

台指選擇權OI匯報

日期：2022/1/18 結算日：2022/1/19					日期：2022/1/18 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
-33	3,273	17,900	8,811	-1,134	0	66	17,400	1,748	9
-1	41	17,950	4,378	-1,136	0	99	17,500	2,266	345 ※
209	3,684	18,000	13,850	-1,523	2	70	17,600	3,021	249
8	82	18,050	5,571	963	0	90	17,700	3,213	260
-106	3,056	18,100	11,433	727	20	366	17,800	3,944	133
54	257	18,150	7,667	-536	2	143	17,900	2,482	289
-315	4,273	18,200	14,214	811	33	307	18,000	2,407	150
195	1,005	18,250	8,936	-587	93	402	18,100	953	101
160	8,483	18,300	15,654	-79	53	1,634	18,200	1,946	116
1,664	4,185	18,350	7,649	541	33	805	18,300	622	169
2,215	11,472	18,400	8,903	-1,590	253	1,430	18,400	1,282	319
2,561	8,304	18,450	5,570	-1,047	547	2,378	18,500	509	160
4,342	19,053	18,500	7,677	383	502	3,231	18,600	249	9
※ 6,468	13,580	18,550	4,721	1,608 ※	211	3,617	18,700	69	5
2,883	17,540	18,600	2,184	-35	324	4,074	18,800	200	61
349	8,216	18,650	1,040	295	35	3,952	18,900	20	11
-5,216	17,447	18,700	857	112	599	5,946	19,000	45	-67
-4,255	6,380	18,750	205	0	-238	3,128	19,100	2	-1
-2,438	12,188	18,800	555	-182	433	3,778	19,200	23	15
-72	3,591	18,850	106	8	164	1,370	19,300	1	-1
-861	7,188	18,900	138	37	181	1,102	19,400	330	133
255	630	18,950	2	0	164	1,442	19,500	17	0
-521	24,422	19,000	45	-36	19	664	19,600	0	0
44	44	19,050	0	0	67	530	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
5,236	222,062	1.0920	242,500	-4,431	4,256	45,981	1.0582	48,655	3,642
昨日 P/C	1.1388	今日增減變化		-0.0468	昨日 P/C	1.0788	今日增減變化		-0.0206

更新日期：2022年1月18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18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	96,465,898	185,061,361	-88,595,463	6,110,694	4,929,034	2,909,501	2,019,533	35,482
投信	60,101,421	51,379,893	8,721,528	-1,587,815	567,873	0	567,873	-8,718
自營商	76,243,944	16,876,595	59,367,349	4,142,309	1,316,897	2,529,562	-1,212,665	-831,862
	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	1,043,802	4,241,511	-3,197,709	675	328,561	3,319	325,242	135,876
投信	23,435	0	23,435	64	1,661	0	1,661	3
自營商	677,865	331,824	346,041	29,699	89,677	501,294	-411,617	-131,034

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18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	44,584	33,853	10,731	-1,417	80,491	36,814	43,677	254
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	57,399	71,088	-13,689	-6,748	60,221	62,105	-1,884	4,544
特定法人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
特定法人(近月)	23,770	14,966	8,804	117	6,872	43,551	-36,679	-1,368
特定法人(全月)	32,274	24,400	7,874	-1,268	19,152	65,589	-46,437	-1,061
十大交易人(週)	---	---	---	---	---	---	---	---
十大交易人(近月)	92,996	68,694	24,302	781	77,781	90,267	-12,486	-4,533
十大交易人(全月)	120,395	91,118	29,277	-603	102,629	124,464	-21,835	-5,770
全市場未沖銷(近月)			222,062	5,236			242,500	-4,431
全市場未沖銷(全月)			283,800	9,593			304,807	310

