

台指選擇權OI匯報

日期：2022/3/2 結算日：2022/3/9					日期：2022/3/2 結算日：2022/3/16				
202203W2					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
0	0	17,100	910	910	0	1	16,700	2,723	85
0	0	17,200	1,704	1,704	0	68	16,800	7,633	439
9	9	17,300	1,817	1,817	4	15	16,900	3,753	332
10	10	17,400	1,239	1,239	-3	118	17,000	12,189	-353
37	37	17,450	527	527	0	104	17,100	2,691	115
58	58	17,500	1,143	1,143	11	321	17,200	3,901	289
29	29	17,550	399	399	8	242	17,300	5,102	-198
15	15	17,600	704	704	-19	1,303	17,400	3,201	52
51	51	17,650	309	309	-56	1,445	17,500	11,330	688
56	56	17,700	669	669	-82	1,850	17,600	5,191	490
103	103	17,750	734	734	-132	1,089	17,700	2,167	269
494	494	17,800	790	790	244	1,615	17,800	2,155	194
494	494	17,850	299	299	145	2,656	17,900	1,990	-184
636	636	17,900	390	390	414	4,688	18,000	2,662	45
599	599	17,950	147	147	-492	5,457	18,100	1,441	33
1,465	1,465	18,000	235	235	648	8,947	18,200	1,356	-58
1,506	1,506	18,050	147	147	377	6,706	18,300	1,365	-79
2,158	2,158	18,100	64	64	621	5,929	18,400	654	-11
1,422	1,422	18,150	23	23	361	7,911	18,500	300	-3
1,466	1,466	18,200	9	9	382	6,424	18,600	247	-8
※ 1,383	1,383	18,250	3	3	※ 679	7,028	18,700	77	1
1,760	1,760	18,300	18	18	91	5,884	18,800	147	0
1,850	1,850	18,350	1	1	-71	4,760	18,900	9	0
※ 2,724	2,724	18,400	3	3	54	7,545	19,000	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
21,308	21,308	0.9291	19,797	19,797	3,208	112,191	1.1145	125,033	7,888
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化	0.9291		昨日 P/C	1.0749	今日增減變化	0.0396	

