

台指選擇權OI匯報

日期：2022/4/7 結算日：2022/4/13					日期：2022/4/7 結算日：2022/4/20				
202204W2					202204 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	16,200	1,098	622	0	3	16,000	7,273	-1,289
0	0	16,300	1,607	693	0	1	16,100	1,349	87
0	0	16,400	2,126	1,332	0	13	16,200	2,394	307
12	12	16,500	2,641	1,775	1	101	16,300	2,438	220
0	0	16,600	4,521	3,217	0	30	16,400	2,580	68
0	0	16,700	4,112	2,562	4	560	16,500	5,458	526
20	20	16,800	4,719	2,415	-13	588	16,600	2,898	424
20	24	16,900	3,751	2,116	25	1,155	16,700	4,139	-387
90	100	17,000	6,204	3,792	-38	1,273	16,800	6,827	117
53	53	17,050	1,349	1,349	-63	1,728	16,900	3,732	-38
392	443	17,100	4,470	1,994	60	1,673	17,000	7,463	-803
320	345	17,150	2,127	1,614	176	1,367	17,100	4,671	360
1,171	1,230	17,200	3,736	2,507	319	1,977	17,200	3,788	-353
2,246	2,295	17,250	1,916	1,201	181	2,359	17,300	4,178	248
3,551	3,618	17,300	2,774	798	222	2,534	17,400	3,239	-450
4,155	4,247	17,350	1,597	816	1,010	4,060	17,500	3,718	-290
3,795	4,124	17,400	2,108	377	1,988	5,709	17,600	2,264	-42
4,037	4,290	17,450	1,084	427	2,107	7,654	17,700	2,084	-33
※ 6,420	7,381	17,500	1,072	172	-437	6,378	17,800	676	-92
5,142	5,711	17,550	352	210	-199	6,194	17,900	729	7
6,397	7,574	17,600	500	13	-1,171	14,515	18,000	804	-20
5,163	6,016	17,650	261	153	239	7,674	18,100	436	-3
4,871	6,660	17,700	183	123	-841	8,247	18,200	213	-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
61,623	81,481	0.7270	59,236	33,061	1,745	114,598	1.0211	117,014	-1,082
昨日 P/C	1.2565	今日增減變化		-0.5295	昨日 P/C	1.0465	今日增減變化		-0.0254

更新日期：2022年4月7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4月7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	86,806,570	109,138,499	-22,331,929	-3,000,526	3,699,877	1,526,633	2,173,244	-244,528
投信	32,943,496	55,663,502	-22,720,006	-2,900,845	435,280	0	435,280	-10,184
自營商	67,257,423	26,227,847	41,029,576	-1,626,319	1,447,605	1,176,387	271,218	84,060
	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	837,106	2,864,394	-2,027,288	541,672	42,994	8,268	34,726	-49,654
投信	28,473	0	28,473	-327	1,654	0	1,654	-34
自營商	709,814	461,287	248,527	-227,518	266,236	340,703	-74,467	47,011

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報

2022年4月7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	38,220	22,864	15,356	-553	49,595	18,238	31,357	-461
投信	0	100	-100	0	200	63	137	0
自營商	79,730	54,945	24,785	-3,140	47,222	53,338	-6,116	-1,034
特定法人(週)	5,168	0	5,168	3,086	1,837	1,797	40	1,012
特定法人(近月)	22,448	22,156	292	-1,005	5,023	25,224	-20,201	-626
特定法人(全月)	27,892	16,420	11,472	917	7,644	37,974	-30,330	2,511
十大交易人(週)	27,414	28,980	-1,566	-3,655	17,540	15,449	2,091	-2,518
十大交易人(近月)	63,498	47,466	16,032	-2,453	51,459	51,268	191	4,278
十大交易人(全月)	108,891	71,371	37,520	-2,175	76,924	83,851	-6,927	3,057
全市場未沖銷(近月)			114,598	1,745			117,014	-1,082
全市場未沖銷(全月)			233,247	68,246			206,676	32,983

