

台指選擇權OI匯報

日期：2022/8/1 結算日：2022/8/3					日期：2022/8/1 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	3,084	-649	0	50	13,600	4,091	19
1	58	14,300	4,698	135	0	92	13,700	3,349	108
0	28	14,400	5,852	-695	0	93	13,800	4,165	-262
-1	25	14,450	4,018	-13	0	28	13,900	2,940	214
3	55	14,500	6,679	482	-12	122	14,000	6,688	316
0	43	14,550	5,188	1,216	0	170	14,100	2,889	69
-50	295	14,600	7,388	573	0	519	14,200	5,610	255
14	152	14,650	6,409	2,449	0	845	14,300	3,918	979
26	275	14,700	5,879	1,286	-39	1,689	14,400	4,501	984
-49	484	14,750	6,001	1,597	5	1,274	14,500	5,032	496
3	1,407	14,800	6,084	1,368	-9	2,029	14,600	4,387	750
167	1,977	14,850	4,357	1,754	13	3,017	14,700	3,893	537
672	4,392	14,900	4,912	427	192	4,299	14,800	3,307	418
1,822	3,996	14,950	2,658	1,092	214	5,238	14,900	1,286	207
3,057	8,269	15,000	4,074	2,177	294	6,336	15,000	1,584	246
2,180	5,709	15,050	841	-209	-181	7,534	15,100	507	-21
3,246	9,600	15,100	774	344	255	9,531	15,200	245	13
3,793	9,049	15,150	340	100	265	5,890	15,300	116	18
※ 4,876	12,503	15,200	264	9	※ 1,932	7,957	15,400	77	1
689	9,489	15,250	82	6	498	9,488	15,500	76	9
873	10,619	15,300	82	15	158	7,435	15,600	72	-1
-256	2,943	15,350	13	0	1,125	4,961	15,700	54	3
582	5,698	15,400	30	11	220	2,563	15,800	62	-12
456	456	15,450	1	1	121	2,811	15,900	28	0
660	8,537	15,500	2	1	-673	4,619	16,000	29	0
14	1,972	15,600	4	0	-14	4,044	16,100	19	0
-16	2,075	15,700	5	3	25	1,344	16,200	11	0
-113	747	15,800	2	0	-245	1,249	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
22,649	101,077	0.9603	97,063	14,162	4,106	113,003	0.8908	100,659	6,010
昨日 P/C	1.0570	今日增減變化	-0.0967		昨日 P/C	0.8692	今日增減變化	0.0216	

更新日期：2022年8月1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8月1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	93,902,277	65,626,921	28,275,356	1,438,723	4,172,734	1,365,120	2,807,614	194,534	
投信	35,307,328	48,107,424	-12,800,096	-2,954,636	787,569	0	787,569	-17,527	
自營商	26,951,793	26,724,800	226,993	721,464	861,816	693,522	168,294	-210,450	
	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	527,093	996,464	-469,371	-242,241	7,279	66,962	-59,683	-10,233	
投信	97,216	0	97,216	307	0	0	0	0	
自營商	402,519	607,577	-205,058	184,086	264,876	200,826	64,050	26,194	

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報								2022年8月1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	39,360	15,421	23,939	3,944	35,097	12,728	22,369	4,982	
投信	0	150	-150	0	550	103	447	0	
自營商	77,752	79,116	-1,364	1,313	58,187	46,843	11,344	-6,383	
特定法人(週)	6,849	0	6,849	1,683	0	2,733	-2,733	-1,916	
特定法人(近月)	27,174	7,528	19,646	939	4,305	20,634	-16,329	-3,667	
特定法人(全月)	31,751	4,071	27,680	6,442	4,305	25,458	-21,153	-2,800	
十大交易人(週)	33,858	43,966	-10,108	-5,344	35,343	32,304	3,039	3,769	
十大交易人(近月)	75,646	58,403	17,243	998	37,760	55,786	-18,026	-41	
十大交易人(全月)	119,753	96,393	23,360	-733	64,168	90,409	-26,241	2,237	
全市場未沖銷(近月)			113,003	4,106			100,659	6,010	
全市場未沖銷(全月)			241,246	27,613			211,906	21,145	

