

台指選擇權OI匯報

日期：2022/1/21 結算日：2022/1/26					日期：2022/1/21 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
0	0	17,100	4,621	1,136	0	8	16,900	1,640	473
8	8	17,200	3,750	1,918	-3	35	17,000	12,354	794
1	1	17,300	3,797	2,076	2	8	17,100	2,139	493
-1	3	17,400	4,411	1,511	2	15	17,200	1,839	530
6	9	17,500	6,905	-1,358	307	331	17,300	2,280	469
34	47	17,600	9,327	412	181	249	17,400	2,981	-19
56	78	17,700	6,302	-8	755	1,446	17,500	3,034	112
142	144	17,750	3,261	2,057	191	735	17,600	4,262	1,044
332	434	17,800	6,449	-289	110	307	17,700	3,812	268
398	408	17,850	3,943	80	122	642	17,800	4,552	46
1,866	1,905	17,900	5,188	981	177	378	17,900	2,508	-337
1,664	1,737	17,950	2,714	-838	410	982	18,000	2,015	-884
3,946	4,212	18,000	3,870	-2,154	287	944	18,100	1,302	-39
3,478	3,629	18,050	1,956	-340	257	3,030	18,200	3,072	59
6,192	6,828	18,100	2,090	-1,476	350	2,981	18,300	827	-64
3,968	4,716	18,150	1,829	-629	953	3,916	18,400	1,282	-14
8,063	9,957	18,200	3,803	-786	391	4,141	18,500	451	-34
5,221	7,700	18,250	1,534	-552	2,089	6,317	18,600	155	-5
9,137	12,912	18,300	1,193	-123	600	6,434	18,700	84	0
5,938	9,106	18,350	409	17	746	6,331	18,800	201	2
3,928	8,844	18,400	227	-13	-21	4,628	18,900	34	15
1,960	5,607	18,450	188	72	763	7,992	19,000	29	-7
1,659	8,408	18,500	155	-20	-139	3,378	19,100	11	0
-96	5,284	18,550	51	13	-57	3,181	19,200	23	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
47,841	118,308	0.8122	96,092	7,023	8,230	72,674	0.9355	67,988	5,630
昨日 P/C	1.2640	今日增減變化	-0.4518		昨日 P/C	0.9676	今日增減變化	-0.0321	

更新日期：2022年1月21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21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	75,495,509	168,526,018	-93,030,509	-2,444,204	3,110,540	3,439,240	-328,700	-702,159
投信	59,489,883	54,711,651	4,778,232	-2,121,375	1,595,060	0	1,595,060	1,027,825
自營商	68,063,190	11,992,361	56,070,829	-800,219	1,639,960	1,124,468	515,492	-249,043
	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	804,594	4,169,101	-3,364,507	353,701	8,122	149,445	-141,323	82,251
投信	22,888	0	22,888	-351	1,624	0	1,624	-32
自營商	661,890	79,205	582,685	-62,558	211,172	134,822	76,350	-100,861

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21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	23,439	22,787	652	130	45,438	23,661	21,777	4,205
投信	0	0	0	0	0	58	-58	0
自營商	47,922	50,379	-2,457	-10,282	43,356	35,930	7,426	-131
特定法人(週)	4,091	0	4,091	-241	0	13,984	-13,984	-3,890
特定法人(近月)	11,081	16,961	-5,880	108	13,269	23,603	-10,334	650
特定法人(全月)	15,653	11,847	3,806	1,821	8,916	39,195	-30,279	-4,201
十大交易人(週)	27,427	39,348	-11,921	-8,718	31,914	36,636	-4,722	-550
十大交易人(近月)	32,365	34,258	-1,893	-1,799	27,411	41,979	-14,568	-4,724
十大交易人(全月)	66,767	69,748	-2,981	-9,750	57,425	79,833	-22,408	-4,062
全市場未沖銷(近月)			72,674	8,230			67,988	5,630
全市場未沖銷(全月)			210,610	57,642			180,847	13,351

