

台指選擇權OI匯報

日期 : 2022/2/11			結算日 : 2022/2/16			日期 : 2022/2/11			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	2,550	-250		0	0	15,900	166	44	
0	8	16,900	3,045	147		0	41	16,000	2,887	555	
-3	19	17,000	15,985	290		0	0	16,100	351	7	
0	16	17,100	3,907	-262		0	7	16,200	703	77	
0	129	17,200	4,255	-69		0	12	16,300	609	5	
0	408	17,300	8,298	1,019		0	25	16,400	1,230	388	
-1	307	17,400	8,665	1,726		3	3	16,500	836	49	
0	0	17,450	2,531	1,241		0	14	16,600	1,266	160	
-9	1,781	17,500	5,723	467		0	0	16,700	1,234	615	※
0	0	17,550	2,077	4		0	61	16,800	1,745	-288	
-16	952	17,600	7,754	35		0	2	16,900	1,325	205	
0	0	17,650	4,496	-31		0	96	17,000	6,611	565	
-2	914	17,700	9,235	1,969		0	12	17,100	752	175	
-2	9	17,750	3,787	1,048		0	129	17,200	1,470	106	
-57	1,222	17,800	11,596	-461		0	10	17,300	2,941	360	
1	45	17,850	4,608	386		0	57	17,400	1,085	186	
-24	1,283	17,900	11,135	1,023		2	38	17,500	2,379	351	
-8	80	17,950	6,099	1,693		4	597	17,600	1,269	184	
-214	3,951	18,000	13,987	1,826		-1	288	17,700	671	39	
-69	453	18,050	7,466	1,987		23	698	17,800	951	167	
9	3,311	18,100	9,007	1,957		5	452	17,900	994	274	
251	1,936	18,150	5,253	706		17	1,524	18,000	1,655	60	
-336	9,044	18,200	13,652	4,625	※	14	1,378	18,100	612	101	
1,434	3,750	18,250	4,084	1,771		73	1,101	18,200	725	223	
1,636	8,734	18,300	4,993	1,744		212	701	18,300	410	249	
1,284	4,886	18,350	2,488	1,871		77	1,106	18,400	318	209	
3,860	14,287	18,400	2,358	786		434	2,371	18,500	302	55	
1,955	8,896	18,450	562	417		249	2,706	18,600	62	13	
2,962	18,933	18,500	906	132		327	2,037	18,700	32	23	
4,071	9,090	18,550	115	51		479	2,719	18,800	11	5	
2,946	13,268	18,600	190	45		684	2,595	18,900	7	0	
2,038	3,358	18,650	38	18		※ 1,329	3,887	19,000	4	0	
2,517	11,908	18,700	138	11		288	2,297	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
25,261	161,571	1.3040	210,685	27,007		5,756	39,410	1.1199	44,136	5,775	
昨日 P/C	1.3475	今日增減變化		-0.0435		昨日 P/C	1.1399	今日增減變化		-0.0199	

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11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	83,908,158	153,332,741	-69,424,583	5,839,586	2,435,399	2,974,335	-538,936	289,324
投信	51,199,433	52,315,326	-1,115,893	-4,763,855	2,240,656	0	2,240,656	-7,911
自營商	77,792,981	20,255,195	57,537,786	-4,360,605	2,095,265	1,561,738	533,527	-97,276
	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	950,382	4,468,950	-3,518,568	37,487	40,205	25,128	15,077	18,443
投信	23,629	0	23,629	31	1,675	0	1,675	-8
自營商	699,635	152,638	546,997	91,488	130,662	216,089	-85,427	-38,380

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11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	38,434	22,949	15,485	481	65,853	31,588	34,265	12,233
投信	0	0	0	0	0	58	-58	0
自營商	62,985	48,848	14,137	1,920	57,169	50,605	6,564	-1,656
特定法人(週)	--	--	--	--	--	--	--	--
特定法人(近月)	13,450	8,321	5,129	-559	8,139	40,725	-32,586	-3,117
特定法人(全月)	25,430	10,421	15,009	4,740	17,639	55,626	-37,987	-4,758
十大交易人(週)	--	--	--	--	--	--	--	--
十大交易人(近月)	59,547	50,326	9,221	2,489	60,687	80,872	-20,185	-1,180
十大交易人(全月)	88,927	62,645	26,282	5,729	77,863	110,148	-32,285	-3,913
全市場未沖銷(近月)			161,571	25,261			210,685	27,007
全市場未沖銷(全月)			210,165	31,557			265,860	34,726

