

台指選擇權OI匯報

日期：2022/6/24 結算日：2022/6/29					日期：2022/6/24 結算日：2022/7/20				
202206W5					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	1	14,400	7,011	1,683	0	323	13,800	1,383	30
-1	35	14,500	6,061	442	0	0	13,900	1,939	-21
-2	29	14,600	5,959	945	0	5	14,000	4,632	264
1	37	14,700	5,727	824	0	4	14,100	2,051	101
20	20	14,750	715	715	-1	12	14,200	3,925	221
103	191	14,800	7,789	1,930	0	17	14,300	2,538	154
20	20	14,850	911	911	-7	184	14,400	2,741	-2
8	190	14,900	4,802	1,087	-16	52	14,500	5,492	21
-21	97	14,950	1,880	1,143	-1	130	14,600	3,047	420
-174	555	15,000	6,805	2,245	-24	133	14,700	2,146	83
-9	349	15,050	2,142	1,281	27	740	14,800	3,430	573
109	1,110	15,100	3,670	912	52	483	14,900	2,446	77
212	818	15,150	2,116	1,295	-99	1,113	15,000	6,420	401
-38	3,308	15,200	3,950	1,850	-4	1,395	15,100	1,960	79
159	2,535	15,250	1,816	1,455	-285	2,297	15,200	2,258	65
1,169	4,722	15,300	3,163	1,889	278	2,943	15,300	1,794	134
537	3,470	15,350	1,982	657	757	4,085	15,400	3,064	58
1,476	6,437	15,400	952	-392	680	6,731	15,500	2,303	18
323	4,242	15,450	309	29	24	5,711	15,600	1,699	29
1,239	8,443	15,500	448	19	-188	4,677	15,700	682	-33
1,159	5,889	15,550	124	1	442	4,070	15,800	749	-9
1,833	8,972	15,600	178	43	660	3,818	15,900	302	-7
1,869	5,357	15,650	201	21	※ 811	8,621	16,000	2,709	-12
2,477	11,112	15,700	71	19	35	4,110	16,100	788	-2
1,418	6,530	15,750	34	17	-406	5,673	16,200	461	-6
176	9,451	15,800	39	-2	8	7,002	16,300	1,296	-3
1,422	5,162	15,850	13	1	-44	3,950	16,400	148	0
1,230	7,555	15,900	7	0	-80	5,561	16,500	144	0
198	2,657	15,950	1	0	-244	4,225	16,600	84	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
