

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/3/11 結算日：2022/3/16					日期：2022/3/11 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
-61	594	16,800	10,730	1,027	0	7	16,400	931	106
-21	95	16,850	2,247	321	7	536	16,500	1,020	107
-54	772	16,900	8,708	2,030	0	585	16,600	513	110
-153	401	16,950	2,616	220	80	843	16,700	1,074	275
-182	1,939	17,000	17,000	-1,682	0	817	16,800	1,751	125
-79	417	17,050	1,714	41	19	605	16,900	849	144
83	1,881	17,100	5,444	302	5	674	17,000	2,948	419
171	841	17,150	2,571	734	10	574	17,100	737	175
320	3,389	17,200	5,519	695	466	1,128	17,200	1,037	242
713	1,992	17,250	2,615	1,006	309	508	17,300	489	25
1,005	5,217	17,300	5,820	222	38	388	17,400	1,095	21
2,190	2,970	17,350	1,860	742	78	491	17,500	1,473	43
919	8,791	17,400	3,682	-763	29	519	17,600	443	-14
1,581	3,133	17,450	886	-336	109	572	17,700	172	-80
※ 4,639	13,732	17,500	5,476	-2,589	92	1,025	17,800	183	0
1,871	1,871	17,550	50	50	19	1,296	17,900	291	-1
3,261	13,003	17,600	2,872	-471	478	2,080	18,000	291	-8
3,922	3,922	17,650	3	3	523	1,597	18,100	332	0
3,682	14,134	17,700	2,314	-54	217	1,297	18,200	214	0
3,329	3,329	17,750	1	1	252	1,513	18,300	56	-1
4,564	16,646	17,800	2,222	-21	61	1,078	18,400	52	-8
1,110	1,110	17,850	1	1	421	2,200	18,500	5	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
34,911	212,746	0.9914	210,911	5,985	4,243	31,896	1.0000	31,895	5,290
昨日 P/C	1.1523	今日增減變化	-0.1610		昨日 P/C	0.9621	今日增減變化	0.0379	

更新日期：2022年3月11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11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	76,780,597	112,924,274	-36,143,677	-11,746,984	3,248,650	1,265,778	1,982,872	-11,656
投信	31,961,120	53,862,077	-21,900,957	-1,215,116	445,673	0	445,673	-7,079
自營商	67,812,642	19,212,879	48,599,763	6,813,313	1,342,186	1,814,315	-472,129	-275,090
	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	811,440	3,144,382	-2,332,942	-53,295	8,350	178,690	-170,340	9,335
投信	22,402	0	22,402	-122	1,670	0	1,670	-9
自營商	671,798	301,542	370,256	4,984	225,405	108,398	117,007	14,473

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11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	53,954	15,898	38,056	7,911	65,995	26,236	39,759	-2,433
投信	0	0	0	0	0	68	-68	0
自營商	69,196	62,379	6,817	-15,186	65,849	62,613	3,236	8,757
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	34,705	4,000	30,705	7,240	10,289	33,810	-23,521	4,721
特定法人(全月)	40,164	4,570	35,594	12,117	10,289	55,105	-44,816	2,579
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	83,747	64,117	19,630	-8,401	68,758	76,167	-7,409	-3,052
十大交易人(全月)	111,952	75,410	36,542	-5,919	92,391	108,265	-15,874	-3,865
全市場未沖銷(近月)			213,744	35,909			210,917	5,991
全市場未沖銷(全月)			257,057	40,265			263,577	11,940

更新日期：2022年3月11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	17800
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	20.73%	較前一交易日	-2.44%
	買權隱含波動率	16.50%	較前一交易日	-0.97%
	賣權隱含波動率	25.14%	較前一交易日	-3.69%
電子選擇權	買權成交最大量	870	買權OI最大量	840
	賣權成交最大量	740	賣權OI最大量	730
金融選擇權	買權成交最大量	1780	買權OI最大量	1760
	賣權成交最大量	1640	賣權OI最大量	1720

