

台指選擇權OI匯報

日期：2022/1/6 結算日：2022/1/12					日期：2022/1/6 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	17,300	326	236	0	69	16,900	2,227	-114
0	0	17,400	402	356	-21	534	17,000	7,800	1,433 ※
0	0	17,500	1,319	816	-1	1,575	17,100	2,524	-256
0	0	17,600	1,589	717	0	532	17,200	4,224	13
0	4	17,700	2,056	-303	-6	341	17,300	5,759	142
3	3	17,800	3,627	2,995	0	1,104	17,400	2,966	118
0	0	17,900	4,487	3,166	-6	584	17,500	4,944	-161
0	0	17,950	1,448	1,448	-14	2,088	17,600	6,838	-70
3	72	18,000	8,396	6,729 ※	-19	2,248	17,700	5,573	215
8	14	18,050	2,414	1,620	-32	2,620	17,800	5,943	533
147	151	18,100	5,414	3,628	346	3,539	17,900	6,445	701
227	227	18,150	3,757	2,368	-41	4,211	18,000	8,136	512
572	626	18,200	4,520	3,015	-185	3,545	18,100	4,412	-256
907	954	18,250	4,066	2,354	21	4,946	18,200	4,551	703
1,825	1,911	18,300	4,523	2,978	403	7,772	18,300	3,695	540
2,434	2,617	18,350	3,298	2,209	1,361	7,753	18,400	1,927	-106
2,940	3,432	18,400	2,738	1,493	1,090	8,943	18,500	1,578	-56
4,384	4,872	18,450	1,777	861	212	7,260	18,600	597	113
4,151	5,527	18,500	1,957	597	1,019	10,335	18,700	226	35
3,428	5,324	18,550	899	557 ※	2,174	9,903	18,800	413	22
5,367	7,108	18,600	655	311	-136	5,859	18,900	33	-18
※ 6,195	7,485	18,650	228	122	886	14,684	19,000	25	4
5,693	7,140	18,700	113	40	16	3,052	19,100	24	-1
2,823	3,994	18,750	43	16	-175	3,530	19,200	3	-1
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
46,958	69,718	0.8977	62,587	39,464	7,305	119,554	1.1192	133,809	5,437
昨日 P/C	1.0159	今日增減變化		-0.1182	昨日 P/C	1.1436	今日增減變化		-0.0244

更新日期：2022年1月6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6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	104,303,379	189,067,689	-84,764,310	4,179,401	3,958,000	2,383,193	1,574,807	1,160,883
投信	58,931,444	49,231,178	9,700,266	-1,029,216	567,456	0	567,456	-8,416
自營商	65,504,721	10,880,927	54,623,794	-5,865,647	2,425,283	1,670,269	755,014	273,618
	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	656,539	4,487,466	-3,830,927	16,669	119,021	229,541	-110,520	-13,768
投信	22,285	0	22,285	112	1,700	0	1,700	3
自營商	833,090	107,962	725,128	121,325	545,679	382,395	163,284	124,198

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6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	49,722	29,437	20,285	-899	63,335	27,633	35,702	4,966
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	53,406	58,247	-4,841	-1,659	49,035	53,208	-4,173	623
特定法人(週)	0	0	0	0	0	2,715	-2,715	-2,715
特定法人(近月)	35,339	23,695	11,644	15	8,745	38,690	-29,945	-2,311
特定法人(全月)	40,204	23,627	16,577	-3,426	18,469	52,316	-33,847	-3,400
十大交易人(週)	17,454	23,236	-5,782	-5,952	20,753	14,786	5,967	3,548
十大交易人(近月)	66,973	54,516	12,457	-1,227	57,684	70,131	-12,447	-3,786
十大交易人(全月)	96,365	75,590	20,775	-1,859	81,507	101,132	-19,625	-9,084
全市場未沖銷(近月)			119,554	7,305			133,809	5,437
全市場未沖銷(全月)			220,338	55,947			228,446	45,641

