

台指選擇權OI匯報

日期：2022/2/16 結算日：2022/2/23					日期：2022/2/16 結算日：2022/3/16				
202202W4					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	0	16,800	3,520	3,520 ※	11	11	15,900	417	47
0	0	16,900	1,185	1,185	0	41	16,000	3,806	334
0	0	17,000	1,236	1,236	0	8	16,100	519	72
0	0	17,100	190	190	0	12	16,200	1,360	78
0	0	17,200	899	899	0	12	16,300	1,809	532
1	1	17,300	1,463	1,463	0	25	16,400	2,520	233
0	0	17,400	1,005	1,005	0	7	16,500	2,189	429
0	0	17,450	782	782	0	14	16,600	2,221	178
1	1	17,500	1,605	1,605	0	0	16,700	1,821	95
0	0	17,550	814	814	0	61	16,800	2,585	80
8	8	17,600	1,029	1,029	-2	5	16,900	2,171	208
0	0	17,650	779	779	0	98	17,000	7,908	655
4	4	17,700	990	990	2	14	17,100	1,590	351
8	8	17,750	713	713	1	131	17,200	2,246	293
65	65	17,800	1,237	1,237	6	16	17,300	2,677	665
1	1	17,850	711	711	-3	58	17,400	1,964	586
36	36	17,900	1,327	1,327	2	56	17,500	3,396	323
3	3	17,950	832	832	-5	606	17,600	1,913	557
58	58	18,000	1,632	1,632	7	236	17,700	1,079	215
53	53	18,050	707	707	40	747	17,800	1,593	283
280	280	18,100	742	742	43	656	17,900	1,443	93
426	426	18,150	607	607	-24	1,993	18,000	3,398	1,155 ※
1,082	1,082	18,200	999	999	620	2,887	18,100	1,243	466
993	993	18,250	322	322	402	2,868	18,200	853	107
1,325	1,325	18,300	242	242	-143	1,919	18,300	688	171
895	895	18,350	154	154	209	2,439	18,400	431	110
2,025	2,025	18,400	126	126	129	3,979	18,500	233	43
1,611	1,611	18,450	40	40	990	4,274	18,600	104	34
※ 3,616	3,616	18,500	49	49	※ 1,355	3,825	18,700	21	4
2,705	2,705	18,600	8	8	1,216	4,932	18,800	125	2
2,694	2,694	18,700	14	14	1,305	4,208	18,900	10	2
1,475	1,475	18,800	4	4	616	5,504	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
21,210	21,210	1.5579	33,044	33,044	9,329	63,792	1.1038	70,414	11,127
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化	1.5579		昨日 P/C	1.0886	今日增減變化	0.0152	

資料日期：2022年2月16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16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	71,872,184	127,999,508	-56,127,324	2,584,823	2,203,658	1,366,826	836,832	1,466,161
投信	46,685,045	52,153,188	-5,468,143	-67,839	561,375	0	561,375	-1,627,411
自營商	63,616,574	12,620,939	50,995,635	79,698	1,502,811	930,976	571,835	95,584
	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	1,073,477	4,214,390	-3,140,913	414,403	6,748	25,307	-18,559	17,994
投信	23,494	0	23,494	141	1,687	0	1,687	26
自營商	569,172	41,566	527,606	110,857	136,655	118,097	18,558	48,460

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16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	17,942	11,252	6,690	-12,809	46,762	13,203	33,559	-10,816
投信	0	0	0	0	0	68	-68	-10
自營商	43,864	24,478	19,386	13,515	33,063	33,254	-191	763
特定法人(週)	0	612	-612	---	0	11,347	-11,347	---
特定法人(近月)	13,019	9,987	3,032	---	8,102	23,001	-14,899	---
特定法人(全月)	13,226	10,086	3,140	-20,132	7,254	41,887	-34,633	11,505
十大交易人(週)	7,897	9,354	-1,457	---	18,731	21,458	-2,727	---
十大交易人(近月)	43,880	26,351	17,529	---	29,599	43,013	-13,414	---
十大交易人(全月)	58,283	33,750	24,533	-3,904	51,004	75,534	-24,530	-1,257
全市場未沖銷(近月)			63,792	---			70,414	---
全市場未沖銷(全月)			95,054	-174,240			119,398	-166,040

