

台指選擇權OI匯報

日期：2022/1/19 結算日：2022/1/26					日期：2022/1/19 結算日：2022/2/16				
202201W4					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
13	13	17,700	1,515	1,515	0	13	17,200	1,061	259
66	66	17,800	1,732	1,732	0	19	17,300	1,647	760 ※
2	2	17,850	778	778	0	66	17,400	2,367	619
15	15	17,900	1,044	1,044	3	102	17,500	2,693	427
14	14	17,950	743	743	15	85	17,600	2,939	-82
55	55	18,000	1,510	1,510	5	95	17,700	3,183	-30
75	75	18,050	693	693	12	378	17,800	4,054	110
343	343	18,100	1,043	1,043	22	165	17,900	2,708	226
316	316	18,150	801	801	149	456	18,000	2,829	422
570	570	18,200	1,339	1,339	107	509	18,100	1,284	331
800	800	18,250	376	376	644	2,278	18,200	2,350	404
1,181	1,181	18,300	652	652	594	1,399	18,300	755	133
1,515	1,515	18,350	284	284	686	2,116	18,400	1,292	10
2,490	2,490	18,400	206	206	477	2,855	18,500	502	-7
1,433	1,433	18,450	25	25	353	3,584	18,600	171	-78
2,667	2,667	18,500	49	49	※ 1,047	4,664	18,700	65	-4
2,265	2,265	18,550	12	12	850	4,924	18,800	196	-4
※ 4,296	4,296	18,600	9	9	237	4,189	18,900	18	-2
3,001	3,001	18,650	18	18	468	6,414	19,000	37	-8
3,349	3,349	18,700	19	19	124	3,252	19,100	11	9
2,443	2,443	18,750	0	0	-421	3,357	19,200	23	0
1,840	1,840	18,800	2	2	132	1,502	19,300	1	0
1,356	1,356	18,850	0	0	44	1,146	19,400	414	84
825	825	18,900	0	0	546	1,988	19,500	17	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
32,965	32,965	0.9255	30,508	30,508	6,363	52,344	1.0471	54,812	6,157
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化	0.9255		昨日 P/C	1.0582	今日增減變化	-0.0110	

更新日期：2022年1月19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19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	77,258,711	166,072,795	-88,814,084	-218,621	3,516,018	3,028,267	487,751	-1,531,782
投信	59,507,992	53,254,881	6,253,111	-2,468,417	564,949	0	564,949	-2,924
自營商	62,832,970	9,597,791	53,235,179	-6,132,170	1,782,572	1,084,281	698,291	1,910,956
	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	736,903	4,283,697	-3,546,794	-349,085	60,913	192,617	-131,704	-456,946
投信	23,252	0	23,252	-183	1,646	0	1,646	-15
自營商	638,435	66,178	572,257	226,216	235,421	154,752	80,669	492,286

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19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	15,502	12,189	3,313	-7,418	34,302	18,327	15,975	-27,702
投信	0	0	0	0	0	58	-58	-9
自營商	36,598	30,123	6,475	20,164	21,510	26,297	-4,787	-2,903
特定法人(週)	2,001	0	2,001	---	360	9,211	-8,851	---
特定法人(近月)	9,823	13,200	-3,377	---	13,456	21,623	-8,167	---
特定法人(全月)	13,081	10,544	2,537	-5,337	13,174	33,806	-20,632	25,805
十大交易人(週)	17,947	16,994	953	---	18,310	18,121	189	---
十大交易人(近月)	26,233	25,377	856	---	26,647	33,540	-6,893	---
十大交易人(全月)	52,395	43,119	9,276	-20,001	47,830	56,196	-8,366	13,469
全市場未沖銷(近月)			52,344	---			54,812	---
全市場未沖銷(全月)			101,156	-182,644			99,501	-205,306

更新日期：2022年1月19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01W4週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	18600	買權OI最大量	18600
	賣權成交最大量	17800	賣權OI最大量	17500
	整體隱含波動率	16.96%	較前一交易日	+4.22%
	買權隱含波動率	11.56%	較前一交易日	+1.73%
	賣權隱含波動率	22.57%	較前一交易日	+7.18%
電子選擇權	買權成交最大量	585	買權OI最大量	880
	賣權成交最大量	860	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	1740	賣權OI最大量	1720

