

台指選擇權OI匯報

日期：2022/5/20 結算日：2022/5/25					日期：2022/5/20 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
1	6	15,300	4,517	-212	0	0	14,600	3,096	105
3	5	15,400	6,148	1,504	0	0	14,700	929	21
57	74	15,500	6,927	1,432	0	7	14,800	2,982	352
0	0	15,550	1,431	1,431	0	0	14,900	1,120	-191
39	70	15,600	6,337	1,930	0	41	15,000	7,267	609
25	45	15,650	3,747	1,030	1	10	15,100	2,020	350
81	205	15,700	6,312	2,192	14	134	15,200	2,913	468
153	217	15,750	3,637	1,656	1	3	15,300	3,240	43
468	706	15,800	7,163	2,214	41	114	15,400	2,512	20
367	839	15,850	3,511	1,370	-4	495	15,500	2,798	205
406	1,348	15,900	5,567	2,175	18	434	15,600	2,518	-333
463	1,254	15,950	3,210	1,613	21	430	15,700	1,680	57
487	3,154	16,000	5,994	2,522	82	960	15,800	2,427	418
751	2,445	16,050	3,200	1,902	118	1,270	15,900	3,024	218
1,311	4,240	16,100	4,503	1,618	158	1,722	16,000	4,135	587
700	3,824	16,150	2,315	1,523	298	1,475	16,100	1,401	331
708	7,284	16,200	2,799	1,016	454	2,153	16,200	1,553	73
-1,285	7,303	16,250	1,179	550	141	2,557	16,300	866	148
1,124	8,830	16,300	923	151	250	4,355	16,400	497	36
1,683	7,485	16,350	293	28	559	6,275	16,500	344	9
※ 1,917	12,579	16,400	591	34	239	4,424	16,600	346	29
1,872	9,352	16,450	183	57	665	5,451	16,700	249	121
658	11,752	16,500	169	5	916	6,997	16,800	535	11
869	2,931	16,550	0	0	142	3,158	16,900	254	0
-557	6,332	16,600	73	-1	※ 954	5,151	17,000	411	19
1,048	2,206	16,650	11	11	156	1,599	17,100	103	-4
251	5,552	16,700	63	7	-14	1,634	17,200	355	0
435	547	16,750	0	0	136	1,368	17,300	61	0
228	3,978	16,800	7	-1	-567	1,636	17,400	239	-4
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
14,361	108,974	0.9973	108,681	30,115	5,201	70,946	1.0308	73,131	3,747
昨日 P/C	0.8304	今日增減變化		0.1669	昨日 P/C	0.9661	今日增減變化		0.0647

更新日期：2022年5月20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20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	107,273,732	88,898,441	18,375,291	16,804,825	2,180,614	1,603,922	576,692	680,355
投信	37,551,699	67,684,066	-30,132,367	435,846	399,479	0	399,479	-3,326
自營商	58,013,977	24,085,230	33,928,747	-4,093,477	1,084,194	964,050	120,144	167,583
	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	458,536	1,365,817	-907,281	-64,982	42,641	118,448	-75,807	-88,280
投信	22,845	0	22,845	255	1,579	0	1,579	20
自營商	311,557	812,316	-500,759	13,896	203,730	91,320	112,410	110,576

臺指選擇權三大法人&大額交易者未平倉口數匯報

2022年5月20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	20,779	11,944	8,835	280	31,607	13,642	17,965	851
投信	0	100	-100	0	400	86	314	0
自營商	67,825	42,712	25,113	11,198	36,117	45,314	-9,197	-6,274
特定法人(週)	1,499	0	1,499	1,499	0	869	-869	-104
特定法人(近月)	10,421	6,635	3,786	542	7,336	21,865	-14,529	-2,397
特定法人(全月)	9,981	6,785	3,196	596	2,566	24,583	-22,017	-3,997
十大交易者(週)	33,686	31,832	1,854	4,873	35,421	23,010	12,411	8,823
十大交易者(近月)	49,586	28,178	21,408	3,730	26,216	32,892	-6,676	102
十大交易者(全月)	84,140	49,659	34,481	11,689	57,007	59,977	-2,970	6,143
全市場未沖銷(近月)			77,068	5,251			73,131	3,747
全市場未沖銷(全月)			198,457	20,299			192,051	34,434

