台指選擇權OI匯報

日期：2022/5/9				結算日：2022/5/11		日期：2022/5/9				結算日：2022/5/18	
202205W2						202205 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	15,000	1,362	838		0	171	14,800	1,330	210	
0	0	15,100	1,650	917		0	11	14,900	1,286	54	
0	0	15,200	3,027	1,468		-2	0	15,000	4,139	342	
0	0	15,300	3,254	1,148		0	0	15,100	1,612	233	
20	20	15,400	5,035	2,020		34	86	15,200	2,928	742	※
5	5	15,500	6,010	2,802		0	3	15,300	2,413	-341	
8	10	15,600	6,467	3,390	※	0	3	15,400	3,123	89	
5	9	15,700	5,572	1,226		0	22	15,500	6,443	-584	
94	97	15,800	7,717	2,084		17	19	15,600	3,467	52	
155	164	15,900	6,744	920		31	36	15,700	3,100	492	
163	163	15,950	2,893	2,893		61	433	15,800	6,448	317	
639	675	16,000	8,353	1,376		95	182	15,900	6,315	208	
840	871	16,050	2,921	445		305	657	16,000	6,109	-400	
2,278	2,367	16,100	3,745	-935		681	948	16,100	3,937	366	
5,415	5,487	16,150	2,327	-317		571	1,214	16,200	5,324	-230	
4,480	4,750	16,200	4,737	-1,031		1,088	2,369	16,300	3,370	-91	
4,158	4,644	16,250	2,544	-409		1,232	2,960	16,400	3,926	-105	
5,214	6,479	16,300	3,365	-717		※ 2,668	5,636	16,500	2,950	-617	
5,741	8,229	16,350	3,482	-442		787	5,419	16,600	2,564	-272	
※ 7,871	11,225	16,400	3,347	-749		929	5,401	16,700	2,613	-224	
4,027	7,177	16,450	1,633	-192		307	6,724	16,800	2,241	-43	
3,286	8,625	16,500	2,638	-521		-11	5,121	16,900	1,604	-54	
1,209	5,829	16,550	1,765	-213		168	10,191	17,000	2,127	-105	
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	
30,733	147,088	0.6810	100,170	16,302		6,005	116,740	0.7885	92,055	-2	
