

台指選擇權OI匯報

日期：2022/6/13 結算日：2022/6/15					日期：2022/6/13 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	0	14,600	3,557	-88	0	0	14,600	1,281	571
0	0	14,700	1,219	-8	0	0	14,700	841	222
0	7	14,800	3,281	-93	240	240	14,800	1,190	249
0	0	14,900	2,565	-202	2	2	14,900	1,072	338
1	34	15,000	9,823	120	2	6	15,000	4,399	1,389
0	6	15,100	2,088	35	3	4	15,100	1,266	314
1	131	15,200	4,369	1,890	11	14	15,200	1,582	223
2	11	15,300	7,275	4,679	40	66	15,300	1,425	315
-5	32	15,400	8,761	2,464	15	35	15,400	1,421	302
-121	397	15,500	9,333	1,536	29	159	15,500	2,657	554
9	419	15,600	10,674	4,720	120	180	15,600	1,948	405
29	462	15,700	8,924	3,532	81	177	15,700	601	26
210	1,220	15,800	14,835	6,498	52	248	15,800	991	-120
390	2,243	15,900	14,153	3,344	177	327	15,900	468	30
2,335	4,951	16,000	13,277	-556	1,088	1,352	16,000	1,066	255
4,503	4,514	16,050	4,926	344	261	611	16,100	936	299
5,170	7,151	16,100	8,211	-1,407	4,158	4,733	16,200	541	-42
3,133	3,197	16,150	4,312	-1,177	524	2,433	16,300	1,381	-59
5,041	7,767	16,200	8,664	-4,927	664	1,608	16,400	257	-8
3,889	4,031	16,250	3,145	-1,358	575	1,858	16,500	116	4
9,018	11,499	16,300	7,058	-3,623	280	2,194	16,600	129	0
4,227	7,758	16,350	3,300	-865	641	2,688	16,700	54	-1
8,349	14,160	16,400	5,371	-3,336	1,001	2,820	16,800	17	-10
6,213	7,659	16,450	2,970	-788	717	2,544	16,900	7	0
4,550	14,200	16,500	4,597	-1,336	-3,145	7,964	17,000	29	15
2,576	5,704	16,550	1,721	-432	31	1,266	17,100	2	0
3,395	14,271	16,600	3,666	-1,281	376	1,506	17,200	26	0
352	5,613	16,650	1,762	-67	-125	1,080	17,300	21	0
-2,294	12,684	16,700	2,475	-254	63	694	17,400	27	0
-5,528	15,845	17,000	999	-25	-1	382	18,000	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
39,214	225,438	0.9117	205,524	4,898	7,800	42,419	0.8551	36,273	8,260
昨日 P/C	1.0314	今日增減變化		-0.1198	昨日 P/C	0.8092	今日增減變化		0.0459

更新日期：2022年6月13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13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	171,259,546	155,219,439	16,040,107	-7,833,302	4,781,910	2,671,724	2,110,186	-286,954	
投信	40,473,349	66,920,325	-26,446,976	-6,706,729	405,794	0	405,794	-12,357	
自營商	55,827,304	24,841,429	30,985,875	-3,404,031	1,465,746	1,387,880	77,866	45,002	
	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	725,881	1,633,647	-907,766	-244,870	300,499	281,135	19,364	37,348	
投信	63,578	0	63,578	-1,154	0	0	0	0	
自營商	656,027	990,594	-334,567	216,678	474,476	374,484	99,992	10,272	

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13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	57,874	26,037	31,837	3,527	45,818	24,749	21,069	3,975	
投信	0	50	-50	100	750	86	664	200	
自營商	59,409	70,301	-10,892	-14,088	59,034	59,560	-526	-1,878	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	24,578	8,662	15,916	-1,191	7,465	24,211	-16,746	2,926	
特定法人(全月)	42,294	13,976	28,318	7,309	10,337	32,254	-21,917	-5,644	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	75,040	67,511	7,529	-12,797	67,216	62,163	5,053	6,820	
十大交易人(全月)	106,011	83,067	22,944	-12,618	77,308	91,831	-14,523	4,127	
全市場未沖銷(近月)			233,672	39,160			205,524	4,898	
全市場未沖銷(全月)			287,951	47,201			251,040	13,656	

