

台指選擇權OI匯報

日期：2022/8/29 結算日：2022/8/31					日期：2022/8/29 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
2	2	14,300	3,084	1,728	0	8	13,900	2,331	314
2	3	14,400	4,262	2,268	-1	25	14,000	5,263	530 ※
16	16	14,500	7,620	4,325 ※	1	121	14,100	1,967	234
52	56	14,600	6,803	2,056	16	73	14,200	4,023	327
65	90	14,650	4,726	2,527	4	38	14,300	3,160	-463
123	153	14,700	6,315	3,440	4	107	14,400	3,598	-110
296	298	14,750	5,493	2,638	11	107	14,500	4,301	-454
1,408	1,457	14,800	7,797	626	45	370	14,600	2,303	22
2,356	2,424	14,850	5,484	1,069	52	405	14,700	3,548	-326
8,288	8,400	14,900	7,434	1,482	202	1,426	14,800	3,359	344
4,279	4,533	14,950	4,982	528	209	694	14,900	3,509	-162
8,201	8,933	15,000	7,241	-1,520	605	2,865	15,000	7,297	-671
5,070	5,796	15,050	3,276	-1,451	868	2,140	15,100	2,289	-302
12,393	13,731	15,100	3,902	-2,108	906	3,199	15,200	1,798	-144
8,839	10,752	15,150	3,098	-860	1,188	4,577	15,300	742	-341
6,758	9,349	15,200	4,388	-1,171	※ 1,736	5,647	15,400	1,022	-125
4,350	7,695	15,250	2,292	-980	1,381	6,216	15,500	428	-73
※ 13,997	20,593	15,300	2,525	-1,071	1,283	6,149	15,600	258	-4
2,195	7,320	15,350	915	-497	-742	6,395	15,700	50	-3
-382	9,254	15,400	417	-569	-86	7,447	15,800	263	-30
-2,567	6,056	15,450	291	97	-391	6,363	15,900	46	-3
-3,601	9,006	15,500	218	-159	799	8,078	16,000	409	-2
164	2,554	15,550	96	6	-223	3,762	16,100	13	-2
-161	5,548	15,600	125	-6	-283	3,334	16,200	95	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
73,257	140,476	0.7116	99,967	15,820	6,520	96,640	0.8746	84,519	-570
昨日 P/C	1.2518	今日增減變化	-0.3950		昨日 P/C	0.9442	今日增減變化	-0.0696	

更新日期：2022年8月29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29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	75,859,282	51,687,744	24,171,538	4,346,165	3,995,677	707,539	3,288,138	-265,401	
投信	24,061,752	48,298,380	-24,236,628	-2,960,192	523,798	0	523,798	-16,159	
自營商	26,603,272	29,113,444	-2,510,172	6,081,345	526,485	1,118,875	-592,390	80,427	
	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	569,838	1,662,678	-1,092,840	-118,781	70,805	60,690	10,115	17,543	
投信	106,162	0	106,162	-2,067	0	0	0	0	
自營商	363,759	279,455	84,304	140,007	96,815	122,825	-26,010	24,504	

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29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	24,226	11,651	12,575	2,020	29,838	13,073	16,765	2,399	
投信	0	100	-100	0	550	97	453	200	
自營商	68,888	82,506	-13,618	-27,020	52,615	36,639	15,976	2,549	
特定法人(週)	3,387	0	3,387	2,829	0	5,095	-5,095	-2,796	
特定法人(近月)	9,243	2,691	6,552	2,158	5,207	15,522	-10,315	-231	
特定法人(全月)	9,598	0	9,598	-720	3,812	19,783	-15,971	-62	
十大交易人(週)	44,963	56,449	-11,486	-18,356	29,750	26,139	3,611	-182	
十大交易人(近月)	51,164	43,301	7,863	438	31,724	45,419	-13,695	579	
十大交易人(全月)	101,897	96,813	5,084	-19,399	55,735	73,075	-17,340	-1,352	
全市場未沖銷(近月)			96,640	6,520			84,519	-570	
全市場未沖銷(全月)			259,446	82,344			197,557	16,019	

