

台指選擇權OI匯報

日期：2022/6/15 結算日：2022/6/22					日期：2022/6/15 結算日：2022/7/20				
202206W4					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	14,400	2,686	2,686	0	0	14,000	2,429	307
0	0	14,900	737	737	0	0	14,500	2,746	359
1	1	15,000	1,614	1,614	0	0	14,600	1,753	280
0	0	15,100	831	831	1	9	14,700	1,126	157
0	0	15,200	1,254	1,254	62	414	14,800	2,139	505
0	0	15,300	983	983	1	4	14,900	1,762	589
20	20	15,400	1,812	1,812	21	45	15,000	5,167	484
2	2	15,500	1,316	1,316	1	35	15,100	1,571	137
53	53	15,600	1,760	1,760	5	94	15,200	1,807	33
5	5	15,650	642	642	55	221	15,300	1,697	-125
89	89	15,700	674	674	19	77	15,400	1,792	352
65	65	15,750	423	423	58	395	15,500	2,730	132
323	323	15,800	819	819	172	556	15,600	2,249	342
214	214	15,850	378	378	71	440	15,700	684	7
843	843	15,900	945	945	116	529	15,800	776	-39
1,492	1,492	15,950	574	574	464	1,799	15,900	420	-46
1,219	1,219	16,000	1,317	1,317	644	2,390	16,000	2,795	1,812
1,026	1,026	16,050	507	507	507	1,796	16,100	855	-13
1,521	1,521	16,100	353	353	275	5,375	16,200	531	10
1,353	1,353	16,150	54	54	672	3,832	16,300	1,344	-10
1,012	1,012	16,200	144	144	467	3,915	16,400	159	-91
1,071	1,071	16,250	73	73	156	4,314	16,500	117	2
2,334	2,334	16,300	76	76	340	3,250	16,600	113	-2
992	992	16,350	28	28	321	3,619	16,700	117	40
1,373	1,373	16,400	22	22	124	3,017	16,800	19	2
1,051	1,051	16,450	6	6	210	2,463	16,900	9	1
2,147	2,147	16,500	9	9	304	7,625	17,000	31	0
1,434	1,434	16,600	1	1	322	1,580	17,100	2	0
1,309	1,309	16,700	0	0	2	1,504	17,200	26	0
764	764	16,800	1	1	39	1,038	17,300	21	0
102	102	17,400	0	0	2	339	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
