

台指選擇權 OI 匯報

日期：2022/6/28 結算日：2022/6/29					日期：2022/6/28 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	34	14,700	5,510	-92	0	0	13,900	1,916	-3
9	29	14,750	1,719	309	-1	4	14,000	4,936	334
-14	168	14,800	9,249	733	0	4	14,100	1,899	11
0	20	14,850	1,667	328	0	12	14,200	5,075	104
-14	131	14,900	4,316	-773	0	17	14,300	2,510	-91
0	84	14,950	2,489	117	1	185	14,400	3,083	220
33	586	15,000	10,141	-1,484	0	50	14,500	6,991	143
13	313	15,050	3,436	960	60	172	14,600	3,775	584
-57	865	15,100	7,812	1,528	26	156	14,700	2,774	368
-33	577	15,150	4,435	833	30	722	14,800	3,390	103
-181	2,748	15,200	8,837	2,049	17	475	14,900	3,348	362
158	1,970	15,250	6,041	2,184	-45	1,288	15,000	6,973	-29
989	4,822	15,300	8,027	2,064	222	1,571	15,100	2,448	20
2,005	4,622	15,350	6,779	2,332	48	2,169	15,200	2,552	110
1,463	6,888	15,400	7,810	2,415	162	3,085	15,300	2,320	255
3,032	6,154	15,450	3,112	226	309	4,371	15,400	3,397	47
3,339	10,678	15,500	3,252	-525	337	7,121	15,500	2,641	60
※ 4,693	10,431	15,550	2,132	-421	745	6,312	15,600	1,704	-22
4,488	13,624	15,600	2,011	-871	626	5,671	15,700	727	0
2,097	8,700	15,650	729	-288	676	5,128	15,800	758	-6
1,142	11,708	15,700	193	-319	※ 968	5,902	15,900	267	-28
-600	8,142	15,750	124	-1	872	9,053	16,000	2,697	-15
-3,164	8,805	15,800	85	-3	281	4,336	16,100	696	-2
-2,946	4,624	15,850	15	-2	378	5,780	16,200	469	-2
-3,059	6,247	15,900	53	-12	-10	7,134	16,300	1,298	0
338	4,001	15,950	3	2	76	3,971	16,400	148	0
-331	3,532	16,000	0	-1	-209	5,719	16,500	143	0
39	1,236	16,050	0	0	304	4,399	16,600	84	0
172	1,989	16,100	21	0	10	3,708	16,700	111	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
