台指選擇權OI匯報

日期：2022/10/26			結算日：2022/11/2			日期：2022/10/26			結算日：2022/11/16		
202211W1						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	12,000	1,730	1,730		0	0	11,500	5,047	381	
0	0	12,100	1,166	1,166		0	5	11,600	2,283	-11	
4	4	12,200	1,375	1,375		0	5	11,700	2,459	35	
35	35	12,300	1,683	1,683		4	6	11,800	3,238	127	
1	1	12,350	543	543		2	16	11,900	2,797	493	
16	16	12,400	1,979	1,979	※	41	104	12,000	5,284	128	
1	1	12,450	418	418		-6	60	12,100	3,585	1,066	※
69	69	12,500	1,293	1,293		10	47	12,200	3,446	157	
32	32	12,550	449	449		27	117	12,300	2,615	167	
184	184	12,600	1,216	1,216		29	234	12,400	3,884	611	
155	155	12,650	564	564		171	315	12,500	5,249	587	
306	306	12,700	1,055	1,055		48	389	12,600	3,256	143	
463	463	12,750	614	614		897	1,623	12,700	3,543	342	
506	506	12,800	672	672		183	2,066	12,800	3,655	183	
359	359	12,850	241	241		222	1,732	12,900	1,047	-148	
1,069	1,069	12,900	316	316		169	4,805	13,000	1,951	35	
1,454	1,454	12,950	83	83		408	3,711	13,100	1,988	-6	
2,444	2,444	13,000	108	108		568	3,720	13,200	1,396	6	
2,869	2,869	13,100	58	58		239	4,229	13,300	375	-24	
※ 4,819	4,819	13,200	58	58		254	7,284	13,400	234	1	
2,566	2,566	13,300	2	2		-192	6,586	13,500	407	43	
2,086	2,086	13,400	1	1		198	4,738	13,600	165	-10	
1,033	1,033	13,500	1	1		※ 921	5,910	13,700	157	8	
1,745	1,745	13,600	0	0		643	10,446	13,800	540	7	
2,326	2,326	13,700	0	0		-36	5,526	13,900	109	0	
601	601	13,800	0	0		179	9,140	14,000	77	0	
519	519	14,000	0	0		269	2,922	14,200	59	-13	
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	
