

台指選擇權OI匯報

日期：2021/12/29 結算日：2022/1/5					日期：2021/12/29 結算日：2022/1/19				
202201W1					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	17,300	1,948	1,948	0	16	16,700	2,896	-45
0	0	17,400	338	338	0	47	16,800	4,271	156
0	0	17,500	1,005	1,005	0	69	16,900	2,603	-307
0	0	17,600	961	961	0	557	17,000	5,963	192
1	1	17,700	905	905	0	1,586	17,100	4,036	-21
2	2	17,750	1,041	1,041	-1	539	17,200	4,514	155
9	9	17,800	2,357	2,357	0	345	17,300	4,987	314
0	0	17,850	839	839	-7	1,113	17,400	3,568	-9
27	27	17,900	1,698	1,698	65	619	17,500	4,384	-27
26	26	17,950	2,015	2,015	-7	2,162	17,600	6,383	210
48	48	18,000	2,298	2,298	-49	2,481	17,700	4,472	305
36	36	18,050	838	838	-41	2,959	17,800	4,713	1,079
136	136	18,100	2,136	2,136	-163	3,213	17,900	3,419	724
213	213	18,150	663	663	-294	4,833	18,000	3,271	1,077
566	566	18,200	1,568	1,568	-298	4,610	18,100	1,096	158
1,490	1,490	18,250	1,659	1,659	-159	6,508	18,200	784	280
※ 2,280	2,280	18,300	2,238	2,238	80	8,346	18,300	443	245
1,665	1,665	18,350	372	372	-345	7,251	18,400	548	102
1,959	1,959	18,400	180	180	160	7,458	18,500	176	85
1,207	1,207	18,450	56	56	282	6,286	18,600	39	12
1,878	1,878	18,500	66	66	592	4,606	18,700	40	7
1,084	1,084	18,550	8	8	795	3,288	18,800	283	58
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
18,363	18,363	1.5231	27,968	27,968	5,926	90,742	1.1617	105,413	4,256
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化	1.5231		昨日 P/C	1.1927	今日增減變化	-0.0310	

更新日期：2021年12月29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29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	106,181,396	190,503,616	-84,322,220	-2,125,329	2,636,002	2,421,883	214,119	63,674
投信	55,531,031	49,588,138	5,942,893	859,590	561,600	0	561,600	15,818
自營商	64,326,298	9,075,641	55,250,657	2,552,782	2,105,496	1,400,381	705,115	-116,804
	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	766,763	4,271,838	-3,505,075	-159,243	165,206	249,531	-84,325	11,665
投信	22,350	0	22,350	203	1,721	0	1,721	7
自營商	756,422	109,987	646,435	764	469,714	383,628	86,086	-6,517

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29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	23,626	19,552	4,074	-1,934	49,924	25,276	24,648	-5,014
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	38,603	38,901	-298	-7,946	38,670	39,520	-850	10,653
特定法人(週)	0	0	0	---	0	0	0	---
特定法人(近月)	15,197	17,032	-1,835	261	7,967	30,454	-22,487	-1,200
特定法人(全月)	17,466	16,025	1,441	-1,828	20,143	42,861	-22,718	7,030
十大交易人(週)	8,223	9,391	-1,168	---	15,053	13,285	1,768	---
十大交易人(近月)	47,929	40,183	7,746	2,474	43,518	57,058	-13,540	-629
十大交易人(全月)	67,108	52,884	14,224	-5,882	68,367	82,503	-14,136	-12,578
全市場未沖銷(近月)			90,742	5,926			105,413	4,256
全市場未沖銷(全月)			131,242	-61,133			159,739	-100,977

更新日期：2021年12月29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01W1週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	18300	買權OI最大量	18300
	賣權成交最大量	18000	賣權OI最大量	17800
	整體隱含波動率	11.49%	較前一交易日	+2.43%
	買權隱含波動率	11.69%	較前一交易日	+1.79%
	賣權隱含波動率	11.31%	較前一交易日	+2.92%
電子選擇權	買權成交最大量	895	買權OI最大量	895
	賣權成交最大量	850	賣權OI最大量	820
金融選擇權	買權成交最大量	1740	買權OI最大量	1680
	賣權成交最大量	1720	賣權OI最大量	1680

