

台指選擇權OI匯報

日期：2022/3/30 結算日：2022/4/6					日期：2022/3/30 結算日：2022/4/20				
202204W1					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
5	5	17,150	678	678	0	559	16,500	3,838	-76
0	0	17,200	1,099	1,099	-1	612	16,600	2,441	-271
18	18	17,250	418	418	-1	1,089	16,700	4,125	-173
6	6	17,300	1,930	1,930	-1	1,351	16,800	6,072	-67
17	17	17,350	999	999	0	1,779	16,900	3,592	37
37	37	17,400	2,824	2,824	-3	1,616	17,000	6,334	613
11	11	17,450	1,558	1,558	3	1,084	17,100	4,054	1,063
150	150	17,500	2,930	2,930	-21	1,630	17,200	3,582	557
103	103	17,550	690	690	-40	2,025	17,300	3,624	622
231	231	17,600	1,799	1,799	-188	1,808	17,400	3,495	369
568	568	17,650	796	796	-285	2,142	17,500	3,850	511
1,442	1,442	17,700	1,834	1,834	-106	2,773	17,600	2,446	273
1,397	1,397	17,750	652	652	-274	3,863	17,700	2,175	576
1,532	1,532	17,800	336	336	-73	5,044	17,800	826	211
1,029	1,029	17,850	133	133	-309	4,775	17,900	828	194
1,857	1,857	17,900	284	284	241	13,596	18,000	664	63
1,515	1,515	17,950	140	140	703	7,478	18,100	452	23
※ 2,414	2,414	18,000	65	65	106	7,371	18,200	209	1
1,856	1,856	18,050	7	7	621	6,617	18,300	88	0
1,970	1,970	18,100	7	7	647	4,947	18,400	53	1
1,480	1,480	18,200	7	7	-35	4,509	18,500	5	0
860	860	18,300	2	2	89	2,802	18,600	15	3
133	133	18,400	6	6	201	3,873	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
18,689	18,689	1.3134	24,546	24,546	1,383	101,044	1.0533	106,427	5,856
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化		1.3134	昨日 P/C	1.0091	今日增減變化		0.0441

更新日期：2022年3月30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30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	94,319,670	111,752,103	-17,432,433	1,215,994	2,708,571	1,036,901	1,671,670	213,841
投信	35,338,080	53,581,896	-18,243,816	1,432,268	471,923	0	471,923	5,680
自營商	69,452,288	25,036,099	44,416,189	-915,121	1,402,307	910,511	491,796	32,157
	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	754,592	3,248,833	-2,494,241	176,373	52,291	0	52,291	-14,649
投信	27,879	0	27,879	309	1,687	0	1,687	13
自營商	622,516	226,749	395,767	-41,556	224,338	298,550	-74,212	17,822

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30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	22,979	15,239	7,740	1,030	43,879	13,207	30,672	-2,436
投信	0	50	-50	0	100	63	37	0
自營商	70,840	38,768	32,072	5,859	38,410	45,688	-7,278	-7,360
特定法人(週)	0	0	0	---	0	0	0	---
特定法人(近月)	15,271	18,403	-3,132	1,736	6,579	25,317	-18,738	2,100
特定法人(全月)	14,854	15,733	-879	574	2,370	36,471	-34,101	2,859
十大交易人(週)	9,144	8,909	235	---	13,389	8,046	5,343	---
十大交易人(近月)	61,222	41,925	19,297	2,328	40,778	48,257	-7,479	3,232
十大交易人(全月)	90,334	57,615	32,719	9,399	62,565	72,890	-10,325	-1,066
全市場未沖銷(近月)			101,044	1,383			106,427	5,856
全市場未沖銷(全月)			147,464	-92,650			157,387	-90,887

更新日期：2022年3月30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 04W1 週 選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	17950	買權OI最大量	18000
	賣權成交最大量	17500	賣權OI最大量	17500
	整體隱含波動率	12.11%	較前一交易日	+1.90%
	買權隱含波動率	10.84%	較前一交易日	+0.16%
	賣權隱含波動率	13.22%	較前一交易日	+3.42%
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	800	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	1820	賣權OI最大量	1580