更新日期：2022年8月1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	15200
	賣權成交最大量	14900	賣權OI最大量	14600
	整體隱含波動率	14.84%	較前一交易日	+0.15%
	買權隱含波動率	9.91%	較前一交易日	-3.83%
	賣權隱含波動率	20.12%	較前一交易日	+4.33%
電子選擇權	買權成交最大量	690	買權OI最大量	680
	賣權成交最大量	640	賣權OI最大量	640
金融選擇權	買權成交最大量	1560	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8月1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	14300	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	20.42%	較前一交易日	-0.52%
	買權隱含波動率	13.65%	較前一交易日	-0.57%
	賣權隱含波動率	26.60%	較前一交易日	+1.53%
	成交量P/C_Ratio值	1.175	較前一交易日	-0.14
	未平倉P/C_Ratio值	0.891	較前一交易日	+0.02
電子選擇權	買權成交最大量	690	買權OI最大量	680
	賣權成交最大量	640	賣權OI最大量	640
金融選擇權	買權成交最大量	1560	買權OI最大量	1560
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1500

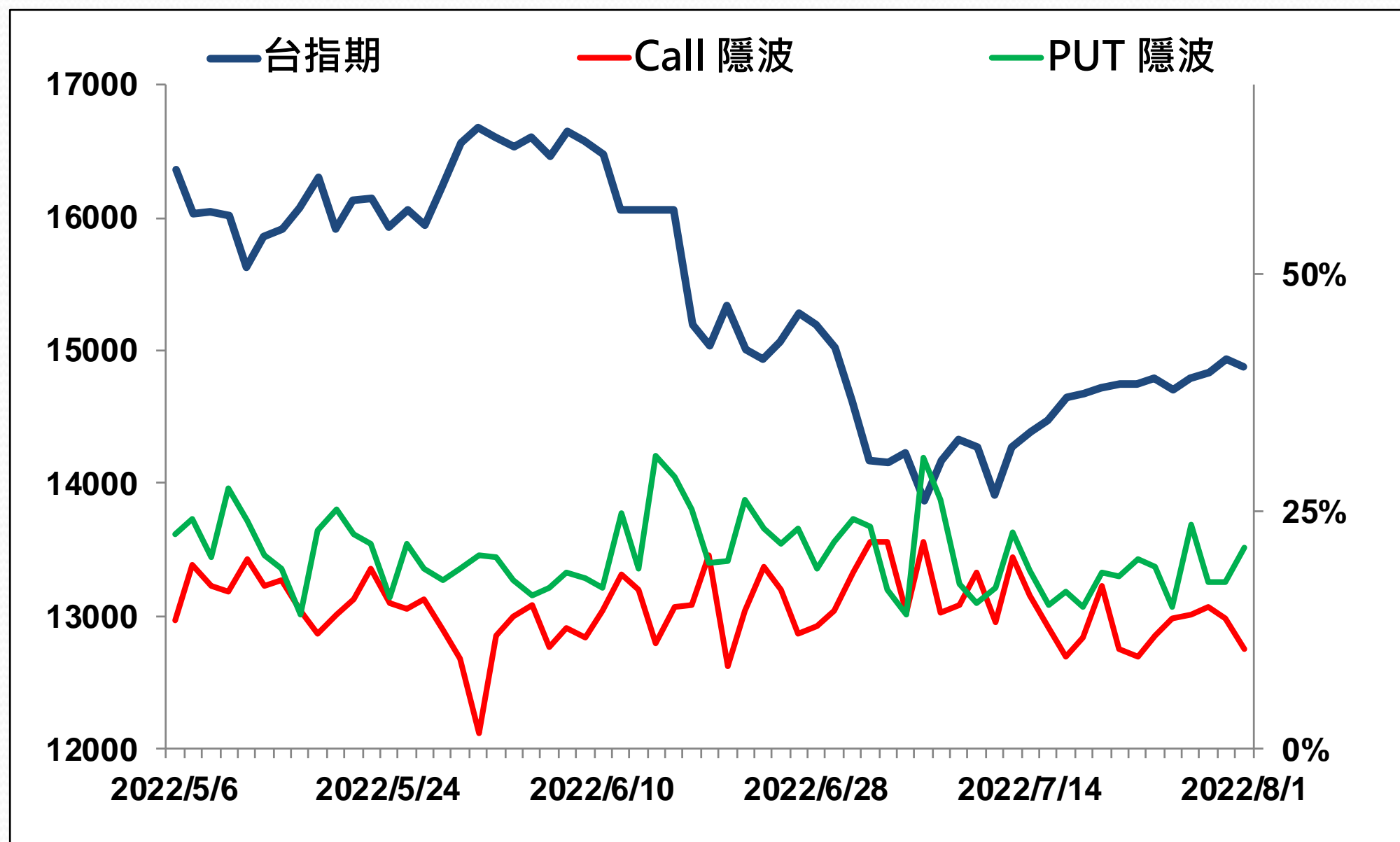
更新日期：2022年8月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