更新日期：2022年4月7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 04W2 週 選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	17500	買權OI最大量	17600
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	15.74%	較前一交易日	+0.74%
	買權隱含波動率	13.25%	較前一交易日	+1.46%
	賣權隱含波動率	19.11%	較前一交易日	+1.56%
電子選擇權	買權成交最大量	820	買權OI最大量	830
	賣權成交最大量	760	賣權OI最大量	730
金融選擇權	買權成交最大量	1960	買權OI最大量	1780
	賣權成交最大量	1880	賣權OI最大量	1880

更新日期：2022年4月7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 04 月 選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	17700	買權OI最大量	18000
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	18.25%	較前一交易日	-1.64%
	買權隱含波動率	14.16%	較前一交易日	+1.34%
	賣權隱含波動率	22.53%	較前一交易日	+1.87%
	成交量P/C_Ratio值	0.949	較前一交易日	+0.01
	未平倉P/C_Ratio值	1.021	較前一交易日	-0.03
電子選擇權	買權成交最大量	820	買權OI最大量	830
	賣權成交最大量	760	賣權OI最大量	730
金融選擇權	買權成交最大量	1960	買權OI最大量	1780
	賣權成交最大量	1880	賣權OI最大量	1880

更新日期：2022年4月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

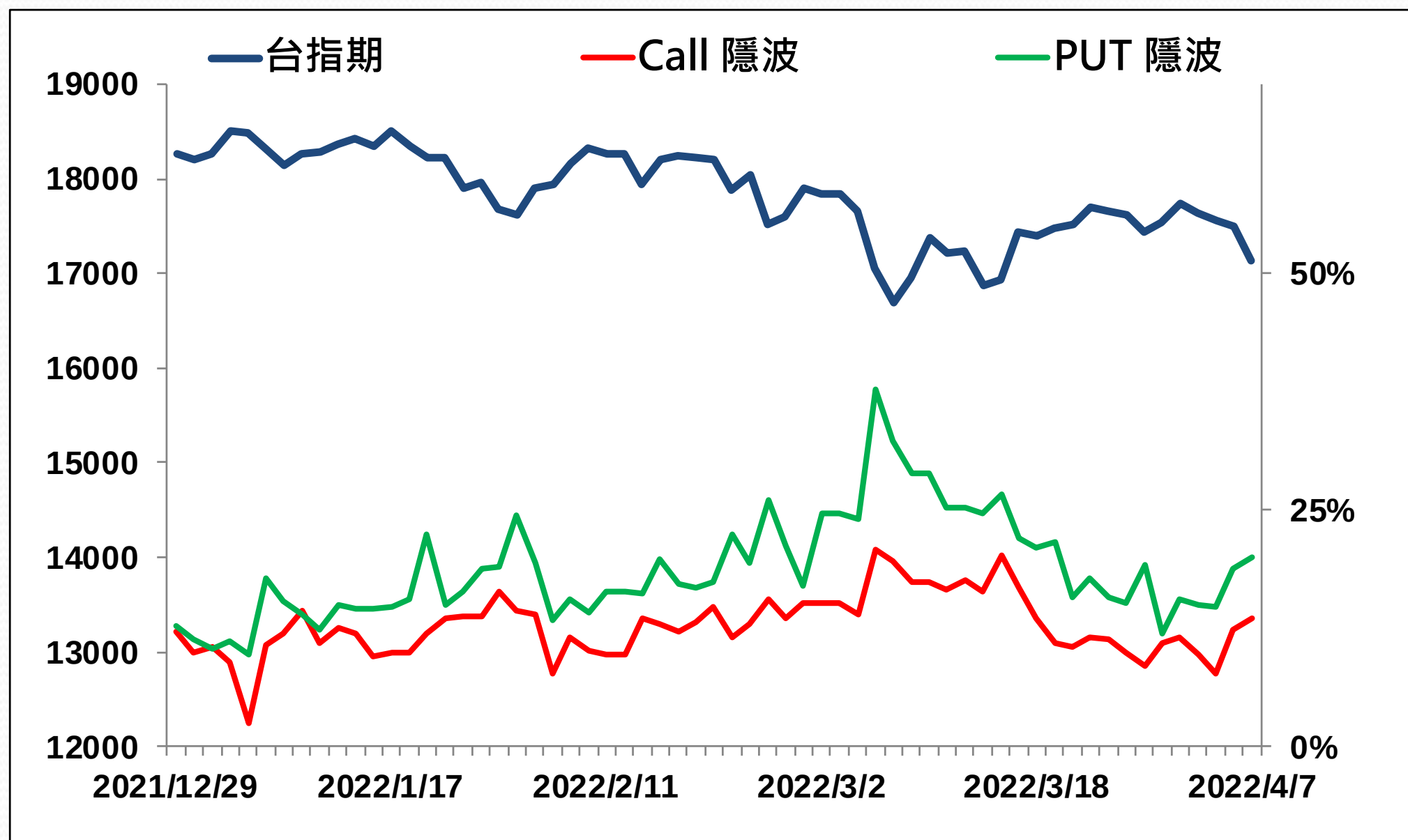
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



