

台指選擇權OI匯報

日期：2022/2/10 結算日：2022/2/16					日期：2022/2/10 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	8	16,900	2,898	343	0	0	15,900	122	-16
-1	22	17,000	15,695	-166	0	41	16,000	2,332	1,282
-3	16	17,100	4,169	-278	0	0	16,100	344	21
-1	129	17,200	4,324	-351	0	7	16,200	626	9
0	408	17,300	7,279	1,811	0	12	16,300	604	74
-4	308	17,400	6,939	1,272	0	25	16,400	842	2
-1	0	17,450	1,290	-99	0	0	16,500	787	34
-27	1,790	17,500	5,256	-564	0	14	16,600	1,106	319
0	0	17,550	2,073	777	0	0	16,700	619	374
-26	968	17,600	7,719	567	0	61	16,800	2,033	296
0	0	17,650	4,527	1,956	0	2	16,900	1,120	690
-103	916	17,700	7,266	1,323	0	96	17,000	6,046	2,061
6	11	17,750	2,739	1,618	0	12	17,100	577	295
-56	1,279	17,800	12,057	5,058	0	129	17,200	1,364	301
8	44	17,850	4,222	1,960	4	10	17,300	2,581	33
-160	1,307	17,900	10,112	5,202	0	57	17,400	899	262
15	88	17,950	4,406	3,078	3	36	17,500	2,028	469
-509	4,165	18,000	12,161	6,521	34	593	17,600	1,085	704
264	522	18,050	5,479	4,195	0	289	17,700	632	272
-261	3,302	18,100	7,050	3,794	6	675	17,800	784	253
578	1,685	18,150	4,547	3,856	25	447	17,900	720	360
77	9,380	18,200	9,027	5,524	4	1,507	18,000	1,595	149
1,383	2,316	18,250	2,313	2,120	569	1,364	18,100	511	108
382	7,098	18,300	3,249	2,284	690	1,028	18,200	502	394
2,312	3,602	18,350	617	569	138	489	18,300	161	120
1,581	10,427	18,400	1,572	379	215	1,029	18,400	109	24
4,714	6,941	18,450	145	137	402	1,937	18,500	247	105
※ 5,764	15,971	18,500	774	131	528	2,457	18,600	49	-2
5,019	5,019	18,550	64	64	※ 895	1,710	18,700	9	0
1,704	10,322	18,600	145	37	251	2,240	18,800	6	1
1,320	1,320	18,650	20	20	432	1,911	18,900	7	1
51	9,391	18,700	127	63	346	2,558	19,000	4	0
662	8,147	18,800	203	5	192	2,009	19,100	0	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
24,731	136,310	1.3475	183,678	52,401	6,197	33,654	1.1399	38,361	10,192
昨日 P/C	1.1765	今日增減變化		0.1710	昨日 P/C	1.0259	今日增減變化		0.1139

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10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	79,641,687	154,905,856	-75,264,169	17,076,508	2,258,906	3,087,166	-828,260	-104,129
投信	57,963,946	54,315,984	3,647,962	-4,826,532	2,248,567	0	2,248,567	27,689
自營商	78,561,855	16,663,464	61,898,391	-1,955,810	2,184,075	1,553,272	630,803	4,306
	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	985,725	4,541,780	-3,556,055	-287,834	47,127	50,493	-3,366	23,375
投信	23,598	0	23,598	-46	1,683	0	1,683	12
自營商	711,478	255,969	455,509	-71,886	180,049	227,096	-47,047	-28,692

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10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	35,901	20,897	15,004	7,462	52,519	30,487	22,032	2,223
投信	0	0	0	0	0	58	-58	0
自營商	53,456	41,239	12,217	8,983	51,282	43,062	8,220	-5,833
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	14,009	8,321	5,688	6,868	8,183	37,652	-29,469	-3,315
特定法人(全月)	20,690	10,421	10,269	4,987	13,779	47,008	-33,229	-1,204
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	52,308	45,576	6,732	4,464	51,943	70,948	-19,005	4,098
十大交易人(全月)	78,917	58,364	20,553	7,834	67,501	95,873	-28,372	2,015
全市場未沖銷(近月)			136,310	24,731			183,678	52,401
全市場未沖銷(全月)			178,608	31,470			231,134	63,884

