

台指選擇權OI匯報

日期 : 2022/1/26			結算日 : 2022/2/2			日期 : 2022/1/26			結算日 : 2022/2/16		
202202W1						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	
2	2	17,000	2,171	2,171		0	12	16,600	1,206	113	
0	0	17,100	783	783		0	0	16,700	1,430	239	
4	4	17,200	1,624	1,624		0	1	16,800	3,399	764	
0	0	17,250	575	575		0	8	16,900	1,852	34	
12	12	17,300	952	952		-25	22	17,000	13,068	344	
5	5	17,350	571	571		5	14	17,100	2,754	236	
31	31	17,400	684	684		104	131	17,200	2,687	237	
1	1	17,450	335	335		20	400	17,300	2,566	192	
68	68	17,500	1,617	1,617		20	295	17,400	3,244	26	
95	95	17,550	254	254		38	1,835	17,500	3,425	-69	
66	66	17,600	391	391		95	1,017	17,600	3,260	-457	
173	173	17,650	267	267		359	1,250	17,700	3,036	-274	
575	575	17,700	620	620		462	1,974	17,800	2,331	-746	
538	538	17,750	249	249		282	1,397	17,900	1,267	-241	
362	362	17,800	160	160	※	1,089	3,361	18,000	1,732	-36	
326	326	17,850	16	16		400	2,509	18,100	1,201	-20	
629	629	17,900	63	63		627	6,028	18,200	2,759	-260	
476	476	17,950	28	28		504	4,997	18,300	764	-3	
1,508	1,508	18,000	32	32		-578	5,818	18,400	1,224	-14	
691	691	18,050	6	6		574	6,484	18,500	386	-2	
957	957	18,100	8	8		419	8,036	18,600	108	-7	
1,735	1,735	18,150	2	2		-56	8,013	18,700	65	-2	
1,854	1,854	18,200	19	19		633	7,240	18,800	198	0	
※	2,571	2,571	18,300	0	0	113	3,732	18,900	12	0	
	1,453	1,453	18,400	3	3	-425	6,852	19,000	10	-2	
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
16,170	16,170	2.2691	36,692	36,692		4,926	91,738	0.9035	82,883	7,445	
昨日 P/C		0.0000	今日增減變化	2.2691		昨日 P/C	0.8690	今日增減變化	0.0345		

更新日期 : 2022年1月26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26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	62,904,012	174,813,770	-111,909,758	3,676,266	2,615,262	3,406,390	-791,128	462,501
投信	60,767,552	55,656,592	5,110,960	1,547,882	2,175,452	0	2,175,452	155,907
自營商	71,671,899	13,307,274	58,364,625	-2,388,722	1,592,146	1,060,360	531,786	-96,384
	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	893,338	4,076,603	-3,183,265	70,582	12,770	3,193	9,577	20,683
投信	22,638	0	22,638	78	1,596	0	1,596	9
自營商	539,736	120,123	419,613	-48,909	142,054	205,878	-63,824	-19,428

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26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	18,153	21,393	-3,240	-746	45,443	23,214	22,229	-3,430
投信	0	0	0	0	0	58	-58	0
自營商	36,577	37,418	-841	18,389	37,697	36,752	945	-14,965
特定法人(週)	156	0	156	---	1,500	8,134	-6,634	---
特定法人(近月)	8,943	12,288	-3,345	749	11,483	30,253	-18,770	-5,309
特定法人(全月)	13,361	14,189	-828	-1,248	10,623	42,159	-31,536	307
十大交易人(週)	6,917	6,675	242	---	22,007	21,047	960	---
十大交易人(近月)	33,659	38,010	-4,351	795	29,227	50,346	-21,119	-2,758
十大交易人(全月)	51,652	49,224	2,428	18,553	49,358	75,337	-25,979	3,697
全市場未沖銷(近月)			91,738	4,926			82,883	7,445
全市場未沖銷(全月)			130,782	-152,921			138,180	-85,510

