

台指選擇權OI匯報

日期：2022/3/21 結算日：2022/3/23					日期：2022/3/21 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
4	485	16,950	3,335	572	1	30	16,400	1,614	110
-32	871	17,000	9,439	1,423	-2	563	16,500	3,020	202
-56	306	17,050	3,421	1,255	2	625	16,600	1,446	20
-51	835	17,100	6,635	2,453	-5	1,101	16,700	3,828	-33
-51	673	17,150	3,254	764	-1	1,364	16,800	3,845	204
-155	987	17,200	8,345	4,153	7	1,791	16,900	2,197	177
-389	838	17,250	3,461	1,534	17	1,684	17,000	4,538	749
-202	1,731	17,300	5,228	2,256	32	1,141	17,100	1,345	126
-115	1,905	17,350	4,138	2,118	-20	1,566	17,200	1,543	203
-538	3,865	17,400	5,912	2,467	-11	2,000	17,300	1,235	146
635	1,213	17,450	2,869	2,557	-38	1,719	17,400	1,936	64
150	5,961	17,500	3,974	2,848	140	2,057	17,500	2,203	475
1,156	2,554	17,550	1,588	1,513	155	2,256	17,600	871	177
-1,382	9,164	17,600	1,546	1,146	89	2,668	17,700	505	103
2,093	3,746	17,650	384	342	0	3,529	17,800	303	105
290	11,353	17,700	531	376	-131	3,529	17,900	389	92
※ 3,721	6,554	17,750	120	118	※ 894	7,864	18,000	360	41
3,129	15,944	17,800	206	106	831	4,953	18,100	334	0
3,000	5,088	17,850	35	34	573	4,402	18,200	209	-5
-1,794	7,367	17,900	92	21	434	3,500	18,300	97	0
319	1,332	17,950	1	1	516	2,616	18,400	52	0
1,118	6,433	18,000	62	1	367	3,432	18,500	5	0
155	2,391	18,100	4	-2	152	2,668	18,600	11	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
11,079	97,155	1.3066	126,945	22,487	4,959	75,383	0.9611	72,452	5,687
昨日 P/C	1.2136	今日增減變化		0.0931	昨日 P/C	0.9480	今日增減變化		0.0131

更新日期：2022年3月21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21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	67,343,753	117,529,181	-50,185,428	8,700,164	2,087,741	924,618	1,163,123	-220,866
投信	40,523,149	53,557,442	-13,034,293	-281,745	450,874	0	450,874	2,540
自營商	70,326,557	21,730,713	48,595,844	-2,465,794	1,346,035	689,379	656,656	13,458
	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	772,369	3,158,050	-2,385,681	73,230	20,242	0	20,242	11,875
投信	27,069	0	27,069	3,651	1,687	0	1,687	14
自營商	568,331	256,253	312,078	2,356	86,027	121,450	-35,423	-15,342

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21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	22,960	14,656	8,304	2,470	43,261	14,129	29,132	-628
投信	0	50	-50	-50	50	63	-13	50
自營商	76,731	40,925	35,806	12,087	41,678	52,476	-10,798	-2,876
特定法人(週)	4,882	0	4,882	2,948	0	2,316	-2,316	-1,189
特定法人(近月)	10,691	14,651	-3,960	-359	5,135	22,400	-17,265	-1,049
特定法人(全月)	12,784	11,981	803	172	0	31,772	-31,772	-1,507
十大交易人(週)	33,101	27,854	5,247	2,816	38,114	23,329	14,785	5,138
十大交易人(近月)	45,527	32,251	13,276	817	28,439	36,441	-8,002	968
十大交易人(全月)	90,741	54,450	36,291	8,140	72,475	70,794	1,681	6,803
全市場未沖銷(近月)			75,383	4,959			72,452	5,687
全市場未沖銷(全月)			195,009	16,769			222,152	28,220