更新日期：2022年2月10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	18400	買權OI最大量	18500
	賣權成交最大量	18000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	11.92%	較前一交易日	-1.50%
	買權隱含波動率	10.08%	較前一交易日	-1.43%
	賣權隱含波動率	13.54%	較前一交易日	-1.14%
電子選擇權	買權成交最大量	910	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	810	賣權OI最大量	850
金融選擇權	買權成交最大量	1840	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1680	賣權OI最大量	1640

更新日期：2022年2月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

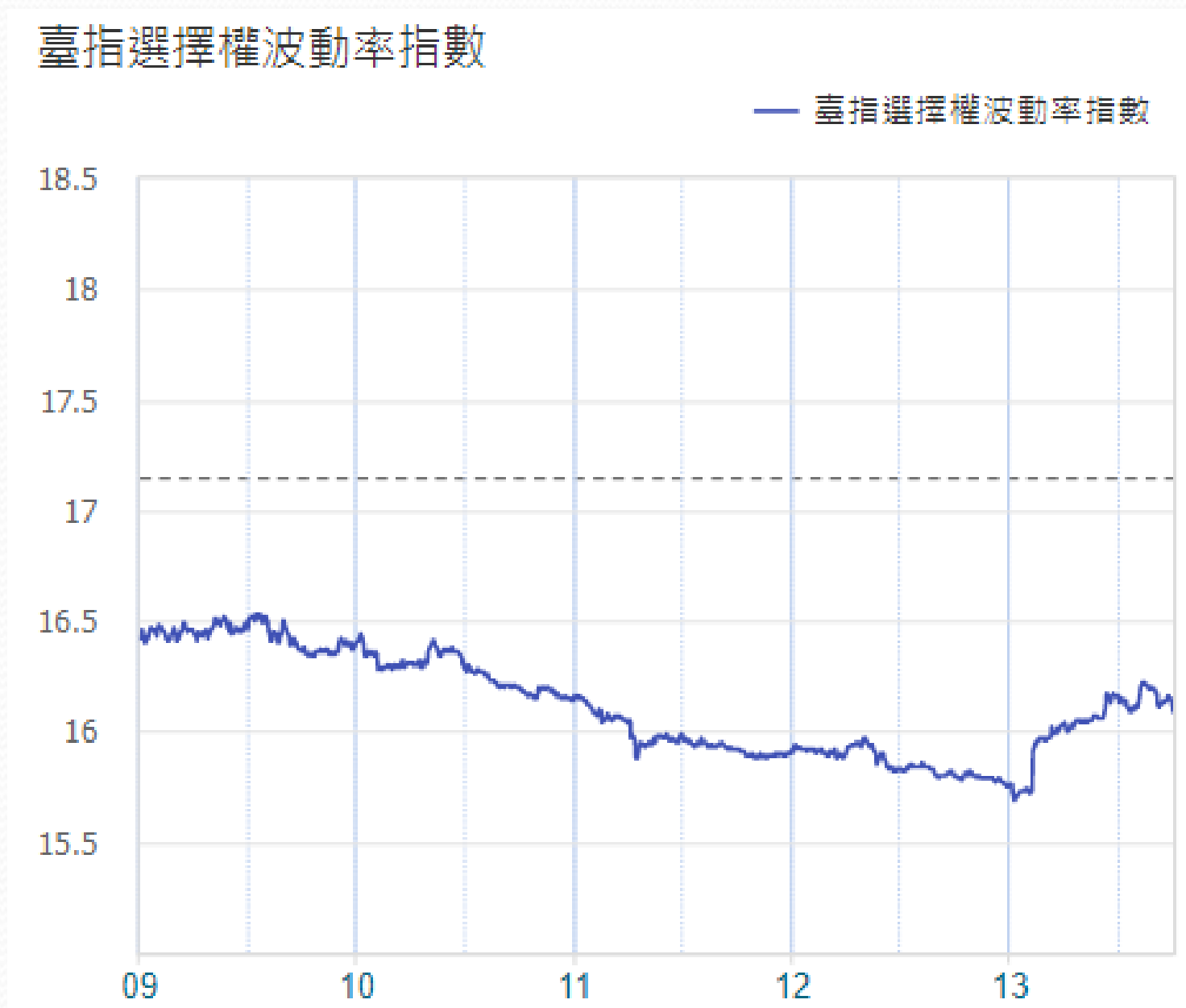
台指選擇權匯報