16,667	112,127	0.8238	92,375	25,150	2,111	115,706	0.6967	80,611	3,660
昨日 P/C	0.7042	今日增減變化	0.1196		昨日 P/C	0.6774	今日增減變化	0.0193	

更新日期：2022年6月24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24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	96,402,119	151,899,536	-55,497,417	-1,637,130	3,467,498	2,021,103	1,446,395	-204,619	
投信	69,171,546	71,113,383	-1,941,837	2,435,290	599,456	16,499	582,957	-237	
自營商	36,797,586	19,098,584	17,699,002	-9,089,061	1,402,267	1,072,399	329,868	72,605	
	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	1,051,668	2,305,700	-1,254,032	-3,951	15,010	438,292	-423,282	4,641	
投信	62,618	0	62,618	522	0	0	0	0	
自營商	648,492	523,426	125,066	-45,140	567,367	138,060	429,307	4,325	

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24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	29,666	18,209	11,457	-1,772	38,110	15,542	22,568	1,804	
投信	0	150	-150	50	600	95	505	0	
自營商	61,791	79,687	-17,896	3,133	60,742	39,476	21,266	-3,784	
特定法人(週)	0	0	0	-1,628	0	5,128	-5,128	-886	
特定法人(近月)	19,987	7,844	12,143	-195	10,296	23,392	-13,096	412	
特定法人(全月)	20,404	9,441	10,963	-2,912	9,102	30,806	-21,704	-3,661	
十大交易人(週)	40,776	42,575	-1,799	7,738	31,163	36,871	-5,708	2,004	
十大交易人(近月)	56,282	55,015	1,267	845	24,358	53,311	-28,953	-540	
十大交易人(全月)	97,608	94,339	3,269	7,460	51,253	93,618	-42,365	1,061	
全市場未沖銷(近月)			115,706	2,111			80,611	3,660	
全市場未沖銷(全月)			249,552	23,113			185,904	28,970	

更新日期：2022年6月24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06W5週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	15500	買權OI最大量	15700
	賣權成交最大量	14800	賣權OI最大量	14800
	整體隱含波動率	18.89%	較前一交易日	-2.20%
