

台指選擇權OI匯報

日期：2022/6/20 結算日：2022/6/22					日期：2022/6/20 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	14,000	212	212	0	0	13,900	1,250	265
0	0	14,100	250	250	0	0	14,000	3,666	677
0	0	14,200	1,149	350	0	0	14,100	1,640	497
0	0	14,300	3,370	-15	0	0	14,200	1,770	163
0	0	14,400	3,301	-285	14	16	14,300	1,910	266
0	0	14,500	4,473	649	3	196	14,400	1,912	-61
0	0	14,600	4,693	39	27	39	14,500	3,796	452
1	1	14,700	6,926	1,469	41	49	14,600	2,314	223
0	62	14,800	5,607	-1,938	9	50	14,700	1,844	80
32	46	14,900	5,843	2,156	141	453	14,800	2,461	-112
32	86	15,000	10,561	1,670	38	61	14,900	2,347	73
132	260	15,100	9,112	2,334	401	584	15,000	5,991	82
83	179	15,200	7,789	935	836	976	15,100	1,925	-120
251	251	15,250	2,235	2,235	256	668	15,200	1,778	-461
695	942	15,300	8,381	1,438	226	653	15,300	1,439	-449
884	884	15,350	1,465	1,465	506	1,414	15,400	2,822	-133
3,494	3,824	15,400	7,803	1,888	841	1,696	15,500	2,215	-225
3,664	3,771	15,450	2,022	1,189	591	2,869	15,600	1,755	3
3,428	4,640	15,500	4,910	-795	742	2,335	15,700	778	-15
3,169	4,194	15,550	2,219	-240	444	2,609	15,800	816	-25
5,776	9,202	15,600	5,027	-450	403	3,116	15,900	316	-53
2,548	4,646	15,650	2,428	172	※ 1,307	5,867	16,000	2,778	-28
※ 6,311	9,524	15,700	3,171	-555	1,071	3,999	16,100	845	-11
3,592	6,446	15,750	1,124	-22	-185	6,098	16,200	506	1
4,456	11,911	15,800	1,889	-110	141	6,168	16,300	1,299	0