昨日 P/C	0.7208	今日增減變化		-0.0398		昨日 P/C	0.8313	今日增減變化		-0.0428	

更新日期：2022年5月9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5月9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	91,820,021	117,795,348	-25,975,327	5,812,427	3,254,742	2,524,586	730,156	-50,284
投信	37,516,002	65,226,685	-27,710,683	-3,660,820	398,779	0	398,779	-6,311
自營商	70,167,551	24,350,933	45,816,618	-1,069,754	911,679	1,905,208	-993,529	269,351
	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	1,652,594	1,310,773	341,821	11,881	167,570	57,452	110,118	-19,047
投信	23,803	0	23,803	-767	1,596	0	1,596	-39
自營商	431,691	975,895	-544,204	-61,470	87,730	186,720	-98,990	51,453

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報 2022年5月9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	24,840	14,989	9,851	-1,137	51,687	16,679	35,008	725
投信	0	100	-100	-100	700	85	615	350
自營商	80,739	82,132	-1,393	-11,199	53,968	54,064	-96	1,557
特定法人(週)	4,531	0	4,531	2,004	1,501	1,367	134	1,269
特定法人(近月)	10,097	6,247	3,850	113	6,132	23,693	-17,561	744
特定法人 (全月)	17,421	0	17,421	3,238	6,009	39,967	-33,958	1,353
十大交易人(週)	35,617	49,960	-14,343	-8,670	29,673	29,310	363	-5,035
十大交易人(近月)	42,705	44,504	-1,799	-2,046	28,762	47,935	-19,173	869
十大交易人(全月)	93,990	87,489	6,501	-10,842	65,258	94,494	-29,236	-3,290
全市場未沖銷 (近月)			116,740	6,005			92,055	-2
全市場未沖銷 (全月)			298,968	36,819			228,168	16,854

更新日期：2022年5月9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 05W2 週 選擇權分析表				
台指選擇權	買權成交最大量	16400	買權OI最大量	16400
	賣權成交最大量	16000	賣權OI最大量	16000
	整體隱含波動率	21.31%	較前一交易日	+3.69%
