

台指選擇權OI匯報

日期 : 2022/2/7			結算日 : 2022/2/9			日期 : 2022/2/7			結算日 : 2022/2/16		
202202W2						202202 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	17,350	1,009	1,009		1	2	16,800	4,288	889	
2	2	17,400	2,337	2,337		0	8	16,900	2,486	634	
5	5	17,450	722	722		1	23	17,000	13,940	872	
56	56	17,500	1,980	1,980		5	19	17,100	3,167	413	
6	6	17,550	1,667	1,667		10	141	17,200	3,423	736	
43	43	17,600	2,020	2,020		-24	376	17,300	4,269	1,703	※
72	72	17,650	1,540	1,540		20	315	17,400	4,915	1,671	
226	226	17,700	2,424	2,424	※	-44	1,791	17,500	3,341	-84	
236	236	17,750	1,890	1,890		68	1,085	17,600	3,602	342	
746	746	17,800	1,959	1,959		-55	1,195	17,700	3,180	144	
638	638	17,850	935	935		31	2,005	17,800	2,500	169	
1,409	1,409	17,900	878	878		348	1,745	17,900	1,475	208	
2,886	2,886	18,000	271	271		2,063	5,424	18,000	2,204	472	
※	3,122	3,122	18,100	38	38	1,510	4,019	18,100	1,194	-7	
2,085	2,085	18,200	39	39		2,696	8,724	18,200	2,689	-70	
897	897	18,300	1	1		260	5,257	18,300	774	10	
920	920	18,400	4	4		1,440	7,258	18,400	1,220	-4	
19	19	18,500	3	3		1,146	7,630	18,500	364	-22	
24	24	18,600	0	0		-771	7,265	18,600	107	-1	
53	53	18,700	0	0		217	8,230	18,700	63	-2	
2	2	18,800	0	0		-102	7,138	18,800	198	0	
0	0	18,900	0	0		-154	3,578	18,900	12	0	
4	4	19,000	0	0		-161	6,691	19,000	9	-1	
0	0	19,100	0	0		-165	3,333	19,100	9	-2	
0	0	19,200	0	0		-27	2,628	19,200	18	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
13,451	13,451	2.2102	29,729	29,729		8,079	99,817	0.9349	93,316	10,433	
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化	2.2102			昨日 P/C	0.9035	今日增減變化	0.0314		

更新日期 : 2022年2月7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2月7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	66,099,072	174,298,753	-108,199,681	3,710,077	3,009,279	3,620,127	-610,848	180,280
投信	60,763,338	54,883,453	5,879,885	768,925	2,189,233	0	2,189,233	13,781
自營商	76,897,531	13,469,362	63,428,169	5,063,544	1,708,448	1,416,956	291,492	-240,294
	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	849,787	4,256,099	-3,406,312	-223,047	21,372	0	21,372	11,795
投信	23,306	0	23,306	668	1,644	0	1,644	48
自營商	765,428	132,650	632,778	213,165	197,234	281,037	-83,803	-19,979

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報

2022年2月7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	22,731	20,555	2,176	5,416	40,339	24,281	16,058	-6,171
投信	0	0	0	0	0	58	-58	0
自營商	41,977	41,435	542	1,383	41,353	28,808	12,545	11,600
特定法人(週)	0	0	0	---	0	1,260	-1,260	---
特定法人(近月)	10,244	12,273	-2,029	1,316	11,469	35,682	-24,213	-5,443
特定法人(全月)	16,336	13,524	2,812	3,640	11,484	40,714	-29,230	2,306
十大交易人(週)	7,908	6,043	1,865	---	9,807	12,938	-3,131	---
十大交易人(近月)	39,493	40,675	-1,182	3,169	32,181	57,479	-25,298	-4,179
十大交易人(全月)	59,737	53,298	6,439	4,011	45,430	75,988	-30,558	-4,579
全市場未沖銷(近月)			99,817	8,079			93,316	10,433
全市場未沖銷(全月)			144,211	13,429			144,903	6,723

