

台指選擇權OI匯報

日期：2022/3/29 結算日：2022/3/30					日期：2022/3/29 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
1	4	16,900	6,762	-1,235	0	100	16,300	1,939	-68
0	17	17,000	6,700	458	0	30	16,400	2,146	-88
3	7	17,050	2,456	-385	0	559	16,500	3,914	858 ※
-9	24	17,100	6,058	85	0	613	16,600	2,712	133
11	45	17,150	4,631	-3	0	1,090	16,700	4,298	-205
0	90	17,200	9,147	-46	-2	1,352	16,800	6,139	279
-24	272	17,250	6,183	1,536	2	1,779	16,900	3,555	299
-38	438	17,300	9,629	-68	-17	1,619	17,000	5,721	281
30	764	17,350	8,624	3,470	7	1,081	17,100	2,991	373
-104	2,447	17,400	10,826	1,998	30	1,651	17,200	3,025	269
-334	2,572	17,450	7,480	3,732	14	2,065	17,300	3,002	780
-264	6,517	17,500	10,587	4,614 ※	102	1,996	17,400	3,126	240
2,655	6,396	17,550	7,290	4,022	-152	2,427	17,500	3,339	134
2,359	9,639	17,600	5,211	2,544	-44	2,879	17,600	2,173	120
※ 4,031	12,615	17,650	2,862	146	151	4,137	17,700	1,599	28
3,652	14,237	17,700	2,284	159	83	5,117	17,800	615	26
1,726	8,753	17,750	965	62	557	5,084	17,900	634	14
103	8,857	17,800	1,342	166	※ 795	13,355	18,000	601	40
7	5,529	17,850	493	123	133	6,775	18,100	429	0
-1,625	6,662	17,900	270	21	60	7,265	18,200	208	1
-409	5,494	17,950	38	-6	102	5,996	18,300	88	-3
-286	7,392	18,000	74	-2	64	4,300	18,400	52	0
-340	3,802	18,050	47	-8	18	4,544	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
10,759	114,068	1.0746	122,579	20,679	1,641	99,661	1.0091	100,571	4,998
昨日 P/C	0.9864	今日增減變化		0.0883	昨日 P/C	0.9750	今日增減變化		0.0341

更新日期：2022年3月29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29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	82,911,525	101,559,952	-18,648,427	10,760,161	2,570,902	1,113,073	1,457,829	473,973
投信	34,653,350	54,329,434	-19,676,084	470,626	466,243	0	466,243	3,635
自營商	69,835,720	24,504,410	45,331,310	-1,050,364	1,313,234	853,595	459,639	-100,673
	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	689,250	3,359,864	-2,670,614	97,772	68,614	1,674	66,940	396
投信	27,570	0	27,570	33	1,674	0	1,674	10
自營商	624,798	187,475	437,323	29,896	239,305	331,339	-92,034	-552

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29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	25,134	18,424	6,710	522	48,667	15,559	33,108	191
投信	0	50	-50	0	100	63	37	0
自營商	84,372	58,159	26,213	-354	56,068	55,986	82	-2,077
特定法人(週)	2,239	0	2,239	1,464	0	2,291	-2,291	-1,195
特定法人(近月)	13,888	18,756	-4,868	0	4,479	25,317	-20,838	-100
特定法人(全月)	14,280	15,733	-1,453	2,930	0	36,960	-36,960	-82
十大交易人(週)	26,049	39,603	-13,554	-774	35,501	26,409	9,092	7,319
十大交易人(近月)	59,149	42,180	16,969	1,303	38,035	48,746	-10,711	-188
十大交易人(全月)	98,072	74,752	23,320	-703	78,679	87,938	-9,259	7,312
全市場未沖銷(近月)			99,661	1,641			100,571	4,998
全市場未沖銷(全月)			240,114	12,770			248,274	26,071

