

台指選擇權OI匯報

日期：2022/1/14 結算日：2022/1/19					日期：2022/1/14 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
-50	3,321	17,900	9,496	-34	0	66	17,400	1,615	269
-6	39	17,950	4,596	-8	-1	99	17,500	1,843	431
-388	4,086	18,000	15,190	2,717	2	68	17,600	2,662	758
6	78	18,050	4,276	1,470	0	91	17,700	1,876	1,027
-179	3,304	18,100	10,579	-665	0	346	17,800	1,620	898
140	261	18,150	5,447	1,903	21	159	17,900	1,126	353
134	4,979	18,200	9,740	504	148	341	18,000	1,456	309
544	1,002	18,250	5,667	2,255	-17	323	18,100	642	141
1,764	9,588	18,300	11,236	3,255	28	1,704	18,200	1,761	295
2,407	3,568	18,350	3,857	1,048	100	755	18,300	408	174
2,783	11,275	18,400	5,760	1,388	35	1,190	18,400	879	117
3,257	5,878	18,450	2,629	1,139	676	1,670	18,500	167	71
1,489	14,661	18,500	3,374	1,124	139	2,620	18,600	189	49
2,487	5,941	18,550	1,451	1,062	342	3,126	18,700	71	48
2,986	14,304	18,600	1,564	785	1,016	3,701	18,800	115	93
917	5,831	18,650	436	381	774	2,851	18,900	6	1
4,411	19,569	18,700	524	237	1,083	4,271	19,000	8	-2
5,585	9,455	18,750	119	87	1,579	3,545	19,100	3	0
-794	14,634	18,800	847	497	933	2,522	19,200	8	0
1,421	4,097	18,850	49	44	334	1,145	19,300	2	-1
-1,648	8,293	18,900	59	30	168	851	19,400	5	0
323	323	18,950	0	0	176	1,129	19,500	17	0
6,025	25,702	19,000	72	35	37	619	19,600	0	0
※ 6,683	11,284	19,100	27	1	128	385	19,700	0	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
47,136	217,230	1.0001	217,243	22,180	9,670	37,810	0.9619	36,370	5,835
昨日 P/C	1.1468	今日增減變化	-0.1467		昨日 P/C	1.0851	今日增減變化	-0.1232	

更新日期：2022年1月14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14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	86,163,350	179,551,697	-93,388,347	1,158,621	4,902,934	2,928,951	1,973,983	-122,671
投信	59,868,007	50,232,730	9,635,277	-52,505	567,520	0	567,520	-448
自營商	68,597,684	11,218,466	57,379,218	1,948,178	2,233,462	2,264,527	-31,065	149,451
	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	1,018,625	3,917,037	-2,898,412	-128,917	225,504	131,962	93,542	56,461
投信	23,530	0	23,530	-140	1,670	0	1,670	-16
自營商	917,447	251,507	665,940	-169,394	330,650	485,910	-155,260	-94,683

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14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	45,129	35,371	9,758	-1,893	77,899	33,907	43,992	-872
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	53,846	70,722	-16,876	-16,195	54,192	48,822	5,370	6,268
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	24,332	13,805	10,527	686	6,872	42,262	-35,390	368
特定法人(全月)	31,766	24,703	7,063	1,745	18,350	61,394	-43,044	-1,032
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	93,556	74,638	18,918	-280	69,884	84,827	-14,943	-3,028
十大交易人(全月)	116,423	93,467	22,956	-14	87,346	111,768	-24,422	-5,896
全市場未沖銷(近月)			217,230	47,136			217,243	22,180
全市場未沖銷(全月)			270,280	56,904			265,314	28,415

更新日期：2022年1月14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	11.74%	較前一交易日	-1.34%
	買權隱含波動率	9.27%	較前一交易日	-2.59%
	賣權隱含波動率	14.36%	較前一交易日	+0.03%
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	810	賣權OI最大量	800
金融選擇權	買權成交最大量	1800	買權OI最大量	1880
	賣權成交最大量	1740	賣權OI最大量	1720

