

台指選擇權OI匯報

日期：2022/2/8 結算日：2022/2/9					日期：2022/2/8 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
1	3	17,400	2,270	-67	0	8	16,900	2,186	-300
5	10	17,450	1,150	428	0	23	17,000	14,870	930
-24	32	17,500	2,672	692	0	19	17,100	3,415	248
2	8	17,550	2,200	533	-10	131	17,200	4,139	716
-3	40	17,600	4,997	2,977	40	416	17,300	4,443	174
-1	71	17,650	4,203	2,663	45	360	17,400	5,088	173
133	359	17,700	6,718	4,294	52	1,843	17,500	4,661	1,320
54	290	17,750	6,047	4,157	-28	1,057	17,600	5,306	1,704
48	794	17,800	9,882	7,923	-26	1,169	17,700	3,830	650
356	994	17,850	9,193	8,258	-513	1,492	17,800	3,122	622
1,164	2,573	17,900	6,799	5,921	-162	1,583	17,900	2,421	946
2,257	3,338	17,950	4,478	4,280	-283	5,141	18,000	2,139	-65
3,889	6,775	18,000	5,353	5,082	397	4,416	18,100	1,365	171
5,482	7,989	18,050	2,115	2,044	-206	8,518	18,200	2,721	32
※ 8,566	11,688	18,100	1,535	1,497	409	5,666	18,300	773	-1
6,695	8,176	18,150	1,114	1,099	-341	6,917	18,400	1,196	-24
4,356	6,441	18,200	381	342	286	7,916	18,500	563	199
1,660	1,660	18,250	54	54	※ 803	8,068	18,600	104	-3
1,158	2,055	18,300	18	17	-469	7,761	18,700	63	0
70	70	18,350	0	0	-475	6,663	18,800	199	1
136	1,056	18,400	5	1	-75	3,503	18,900	12	0
372	391	18,500	6	3	-77	6,614	19,000	9	0
245	269	18,600	0	0	-493	2,840	19,100	9	0
0	53	18,700	0	0	-62	2,566	19,200	16	-2
2	4	18,800	0	0	-115	1,566	19,300	1	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
36,626	55,146	1.4349	79,131	52,524	-1,418	98,399	0.9916	97,570	4,254
昨日 P/C	1.6206	今日增減變化		-0.1856	昨日 P/C	0.9349	今日增減變化		0.0567

更新日期：2022年2月8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8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	67,696,514	173,558,784	-105,862,270	2,337,411	2,796,039	3,499,378	-703,339	-92,491
投信	61,439,786	54,220,724	7,219,062	1,339,177	2,188,850	0	2,188,850	-383
自營商	76,465,268	14,727,386	61,737,882	-1,690,287	1,838,480	1,299,895	538,585	247,093
	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	1,047,758	4,261,452	-3,213,694	192,618	19,846	1,654	18,192	-3,180
投信	23,525	0	23,525	219	1,654	0	1,654	10
自營商	816,015	215,287	600,728	-32,050	193,473	277,788	-84,315	-512

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8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	28,135	21,949	6,186	4,010	44,131	26,860	17,271	1,213
投信	0	0	0	0	0	58	-58	0
自營商	57,621	46,546	11,075	10,533	50,404	36,880	13,524	979
特定法人(週)	565	0	565	565	0	1,968	-1,968	-708
特定法人(近月)	10,593	10,307	286	2,315	9,956	36,010	-26,054	-1,841
特定法人(全月)	19,239	8,921	10,318	7,506	12,014	42,688	-30,674	-1,444
十大交易人(週)	22,684	19,055	3,629	1,764	26,388	22,829	3,559	6,690
十大交易人(近月)	38,634	38,358	276	1,458	30,512	56,623	-26,111	-813
十大交易人(全月)	77,272	57,514	19,758	13,319	52,321	83,656	-31,335	-777
全市場未沖銷(近月)			98,399	-1,418			97,570	4,254
全市場未沖銷(全月)			184,693	40,482			205,141	60,238

