

台指選擇權OI匯報

日期：2022/9/27 結算日：2022/9/28					日期：2022/9/27 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	13,100	2,420	674	0	11	12,600	1,259	96
0	36	13,200	4,495	436	0	0	12,700	1,327	373
10	22	13,300	5,122	441	0	173	12,800	5,031	900
49	80	13,400	7,573	-1,822	0	0	12,900	1,982	375
6	6	13,450	1,187	1,187	1	16	13,000	4,267	814
43	78	13,500	10,362	2,366	2	4	13,100	1,666	367
74	74	13,550	2,031	2,031	-3	24	13,200	3,120	765
64	276	13,600	13,437	2,561	4	49	13,300	3,100	531
68	68	13,650	3,358	3,358	4	29	13,400	2,776	439
570	1,117	13,700	12,763	1,203	47	133	13,500	3,492	363
1,264	1,860	13,750	4,585	2,207	12	83	13,600	2,690	521
2,702	5,826	13,800	9,829	1,950	106	323	13,700	2,936	313
1,824	5,239	13,850	4,195	2,916	1,084	1,690	13,800	4,537	1,886
2,129	7,469	13,900	5,891	-402	919	1,547	13,900	2,222	-88
1,988	6,831	13,950	1,142	-346	1,464	2,785	14,000	3,040	-57
4,876	14,760	14,000	4,146	-511	486	1,605	14,100	1,497	-73
1,964	9,542	14,050	1,121	-246	568	3,418	14,200	1,044	-28
2,216	12,176	14,100	2,047	-397	343	3,623	14,300	775	-36
-108	8,100	14,150	1,550	-168	790	3,980	14,400	1,265	-14
-1,871	9,804	14,200	1,769	-257	371	5,502	14,500	2,366	-56
-273	6,404	14,250	1,309	-76	-225	4,360	14,600	1,168	-32
-719	9,732	14,300	1,922	-162	156	3,738	14,700	544	-6
-686	8,112	14,350	1,143	-29	916	7,547	14,800	649	-9
-979	7,906	14,400	1,191	-32	54	3,016	14,900	161	10
-947	6,293	14,450	441	-11	18	8,550	15,000	885	12
-1,473	6,644	14,500	1,064	-21	-206	3,509	15,100	102	18
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
7,844	174,365	0.6701	116,844	16,890	6,746	92,575	0.6987	64,678	8,360
昨日 P/C	0.6002	今日增減變化		0.0699	昨日 P/C	0.6562	今日增減變化		0.0425

更新日期：2022年9月27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27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	69,913,848	71,574,584	-1,660,736	-2,037,547	3,921,394	861,288	3,060,106	14,441
投信	24,679,116	50,468,958	-25,789,842	214,834	491,441	0	491,441	3,531
自營商	35,527,609	18,788,473	16,739,136	1,133,805	1,111,898	924,537	187,361	-53,984
	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	1,720,602	1,440,504	280,098	179,987	178,396	44,939	133,457	-21,366
投信	93,366	0	93,366	-769	0	0	0	0
自營商	333,452	364,573	-31,121	-26,639	13,618	162,054	-148,436	10,462

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27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	27,596	16,242	11,354	3,215	31,950	14,515	17,435	2,662
投信	0	100	-100	0	600	111	489	0
自營商	73,750	88,845	-15,095	-2,800	56,740	42,970	13,770	4,680
特定法人(週)	8,192	0	8,192	1,443	1,315	1,172	143	570
特定法人(近月)	9,610	9,393	217	1,718	6,865	15,177	-8,312	-2,089
特定法人(全月)	13,409	4,949	8,460	873	5,200	23,258	-18,058	-4,973
十大交易人(週)	39,793	66,598	-26,805	-1,770	32,405	38,832	-6,427	700
十大交易人(近月)	44,710	43,008	1,702	-721	18,385	35,518	-17,133	-3,503
十大交易人(全月)	97,982	106,618	-8,636	-1,521	53,331	81,618	-28,287	-4,620
全市場未沖銷(近月)			92,575	6,746			64,678	8,360
全市場未沖銷(全月)			297,486	16,034			201,175	25,518

