

台指選擇權OI匯報

| 日期：2022/1/5 結算日：2022/1/12 | | | | | 日期：2022/1/5 結算日：2022/1/19 | | | | |
|---------------------------|--------|--------|--------|--------|---------------------------|---------|--------|---------|---------|
| 202201W2 | | | | | 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 | 17,500 | 503 | 503 | 0 | 555 | 17,000 | 6,367 | 463 |
| 0 | 0 | 17,600 | 872 | 872 | 0 | 1,576 | 17,100 | 2,780 | -56 |
| 4 | 4 | 17,700 | 2,359 | 2,359 | 0 | 532 | 17,200 | 4,211 | -26 |
| 0 | 0 | 17,800 | 632 | 632 | -4 | 347 | 17,300 | 5,617 | 26 |
| 0 | 0 | 17,900 | 1,321 | 1,321 | 0 | 1,104 | 17,400 | 2,848 | -38 |
| 69 | 69 | 18,000 | 1,667 | 1,667 | -11 | 590 | 17,500 | 5,105 | 37 |
| 6 | 6 | 18,050 | 794 | 794 | -15 | 2,102 | 17,600 | 6,908 | 85 |
| 4 | 4 | 18,100 | 1,786 | 1,786 | -91 | 2,267 | 17,700 | 5,358 | -19 |
| 0 | 0 | 18,150 | 1,389 | 1,389 | -99 | 2,652 | 17,800 | 5,410 | 187 |
| 54 | 54 | 18,200 | 1,505 | 1,505 | 260 | 3,193 | 17,900 | 5,744 | -607 |
| 47 | 47 | 18,250 | 1,712 | 1,712 | -264 | 4,252 | 18,000 | 7,624 | 1,089 |
| 86 | 86 | 18,300 | 1,545 | 1,545 | -44 | 3,730 | 18,100 | 4,668 | 1,069 |
| 183 | 183 | 18,350 | 1,089 | 1,089 | -135 | 4,925 | 18,200 | 3,848 | 380 |
| 492 | 492 | 18,400 | 1,245 | 1,245 | -328 | 7,369 | 18,300 | 3,155 | 865 |
| 488 | 488 | 18,450 | 916 | 916 | -101 | 6,392 | 18,400 | 2,033 | 184 |
| 1,376 | 1,376 | 18,500 | 1,360 | 1,360 | -16 | 7,853 | 18,500 | 1,634 | 822 |
| 1,896 | 1,896 | 18,550 | 342 | 342 | 393 | 7,048 | 18,600 | 484 | 108 |
| 1,741 | 1,741 | 18,600 | 344 | 344 | 35 | 9,316 | 18,700 | 191 | 27 |
| 1,290 | 1,290 | 18,650 | 106 | 106 | 1,011 | 7,729 | 18,800 | 391 | 27 |
| 1,447 | 1,447 | 18,700 | 73 | 73 | 891 | 5,995 | 18,900 | 51 | 29 |
| 1,171 | 1,171 | 18,750 | 27 | 27 | ※ 1,343 | 13,798 | 19,000 | 21 | 4 |
| 2,126 | 2,126 | 18,800 | 15 | 15 | 444 | 3,036 | 19,100 | 25 | 23 |
| 2,517 | 2,517 | 18,850 | 0 | 0 | 607 | 3,705 | 19,200 | 4 | 3 |
| ※ 3,272 | 3,272 | 18,900 | 5 | 5 | 309 | 2,334 | 19,300 | 9 | 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 |
| 22,760 | 22,760 | 1.0159 | 23,123 | 23,123 | 4,762 | 112,249 | 1.1436 | 128,372 | 4,499 |
| 昨日 P/C | 0.0000 | 今日增減變化 | | 1.0159 | 昨日 P/C | 1.1524 | 今日增減變化 | | -0.0088 |

