

台指選擇權OI匯報

日期：2022/5/3 結算日：2022/5/4					日期：2022/5/3 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
-7	57	15,900	4,282	440	0	1	15,300	2,191	319
-2	21	15,950	1,531	216	0	3	15,400	2,336	135
-1	118	16,000	8,769	894	0	21	15,500	6,660	301
0	14	16,050	2,994	751	0	2	15,600	3,008	304
-9	339	16,100	6,679	1,857	0	2	15,700	2,340	49
2	236	16,150	4,316	2,124	16	387	15,800	8,168	105
-11	503	16,200	7,144	2,106	2	55	15,900	4,036	-46
-22	869	16,250	5,737	2,766	46	318	16,000	6,296	-151
10	2,198	16,300	7,900	2,299	9	232	16,100	3,586	101
204	1,410	16,350	5,732	2,969	-30	578	16,200	5,823	-118
417	2,070	16,400	6,810	2,114	41	897	16,300	3,712	73
983	3,283	16,450	4,783	2,025	129	1,570	16,400	4,013	58
3,781	7,663	16,500	6,926	1,464	262	2,623	16,500	3,101	182
4,003	7,033	16,550	3,331	1,460	189	3,550	16,600	3,333	281
3,566	9,314	16,600	2,754	122	412	3,241	16,700	2,423	58
6,074	10,473	16,650	1,355	487	853	5,555	16,800	2,407	-51
※ 6,879	14,066	16,700	964	175	394	3,808	16,900	1,696	4
4,393	10,602	16,750	341	39	※ 1,227	7,152	17,000	2,266	-82
1,068	10,060	16,800	410	32	855	6,589	17,100	1,319	-5
1,676	8,125	16,850	122	43	256	6,150	17,200	1,102	6
-987	6,407	16,900	67	2	768	6,034	17,300	542	-12
-463	3,024	16,950	55	1	478	5,209	17,400	477	19
158	4,957	17,000	15	-8	121	6,574	17,500	180	0
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
31,036	110,625	1.1231	124,241	24,291	5,674	99,745	0.8880	88,574	2,398
昨日 P/C	1.2558	今日增減變化		-0.1327	昨日 P/C	0.9161	今日增減變化		-0.0281

更新日期：2022年5月3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5月3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	71,338,104	103,698,484	-32,360,380	-13,713,706	3,483,000	2,336,957	1,146,043	-350,434
投信	38,267,750	62,982,339	-24,714,589	1,082,131	408,000	0	408,000	-2,312
自營商	67,934,922	20,772,406	47,162,516	5,007,534	380,991	1,538,974	-1,157,983	-17,593
	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	1,998,888	1,073,277	925,611	75,963	171,570	40,850	130,720	-40,048
投信	25,211	0	25,211	-370	1,634	0	1,634	-8
自營商	462,682	826,541	-363,859	32,752	6,536	200,952	-194,416	23,940

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報

2022年5月3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	19,749	12,884	6,865	-1,094	43,664	16,002	27,662	128
投信	0	0	0	0	350	85	265	0
自營商	78,820	61,042	17,778	-5,846	53,829	57,005	-3,176	13,520
特定法人(週)	0	0	0	-2,926	0	0	0	0
特定法人(近月)	8,419	2,971	5,448	94	7,625	21,297	-13,672	263
特定法人(全月)	12,029	0	12,029	2,776	6,529	33,904	-27,375	-300
十大交易人(週)	33,648	34,701	-1,053	-5,097	41,971	37,955	4,016	-7,848
十大交易人(近月)	41,618	37,145	4,473	-866	30,782	47,852	-17,070	-1,514
十大交易人(全月)	92,514	66,869	25,645	-5,548	72,284	97,241	-24,957	-10,753
全市場未沖銷(近月)			99,745	5,674			88,574	2,398
全市場未沖銷(全月)			240,918	37,416			243,750	27,429

更新日期：2022年5月3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	16600	買權OI最大量	16700
	賣權成交最大量	16400	賣權OI最大量	16000
	整體隱含波動率	16.23%	較前一交易日	+0.31%
	買權隱含波動率	14.21%	較前一交易日	+1.25%
	賣權隱含波動率	18.19%	較前一交易日	-0.44%
電子選擇權	買權成交最大量	780	買權OI最大量	800
	賣權成交最大量	710	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	1740	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年5月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

