

台指選擇權OI匯報

日期：2022/3/8 結算日：2022/3/9					日期：2022/3/8 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
7	7	15,800	638	638	0	4	15,600	1,894	-835
0	0	15,900	1,824	1,070	0	0	15,700	2,079	-989
0	0	16,000	4,784	2,989	6	178	15,800	1,924	-502
0	0	16,100	4,358	1,975	2	13	15,900	1,185	281
17	17	16,200	8,809	7,188	-1	38	16,000	6,050	1,388
6	6	16,300	10,002	7,022	2	10	16,100	2,187	466
0	0	16,400	6,359	1,303	-10	14	16,200	2,895	356
67	67	16,500	6,831	971	14	25	16,300	2,852	488
208	216	16,600	6,238	1,287	20	45	16,400	3,424	-156
1,347	1,367	16,700	6,794	2,074	98	113	16,500	2,870	-20
531	531	16,750	1,012	1,012	95	112	16,600	2,327	12
4,031	4,055	16,800	5,242	1,023	178	269	16,700	3,223	626
1,512	1,512	16,850	931	931	463	566	16,800	6,752	38
3,725	3,782	16,900	4,417	-338	408	567	16,900	3,810	-567
1,725	1,725	16,950	959	959	1,299	1,630	17,000	11,483	-806
※ 6,361	6,853	17,000	7,172	-113	830	1,356	17,100	1,975	-1,012
3,519	3,519	17,050	370	370	1,150	2,287	17,200	2,815	-781
5,953	7,539	17,100	4,274	-479	※ 1,889	2,731	17,300	3,589	-466
4,955	4,955	17,150	214	214	1,607	4,584	17,400	2,478	-160
5,557	8,358	17,200	5,104	-1,465	1,759	4,728	17,500	9,112	-1,841
※ 2,683	4,797	17,250	794	14	305	4,193	17,600	2,859	-340
2,485	5,868	17,300	2,449	-1,400	-601	4,405	17,700	2,342	-190
2,408	4,489	17,350	1,574	-262	768	4,490	17,800	2,264	-155
1,553	5,353	17,400	2,752	-574	147	3,447	17,900	1,652	-52
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
34,813	162,050	0.7209	116,826	26,660	8,520	137,816	0.9042	124,614	-203
昨日 P/C	0.7044	今日增減變化		0.0166	昨日 P/C	0.9654	今日增減變化		-0.0612

更新日期：2022年3月8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8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	66,534,760	119,337,275	-52,802,515	13,454,041	3,508,512	1,973,538	1,534,974	619,731
投信	30,222,963	55,266,756	-25,043,793	-7,767,451	419,768	0	419,768	-7,558
自營商	67,677,468	18,073,882	49,603,586	-1,884,913	1,421,683	1,374,873	46,810	-99,792
	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	1,054,022	3,177,112	-2,123,090	149,756	0	119,961	-119,961	6,951
投信	21,715	0	21,715	-317	1,621	0	1,621	-49
自營商	624,641	262,255	362,386	-61,185	184,854	116,864	67,990	-20,524

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8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	34,408	20,290	14,118	-2,218	65,718	27,088	38,630	-2,136
投信	0	0	0	0	0	68	-68	0
自營商	90,153	95,114	-4,961	-12,363	83,757	70,820	12,937	1,202
特定法人(週)	1,753	4,256	-2,503	-3,600	0	1,417	-1,417	-142
特定法人(近月)	14,077	7,311	6,766	-86	#N/A	#N/A	#N/A	---
特定法人(全月)	15,652	13,386	2,266	-12,642	#N/A	#N/A	#N/A	---
十大交易人(週)	35,737	57,815	-22,078	-11,402	35,086	39,720	-4,634	-742
十大交易人(近月)	66,477	53,275	13,202	-2,175	53,499	67,665	-14,166	395
十大交易人(全月)	111,481	103,766	7,715	-15,309	#N/A	#N/A	#N/A	---
全市場未沖銷(近月)			137,816	8,520			124,614	-203
全市場未沖銷(全月)			330,126	47,316			#N/A	---