更新日期：2022年3月11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	18000	買權OI最大量	21100
	賣權成交最大量	16000	賣權OI最大量	15000
	整體隱含波動率	20.74%	較前一交易日	+2.44%
	買權隱含波動率	16.50%	較前一交易日	-0.97%
	賣權隱含波動率	25.16%	較前一交易日	-3.69%
	成交量P/C_Ratio值	1.033	較前一交易日	+0.13
	未平倉P/C_Ratio值	1.000	較前一交易日	+0.04
電子選擇權	買權成交最大量	870	買權OI最大量	840
	賣權成交最大量	740	賣權OI最大量	730
金融選擇權	買權成交最大量	1780	買權OI最大量	1760
	賣權成交最大量	1640	賣權OI最大量	1720

更新日期：2022年3月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

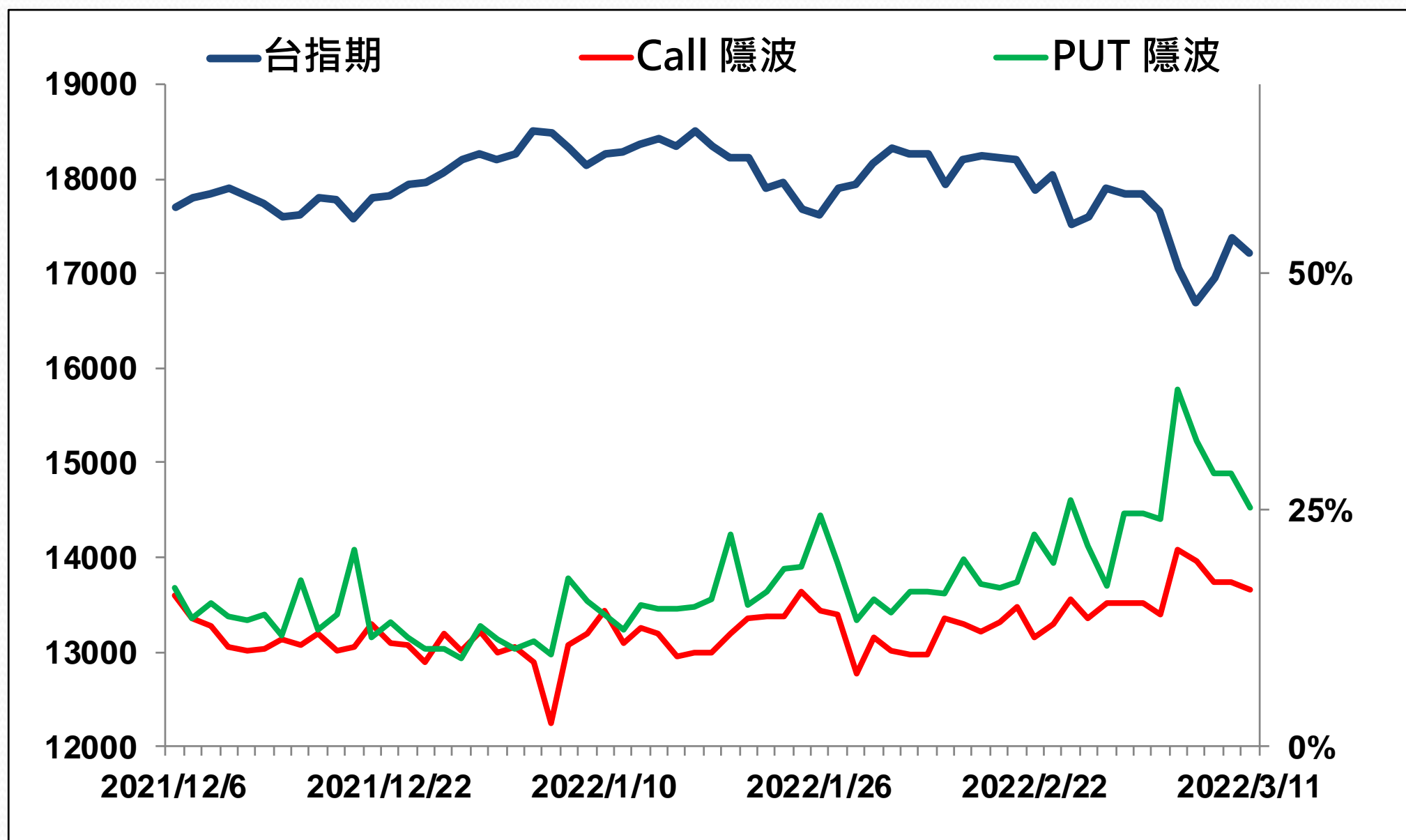
# 選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