更新日期：2022年1月21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	18300	買權OI最大量	18300
	賣權成交最大量	18000	賣權OI最大量	17600
	整體隱含波動率	14.65%	較前一交易日	+0.71%
	買權隱含波動率	13.70%	較前一交易日	+0.16%
	賣權隱含波動率	15.80%	較前一交易日	+1.54%
電子選擇權	買權成交最大量	895	買權OI最大量	855
	賣權成交最大量	830	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	1700	賣權OI最大量	1700

更新日期：2022年1月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

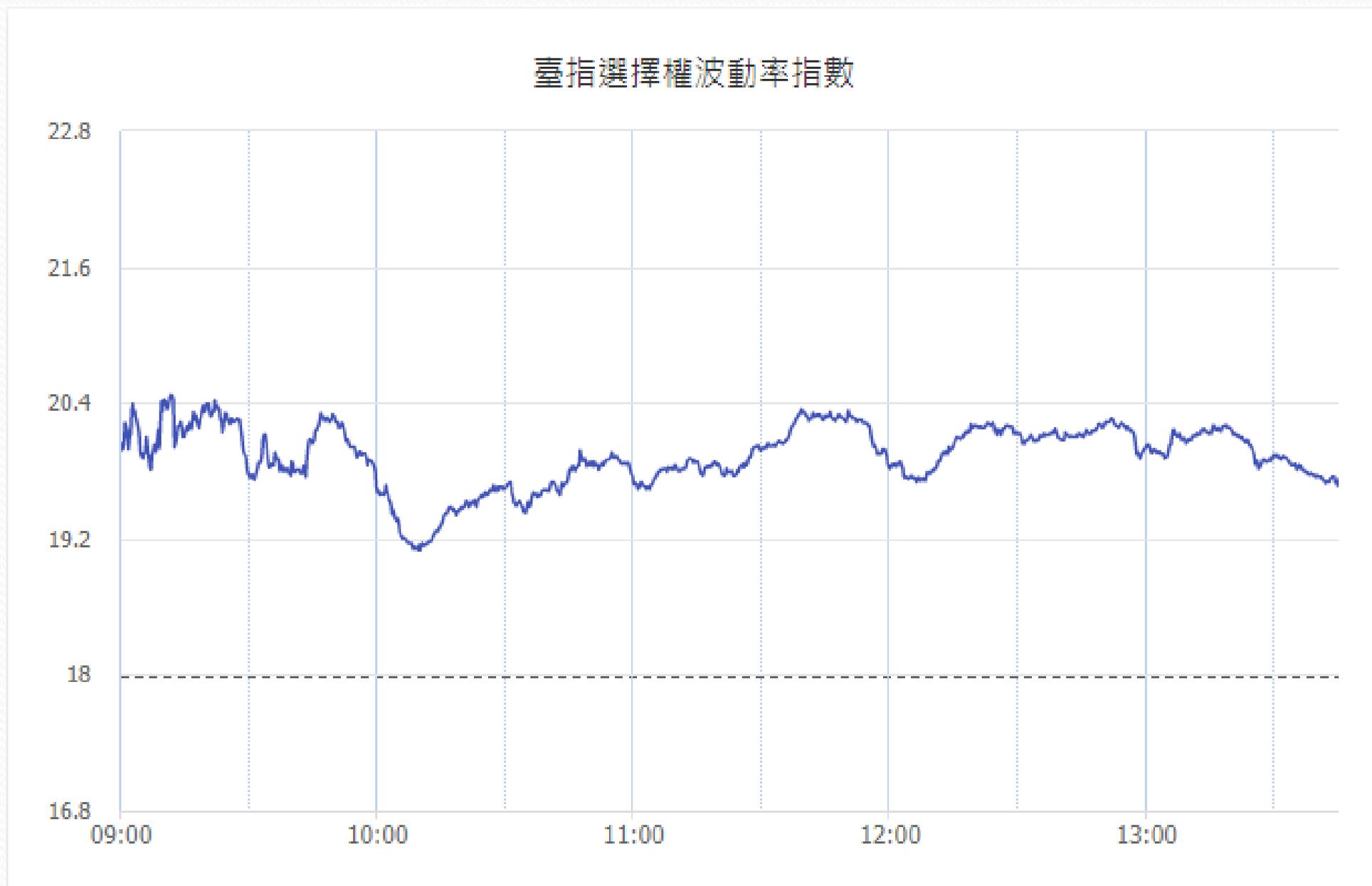
台指選擇權匯報

