

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/2/25 結算日：2022/3/2					日期：2022/2/25 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
73	73	17,000	8,222	3,945 ※	0	7	16,500	2,713	-6
60	60	17,100	5,508	782	2	15	16,600	3,024	330
1	1	17,150	748	748	0	1	16,700	2,662	189
133	146	17,200	5,525	833	1	68	16,800	6,848	-310
0	0	17,250	875	875	6	11	16,900	3,297	97
500	558	17,300	5,681	940	19	117	17,000	11,540	2,072 ※
14	14	17,350	1,252	1,252	80	101	17,100	2,455	104
710	844	17,400	6,580	2,505	142	311	17,200	3,253	256
682	756	17,450	3,120	575	166	230	17,300	4,501	427
1,509	1,752	17,500	6,740	2,168	149	1,338	17,400	2,784	19
989	1,250	17,550	2,532	637	165	1,410	17,500	8,413	41
1,752	2,906	17,600	6,166	1,841	614	2,155	17,600	4,187	-116
1,580	2,616	17,650	2,486	229	177	1,264	17,700	1,760	-254
※ 2,723	4,321	17,700	2,626	388	319	1,686	17,800	1,962	-205
2,038	3,507	17,750	1,569	-112	1,080	2,418	17,900	1,879	-37
1,960	5,993	17,800	2,561	-119	※ 1,283	4,841	18,000	2,462	-228
1,391	4,291	17,850	999	-86	941	5,168	18,100	1,390	-133
1,858	6,364	17,900	2,113	-159	990	7,033	18,200	1,456	-90
1,084	4,190	17,950	1,128	-45	908	5,484	18,300	1,492	-180
1,642	12,095	18,000	1,232	-89	192	4,191	18,400	585	-13
※ 2,049	6,297	18,050	1,128	-29	-118	7,440	18,500	303	-8
461	7,261	18,100	1,038	-58	29	5,881	18,600	254	-6
-8	4,809	18,150	338	-12	-167	6,032	18,700	76	-1
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
16,777	104,872	1.0427	109,348	29,582	7,644	105,039	1.0241	107,569	3,836
昨日 P/C	0.9055	今日增減變化		0.1372	昨日 P/C	1.0651	今日增減變化		-0.0410

更新日期：2022年2月25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25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	62,810,077	134,433,016	-71,622,939	-1,779,605	3,228,902	2,382,523	846,379	-122,244
投信	41,686,392	54,094,398	-12,408,006	-947,499	499,830	0	499,830	-1,067
自營商	69,801,137	17,913,399	51,887,738	-2,253,636	1,429,341	1,179,471	249,870	210,101
	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	903,310	3,945,634	-3,042,324	-155,519	0	82,080	-82,080	-58,854
投信	22,758	0	22,758	-28	1,675	0	1,675	16
自營商	539,078	146,972	392,106	-107,361	157,389	130,523	26,866	66,670

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25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	29,642	18,835	10,807	599	63,418	23,785	39,633	1,361
投信	0	0	0	0	0	68	-68	0
自營商	65,951	53,728	12,223	-5,158	63,284	59,611	3,673	-12,215
特定法人(週)	3,968	0	3,968	1,379	0	5,584	-5,584	-1,326
特定法人(近月)	15,357	5,767	9,590	-110	8,583	31,333	-22,750	-1,275
特定法人(全月)	17,507	6,388	11,119	-462	6,648	50,202	-43,554	-1,800
十大交易人(週)	21,646	33,004	-11,358	-5,993	40,991	31,542	9,449	9,645
十大交易人(近月)	55,948	35,948	20,000	-629	39,887	62,934	-23,047	2,401
十大交易人(全月)	83,675	59,314	24,361	-6,167	86,445	108,466	-22,021	10,583
全市場未沖銷(近月)			105,039	7,644			107,569	3,836
全市場未沖銷(全月)			228,479	25,728			245,286	35,874

