

台指選擇權OI匯報

日期：2022/2/23 結算日：2022/3/2					日期：2022/2/23 結算日：2022/3/16				
202203W1					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	1,415	1,415	0	5	16,900	3,256	222
0	0	17,500	1,529	1,529	0	98	17,000	9,400	736
0	0	17,550	499	499	0	14	17,100	2,176	80
9	9	17,600	1,682	1,682	-1	134	17,200	3,437	1,101 ※
7	7	17,650	953	953	-1	13	17,300	4,083	568
79	79	17,700	1,780	1,780	16	890	17,400	2,829	354
31	31	17,750	747	747	-4	1,053	17,500	8,924	601
33	33	17,800	1,664	1,664	17	1,243	17,600	2,885	478
29	29	17,850	418	418	89	538	17,700	2,677	456
131	131	17,900	1,912	1,912 ※	64	879	17,800	2,610	198
142	142	17,950	825	825	47	1,019	17,900	2,068	70
630	630	18,000	1,131	1,131	-28	2,209	18,000	2,780	51
560	560	18,050	260	260	-11	3,197	18,100	1,589	98
1,380	1,380	18,100	391	391	226	4,130	18,200	1,465	11
698	698	18,150	201	201	10	3,294	18,300	1,566	-39
1,367	1,367	18,200	229	229	606	3,541	18,400	625	36
1,360	1,360	18,250	107	107	547	6,602	18,500	336	0
2,517	2,517	18,300	58	58	647	6,402	18,600	256	13
1,179	1,179	18,350	36	36	※ 721	6,043	18,700	73	0
※ 2,571	2,571	18,400	8	8	8	5,330	18,800	146	1
1,888	1,888	18,450	11	11	-421	4,845	18,900	12	0
2,329	2,329	18,500	4	4	159	7,009	19,000	10	1
1,210	1,210	18,600	6	6	-35	3,386	19,100	1	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
19,801	19,801	1.4234	28,185	28,185	2,227	89,589	1.1442	102,510	8,148
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化		1.4234	昨日 P/C	1.0801	今日增減變化		0.0641

更新日期：2022年2月23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23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	70,694,621	132,375,298	-61,680,677	9,052,904	2,906,396	1,756,877	1,149,519	322,250
投信	45,548,833	53,274,418	-7,725,585	1,175,079	518,141	0	518,141	672
自營商	67,855,392	14,492,338	53,363,054	-1,906,569	1,392,985	1,441,052	-48,067	-92,314
	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	974,024	3,919,286	-2,945,262	-50,352	0	33,960	-33,960	9,699
投信	23,234	0	23,234	89	1,698	0	1,698	19
自營商	482,444	89,356	393,088	8,617	106,964	149,404	-42,440	2,847

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23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	23,283	13,418	9,865	754	48,135	18,567	29,568	-12,248
投信	0	0	0	0	0	68	-68	0
自營商	54,008	30,085	23,923	9,831	49,705	38,725	10,980	-4,337
特定法人(週)	1,411	612	799	---	0	1,210	-1,210	---
特定法人(近月)	14,041	10,437	3,604	-908	9,302	27,558	-18,256	-975
特定法人(全月)	17,324	8,955	8,369	-1,437	8,505	40,766	-32,261	11,051
十大交易人(週)	9,893	7,916	1,977	---	13,630	14,083	-453	---
十大交易人(近月)	54,773	33,208	21,565	302	36,477	61,241	-24,764	688
十大交易人(全月)	75,818	40,620	35,198	8,773	56,224	89,460	-33,236	5,411
全市場未沖銷(近月)			89,589	2,227			102,510	8,148
全市場未沖銷(全月)			125,199	-108,327			155,395	-94,548

