

台指選擇權OI匯報

日期：2022/1/7 結算日：2022/1/12					日期：2022/1/7 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	17,000	380	157	0	16	16,700	2,758	-48
0	0	17,100	386	17	-4	43	16,800	4,631	-151
0	0	17,200	585	10	0	69	16,900	2,274	47
0	0	17,300	1,508	1,182	0	534	17,000	7,817	17
0	0	17,400	852	450	1	1,576	17,100	2,541	17
0	0	17,500	2,291	972	-2	530	17,200	4,115	-109
0	0	17,600	3,229	1,640	1	342	17,300	5,693	-66
7	11	17,700	4,485	2,429	0	1,104	17,400	3,092	126
12	15	17,800	5,062	1,435	-3	581	17,500	6,080	1,136
5	5	17,850	1,211	1,211	-21	2,067	17,600	6,519	-319
5	5	17,900	5,057	570	-2	2,246	17,700	5,729	156
15	15	17,950	2,442	994	-16	2,604	17,800	5,696	-247
61	133	18,000	8,841	445	-29	3,510	17,900	6,681	236
172	186	18,050	3,720	1,306	49	4,260	18,000	7,626	-510
402	553	18,100	6,305	891	128	3,673	18,100	4,428	16
701	928	18,150	3,971	214	633	5,579	18,200	4,012	-539
1,578	2,204	18,200	4,379	-141	901	8,673	18,300	2,787	-908
1,805	2,759	18,250	3,513	-553	310	8,063	18,400	2,036	109
3,856	5,767	18,300	6,340	1,817	1,380	10,323	18,500	1,515	-63
2,685	5,302	18,350	3,941	643	594	7,854	18,600	591	-6
5,537	8,969	18,400	3,438	700	404	10,739	18,700	202	-24
2,253	7,125	18,450	1,916	139	※ 1,479	11,382	18,800	418	5
※ 6,099	11,626	18,500	1,886	-71	135	5,994	18,900	32	-1
3,547	8,871	18,550	756	-143	-325	14,359	19,000	26	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
33,242	102,960	0.7727	79,555	16,968	6,020	125,574	1.0662	133,882	73
昨日 P/C	0.8977	今日增減變化		-0.1250	昨日 P/C	1.1192	今日增減變化		-0.0531

更新日期：2022年1月7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7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	92,049,605	188,525,778	-96,476,173	-11,711,863	3,987,333	2,536,962	1,450,371	-124,436
投信	57,922,026	49,785,366	8,136,660	-1,563,606	559,136	0	559,136	-8,320
自營商	67,502,552	13,630,058	53,872,494	-751,300	2,333,827	1,705,146	628,681	-126,333
	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	827,424	4,452,315	-3,624,891	206,036	138,695	219,882	-81,187	29,333
投信	22,409	0	22,409	124	1,691	0	1,691	-9
自營商	820,520	98,231	722,289	-2,839	524,250	434,563	89,687	-73,597

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7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	48,170	33,091	15,079	-5,206	63,689	29,865	33,824	-1,878
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	55,207	69,746	-14,539	-9,698	55,832	55,809	23	4,196
特定法人(週)	0	0	0	0	0	2,754	-2,754	-39
特定法人(近月)	33,357	22,538	10,819	-825	8,745	35,452	-26,707	3,238
特定法人(全月)	38,172	28,024	10,148	-6,429	12,357	51,116	-38,759	-4,912
十大交易人(週)	21,338	32,760	-11,422	-5,640	27,858	21,067	6,791	824
十大交易人(近月)	66,748	56,716	10,032	-2,425	57,818	72,064	-14,246	-1,799
十大交易人(全月)	97,728	85,924	11,804	-8,971	86,525	104,801	-18,276	1,349
全市場未沖銷(近月)			125,574	6,020			133,882	73
全市場未沖銷(全月)			261,731	41,393			246,134	17,688

更新日期：2022年1月7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	18400	買權OI最大量	18500
	賣權成交最大量	18200	賣權OI最大量	18000
	整體隱含波動率	13.26%	較前一交易日	+2.27%
	買權隱含波動率	11.74%	較前一交易日	+1.36%
	賣權隱含波動率	14.89%	較前一交易日	-3.24%
電子選擇權	買權成交最大量	905	買權OI最大量	905
	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	1700	賣權OI最大量	1680

