

台指選擇權OI匯報

日期：2022/4/28 結算日：2022/5/4					日期：2022/4/28 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
-1	39	15,800	5,240	2,093	0	61	15,200	2,415	46
0	0	15,850	1,091	1,091	0	2	15,300	1,863	271
32	63	15,900	3,219	2,449	1	3	15,400	2,056	244
21	21	15,950	757	757	8	21	15,500	6,089	740
84	101	16,000	6,066	4,613	2	2	15,600	2,684	241
14	14	16,050	769	769	1	4	15,700	2,164	315
243	345	16,100	4,299	3,403	1	372	15,800	7,474	-157
130	202	16,150	1,668	1,370	27	55	15,900	3,784	764
347	643	16,200	2,452	1,744	19	269	16,000	5,534	1,121 ※
630	805	16,250	1,888	1,656	50	212	16,100	2,765	486
1,057	2,136	16,300	2,941	2,210	322	738	16,200	5,185	514
801	1,266	16,350	1,324	1,164	81	861	16,300	2,251	340
860	1,929	16,400	1,668	1,391	221	1,307	16,400	3,427	324
1,924	2,837	16,450	1,094	952	460	2,026	16,500	2,470	111
2,259	4,130	16,500	1,012	844	272	2,967	16,600	3,139	39
1,906	2,810	16,550	389	342	395	3,331	16,700	2,131	-6
2,561	5,299	16,600	419	382	※ 1,147	4,393	16,800	2,153	-32
2,648	4,156	16,650	27	16	448	2,688	16,900	1,598	-36
※ 4,015	6,426	16,700	98	56	-6	5,549	17,000	2,191	-15
2,944	5,293	16,750	9	4	477	5,158	17,100	1,321	-14
3,828	7,663	16,800	21	20	77	5,317	17,200	1,084	-10
1,783	2,989	16,850	0	0	258	5,146	17,300	540	-8
2,116	3,699	16,900	1	0	158	4,453	17,400	474	-7
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
35,155	62,928	1.0882	68,477	52,783	4,054	91,603	0.8539	78,219	7,048
昨日 P/C	0.5651	今日增減變化		0.5231	昨日 P/C	0.8129	今日增減變化		0.0410

更新日期：2022年4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4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	77,123,473	115,413,747	-38,290,274	3,714,237	3,909,612	2,095,249	1,814,363	-1,673,634
投信	36,004,436	62,008,914	-26,004,478	103,583	415,471	0	415,471	-3,912
自營商	65,321,848	19,026,924	46,294,924	-1,185,458	603,768	1,823,260	-1,219,492	-921,214
	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	2,028,825	1,206,475	822,350	1,454,170	169,575	24,225	145,350	274,982
投信	25,248	0	25,248	-25	1,615	0	1,615	-5
自營商	434,499	780,856	-346,357	-295,722	8,075	256,820	-248,745	-378,412

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報

2022年4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	19,134	11,563	7,571	2,608	43,270	16,707	26,563	-849
投信	0	0	0	0	350	85	265	0
自營商	65,624	52,858	12,766	6,911	39,588	48,669	-9,081	-7,739
特定法人(週)	3,425	0	3,425	505	1,329	1,719	-390	-390
特定法人(近月)	7,705	4,983	2,722	621	8,090	22,917	-14,827	-1,087
特定法人(全月)	12,924	2,971	9,953	2,098	8,933	35,447	-26,514	586
十大交易人(週)	21,553	21,814	-261	5,060	28,584	23,433	5,151	3,711
十大交易人(近月)	37,900	34,705	3,195	1,620	26,868	44,383	-17,515	-940
十大交易人(全月)	79,935	55,962	23,973	9,759	59,298	82,704	-23,406	189
全市場未沖銷(近月)			91,603	4,054			78,219	7,048
全市場未沖銷(全月)			183,850	40,377			175,709	60,945

更新日期：2022年4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 05W1 週 選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16500	買權OI最大量	16800
	賣權成交最大量	16000	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	19.73%	較前一交易日	+0.54%
	買權隱含波動率	15.14%	較前一交易日	-1.08%
	賣權隱含波動率	23.88%	較前一交易日	+0.34%
電子選擇權	買權成交最大量	785	買權OI最大量	785
	賣權成交最大量	700	賣權OI最大量	700
金融選擇權	買權成交最大量	1880	買權OI最大量	2040
	賣權成交最大量	1760	賣權OI最大量	1760

