台指選擇權OI匯報

日期：2022/5/11			結算日：2022/5/18			日期：2022/5/11			結算日：2022/6/15		
202205 月台指選擇權 OI 序列						202206 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	86	15,200	5,499	1,646	※	0	6	14,800	1,337	123	
7	13	15,300	4,642	1,200		0	0	14,900	432	33	
4	20	15,400	5,201	1,585		0	3	15,000	2,166	266	※
10	43	15,500	9,028	1,643		0	0	15,100	275	14	
-7	87	15,600	5,338	1,036		0	1	15,200	781	47	
1	1	15,650	917	917		0	0	15,300	323	55	
64	263	15,700	4,320	662		1	3	15,400	1,526	8	
33	33	15,750	557	557		4	15	15,500	864	59	
-7	811	15,800	7,001	797		2	12	15,600	1,663	77	
55	55	15,850	344	344		10	36	15,700	425	58	
328	926	15,900	6,444	1,088		22	87	15,800	751	45	
594	594	15,950	333	333		17	82	15,900	939	71	
※ 3,439	5,575	16,000	7,548	940		93	516	16,000	1,549	96	
753	753	16,050	320	320		61	320	16,100	734	42	
613	2,955	16,100	2,777	-248		83	157	16,200	953	31	
491	491	16,150	79	79		103	367	16,300	368	-1	
1,825	4,160	16,200	4,769	-160		36	432	16,400	499	18	
761	761	16,250	63	63		92	949	16,500	299	-3	
1,525	5,759	16,300	2,891	-99		135	731	16,600	280	0	
1,324	1,324	16,350	7	7		※ 463	928	16,700	72	-16	
2,498	6,842	16,400	3,468	7		68	990	16,800	481	-39	
978	978	16,450	6	6		114	1,127	16,900	83	0	
2,905	9,938	16,500	2,713	-10		125	1,931	17,000	296	-1	
3,175	9,143	16,600	2,458	-2		28	986	17,100	107	0	
1,149	6,386	16,700	2,495	-10		-30	1,008	17,200	360	0	
363	7,103	16,800	2,160	-6		-36	904	17,300	63	0	
199	6,412	16,900	1,604	2		-17	896	17,400	242	0	
550	10,520	17,000	2,107	-19		-15	677	17,500	57	-1	
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	
24,148	148,858	0.7874	117,209	22,162		1,548	27,683	1.1313	31,319	1,521	
昨日 P/C	0.7621	今日增減變化		0.0252		昨日 P/C	1.0632	今日增減變化		0.0682	

中華開發金控 CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL

凱基期貨 KGI FUTURES

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11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	92,391,879	121,480,604	-29,088,725	12,035,969	3,022,186	3,455,161	-432,975	-595,006
投信	36,646,426	68,024,830	-31,378,404	-913,972	400,602	0	400,602	55
自營商	70,157,931	19,431,980	50,725,951	-239,811	1,322,362	1,881,594	-559,232	158,794
	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	1,054,739	1,592,916	-538,177	125,570	232,319	99,565	132,754	19,856
投信	23,551	0	23,551	-215	1,580	0	1,580	-10
自營商	316,017	950,417	-634,400	-91,051	91,588	188,068	-96,480	2,152

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11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	19,657	13,804	5,853	-5,236	47,734	14,151	33,583	-1,555
投信	0	0	0	0	800	85	715	50
自營商	56,152	62,047	-5,895	4,701	42,270	38,072	4,198	-10,925
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	10,587	9,713	874	-3,546	5,701	22,148	-16,447	-705
特定法人 (全月)	13,190	6,742	6,448	-9,239	6,300	38,583	-32,283	1,916
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	44,429	54,655	-10,226	-3,572	32,577	57,161	-24,584	-354
十大交易人(全月)	70,441	65,802	4,639	10,753	47,304	82,607	-35,303	5,989
全市場未沖銷 (近月)			148,858	24,148			117,209	22,162
全市場未沖銷 (全月)			188,111	-128,525			156,458	-100,409