更新日期：2022年2月8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	18000	賣權OI最大量	17800
	整體隱含波動率	10.63%	較前一交易日	-4.92%
	買權隱含波動率	7.67%	較前一交易日	-5.70%
	賣權隱含波動率	12.80%	較前一交易日	-4.57%
電子選擇權	買權成交最大量	900	買權OI最大量	920
	賣權成交最大量	860	賣權OI最大量	800
金融選擇權	買權成交最大量	1820	買權OI最大量	1880
	賣權成交最大量	1780	賣權OI最大量	1740

更新日期：2022年2月8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	18200	買權OI最大量	18200
	賣權成交最大量	17600	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	17.02%	較前一交易日	+0.99%
	買權隱含波動率	15.08%	較前一交易日	+0.66%
	賣權隱含波動率	17.19%	較前一交易日	-4.54%
	成交量P/C_Ratio值	1.230	較前一交易日	+0.30
	未平倉P/C_Ratio值	0.992	較前一交易日	+0.06
電子選擇權	買權成交最大量	900	買權OI最大量	920
	賣權成交最大量	860	賣權OI最大量	800
金融選擇權	買權成交最大量	1820	買權OI最大量	1880
	賣權成交最大量	1780	賣權OI最大量	1740

更新日期：2022年2月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

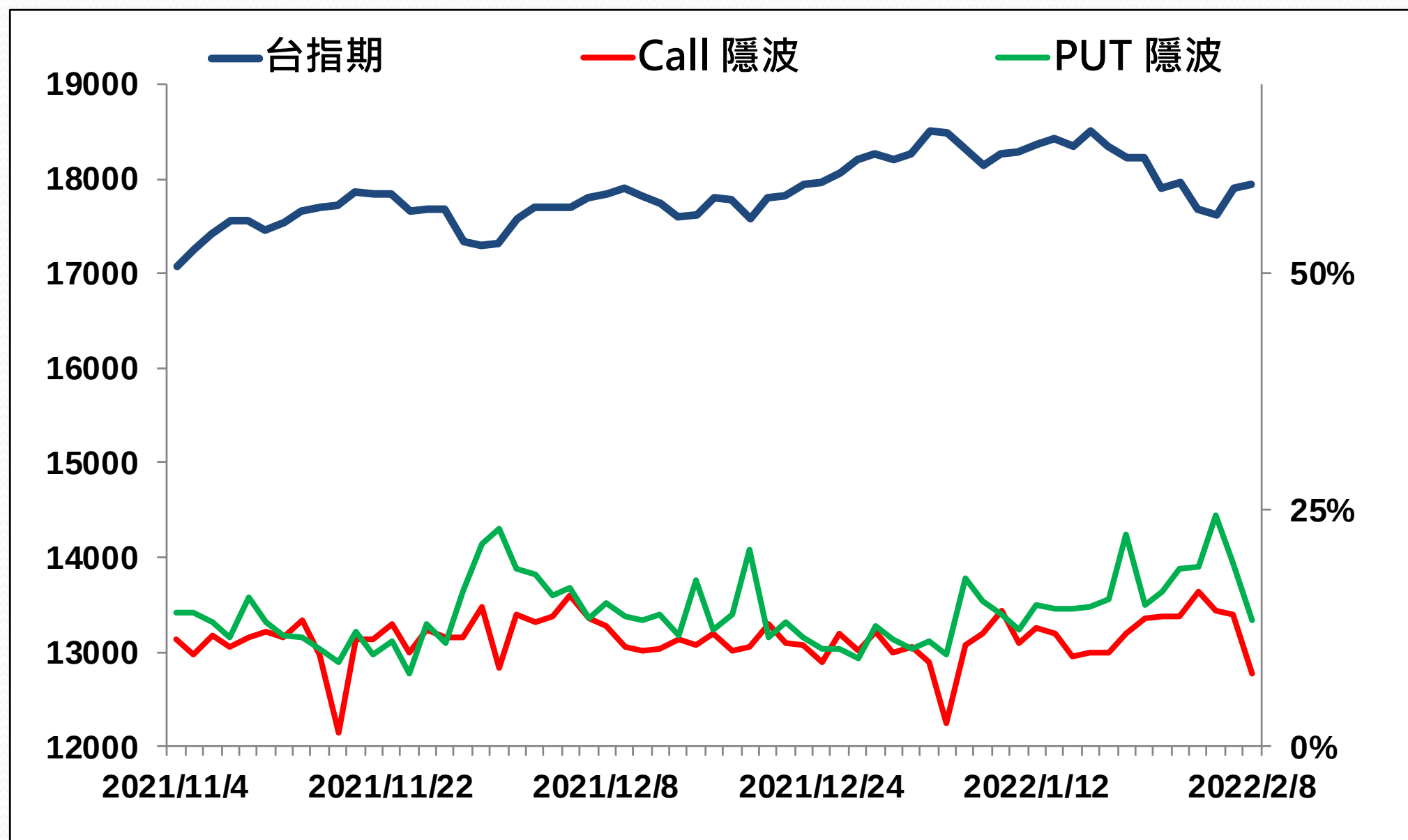
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



