

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/1/25 結算日：2022/1/26					日期：2022/1/25 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	17,000	7,103	1,332	0	0	16,700	1,191	118
7	7	17,100	6,835	1,340	0	1	16,800	2,635	383
6	6	17,200	5,777	204	0	8	16,900	1,818	-83
8	9	17,300	6,614	1,208	12	47	17,000	12,724	228
164	169	17,400	8,576	575	1	9	17,100	2,518	197
46	48	17,450	3,690	2,707	13	27	17,200	2,450	309
288	342	17,500	10,101	81	5	380	17,300	2,374	38
305	353	17,550	3,783	1,824	24	275	17,400	3,218	66
1,034	1,201	17,600	9,773	-838	122	1,797	17,500	3,494	-85
3,213	3,296	17,650	3,323	238	119	922	17,600	3,717	-688
4,751	5,229	17,700	9,053	145	454	891	17,700	3,310	-1,251
4,398	4,877	17,750	3,929	-2,934	699	1,512	17,800	3,077	-1,419
5,651	6,909	17,800	5,892	-4,343	324	1,115	17,900	1,508	-1,286
5,499	7,143	17,850	3,351	-2,789	1,002	2,272	18,000	1,768	-203
7,167	11,445	17,900	5,082	-1,929	657	2,109	18,100	1,221	-60
4,985	8,500	17,950	2,759	-1,268	1,828	5,401	18,200	3,019	16
※ 10,540	18,623	18,000	4,519	-342	※ 1,257	4,493	18,300	767	-59
2,565	9,769	18,050	1,678	39	1,665	6,396	18,400	1,238	-7
4,552	14,881	18,100	1,904	-94	383	5,910	18,500	388	-23
-2,695	7,842	18,150	1,464	-215	362	7,617	18,600	115	-25
-6,704	9,341	18,200	2,982	-221	755	8,069	18,700	67	-1
-2,394	10,040	18,250	1,416	0	-99	6,607	18,800	198	0
-2,992	9,328	18,300	1,031	-68	-973	3,619	18,900	12	-1
-1,792	5,850	18,350	393	-8	-526	7,277	19,000	12	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
31,763	175,814	0.7402	130,130	-4,011	8,312	86,812	0.8690	75,438	1,975
昨日 P/C	0.9312	今日增減變化		-0.1910	昨日 P/C	0.9358	今日增減變化		-0.0669

更新日期：2022年1月25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25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	61,931,981	177,518,005	-115,586,024	-18,200,903	2,768,288	4,021,917	-1,253,629	-472,228
投信	59,271,526	55,708,448	3,563,078	-2,265,764	2,019,545	0	2,019,545	317,206
自營商	73,574,638	12,821,291	60,753,347	2,806,322	1,802,690	1,174,520	628,170	-212,436
	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	846,875	4,100,722	-3,253,847	201,354	3,173	14,279	-11,106	139,201
投信	22,560	0	22,560	-252	1,587	0	1,587	-29
自營商	600,348	131,826	468,522	-182,435	180,860	225,256	-44,396	-126,826

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25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	26,483	28,977	-2,494	-465	53,140	27,481	25,659	3,284
投信	0	0	0	0	0	58	-58	0
自營商	55,095	74,325	-19,230	-16,860	52,483	36,573	15,910	6,726
特定法人(週)	5,722	4,285	1,437	-1,921	0	14,343	-14,343	-2,183
特定法人(近月)	9,043	13,137	-4,094	3,383	12,662	26,123	-13,461	-64
特定法人(全月)	14,844	14,424	420	145	11,841	43,684	-31,843	-172
十大交易人(週)	33,650	53,069	-19,419	-11,313	33,099	41,356	-8,257	-4,316
十大交易人(近月)	34,614	39,760	-5,146	-1,523	29,510	47,871	-18,361	-3,726
十大交易人(全月)	71,363	87,488	-16,125	-15,125	61,203	90,879	-29,676	-7,981
全市場未沖銷(近月)			86,812	8,312			75,438	1,975
全市場未沖銷(全月)			283,703	41,155			223,690	-1,420

