

台指選擇權OI匯報

日期：2022/6/30 結算日：2022/7/6					日期：2022/6/30 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	13,400	0	0	0	0	13,300	1,477	311
0	0	13,500	0	0	0	518	13,400	1,430	2
0	0	13,600	0	0	0	16	13,500	2,307	-372
0	0	13,700	3,310	3,310	0	10	13,600	2,536	-318
0	0	13,800	1,537	794	7	7	13,700	1,519	132
0	0	13,900	2,210	1,790	4	327	13,800	1,946	267
1	1	14,000	3,976	2,171	5	5	13,900	2,454	404
0	0	14,100	4,299	3,650	-2	2	14,000	5,312	548
4	4	14,200	4,955	4,326	5	9	14,100	2,230	391
2	2	14,300	5,207	3,935	14	26	14,200	4,917	-48
20	21	14,400	4,244	3,085	4	21	14,300	3,927	961
55	61	14,500	4,658	2,991	52	236	14,400	3,512	337
252	255	14,600	3,961	2,230	116	167	14,500	5,379	-1,549
805	807	14,700	4,024	1,114	67	251	14,600	3,255	-1,247
1,295	1,326	14,800	3,399	1,528	363	517	14,700	2,516	-568
1,397	1,397	14,850	785	785	186	874	14,800	3,093	-308
1,865	1,976	14,900	1,862	128	971	1,479	14,900	2,840	-723
1,676	1,676	14,950	353	353	2,527	3,841	15,000	6,327	-735
3,467	3,746	15,000	1,014	281	833	2,250	15,100	1,970	-162
2,450	2,509	15,050	441	189	1,089	3,597	15,200	2,230	-387
5,017	5,244	15,100	716	387	1,341	4,582	15,300	2,193	-78
3,601	4,331	15,150	275	-80	836	6,170	15,400	3,104	-262
4,658	5,707	15,200	349	98	-605	6,212	15,500	2,374	-213
3,624	4,443	15,250	331	105	174	6,524	15,600	1,658	-38
5,445	7,162	15,300	215	-37	102	5,637	15,700	703	-35
3,808	4,754	15,350	65	32	289	5,666	15,800	731	-23
※ 5,654	7,181	15,400	57	6	-864	5,518	15,900	269	-1
1,684	3,058	15,450	23	-1	-635	9,106	16,000	2,690	-5
2,990	4,809	15,500	44	14	61	4,681	16,100	694	-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
64,592	91,182	0.5747	52,405	33,218	6,411	132,546	0.6703	88,847	-2,928
昨日 P/C	0.7216	今日增減變化		-0.1469	昨日 P/C	0.7276	今日增減變化		-0.0573

更新日期：2022年6月30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30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	96,205,344	148,995,887	-52,790,543	7,194,377	3,079,353	1,872,651	1,206,702	-58,835
投信	73,412,480	71,865,261	1,547,219	-4,468,190	618,002	15,983	602,019	820
自營商	36,665,639	21,951,562	14,714,077	-351,997	1,438,313	1,227,978	210,335	-58,595
	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	1,628,622	2,598,865	-970,243	202,755	4,406	487,608	-483,202	-9,202
投信	60,723	0	60,723	-1,170	0	0	0	0
自營商	632,000	642,793	-10,793	-29,835	612,437	138,025	474,412	9,391

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30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	33,225	17,929	15,296	-858	37,027	13,007	24,020	6,068
投信	0	0	0	100	900	95	805	250
自營商	57,059	84,205	-27,146	-4,320	52,217	36,508	15,709	-2,499
特定法人(週)	656	0	656	656	0	2,495	-2,495	-2,495
特定法人(近月)	21,774	10,541	11,233	-1,886	7,488	24,492	-17,004	-2,887
特定法人(全月)	22,132	7,984	14,148	752	8,032	30,142	-22,110	-5,263
十大交易人(週)	30,664	39,151	-8,487	-4,591	18,773	18,727	46	-3,302
十大交易人(近月)	57,414	59,899	-2,485	-2,346	25,070	55,664	-30,594	257
十大交易人(全月)	95,361	100,871	-5,510	-11,012	43,792	80,429	-36,637	-4,392
全市場未沖銷(近月)			132,546	6,411			88,847	-2,928
全市場未沖銷(全月)			251,875	73,237			155,391	30,729

