

台指選擇權OI匯報

日期：2022/3/31 結算日：2022/4/6					日期：2022/3/31 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
1	1	17,100	1,831	964	0	559	16,500	3,909	71
-5	0	17,150	1,664	986	1	613	16,600	2,427	-14
2	2	17,200	3,597	2,498	-10	1,079	16,700	4,216	91
0	18	17,250	2,028	1,610	-11	1,340	16,800	6,121	49
20	26	17,300	5,353	3,423	-1	1,778	16,900	3,519	-73
11	28	17,350	2,532	1,533	-4	1,612	17,000	6,759	425
56	93	17,400	5,062	2,238	-7	1,077	17,100	4,472	418
25	36	17,450	3,966	2,408	-27	1,603	17,200	3,893	311
340	490	17,500	5,064	2,134	-20	2,005	17,300	4,010	386
301	404	17,550	2,470	1,780	50	1,858	17,400	3,892	397
420	651	17,600	3,346	1,547	-48	2,094	17,500	4,000	150
651	1,219	17,650	2,278	1,482	-84	2,689	17,600	2,327	-119
1,428	2,870	17,700	3,397	1,563	203	4,066	17,700	2,246	71
2,985	4,382	17,750	1,790	1,138	54	5,098	17,800	819	-7
3,970	5,502	17,800	739	403	209	4,984	17,900	831	3
2,402	3,431	17,850	403	270	420	14,016	18,000	810	146
3,055	4,912	17,900	344	60	-768	6,710	18,100	454	2
3,536	5,051	17,950	208	68	※ 1,487	8,858	18,200	218	9
※ 4,832	7,246	18,000	152	87	1,085	7,702	18,300	87	-1
3,342	5,198	18,050	37	30	379	5,326	18,400	52	-1
2,828	4,798	18,100	9	2	-47	4,462	18,500	5	0
626	626	18,150	1	1	81	2,883	18,600	11	-4
935	2,415	18,200	3	-4	8	3,881	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
33,949	52,638	1.0549	55,528	30,982	2,887	103,931	1.0649	110,674	4,247
昨日 P/C	1.3134	今日增減變化		-0.2585	昨日 P/C	1.0533	今日增減變化		0.0116

更新日期：2022年3月31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31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	81,063,184	113,414,903	-32,351,719	-14,919,286	2,527,879	797,584	1,730,295	58,625
投信	34,989,383	53,840,129	-18,850,746	-606,930	468,004	0	468,004	-3,919
自營商	68,755,401	23,931,565	44,823,836	407,647	1,212,706	939,194	273,512	-218,284
	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	783,917	3,180,681	-2,396,764	97,477	108,934	0	108,934	56,643
投信	28,131	0	28,131	252	1,676	0	1,676	-11
自營商	605,643	270,058	335,585	-60,182	172,612	299,972	-127,360	-53,148

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31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	28,156	18,614	9,542	1,802	46,714	14,695	32,019	1,347
投信	0	100	-100	-50	200	63	137	100
自營商	74,123	48,230	25,893	-6,179	47,357	49,642	-2,285	4,993
特定法人(週)	0	0	0	0	0	1,461	-1,461	-1,461
特定法人(近月)	20,390	21,486	-1,096	2,036	6,578	25,367	-18,789	-51
特定法人(全月)	17,581	16,224	1,357	2,236	0	37,292	-37,292	-3,191
十大交易人(週)	15,572	21,855	-6,283	-6,518	23,137	16,253	6,884	1,541
十大交易人(近月)	62,377	41,195	21,182	1,885	42,768	49,436	-6,668	811
十大交易人(全月)	95,922	62,948	32,974	255	71,530	81,405	-9,875	450
全市場未沖銷(近月)			103,931	2,887			110,674	4,247
全市場未沖銷(全月)			185,262	37,798			193,314	35,927

更新日期：2022年3月31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	17800	買權OI最大量	18000
	賣權成交最大量	17700	賣權OI最大量	17300
	整體隱含波動率	11.60%	較前一交易日	-0.51%
	買權隱含波動率	9.33%	較前一交易日	-1.51%
	賣權隱含波動率	13.81%	較前一交易日	+0.58%
電子選擇權	買權成交最大量	855	買權OI最大量	855
	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	1980	買權OI最大量	1780
	賣權成交最大量	1840	賣權OI最大量	1840