更新日期：2022年1月25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	18000
	賣權成交最大量	17600	賣權OI最大量	17500
	整體隱含波動率	16.92%	較前一交易日	+0.80%
	買權隱含波動率	16.33%	較前一交易日	+2.70%
	賣權隱含波動率	17.67%	較前一交易日	-0.83%
電子選擇權	買權成交最大量	890	買權OI最大量	920
	賣權成交最大量	815	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	1720	賣權OI最大量	1700

更新日期：2022年1月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

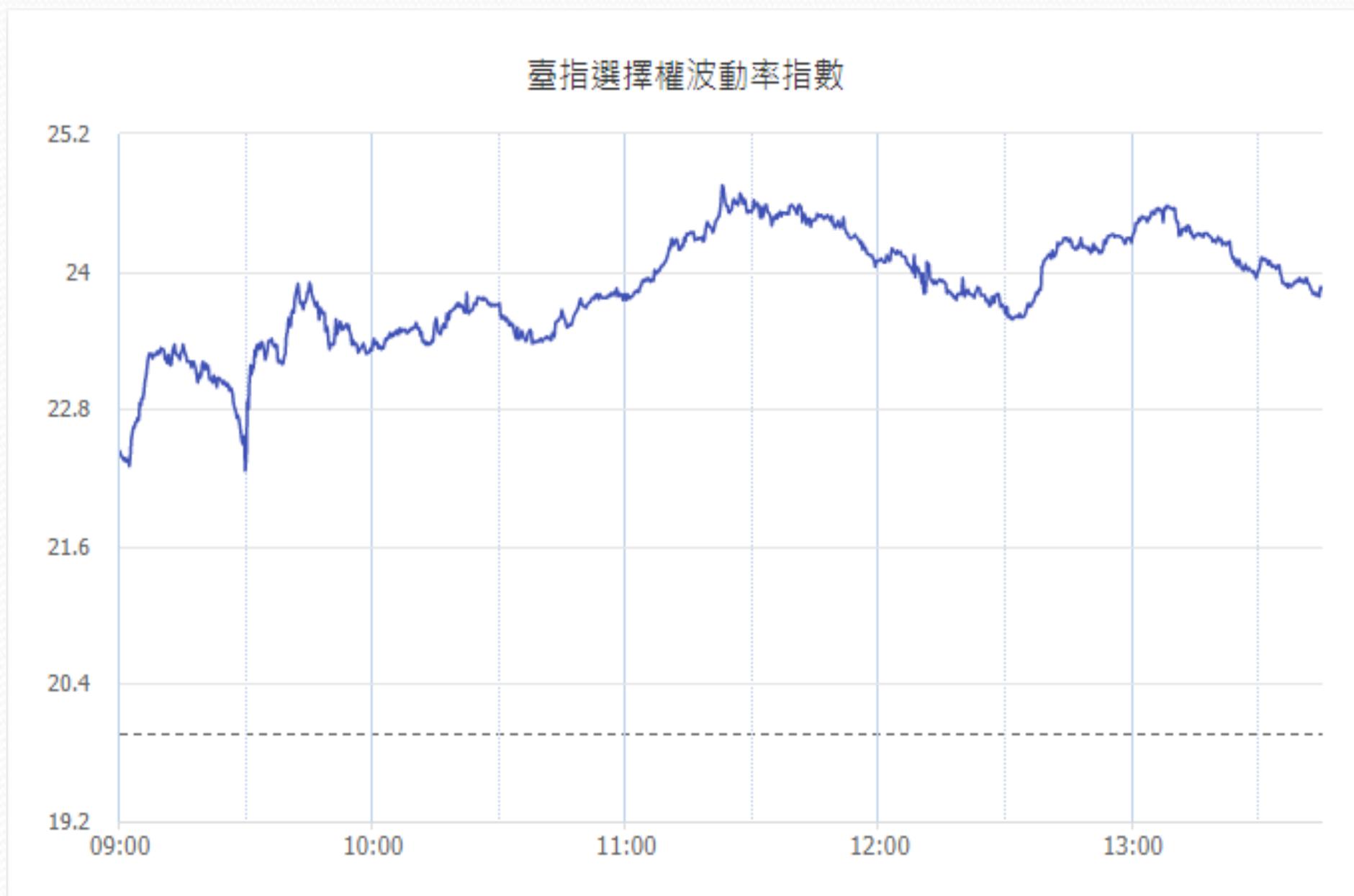
