

台指選擇權OI匯報

日期：2022/1/3 結算日：2022/1/5					日期：2022/1/3 結算日：2022/1/19				
202201W1					202201 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	17,300	2,524	-10	0	47	16,800	4,449	34
0	0	17,400	1,078	5	0	69	16,900	2,637	32
0	0	17,500	2,484	-22	0	556	17,000	6,150	185
0	0	17,600	1,825	-162	-9	1,577	17,100	4,214	42
0	50	17,700	2,282	65	-4	535	17,200	4,588	128
-4	3	17,750	2,955	722	0	353	17,300	5,858	43
-1	15	17,800	2,984	-471	-3	1,110	17,400	3,454	-328
0	0	17,850	5,978	-381	-6	619	17,500	5,009	348
4	29	17,900	4,314	845	-8	2,143	17,600	6,974	304
3	32	17,950	5,588	734	-58	2,314	17,700	5,815	1,146 ※
30	135	18,000	9,215	4,043	-32	2,878	17,800	5,682	575
5	180	18,050	5,446	1,095	-115	3,044	17,900	5,061	604
-78	446	18,100	7,494	4,435	-81	4,739	18,000	4,925	1,029
350	1,117	18,150	7,745	5,463 ※	-539	3,963	18,100	1,790	424
446	2,158	18,200	7,059	4,350	-107	6,297	18,200	2,022	946
1,217	3,698	18,250	4,628	2,105	260	8,500	18,300	1,442	971
3,528	8,466	18,300	4,205	2,286	422	7,610	18,400	761	152
2,041	6,184	18,350	1,505	1,174	0	7,872	18,500	388	216
※ 5,122	10,188	18,400	1,411	1,064	844	8,002	18,600	119	76
3,566	7,007	18,450	532	357	902	6,763	18,700	75	25
2,883	8,879	18,500	288	187	※ 1,265	4,923	18,800	301	-1
1,724	6,050	18,550	107	88	438	4,222	18,900	18	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
23,389	71,798	1.2086	86,774	28,276	4,642	100,482	1.1800	118,569	6,975
昨日 P/C	1.2084	今日增減變化		0.0002	昨日 P/C	1.1644	今日增減變化		0.0156

更新日期：2022年1月3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3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	97,129,829	189,064,317	-91,934,488	-392,641	2,390,467	2,804,197	-413,730	-466,281
投信	56,116,961	49,385,562	6,731,399	707,861	565,792	0	565,792	5,312
自營商	67,026,324	9,630,774	57,395,550	514,427	2,393,708	1,435,619	958,089	383,870
	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	639,694	4,326,522	-3,686,828	-74,826	167,993	229,082	-61,089	19,422
投信	22,058	0	22,058	-219	1,697	0	1,697	-16
自營商	841,595	246,010	595,585	-84,723	422,450	393,585	28,865	-55,113

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3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	35,992	27,229	8,763	4,623	57,126	27,548	29,578	3,616
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	45,339	43,868	1,471	4,860	50,752	51,493	-741	-2,643
特定法人(週)	1,000	0	1,000	483	0	0	0	1,003
特定法人(近月)	20,633	20,872	-239	1,075	8,359	34,943	-26,584	-1,872
特定法人(全月)	25,698	21,364	4,334	1,191	18,315	48,169	-29,854	-4,911
十大交易人(週)	18,828	24,171	-5,343	1,805	29,043	25,416	3,627	-12
十大交易人(近月)	52,620	44,047	8,573	606	50,509	62,902	-12,393	585
十大交易人(全月)	78,029	61,945	16,084	4,682	84,321	100,289	-15,968	-1,558
全市場未沖銷(近月)			100,482	4,642			118,569	6,975
全市場未沖銷(全月)			198,746	30,914			234,198	37,123

更新日期：2022年1月3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01W1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	18400
	賣權成交最大量	18200	賣權OI最大量	18000
	整體隱含波動率	9.73%	較前一交易日	-0.02%
	買權隱含波動率	10.11%	較前一交易日	+0.68%
	賣權隱含波動率	9.35%	較前一交易日	-0.76%
電子選擇權	買權成交最大量	905	買權OI最大量	880
	賣權成交最大量	870	賣權OI最大量	860
金融選擇權	買權成交最大量	1740	買權OI最大量	1680
	賣權成交最大量	1680	賣權OI最大量	1680