更新日期：2022年6月30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	15300	買權OI最大量	15400
	賣權成交最大量	14700	賣權OI最大量	14300
	整體隱含波動率	20.24%	較前一交易日	+2.79%
	買權隱含波動率	18.50%	較前一交易日	+4.29%
	賣權隱含波動率	22.30%	較前一交易日	+0.78%
電子選擇權	買權成交最大量	710	買權OI最大量	740
	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	1620	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30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	15500	買權OI最大量	16000
	賣權成交最大量	14500	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	23.99%	較前一交易日	-8.59%
	買權隱含波動率	18.77%	較前一交易日	+3.75%
	賣權隱含波動率	31.24%	較前一交易日	+0.23%
	成交量P/C_Ratio值	0.737	較前一交易日	+0.12
	未平倉P/C_Ratio值	0.670	較前一交易日	-0.06
電子選擇權	買權成交最大量	710	買權OI最大量	740
	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	1620	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30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

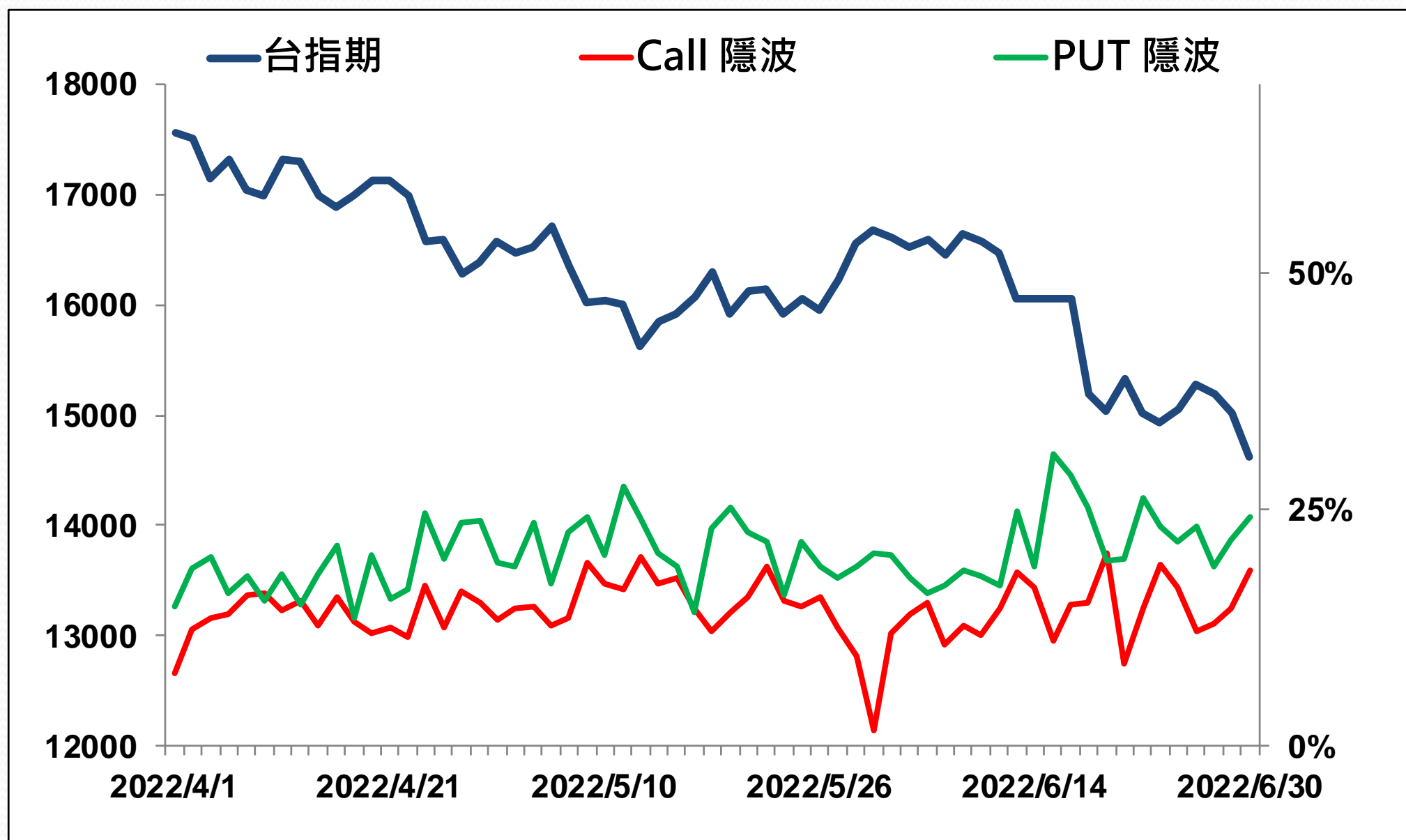
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



