台指選擇權OI匯報

日期：2022/10/17			結算日：2022/10/19			日期：2022/10/17			結算日：2022/11/16		
202210 月台指選擇權 OI 序列						202211 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	11,600	2,887	36		0	0	11,100	797	-13	
0	3	12,000	13,056	609		0	0	11,500	1,100	415	※
0	5	12,100	5,235	-295		0	0	11,600	683	134	
-3	46	12,200	6,498	-359		0	0	11,700	964	96	
13	45	12,300	8,039	656		0	0	11,800	742	176	
-49	840	12,400	9,601	1,680		0	0	11,900	601	100	
12	12	12,450	2,439	1,425		0	15	12,000	2,154	392	
-22	123	12,500	11,084	308		3	3	12,100	1,005	335	
33	34	12,550	4,814	1,927		0	4	12,200	1,529	42	
12	383	12,600	9,726	1,586		2	14	12,300	1,527	142	
34	39	12,650	4,142	1,297		-4	15	12,400	1,477	269	
78	631	12,700	9,534	2,601	※	20	48	12,500	2,185	-135	
63	477	12,750	3,991	571		16	76	12,600	721	72	
227	1,929	12,800	10,477	656		13	113	12,700	855	86	
1,731	2,518	12,850	4,244	215		158	316	12,800	1,827	238	
2,573	4,320	12,900	7,532	578		70	457	12,900	799	145	
1,633	3,338	12,950	3,766	14		912	1,211	13,000	1,289	-7	
3,709	7,343	13,000	8,061	-546		202	417	13,100	1,517	30	
4,084	6,189	13,050	2,487	-25		760	1,246	13,200	1,349	52	
4,342	9,480	13,100	4,275	-1,196		170	729	13,300	358	-25	
4,868	7,787	13,150	2,374	-1,515		413	874	13,400	225	4	
※ 6,980	12,518	13,200	4,568	-1,332		914	2,205	13,500	292	-23	
6,021	10,443	13,250	902	-154		459	1,616	13,600	87	-18	
5,285	13,778	13,300	4,903	-268		468	1,959	13,700	68	-13	
3,974	9,826	13,350	190	-33		※ 1,152	3,948	13,800	501	-3	
2,303	13,811	13,400	3,576	-192		202	1,900	13,900	54	4	
2,006	8,413	13,450	66	-3		681	4,390	14,000	63	-4	
596	14,490	13,500	3,664	-366		113	1,146	14,100	51	0	
-1,497	13,295	13,600	3,372	-346		83	1,567	14,200	64	0	
-558	10,197	13,700	2,138	-3		74	1,328	14,300	47	0	
-359	6,153	13,900	1,216	-72		181	2,487	14,500	426	-1	
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	
46,626	261,472	0.7480	195,574	6,783		8,102	48,149	0.8401	40,449	3,521	
昨日 P/C	0.8787	今日增減變化		-0.1307		昨日 P/C	0.9221	今日增減變化		-0.0820	

更新日期：2022年10月17日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

中華開發金控 CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL
凱基期貨 KGI FUTURES

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10月17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	82,986,757	77,175,895	5,810,862	-11,024,327	2,926,904	827,743	2,099,161	-313,235
投信	29,231,919	48,493,098	-19,261,179	2,578,143	393,174	0	393,174	-6,886
自營商	37,633,922	24,393,410	13,240,512	1,027,597	1,755,520	1,055,941	699,579	333,806
	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	777,817	1,360,152	-582,335	115,729	3,896	179,345	-175,449	-69,275
投信	100,492	0	100,492	-1,431	0	0	0	0
自營商	598,831	499,747	99,084	117,256	383,357	183,185	200,172	87,451

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報								2022年10月17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	56,795	20,895	35,900	3,353	47,306	22,994	24,312	-210
投信	0	0	0	0	700	111	589	100
自營商	96,322	128,314	-31,992	-9,810	60,785	63,934	-3,149	4,995
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	20,851	0	20,851	4,292	6,109	19,043	-12,934	2,507
特定法人 (全月)	38,475	0	38,475	3,722	12,786	32,949	-20,163	4,886
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	87,471	96,727	-9,256	-11,789	57,841	74,841	-17,000	-1,537
十大交易人(全月)	145,183	143,138	2,045	-8,653	78,102	101,382	-23,280	-2,811
全市場未沖銷 (近月)			261,472	46,626			195,574	6,783
全市場未沖銷 (全月)			349,760	57,041			244,520	10,353

