

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/2/21 結算日：2022/2/23					日期：2022/2/21 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	17,450	2,097	480	0	0	16,700	2,103	0
5	6	17,500	4,837	531	0	59	16,800	5,720	335
0	30	17,550	3,317	851	0	5	16,900	2,779	51
0	10	17,600	4,901	1,345	0	98	17,000	8,954	288
1	4	17,650	5,124	1,852	0	14	17,100	1,997	125
4	22	17,700	5,516	407	0	132	17,200	2,703	133
1	10	17,750	4,428	723	0	14	17,300	3,775	400
3	79	17,800	8,693	519	-1	674	17,400	2,483	-257
1	13	17,850	5,441	1,356	-3	941	17,500	7,969	53
144	218	17,900	9,335	1,528	0	1,208	17,600	2,233	250
165	293	17,950	5,511	1,262	41	380	17,700	2,882	337
219	575	18,000	8,890	230	17	743	17,800	2,525	149
271	585	18,050	5,077	2,186	18	718	17,900	1,967	195
672	1,714	18,100	6,950	1,410	-38	1,857	18,000	2,893	-71
642	2,168	18,150	4,097	448	-27	2,995	18,100	1,588	131
1,929	5,432	18,200	6,542	1,231	518	3,405	18,200	1,630	395
1,576	4,981	18,250	3,187	198	173	2,289	18,300	1,503	476
2,632	7,323	18,300	2,174	340	-256	2,448	18,400	700	106
2,874	7,082	18,350	1,005	194	525	5,419	18,500	353	25
2,812	11,360	18,400	658	101	95	4,708	18,600	217	7
2,586	9,696	18,450	364	122	328	5,006	18,700	73	6
※ 3,303	12,429	18,500	322	73	-30	5,265	18,800	125	0
1,340	6,955	18,550	119	22	262	5,436	18,900	12	0
-2,461	9,610	18,600	128	14	730	6,693	19,000	10	1
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
17,647	99,000	1.3069	129,383	18,957	6,109	81,427	1.1260	91,686	4,136
昨日 P/C	1.3574	今日增減變化		-0.0505	昨日 P/C	1.1624	今日增減變化		-0.0364

更新日期：2022年2月21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21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	76,384,111	147,275,517	-70,891,406	-8,230,099	3,134,377	1,884,090	1,250,287	-161,294
投信	47,019,742	52,567,117	-5,547,375	172,257	557,607	0	557,607	-2,158
自營商	67,800,034	13,650,248	54,149,786	1,915,126	1,305,667	1,274,496	31,171	10,316
	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	1,075,046	4,392,331	-3,317,285	-53,127	5,139	71,946	-66,807	-29,389
投信	23,488	0	23,488	-34	1,713	0	1,713	12
自營商	596,148	70,462	525,686	31,816	164,402	157,499	6,903	37,496

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21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	25,194	16,413	8,781	-842	59,862	17,597	42,265	281
投信	0	0	0	0	0	68	-68	0
自營商	64,417	39,268	25,149	-4,640	61,370	50,368	11,002	5,728
特定法人(週)	2,781	2,134	647	-632	0	15,020	-15,020	36
特定法人(近月)	14,041	10,437	3,604	1,200	7,772	25,933	-18,161	566
特定法人(全月)	16,887	7,283	9,604	1,215	3,824	51,689	-47,865	-2,787
十大交易人(週)	25,440	29,008	-3,568	-5,200	43,399	46,099	-2,700	-719
十大交易人(近月)	51,242	32,012	19,230	1,933	34,351	55,472	-21,121	-1,470
十大交易人(全月)	81,675	47,944	33,731	-1,759	74,339	110,309	-35,970	-3,111
全市場未沖銷(近月)			81,427	6,109			91,686	4,136
全市場未沖銷(全月)			194,096	24,103			241,845	23,951

