

台指選擇權OI匯報

日期：2022/9/12 結算日：2022/9/14					日期：2022/9/12 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
3	46	14,000	6,268	77	0	2	13,200	1,736	-391
-27	252	14,200	6,351	2,836	0	4	13,600	3,295	-190
-5	225	14,250	2,653	771	0	15	13,700	4,915	-268
-37	638	14,300	4,703	1,702	-2	168	13,800	4,091	-471
-259	716	14,350	3,281	1,557	-4	40	13,900	3,652	-41
-855	1,867	14,400	5,612	2,598	-7	85	14,000	8,193	852
-75	1,356	14,450	4,686	2,672	-19	161	14,100	5,411	1,243 ※
-73	2,203	14,500	5,147	2,721	-17	208	14,200	9,286	412
-485	2,239	14,550	4,678	3,831	-50	463	14,300	4,489	183
-774	2,909	14,600	5,329	4,274	-120	990	14,400	5,495	952
-515	2,869	14,650	4,952	4,134	-129	1,569	14,500	5,285	942
-928	4,300	14,700	6,266	5,689 ※	-334	2,731	14,600	4,272	771
-438	3,208	14,750	4,835	4,786	-422	3,032	14,700	3,915	687
57	5,985	14,800	4,432	4,318	-111	4,336	14,800	4,344	971
-1,000	5,048	14,850	2,613	2,596	-286	3,788	14,900	3,097	-6
565	6,714	14,900	736	668	-481	7,819	15,000	6,549	8
5,624	8,410	14,950	210	206	142	5,814	15,100	1,835	-44
※ 5,979	9,482	15,000	597	592	-173	8,044	15,200	1,312	15
3,445	4,921	15,050	139	136	※ 871	6,542	15,300	658	24
2,976	4,802	15,100	68	52	780	7,342	15,400	886	-22
1,308	2,372	15,200	4	3	-81	5,307	15,500	296	-17
370	1,576	15,300	5	1	-400	5,430	15,600	260	8
1	1,693	15,400	20	20	-407	5,569	15,700	41	0
-200	218	15,500	0	0	-644	6,129	15,800	276	0
-2	34	15,600	0	0	-123	4,864	15,900	49	0
2	2	15,700	0	0	-165	7,016	16,000	408	0
0	2	15,800	0	0	-19	2,083	16,100	13	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
14,612	74,263	1.3064	97,016	43,886	-2,340	120,171	1.0095	121,313	5,590
昨日 P/C	0.8907	今日增減變化	0.4157		昨日 P/C	0.9446	今日增減變化	0.0649	

更新日期：2022年9月12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12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	88,194,168	63,663,309	24,530,859	9,503,908	3,799,651	1,018,887	2,780,764	-95,946	
投信	24,708,031	48,472,013	-23,763,982	2,012,667	535,394	0	535,394	9,918	
自營商	30,902,641	35,230,066	-4,327,425	-4,712,815	871,262	1,275,569	-404,307	51,472	
	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	1,584,940	1,728,883	-143,943	64,011	85,403	89,745	-4,342	-2,916	
投信	106,393	0	106,393	1,646	0	0	0	0	
自營商	519,452	657,135	-137,683	-19,075	172,249	193,963	-21,714	-4,593	

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12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	25,841	8,279	17,562	5,297	36,599	14,224	22,375	6,676	
投信	0	100	-100	0	550	97	453	0	
自營商	80,342	69,902	10,440	2,089	56,144	63,008	-6,864	-8,842	
特定法人(週)	2,102	662	1,440	544	0	2,000	-2,000	-1,272	
特定法人(近月)	12,183	0	12,183	3,632	4,142	21,765	-17,623	-1,295	
特定法人(全月)	14,719	0	14,719	500	4,552	26,637	-22,085	-6,181	
十大交易人(週)	33,060	28,395	4,665	1,471	39,944	20,243	19,701	12,919	
十大交易人(近月)	58,460	52,686	5,774	1,257	46,031	62,304	-16,273	-311	
十大交易人(全月)	106,101	81,802	24,299	2,992	82,482	85,637	-3,155	9,393	
全市場未沖銷(近月)			120,171	-2,340			121,313	5,590	
全市場未沖銷(全月)			226,643	13,617			241,835	54,973	