更新日期：2022年1月5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5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 | 103,113,416 | 192,057,127 | -88,943,711 | 2,450,720 | 2,767,770 | 2,353,846 | 413,924 | 385,078 |
| 投信 | 59,280,138 | 48,550,656 | 10,729,482 | 1,879,797 | 575,872 | 0 | 575,872 | -1,024 |
| 自營商 | 70,579,244 | 10,089,803 | 60,489,441 | -153,444 | 2,114,946 | 1,633,550 | 481,396 | -740,814 |
| | 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 | 672,006 | 4,519,602 | -3,847,596 | -195,545 | 132,397 | 229,149 | -96,752 | -6,726 |
| 投信 | 22,173 | 0 | 22,173 | -2 | 1,697 | 0 | 1,697 | -2 |
| 自營商 | 765,806 | 162,003 | 603,803 | 80,119 | 381,817 | 342,731 | 39,086 | -1,733 |

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5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 | 47,752 | 26,568 | 21,184 | -1,557 | 56,952 | 26,216 | 30,736 | -3,606 |
| 投信 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 49 | -49 | 0 |
| 自營商 | 47,524 | 50,706 | -3,182 | -6,588 | 39,402 | 44,198 | -4,796 | 3,830 |
| 特定法人(週) | 0 | 0 | 0 | --- | 0 | 0 | 0 | --- |
| 特定法人(近月) | 35,030 | 23,401 | 11,629 | 1,340 | 8,952 | 36,586 | -27,634 | 1,265 |
| 特定法人(全月) | 43,016 | 23,013 | 20,003 | -395 | 18,671 | 49,118 | -30,447 | 7,109 |
| 十大交易人(週) | 11,326 | 11,156 | 170 | --- | 9,771 | 7,352 | 2,419 | --- |
| 十大交易人(近月) | 66,211 | 52,527 | 13,684 | -256 | 54,816 | 63,477 | -8,661 | 2,135 |
| 十大交易人(全月) | 91,954 | 69,320 | 22,634 | -5,468 | 77,135 | 87,676 | -10,541 | -3,469 |
| 全市場未沖銷(近月) | | | 112,249 | 4,762 | | | 128,372 | 4,499 |
| 全市場未沖銷(全月) | | | 164,391 | -51,435 | | | 182,805 | -105,801 |

更新日期：2022年1月5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01W2週選擇權分析表

| | | | | |
|-------|---------|-------|---------|--------|
| 台指選擇權 | 買權成交最大量 | 18900 | 買權OI最大量 | 18900 |
| | 賣權成交最大量 | 18200 | 賣權OI最大量 | 17700 |
| | 整體隱含波動率 | 5.46% | 較前一交易日 | -3.75% |
| | 買權隱含波動率 | 1.45% | 較前一交易日 | -6.58% |
| | 賣權隱含波動率 | 9.19% | 較前一交易日 | -1.12% |
| 電子選擇權 | 買權成交最大量 | 920 | 買權OI最大量 | 880 |
| | 賣權成交最大量 | 880 | 賣權OI最大量 | 880 |
| 金融選擇權 | 買權成交最大量 | 1740 | 買權OI最大量 | 1740 |
| | 賣權成交最大量 | 1660 | 賣權OI最大量 | 1680 |