更新日期：2022年2月21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	18300	買權OI最大量	18500
	賣權成交最大量	18000	賣權OI最大量	17900
	整體隱含波動率	16.05%	較前一交易日	+1.33%
	買權隱含波動率	14.88%	較前一交易日	+1.87%
	賣權隱含波動率	16.98%	較前一交易日	+0.94%
電子選擇權	買權成交最大量	895	買權OI最大量	860
	賣權成交最大量	820	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	1780	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年2月21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	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	18.33%	較前一交易日	+0.54%
	買權隱含波動率	14.40%	較前一交易日	+0.26%
	賣權隱含波動率	22.47%	較前一交易日	+0.35%
	成交量P/C_Ratio值	0.949	較前一交易日	-0.39
	未平倉P/C_Ratio值	1.126	較前一交易日	-0.04
電子選擇權	買權成交最大量	895	買權OI最大量	860
	賣權成交最大量	820	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	1780	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年2月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

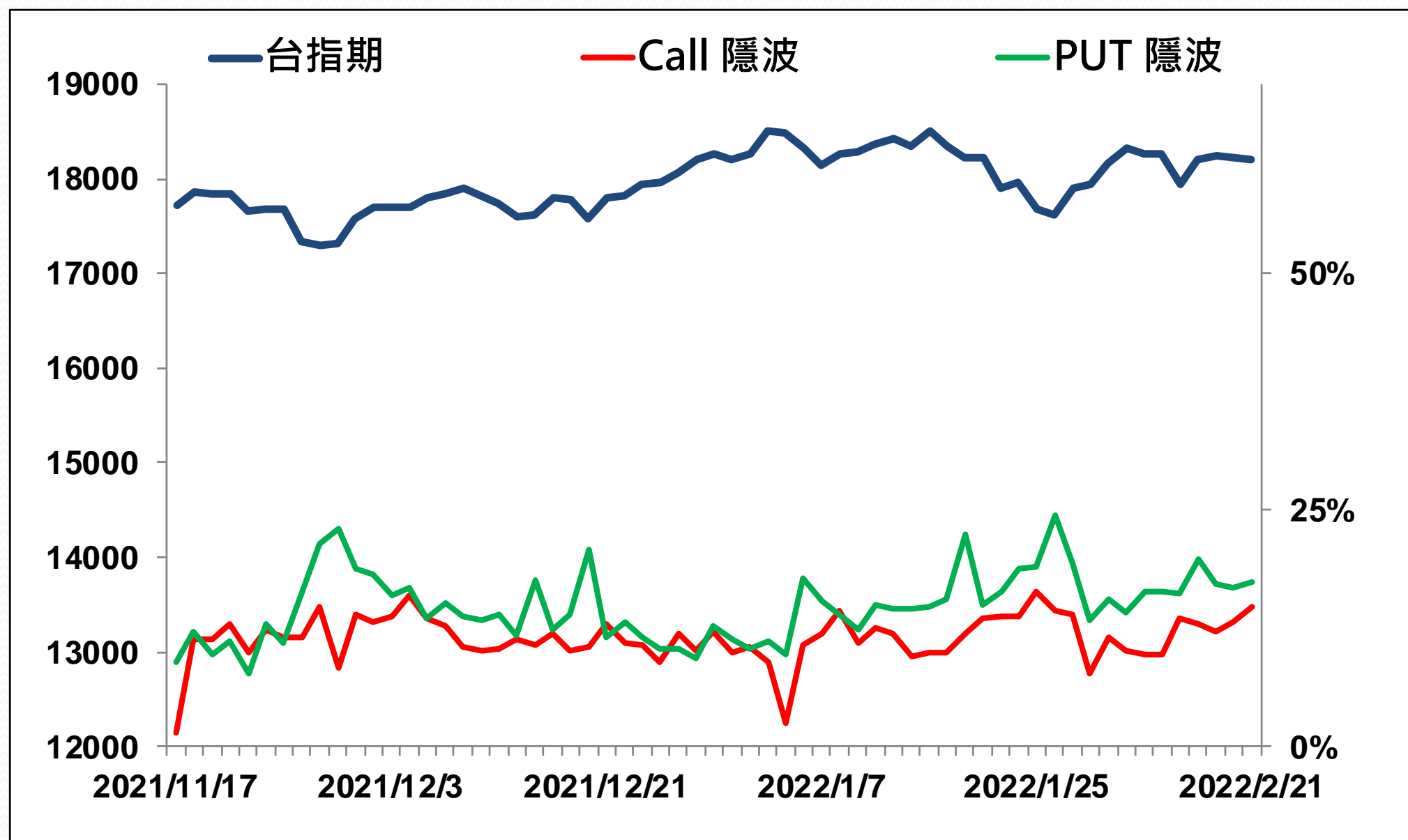
# 選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



