

台指選擇權OI匯報

日期：2022/1/17 結算日：2022/1/19					日期：2022/1/17 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
-4	74	18,050	4,608	332	0	99	17,500	1,921	78
-142	3,162	18,100	10,706	127	0	68	17,600	2,772	110
-58	203	18,150	8,203	2,756	-1	90	17,700	2,953	1,077
-391	4,588	18,200	13,403	3,663	0	346	17,800	3,811	2,191
-192	810	18,250	9,523	3,856	-18	141	17,900	2,193	1,067
-1,265	8,323	18,300	15,733	4,497	-67	274	18,000	2,257	801
-1,047	2,521	18,350	7,108	3,251	-14	309	18,100	852	210
-2,018	9,257	18,400	10,493	4,733	-123	1,581	18,200	1,830	69
-135	5,743	18,450	6,617	3,988	17	772	18,300	453	45
50	14,711	18,500	7,294	3,920	-13	1,177	18,400	963	84
1,171	7,112	18,550	3,113	1,662	161	1,831	18,500	349	182
353	14,657	18,600	2,219	655	109	2,729	18,600	240	51
2,036	7,867	18,650	745	309	280	3,406	18,700	64	-7
※ 3,094	22,663	18,700	745	221	49	3,750	18,800	139	24
1,180	10,635	18,750	205	86	1,066	3,917	18,900	9	3
-8	14,626	18,800	737	-110	※ 1,076	5,347	19,000	112	104
-434	3,663	18,850	98	49	-179	3,366	19,100	3	0
-244	8,049	18,900	101	42	823	3,345	19,200	8	0
52	375	18,950	2	2	61	1,206	19,300	2	0
-759	24,943	19,000	81	9	70	921	19,400	197	192
-256	11,028	19,100	28	1	149	1,278	19,500	17	0
-114	6,693	19,200	6	-1	26	645	19,600	0	0
41	3,692	19,300	4	0	78	463	19,700	0	0
-89	1,811	19,400	0	0	53	338	19,800	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
-404	216,826	1.1388	246,931	29,688	3,915	41,725	1.0788	45,013	8,643
昨日 P/C	1.0001	今日增減變化		0.1388	昨日 P/C	0.9619	今日增減變化		0.1169

更新日期：2022年1月17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17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	91,784,895	186,491,052	-94,706,157	-1,317,810	4,789,617	2,805,566	1,984,051	10,068
投信	60,630,310	50,320,967	10,309,343	674,066	576,591	0	576,591	9,071
自營商	73,826,978	18,601,938	55,225,040	-2,154,178	2,322,315	2,703,118	-380,803	-349,738
	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	981,292	4,179,676	-3,198,384	-299,972	210,960	21,594	189,366	95,824
投信	23,371	0	23,371	-159	1,658	0	1,658	-12
自營商	774,663	458,321	316,342	-349,598	327,032	607,615	-280,583	-125,323

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17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	45,473	33,325	12,148	2,390	78,552	35,129	43,423	-569
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	63,977	70,918	-6,941	9,935	53,253	59,681	-6,428	-11,798
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	23,730	15,043	8,687	-1,840	6,872	42,183	-35,311	79
特定法人(全月)	33,070	23,928	9,142	2,079	18,651	64,027	-45,376	-2,332
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	98,723	75,202	23,521	4,603	75,497	83,450	-7,953	6,990
十大交易人(全月)	126,076	96,196	29,880	6,924	98,796	114,861	-16,065	8,357
全市場未沖銷(近月)			216,826	-404			246,931	29,688
全市場未沖銷(全月)			274,207	3,927			304,497	39,183

更新日期：2022年1月17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	18400	賣權OI最大量	18300
	整體隱含波動率	12.28%	較前一交易日	+0.55%
	買權隱含波動率	9.69%	較前一交易日	+0.41%
	賣權隱含波動率	14.50%	較前一交易日	+0.15%
電子選擇權	買權成交最大量	940	買權OI最大量	920
	賣權成交最大量	830	賣權OI最大量	830
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	1760	賣權OI最大量	1720