更新日期：2022年1月19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

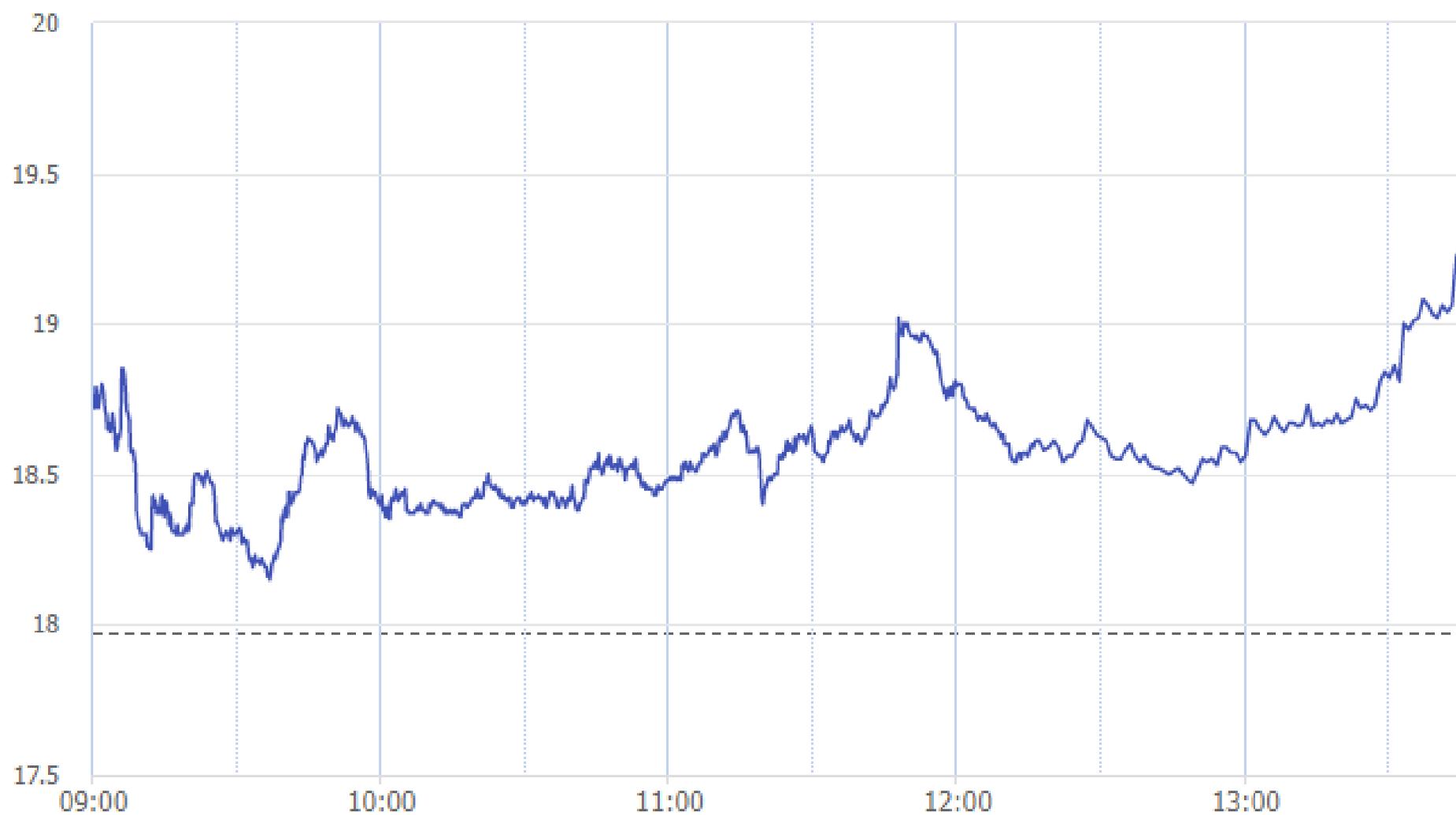
2022年02月選擇權分析表

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	17.03%	較前一交易日	-0.94%
	買權隱含波動率	12.86%	較前一交易日	+0.49%
	賣權隱含波動率	21.98%	較前一交易日	+1.69%
	成交量P/C_Ratio值	0.846	較前一交易日	-0.02
	未平倉P/C_Ratio值	1.047	較前一交易日	-0.01
電子選擇權	買權成交最大量	655	買權OI最大量	880
	賣權成交最大量	860	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	1740	賣權OI最大量	1720