更新日期：2022年10月17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	13200	買權OI最大量	13500
	賣權成交最大量	12800	賣權OI最大量	12000
	整體隱含波動率	24.05%	較前一交易日	+1.84%
	買權隱含波動率	23.97%	較前一交易日	+1.88%
	賣權隱含波動率	24.16%	較前一交易日	+1.82%
電子選擇權	買權成交最大量	640	買權OI最大量	660
	賣權成交最大量	510	賣權OI最大量	540
金融選擇權	買權成交最大量	1500	買權OI最大量	1500
	賣權成交最大量	1320	賣權OI最大量	1300

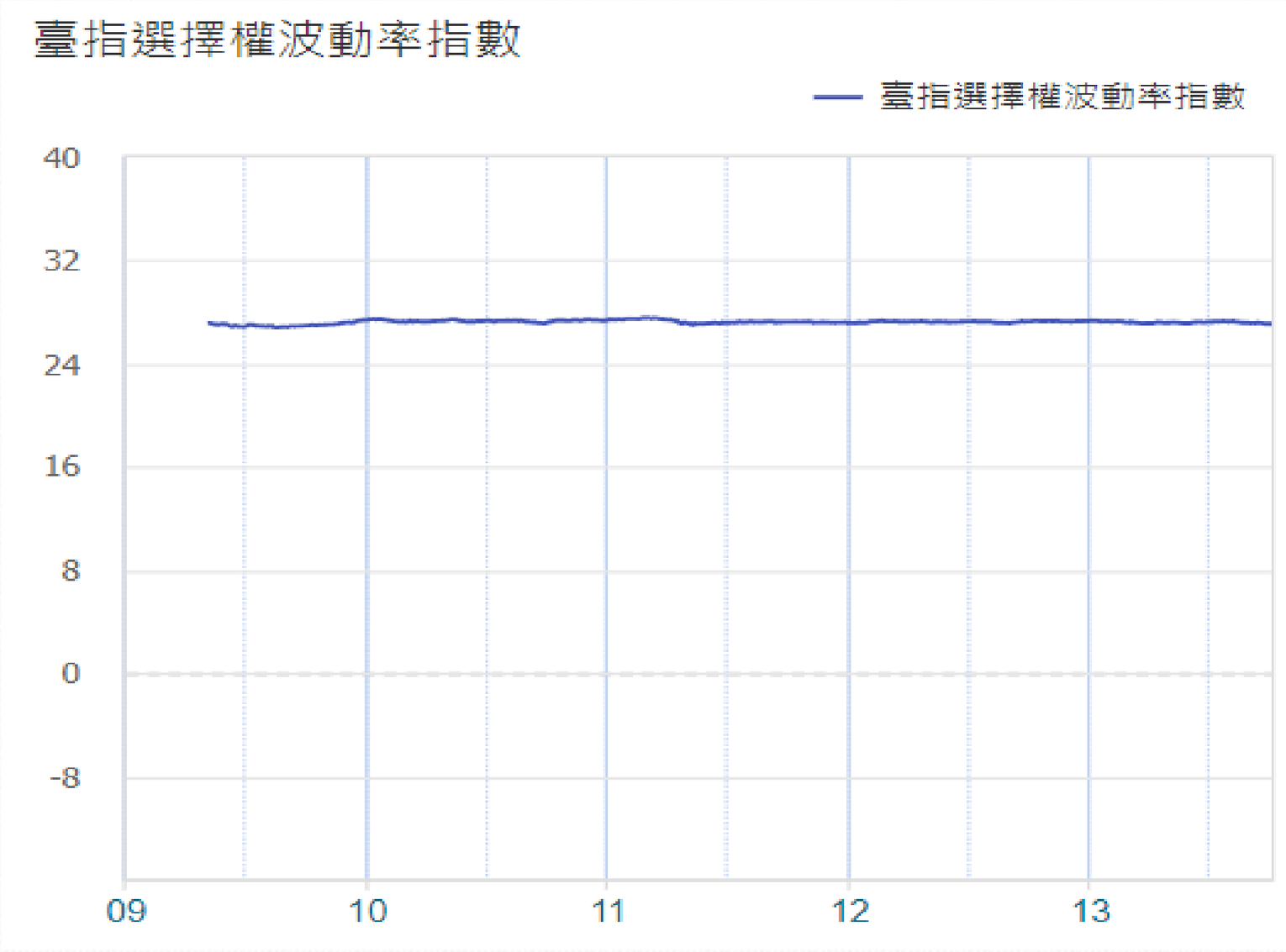
更新日期：2022年10月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指選擇權匯報