更新日期：2022年1月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

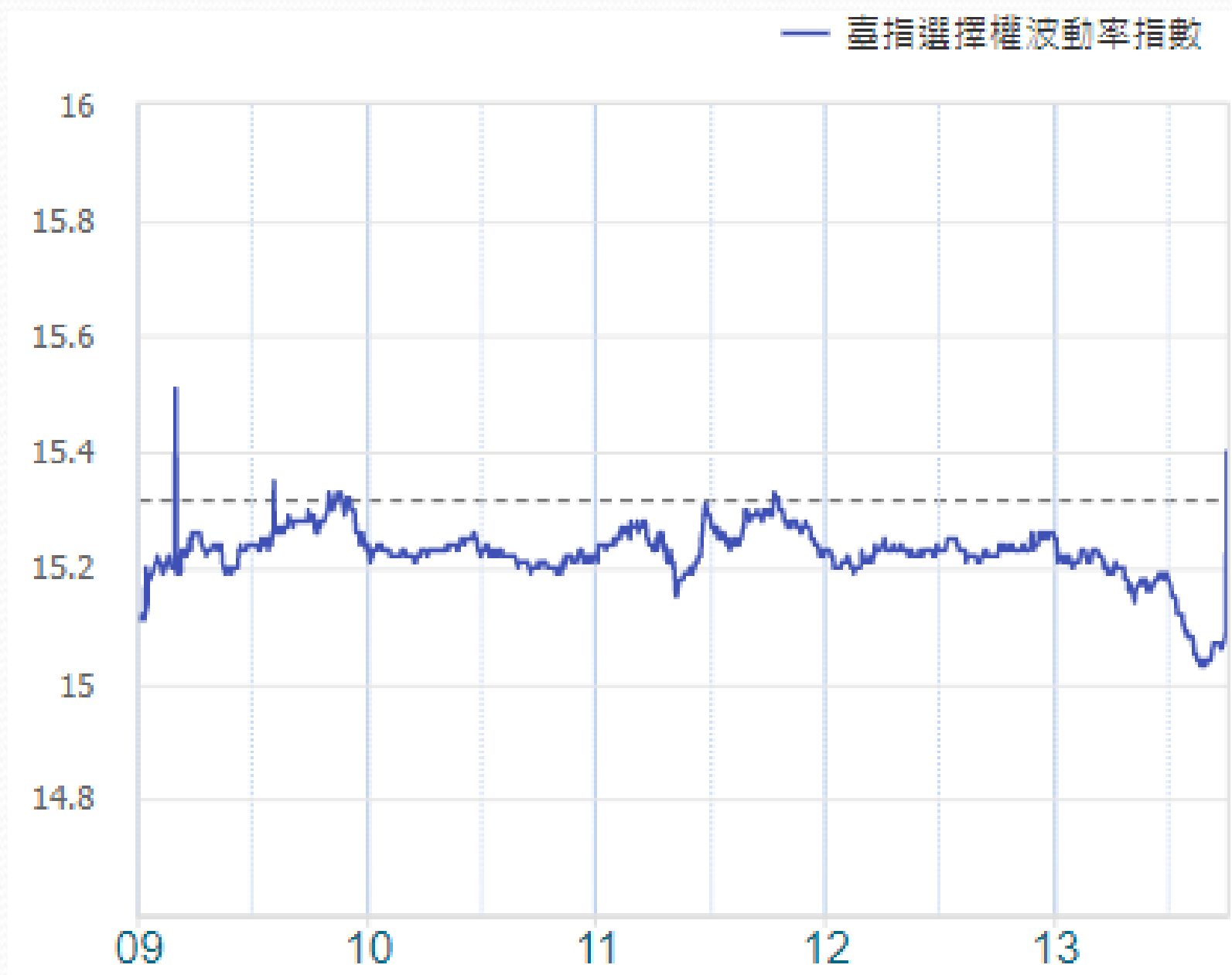
台指選擇權匯報

2022年01月選擇權分析表

| | | | | |
|-------|---------------|--------|---------|--------|
| 台指選擇權 | 買權成交最大量 | 18800 | 買權OI最大量 | 19000 |
| | 賣權成交最大量 | 18000 | 賣權OI最大量 | 18000 |
| | 整體隱含波動率 | 13.72% | 較前一交易日 | -0.01% |
| | 買權隱含波動率 | 11.79% | 較前一交易日 | -0.57% |
| | 賣權隱含波動率 | 15.76% | 較前一交易日 | +0.39% |
| | 成交量P/C_Ratio值 | 0.925 | 較前一交易日 | +0.09 |
| | 未平倉P/C_Ratio值 | 1.144 | 較前一交易日 | -0.01 |
| 電子選擇權 | 買權成交最大量 | 920 | 買權OI最大量 | 880 |
| | 賣權成交最大量 | 880 | 賣權OI最大量 | 880 |
| 金融選擇權 | 買權成交最大量 | 1740 | 買權OI最大量 | 1740 |
| | 賣權成交最大量 | 1660 | 賣權OI最大量 | 1680 |

