台指選擇權OI匯報

日期：2022/10/24			結算日：2022/10/26			日期：2022/10/24			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	
12	54	12,400	7,885	-57		3	57	12,000	4,901	69	
6	6	12,450	649	649		3	62	12,100	1,973	177	
-32	115	12,500	8,204	1,607		0	26	12,200	3,336	134	
0	0	12,550	1,528	1,528		-1	63	12,300	2,385	70	
-39	298	12,600	8,100	2,069		6	208	12,400	2,745	-25	
11	168	12,650	3,196	1,502		-1	107	12,500	4,336	265	
-194	660	12,700	8,157	2,950		5	218	12,600	2,601	217	
-72	759	12,750	5,118	3,213	※	13	432	12,700	3,245	1,470	※
-434	2,594	12,800	5,987	2,373		-32	1,203	12,800	3,982	-52	
378	2,060	12,850	3,877	1,821		330	1,262	12,900	1,538	635	
897	4,620	12,900	4,921	1,052		513	3,867	13,000	2,292	320	
577	3,909	12,950	2,262	230		-77	2,709	13,100	2,206	202	
319	6,675	13,000	3,905	1,196		-87	2,733	13,200	1,433	17	
2,094	6,086	13,050	3,200	2,365		661	3,492	13,300	402	1	
3,116	9,983	13,100	1,540	933		235	5,702	13,400	238	18	
3,614	8,912	13,150	687	472		721	5,335	13,500	388	-19	
3,387	11,883	13,200	349	67		57	3,596	13,600	175	14	
4,500	11,564	13,250	115	26		516	5,600	13,700	131	-1	
4,274	15,390	13,300	140	71		213	8,113	13,800	534	-1	
337	8,461	13,350	96	32		211	3,575	13,900	110	4	
-172	7,984	13,400	101	41		641	8,256	14,000	70	-6	
87	4,390	13,450	73	63		822	3,346	14,100	51	1	
242	6,665	13,500	36	5	※	926	2,966	14,200	72	0	
-148	3,577	13,700	1	0		109	1,668	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	
22,761	131,064	0.7654	100,314	25,190		6,690	92,217	0.8447	77,897	6,550	