更新日期：2022年2月23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03W1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	18400
	賣權成交最大量	17900	賣權OI最大量	17900
	整體隱含波動率	15.11%	較前一交易日	-1.32%
	買權隱含波動率	12.41%	較前一交易日	+1.29%
	賣權隱含波動率	17.31%	較前一交易日	-4.55%
電子選擇權	買權成交最大量	870	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	815	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	1800
	賣權成交最大量	1720	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年2月23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	19.05%	較前一交易日	+1.70%
	買權隱含波動率	13.77%	較前一交易日	-0.79%
	賣權隱含波動率	23.61%	較前一交易日	-3.02%
	成交量P/C_Ratio值	1.104	較前一交易日	+0.08
	未平倉P/C_Ratio值	1.144	較前一交易日	+0.06
電子選擇權	買權成交最大量	870	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	815	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	1800
	賣權成交最大量	1720	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年2月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

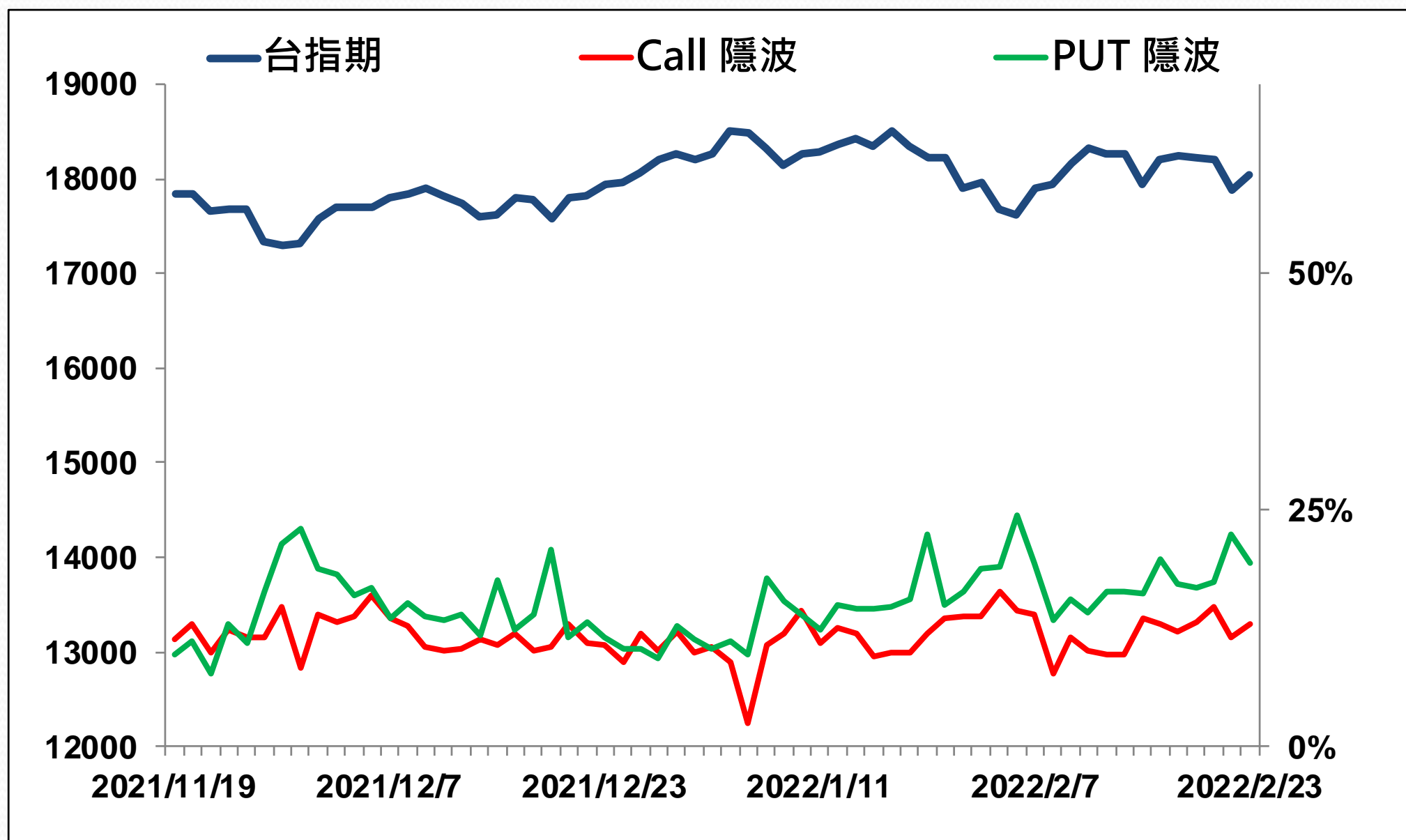
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



