台指選擇權OI匯報

日期：2022/5/13			結算日：2022/5/18			日期：2022/5/13			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	
3	28	15,000	13,783	4,390	※	0	0	14,200	1,404	491	
14	19	15,100	9,028	1,691		0	0	14,300	612	-71	
3	3	15,150	965	965		0	0	14,400	793	82	
1	117	15,200	10,933	2,481		3	5	14,500	1,621	279	
1	1	15,250	1,711	1,711		0	0	14,600	2,173	118	
31	84	15,300	11,162	2,543		0	0	14,700	568	223	
2	2	15,350	1,413	1,413		0	6	14,800	1,845	49	
147	230	15,400	10,385	2,503		0	0	14,900	620	163	
3	3	15,450	1,514	1,514		12	23	15,000	3,347	916	※
220	809	15,500	13,460	1,923		9	10	15,100	848	129	
133	346	15,550	4,727	3,226		3	8	15,200	1,134	110	
721	1,488	15,600	8,222	1,016		2	2	15,300	661	74	
381	961	15,650	3,425	1,220		30	36	15,400	1,511	-242	
672	2,177	15,700	6,835	1,431		15	217	15,500	1,191	134	
706	1,474	15,750	2,304	927		29	447	15,600	1,936	109	
1,358	4,221	15,800	6,495	-448		95	366	15,700	631	94	
840	2,224	15,850	1,983	575		600	837	15,800	1,027	183	
1,154	4,909	15,900	6,270	-682		244	382	15,900	945	-27	
1,111	3,869	15,950	944	-73		26	864	16,000	1,617	-59	
1,661	12,499	16,000	6,136	-588		122	756	16,100	757	-14	
1,761	5,808	16,050	559	-16		204	748	16,200	978	9	
1,452	8,451	16,100	2,573	-269		442	1,176	16,300	347	-8	
2,192	5,927	16,150	192	75		※ 804	1,452	16,400	482	-2	
587	10,853	16,200	4,685	-46		642	2,153	16,500	286	-4	
※ 3,019	6,696	16,250	76	-10		779	1,825	16,600	288	8	
1,154	10,557	16,300	2,595	-80		287	1,616	16,700	67	0	
318	5,572	16,350	32	0		55	1,380	16,800	481	0	
-2,040	9,836	16,400	3,144	-34		26	1,130	16,900	81	-1	
-614	3,862	16,450	15	0		179	2,044	17,000	292	-5	