更新日期：2022年1月18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	18500	賣權OI最大量	18300
	整體隱含波動率	12.73%	較前一交易日	+0.45%
	買權隱含波動率	9.82%	較前一交易日	+0.14%
	賣權隱含波動率	15.39%	較前一交易日	+0.89%
電子選擇權	買權成交最大量	960	買權OI最大量	920
	賣權成交最大量	830	賣權OI最大量	800
金融選擇權	買權成交最大量	1860	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18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	16.08%	較前一交易日	+0.08%
	買權隱含波動率	12.37%	較前一交易日	+0.45%
	賣權隱含波動率	20.30%	較前一交易日	+0.06%
	成交量P/C_Ratio值	0.871	較前一交易日	-0.02
	未平倉P/C_Ratio值	1.058	較前一交易日	-0.02
電子選擇權	買權成交最大量	960	買權OI最大量	920
	賣權成交最大量	830	賣權OI最大量	800
金融選擇權	買權成交最大量	1860	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18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

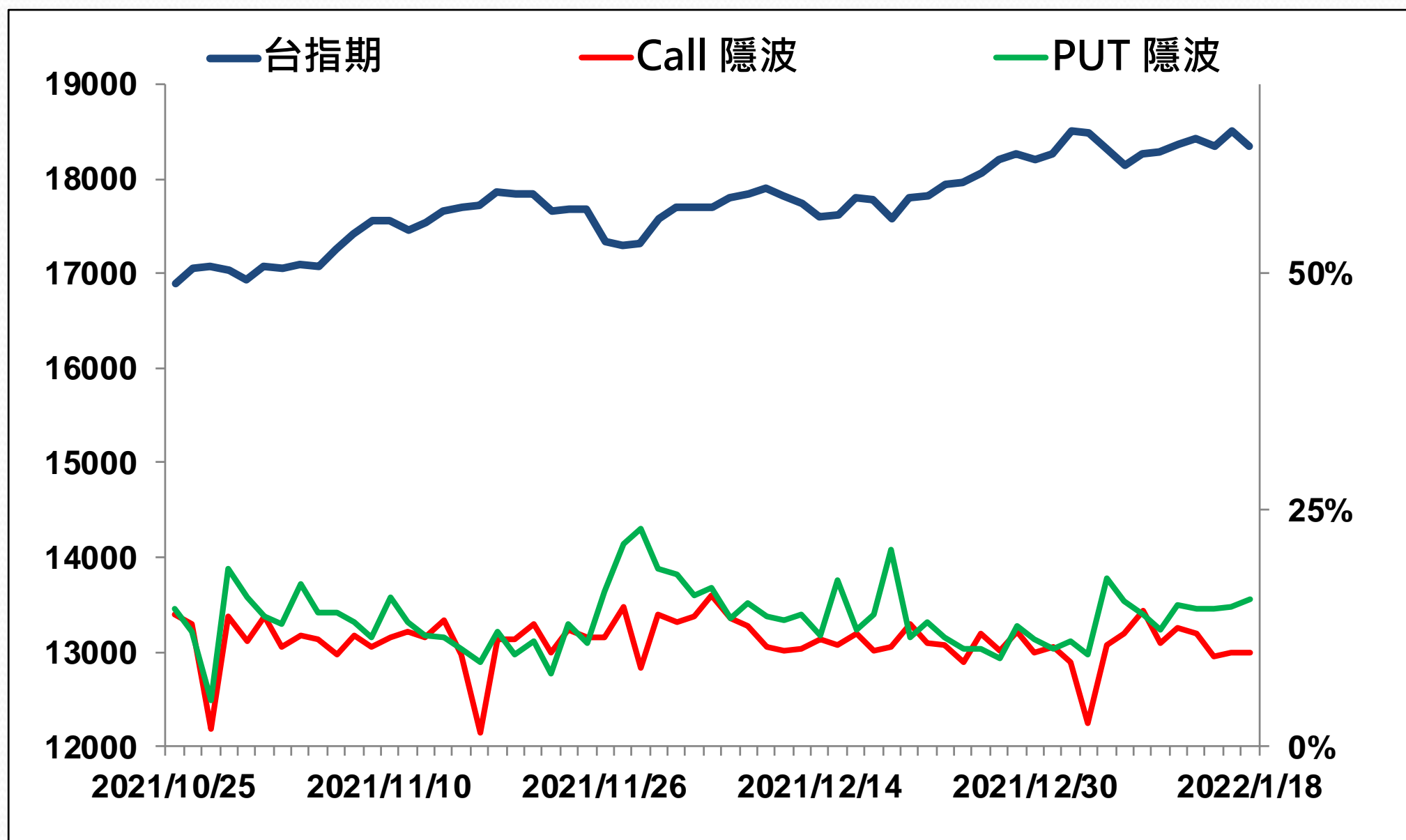
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