# 台指選擇權匯報

## 2022年02月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	18400	買權OI最大量	18700
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	21.55%	較前一交易日	-4.28%
	買權隱含波動率	16.07%	較前一交易日	+2.20%
	賣權隱含波動率	26.96%	較前一交易日	+5.44%
	成交量P/C_Ratio值	0.948	較前一交易日	+0.15
	未平倉P/C_Ratio值	0.869	較前一交易日	-0.07
電子選擇權	買權成交最大量	890	買權OI最大量	920
	賣權成交最大量	815	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	1720	賣權OI最大量	1700

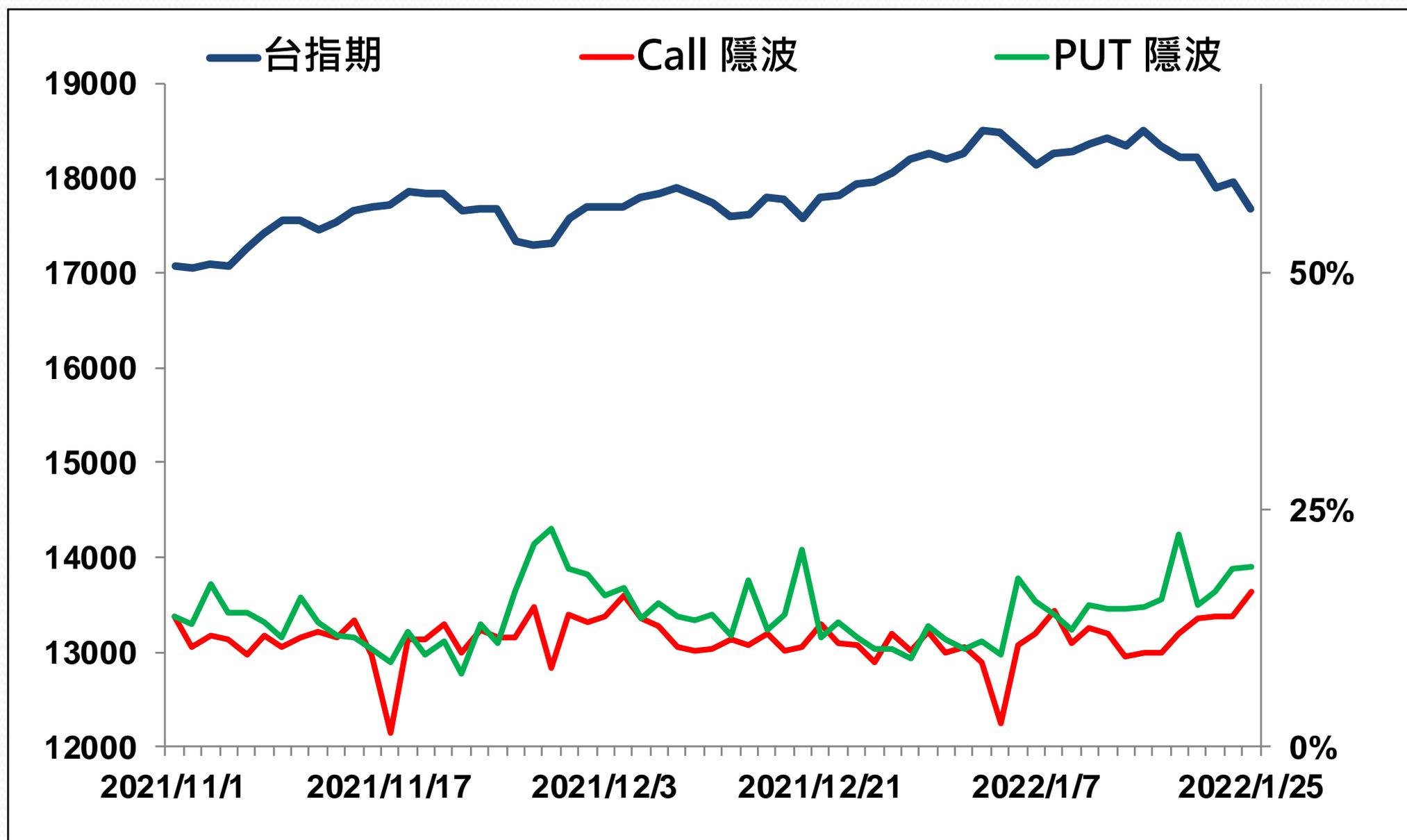
更新日期：2022年1月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權當日波動率指數



