

台指選擇權OI匯報

日期：2022/1/13 結算日：2022/1/19					日期：2022/1/13 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
-6	2,214	17,700	8,530	1,429	0	8	16,900	533	69
0	0	17,750	1,910	651	3	29	17,000	10,637	193
-43	2,570	17,800	9,787	2,812	0	5	17,100	511	12
0	2	17,850	1,940	1,331	0	13	17,200	851	24
-26	3,371	17,900	9,530	1,085	0	20	17,300	723	83
27	45	17,950	4,604	3,040	0	66	17,400	1,346	269
-269	4,474	18,000	12,473	2,602	4	100	17,500	1,412	305
44	72	18,050	2,806	1,862	0	66	17,600	1,904	439
-87	3,483	18,100	11,244	4,880	0	91	17,700	849	185
82	121	18,150	3,544	2,380	0	346	17,800	722	166
-389	4,845	18,200	9,236	3,116	2	138	17,900	773	191
126	458	18,250	3,412	2,791	5	193	18,000	1,147	226
-525	7,824	18,300	7,981	3,205	21	340	18,100	501	53
20	1,161	18,350	2,809	2,125	1	1,676	18,200	1,466	83
198	8,492	18,400	4,372	1,759	-12	655	18,300	234	68
1,355	2,621	18,450	1,490	1,030	135	1,155	18,400	762	275
378	13,172	18,500	2,250	635	-27	994	18,500	96	8
1,828	3,454	18,550	389	319	31	2,481	18,600	140	54
1,122	11,318	18,600	779	168	-11	2,784	18,700	23	14
2,616	4,914	18,650	55	47	144	2,685	18,800	22	13
2,914	15,158	18,700	287	44	281	2,077	18,900	5	2
2,438	3,870	18,750	32	19	885	3,188	19,000	10	-1
3,745	15,428	18,800	350	-68	276	1,966	19,100	3	1
2,676	2,676	18,850	5	5	150	1,589	19,200	8	4
2,131	9,941	18,900	29	3	264	811	19,300	3	3
※ 5,341	19,677	19,000	37	3	104	683	19,400	5	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
27,219	170,094	1.1468	195,063	37,711	3,697	28,140	1.0851	30,535	2,988
昨日 P/C	1.1013	今日增減變化		0.0455	昨日 P/C	1.1270	今日增減變化		-0.0419

更新日期：2022年1月13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13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	89,271,668	183,818,636	-94,546,968	9,797,186	4,864,607	2,767,953	2,096,654	386,840
投信	60,061,519	50,373,737	9,687,782	249,897	567,968	0	567,968	320
自營商	67,700,838	12,269,798	55,431,040	-6,682,337	2,174,858	2,355,374	-180,516	-386,053
	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	1,208,326	3,977,821	-2,769,495	508,548	203,946	166,865	37,081	-1,674
投信	23,670	0	23,670	455	1,686	0	1,686	1
自營商	1,051,958	216,624	835,334	112,175	399,371	459,948	-60,577	-26,984

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13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	45,703	34,052	11,651	-197	75,917	31,053	44,864	3,164
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	54,300	54,981	-681	8,230	47,513	48,411	-898	-6,189
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	29,840	19,999	9,841	1,159	6,504	42,262	-35,758	-872
特定法人(全月)	34,925	29,607	5,318	-1,686	18,248	60,260	-42,012	-5,917
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	77,114	57,916	19,198	7,279	68,589	80,504	-11,915	5,502
十大交易人(全月)	97,734	74,764	22,970	9,730	85,057	103,583	-18,526	5,252
全市場未沖銷(近月)			170,094	27,219			195,063	37,711
全市場未沖銷(全月)			213,376	31,002			236,899	40,960

更新日期：2022年1月13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	18300	賣權OI最大量	18000
	整體隱含波動率	13.07%	較前一交易日	-0.58%
	買權隱含波動率	11.86%	較前一交易日	-0.62%
	賣權隱含波動率	14.32%	較前一交易日	-0.48%
電子選擇權	買權成交最大量	920	買權OI最大量	920
	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	1880
	賣權成交最大量	1660	賣權OI最大量	1720

