

台指選擇權OI匯報

日期：2022/3/18 結算日：2022/3/23					日期：2022/3/18 結算日：2022/4/20				
202203W4					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
-97	481	16,950	2,763	574	0	565	16,500	2,818	384
-141	903	17,000	8,016	2,961 ※	-1	623	16,600	1,426	129
4	362	17,050	2,166	295	-7	1,106	16,700	3,861	117
-4	886	17,100	4,182	1,653	-48	1,365	16,800	3,641	52
-268	724	17,150	2,490	762	0	1,784	16,900	2,020	73
-25	1,142	17,200	4,192	1,462	23	1,667	17,000	3,789	158
-49	1,227	17,250	1,927	490	36	1,109	17,100	1,219	62
71	1,933	17,300	2,972	1,227	56	1,586	17,200	1,340	2
143	2,020	17,350	2,020	473	-79	2,011	17,300	1,089	2
393	4,403	17,400	3,445	1,443	85	1,757	17,400	1,872	-11
578	578	17,450	312	312	122	1,917	17,500	1,728	16
1,088	5,811	17,500	1,126	83	148	2,101	17,600	694	138
1,398	1,398	17,550	75	75	362	2,579	17,700	402	65
4,720	10,546	17,600	400	-74	439	3,529	17,800	198	6
1,653	1,653	17,650	42	42	87	3,660	17,900	297	4
2,745	11,063	17,700	155	47	※ 1,149	6,970	18,000	319	9
2,833	2,833	17,750	2	2	725	4,122	18,100	334	1
※ 5,157	12,815	17,800	100	54	604	3,829	18,200	214	0
2,088	2,088	17,850	1	1	678	3,066	18,300	97	40
3,234	9,161	17,900	71	9	201	2,100	18,400	52	0
1,013	1,013	17,950	0	0	75	3,065	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
29,215	86,076	1.2136	104,458	19,560	5,276	70,424	0.9480	66,765	4,048
昨日 P/C	1.4931	今日增減變化		-0.2795	昨日 P/C	0.9627	今日增減變化		-0.0146

更新日期：2022年3月18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3月18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	59,797,039	118,682,631	-58,885,592	-15,025,616	2,293,653	909,664	1,383,989	-12,319
投信	39,906,499	52,659,047	-12,752,548	5,138,019	448,334	0	448,334	-1,877
自營商	69,587,727	18,526,089	51,061,638	1,483,785	1,279,963	636,765	643,198	202,781
	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	628,689	3,087,600	-2,458,911	-378,304	11,714	3,347	8,367	31,906
投信	23,418	0	23,418	161	1,673	0	1,673	-8
自營商	560,117	250,395	309,722	166,717	95,384	115,465	-20,081	-26,806

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報

2022年3月18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	19,946	14,112	5,834	-396	42,597	12,837	29,760	198
投信	0	0	0	0	0	63	-63	0
自營商	67,484	43,765	23,719	1,388	42,364	50,286	-7,922	1,530
特定法人(週)	1,934	0	1,934	1,703	0	1,127	-1,127	-256
特定法人(近月)	9,768	13,369	-3,601	-1,836	6,068	22,284	-16,216	200
特定法人(全月)	8,730	8,099	631	-124	2,967	33,232	-30,265	-1,280
十大交易人(週)	28,302	25,871	2,431	-575	35,007	25,360	9,647	3,171
十大交易人(近月)	42,095	29,636	12,459	-1,035	26,562	35,532	-8,970	-2,748
十大交易人(全月)	81,149	52,998	28,151	2,565	67,020	72,142	-5,122	-1,494
全市場未沖銷(近月)			70,424	5,276			66,765	4,048
全市場未沖銷(全月)			178,240	34,858			193,932	23,813

更新日期：2022年3月18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 03W4 週 選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	17700	買權OI最大量	17800
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	17.10%	較前一交易日	-2.14%
	買權隱含波動率	13.44%	較前一交易日	-3.37%
	賣權隱含波動率	20.63%	較前一交易日	-0.57%
電子選擇權	買權成交最大量	835	買權OI最大量	835
	賣權成交最大量	780	賣權OI最大量	730
金融選擇權	買權成交最大量	1860	買權OI最大量	1780
	賣權成交最大量	1740	賣權OI最大量	1580