更新日期：2022年5月11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	16500	買權OI最大量	17000
	賣權成交最大量	15700	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	20.39%	較前一交易日	+2.17%
	買權隱含波動率	17.95%	較前一交易日	+0.95%
	賣權隱含波動率	23.39%	較前一交易日	+4.00%
電子選擇權	買權成交最大量	435	買權OI最大量	435
	賣權成交最大量	660	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1780	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1700

更新日期：2022年5月11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 06 月 選擇權分析表				
台指選擇權	買權成交最大量	17000	買權OI最大量	17000
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	13000
	整體隱含波動率	22.13%	較前一交易日	-0.45%
	買權隱含波動率	16.60%	較前一交易日	-1.99%
	賣權隱含波動率	27.55%	較前一交易日	+2.67%
	成交量P/C_Ratio值	0.940	較前一交易日	-0.01
	未平倉P/C_Ratio值	1.039	較前一交易日	+0.28
電子選擇權	買權成交最大量	505	買權OI最大量	505
	賣權成交最大量	660	賣權OI最大量	690
金融選擇權	買權成交最大量	1780	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1700

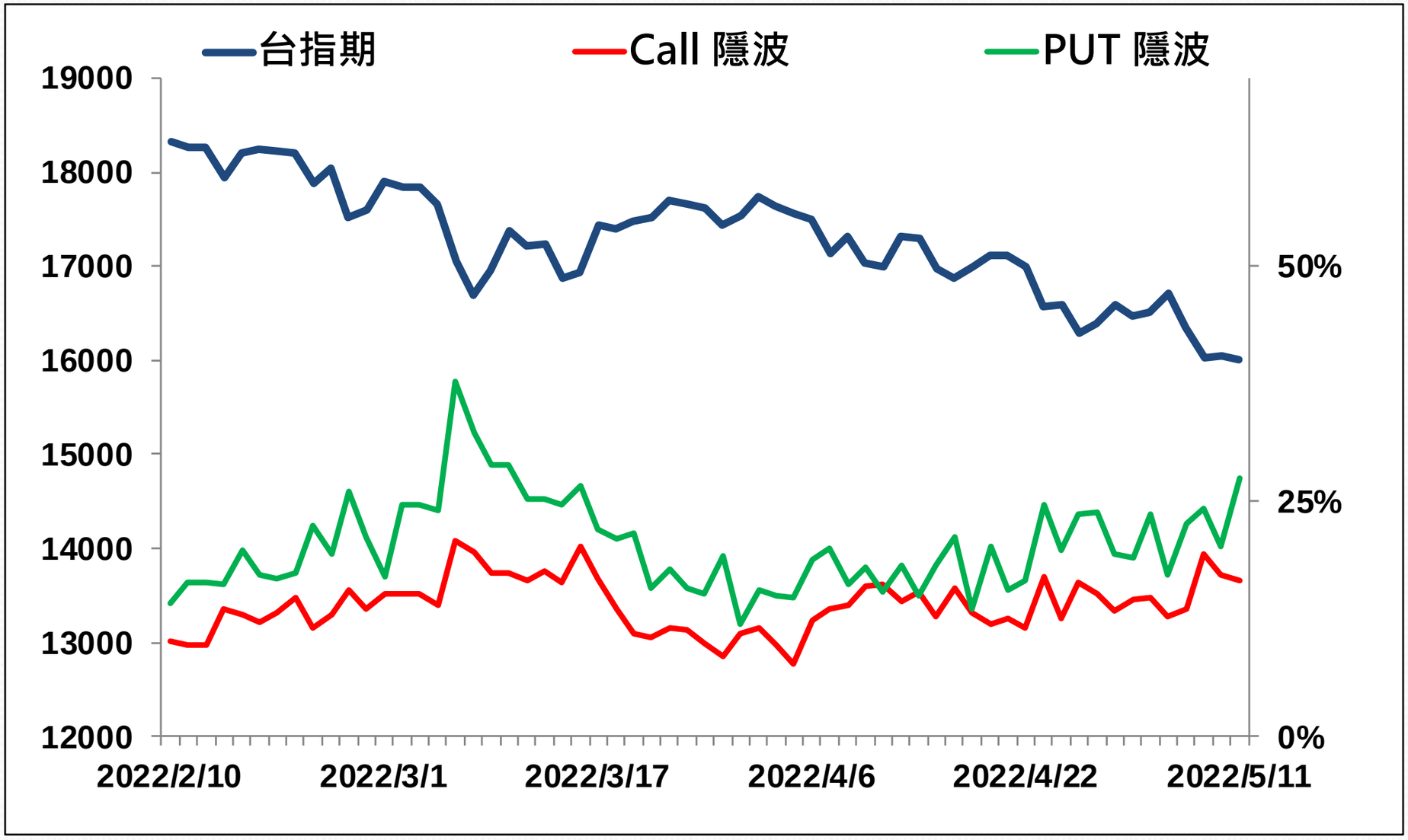
更新日期：2022年5月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