更新日期：2022年3月31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	18200	買權OI最大量	18000
	賣權成交最大量	17300	賣權OI最大量	16000
	整體隱含波動率	15.72%	較前一交易日	+0.31%
	買權隱含波動率	11.56%	較前一交易日	-0.91%
	賣權隱含波動率	20.26%	較前一交易日	+1.47%
	成交量P/C_Ratio值	0.969	較前一交易日	-0.23
	未平倉P/C_Ratio值	1.065	較前一交易日	+0.01
電子選擇權	買權成交最大量	855	買權OI最大量	855
	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	1980	買權OI最大量	1780
	賣權成交最大量	1840	賣權OI最大量	1840

更新日期：2022年3月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

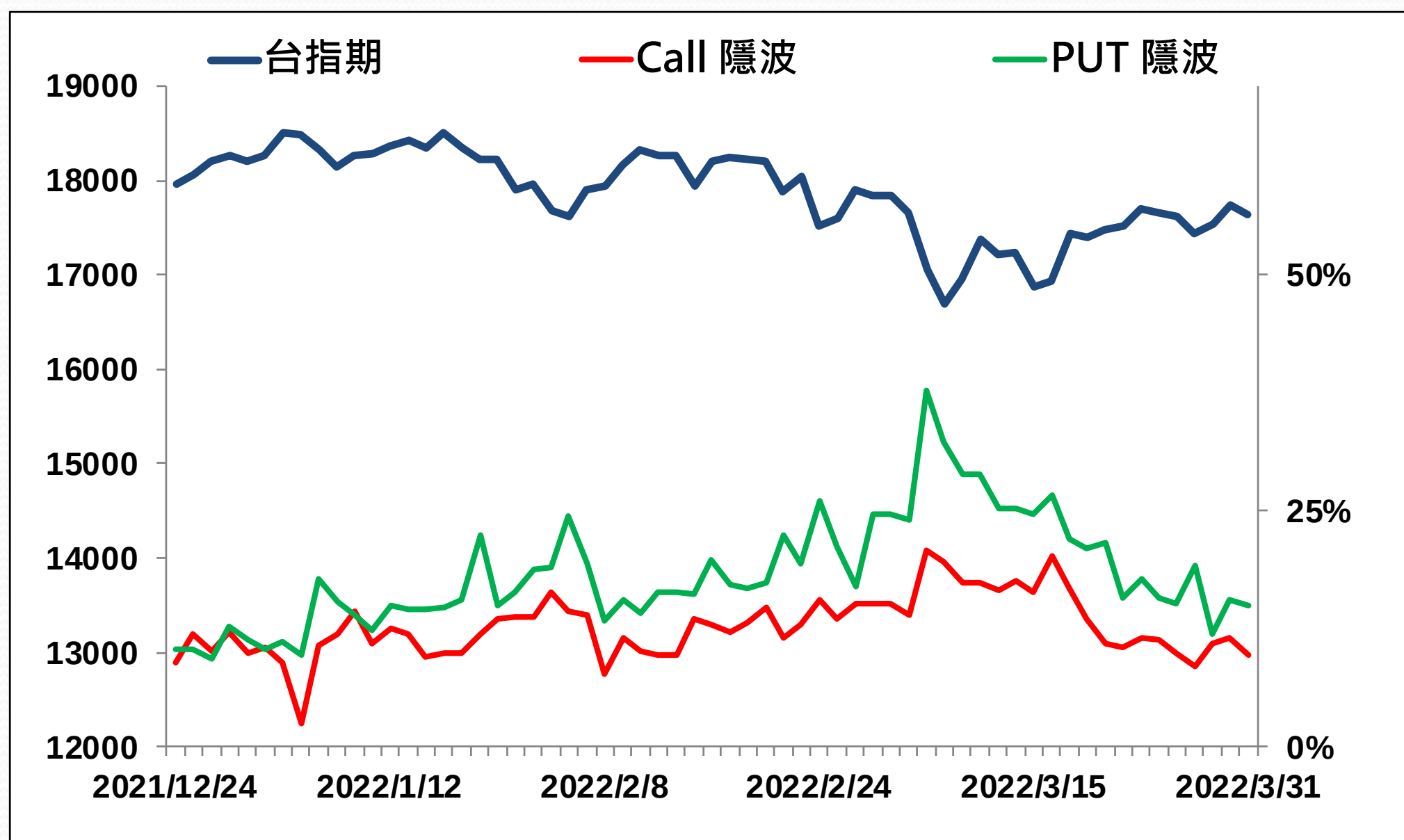
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