更新日期：2022年3月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

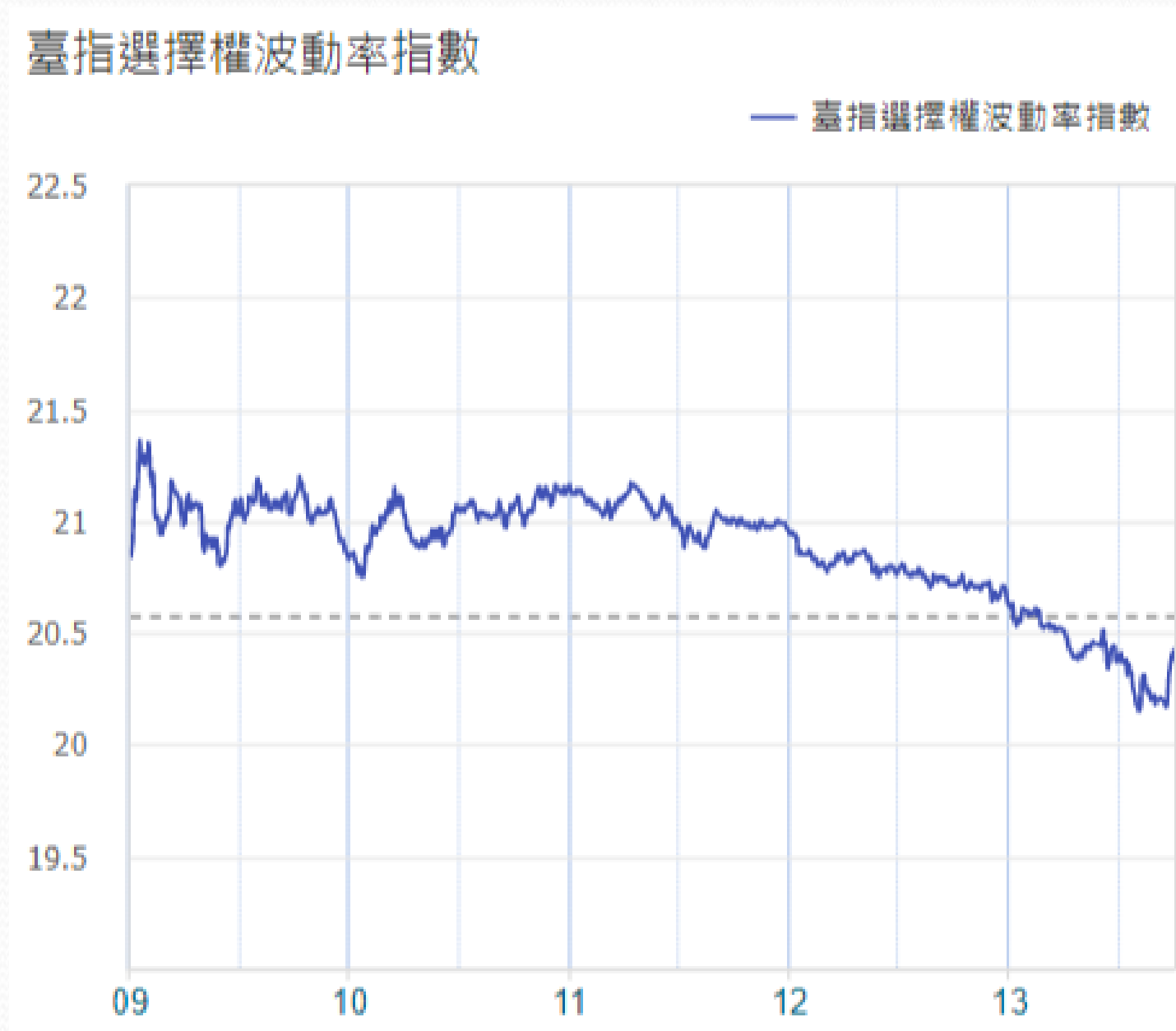
台指選擇權匯報

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	16000	賣權OI最大量	16000
	整體隱含波動率	19.33%	較前一交易日	+1.52%
	買權隱含波動率	14.94%	較前一交易日	-1.42%
	賣權隱含波動率	24.83%	較前一交易日	-0.74%
