

台指選擇權OI匯報

日期：2022/3/23 結算日：2022/3/30					日期：2022/3/23 結算日：2022/4/20				
202203W5					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
0	0	17,150	521	521	-3	560	16,500	3,391	437
2	2	17,200	2,045	2,045	-1	623	16,600	1,978	306
22	22	17,250	1,031	1,031	-7	1,093	16,700	3,911	28
13	13	17,300	1,789	1,789	-3	1,358	16,800	5,522	1,590 ※
20	20	17,350	1,431	1,431	-9	1,786	16,900	3,001	418
68	68	17,400	1,098	1,098	-42	1,650	17,000	5,350	193
20	20	17,450	811	811	-108	1,062	17,100	2,353	912
133	133	17,500	3,446	3,446 ※	-4	1,574	17,200	2,100	486
61	61	17,550	620	620	-33	1,960	17,300	1,783	350
213	213	17,600	1,291	1,291	-53	1,684	17,400	2,429	390
445	445	17,650	688	688	30	2,434	17,500	2,770	520
1,226	1,226	17,700	1,741	1,741	-65	2,249	17,600	1,294	367
776	776	17,750	280	280	-22	2,662	17,700	940	392
2,255	2,255	17,800	523	523	-473	3,108	17,800	639	239
1,344	1,344	17,850	89	89	-175	3,839	17,900	518	46
2,136	2,136	17,900	94	94	357	8,671	18,000	539	173
1,354	1,354	17,950	5	5	1,317	6,651	18,100	423	90
※ 3,677	3,677	18,000	29	29	※ 1,753	6,338	18,200	205	-4
1,763	1,763	18,050	14	14	1,283	4,951	18,300	91	-7
3,121	3,121	18,100	1	1	1,407	3,936	18,400	53	1
1,448	1,448	18,200	5	5	419	3,816	18,500	5	0
421	421	18,300	1	1	180	3,223	18,600	12	1
791	791	18,400	4	4	23	4,163	18,700	4	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
21,542	21,542	1.4183	30,554	30,554	6,195	85,146	0.9993	85,086	9,785
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化		1.4183	昨日 P/C	0.9538	今日增減變化		0.0455

更新日期：2022年3月23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23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	81,857,781	124,376,597	-42,518,816	2,857,709	2,399,720	925,512	1,474,208	323,661
投信	41,412,120	53,751,863	-12,339,743	920,906	469,367	0	469,367	18,300
自營商	72,159,429	21,243,533	50,915,896	3,526,517	1,454,308	839,572	614,736	-81,429
	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	823,517	3,482,829	-2,659,312	-145,571	20,368	0	20,368	-4,991
投信	27,759	0	27,759	495	1,697	0	1,697	6
自營商	660,545	207,267	453,278	135,317	217,251	237,613	-20,362	23,591

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23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	19,392	12,868	6,524	-3,230	38,940	11,314	27,626	-1,379
投信	0	50	-50	0	100	63	37	50
自營商	64,008	33,558	30,450	131	36,585	42,049	-5,464	5,541
特定法人(週)	0	0	0	---	0	0	0	---
特定法人(近月)	12,577	16,907	-4,330	-489	5,424	22,668	-17,244	1,167
特定法人(全月)	12,610	14,237	-1,627	-2,589	4,188	32,087	-27,899	6,172
十大交易人(週)	9,058	9,955	-897	---	15,935	13,955	1,980	---
十大交易人(近月)	52,034	35,616	16,418	1,825	31,014	41,571	-10,557	-1,721
十大交易人(全月)	78,262	52,086	26,176	-7,058	53,934	67,038	-13,104	-17,033
全市場未沖銷(近月)			85,146	6,195			85,086	9,785
全市場未沖銷(全月)			130,467	-77,100			138,617	-100,446

更新日期：2022年3月23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 03W5 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	17500	賣權OI最大量	17500
	整體隱含波動率	13.86%	較前一交易日	+1.05%
	買權隱含波動率	11.06%	較前一交易日	+0.94%
	賣權隱含波動率	16.11%	較前一交易日	+0.93%
電子選擇權	買權成交最大量	850	買權OI最大量	830
	賣權成交最大量	800	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	1840	賣權OI最大量	1580

