

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/7/28 結算日：2022/8/3					日期：2022/7/28 結算日：2022/8/17				
202208W1					202208 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	2	14,000	3,326	1,725	1	40	13,500	3,434	304
-1	1	14,100	3,023	1,459	0	50	13,600	2,844	289
0	1	14,200	4,149	2,290	0	92	13,700	3,339	-46
0	57	14,300	6,233	4,397	-1	93	13,800	3,845	161
2	16	14,400	4,794	3,253	-1	28	13,900	2,900	210
15	26	14,450	3,327	2,792	1	138	14,000	5,872	601
6	72	14,500	5,158	4,072	2	170	14,100	2,259	148
36	43	14,550	3,388	2,956	-3	520	14,200	5,252	-46
73	351	14,600	4,275	3,365	11	858	14,300	2,672	-328
27	94	14,650	2,388	1,878	14	1,736	14,400	3,458	301
36	195	14,700	3,231	2,258	4	1,313	14,500	4,282	215
-6	427	14,750	1,425	1,003	28	2,115	14,600	3,513	379
445	1,274	14,800	2,203	1,586	6	3,156	14,700	3,103	493
616	1,818	14,850	1,273	963	22	4,384	14,800	2,522	338
495	2,788	14,900	1,630	1,382	-63	5,096	14,900	1,083	209
932	1,934	14,950	834	782	63	6,242	15,000	1,217	242
2,893	4,869	15,000	766	683	198	7,666	15,100	376	84
2,140	3,232	15,050	255	250	※ 1,176	8,984	15,200	202	59
2,417	4,907	15,100	200	167	88	5,458	15,300	90	22
2,372	3,975	15,150	35	22	537	5,457	15,400	81	13
4,165	6,667	15,200	66	58	393	7,943	15,500	47	1
4,187	5,569	15,250	30	29	179	7,022	15,600	72	-3
5,878	7,619	15,300	17	16	208	3,513	15,700	47	-1
3,280	3,280	15,350	12	12	239	2,043	15,800	111	36
2,813	4,284	15,400	12	8	683	2,470	15,900	28	-1
5,282	6,960	15,500	1	1	24	5,118	16,000	29	0
828	1,703	15,600	2	2	64	4,839	16,100	21	0
1,430	1,765	15,700	1	1	43	1,298	16,200	11	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
40,832	64,983	0.9289	60,361	40,208	4,631	107,337	0.8285	88,930	6,893
昨日 P/C	0.8345	今日增減變化		0.0944	昨日 P/C	0.7988	今日增減變化		0.0298

更新日期：2022年7月28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7月28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	85,230,552	55,207,380	30,023,172	4,104,752	4,279,887	1,555,569	2,724,318	305,026	
投信	38,088,177	48,910,334	-10,822,157	676,367	815,085	0	815,085	17,850	
自營商	26,732,931	27,218,086	-485,155	1,294,036	731,992	621,581	110,411	-121,250	
	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	530,810	949,392	-418,582	-140,102	1,445	52,016	-50,571	-4,398	
投信	97,062	0	97,062	1,241	0	0	0	0	
自營商	347,288	611,170	-263,882	77,487	244,117	197,828	46,289	4,424	

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報								2022年7月28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	31,734	14,345	17,389	3,310	25,470	12,491	12,979	25	
投信	0	150	-150	0	550	103	447	0	
自營商	69,027	74,570	-5,543	2,303	54,042	31,196	22,846	5,723	
特定法人(週)	2,511	0	2,511	1,000	0	1,031	-1,031	-803	
特定法人(近月)	26,153	7,695	18,458	1,231	6,322	15,828	-9,506	-546	
特定法人(全月)	27,160	8,247	18,913	-1,144	4,052	18,795	-14,743	-1,771	
十大交易人(週)	23,887	28,444	-4,557	-4,195	19,049	23,471	-4,422	-3,044	
十大交易人(近月)	73,141	58,880	14,261	1,166	32,749	50,354	-17,605	-102	
十大交易人(全月)	108,343	88,381	19,962	675	47,587	77,575	-29,988	-5,293	
全市場未沖銷(近月)			107,337	4,631			88,930	6,893	
全市場未沖銷(全月)			197,935	45,919			161,947	47,619	

