

台指選擇權OI匯報

日期：2022/2/24 結算日：2022/3/2					日期：2022/2/24 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	16,600	5,493	5,366 ※	0	25	16,400	3,446	13
1	1	16,700	4,360	4,163	0	7	16,500	2,719	144
0	0	16,800	2,852	1,353	0	13	16,600	2,694	82
0	0	16,900	2,354	652	1	1	16,700	2,473	155
0	0	17,000	4,277	2,788	8	67	16,800	7,158	389
0	0	17,100	4,726	3,369	0	5	16,900	3,200	-56
13	13	17,200	4,692	3,698	0	98	17,000	9,468	68
58	58	17,300	4,741	3,013	7	21	17,100	2,351	175
134	134	17,400	4,075	2,642	35	169	17,200	2,997	-440
74	74	17,450	2,545	1,130	51	64	17,300	4,074	-9
243	243	17,500	4,572	3,043	299	1,189	17,400	2,765	-64
261	261	17,550	1,895	1,396	192	1,245	17,500	8,372	-552
1,145	1,154	17,600	4,325	2,643	298	1,541	17,600	4,303	1,418 ※
1,029	1,036	17,650	2,257	1,304	549	1,087	17,700	2,014	-663
1,519	1,598	17,700	2,238	458	488	1,367	17,800	2,167	-443
1,438	1,469	17,750	1,681	934	319	1,338	17,900	1,916	-152
4,000	4,033	17,800	2,680	1,016	1,349	3,558	18,000	2,690	-90
2,871	2,900	17,850	1,085	667	1,030	4,227	18,100	1,523	-66
4,375	4,506	17,900	2,272	360 ※	1,913	6,043	18,200	1,546	81
2,964	3,106	17,950	1,173	348	1,282	4,576	18,300	1,672	106
※ 9,823	10,453	18,000	1,321	190	458	3,999	18,400	598	-27
3,688	4,248	18,050	1,157	897	956	7,558	18,500	311	-25
5,420	6,800	18,100	1,096	705	-550	5,852	18,600	260	4
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
68,294	88,095	0.9055	79,766	51,581	7,806	97,395	1.0651	103,733	1,223
昨日 P/C	1.4234	今日增減變化	-0.5180		昨日 P/C	1.1442	今日增減變化	-0.0792	

