

台指選擇權OI匯報

日期：2021/12/30 結算日：2022/1/5					日期：2021/12/30 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	17,200	1,053	516	0	16	16,700	2,892	-4
0	0	17,300	2,534	586	0	47	16,800	4,415	144
0	0	17,400	1,073	735	0	69	16,900	2,605	2
0	0	17,500	2,506	1,501	-1	556	17,000	5,965	2
0	0	17,600	1,987	1,026	0	1,586	17,100	4,172	136
49	50	17,700	2,217	1,312	0	539	17,200	4,460	-54
5	7	17,750	2,233	1,192	8	353	17,300	5,815	828
7	16	17,800	3,455	1,098	0	1,113	17,400	3,782	214
0	0	17,850	6,359	5,520	6	625	17,500	4,661	277
-2	25	17,900	3,469	1,771	-11	2,151	17,600	6,670	287
3	29	17,950	4,854	2,839	-109	2,372	17,700	4,669	197
57	105	18,000	5,172	2,874	-49	2,910	17,800	5,107	394
139	175	18,050	4,351	3,513	-54	3,159	17,900	4,457	1,038
388	524	18,100	3,059	923	-13	4,820	18,000	3,896	625
554	767	18,150	2,282	1,619	-108	4,502	18,100	1,366	270
1,146	1,712	18,200	2,709	1,141	-104	6,404	18,200	1,076	292
991	2,481	18,250	2,523	864	-106	8,240	18,300	471	28
2,658	4,938	18,300	1,919	-319	-63	7,188	18,400	609	61
2,478	4,143	18,350	331	-41	414	7,872	18,500	172	-4
3,107	5,066	18,400	347	167	872	7,158	18,600	43	4
2,234	3,441	18,450	175	119	※ 1,255	5,861	18,700	50	10
※ 4,118	5,996	18,500	101	35	370	3,658	18,800	302	19
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
30,046	48,409	1.2084	58,498	30,530	5,098	95,840	1.1644	111,594	6,181
昨日 P/C	1.5231	今日增減變化		-0.3147	昨日 P/C	1.1617	今日增減變化		0.0027

更新日期：2021年12月30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30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	99,430,782	190,972,629	-91,541,847	-7,219,627	2,483,621	2,431,070	52,551	-161,568
投信	55,672,197	49,648,659	6,023,538	80,645	560,480	0	560,480	-1,120
自營商	65,400,515	8,519,392	56,881,123	1,630,466	1,957,829	1,383,610	574,219	-130,896
	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	733,421	4,345,423	-3,612,002	-106,927	167,874	248,385	-80,511	3,814
投信	22,277	0	22,277	-73	1,713	0	1,713	-8
自營商	783,101	102,793	680,308	33,873	455,566	371,588	83,978	-2,108

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30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	26,163	22,023	4,140	66	52,318	26,356	25,962	1,314
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	42,623	46,012	-3,389	-3,091	47,143	45,241	1,902	2,752
特定法人(週)	517	0	517	517	0	1,003	-1,003	-1,003
特定法人(近月)	17,190	18,504	-1,314	521	8,192	32,904	-24,712	-2,225
特定法人(全月)	21,359	18,216	3,143	1,702	20,378	45,321	-24,943	-2,225
十大交易人(週)	12,528	19,676	-7,148	-5,980	25,002	21,363	3,639	1,871
十大交易人(近月)	50,210	42,243	7,967	221	47,391	60,369	-12,978	562
十大交易人(全月)	71,464	60,062	11,402	-2,822	77,898	92,308	-14,410	-274
全市場未沖銷(近月)			95,840	5,098			111,594	6,181
全市場未沖銷(全月)			167,832	36,590			197,075	37,336

更新日期：2021年12月30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	18500
	賣權成交最大量	18200	賣權OI最大量	17850
	整體隱含波動率	9.75%	較前一交易日	-1.74%
	買權隱含波動率	9.43%	較前一交易日	-2.26%
	賣權隱含波動率	10.11%	較前一交易日	-1.21%
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	855	賣權OI最大量	820
金融選擇權	買權成交最大量	1680	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30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

