

台指選擇權OI匯報

日期：2022/9/21 結算日：2022/9/28					日期：2022/9/21 結算日：2022/10/19				
202209W4					202210 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	13,500	1,338	1,338	0	1	13,200	975	200
5	5	13,600	817	817	0	0	13,300	1,140	191
0	0	13,700	1,092	1,092	0	0	13,400	1,189	251
21	21	13,800	963	963	3	15	13,500	1,974	468
2	2	13,900	1,451	1,451	0	12	13,600	1,393	409
31	31	14,000	1,847	1,847	-1	4	13,700	2,093	367
8	8	14,100	856	856	148	215	13,800	1,910	337
15	15	14,150	645	645	31	62	13,900	1,899	574
37	37	14,200	1,346	1,346	18	91	14,000	3,470	398
99	99	14,250	691	691	25	59	14,100	1,376	168
21	21	14,300	962	962	12	102	14,200	1,140	185
82	82	14,350	893	893	93	236	14,300	972	359
628	628	14,400	1,551	1,551	513	1,280	14,400	1,572	452
715	715	14,450	171	171	465	1,744	14,500	2,638	186
738	738	14,500	393	393	46	1,473	14,600	1,281	17
786	786	14,550	137	137	110	1,707	14,700	572	17
1,901	1,901	14,600	84	84	274	1,744	14,800	651	-2
926	926	14,650	36	36	133	1,325	14,900	113	-14
1,597	1,597	14,700	71	71	643	3,087	15,000	840	36
1,465	1,465	14,750	17	17	187	2,709	15,100	53	10
1,733	1,733	14,800	32	32	622	3,659	15,200	458	20
1,668	1,668	14,850	1	1	152	2,686	15,300	114	24
2,441	2,441	14,900	32	32	310	3,396	15,400	83	29
1,639	1,639	14,950	0	0	836	2,804	15,500	225	3
2,287	2,287	15,000	35	35	66	2,360	15,600	29	22
1,653	1,653	15,100	17	17	97	1,102	15,700	22	19
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
23,590	23,590	0.7741	18,261	18,261	5,764	49,303	0.7540	37,174	6,551
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化		0.7741	昨日 P/C	0.7033	今日增減變化		0.0506

更新日期：2022年9月21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9月21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	83,032,661	61,176,960	21,855,701	-16,301,425	3,802,302	629,748	3,172,554	26,811	
投信	24,075,017	48,622,714	-24,547,697	910,732	523,908	0	523,908	-6,544	
自營商	29,818,722	17,641,569	12,177,153	13,780,200	780,570	912,870	-132,300	364,469	
	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	1,075,200	1,523,712	-448,512	-243,459	78,122	9,943	68,179	-151,486	
投信	104,448	0	104,448	-394	0	0	0	0	
自營商	245,760	225,792	19,968	192,670	51,134	127,836	-76,702	188,757	

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報								2022年9月21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	9,376	5,094	4,282	-20,036	18,534	7,497	11,037	-14,987	
投信	0	0	0	0	0	111	-111	-514	
自營商	38,122	35,195	2,927	12,561	16,261	22,196	-5,935	1,741	
特定法人(週)	2,021	0	2,021	---	0	1,300	-1,300	---	
特定法人(近月)	3,153	3,455	-302	---	4,514	5,855	-1,341	---	
特定法人(全月)	5,345	2,880	2,465	-16,351	6,219	15,603	-9,384	11,373	
十大交易人(週)	10,313	13,550	-3,237	---	8,436	7,034	1,402	---	
十大交易人(近月)	29,304	25,398	3,906	---	12,858	17,302	-4,444	---	
十大交易人(全月)	52,057	46,327	5,730	2,623	30,796	32,663	-1,867	-6,288	
全市場未沖銷(近月)			49,303	---			37,174	---	
全市場未沖銷(全月)			95,061	-194,579			72,676	-181,517	

更新日期：2022年9月21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 09W4 週 選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	14900	買權OI最大量	14900
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	16.95%	較前一交易日	+6.09%
	買權隱含波動率	18.53%	較前一交易日	+5.28%
	賣權隱含波動率	15.34%	較前一交易日	+6.87%
電子選擇權	買權成交最大量	660	買權OI最大量	660
	賣權成交最大量	600	賣權OI最大量	600
金融選擇權	買權成交最大量	1620	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1560	賣權OI最大量	1420

