

台指選擇權OI匯報

日期：2022/2/15 結算日：2022/2/16					日期：2022/2/15 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
-5	10	17,000	16,054	618	0	7	16,500	1,760	348
-1	15	17,100	4,008	269	0	14	16,600	2,043	261
0	129	17,200	4,850	257	0	0	16,700	1,726	256
0	408	17,300	7,110	-269	0	61	16,800	2,505	450
1	308	17,400	9,630	82	5	7	16,900	1,963	247
5	5	17,450	3,225	250	0	98	17,000	7,253	584
-12	1,754	17,500	8,583	92	0	12	17,100	1,239	651
0	4	17,550	3,080	485	0	130	17,200	1,953	140
-23	959	17,600	7,492	72	-2	10	17,300	2,012	8
22	27	17,650	5,394	1,058	2	61	17,400	1,378	94
3	867	17,700	9,689	901	15	54	17,500	3,073	900
136	183	17,750	6,224	1,085	12	611	17,600	1,356	68
302	1,784	17,800	14,492	4,021	-23	229	17,700	864	150
182	719	17,850	6,416	324	-12	707	17,800	1,310	296
1,396	3,418	17,900	14,971	4,724	94	613	17,900	1,350	207
2,859	4,258	17,950	8,581	2,776	152	2,017	18,000	2,243	363
2,788	10,949	18,000	11,895	815	682	2,267	18,100	777	-14
※ 5,222	8,928	18,050	6,687	1,402	582	2,466	18,200	746	85
4,425	13,335	18,100	5,586	-732	597	2,062	18,300	517	42
2,889	8,927	18,150	3,444	-570	633	2,230	18,400	321	0
1,018	19,395	18,200	8,660	-1,498	698	3,850	18,500	190	-3
1,628	10,323	18,250	2,208	-420	375	3,284	18,600	70	10
-249	16,551	18,300	2,977	-366	249	2,470	18,700	17	-3
-3,006	6,689	18,350	1,361	-106	501	3,716	18,800	123	109
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
5,045	205,090	1.0308	211,417	14,524	9,117	54,463	1.0886	59,287	9,821
昨日 P/C	0.9842	今日增減變化		0.0466	昨日 P/C	1.0909	今日增減變化		-0.0023

更新日期：2022年2月15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15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	83,179,772	141,891,919	-58,712,147	17,170,096	2,260,377	2,889,706	-629,329	-43,360
投信	47,772,081	53,172,385	-5,400,304	-748,712	2,188,786	0	2,188,786	-6,440
自營商	69,614,968	18,699,031	50,915,937	-9,138,676	2,074,095	1,597,844	476,251	208,413
	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	998,785	4,554,101	-3,555,316	-43,579	4,985	41,538	-36,553	-31,568
投信	23,353	0	23,353	-42	1,661	0	1,661	0
自營商	650,316	233,567	416,749	-76,145	176,110	206,012	-29,902	28,246

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15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	45,675	26,176	19,499	-522	76,585	32,210	44,375	5,095
投信	0	0	0	0	0	58	-58	0
自營商	62,919	57,048	5,871	7,626	58,417	59,371	-954	-14,616
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	19,864	8,321	11,543	541	8,139	39,265	-31,126	-3,122
特定法人(全月)	33,693	10,421	23,272	4,206	15,436	61,574	-46,138	-5,391
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	55,291	52,271	3,020	6,415	65,045	71,785	-6,740	11,409
十大交易人(全月)	94,229	65,792	28,437	11,488	89,869	113,142	-23,273	10,446
全市場未沖銷(近月)			205,090	5,045			211,417	14,524
全市場未沖銷(全月)			269,294	14,470			285,438	25,883

更新日期：2022年2月15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	18100	買權OI最大量	18200
	賣權成交最大量	17900	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	14.56%	較前一交易日	+1.41%
	買權隱含波動率	13.54%	較前一交易日	+3.92%
	賣權隱含波動率	15.50%	較前一交易日	-0.42%
電子選擇權	買權成交最大量	880	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	1680	賣權OI最大量	1640