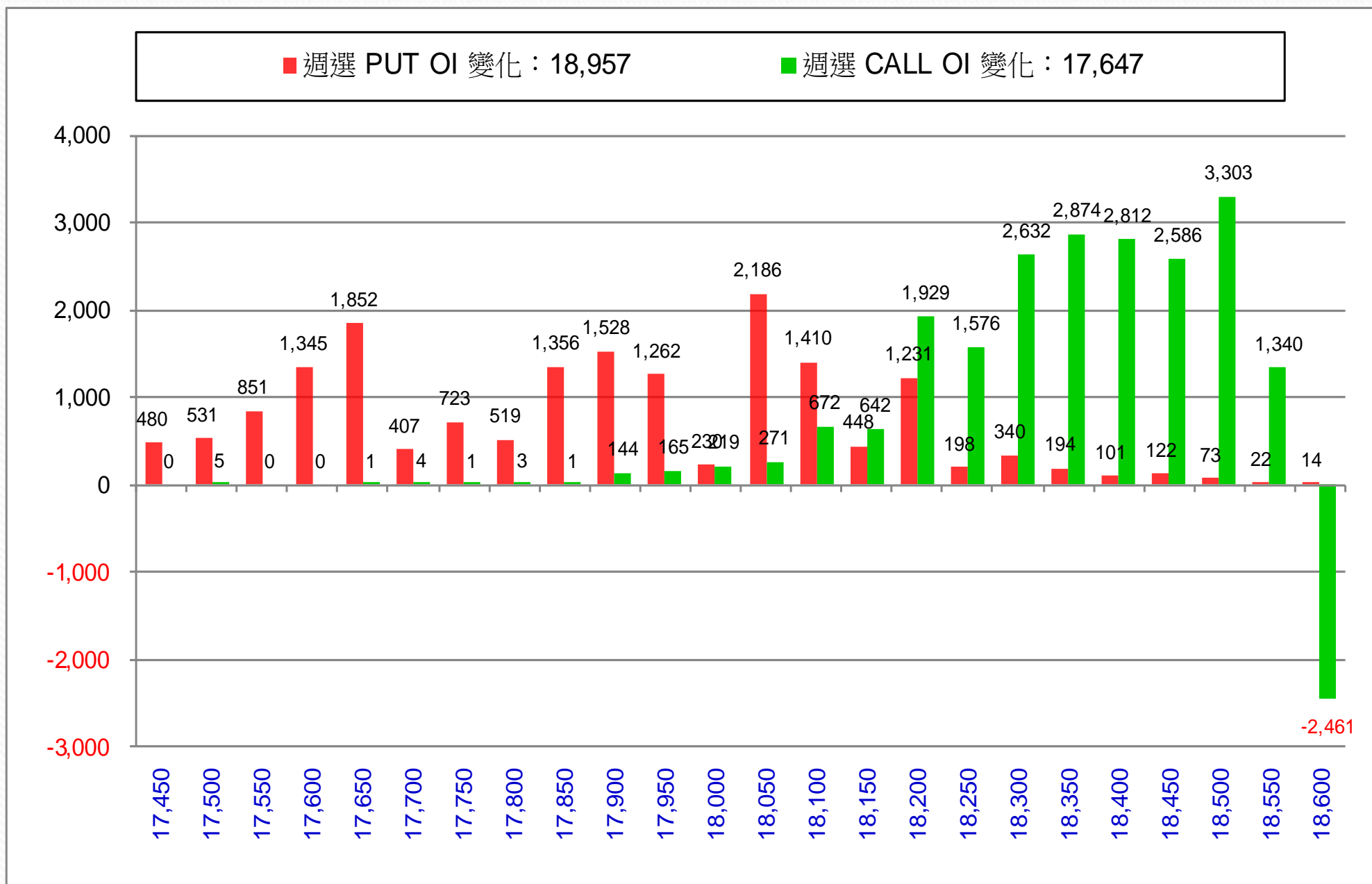
更新日期：2022年2月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2022年2月21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