	成交量P/C_Ratio值	0.807	較前一交易日	-0.17
	未平倉P/C_Ratio值	0.948	較前一交易日	-0.01
電子選擇權	買權成交最大量	835	買權OI最大量	835
	賣權成交最大量	780	賣權OI最大量	730
金融選擇權	買權成交最大量	1860	買權OI最大量	1780
	賣權成交最大量	1740	賣權OI最大量	1580

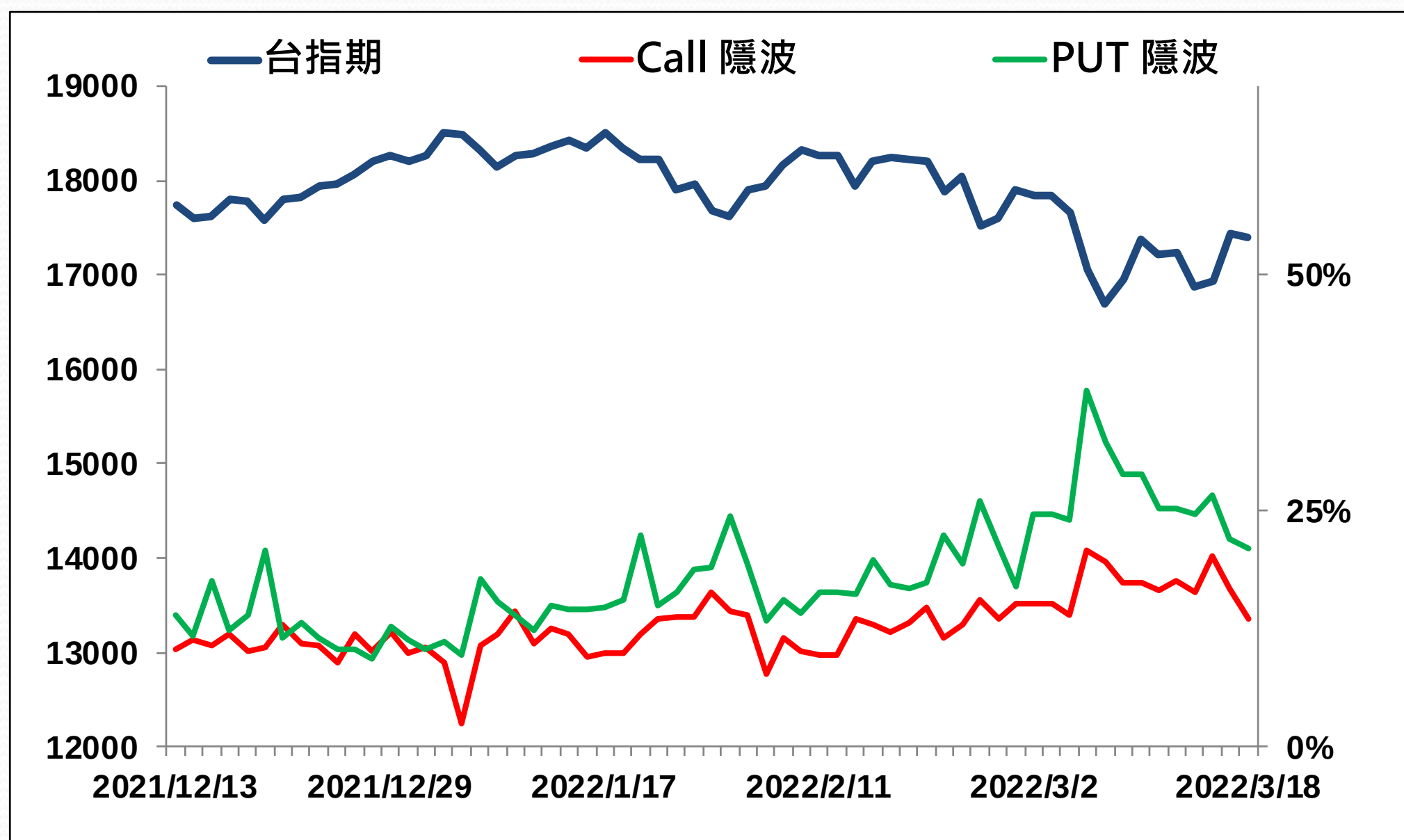
更新日期：2022年3月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



