台指選擇權OI匯報

日期：2022/5/12			結算日：2022/5/18		
202205 月台指選擇權 OI 序列					
OI 增減	Call	履約價	Put	OI 增減	
40	53	15,300	8,619	3,977	※
63	83	15,400	7,882	2,681	
546	589	15,500	11,537	2,509	
213	213	15,550	1,501	1,501	
680	767	15,600	7,206	1,868	
579	580	15,650	2,205	1,288	
1,242	1,505	15,700	5,404	1,084	
735	768	15,750	1,377	820	
2,052	2,863	15,800	6,943	-58	
1,329	1,384	15,850	1,408	1,064	
2,829	3,755	15,900	6,952	508	
2,164	2,758	15,950	1,017	684	
5,263	10,838	16,000	6,724	-824	
3,294	4,047	16,050	575	255	
4,044	6,999	16,100	2,842	65	
3,244	3,735	16,150	117	38	
※ 6,106	10,266	16,200	4,731	-38	
2,916	3,677	16,250	86	23	
3,644	9,403	16,300	2,675	-216	
3,930	5,254	16,350	32	25	
5,034	11,876	16,400	3,178	-290	
3,498	4,476	16,450	15	9	
3,784	13,722	16,500	2,584	-129	
1,608	10,751	16,600	2,434	-24	
14	6,400	16,700	2,453	-42	
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計	
57,057	198,485	0.7869	156,192	38,983	
昨日 P/C	0.7874	今日增減變化		-0.0005	

日期：2022/5/12			結算日：2022/6/15		
202206 月台指選擇權 OI 序列					
OI 增減	Call	履約價	Put	OI 增減	
4	5	15,200	1,024	243	
0	0	15,300	587	264	
3	6	15,400	1,753	227	
187	202	15,500	1,057	193	
406	418	15,600	1,827	164	
235	271	15,700	537	112	
150	237	15,800	844	93	
56	138	15,900	972	33	
322	838	16,000	1,676	127	
314	634	16,100	771	37	
387	544	16,200	969	16	
367	734	16,300	355	-13	
216	648	16,400	484	-15	
※ 562	1,511	16,500	290	-9	
315	1,046	16,600	280	0	
401	1,329	16,700	67	-5	
335	1,325	16,800	481	0	
-23	1,104	16,900	82	-1	
-66	1,865	17,000	297	1	
-178	808	17,100	107	0	
-66	942	17,200	357	-3	
-20	884	17,300	63	0	
21	917	17,400	242	0	
-3	674	17,500	57	0	
2	732	17,600	650	-1	
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計	
4,122	31,173	1.1722	36,542	5,223	
昨日 P/C	1.0388	今日增減變化		0.1334	

更新日期：2022年5月12日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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12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	101,133,922	121,595,937	-20,462,015	8,626,710	2,702,501	3,355,575	-653,074	-220,099
投信	35,011,200	69,576,658	-34,565,458	-3,187,054	392,741	0	392,741	-7,861
自營商	69,205,281	21,809,882	47,395,399	-3,330,552	1,394,386	1,872,742	-478,356	80,876
	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	1,054,685	1,731,120	-676,435	-138,258	226,071	101,501	124,570	-8,184
投信	22,716	0	22,716	-835	1,538	0	1,538	-42
自營商	280,503	958,913	-678,410	-44,010	87,601	141,487	-53,886	42,594

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12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	23,399	15,257	8,142	2,289	50,675	17,332	33,343	-240
投信	0	0	0	0	950	85	865	150
自營商	67,430	72,309	-4,879	1,016	42,608	45,639	-3,031	-7,229
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	10,875	6,742	4,133	3,259	5,329	20,482	-15,153	1,294
特定法人 (全月)	13,610	0	13,610	7,162	8,436	39,638	-31,202	1,081
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	53,459	63,153	-9,694	532	41,934	59,557	-17,623	6,961
十大交易人(全月)	81,593	76,385	5,208	569	57,942	86,493	-28,551	6,752
全市場未沖銷 (近月)			205,919	57,061			156,192	38,983
全市場未沖銷 (全月)			250,555	62,444			201,238	44,780

