

台指選擇權OI匯報

日期：2022/4/6 結算日：2022/4/13					日期：2022/4/6 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	16,900	1,635	1,635	0	100	16,300	2,218	247
0	0	16,950	0	0	0	30	16,400	2,512	334
10	10	17,000	2,412	2,412	-1	556	16,500	4,932	312
0	0	17,050	0	0	-11	601	16,600	2,474	8
51	51	17,100	2,476	2,476	-1	1,130	16,700	4,526	344
25	25	17,150	513	513	-25	1,311	16,800	6,710	75
59	59	17,200	1,229	1,229	3	1,791	16,900	3,770	168
49	49	17,250	715	715	-2	1,613	17,000	8,266	398
67	67	17,300	1,976	1,976	23	1,191	17,100	4,311	27
92	92	17,350	781	781	24	1,658	17,200	4,141	123
329	329	17,400	1,731	1,731	116	2,178	17,300	3,930	32
253	253	17,450	657	657	364	2,312	17,400	3,689	156
961	961	17,500	900	900	186	3,050	17,500	4,008	-325
1,177	1,177	17,600	487	487	226	3,721	17,600	2,306	-172
1,789	1,789	17,700	60	60	703	5,547	17,700	2,117	-41
※ 2,583	2,583	17,800	1,015	1,015	864	6,815	17,800	768	-40
2,406	2,406	17,900	1	1	※ 1,217	6,393	17,900	722	-72
1,766	1,766	18,000	5	5	787	15,686	18,000	824	-4
597	597	18,100	4	4	-109	7,435	18,100	439	-2
231	231	18,200	0	0	-53	9,088	18,200	218	1
10	10	18,300	0	0	-266	7,464	18,300	85	-1
0	0	18,400	0	0	-615	4,790	18,400	53	1
81	81	18,500	0	0	-72	3,790	18,500	5	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
12,554	12,554	2.0636	25,906	25,906	3,439	112,853	1.0465	118,096	5,178
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化		2.0636	昨日 P/C	1.0320	今日增減變化		0.0144

更新日期：2022年4月6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6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	85,165,615	104,497,018	-19,331,403	2,395,618	3,615,360	1,197,588	2,417,772	1,032,612
投信	34,484,850	54,304,011	-19,819,161	-64,024	445,464	0	445,464	-17,342
自營商	68,204,222	25,548,327	42,655,895	12,548	1,320,102	1,132,944	187,158	-37,660
	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	689,280	3,258,240	-2,568,960	49,133	84,380	0	84,380	-25,100
投信	28,800	0	28,800	486	1,688	0	1,688	4
自營商	823,565	347,520	476,045	155,271	244,698	366,176	-121,478	28,418

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6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	34,834	18,925	15,909	3,405	46,575	14,757	31,818	-468
投信	0	100	-100	0	200	63	137	0
自營商	68,869	40,944	27,925	4,377	44,059	49,141	-5,082	4,173
特定法人(週)	2,907	825	2,082	---	825	1,797	-972	---
特定法人(近月)	23,253	21,956	1,297	1,365	5,023	24,598	-19,575	768
特定法人(全月)	30,196	19,641	10,555	7,839	6,203	39,044	-32,841	4,953
十大交易人(週)	11,040	8,951	2,089	---	14,056	9,447	4,609	---
十大交易人(近月)	64,231	45,746	18,485	-1,961	47,728	51,815	-4,087	1,023
十大交易人(全月)	98,174	58,479	39,695	5,492	70,033	80,017	-9,984	-7,638
全市場未沖銷(近月)			112,853	3,439			118,096	5,178
全市場未沖銷(全月)			165,001	-48,578			173,693	-47,712