13,284	128,433	1.0470	134,475	5,430	6,221	122,999	0.7294	89,710	3,100
昨日 P/C	1.1207	今日增減變化	-0.0737		昨日 P/C	0.7417	今日增減變化	-0.0123	

更新日期：2022年6月28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28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	94,333,322	153,700,123	-59,366,801	-2,350,892	3,477,280	2,143,072	1,334,208	348,115	
投信	76,289,074	69,539,899	6,749,175	1,634,435	625,410	16,678	608,732	14,835	
自營商	38,766,658	21,963,889	16,802,769	-2,193,862	1,411,904	1,236,899	175,005	-343,167	
	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	1,299,987	2,630,494	-1,330,507	-42,276	9,110	482,819	-473,709	2,145	
投信	62,361	0	62,361	-281	0	0	0	0	
自營商	581,860	513,162	68,698	51,142	602,754	141,175	461,579	10,034	

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28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	33,547	17,888	15,659	528	39,970	15,990	23,980	1,635	
投信	0	100	-100	50	650	95	555	50	
自營商	62,487	86,614	-24,127	-10,215	70,412	50,038	20,374	2,458	
特定法人(週)	1,524	2,071	-547	-2,071	0	5,856	-5,856	-575	
特定法人(近月)	20,268	7,854	12,414	55	9,100	23,136	-14,036	-348	
特定法人(全月)	20,795	9,925	10,870	-254	7,105	26,081	-18,976	4,482	
十大交易人(週)	32,720	42,783	-10,063	-11,355	45,279	44,143	1,136	-2,942	
十大交易人(近月)	60,452	58,706	1,746	-3,078	26,721	57,600	-30,879	-1,354	
十大交易人(全月)	98,675	102,842	-4,167	-14,674	65,290	102,008	-36,718	-1,597	
全市場未沖銷(近月)			122,999	6,221			89,710	3,100	
全市場未沖銷(全月)			276,941	22,769			237,437	8,773	

更新日期：2022年6月28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	15500	買權OI最大量	15600
