

台指選擇權OI匯報

日期：2022/9/13 結算日：2022/9/14					日期：2022/9/13 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
-112	526	14,300	5,650	947	0	15	13,700	4,176	-739
-15	701	14,350	2,930	-351	-2	166	13,800	3,697	-394
-188	1,679	14,400	4,849	-763	0	40	13,900	3,549	-103
-102	1,254	14,450	5,111	425	-7	78	14,000	8,432	239
-143	2,060	14,500	5,596	449	-14	147	14,100	5,579	168
-172	2,067	14,550	5,801	1,123	-3	205	14,200	9,424	138
-507	2,402	14,600	7,329	2,000	-7	456	14,300	4,821	332
-419	2,450	14,650	6,284	1,332	-20	970	14,400	6,618	1,123
-637	3,663	14,700	9,988	3,722	-104	1,465	14,500	5,880	595
-567	2,641	14,750	7,025	2,190	-221	2,510	14,600	5,199	927
-1,323	4,662	14,800	8,301	3,869	-64	2,968	14,700	5,312	1,397
-418	4,630	14,850	4,722	2,109	-514	3,822	14,800	4,984	640
1,813	8,527	14,900	5,042	4,306	215	4,003	14,900	3,804	707
-451	7,959	14,950	2,822	2,612	500	8,319	15,000	7,120	571
3,837	13,319	15,000	1,786	1,189	1,567	7,381	15,100	1,925	90
5,346	10,267	15,050	488	349	662	8,706	15,200	1,346	34
4,234	9,036	15,100	161	93	654	7,196	15,300	661	3
1,160	1,160	15,150	38	38	527	7,869	15,400	907	21
2,114	4,486	15,200	69	65	-273	5,034	15,500	296	0
348	348	15,250	1	1	114	5,544	15,600	260	0
644	2,220	15,300	31	26	-154	5,415	15,700	52	11
68	1,761	15,400	19	-1	-18	6,111	15,800	276	0
-8	210	15,500	10	10	-34	4,830	15,900	49	0
0	34	15,600	1	1	-120	6,896	16,000	408	0
0	2	15,700	1	1	-20	2,063	16,100	13	0
0	2	15,800	0	0	-52	2,863	16,200	94	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
14,474	88,737	1.3512	119,898	22,882	2,534	122,705	1.0331	126,767	5,454
昨日 P/C	1.3064	今日增減變化	0.0448		昨日 P/C	1.0095	今日增減變化	0.0236	

更新日期：2022年9月13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13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	94,165,673	61,505,683	32,659,990	8,129,131	3,849,507	907,434	2,942,073	161,309	
投信	24,612,079	48,090,824	-23,478,745	285,237	541,711	0	541,711	6,317	
自營商	29,784,153	36,771,914	-6,987,761	-2,660,336	846,751	1,259,195	-412,444	-8,137	
	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	1,643,133	1,725,994	-82,861	61,082	85,798	81,435	4,363	8,705	
投信	106,311	0	106,311	-82	0	0	0	0	
自營商	509,671	725,419	-215,748	-78,065	158,505	178,864	-20,359	1,355	

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13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	28,872	8,284	20,588	3,026	43,192	16,787	26,405	4,030	
投信	0	100	-100	0	550	97	453	0	
自營商	84,609	70,563	14,046	3,606	61,856	73,605	-11,749	-4,885	
特定法人(週)	3,070	0	3,070	1,630	0	0	0	2,000	
特定法人(近月)	13,064	0	13,064	881	4,142	21,776	-17,634	-11	
特定法人(全月)	17,880	0	17,880	3,161	4,552	30,108	-25,556	-3,471	
十大交易人(週)	35,482	28,439	7,043	2,378	44,329	25,132	19,197	-504	
十大交易人(近月)	62,138	53,611	8,527	2,753	47,503	62,088	-14,585	1,688	
十大交易人(全月)	112,385	83,171	29,214	4,915	94,705	94,778	-73	3,082	
全市場未沖銷(近月)			122,705	2,534			126,767	5,454	
全市場未沖銷(全月)			245,213	18,570			277,769	35,934	