2022 年 11 月 選擇權分析表				
台指選擇權	買權成交最大量	13800	買權OI最大量	17800
	賣權成交最大量	12000	賣權OI最大量	14800
	整體隱含波動率	25.55%	較前一交易日	-0.07%
	買權隱含波動率	22.96%	較前一交易日	+0.60%
	賣權隱含波動率	29.62%	較前一交易日	+1.15%
	成交量P/C_Ratio值	0.712	較前一交易日	-0.30
	未平倉P/C_Ratio值	0.840	較前一交易日	-0.08
電子選擇權	買權成交最大量	640	買權OI最大量	660
	賣權成交最大量	510	賣權OI最大量	540
金融選擇權	買權成交最大量	1500	買權OI最大量	1500
	賣權成交最大量	1320	賣權OI最大量	1300

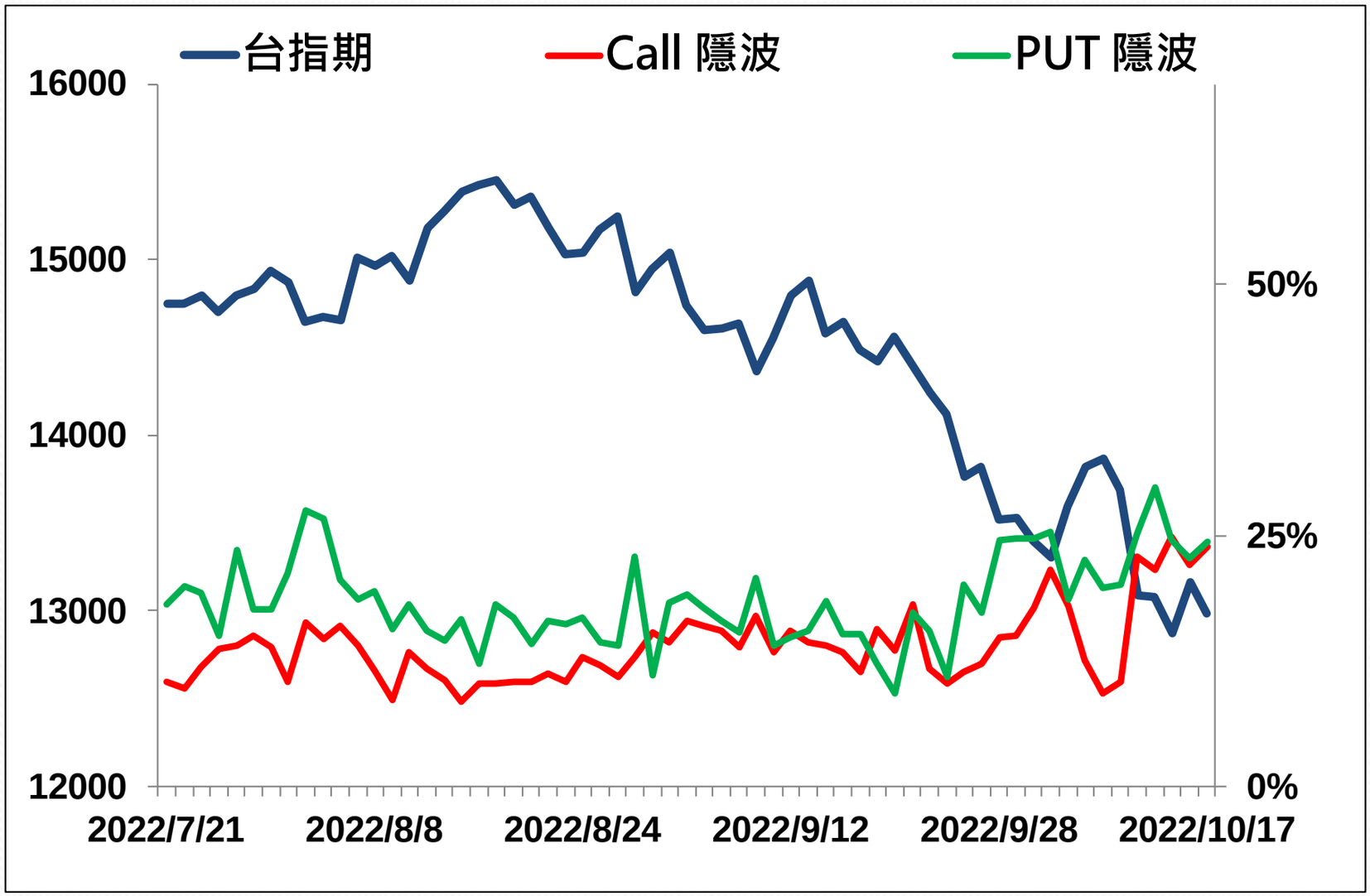
更新日期：2022年10月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