更新日期：2022年8月29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	15300
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	14800
	整體隱含波動率	17.21%	較前一交易日	+5.17%
	買權隱含波動率	12.64%	較前一交易日	+2.02%
	賣權隱含波動率	22.55%	較前一交易日	+9.36%
電子選擇權	買權成交最大量	720	買權OI最大量	760
	賣權成交最大量	650	賣權OI最大量	660
金融選擇權	買權成交最大量	1620	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年8月29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	15500	買權OI最大量	16000
	賣權成交最大量	14500	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	18.88%	較前一交易日	-2.23%
	買權隱含波動率	14.33%	較前一交易日	+1.37%
	賣權隱含波動率	24.72%	較前一交易日	+4.82%
	成交量P/C_Ratio值	0.756	較前一交易日	-0.22
	未平倉P/C_Ratio值	0.875	較前一交易日	-0.07
電子選擇權	買權成交最大量	720	買權OI最大量	760
	賣權成交最大量	650	賣權OI最大量	660
金融選擇權	買權成交最大量	1620	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年8月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

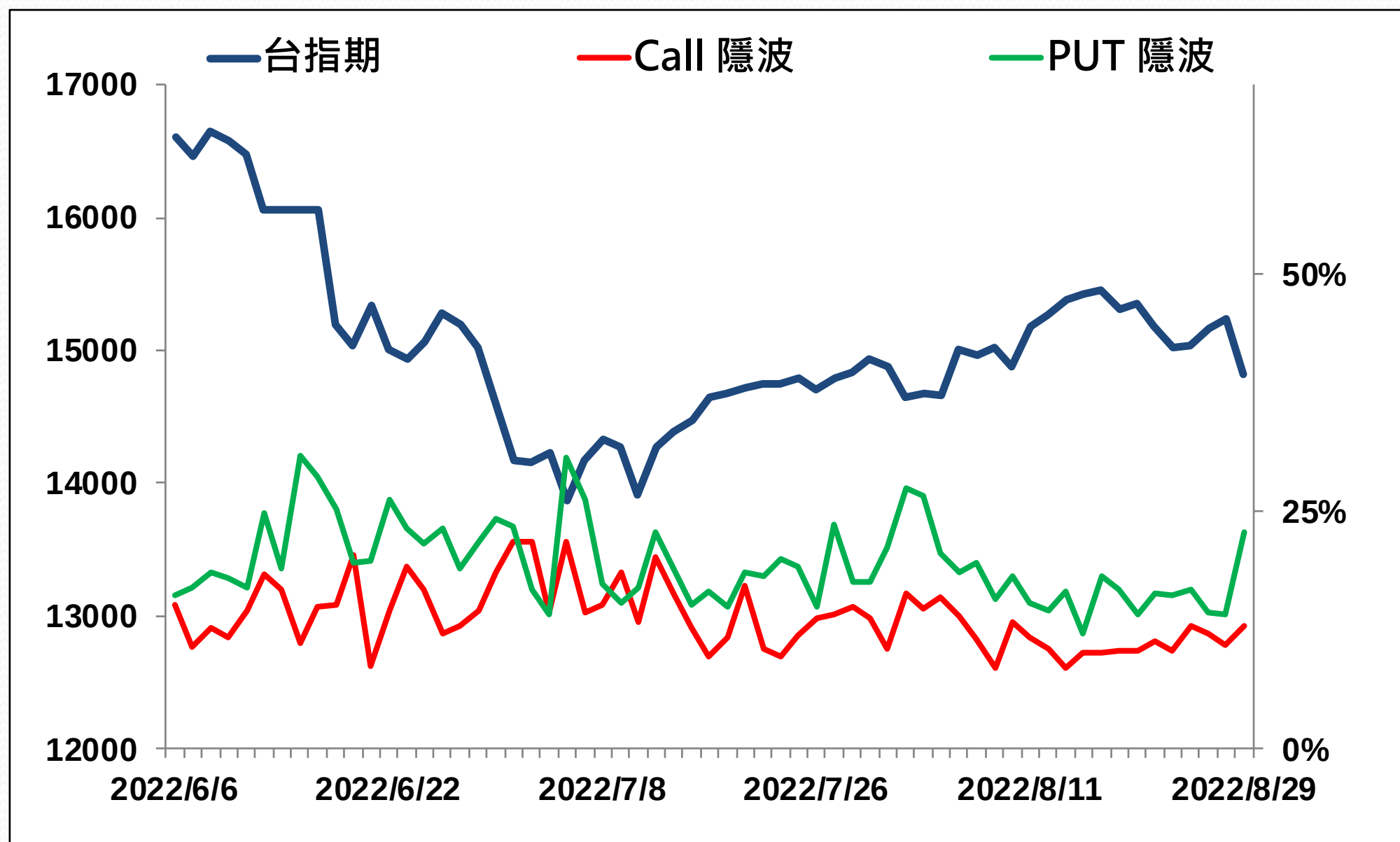
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