更新日期：2022年1月26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 02W1 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	15900	賣權OI最大量	15900
	整體隱含波動率	18.38%	較前一交易日	+1.46%
	買權隱含波動率	12.92%	較前一交易日	-3.42%
	賣權隱含波動率	21.79%	較前一交易日	+4.12%
電子選擇權	買權成交最大量	865	買權OI最大量	885
	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26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	18600
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	21.67%	較前一交易日	-0.12%
	買權隱含波動率	15.33%	較前一交易日	-0.74%
	賣權隱含波動率	27.66%	較前一交易日	+0.70%
	成交量P/C_Ratio值	0.992	較前一交易日	+0.04
	未平倉P/C_Ratio值	0.903	較前一交易日	+0.03
電子選擇權	買權成交最大量	865	買權OI最大量	885
	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26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

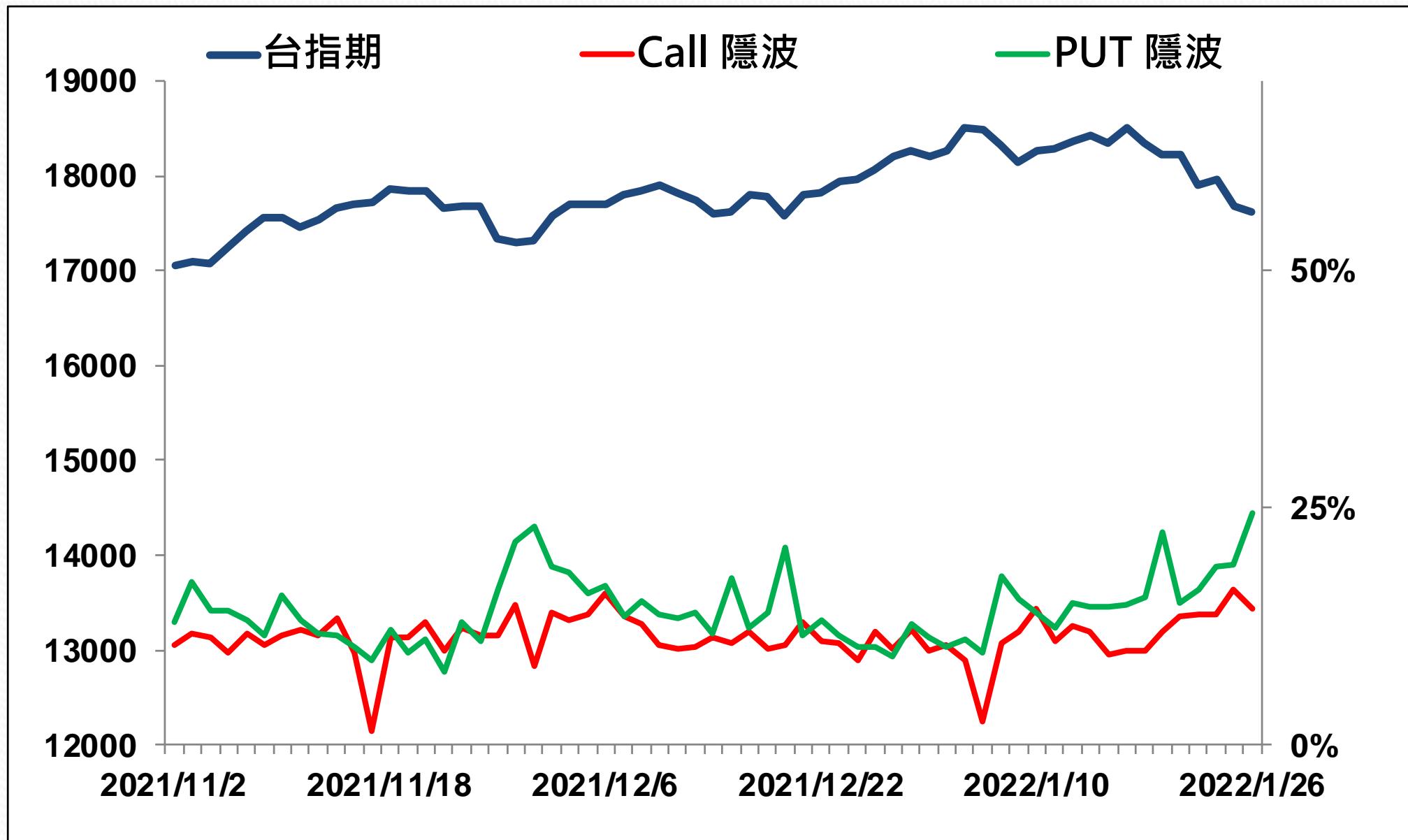
— 臺指選擇權波動率指數



更新日期：2022年1月26日

資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

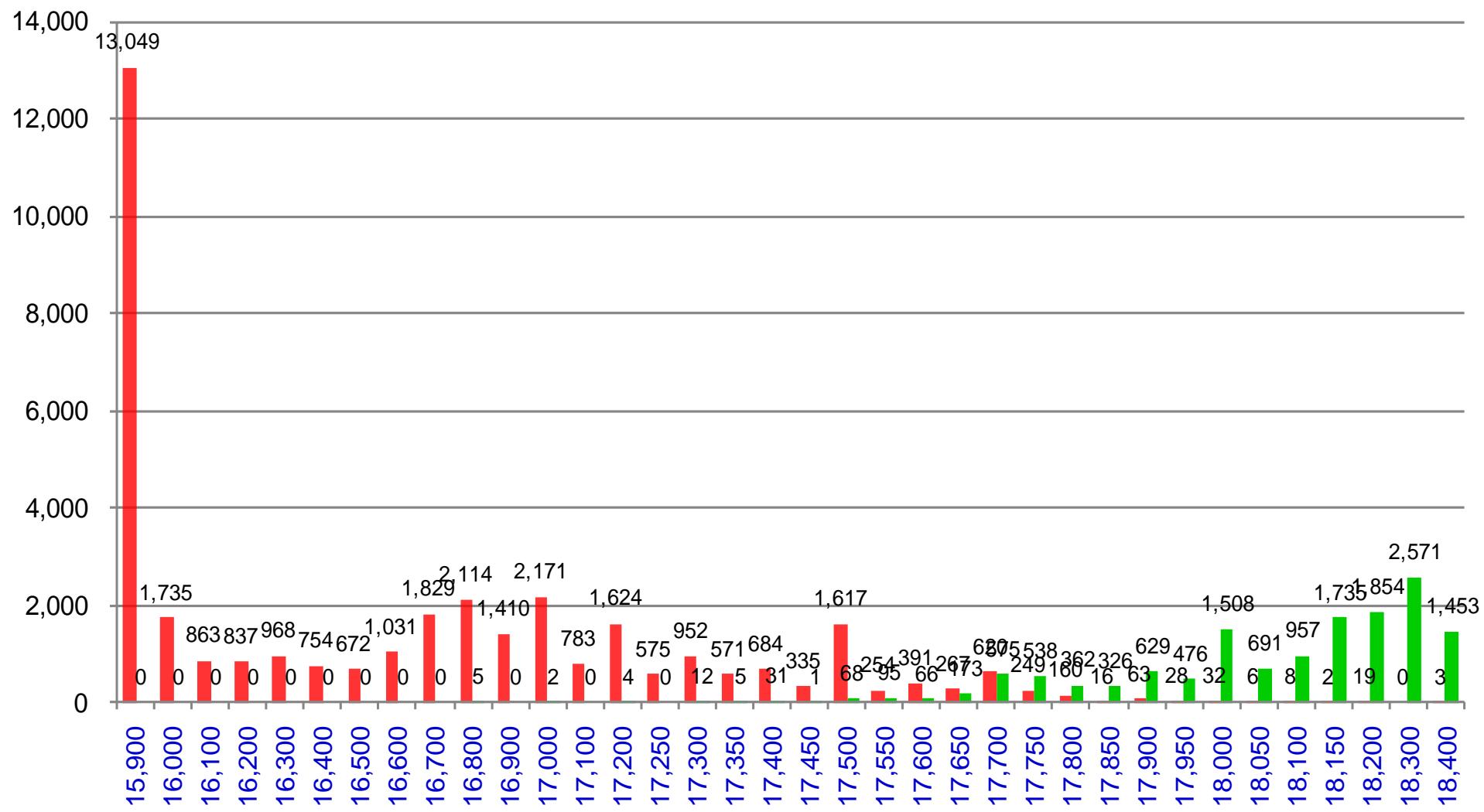
台指近月隱含波動度



更新日期：2022年1月26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

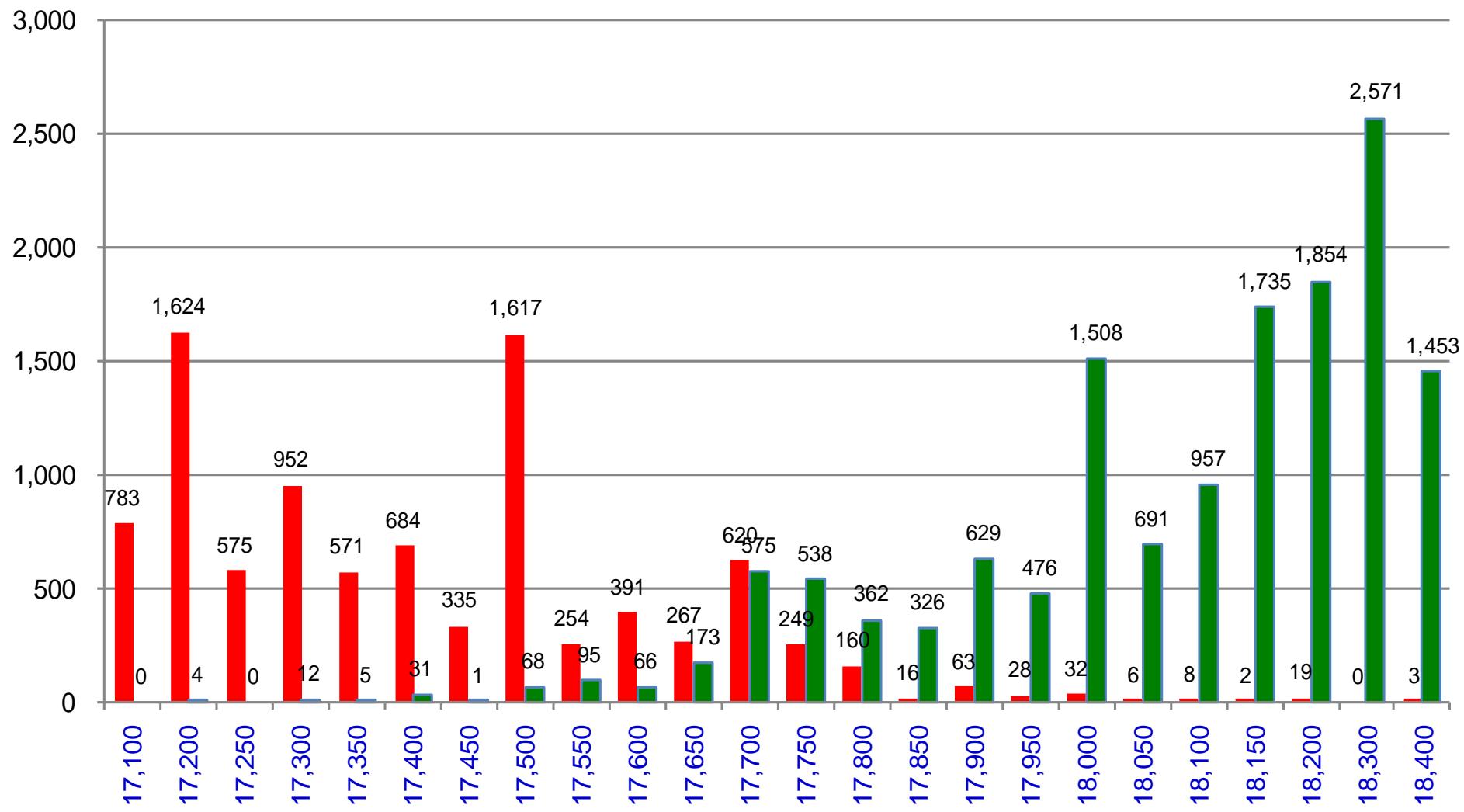
■ 週選 PUT OI 變化 : 36,692 ■ 週選 CALL OI 變化 : 16,170