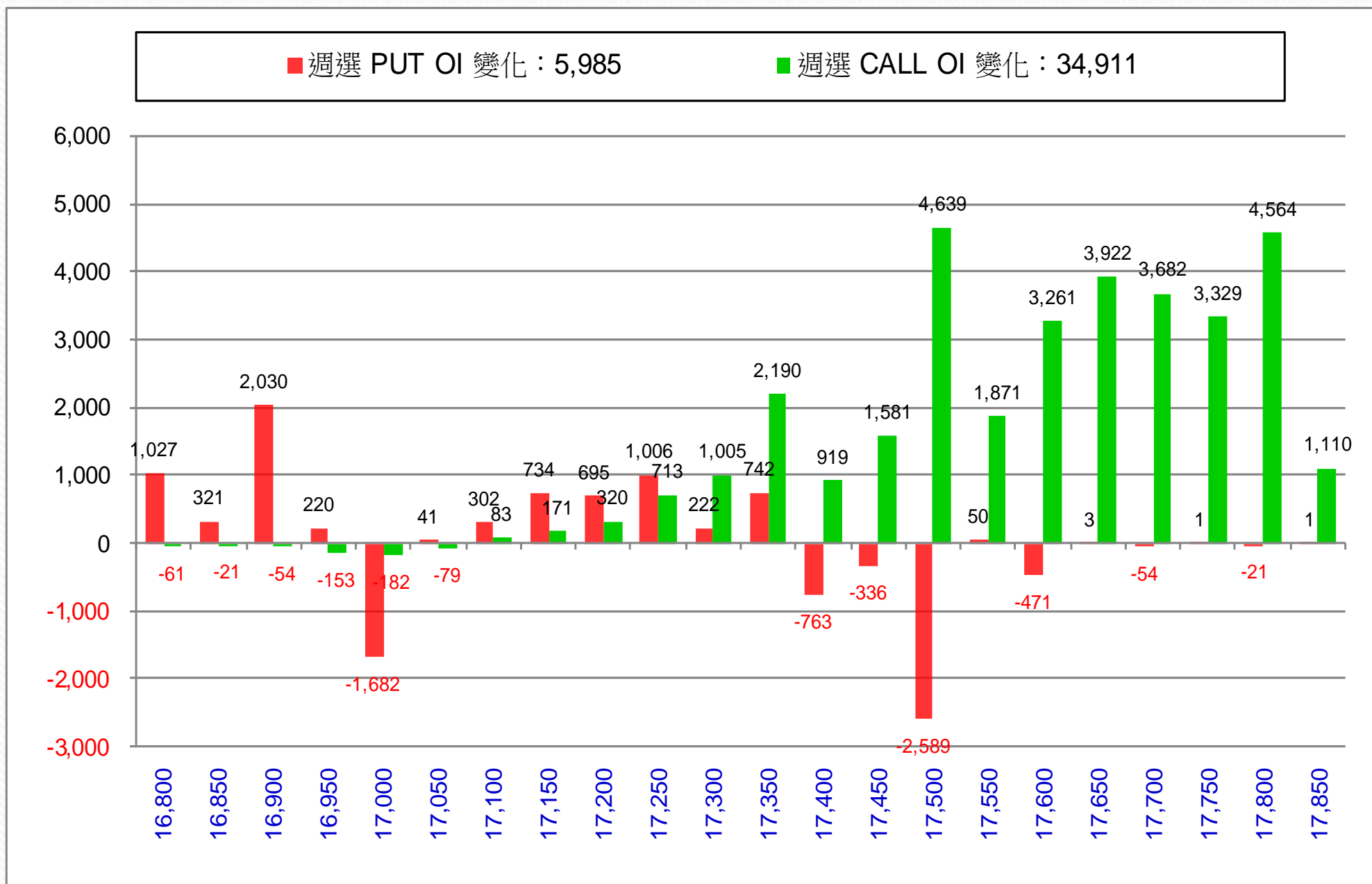
更新日期：2022年3月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2022年3月11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

