

台指選擇權OI匯報

日期：2022/4/12 結算日：2022/4/13					日期：2022/4/12 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	16,300	3,370	148	0	0	15,800	5,757	1,885
0	6	16,400	4,548	956	0	10	15,900	1,579	-49
0	2	16,500	6,257	1,510	0	3	16,000	6,716	-393
4	4	16,550	1,126	1,126	0	1	16,100	2,161	751
6	9	16,600	8,685	2,266	0	13	16,200	3,335	935
2	2	16,650	1,453	1,453	0	101	16,300	5,807	1,999
23	31	16,700	8,304	1,901	1	32	16,400	3,534	532
6	8	16,750	6,087	3,148	22	581	16,500	8,069	1,158
47	143	16,800	11,084	3,499	9	610	16,600	3,770	292
381	424	16,850	4,881	2,404	24	1,083	16,700	4,832	132
1,081	1,456	16,900	7,853	1,566	155	1,456	16,800	8,202	649
1,405	1,769	16,950	3,743	1,322	433	2,172	16,900	4,959	13
※ 4,940	6,373	17,000	9,893	693	960	3,414	17,000	6,972	-39
3,241	4,848	17,050	3,423	654	183	2,257	17,100	4,118	-441
3,621	7,160	17,100	5,347	227	497	3,571	17,200	3,761	-220
1,766	5,866	17,150	2,817	-274	※ 1,491	5,389	17,300	3,046	-1,095
4,262	10,280	17,200	3,855	-710	1,395	7,028	17,400	2,614	-207
373	7,732	17,250	2,649	-209	936	7,225	17,500	3,296	-88
135	9,756	17,300	3,960	-305	414	6,402	17,600	2,126	-25
-147	8,588	17,350	1,849	-83	-152	6,537	17,700	2,019	-22
-2,133	8,367	17,400	2,075	-336	-32	6,457	17,800	605	-36
-1,173	5,192	17,450	1,291	-54	-351	5,499	17,900	646	-3
-1,136	5,698	17,500	972	-43	-369	14,773	18,000	776	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
11,647	138,001	0.8446	116,560	21,124	4,635	126,417	1.0540	133,246	6,874
昨日 P/C	0.7445	今日增減變化		0.1001	昨日 P/C	1.0377	今日增減變化		0.0163

更新日期：2022年4月12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12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	100,943,992	107,101,005	-6,157,013	-4,878,830	5,251,686	1,907,730	3,343,956	-438,702
投信	32,249,000	56,389,000	-24,140,000	-257,534	424,974	0	424,974	9,842
自營商	68,333,461	27,670,786	40,662,675	1,025,168	1,615,886	1,265,283	350,603	74,829
	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	1,162,825	2,430,643	-1,267,818	479,189	3,317	39,809	-36,492	-23,124
投信	28,641	0	28,641	-189	1,659	0	1,659	-12
自營商	853,367	794,276	59,091	-186,878	466,093	476,025	-9,932	20,095

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12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	49,900	26,484	23,416	-1,023	59,089	26,054	33,035	129
投信	0	0	0	100	200	63	137	0
自營商	85,751	84,064	1,687	-3,050	69,788	69,738	50	997
特定法人(週)	12,981	0	12,981	-92	3,038	2,920	118	179
特定法人(近月)	22,486	17,670	4,816	2,496	8,778	26,952	-18,174	862
特定法人(全月)	35,254	16,616	18,638	394	12,900	45,061	-32,161	-683
十大交易人(週)	41,018	47,975	-6,957	114	34,161	28,354	5,807	2,687
十大交易人(近月)	63,685	52,478	11,207	-1,100	62,919	62,929	-10	-2,062
十大交易人(全月)	125,869	99,118	26,751	1,304	101,011	110,689	-9,678	-1,984
全市場未沖銷(近月)			126,417	4,635			133,246	6,874
全市場未沖銷(全月)			310,926	18,463			286,218	29,635

更新日期：2022年4月12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	17100	買權OI最大量	17600
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	16800
	整體隱含波動率	15.00%	較前一交易日	-1.40%
	買權隱含波動率	15.93%	較前一交易日	-0.08%
	賣權隱含波動率	14.08%	較前一交易日	-2.80%
電子選擇權	買權成交最大量	825	買權OI最大量	825
	賣權成交最大量	745	賣權OI最大量	760
金融選擇權	買權成交最大量	1940	買權OI最大量	1960
	賣權成交最大量	1920	賣權OI最大量	1880

