

台指選擇權 OI 匯報

日期：2022/6/17 結算日：2022/6/22					日期：2022/6/17 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	14,300	3,385	2,348	0	0	14,100	1,143	400	
0	0	14,400	3,586	1,043	0	0	14,200	1,607	493	
0	0	14,500	3,824	1,628	1	2	14,300	1,644	354	
0	0	14,600	4,654	3,232	180	193	14,400	1,973	400	
0	0	14,700	5,457	3,009	12	12	14,500	3,344	411	
62	62	14,800	7,545	3,920	7	8	14,600	2,091	68	
14	14	14,900	3,687	1,397	31	41	14,700	1,764	102	
53	54	15,000	8,891	4,689	※	-103	312	14,800	2,573	210
127	128	15,100	6,778	3,075	6	23	14,900	2,274	40	
96	96	15,200	6,854	2,819	132	183	15,000	5,909	808	
222	247	15,300	6,943	2,552	95	140	15,100	2,045	-202	
303	330	15,400	5,915	739	297	412	15,200	2,239	508	
1,154	1,212	15,500	5,705	505	173	427	15,300	1,888	215	
964	1,025	15,550	2,459	781	622	908	15,400	2,955	1,059	※
3,239	3,426	15,600	5,477	-212	233	855	15,500	2,440	-273	
1,999	2,098	15,650	2,256	-134	※	1,655	2,278	15,600	1,752	-218
2,660	3,213	15,700	3,726	-272	920	1,593	15,700	793	-918	
2,364	2,854	15,750	1,146	-347	1,200	2,165	15,800	841	-11	
※	6,323	7,455	15,800	1,999	-1,081	704	2,713	15,900	369	-54
4,555	5,551	15,850	1,021	-343	1,264	4,560	16,000	2,806	-101	
4,603	6,603	15,900	1,794	-535	274	2,928	16,100	856	-13	
3,452	5,252	15,950	1,222	-304	214	6,283	16,200	505	-25	
4,342	8,825	16,000	1,838	-486	1,035	6,027	16,300	1,299	8	
2,438	5,962	16,050	971	-354	150	4,103	16,400	153	-6	
3,062	7,913	16,100	966	-191	653	5,831	16,500	146	8	
2,524	6,010	16,150	522	-63	-23	4,579	16,600	91	-17	
1,620	7,237	16,200	540	-26	-217	3,842	16,700	190	-2	
-104	4,254	16,250	350	-54	-151	3,096	16,800	19	0	