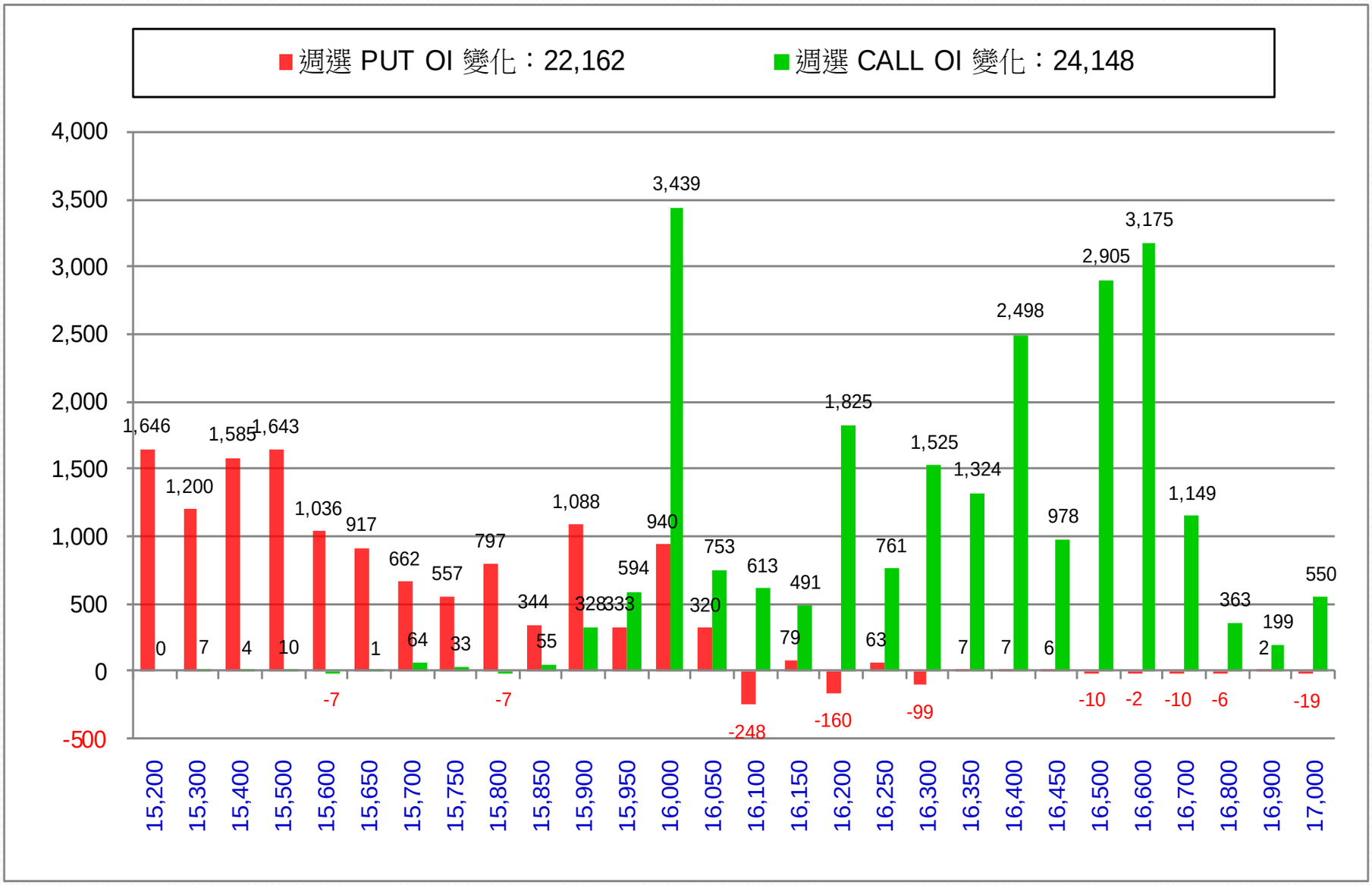
更新日期：2022年5月11日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



