

台指選擇權OI匯報

日期：2022/9/8 結算日：2022/9/14					日期：2022/9/8 結算日：2022/9/21				
202209W2					202209 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
20	43	14,000	6,191	4,684 ※	0	6	13,400	2,068	238
2	2	14,050	1,458	1,458	0	12	13,500	3,911	222
109	150	14,100	3,861	2,666	0	4	13,600	3,485	272
7	7	14,150	759	759	-1	15	13,700	5,183	489
184	279	14,200	3,515	2,201	3	170	13,800	4,562	434
187	230	14,250	1,882	1,484	23	44	13,900	3,693	71
510	675	14,300	3,001	2,100	-1	92	14,000	7,341	335
532	975	14,350	1,724	1,338	-23	180	14,100	4,168	645
1,443	2,722	14,400	3,014	2,387	105	225	14,200	8,874	534
737	1,431	14,450	2,014	1,792	112	513	14,300	4,306	734 ※
1,229	2,276	14,500	2,426	2,210	350	1,110	14,400	4,543	387
1,235	2,724	14,550	847	775	179	1,698	14,500	4,343	-745
2,189	3,683	14,600	1,055	882 ※	649	3,065	14,600	3,501	-26
1,832	3,384	14,650	818	800 ※	649	3,454	14,700	3,228	-459
2,901	5,228	14,700	577	405	462	4,447	14,800	3,373	72
2,394	3,646	14,750	49	39	294	4,074	14,900	3,103	-119
3,348	5,928	14,800	114	80	-170	8,300	15,000	6,541	17
2,924	6,048	14,850	17	7	333	5,672	15,100	1,879	27
※ 3,495	6,149	14,900	68	56	474	8,217	15,200	1,297	-36
997	2,786	14,950	4	2	-1,403	5,671	15,300	634	-9
1,893	3,503	15,000	5	2	-817	6,562	15,400	908	-8
429	1,476	15,050	3	3	-982	5,388	15,500	313	-12
991	1,826	15,100	16	6	-191	5,830	15,600	252	0
435	1,064	15,200	1	0	-161	5,976	15,700	41	-2
-8	1,206	15,300	4	0	-314	6,773	15,800	276	-1
3	1,692	15,400	0	0	-134	4,987	15,900	49	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
30,062	59,651	0.8907	53,130	38,231	-1,013	122,511	0.9446	115,723	5,686
昨日 P/C	0.5035	今日增減變化	0.3872		昨日 P/C	0.8908	今日增減變化	0.0538	

更新日期：2022年9月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指期貨、選擇權籌碼匯報

期貨三大法人未平倉金額匯報								2022年9月8日	
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	83,626,393	68,599,442	15,026,951	10,784,837	4,042,945	1,166,235	2,876,710	285,305	
投信	24,115,610	49,892,259	-25,776,649	1,191,540	525,476	0	525,476	36,780	
自營商	32,563,240	32,177,850	385,390	-1,778,998	839,099	1,294,878	-455,779	-112,331	
	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	1,475,703	1,683,657	-207,954	232,935	86,974	88,400	-1,426	-1,426	
投信	104,747	0	104,747	285	0	0	0	0	
自營商	482,188	600,796	-118,608	-167,767	175,327	192,448	-17,121	-21,333	

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報								2022年9月8日	
	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	21,265	9,000	12,265	2,935	28,809	13,110	15,699	-857	
投信	0	100	-100	0	550	97	453	0	
自營商	77,105	68,754	8,351	12,143	48,099	46,121	1,978	-6,657	
特定法人(週)	896	0	896	542	0	728	-728	-834	
特定法人(近月)	11,289	2,738	8,551	3,499	4,142	20,470	-16,328	-1,201	
特定法人(全月)	14,219	0	14,219	2,083	7,509	23,413	-15,904	859	
十大交易人(週)	28,488	25,294	3,194	4,996	18,651	11,869	6,782	5,615	
十大交易人(近月)	57,730	53,213	4,517	1,360	45,452	61,414	-15,962	2,169	
十大交易人(全月)	101,225	79,918	21,307	7,219	63,761	76,309	-12,548	7,590	
全市場未沖銷(近月)			122,511	-1,013			115,723	5,686	
全市場未沖銷(全月)			213,026	30,192			186,862	44,829	