更新日期：2022年6月13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	16500	買權OI最大量	17000
	賣權成交最大量	16000	賣權OI最大量	15800
	整體隱含波動率	21.40%	較前一交易日	+5.70%
	買權隱含波動率	18.92%	較前一交易日	+4.01%
	賣權隱含波動率	24.39%	較前一交易日	+7.88%
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	1620	買權OI最大量	1720
	賣權成交最大量	1460	賣權OI最大量	1460

更新日期：2022年6月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

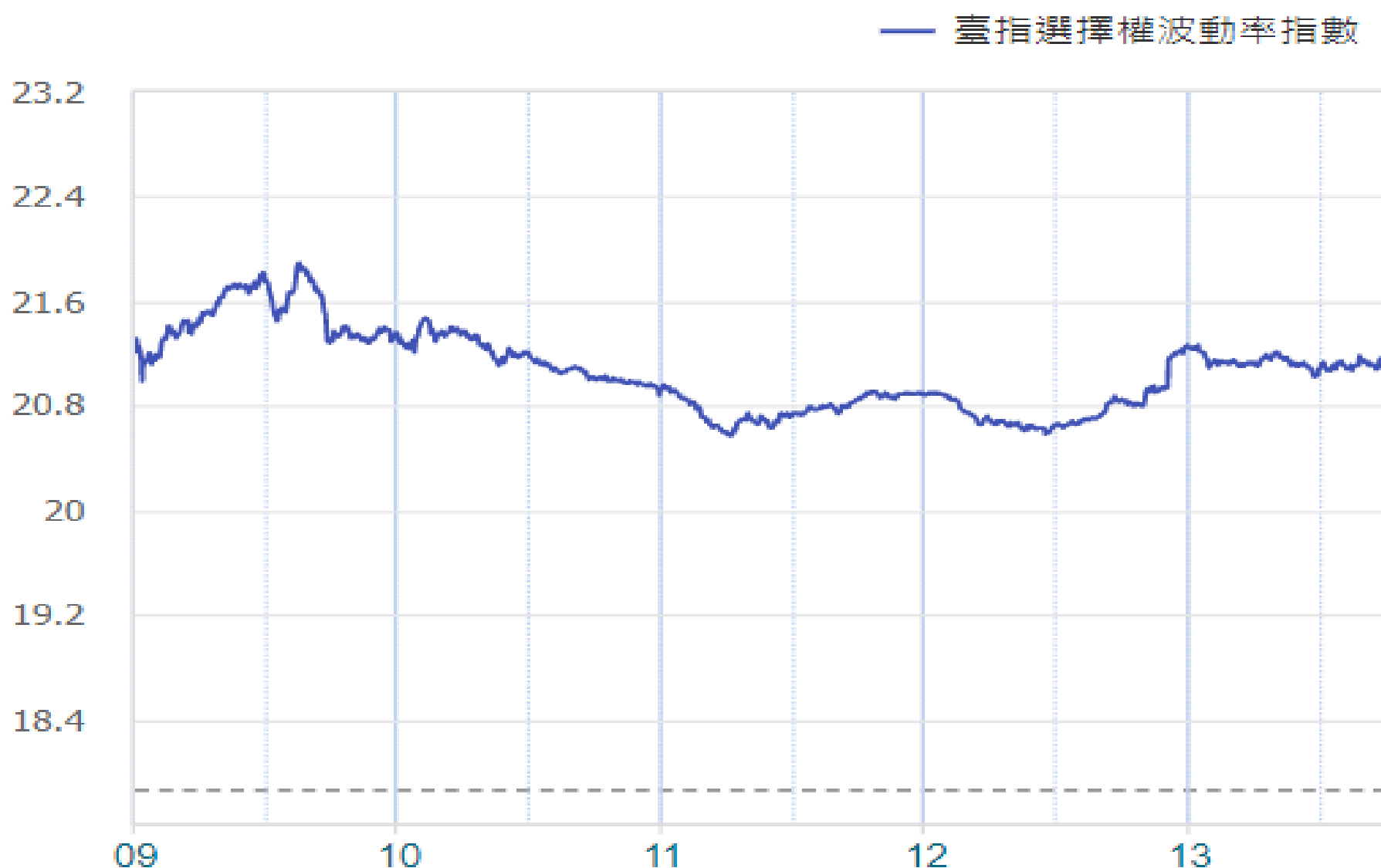
台指選擇權匯報

