

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/3/9 結算日：2022/3/16					日期：2022/3/9 結算日：2022/4/20				
202203 月台指選擇權 OI 序列					202204 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
546	546	16,950	416	416	87	350	16,900	662	194
711	2,341	17,000	11,669	186	30	719	17,000	2,126	115
552	552	17,050	129	129	34	540	17,100	376	46
533	1,889	17,100	1,981	6	36	617	17,200	500	-19
520	520	17,150	33	33	40	179	17,300	399	11
1,265	3,552	17,200	2,575	-240	95	305	17,400	1,052	-1
1,041	1,041	17,250	22	22	86	383	17,500	1,384	15
1,458	4,189	17,300	3,162	-427	133	379	17,600	435	-4
3,613	8,197	17,400	2,369	-109	50	324	17,700	247	-2
※ 3,073	7,801	17,500	9,004	-108	135	614	17,800	187	-16
※ 4,114	8,307	17,600	2,740	-119	333	1,035	17,900	287	-2
1,849	6,254	17,700	2,304	-38	310	1,068	18,000	287	0
368	4,858	17,800	2,240	-24	-20	708	18,100	332	0
36	3,483	17,900	1,575	-77	80	859	18,200	211	0
-245	9,367	18,000	2,422	-21	204	1,060	18,300	57	-3
-464	8,265	18,100	1,278	-21	150	626	18,400	59	1
-375	8,190	18,200	892	-7	25	1,293	18,500	5	0
-248	6,941	18,300	996	-58	-7	588	18,600	13	0
-320	4,839	18,400	598	-3	29	1,317	18,700	4	0
-222	5,932	18,500	281	-1	36	395	18,800	10	0
20	4,478	18,600	220	0	1	331	18,900	8	-1
-35	5,914	18,700	76	0	96	1,011	19,000	0	0
-102	4,724	18,800	146	0	-18	424	19,100	1	0
-205	4,027	18,900	7	-1	-11	432	19,200	0	0
-226	9,646	19,000	9	0	-19	441	19,300	0	0
-12	3,053	19,100	1	0	-2	199	19,400	0	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
18,468	156,284	0.9655	150,894	26,280	2,961	22,467	0.9831	22,088	2,029
昨日 P/C	0.9042	今日增減變化		0.0613	昨日 P/C	1.0284	今日增減變化		-0.0452

# 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9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	73,463,706	116,370,416	-42,906,710	9,895,805	3,194,204	1,633,580	1,560,624	25,650
投信	30,942,094	54,704,592	-23,762,498	1,281,295	425,048	0	425,048	5,280
自營商	64,068,728	20,136,082	43,932,646	-5,670,940	1,433,264	1,316,052	117,212	70,402
	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	1,037,874	3,157,267	-2,119,393	3,697	0	181,841	-181,841	-61,880
投信	21,939	0	21,939	224	1,653	0	1,653	32
自營商	625,882	302,047	323,835	-38,551	193,368	92,434	100,934	32,944

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9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	29,628	14,199	15,429	1,311	61,890	23,065	38,825	195
投信	0	0	0	0	0	68	-68	0
自營商	70,424	47,629	22,795	27,756	55,769	51,974	3,795	-9,142
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	14,077	7,311	6,766	0	10,516	36,167	-25,651	-1,048
特定法人(全月)	18,933	11,455	7,478	5,212	10,516	57,464	-46,948	-4,878
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	71,768	51,197	20,571	7,369	59,725	71,822	-12,097	2,069
十大交易人(全月)	93,545	64,481	29,064	21,349	79,531	99,440	-19,909	2,548
全市場未沖銷(近月)			156,284	18,468			150,894	26,280
全市場未沖銷(全月)			189,460	-140,666			192,558	-88,113