更新日期：2022年9月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指選擇權匯報

2022年09W2週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	14700	買權OI最大量	14900
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	12.03%	較前一交易日	-3.27%
	買權隱含波動率	12.74%	較前一交易日	-2.89%
	賣權隱含波動率	11.40%	較前一交易日	-3.43%
電子選擇權	買權成交最大量	690	買權OI最大量	760
	賣權成交最大量	630	賣權OI最大量	650
金融選擇權	買權成交最大量	1580	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1520

更新日期：2022年9月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指選擇權匯報

2022年09月選擇權分析表				
台指選擇權	買權成交最大量	15000	買權OI最大量	15000
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	14200
	整體隱含波動率	18.85%	較前一交易日	+2.63%
	買權隱含波動率	15.00%	較前一交易日	-3.11%
	賣權隱含波動率	22.49%	較前一交易日	-2.97%
	成交量P/C_Ratio值	0.946	較前一交易日	+0.08
	未平倉P/C_Ratio值	0.945	較前一交易日	+0.05
電子選擇權	買權成交最大量	690	買權OI最大量	760
	賣權成交最大量	630	賣權OI最大量	650
金融選擇權	買權成交最大量	1580	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1520

更新日期：2022年9月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

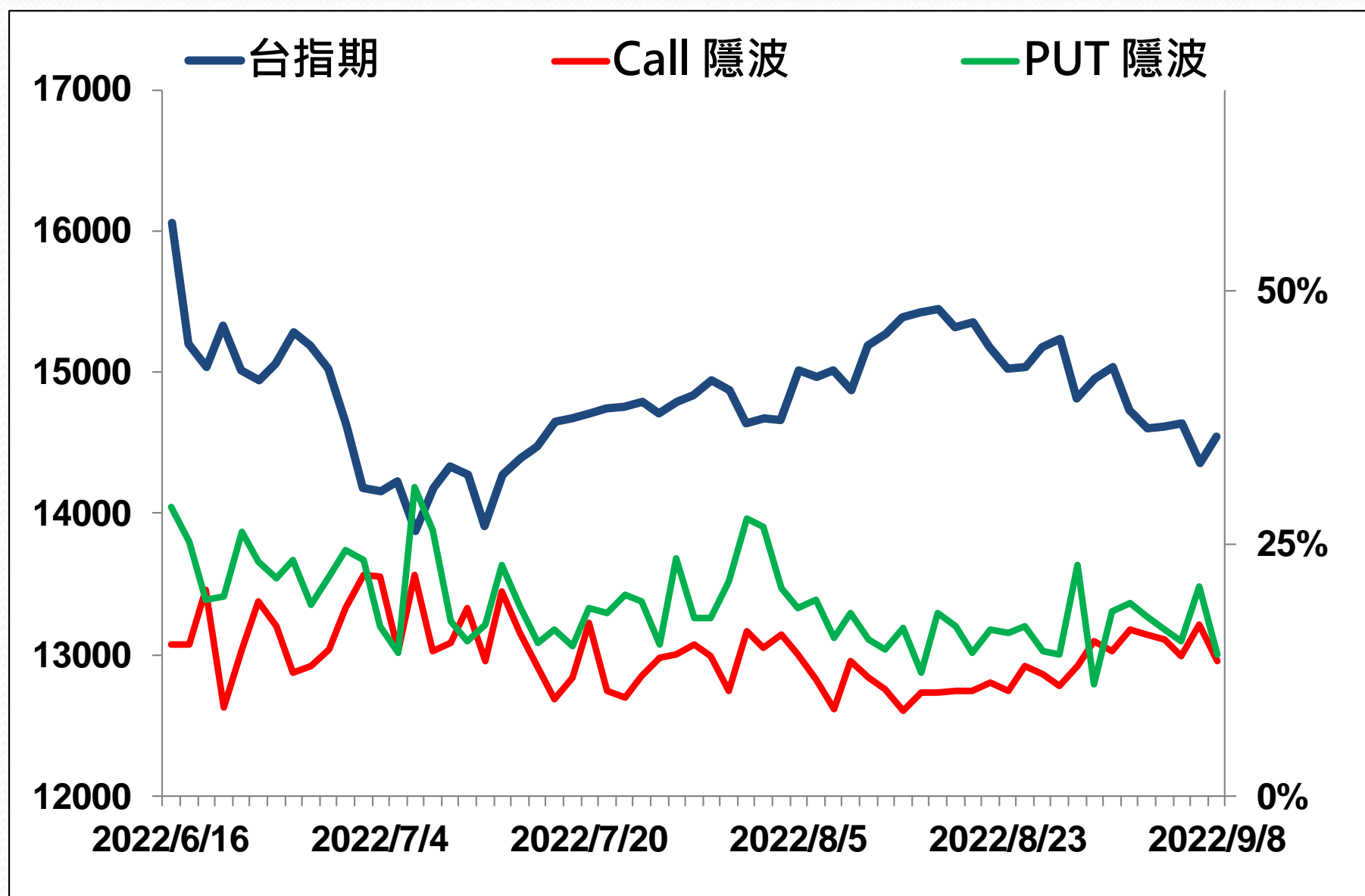
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