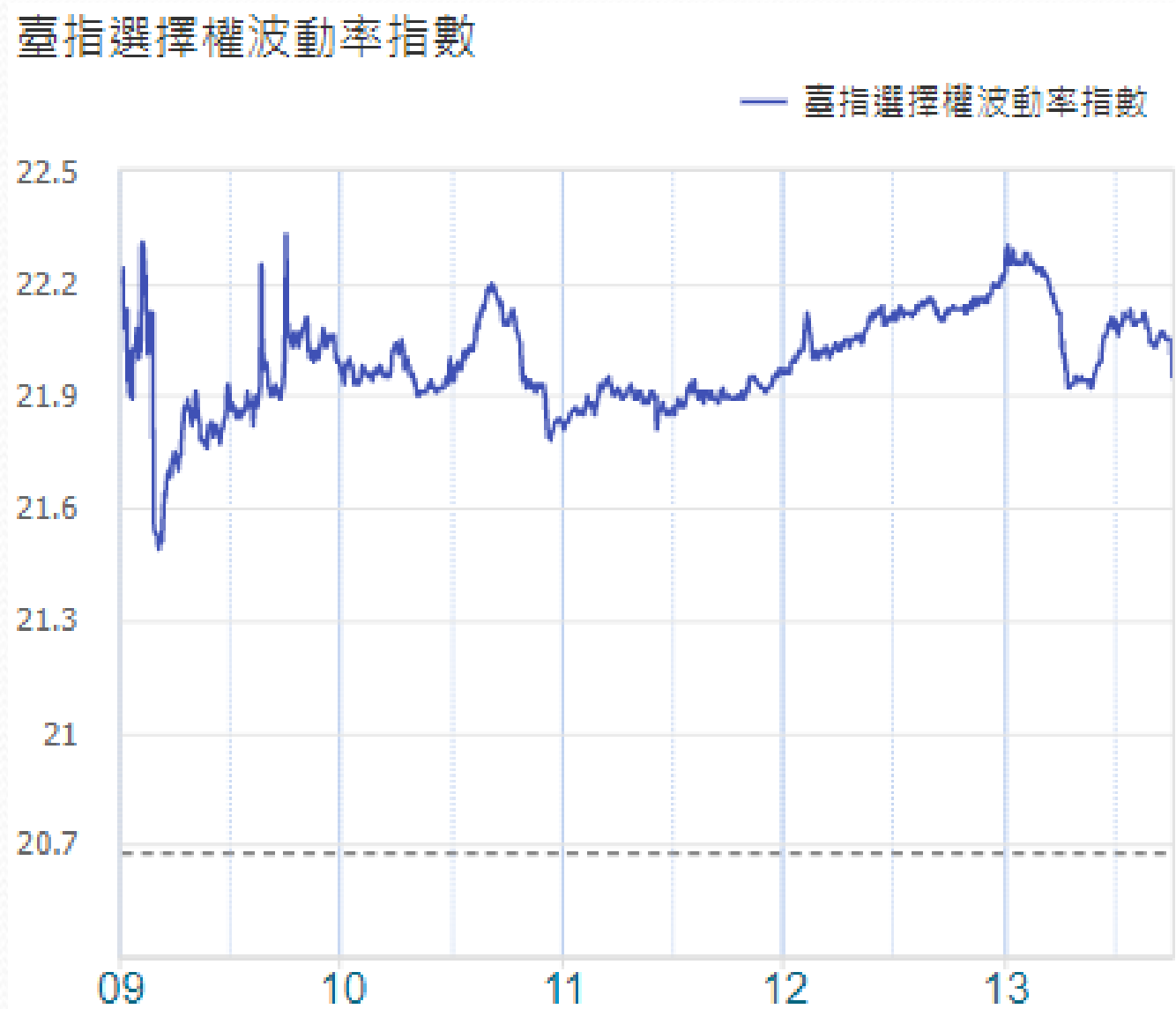
台指選擇權匯報

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	17000
	賣權成交最大量	16000	賣權OI最大量	15800
	整體隱含波動率	20.77%	較前一交易日	-1.71%
	買權隱含波動率	16.49%	較前一交易日	+1.24%
	賣權隱含波動率	25.26%	較前一交易日	+2.29%
	成交量P/C_Ratio值	0.930	較前一交易日	-0.02
