

台指選擇權OI匯報

日期：2022/8/25 結算日：2022/8/31						日期：2022/8/25 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	
13	30	14,700	3,128	1,564		0	57	14,200	3,569	258	
0	2	14,750	2,549	2,014		0	34	14,300	3,317	-35	
30	52	14,800	5,528	3,554		1	102	14,400	3,533	71	
55	77	14,850	3,402	2,615		-15	96	14,500	4,676	426	
22	134	14,900	4,967	3,848		0	325	14,600	2,500	-101	
190	290	14,950	4,021	3,338		-12	349	14,700	3,956	302	
275	722	15,000	6,048	4,739	※	-3	1,225	14,800	2,706	315	
162	958	15,050	3,383	2,786		7	475	14,900	3,267	431	
-86	1,421	15,100	3,422	2,637		136	2,327	15,000	6,962	684	
761	2,128	15,150	2,240	1,624		-76	1,341	15,100	2,037	178	
1,650	3,277	15,200	2,999	2,565	※	479	2,646	15,200	1,478	59	
1,206	3,326	15,250	1,165	947		-42	3,546	15,300	702	18	
4,165	6,879	15,300	941	737		-192	4,128	15,400	956	2	
2,270	4,511	15,350	401	376		121	4,356	15,500	357	28	
4,414	7,690	15,400	198	182		148	5,550	15,600	223	3	
※ 4,991	8,000	15,450	49	28		310	7,015	15,700	53	10	
4,802	8,667	15,500	66	63		-84	7,064	15,800	266	1	
1,924	3,523	15,600	41	5		139	6,584	15,900	42	2	
608	1,365	15,700	62	42		-66	6,822	16,000	411	5	
211	2,051	15,800	5	0		52	3,966	16,100	7	0	
23	161	15,900	0	0		7	3,571	16,200	100	1	
5	40	16,000	0	0		82	2,044	16,300	72	0	
1	1	16,100	0	0		197	1,557	16,400	81	0	
0	0	16,200	0	0		15	1,906	16,500	5	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	
27,695	55,337	1.1066	61,234	40,532		1,248	89,750	0.9070	81,405	6,258	
昨日 P/C	0.7489	今日增減變化		0.3577		昨日 P/C	0.8491	今日增減變化		0.0579	

更新日期：2022年8月25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25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	83,964,456	68,324,361	15,640,095	-5,315,438	4,223,324	424,582	3,798,742	202,848		
投信	25,661,572	46,523,356	-20,861,784	-182,645	508,936	0	508,936	5,177		
自營商	25,734,222	32,574,791	-6,840,569	1,287,055	714,180	1,141,566	-427,386	17,914		
	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	601,473	1,456,866	-855,393	10,967	45,834	63,576	-17,742	-6,002		
投信	107,916	0	107,916	802	0	0	0	0		
自營商	304,701	365,010	-60,309	-39,830	104,974	137,501	-32,527	-10,514		

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25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	17,942	8,757	9,185	621	23,472	10,289	13,183	539		
投信	0	100	-100	0	350	97	253	0		
自營商	58,507	49,747	8,760	3,537	48,187	27,781	20,406	5,730		
特定法人(週)	989	823	166	166	0	1,573	-1,573	-1,192		
特定法人(近月)	9,243	4,849	4,394	184	3,751	15,369	-11,618	-1,347		
特定法人(全月)	11,658	2,749	8,909	392	3,751	18,920	-15,169	-2,745		
十大交易人(週)	21,683	16,822	4,861	3,389	17,703	20,163	-2,460	-1,880		
十大交易人(近月)	47,644	42,067	5,577	406	29,845	45,743	-15,898	-647		
十大交易人(全月)	80,510	58,909	21,601	3,213	43,332	68,516	-25,184	-5,832		
全市場未沖銷(近月)			89,750	1,248			81,405	6,258		
全市場未沖銷(全月)			164,552	29,823			153,924	47,086		