更新日期：2022年4月6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	17800	買權OI最大量	17800
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	17100
	整體隱含波動率	15.01%	較前一交易日	+4.57%
	買權隱含波動率	11.79%	較前一交易日	+4.90%
	賣權隱含波動率	17.55%	較前一交易日	+3.72%
電子選擇權	買權成交最大量	840	買權OI最大量	830
	賣權成交最大量	770	賣權OI最大量	730
金融選擇權	買權成交最大量	1940	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6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	18000	買權OI最大量	18000
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	16000
	整體隱含波動率	16.60%	較前一交易日	-0.64%
	買權隱含波動率	12.82%	較前一交易日	+1.03%
	賣權隱含波動率	20.66%	較前一交易日	+0.58%
	成交量P/C_Ratio值	0.937	較前一交易日	-0.12
	未平倉P/C_Ratio值	1.046	較前一交易日	+0.01
電子選擇權	買權成交最大量	840	買權OI最大量	830
	賣權成交最大量	770	賣權OI最大量	730
金融選擇權	買權成交最大量	1940	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6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

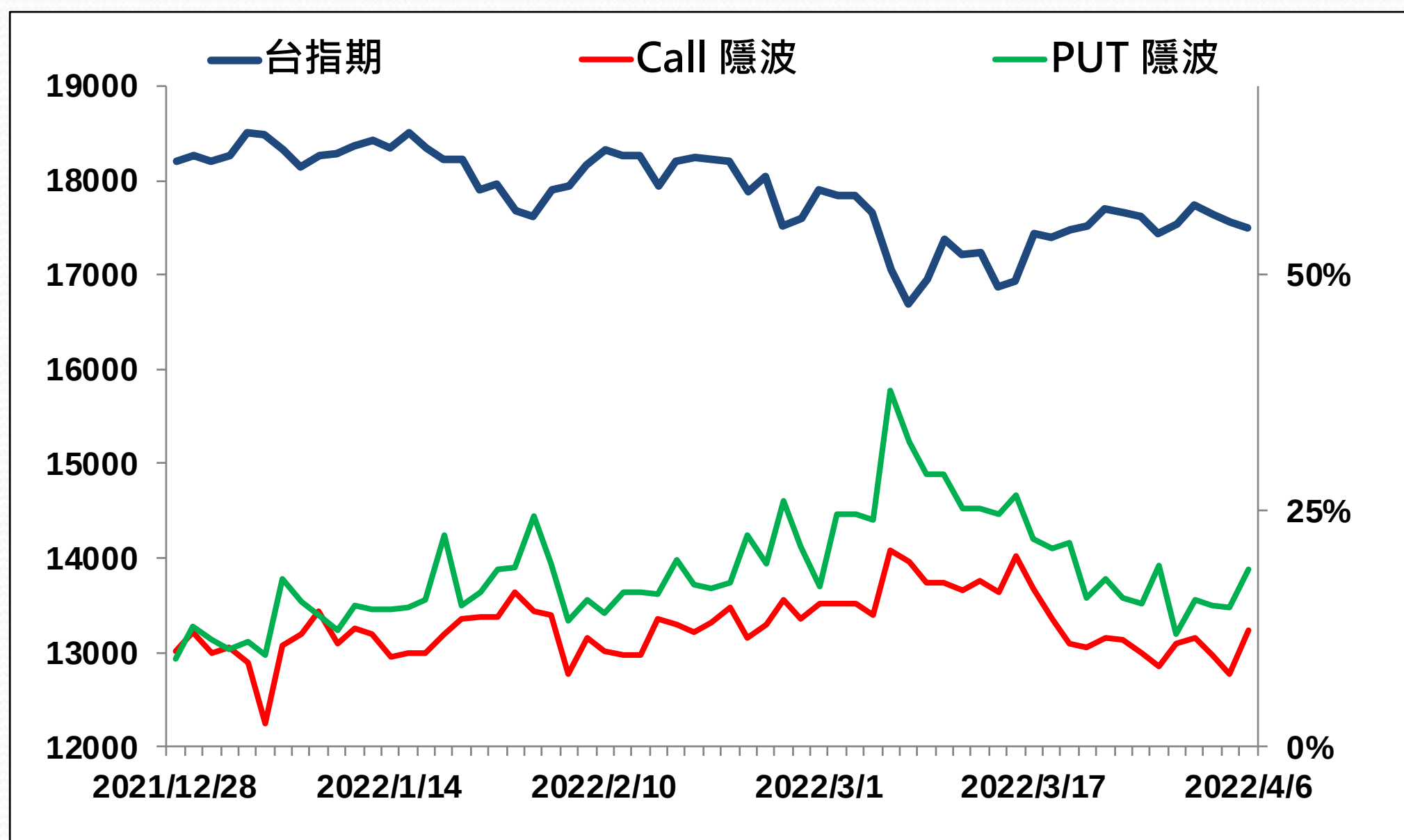
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



