

台指選擇權OI匯報

日期：2022/1/11 結算日：2022/1/12					日期：2022/1/11 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	1	17,500	3,591	-403	0	43	16,800	4,674	16
0	0	17,600	3,604	-91	0	69	16,900	2,129	-232
0	0	17,650	1,358	47	0	534	17,000	7,832	-303
-1	5	17,700	5,250	104	1	1,577	17,100	2,575	-101
0	1	17,750	1,788	631	0	530	17,200	4,120	-94
6	24	17,800	7,764	-392	-1	340	17,300	5,939	20
2	32	17,850	4,152	469	-1	1,102	17,400	3,190	-26
148	265	17,900	7,713	193	-3	577	17,500	6,138	27
110	198	17,950	6,671	1,301	-1	2,034	17,600	6,674	16
118	487	18,000	12,749	1,854	-11	2,232	17,700	6,311	286
340	859	18,050	6,232	23	5	2,619	17,800	6,130	848
1,141	2,579	18,100	11,108	3,567	-27	3,450	17,900	7,915	538
773	3,316	18,150	8,190	2,097	206	4,665	18,000	7,940	353
2,236	7,155	18,200	9,969	2,747	-15	3,648	18,100	4,526	-334
4,044	9,500	18,250	8,016	3,140	-198	6,271	18,200	4,552	224
2,355	10,528	18,300	8,461	3,456	-400	8,194	18,300	3,536	659
※ 5,588	13,228	18,350	4,603	1,169	337	8,267	18,400	1,990	148
3,665	15,613	18,400	3,319	-19	※ 960	12,003	18,500	1,397	-61
786	10,708	18,450	1,906	137	38	8,419	18,600	493	-34
1,823	14,471	18,500	1,876	117	-155	10,832	18,700	183	-7
857	8,429	18,550	697	-38	-47	11,580	18,800	418	2
-1,614	5,732	18,600	552	-20	-47	5,880	18,900	29	-2
-772	6,229	18,650	217	0	-179	13,851	19,000	24	-1
-313	5,681	18,700	120	1	-69	2,917	19,100	24	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
19,605	134,421	0.9411	126,497	19,570	327	128,019	1.0750	137,616	1,599
昨日 P/C	0.9313	今日增減變化		0.0098	昨日 P/C	1.0652	今日增減變化		0.0098

更新日期：2022年1月11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11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	87,524,814	190,926,572	-103,401,758	-10,632,650	4,163,839	2,444,100	1,719,739	1,247,136
投信	58,825,464	49,682,322	9,143,142	-118,318	562,912	0	562,912	-1,472
自營商	73,465,730	13,482,397	59,983,333	2,892,996	2,167,971	1,612,528	555,443	541,471
	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	1,078,957	4,531,526	-3,452,569	17,341	210,900	168,720	42,180	37,115
投信	23,070	0	23,070	546	1,687	0	1,687	-1
自營商	917,390	109,974	807,416	155,944	472,328	435,125	37,203	77,670

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11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	47,083	37,063	10,020	-3,442	68,192	31,192	37,000	3,006
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	65,765	77,365	-11,600	-2,017	72,572	59,856	12,716	6,104
特定法人(週)	1,172	2,060	-888	1,077	0	2,517	-2,517	734
特定法人(近月)	31,188	22,565	8,623	1,292	8,869	34,500	-25,631	-1,340
特定法人(全月)	36,453	26,346	10,107	-1,332	15,795	52,574	-36,779	-3,189
十大交易人(週)	37,116	41,936	-4,820	3,723	36,381	33,910	2,471	-3,718
十大交易人(近月)	63,645	56,498	7,147	-896	58,347	71,093	-12,746	56
十大交易人(全月)	106,363	95,941	10,422	-152	94,791	118,973	-24,182	-4,874
全市場未沖銷(近月)			128,019	327			137,616	1,599
全市場未沖銷(全月)			299,510	23,279			300,491	24,337

更新日期：2022年1月11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	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	11.10%	較前一交易日	-2.75%
	買權隱含波動率	10.70%	較前一交易日	-3.59%
	賣權隱含波動率	11.54%	較前一交易日	-1.89%
電子選擇權	買權成交最大量	890	買權OI最大量	910
	賣權成交最大量	850	賣權OI最大量	860
金融選擇權	買權成交最大量	1780	買權OI最大量	1740
	賣權成交最大量	1740	賣權OI最大量	1740