更新日期：2022年2月7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 02W2 週 選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	18000	買權OI最大量	18100
	賣權成交最大量	17700	賣權OI最大量	17700
	整體隱含波動率	15.55%	較前一交易日	-2.83%
	買權隱含波動率	13.37%	較前一交易日	+0.45%
	賣權隱含波動率	17.36%	較前一交易日	-4.43%
電子選擇權	買權成交最大量	870	買權OI最大量	920
	賣權成交最大量	830	賣權OI最大量	800
金融選擇權	買權成交最大量	1800	買權OI最大量	1880
	賣權成交最大量	1740	賣權OI最大量	1700

更新日期：2022年2月7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02月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	18000	買權OI最大量	18200
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	18.01%	較前一交易日	+3.66%
	買權隱含波動率	14.42%	較前一交易日	-0.91%
	賣權隱含波動率	21.72%	較前一交易日	-5.93%
	成交量P/C_Ratio值	0.929	較前一交易日	-0.06
	未平倉P/C_Ratio值	0.935	較前一交易日	+0.03
電子選擇權	買權成交最大量	870	買權OI最大量	920
	賣權成交最大量	830	賣權OI最大量	800
金融選擇權	買權成交最大量	1800	買權OI最大量	1880
	賣權成交最大量	1740	賣權OI最大量	1700

