

台指選擇權OI匯報

日期：2022/3/24 結算日：2022/3/30					日期：2022/3/24 結算日：2022/4/20				
202203W5					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
2	5	17,100	4,168	2,089	0	560	16,500	3,251	-140
0	0	17,150	2,530	2,009	0	623	16,600	2,110	132
1	3	17,200	5,209	3,164	3	1,096	16,700	3,906	-5
3	25	17,250	3,015	1,984	-1	1,357	16,800	5,813	291
19	32	17,300	5,087	3,298	1	1,787	16,900	3,103	102
15	35	17,350	3,138	1,707	-1	1,649	17,000	5,560	210
40	108	17,400	3,515	2,417	-4	1,058	17,100	2,646	293
106	126	17,450	2,809	1,998	39	1,613	17,200	2,259	159
338	471	17,500	4,523	1,077	19	1,979	17,300	1,951	168
380	441	17,550	2,363	1,743	201	1,885	17,400	2,554	125
1,457	1,670	17,600	3,380	2,089	-87	2,347	17,500	3,368	598
1,591	2,036	17,650	2,169	1,481	251	2,500	17,600	1,861	567
2,663	3,889	17,700	2,305	564	285	2,947	17,700	1,498	558
2,174	2,950	17,750	810	530	-53	3,055	17,800	641	2
3,181	5,436	17,800	844	321	108	3,947	17,900	555	37
2,523	3,867	17,850	199	110	※ 1,561	10,232	18,000	559	20
4,563	6,699	17,900	224	130	125	6,776	18,100	425	2
3,851	5,205	17,950	43	38	544	6,882	18,200	203	-2
※ 5,337	9,014	18,000	88	59	775	5,726	18,300	91	0
3,340	5,103	18,050	54	40	266	4,202	18,400	52	-1
1,364	4,485	18,100	7	6	249	4,065	18,500	5	0
696	696	18,150	0	0	236	3,459	18,600	11	-1
1,470	2,918	18,200	11	6	369	4,532	18,700	4	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
36,801	58,343	1.1341	66,169	35,615	5,169	90,315	1.0154	91,707	6,621
昨日 P/C	1.4183	今日增減變化		-0.2842	昨日 P/C	0.9993	今日增減變化		0.0161

更新日期：2022年3月24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24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	77,959,067	116,474,435	-38,515,368	4,003,448	2,306,332	1,087,082	1,219,250	-254,958
投信	35,974,084	53,671,354	-17,697,270	-5,357,527	469,196	0	469,196	-171
自營商	70,281,221	22,685,337	47,595,884	-3,320,012	1,566,133	826,045	740,088	125,352
	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	758,295	3,540,555	-2,782,260	-122,948	60,782	0	60,782	40,414
投信	27,675	0	27,675	-84	1,688	0	1,688	-9
自營商	697,287	186,344	510,943	57,665	246,500	310,651	-64,151	-43,789

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24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	21,528	16,233	5,295	-1,229	44,269	13,089	31,180	3,554
投信	0	50	-50	0	100	63	37	0
自營商	75,726	41,426	34,300	3,850	48,864	48,378	486	5,950
特定法人(週)	560	0	560	560	0	1,916	-1,916	-1,916
特定法人(近月)	13,527	18,003	-4,476	-146	4,173	24,900	-20,727	-3,483
特定法人(全月)	13,670	15,333	-1,663	-36	2,207	35,139	-32,932	-5,033
十大交易人(週)	18,536	20,955	-2,419	-1,522	22,423	22,139	284	-1,696
十大交易人(近月)	56,788	38,362	18,426	2,008	34,630	45,629	-10,999	-442
十大交易人(全月)	88,816	56,081	32,735	6,559	64,339	80,409	-16,070	-2,966
全市場未沖銷(近月)			90,315	5,169			91,707	6,621
全市場未沖銷(全月)			173,111	42,644			181,521	42,904

