

台指選擇權OI匯報

日期：2022/8/26 結算日：2022/8/31					日期：2022/8/26 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
-3	49	14,800	7,171	1,643	0	34	14,300	3,623	306
-9	68	14,850	4,415	1,013	1	103	14,400	3,708	175
-22	112	14,900	5,952	985	0	96	14,500	4,755	79
-36	254	14,950	4,454	433	0	325	14,600	2,281	-219
10	732	15,000	8,761	2,713	4	353	14,700	3,874	-82
-232	726	15,050	4,727	1,344	-1	1,224	14,800	3,015	309
-83	1,338	15,100	6,010	2,588	10	485	14,900	3,671	404
-215	1,913	15,150	3,958	1,718	-67	2,260	15,000	7,968	1,006
-686	2,591	15,200	5,559	2,560	-69	1,272	15,100	2,591	554
19	3,345	15,250	3,272	2,107	-353	2,293	15,200	1,942	464
-283	6,596	15,300	3,596	2,655	-157	3,389	15,300	1,083	381
614	5,125	15,350	1,412	1,011	-217	3,911	15,400	1,147	191
1,946	9,636	15,400	986	788	479	4,835	15,500	501	144
623	8,623	15,450	194	145	-684	4,866	15,600	262	39
3,940	12,607	15,500	377	311	122	7,137	15,700	53	0
2,390	2,390	15,550	90	90	469	7,533	15,800	293	27
2,186	5,709	15,600	131	90	170	6,754	15,900	49	7
398	398	15,650	0	0	457	7,279	16,000	411	0
990	2,355	15,700	91	29	19	3,985	16,100	15	8
246	2,297	15,800	5	0	46	3,617	16,200	95	-5
34	195	15,900	1	1	-39	2,005	16,300	72	0
9	49	16,000	0	0	71	1,628	16,400	81	0
28	29	16,100	0	0	34	1,940	16,500	5	0
0	0	16,200	0	0	25	1,240	16,600	44	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
11,882	67,219	1.2518	84,147	22,913	370	90,120	0.9442	85,089	3,684
昨日 P/C	1.1066	今日增減變化		0.1452	昨日 P/C	0.9070	今日增減變化		0.0372

更新日期：2022年8月26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26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	79,617,576	59,792,203	19,825,373	4,185,278	4,079,361	525,822	3,553,539	-245,203		
投信	24,973,903	46,250,339	-21,276,436	-414,652	539,957	0	539,957	31,021		
自營商	25,997,014	34,588,531	-8,591,517	-1,750,948	531,447	1,204,264	-672,817	-245,431		
	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	596,850	1,570,909	-974,059	-118,666	46,057	53,485	-7,428	10,314		
投信	108,229	0	108,229	313	0	0	0	0		
自營商	305,590	361,293	-55,703	4,606	87,656	138,170	-50,514	-17,987		

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26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	19,023	8,468	10,555	1,370	24,989	10,623	14,366	1,183		
投信	0	100	-100	0	350	97	253	0		
自營商	63,306	49,904	13,402	4,642	47,701	34,274	13,427	-6,979		
特定法人(週)	1,409	851	558	392	0	2,299	-2,299	-726		
特定法人(近月)	9,243	4,849	4,394	0	5,235	15,319	-10,084	1,534		
特定法人(全月)	13,067	2,749	10,318	1,409	3,928	19,837	-15,909	-740		
十大交易人(週)	24,639	17,769	6,870	2,009	24,704	20,911	3,793	6,253		
十大交易人(近月)	48,907	41,482	7,425	1,848	31,781	46,055	-14,274	1,624		
十大交易人(全月)	83,809	59,326	24,483	2,882	52,435	68,423	-15,988	9,196		
全市場未沖銷(近月)			90,120	370			85,089	3,684		
全市場未沖銷(全月)			177,102	12,550			181,538	27,614		

