

台指選擇權OI匯報

日期：2022/3/1 結算日：2022/3/2					日期：2022/3/1 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
-103	455	17,300	5,891	210	0	1	16,700	2,638	-24
16	30	17,350	1,941	689	0	68	16,800	7,194	346
-110	734	17,400	7,098	518	0	11	16,900	3,421	124
-204	552	17,450	3,189	69	4	121	17,000	12,542	1,002
-514	1,238	17,500	9,254	2,514	3	104	17,100	2,576	121
-288	962	17,550	4,954	2,422	-1	310	17,200	3,612	359
-1,152	1,754	17,600	9,845	3,679	4	234	17,300	5,300	799
-690	1,926	17,650	6,924	4,438	-16	1,322	17,400	3,149	365
-1,340	2,981	17,700	7,180	4,554	91	1,501	17,500	10,642	2,229
-1,376	2,131	17,750	4,806	3,237	-223	1,932	17,600	4,701	514
-1,355	4,638	17,800	8,250	5,689	-43	1,221	17,700	1,898	138
-189	4,102	17,850	4,789	3,790	-315	1,371	17,800	1,961	-1
-1,208	5,156	17,900	6,544	4,431	93	2,511	17,900	2,174	295
913	5,103	17,950	3,515	2,387	-567	4,274	18,000	2,617	155
1,488	13,583	18,000	2,735	1,503	781	5,949	18,100	1,408	18
4,652	10,949	18,050	1,472	344	※ 1,266	8,299	18,200	1,414	-42
※ 5,386	12,647	18,100	1,290	252	845	6,329	18,300	1,444	-48
752	5,561	18,150	601	263	1,117	5,308	18,400	665	80
327	6,895	18,200	433	133	110	7,550	18,500	303	0
-241	3,983	18,250	144	-2	161	6,042	18,600	255	1
※ -88	4,848	18,300	83	0	317	6,349	18,700	76	0
-40	2,184	18,350	60	-5	-6	5,793	18,800	147	1
-226	2,781	18,400	16	0	159	4,831	18,900	9	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
3,303	108,175	1.3622	147,357	38,009	3,944	108,983	1.0749	117,145	9,576
昨日 P/C	1.0427	今日增減變化		0.3195	昨日 P/C	1.0241	今日增減變化		0.0508

更新日期：2022年3月1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1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	75,229,385	139,915,836	-64,686,451	6,936,488	3,224,902	2,014,718	1,210,184	363,805
投信	42,458,605	52,772,334	-10,313,729	2,094,277	507,060	0	507,060	7,230
自營商	70,863,099	22,036,543	48,826,556	-3,061,182	1,409,395	1,230,328	179,067	-70,803
	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	1,008,382	3,795,935	-2,787,553	254,771	12,018	60,092	-48,074	34,006
投信	23,039	0	23,039	281	1,717	0	1,717	42
自營商	551,053	182,486	368,567	-23,539	200,821	173,290	27,531	665

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1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	35,672	17,987	17,685	6,878	67,675	22,812	44,863	5,230
投信	0	0	0	0	0	68	-68	0
自營商	79,869	49,905	29,964	17,741	60,742	75,680	-14,938	-18,611
特定法人(週)	3,500	2,761	739	-3,229	0	7,459	-7,459	-1,875
特定法人(近月)	16,556	6,767	9,789	199	8,107	32,445	-24,338	-1,588
特定法人(全月)	21,787	7,501	14,286	3,167	6,299	52,559	-46,260	-2,706
十大交易人(週)	32,829	30,579	2,250	13,608	52,489	28,591	23,898	14,449
十大交易人(近月)	60,682	37,373	23,309	3,309	44,069	65,789	-21,720	1,327
十大交易人(全月)	100,510	59,649	40,861	16,500	102,660	107,594	-4,934	17,087
全市場未沖銷(近月)			108,983	3,944			117,145	9,576
全市場未沖銷(全月)			236,317	7,838			294,714	49,428