更新日期：2022年1月7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	18200	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	15.34%	較前一交易日	-0.31%
	買權隱含波動率	13.04%	較前一交易日	+0.87%
	賣權隱含波動率	17.85%	較前一交易日	+0.07%
	成交量P/C_Ratio值	0.885	較前一交易日	-0.10
	未平倉P/C_Ratio值	1.066	較前一交易日	-0.05
電子選擇權	買權成交最大量	905	買權OI最大量	905
	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	1700	賣權OI最大量	1680

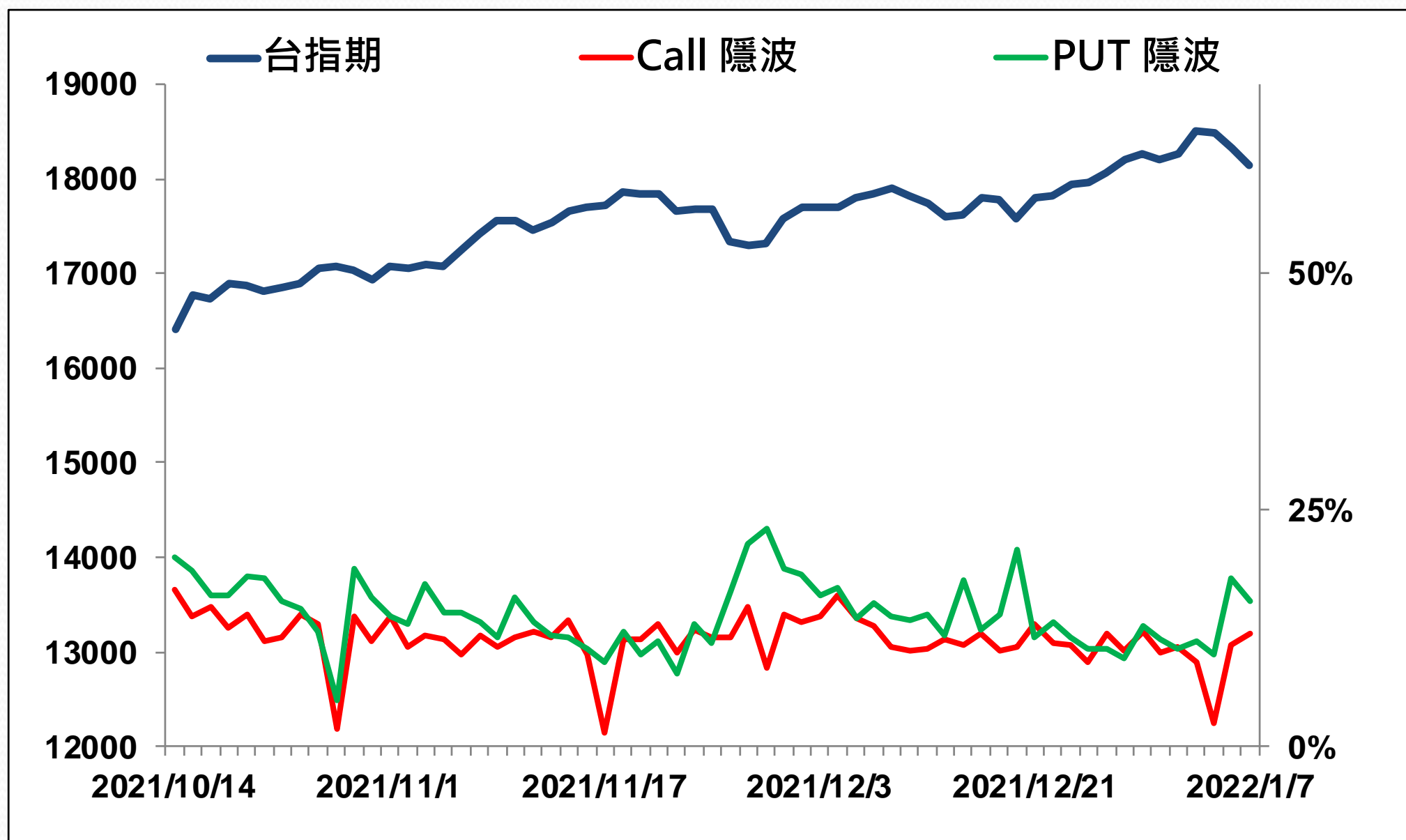
更新日期：2022年1月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