更新日期：2022年1月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

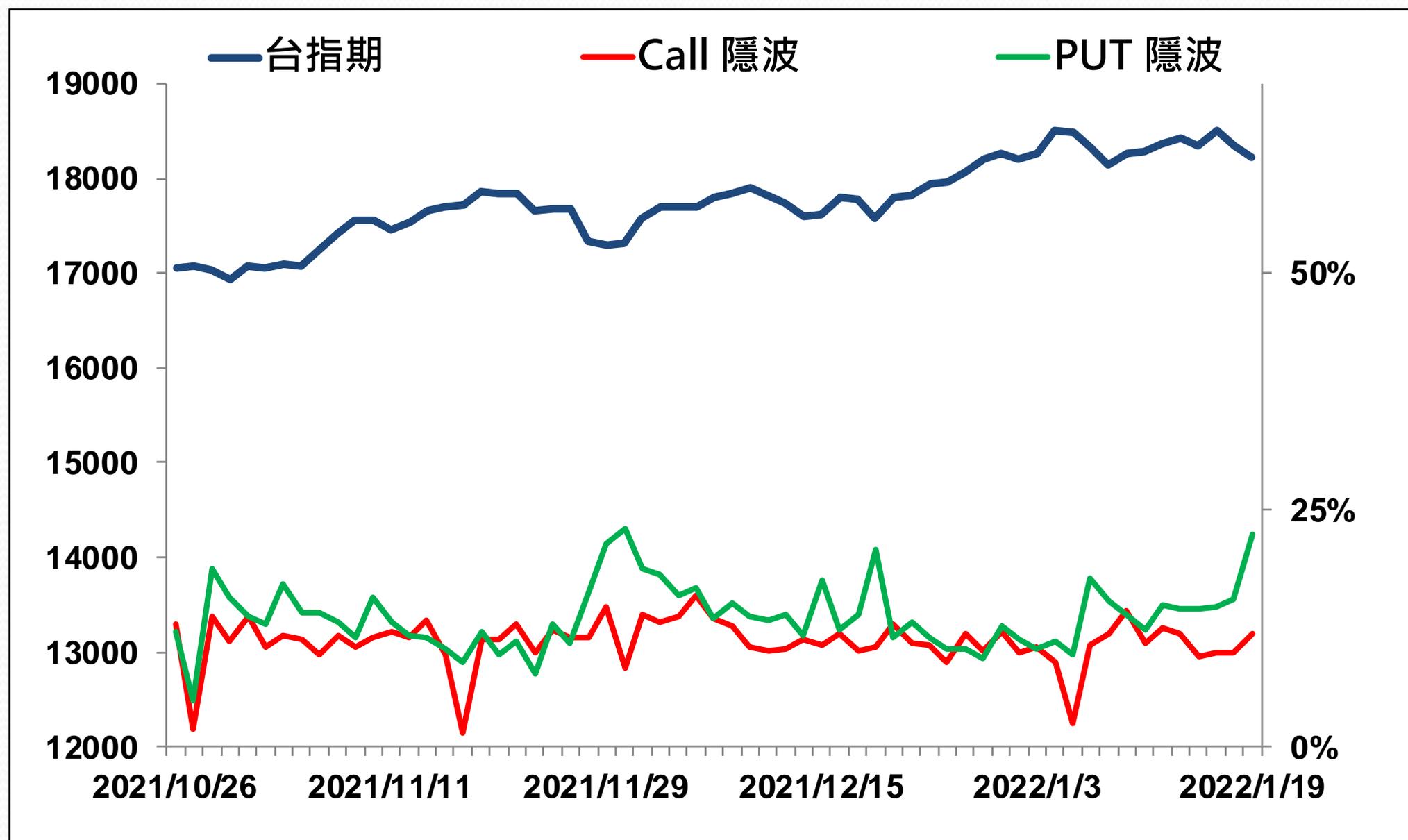
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



