

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/3/3 結算日：2022/3/9					日期：2022/3/3 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
1	1	17,200	5,956	4,252 ※	0	1	16,700	2,579	-144
4	13	17,300	4,031	2,214	0	68	16,800	7,768	135
0	0	17,350	1,339	1,339	0	15	16,900	4,390	637
4	14	17,400	3,615	2,376	1	119	17,000	12,265	76
6	43	17,450	2,648	2,121	0	104	17,100	2,699	8
12	70	17,500	3,073	1,930	-2	319	17,200	4,077	176
27	56	17,550	1,678	1,279	-1	241	17,300	5,091	-11
93	108	17,600	2,824	2,120	4	1,307	17,400	3,437	236
61	112	17,650	1,594	1,285	15	1,460	17,500	12,192	862
275	331	17,700	3,623	2,954	-16	1,834	17,600	4,339	-852
476	579	17,750	1,405	671	59	1,148	17,700	2,942	775
558	1,052	17,800	4,044	3,254	-114	1,501	17,800	2,718	563
602	1,096	17,850	1,153	854	172	2,828	17,900	2,361	371
1,120	1,756	17,900	1,736	1,346	166	4,854	18,000	3,036	374
1,231	1,830	17,950	617	470	-1	5,456	18,100	1,483	42
1,632	3,097	18,000	699	464	-536	8,411	18,200	1,319	-37
1,574	3,080	18,050	299	152	66	6,772	18,300	1,357	-8
2,696	4,854	18,100	220	156 ※	824	6,753	18,400	636	-18
3,359	4,781	18,150	62	39	85	7,996	18,500	300	0
2,977	4,443	18,200	57	48	-133	6,291	18,600	226	-21
※ 2,823	4,206	18,250	10	7	-76	6,952	18,700	78	1
※ 4,959	6,719	18,300	24	6	217	6,101	18,800	147	0
2,629	4,479	18,350	2	1	256	5,016	18,900	9	0
2,449	5,173	18,400	1	-2	431	7,976	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
32,561	53,869	1.1983	64,550	44,753	-407	111,784	1.2152	135,835	10,802
昨日 P/C	0.9291	今日增減變化		0.2692	昨日 P/C	1.1145	今日增減變化		0.1007

更新日期：2022年3月3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3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	65,099,051	134,769,222	-69,670,171	2,401,878	3,045,458	2,097,757	947,701	-13,030
投信	42,491,730	52,822,420	-10,330,690	554,058	505,890	0	505,890	2,010
自營商	70,590,204	20,332,277	50,257,927	-2,009,405	1,433,074	1,197,086	235,988	94,966
	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	963,424	3,959,972	-2,996,548	-156,329	8,664	53,714	-45,050	1,344
投信	23,023	0	23,023	47	1,733	0	1,733	15
自營商	602,045	189,510	412,535	46,785	200,960	176,651	24,309	1,910

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3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	31,485	12,562	18,923	3,169	62,594	22,481	40,113	1,166
投信	0	0	0	0	0	68	-68	0
自營商	69,523	45,020	24,503	3,424	62,141	60,413	1,728	-790
特定法人(週)	2,408	638	1,770	770	0	0	0	0
特定法人(近月)	16,434	6,767	9,667	-1,403	8,565	40,662	-32,097	-7,216
特定法人(全月)	20,319	4,000	16,319	2,540	9,873	56,423	-46,550	-6,068
十大交易人(週)	20,053	17,902	2,151	2,857	22,753	16,660	6,093	7,759
十大交易人(近月)	59,622	37,147	22,475	-1,805	58,019	72,817	-14,798	6,493
十大交易人(全月)	90,999	50,747	40,252	1,394	92,463	105,638	-13,175	15,706
全市場未沖銷(近月)			111,784	-407			135,835	10,802
全市場未沖銷(全月)			186,644	32,845			234,741	57,135