1,025	6,576	15,850	915	-106	-296	3,807	16,400	150	-3
1,966	8,569	15,900	1,593	-201	-171	5,660	16,500	146	0
2,535	7,787	15,950	1,135	-87	-85	4,494	16,600	88	-3
-547	8,278	16,000	1,665	-173	72	3,914	16,700	190	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
35,692	152,164	0.7552	114,916	13,396	8,993	91,840	0.6898	63,354	4,555
昨日 P/C	0.8653	今日增減變化		-0.1101	昨日 P/C	0.7097	今日增減變化		-0.0199

更新日期：2022年6月20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20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	108,447,739	152,485,114	-44,037,375	-4,726,820	3,498,498	1,443,339	2,055,159	-468,004	
投信	57,427,439	70,823,066	-13,395,627	3,113,745	375,435	0	375,435	-1,782	
自營商	52,810,006	17,992,740	34,817,266	154,208	1,251,392	839,839	411,553	81,847	
	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	422,742	1,624,540	-1,201,798	158,889	14,777	437,399	-422,622	3,430	
投信	57,505	0	57,505	-792	0	0	0	0	
自營商	540,707	357,387	183,320	-76,843	466,942	81,241	385,701	-17,608	

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20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	26,115	17,016	9,099	-3,052	27,998	12,895	15,103	947	
投信	0	200	-200	-100	600	95	505	300	
自營商	60,195	74,178	-13,983	-5,546	60,380	38,332	22,048	4,576	
特定法人(週)	0	0	0	0	0	1,374	-1,374	-66	
特定法人(近月)	18,728	8,810	9,918	-398	7,123	17,865	-10,742	-358	
特定法人(全月)	18,020	10,323	7,697	-1,330	4,634	20,219	-15,585	-1,354	