更新日期：2022年3月1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	18000	買權OI最大量	18000
	賣權成交最大量	17600	賣權OI最大量	17600
	整體隱含波動率	15.38%	較前一交易日	-1.49%
	買權隱含波動率	15.04%	較前一交易日	+1.83%
	賣權隱含波動率	15.63%	較前一交易日	-4.75%
電子選擇權	買權成交最大量	865	買權OI最大量	865
	賣權成交最大量	830	賣權OI最大量	830
金融選擇權	買權成交最大量	1800	買權OI最大量	1800
	賣權成交最大量	1720	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年3月1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	18300	買權OI最大量	18200
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	20.57%	較前一交易日	+0.48%
	買權隱含波動率	16.17%	較前一交易日	+0.44%
	賣權隱含波動率	25.50%	較前一交易日	-0.82%
	成交量P/C_Ratio值	0.872	較前一交易日	-0.18
	未平倉P/C_Ratio值	1.075	較前一交易日	+0.05
電子選擇權	買權成交最大量	865	買權OI最大量	865
	賣權成交最大量	830	賣權OI最大量	830
金融選擇權	買權成交最大量	1800	買權OI最大量	1800
	賣權成交最大量	1720	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年3月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

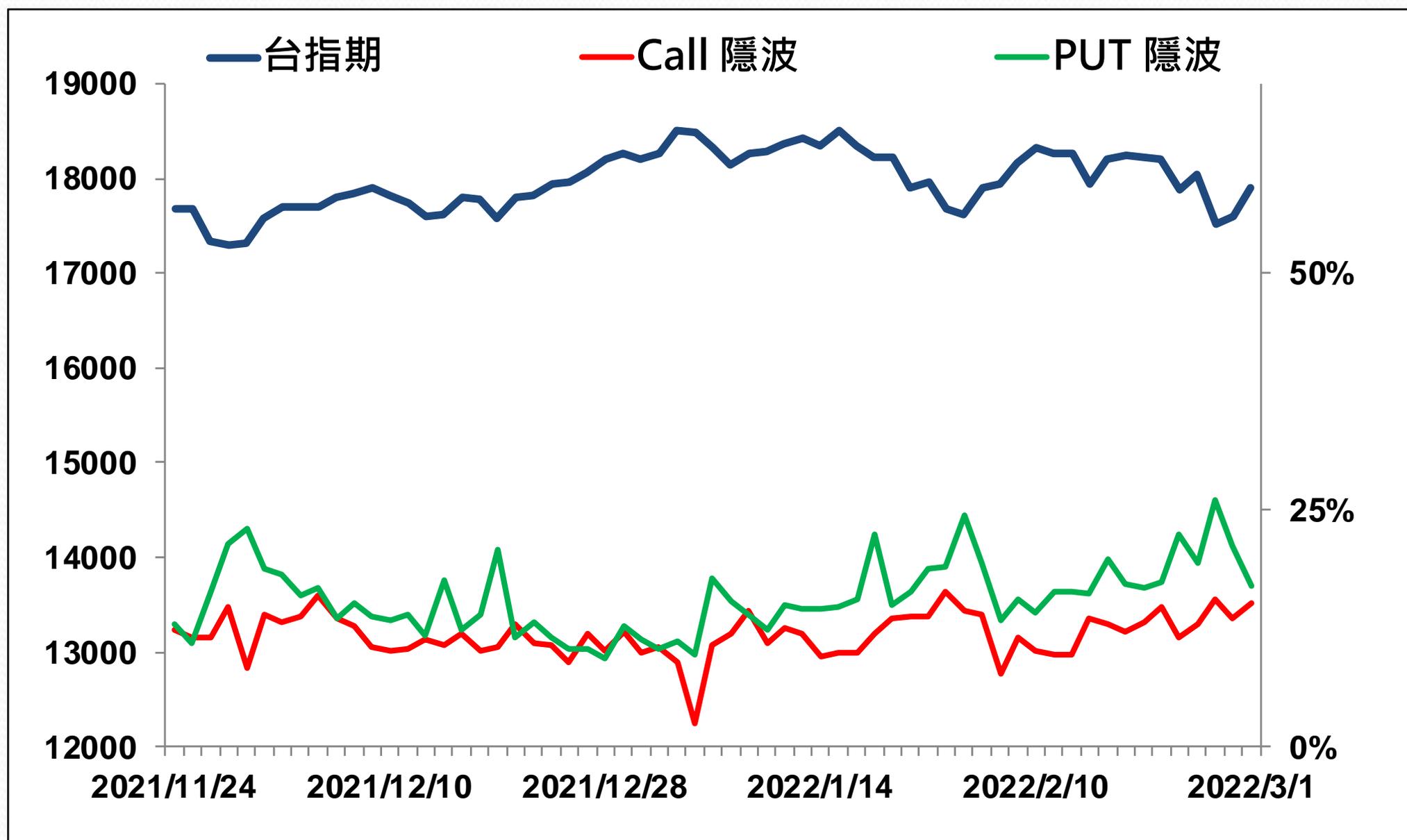
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2022年3月1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