更新日期：2022年3月21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	17600	買權OI最大量	17800
	賣權成交最大量	17400	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	16.53%	較前一交易日	-0.56%
	買權隱含波動率	10.57%	較前一交易日	-2.88%
	賣權隱含波動率	21.12%	較前一交易日	+0.49%
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	780	賣權OI最大量	730
金融選擇權	買權成交最大量	1880	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21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	19.44%	較前一交易日	-0.10%
	買權隱含波動率	13.80%	較前一交易日	-1.14%
	賣權隱含波動率	24.45%	較前一交易日	-0.38%
	成交量P/C_Ratio值	1.075	較前一交易日	+0.27
	未平倉P/C_Ratio值	0.961	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	780	賣權OI最大量	730
金融選擇權	買權成交最大量	1880	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21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

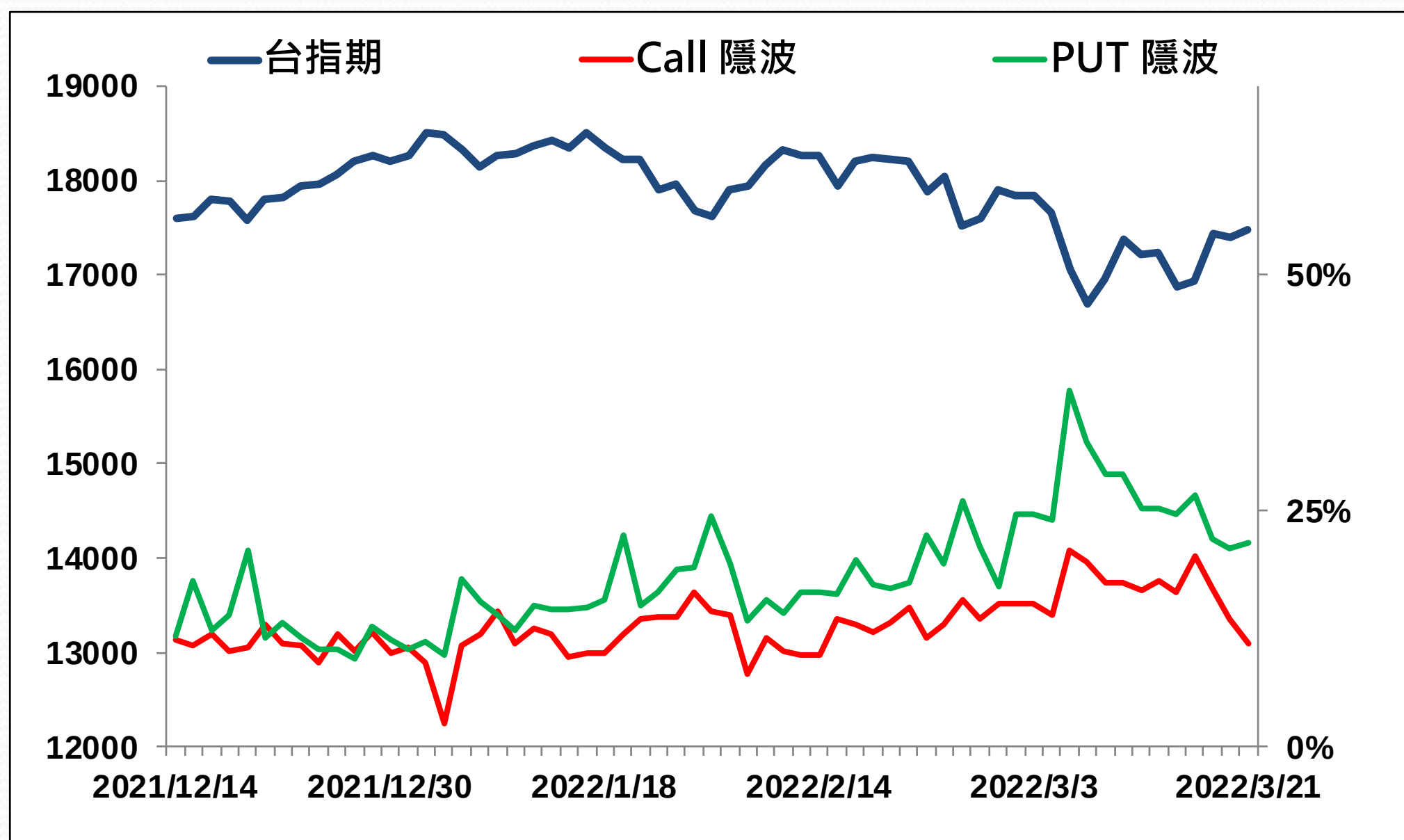
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