更新日期：2022年1月26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：36,692 ■ 週選 CALL OI 總額：16,170



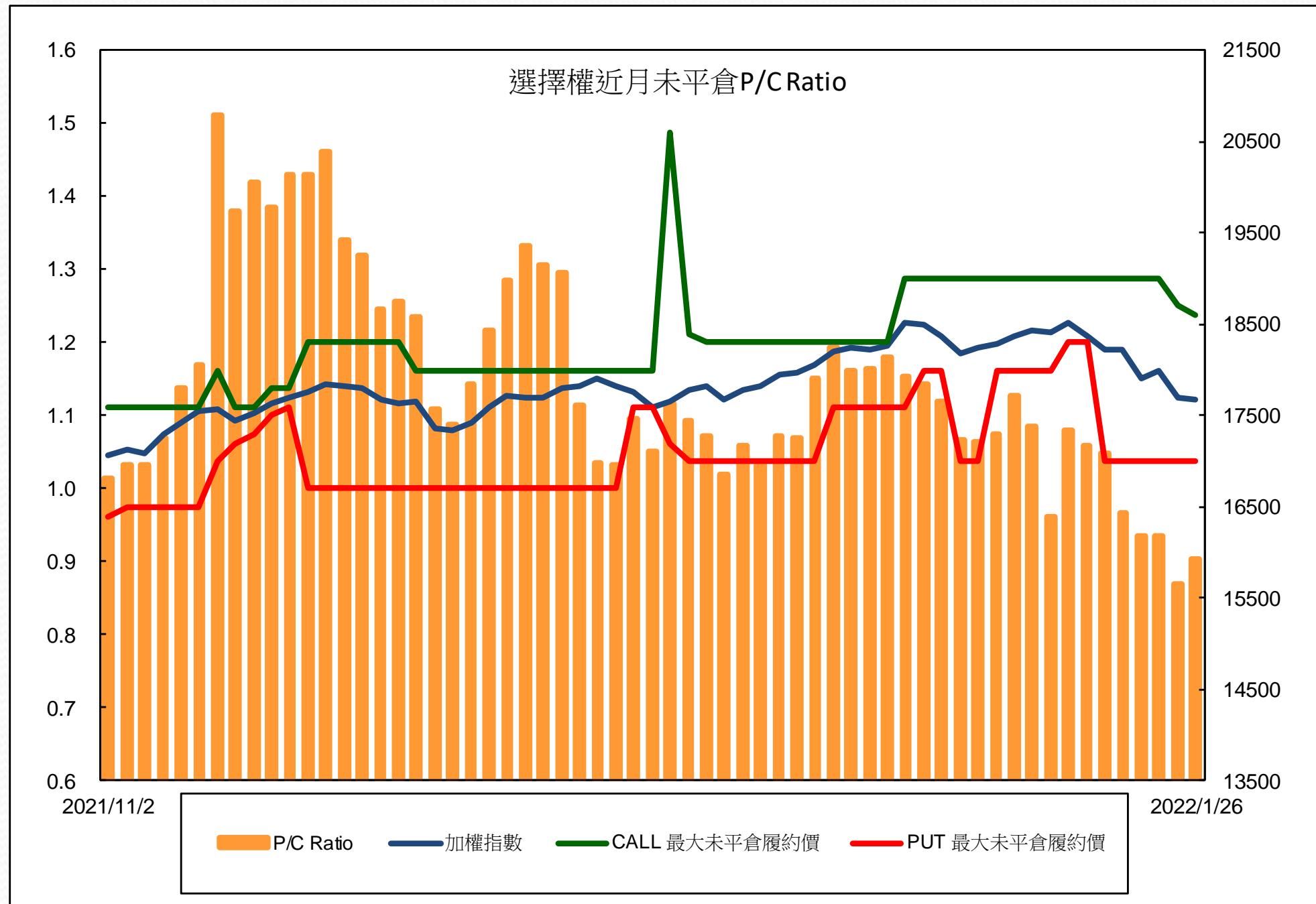
更新日期：2022年1月26日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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25日	55,095	74,325	-19,230
	1月26日	36,577	37,418	-841
Put	1月25日	52,483	36,573	15,910
	1月26日	37,697	36,752	945

