

台指選擇權OI匯報

日期：2022/6/2 結算日：2022/6/8					日期：2022/6/2 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	15,400	439	137	0	6	15,100	2,277	54
0	0	15,500	2,301	2,125	0	136	15,200	2,534	106
0	0	15,600	1,688	1,243	0	9	15,300	3,282	-168
0	0	15,700	2,752	1,703	-83	37	15,400	4,231	2
0	0	15,800	3,496	1,382	0	503	15,500	6,006	407
3	3	15,900	5,844	3,855	-1	436	15,600	5,038	311
12	14	16,000	6,976	5,480	-14	463	15,700	4,740	-176
7	11	16,100	4,796	3,490	-11	1,049	15,800	5,457	424
15	19	16,200	4,557	2,519	-12	1,853	15,900	6,372	438
20	20	16,250	1,077	1,077	-107	2,900	16,000	8,844	-310
91	114	16,300	5,183	2,117	-61	2,296	16,100	4,007	-43
98	100	16,350	1,816	1,200	-72	3,595	16,200	6,130	33
86	153	16,400	2,794	1,389	-284	2,750	16,300	3,727	441
255	325	16,450	2,324	1,588	-273	3,969	16,400	2,738	182
636	782	16,500	3,398	2,021	35	5,916	16,500	3,267	25
1,405	1,880	16,550	1,693	552	327	5,240	16,600	1,962	-201
2,305	2,659	16,600	1,958	890	358	7,899	16,700	1,217	-337
1,579	2,183	16,650	1,230	323	223	7,028	16,800	1,253	187
2,656	4,161	16,700	905	-92	978	8,660	16,900	298	-8
2,661	3,475	16,750	323	-9	※ 1,637	13,348	17,000	878	12
※ 4,369	5,966	16,800	327	62	477	5,648	17,100	154	-12
3,918	5,118	16,850	204	48	308	4,810	17,200	370	12
3,422	5,291	16,900	260	28	-32	3,562	17,300	57	-3
3,278	4,566	16,950	22	18	-61	2,941	17,400	239	0
4,348	6,590	17,000	28	-6	208	1,158	17,500	52	0
2,170	5,055	17,050	17	15	13	792	17,600	647	-1
1,910	4,105	17,100	9	4	-9	809	17,700	33	0
524	1,918	17,150	0	0	2	953	17,800	313	-1
494	1,996	17,200	1	1	1	502	17,900	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
38,610	63,906	0.9073	57,985	33,905	3,555	108,878	1.1304	123,071	2,068
昨日 P/C	0.9519	今日增減變化	-0.0446		昨日 P/C	1.1489	今日增減變化	-0.0185	

更新日期：2022年6月2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2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	178,706,311	143,812,890	34,893,421	9,315,132	5,000,573	2,440,573	2,560,000	527,908
投信	45,779,877	63,972,790	-18,192,913	-857,483	419,521	0	419,521	-2,932
自營商	56,116,004	25,682,799	30,433,205	-378,755	1,162,851	1,261,746	-98,895	-316,347
	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	801,216	1,526,415	-725,199	-31,837	139,264	167,117	-27,853	13,052
投信	65,099	0	65,099	-304	0	0	0	0
自營商	388,451	909,061	-520,610	12,476	437,153	355,960	81,193	-48,591

臺指選擇權三大法人&大額交易者未平倉口數匯報

2022年6月2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	44,259	23,309	20,950	1,696	34,029	15,586	18,443	530
投信	0	150	-150	0	550	86	464	0
自營商	60,609	49,519	11,090	-2,140	44,526	48,488	-3,962	5,036
特定法人(週)	2,191	0	2,191	947	0	0	0	0
特定法人(近月)	22,800	9,791	13,009	257	4,679	21,427	-16,748	-268
特定法人(全月)	30,564	18,273	12,291	-2,176	3,034	24,124	-21,090	1,287
十大交易者(週)	20,411	26,632	-6,221	-4,161	20,707	16,551	4,156	-514
十大交易者(近月)	62,707	37,308	25,399	-1,140	39,596	44,638	-5,042	-53
十大交易者(全月)	93,806	61,419	32,387	-2,452	57,668	69,171	-11,503	-3,084
全市場未沖銷(近月)			108,878	3,555			123,071	2,068
全市場未沖銷(全月)			200,260	43,422			200,134	37,598

