

台指選擇權OI匯報

日期：2022/8/2 結算日：2022/8/3					日期：2022/8/2 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	0	13,700	2,088	544	0	3	13,300	2,466	294
0	1	13,800	2,520	341	0	10	13,400	4,381	69
0	0	13,900	2,305	245	0	38	13,500	5,159	562
0	2	14,000	5,314	1,492	-2	48	13,600	3,848	-243
0	1	14,100	4,331	555	-2	90	13,700	3,441	92
6	7	14,200	5,225	2,141	0	93	13,800	3,563	-602
4	62	14,300	6,613	1,915	0	28	13,900	3,091	151
-2	26	14,400	6,832	980	0	122	14,000	6,686	-2
128	153	14,450	4,732	714	0	170	14,100	2,855	-34
53	108	14,500	7,803	1,124	1	520	14,200	6,137	527
104	147	14,550	6,362	1,174	4	849	14,300	4,179	261
128	423	14,600	8,114	726	30	1,719	14,400	5,340	839
878	1,030	14,650	4,425	-1,984	392	1,666	14,500	6,247	1,215
3,011	3,286	14,700	5,667	-212	※ 2,012	4,041	14,600	6,754	2,367
2,651	3,135	14,750	4,296	-1,705	1,157	4,174	14,700	3,608	-285
4,954	6,361	14,800	4,086	-1,998	530	4,829	14,800	2,899	-408
4,554	6,531	14,850	3,039	-1,318	168	5,406	14,900	1,274	-12
※ 5,953	10,345	14,900	3,976	-936	399	6,735	15,000	1,426	-158
5,028	9,024	14,950	2,145	-513	-264	7,270	15,100	474	-33
4,416	12,685	15,000	1,765	-2,309	147	9,678	15,200	229	-16
1,952	7,661	15,050	781	-60	1,506	7,396	15,300	112	-4
-28	9,572	15,100	688	-86	765	8,722	15,400	78	1
-1,059	7,990	15,150	295	-45	26	9,514	15,500	65	-11
-3,109	9,394	15,200	244	-20	481	7,916	15,600	71	-1
-2,370	7,119	15,250	71	-11	578	5,539	15,700	54	0
-1,856	8,763	15,300	80	-2	988	3,551	15,800	63	1
-449	2,494	15,350	13	0	-487	2,324	15,900	17	-11
-895	4,803	15,400	38	8	66	4,685	16,000	29	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
21,244	122,321	0.8105	99,143	2,080	8,605	121,608	0.8835	107,435	6,776
昨日 P/C	0.9603	今日增減變化	-0.1498		昨日 P/C	0.8908	今日增減變化	-0.0073	

更新日期：2022年8月2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2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	98,456,970	64,108,554	34,348,416	6,073,060	4,043,528	1,232,882	2,810,646	3,032		
投信	33,223,647	47,552,315	-14,328,668	-1,528,572	773,946	0	773,946	-13,623		
自營商	24,437,820	28,299,262	-3,861,442	-4,088,435	958,256	874,376	83,880	-84,414		
	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	585,570	962,870	-377,300	92,071	0	90,525	-90,525	-30,842		
投信	96,589	0	96,589	-627	0	0	0	0		
自營商	439,169	567,451	-128,282	76,776	293,120	182,480	110,640	46,590		

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2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	46,735	17,802	28,933	4,994	47,967	16,687	31,280	8,911		
投信	0	150	-150	0	550	103	447	0		
自營商	82,582	82,284	298	1,662	60,256	46,825	13,431	2,087		
特定法人(週)	9,742	0	9,742	2,893	0	7,331	-7,331	-4,598		
特定法人(近月)	29,789	9,681	20,108	462	5,994	25,679	-19,685	-3,356		
特定法人(全月)	35,752	6,496	29,256	1,576	5,994	37,126	-31,132	-9,979		
十大交易人(週)	36,399	44,262	-7,863	2,245	27,655	32,279	-4,624	-7,663		
十大交易人(近月)	78,575	62,399	16,176	-1,067	42,976	61,598	-18,622	-596		
十大交易人(全月)	126,797	104,728	22,069	-1,291	65,953	97,244	-31,291	-5,050		
全市場未沖銷(近月)			121,608	8,605			107,435	6,776		
全市場未沖銷(全月)			272,993	31,747			221,534	9,628		