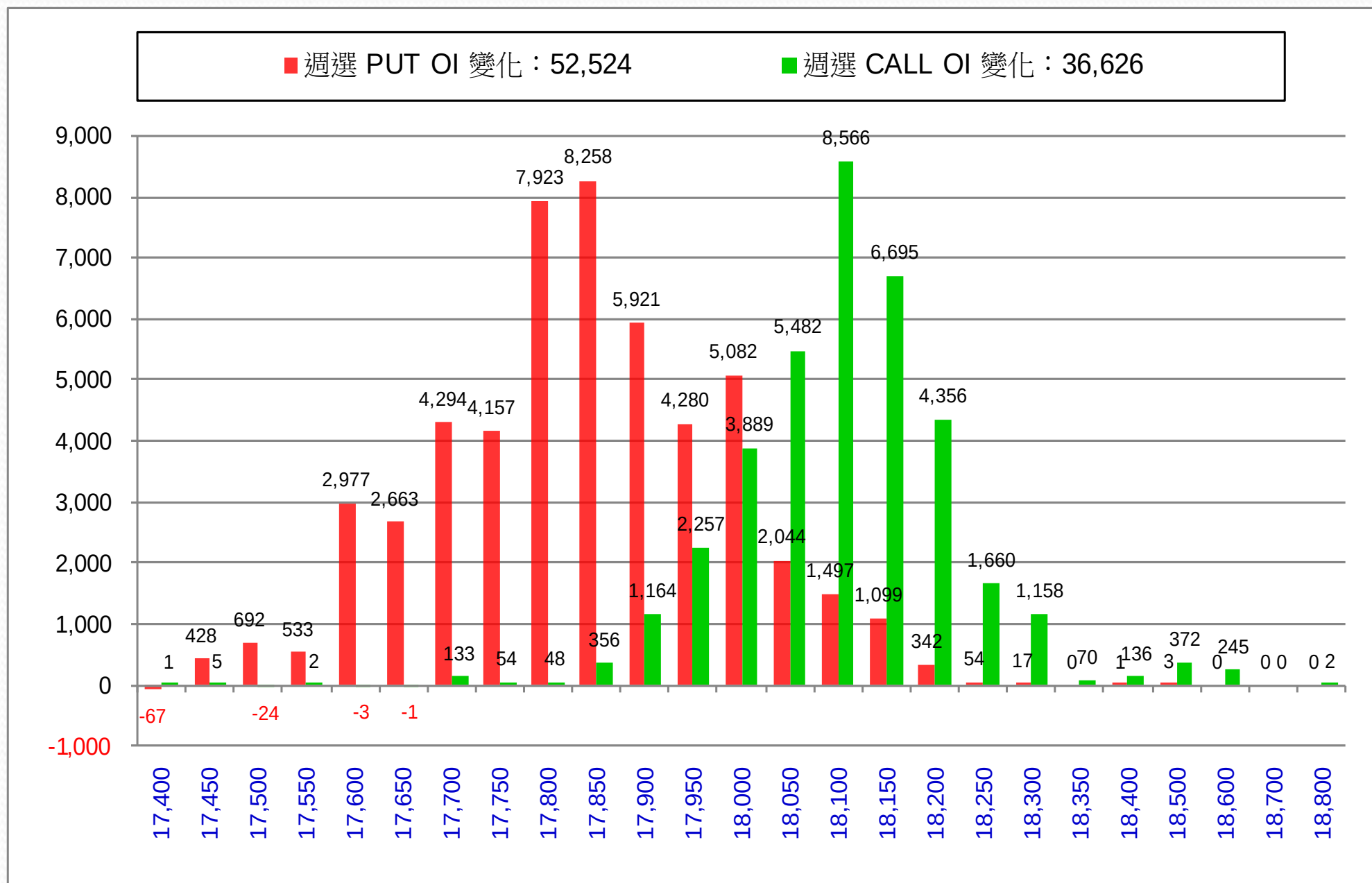
更新日期：2022年2月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年2月8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