23,220	23,220	1.0520	24,427	24,427	6,712	61,292	0.7825	47,962	6,593
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化	1.0520		昨日 P/C	0.7580	今日增減變化	0.0246	

更新日期：2022年6月15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15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	95,257,014	114,750,140	-19,493,126	-26,737,776	3,276,295	1,014,706	2,261,589	162,399
投信	40,674,554	67,684,175	-27,009,621	-62,813	386,964	0	386,964	2,887
自營商	51,409,829	15,804,853	35,604,976	2,595,726	991,774	868,519	123,255	255,107
	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	236,563	1,607,990	-1,371,427	-333,169	1,543	313,249	-311,706	-321,916
投信	59,141	0	59,141	-3,410	0	0	0	0
自營商	493,866	145,454	348,412	600,277	353,370	30,862	322,508	211,691

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15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	24,253	13,515	10,738	-28,974	17,319	7,192	10,127	-16,209
投信	0	0	0	0	100	95	5	-659
自營商	30,084	32,025	-1,941	25,065	30,769	22,006	8,763	-2,035
特定法人(週)	0	0	0	---	0	1,137	-1,137	---
特定法人(近月)	20,523	12,087	8,436	---	4,955	10,566	-5,611	---
特定法人(全月)	20,774	12,122	8,652	-28,072	5,261	13,963	-8,702	18,533
十大交易人(週)	11,869	11,994	-125	---	14,266	9,788	4,478	---
十大交易人(近月)	39,081	31,274	7,807	---	15,920	31,485	-15,565	---
十大交易人(全月)	56,353	43,733	12,620	-1,410	31,642	45,424	-13,782	13,366
全市場未沖銷(近月)			61,292	---			47,962	---
全市場未沖銷(全月)			97,117	-224,597			82,192	-197,548

更新日期：2022年6月15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06W4週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	16300	買權OI最大量	16300
	賣權成交最大量	15400	賣權OI最大量	14400
	整體隱含波動率	22.12%	較前一交易日	+4.44%
