台指選擇權OI匯報

Γ	日期:202	22/5/19		結算日	: 2022/5/25		日期:20	22/5/19		結算日	: 2022/6/15
		202205W4					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	0	14,900	2 ,057	1,709		0	5	14,500	2, 796	407
	0	0	15,000	4,198	3,058		0	0	14,600	2,9 91	215
	0	0	15,100	4,357	2,807		0	0	14,700	908	300
	5	5	15,200	3,970	1,944		1	7	14,800	2, 630	-271
8	5	5	15,300	4,729	3,370		0	0	14,900	1,311	394
	2	2	15,400	4,644	3,432		2	41	15,000	6,658	615
	13	17	15,500	5,495	4,219	*	1	9	15,100	1,670	250
	30	31	15,600	4,407	2,949		43	120	15,200	2 ,445	403
	20	20	15,650	2,7 17	2,009		1	2	15,300	3,1 97	1,585
	120	124	15,700	4,120	2,322		6	73	15,400	2 ,492	224
	64	64	15,750	1 ,981	1,132		-8	499	15,500	2 ,593	113
	229	238	15,800	4,949	3,564		-9	416	15,600	2 ,851	31
	448	472	15,850	2 ,141	1,380		67	409	15,700	1,623	224
ä	917	942	15,900	3,39 ²	1,751		68	878	15,800	2 ,009	-302
	772	791	15,950	1 ,597	864		747	1,152	15,900	2, 806	444
	2,549	2,667	16,000	3,472	1,378		513	1,564	16,000	3,5 48	785
	1,635	1,694	16,050	1,298	370		175	1,177	16,100	1,070	-163
8	2,707	2,929	16,100	2,8 85	400		281	1,699	16,200	1,480	83
	2,478	3,124	16,150	792	5		913	2,41 <mark>6</mark>	16,300	718	29
	5,140	6, <mark>576</mark>	16,200	1 ,783	534		1,530	4 <mark>,105</mark>	16,400	461	-8
	5,290	8,588	16,250	629	-2		395	5,716	16,500	335	-17
	6,622	7 <mark>,706</mark>	16,300	772	319		372	4 <mark>,185</mark>	16,600	317	-26
	4,784	5,8 <mark>02</mark>	16,350	265	-7		1,142	4,786	16,700	128	8
	9,181	10,662	16,400	557	272		※ 2,010	6,081	16,800	524	-4
	5,768	7 <mark>,480</mark>	16,450	126	-152		485	3,0 <mark>16</mark>	16,900	254	-19
	8,056	11,094	16,500	164	72		553	4 <mark>,197</mark>	17,000	392	58
	2,062	2,062	16,550	0	0		184	1,443	17,100	107	1
	3,064	6, <mark>889</mark>	16,600	74	22		388	1,648	17,200	355	1
	1,158	1,158	16,650	0	0		-110	1,232	17,300	61	-2
	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
	70,040	94,613	0.8304	78,566	49,971		10,463	65,745	1.0554	69,384	8,228
	昨日 P/C	1.1637	今日增	減變化	-0.3333		昨日 P/C	1.0261	今日增	減變化	0.0293





台指期貨、選擇權籌碼匯報

			額匯報 2022年5月19日							
單位:千元	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	94,668,284	93,097,818	1,570,466	-4,215,577	1,637,875	1,741,538	-103,663	-508,477		
投信	37,066,266	67,634,479	-30,568,213	-1,207,718	402,805	0	402,805	-8,051		
自營商	58,886,079	20,863,855	38,022,224	-2,740,393	772,980	820,419	-47,439	-56,502		
		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	451,808	1,294,107	-842,299	194,007	15,591	3,118	12,473	14,048		
投信	22,590	0	22,590	-549	1,559	0	1,559	-16		
自營商	217,723	732,378	-514,655	-177,399	51,450	49,616	1,834	14,430		

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19日							5月19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	18,937	10,382	8,555	-31	30,563	13,449	17,114	-2,326
投信	0	100	-100	-100	400	86	314	400
自營商	57,429	43,514	13,915	-1,464	35,542	38,465	-2,923	9,452
特定法人(週)	0	0	0	0	0	765	-765	0
特定法人(近月)	9,779	6,535	3,244	29	8,627	20,759	-12,132	2,931
特定法人 (全月)	9,285	6,685	2,600	-2,863	4,608	22,628	-18,020	-1,452
十大交易人(週)	29,133	32,152	-3,019	-4,853	28,536	24,948	3,588	-1,644
十大交易人(近月)	44,426	26,748	17,678	1,811	26,126	32,904	-6,778	-4,064
十大交易人(全月)	72,229	49,437	22,792	1,043	51,510	60,623	-9,113	-8,696
全市場未沖銷 (近月)			71,817	12,215			69,384	8,228
全市場未沖銷 (全月)			178,158	82,940			157,617	58,914





