台指選擇權OI匯報

日期：2022/10/19			結算日：2022/10/26				日期：2022/10/19			結算日：2022/11/16		
202210W4							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	12,400	1,922	1,922			0	3	12,100	1,380	100	
8	8	12,500	1,413	1,413			23	27	12,200	2,453	365	
12	12	12,600	2,308	2,308	※		22	41	12,300	1,377	-235	
38	38	12,700	1,086	1,086			112	137	12,400	2,013	262	
59	59	12,750	408	408			3	47	12,500	3,288	592	※
102	102	12,800	1,004	1,004			-1	78	12,600	1,560	238	
45	45	12,850	547	547			13	133	12,700	1,444	332	
152	152	12,900	655	655			32	296	12,800	2,956	201	
126	126	12,950	331	331			55	537	12,900	1,212	154	
861	861	13,000	676	676			627	1,876	13,000	2,182	416	
383	383	13,050	394	394			141	1,139	13,100	2,015	436	
1,246	1,246	13,100	528	528			110	1,528	13,200	1,425	65	
567	567	13,150	140	140			351	1,663	13,300	356	-21	
1,136	1,136	13,200	204	204			511	1,662	13,400	273	39	
674	674	13,250	76	76			476	3,569	13,500	293	10	
1,991	1,991	13,300	28	28			680	2,653	13,600	123	18	
1,167	1,167	13,350	23	23			1,497	3,748	13,700	89	21	
1,549	1,549	13,400	84	84			608	5,306	13,800	538	35	
1,432	1,432	13,450	2	2			683	2,811	13,900	105	61	
3,502	3,502	13,500	20	20		※	1,730	6,431	14,000	73	-4	
※ 4,487	4,487	13,600	2	2			222	1,619	14,100	50	-1	
2,072	2,072	13,700	2	2			356	1,925	14,200	73	9	
1,688	1,688	13,800	0	0			298	1,809	14,300	48	0	
1,936	1,936	14,000	0	0			-59	2,405	14,500	427	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	
28,037	28,037	0.5948	16,676	16,676			10,413	64,167	0.8259	52,995	5,630	
