

台指選擇權OI匯報

日期：2022/8/24 結算日：2022/8/31						日期：2022/8/24 結算日：2022/9/21					
202208W5						202209 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	14,500	2,558	2,558	※	0	120	14,100	1,477	-188	
4	4	14,600	1,267	1,267		0	57	14,200	3,311	-156	
25	25	14,650	1,119	1,119		-1	34	14,300	3,352	60	
17	17	14,700	1,564	1,564		6	101	14,400	3,462	-157	
2	2	14,750	535	535		6	111	14,500	4,250	414	※
22	22	14,800	1,974	1,974		-1	325	14,600	2,601	-116	
22	22	14,850	787	787		29	361	14,700	3,654	164	
112	112	14,900	1,119	1,119		1	1,228	14,800	2,391	80	
100	100	14,950	683	683		19	468	14,900	2,836	-58	
447	447	15,000	1,309	1,309		666	2,191	15,000	6,278	3	
796	796	15,050	597	597		485	1,417	15,100	1,859	8	
1,507	1,507	15,100	785	785		613	2,167	15,200	1,419	-36	
1,367	1,367	15,150	616	616		698	3,588	15,300	684	-62	
1,627	1,627	15,200	434	434		569	4,320	15,400	954	3	
2,120	2,120	15,250	218	218		268	4,235	15,500	329	18	
2,714	2,714	15,300	204	204		177	5,402	15,600	220	6	
2,241	2,241	15,350	25	25	※	790	6,705	15,700	43	-4	
3,276	3,276	15,400	16	16		-87	7,148	15,800	265	-7	
3,009	3,009	15,450	21	21		373	6,445	15,900	40	1	
※ 3,865	3,865	15,500	3	3		116	6,888	16,000	406	-9	
1,599	1,599	15,600	36	36		-157	3,914	16,100	7	0	
757	757	15,700	20	20		-62	3,564	16,200	99	0	
1,840	1,840	15,800	5	5		-81	1,962	16,300	72	0	
138	138	15,900	0	0		40	1,360	16,400	81	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	
27,642	27,642	0.7489	20,702	20,702		4,726	88,502	0.8491	75,147	623	
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化		0.7489		昨日 P/C	0.8896	今日增減變化		-0.0405	

更新日期：2022年8月24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24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	81,831,045	60,875,512	20,955,533	7,785,276	4,247,163	651,269	3,595,894	15,974	
投信	26,088,732	46,767,871	-20,679,139	-1,350,125	503,759	0	503,759	289	
自營商	24,724,571	32,852,195	-8,127,624	-2,697,859	765,356	1,210,656	-445,300	-69,783	
	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	641,106	1,507,466	-866,360	-6,296	46,960	58,700	-11,740	1,443	
投信	107,114	0	107,114	-394	0	0	0	0	
自營商	261,482	281,961	-20,479	75	123,270	145,283	-22,013	2,887	

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24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	15,128	6,564	8,564	-1,312	20,638	7,994	12,644	-4,985	
投信	0	100	-100	0	350	97	253	0	
自營商	52,156	46,933	5,223	16,944	37,630	22,954	14,676	91	
特定法人(週)	0	0	0	---	0	381	-381	---	
特定法人(近月)	9,059	4,849	4,210	-2,024	5,090	15,361	-10,271	857	
特定法人(全月)	11,266	2,749	8,517	-2,329	5,229	17,653	-12,424	3,428	
十大交易人(週)	14,199	12,727	1,472	---	8,010	8,590	-580	---	
十大交易人(近月)	47,314	42,143	5,171	-813	27,672	42,923	-15,251	974	
十大交易人(全月)	73,387	54,999	18,388	26,594	35,885	55,237	-19,352	1,116	
全市場未沖銷(近月)			88,502	4,726			75,147	623	
全市場未沖銷(全月)			134,729	-94,755			106,838	-73,565	