更新日期：2022年3月2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2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	70,291,354	142,363,403	-72,072,049	-7,385,598	3,154,289	2,193,558	960,731	-249,453
投信	42,040,598	52,925,346	-10,884,748	-571,019	503,880	0	503,880	-3,180
自營商	71,065,688	18,798,356	52,267,332	3,440,776	1,383,746	1,242,724	141,022	-38,045
	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	1,005,651	3,845,870	-2,840,219	-52,666	8,592	54,986	-46,394	1,680
投信	22,976	0	22,976	-63	1,718	0	1,718	1
自營商	549,566	183,816	365,750	-2,817	199,267	176,868	22,399	-5,132

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2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	28,554	12,800	15,754	-1,931	59,348	20,401	38,947	-5,916
投信	0	0	0	0	0	68	-68	0
自營商	62,203	41,124	21,079	-8,885	49,873	47,355	2,518	17,456
特定法人(週)	1,000	0	1,000	---	0	0	0	---
特定法人(近月)	17,837	6,767	11,070	1,281	8,107	32,988	-24,881	-543
特定法人(全月)	20,546	6,767	13,779	-507	8,953	49,435	-40,482	5,778
十大交易人(週)	10,068	10,774	-706	---	6,603	8,269	-1,666	---
十大交易人(近月)	61,552	37,272	24,280	971	47,145	68,436	-21,291	429
十大交易人(全月)	85,304	46,446	38,858	-2,003	67,706	96,587	-28,881	-23,947
全市場未沖銷(近月)			112,191	3,208			125,033	7,888
全市場未沖銷(全月)			153,799	-82,518			177,606	-117,108

更新日期：2022年3月2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03W2週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	18100	買權OI最大量	18400
	賣權成交最大量	17300	賣權OI最大量	17300
	整體隱含波動率	19.18%	較前一交易日	+3.80%
	買權隱含波動率	12.52%	較前一交易日	-2.52%
	賣權隱含波動率	20.43%	較前一交易日	+4.80%