	未平倉P/C_Ratio值	0.888	較前一交易日	-0.03
電子選擇權	買權成交最大量	780	買權OI最大量	800
	賣權成交最大量	710	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	1740	賣權OI最大量	1780

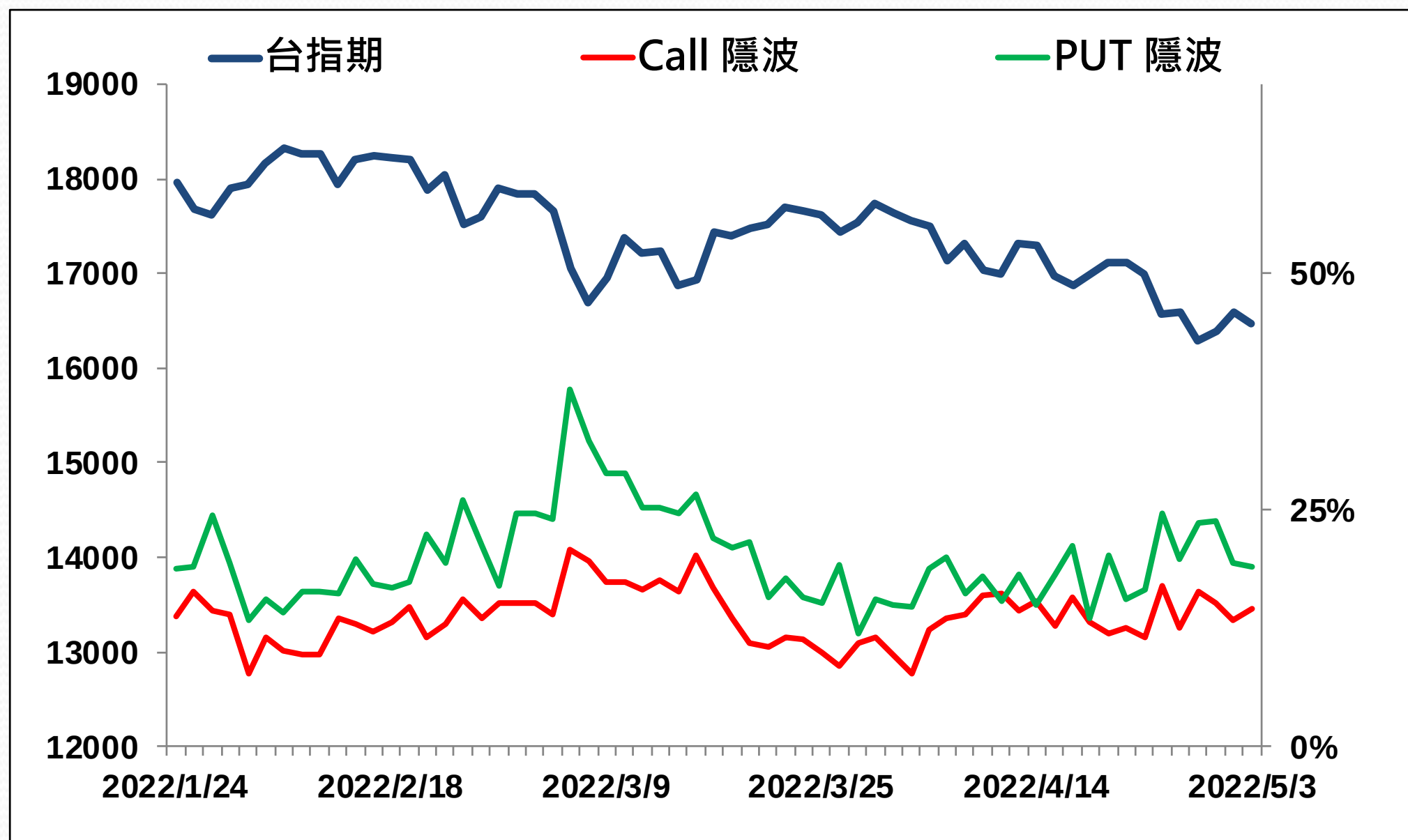
更新日期：2022年5月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