更新日期：2022年8月24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 08W5 週 選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15400	買權OI最大量	15500
	賣權成交最大量	14800	賣權OI最大量	14500
	整體隱含波動率	13.52%	較前一交易日	+1.40%
	買權隱含波動率	12.67%	較前一交易日	+2.67%
	賣權隱含波動率	14.52%	較前一交易日	-0.74%
電子選擇權	買權成交最大量	740	買權OI最大量	760
	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	1640	買權OI最大量	1680
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年8月24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	15600	買權OI最大量	15800
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	17.52%	較前一交易日	+0.00%
	買權隱含波動率	13.58%	較前一交易日	+0.00%
	賣權隱含波動率	22.05%	較前一交易日	+0.00%
	成交量P/C_Ratio值	0.750	較前一交易日	+0.04
	未平倉P/C_Ratio值	0.849	較前一交易日	-0.04
電子選擇權	買權成交最大量	740	買權OI最大量	760
	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	1640	買權OI最大量	1680
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年8月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

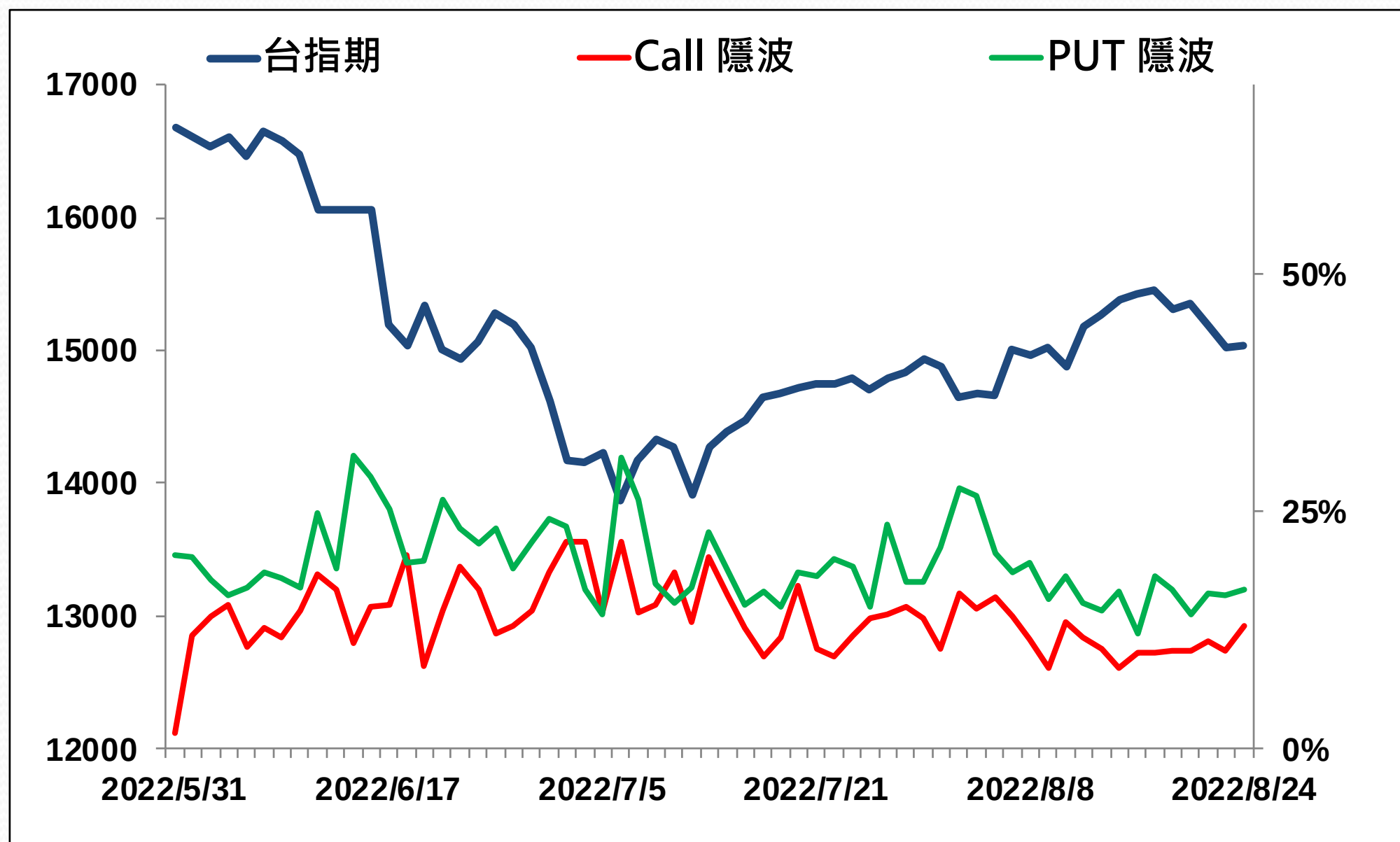
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