更新日期：2022年8月25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	15300	買權OI最大量	15500
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	12.65%	較前一交易日	-0.87%
	買權隱含波動率	11.86%	較前一交易日	-0.81%
	賣權隱含波動率	13.35%	較前一交易日	-1.17%
電子選擇權	買權成交最大量	725	買權OI最大量	725
	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	1660	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25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	17.02%	較前一交易日	+0.51%
	買權隱含波動率	13.38%	較前一交易日	-0.21%
	賣權隱含波動率	20.02%	較前一交易日	-2.02%
	成交量P/C_Ratio值	1.131	較前一交易日	+0.38
	未平倉P/C_Ratio值	0.907	較前一交易日	+0.06
電子選擇權	買權成交最大量	725	買權OI最大量	725
	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	1660	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25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

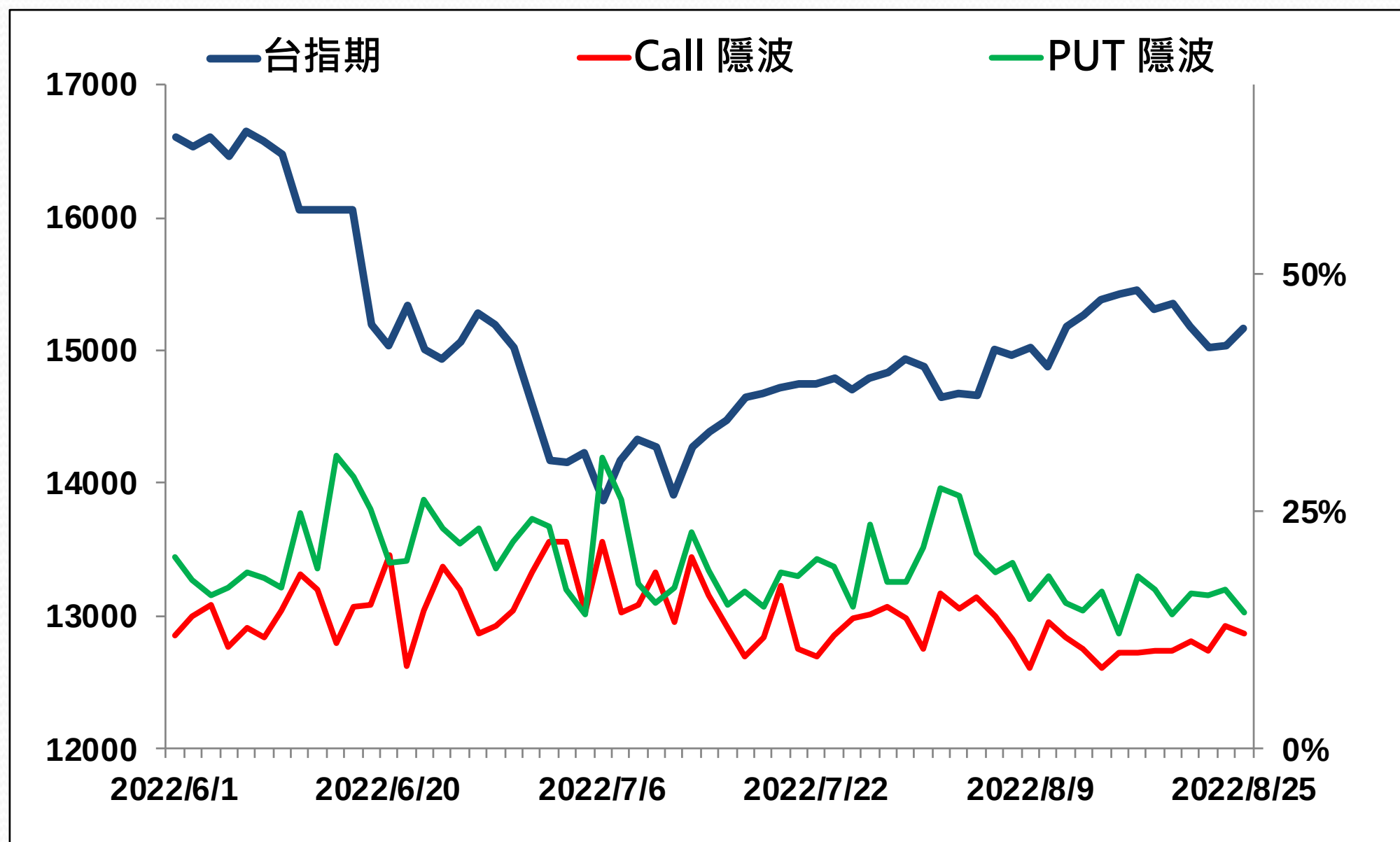
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