更新日期：2022年8月26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	15200	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	12.04%	較前一交易日	-0.61%
	買權隱含波動率	10.61%	較前一交易日	-1.25%
	賣權隱含波動率	13.19%	較前一交易日	-0.16%
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	700	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	1660
	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年8月26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	16.66%	較前一交易日	+0.36%
	買權隱含波動率	12.96%	較前一交易日	-0.42%
	賣權隱含波動率	19.90%	較前一交易日	-0.12%
	成交量P/C_Ratio值	0.975	較前一交易日	-0.16
	未平倉P/C_Ratio值	0.944	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	700	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	1660
	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1560

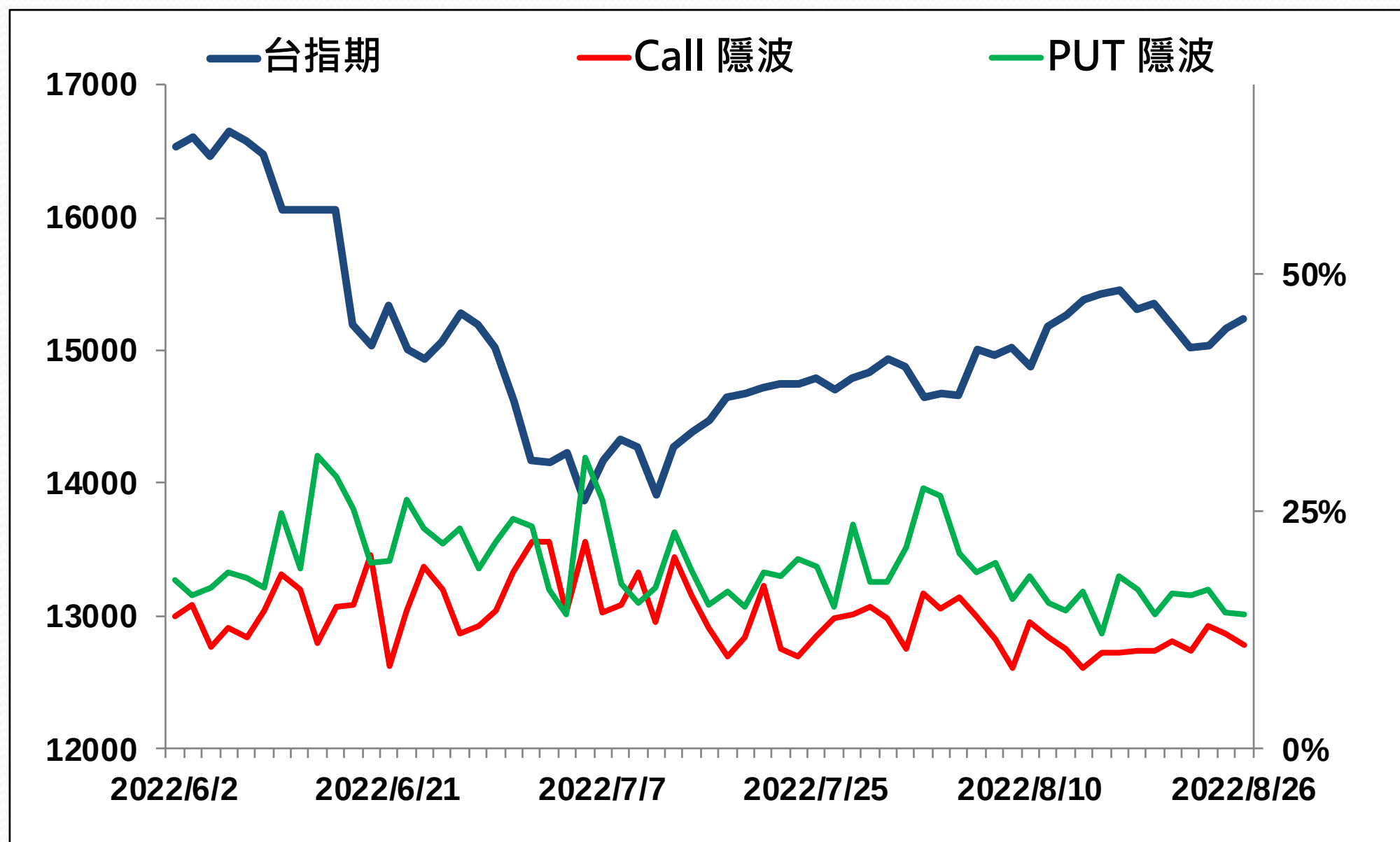
更新日期：2022年8月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