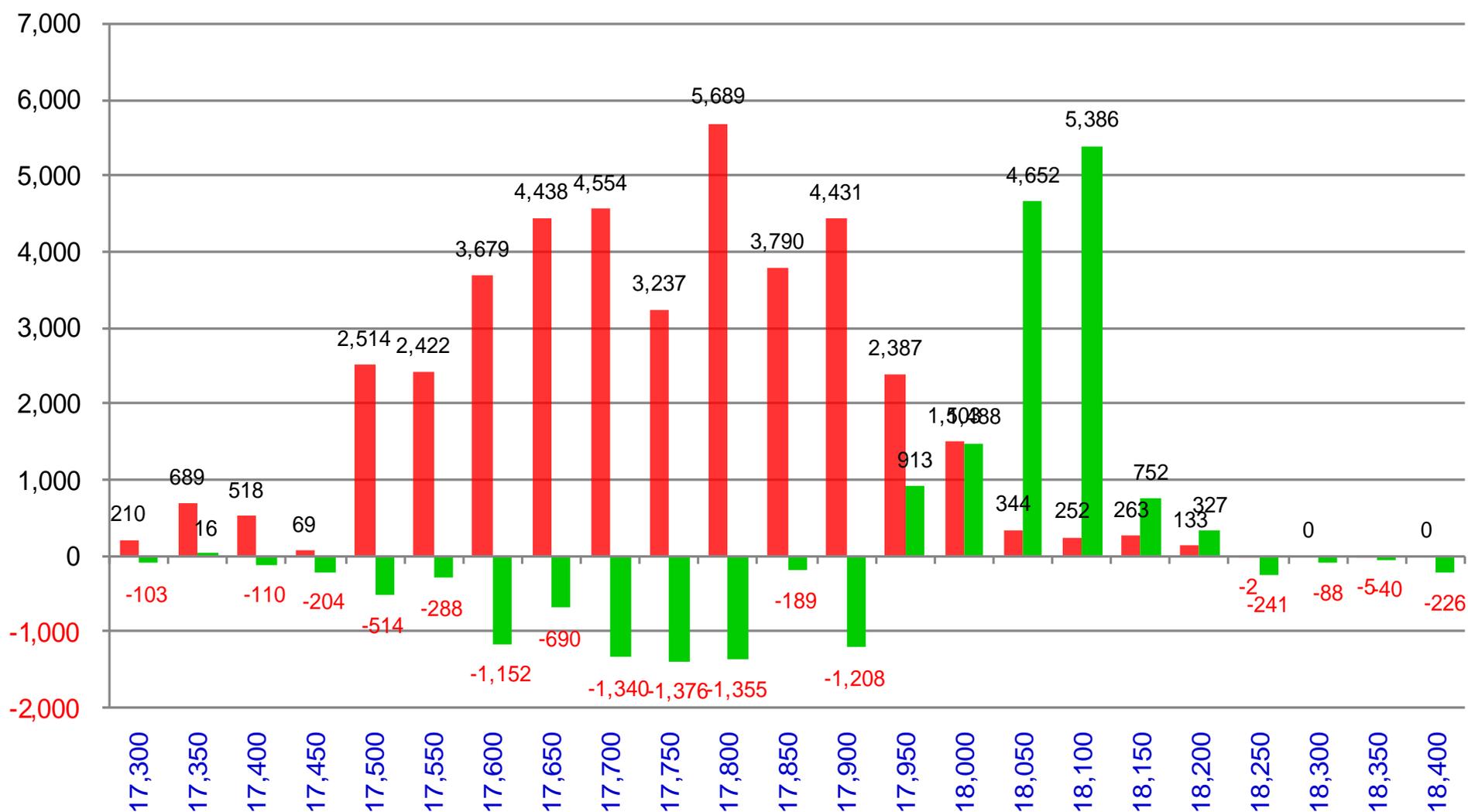


更新日期：2022年3月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：38,009

週選 CALL OI 變化：3,303

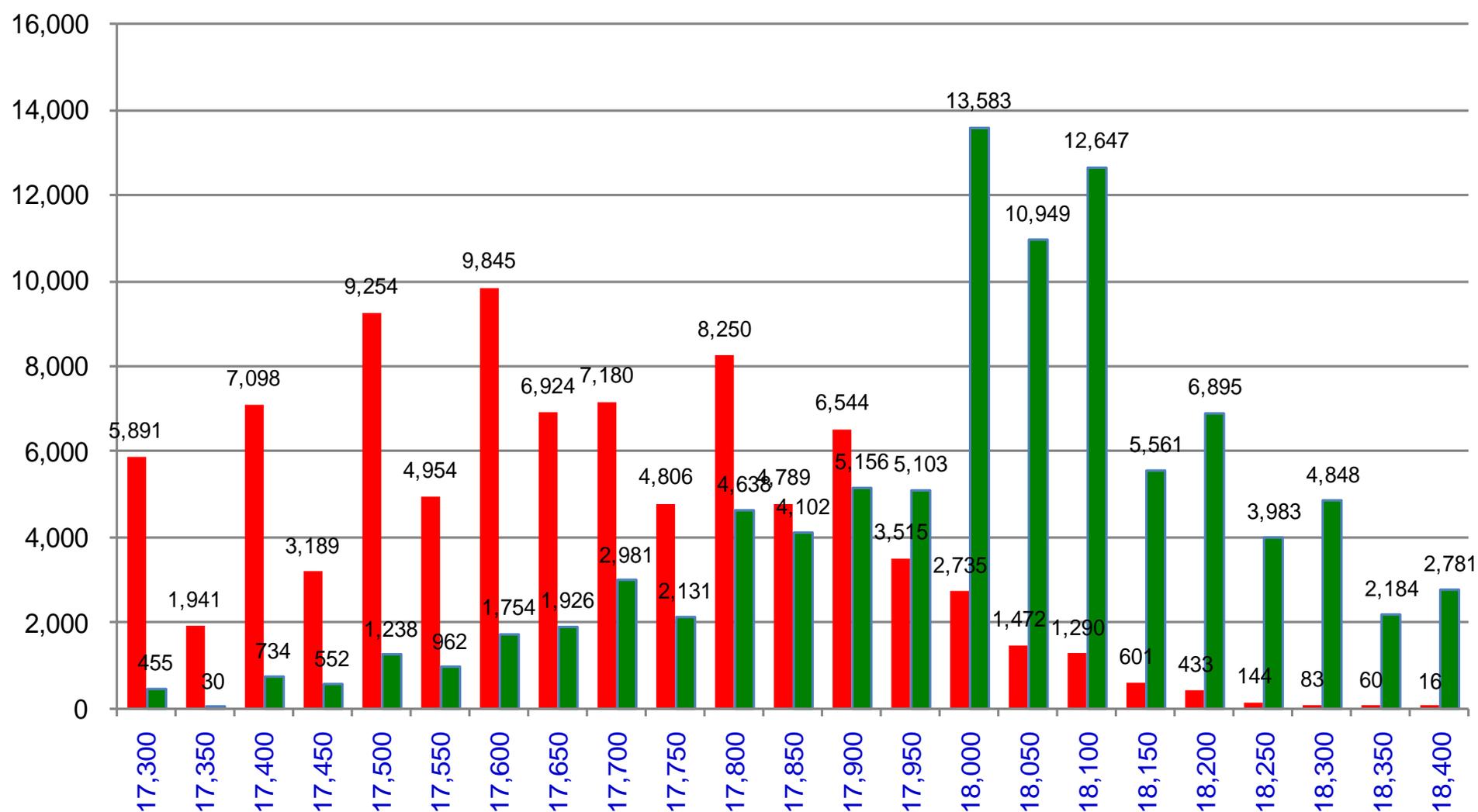


