

台指選擇權OI匯報

日期：2022/3/7 結算日：2022/3/9					日期：2022/3/7 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	16,000	1,795	918	-1	39	16,000	4,662	-1,372
0	0	16,100	2,383	761	0	8	16,100	1,721	-2,200
0	0	16,200	1,621	1,019	0	24	16,200	2,539	111
0	0	16,300	2,980	2,031	-1	11	16,300	2,364	-30
0	0	16,400	5,056	2,424	0	25	16,400	3,580	134
0	0	16,500	5,860	2,516	8	15	16,500	2,890	43
8	8	16,600	4,951	2,404	-1	17	16,600	2,315	-385
20	20	16,700	4,720	2,452	90	91	16,700	2,597	60
24	24	16,800	4,219	1,687	35	103	16,800	6,714	-406
53	57	16,900	4,755	1,478	144	159	16,900	4,377	278
491	492	17,000	7,285	2,289	214	331	17,000	12,289	-687
1,580	1,586	17,100	4,753	-132	422	526	17,100	2,987	89
2,800	2,801	17,200	6,569	97	821	1,137	17,200	3,596	-675
2,114	2,114	17,250	780	780	594	842	17,300	4,055	-1,411
3,371	3,383	17,300	3,849	-2,088	992	2,977	17,400	2,638	-1,282
2,073	2,081	17,350	1,836	-206	1,566	2,969	17,500	10,953	-1,965
3,773	3,800	17,400	3,326	-764	1,988	3,888	17,600	3,199	-1,398
3,235	3,285	17,450	2,279	-685	3,420	5,006	17,700	2,532	-482
5,835	5,911	17,500	2,991	-2,403	1,699	3,722	17,800	2,419	-239
4,299	4,461	17,550	1,739	-822	48	3,300	17,900	1,704	-611
※ 6,902	7,187	17,600	1,829	-1,764	※ 3,674	8,199	18,000	2,586	-232
4,294	4,932	17,650	1,205	-467	3,198	9,199	18,100	1,333	-41
4,985	7,349	17,700	2,912	-309	-695	9,287	18,200	928	-48
3,656	6,173	17,750	1,479	-266	-112	7,670	18,300	1,083	-27
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
45,300	127,237	0.7086	90,166	10,245	13,233	129,296	0.9654	124,817	-13,855
昨日 P/C	0.9723	今日增減變化		-0.2636	昨日 P/C	1.1948	今日增減變化		-0.2294

更新日期：2022年3月7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7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	63,430,159	129,686,715	-66,256,556	-4,504,841	3,552,546	2,637,303	915,243	441,399
投信	37,885,818	55,162,160	-17,276,342	-5,481,185	427,326	0	427,326	-43,205
自營商	69,506,980	18,018,481	51,488,499	3,117,400	1,715,439	1,568,837	146,602	-62,080
	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	1,060,945	3,333,791	-2,272,846	579,530	0	126,912	-126,912	-73,629
投信	22,032	0	22,032	-661	1,670	0	1,670	-49
自營商	676,166	252,595	423,571	69,359	243,800	155,286	88,514	55,848

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7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	32,286	15,950	16,336	-2,419	66,323	25,557	40,766	-2,751
投信	0	0	0	0	0	68	-68	0
自營商	81,938	74,536	7,402	-17,000	71,804	60,069	11,735	6,806
特定法人(週)	1,097	0	1,097	-1,123	0	1,275	-1,275	-125
特定法人(近月)	14,163	7,311	6,852	-155	12,554	39,998	-27,444	7,892
特定法人(全月)	19,414	4,506	14,908	632	14,755	54,053	-39,298	3,755
十大交易人(週)	29,338	40,014	-10,676	-13,476	24,047	27,939	-3,892	-10,427
十大交易人(近月)	63,556	48,179	15,377	-6,540	54,979	69,540	-14,561	2,041
十大交易人(全月)	103,414	80,390	23,024	-16,338	92,090	114,326	-22,236	-8,810
全市場未沖銷(近月)			129,296	13,233			124,817	-13,855
全市場未沖銷(全月)			282,810	62,454			252,194	-2,318