更新日期：2022年3月30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	16.02%	較前一交易日	+1.55%
	買權隱含波動率	12.47%	較前一交易日	+0.27%
	賣權隱含波動率	18.79%	較前一交易日	-3.63%
	成交量P/C_Ratio值	1.198	較前一交易日	-0.05
	未平倉P/C_Ratio值	1.053	較前一交易日	+0.04
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	800	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	1820	賣權OI最大量	1580

更新日期：2022年3月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

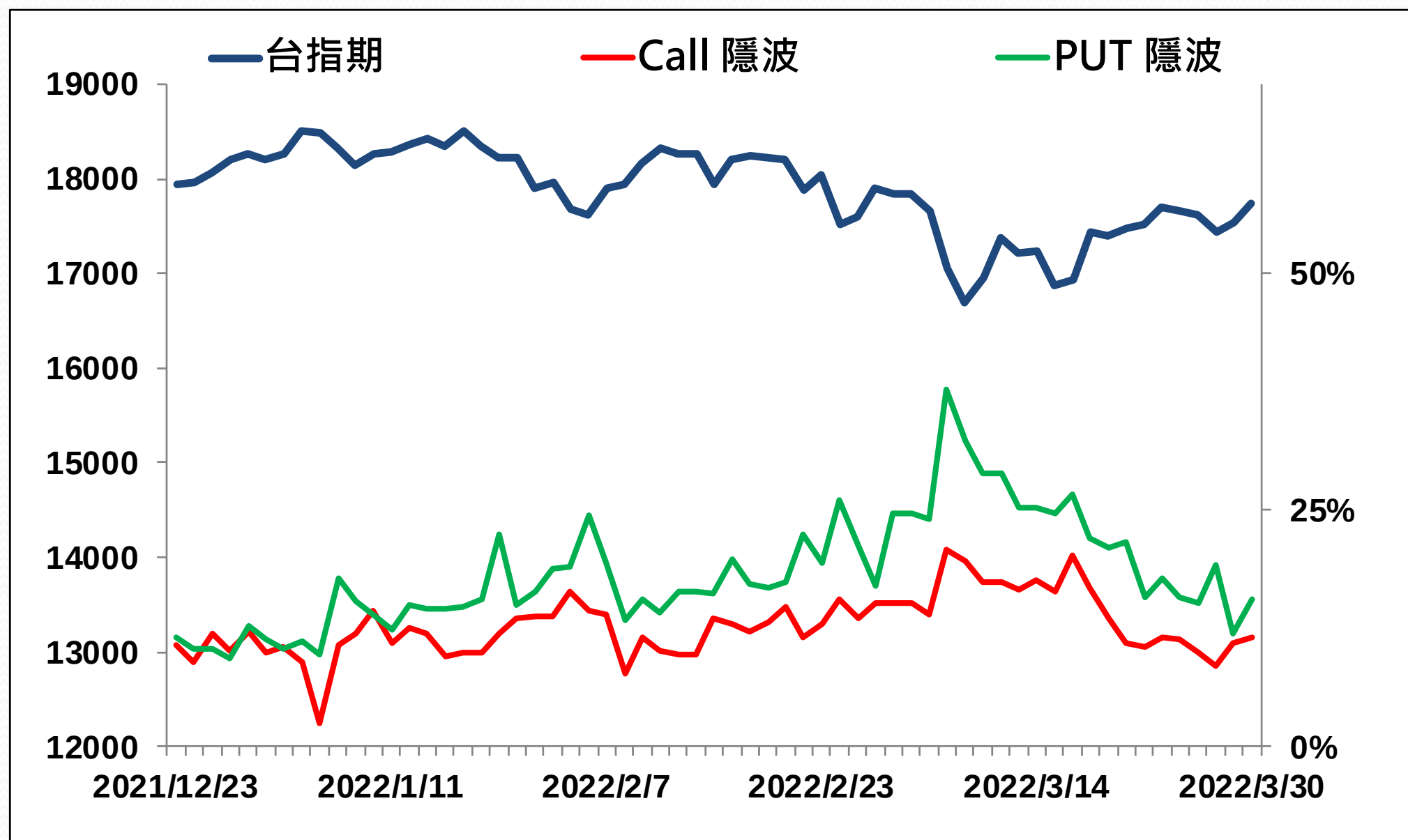
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