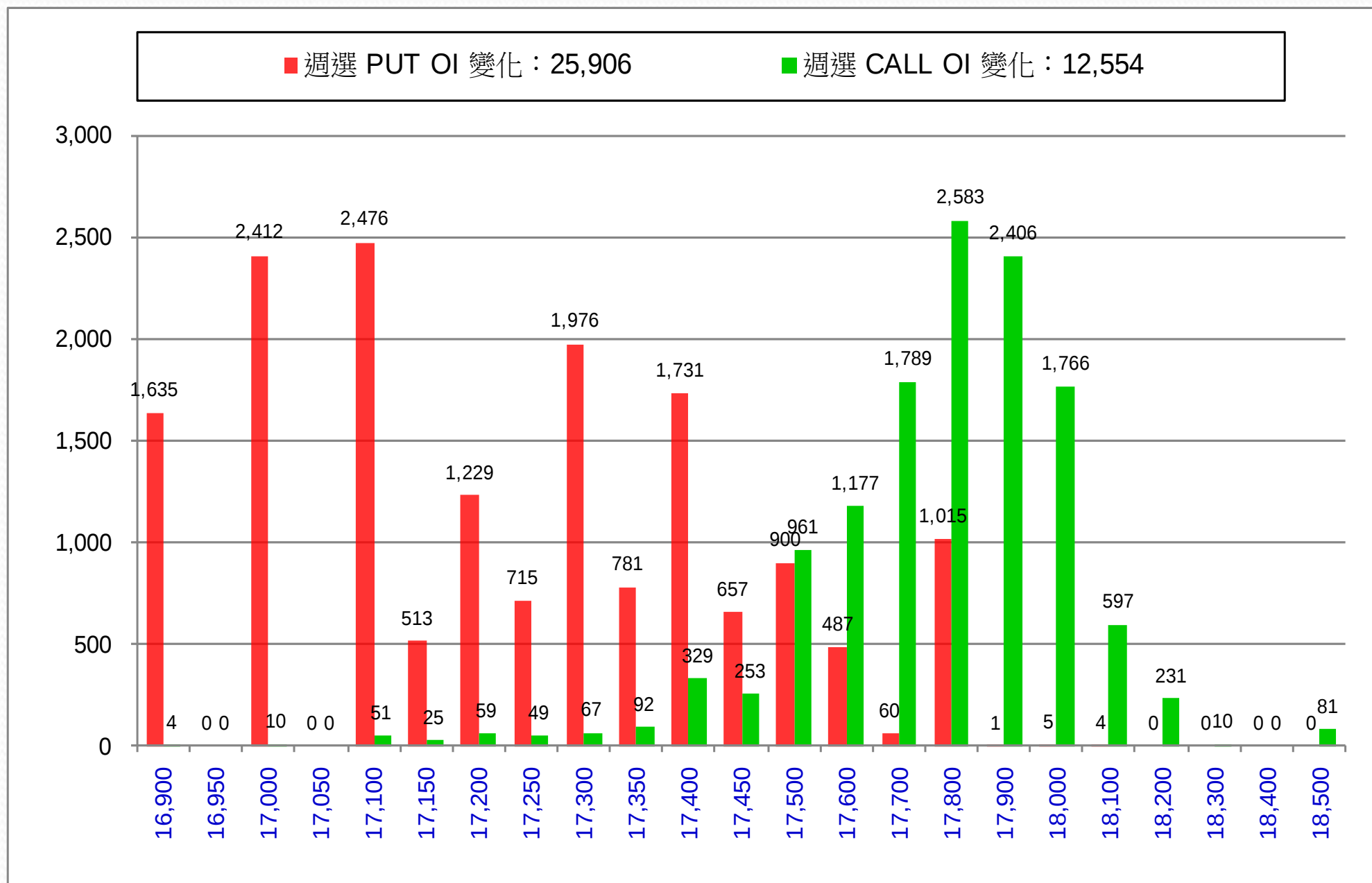
更新日期：2022年4月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年4月6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

