台指選擇權OI匯報

日期：2022/10/25			結算日：2022/10/26			日期：2022/10/25			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	19	12,000	5,038	3		0	2	11,800	3,111	249	
2	9	12,100	4,356	499		2	14	11,900	2,304	357	
7	28	12,200	5,862	-404		6	63	12,000	5,156	255	
3	27	12,300	5,994	1,196		4	66	12,100	2,519	546	
21	75	12,400	8,207	322		11	37	12,200	3,289	-47	
23	29	12,450	3,147	2,498	※	27	90	12,300	2,448	63	
145	260	12,500	8,115	-89		-3	205	12,400	3,273	528	
175	175	12,550	2,856	1,328		37	144	12,500	4,662	326	
419	717	12,600	9,687	1,587		123	341	12,600	3,113	512	
2,116	2,284	12,650	4,792	1,596		294	726	12,700	3,201	-44	
3,831	4,491	12,700	6,785	-1,372		680	1,883	12,800	3,472	-510	
3,044	3,803	12,750	4,953	-165		248	1,510	12,900	1,195	-343	
4,290	6,884	12,800	4,857	-1,130		769	4,636	13,000	1,916	-376	
5,740	7,800	12,850	3,310	-567		594	3,303	13,100	1,994	-212	
6,840	11,460	12,900	4,056	-865		419	3,152	13,200	1,390	-43	
7,142	11,051	12,950	2,037	-225		498	3,990	13,300	399	-3	
※ 7,832	14,507	13,000	2,367	-1,538		1,328	7,030	13,400	233	-5	
3,844	9,930	13,050	3,346	146		1,443	6,778	13,500	364	-24	
1,810	11,793	13,100	1,107	-433		944	4,540	13,600	175	0	
181	9,093	13,150	600	-87		-611	4,989	13,700	149	18	
-2,499	9,384	13,200	318	-31		1,690	9,803	13,800	533	-1	
-4,015	7,549	13,250	108	-7		※ 1,987	5,562	13,900	109	-1	
-4,493	10,897	13,300	71	-69		705	8,961	14,000	77	7	
-1,496	6,488	13,400	102	1		-313	2,653	14,200	72	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	
25,828	156,892	0.6545	102,680	2,366		10,977	103,194	0.8071	83,288	5,391	