更新日期：2022年9月27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	13900	買權OI最大量	14000
	賣權成交最大量	13800	賣權OI最大量	13600
	整體隱含波動率	13.50%	較前一交易日	-0.48%
	買權隱含波動率	11.37%	較前一交易日	+1.25%
	賣權隱含波動率	16.09%	較前一交易日	-3.21%
電子選擇權	買權成交最大量	655	買權OI最大量	665
	賣權成交最大量	580	賣權OI最大量	600
金融選擇權	買權成交最大量	1500	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1440	賣權OI最大量	1500

更新日期：2022年9月27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

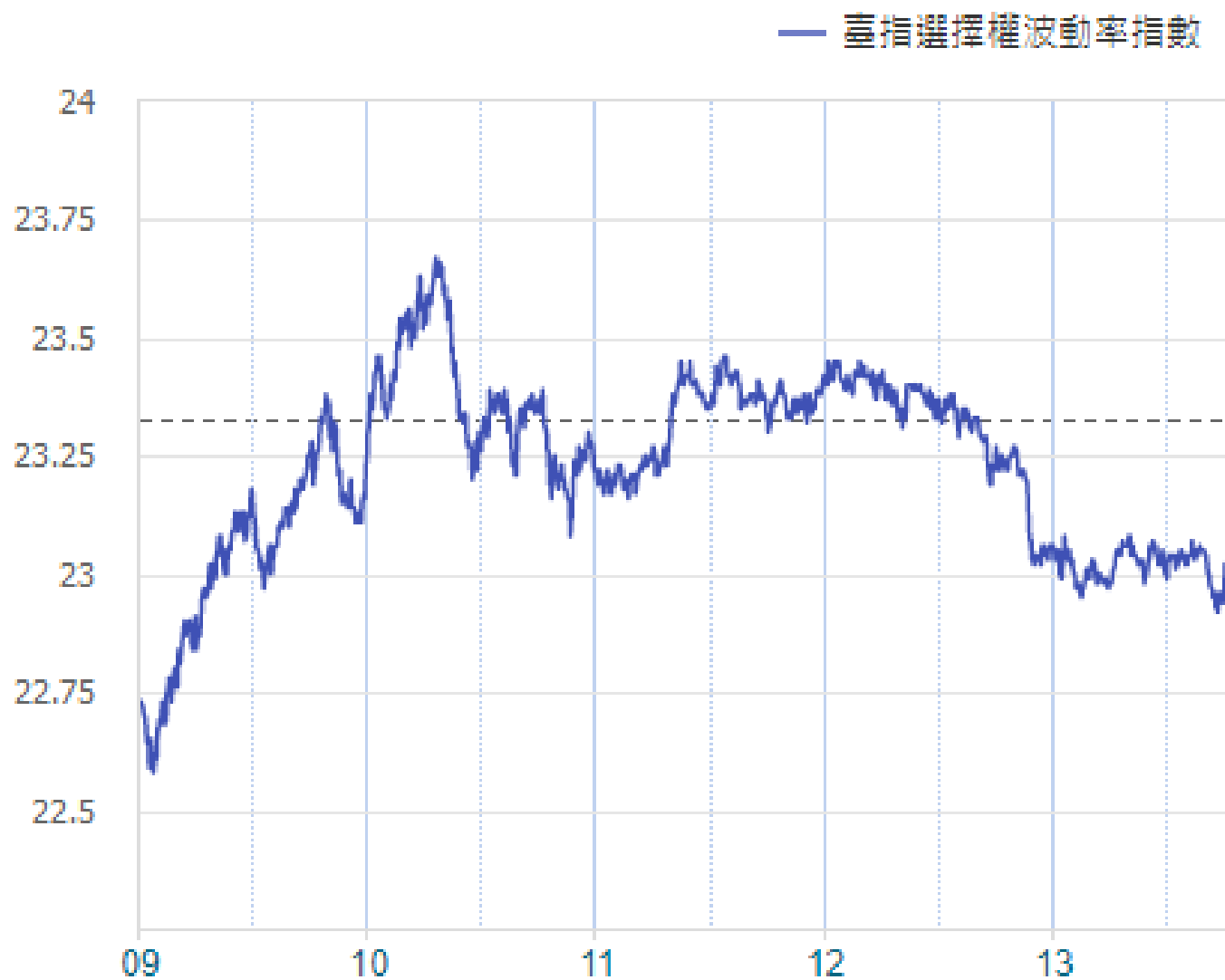
2022 年 10 月 選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	14000	買權OI最大量	17800
	賣權成交最大量	13800	賣權OI最大量	12800
	整體隱含波動率	21.94%	較前一交易日	-0.21%
	買權隱含波動率	18.65%	較前一交易日	-0.44%
	賣權隱含波動率	25.52%	較前一交易日	+0.14%
	成交量P/C_Ratio值	0.953	較前一交易日	+0.22
	未平倉P/C_Ratio值	0.699	較前一交易日	+0.04
電子選擇權	買權成交最大量	655	買權OI最大量	665
	賣權成交最大量	580	賣權OI最大量	600
金融選擇權	買權成交最大量	1500	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1440	賣權OI最大量	1500