更新日期：2022年2月11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	18200	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	13.15%	較前一交易日	+1.23%
	買權隱含波動率	9.62%	較前一交易日	-0.46%
	賣權隱含波動率	15.92%	較前一交易日	+2.38%
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	1920	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1740	賣權OI最大量	1640

更新日期：2022年2月11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	19000	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	18.10%	較前一交易日	-0.86%
	買權隱含波動率	11.63%	較前一交易日	+0.11%
	賣權隱含波動率	21.84%	較前一交易日	+0.59%
	成交量P/C_Ratio值	1.402	較前一交易日	+0.02
	未平倉P/C_Ratio值	1.120	較前一交易日	-0.02
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	1920	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1740	賣權OI最大量	1640

更新日期：2022年2月11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

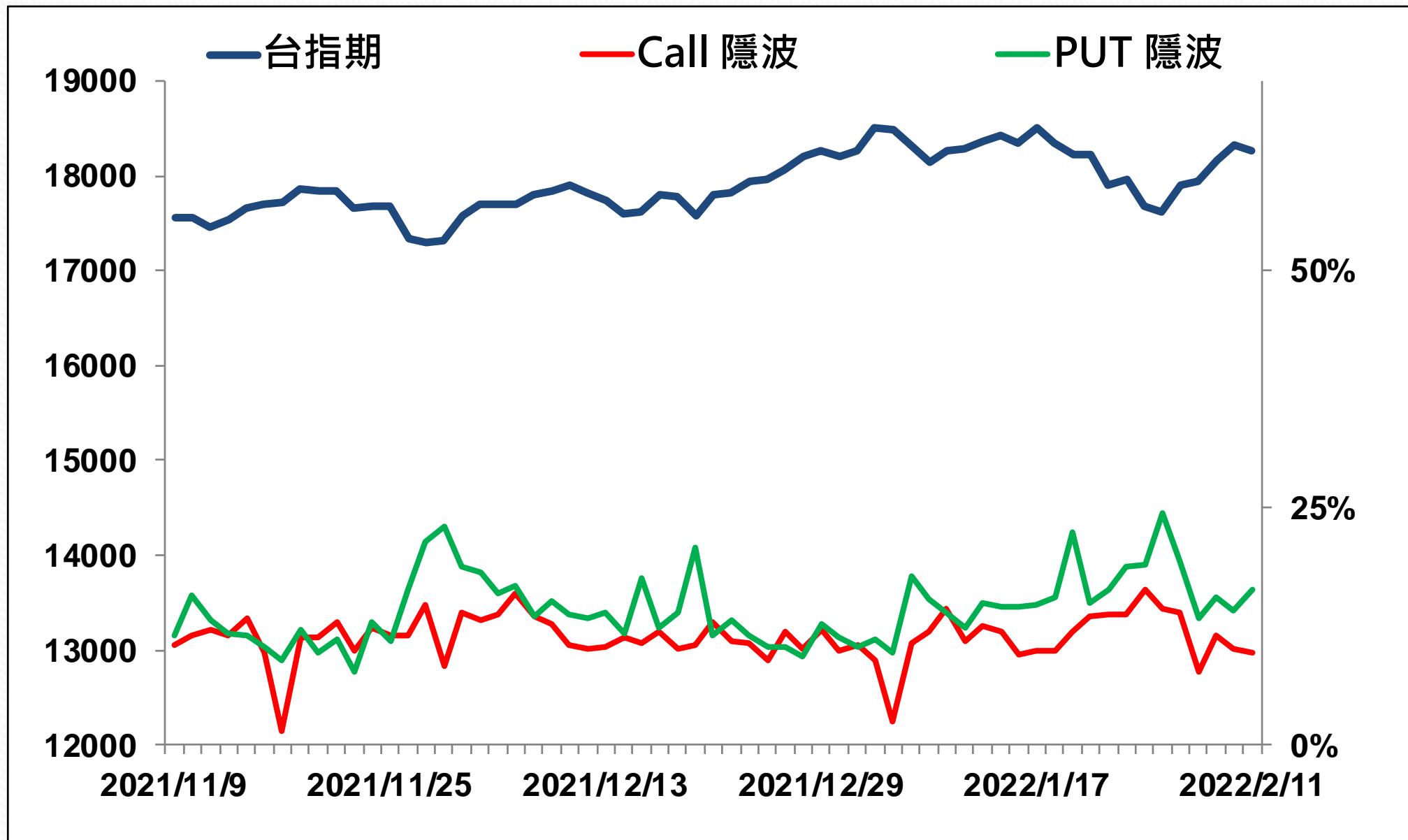
— 臺指選擇權波動率指數



更新日期：2022年2月11日

資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

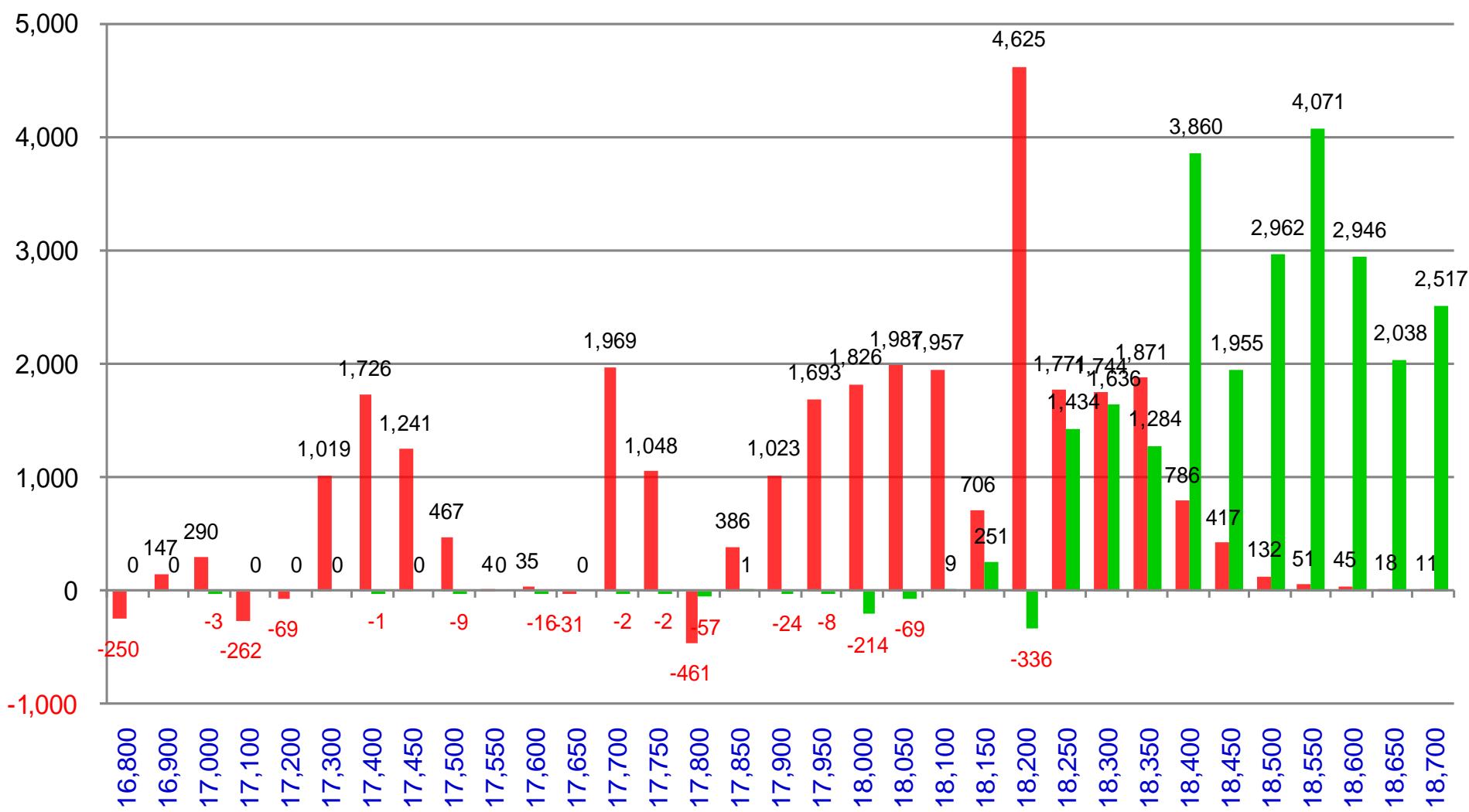
台指近月隱含波動度



更新日期：2022年2月11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 : 27,007 ■ 週選 CALL OI 變化 : 25,261

