

台指選擇權OI匯報

日期：2022/9/14 結算日：2022/9/21					日期：2022/9/14 結算日：2022/10/19				
202209 月台指選擇權 OI 序列					202210 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
0	15	13,700	4,540	364	-1	8	13,500	735	-191
2	168	13,800	4,658	961	2	4	13,600	657	211
11	51	13,900	4,192	643	0	3	13,700	853	50
30	108	14,000	11,773	3,341	3	7	13,800	586	109
11	158	14,100	5,496	-83	3	5	13,900	576	44
-2	203	14,200	10,382	958	5	35	14,000	1,571	181
78	534	14,300	5,262	441	6	11	14,100	412	8
296	1,266	14,400	7,400	782	0	36	14,200	441	-23
106	106	14,450	766	766	6	41	14,300	431	24
808	2,273	14,500	5,298	-582	27	83	14,400	396	35
359	359	14,550	833	833	28	81	14,500	1,859	-98
830	3,340	14,600	5,824	625	420	556	14,600	930	245
971	971	14,650	433	433	308	523	14,700	330	120
1,208	4,176	14,700	4,281	-1,031	166	405	14,800	642	20
1,075	1,075	14,750	217	217	125	353	14,900	86	9
3,094	6,916	14,800	4,630	-354	156	907	15,000	800	24
1,880	1,880	14,850	11	11	178	637	15,100	34	1
3,396	7,399	14,900	3,552	-252	422	1,463	15,200	416	-17
3,673	3,673	14,950	5	5	290	1,400	15,300	88	-3
※ 4,147	12,466	15,000	6,675	-445	737	1,570	15,400	47	-5
2,058	2,058	15,050	21	21	509	1,328	15,500	153	24
1,638	9,019	15,100	1,887	-38	154	1,236	15,600	26	0
1,440	1,440	15,150	0	0	60	773	15,700	2	0
1,454	10,160	15,200	1,321	-25	200	963	15,800	6	0
218	218	15,250	0	0	6	549	15,900	1	0
-179	7,017	15,300	669	8	76	1,062	16,000	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
30,131	143,416	0.9653	138,445	11,678	4,818	21,741	0.8370	18,198	2,468
昨日 P/C	1.0331	今日增減變化	-0.0678		昨日 P/C	0.9295	今日增減變化	-0.0925	

更新日期：2022年9月14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14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	88,605,343	62,405,708	26,199,635	-6,460,355	3,448,178	894,371	2,553,807	-388,266	
投信	24,517,136	49,154,052	-24,636,916	-1,158,171	531,788	0	531,788	-9,923	
自營商	27,810,451	29,730,815	-1,920,364	5,067,397	867,071	1,219,008	-351,937	60,507	
	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	1,603,909	1,668,513	-64,604	18,257	116,300	80,405	35,895	31,532	
投信	104,570	0	104,570	-1,741	0	0	0	0	
自營商	435,187	693,542	-258,355	-42,607	145,021	162,250	-17,229	3,130	

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14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	25,144	6,535	18,609	-1,979	40,710	15,286	25,424	-981	
投信	0	0	0	100	500	97	403	-50	
自營商	63,340	68,293	-4,953	-18,999	43,283	45,820	-2,537	9,212	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	14,117	0	14,117	1,053	5,891	20,440	-14,549	3,085	
特定法人(全月)	18,733	0	18,733	853	9,671	32,600	-22,929	2,627	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	70,178	60,772	9,406	879	52,347	59,304	-6,957	7,628	
十大交易人(全月)	92,177	78,619	13,558	-15,656	66,455	77,089	-10,634	-10,561	
全市場未沖銷(近月)			152,901	30,196			138,445	11,678	
全市場未沖銷(全月)			191,754	-53,459			172,306	-105,463	

更新日期：2022年9月14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	14000
	整體隱含波動率	15.97%	較前一交易日	+1.76%
	買權隱含波動率	13.86%	較前一交易日	-0.35%
	賣權隱含波動率	17.91%	較前一交易日	+3.71%
電子選擇權	買權成交最大量	375	買權OI最大量	375
	賣權成交最大量	600	賣權OI最大量	600
金融選擇權	買權成交最大量	1600	買權OI最大量	1580
	賣權成交最大量	1560	賣權OI最大量	1420

