

台指選擇權OI匯報

日期：2022/3/25 結算日：2022/3/30					日期：2022/3/25 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
4	9	17,100	4,341	173	0	560	16,500	3,144	-107
0	0	17,150	2,951	421	0	623	16,600	2,154	44
10	13	17,200	6,151	942	-3	1,093	16,700	4,009	103
-1	24	17,250	3,917	902	-3	1,354	16,800	6,006	193
-2	30	17,300	8,212	3,125	-4	1,783	16,900	3,227	124
-3	32	17,350	3,815	677	-4	1,645	17,000	5,738	178
94	202	17,400	7,051	3,536	15	1,073	17,100	2,700	54
60	186	17,450	3,172	363	-7	1,606	17,200	2,679	420
146	617	17,500	5,760	1,237	-31	1,948	17,300	2,168	217
62	503	17,550	3,345	982	4	1,889	17,400	2,786	232
-26	1,644	17,600	3,903	523	169	2,516	17,500	3,385	17
725	2,761	17,650	3,204	1,035	-18	2,482	17,600	2,207	346
1,181	5,070	17,700	2,738	433	589	3,536	17,700	1,604	106
2,657	5,607	17,750	1,434	624	536	3,591	17,800	629	-12
2,132	7,568	17,800	1,086	242	-55	3,892	17,900	595	40
1,615	5,482	17,850	253	54	554	10,786	18,000	576	17
3,299	9,998	17,900	214	-10	46	6,822	18,100	442	17
3,165	8,370	17,950	77	34	148	7,030	18,200	207	4
※ 3,418	12,432	18,000	86	-2	469	6,195	18,300	91	0
638	5,741	18,050	55	1	166	4,368	18,400	52	0
590	5,075	18,100	9	2	316	4,381	18,500	5	0
525	1,221	18,150	0	0	248	3,707	18,600	12	1
76	2,994	18,200	15	4	343	4,875	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
20,513	78,856	1.0559	83,263	17,094	3,422	93,737	0.9968	93,441	1,734
昨日 P/C	1.1341	今日增減變化		-0.0783	昨日 P/C	1.0154	今日增減變化		-0.0186

更新日期：2022年3月25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25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	72,359,643	114,771,473	-42,411,830	-3,896,462	2,211,080	1,052,580	1,158,500	-60,750
投信	35,848,162	53,543,171	-17,695,009	2,261	470,020	0	470,020	824
自營商	70,871,948	21,361,097	49,510,851	1,914,967	1,601,973	817,565	784,408	44,320
	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	658,800	3,451,380	-2,792,580	-10,320	53,494	8,359	45,135	-15,647
投信	27,450	0	27,450	-225	1,672	0	1,672	-16
自營商	671,510	166,532	504,978	-5,965	232,360	307,578	-75,218	-11,067

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25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	21,008	17,647	3,361	-1,934	45,893	13,771	32,122	942
投信	0	50	-50	0	100	63	37	0
自營商	79,797	47,520	32,277	-2,023	52,742	48,119	4,623	4,137
特定法人(週)	645	0	645	85	0	873	-873	1,043
特定法人(近月)	13,584	18,756	-5,172	-696	4,479	25,779	-21,300	-573
特定法人(全月)	13,697	15,733	-2,036	-373	2,287	36,557	-34,270	-1,338
十大交易人(週)	20,656	29,471	-8,815	-6,396	25,657	26,828	-1,171	-1,455
十大交易人(近月)	58,637	40,147	18,490	64	34,358	46,668	-12,310	-1,311
十大交易人(全月)	93,121	63,321	29,800	-2,935	65,416	85,305	-19,889	-3,819
全市場未沖銷(近月)			93,737	3,422			93,441	1,734
全市場未沖銷(全月)			197,550	24,439			200,386	18,865

更新日期：2022年3月25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	17800	買權OI最大量	18000
	賣權成交最大量	17600	賣權OI最大量	17300
	整體隱含波動率	12.13%	較前一交易日	-0.72%
	買權隱含波動率	9.74%	較前一交易日	-1.32%
	賣權隱含波動率	14.59%	較前一交易日	-0.08%
電子選擇權	買權成交最大量	870	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	1880	買權OI最大量	1780
	賣權成交最大量	1860	賣權OI最大量	1580

