

台指選擇權OI匯報

日期：2022/2/18 結算日：2022/2/23					日期：2022/2/18 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	1	17,500	4,306	383	0	0	16,700	2,103	120
30	30	17,550	2,466	797	0	59	16,800	5,385	1,123
0	10	17,600	3,556	912	0	5	16,900	2,728	242
3	3	17,650	3,272	757	0	98	17,000	8,666	309
3	18	17,700	5,109	960	0	14	17,100	1,872	86
-1	9	17,750	3,705	822	1	132	17,200	2,570	249
-5	76	17,800	8,174	1,946	5	14	17,300	3,375	430
9	12	17,850	4,085	1,656	3	675	17,400	2,740	234
37	74	17,900	7,807	2,681	51	944	17,500	7,916	4,050 ※
90	128	17,950	4,249	1,001	96	1,208	17,600	1,983	3
179	356	18,000	8,660	2,846 ※	10	339	17,700	2,545	308
217	314	18,050	2,891	595	-10	726	17,800	2,376	697
598	1,042	18,100	5,540	1,774	49	700	17,900	1,772	168
472	1,526	18,150	3,649	518	28	1,895	18,000	2,964	-159
1,100	3,503	18,200	5,311	1,295	275	3,022	18,100	1,457	224
1,378	3,405	18,250	2,989	917	89	2,887	18,200	1,235	147
1,619	4,691	18,300	1,834	368	73	2,116	18,300	1,027	-76
1,233	4,208	18,350	811	236	113	2,704	18,400	594	47
2,373	8,548	18,400	557	4	385	4,894	18,500	328	18
2,670	7,110	18,450	242	-27	109	4,613	18,600	210	18
1,312	9,126	18,500	249	66	204	4,678	18,700	67	2
※ 3,495	5,615	18,550	97	33	84	5,295	18,800	125	0
731	12,071	18,600	114	-21	173	5,174	18,900	12	1
244	3,739	18,650	1	0	141	5,963	19,000	9	5
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
18,655	81,353	1.3574	110,426	25,710	2,231	75,318	1.1624	87,550	8,829
昨日 P/C	1.3512	今日增減變化		0.0062	昨日 P/C	1.0771	今日增減變化		0.0853

更新日期：2022年2月18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18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	80,872,674	143,533,981	-62,661,307	-2,717,566	3,115,213	1,703,632	1,411,581	-415,258
投信	46,839,745	52,559,377	-5,719,632	-155,212	559,765	0	559,765	-2,608
自營商	66,659,446	14,424,786	52,234,660	531,636	1,300,294	1,279,439	20,855	-45,512
	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	1,069,355	4,333,513	-3,264,158	-49,439	13,606	51,024	-37,418	16,668
投信	23,522	0	23,522	-76	1,701	0	1,701	11
自營商	578,912	85,042	493,870	-77,822	139,449	170,042	-30,593	11,652

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18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	23,514	13,891	9,623	1,212	58,843	16,859	41,984	2,912
投信	0	0	0	0	0	68	-68	0
自營商	63,610	33,821	29,789	-1,605	54,075	48,801	5,274	466
特定法人(週)	2,900	1,621	1,279	-230	0	15,056	-15,056	8
特定法人(近月)	12,341	9,937	2,404	295	7,206	25,933	-18,727	-3,961
特定法人(全月)	17,779	9,390	8,389	2,392	6,163	51,241	-45,078	-2,381
十大交易人(週)	26,471	24,839	1,632	-2,337	38,574	40,555	-1,981	1,265
十大交易人(近月)	47,248	29,951	17,297	-174	33,188	52,839	-19,651	-4,358
十大交易人(全月)	79,239	43,749	35,490	-1,480	69,453	102,312	-32,859	-3,447
全市場未沖銷(近月)			75,318	2,231			87,550	8,829
全市場未沖銷(全月)			169,993	21,761			217,894	35,792