昨日 P/C	0.7654	今日增減變化		-0.1109		昨日 P/C	0.8447	今日增減變化		-0.0376	

更新日期：2022年10月25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25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	81,131,380	58,487,652	22,643,728	878,239	3,231,338	1,000,393	2,230,945	-108,453
投信	20,950,546	47,951,837	-27,001,291	-1,555,391	382,838	27,346	355,492	-8,362
自營商	23,994,550	20,872,080	3,122,470	-2,836,297	740,471	565,090	175,381	-109,066
	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	1,189,208	705,228	483,980	150,292	3,884	45,315	-41,431	-6,190
投信	100,944	0	100,944	-132	0	0	0	0
自營商	359,528	428,640	-69,112	9,809	134,649	104,871	29,778	3,674

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25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	42,817	21,218	21,599	-3,047	36,973	16,790	20,183	1,489
投信	0	200	-200	-200	300	136	164	100
自營商	84,536	94,116	-9,580	-10,203	46,108	48,176	-2,068	6,355
特定法人(週)	1,220	0	1,220	148	0	0	0	1,247
特定法人(近月)	19,795	13,120	6,675	-4,448	9,091	26,375	-17,284	-2,537
特定法人 (全月)	28,955	4,774	24,181	-4,115	9,675	26,814	-17,139	178
十大交易人(週)	38,158	59,734	-21,576	-6,710	30,547	30,159	388	-5,589
十大交易人(近月)	56,457	44,862	11,595	-1,239	36,755	54,839	-18,084	-5,048
十大交易人(全月)	122,392	120,039	2,353	-8,107	63,568	82,972	-19,404	-9,330
全市場未沖銷 (近月)			103,194	10,977			83,288	5,391
全市場未沖銷 (全月)			307,963	38,922			198,660	9,023

更新日期：2022年10月25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	13000
	賣權成交最大量	12800	賣權OI最大量	12600
	整體隱含波動率	20.84%	較前一交易日	-1.14%