更新日期：2022年3月25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	16800	賣權OI最大量	16000
	整體隱含波動率	15.65%	較前一交易日	+1.25%
	買權隱含波動率	11.74%	較前一交易日	-0.75%
	賣權隱含波動率	20.38%	較前一交易日	-0.61%
	成交量P/C_Ratio值	0.894	較前一交易日	-0.14
	未平倉P/C_Ratio值	0.997	較前一交易日	-0.02
電子選擇權	買權成交最大量	870	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	1880	買權OI最大量	1780
	賣權成交最大量	1860	賣權OI最大量	1580

更新日期：2022年3月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

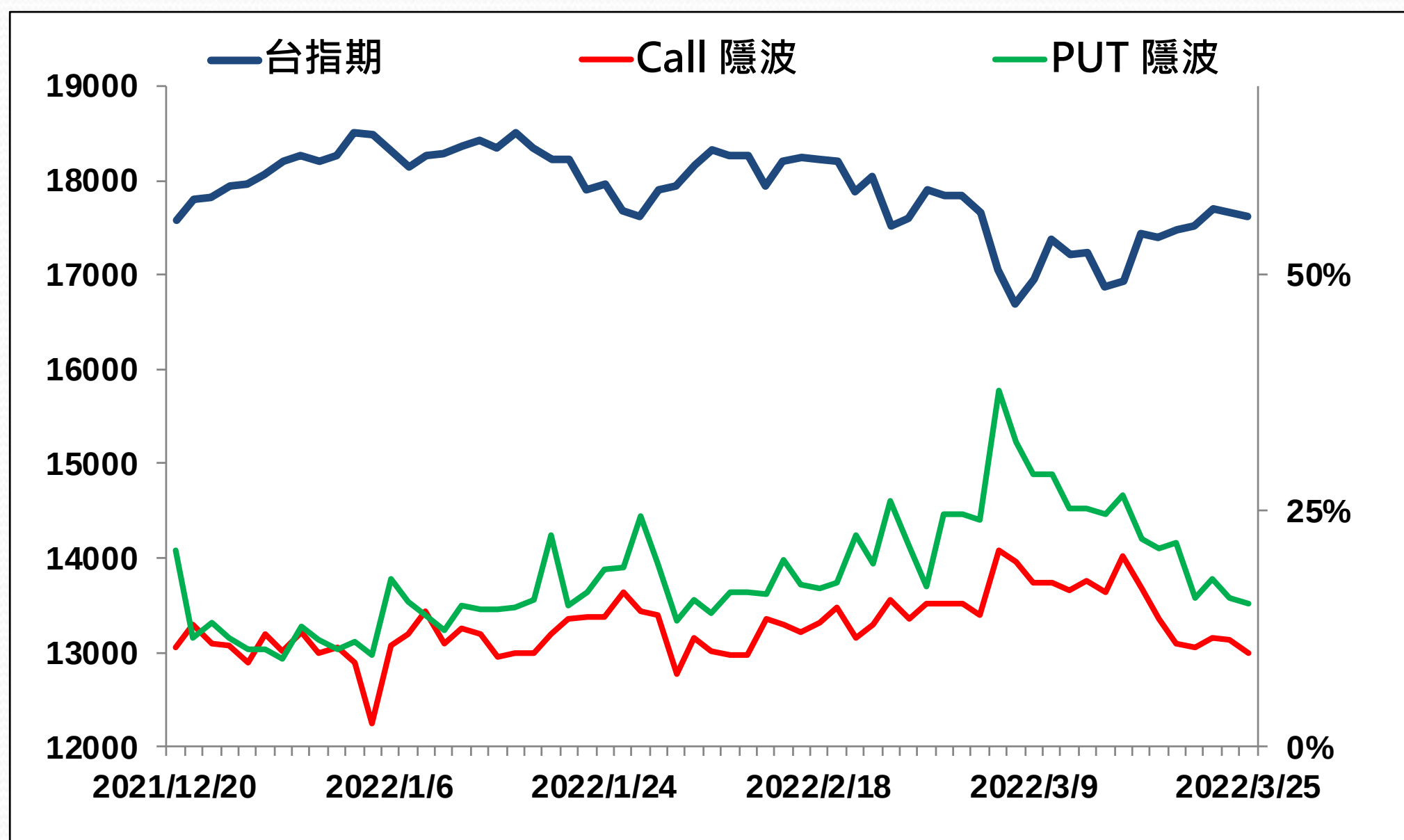
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