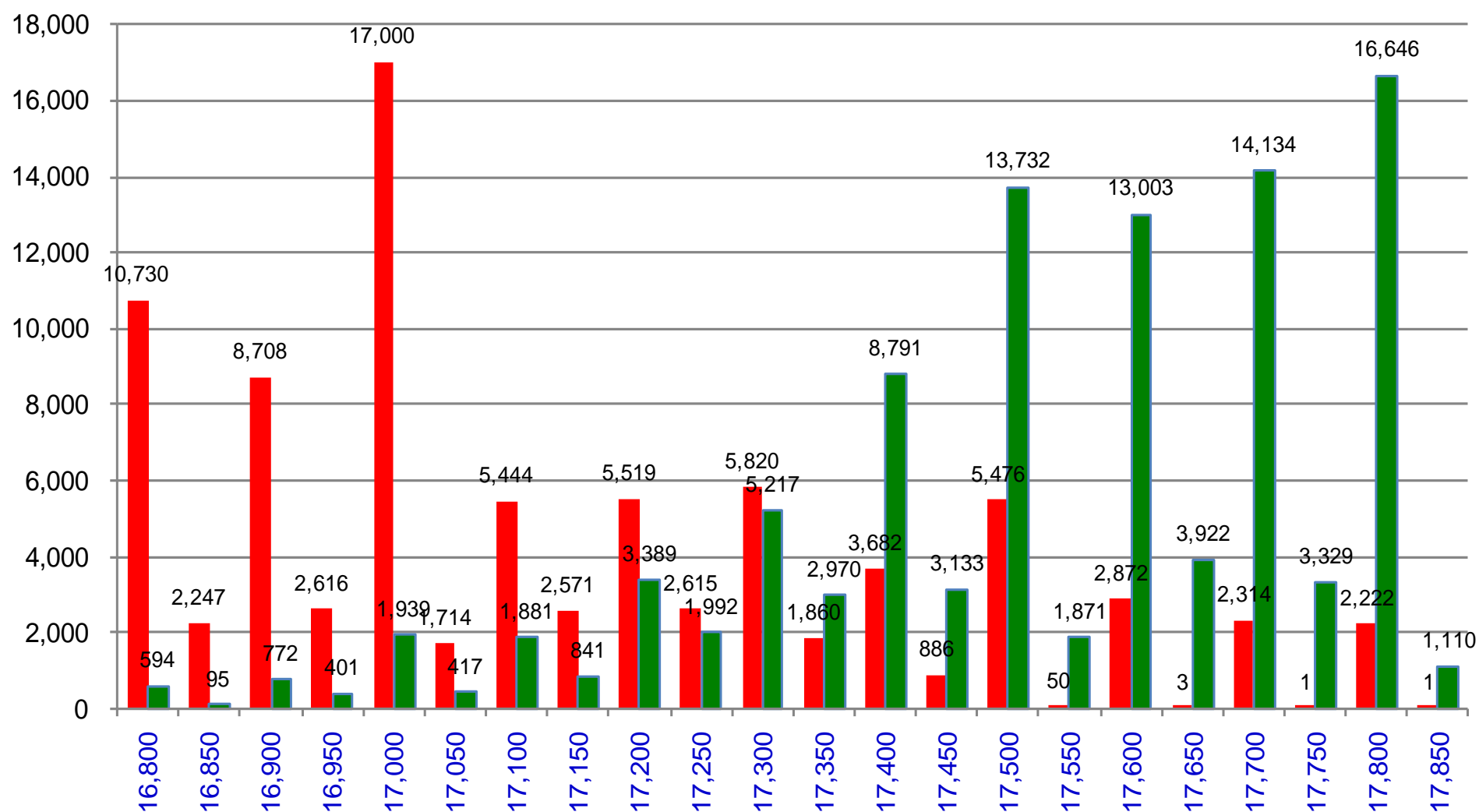


更新日期：2022年3月11日      資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：210,911