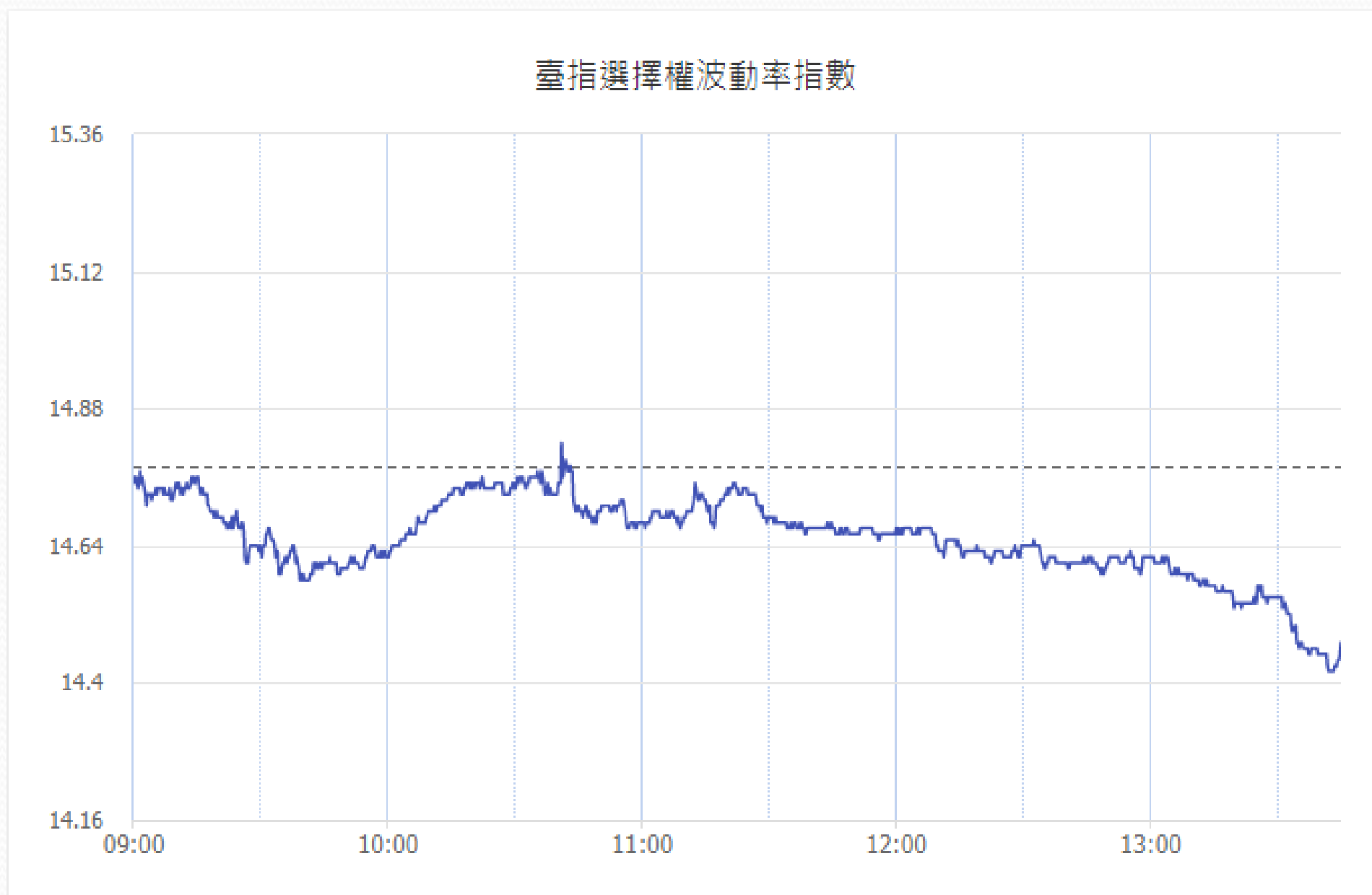
台指選擇權匯報

2022年01月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	18600	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	13.50%	較前一交易日	+0.30%
	買權隱含波動率	11.55%	較前一交易日	-0.96%
	賣權隱含波動率	15.63%	較前一交易日	+0.37%
	成交量P/C_Ratio值	0.942	較前一交易日	+0.06
	未平倉P/C_Ratio值	1.164	較前一交易日	+0.00
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	855	賣權OI最大量	820
金融選擇權	買權成交最大量	1680	買權OI最大量	1680
	賣權成交最大量	1720	賣權OI最大量	1680