更新日期：2022年3月8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	17200	買權OI最大量	17200
	賣權成交最大量	16800	賣權OI最大量	16300
	整體隱含波動率	24.91%	較前一交易日	-3.50%
	買權隱含波動率	18.86%	較前一交易日	-2.28%
	賣權隱含波動率	31.12%	較前一交易日	-6.45%
電子選擇權	買權成交最大量	810	買權OI最大量	860
	賣權成交最大量	775	賣權OI最大量	830
金融選擇權	買權成交最大量	1720	買權OI最大量	1820
	賣權成交最大量	1620	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年3月8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

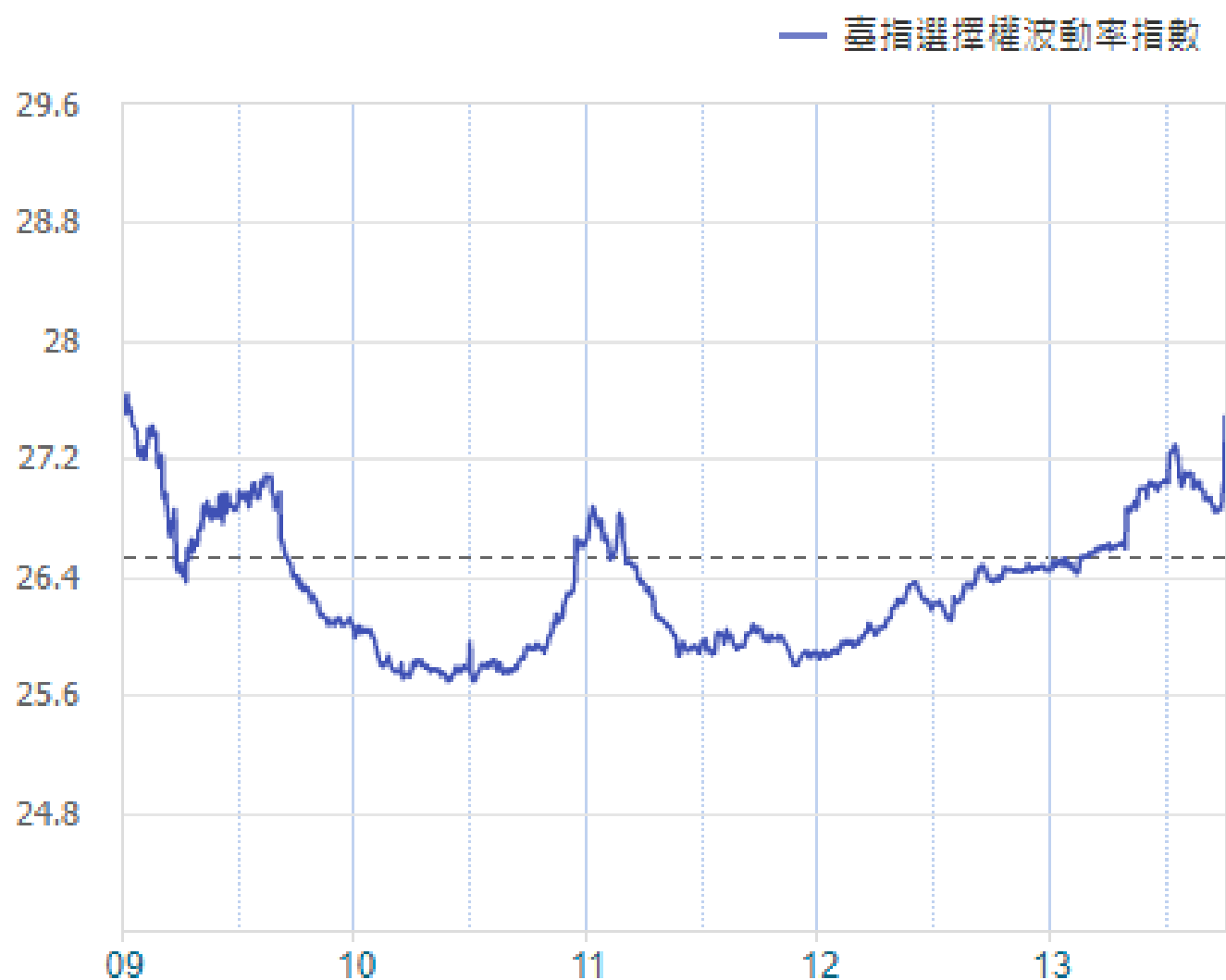
2022年03月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	17700	買權OI最大量	19000
	賣權成交最大量	16800	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	29.70%	較前一交易日	-0.67%
	買權隱含波動率	22.80%	較前一交易日	+2.63%
	賣權隱含波動率	37.22%	較前一交易日	-1.20%
	成交量P/C_Ratio值	0.947	較前一交易日	+0.01
	未平倉P/C_Ratio值	0.904	較前一交易日	-0.06
電子選擇權	買權成交最大量	810	買權OI最大量	860
	賣權成交最大量	775	賣權OI最大量	830
金融選擇權	買權成交最大量	1720	買權OI最大量	1820
	賣權成交最大量	1620	賣權OI最大量	1780