更新日期：2022年3月23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	16.68%	較前一交易日	+1.18%
	買權隱含波動率	12.29%	較前一交易日	-1.13%
	賣權隱含波動率	20.61%	較前一交易日	-1.73%
	成交量P/C_Ratio值	1.200	較前一交易日	+0.15
	未平倉P/C_Ratio值	0.999	較前一交易日	+0.05
電子選擇權	買權成交最大量	850	買權OI最大量	830
	賣權成交最大量	800	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	1840	賣權OI最大量	1580

更新日期：2022年3月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

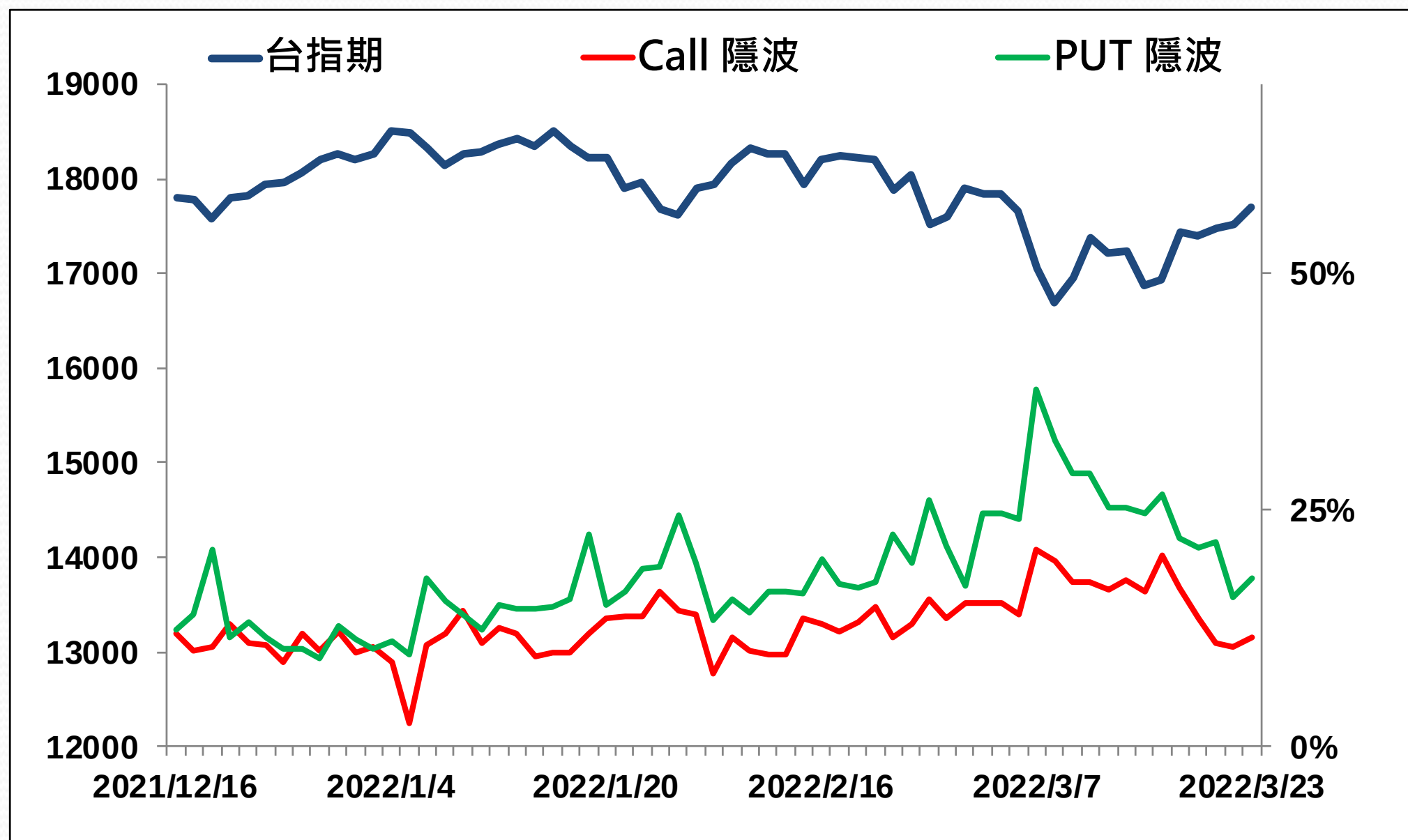
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



