

# 台指選擇權OI匯報

日期 : 2022/2/9			結算日 : 2022/2/16			日期 : 2022/2/9			結算日 : 2022/3/16			
202202 月台指選擇權 OI 序列					202203 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	2	16,800	3,089	-419	0	0	16,100	323	193			
0	8	16,900	2,555	369	0	7	16,200	617	213			
0	23	17,000	15,861	991	0	12	16,300	530	273			
0	19	17,100	4,447	1,032	0	25	16,400	840	223			
-1	130	17,200	4,675	536	0	0	16,500	753	236			
-8	408	17,300	5,468	1,025	0	14	16,600	787	256			
-48	312	17,400	5,667	579	0	0	16,700	245	-43			
1	1	17,450	1,389	1,389	-1	61	16,800	1,737	230			
-26	1,817	17,500	5,820	1,159	0	2	16,900	430	101			
0	0	17,550	1,296	1,296	0	96	17,000	3,985	3,010	※		
-63	994	17,600	7,152	1,846	0	12	17,100	282	126			
0	0	17,650	2,571	2,571	0	129	17,200	1,063	286			
-150	1,019	17,700	5,943	2,113	0	6	17,300	2,548	1,193			
5	5	17,750	1,121	1,121	0	57	17,400	637	325			
-157	1,335	17,800	6,999	3,877	※	2	17,500	1,559	138			
36	36	17,850	2,262	2,262	4	559	17,600	381	124			
-116	1,467	17,900	4,910	2,489	10	289	17,700	360	128			
73	73	17,950	1,328	1,328	9	669	17,800	531	123			
-467	4,674	18,000	5,640	3,501	25	422	17,900	360	115			
258	258	18,050	1,284	1,284	33	1,503	18,000	1,446	472			
-853	3,563	18,100	3,256	1,891	473	795	18,100	403	6			
1,107	1,107	18,150	691	691	53	338	18,200	108	40			
785	9,303	18,200	3,503	782	88	351	18,300	41	18			
933	933	18,250	193	193	300	814	18,400	85	10			
1,050	6,716	18,300	965	192	588	1,535	18,500	142	-45			
1,290	1,290	18,350	48	48	667	1,929	18,600	51	12			
1,929	8,846	18,400	1,193	-3	361	815	18,700	9	3			
2,227	2,227	18,450	8	8	※	709	1,989	18,800	5	1		
※ 2,291	10,207	18,500	643	80	-323	1,479	18,900	6	0			
550	8,618	18,600	108	4	318	2,212	19,000	4	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	
13,180	111,579	1.1765	131,277	33,707		3,798	27,457	1.0259	28,169	9,626		
昨日 P/C		0.9916	今日增減變化		0.1850	昨日 P/C	0.7838	今日增減變化		0.2422		

資料來源：2022 年 2 月 16 日 貨幣市場 · 台灣期貨交易所 · 凱基期貨

# 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9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	73,913,903	166,254,580	-92,340,677	13,521,593	2,676,723	3,400,854	-724,131	-20,792
投信	62,530,558	54,056,064	8,474,494	1,255,432	2,220,878	0	2,220,878	32,028
自營商	79,130,876	15,276,675	63,854,201	2,116,319	2,143,482	1,516,985	626,497	87,912
	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	1,054,904	4,323,125	-3,268,221	-54,527	13,370	40,111	-26,741	-44,933
投信	23,644	0	23,644	119	1,671	0	1,671	17
自營商	801,976	274,581	527,395	-73,333	254,016	272,371	-18,355	65,960

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9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	28,664	21,122	7,542	1,356	46,247	26,438	19,809	2,538
投信	0	0	0	0	0	58	-58	0
自營商	44,057	40,823	3,234	-7,841	42,707	28,654	14,053	529
特定法人(週)	--	--	--	--	--	--	--	--
特定法人(近月)	10,983	12,163	-1,180	-1,466	8,351	34,505	-26,154	-100
特定法人(全月)	17,821	12,539	5,282	-5,036	13,564	45,589	-32,025	-1,351
十大交易人(週)	--	--	--	--	--	--	--	--
十大交易人(近月)	42,838	40,570	2,268	1,992	40,210	63,313	-23,103	3,008
十大交易人(全月)	66,272	53,553	12,719	-7,039	53,526	83,913	-30,387	948
全市場未沖銷(近月)			111,579	13,180			131,277	33,707
全市場未沖銷(全月)			147,138	-37,555			167,250	-37,891