更新日期：2022年9月14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10月選擇權分析表				
台指選擇權	買權成交最大量	15200	買權OI最大量	17800
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	14500
	整體隱含波動率	20.47%	較前一交易日	-1.81%
	買權隱含波動率	15.83%	較前一交易日	+0.62%
	賣權隱含波動率	26.84%	較前一交易日	+5.52%
	成交量P/C_Ratio值	0.722	較前一交易日	-0.51
	未平倉P/C_Ratio值	0.837	較前一交易日	-0.20
電子選擇權	買權成交最大量	445	買權OI最大量	445
	賣權成交最大量	600	賣權OI最大量	600
金融選擇權	買權成交最大量	1600	買權OI最大量	1580
	賣權成交最大量	1560	賣權OI最大量	1420

更新日期：2022年9月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

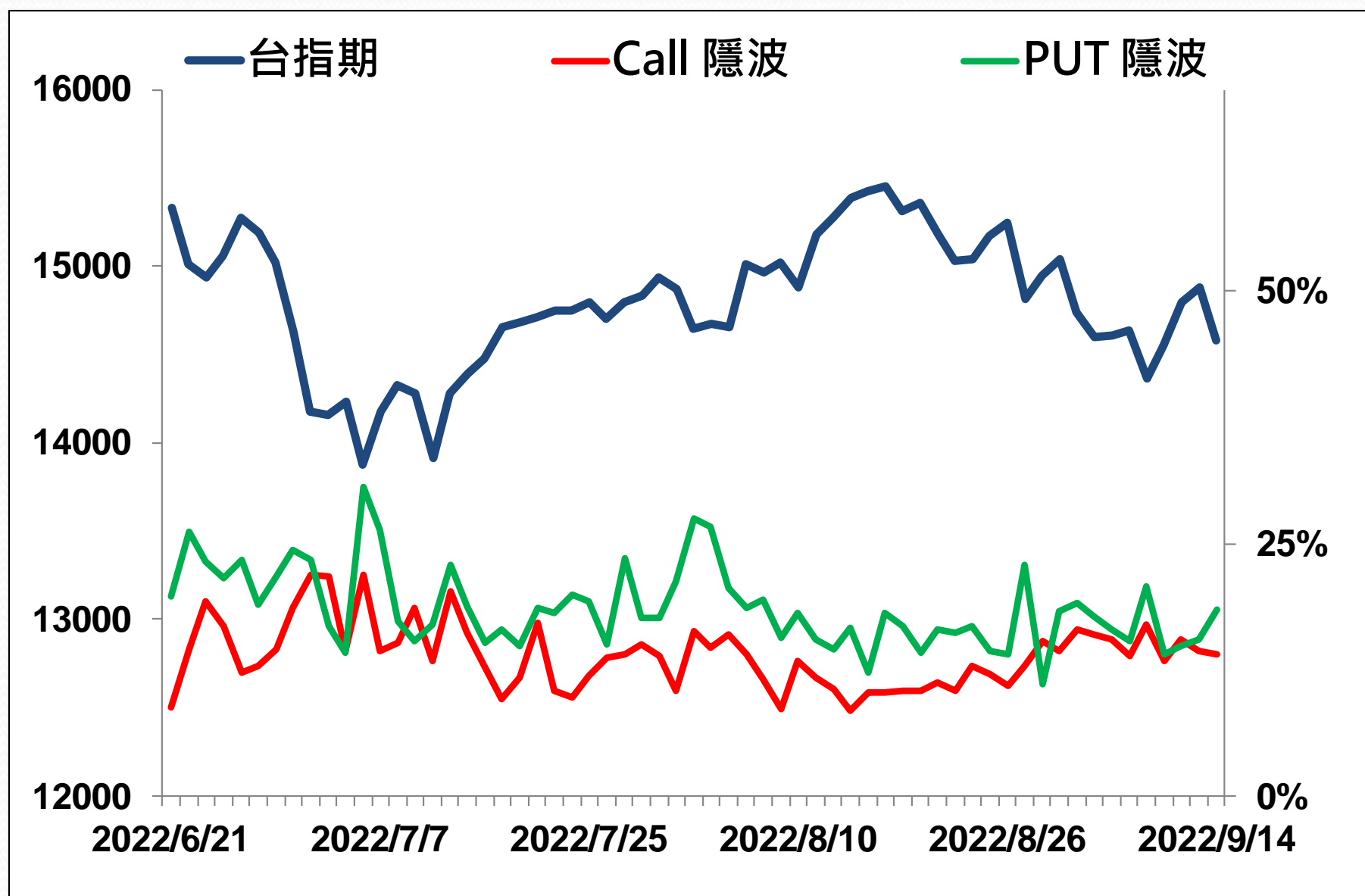
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