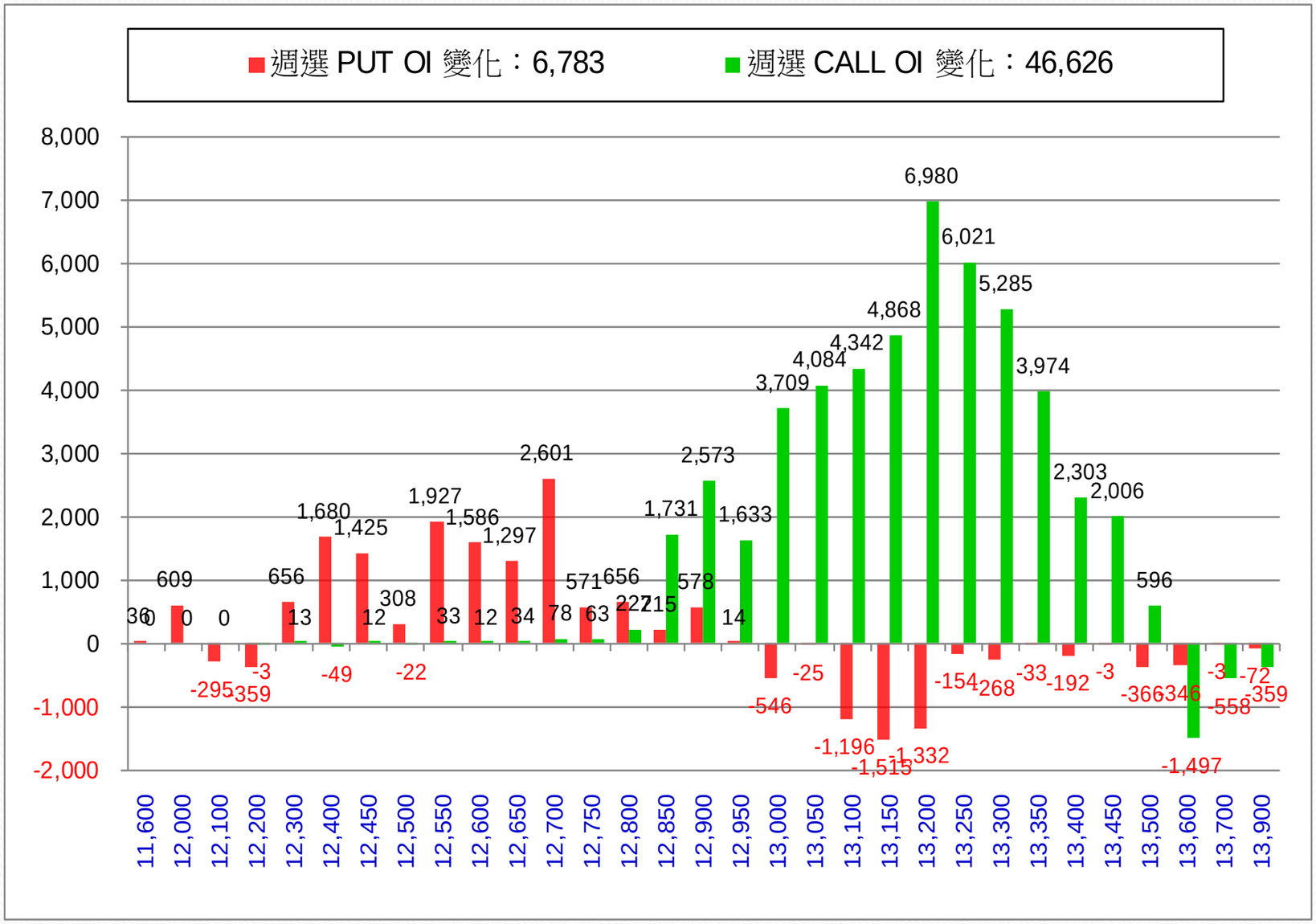
更新日期：2022年10月17日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