更新日期：2022年3月24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 03W5 週 選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	17900	買權OI最大量	18000
	賣權成交最大量	17500	賣權OI最大量	17200
	整體隱含波動率	12.85%	較前一交易日	-1.01%
	買權隱含波動率	11.07%	較前一交易日	+0.01%
	賣權隱含波動率	14.67%	較前一交易日	-1.44%
電子選擇權	買權成交最大量	830	買權OI最大量	830
	賣權成交最大量	825	賣權OI最大量	730
金融選擇權	買權成交最大量	1900	買權OI最大量	1780
	賣權成交最大量	1760	賣權OI最大量	1580

更新日期：2022年3月24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	18000
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	16000
	整體隱含波動率	16.90%	較前一交易日	-0.22%
	買權隱含波動率	12.49%	較前一交易日	+0.20%
	賣權隱含波動率	20.99%	較前一交易日	+0.38%
	成交量P/C_Ratio值	1.037	較前一交易日	-0.16
	未平倉P/C_Ratio值	1.015	較前一交易日	+0.02
電子選擇權	買權成交最大量	830	買權OI最大量	830
	賣權成交最大量	825	賣權OI最大量	730
金融選擇權	買權成交最大量	1900	買權OI最大量	1780
	賣權成交最大量	1760	賣權OI最大量	1580

更新日期：2022年3月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

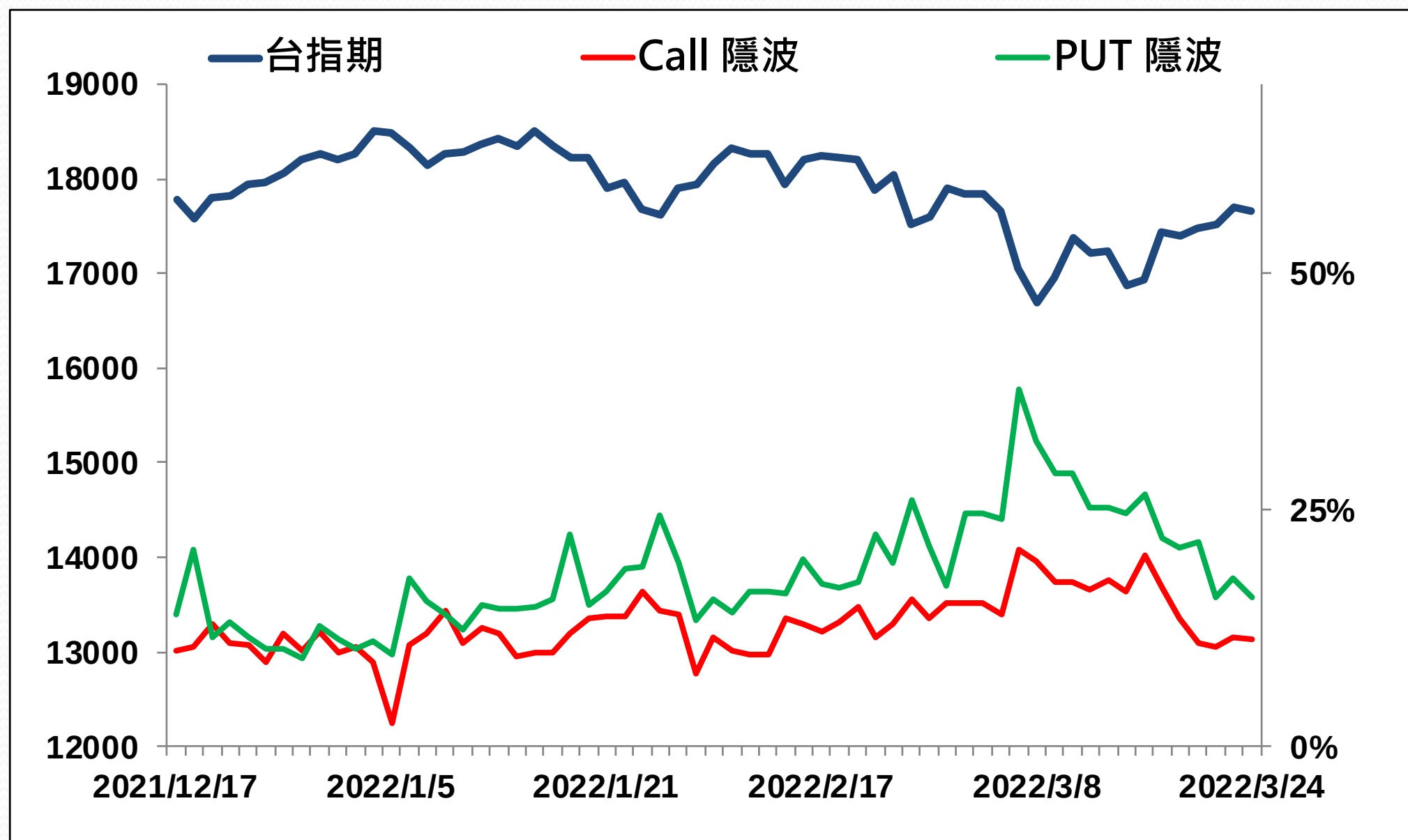
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



