

台指選擇權OI匯報

日期 : 2022/9/26			結算日 : 2022/9/28			日期 : 2022/9/26			結算日 : 2022/10/19			
202209W4						202210 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	12,700	266	266		0	11	12,600	1,163	-86		
0	0	12,800	1,316	915		0	0	12,700	954	328		
0	0	12,900	1,487	991		1	173	12,800	4,131	451		
0	0	13,000	2,628	847		0	0	12,900	1,607	257		
0	0	13,100	1,746	239		7	15	13,000	3,453	516		
36	36	13,200	4,059	1,894		2	2	13,100	1,299	98		
12	12	13,300	4,681	1,628		19	27	13,200	2,355	566		
-2	31	13,400	9,395	1,427		13	45	13,300	2,569	678	※	
33	35	13,500	7,996	3,834		20	25	13,400	2,337	-2		
196	212	13,600	10,876	5,494	※	61	86	13,500	3,129	85		
516	547	13,700	11,560	1,858		40	71	13,600	2,169	86		
596	596	13,750	2,378	2,378		186	217	13,700	2,623	205		
3,006	3,124	13,800	7,879	-826		345	606	13,800	2,651	-358		
3,415	3,415	13,850	1,279	1,279		504	628	13,900	2,310	128		
5,176	5,340	13,900	6,293	-2,376		929	1,321	14,000	3,097	-454		
4,819	4,843	13,950	1,488	406		743	1,119	14,100	1,570	-326		
※	9,335	9,884	14,000	4,657	-1,465		1,618	2,850	14,200	1,072	-249	
7,178	7,578	14,050	1,367	-759		※	1,839	3,280	14,300	811	-183	
8,265	9,960	14,100	2,444	-1,591		1,180	3,190	14,400	1,279	-234		
6,045	8,208	14,150	1,718	-1,057		1,819	5,131	14,500	2,422	-79		
6,742	11,675	14,200	2,026	-1,189		1,185	4,585	14,600	1,200	-53		
2,172	6,677	14,250	1,385	-426		408	3,582	14,700	550	6		
4,699	10,451	14,300	2,084	-73		-308	6,631	14,800	658	5		
2,733	8,798	14,350	1,172	68		147	2,962	14,900	151	4		
152	8,885	14,400	1,223	-1,129		575	8,532	15,000	873	27		
-1,858	7,240	14,450	452	-52		668	3,715	15,100	84	25		
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		
53,972	166,521	0.6002	99,954	12,192		12,351	85,829	0.6562	56,318	2,990		
昨日 P/C	0.7798	今日增減變化	-0.1796			昨日 P/C	0.7258	今日增減變化	-0.0696			

更新日期 : 2022年9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9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	72,868,795	72,491,984	376,811	-12,783,831	4,003,880	958,215	3,045,665	-331,330
投信	24,223,872	50,228,548	-26,004,676	-818,164	487,910	0	487,910	-12,959
自營商	34,230,495	18,625,164	15,605,331	517,432	1,219,599	978,254	241,345	285,331
	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	1,549,485	1,449,374	100,111	238,212	181,985	27,162	154,823	-5,947
投信	94,135	0	94,135	-9,062	0	0	0	0
自營商	385,505	389,987	-4,482	19,800	13,581	172,479	-158,898	48,006

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報								2022年9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	22,002	13,863	8,139	2,107	27,318	12,545	14,773	501
投信	0	100	-100	-100	600	111	489	200
自營商	75,410	87,705	-12,295	-10,594	52,017	42,927	9,090	1,693
特定法人(週)	6,749	0	6,749	3,477	1,310	1,737	-427	-1,757
特定法人(近月)	6,907	8,408	-1,501	-611	4,978	11,201	-6,223	-379
特定法人(全月)	12,031	4,444	7,587	1,515	5,866	18,951	-13,085	550
十大交易人(週)	41,651	66,686	-25,035	-8,136	30,917	38,044	-7,127	-3,901
十大交易人(近月)	42,510	40,087	2,423	-1,538	15,904	29,534	-13,630	-1,782
十大交易人(全月)	95,693	102,808	-7,115	-9,109	51,908	75,575	-23,667	-5,231
全市場未沖銷(近月)			85,829	12,351			56,318	2,990
全市場未沖銷(全月)			281,452	68,508			175,657	16,355

