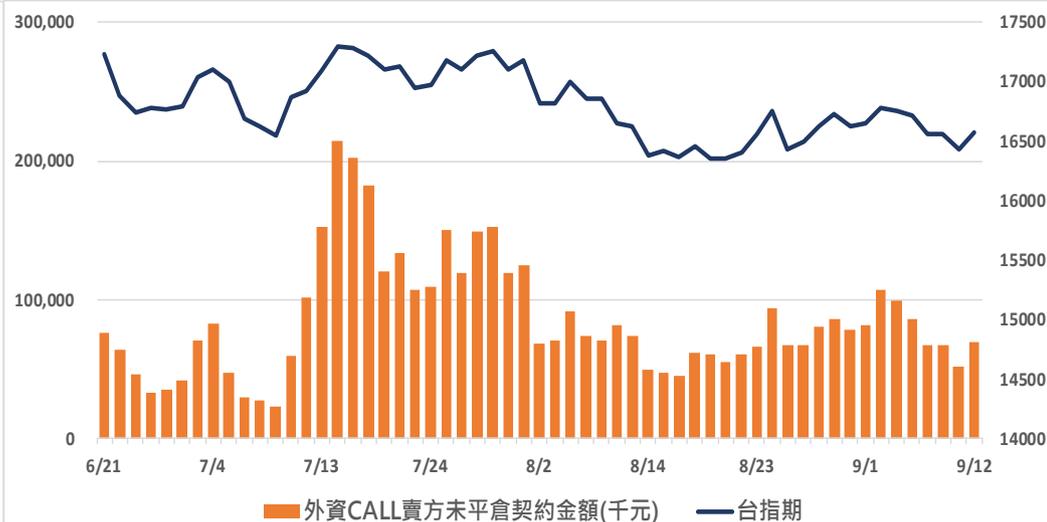
更新日期：2023年9月12日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

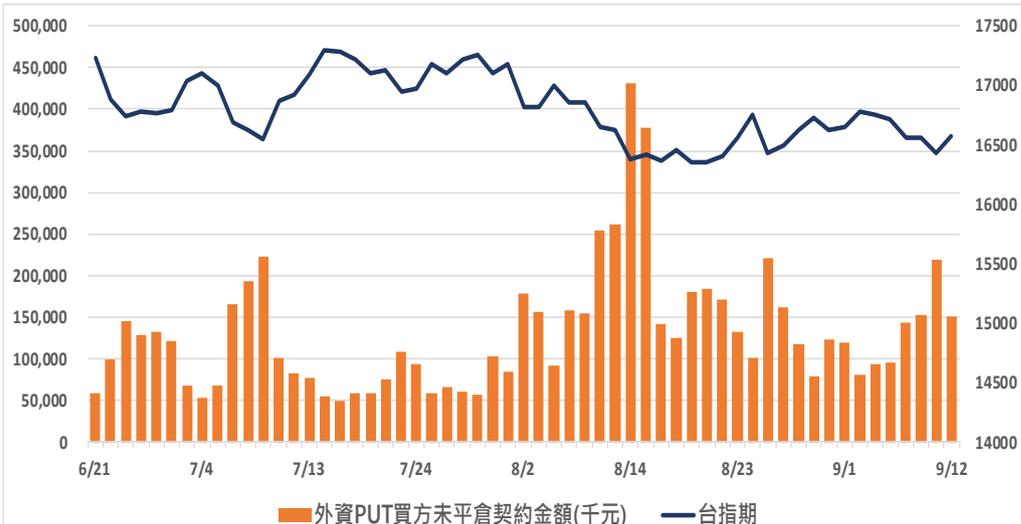
Buy Call未平倉金額



