

台指選擇權OI匯報

日期：2022/6/1 結算日：2022/6/8					日期：2022/6/1 結算日：2022/6/15				
202206W2					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	15,600	445	445	-79	136	15,200	2,428	-263
0	0	15,700	1,049	1,049	0	9	15,300	3,450	-120
0	0	15,800	2,114	2,114	0	120	15,400	4,229	365
0	0	15,900	1,989	1,989	-5	503	15,500	5,599	82
2	2	16,000	1,496	1,496	-23	437	15,600	4,727	-49
4	4	16,100	1,306	1,306	-2	477	15,700	4,916	-244
4	4	16,200	2,038	2,038	-14	1,060	15,800	5,033	-25
23	23	16,300	3,066	3,066	0	1,865	15,900	5,934	255
2	2	16,350	616	616	-43	3,007	16,000	9,154	785
67	67	16,400	1,405	1,405	-80	2,357	16,100	4,050	610
70	70	16,450	736	736	-140	3,667	16,200	6,097	1,712
146	146	16,500	1,377	1,377	-244	3,034	16,300	3,286	306
475	475	16,550	1,141	1,141	-444	4,242	16,400	2,556	486
354	354	16,600	1,068	1,068	-199	5,881	16,500	3,242	610
604	604	16,650	907	907	-242	4,913	16,600	2,163	844
1,505	1,505	16,700	997	997	-276	7,541	16,700	1,554	771
814	814	16,750	332	332	-2,892	6,805	16,800	1,066	293
1,597	1,597	16,800	265	265	1,243	7,682	16,900	306	59
1,200	1,200	16,850	156	156	1,010	11,711	17,000	866	375
1,869	1,869	16,900	232	232	1,819	5,171	17,100	166	57
1,288	1,288	16,950	4	4	1,126	4,502	17,200	358	5
2,242	2,242	17,000	34	34	703	3,594	17,300	60	-5
2,885	2,885	17,050	2	2	426	3,002	17,400	239	0
2,195	2,195	17,100	5	5	-91	950	17,500	52	0
1,394	1,394	17,150	0	0	47	779	17,600	648	0
1,502	1,502	17,200	0	0	-10	818	17,700	33	-1
1,122	1,122	17,250	1	1	28	951	17,800	314	40
1,701	1,701	17,300	0	0	0	501	17,900	1	0
862	862	17,400	0	0	7	905	18,000	121	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
25,296	25,296	0.9519	24,080	24,080	1,608	105,323	1.1489	121,003	7,288
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化	0.9519		昨日 P/C	1.0964	今日增減變化	0.0525	

更新日期：2022年6月1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6月1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	173,636,406	148,058,117	25,578,289	-1,830,092	4,853,586	2,821,494	2,032,092	598,691
投信	45,990,874	63,326,304	-17,335,430	803,490	422,453	0	422,453	-2,603
自營商	56,800,902	25,988,942	30,811,960	4,477,375	1,365,907	1,148,455	217,452	-131,218
	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	897,195	1,590,557	-693,362	387,252	127,624	168,529	-40,905	3,318
投信	65,403	0	65,403	-242	0	0	0	0
自營商	330,153	863,239	-533,086	-109,050	386,685	256,901	129,784	-49,223

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報

2022年6月1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	40,555	21,301	19,254	-367	32,144	14,231	17,913	-3,712
投信	0	150	-150	0	550	86	464	0
自營商	53,156	39,926	13,230	-9,040	34,468	43,466	-8,998	13,269
特定法人(週)	1,244	0	1,244	---	0	0	0	---
特定法人(近月)	22,573	9,821	12,752	-1,514	4,709	21,189	-16,480	-2,823
特定法人(全月)	32,301	17,834	14,467	-2,722	2,681	25,058	-22,377	3,350
十大交易人(週)	11,800	13,860	-2,060	---	13,444	8,774	4,670	---
十大交易人(近月)	64,249	37,710	26,539	-2,628	40,539	45,528	-4,989	618
十大交易人(全月)	88,765	53,926	34,839	-9,034	53,829	62,248	-8,419	-19,900
全市場未沖銷(近月)			105,323	1,608			121,003	7,288
全市場未沖銷(全月)			156,838	-64,470			162,536	-136,747