更新日期：2022年2月24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24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	72,523,567	142,366,901	-69,843,334	-8,162,657	3,247,539	2,278,916	968,623	-180,896
投信	43,039,949	54,500,456	-11,460,507	-3,734,922	500,897	0	500,897	-17,244
自營商	69,985,789	15,844,415	54,141,374	778,320	1,323,363	1,283,594	39,769	87,836
	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	886,917	3,773,722	-2,886,805	58,457	18,249	41,475	-23,226	10,734
投信	22,786	0	22,786	-448	1,659	0	1,659	-39
自營商	560,795	61,328	499,467	106,379	127,733	167,537	-39,804	2,636

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24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	27,081	16,873	10,208	343	58,976	20,704	38,272	8,704
投信	0	0	0	0	0	68	-68	0
自營商	65,955	48,574	17,381	-6,542	61,093	45,205	15,888	4,908
特定法人(週)	2,589	0	2,589	1,790	0	4,258	-4,258	-3,048
特定法人(近月)	15,467	5,767	9,700	6,096	8,983	30,458	-21,475	-3,219
特定法人(全月)	17,649	6,068	11,581	3,212	5,982	47,736	-41,754	-9,493
十大交易人(週)	22,381	27,746	-5,365	-7,342	30,045	30,241	-196	257
十大交易人(近月)	55,104	34,475	20,629	-936	35,800	61,248	-25,448	-684
十大交易人(全月)	85,464	54,936	30,528	-4,670	70,923	103,527	-32,604	632
全市場未沖銷(近月)			97,395	7,806			103,733	1,223
全市場未沖銷(全月)			202,751	77,552			209,412	54,017

更新日期：2022年2月24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	18000	買權OI最大量	18000
	賣權成交最大量	17300	賣權OI最大量	16600
	整體隱含波動率	20.70%	較前一交易日	+5.59%
	買權隱含波動率	15.38%	較前一交易日	+2.97%
	賣權隱含波動率	25.44%	較前一交易日	+8.13%