更新日期：2022年2月15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	18500	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	20.44%	較前一交易日	-2.34%
	買權隱含波動率	14.45%	較前一交易日	+2.82%
	賣權隱含波動率	25.22%	較前一交易日	+3.38%
	成交量P/C_Ratio值	1.136	較前一交易日	-0.06
	未平倉P/C_Ratio值	1.089	較前一交易日	-0.00
電子選擇權	買權成交最大量	880	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	1680	賣權OI最大量	1640

更新日期：2022年2月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

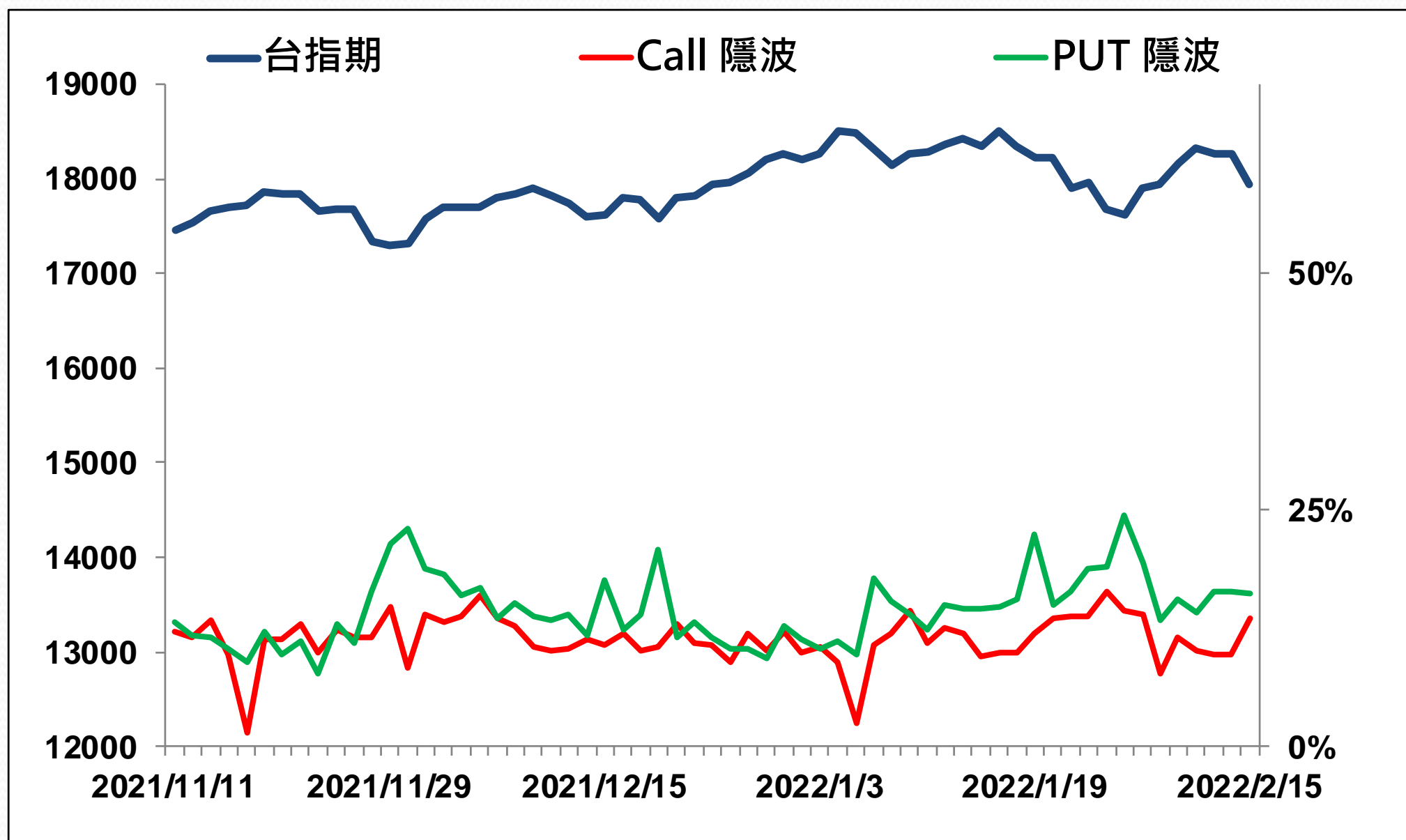
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2022年2月15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

