

台指選擇權OI匯報

日期：2022/6/6 結算日：2022/6/8					日期：2022/6/6 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	15,500	1,268	-1,033	0	6	15,100	2,089	-188
0	0	15,600	1,779	91	1	137	15,200	2,462	-72
0	0	15,700	2,649	-103	0	9	15,300	3,205	-77
0	0	15,800	3,383	-113	0	37	15,400	4,957	726
-1	2	15,900	5,263	-581	20	523	15,500	5,878	-128
-2	12	16,000	7,016	40	0	436	15,600	4,917	-121
6	17	16,100	6,885	2,089	1	464	15,700	4,650	-90
0	19	16,200	7,182	2,625	-17	1,032	15,800	4,806	-651
12	32	16,250	5,114	4,037	-8	1,845	15,900	6,342	-30
-7	107	16,300	6,836	1,653	-112	2,788	16,000	9,435	591
14	114	16,350	4,197	2,381	-39	2,257	16,100	4,523	516
-2	151	16,400	5,426	2,632	-168	3,427	16,200	6,197	67
120	445	16,450	5,058	2,734	-62	2,688	16,300	4,354	627
693	1,475	16,500	6,588	3,190	-188	3,781	16,400	2,867	129
810	2,690	16,550	3,455	1,762	-188	5,728	16,500	3,335	68
2,038	4,697	16,600	5,275	3,317	642	5,882	16,600	2,428	466
2,297	4,480	16,650	3,275	2,045	217	8,116	16,700	1,192	-25
※ 3,073	7,234	16,700	2,005	1,100	※ 783	7,811	16,800	1,364	111
2,842	6,317	16,750	657	334	-69	8,591	16,900	370	72
2,337	8,303	16,800	600	273	309	13,657	17,000	935	57
2,059	7,177	16,850	204	0	244	5,892	17,100	154	0
1,549	6,840	16,900	264	4	632	5,442	17,200	356	-14
1,895	6,461	16,950	22	0	57	3,619	17,300	59	2
951	7,541	17,000	34	6	737	3,678	17,400	245	6
-808	4,247	17,050	17	0	17	1,175	17,500	52	0
-726	3,379	17,100	9	0	-7	785	17,600	647	0
-196	1,722	17,150	0	0	28	837	17,700	33	0
-95	1,901	17,200	1	0	3	956	17,800	313	0
-438	730	17,250	1	-2	2	504	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
18,566	82,472	1.0477	86,406	28,421	2,903	111,781	1.1284	126,138	3,067
昨日 P/C	0.9073	今日增減變化	0.1404		昨日 P/C	1.1304	今日增減變化	-0.0019	

更新日期：2022年6月6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6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	170,178,260	140,848,877	29,329,383	-5,564,038	4,997,706	1,867,207	3,130,499	570,499
投信	45,945,480	63,740,680	-17,795,200	397,713	422,124	0	422,124	2,603
自營商	57,656,775	24,522,674	33,134,101	2,700,896	1,062,070	1,386,116	-324,046	-225,151
	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	802,791	1,557,551	-754,760	-29,561	150,494	166,852	-16,358	11,495
投信	65,637	0	65,637	538	0	0	0	0
自營商	455,533	1,029,433	-573,900	-53,290	418,512	365,371	53,141	-28,052

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6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	46,296	23,484	22,812	1,862	35,134	17,045	18,089	-354
投信	0	150	-150	0	550	86	464	0
自營商	58,565	49,809	8,756	-2,334	53,981	48,268	5,713	9,675
特定法人(週)	2,191	0	2,191	0	0	0	0	0
特定法人(近月)	24,359	9,791	14,568	1,559	4,679	21,427	-16,748	0
特定法人(全月)	32,046	18,118	13,928	1,637	3,348	24,124	-20,776	314
十大交易人(週)	19,876	28,092	-8,216	-1,995	24,586	22,833	1,753	-2,403
十大交易人(近月)	62,709	37,672	25,037	-362	41,020	46,526	-5,506	-464
十大交易人(全月)	93,478	63,682	29,796	-2,591	59,971	78,029	-18,058	-6,555
全市場未沖銷(近月)			111,781	2,903			126,138	3,067
全市場未沖銷(全月)			223,687	23,427			236,387	36,253