2022 年 03 月 選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	18700	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	17.24%	較前一交易日	+1.12%
	買權隱含波動率	11.51%	較前一交易日	-0.70%
	賣權隱含波動率	21.25%	較前一交易日	-0.56%
	成交量P/C_Ratio值	1.379	較前一交易日	-0.29
	未平倉P/C_Ratio值	1.140	較前一交易日	+0.11
電子選擇權	買權成交最大量	910	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	810	賣權OI最大量	850
金融選擇權	買權成交最大量	1840	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1680	賣權OI最大量	1640

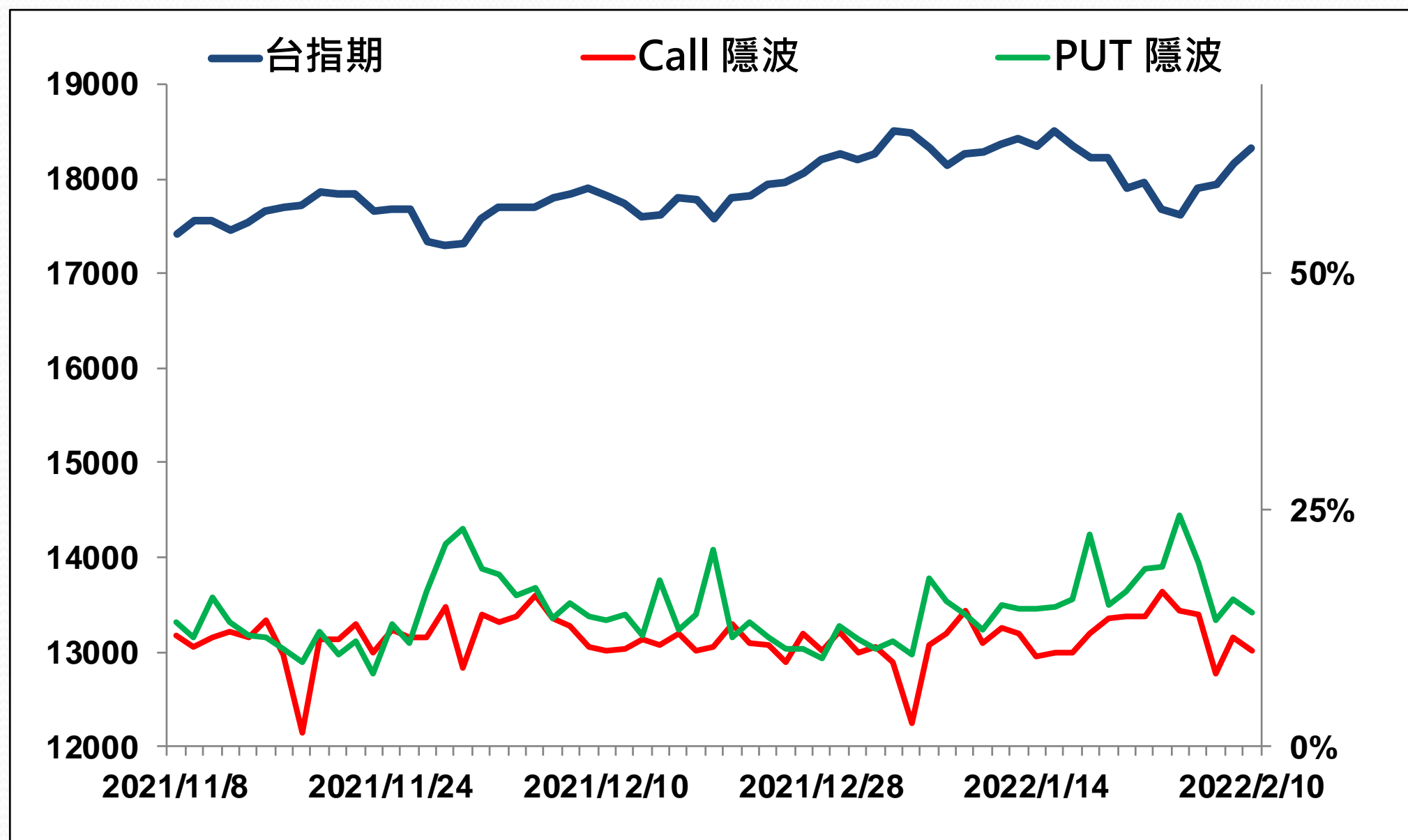
更新日期：2022年2月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