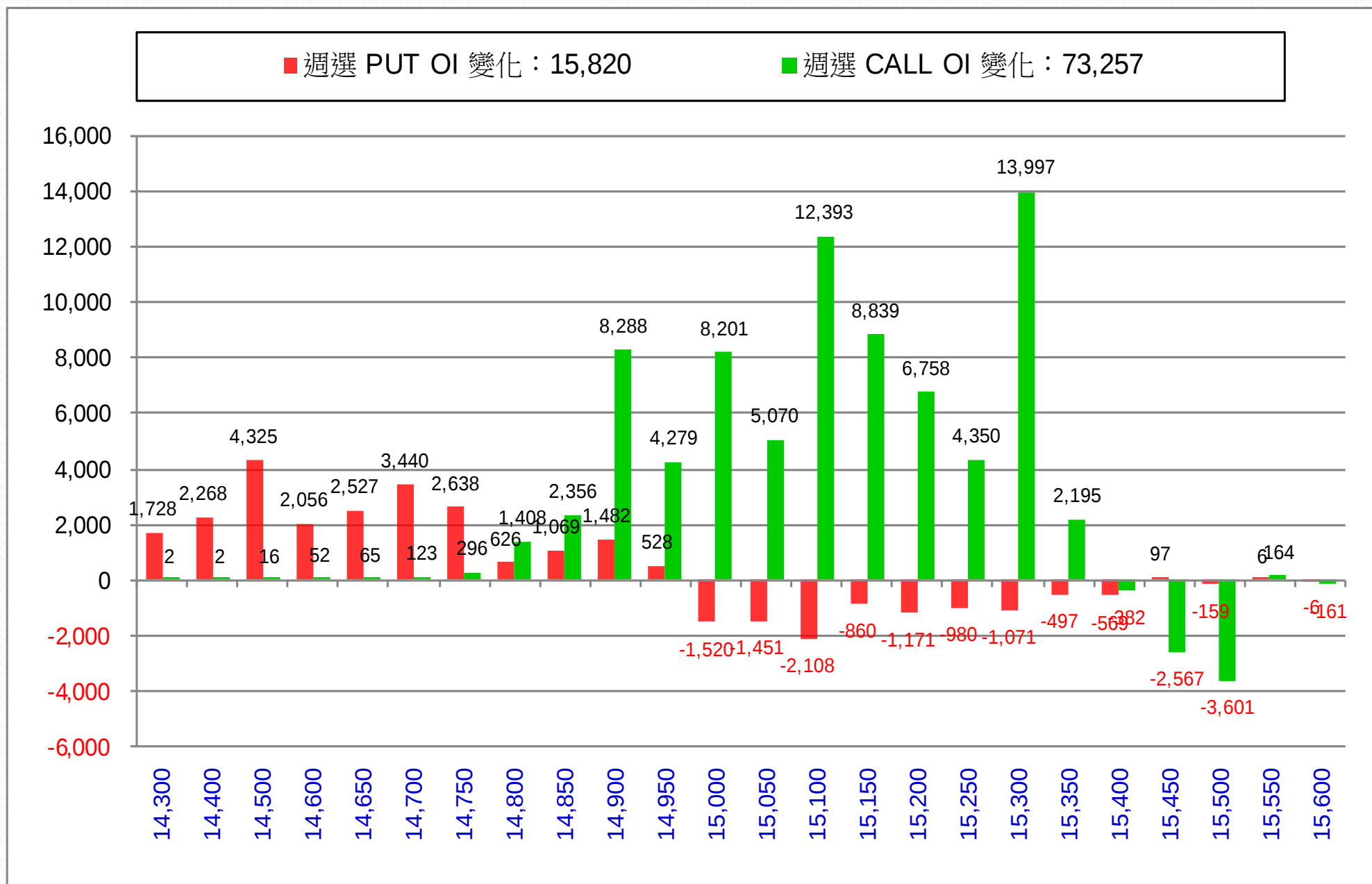
更新日期：2022年8月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年8月29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