更新日期：2022年2月7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

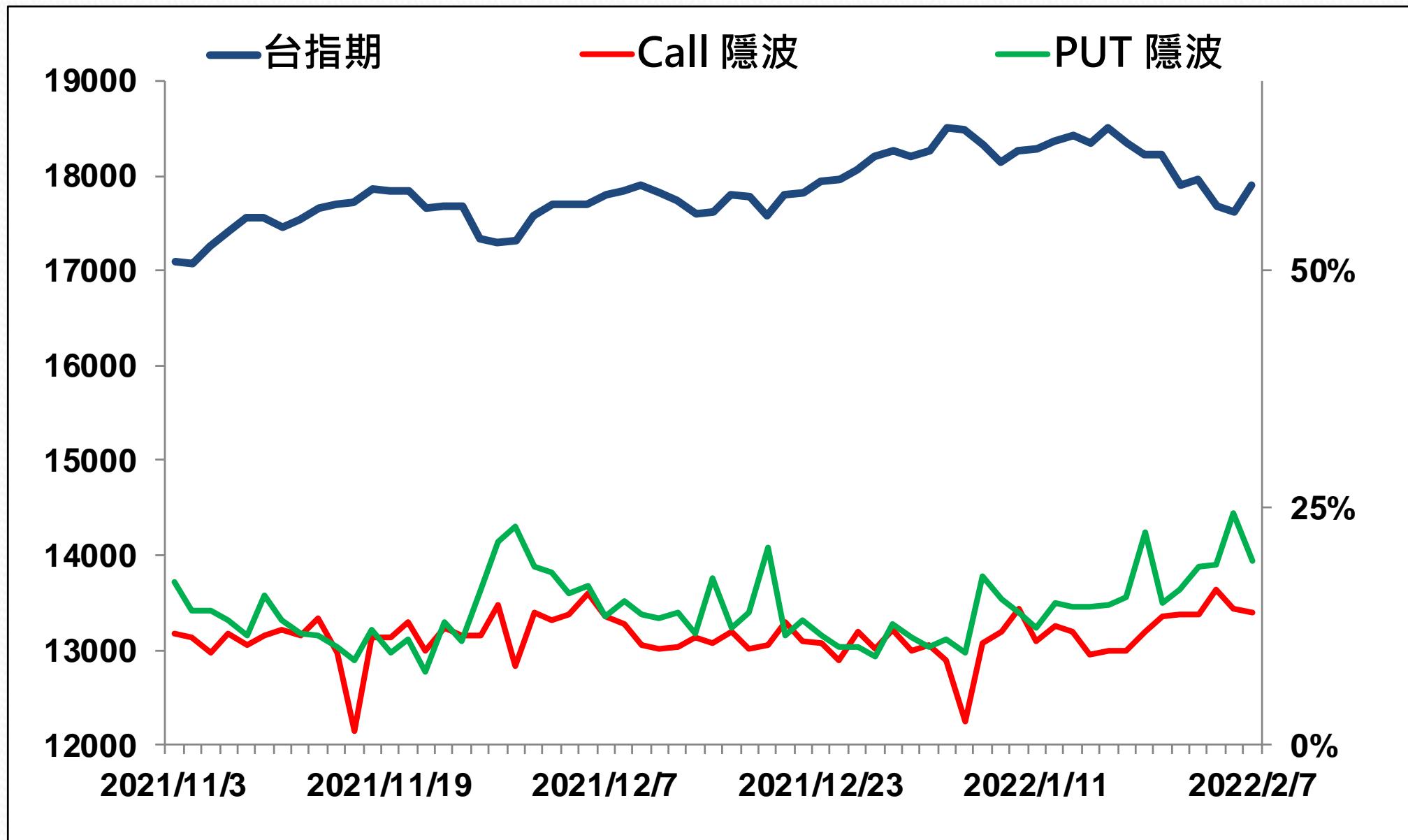
— 臺指選擇權波動率指數



更新日期：2022年2月7日

資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

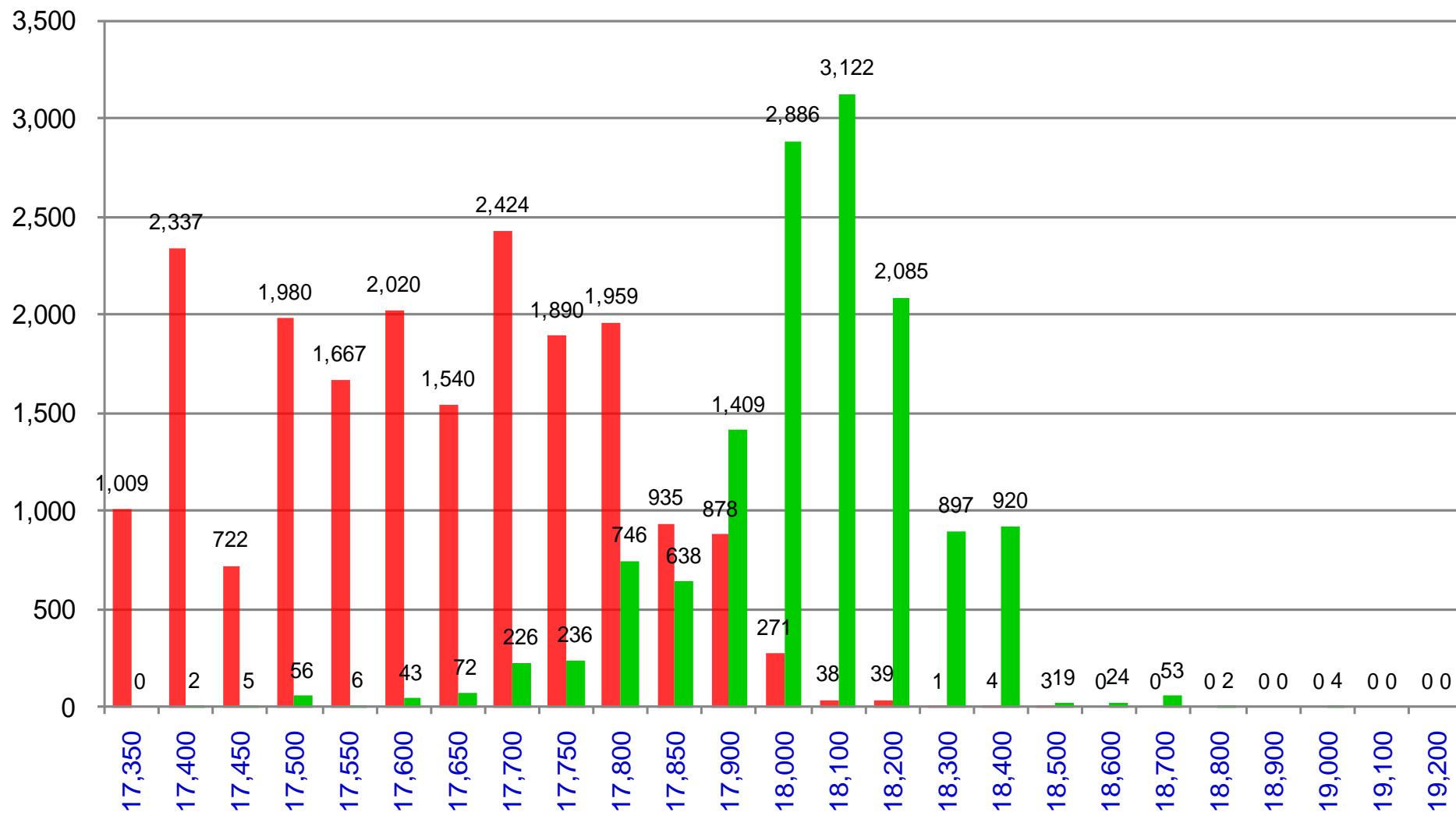
台指近月隱含波動度