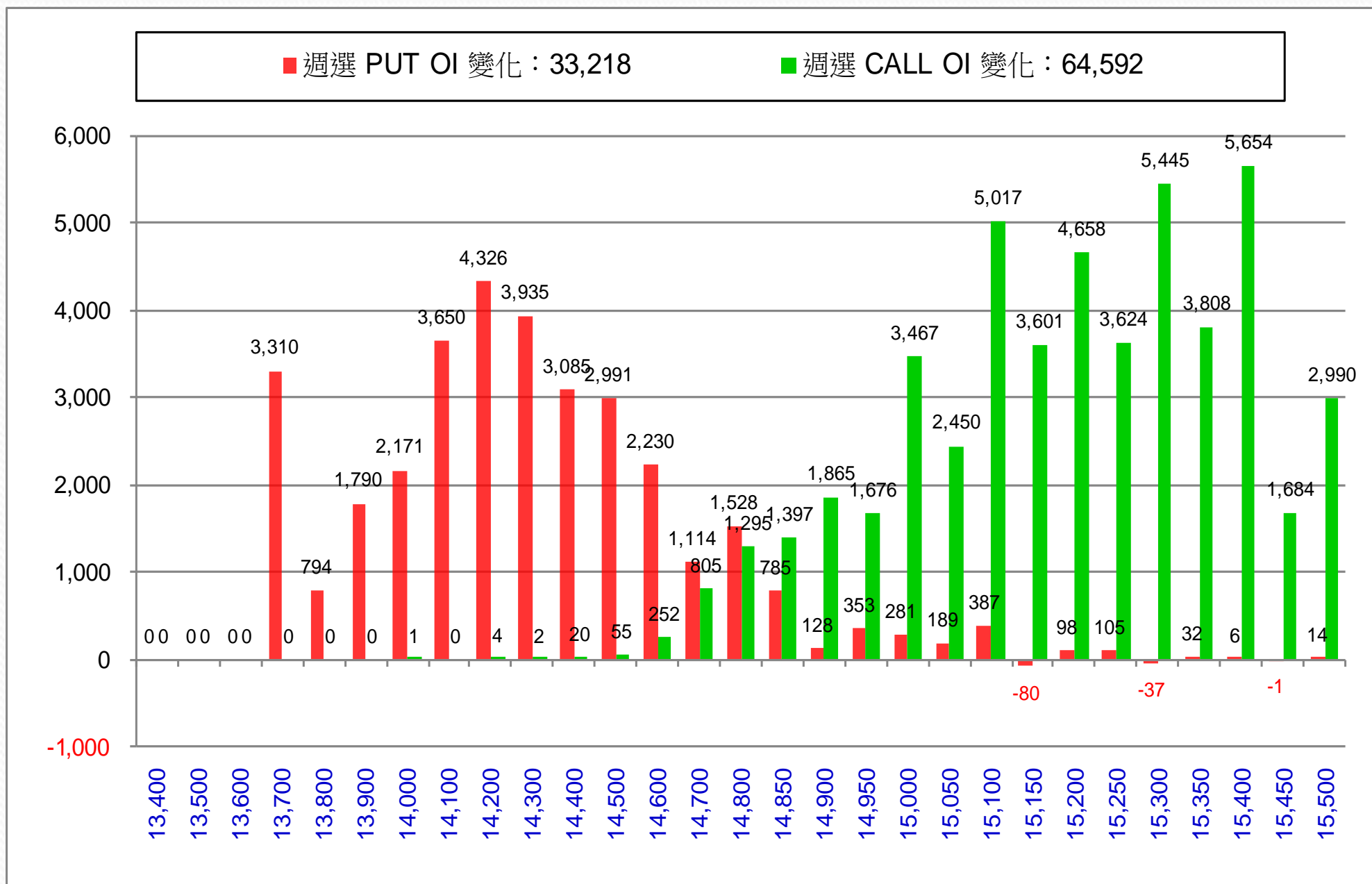
更新日期：2022年6月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年6月30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