更新日期：2022年5月12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	16200	買權OI最大量	16500
	賣權成交最大量	15500	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	21.83%	較前一交易日	#DIV/0!
	買權隱含波動率	20.14%	較前一交易日	#DIV/0!
	賣權隱含波動率	23.82%	較前一交易日	#DIV/0!
電子選擇權	買權成交最大量	780	買權OI最大量	800
	賣權成交最大量	720	賣權OI最大量	740
金融選擇權	買權成交最大量	1700	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1560	賣權OI最大量	1700

更新日期：2022年5月12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	22.21%	較前一交易日	-1.07%
	買權隱含波動率	18.27%	較前一交易日	+1.66%
	賣權隱含波動率	27.25%	較前一交易日	-0.26%
	成交量P/C_Ratio值	0.830	較前一交易日	-0.11
	未平倉P/C_Ratio值	1.049	較前一交易日	+0.01
電子選擇權	買權成交最大量	780	買權OI最大量	800
	賣權成交最大量	720	賣權OI最大量	740
金融選擇權	買權成交最大量	1700	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1560	賣權OI最大量	1700

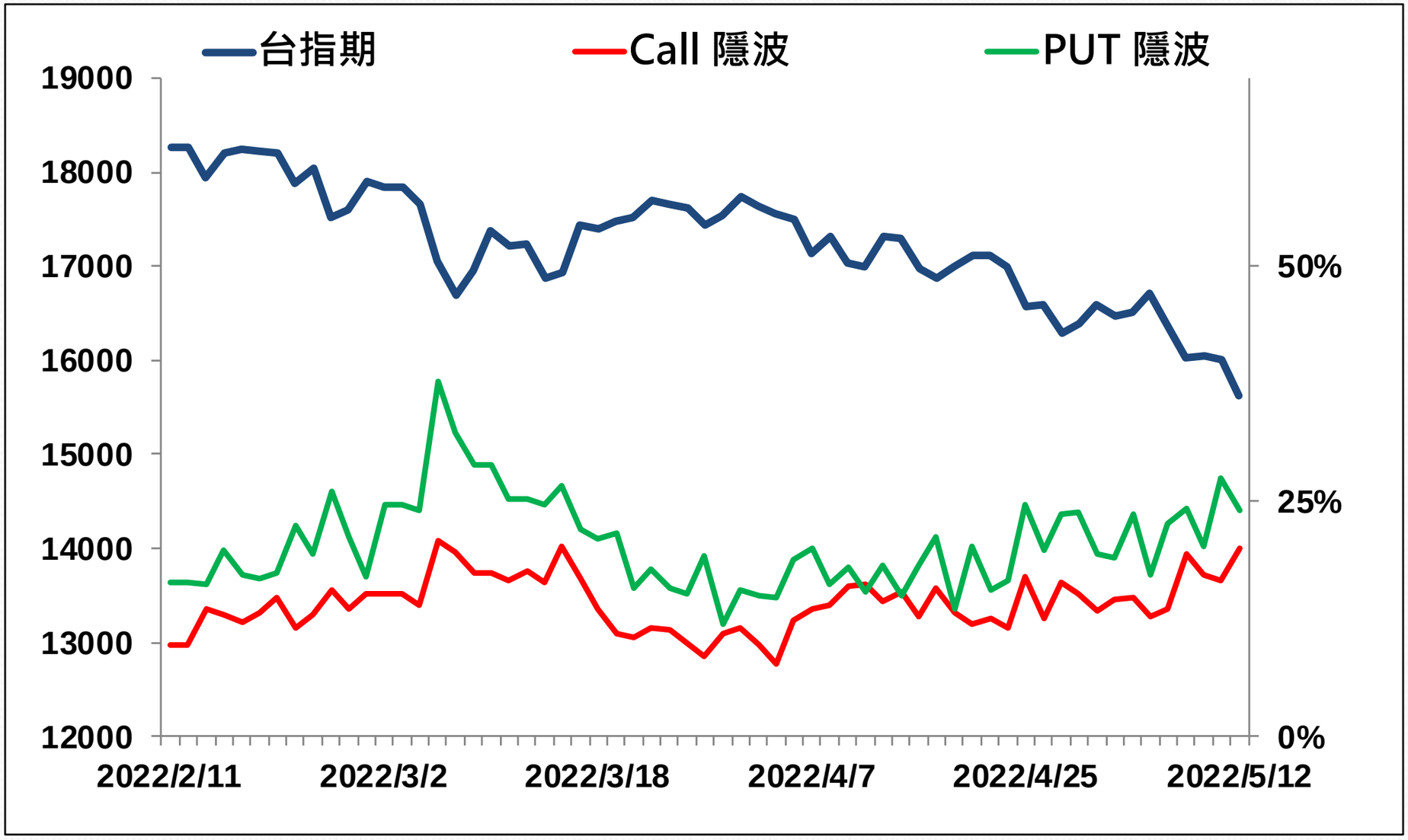
更新日期：2022年5月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