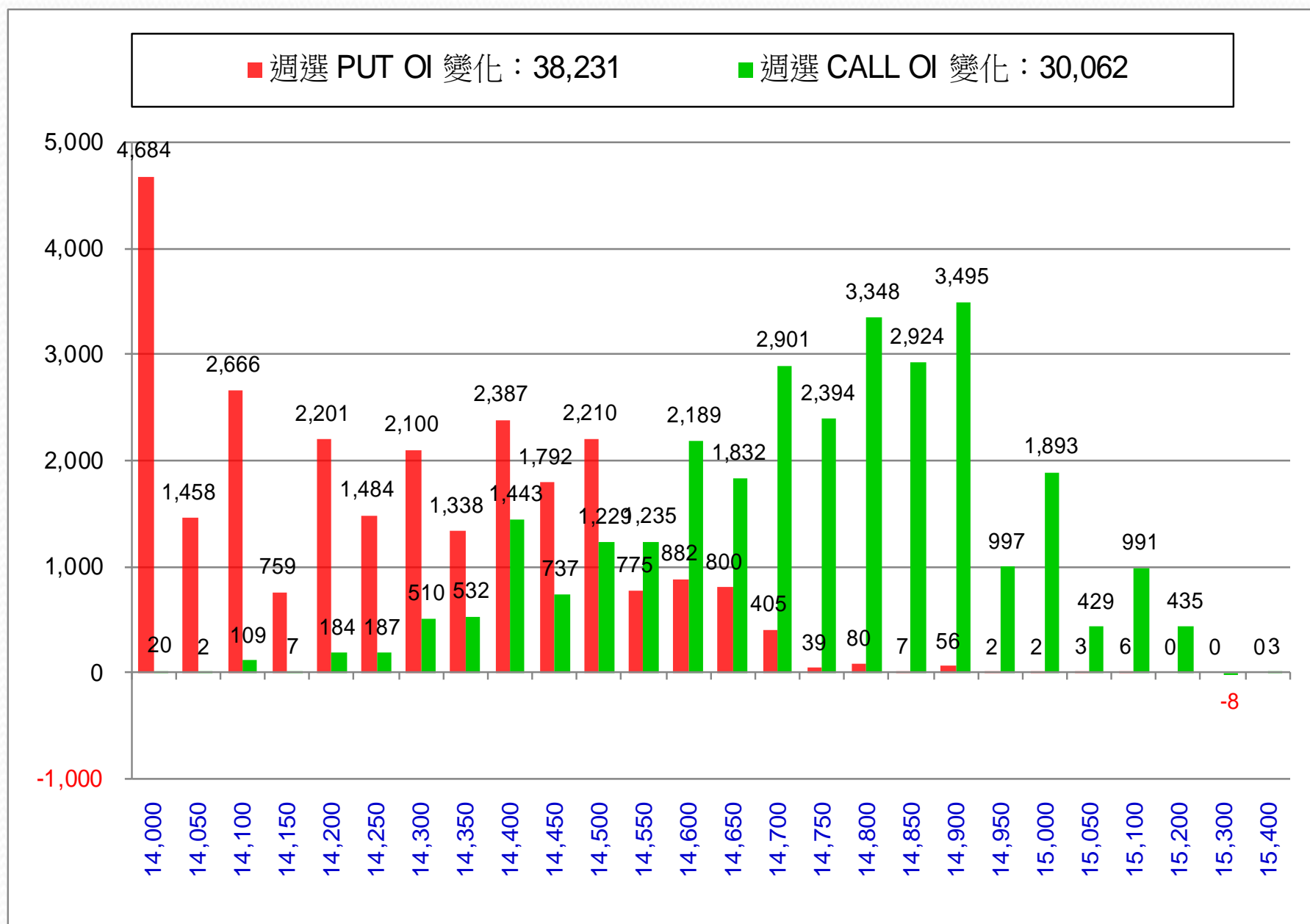
更新日期：2022年9月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