更新日期：2022年3月9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	17400	買權OI最大量	19000
	賣權成交最大量	16000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	23.18%	較前一交易日	-1.74%
	買權隱含波動率	17.47%	較前一交易日	-1.39%
	賣權隱含波動率	28.83%	較前一交易日	-2.29%
電子選擇權	買權成交最大量	495	買權OI最大量	495
	賣權成交最大量	730	賣權OI最大量	730
金融選擇權	買權成交最大量	1800	買權OI最大量	1760
	賣權成交最大量	540	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年3月9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04月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	21100	買權OI最大量	21100
	賣權成交最大量	16800	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	23.18%	較前一交易日	+6.52%
	買權隱含波動率	17.47%	較前一交易日	-5.33%
	賣權隱含波動率	28.84%	較前一交易日	-8.37%
	成交量P/C_Ratio值	0.938	較前一交易日	-0.01
	未平倉P/C_Ratio值	0.983	較前一交易日	+0.08
電子選擇權	買權成交最大量	565	買權OI最大量	565
	賣權成交最大量	730	賣權OI最大量	730
金融選擇權	買權成交最大量	1800	買權OI最大量	1760
	賣權成交最大量	760	賣權OI最大量	1560

更新日期：2022年3月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

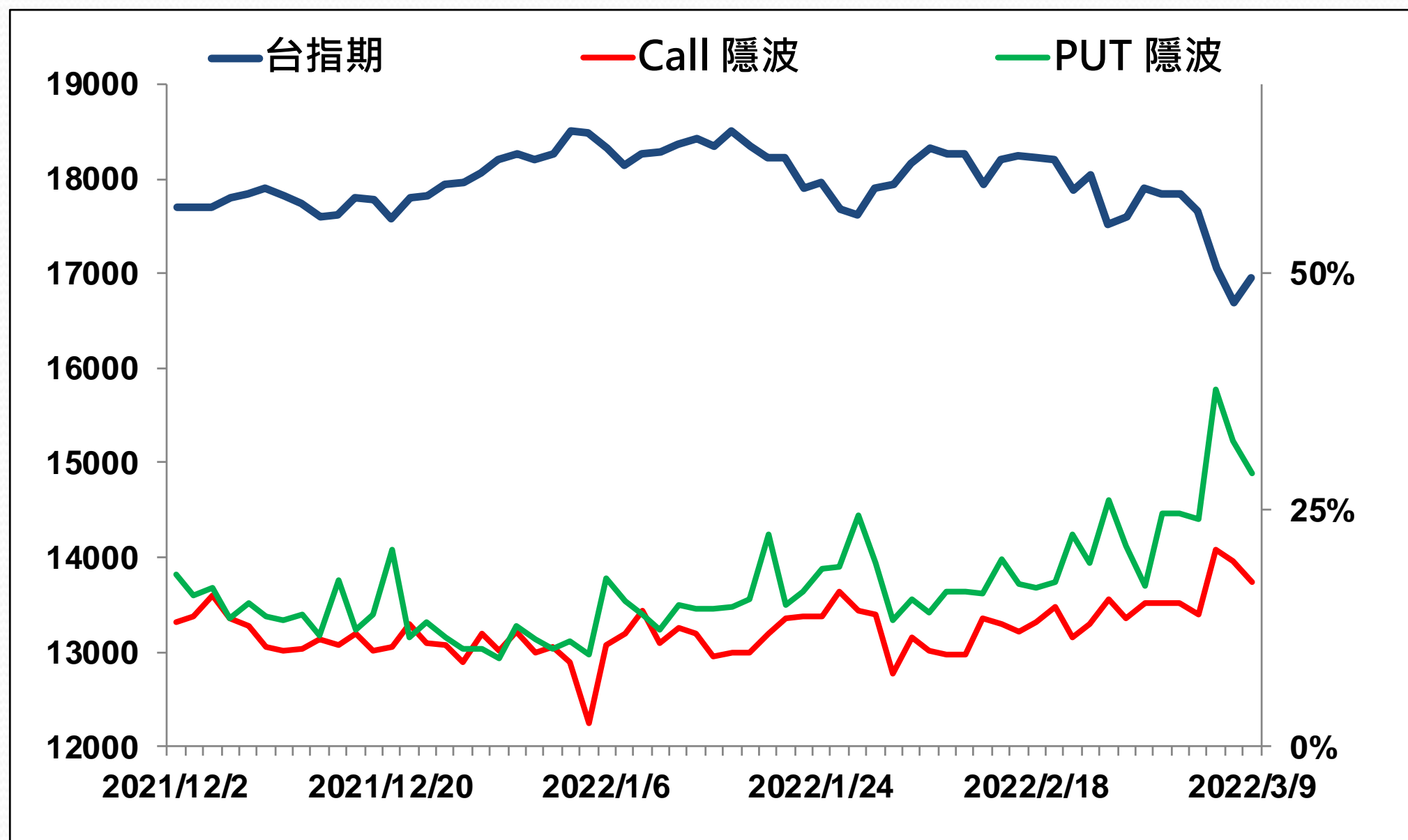
# 選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