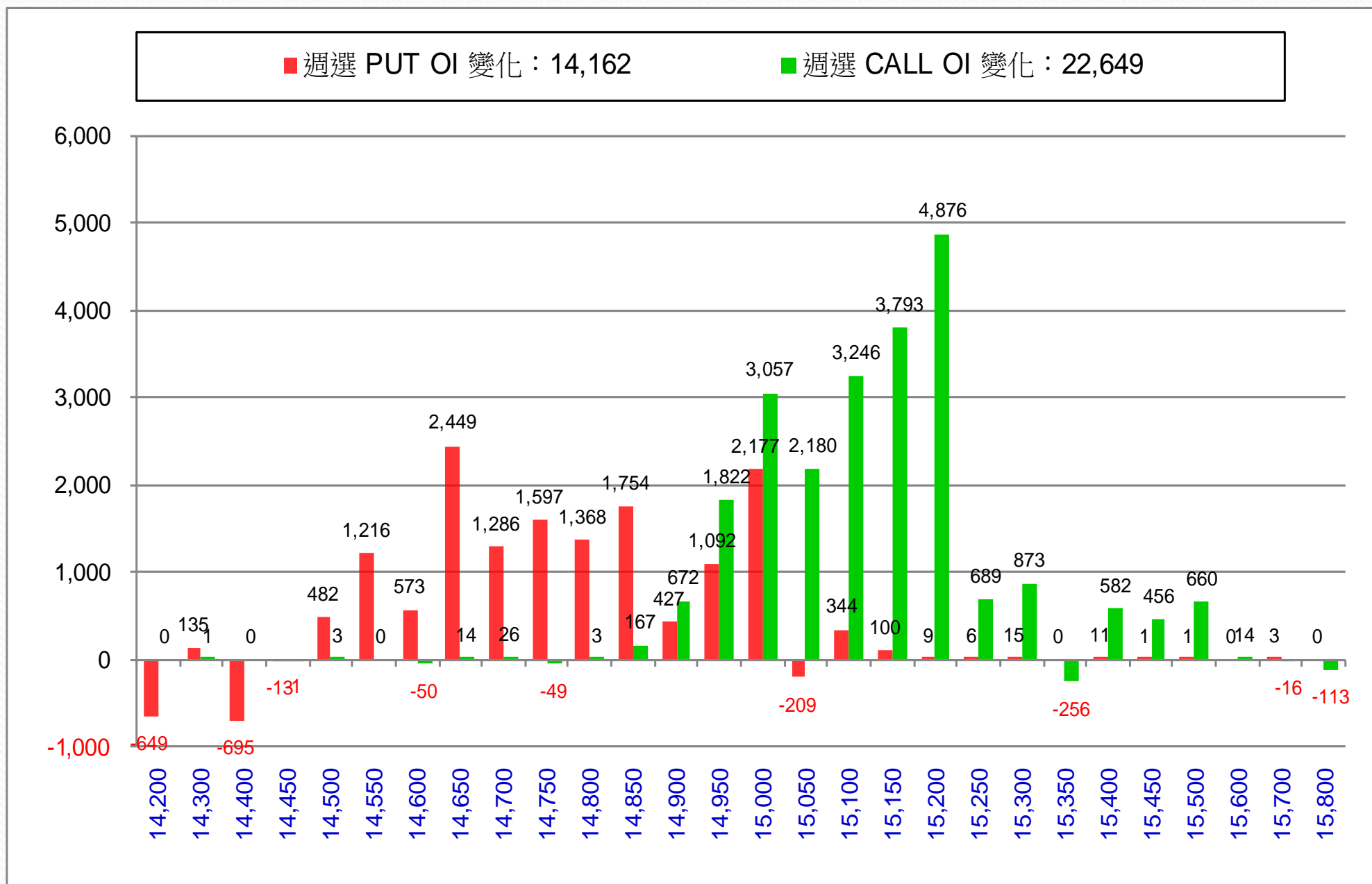
更新日期：2022年8月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年8月1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