更新日期：2022年4月12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	17400	買權OI最大量	18000
	賣權成交最大量	16500	賣權OI最大量	16800
	整體隱含波動率	19.68%	較前一交易日	-0.82%
	買權隱含波動率	17.26%	較前一交易日	+1.57%
	賣權隱含波動率	21.44%	較前一交易日	-0.47%
	成交量P/C_Ratio值	1.303	較前一交易日	+0.27
	未平倉P/C_Ratio值	1.054	較前一交易日	+0.02
電子選擇權	買權成交最大量	825	買權OI最大量	825
	賣權成交最大量	745	賣權OI最大量	760
金融選擇權	買權成交最大量	1940	買權OI最大量	1960
	賣權成交最大量	1920	賣權OI最大量	1880

更新日期：2022年4月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

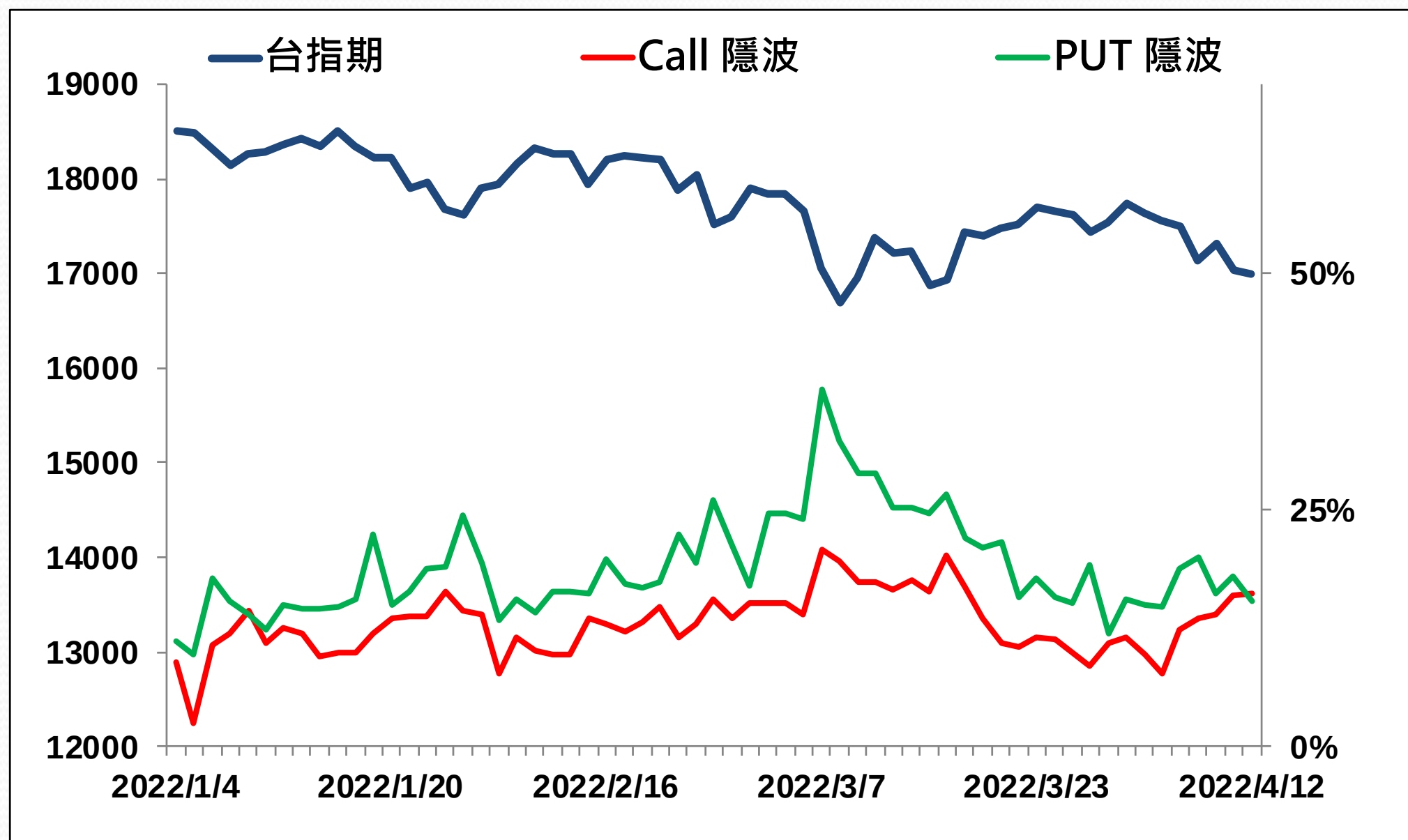
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