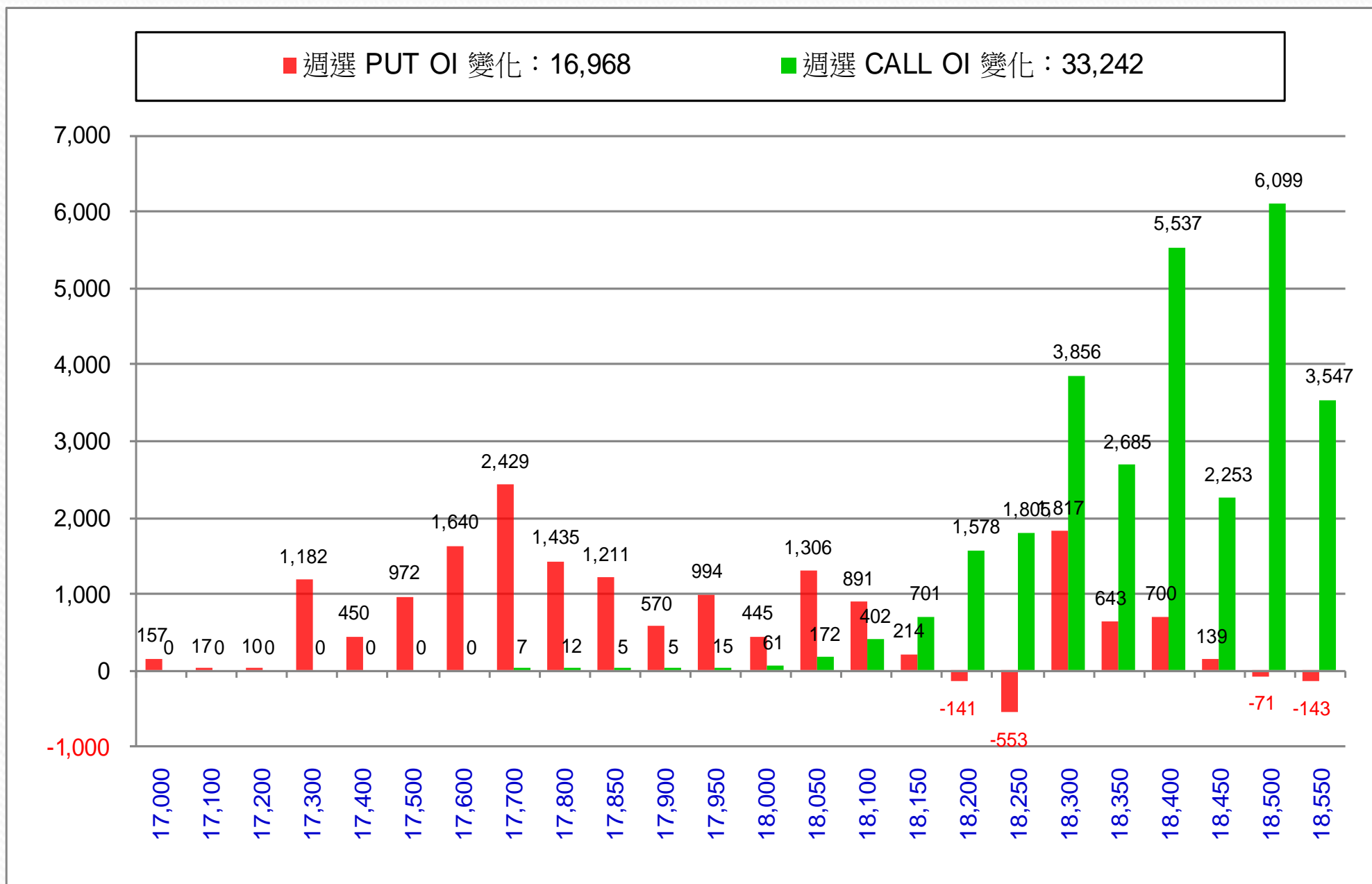
更新日期：2022年1月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年1月7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