更新日期：2022年6月2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	16800	買權OI最大量	17000
	賣權成交最大量	16400	賣權OI最大量	16000
	整體隱含波動率	15.35%	較前一交易日	+0.03%
	買權隱含波動率	13.84%	較前一交易日	+2.19%
	賣權隱含波動率	16.81%	較前一交易日	-2.11%
電子選擇權	買權成交最大量	785	買權OI最大量	785
	賣權成交最大量	755	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	1600	賣權OI最大量	1540

更新日期：2022年6月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

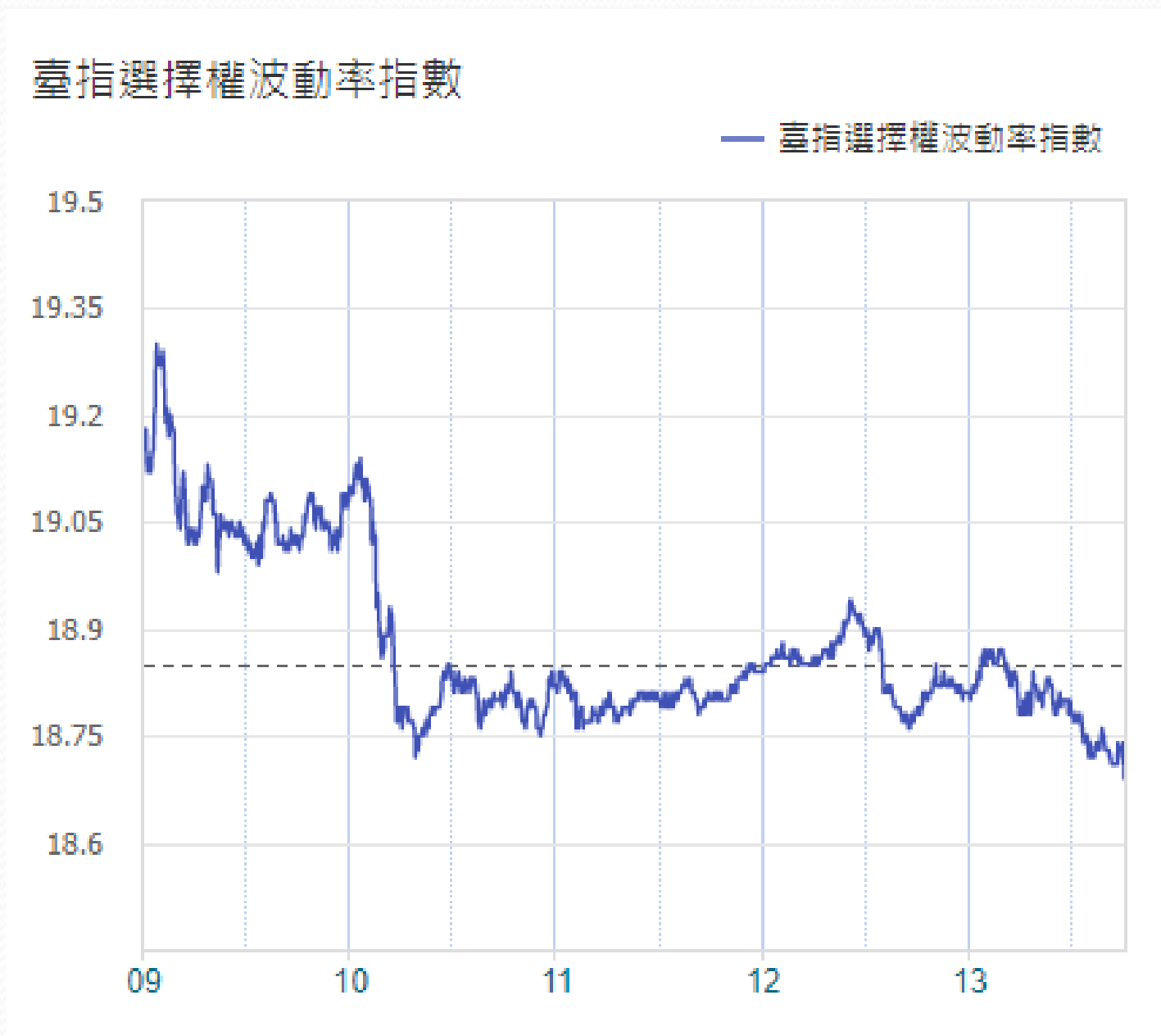
台指選擇權匯報