更新日期：2022年2月16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02W4週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	18500	買權OI最大量	18500
	賣權成交最大量	16800	賣權OI最大量	16800
	整體隱含波動率	16.15%	較前一交易日	+1.59%
	買權隱含波動率	12.88%	較前一交易日	-0.66%
	賣權隱含波動率	18.94%	較前一交易日	+3.44%
電子選擇權	買權成交最大量	575	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	870	賣權OI最大量	850
金融選擇權	買權成交最大量	1820	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1740	賣權OI最大量	1740

更新日期：2022年2月16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	18600	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	17.83%	較前一交易日	+2.61%
	買權隱含波動率	13.32%	較前一交易日	-1.13%
	賣權隱含波動率	21.97%	較前一交易日	-3.25%
	成交量P/C_Ratio值	1.071	較前一交易日	-0.07
	未平倉P/C_Ratio值	1.104	較前一交易日	+0.02
電子選擇權	買權成交最大量	645	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	870	賣權OI最大量	850
金融選擇權	買權成交最大量	1820	買權OI最大量	1920
	賣權成交最大量	1740	賣權OI最大量	1740

更新日期：2022年2月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

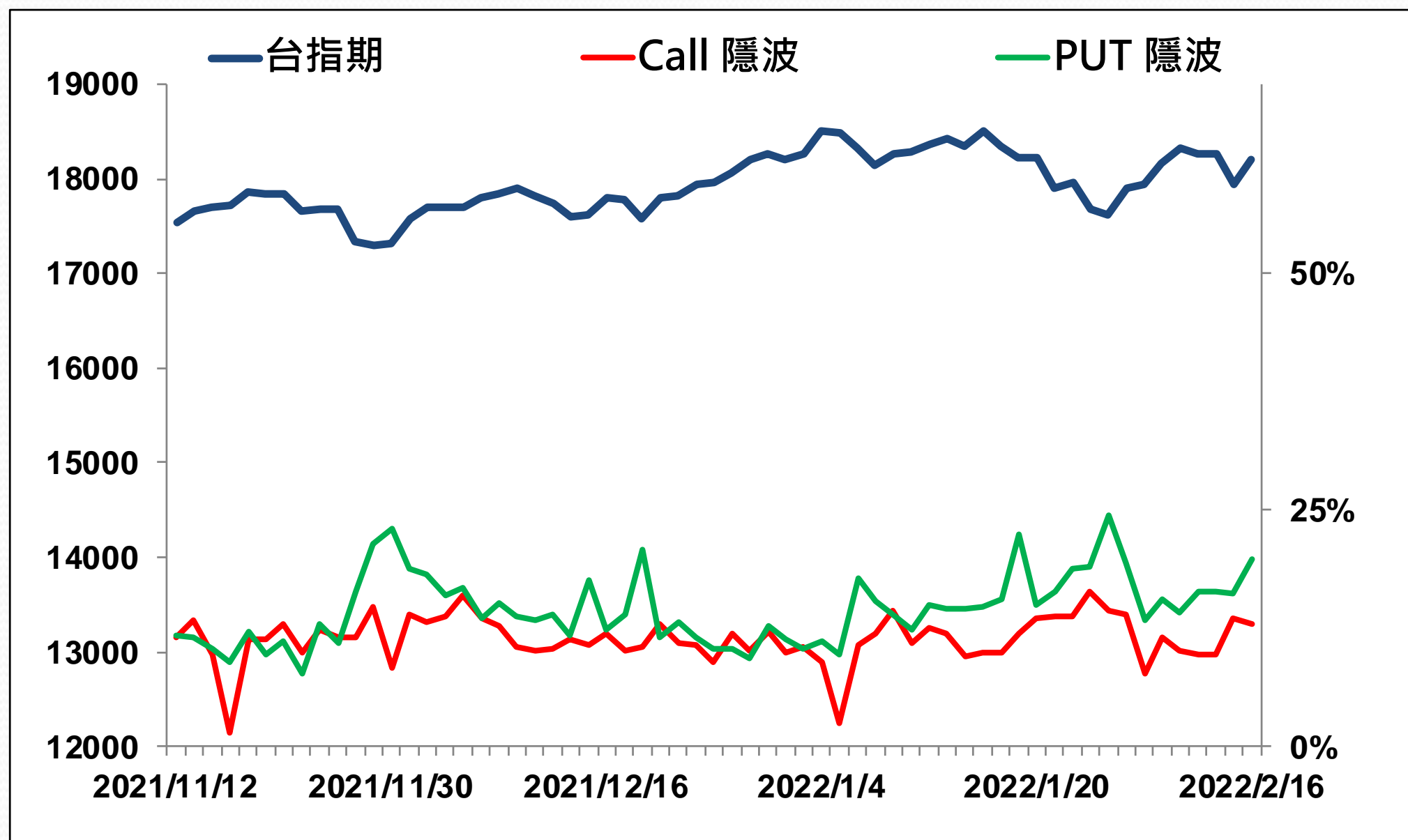
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