更新日期：2022年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

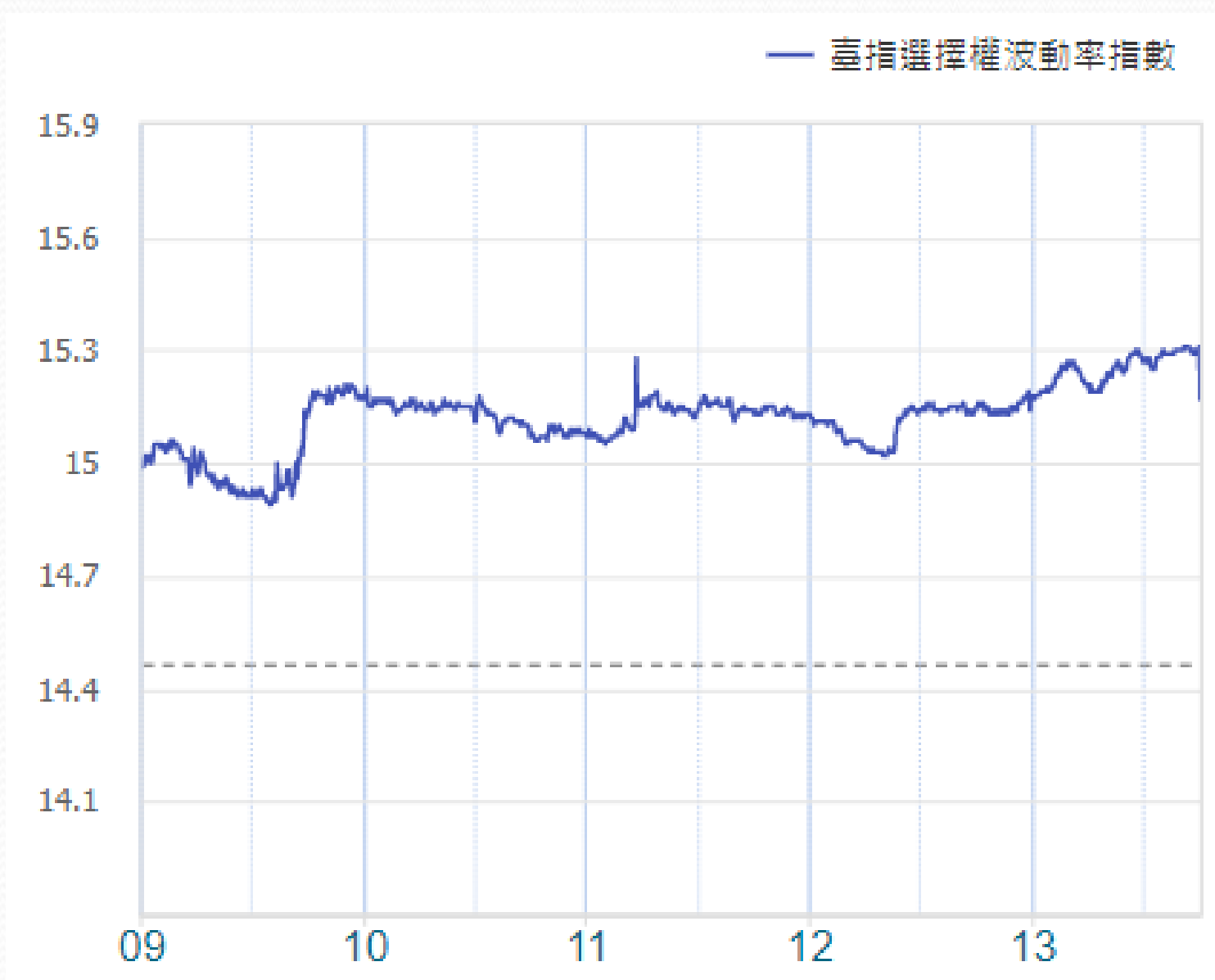
台指選擇權匯報

2022年01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	18300
	賣權成交最大量	18000	賣權OI最大量	17600
	整體隱含波動率	13.91%	較前一交易日	-0.41%
	買權隱含波動率	12.50%	較前一交易日	+0.94%
	賣權隱含波動率	15.37%	較前一交易日	-0.26%