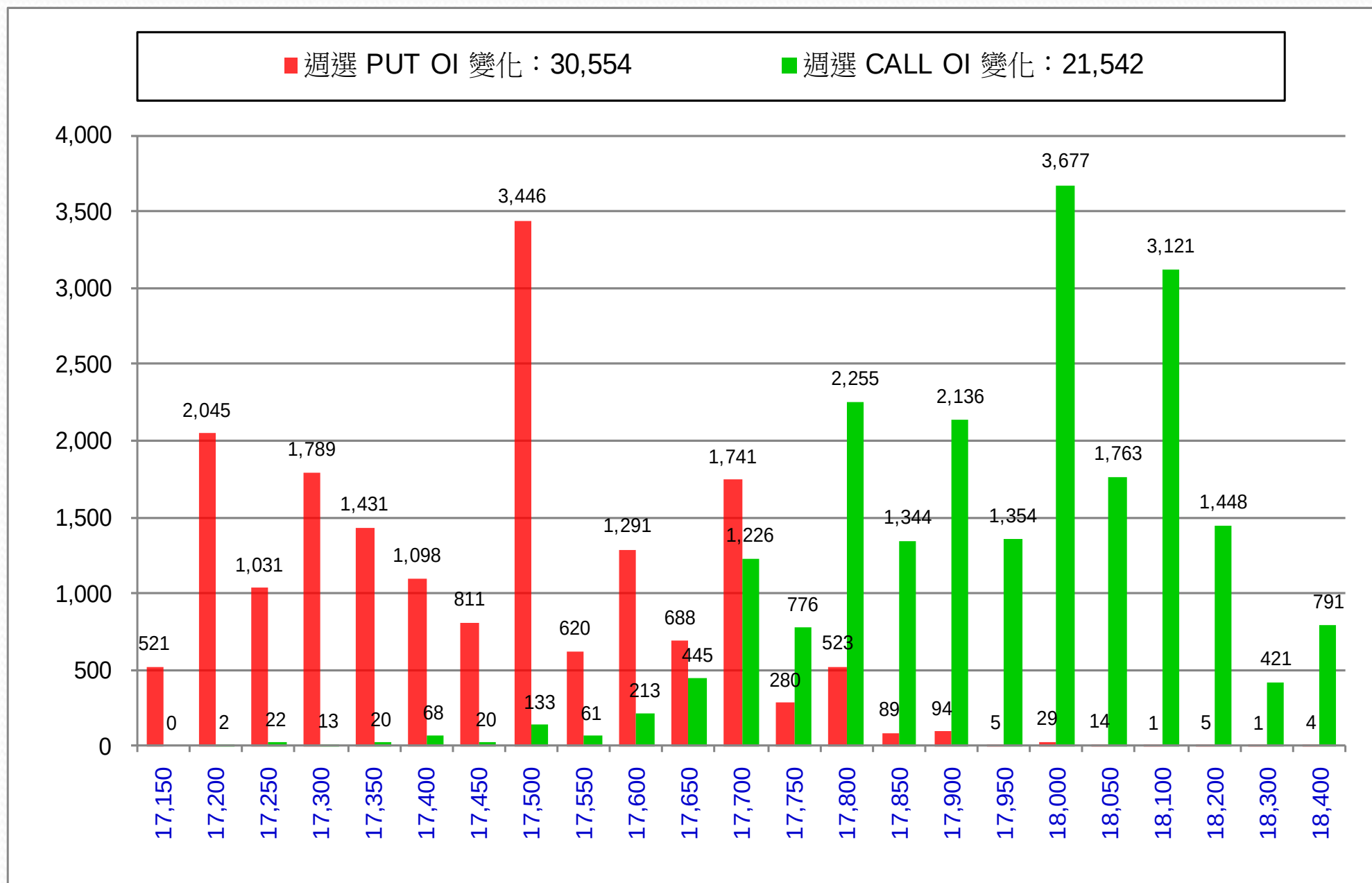
更新日期：2022年3月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年3月23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