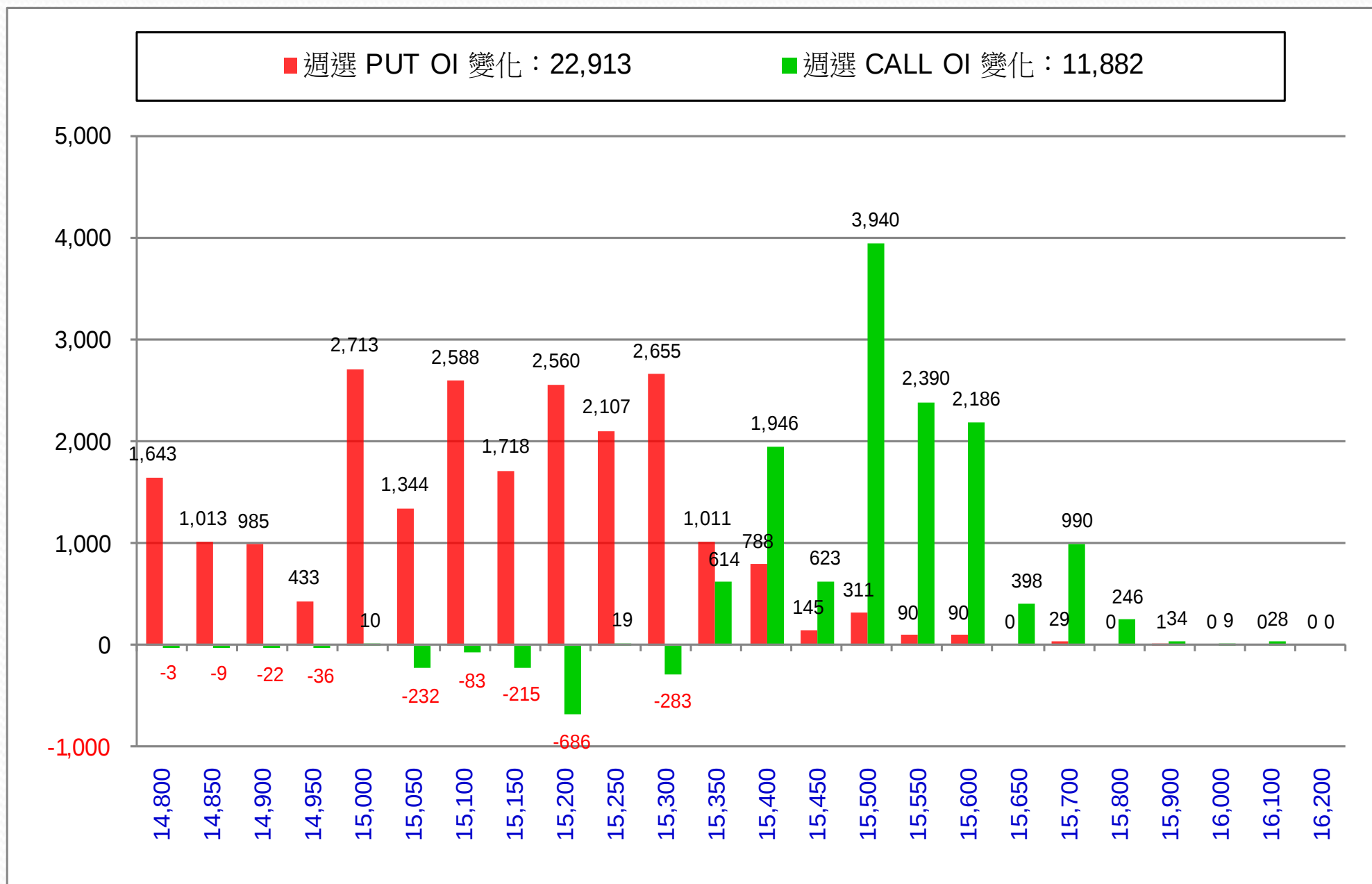
更新日期：2022年8月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年8月26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

