

台指選擇權OI匯報

日期 : 2022/2/14			結算日 : 2022/2/16			日期 : 2022/2/14			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	2,373	-177		0	0	15,900	289	123	
0	8	16,900	3,184	139		0	41	16,000	3,331	444	
-4	15	17,000	15,436	-549		5	5	16,100	459	108	
0	16	17,100	3,739	-168		0	7	16,200	950	247	
0	129	17,200	4,593	338		0	12	16,300	1,063	454	
0	408	17,300	7,379	-919		0	25	16,400	1,757	527	
0	307	17,400	9,548	883		4	7	16,500	1,412	576	
0	0	17,450	2,975	444		0	14	16,600	1,782	516	
-15	1,766	17,500	8,491	2,768	※	0	0	16,700	1,470	236	
4	4	17,550	2,595	518		0	61	16,800	2,055	310	
30	982	17,600	7,420	-334		0	2	16,900	1,716	391	
5	5	17,650	4,336	-160		2	98	17,000	6,669	58	
-50	864	17,700	8,788	-447		0	12	17,100	588	-164	
38	47	17,750	5,139	1,352		1	130	17,200	1,813	343	
260	1,482	17,800	10,471	-1,125		2	12	17,300	2,004	-937	
492	537	17,850	6,092	1,484		2	59	17,400	1,284	199	
739	2,022	17,900	10,247	-888		1	39	17,500	2,173	-206	
1,319	1,399	17,950	5,805	-294		2	599	17,600	1,288	19	
4,210	8,161	18,000	11,080	-2,907		-36	252	17,700	714	43	
3,253	3,706	18,050	5,285	-2,181		21	719	17,800	1,014	63	
5,599	8,910	18,100	6,318	-2,689		67	519	17,900	1,143	149	
4,102	6,038	18,150	4,014	-1,239		341	1,865	18,000	1,880	225	
※	9,333	18,377	18,200	10,158	-3,494	207	1,585	18,100	791	179	
4,945	8,695	18,250	2,628	-1,456		783	1,884	18,200	661	-64	
8,066	16,800	18,300	3,343	-1,650		764	1,465	18,300	475	65	
4,809	9,695	18,350	1,467	-1,021		491	1,597	18,400	321	3	
2,377	16,664	18,400	2,399	41		781	3,152	18,500	193	-109	
-1,099	7,797	18,450	508	-54		203	2,909	18,600	60	-2	
-2,179	16,754	18,500	877	-29		184	2,221	18,700	20	-12	
-4,524	4,566	18,550	181	66		496	3,215	18,800	14	3	
-871	12,397	18,600	184	-6		-255	2,340	18,900	6	-1	
672	4,030	18,650	32	-6		586	4,473	19,000	4	0	
-2,246	9,662	18,700	70	-68		-45	2,252	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
38,474	200,045	0.9842	196,893	-13,792		5,936	45,346	1.0909	49,466	5,330	
昨日 P/C	1.3040	今日增減變化	-0.3197			昨日 P/C	1.1199	今日增減變化	-0.0291		

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14日
單位：千元	臺股期貨				電子期貨			
外資	買方金額 75,109,608	賣方金額 150,991,851	淨部位 -75,882,243	淨部位增減 -6,457,660	買方金額 2,672,919	賣方金額 3,258,888	淨部位 -585,969	淨部位增減 -47,033
投信	買方金額 48,053,757	賣方金額 52,705,349	淨部位 -4,651,592	淨部位增減 -3,535,699	買方金額 2,195,226	賣方金額 0	淨部位 2,195,226	淨部位增減 -45,430
自營商	買方金額 78,441,763	賣方金額 18,387,150	淨部位 60,054,613	淨部位增減 2,516,827	買方金額 1,983,211	賣方金額 1,715,373	淨部位 267,838	淨部位增減 -265,689
	金融期貨				非金電期貨			
外資	買方金額 1,046,567	賣方金額 4,558,304	淨部位 -3,511,737	淨部位增減 6,831	買方金額 21,605	賣方金額 26,590	淨部位 -4,985	淨部位增減 -20,062
投信	買方金額 23,395	賣方金額 0	淨部位 23,395	淨部位增減 -234	買方金額 1,661	賣方金額 0	淨部位 1,661	淨部位增減 -14
自營商	買方金額 643,992	賣方金額 151,098	淨部位 492,894	淨部位增減 -54,103	買方金額 141,248	賣方金額 199,396	淨部位 -58,148	淨部位增減 27,279

