

台指選擇權OI匯報

日期：2022/7/29 結算日：2022/8/3					日期：2022/7/29 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	1	14,200	3,733	-416	0	50	13,600	4,072	1,228 ※
0	57	14,300	4,563	-1,670	0	92	13,700	3,241	-98
12	28	14,400	6,547	1,753	0	93	13,800	4,427	582
0	26	14,450	4,031	704	0	28	13,900	2,726	-174
-20	52	14,500	6,197	1,039	-4	134	14,000	6,372	500
0	43	14,550	3,972	584	0	170	14,100	2,820	561
-6	345	14,600	6,815	2,540	-1	519	14,200	5,355	103
44	138	14,650	3,960	1,572	-13	845	14,300	2,939	267
54	249	14,700	4,593	1,362	-8	1,728	14,400	3,517	59
106	533	14,750	4,404	2,979 ※	-44	1,269	14,500	4,536	254
130	1,404	14,800	4,716	2,513	-77	2,038	14,600	3,637	124
-8	1,810	14,850	2,603	1,330	-152	3,004	14,700	3,356	253
932	3,720	14,900	4,485	2,855	-277	4,107	14,800	2,889	367
240	2,174	14,950	1,566	732	-72	5,024	14,900	1,079	-4
343	5,212	15,000	1,897	1,131	-200	6,042	15,000	1,338	121
297	3,529	15,050	1,050	795	49	7,715	15,100	528	152
1,447	6,354	15,100	430	230	292	9,276	15,200	232	30
1,281	5,256	15,150	240	205	167	5,625	15,300	98	8
960	7,627	15,200	255	189	568	6,025	15,400	76	-5
※ 3,231	8,800	15,250	76	46	※ 1,047	8,990	15,500	67	20
2,127	9,746	15,300	67	50	255	7,277	15,600	73	1
-81	3,199	15,350	13	1	323	3,836	15,700	51	4
832	5,116	15,400	19	7	300	2,343	15,800	74	-37
917	7,877	15,500	1	0	220	2,690	15,900	28	0
255	1,958	15,600	4	2	174	5,292	16,000	29	0
326	2,091	15,700	2	1	-781	4,058	16,100	19	-2
25	860	15,800	2	2	21	1,319	16,200	11	0
0	214	15,900	0	0	-55	1,494	16,300	53	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
13,445	78,428	1.0570	82,901	22,540	1,560	108,897	0.8692	94,649	5,719
昨日 P/C	0.9289	今日增減變化		0.1281	昨日 P/C	0.8285	今日增減變化		0.0406

更新日期：2022年7月29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29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	89,320,463	62,483,830	26,836,633	-3,186,539	4,120,198	1,507,118	2,613,080	-111,238	
投信	38,485,440	48,330,900	-9,845,460	976,697	805,096	0	805,096	-9,989	
自營商	26,942,432	27,436,903	-494,471	-9,316	938,596	559,852	378,744	268,333	
	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	579,939	807,069	-227,130	191,452	0	49,450	-49,450	1,121	
投信	96,909	0	96,909	-153	0	0	0	0	
自營商	281,630	670,774	-389,144	-125,262	247,243	209,387	37,856	-8,433	
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29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	34,949	14,954	19,995	2,606	29,242	11,855	17,387	4,408	
投信	0	150	-150	0	550	103	447	0	
自營商	73,184	75,861	-2,677	2,866	56,657	38,930	17,727	-5,119	
特定法人(週)	5,166	0	5,166	2,655	0	817	-817	214	
特定法人(近月)	26,347	7,640	18,707	249	5,983	18,645	-12,662	-3,156	
特定法人(全月)	29,430	8,192	21,238	2,325	4,052	22,405	-18,353	-3,610	
十大交易人(週)	28,318	33,082	-4,764	-207	28,527	29,257	-730	3,692	
十大交易人(近月)	74,353	58,108	16,245	1,984	34,518	52,503	-17,985	-380	
十大交易人(全月)	114,038	89,945	24,093	4,131	56,156	84,634	-28,478	1,510	
全市場未沖銷(近月)			108,897	1,560			94,649	5,719	
全市場未沖銷(全月)			213,633	15,698			190,761	28,814	