更新日期：2022年2月18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	18400	買權OI最大量	18600
	賣權成交最大量	18000	賣權OI最大量	18000
	整體隱含波動率	14.73%	較前一交易日	+0.38%
	買權隱含波動率	13.01%	較前一交易日	+1.05%
	賣權隱含波動率	16.03%	較前一交易日	-0.22%
電子選擇權	買權成交最大量	890	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	825	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	1740	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年2月18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	17500	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	18.87%	較前一交易日	-0.27%
	買權隱含波動率	14.14%	較前一交易日	+0.41%
	賣權隱含波動率	22.12%	較前一交易日	-0.46%
	成交量P/C_Ratio值	1.339	較前一交易日	+0.21
	未平倉P/C_Ratio值	1.162	較前一交易日	+0.09
電子選擇權	買權成交最大量	890	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	825	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	1740	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年2月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

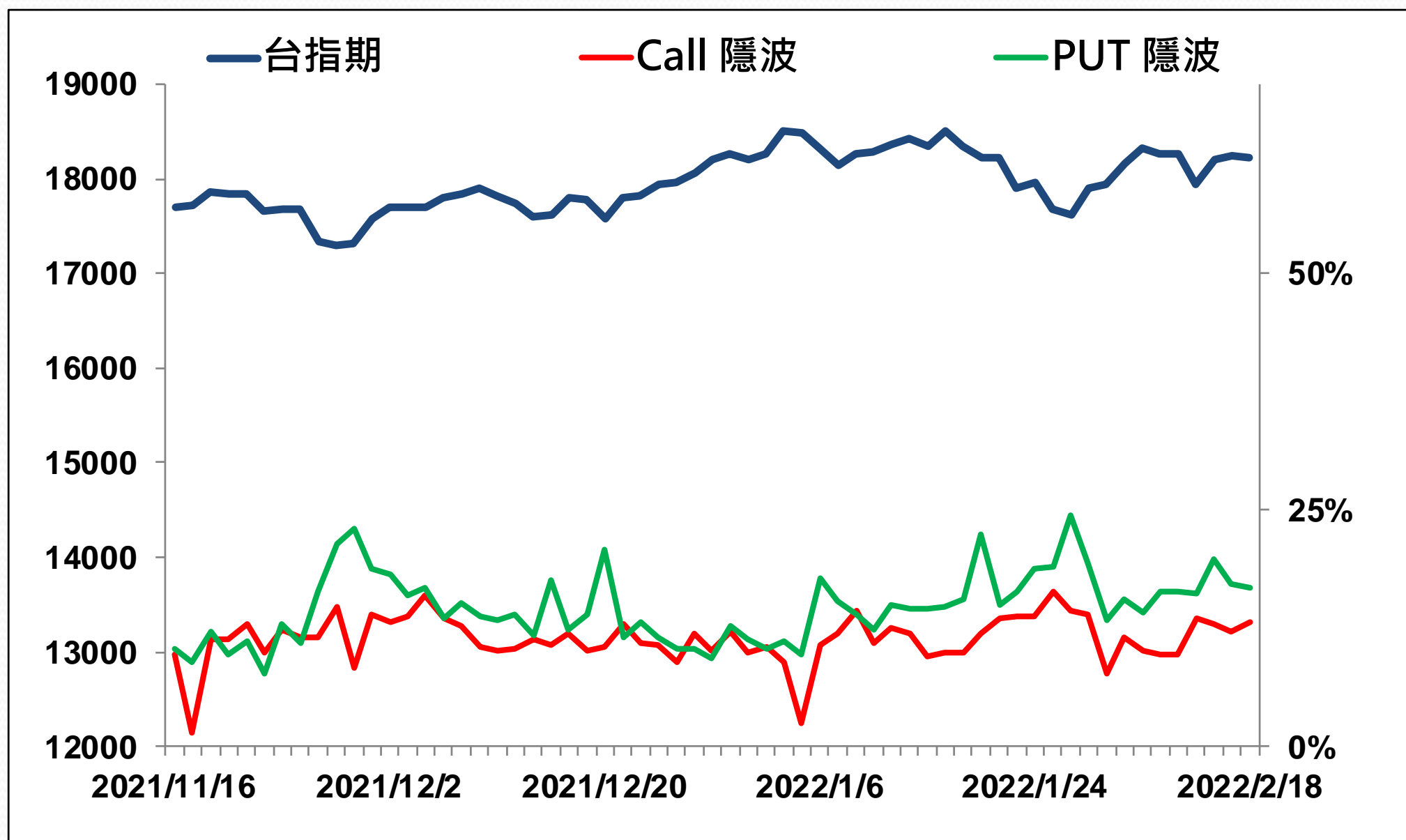
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



