

台指選擇權OI匯報

日期：2022/5/17 結算日：2022/5/18					日期：2022/5/17 結算日：2022/6/15				
202205 月台指選擇權 OI 序列					202206 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	84	15,300	9,657	-605	0	0	14,600	2,865	610
3	5	15,350	2,038	-170	0	0	14,700	902	203
-3	191	15,400	8,756	-1,458	0	6	14,800	2,665	252
0	4	15,450	2,015	-846	0	0	14,900	759	88
-95	636	15,500	13,062	-2,661	5	29	15,000	4,667	961 ※
-10	321	15,550	4,467	-1,309	0	10	15,100	1,281	331
-146	911	15,600	8,955	-1,403	0	8	15,200	1,703	301
-15	893	15,650	5,948	45	0	1	15,300	884	34
-319	1,737	15,700	8,763	-1,507	10	46	15,400	1,932	303
-43	1,224	15,750	6,666	1,274	-89	136	15,500	2,845	379
-383	3,557	15,800	10,356	332	-5	428	15,600	2,285	289
13	2,194	15,850	5,824	2,541	-12	352	15,700	939	170
-1,007	4,428	15,900	12,587	3,777	-6	847	15,800	1,767	361
-522	4,152	15,950	6,559	4,284	-18	426	15,900	1,173	145
-1,772	11,338	16,000	11,970	5,144 ※	107	1,036	16,000	2,190	381
770	7,187	16,050	6,415	4,587	44	914	16,100	846	66
-227	11,232	16,100	7,133	4,412	195	1,172	16,200	993	19
1,633	10,814	16,150	1,361	974	293	1,631	16,300	369	10
※ 3,045	19,397	16,200	5,358	560	-65	2,378	16,400	470	-16
883	11,148	16,250	294	156	※ 1,166	4,080	16,500	328	27
-3,383	13,591	16,300	2,630	-2	625	2,600	16,600	299	8
-58	6,513	16,350	118	23	507	1,867	16,700	68	1
-401	12,602	16,400	3,083	-13	436	1,881	16,800	482	0
-620	3,961	16,450	51	36	150	1,302	16,900	80	0
-448	9,534	16,500	2,452	-73	446	2,874	17,000	294	3
-122	9,471	16,600	2,297	-67	161	991	17,100	106	0
-329	5,686	16,700	2,358	-41	69	1,091	17,200	354	0
-153	6,937	16,800	2,120	-3	-10	986	17,300	61	0
-159	5,799	16,900	1,451	-17	115	1,734	17,400	242	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
-4,449	237,220	0.9488	225,073	12,946	4,074	45,008	1.1474	51,641	5,991
昨日 P/C	0.8778	今日增減變化		0.0710	昨日 P/C	1.0190	今日增減變化		0.1283

更新日期：2022年5月17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17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	115,815,856	115,217,432	598,424	8,415,855	2,193,782	2,376,059	-182,277	487,439
投信	36,889,150	67,972,348	-31,083,198	802,351	406,803	0	406,803	4,527
自營商	65,386,065	28,465,734	36,920,331	-3,207,283	1,364,593	1,902,031	-537,438	50,167
	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	762,773	1,959,385	-1,196,612	-116,695	230,276	148,818	81,458	-1,424
投信	22,609	0	22,609	-37	1,563	0	1,563	0
自營商	237,384	770,681	-533,297	-282,447	126,680	180,001	-53,321	13,931

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17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	32,989	17,563	15,426	2,552	56,961	19,356	37,605	1,326
投信	0	0	0	0	1,050	85	965	0
自營商	84,910	76,423	8,487	1,897	51,703	67,684	-15,981	-8,453
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	17,115	0	17,115	2,877	2,899	23,738	-20,839	-3,297
特定法人(全月)	22,471	0	22,471	4,681	7,421	44,902	-37,481	-1,158
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	69,313	65,853	3,460	1,556	63,688	65,226	-1,538	10,221
十大交易人(全月)	106,602	81,854	24,748	3,763	83,959	94,867	-10,908	9,189
全市場未沖銷(近月)			237,220	-4,449			225,073	12,946
全市場未沖銷(全月)			297,261	266			285,807	19,275

