

台指選擇權OI匯報

日期：2022/1/24 結算日：2022/1/26					日期：2022/1/24 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
45	54	17,500	10,020	3,115	0	35	17,000	12,496	142
48	48	17,550	1,959	1,959	0	8	17,100	2,321	182
120	167	17,600	10,611	1,284	-1	14	17,200	2,141	302
83	83	17,650	3,085	3,085	44	375	17,300	2,336	56
400	478	17,700	8,908	2,606	2	251	17,400	3,152	171
335	479	17,750	6,863	3,602	229	1,675	17,500	3,579	545
824	1,258	17,800	10,235	3,786	68	803	17,600	4,405	143
1,236	1,644	17,850	6,140	2,197	130	437	17,700	4,561	749
2,373	4,278	17,900	7,011	1,823	171	813	17,800	4,496	-56
1,778	3,515	17,950	4,027	1,313	413	791	17,900	2,794	286
3,871	8,083	18,000	4,861	991	288	1,270	18,000	1,971	-44
3,575	7,204	18,050	1,639	-317	508	1,452	18,100	1,281	-21
3,501	10,329	18,100	1,998	-92	543	3,573	18,200	3,003	-69
5,821	10,537	18,150	1,679	-150	255	3,236	18,300	826	-1
※ 6,088	16,045	18,200	3,203	-600	815	4,731	18,400	1,245	-37
4,734	12,434	18,250	1,416	-118	※ 1,386	5,527	18,500	411	-40
-592	12,320	18,300	1,099	-94	938	7,255	18,600	140	-15
-1,464	7,642	18,350	401	-8	880	7,314	18,700	68	-16
-1,169	7,675	18,400	218	-9	375	6,706	18,800	198	-3
-916	4,691	18,450	187	-1	-36	4,592	18,900	13	-21
-455	7,953	18,500	137	-18	-189	7,803	19,000	12	-17
-1,297	3,987	18,550	50	-1	-120	3,258	19,100	11	0
-337	6,869	18,600	35	0	-640	2,541	19,200	20	-3
-520	3,462	18,650	5	-8	-112	1,858	19,300	1	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
25,743	144,051	0.9312	134,141	38,049	5,826	78,500	0.9358	73,463	5,475
昨日 P/C	0.8122	今日增減變化		0.1190	昨日 P/C	0.9355	今日增減變化		0.0003

更新日期：2022年1月24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24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	70,351,732	167,736,853	-97,385,121	-4,354,612	2,752,348	3,533,749	-781,401	-452,701
投信	60,317,563	54,488,721	5,828,842	1,050,610	1,702,339	0	1,702,339	107,279
自營商	68,426,549	10,479,524	57,947,025	1,876,196	1,981,285	1,140,679	840,606	325,114
	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	835,285	4,290,486	-3,455,201	-90,694	0	150,307	-150,307	-8,984
投信	22,812	0	22,812	-76	1,616	0	1,616	-8
自營商	756,224	105,267	650,957	68,272	247,258	164,828	82,430	6,080

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24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	23,926	25,955	-2,029	-2,681	47,175	24,800	22,375	598
投信	0	0	0	0	0	58	-58	0
自營商	58,029	60,399	-2,370	87	49,881	40,697	9,184	1,758
特定法人(週)	3,358	0	3,358	-733	0	12,160	-12,160	1,824
特定法人(近月)	9,134	16,611	-7,477	-1,597	11,187	24,584	-13,397	-3,063
特定法人(全月)	14,435	14,160	275	-3,531	8,916	40,587	-31,671	-1,392
十大交易人(週)	39,395	47,501	-8,106	3,815	40,328	44,269	-3,941	781
十大交易人(近月)	33,448	37,071	-3,623	-1,730	30,005	44,640	-14,635	-67
十大交易人(全月)	76,031	77,031	-1,000	1,981	67,410	89,105	-21,695	713
全市場未沖銷(近月)			78,500	5,826			73,463	5,475
全市場未沖銷(全月)			242,548	31,938			225,110	44,263

