

# 台指選擇權OI匯報

日期 : 2022/9/22 結算日 : 2022/9/28					日期 : 2022/9/22 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		
5	5	13,400	3,260	2,633	※	0	13,100	988	148		
1	1	13,500	3,690	2,352		7	13,200	1,531	556		
6	11	13,600	5,632	4,815		32	13,300	1,643	503		
6	6	13,700	7,378	6,286		3	13,400	2,062	873		
8	29	13,800	5,712	4,749		6	13,500	2,809	835		
81	83	13,900	5,379	3,928		20	13,600	1,953	560		
170	201	14,000	5,048	3,201		13	13,700	2,339	246		
87	87	14,050	1,540	1,540		31	13,800	2,592	682		
595	603	14,100	2,814	1,958		10	13,900	2,204	305		
879	894	14,150	2,146	1,501		77	168	14,000	3,339		
2,636	2,673	14,200	3,565	2,219		149	208	14,100	1,552		
2,027	2,126	14,250	1,313	622		977	1,079	14,200	1,322		
2,104	2,125	14,300	1,772	810		421	657	14,300	971		
1,826	1,908	14,350	949	56		364	1,644	14,400	1,588		
5,103	5,731	14,400	2,582	1,031		482	2,226	14,500	2,569		
3,448	4,163	14,450	597	426		725	2,198	14,600	1,272		
4,396	5,134	14,500	1,537	1,144		1,128	2,835	14,700	549		
5,979	6,765	14,550	590	453		1,074	2,818	14,800	661		
※ 6,349	8,250	14,600	1,142	1,058		1,346	2,671	14,900	150		
4,945	5,871	14,650	520	484	※	3,133	6,220	15,000	837		
3,651	5,248	14,700	184	113		523	3,232	15,100	53		
2,128	3,593	14,750	134	117		1,844	5,503	15,200	462		
4,290	6,023	14,800	1,322	1,290		219	2,905	15,300	122		
1,727	3,395	14,850	892	891		-114	3,282	15,400	83		
1,658	4,099	14,900	37	5		108	2,912	15,500	226		
635	2,274	14,950	13	13		-78	2,282	15,600	29		
增減總計		OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計		OI 總計	P/C	OI 總計		
59,030	82,620	0.8362	69,089	50,828	增減總計		62,056	0.7581	47,045		
昨日 P/C		0.7741	今日增減變化		0.0621	昨日 P/C		0.7540	今日增減變化		0.0041

更新日期 : 2022年9月22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22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	79,868,555	62,260,545	17,608,010	-4,247,691	4,130,794	793,678	3,337,116	164,562
投信	24,468,298	49,708,349	-25,240,051	-692,354	513,402	0	513,402	-10,506
自營商	35,018,392	18,819,638	16,198,754	4,021,601	1,013,499	950,755	62,744	195,044
	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	1,106,768	1,581,964	-475,196	-26,684	177,762	11,198	166,564	98,385
投信	103,238	0	103,238	-1,210	0	0	0	0
自營商	261,127	294,531	-33,404	-53,372	13,997	212,754	-198,757	-122,055

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22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	13,551	9,181	4,370	88	23,450	9,705	13,745	2,708
投信	0	0	0	0	400	111	289	400
自營商	53,907	48,774	5,133	2,206	41,669	36,589	5,080	11,015
特定法人(週)	1,532	0	1,532	-489	956	750	206	1,506
特定法人(近月)	4,369	5,039	-670	-368	4,514	9,356	-4,842	-3,501
特定法人(全月)	8,122	3,108	5,014	2,549	5,114	16,523	-11,409	-2,025
十大交易人(週)	24,494	31,869	-7,375	-4,138	24,438	27,230	-2,792	-4,194
十大交易人(近月)	33,191	29,015	4,176	270	14,516	23,830	-9,314	-4,870
十大交易人(全月)	68,761	61,102	7,659	1,929	43,850	57,481	-13,631	-11,764
全市場未沖銷(近月)			62,056	12,753			47,045	9,871
全市場未沖銷(全月)			167,813	72,752			133,923	61,247