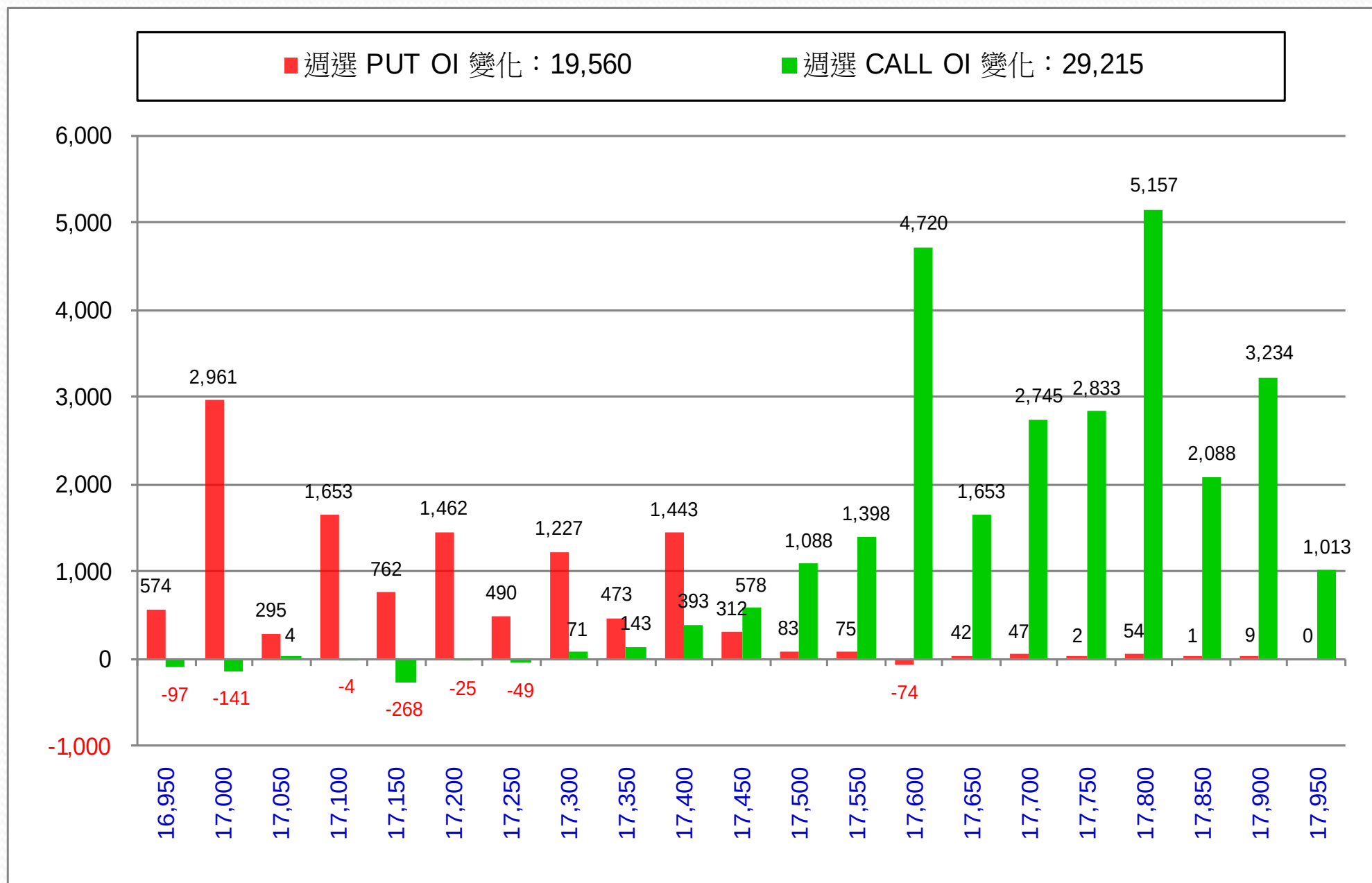
更新日期：2022年3月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年3月18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