更新日期：2022年6月6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	16800
	賣權成交最大量	16500	賣權OI最大量	16200
	整體隱含波動率	15.32%	較前一交易日	-0.02%
	買權隱含波動率	15.22%	較前一交易日	+1.38%
	賣權隱含波動率	15.42%	較前一交易日	-1.39%
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	750	賣權OI最大量	745
金融選擇權	買權成交最大量	1700	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6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	16000	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	17.34%	較前一交易日	+0.53%
	買權隱含波動率	14.40%	較前一交易日	+0.51%
	賣權隱含波動率	19.91%	較前一交易日	-1.14%
	成交量P/C_Ratio值	1.155	較前一交易日	-0.06
	未平倉P/C_Ratio值	1.128	較前一交易日	-0.00
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	750	賣權OI最大量	745
金融選擇權	買權成交最大量	1700	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6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

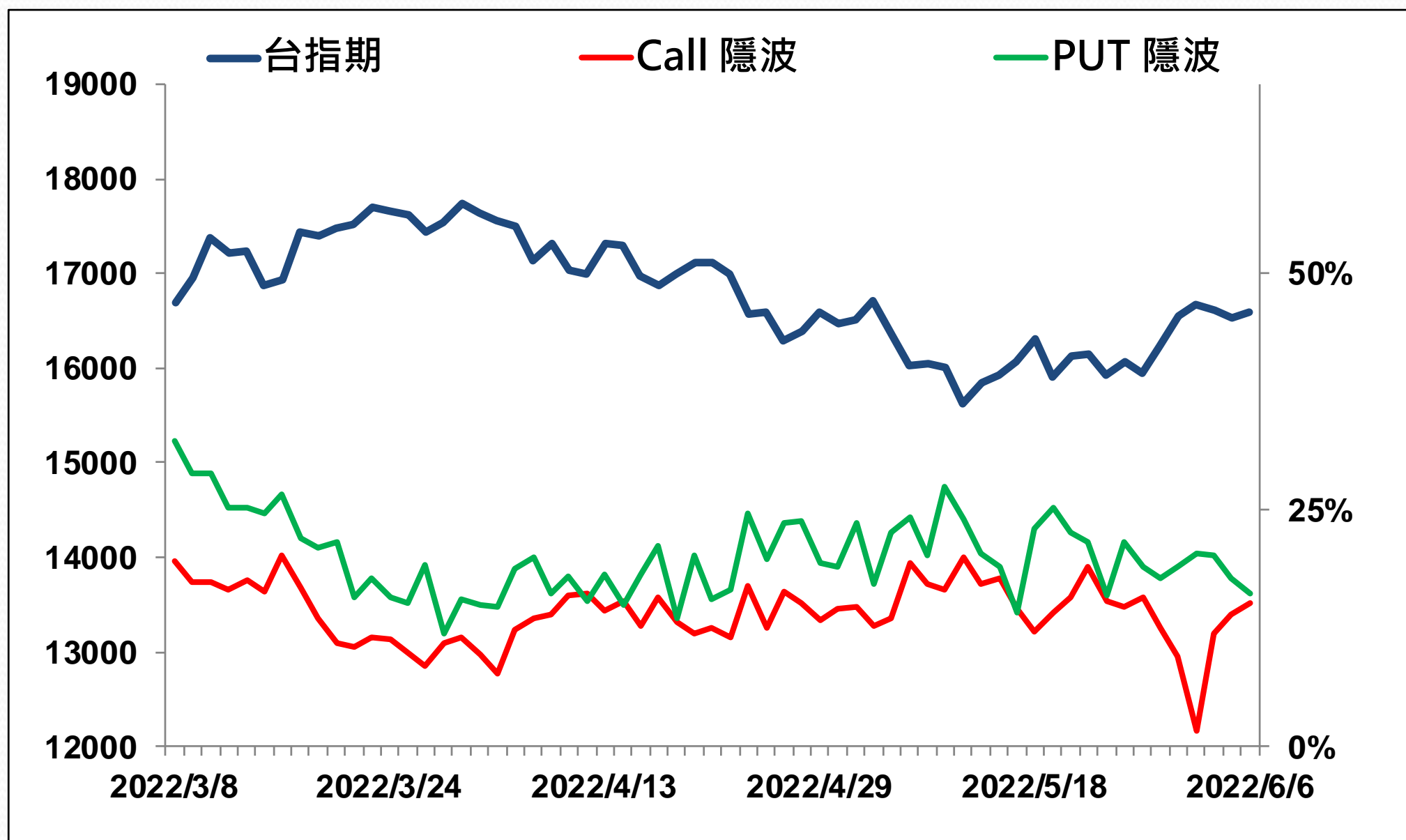
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



