

台指選擇權OI匯報

日期：2022/6/14 結算日：2022/6/15					日期：2022/6/14 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
-5	29	15,000	9,119	-704	0	0	14,500	2,387	535 ※
0	6	15,100	2,480	392	0	0	14,600	1,473	192
0	131	15,200	4,710	341	8	8	14,700	969	128
-3	8	15,300	7,882	607	112	352	14,800	1,634	444
5	37	15,400	13,296	4,535	1	3	14,900	1,173	101
-38	359	15,500	9,838	505	18	24	15,000	4,683	284
9	428	15,600	13,849	3,175	30	34	15,100	1,434	168
14	14	15,650	4,382	4,382	75	89	15,200	1,774	192
82	544	15,700	12,894	3,970	100	166	15,300	1,822	397
205	205	15,750	3,202	3,202	23	58	15,400	1,440	19
824	2,044	15,800	15,381	546	178	337	15,500	2,598	-59
563	563	15,850	5,848	5,848 ※	204	384	15,600	1,907	-41
3,672	5,915	15,900	15,256	1,103	192	369	15,700	677	76
1,465	1,465	15,950	4,127	4,127	165	413	15,800	815	-176
4,466	9,417	16,000	14,111	834	1,008	1,335	15,900	466	-2
2,573	7,087	16,050	6,259	1,333	394	1,746	16,000	983	-83
2,264	9,415	16,100	7,846	-365	678	1,289	16,100	868	-68
4,811	8,008	16,150	2,685	-1,627	367	5,100	16,200	521	-20
※ 6,169	13,936	16,200	6,522	-2,142	727	3,160	16,300	1,354	-27
5,318	9,349	16,250	2,600	-545	1,840	3,448	16,400	250	-7
1,773	13,272	16,300	5,316	-1,742	※ 2,300	4,158	16,500	115	-1
1,387	9,145	16,350	2,962	-338	716	2,910	16,600	115	-14
-797	13,363	16,400	4,251	-1,120	610	3,298	16,700	77	23
-2,341	5,318	16,450	2,725	-245	73	2,893	16,800	17	0
-826	13,374	16,500	3,493	-1,104	-291	2,253	16,900	8	1
-1,121	4,583	16,550	1,664	-57	-643	7,321	17,000	31	2
-1,947	12,324	16,600	3,304	-362	-8	1,258	17,100	2	0
-1,314	4,299	16,650	1,678	-84	-4	1,502	17,200	26	0
-978	11,706	16,700	2,386	-89	-81	999	17,300	21	0
-1,411	14,434	17,000	1,002	3	50	337	17,900	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
21,389	246,827	0.9269	228,788	23,264	12,161	54,580	0.7580	41,369	5,096
昨日 P/C	0.8795	今日增減變化		0.0474	昨日 P/C	0.8551	今日增減變化		-0.0972

更新日期：2022年6月14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14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	179,501,946	172,257,296	7,244,650	-8,795,457	4,864,603	2,765,413	2,099,190	-10,996	
投信	40,437,752	67,384,560	-26,946,808	-499,832	384,077	0	384,077	-21,717	
自營商	56,346,910	23,337,660	33,009,250	2,023,375	1,155,930	1,287,782	-131,852	-209,718	
	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	1,297,452	2,335,710	-1,038,258	-130,492	291,036	280,826	10,210	-9,154	
投信	62,551	0	62,551	-1,027	0	0	0	0	
自營商	622,606	874,471	-251,865	82,702	391,417	280,600	110,817	10,825	

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14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	64,141	24,429	39,712	7,875	50,803	24,467	26,336	5,267	
投信	0	0	0	50	750	86	664	0	
自營商	68,818	95,824	-27,006	-16,114	66,379	55,581	10,798	11,324	
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
特定法人(近月)	28,372	4,897	23,475	7,559	4,654	24,424	-19,770	-3,024	
特定法人(全月)	46,018	9,294	36,724	8,406	9,995	37,230	-27,235	-5,318	
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---	
十大交易人(近月)	80,685	84,627	-3,942	-11,471	67,473	71,715	-4,242	-9,295	
十大交易人(全月)	119,726	105,696	14,030	-8,914	77,585	104,733	-27,148	-12,625	
全市場未沖銷(近月)			255,010	21,338			228,788	23,264	
全市場未沖銷(全月)			321,714	33,763			279,740	28,700	