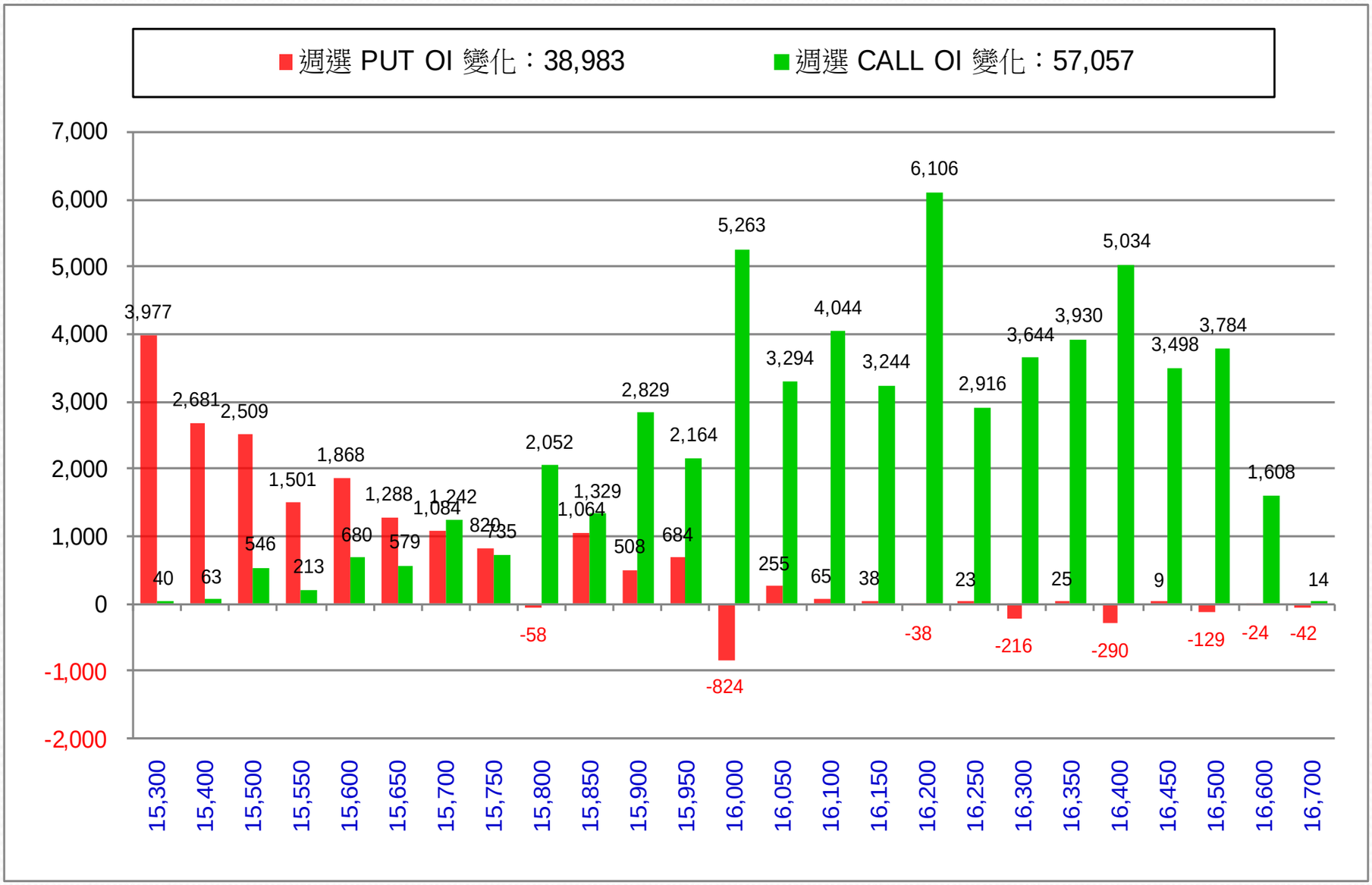
更新日期：2022年5月12日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



