

台指選擇權OI匯報

日期：2021/12/23 結算日：2021/12/29					日期：2021/12/23 結算日：2022/1/19				
202112W5					202201 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
0	0	17,100	1,676	948	0	0	16,400	1,486	35
0	3	17,200	2,526	1,133	-12	10	16,500	2,245	-336
0	0	17,300	2,736	241	0	14	16,600	2,335	-128
0	5	17,350	2,893	1,976	0	16	16,700	3,409	143
21	21	17,400	2,168	746	0	48	16,800	4,026	115
2	4	17,450	4,175	2,248	0	69	16,900	3,143	-40
19	71	17,500	4,689	2,673	-2	559	17,000	5,827	133
36	49	17,550	5,001	3,343	-2	1,586	17,100	4,319	139
9	84	17,600	5,192	1,795	-4	549	17,200	4,296	34
44	92	17,650	5,685	4,404	-37	363	17,300	3,140	272
80	275	17,700	4,884	3,508	-13	1,165	17,400	2,967	492
200	378	17,750	6,687	5,777	-70	586	17,500	3,111	592
-84	780	17,800	4,392	2,718	-177	2,177	17,600	3,870	419
-8	1,132	17,850	3,231	2,243	-103	2,732	17,700	2,732	159
1,505	2,975	17,900	3,093	2,591	-195	3,364	17,800	2,293	438
1,586	3,059	17,950	3,318	3,196	※ 1,224	3,933	17,900	1,133	538
4,297	6,972	18,000	1,985	1,796	-316	5,854	18,000	1,595	263
3,163	4,796	18,050	290	239	-336	5,801	18,100	136	57
※ 6,856	9,697	18,100	414	341	262	7,721	18,200	117	63
3,719	6,019	18,150	79	76	586	8,738	18,300	52	32
6,162	7,672	18,200	86	73	277	7,543	18,400	73	8
4,495	5,624	18,250	9	8	-99	6,553	18,500	6	2
2,944	3,727	18,300	7	6	-161	5,250	18,600	8	1
695	695	18,350	0	0	1,213	3,018	18,700	3	2
1,158	1,578	18,400	0	-1	-235	2,586	18,800	224	10
563	794	18,500	1	1	190	1,126	18,900	0	0
63	72	18,600	0	0	205	1,939	19,000	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
37,802	56,853	1.2509	71,118	44,095	2,366	83,400	1.0709	89,317	5,725
昨日 P/C	1.4185	今日增減變化	-0.1675		昨日 P/C	1.0316	今日增減變化	0.0394	

更新日期：2021年12月23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

2021年12月23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	79,984,278	165,599,988	-85,615,710	604,263	2,572,220	2,300,183	272,037	-89,869
投信	53,993,018	50,646,761	3,346,257	196,942	519,953	0	519,953	4,409
自營商	65,311,349	7,850,750	57,460,599	1,169,252	2,079,637	1,342,922	736,715	180,395
	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	656,760	3,881,604	-3,224,844	-31,993	133,897	279,659	-145,762	33,283
投信	33,680	0	33,680	124	1,695	0	1,695	6
自營商	734,214	126,290	607,924	-19,573	435,570	288,111	147,459	-24,832

臺指選擇權三大法人&大額交易人未平倉口數匯報

2021年12月23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	21,121	18,978	2,143	-568	51,577	24,285	27,292	1,819
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	44,510	40,889	3,621	3,380	43,755	38,500	5,255	1,364
特定法人(週)	698	666	32	-166	0	2,918	-2,918	0
特定法人(近月)	11,491	15,349	-3,858	606	7,543	26,259	-18,716	-85
特定法人(全月)	15,813	11,989	3,824	-60	14,575	40,208	-25,633	-3,560
十大交易人(週)	16,947	19,905	-2,958	-765	26,394	23,277	3,117	2,275
十大交易人(近月)	42,167	36,813	5,354	2,301	37,616	53,010	-15,394	-17
十大交易人(全月)	69,813	54,930	14,883	2,883	67,600	86,936	-19,336	1,334
全市場未沖銷(近月)			83,400	2,366			89,317	5,725
全市場未沖銷(全月)			159,281	40,793			183,062	50,316