更新日期：2022年2月10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

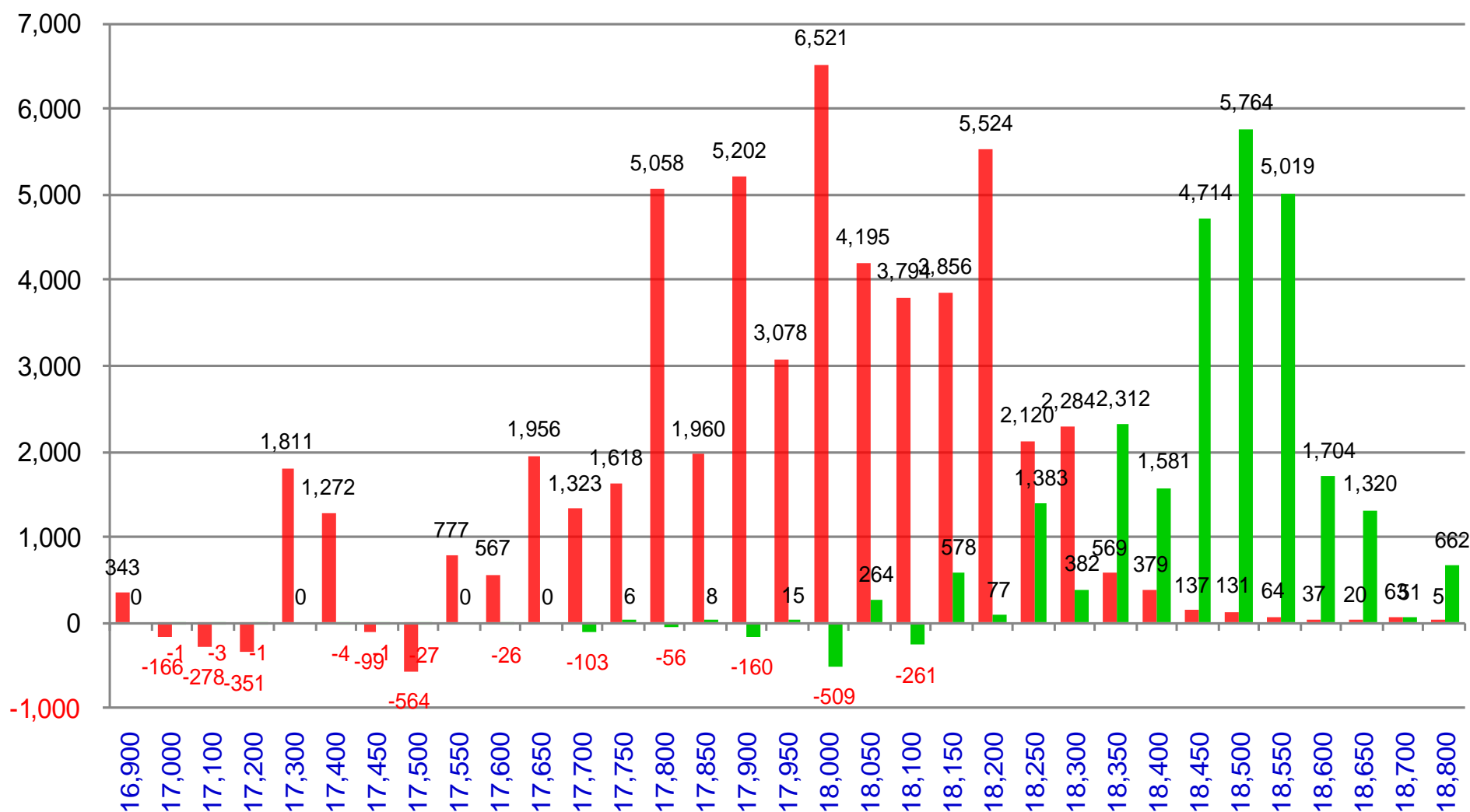


更新日期：2022年2月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：52,401

週選 CALL OI 變化：24,731