更新日期：2022年9月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

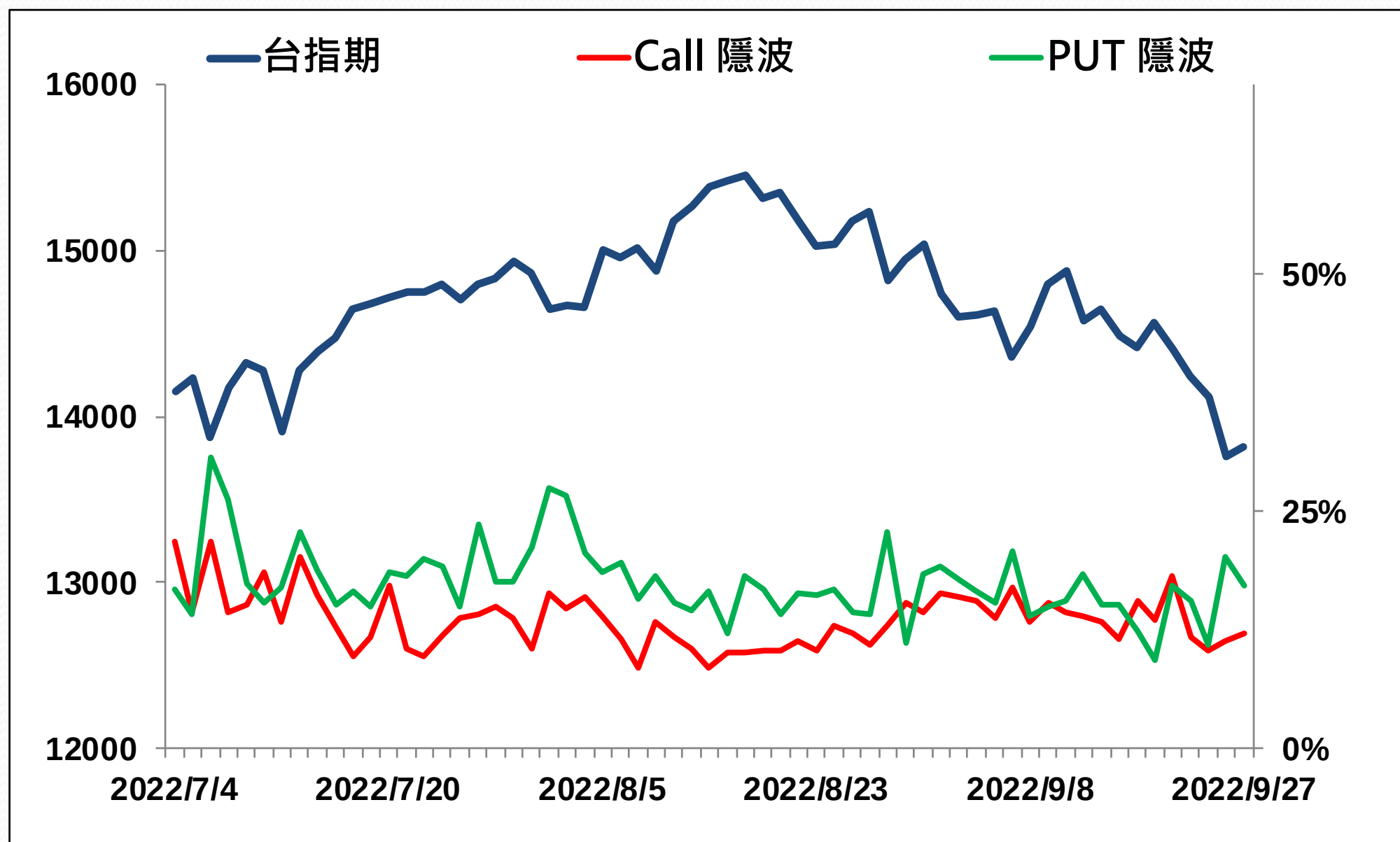
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