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	16000	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	17.86%	較前一交易日	-0.51%
	買權隱含波動率	13.89%	較前一交易日	+1.46%
	賣權隱含波動率	21.05%	較前一交易日	-0.48%
	成交量P/C_Ratio值	1.215	較前一交易日	+0.04
	未平倉P/C_Ratio值	1.130	較前一交易日	-0.02
電子選擇權	買權成交最大量	785	買權OI最大量	785
	賣權成交最大量	755	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	1600	賣權OI最大量	1540

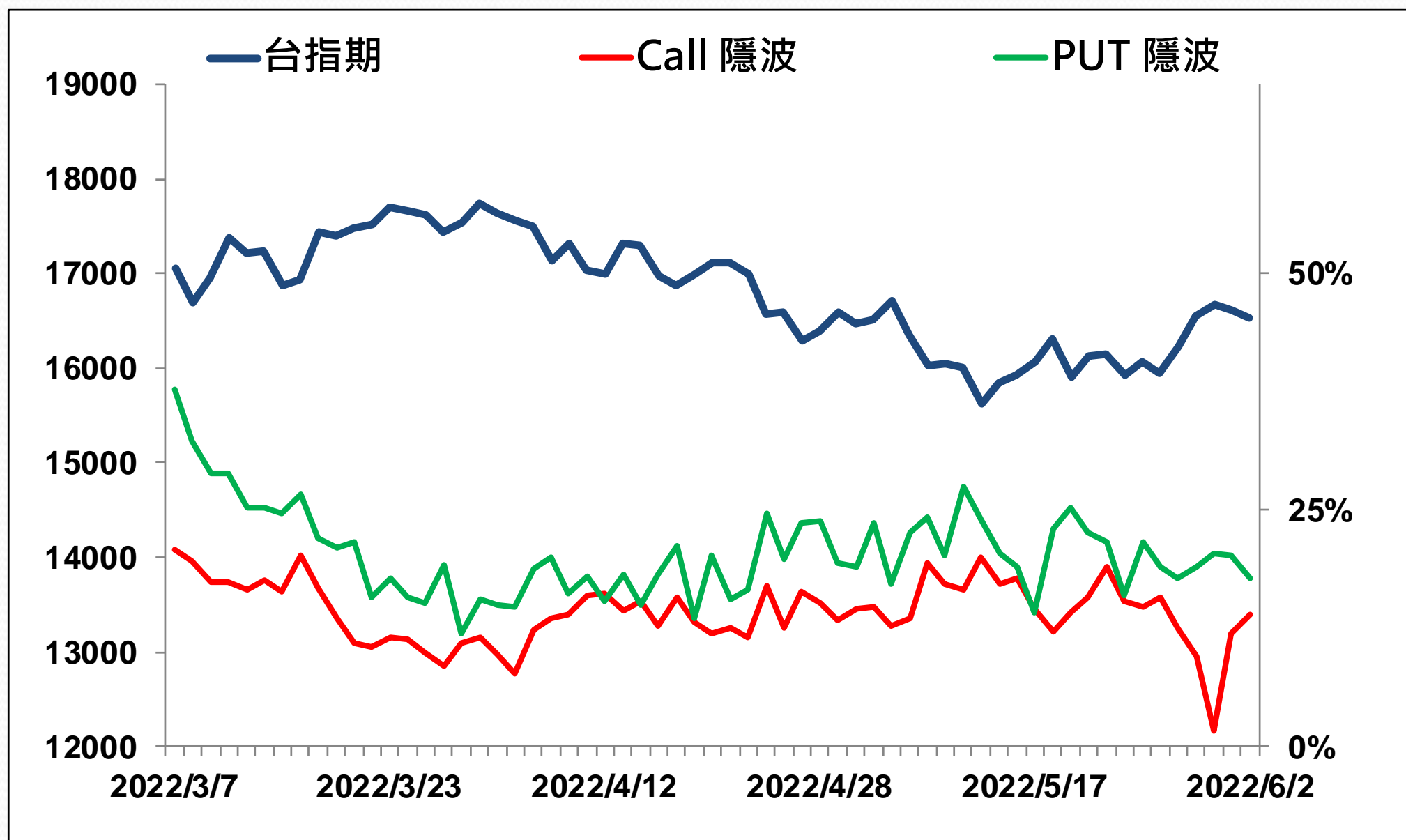
更新日期：2022年6月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