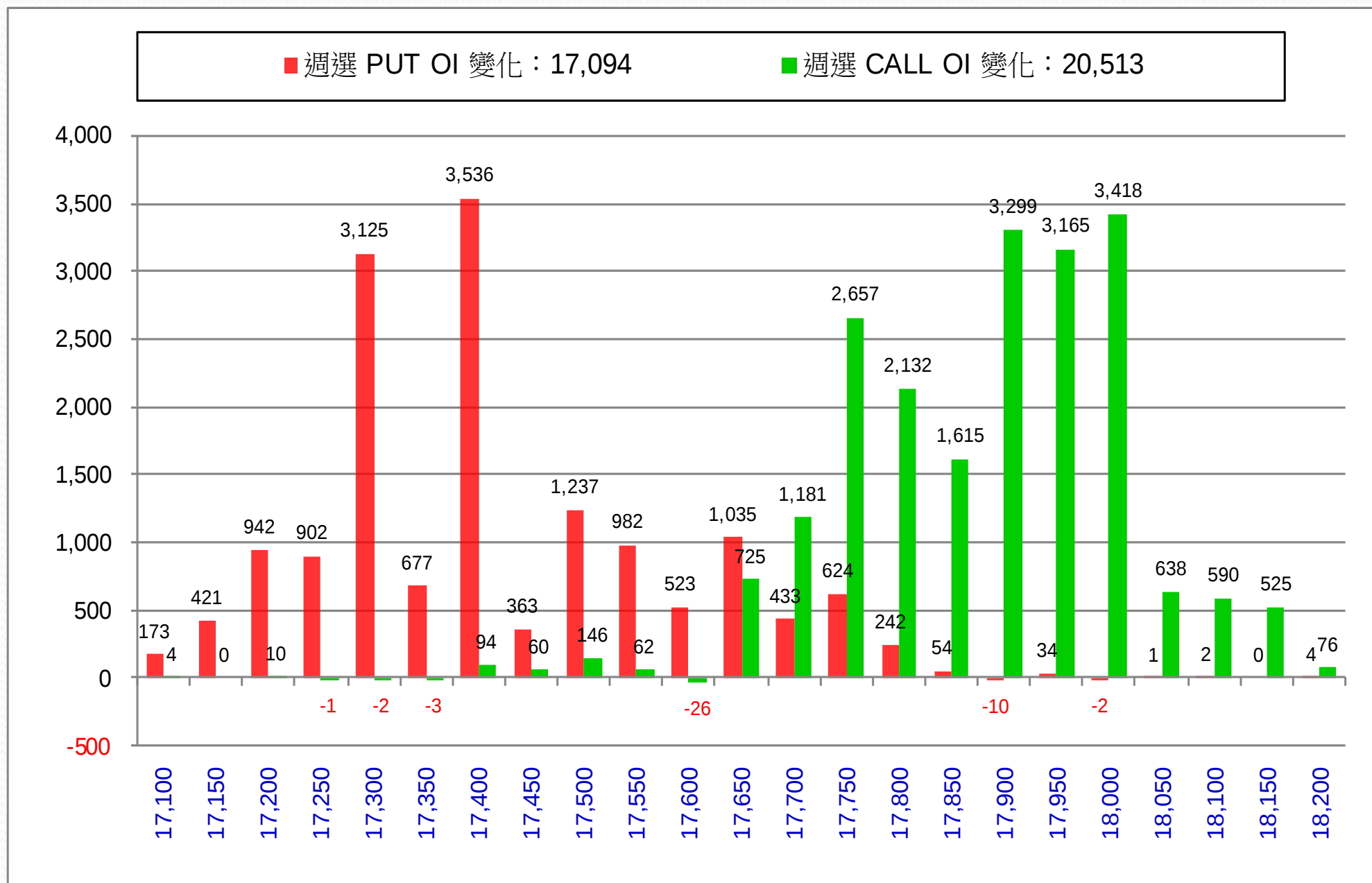
更新日期：2022年3月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年3月25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

