

台指選擇權OI匯報

日期：2022/1/12 結算日：2022/1/19					日期：2022/1/12 結算日：2022/2/16				
202201 月台指選擇權 OI 序列					202202 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
-2	2,032	17,600	7,576	902	0	8	16,900	464	64
-12	2,220	17,700	7,101	790	0	26	17,000	10,444	102
0	0	17,750	1,259	1,259	0	5	17,100	499	49
-6	2,613	17,800	6,975	845	0	13	17,200	827	19
2	2	17,850	609	609	0	20	17,300	640	165
-53	3,397	17,900	8,445	530	0	66	17,400	1,077	127
18	18	17,950	1,564	1,564	27	96	17,500	1,107	61
78	4,743	18,000	9,871	1,931	-3	66	17,600	1,465	120
28	28	18,050	944	944	-2	91	17,700	664	234
-78	3,570	18,100	6,364	1,838	0	346	17,800	556	56
39	39	18,150	1,164	1,164	2	136	17,900	582	1
-1,037	5,234	18,200	6,120	1,568	4	188	18,000	921	228
332	332	18,250	621	621	4	319	18,100	448	21
155	8,349	18,300	4,776	1,240	-102	1,675	18,200	1,383	113
1,141	1,141	18,350	684	684	-18	667	18,300	166	19
27	8,294	18,400	2,613	623	417	1,020	18,400	487	424
1,266	1,266	18,450	460	460	-144	1,021	18,500	88	9
791	12,794	18,500	1,615	218	33	2,450	18,600	86	1
1,626	1,626	18,550	70	70	-262	2,795	18,700	9	2
1,777	10,196	18,600	611	118	1	2,541	18,800	9	1
※ 2,298	2,298	18,650	8	8	244	1,796	18,900	3	0
1,412	12,244	18,700	243	60	347	2,303	19,000	11	0
1,432	1,432	18,750	13	13	※ 547	1,690	19,100	2	0
103	11,683	18,800	418	0	301	1,439	19,200	4	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
14,856	142,875	1.1013	157,352	19,736	2,319	24,443	1.1270	27,547	2,007
昨日 P/C	1.0750	今日增減變化		0.0264	昨日 P/C	1.1544	今日增減變化		-0.0274

更新日期：2022年1月12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12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	84,628,415	188,972,569	-104,344,154	-942,396	4,479,800	2,769,986	1,709,814	-9,925
投信	59,721,971	50,284,086	9,437,885	294,743	567,648	0	567,648	4,736
自營商	71,197,973	9,084,596	62,113,377	2,130,044	2,084,640	1,879,103	205,537	-349,906
	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	1,175,056	4,453,099	-3,278,043	174,526	203,885	165,130	38,755	-3,425
投信	23,215	0	23,215	145	1,685	0	1,685	-2
自營商	860,636	137,477	723,159	-84,257	434,612	468,205	-33,593	-70,796

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12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	44,612	32,764	11,848	1,828	71,017	29,317	41,700	4,700
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	41,215	50,126	-8,911	2,689	47,028	41,737	5,291	-7,425
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	30,969	22,287	8,682	59	6,323	41,209	-34,886	-9,255
特定法人(全月)	36,129	29,125	7,004	-3,103	21,674	57,769	-36,095	684
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	64,791	52,872	11,919	4,772	60,831	78,248	-17,417	-4,671
十大交易人(全月)	82,795	69,555	13,240	2,818	77,316	101,094	-23,778	404
全市場未沖銷(近月)			142,875	14,856			157,352	19,736
全市場未沖銷(全月)			182,374	-117,136			195,939	-104,552

更新日期：2022年1月12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	13.65%	較前一交易日	+2.55%
	買權隱含波動率	12.48%	較前一交易日	+1.79%
	賣權隱含波動率	14.80%	較前一交易日	+3.26%
電子選擇權	買權成交最大量	880	買權OI最大量	880
	賣權成交最大量	820	賣權OI最大量	800
金融選擇權	買權成交最大量	1880	買權OI最大量	1780
	賣權成交最大量	1720	賣權OI最大量	1720