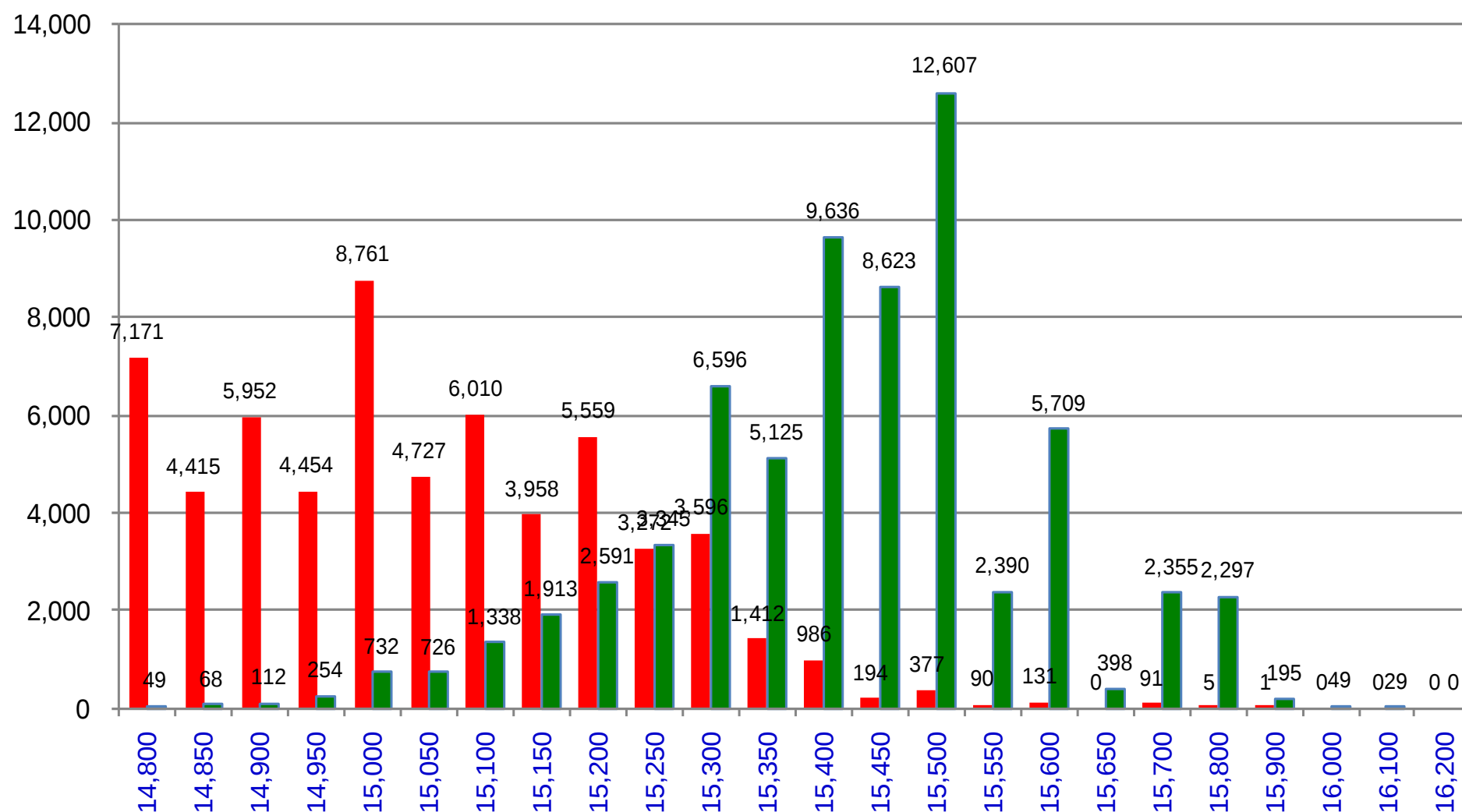


更新日期：2022年8月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：84,147

週選 CALL OI 總額：67,219



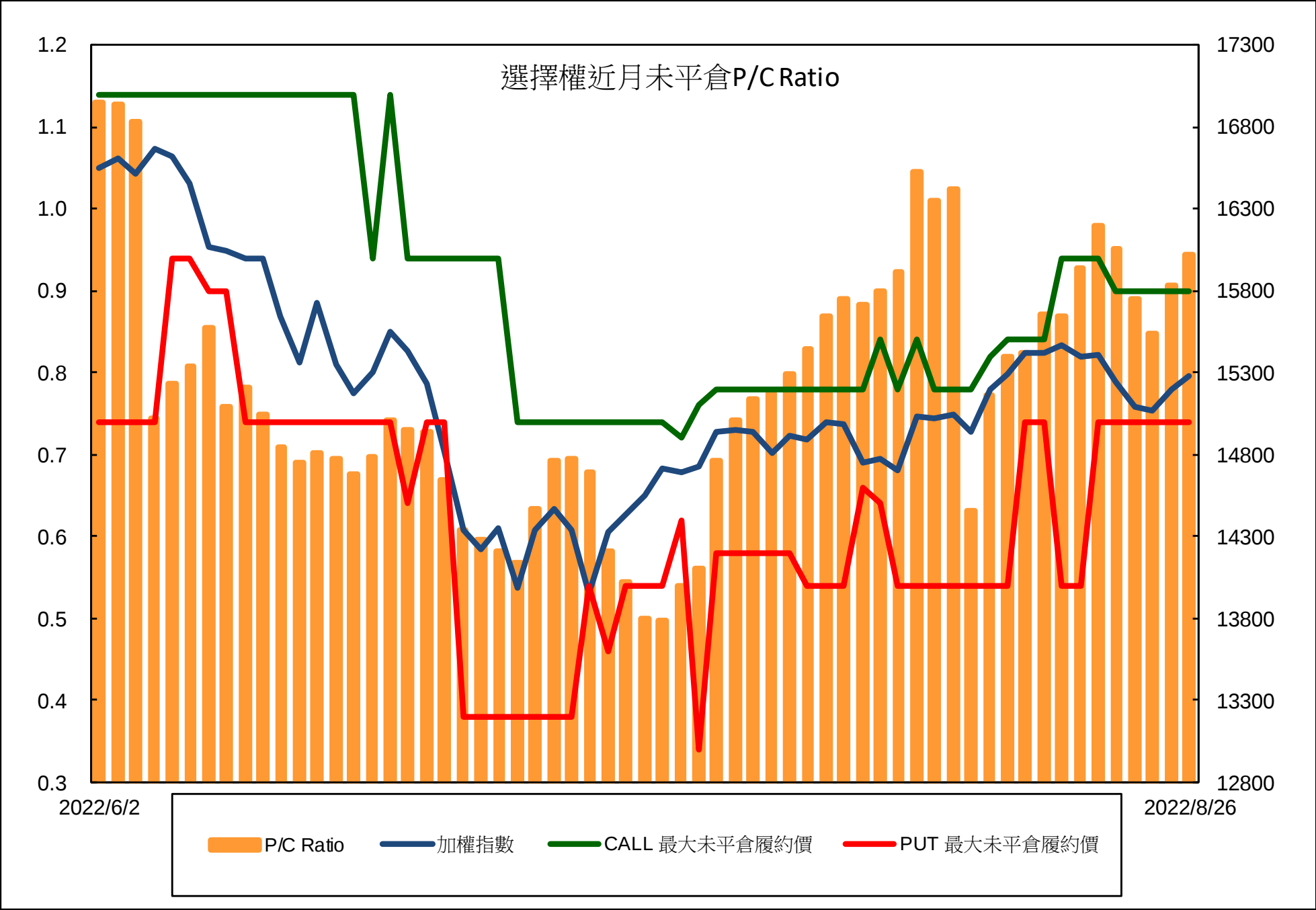
更新日期：2022年8月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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25日	58,507	49,747	8,760
	8月26日	63,306	49,904	13,402
Put	8月25日	48,187	27,781	20,406
	8月26日	47,701	34,274	13,427