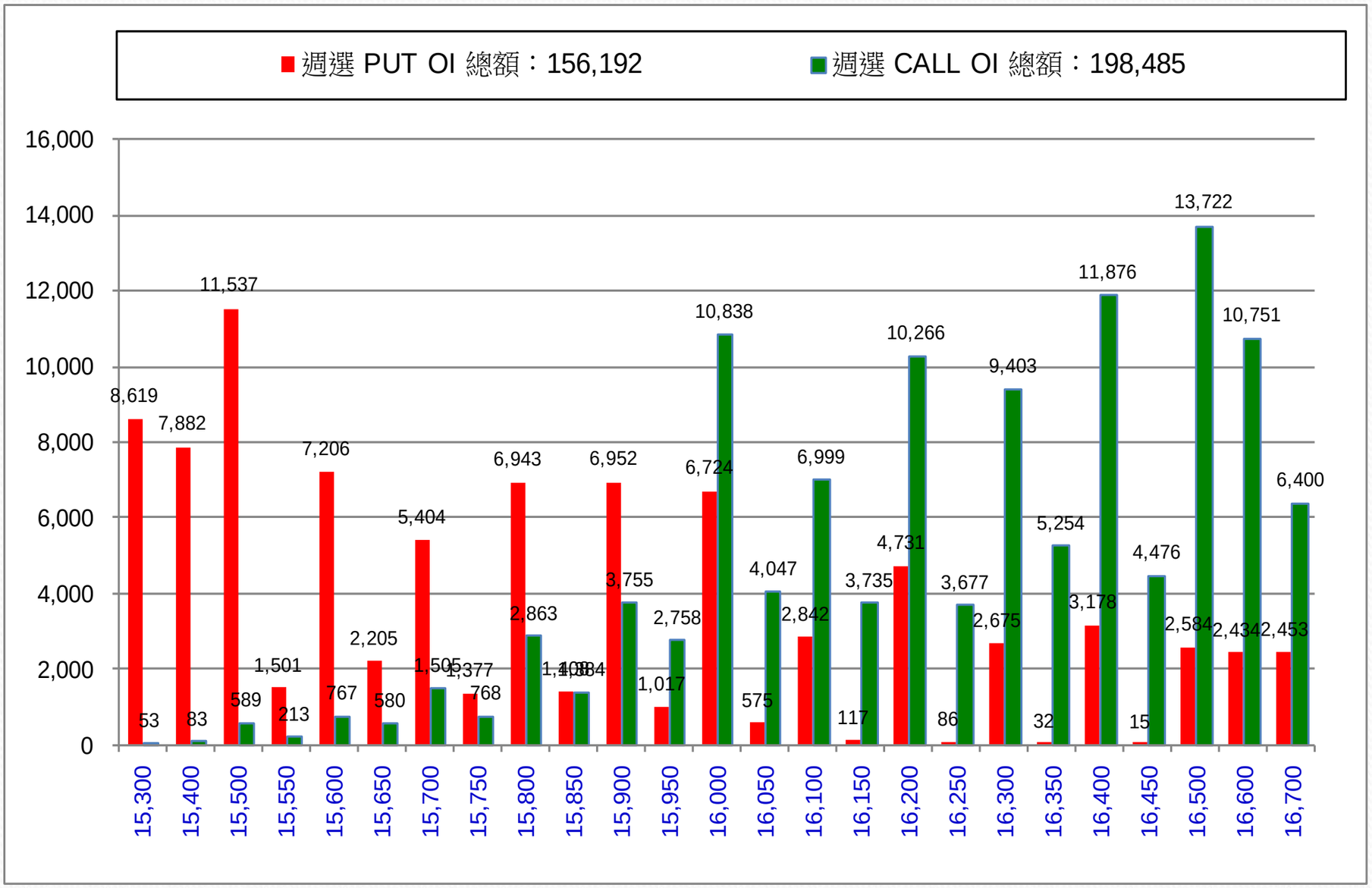
更新日期：2022年5月12日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年5月12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