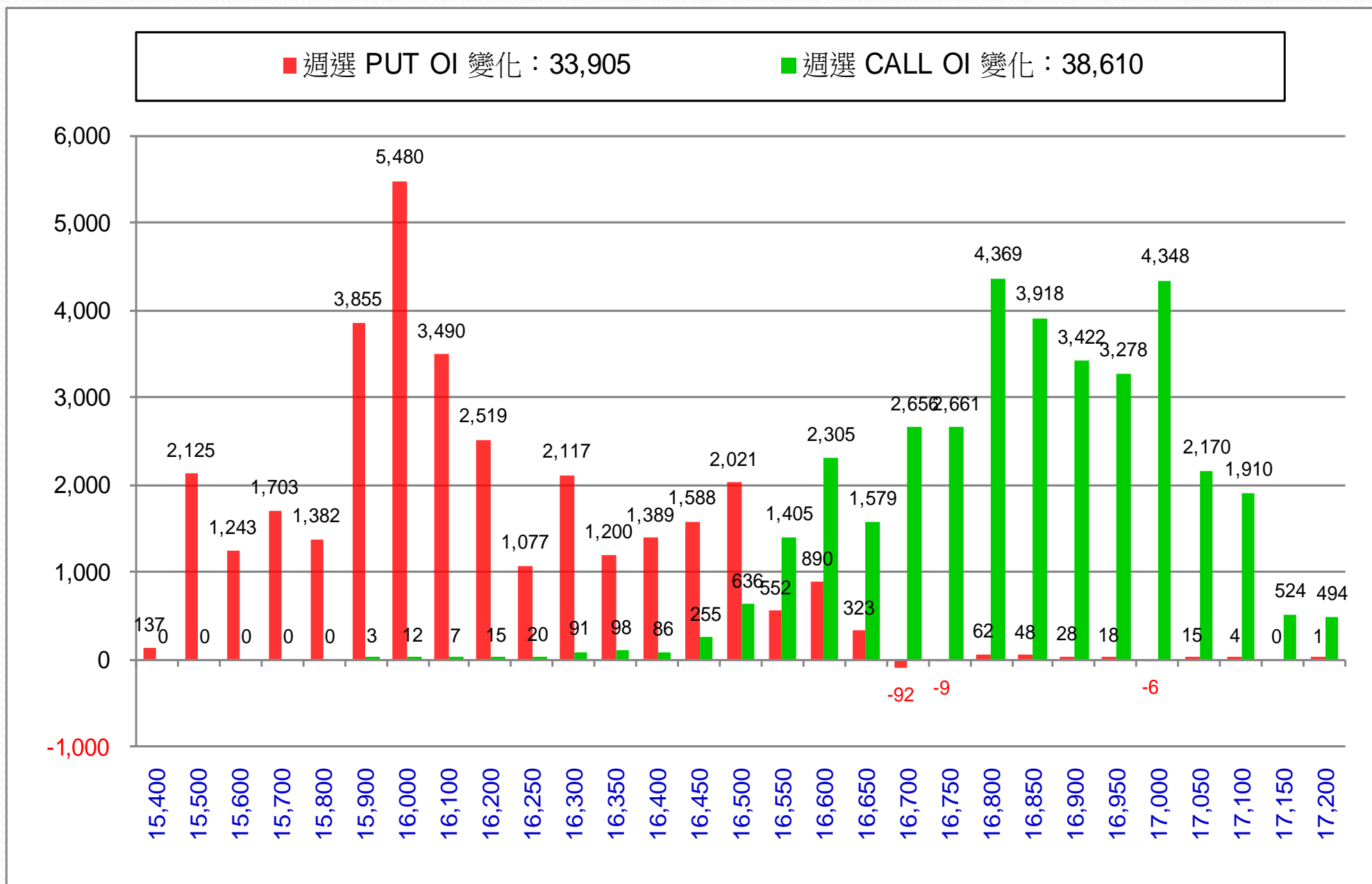
更新日期：2022年6月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年6月2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