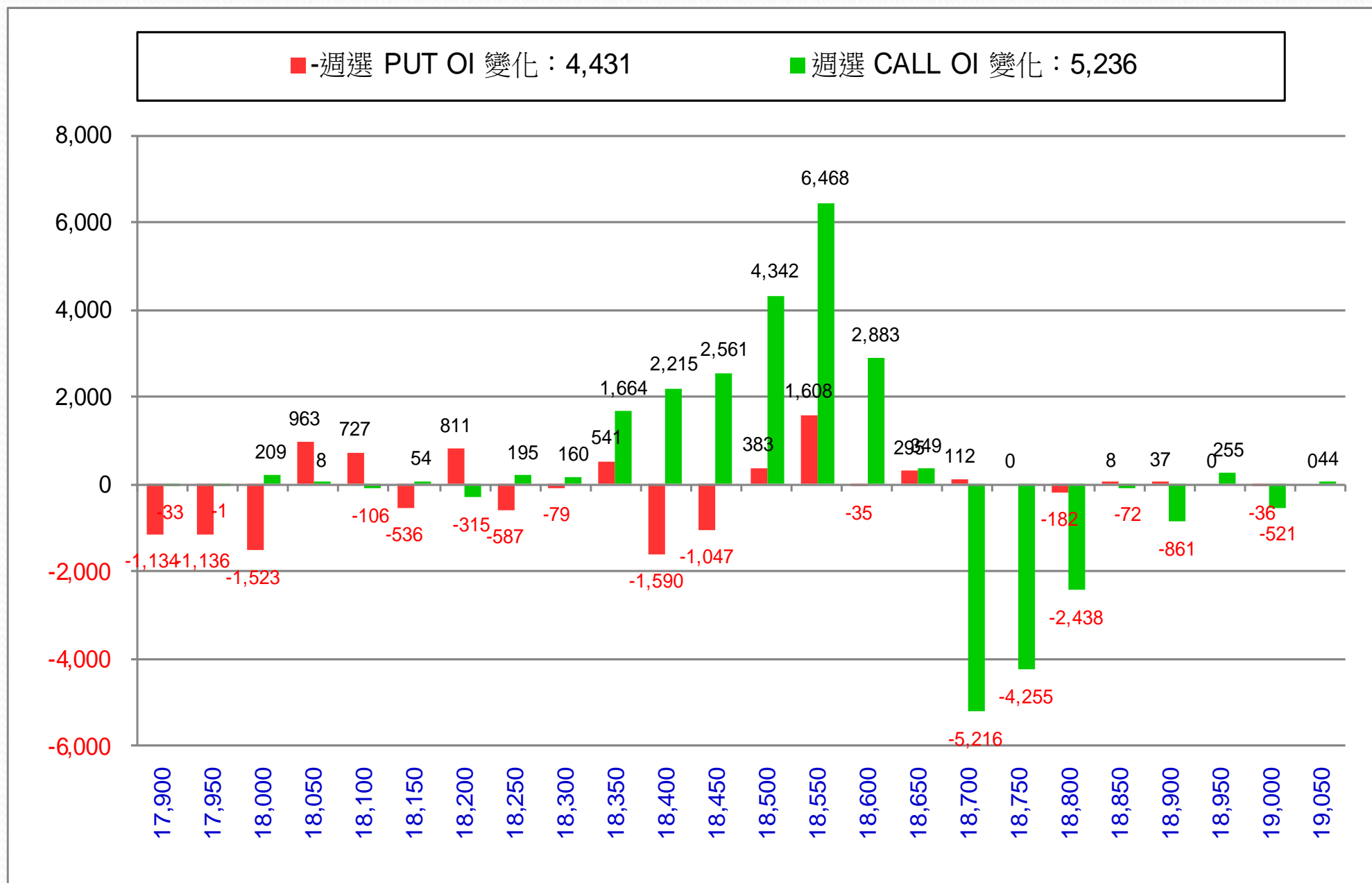
更新日期：2022年1月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年1月18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