	買權隱含波動率	16.52%	較前一交易日	-0.61%
	賣權隱含波動率	27.92%	較前一交易日	+9.64%
電子選擇權	買權成交最大量	730	買權OI最大量	730
	賣權成交最大量	680	賣權OI最大量	680
金融選擇權	買權成交最大量	1700	買權OI最大量	1720
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年6月15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	16200	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	20.38%	較前一交易日	-1.15%
	買權隱含波動率	11.12%	較前一交易日	-0.32%
	賣權隱含波動率	30.79%	較前一交易日	+0.57%
	成交量P/C_Ratio值	0.754	較前一交易日	-0.01
	未平倉P/C_Ratio值	0.783	較前一交易日	+0.02
電子選擇權	買權成交最大量	730	買權OI最大量	730
	賣權成交最大量	680	賣權OI最大量	680
金融選擇權	買權成交最大量	1700	買權OI最大量	1720
	賣權成交最大量	1520	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年6月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

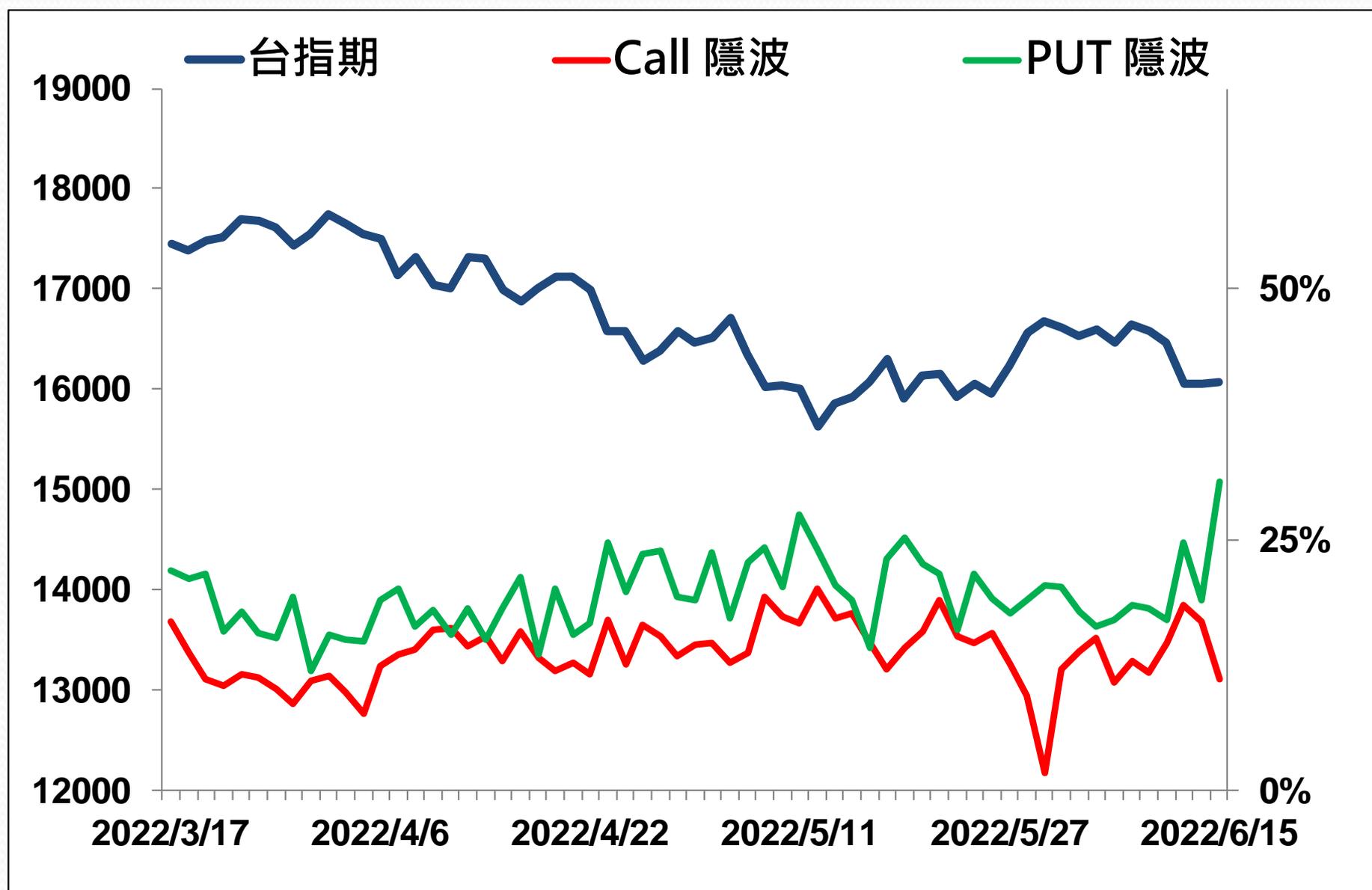
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



