

台指選擇權OI匯報

日期：2022/7/1 結算日：2022/7/6					日期：2022/7/1 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	13,200	0	0	4	4	13,200	5,952	805
0	0	13,300	2,533	2,533	2	2	13,300	1,776	299
0	0	13,400	1,116	1,116	0	518	13,400	1,813	383
1	1	13,500	2,527	2,527	1	17	13,500	2,389	82
1	1	13,600	972	972	1	11	13,600	2,753	217
0	0	13,700	3,855	545	-2	5	13,700	1,841	322
38	38	13,800	3,937	2,400	211	538	13,800	2,196	250
32	32	13,900	5,066	2,856	34	39	13,900	2,751	297
119	120	14,000	6,920	2,944	73	75	14,000	5,510	198
60	60	14,100	6,034	1,735	86	95	14,100	2,130	-100
377	381	14,200	6,335	1,380	386	412	14,200	4,710	-207
1,637	1,639	14,300	5,156	-51	649	670	14,300	3,417	-510
1,933	1,954	14,400	3,771	-473	571	807	14,400	2,225	-1,287
1,694	1,694	14,450	570	570	979	1,146	14,500	4,058	-1,321
3,865	3,926	14,500	3,601	-1,057	910	1,161	14,600	2,715	-540
1,377	1,377	14,550	185	185	808	1,325	14,700	2,060	-456
2,905	3,160	14,600	2,566	-1,395	3,186	4,060	14,800	2,729	-364
1,936	1,936	14,650	688	688	1,418	2,897	14,900	2,491	-349
5,834	6,641	14,700	3,058	-966	2,220	6,061	15,000	5,948	-379
2,002	2,002	14,750	221	221	874	3,124	15,100	1,687	-283
6,202	7,528	14,800	2,485	-914	700	4,297	15,200	2,040	-190
2,849	4,246	14,850	680	-105	-80	4,502	15,300	1,840	-353
4,688	6,664	14,900	1,166	-696	-2,035	4,135	15,400	2,256	-848
2,943	4,619	14,950	348	-5	562	6,774	15,500	2,079	-295
5,149	8,895	15,000	727	-287	204	6,728	15,600	1,640	-18
420	4,751	15,150	255	-20	-601	4,917	15,900	265	-4
56	5,763	15,200	324	-25	862	9,968	16,000	2,660	-30
422	4,865	15,250	288	-43	-633	4,048	16,100	690	-4
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