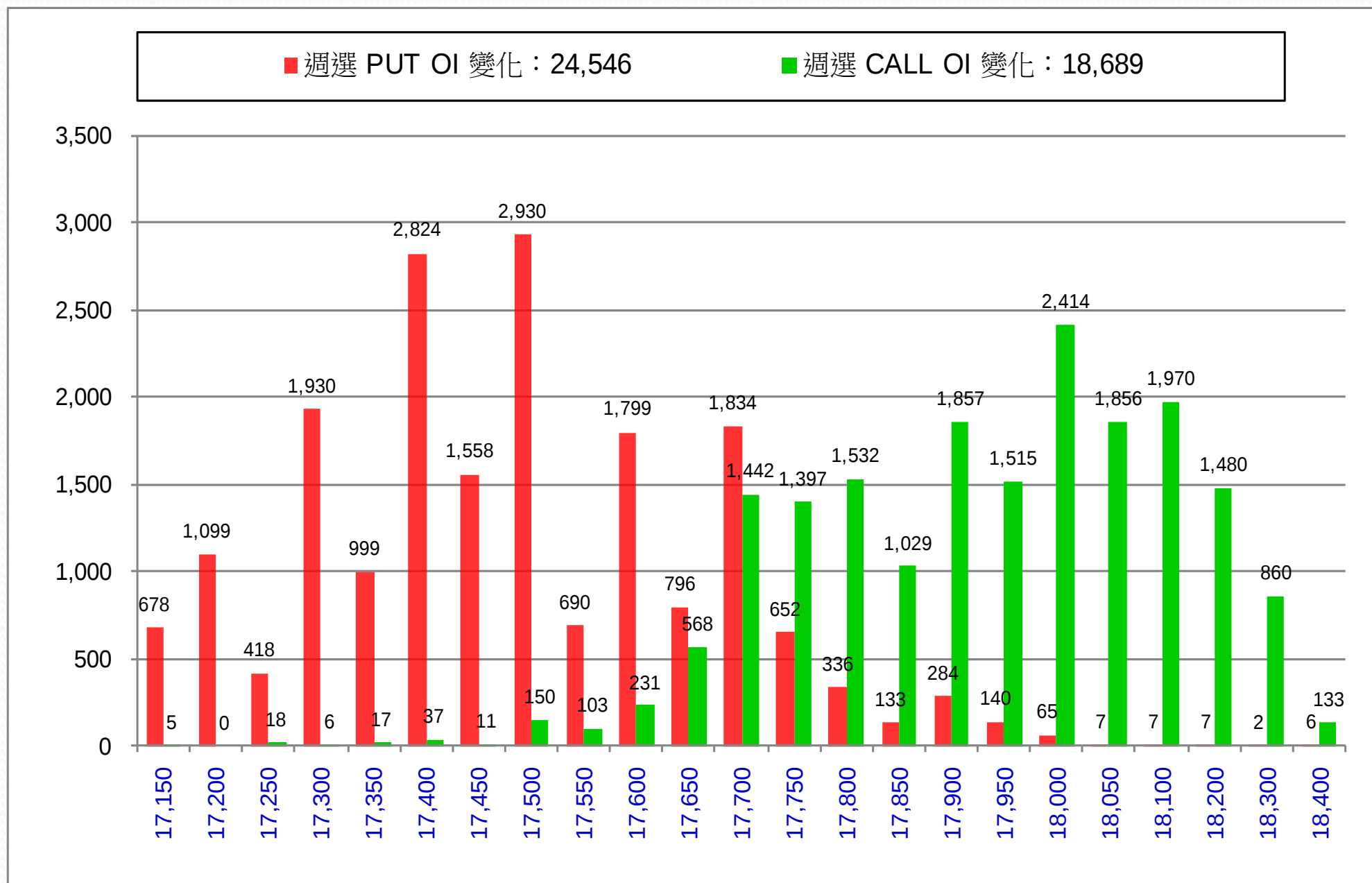
更新日期：2022年3月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年3月30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