更新日期：2022年6月14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	16000	買權OI最大量	17000
	賣權成交最大量	15800	賣權OI最大量	15800
	整體隱含波動率	17.68%	較前一交易日	-3.72%
	買權隱含波動率	17.13%	較前一交易日	-1.79%
	賣權隱含波動率	18.28%	較前一交易日	-6.11%
電子選擇權	買權成交最大量	770	買權OI最大量	810
	賣權成交最大量	650	賣權OI最大量	670
金融選擇權	買權成交最大量	1660	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14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	16500	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	19.23%	較前一交易日	+0.63%
	買權隱含波動率	11.45%	較前一交易日	+0.84%
	賣權隱含波動率	30.23%	較前一交易日	+1.10%
	成交量P/C_Ratio值	0.765	較前一交易日	+0.10
	未平倉P/C_Ratio值	0.758	較前一交易日	-0.10
電子選擇權	買權成交最大量	770	買權OI最大量	810
	賣權成交最大量	650	賣權OI最大量	670
金融選擇權	買權成交最大量	1660	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14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

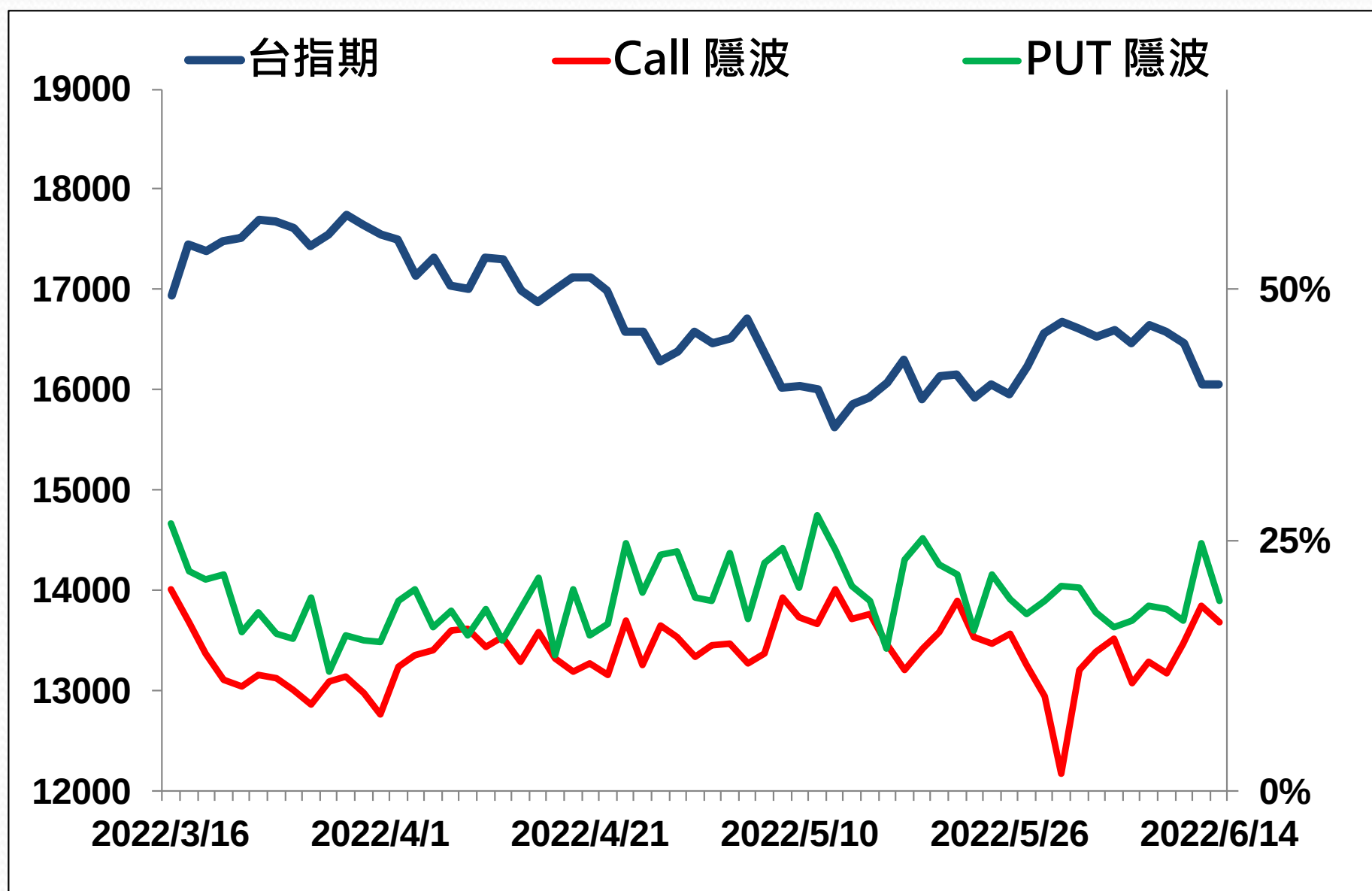
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