-161	13,561	16,500	2,549	-35		-63	745	17,100	107	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	
13,550	219,469	0.8636	189,533	33,341		5,748	37,325	1.0760	40,161	3,619	
昨日 P/C	0.7585	今日增減變化		0.1051		昨日 P/C	1.0493	今日增減變化		0.0267	

更新日期：2022年5月13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13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	107,998,881	125,194,837	-17,195,956	3,266,059	2,482,033	3,435,258	-953,225	-300,151
投信	36,167,418	68,880,914	-32,713,496	1,851,962	398,670	0	398,670	5,929
自營商	70,616,316	25,123,971	45,492,345	-1,903,054	1,333,366	1,927,244	-593,878	-115,522
	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	1,026,388	1,693,584	-667,196	9,239	231,206	153,096	78,110	-46,460
投信	22,845	0	22,845	129	1,562	0	1,562	24
自營商	198,881	686,932	-488,051	190,359	92,110	101,543	-9,433	44,453

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13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	27,269	16,165	11,104	2,962	53,733	17,882	35,851	2,508
投信	0	0	0	0	1,050	85	965	100
自營商	72,443	75,013	-2,570	2,309	50,710	56,263	-5,553	-2,522
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	13,218	3,276	9,942	5,809	2,899	21,177	-18,278	-3,125
特定法人 (全月)	16,654	0	16,654	3,044	6,890	40,409	-33,519	-2,317
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	57,816	62,793	-4,977	4,717	53,505	66,920	-13,415	4,208
十大交易人(全月)	88,959	76,736	12,223	7,015	69,454	94,983	-25,529	3,022
全市場未沖銷 (近月)			219,469	13,550			189,533	33,341
全市場未沖銷 (全月)			270,300	19,745			238,244	37,006

更新日期：2022年5月13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	16000	買權OI最大量	16500
	賣權成交最大量	15500	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	18.76%	較前一交易日	-3.07%