更新日期：2022年3月7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	17800	買權OI最大量	17700
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	28.41%	較前一交易日	+10.16%
	買權隱含波動率	21.14%	較前一交易日	+7.68%
	賣權隱含波動率	37.57%	較前一交易日	+14.65%
電子選擇權	買權成交最大量	825	買權OI最大量	865
	賣權成交最大量	770	賣權OI最大量	845
金融選擇權	買權成交最大量	1740	買權OI最大量	1820
	賣權成交最大量	1640	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年3月7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	18000	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	29.03%	較前一交易日	-6.86%
	買權隱含波動率	20.17%	較前一交易日	+4.02%
	賣權隱含波動率	38.42%	較前一交易日	+10.59%
	成交量P/C_Ratio值	0.938	較前一交易日	-0.11
	未平倉P/C_Ratio值	0.965	較前一交易日	-0.23
電子選擇權	買權成交最大量	825	買權OI最大量	865
	賣權成交最大量	770	賣權OI最大量	845
金融選擇權	買權成交最大量	1740	買權OI最大量	1820
	賣權成交最大量	1640	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年3月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

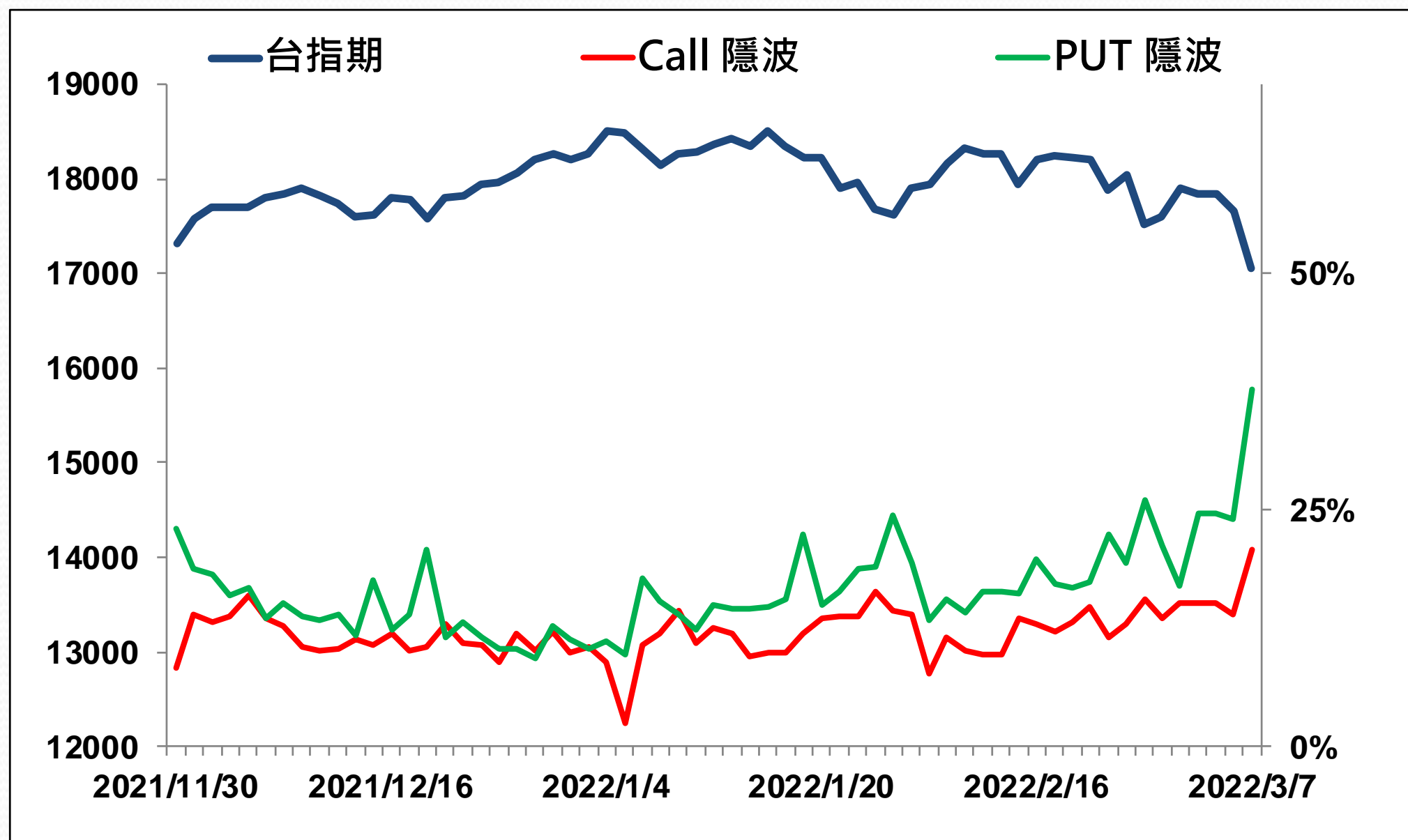
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