更新日期：2022年1月24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	18000	買權OI最大量	18200
	賣權成交最大量	17800	賣權OI最大量	17600
	整體隱含波動率	16.12%	較前一交易日	+1.47%
	買權隱含波動率	13.63%	較前一交易日	-0.06%
	賣權隱含波動率	18.50%	較前一交易日	+2.70%
電子選擇權	買權成交最大量	895	買權OI最大量	895
	賣權成交最大量	820	賣權OI最大量	800
金融選擇權	買權成交最大量	1760	買權OI最大量	1880
	賣權成交最大量	1660	賣權OI最大量	1700

更新日期：2022年1月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

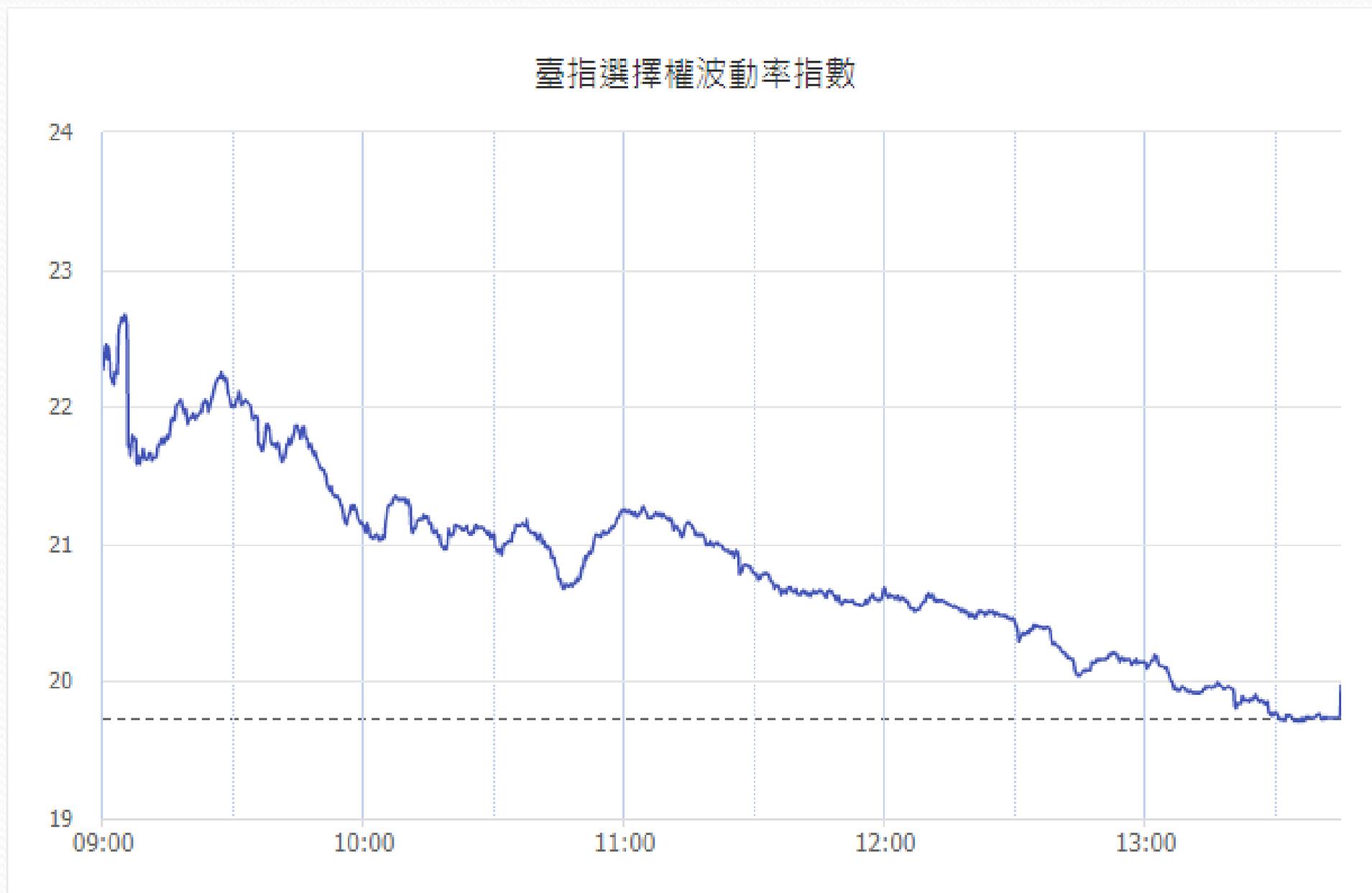