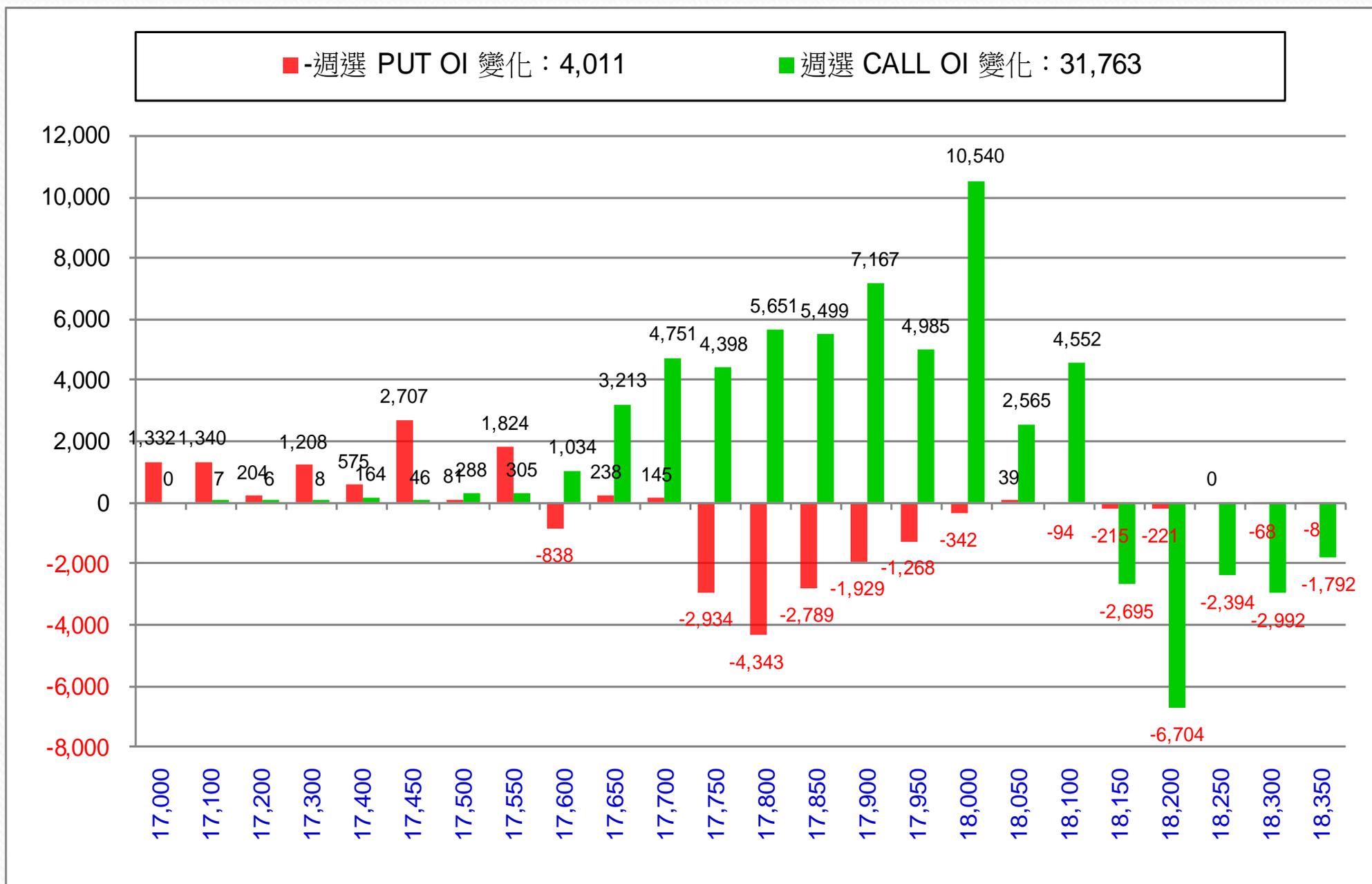
更新日期：2022年1月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2022年1月25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