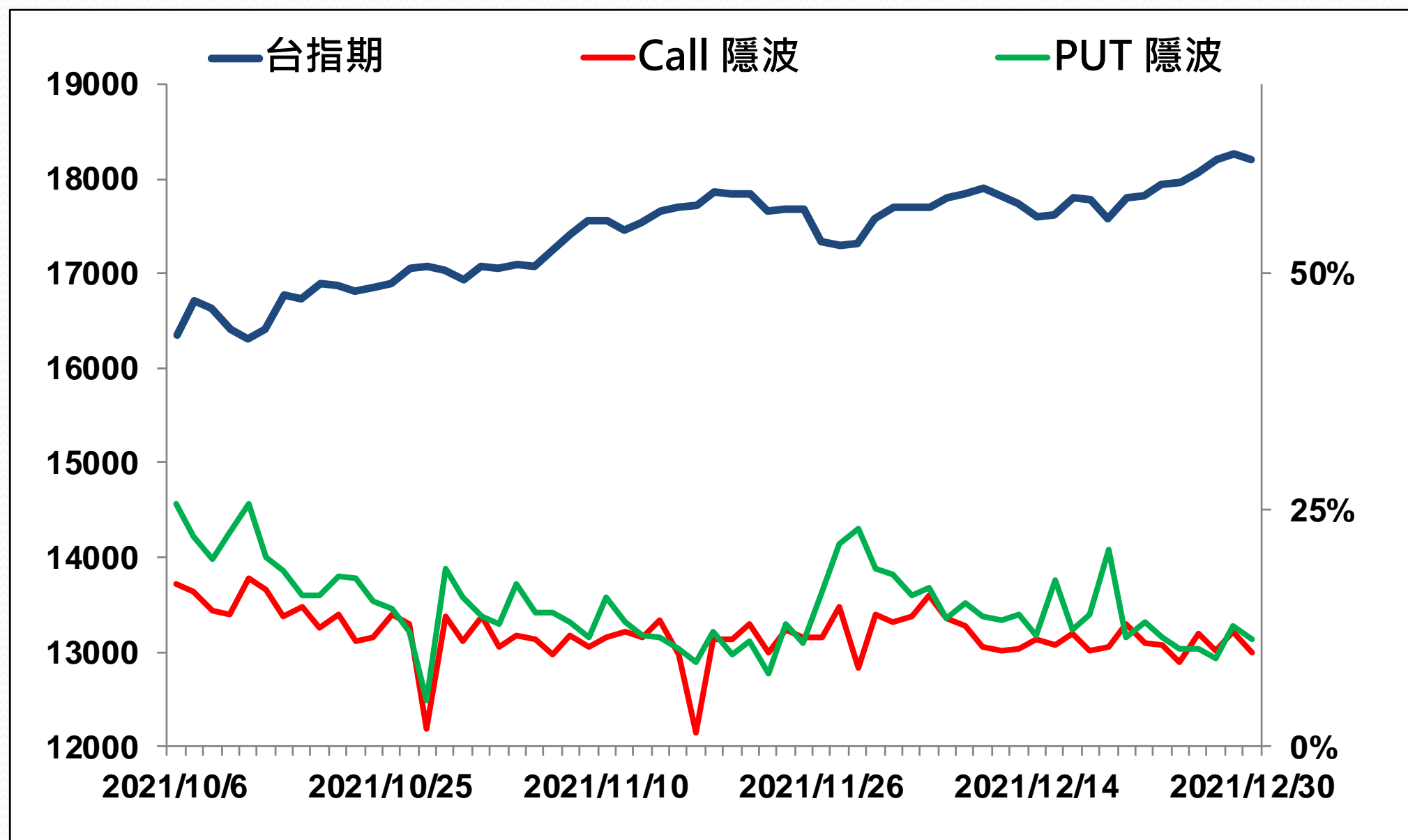
更新日期：2021年12月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



