

台指選擇權OI匯報

日期：2022/3/28 結算日：2022/3/30					日期：2022/3/28 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
0	0	16,800	2,950	926	0	100	16,300	2,007	-115
3	3	16,900	7,997	3,540	0	30	16,400	2,234	441
15	17	17,000	6,242	2,651	-1	559	16,500	3,056	-88
4	4	17,050	2,841	885	-10	613	16,600	2,579	425
24	33	17,100	5,973	1,632	-3	1,090	16,700	4,503	494
34	34	17,150	4,634	1,683	0	1,354	16,800	5,860	-146
77	90	17,200	9,193	3,042	-6	1,777	16,900	3,256	29
272	296	17,250	4,647	730	-9	1,636	17,000	5,440	-298
446	476	17,300	9,697	1,485	1	1,074	17,100	2,618	-82
702	734	17,350	5,154	1,339	15	1,621	17,200	2,756	77
2,349	2,551	17,400	8,828	1,777	103	2,051	17,300	2,222	54
2,720	2,906	17,450	3,748	576	5	1,894	17,400	2,886	100
※ 6,164	6,781	17,500	5,973	213	63	2,579	17,500	3,205	-180
3,238	3,741	17,550	3,268	-77	441	2,923	17,600	2,053	-154
5,636	7,280	17,600	2,667	-1,236	450	3,986	17,700	1,571	-33
5,823	8,584	17,650	2,716	-488	1,443	5,034	17,800	589	-40
5,515	10,585	17,700	2,125	-613	635	4,527	17,900	620	25
1,420	7,027	17,750	903	-531	※ 1,774	12,560	18,000	561	-15
1,186	8,754	17,800	1,176	90	-180	6,642	18,100	429	-13
40	5,522	17,850	370	117	175	7,205	18,200	207	0
-1,711	8,287	17,900	249	35	-301	5,894	18,300	91	0
-2,467	5,903	17,950	44	-33	-132	4,236	18,400	52	0
-4,754	7,678	18,000	76	-10	145	4,526	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
24,453	103,309	0.9864	101,900	18,637	4,283	98,020	0.9750	95,573	2,132
昨日 P/C	1.0559	今日增減變化		-0.0695	昨日 P/C	0.9968	今日增減變化		-0.0218

更新日期：2022年3月28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28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	70,481,132	99,889,720	-29,408,588	13,003,242	2,231,593	1,247,737	983,856	-174,644
投信	34,221,856	54,368,566	-20,146,710	-2,451,701	462,608	0	462,608	-7,412
自營商	69,858,119	23,476,445	46,381,674	-3,129,177	1,351,903	791,591	560,312	-224,096
	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	679,246	3,447,632	-2,768,386	24,194	66,544	0	66,544	21,409
投信	27,537	0	27,537	87	1,664	0	1,664	-8
自營商	598,349	190,922	407,427	-97,551	224,573	316,055	-91,482	-16,264

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28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	24,218	18,030	6,188	2,827	47,800	14,883	32,917	795
投信	0	50	-50	0	100	63	37	0
自營商	83,895	57,328	26,567	-5,710	53,434	51,275	2,159	-2,464
特定法人(週)	775	0	775	130	0	1,096	-1,096	-223
特定法人(近月)	13,888	18,756	-4,868	304	4,479	25,217	-20,738	562
特定法人(全月)	11,350	15,733	-4,383	-2,347	0	36,878	-36,878	-2,608
十大交易人(週)	24,999	37,779	-12,780	-3,965	28,158	26,385	1,773	2,944
十大交易人(近月)	58,171	42,505	15,666	-2,824	36,047	46,570	-10,523	1,787
十大交易人(全月)	97,042	73,019	24,023	-5,777	69,655	86,226	-16,571	3,318
全市場未沖銷(近月)			98,020	4,283			95,573	2,132
全市場未沖銷(全月)			227,344	29,794			222,203	21,817

更新日期：2022年3月28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	17600	買權OI最大量	17700
	賣權成交最大量	17300	賣權OI最大量	17300
	整體隱含波動率	13.34%	較前一交易日	+1.21%
	買權隱含波動率	8.11%	較前一交易日	-1.63%
	賣權隱含波動率	18.72%	較前一交易日	+4.13%
電子選擇權	買權成交最大量	840	買權OI最大量	830
	賣權成交最大量	775	賣權OI最大量	730
金融選擇權	買權成交最大量	1860	買權OI最大量	1780
	賣權成交最大量	1780	賣權OI最大量	1580