更新日期：2022年3月29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	17500	賣權OI最大量	17400
	整體隱含波動率	10.21%	較前一交易日	-3.13%
	買權隱含波動率	10.68%	較前一交易日	+2.57%
	賣權隱含波動率	9.81%	較前一交易日	-8.91%
電子選擇權	買權成交最大量	850	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	1900	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29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	+0.00%
	買權隱含波動率	12.21%	較前一交易日	+0.00%
	賣權隱含波動率	22.42%	較前一交易日	+0.00%
	成交量P/C_Ratio值	1.250	較前一交易日	+0.20
	未平倉P/C_Ratio值	1.009	較前一交易日	+0.03
電子選擇權	買權成交最大量	850	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	1900	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29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

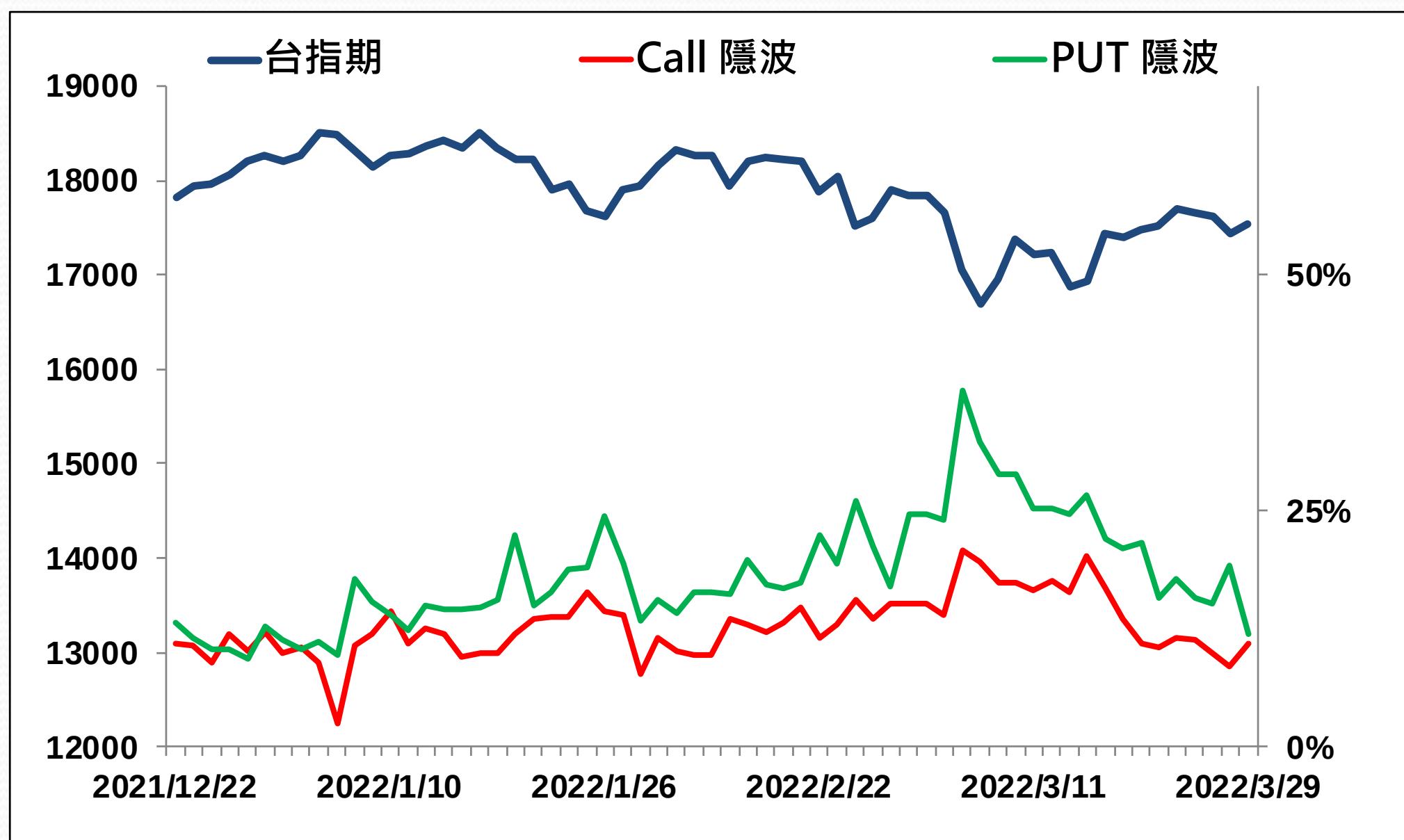
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