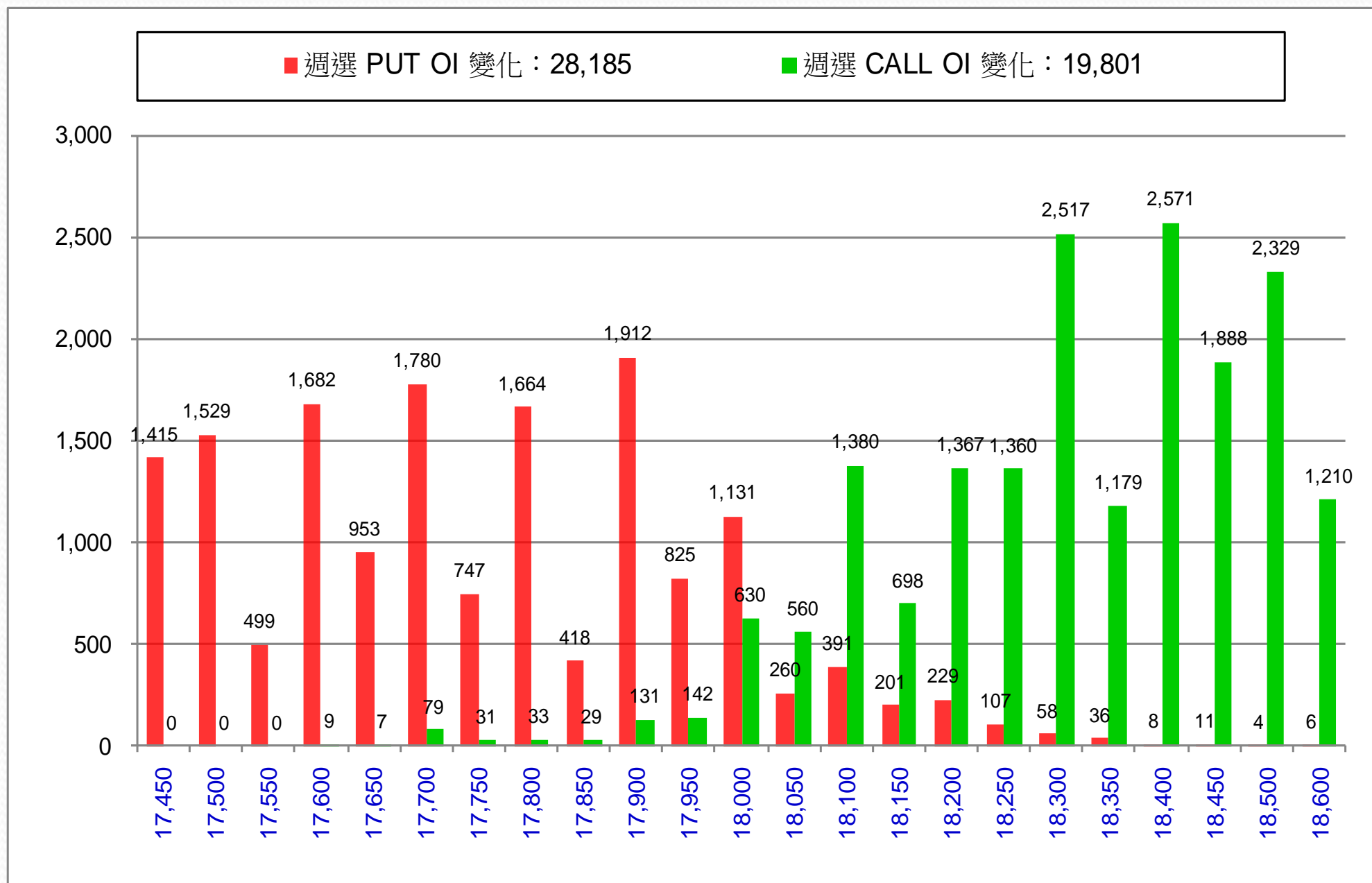
更新日期：2022年2月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年2月23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