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	19.86%	較前一交易日	-2.83%
	買權隱含波動率	10.61%	較前一交易日	+1.53%
	賣權隱含波動率	29.13%	較前一交易日	+3.57%
	成交量P/C_Ratio值	0.667	較前一交易日	-0.27
	未平倉P/C_Ratio值	0.855	較前一交易日	+0.05
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	1620	買權OI最大量	1720
	賣權成交最大量	1460	賣權OI最大量	1460

更新日期：2022年6月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

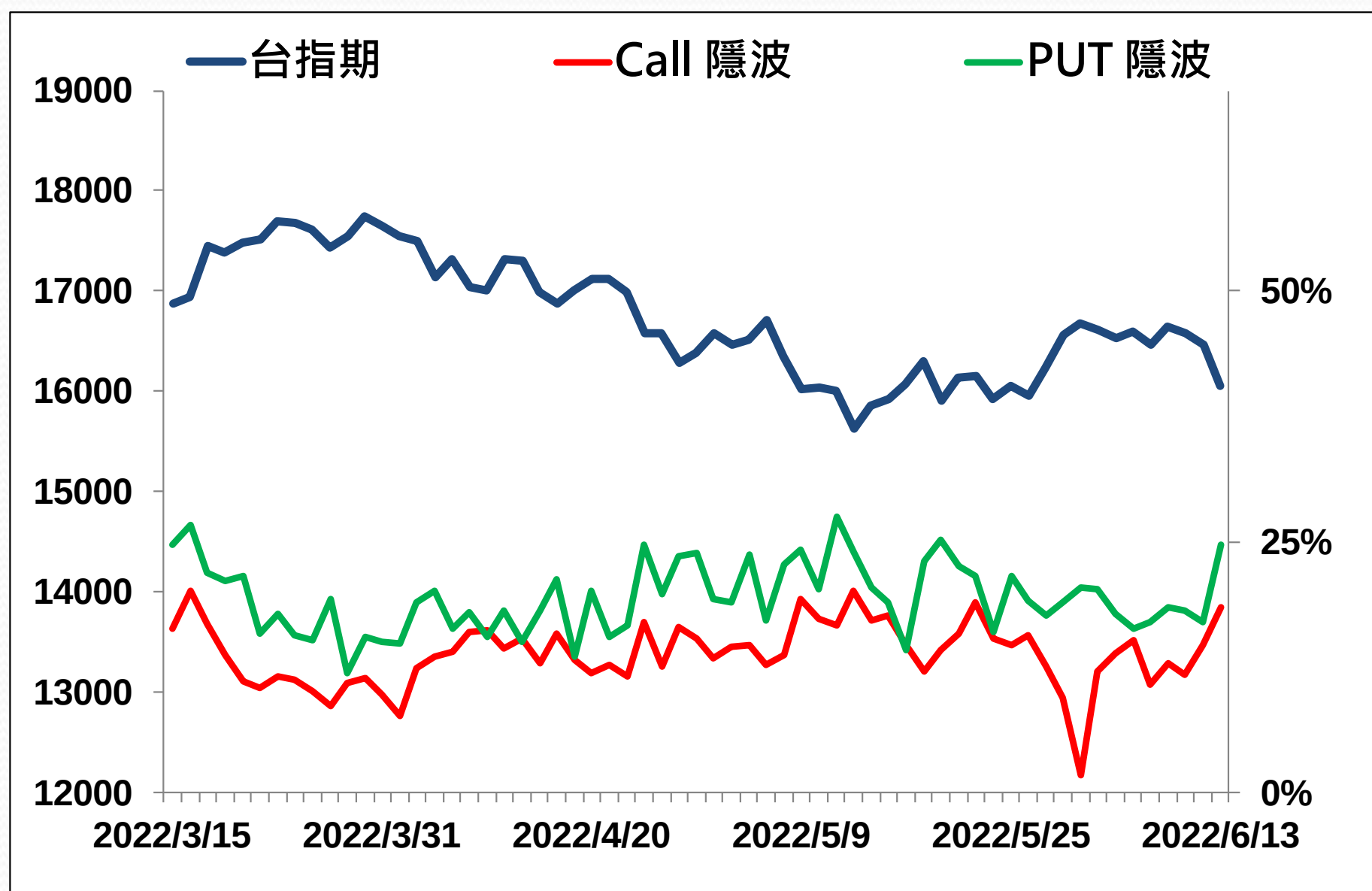
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



