

台指選擇權OI匯報

日期：2022/4/27 結算日：2022/5/4					日期：2022/4/27 結算日：2022/5/18				
202205W1					202205 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	15,300	435	435	0	0	15,100	1,018	139
0	0	15,400	888	888	0	61	15,200	2,369	98
0	0	15,500	915	915	1	2	15,300	1,592	404
5	5	15,600	630	630	0	2	15,400	1,812	613
2	2	15,700	852	852	1	13	15,500	5,349	1,852 ※
40	40	15,800	3,147	3,147 ※	0	0	15,600	2,443	597
31	31	15,900	770	770	3	3	15,700	1,849	335
17	17	16,000	1,453	1,453	114	371	15,800	7,631	-140
102	102	16,100	896	896	26	28	15,900	3,020	1,291
72	72	16,150	298	298	166	250	16,000	4,413	18
296	296	16,200	708	708	147	162	16,100	2,279	-451
175	175	16,250	232	232	361	416	16,200	4,671	-1,632
1,079	1,079	16,300	731	731	643	780	16,300	1,911	-538
465	465	16,350	160	160	845	1,086	16,400	3,103	-357
1,069	1,069	16,400	277	277	608	1,566	16,500	2,359	-378
913	913	16,450	142	142	710	2,695	16,600	3,100	-412
1,871	1,871	16,500	168	168	1,657	2,936	16,700	2,137	-192
904	904	16,550	47	47 ※	1,810	3,246	16,800	2,185	-61
2,738	2,738	16,600	37	37	730	2,240	16,900	1,634	-87
1,508	1,508	16,650	11	11	1,387	5,555	17,000	2,206	-162
2,411	2,411	16,700	42	42	869	4,681	17,100	1,335	-453
2,349	2,349	16,750	5	5	684	5,240	17,200	1,094	-73
※ 3,835	3,835	16,800	1	1	315	4,888	17,300	548	-53
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
27,773	27,773	0.5651	15,694	15,694	9,841	87,549	0.8129	71,171	306
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化	0.5651		昨日 P/C	0.9119	今日增減變化	-0.0990	

更新日期：2022年4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4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	71,801,137	113,805,648	-42,004,511	-9,944,318	5,056,221	1,568,224	3,487,997	233,274
投信	35,561,036	61,669,097	-26,108,061	-1,953,667	419,383	0	419,383	-17,995
自營商	64,112,333	16,631,951	47,480,382	313,245	1,015,954	1,314,232	-298,278	-35,873
	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	1,413,472	2,045,292	-631,820	427,213	8,102	137,734	-129,632	-41,180
投信	25,273	0	25,273	-467	1,620	0	1,620	-18
自營商	550,473	601,108	-50,635	6,454	228,476	98,809	129,667	44,486

臺指選擇權三大法人&大額交易者未平倉口數匯報

2022年4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	14,364	9,401	4,963	-9,129	40,828	13,416	27,412	8,243
投信	0	0	0	0	350	85	265	0
自營商	52,355	46,500	5,855	9,890	28,246	29,588	-1,342	-8,329
特定法人(週)	2,920	0	2,920	---	0	0	0	---
特定法人(近月)	6,968	4,867	2,101	612	8,501	22,241	-13,740	-4,554
特定法人(全月)	10,826	2,971	7,855	-9,352	9,701	36,801	-27,100	-8,904
十大交易者(週)	10,182	15,503	-5,321	---	5,993	4,553	1,440	---
十大交易者(近月)	35,899	34,324	1,575	-2,424	24,119	40,694	-16,575	-6,859
十大交易者(全月)	66,419	52,205	14,214	4,706	39,185	62,780	-23,595	-4,821
全市場未沖銷(近月)			87,549	9,841			71,171	306
全市場未沖銷(全月)			143,473	-132,220			114,764	-116,946

更新日期：2022年4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05W1週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16800	買權OI最大量	16800
	賣權成交最大量	15800	賣權OI最大量	15800
	整體隱含波動率	19.19%	較前一交易日	+3.40%
	買權隱含波動率	16.22%	較前一交易日	+3.91%
	賣權隱含波動率	23.54%	較前一交易日	+4.10%
電子選擇權	買權成交最大量	760	買權OI最大量	830
	賣權成交最大量	705	賣權OI最大量	700
金融選擇權	買權成交最大量	1900	買權OI最大量	2040
	賣權成交最大量	1740	賣權OI最大量	1760