更新日期：2022年9月22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	14600	買權OI最大量	14600
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	13700
	整體隱含波動率	12.00%	較前一交易日	-4.96%
	買權隱含波動率	10.69%	較前一交易日	-7.84%
	賣權隱含波動率	13.60%	較前一交易日	-1.74%
電子選擇權	買權成交最大量	645	買權OI最大量	645
	賣權成交最大量	615	賣權OI最大量	600
金融選擇權	買權成交最大量	1560	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1460	賣權OI最大量	1420

更新日期：2022年9月22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	14000	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	19.79%	較前一交易日	+0.25%
	買權隱含波動率	16.13%	較前一交易日	-0.83%
	賣權隱含波動率	24.23%	較前一交易日	+0.56%
	成交量P/C_Ratio值	0.819	較前一交易日	-0.22
	未平倉P/C_Ratio值	0.758	較前一交易日	+0.00
電子選擇權	買權成交最大量	645	買權OI最大量	645
	賣權成交最大量	615	賣權OI最大量	600
金融選擇權	買權成交最大量	1560	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1460	賣權OI最大量	1420

更新日期：2022年9月22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

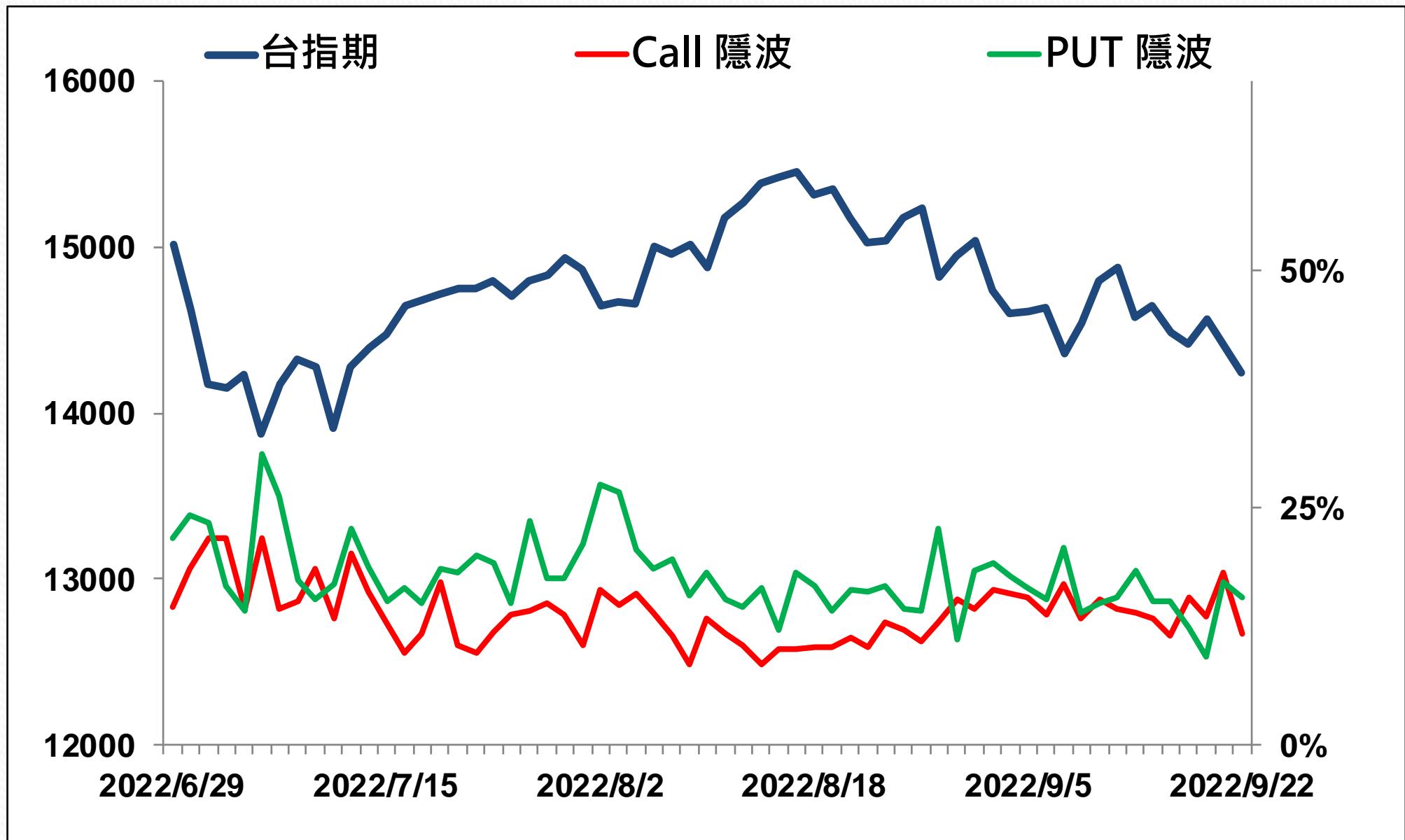
— 臺指選擇權波動率指數



更新日期：2022年9月22日

資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

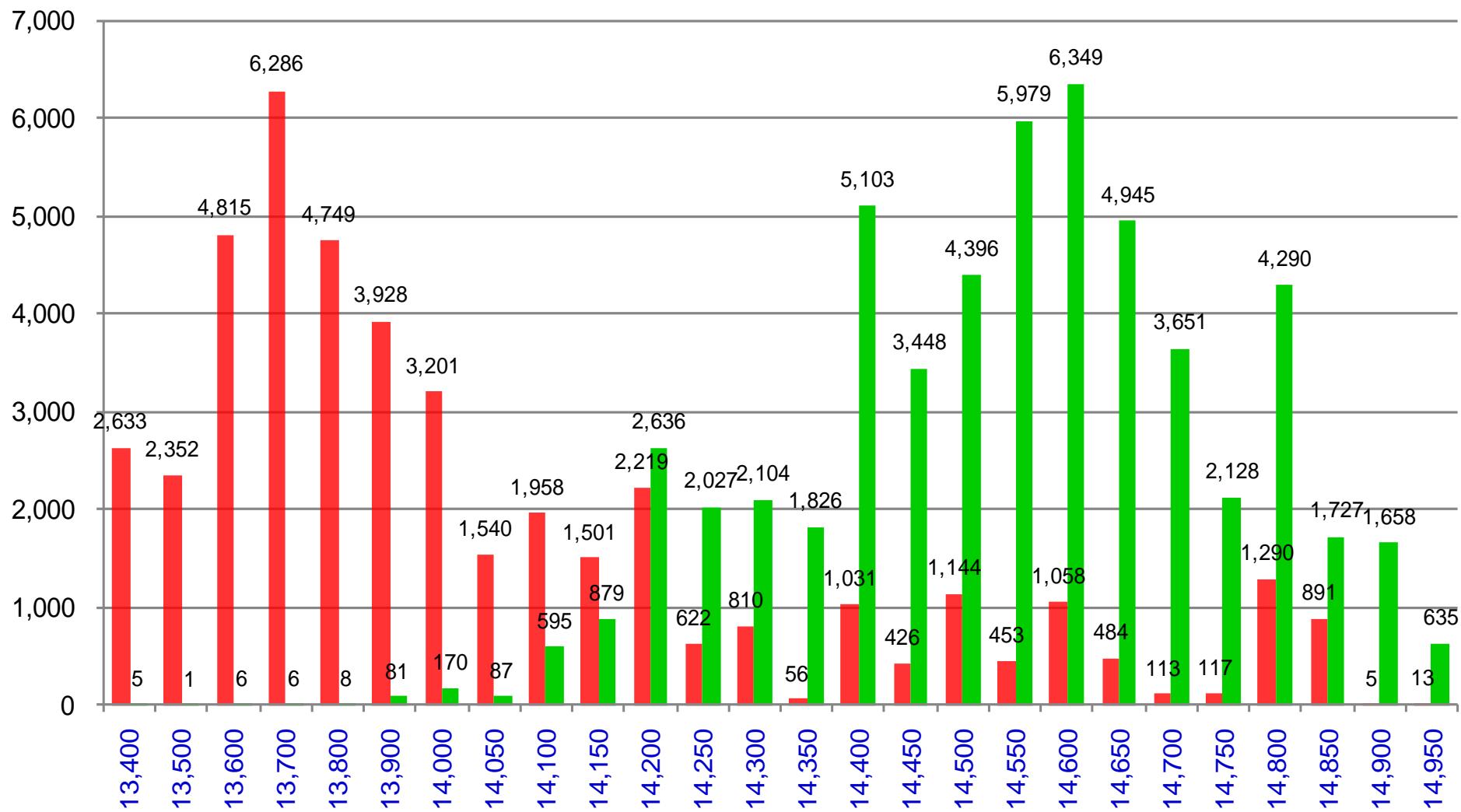
# 台指近月隱含波動度



更新日期：2022年9月22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

■ 週選 PUT OI 變化 : 50,828      ■ 週選 CALL OI 變化 : 59,030

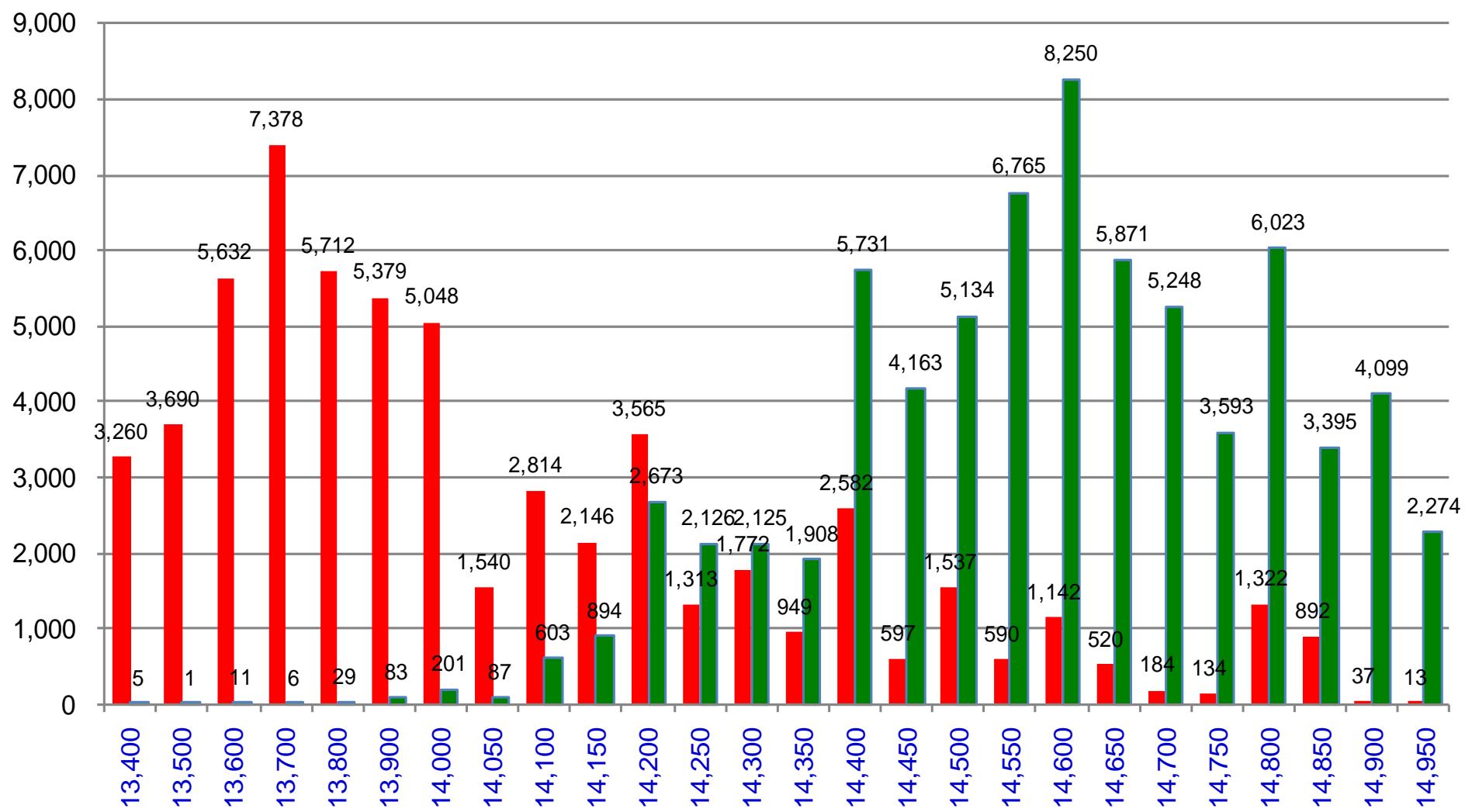


更新日期：2022年9月22日 資料來源：台灣期貨交易所 · 凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：69,089