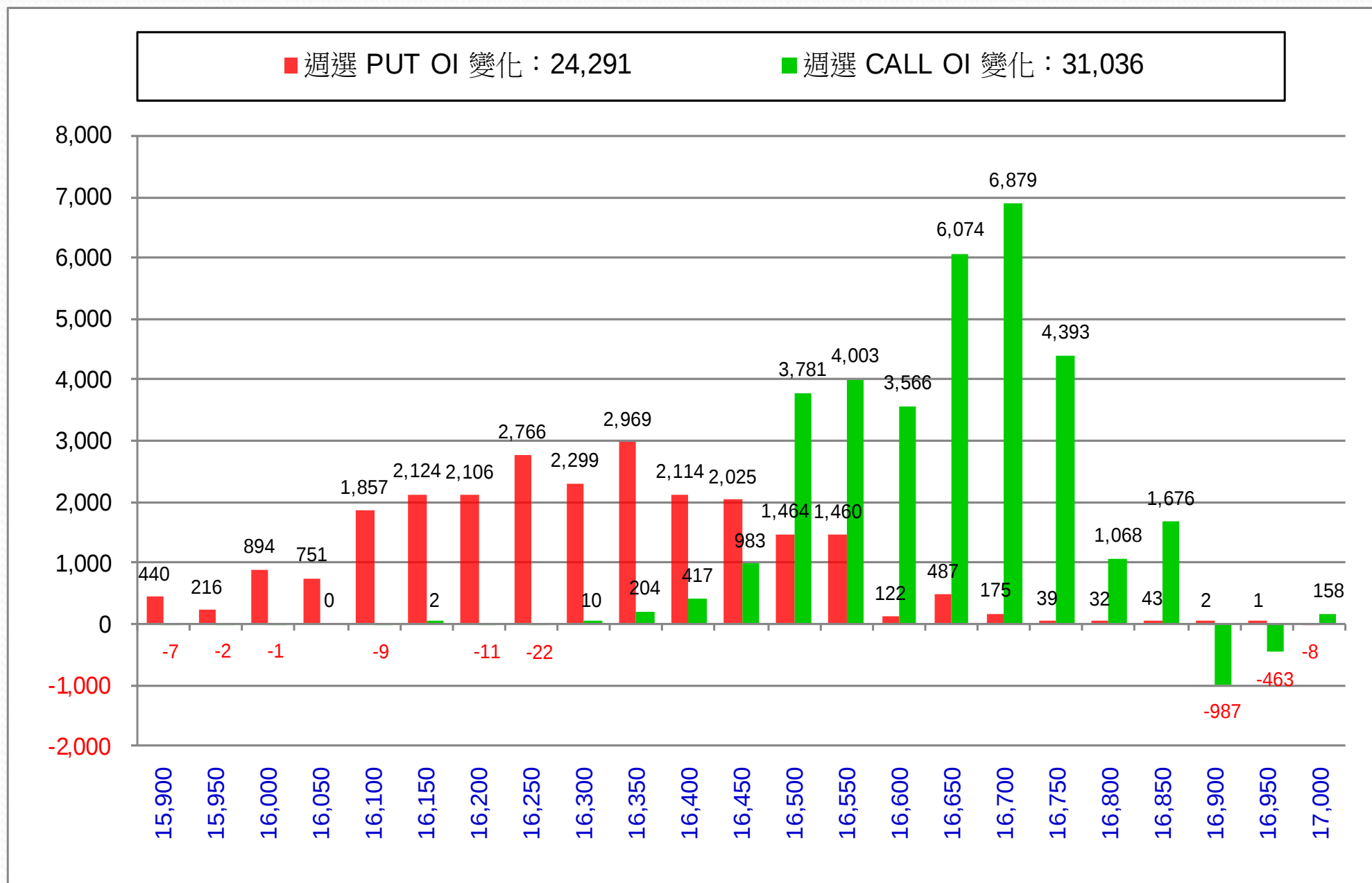
更新日期：2022年5月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年5月3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