更新日期：2022年2月9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	18500
	賣權成交最大量	17800	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	13.42%	較前一交易日	+2.78%
	買權隱含波動率	11.52%	較前一交易日	+3.85%
	賣權隱含波動率	14.68%	較前一交易日	+1.89%
電子選擇權	買權成交最大量	900	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	830	賣權OI最大量	850
金融選擇權	買權成交最大量	1860	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1780	賣權OI最大量	1640

更新日期：2022年2月9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03月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	18900	買權OI最大量	19000
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	18.36%	較前一交易日	-1.34%
	買權隱含波動率	12.21%	較前一交易日	-2.86%
	賣權隱含波動率	21.81%	較前一交易日	+4.63%
	成交量P/C_Ratio值	1.669	較前一交易日	+0.44
	未平倉P/C_Ratio值	1.026	較前一交易日	+0.03
電子選擇權	買權成交最大量	900	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	830	賣權OI最大量	850
金融選擇權	買權成交最大量	1860	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1780	賣權OI最大量	1640

更新日期：2022年2月9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

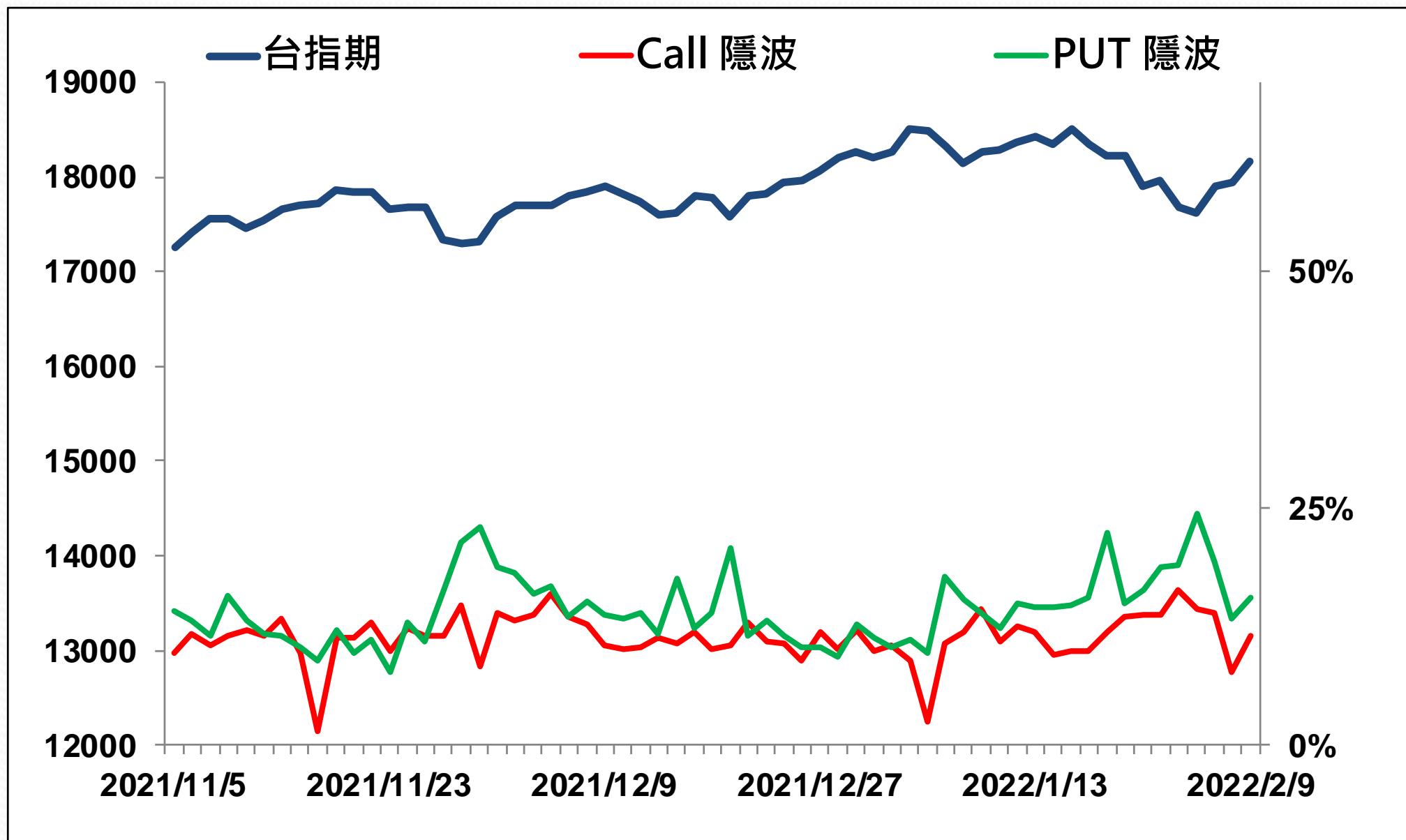
臺指選擇權波動率指數

— 臺指選擇權波動率指數



更新日期：2022年2月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

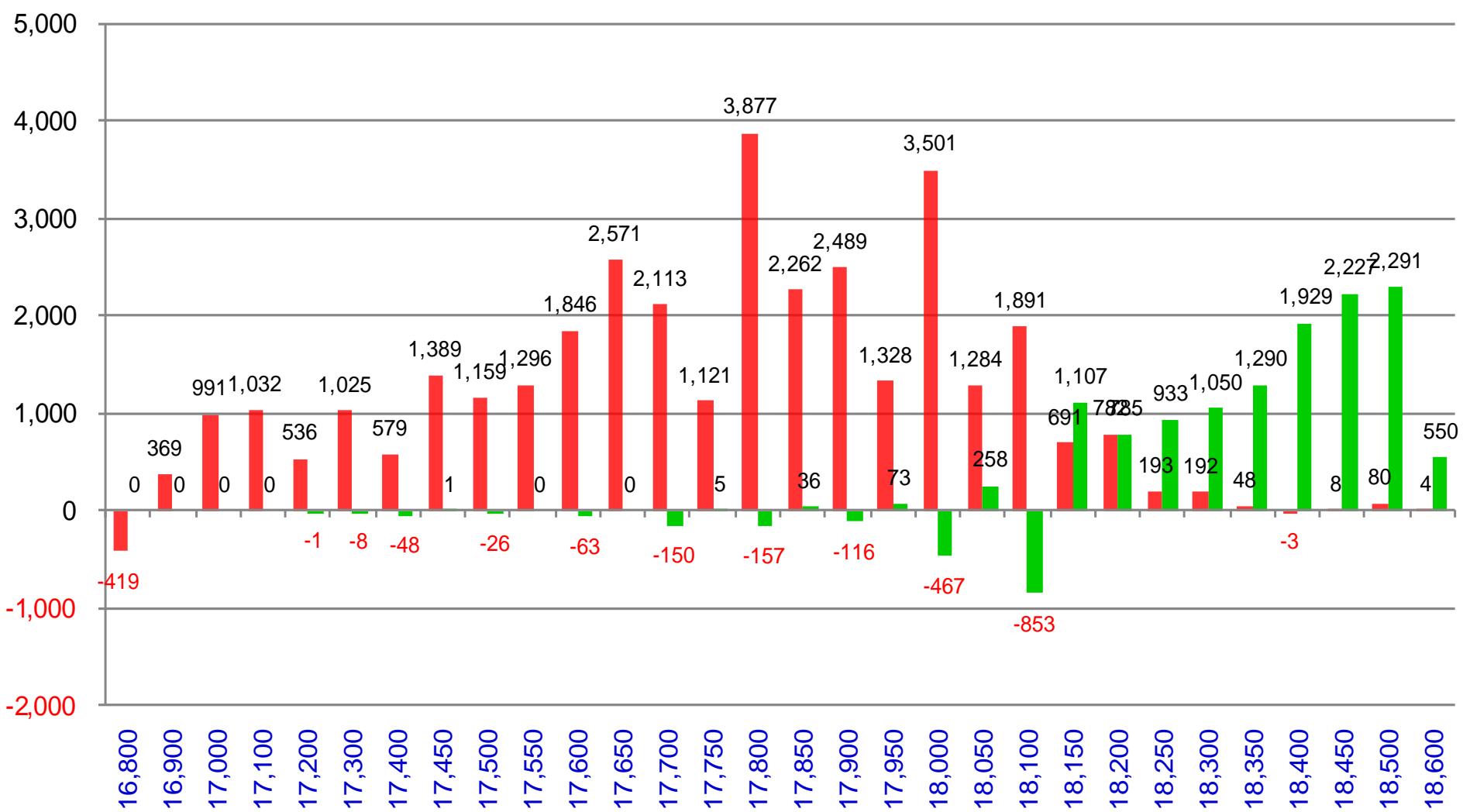
# 台指近月隱含波動度



更新日期：2022年2月9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

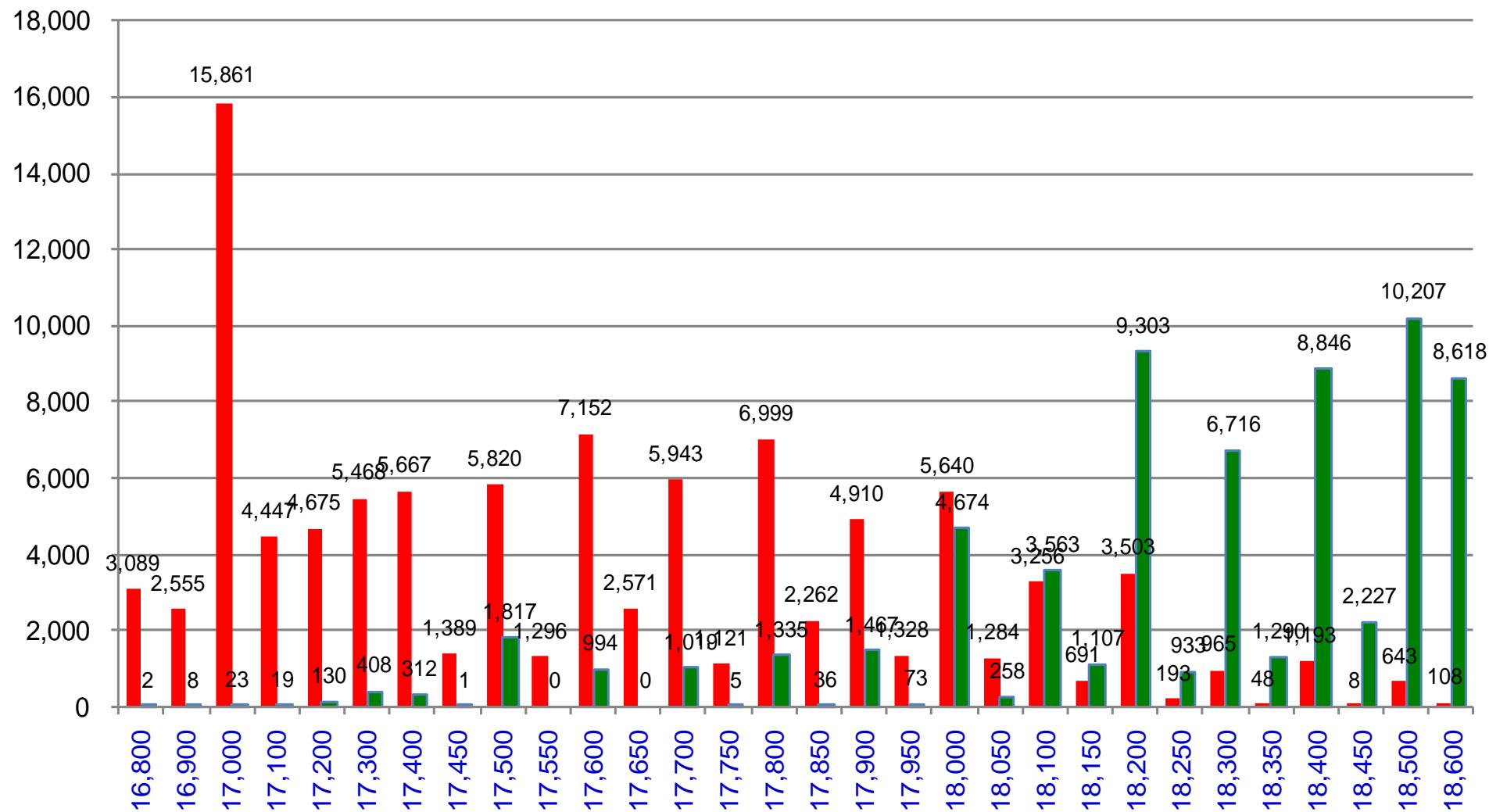
■ 週選 PUT OI 變化 : 33,707      ■ 週選 CALL OI 變化 : 13,180