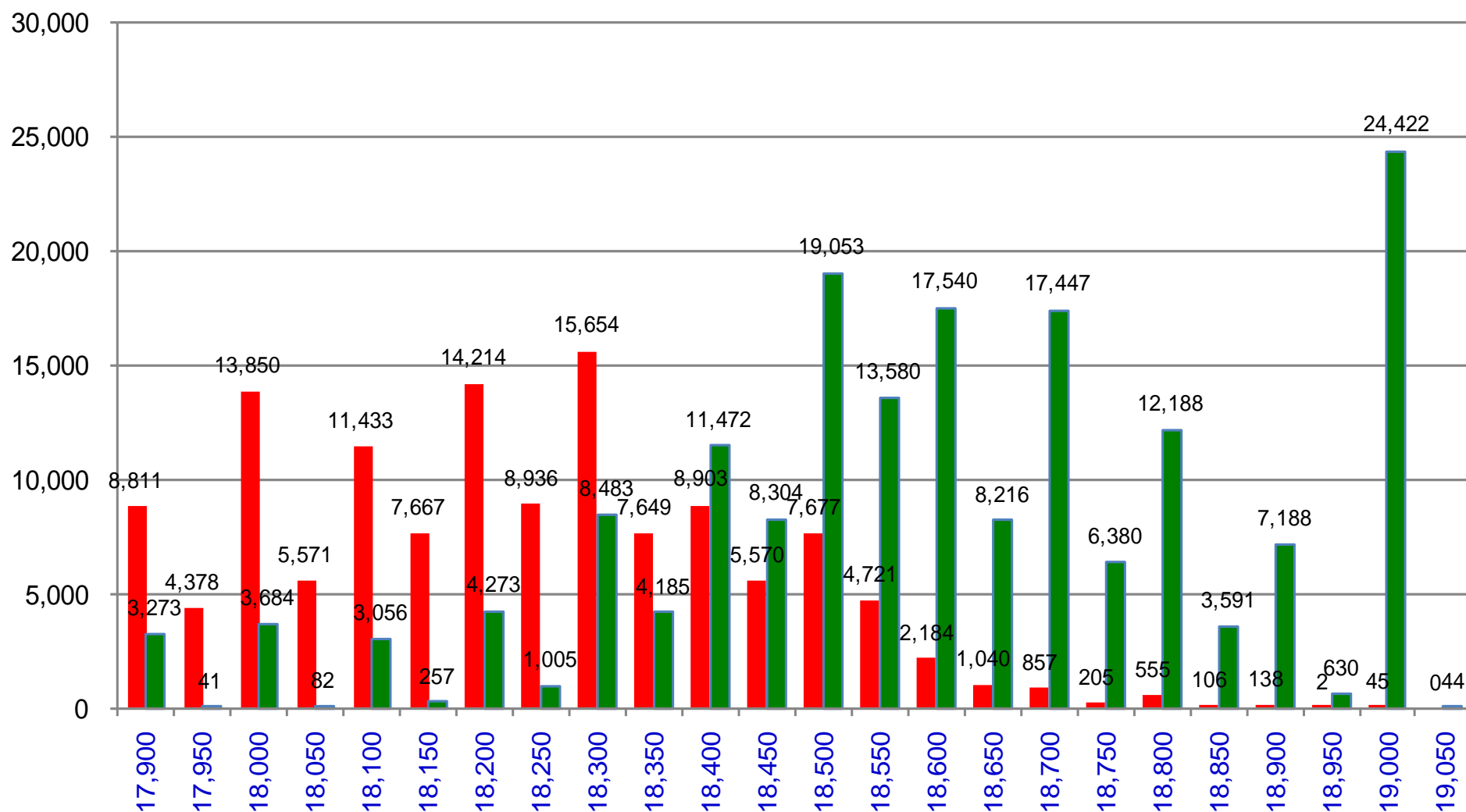


更新日期：2022年1月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：242,500

週選 CALL OI 總額：222,062



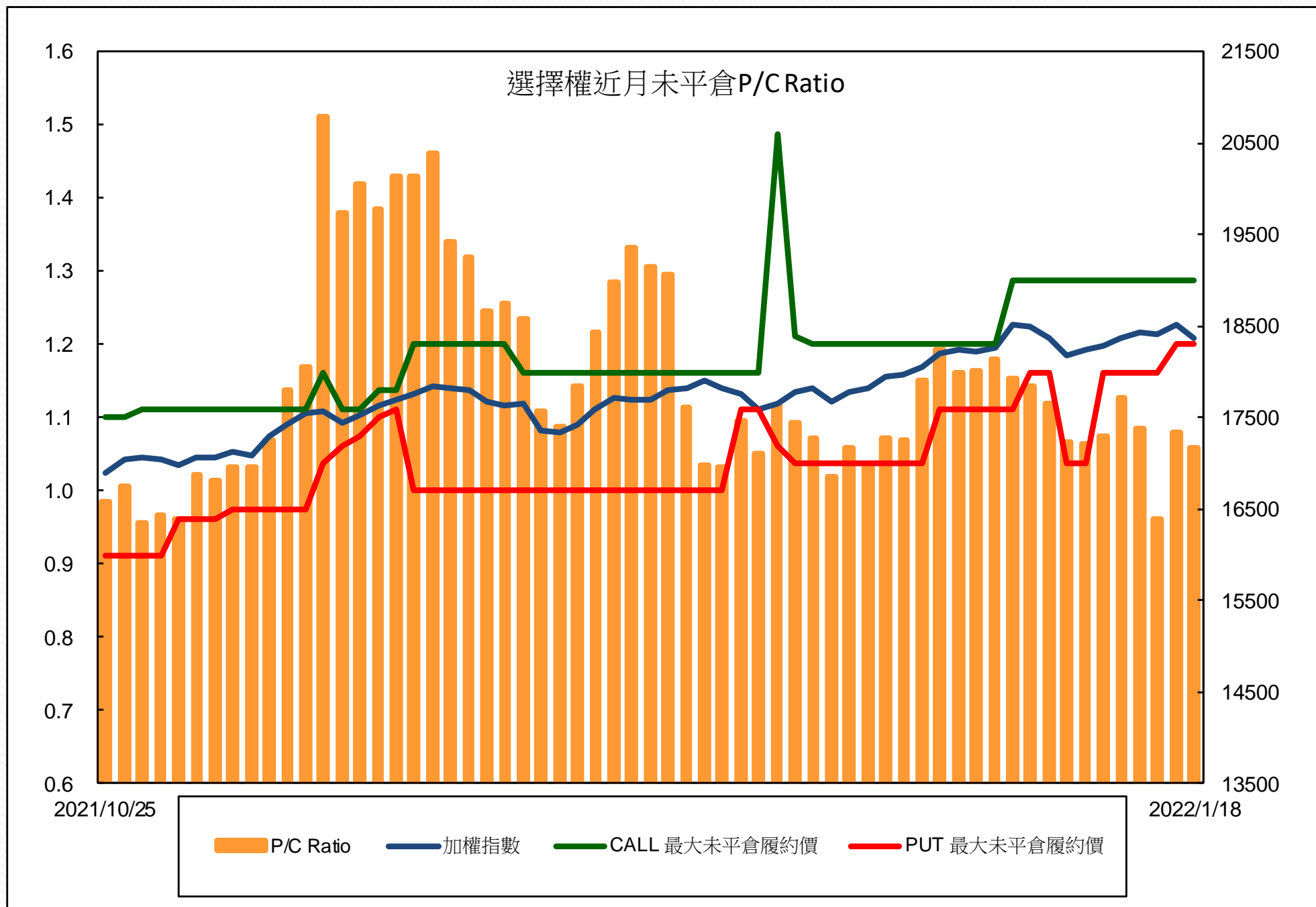
更新日期：2022年1月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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17日	63,977	70,918	-6,941
	1月18日	57,399	71,088	-13,689
Put	1月17日	53,253	59,681	-6,428
	1月18日	60,221	62,105	-1,884