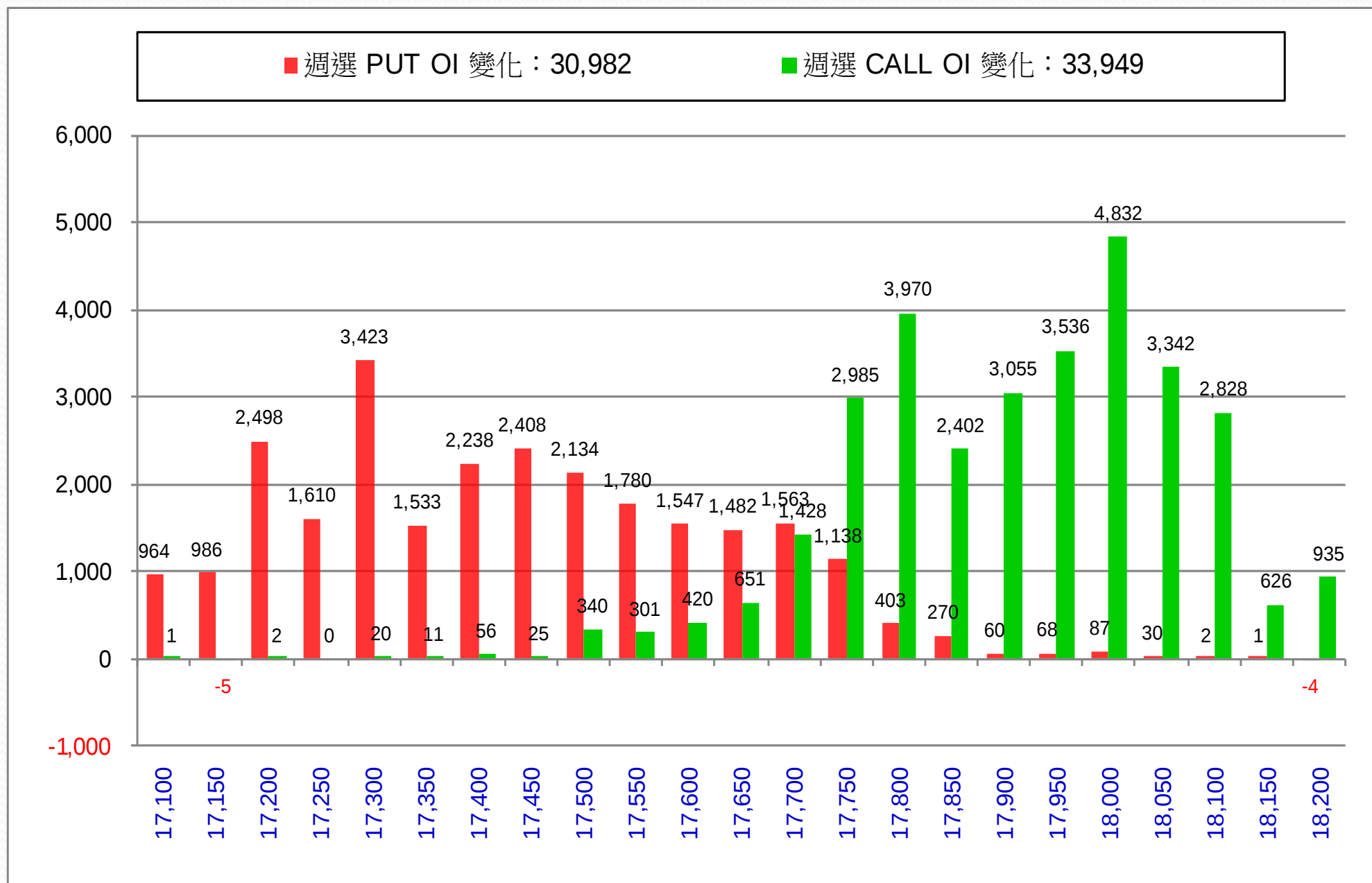
更新日期：2022年3月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年3月31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

