台指選擇權OI匯報

日期：2022/10/20			結算日：2022/10/26			日期：2022/10/20			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	
46	46	12,400	6,329	4,407	※	17	32	12,000	3,477	672	
102	110	12,500	4,826	3,413		47	50	12,100	1,657	277	
208	220	12,600	4,840	2,532		0	27	12,200	2,772	319	
168	168	12,650	1,045	1,045		18	59	12,300	1,959	582	
677	715	12,700	3,407	2,321		43	180	12,400	2,357	344	
615	674	12,750	1,457	1,049		53	100	12,500	3,745	457	
2,059	2,161	12,800	2,440	1,436		121	199	12,600	2,005	445	
1,701	1,746	12,850	912	365		195	328	12,700	1,525	81	
2,717	2,869	12,900	1,254	599		833	1,129	12,800	2,821	-135	
2,387	2,513	12,950	1,092	761		404	941	12,900	882	-330	
3,323	4,184	13,000	1,445	769		1,094	2,970	13,000	1,996	-186	
2,782	3,165	13,050	436	42		1,231	2,370	13,100	2,003	-12	
3,993	5,239	13,100	398	-130		1,167	2,695	13,200	1,415	-10	
2,841	3,408	13,150	132	-8		721	2,384	13,300	423	67	
4,597	5,733	13,200	211	7		※ 3,270	4,932	13,400	231	-42	
3,947	4,621	13,250	86	10		576	4,145	13,500	291	-2	
※ 5,064	7,055	13,300	62	34		578	3,231	13,600	140	17	
4,355	5,522	13,350	63	40		1,118	4,866	13,700	133	44	
3,991	5,540	13,400	78	-6		919	6,225	13,800	535	-3	
2,583	4,015	13,450	2	0		155	2,966	13,900	106	1	
2,416	5,918	13,500	30	10		908	7,339	14,000	75	2	
402	4,889	13,600	2	0		42	1,661	14,100	50	0	