更新日期：2022年2月25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	17800	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	16.86%	較前一交易日	-3.84%
	買權隱含波動率	13.21%	較前一交易日	-2.17%
	賣權隱含波動率	20.39%	較前一交易日	-5.06%
電子選擇權	買權成交最大量	855	買權OI最大量	865
	賣權成交最大量	805	賣權OI最大量	810
金融選擇權	買權成交最大量	1820	買權OI最大量	1800
	賣權成交最大量	1700	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年2月25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	18000	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	21.05%	較前一交易日	+1.46%
	買權隱含波動率	15.73%	較前一交易日	-0.46%
	賣權隱含波動率	26.32%	較前一交易日	-2.63%
	成交量P/C_Ratio值	1.052	較前一交易日	+0.05
	未平倉P/C_Ratio值	1.024	較前一交易日	-0.04
電子選擇權	買權成交最大量	855	買權OI最大量	865
	賣權成交最大量	805	賣權OI最大量	810
金融選擇權	買權成交最大量	1820	買權OI最大量	1800
	賣權成交最大量	1700	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年2月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理



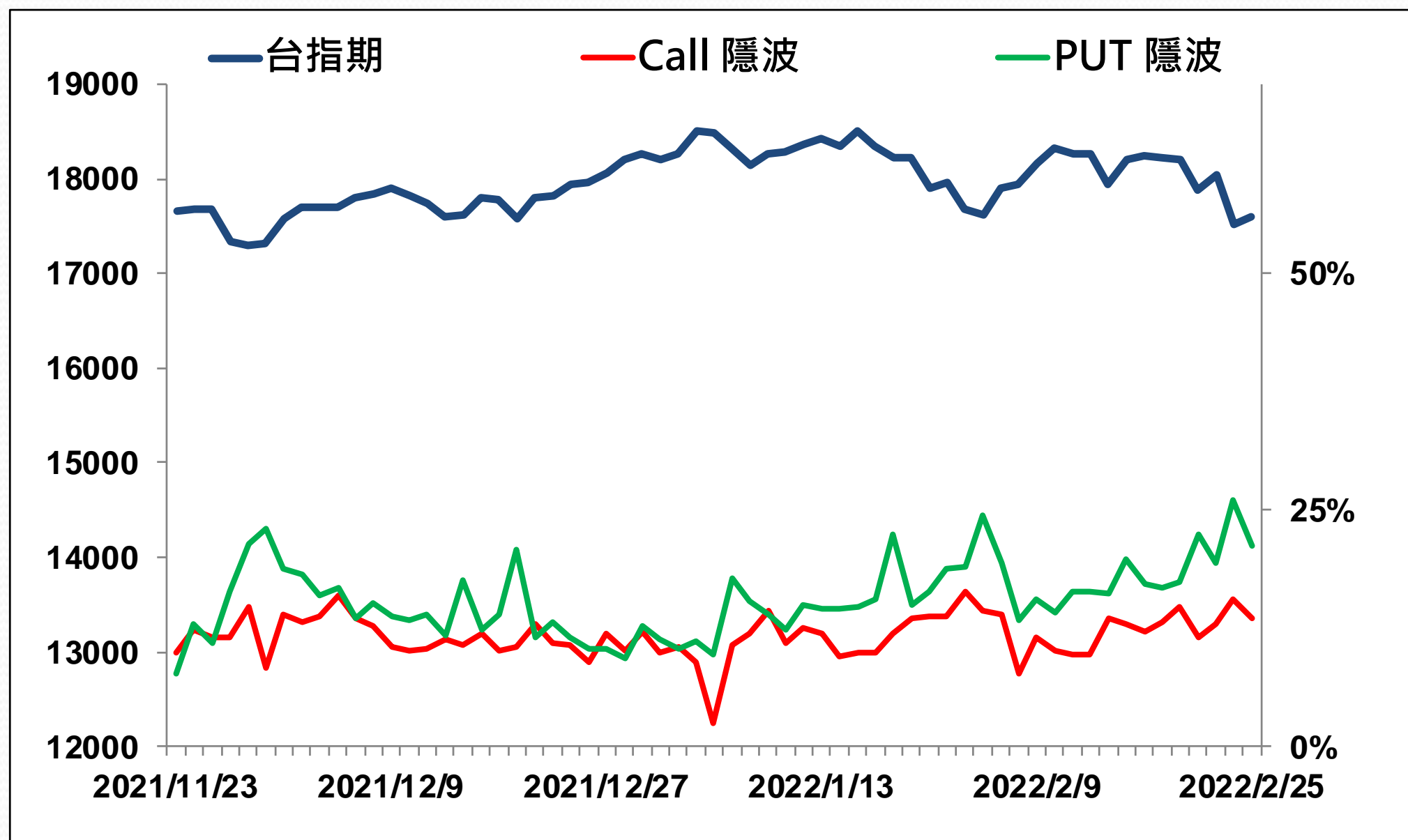
# 選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



