

台指選擇權OI匯報

日期：2022/2/22 結算日：2022/2/23					日期：2022/2/22 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	17,300	4,272	1,095	0	59	16,800	6,784	1,064 ※
0	0	17,400	5,770	1,097	0	5	16,900	3,034	255
0	0	17,450	2,949	852	0	98	17,000	8,664	-290
4	10	17,500	5,917	1,080	0	14	17,100	2,096	99
0	30	17,550	5,084	1,767	3	135	17,200	2,336	-367
15	25	17,600	6,374	1,473	0	14	17,300	3,515	-260
130	134	17,650	6,156	1,032	200	874	17,400	2,475	-8
336	358	17,700	7,009	1,493	116	1,057	17,500	8,323	354
188	198	17,750	6,237	1,809 ※	18	1,226	17,600	2,407	174
841	920	17,800	9,229	536	69	449	17,700	2,221	-661
2,378	2,391	17,850	6,880	1,439	72	815	17,800	2,412	-113
4,272	4,490	17,900	9,225	-110	254	972	17,900	1,998	31
4,373	4,666	17,950	6,442	931	380	2,237	18,000	2,729	-164
6,715	7,290	18,000	6,675	-2,215	213	3,208	18,100	1,491	-97
5,077	5,662	18,050	3,170	-1,907	499	3,904	18,200	1,454	-176
※ 8,044	9,758	18,100	4,192	-2,758	995	3,284	18,300	1,605	102
6,230	8,398	18,150	2,133	-1,964	487	2,935	18,400	589	-111
5,559	10,991	18,200	3,901	-2,641	636	6,055	18,500	336	-17
2,536	7,517	18,250	2,255	-932	※ 1,047	5,755	18,600	243	26
2,177	9,500	18,300	1,725	-449	316	5,322	18,700	73	0
158	7,240	18,350	940	-65	57	5,322	18,800	145	20
-2,583	8,777	18,400	507	-151	-170	5,266	18,900	12	0
-3,307	6,389	18,450	287	-77	157	6,850	19,000	9	-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
32,685	131,685	1.0053	132,388	3,005	5,935	87,362	1.0801	94,362	2,676
昨日 P/C	1.3069	今日增減變化	-0.3016		昨日 P/C	1.1260	今日增減變化	-0.0459	

更新日期：2022年2月22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22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	68,415,096	139,148,677	-70,733,581	157,825	2,781,395	1,954,126	827,269	-423,018
投信	44,910,984	53,811,648	-8,900,664	-3,353,289	517,469	0	517,469	-40,138
自營商	68,546,804	13,277,181	55,269,623	1,119,837	1,419,577	1,375,330	44,247	13,076
	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	959,636	3,854,546	-2,894,910	422,375	1,679	45,338	-43,659	23,148
投信	23,145	0	23,145	-343	1,679	0	1,679	-34
自營商	478,830	94,359	384,471	-141,215	119,178	164,465	-45,287	-52,190

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22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	26,922	17,811	9,111	330	63,662	21,846	41,816	-449
投信	0	0	0	0	0	68	-68	0
自營商	67,255	53,163	14,092	-11,057	65,980	50,663	15,317	4,315
特定法人(週)	3,863	2,435	1,428	781	0	15,270	-15,270	-250
特定法人(近月)	14,949	10,437	4,512	908	8,652	25,933	-17,281	880
特定法人(全月)	17,390	7,584	9,806	202	9,380	52,692	-43,312	4,553
十大交易人(週)	26,195	38,138	-11,943	-8,375	43,619	47,899	-4,280	-1,580
十大交易人(近月)	53,719	32,456	21,263	2,033	32,409	57,861	-25,452	-4,331
十大交易人(全月)	85,969	59,544	26,425	-7,306	78,190	116,837	-38,647	-2,677
全市場未沖銷(近月)			87,362	5,935			94,362	2,676
全市場未沖銷(全月)			233,526	39,430			249,943	8,098

