

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/3/4 結算日：2022/3/9					日期：2022/3/4 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	17,000	4,996	601	0	7	16,500	2,847	-172
6	6	17,100	4,885	1,165	0	18	16,600	2,700	-215
0	1	17,200	6,472	516	0	1	16,700	2,537	-42
-1	12	17,300	5,937	1,906	0	68	16,800	7,120	-648
8	8	17,350	2,042	703	0	15	16,900	4,099	-291
13	27	17,400	4,090	475	-2	117	17,000	12,976	711
7	50	17,450	2,964	316	0	104	17,100	2,898	199
6	76	17,500	5,394	2,321	-3	316	17,200	4,271	194
106	162	17,550	2,561	883	7	248	17,300	5,466	375
177	285	17,600	3,593	769	678	1,985	17,400	3,920	483
526	638	17,650	1,672	78	-57	1,403	17,500	12,918	726
2,033	2,364	17,700	3,221	-402	66	1,900	17,600	4,597	258
1,938	2,517	17,750	1,745	340	438	1,586	17,700	3,014	72
1,824	2,876	17,800	3,813	-231	522	2,023	17,800	2,658	-60
1,988	3,084	17,850	1,579	426	424	3,252	17,900	2,315	-46
2,541	4,297	17,900	2,175	439	-329	4,525	18,000	2,818	-218
2,191	4,021	17,950	690	73	545	6,001	18,100	1,374	-109
※ 4,283	7,380	18,000	613	-86	※ 1,571	9,982	18,200	976	-343
3,048	6,128	18,050	369	70	1,010	7,782	18,300	1,110	-247
3,384	8,238	18,100	285	65	285	7,038	18,400	630	-6
※ 2,234	7,015	18,150	70	8	156	8,152	18,500	292	-8
2,328	6,771	18,200	58	1	-343	5,948	18,600	225	-1
-172	4,034	18,250	10	0	-100	6,852	18,700	77	-1
-314	6,405	18,300	23	-1	-386	5,715	18,800	147	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
28,068	81,937	0.9754	79,921	15,371	4,279	116,063	1.1948	138,672	2,837
昨日 P/C	1.1983	今日增減變化	-0.2229		昨日 P/C	1.2152	今日增減變化	-0.0204	

更新日期：2022年3月4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4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	72,561,132	134,312,847	-61,751,715	7,918,456	3,128,038	2,654,194	473,844	-473,857
投信	41,498,598	53,293,755	-11,795,157	-1,464,467	470,531	0	470,531	-35,359
自營商	68,646,283	20,275,184	48,371,099	-1,886,828	1,414,697	1,206,015	208,682	-27,306
	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	928,659	3,781,035	-2,852,376	144,172	6,875	60,158	-53,283	-8,233
投信	22,693	0	22,693	-330	1,719	0	1,719	-14
自營商	584,684	230,472	354,212	-58,323	207,969	175,303	32,666	8,357

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4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	33,367	14,612	18,755	-168	68,269	24,752	43,517	3,404
投信	0	0	0	0	0	68	-68	0
自營商	72,997	48,595	24,402	-101	68,504	63,575	4,929	3,201
特定法人(週)	2,220	0	2,220	450	0	1,150	-1,150	-1,150
特定法人(近月)	16,288	9,281	7,007	-2,660	9,736	45,072	-35,336	-3,239
特定法人(全月)	21,260	6,984	14,276	-2,043	14,732	57,785	-43,053	3,497
十大交易人(週)	27,490	24,690	2,800	649	25,721	19,186	6,535	442
十大交易人(近月)	59,848	37,931	21,917	-558	60,852	77,454	-16,602	-1,804
十大交易人(全月)	94,978	55,616	39,362	-890	99,538	112,964	-13,426	-251
全市場未沖銷(近月)			116,063	4,279			138,672	2,837
全市場未沖銷(全月)			220,356	33,712			254,512	19,771