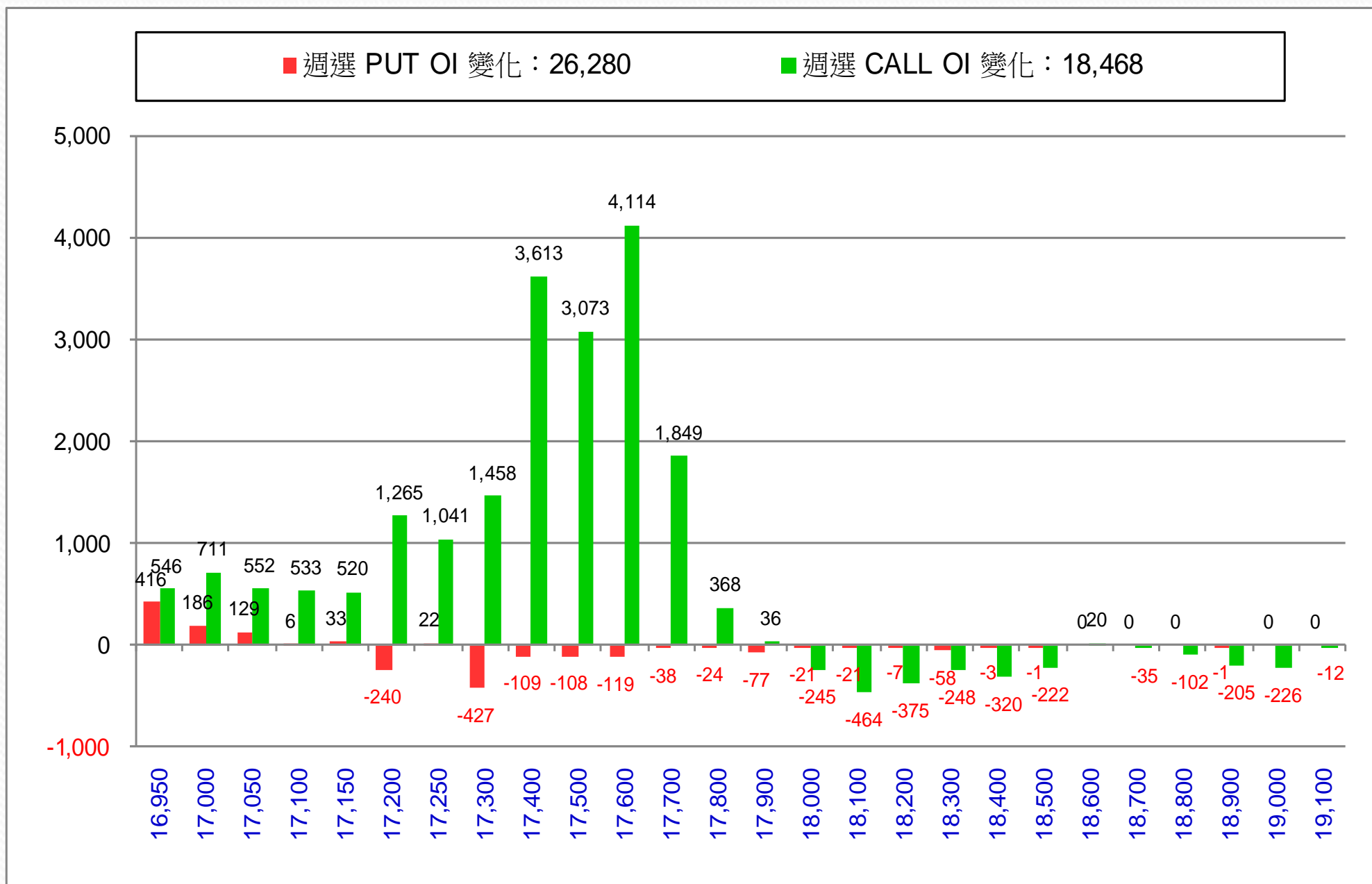
更新日期：2022年3月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2022年3月9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