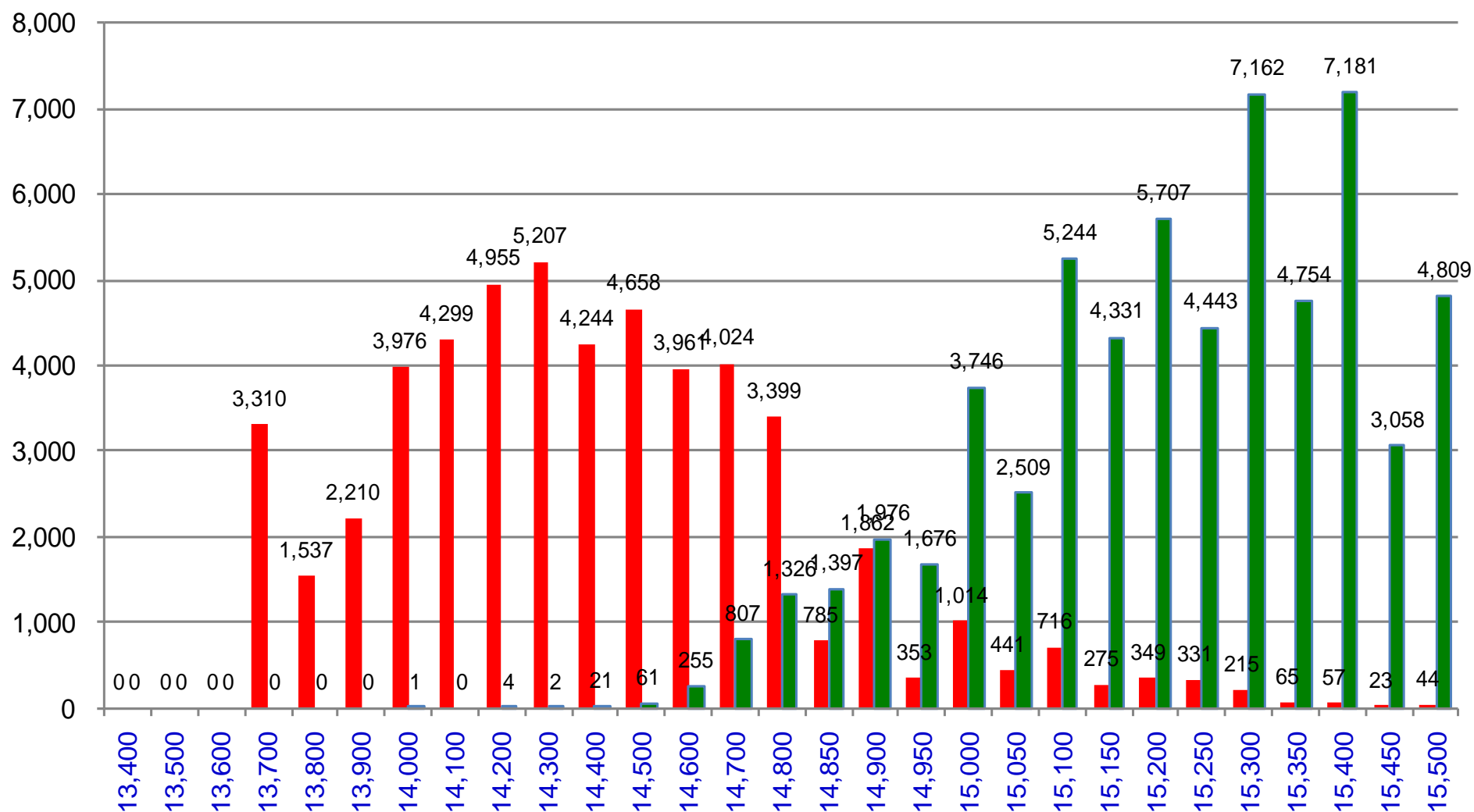


更新日期：2022年6月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：52,405

週選 CALL OI 總額：91,182



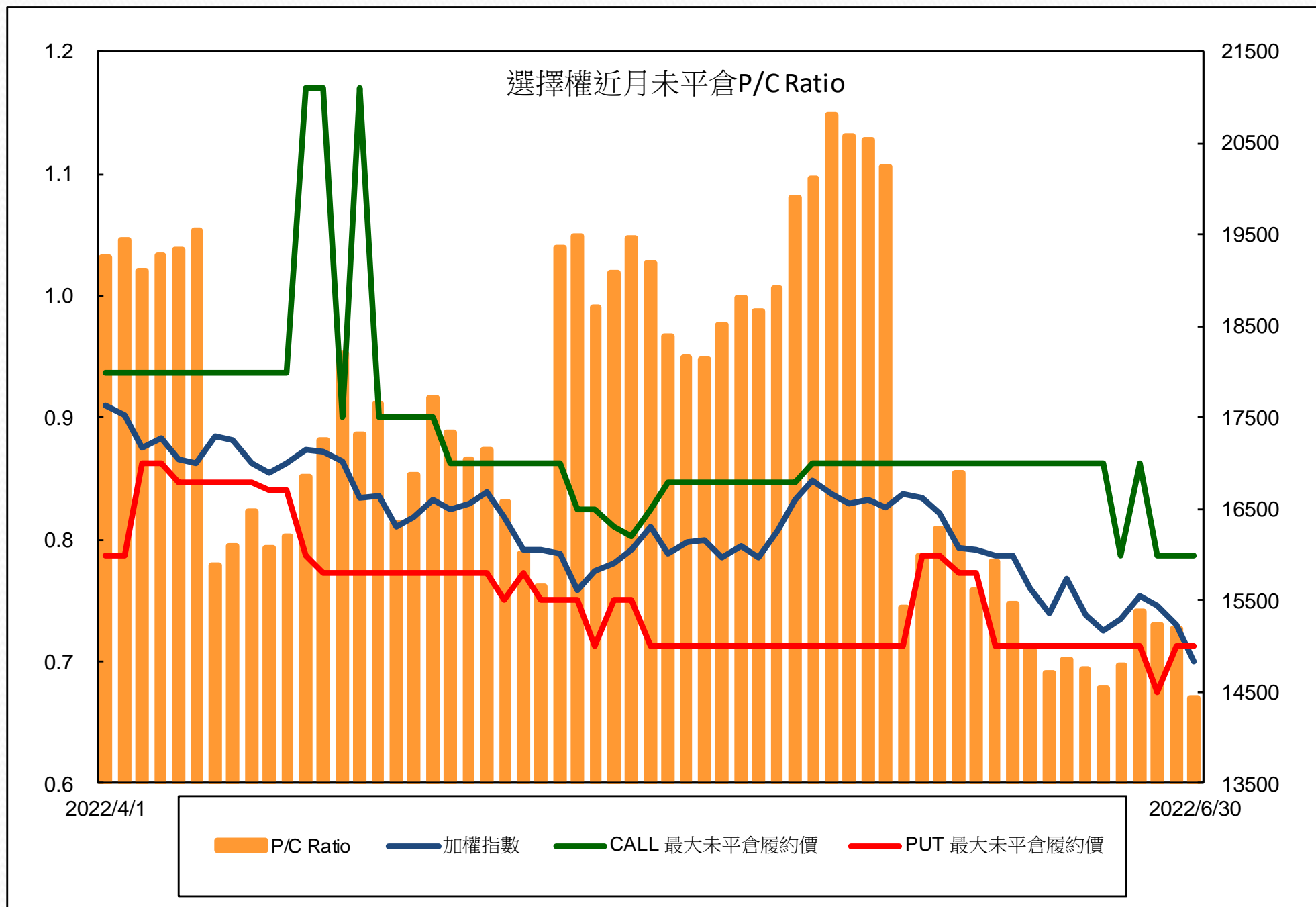
更新日期：2022年6月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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29日	46,588	69,414	-22,826
	6月30日	57,059	84,205	-27,146
Put	6月29日	48,866	30,658	18,208
	6月30日	52,217	36,508	15,709