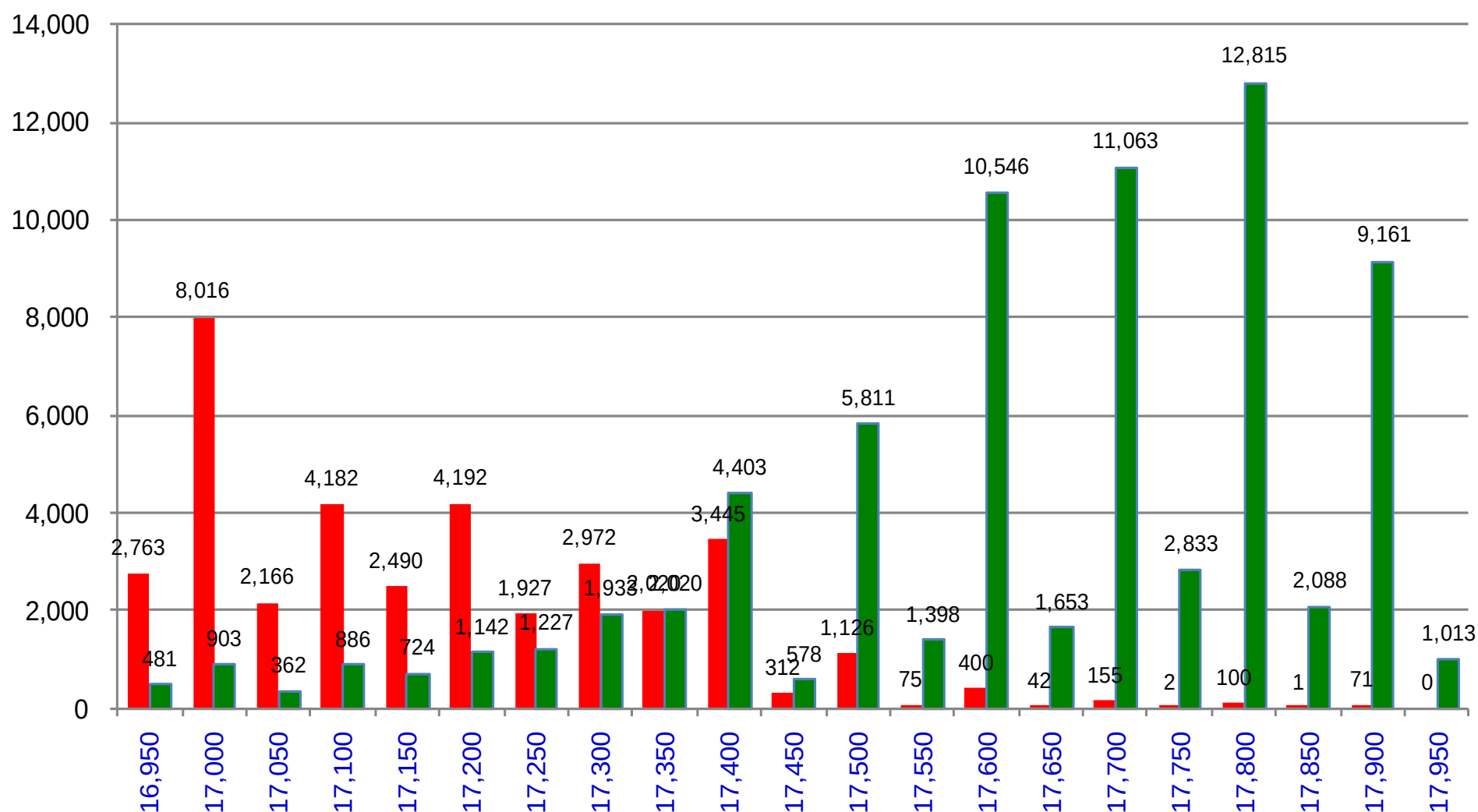


更新日期：2022年3月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：104,458

週選 CALL OI 總額：86,076



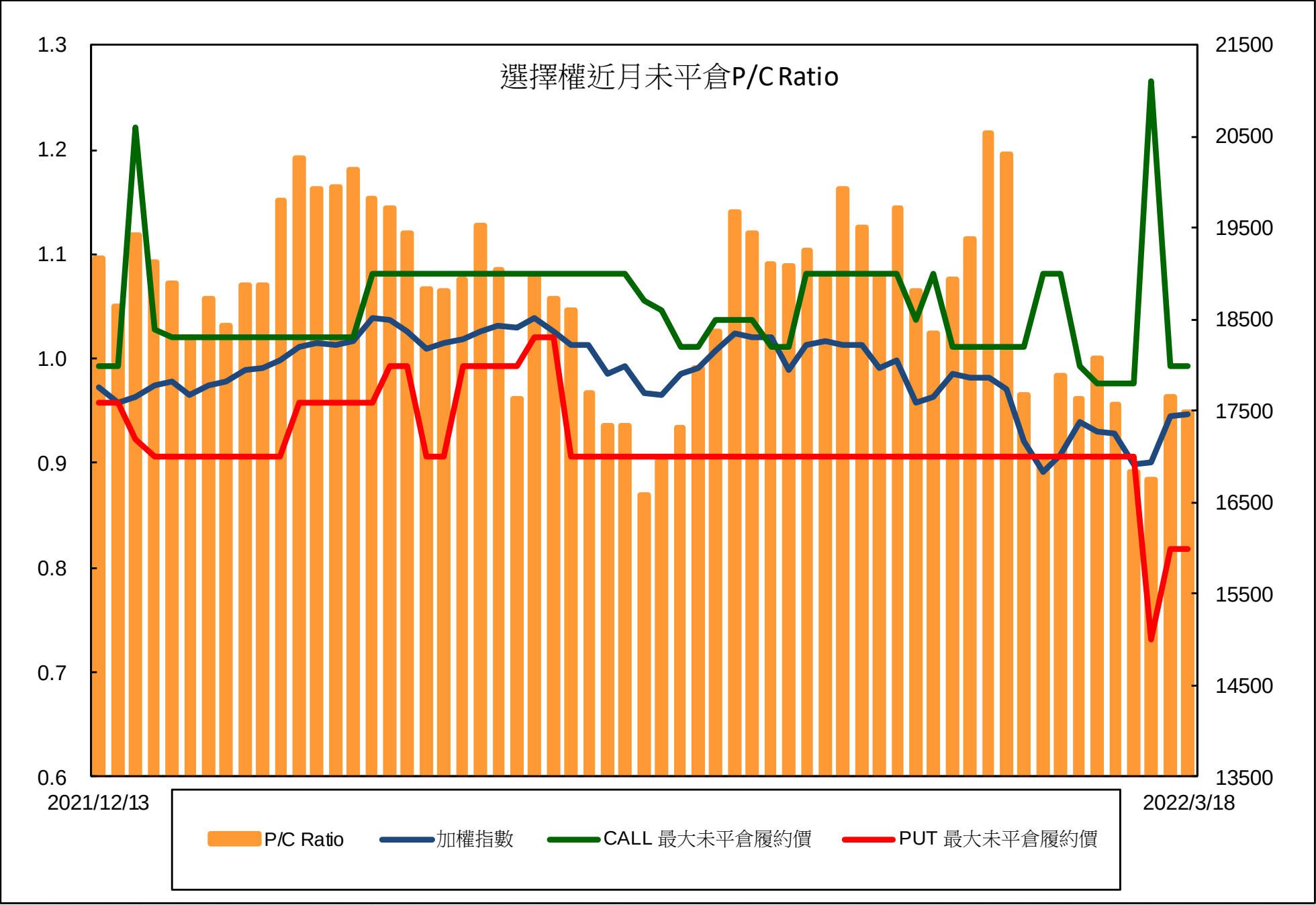
更新日期：2022年3月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	3月17日	56,537	34,206	22,331
	3月18日	67,484	43,765	23,719
Put	3月17日	35,164	44,616	-9,452
	3月18日	42,364	50,286	-7,922