更新日期：2022年4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05月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	17000	買權OI最大量	17500
	賣權成交最大量	16000	賣權OI最大量	15800
	整體隱含波動率	20.19%	較前一交易日	-1.92%
	買權隱含波動率	16.68%	較前一交易日	+2.96%
	賣權隱含波動率	23.56%	較前一交易日	+0.66%
	成交量P/C_Ratio值	0.961	較前一交易日	+0.02
	未平倉P/C_Ratio值	0.813	較前一交易日	-0.10
電子選擇權	買權成交最大量	760	買權OI最大量	830
	賣權成交最大量	705	賣權OI最大量	700
金融選擇權	買權成交最大量	1900	買權OI最大量	2040
	賣權成交最大量	1740	賣權OI最大量	1760

更新日期：2022年4月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

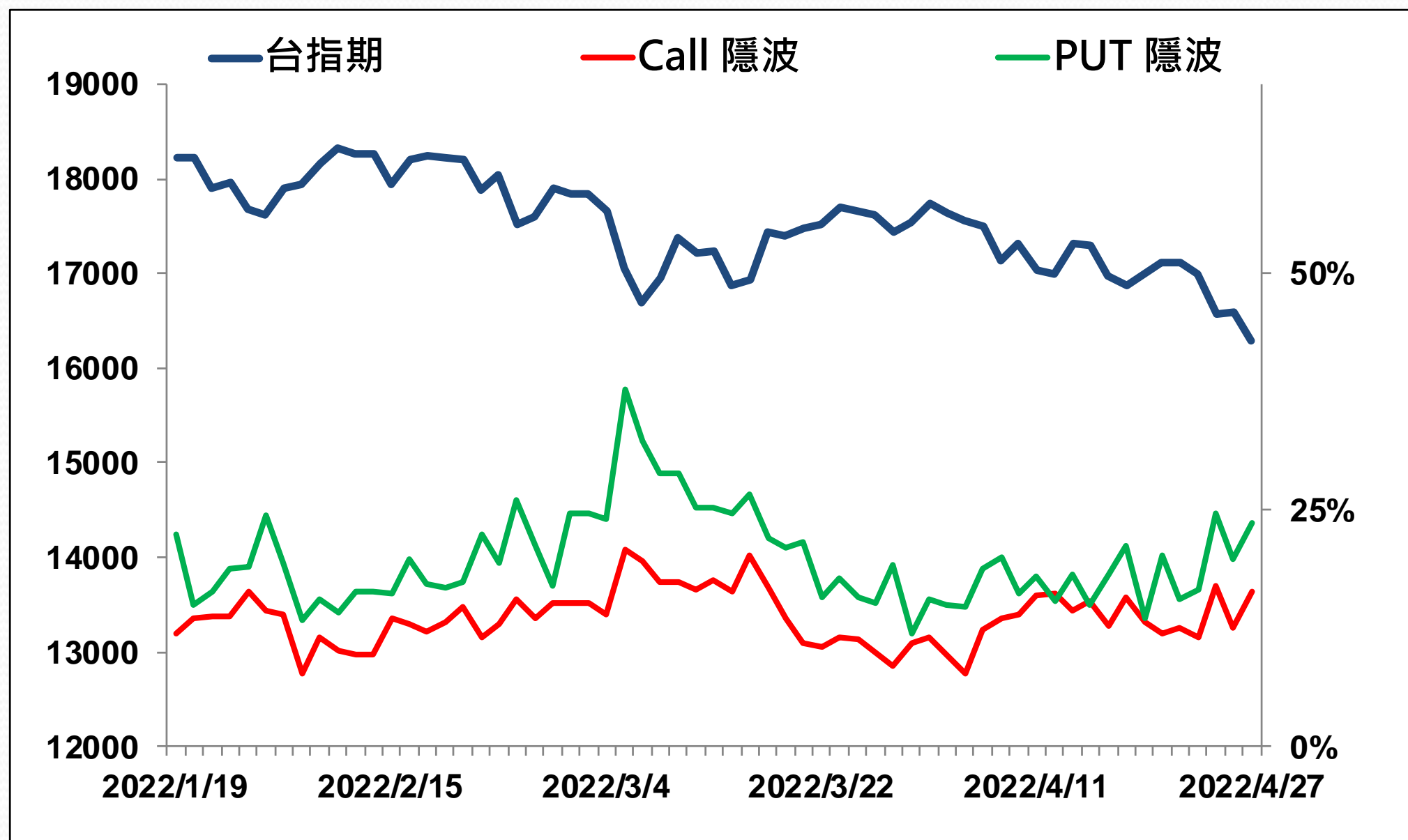
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