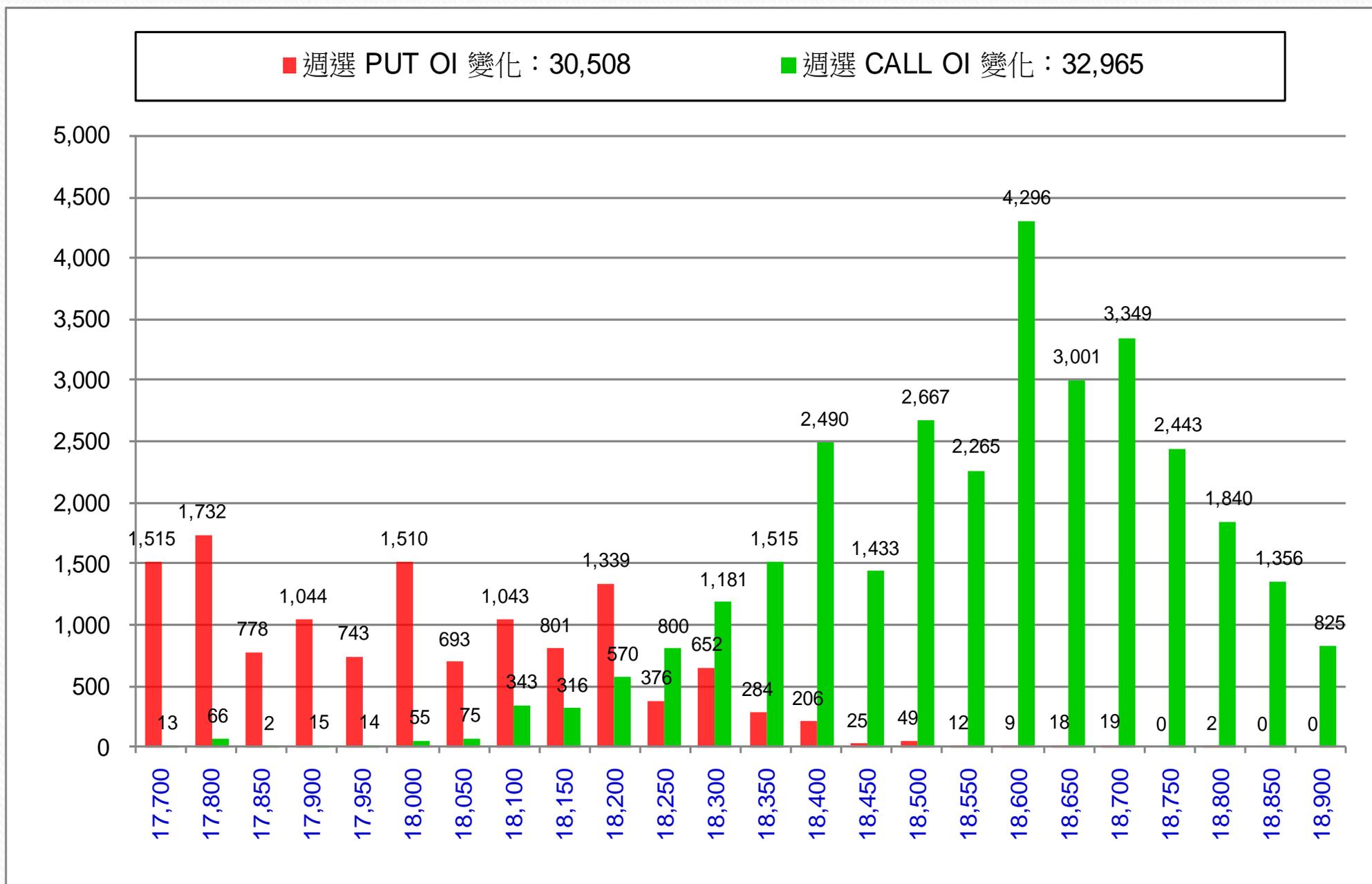
更新日期：2022年1月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2022年1月19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