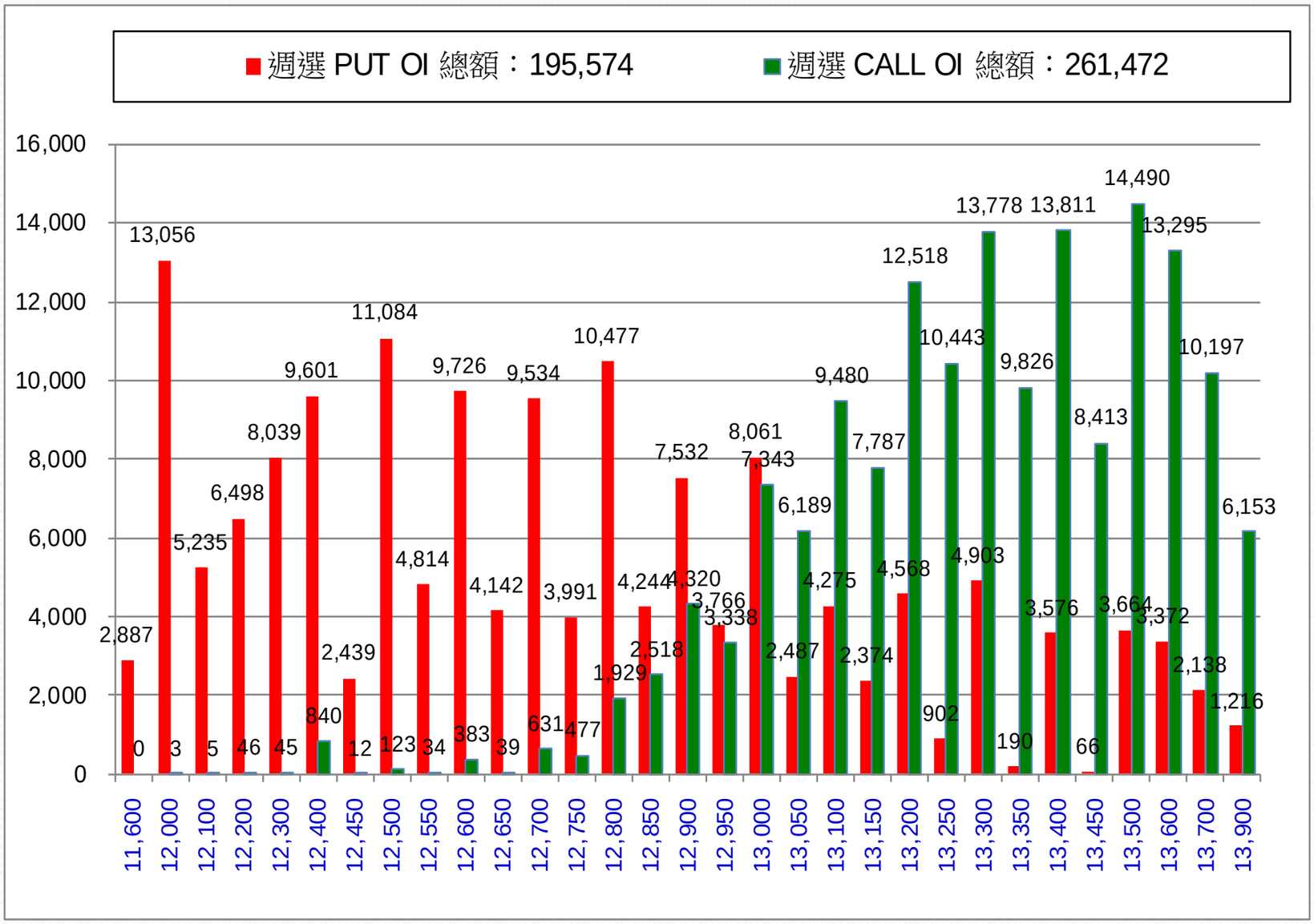
更新日期：2022年10月17日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年10月17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