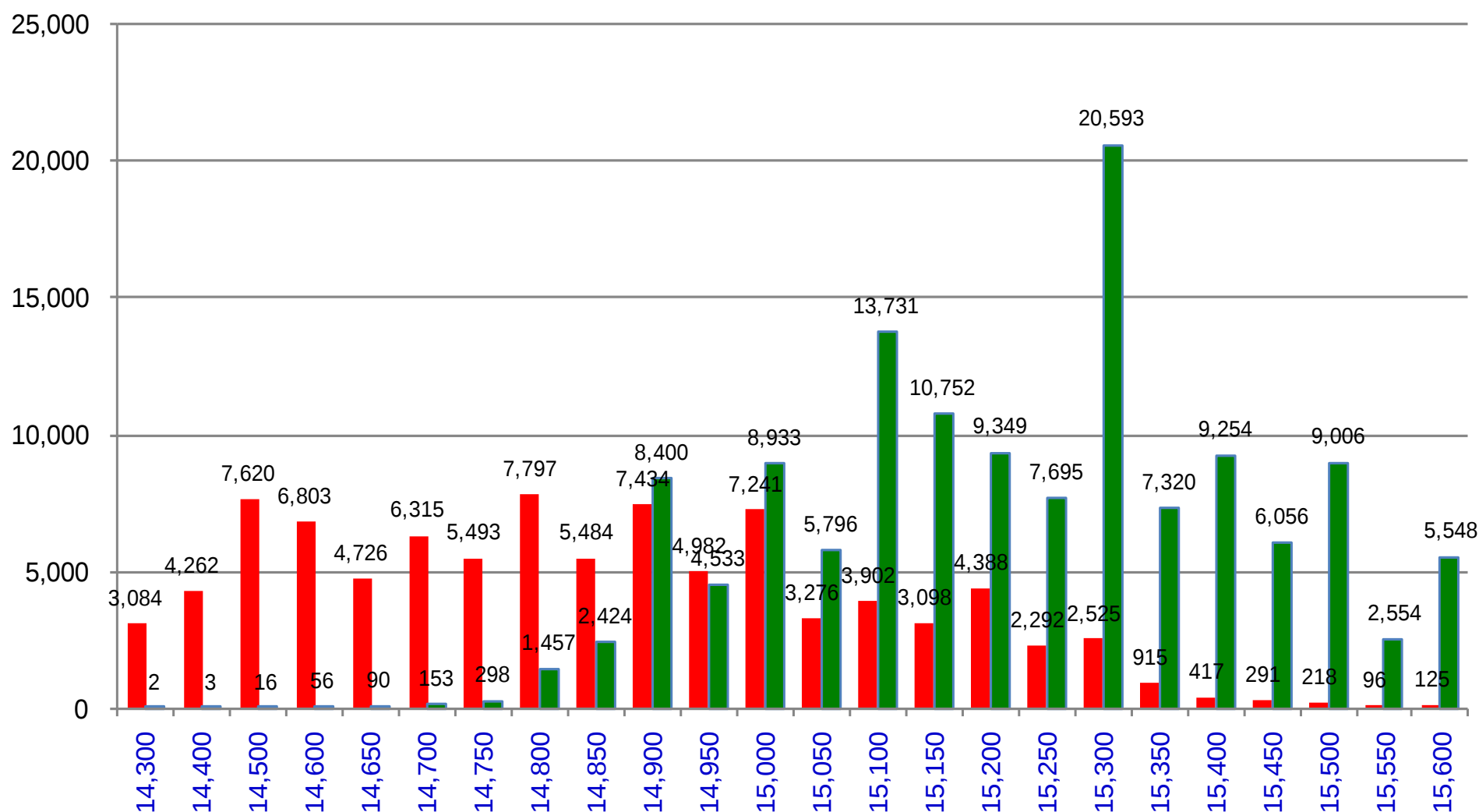


更新日期：2022年8月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：99,967

週選 CALL OI 總額：140,476



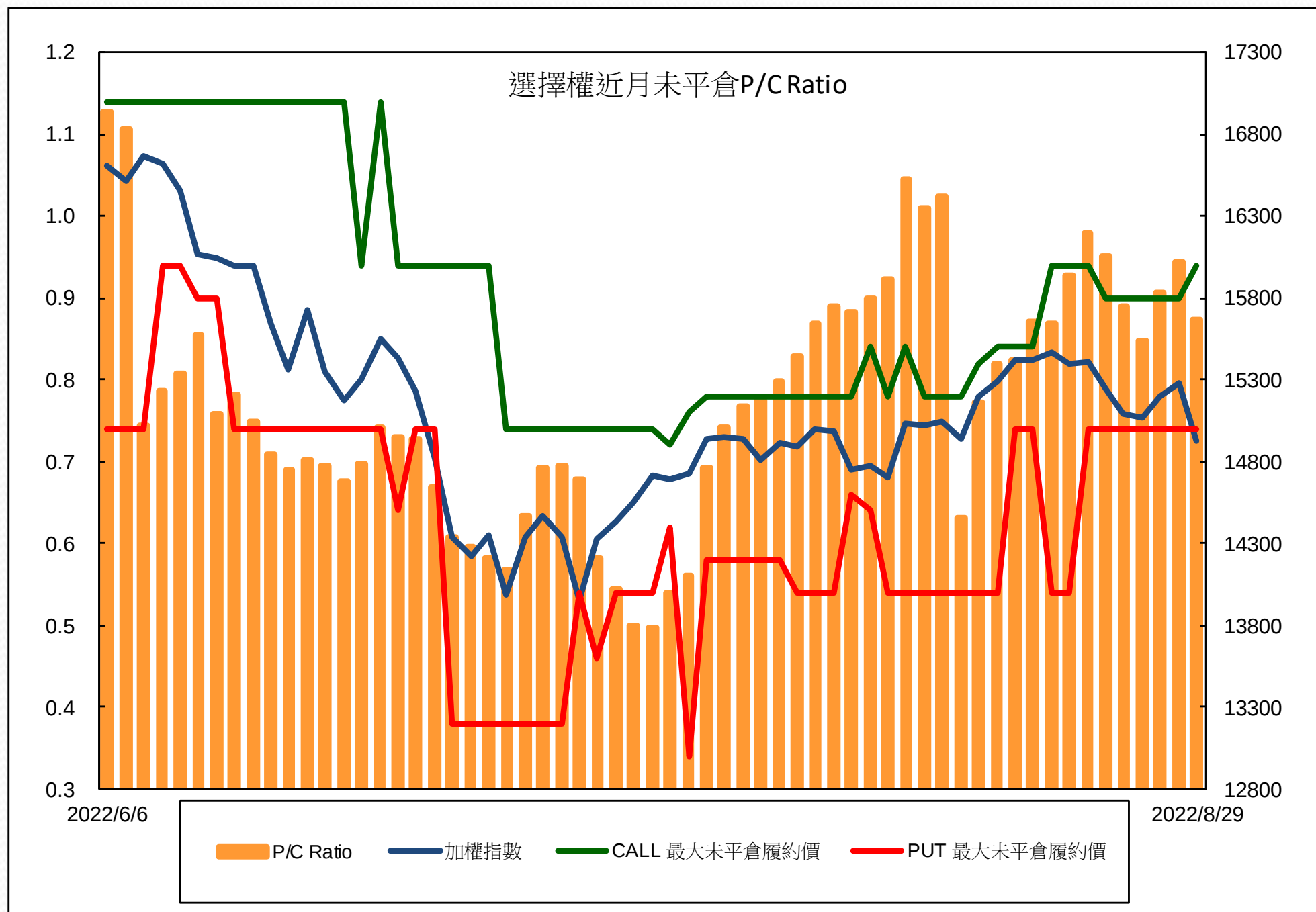
更新日期：2022年8月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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26日	63,306	49,904	13,402
	8月29日	68,888	82,506	-13,618
Put	8月26日	47,701	34,274	13,427
	8月29日	52,615	36,639	15,976

