

台指選擇權OI匯報

日期：2022/6/10 結算日：2022/6/15					日期：2022/6/10 結算日：2022/7/20				
202206 月台指選擇權 OI 序列					202207 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	37	15,400	6,297	995	0	4	15,000	3,010	371
-1	518	15,500	7,797	-71	0	1	15,100	952	287
0	410	15,600	5,954	1,001	0	3	15,200	1,359	718 ※
-15	433	15,700	5,392	-29	3	26	15,300	1,110	142
1	1,010	15,800	8,337	676	5	20	15,400	1,119	212
2	1,853	15,900	10,809	1,283	11	130	15,500	2,103	507
-4	2,616	16,000	13,833	739	6	60	15,600	1,543	80
11	11	16,050	4,582	610	0	96	15,700	575	94
-56	1,981	16,100	9,618	1,656	1	196	15,800	1,111	35
63	64	16,150	5,489	1,432	41	150	15,900	438	109
-41	2,726	16,200	13,591	2,503 ※	80	264	16,000	811	146
139	142	16,250	4,503	1,187	102	350	16,100	637	38
-91	2,481	16,300	10,681	1,425	14	575	16,200	583	-39
3,478	3,531	16,350	4,165	898	161	1,909	16,300	1,440	45
2,234	5,811	16,400	8,707	1,545	250	944	16,400	265	142
960	1,446	16,450	3,758	1,235	388	1,283	16,500	112	-28
※ 3,749	9,650	16,500	5,933	-837	387	1,914	16,600	129	-17
1,935	3,128	16,550	2,153	-175	279	2,047	16,700	55	8
2,882	10,876	16,600	4,947	96	320	1,819	16,800	27	5
2,846	5,261	16,650	1,829	-105	257	1,827	16,900	7	-1
3,184	14,978	16,700	2,729	280	※ 773	11,109	17,000	14	2
2,706	5,671	16,750	402	163	272	1,235	17,100	2	0
3,350	17,080	16,800	1,575	94	155	1,130	17,200	26	0
2,008	5,585	16,850	94	41	17	1,205	17,300	21	0
1,563	15,010	16,900	441	-22	-11	631	17,400	27	5
-179	3,366	16,950	73	10	22	1,734	17,500	1	0
-57	21,373	17,000	1,024	-20	107	431	17,600	2	0
733	1,979	17,050	1	1	27	360	17,700	0	0
-1,894	10,928	17,100	164	-5	0	287	17,800	0	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
28,609	187,781	1.0684	200,626	15,118	4,219	34,619	0.8092	28,013	4,106
昨日 P/C	1.1182	今日增減變化		-0.0498	昨日 P/C	0.7864	今日增減變化		0.0228

更新日期：2022年6月10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10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	164,160,611	140,287,202	23,873,409	-3,442,378	4,478,740	2,081,600	2,397,140	-298,208
投信	45,312,506	65,052,753	-19,740,247	-1,106,623	418,151	0	418,151	-3,425
自營商	58,016,601	23,626,695	34,389,906	374,742	1,395,543	1,362,679	32,864	-12,209
	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	572,015	1,234,911	-662,896	154,457	148,776	166,760	-17,984	-29,462
投信	64,732	0	64,732	-102	0	0	0	0
自營商	561,400	1,112,645	-551,245	31,149	513,924	424,204	89,720	50,559

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10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	54,824	26,514	28,310	657	39,926	22,832	17,094	246
投信	0	150	-150	0	550	86	464	0
自營商	57,650	54,454	3,196	-2,161	53,184	51,832	1,352	-4,057
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	26,989	9,882	17,107	-169	4,654	24,326	-19,672	723
特定法人(全月)	40,339	19,330	21,009	-1,742	12,321	28,594	-16,273	1,827
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	74,445	54,119	20,326	-3,177	57,453	59,220	-1,767	1,981
十大交易人(全月)	103,261	67,699	35,562	-29	65,207	83,857	-18,650	796
全市場未沖銷(近月)			194,512	28,610			200,626	15,118
全市場未沖銷(全月)			240,750	33,066			237,384	19,517