更新日期：2022年9月13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	14900	買權OI最大量	15000
	賣權成交最大量	14800	賣權OI最大量	14700
	整體隱含波動率	14.21%	較前一交易日	+0.12%
	買權隱含波動率	14.21%	較前一交易日	-1.05%
	賣權隱含波動率	14.21%	較前一交易日	+1.06%
電子選擇權	買權成交最大量	700	買權OI最大量	760
	賣權成交最大量	680	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	1580	賣權OI最大量	1520

更新日期：2022年9月13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	14500	賣權OI最大量	14200
	整體隱含波動率	18.66%	較前一交易日	+0.56%
	買權隱含波動率	15.21%	較前一交易日	-0.86%
	賣權隱含波動率	21.32%	較前一交易日	-0.90%
	成交量P/C_Ratio值	1.233	較前一交易日	+0.17
	未平倉P/C_Ratio值	1.033	較前一交易日	+0.02
電子選擇權	買權成交最大量	700	買權OI最大量	760
	賣權成交最大量	680	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	1580	賣權OI最大量	1520

更新日期：2022年9月13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

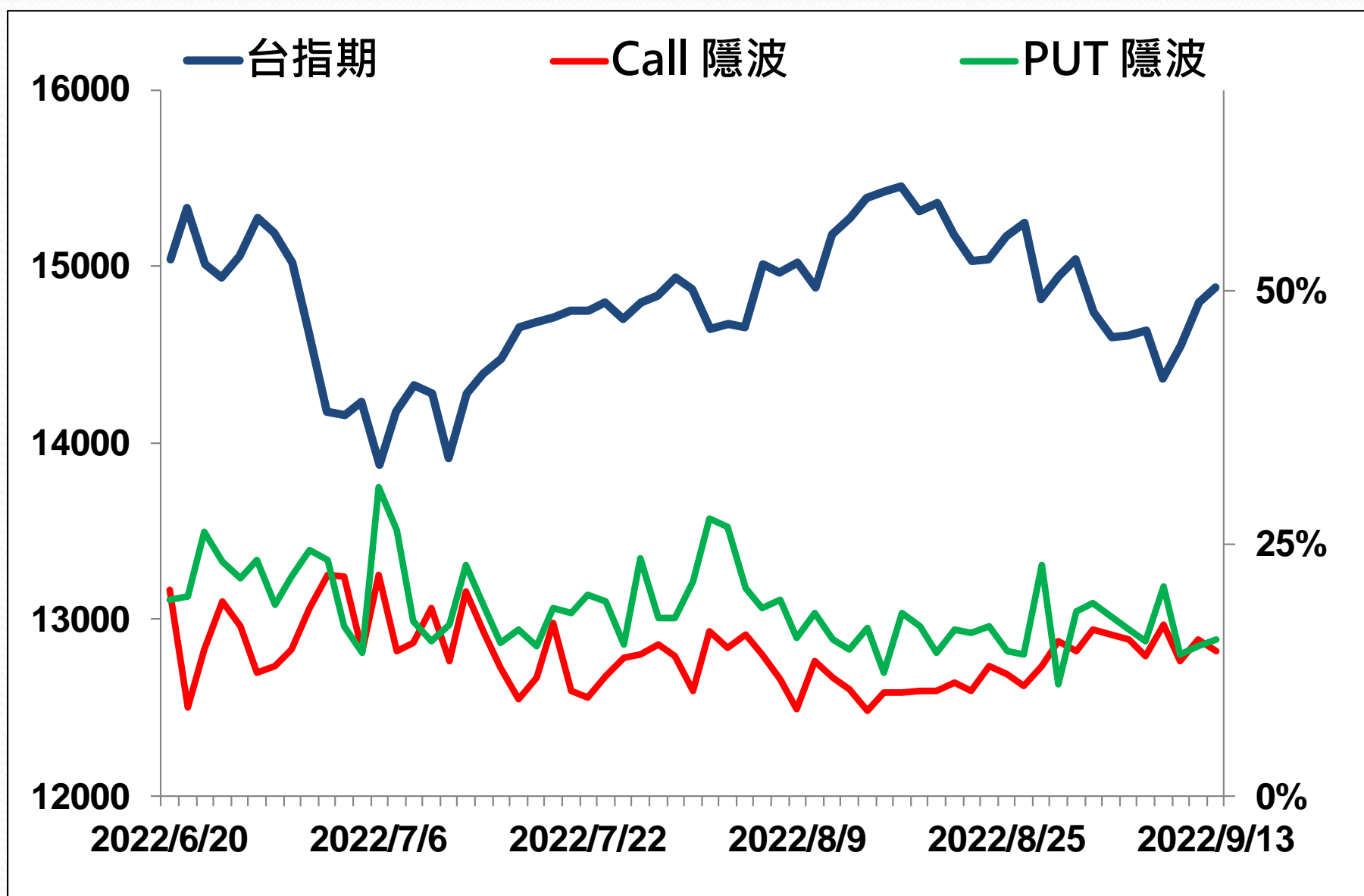
臺指選擇權波動率指數

— 臺指選擇權波動率指數



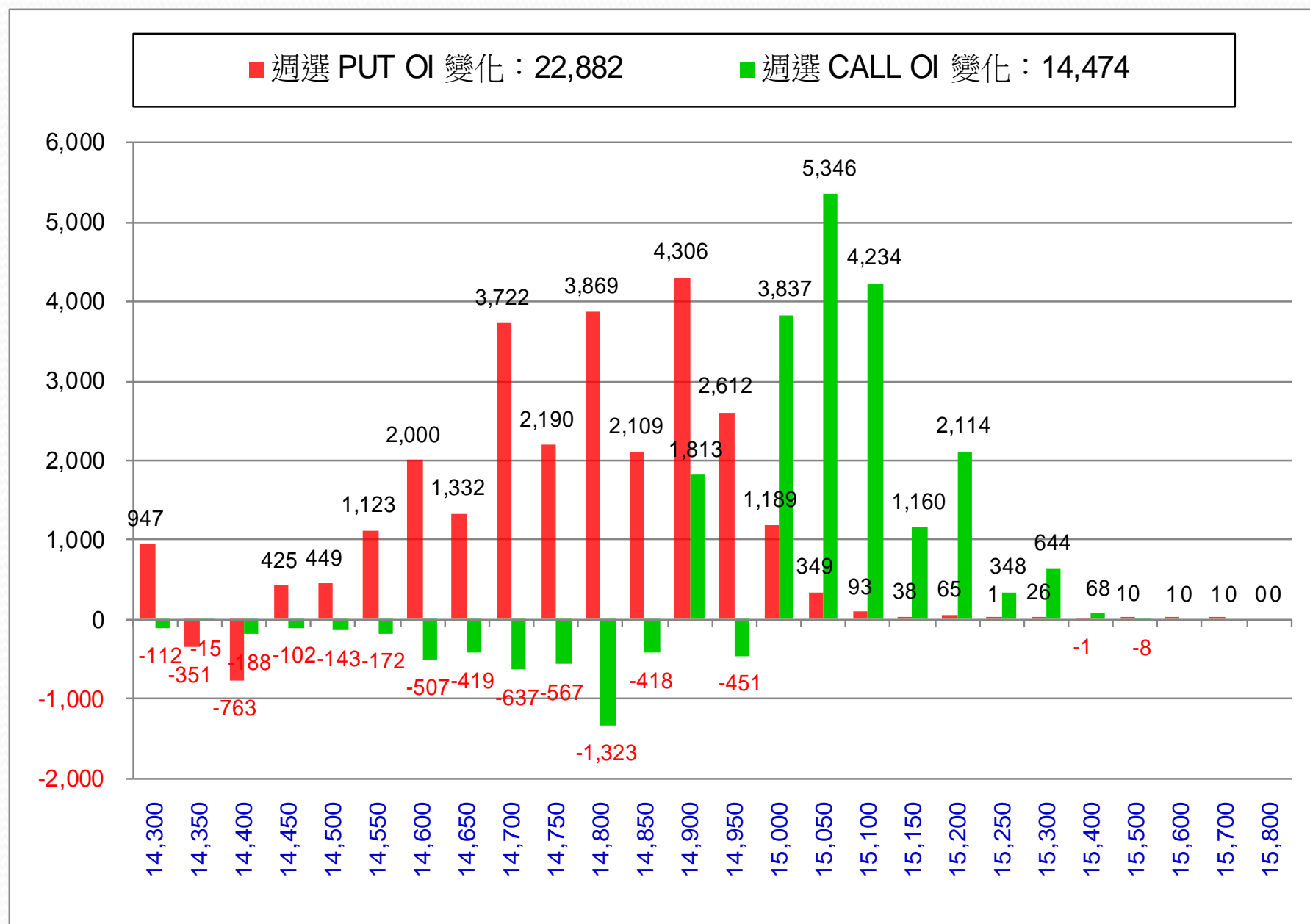
更新日期：2022年9月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