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14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	43,691	23,670	20,021	4,536	69,722	30,442	39,280	5,015
投信	0	0	0	0	0	58	-58	0
自營商	57,258	59,013	-1,755	-15,892	58,758	45,096	13,662	7,098
特定法人(週)	--	--	--	--	--	--	--	--
特定法人(近月)	19,323	8,321	11,002	5,873	8,139	36,143	-28,004	4,582
特定法人(全月)	29,487	10,421	19,066	4,057	14,401	55,148	-40,747	-2,760
十大交易人(週)	--	--	--	--	--	--	--	--
十大交易人(近月)	55,375	58,770	-3,395	-12,616	53,745	71,894	-18,149	2,036
十大交易人(全月)	88,019	71,070	16,949	-9,333	74,741	108,460	-33,719	-1,434
全市場未沖銷(近月)			200,045	38,474			196,893	-13,792
全市場未沖銷(全月)			254,824	44,659			259,555	-6,305

更新日期：2022年2月14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	18300	買權OI最大量	18200
	賣權成交最大量	18000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	13.15%	較前一交易日	+0.00%
	買權隱含波動率	9.62%	較前一交易日	+0.00%
	賣權隱含波動率	15.92%	較前一交易日	+0.00%
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	800	賣權OI最大量	850
金融選擇權	買權成交最大量	1940	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1720	賣權OI最大量	1640

更新日期：2022年2月14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	18800	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	+0.00%
	買權隱含波動率	11.63%	較前一交易日	+0.00%
	賣權隱含波動率	21.84%	較前一交易日	+0.00%
	成交量P/C_Ratio值	1.196	較前一交易日	-0.21
	未平倉P/C_Ratio值	1.091	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	800	賣權OI最大量	850
金融選擇權	買權成交最大量	1940	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1720	賣權OI最大量	1640