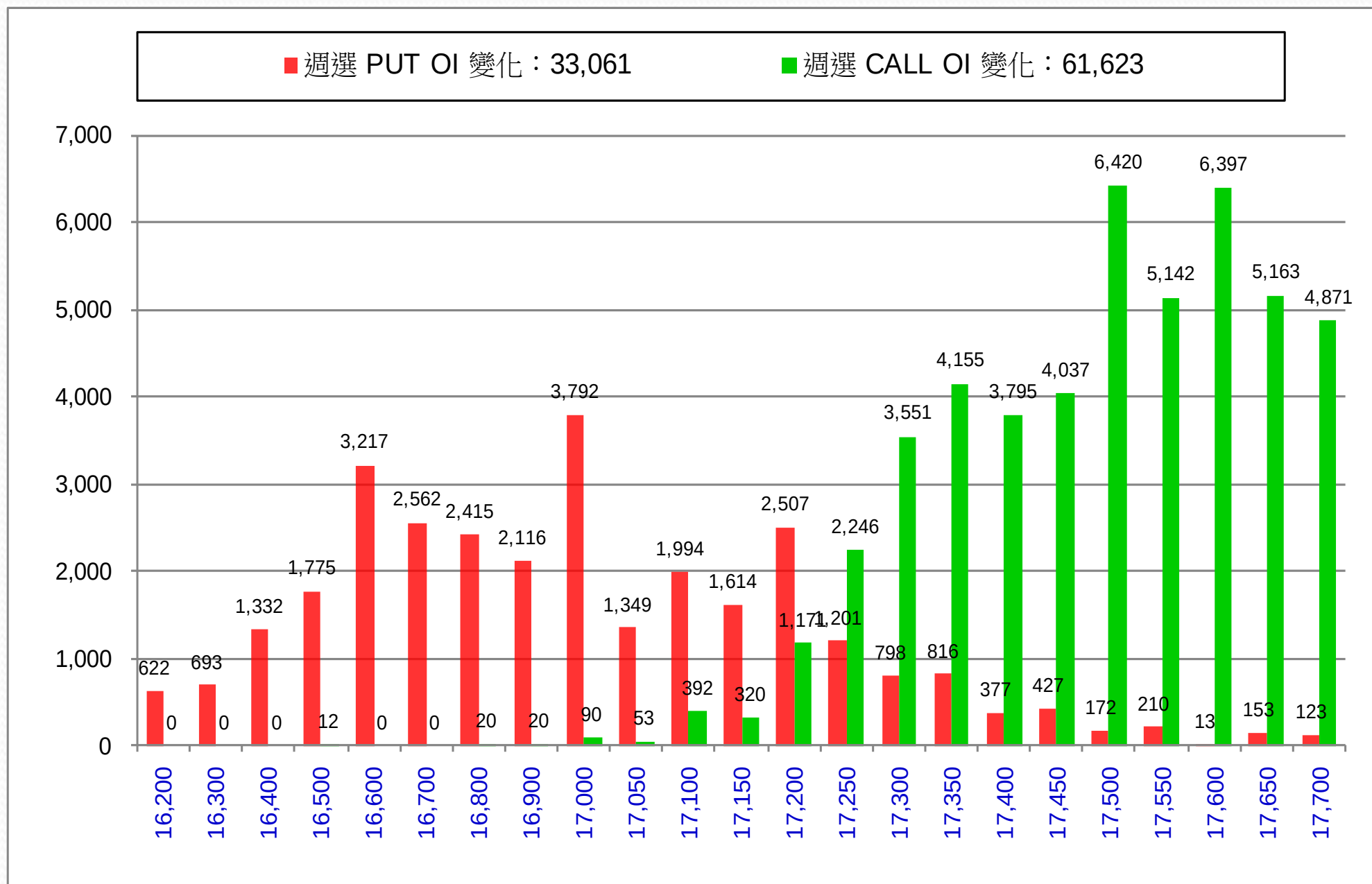
更新日期：2022年4月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年4月7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