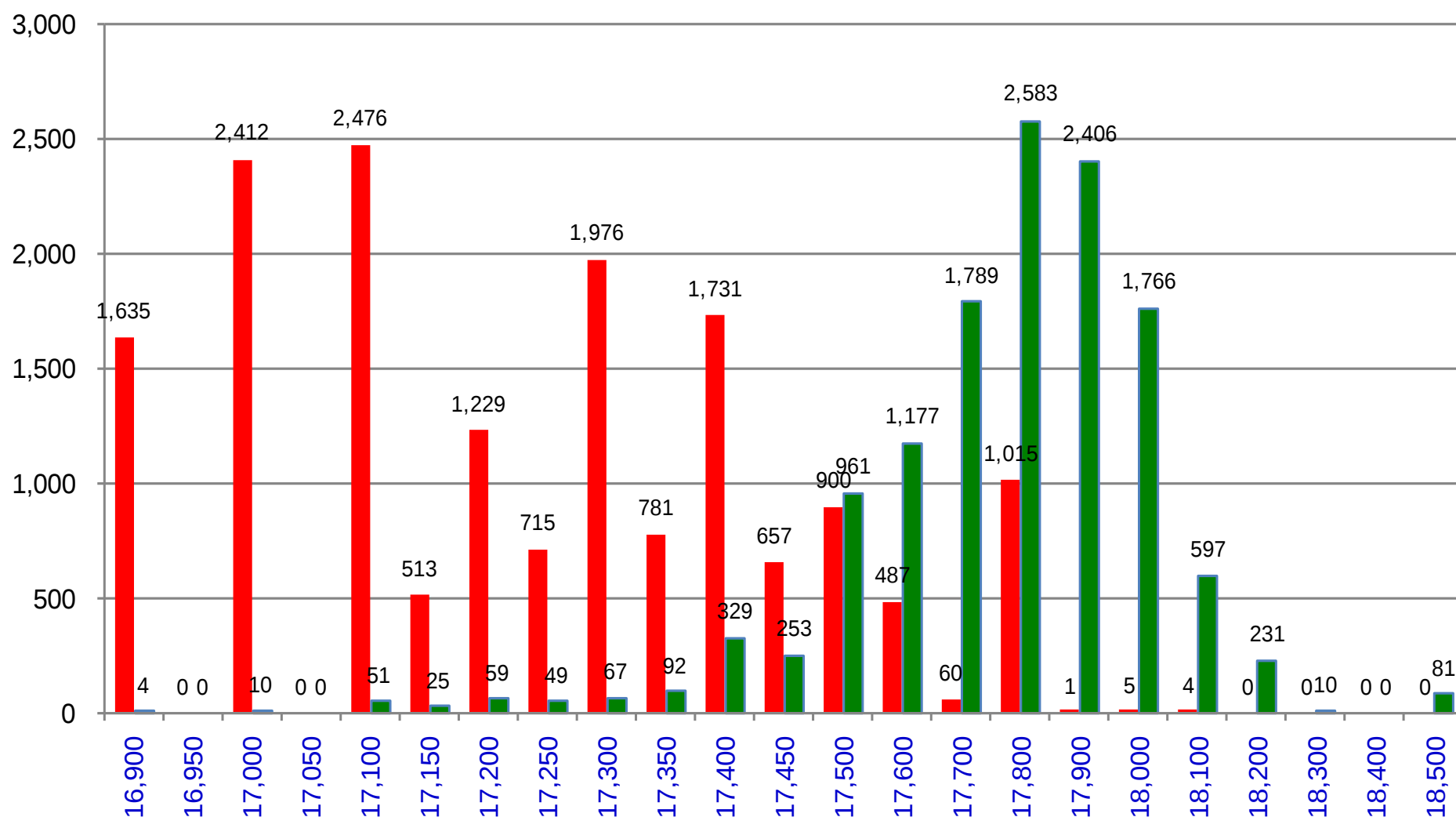


更新日期：2022年4月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：25,906