更新日期：2022年7月28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08W1週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15000	買權OI最大量	15300
	賣權成交最大量	14600	賣權OI最大量	14300
	整體隱含波動率	15.35%	較前一交易日	-0.65%
	買權隱含波動率	14.96%	較前一交易日	+14.96%
	賣權隱含波動率	15.79%	較前一交易日	-0.22%
電子選擇權	買權成交最大量	720	買權OI最大量	720
	賣權成交最大量	660	賣權OI最大量	660
金融選擇權	買權成交最大量	1560	買權OI最大量	1460
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1500

更新日期：2022年7月28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

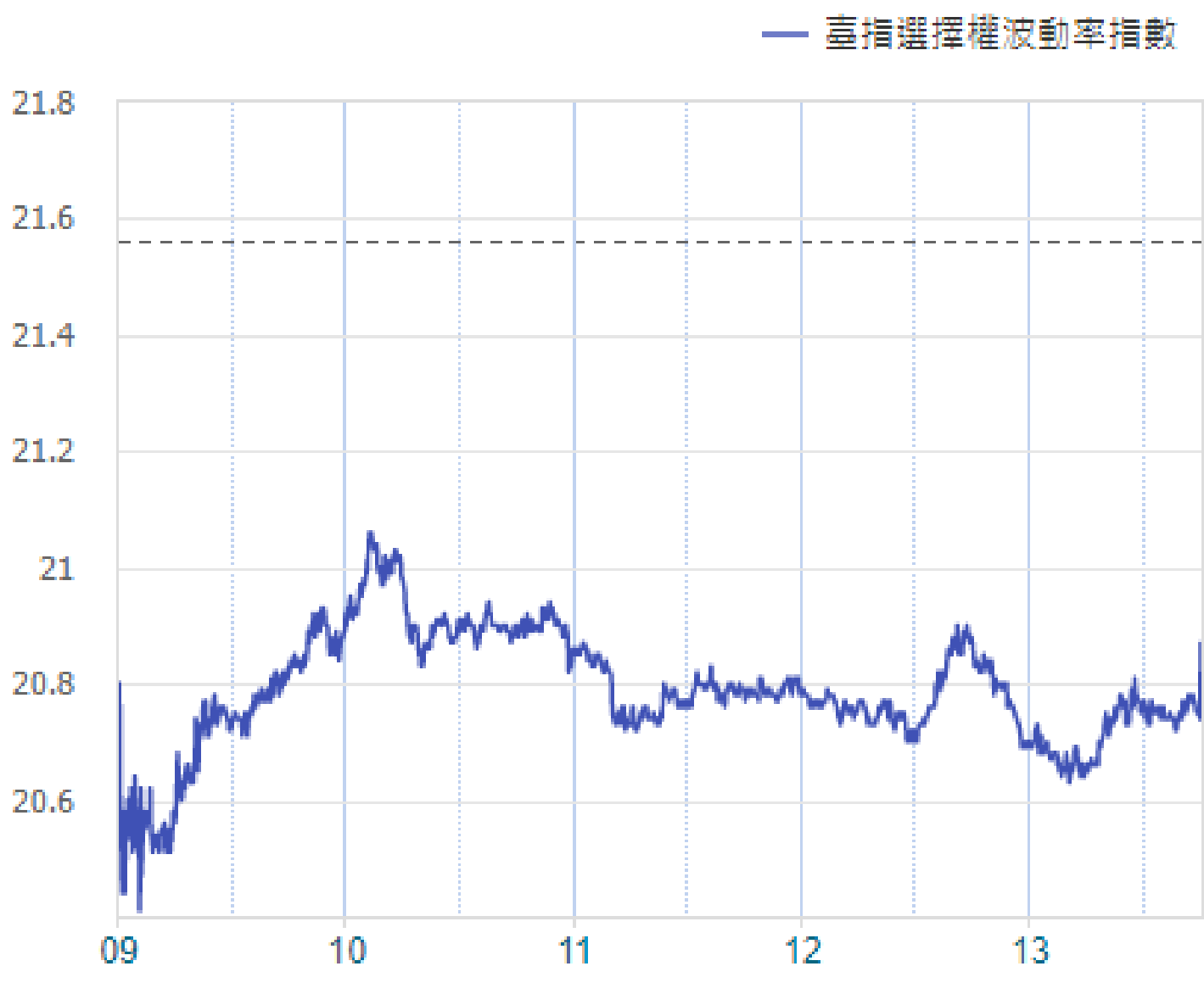
## 2022年08月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15200	買權OI最大量	15200
	賣權成交最大量	14500	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	20.49%	較前一交易日	-0.42%
	買權隱含波動率	15.43%	較前一交易日	+1.38%
	賣權隱含波動率	24.98%	較前一交易日	-1.17%
	成交量P/C_Ratio值	1.022	較前一交易日	+0.08
	未平倉P/C_Ratio值	0.829	較前一交易日	+0.03
電子選擇權	買權成交最大量	720	買權OI最大量	720
	賣權成交最大量	660	賣權OI最大量	660
金融選擇權	買權成交最大量	1560	買權OI最大量	1460
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1500