更新日期：2022年3月28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	17.57%	較前一交易日	-1.92%
	買權隱含波動率	12.21%	較前一交易日	+0.46%
	賣權隱含波動率	22.42%	較前一交易日	+2.04%
	成交量P/C_Ratio值	1.052	較前一交易日	+0.16
	未平倉P/C_Ratio值	0.975	較前一交易日	-0.02
電子選擇權	買權成交最大量	840	買權OI最大量	830
	賣權成交最大量	775	賣權OI最大量	730
金融選擇權	買權成交最大量	1860	買權OI最大量	1780
	賣權成交最大量	1780	賣權OI最大量	1580

更新日期：2022年3月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

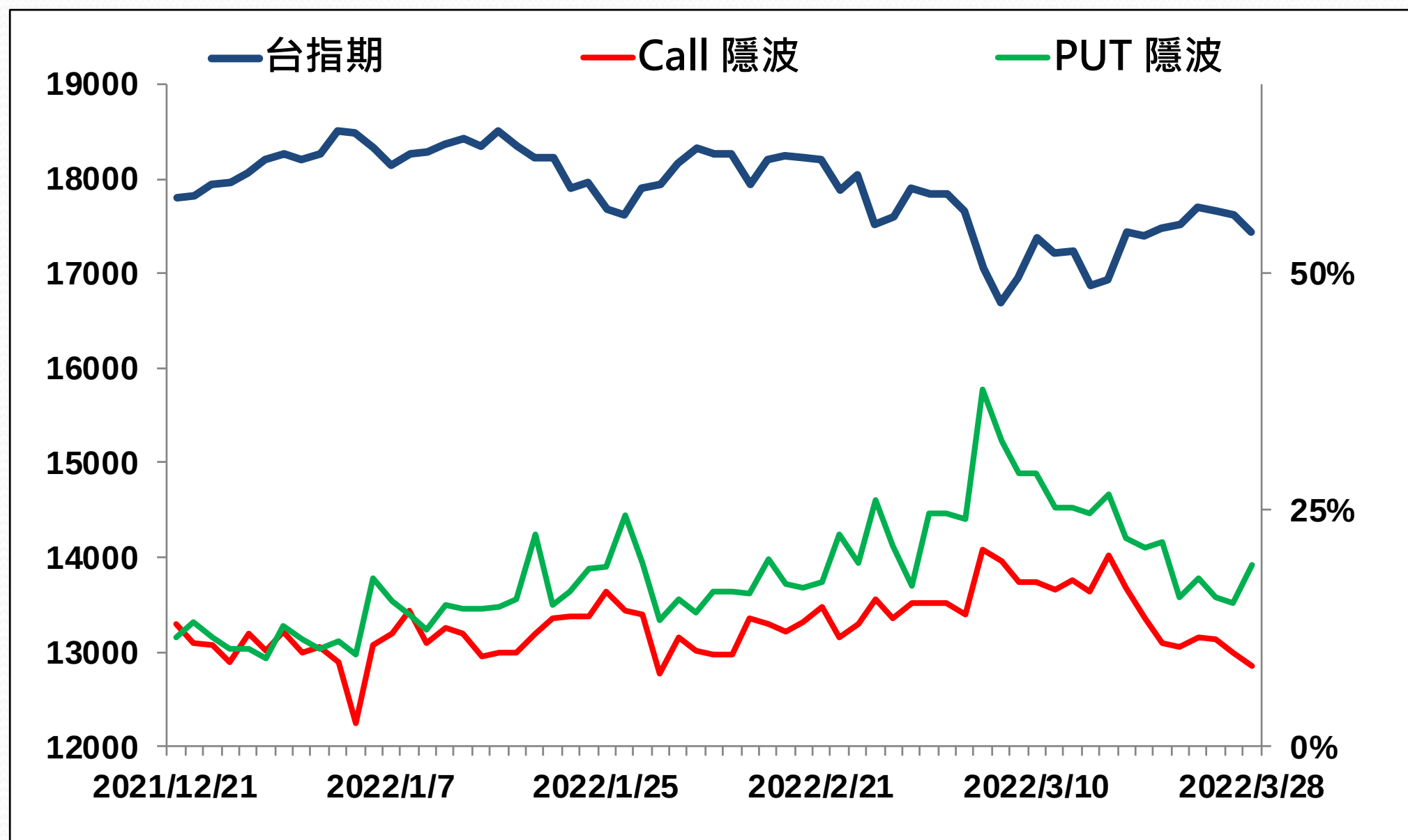
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