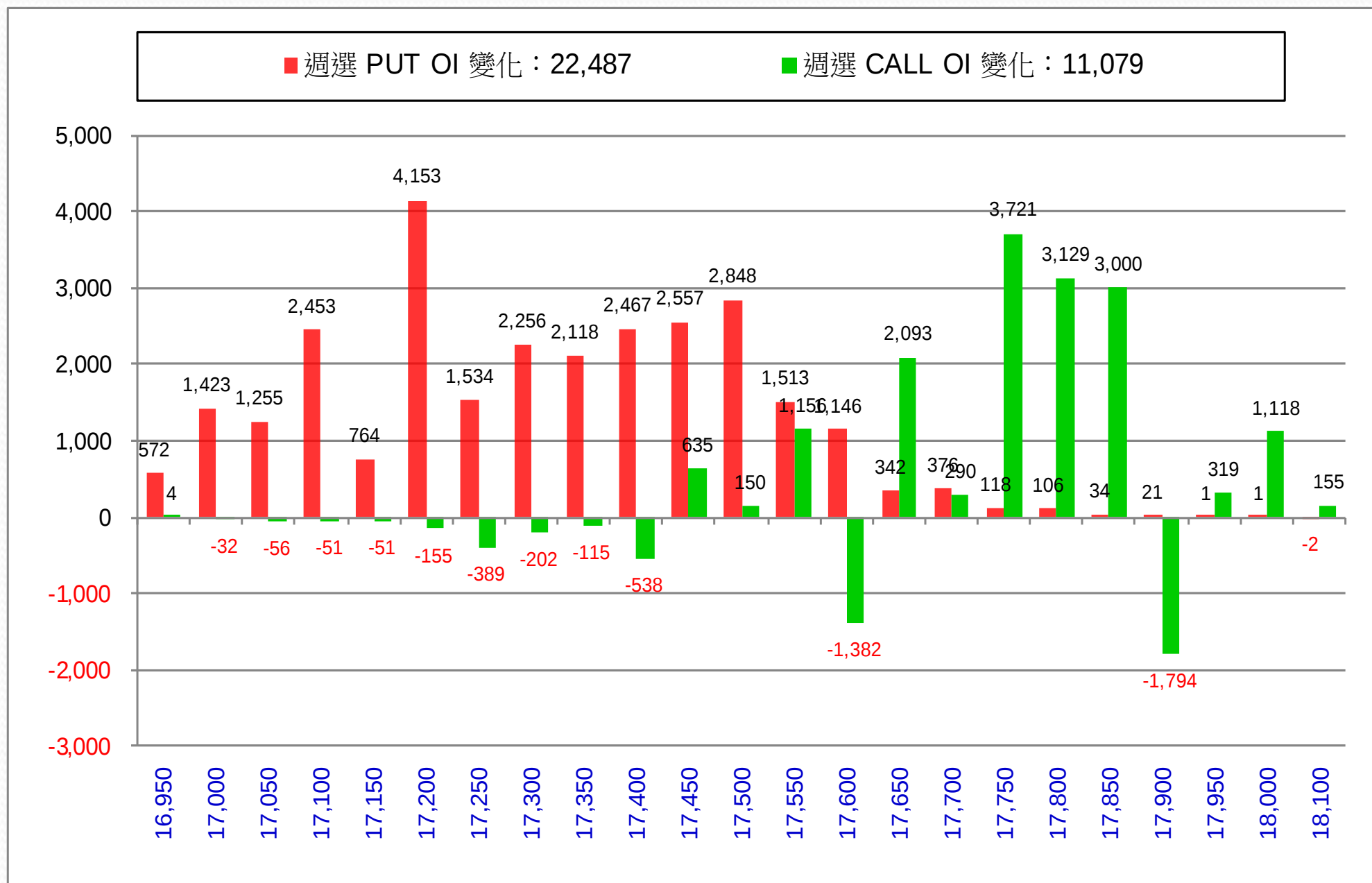
更新日期：2022年3月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年3月21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

