

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/1/20 結算日：2022/1/26					日期：2022/1/20 結算日：2022/2/16				
202201W4					202202 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
9	22	17,700	6,310	4,795	0	13	17,200	1,309	248
2	2	17,750	1,204	1,204	5	24	17,300	1,811	164
36	102	17,800	6,738	5,006	2	68	17,400	3,000	633
8	10	17,850	3,863	3,085	589	691	17,500	2,922	229
24	39	17,900	4,207	3,163	459	544	17,600	3,218	279
59	73	17,950	3,552	2,809	102	197	17,700	3,544	361
211	266	18,000	6,024	4,514	142	520	17,800	4,506	452
76	151	18,050	2,296	1,603	36	201	17,900	2,845	137
293	636	18,100	3,566	2,523	116	572	18,000	2,899	70
432	748	18,150	2,458	1,657	148	657	18,100	1,341	57
1,324	1,894	18,200	4,589	3,250	495	2,773	18,200	3,013	663
1,679	2,479	18,250	2,086	1,710	1,232	2,631	18,300	891	136
2,594	3,775	18,300	1,316	664	847	2,963	18,400	1,296	4
1,653	3,168	18,350	392	108	895	3,750	18,500	485	-17
2,426	4,916	18,400	240	34	644	4,228	18,600	160	-11
2,214	3,647	18,450	116	91	1,170	5,834	18,700	84	19
4,082	6,749	18,500	175	126	661	5,585	18,800	199	3
3,115	5,380	18,550	38	26	460	4,649	18,900	19	1
7,266	11,562	18,600	38	29	815	7,229	19,000	36	-1
5,420	8,421	18,650	25	7	265	3,517	19,100	11	0
1,707	5,056	18,700	22	3	-119	3,238	19,200	23	0
283	2,726	18,750	1	1	446	1,948	19,300	1	0
281	2,121	18,800	2	0	214	1,360	19,400	414	0
-105	1,251	18,850	0	0	※ 1,636	3,624	19,500	17	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
37,502	70,467	1.2640	89,069	58,561	12,100	64,444	0.9676	62,358	7,546
昨日 P/C	0.9255	今日增減變化		0.3385	昨日 P/C	1.0471	今日增減變化		-0.0795

更新日期：2022年1月20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1月20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	79,576,663	170,162,968	-90,586,305	-1,772,221	3,590,141	3,216,682	373,459	-114,292
投信	60,128,266	53,228,659	6,899,607	646,496	567,235	0	567,235	2,286
自營商	65,643,583	8,772,535	56,871,048	3,635,869	1,951,853	1,187,318	764,535	66,244
	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	745,429	4,463,637	-3,718,208	-171,414	3,312	226,886	-223,574	-91,870
投信	23,239	0	23,239	-13	1,656	0	1,656	10
自營商	732,821	87,578	645,243	72,986	342,813	165,602	177,211	96,542

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報

2022年1月20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	21,009	20,487	522	-2,791	40,751	23,179	17,572	1,597
投信	0	0	0	0	0	58	-58	0
自營商	42,812	34,987	7,825	1,350	43,818	36,261	7,557	12,344
特定法人(週)	4,332	0	4,332	2,331	0	10,094	-10,094	-1,243
特定法人(近月)	9,965	15,953	-5,988	-2,611	12,169	23,153	-10,984	-2,817
特定法人(全月)	15,911	13,926	1,985	-552	8,916	34,994	-26,078	-5,446
十大交易人(週)	22,952	26,155	-3,203	-4,156	36,080	40,252	-4,172	-4,361
十大交易人(近月)	29,544	29,638	-94	-950	27,040	36,884	-9,844	-2,951
十大交易人(全月)	58,703	51,934	6,769	-2,507	60,249	78,595	-18,346	-9,980
全市場未沖銷(近月)			64,444	12,100			62,358	7,546
全市場未沖銷(全月)			152,968	51,812			167,496	67,995

