

台指選擇權OI匯報

日期：2022/5/31 結算日：2022/6/1					日期：2022/5/31 結算日：2022/6/15				
202206W1					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
-31	1,746	16,050	3,669	-1,508	0	9	15,300	3,570	-118
-90	2,275	16,100	6,438	-1,343	0	120	15,400	3,864	-189
-124	2,505	16,150	4,432	-926	-8	508	15,500	5,517	247
-295	2,934	16,200	7,670	-28	-14	460	15,600	4,776	452
-280	3,603	16,250	5,346	-1,763	-23	479	15,700	5,160	64
-558	3,160	16,300	7,261	-1,301	-32	1,074	15,800	5,058	228
-617	2,445	16,350	6,714	604	-36	1,865	15,900	5,679	527
-1,228	4,158	16,400	9,524	1,891	-32	3,050	16,000	8,369	633
-565	3,133	16,450	9,063	3,389	-132	2,437	16,100	3,440	135
-1,686	4,890	16,500	10,299	2,650	-169	3,807	16,200	4,385	1,235
111	4,802	16,550	8,136	3,320	-277	3,278	16,300	2,980	1,127
-543	8,222	16,600	9,024	5,081	-661	4,686	16,400	2,070	570
945	5,910	16,650	5,593	4,745	-517	6,080	16,500	2,632	952
647	13,394	16,700	4,856	4,314	-797	5,155	16,600	1,319	310
1,779	6,606	16,750	2,075	1,940	-134	7,817	16,700	783	372
717	9,162	16,800	1,070	893	45	9,697	16,800	773	123
3,906	3,906	16,850	112	112	1,304	6,439	16,900	247	34
689	3,822	16,900	90	65	2,535	10,701	17,000	491	27
279	279	16,950	20	20	614	3,352	17,100	109	-3
185	2,063	17,000	48	4	520	3,376	17,200	353	5
48	48	17,050	0	0	428	2,891	17,300	65	8
106	595	17,100	2	0	197	2,576	17,400	239	0
13	17	17,200	0	0	-48	1,041	17,500	52	0
0	3	17,300	2	0	-4	732	17,600	648	0
0	1	17,400	3	3	-22	828	17,700	34	0
0	0	17,500	0	0	-34	923	17,800	274	0
1	13	17,600	0	0	-4	501	17,900	1	0
0	0	17,700	0	0	19	898	18,000	121	0
0	1	17,800	0	0	0	376	18,100	1	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
3,323	92,728	1.8365	170,291	16,327	2,682	103,715	1.0964	113,715	4,494
昨日 P/C	1.7221	今日增減變化	0.1144	昨日 P/C	1.0810	今日增減變化	0.0154		

更新日期：2022年5月31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31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	165,531,530	138,123,149	27,408,381	3,537,707	4,446,026	3,012,625	1,433,401	-63,783
投信	45,892,767	64,031,687	-18,138,920	9,839,166	425,056	0	425,056	1,672
自營商	56,215,799	29,881,214	26,334,585	-5,657,551	1,476,466	1,127,796	348,670	414,864
	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	706,944	1,787,558	-1,080,614	255,370	122,843	167,066	-44,223	-8,224
投信	65,645	0	65,645	24	0	0	0	-1,636
自營商	417,222	841,258	-424,036	-119,381	444,462	265,455	179,007	91,807

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31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	44,044	24,423	19,621	-1,564	36,814	15,189	21,625	1,790
投信	0	150	-150	0	550	86	464	0
自營商	65,888	43,618	22,270	827	53,746	76,013	-22,267	-10,437
特定法人(週)	3,204	2,411	793	-2,680	0	2,418	-2,418	-288
特定法人(近月)	23,387	9,121	14,266	1,748	6,660	20,317	-13,657	-631
特定法人(全月)	34,323	17,134	17,189	3,388	0	25,727	-25,727	126
十大交易人(週)	30,718	33,823	-3,105	-3,094	58,783	35,863	22,920	3,809
十大交易人(近月)	65,660	36,493	29,167	4,470	38,739	44,346	-5,607	1,872
十大交易人(全月)	106,324	62,451	43,873	1,580	90,945	79,464	11,481	9,097
全市場未沖銷(近月)			103,715	2,682			113,715	4,494
全市場未沖銷(全月)			221,308	6,650			299,283	21,965