更新日期：2022年1月13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	19000	買權OI最大量	19000
	賣權成交最大量	17500	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	15.16%	較前一交易日	+0.27%
	買權隱含波動率	11.79%	較前一交易日	-0.68%
	賣權隱含波動率	18.39%	較前一交易日	-0.83%
	成交量P/C_Ratio值	0.917	較前一交易日	+0.17
	未平倉P/C_Ratio值	1.085	較前一交易日	-0.04
電子選擇權	買權成交最大量	920	買權OI最大量	920
	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	1880
	賣權成交最大量	1660	賣權OI最大量	1720

更新日期：2022年1月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

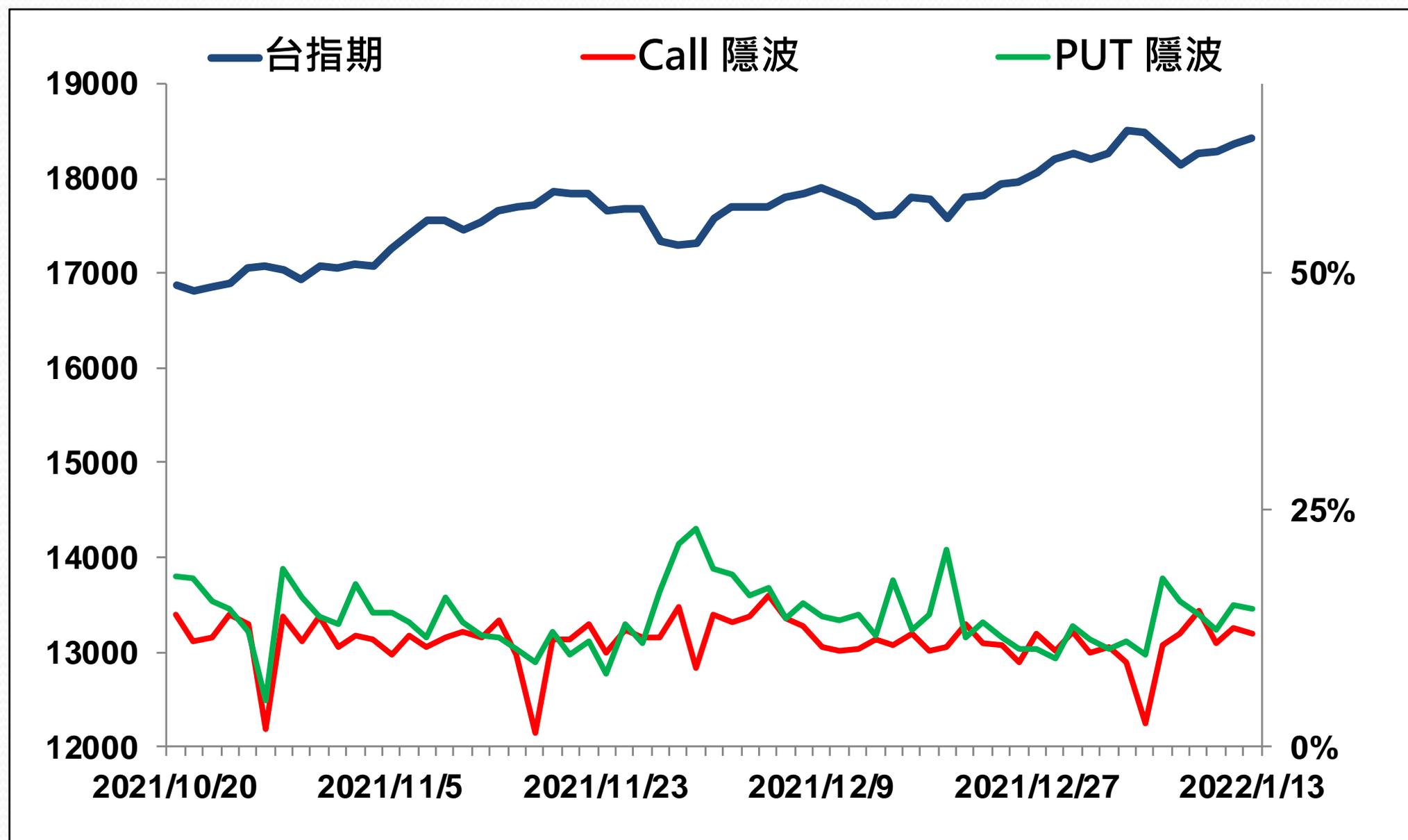
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