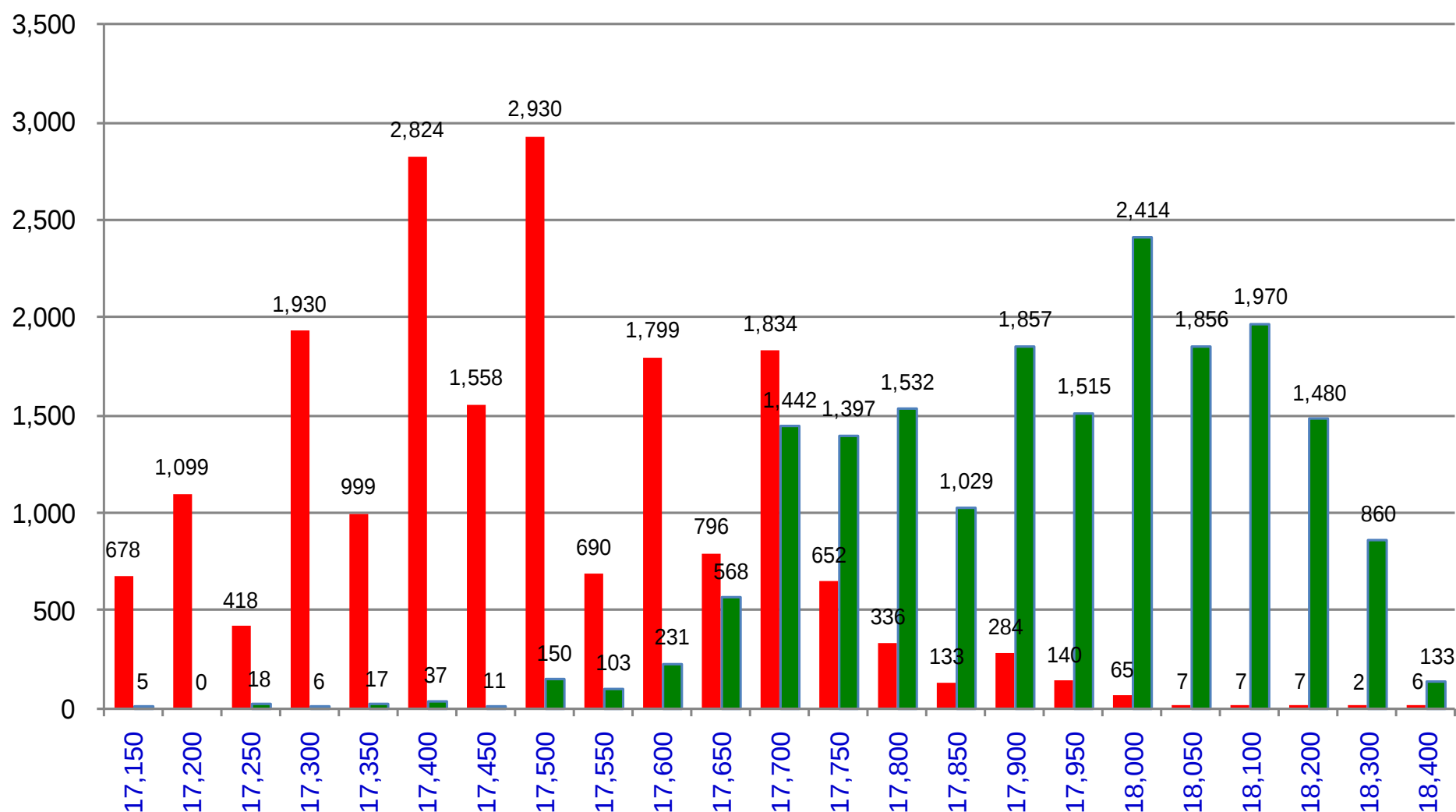


更新日期：2022年3月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：24,546

週選 CALL OI 總額：18,689



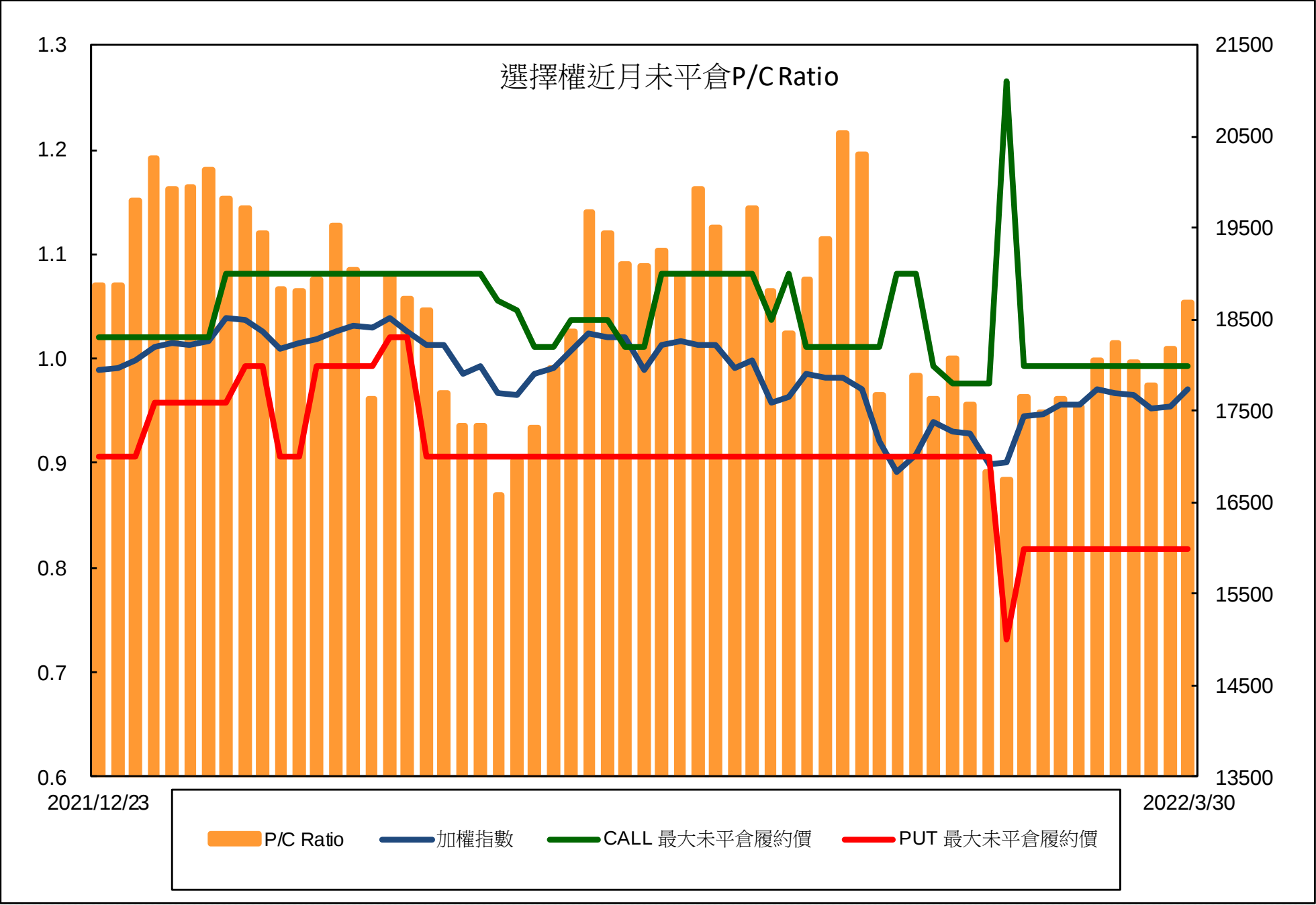
更新日期：2022年3月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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29日	84,372	58,159	26,213
	3月30日	70,840	38,768	32,072
Put	3月29日	56,068	55,986	82
	3月30日	38,410	45,688	-7,278

更新日期：2022年3月30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30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