更新日期：2022年7月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

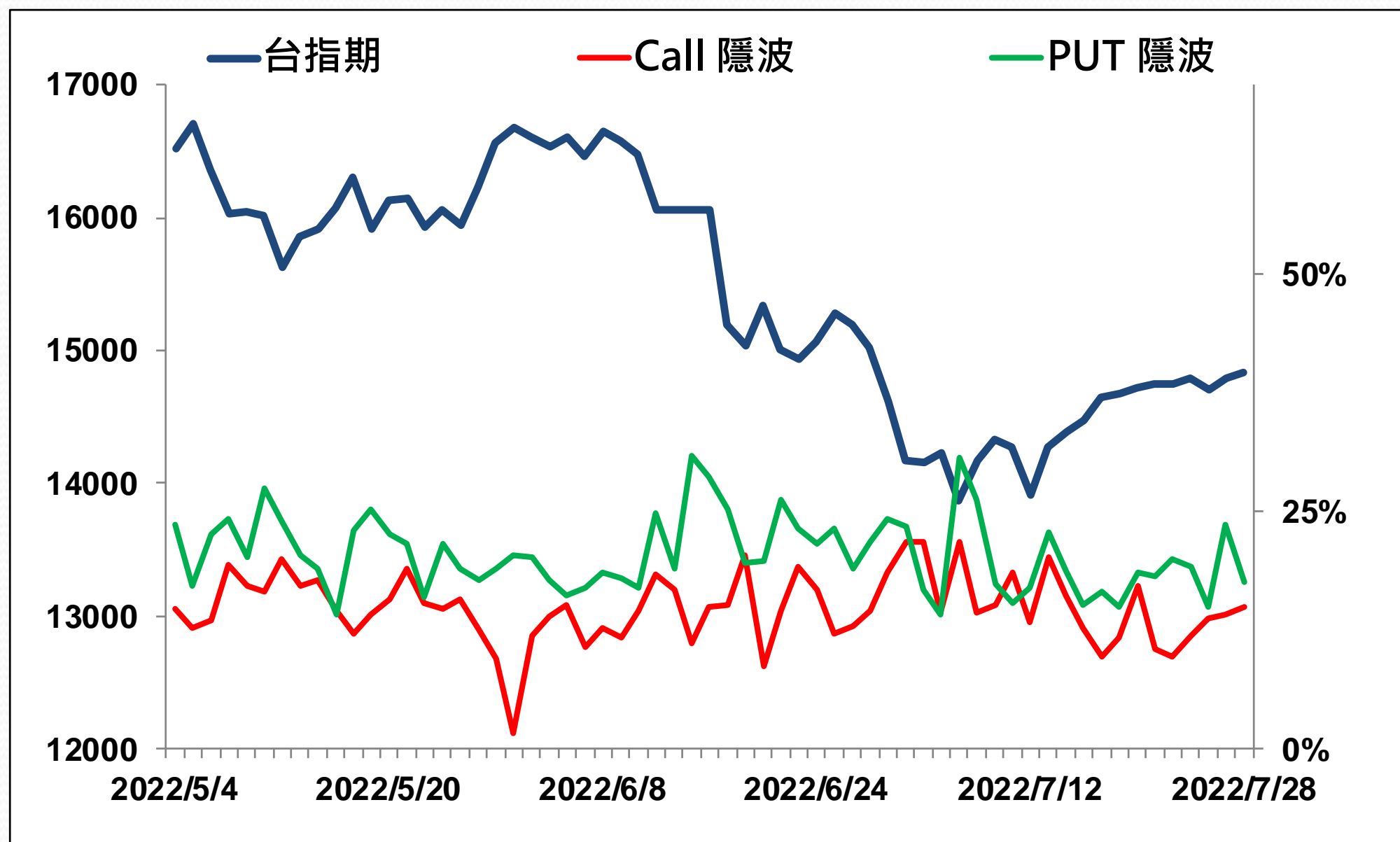
# 選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