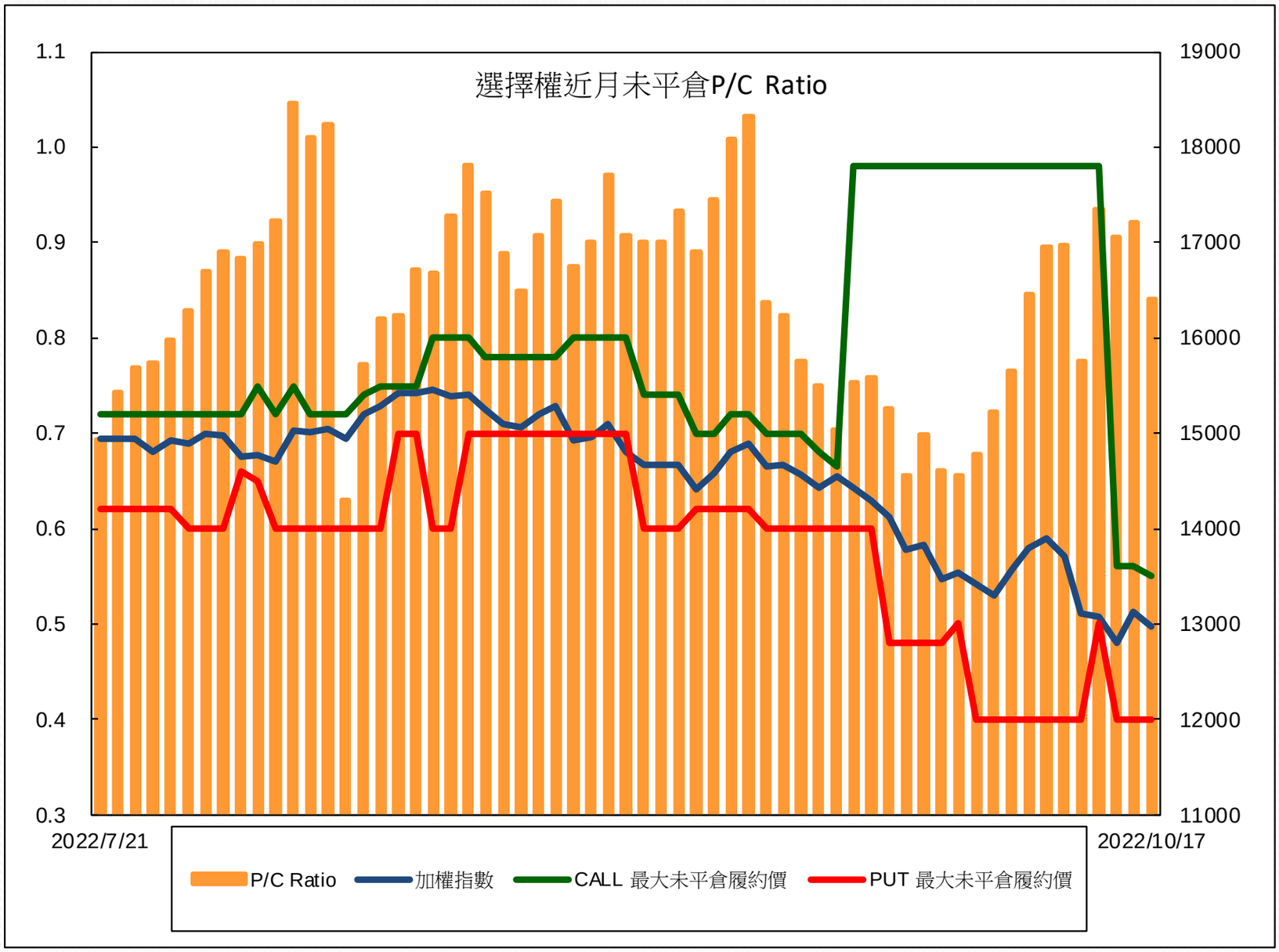
更新日期：2022年10月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	10月14日	83,559	105,741	-22,182
	10月17日	96,322	128,314	-31,992
Put	10月14日	56,568	64,712	-8,144
	10月17日	60,785	63,934	-3,149