更新日期：2022年3月3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	18300
	賣權成交最大量	17700	賣權OI最大量	17200
	整體隱含波動率	19.18%	較前一交易日	+0.00%
	買權隱含波動率	12.52%	較前一交易日	+0.00%
	賣權隱含波動率	20.43%	較前一交易日	+0.00%
電子選擇權	買權成交最大量	860	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	805	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	1820
	賣權成交最大量	1780	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年3月3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	18200	買權OI最大量	18200
	賣權成交最大量	17500	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	21.57%	較前一交易日	+0.00%
	買權隱含波動率	15.34%	較前一交易日	+0.00%
	賣權隱含波動率	25.98%	較前一交易日	+0.00%
	成交量P/C_Ratio值	1.618	較前一交易日	+0.44
	未平倉P/C_Ratio值	1.215	較前一交易日	+0.10
電子選擇權	買權成交最大量	860	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	805	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	1820
	賣權成交最大量	1780	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年3月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理



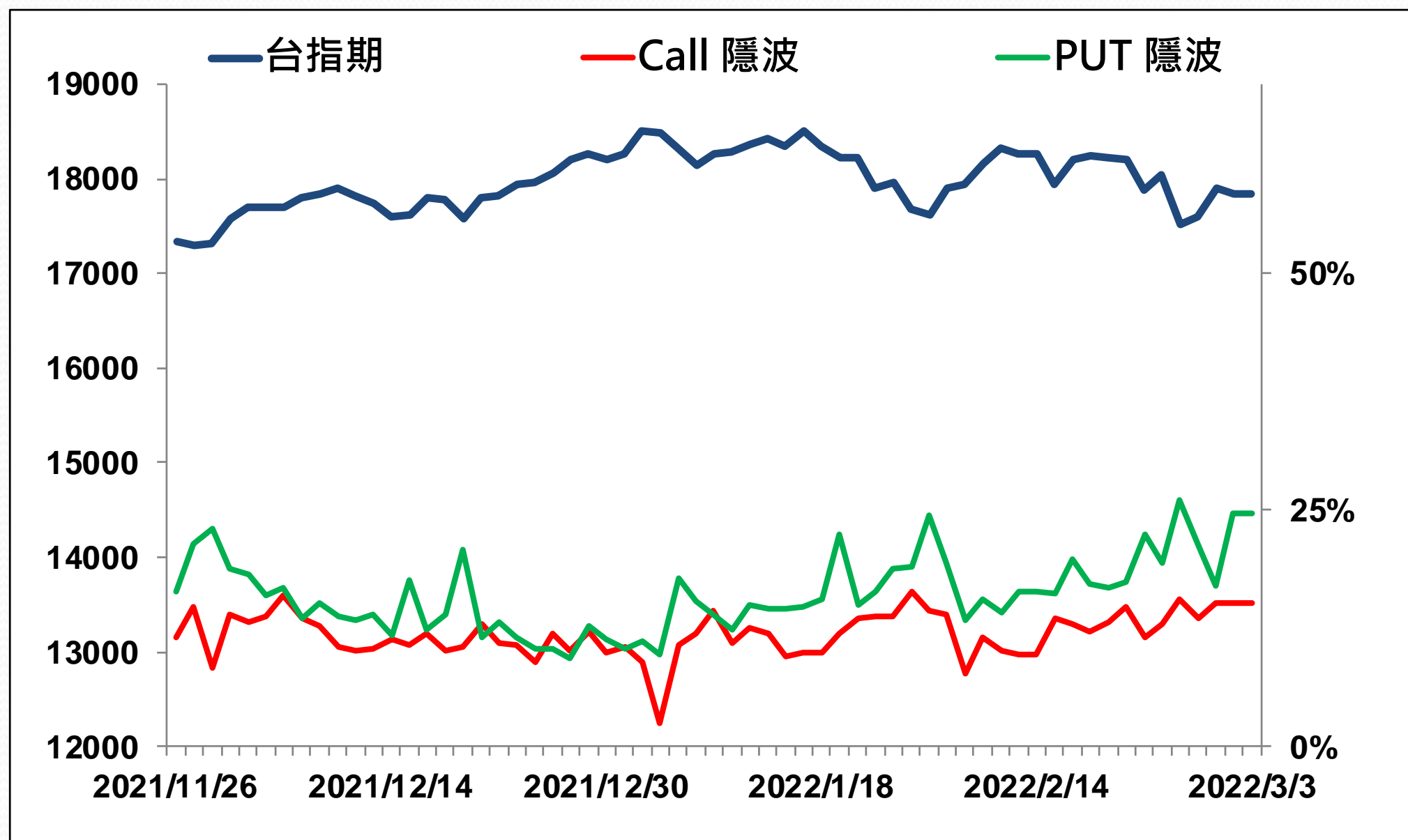
# 選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