更新日期：2022年1月20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01W4週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	18500	買權OI最大量	18600
	賣權成交最大量	18000	賣權OI最大量	17600
	整體隱含波動率	13.93%	較前一交易日	-3.02%
	買權隱含波動率	13.53%	較前一交易日	+1.98%
	賣權隱含波動率	14.26%	較前一交易日	-8.31%
電子選擇權	買權成交最大量	910	買權OI最大量	920
	賣權成交最大量	860	賣權OI最大量	800
金融選擇權	買權成交最大量	1820	買權OI最大量	1880
	賣權成交最大量	1720	賣權OI最大量	1720

更新日期：2022年1月20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02月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	18700	買權OI最大量	19000
	賣權成交最大量	18000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	16.66%	較前一交易日	+0.36%
	買權隱含波動率	13.89%	較前一交易日	+1.02%
	賣權隱含波動率	20.11%	較前一交易日	-1.87%
	成交量P/C_Ratio值	0.802	較前一交易日	-0.04
	未平倉P/C_Ratio值	0.968	較前一交易日	-0.08
電子選擇權	買權成交最大量	910	買權OI最大量	920
	賣權成交最大量	860	賣權OI最大量	800
金融選擇權	買權成交最大量	1820	買權OI最大量	1880
	賣權成交最大量	1720	賣權OI最大量	1720

更新日期：2022年1月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

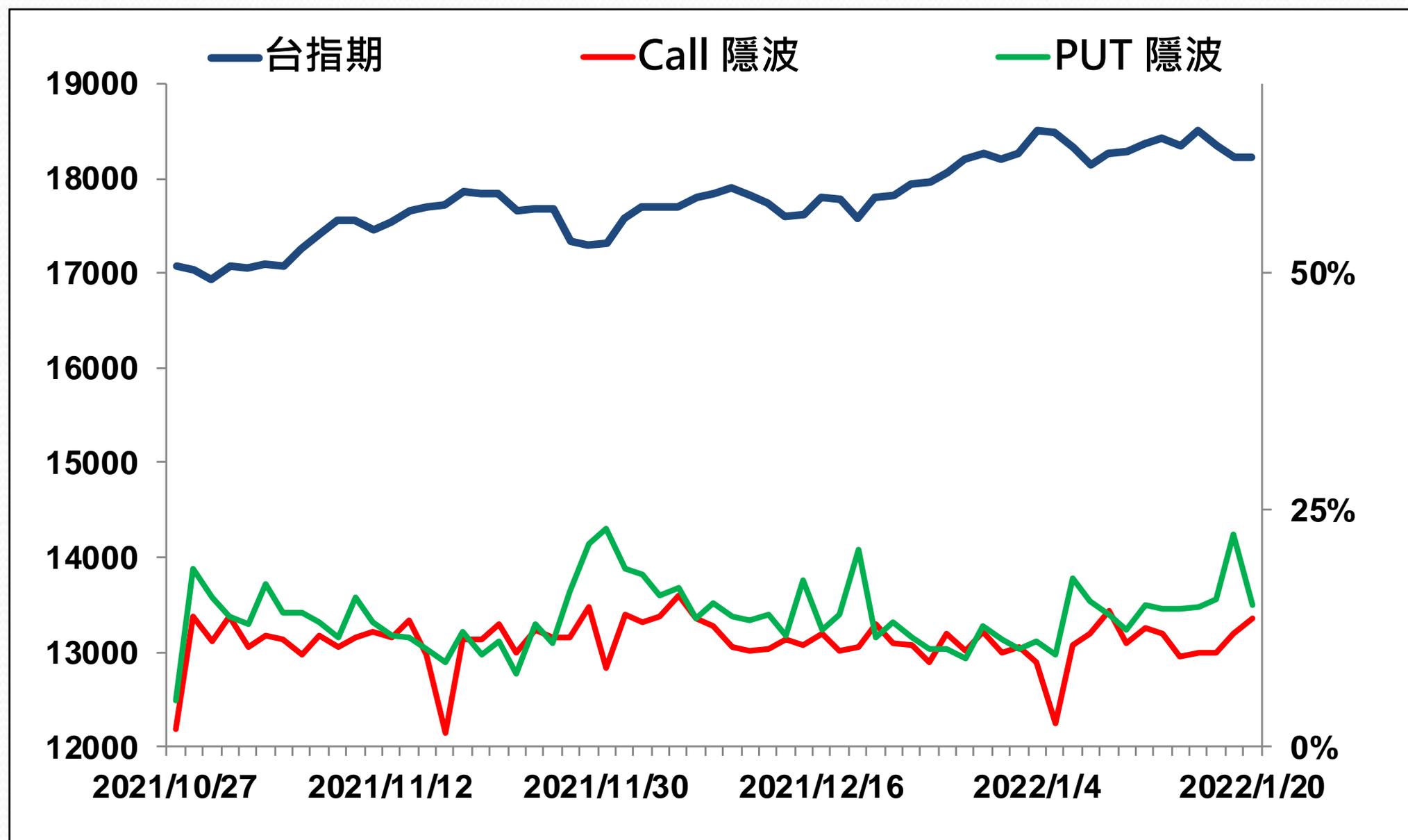
# 選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