更新日期：2022年9月12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	14800	買權OI最大量	15000
	賣權成交最大量	14500	賣權OI最大量	14200
	整體隱含波動率	14.09%	較前一交易日	+2.06%
	買權隱含波動率	15.26%	較前一交易日	+2.52%
	賣權隱含波動率	13.15%	較前一交易日	+1.76%
電子選擇權	買權成交最大量	715	買權OI最大量	705
	賣權成交最大量	625	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	1580
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1520

更新日期：2022年9月12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	15200
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	14200
	整體隱含波動率	19.22%	較前一交易日	-0.37%
	買權隱含波動率	16.07%	較前一交易日	+1.06%
	賣權隱含波動率	22.22%	較前一交易日	-0.27%
	成交量P/C_Ratio值	1.067	較前一交易日	+0.12
	未平倉P/C_Ratio值	1.010	較前一交易日	+0.06
電子選擇權	買權成交最大量	715	買權OI最大量	705
	賣權成交最大量	625	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	1580
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1520

更新日期：2022年9月12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

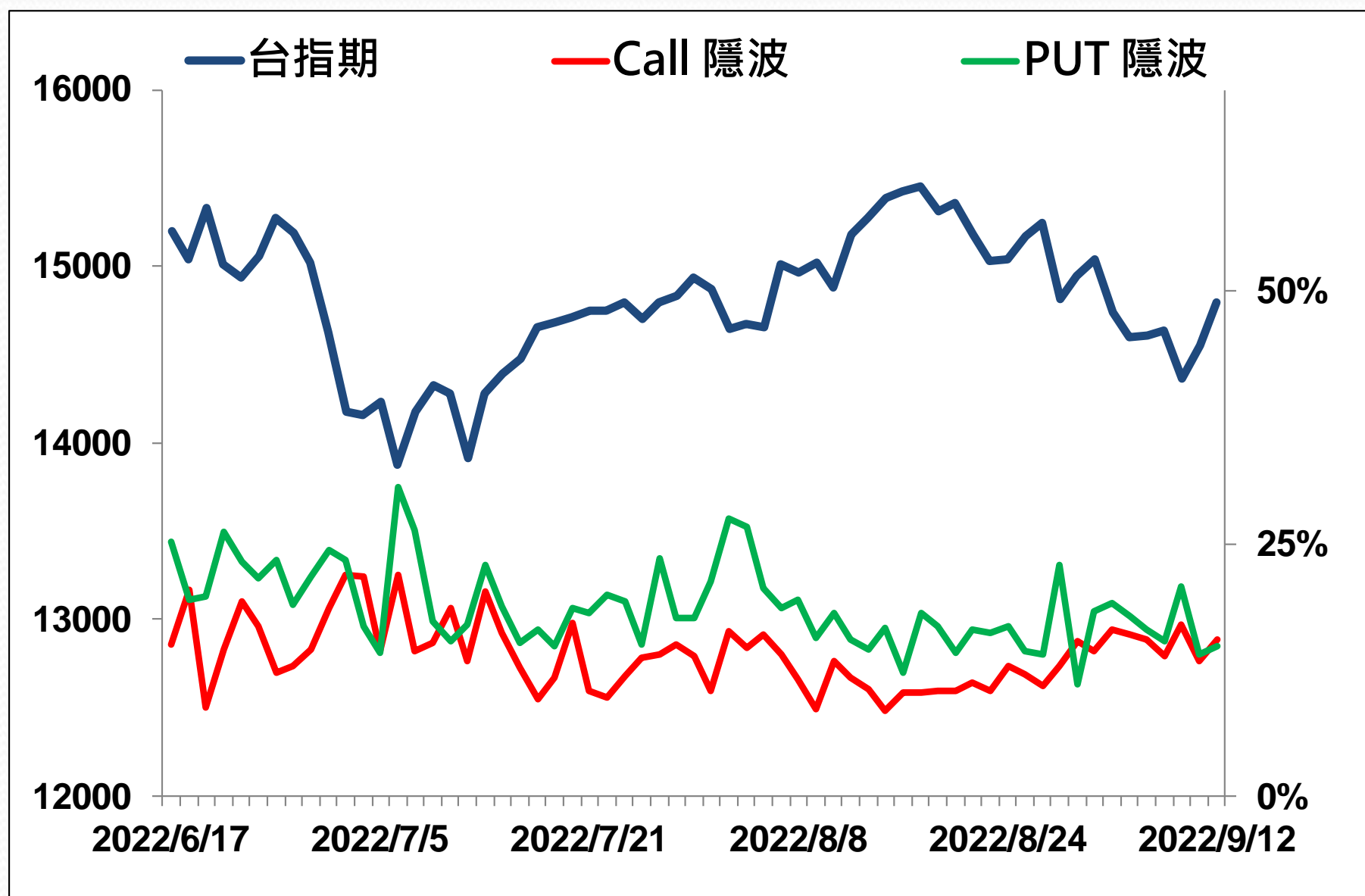
臺指選擇權波動率指數

— 臺指選擇權波動率指數



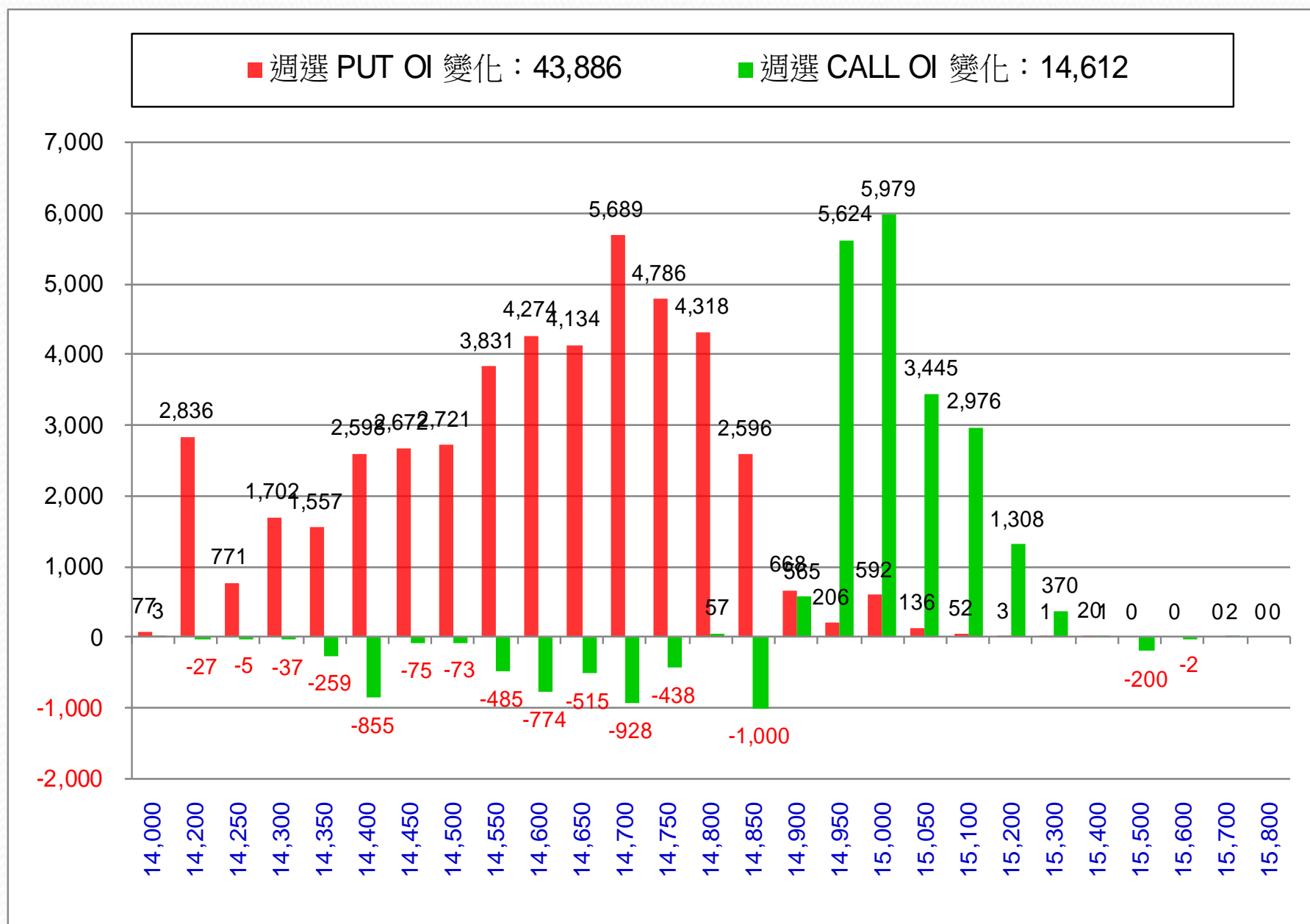
更新日期：2022年9月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