	買權隱含波動率	19.49%	較前一交易日	+6.33%
	賣權隱含波動率	23.71%	較前一交易日	+1.66%
電子選擇權	買權成交最大量	755	買權OI最大量	785
	賣權成交最大量	710	賣權OI最大量	695
金融選擇權	買權成交最大量	1740	買權OI最大量	1840
	賣權成交最大量	1700	賣權OI最大量	1760

更新日期：2022年5月9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 05 月 選擇權分析表				
台指選擇權	買權成交最大量	16800	買權OI最大量	17000
	賣權成交最大量	16000	賣權OI最大量	15800
	整體隱含波動率	21.96%	較前一交易日	-1.75%
	買權隱含波動率	18.58%	較前一交易日	+3.13%
	賣權隱含波動率	26.10%	較前一交易日	+1.12%
	成交量P/C_Ratio值	0.908	較前一交易日	-0.12
	未平倉P/C_Ratio值	0.789	較前一交易日	-0.04
電子選擇權	買權成交最大量	755	買權OI最大量	785
	賣權成交最大量	710	賣權OI最大量	695
金融選擇權	買權成交最大量	1740	買權OI最大量	1840
	賣權成交最大量	1700	賣權OI最大量	1760

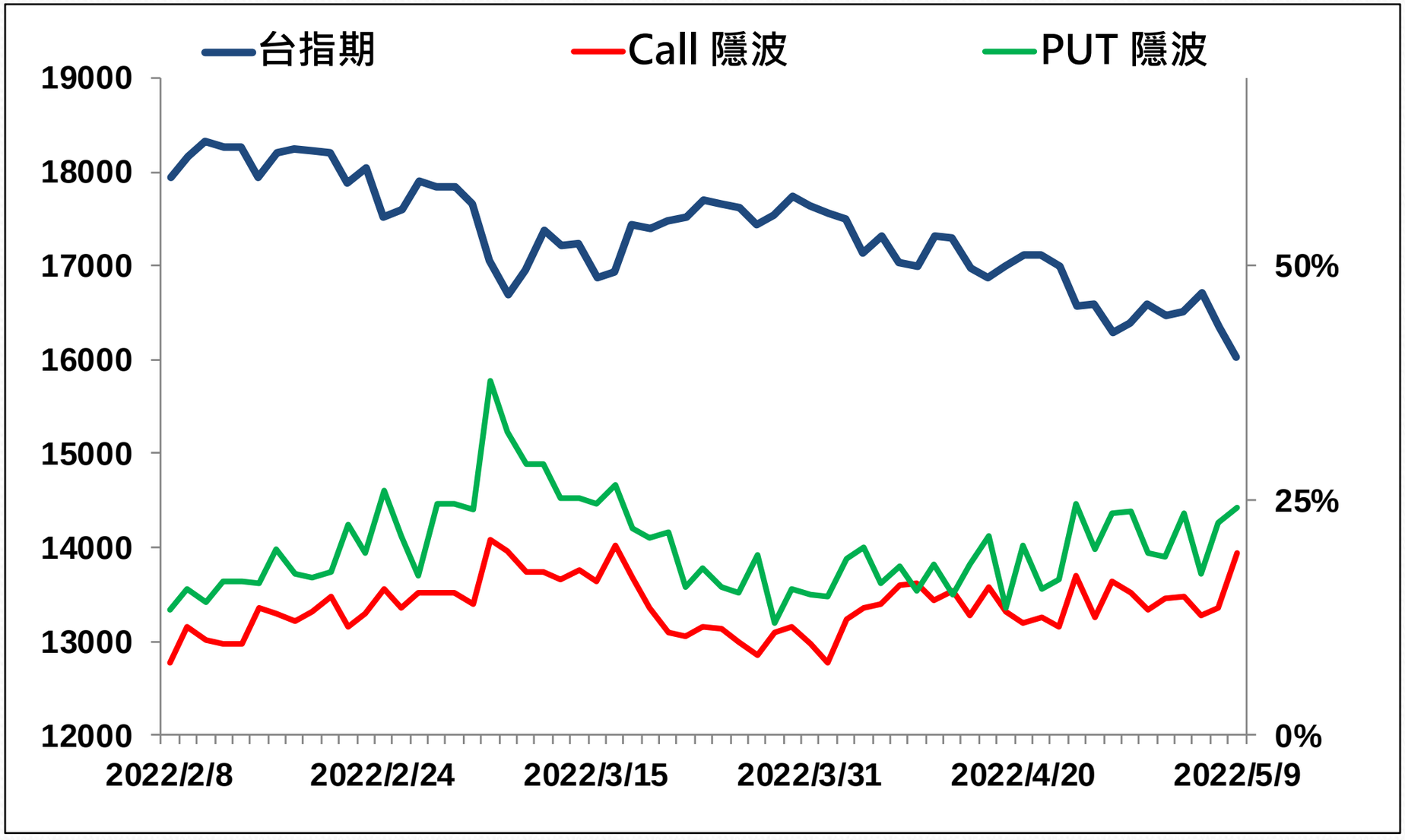
更新日期：2022年5月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



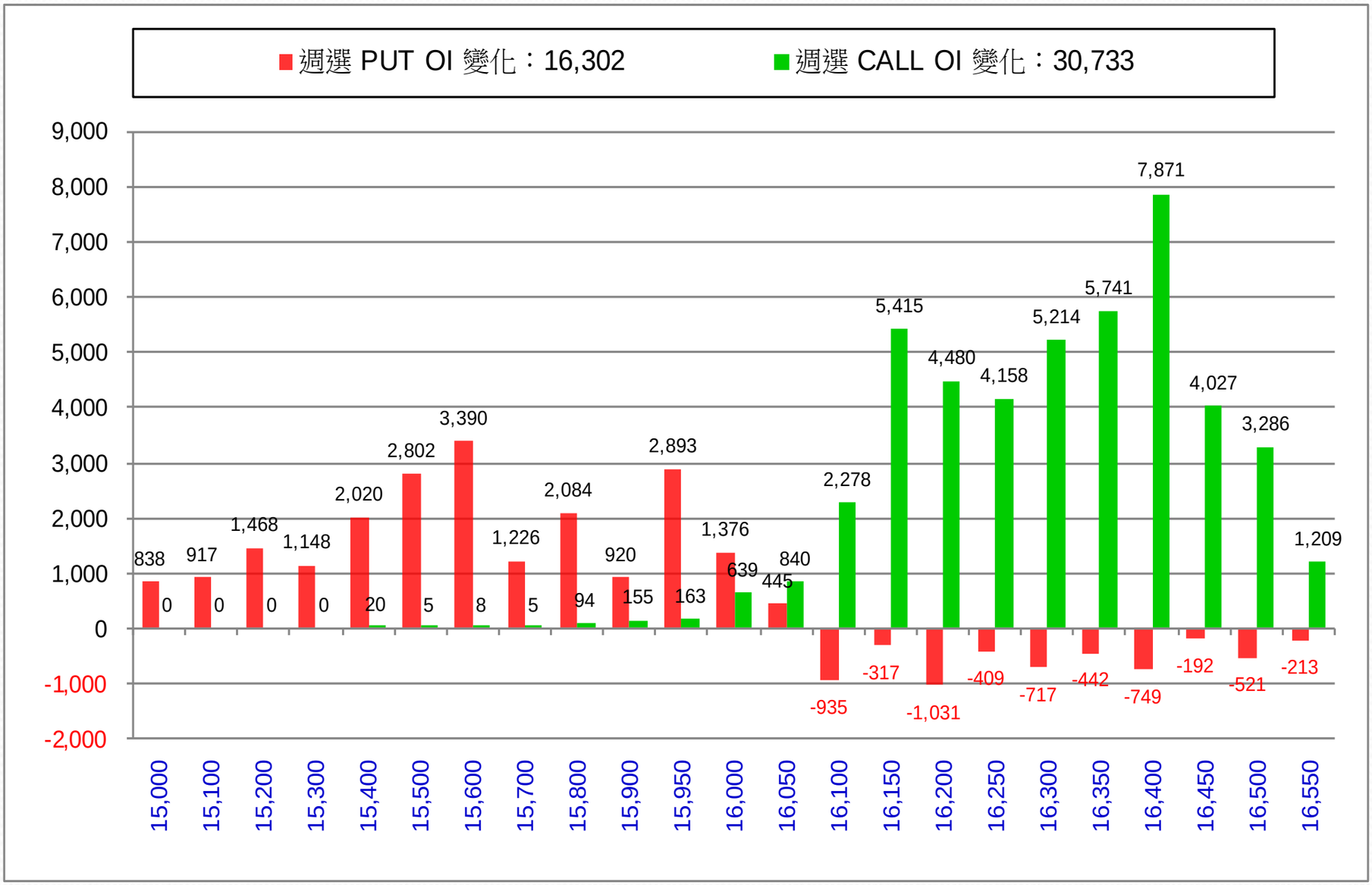