更新日期：2022年1月6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	18500	買權OI最大量	18650
	賣權成交最大量	18300	賣權OI最大量	18000
	整體隱含波動率	10.99%	較前一交易日	+5.53%
	買權隱含波動率	10.37%	較前一交易日	+8.92%
	賣權隱含波動率	18.13%	較前一交易日	+8.94%
電子選擇權	買權成交最大量	910	買權OI最大量	880
	賣權成交最大量	860	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	1740
	賣權成交最大量	1680	賣權OI最大量	1680

更新日期：2022年1月6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	19000
	賣權成交最大量	18000	賣權OI最大量	18000
	整體隱含波動率	15.04%	較前一交易日	-1.31%
	買權隱含波動率	12.17%	較前一交易日	+0.38%
	賣權隱含波動率	17.79%	較前一交易日	+2.03%
	成交量P/C_Ratio值	0.988	較前一交易日	+0.06
	未平倉P/C_Ratio值	1.119	較前一交易日	-0.02
電子選擇權	買權成交最大量	910	買權OI最大量	880
	賣權成交最大量	860	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	1740
	賣權成交最大量	1680	賣權OI最大量	1680

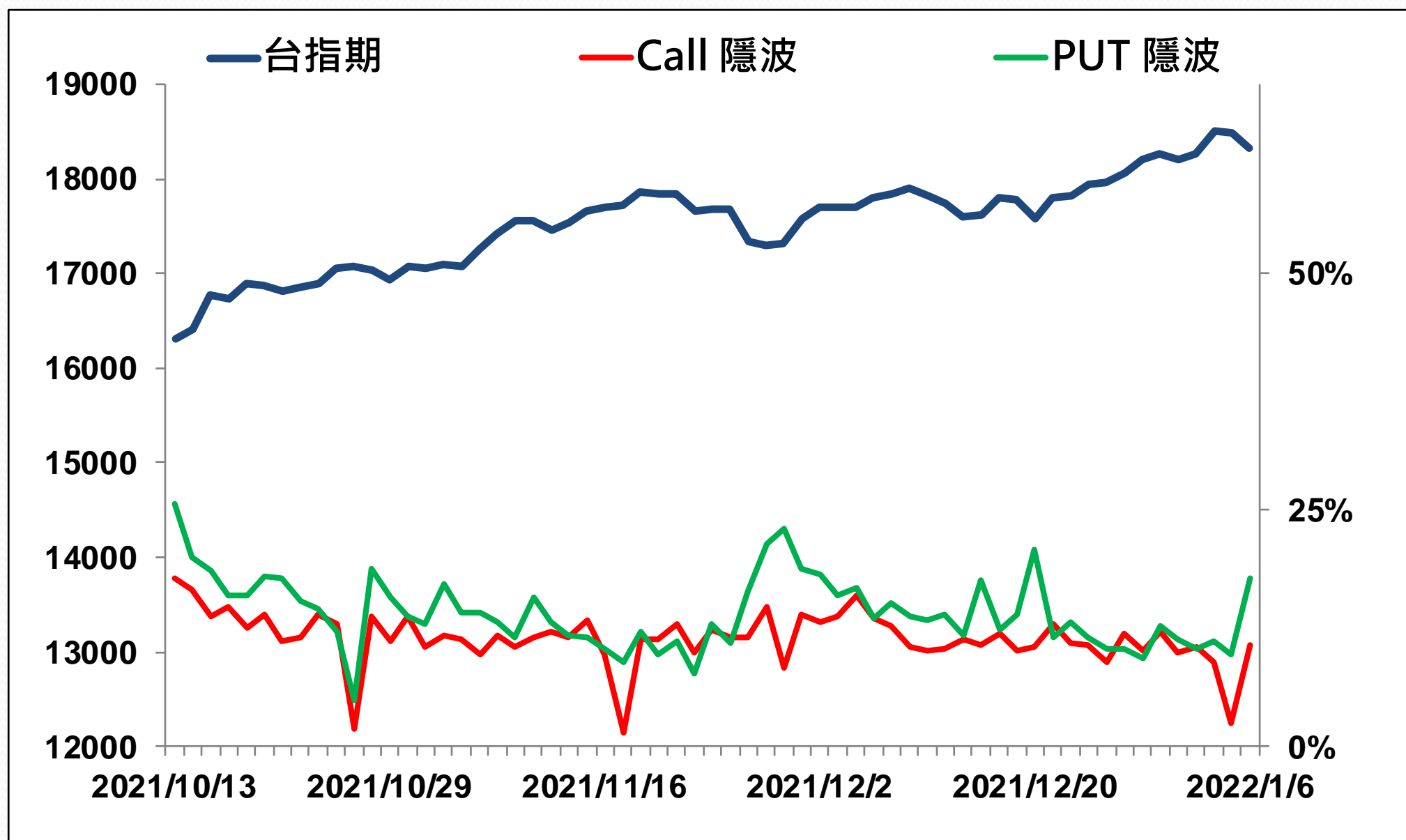
更新日期：2022年1月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