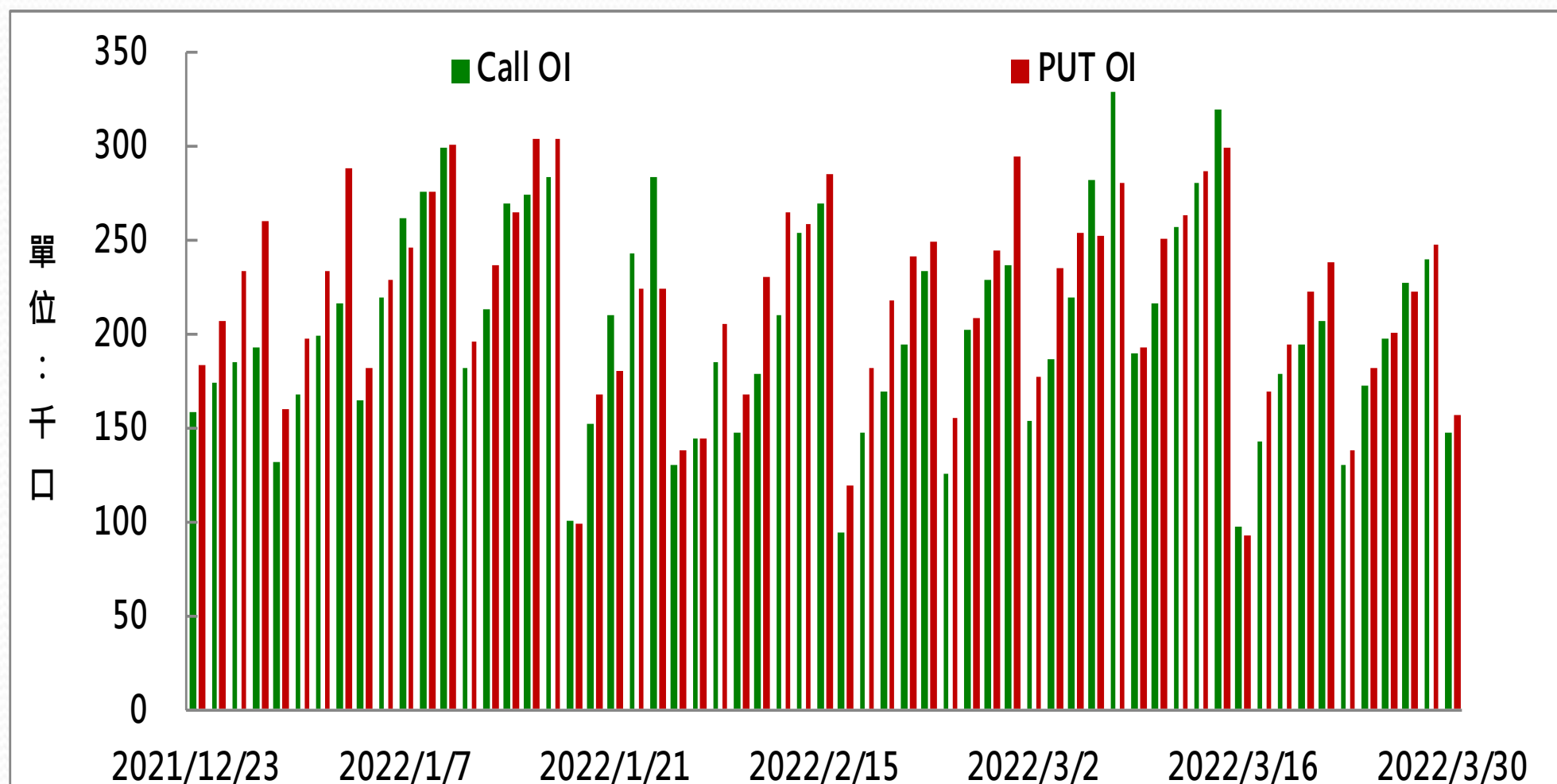


中華開發金控
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL



凱基期貨
KGI FUTURES

選擇權全月Put Call OI



更新日期：2022年3月30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30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