

台指選擇權OI匯報

日期：2022/6/22 結算日：2022/6/29					日期：2022/6/22 結算日：2022/7/20				
202206W5					202207 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	13,900	0	0	8	323	13,800	1,260	-21
0	0	14,000	0	0	0	0	13,900	1,520	30
0	0	14,100	2,133	2,133	0	0	14,000	3,730	289
0	0	14,200	2,146	2,146	0	1	14,100	1,693	224
0	0	14,300	1,170	1,170	0	0	14,200	3,188	252
0	0	14,400	1,120	1,120	1	17	14,300	1,986	158
25	25	14,500	1,916	1,916	-11	185	14,400	2,477	445
20	20	14,600	1,772	1,772	-13	24	14,500	5,541	-88
4	4	14,700	1,750	1,750	-3	48	14,600	2,592	90
3	3	14,800	1,686	1,686	-21	31	14,700	2,174	19
32	32	14,900	1,287	1,287	68	532	14,800	2,812	254
56	56	15,000	3,046	3,046	90	161	14,900	2,385	-66
109	109	15,100	1,125	1,125	107	677	15,000	6,296	-1
492	492	15,200	967	967	352	1,388	15,100	1,929	-93
878	878	15,300	695	695	510	1,342	15,200	2,099	-78
654	654	15,350	620	620	664	1,491	15,300	1,852	-25
1,093	1,093	15,400	614	614	948	2,574	15,400	3,042	38
1,432	1,432	15,450	103	103	1,252	5,403	15,500	2,220	23
1,902	1,902	15,500	288	288	1,611	4,784	15,600	1,697	-19
1,604	1,604	15,550	93	93	1,255	3,943	15,700	759	0
2,273	2,273	15,600	121	121	167	3,243	15,800	768	-8
1,342	1,342	15,650	50	50	-827	3,422	15,900	310	-4
3,171	3,171	15,700	48	48	847	6,837	16,000	2,736	-20
1,282	1,282	15,750	16	16	-106	4,259	16,100	798	-48
3,230	3,230	15,800	33	33	-431	6,076	16,200	488	-19
2,038	2,038	15,850	12	12	273	7,017	16,300	1,299	-2
2,241	2,241	15,900	7	7	480	4,255	16,400	150	1
2,072	2,072	15,950	0	0	-67	5,756	16,500	144	-2
※ 3,705	3,705	16,000	0	0	56	4,466	16,600	85	-3
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