40,273	131,455	0.5089	66,895	14,490	8,400	140,946	0.6079	85,676	-3,171
昨日 P/C	0.5747	今日增減變化	-0.0658		昨日 P/C	0.6703	今日增減變化	-0.0624	

更新日期：2022年7月1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7月1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	99,897,182	143,119,489	-43,222,307	9,568,236	3,553,378	1,270,155	2,283,223	1,076,521	
投信	70,770,105	74,747,610	-3,977,505	-5,524,724	669,440	15,272	654,168	52,149	
自營商	32,791,290	20,772,017	12,019,273	-2,694,804	2,847,778	1,147,843	1,699,935	1,489,600	
	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	1,572,760	2,719,643	-1,146,883	-176,640	1,457	489,451	-487,994	-4,792	
投信	69,183	0	69,183	8,460	0	0	0	0	
自營商	868,362	774,428	93,934	104,727	1,163,820	496,527	667,293	192,881	

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報								2022年7月1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	37,835	21,865	15,970	674	38,428	14,742	23,686	-334	
投信	0	0	0	0	900	95	805	0	
自營商	66,103	104,279	-38,176	-11,030	49,566	34,314	15,252	-457	
特定法人(週)	0	0	0	-656	0	2,495	-2,495	0	
特定法人(近月)	26,192	12,205	13,987	2,754	8,437	25,242	-16,805	199	
特定法人(全月)	26,765	9,370	17,395	3,247	9,754	29,538	-19,784	2,326	
十大交易人(週)	37,371	55,818	-18,447	-9,960	18,501	22,352	-3,851	-3,897	
十大交易人(近月)	55,748	64,647	-8,899	-6,414	25,273	50,654	-25,381	5,213	
十大交易人(全月)	102,581	122,254	-19,673	-14,163	43,138	77,785	-34,647	1,990	
全市場未沖銷(近月)			140,946	8,400			85,676	-3,171	
全市場未沖銷(全月)			302,167	50,292			166,126	10,735	

更新日期：2022年7月1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	15000	買權OI最大量	15000
	賣權成交最大量	14300	賣權OI最大量	14000
	整體隱含波動率	21.26%	較前一交易日	+1.02%
	買權隱含波動率	21.72%	較前一交易日	+3.22%