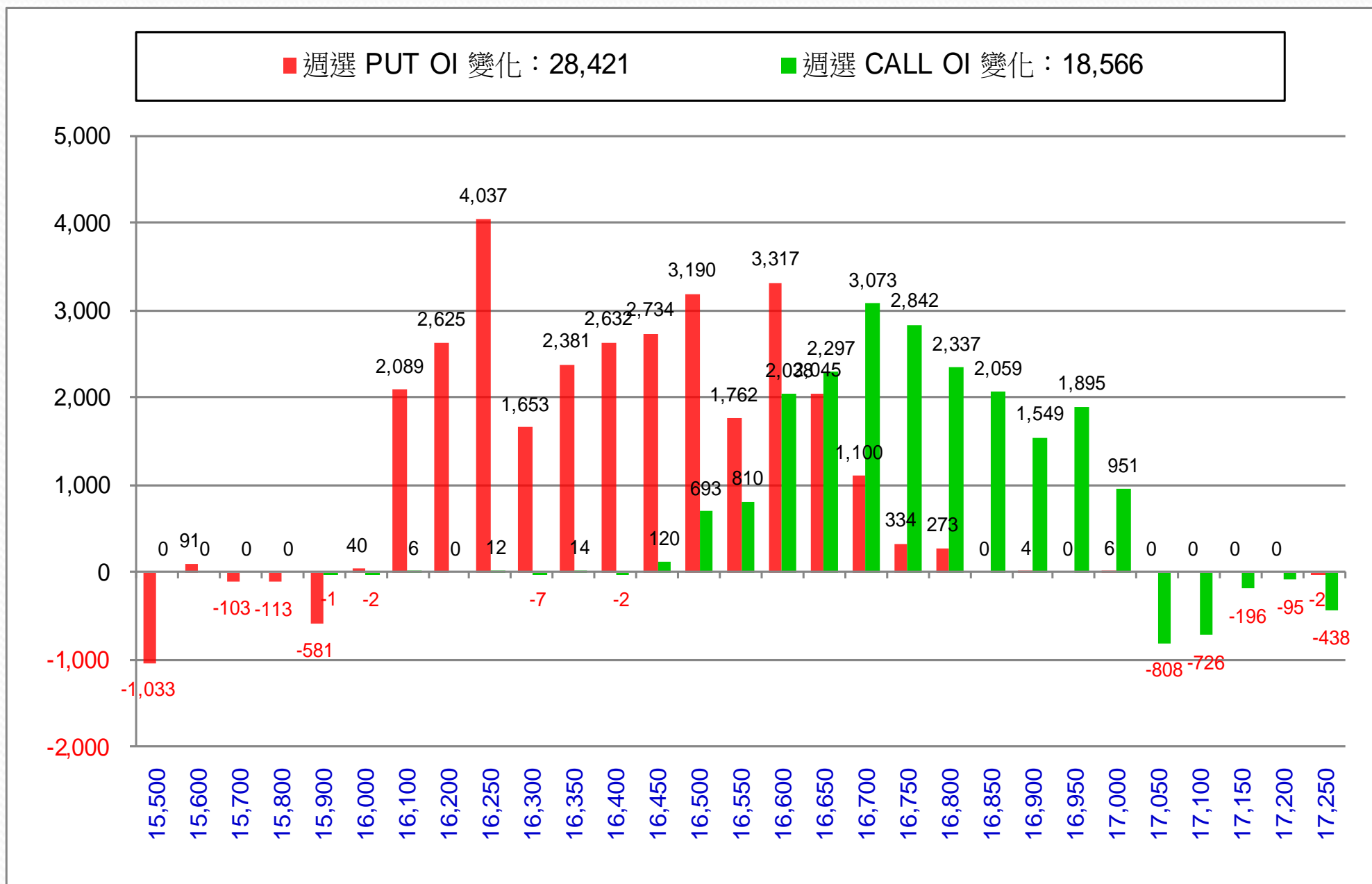
更新日期：2022年6月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年6月6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