更新日期：2022年5月31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06W1週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16700	買權OI最大量	16700
	賣權成交最大量	16500	賣權OI最大量	16500
	整體隱含波動率	10.63%	較前一交易日	-2.77%
	買權隱含波動率	0.58%	較前一交易日	-7.86%
	賣權隱含波動率	20.03%	較前一交易日	+2.31%
電子選擇權	買權成交最大量	780	買權OI最大量	780
	賣權成交最大量	735	賣權OI最大量	740
金融選擇權	買權成交最大量	1740	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1660	賣權OI最大量	1540

更新日期：2022年5月31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	17000	買權OI最大量	17000
	賣權成交最大量	16200	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	16.92%	較前一交易日	+2.00%
	買權隱含波動率	9.26%	較前一交易日	-4.21%
	賣權隱含波動率	23.40%	較前一交易日	+0.15%
	成交量P/C_Ratio值	1.159	較前一交易日	-0.11
	未平倉P/C_Ratio值	1.096	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	780
	賣權成交最大量	735	賣權OI最大量	740
金融選擇權	買權成交最大量	1740	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1660	賣權OI最大量	1540

更新日期：2022年5月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

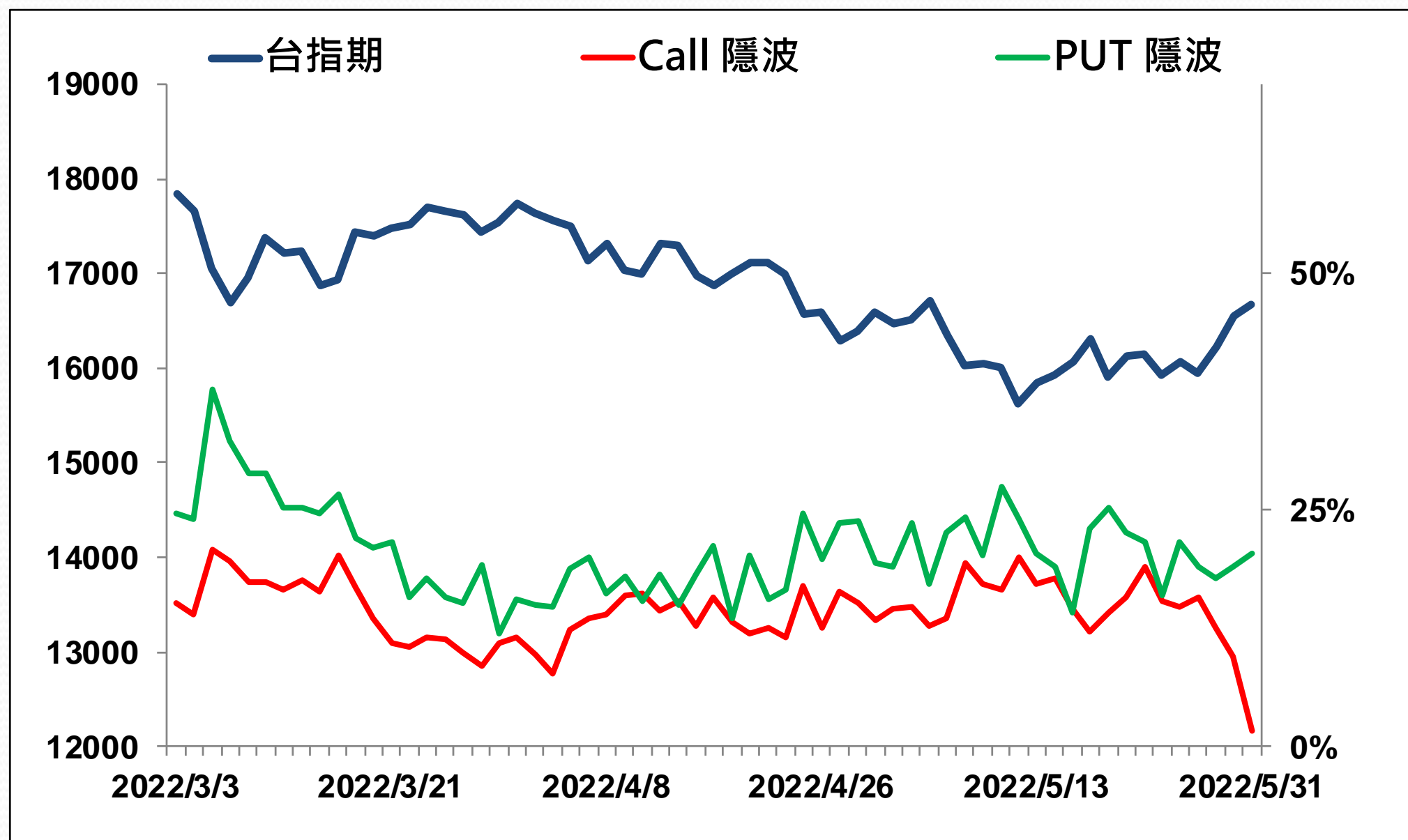
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2022年5月31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