台指選擇權匯報

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	17.27%	較前一交易日	-0.14%
	買權隱含波動率	13.87%	較前一交易日	-0.61%
	賣權隱含波動率	21.52%	較前一交易日	+1.00%
	成交量P/C_Ratio值	0.799	較前一交易日	+0.01
	未平倉P/C_Ratio值	0.936	較前一交易日	+0.00
電子選擇權	買權成交最大量	895	買權OI最大量	895
	賣權成交最大量	820	賣權OI最大量	800
金融選擇權	買權成交最大量	1760	買權OI最大量	1880
	賣權成交最大量	1660	賣權OI最大量	1700

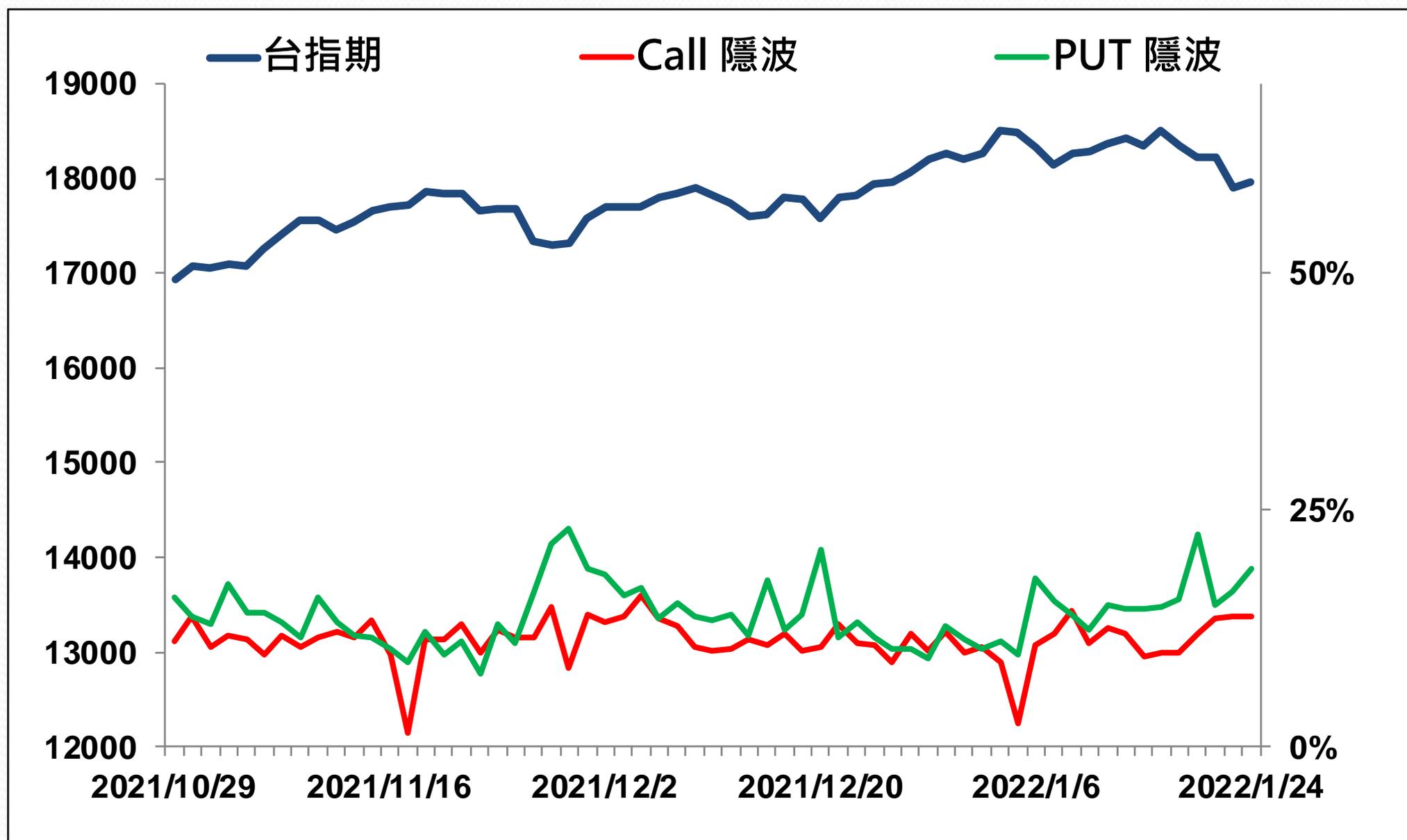
更新日期：2022年1月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