更新日期：2022年8月2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	15000
	賣權成交最大量	14700	賣權OI最大量	14600
	整體隱含波動率	20.44%	較前一交易日	+5.59%
	買權隱含波動率	15.86%	較前一交易日	+5.95%
	賣權隱含波動率	25.38%	較前一交易日	+5.26%
電子選擇權	買權成交最大量	690	買權OI最大量	720
	賣權成交最大量	655	賣權OI最大量	640
金融選擇權	買權成交最大量	1500	買權OI最大量	1460
	賣權成交最大量	1460	賣權OI最大量	1500

更新日期：2022年8月2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	14600	賣權OI最大量	14600
	整體隱含波動率	28.37%	較前一交易日	-7.95%
	買權隱含波動率	19.01%	較前一交易日	+5.36%
	賣權隱含波動率	35.15%	較前一交易日	+8.55%
	成交量P/C_Ratio值	1.385	較前一交易日	+0.21
	未平倉P/C_Ratio值	0.883	較前一交易日	-0.01
電子選擇權	買權成交最大量	690	買權OI最大量	720
	賣權成交最大量	655	賣權OI最大量	640
金融選擇權	買權成交最大量	1500	買權OI最大量	1460
	賣權成交最大量	1460	賣權OI最大量	1500

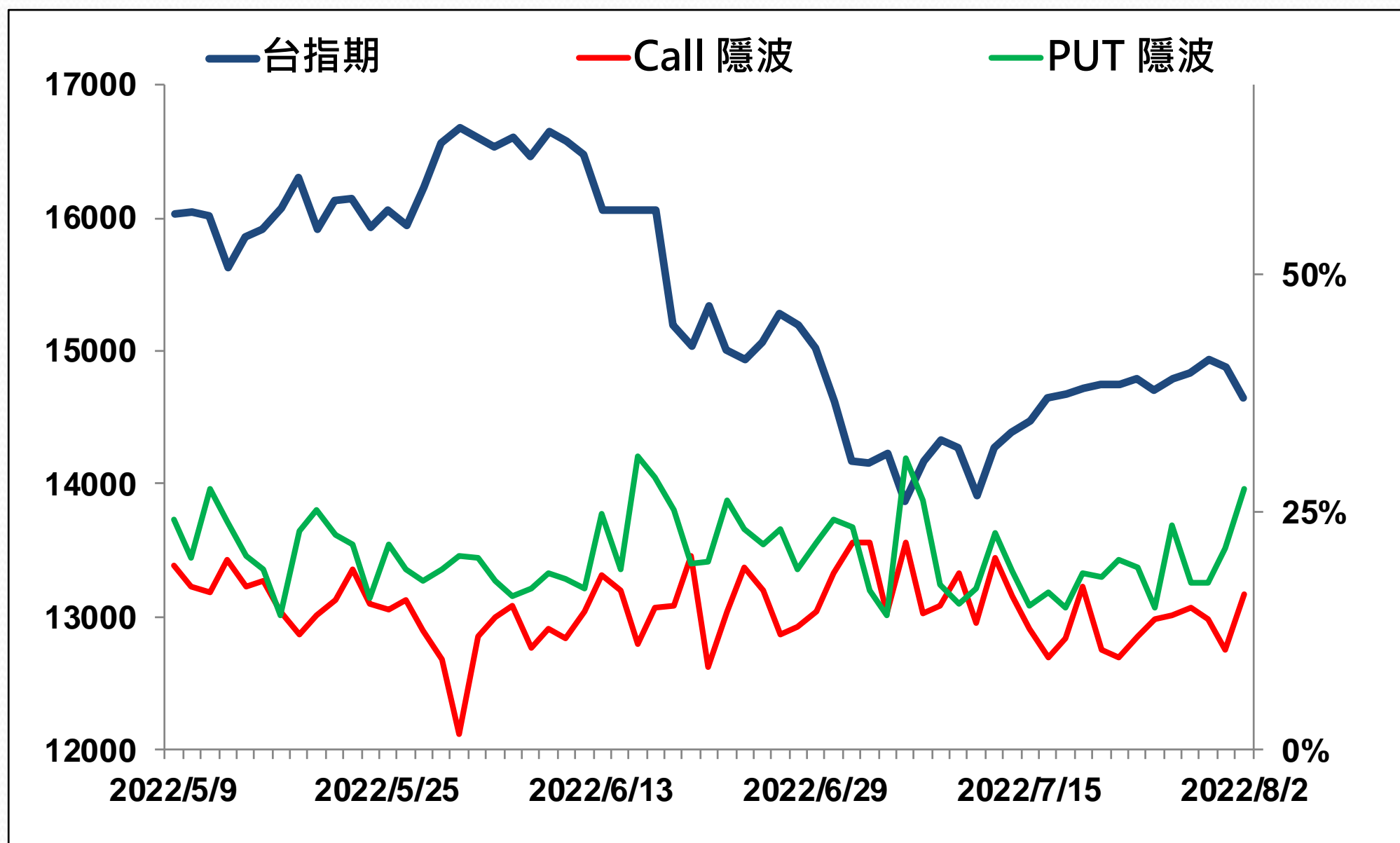
更新日期：2022年8月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



