

台指選擇權OI

日期：2023/9/14 結算日：2023/9/20					日期：2023/9/14 結算日：2023/10/18				
202309 月台指選擇權 OI 序列					202310 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
-133	1,860	16,300	13,774	2,274	1	21	15,800	2,027	-15
-21	344	16,350	4,400	2,269	1	23	15,900	1,250	473
-204	2,086	16,400	12,502	5,355	-1	35	16,000	3,430	111
90	779	16,450	5,433	3,311	0	29	16,100	2,088	13
-412	2,267	16,500	11,860	5,372	2	27	16,200	1,014	131
-207	1,873	16,550	6,160	3,914	-11	105	16,300	2,029	214
-653	6,325	16,600	12,186	4,662	-6	145	16,400	3,095	664
342	3,143	16,650	4,270	3,275	-26	749	16,500	1,633	141
-3,045	5,011	16,700	6,560	4,225	-12	786	16,600	1,450	205
-183	3,992	16,750	6,928	6,436	43	913	16,700	614	261
1,964	11,840	16,800	4,962	2,652	95	922	16,800	370	139
1,109	5,500	16,850	2,674	2,581	181	2,189	16,900	247	169
2,802	10,291	16,900	1,510	700	101	2,944	17,000	116	61
3,904	7,306	16,950	213	190	157	3,651	17,100	10	5
3,185	16,421	17,000	1,229	319	148	3,693	17,200	50	12
※ 4,146	6,127	17,050	47	27	167	2,997	17,300	15	0
2,151	7,893	17,100	166	35	249	3,501	17,400	3	0
1,054	6,587	17,200	163	7	315	2,289	17,500	4	-6
1,092	6,618	17,300	507	4	412	1,316	17,600	3	1
1,715	6,036	17,400	196	4	14	509	17,700	21	0
674	4,648	17,500	110	-2	119	647	17,800	3	0
10	3,380	17,600	70	1	29	348	17,900	2	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
18,998	146,731	1.3011	190,912	54,953	2,671	33,219	0.7925	26,327	2,562
昨日 P/C	1.0941	今日增減變化	0.2070		昨日 P/C	0.7780	今日增減變化	0.0146	

更新日期：2023年9月14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	106,700,231	100,182,710	6,517,521	8,729,678	1,183,198	2,923,375	-1,740,177	-138,159
投信	46,666,006	38,049,360	8,616,646	1,709,845	659,160	0	659,160	11,880
自營商	14,101,432	27,482,282	-13,380,850	-2,923,193	491,089	1,156,834	-665,745	350,525
	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	2,123,007	1,719,773	403,234	-23,094	137,854	44,469	93,385	-27,032
投信	28,274	0	28,274	312	0	0	0	0
自營商	384,201	1,362,965	-978,764	23,294	108,183	219,303	-111,120	25,392

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	45,774	11,402	34,372	4,370	44,567	14,916	29,651	-459
投信	200	0	200	0	300	120	180	0
自營商	65,315	63,663	1,652	3,965	56,614	70,613	-13,999	-1,495
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	26,865	1,780	25,085	670	3,240	21,906	-18,666	500
特定法人(全月)	37,060	2,628	34,432	3,905	7,056	31,336	-24,280	782
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	61,563	48,679	12,884	7,263	67,605	64,025	3,580	3,491
十大交易人(全月)	94,678	72,848	21,830	7,118	78,934	88,159	-9,225	370
全市場未沖銷(近月)			149,508	20,389			197,680	56,102
全市場未沖銷(全月)			206,315	27,358			243,539	64,214

