

# 台指選擇權OI匯報

日期：2022/1/4 結算日：2022/1/5					日期：2022/1/4 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
-8	7	17,800	2,875	-109	-1	555	17,000	5,904	-246
0	0	17,850	5,595	-383	-1	1,576	17,100	2,836	-1,378
-5	24	17,900	3,585	-729	-3	532	17,200	4,237	-351
2	34	17,950	4,463	-1,125	-2	351	17,300	5,591	-267
-52	83	18,000	7,853	-1,362	-6	1,104	17,400	2,886	-568
-76	104	18,050	4,449	-997	-18	601	17,500	5,068	59
-97	349	18,100	7,382	-112	-26	2,117	17,600	6,823	-151
-99	1,018	18,150	5,024	-2,721	44	2,358	17,700	5,377	-438
-481	1,677	18,200	8,829	1,770	-127	2,751	17,800	5,223	-459
-1,240	2,458	18,250	11,036	6,408	-111	2,933	17,900	6,351	1,290
-2,889	5,577	18,300	9,692	5,487	-223	4,516	18,000	6,535	1,610
-2,366	3,818	18,350	11,396	9,891	-189	3,774	18,100	3,599	1,809
-2,209	7,979	18,400	11,828	10,417	-1,237	5,060	18,200	3,468	1,446
-260	6,747	18,450	10,400	9,868	-803	7,697	18,300	2,290	848
2,121	11,000	18,500	7,977	7,689	-1,117	6,493	18,400	1,849	1,088
※ 5,853	11,903	18,550	3,425	3,318	-3	7,869	18,500	812	424
4,342	10,228	18,600	813	781	-1,347	6,655	18,600	376	257
2,379	5,905	18,650	180	179	2,518	9,281	18,700	164	89
2,236	4,690	18,700	69	68	1,795	6,718	18,800	364	63
925	2,367	18,750	42	42	882	5,104	18,900	22	4
-11	2,113	18,800	55	55	※ 4,968	12,455	19,000	17	13
468	1,638	18,900	0	0	193	2,592	19,100	2	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
8,625	80,423	1.6740	134,626	47,852	7,005	107,487	1.1524	123,873	5,304
昨日 P/C	1.2086	今日增減變化	0.4654		昨日 P/C	1.1800	今日增減變化	-0.0276	

更新日期：2022年1月4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4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	100,381,565	191,775,996	-91,394,431	540,057	2,527,524	2,498,678	28,846	442,576
投信	57,482,260	48,632,575	8,849,685	2,118,286	576,896	0	576,896	11,104
自營商	71,822,437	11,179,552	60,642,885	3,247,335	2,649,988	1,427,778	1,222,210	264,121
	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	702,790	4,354,841	-3,652,051	34,777	139,285	229,311	-90,026	-28,937
投信	22,175	0	22,175	117	1,699	0	1,699	2
自營商	774,430	250,746	523,684	-71,901	427,928	387,109	40,819	11,954

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4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	51,253	28,512	22,741	13,978	61,941	27,599	34,342	4,764
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	54,325	50,919	3,406	1,935	56,532	65,158	-8,626	-7,885
特定法人(週)	2,138	0	2,138	1,138	0	1,452	-1,452	-1,452
特定法人(近月)	33,690	23,401	10,289	10,528	8,488	37,387	-28,899	-2,315
特定法人(全月)	40,444	20,046	20,398	16,064	15,672	53,228	-37,556	-7,702
十大交易人(週)	29,323	27,722	1,601	6,944	47,824	33,943	13,881	10,254
十大交易人(近月)	64,849	50,909	13,940	5,367	52,267	63,063	-10,796	1,597
十大交易人(全月)	102,298	74,196	28,102	12,018	97,971	105,043	-7,072	8,896
全市場未沖銷(近月)			107,487	7,005			123,873	5,304
全市場未沖銷(全月)			215,826	17,080			288,606	54,408

更新日期：2022年1月4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	18400	買權OI最大量	18550
	賣權成交最大量	18400	賣權OI最大量	18400
	整體隱含波動率	9.20%	較前一交易日	-0.53%
	買權隱含波動率	8.03%	較前一交易日	-2.08%
	賣權隱含波動率	10.31%	較前一交易日	+0.97%
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	865	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	550	賣權OI最大量	1680