昨日 P/C	0.8279	今日增減變化		-0.2331			昨日 P/C	0.8811	今日增減變化		-0.0553	

更新日期：2022年10月19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19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	68,283,106	55,943,660	12,339,446	-2,363,738	2,690,393	696,725	1,993,668	218,534
投信	22,457,961	46,982,065	-24,524,104	246,014	388,377	0	388,377	-7,703
自營商	31,891,745	17,928,650	13,963,095	4,471,207	764,985	407,207	357,778	-332,078
	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	949,296	1,090,797	-141,501	450,684	6,563	34,128	-27,565	126,208
投信	100,287	0	100,287	-1,227	0	0	0	0
自營商	196,453	160,735	35,718	-60,021	32,815	11,813	21,002	-177,483

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19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	31,549	11,705	19,844	-15,839	23,771	12,865	10,906	-15,366
投信	0	0	0	0	200	136	64	-525
自營商	50,845	61,089	-10,244	25,594	20,596	25,597	-5,001	9,114
特定法人(週)	0	0	0	---	0	360	-360	---
特定法人(近月)	17,431	7,891	9,540	---	10,207	20,071	-9,864	---
特定法人 (全月)	26,309	6,431	19,878	-20,519	12,298	21,871	-9,573	14,192
十大交易人(週)	12,492	16,431	-3,939	---	6,592	6,055	537	---
十大交易人(近月)	39,263	32,768	6,495	---	28,810	34,034	-5,224	---
十大交易人(全月)	80,313	73,557	6,756	8,971	38,053	43,027	-4,974	1,948
全市場未沖銷 (近月)			64,167	---			52,995	---
全市場未沖銷 (全月)			133,387	-223,119			79,269	-194,227

更新日期：2022年10月19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 10W4 週 選擇權分析表				
台指選擇權	買權成交最大量	13500	買權OI最大量	13600
	賣權成交最大量	12600	賣權OI最大量	12600
	整體隱含波動率	21.37%	較前一交易日	+2.38%
	買權隱含波動率	18.56%	較前一交易日	+3.34%