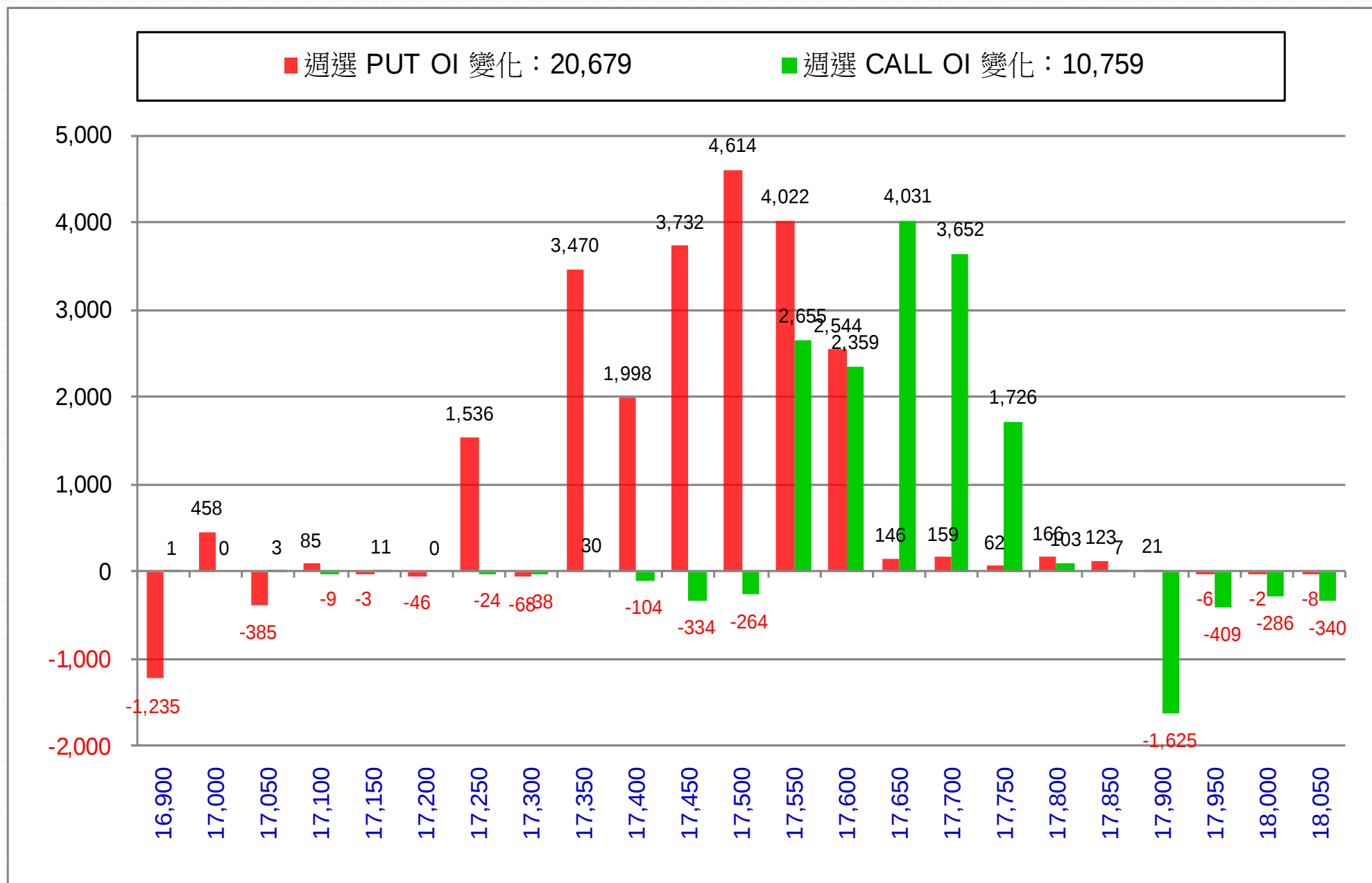
更新日期：2022年3月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年3月29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

