

台指選擇權 OI 匯報

日期：2022/6/29 結算日：2022/7/6					日期：2022/6/29 結算日：2022/7/20						
202207W1					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	14,000	1,805	1,805	0	0	13,700	1,387	25		
0	0	14,100	649	649	20	323	13,800	1,679	187		
0	0	14,200	629	629	0	0	13,900	2,050	134		
0	0	14,300	1,272	1,272	0	4	14,000	4,764	-172		
1	1	14,400	1,159	1,159	0	4	14,100	1,839	-60		
6	6	14,500	1,667	1,667	0	12	14,200	4,965	-110		
3	3	14,600	1,731	1,731	0	17	14,300	2,966	456		
2	2	14,700	2,910	2,910	※	-1	184	14,400	3,175	92	
31	31	14,800	1,871	1,871		1	51	14,500	6,928	-63	
111	111	14,900	1,734	1,734		12	184	14,600	4,502	727	※
279	279	15,000	733	733		-2	154	14,700	3,084	310	
59	59	15,050	252	252		-34	688	14,800	3,401	11	
227	227	15,100	329	329		33	508	14,900	3,563	215	
730	730	15,150	355	355		26	1,314	15,000	7,062	89	
1,049	1,049	15,200	251	251		-154	1,417	15,100	2,132	-316	
819	819	15,250	226	226		339	2,508	15,200	2,617	65	
1,717	1,717	15,300	252	252		156	3,241	15,300	2,271	-49	
946	946	15,350	33	33	※	963	5,334	15,400	3,366	-31	
1,527	1,527	15,400	51	51		-304	6,817	15,500	2,587	-54	
1,374	1,374	15,450	24	24		38	6,350	15,600	1,696	-8	
1,819	1,819	15,500	30	30		-136	5,535	15,700	738	11	
1,189	1,189	15,550	14	14		249	5,377	15,800	754	-4	
1,391	1,391	15,600	4	4		480	6,382	15,900	270	3	
1,746	1,746	15,650	4	4		688	9,741	16,000	2,695	-2	
※ 3,050	3,050	15,700	5	5		284	4,620	16,100	695	-1	
1,435	1,435	15,750	0	0		554	6,334	16,200	469	0	
1,704	1,704	15,800	15	15		-103	7,031	16,300	1,296	-2	
781	781	15,850	0	0		-89	3,882	16,400	148	0	
1,483	1,483	15,900	0	0		19	5,738	16,500	142	-1	
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		
