

台指選擇權OI匯報

日期：2022/4/8 結算日：2022/4/13					日期：2022/4/8 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
4	4	16,700	4,820	708	0	1	16,100	1,467	118
0	0	16,750	1,395	1,395	0	13	16,200	2,399	5
-8	12	16,800	6,358	1,639	0	101	16,300	2,599	161
0	0	16,850	829	829	0	30	16,400	2,746	166
23	47	16,900	6,278	2,527	5	565	16,500	6,064	606
2	2	16,950	1,444	1,444	0	588	16,600	3,089	191
80	180	17,000	8,489	2,285	-81	1,074	16,700	4,378	239
74	127	17,050	1,910	561	-5	1,268	16,800	7,978	1,151
181	624	17,100	5,522	1,052	13	1,741	16,900	3,784	52
392	737	17,150	3,340	1,213	90	1,763	17,000	8,042	579
705	1,935	17,200	5,127	1,391	19	1,386	17,100	4,971	300
958	3,253	17,250	2,717	801	216	2,193	17,200	4,297	509
1,557	5,175	17,300	3,777	1,003	756	3,115	17,300	4,137	-41
928	5,175	17,350	1,879	282	389	2,923	17,400	3,010	-229
940	5,064	17,400	2,143	35	729	4,789	17,500	3,705	-13
1,459	5,749	17,450	1,103	19	※ 1,430	7,139	17,600	2,194	-70
1,370	8,751	17,500	1,034	-38	342	7,996	17,700	2,039	-45
2,305	8,016	17,550	356	4	-169	6,209	17,800	688	12
※ 6,579	14,153	17,600	471	-29	229	6,423	17,900	695	-34
1,682	7,698	17,650	247	-14	989	15,504	18,000	799	-5
15	6,675	17,700	162	-21	-290	7,384	18,100	436	0
-677	4,827	17,750	38	-2	-49	8,198	18,200	213	0
-329	6,000	17,800	1,096	-15	-363	6,091	18,300	84	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
18,425	99,906	0.8265	82,574	23,338	3,742	118,340	1.0326	122,196	5,182
昨日 P/C	0.7118	今日增減變化		0.1147	昨日 P/C	1.0211	今日增減變化		0.0115

更新日期：2022年4月8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8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	95,689,391	104,807,932	-9,118,541	13,213,388	3,988,615	1,810,413	2,178,202	4,958
投信	33,330,965	55,438,555	-22,107,590	612,416	424,860	0	424,860	-10,420
自營商	64,796,491	27,324,445	37,472,046	-3,557,530	1,489,920	1,115,789	374,131	102,913
	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	944,979	2,580,894	-1,635,915	391,373	20,178	1,682	18,496	-16,230
投信	28,869	0	28,869	396	1,682	0	1,682	28
自營商	817,837	642,829	175,008	-73,519	282,494	341,361	-58,867	15,600

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8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	47,613	23,964	23,649	8,293	51,323	19,461	31,862	505
投信	0	100	-100	0	200	63	137	0
自營商	86,252	60,370	25,882	1,097	53,184	62,261	-9,077	-2,961
特定法人(週)	13,342	0	13,342	8,174	0	1,797	-1,797	-1,837
特定法人(近月)	22,445	22,710	-265	-557	5,023	25,703	-20,680	-479
特定法人(全月)	35,725	21,485	14,240	2,768	4,908	39,074	-34,166	-3,836
十大交易人(週)	39,896	35,370	4,526	6,092	25,921	18,298	7,623	5,532
十大交易人(近月)	65,349	48,810	16,539	507	53,927	53,579	348	157
十大交易人(全月)	123,074	78,901	44,173	6,653	86,068	90,389	-4,321	2,606
全市場未沖銷(近月)			118,340	3,742			122,196	5,182
全市場未沖銷(全月)			257,577	24,330			237,370	30,694

更新日期：2022年4月8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	14.52%	較前一交易日	-1.22%
	買權隱含波動率	13.80%	較前一交易日	+0.55%
	賣權隱含波動率	15.20%	較前一交易日	-3.91%
電子選擇權	買權成交最大量	820	買權OI最大量	820
	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	1960
	賣權成交最大量	1860	賣權OI最大量	1880