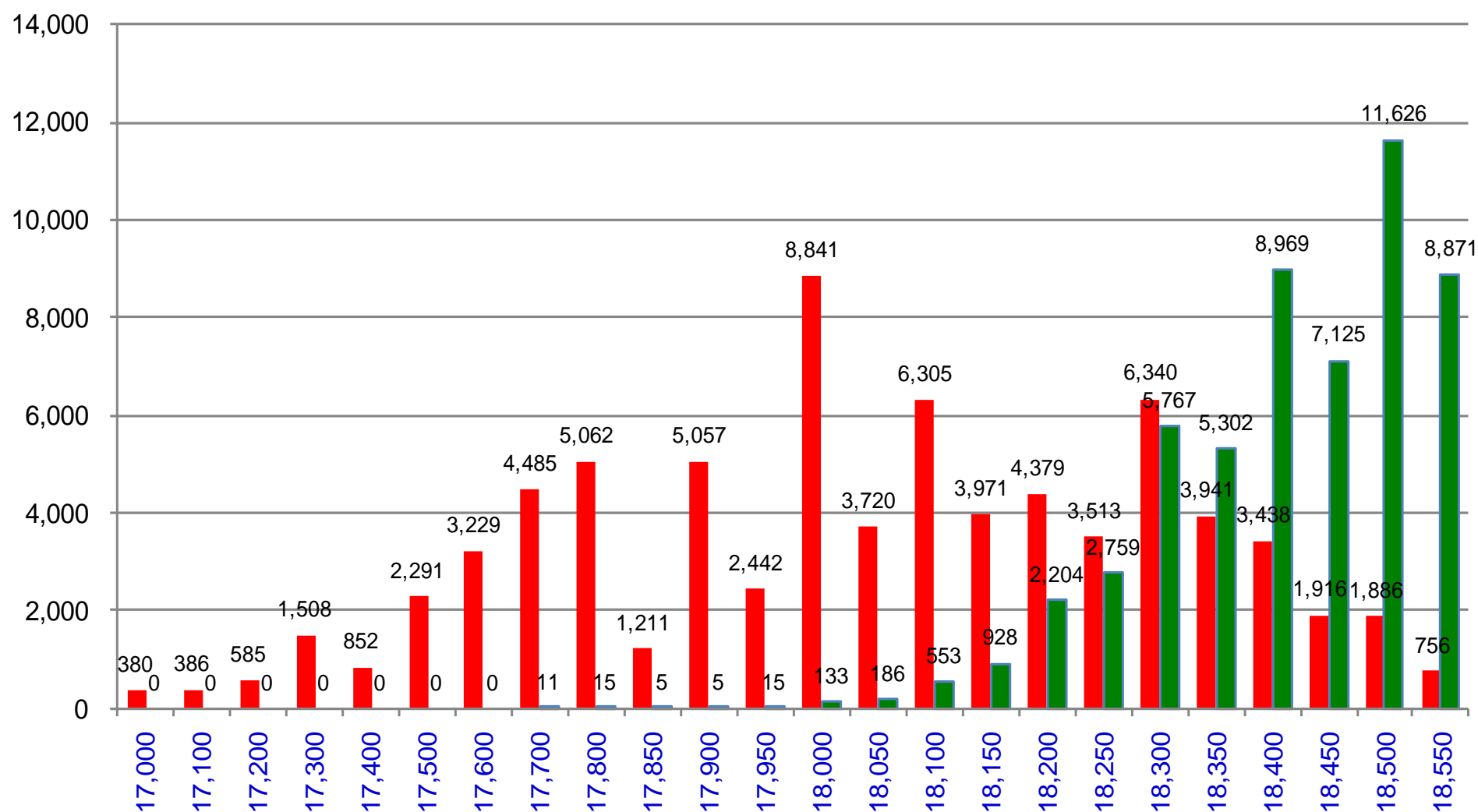


更新日期：2022年1月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：79,555

週選 CALL OI 總額：102,960



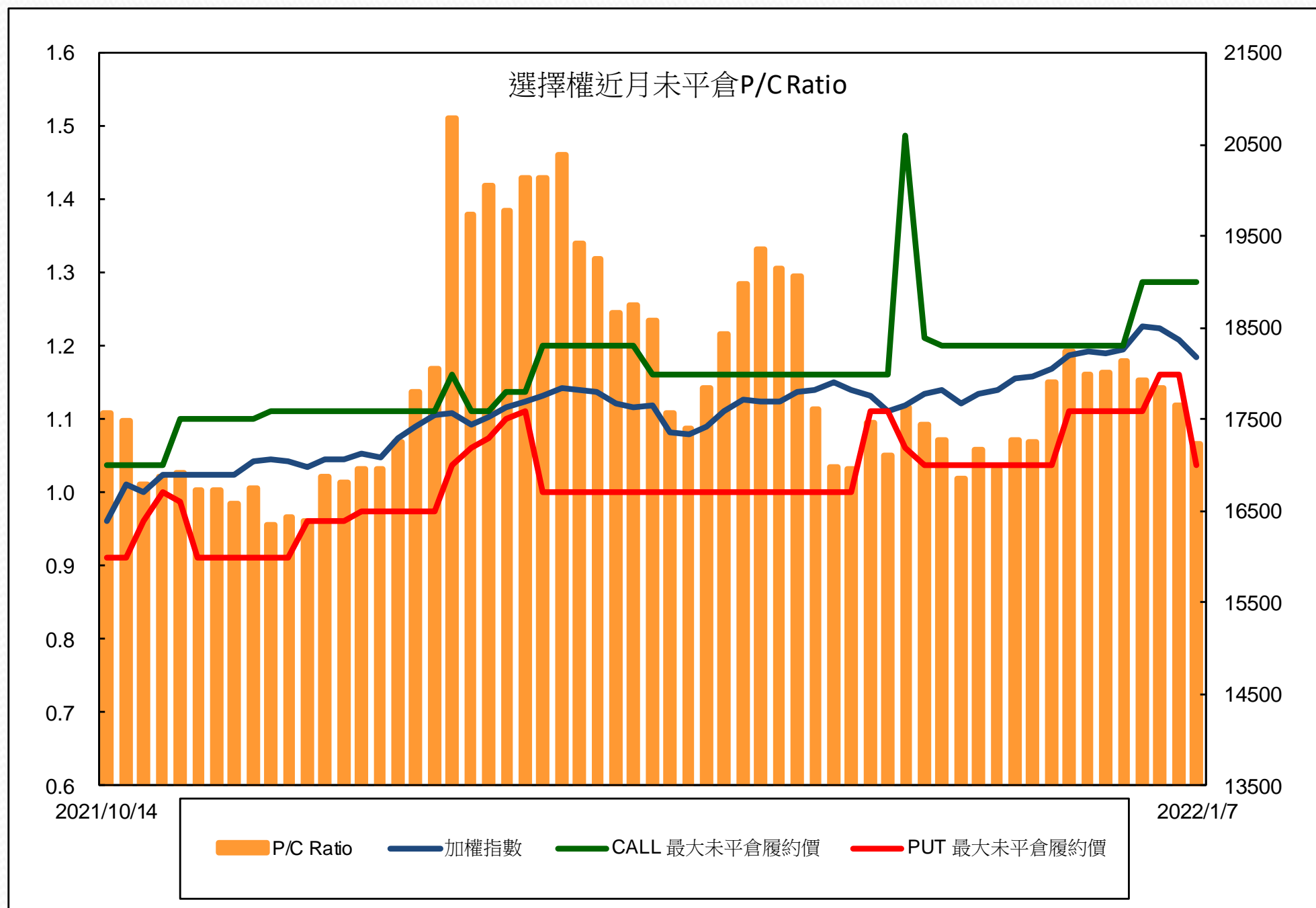
更新日期：2022年1月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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6日	53,406	58,247	-4,841
	1月7日	55,207	69,746	-14,539
Put	1月6日	49,035	53,208	-4,173
	1月7日	55,832	55,809	23