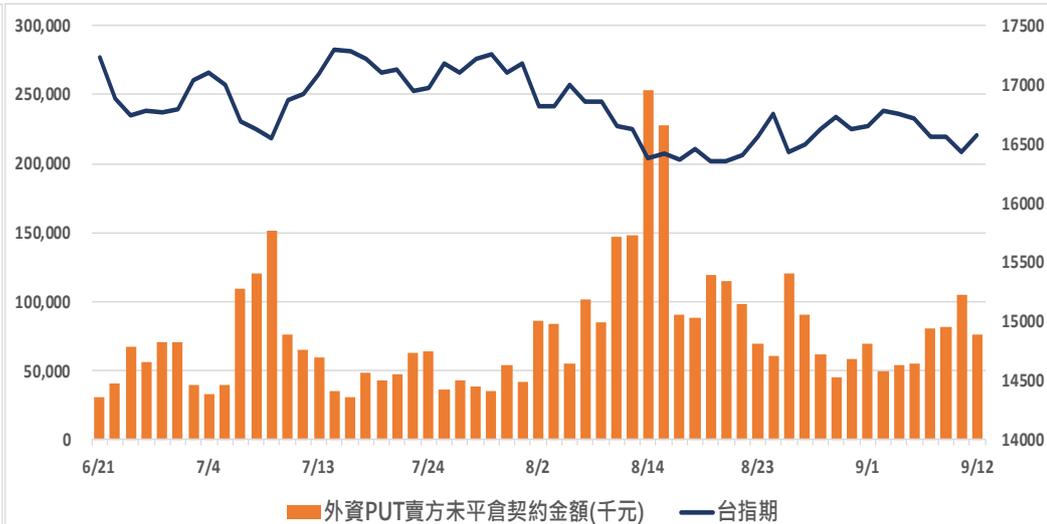
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



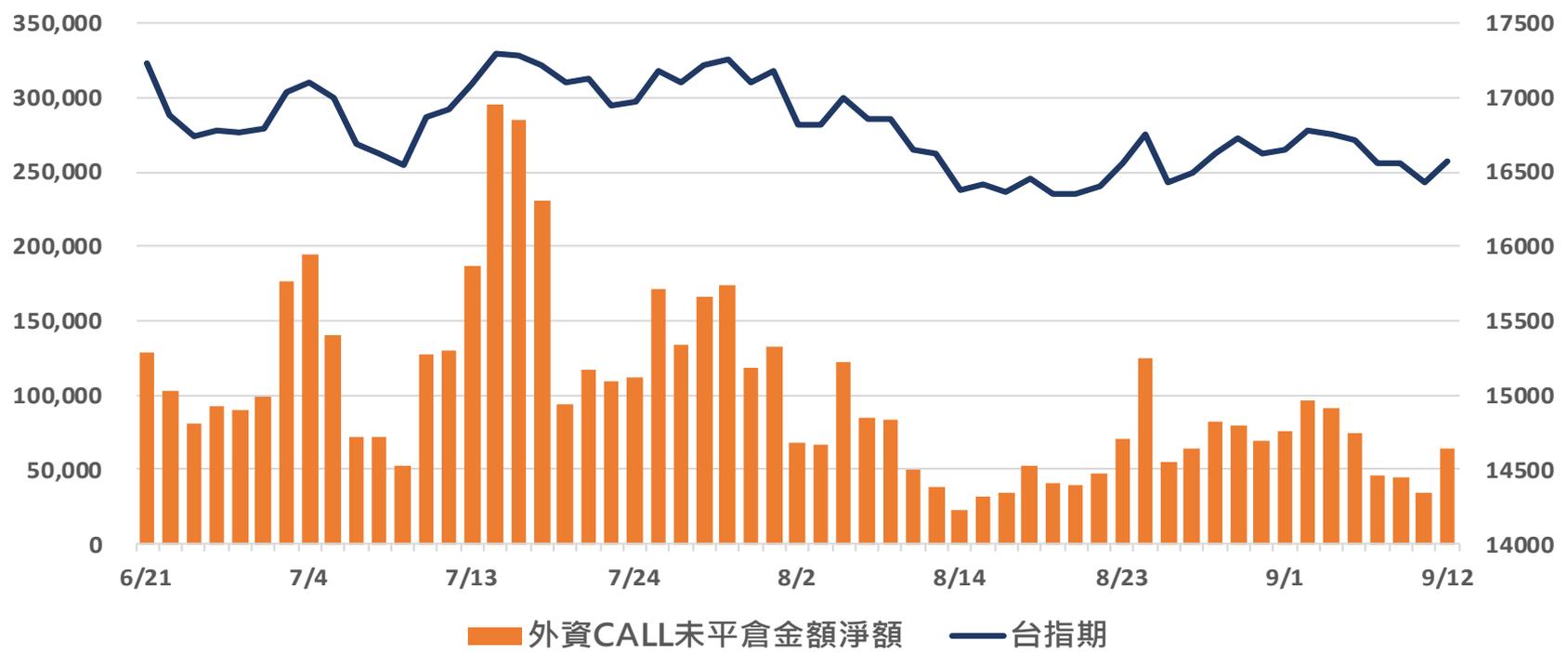
Sell Put未平倉金額



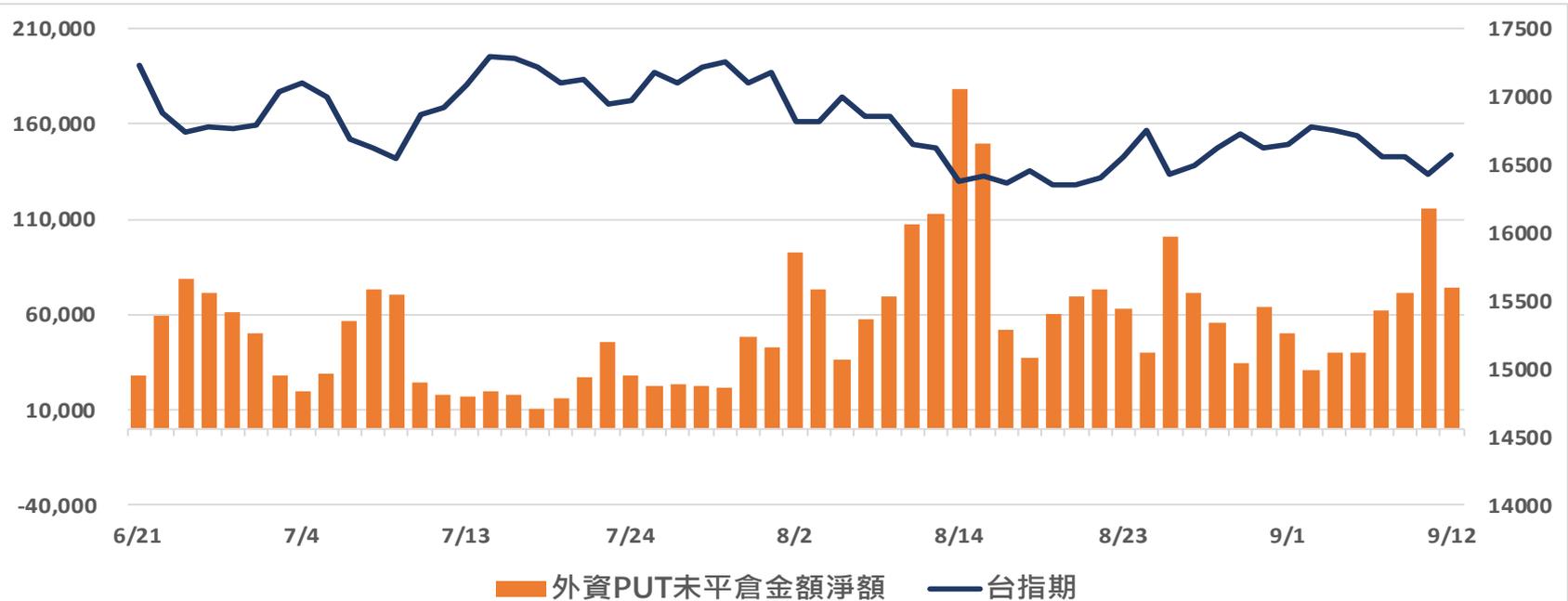
更新日期：2023年9月12日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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12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