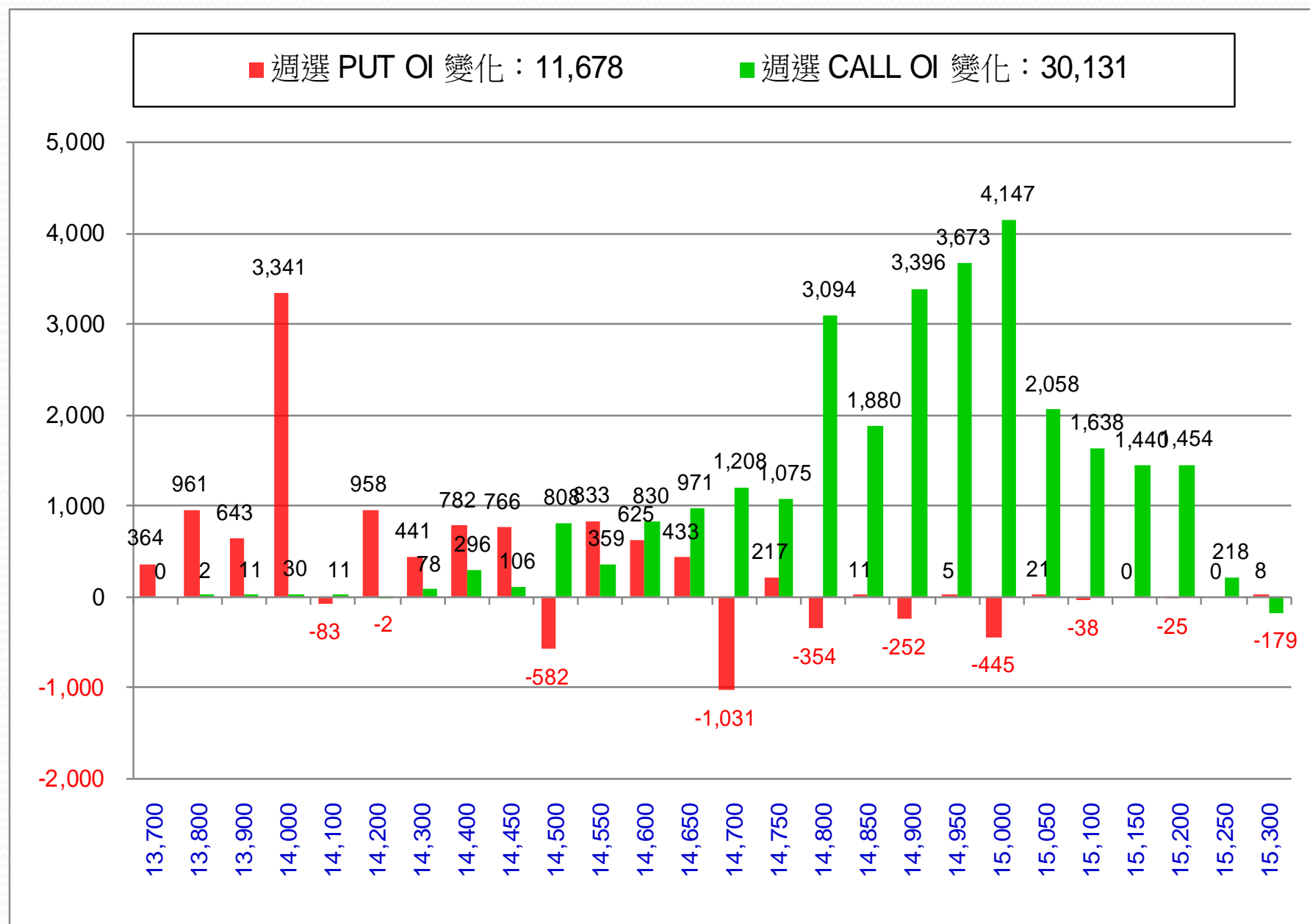
更新日期：2022年9月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