更新日期：2022年7月29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	14800	賣權OI最大量	14600
	整體隱含波動率	14.70%	較前一交易日	-0.65%
	買權隱含波動率	13.73%	較前一交易日	-1.23%
	賣權隱含波動率	15.79%	較前一交易日	+0.00%
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	665	賣權OI最大量	660
金融選擇權	買權成交最大量	1580	買權OI最大量	1560
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1500

更新日期：2022年7月29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	15000	買權OI最大量	15200
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	19.90%	較前一交易日	+0.59%
	買權隱含波動率	14.21%	較前一交易日	-1.22%
	賣權隱含波動率	25.07%	較前一交易日	+0.09%
	成交量P/C_Ratio值	1.313	較前一交易日	+0.29
	未平倉P/C_Ratio值	0.869	較前一交易日	+0.04
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	665	賣權OI最大量	660
金融選擇權	買權成交最大量	1580	買權OI最大量	1560
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1500

更新日期：2022年7月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

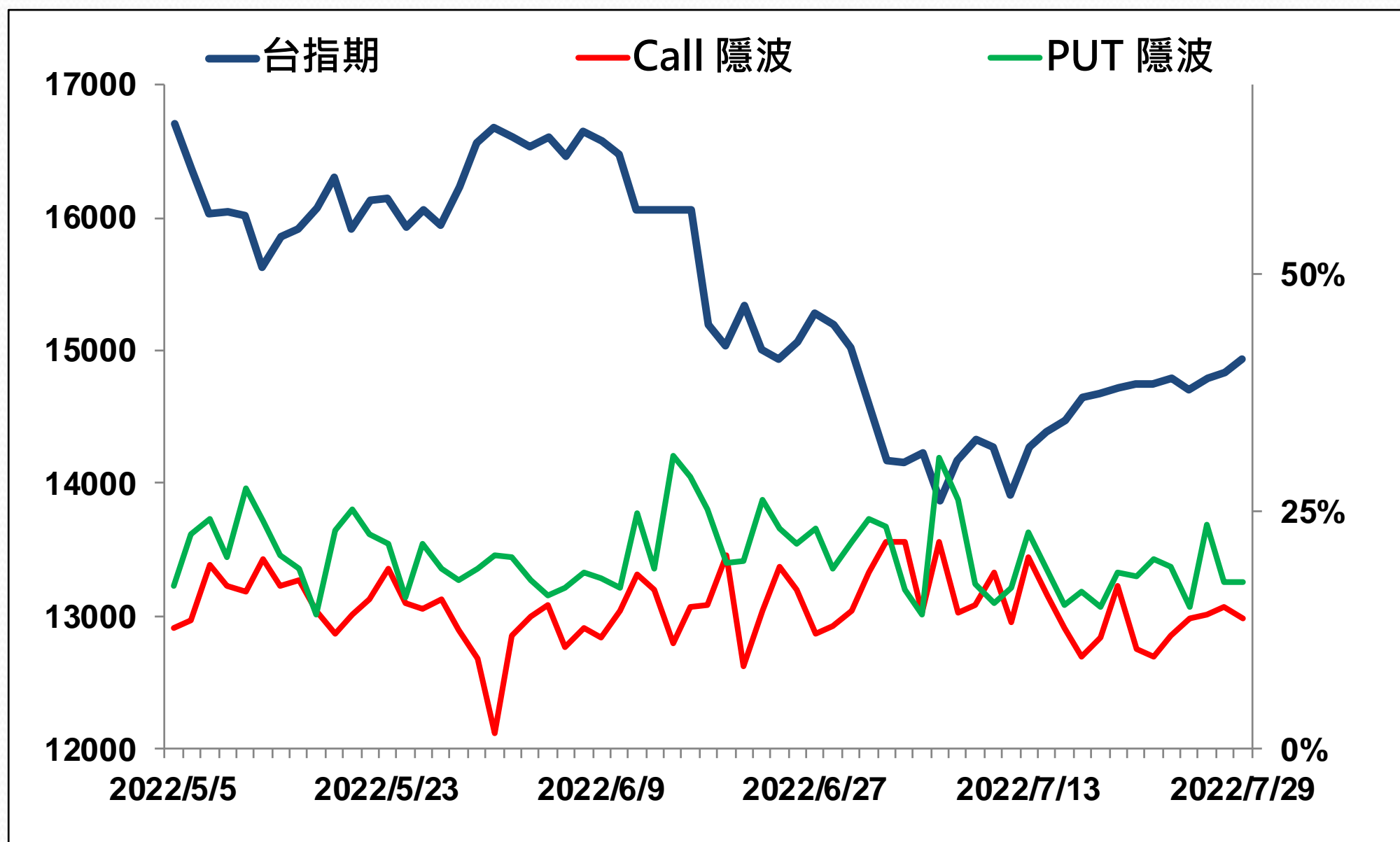
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