更新日期：2021年12月23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

2021年12W5週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	18100	買權OI最大量	18100
	賣權成交最大量	17800	賣權OI最大量	17750
	整體隱含波動率	10.45%	較前一交易日	-0.66%
	買權隱含波動率	10.50%	較前一交易日	+0.15%
	賣權隱含波動率	10.39%	較前一交易日	-1.36%
電子選擇權	買權成交最大量	855	買權OI最大量	880
	賣權成交最大量	835	賣權OI最大量	810
金融選擇權	買權成交最大量	1700	買權OI最大量	1680
	賣權成交最大量	1680	賣權OI最大量	1660

更新日期：2021年12月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

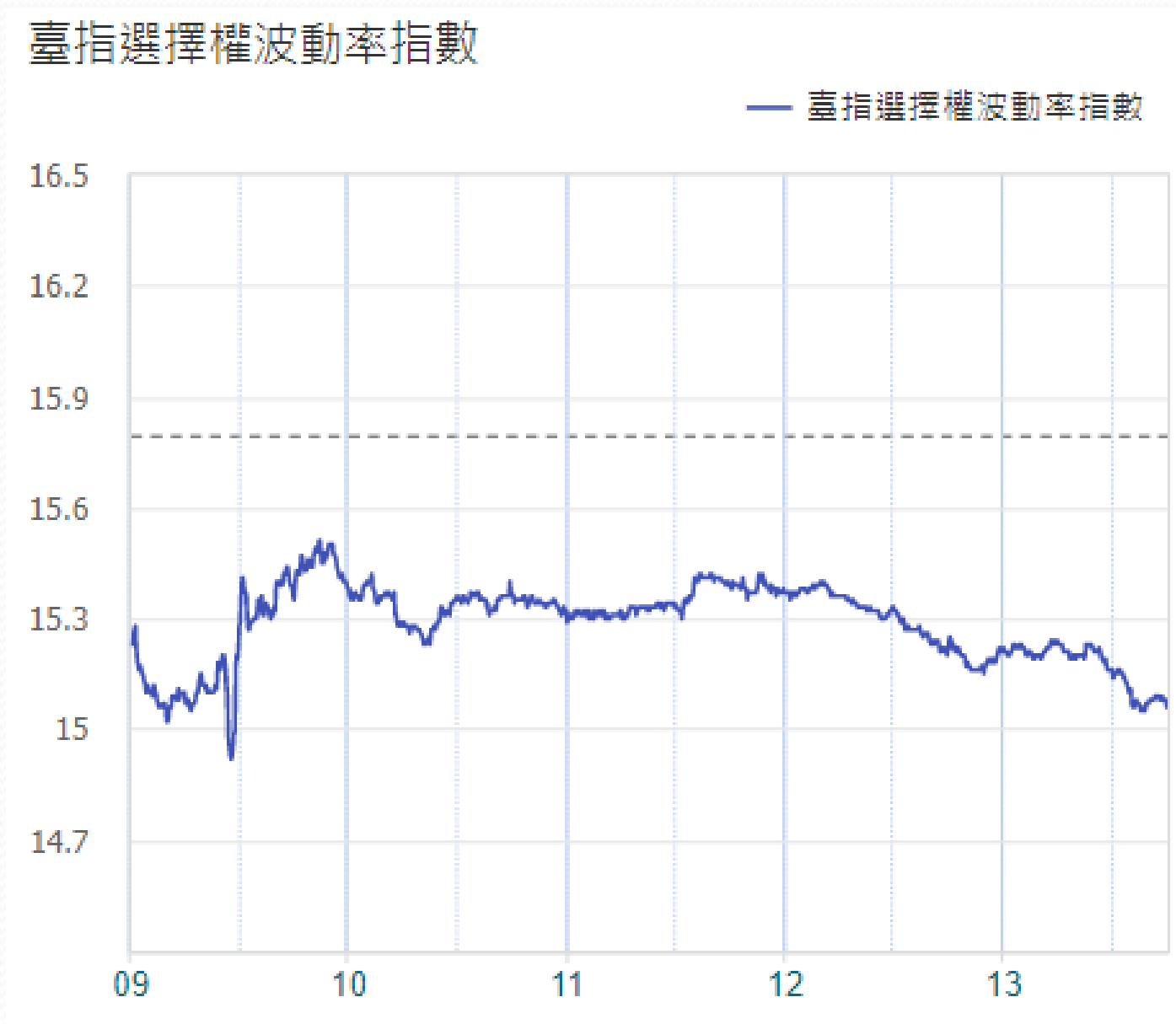
台指選擇權匯報