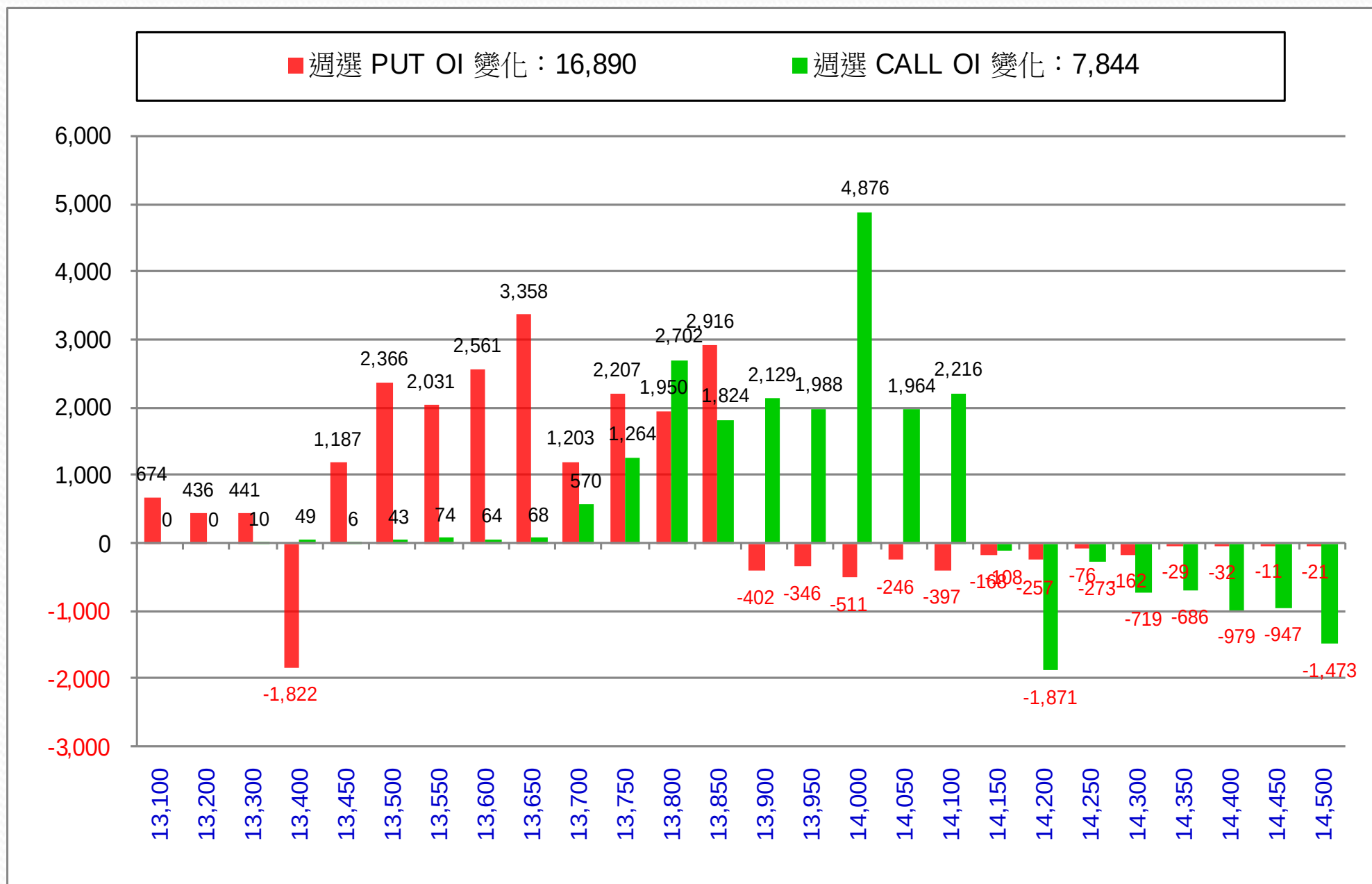
更新日期：2022年9月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年9月27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