更新日期：2022年4月8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	17600	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	17.70%	較前一交易日	+0.55%
	買權隱含波動率	14.60%	較前一交易日	+0.44%
	賣權隱含波動率	20.24%	較前一交易日	-2.29%
	成交量P/C_Ratio值	1.203	較前一交易日	+0.25
	未平倉P/C_Ratio值	1.033	較前一交易日	+0.01
電子選擇權	買權成交最大量	820	買權OI最大量	820
	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	1960
	賣權成交最大量	1860	賣權OI最大量	1880

更新日期：2022年4月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

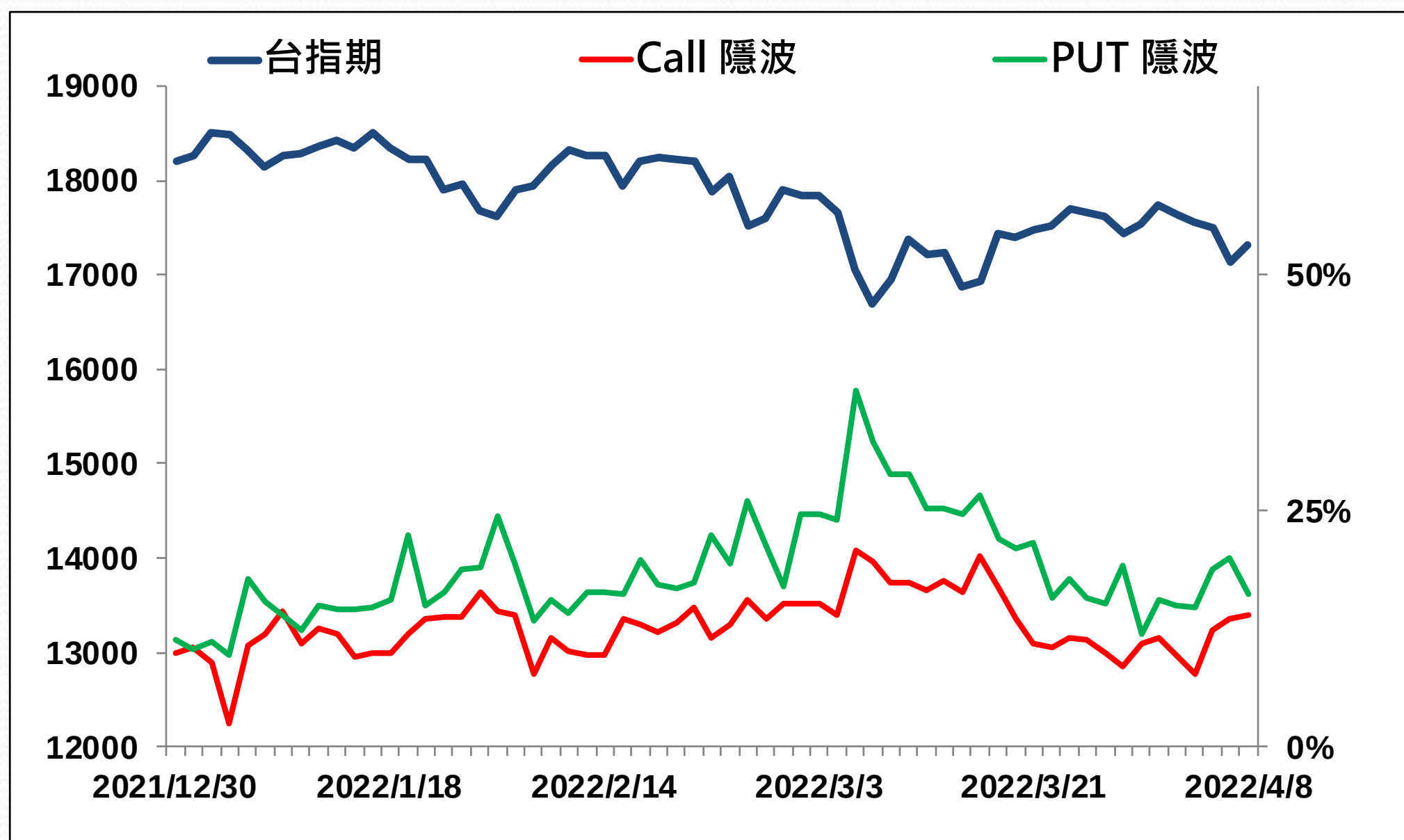
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