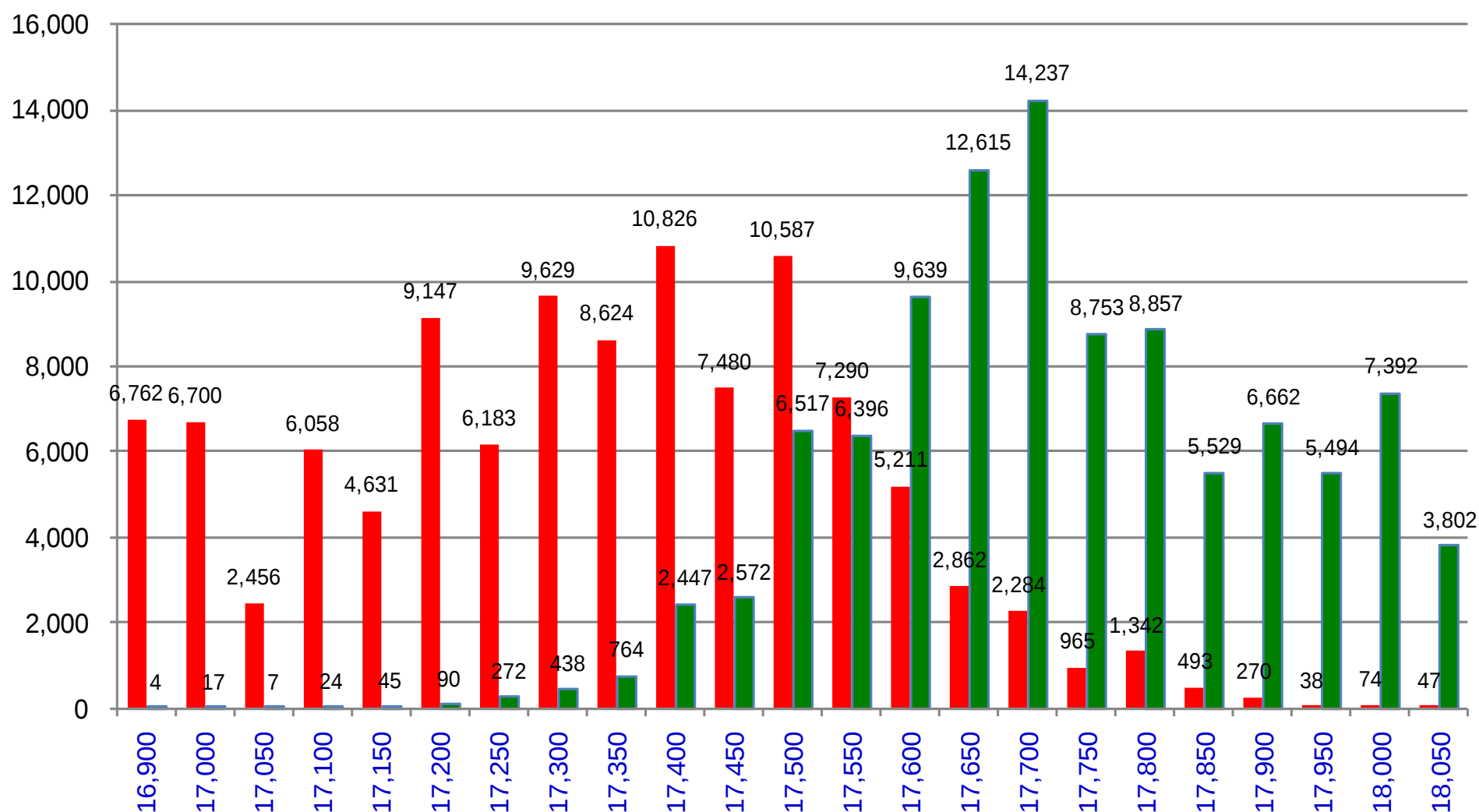


更新日期：2022年3月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：122,579

週選 CALL OI 總額：114,068



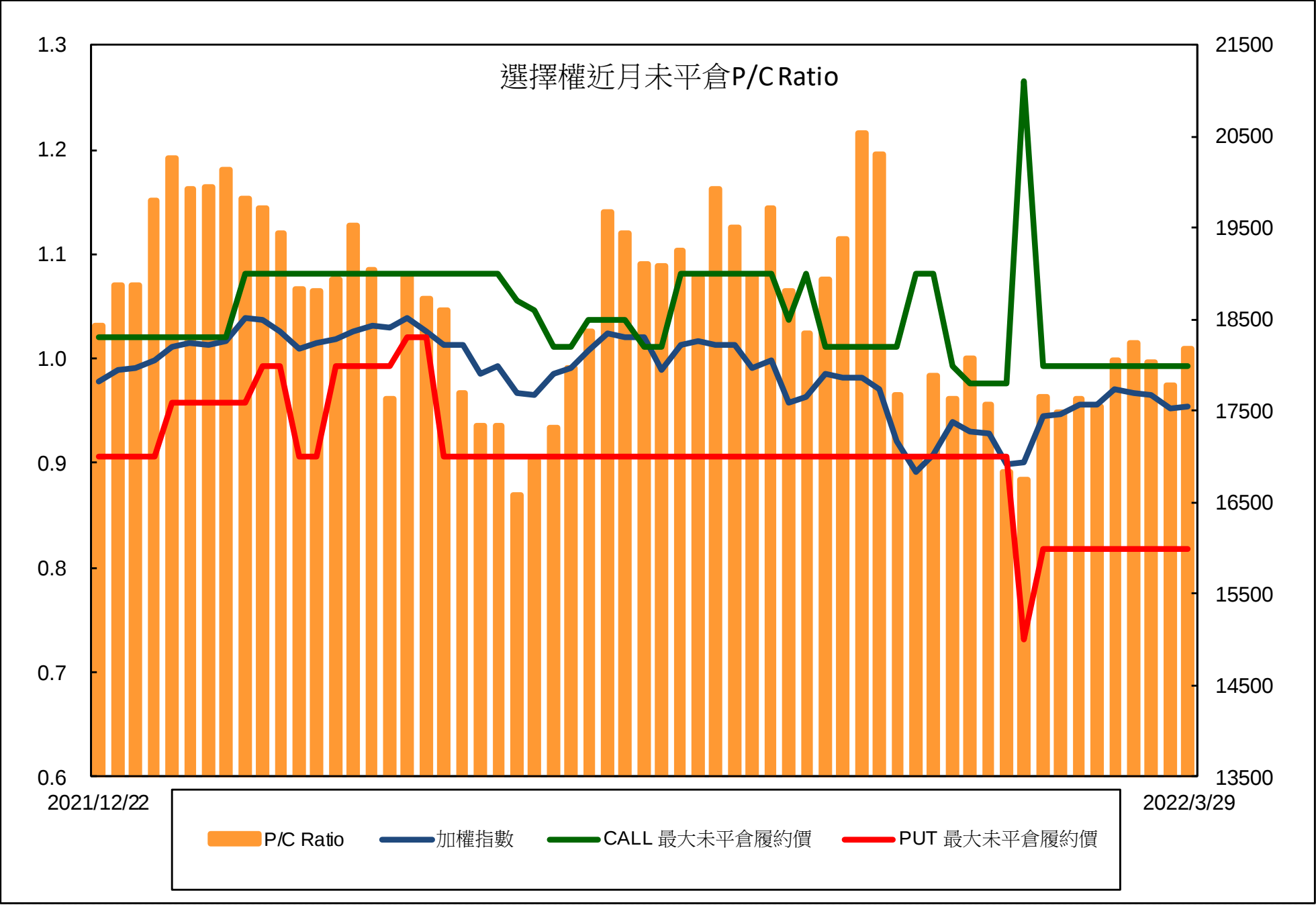
更新日期：2022年3月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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28日	83,895	57,328	26,567
	3月29日	84,372	58,159	26,213
Put	3月28日	53,434	51,275	2,159
	3月29日	56,068	55,986	82