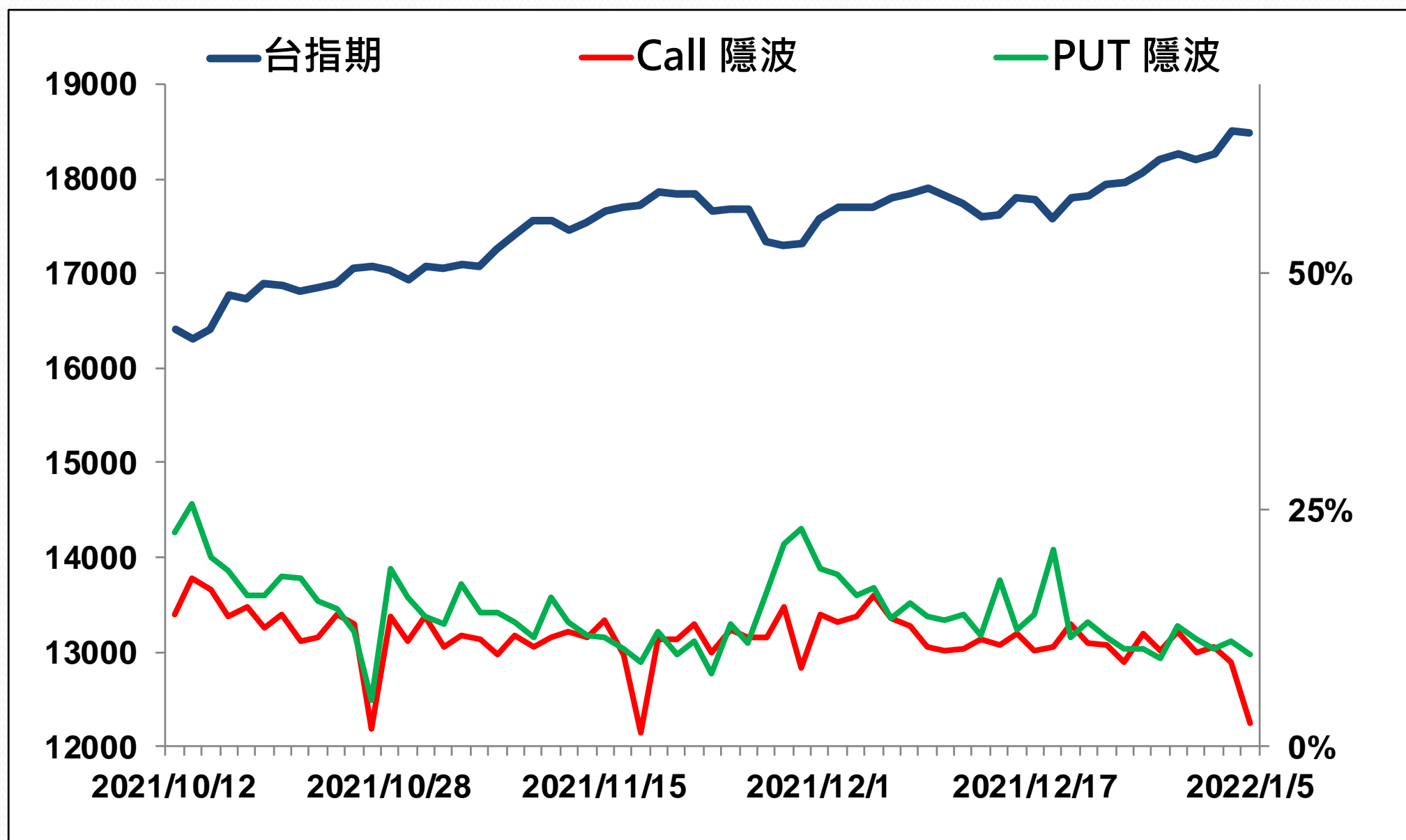
更新日期：2022年1月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