更新日期：2022年1月14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	18000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	15.09%	較前一交易日	+0.07%
	買權隱含波動率	11.80%	較前一交易日	+0.01%
	賣權隱含波動率	19.07%	較前一交易日	+0.68%
	成交量P/C_Ratio值	0.791	較前一交易日	-0.13
	未平倉P/C_Ratio值	0.962	較前一交易日	-0.12
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	810	賣權OI最大量	800
金融選擇權	買權成交最大量	1800	買權OI最大量	1880
	賣權成交最大量	1740	賣權OI最大量	1720

更新日期：2022年1月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

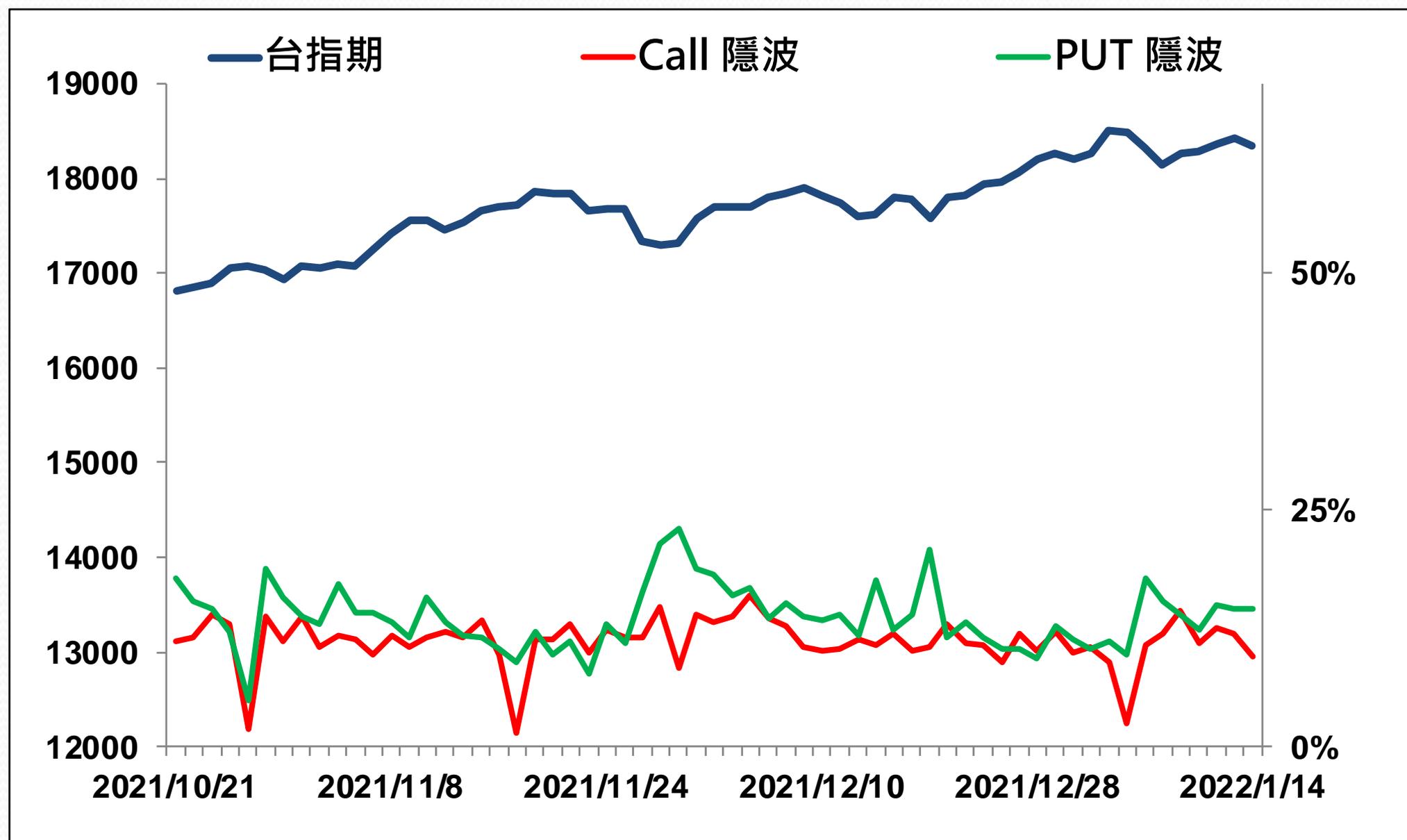
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