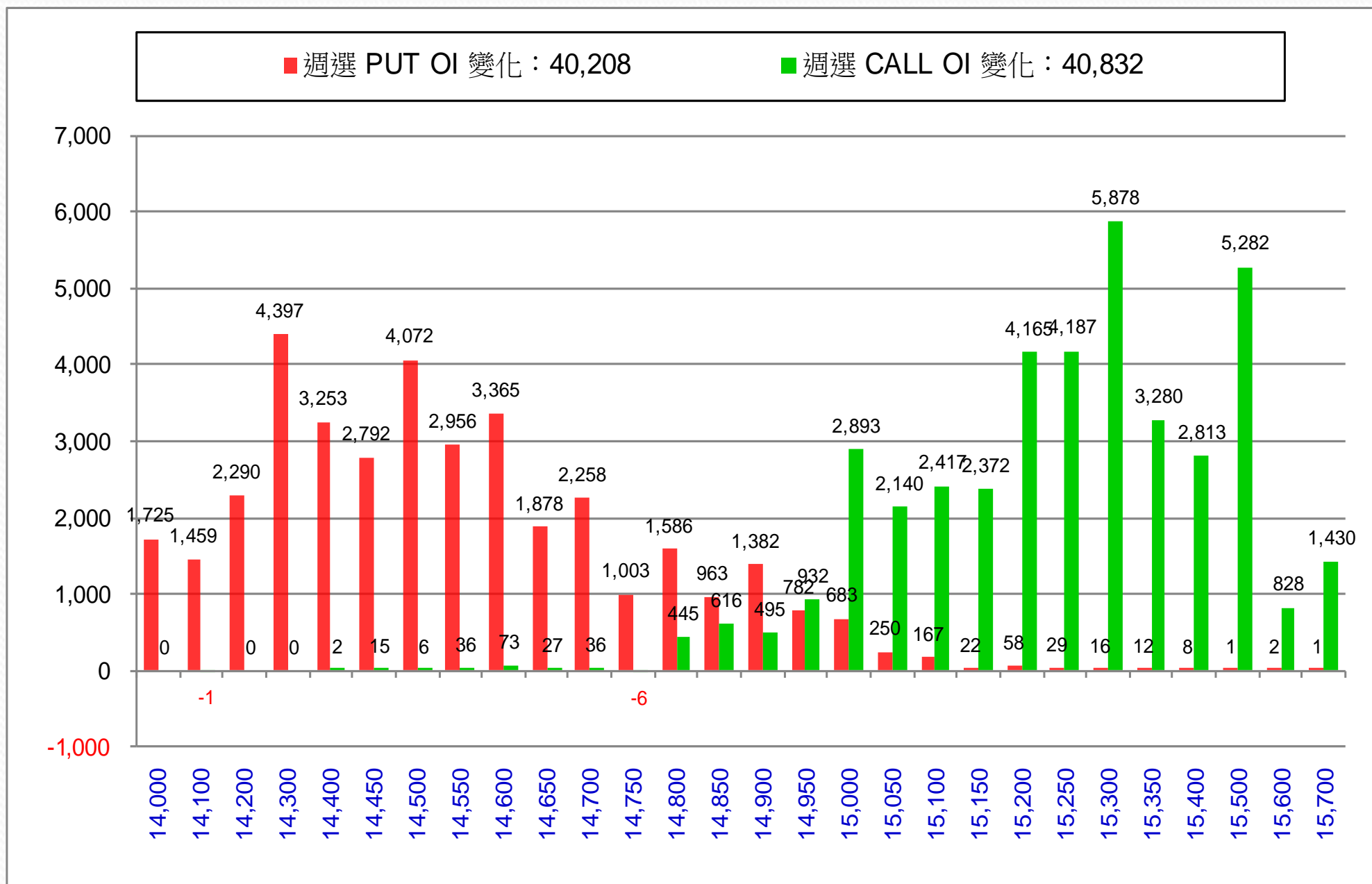
更新日期：2022年7月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2022年7月28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