更新日期：2022年5月17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	16000	買權OI最大量	16200
	賣權成交最大量	16000	賣權OI最大量	15500
	整體隱含波動率	13.97%	較前一交易日	-4.20%
	買權隱含波動率	14.60%	較前一交易日	-3.20%
	賣權隱含波動率	13.45%	較前一交易日	-5.07%
電子選擇權	買權成交最大量	800	買權OI最大量	800
	賣權成交最大量	720	賣權OI最大量	720
金融選擇權	買權成交最大量	1700	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1540

更新日期：2022年5月17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 06 月 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	16500
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	13000
	整體隱含波動率	20.06%	較前一交易日	+1.48%
	買權隱含波動率	14.66%	較前一交易日	-1.44%
	賣權隱含波動率	24.25%	較前一交易日	-1.50%
	成交量P/C_Ratio值	1.180	較前一交易日	-0.00
	未平倉P/C_Ratio值	1.048	較前一交易日	+0.03
電子選擇權	買權成交最大量	800	買權OI最大量	800
	賣權成交最大量	720	賣權OI最大量	720
金融選擇權	買權成交最大量	1700	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1540

更新日期：2022年5月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

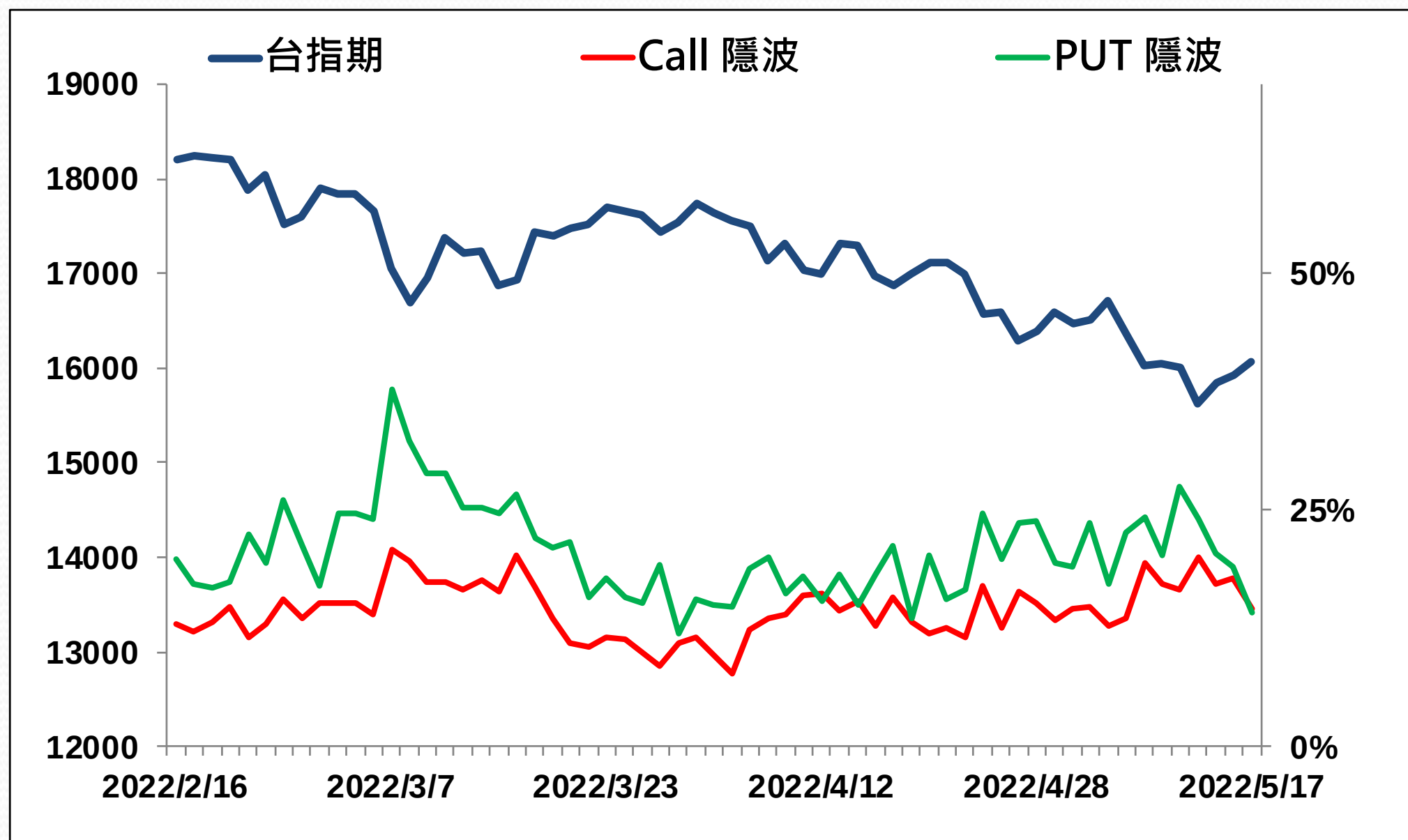
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