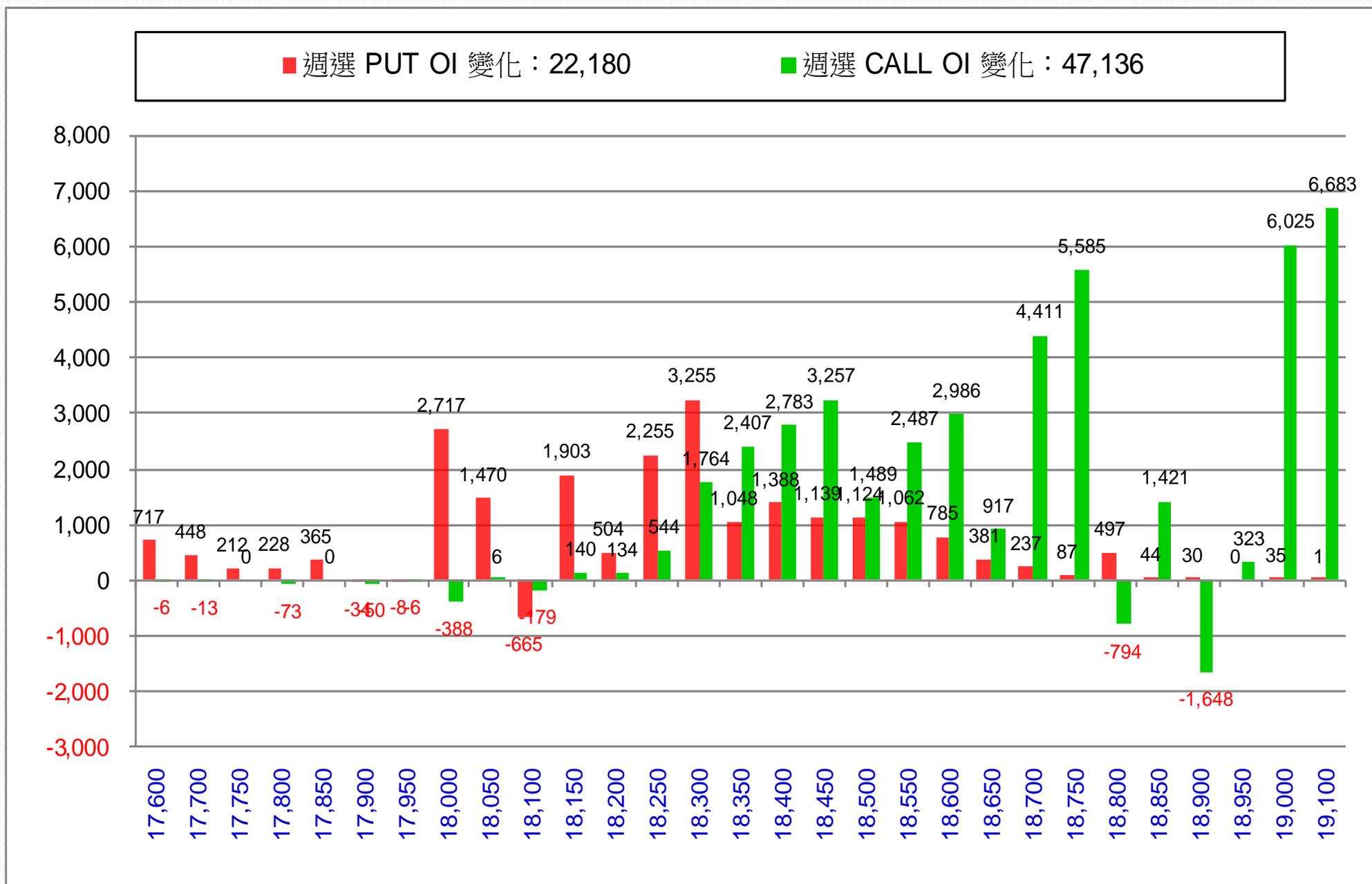
更新日期：2022年1月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



