

台指選擇權OI匯報

日期：2022/10/4 結算日：2022/10/5					日期：2022/10/4 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
-11	142	13,000	10,004	-655	0	792	12,400	2,789	487
-9	8	13,050	2,357	624	2	31	12,500	3,715	694
-53	102	13,100	7,093	754	0	16	12,600	2,437	125
16	135	13,150	3,708	-66	2	42	12,700	2,568	-66
-3	481	13,200	6,654	1,579	2	291	12,800	5,378	374
-569	542	13,250	4,064	1,747	14	78	12,900	2,891	323
-1,728	2,155	13,300	8,817	3,227	46	269	13,000	5,925	423
-608	1,923	13,350	6,040	3,702	5	138	13,100	3,509	714
-1,581	3,114	13,400	7,324	4,503	-107	346	13,200	4,492	789
-1,044	3,407	13,450	6,250	4,419	-199	519	13,300	4,742	583
-2,158	6,253	13,500	7,659	5,150	-122	1,237	13,400	3,623	224
-1,629	6,855	13,550	4,570	3,325	-109	2,151	13,500	4,030	280
-237	10,518	13,600	5,000	4,030	-144	3,092	13,600	2,080	93
25	10,180	13,650	2,861	2,425	796	4,311	13,700	2,306	33
※ 3,823	14,854	13,700	1,077	620	640	6,101	13,800	3,721	161
2,289	11,487	13,750	832	426	293	5,214	13,900	1,761	-37
646	11,871	13,800	368	182	※ 1,166	8,568	14,000	2,088	-227
1,580	7,071	13,850	148	97	629	4,596	14,100	1,294	-15
875	7,283	13,900	139	-31	225	5,670	14,200	841	-12
-226	4,049	13,950	67	-14	161	5,330	14,300	711	-10
-268	7,275	14,000	81	2	200	4,663	14,400	1,157	-7
-195	2,859	14,050	18	-3	-66	5,716	14,500	2,270	3
-301	3,734	14,100	39	0	-250	3,554	14,600	1,130	-4
-132	2,372	14,150	8	0	-1	3,099	14,700	495	-24
-268	4,464	14,200	33	-2	48	7,985	14,800	643	0
-489	3,928	14,300	13	0	-185	2,339	14,900	158	0
-171	1,310	14,500	15	0	-30	2,551	15,100	102	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
-2,707	133,170	0.8922	118,818	32,180	2,491	120,325	0.7652	92,067	6,873
昨日 P/C	0.6376	今日增減變化		0.2546	昨日 P/C	0.7230	今日增減變化		0.0422

更新日期：2022年10月4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4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	72,718,316	80,064,387	-7,346,071	-3,155,025	3,719,700	937,364	2,782,336	-150,851		
投信	26,565,977	49,222,972	-22,656,995	2,794,304	411,647	0	411,647	11,886		
自營商	39,886,514	24,884,482	15,002,032	1,916,659	902,417	1,068,693	-166,276	-257,665		
	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	1,541,257	1,340,161	201,096	-111,898	177,463	106,478	70,985	13,141		
投信	104,857	0	104,857	14,817	0	0	0	0		
自營商	323,188	326,062	-2,874	-22,879	13,651	98,287	-84,636	-13,341		

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4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	34,418	17,625	16,793	3,417	47,469	16,340	31,129	1,449		
投信	0	100	-100	-100	700	111	589	0		
自營商	85,745	97,820	-12,075	-905	49,275	61,548	-12,273	-5,085		
特定法人(週)	4,164	0	4,164	1,120	0	1,788	-1,788	1,298		
特定法人(近月)	11,604	8,494	3,110	-434	7,692	24,695	-17,003	425		
特定法人(全月)	20,956	4,444	16,512	2,787	3,574	36,801	-33,227	-3,632		
十大交易人(週)	43,836	51,519	-7,683	-757	42,875	27,483	15,392	10,944		
十大交易人(近月)	53,662	55,852	-2,190	1,793	30,937	51,930	-20,993	-1,564		
十大交易人(全月)	121,101	114,880	6,221	1,490	74,366	88,060	-13,694	7,839		
全市場未沖銷(近月)			120,325	2,491			92,067	6,873		
全市場未沖銷(全月)			297,138	2,064			234,793	40,676		