	成交量P/C_Ratio值	0.955	較前一交易日	+0.01
	未平倉P/C_Ratio值	1.180	較前一交易日	+0.02
電子選擇權	買權成交最大量	905	買權OI最大量	880
	賣權成交最大量	870	賣權OI最大量	860
金融選擇權	買權成交最大量	1740	買權OI最大量	1680
	賣權成交最大量	1680	賣權OI最大量	1680

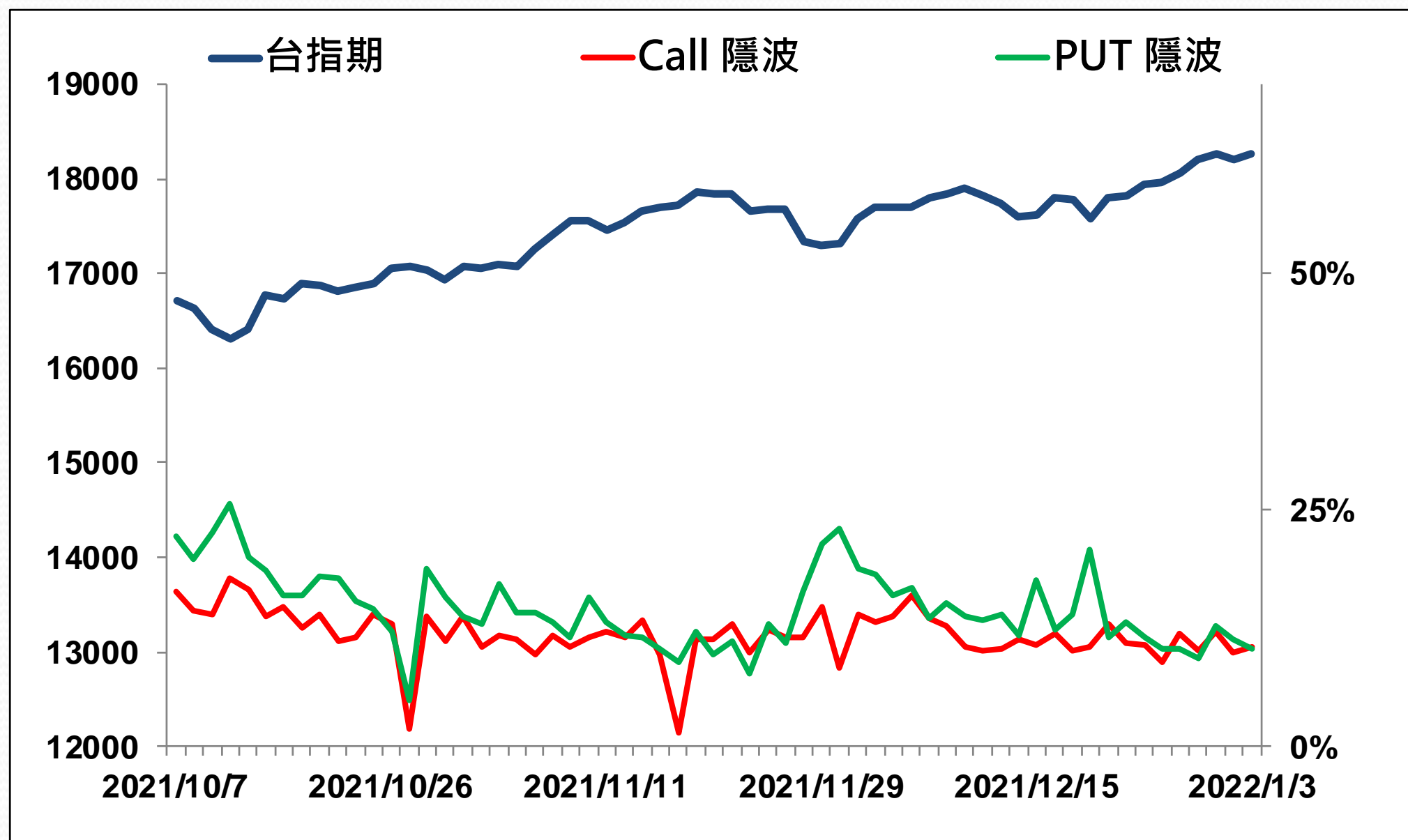
更新日期：2022年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