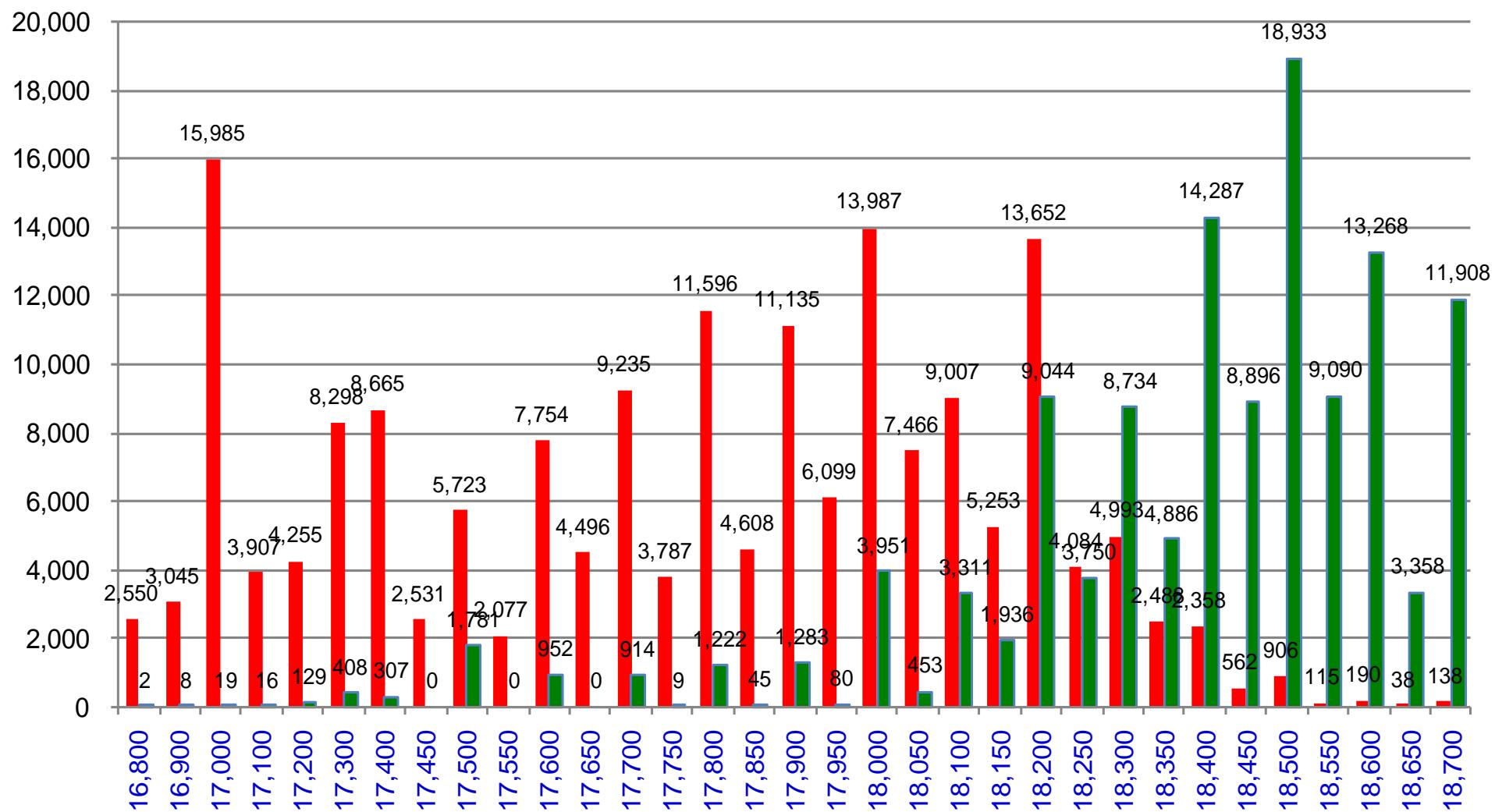


更新日期：2022年2月11日 資料來源：台灣期貨交易所 · 凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：210,685