更新日期：2022年1月11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	14.60%	較前一交易日	+0.63%
	買權隱含波動率	12.85%	較前一交易日	-1.33%
	賣權隱含波動率	16.28%	較前一交易日	-0.01%
	成交量P/C_Ratio值	1.048	較前一交易日	+0.12
	未平倉P/C_Ratio值	1.075	較前一交易日	+0.01
電子選擇權	買權成交最大量	890	買權OI最大量	910
	賣權成交最大量	850	賣權OI最大量	860
金融選擇權	買權成交最大量	1780	買權OI最大量	1740
	賣權成交最大量	1740	賣權OI最大量	1740

更新日期：2022年1月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

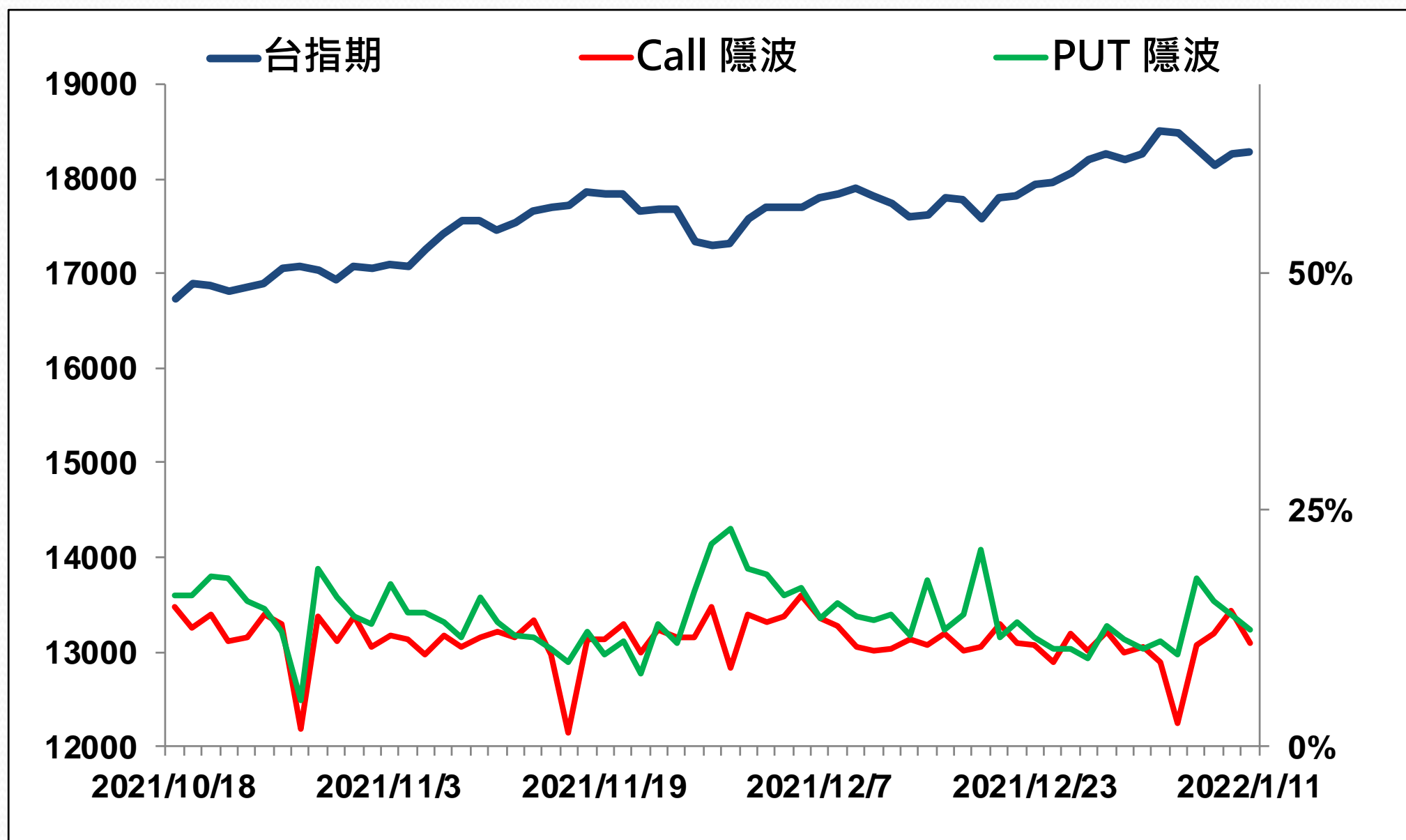
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