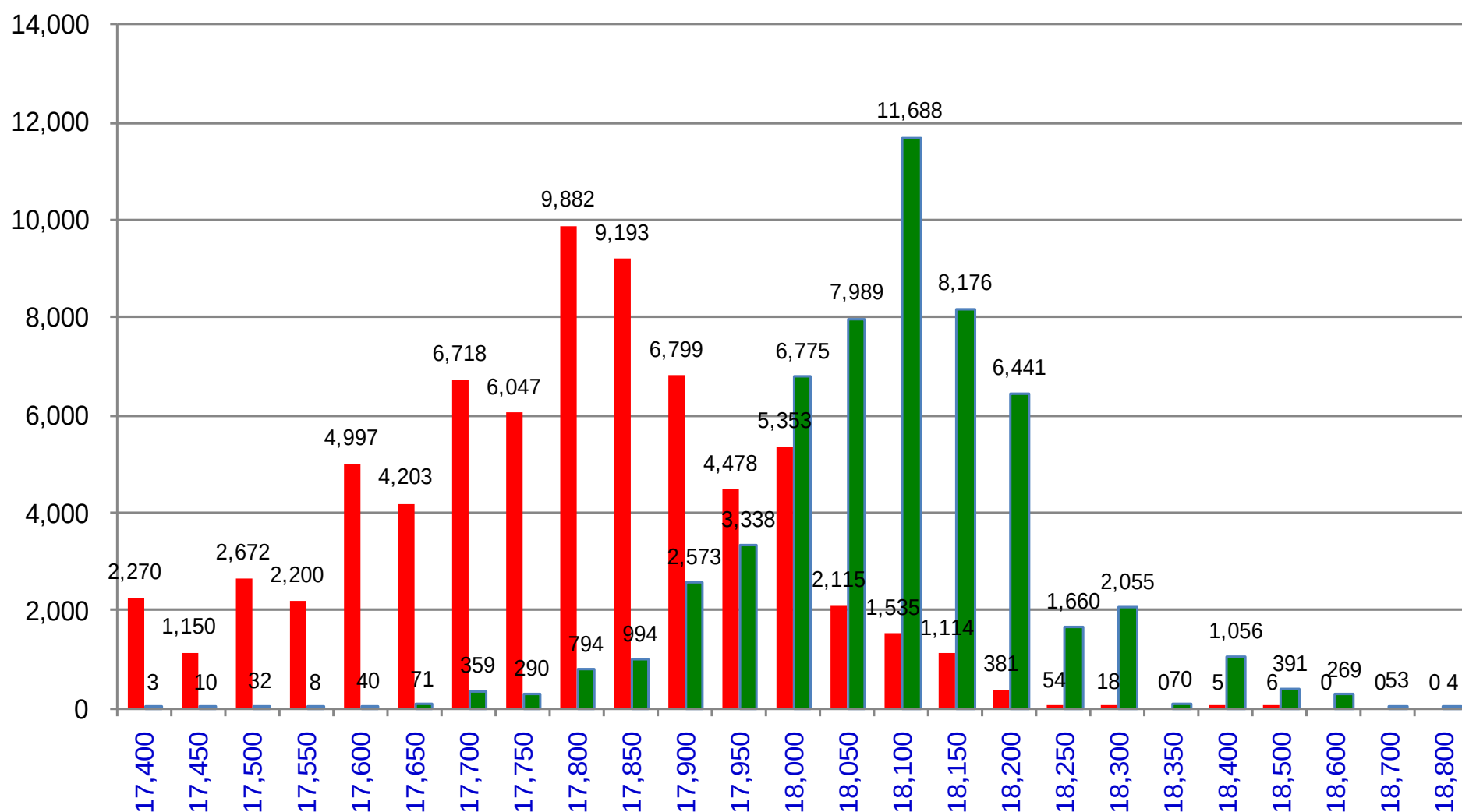


更新日期：2022年2月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：79,131

■ 週選 CALL OI 總額：55,146



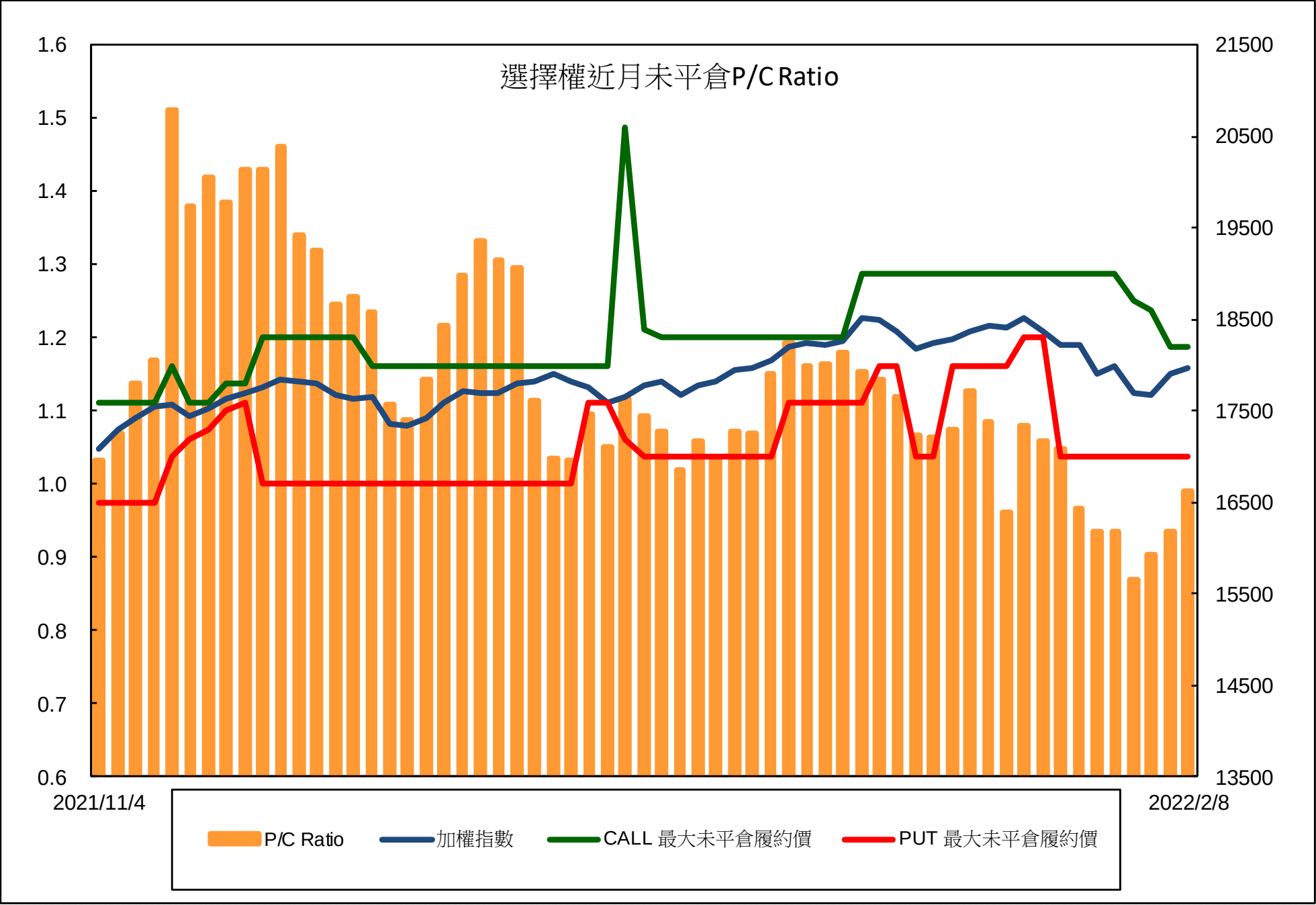
更新日期：2022年2月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	2月7日	41,977	41,435	542
	2月8日	57,621	46,546	11,075
Put	2月7日	41,353	28,808	12,545
	2月8日	50,404	36,880	13,524