更新日期：2022年4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 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	20.11%	較前一交易日	+0.08%
	買權隱含波動率	15.80%	較前一交易日	-0.87%
	賣權隱含波動率	24.07%	較前一交易日	+0.51%
	成交量P/C_Ratio值	0.983	較前一交易日	+0.02
	未平倉P/C_Ratio值	0.854	較前一交易日	+0.04
電子選擇權	買權成交最大量	785	買權OI最大量	785
	賣權成交最大量	700	賣權OI最大量	700
金融選擇權	買權成交最大量	1880	買權OI最大量	2040
	賣權成交最大量	1760	賣權OI最大量	1760

更新日期：2022年4月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

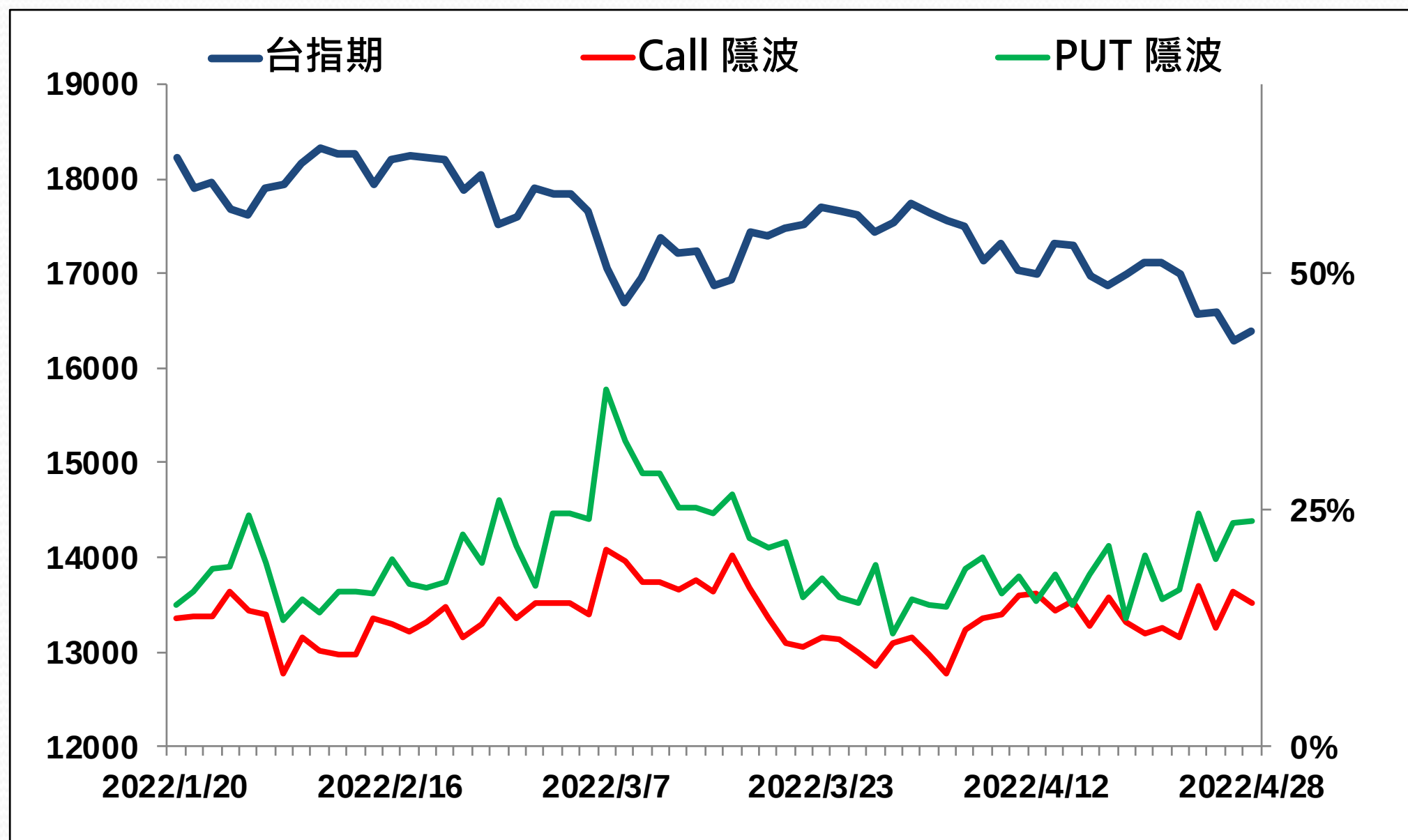
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



