

台指選擇權OI匯報

日期：2022/9/28 結算日：2022/10/5					日期：2022/9/28 結算日：2022/10/19				
202210W1					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	12,300	0	0	0	0	12,300	1,590	229
0	0	12,400	1,498	1,498	0	791	12,400	1,206	110
0	0	12,500	691	691	0	20	12,500	2,013	319
0	0	12,600	753	753	1	12	12,600	1,515	256
0	0	12,700	645	645	22	22	12,700	1,439	112
15	15	12,800	897	897	57	230	12,800	5,082	51
0	0	12,900	1,292	1,292	3	3	12,900	2,022	40
3	3	13,000	1,888	1,888	12	28	13,000	4,618	351
5	5	13,100	1,295	1,295	19	23	13,100	2,218	552
19	19	13,200	1,605	1,605	66	90	13,200	3,410	290
160	160	13,300	1,647	1,647	77	126	13,300	3,145	45
159	159	13,400	890	890	248	277	13,400	2,903	127
178	178	13,450	755	755	391	524	13,500	3,242	-250
750	750	13,500	773	773	569	652	13,600	2,379	-311
824	824	13,550	256	256	886	1,209	13,700	2,686	-250
1,218	1,218	13,600	291	291	466	2,156	13,800	4,069	-468
622	622	13,650	120	120	450	1,997	13,900	2,092	-130
1,952	1,952	13,700	128	128	1,252	4,037	14,000	2,565	-475
1,168	1,168	13,750	116	116	1,031	2,636	14,100	1,403	-94
2,075	2,075	13,800	125	125	1,153	4,571	14,200	956	-88
1,088	1,088	13,850	49	49	667	4,290	14,300	757	-18
2,837	2,837	13,900	112	112	-62	3,918	14,400	1,206	-59
1,815	1,815	13,950	23	23	-248	5,254	14,500	2,280	-86
3,604	3,604	14,000	88	88	-250	4,110	14,600	1,158	-10
2,402	2,402	14,050	3	3	-60	3,678	14,700	521	-23
3,675	3,675	14,100	7	7	※	1,679	14,800	648	-1
※	3,740	14,200	12	12	398	8,948	15,000	877	-8
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
37,500	37,500	0.4257	15,965	15,965	8,232	100,807	0.6611	66,646	1,968
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化		0.4257	昨日 P/C	0.6987	今日增減變化		-0.0375

更新日期：2022年9月28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28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	71,376,970	67,657,934	3,719,036	5,379,772	3,810,899	736,477	3,074,422	14,316		
投信	24,764,886	51,586,755	-26,821,869	-1,032,027	452,266	0	452,266	-39,175		
自營商	35,732,555	20,988,226	14,744,329	-1,994,807	1,037,812	988,476	49,336	-138,025		
	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	1,866,788	1,419,110	447,678	167,580	172,280	53,420	118,860	-14,597		
投信	92,169	0	92,169	-1,197	0	0	0	0		
自營商	321,859	469,623	-147,764	-116,643	13,355	149,576	-136,221	12,215		

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28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	18,578	10,408	8,170	-3,184	30,581	10,691	19,890	2,455		
投信	0	100	-100	0	600	111	489	0		
自營商	59,499	65,717	-6,218	8,877	27,846	25,582	2,264	-11,506		
特定法人(週)	450	0	450	---	282	853	-571	---		
特定法人(近月)	10,326	7,284	3,042	2,825	6,824	17,301	-10,477	-2,165		
特定法人(全月)	9,933	4,444	5,489	-2,971	8,182	26,727	-18,545	-487		
十大交易人(週)	17,572	23,035	-5,463	---	5,773	4,390	1,383	---		
十大交易人(近月)	47,778	48,220	-442	-2,144	19,376	37,435	-18,059	-926		
十大交易人(全月)	81,594	75,028	6,566	15,202	34,745	53,531	-18,786	9,501		
全市場未沖銷(近月)			100,807	8,232			66,646	1,968		
全市場未沖銷(全月)			170,177	-127,309			102,921	-98,254		