更新日期：2022年5月20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05W4週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16200	買權OI最大量	16400
	賣權成交最大量	15800	賣權OI最大量	15800
	整體隱含波動率	18.95%	較前一交易日	-0.64%
	買權隱含波動率	16.21%	較前一交易日	+2.00%
	賣權隱含波動率	21.71%	較前一交易日	-3.30%
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	680	賣權OI最大量	680
金融選擇權	買權成交最大量	1640	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1540

更新日期：2022年5月20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	16500	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	20.17%	較前一交易日	-0.26%
	買權隱含波動率	14.18%	較前一交易日	+0.00%
	賣權隱含波動率	26.18%	較前一交易日	+0.32%
	成交量P/C_Ratio值	1.116	較前一交易日	+0.19
	未平倉P/C_Ratio值	0.949	較前一交易日	-0.02
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	680	賣權OI最大量	680
金融選擇權	買權成交最大量	1640	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1540

更新日期：2022年5月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

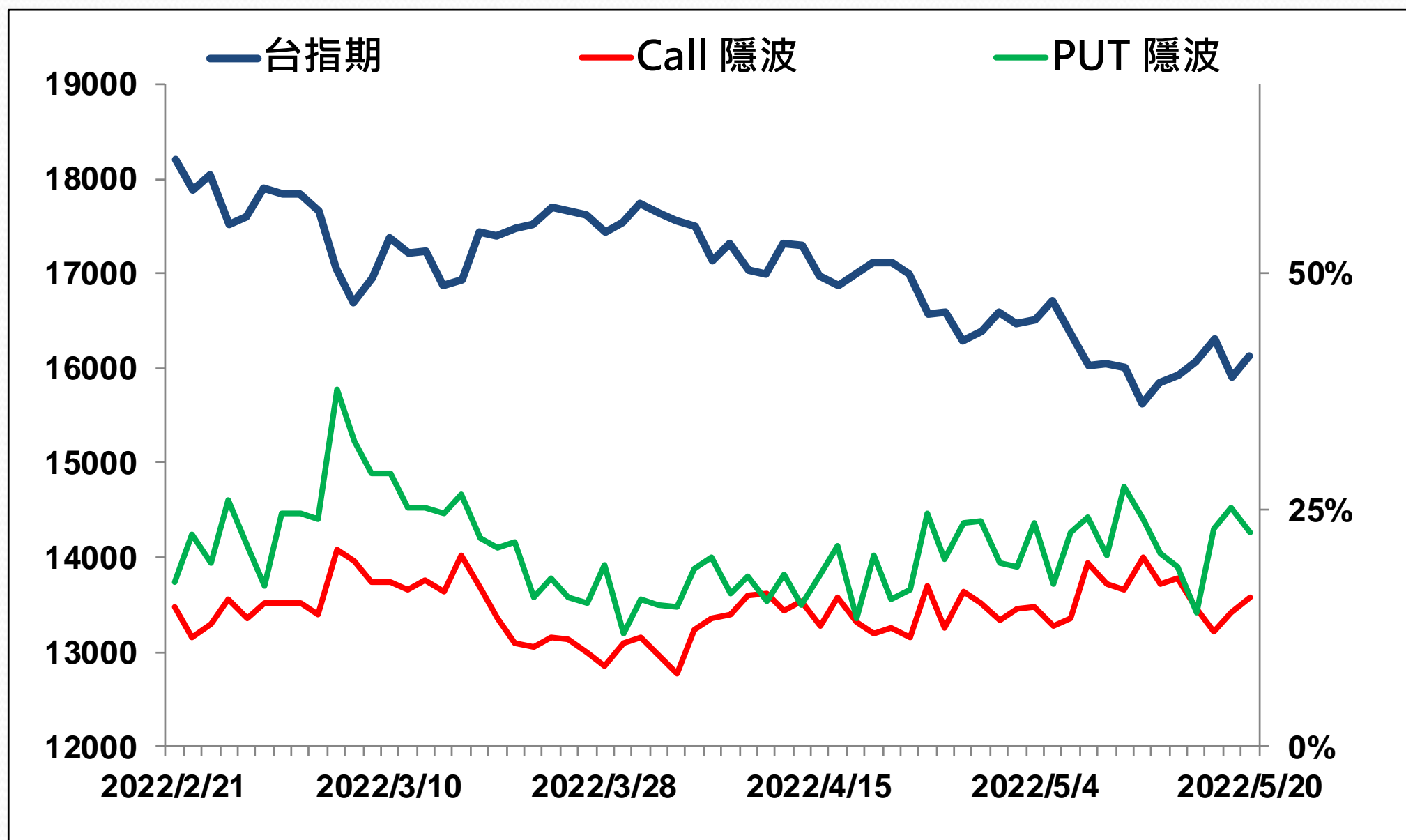
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