25,767	25,767	0.7624	19,645	19,645		6,058	109,252	0.8011	87,523	4,235	
昨日 P/C	0.6545	今日增減變化		0.1079		昨日 P/C	0.8071	今日增減變化		-0.0060	

更新日期：2022年10月26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26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	92,737,112	54,067,317	38,669,795	16,026,067	3,127,344	872,641	2,254,703	23,758
投信	21,122,030	46,425,656	-25,303,626	1,697,665	463,733	27,413	436,320	80,828
自營商	20,223,968	21,139,141	-915,173	-4,037,643	586,918	552,729	34,189	-141,192
	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	1,585,291	642,268	943,023	459,043	2,600	44,203	-41,603	-172
投信	102,594	0	102,594	1,650	0	0	0	0
自營商	390,701	321,844	68,857	137,969	201,516	154,713	46,803	17,025

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26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	38,878	20,062	18,816	-2,783	32,871	15,601	17,270	-2,913
投信	0	200	-200	0	300	136	164	0
自營商	72,181	73,346	-1,165	8,415	33,723	37,742	-4,019	-1,951
特定法人(週)	0	0	0	---	0	309	-309	---
特定法人(近月)	19,795	11,194	8,601	1,926	10,866	27,982	-17,116	168
特定法人 (全月)	33,144	12,999	20,145	-4,036	12,032	31,700	-19,668	-2,529
十大交易人(週)	15,121	14,759	362	---	10,015	6,960	3,055	---
十大交易人(近月)	60,420	44,954	15,466	3,871	39,622	56,404	-16,782	1,302
十大交易人(全月)	111,717	85,988	25,729	23,376	51,650	68,321	-16,671	2,733
全市場未沖銷 (近月)			109,252	6,058			87,523	4,235
全市場未沖銷 (全月)			184,313	-123,650			120,551	-78,109

更新日期：2022年10月26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 11W1 週 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	13200