更新日期：2022年1月4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	19000	買權OI最大量	19000
	賣權成交最大量	18000	賣權OI最大量	17600
	整體隱含波動率	13.72%	較前一交易日	+0.19%
	買權隱含波動率	12.35%	較前一交易日	-0.14%
	賣權隱含波動率	15.37%	較前一交易日	-0.01%
	成交量P/C_Ratio值	0.837	較前一交易日	-0.12
	未平倉P/C_Ratio值	1.152	較前一交易日	-0.03
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	865	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	780	賣權OI最大量	1680

更新日期：2022年1月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

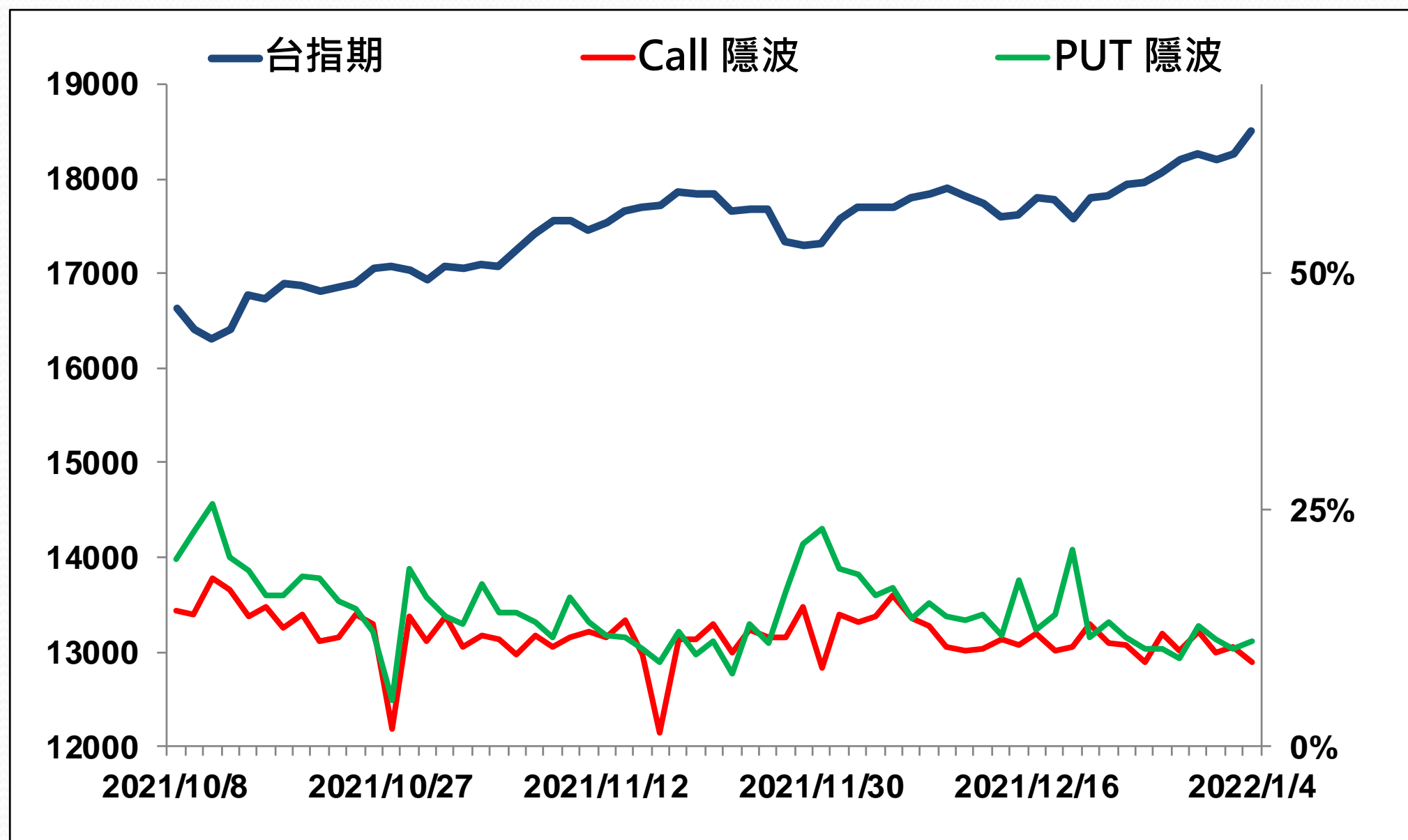


# 選擇權當日波動率指數



更新日期：2022年1月4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