電子選擇權	買權成交最大量	850	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	810	賣權OI最大量	830
金融選擇權	買權成交最大量	1820	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2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	21.57%	較前一交易日	-1.00%
	買權隱含波動率	15.34%	較前一交易日	-0.83%
	賣權隱含波動率	25.98%	較前一交易日	+0.48%
	成交量P/C_Ratio值	1.181	較前一交易日	+0.31
	未平倉P/C_Ratio值	1.114	較前一交易日	+0.04
電子選擇權	買權成交最大量	850	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	810	賣權OI最大量	830
金融選擇權	買權成交最大量	1820	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2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

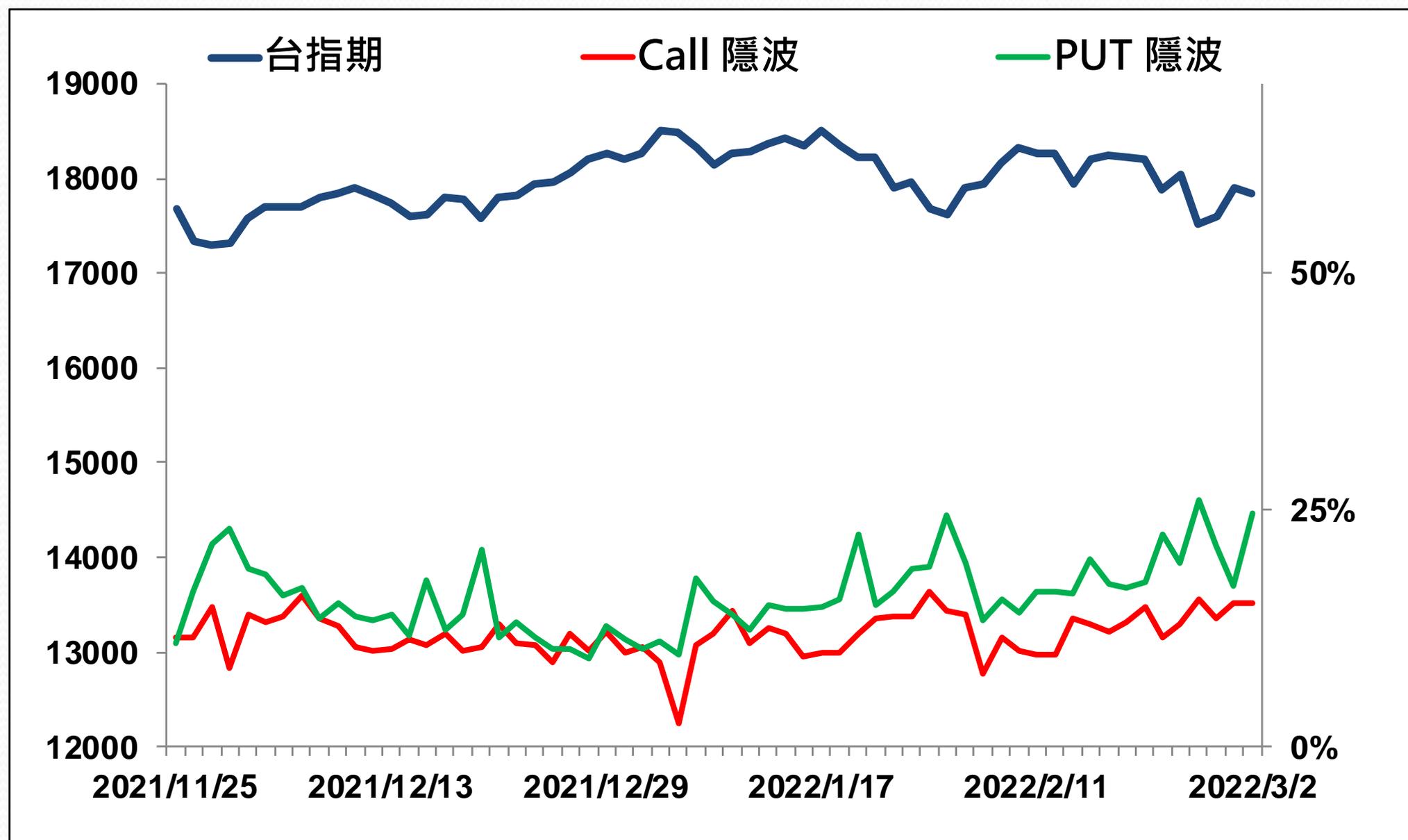
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



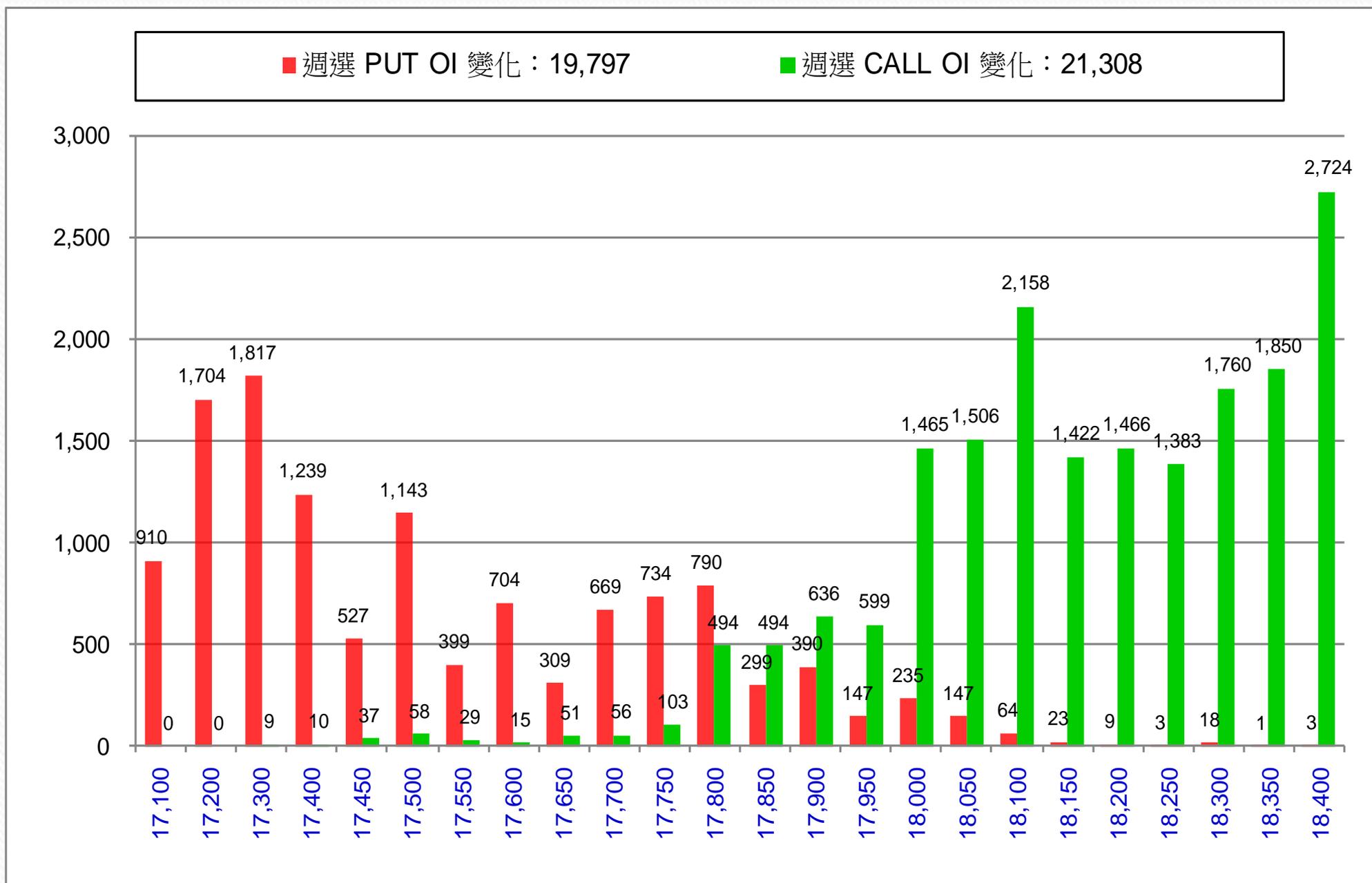