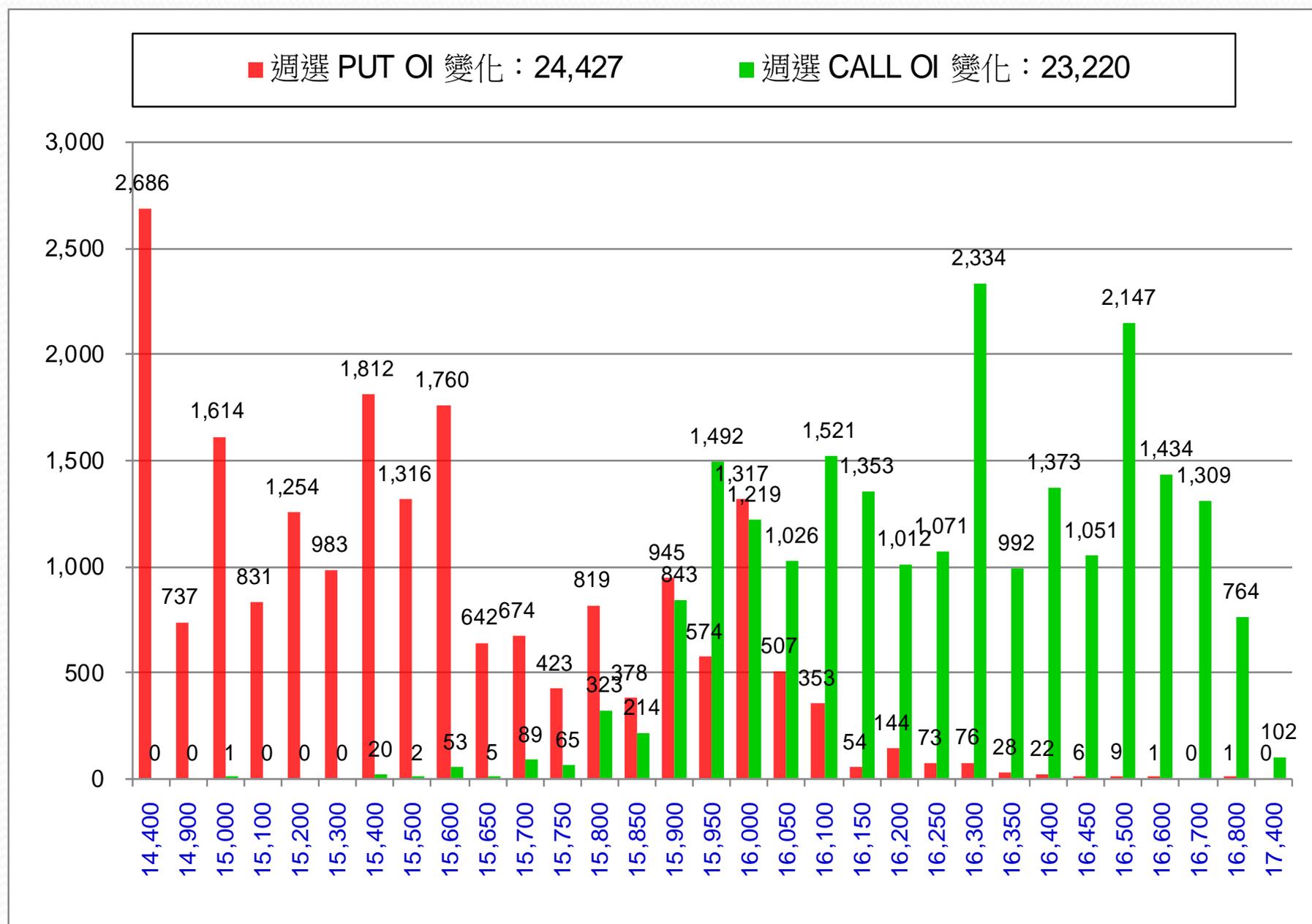
更新日期：2022年6月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



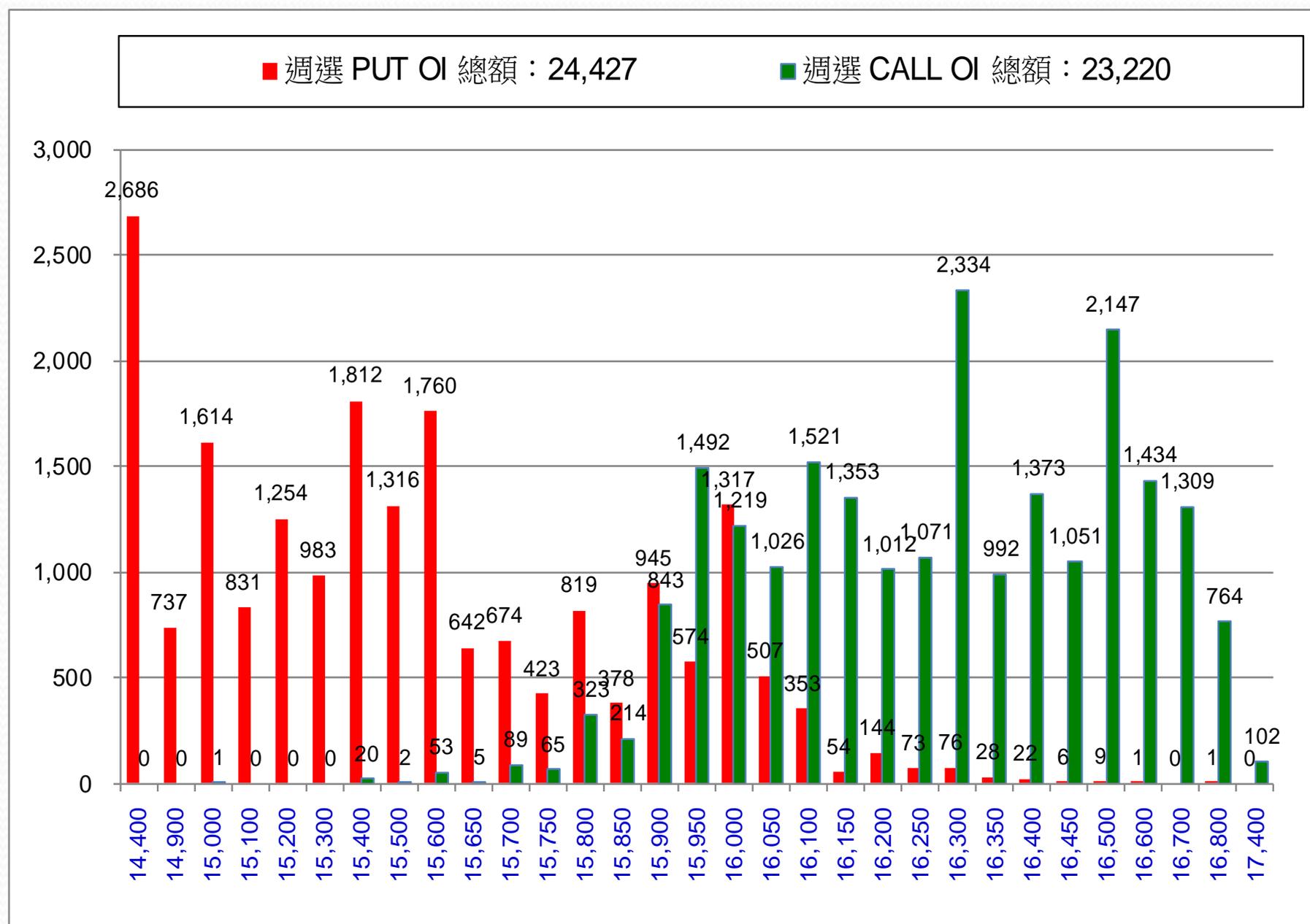
更新日期：2022年6月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年6月15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



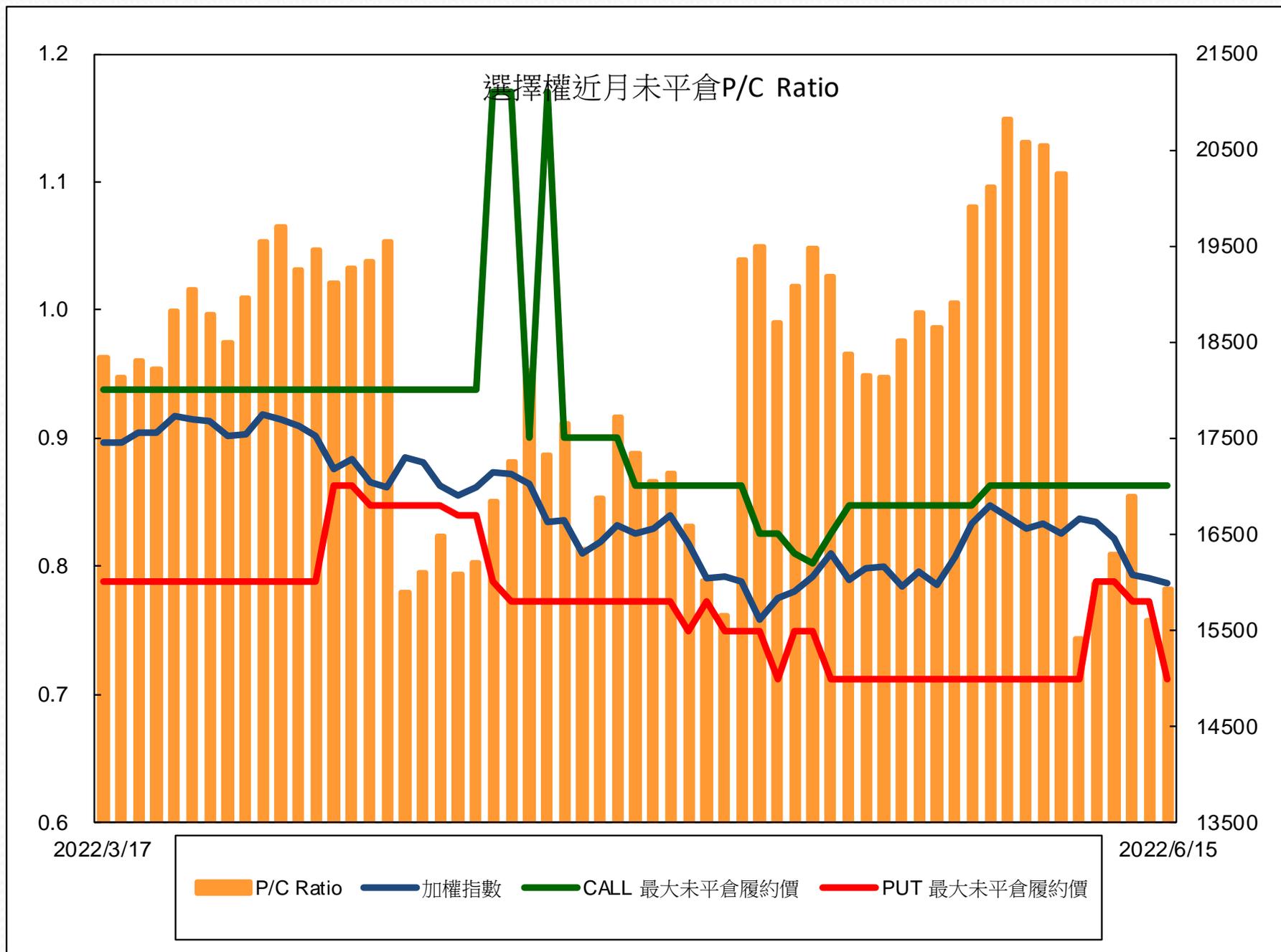
更新日期：2022年6月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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14日	68,818	95,824	-27,006
	6月15日	30,084	32,025	-1,941
Put	6月14日	66,379	55,581	10,798
	6月15日	30,769	22,006	8,763

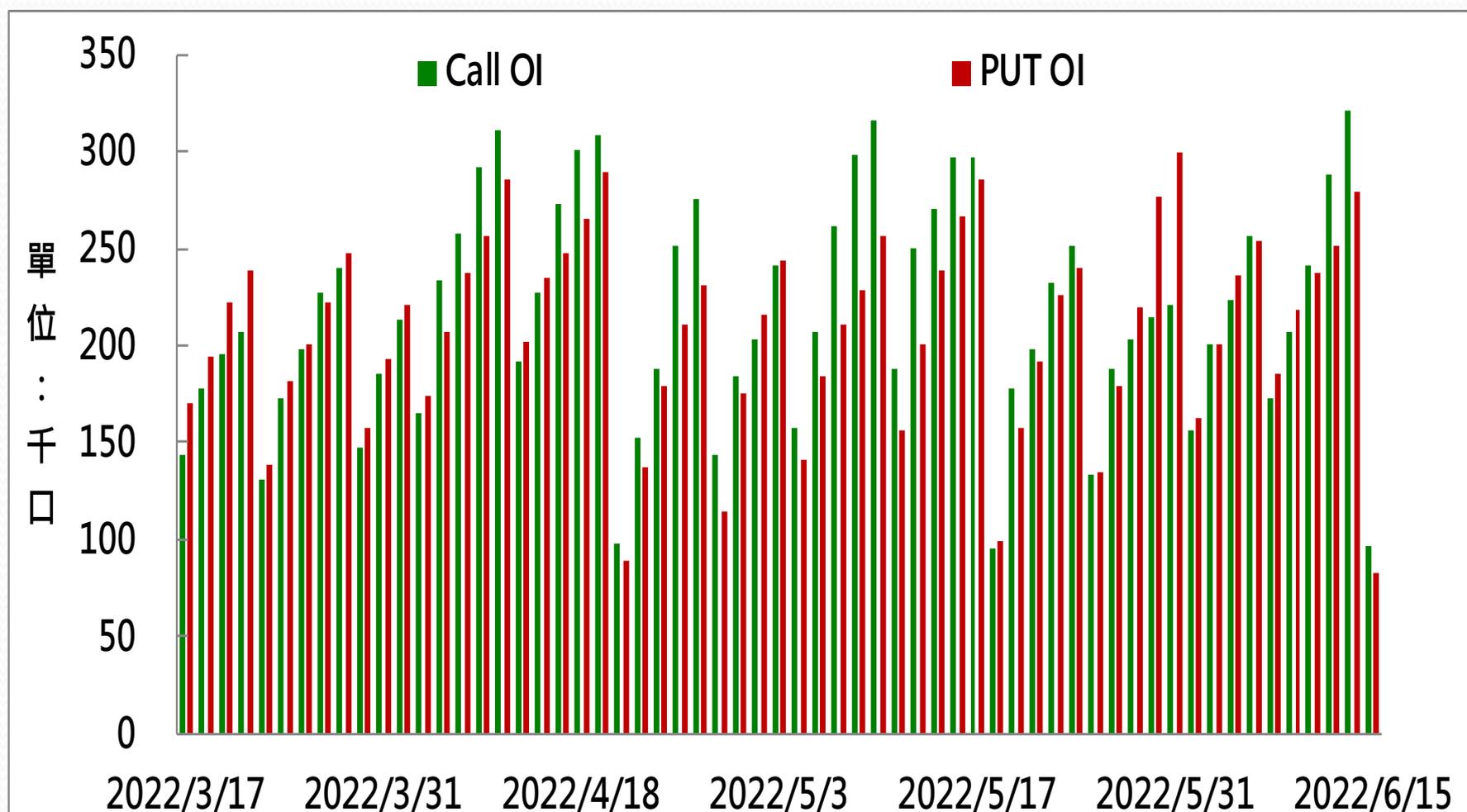
更新日期：2022年6月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年6月15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15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15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