週選 CALL OI 總額：212,746



更新日期：2022年3月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

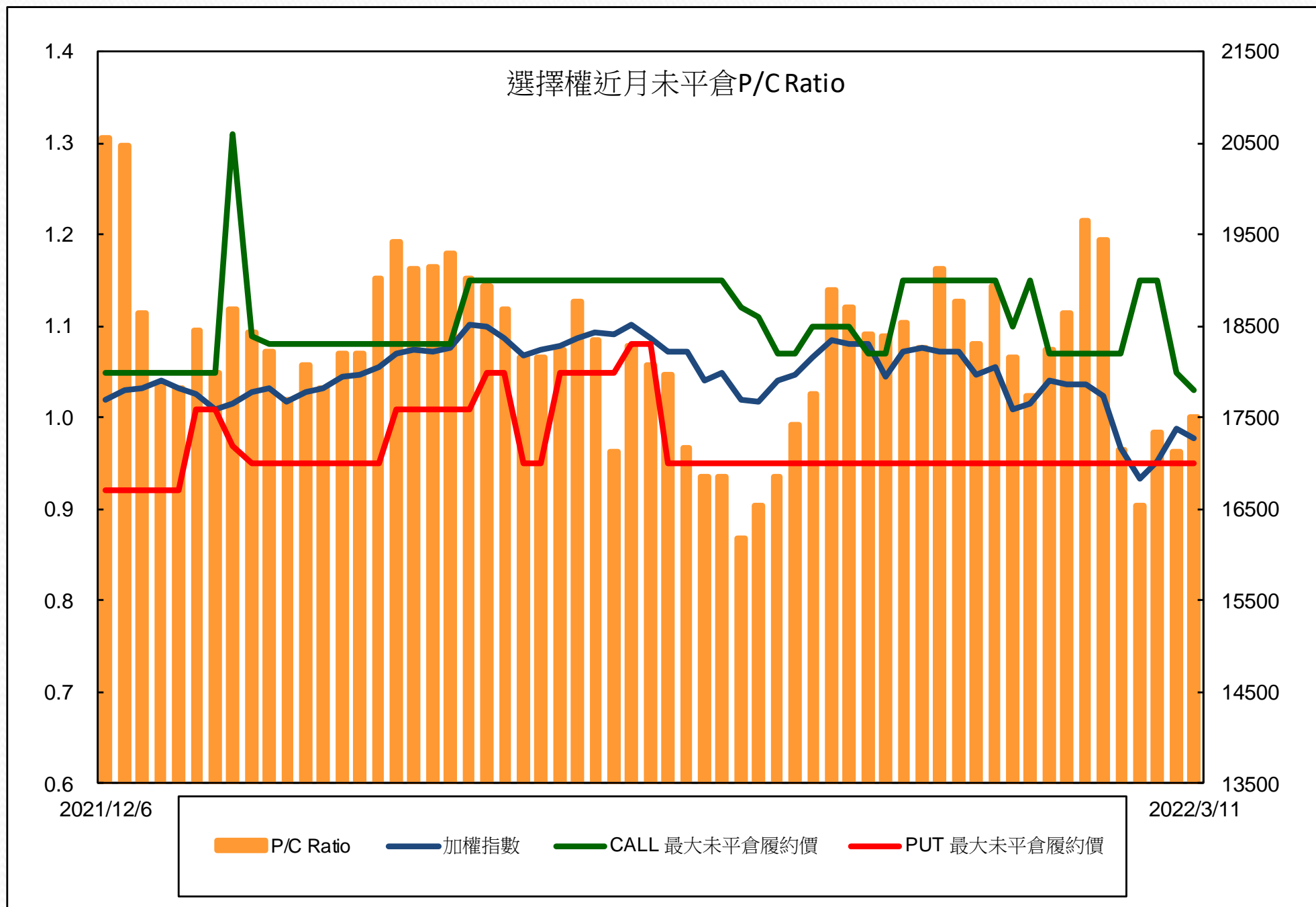


# 自營商選擇權OI部位統計

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10日	71,880	49,877	22,003
	3月11日	69,196	62,379	6,817
Put	3月10日	58,692	64,213	-5,521
	3月11日	65,849	62,613	3,236