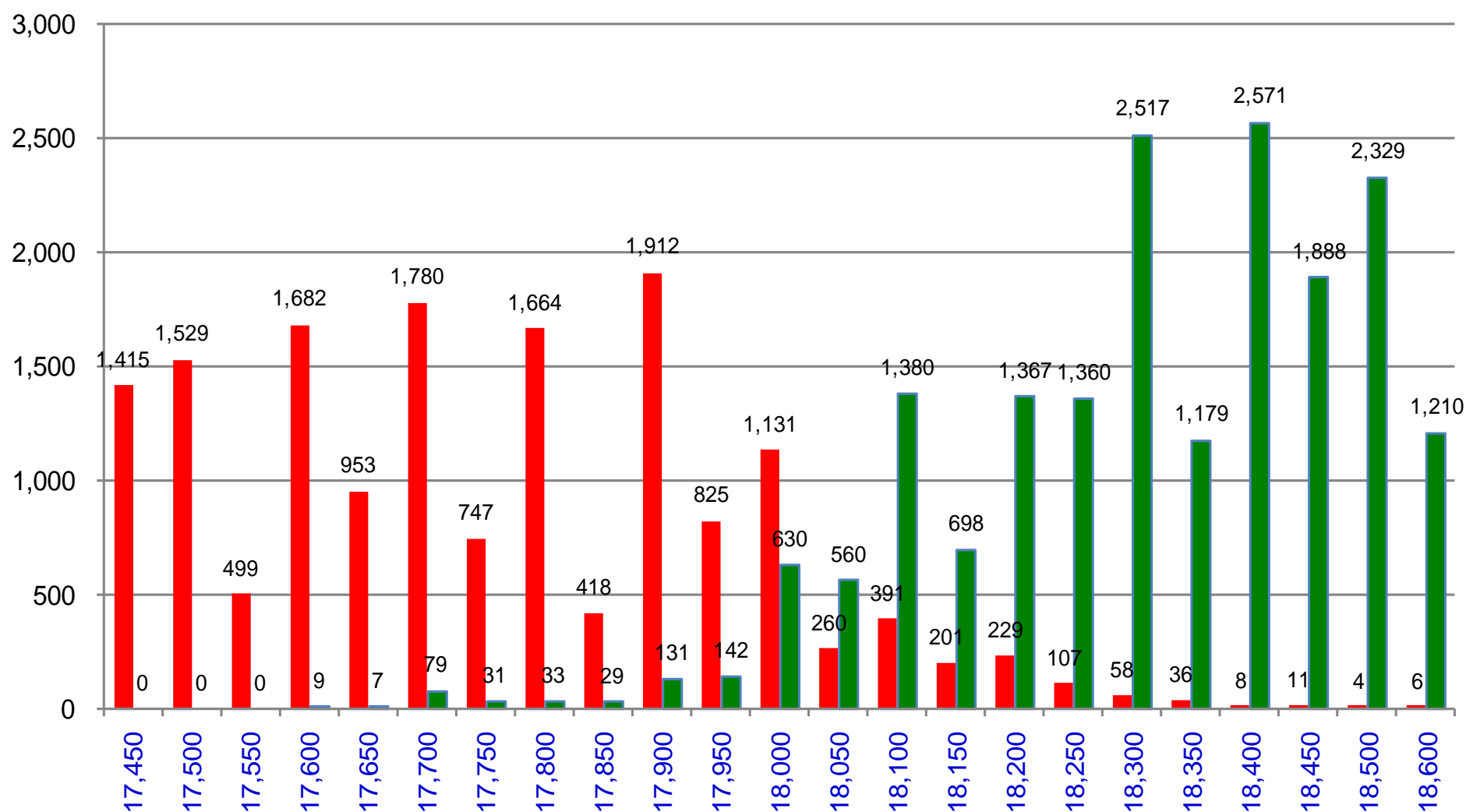


更新日期：2022年2月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：28,185

■ 週選 CALL OI 總額：19,801



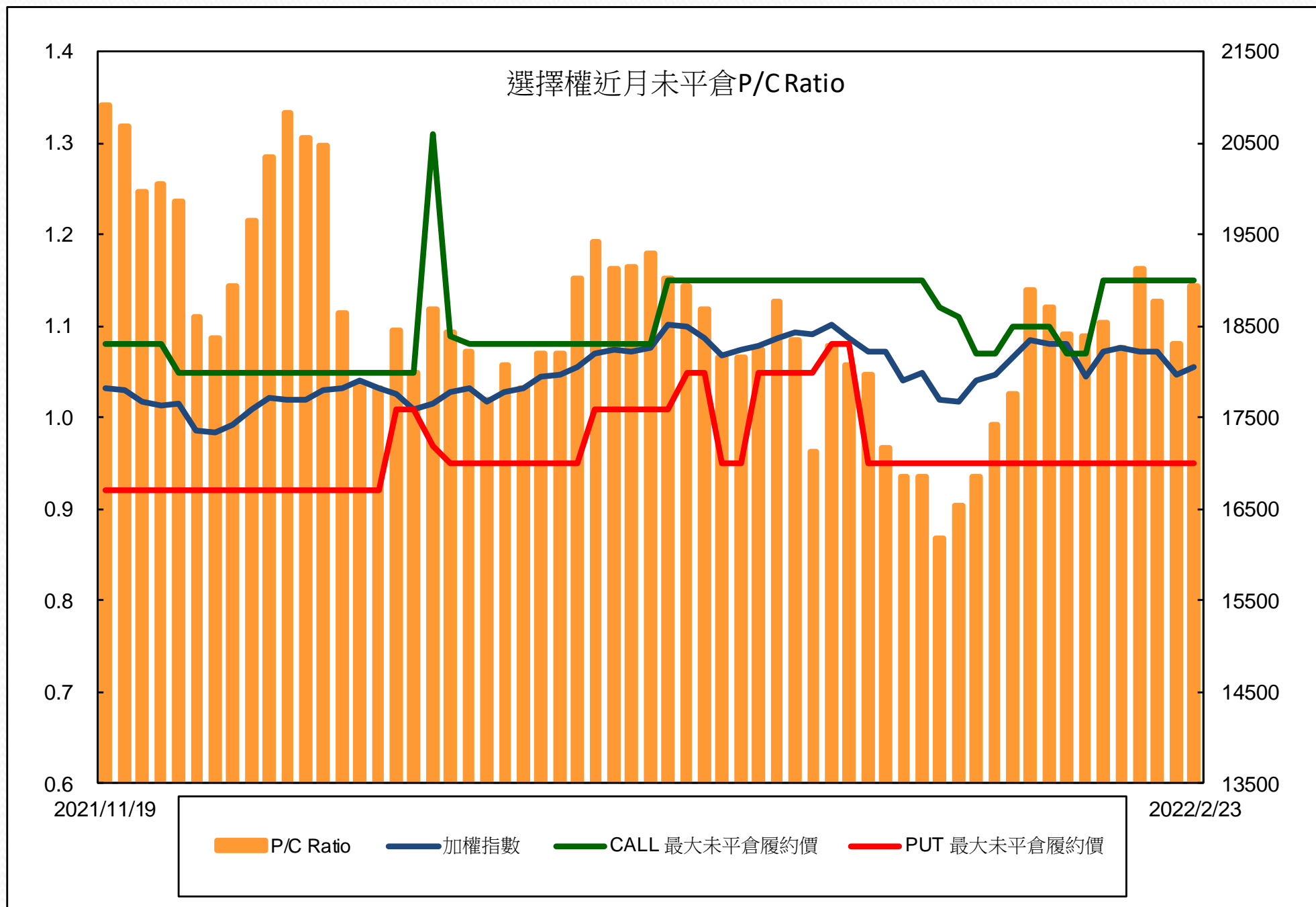
更新日期：2022年2月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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22日	67,255	53,163	14,092
	2月23日	54,008	30,085	23,923
Put	2月22日	65,980	50,663	15,317
	2月23日	49,705	38,725	10,980