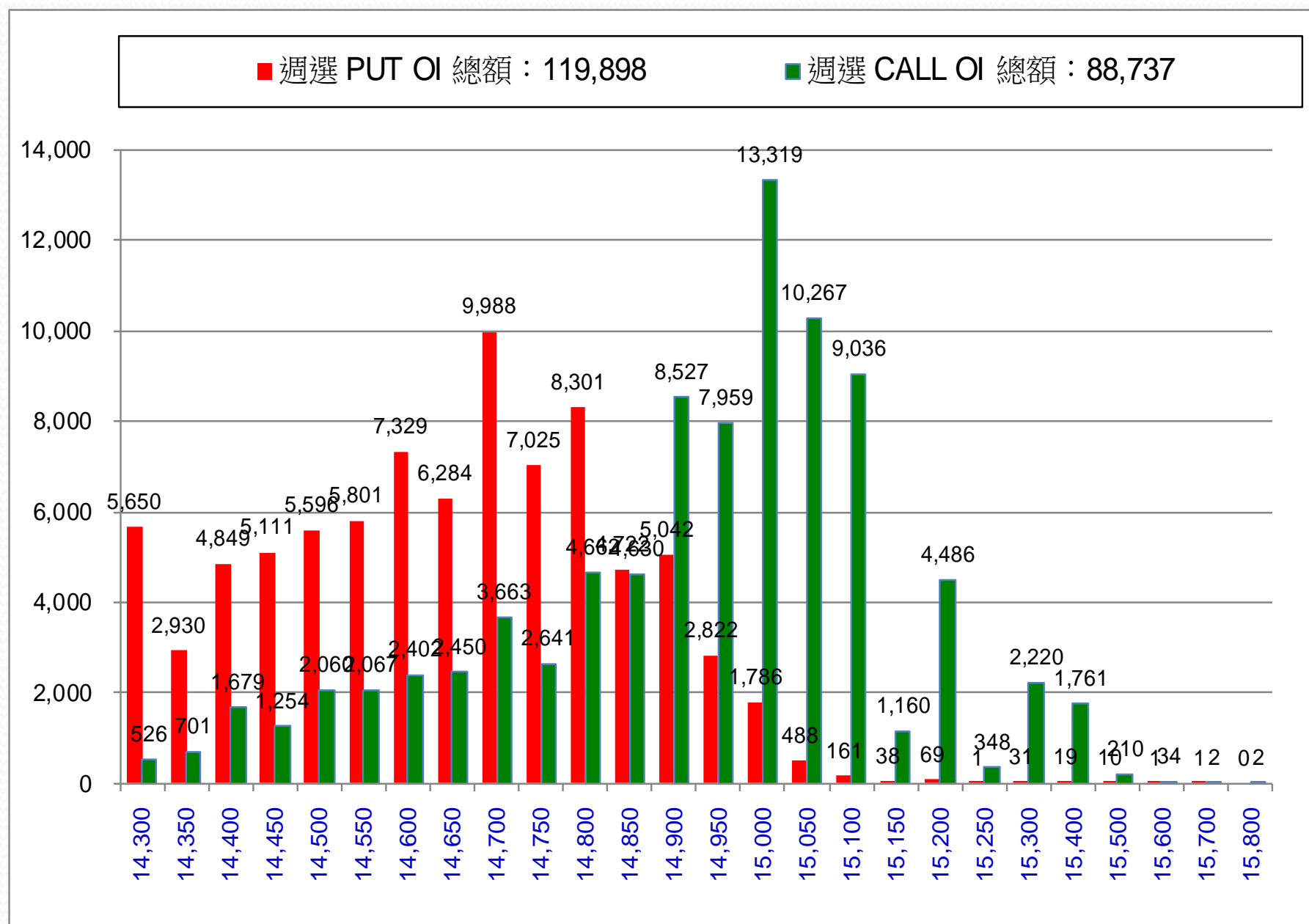
更新日期：2022年9月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年9月13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