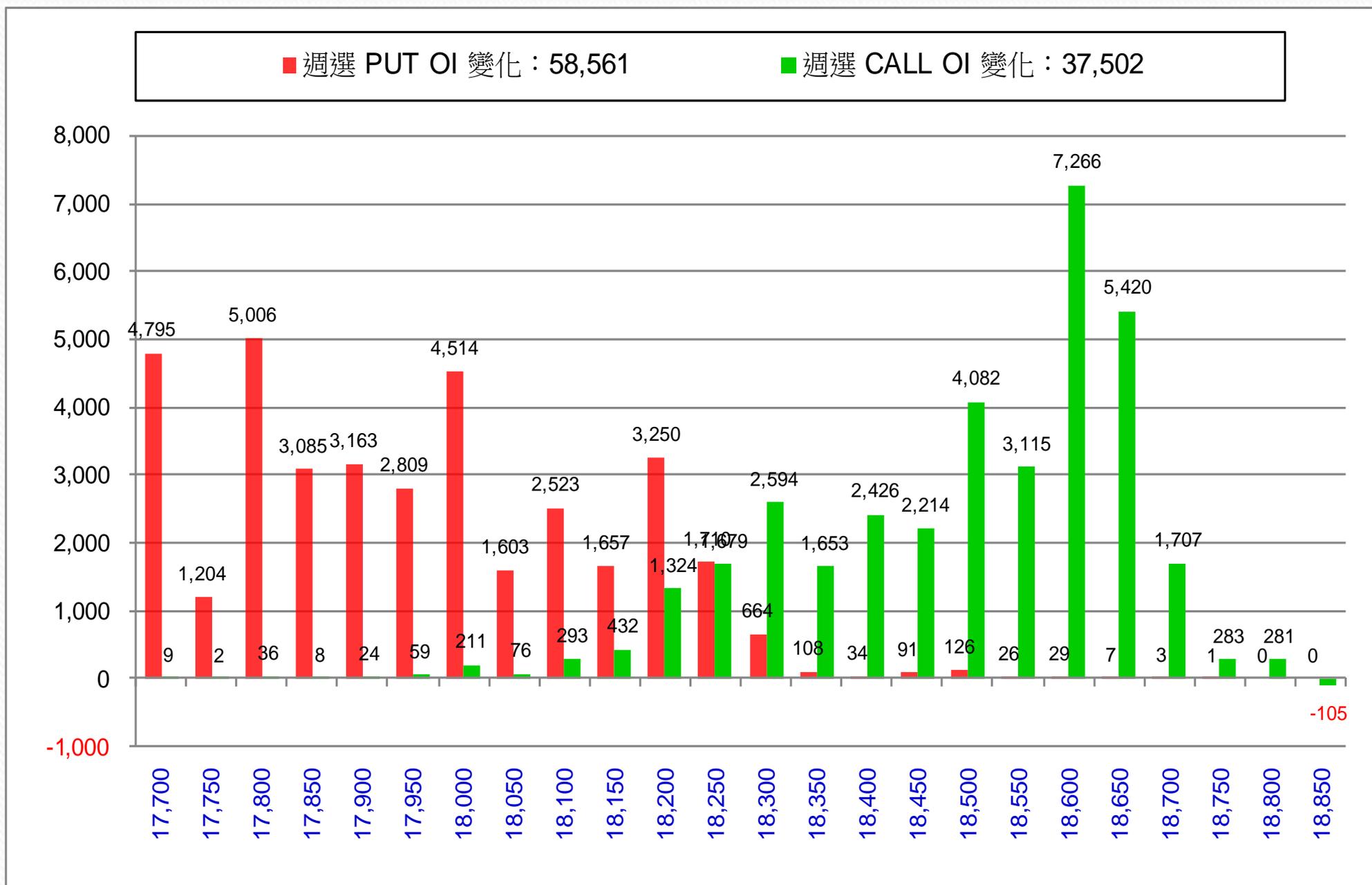
更新日期：2022年1月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