更新日期：2022年3月4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	18000	買權OI最大量	18100
	賣權成交最大量	17500	賣權OI最大量	17200
	整體隱含波動率	18.26%	較前一交易日	-0.92%
	買權隱含波動率	13.46%	較前一交易日	+0.94%
	賣權隱含波動率	22.92%	較前一交易日	+2.49%
電子選擇權	買權成交最大量	875	買權OI最大量	865
	賣權成交最大量	800	賣權OI最大量	830
金融選擇權	買權成交最大量	1780	買權OI最大量	1820
	賣權成交最大量	1700	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年3月4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	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	22.17%	較前一交易日	-0.59%
	買權隱含波動率	16.15%	較前一交易日	+0.81%
	賣權隱含波動率	27.83%	較前一交易日	+1.85%
	成交量P/C_Ratio值	1.043	較前一交易日	-0.57
	未平倉P/C_Ratio值	1.195	較前一交易日	-0.02
電子選擇權	買權成交最大量	875	買權OI最大量	865
	賣權成交最大量	800	賣權OI最大量	830
金融選擇權	買權成交最大量	1780	買權OI最大量	1820
	賣權成交最大量	1700	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年3月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

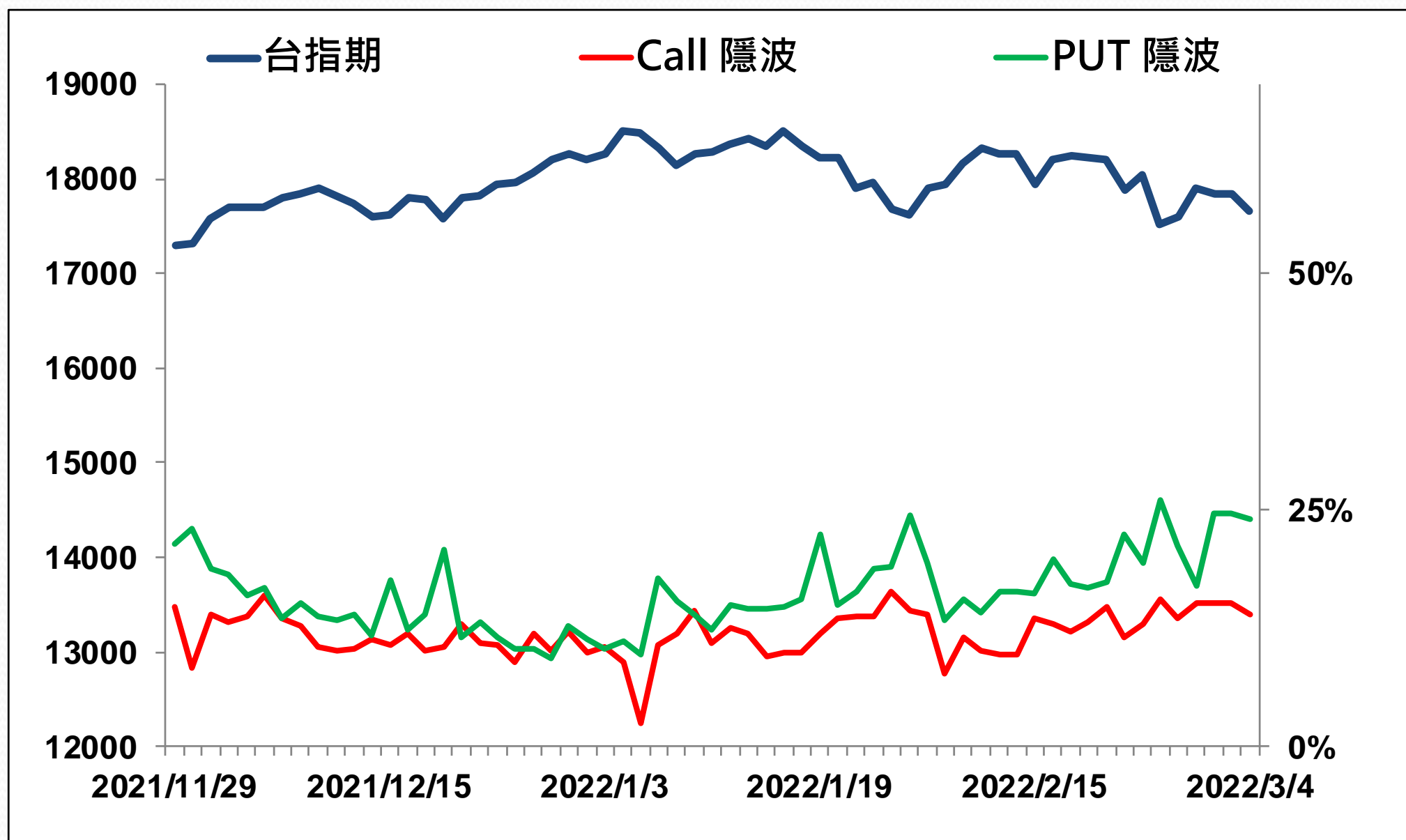
# 選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