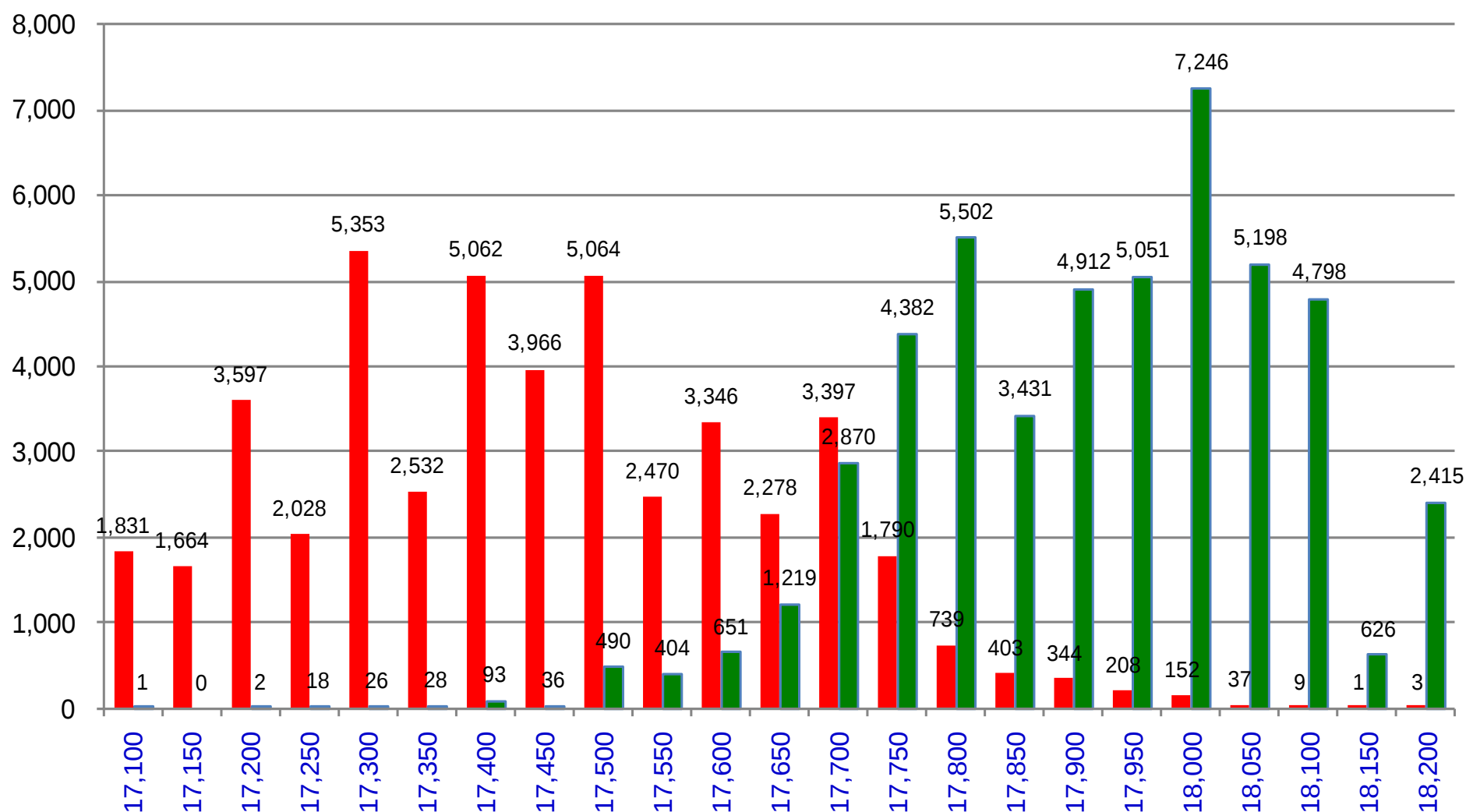


更新日期：2022年3月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：55,528

■ 週選 CALL OI 總額：52,638



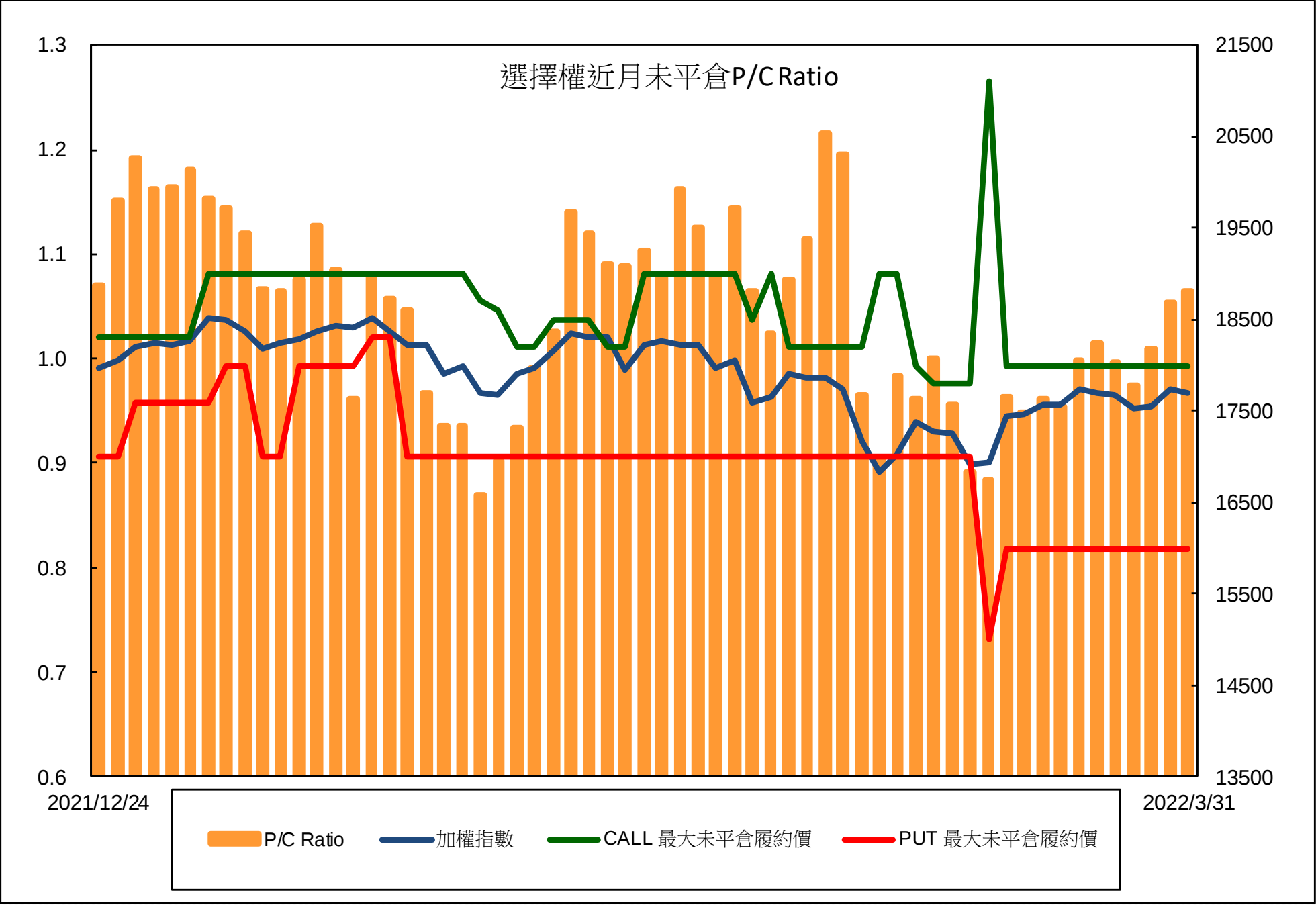
更新日期：2022年3月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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30日	70,840	38,768	32,072
	3月31日	74,123	48,230	25,893
Put	3月30日	38,410	45,688	-7,278
	3月31日	47,357	49,642	-2,285