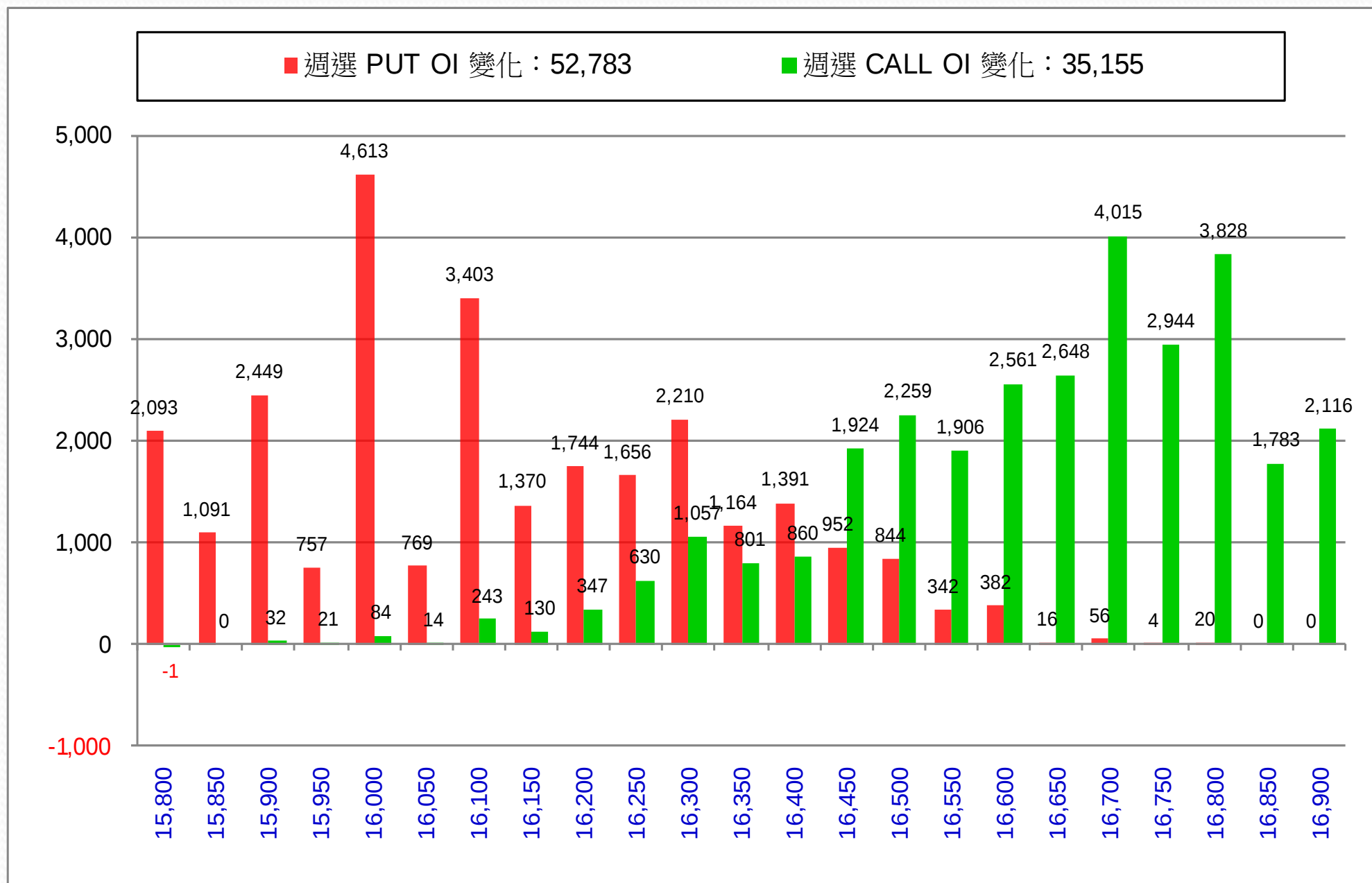
更新日期：2022年4月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年4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

