

# 台指選擇權OI匯報

日期 : 2022/9/23			結算日 : 2022/9/28			日期 : 2022/9/23			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	13,100	1,507	193		0	0	12,900	1,350	53	
0	0	13,200	2,165	60		0	8	13,000	2,937	442	
0	0	13,300	3,053	126		0	0	13,100	1,201	213	
28	33	13,400	7,968	4,708	※	0	8	13,200	1,789	258	
1	2	13,500	4,162	472		0	32	13,300	1,891	248	
5	16	13,600	5,382	-250		2	5	13,400	2,339	277	
25	31	13,700	9,702	2,324		4	25	13,500	3,044	235	
89	118	13,800	8,705	2,993		-1	31	13,600	2,083	130	
81	164	13,900	8,669	3,290		14	31	13,700	2,418	79	
24	24	13,950	1,082	1,082		15	261	13,800	3,009	417	
348	549	14,000	6,122	1,074		52	124	13,900	2,182	-22	
313	400	14,050	2,126	586		224	392	14,000	3,551	212	
1,092	1,695	14,100	4,035	1,221		168	376	14,100	1,896	344	
1,269	2,163	14,150	2,775	629		153	1,232	14,200	1,321	-1	
2,260	4,933	14,200	3,215	-350		784	1,441	14,300	994	23	
2,379	4,505	14,250	1,811	498		366	2,010	14,400	1,513	-75	
3,627	5,752	14,300	2,157	385		1,086	3,312	14,500	2,501	-68	
4,157	6,065	14,350	1,104	155		1,202	3,400	14,600	1,253	-19	
3,002	8,733	14,400	2,352	-230		339	3,174	14,700	544	-5	
4,935	9,098	14,450	504	-93	※	4,121	6,939	14,800	653	-8	
4,961	10,095	14,500	1,281	-256		144	2,815	14,900	147	-3	
457	7,222	14,550	528	-62		1,737	7,957	15,000	846	9	
2,311	10,561	14,600	910	-232		-185	3,047	15,100	59	6	
-1,269	4,602	14,650	521	1		255	5,758	15,200	467	5	
1,517	6,765	14,700	168	-16		472	3,377	15,300	117	-5	
359	3,952	14,750	91	-43		-132	3,150	15,400	89	6	
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	
29,929	112,549	0.7798	87,762	18,673		11,422	73,478	0.7258	53,328	6,283	
昨日 P/C	0.8362	今日增減變化	-0.0564			昨日 P/C	0.7581	今日增減變化	-0.0323		

更新日期 : 2022年9月23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23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	77,789,283	64,628,641	13,160,642	-4,447,368	4,275,461	898,466	3,376,995	39,879
投信	24,460,847	49,647,359	-25,186,512	53,539	500,869	0	500,869	-12,533
自營商	34,618,932	19,531,033	15,087,899	-1,110,855	1,169,379	1,213,365	-43,986	-106,730
	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	1,340,041	1,478,142	-138,101	337,095	184,536	23,766	160,770	-5,794
投信	103,197	0	103,197	-41	0	0	0	0
自營商	332,354	356,636	-24,282	9,122	13,980	220,884	-206,904	-8,147

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23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	16,306	10,274	6,032	1,662	24,807	10,535	14,272	527
投信	0	0	0	0	400	111	289	0
自營商	60,265	61,966	-1,701	-6,834	49,734	42,337	7,397	2,317
特定法人(週)	3,272	0	3,272	1,740	1,330	0	1,330	1,124
特定法人(近月)	5,566	6,456	-890	-220	4,195	10,039	-5,844	-1,002
特定法人(全月)	9,712	3,640	6,072	1,058	4,195	17,830	-13,635	-2,226
十大交易人(週)	27,283	44,182	-16,899	-9,524	33,119	36,345	-3,226	-434
十大交易人(近月)	37,939	33,978	3,961	-215	15,605	27,453	-11,848	-2,534
十大交易人(全月)	77,333	75,339	1,994	-5,665	52,667	71,103	-18,436	-4,805
全市場未沖銷(近月)			73,478	11,422			53,328	6,283
全市場未沖銷(全月)			212,944	45,131			159,302	25,379