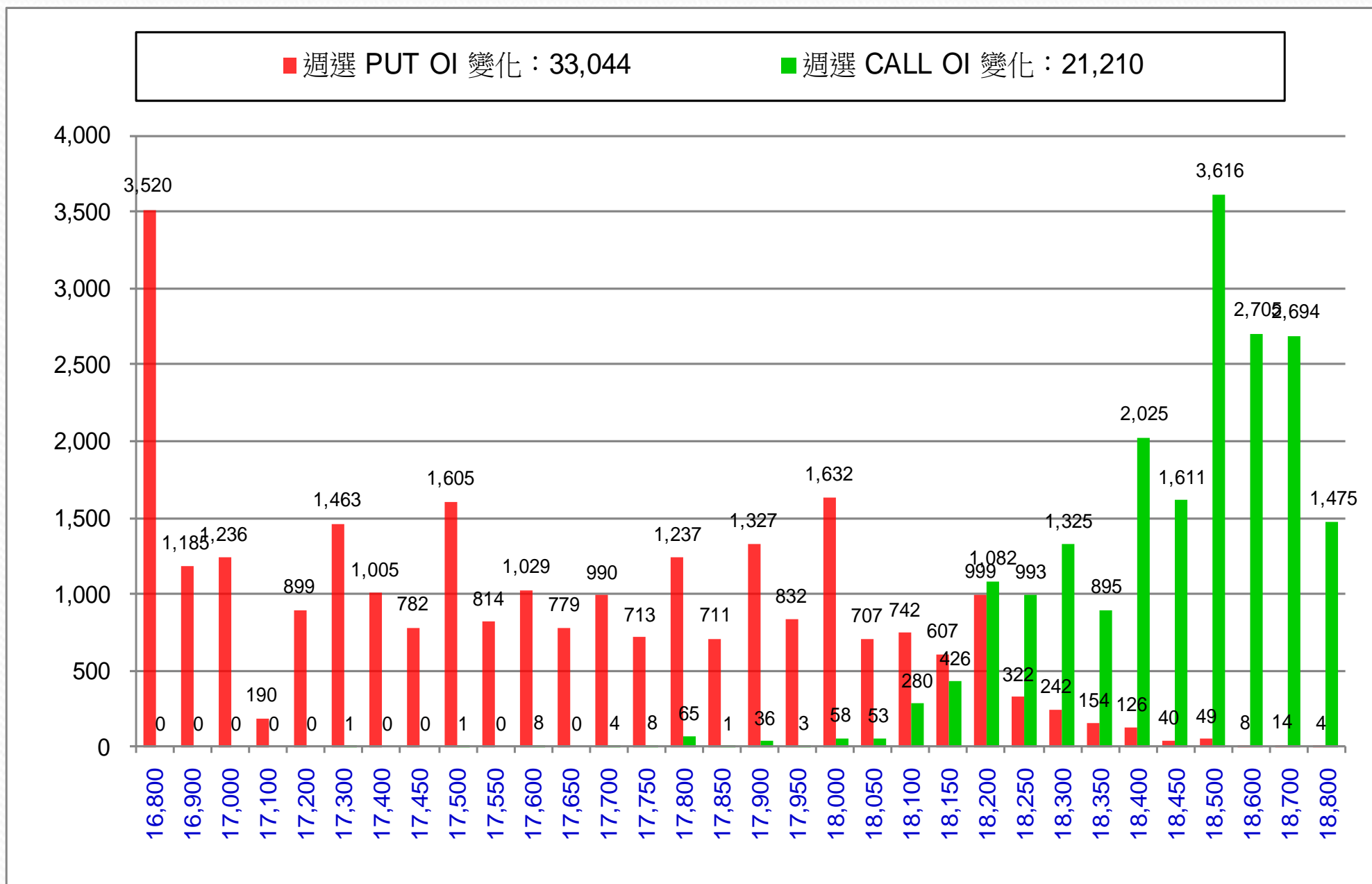
更新日期：2022年2月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年2月16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