更新日期：2022年9月21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 10 月 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	17800
	賣權成交最大量	14400	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	20.58%	較前一交易日	-0.53%
	買權隱含波動率	16.85%	較前一交易日	-0.11%
	賣權隱含波動率	24.20%	較前一交易日	+0.53%
	成交量P/C_Ratio值	1.037	較前一交易日	+0.14
	未平倉P/C_Ratio值	0.754	較前一交易日	+0.05
電子選擇權	買權成交最大量	660	買權OI最大量	660
	賣權成交最大量	600	賣權OI最大量	600
金融選擇權	買權成交最大量	1620	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1560	賣權OI最大量	1420

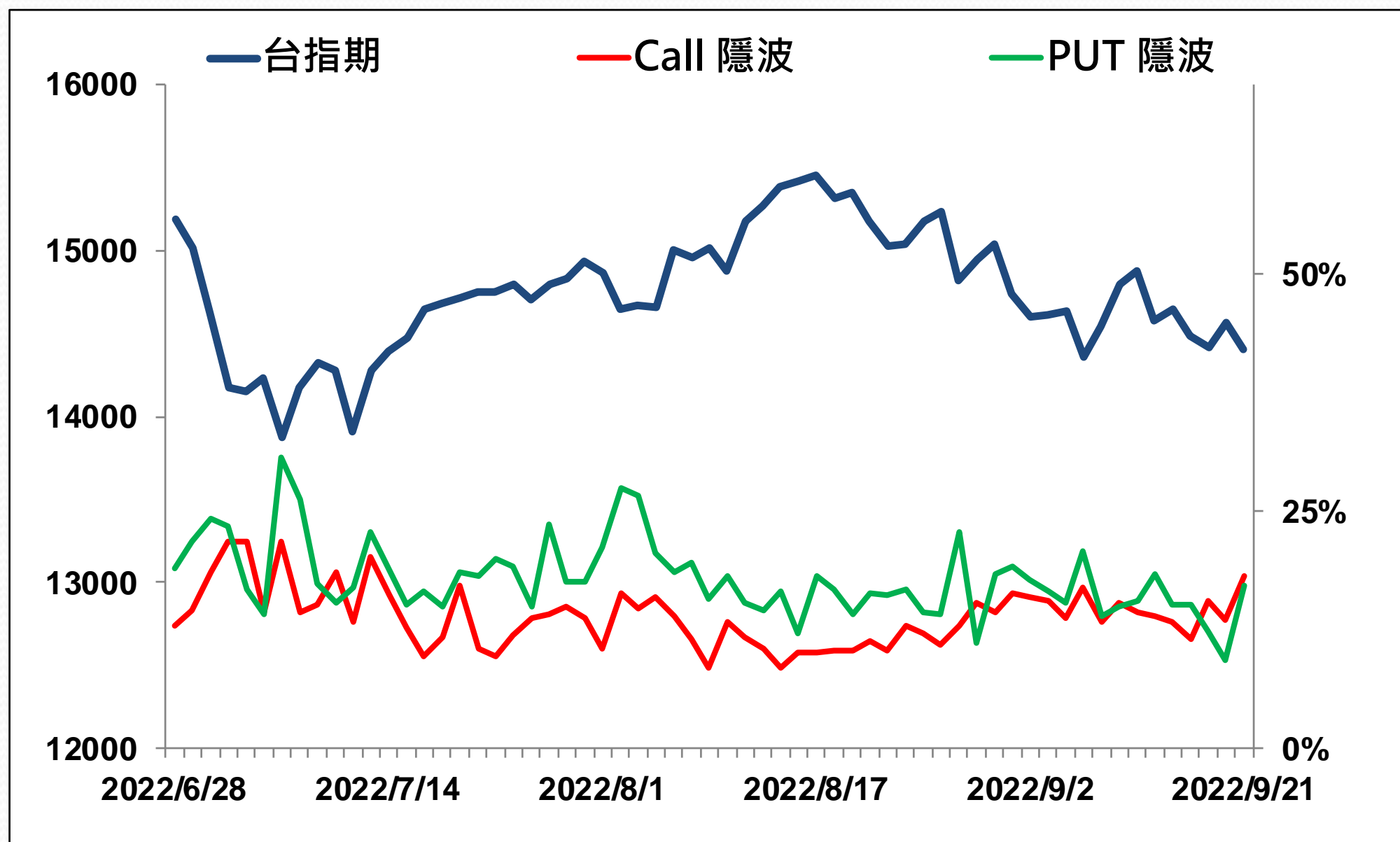
更新日期：2022年9月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