更新日期：2022年1月12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02月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	19100	買權OI最大量	18700
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	15.43%	較前一交易日	-0.83%
	買權隱含波動率	12.47%	較前一交易日	-0.38%
	賣權隱含波動率	19.23%	較前一交易日	+2.95%
	成交量P/C_Ratio值	0.750	較前一交易日	-0.30
	未平倉P/C_Ratio值	1.127	較前一交易日	+0.05
電子選擇權	買權成交最大量	880	買權OI最大量	880
	賣權成交最大量	820	賣權OI最大量	800
金融選擇權	買權成交最大量	1880	買權OI最大量	1780
	賣權成交最大量	1720	賣權OI最大量	1720

更新日期：2022年1月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

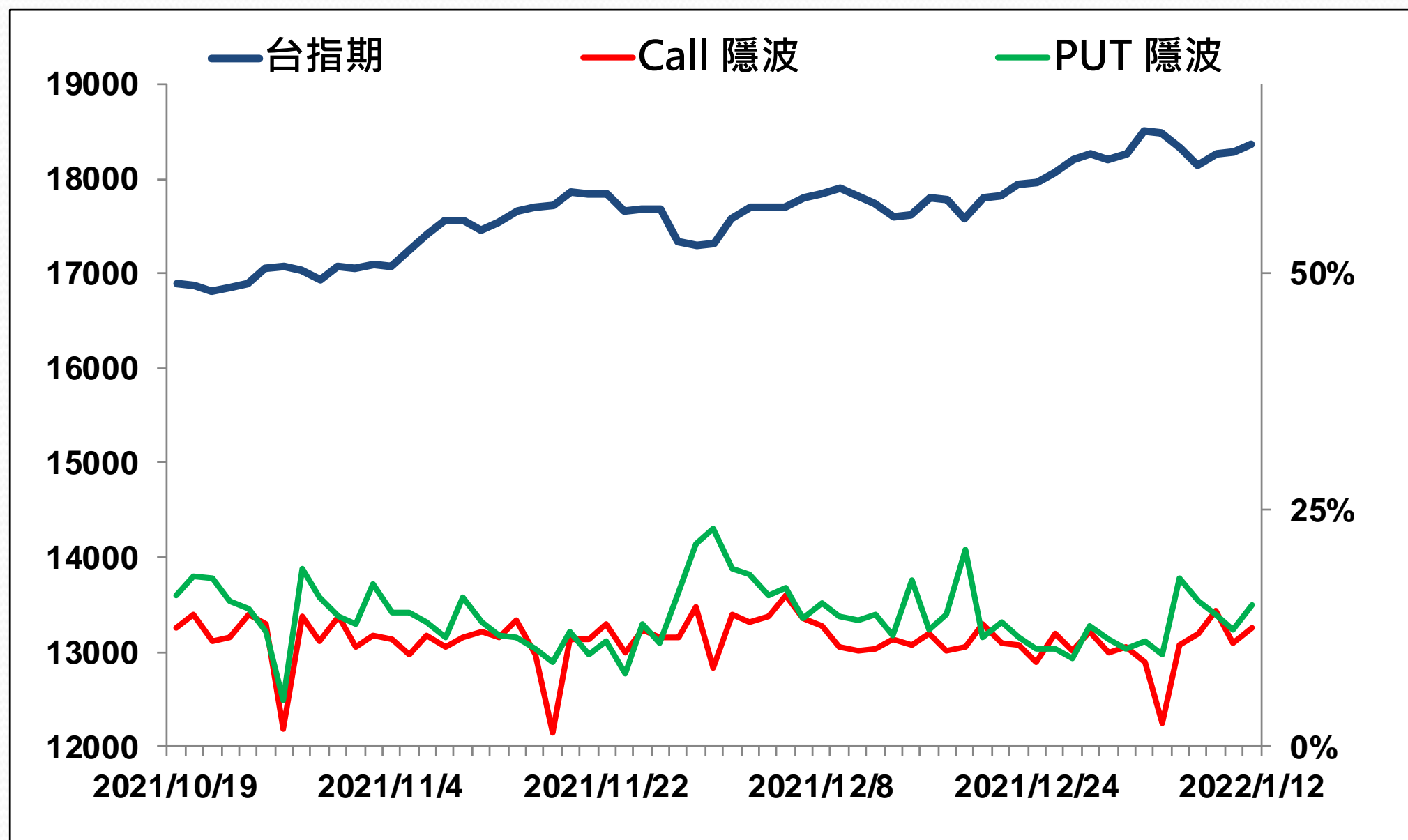
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