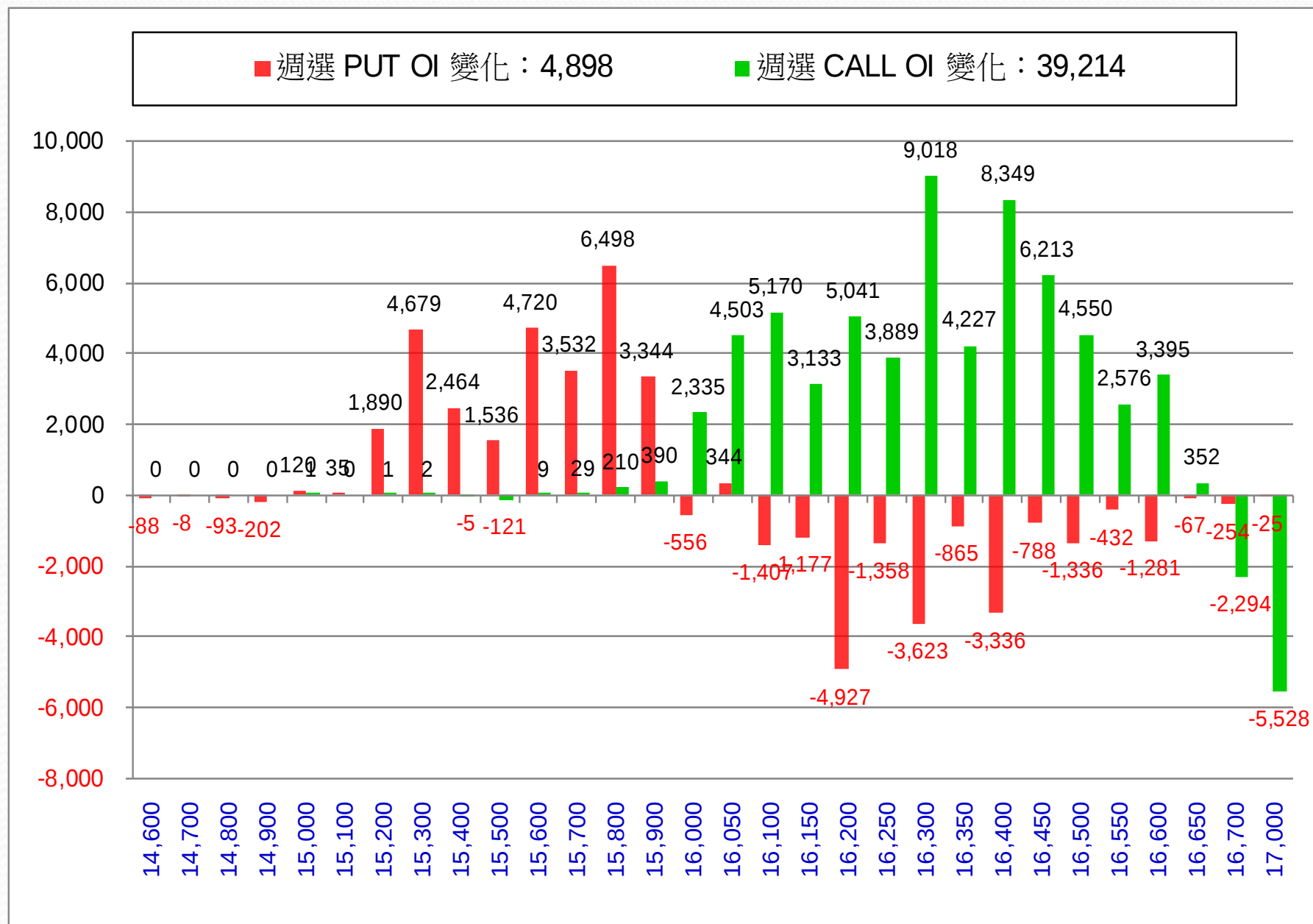
更新日期：2022年6月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