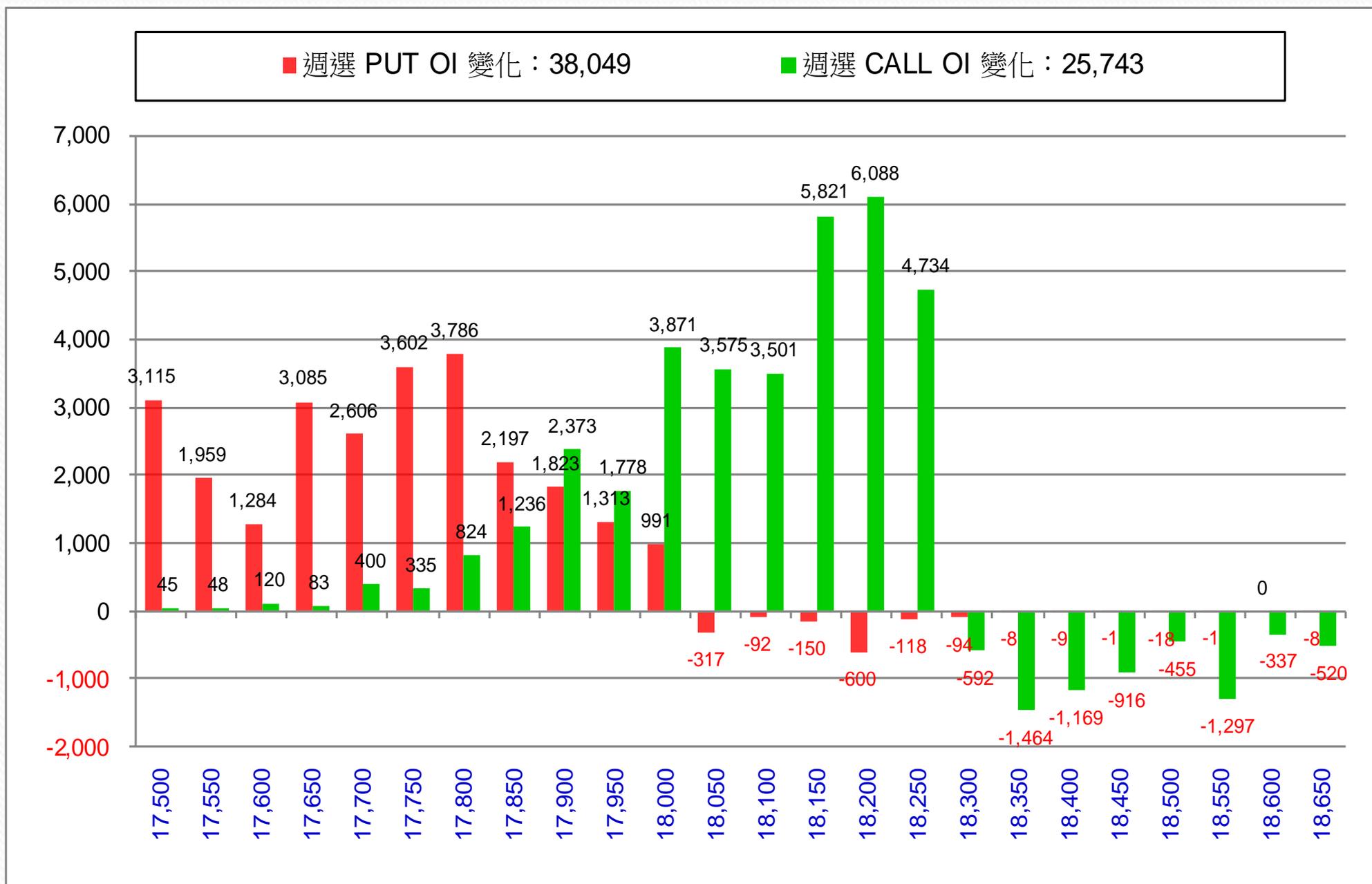
更新日期：2022年1月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年1月24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