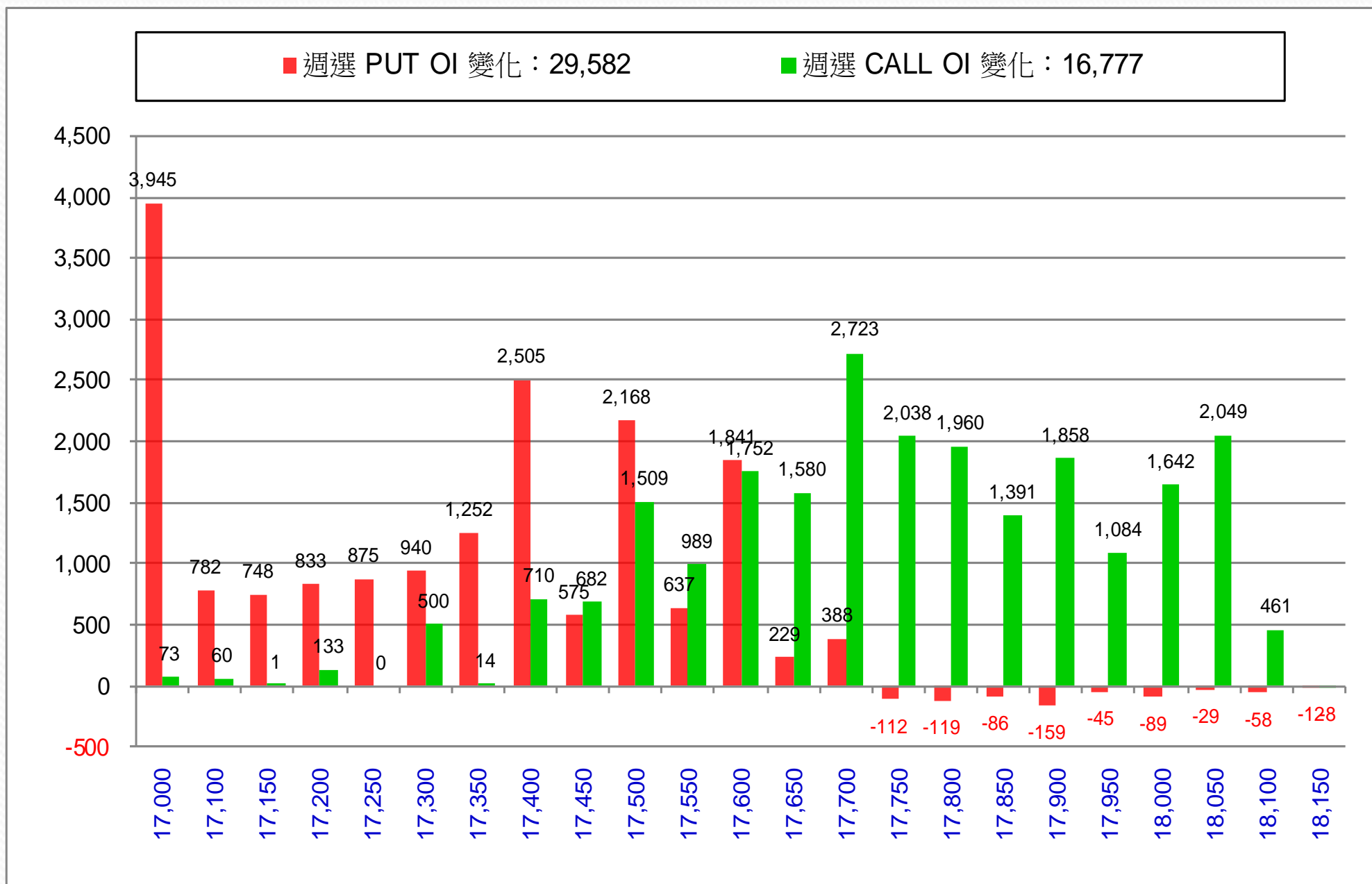
更新日期：2022年2月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2022年2月25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