	賣權成交最大量	12500	賣權OI最大量	12400
	整體隱含波動率	22.20%	較前一交易日	+1.36%
	買權隱含波動率	19.72%	較前一交易日	-2.95%
	賣權隱含波動率	25.27%	較前一交易日	+7.00%
電子選擇權	買權成交最大量	580	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	1380	賣權OI最大量	1360

更新日期：2022年10月26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	25.17%	較前一交易日	+0.63%
	買權隱含波動率	22.36%	較前一交易日	-1.69%
	賣權隱含波動率	28.95%	較前一交易日	-0.01%
	成交量P/C_Ratio值	0.827	較前一交易日	+0.22
	未平倉P/C_Ratio值	0.801	較前一交易日	-0.01
電子選擇權	買權成交最大量	580	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	1380	賣權OI最大量	1360

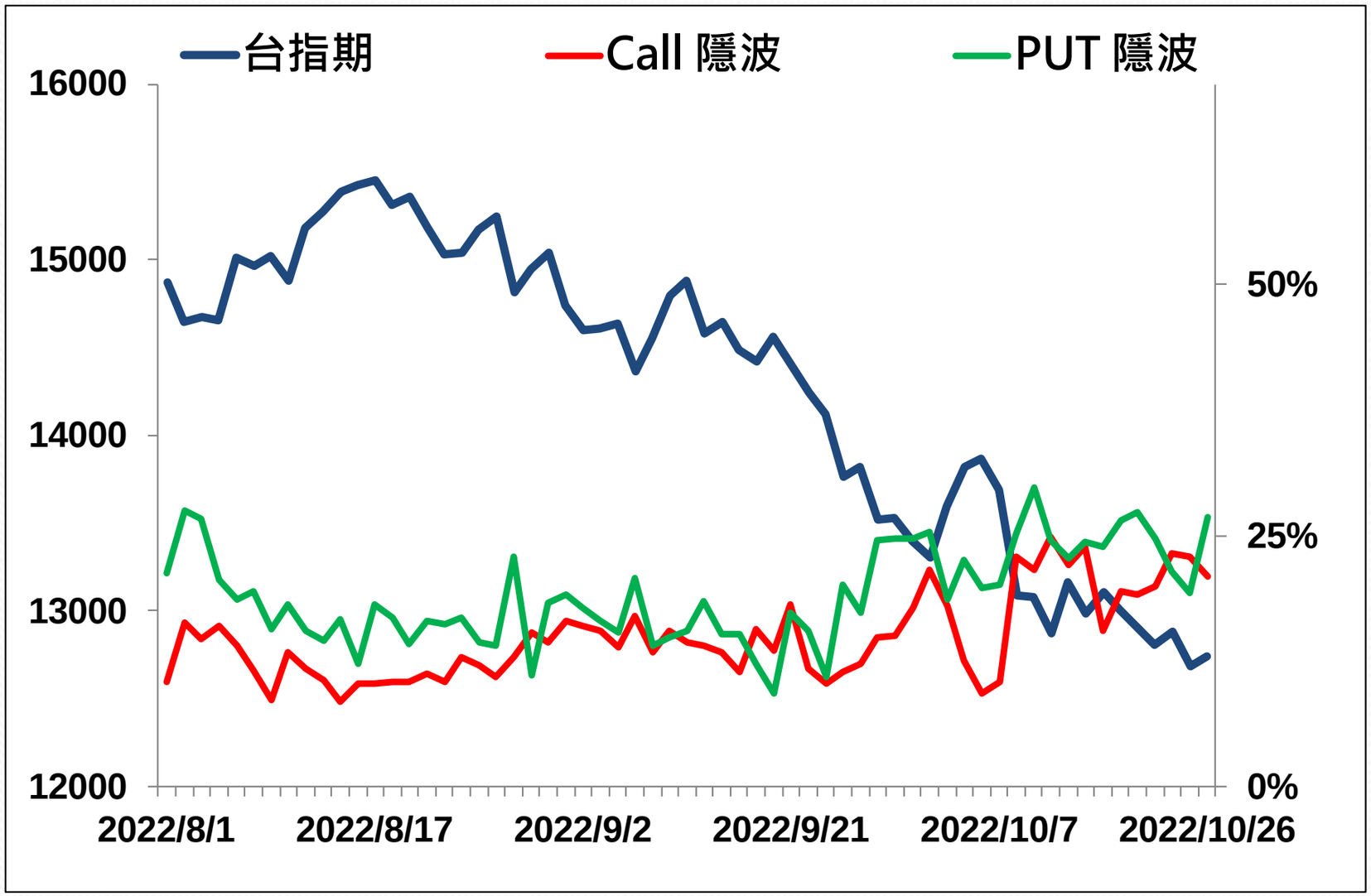
更新日期：2022年10月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



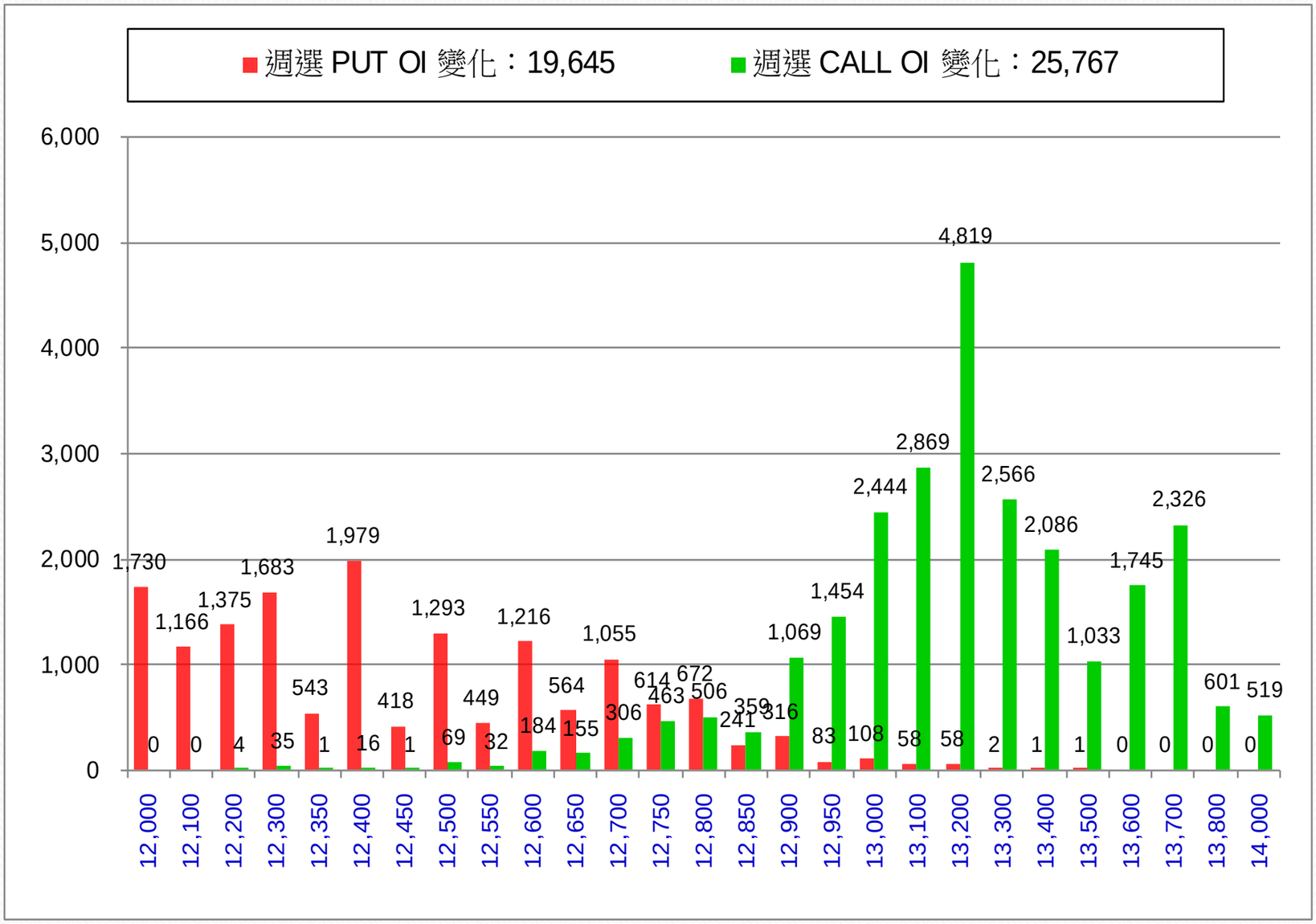
更新日期：2022年10月26日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