	賣權成交最大量	15400	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	15.20%	較前一交易日	-3.09%
	買權隱含波動率	12.80%	較前一交易日	+0.63%
	賣權隱含波動率	18.13%	較前一交易日	-4.56%
電子選擇權	買權成交最大量	725	買權OI最大量	735
	賣權成交最大量	665	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28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	16000
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	14500
	整體隱含波動率	18.91%	較前一交易日	+0.62%
	買權隱含波動率	13.38%	較前一交易日	+1.23%
	賣權隱含波動率	27.17%	較前一交易日	-1.34%
	成交量P/C_Ratio值	0.649	較前一交易日	-0.17
	未平倉P/C_Ratio值	0.729	較前一交易日	-0.01
電子選擇權	買權成交最大量	725	買權OI最大量	735
	賣權成交最大量	665	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28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

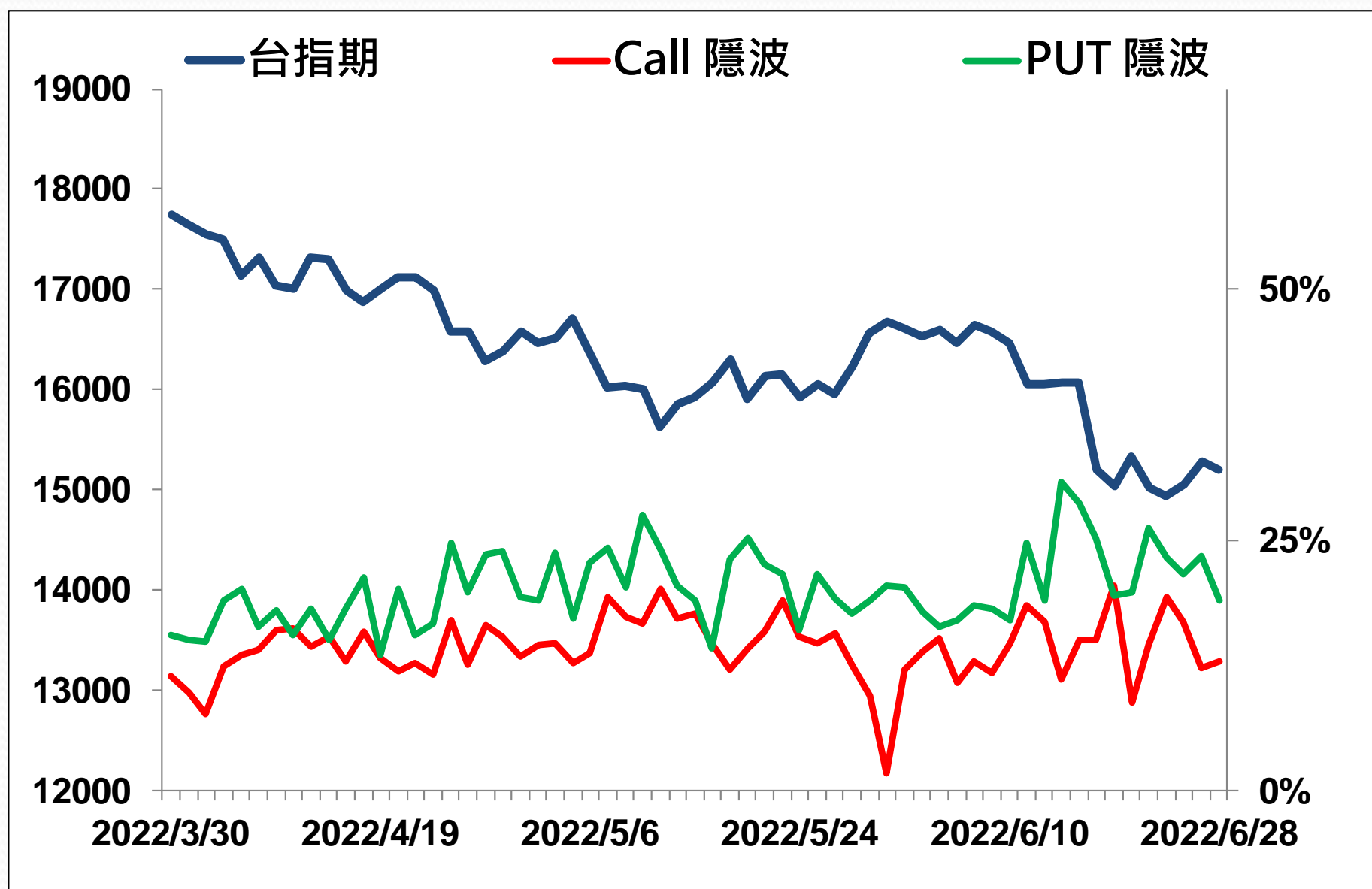
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



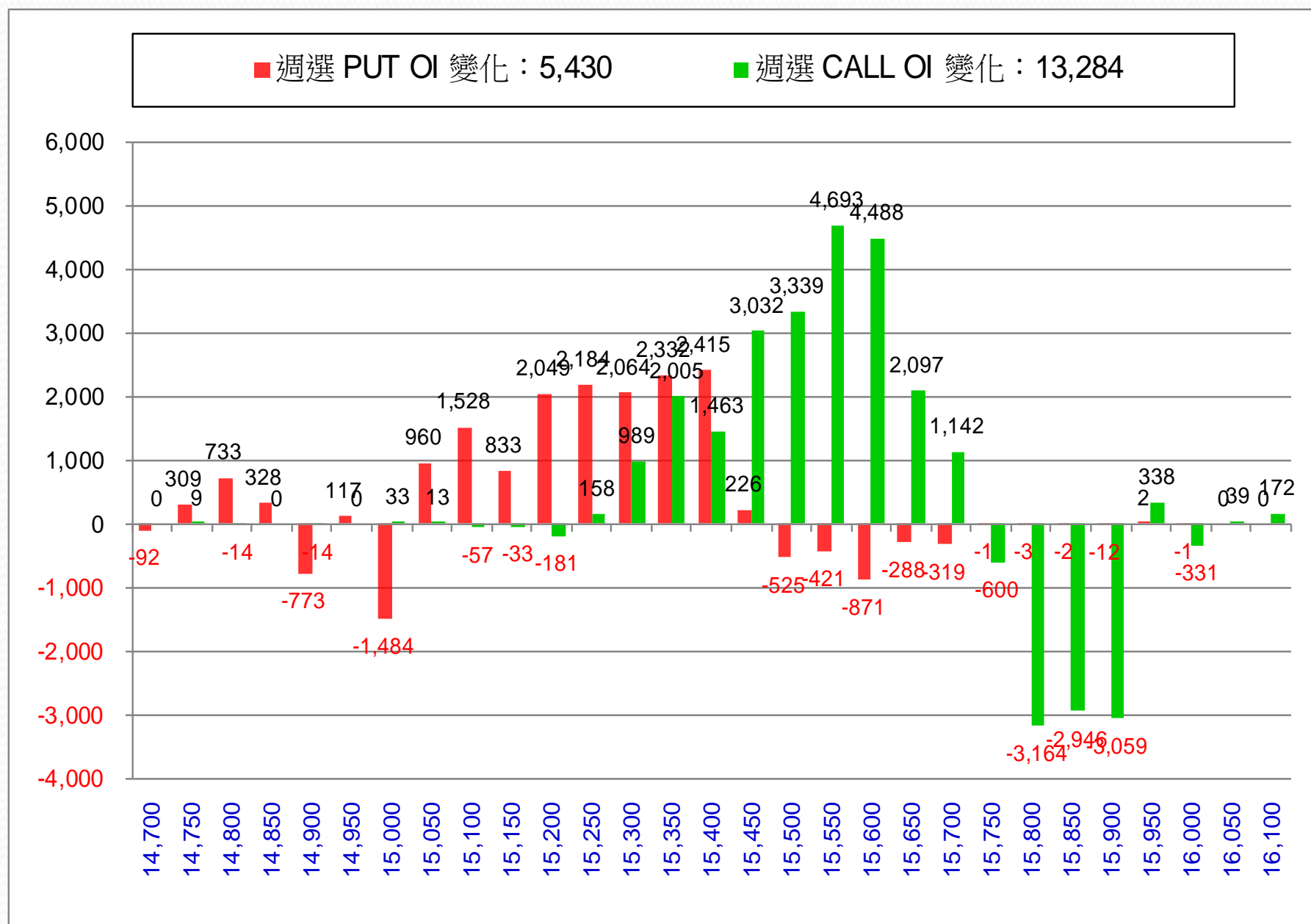