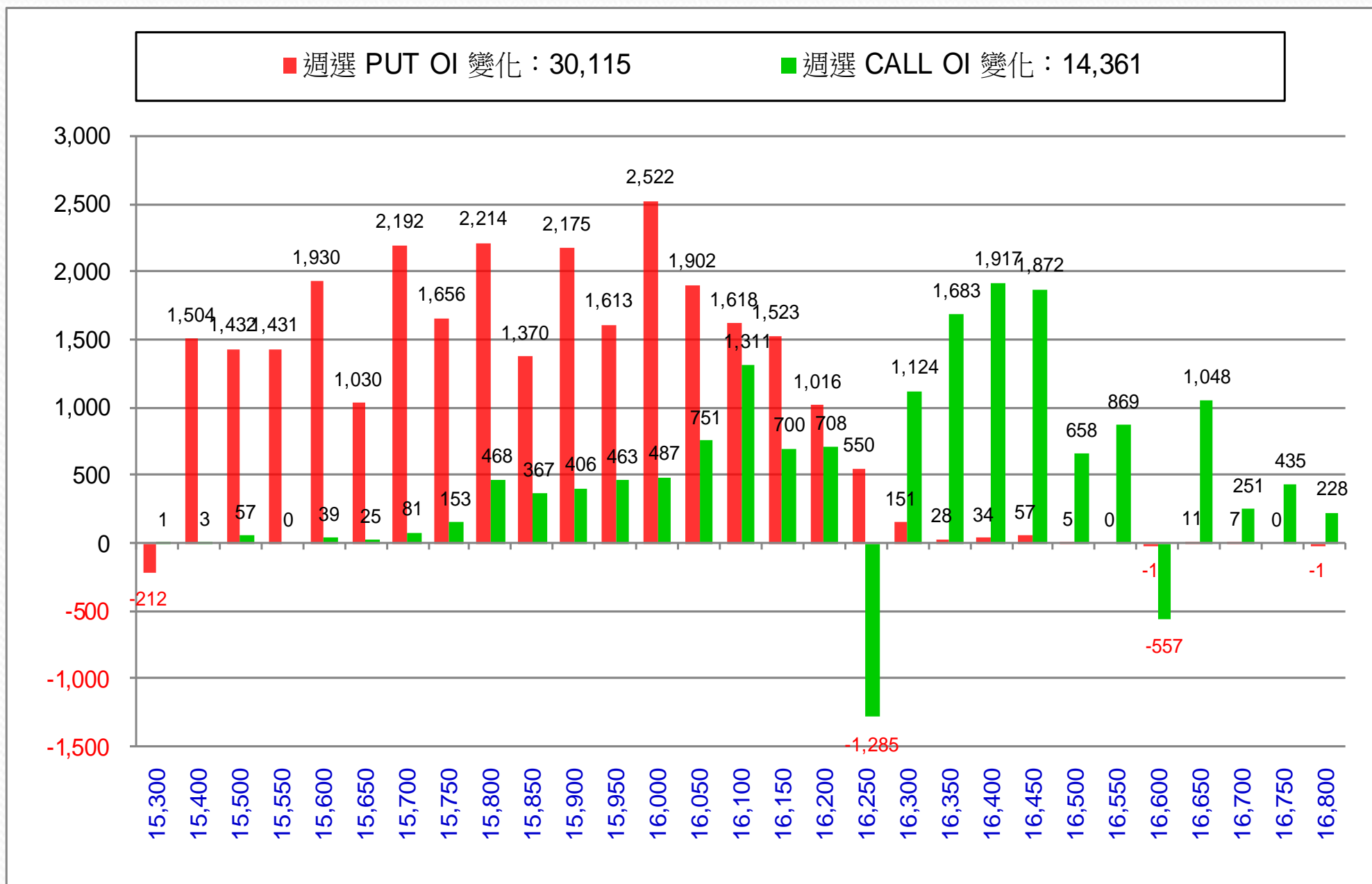
更新日期：2022年5月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年5月20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