更新日期：2022年10月4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	13600	買權OI最大量	13700
	賣權成交最大量	13300	賣權OI最大量	13000
	整體隱含波動率	17.51%	較前一交易日	-5.57%
	買權隱含波動率	17.56%	較前一交易日	-3.99%
	賣權隱含波動率	17.46%	較前一交易日	-7.47%
電子選擇權	買權成交最大量	640	買權OI最大量	640
	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	1480	買權OI最大量	1480
	賣權成交最大量	1420	賣權OI最大量	1400

更新日期：2022年10月4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

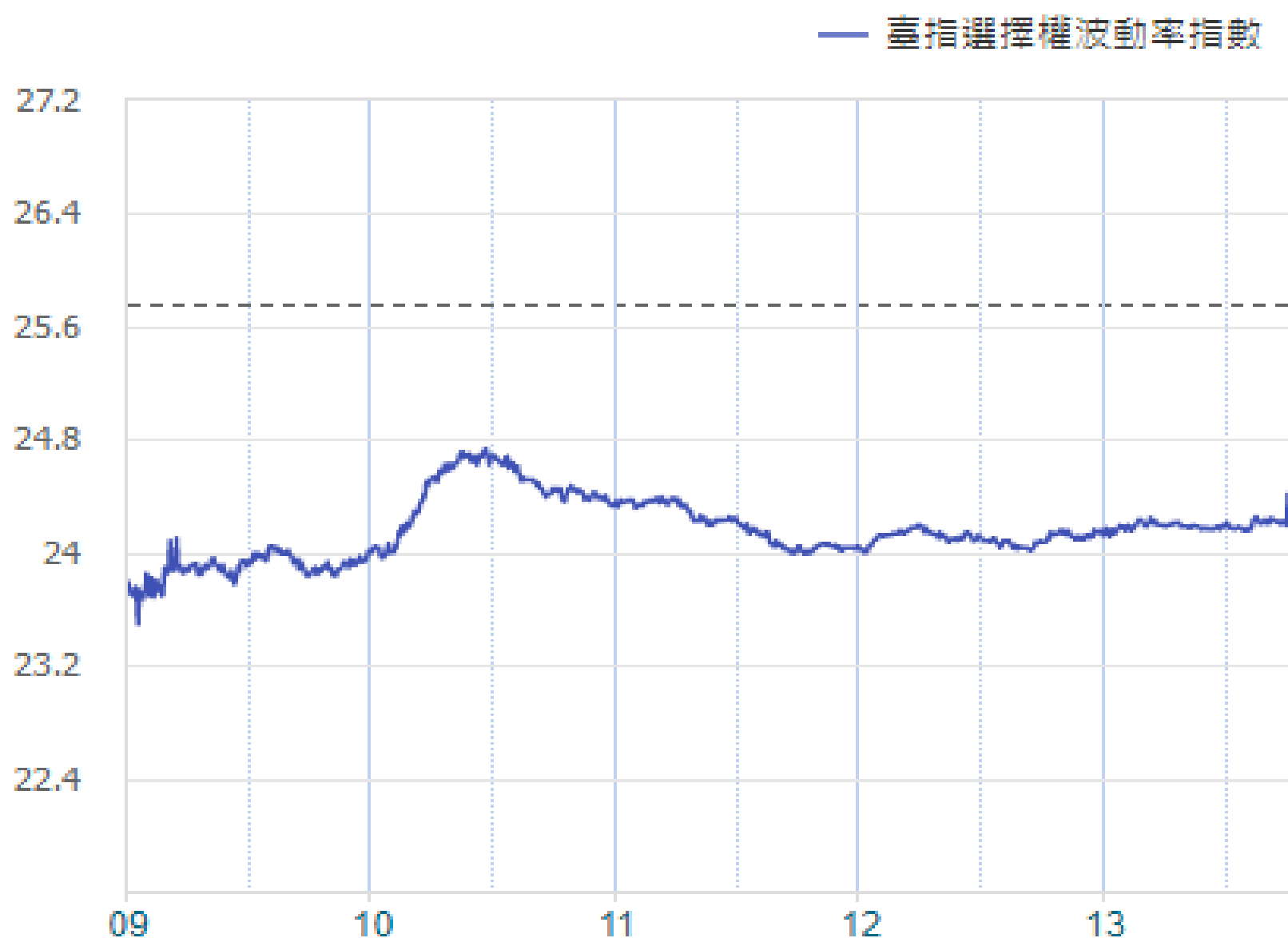
2022 年 10 月 選擇權分析表