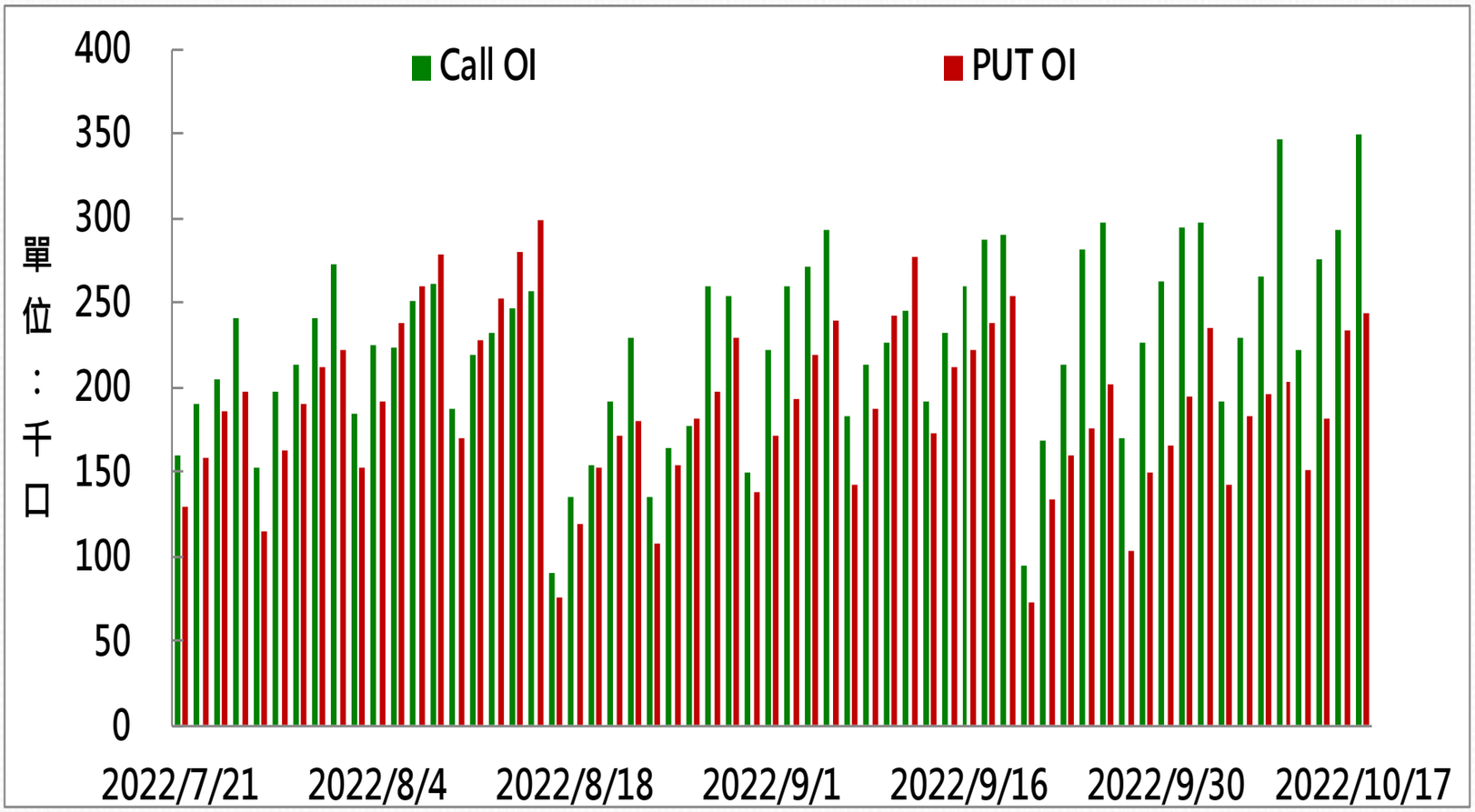
更新日期：2022年10月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年10月17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10月17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10月17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