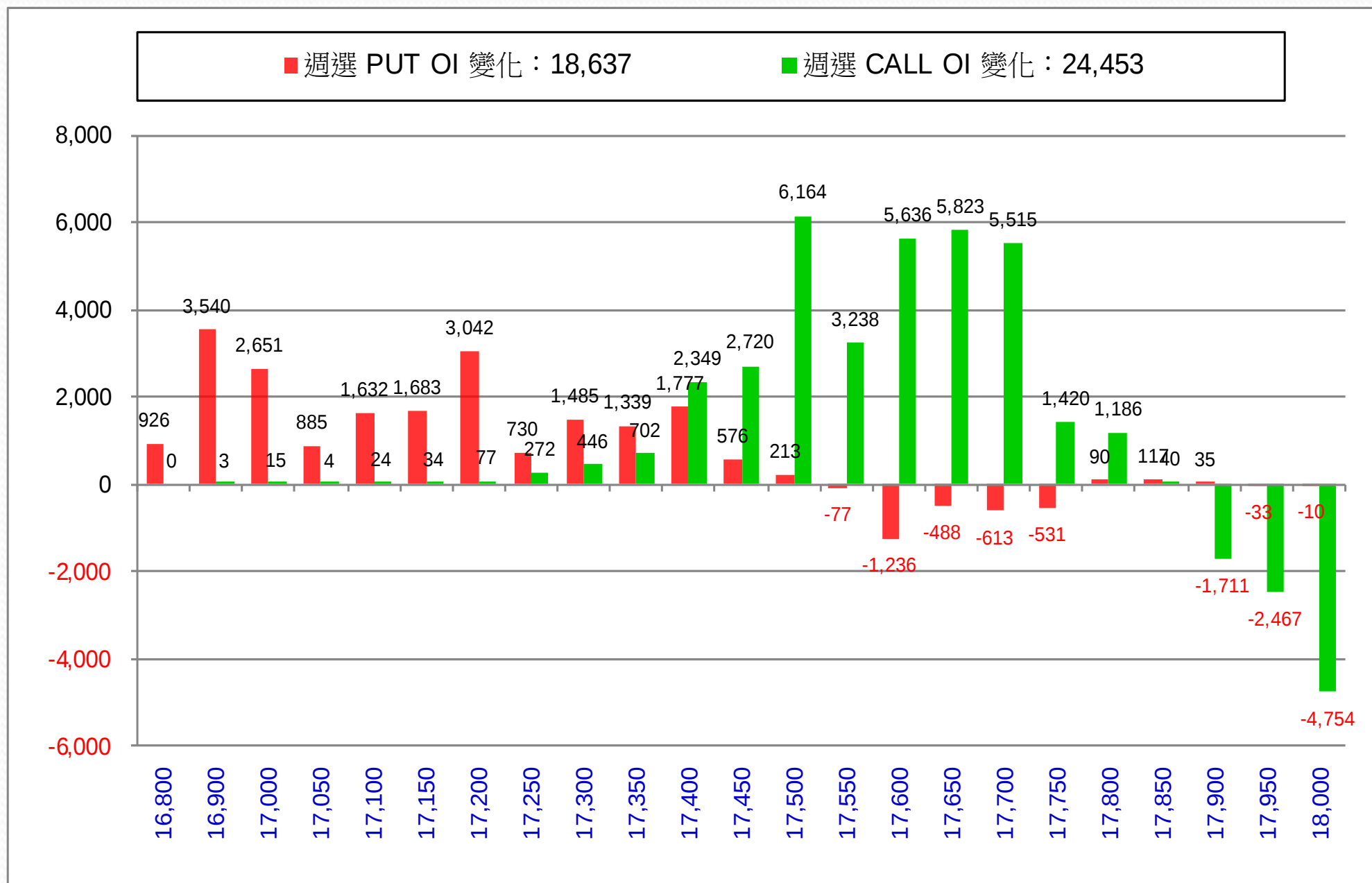
更新日期：2022年3月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年3月28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