2022年01月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	17900	買權OI最大量	18300
	賣權成交最大量	17500	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	14.26%	較前一交易日	+0.34%
	買權隱含波動率	12.13%	較前一交易日	-0.33%
	賣權隱含波動率	16.36%	較前一交易日	-0.64%
	成交量P/C_Ratio值	1.011	較前一交易日	+0.13
	未平倉P/C_Ratio值	1.071	較前一交易日	+0.04
電子選擇權	買權成交最大量	855	買權OI最大量	880
	賣權成交最大量	835	賣權OI最大量	810
金融選擇權	買權成交最大量	1700	買權OI最大量	1680
	賣權成交最大量	1680	賣權OI最大量	1660

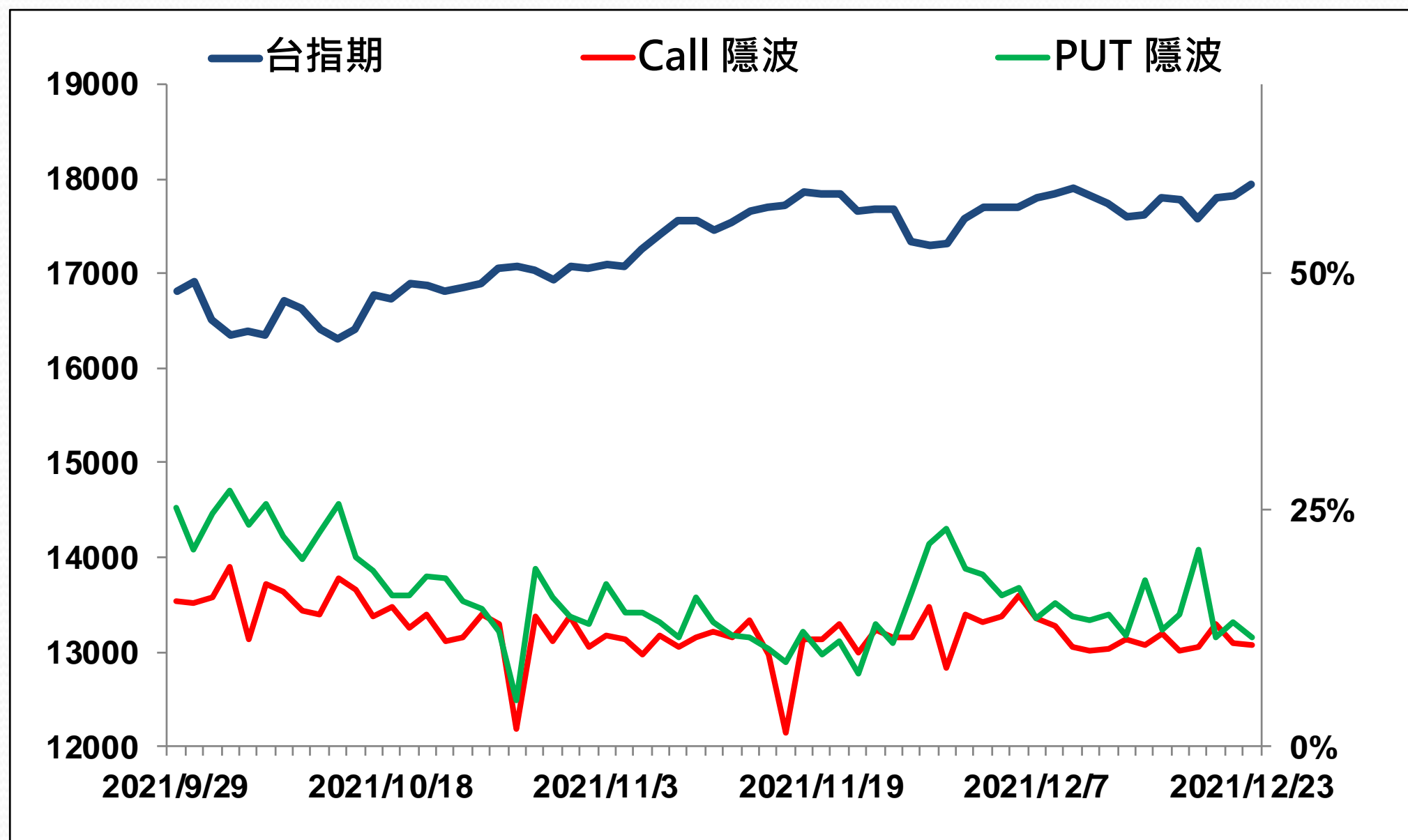
更新日期：2021年12月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