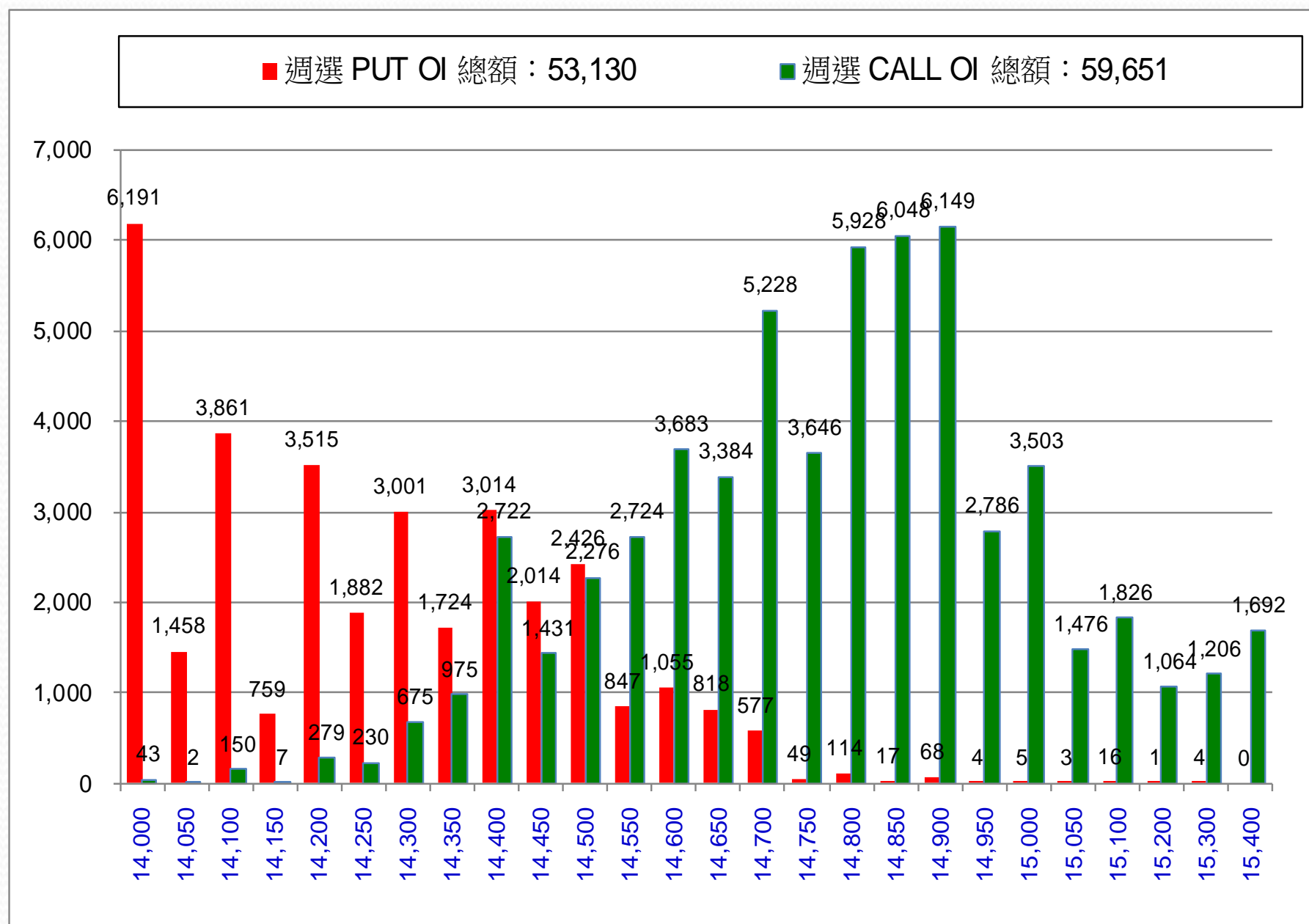
更新日期：2022年9月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年9月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量