更新日期：2022年3月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

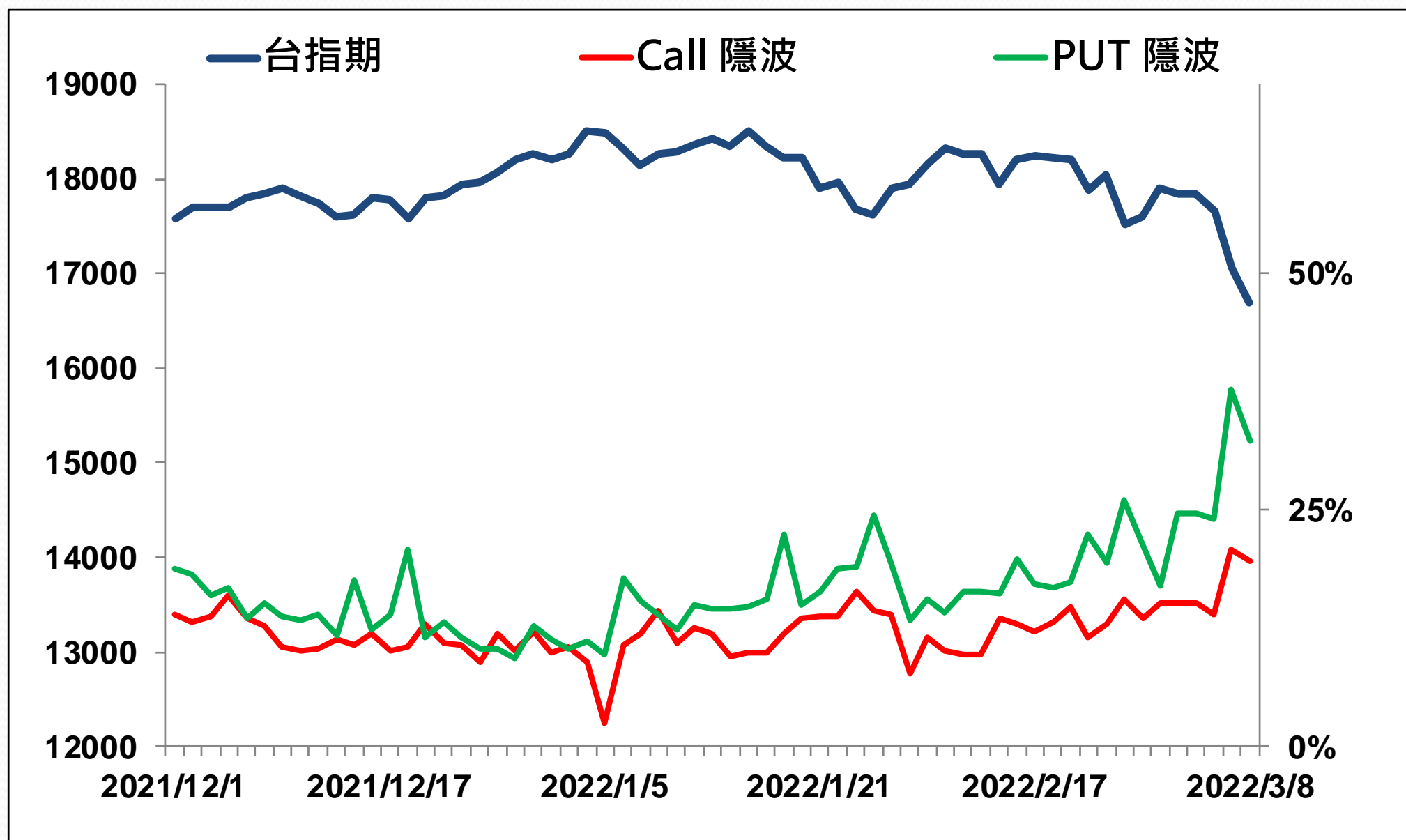
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