2022年02月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	18500	買權OI最大量	19000
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	17.13%	較前一交易日	-0.47%
	買權隱含波動率	14.48%	較前一交易日	+0.60%
	賣權隱含波動率	20.51%	較前一交易日	+0.40%
	成交量P/C_Ratio值	0.788	較前一交易日	-0.01
	未平倉P/C_Ratio值	0.936	較前一交易日	-0.03
電子選擇權	買權成交最大量	895	買權OI最大量	855
	賣權成交最大量	830	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	1700	賣權OI最大量	1700

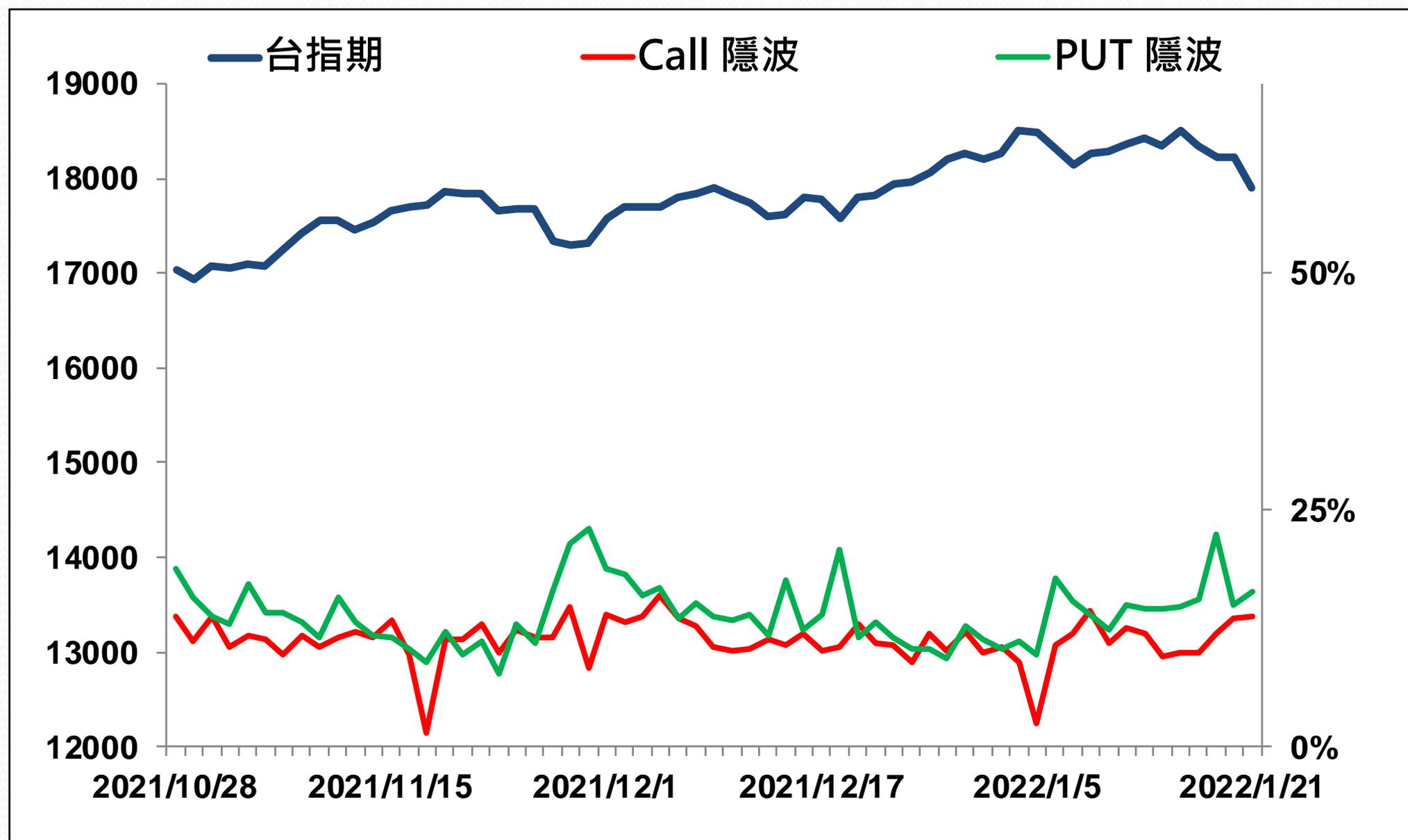
更新日期：2022年1月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