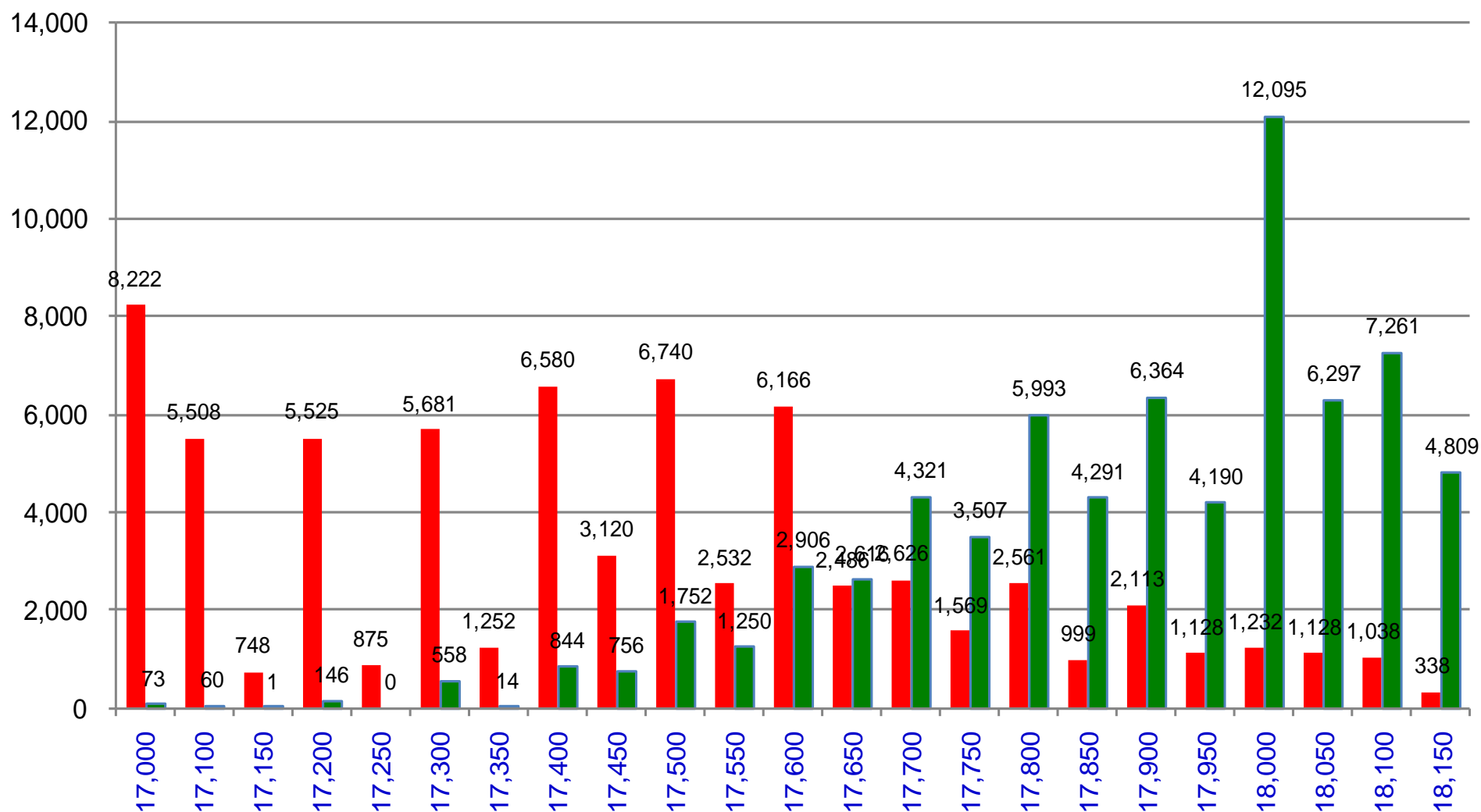
更新日期：2022年2月25日    資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理



# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：109,348

週選 CALL OI 總額：104,872



更新日期：2022年2月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

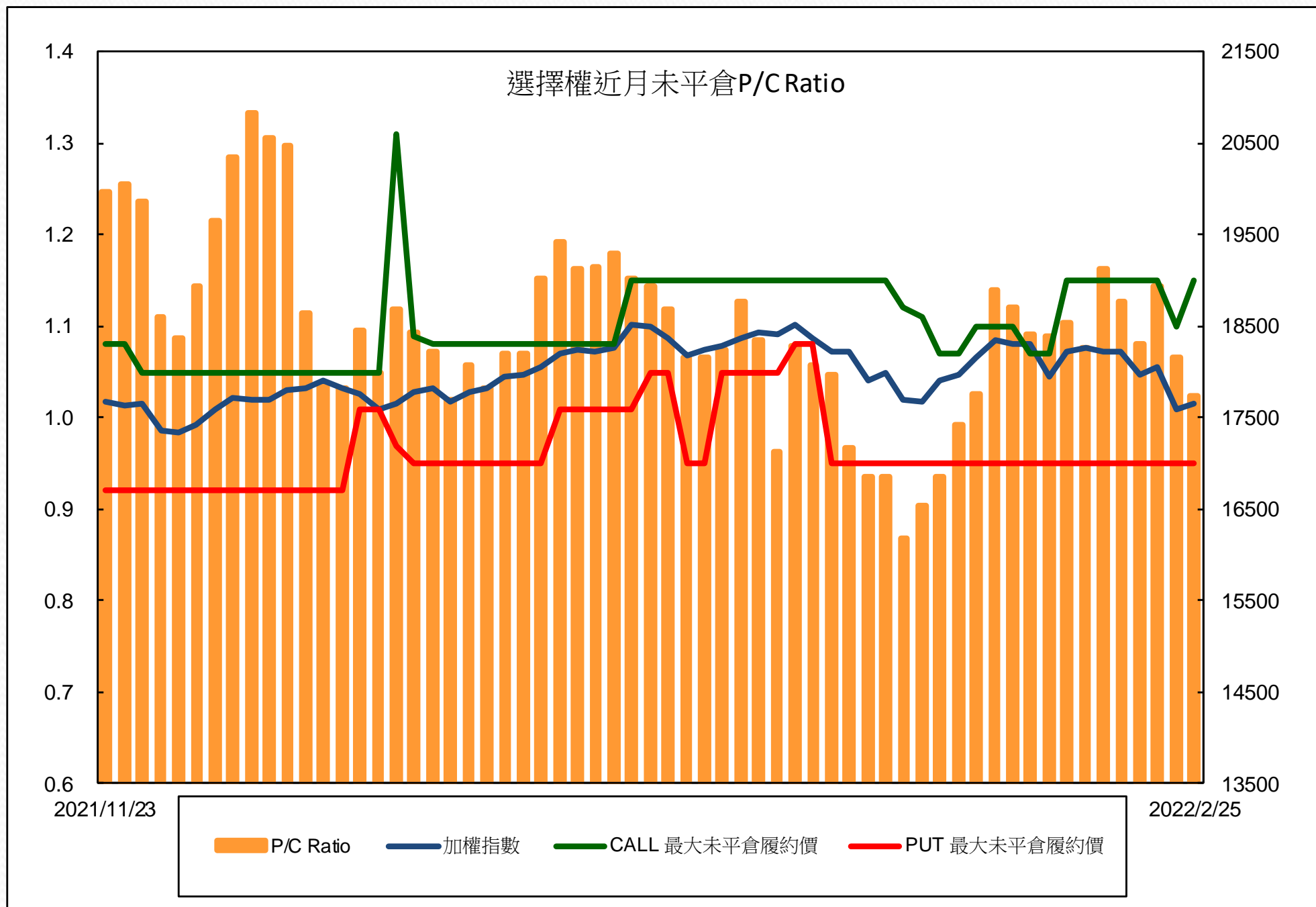


# 自營商選擇權OI部位統計

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24日	65,955	48,574	17,381
	2月25日	65,951	53,728	12,223
Put	2月24日	61,093	45,205	15,888
	2月25日	63,284	59,611	3,673