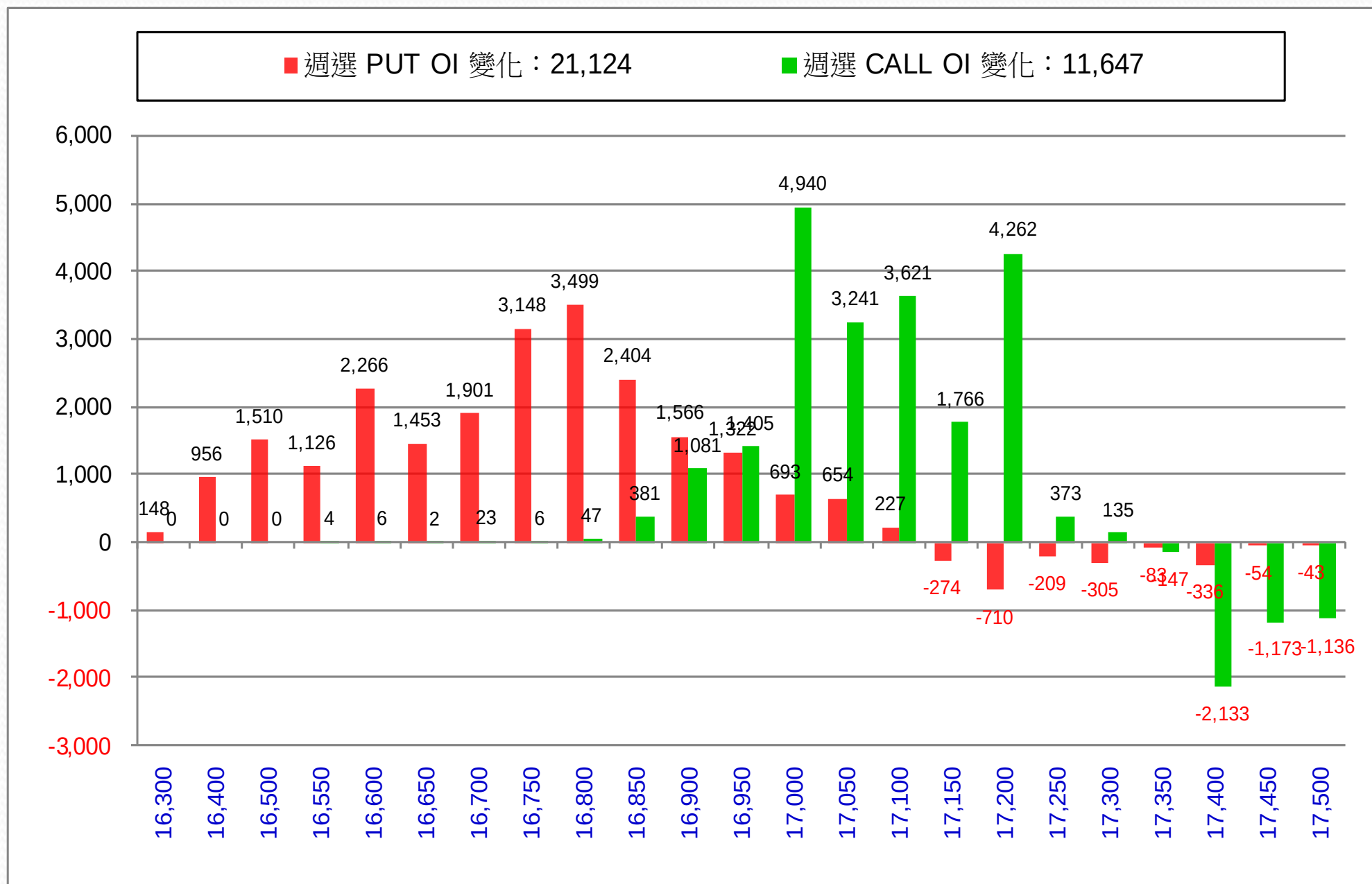
更新日期：2022年4月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年4月12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