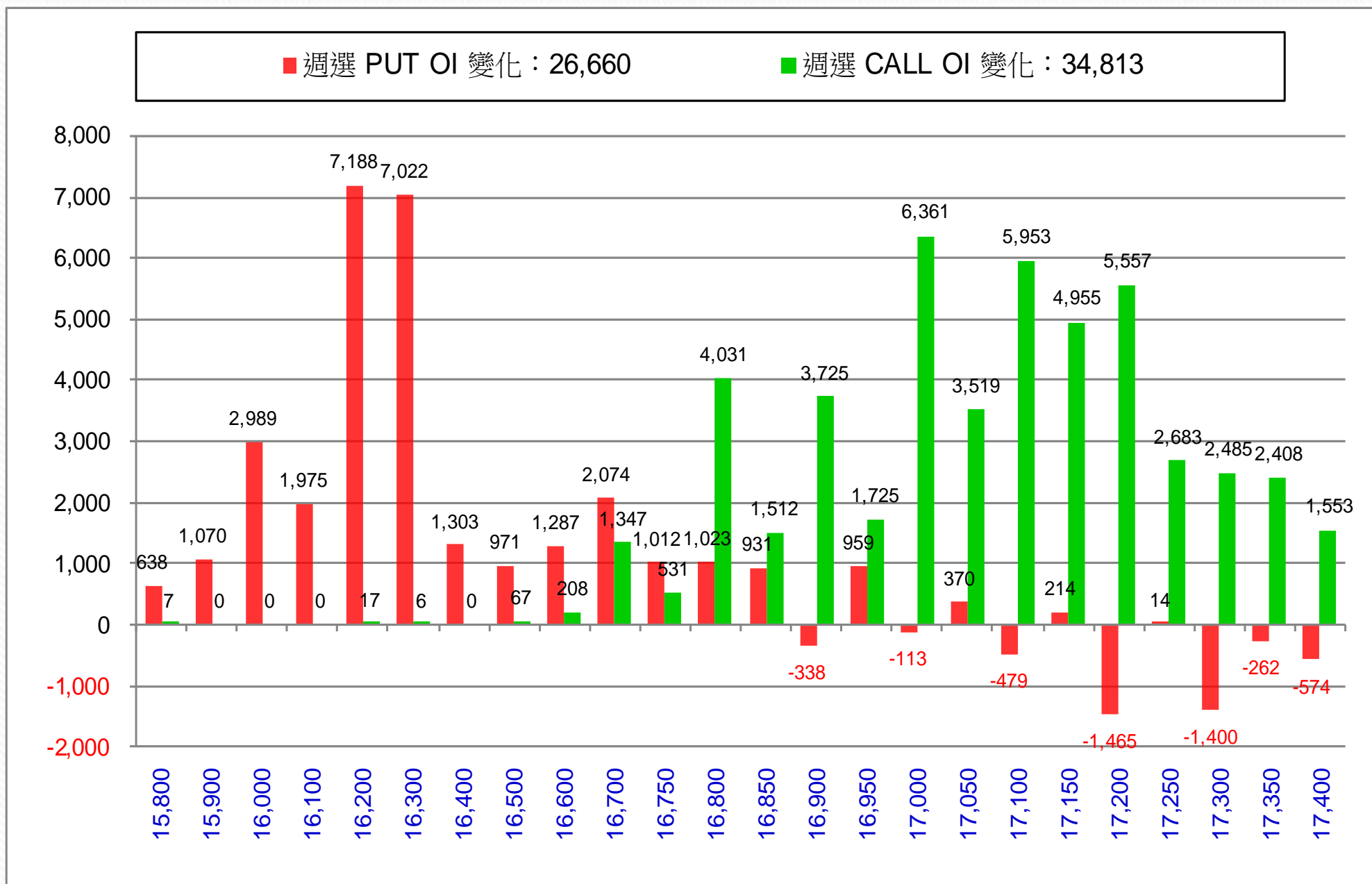
更新日期：2022年3月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年3月8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