更新日期：2023年9月14日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

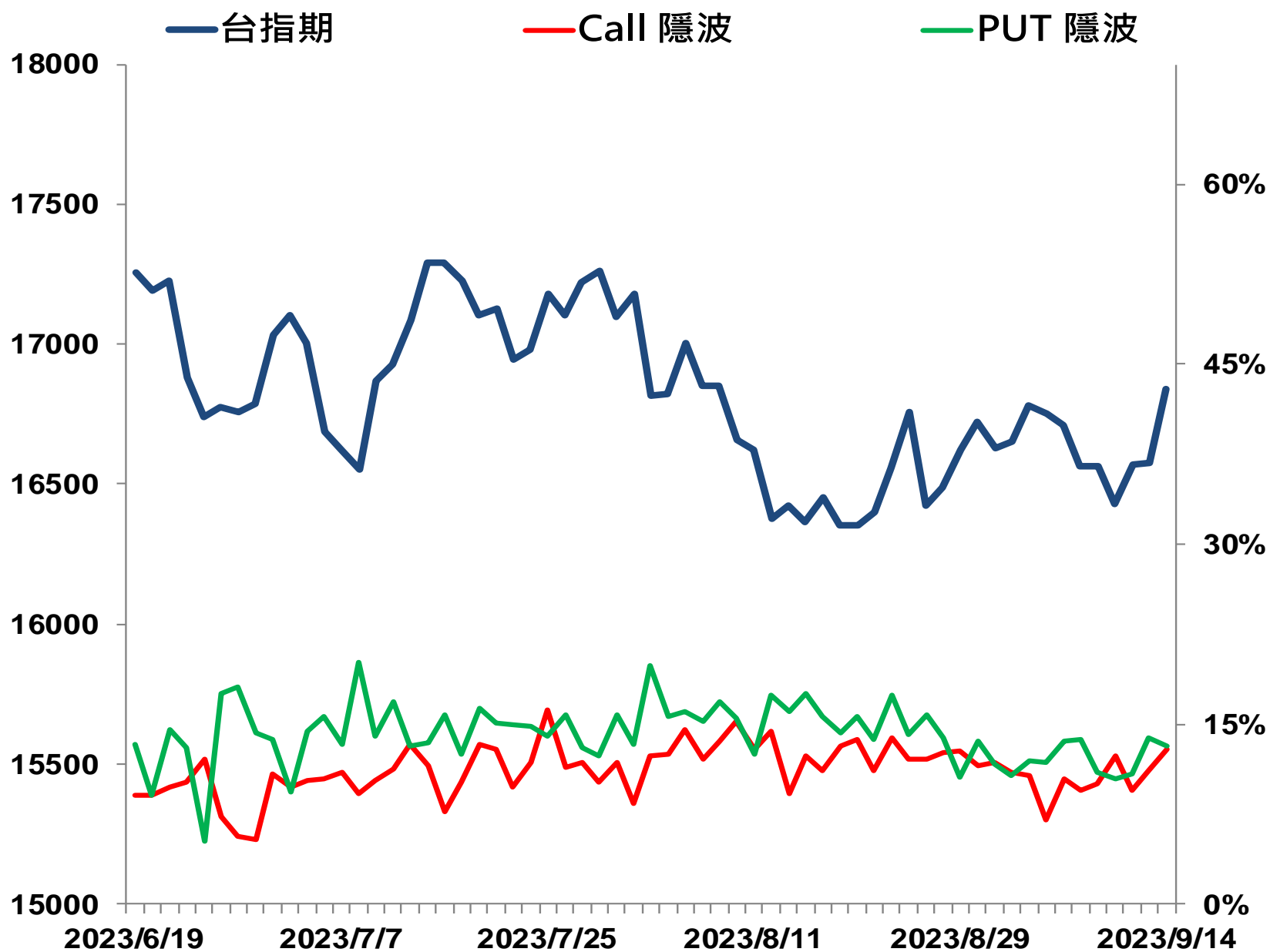
選擇權當日波動率

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2023年9月14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



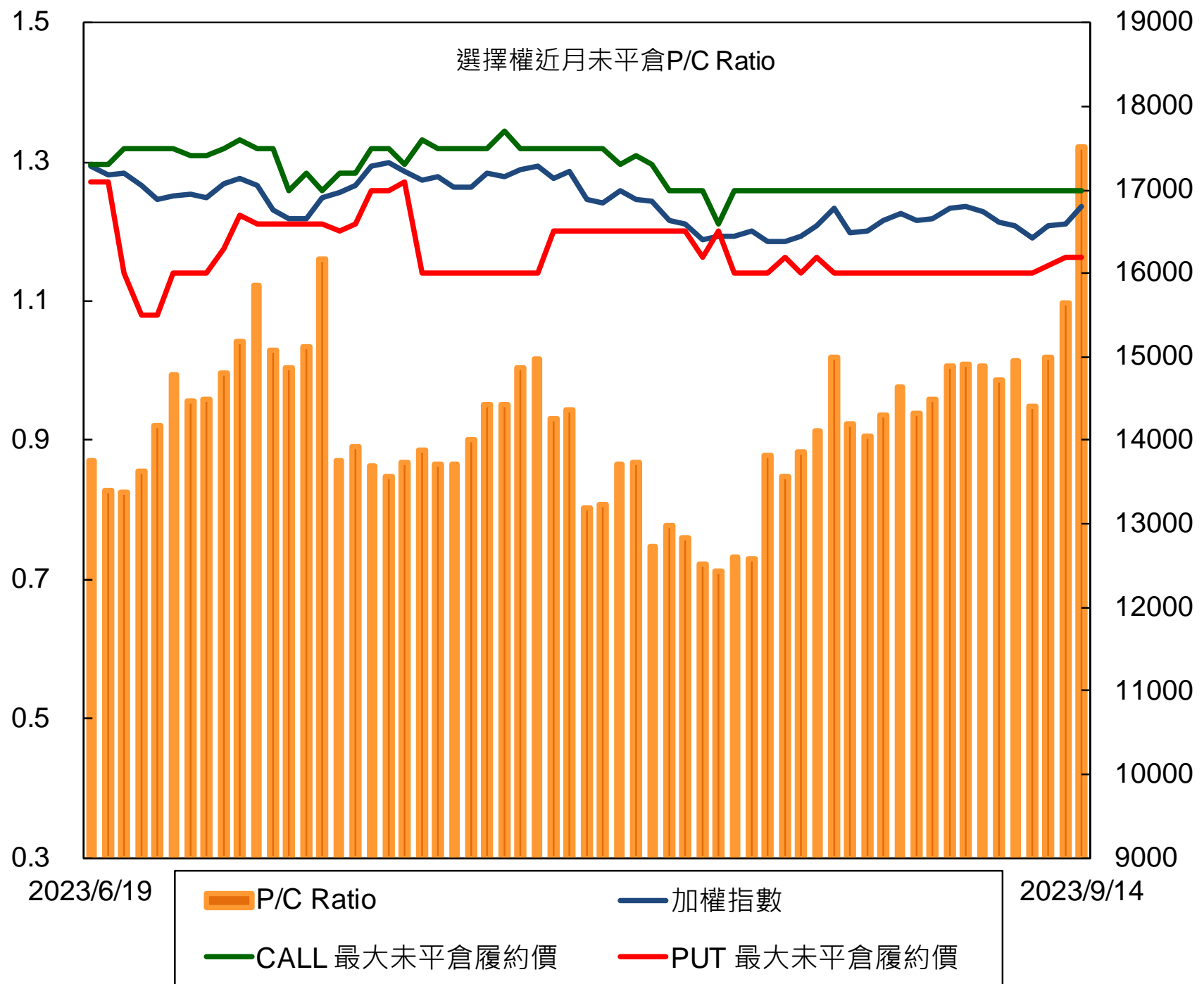
更新日期：2023年9月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理，本資料僅供參考