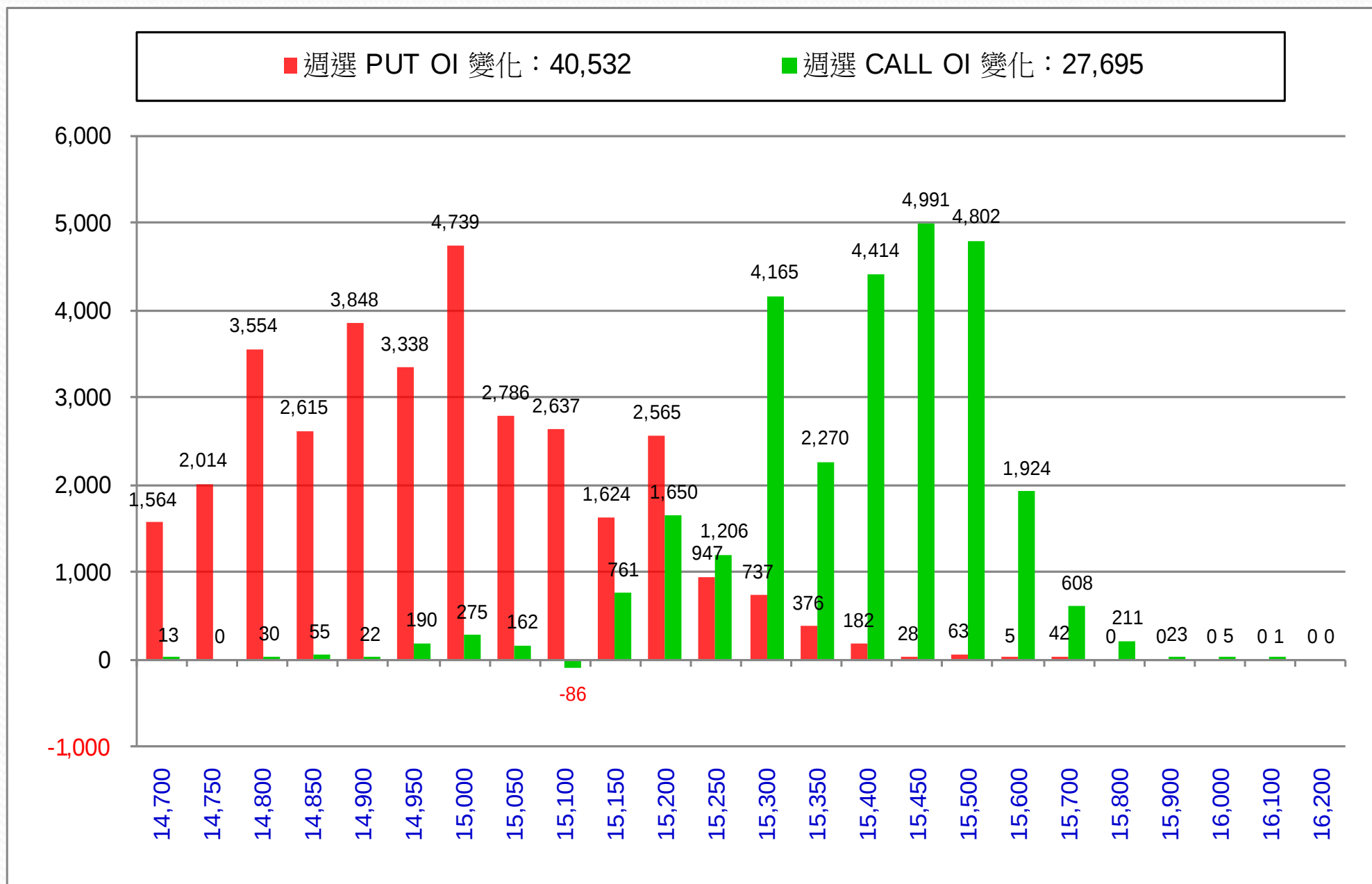
更新日期：2022年8月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年8月25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