更新日期：2022年2月9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：131,277      ■ 週選 CALL OI 總額：111,579



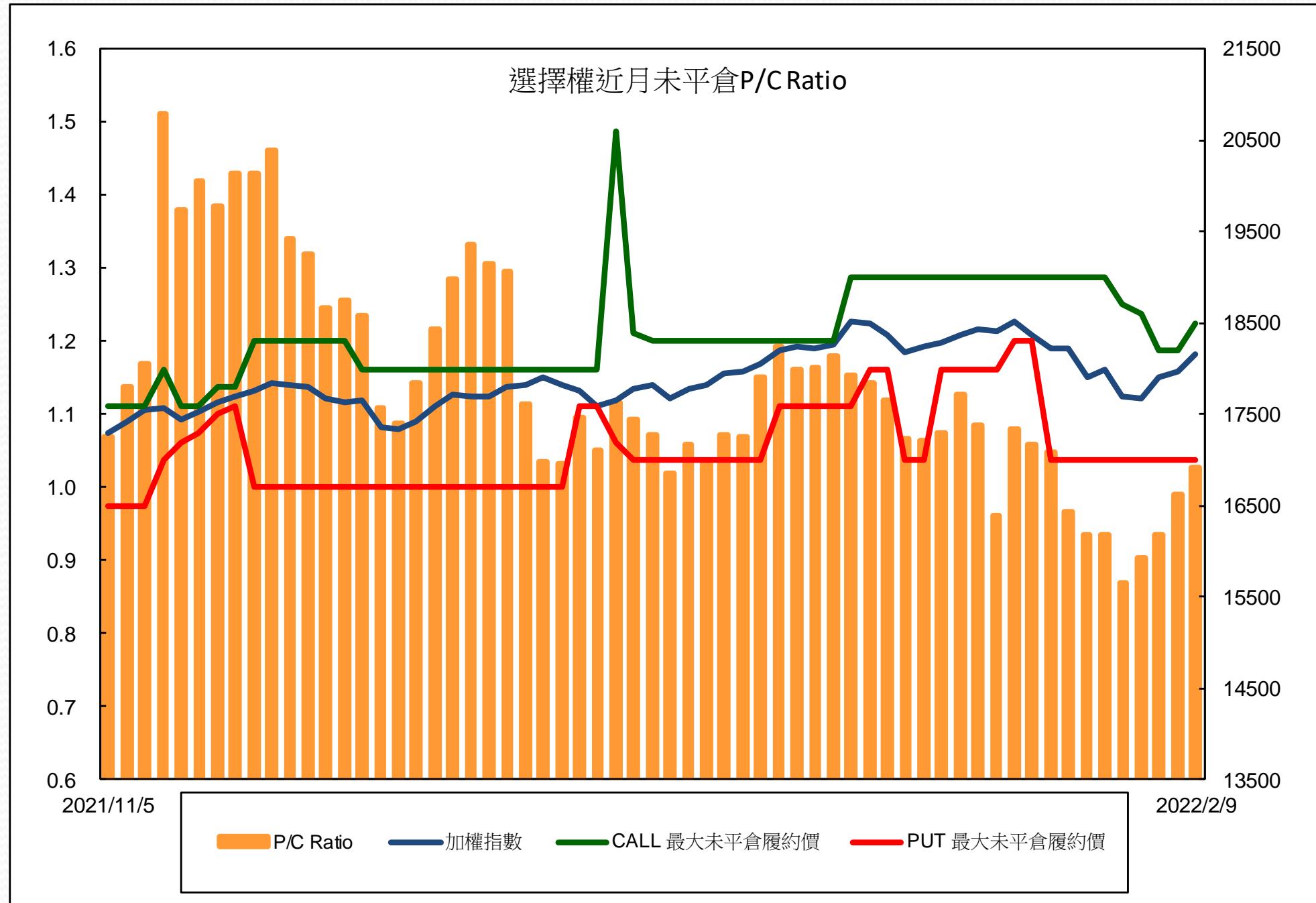
更新日期：2022年2月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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8日	57,621	46,546	11,075
	2月9日	44,057	40,823	3,234
Put	2月8日	50,404	36,880	13,524
	2月9日	42,707	28,654	14,053