昨日 P/C	0.6936	今日增減變化		0.0718		昨日 P/C	0.8342	今日增減變化		0.0105	

更新日期：2022年10月24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24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	76,820,996	55,055,507	21,765,489	-8,364,062	3,367,986	1,028,588	2,339,398	83,580
投信	21,699,233	47,145,133	-25,445,900	1,362,648	391,843	27,989	363,854	8,772
自營商	28,041,100	22,082,333	5,958,767	-5,061,594	820,899	536,452	284,447	-7,890
	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	1,203,217	869,529	333,688	-96,186	1,305	36,546	-35,241	-11,967
投信	101,076	0	101,076	818	0	0	0	0
自營商	264,459	343,380	-78,921	-2,011	100,500	74,396	26,104	19,647

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24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	42,125	17,479	24,646	1,459	35,502	16,808	18,694	3,284
投信	0	0	0	0	200	136	64	0
自營商	83,497	82,874	623	-2,009	39,042	47,465	-8,423	-1,440
特定法人(週)	1,072	0	1,072	-13	0	1,247	-1,247	-1,563
特定法人(近月)	21,894	10,771	11,123	690	10,602	25,349	-14,747	-580
特定法人 (全月)	28,296	0	28,296	1,685	9,675	26,992	-17,317	-5,658
十大交易人(週)	39,299	54,165	-14,866	-6,695	31,358	25,381	5,977	2,158
十大交易人(近月)	53,617	40,783	12,834	494	36,010	49,046	-13,036	-749
十大交易人(全月)	119,794	109,334	10,460	-4,946	63,403	73,477	-10,074	2,809
全市場未沖銷 (近月)			92,217	6,690			77,897	6,550
全市場未沖銷 (全月)			269,041	31,090			189,637	33,018

更新日期：2022年10月24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	13100	買權OI最大量	13300
	賣權成交最大量	12800	賣權OI最大量	12500
	整體隱含波動率	21.98%	較前一交易日	+0.30%
	買權隱含波動率	23.13%	較前一交易日	+3.48%