	賣權隱含波動率	20.68%	較前一交易日	-1.62%
電子選擇權	買權成交最大量	735	買權OI最大量	705
	賣權成交最大量	635	賣權OI最大量	615
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	1460	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年7月1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	15000	買權OI最大量	16000
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	13200
	整體隱含波動率	27.54%	較前一交易日	-3.54%
	買權隱含波動率	22.52%	較前一交易日	+3.75%
	賣權隱含波動率	34.46%	較前一交易日	+3.23%
	成交量P/C_Ratio值	0.798	較前一交易日	+0.06
	未平倉P/C_Ratio值	0.608	較前一交易日	-0.06
電子選擇權	買權成交最大量	735	買權OI最大量	705
	賣權成交最大量	635	賣權OI最大量	615
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	1460	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年7月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

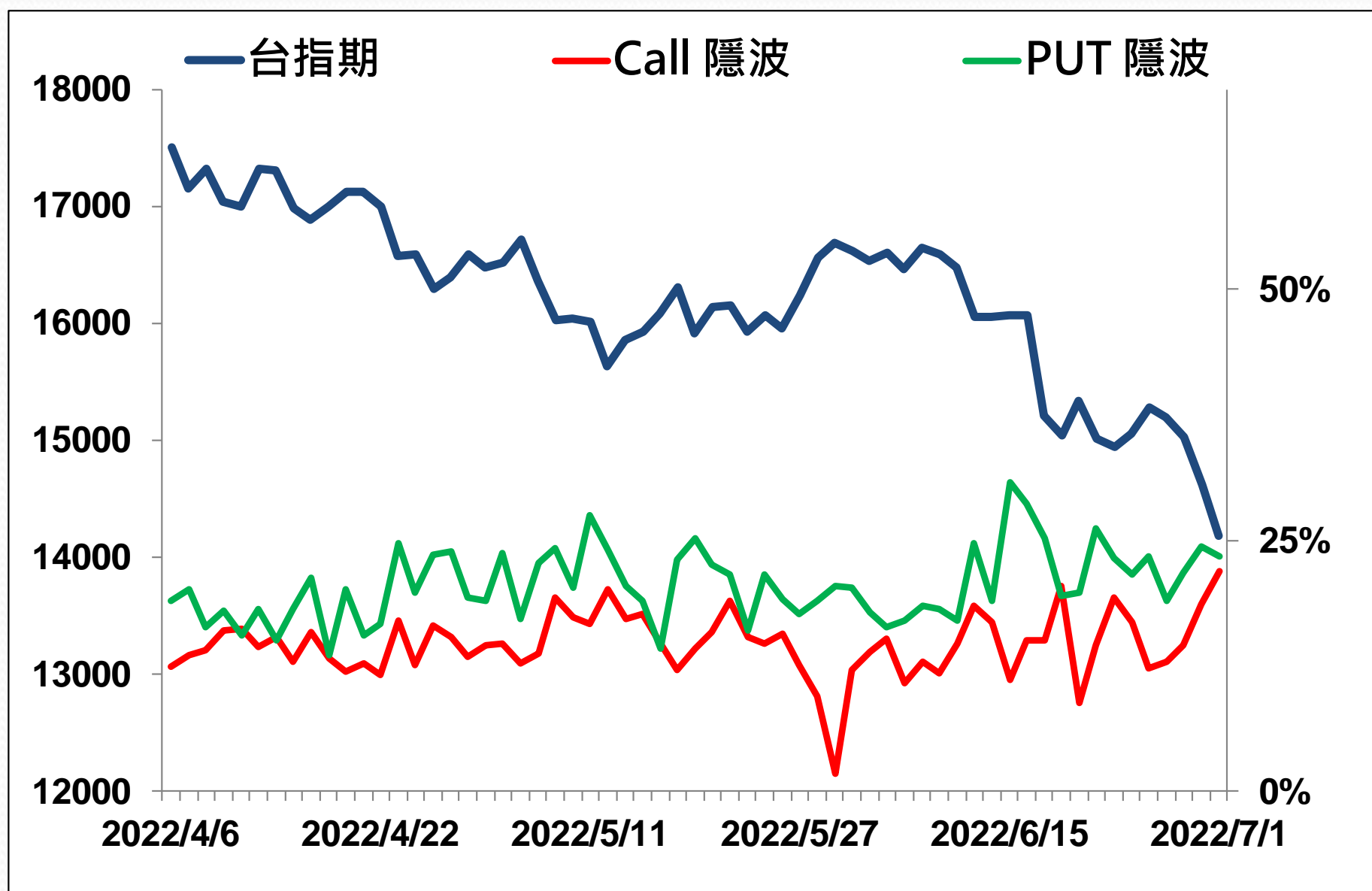
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