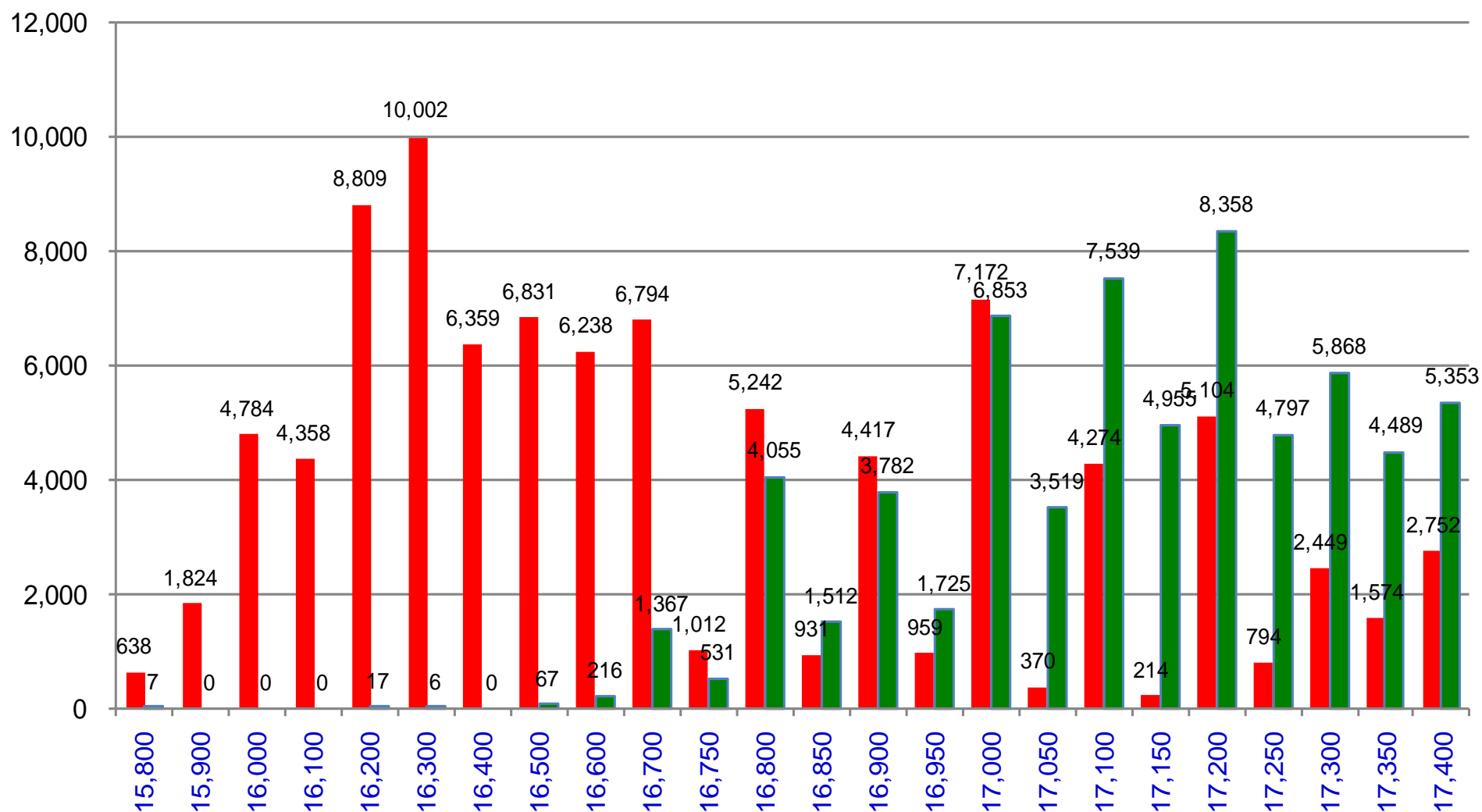


更新日期：2022年3月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：116,826

週選 CALL OI 總額：162,050



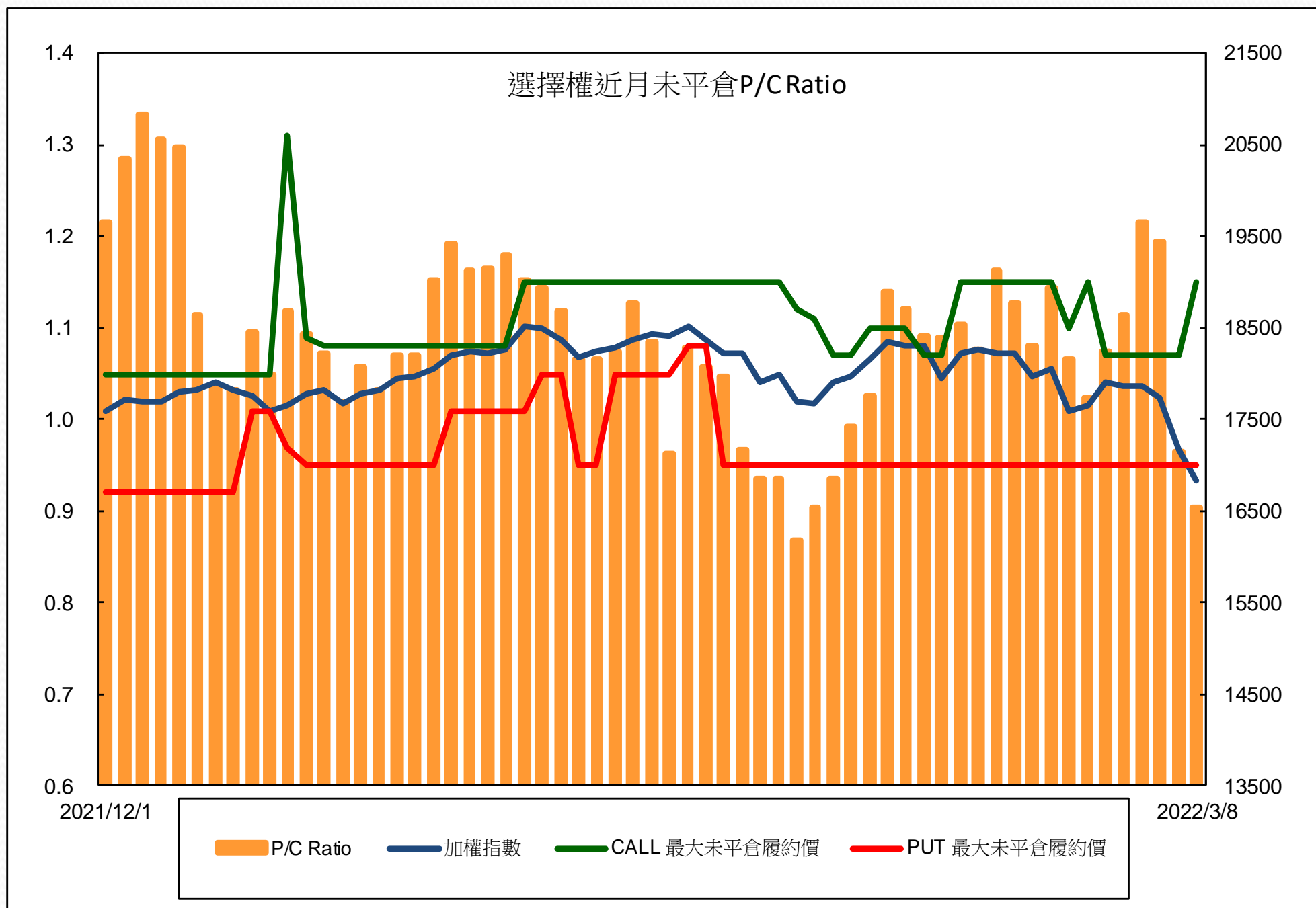
更新日期：2022年3月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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7日	81,938	74,536	7,402
	3月8日	90,153	95,114	-4,961
Put	3月7日	71,804	60,069	11,735
	3月8日	83,757	70,820	12,937