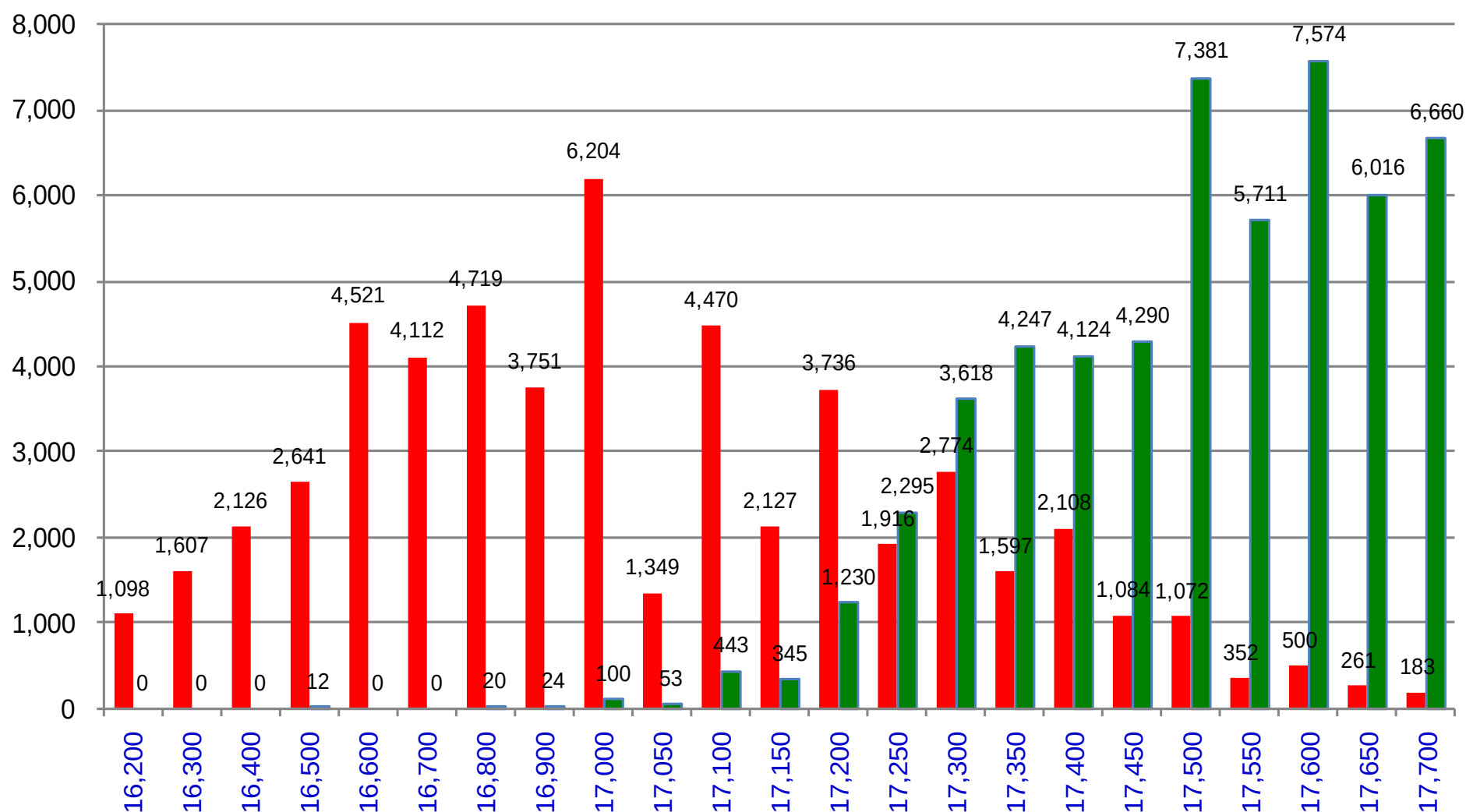


更新日期：2022年4月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：59,236

週選 CALL OI 總額：81,481



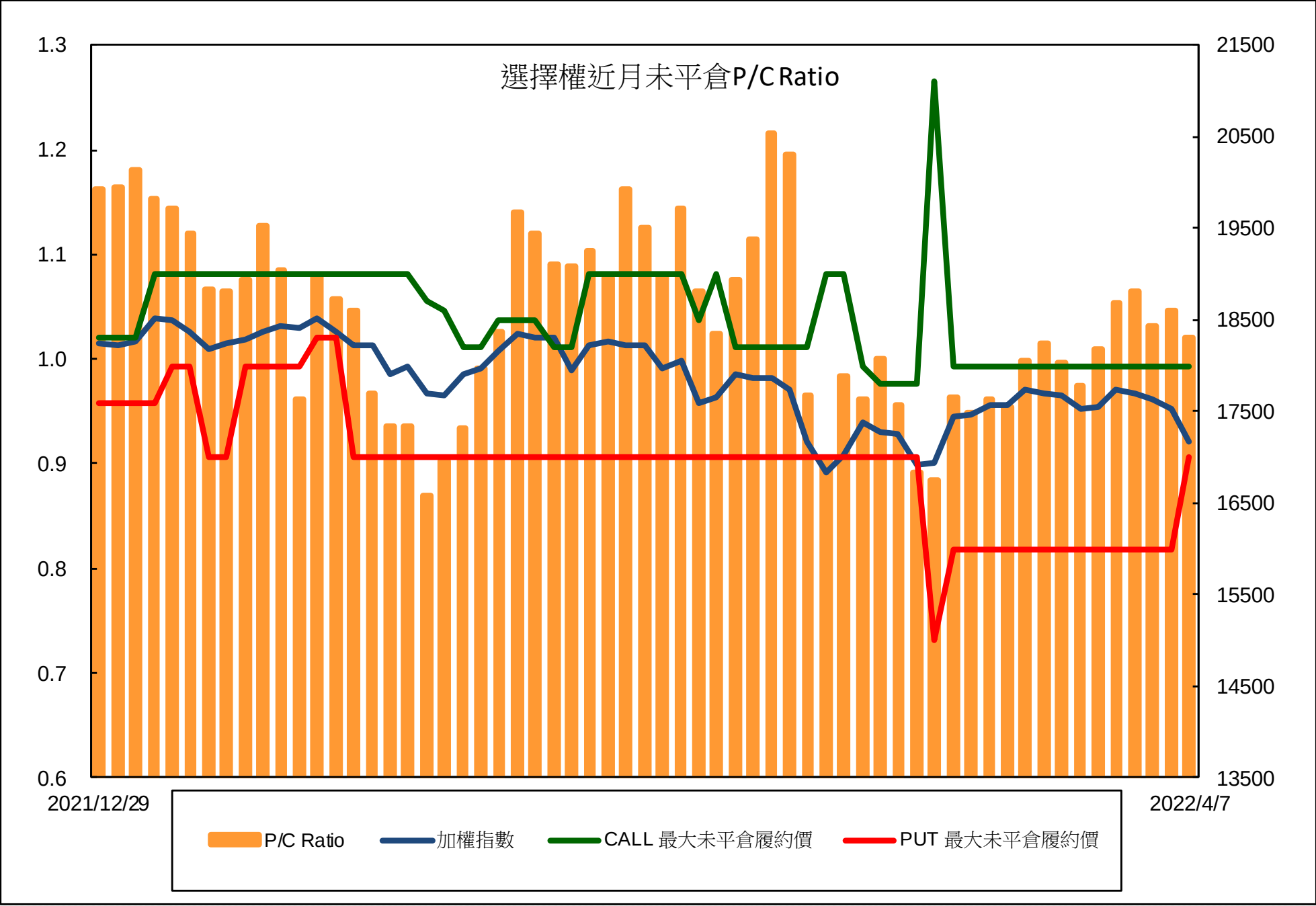
更新日期：2022年4月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	4月6日	68,869	40,944	27,925
	4月7日	79,730	54,945	24,785
Put	4月6日	44,059	49,141	-5,082
	4月7日	47,222	53,338	-6,116

