

台指選擇權OI匯報

日期：2022/5/10 結算日：2022/5/11					日期：2022/5/10 結算日：2022/5/18				
202205W2					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	6,280	3,026	0	11	14,900	1,457	171
7	27	15,400	7,675	2,640	3	3	15,000	4,759	620
4	9	15,500	8,122	2,112	0	0	15,100	2,057	445
133	143	15,600	9,214	2,747	0	86	15,200	3,853	925
70	70	15,650	2,505	2,505	3	6	15,300	3,442	1,029 ※
358	367	15,700	9,570	3,998 ※	13	16	15,400	3,616	493
315	315	15,750	2,297	2,297	11	33	15,500	7,385	942
895	992	15,800	9,414	1,697	75	94	15,600	4,302	835
1,002	1,002	15,850	2,742	2,742	163	199	15,700	3,658	558
1,975	2,139	15,900	8,591	1,847	385	818	15,800	6,204	-244
2,668	2,831	15,950	4,172	1,279	416	598	15,900	5,356	-959
※ 5,620	6,295	16,000	8,138	-215	1,479	2,136	16,000	6,608	499
4,193	5,064	16,050	3,209	288	1,394	2,342	16,100	3,025	-912
4,491	6,858	16,100	3,400	-345	1,121	2,335	16,200	4,929	-395
1,187	6,674	16,150	1,954	-373	※ 1,865	4,234	16,300	2,990	-380
4,840	9,590	16,200	3,416	-1,321	1,384	4,344	16,400	3,461	-465
2,394	7,038	16,250	2,330	-214	1,397	7,033	16,500	2,723	-227
-43	6,436	16,300	2,837	-528	549	5,968	16,600	2,460	-104
-1,435	6,794	16,350	3,281	-201	-164	5,237	16,700	2,505	-108
-2,996	8,229	16,400	2,559	-788	16	6,740	16,800	2,166	-75
-2,327	4,850	16,450	1,540	-93	1,092	6,213	16,900	1,602	-2
-3,193	5,432	16,500	2,181	-457	-221	9,970	17,000	2,126	-1
-1,636	4,193	16,550	1,709	-56	-693	6,076	17,100	1,189	-10
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
7,762	154,850	0.8028	124,313	24,143	7,970	124,710	0.7621	95,047	2,992
昨日 P/C	0.6810	今日增減變化		0.1218	昨日 P/C	0.7885	今日增減變化		-0.0264

更新日期：2022年5月10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10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	86,483,936	127,608,630	-41,124,694	-15,149,367	3,124,857	2,962,826	162,031	-568,125
投信	36,720,605	67,185,037	-30,464,432	-2,753,749	400,547	0	400,547	1,768
自營商	73,613,094	22,647,332	50,965,762	5,149,144	1,236,642	1,954,668	-718,026	275,503
	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	1,094,952	1,758,699	-663,747	-1,005,568	166,961	54,063	112,898	2,780
投信	23,766	0	23,766	-37	1,590	0	1,590	-6
自營商	346,188	889,537	-543,349	855	89,000	187,632	-98,632	358

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10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	27,212	16,123	11,089	1,238	52,642	17,504	35,138	130
投信	0	0	0	100	750	85	665	50
自營商	79,946	90,542	-10,596	-9,203	67,194	52,071	15,123	15,219
特定法人(週)	4,572	0	4,572	41	0	1,721	-1,721	-1,855
特定法人(近月)	10,667	6,247	4,420	570	6,906	22,648	-15,742	1,819
特定法人(全月)	15,687	0	15,687	-1,734	8,928	43,127	-34,199	-241
十大交易人(週)	33,221	55,700	-22,479	-8,136	31,398	37,219	-5,821	-6,184
十大交易人(近月)	43,912	50,566	-6,654	-4,855	28,353	52,583	-24,230	-5,057
十大交易人(全月)	93,611	99,725	-6,114	-12,615	65,565	106,857	-41,292	-12,056
全市場未沖銷(近月)			124,710	7,970			95,047	2,992
全市場未沖銷(全月)			316,636	17,668			256,867	28,699