更新日期：2022年2月22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	18200	買權OI最大量	18200
	賣權成交最大量	17800	賣權OI最大量	17800
	整體隱含波動率	16.43%	較前一交易日	+0.37%
	買權隱含波動率	11.12%	較前一交易日	-3.76%
	賣權隱含波動率	21.86%	較前一交易日	+4.88%
電子選擇權	買權成交最大量	850	買權OI最大量	850
	賣權成交最大量	810	賣權OI最大量	850
金融選擇權	買權成交最大量	1800	買權OI最大量	1800
	賣權成交最大量	1780	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年2月22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	20.74%	較前一交易日	-2.42%
	買權隱含波動率	14.56%	較前一交易日	+0.16%
	賣權隱含波動率	26.63%	較前一交易日	+4.15%
	成交量P/C_Ratio值	1.027	較前一交易日	+0.08
	未平倉P/C_Ratio值	1.080	較前一交易日	-0.05
電子選擇權	買權成交最大量	850	買權OI最大量	850
	賣權成交最大量	810	賣權OI最大量	850
金融選擇權	買權成交最大量	1800	買權OI最大量	1800
	賣權成交最大量	1780	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年2月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

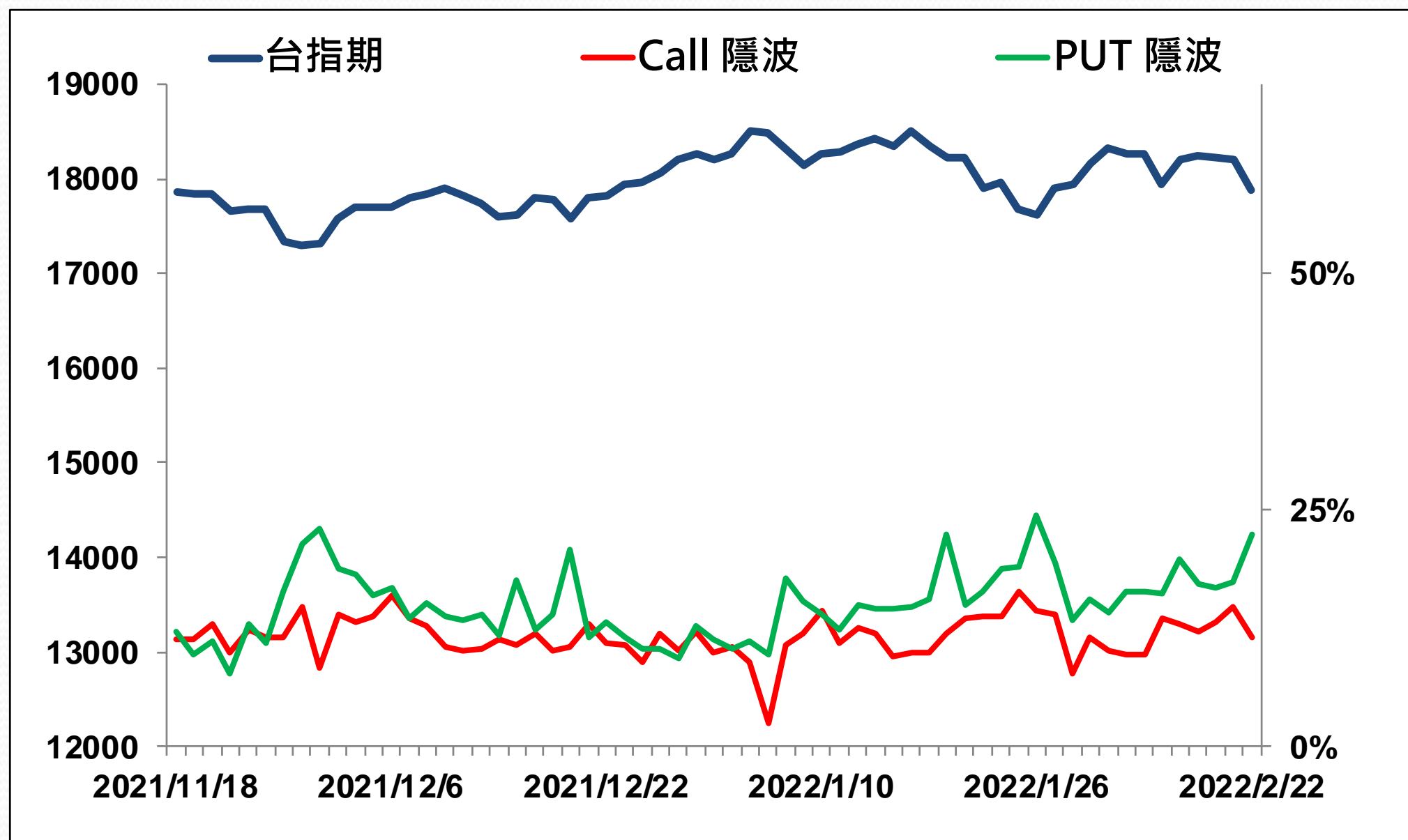
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2022年2月22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