-552	7,851	16,300	149	-6	11	2,908	16,900	7	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	
40,933	116,365	0.8653	100,687	28,152	11,664	82,847	0.7097	58,799	5,547	
昨日 P/C	0.9616	今日增減變化	-0.0963		昨日 P/C	0.7481	今日增減變化	-0.0384		

更新日期：2022年6月17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17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	102,677,580	141,988,135	-39,310,555	-19,452,273	3,598,930	1,075,767	2,523,163	-247,896	
投信	53,228,283	69,737,655	-16,509,372	3,315,338	377,217	0	377,217	-6,075	
自營商	51,382,512	16,719,454	34,663,058	3,462,572	1,223,808	894,102	329,706	312,675	
	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	360,812	1,721,499	-1,360,687	-72,032	16,678	442,730	-426,052	-105,613	
投信	58,297	0	58,297	-1,036	0	0	0	0	
自營商	545,020	284,857	260,163	-47,938	470,027	66,718	403,309	99,655	

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17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	26,763	14,612	12,151	-919	25,926	11,770	14,156	5,515	
投信	0	100	-100	-100	300	95	205	200	
自營商	48,436	56,873	-8,437	-12,589	57,664	40,192	17,472	10,152	
特定法人(週)	0	0	0	-516	0	1,308	-1,308	420	
特定法人(近月)	19,096	8,780	10,316	-753	5,667	16,051	-10,384	-5,747	
特定法人(全月)	18,508	9,481	9,027	-833	4,699	18,930	-14,231	-6,179	
十大交易人(週)	29,254	38,126	-8,872	-9,834	38,151	38,476	-325	-7,635	
十大交易人(近月)	43,258	39,938	3,320	-1,976	16,414	38,921	-22,507	-5,282	
十大交易人(全月)	77,033	73,911	3,122	-13,311	52,544	79,112	-26,568	-12,511	
全市場未沖銷(近月)			82,847	11,664			58,799	5,547	
全市場未沖銷(全月)			213,696	53,796			170,860	34,810	

更新日期：2022年6月17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	15800	買權OI最大量	16000
	賣權成交最大量	15200	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	19.87%	較前一交易日	-2.26%