更新日期：2022年2月7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

■ 週選 PUT OI 變化 : 29,729 ■ 週選 CALL OI 變化 : 13,451

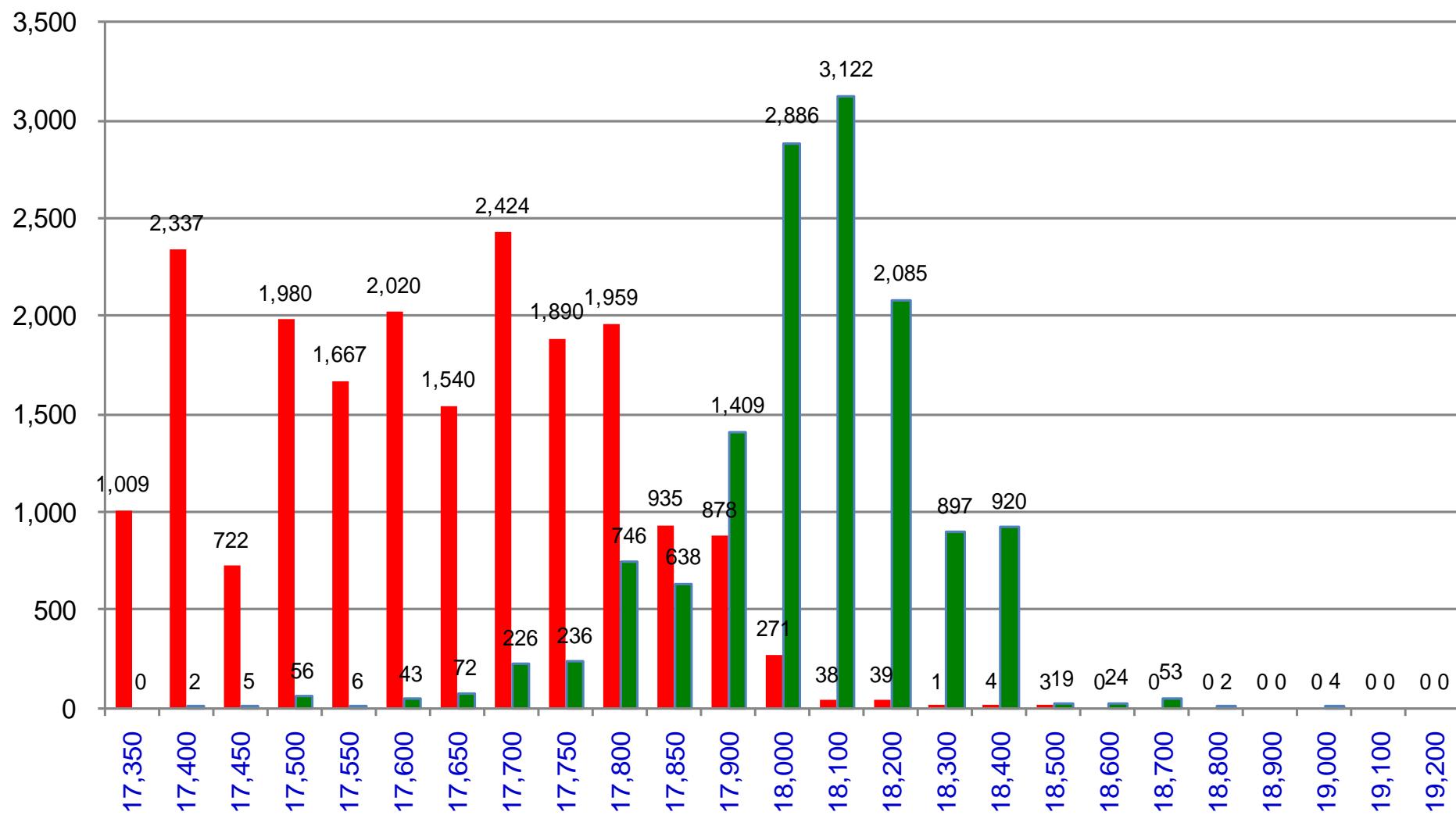


更新日期：2022年2月7日 資料來源：台灣期貨交易所 · 凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：29,729