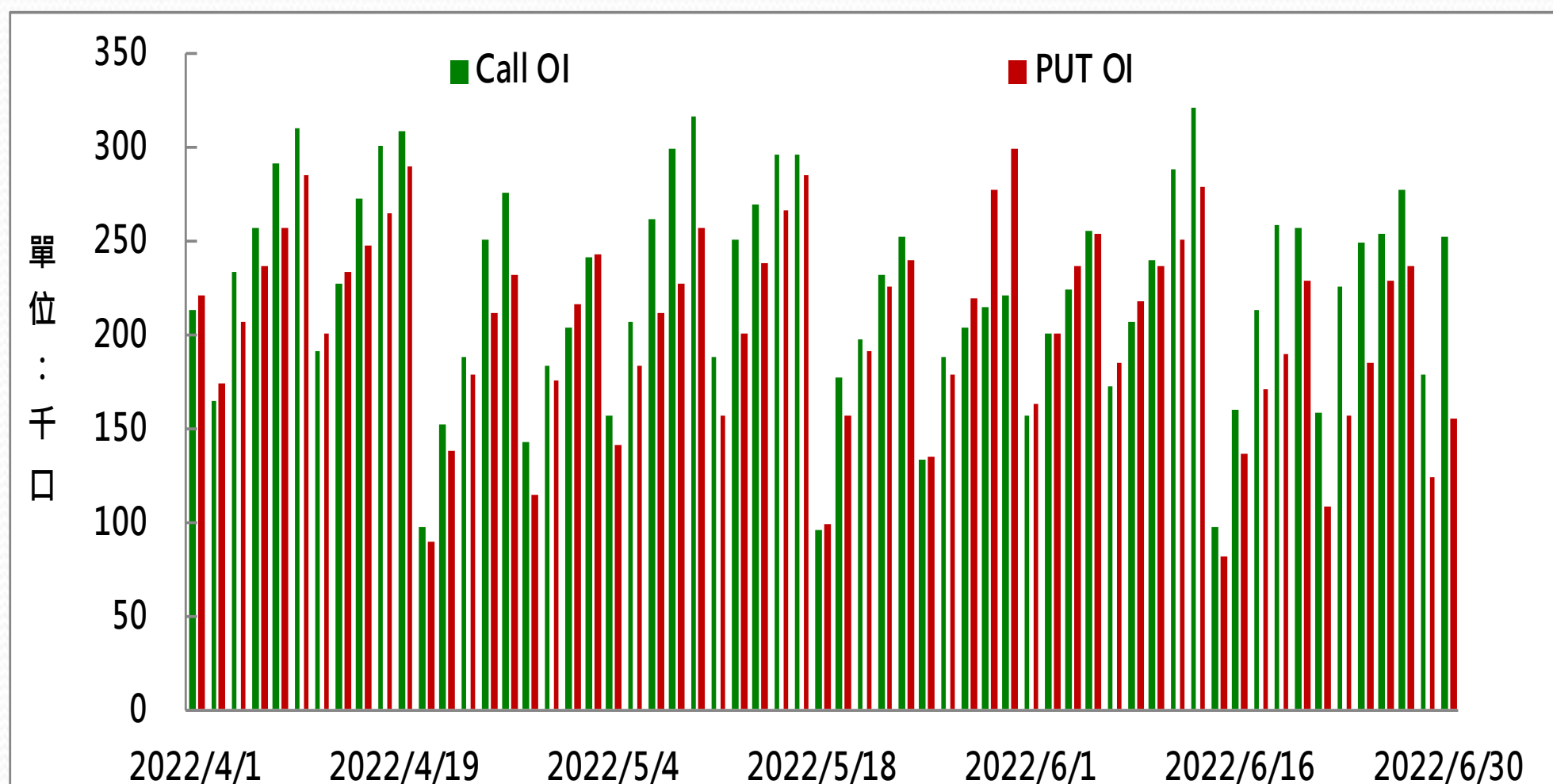
更新日期：2022年6月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年6月30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30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30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