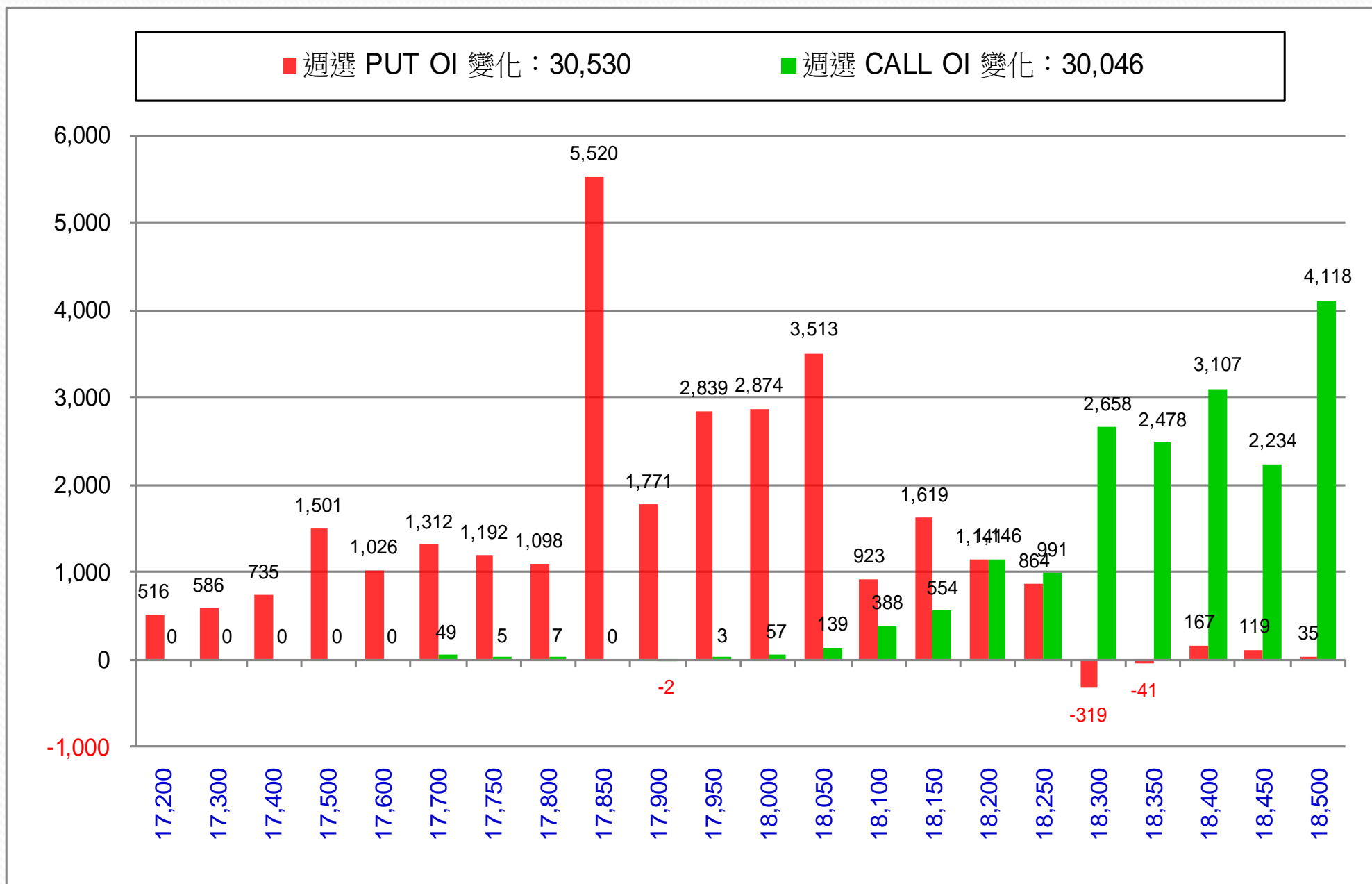
更新日期：2021年12月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2021年12月30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