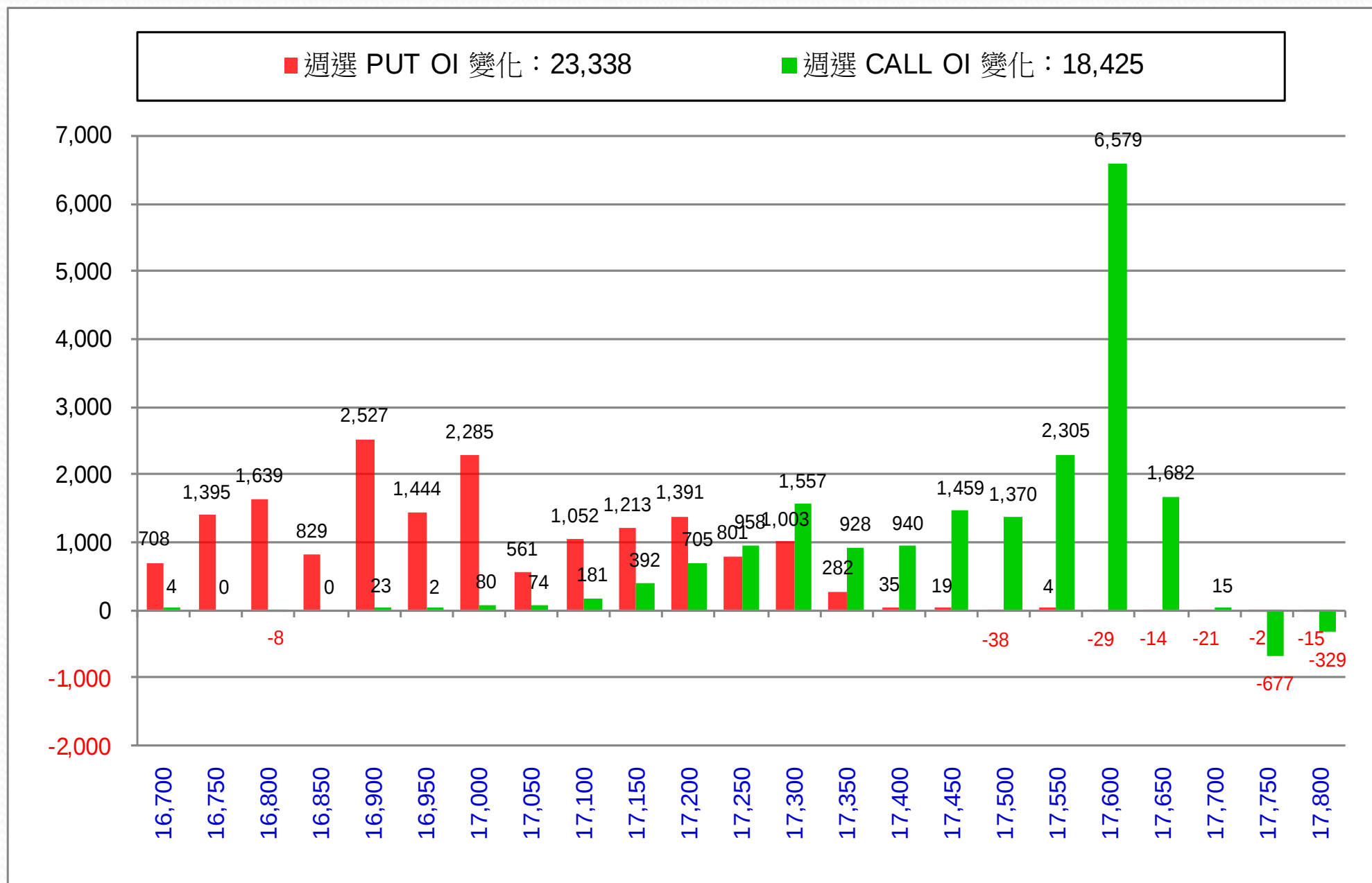
更新日期：2022年4月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年4月8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