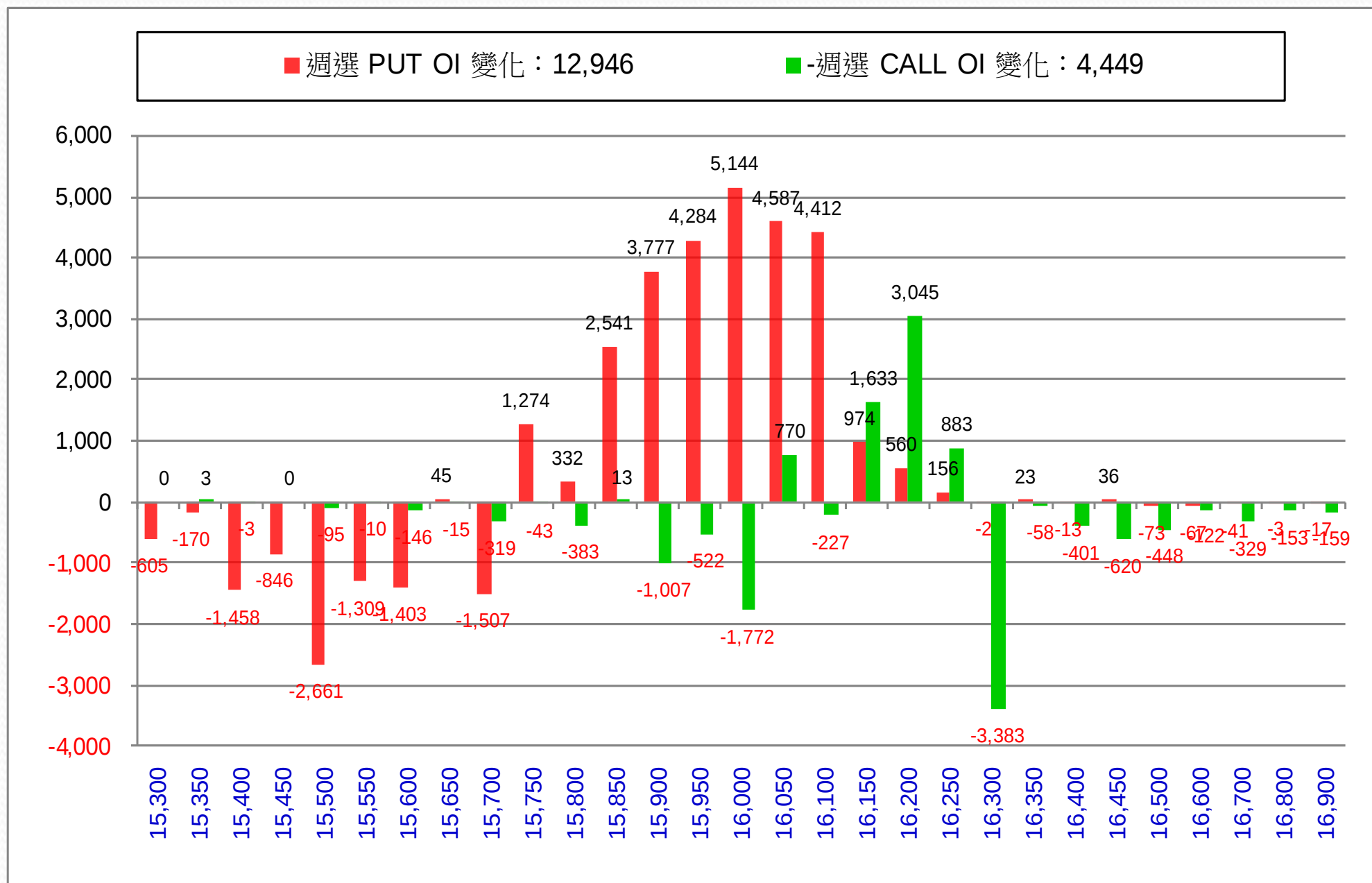
更新日期：2022年5月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年5月17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