更新日期：2022年9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 09W4 週 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	14200
	賣權成交最大量	13800	賣權OI最大量	13700
	整體隱含波動率	13.97%	較前一交易日	+4.95%
	買權隱含波動率	10.12%	較前一交易日	+1.10%
	賣權隱含波動率	19.30%	較前一交易日	+10.27%
電子選擇權	買權成交最大量	670	買權OI最大量	690
	賣權成交最大量	615	賣權OI最大量	600
金融選擇權	買權成交最大量	1560	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1480	賣權OI最大量	1460

更新日期：2022年9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10月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	14500	買權OI最大量	17800
	賣權成交最大量	13500	賣權OI最大量	12800
	整體隱含波動率	21.73%	較前一交易日	-3.09%
	買權隱含波動率	19.09%	較前一交易日	+2.51%
	賣權隱含波動率	25.38%	較前一交易日	+3.23%
	成交量P/C_Ratio值	0.736	較前一交易日	+0.08
	未平倉P/C_Ratio值	0.656	較前一交易日	-0.07
電子選擇權	買權成交最大量	670	買權OI最大量	690
	賣權成交最大量	615	賣權OI最大量	600
金融選擇權	買權成交最大量	1560	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1480	賣權OI最大量	1460

更新日期：2022年9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

臺指選擇權波動率指數

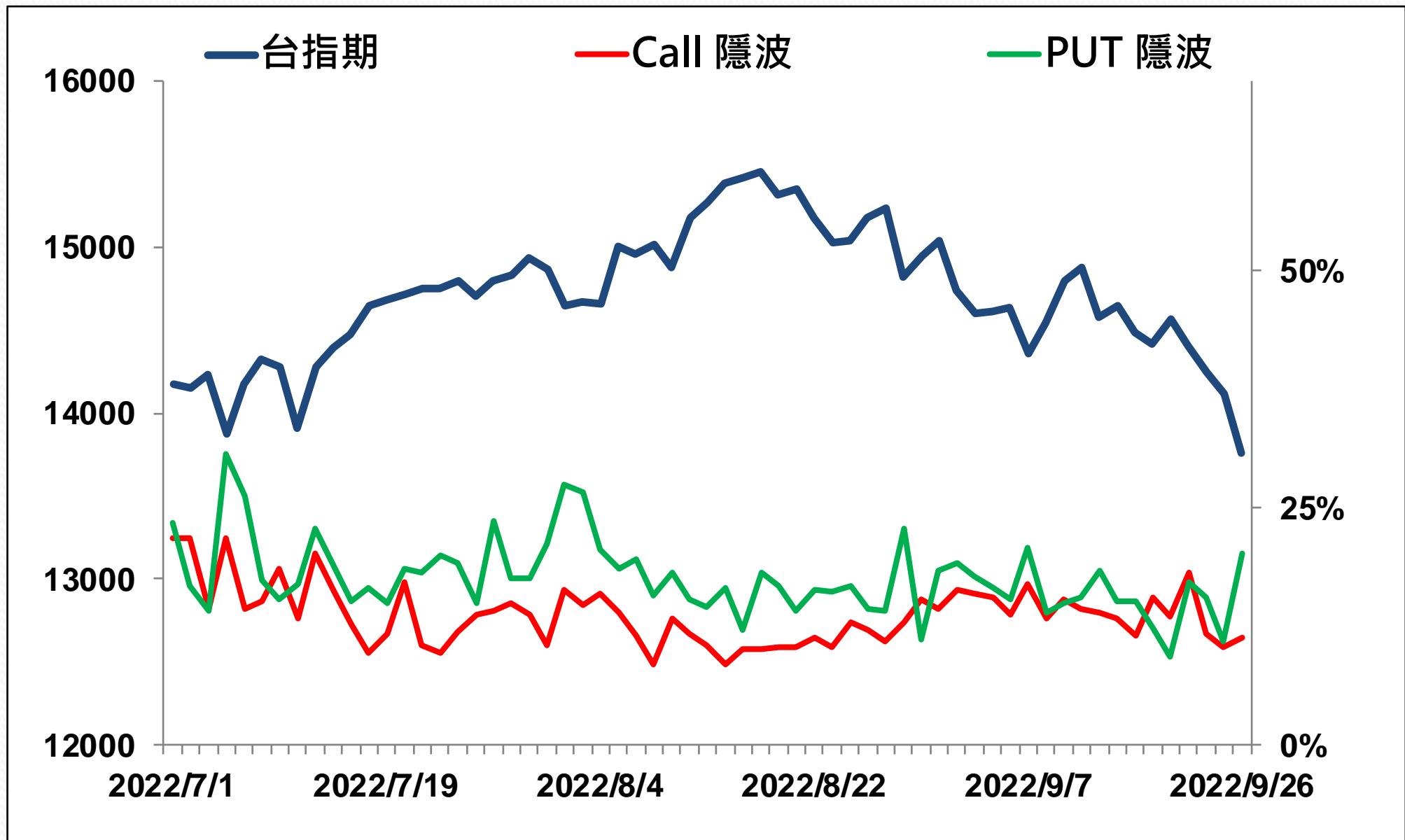
— 臺指選擇權波動率指數



更新日期：2022年9月26日

資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

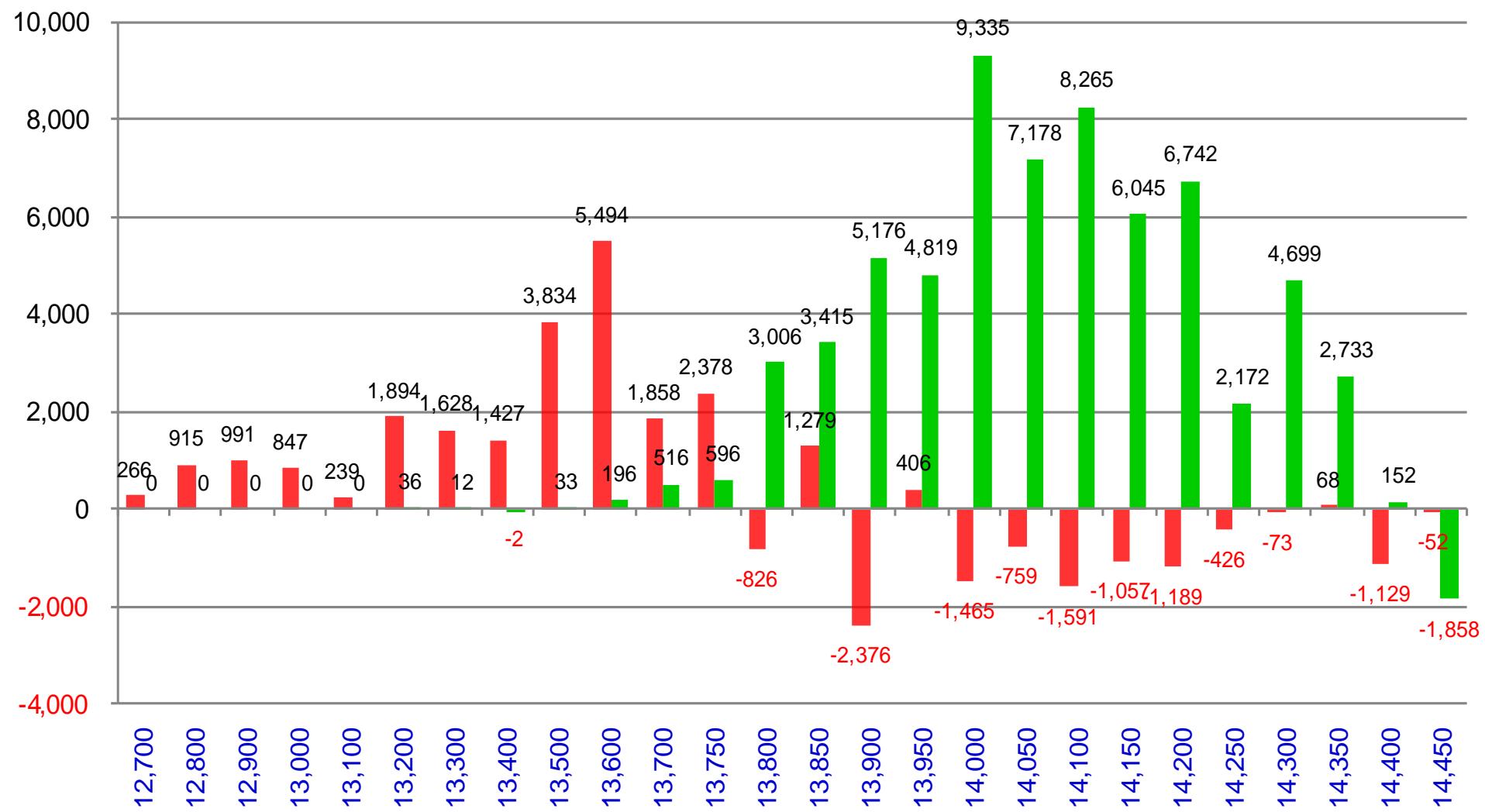
台指近月隱含波動度



更新日期：2022年9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

■ 週選 PUT OI 變化 : 12,192 ■ 週選 CALL OI 變化 : 53,972

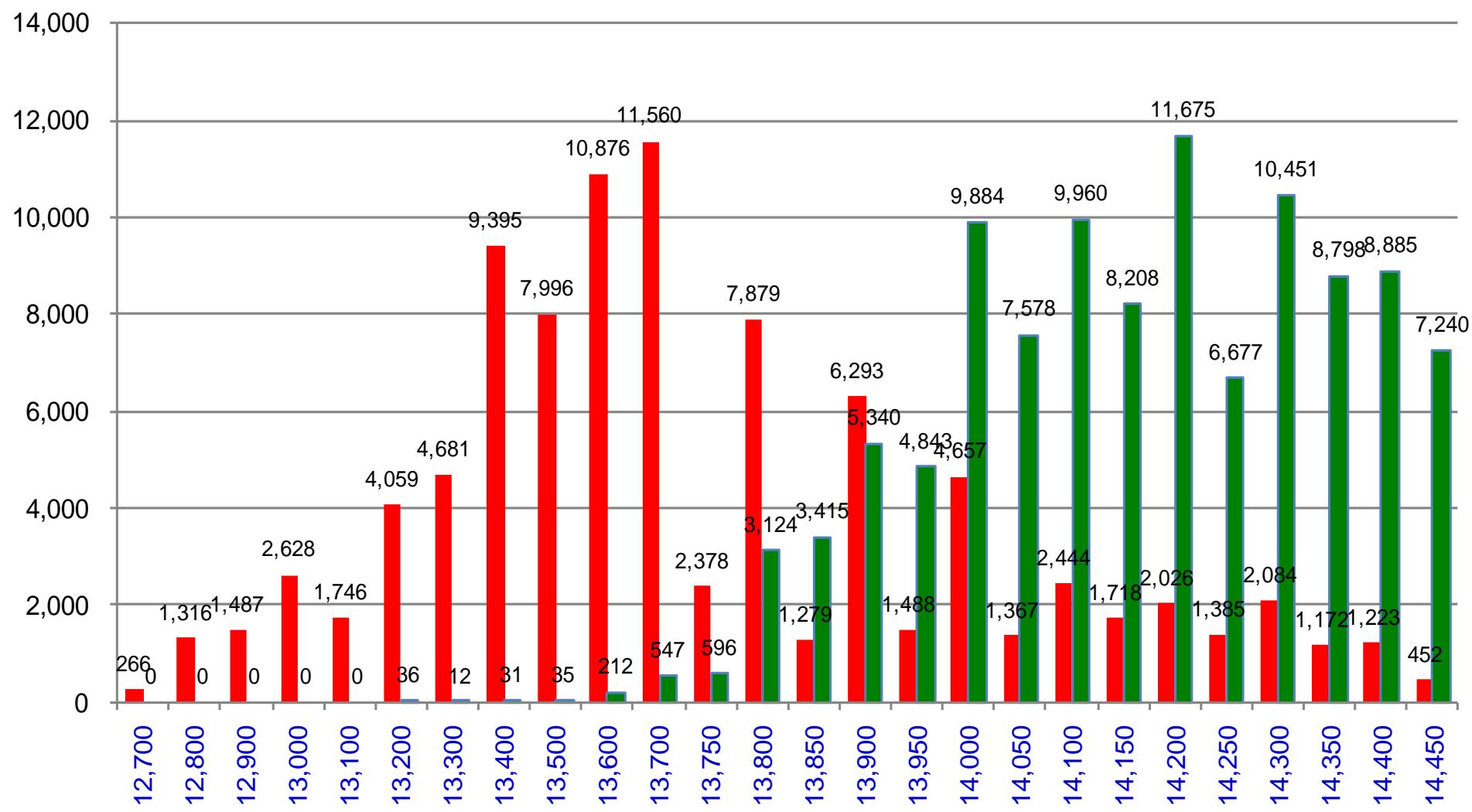


更新日期：2022年9月26日 資料來源：台灣期貨交易所 · 凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：99,954