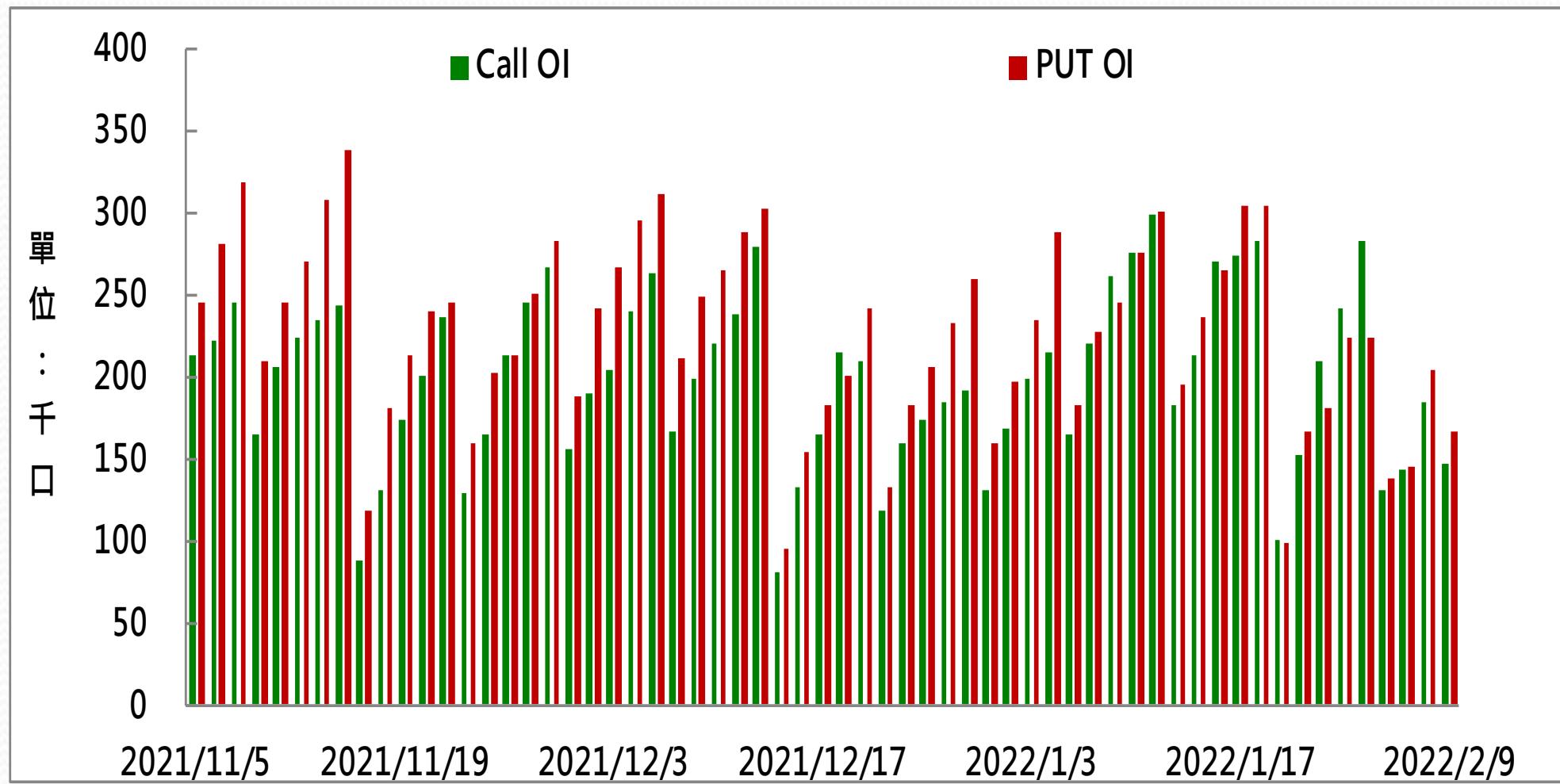
更新日期：2022年2月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年2月9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9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9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