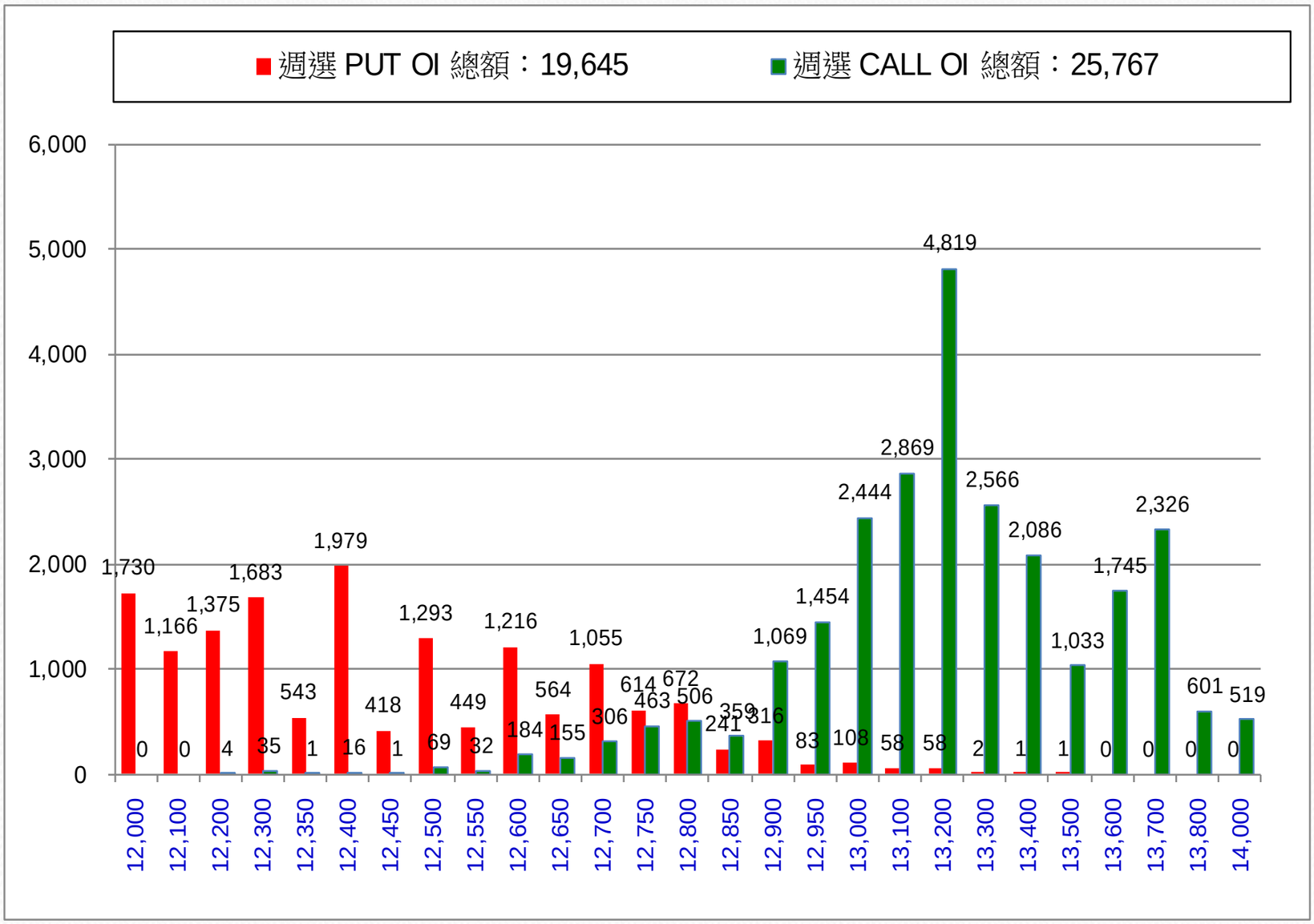
更新日期：2022年10月26日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年10月26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



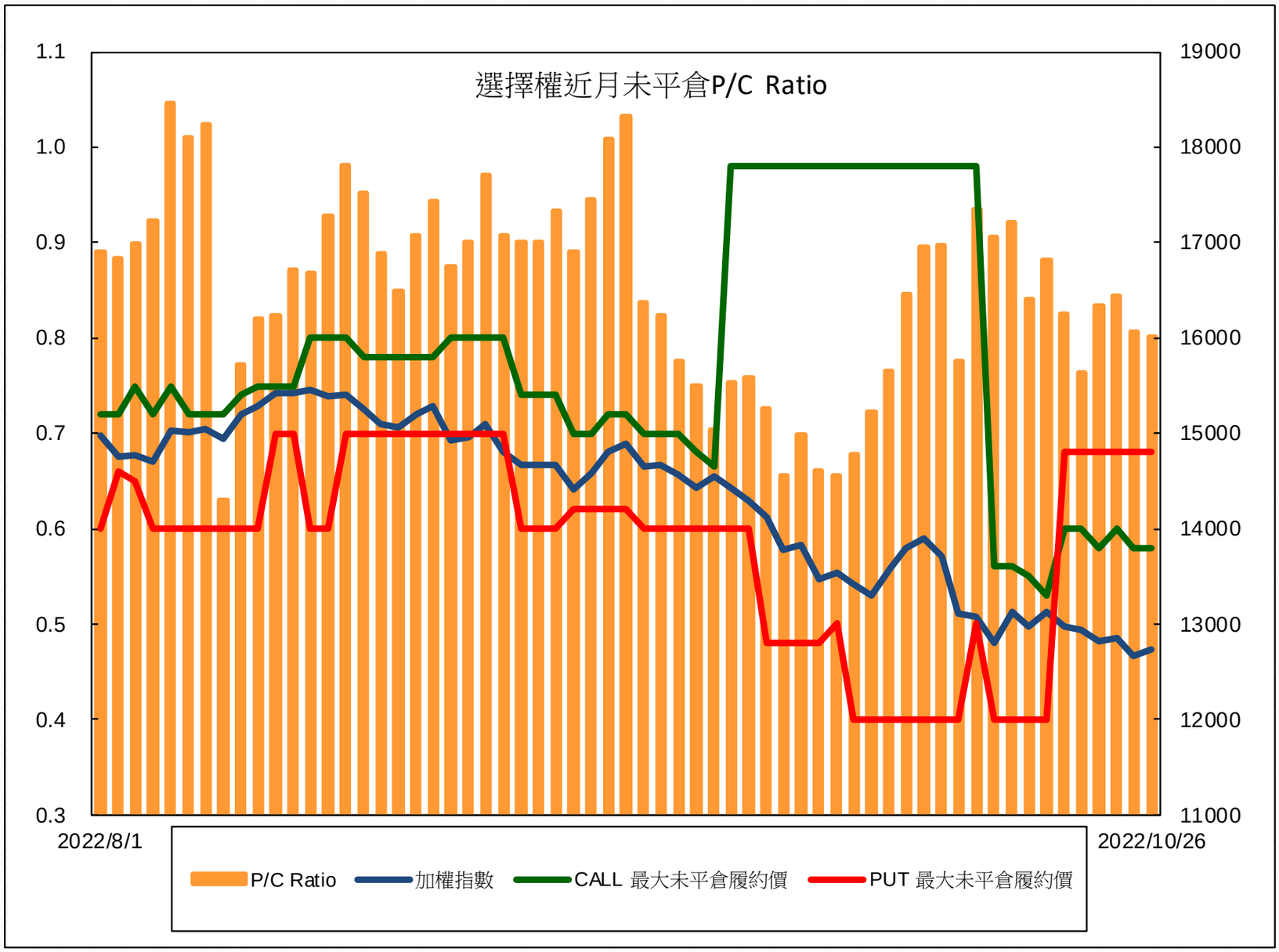
更新日期：2022年10月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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25日	84,536	94,116	-9,580
	10月26日	72,181	73,346	-1,165
Put	10月25日	46,108	48,176	-2,068
	10月26日	33,723	37,742	-4,019

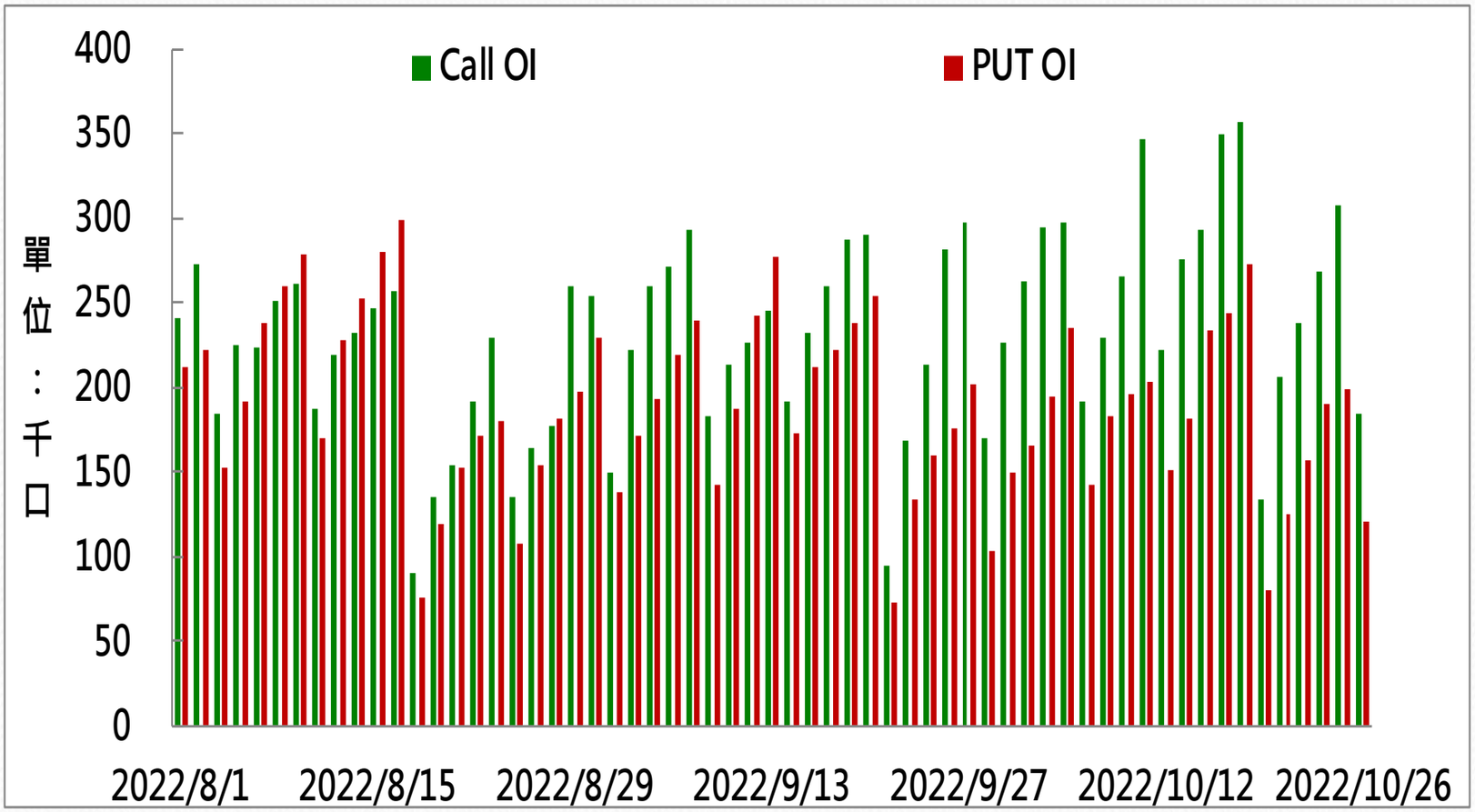
更新日期：2022年10月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年10月26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26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26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