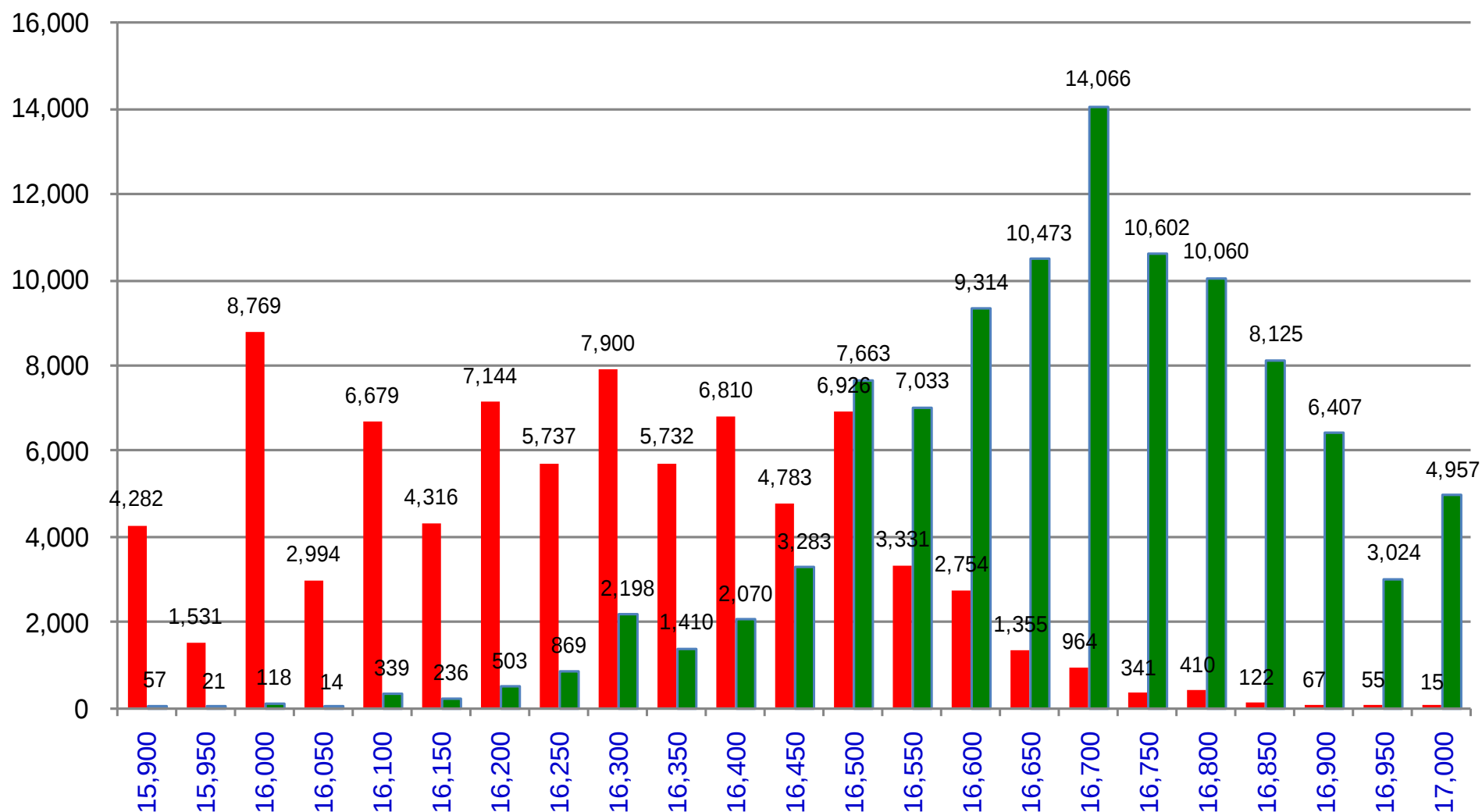


更新日期：2022年5月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：124,241

週選 CALL OI 總額：110,625



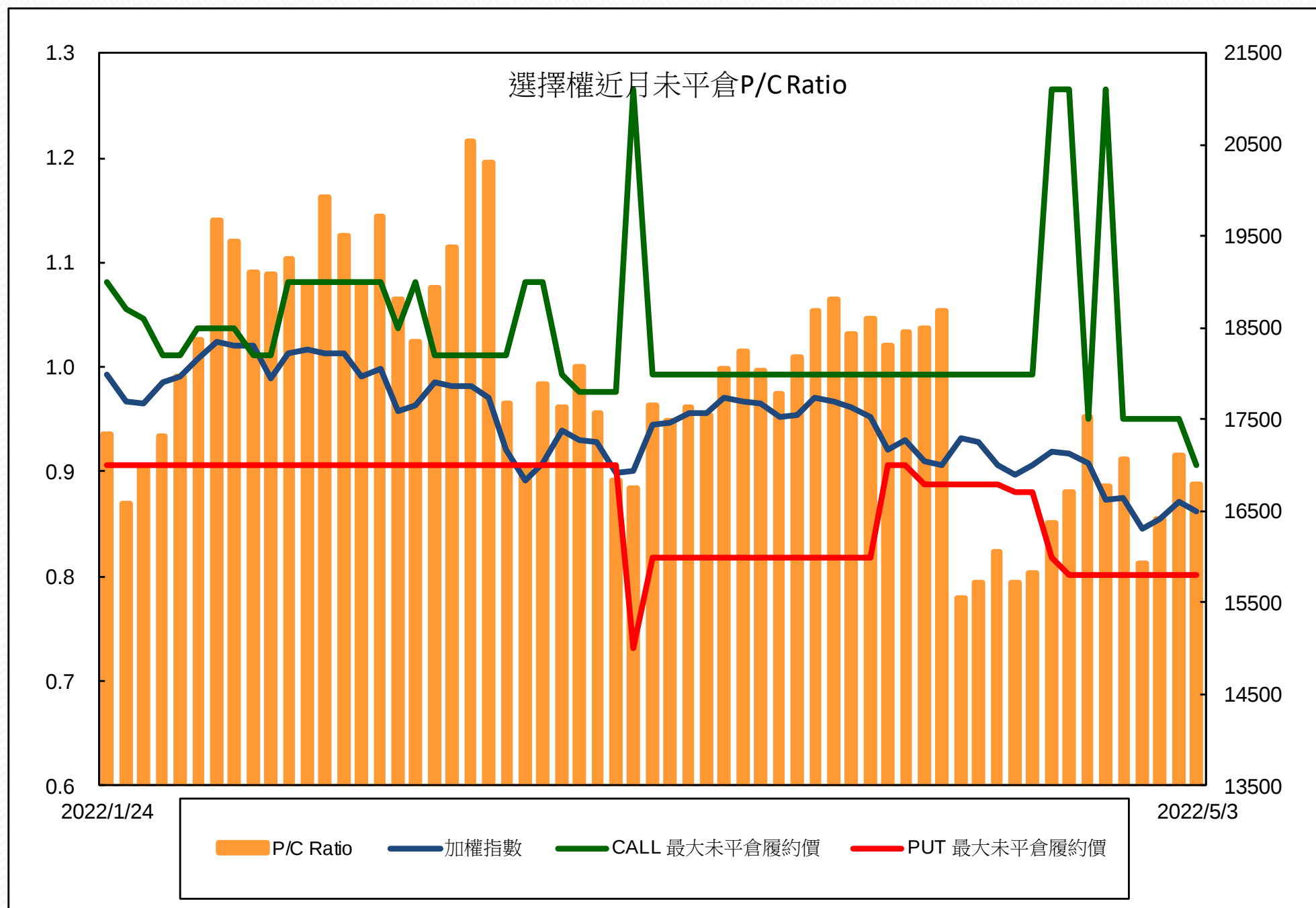
更新日期：2022年5月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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29日	74,365	50,741	23,624
	5月3日	78,820	61,042	17,778
Put	4月29日	43,032	59,728	-16,696
	5月3日	53,829	57,005	-3,176