更新日期：2022年6月1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06W2週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	17050	買權OI最大量	17050
	賣權成交最大量	16300	賣權OI最大量	16300
	整體隱含波動率	15.32%	較前一交易日	+4.69%
	買權隱含波動率	11.65%	較前一交易日	+11.08%
	賣權隱含波動率	18.92%	較前一交易日	-1.11%
電子選擇權	買權成交最大量	795	買權OI最大量	795
	賣權成交最大量	760	賣權OI最大量	750
金融選擇權	買權成交最大量	1720	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1720	賣權OI最大量	1540

更新日期：2022年6月1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	16800	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	17.35%	較前一交易日	-0.43%
	買權隱含波動率	12.43%	較前一交易日	+3.17%
	賣權隱含波動率	21.53%	較前一交易日	-1.88%
	成交量P/C_Ratio值	1.170	較前一交易日	+0.01
	未平倉P/C_Ratio值	1.149	較前一交易日	+0.05
電子選擇權	買權成交最大量	795	買權OI最大量	795
	賣權成交最大量	760	賣權OI最大量	750
金融選擇權	買權成交最大量	1720	買權OI最大量	1660
	賣權成交最大量	1720	賣權OI最大量	1540

更新日期：2022年6月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

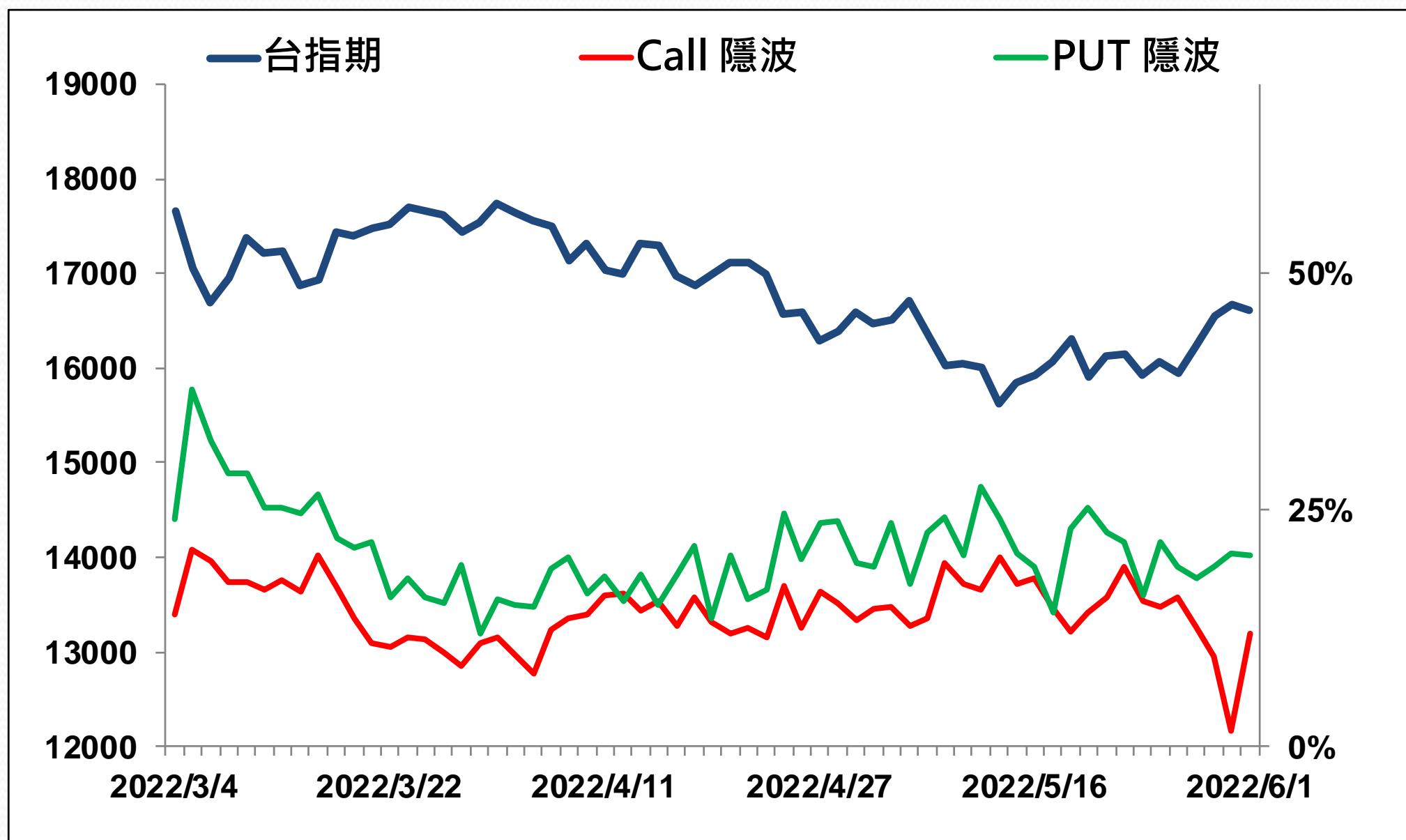
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



