

台指選擇權OI匯報

日期：2022/6/27 結算日：2022/6/29					日期：2022/6/27 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
-9	182	14,800	8,516	727	0	5	14,000	4,602	-30
0	20	14,850	1,339	428	0	4	14,100	1,888	-163
-45	145	14,900	5,089	287	0	12	14,200	4,971	1,046
-13	84	14,950	2,372	492	0	17	14,300	2,601	63
-2	553	15,000	11,625	4,820	0	184	14,400	2,863	122
-49	300	15,050	2,476	334	-2	50	14,500	6,848	1,356
-188	922	15,100	6,284	2,614	-18	112	14,600	3,191	144
-208	610	15,150	3,602	1,486	-3	130	14,700	2,406	260
-379	2,929	15,200	6,788	2,838	-48	692	14,800	3,287	-143
-723	1,812	15,250	3,857	2,041	-25	458	14,900	2,986	540
-889	3,833	15,300	5,963	2,800	220	1,333	15,000	7,002	582
-853	2,617	15,350	4,447	2,465	-46	1,349	15,100	2,428	468
-1,012	5,425	15,400	5,395	4,443	-176	2,121	15,200	2,442	184
-1,120	3,122	15,450	2,886	2,577	-20	2,923	15,300	2,065	271
-1,104	7,339	15,500	3,777	3,329	-23	4,062	15,400	3,350	286
-151	5,738	15,550	2,553	2,429	53	6,784	15,500	2,581	278
164	9,136	15,600	2,882	2,704	-144	5,567	15,600	1,726	27
1,246	6,603	15,650	1,017	816	368	5,045	15,700	727	45
-546	10,566	15,700	512	441	382	4,452	15,800	764	15
2,212	8,742	15,750	125	91	※ 1,116	4,934	15,900	295	-7
※ 2,518	11,969	15,800	88	49	-440	8,181	16,000	2,712	3
2,408	7,570	15,850	17	4	-55	4,055	16,100	698	-90
1,751	9,306	15,900	65	58	-271	5,402	16,200	471	10
1,006	3,663	15,950	1	0	142	7,144	16,300	1,298	2
279	3,863	16,000	1	0	-55	3,895	16,400	148	0
-181	1,197	16,050	0	0	367	5,928	16,500	143	-1
53	1,817	16,100	21	0	-130	4,095	16,600	84	0
-642	1,038	16,150	2	0	-37	3,698	16,700	111	0
-440	1,514	16,200	2	0	33	3,191	16,800	14	-2