	賣權隱含波動率	26.02%	較前一交易日	+2.45%
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	560	賣權OI最大量	540
金融選擇權	買權成交最大量	1440	買權OI最大量	1500
	賣權成交最大量	1340	賣權OI最大量	1300

更新日期：2022年10月19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	14000
	賣權成交最大量	12500	賣權OI最大量	14800
	整體隱含波動率	24.25%	較前一交易日	+0.59%
	買權隱含波動率	21.43%	較前一交易日	+0.53%
	賣權隱含波動率	27.43%	較前一交易日	-1.81%
	成交量P/C_Ratio值	0.852	較前一交易日	-0.07
	未平倉P/C_Ratio值	0.826	較前一交易日	-0.06
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	560	賣權OI最大量	540
金融選擇權	買權成交最大量	1440	買權OI最大量	1500
	賣權成交最大量	1340	賣權OI最大量	1300

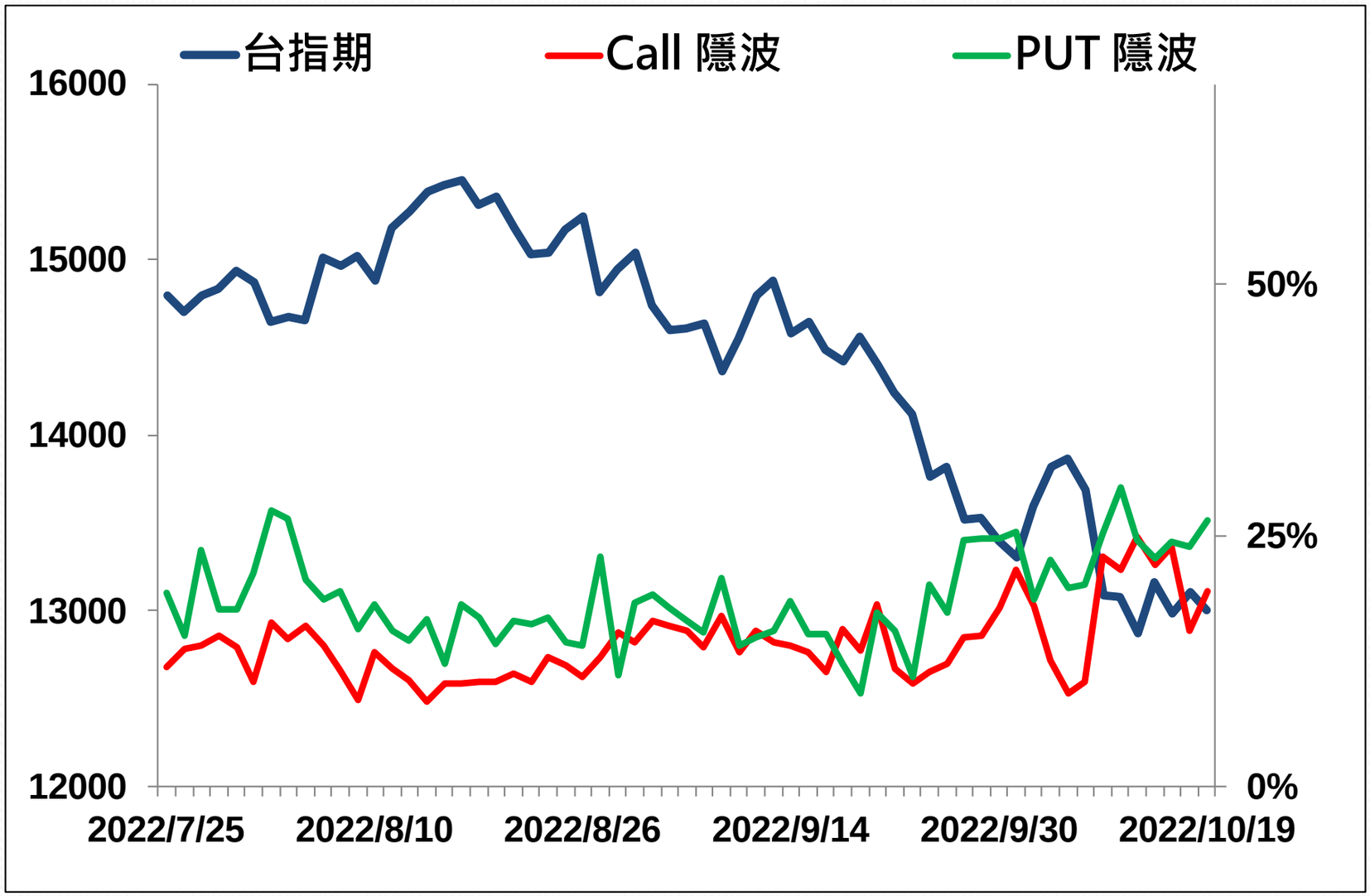
更新日期：2022年10月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



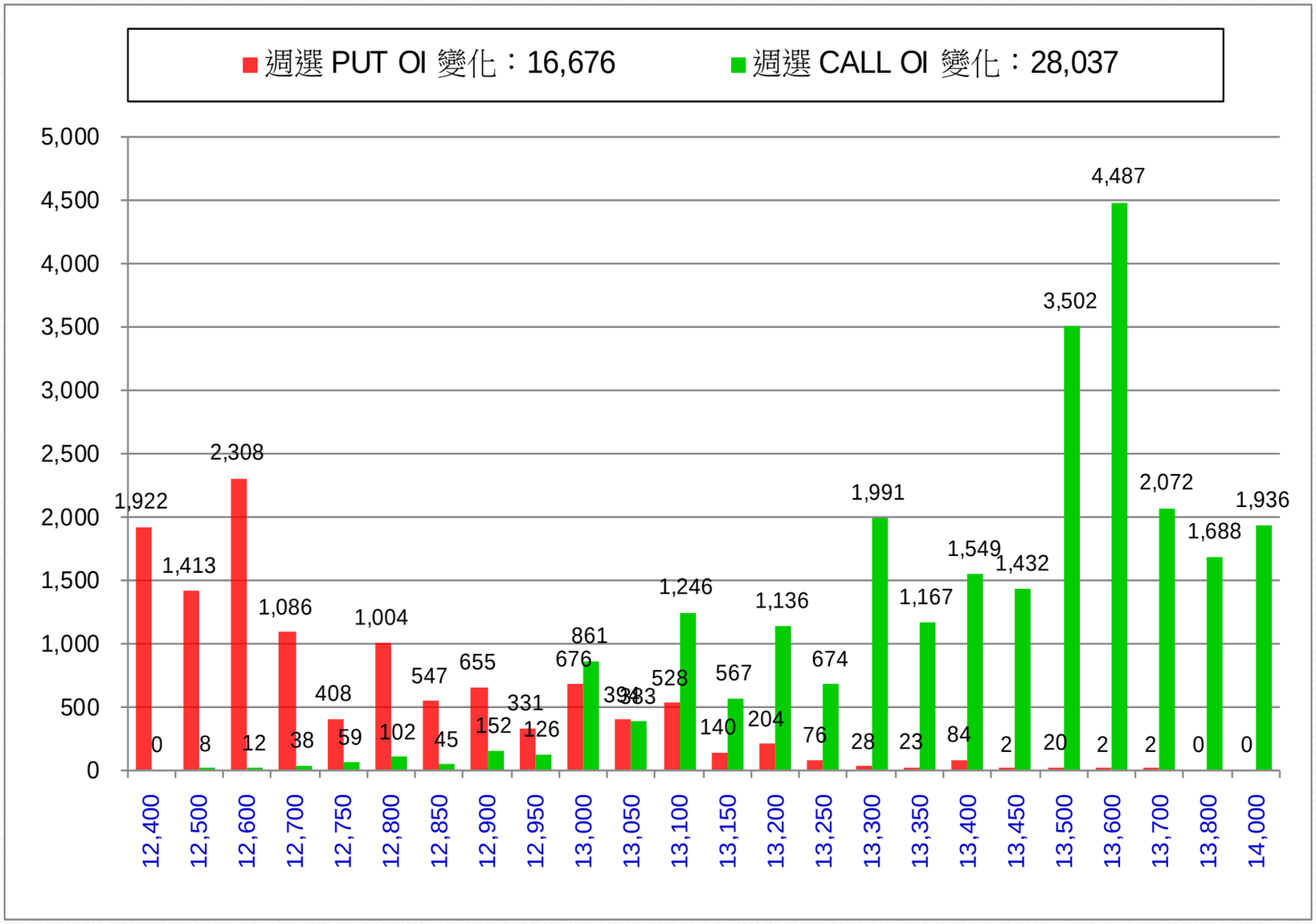
更新日期：2022年10月19日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