更新日期：2022年1月17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	17800	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	16.17%	較前一交易日	-1.08%
	買權隱含波動率	11.92%	較前一交易日	+0.12%
	賣權隱含波動率	20.24%	較前一交易日	+1.17%
	成交量P/C_Ratio值	0.896	較前一交易日	+0.11
	未平倉P/C_Ratio值	1.079	較前一交易日	+0.12
電子選擇權	買權成交最大量	940	買權OI最大量	920
	賣權成交最大量	830	賣權OI最大量	830
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	1760	賣權OI最大量	1720

更新日期：2022年1月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

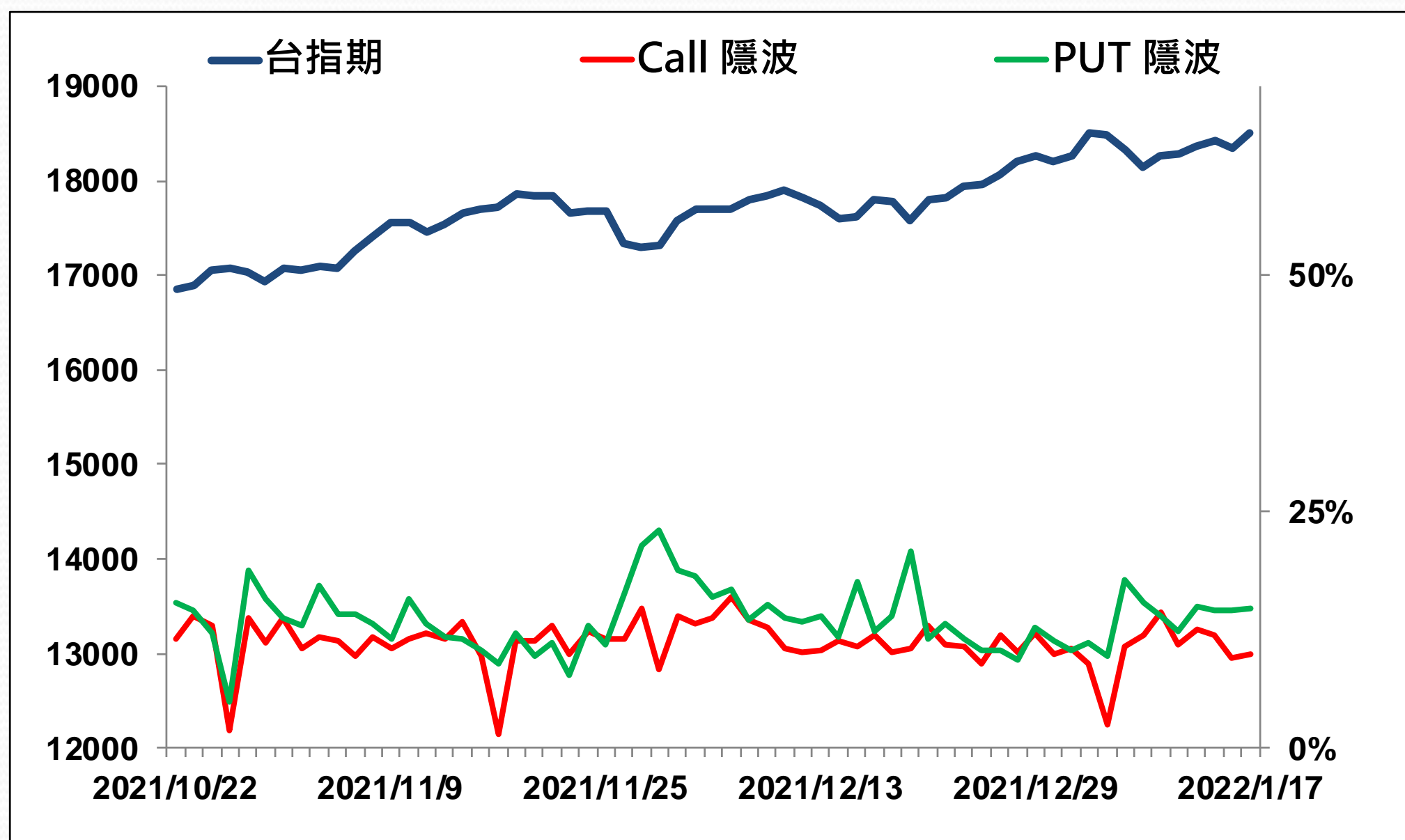
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