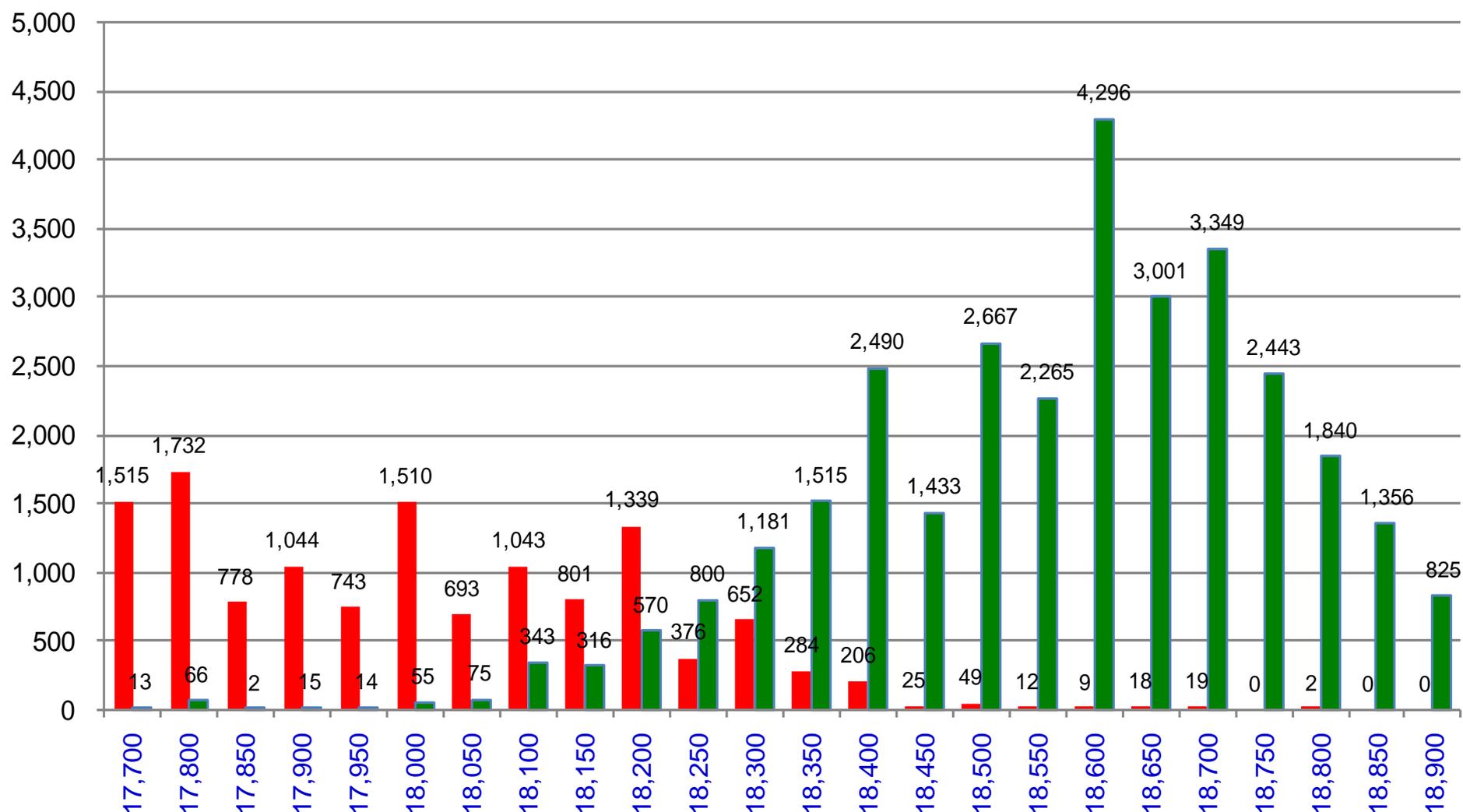


更新日期：2022年1月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：30,508

■ 週選 CALL OI 總額：32,965



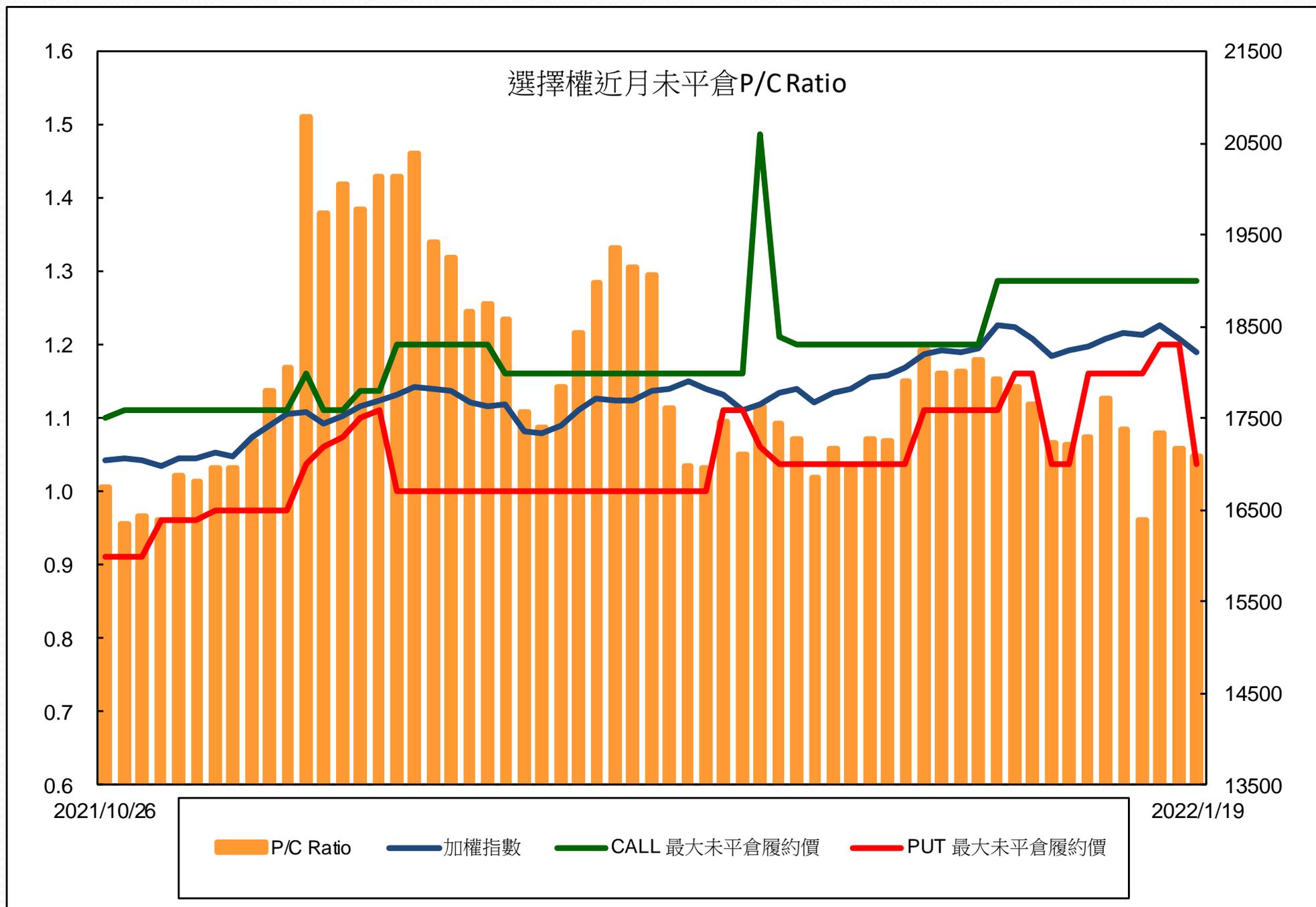
更新日期：2022年1月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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18日	57,399	71,088	-13,689
	1月19日	36,598	30,123	6,475
Put	1月18日	60,221	62,105	-1,884
	1月19日	21,510	26,297	-4,787