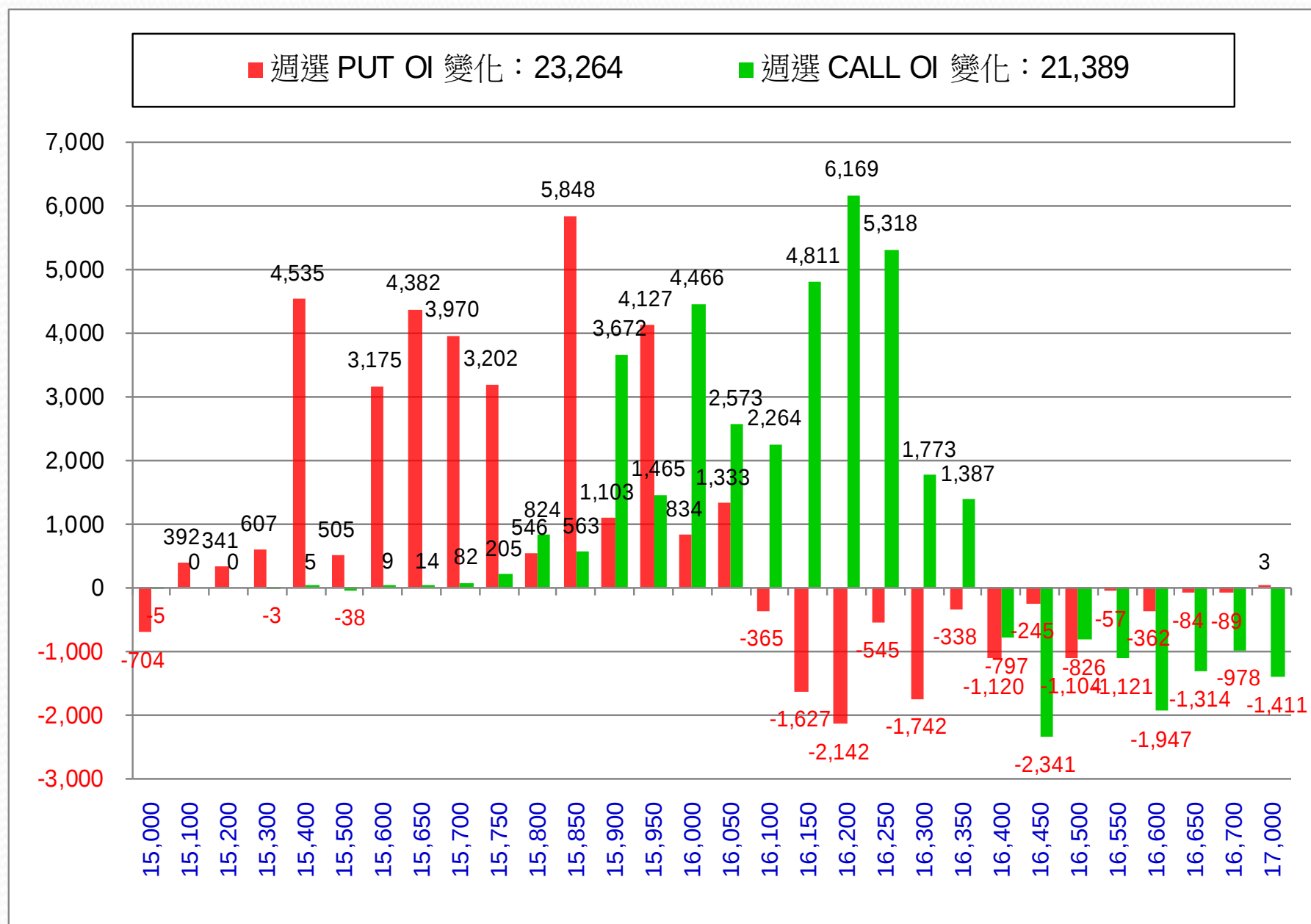
更新日期：2022年6月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