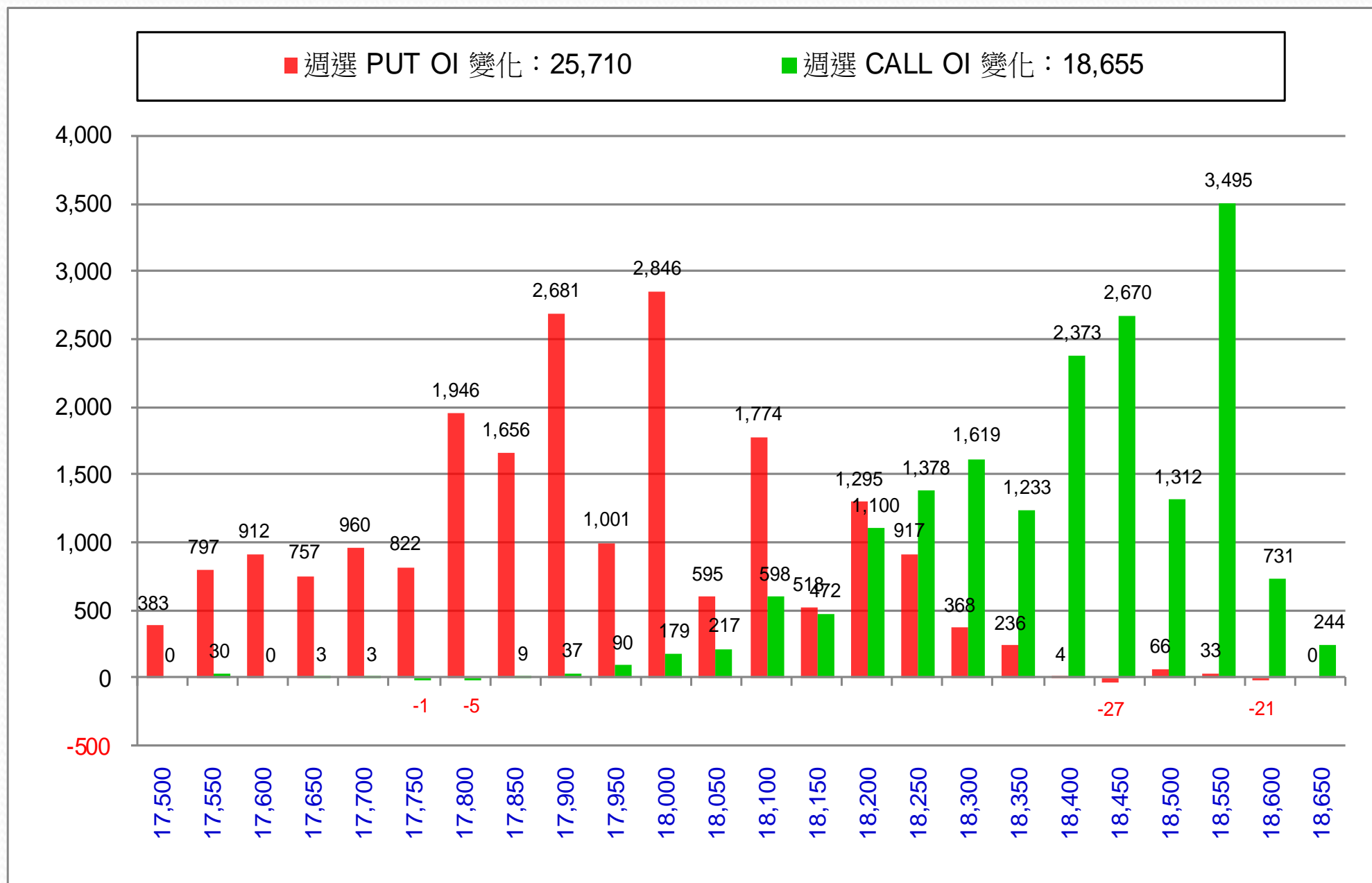
更新日期：2022年2月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年2月18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