35,784	35,784	0.6382	22,837	22,837	7,458	106,426	0.6940	73,857	4,478
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化		0.6382	昨日 P/C	0.7010	今日增減變化		-0.0070

更新日期：2022年6月22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6月22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	105,909,862	155,611,580	-49,701,718	8,176,595	3,266,575	1,732,777	1,533,798	-386,716	
投信	65,891,826	70,495,425	-4,603,599	-1,163,025	572,065	0	572,065	155,055	
自營商	45,167,588	14,784,544	30,383,044	378,870	1,273,954	903,674	370,280	-222,569	
	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	700,749	2,070,636	-1,369,887	-254,763	0	431,868	-431,868	1,946	
投信	61,971	0	61,971	-686	0	0	0	0	
自營商	627,494	405,195	222,299	90,805	501,370	87,229	414,141	-113	

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報								2022年6月22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	27,073	13,185	13,888	1,252	26,657	12,513	14,144	-935	
投信	0	200	-200	0	600	95	505	0	
自營商	40,810	57,491	-16,681	-10,925	41,868	22,639	19,229	3,366	
特定法人(週)	0	0	0	---	267	0	267	---	
特定法人(近月)	21,539	8,527	13,012	346	8,904	20,788	-11,884	-2,809	
特定法人(全月)	22,504	8,527	13,977	7,270	9,164	23,138	-13,974	644	
十大交易人(週)	16,431	22,116	-5,685	---	11,525	8,049	3,476	---	
十大交易人(近月)	52,560	52,108	452	-3,918	22,499	49,222	-26,723	-64	
十大交易人(全月)	74,864	71,879	2,985	-1,851	34,565	63,475	-28,910	-1,035	
全市場未沖銷(近月)			106,426	7,458			73,857	4,478	
全市場未沖銷(全月)			158,461	-98,277			108,554	-120,285	

更新日期：2022年6月22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 06W5 週 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	16000
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	19.49%	較前一交易日	+5.13%