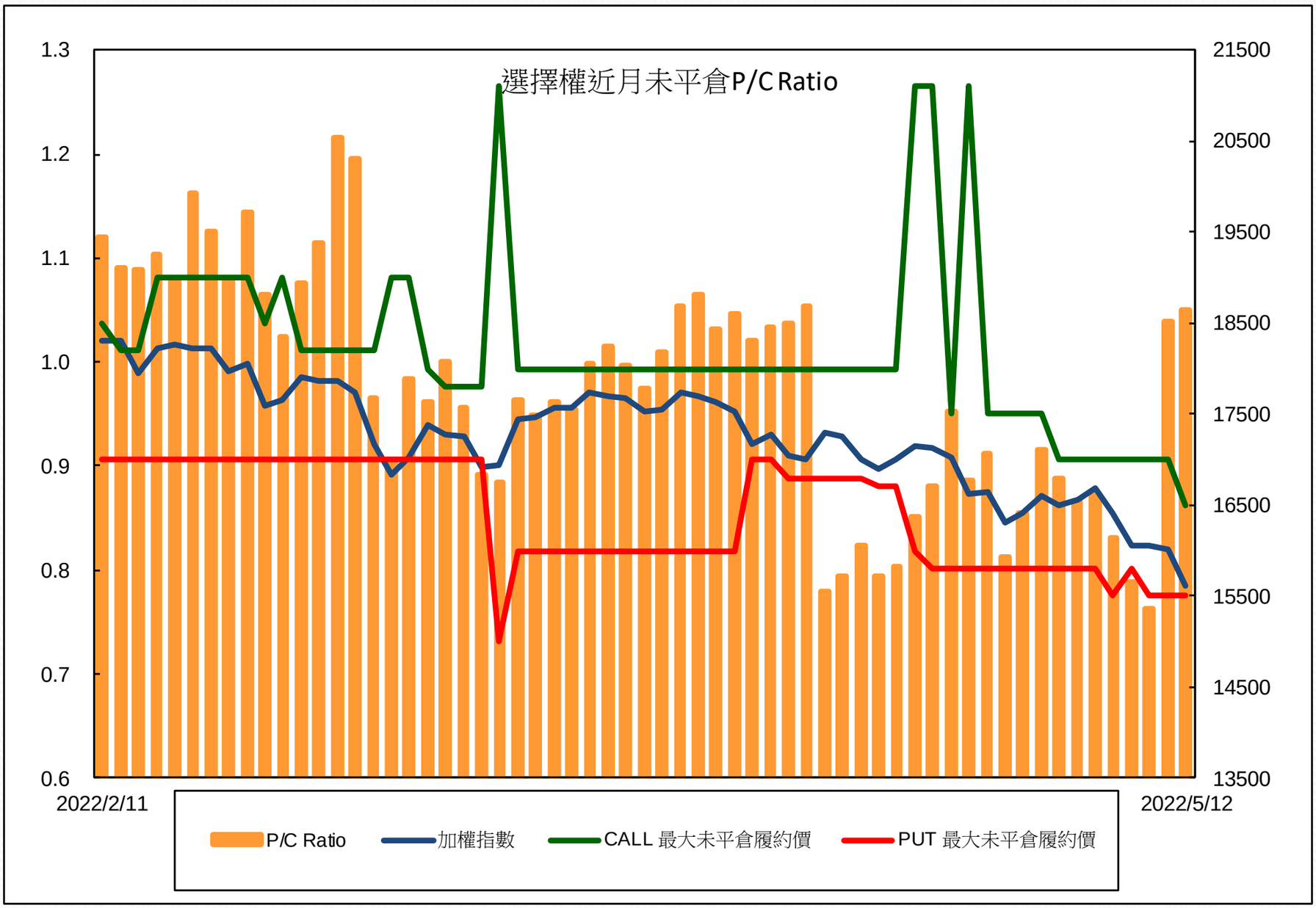
更新日期：2022年5月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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11日	56,152	62,047	-5,895
	5月12日	67,430	72,309	-4,879
Put	5月11日	42,270	38,072	4,198
	5月12日	42,608	45,639	-3,031