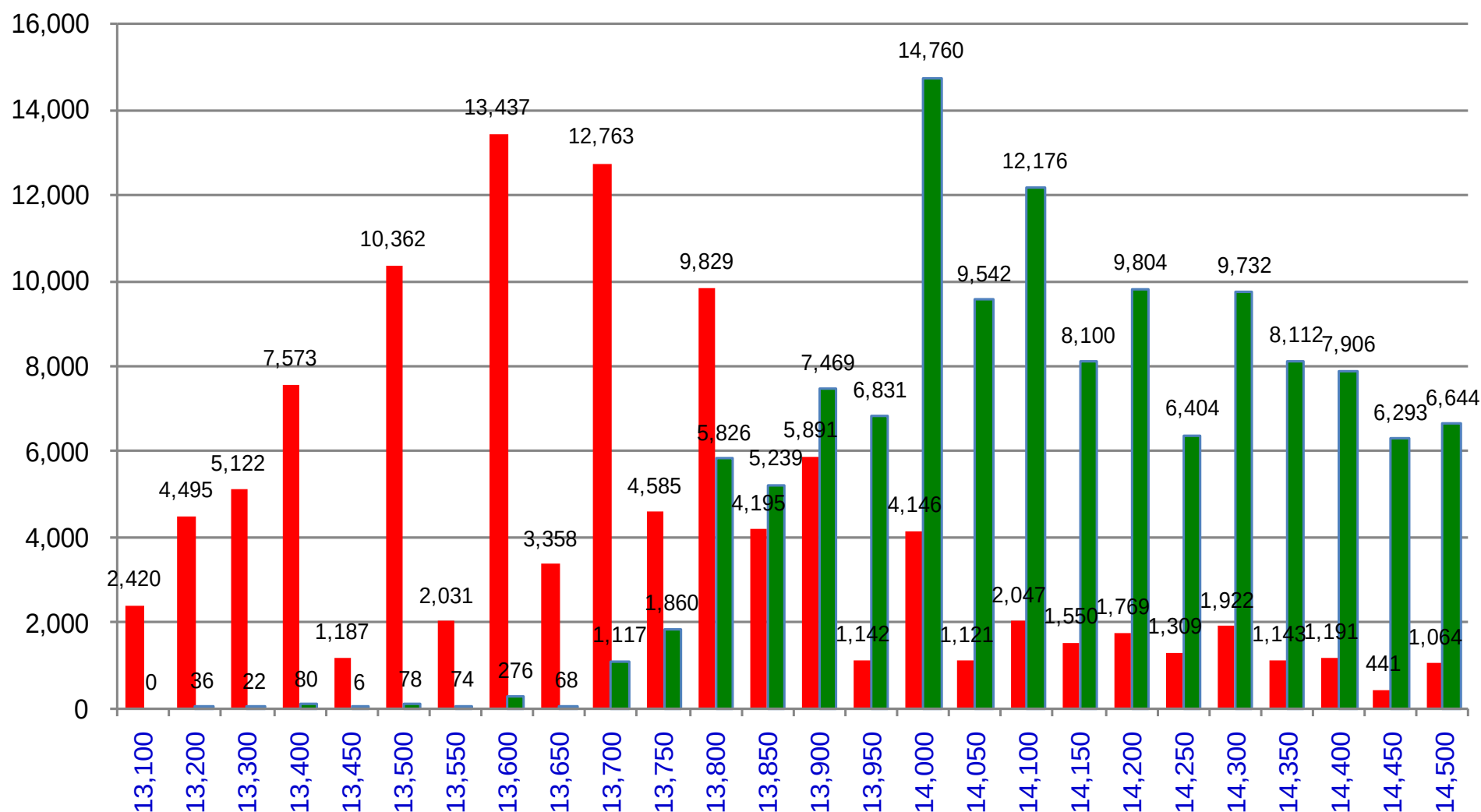


更新日期：2022年9月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：116,844

週選 CALL OI 總額：174,365



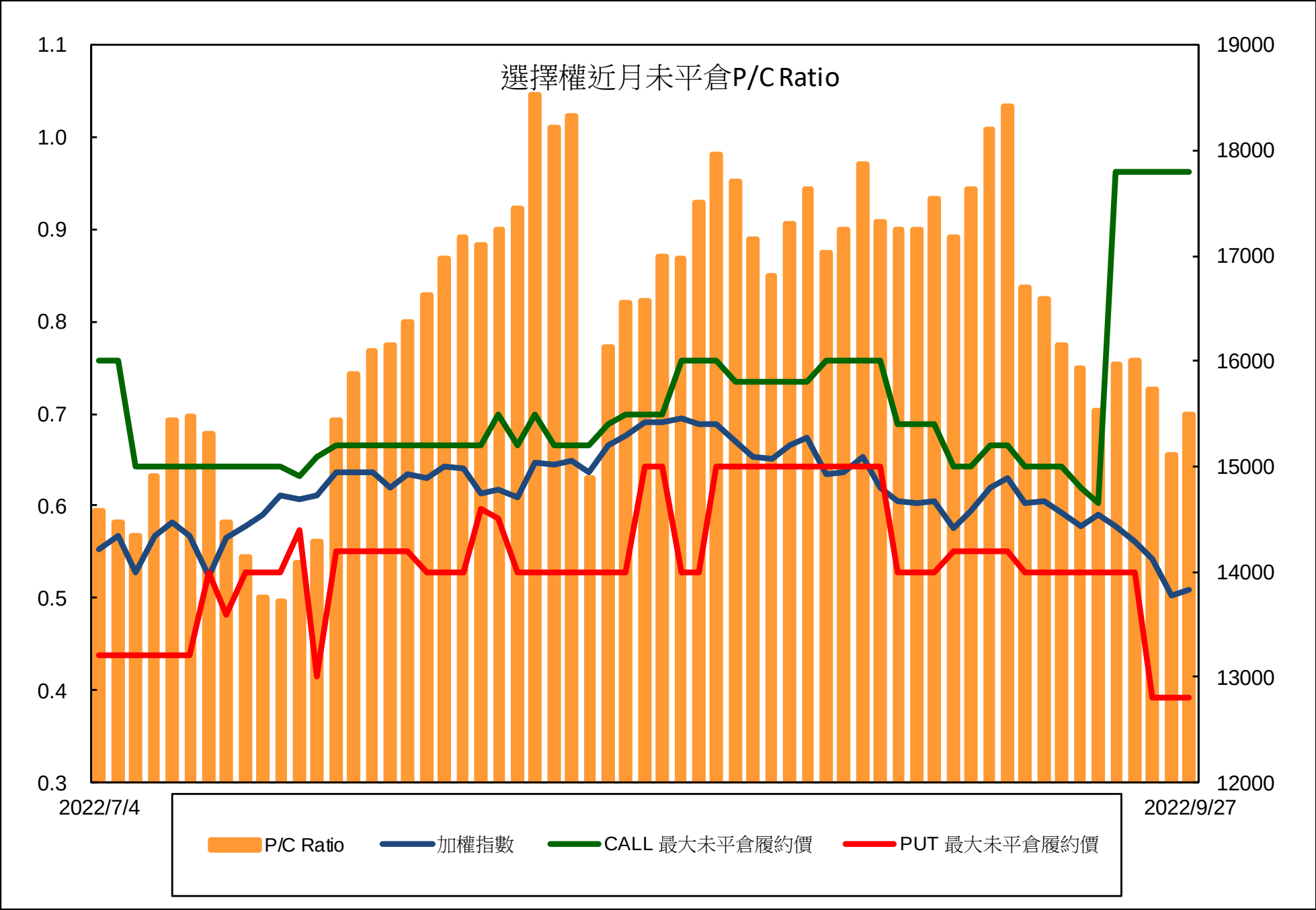
更新日期：2022年9月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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26日	75,410	87,705	-12,295
	9月27日	73,750	88,845	-15,095
Put	9月26日	52,017	42,927	9,090
	9月27日	56,740	42,970	13,770