	買權隱含波動率	15.62%	較前一交易日	-0.89%
	賣權隱含波動率	24.21%	較前一交易日	-3.72%
電子選擇權	買權成交最大量	725	買權OI最大量	725
	賣權成交最大量	650	賣權OI最大量	650
金融選擇權	買權成交最大量	1620	買權OI最大量	1640
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年6月17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	16000	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	20.63%	較前一交易日	-0.25%
	買權隱含波動率	12.15%	較前一交易日	+1.03%
	賣權隱含波動率	31.90%	較前一交易日	+1.10%
	成交量P/C_Ratio值	0.903	較前一交易日	+0.27
	未平倉P/C_Ratio值	0.710	較前一交易日	-0.04
電子選擇權	買權成交最大量	725	買權OI最大量	725
	賣權成交最大量	650	賣權OI最大量	650
金融選擇權	買權成交最大量	1620	買權OI最大量	1640
	賣權成交最大量	1500	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年6月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

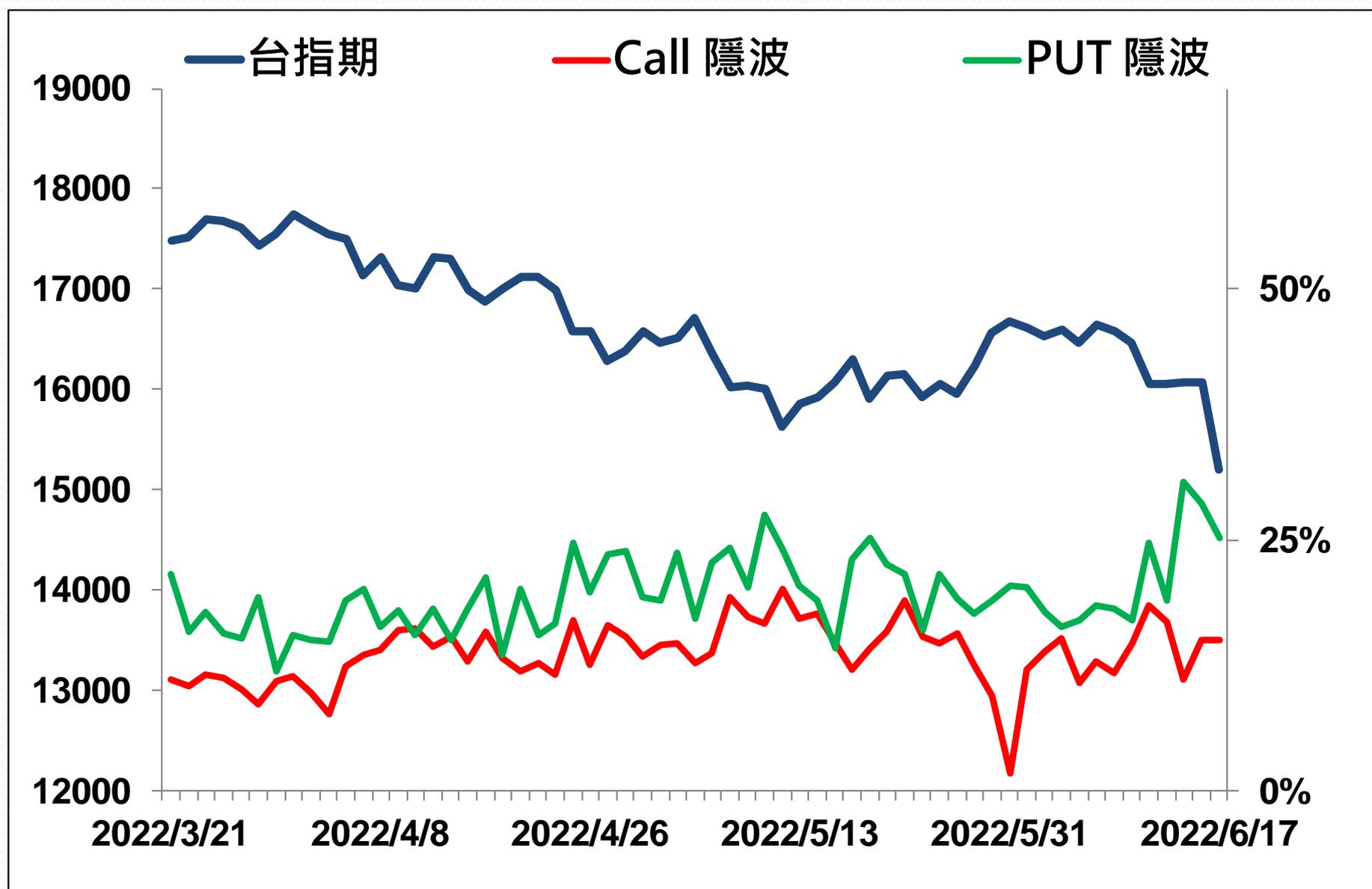
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