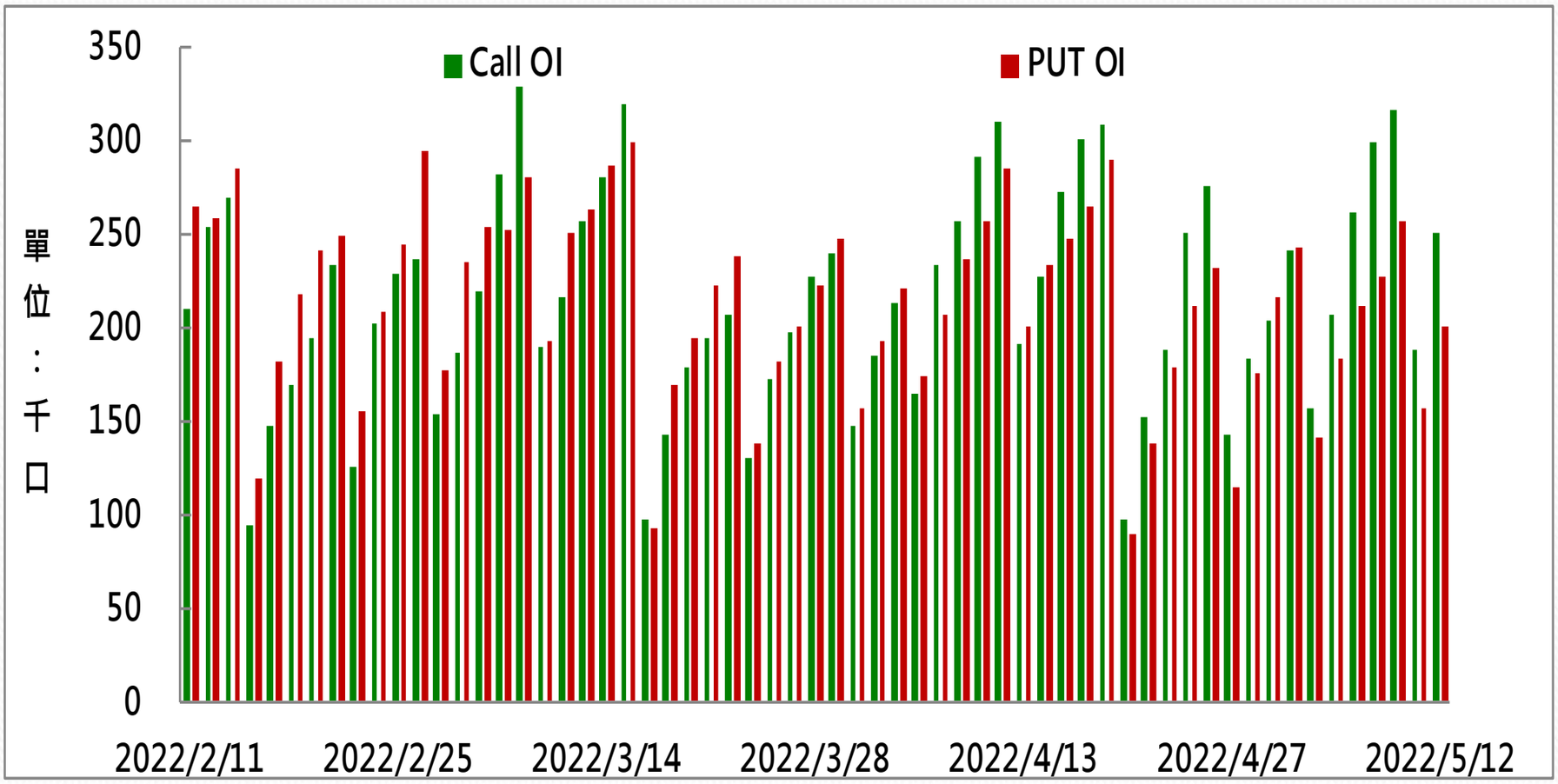
更新日期：2022年5月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年5月12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12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12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