更新日期：2022年9月23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	14400	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	9.02%	較前一交易日	-2.97%
	買權隱含波動率	9.02%	較前一交易日	-1.68%
	賣權隱含波動率	9.03%	較前一交易日	-4.56%
電子選擇權	買權成交最大量	685	買權OI最大量	685
	賣權成交最大量	610	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	1460

更新日期：2022年9月23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	14800	買權OI最大量	17800
	賣權成交最大量	13500	賣權OI最大量	12800
	整體隱含波動率	18.64%	較前一交易日	+1.15%
	買權隱含波動率	16.57%	較前一交易日	+0.44%
	賣權隱含波動率	22.15%	較前一交易日	-2.08%
	成交量P/C_Ratio值	0.654	較前一交易日	-0.16
	未平倉P/C_Ratio值	0.726	較前一交易日	-0.03
電子選擇權	買權成交最大量	685	買權OI最大量	685
	賣權成交最大量	610	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	1460

更新日期：2022年9月23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

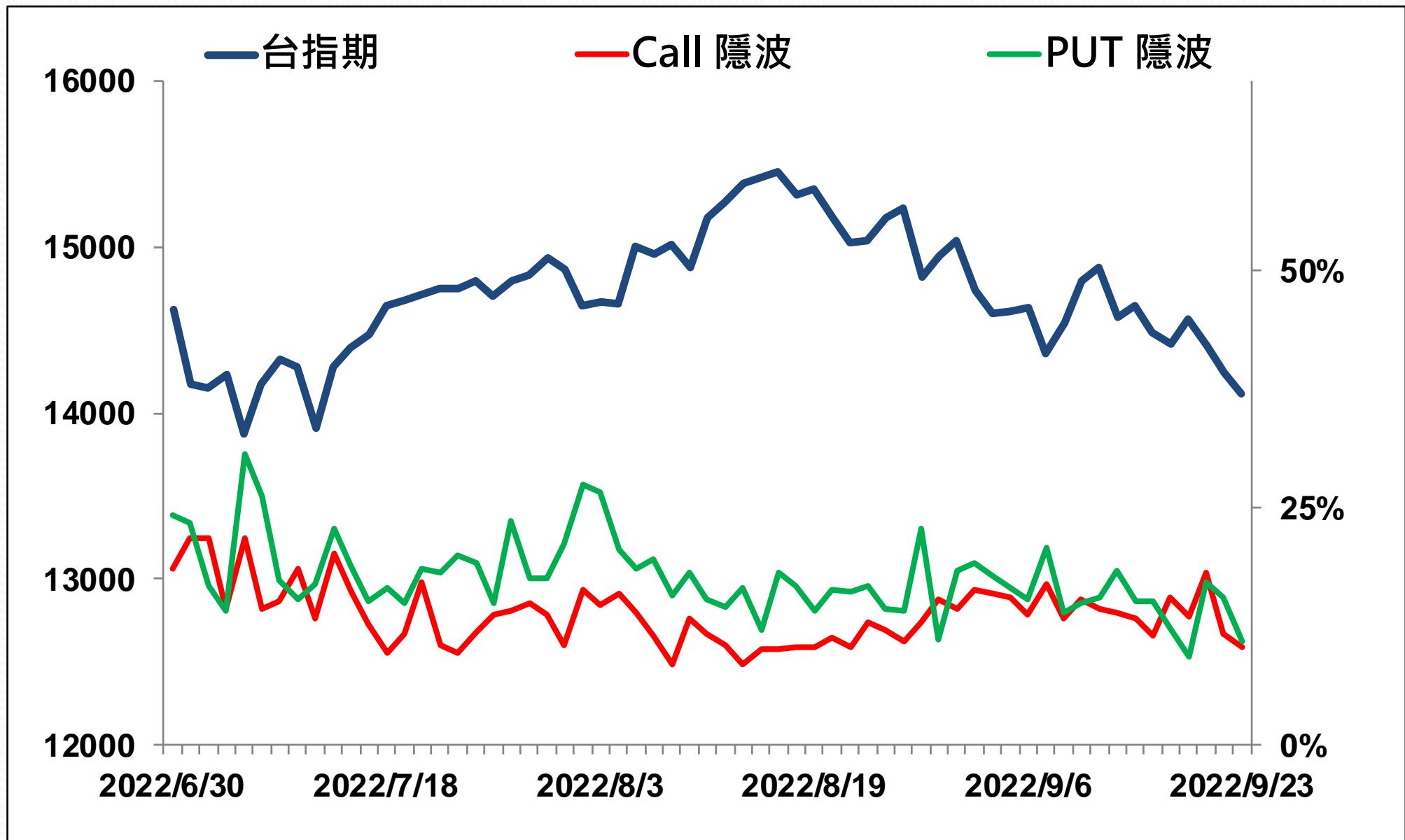
— 臺指選擇權波動率指數



更新日期：2022年9月23日

資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

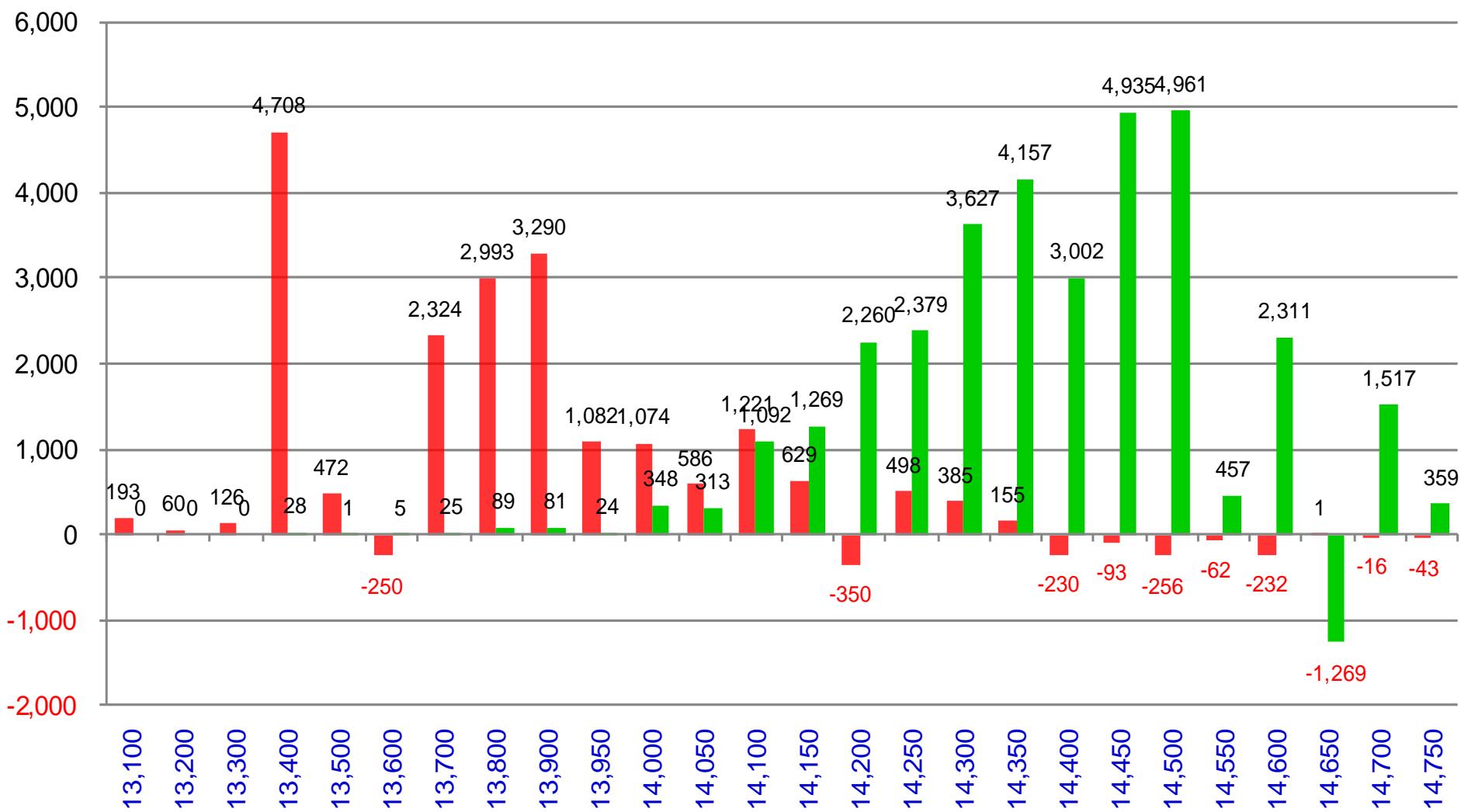
# 台指近月隱含波動度



更新日期：2022年9月23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

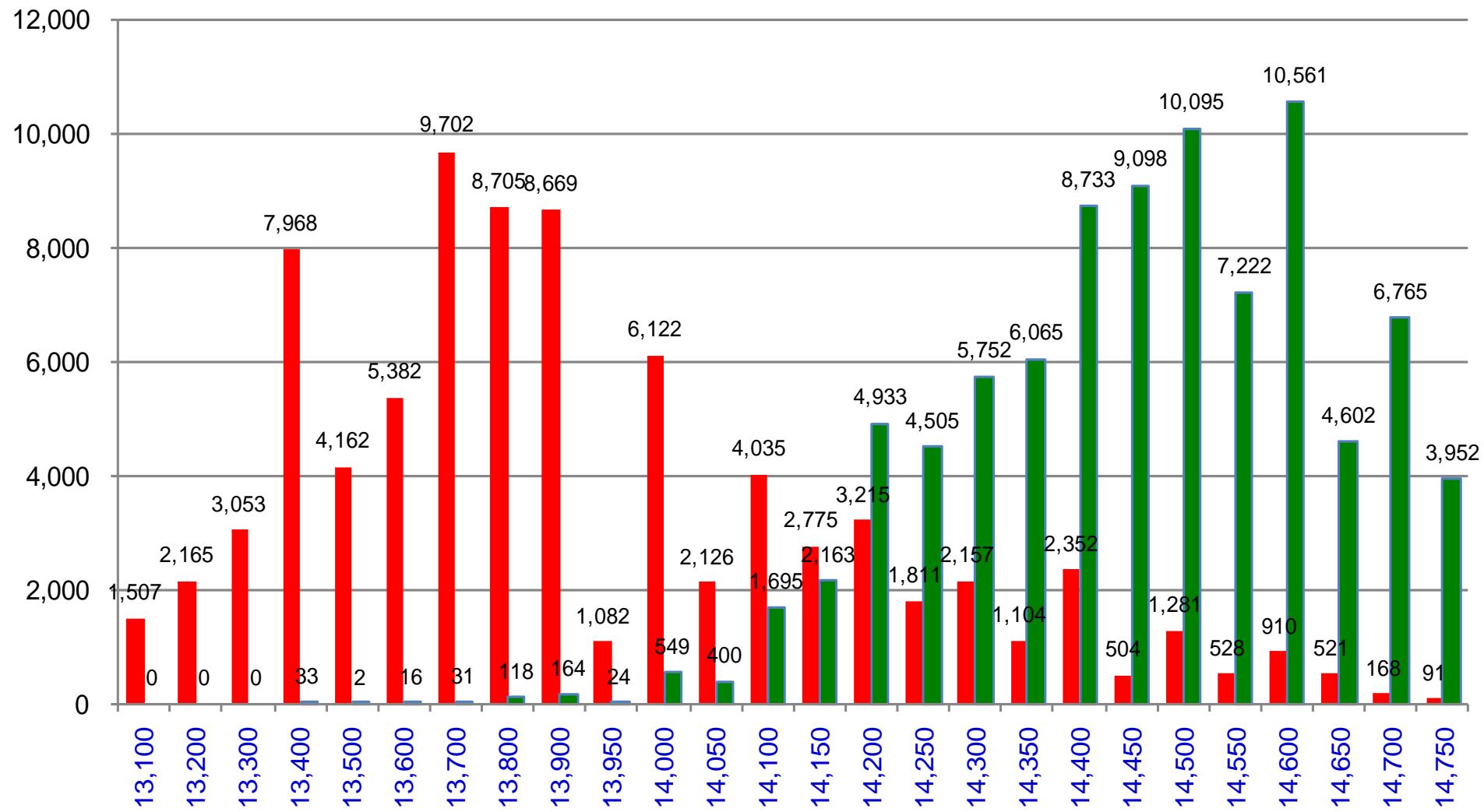
■ 週選 PUT OI 變化 : 18,673 ■ 週選 CALL OI 變化 : 29,929