	買權隱含波動率	17.15%	較前一交易日	-2.89%
	賣權隱含波動率	20.84%	較前一交易日	-1.38%
電子選擇權	買權成交最大量	705	買權OI最大量	725
	賣權成交最大量	665	賣權OI最大量	650
金融選擇權	買權成交最大量	1660	買權OI最大量	1640
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年6月24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	16000
	賣權成交最大量	14000	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	20.13%	較前一交易日	+1.27%
	買權隱含波動率	14.26%	較前一交易日	-1.33%
	賣權隱含波動率	28.50%	較前一交易日	-0.84%
	成交量P/C_Ratio值	0.708	較前一交易日	-0.06
	未平倉P/C_Ratio值	0.697	較前一交易日	+0.02
電子選擇權	買權成交最大量	705	買權OI最大量	725
	賣權成交最大量	665	賣權OI最大量	650
金融選擇權	買權成交最大量	1660	買權OI最大量	1640
	賣權成交最大量	1540	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年6月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

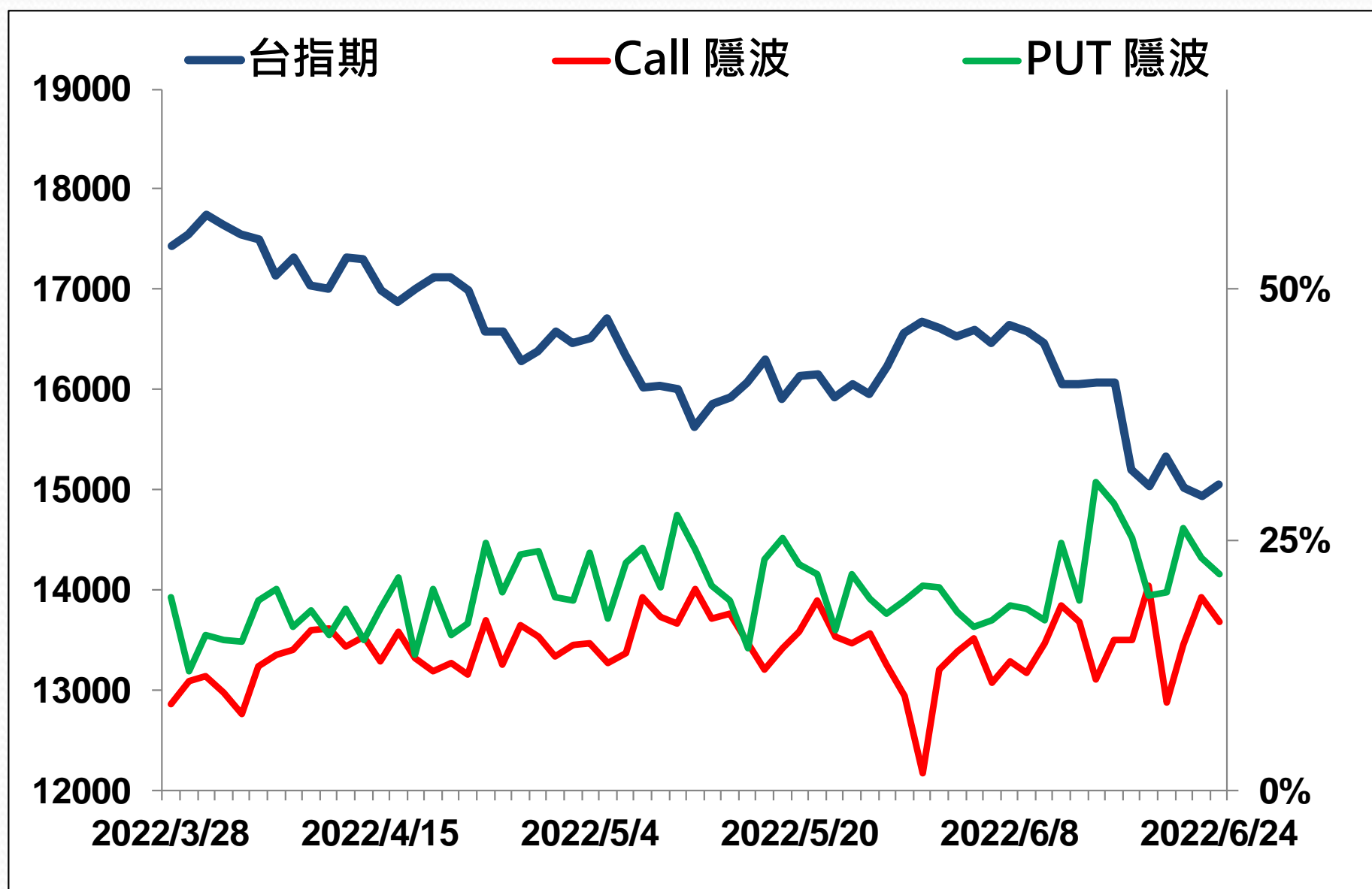
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