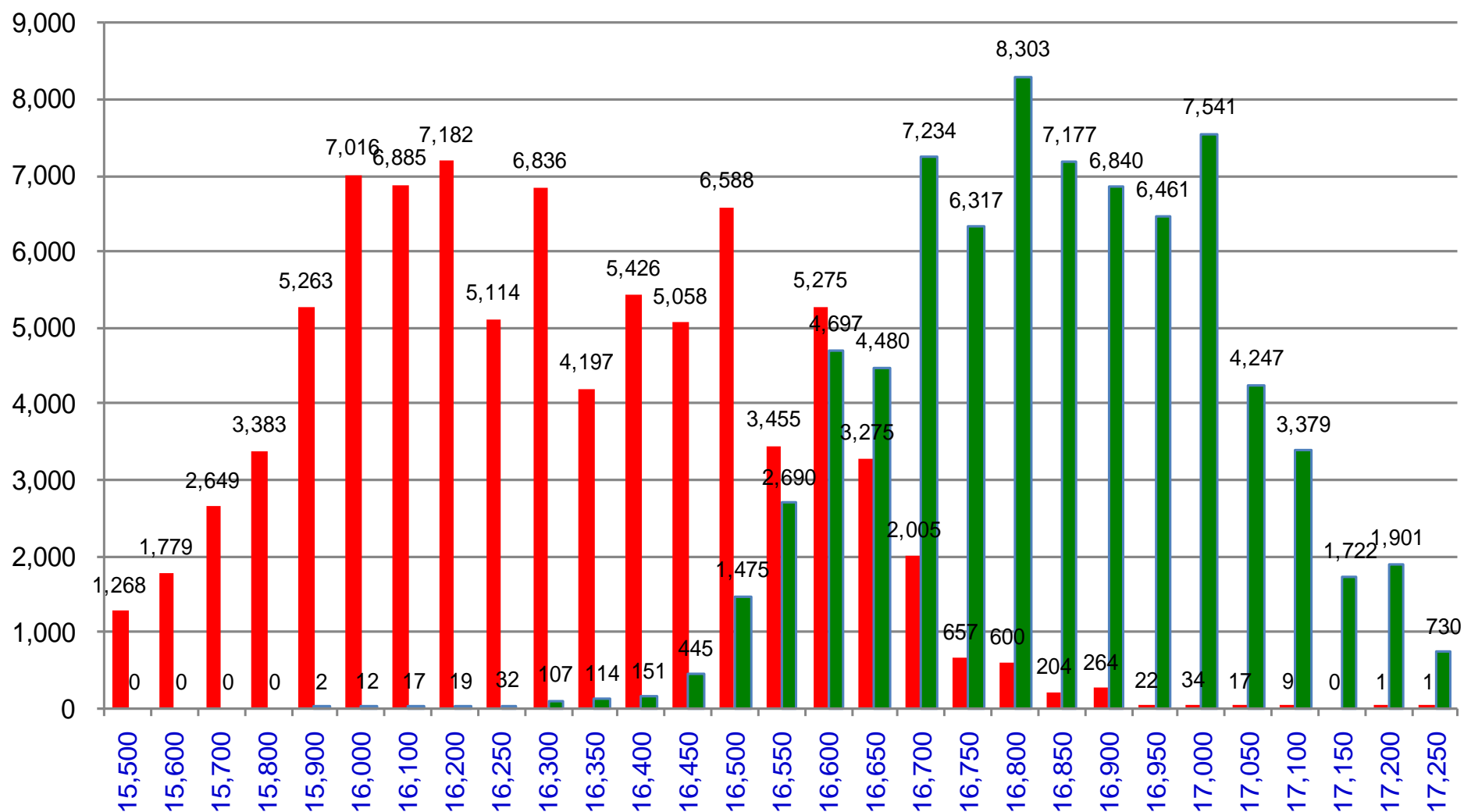


更新日期：2022年6月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：86,406

週選 CALL OI 總額：82,472



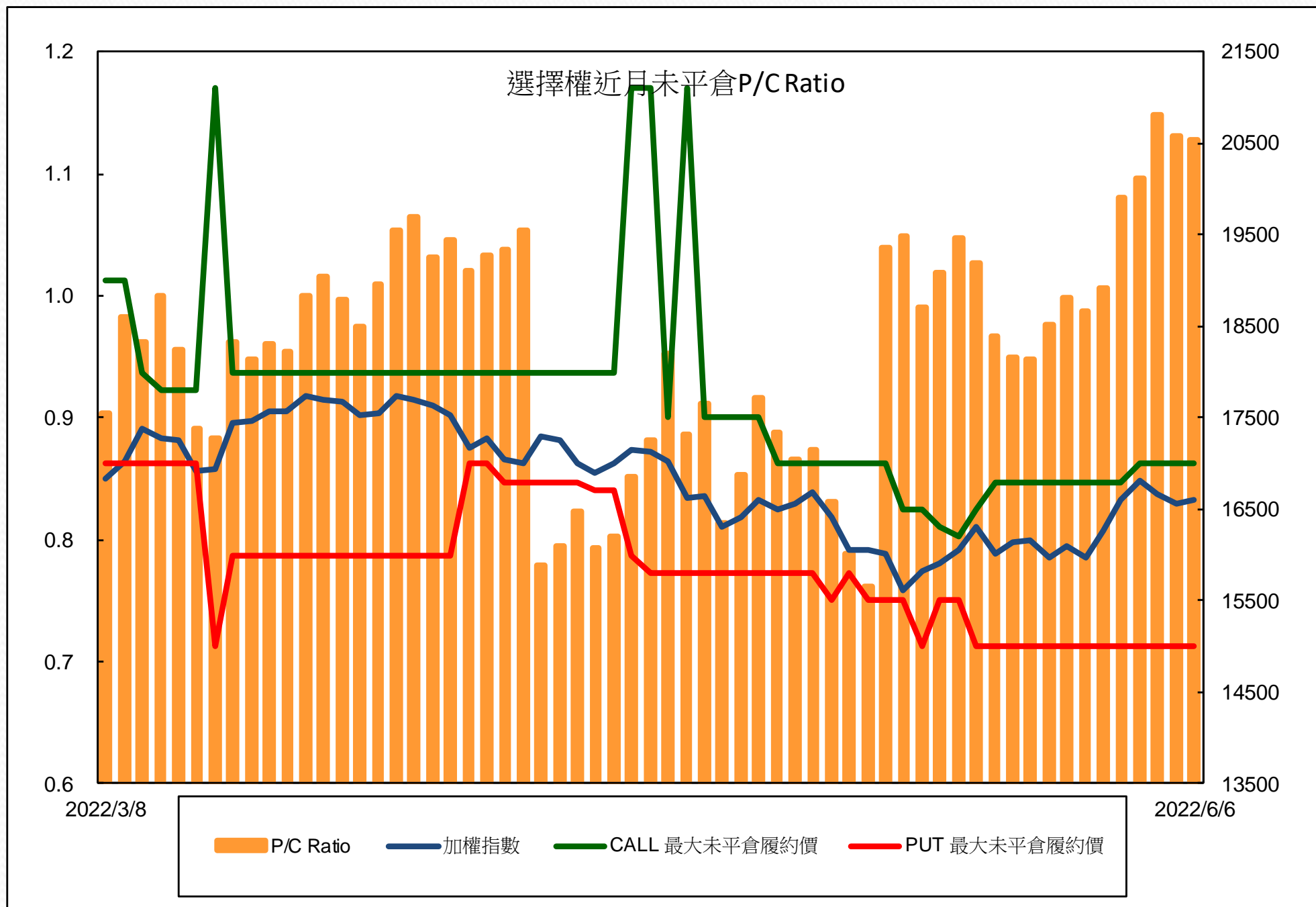
更新日期：2022年6月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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2日	60,609	49,519	11,090
	6月6日	58,565	49,809	8,756
Put	6月2日	44,526	48,488	-3,962
	6月6日	53,981	48,268	5,713