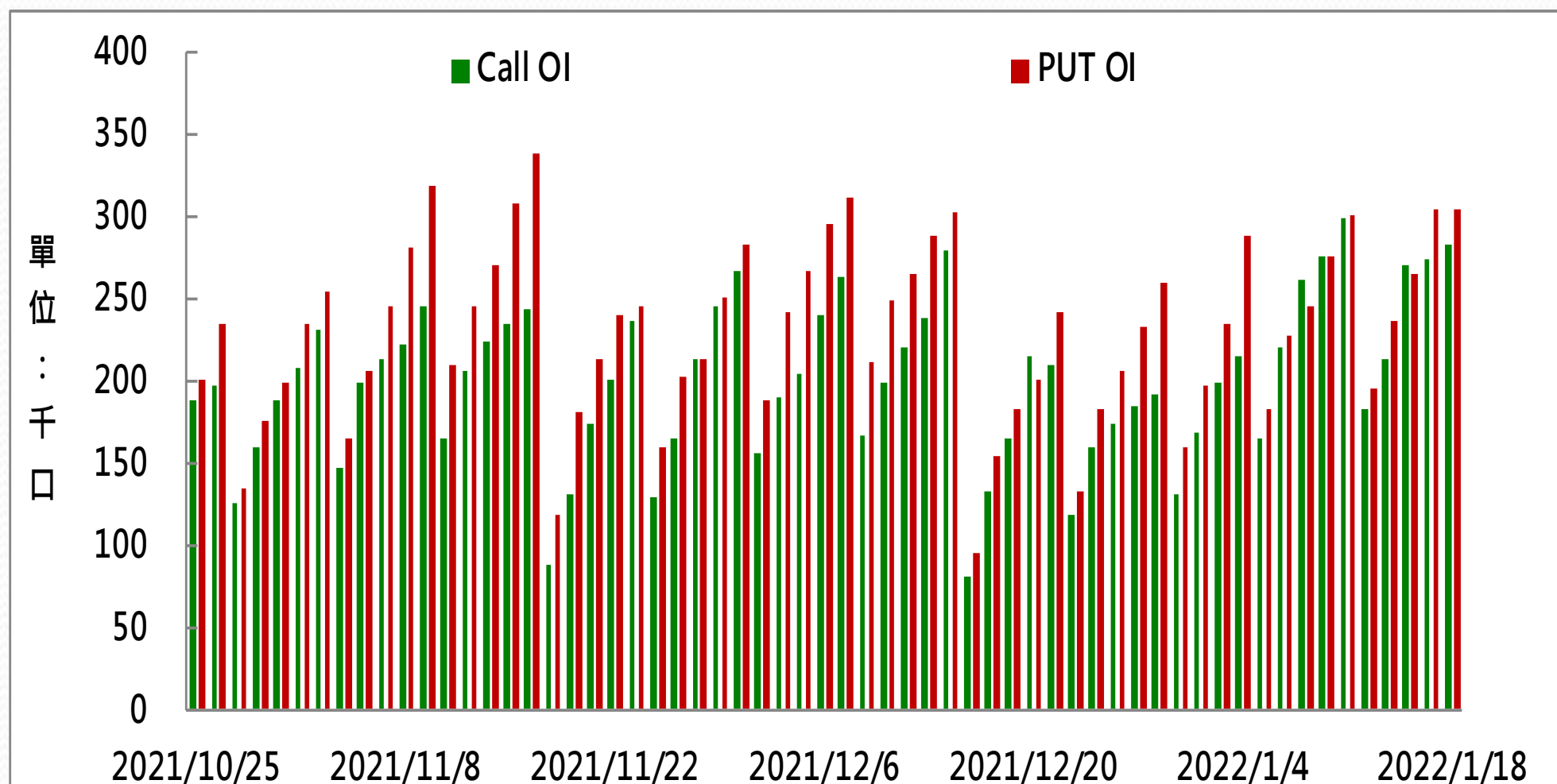
更新日期：2022年1月18日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年1月18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18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18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