更新日期：2022年3月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：147,357

週選 CALL OI 總額：108,175



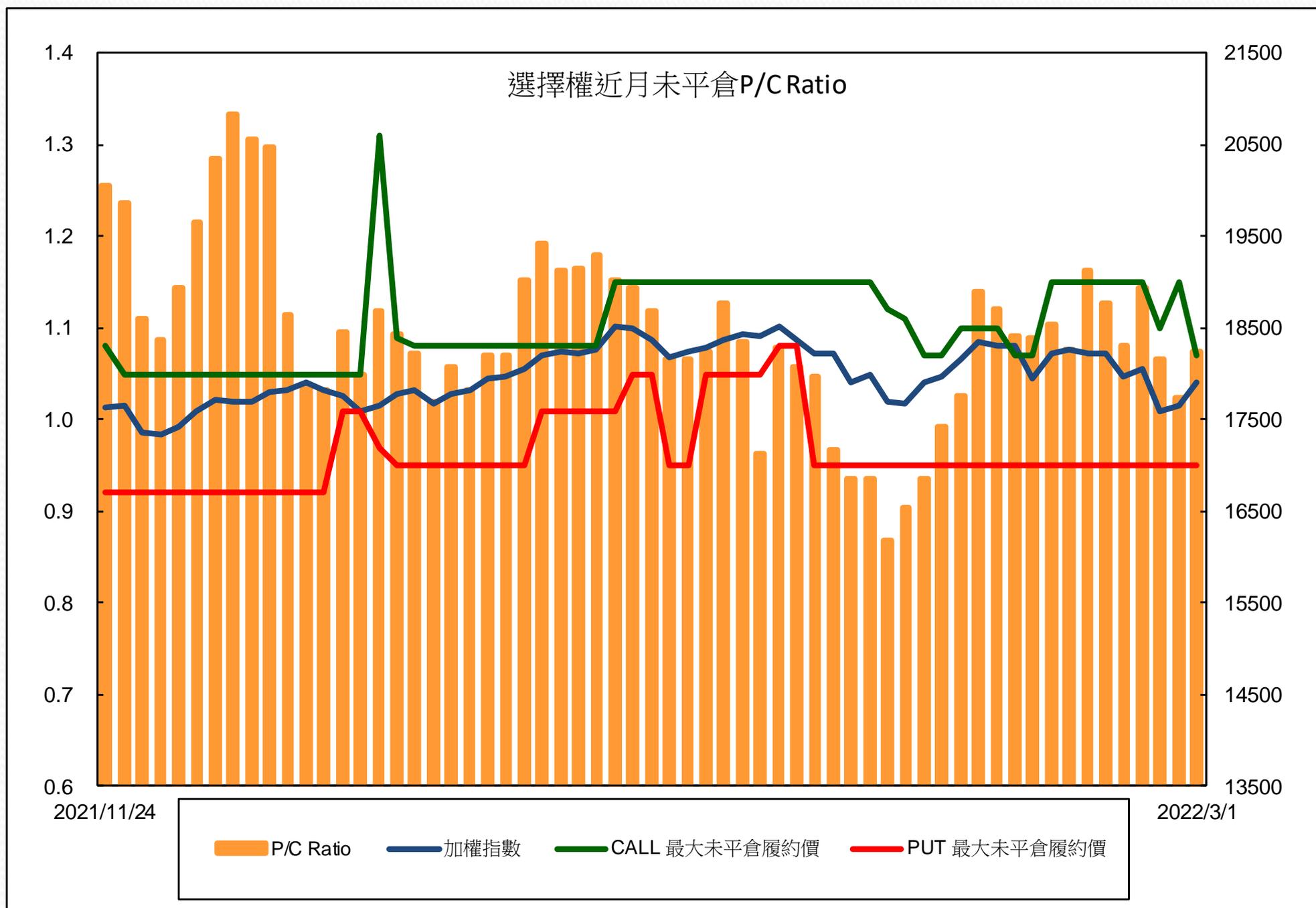
更新日期：2022年3月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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25日	65,951	53,728	12,223
	3月1日	79,869	49,905	29,964
Put	2月25日	63,284	59,611	3,673
	3月1日	60,742	75,680	-14,938