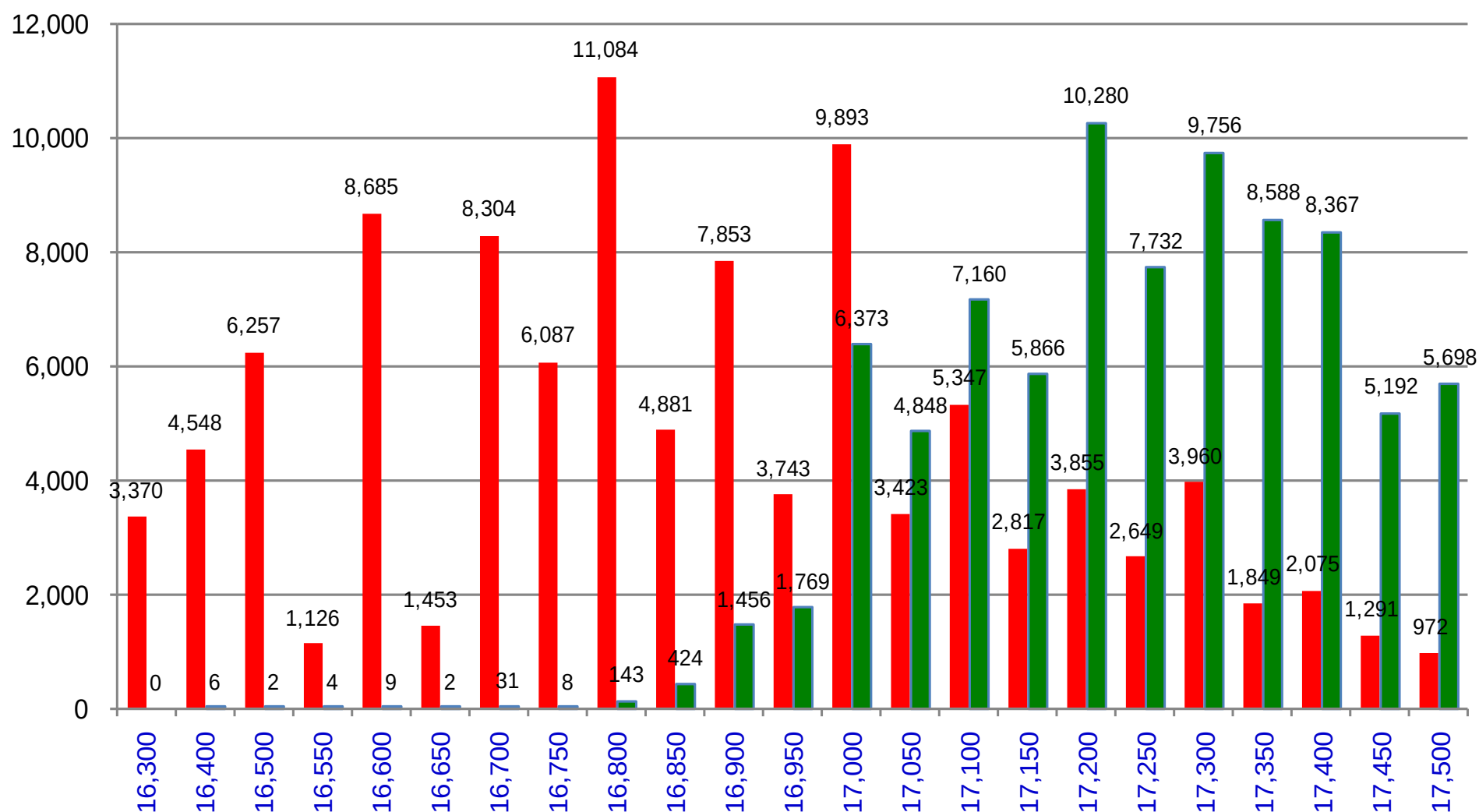


更新日期：2022年4月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：116,560

週選 CALL OI 總額：138,001



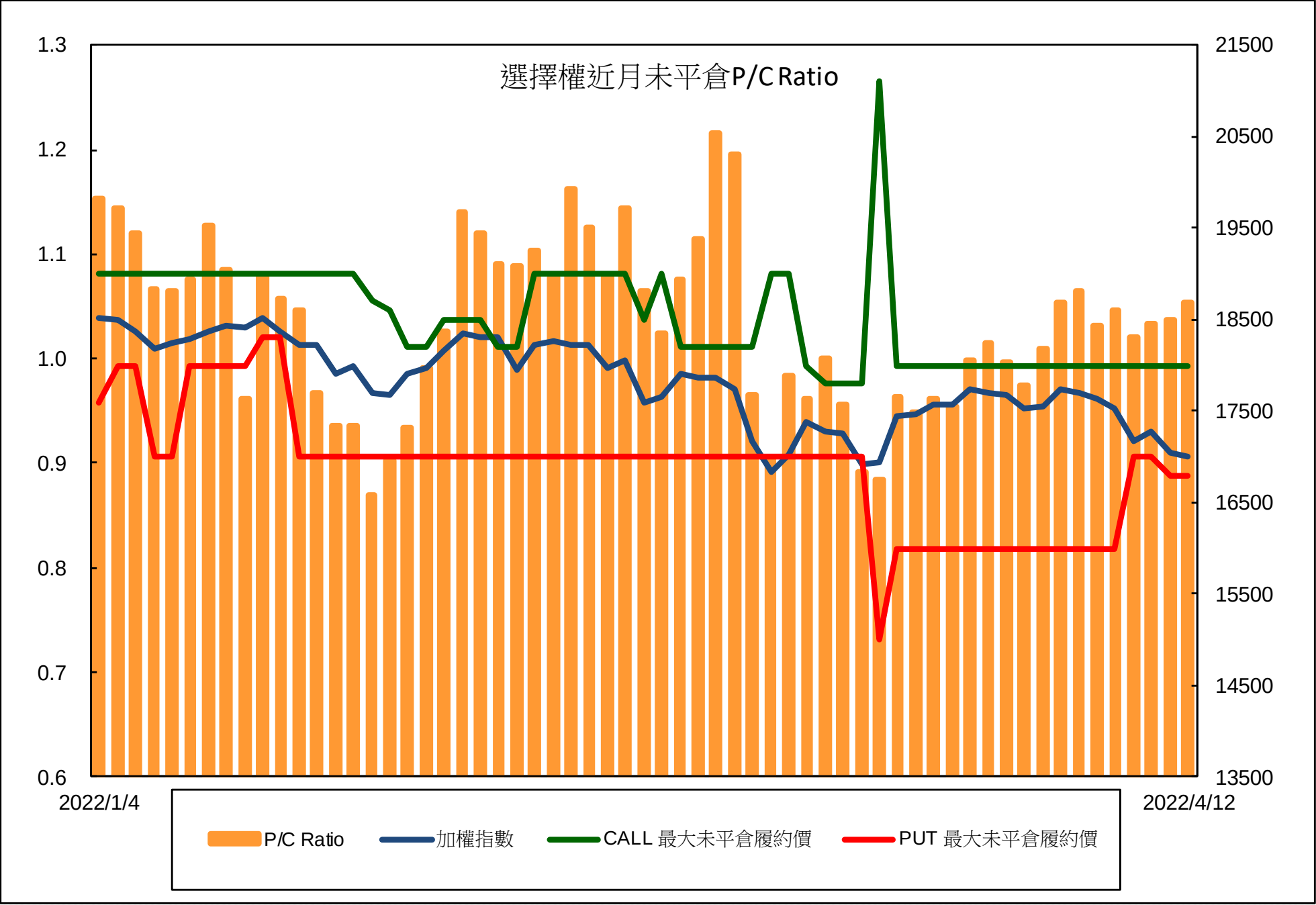
更新日期：2022年4月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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11日	80,897	76,160	4,737
	4月12日	85,751	84,064	1,687
Put	4月11日	60,997	61,944	-947
	4月12日	69,788	69,738	50