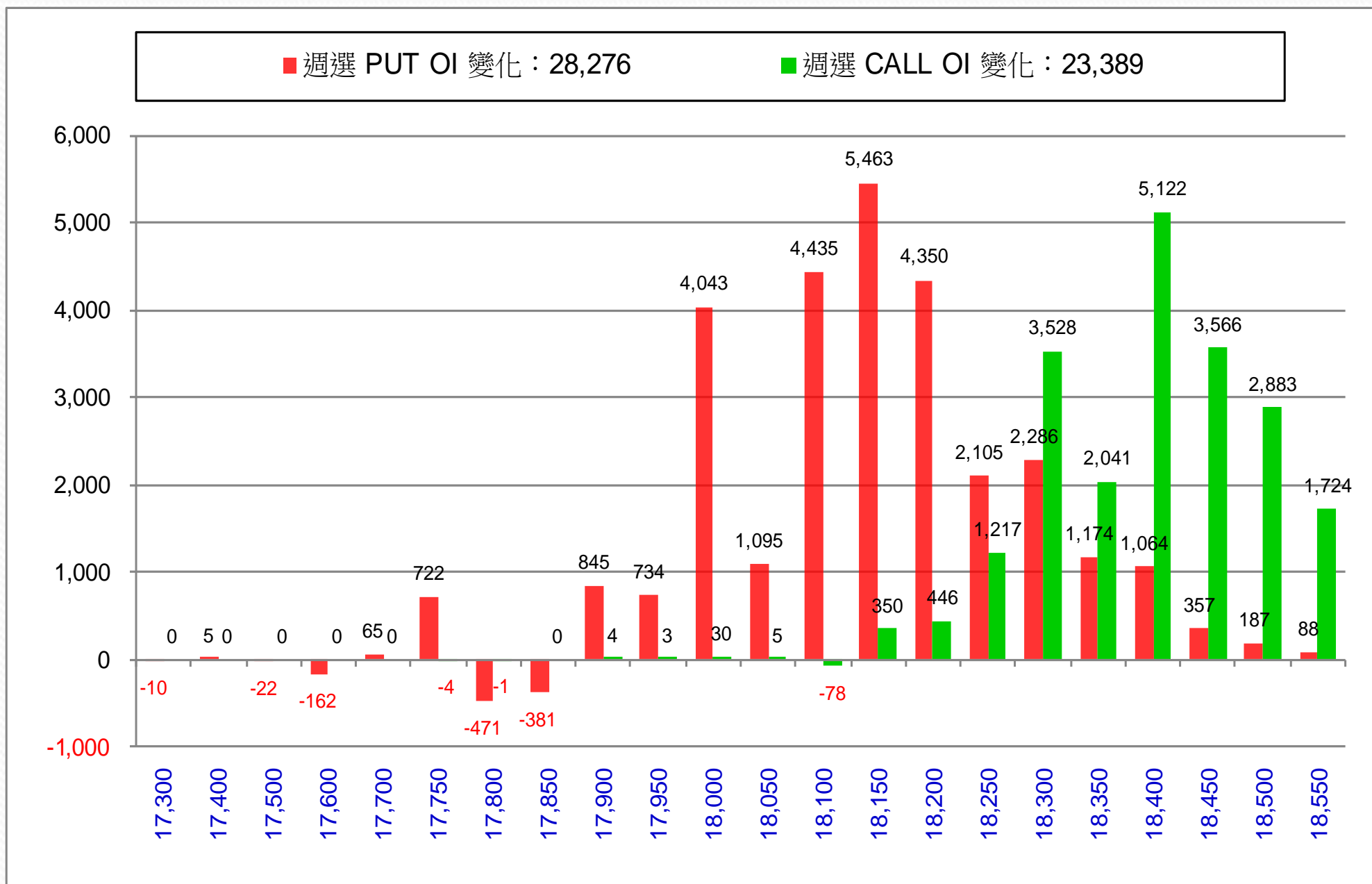
更新日期：2022年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