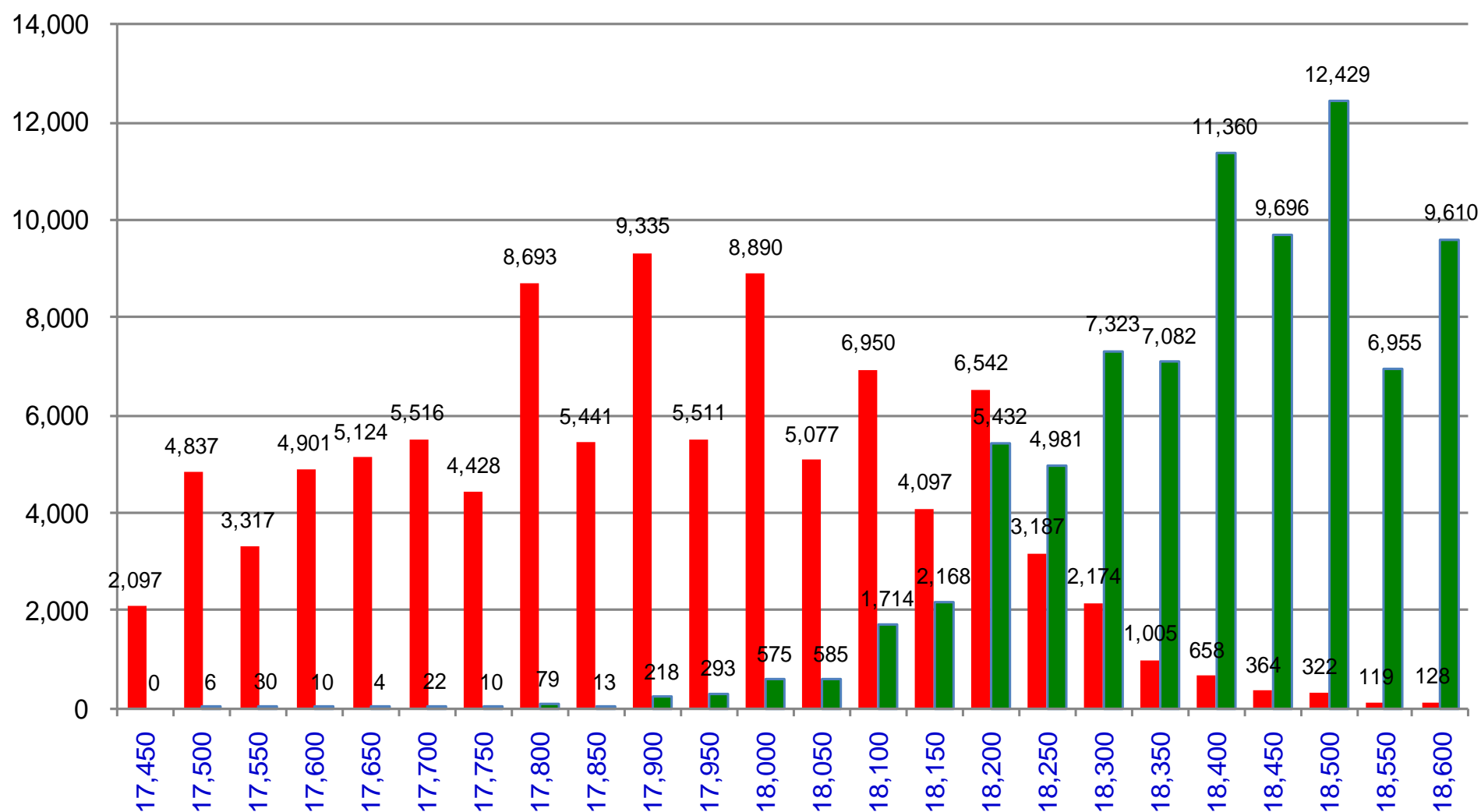


更新日期：2022年2月21日      資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：129,383