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13日	58,595	60,908	-2,313
	9月14日	65,315	63,663	1,652
Put	9月13日	48,745	61,249	-12,504
	9月14日	56,614	70,613	-13,999

更新日期：2023年9月14日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

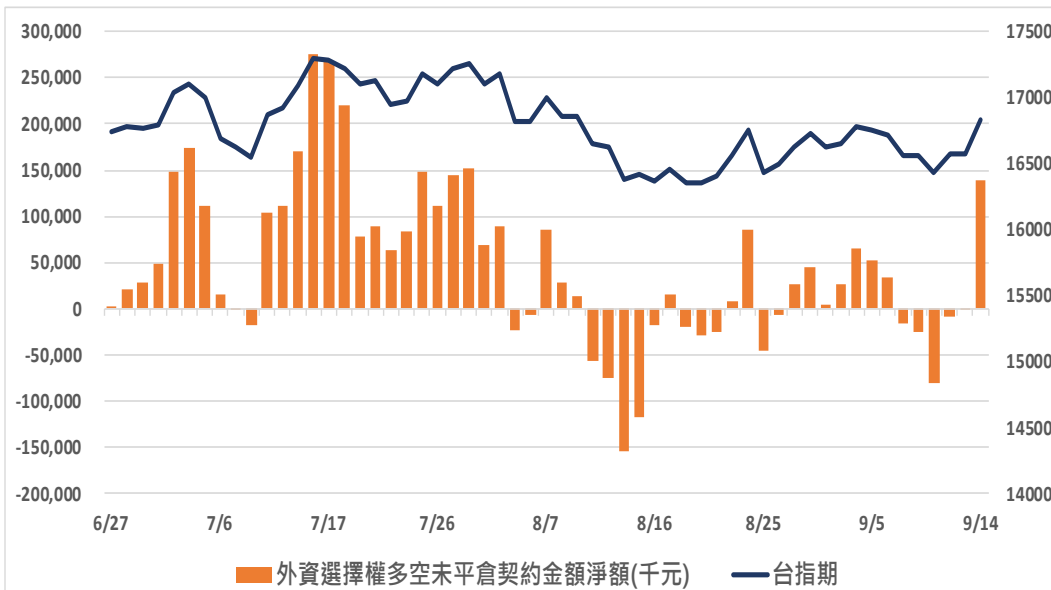
選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2023年9月14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