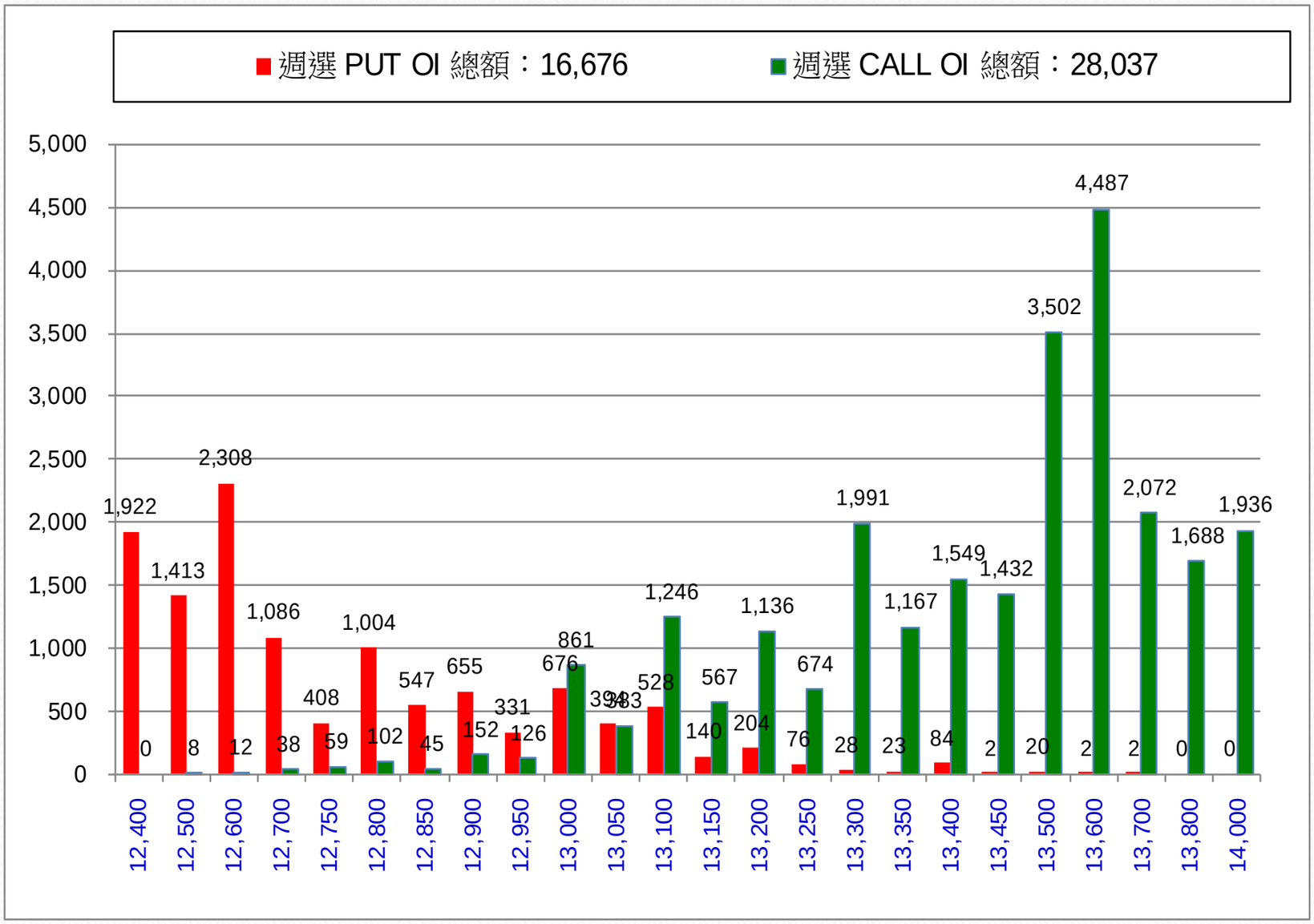
更新日期：2022年10月19日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年10月19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



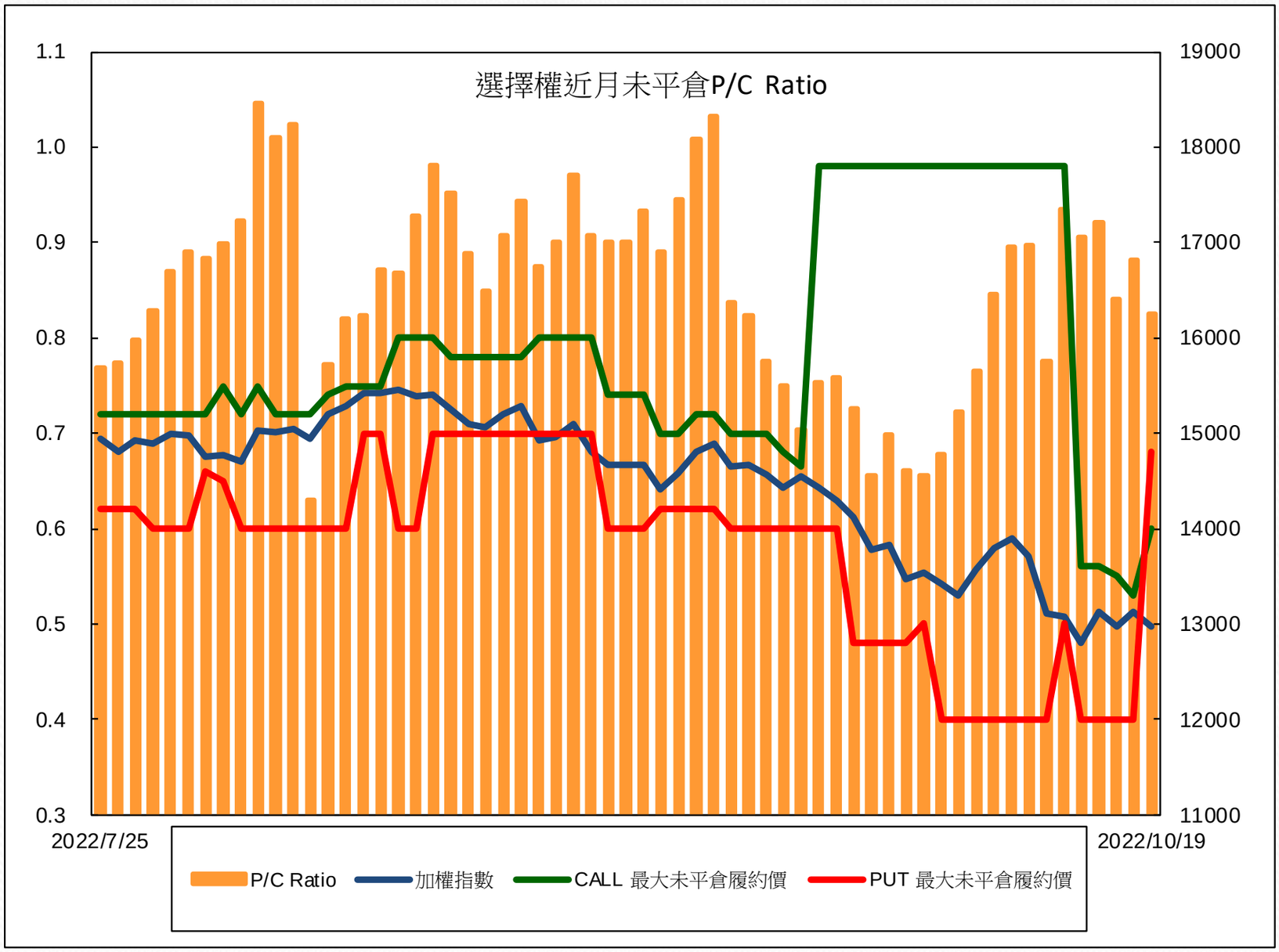
更新日期：2022年10月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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18日	91,567	127,405	-35,838
	10月19日	50,845	61,089	-10,244
Put	10月18日	58,831	72,946	-14,115
	10月19日	20,596	25,597	-5,001

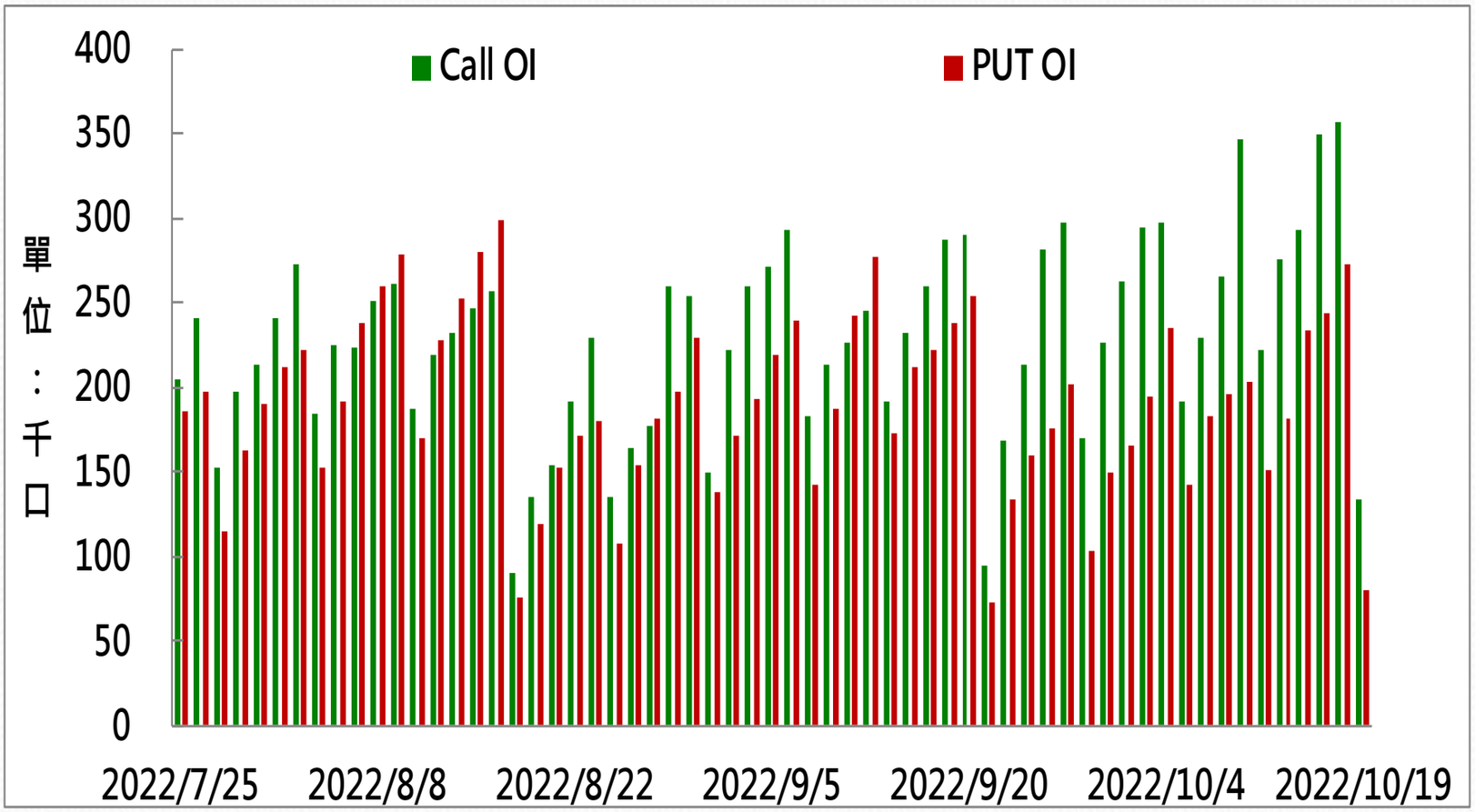
更新日期：2022年10月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年10月19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19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19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