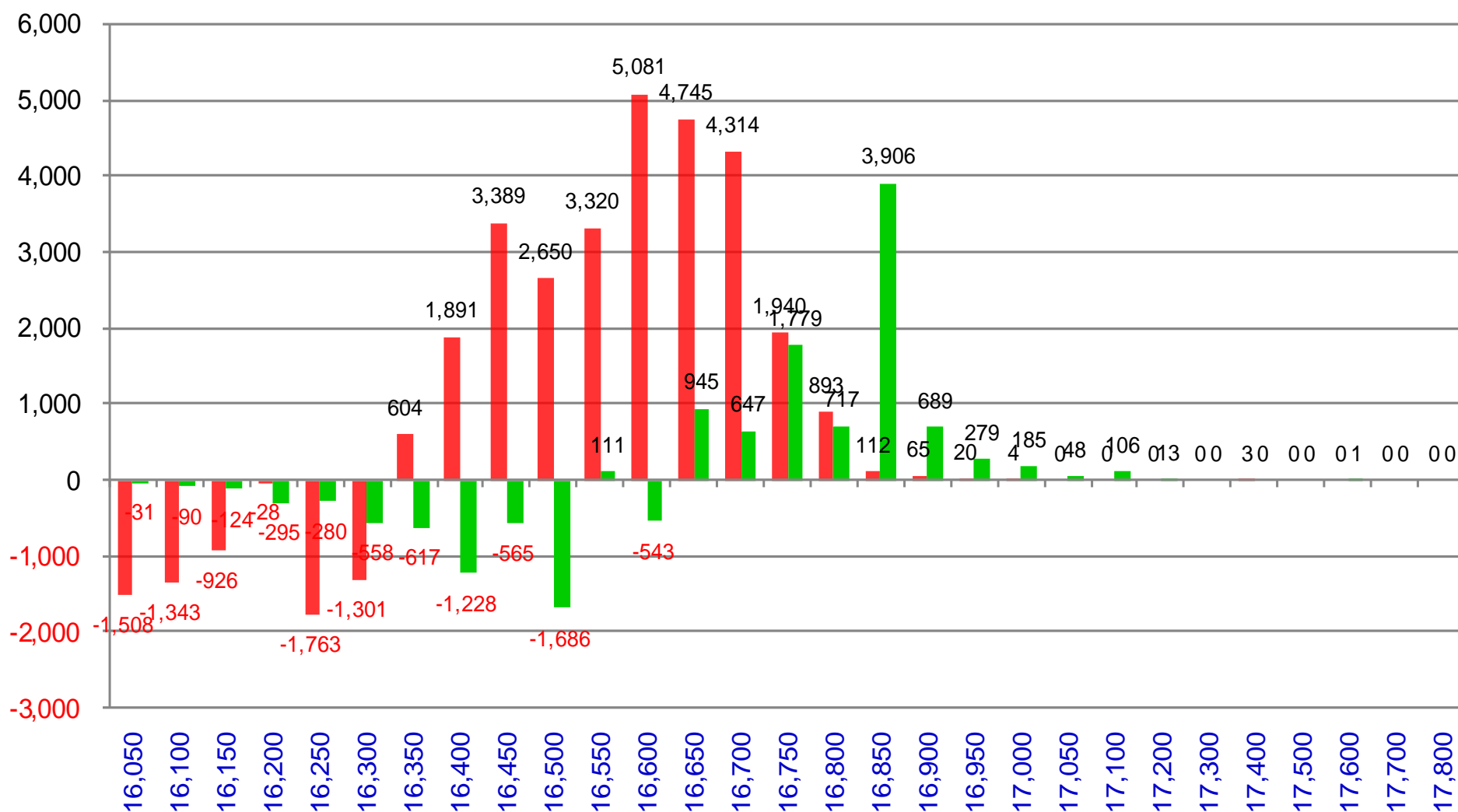


更新日期：2022年5月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：16,327

週選 CALL OI 變化：3,323

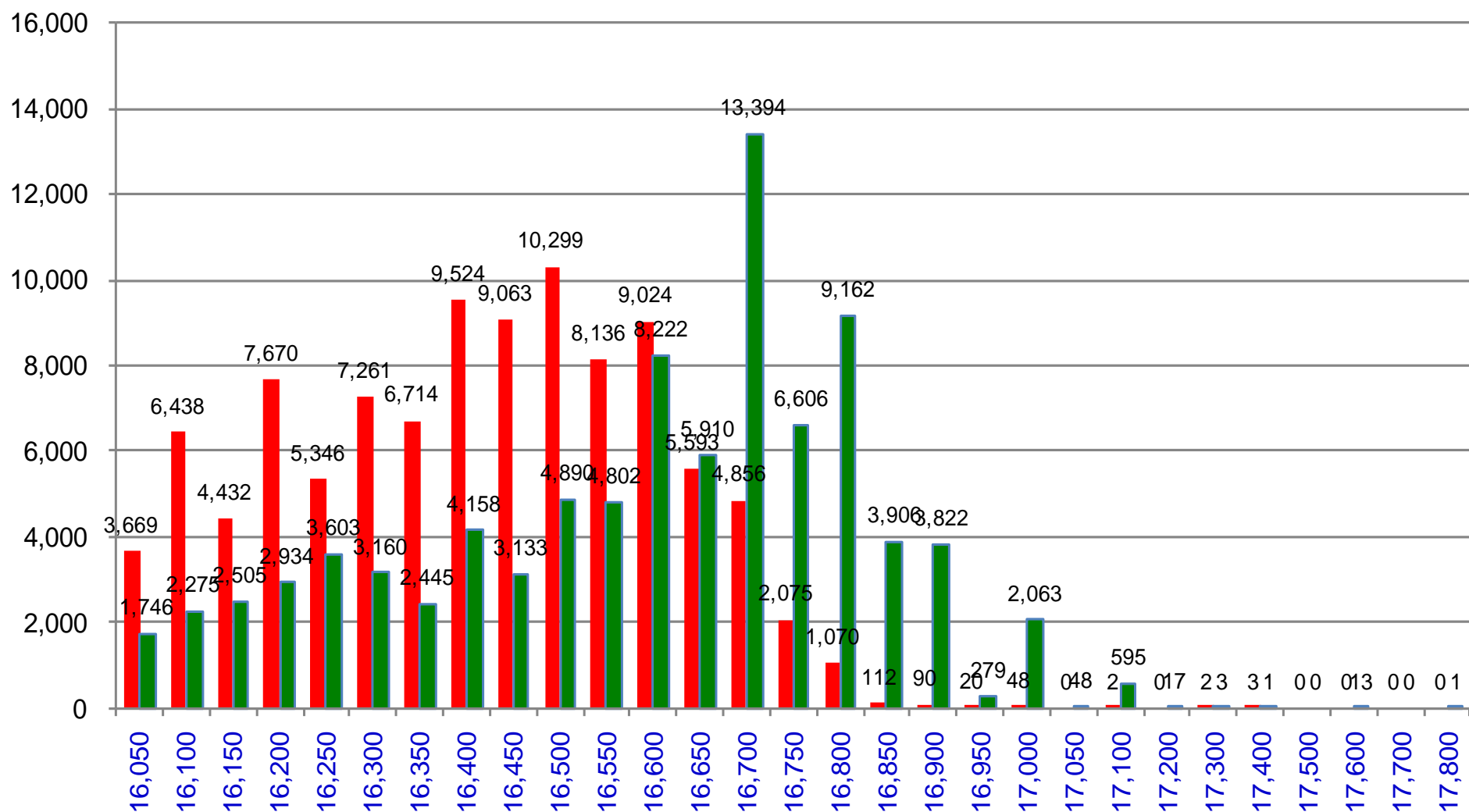