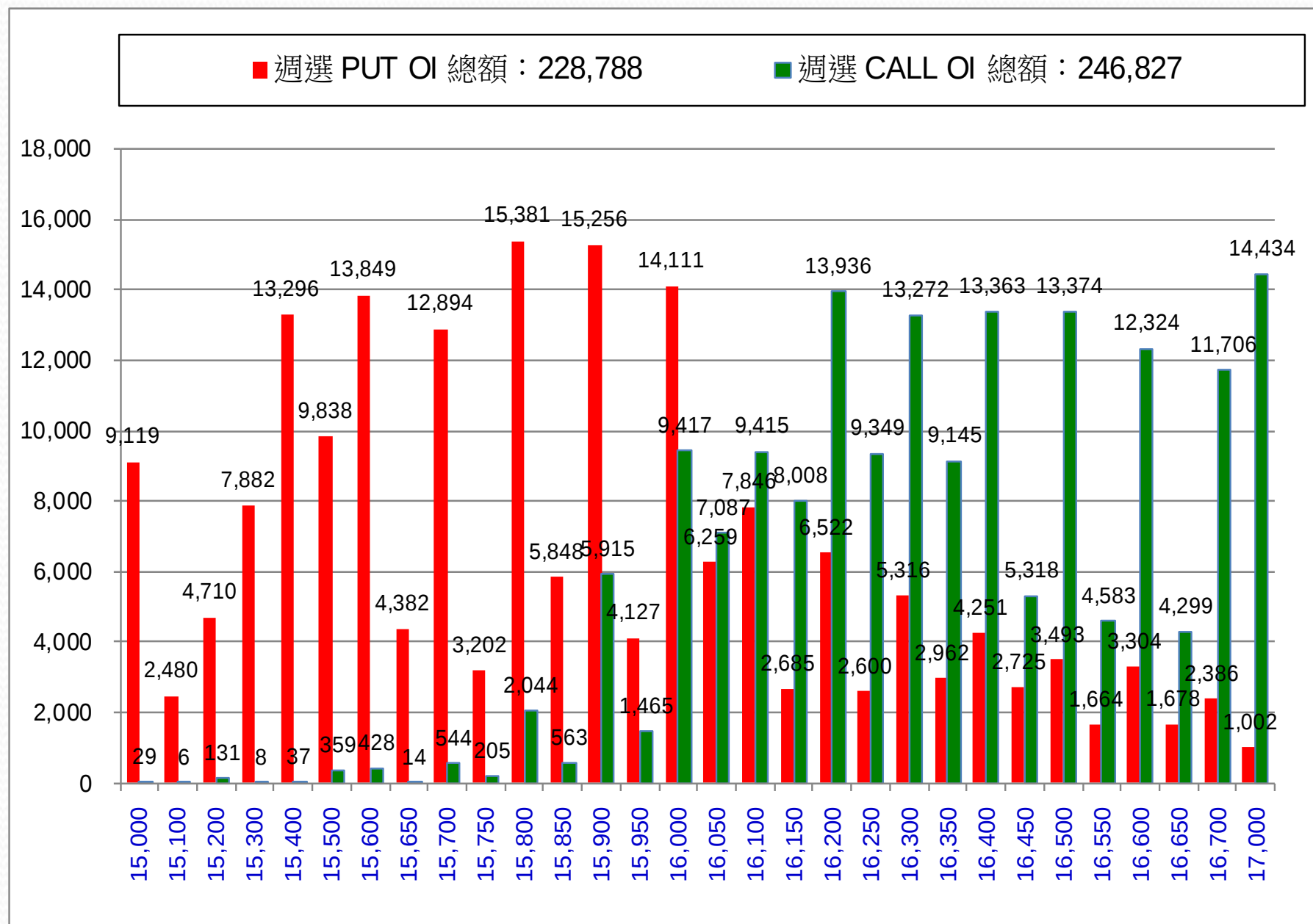
更新日期：2022年6月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年6月14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