十大交易人(週)	43,520	47,891	-4,371	4,501	36,416	37,778	-1,362	-1,037	
十大交易人(近月)	46,056	44,725	1,331	-1,989	17,559	42,042	-24,483	-1,976	
十大交易人(全月)	90,859	90,794	65	-3,057	50,632	82,067	-31,435	-4,867	
全市場未沖銷(近月)			91,840	8,993			63,354	4,555	
全市場未沖銷(全月)			258,560	44,864			189,468	18,608	

更新日期：2022年6月20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	15700	買權OI最大量	15800
	賣權成交最大量	15200	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	19.86%	較前一交易日	-0.01%
	買權隱含波動率	21.24%	較前一交易日	+5.62%
	賣權隱含波動率	17.99%	較前一交易日	-6.21%
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	1560	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年6月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

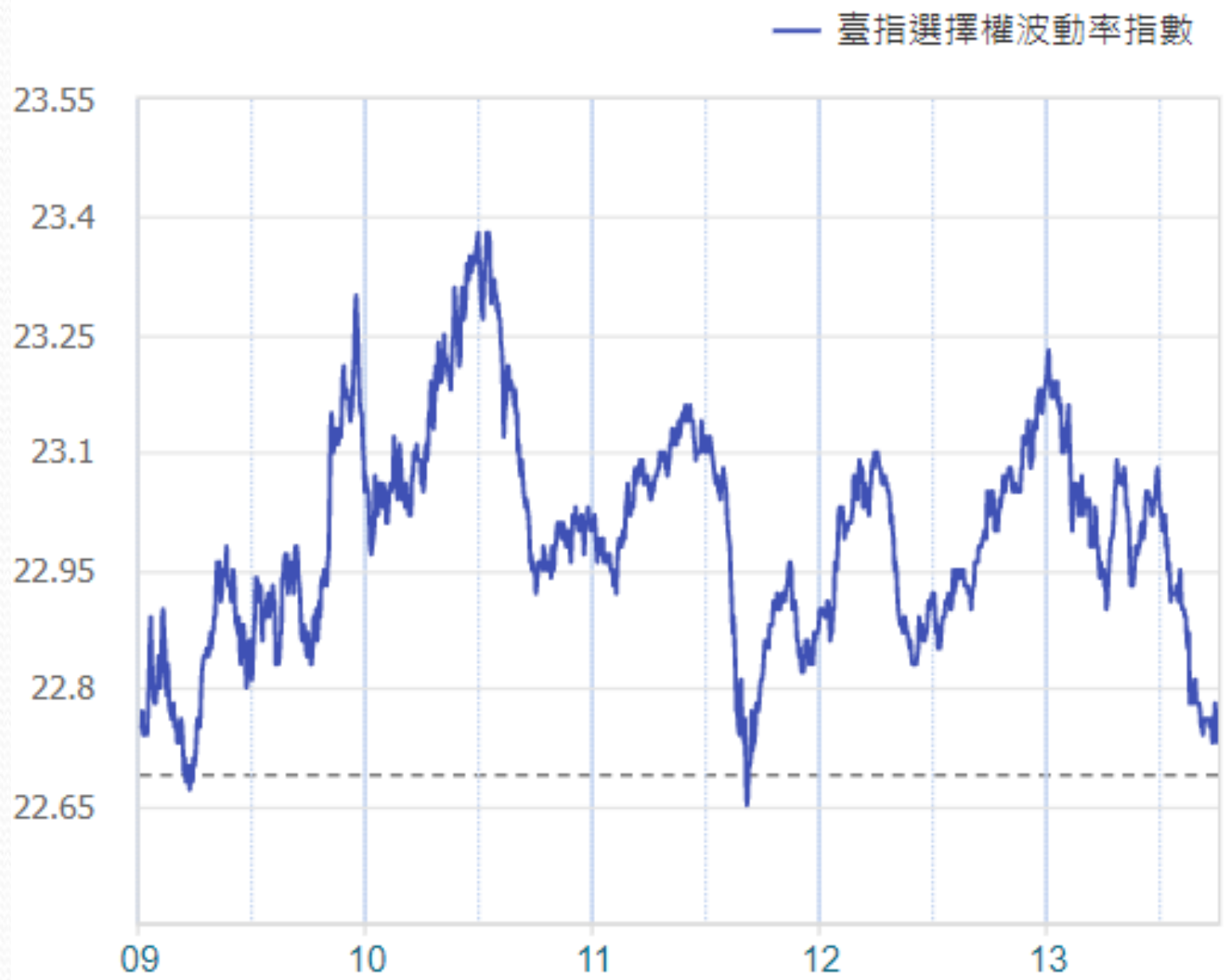
台指選擇權匯報

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	21.33%	較前一交易日	-0.69%
	買權隱含波動率	13.94%	較前一交易日	+1.79%
	賣權隱含波動率	30.75%	較前一交易日	-1.15%
	成交量P/C_Ratio值	0.811	較前一交易日	-0.09
	未平倉P/C_Ratio值	0.690	較前一交易日	-0.02
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	1560	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年6月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

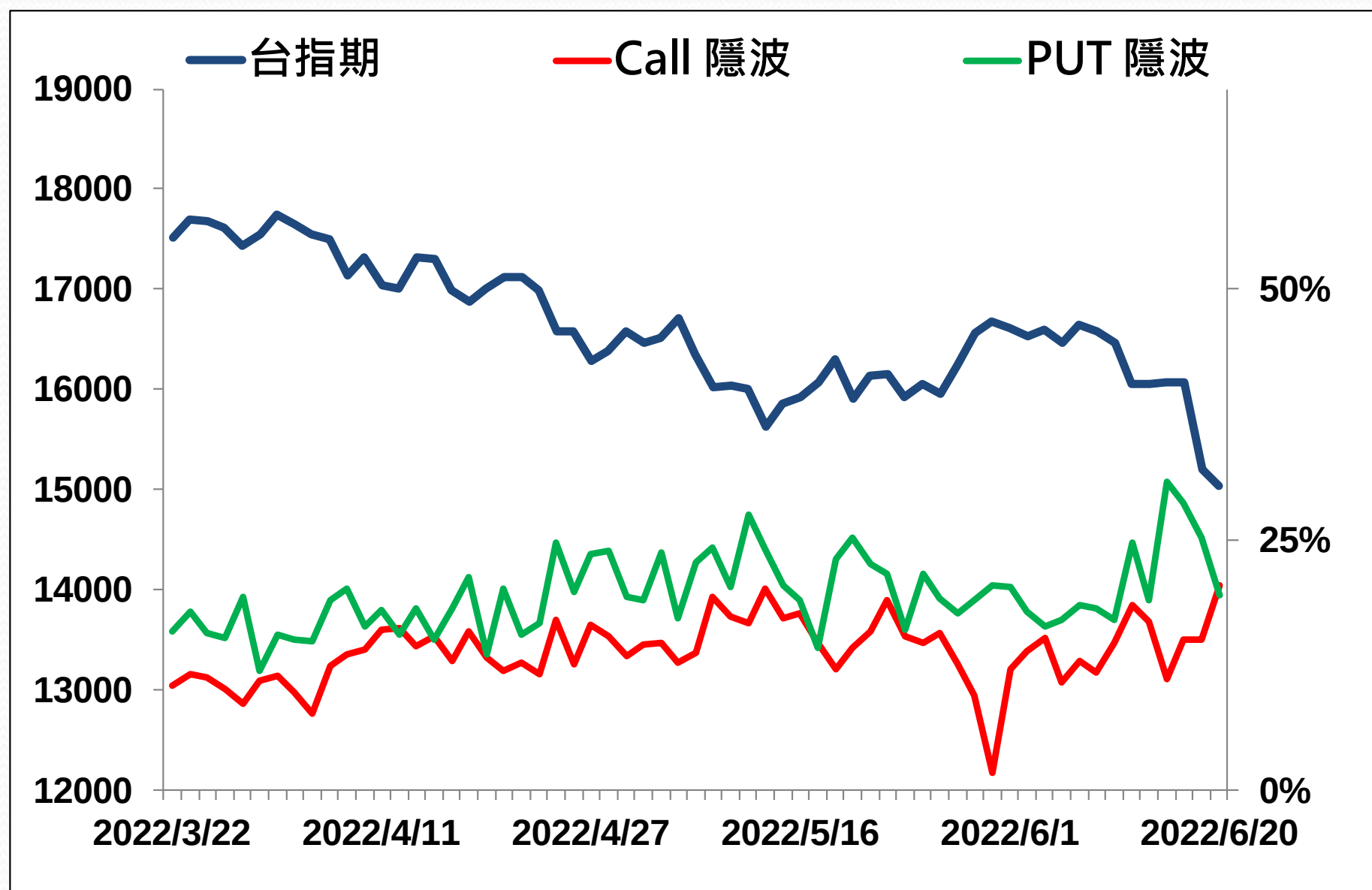
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



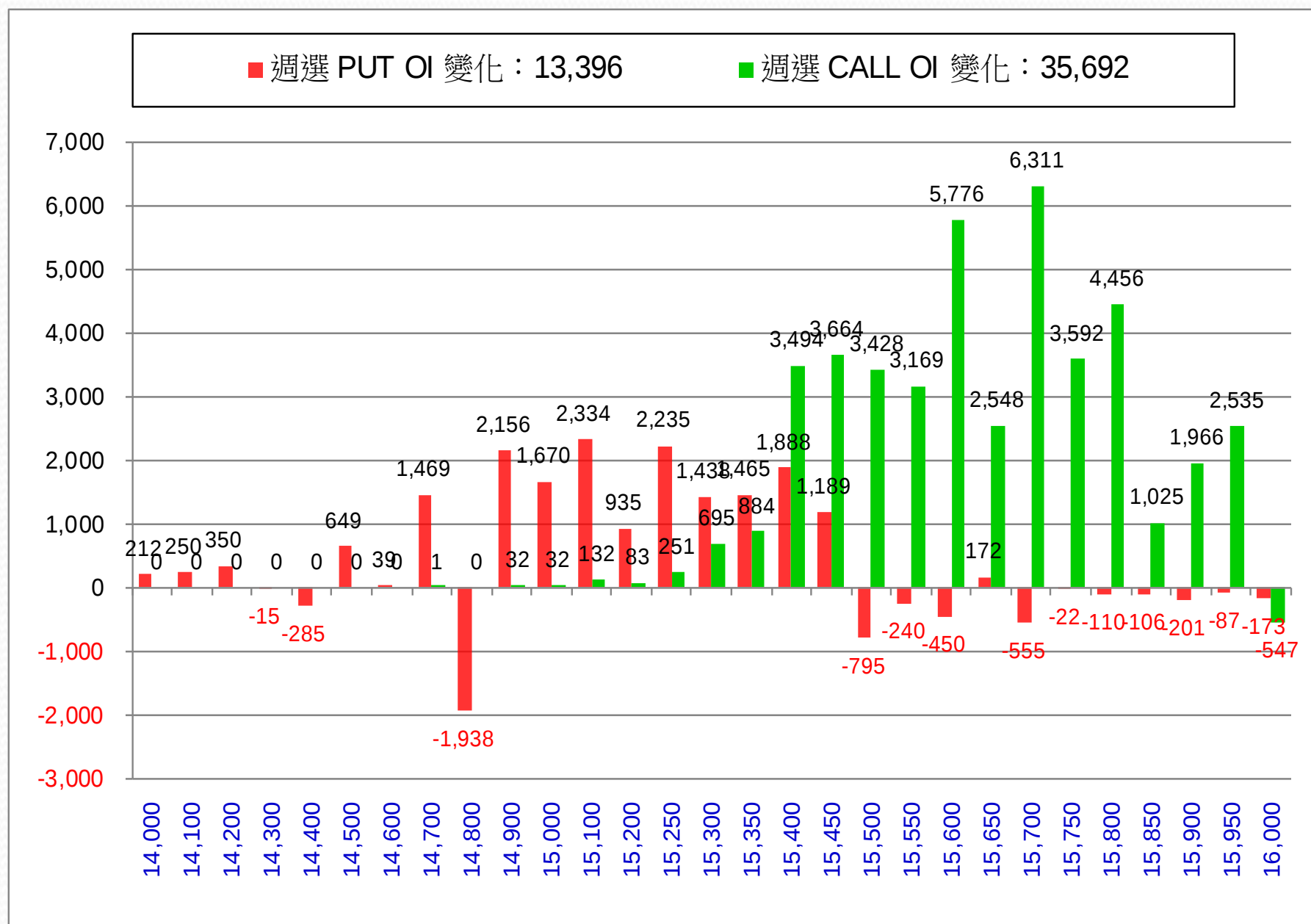
更新日期：2022年6月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



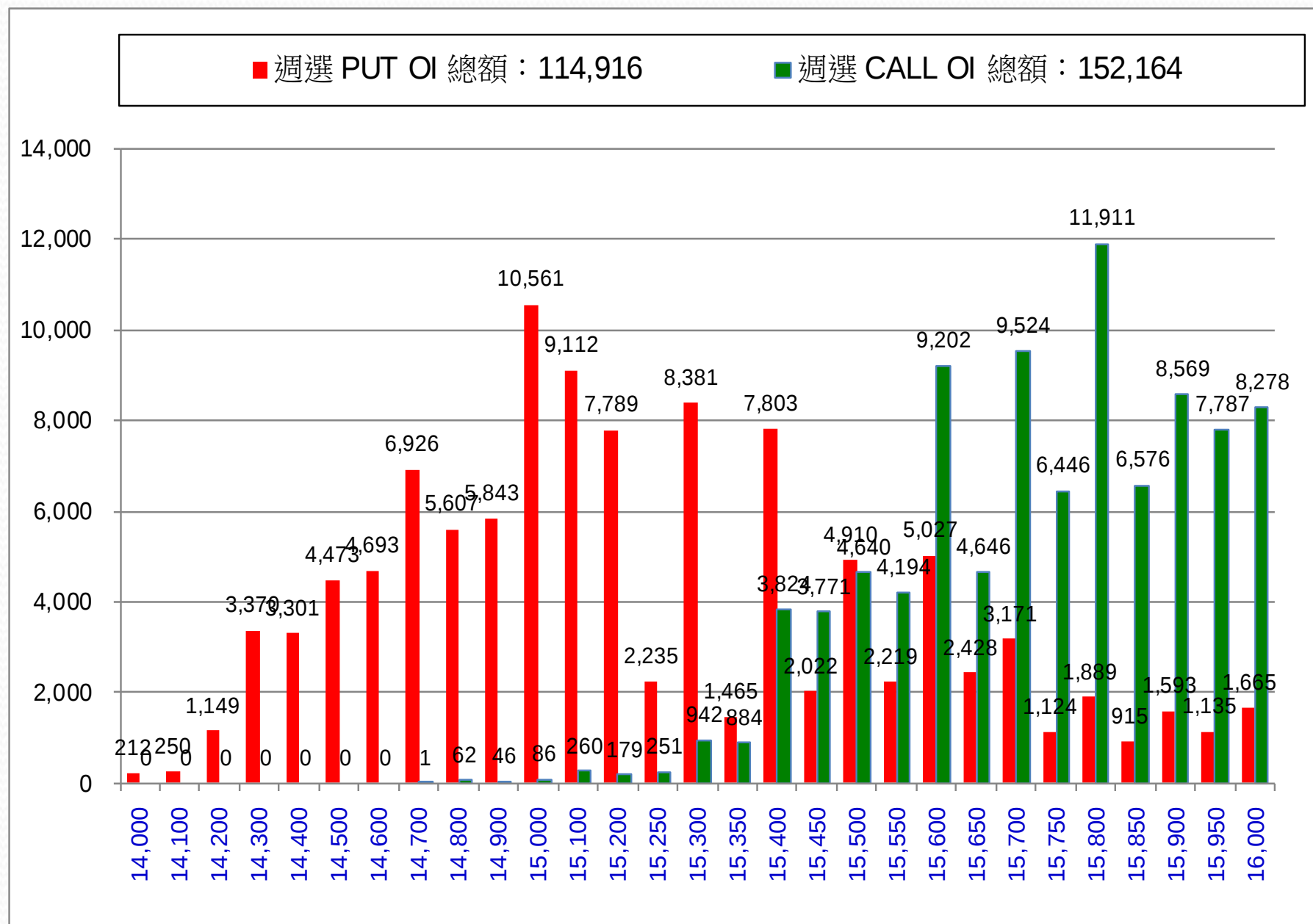