更新日期：2022年8月2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

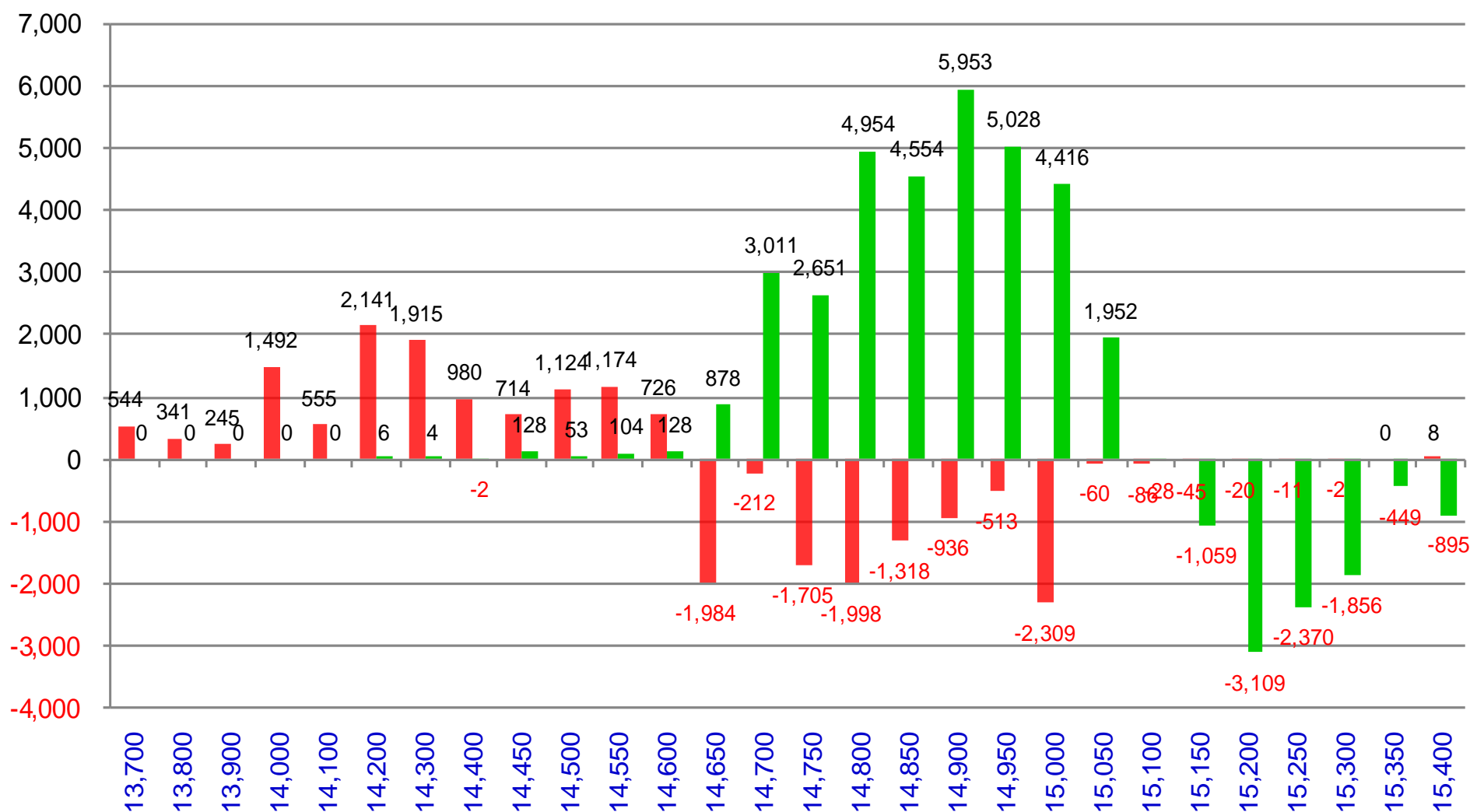


更新日期：2022年8月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