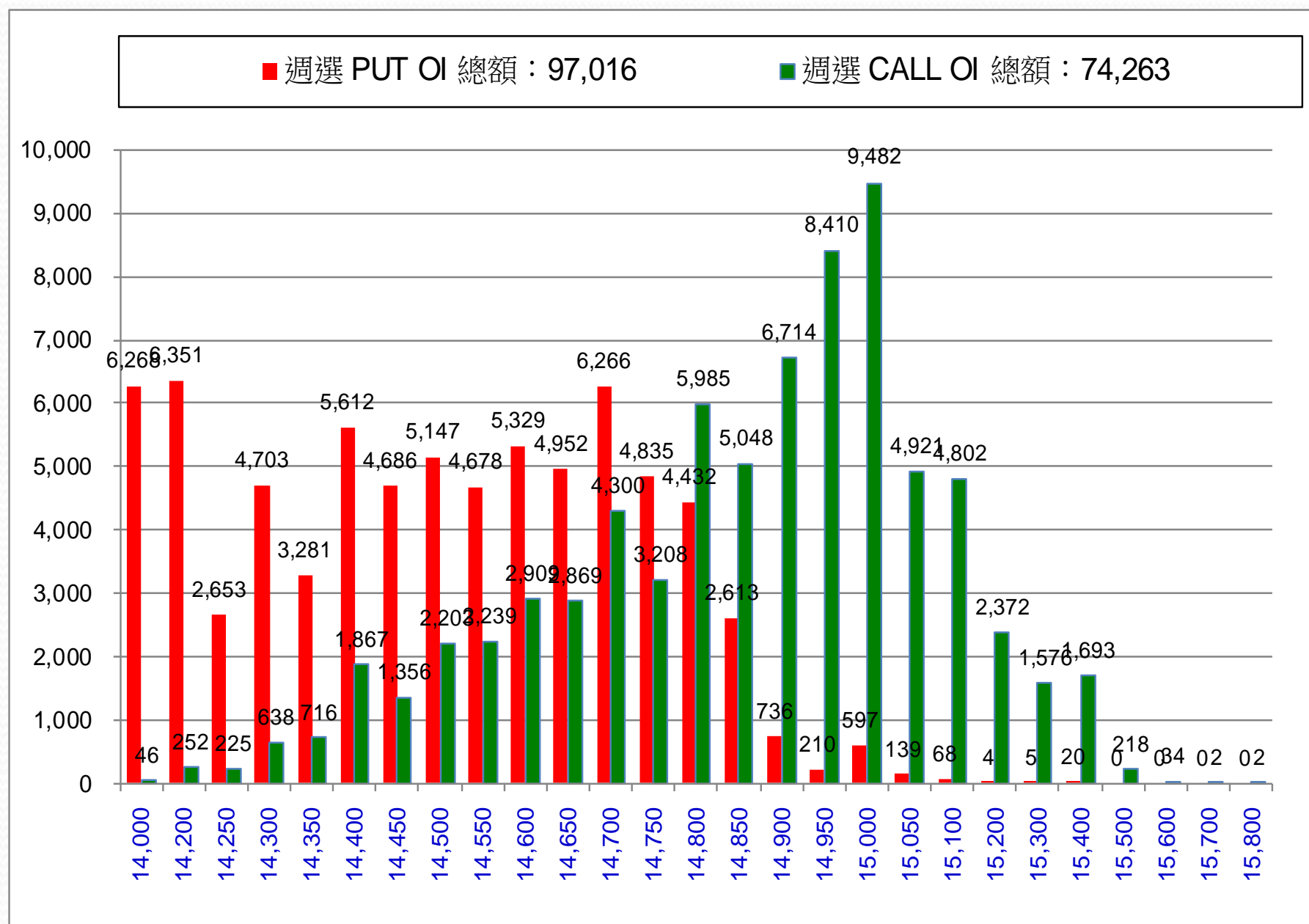
更新日期：2022年9月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年9月12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