更新日期：2022年6月10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	16600	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	15.71%	較前一交易日	+0.83%
	買權隱含波動率	14.91%	較前一交易日	+2.89%
	賣權隱含波動率	16.51%	較前一交易日	-1.02%
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	670
金融選擇權	買權成交最大量	1700	買權OI最大量	1680
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1460

更新日期：2022年6月10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 07 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	15000	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	17.03%	較前一交易日	+0.64%
	買權隱含波動率	9.08%	較前一交易日	+1.42%
	賣權隱含波動率	25.56%	較前一交易日	-0.81%
	成交量P/C_Ratio值	0.937	較前一交易日	-0.20
	未平倉P/C_Ratio值	0.809	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	670
金融選擇權	買權成交最大量	1700	買權OI最大量	1680
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1460

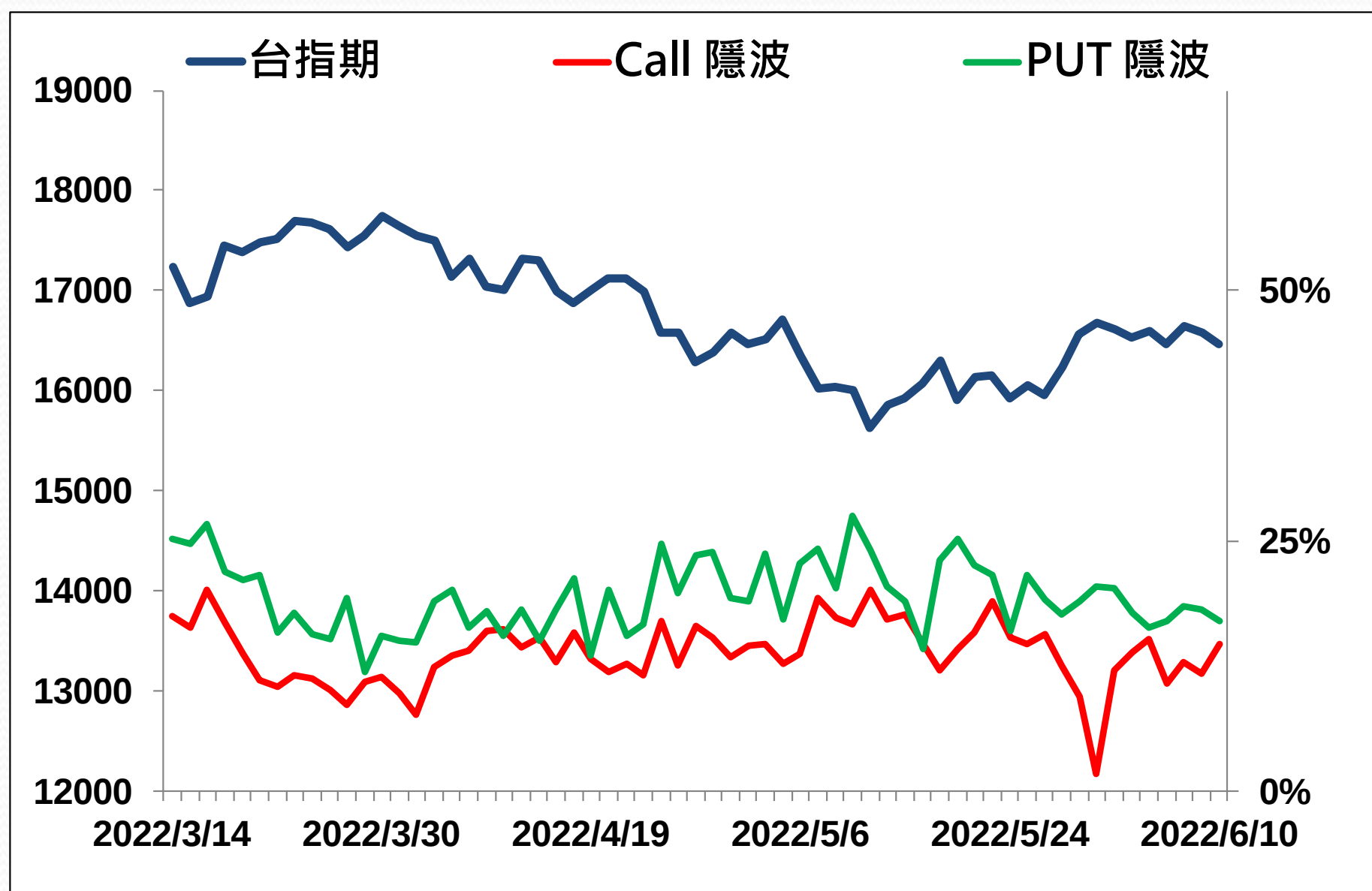
更新日期：2022年6月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