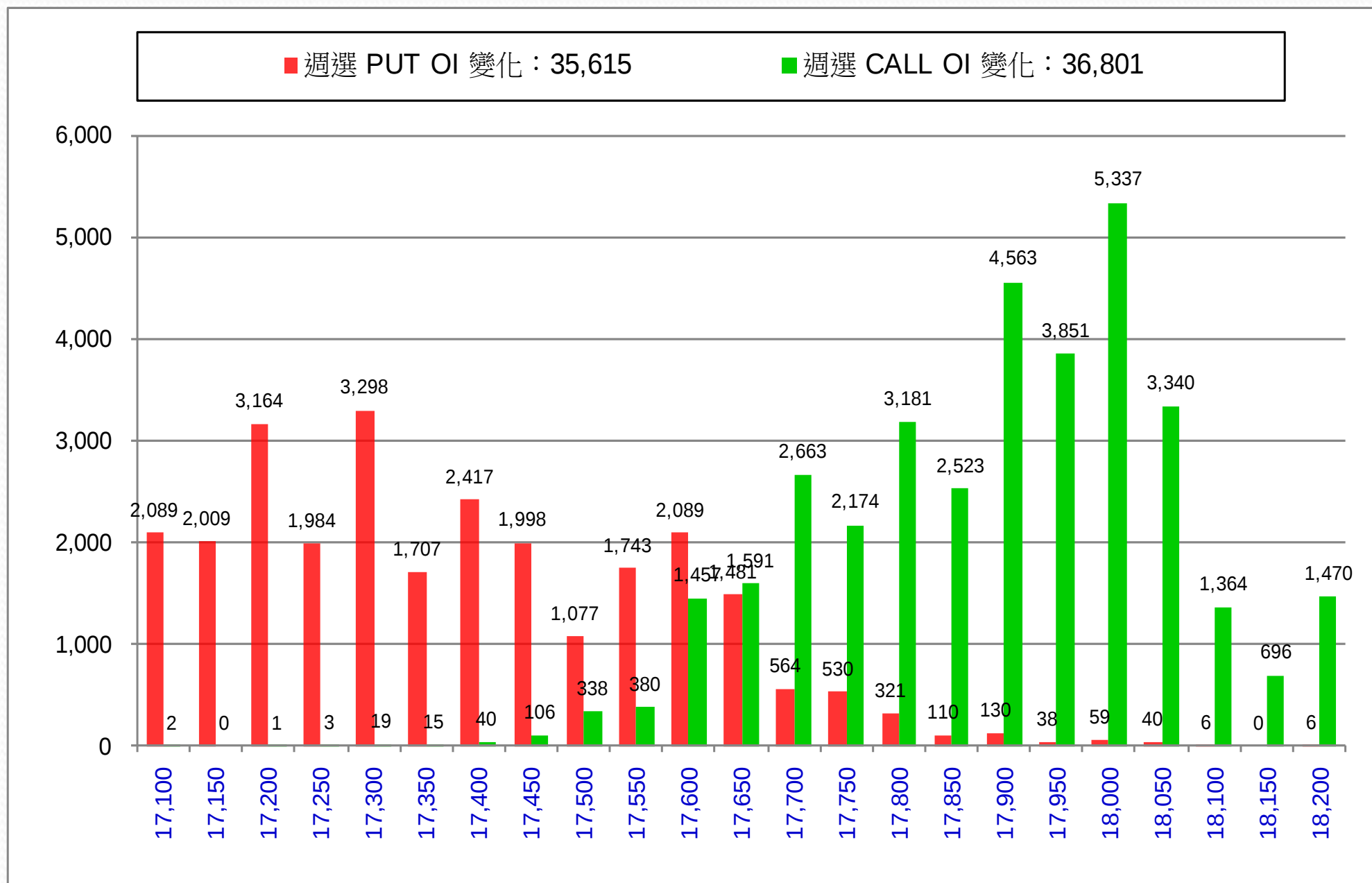
更新日期：2022年3月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年3月24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