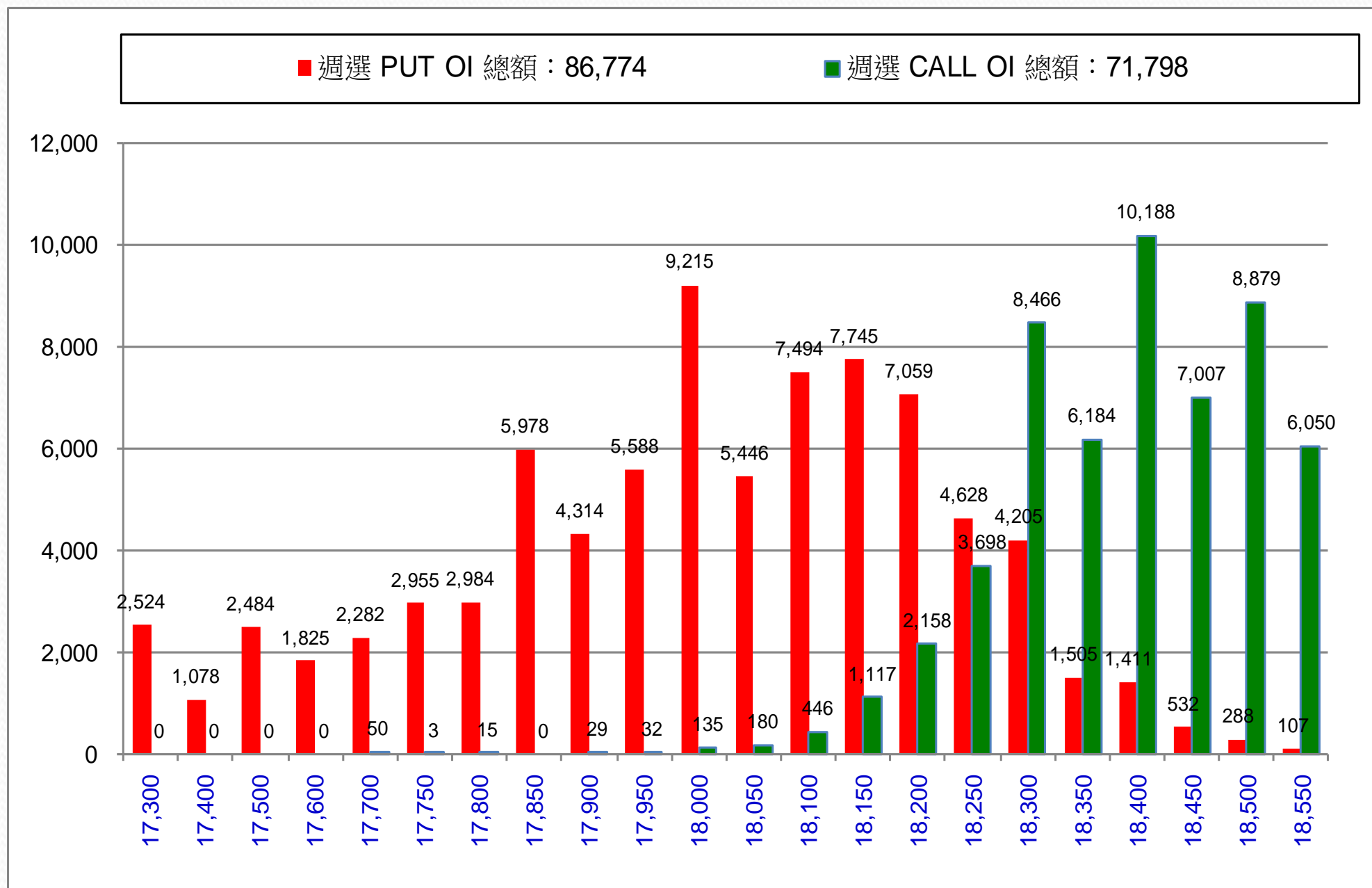
更新日期：2022年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年1月3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