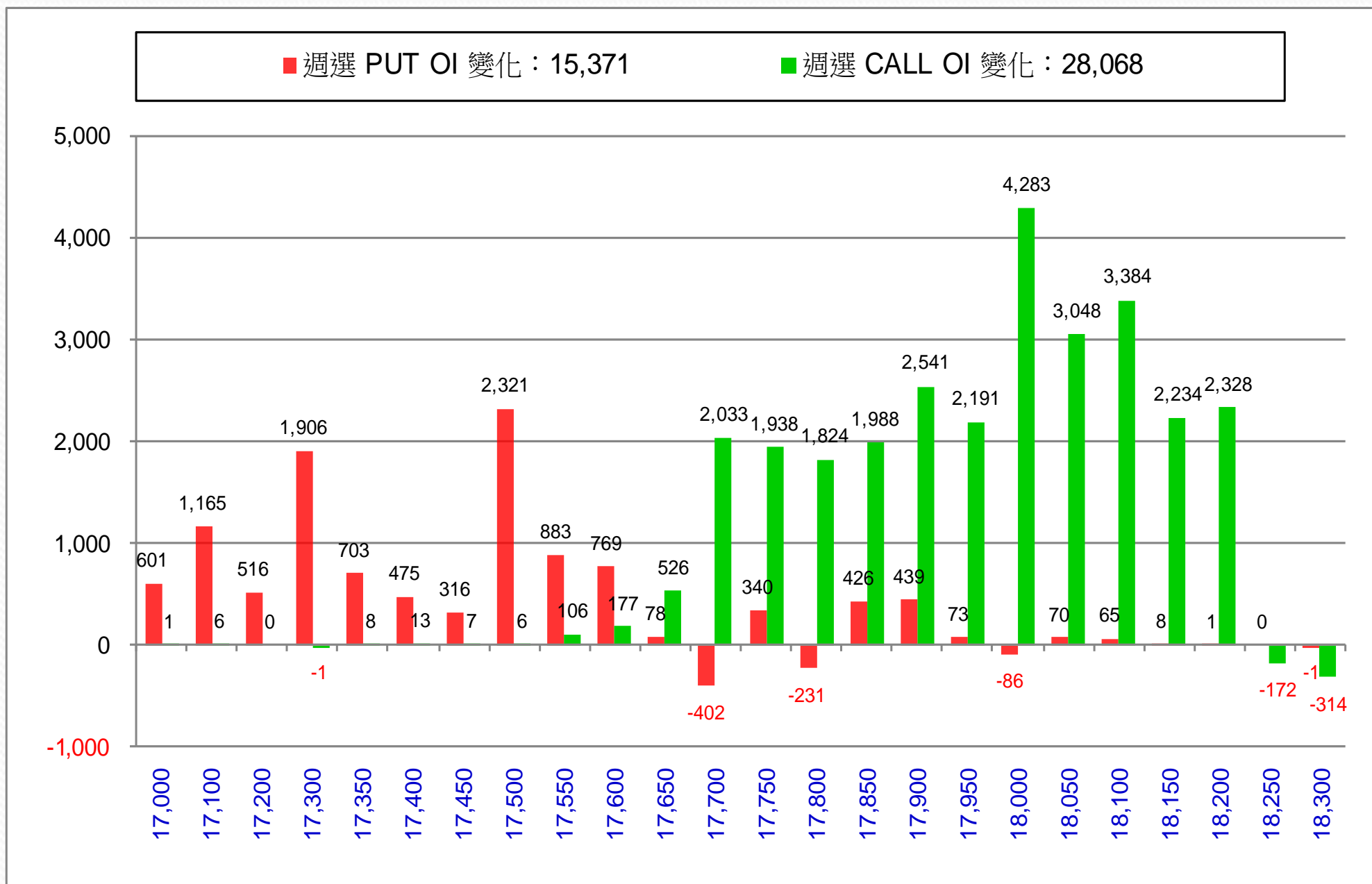
更新日期：2022年3月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2022年3月4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