更新日期：2022年6月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年6月20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



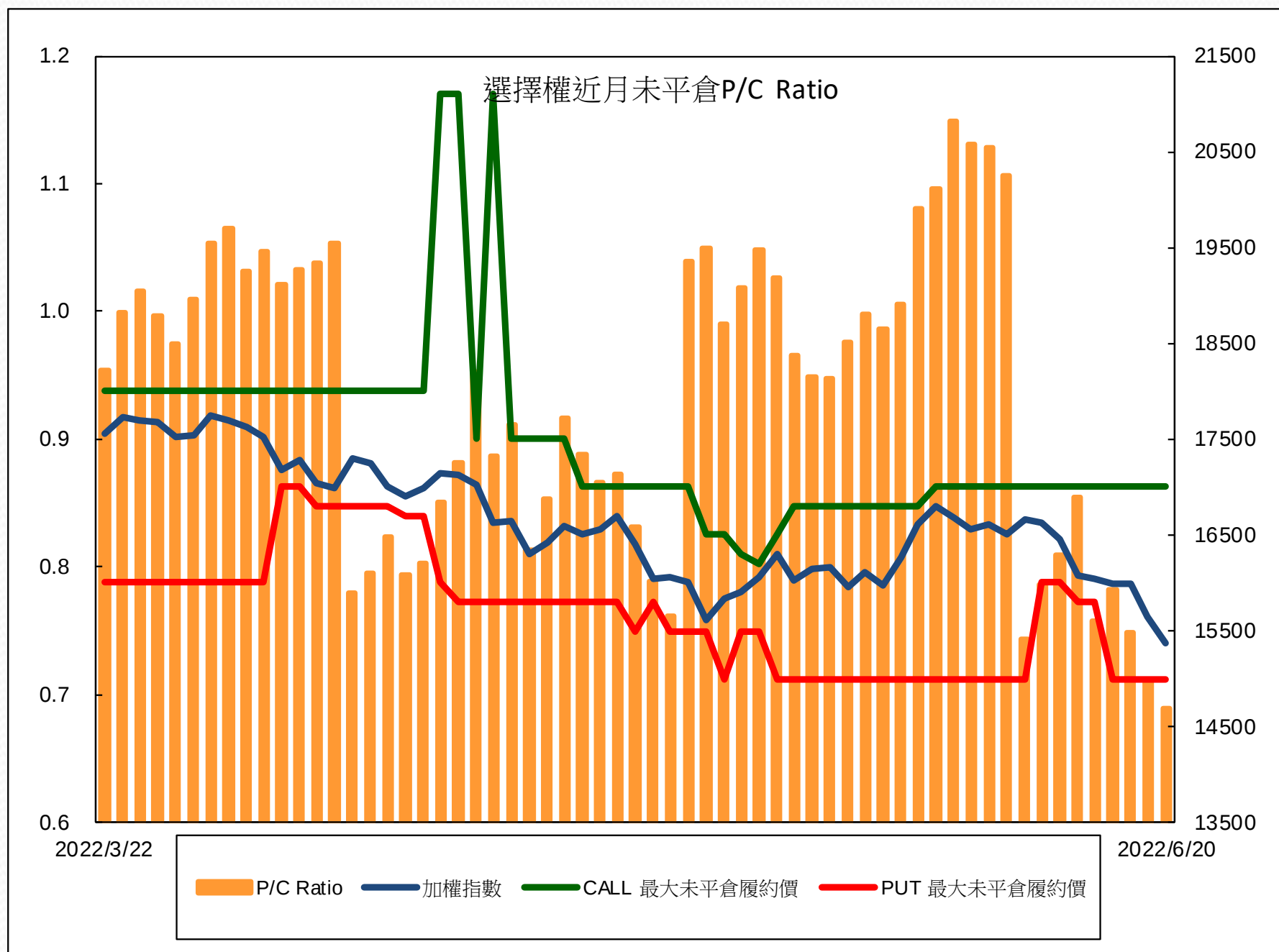
更新日期：2022年6月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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17日	48,436	56,873	-8,437
	6月20日	60,195	74,178	-13,983
Put	6月17日	57,664	40,192	17,472
	6月20日	60,380	38,332	22,048

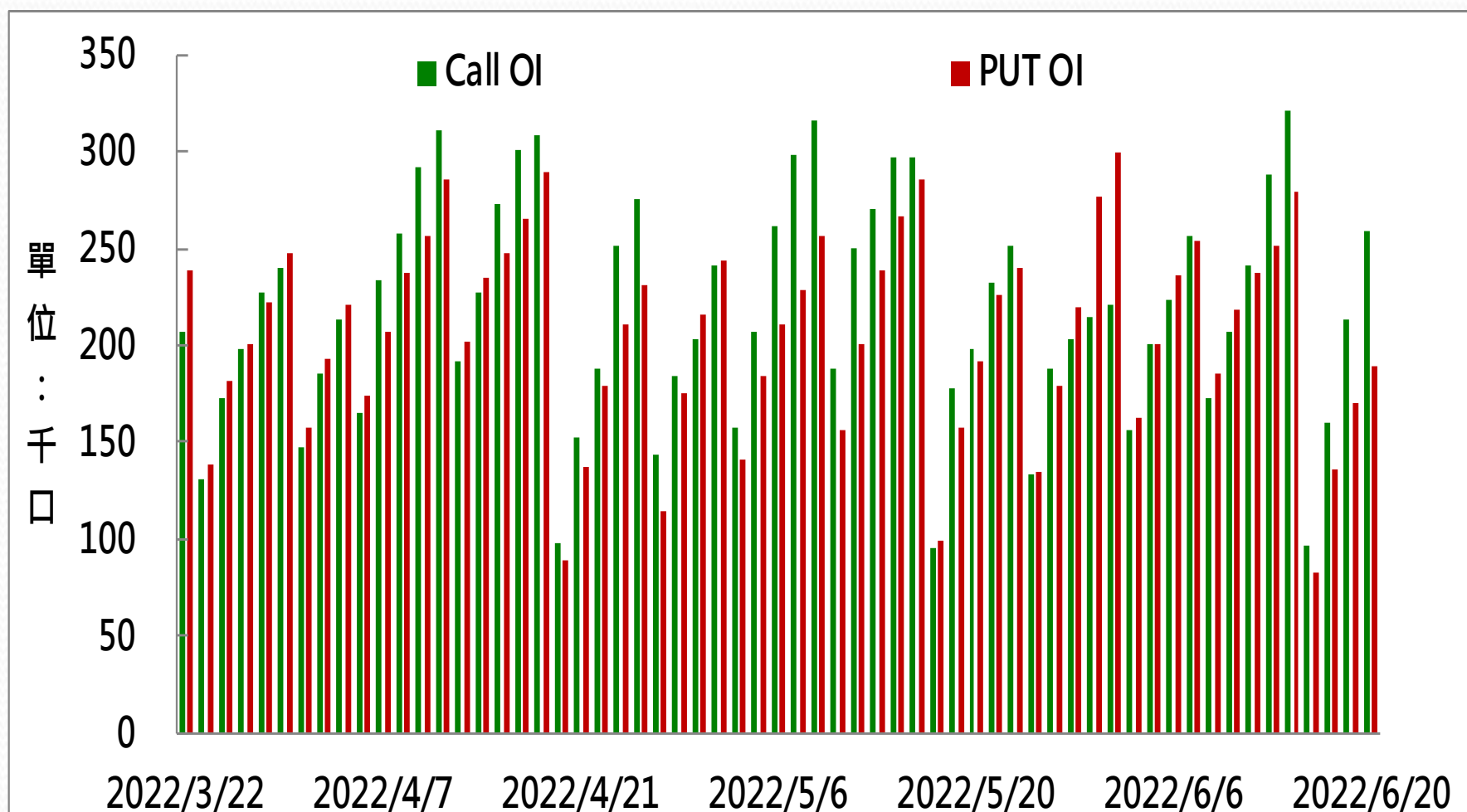
更新日期：2022年6月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年6月20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20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20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