■ 週選 CALL OI 總額：166,521



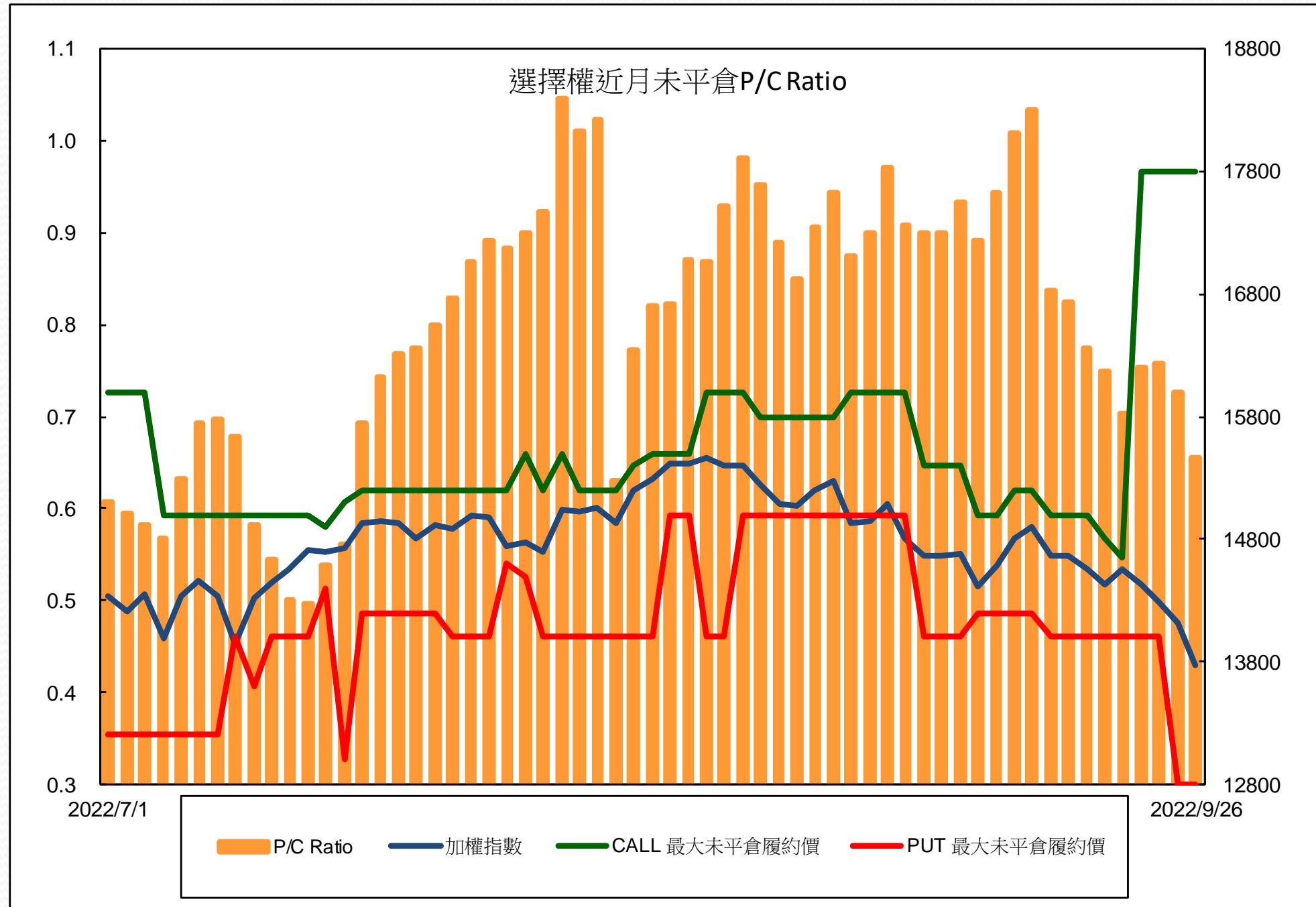
更新日期：2022年9月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	9月23日	60,265	61,966	-1,701
	9月26日	75,410	87,705	-12,295
Put	9月23日	49,734	42,337	7,397
	9月26日	52,017	42,927	9,090