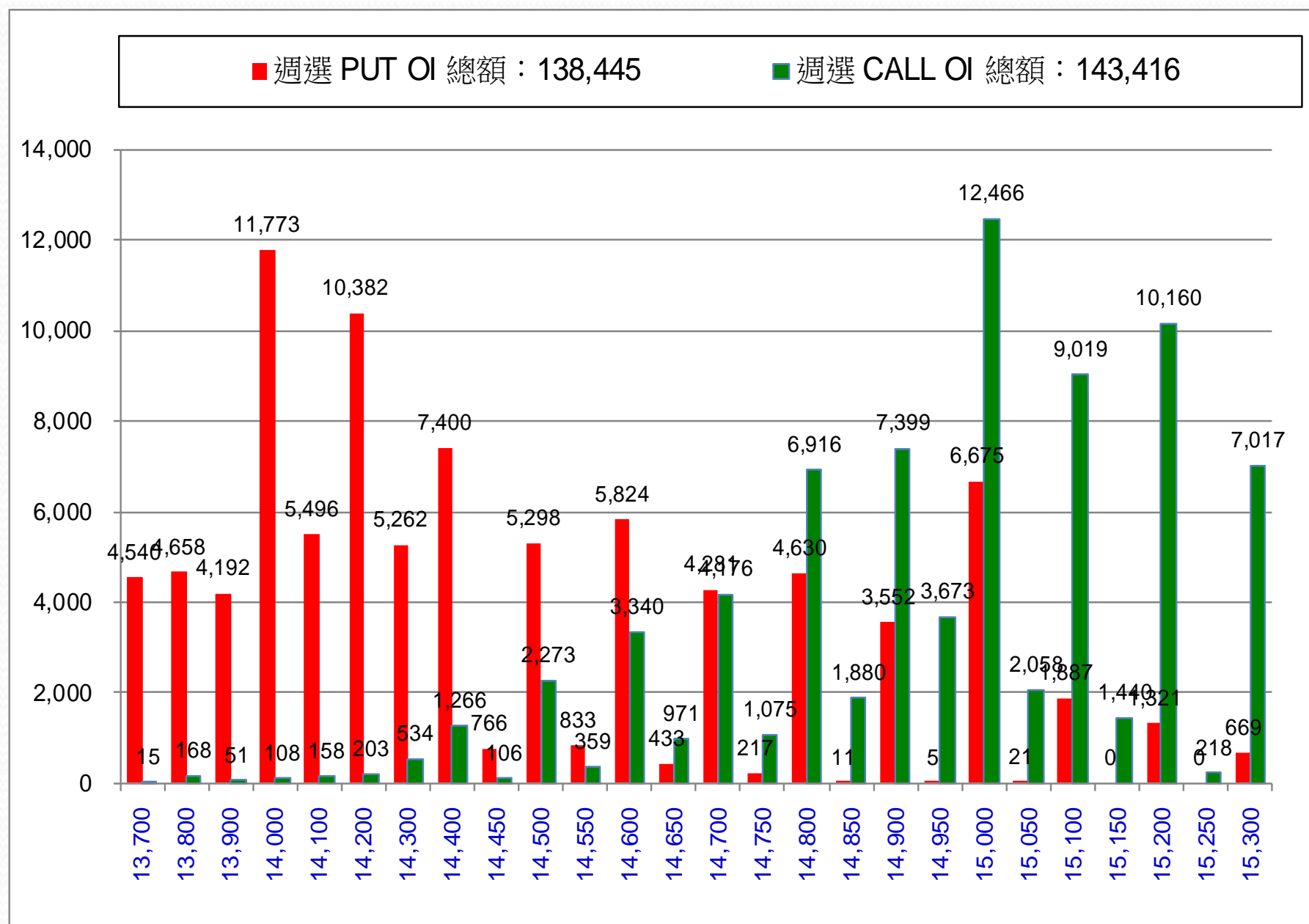
更新日期：2022年9月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年9月14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