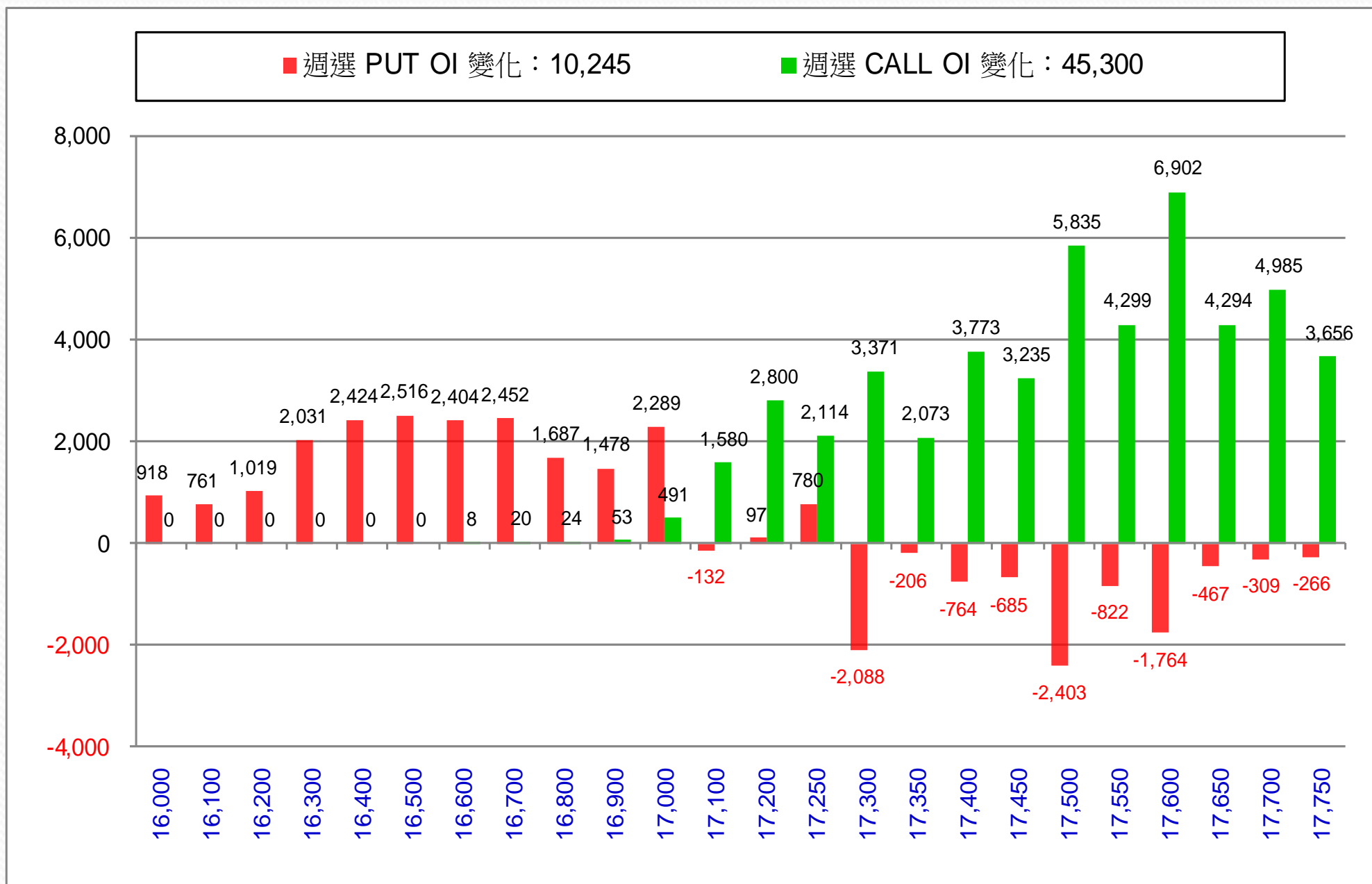
更新日期：2022年3月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年3月7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