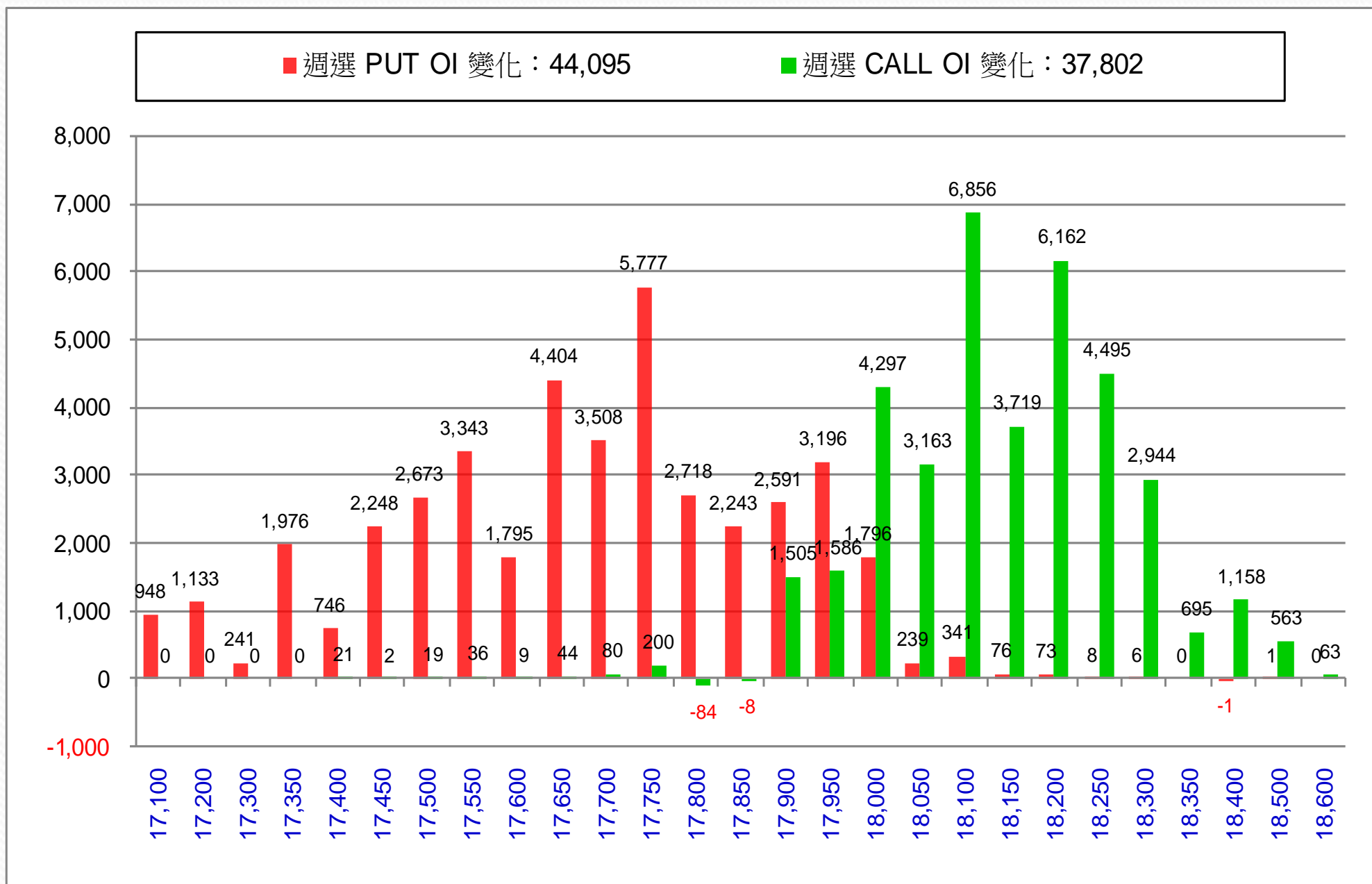
更新日期：2021年12月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