1,765	3,837	13,700	2	0		78	2,003	14,200	72	-1	
780	1,292	13,900	0	0		138	1,565	14,400	54	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	
55,748	83,785	0.6603	55,325	38,649		14,649	78,816	0.7641	60,224	7,229	
昨日 P/C	0.5948	今日增減變化		0.0655		昨日 P/C	0.8259	今日增減變化		-0.0618	

更新日期：2022年10月20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20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	70,458,268	50,685,962	19,772,306	7,432,860	3,214,526	918,772	2,295,754	302,086
投信	22,261,948	47,766,453	-25,504,505	-980,401	387,717	28,198	359,519	-28,858
自營商	31,369,894	19,962,418	11,407,476	-2,555,619	841,145	467,610	373,535	15,757
	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	1,052,006	915,026	136,980	278,481	22,039	33,706	-11,667	15,898
投信	99,995	0	99,995	-292	0	0	0	0
自營商	220,538	298,616	-78,078	-113,796	33,706	29,820	3,886	-17,116

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20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	38,968	14,536	24,432	4,588	28,149	15,057	13,092	2,186
投信	0	0	0	0	200	136	64	0
自營商	73,482	74,165	-683	9,561	29,437	33,025	-3,588	1,413
特定法人(週)	1,479	0	1,479	1,479	795	989	-194	166
特定法人(近月)	20,866	7,891	12,975	3,435	10,207	22,472	-12,265	-2,401
特定法人 (全月)	25,848	0	25,848	5,970	11,156	22,155	-10,999	-1,426
十大交易人(週)	30,791	36,426	-5,635	-1,696	17,058	20,019	-2,961	-3,498