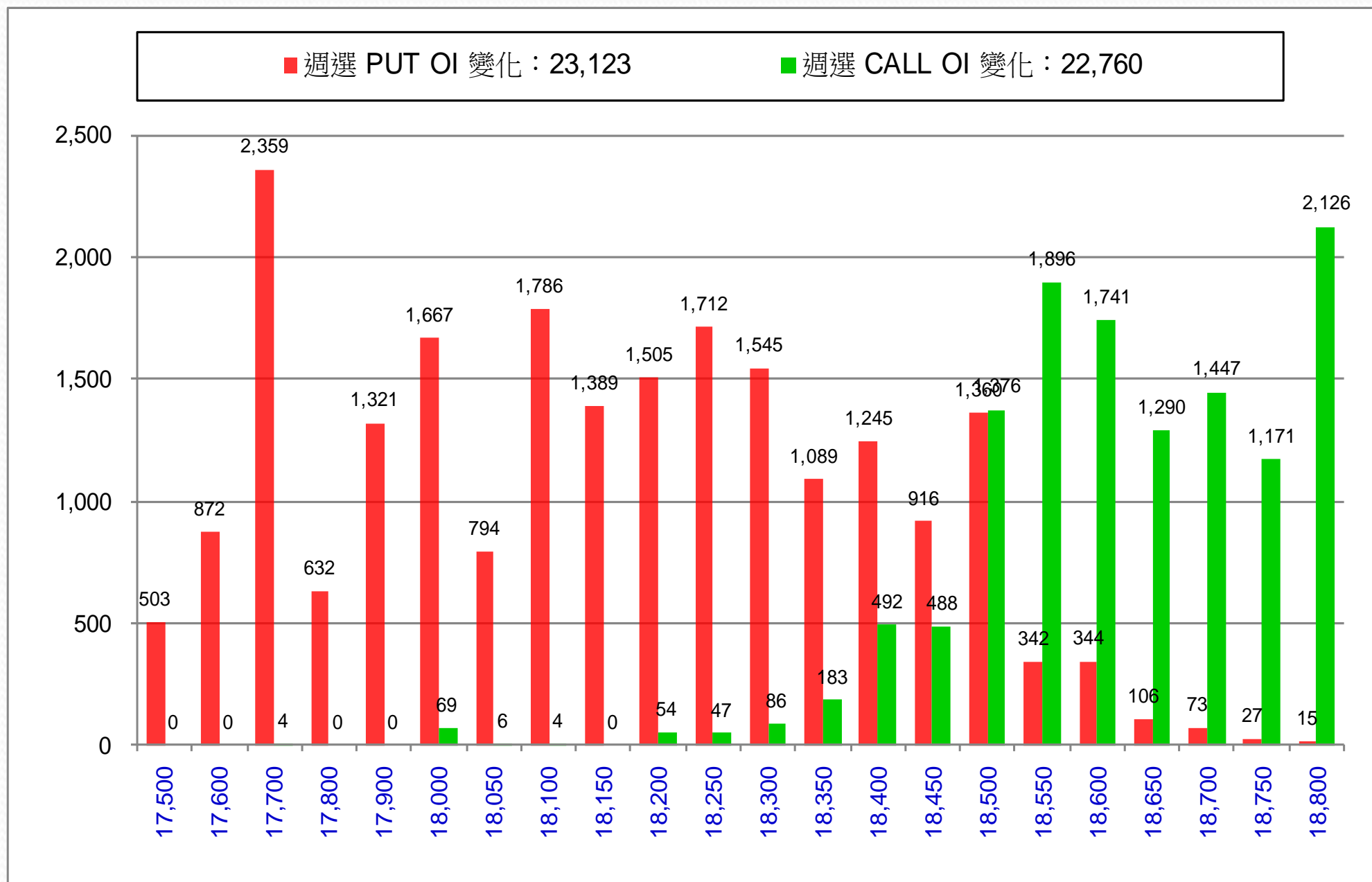
更新日期：2022年1月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年1月5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