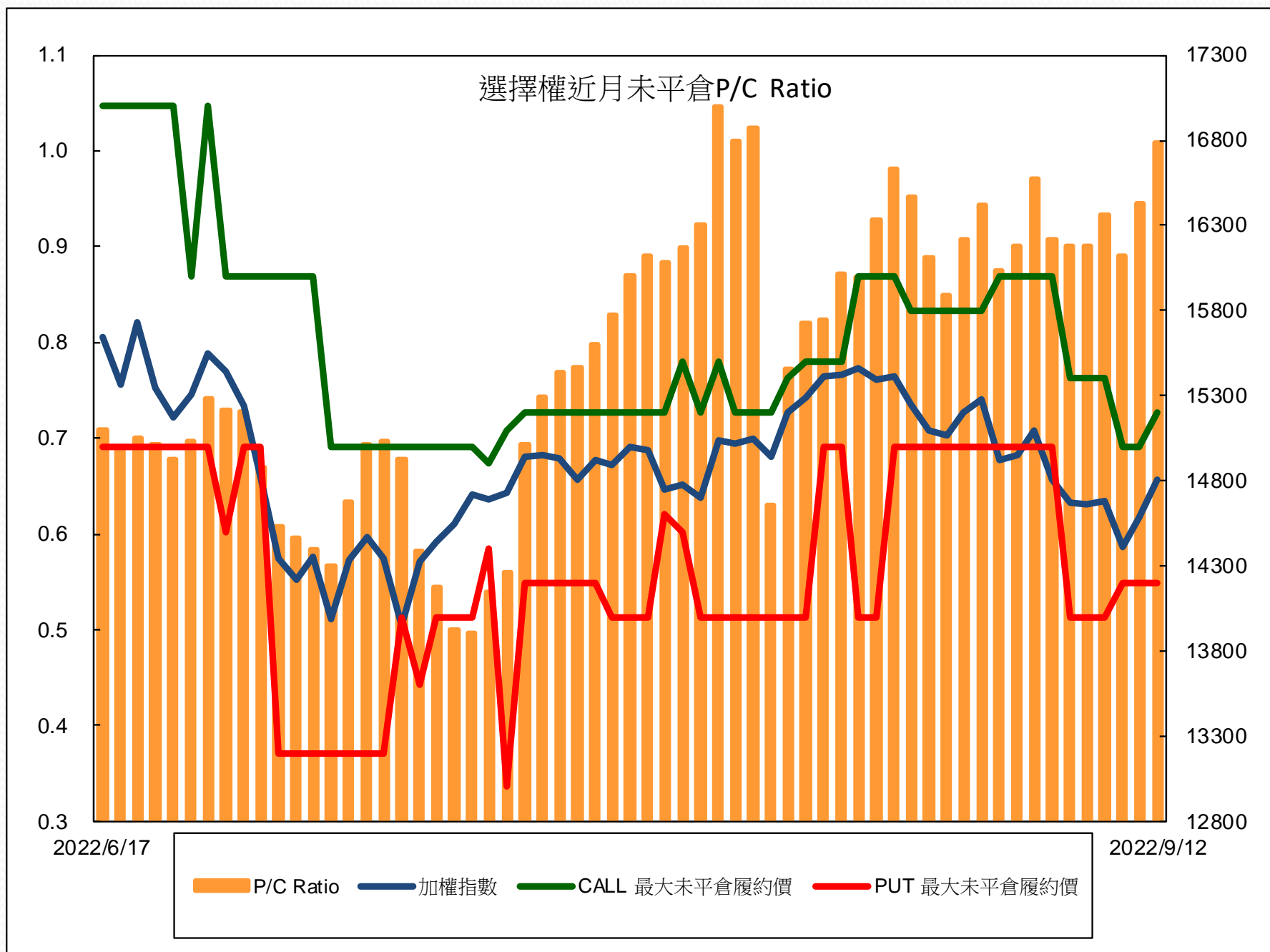
更新日期：2022年9月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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8日	77,105	68,754	8,351
	9月12日	80,342	69,902	10,440
Put	9月8日	48,099	46,121	1,978
	9月12日	56,144	63,008	-6,864