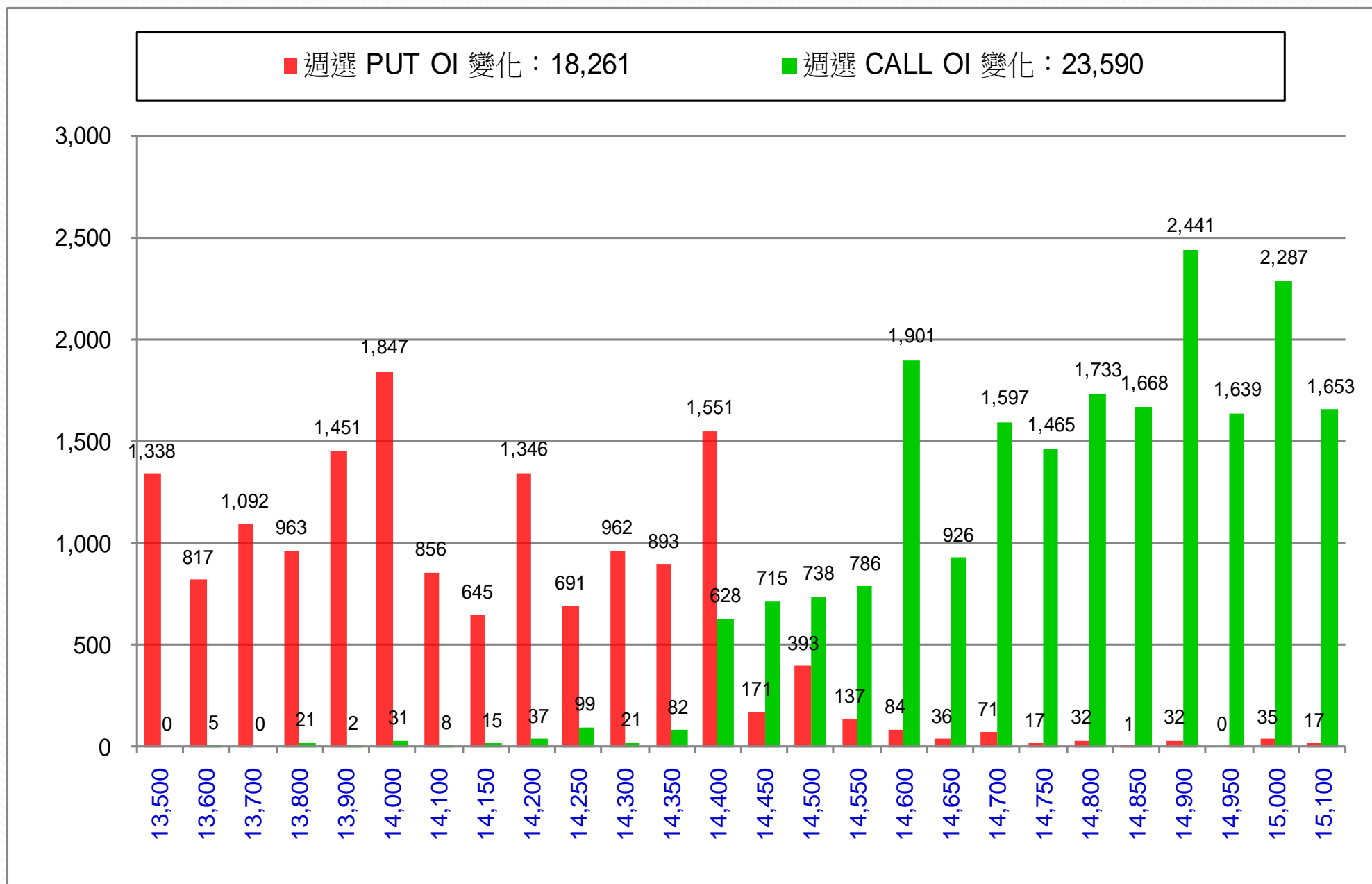
更新日期：2022年9月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年9月21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