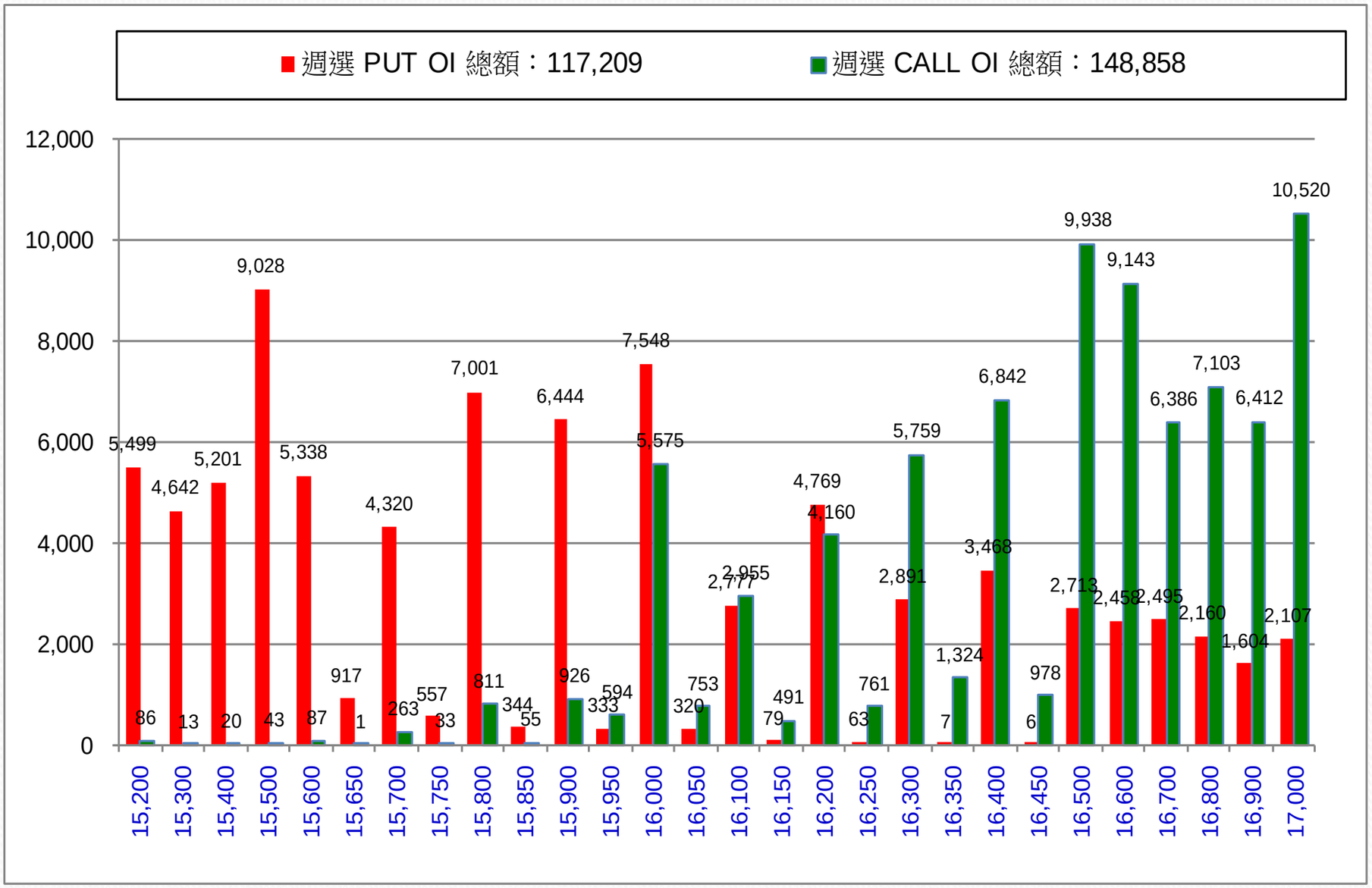
更新日期：2022年5月11日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年5月11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