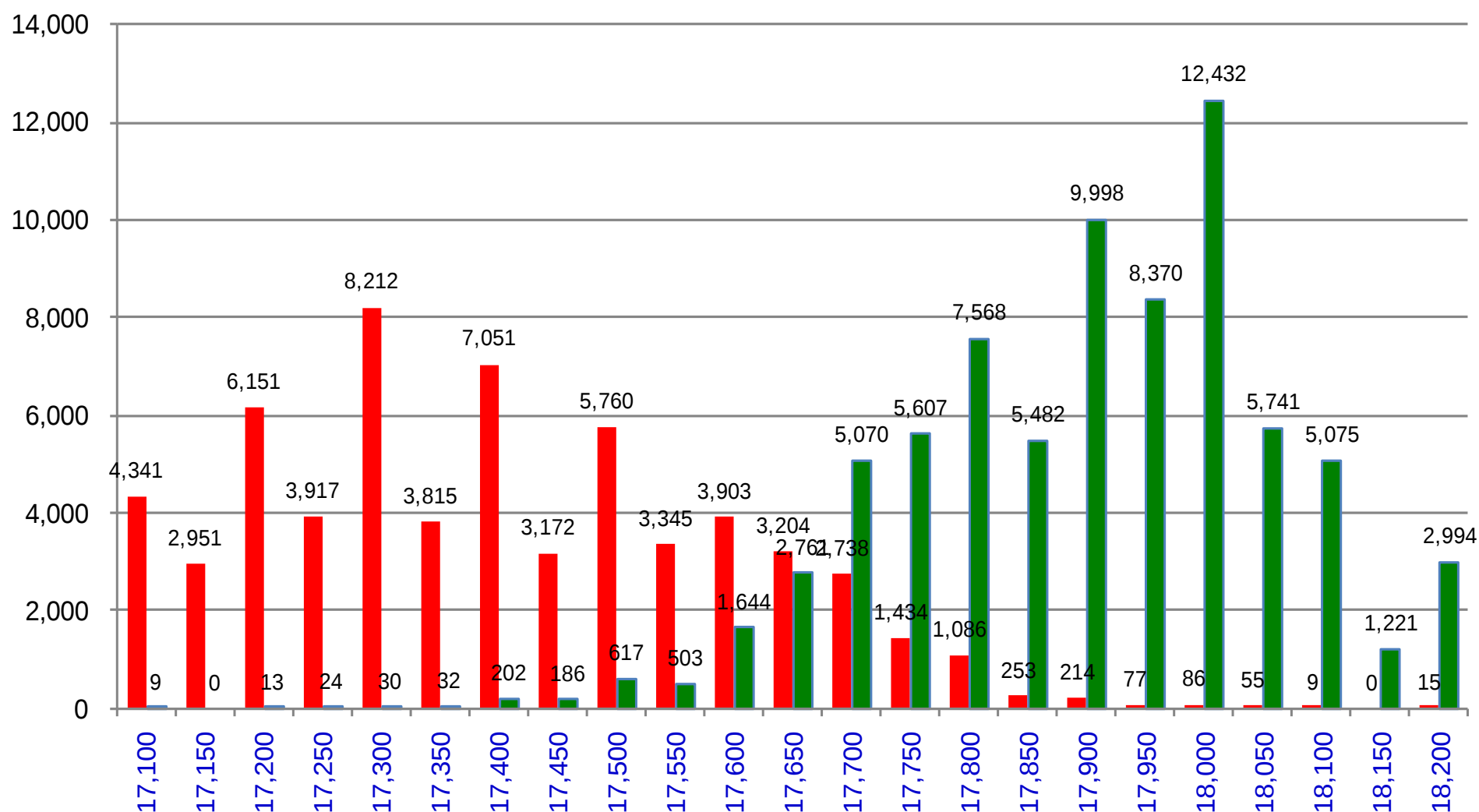


更新日期：2022年3月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：83,263

週選 CALL OI 總額：78,856



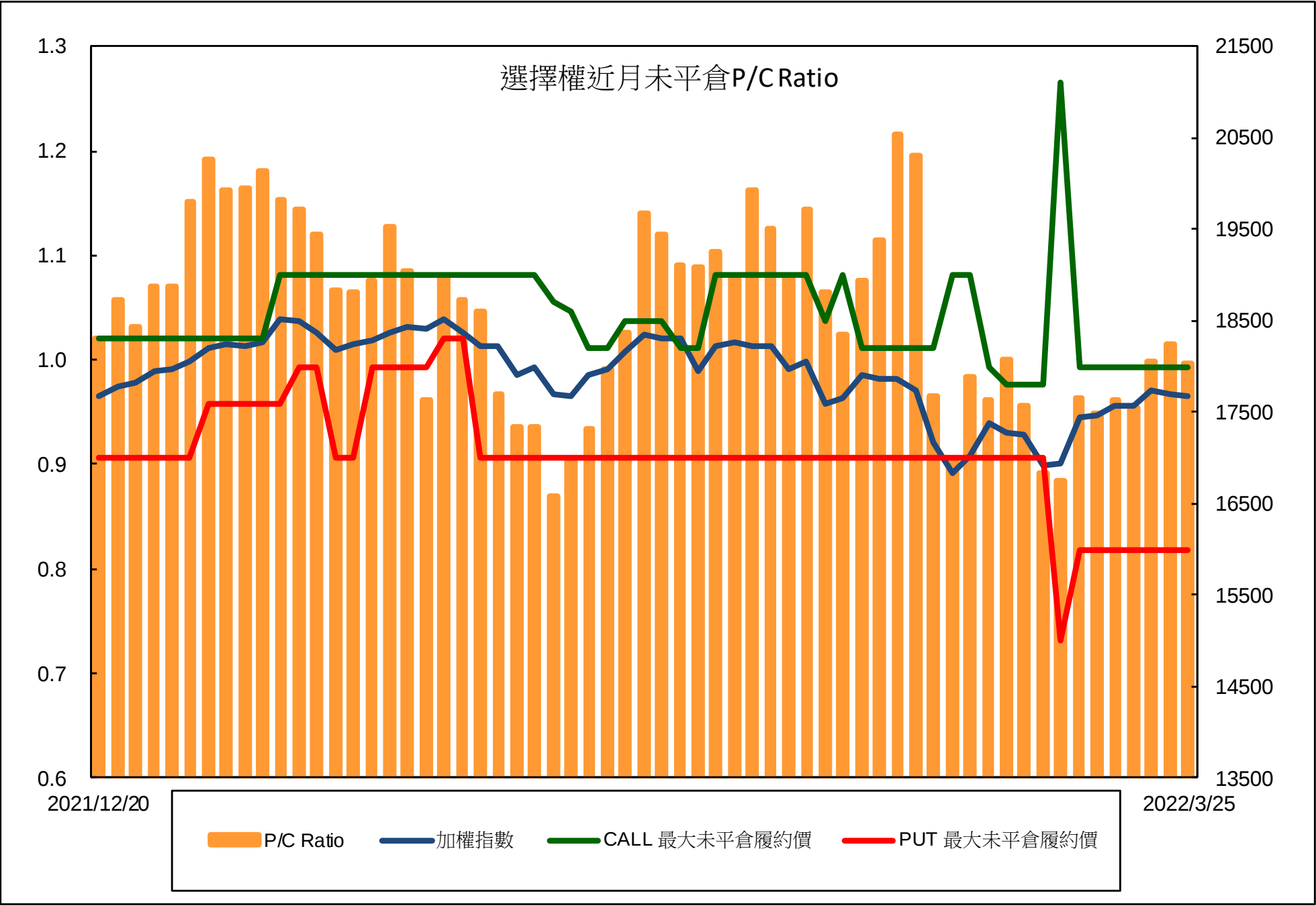
更新日期：2022年3月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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24日	75,726	41,426	34,300
	3月25日	79,797	47,520	32,277
Put	3月24日	48,864	48,378	486
	3月25日	52,742	48,119	4,623