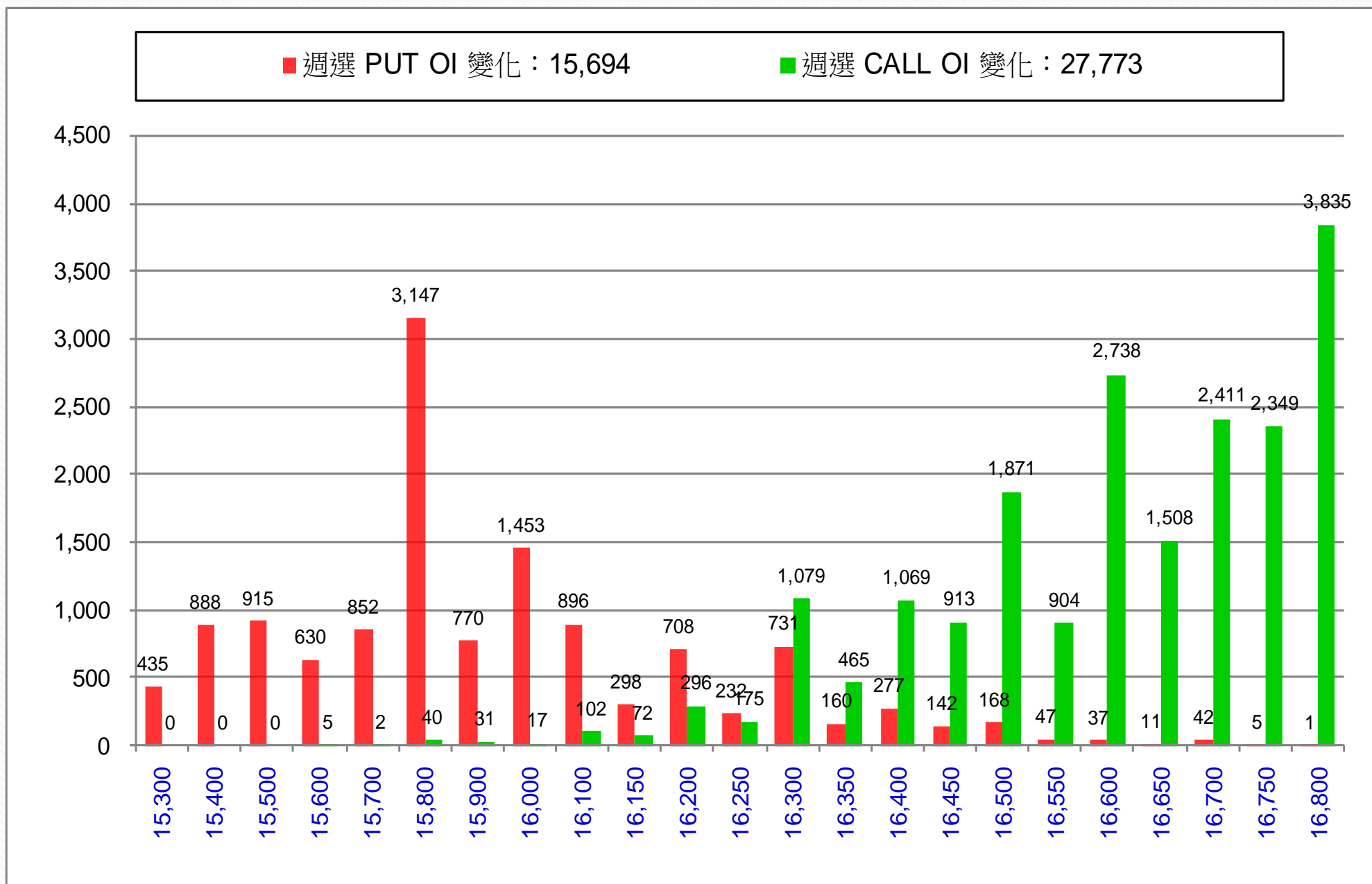
更新日期：2022年4月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年4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