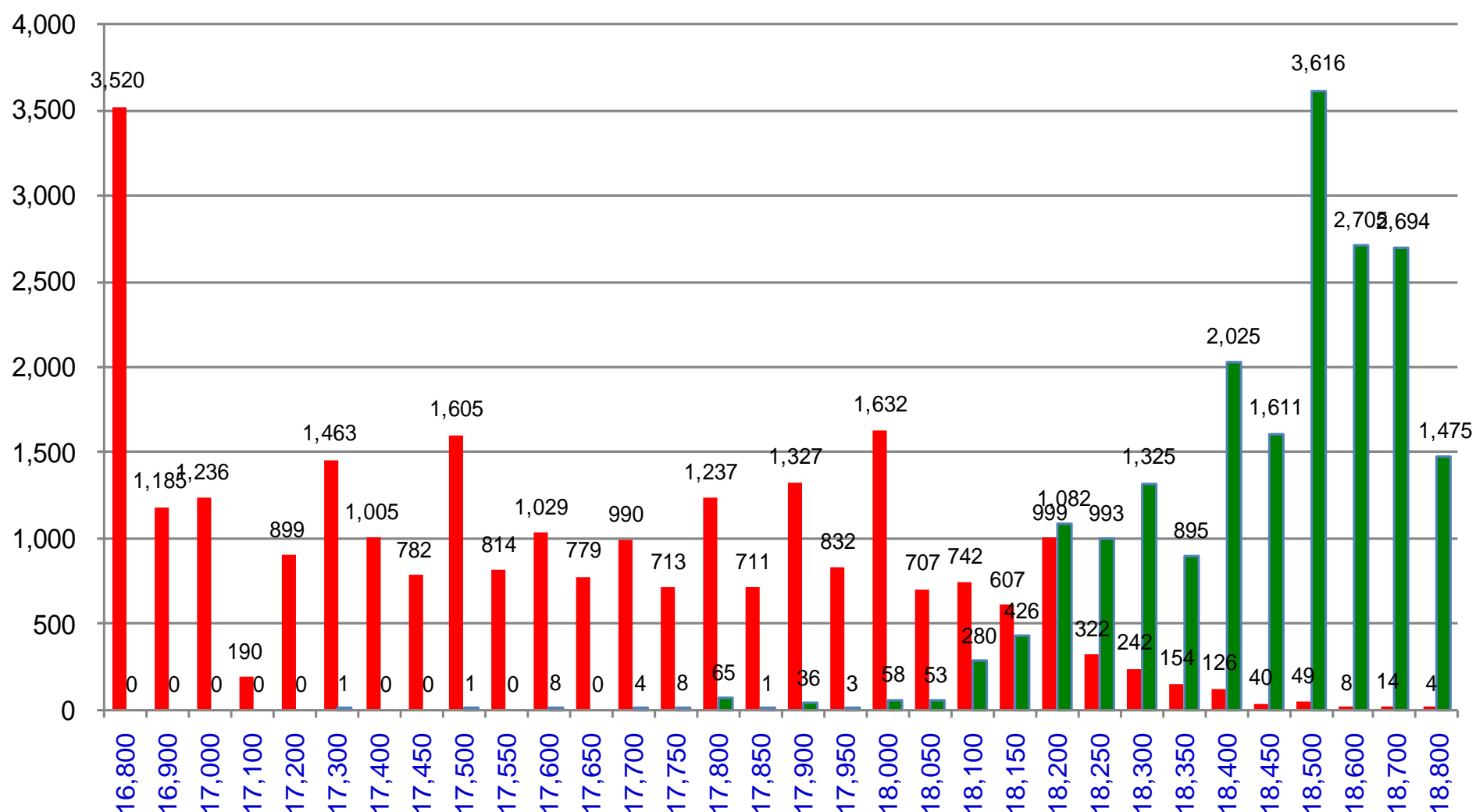


更新日期：2022年2月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：33,044

週選 CALL OI 總額：21,210



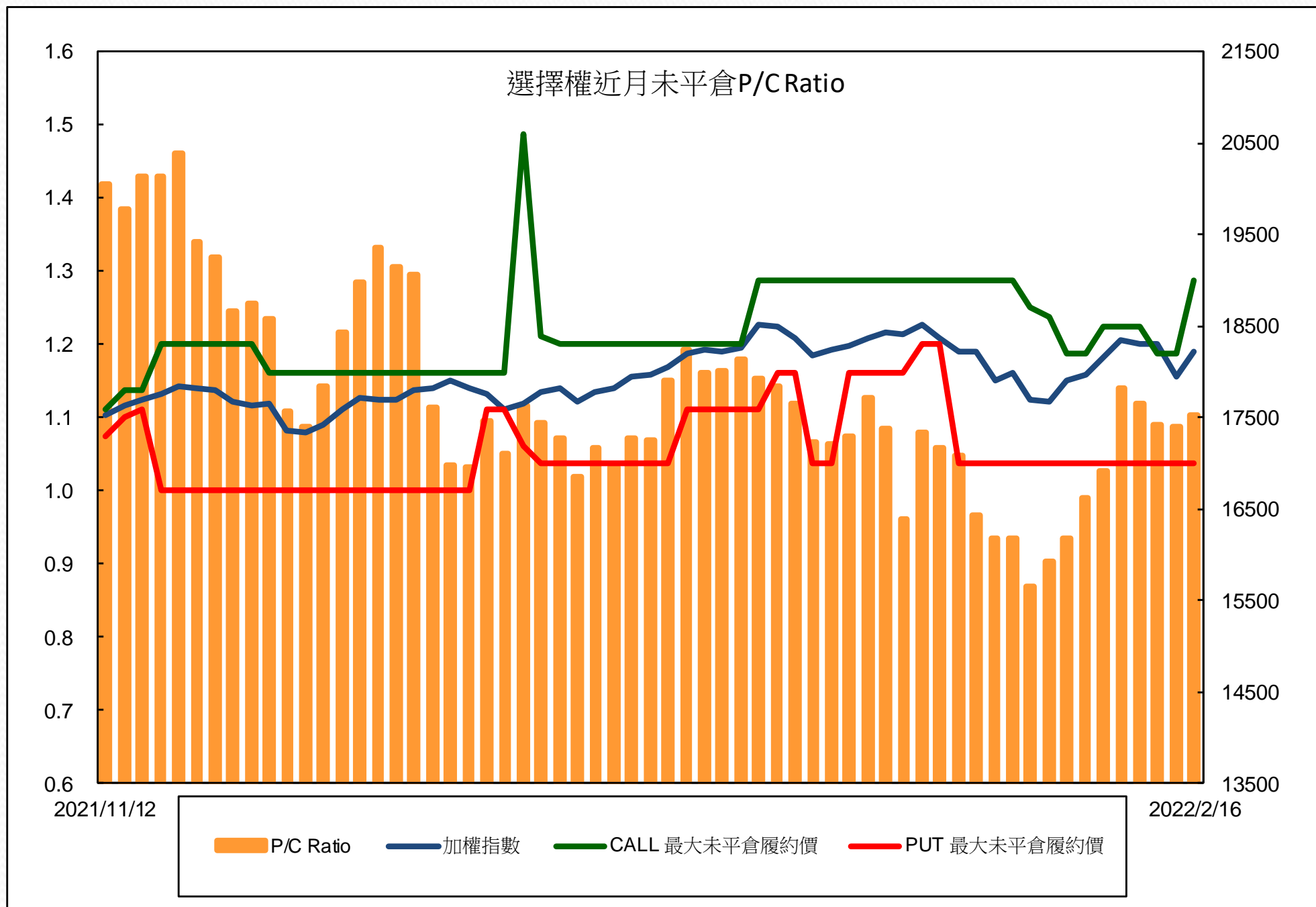
更新日期：2022年2月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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15日	62,919	57,048	5,871
	2月16日	43,864	24,478	19,386
Put	2月15日	58,417	59,371	-954
	2月16日	33,063	33,254	-191