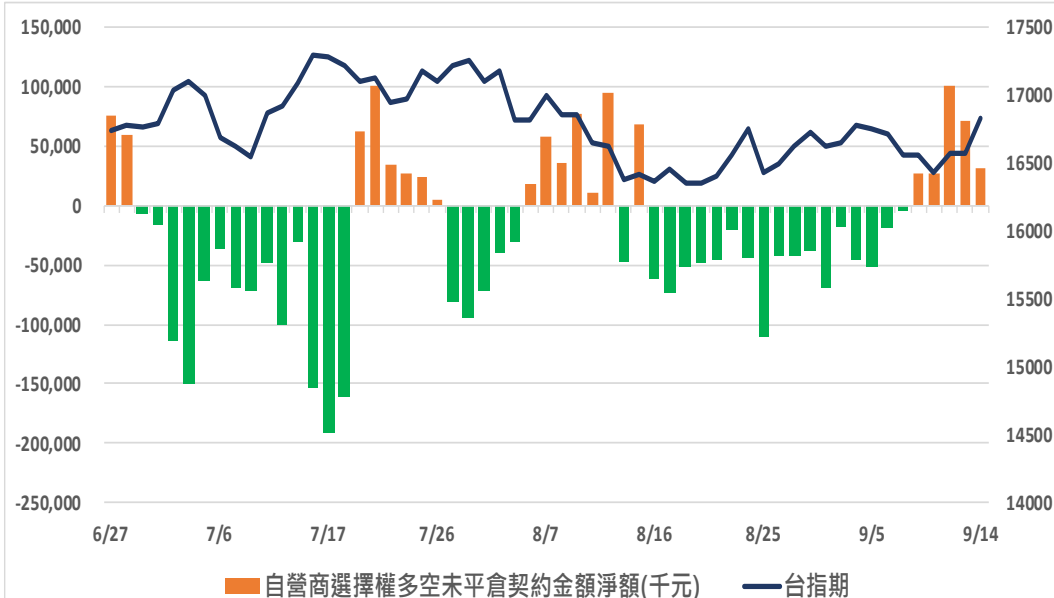
外資選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/9/8	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
2023/9/13	16579	-108	-1,399	-2,307	+7,137
2023/9/14	16836	4,721	+4,829	138,780	+141,087

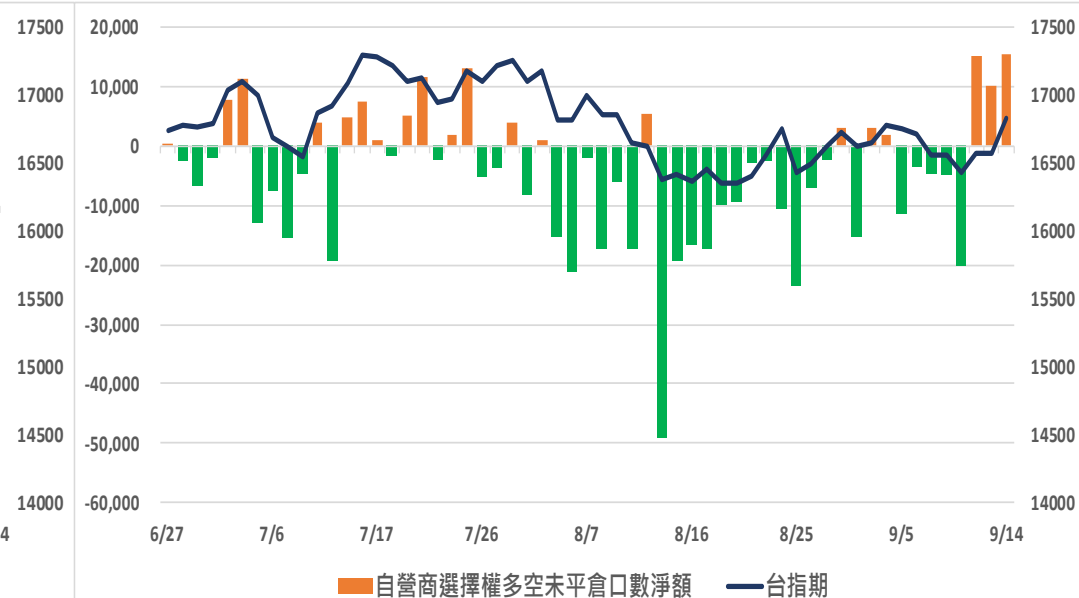
更新日期：2023年9月14日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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