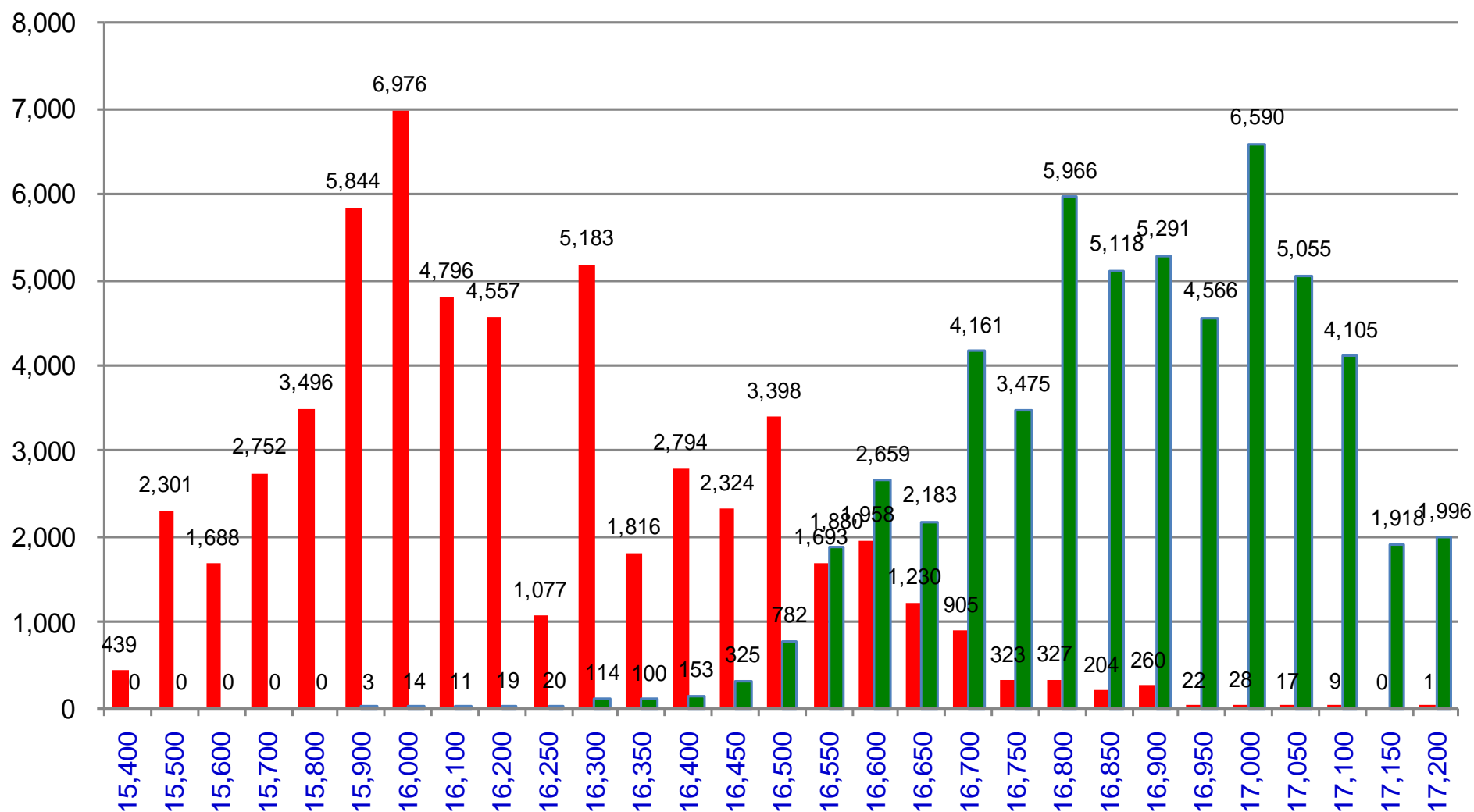


更新日期：2022年6月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：57,985

週選 CALL OI 總額：63,906



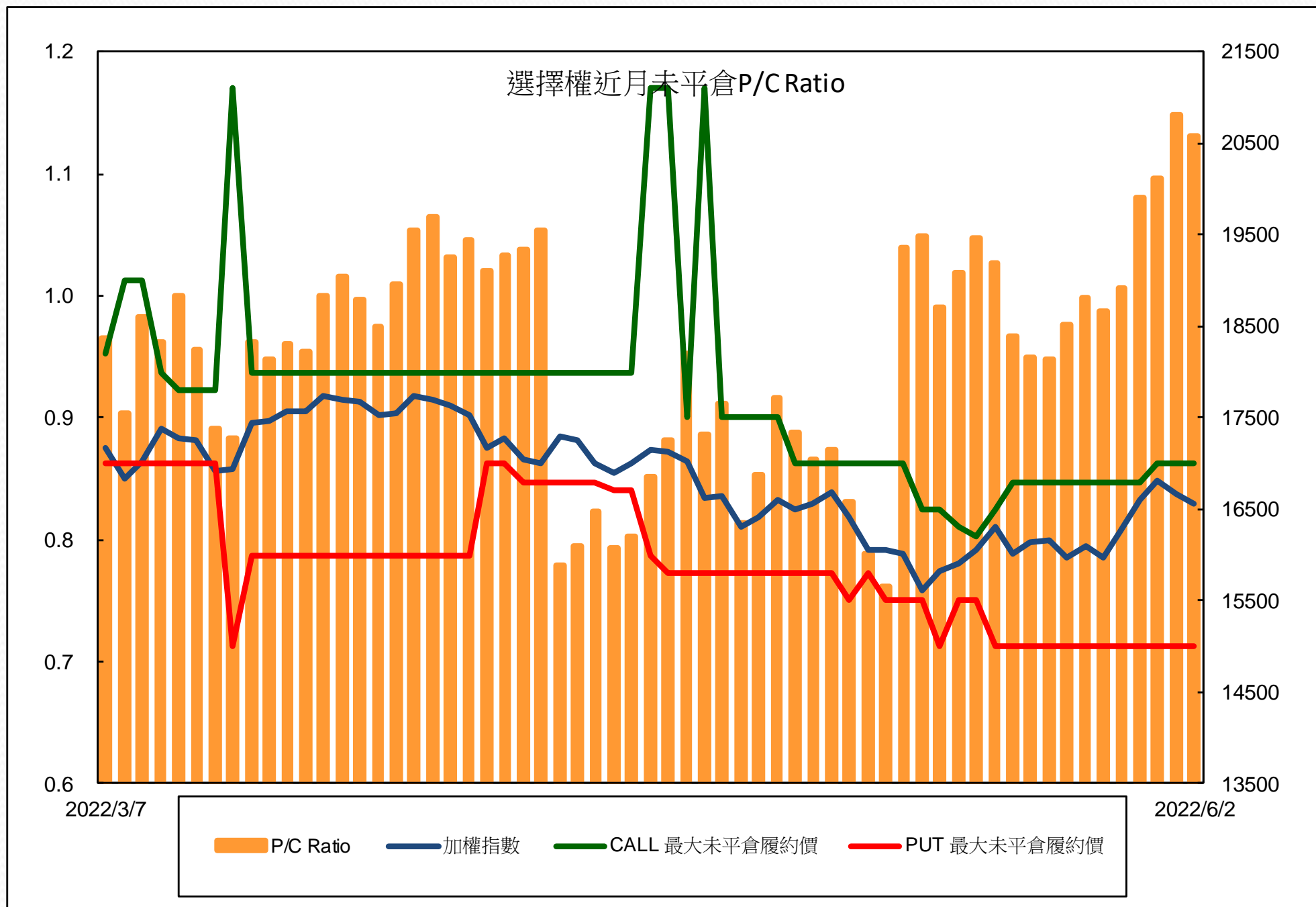
更新日期：2022年6月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	6月1日	53,156	39,926	13,230
	6月2日	60,609	49,519	11,090
Put	6月1日	34,468	43,466	-8,998
	6月2日	44,526	48,488	-3,962