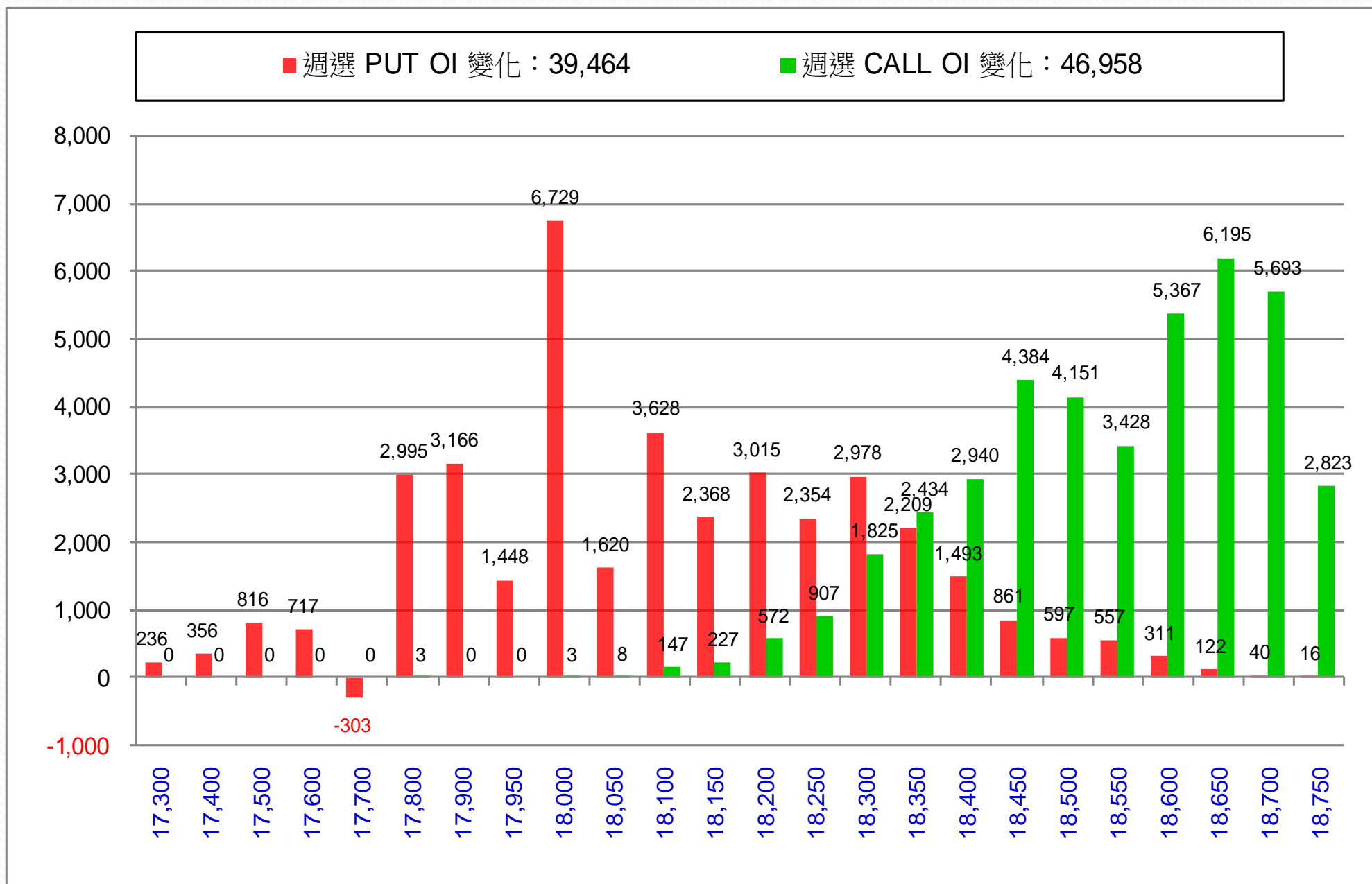
更新日期：2022年1月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年1月6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