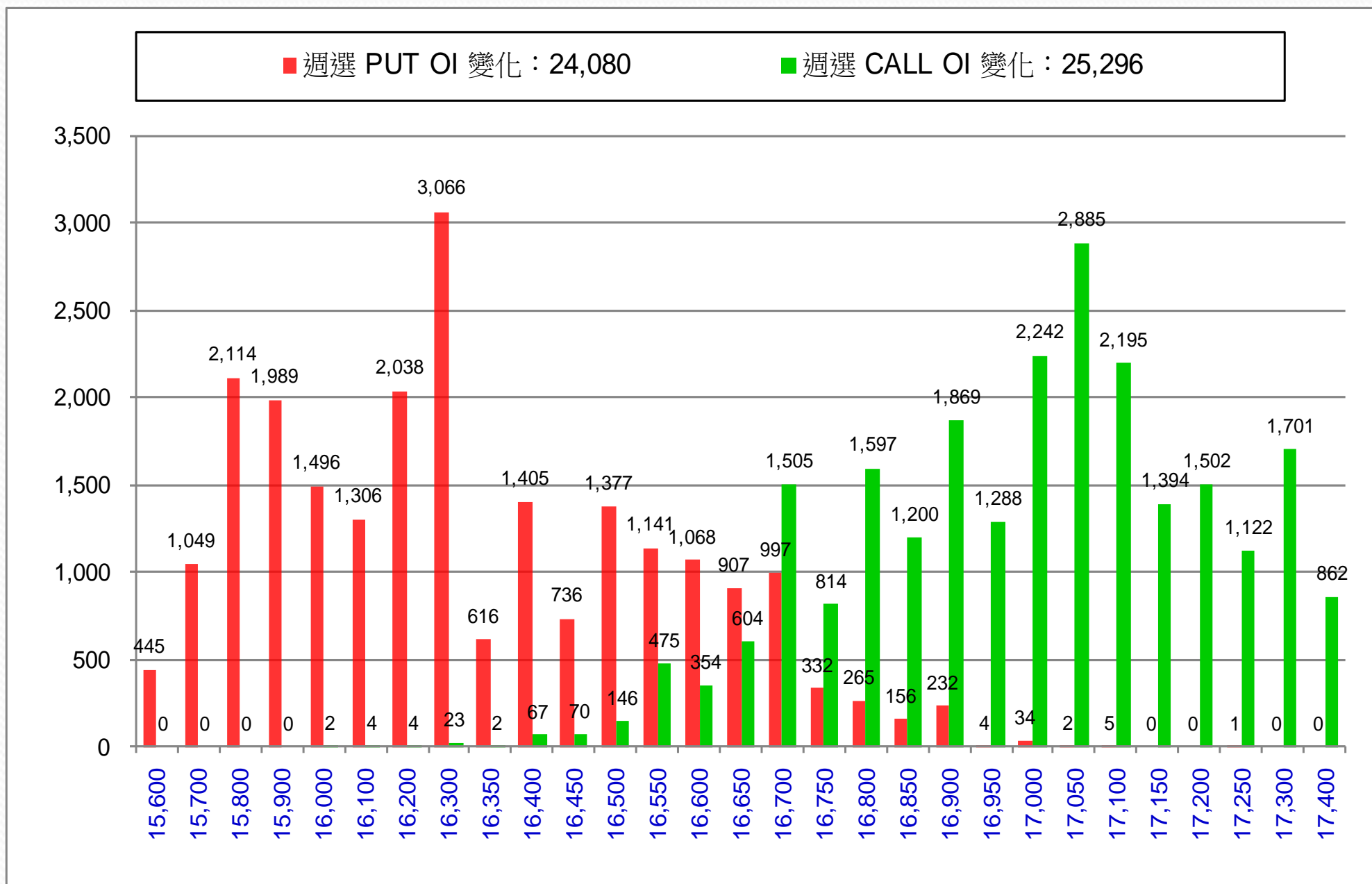
更新日期：2022年6月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年6月1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