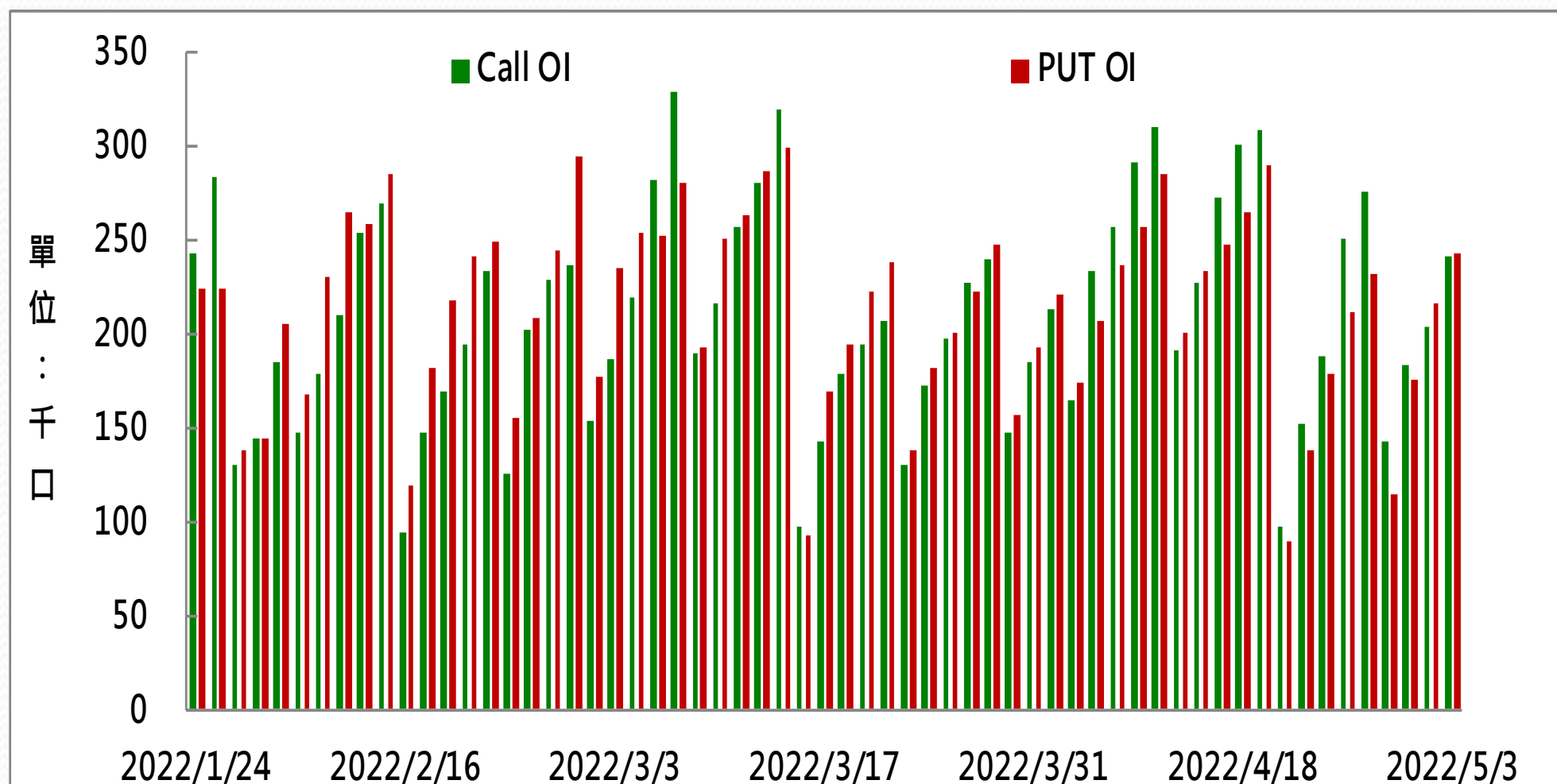
更新日期：2022年5月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年5月3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5月3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5月3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