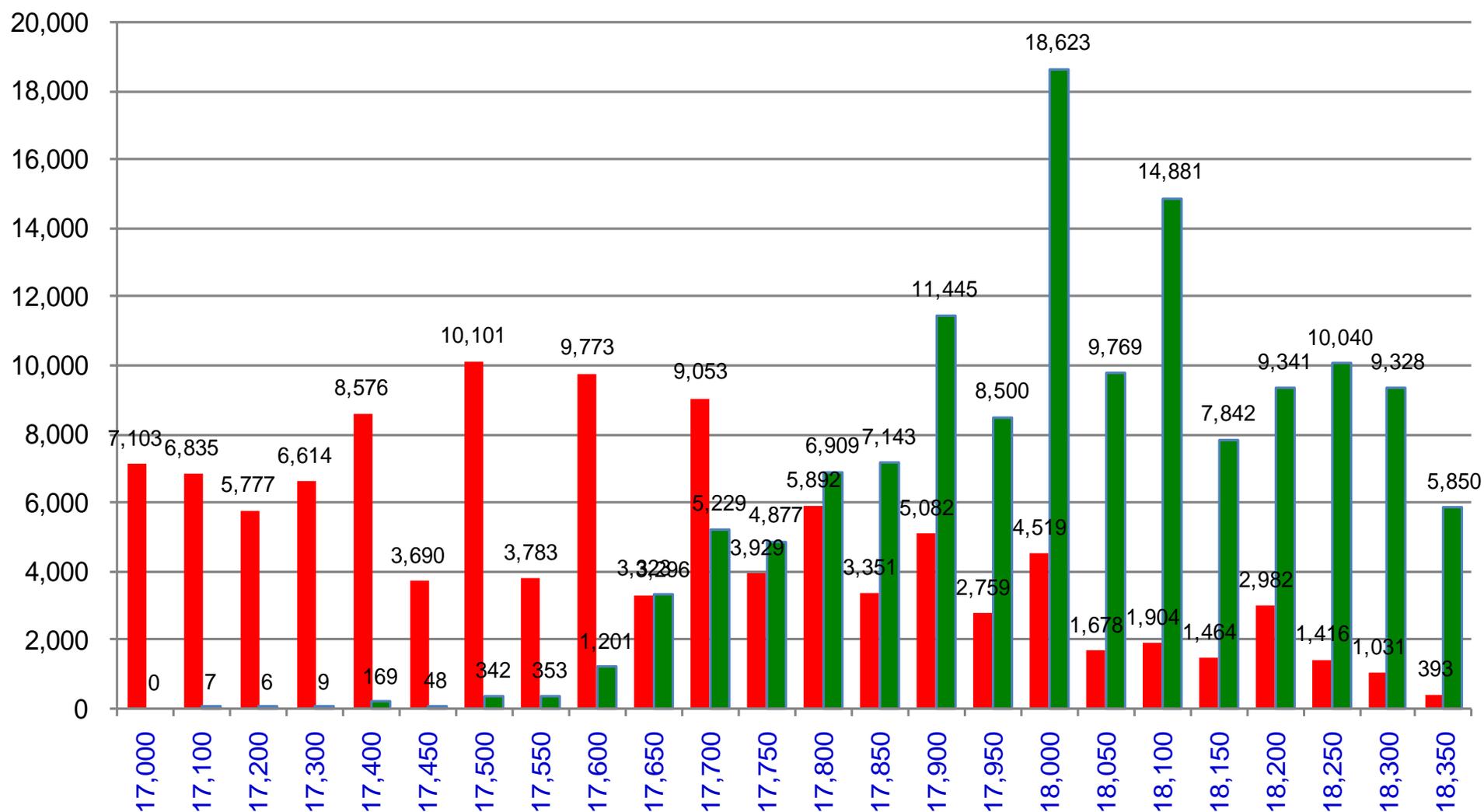


更新日期：2022年1月25日    資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：130,130