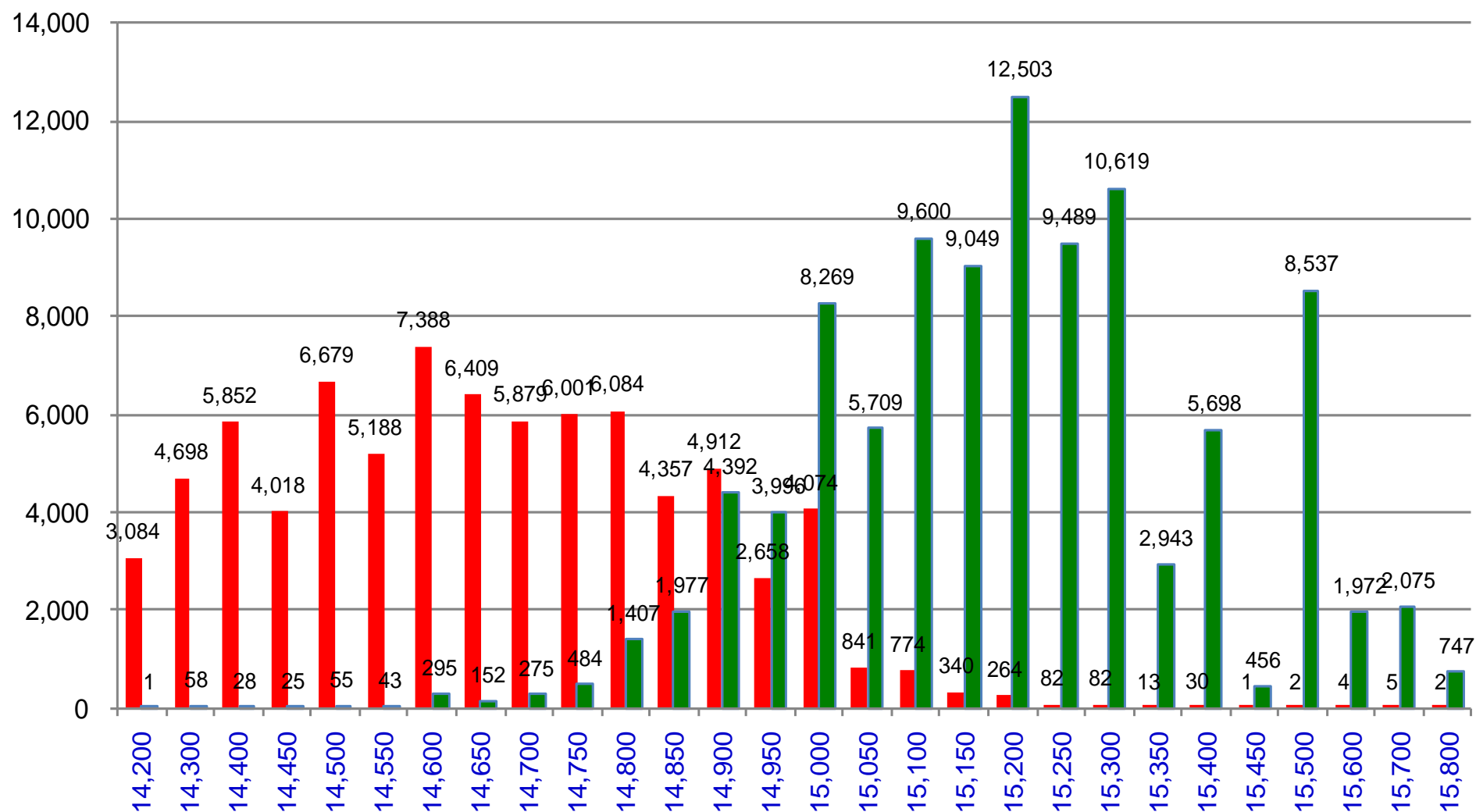


更新日期：2022年8月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：97,063

週選 CALL OI 總額：101,077



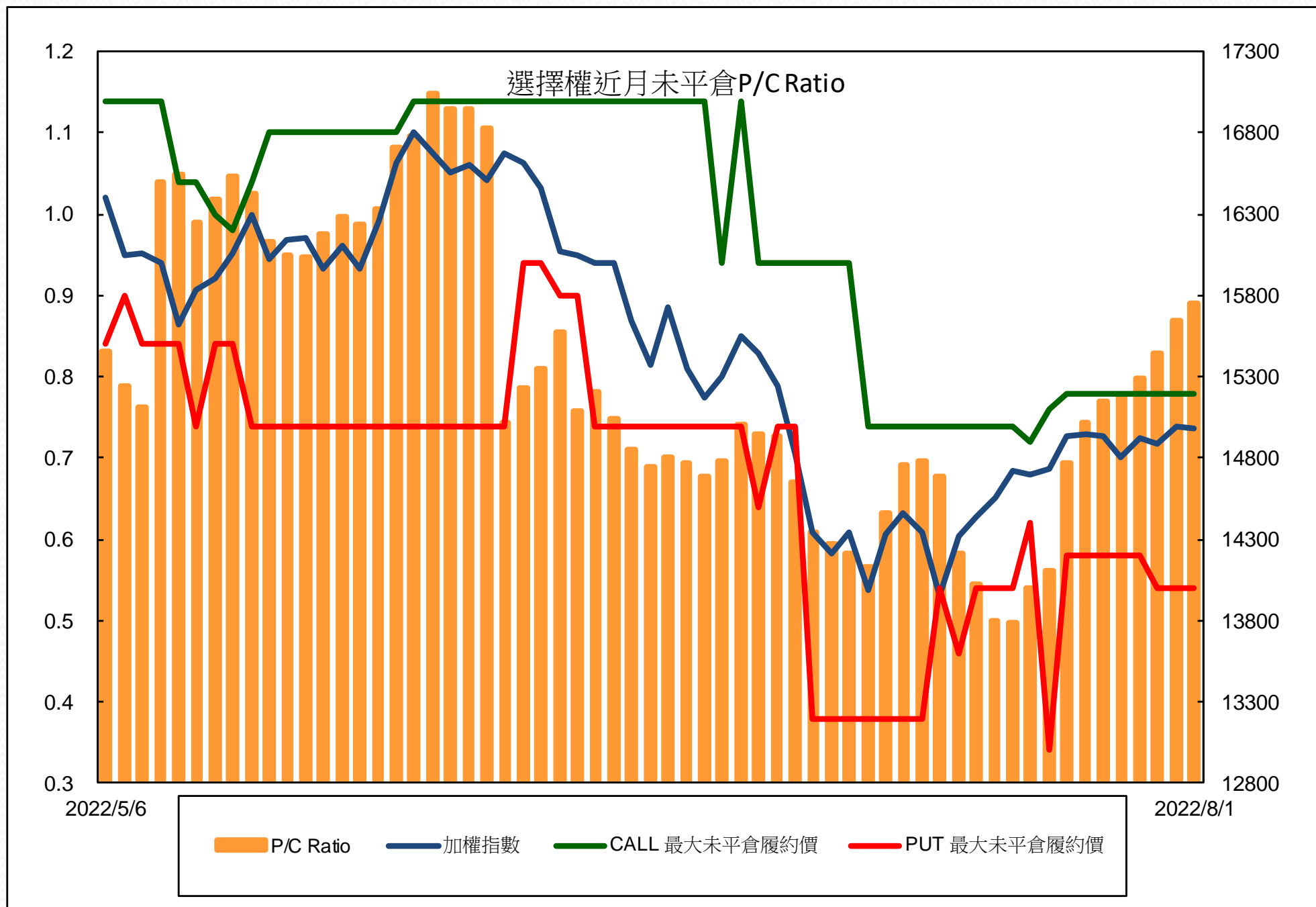
更新日期：2022年8月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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29日	73,184	75,861	-2,677
	8月1日	77,752	79,116	-1,364
Put	7月29日	56,657	38,930	17,727
	8月1日	58,187	46,843	11,344