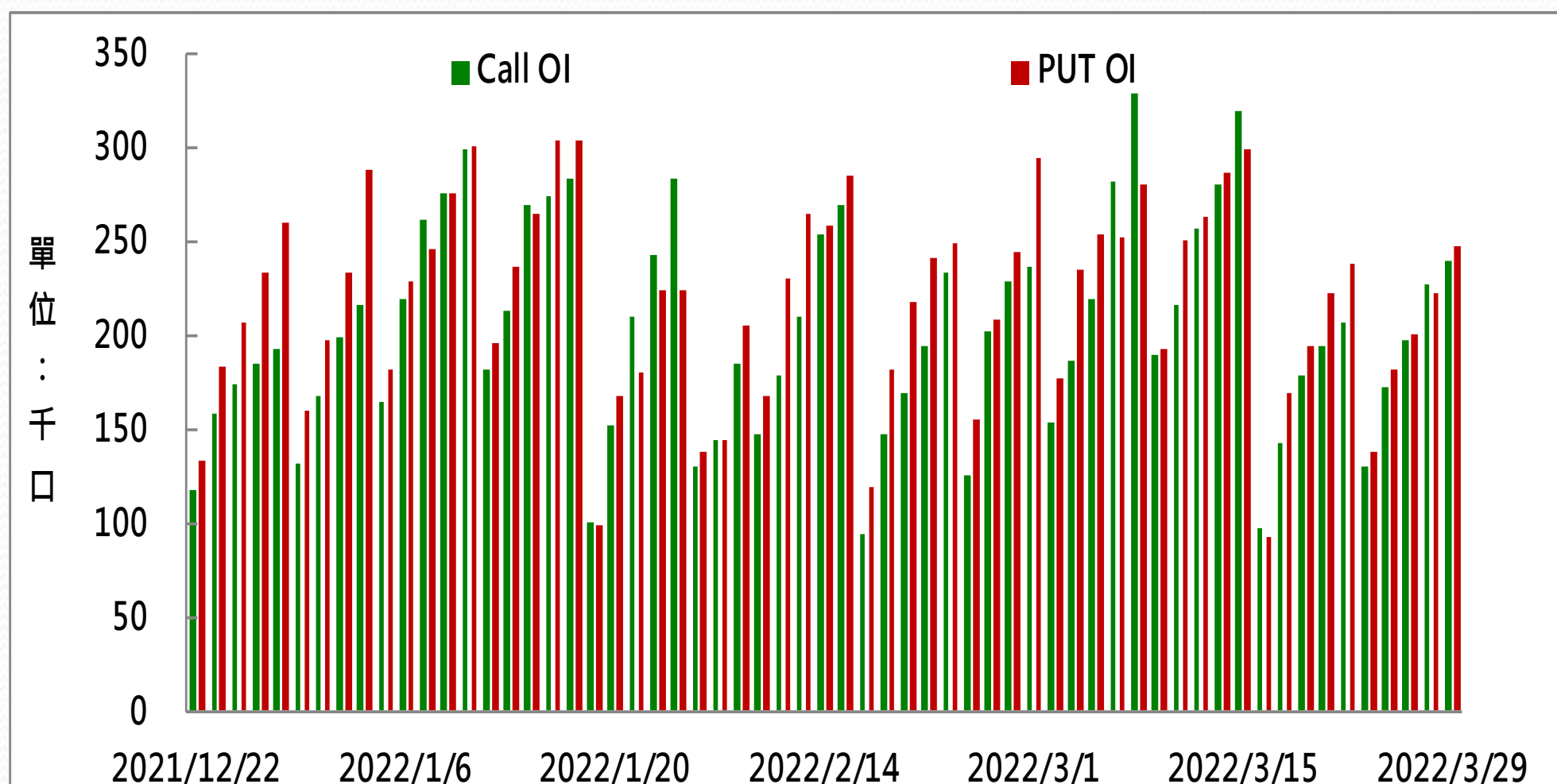
更新日期：2022年3月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年3月29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29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29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