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	12000
	整體隱含波動率	22.98%	較前一交易日	+1.95%
	買權隱含波動率	20.16%	較前一交易日	-1.93%
	賣權隱含波動率	25.44%	較前一交易日	-2.53%
	成交量P/C_Ratio值	1.083	較前一交易日	+0.15
	未平倉P/C_Ratio值	0.765	較前一交易日	+0.04
電子選擇權	買權成交最大量	640	買權OI最大量	640
	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	1480	買權OI最大量	1480
	賣權成交最大量	1420	賣權OI最大量	1400

更新日期：2022年10月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

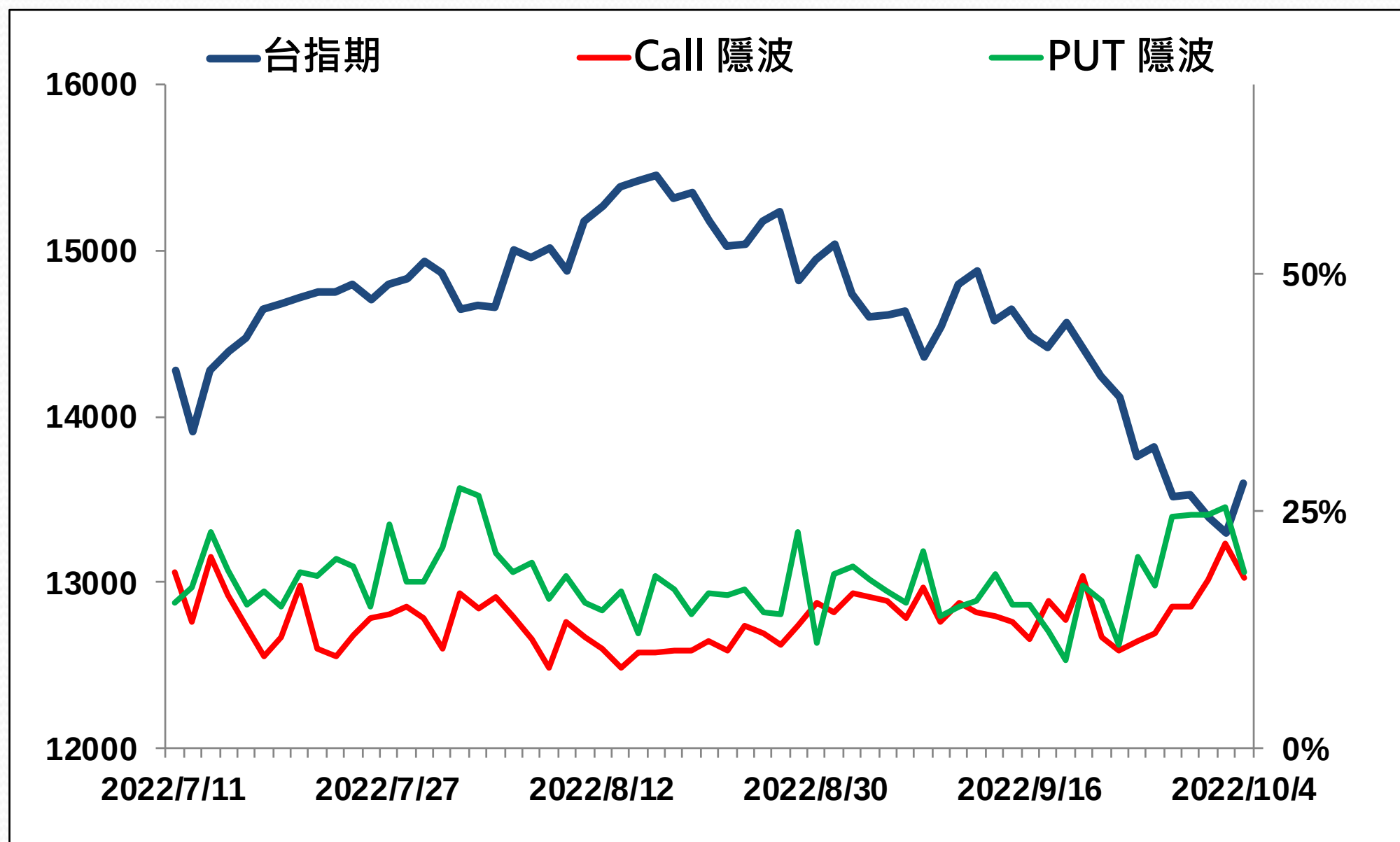
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