更新日期：2022年9月23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：87,762      ■ 週選 CALL OI 總額：112,549



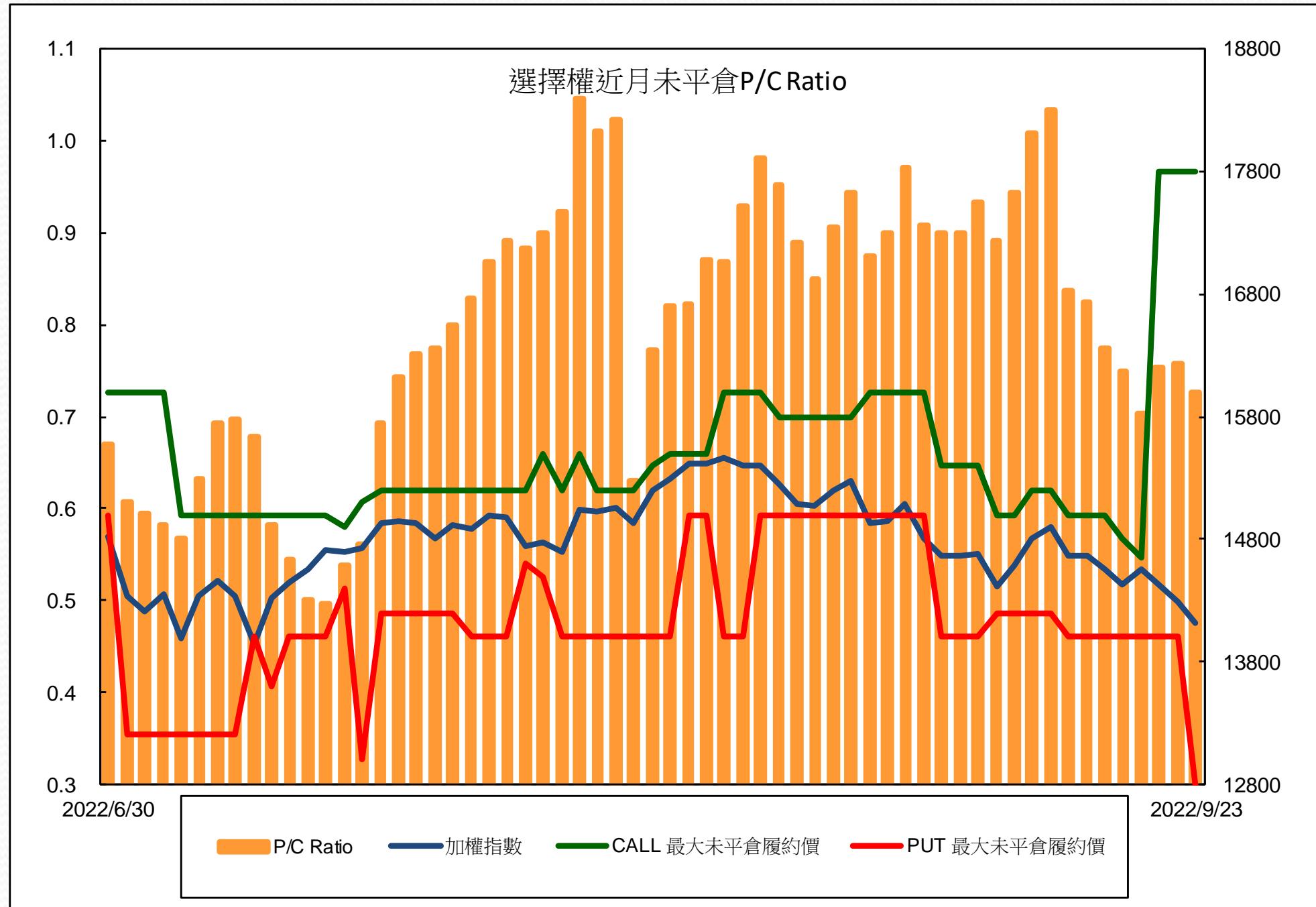
更新日期：2022年9月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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22日	53,907	48,774	5,133
	9月23日	60,265	61,966	-1,701
Put	9月22日	41,669	36,589	5,080
	9月23日	49,734	42,337	7,397