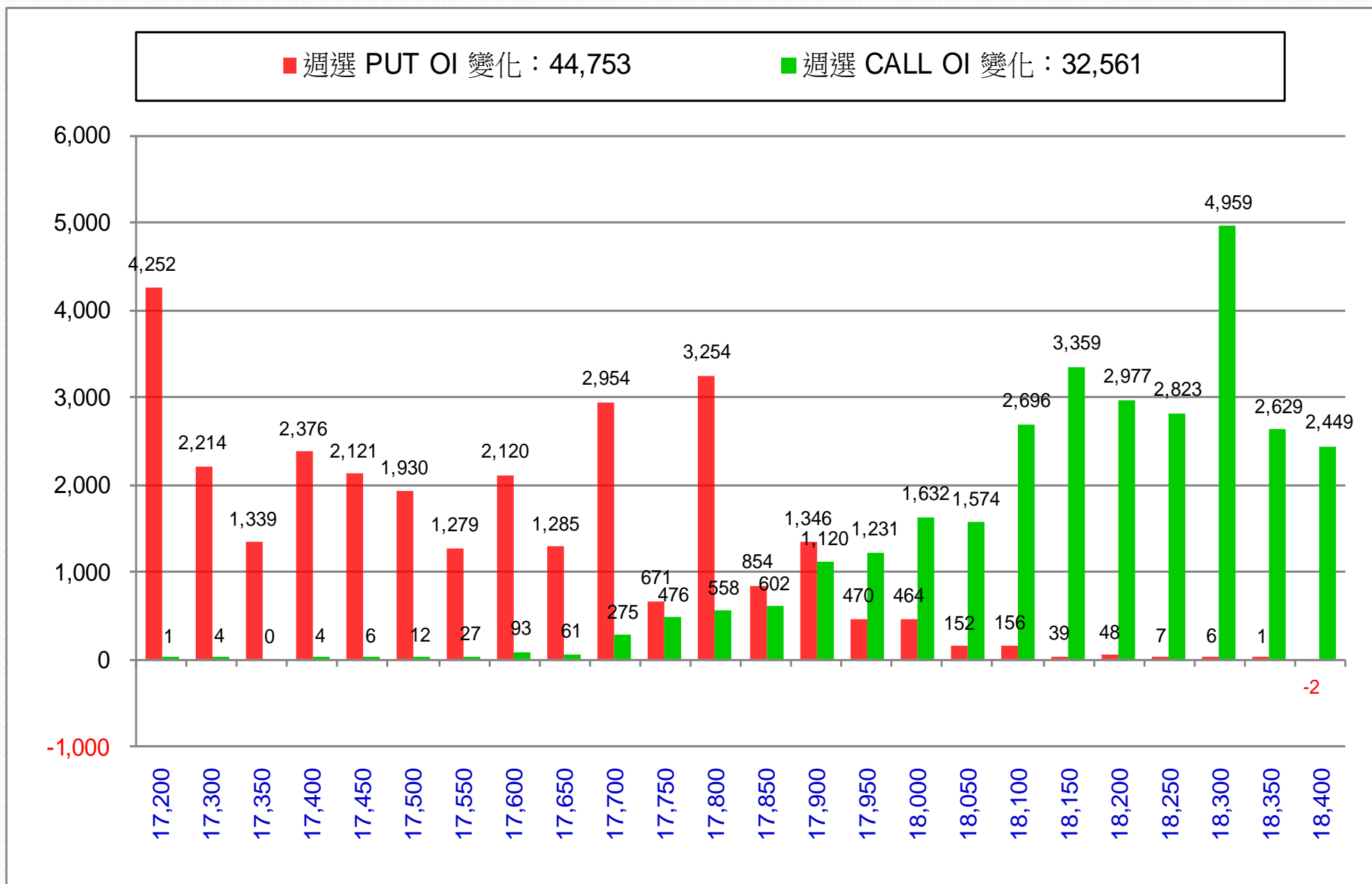
更新日期：2022年3月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2022年3月3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