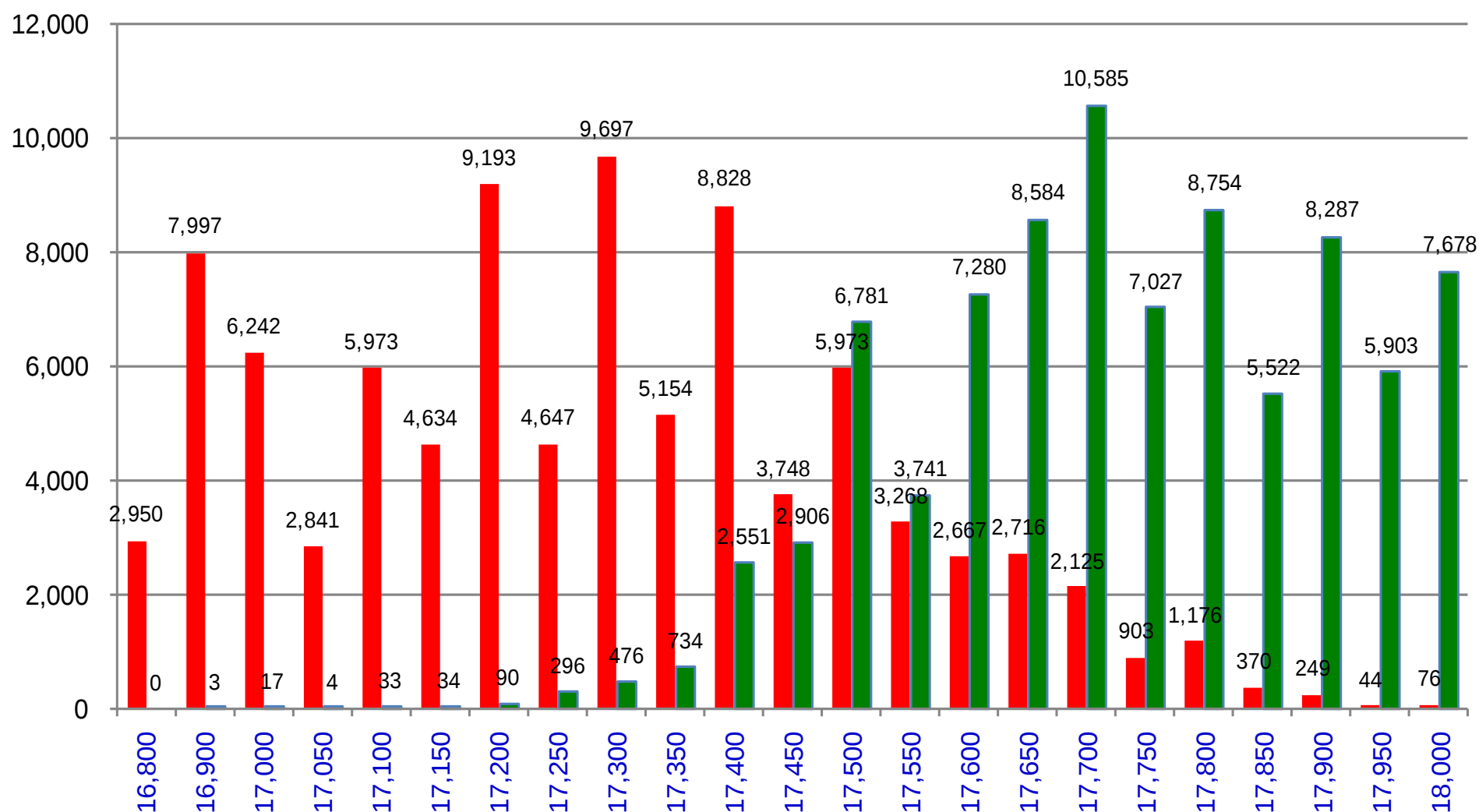


更新日期：2022年3月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：101,900