更新日期：2022年3月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



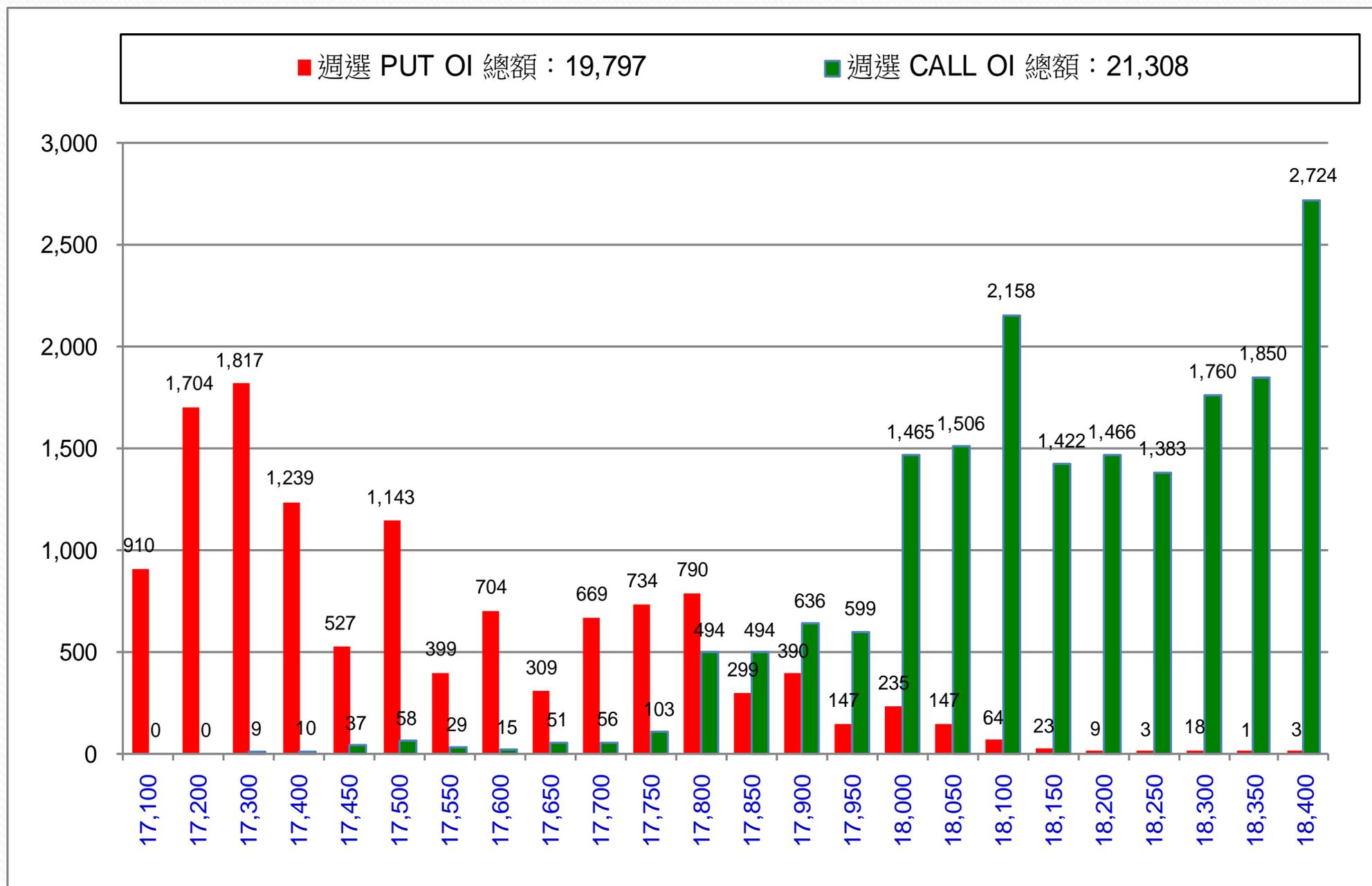
更新日期：2022年3月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年3月2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



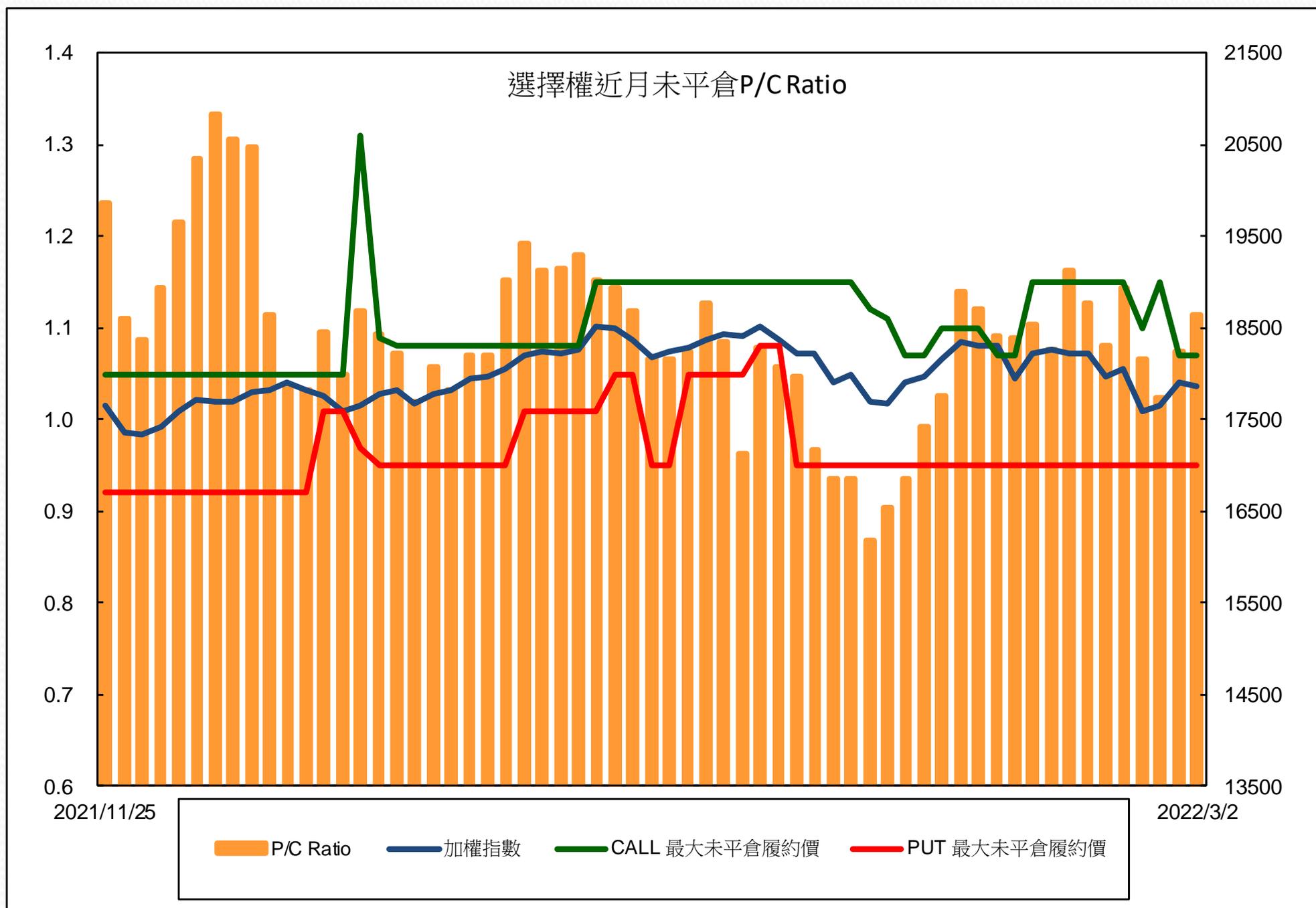
更新日期：2022年3月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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1日	79,869	49,905	29,964
	3月2日	62,203	41,124	21,079
Put	3月1日	60,742	75,680	-14,938
	3月2日	49,873	47,355	2,518

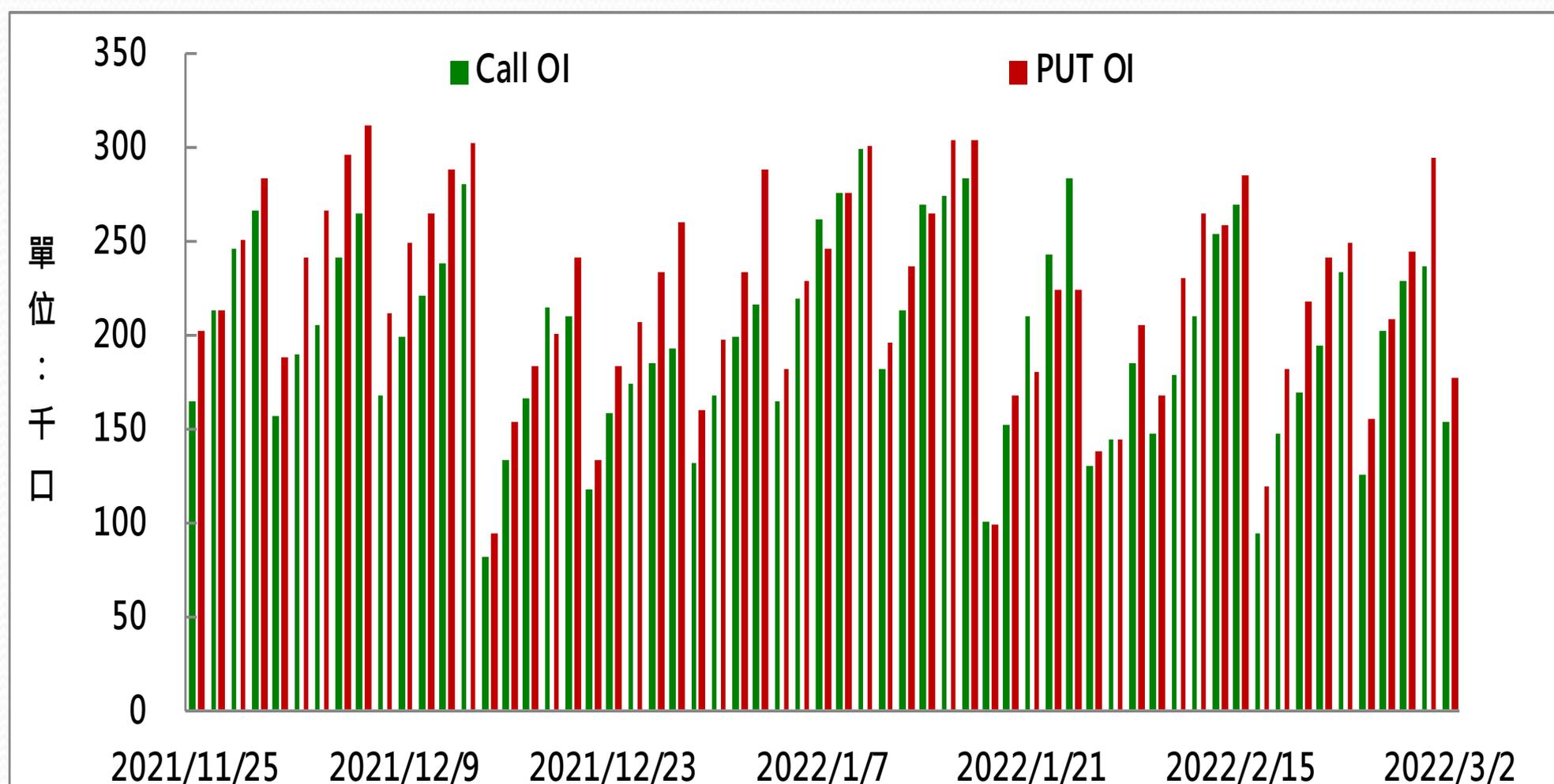
更新日期：2022年3月2日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年3月2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2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2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