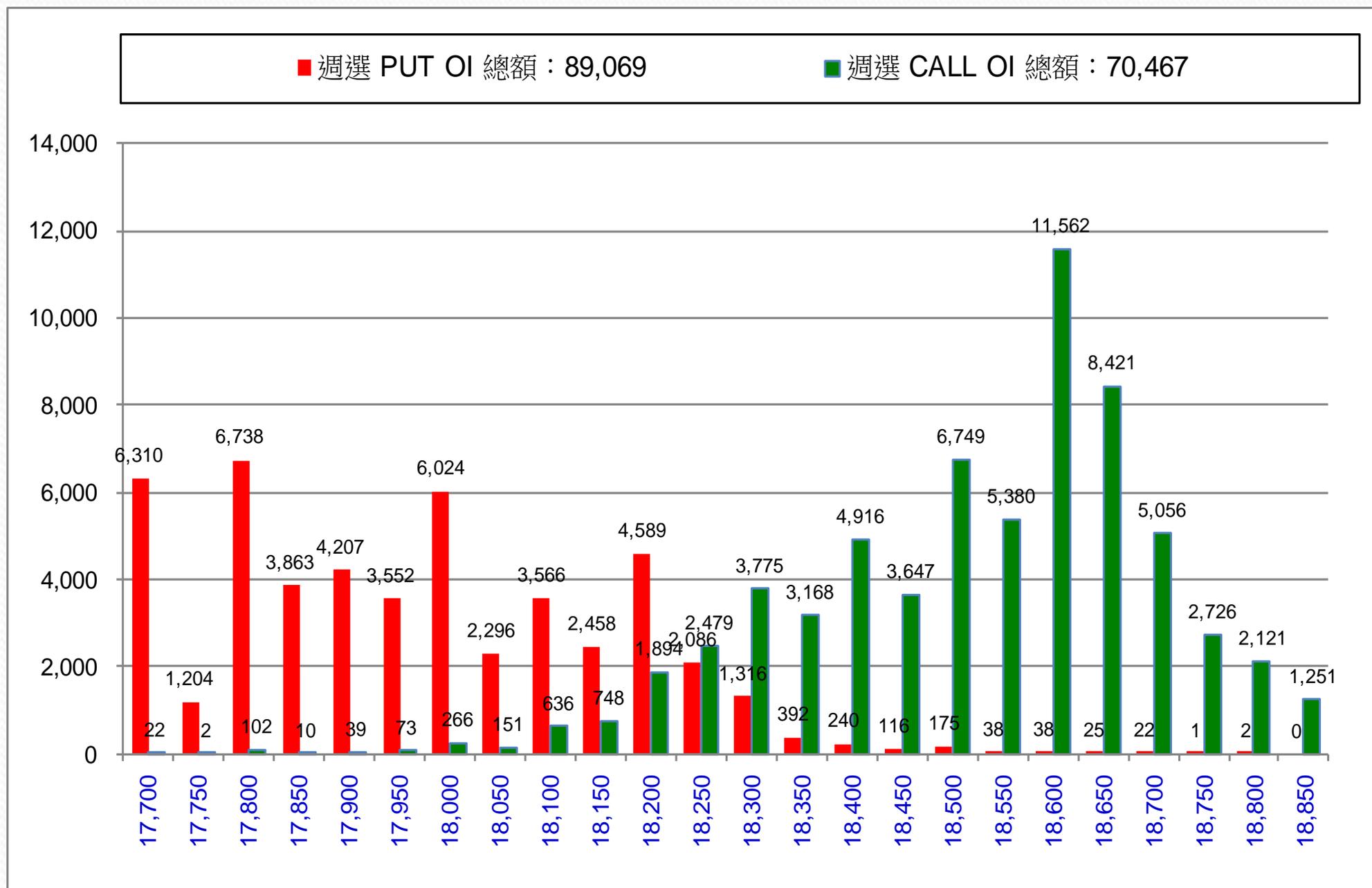
更新日期：2022年1月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年1月20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