	買權隱含波動率	17.21%	較前一交易日	-2.94%
	賣權隱含波動率	20.02%	較前一交易日	-3.80%
電子選擇權	買權成交最大量	780	買權OI最大量	780
	賣權成交最大量	660	賣權OI最大量	740
金融選擇權	買權成交最大量	1740	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1540

更新日期：2022年5月13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	16400	買權OI最大量	16500
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	13000
	整體隱含波動率	20.80%	較前一交易日	+1.41%
	買權隱含波動率	16.49%	較前一交易日	-1.78%
	賣權隱含波動率	25.44%	較前一交易日	-1.81%
	成交量P/C_Ratio值	0.887	較前一交易日	+0.06
	未平倉P/C_Ratio值	0.990	較前一交易日	-0.06
電子選擇權	買權成交最大量	780	買權OI最大量	780
	賣權成交最大量	660	賣權OI最大量	740
金融選擇權	買權成交最大量	1740	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1540

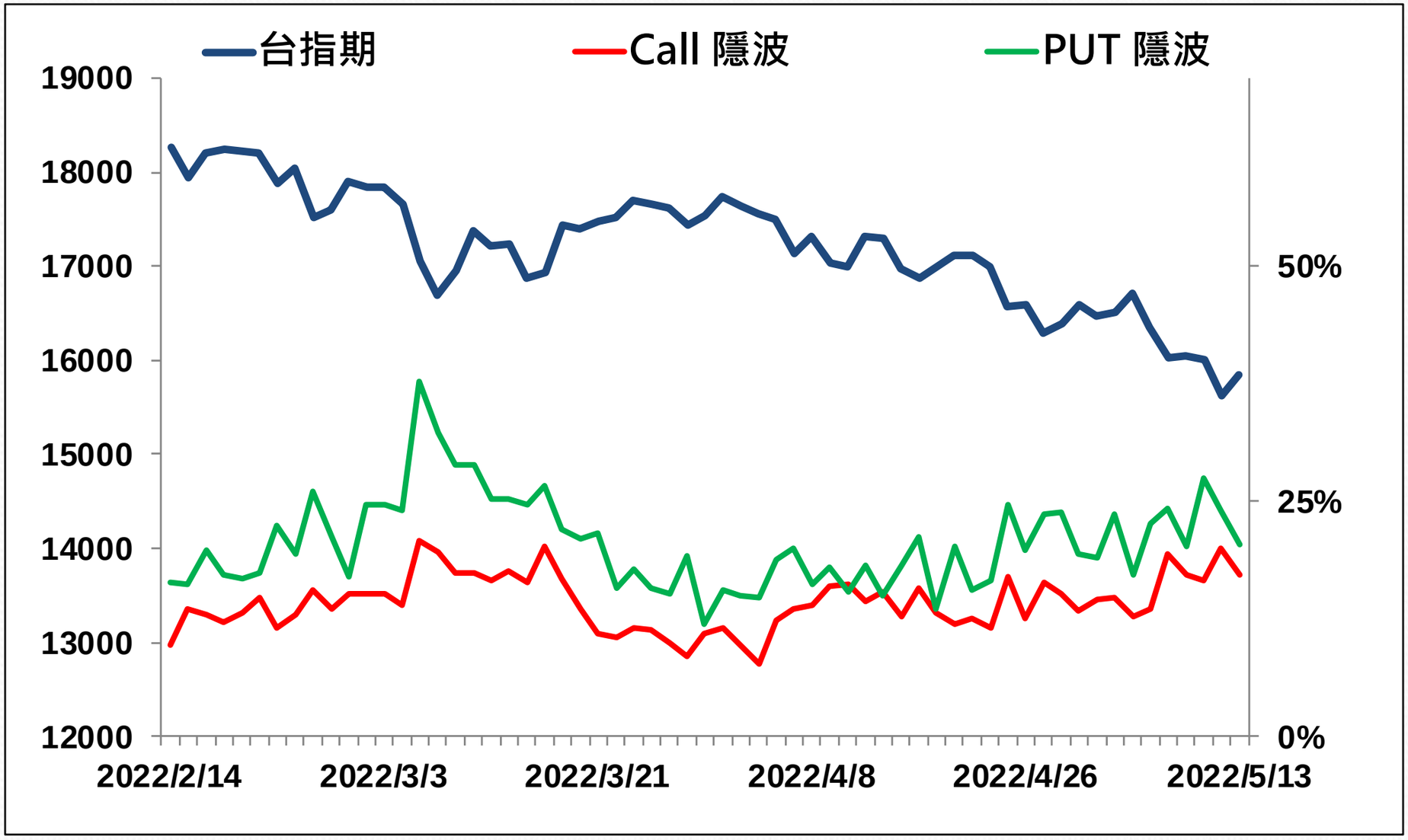
更新日期：2022年5月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



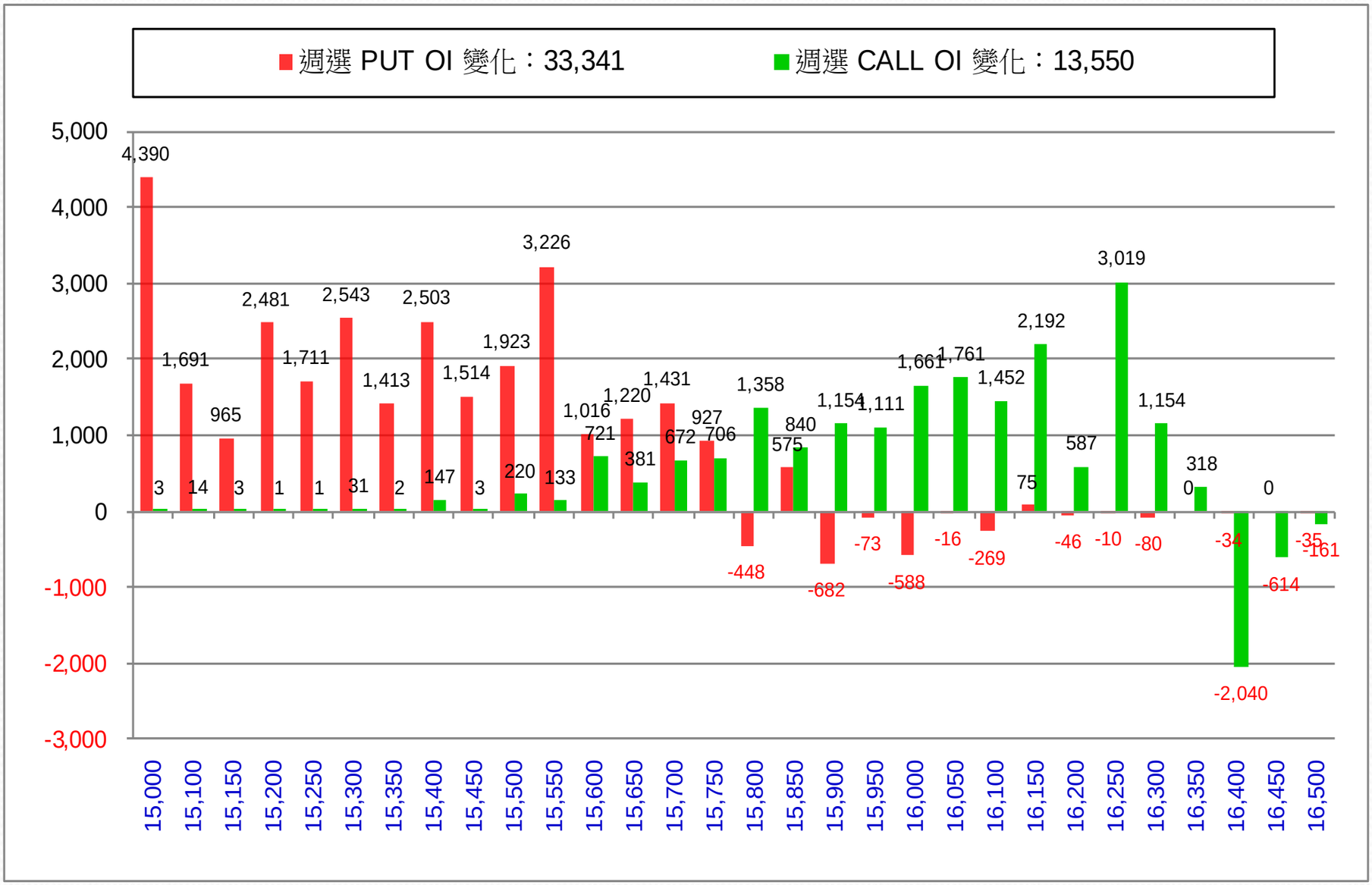