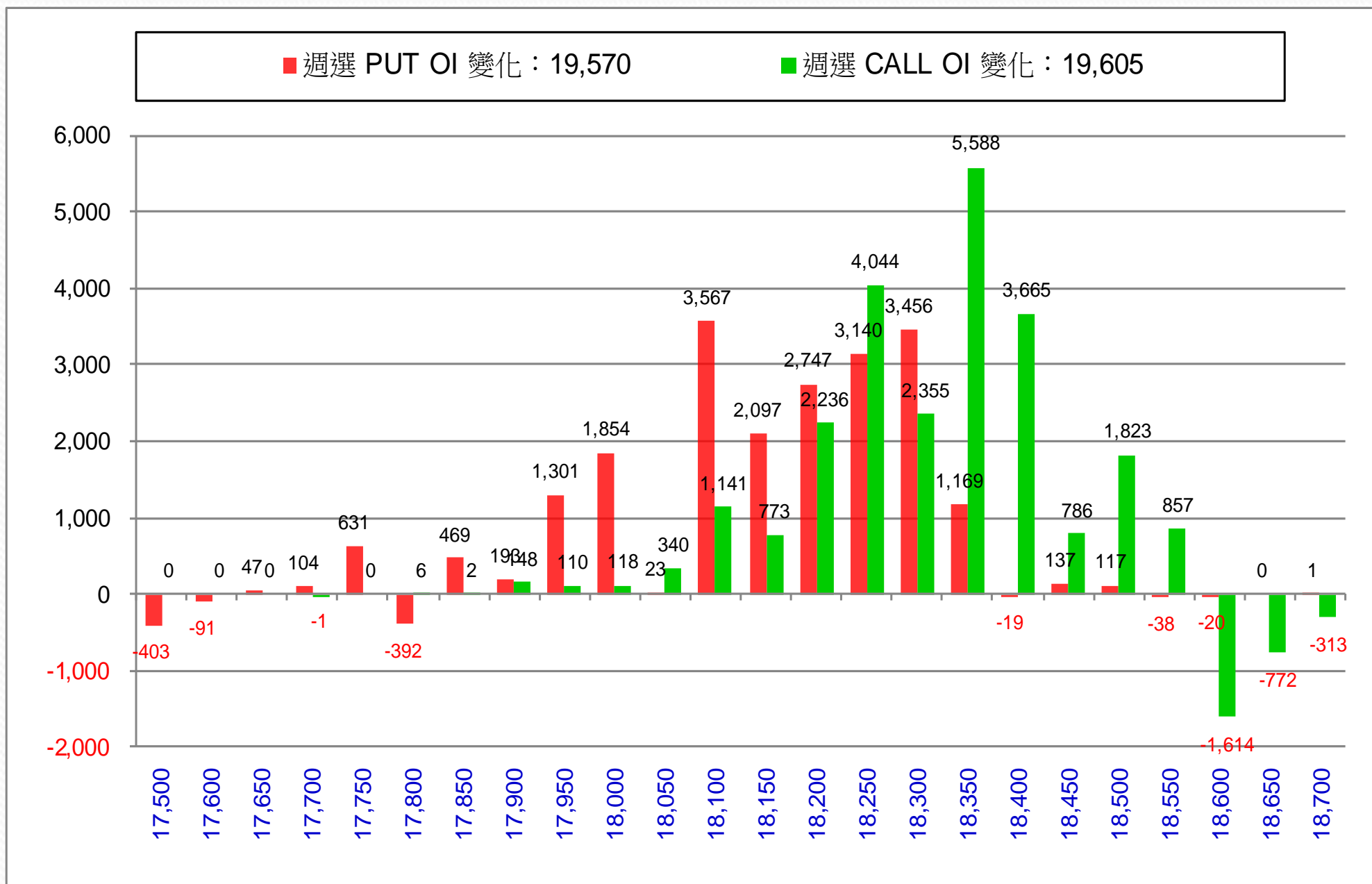
更新日期：2022年1月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年1月11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