26,590	26,590	0.7216	19,187	19,187	3,136	126,135	0.7276	91,775	2,065		
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化	0.7216		昨日 P/C	0.7294	今日增減變化	-0.0018			

更新日期：2022年6月29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29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	90,003,501	149,988,421	-59,984,920	-618,119	3,291,495	2,025,958	1,265,537	-68,671	
投信	75,938,915	69,923,506	6,015,409	-733,766	617,670	16,471	601,199	-7,533	
自營商	37,413,027	22,346,953	15,066,074	-1,736,695	1,413,645	1,144,715	268,930	93,925	
	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	1,406,082	2,579,080	-1,172,998	157,509	1,500	475,500	-474,000	-291	
投信	61,893	0	61,893	-468	0	0	0	0	
自營商	585,457	566,415	19,042	-49,656	604,489	139,468	465,021	3,442	

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29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	29,540	13,386	16,154	495	30,539	12,587	17,952	-6,028	
投信	0	100	-100	0	650	95	555	0	
自營商	46,588	69,414	-22,826	1,301	48,866	30,658	18,208	-2,166	
特定法人(週)	0	0	0	---	0	0	0	---	
特定法人(近月)	21,003	7,884	13,119	705	9,063	23,180	-14,117	-81	
特定法人(全月)	21,280	7,884	13,396	2,526	9,351	26,198	-16,847	2,129	
十大交易人(週)	12,281	16,177	-3,896	---	11,087	7,739	3,348	---	
十大交易人(近月)	58,010	58,149	-139	-1,885	27,182	58,033	-30,851	28	
十大交易人(全月)	84,476	78,974	5,502	9,669	39,395	71,640	-32,245	4,473	
全市場未沖銷(近月)			126,135	3,136			91,775	2,065	
全市場未沖銷(全月)			178,638	-98,303			124,662	-112,775	

更新日期：2022年6月29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07W1週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15700	買權OI最大量	15700
	賣權成交最大量	14700	賣權OI最大量	14700