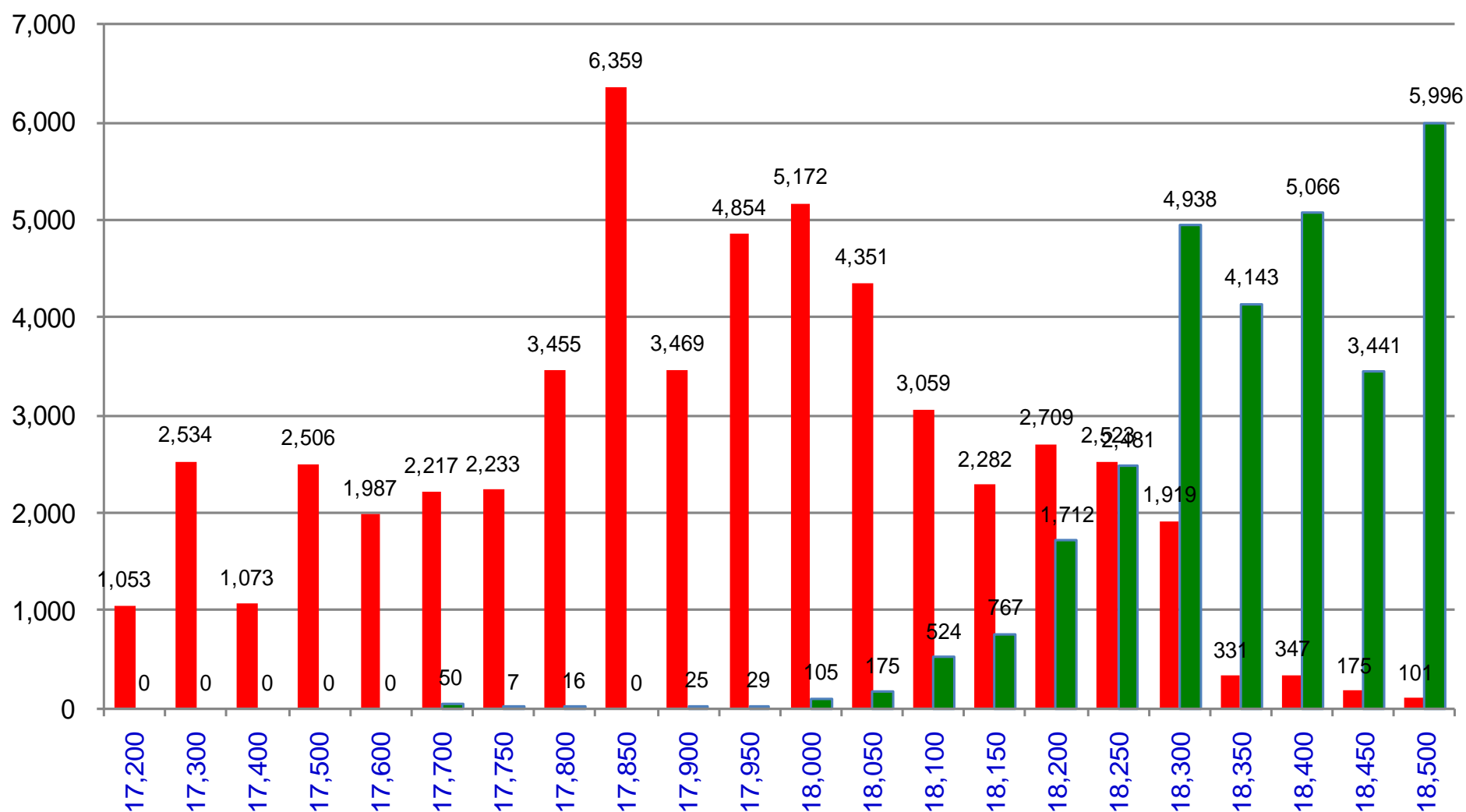


更新日期：2021年12月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：58,498

週選 CALL OI 總額：48,409



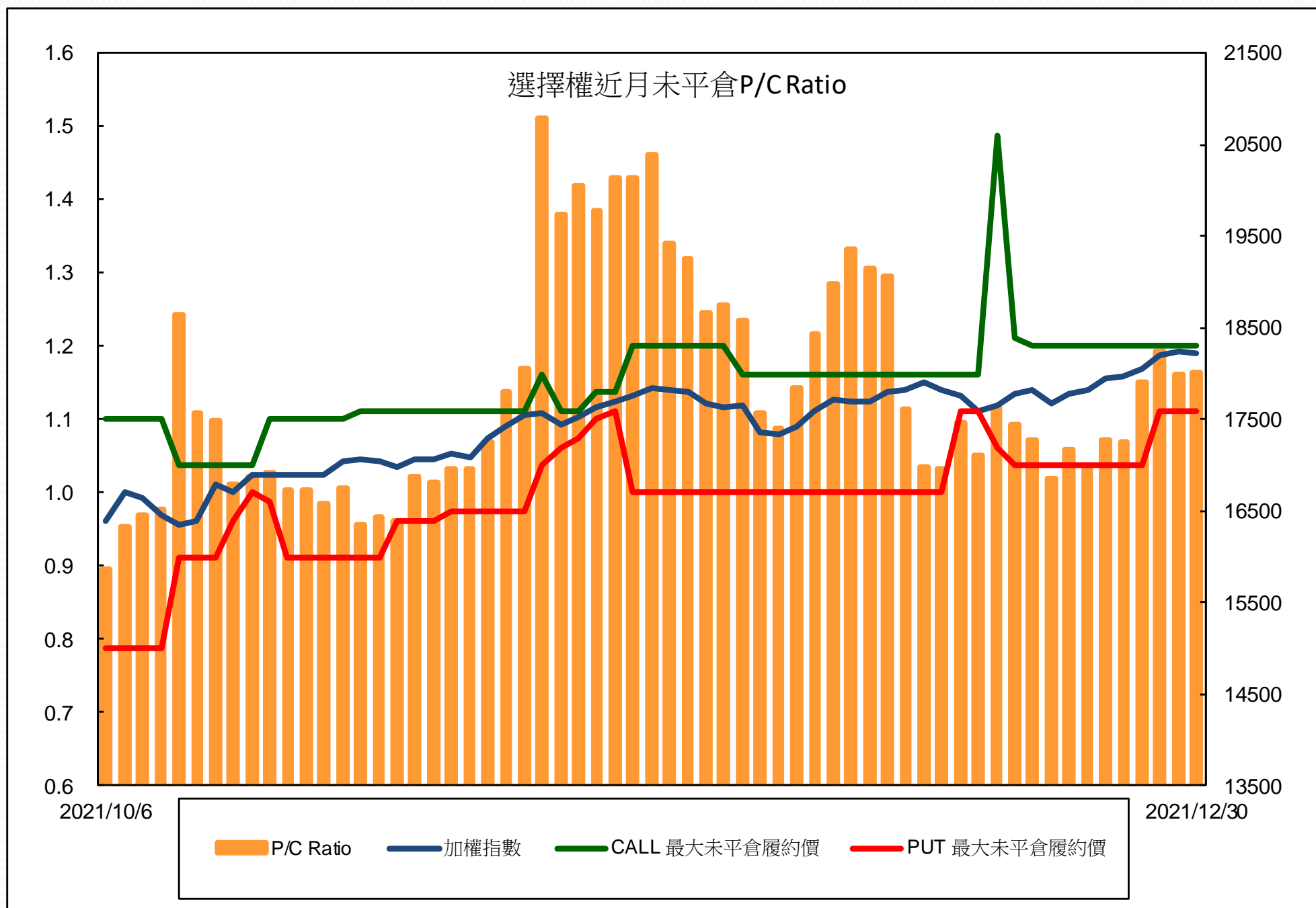
更新日期：2021年12月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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29日	38,603	38,901	-298
	12月30日	42,623	46,012	-3,389
Put	12月29日	38,670	39,520	-850
	12月30日	47,143	45,241	1,902