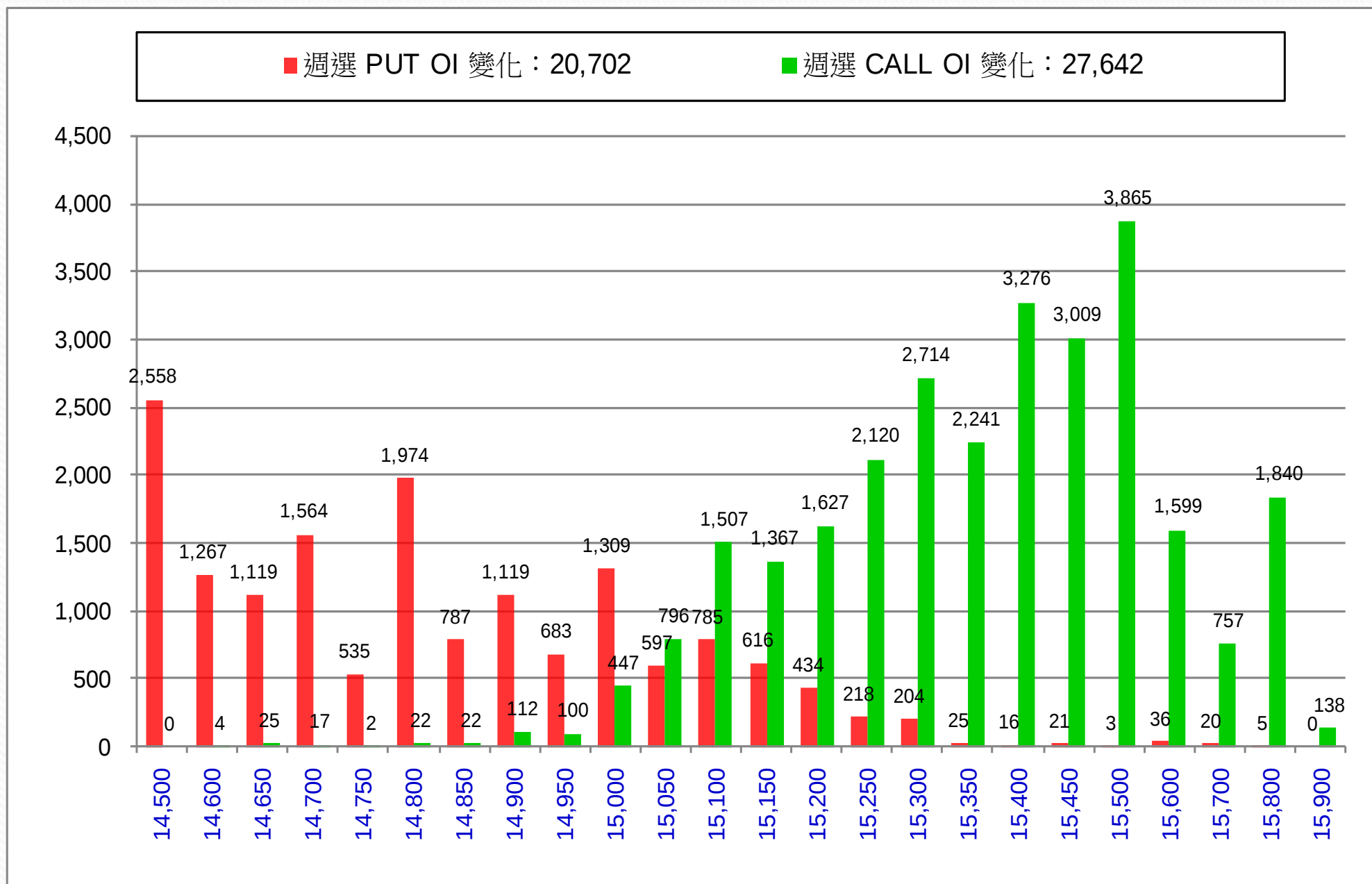
更新日期：2022年8月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年8月24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