更新日期：2021年12月29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	19000	買權OI最大量	18300
	賣權成交最大量	17800	賣權OI最大量	17600
	整體隱含波動率	13.79%	較前一交易日	+0.21%
	買權隱含波動率	12.51%	較前一交易日	+0.41%
	賣權隱含波動率	15.26%	較前一交易日	-0.11%
	成交量P/C_Ratio值	0.881	較前一交易日	-0.40
	未平倉P/C_Ratio值	1.162	較前一交易日	-0.03
電子選擇權	買權成交最大量	895	買權OI最大量	895
	賣權成交最大量	850	賣權OI最大量	820
金融選擇權	買權成交最大量	1740	買權OI最大量	1680
	賣權成交最大量	1720	賣權OI最大量	1680

更新日期：2021年12月29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

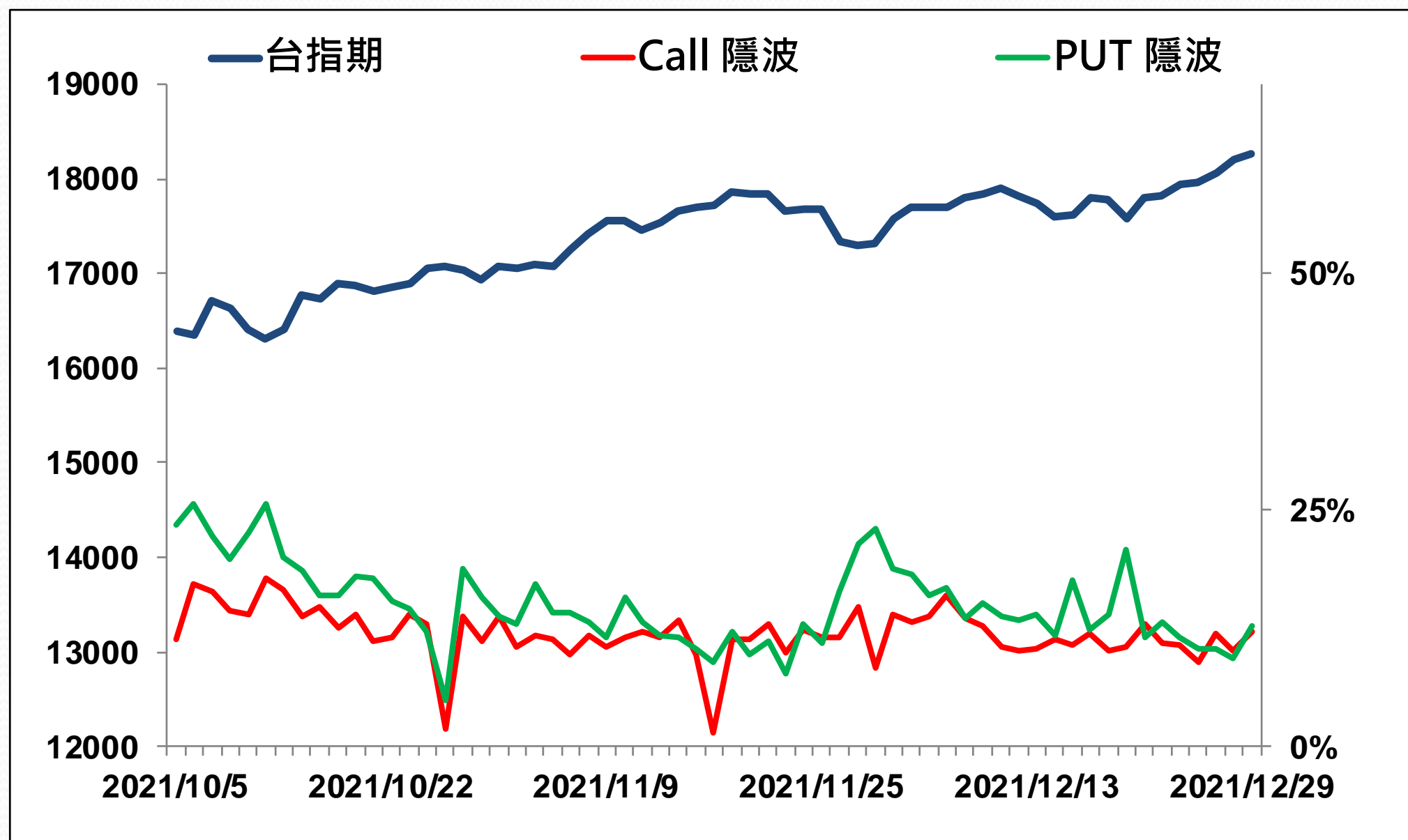
臺指選擇權波動率指數



更新日期：2021年12月29日

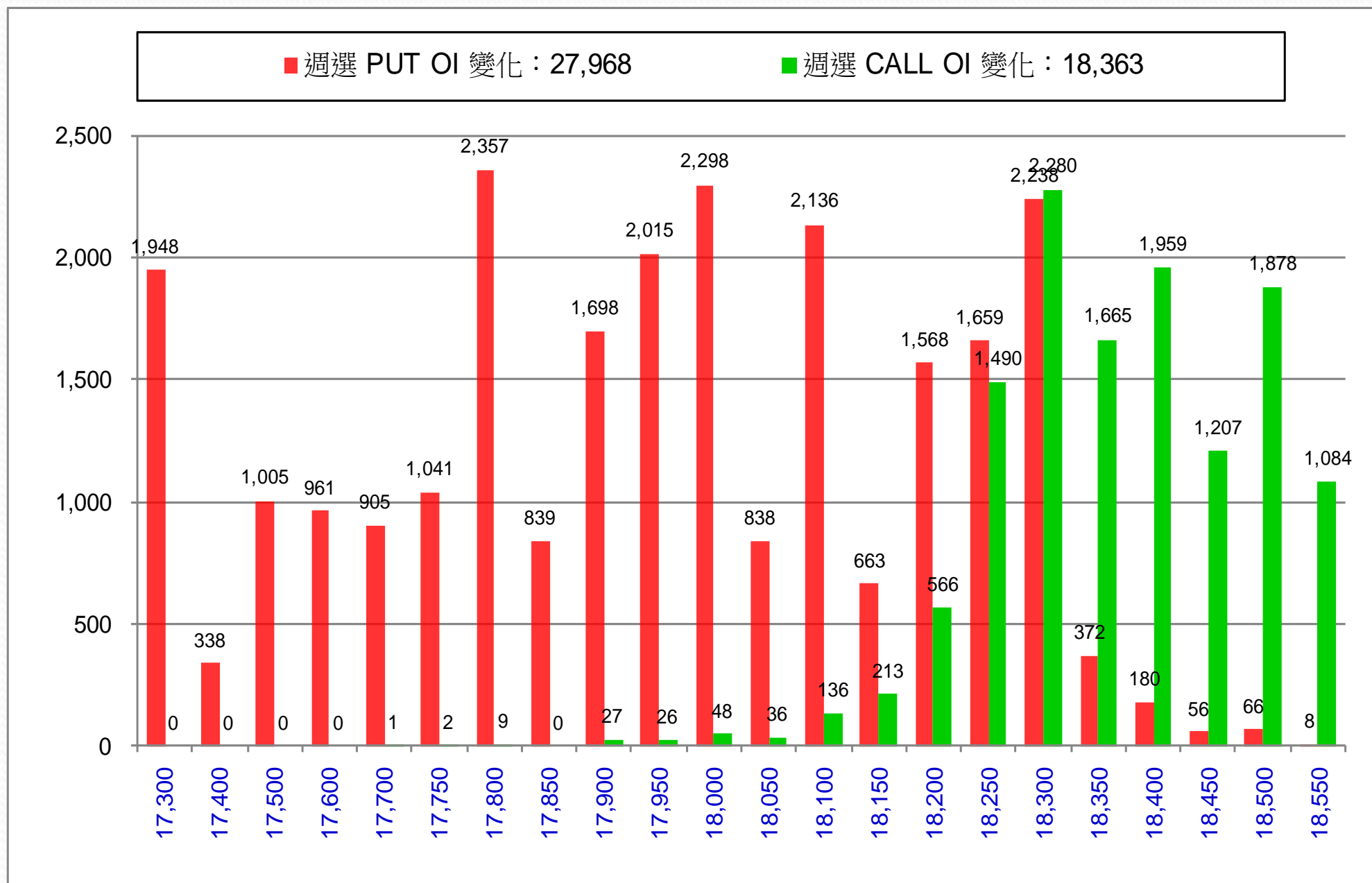
資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2021年12月29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