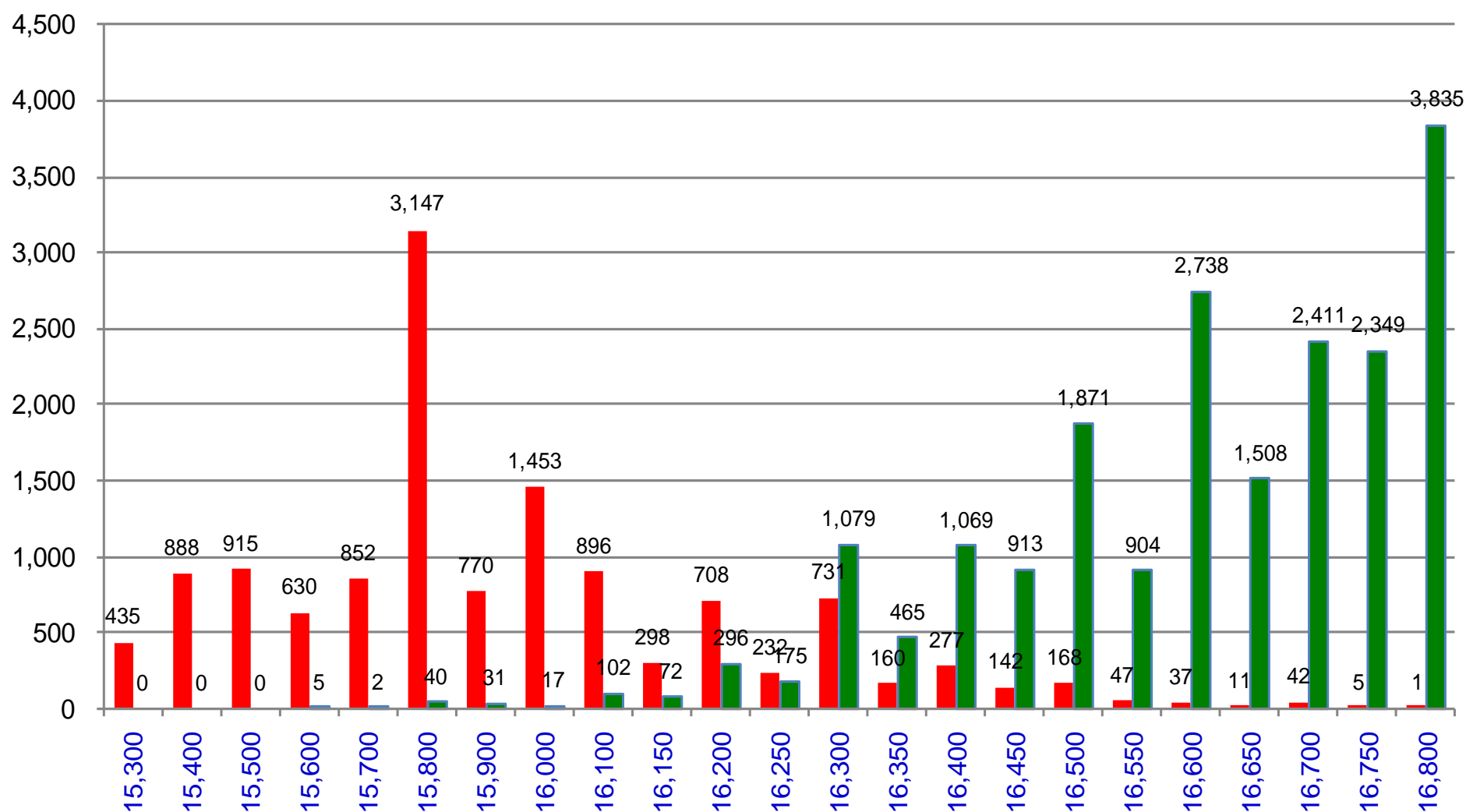


更新日期：2022年4月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：15,694

■ 週選 CALL OI 總額：27,773



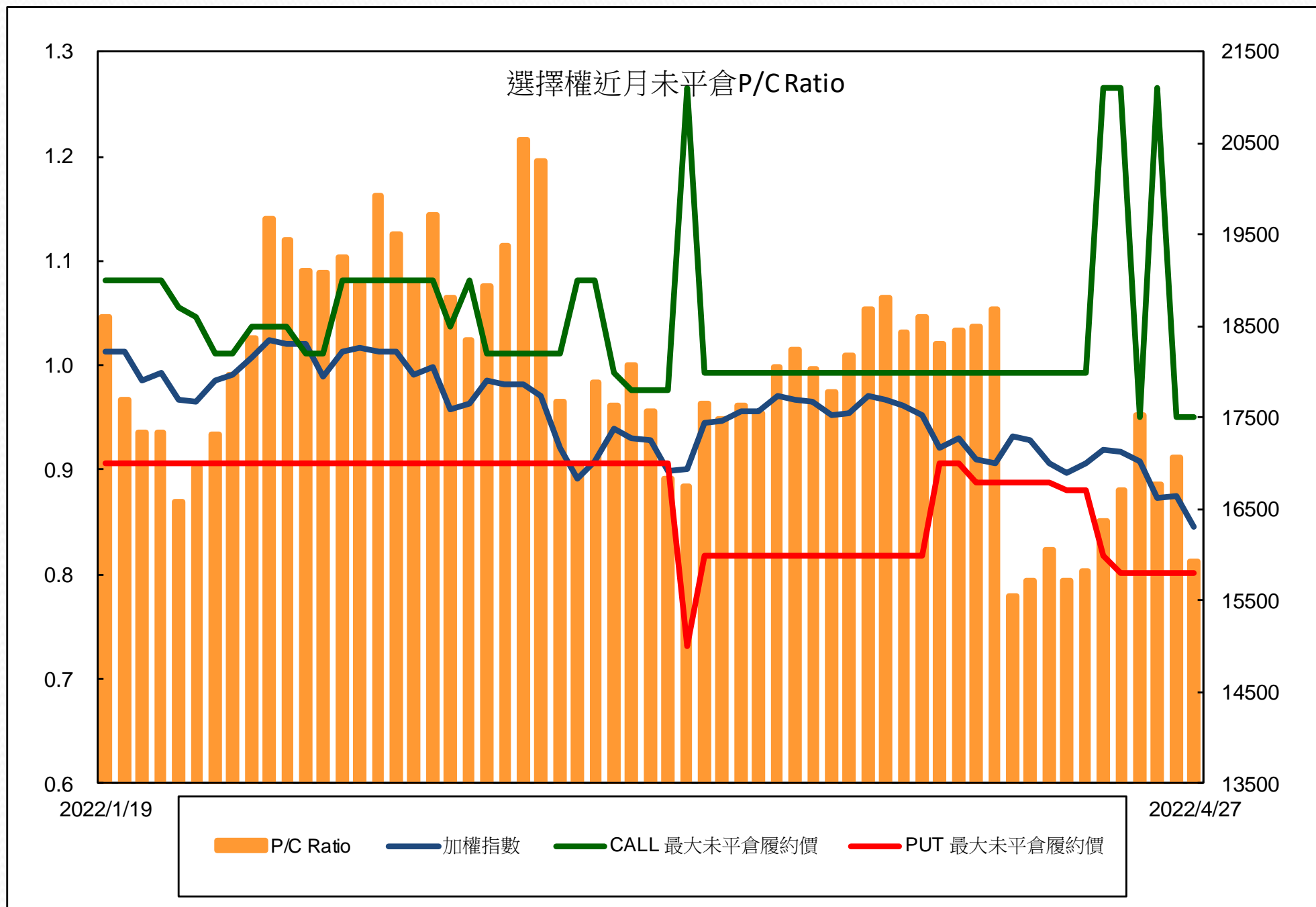
更新日期：2022年4月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	4月26日	68,354	72,389	-4,035
	4月27日	52,355	46,500	5,855
Put	4月26日	53,001	46,014	6,987
	4月27日	28,246	29,588	-1,342