十大交易人(近月)	46,793	36,021	10,772	4,277	29,518	38,716	-9,198	-3,974
十大交易人(全月)	103,761	92,793	10,968	4,212	44,821	57,708	-12,887	-7,913
全市場未沖銷 (近月)			78,816	14,649			60,224	7,229
全市場未沖銷 (全月)			206,104	72,717			125,497	46,228

更新日期：2022年10月20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	13000	買權OI最大量	13300
	賣權成交最大量	12600	賣權OI最大量	12400
	整體隱含波動率	22.22%	較前一交易日	+0.85%
	買權隱含波動率	18.66%	較前一交易日	+0.10%
	賣權隱含波動率	27.04%	較前一交易日	+1.03%
電子選擇權	買權成交最大量	610	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	1340	買權OI最大量	1500
	賣權成交最大量	1340	賣權OI最大量	1360

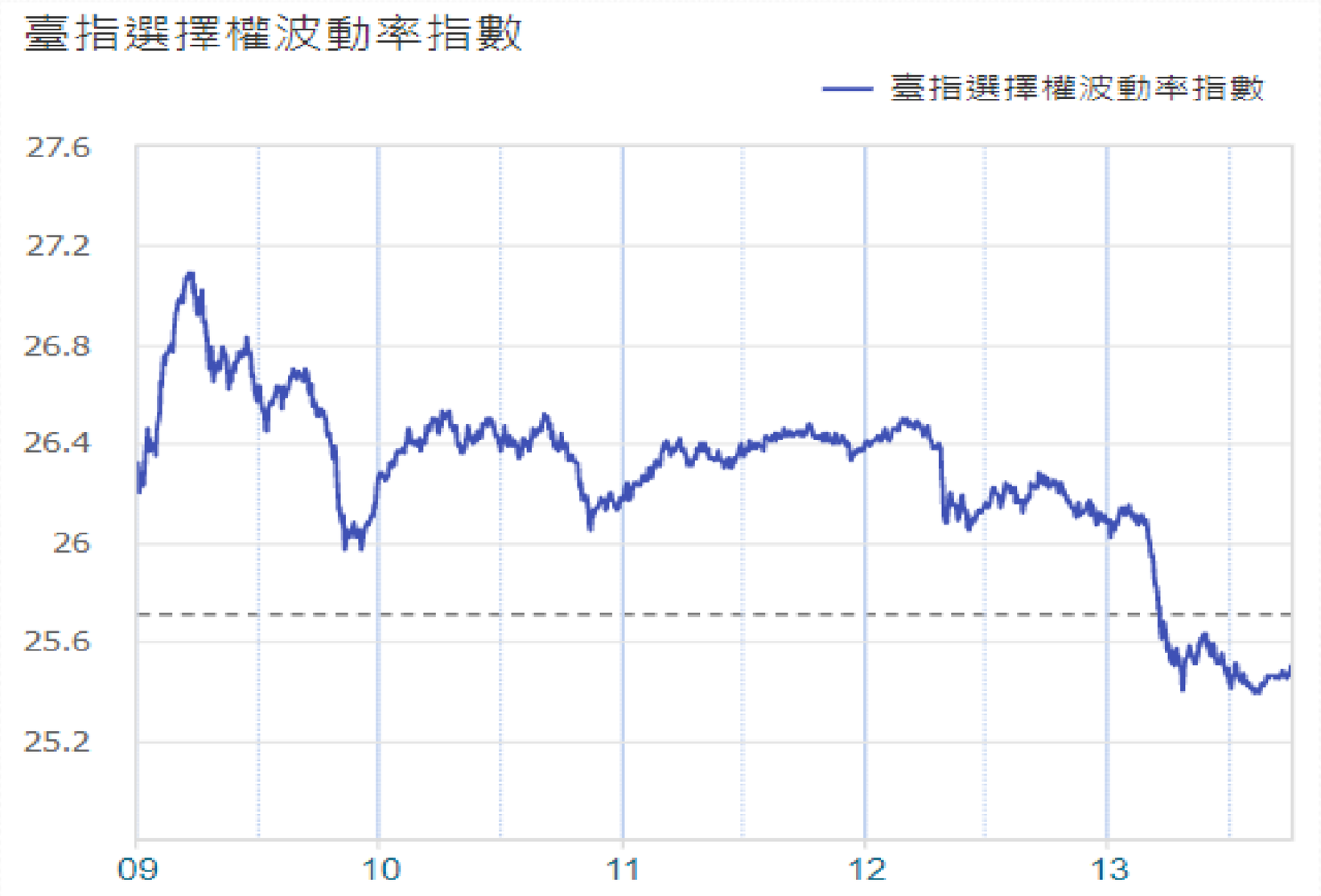