	整體隱含波動率	17.45%	較前一交易日	+2.25%
	買權隱含波動率	14.21%	較前一交易日	+1.41%
	賣權隱含波動率	21.52%	較前一交易日	+3.39%
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	655	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	1500	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年6月29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	15000
	整體隱含波動率	15.40%	較前一交易日	+3.51%
	買權隱含波動率	15.02%	較前一交易日	+1.64%
	賣權隱含波動率	31.01%	較前一交易日	+3.84%
	成交量P/C_Ratio值	0.617	較前一交易日	-0.03
	未平倉P/C_Ratio值	0.728	較前一交易日	-0.00
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	655	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	1500	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年6月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

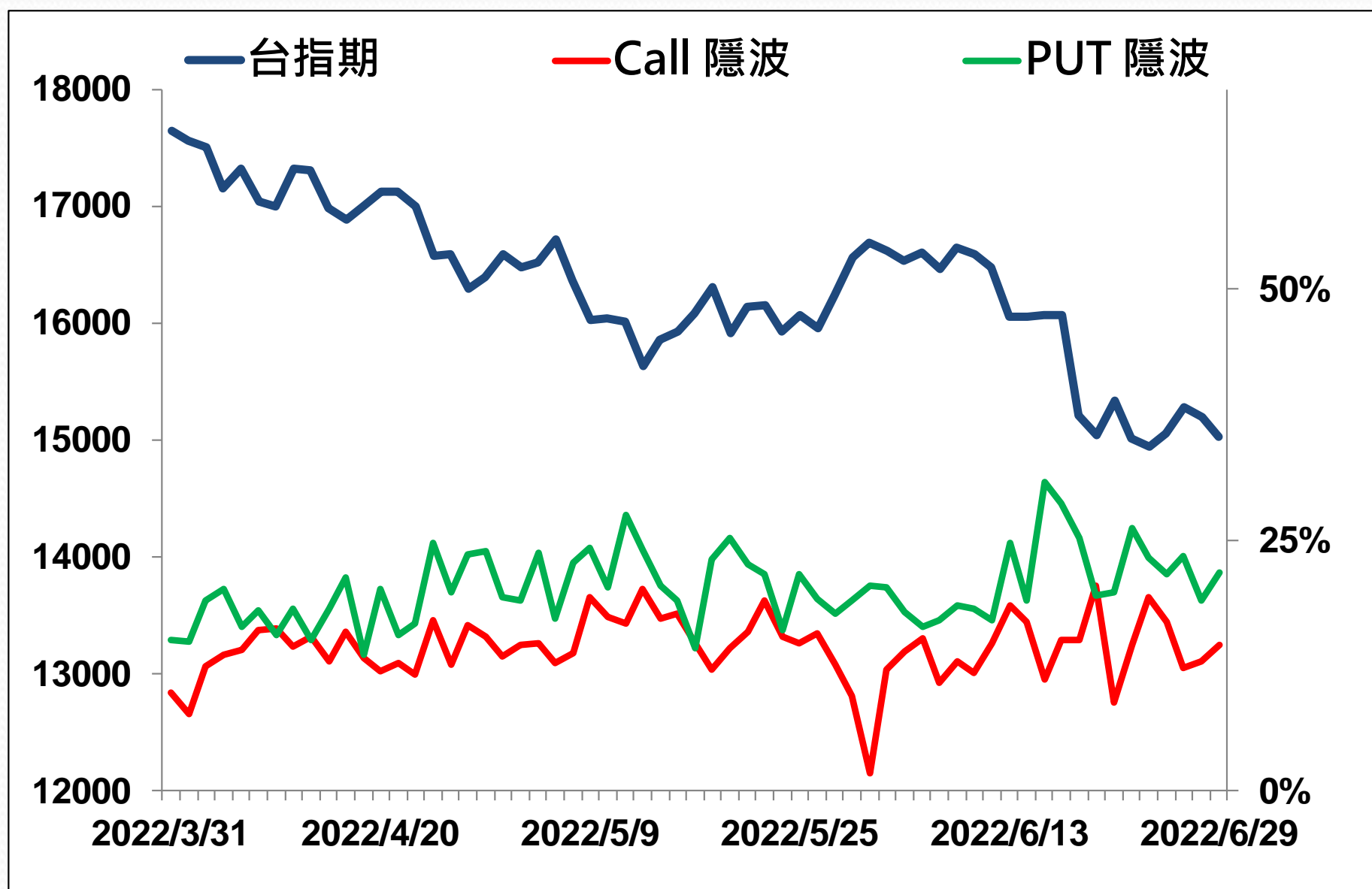
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