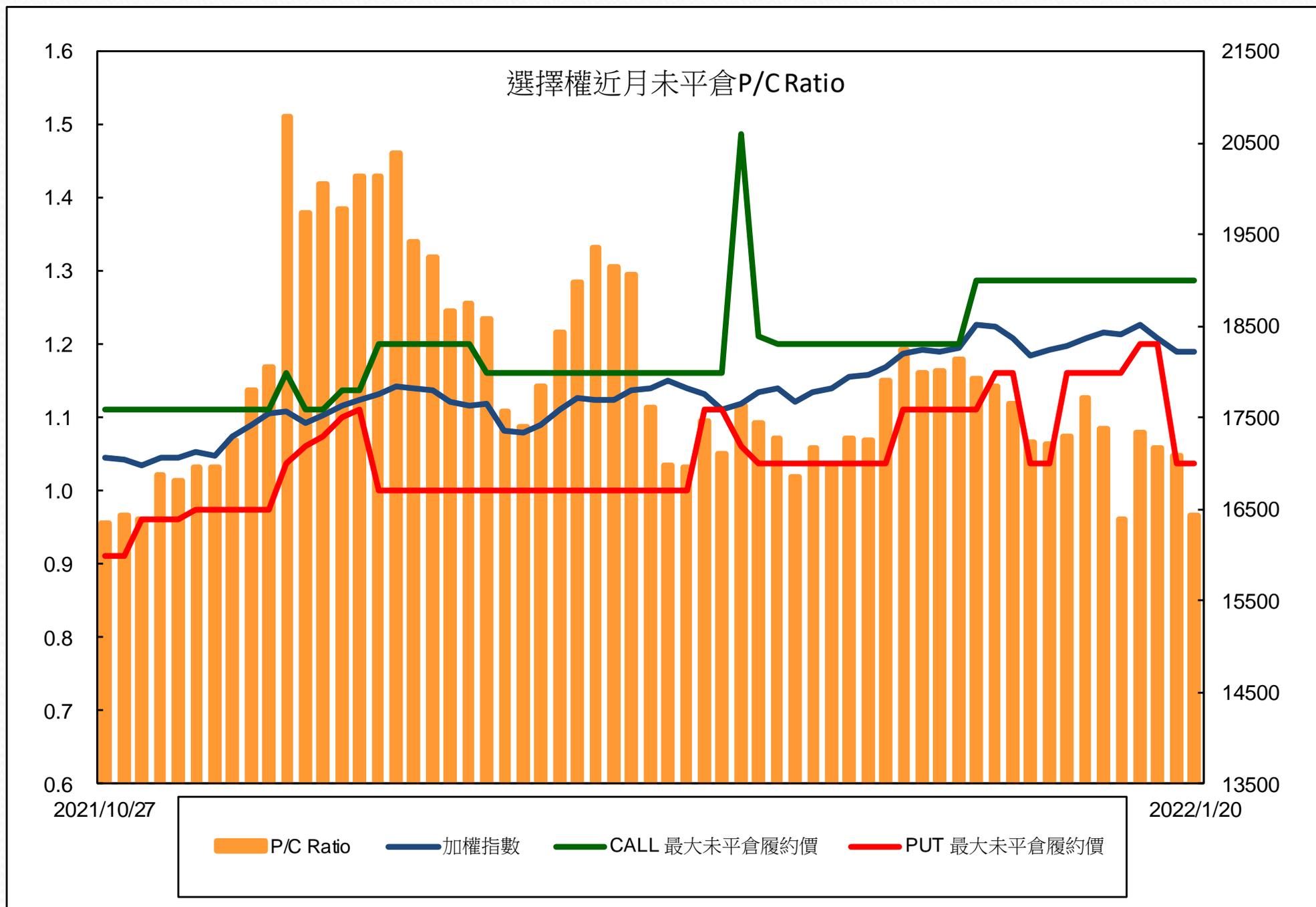
更新日期：2022年1月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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	1月19日	36,598	30,123	6,475
	1月20日	42,812	34,987	7,825
Put	1月19日	21,510	26,297	-4,787
	1月20日	43,818	36,261	7,557