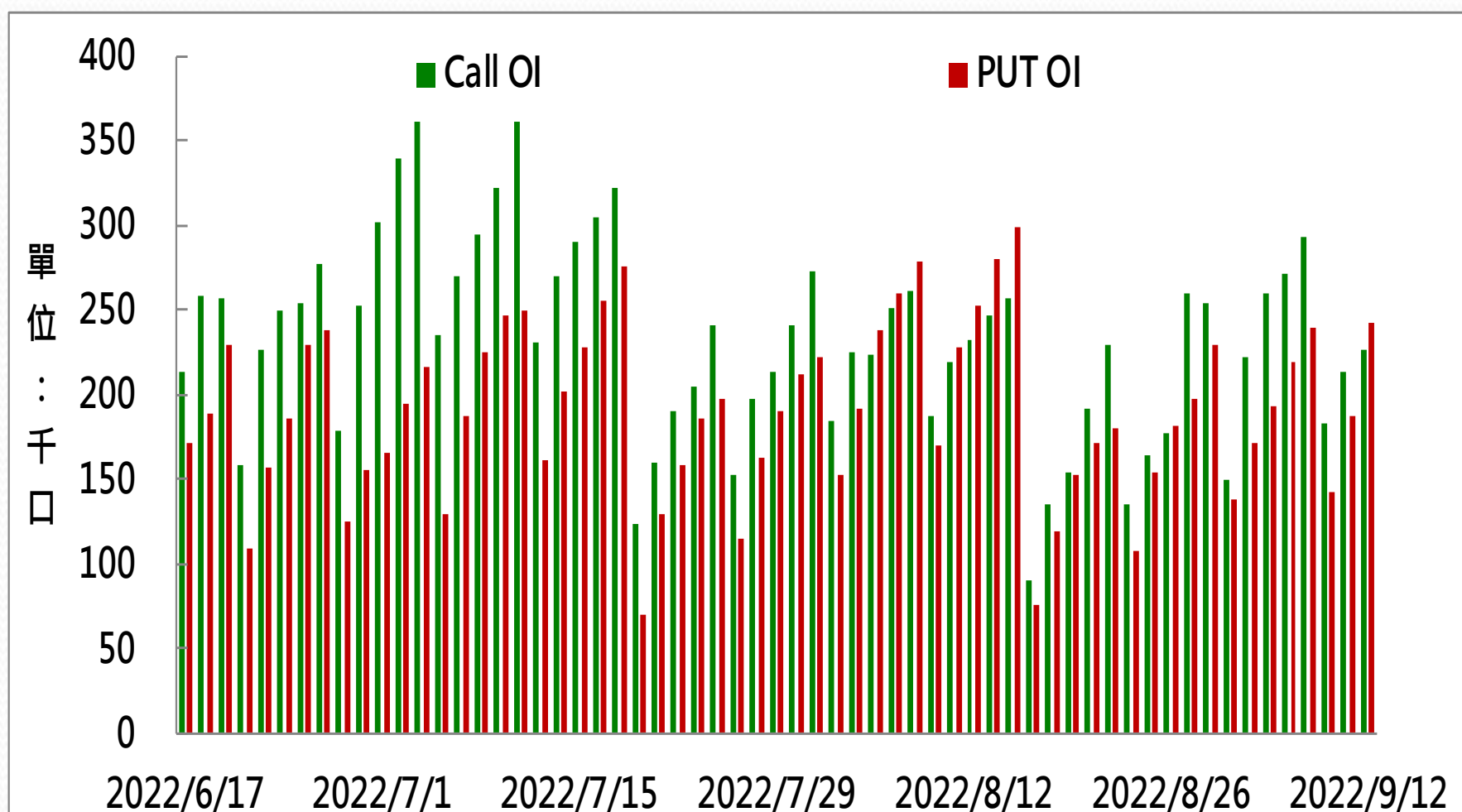
更新日期：2022年9月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年9月12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12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