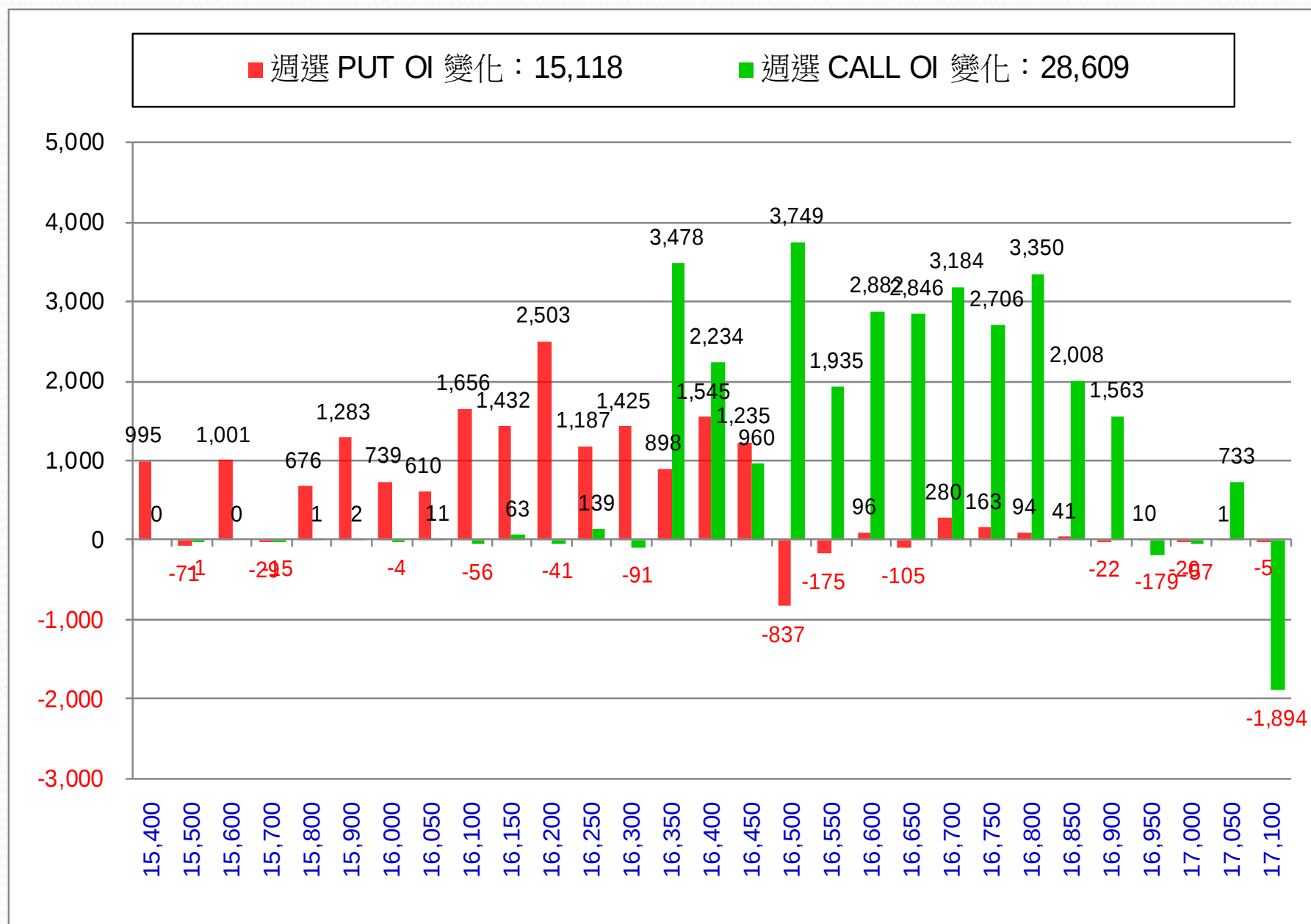
更新日期：2022年6月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