：2,080

週選 CALL OI 變化：21,244

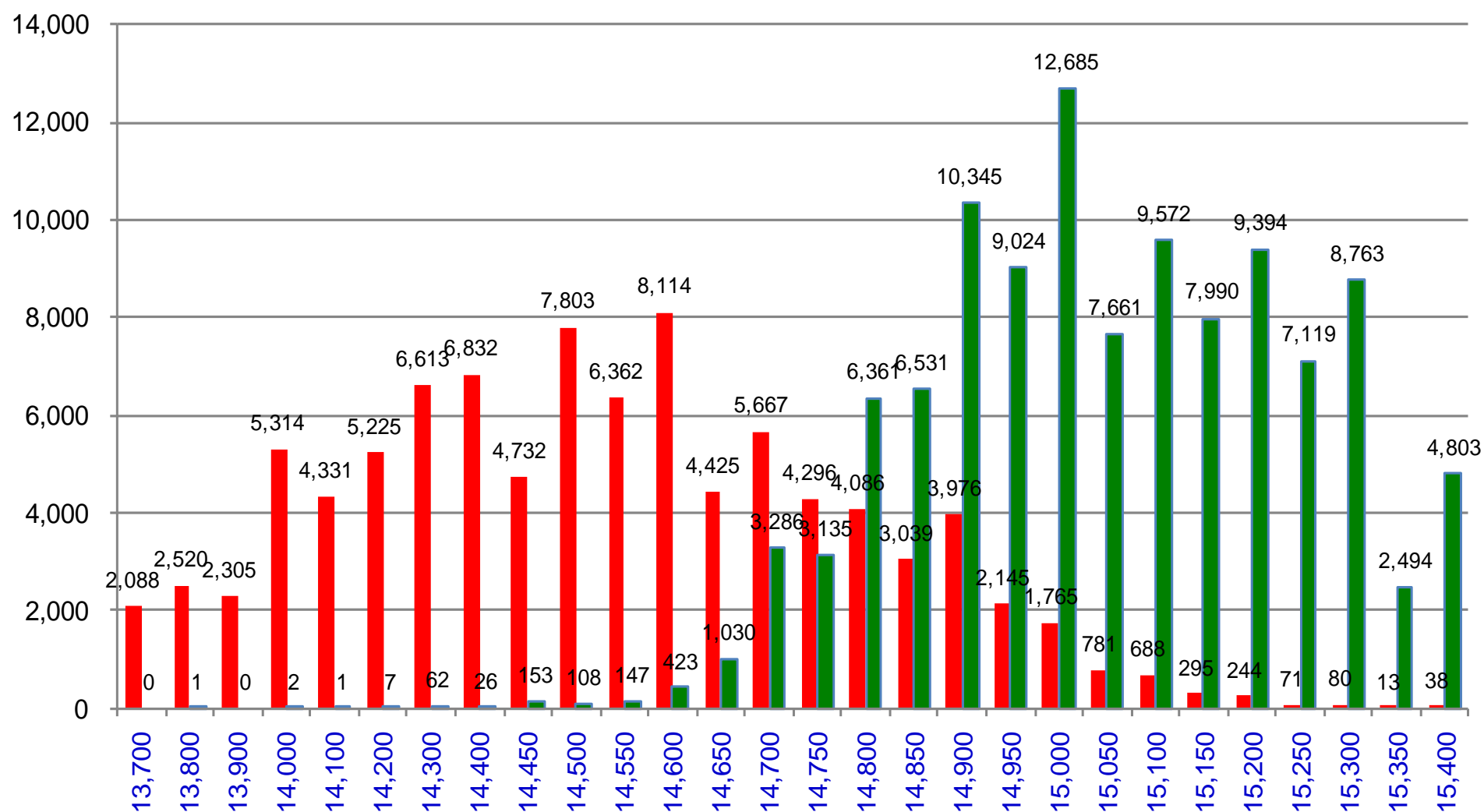


更新日期：2022年8月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：99,143