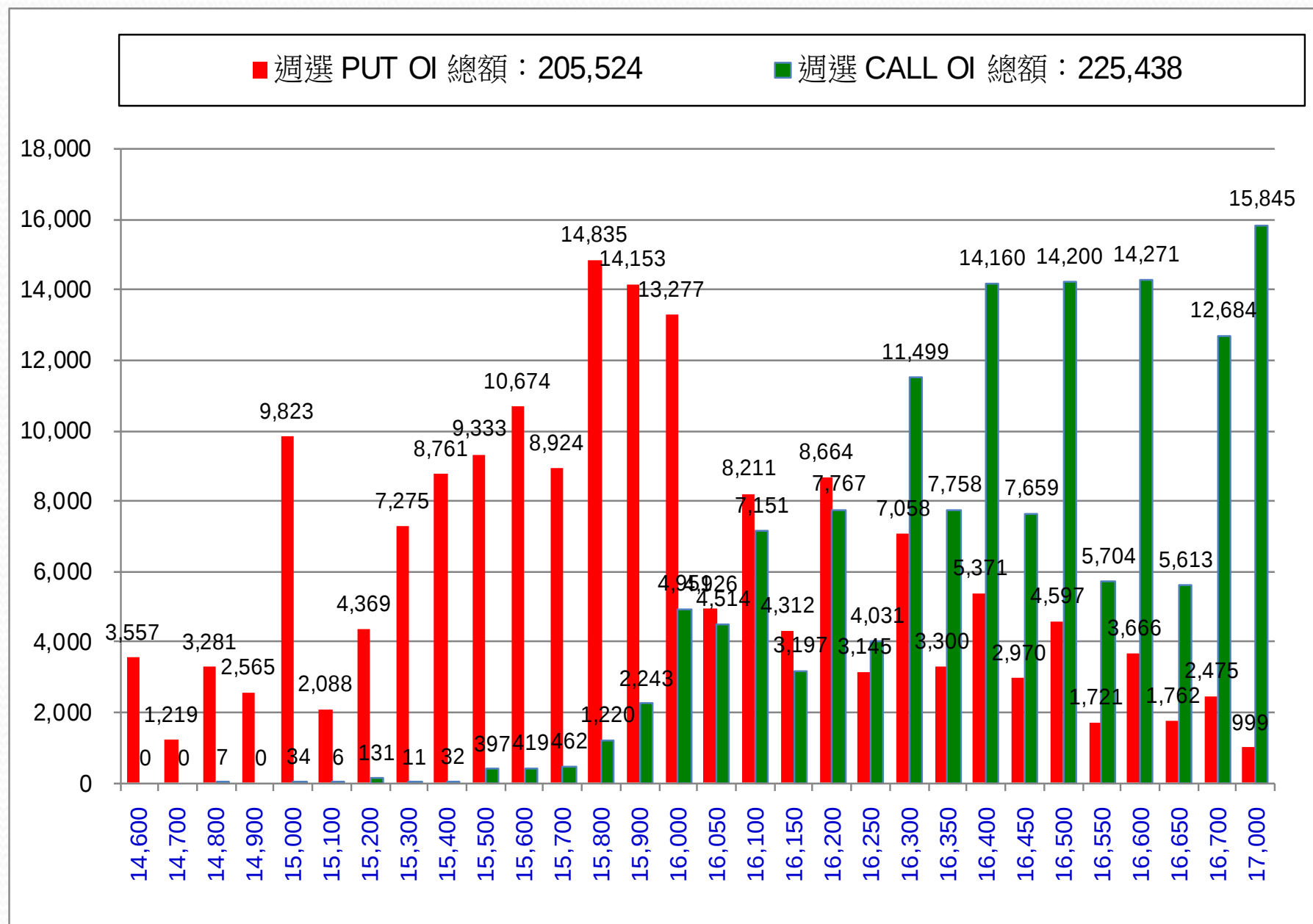
更新日期：2022年6月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年6月13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