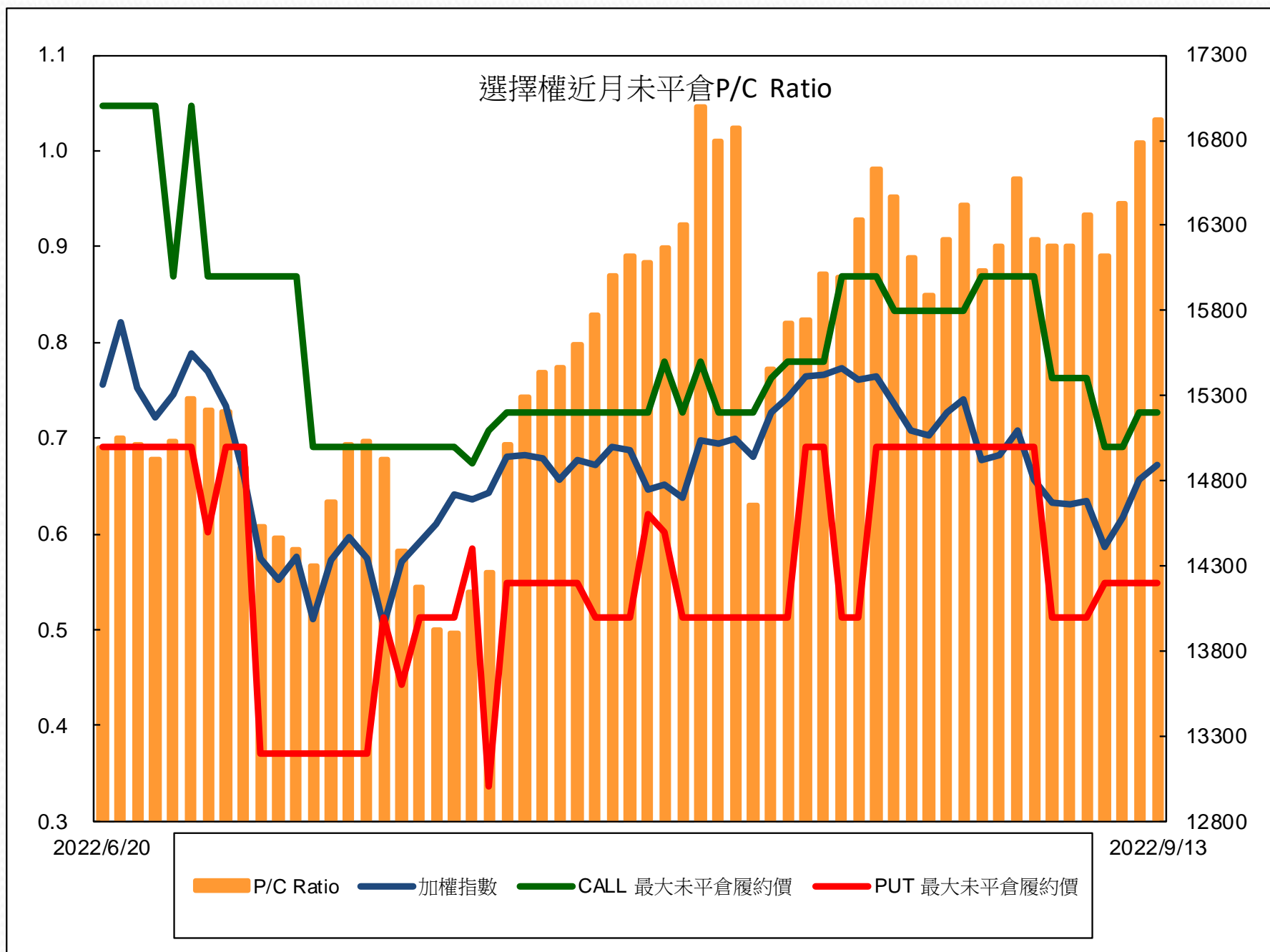
更新日期：2022年9月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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12日	80,342	69,902	10,440
	9月13日	84,609	70,563	14,046
Put	9月12日	56,144	63,008	-6,864
	9月13日	61,856	73,605	-11,749