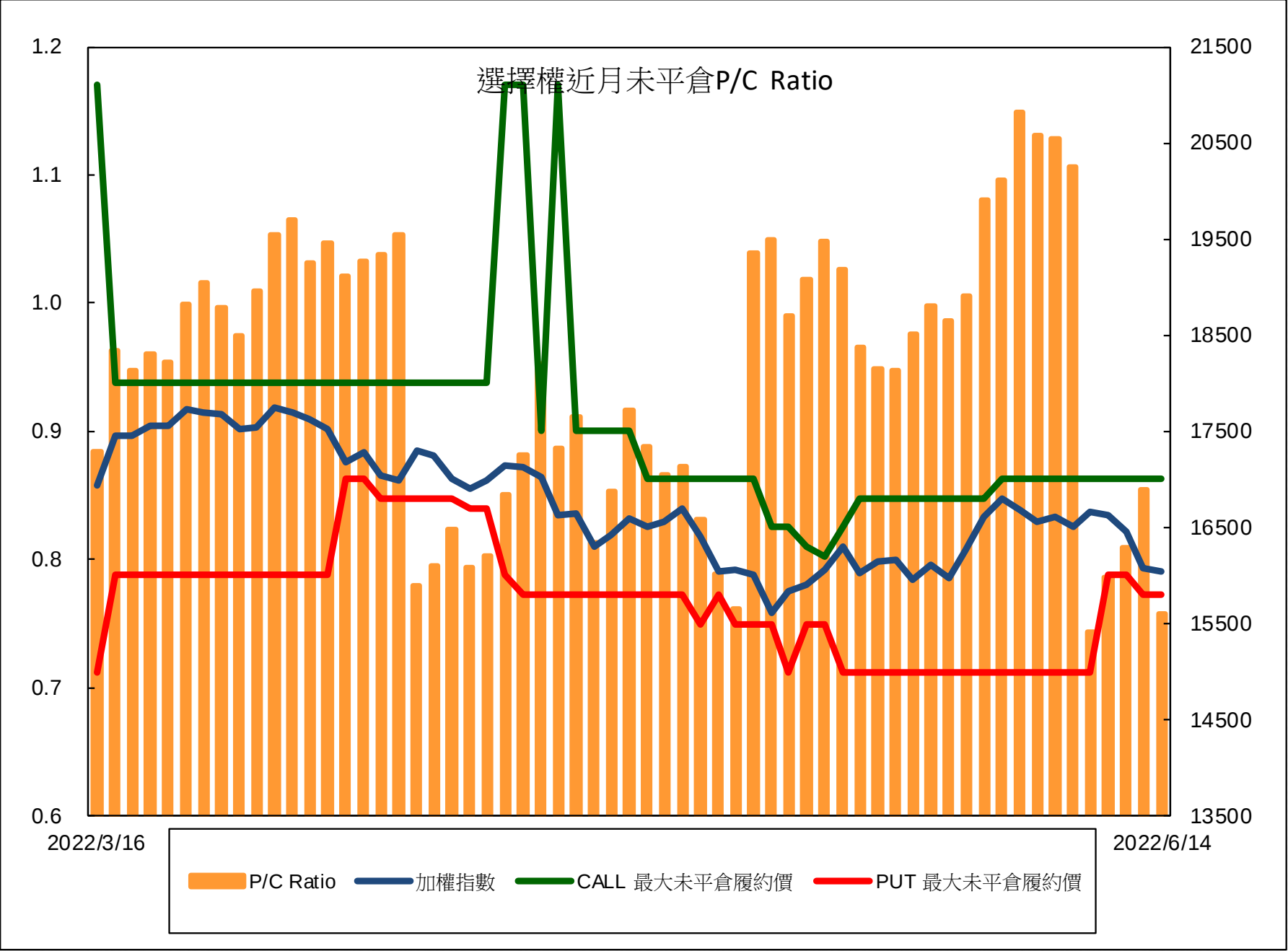
更新日期：2022年6月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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13日	59,409	70,301	-10,892
	6月14日	68,818	95,824	-27,006
Put	6月13日	59,034	59,560	-526
	6月14日	66,379	55,581	10,798