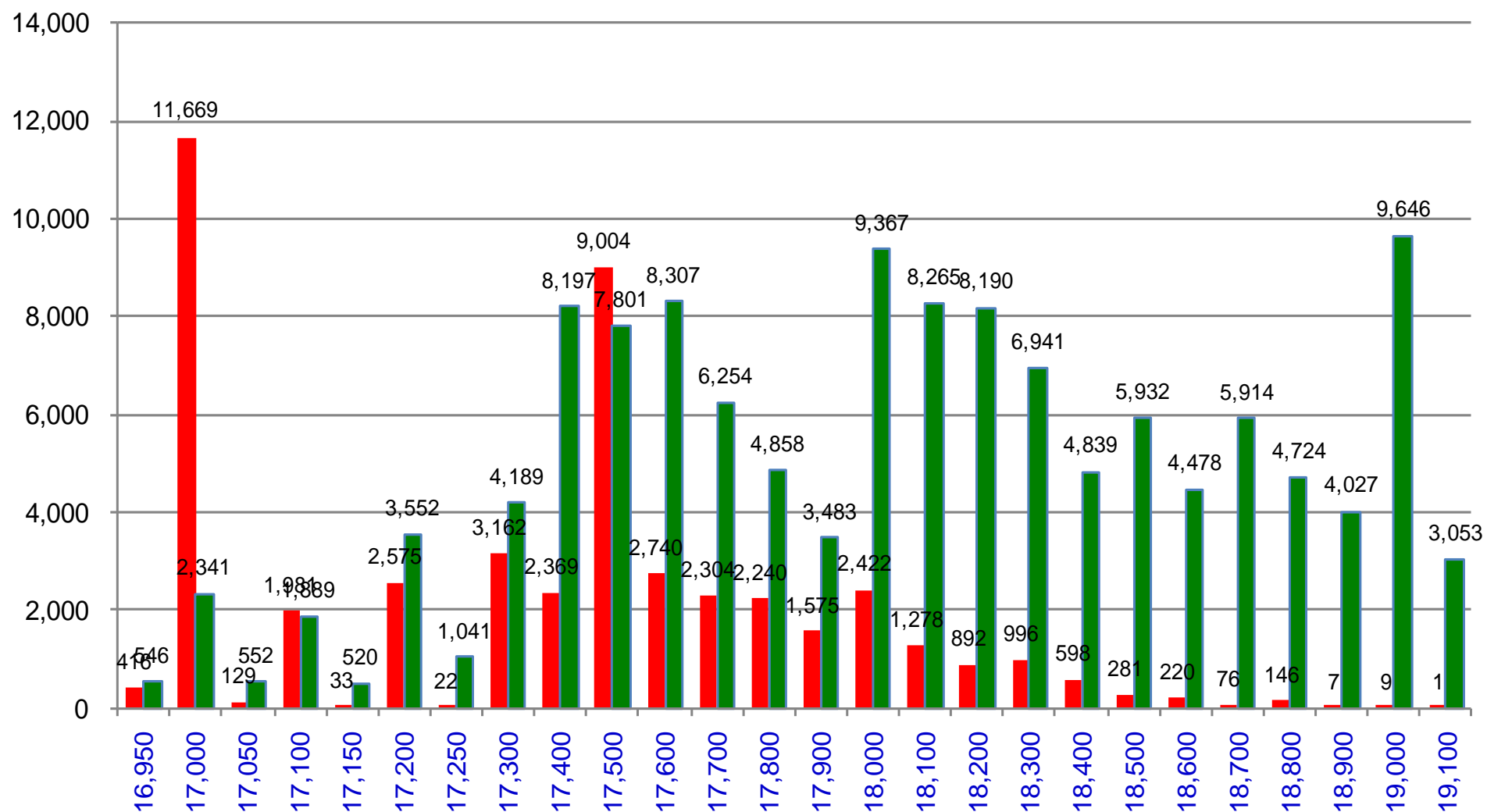


更新日期：2022年3月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：150,894

週選 CALL OI 總額：156,284



更新日期：2022年3月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