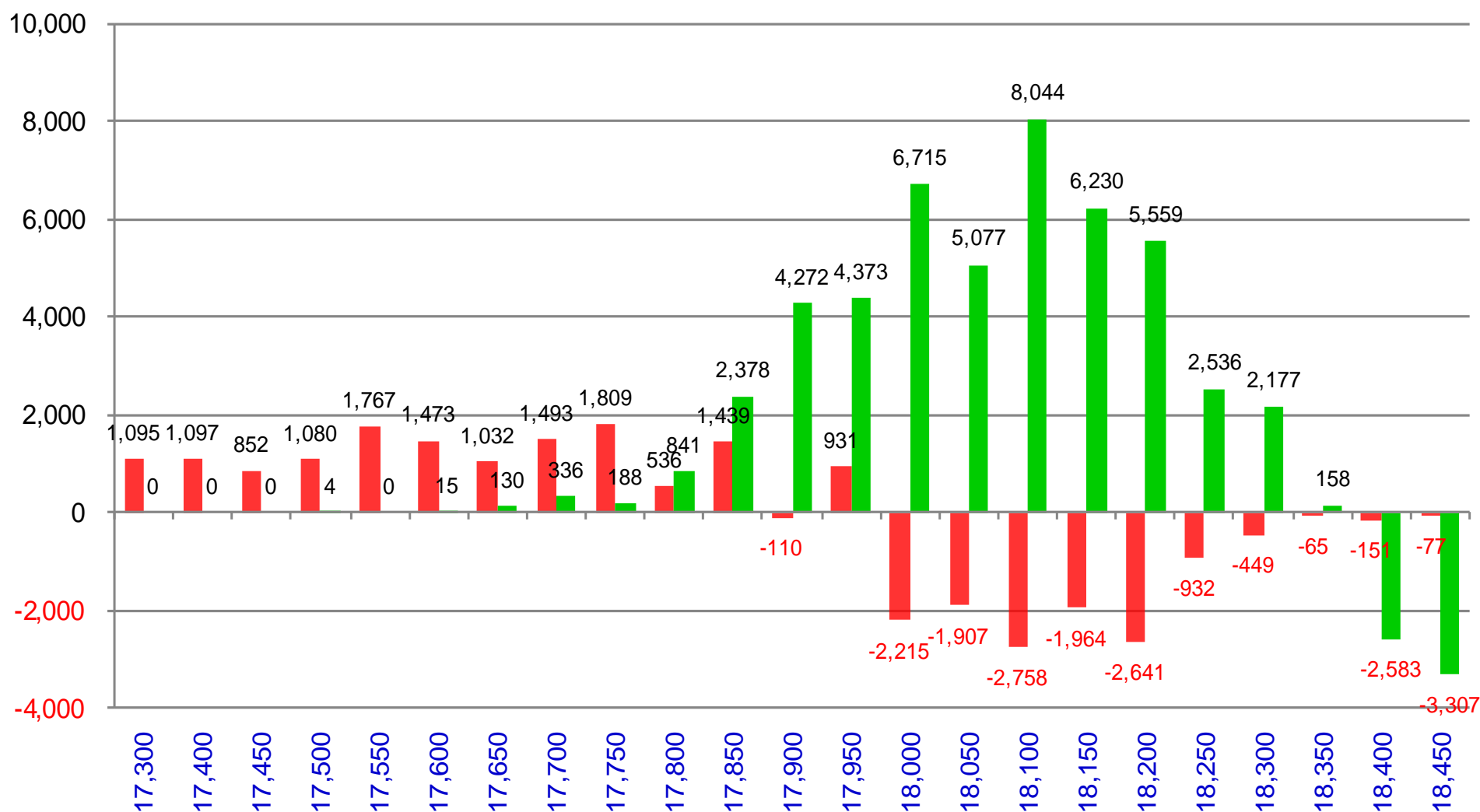


更新日期：2022年2月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：3,005

週選 CALL OI 變化：32,685

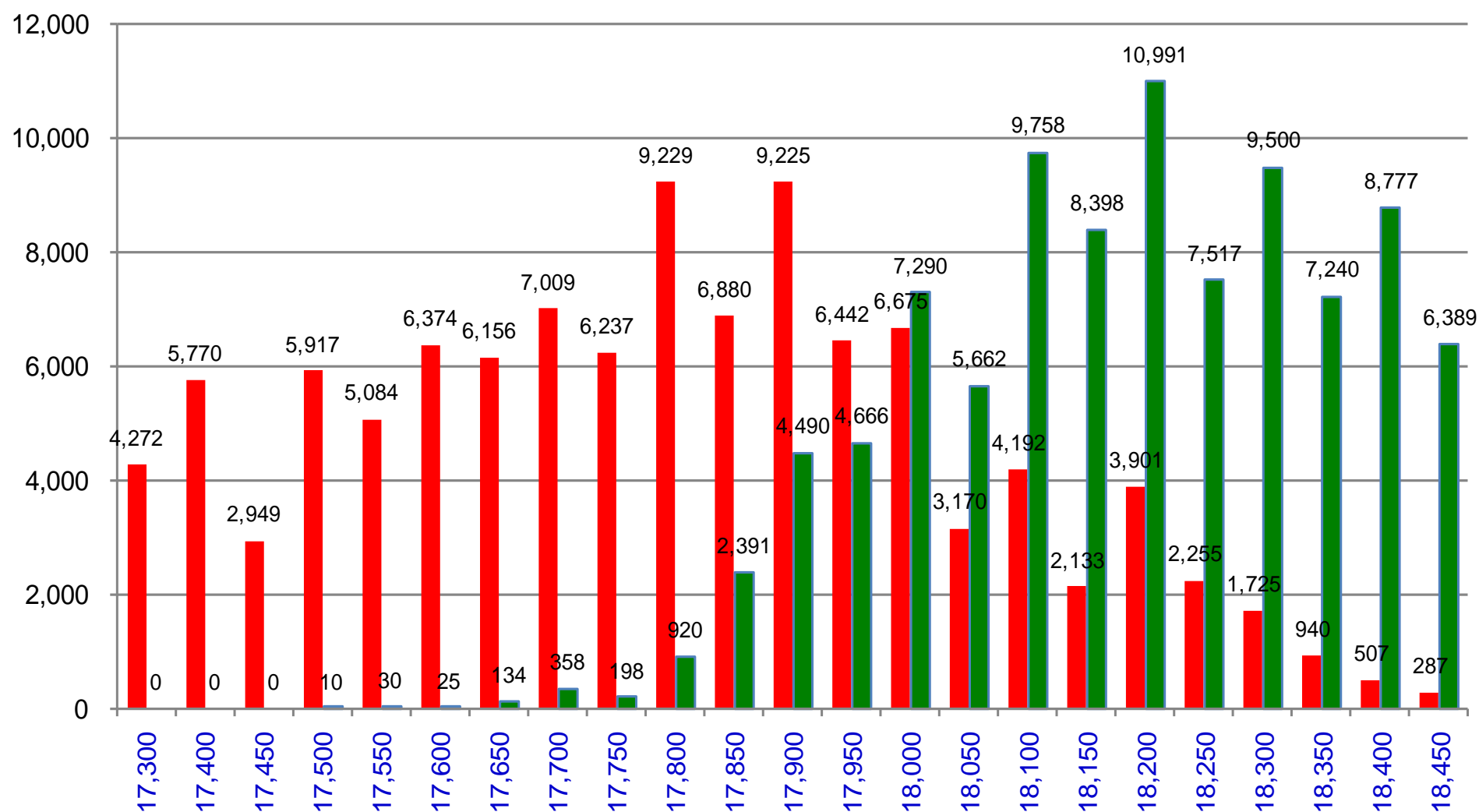