	買權隱含波動率	22.67%	較前一交易日	-0.46%
	賣權隱含波動率	18.27%	較前一交易日	-2.40%
電子選擇權	買權成交最大量	590	買權OI最大量	660
	賣權成交最大量	540	賣權OI最大量	540
金融選擇權	買權成交最大量	1460	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25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	13300	買權OI最大量	13800
	賣權成交最大量	12000	賣權OI最大量	14800
	整體隱含波動率	25.80%	較前一交易日	-0.07%
	買權隱含波動率	24.06%	較前一交易日	+0.32%
	賣權隱含波動率	28.95%	較前一交易日	+0.72%
	成交量P/C_Ratio值	0.607	較前一交易日	-0.24
	未平倉P/C_Ratio值	0.807	較前一交易日	-0.04
電子選擇權	買權成交最大量	590	買權OI最大量	660
	賣權成交最大量	540	賣權OI最大量	540
金融選擇權	買權成交最大量	1460	買權OI最大量	1500
	賣權成交最大量	1320	賣權OI最大量	1340

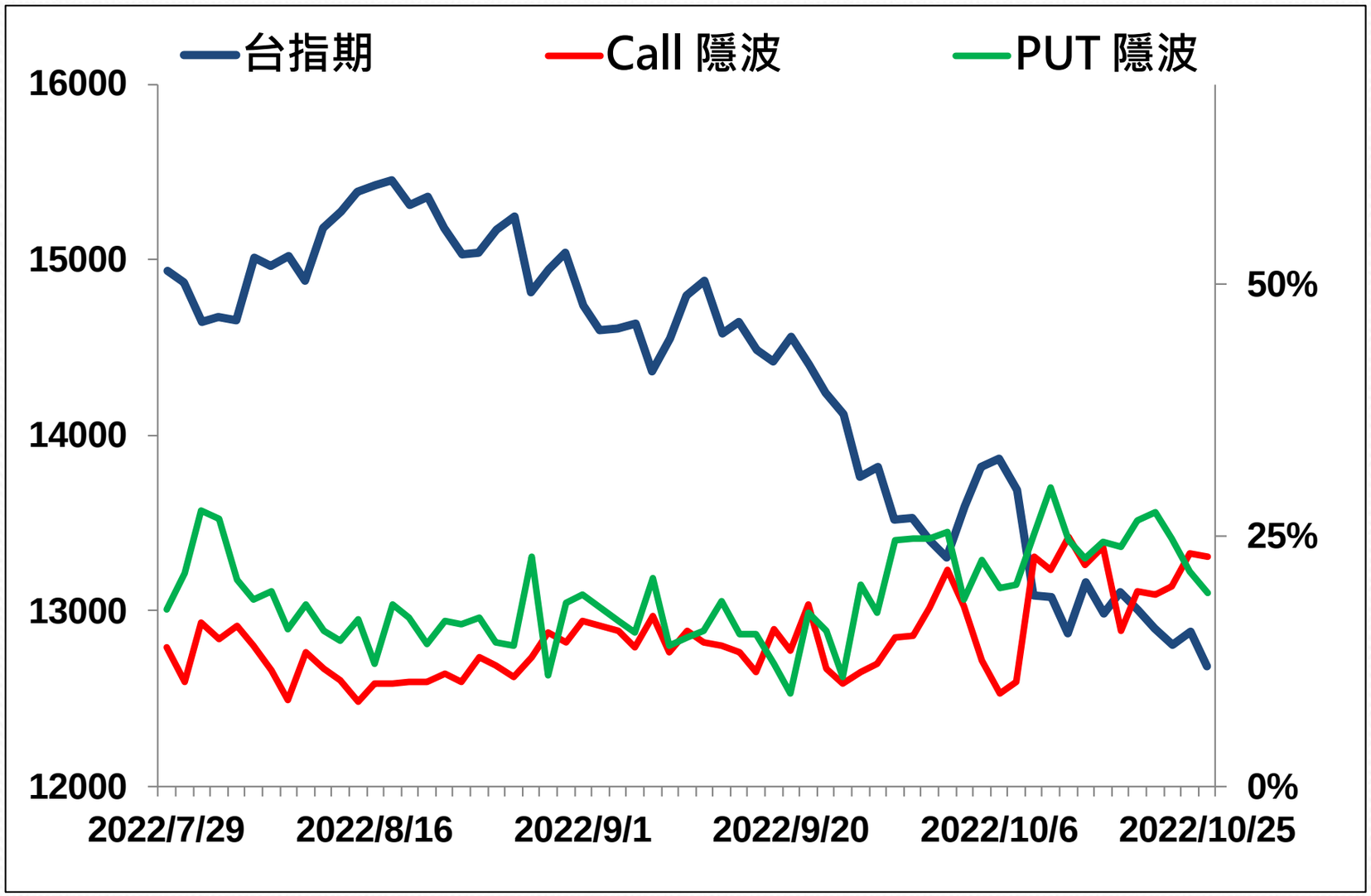
更新日期：2022年10月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



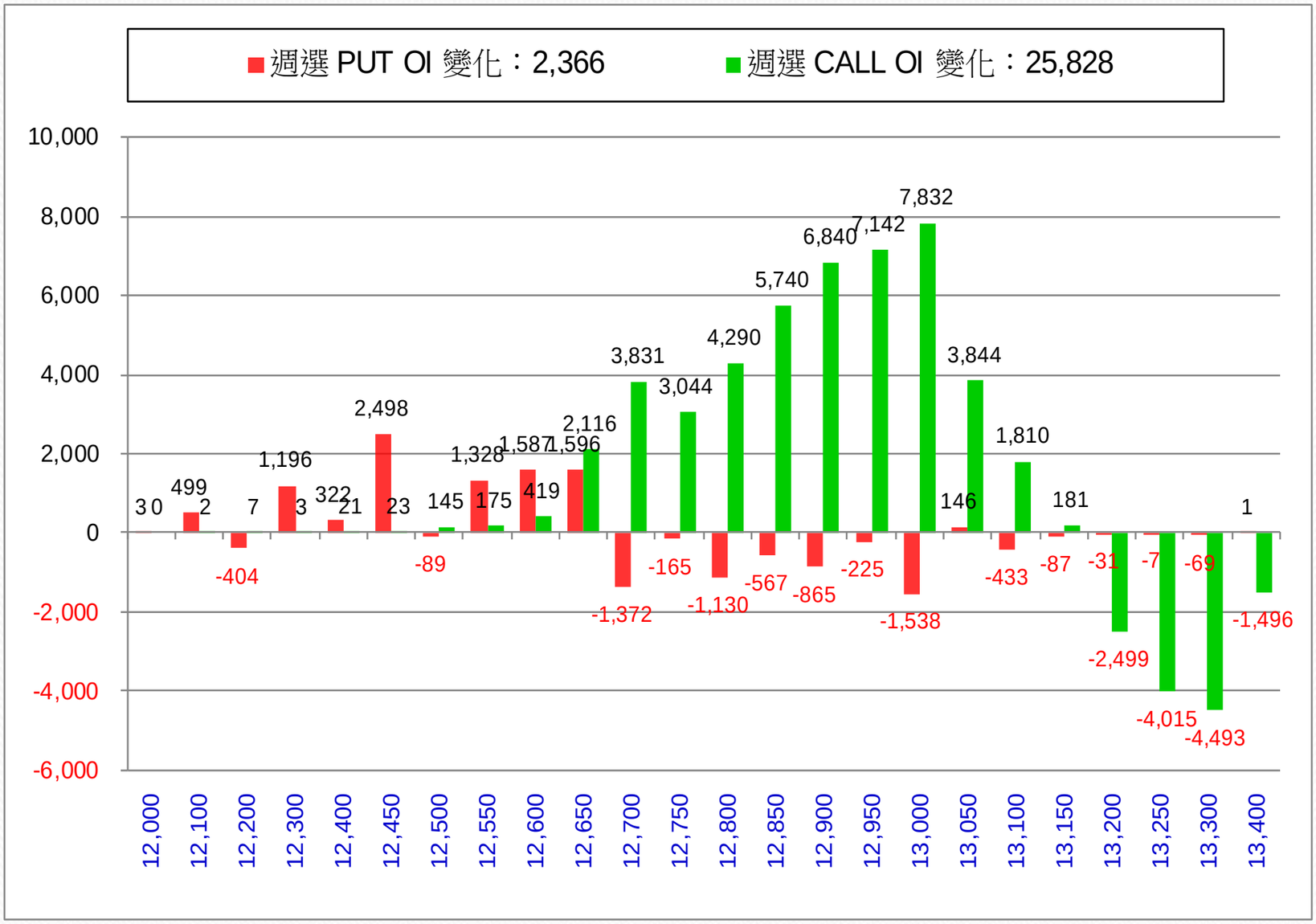
更新日期：2022年10月25日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