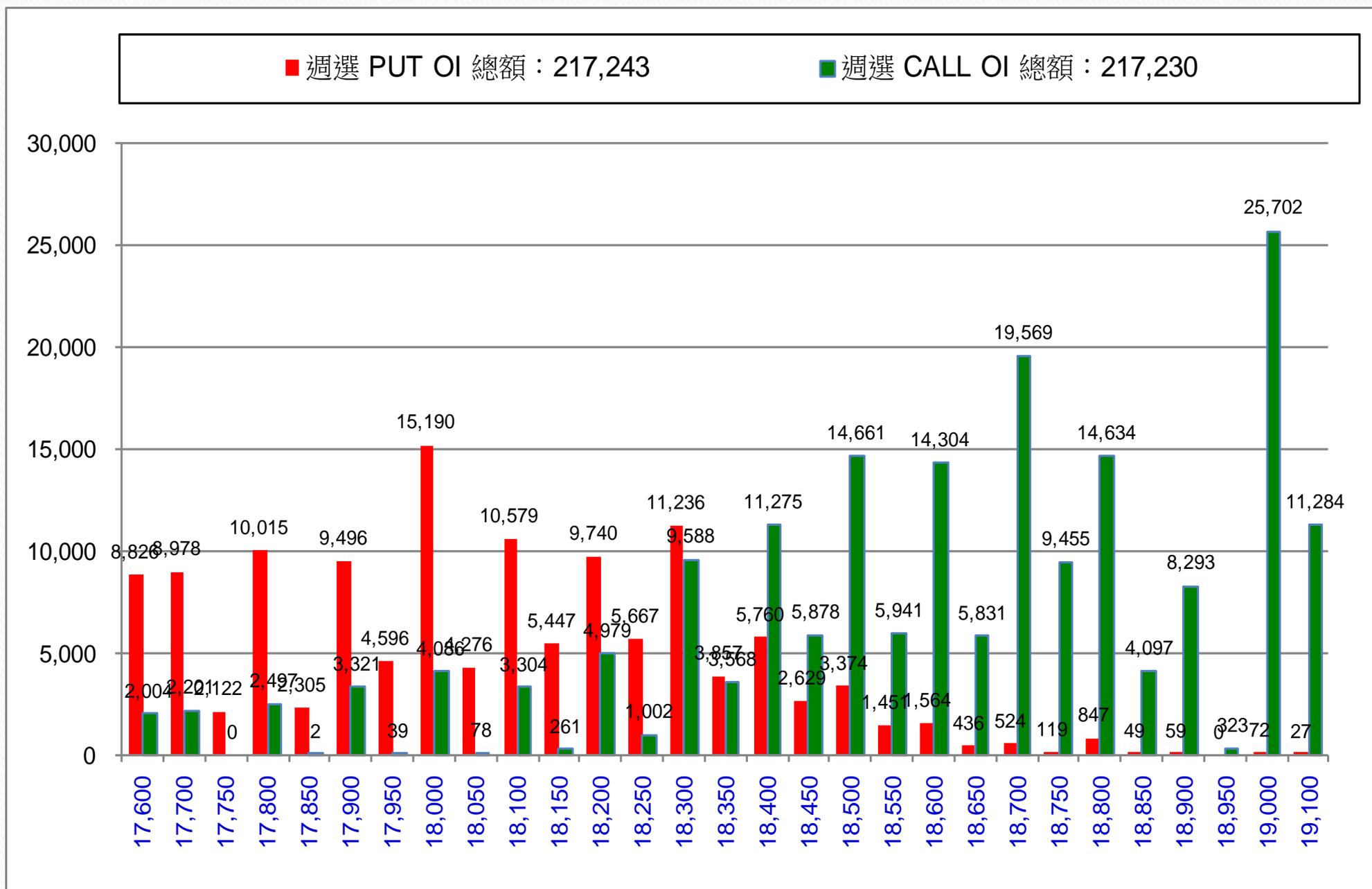
更新日期：2022年1月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2022年1月14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