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
3,022	115,149	1.1207	129,045	36,670	1,072	116,778	0.7417	86,610	5,999
昨日 P/C	0.8238	今日增減變化		0.2969	昨日 P/C	0.6967	今日增減變化		0.0450

更新日期：2022年6月27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27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	99,941,227	156,957,136	-57,015,909	-1,518,492	3,134,767	2,148,674	986,093	-460,302	
投信	73,824,575	68,709,835	5,114,740	7,056,577	610,705	16,808	593,897	10,940	
自營商	38,643,014	19,646,383	18,996,631	1,297,629	1,694,737	1,176,565	518,172	188,304	
	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	1,252,836	2,541,067	-1,288,231	-34,199	16,723	492,577	-475,854	-52,572	
投信	62,642	0	62,642	24	0	0	0	0	
自營商	512,207	494,651	17,556	-107,510	591,386	139,841	451,545	22,238	

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27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	32,874	17,743	15,131	3,674	38,473	16,128	22,345	-223	
投信	0	150	-150	0	600	95	505	0	
自營商	66,940	80,852	-13,912	3,984	67,790	49,874	17,916	-3,350	
特定法人(週)	1,524	0	1,524	1,524	0	5,281	-5,281	-153	
特定法人(近月)	20,213	7,854	12,359	216	9,183	22,871	-13,688	-592	
特定法人(全月)	20,719	9,595	11,124	161	7,084	30,542	-23,458	-1,754	
十大交易人(週)	43,938	42,646	1,292	3,091	45,684	41,606	4,078	9,786	
十大交易人(近月)	60,277	55,453	4,824	3,557	25,905	55,430	-29,525	-572	
十大交易人(全月)	105,011	94,504	10,507	7,238	65,346	100,467	-35,121	7,244	
全市場未沖銷(近月)			116,778	1,072			86,610	5,999	
全市場未沖銷(全月)			254,172	4,620			228,664	42,760	

更新日期：2022年6月27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	15600	買權OI最大量	15800
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	18.29%	較前一交易日	-0.60%