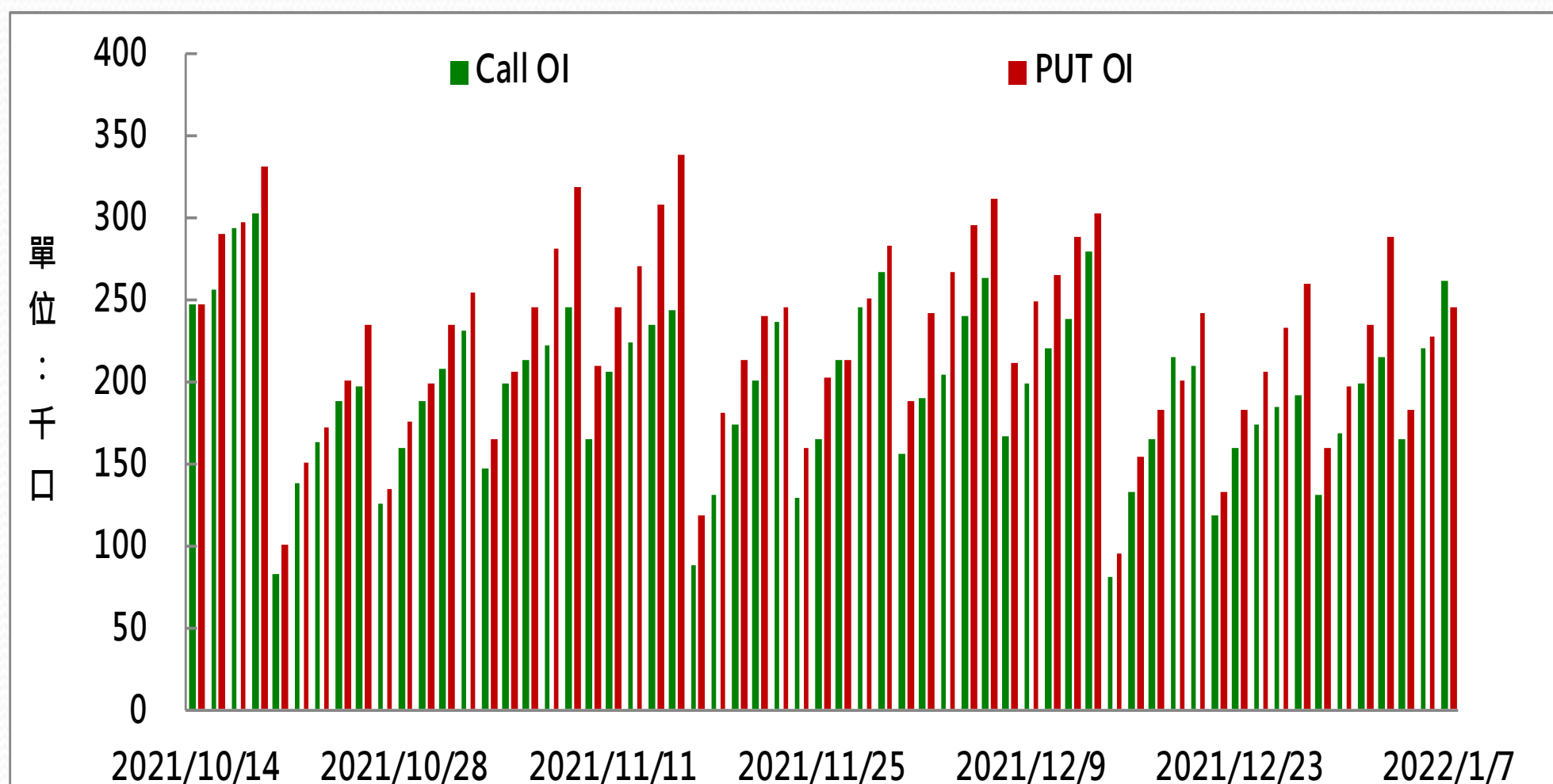
更新日期：2022年1月7日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年1月7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7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7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