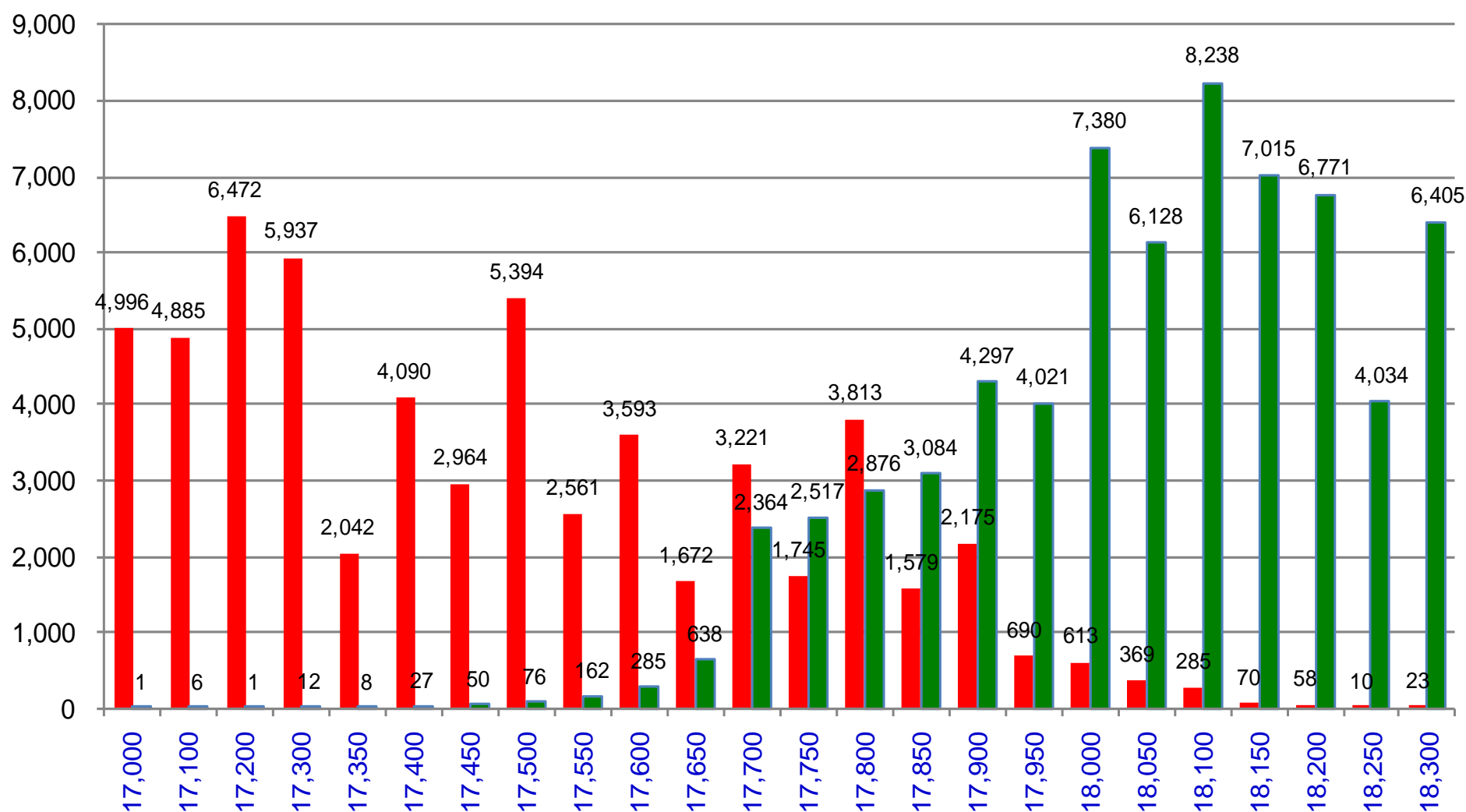


更新日期：2022年3月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：79,921

■ 週選 CALL OI 總額：81,937



更新日期：2022年3月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