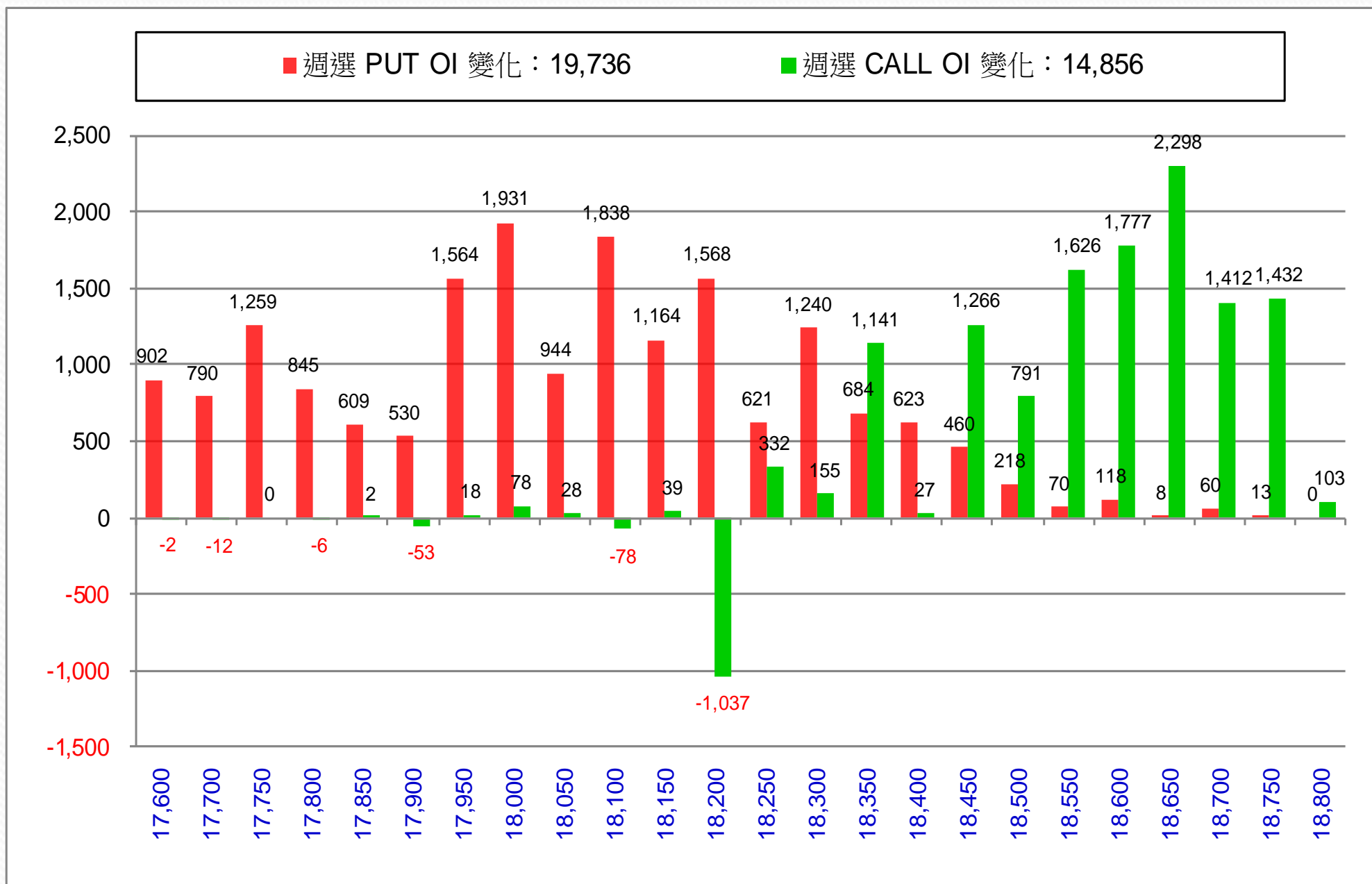
更新日期：2022年1月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年1月12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