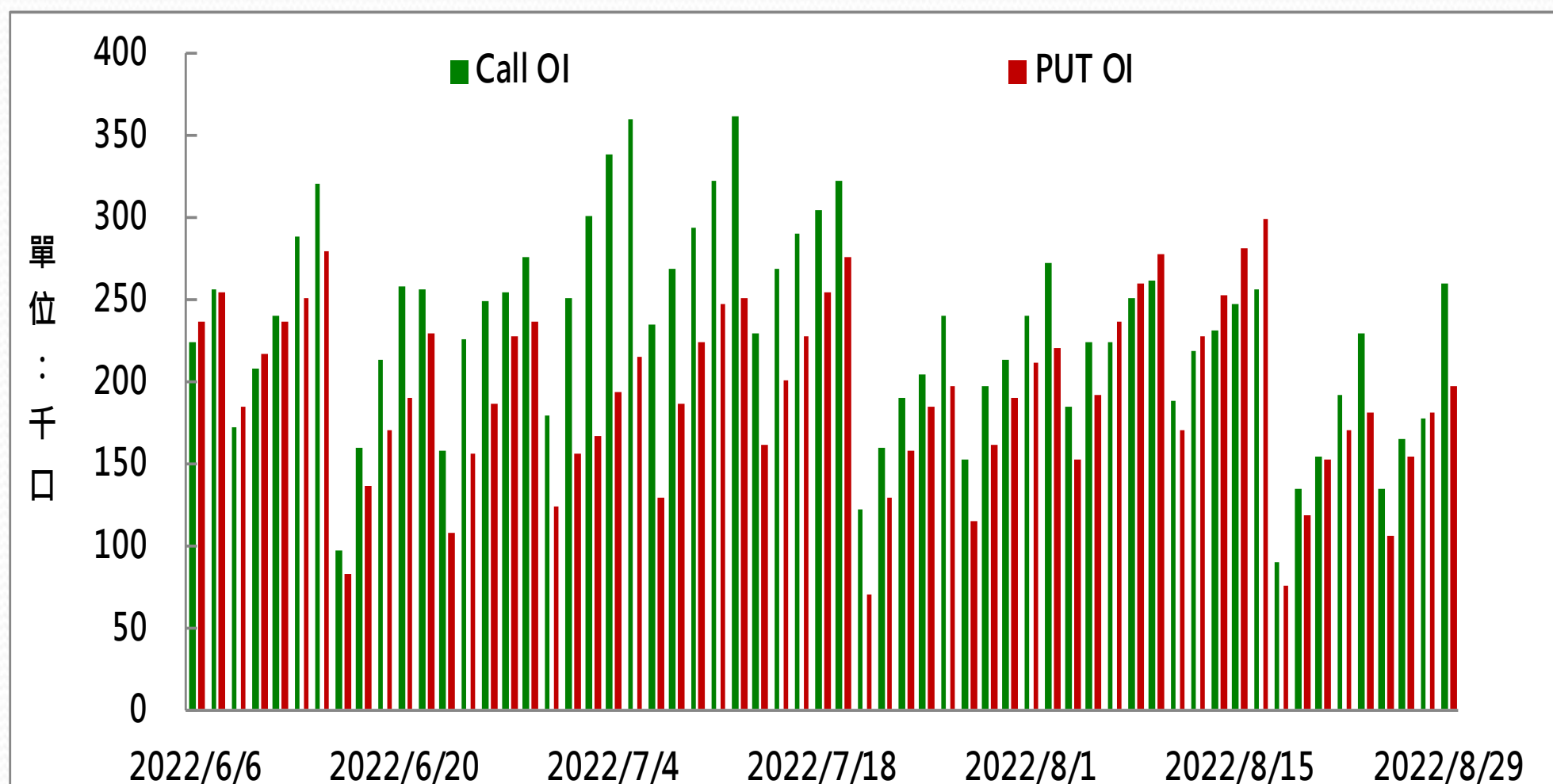
更新日期：2022年8月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年8月29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29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29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