台指選擇權OI匯報

日期：2022/10/18			結算日：2022/10/19			日期：2022/10/18			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	
1	18	11,900	4,820	-26		0	0	11,200	533	71	
0	3	12,000	12,550	-506		0	1	11,300	1,281	138	
-19	20	12,650	5,325	1,183		0	4	12,200	2,088	559	
-74	557	12,700	10,309	775		5	19	12,300	1,612	85	
-54	423	12,750	5,058	1,067		10	25	12,400	1,751	274	
-366	1,563	12,800	12,322	1,845		-4	44	12,500	2,696	511	
-779	1,739	12,850	6,535	2,291		3	79	12,600	1,322	601	
-1,135	3,185	12,900	10,759	3,227		7	120	12,700	1,112	257	
-745	2,593	12,950	6,262	2,496		-52	264	12,800	2,755	928	※
177	7,520	13,000	10,684	2,623		25	482	12,900	1,058	259	
-1,044	5,145	13,050	6,434	3,947		38	1,249	13,000	1,766	477	
1,744	11,224	13,100	12,154	7,879	※	581	998	13,100	1,579	62	
-426	7,361	13,150	4,699	2,325		172	1,418	13,200	1,360	11	
837	13,355	13,200	6,180	1,612		583	1,312	13,300	377	19	
4,507	14,950	13,250	1,413	511		277	1,151	13,400	234	9	
※ 6,385	20,163	13,300	5,030	127		※ 888	3,093	13,500	283	-9	
1,206	11,032	13,350	320	130		357	1,973	13,600	105	18	
-250	13,561	13,400	3,985	409		292	2,251	13,700	68	0	
-1,744	6,669	13,450	173	107		750	4,698	13,800	503	2	
-578	13,912	13,500	3,608	-56		228	2,128	13,900	44	-10	
-780	12,515	13,600	3,349	-23		311	4,701	14,000	77	14	
-1,841	8,356	13,700	2,104	-34		251	1,397	14,100	51	0	
-650	7,837	13,800	3,064	-17		2	1,569	14,200	64	0	
-121	6,032	13,900	1,209	-7		183	1,511	14,300	48	1	
-2,082	9,307	14,000	1,680	-13		22	1,351	14,400	54	0	
-102	5,314	14,200	661	-2		7	1,054	14,600	428	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	