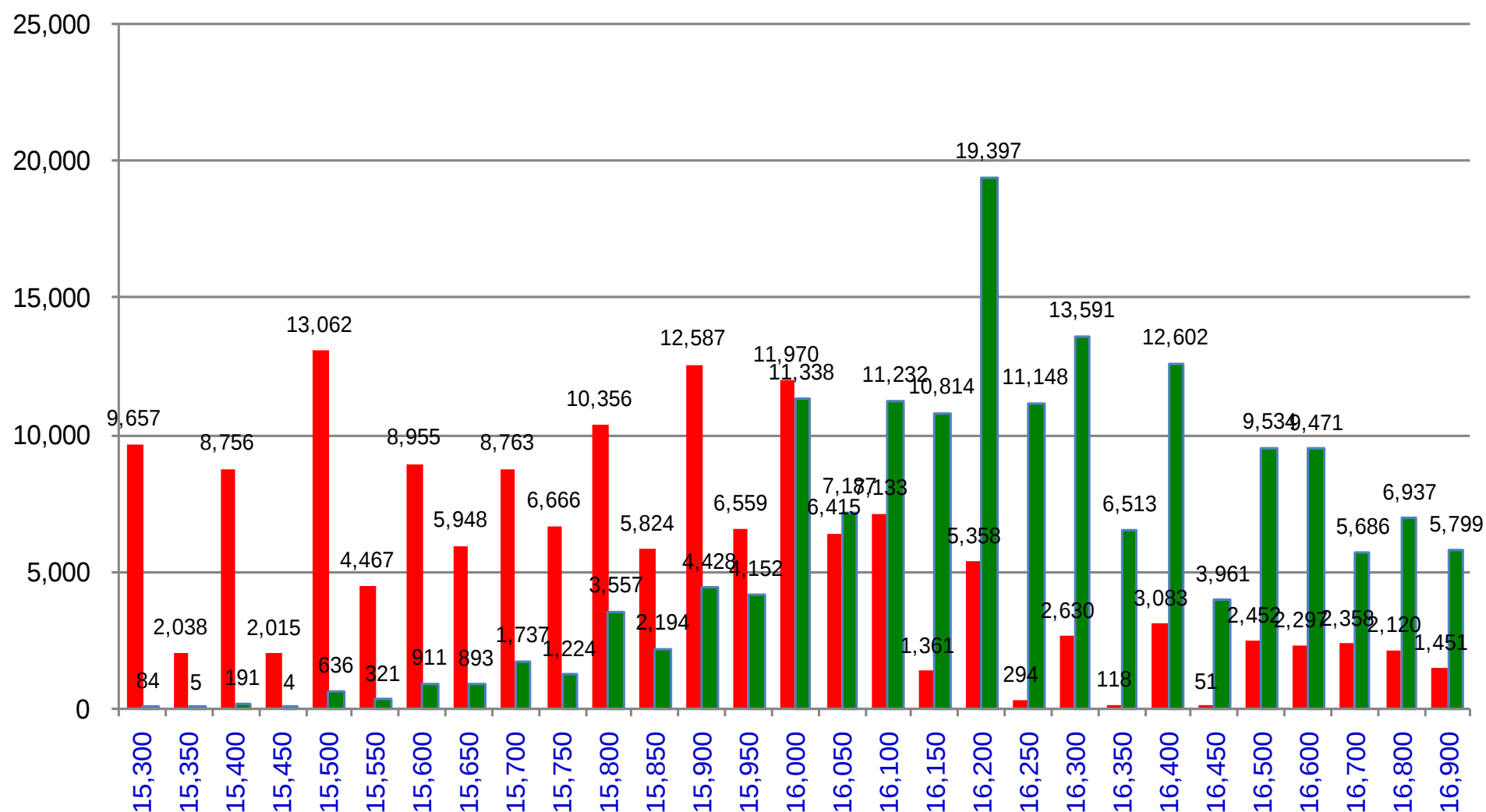


更新日期：2022年5月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：225,073

週選 CALL OI 總額：237,220



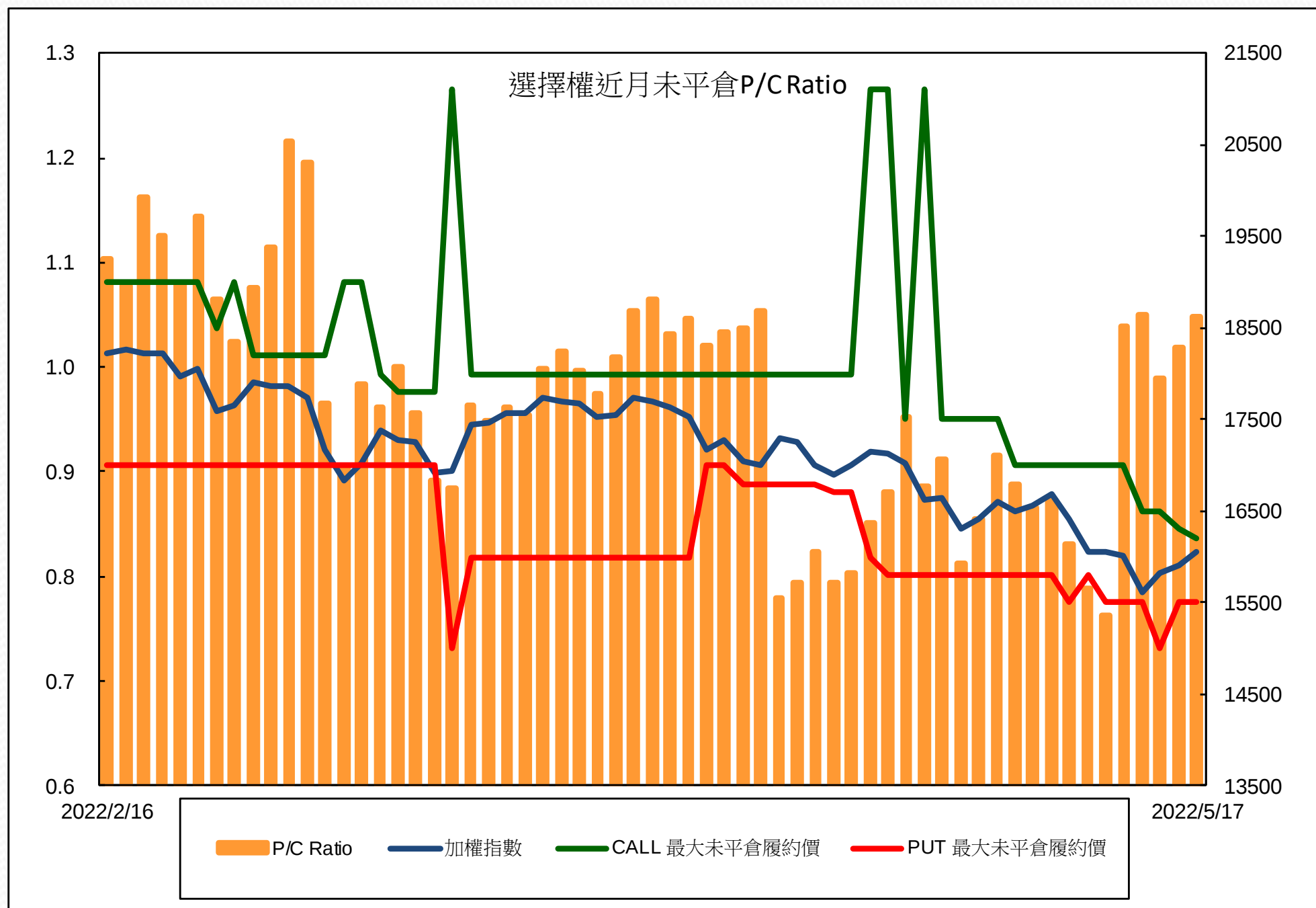
更新日期：2022年5月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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16日	84,265	77,675	6,590
	5月17日	84,910	76,423	8,487
Put	5月16日	54,696	62,224	-7,528
	5月17日	51,703	67,684	-15,981