	賣權隱含波動率	20.67%	較前一交易日	-3.51%
電子選擇權	買權成交最大量	620	買權OI最大量	660
	賣權成交最大量	570	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	1320	賣權OI最大量	1340

更新日期：2022年10月24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	13500	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	25.73%	較前一交易日	-0.77%
	買權隱含波動率	23.73%	較前一交易日	+1.97%
	賣權隱含波動率	28.23%	較前一交易日	-0.16%
	成交量P/C_Ratio值	0.842	較前一交易日	-0.06
	未平倉P/C_Ratio值	0.845	較前一交易日	+0.01
電子選擇權	買權成交最大量	620	買權OI最大量	660
	賣權成交最大量	570	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	1320	賣權OI最大量	1340

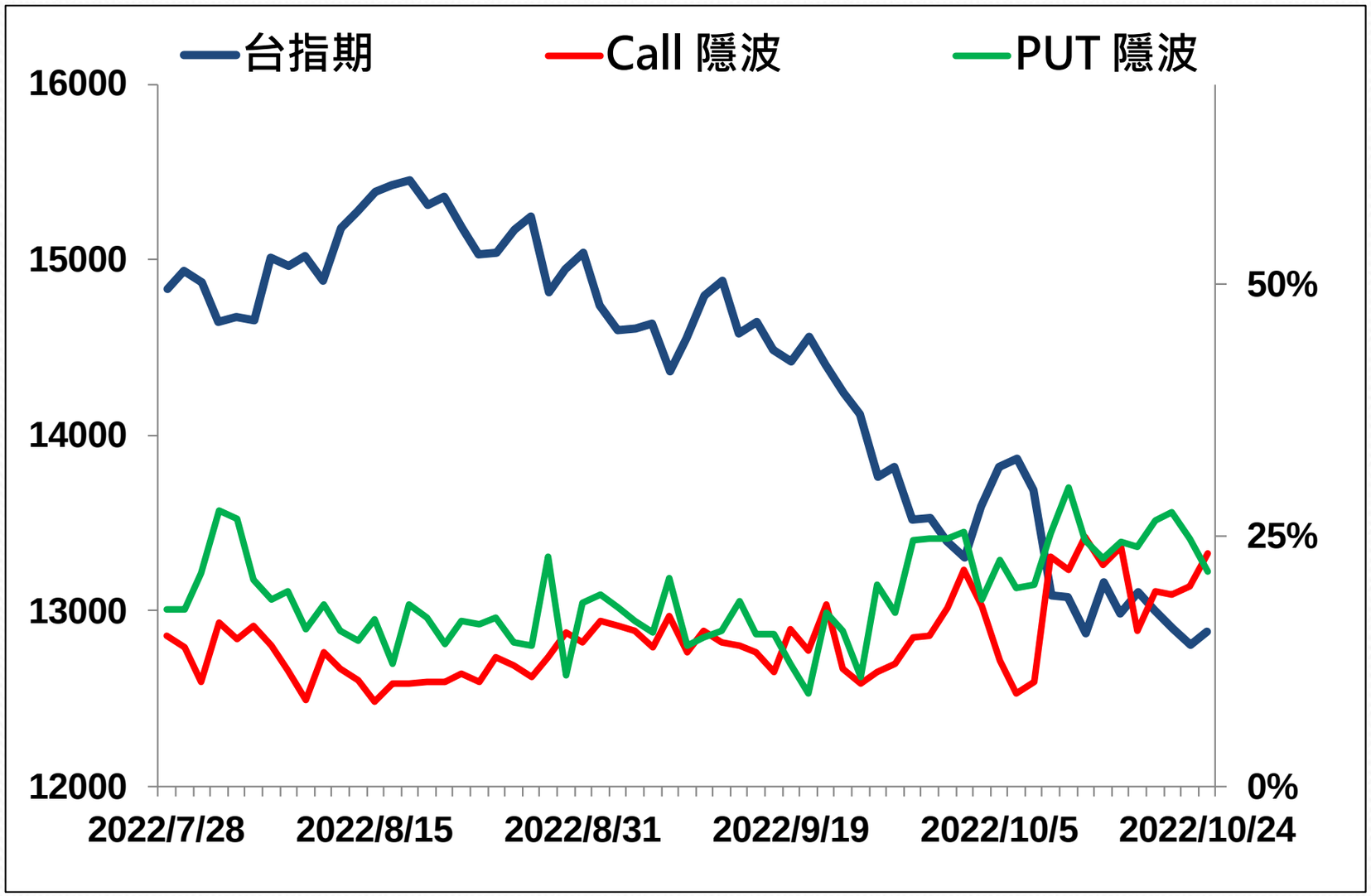
更新日期：2022年10月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



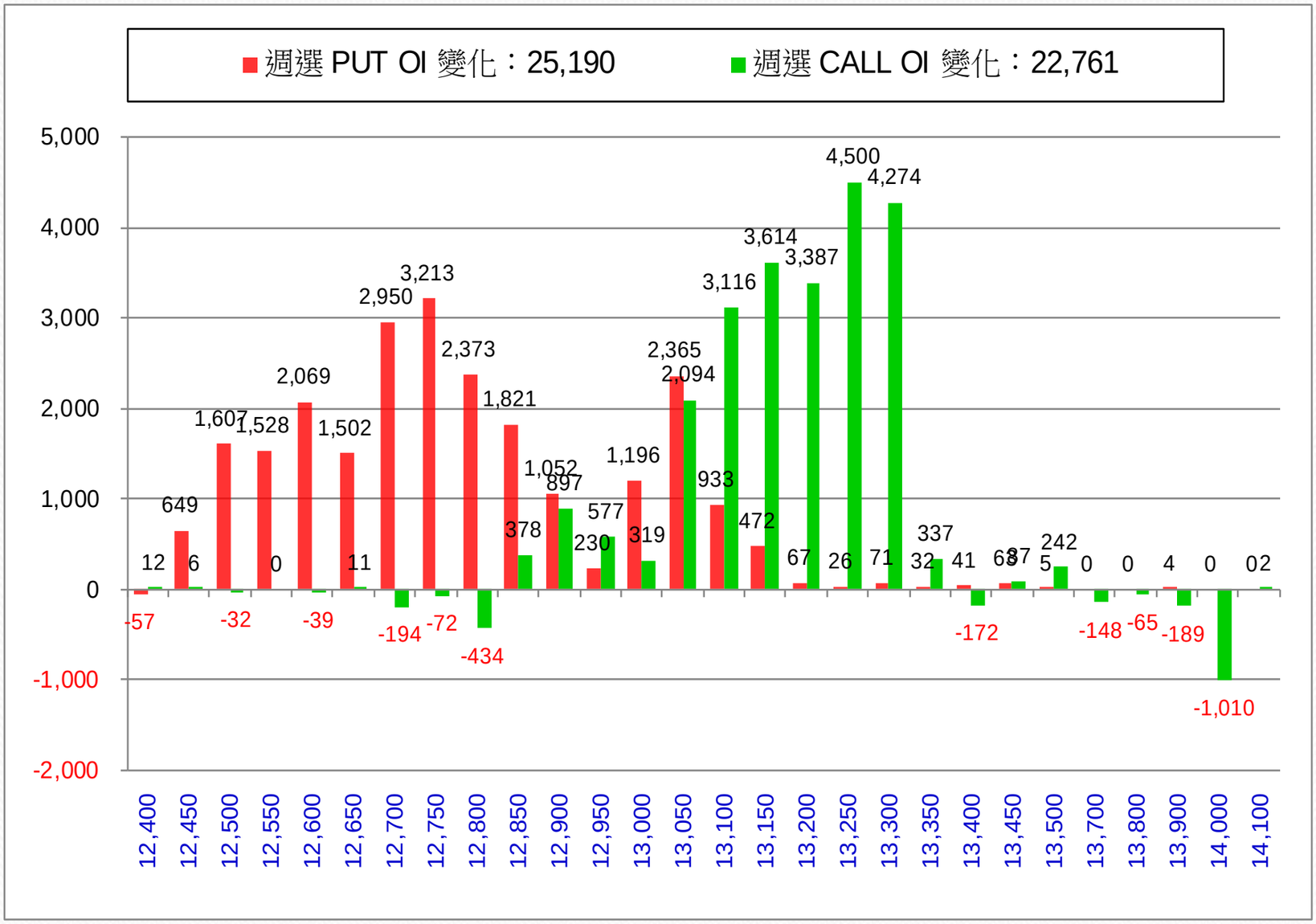
更新日期：2022年10月24日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