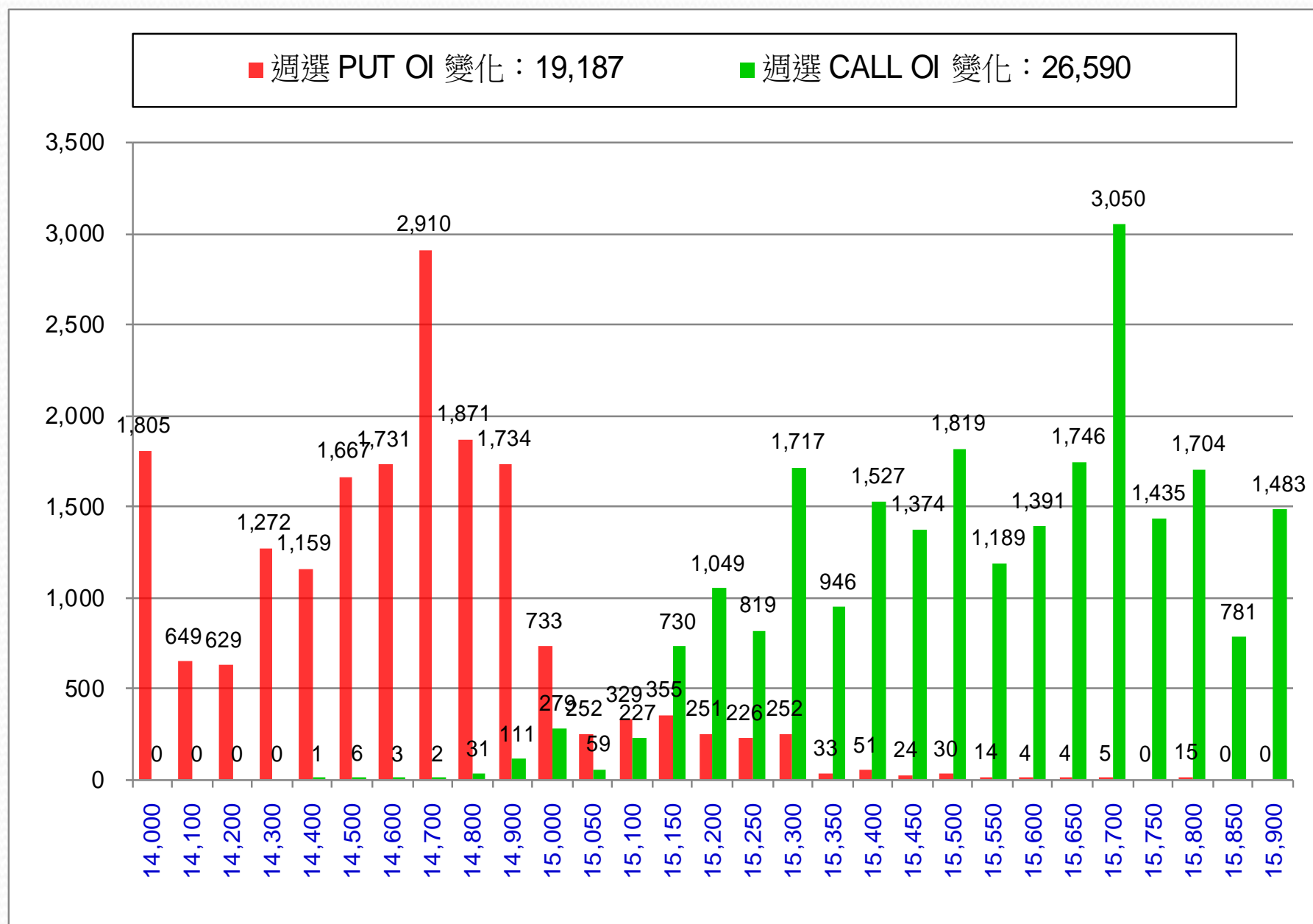
更新日期：2022年6月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



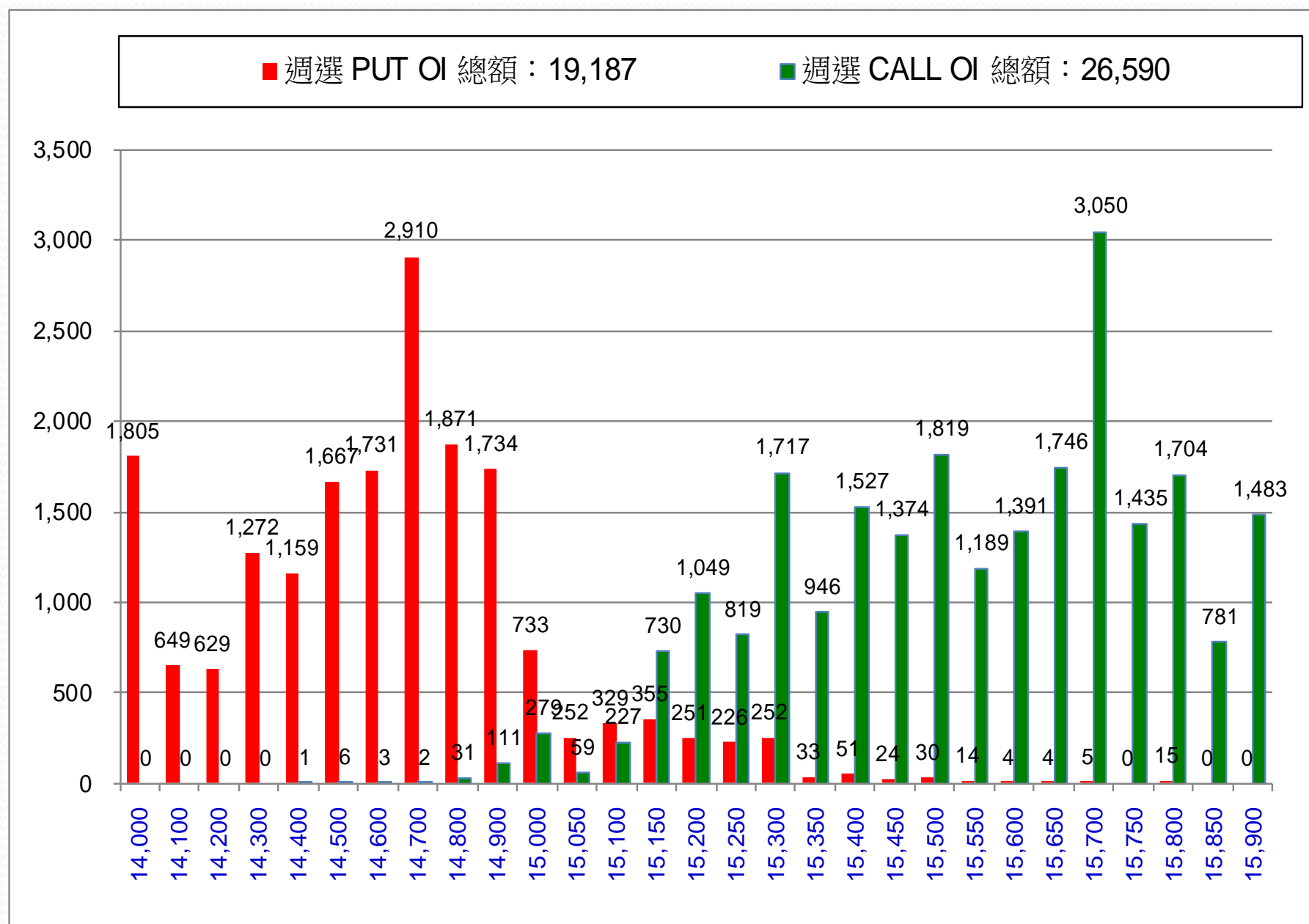
更新日期：2022年6月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年6月29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



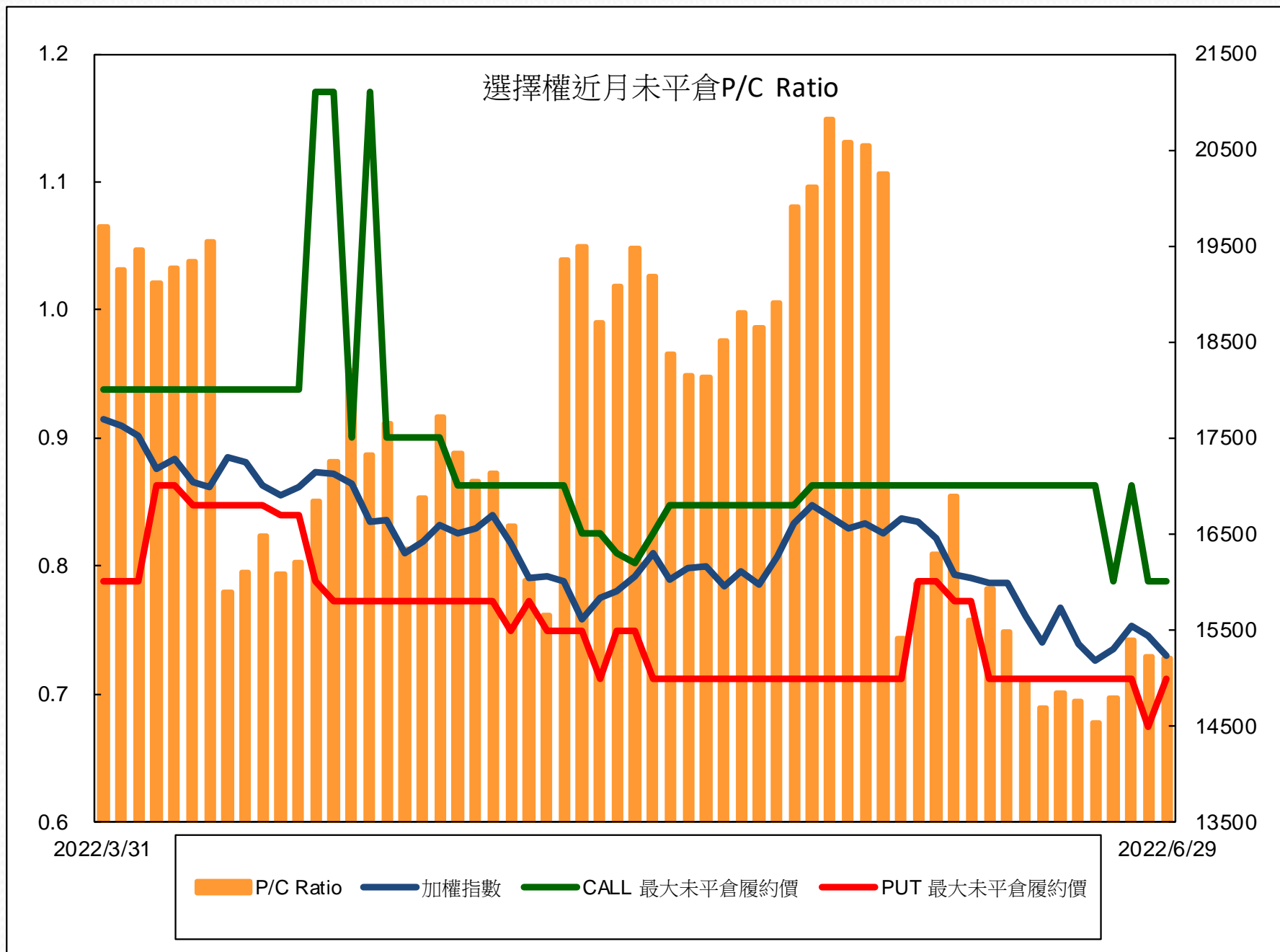
更新日期：2022年6月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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28日	62,487	86,614	-24,127
	6月29日	46,588	69,414	-22,826
Put	6月28日	70,412	50,038	20,374
	6月29日	48,866	30,658	18,208

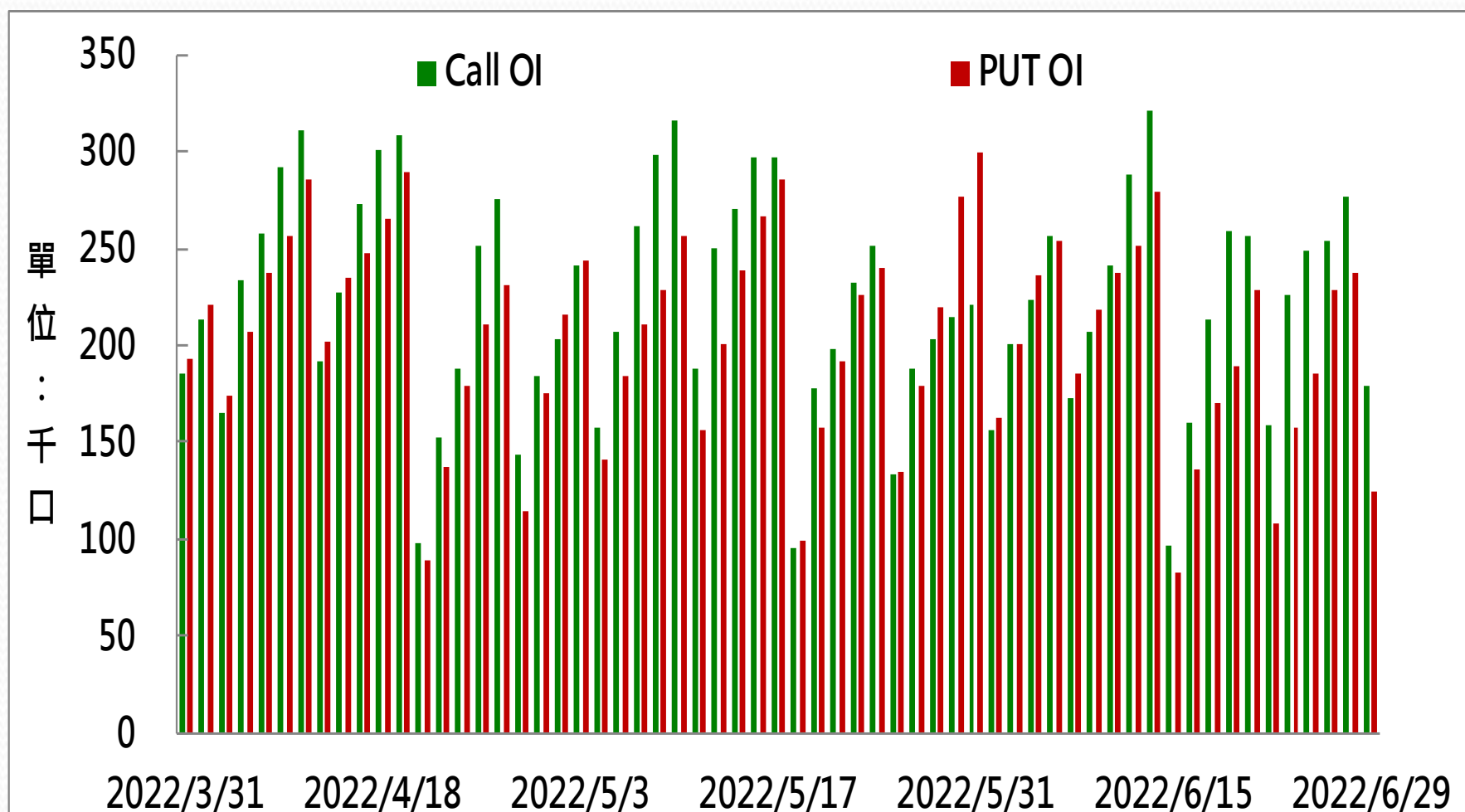
更新日期：2022年6月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年6月29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29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29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