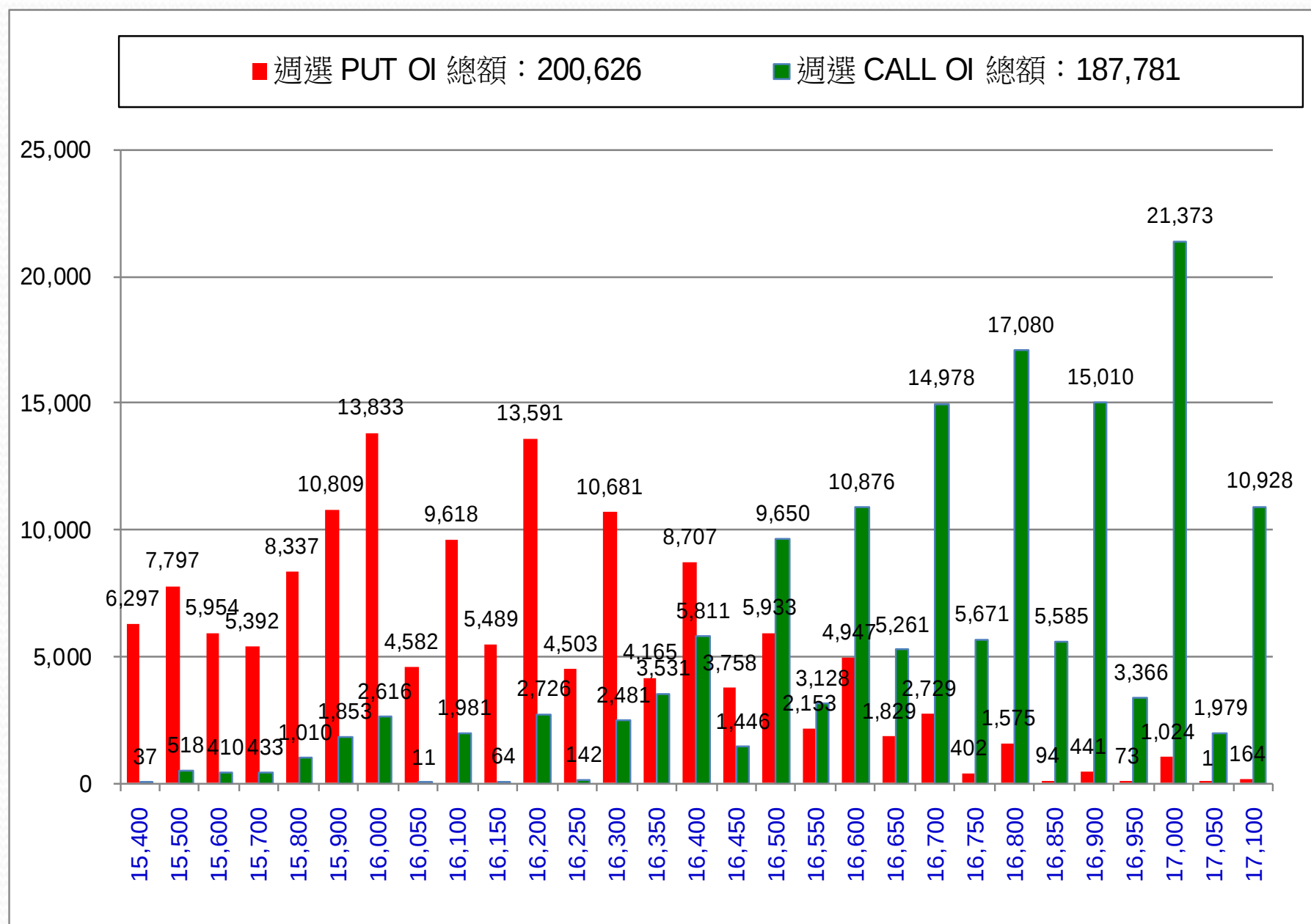
更新日期：2022年6月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年6月10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