更新日期：2022年5月10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05W2週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16100	買權OI最大量	16200
	賣權成交最大量	15800	賣權OI最大量	15700
	整體隱含波動率	18.22%	較前一交易日	-3.09%
	買權隱含波動率	17.00%	較前一交易日	-2.49%
	賣權隱含波動率	19.39%	較前一交易日	-4.32%
電子選擇權	買權成交最大量	745	買權OI最大量	785
	賣權成交最大量	695	賣權OI最大量	700
金融選擇權	買權成交最大量	1760	買權OI最大量	1840
	賣權成交最大量	1640	賣權OI最大量	1760

更新日期：2022年5月10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	16500	買權OI最大量	17000
	賣權成交最大量	15500	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	21.68%	較前一交易日	+0.27%
	買權隱含波動率	18.60%	較前一交易日	+0.01%
	賣權隱含波動率	24.89%	較前一交易日	-1.21%
	成交量P/C_Ratio值	0.950	較前一交易日	+0.04
	未平倉P/C_Ratio值	0.762	較前一交易日	-0.03
電子選擇權	買權成交最大量	745	買權OI最大量	785
	賣權成交最大量	695	賣權OI最大量	700
金融選擇權	買權成交最大量	1760	買權OI最大量	1840
	賣權成交最大量	1640	賣權OI最大量	1760

更新日期：2022年5月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

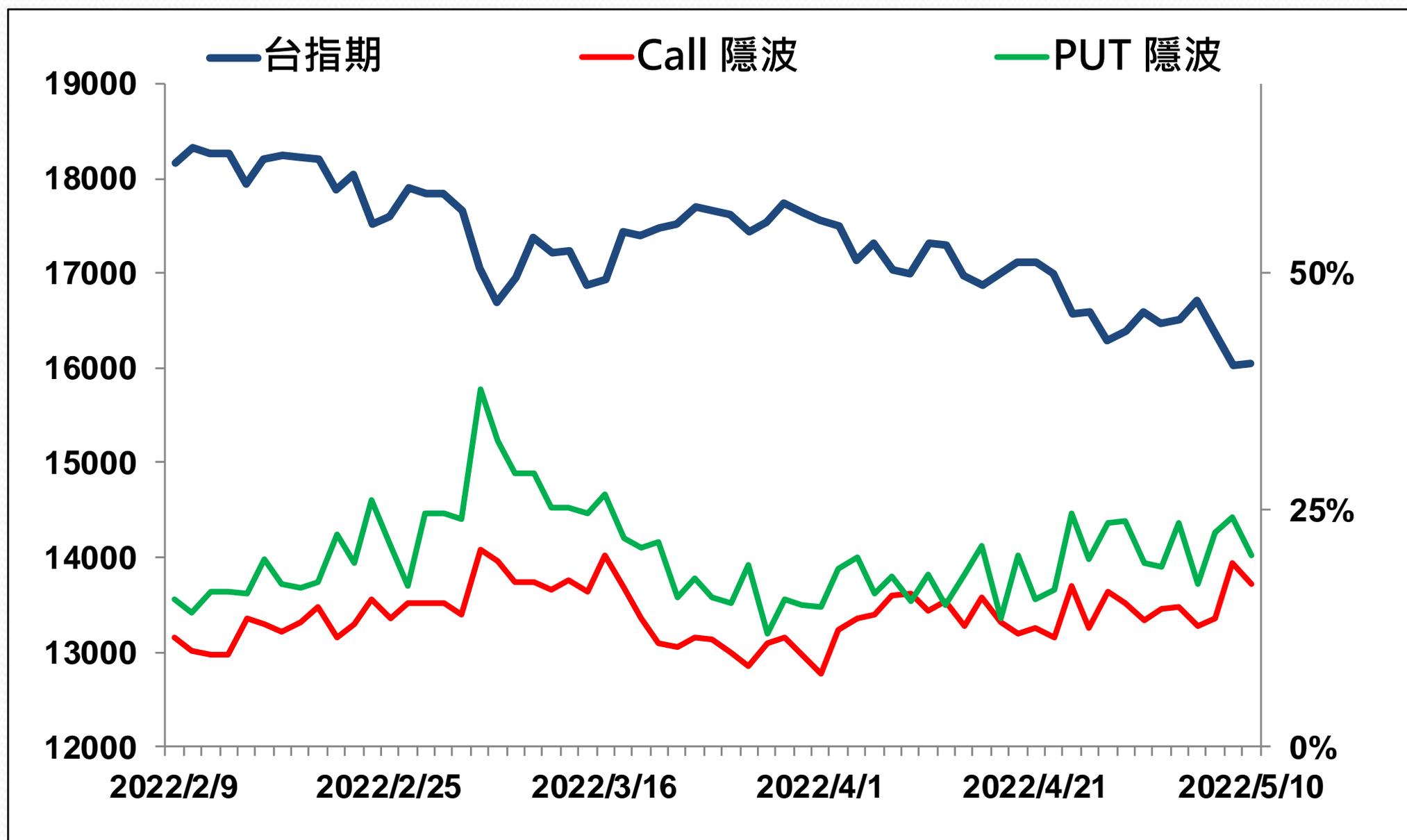
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2022年5月10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