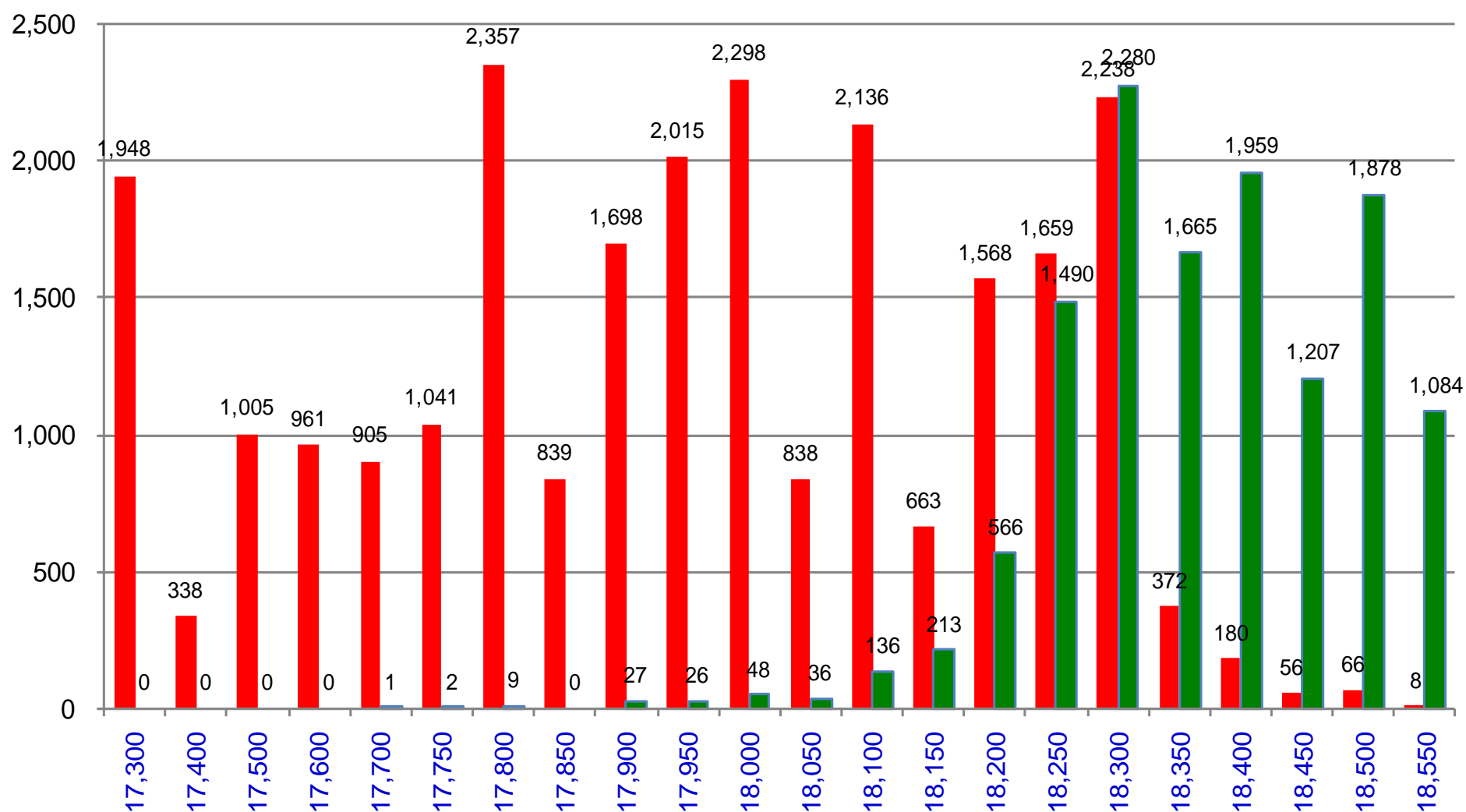


更新日期：2021年12月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：27,968

週選 CALL OI 總額：18,363



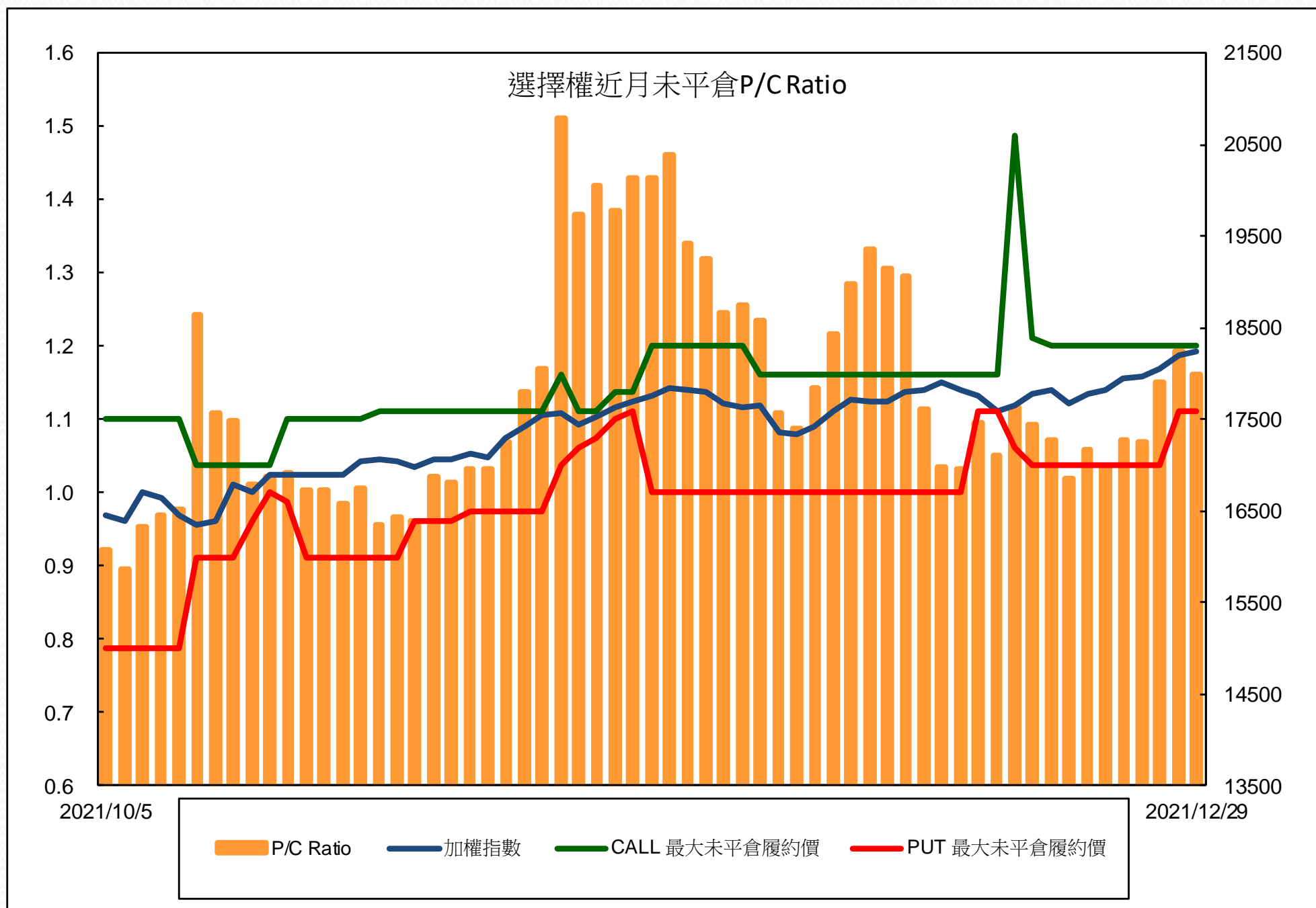
更新日期：2021年12月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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28日	50,367	42,719	7,648
	12月29日	38,603	38,901	-298
Put	12月28日	45,941	57,444	-11,503
	12月29日	38,670	39,520	-850