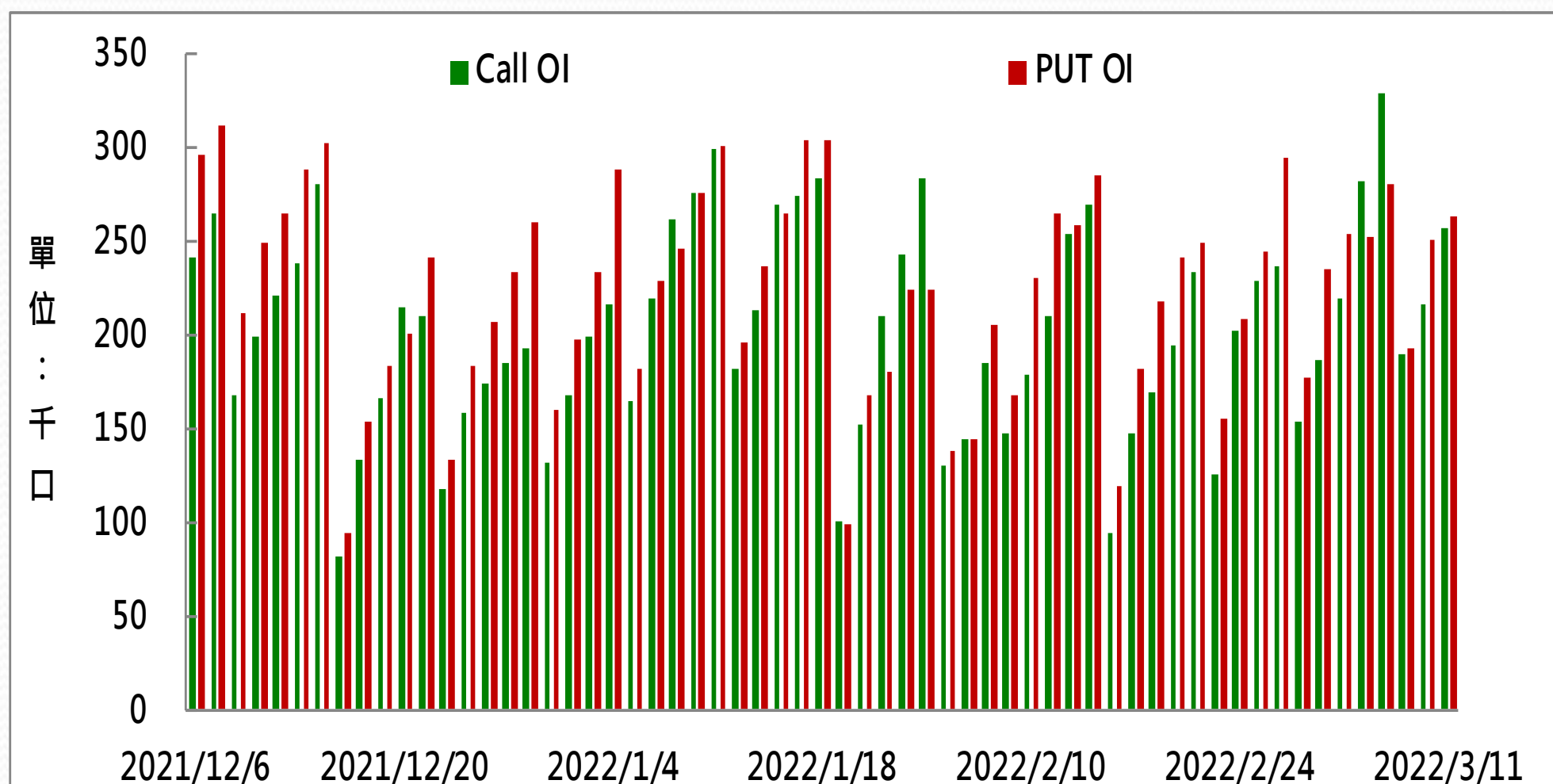
更新日期：2022年3月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年3月11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11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11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