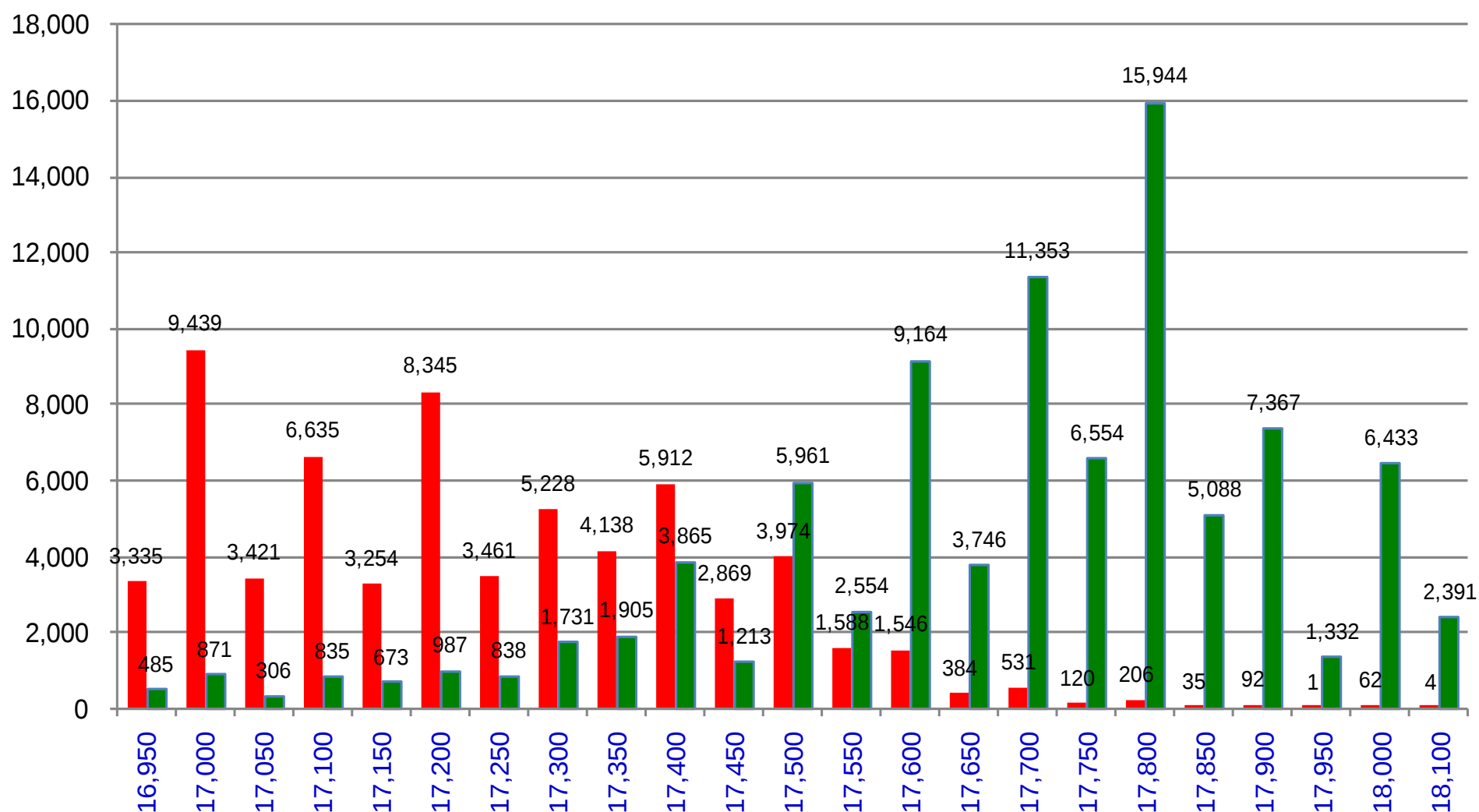


更新日期：2022年3月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：126,945

週選 CALL OI 總額：97,155



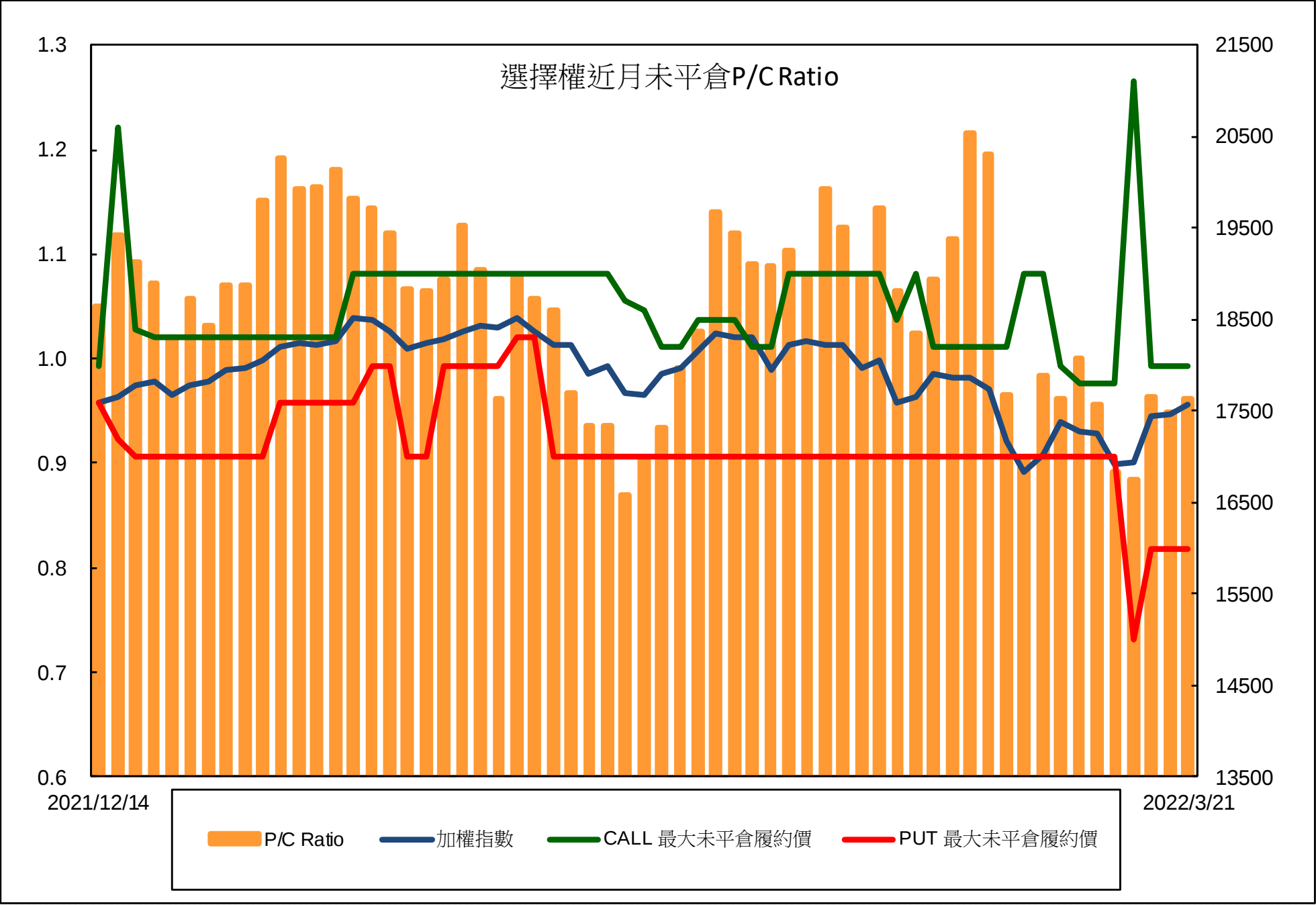
更新日期：2022年3月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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18日	67,484	43,765	23,719
	3月21日	76,731	40,925	35,806
Put	3月18日	42,364	50,286	-7,922
	3月21日	41,678	52,476	-10,798