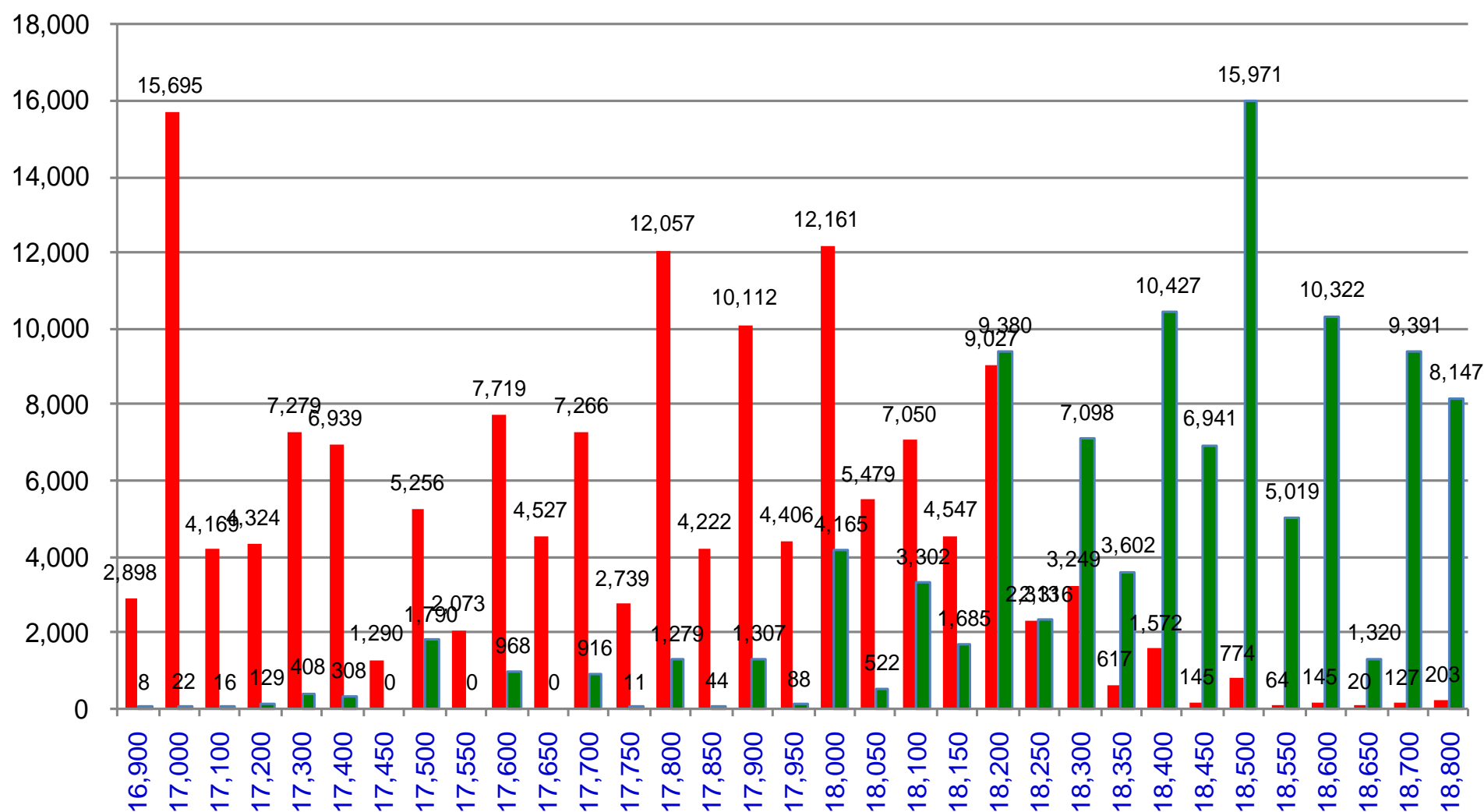


更新日期：2022年2月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：183,678

週選 CALL OI 總額：136,310



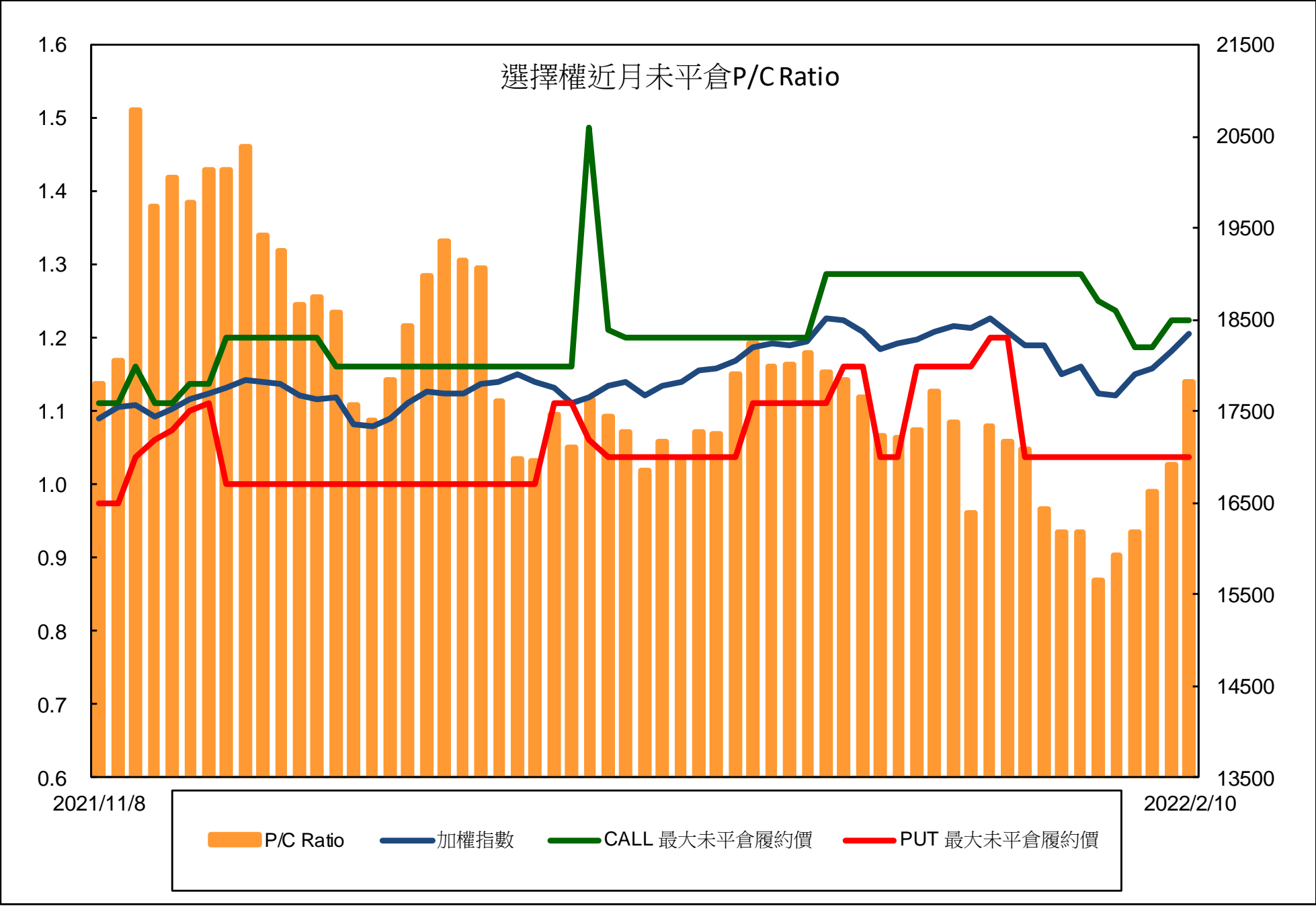
更新日期：2022年2月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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9日	44,057	40,823	3,234
	2月10日	53,456	41,239	12,217
Put	2月9日	42,707	28,654	14,053
	2月10日	51,282	43,062	8,220