週選 CALL OI 總額：122,321



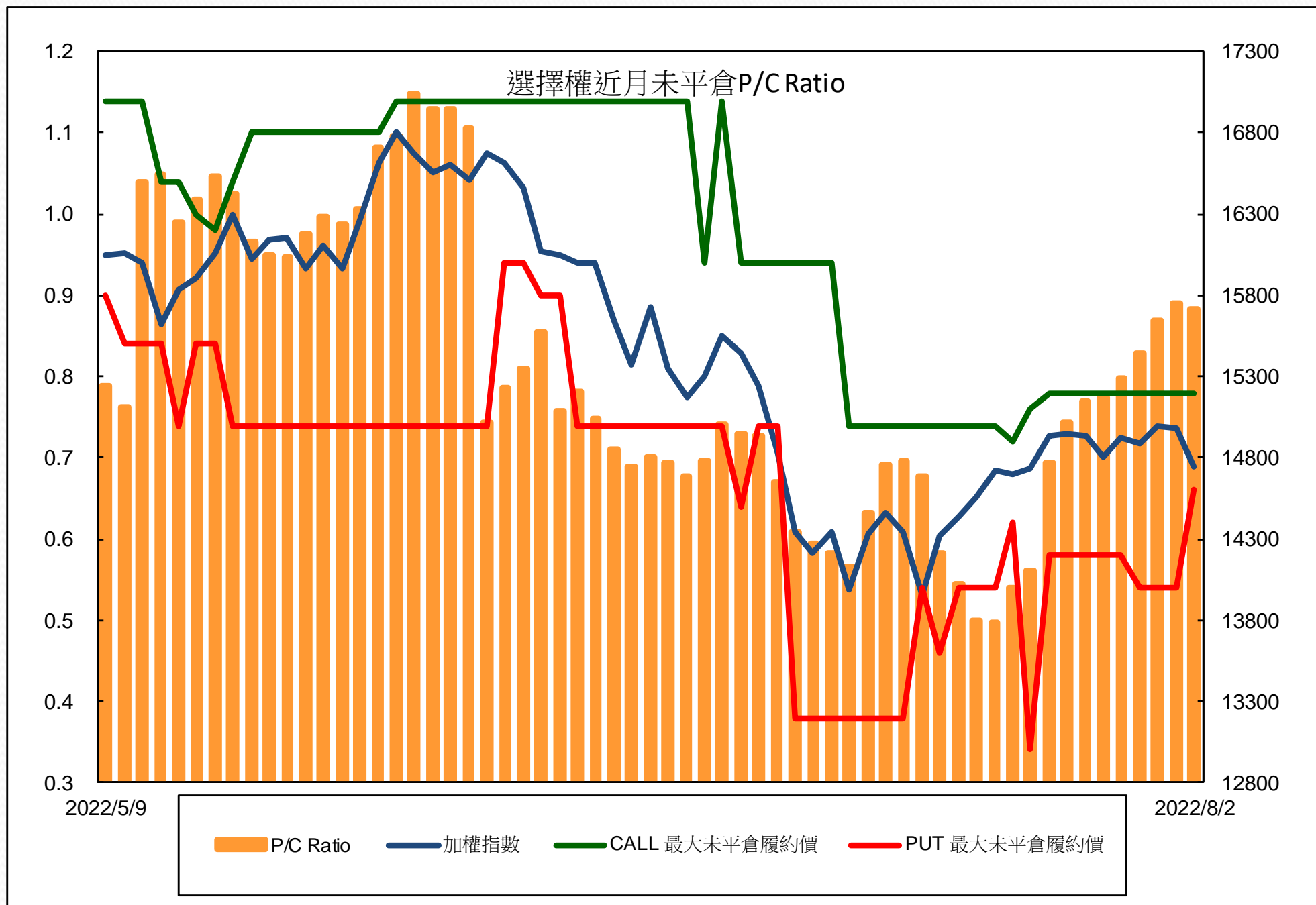
更新日期：2022年8月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