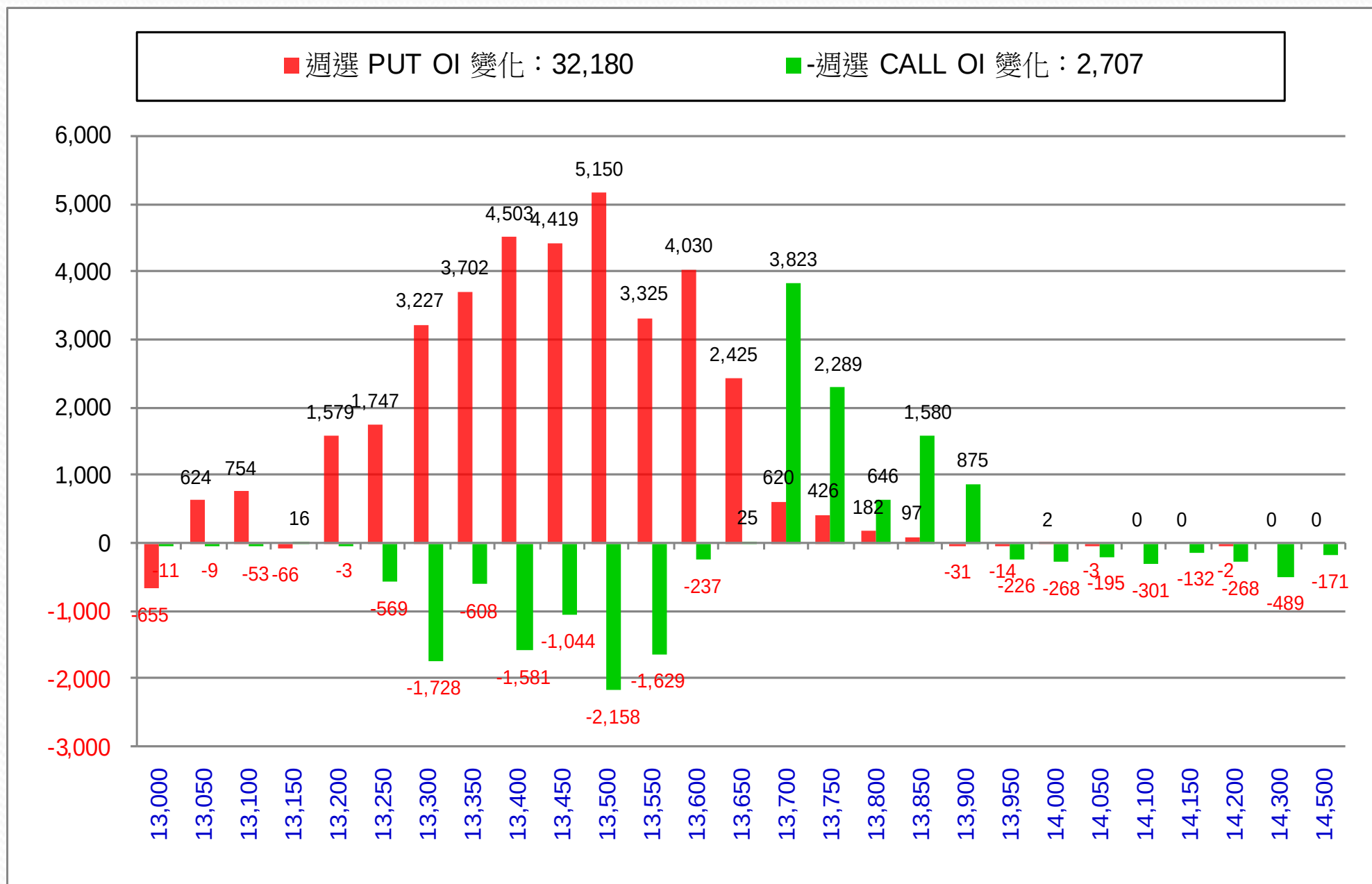
更新日期：2022年10月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年10月4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