更新日期：2022年2月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

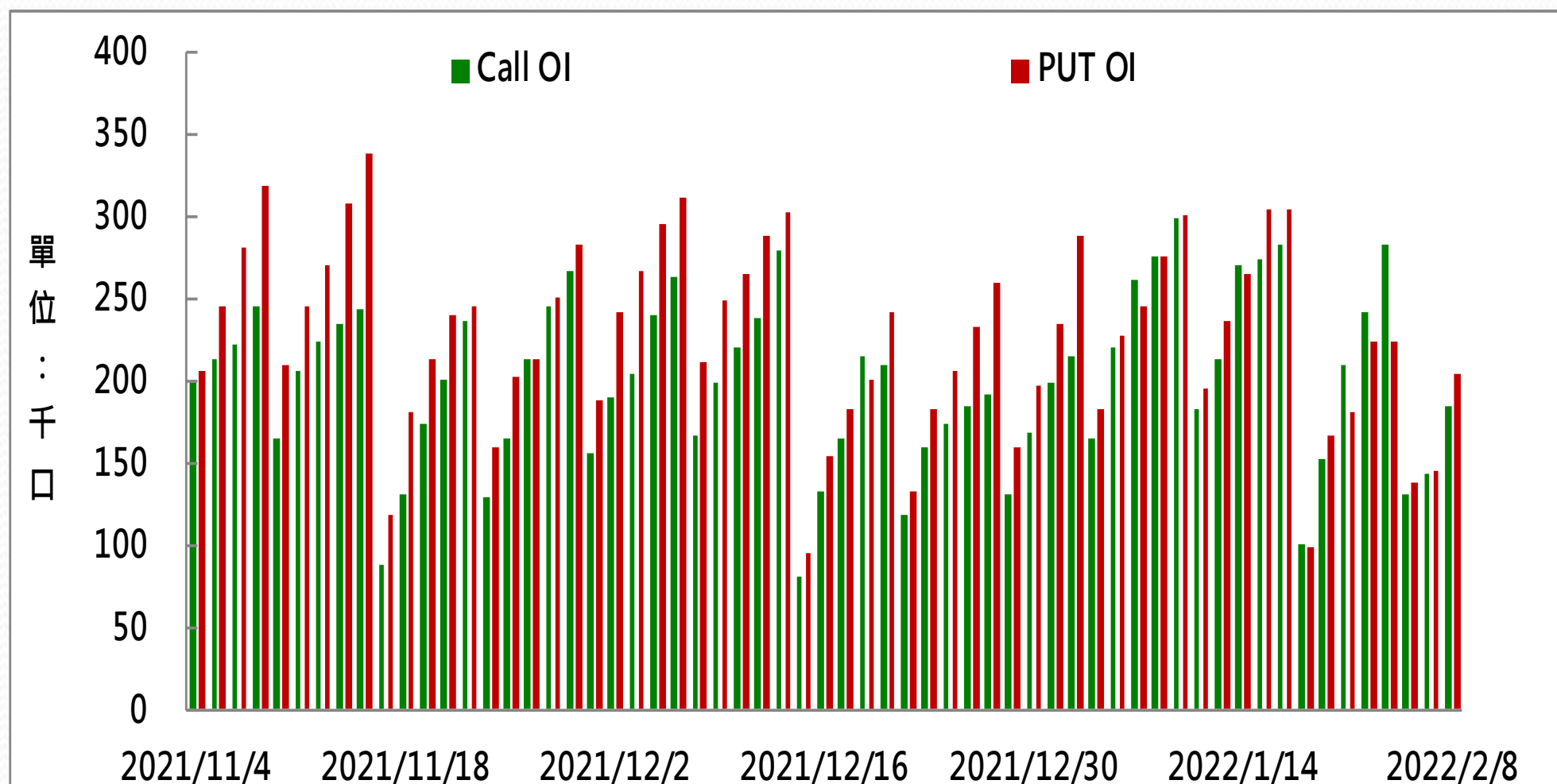
選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年2月8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8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8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