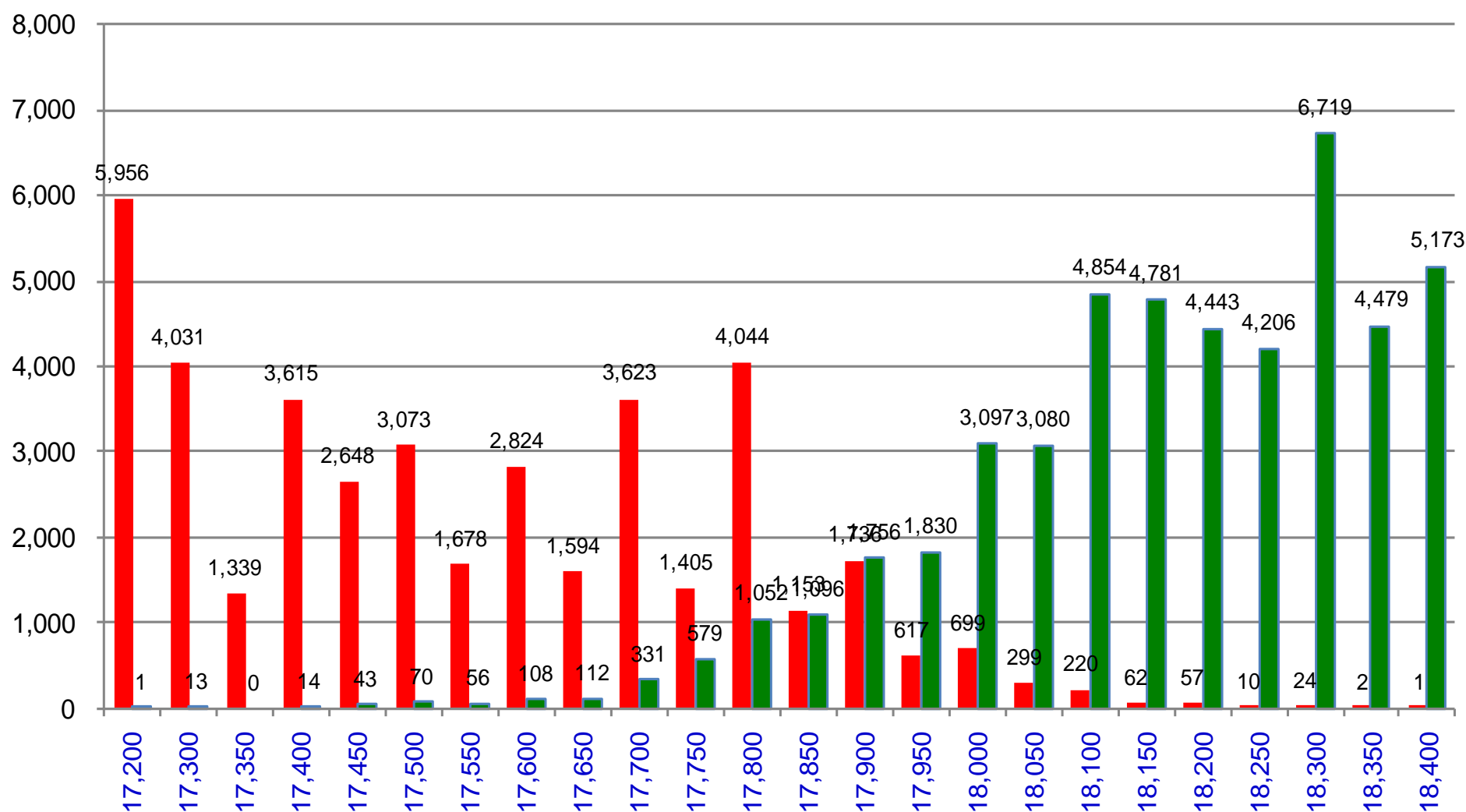
更新日期：2022年3月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理



# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：64,550

週選 CALL OI 總額：53,869



更新日期：2022年3月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

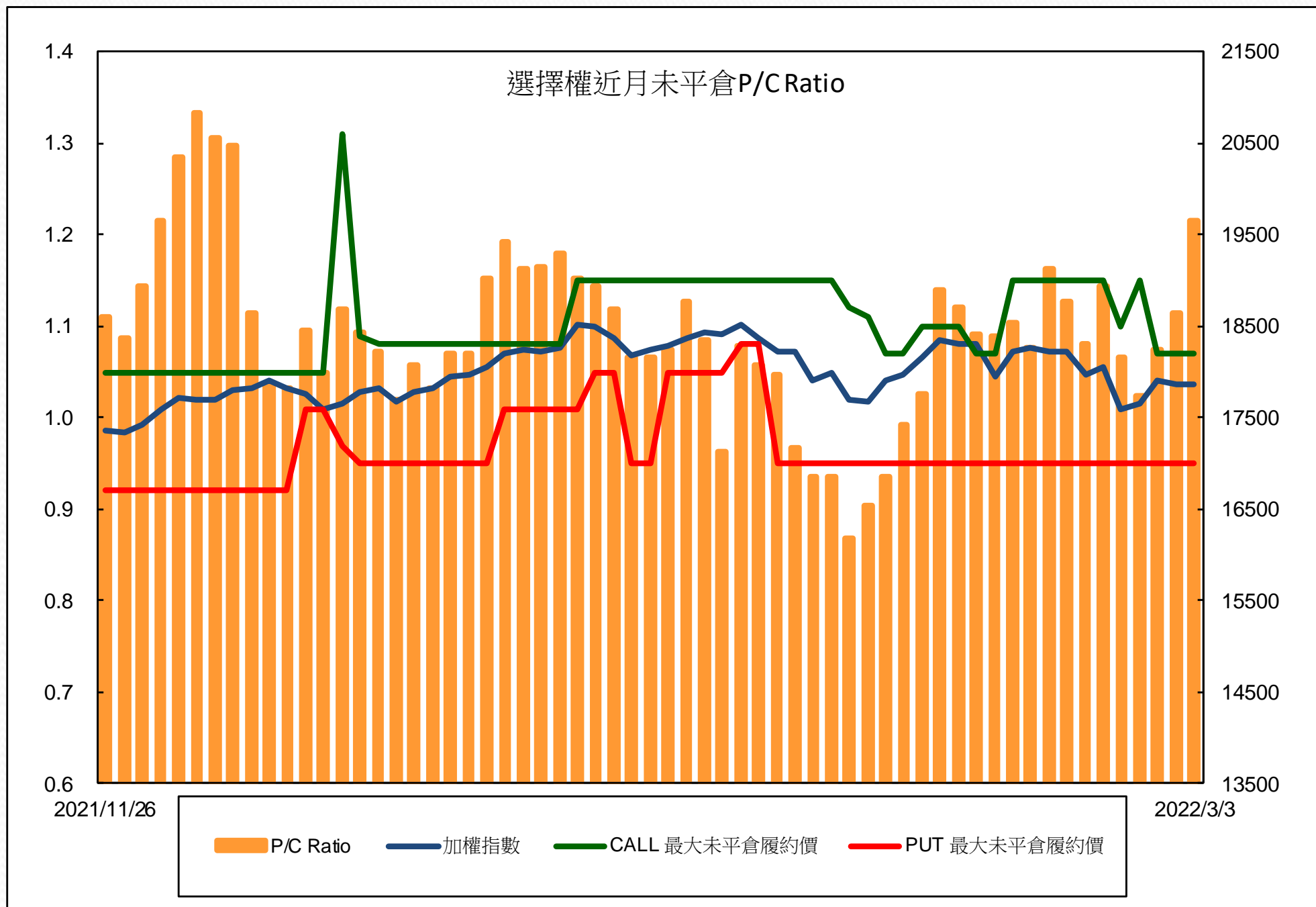


# 自營商選擇權OI部位統計

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2日	62,203	41,124	21,079
	3月3日	69,523	45,020	24,503
Put	3月2日	49,873	47,355	2,518
	3月3日	62,141	60,413	1,728