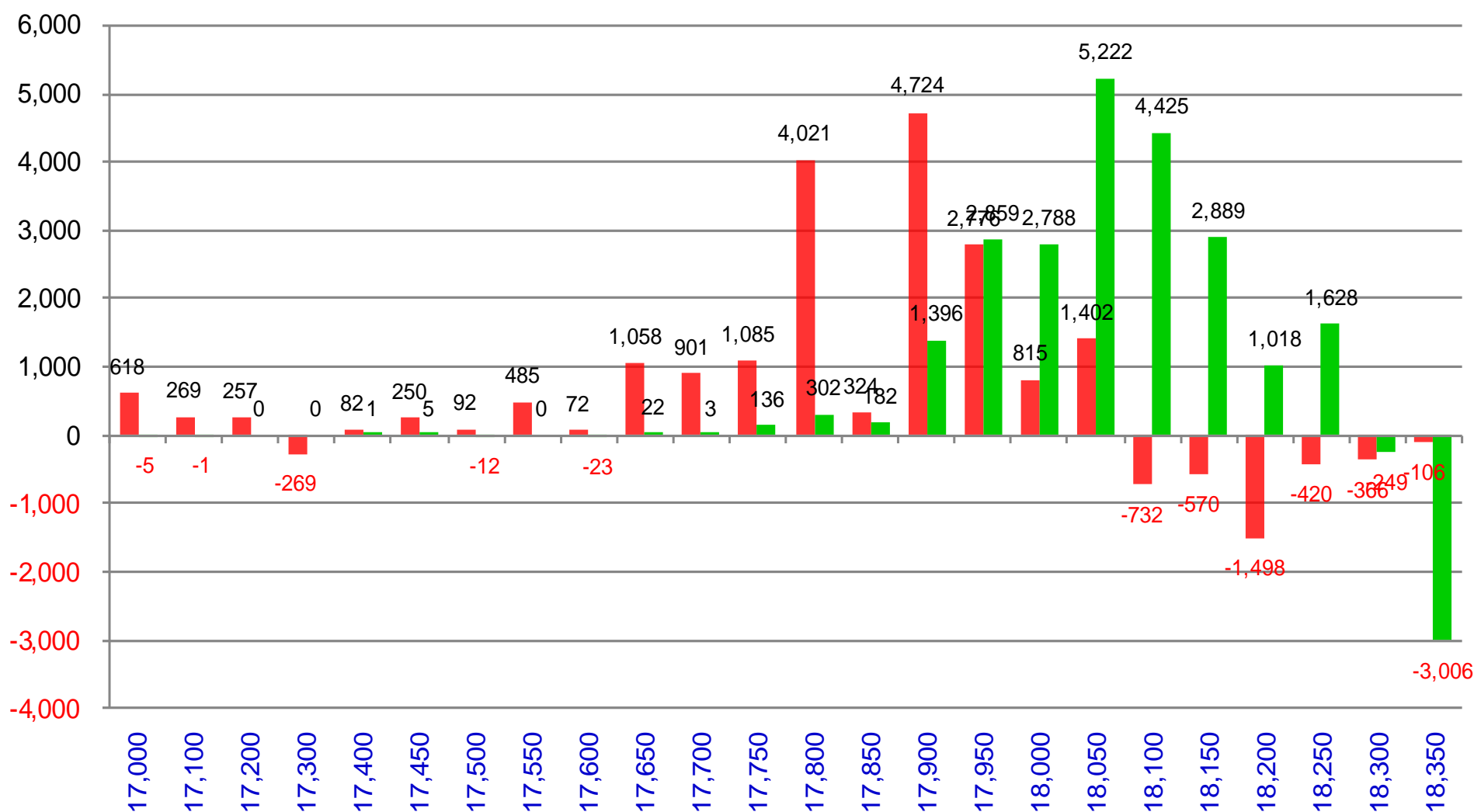


更新日期：2022年2月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：14,524

週選 CALL OI 變化：5,045

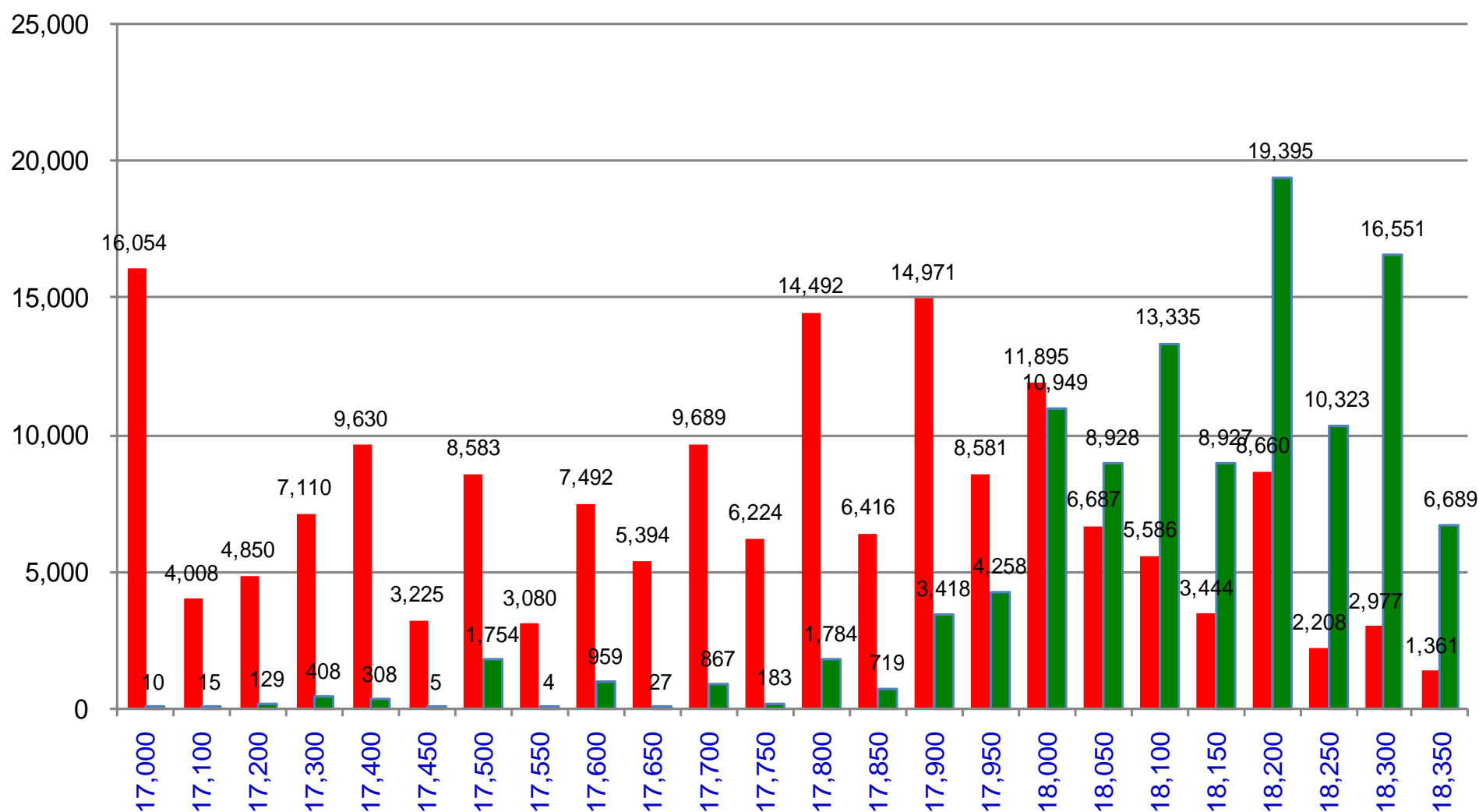