電子選擇權	買權成交最大量	875	買權OI最大量	865
	賣權成交最大量	820	賣權OI最大量	810
金融選擇權	買權成交最大量	1880	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24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	18500
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	22.52%	較前一交易日	-3.47%
	買權隱含波動率	16.19%	較前一交易日	+2.42%
	賣權隱含波動率	28.95%	較前一交易日	+5.34%
	成交量P/C_Ratio值	0.997	較前一交易日	-0.11
	未平倉P/C_Ratio值	1.065	較前一交易日	-0.08
電子選擇權	買權成交最大量	875	買權OI最大量	865
	賣權成交最大量	820	賣權OI最大量	810
金融選擇權	買權成交最大量	1880	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24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

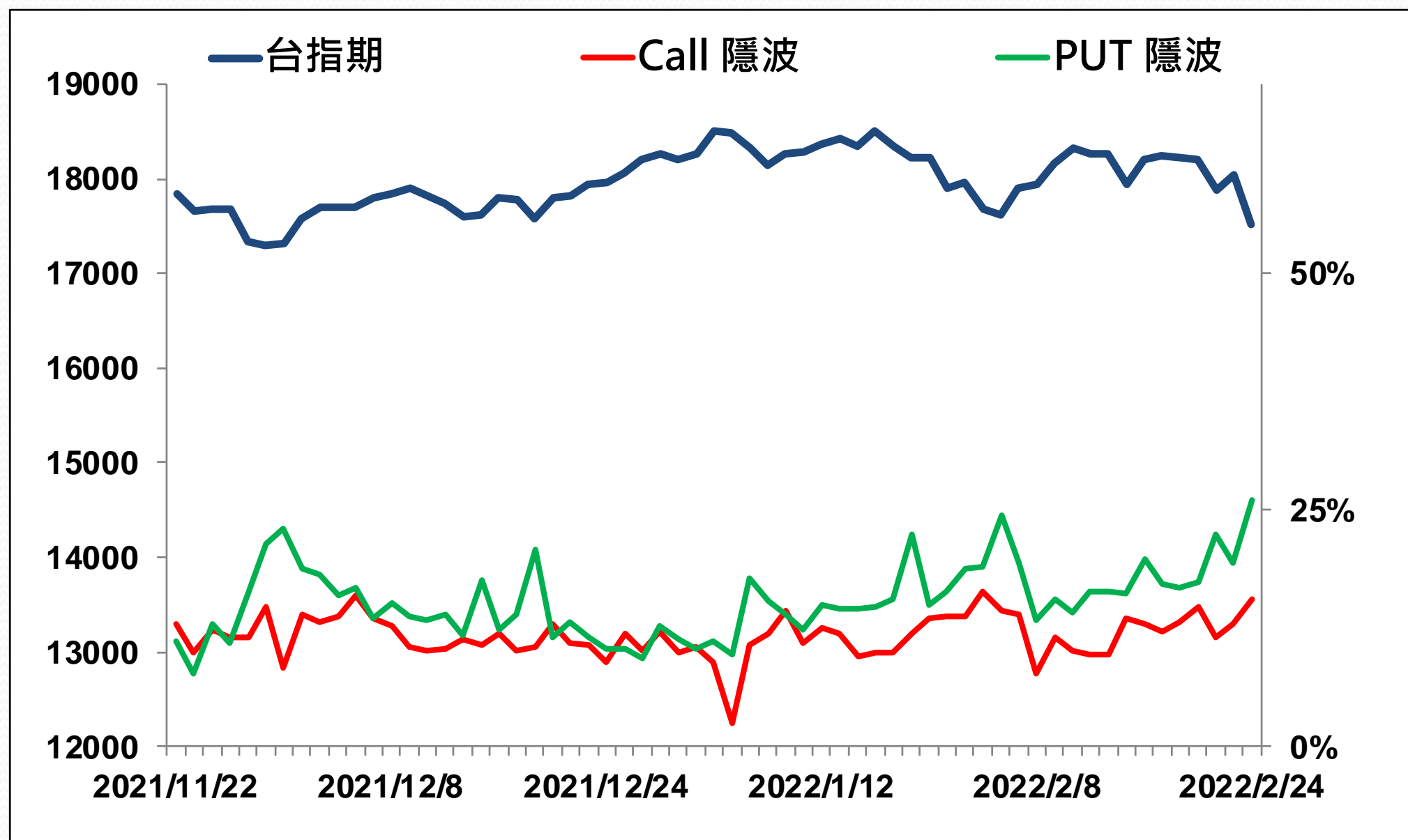
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



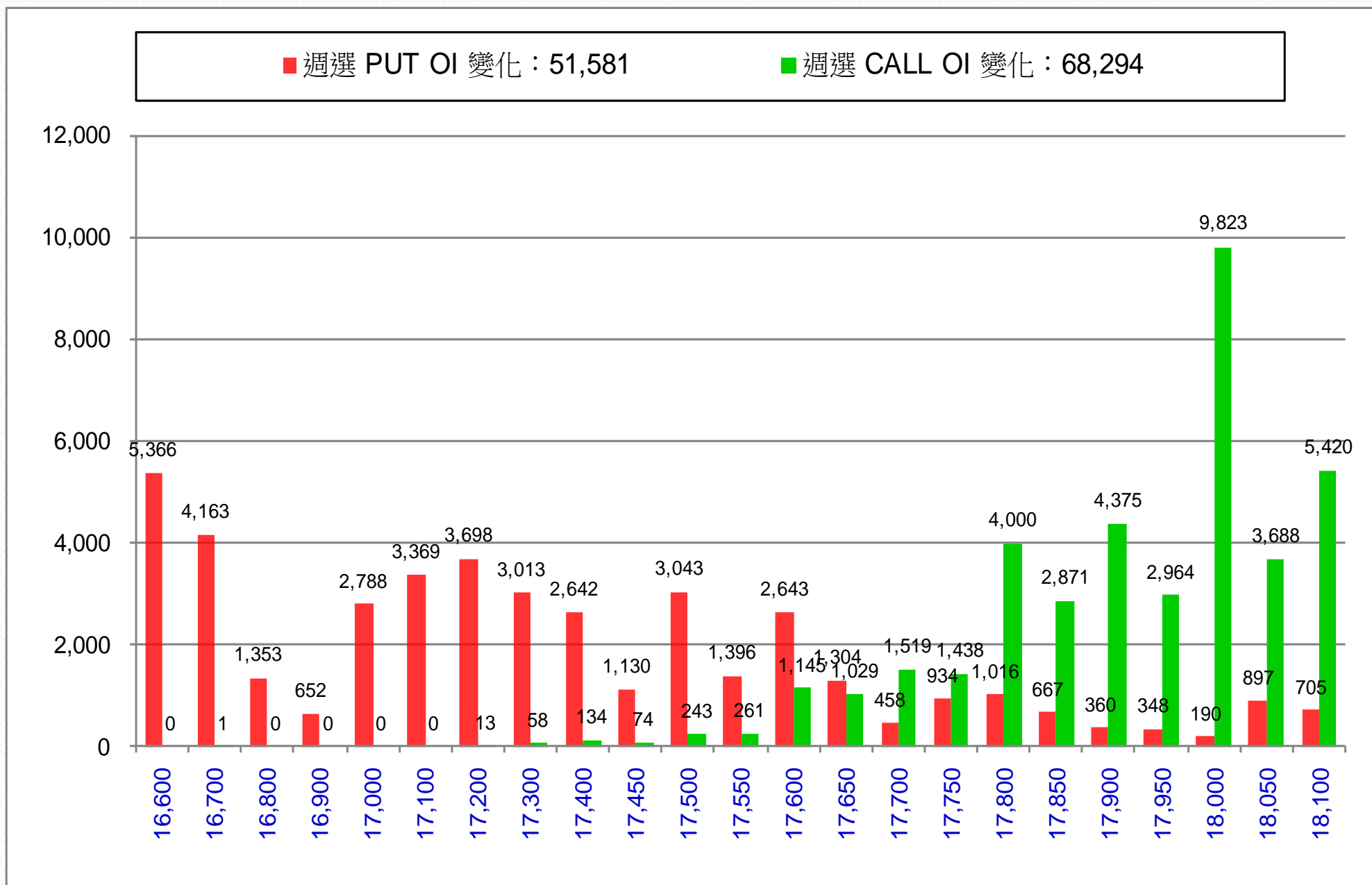
更新日期：2022年2月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