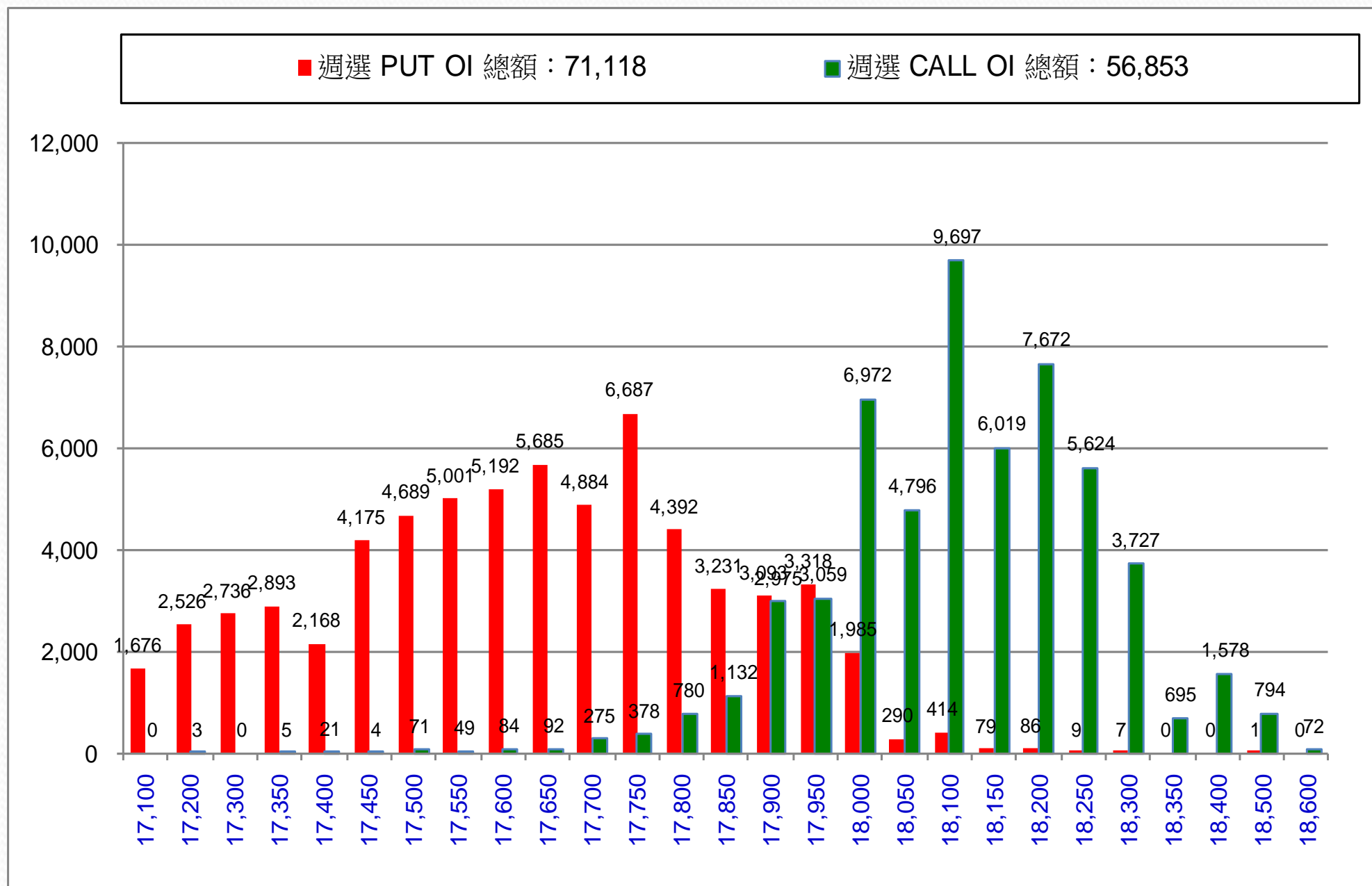
更新日期：2021年12月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2021年12月23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