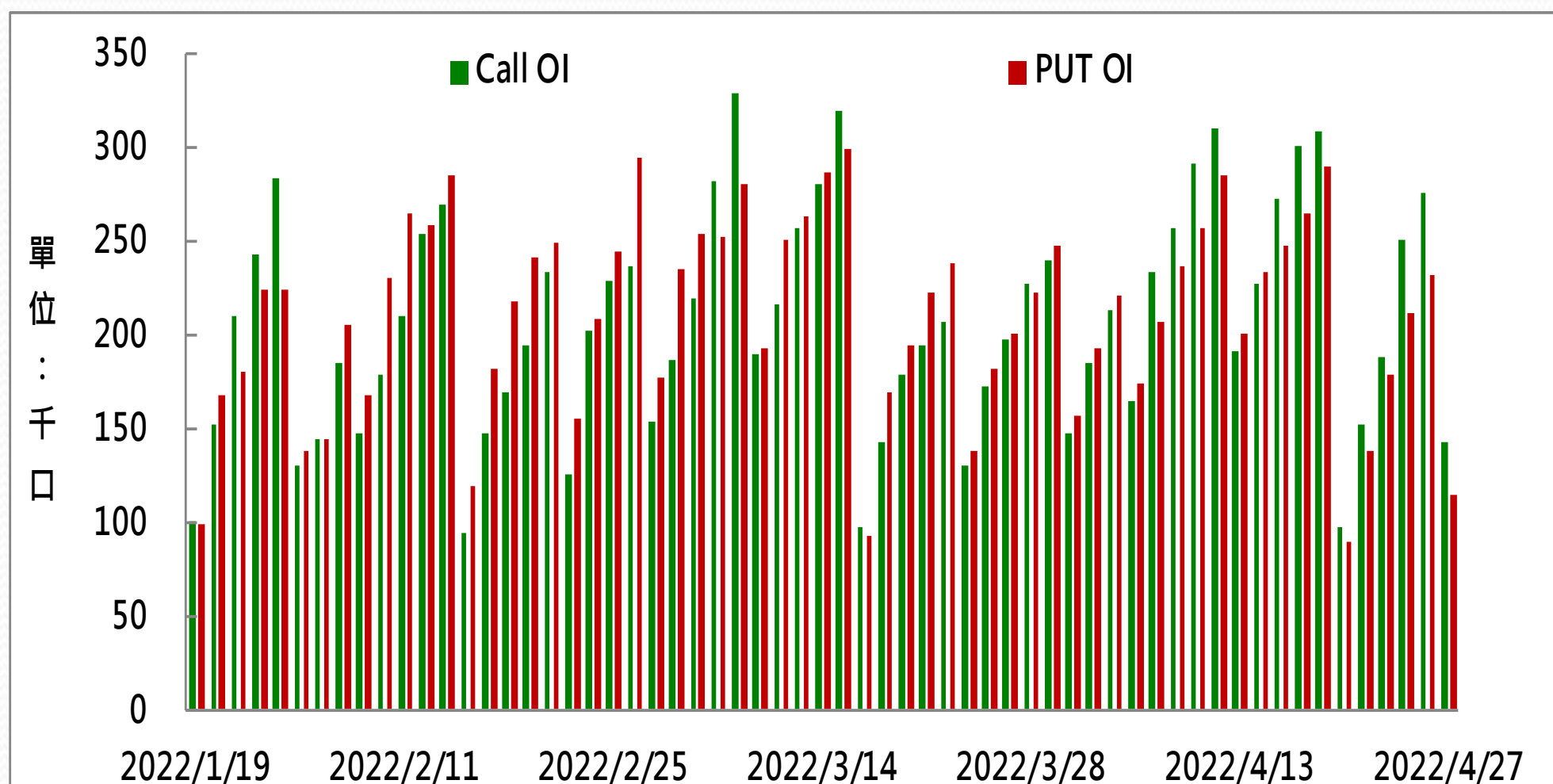
更新日期：2022年4月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年4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4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4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