1,073	262,545	0.8279	217,353	21,779		5,605	53,754	0.8811	47,365	6,916	
昨日 P/C	0.7480	今日增減變化		0.0799		昨日 P/C	0.8401	今日增減變化		0.0411	

更新日期：2022年10月18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10月18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	89,759,211	75,056,027	14,703,184	8,892,322	2,909,028	1,133,894	1,775,134	-324,027
投信	22,135,115	46,905,233	-24,770,118	-5,508,939	396,080	0	396,080	2,906
自營商	38,374,415	28,882,527	9,491,888	-3,748,624	1,824,369	1,134,513	689,856	-9,723
	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	875,870	1,468,055	-592,185	-9,850	2,627	156,400	-153,773	21,676
投信	101,514	0	101,514	1,022	0	0	0	0
自營商	554,486	458,747	95,739	-3,345	386,380	187,895	198,485	-1,687

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18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	60,123	24,440	35,683	-217	50,206	23,934	26,272	1,960
投信	0	0	0	0	700	111	589	0
自營商	91,567	127,405	-35,838	-3,846	58,831	72,946	-14,115	-10,966
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	21,855	4,444	17,411	-3,440	3,574	16,730	-13,156	-222
特定法人 (全月)	40,397	0	40,397	1,922	10,984	34,749	-23,765	-3,602
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	83,258	99,542	-16,284	-7,028	70,660	70,389	271	17,271
十大交易人(全月)	142,765	144,980	-2,215	-4,260	93,691	100,613	-6,922	16,358
全市場未沖銷 (近月)			262,545	1,073			217,353	21,779
全市場未沖銷 (全月)			356,506	6,746			273,496	28,976

更新日期：2022年10月18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	13300
	賣權成交最大量	13000	賣權OI最大量	12000