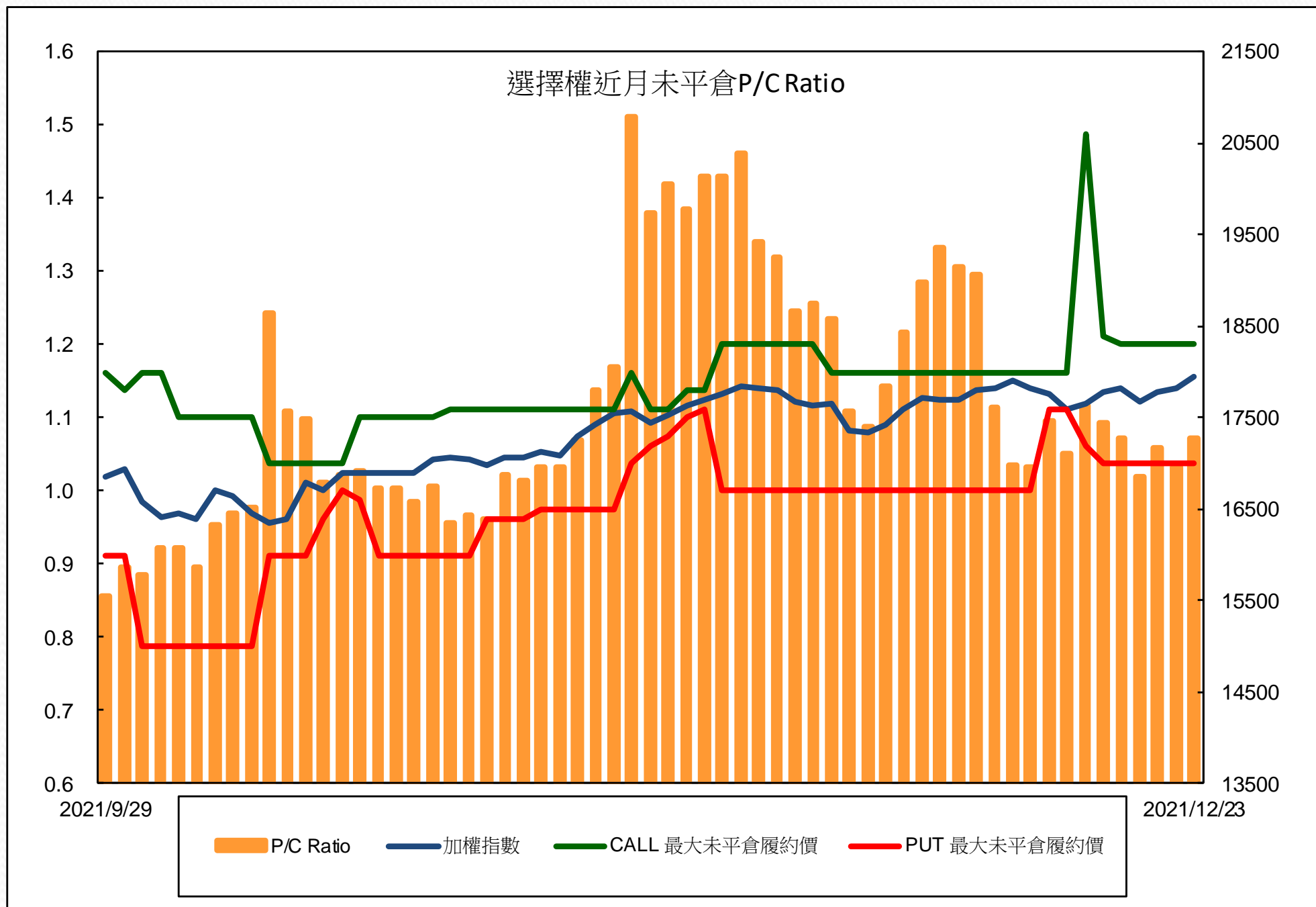
更新日期：2021年12月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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	12月22日	36,799	36,558	241
	12月23日	44,510	40,889	3,621
Put	12月22日	34,215	30,324	3,891
	12月23日	43,755	38,500	5,255