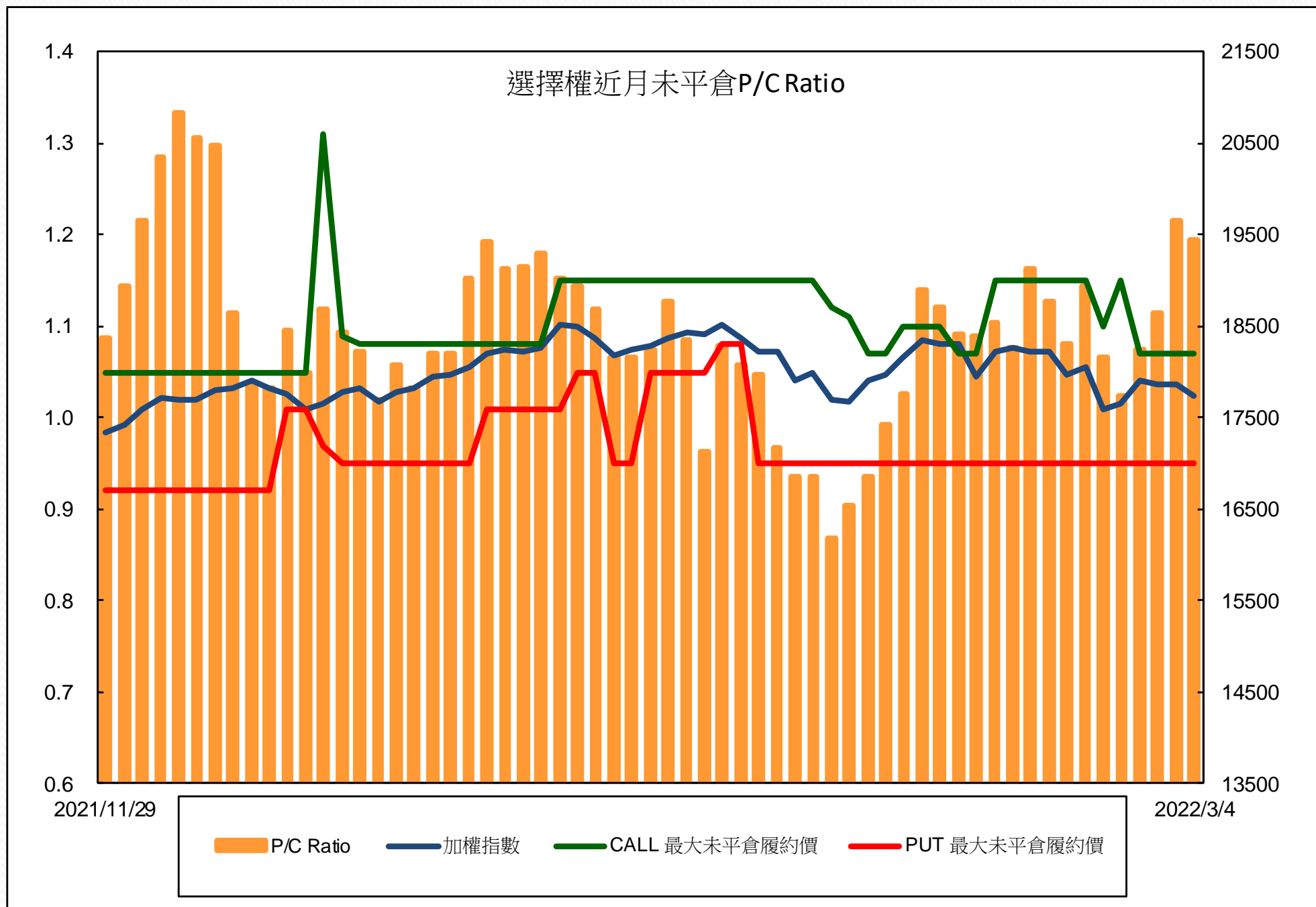


# 自營商選擇權OI部位統計

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3日	69,523	45,020	24,503
	3月4日	72,997	48,595	24,402
Put	3月3日	62,141	60,413	1,728
	3月4日	68,504	63,575	4,929