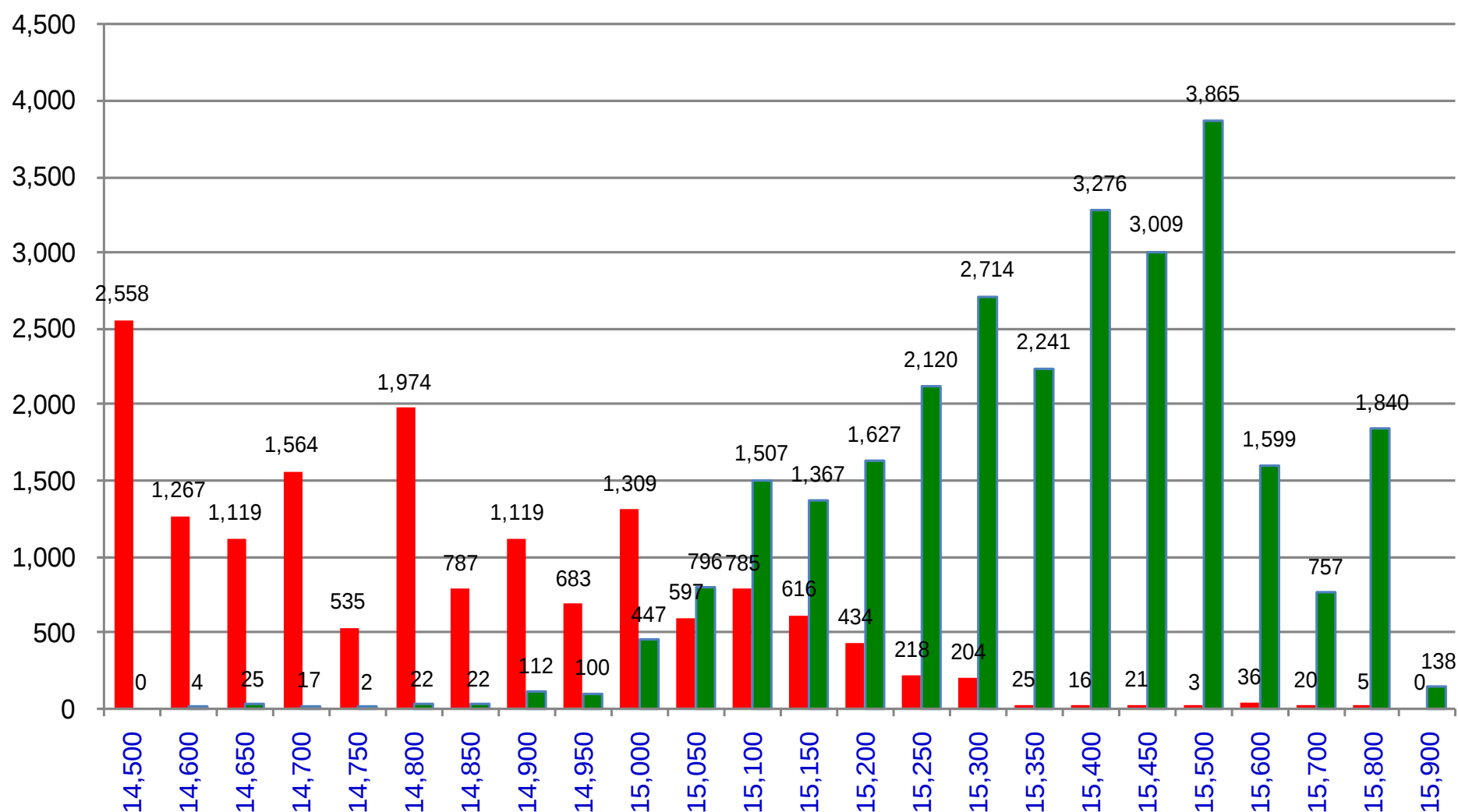


更新日期：2022年8月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：20,702

週選 CALL OI 總額：27,642



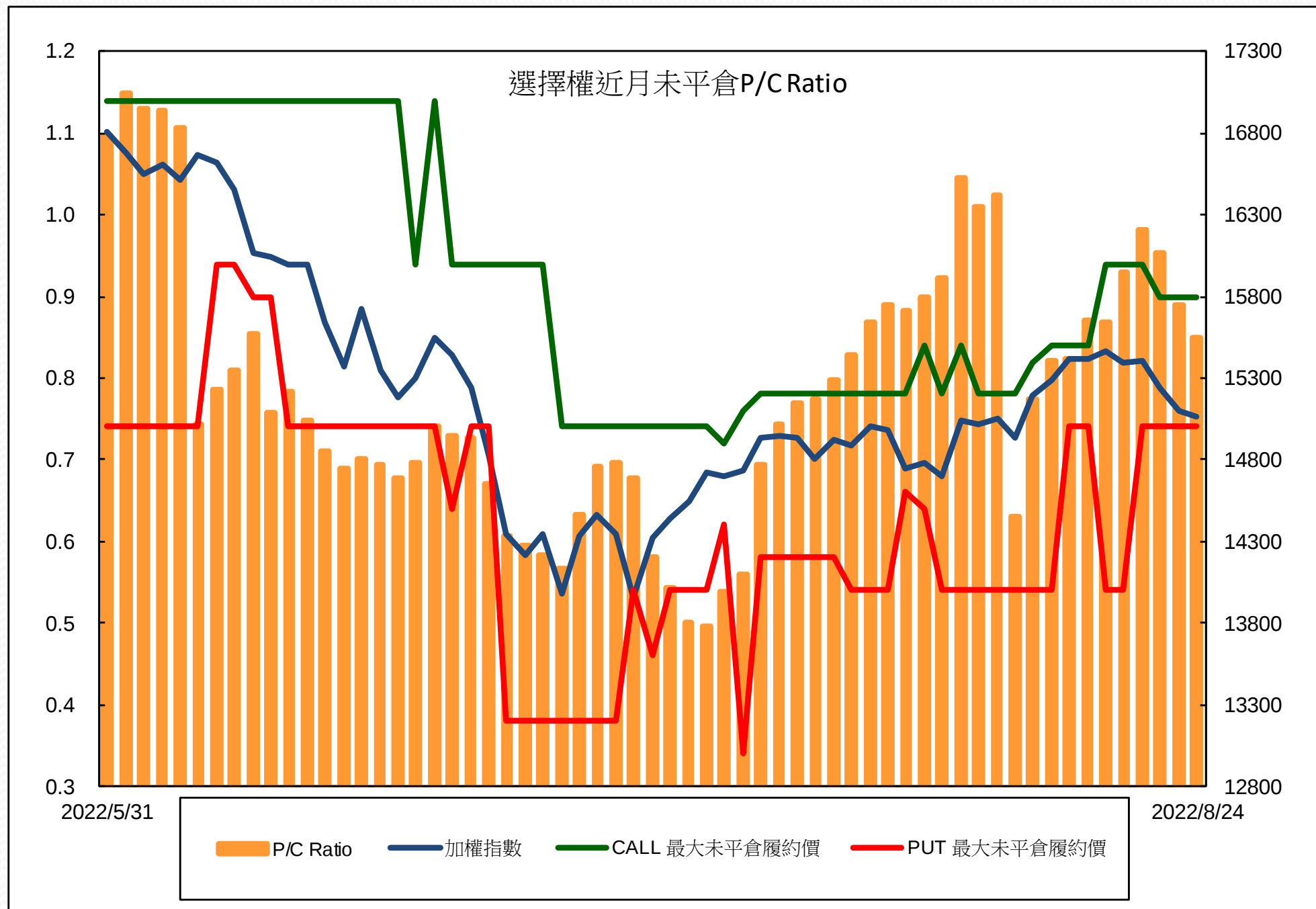
更新日期：2022年8月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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23日	53,519	65,240	-11,721
	8月24日	52,156	46,933	5,223
Put	8月23日	48,776	34,191	14,585
	8月24日	37,630	22,954	14,676