更新日期：2022年10月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	13400	買權OI最大量	14000
	賣權成交最大量	12000	賣權OI最大量	14800
	整體隱含波動率	23.84%	較前一交易日	+0.41%
	買權隱含波動率	20.70%	較前一交易日	-0.73%
	賣權隱含波動率	28.80%	較前一交易日	+1.37%
	成交量P/C_Ratio值	0.718	較前一交易日	-0.13
	未平倉P/C_Ratio值	0.764	較前一交易日	-0.06
電子選擇權	買權成交最大量	610	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	1340	買權OI最大量	1500
	賣權成交最大量	1340	賣權OI最大量	1360

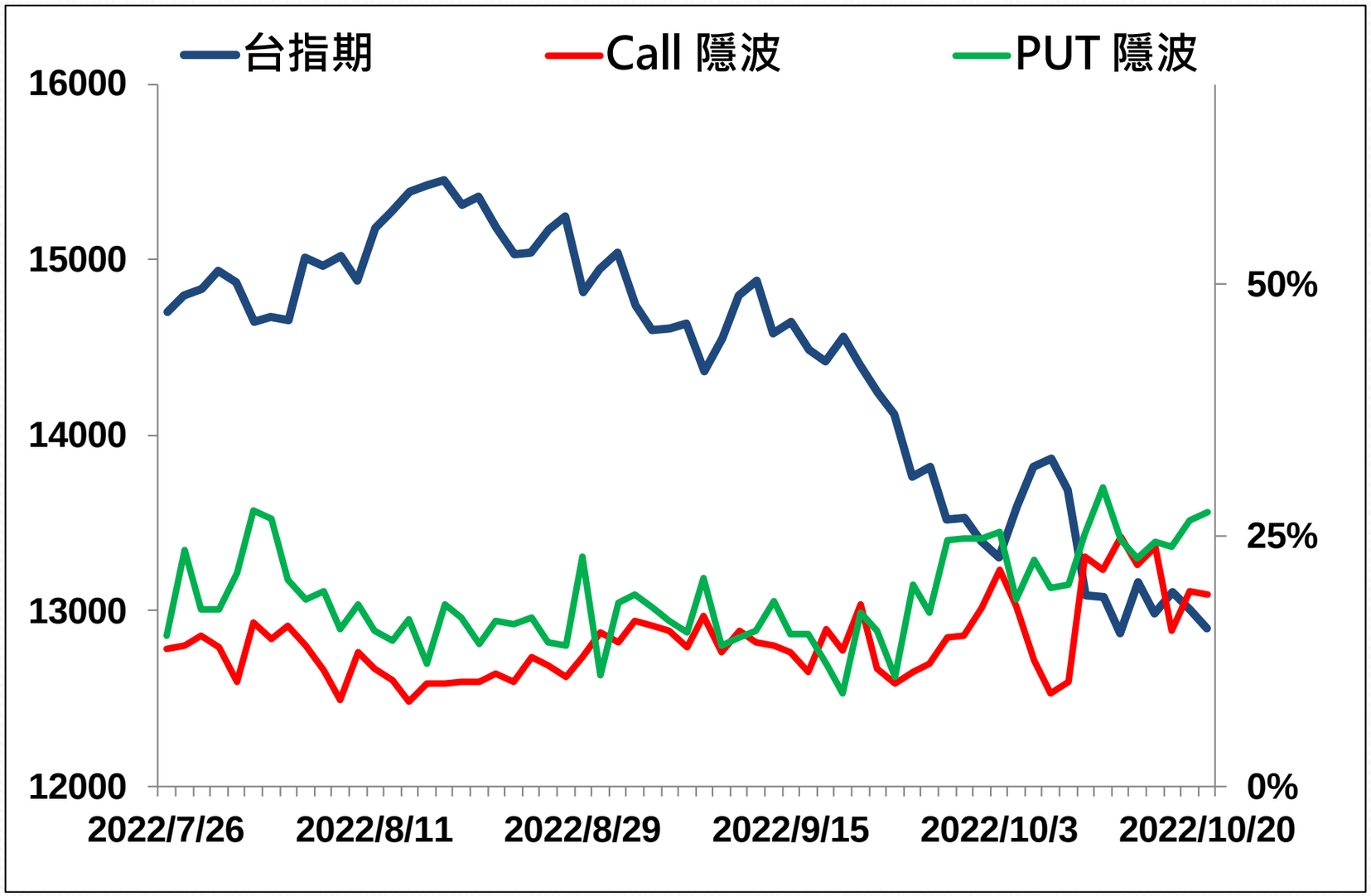
更新日期：2022年10月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



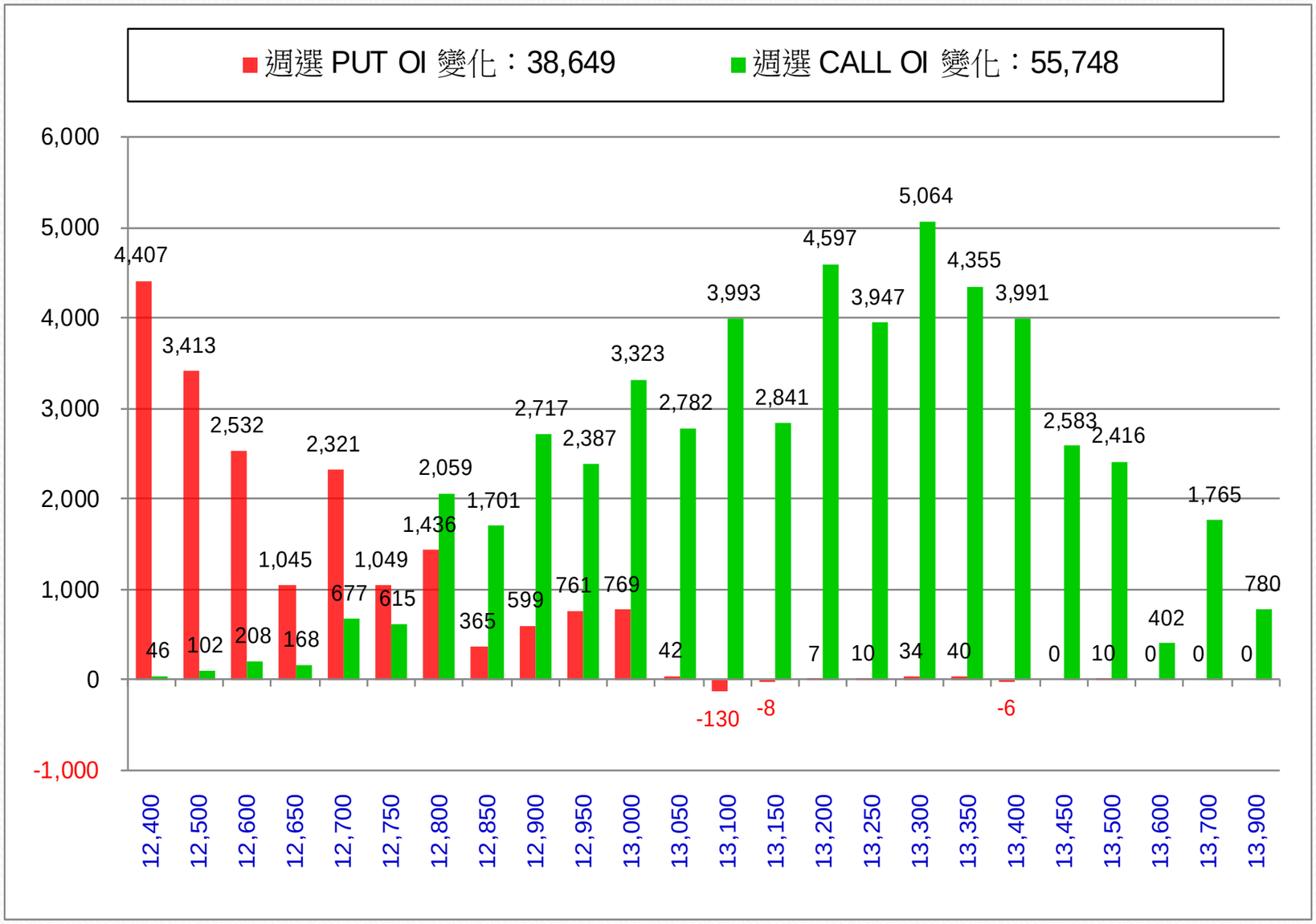
更新日期：2022年10月20日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



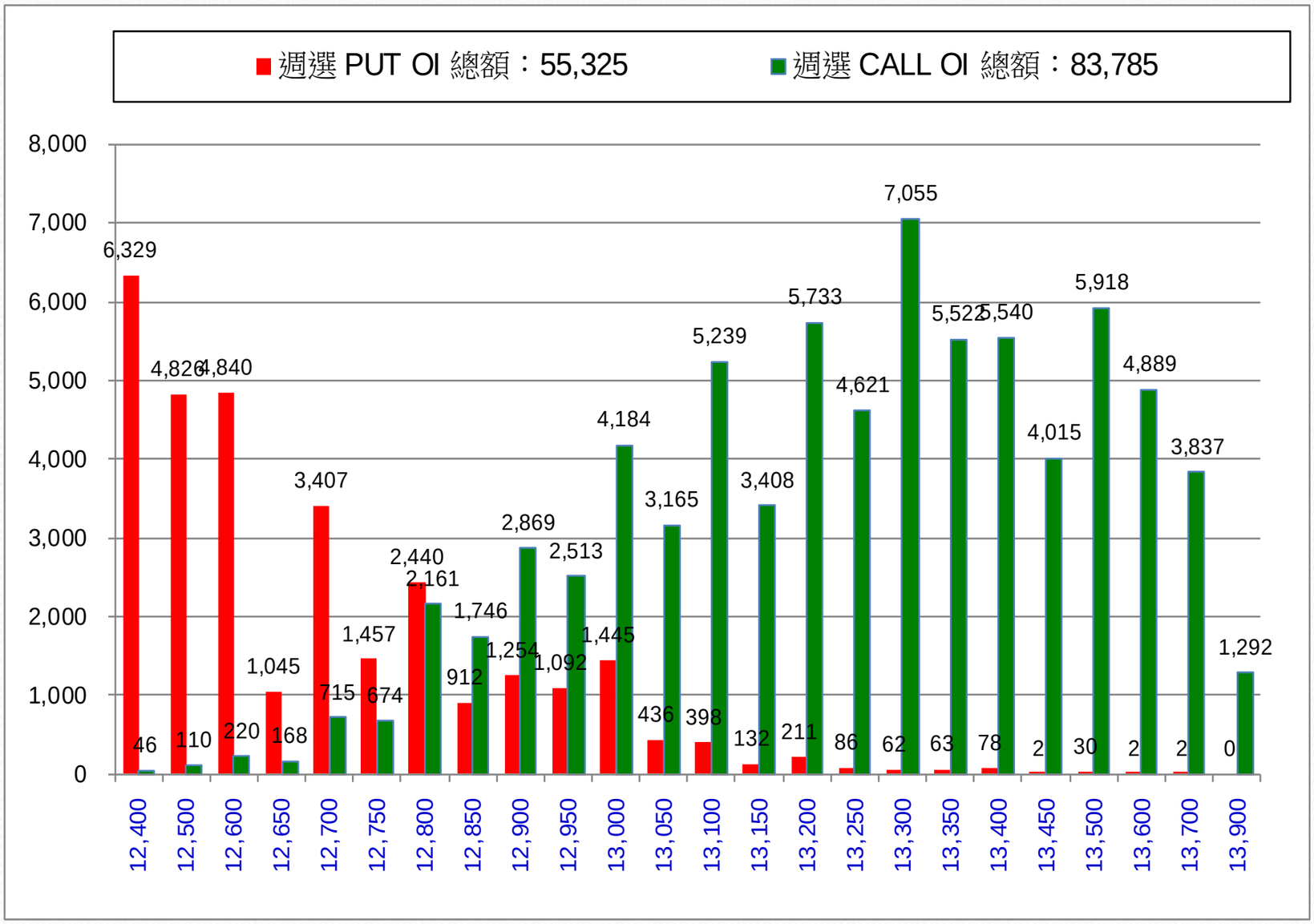