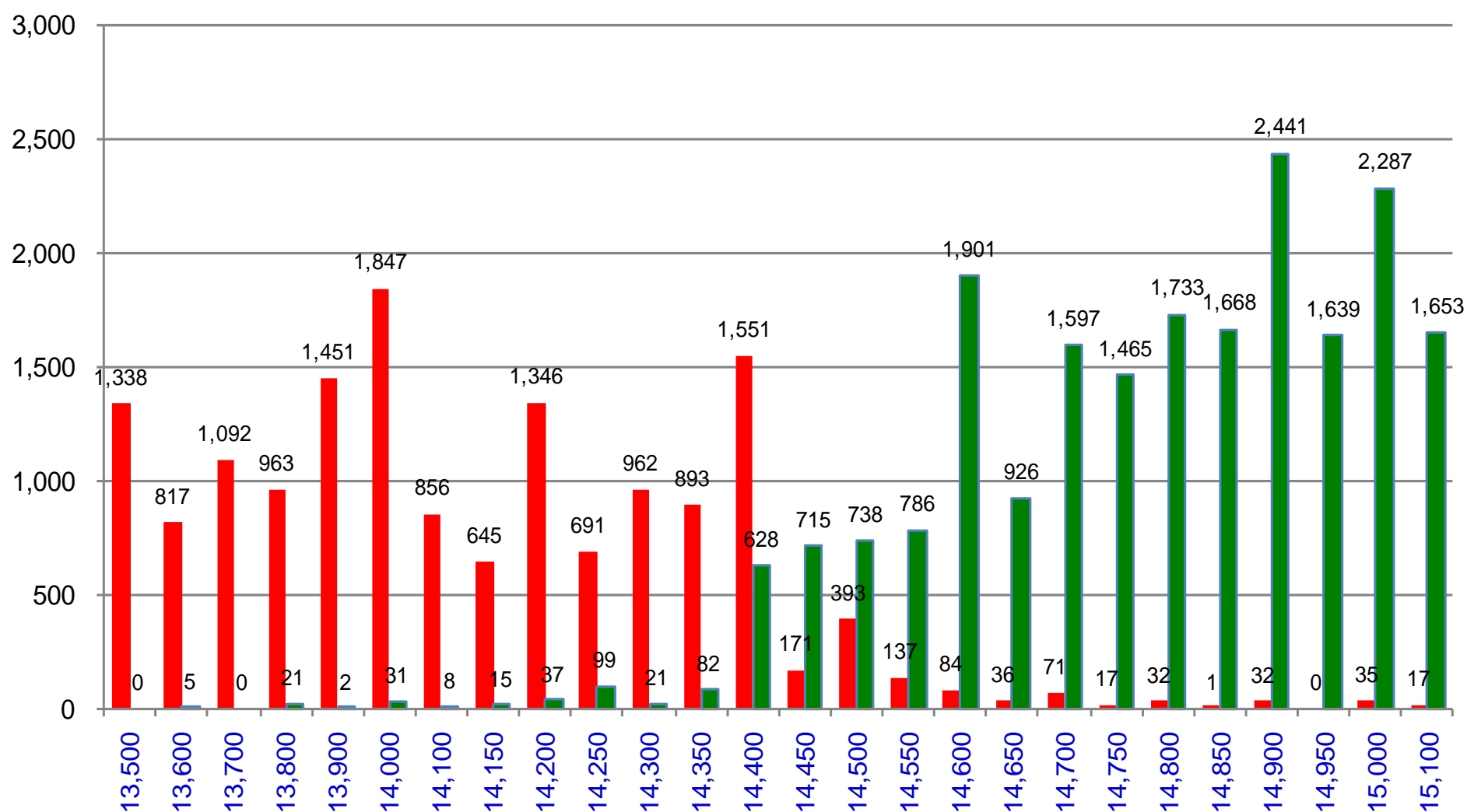


更新日期：2022年9月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：18,261

週選 CALL OI 總額：23,590



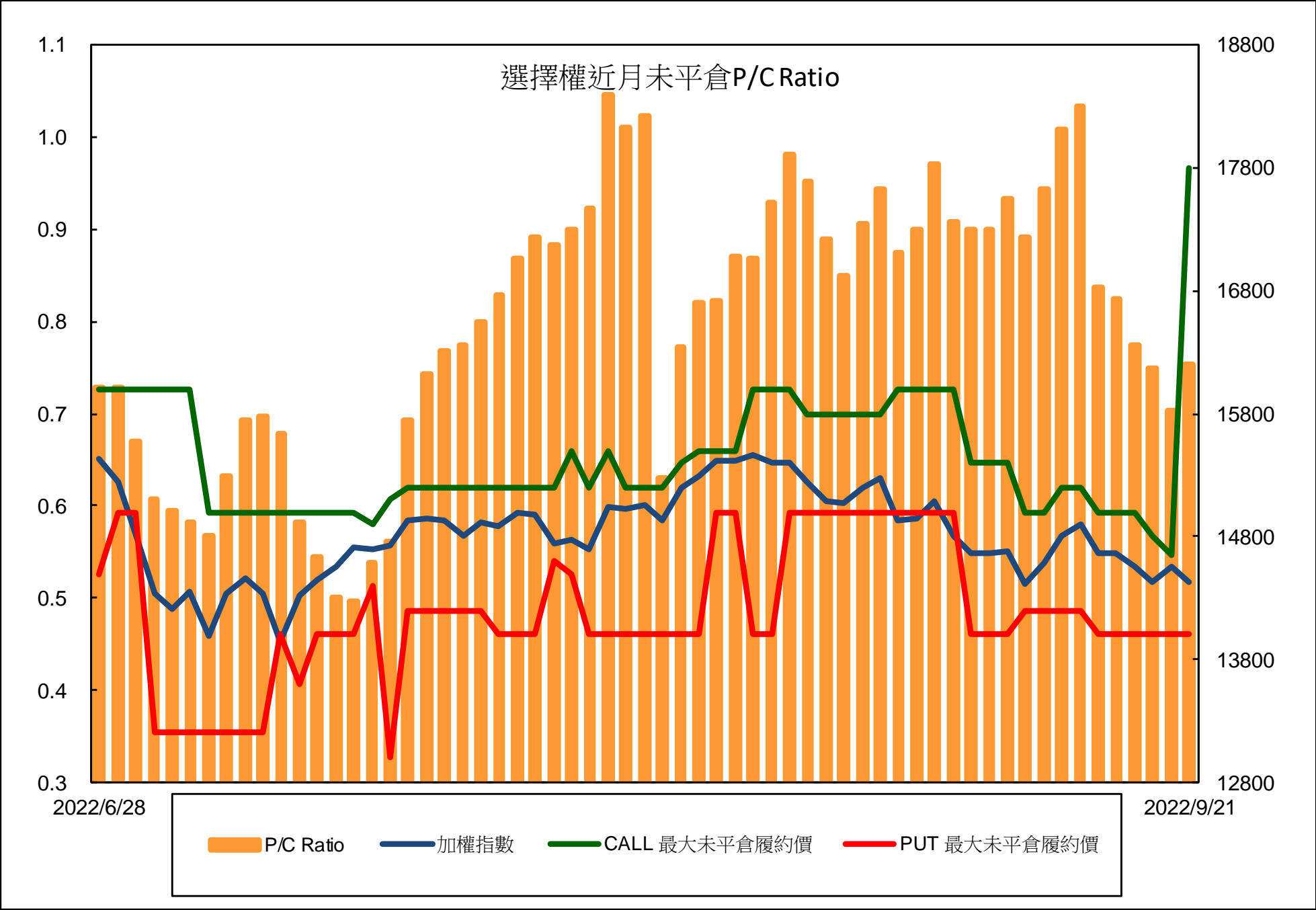
更新日期：2022年9月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	9月20日	73,088	82,722	-9,634
	9月21日	38,122	35,195	2,927
Put	9月20日	48,110	55,786	-7,676
	9月21日	16,261	22,196	-5,935