更新日期：2022年2月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：211,417

週選 CALL OI 總額：205,090



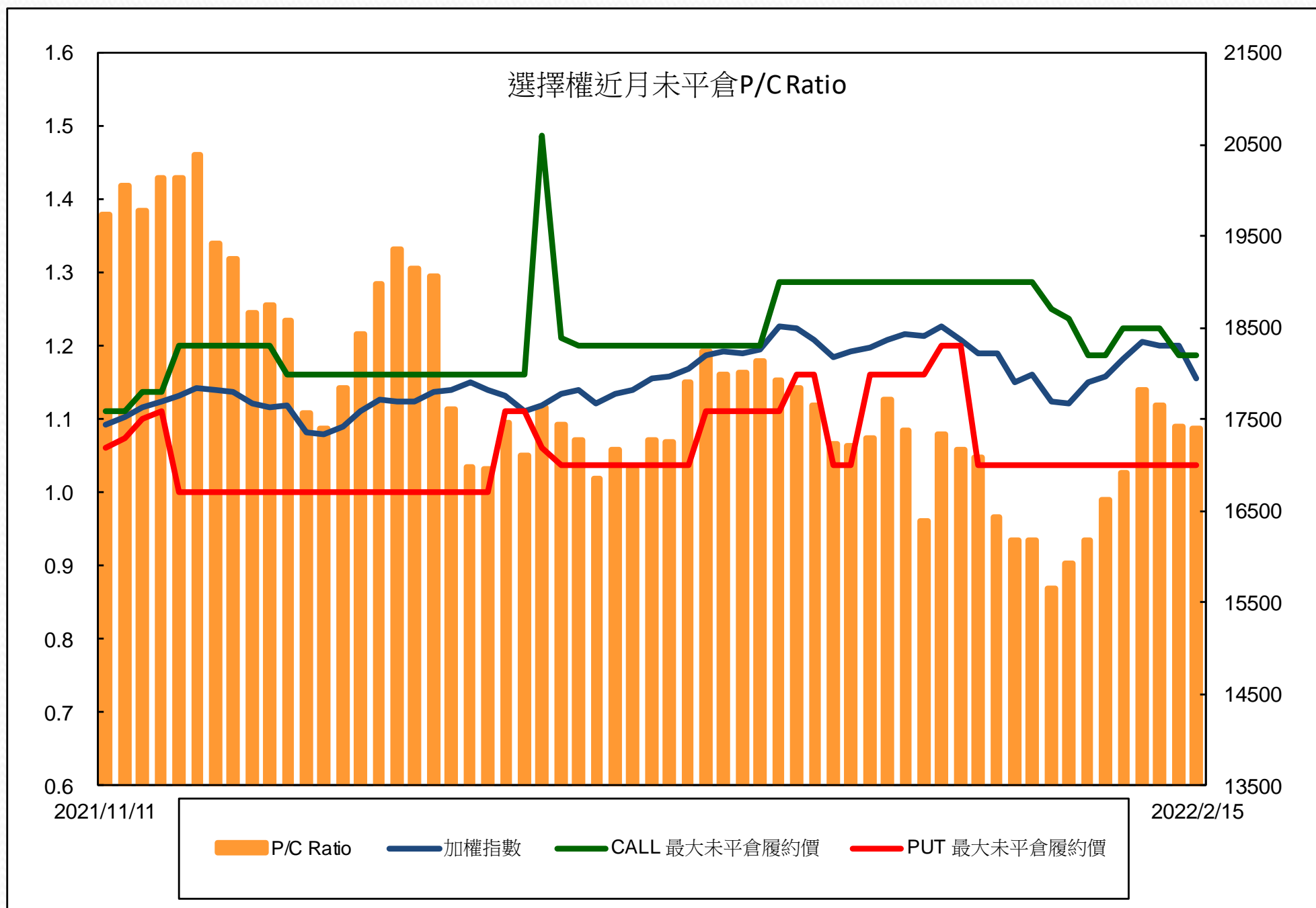
更新日期：2022年2月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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14日	57,258	59,013	-1,755
	2月15日	62,919	57,048	5,871
Put	2月14日	58,758	45,096	13,662
	2月15日	58,417	59,371	-954