台指選擇權匯報

2022 年 05W4 週 選擇權分析表							
	買權成交最大量	16300	買權OI最大量	16500			
	賣權成交最大量	15600	賣權OI最大量	15500			
台指選擇權	整體隱含波動率	19.59%	較前一交易日	+2.61%			
	買權隱含波動率	14.21%	較前一交易日	+2.30%			
	賣權隱含波動率	25.01%	較前一交易日	+3.13%			
電子選擇權	買權成交最大量	745	買權OI最大量	740			
电)选择惟	賣權成交最大量	745	賣權OI最大量	720			
金融選擇權	買權成交最大量	1680	買權OI最大量	1920			
北川大と「十一庄	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1540			





台指選擇權匯報

	2022 年 06 月 選擇權分析表							
	買權成交最大量	16800	買權OI最大量	16800				
	賣權成交最大量	15000	賣權OI最大量	15000				
	整體隱含波動率	19.90%	較前一交易日	-0.94%				
台指選擇權	買權隱含波動率	14.18%	較前一交易日	+1.70%				
	賣權隱含波動率	25.87%	較前一交易日	+0.93%				
	成交量P/C_Ratio值	0.925	較前一交易日	-0.17				
	未平倉P/C_Ratio值	0.966	較前一交易日	-0.06				
電子選擇權	買權成交最大量	745	買權OI最大量	740				
电」选择性	賣權成交最大量	745	賣權OI最大量	720				
金融選擇權	買權成交最大量	1680	買權OI最大量	1920				
业附及选1千1硅	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1540				