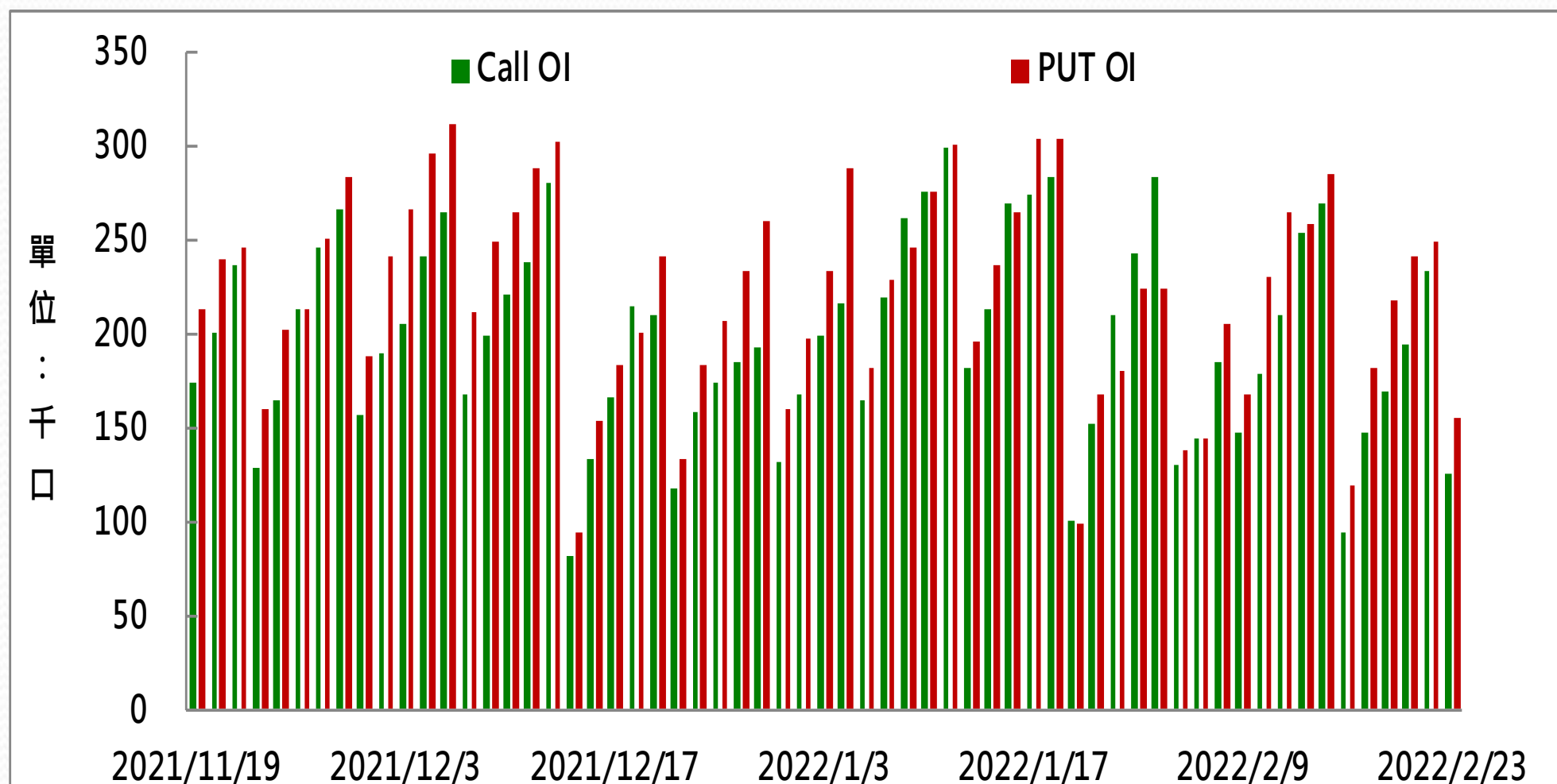
更新日期：2022年2月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年2月23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23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23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