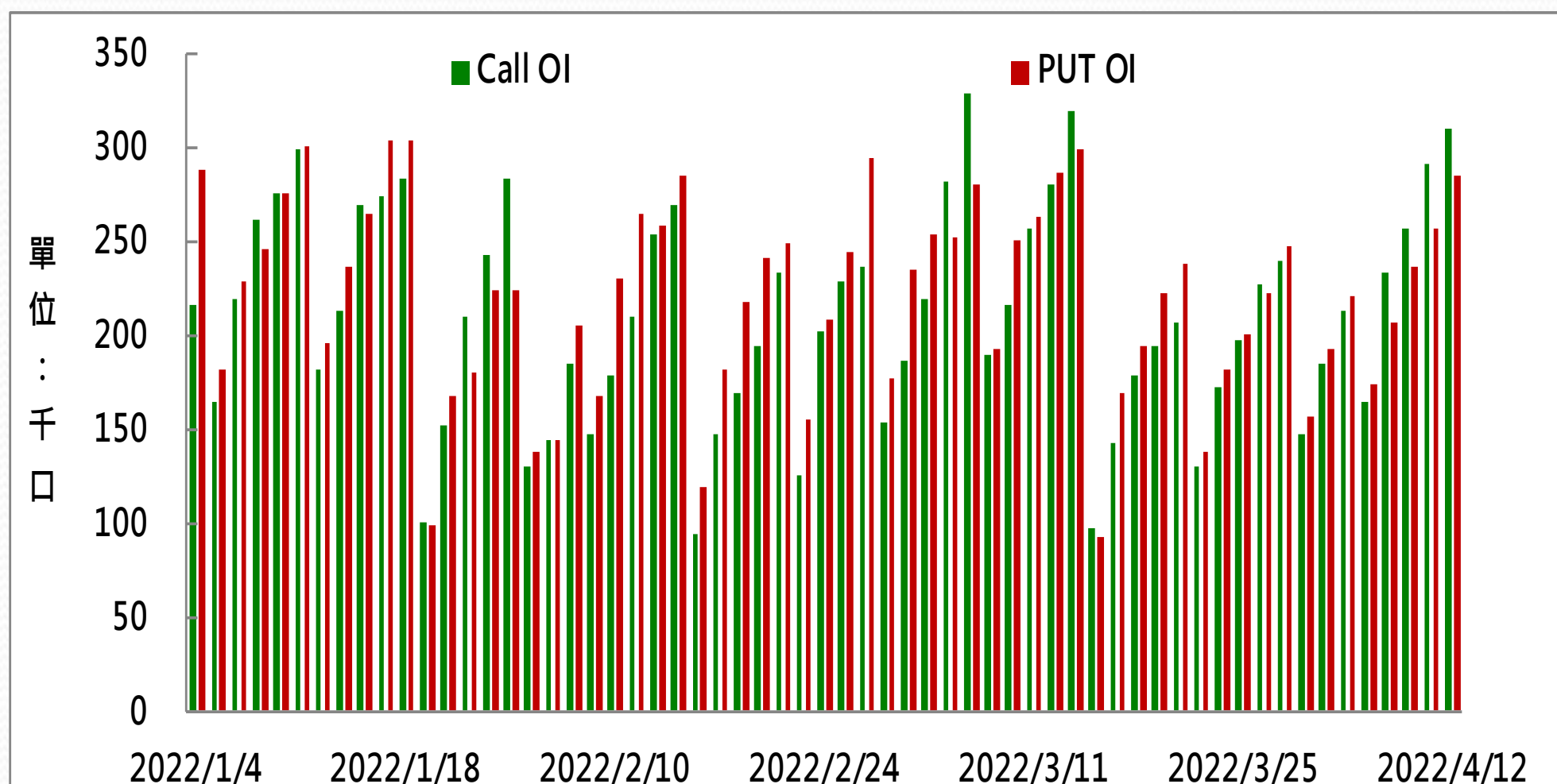
更新日期：2022年4月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年4月12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12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12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