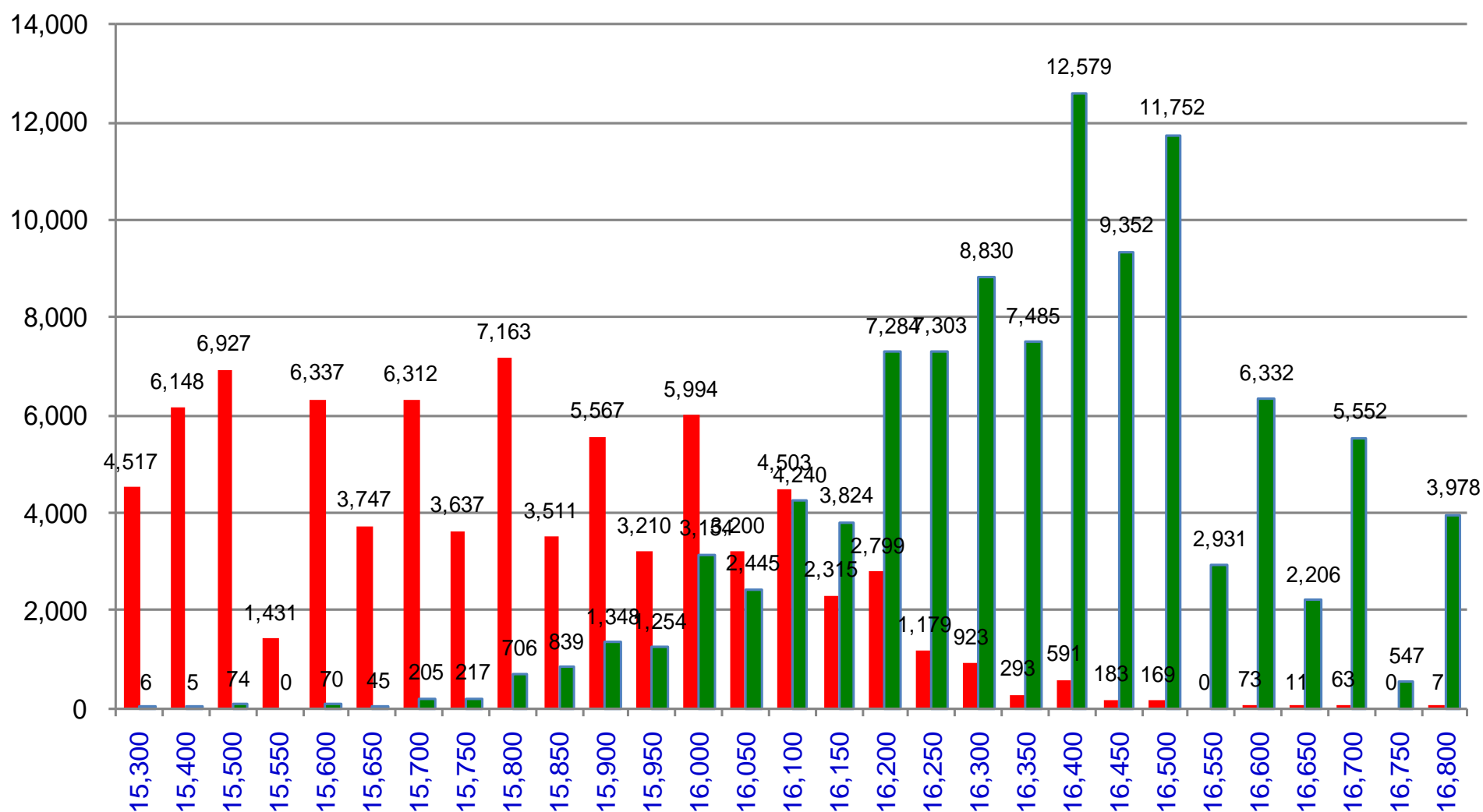


更新日期：2022年5月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：108,681

週選 CALL OI 總額：108,974



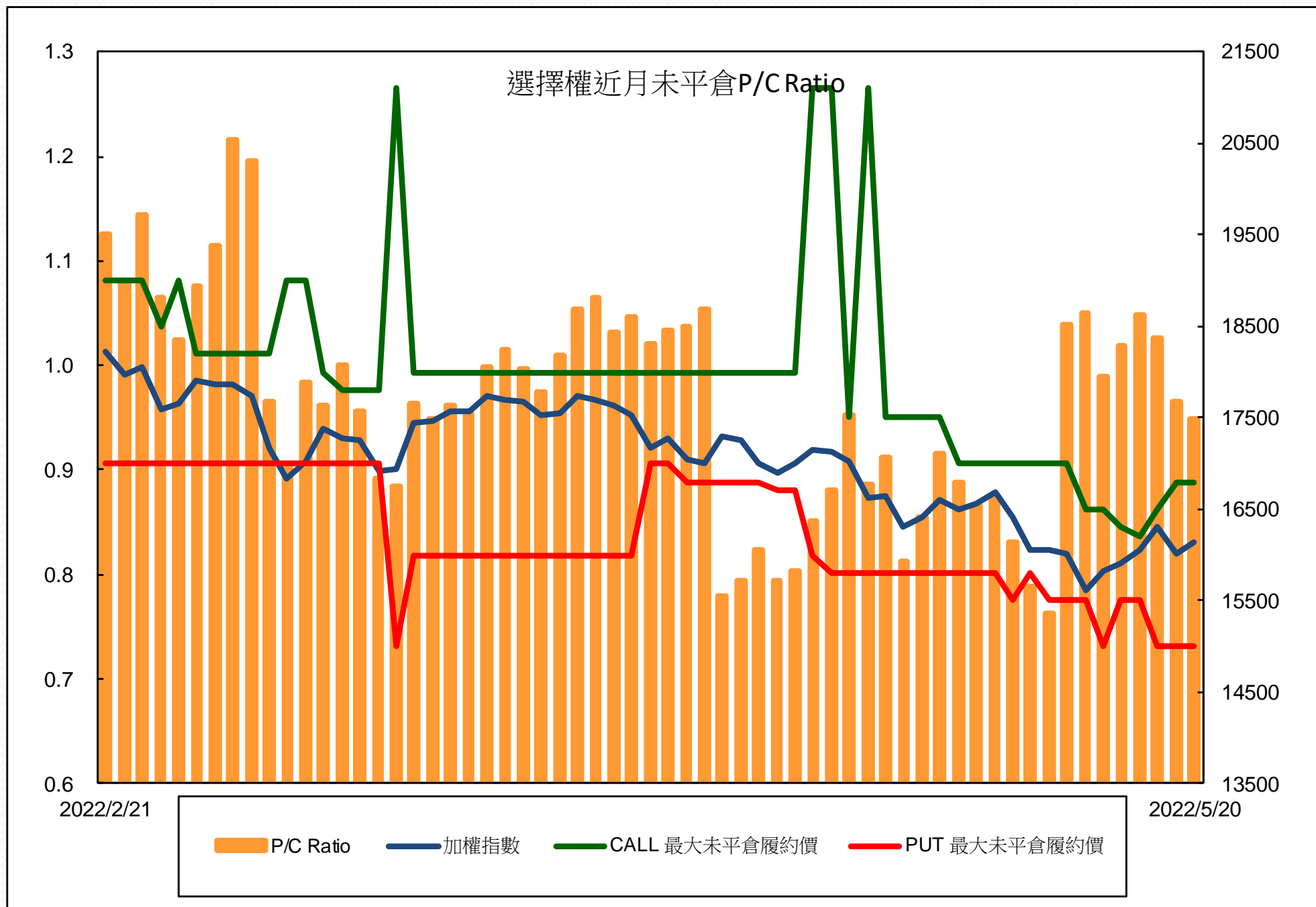
更新日期：2022年5月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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19日	57,429	43,514	13,915
	5月20日	67,825	42,712	25,113
Put	5月19日	35,542	38,465	-2,923
	5月20日	36,117	45,314	-9,197