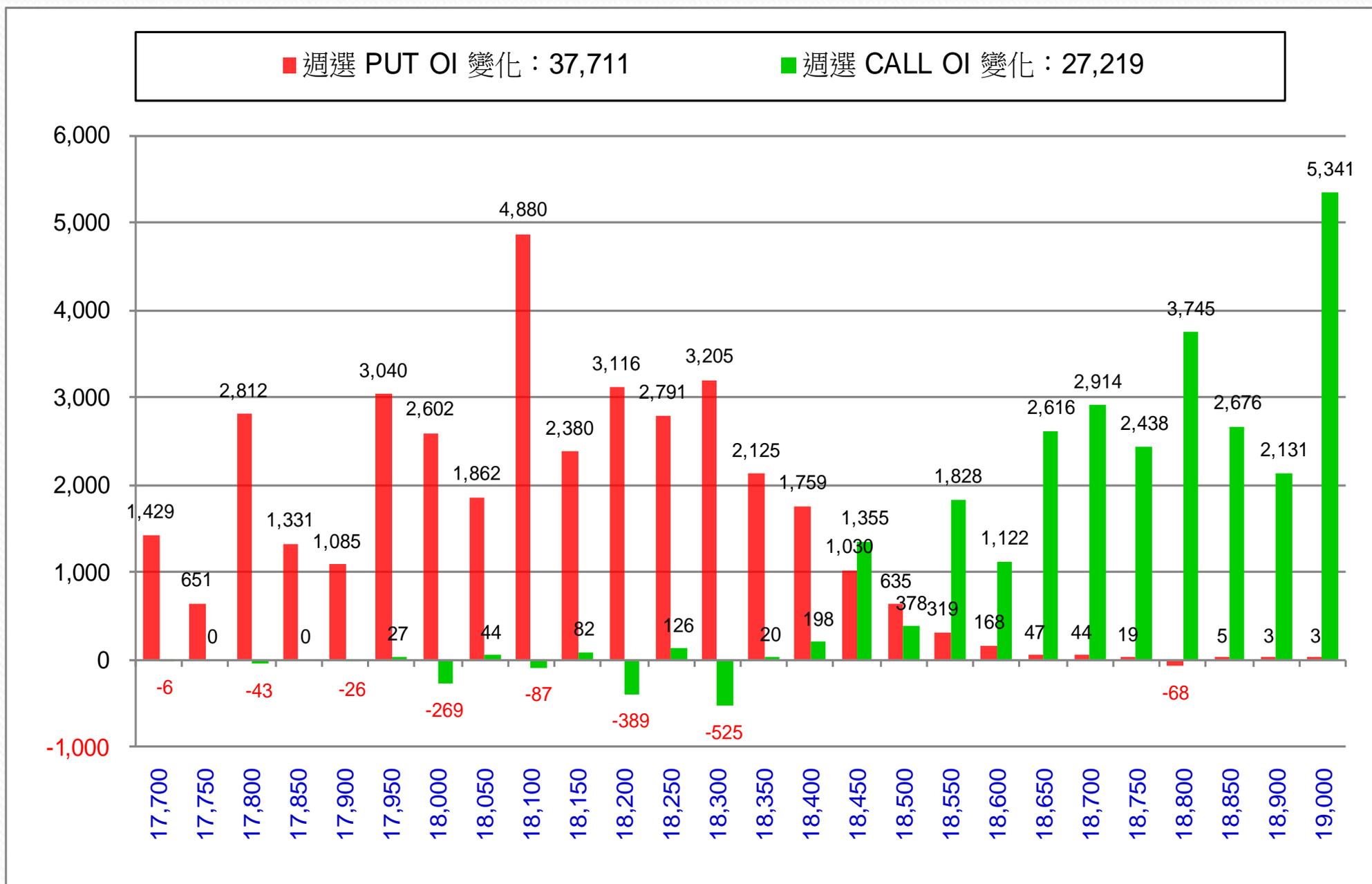
更新日期：2022年1月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年1月13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