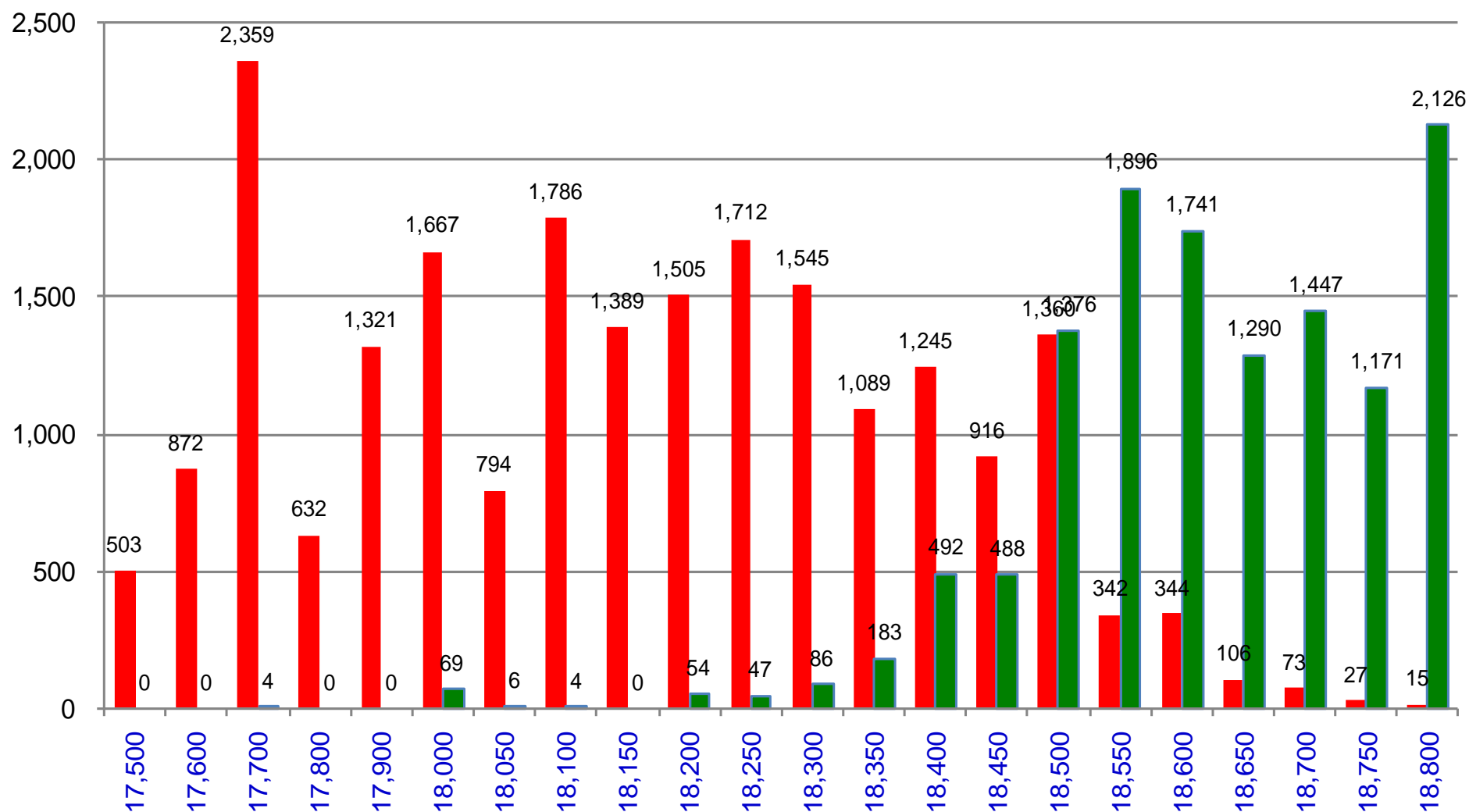


更新日期：2022年1月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：23,123

週選 CALL OI 總額：22,760



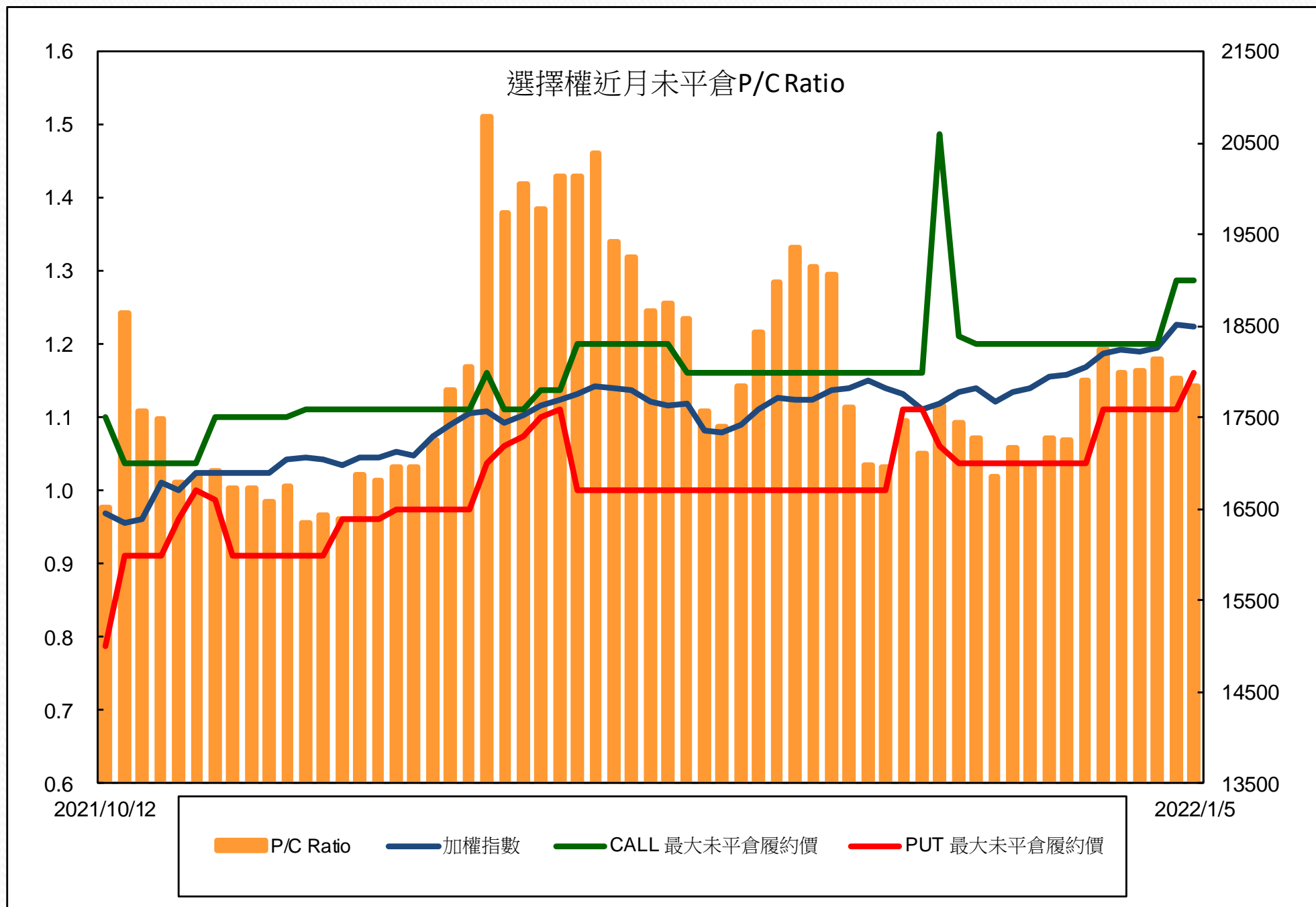
更新日期：2022年1月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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4日 | 54,325 | 50,919 | 3,406 |
| | 1月5日 | 47,524 | 50,706 | -3,182 |
| Put | 1月4日 | 56,532 | 65,158 | -8,626 |
| | 1月5日 | 39,402 | 44,198 | -4,796 |