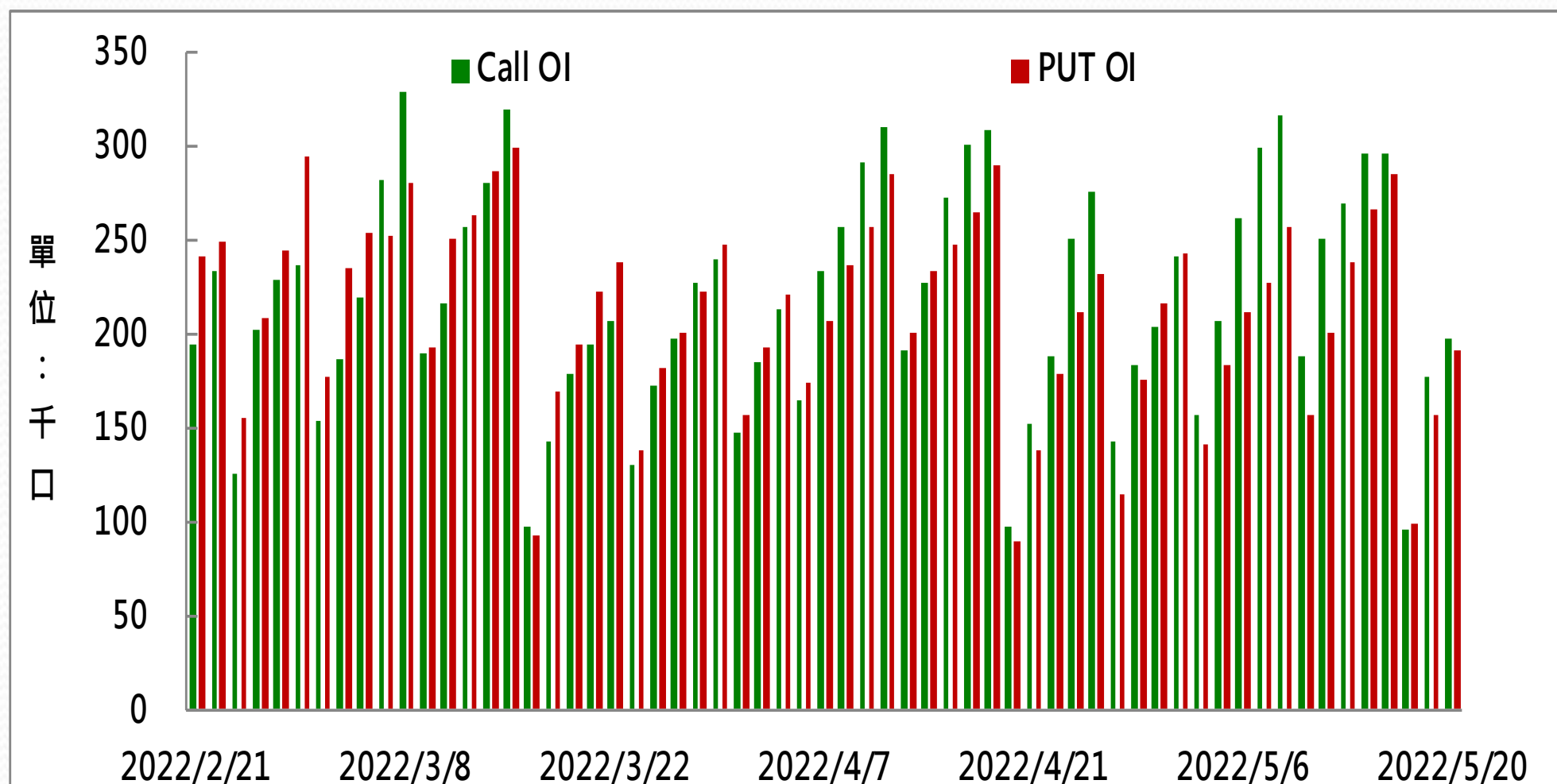
更新日期：2022年5月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年5月20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20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20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