更新日期：2022年9月28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 10W1 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	13000	賣權OI最大量	13000
	整體隱含波動率	17.12%	較前一交易日	+3.63%
	買權隱含波動率	13.44%	較前一交易日	+2.07%
	賣權隱含波動率	23.89%	較前一交易日	+7.80%
電子選擇權	買權成交最大量	655	買權OI最大量	655
	賣權成交最大量	600	賣權OI最大量	600
金融選擇權	買權成交最大量	1480	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1420	賣權OI最大量	1500

更新日期：2022年9月28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

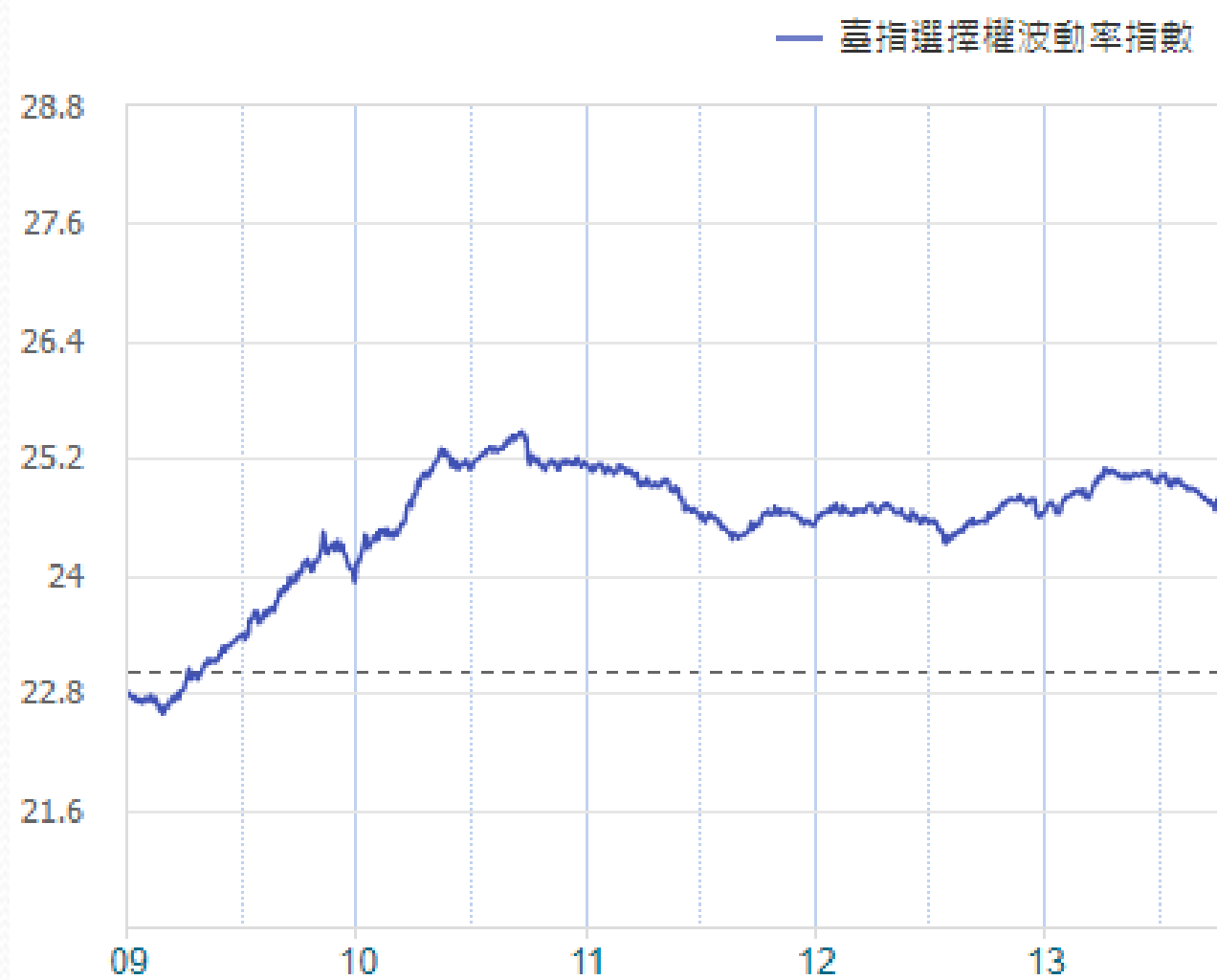
2022 年 10 月 選擇權分析表