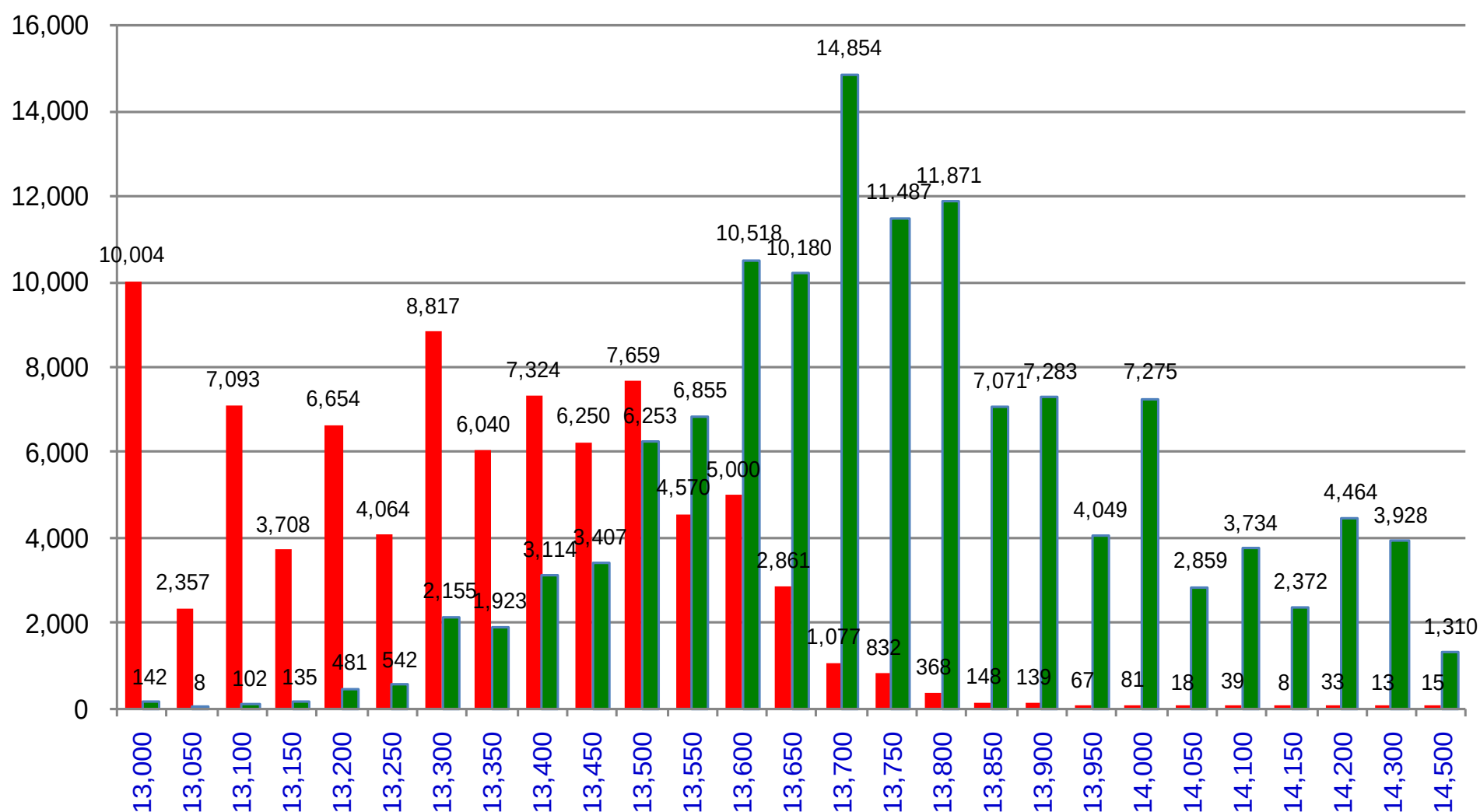


更新日期：2022年10月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：118,818

週選 CALL OI 總額：133,170



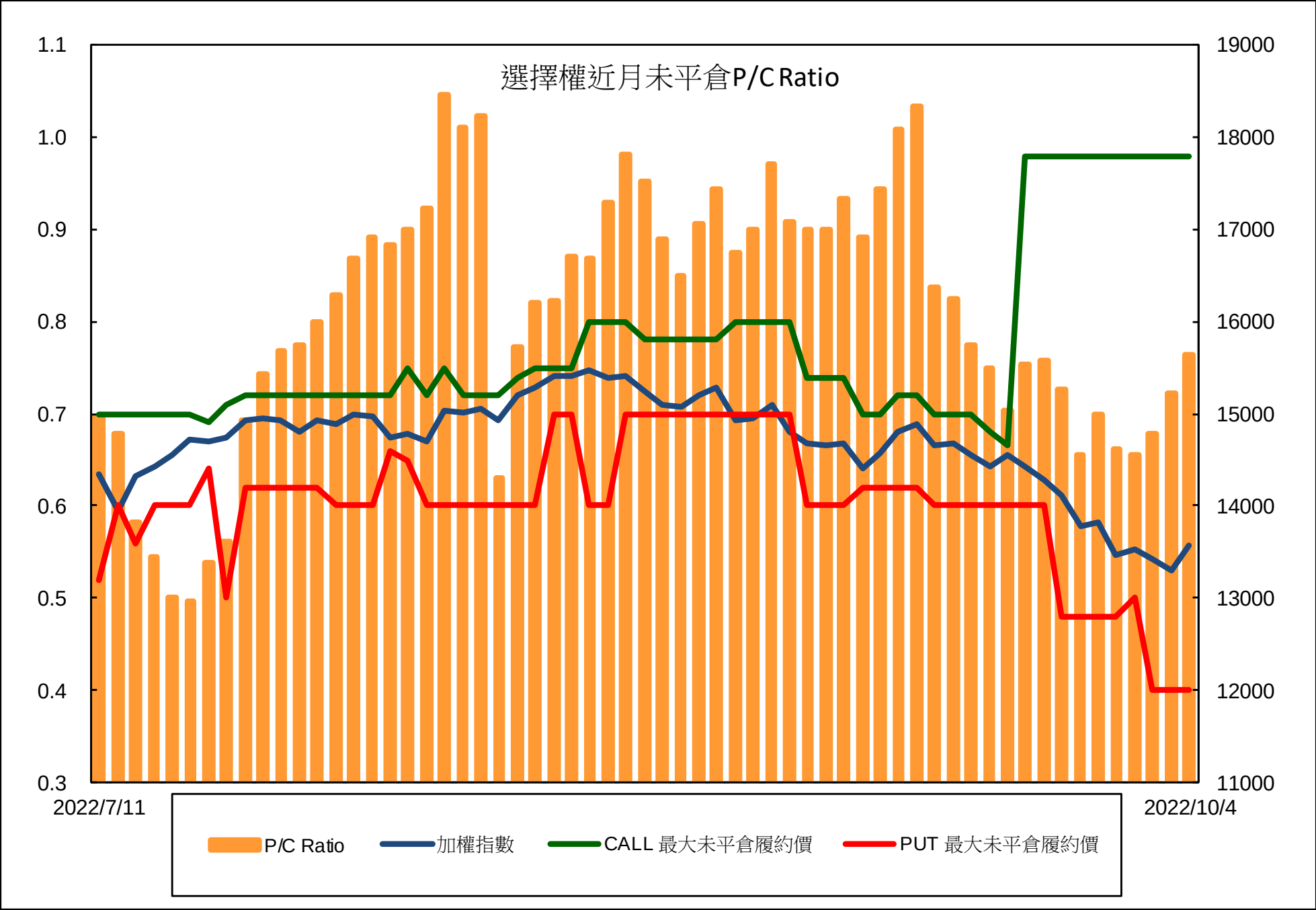
更新日期：2022年10月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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3日	84,581	95,751	-11,170
	10月4日	85,745	97,820	-12,075
Put	10月3日	44,156	51,344	-7,188
	10月4日	49,275	61,548	-12,273