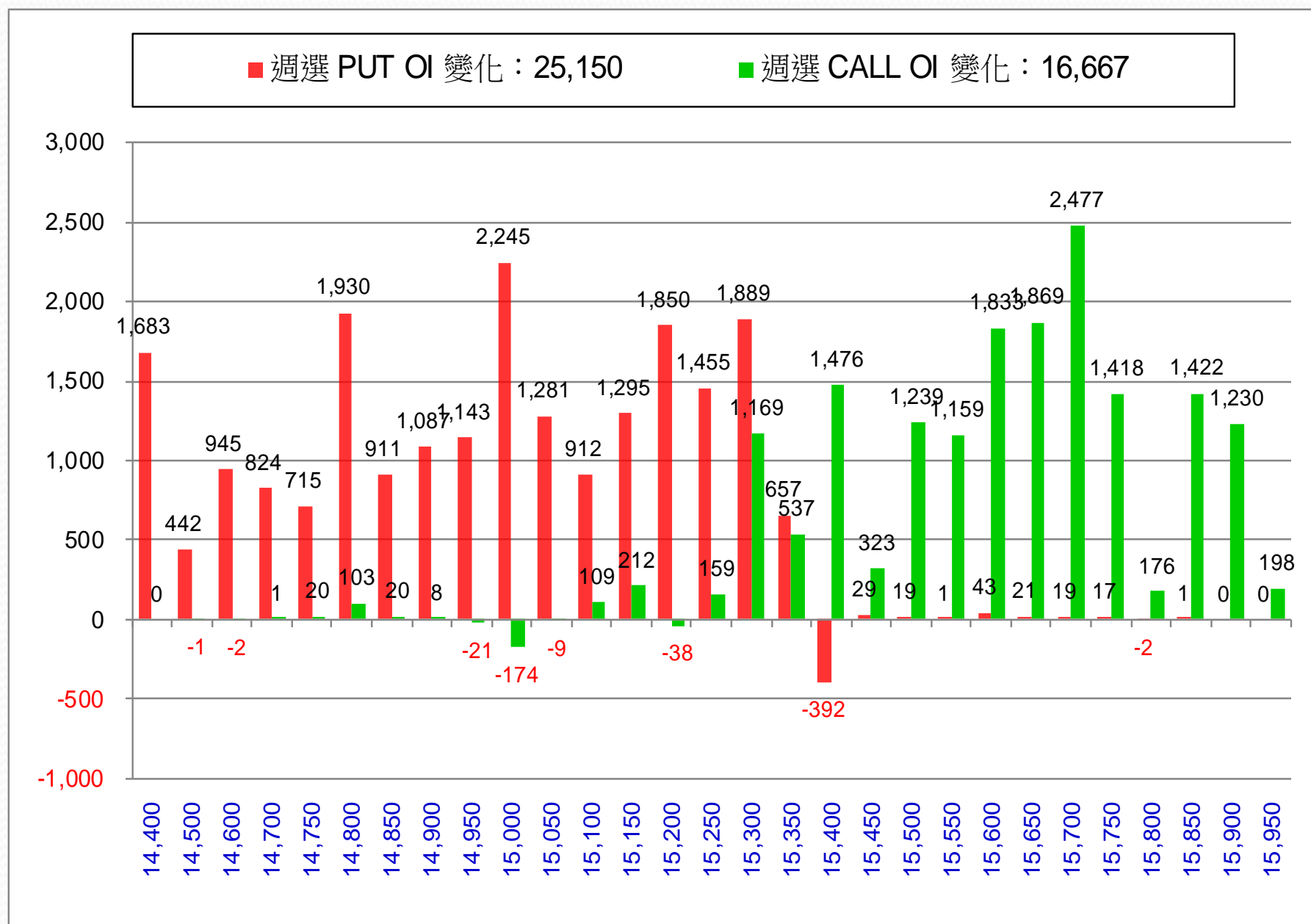
更新日期：2022年6月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



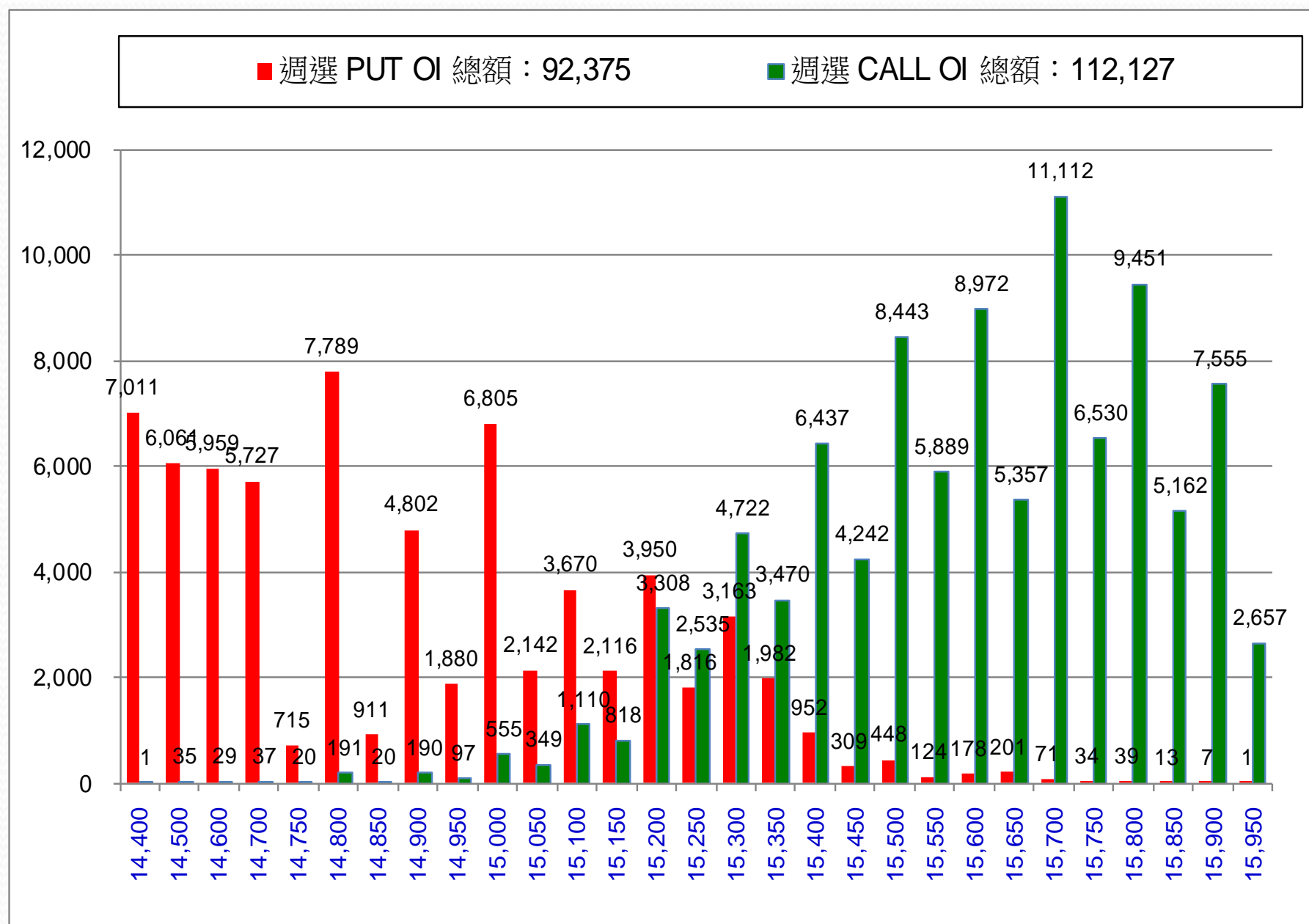
更新日期：2022年6月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年6月24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



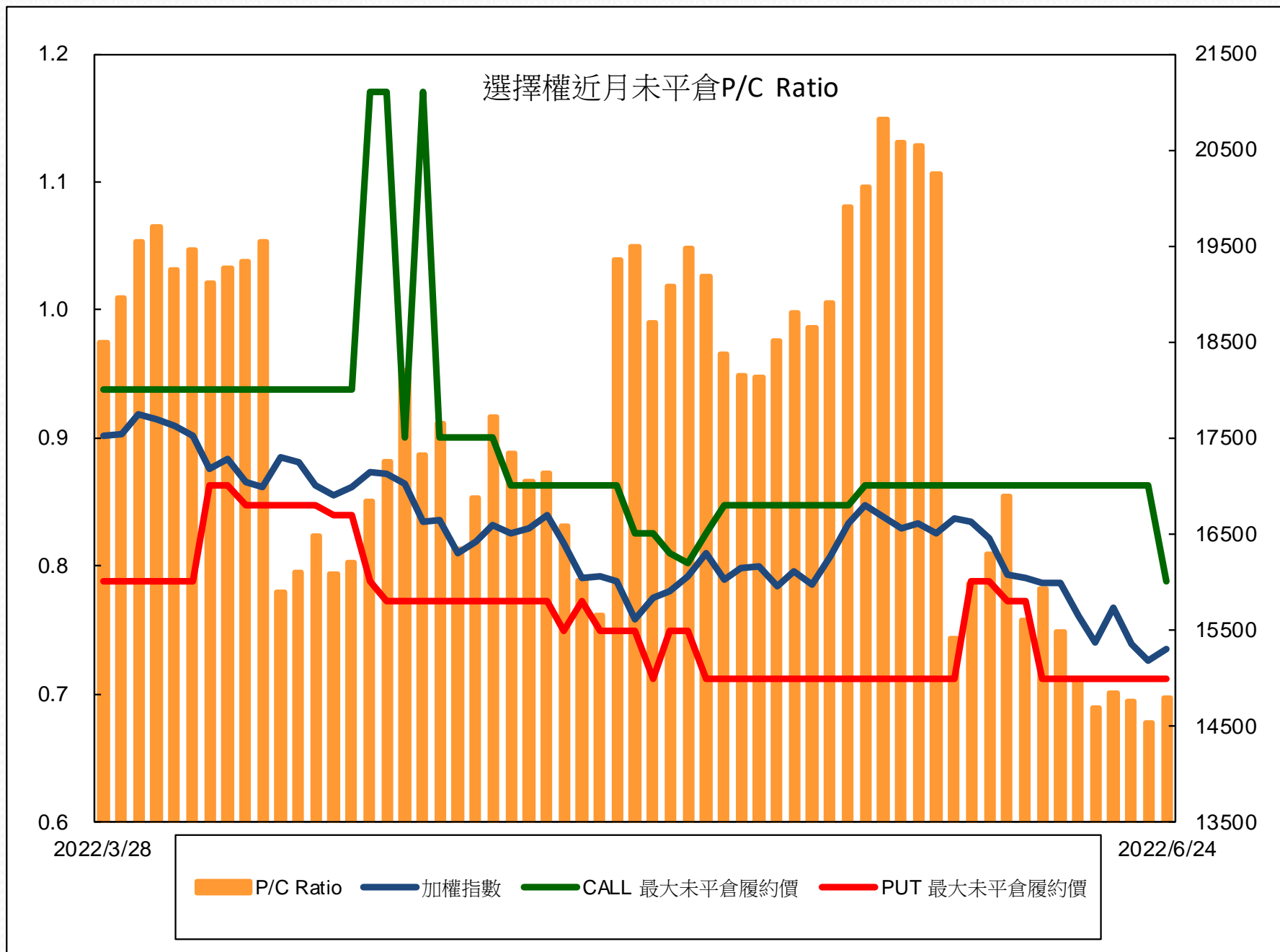
更新日期：2022年6月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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23日	51,670	72,699	-21,029
	6月24日	61,791	79,687	-17,896
Put	6月23日	56,393	31,343	25,050
	6月24日	60,742	39,476	21,266

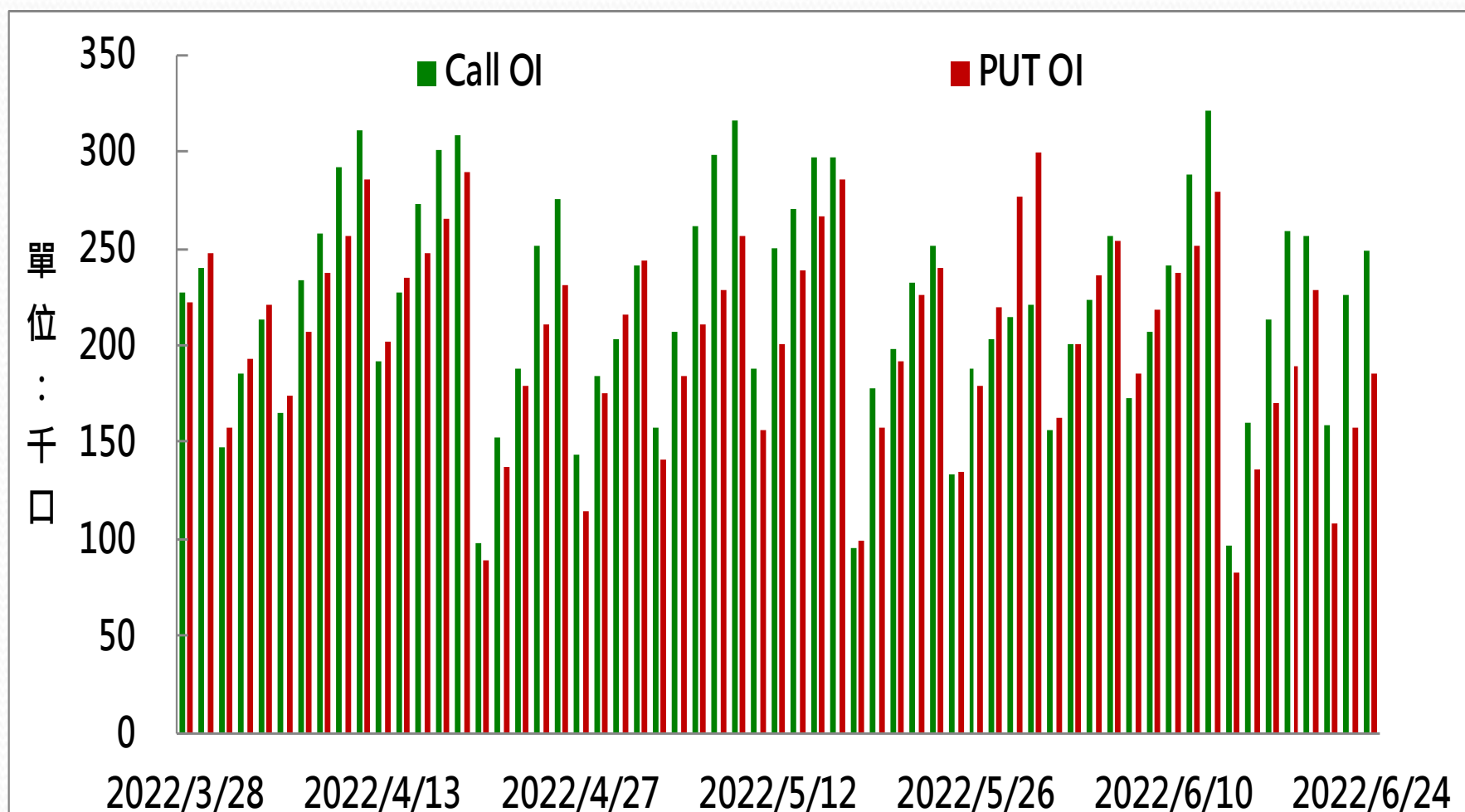
更新日期：2022年6月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年6月24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24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24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