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	13000	賣權OI最大量	12800
	整體隱含波動率	21.94%	較前一交易日	+0.00%
	買權隱含波動率	18.65%	較前一交易日	+0.00%
	賣權隱含波動率	25.52%	較前一交易日	+0.00%
	成交量P/C_Ratio值	0.848	較前一交易日	-0.10
	未平倉P/C_Ratio值	0.661	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	655
	賣權成交最大量	600	賣權OI最大量	600
金融選擇權	買權成交最大量	1480	買權OI最大量	1600
	賣權成交最大量	1420	賣權OI最大量	1500

更新日期：2022年9月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

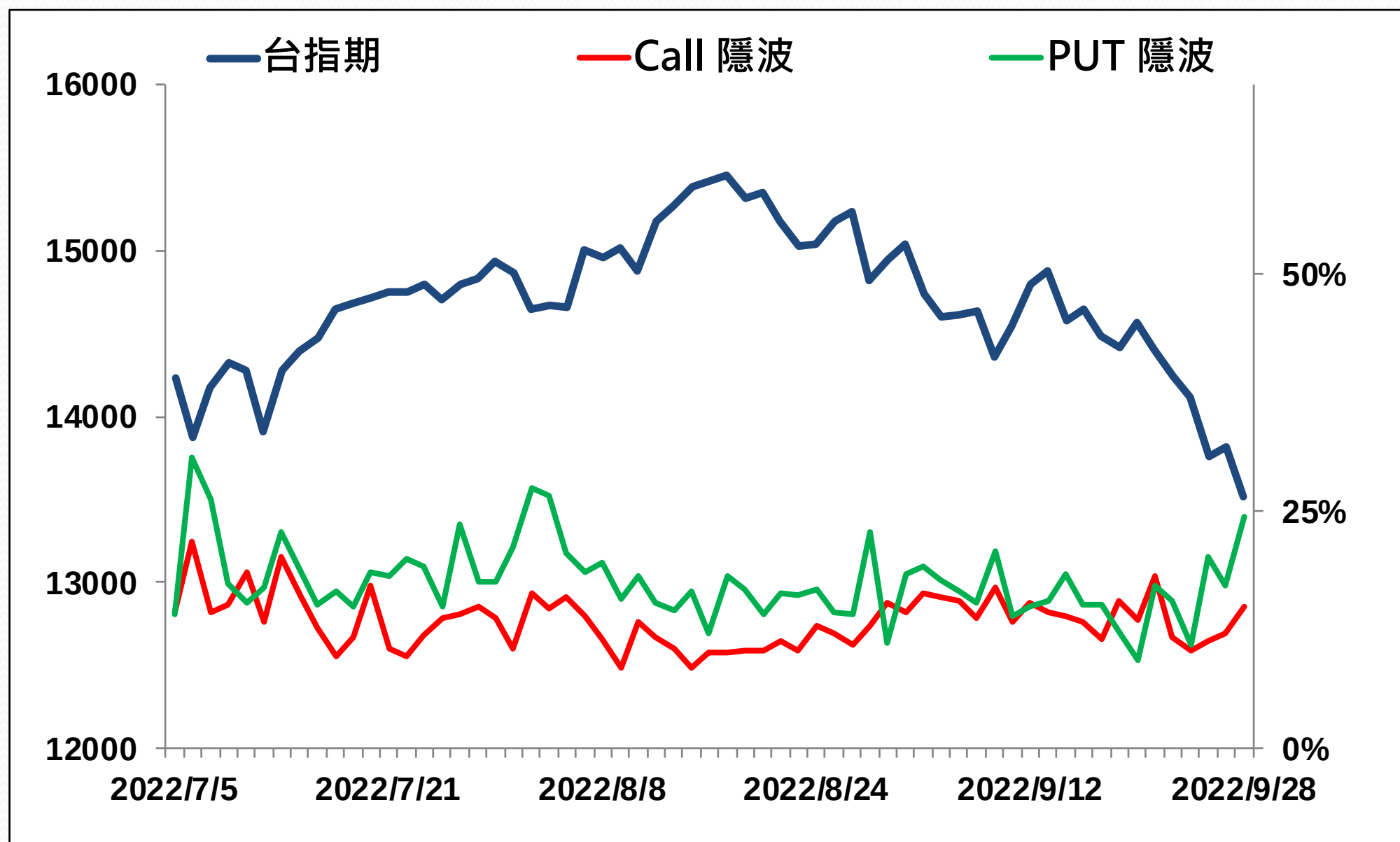
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