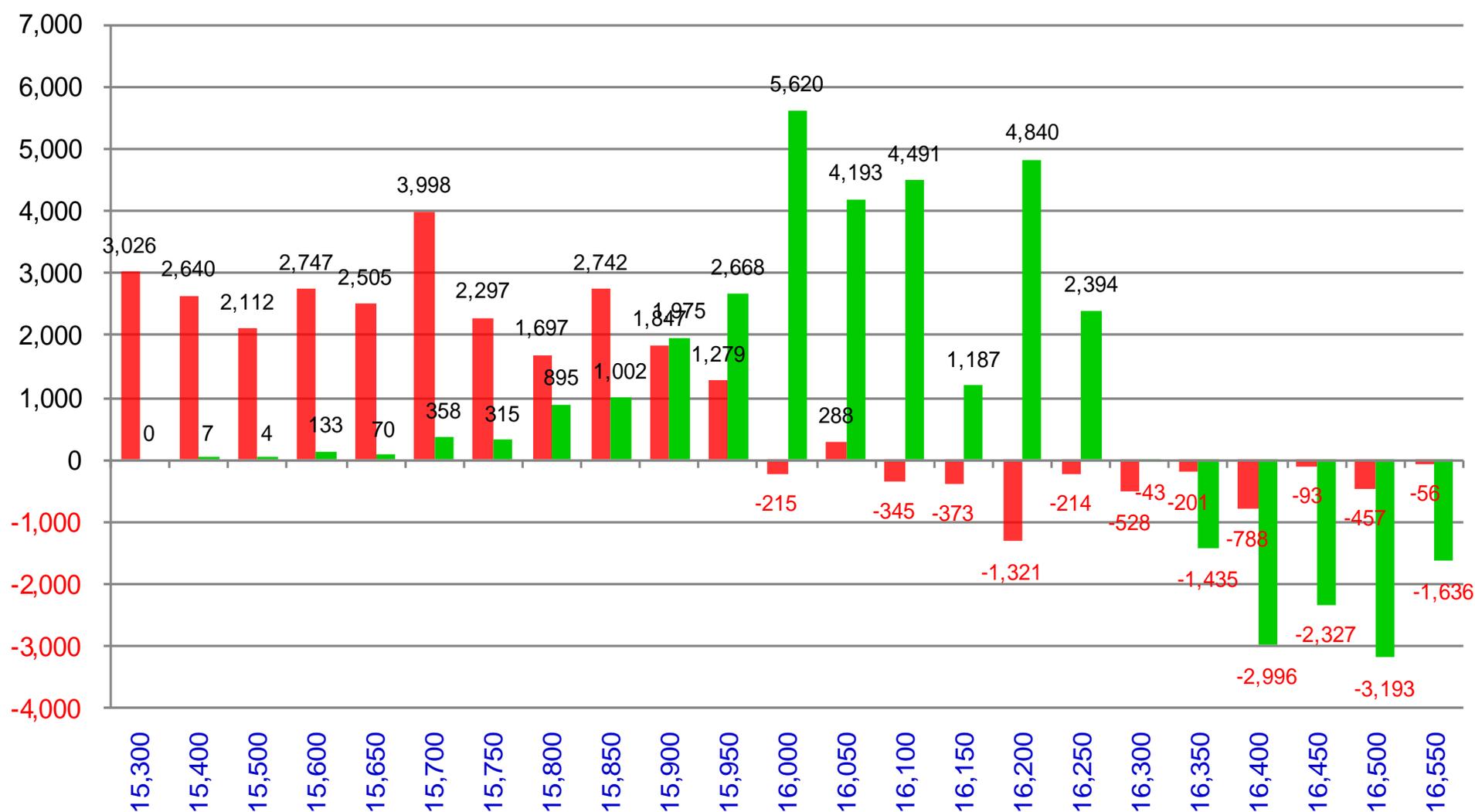


更新日期：2022年5月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：24,143

週選 CALL OI 變化：7,762

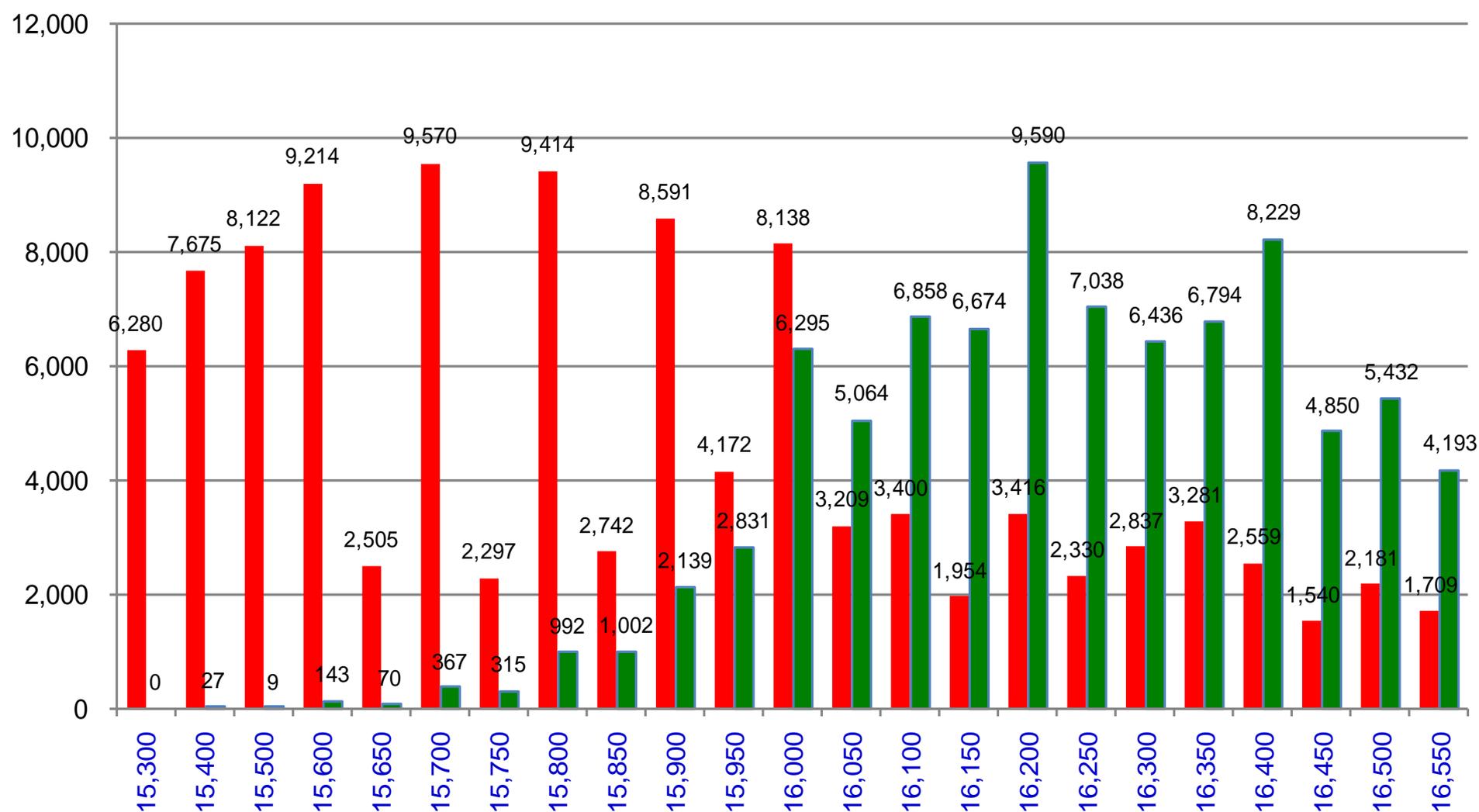