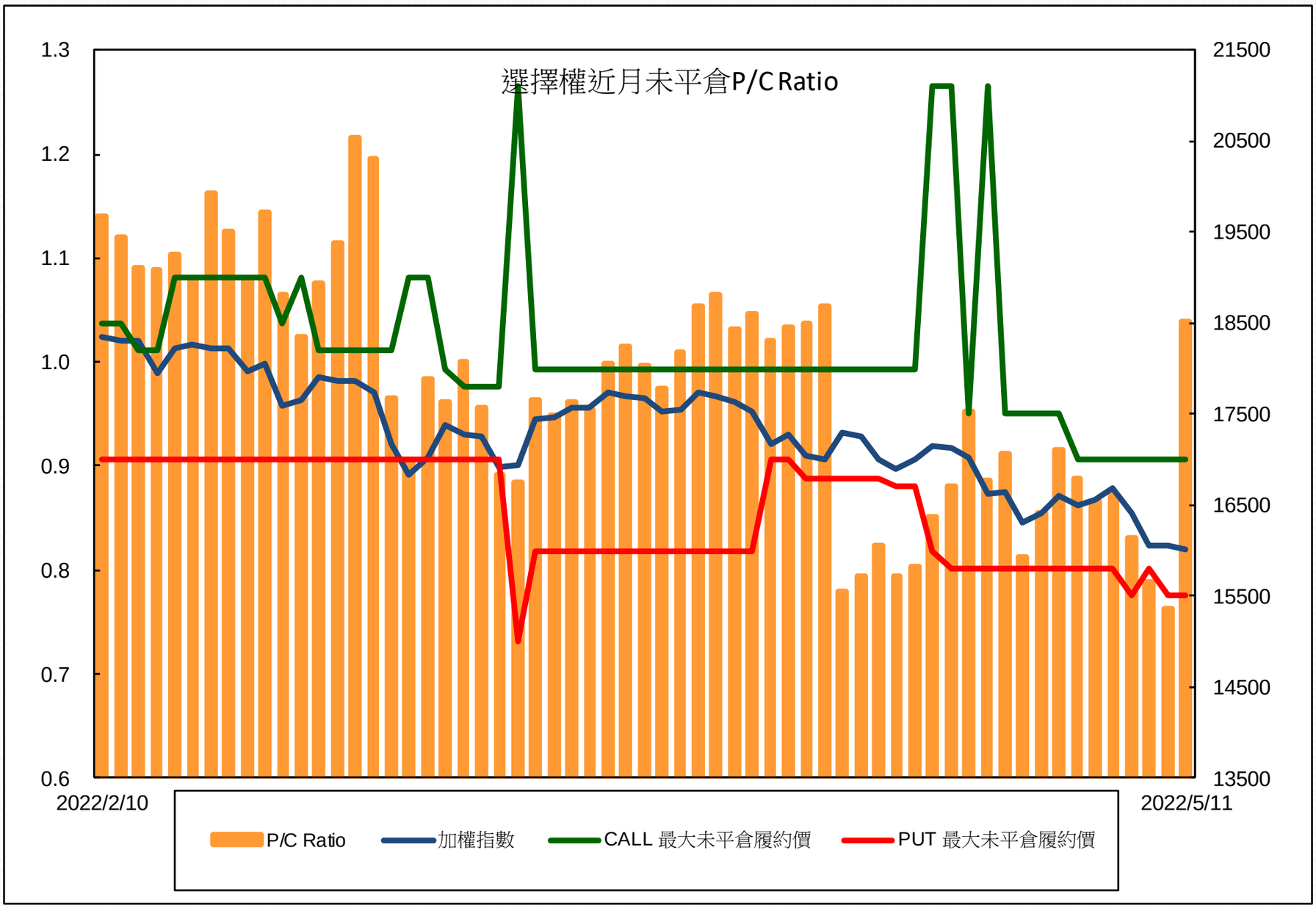
更新日期：2022年5月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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10日	79,946	90,542	-10,596
	5月11日	56,152	62,047	-5,895
Put	5月10日	67,194	52,071	15,123
	5月11日	42,270	38,072	4,198