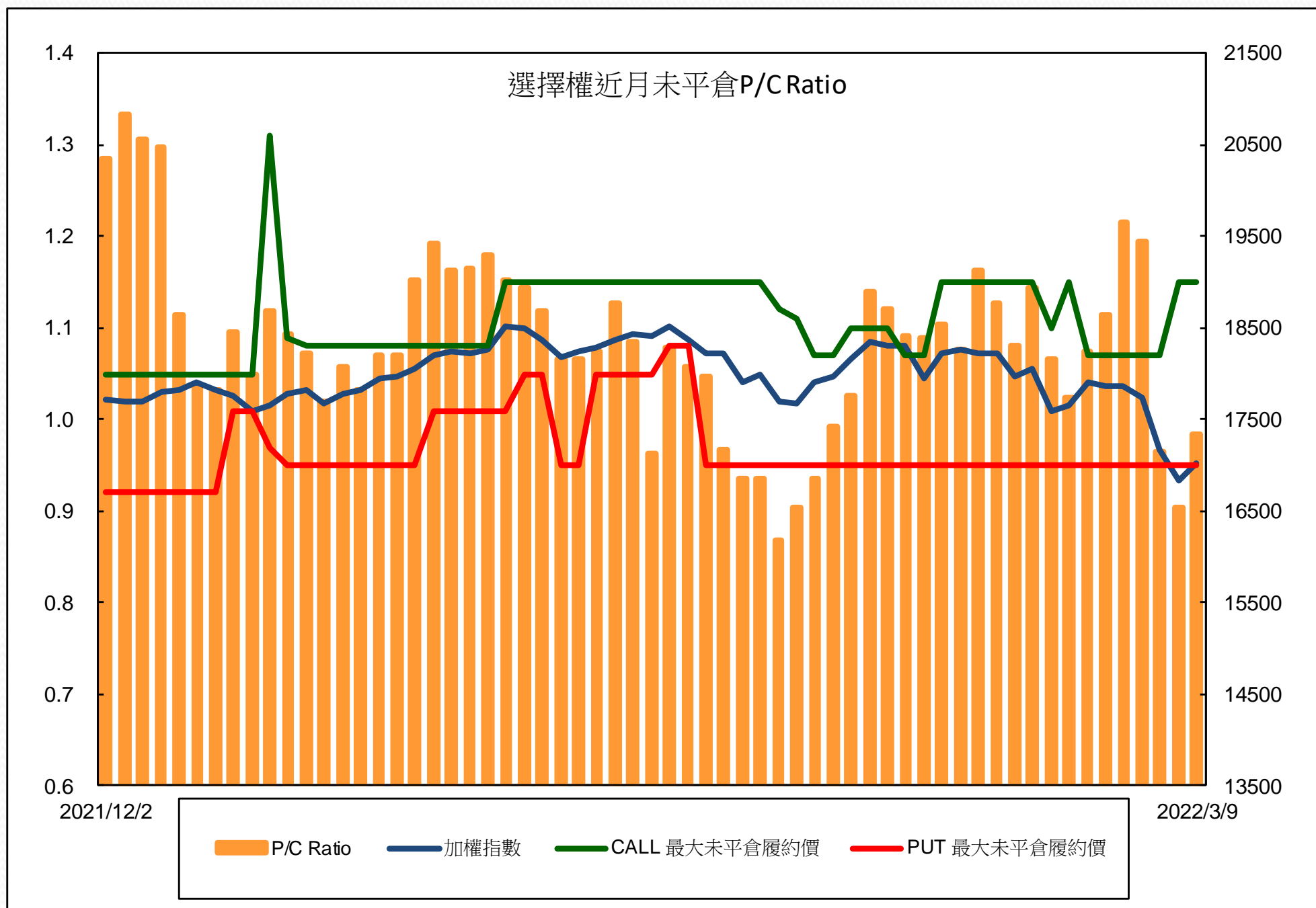


# 自營商選擇權OI部位統計

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8日	90,153	95,114	-4,961
	3月9日	70,424	47,629	22,795
Put	3月8日	83,757	70,820	12,937
	3月9日	55,769	51,974	3,795