更新日期：2022年2月14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

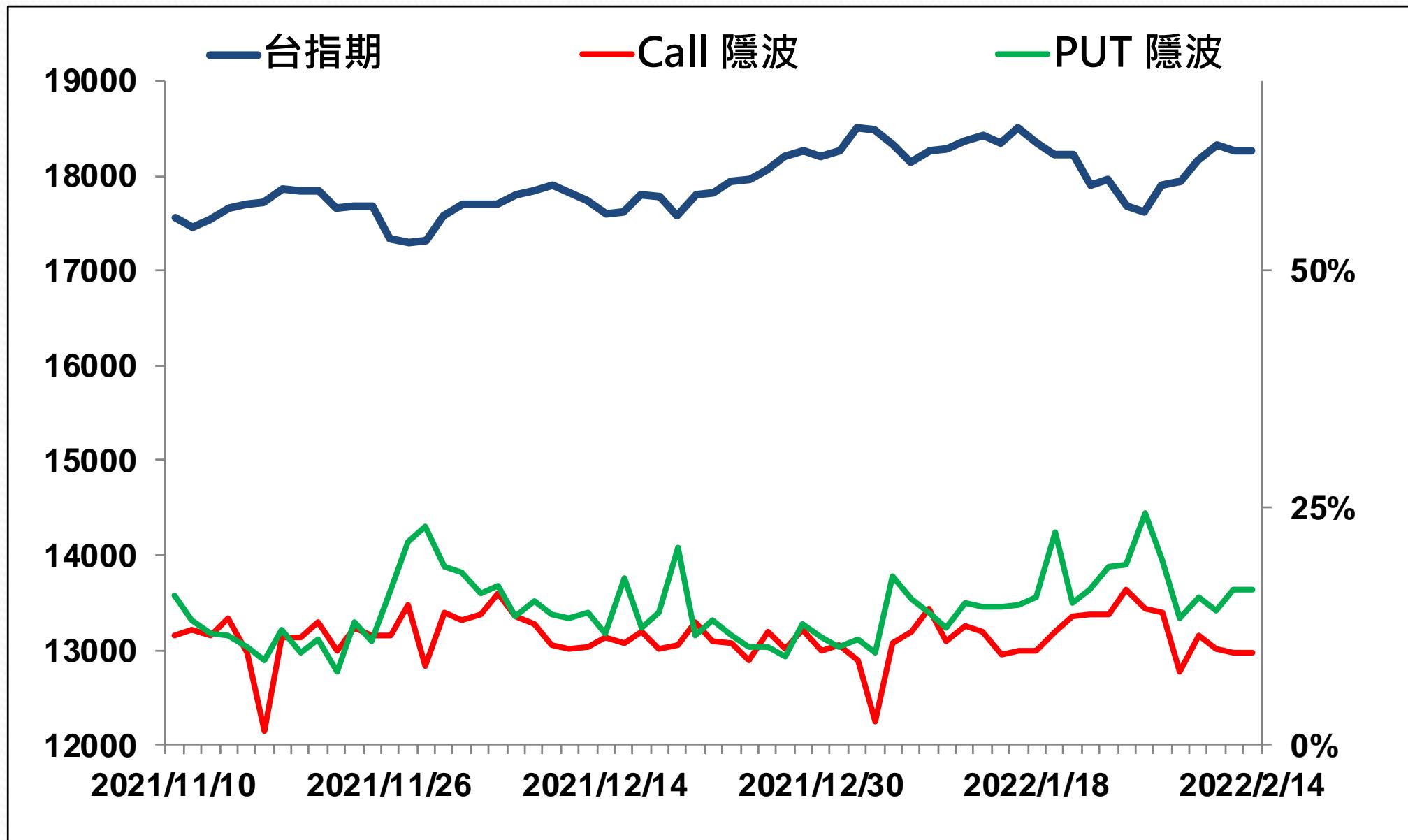
— 臺指選擇權波動率指數



更新日期：2022年2月14日

資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

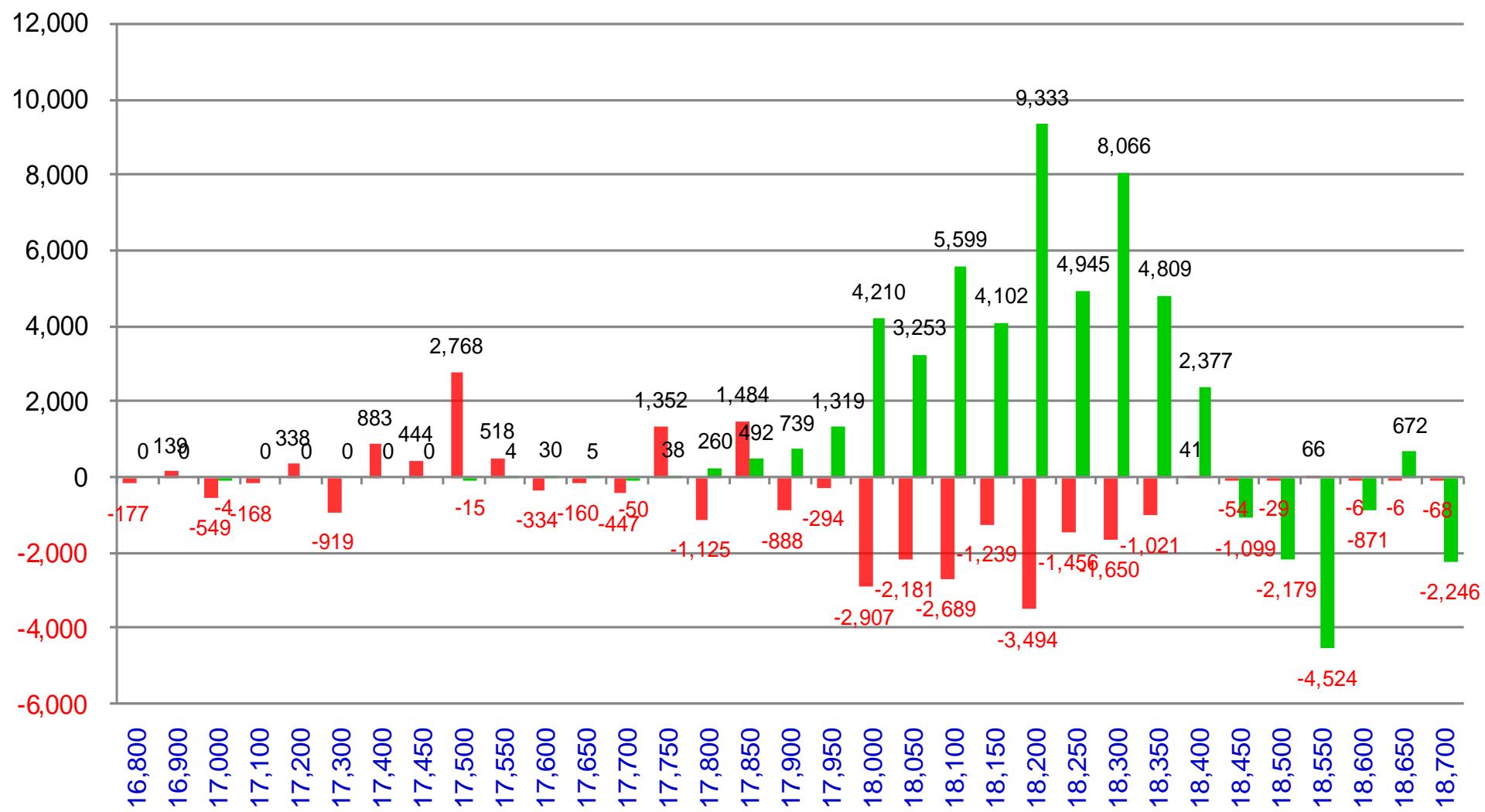
台指近月隱含波動度