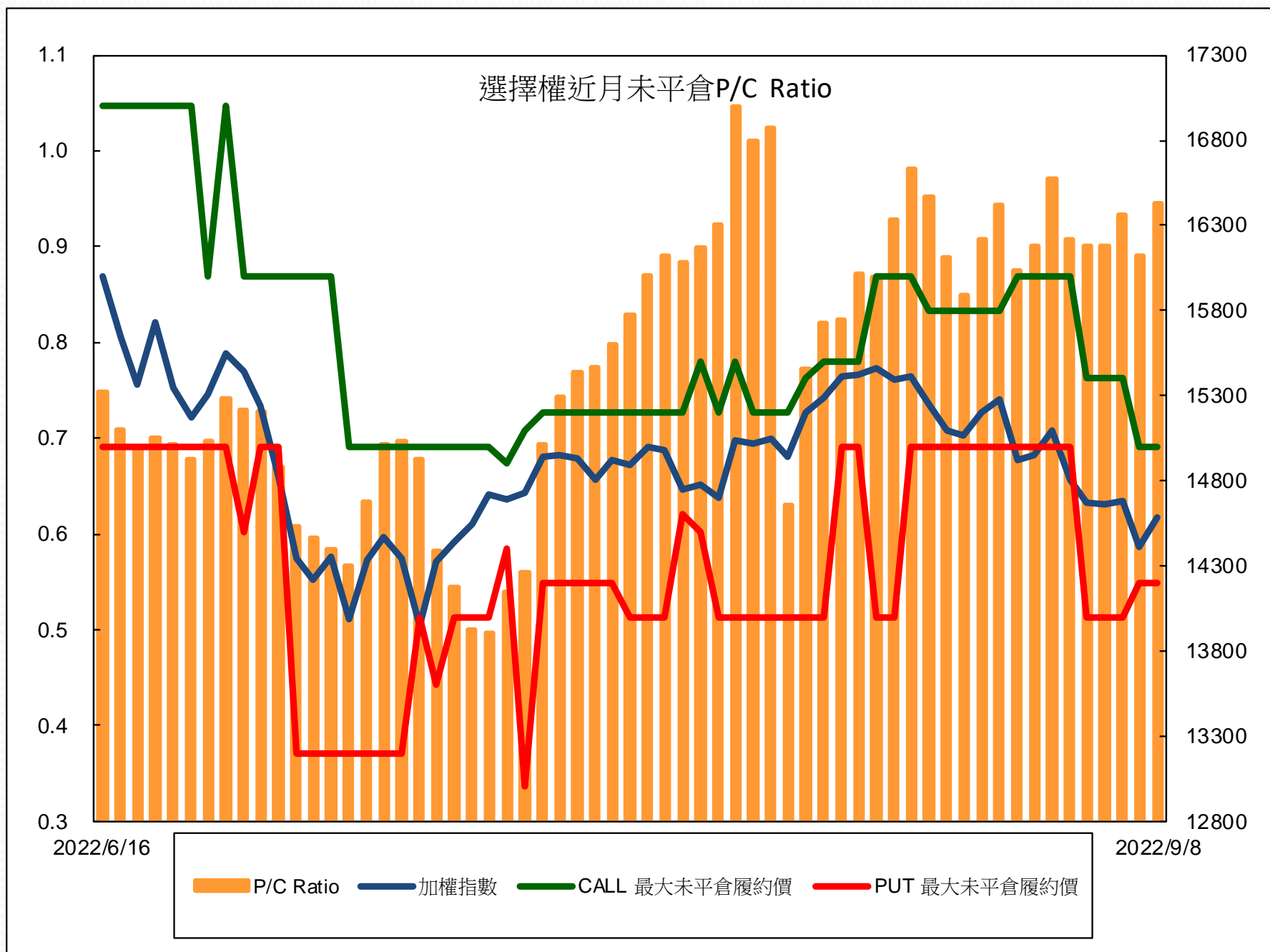
更新日期：2022年9月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