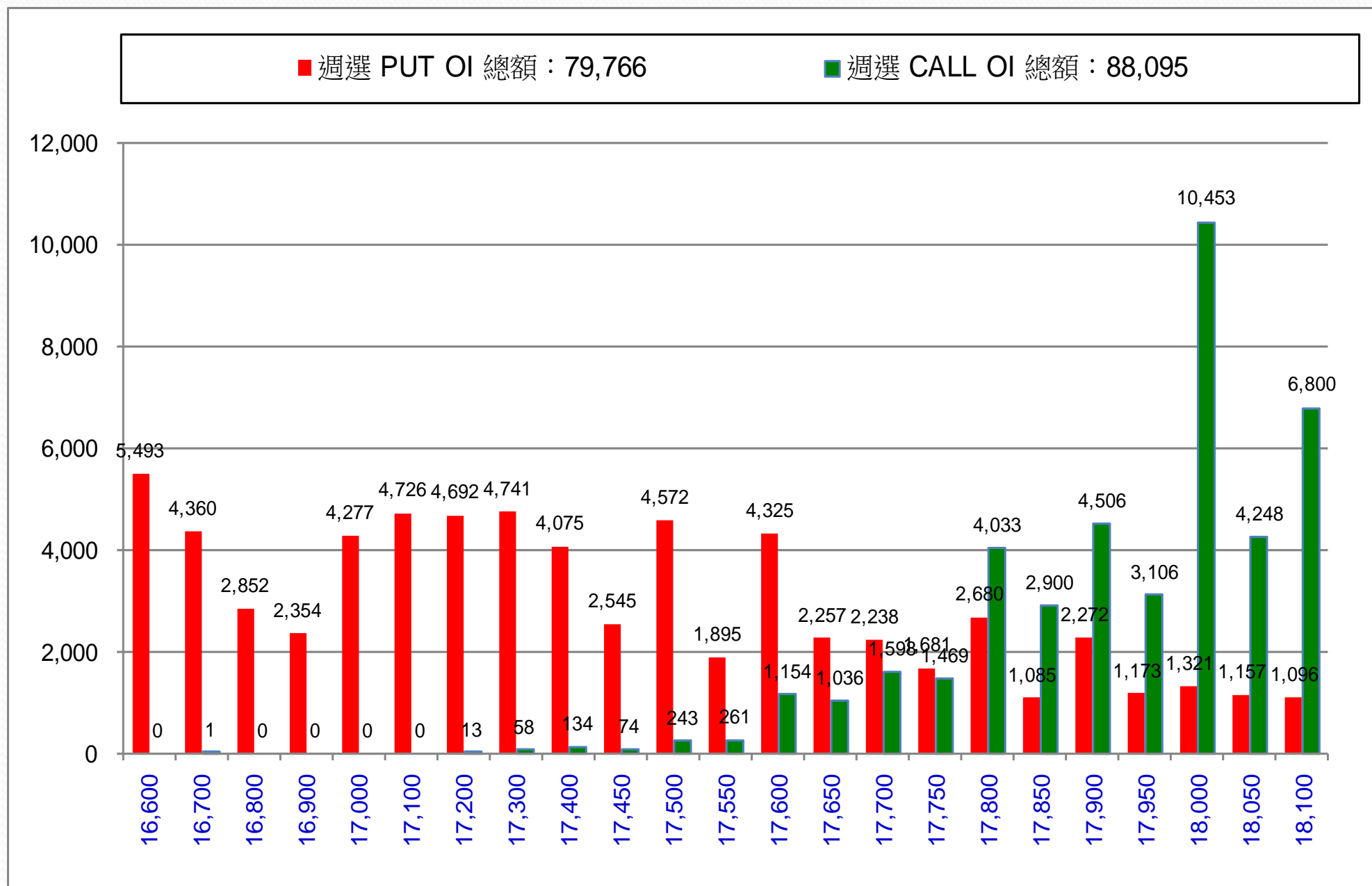
更新日期：2022年2月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年2月24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



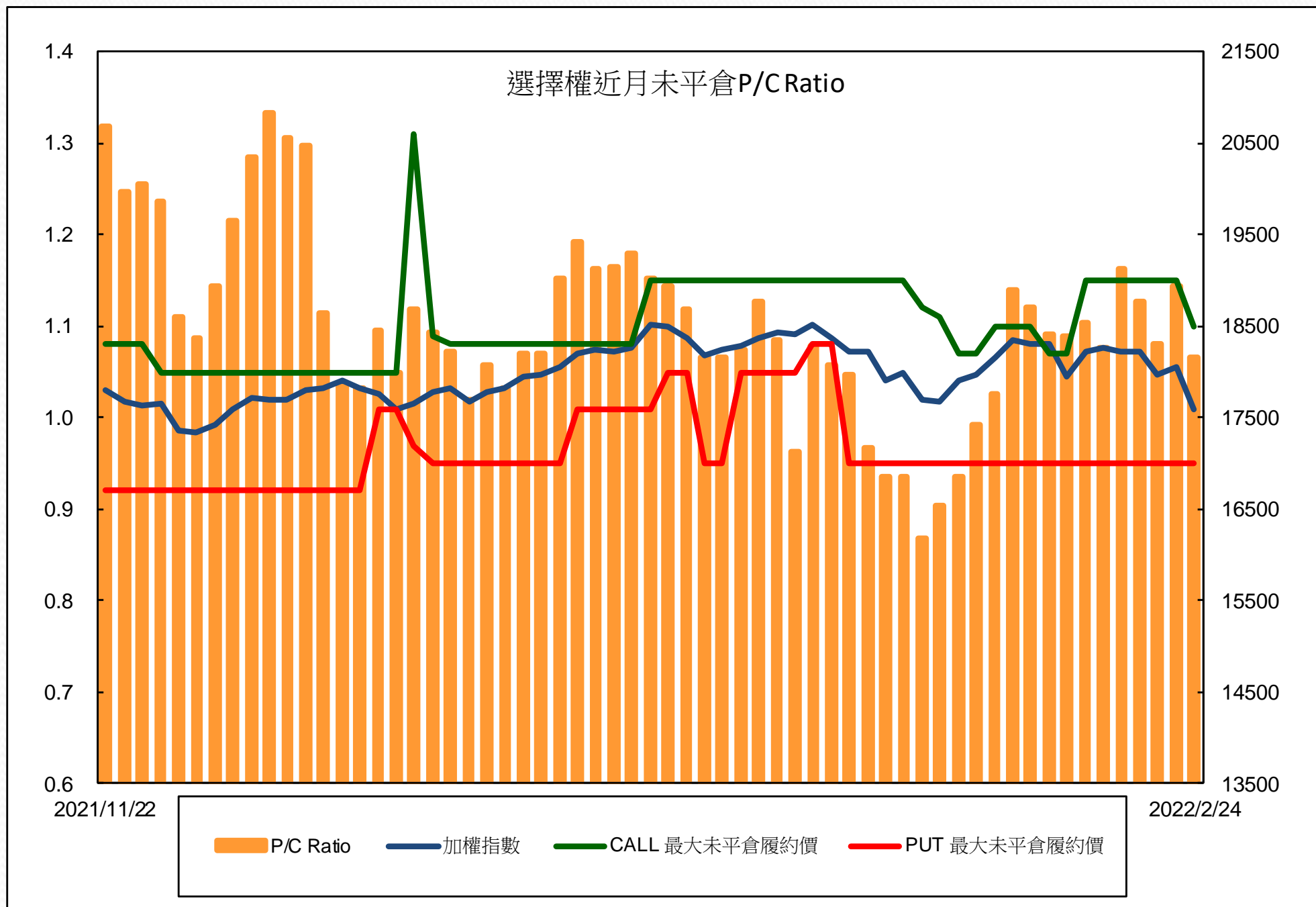
更新日期：2022年2月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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23日	54,008	30,085	23,923
	2月24日	65,955	48,574	17,381
Put	2月23日	49,705	38,725	10,980
	2月24日	61,093	45,205	15,888

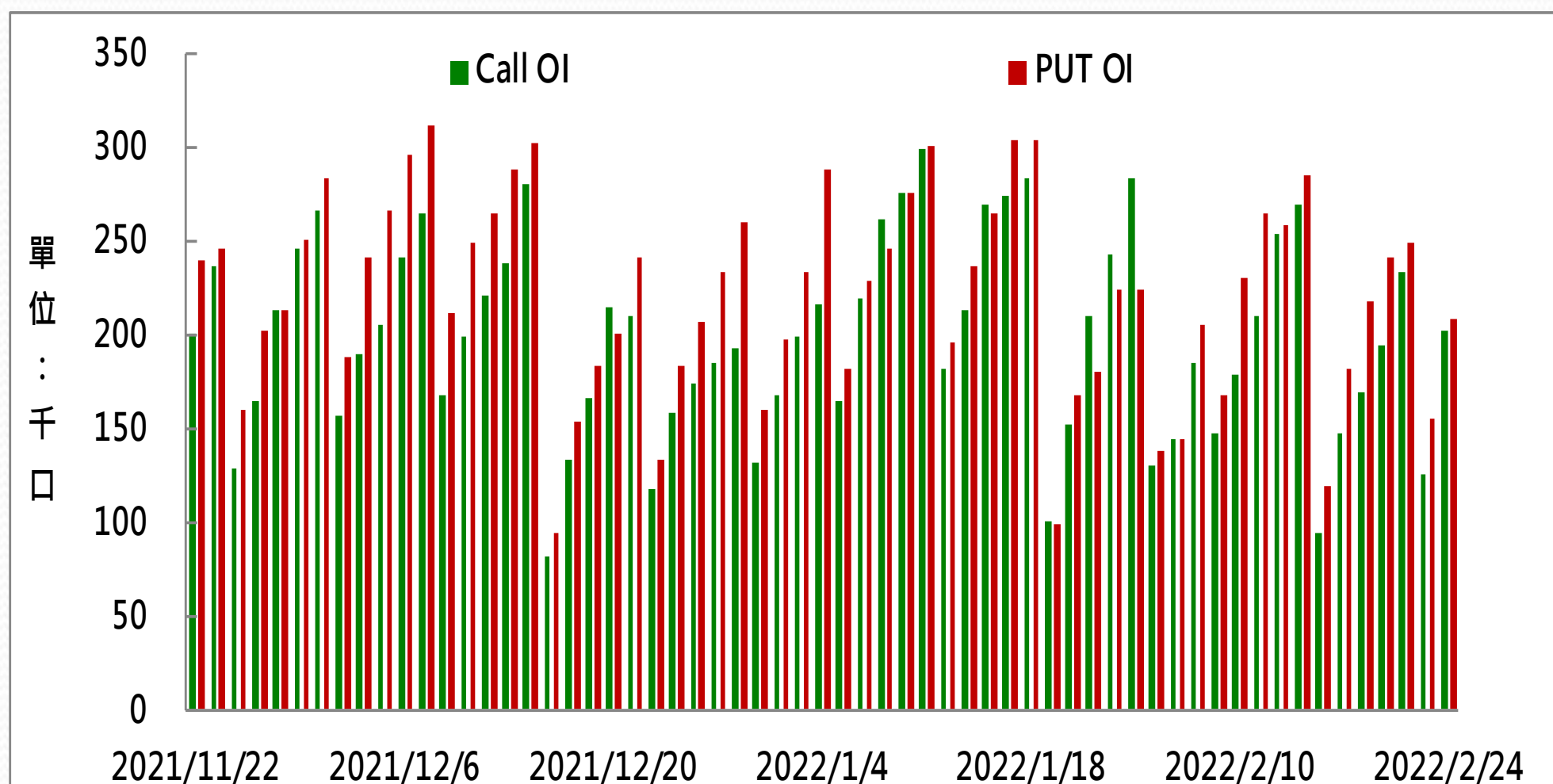
更新日期：2022年2月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年2月24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24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24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