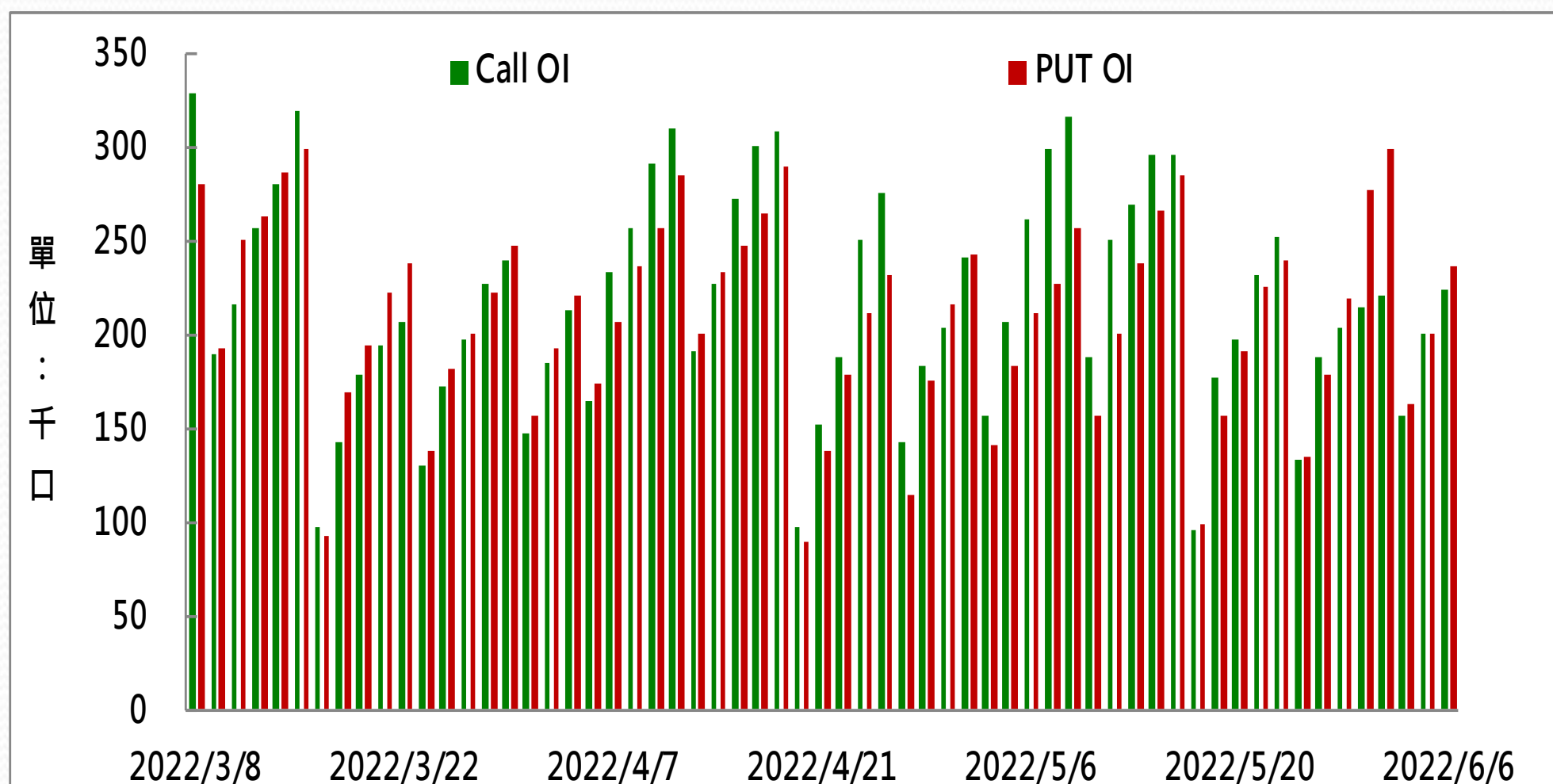
更新日期：2022年6月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年6月6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6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6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