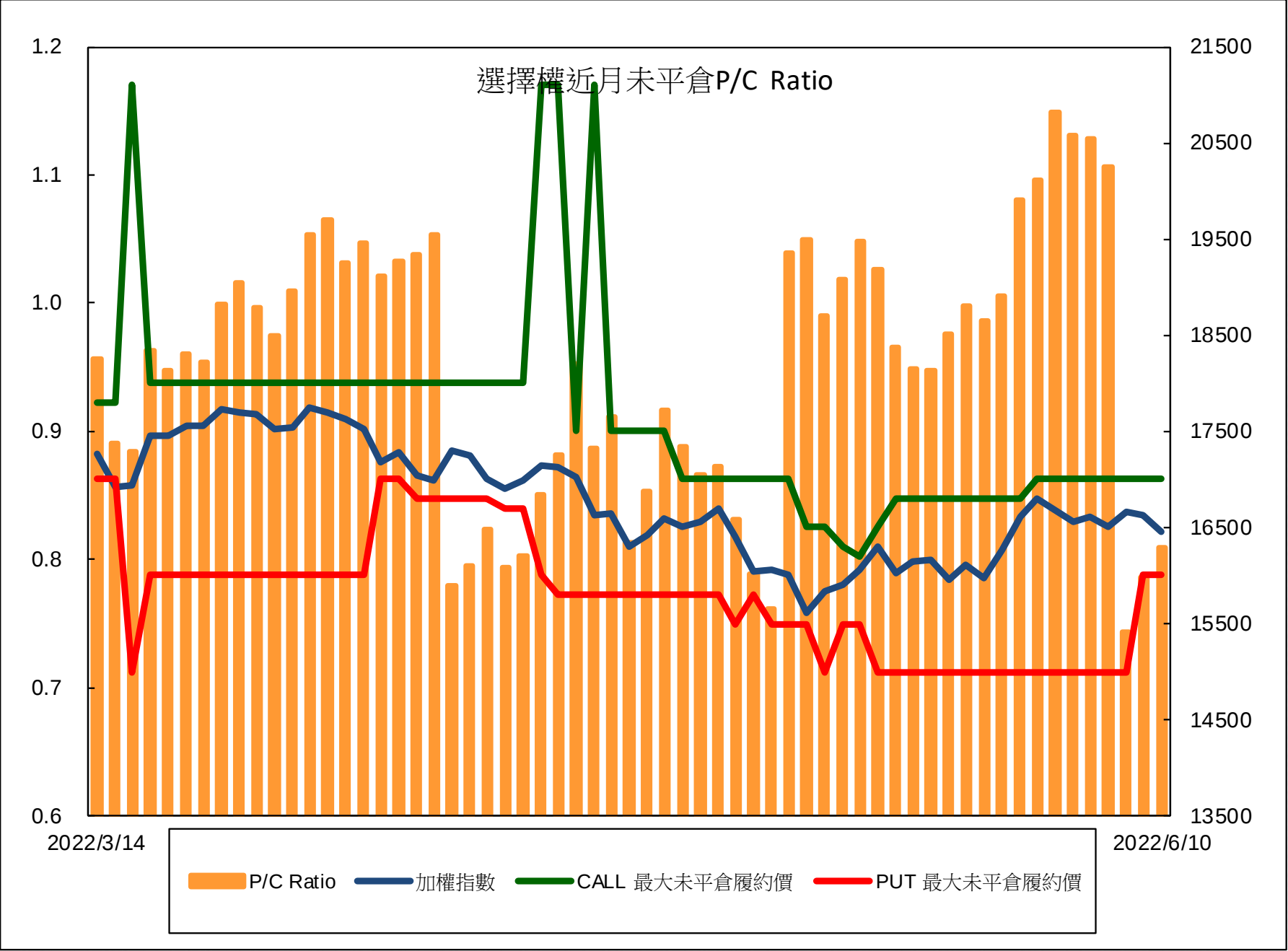
更新日期：2022年6月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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9日	53,542	48,185	5,357
	6月10日	57,650	54,454	3,196
Put	6月9日	55,959	50,550	5,409
	6月10日	53,184	51,832	1,352