■ 週選 CALL OI 總額：13,451



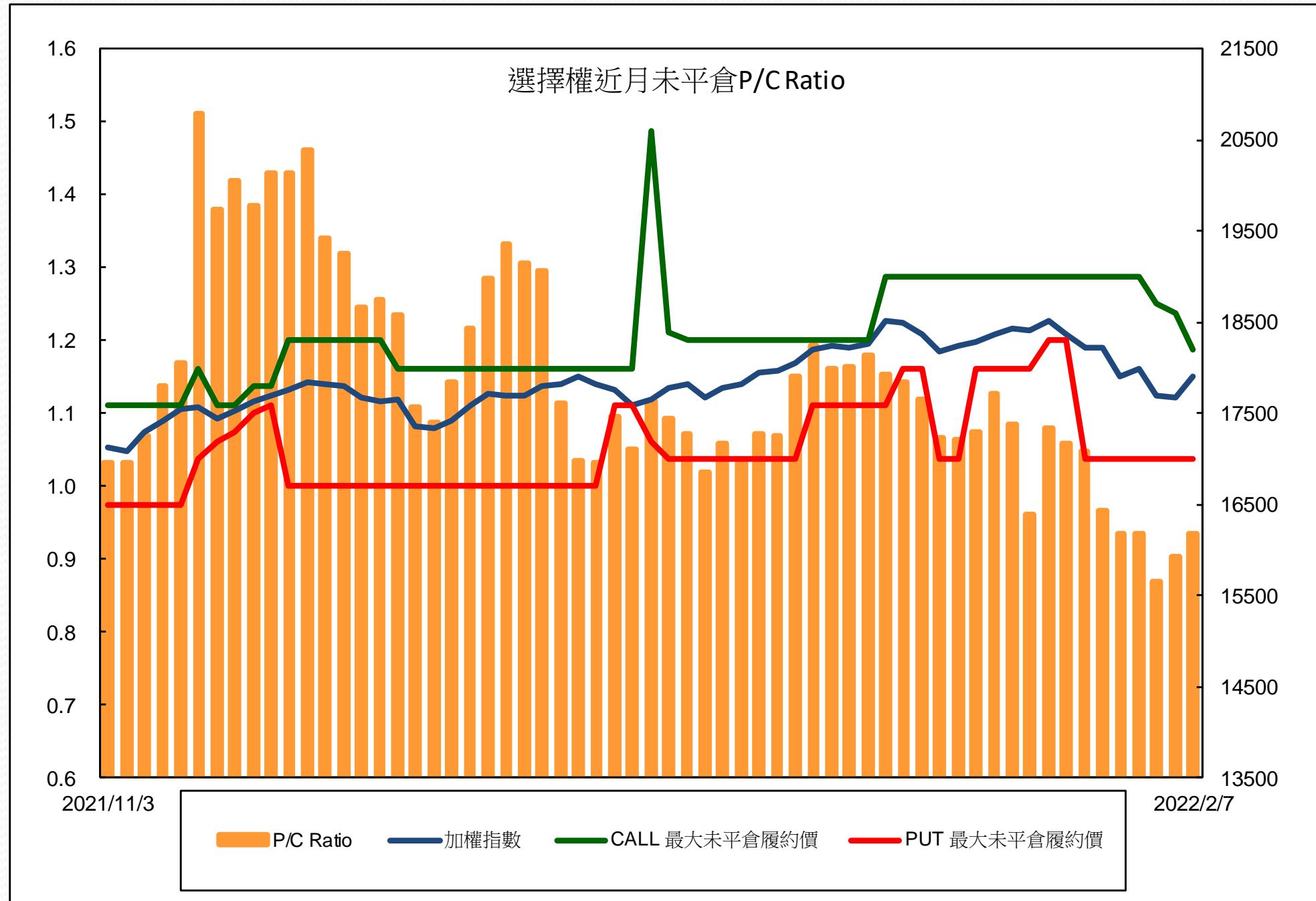
更新日期：2022年2月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	1月26日	36,577	37,418	-841
	2月7日	41,977	41,435	542
Put	1月26日	37,697	36,752	945
	2月7日	41,353	28,808	12,545