週選 CALL OI 總額：103,309



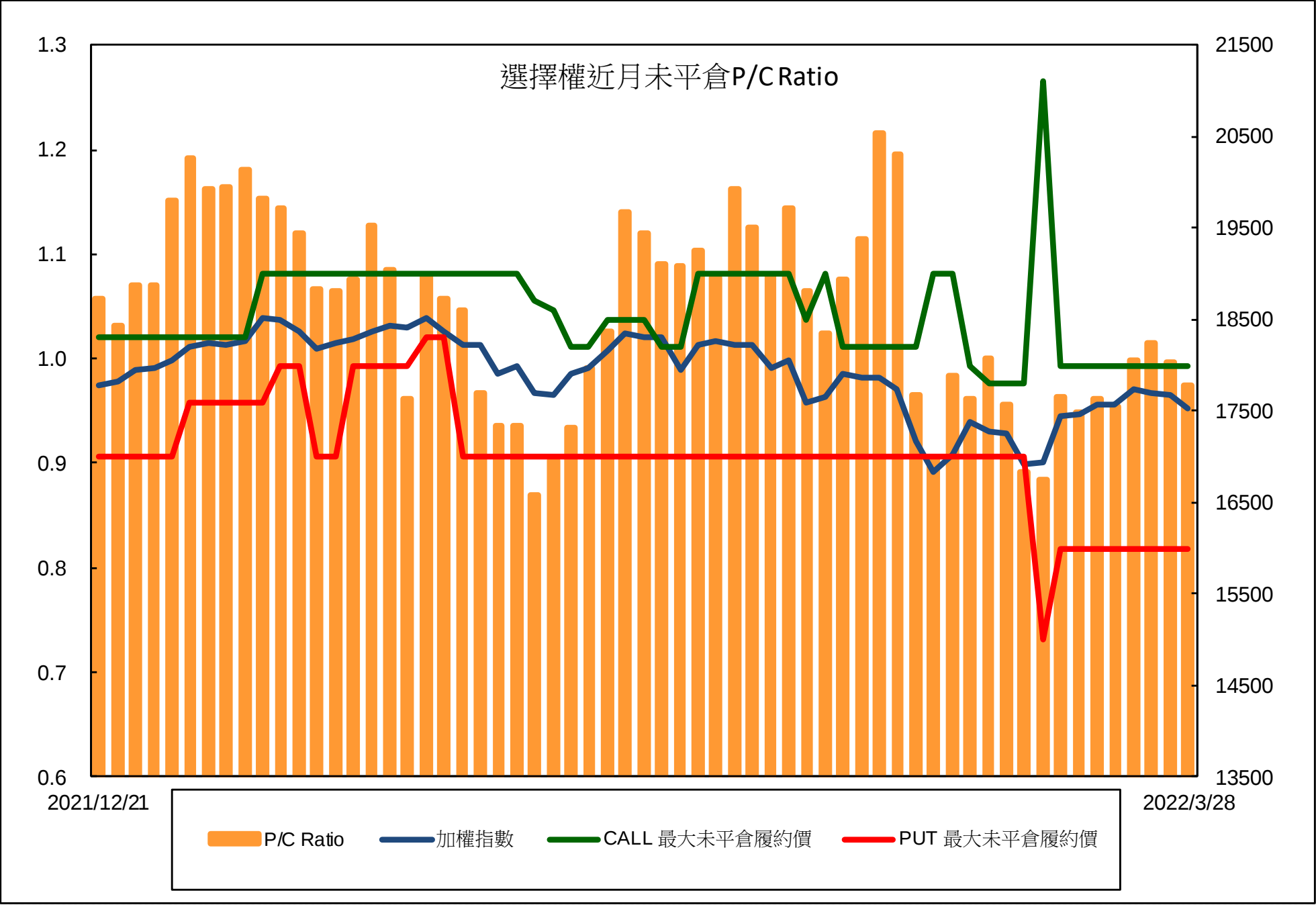
更新日期：2022年3月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