更新日期：2022年1月17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

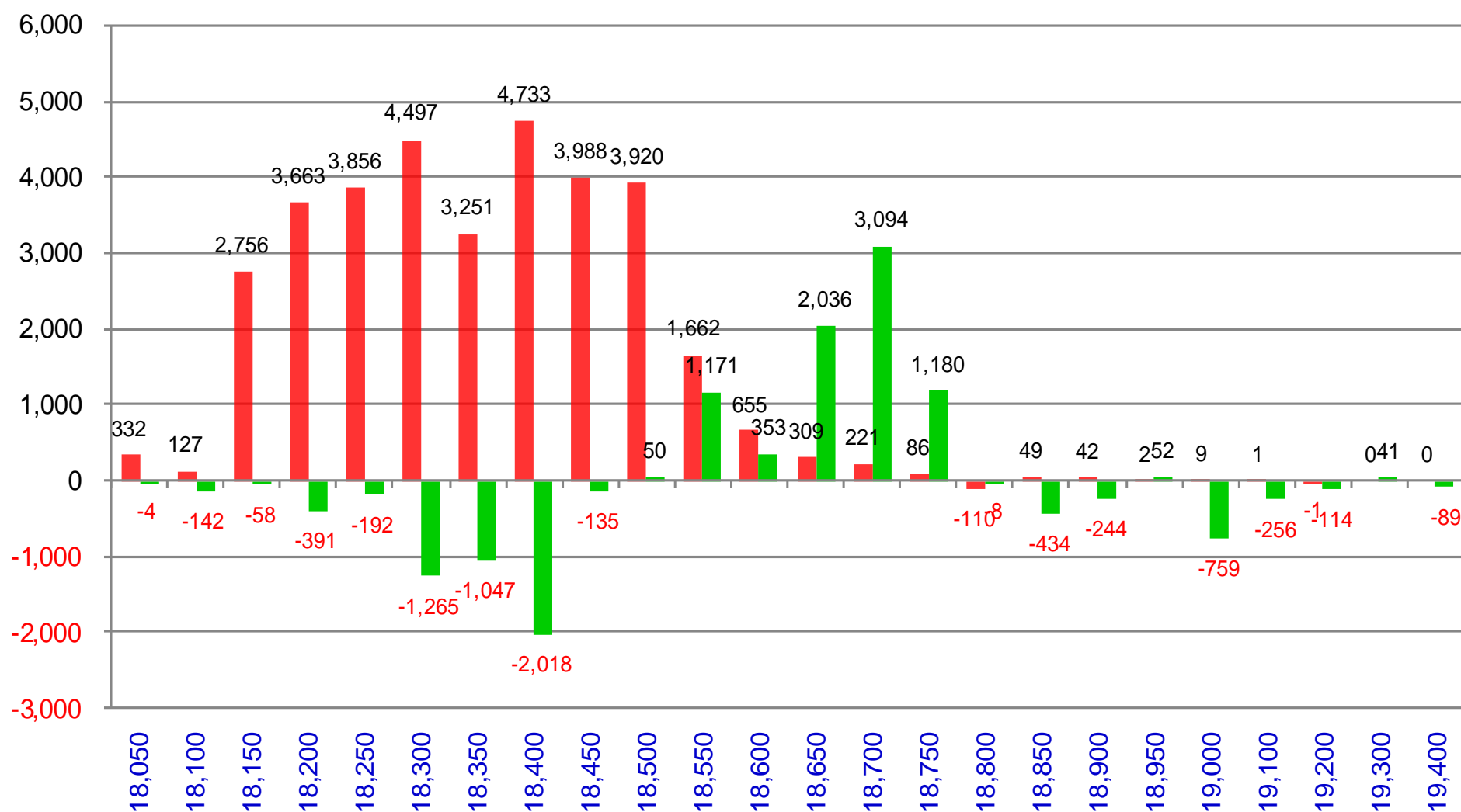


更新日期：2022年1月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量

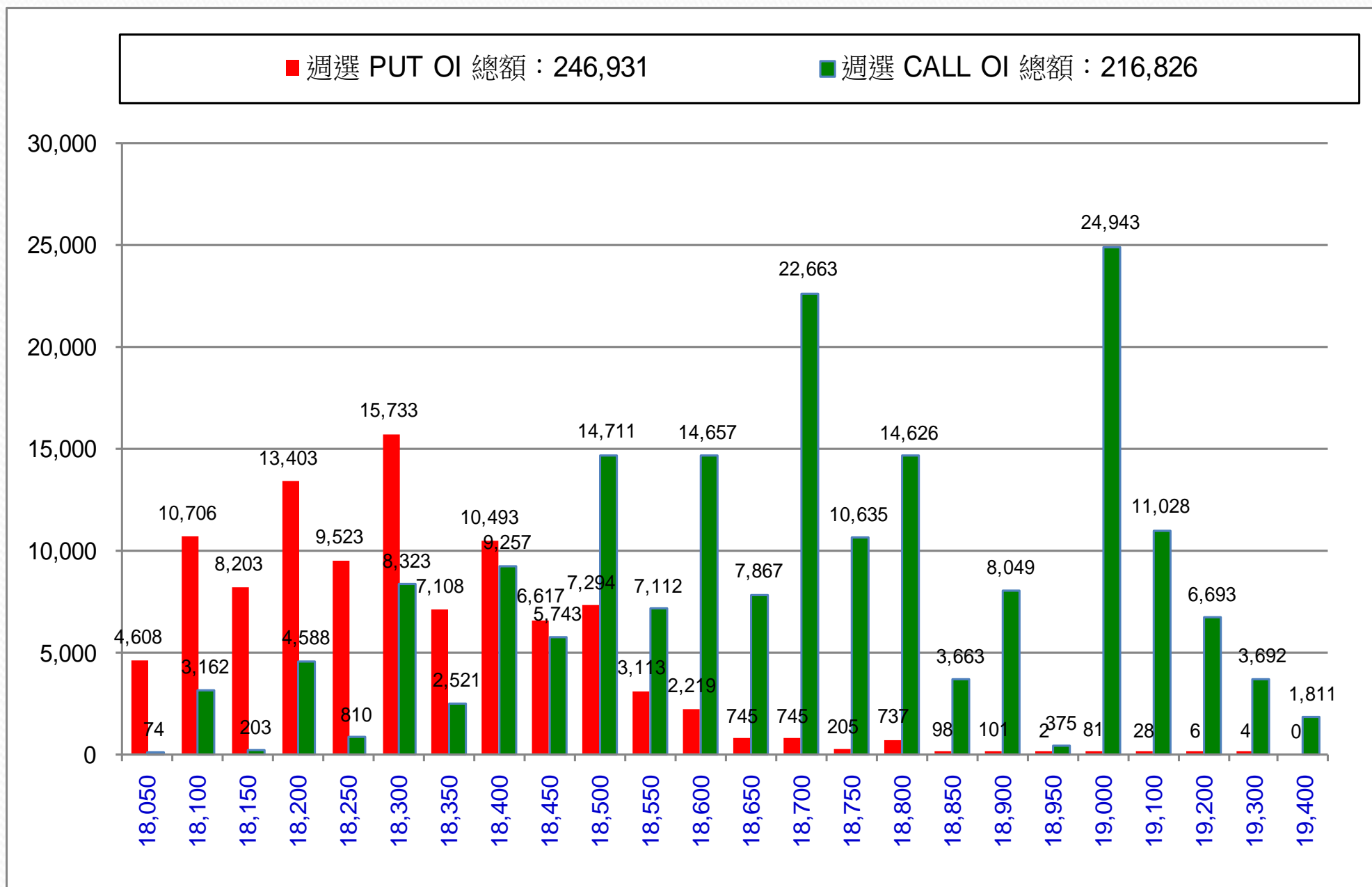