更新日期：2022年1月21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

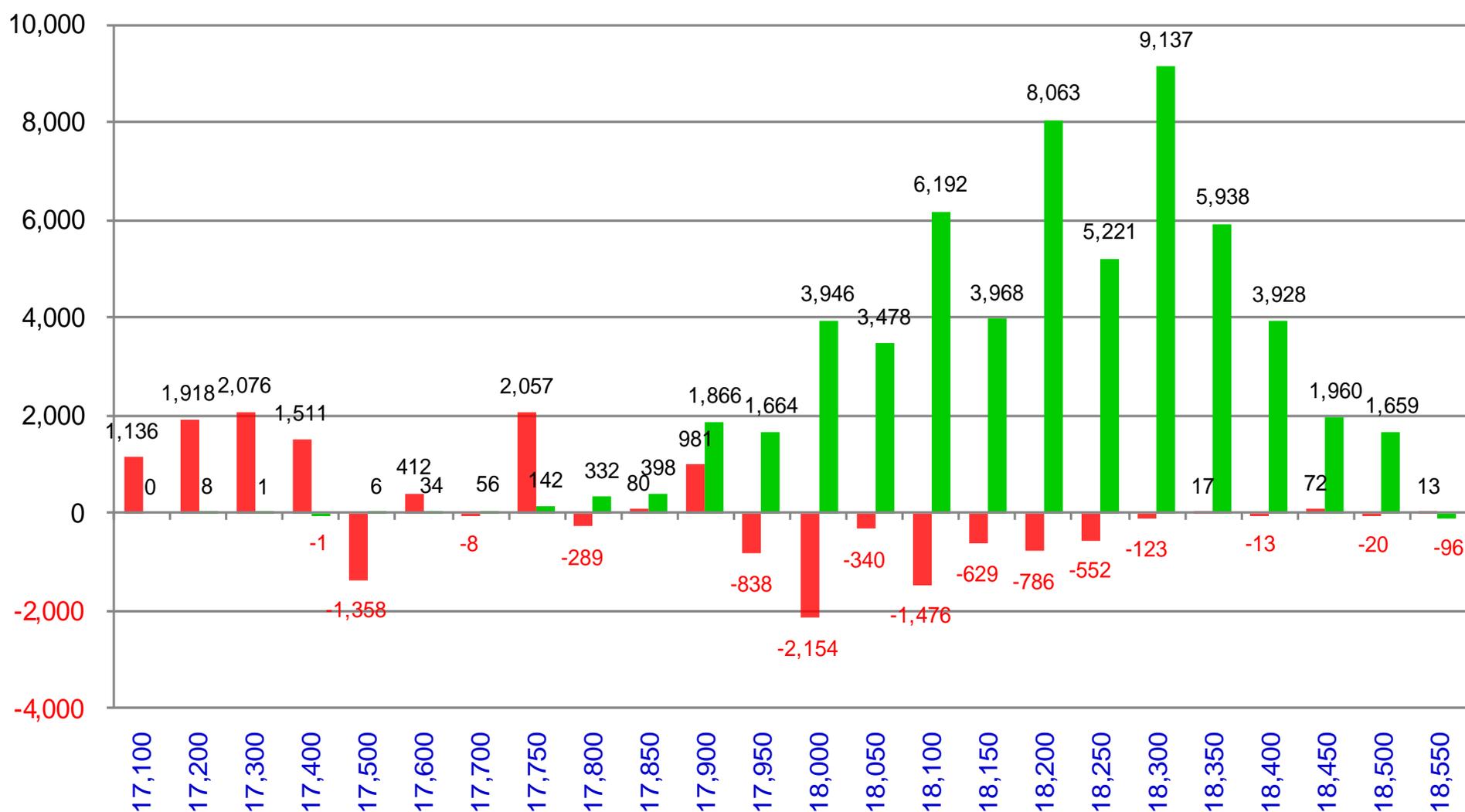


更新日期：2022年1月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：7,023

週選 CALL OI 變化：47,841

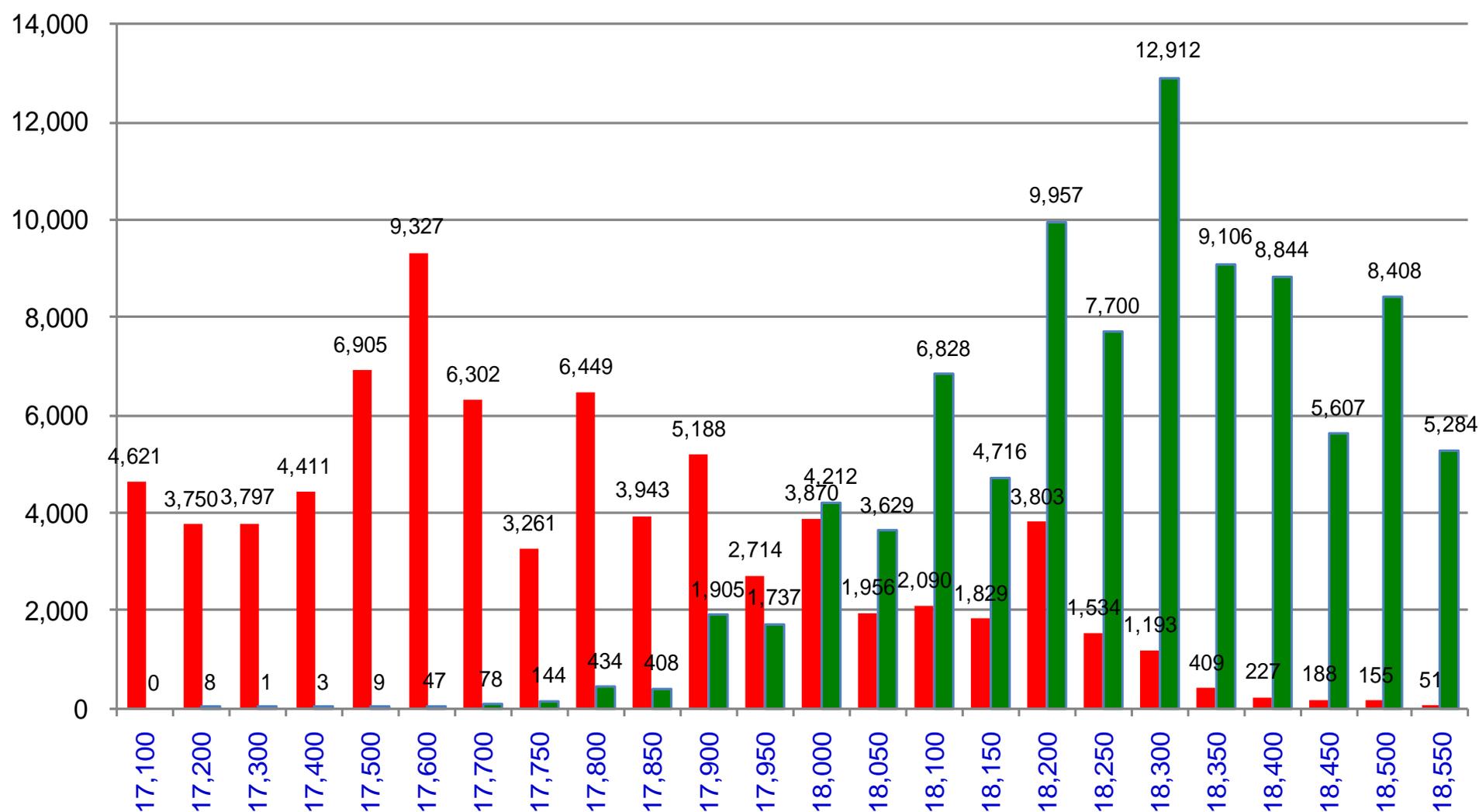