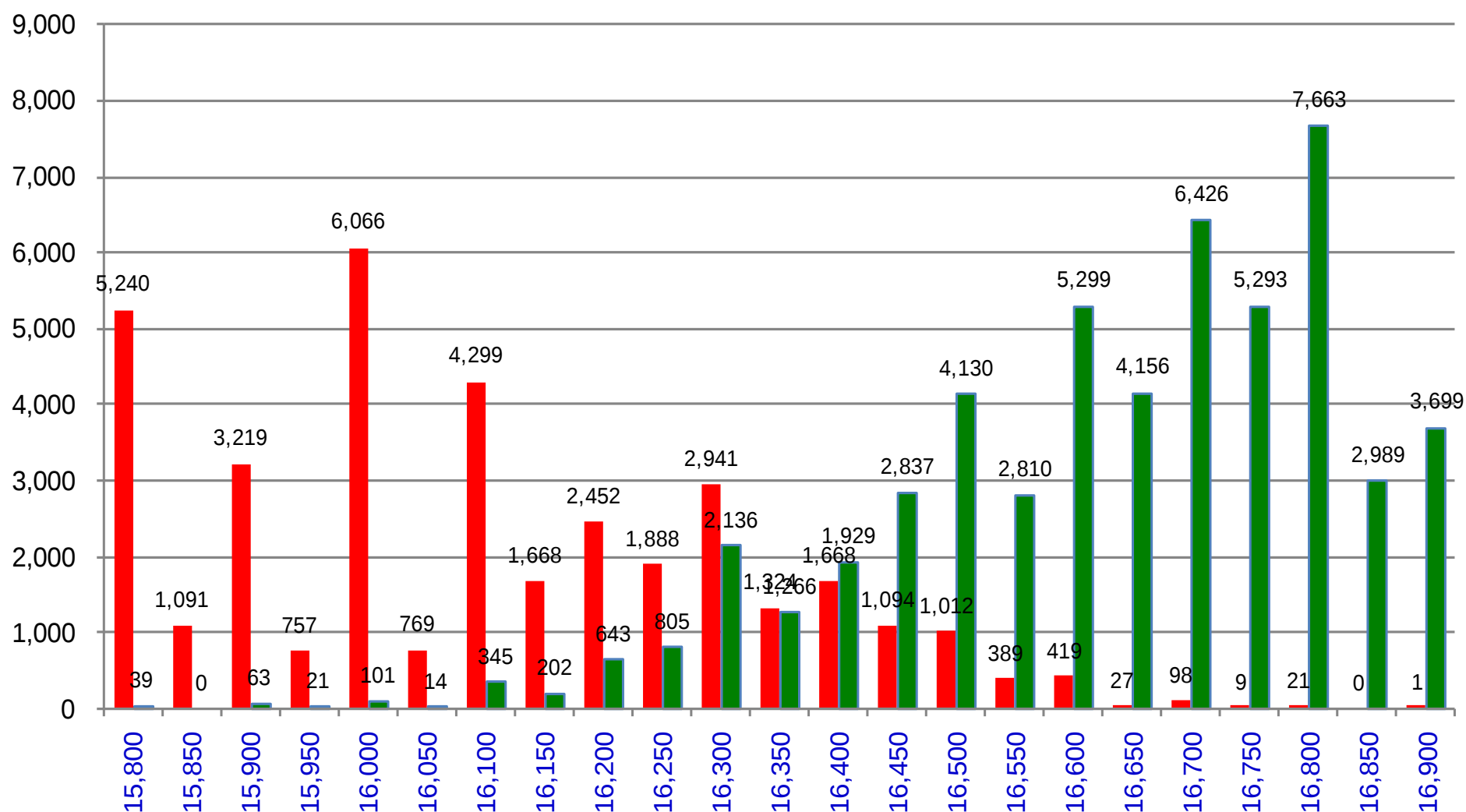


更新日期：2022年4月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：68,477

週選 CALL OI 總額：62,928



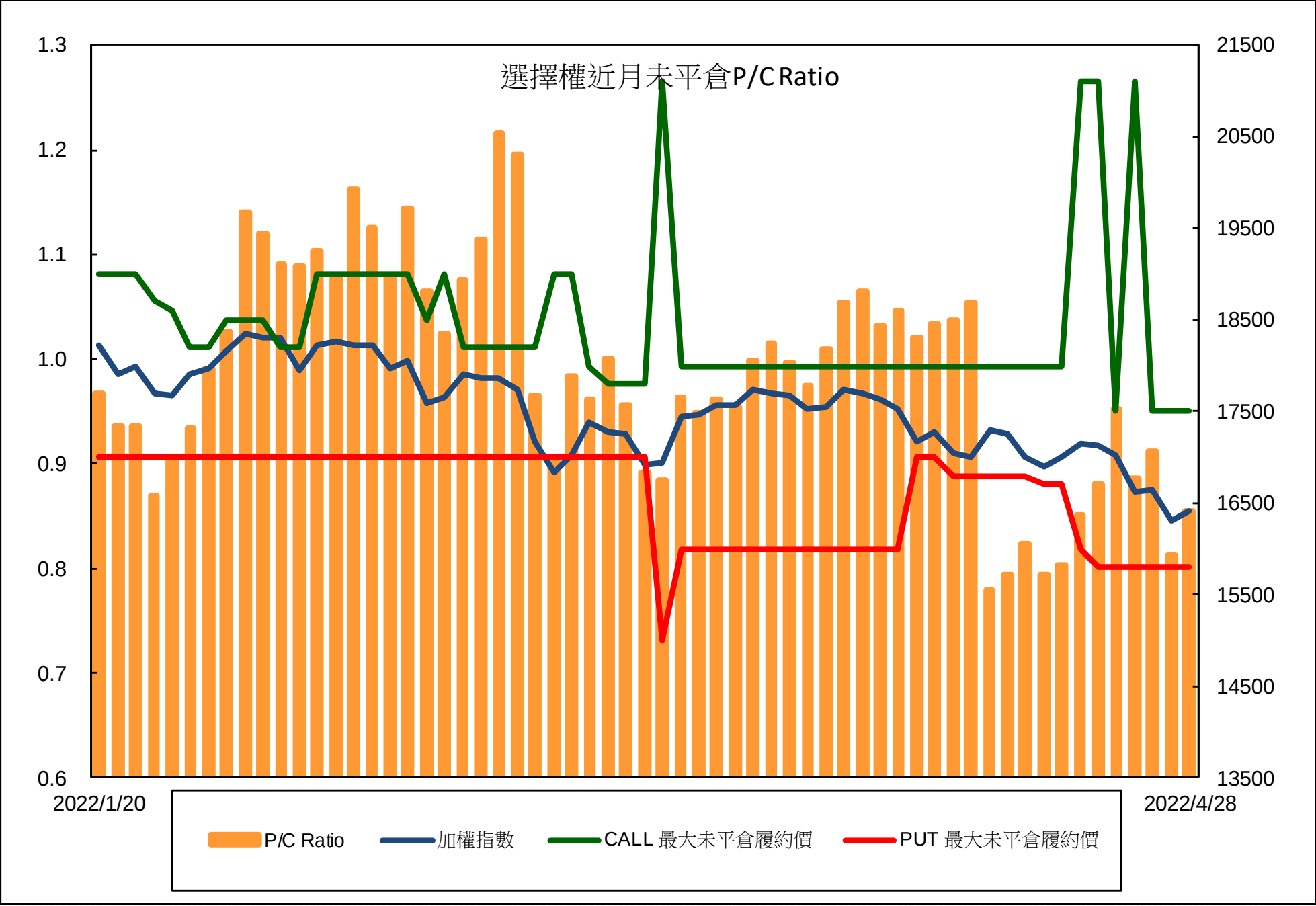
更新日期：2022年4月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	4月27日	52,355	46,500	5,855
	4月28日	65,624	52,858	12,766
Put	4月27日	28,246	29,588	-1,342
	4月28日	39,588	48,669	-9,081