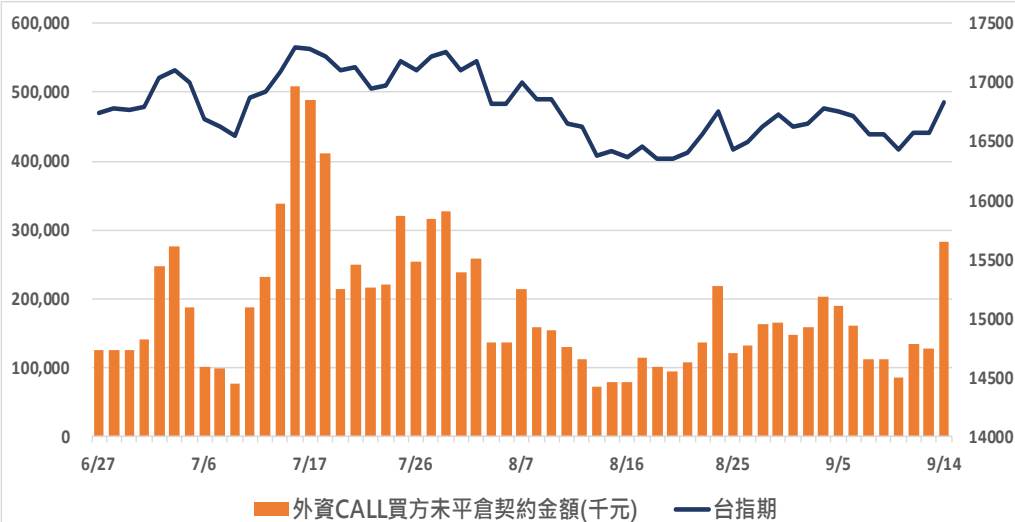
自營商選擇權多空未平倉口數淨額以及金額

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
2023/9/8	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
2023/9/13	16579	10,191	-4,923	70,925	-29,579
2023/9/14	16836	15,651	+5,460	31,198	-39,727

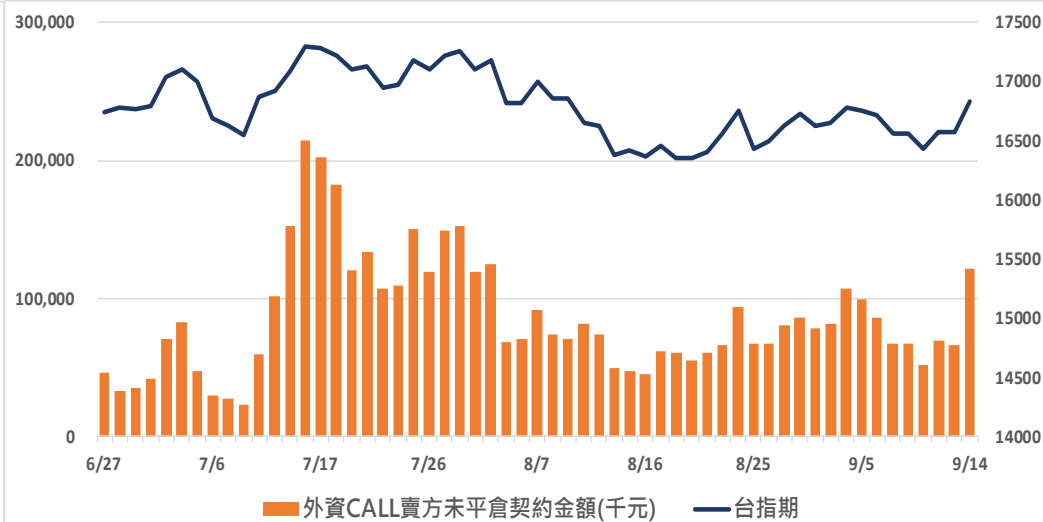
更新日期：2023年9月14日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資選擇權未平倉金額