更新日期：2022年5月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：124,313

週選 CALL OI 總額：154,850



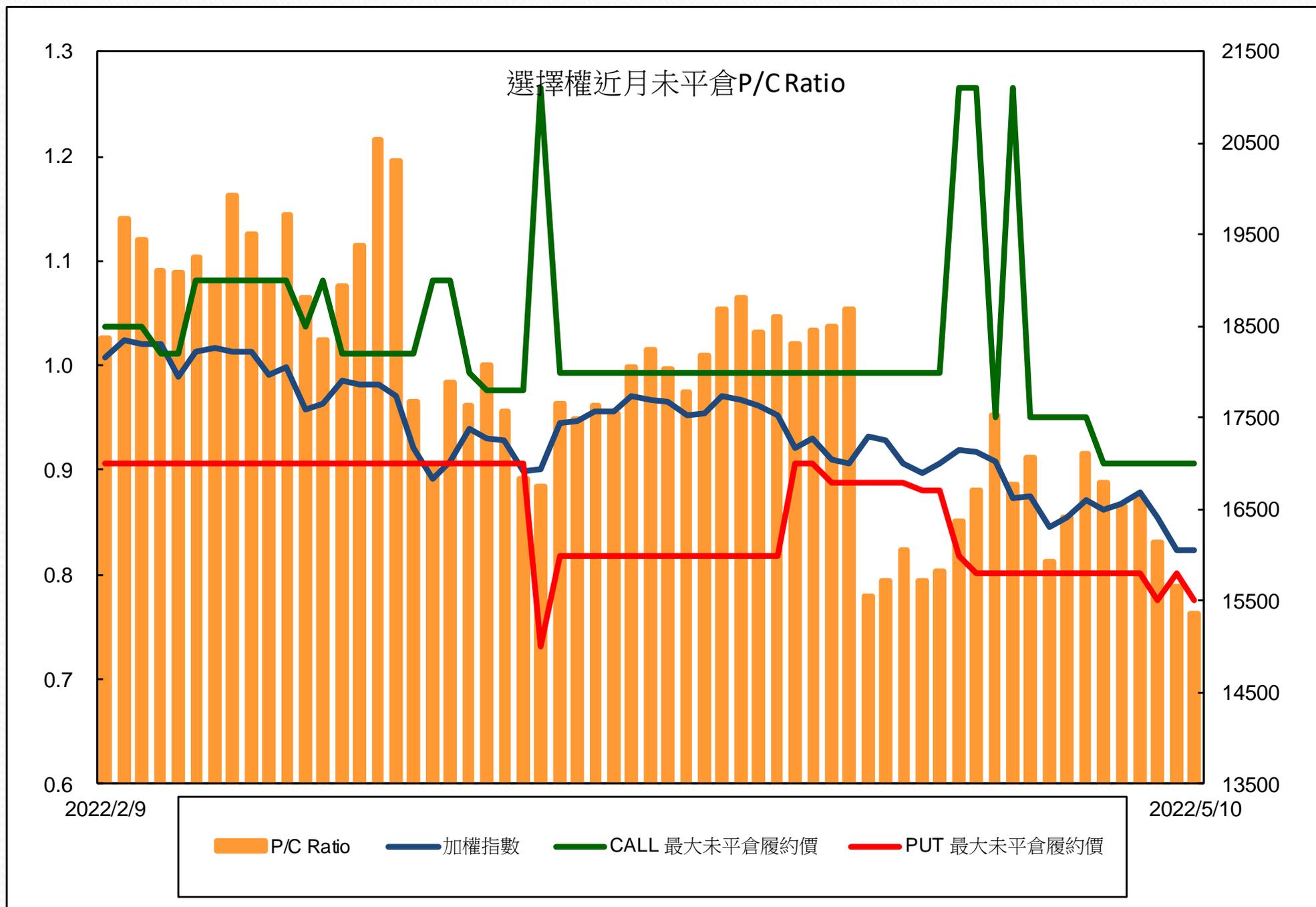
更新日期：2022年5月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	5月9日	80,739	82,132	-1,393
	5月10日	79,946	90,542	-10,596
Put	5月9日	53,968	54,064	-96
	5月10日	67,194	52,071	15,123