更新日期：2022年8月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

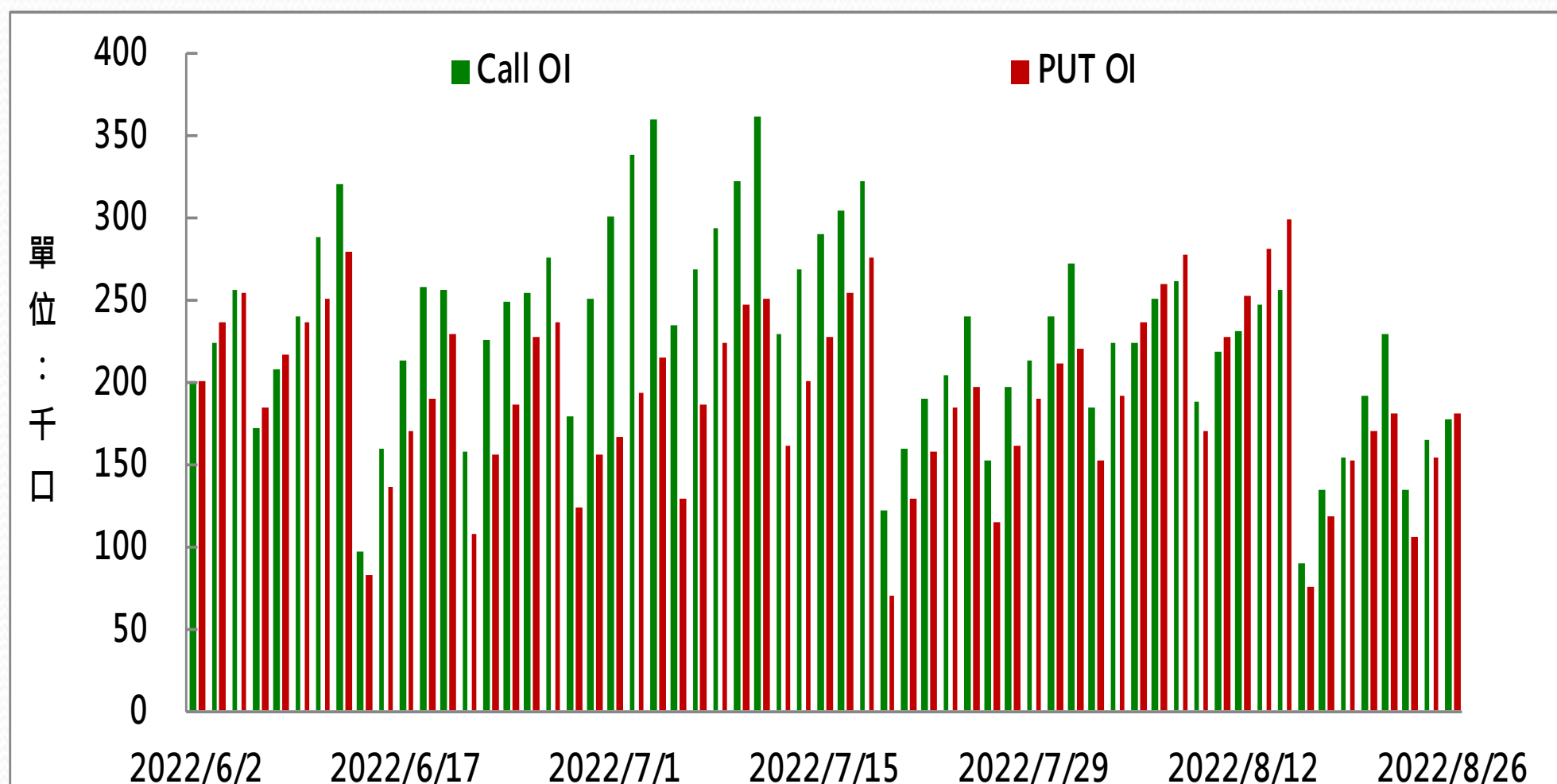
選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年8月26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26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26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