週選 CALL OI 總額：175,814



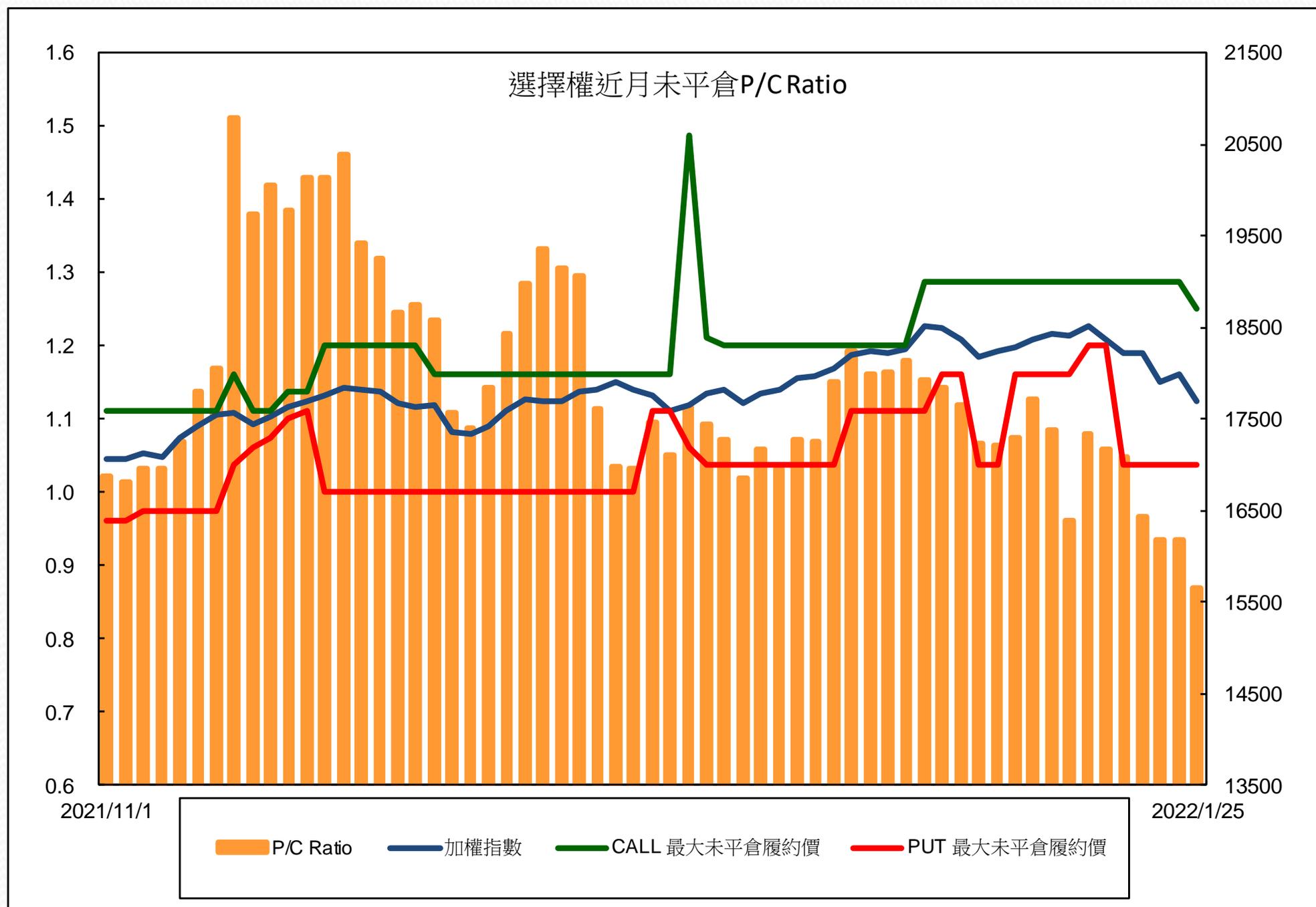
更新日期：2022年1月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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24日	58,029	60,399	-2,370
	1月25日	55,095	74,325	-19,230
Put	1月24日	49,881	40,697	9,184
	1月25日	52,483	36,573	15,910