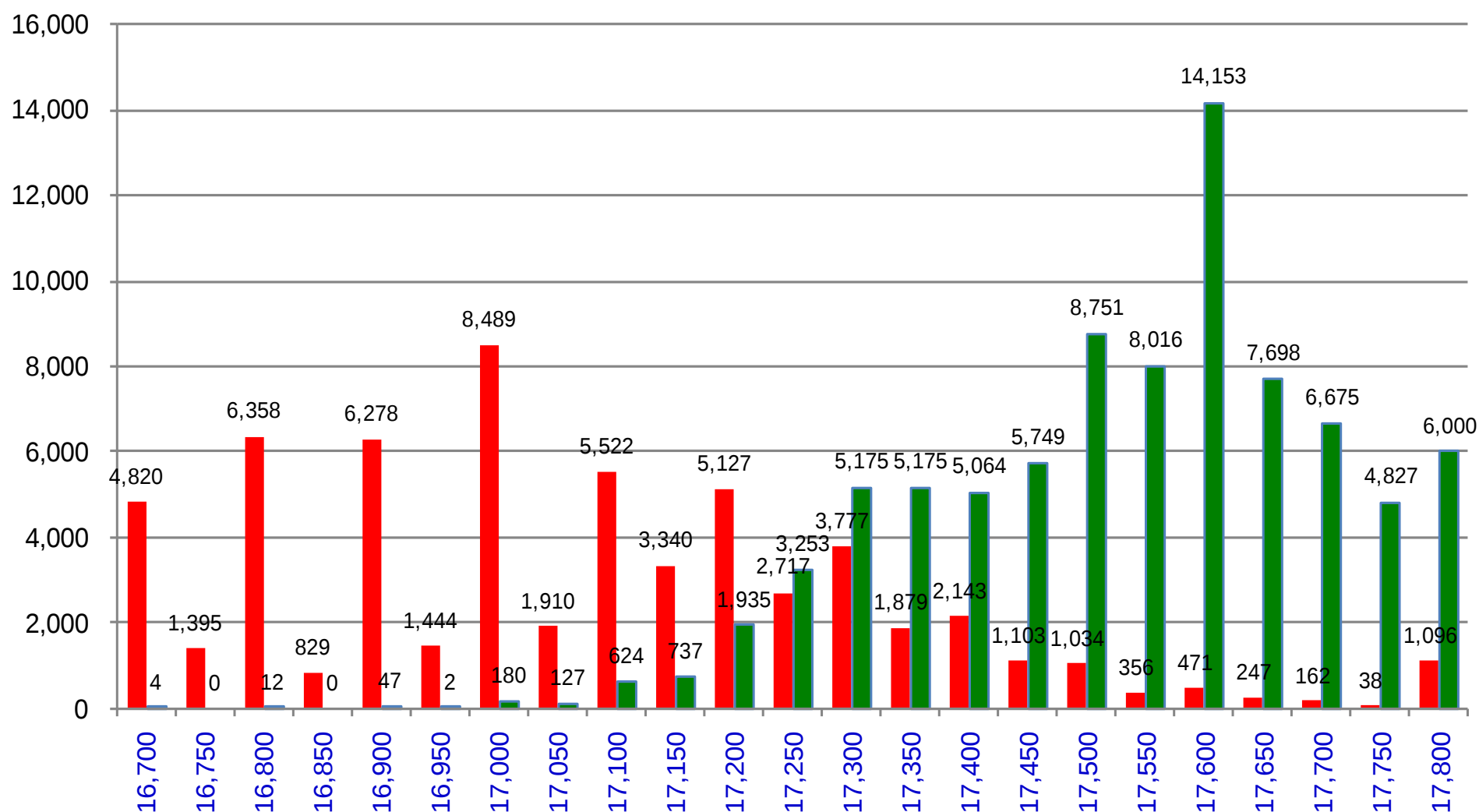


更新日期：2022年4月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：82,574

週選 CALL OI 總額：99,906



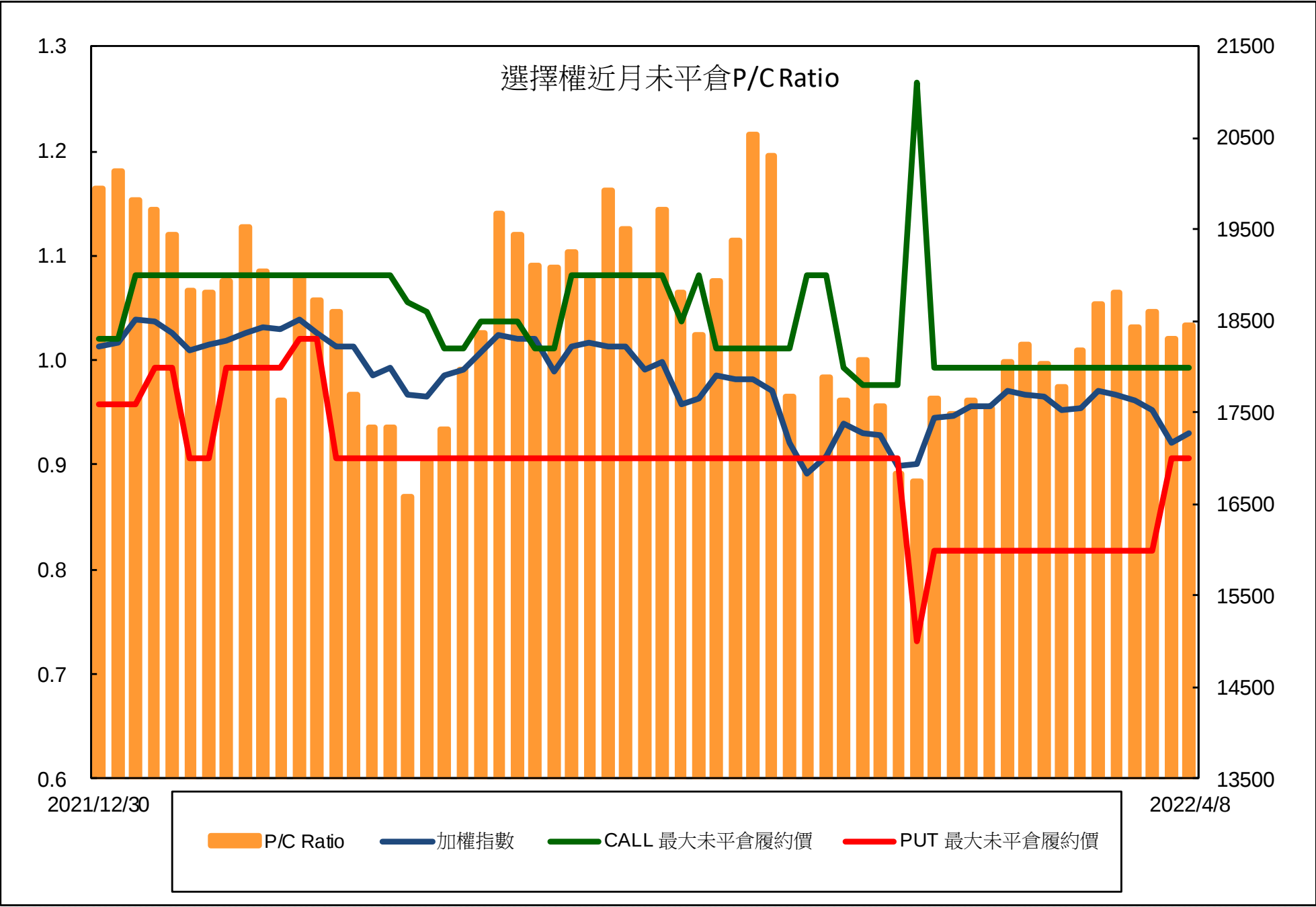
更新日期：2022年4月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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7日	79,730	54,945	24,785
	4月8日	86,252	60,370	25,882
Put	4月7日	47,222	53,338	-6,116
	4月8日	53,184	62,261	-9,077