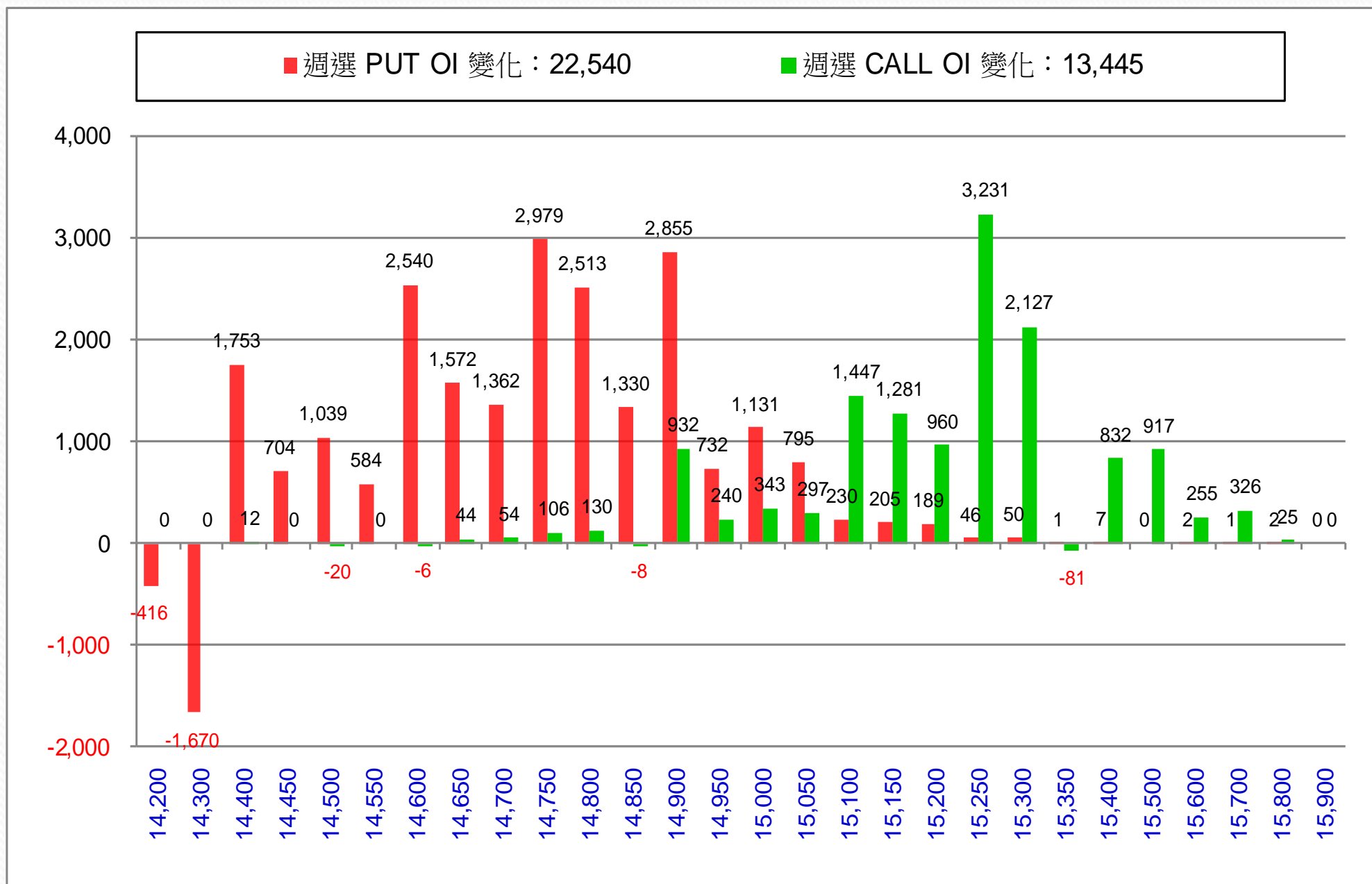
更新日期：2022年7月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年7月29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