更新日期：2022年1月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：96,092

週選 CALL OI 總額：118,308



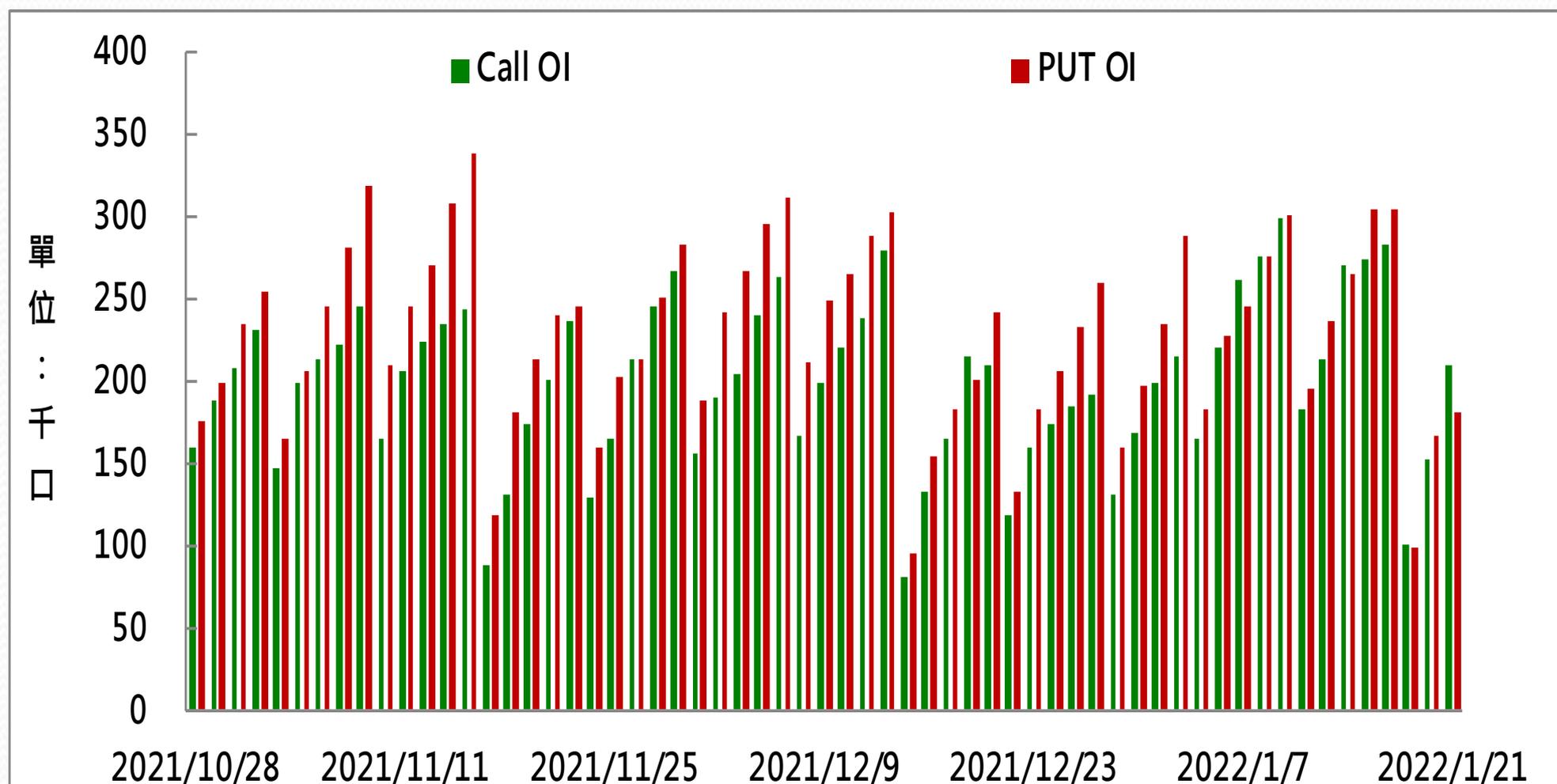
更新日期：2022年1月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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20日	42,812	34,987	7,825
	1月21日	47,922	50,379	-2,457
Put	1月20日	43,818	36,261	7,557
	1月21日	43,356	35,930	7,426

更新日期：2022年1月21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21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21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