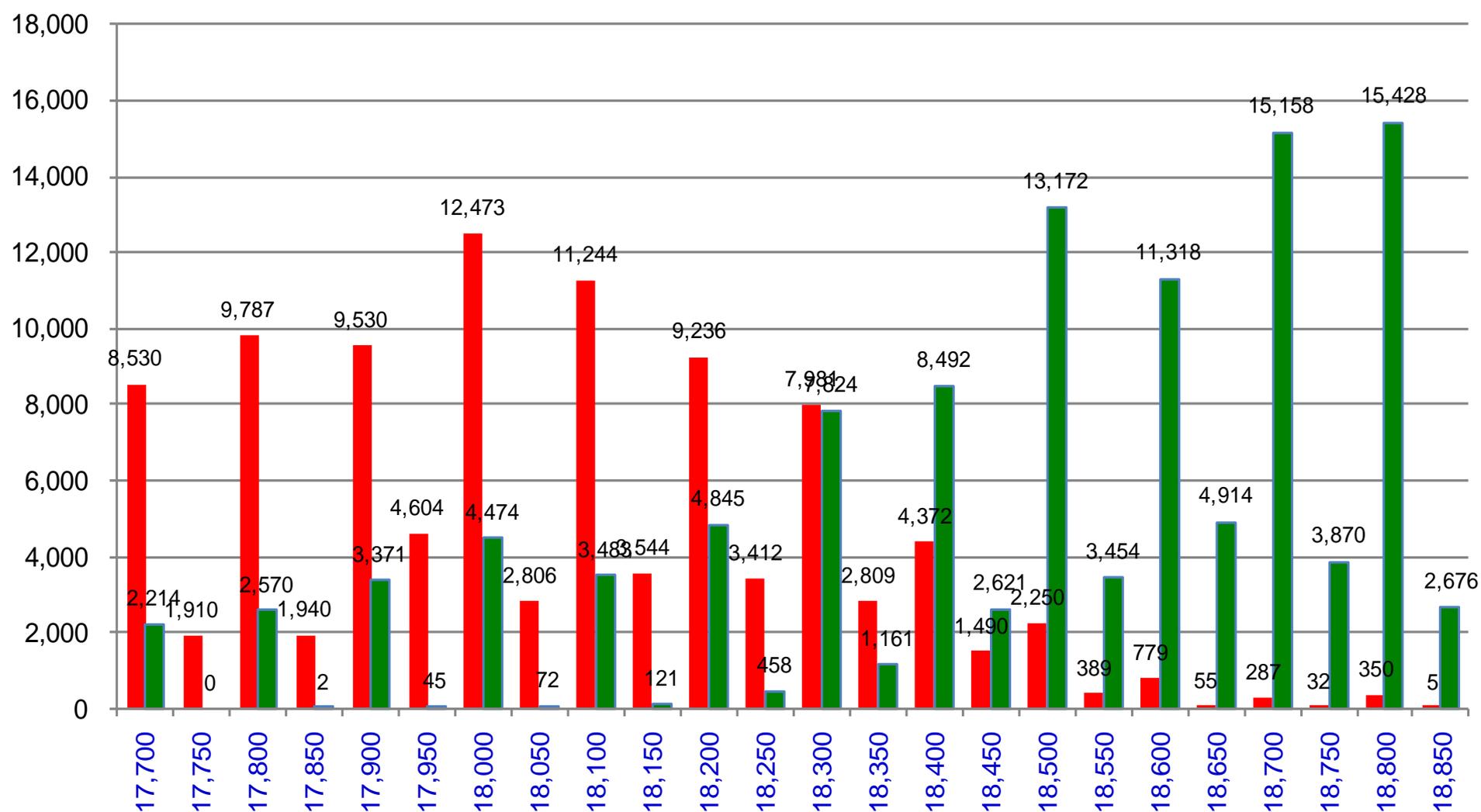


更新日期：2022年1月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：195,063

週選 CALL OI 總額：170,094



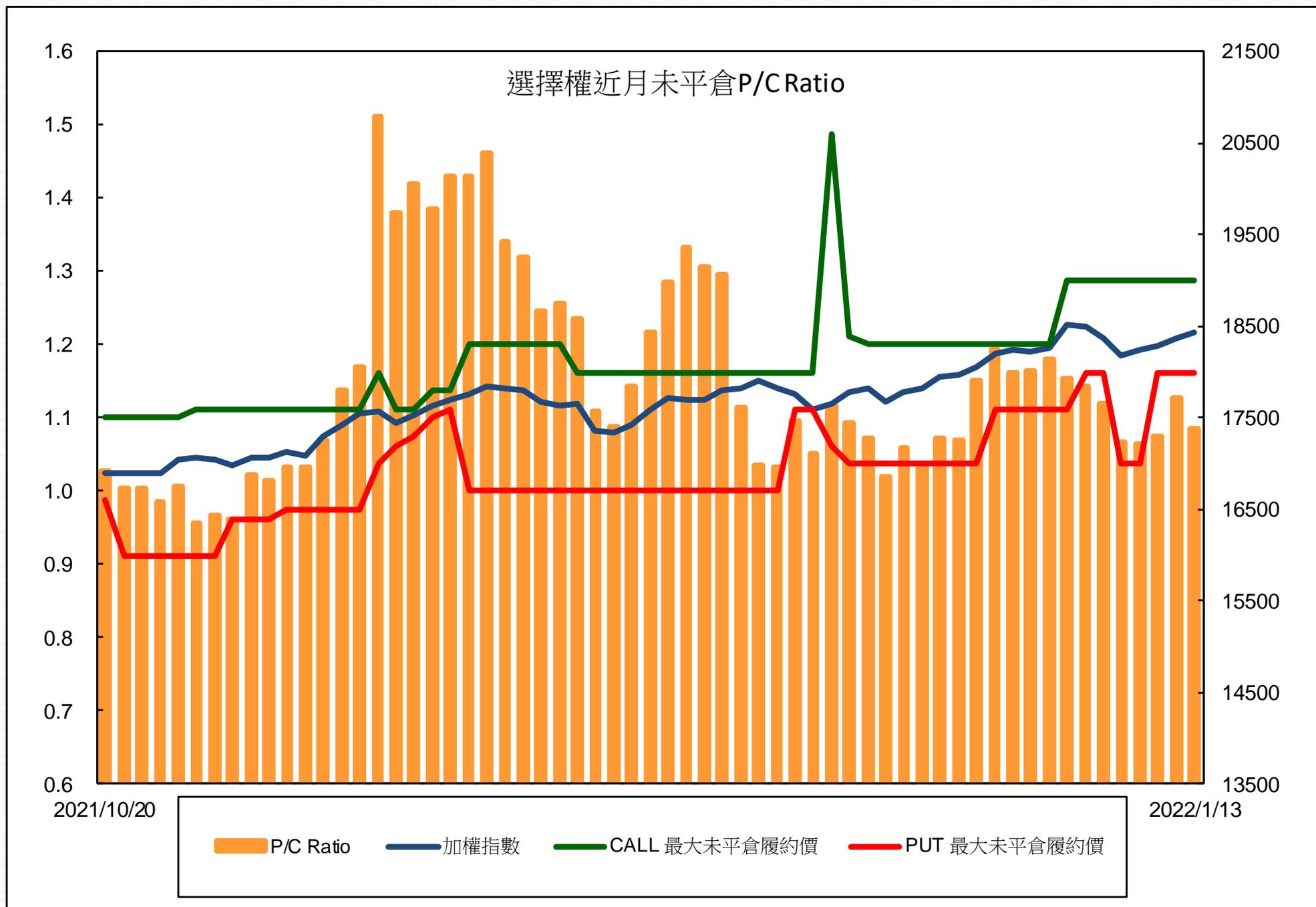
更新日期：2022年1月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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12日	41,215	50,126	-8,911
	1月13日	54,300	54,981	-681
Put	1月12日	47,028	41,737	5,291
	1月13日	47,513	48,411	-898