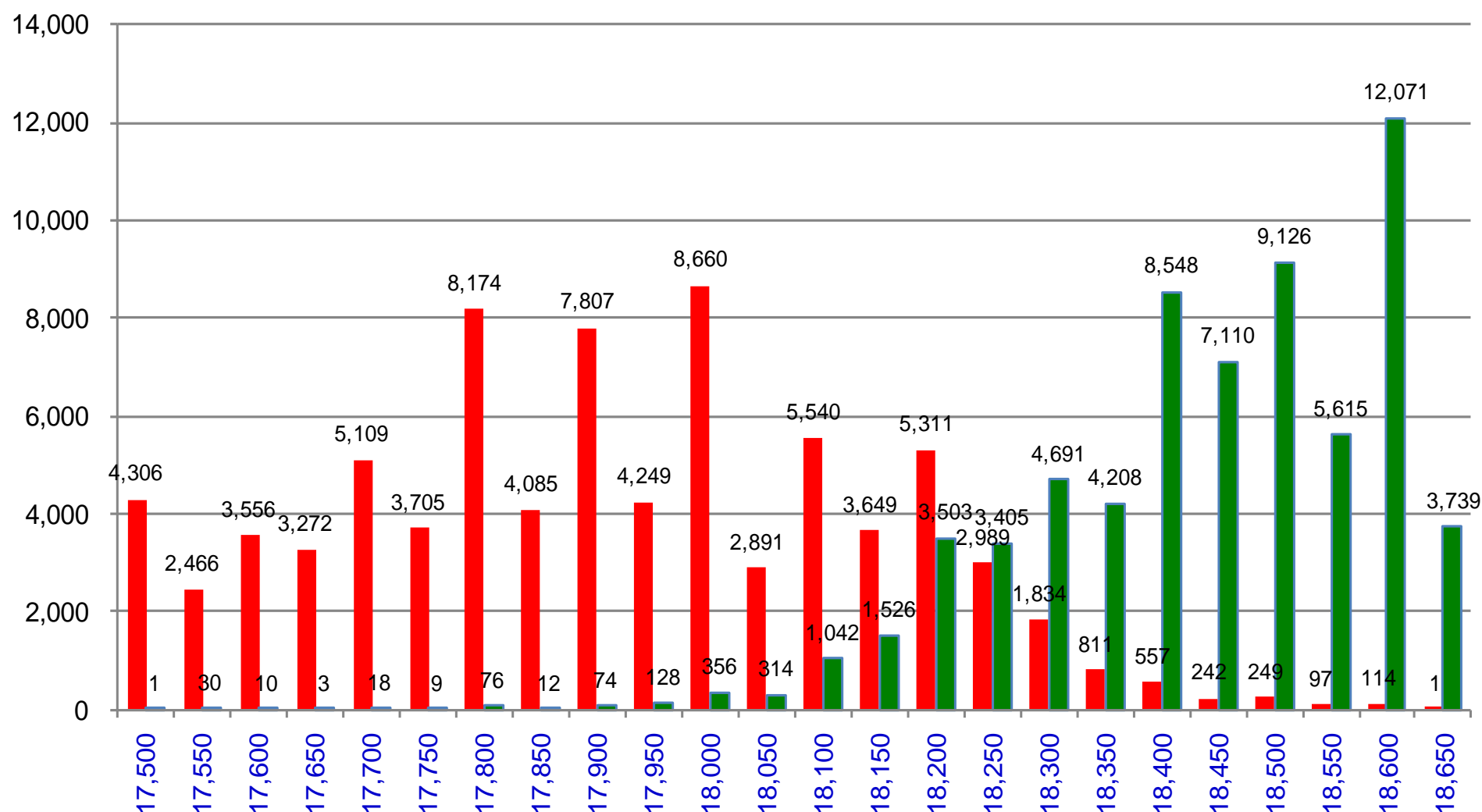


更新日期：2022年2月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：110,426

週選 CALL OI 總額：81,353



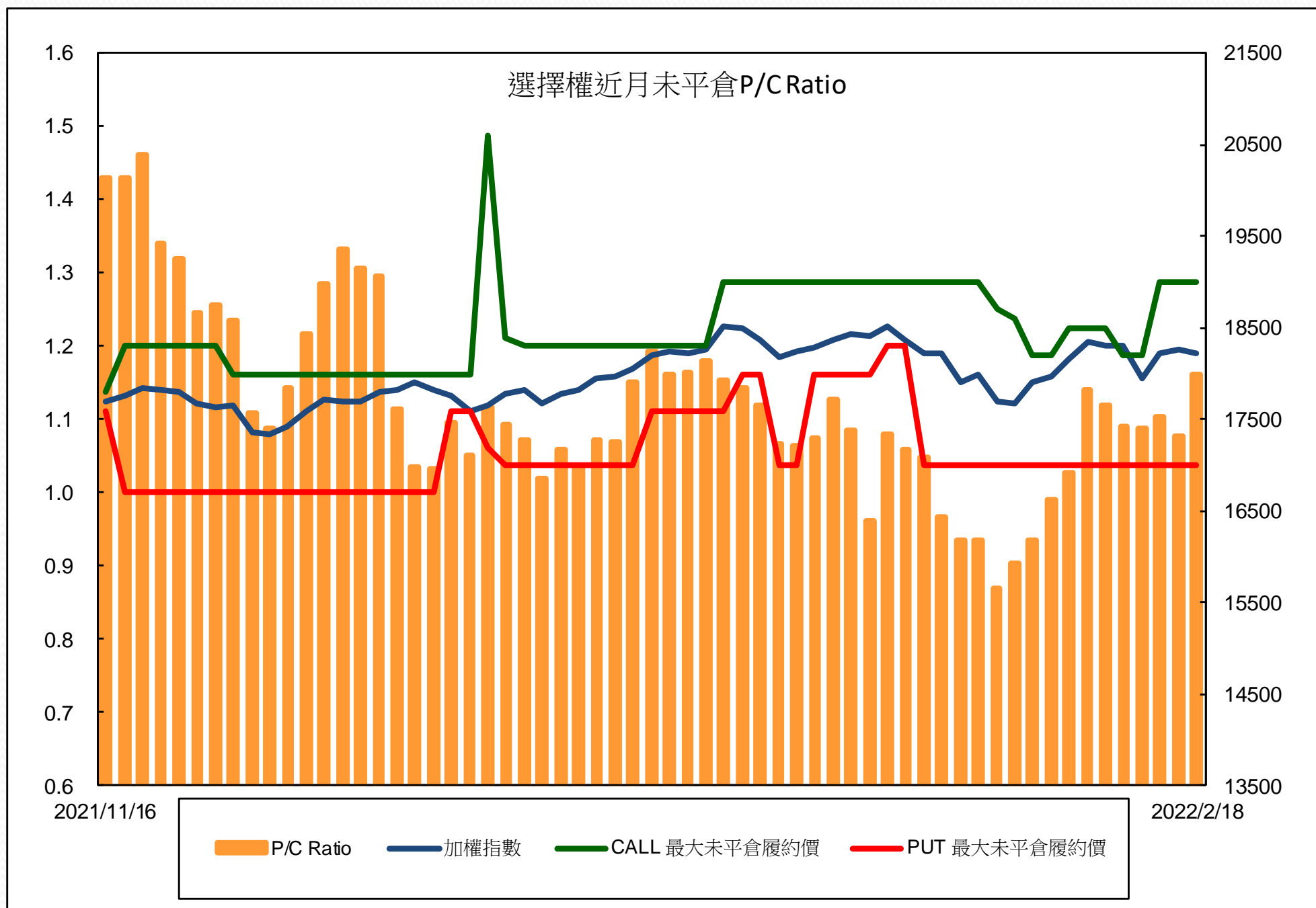
更新日期：2022年2月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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17日	62,152	30,758	31,394
	2月18日	63,610	33,821	29,789
Put	2月17日	47,053	42,245	4,808
	2月18日	54,075	48,801	5,274