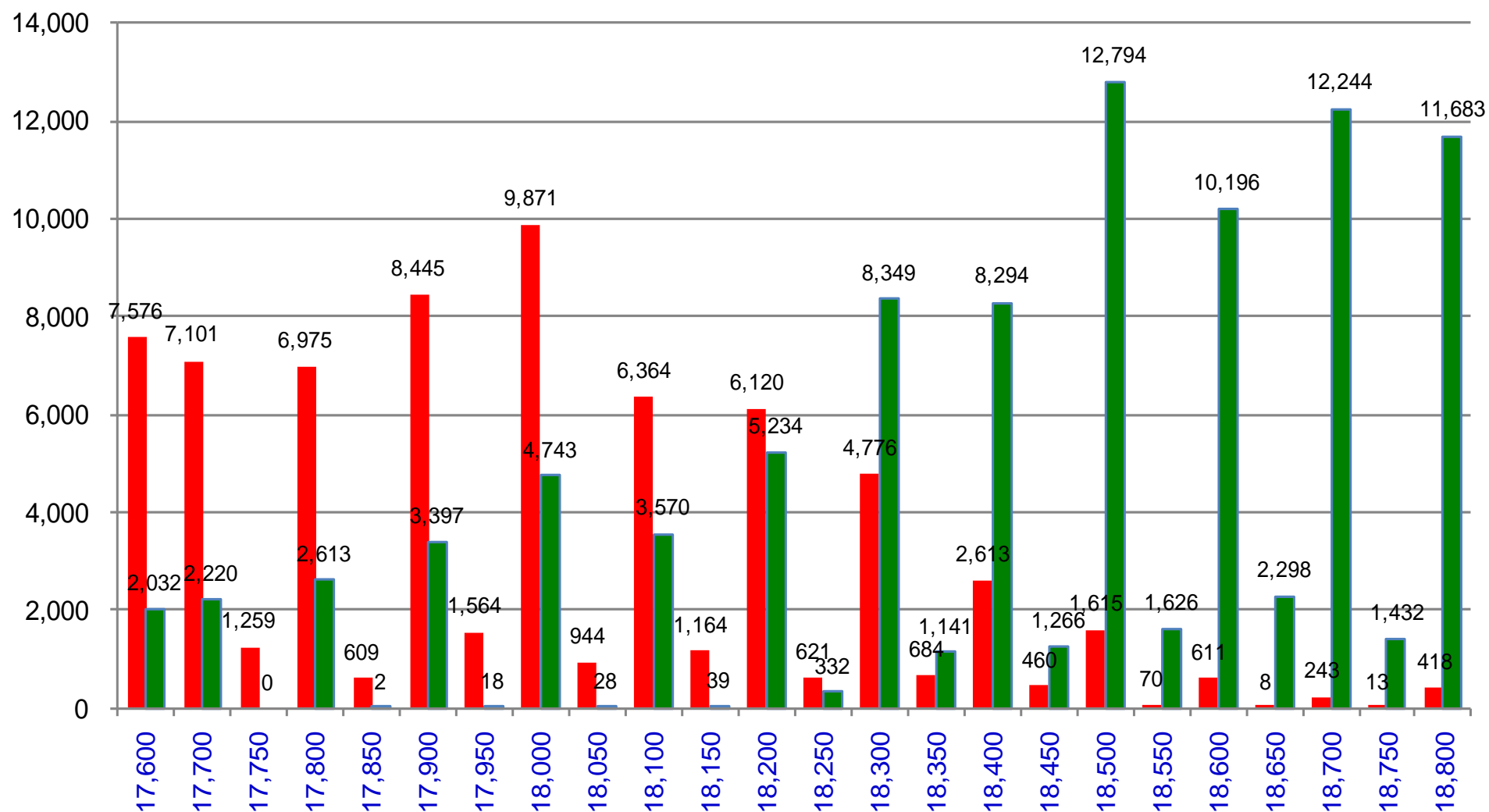


更新日期：2022年1月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：157,352

■ 週選 CALL OI 總額：142,875



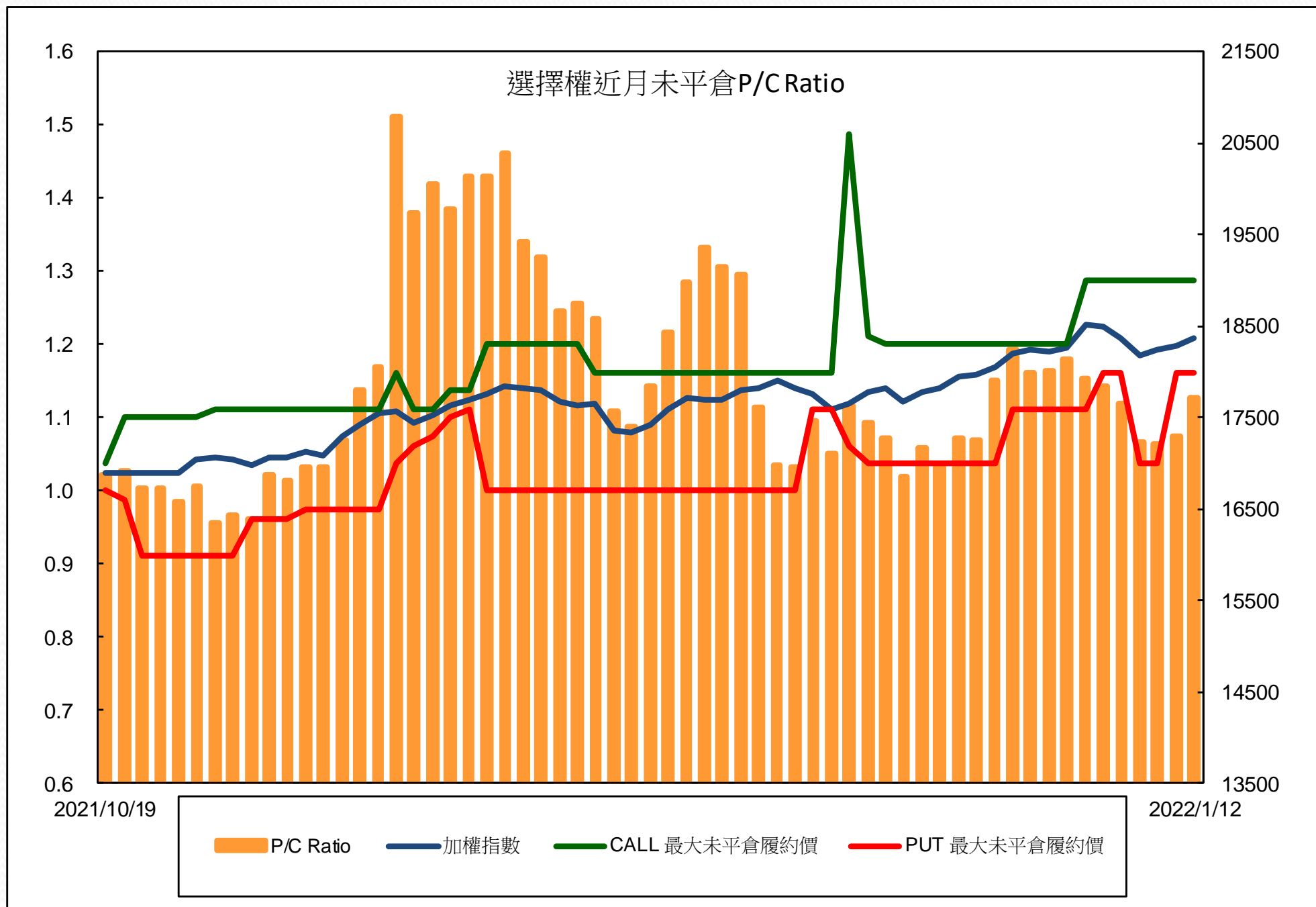
更新日期：2022年1月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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11日	65,765	77,365	-11,600
	1月12日	41,215	50,126	-8,911
Put	1月11日	72,572	59,856	12,716
	1月12日	47,028	41,737	5,291