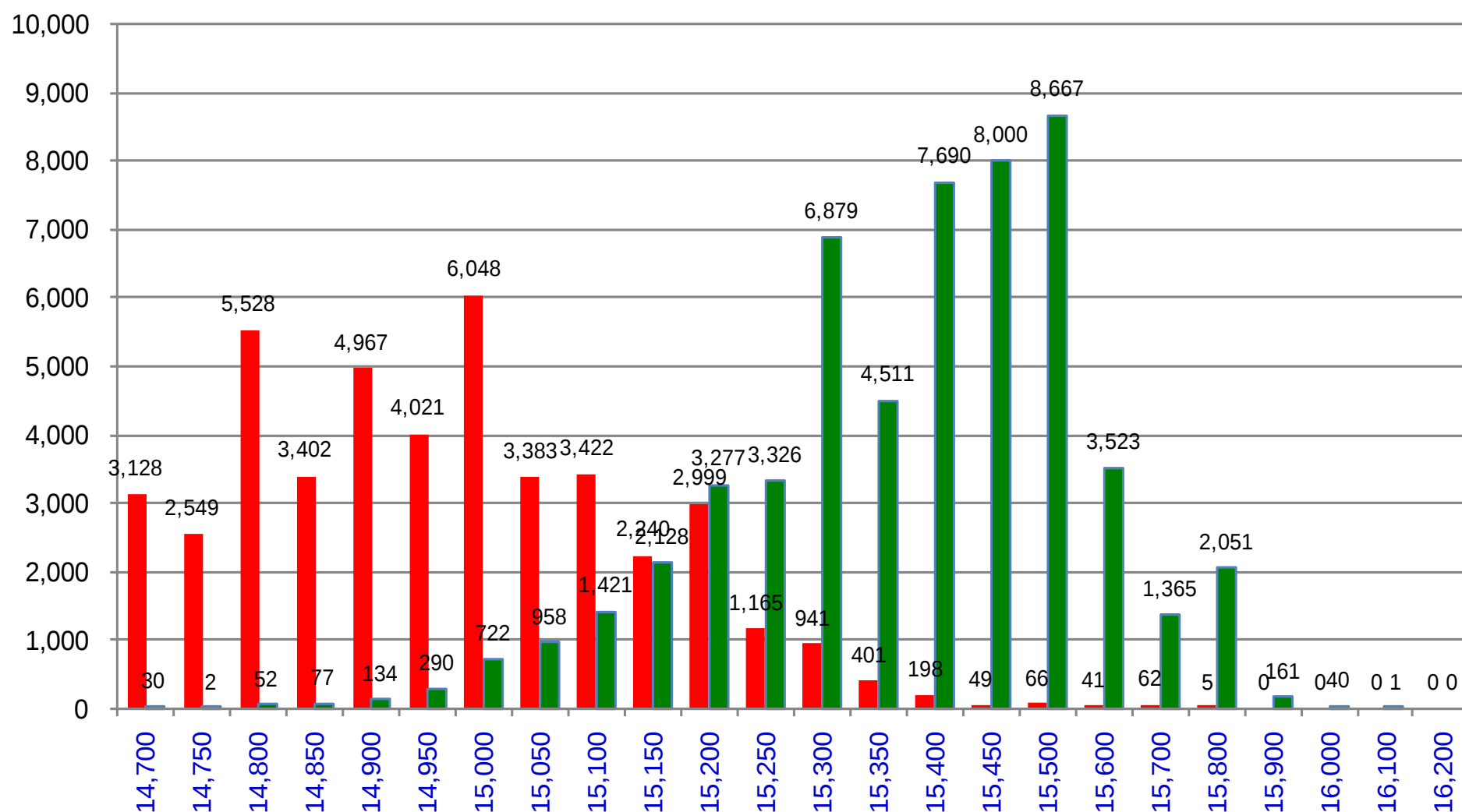


更新日期：2022年8月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：61,234

週選 CALL OI 總額：55,337



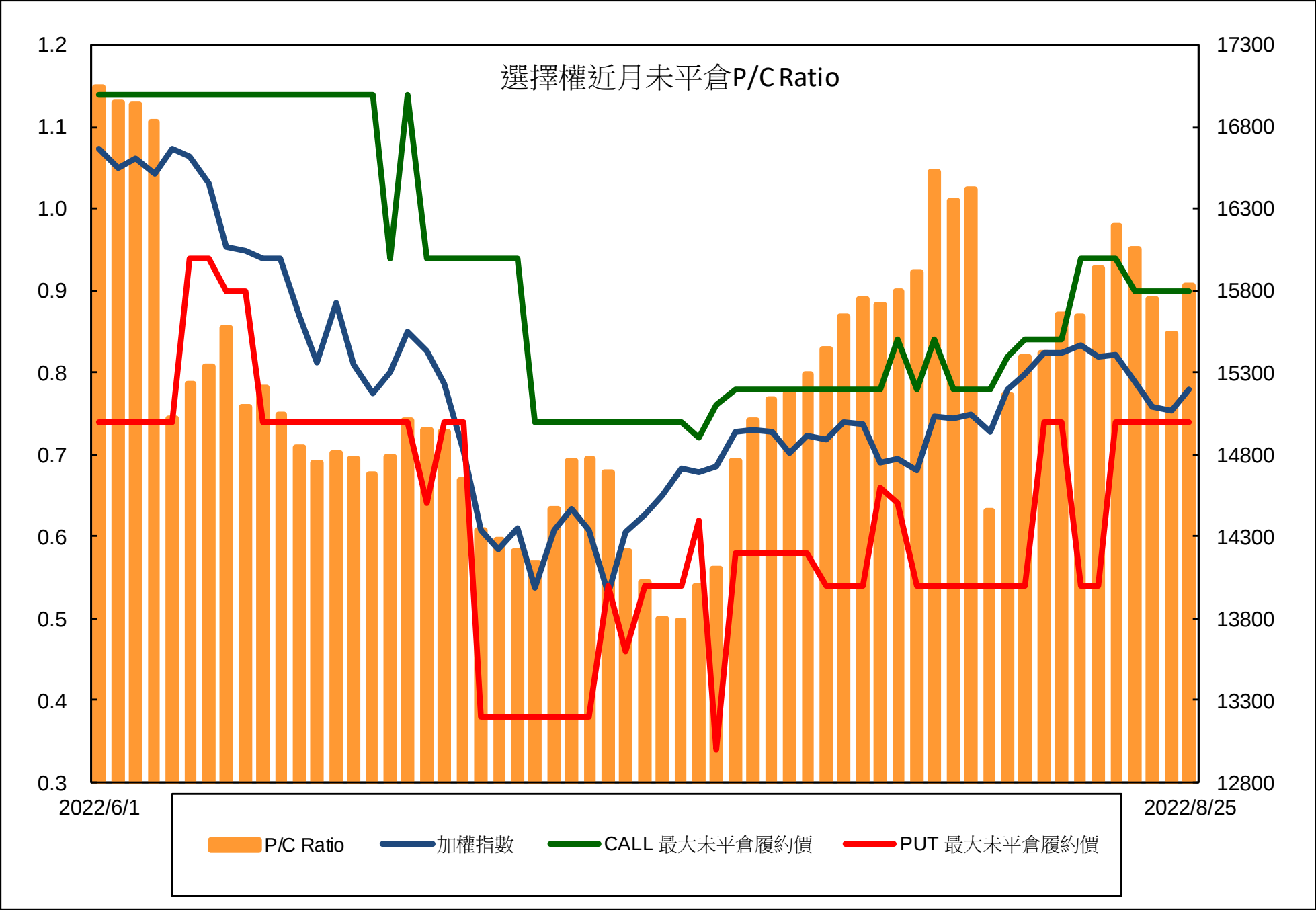
更新日期：2022年8月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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24日	52,156	46,933	5,223
	8月25日	58,507	49,747	8,760
Put	8月24日	37,630	22,954	14,676
	8月25日	48,187	27,781	20,406