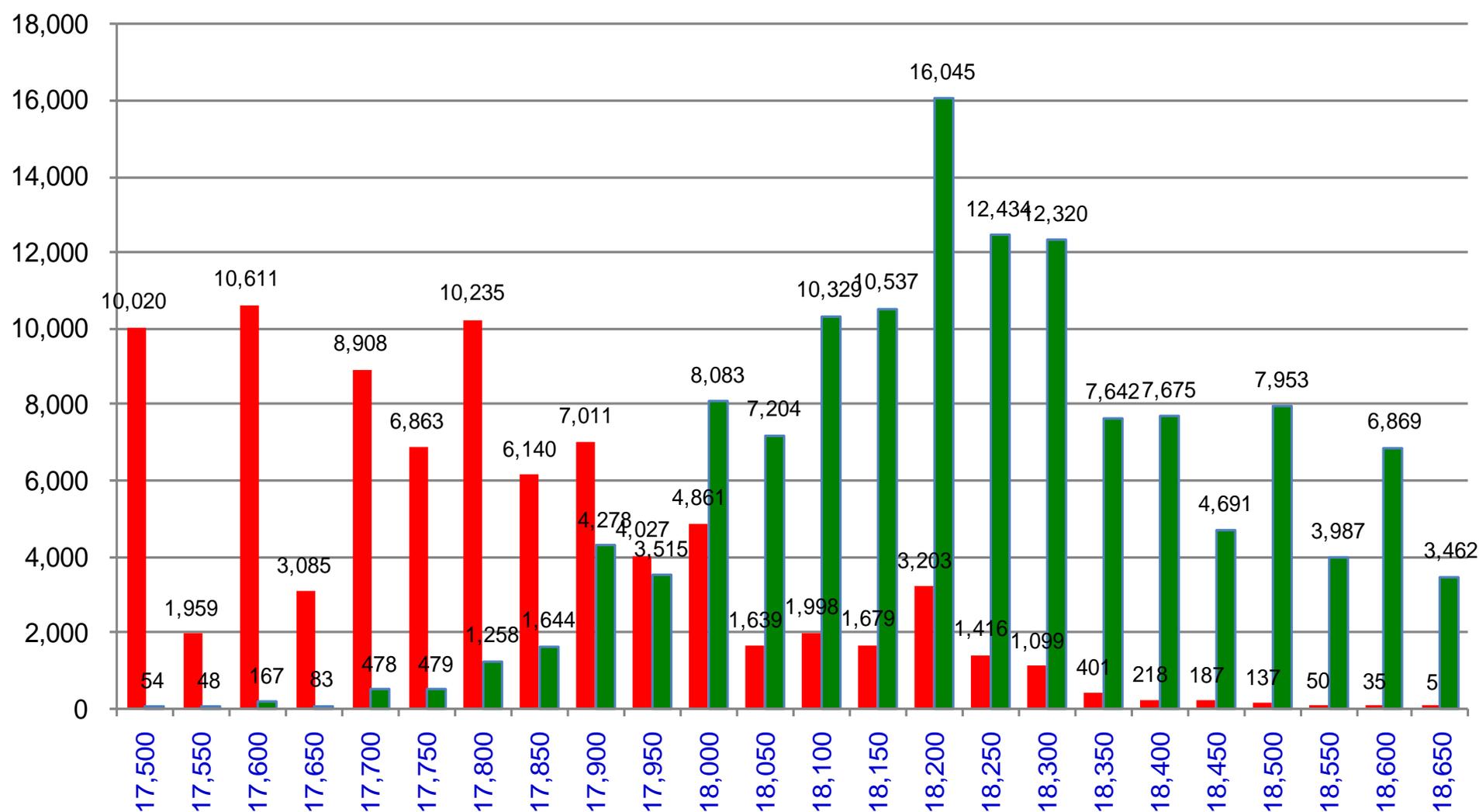


更新日期：2022年1月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：134,141

■ 週選 CALL OI 總額：144,051



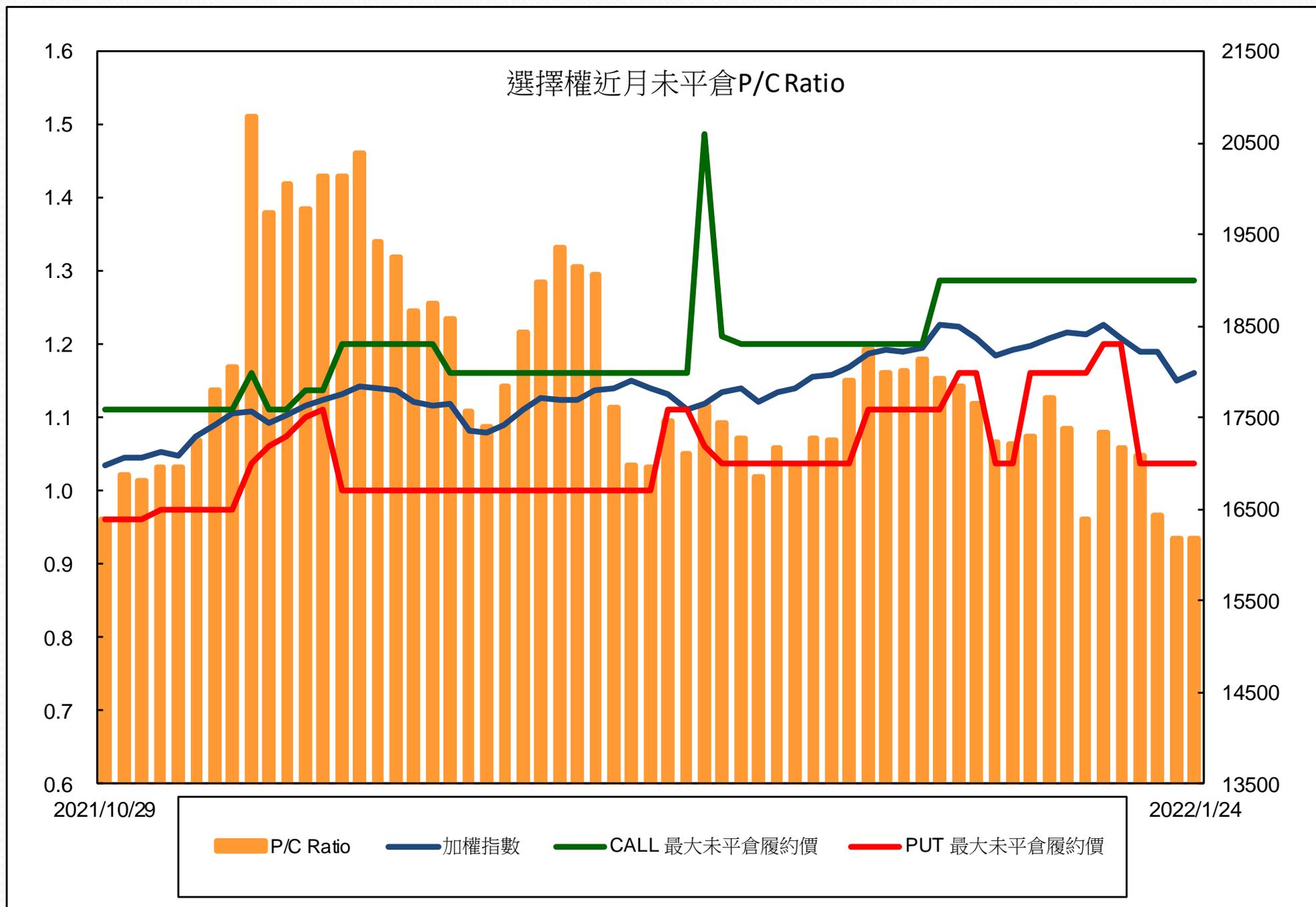
更新日期：2022年1月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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21日	47,922	50,379	-2,457
	1月24日	58,029	60,399	-2,370
Put	1月21日	43,356	35,930	7,426
	1月24日	49,881	40,697	9,184