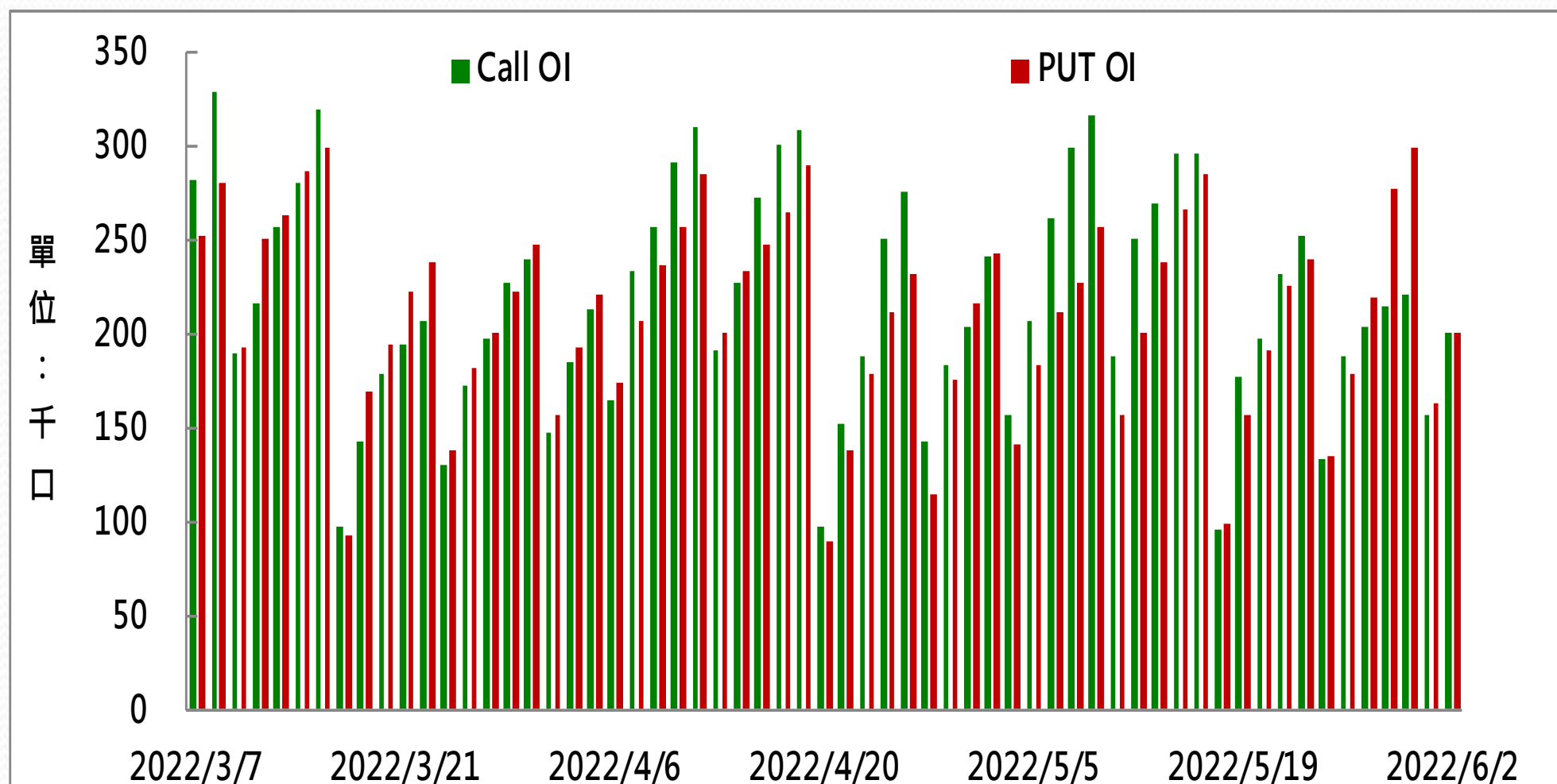
更新日期：2022年6月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年6月2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2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2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