選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數

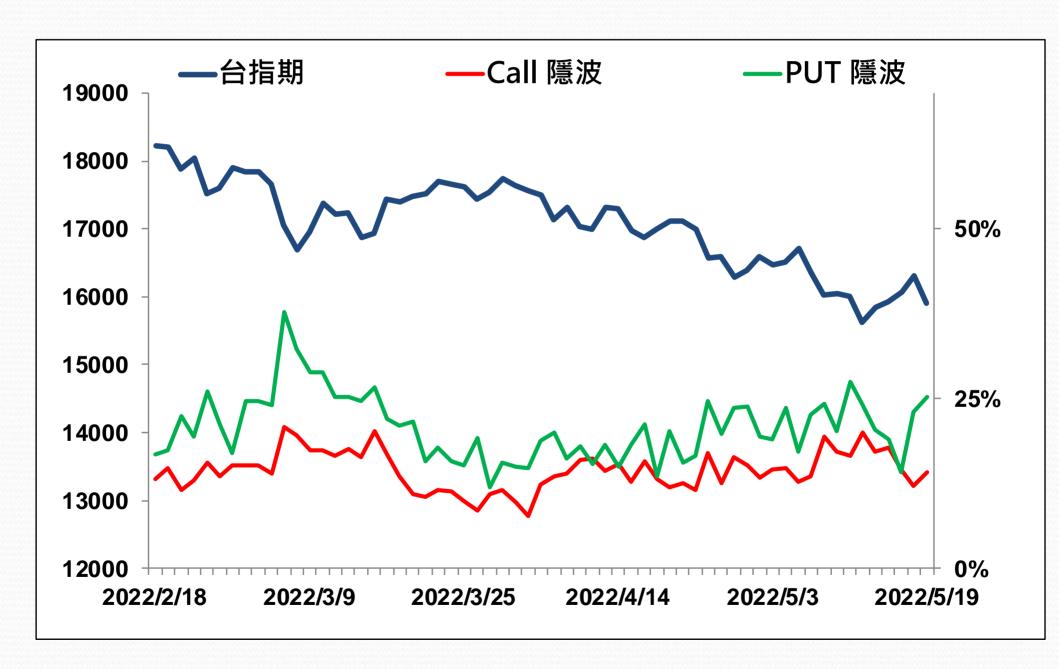








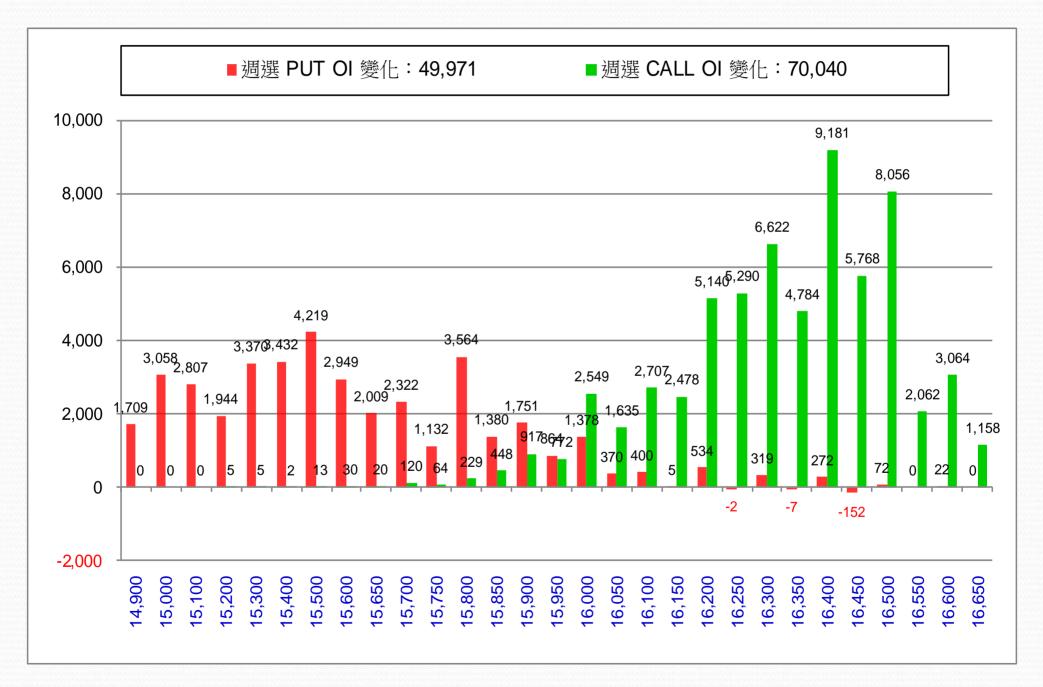
台指近月隱含波動度







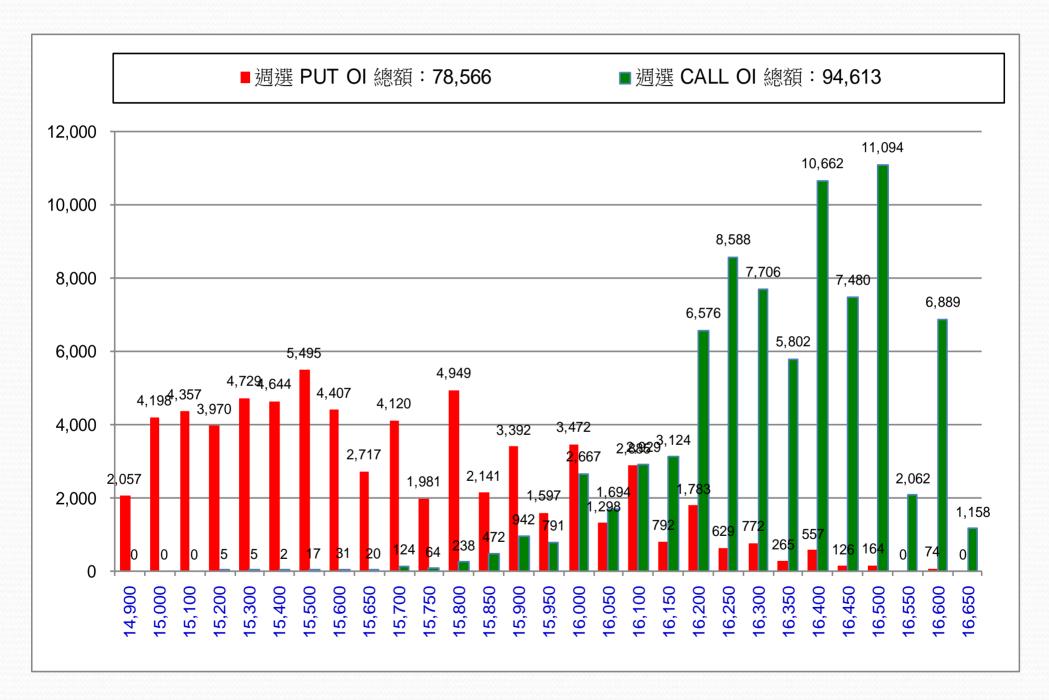
台指週選擇權OI每日變化量







台指週選擇權OI每日總量







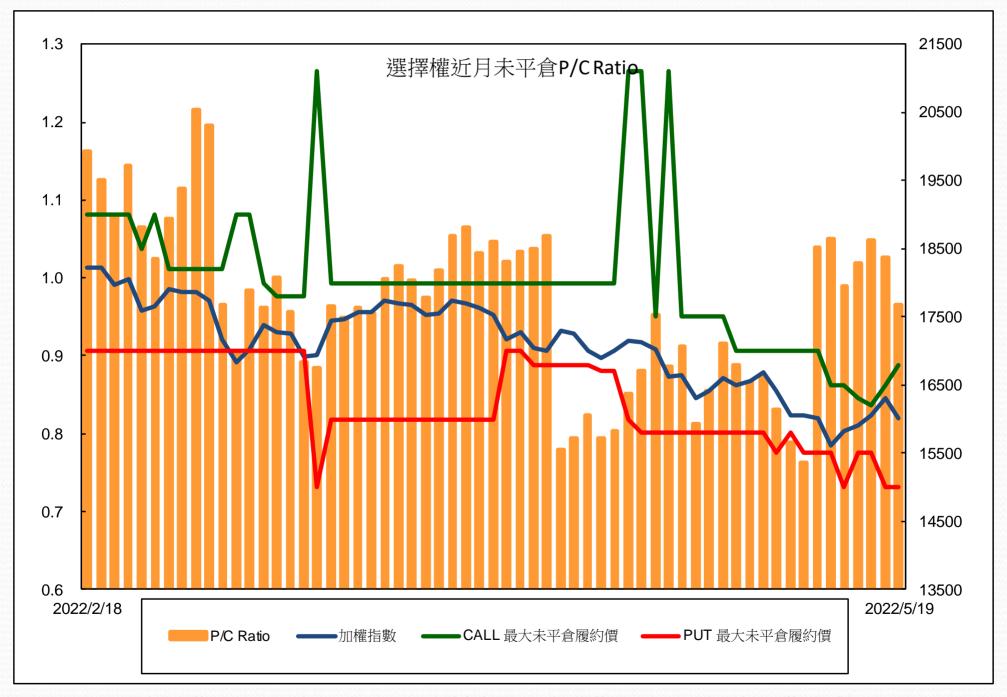
自營商選擇權0I部位統計

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18日	42,499	27,120	15,379