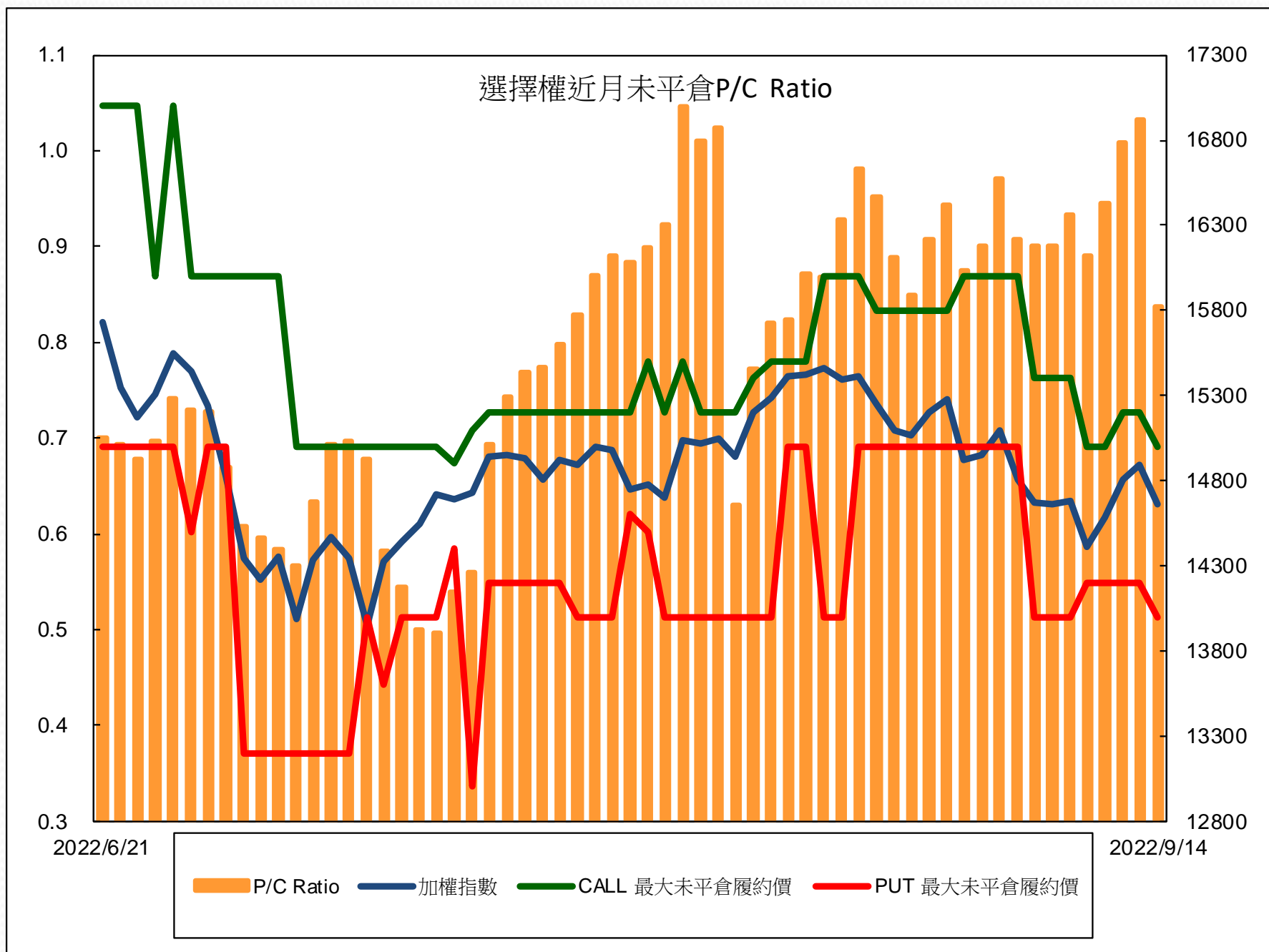
更新日期：2022年9月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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13日	84,609	70,563	14,046
	9月14日	63,340	68,293	-4,953
Put	9月13日	61,856	73,605	-11,749
	9月14日	43,283	45,820	-2,537