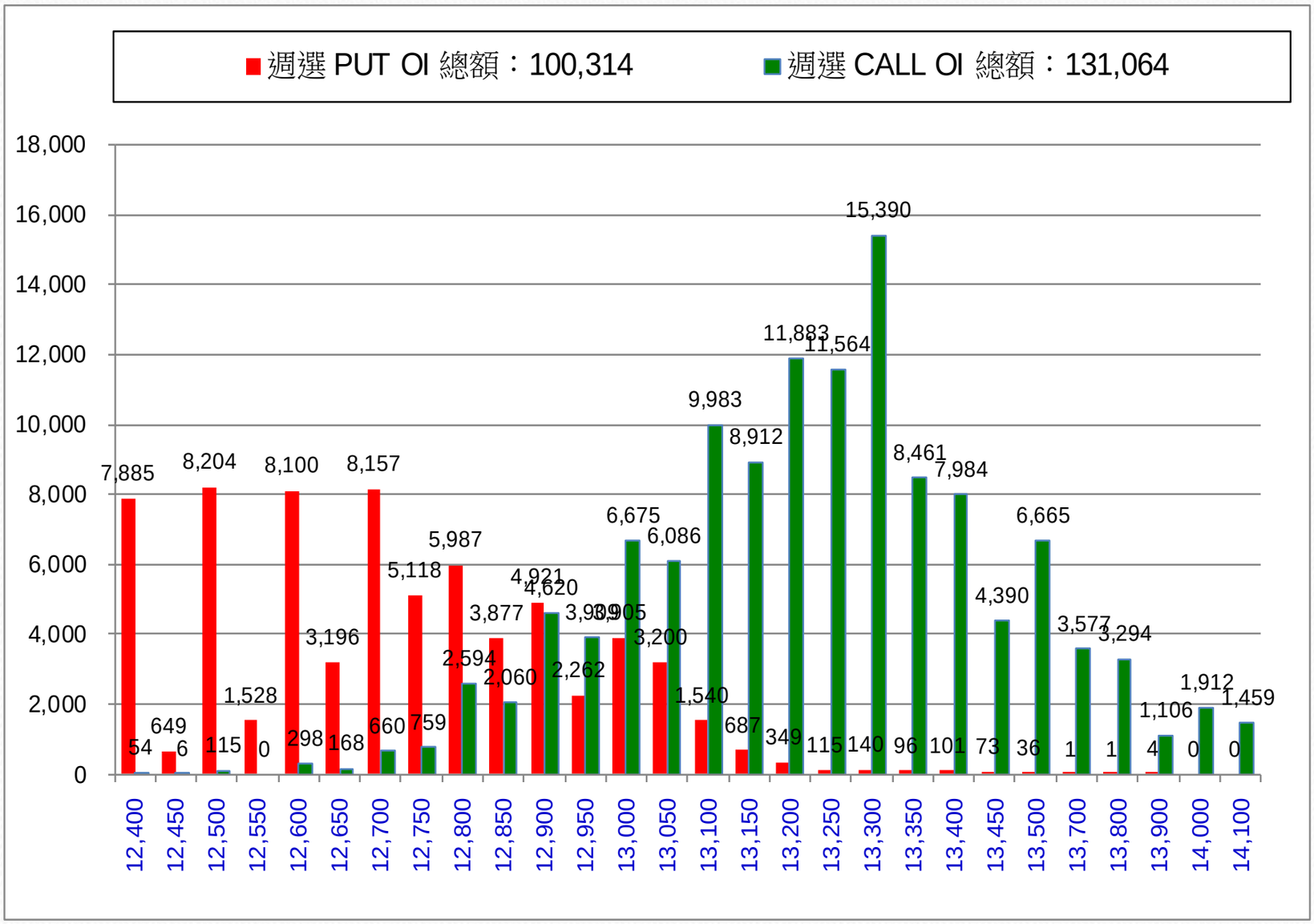
更新日期：2022年10月24日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年10月24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



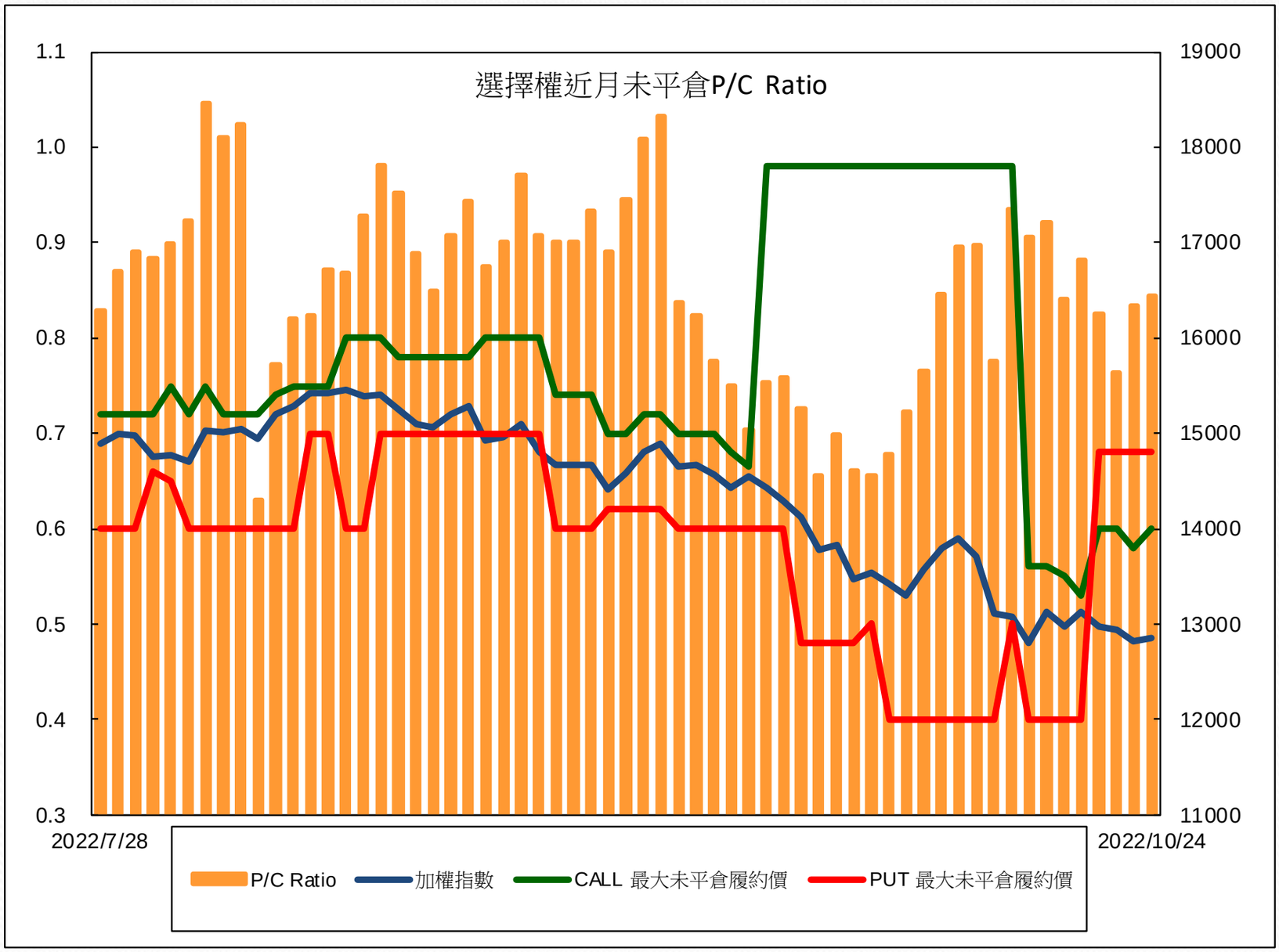
更新日期：2022年10月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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21日	81,825	79,193	2,632
	10月24日	83,497	82,874	623
Put	10月21日	34,580	41,563	-6,983
	10月24日	39,042	47,465	-8,423

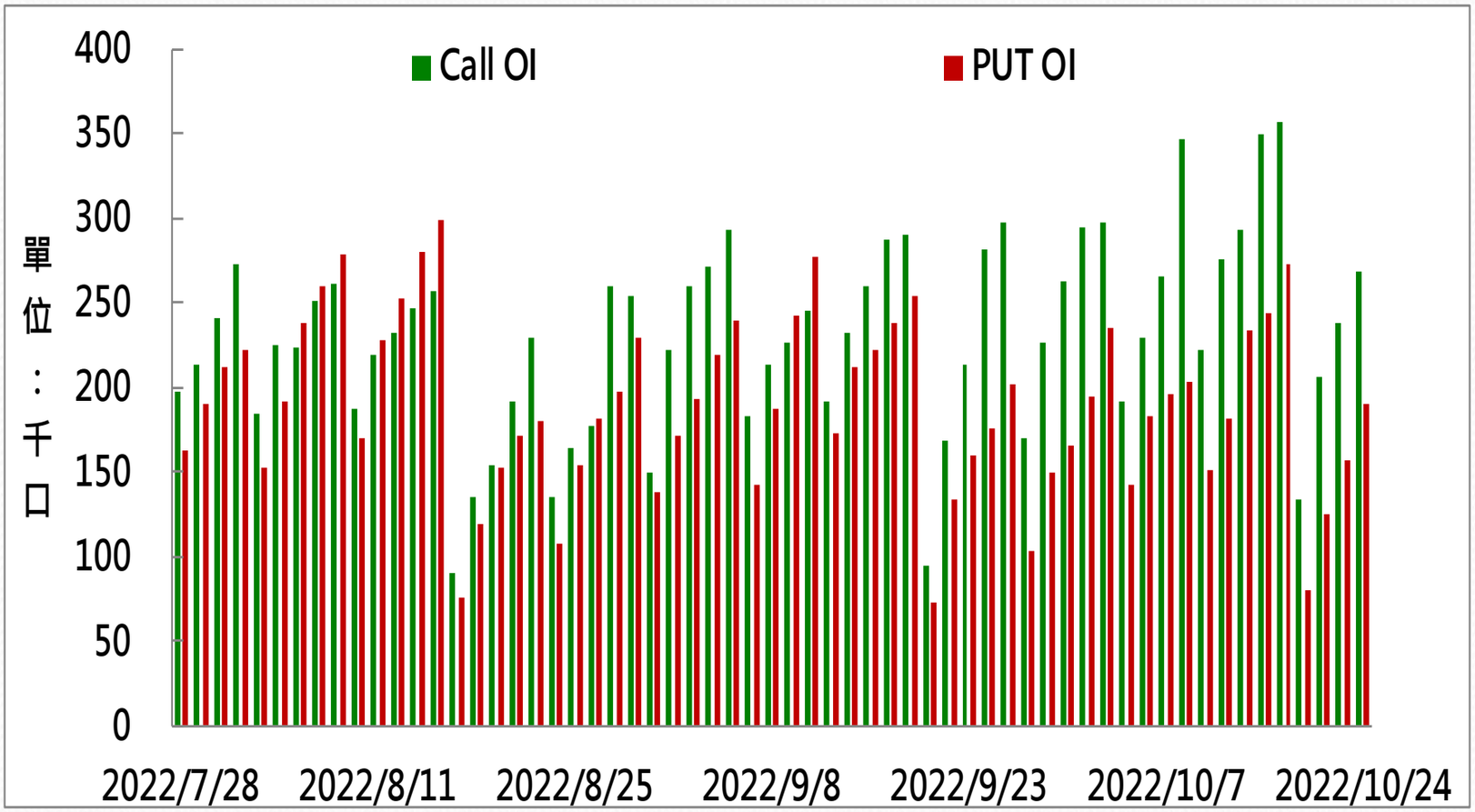
更新日期：2022年10月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年10月24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24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24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