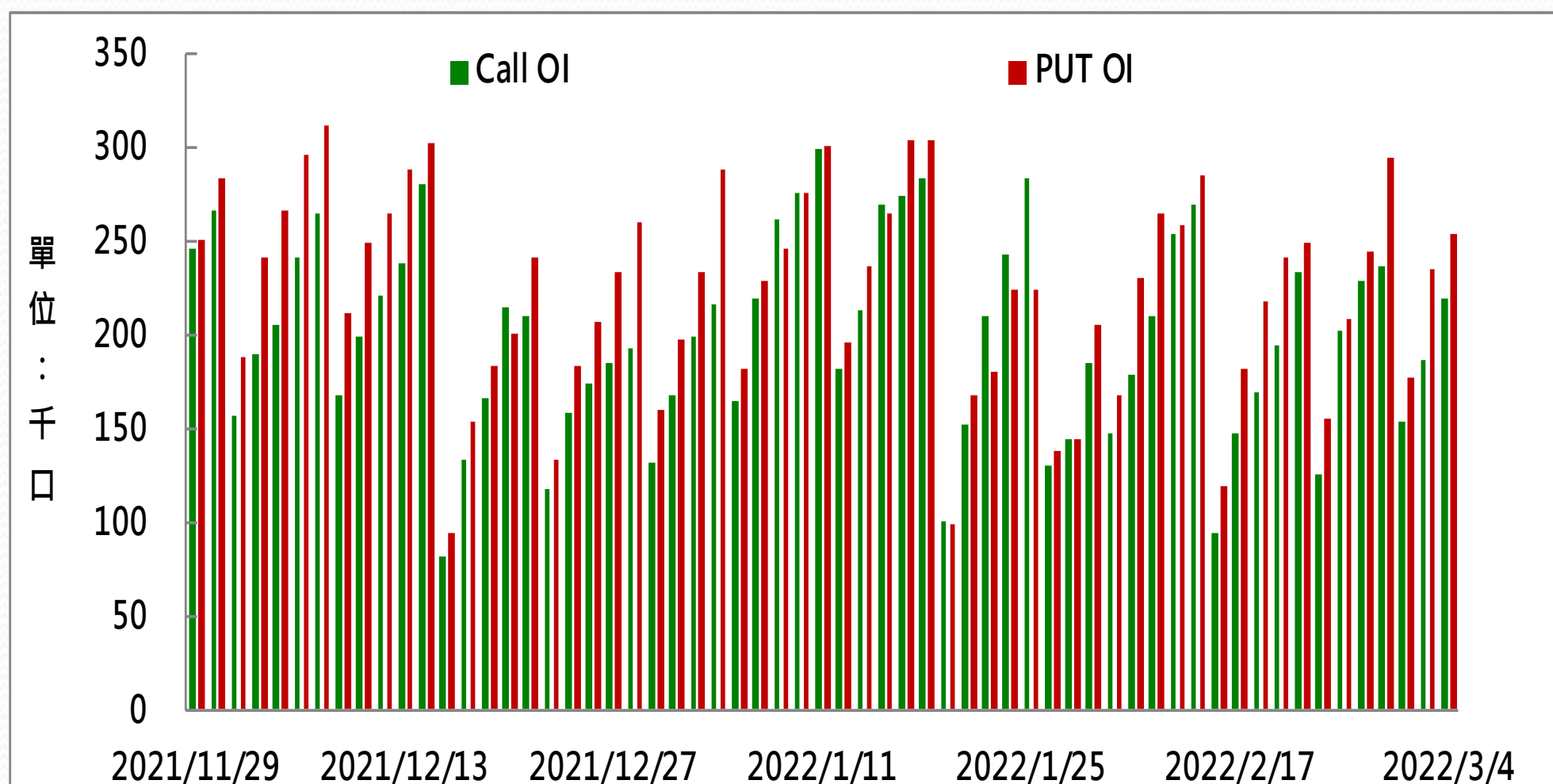
更新日期：2022年3月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年3月4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4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4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