更新日期：2022年2月14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 : 13,792 ■ 週選 CALL OI 變化 : 38,474

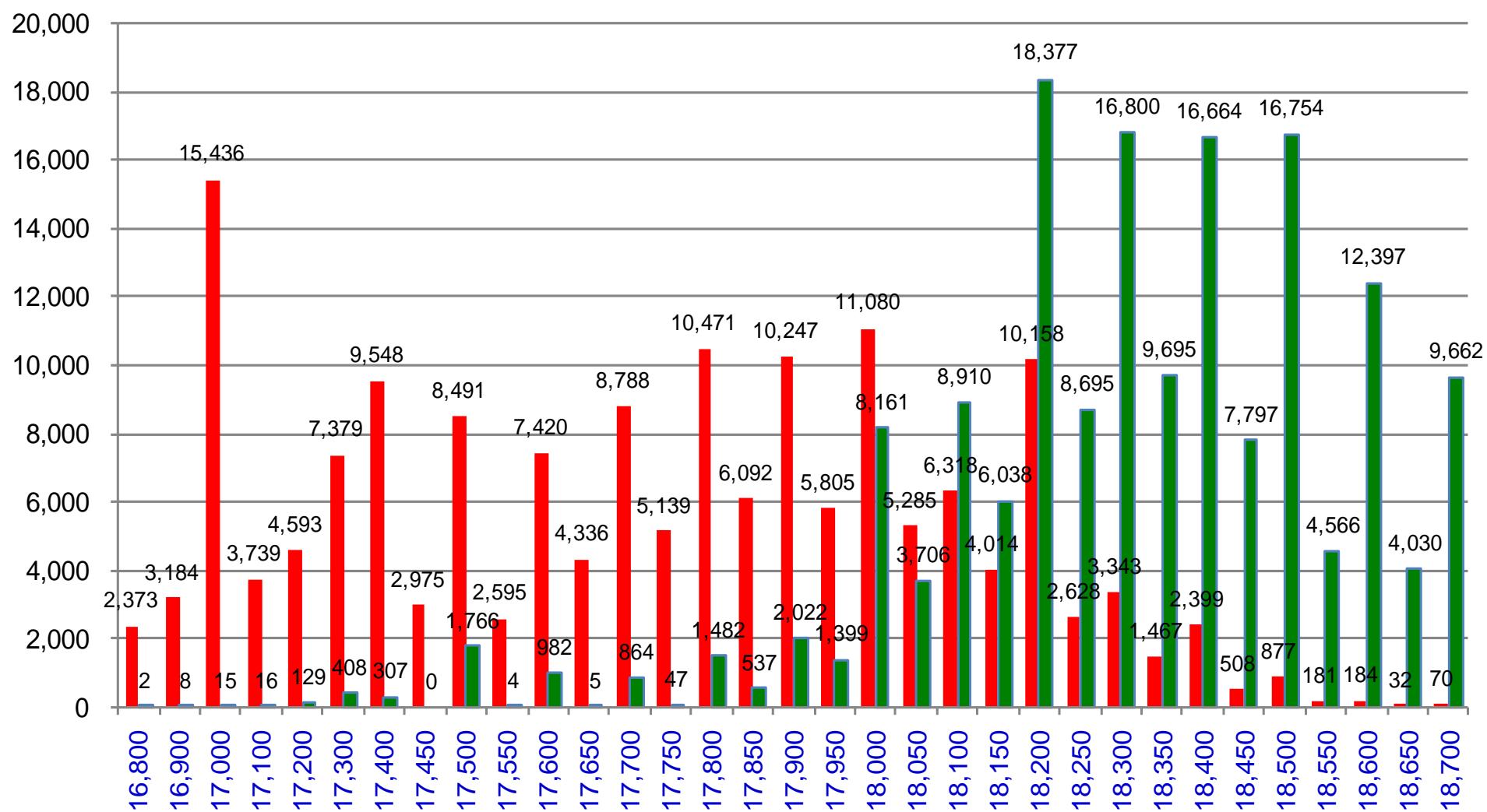


更新日期：2022年2月14日 資料來源：台灣期貨交易所 · 凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：196,893