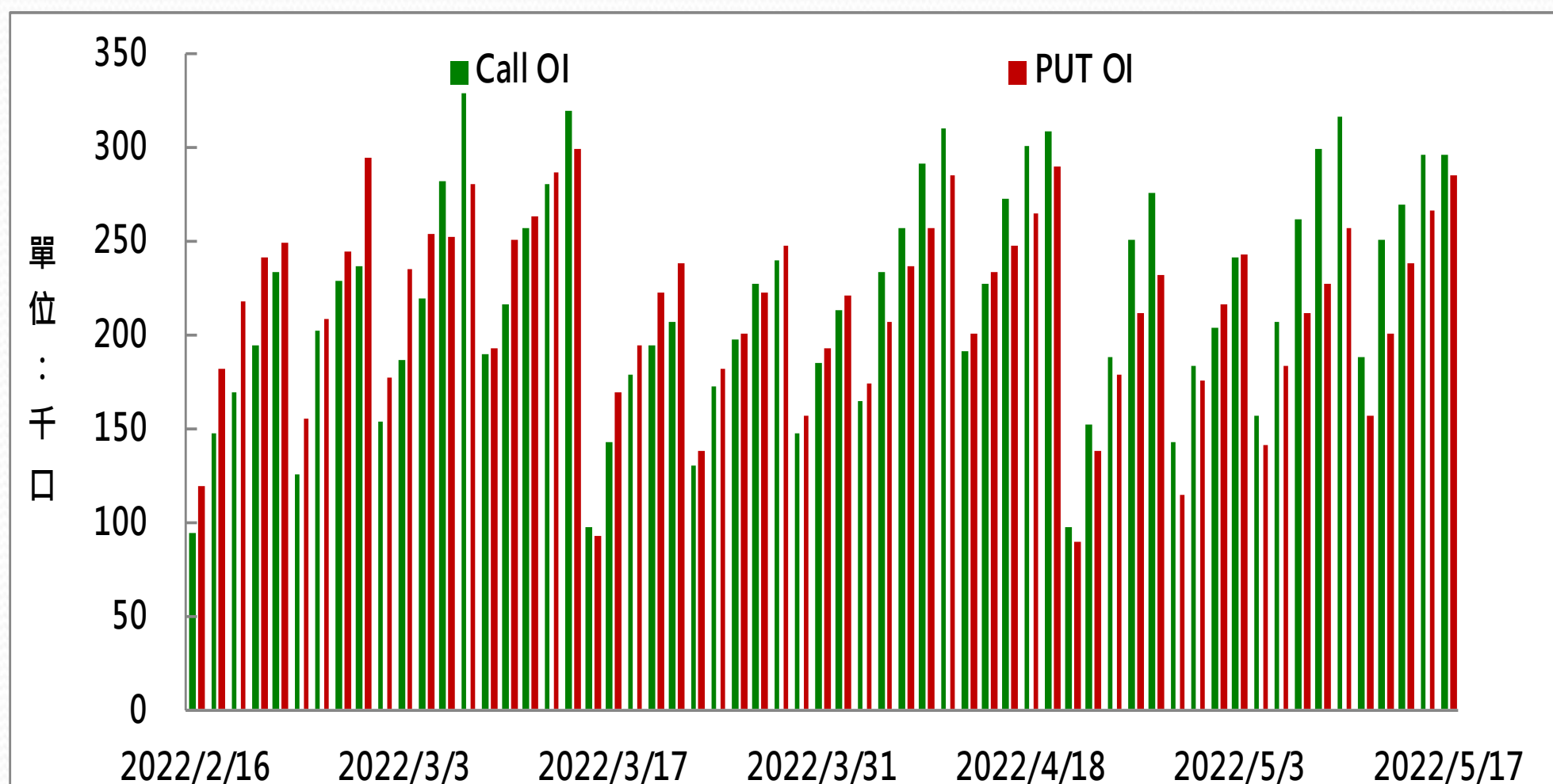
更新日期：2022年5月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年5月17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17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17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