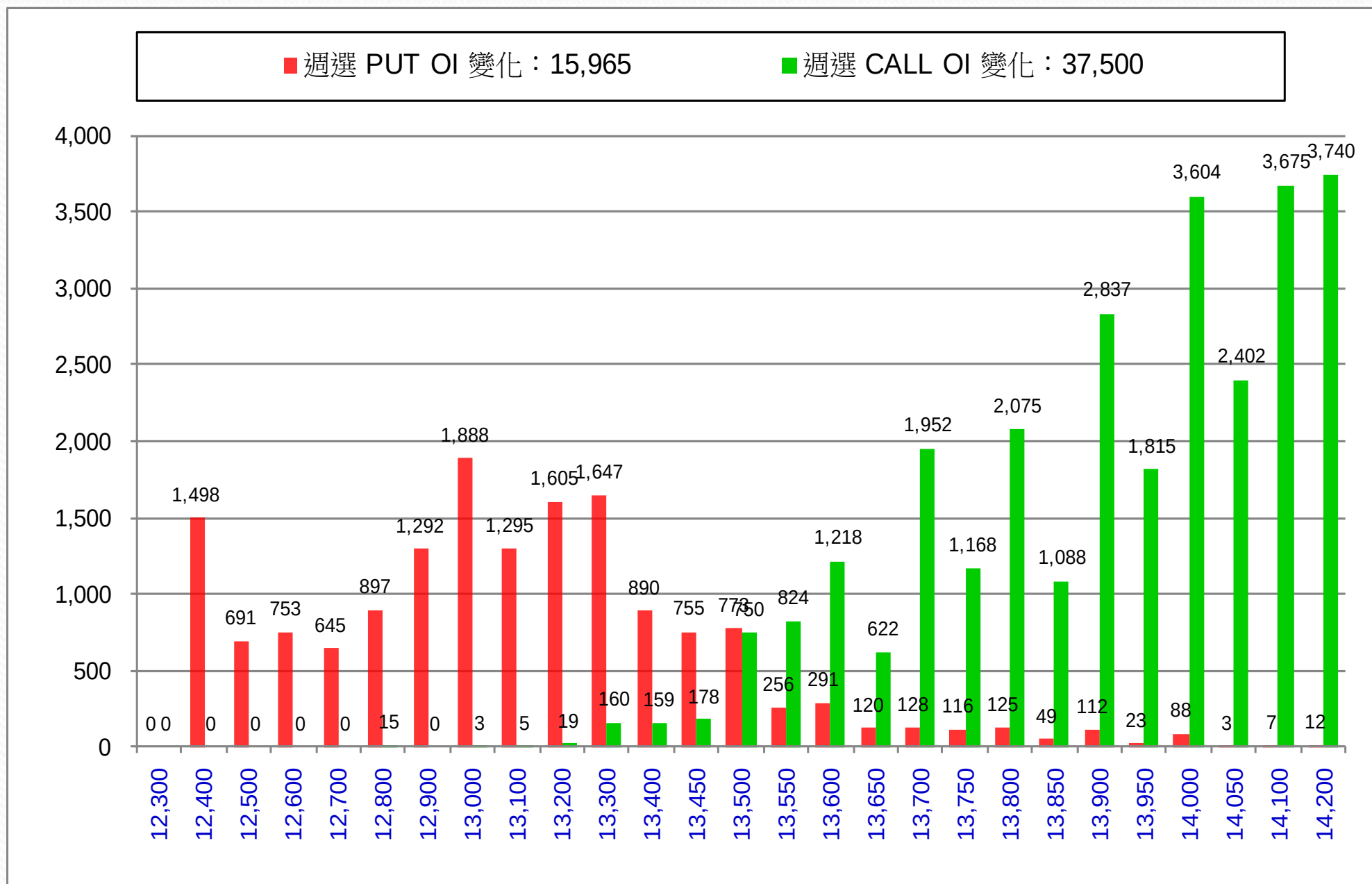
更新日期：2022年9月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年9月28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