■ 週選 CALL OI 總額：82,620



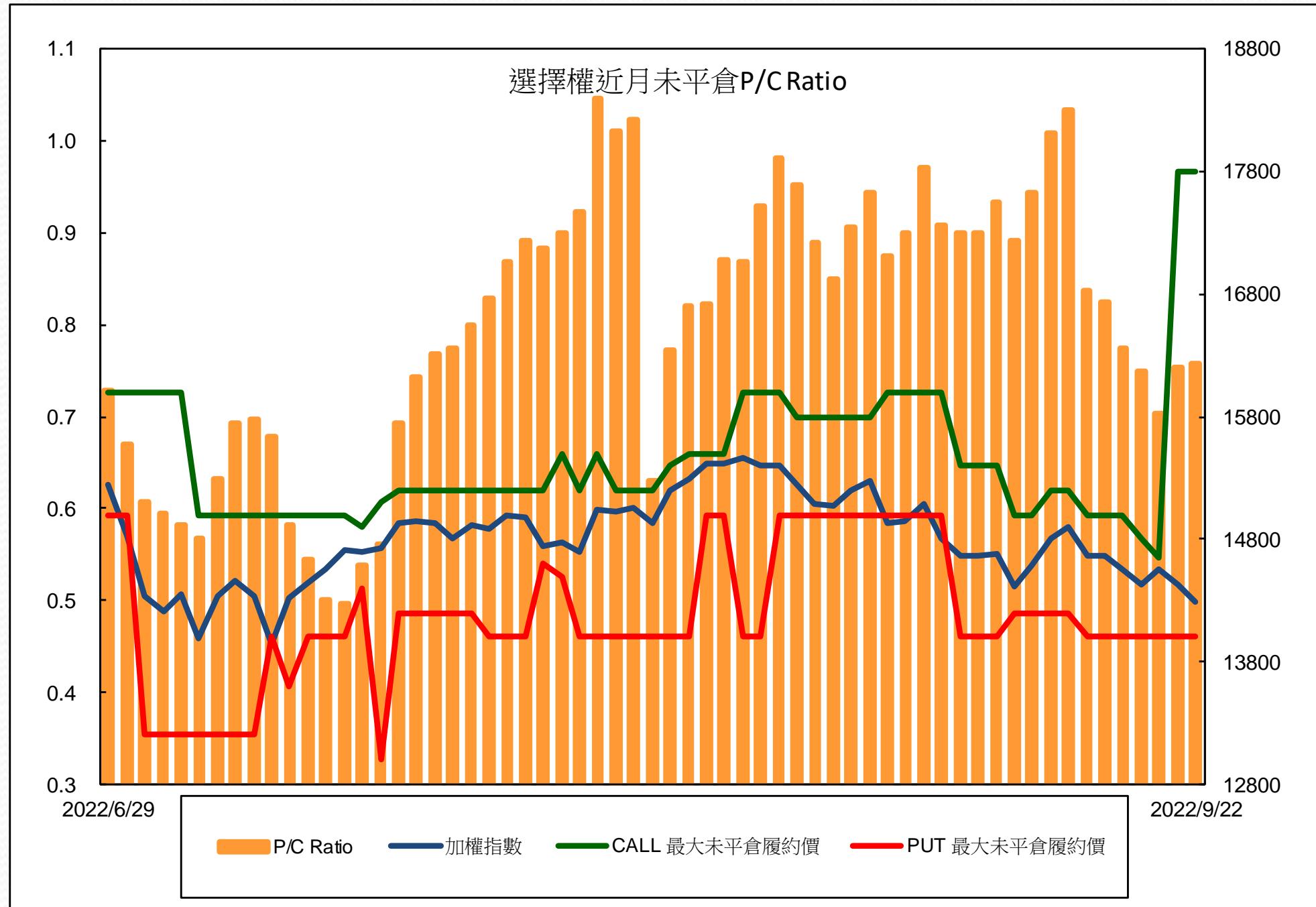
更新日期：2022年9月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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21日	38,122	35,195	2,927
	9月22日	53,907	48,774	5,133
Put	9月21日	16,261	22,196	-5,935
	9月22日	41,669	36,589	5,080