■ 週選 CALL OI 總額：161,571



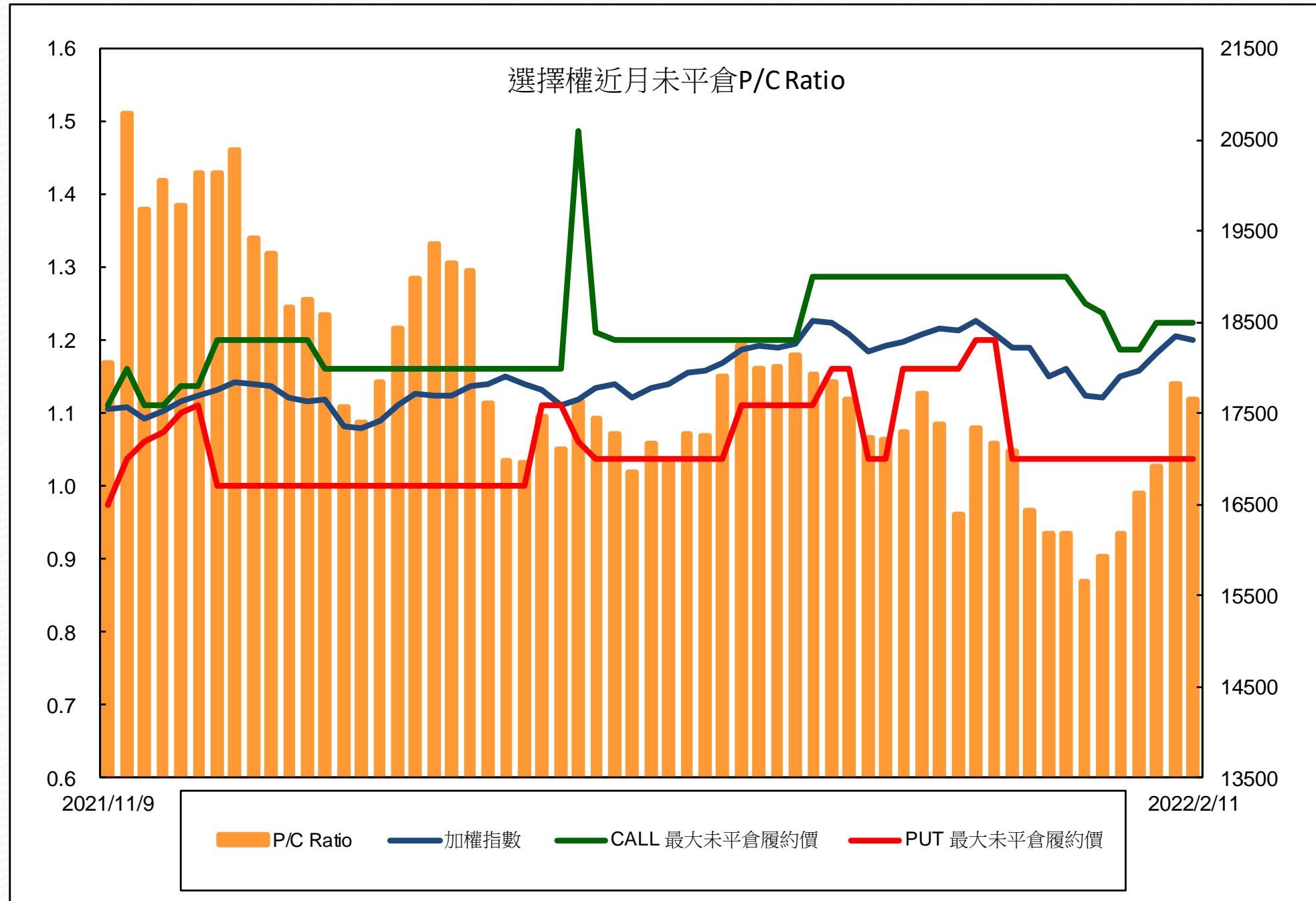
更新日期：2022年2月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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10日	53,456	41,239	12,217
	2月11日	62,985	48,848	14,137
Put	2月10日	51,282	43,062	8,220
	2月11日	57,169	50,605	6,564