週選 CALL OI 總額：99,000



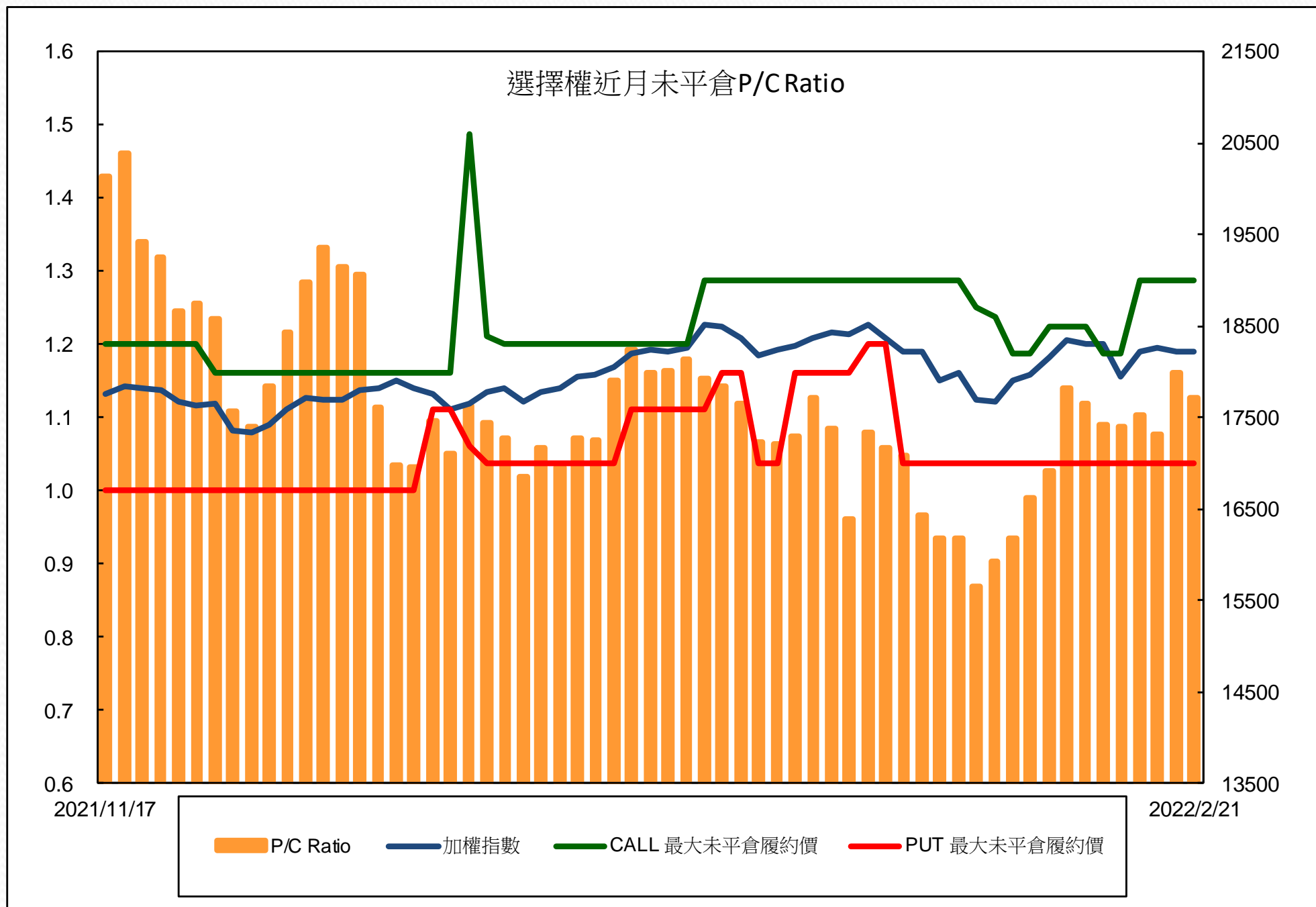
更新日期：2022年2月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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18日	63,610	33,821	29,789
	2月21日	64,417	39,268	25,149
Put	2月18日	54,075	48,801	5,274
	2月21日	61,370	50,368	11,002