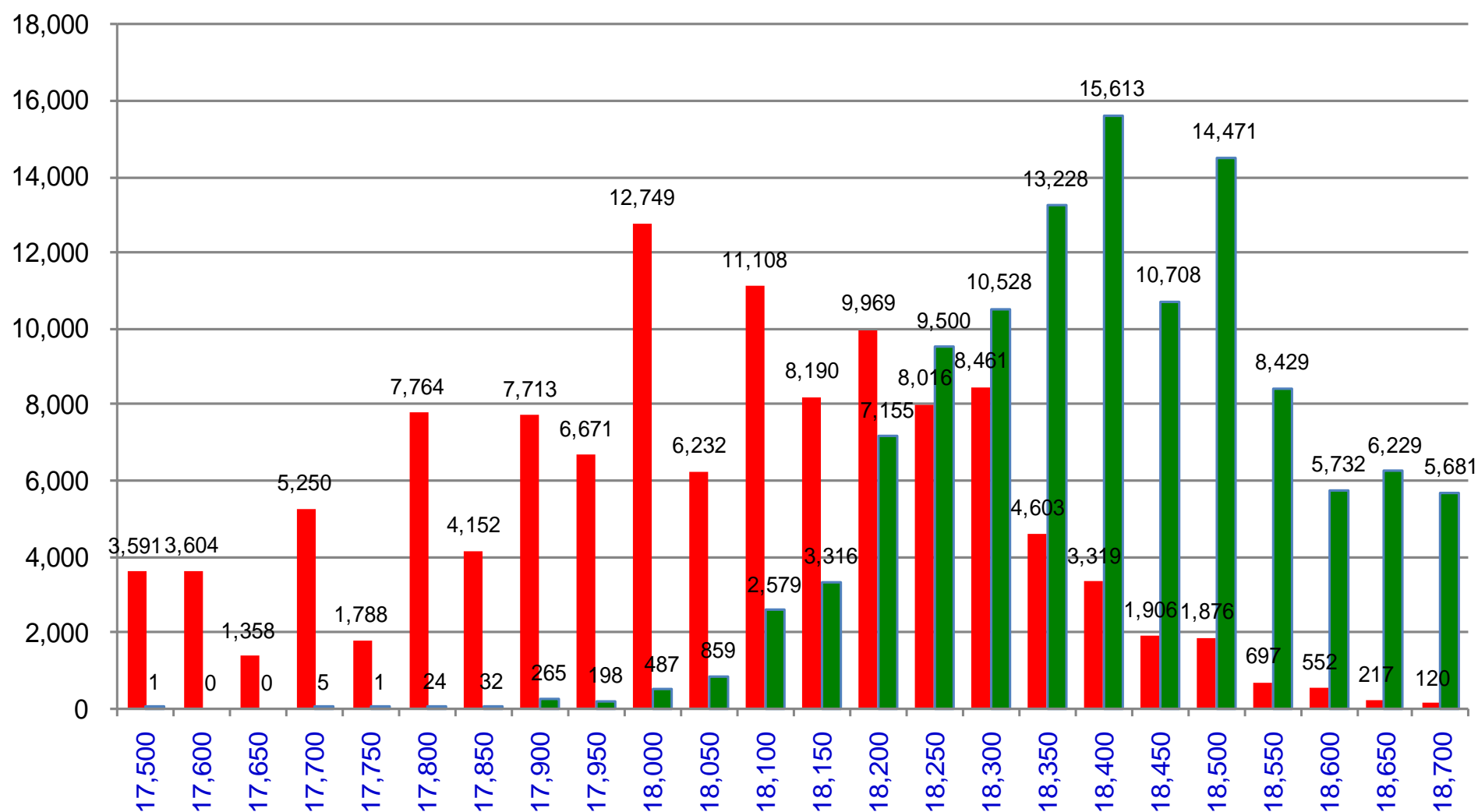


更新日期：2022年1月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：126,497

週選 CALL OI 總額：134,421



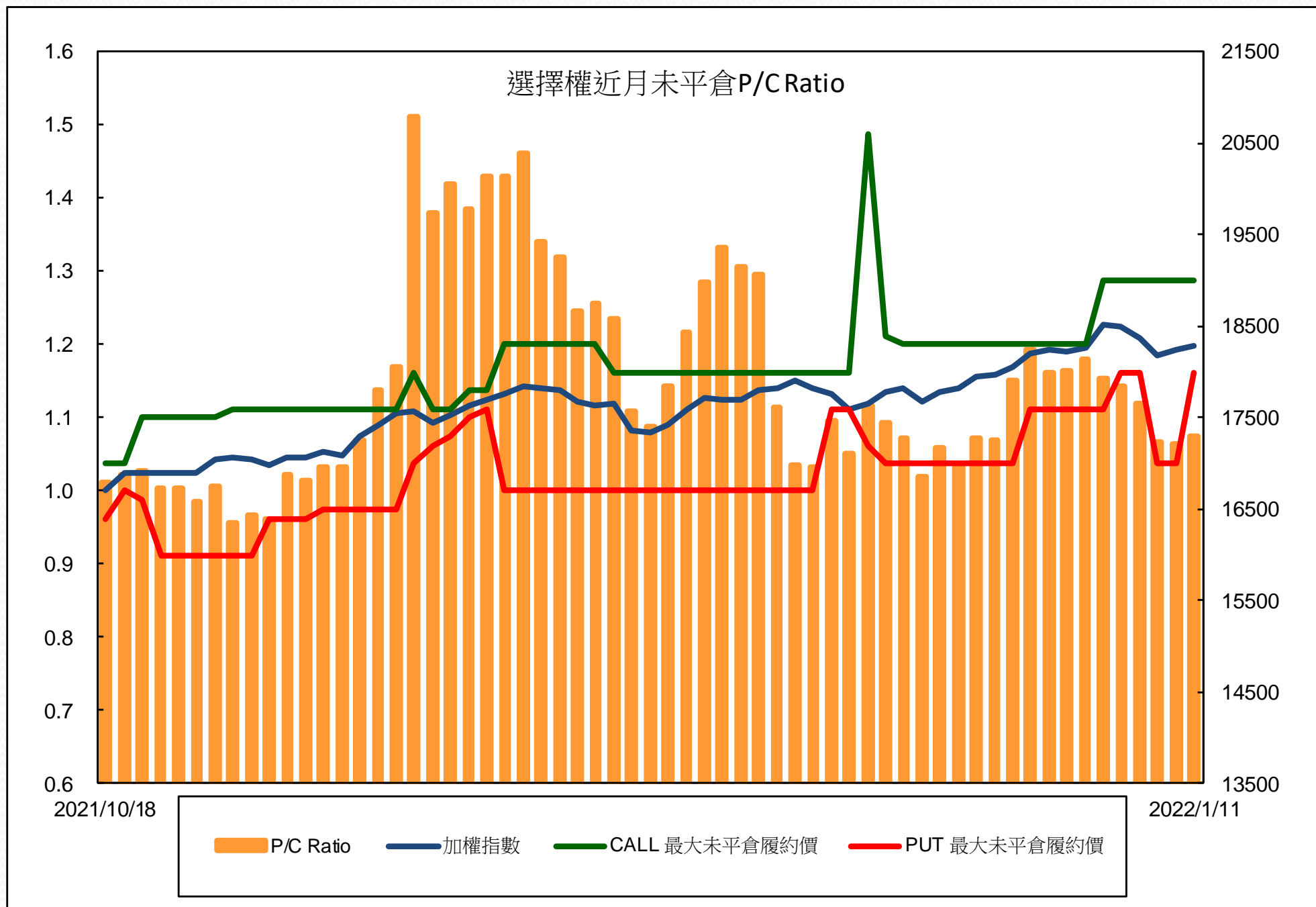
更新日期：2022年1月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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10日	61,983	71,566	-9,583
	1月11日	65,765	77,365	-11,600
Put	1月10日	63,600	56,988	6,612
	1月11日	72,572	59,856	12,716