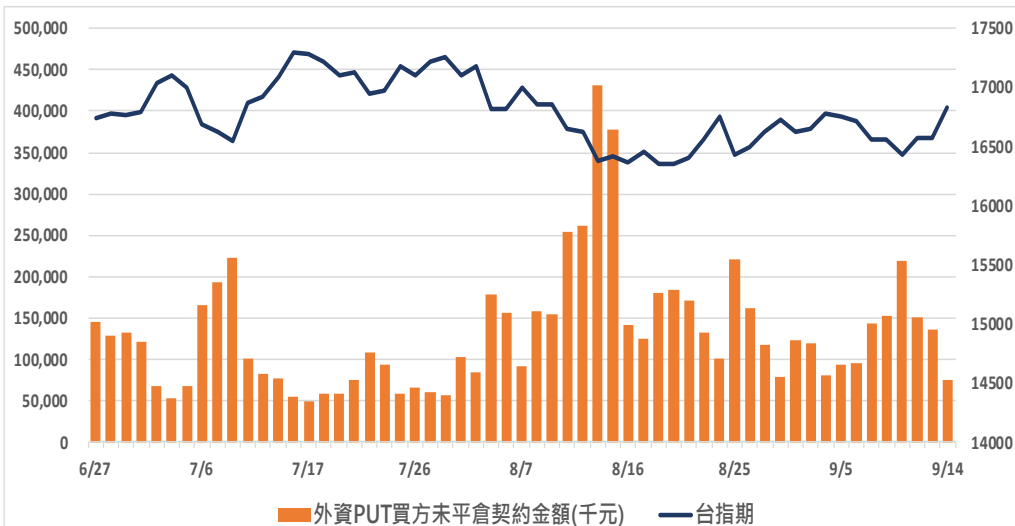
Buy Call未平倉金額



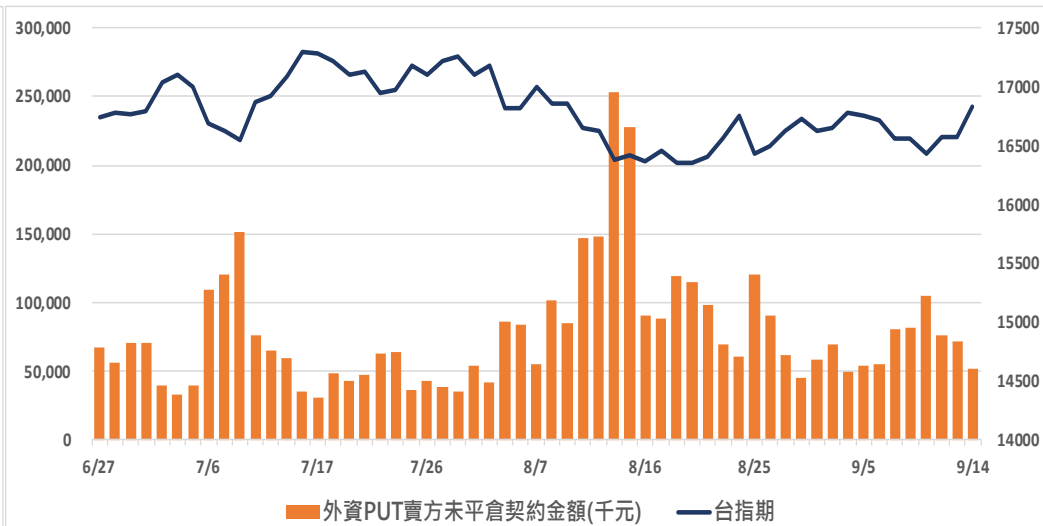
Sell Call未平倉金額



Buy Put未平倉金額