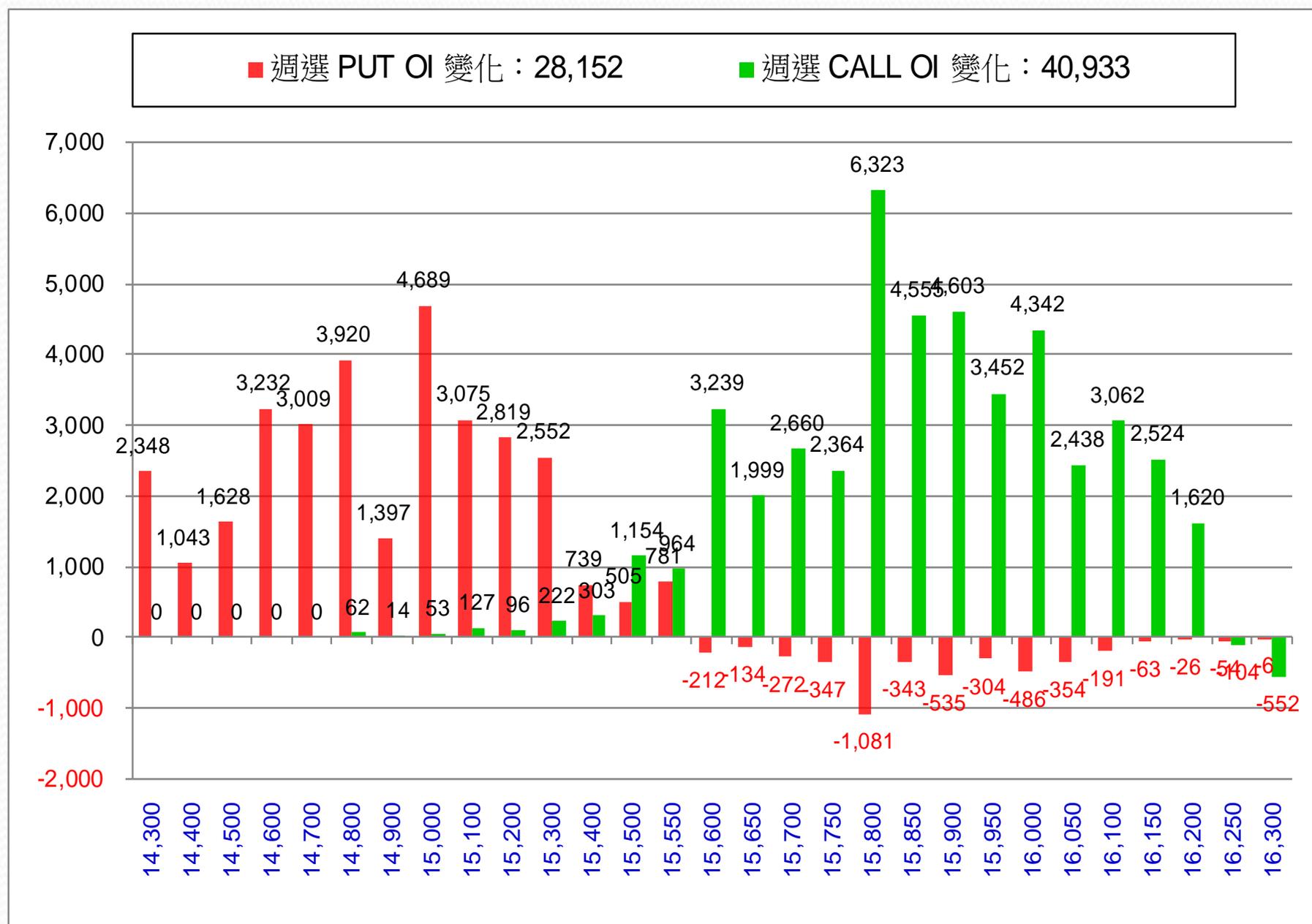
更新日期：2022年6月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



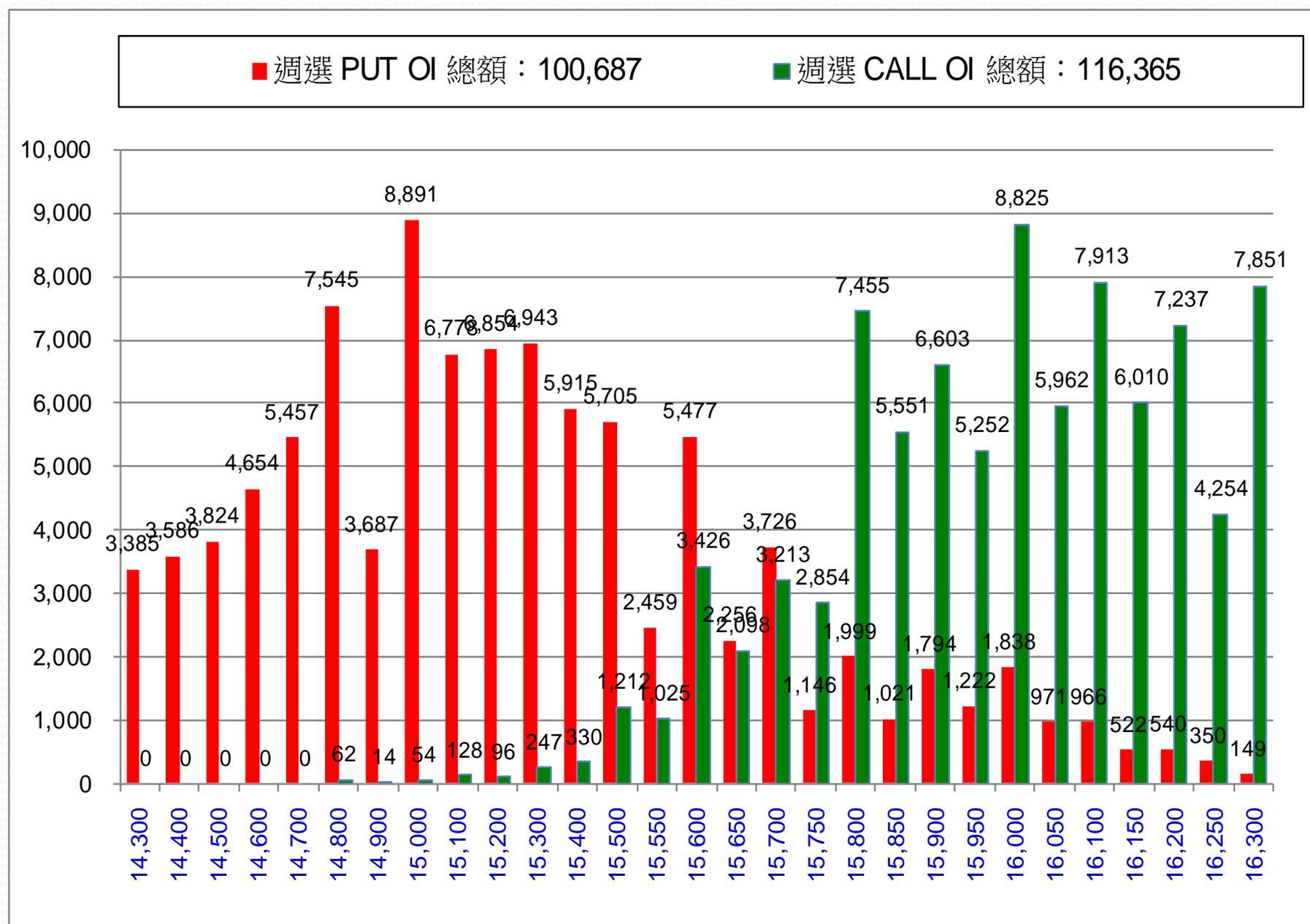
更新日期：2022年6月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年6月17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



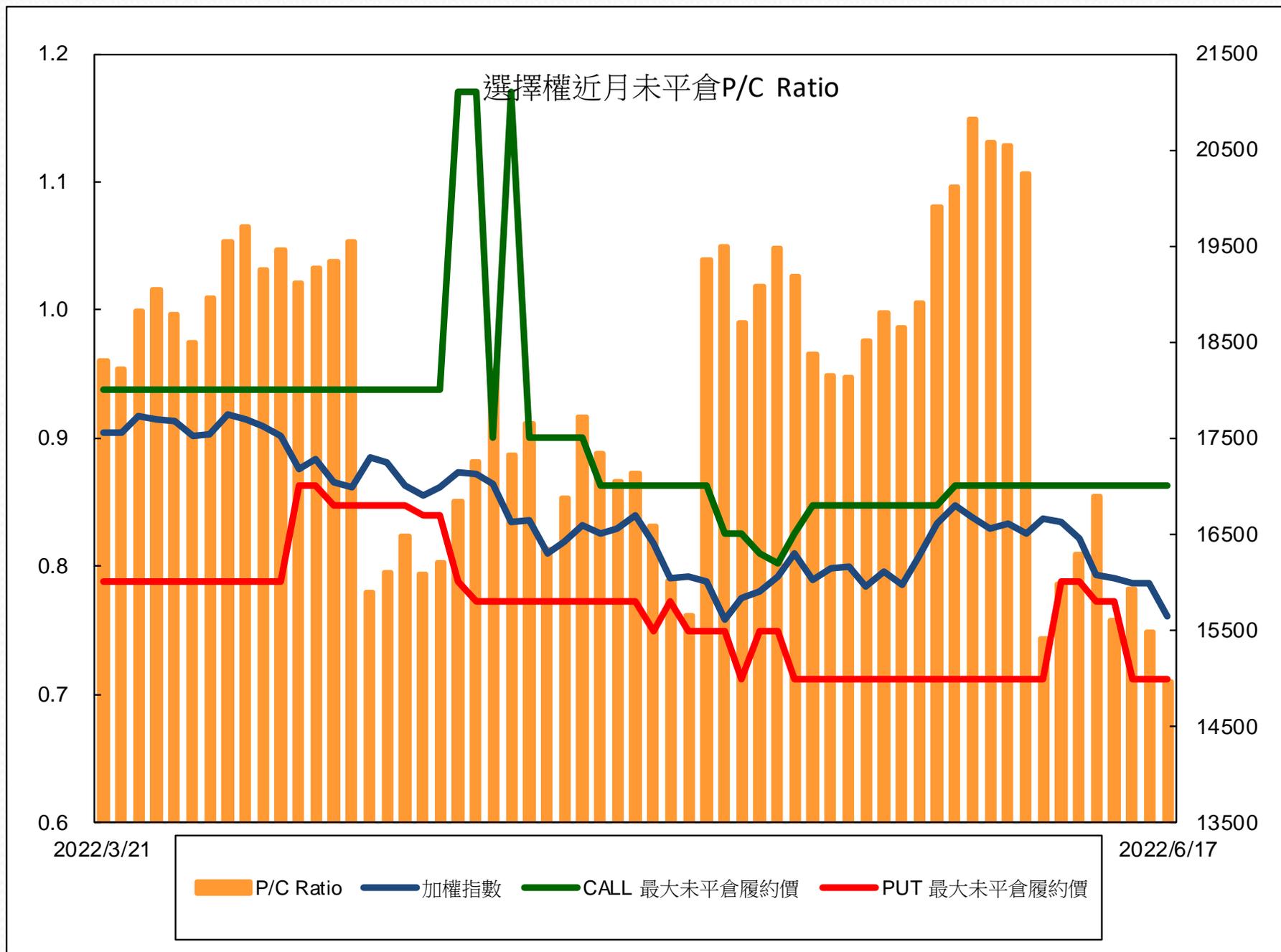
更新日期：2022年6月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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16日	44,169	40,017	4,152
	6月17日	48,436	56,873	-8,437
Put	6月16日	42,027	34,707	7,320
	6月17日	57,664	40,192	17,472

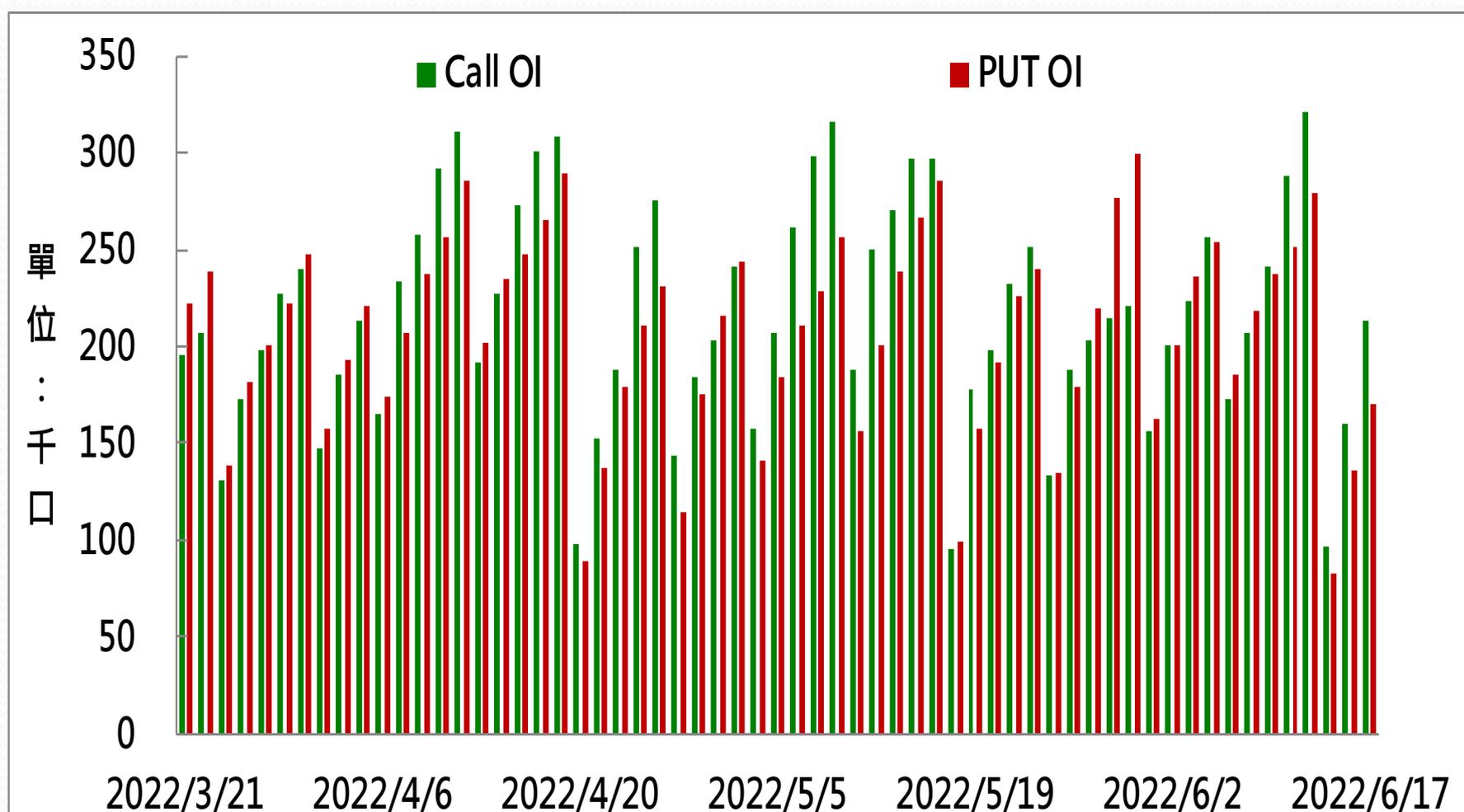
更新日期：2022年6月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年6月17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17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17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