更新日期：2022年6月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

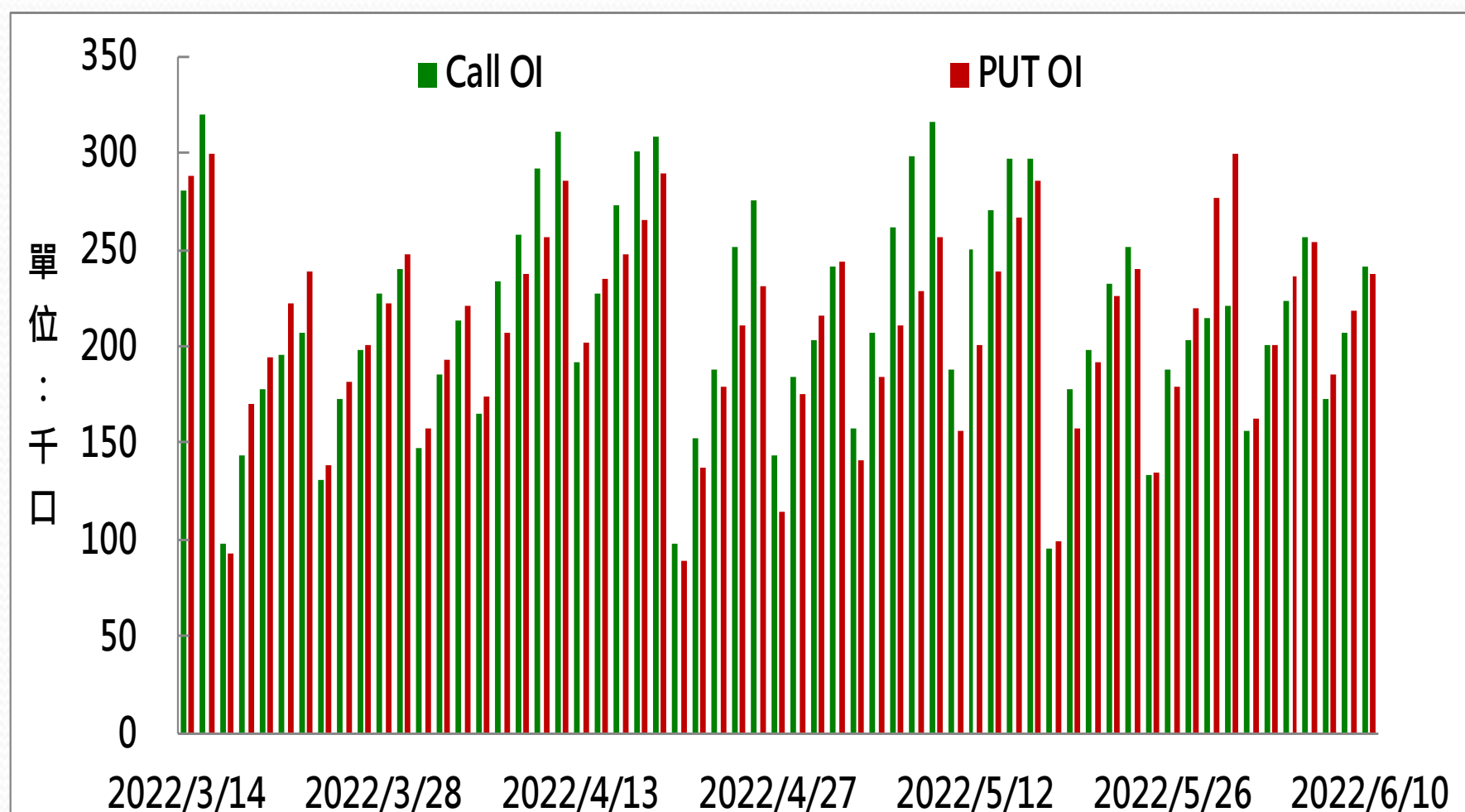
選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年6月10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10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10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