更新日期：2022年6月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

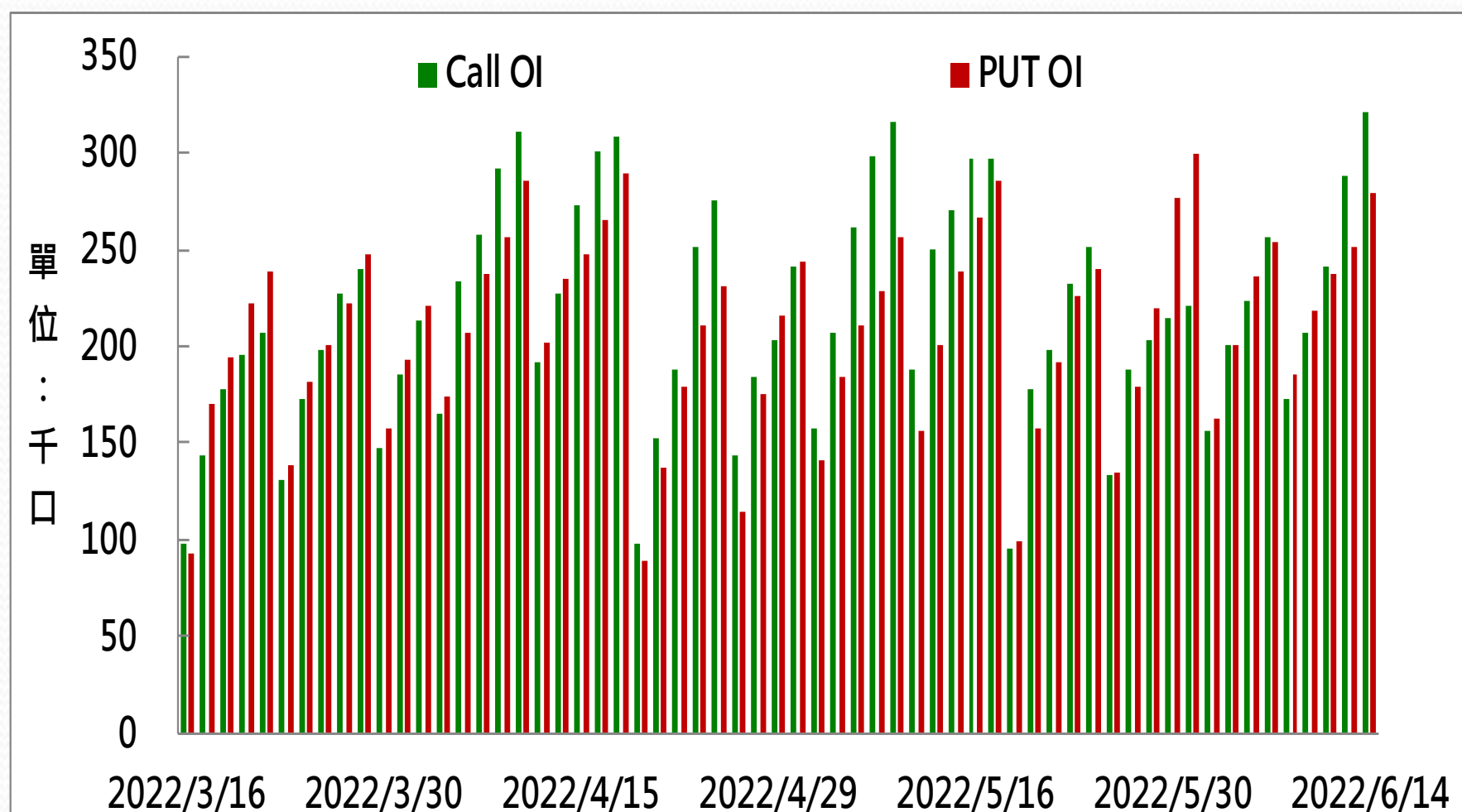
選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年6月14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14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14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