更新日期：2022年4月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

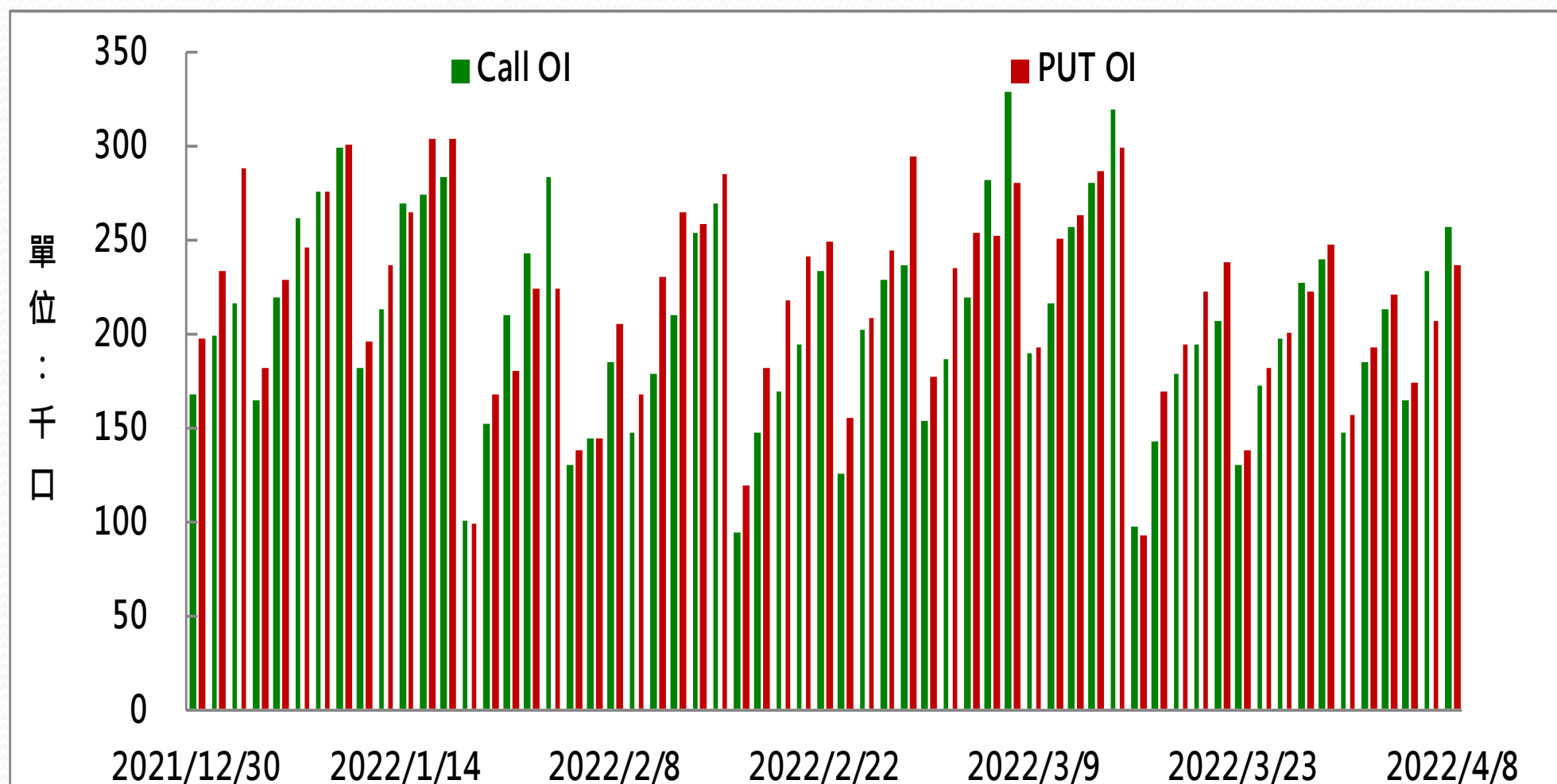
選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年4月8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8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8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