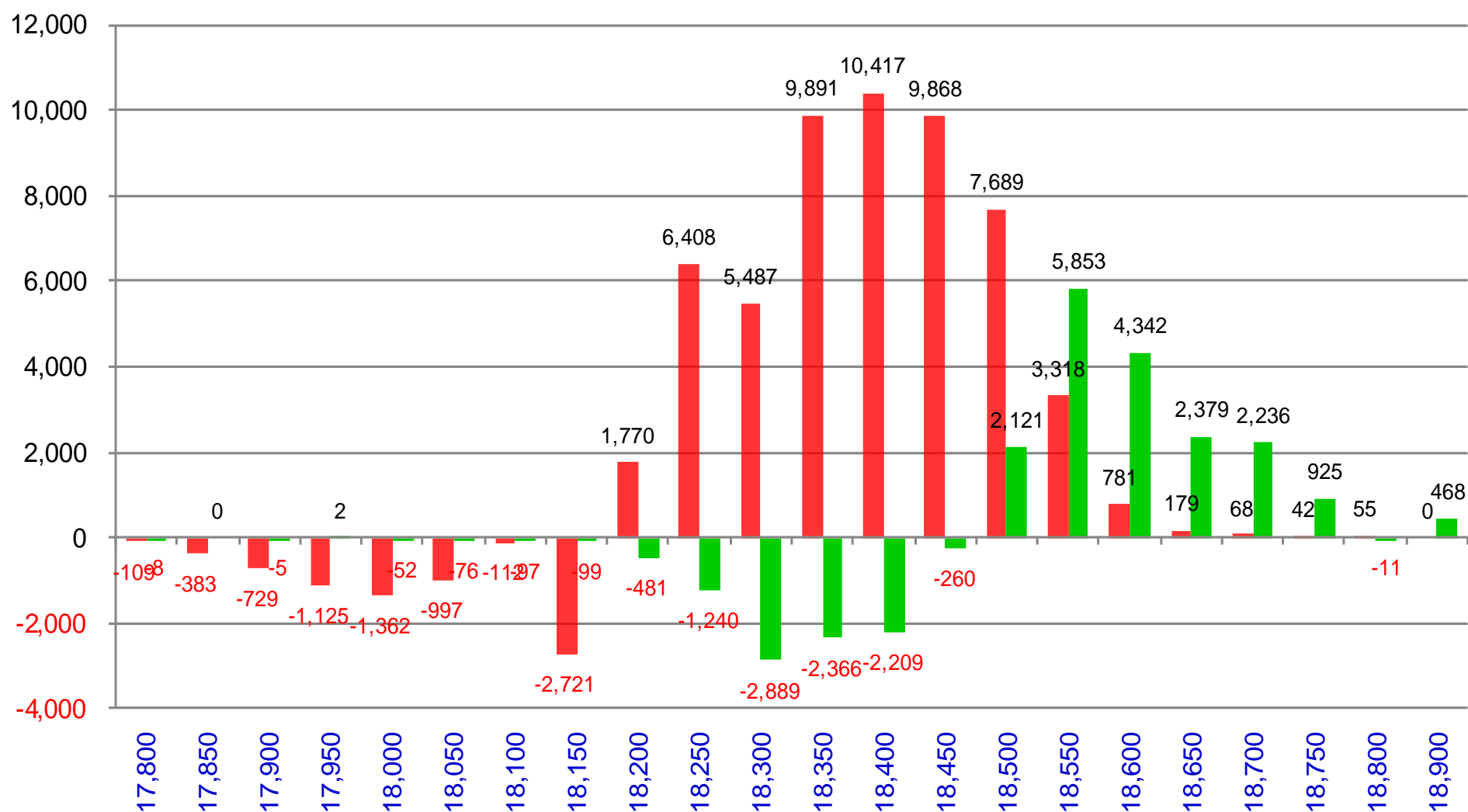


更新日期：2022年1月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI每日變化量

週選 PUT OI 變化：47,852

週選 CALL OI 變化：8,625



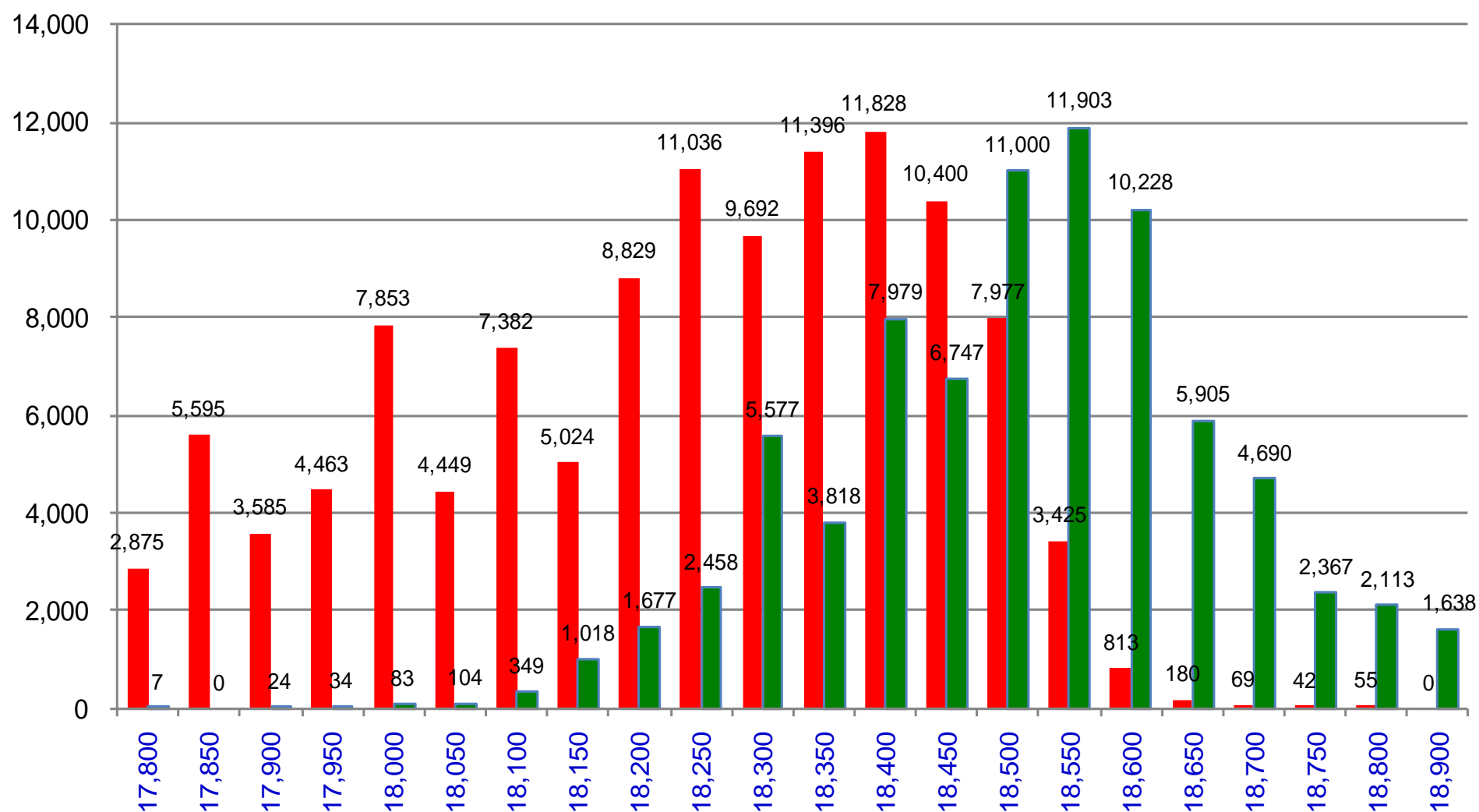
更新日期：2022年1月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理



# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：134,626

週選 CALL OI 總額：80,423



更新日期：2022年1月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

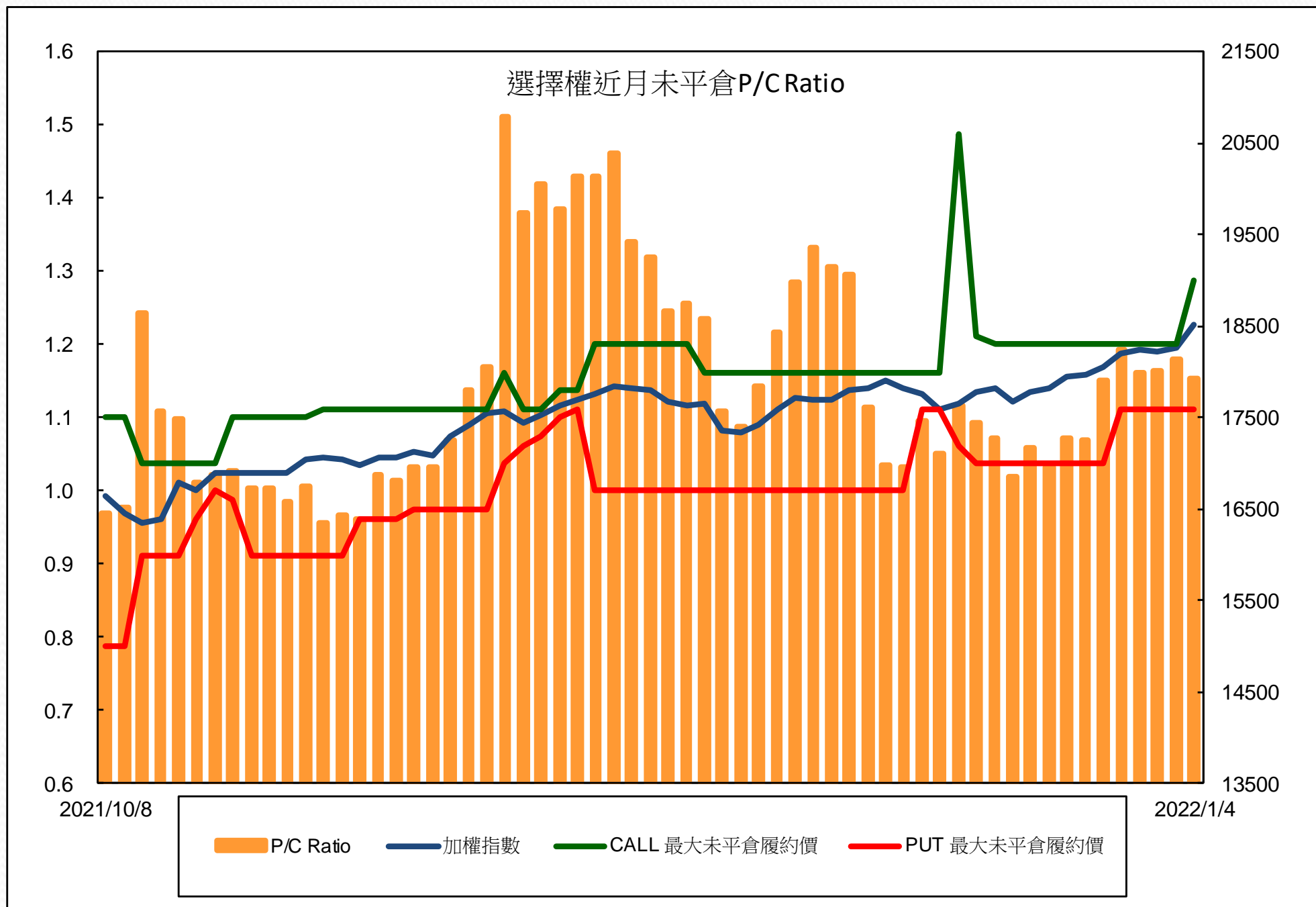


# 自營商選擇權OI部位統計

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3日	45,339	43,868	1,471
	1月4日	54,325	50,919	3,406
Put	1月3日	50,752	51,493	-741
	1月4日	56,532	65,158	-8,626