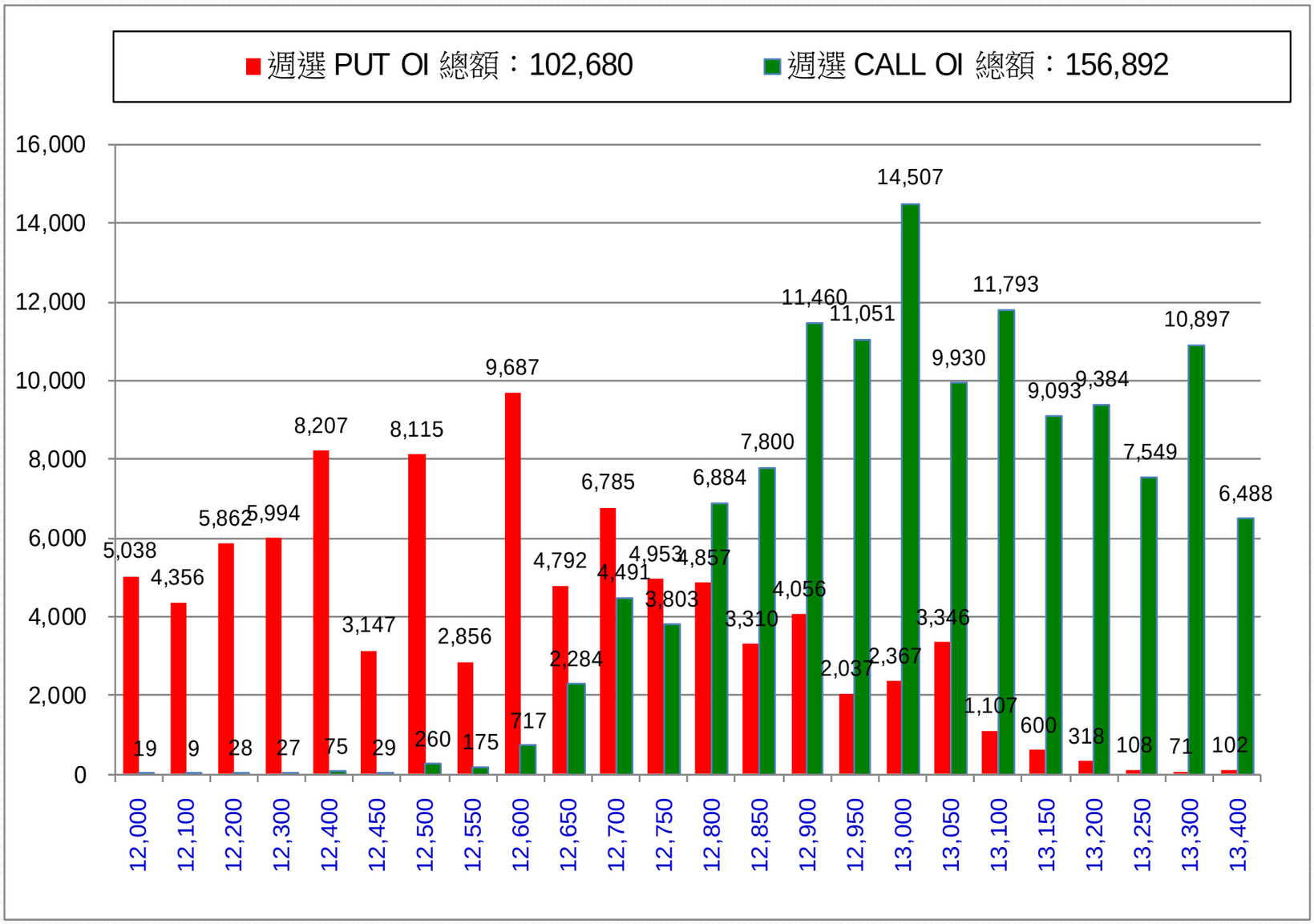
更新日期：2022年10月25日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年10月25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



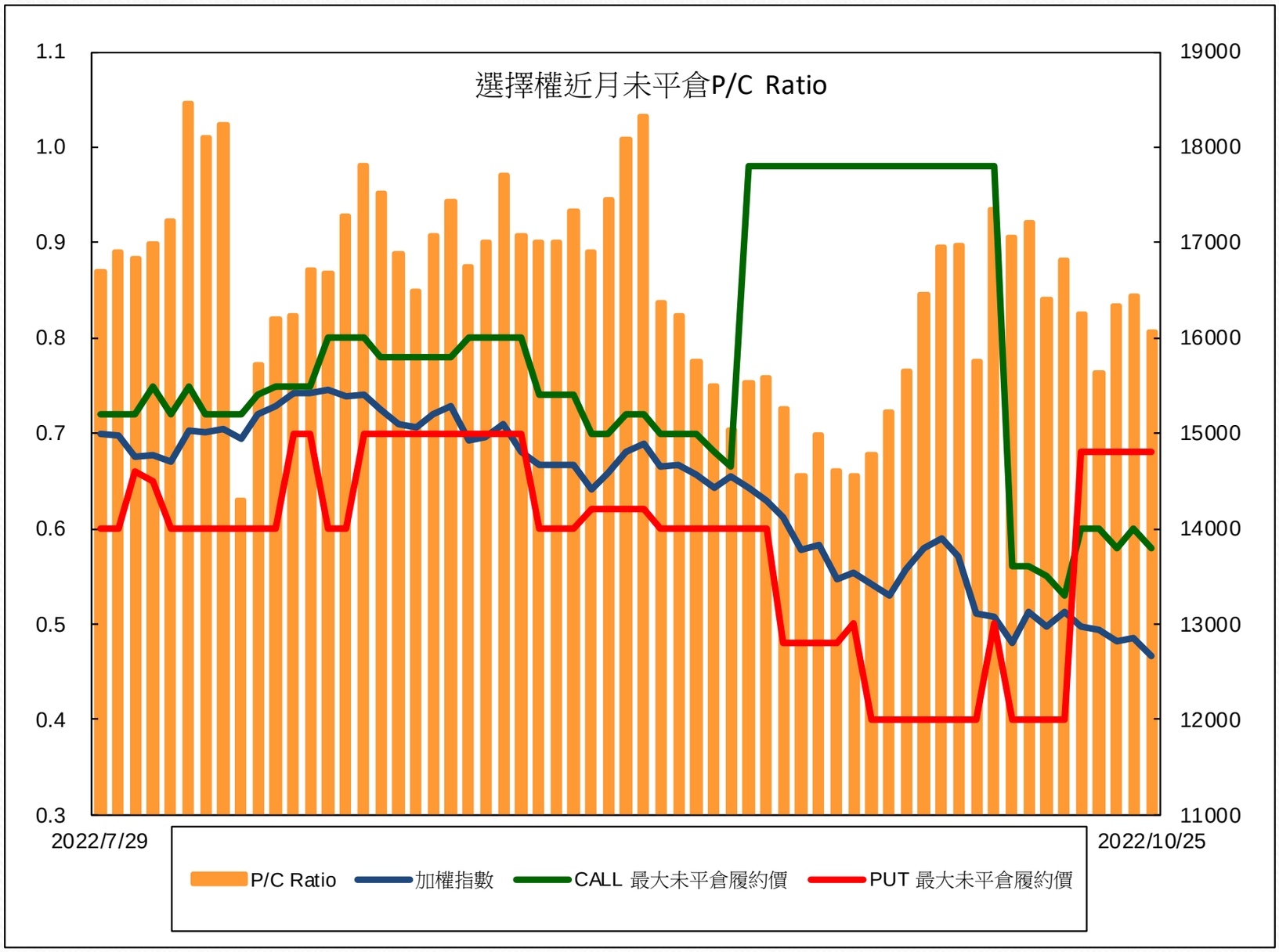
更新日期：2022年10月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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24日	83,497	82,874	623
	10月25日	84,536	94,116	-9,580
Put	10月24日	39,042	47,465	-8,423
	10月25日	46,108	48,176	-2,068

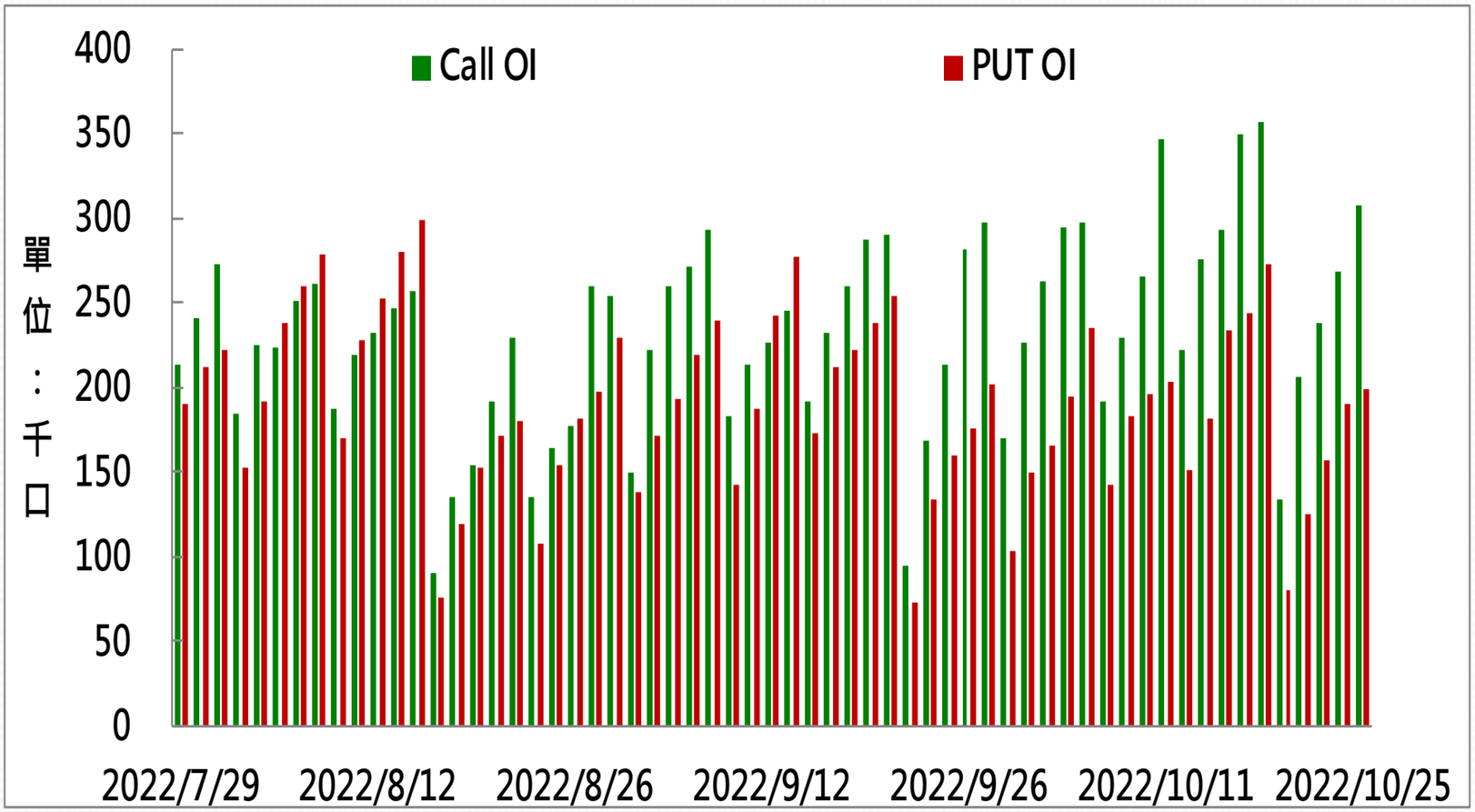
更新日期：2022年10月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年10月25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25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25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