更新日期：2022年2月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：132,388

週選 CALL OI 總額：131,685



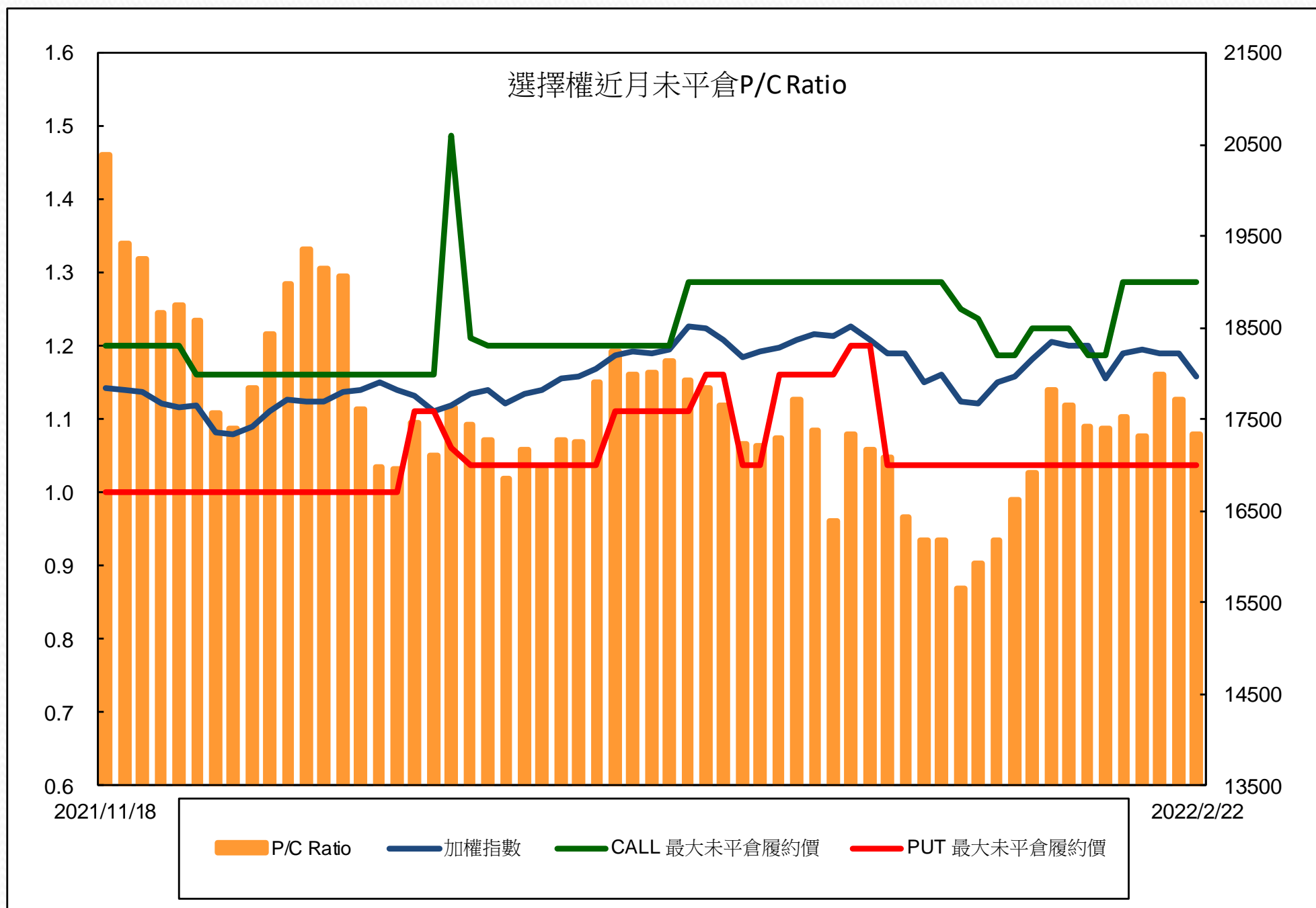
更新日期：2022年2月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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21日	64,417	39,268	25,149
	2月22日	67,255	53,163	14,092
Put	2月21日	61,370	50,368	11,002
	2月22日	65,980	50,663	15,317