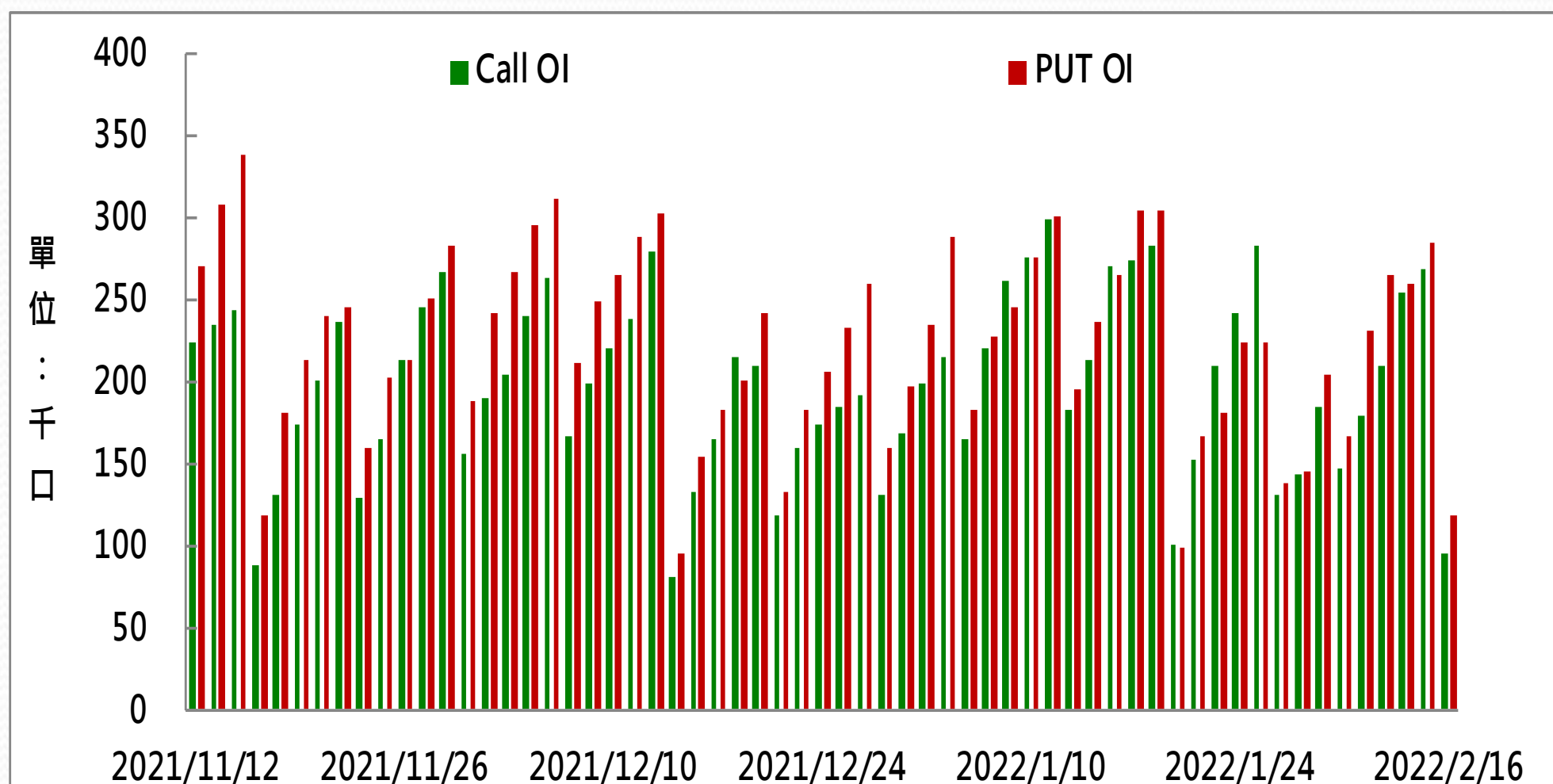
更新日期：2022年2月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年2月16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16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16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