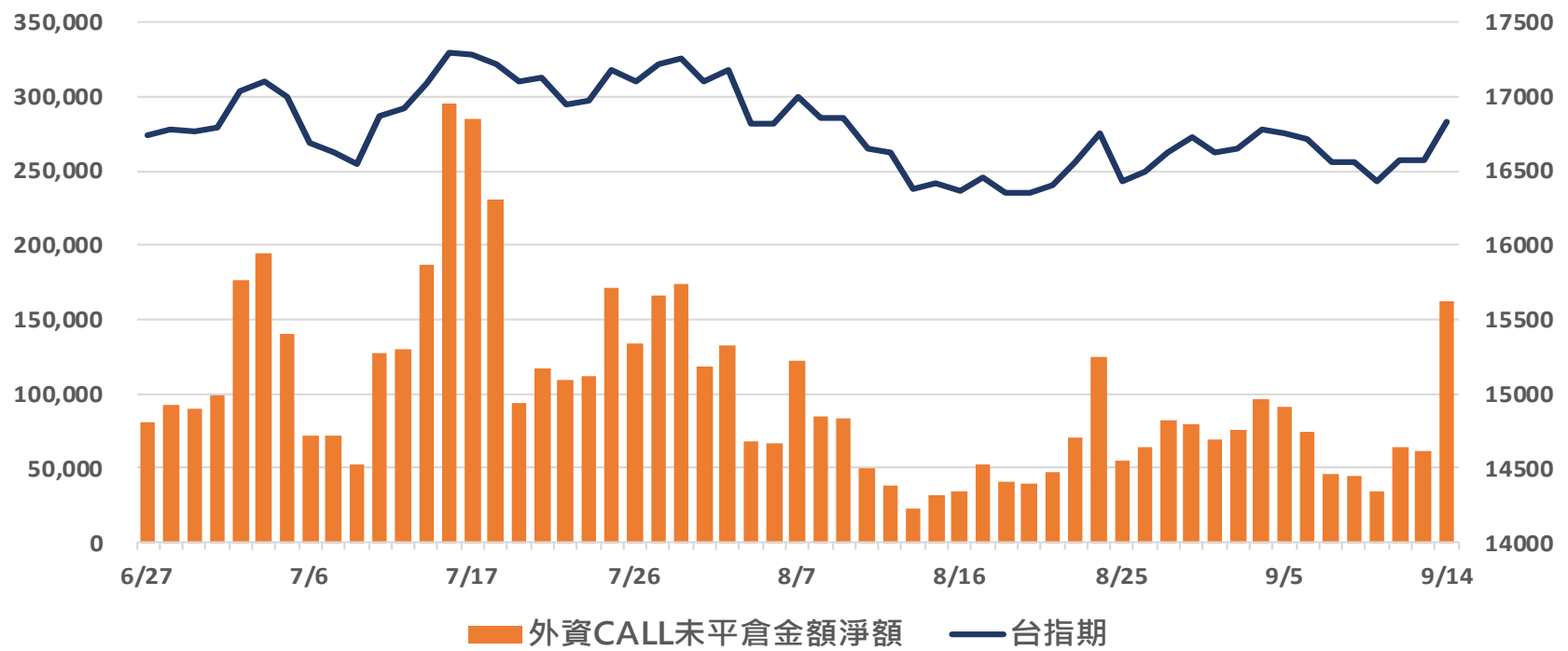
Sell Put未平倉金額



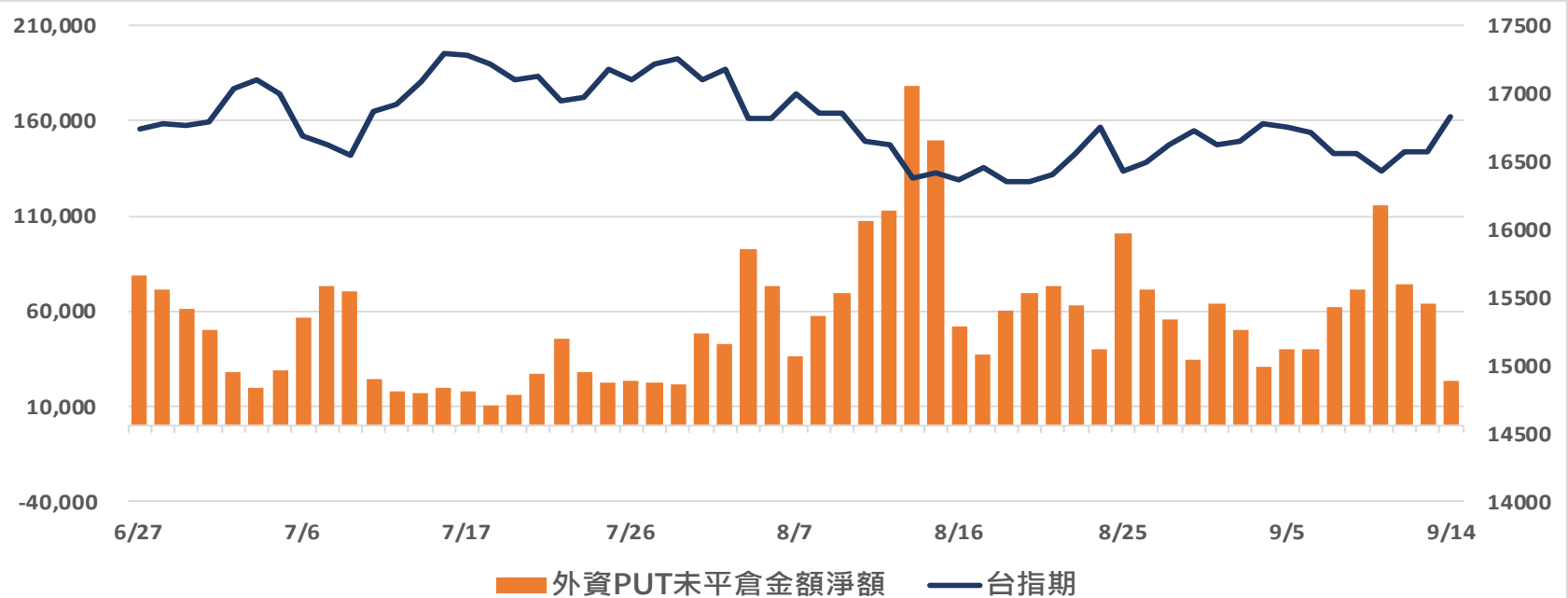
更新日期：2023年9月14日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