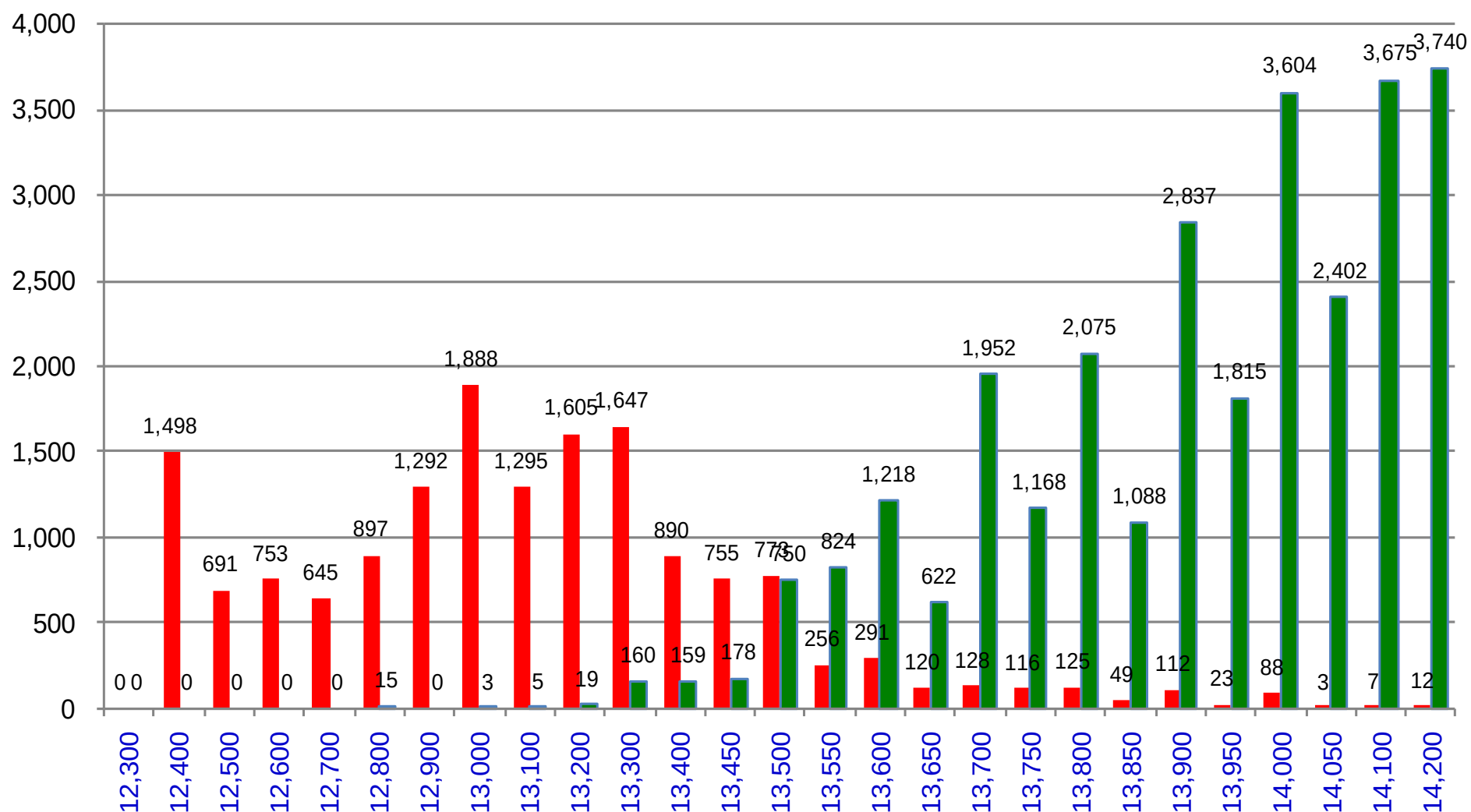


更新日期：2022年9月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：15,965

■ 週選 CALL OI 總額：37,500



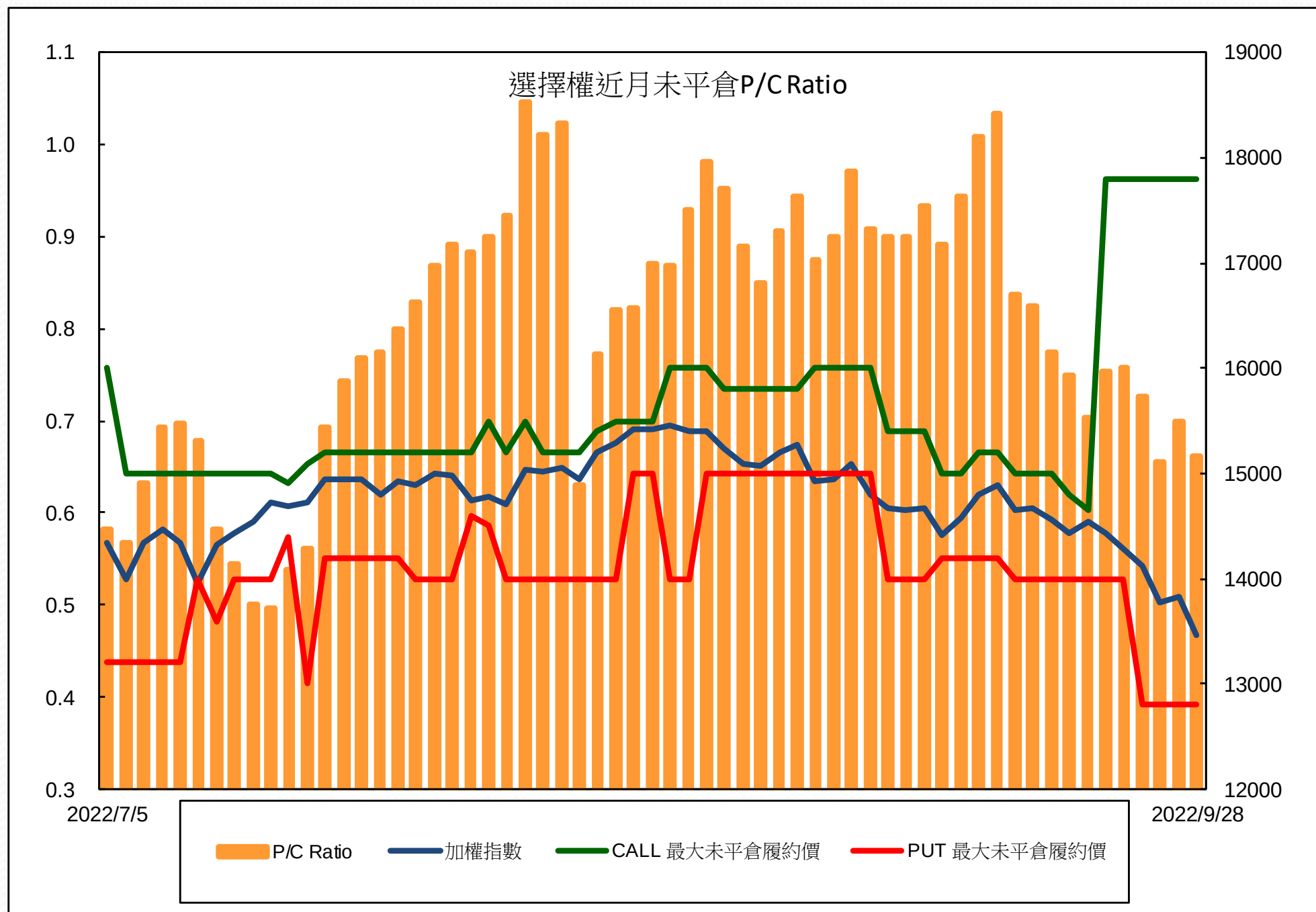
更新日期：2022年9月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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27日	73,750	88,845	-15,095
	9月28日	59,499	65,717	-6,218
Put	9月27日	56,740	42,970	13,770
	9月28日	27,846	25,582	2,264