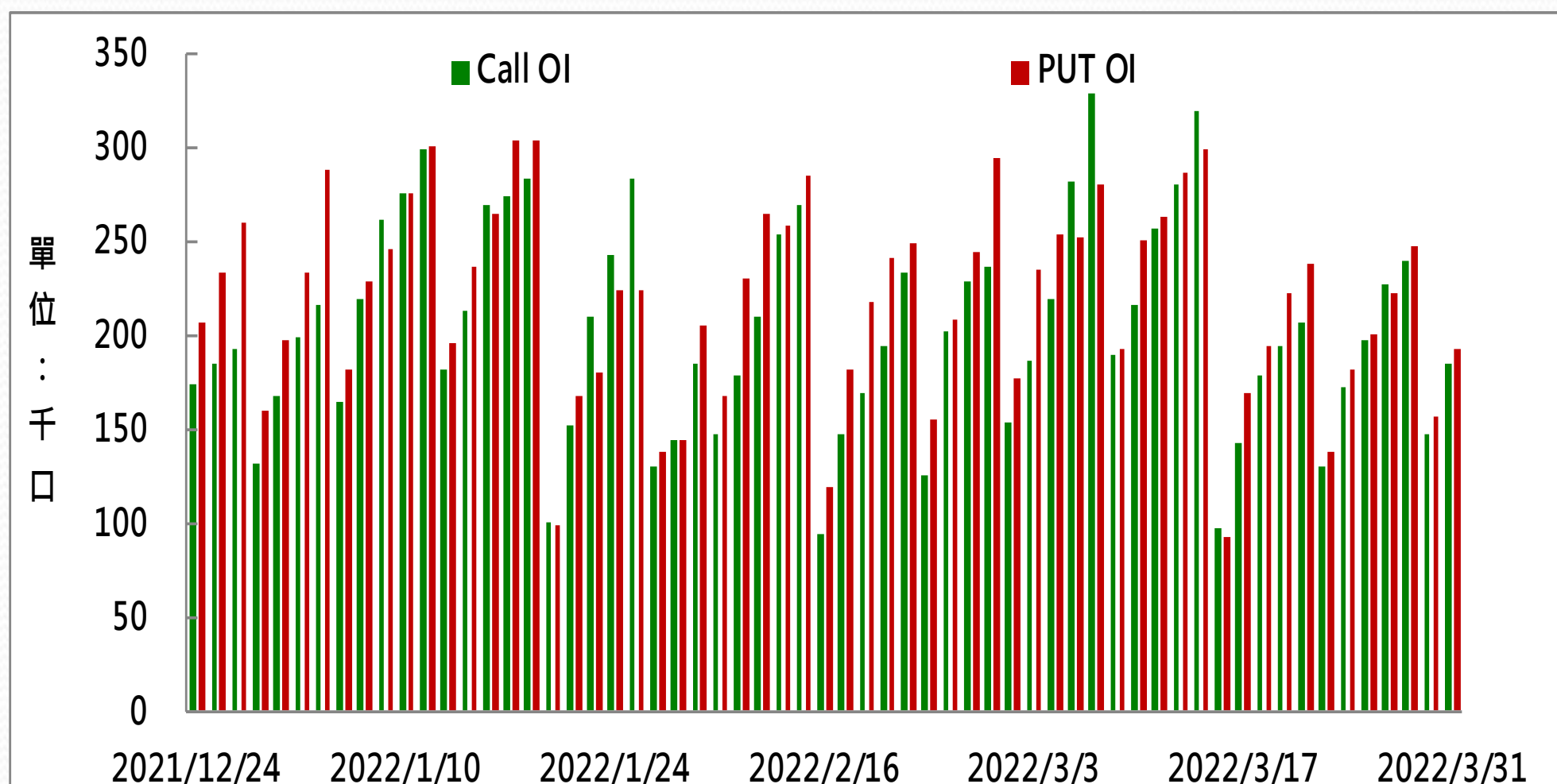
更新日期：2022年3月31日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年3月31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31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31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