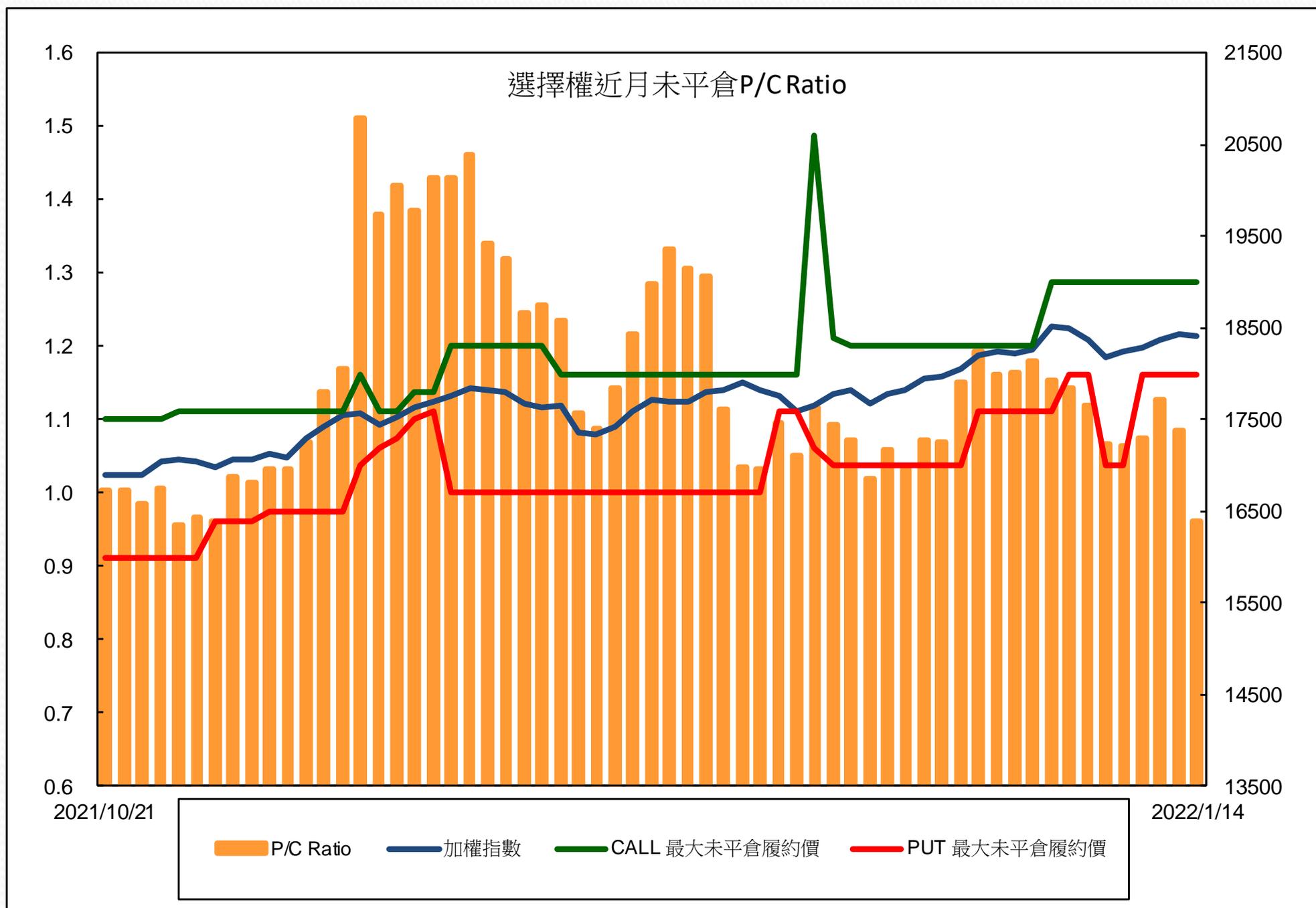
更新日期：2022年1月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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13日	54,300	54,981	-681
	1月14日	53,846	70,722	-16,876
Put	1月13日	47,513	48,411	-898
	1月14日	54,192	48,822	5,370