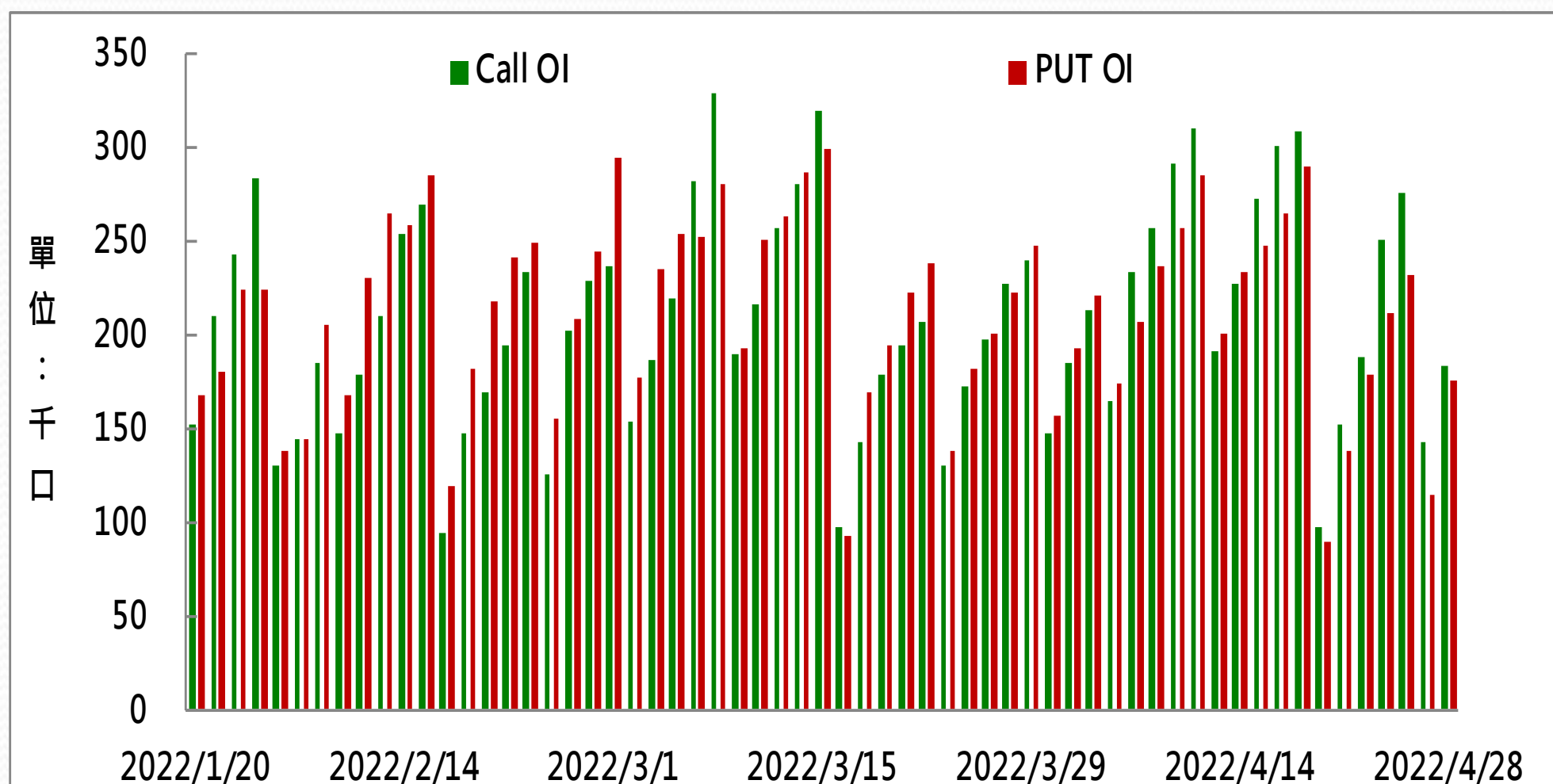
更新日期：2022年4月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年4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4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4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