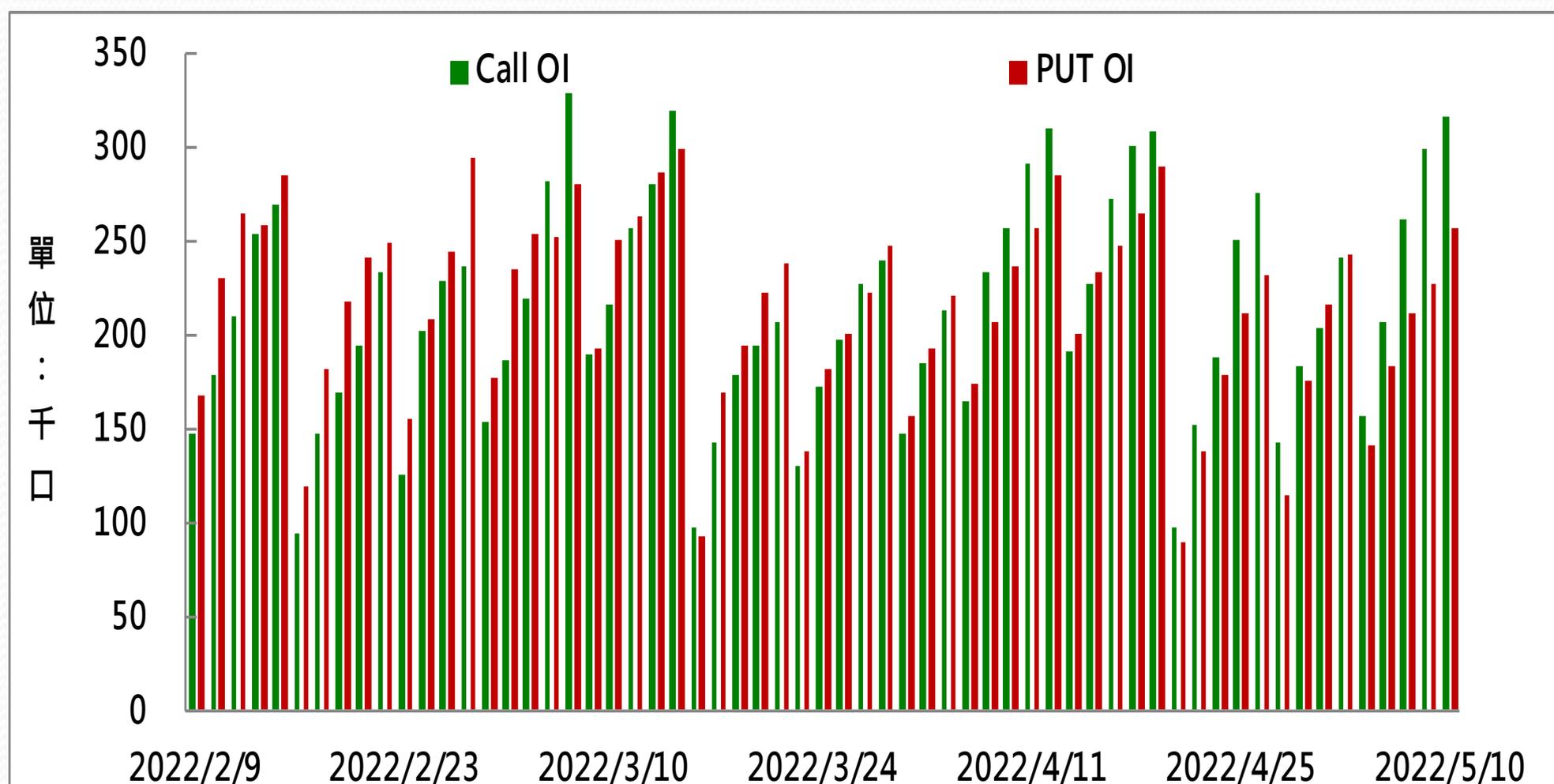
更新日期：2022年5月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年5月10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10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10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