	買權隱含波動率	12.17%	較前一交易日	-4.99%
	賣權隱含波動率	22.70%	較前一交易日	+1.86%
電子選擇權	買權成交最大量	740	買權OI最大量	810
	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	1660	買權OI最大量	1640
	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年6月27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	14500	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	19.53%	較前一交易日	+0.60%
	買權隱含波動率	12.15%	較前一交易日	-2.11%
	賣權隱含波動率	28.50%	較前一交易日	+0.00%
	成交量P/C_Ratio值	0.819	較前一交易日	+0.11
	未平倉P/C_Ratio值	0.742	較前一交易日	+0.04
電子選擇權	買權成交最大量	740	買權OI最大量	810
	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	1660	買權OI最大量	1640
	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年6月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

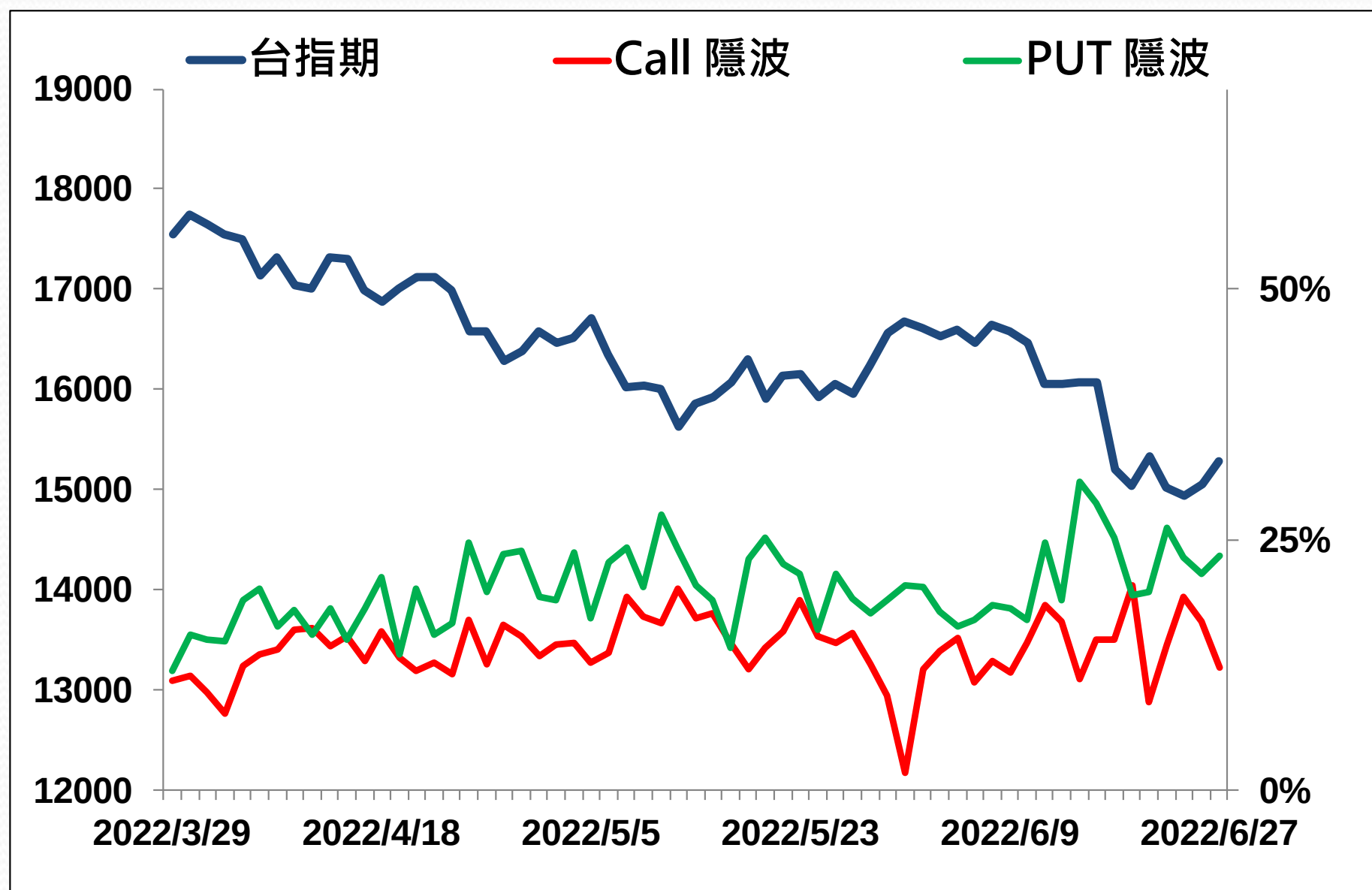
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