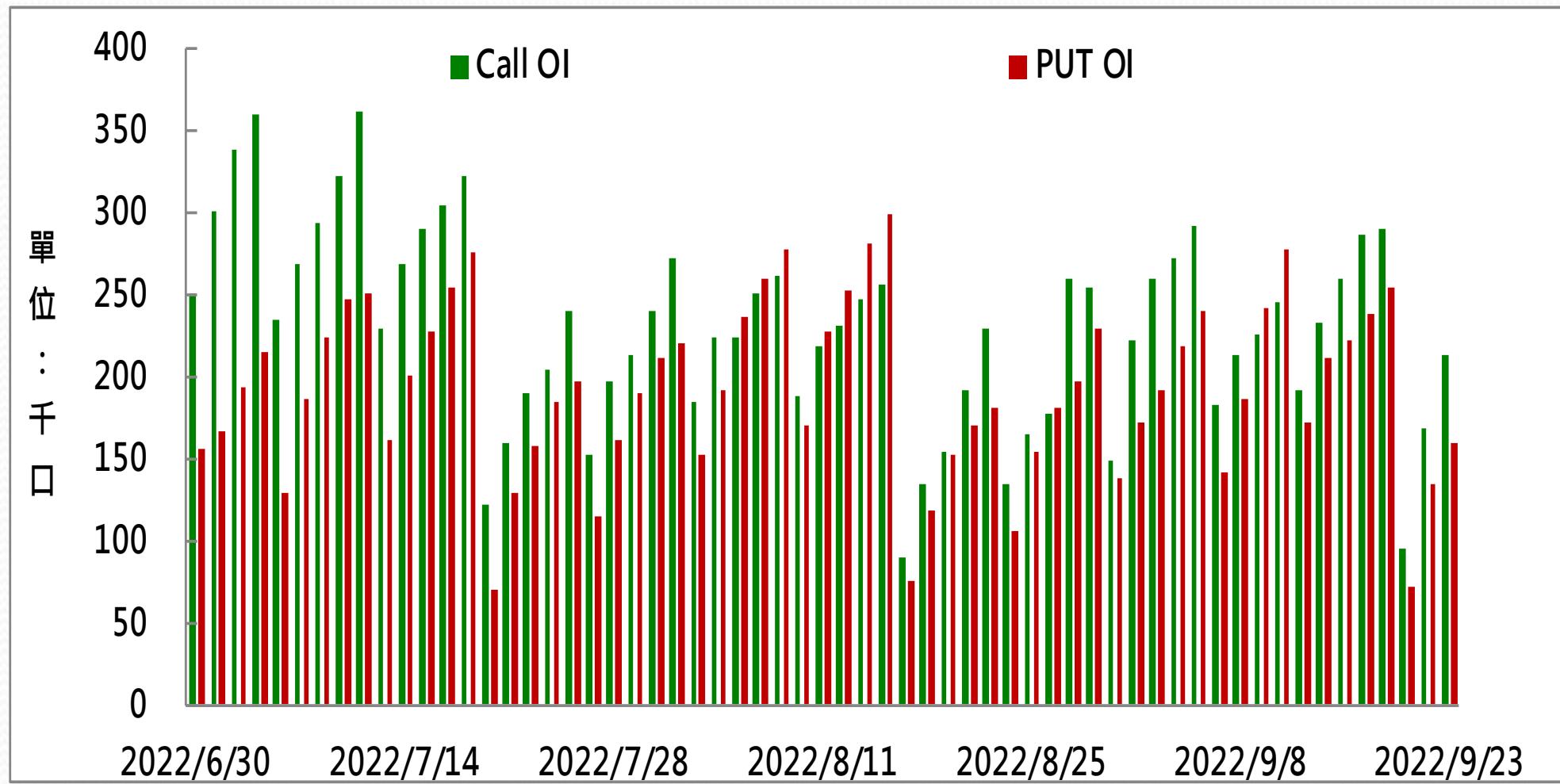
更新日期：2022年9月23日 資料來源：台灣期貨交易所 · 凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年9月23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23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23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