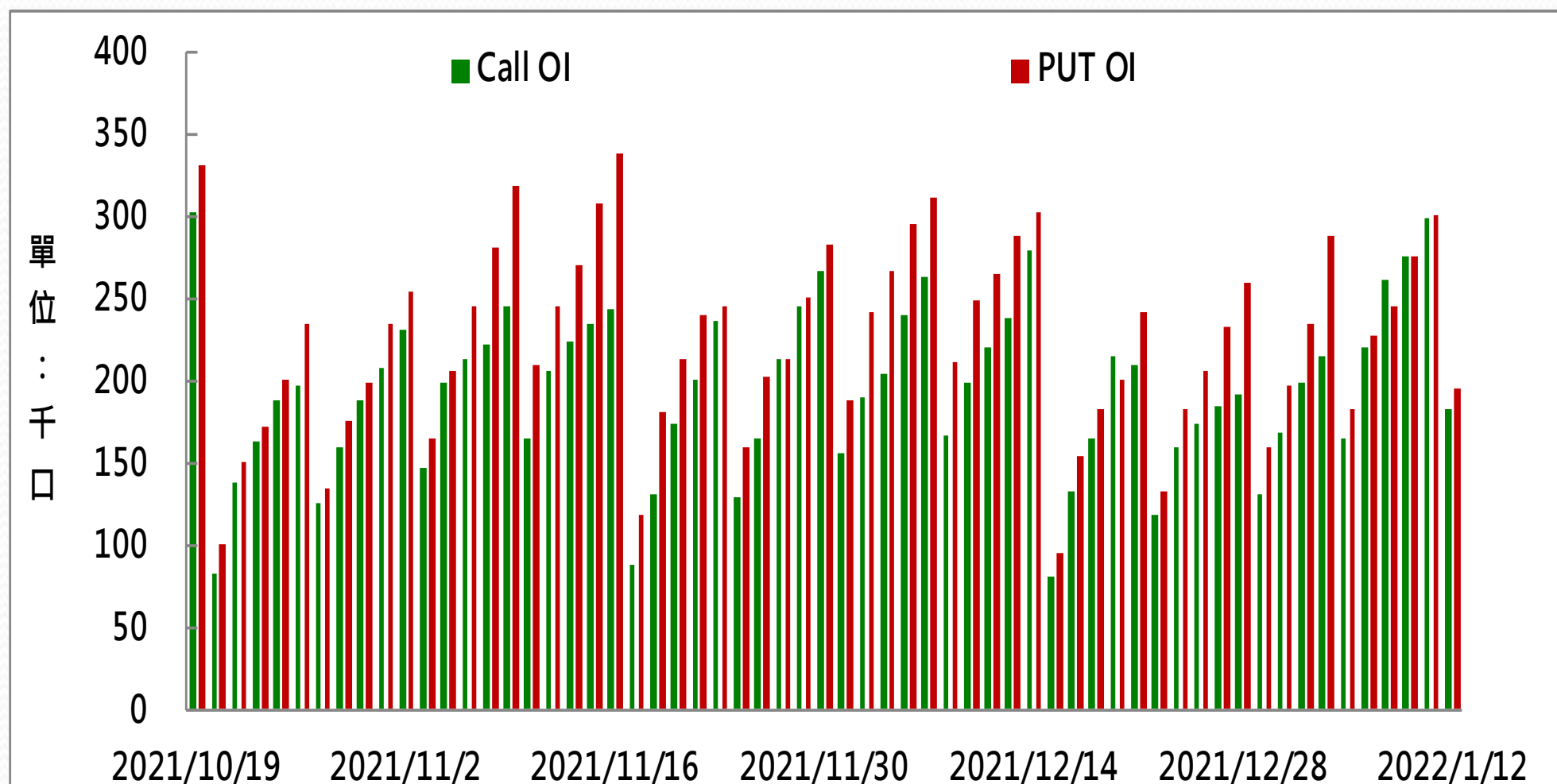
更新日期：2022年1月12日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年1月12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12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12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