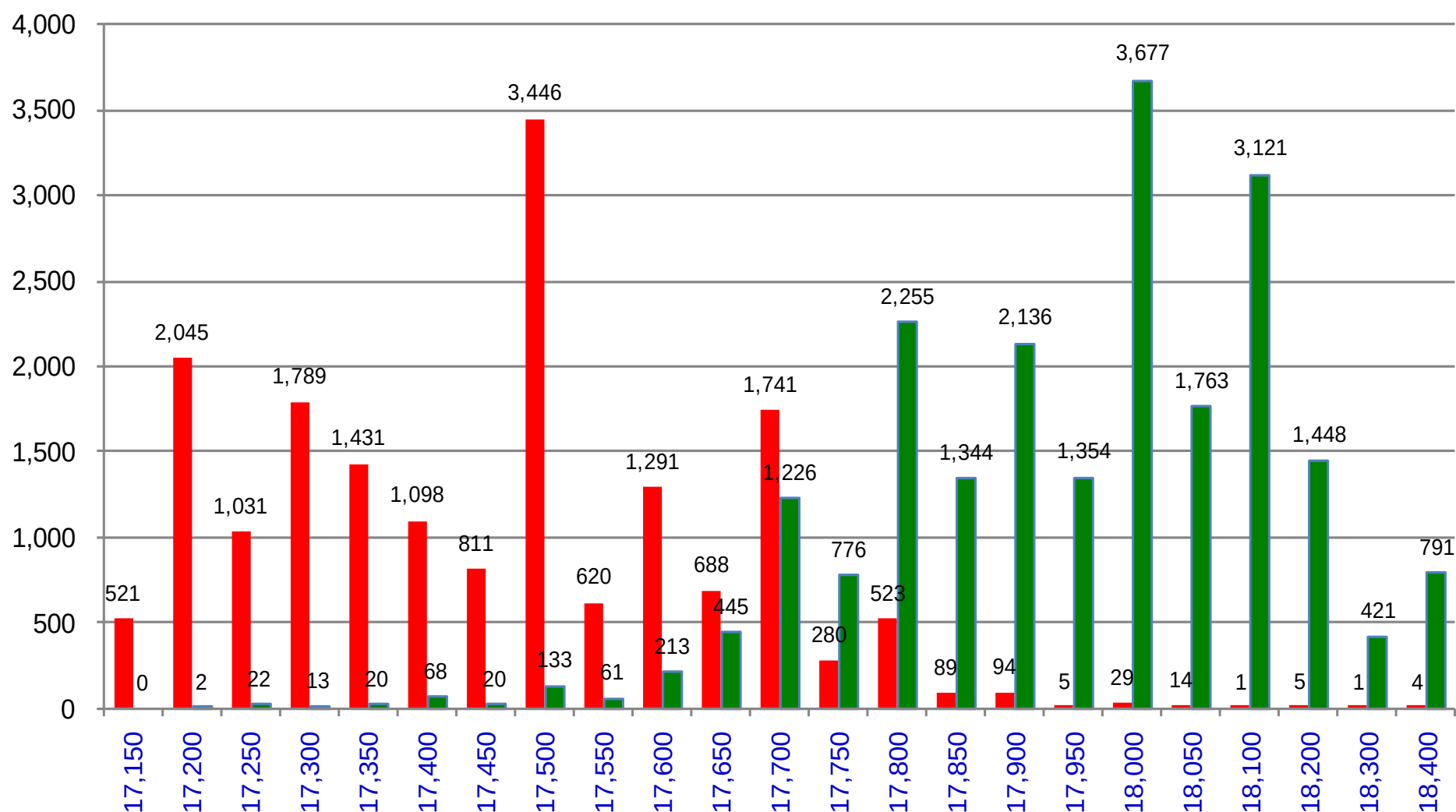


更新日期：2022年3月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：30,554

週選 CALL OI 總額：21,542



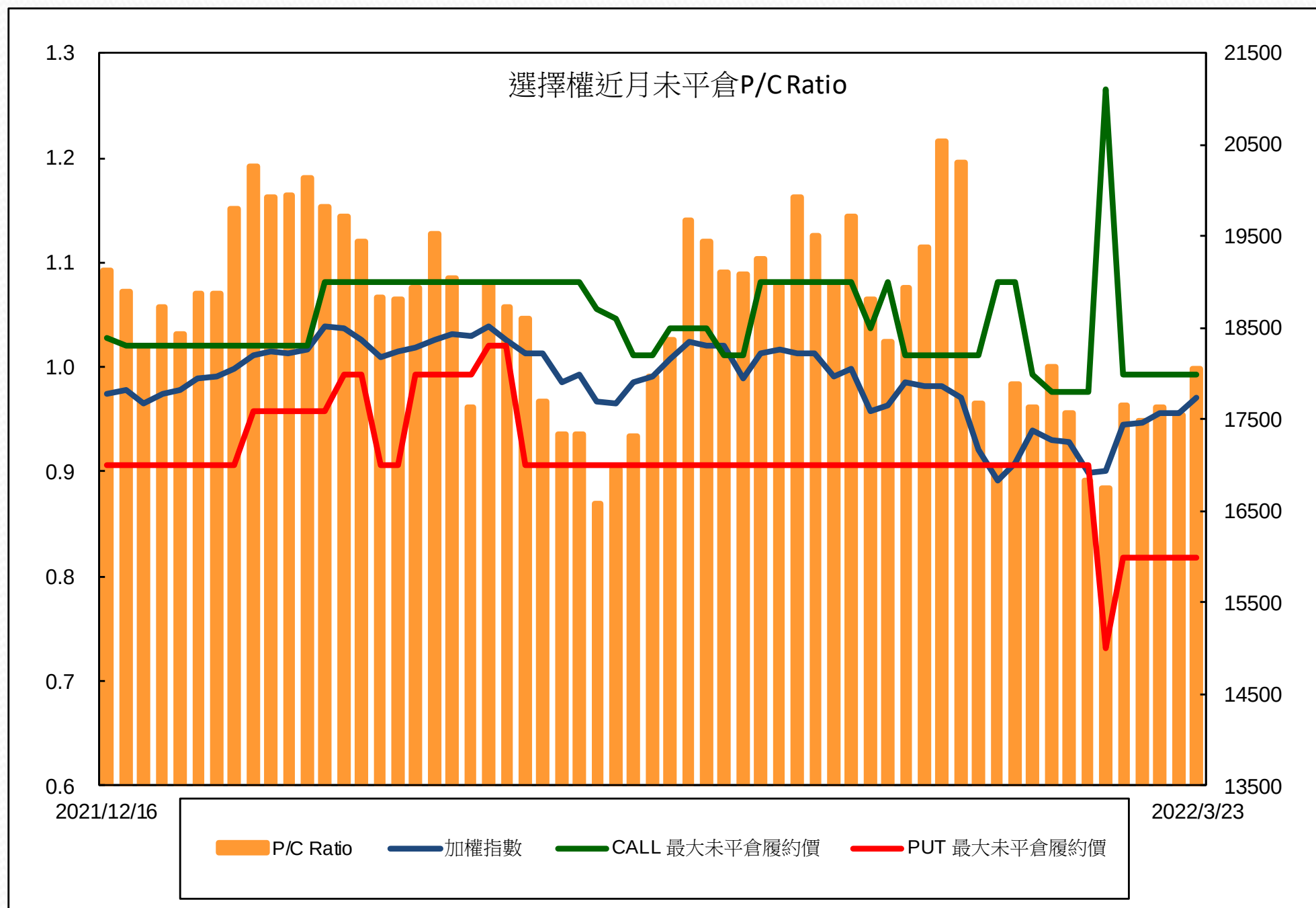
更新日期：2022年3月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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22日	74,188	43,869	30,319
	3月23日	64,008	33,558	30,450
Put	3月22日	45,391	56,396	-11,005
	3月23日	36,585	42,049	-5,464