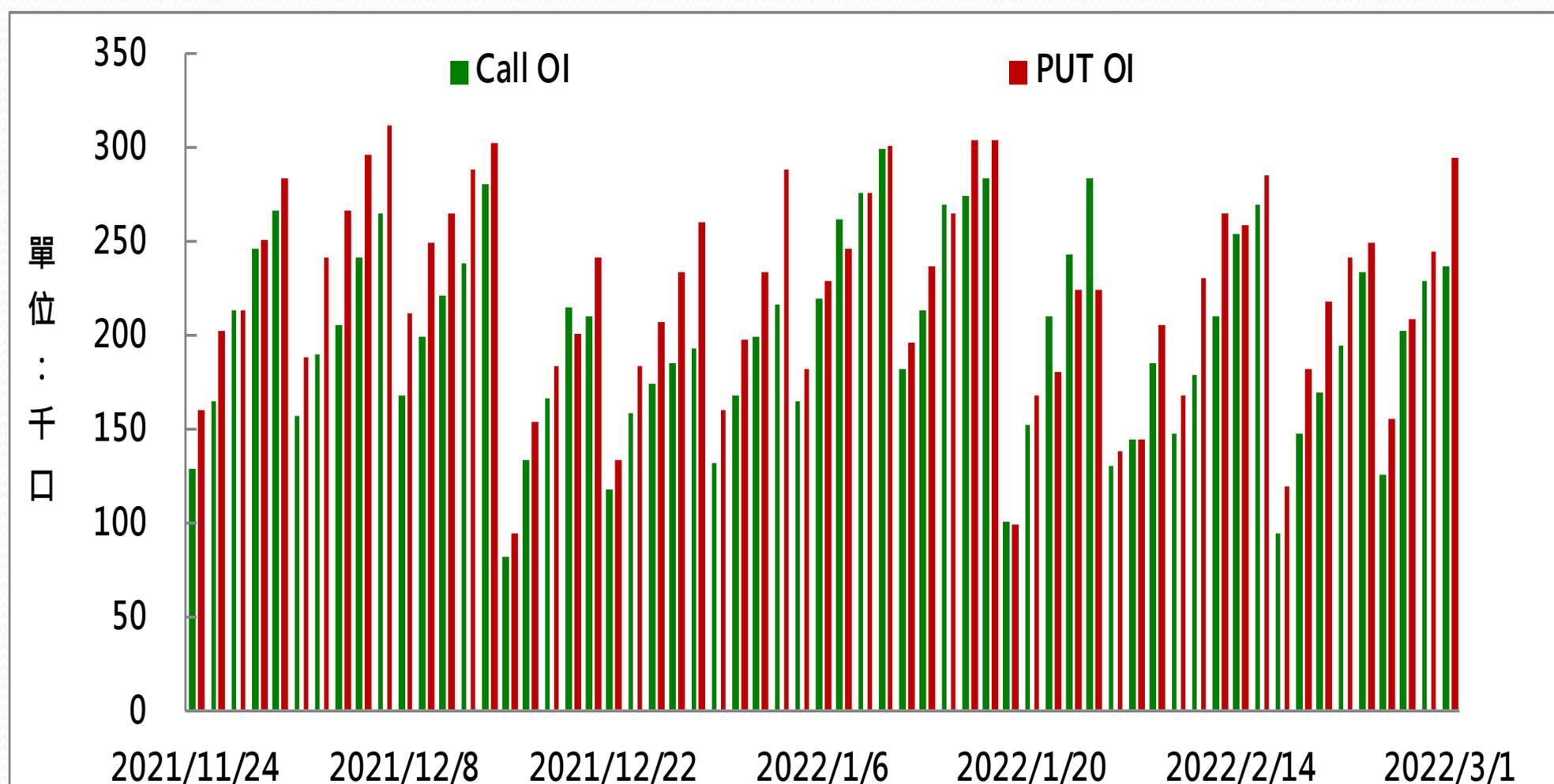
更新日期：2022年3月1日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年3月1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1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1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