	買權隱含波動率	15.63%	較前一交易日	+6.90%
	賣權隱含波動率	23.84%	較前一交易日	+4.88%
電子選擇權	買權成交最大量	745	買權OI最大量	745
	賣權成交最大量	660	賣權OI最大量	650
金融選擇權	買權成交最大量	1640	買權OI最大量	1640
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年6月22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 07 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	17000
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	19.80%	較前一交易日	-1.93%
	買權隱含波動率	13.28%	較前一交易日	+4.32%
	賣權隱含波動率	30.41%	較前一交易日	+1.39%
	成交量P/C_Ratio值	0.653	較前一交易日	-0.13
	未平倉P/C_Ratio值	0.694	較前一交易日	-0.01
電子選擇權	買權成交最大量	745	買權OI最大量	745
	賣權成交最大量	660	賣權OI最大量	650
金融選擇權	買權成交最大量	1640	買權OI最大量	1640
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年6月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

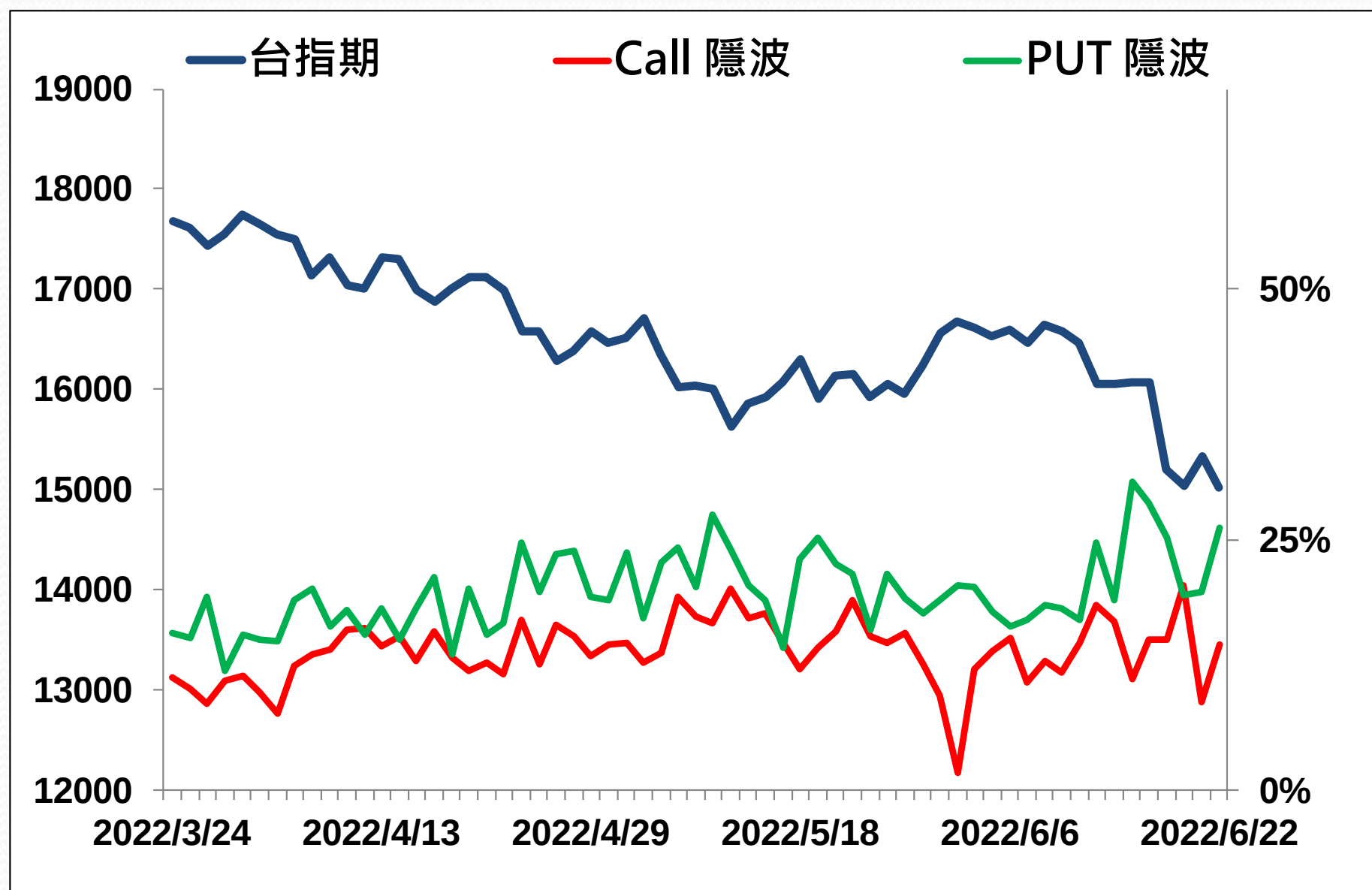