	整體隱含波動率	18.99%	較前一交易日	-5.06%
	買權隱含波動率	15.22%	較前一交易日	-8.75%
	賣權隱含波動率	23.57%	較前一交易日	-0.59%
電子選擇權	買權成交最大量	650	買權OI最大量	660
	賣權成交最大量	530	賣權OI最大量	540
金融選擇權	買權成交最大量	1520	買權OI最大量	1500
	賣權成交最大量	1300	賣權OI最大量	1300

更新日期：2022年10月18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	14000	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	24.84%	較前一交易日	+0.71%
	買權隱含波動率	20.90%	較前一交易日	-2.06%
	賣權隱含波動率	29.24%	較前一交易日	-0.38%
	成交量P/C_Ratio值	0.917	較前一交易日	+0.20
	未平倉P/C_Ratio值	0.881	較前一交易日	+0.04
電子選擇權	買權成交最大量	650	買權OI最大量	660
	賣權成交最大量	530	賣權OI最大量	540
金融選擇權	買權成交最大量	1520	買權OI最大量	1500
	賣權成交最大量	1300	賣權OI最大量	1300

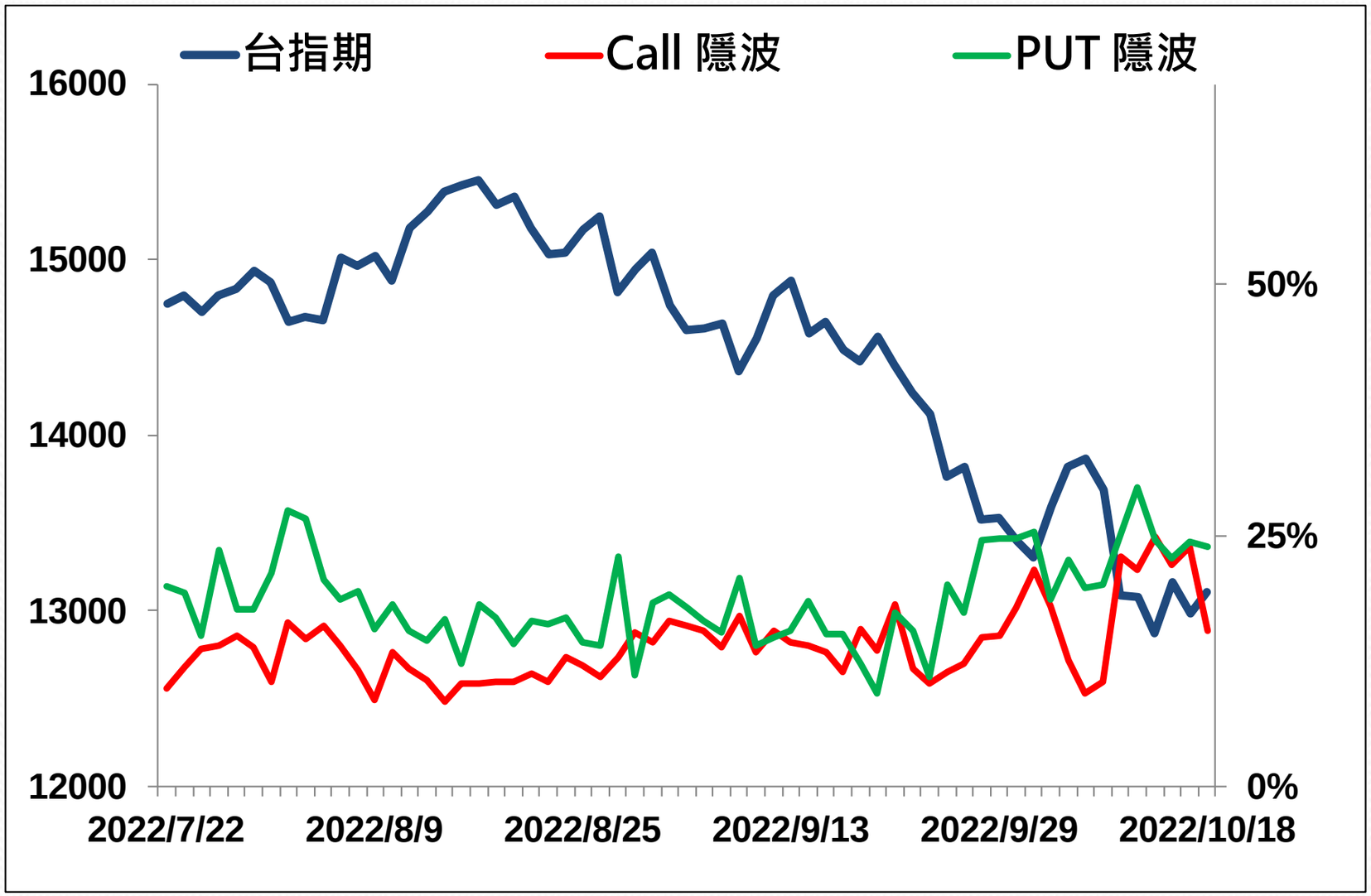
更新日期：2022年10月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



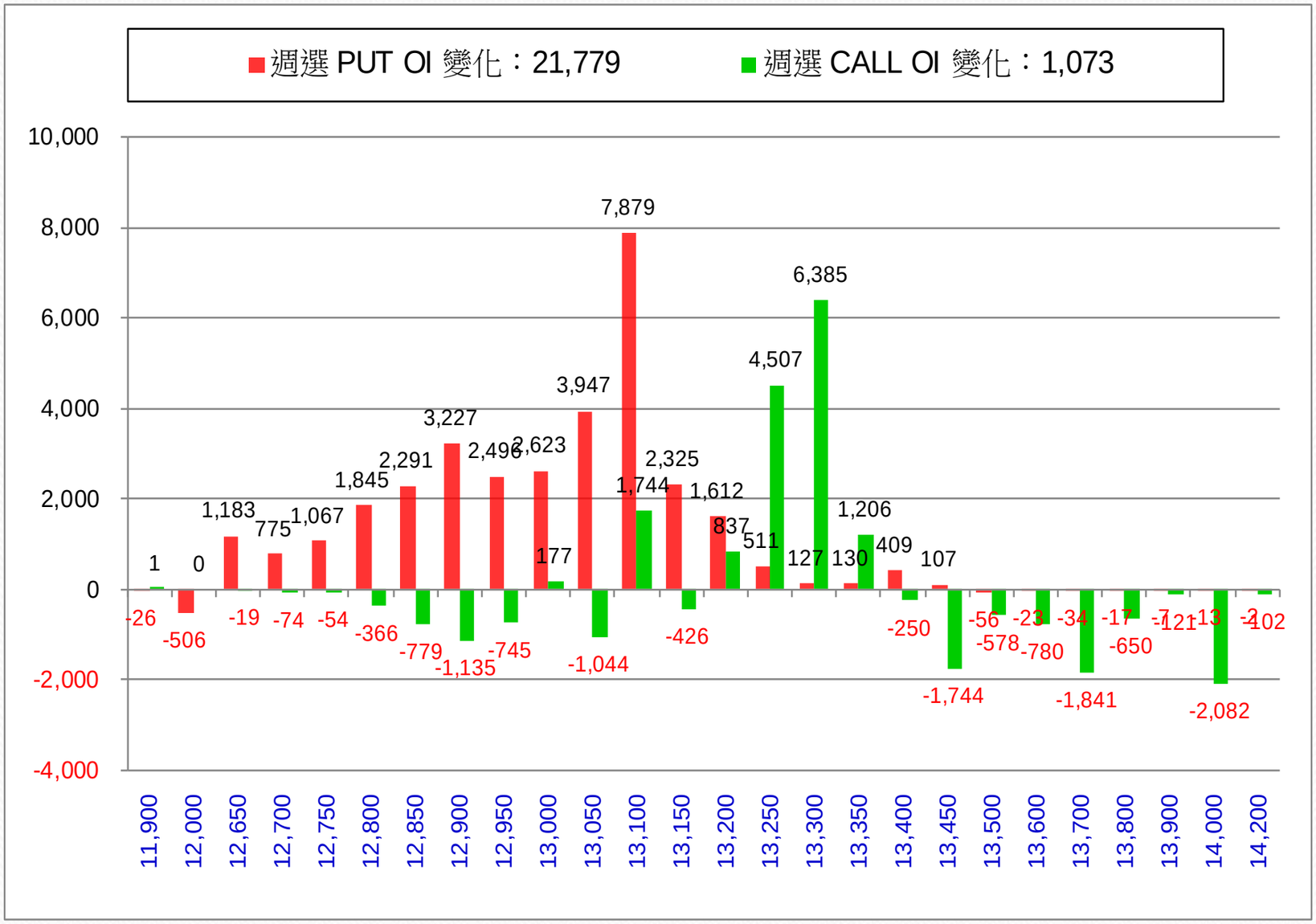