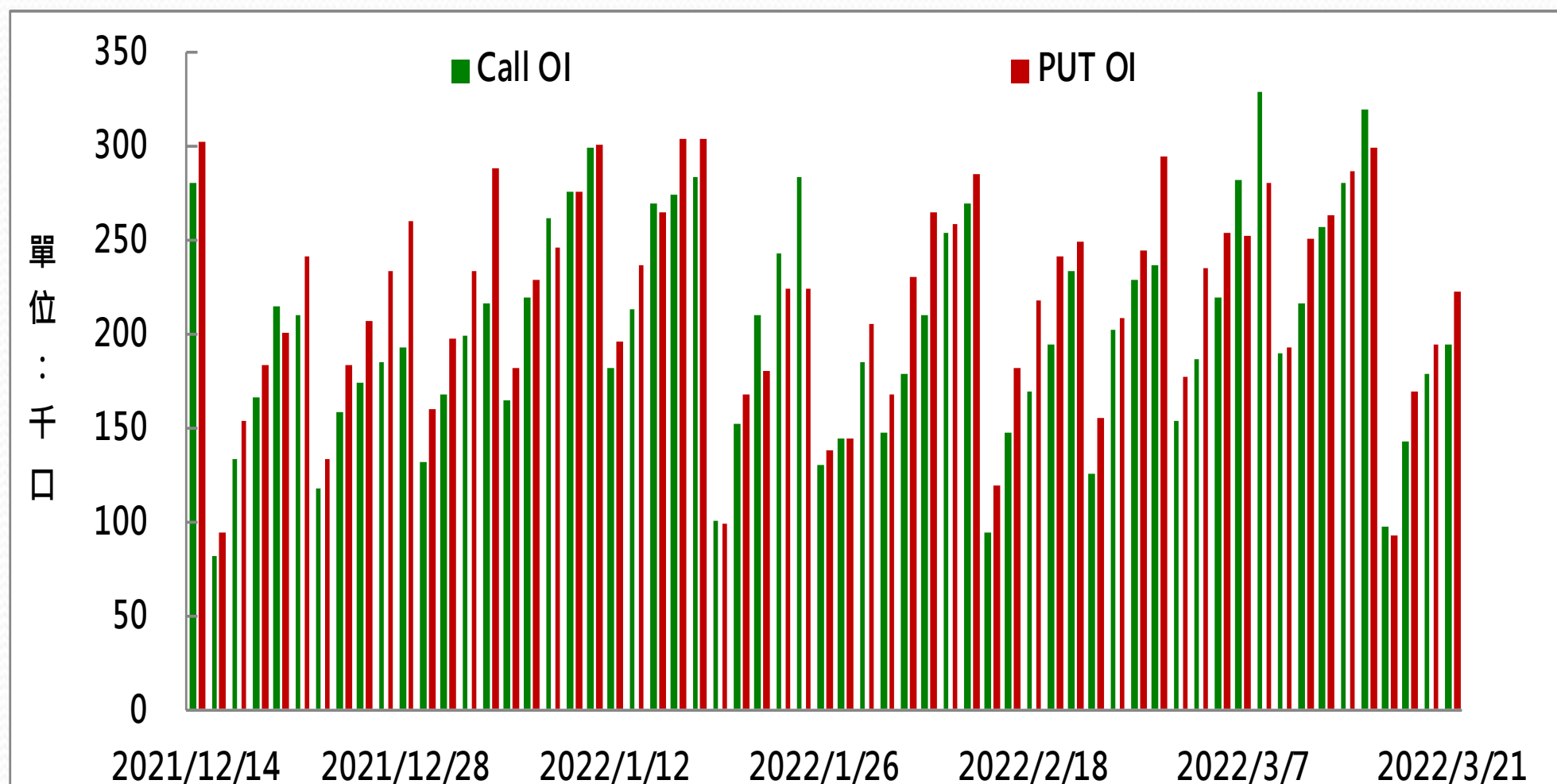
更新日期：2022年3月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年3月21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3月21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21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