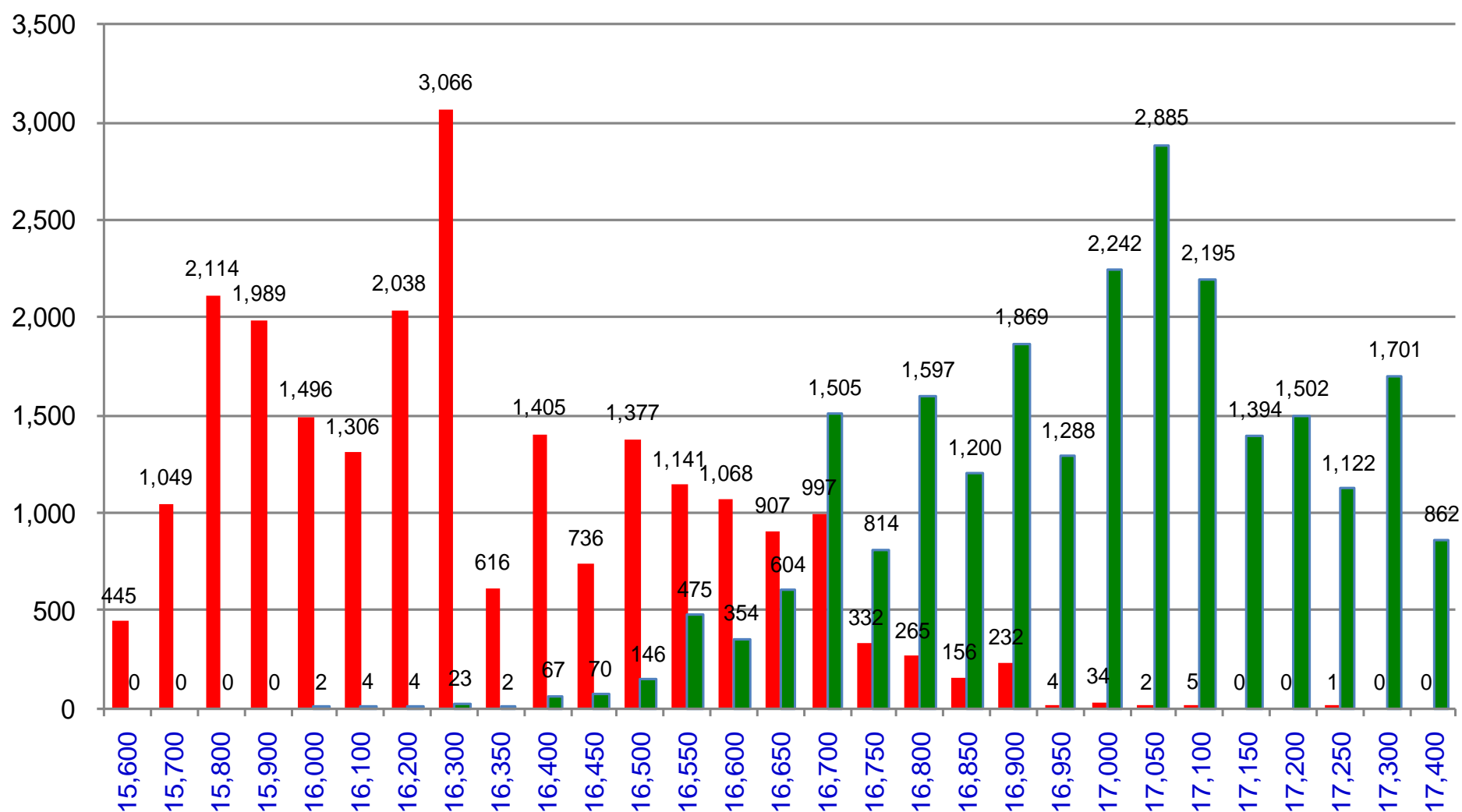


更新日期：2022年6月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：24,080

週選 CALL OI 總額：25,296



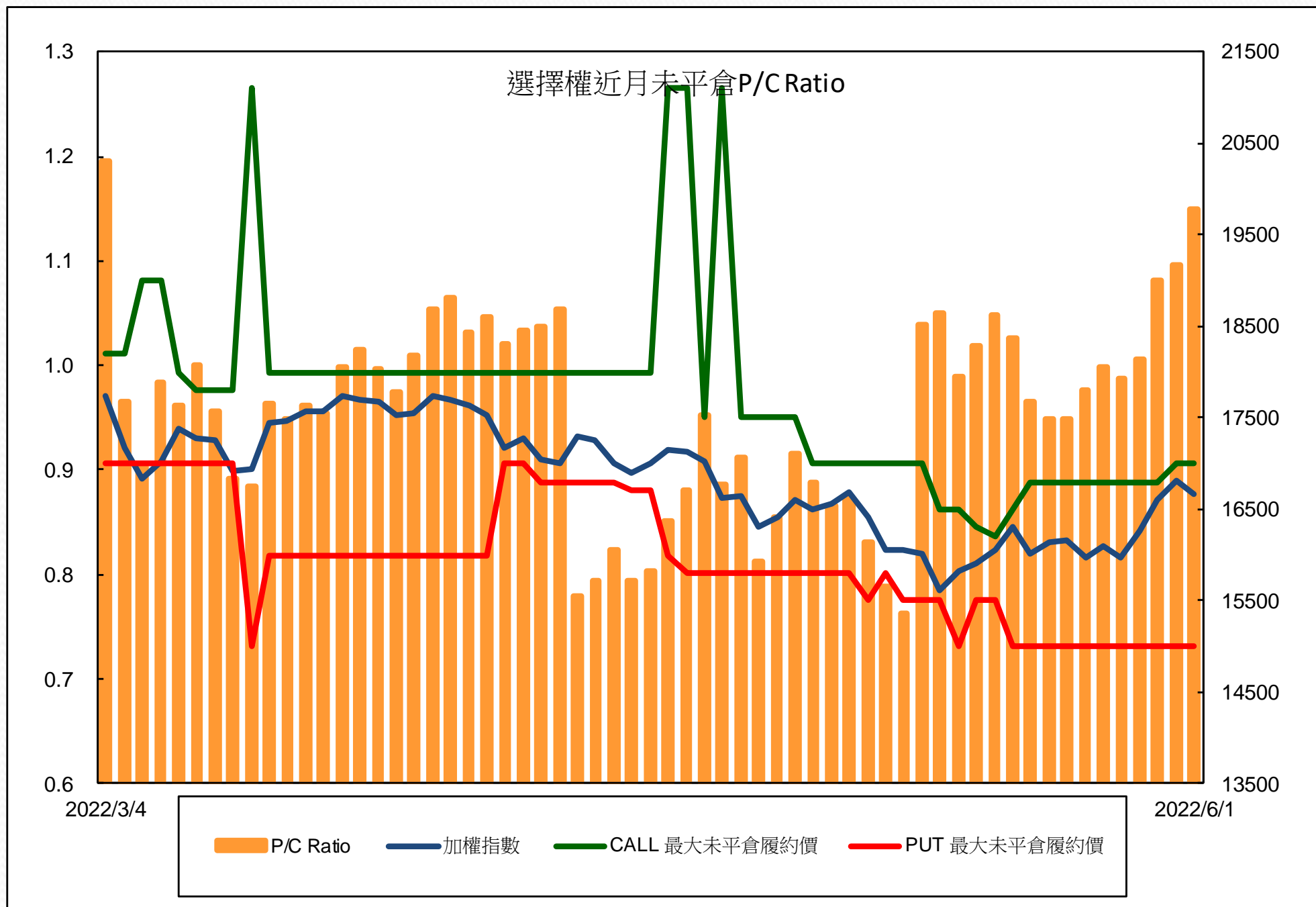
更新日期：2022年6月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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31日	65,888	43,618	22,270
	6月1日	53,156	39,926	13,230
Put	5月31日	53,746	76,013	-22,267
	6月1日	34,468	43,466	-8,998