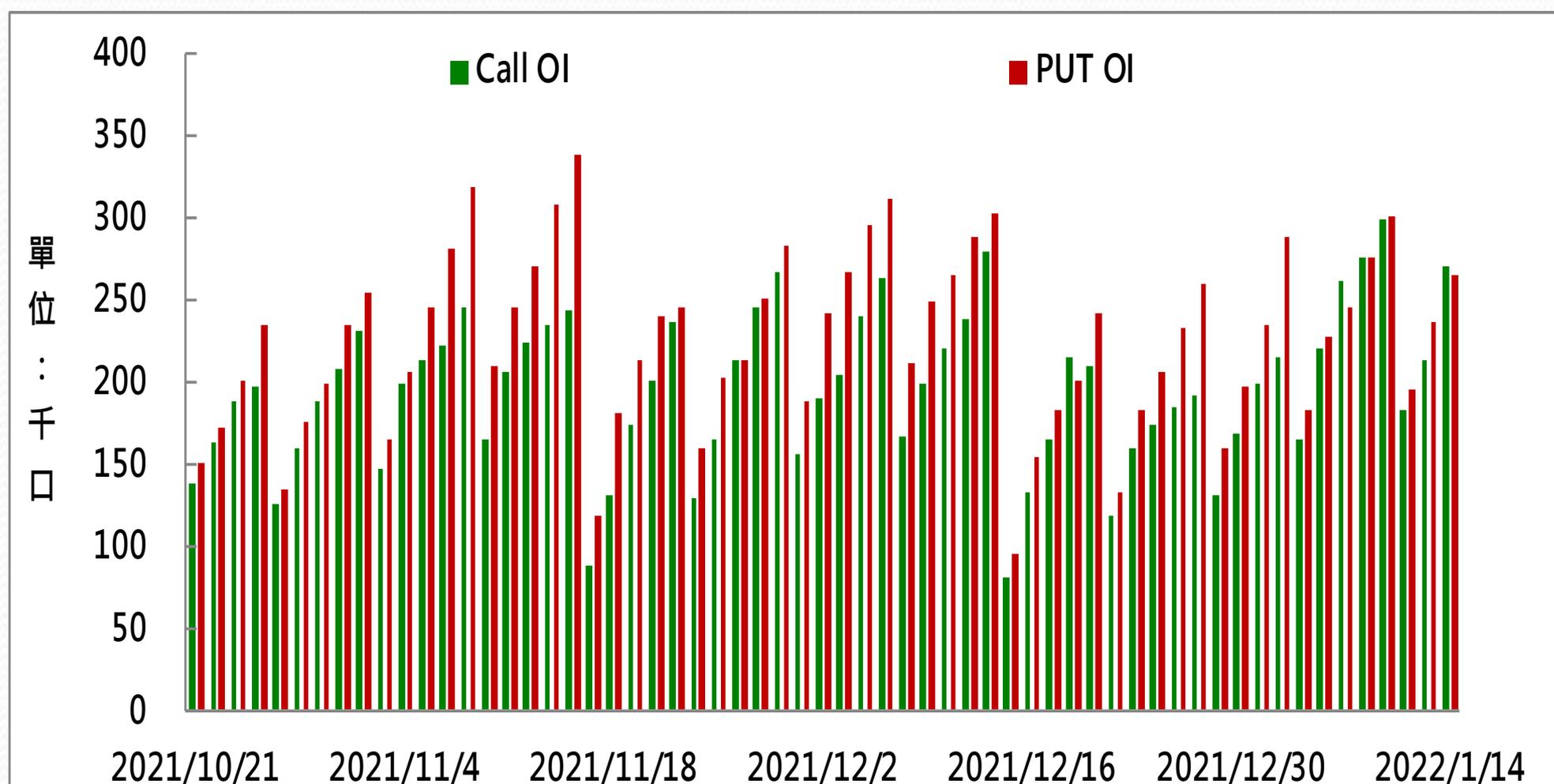
更新日期：2022年1月14日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年1月14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14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14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