■ 週選 CALL OI 總額：200,045



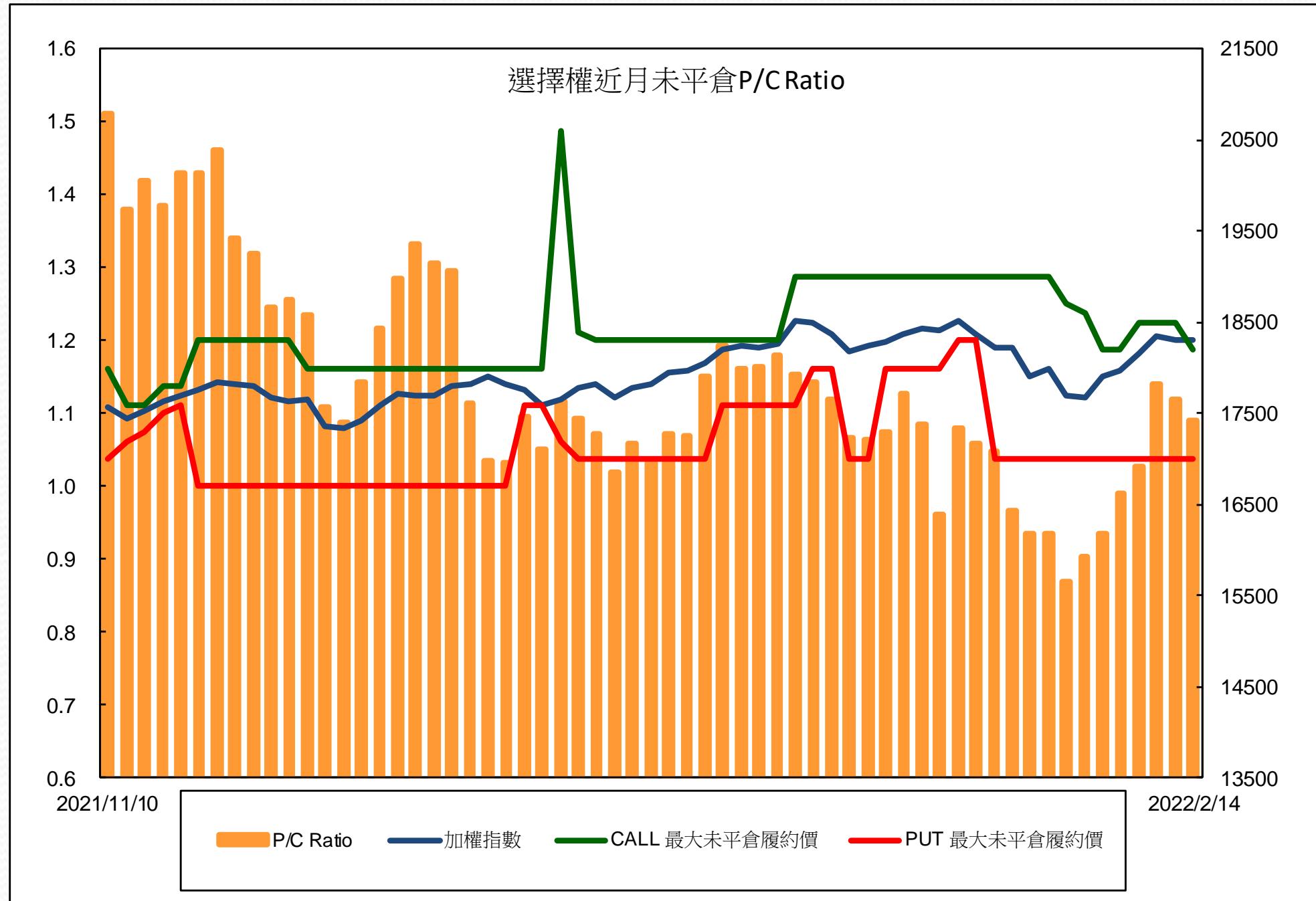
更新日期：2022年2月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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11日	62,985	48,848	14,137
	2月14日	57,258	59,013	-1,755
Put	2月11日	57,169	50,605	6,564
	2月14日	58,758	45,096	13,662