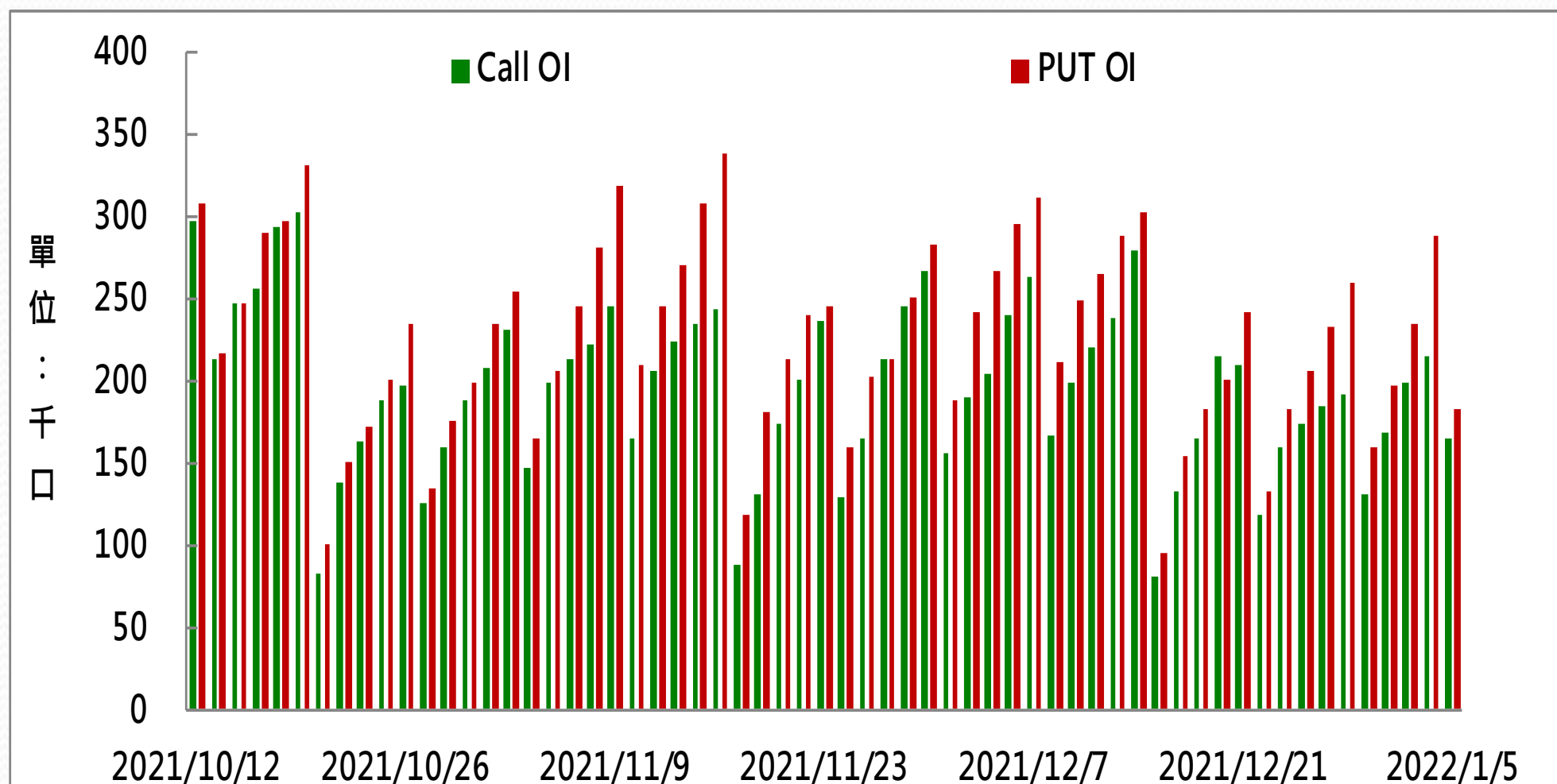
更新日期：2022年1月5日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年1月5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5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5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