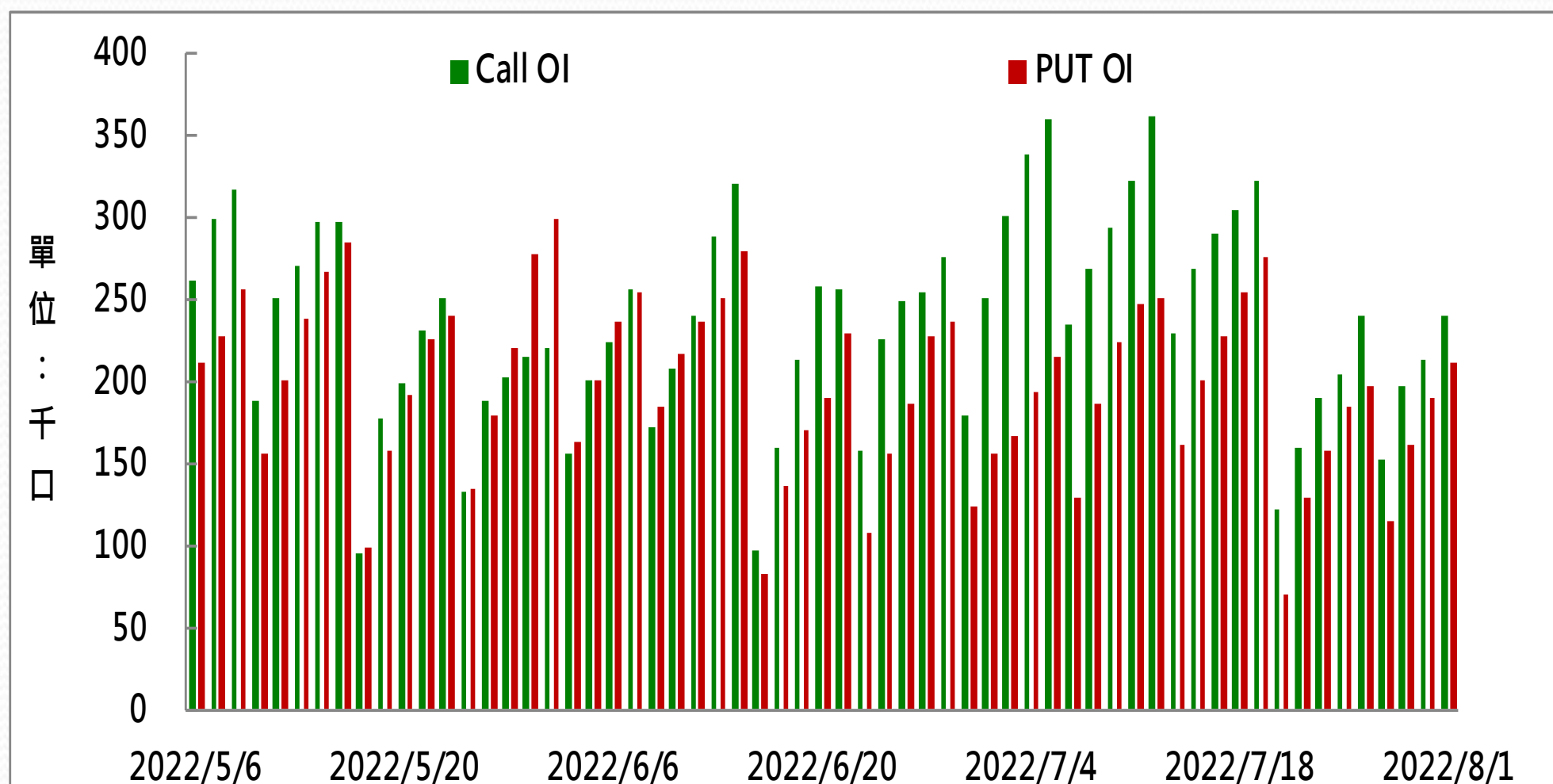
更新日期：2022年8月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年8月1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8月1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8月1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