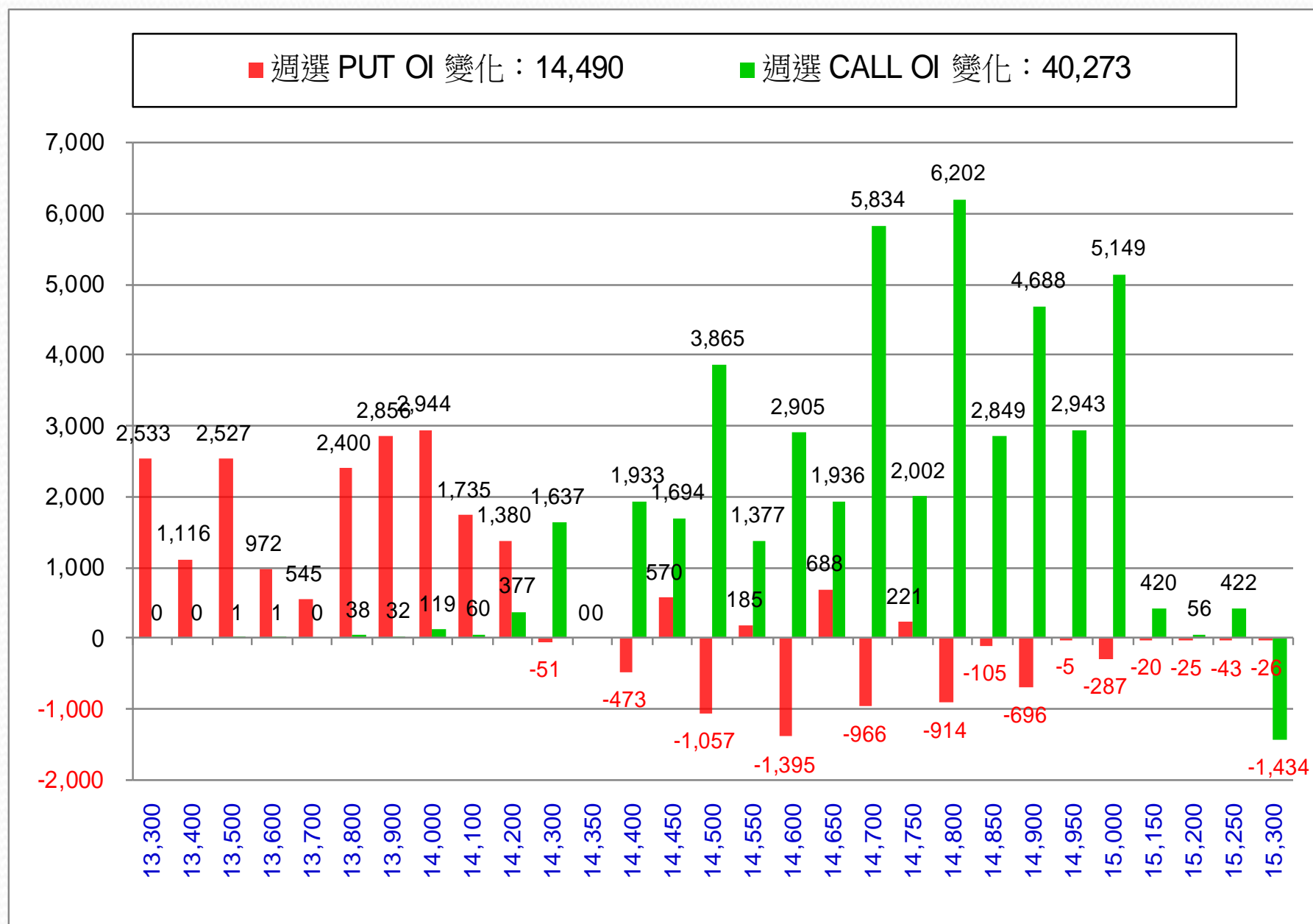
更新日期：2022年7月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



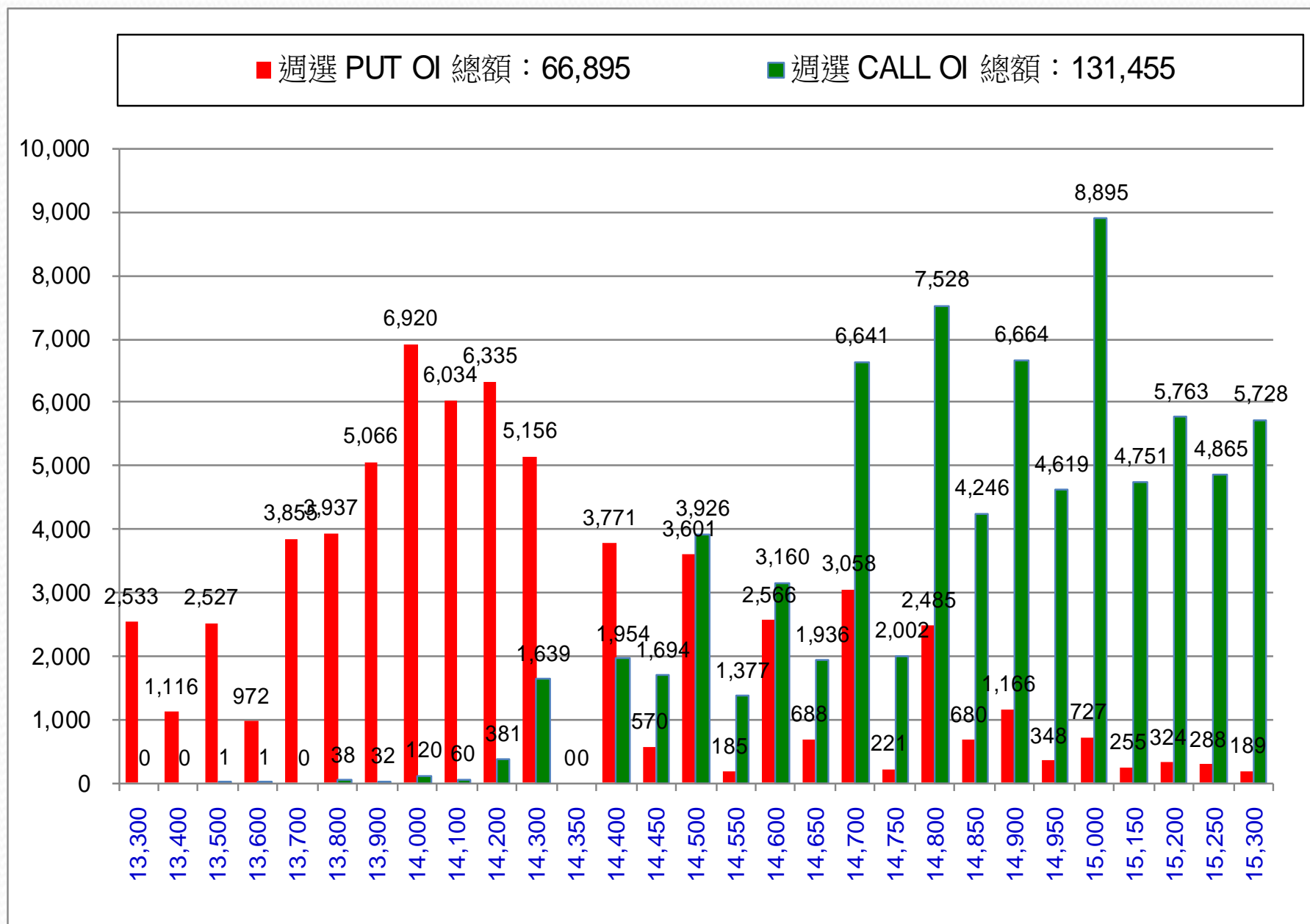
更新日期：2022年7月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年7月1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



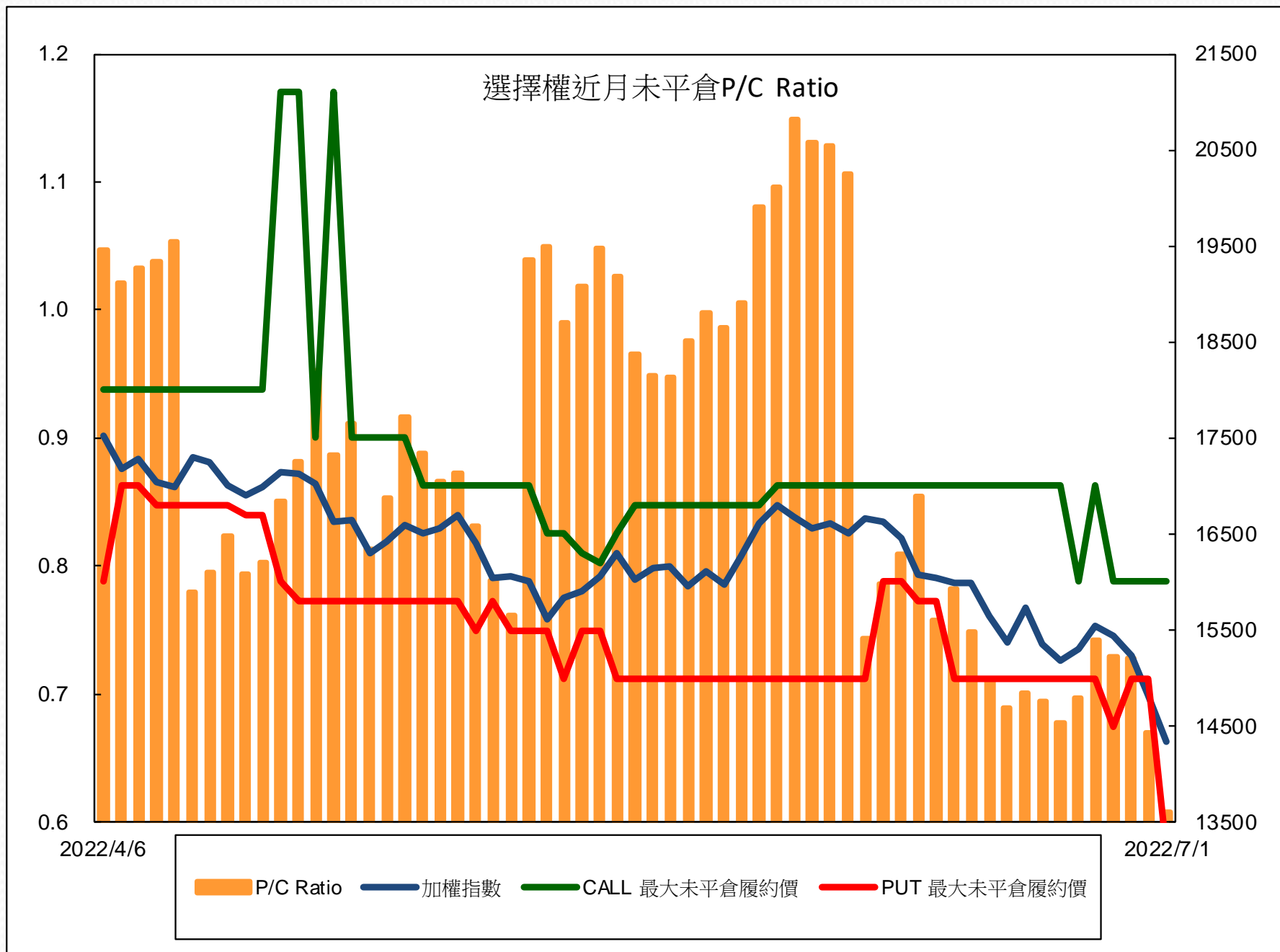
更新日期：2022年7月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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30日	57,059	84,205	-27,146
	7月1日	66,103	104,279	-38,176
Put	6月30日	52,217	36,508	15,709
	7月1日	49,566	34,314	15,252

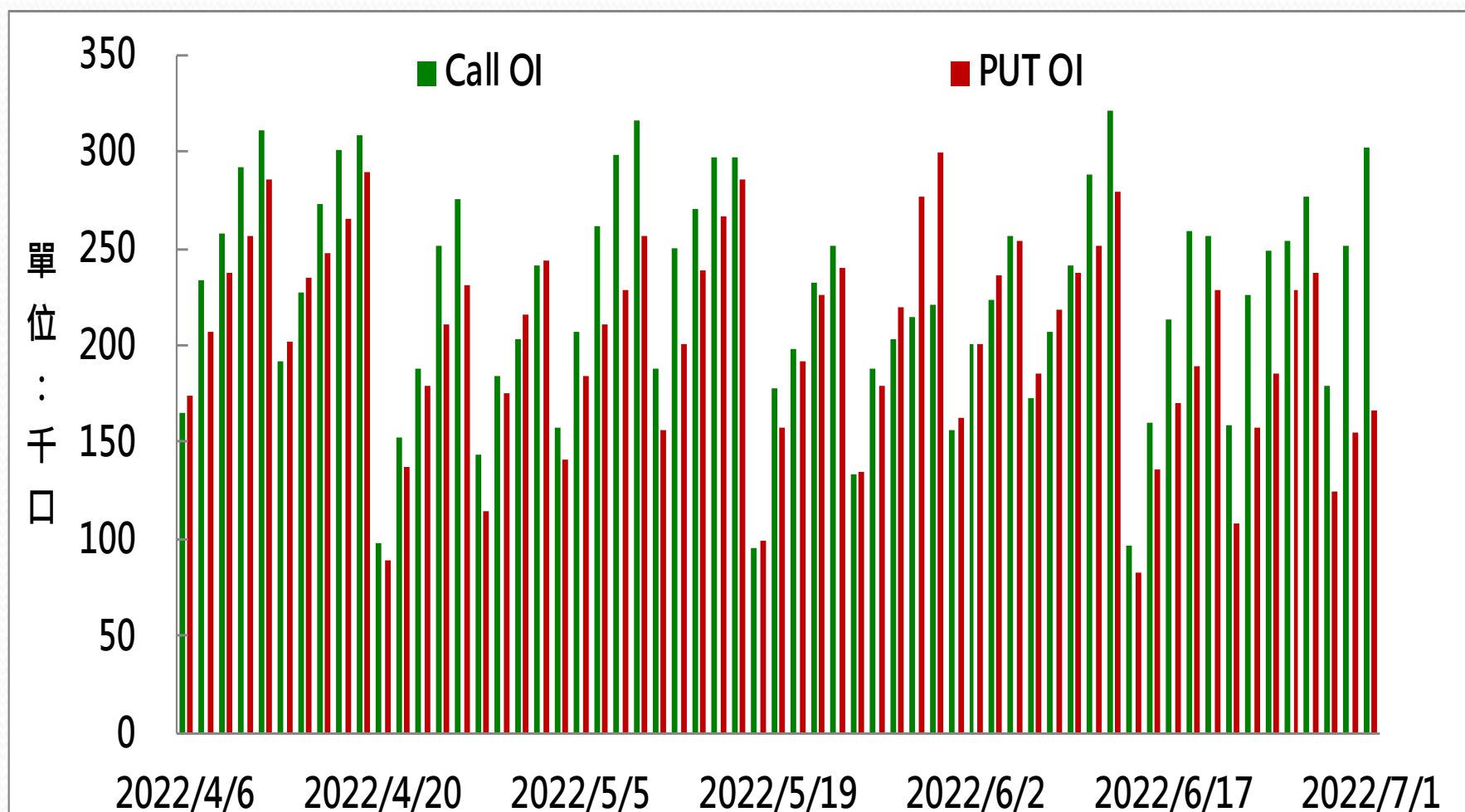
更新日期：2022年7月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年7月1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7月1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7月1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