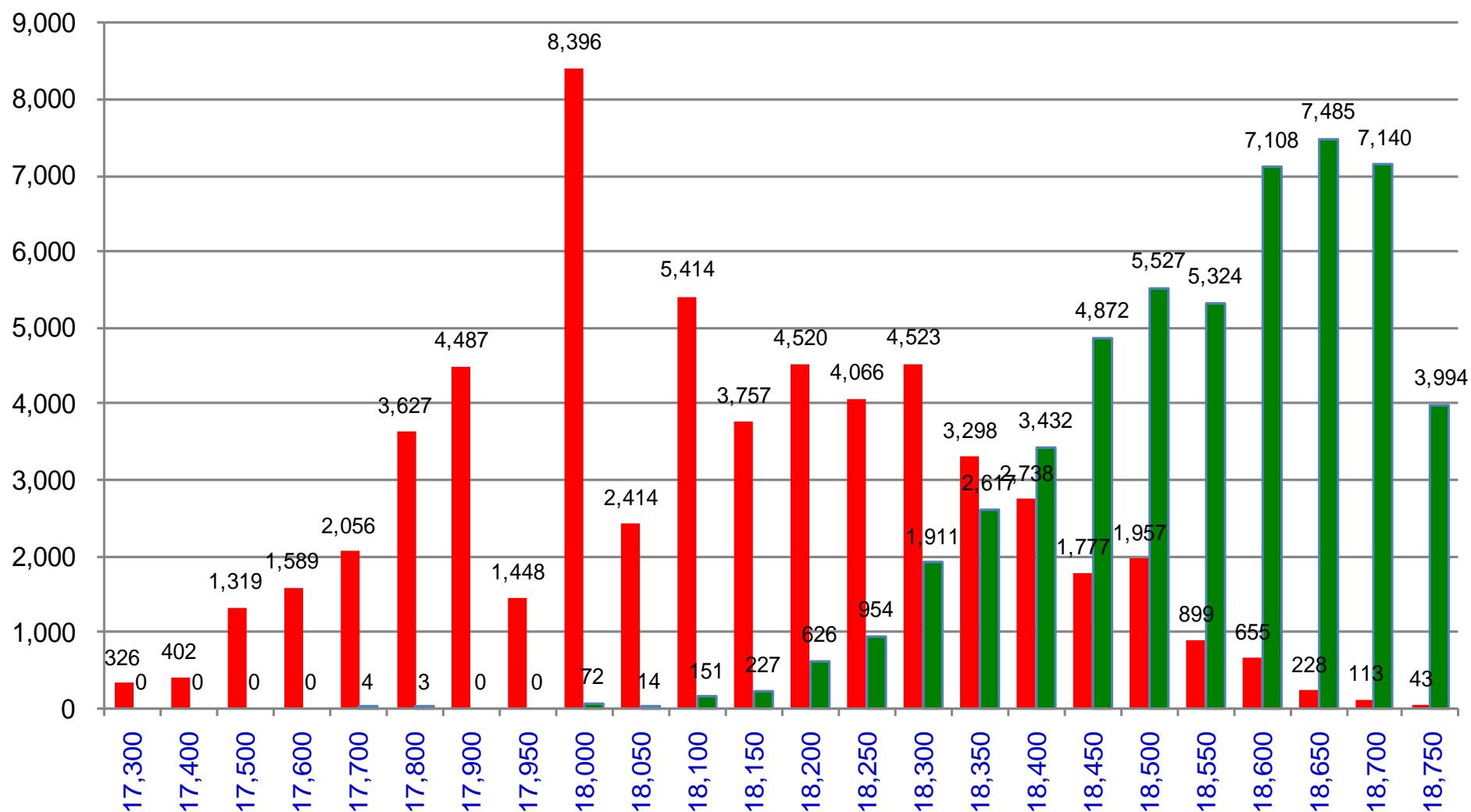


更新日期：2022年1月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：62,587

週選 CALL OI 總額：69,718



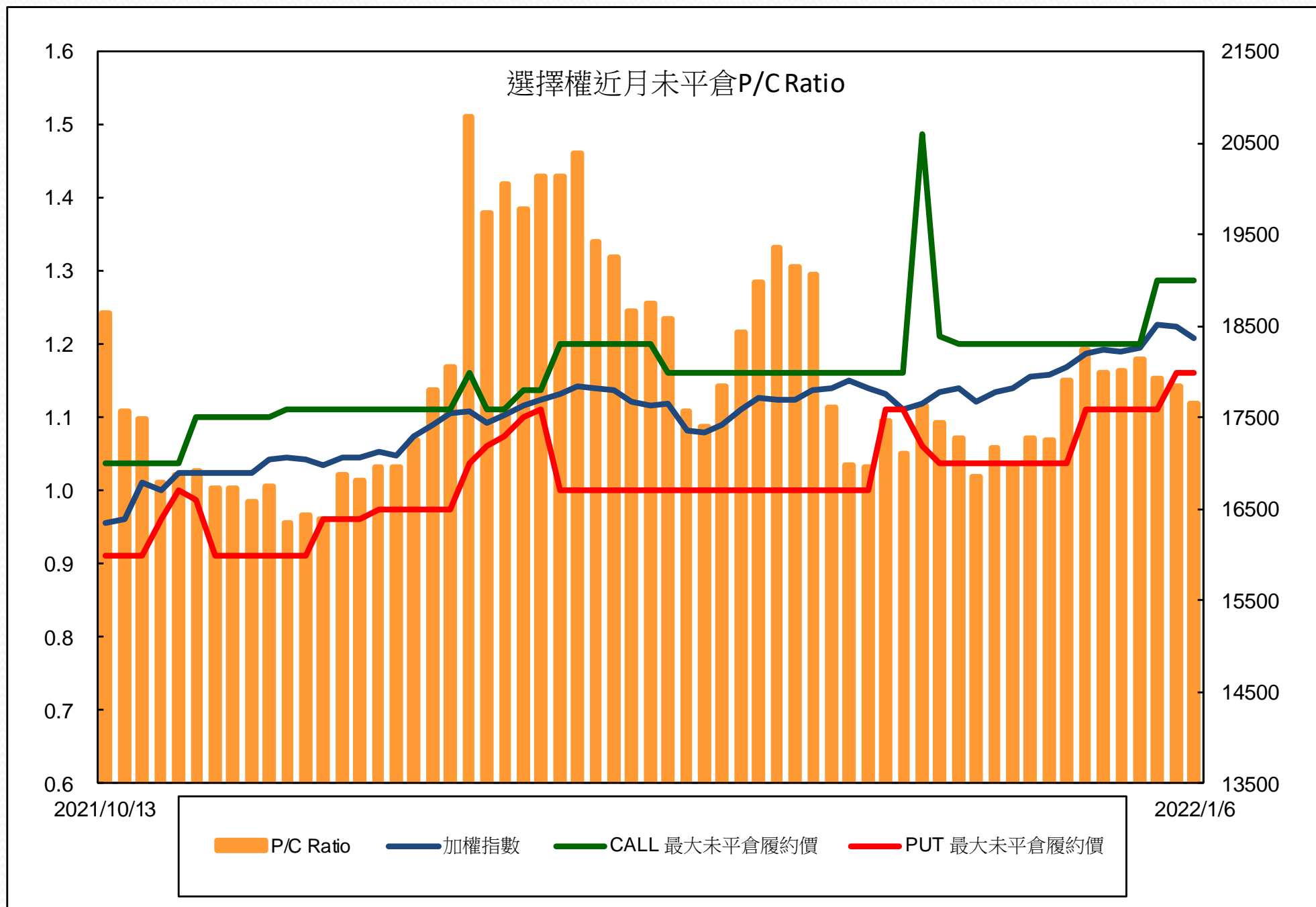
更新日期：2022年1月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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5日	47,524	50,706	-3,182
	1月6日	53,406	58,247	-4,841
Put	1月5日	39,402	44,198	-4,796
	1月6日	49,035	53,208	-4,173