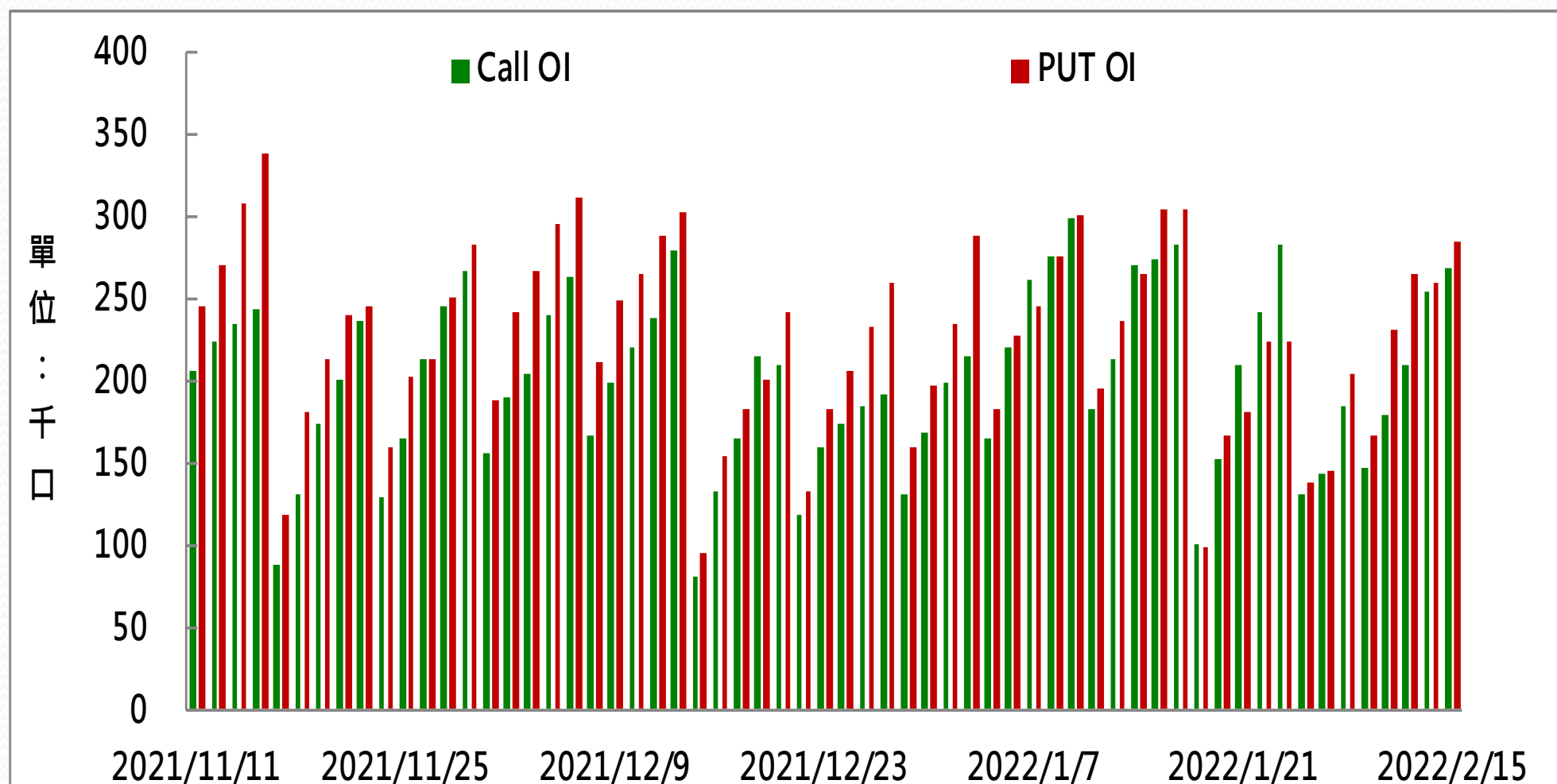
更新日期：2022年2月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年2月15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15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15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