更新日期：2022年10月18日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



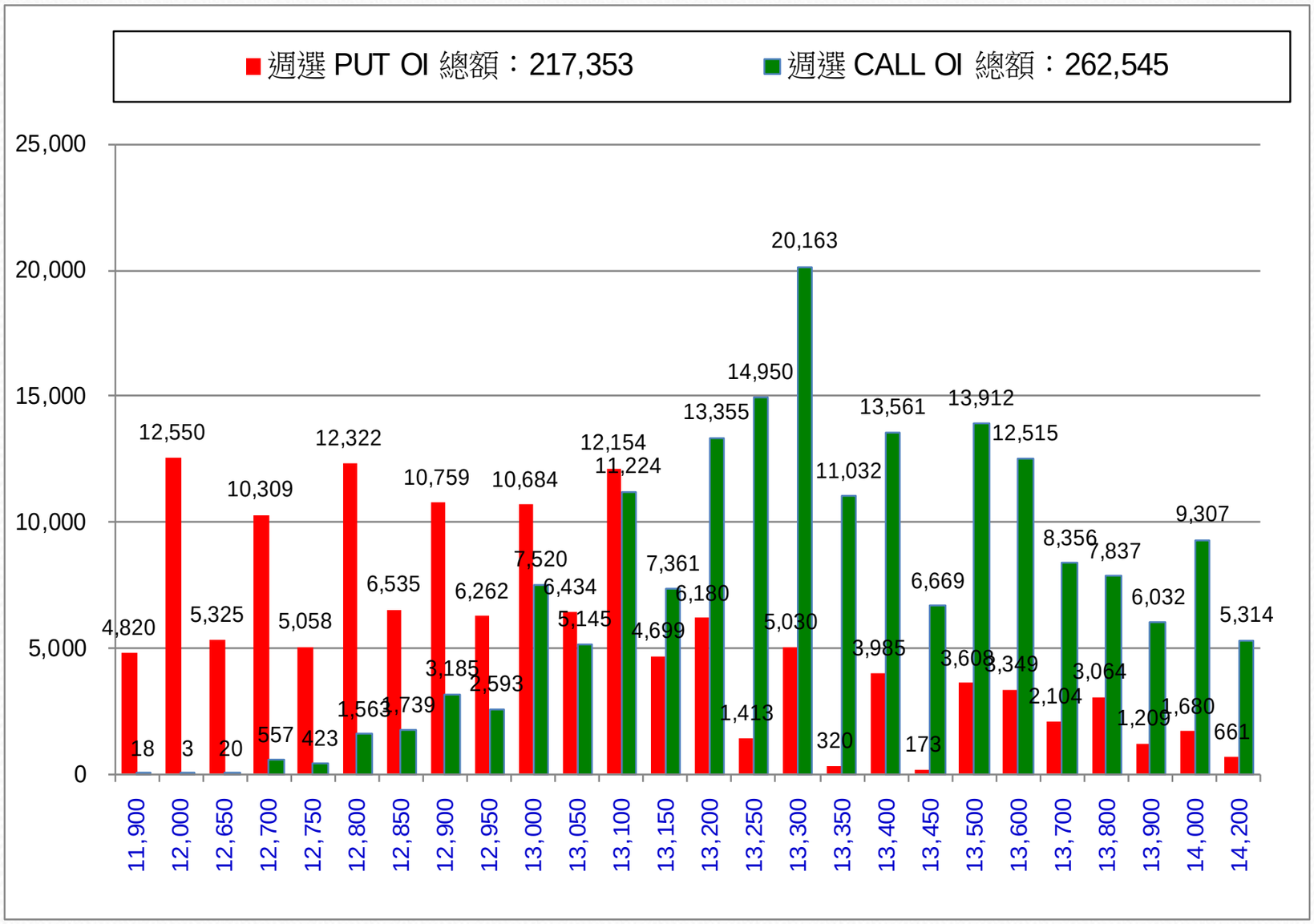
更新日期：2022年10月18日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年10月18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



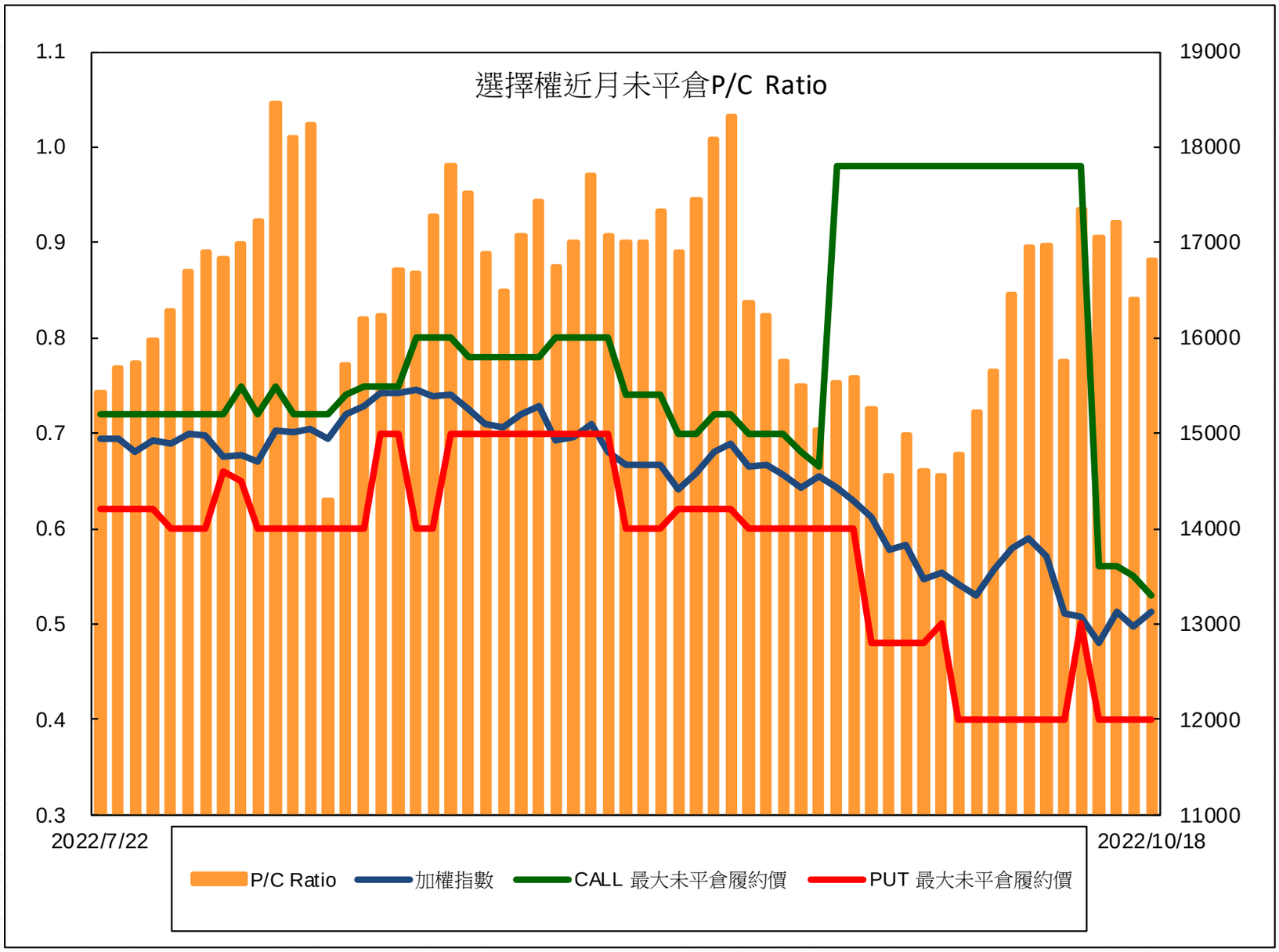
更新日期：2022年10月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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17日	96,322	128,314	-31,992
	10月18日	91,567	127,405	-35,838
Put	10月17日	60,785	63,934	-3,149
	10月18日	58,831	72,946	-14,115

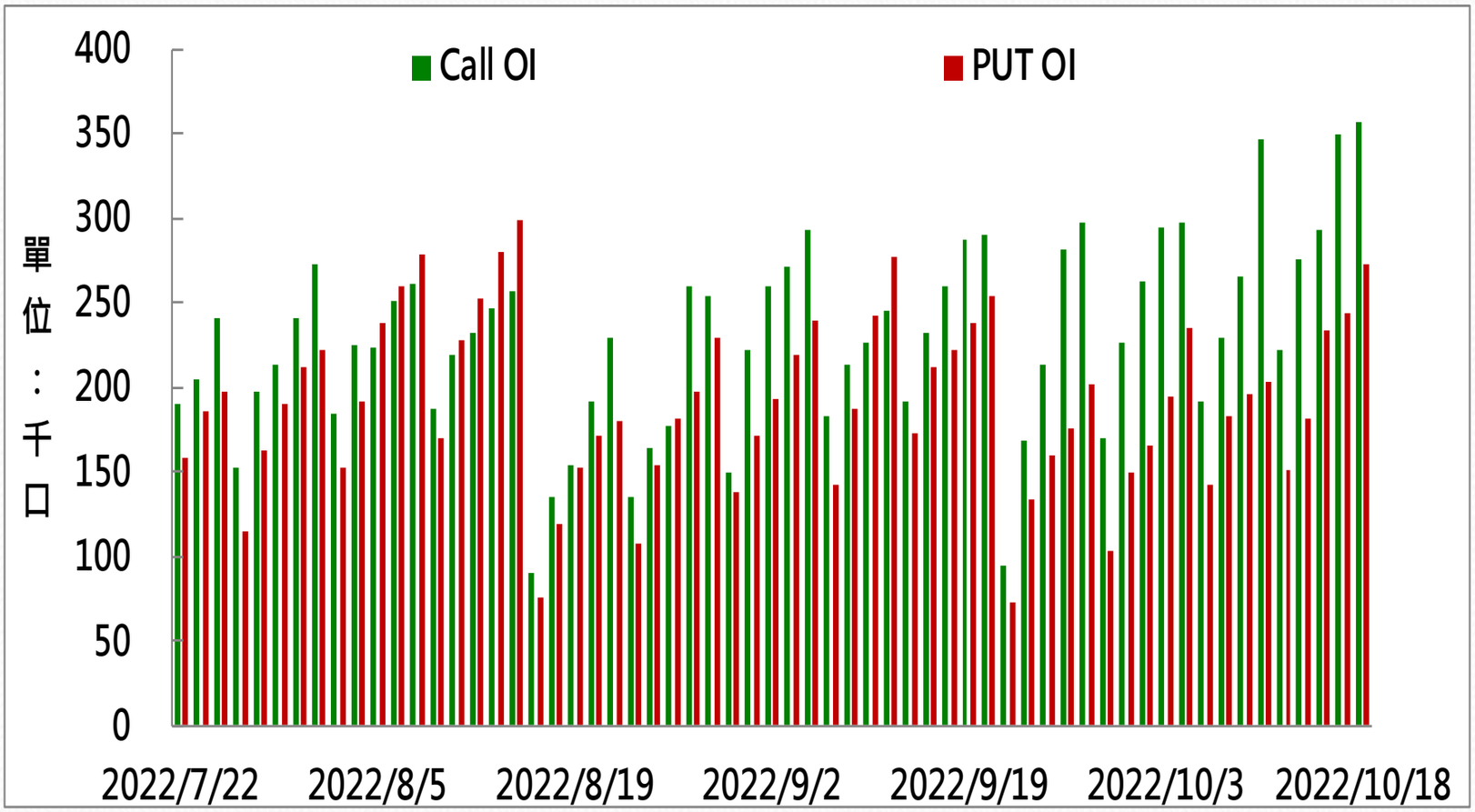
更新日期：2022年10月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年10月18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18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18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