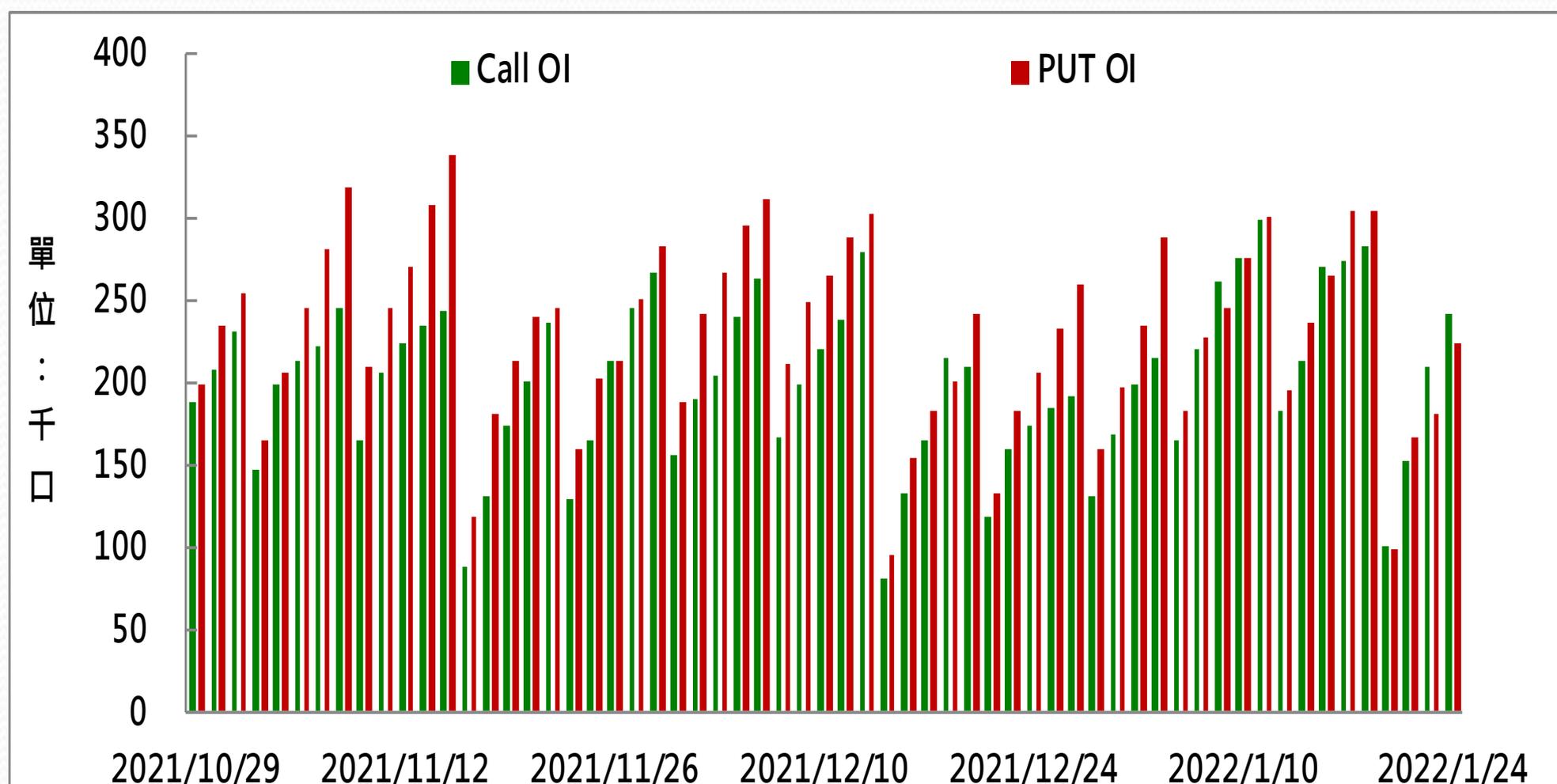
更新日期：2022年1月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年1月24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24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24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