更新日期：2022年3月18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3月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

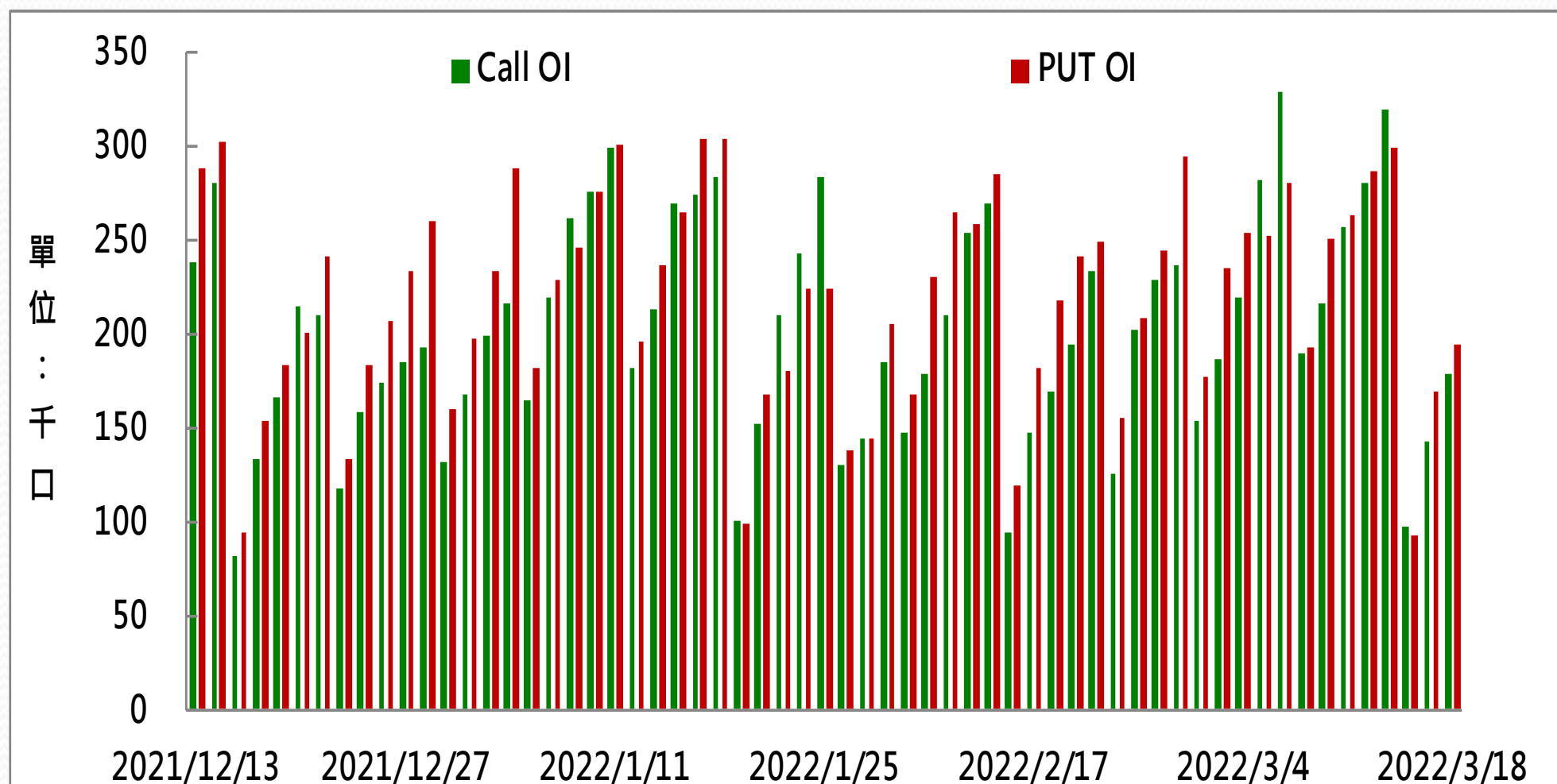


中華開發金控
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL



凱基期貨
KGI FUTURES

選擇權全月Put Call OI



更新日期：2022年3月18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3月18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