自營商選擇權OI部位統計

選擇權	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	9月7日	63,922	67,714	-3,792
	9月8日	77,105	68,754	8,351
Put	9月7日	44,224	35,589	8,635
	9月8日	48,099	46,121	1,978

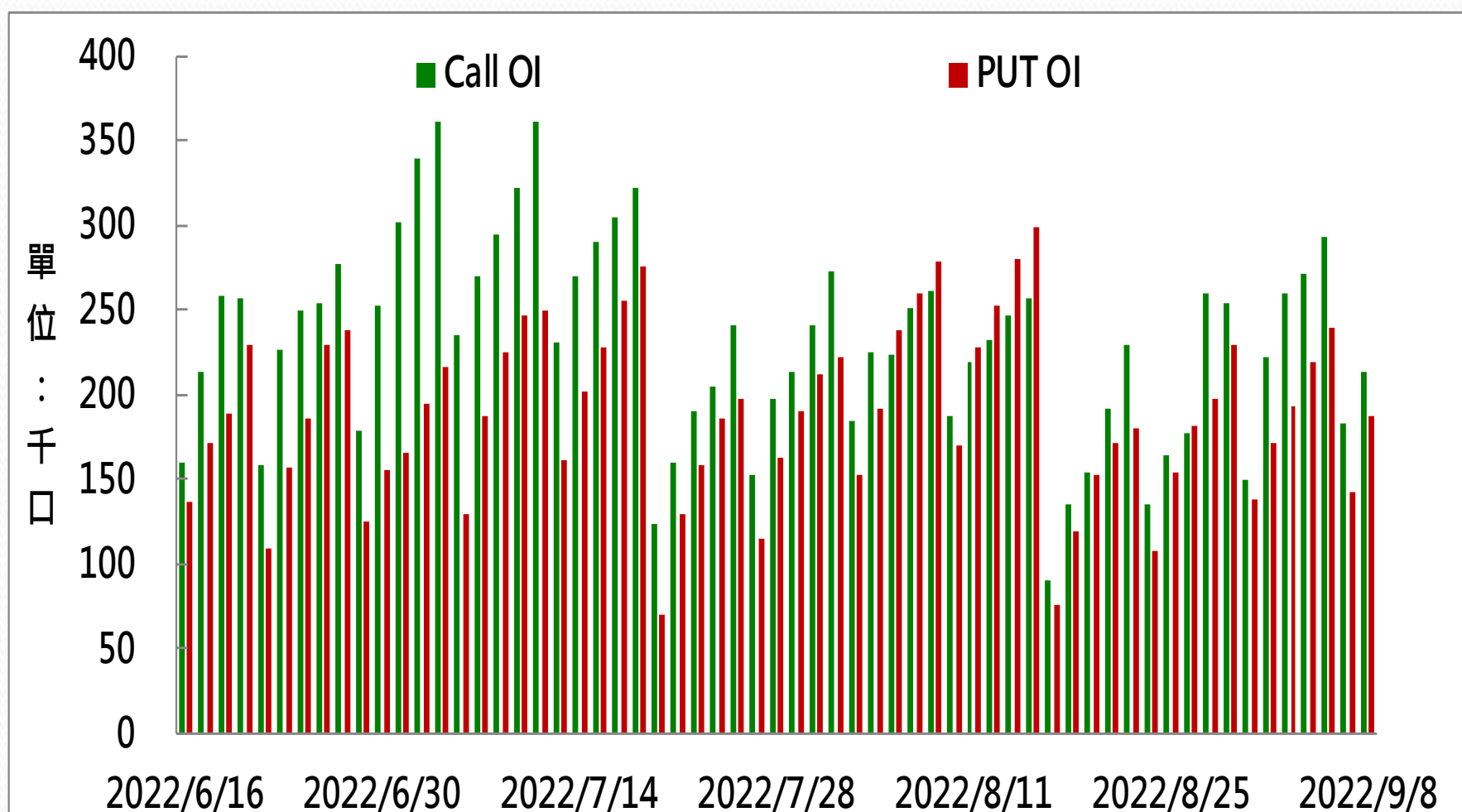
更新日期：2022年9月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年9月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權全月Put Call OI



更新日期：2022年9月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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

更新日期：2022年9月8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