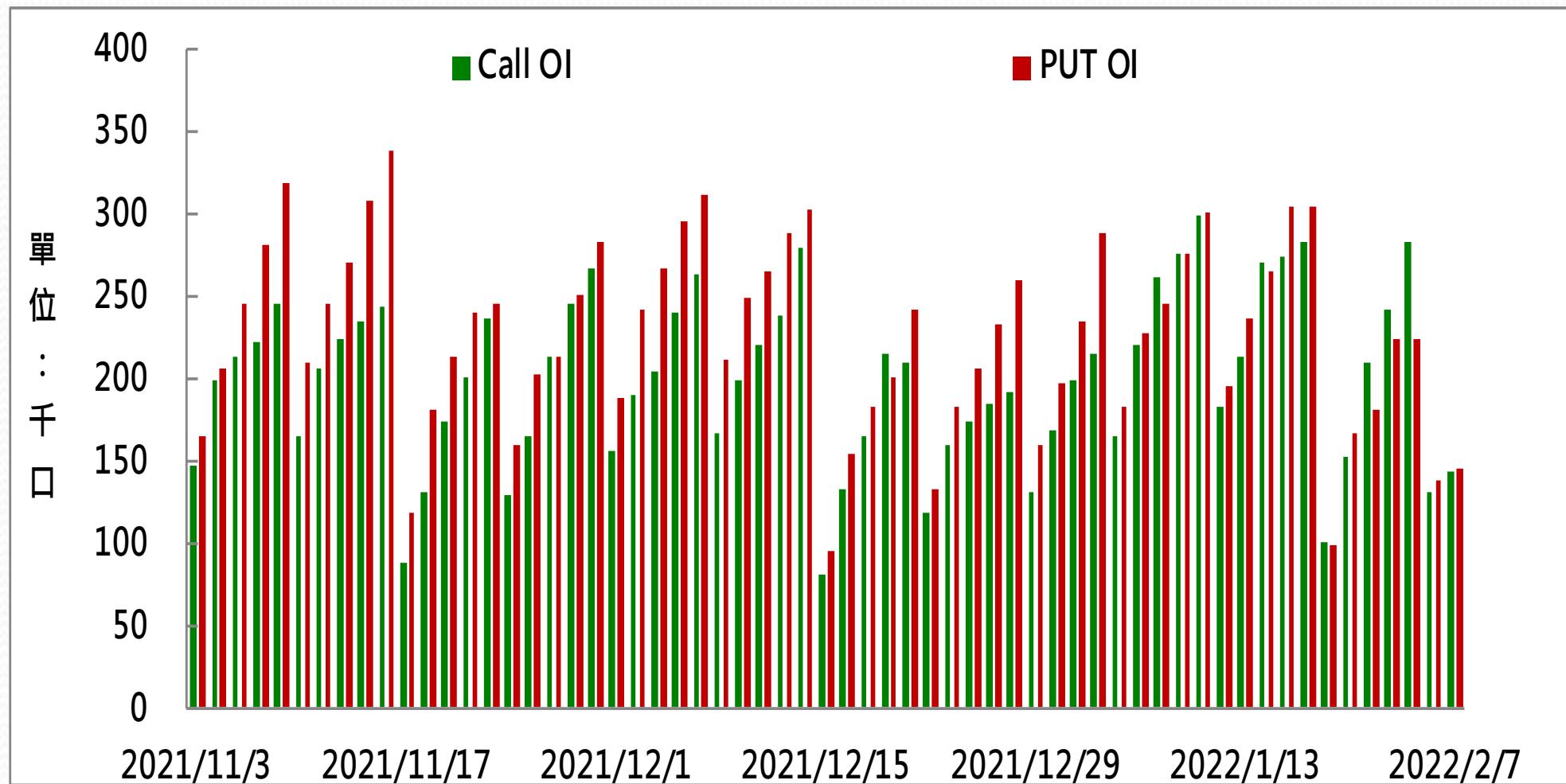
更新日期：2022年2月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年2月7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2月7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2月7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