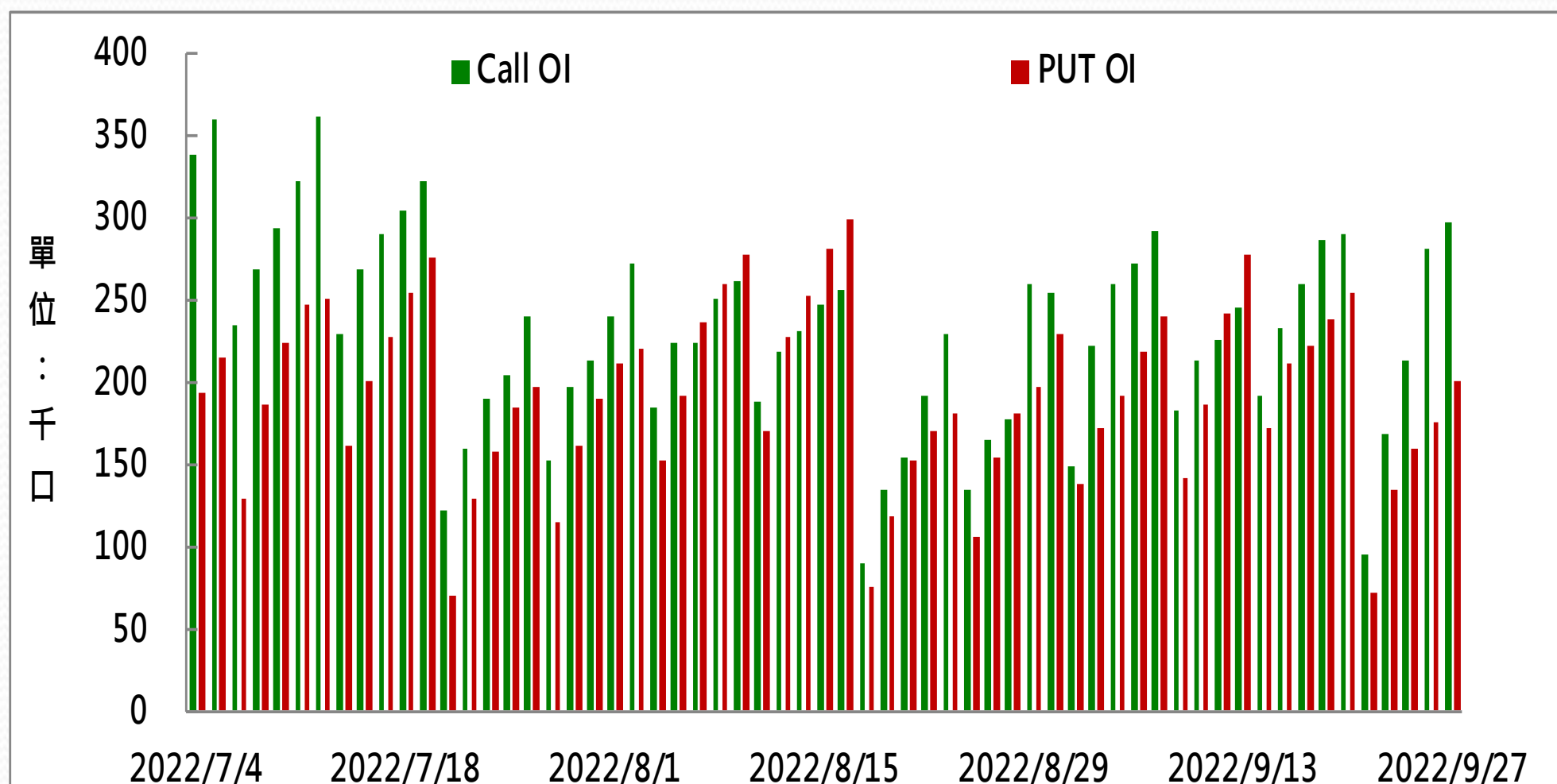
更新日期：2022年9月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年9月27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27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27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