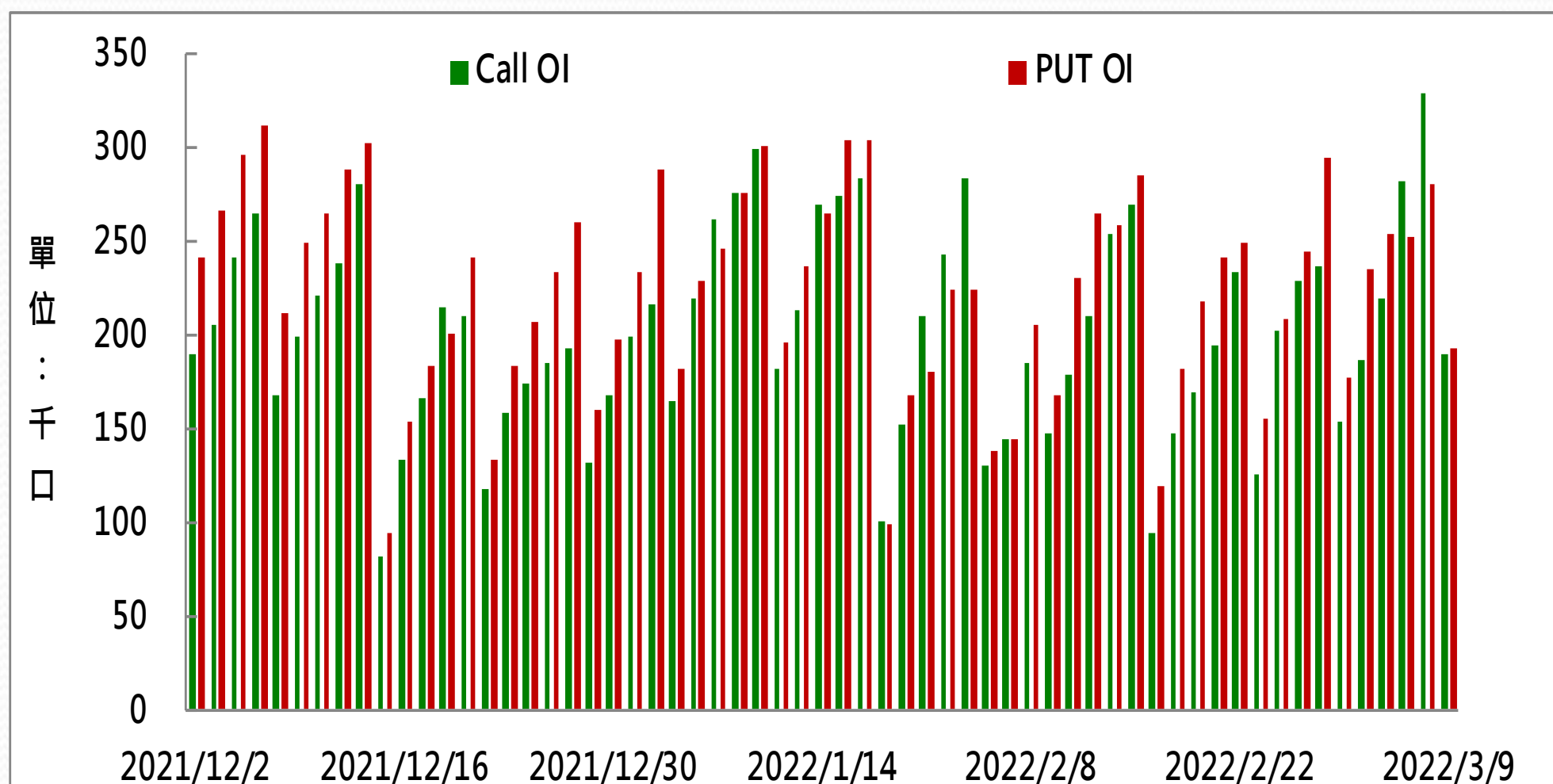
更新日期：2022年3月9日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年3月9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9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9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