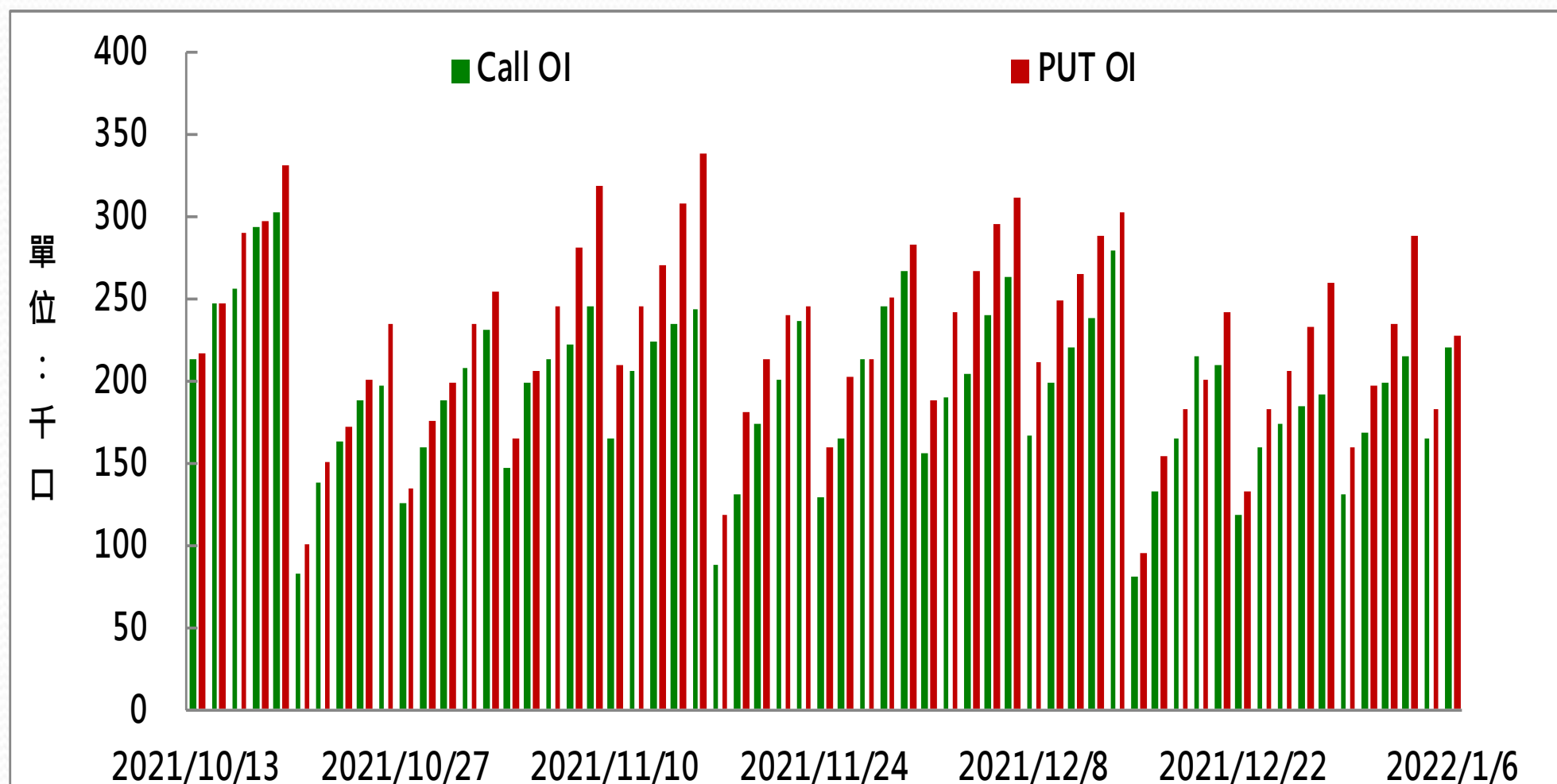
更新日期：2022年1月6日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年1月6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6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6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