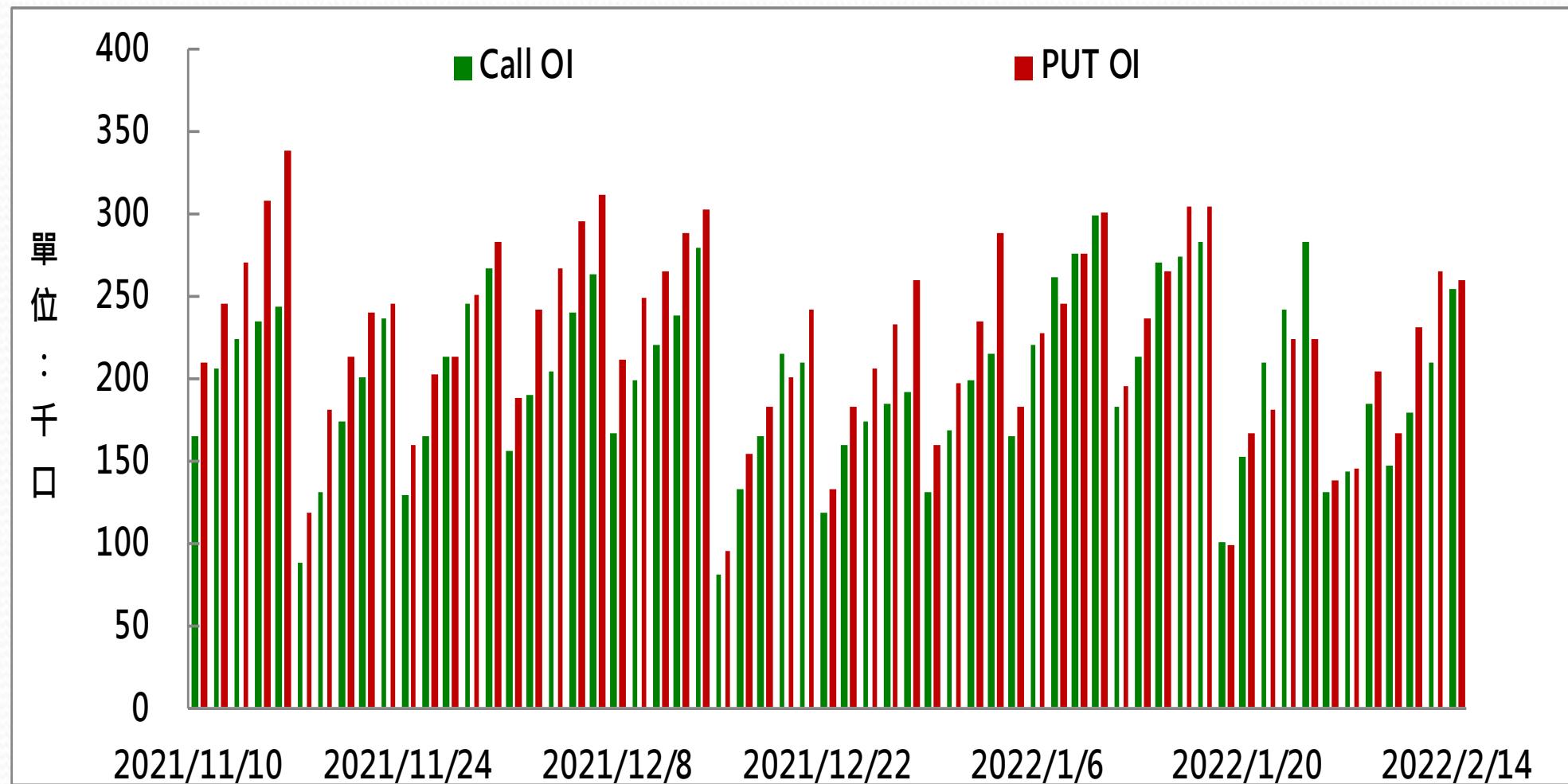
更新日期：2022年2月14日 資料來源：台灣期貨交易所 · 凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年2月14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14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14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