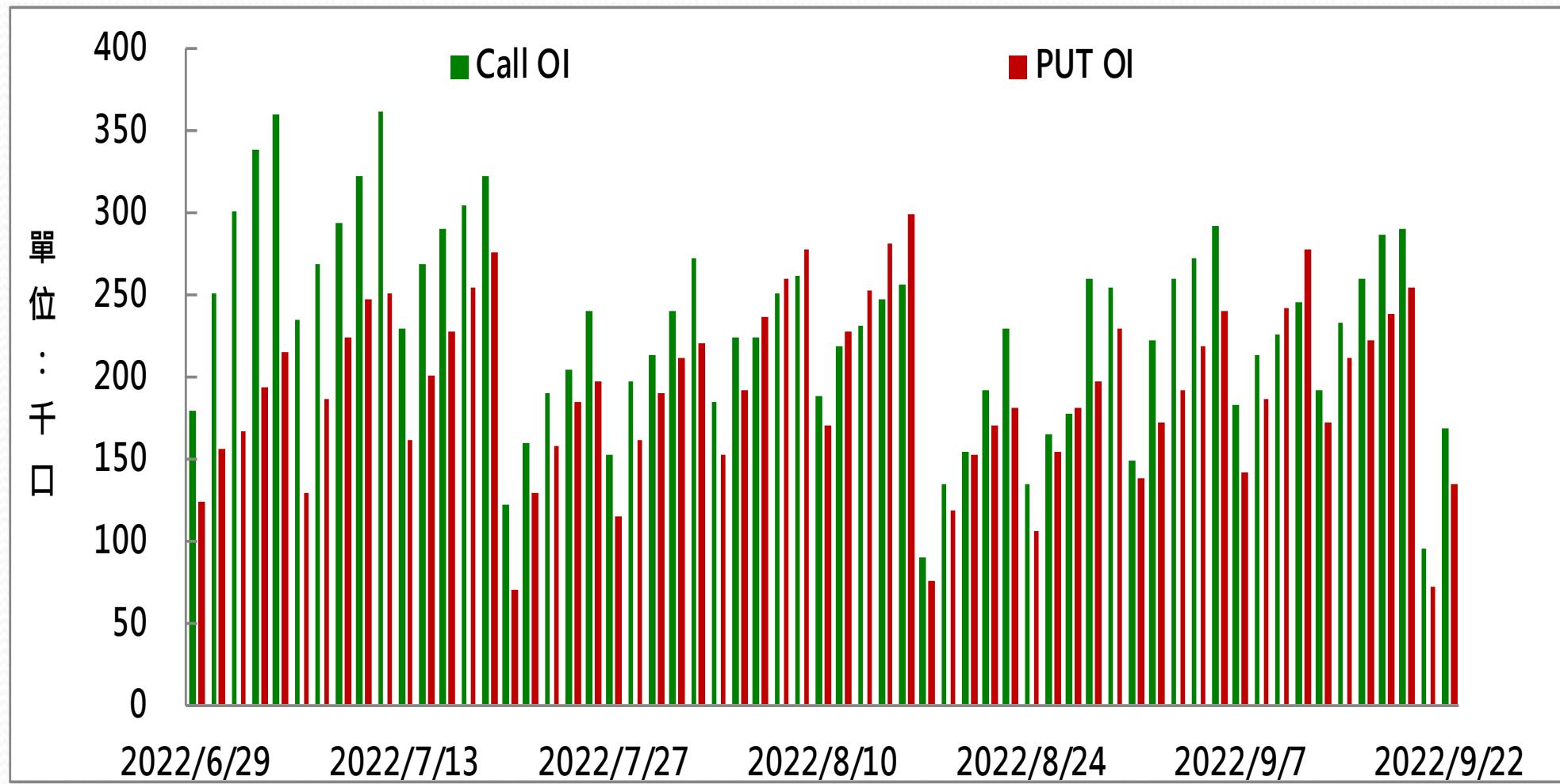
更新日期：2022年9月22日 資料來源：台灣期貨交易所 · 凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年9月22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22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22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