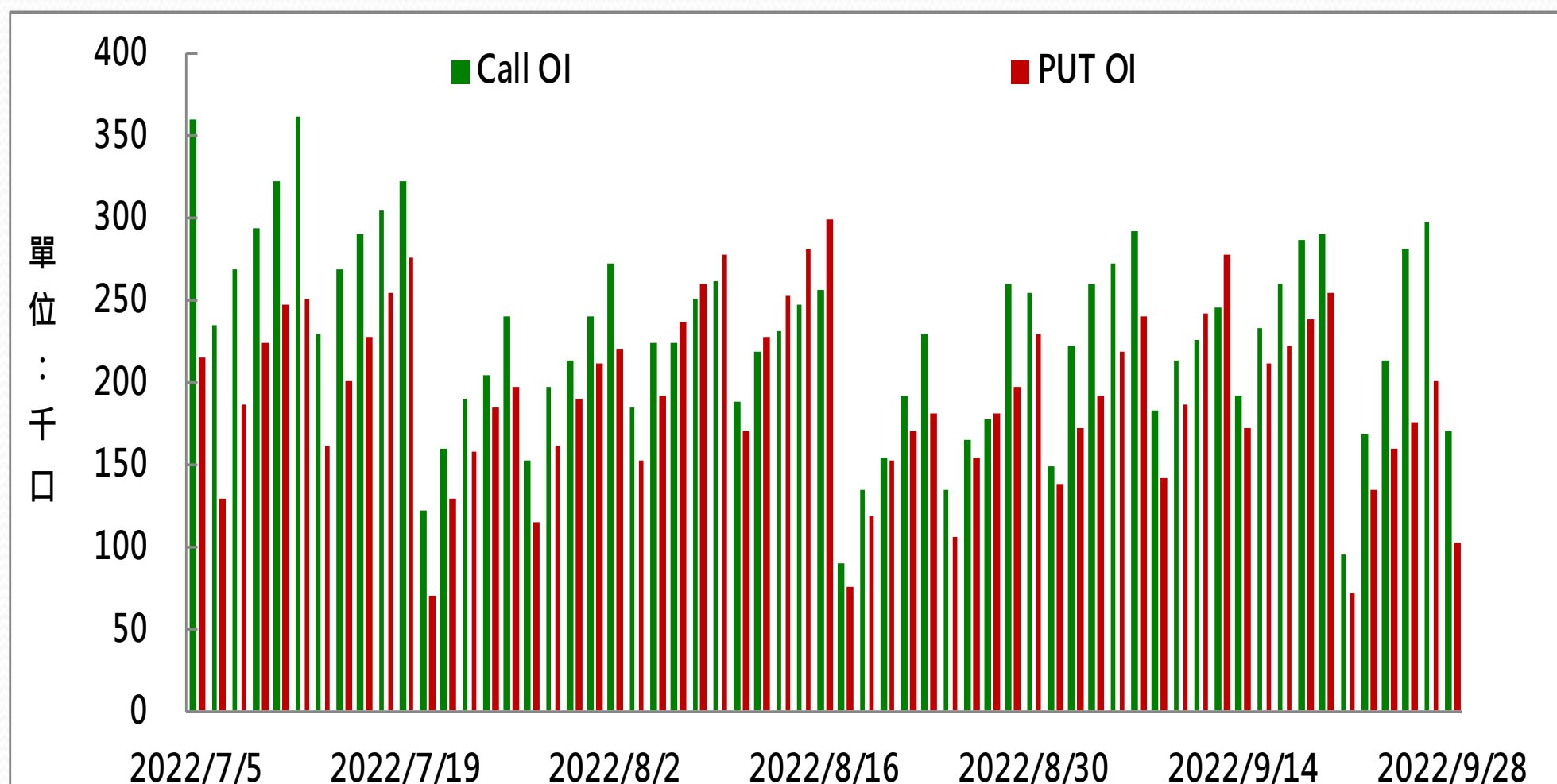
更新日期：2022年9月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年9月28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28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28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