更新日期：2022年3月25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25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

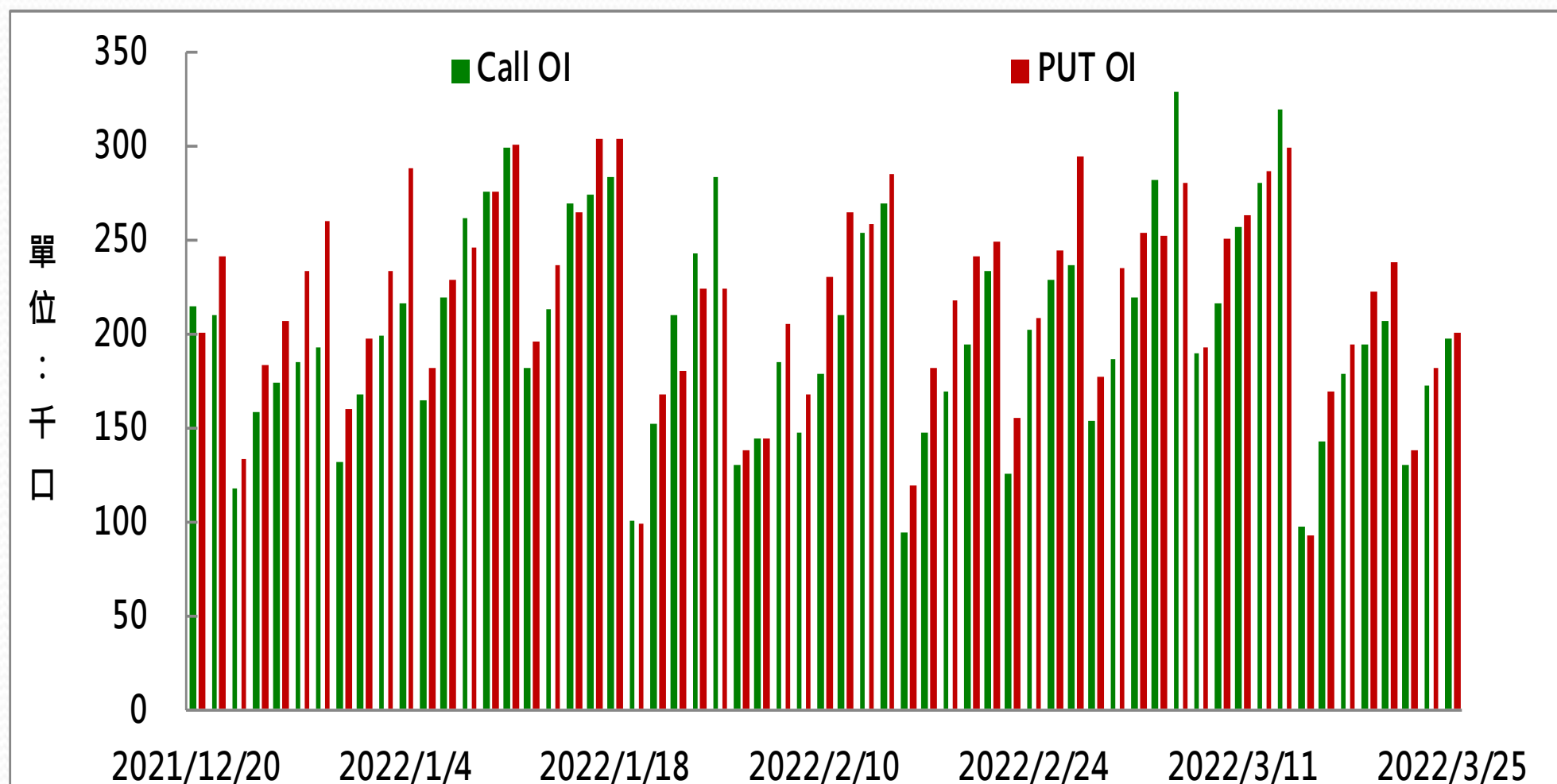


中華開發金控
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL



凱基期貨
KGI FUTURES

選擇權全月Put Call OI



更新日期：2022年3月25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25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