週選 CALL OI 總額：12,554



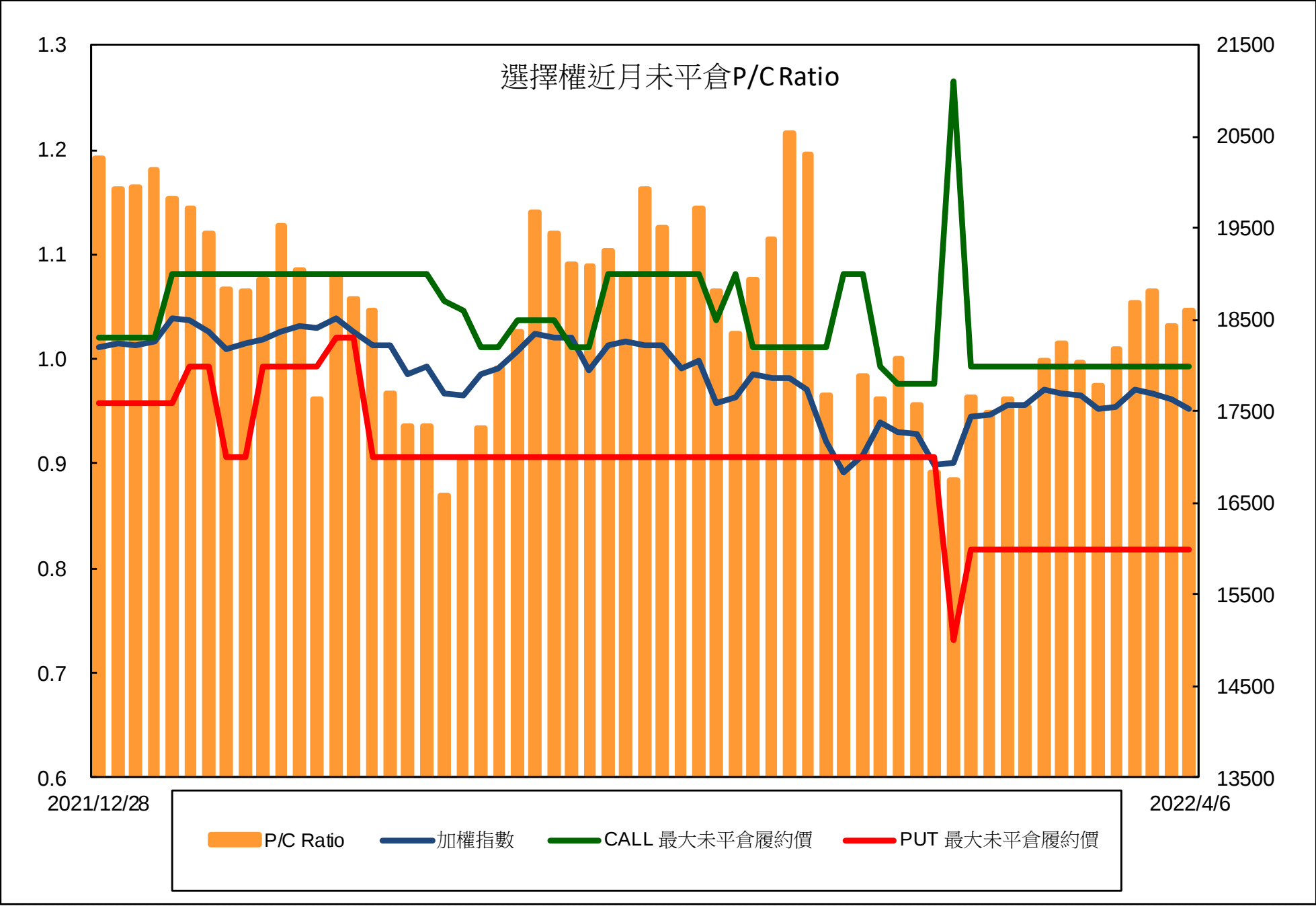
更新日期：2022年4月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