更新日期：2022年5月9日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



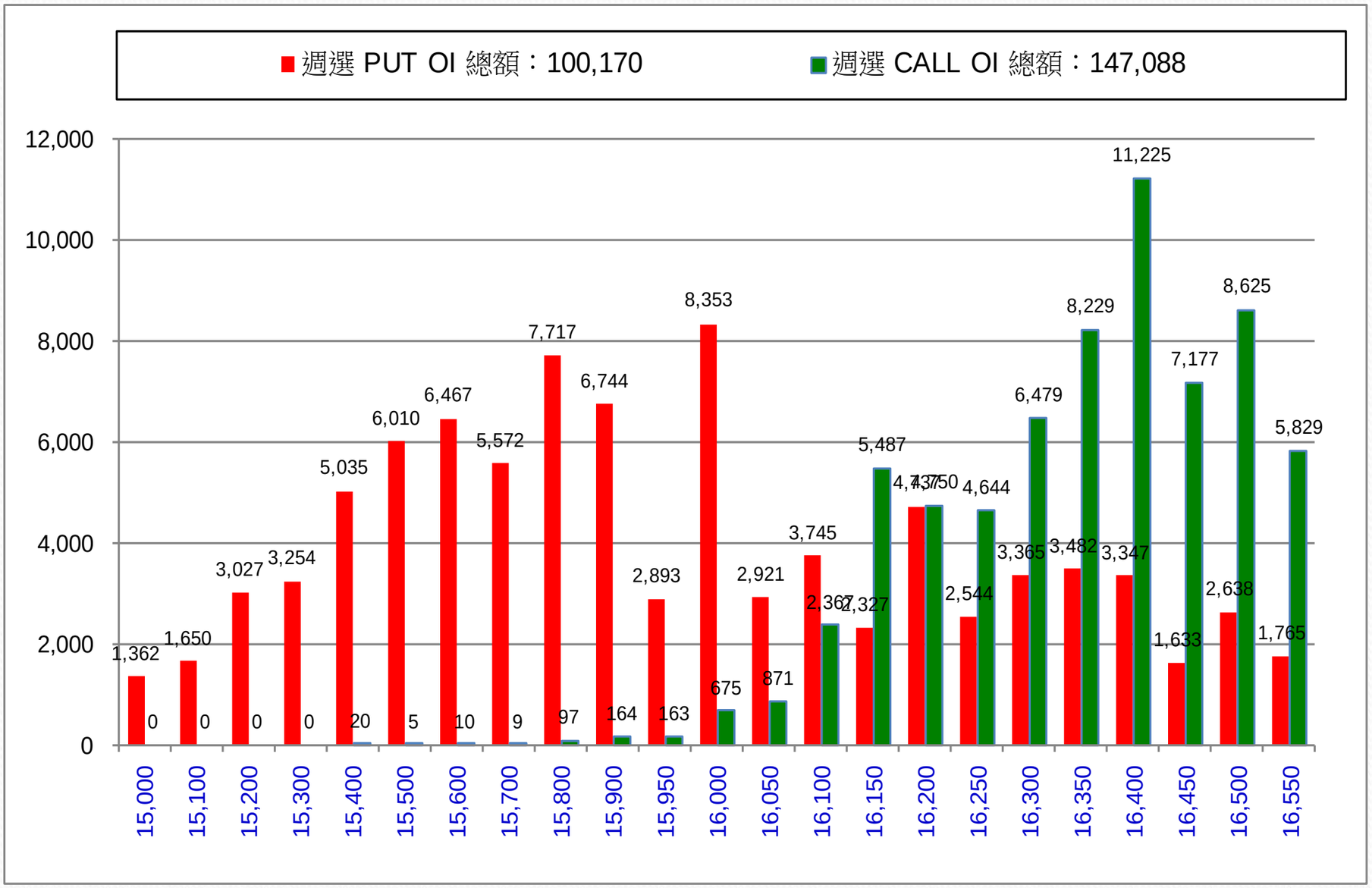
更新日期：2022年5月9日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年5月9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



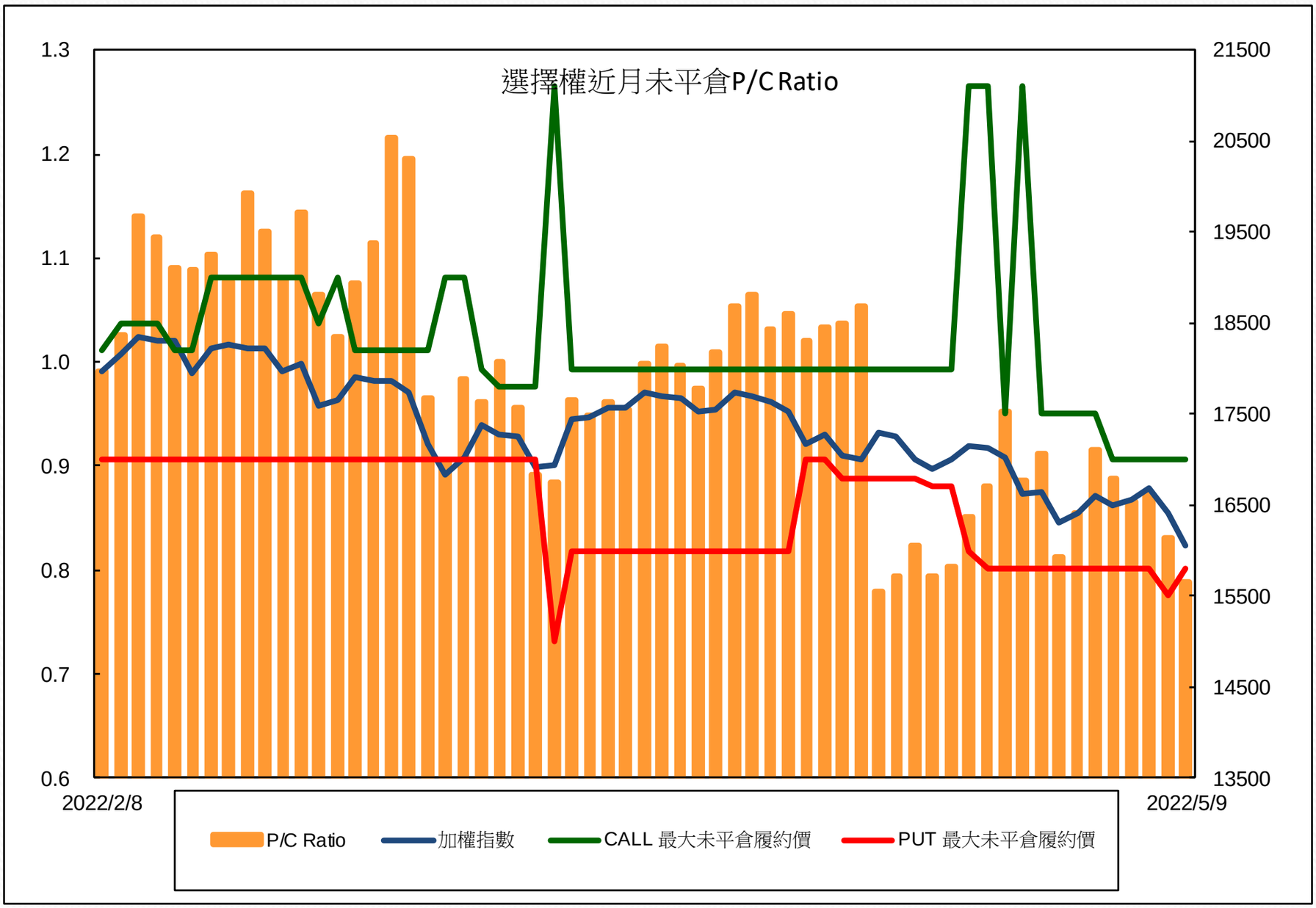
更新日期：2022年5月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	5月6日	76,340	66,534	9,806
	5月9日	80,739	82,132	-1,393
Put	5月6日	47,333	48,986	-1,653
	5月9日	53,968	54,064	-96

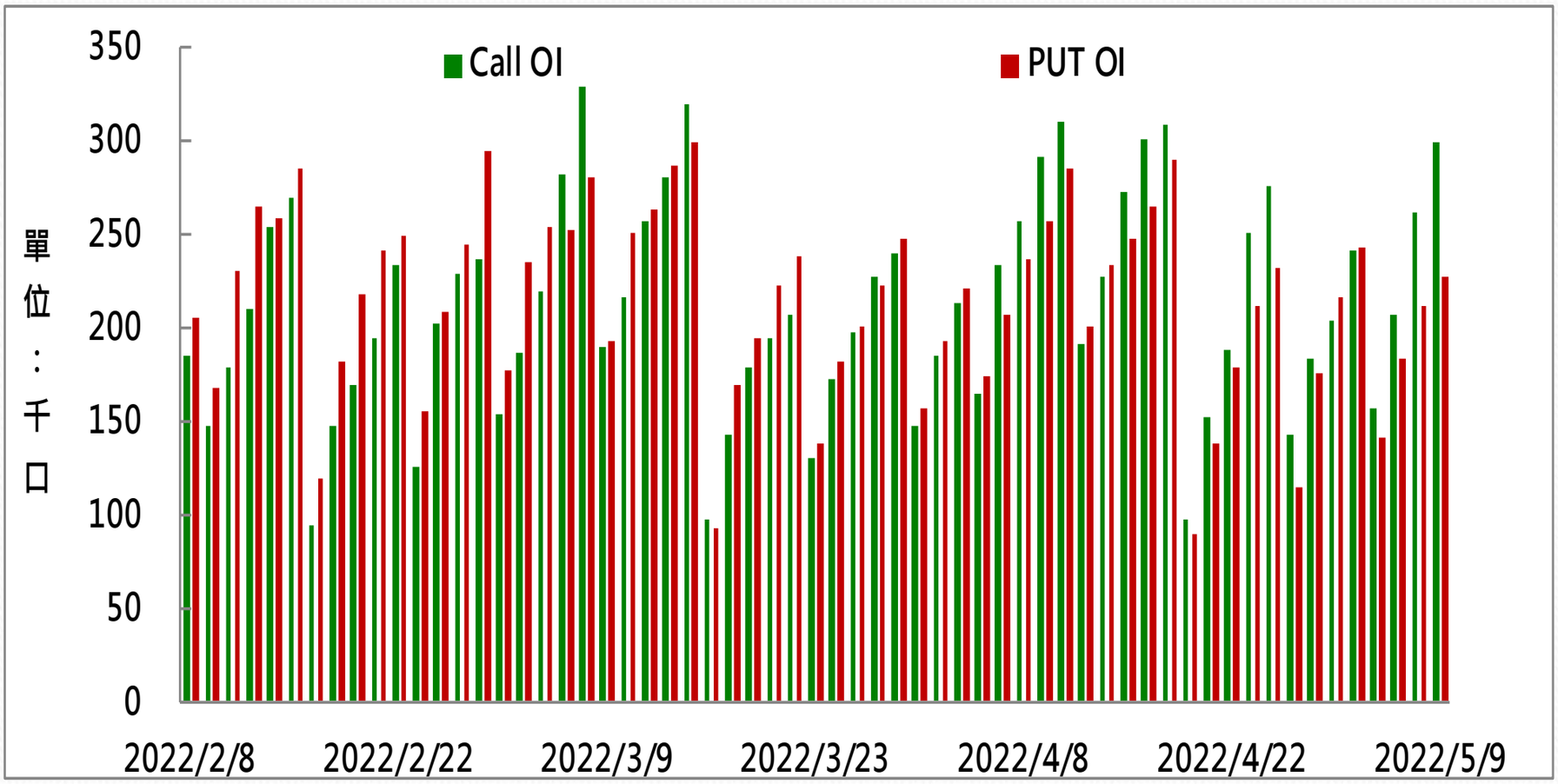
更新日期：2022年5月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年5月9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5月9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：109年金管期總字第011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5月9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