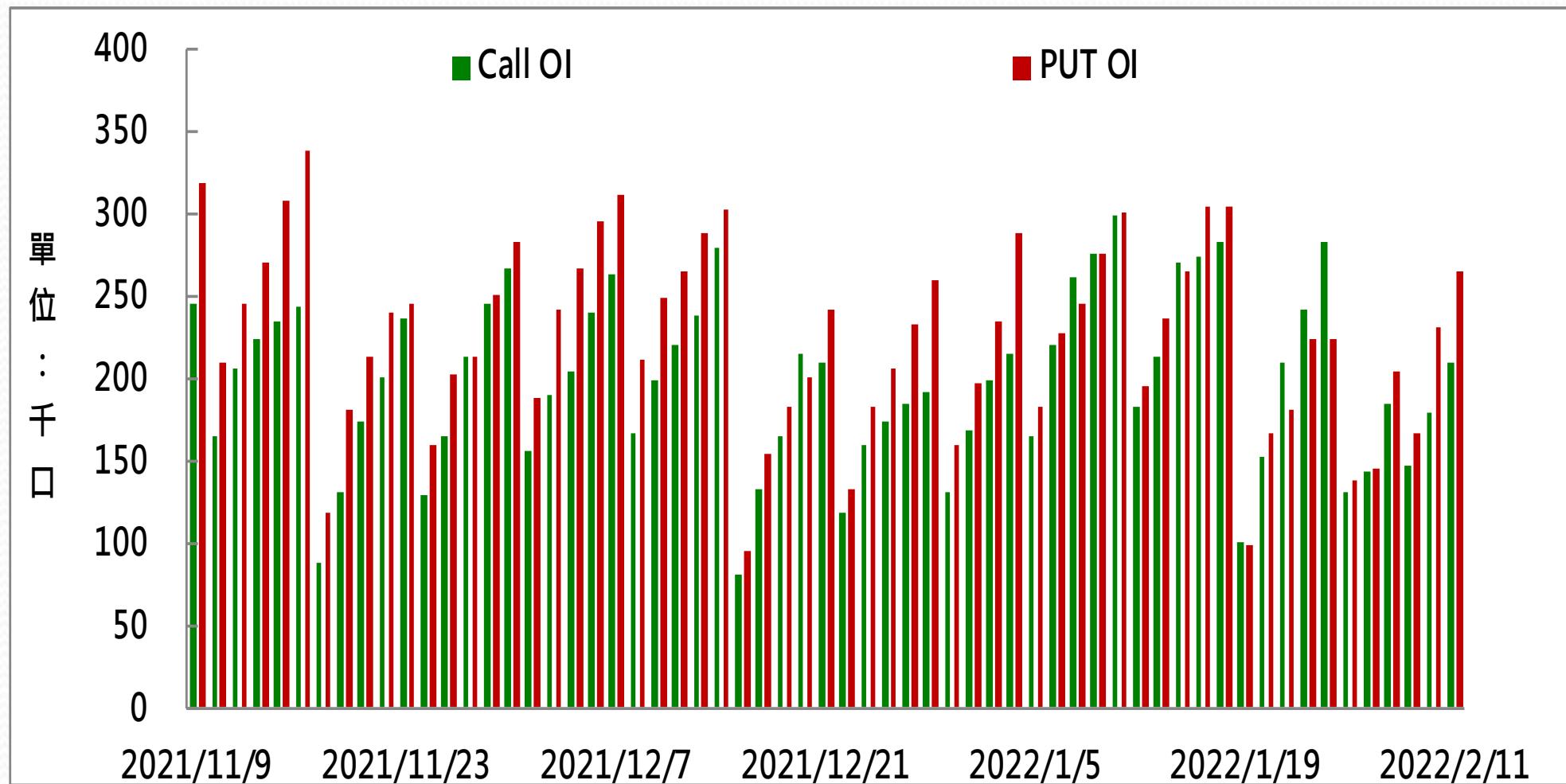
更新日期：2022年2月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年2月11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11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11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