更新日期：2022年2月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

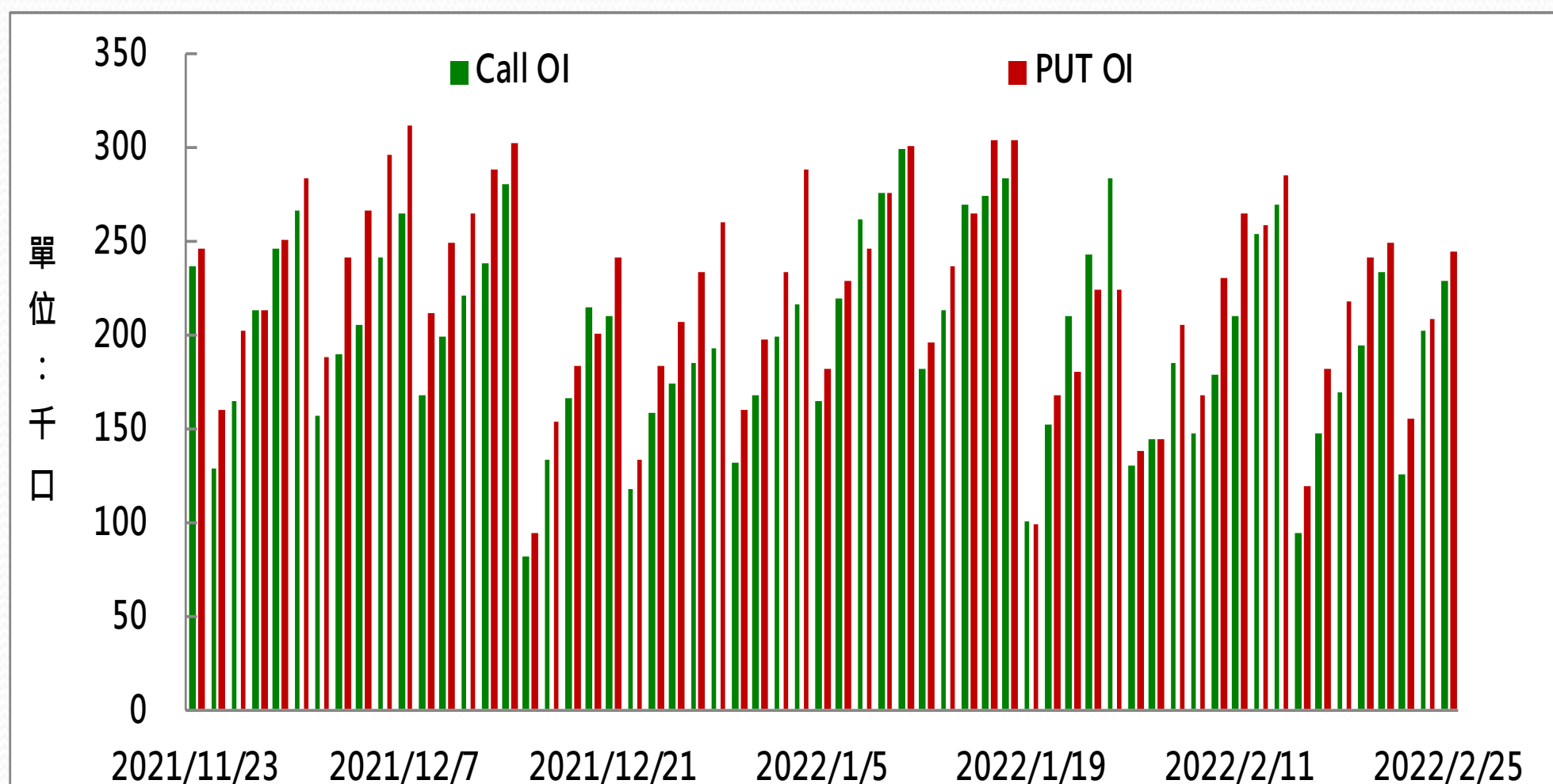
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年2月25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25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25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