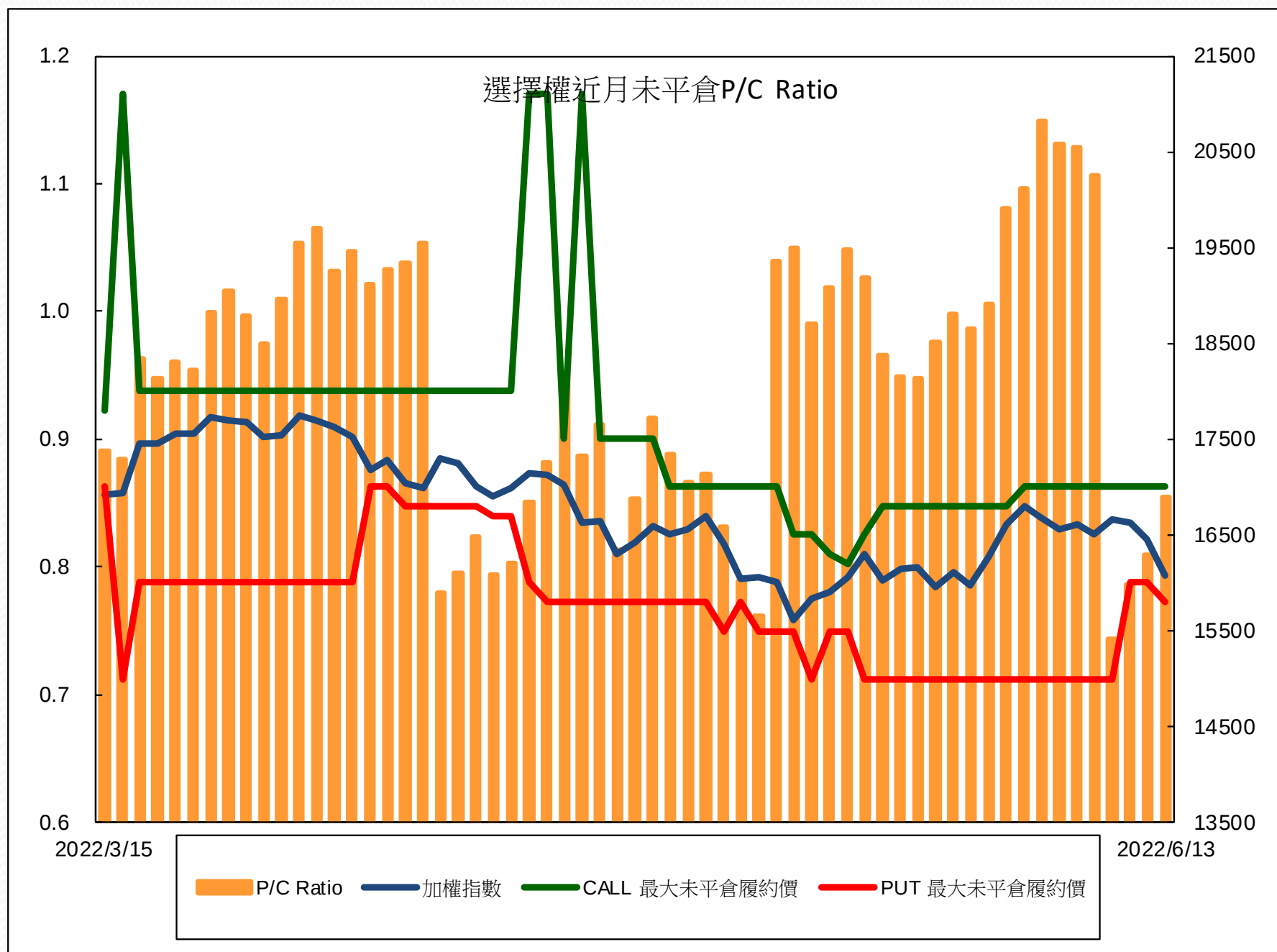
更新日期：2022年6月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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10日	57,650	54,454	3,196
	6月13日	59,409	70,301	-10,892
Put	6月10日	53,184	51,832	1,352
	6月13日	59,034	59,560	-526