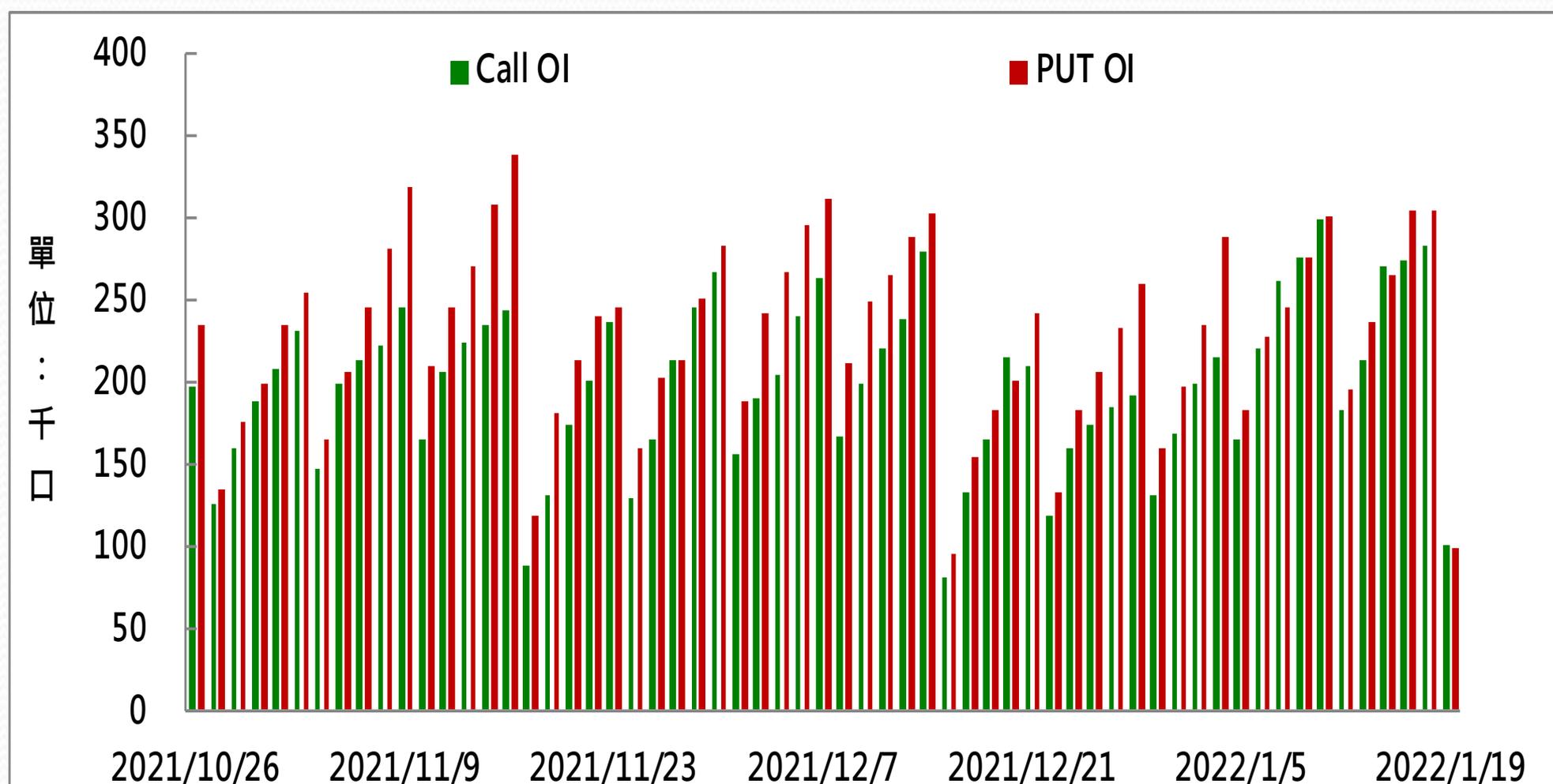
更新日期：2022年1月19日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2022年1月19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19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19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