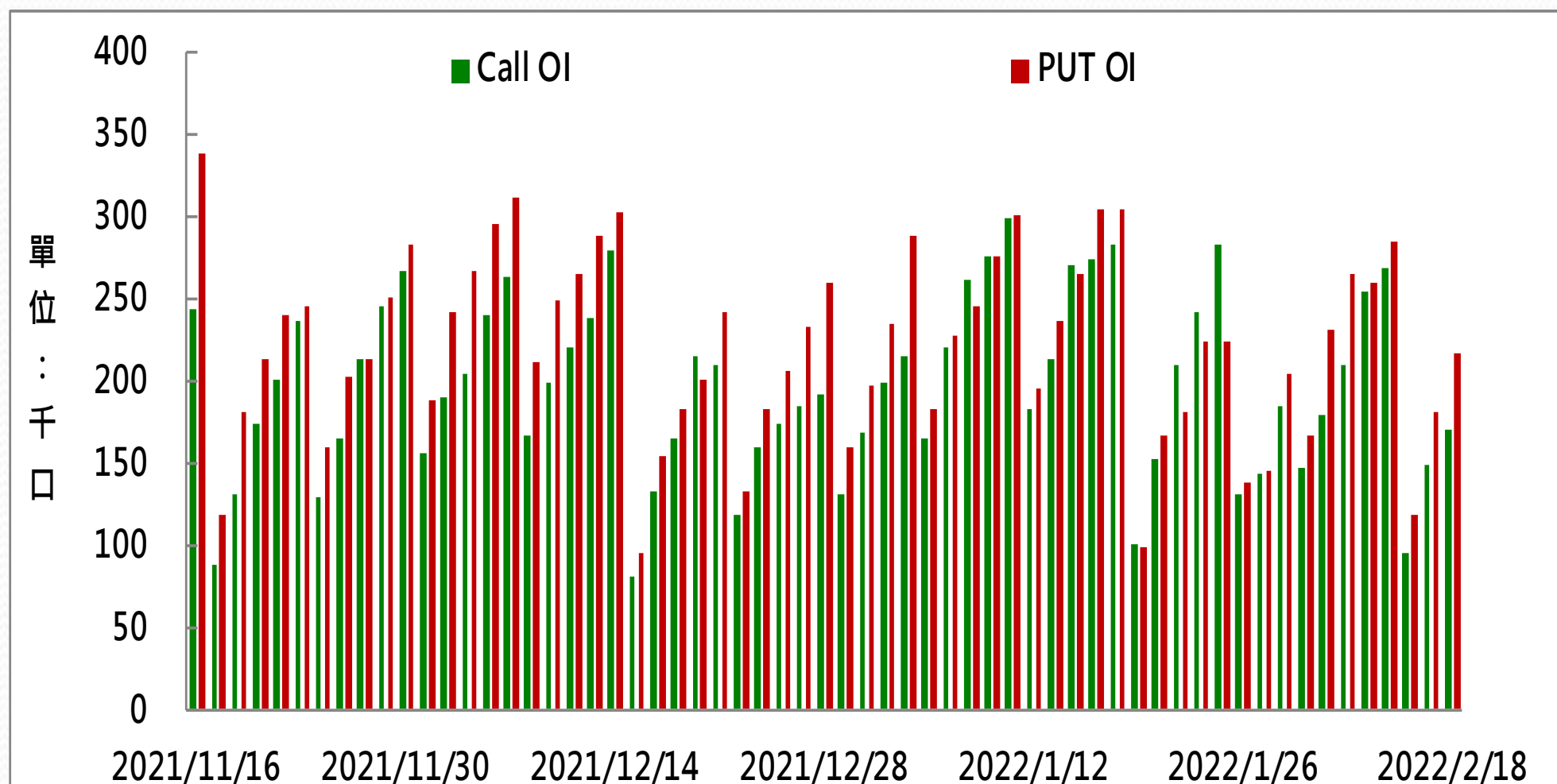
更新日期：2022年2月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年2月18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18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18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