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



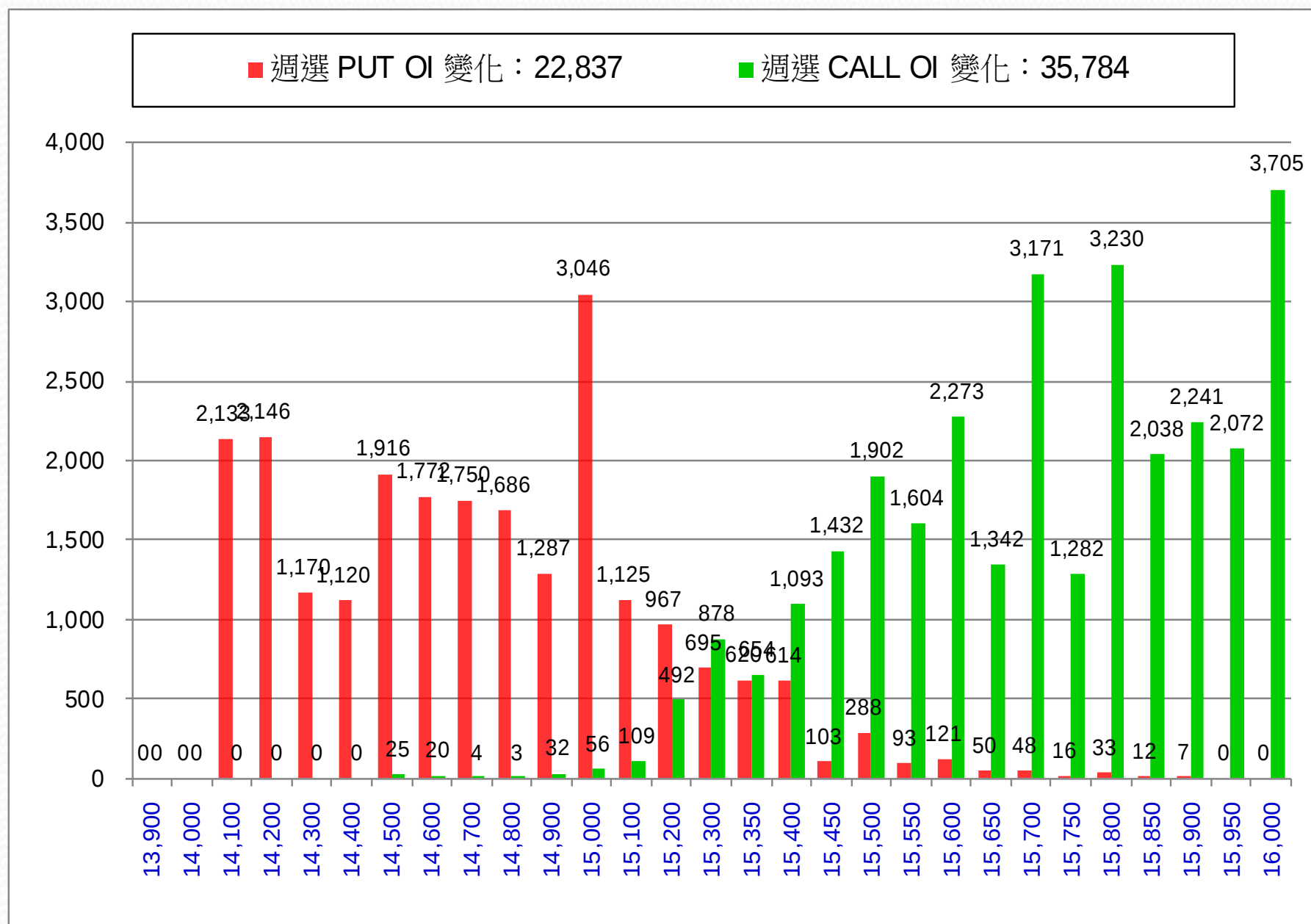
更新日期：2022年6月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



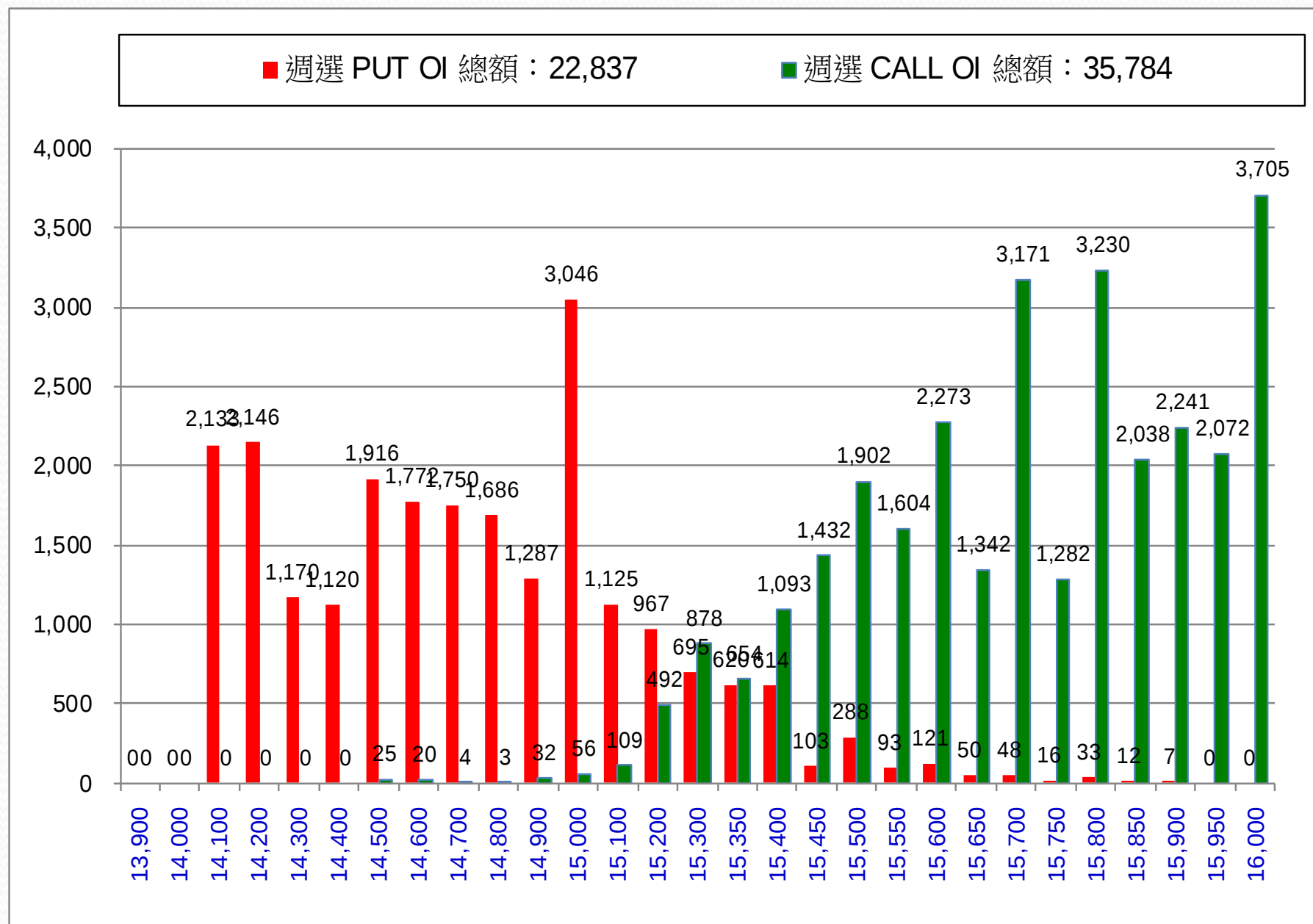
更新日期：2022年6月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年6月22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



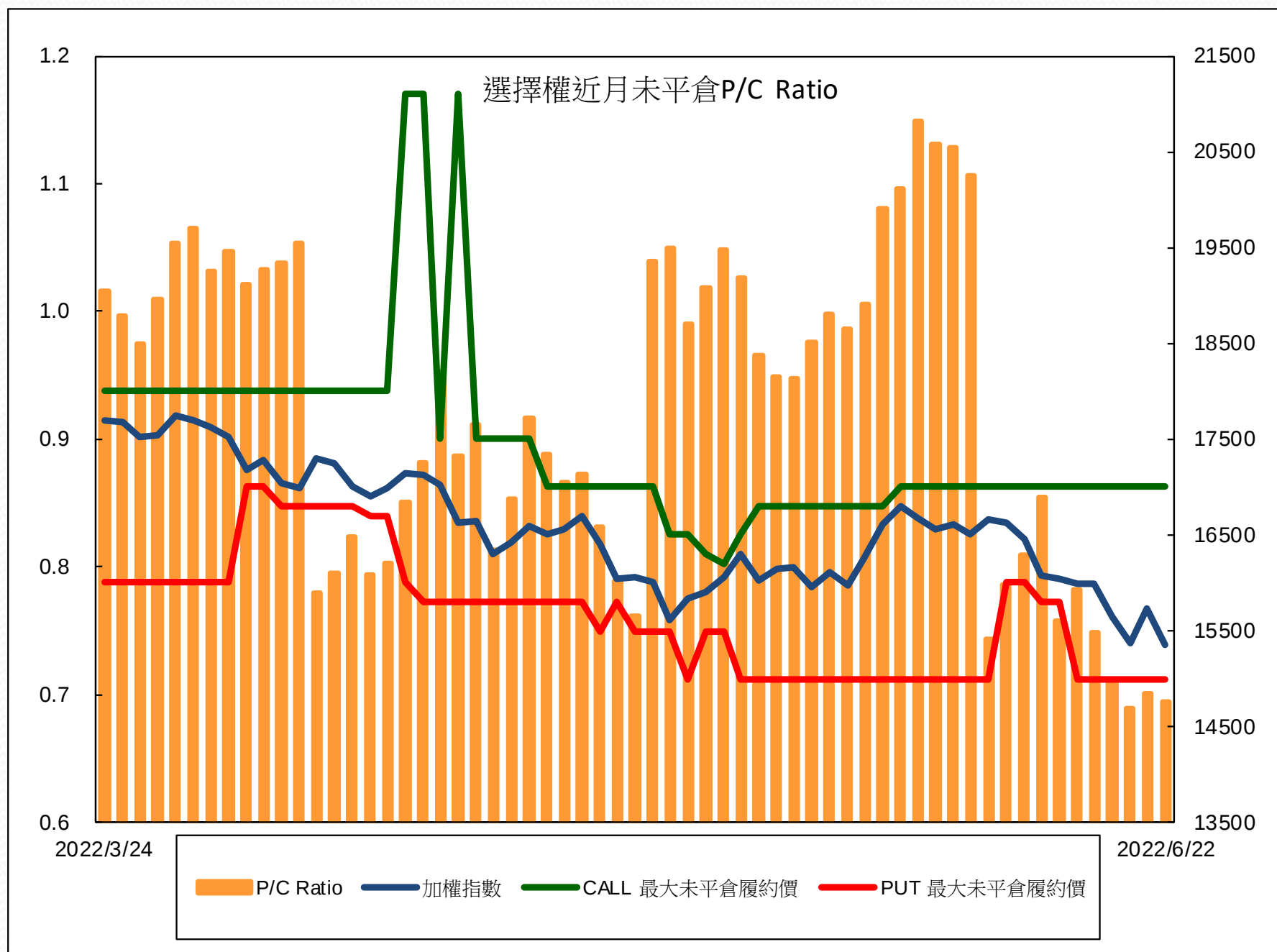
更新日期：2022年6月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	6月21日	64,128	69,884	-5,756
	6月22日	40,810	57,491	-16,681
Put	6月21日	62,160	46,297	15,863
	6月22日	41,868	22,639	19,229

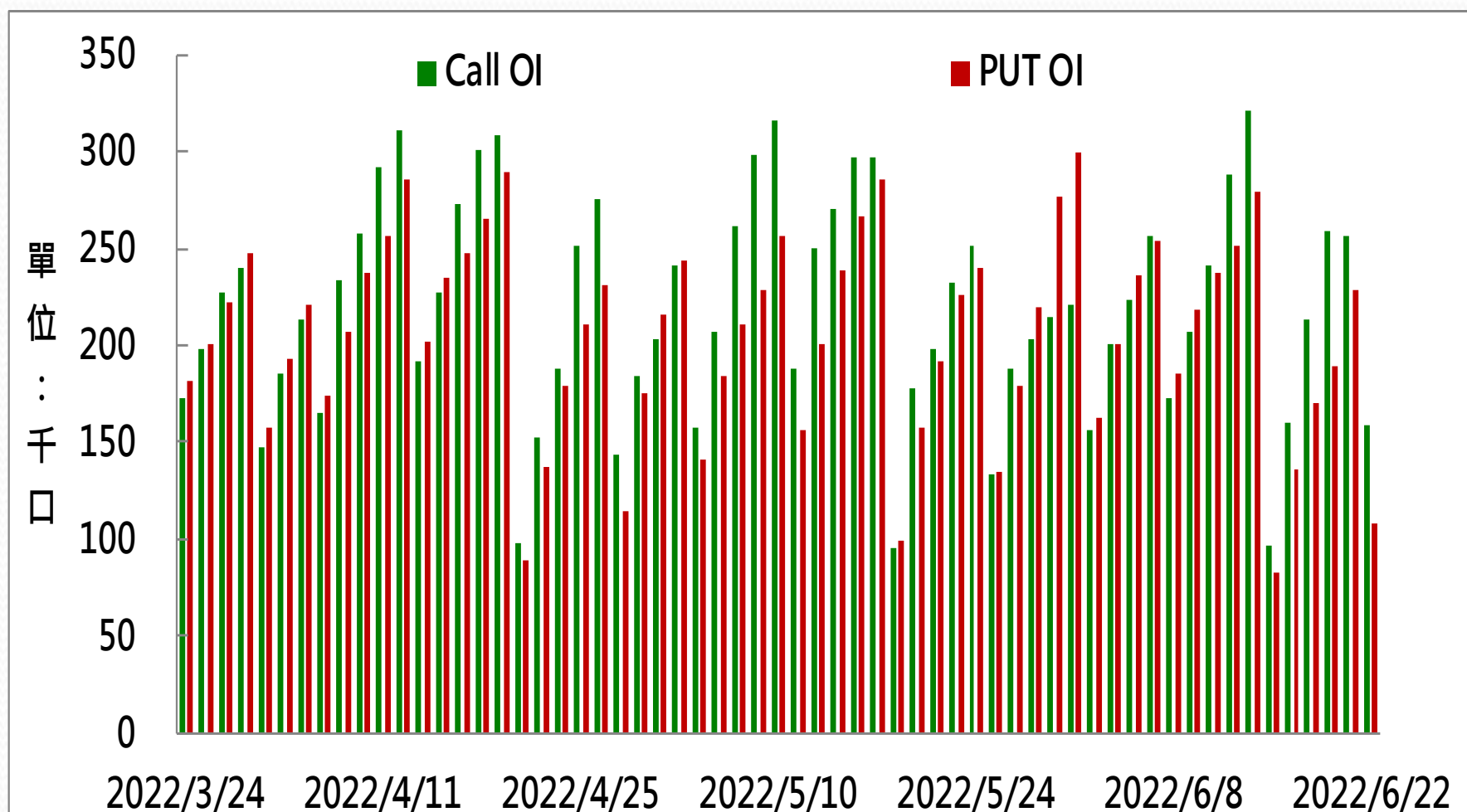
更新日期：2022年6月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年6月22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6月22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6月22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