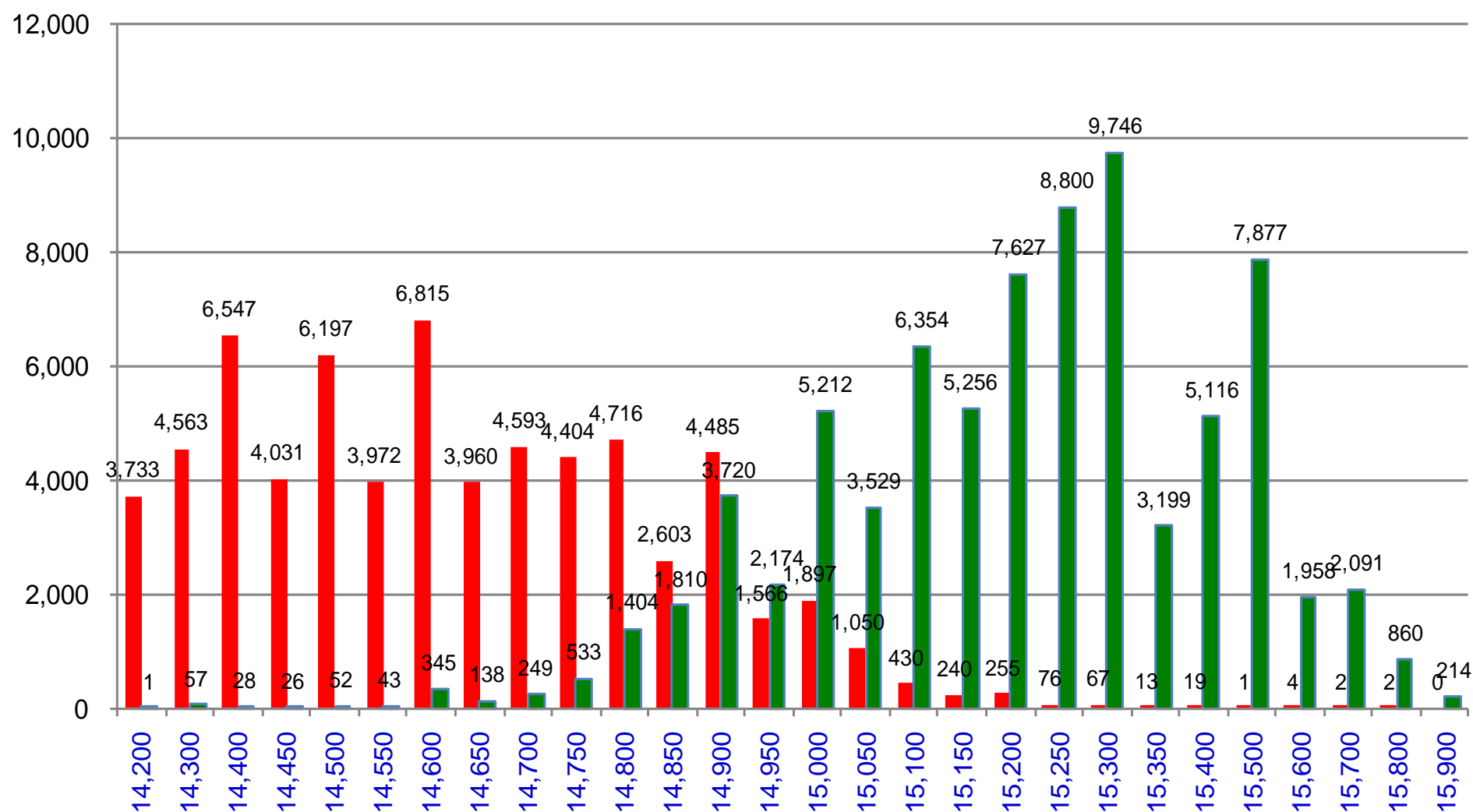


更新日期：2022年7月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：82,901

週選 CALL OI 總額：78,428



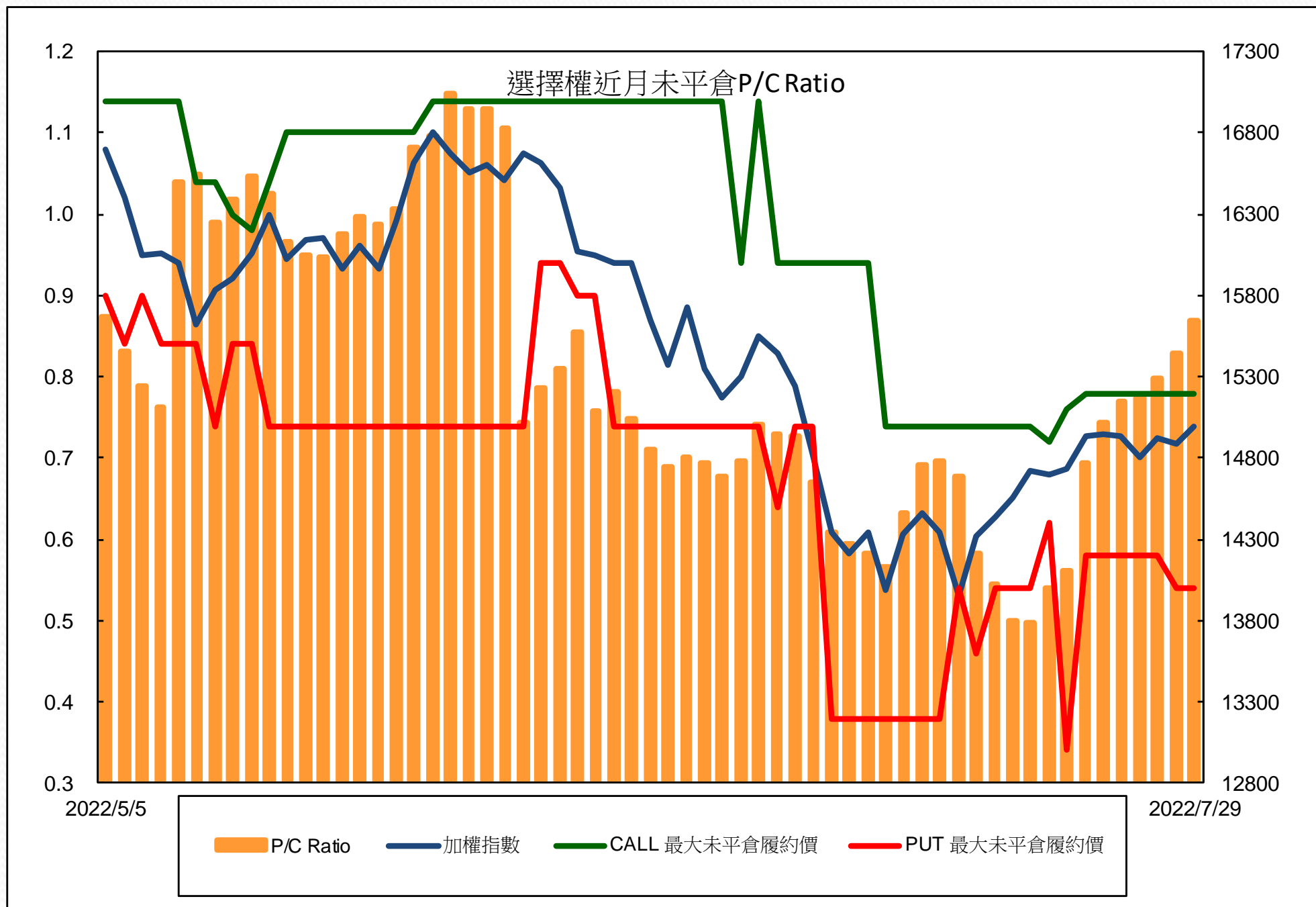
更新日期：2022年7月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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28日	69,027	74,570	-5,543
	7月29日	73,184	75,861	-2,677
Put	7月28日	54,042	31,196	22,846
	7月29日	56,657	38,930	17,727