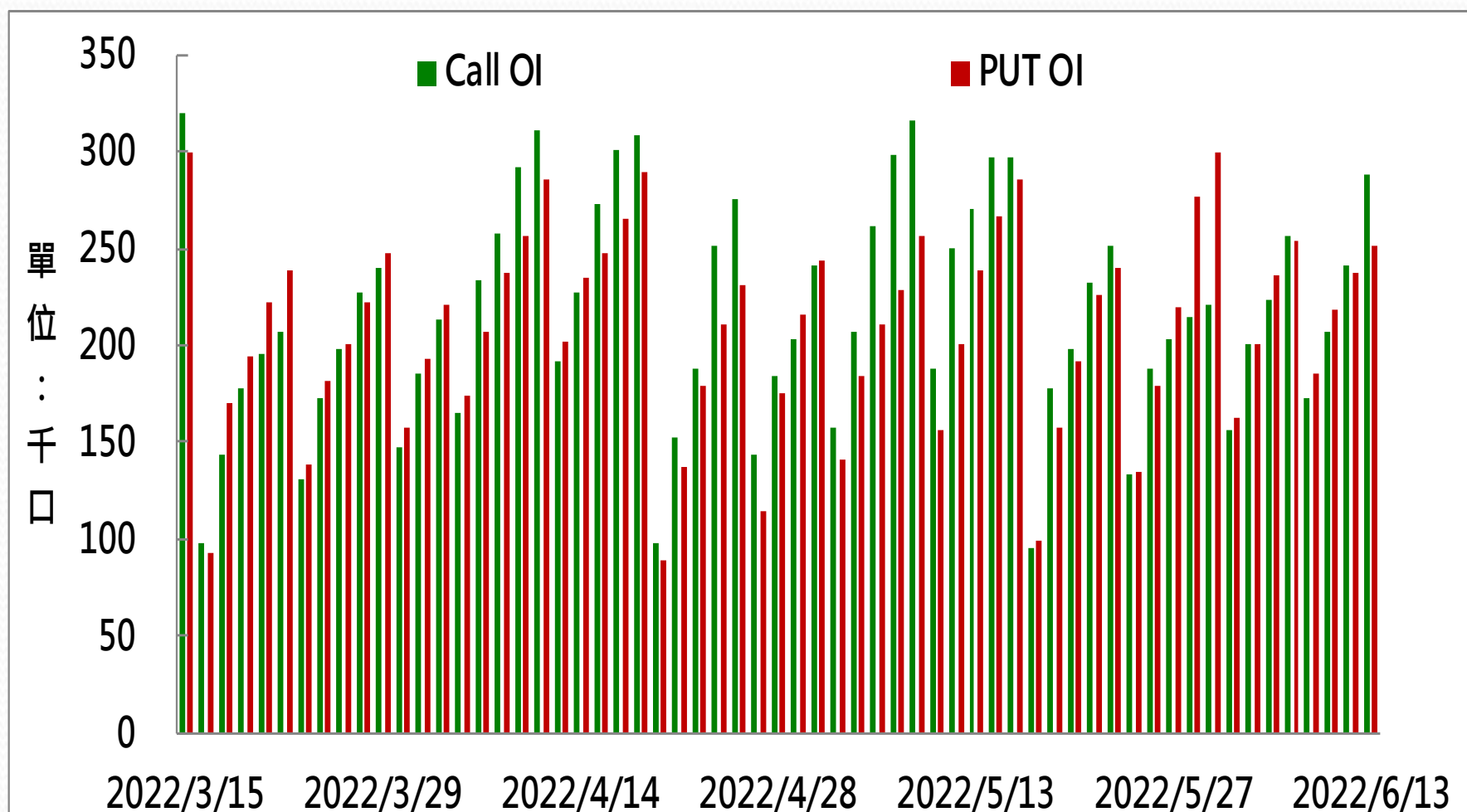
更新日期：2022年6月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年6月13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13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13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