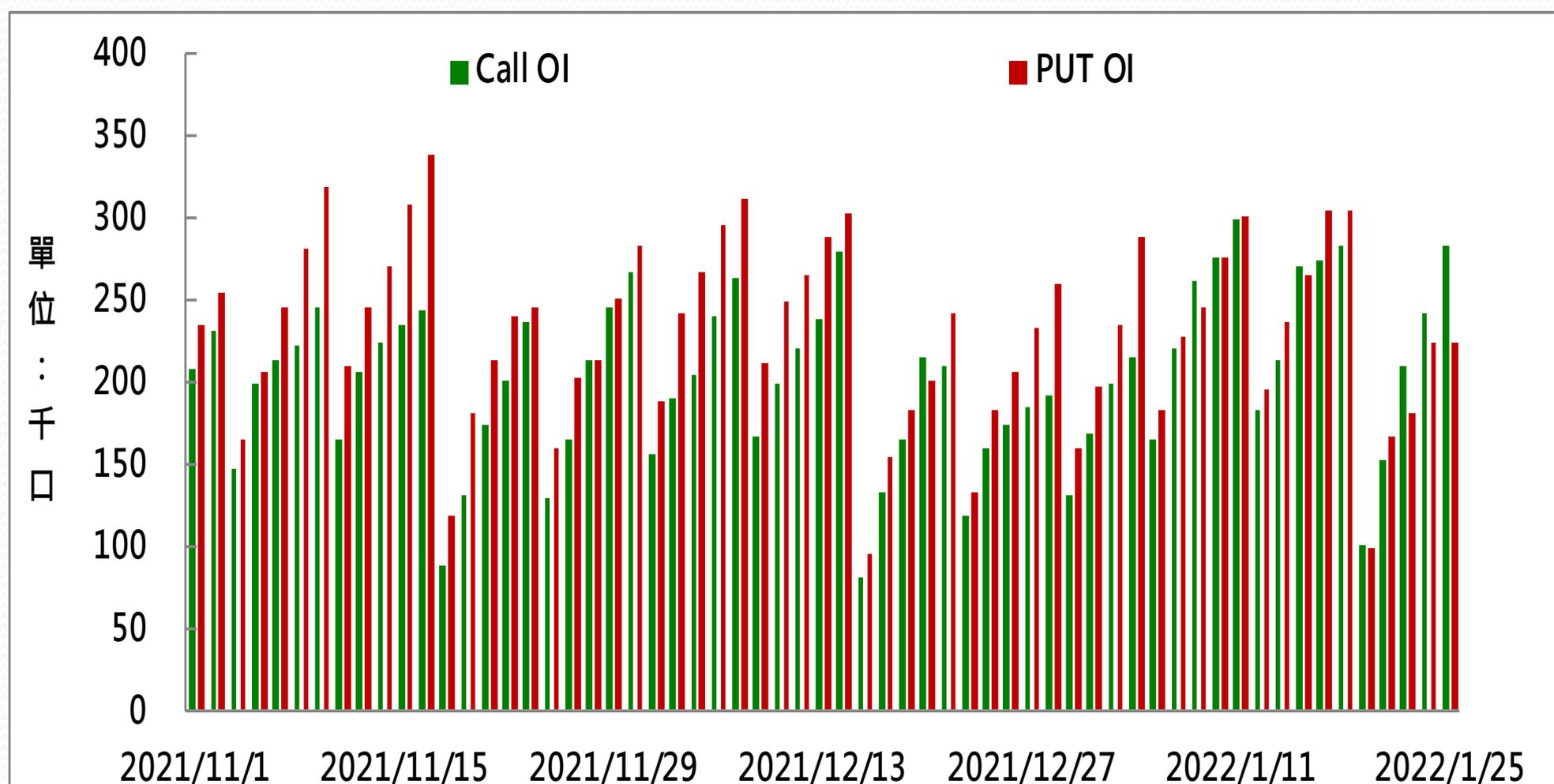
更新日期：2022年1月25日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年1月25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25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25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