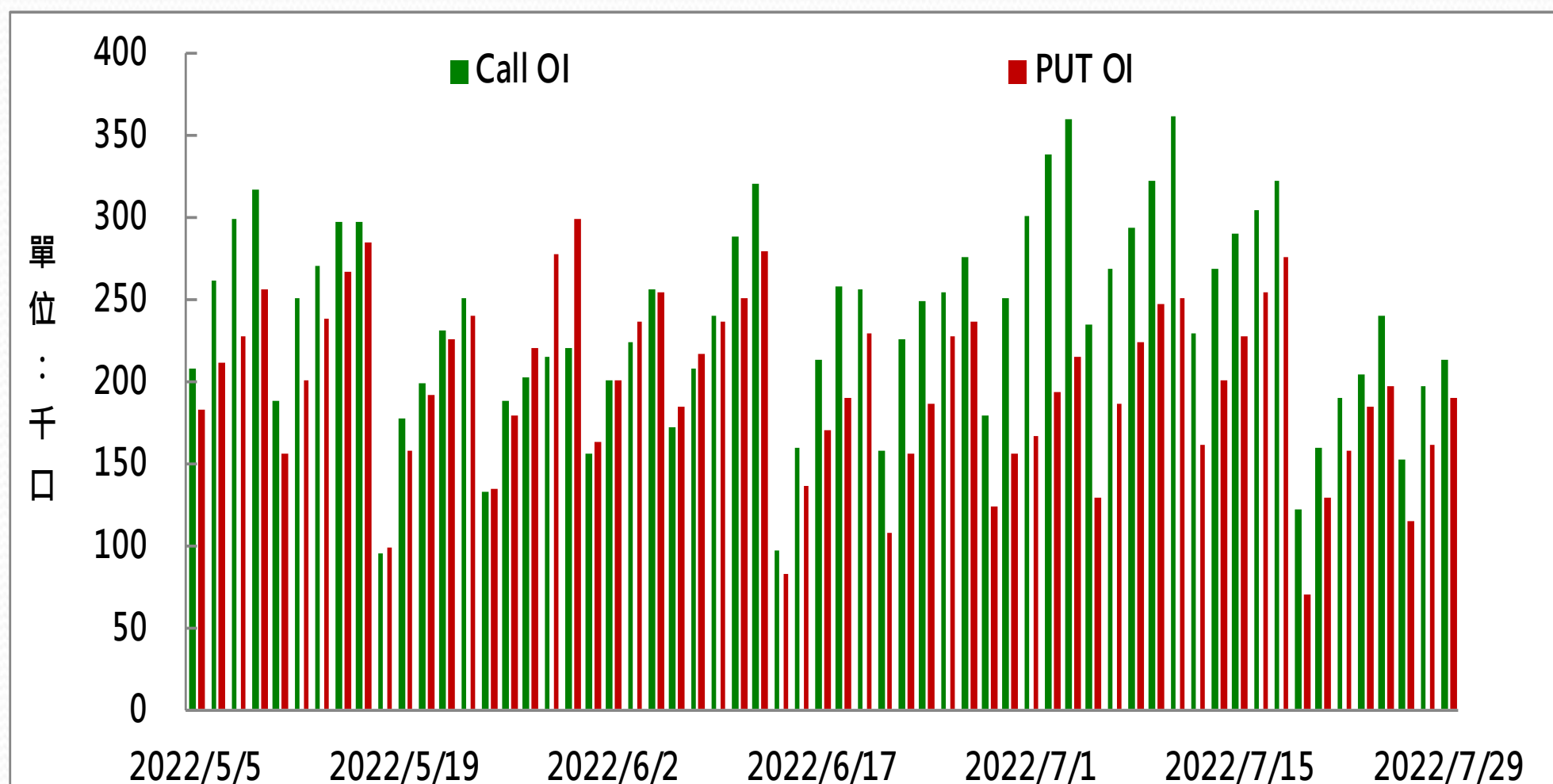
更新日期：2022年7月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年7月29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29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29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