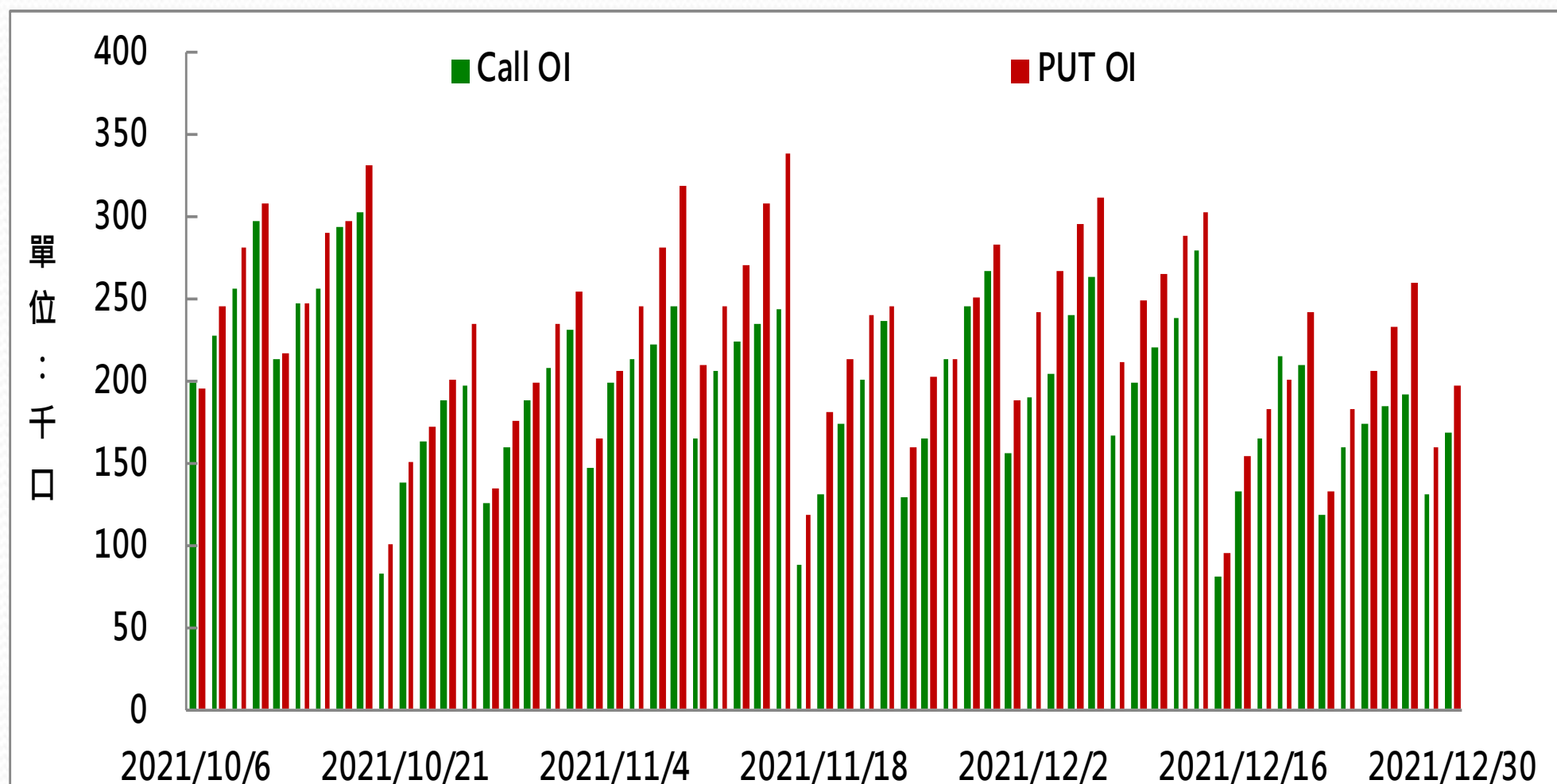
更新日期：2021年12月30日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2021年12月30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30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30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