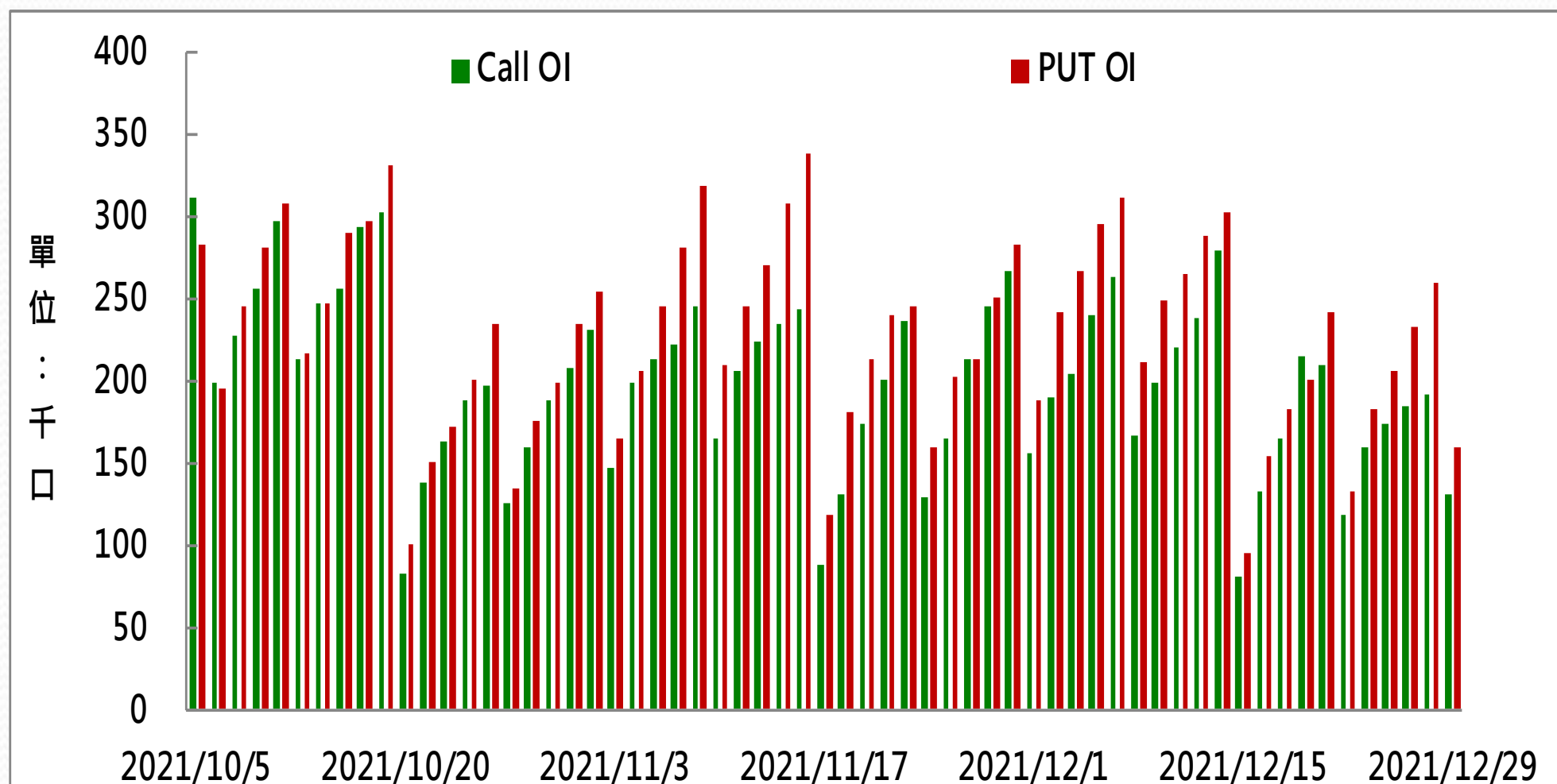
更新日期：2021年12月29日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2021年12月29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29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29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