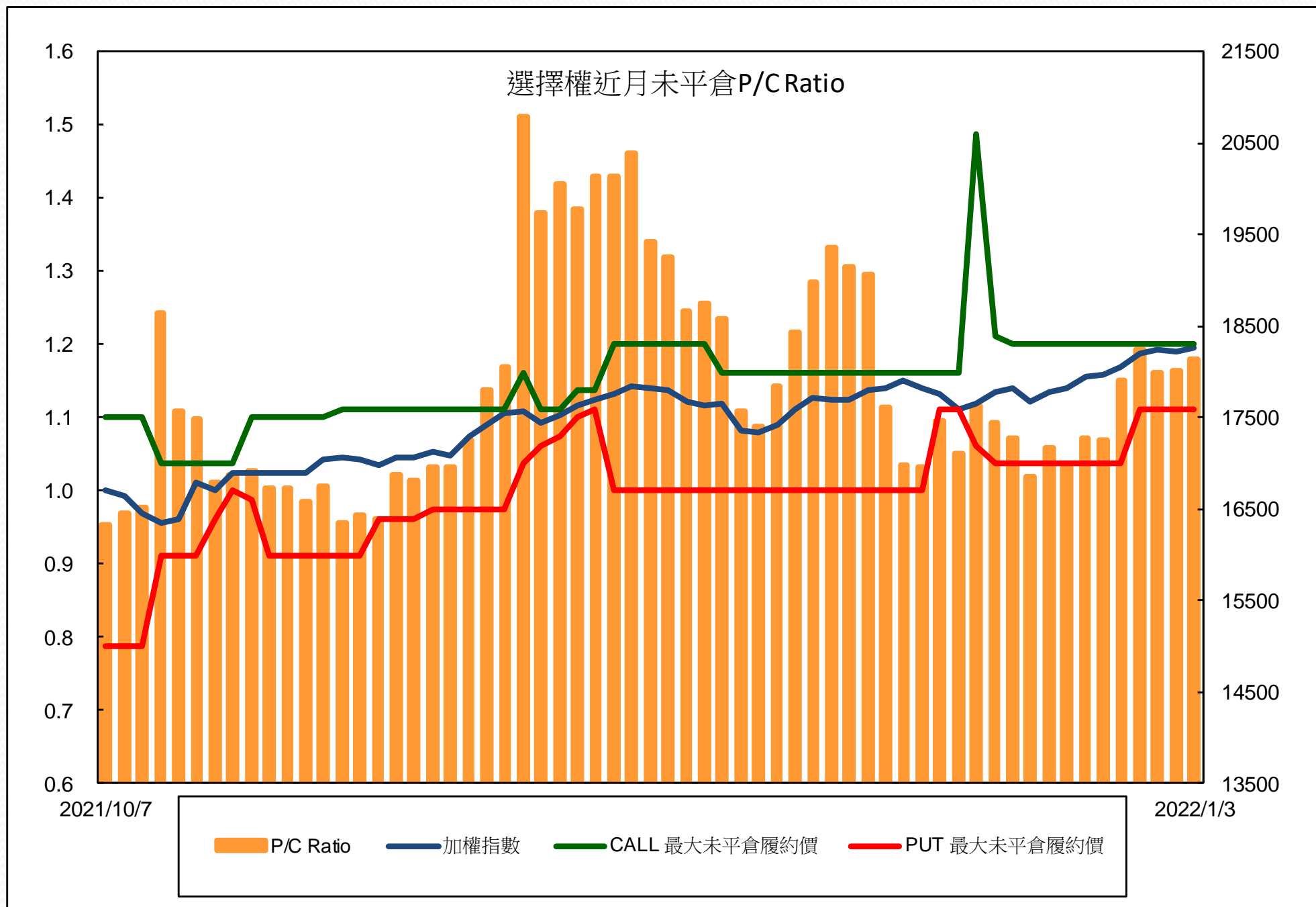
更新日期：2022年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	12月30日	42,623	46,012	-3,389
	1月3日	45,339	43,868	1,471
Put	12月30日	47,143	45,241	1,902
	1月3日	50,752	51,493	-741