更新日期：2022年9月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

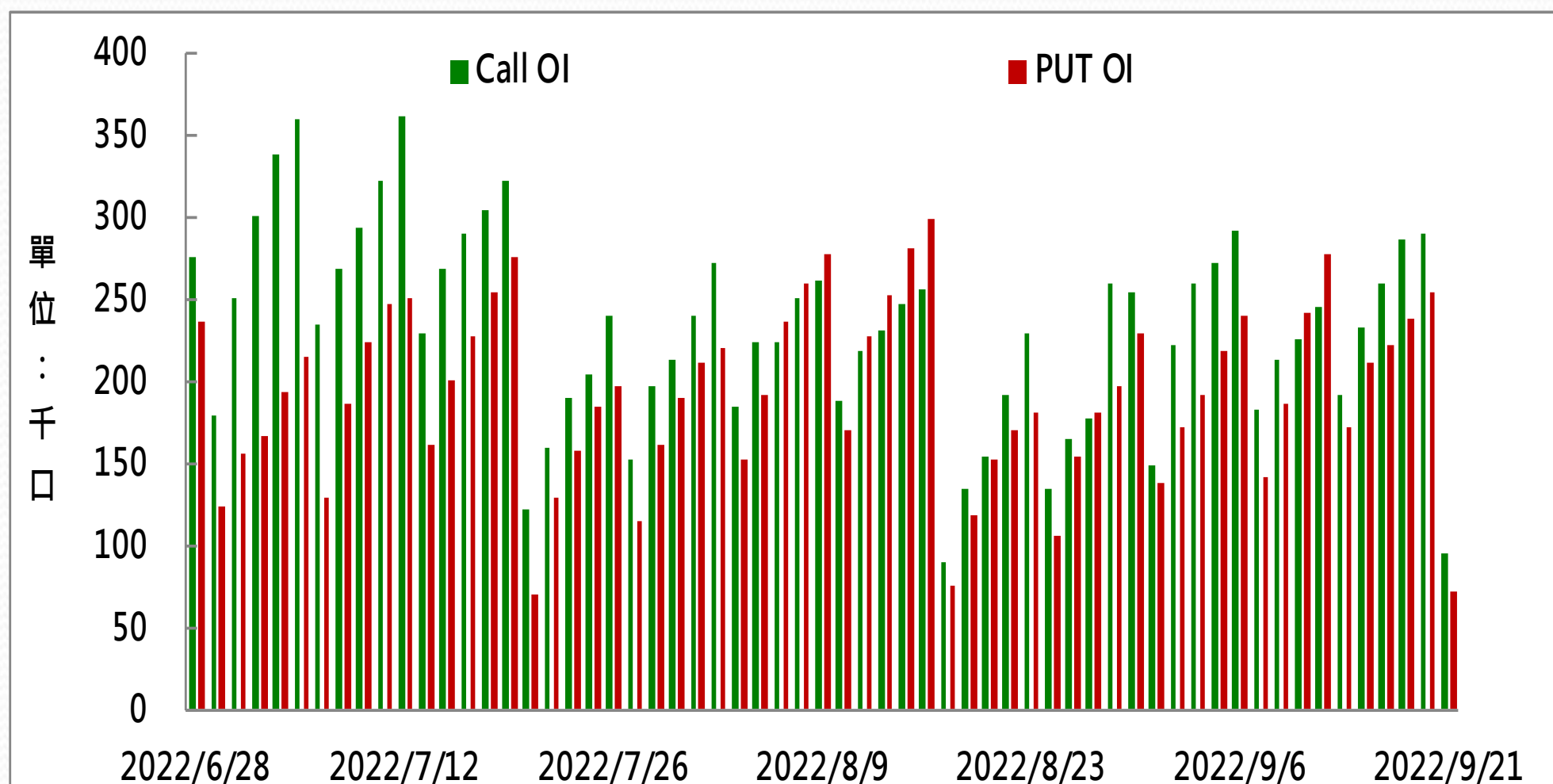
選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年9月21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9月21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9月21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