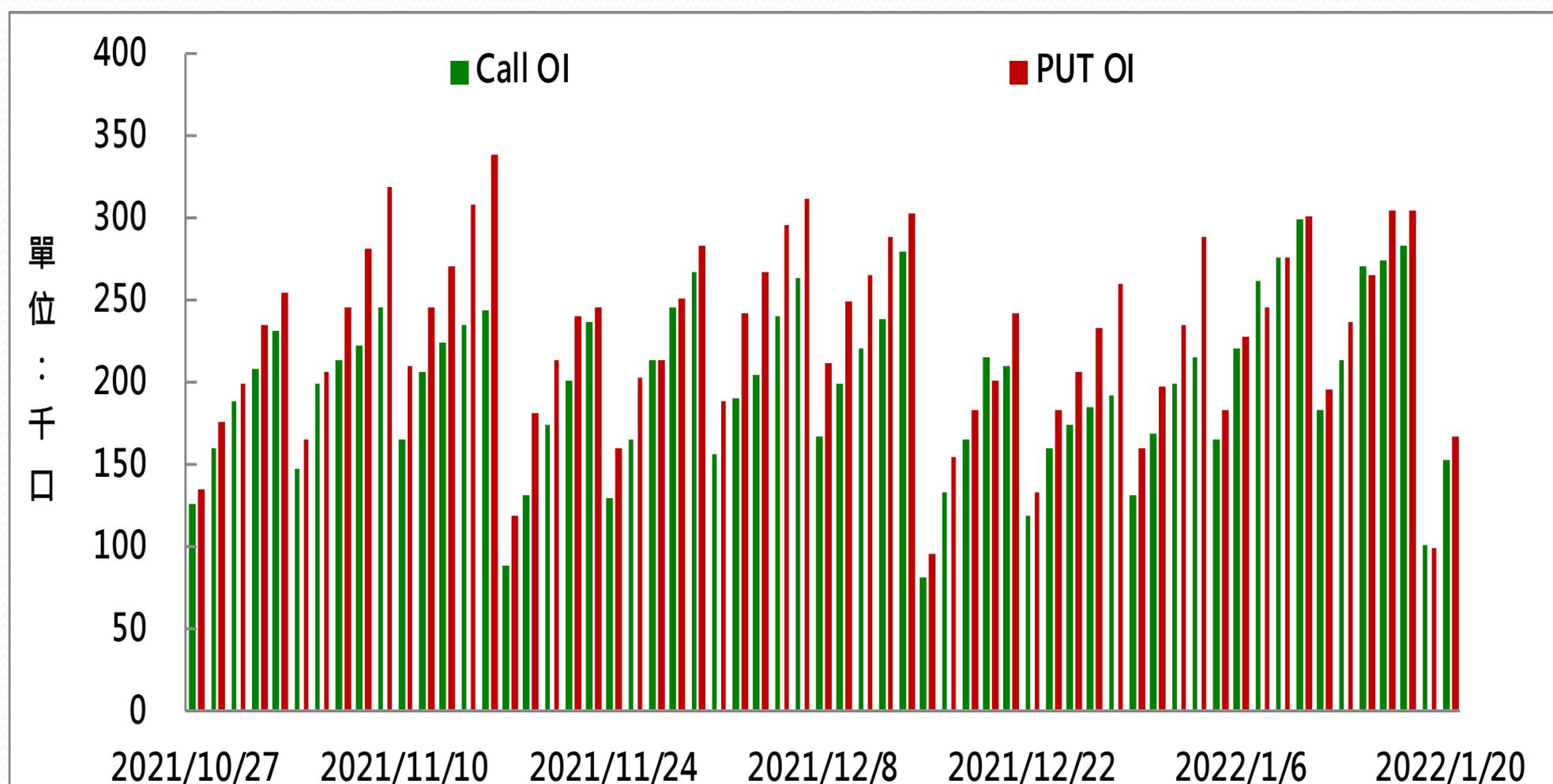
更新日期：2022年1月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年1月20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1月20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1月20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