Call	5月19日	57,429	43,514	13,915
Dut	5月18日	19,655	32,030	-12,375
Put	5月19日	35,542	38,465	-2,923





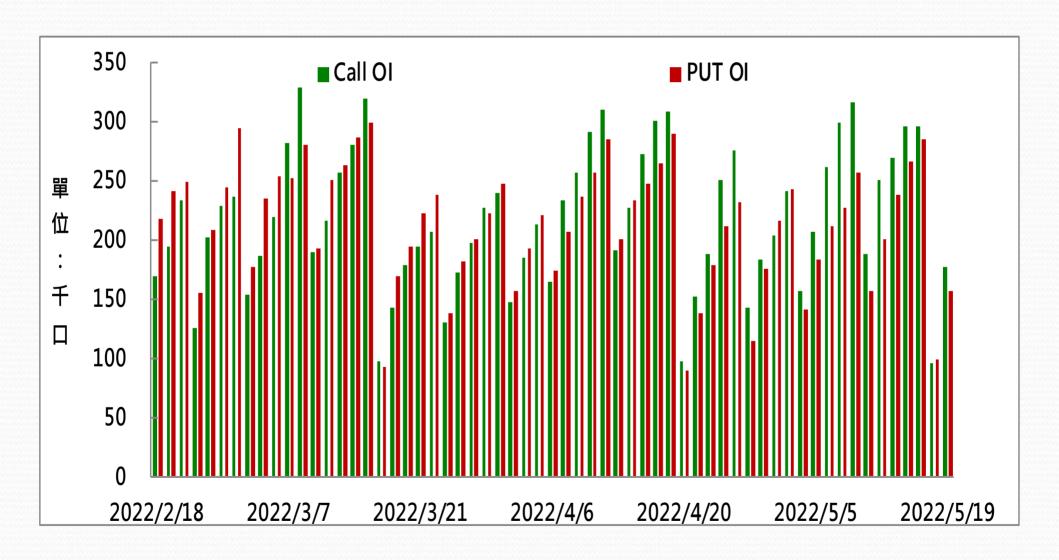
選擇權近月未平倉P/C Ratio







選擇權全月Put Call OI







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19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