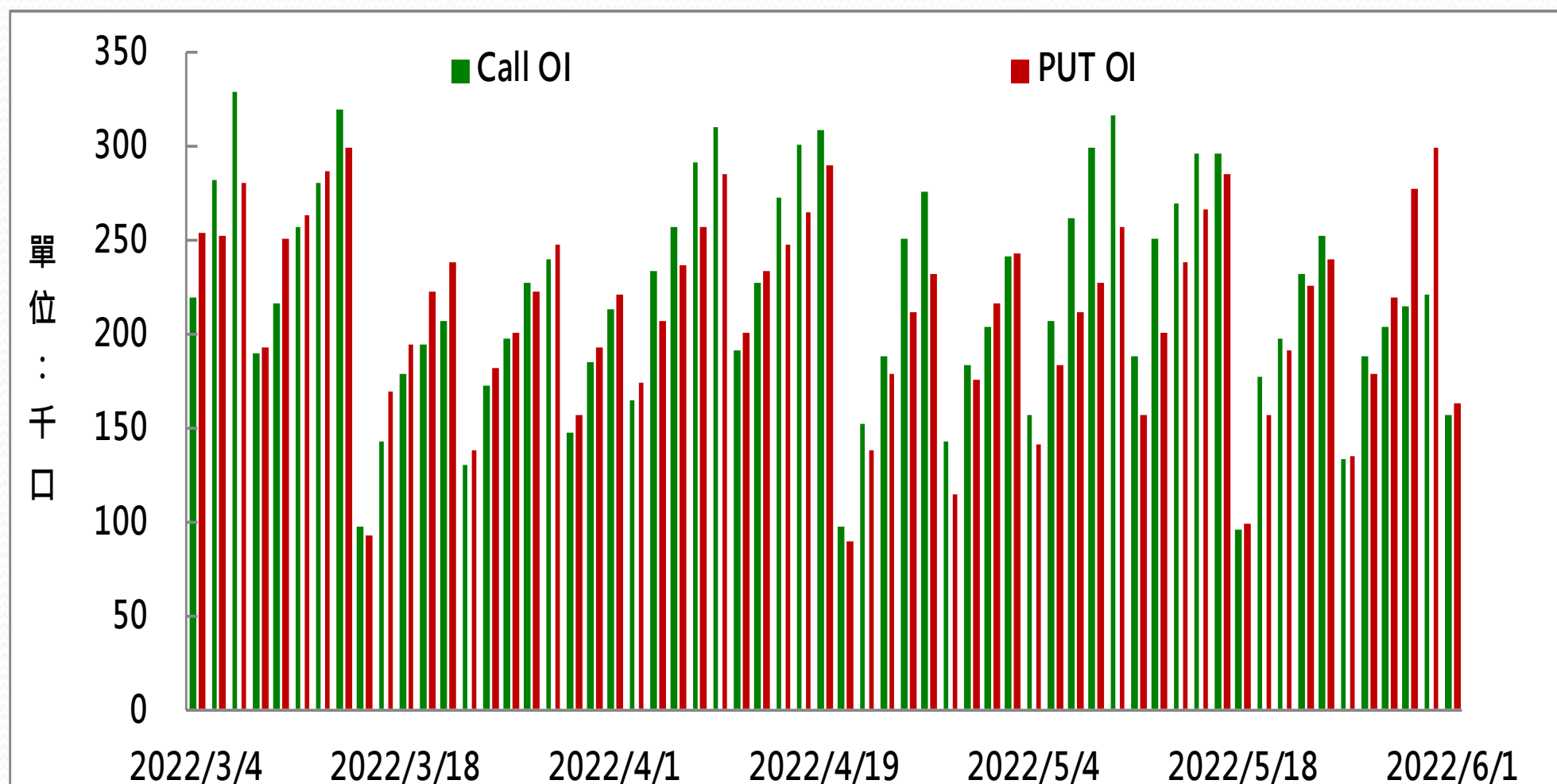
更新日期：2022年6月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年6月1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6月1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6月1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