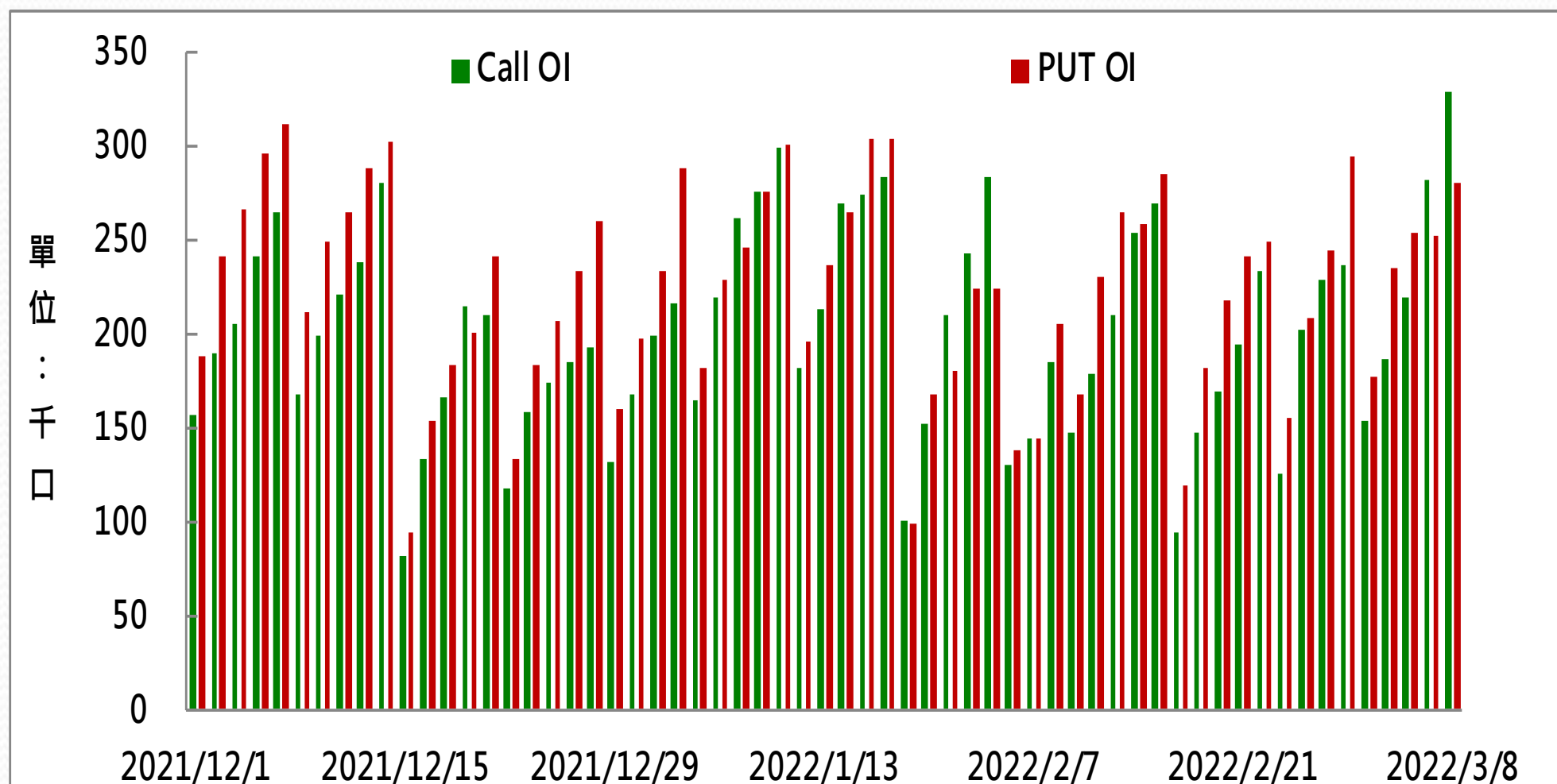
更新日期：2022年3月8日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年3月8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8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8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