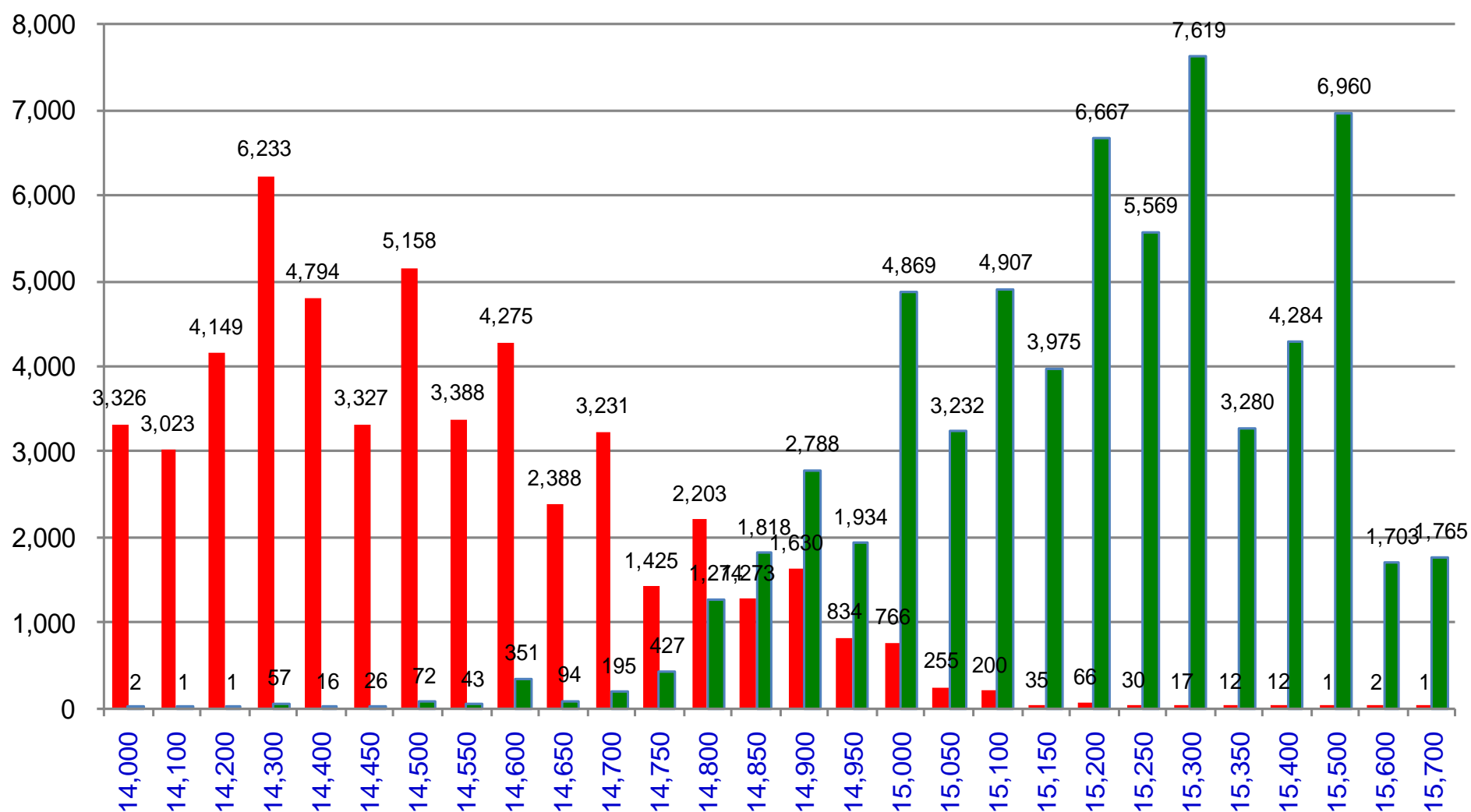


更新日期：2022年7月28日    資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：60,361

週選 CALL OI 總額：64,983



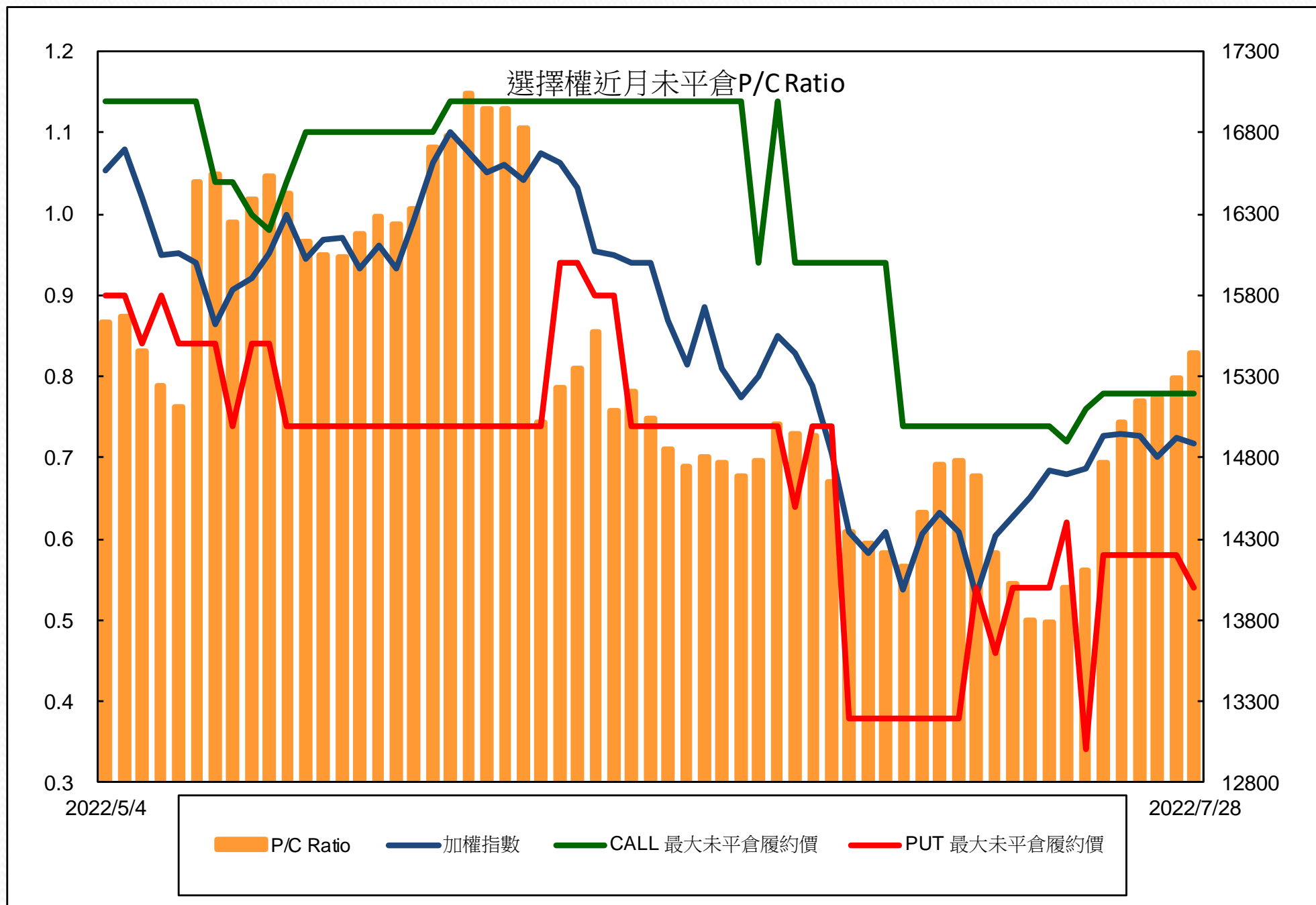
更新日期：2022年7月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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	7月27日	56,513	64,359	-7,846
	7月28日	69,027	74,570	-5,543
Put	7月27日	42,280	25,157	17,123
	7月28日	54,042	31,196	22,846