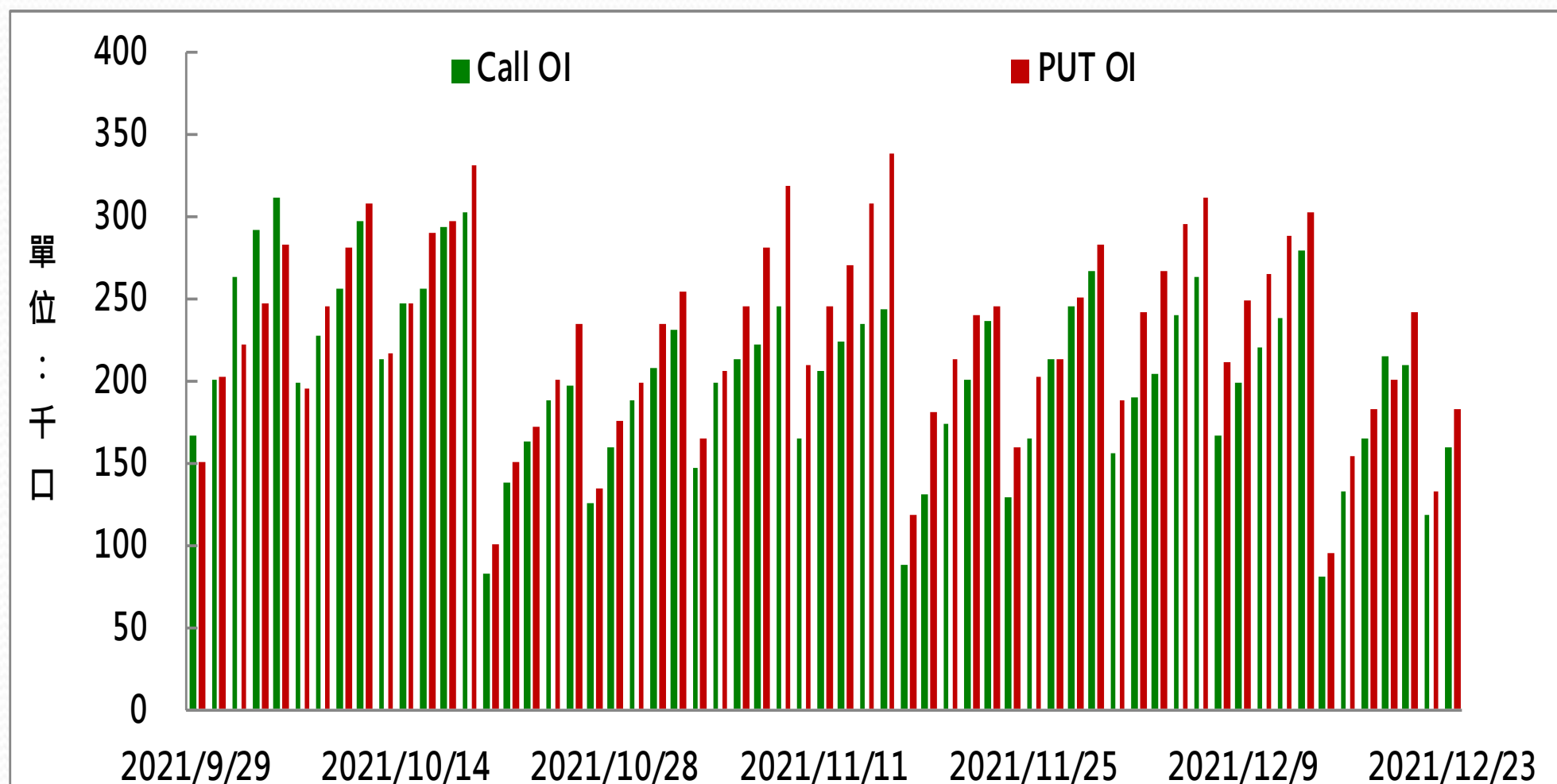
更新日期：2021年12月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2021年12月23日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整

選擇權全月Put Call OI



更新日期：2021年12月23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：2021年12月23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