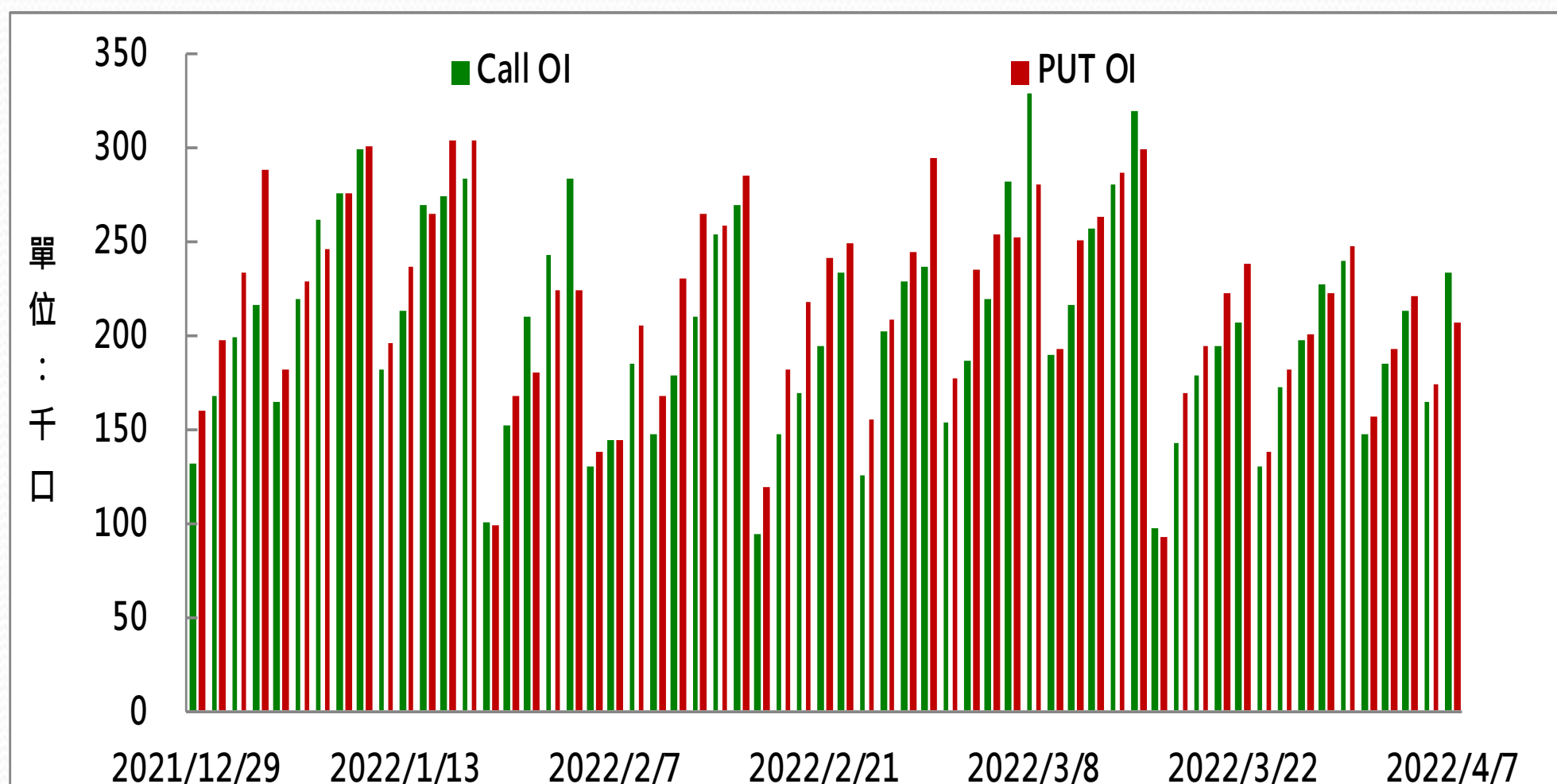
更新日期：2022年4月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年4月7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4月7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4月7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