自營商選擇權OI部位統計

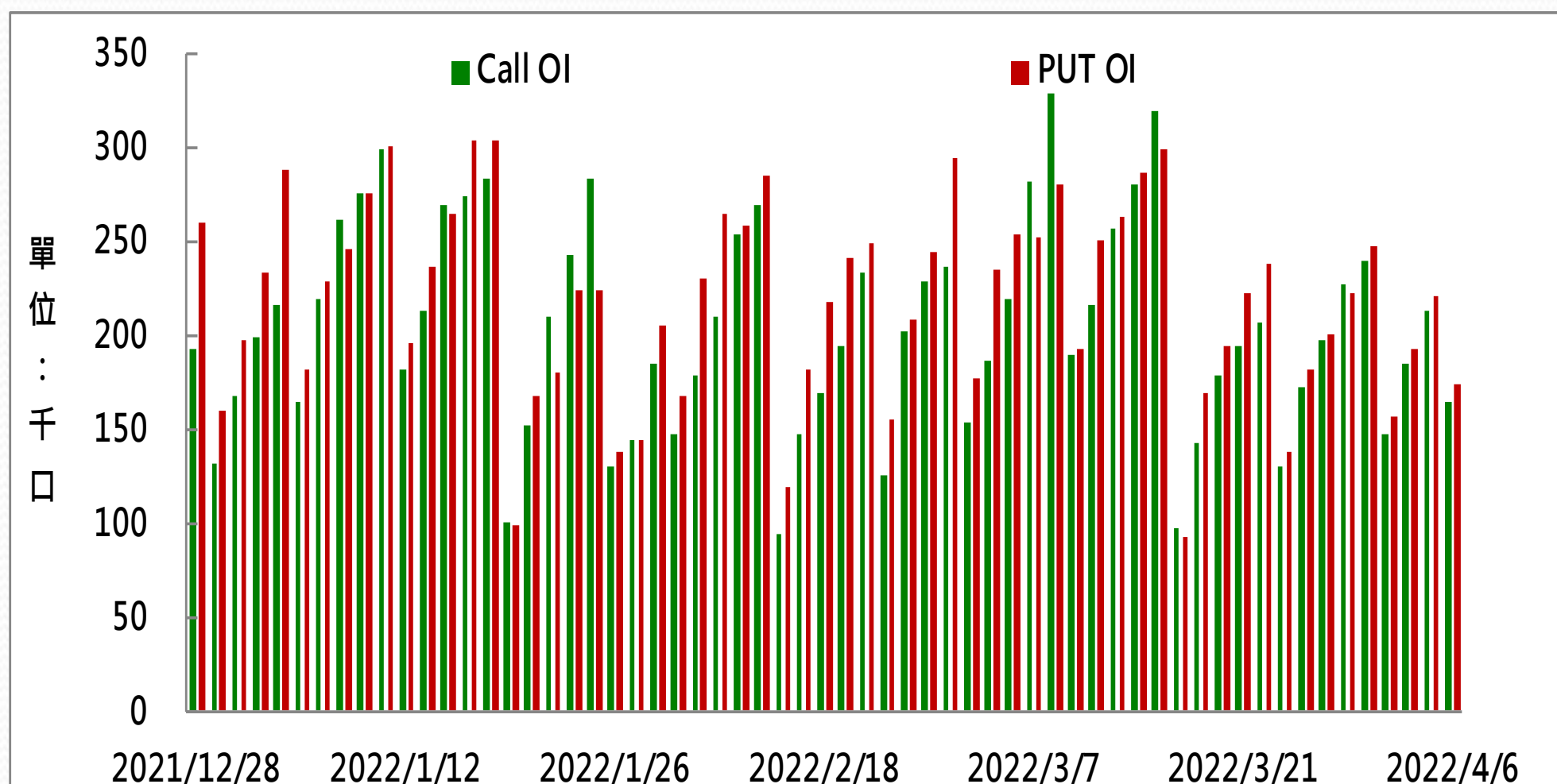
選擇權	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	4月1日	76,845	53,297	23,548
	4月6日	68,869	40,944	27,925
Put	4月1日	47,396	56,651	-9,255
	4月6日	44,059	49,141	-5,082

更新日期：2022年4月6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



選擇權全月Put Call OI



更新日期：2022年4月6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6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