週選 PUT OI 變化：29,688

-週選 CALL OI 變化：404



更新日期：2022年1月17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



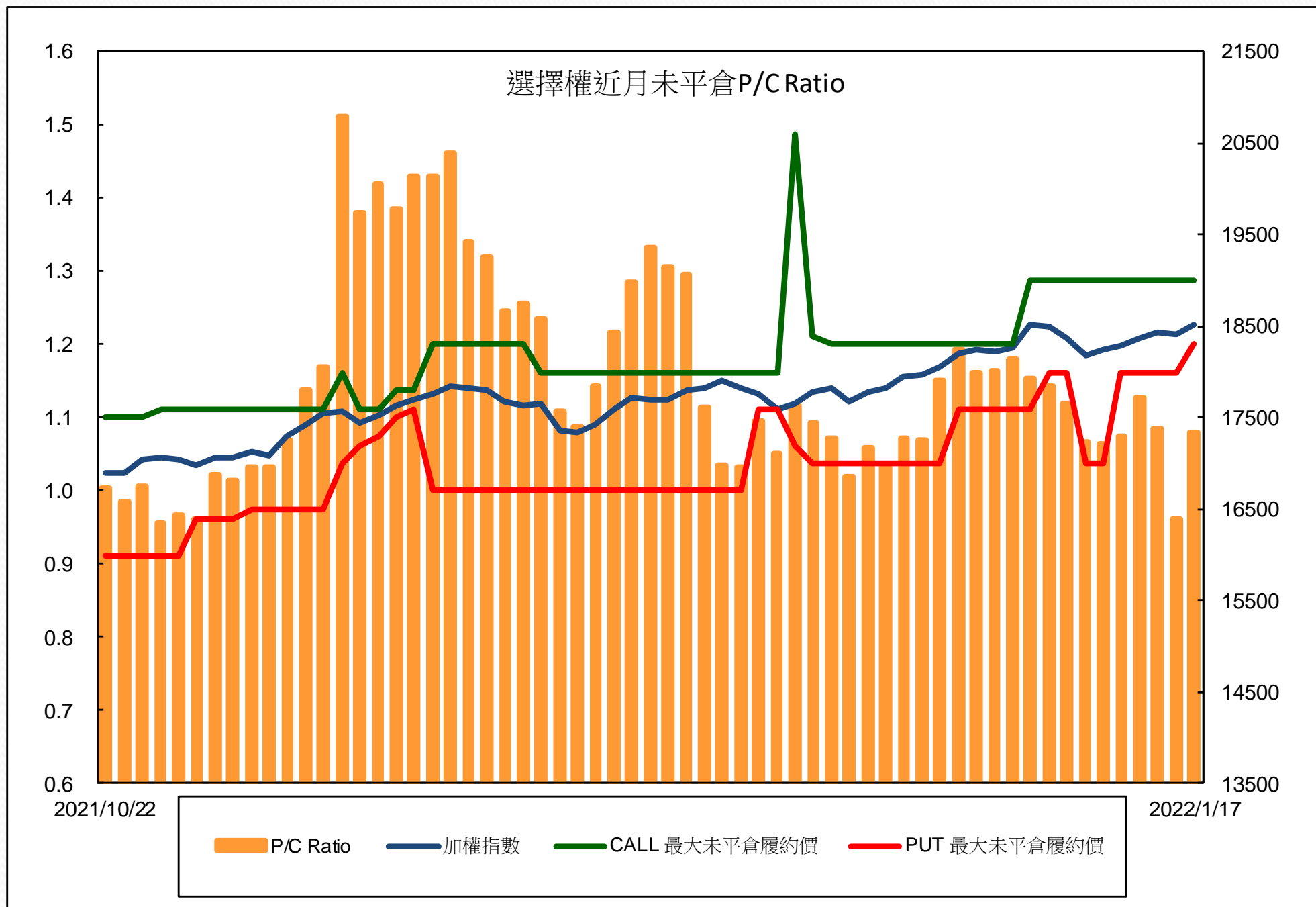
更新日期：2022年1月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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14日	53,846	70,722	-16,876
	1月17日	63,977	70,918	-6,941
Put	1月14日	54,192	48,822	5,370
	1月17日	53,253	59,681	-6,428