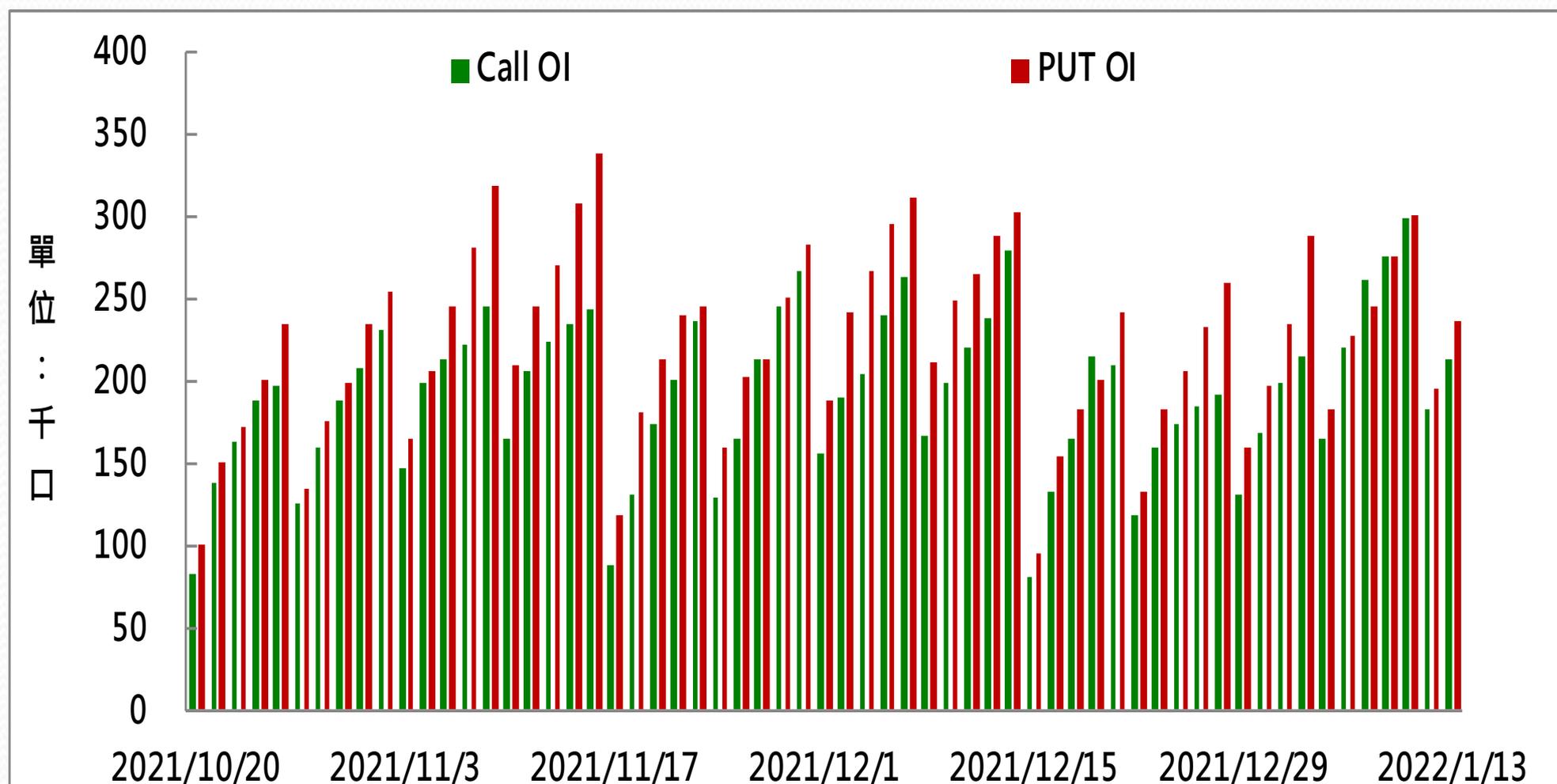
更新日期：2022年1月13日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年1月13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13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13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