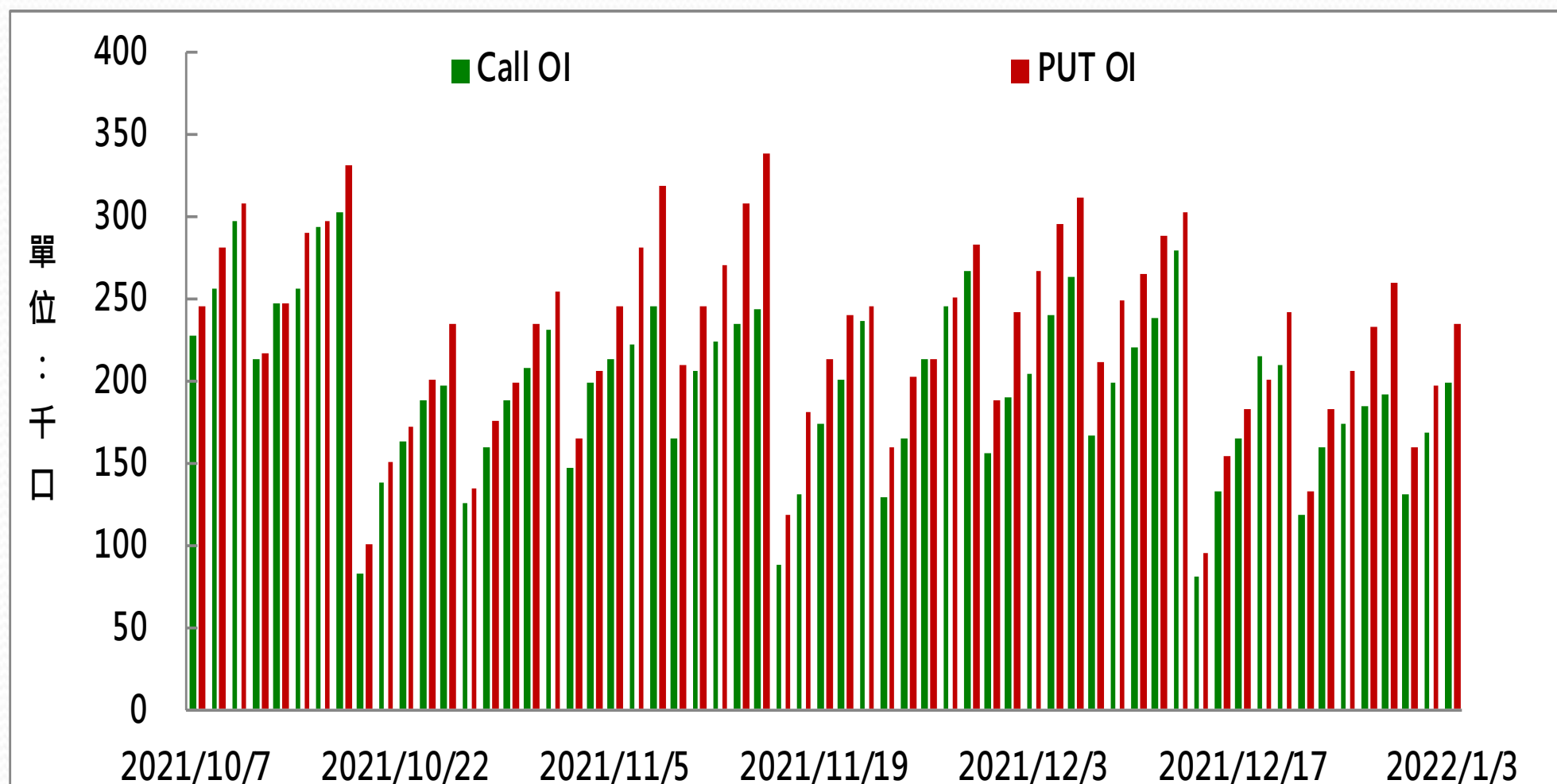
更新日期：2022年1月3日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年1月3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3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3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