更新日期：2022年10月20日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年10月20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



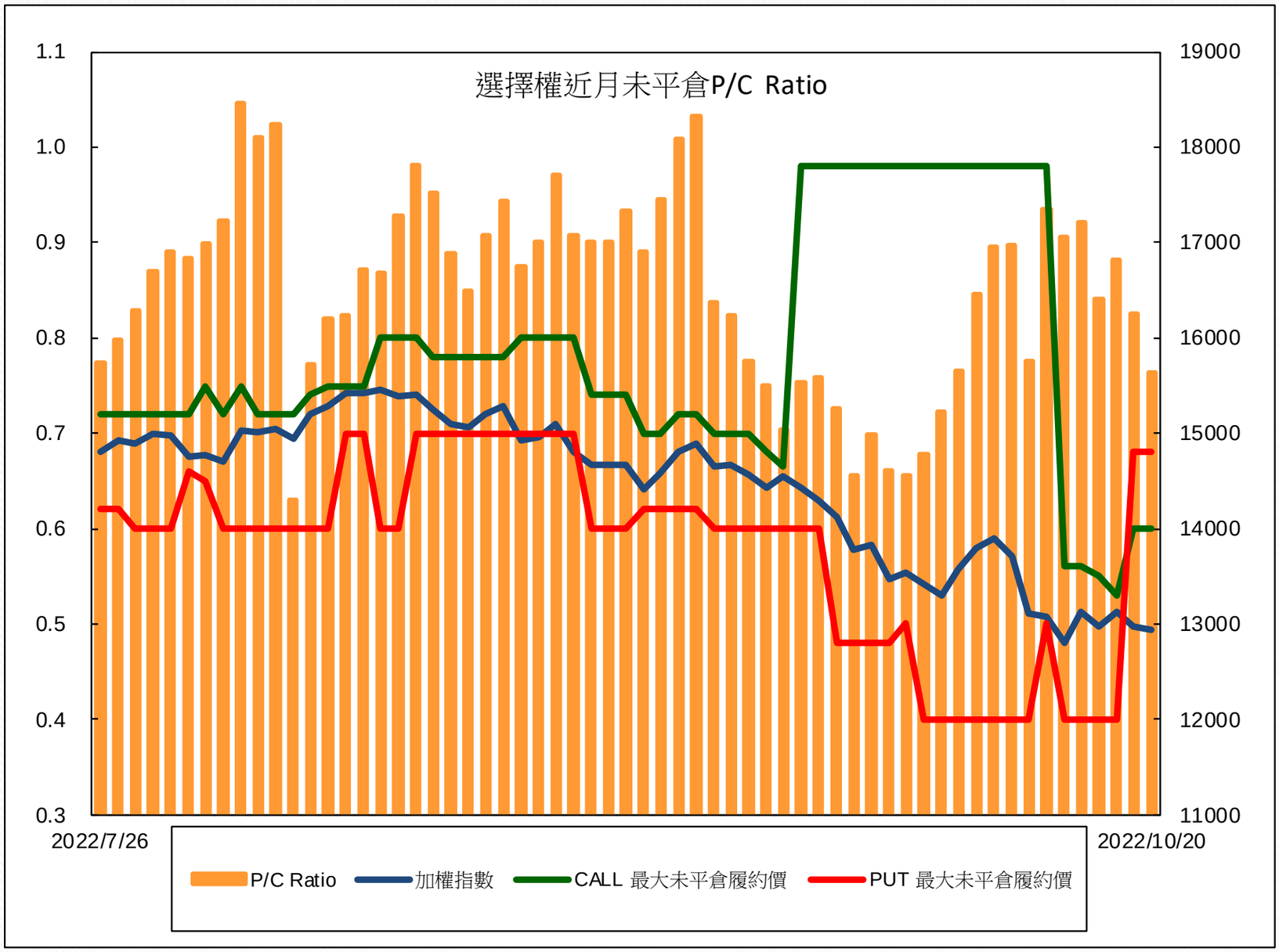
更新日期：2022年10月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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19日	50,845	61,089	-10,244
	10月20日	73,482	74,165	-683
Put	10月19日	20,596	25,597	-5,001
	10月20日	29,437	33,025	-3,588

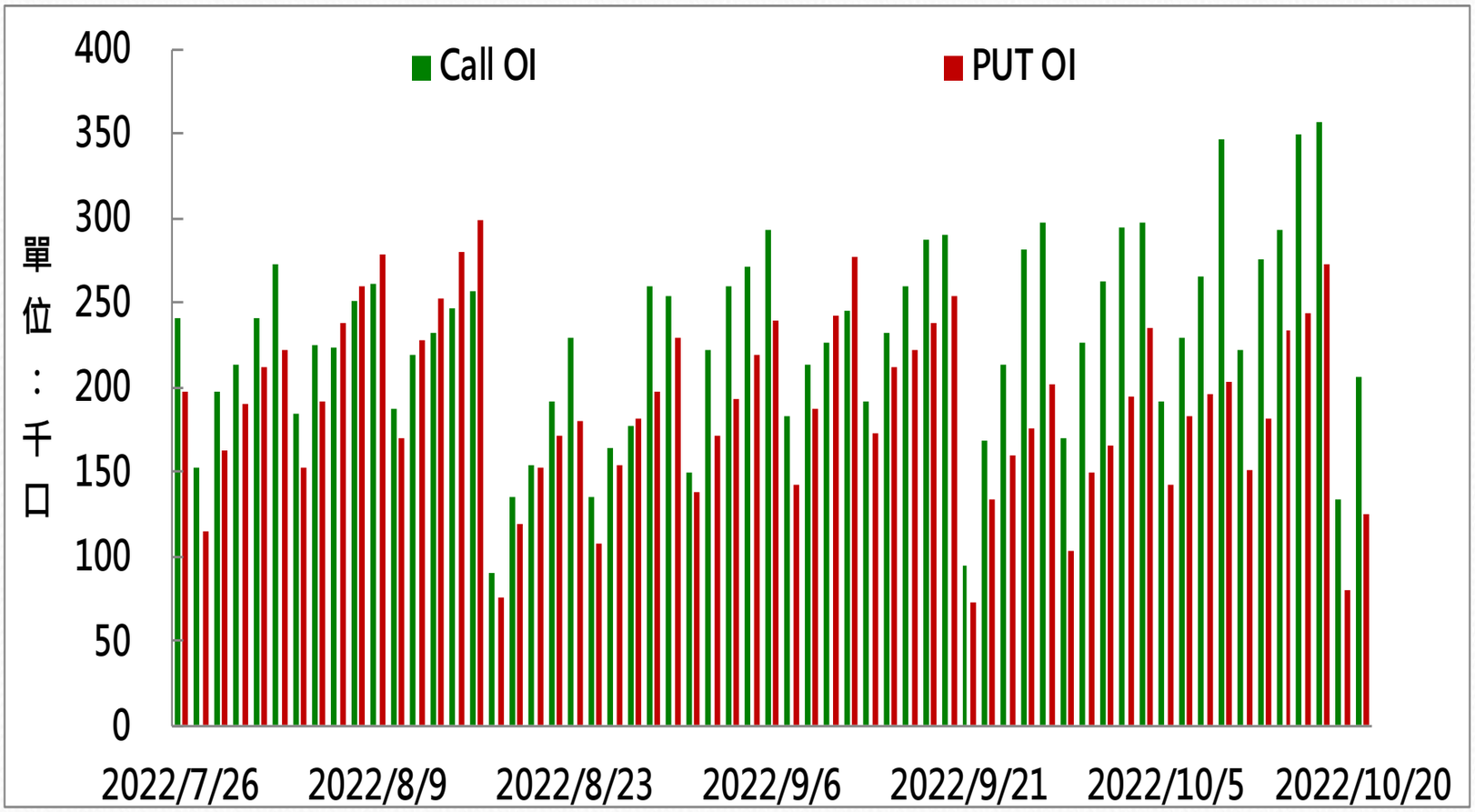
更新日期：2022年10月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年10月20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20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20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