更新日期：2022年5月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：170,291

週選 CALL OI 總額：92,728



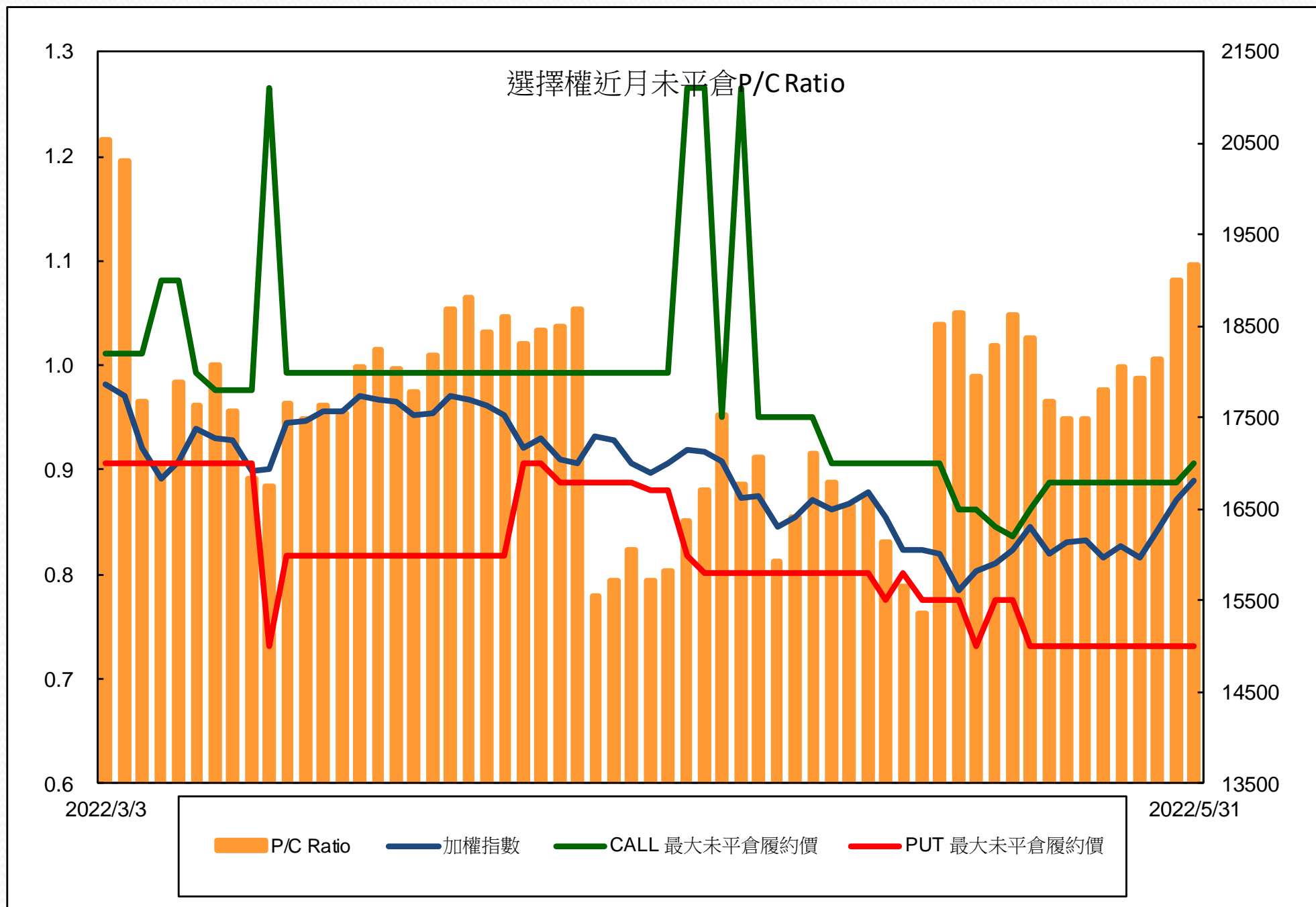
更新日期：2022年5月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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30日	65,171	43,728	21,443
	5月31日	65,888	43,618	22,270
Put	5月30日	54,591	66,421	-11,830
	5月31日	53,746	76,013	-22,267