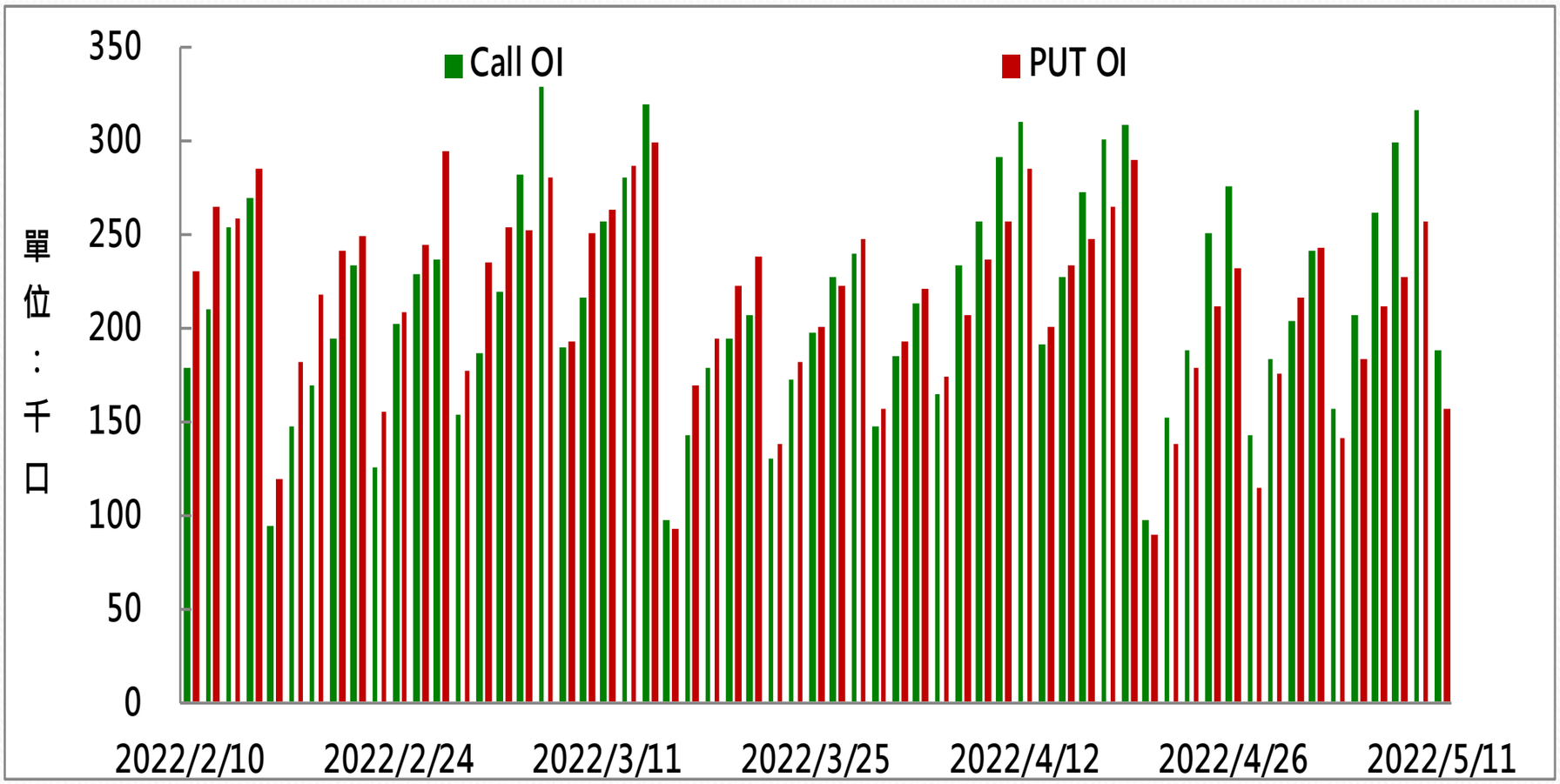
更新日期：2022年5月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年5月11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11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11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