更新日期：2022年1月4日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

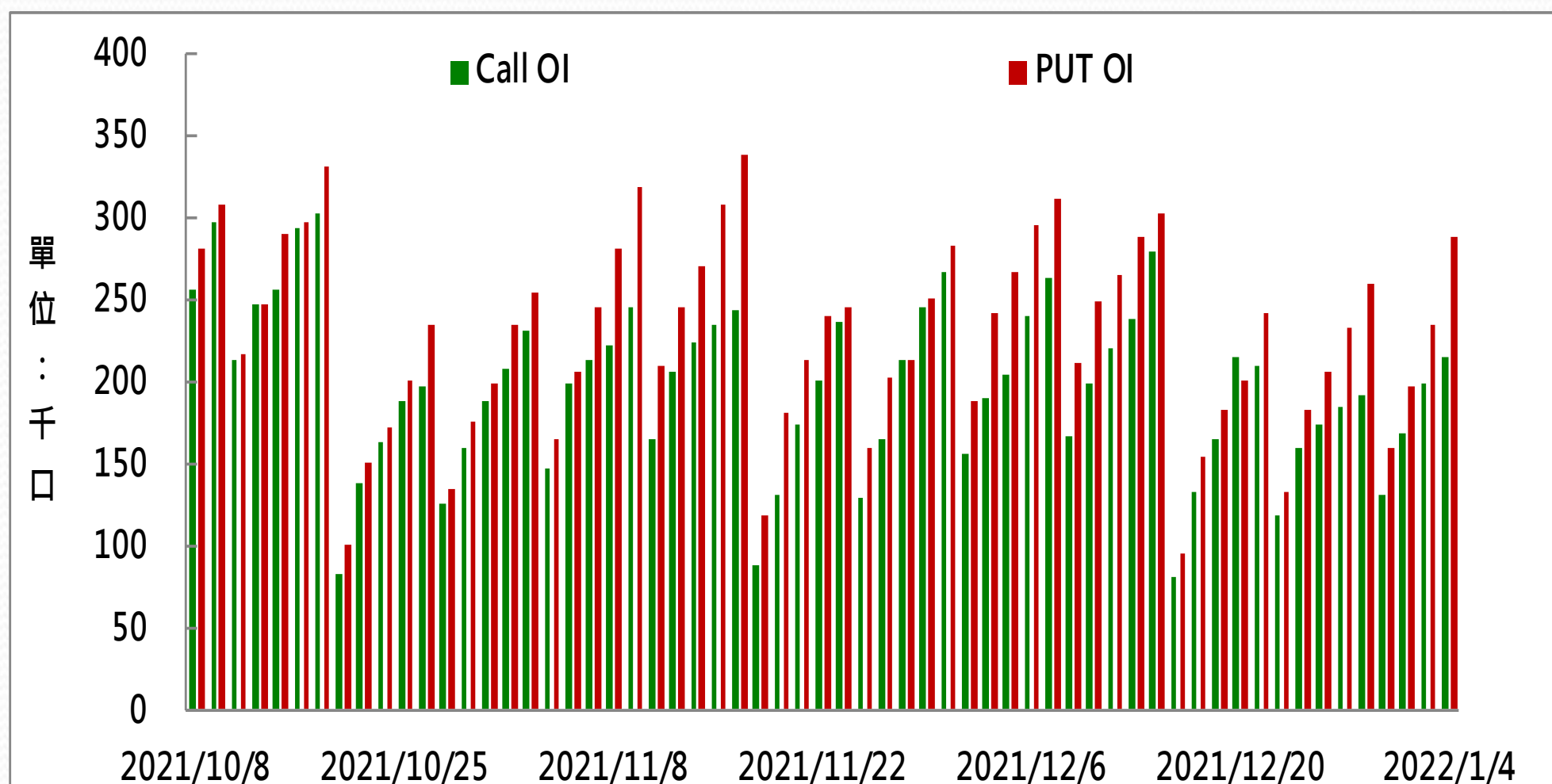
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年1月4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4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4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