外資買賣權未平倉金額淨額

Buy Call – Sell Call 未平倉金額



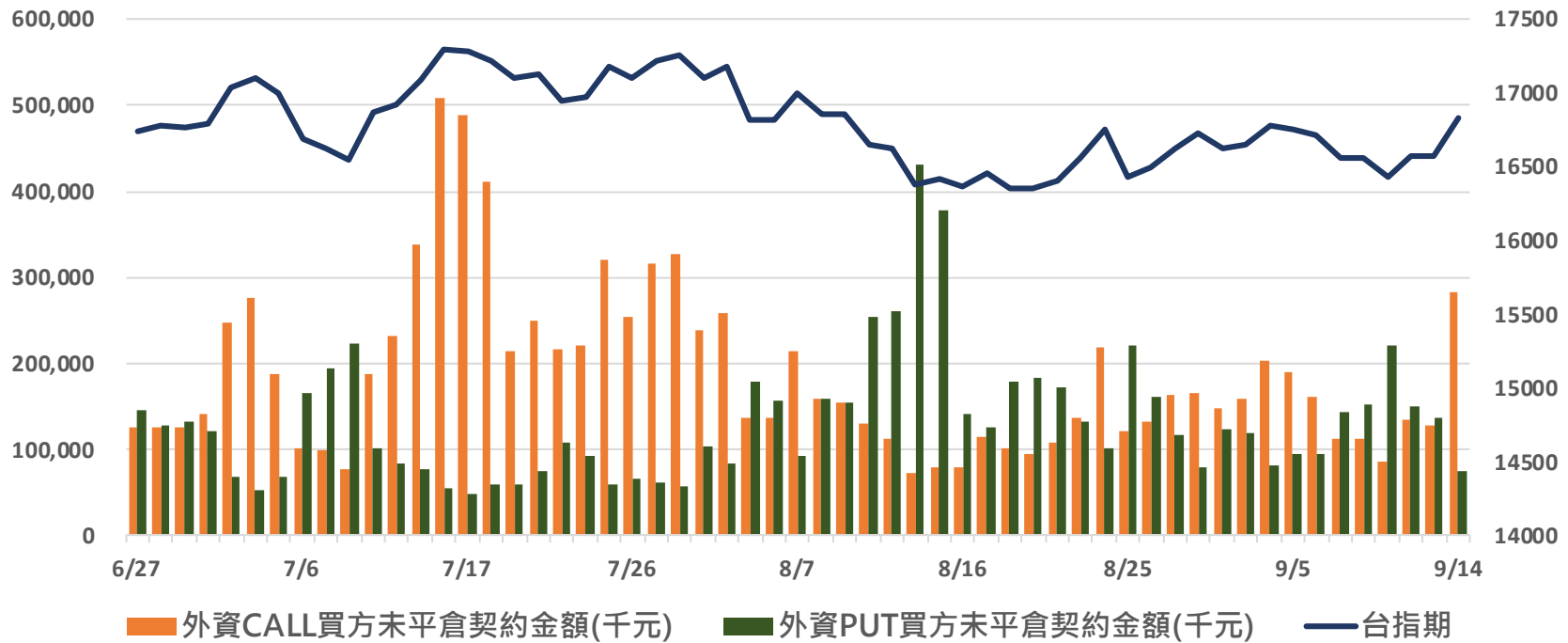
Buy Put – Sell Put 未平倉金額



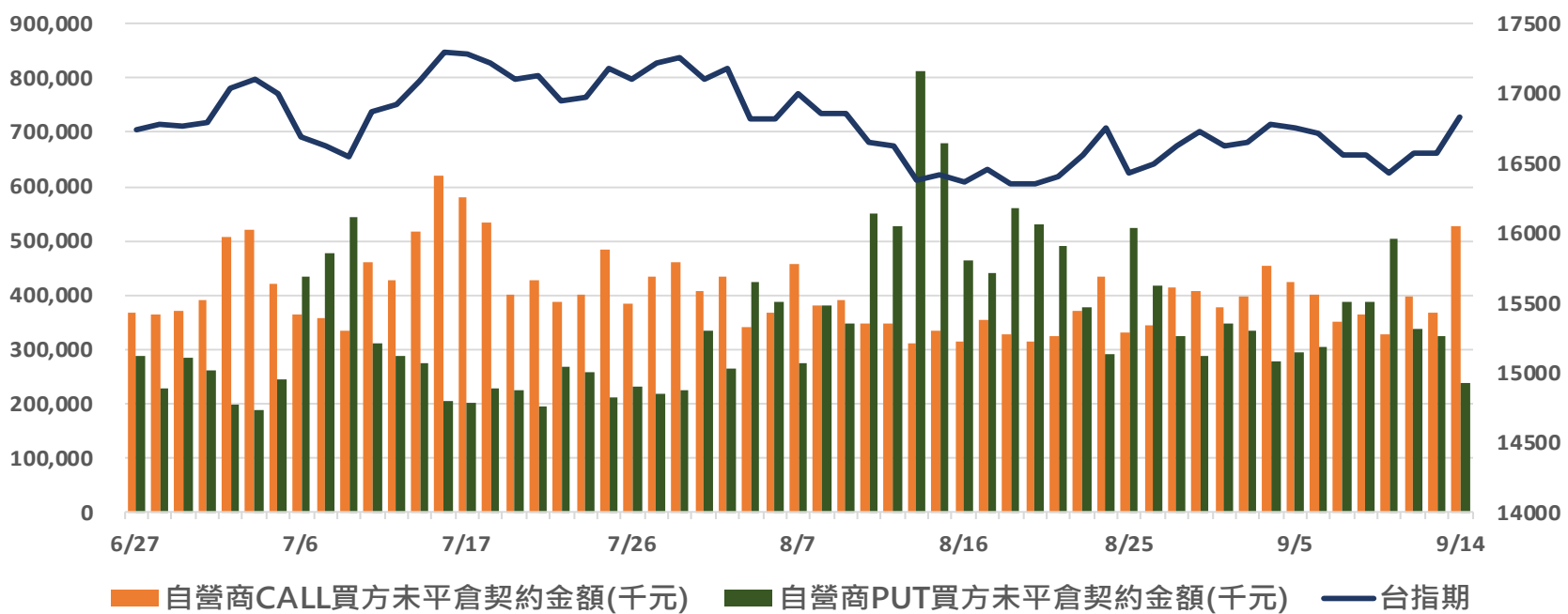
更新日期：2023年9月14日 資料來源：凱基期貨整理，本資料僅供參考

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14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