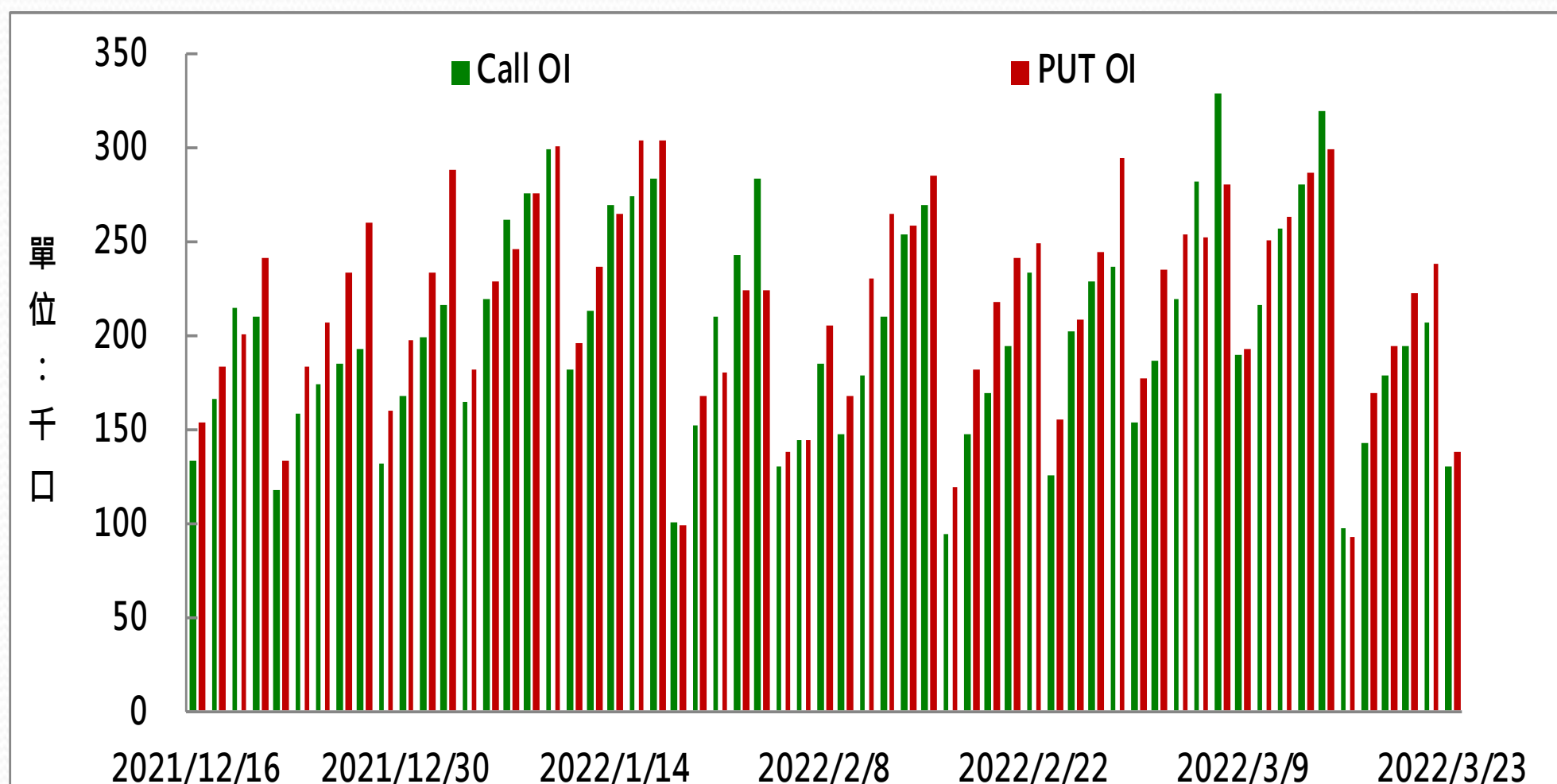
更新日期：2022年3月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年3月23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23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23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