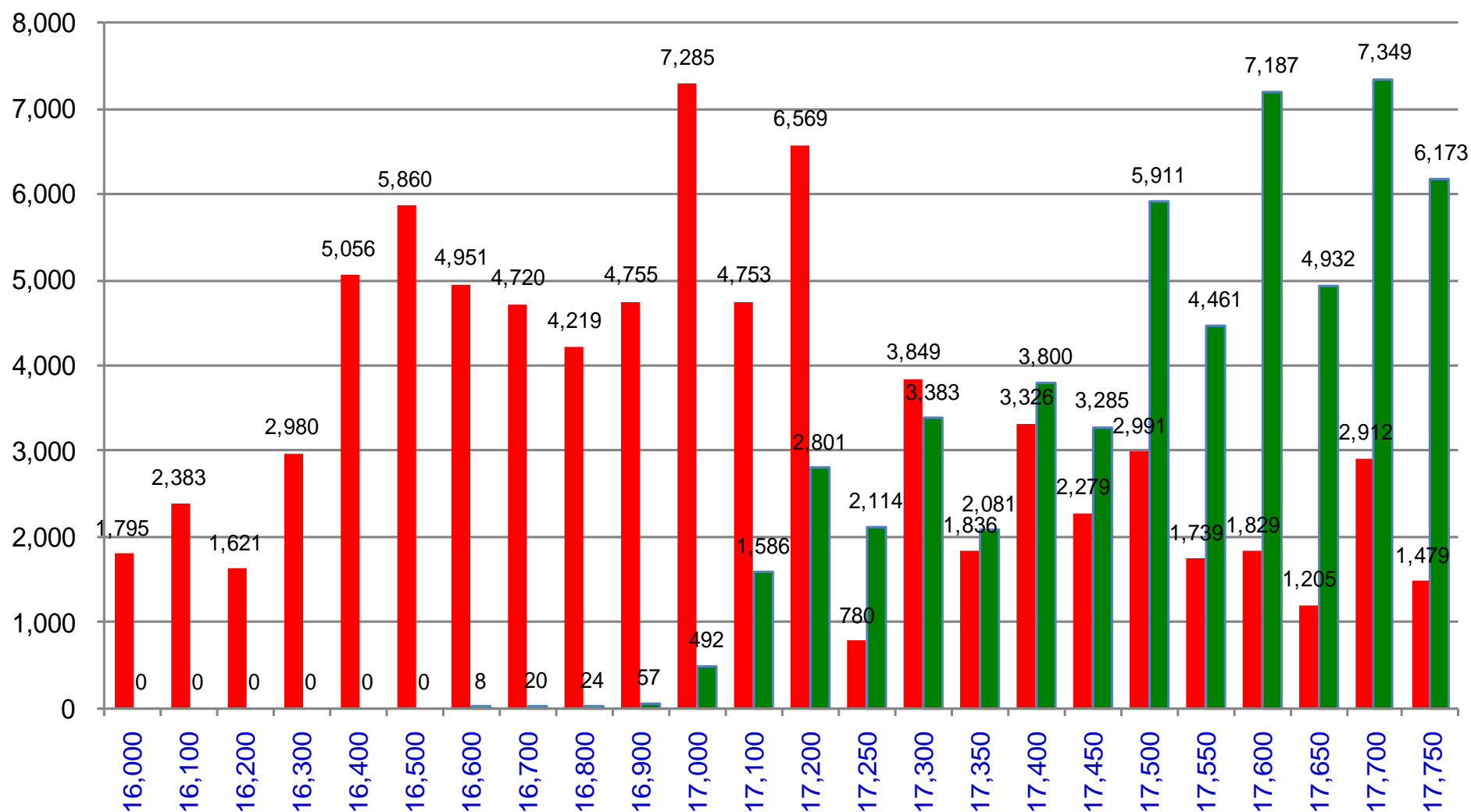


更新日期：2022年3月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：90,166

週選 CALL OI 總額：127,237



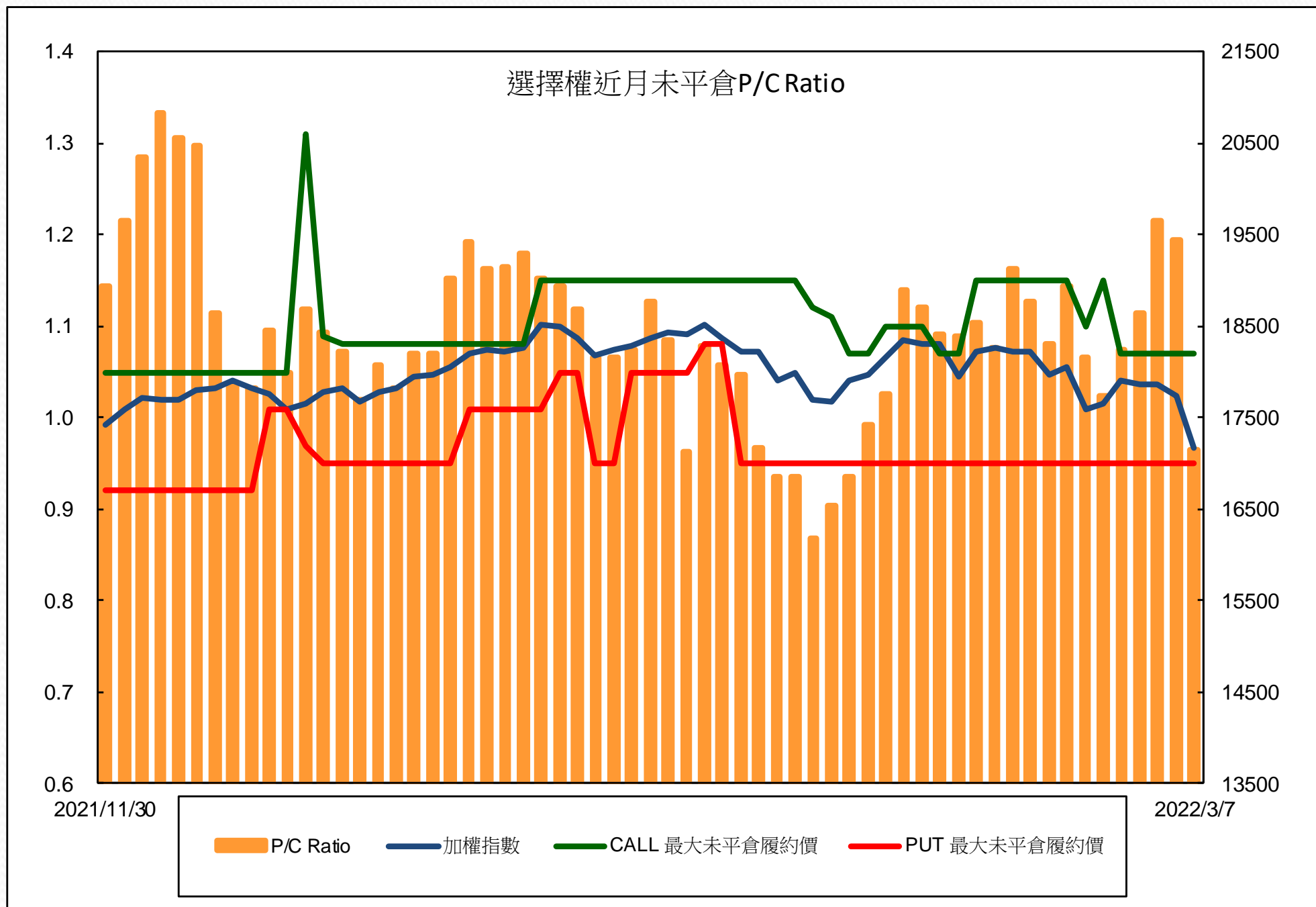
更新日期：2022年3月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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4日	72,997	48,595	24,402
	3月7日	81,938	74,536	7,402
Put	3月4日	68,504	63,575	4,929
	3月7日	71,804	60,069	11,735