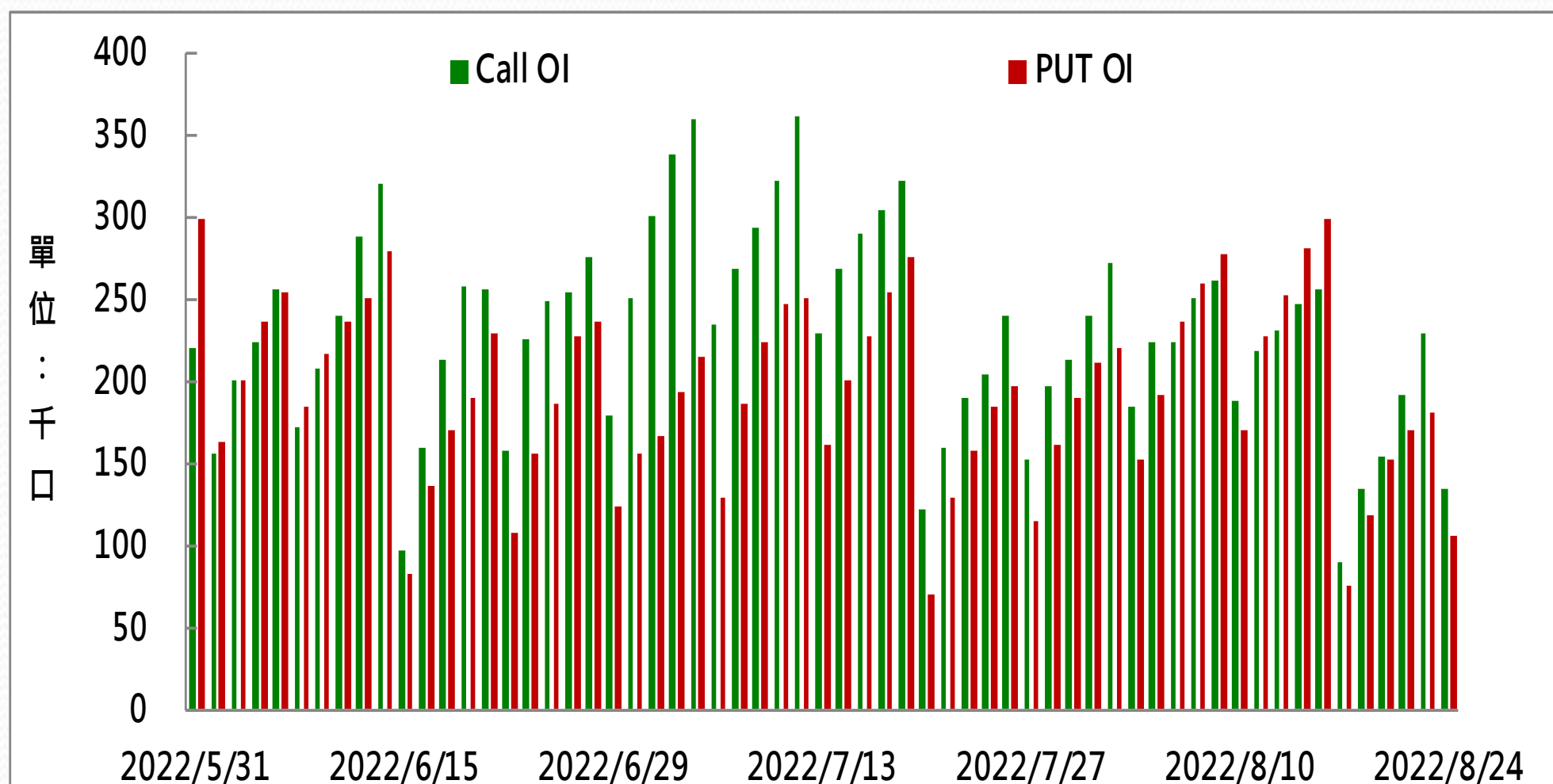
更新日期：2022年8月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年8月24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24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8月24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