更新日期：2022年5月13日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



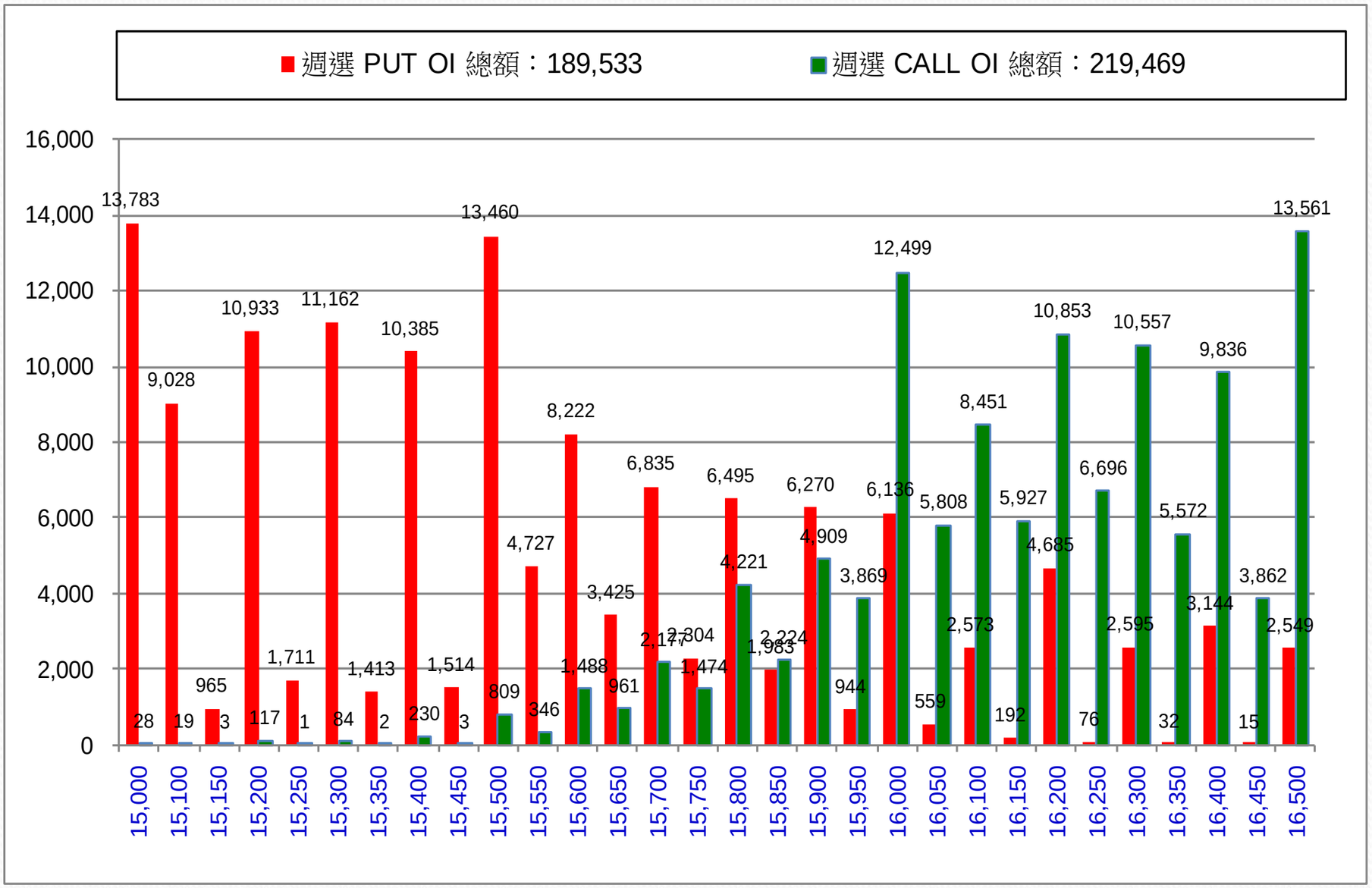
更新日期：2022年5月13日　資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年5月13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



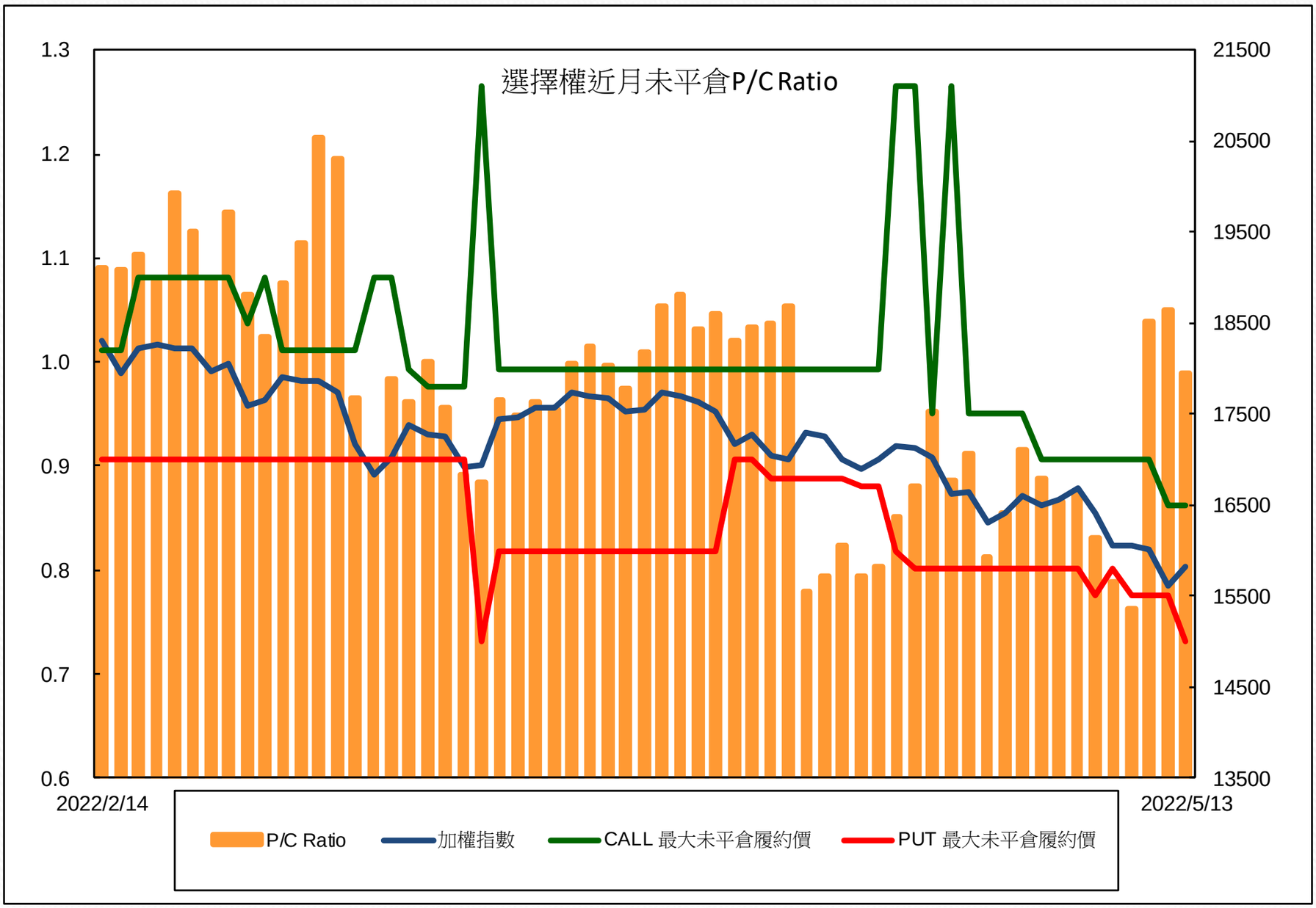
更新日期：2022年5月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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12日	67,430	72,309	-4,879
	5月13日	72,443	75,013	-2,570
Put	5月12日	42,608	45,639	-3,031
	5月13日	50,710	56,263	-5,553

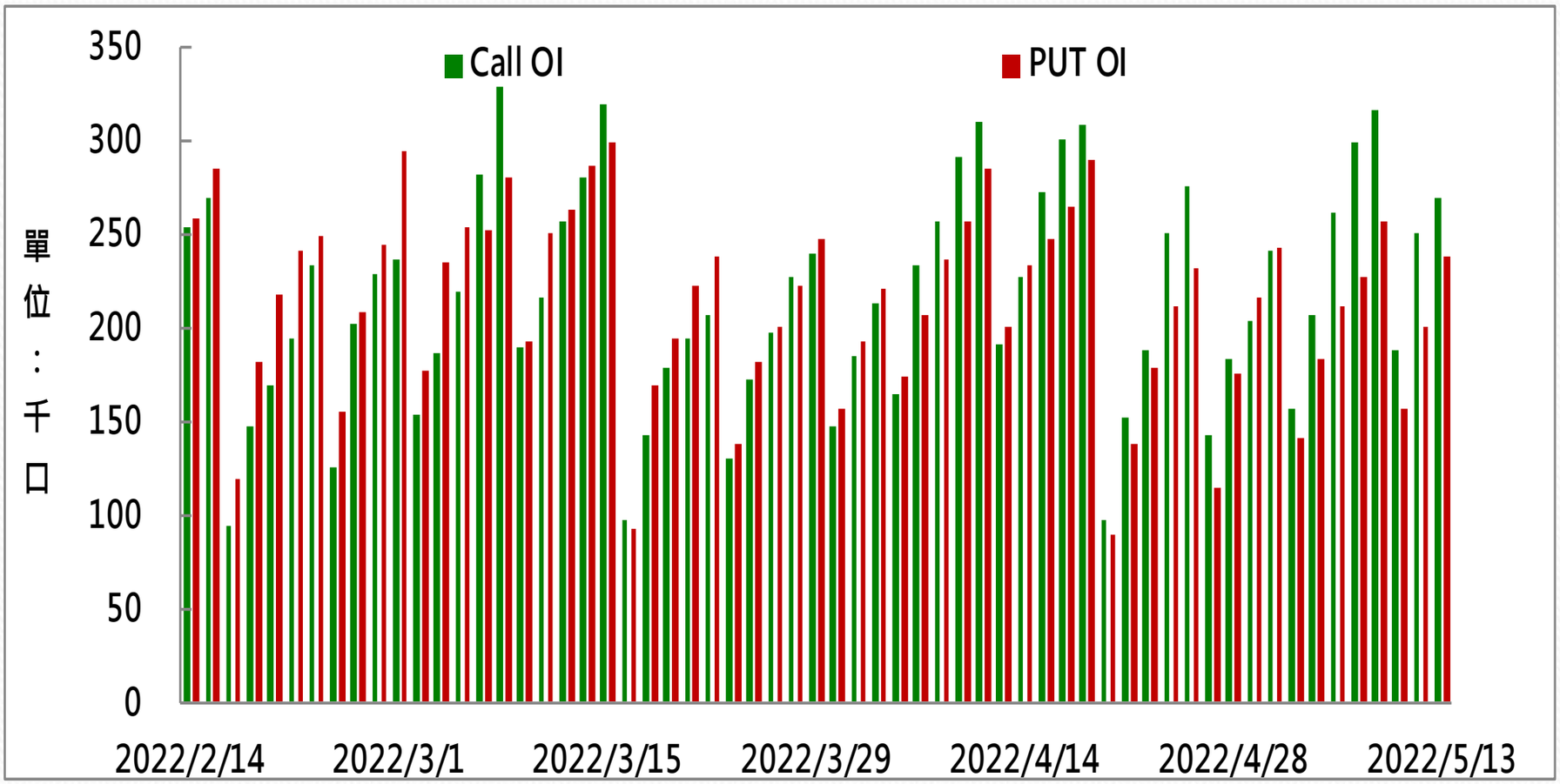
更新日期：2022年5月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年5月13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13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13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