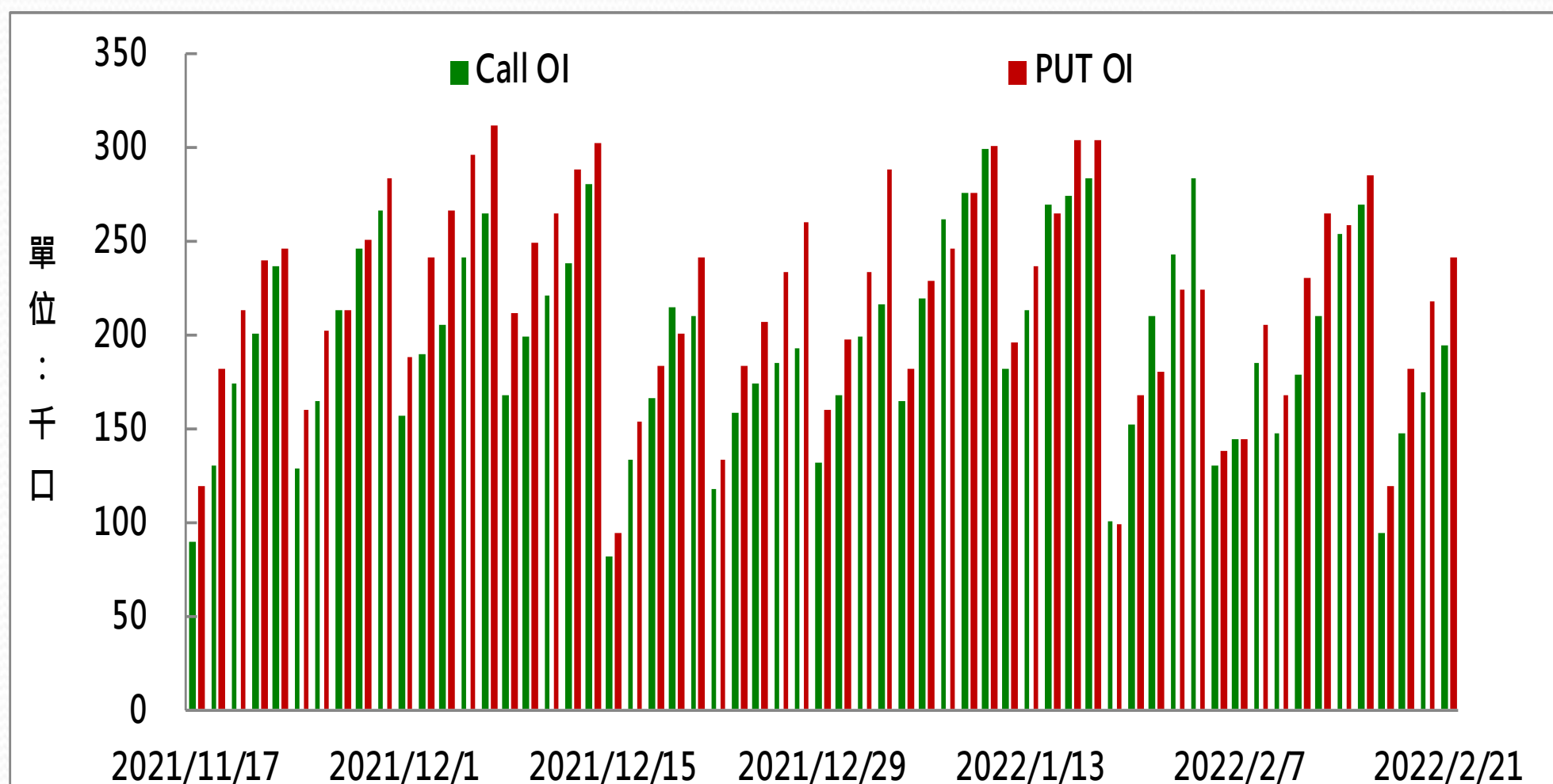
更新日期：2022年2月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年2月21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21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21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