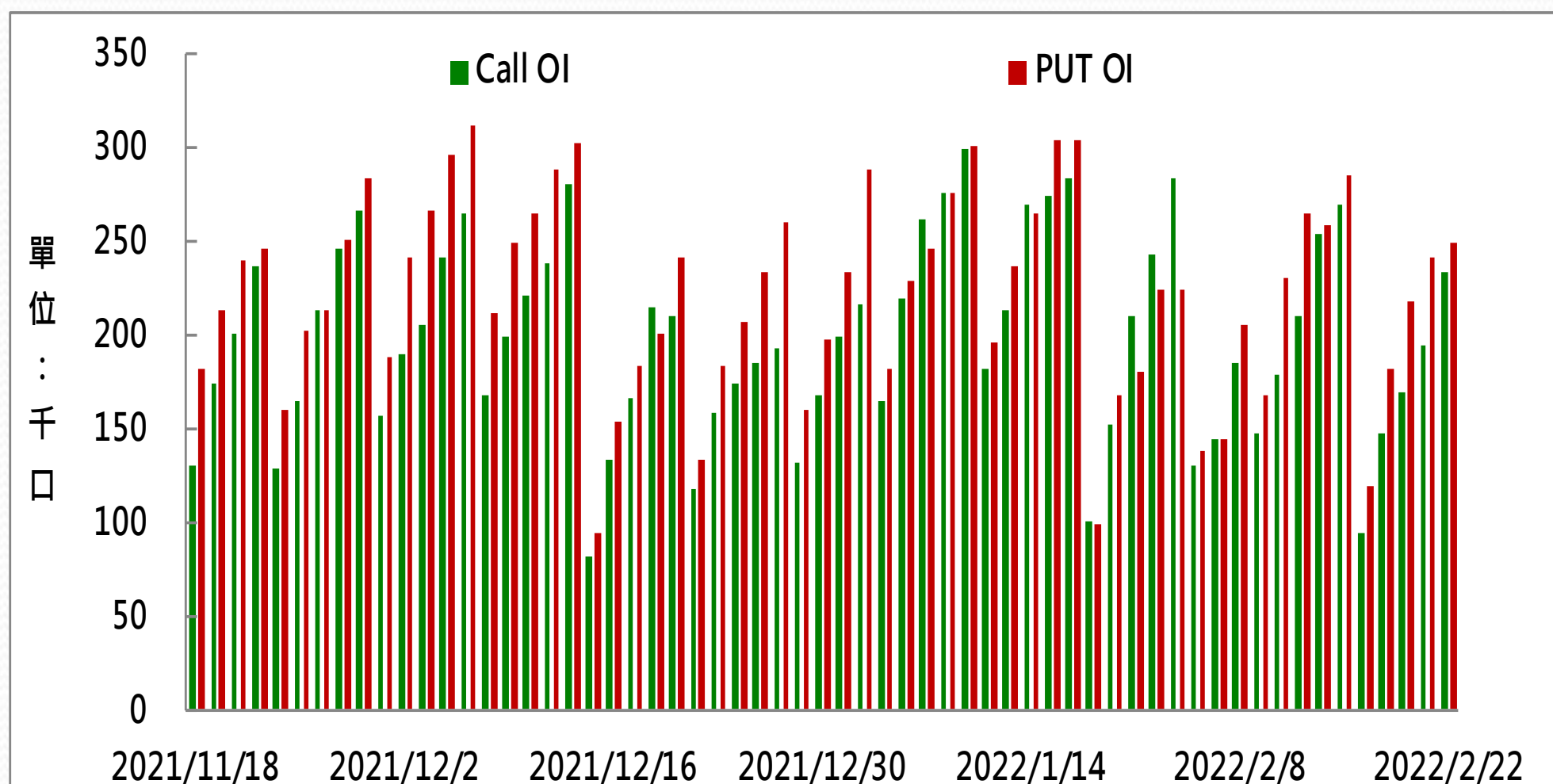
更新日期：2022年2月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年2月22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22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22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