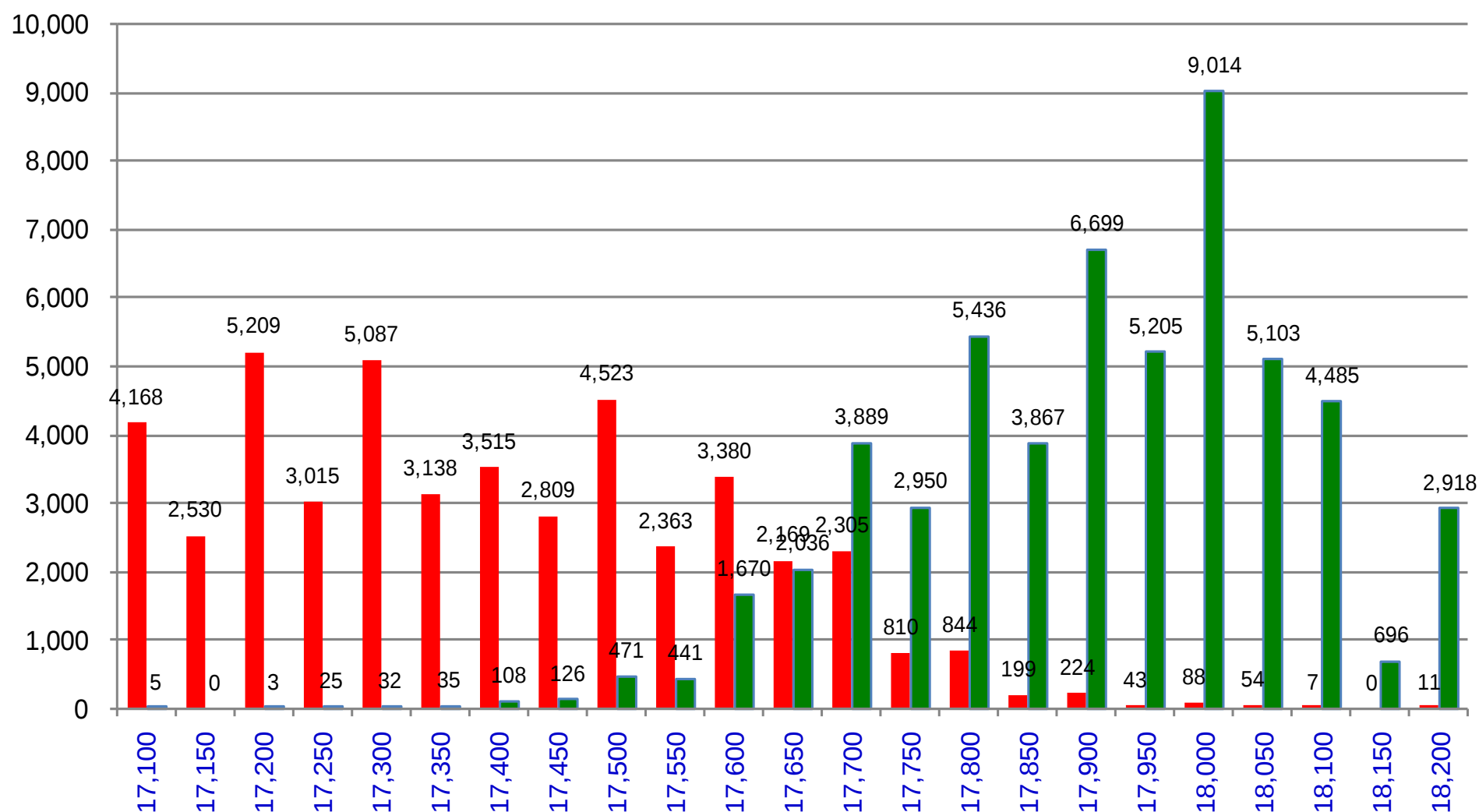


更新日期：2022年3月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：66,169

週選 CALL OI 總額：58,343



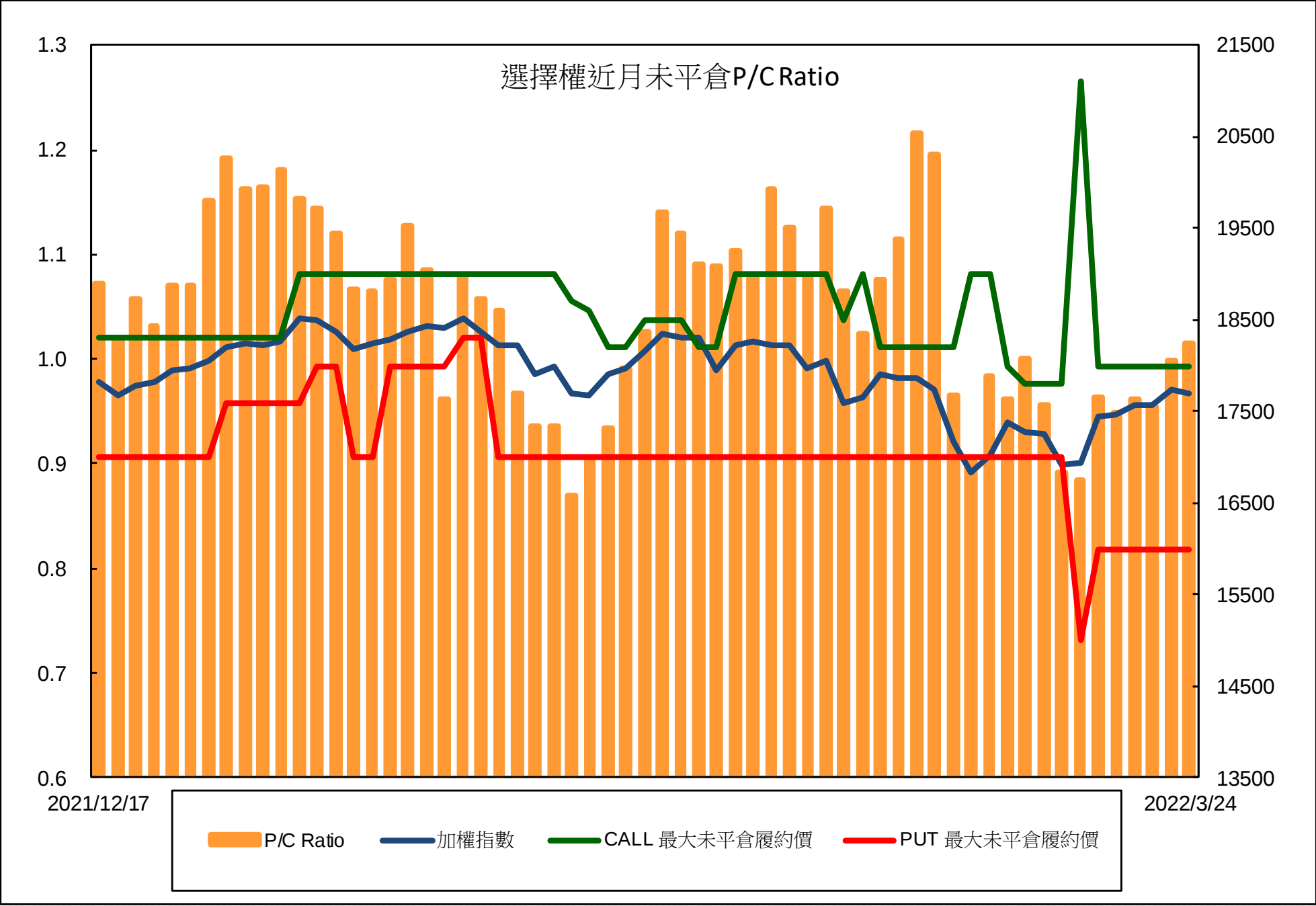
更新日期：2022年3月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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23日	64,008	33,558	30,450
	3月24日	75,726	41,426	34,300
Put	3月23日	36,585	42,049	-5,464
	3月24日	48,864	48,378	486