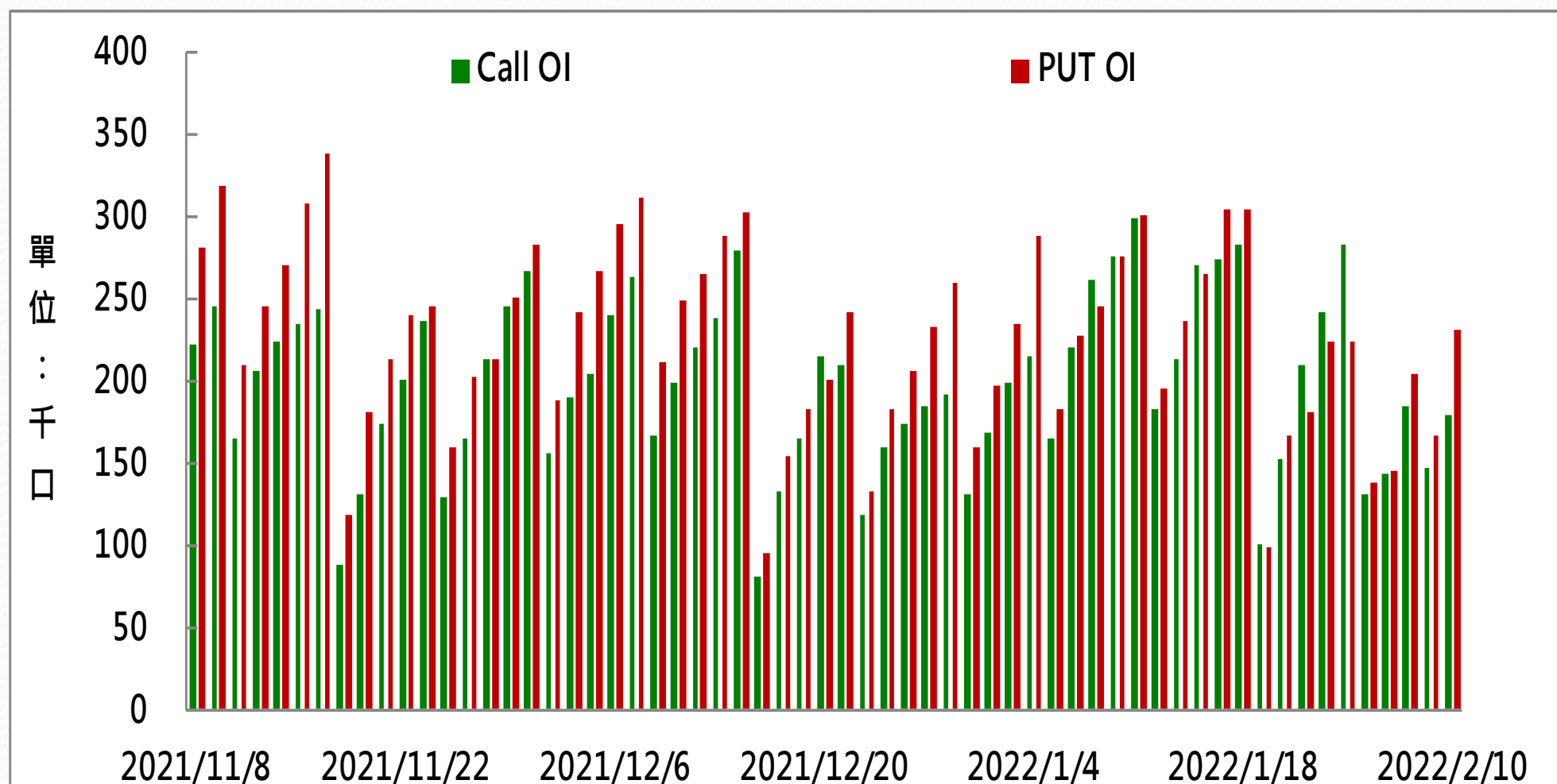
更新日期：2022年2月10日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年2月10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10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10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