自營商選擇權OI部位統計

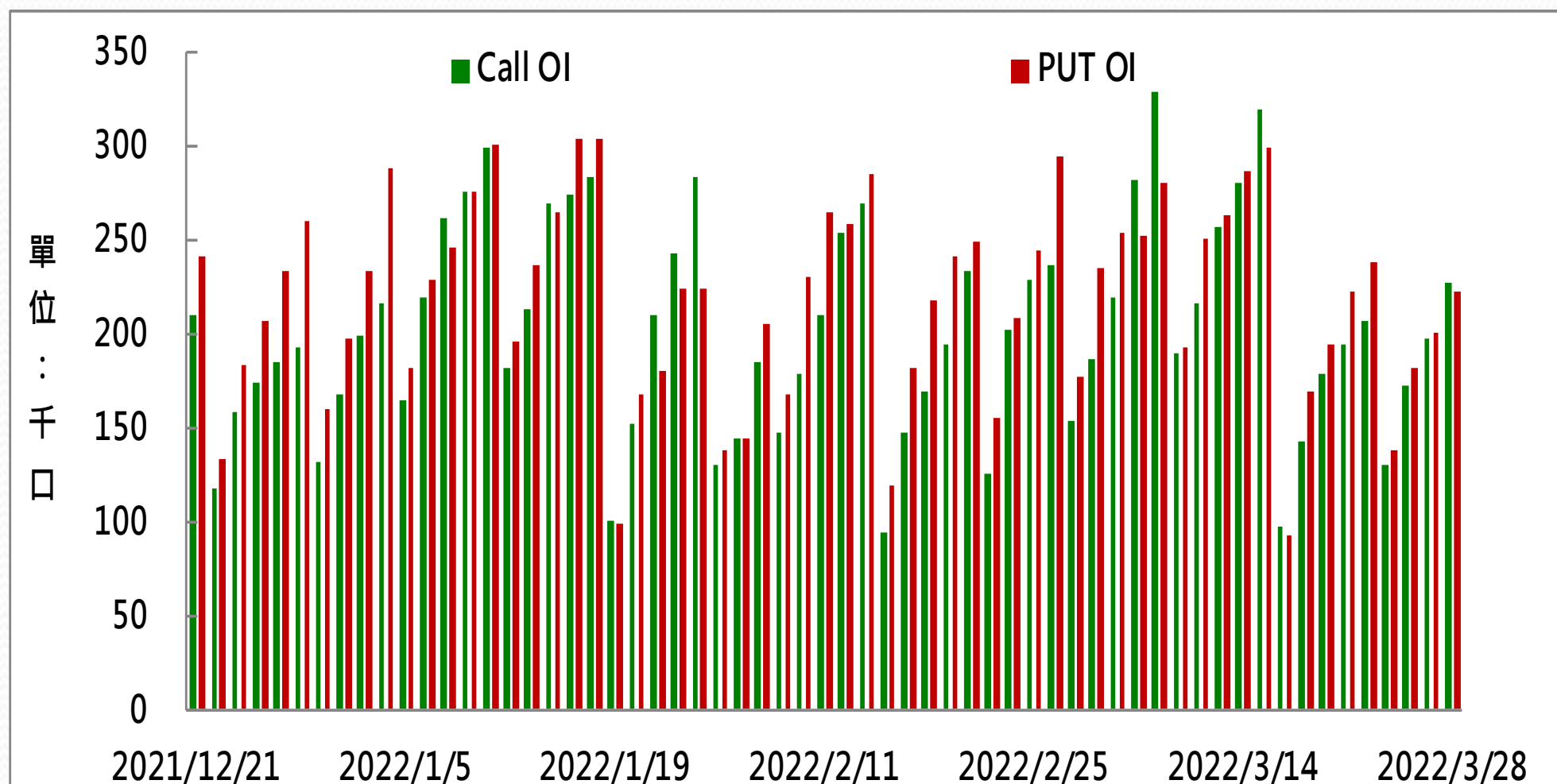
選擇權	日期	買方口數	賣方口數	自營商選擇權 多空淨額(口)
Call	3月25日	79,797	47,520	32,277
	3月28日	83,895	57,328	26,567
Put	3月25日	52,742	48,119	4,623
	3月28日	53,434	51,275	2,159

更新日期：2022年3月28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



選擇權全月Put Call OI



更新日期：2022年3月28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28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