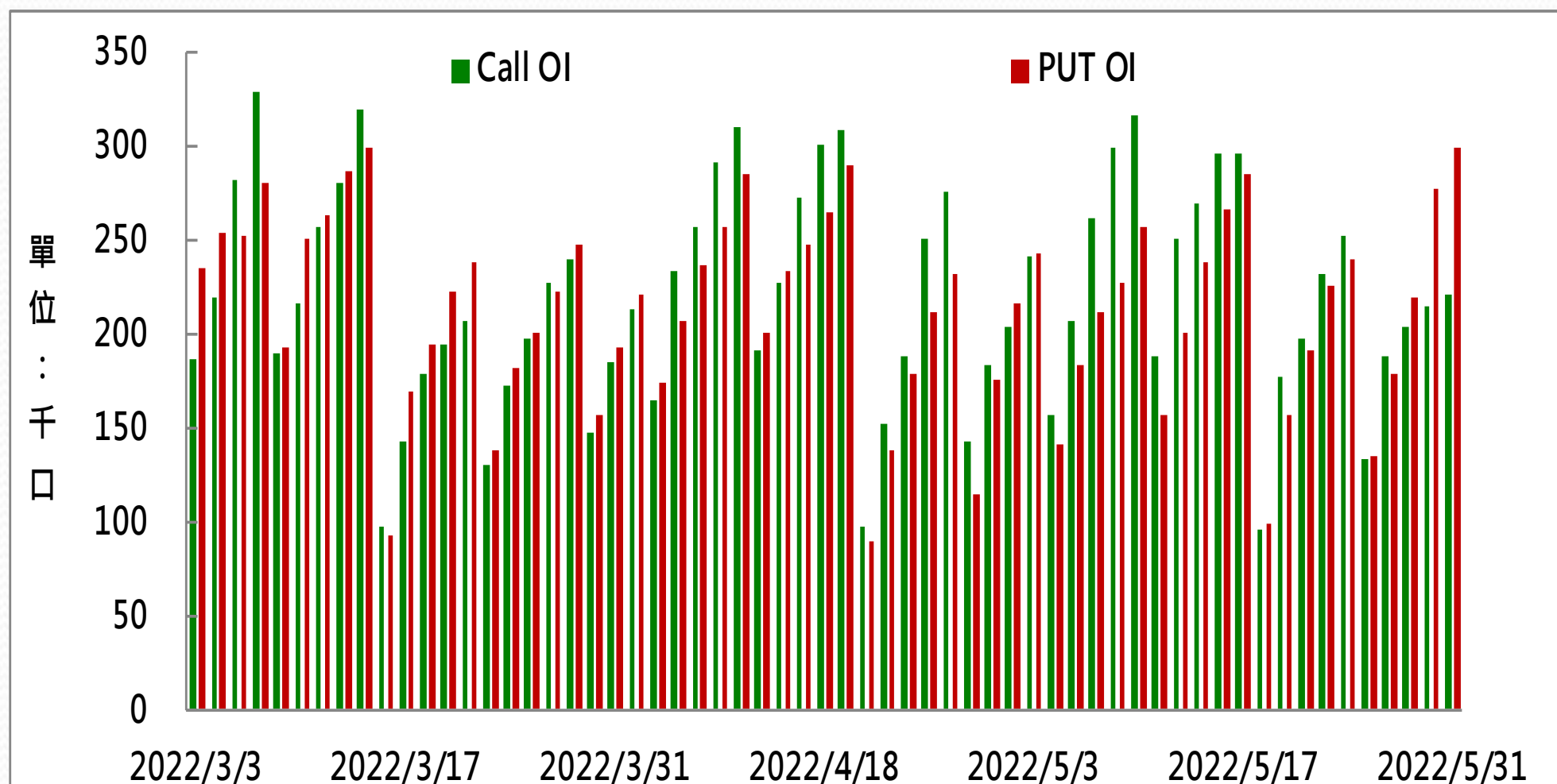
更新日期：2022年5月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年5月31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31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31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