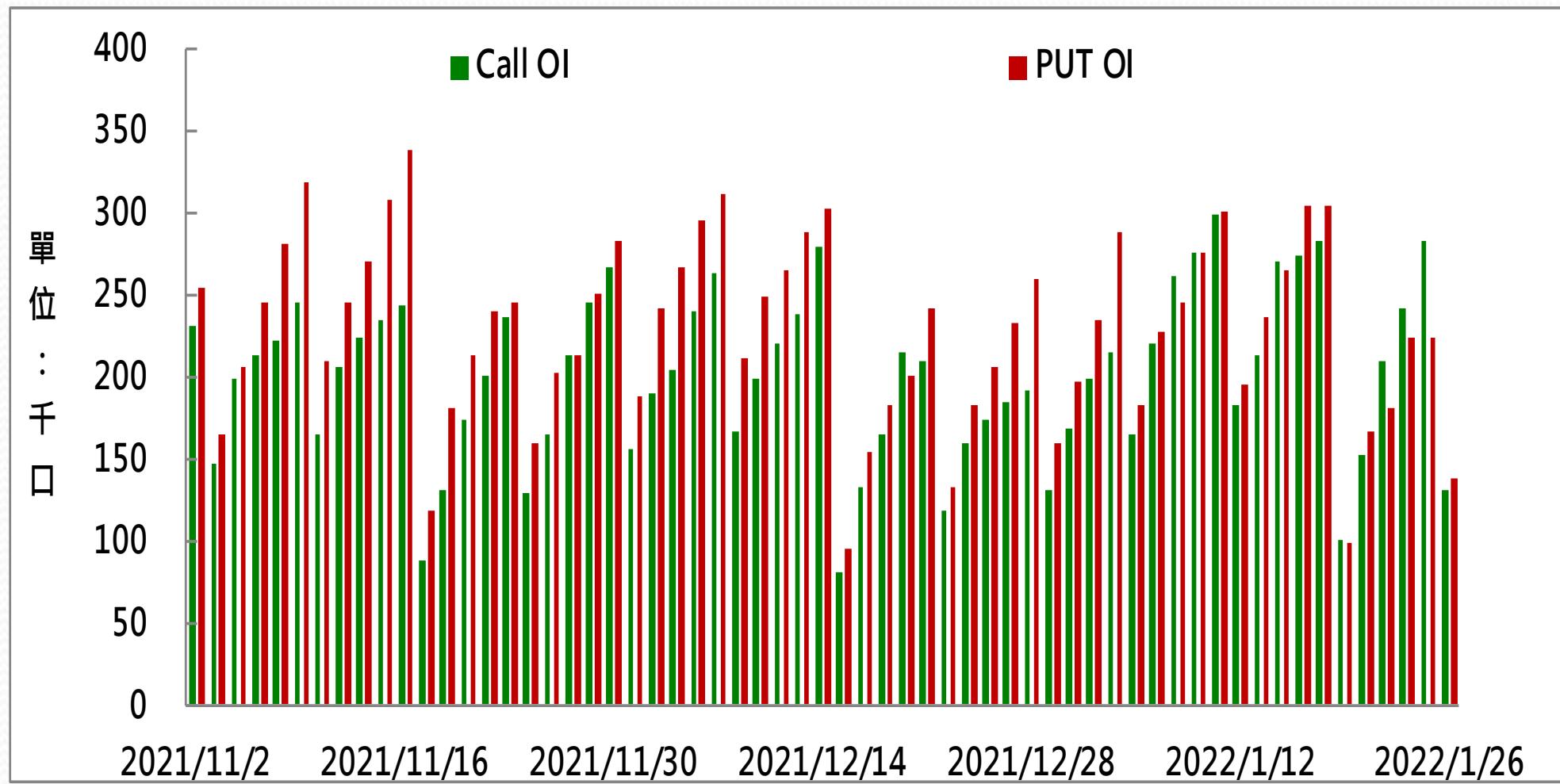
更新日期：2022年1月26日 資料來源：台灣期貨交易所 · 凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年1月26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26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26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