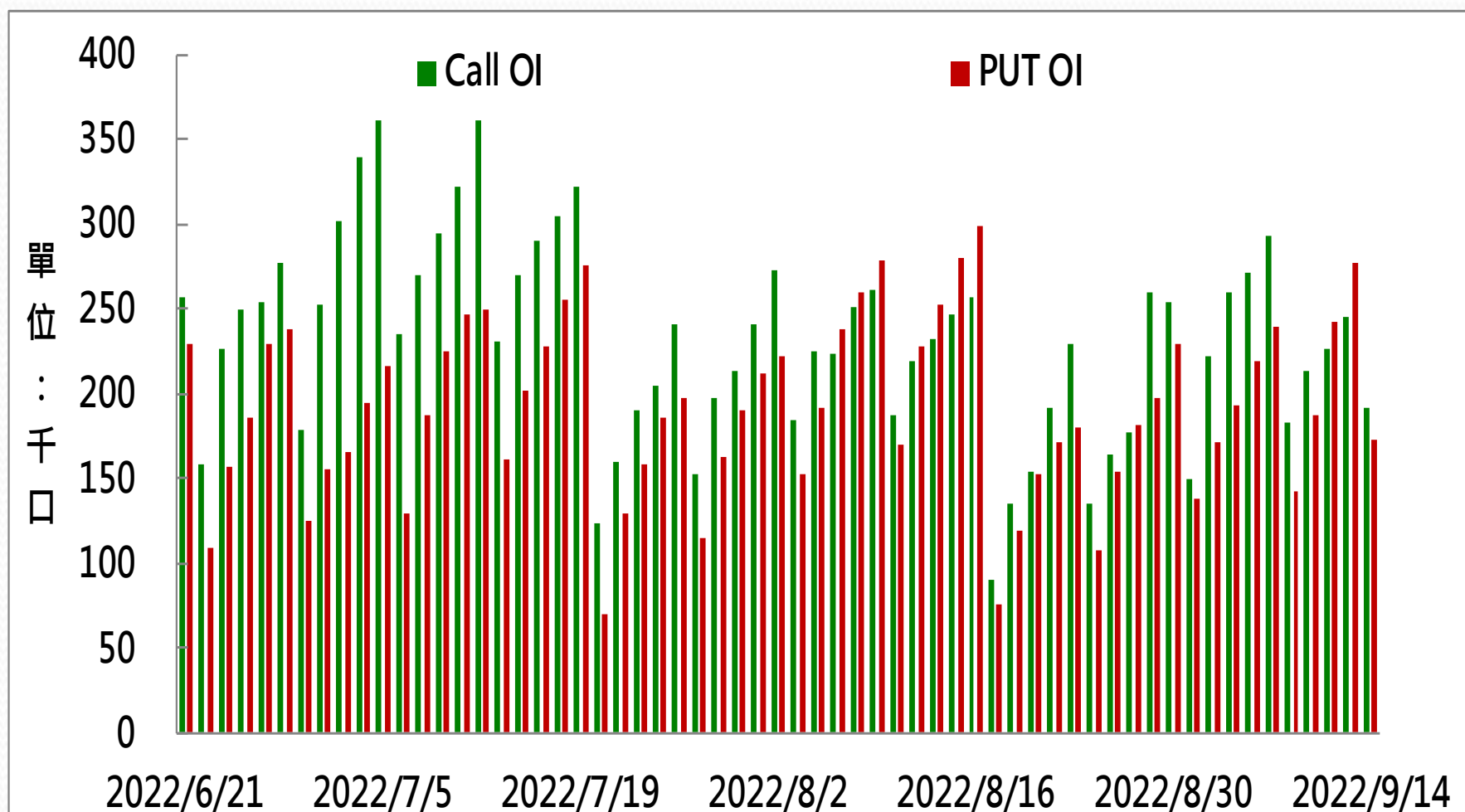
更新日期：2022年9月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年9月14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14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