自營商選擇權OI部位統計

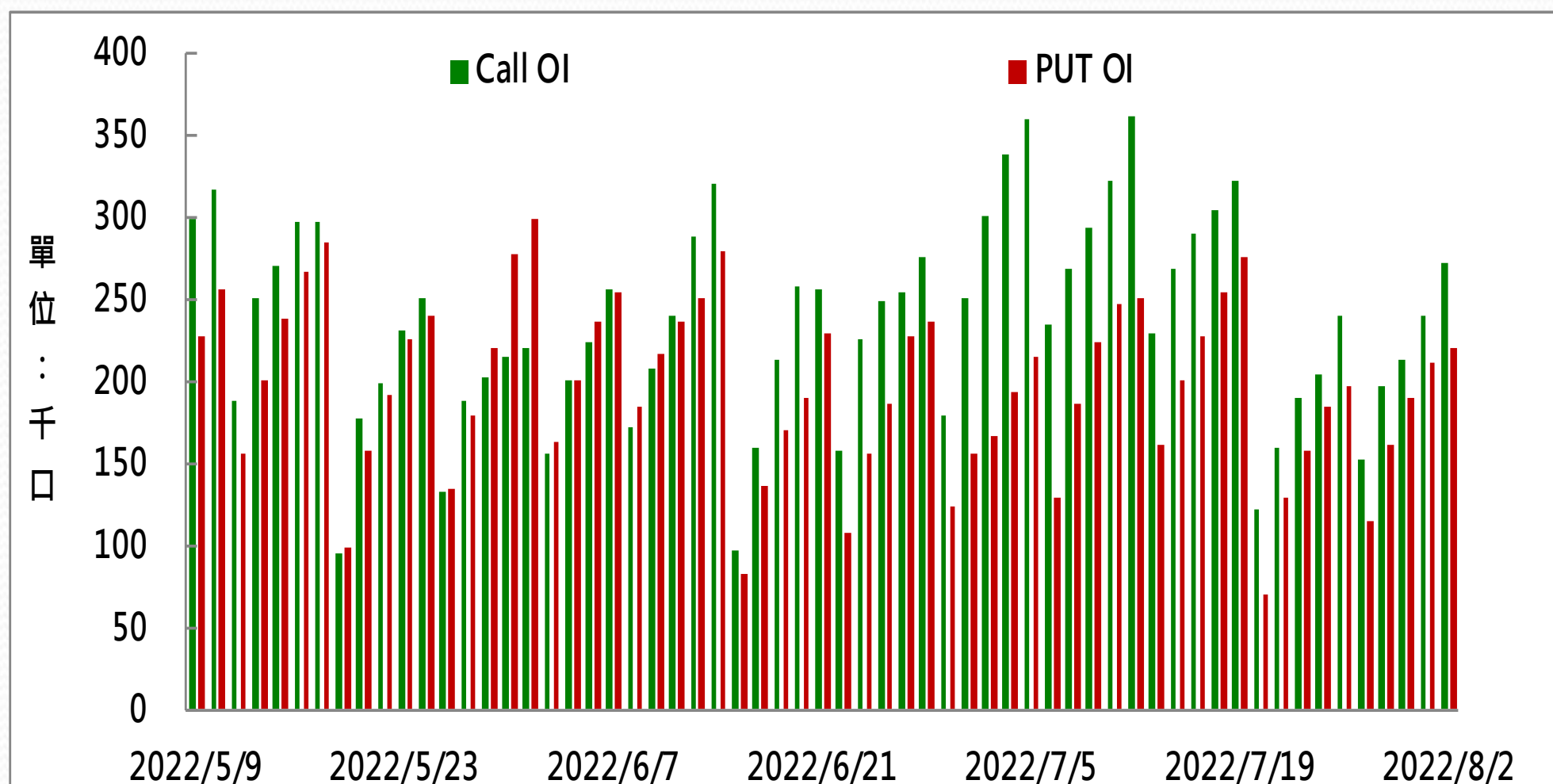
選擇權	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	8月1日	77,752	79,116	-1,364
	8月2日	82,582	82,284	298
Put	8月1日	58,187	46,843	11,344
	8月2日	60,256	46,825	13,431

更新日期：2022年8月2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



選擇權全月Put Call OI



更新日期：2022年8月2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2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