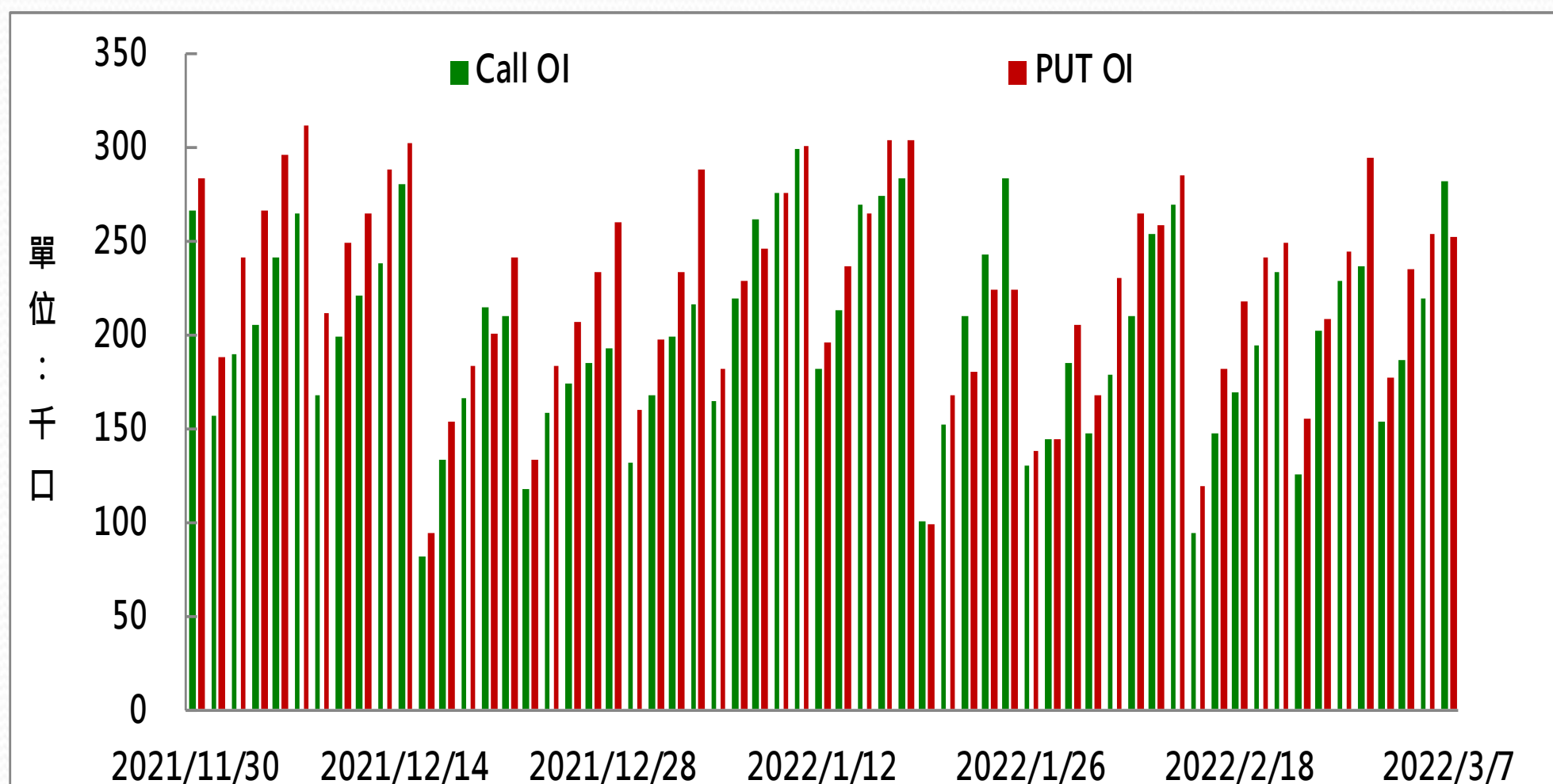
更新日期：2022年3月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年3月7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7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7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