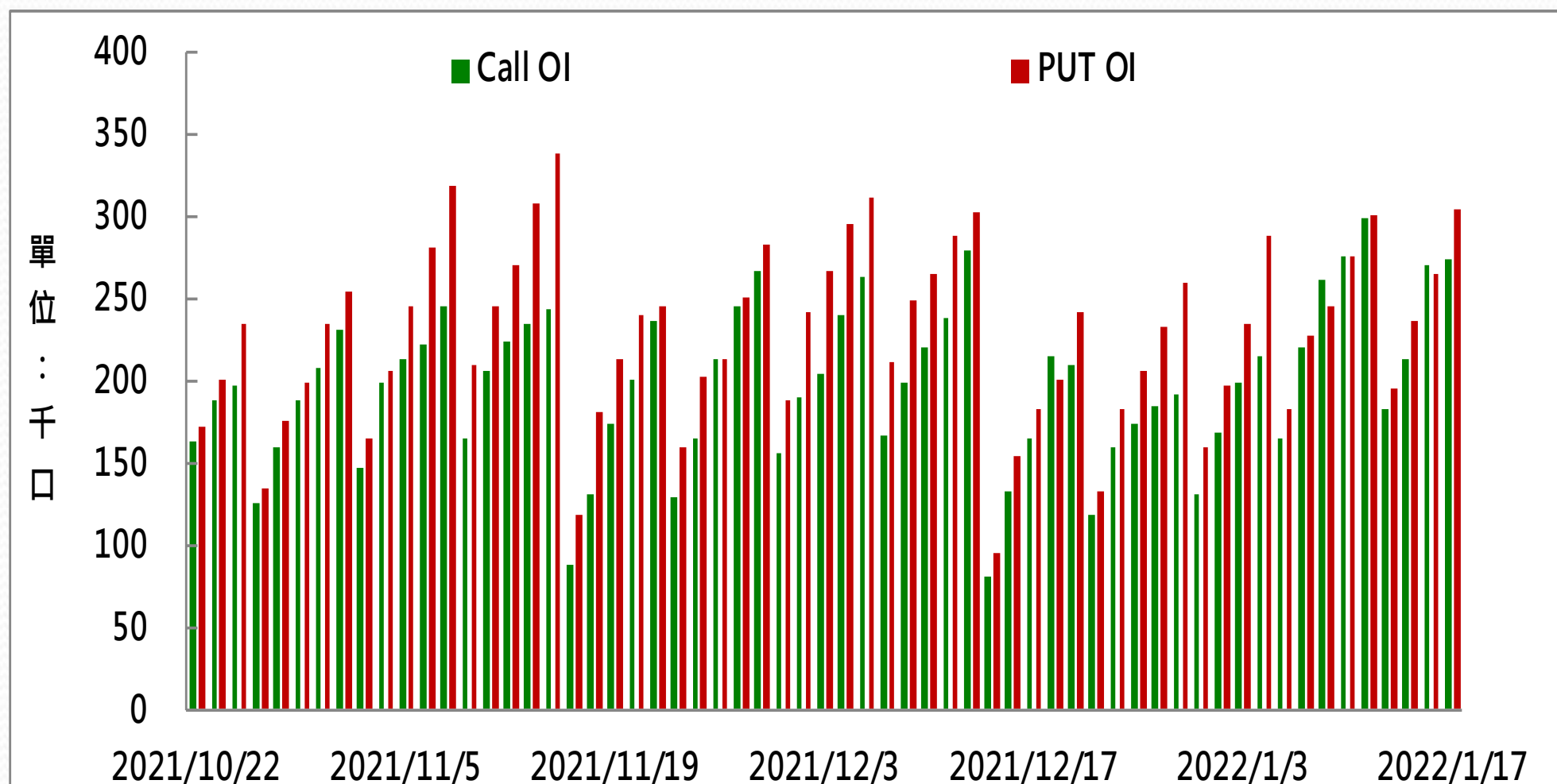
更新日期：2022年1月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年1月17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17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17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