更新日期：2022年8月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

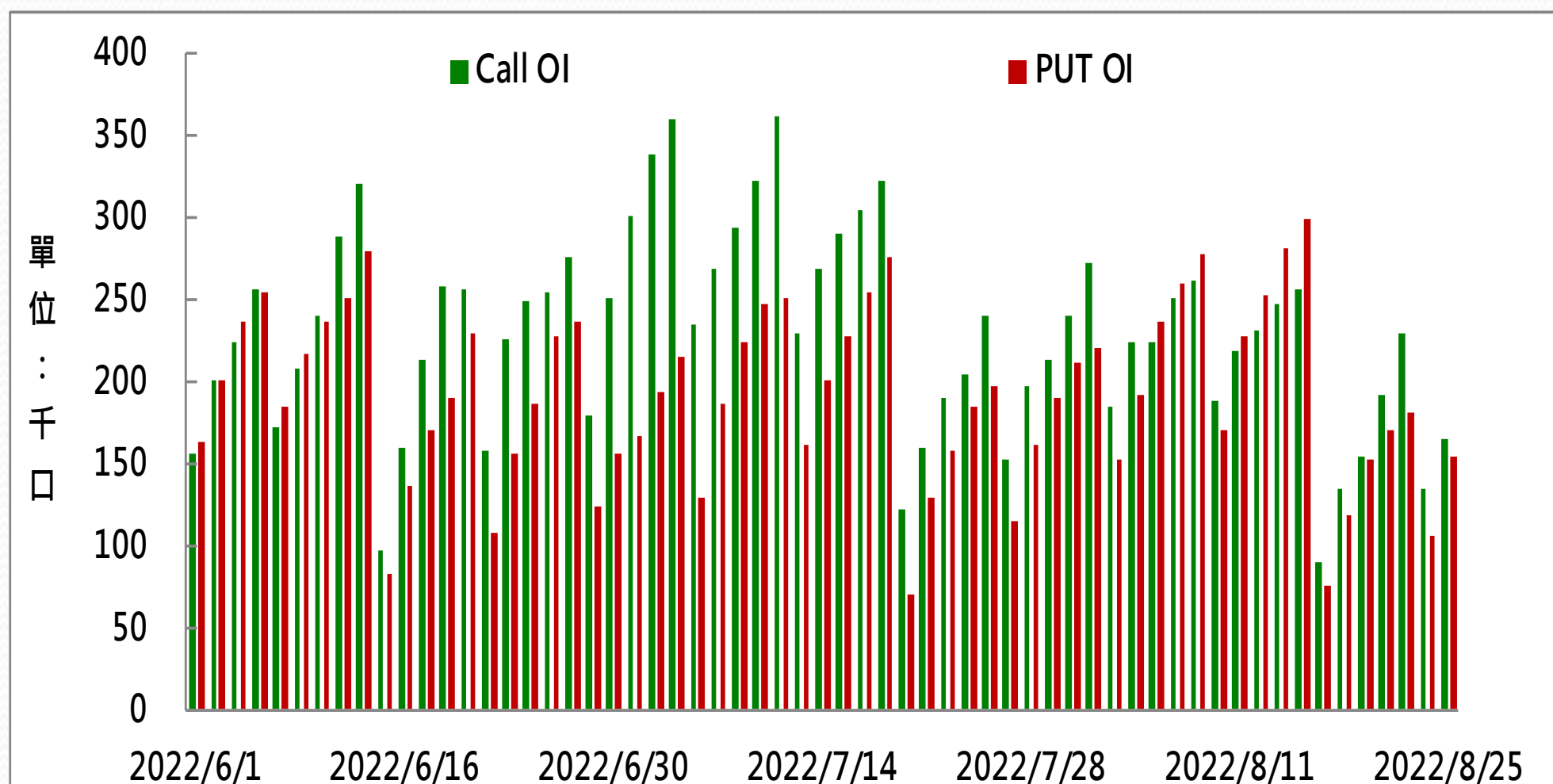
選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年8月25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25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25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