更新日期：2022年6月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



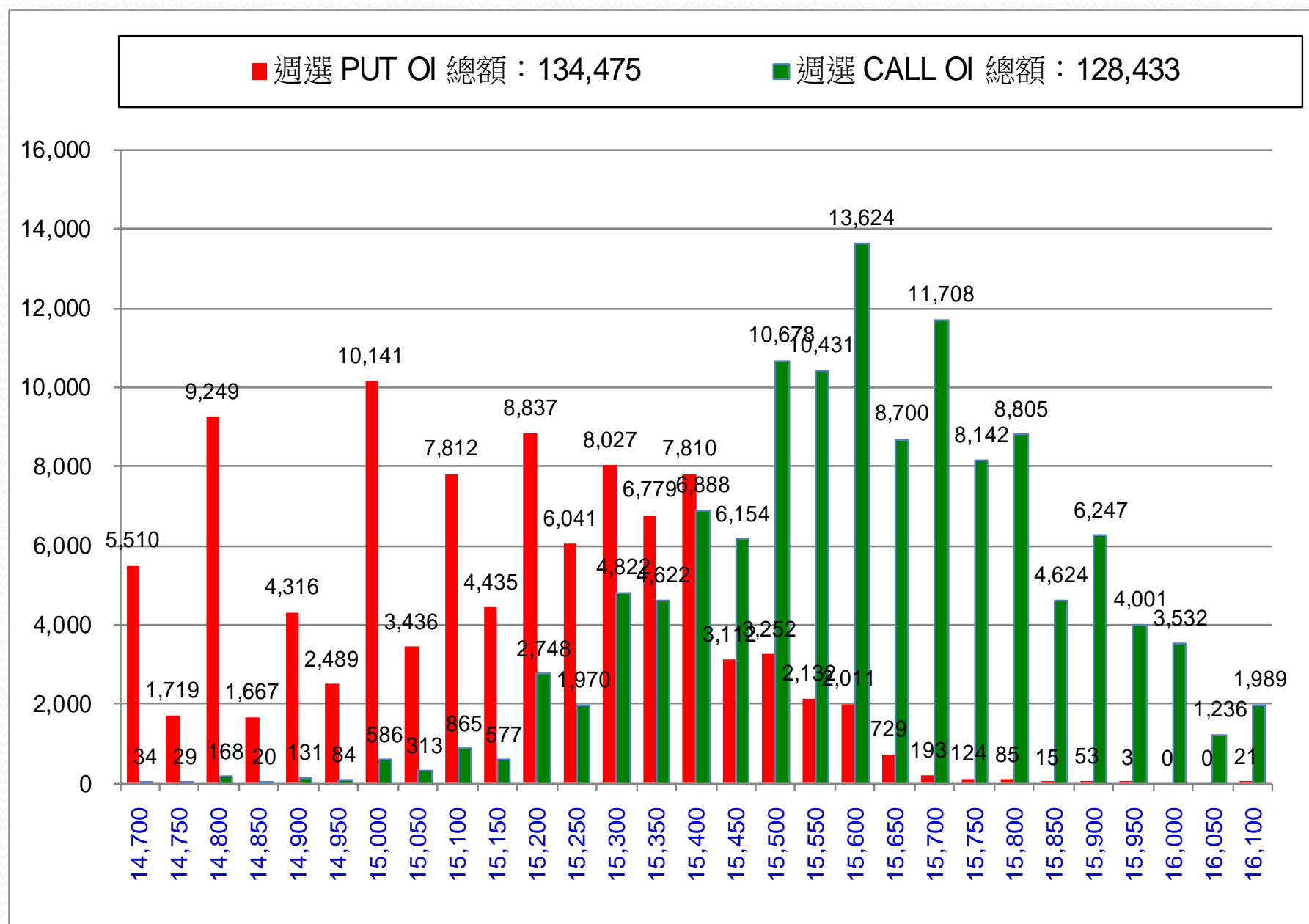
更新日期：2022年6月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年6月28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



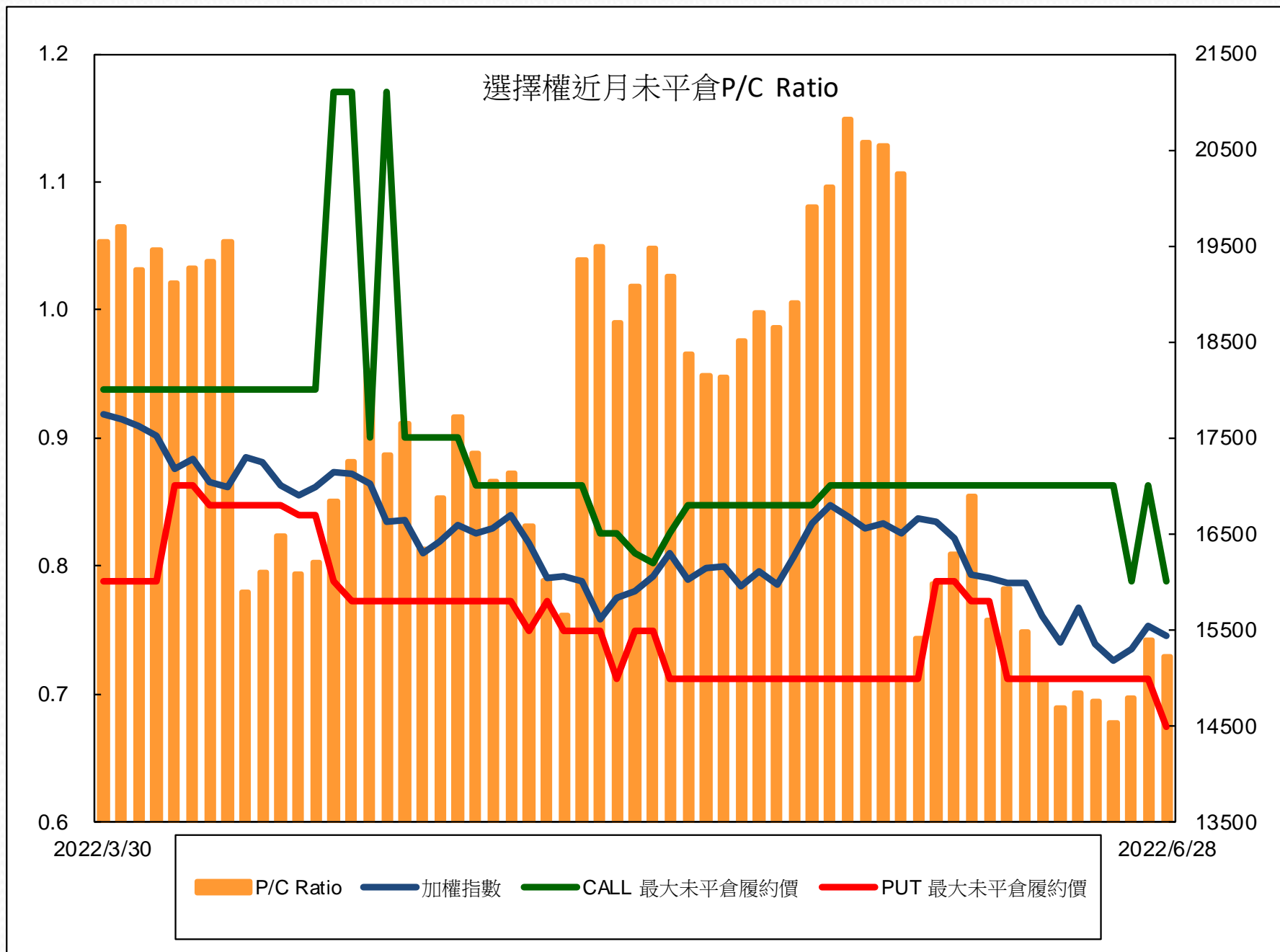
更新日期：2022年6月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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27日	66,940	80,852	-13,912
	6月28日	62,487	86,614	-24,127
Put	6月27日	67,790	49,874	17,916
	6月28日	70,412	50,038	20,374

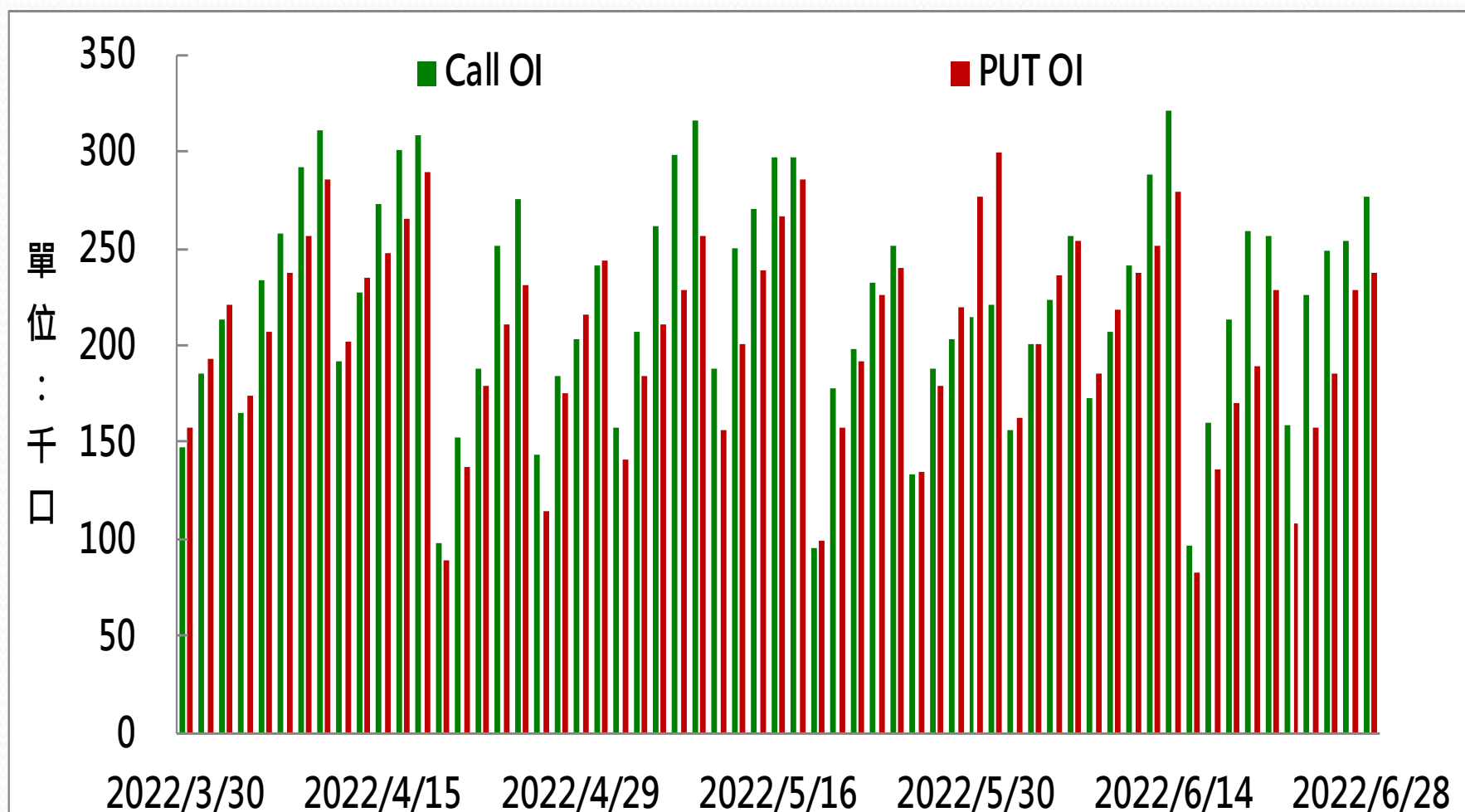
更新日期：2022年6月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年6月28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28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28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