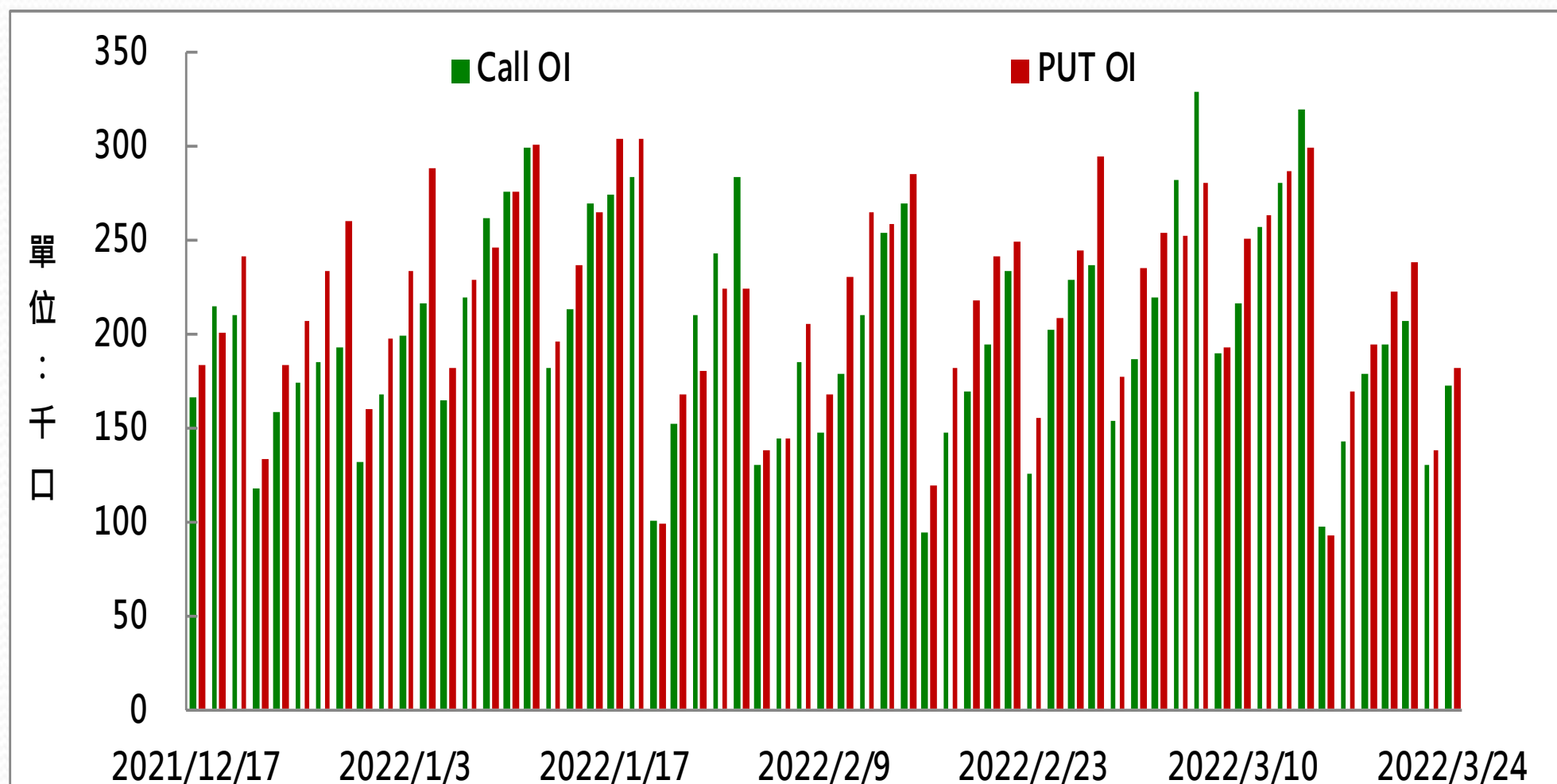
更新日期：2022年3月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年3月24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24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24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