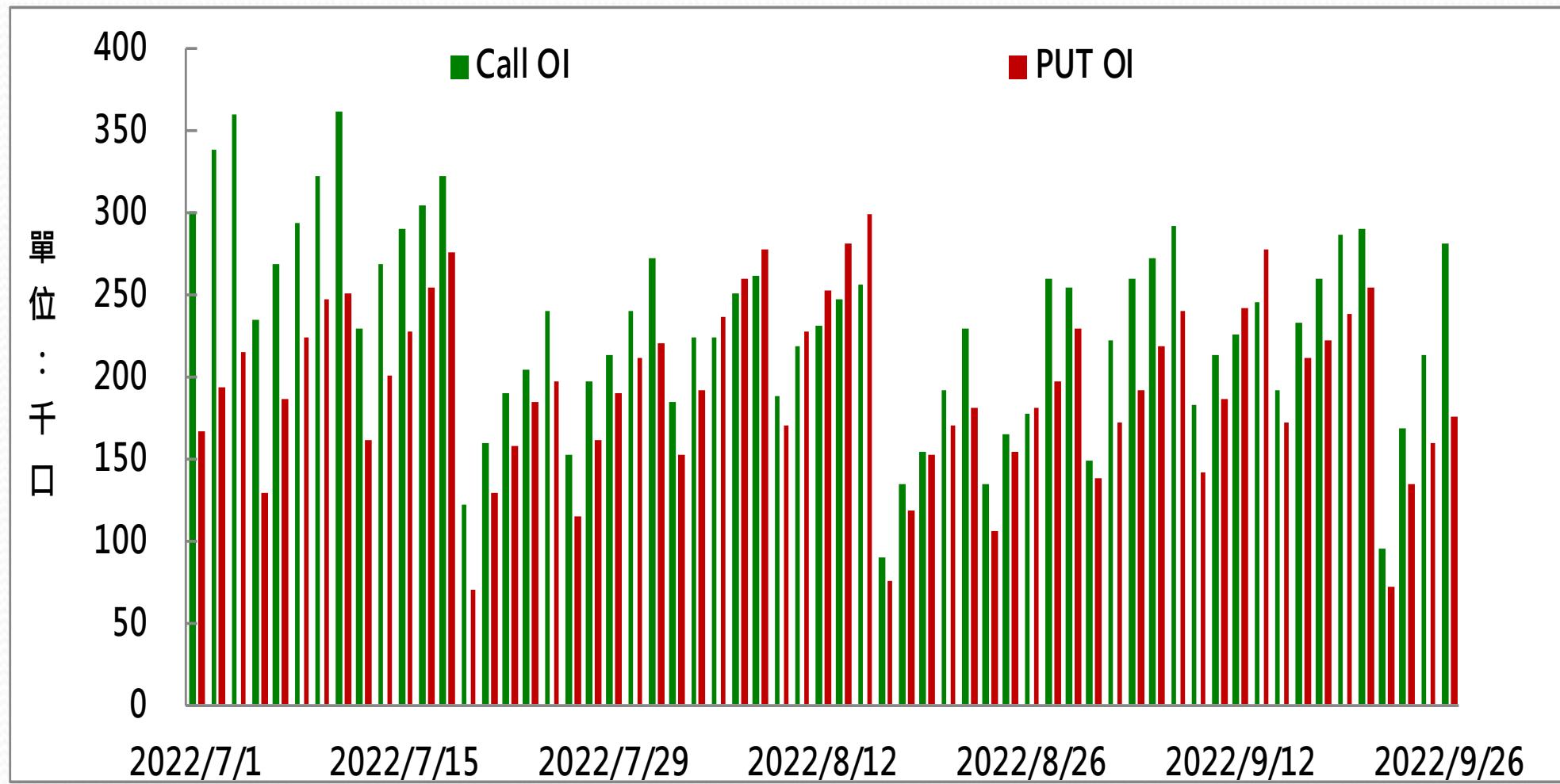
更新日期：2022年9月26日 資料來源：台灣期貨交易所 · 凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年9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9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9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