更新日期：2022年3月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

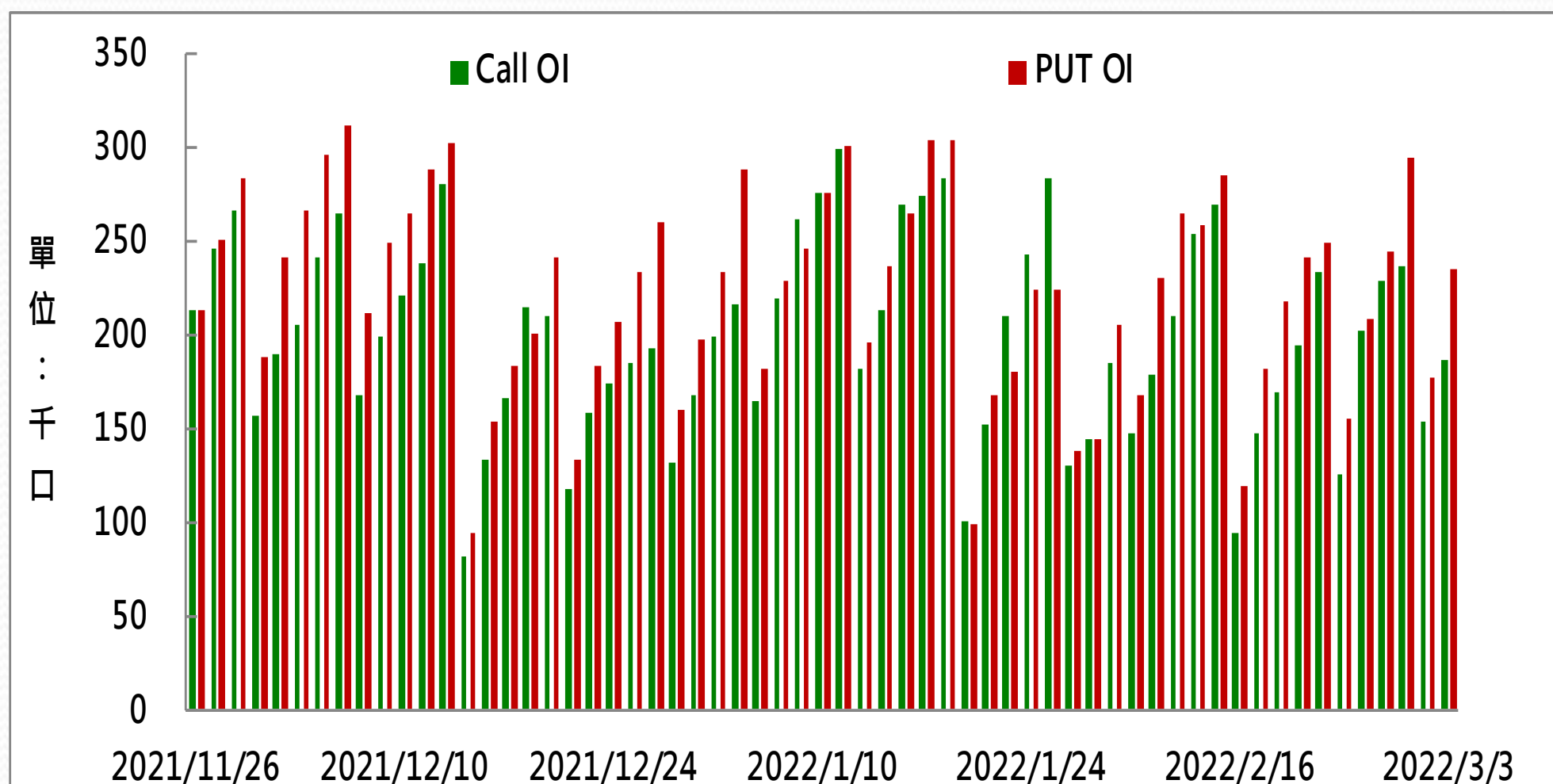
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年3月3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3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3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