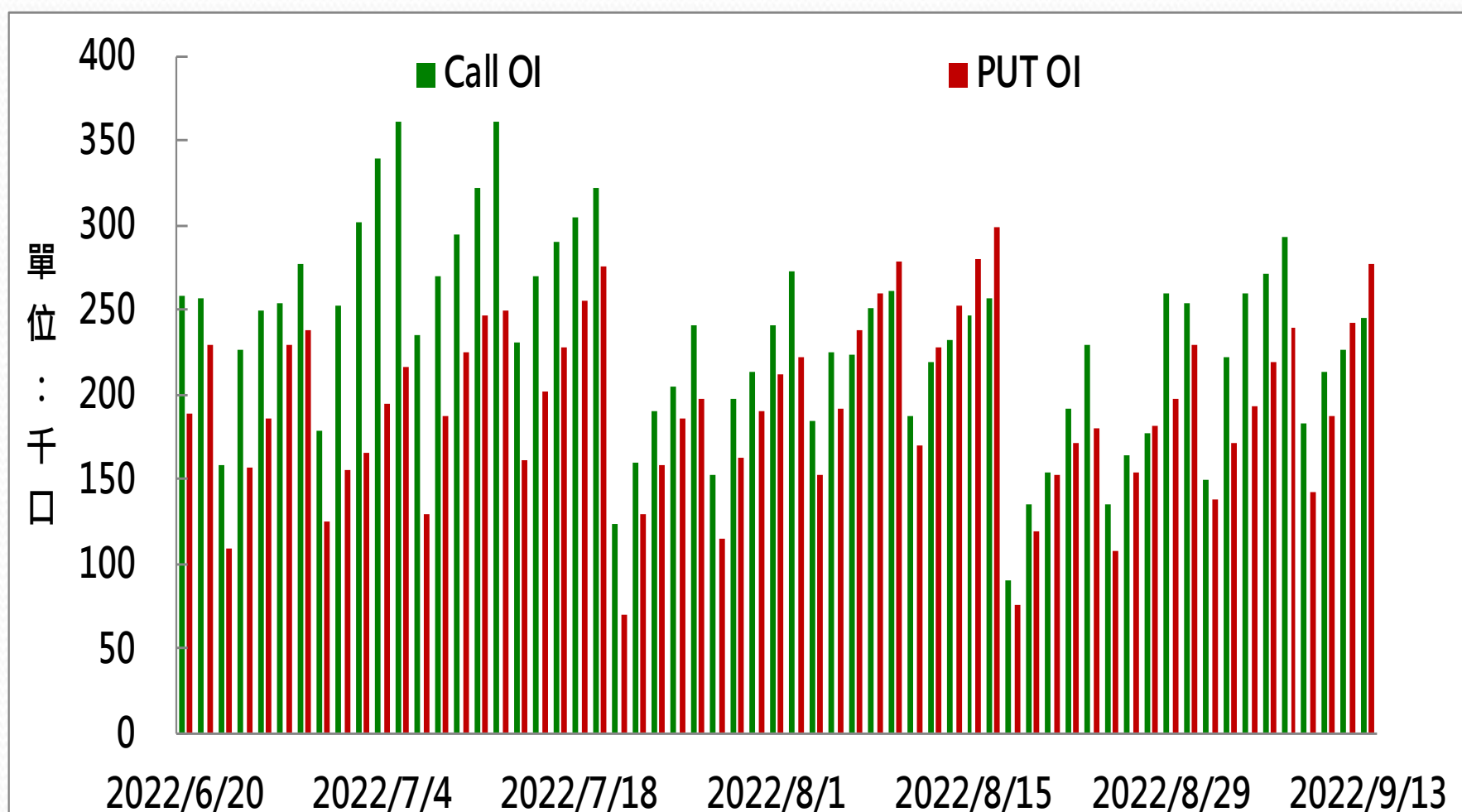
更新日期：2022年9月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年9月13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13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13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