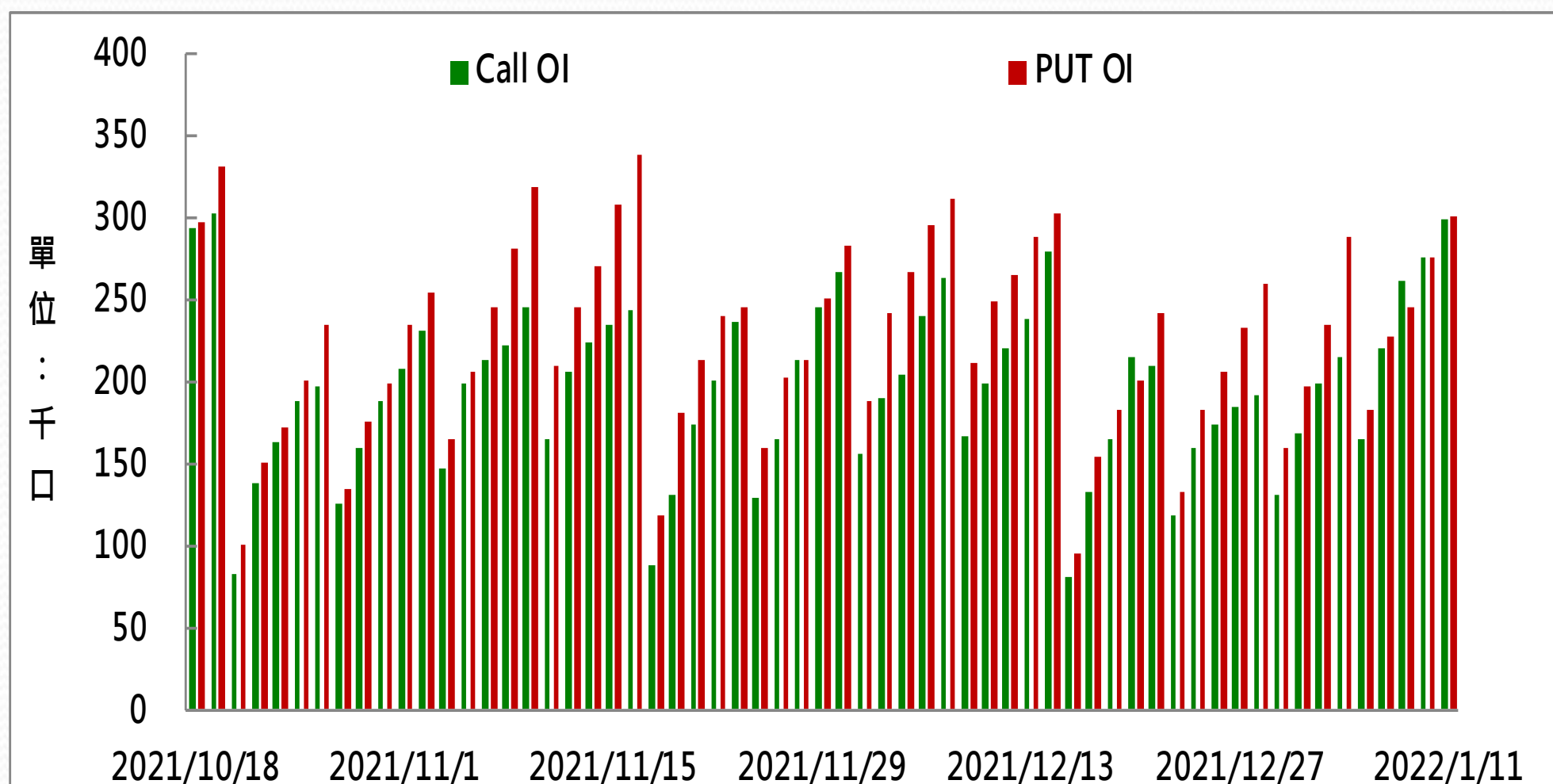
更新日期：2022年1月11日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年1月11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11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11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