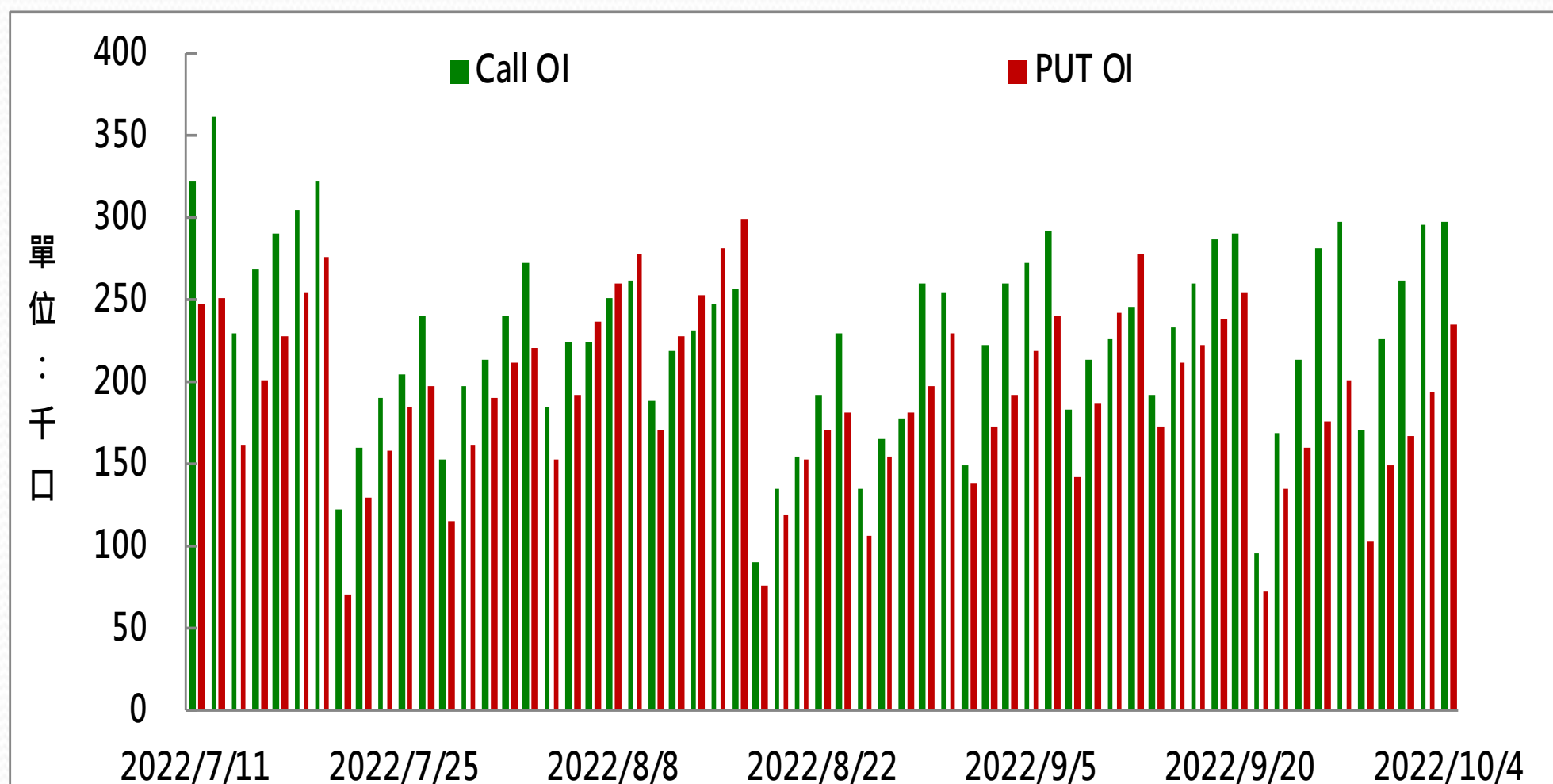
更新日期：2022年10月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年10月4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4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4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