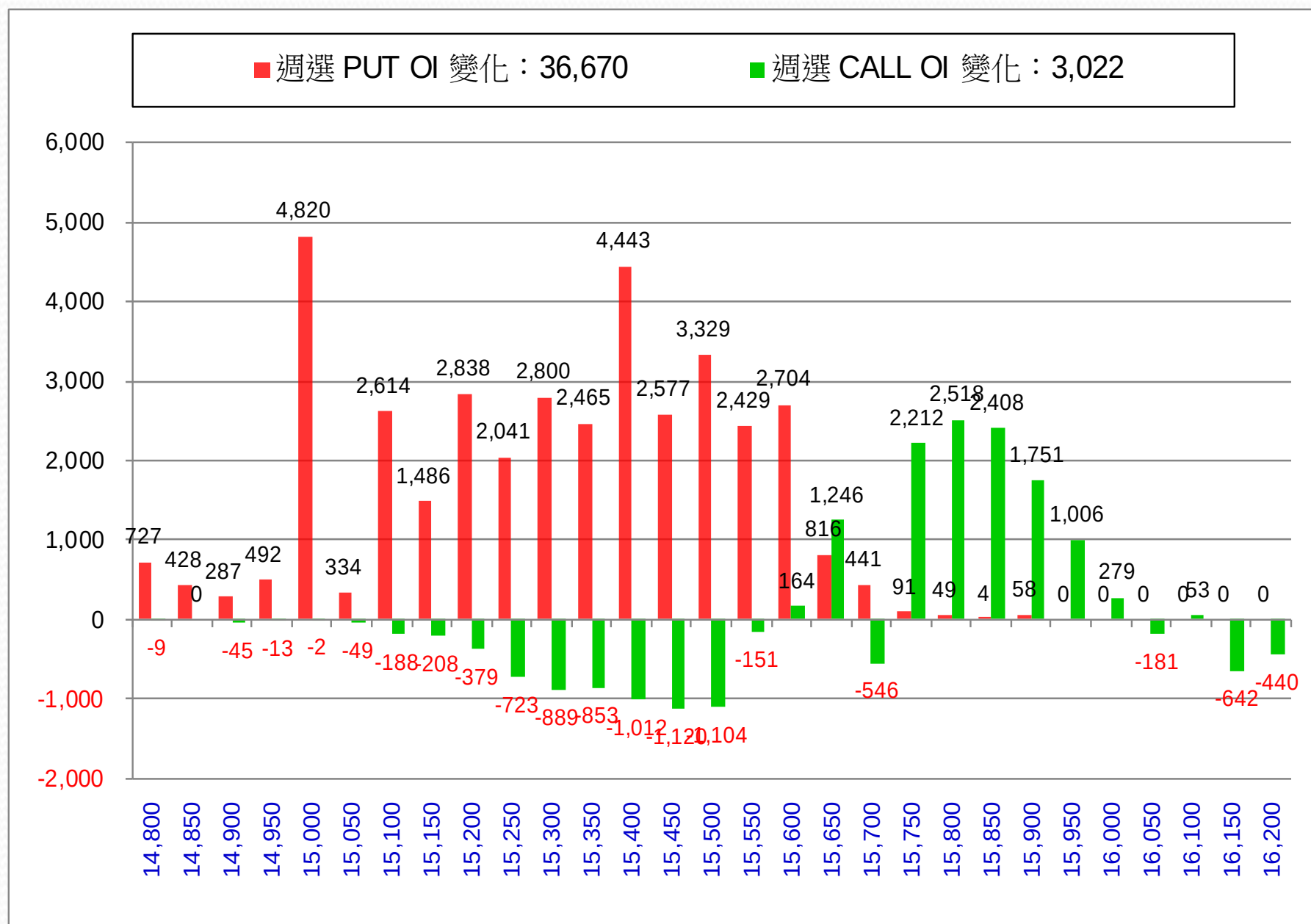
更新日期：2022年6月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



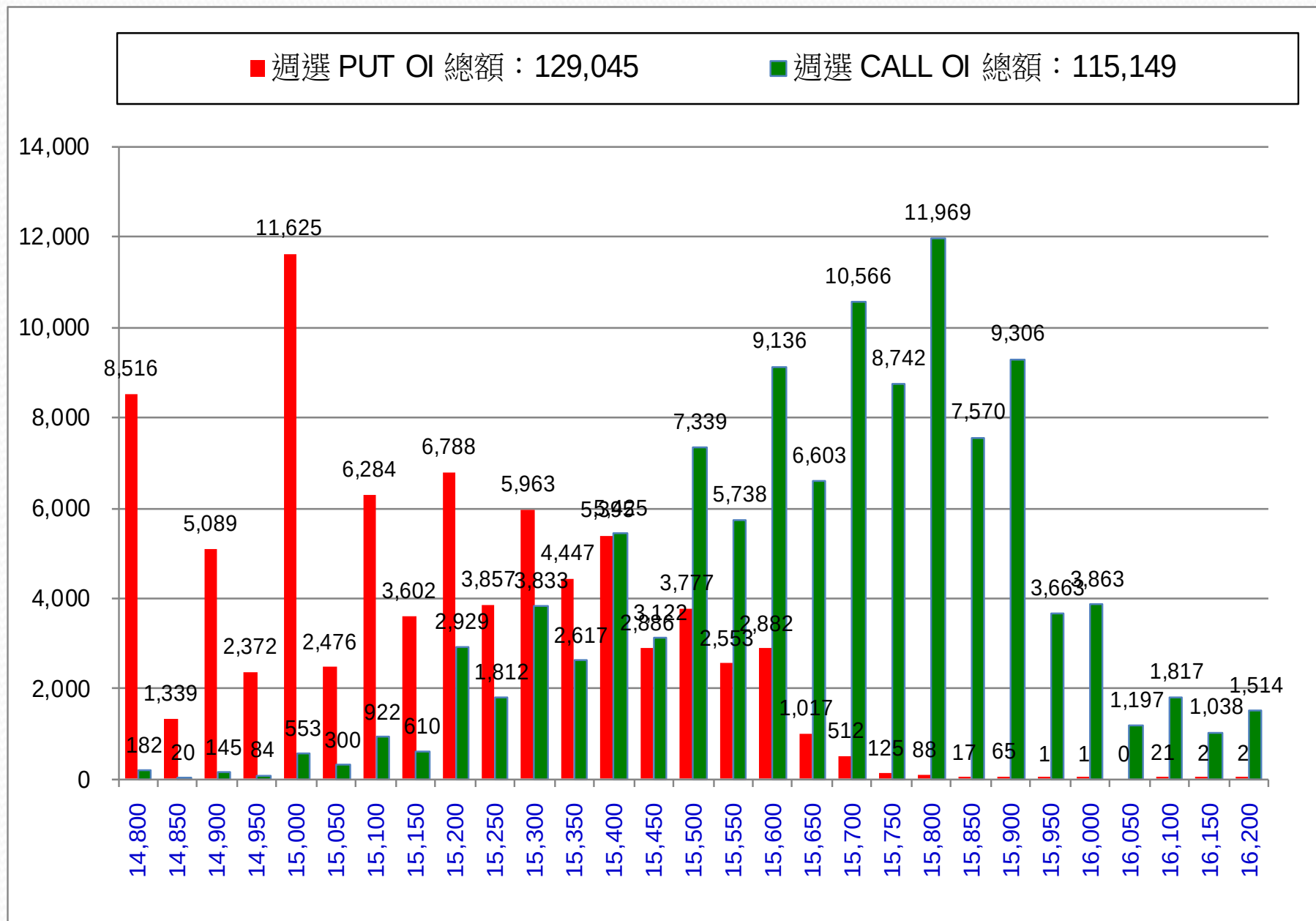
更新日期：2022年6月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年6月27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



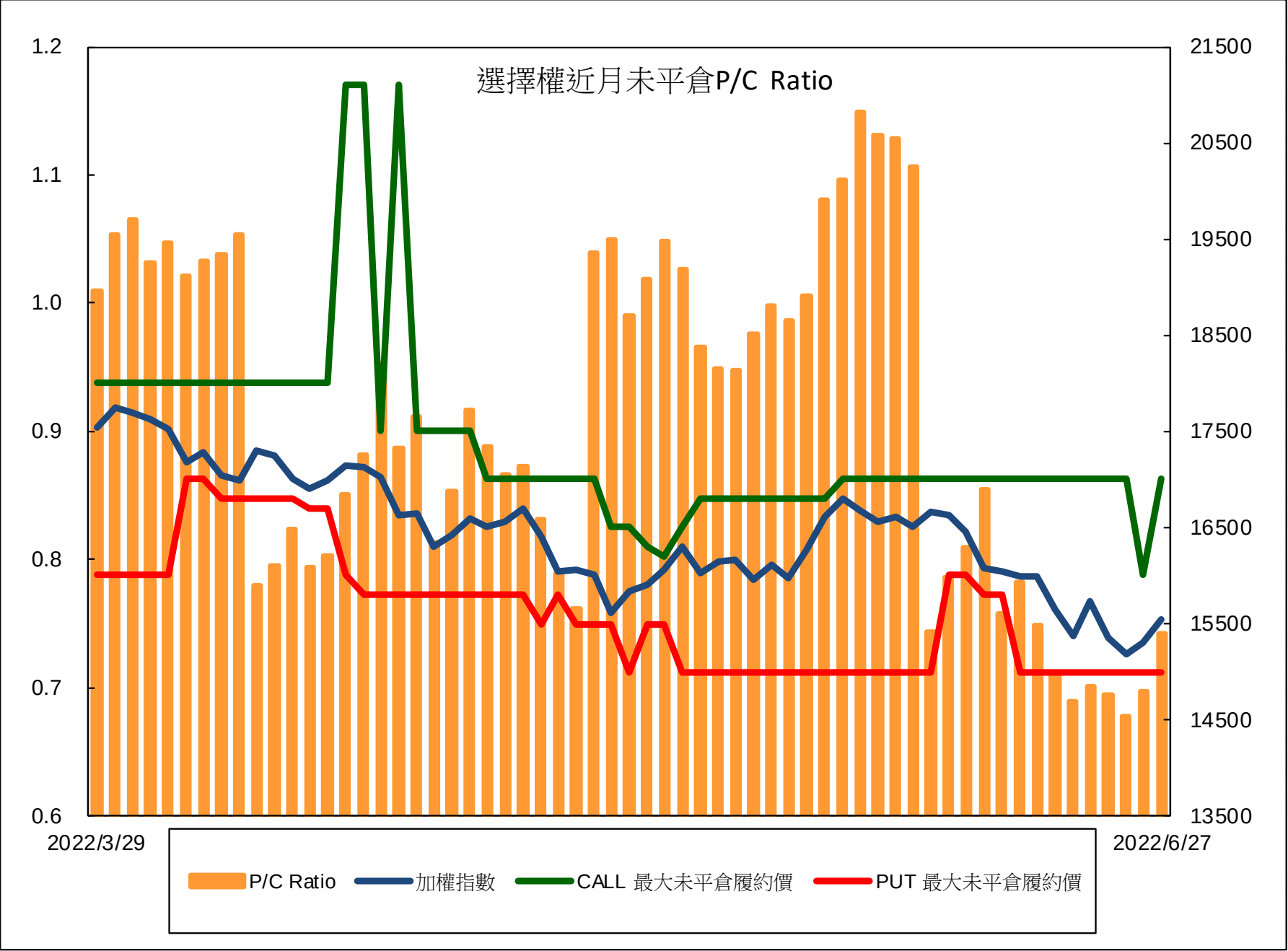
更新日期：2022年6月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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24日	61,791	79,687	-17,896
	6月27日	66,940	80,852	-13,912
Put	6月24日	60,742	39,476	21,266
	6月27日	67,790	49,874	17,916

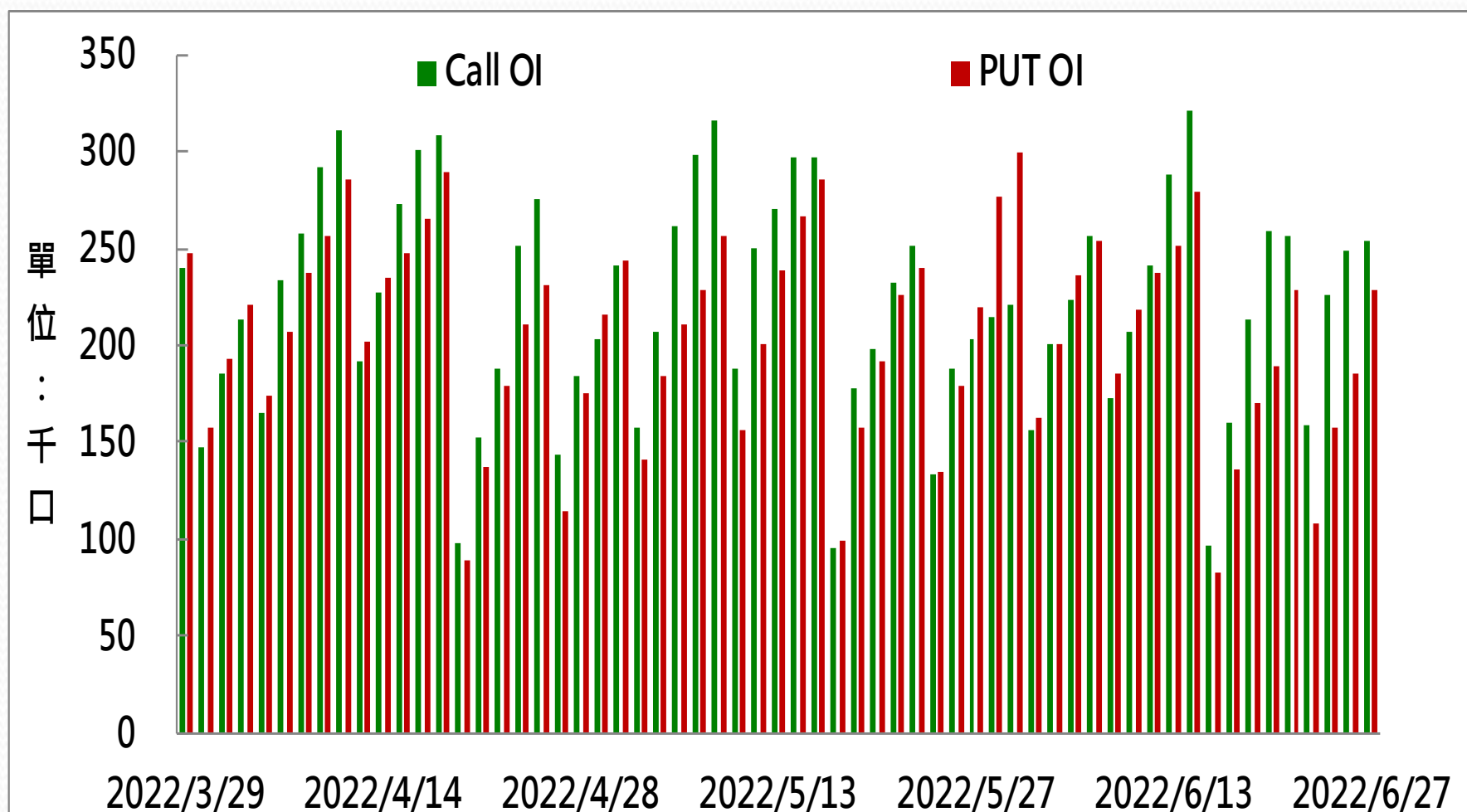
更新日期：2022年6月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年6月27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27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27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