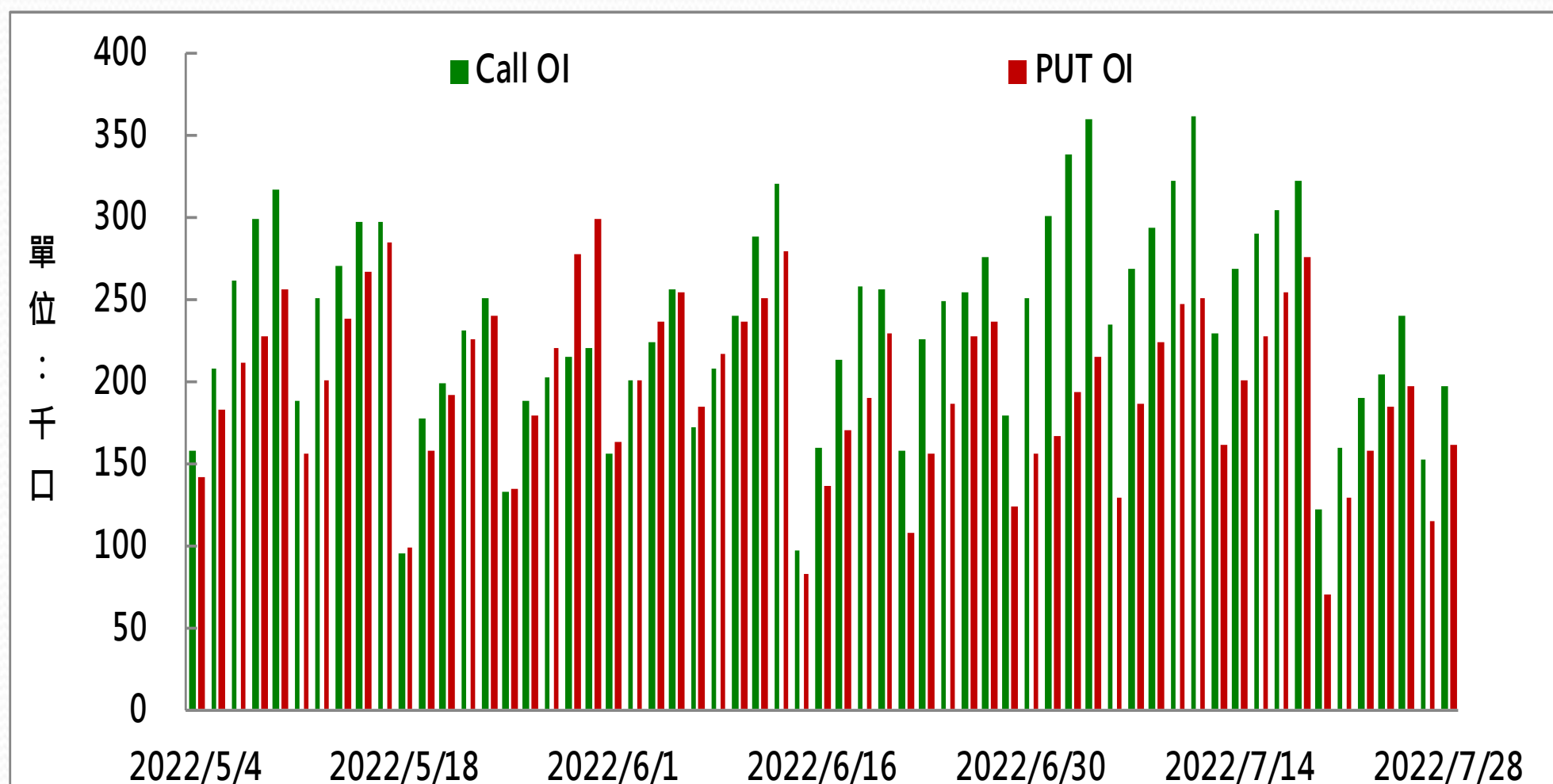
更新日期：2022年7月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年7月28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7月28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：109年金管期總字第011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7月28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