

# 台指選擇權OI匯報

日期：2021/12/20 結算日：2021/12/22					日期：2021/12/20 結算日：2022/1/19				
202112W4					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
4	15	17,250	5,473	1,521	1	69	16,900	2,301	173
6	44	17,300	7,866	2,256	-3	563	17,000	4,620	382
1	25	17,350	5,164	921	269	1,592	17,100	3,724	-47
-89	179	17,400	7,993	2,665	4	527	17,200	3,920	-129
59	133	17,450	6,407	2,414	34	396	17,300	2,141	21
211	638	17,500	10,221	3,283	63	1,170	17,400	1,529	136
381	646	17,550	5,084	513	147	732	17,500	2,216	-188
1,610	2,636	17,600	8,848	793	150	2,249	17,600	3,067	50
2,529	4,032	17,650	4,238	-277	818	3,039	17,700	2,099	76
6,966	9,516	17,700	3,980	-812	415	3,280	17,800	1,679	95
5,256	8,396	17,750	3,356	-480	528	2,230	17,900	573	1
5,672	11,719	17,800	3,051	-618	992	5,978	18,000	1,386	51
7,295	13,069	17,850	1,459	-200	628	4,982	18,100	60	-5
※ 7,781	14,785	17,900	1,227	207	689	5,797	18,200	60	8
1,758	8,639	17,950	564	-13	566	7,067	18,300	15	1
360	16,408	18,000	435	-53	434	6,784	18,400	65	-2
538	10,333	18,050	78	7	845	5,832	18,500	2	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
42,521	124,651	0.8476	105,650	14,152	6,701	73,217	1.0202	74,695	3,337
昨日 P/C	1.1141	今日增減變化	-0.2665		昨日 P/C	1.0728	今日增減變化	-0.0526	

更新日期：2021年12月20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20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	75,903,582	169,527,801	-93,624,219	-3,277,969	2,890,632	2,426,786	463,846	-544,093
投信	52,710,836	51,560,793	1,150,043	-1,713,522	490,735	0	490,735	-6,424
自營商	63,838,972	8,477,169	55,361,803	4,662,224	1,418,244	1,216,754	201,490	-12,912
	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	574,425	3,796,200	-3,221,775	-215,789	56,753	277,087	-220,334	23,498
投信	19,980	0	19,980	-194	1,669	0	1,669	-13
自營商	657,675	69,930	587,745	80,003	248,720	65,108	183,612	-31,633

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20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	22,055	17,760	4,295	-1,195	53,321	26,470	26,851	966
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	49,920	55,689	-5,769	-12,926	43,714	35,907	7,807	15,779
特定法人(週)	3,625	0	3,625	1,544	2,176	6,248	-4,072	1,546
特定法人(近月)	10,739	13,244	-2,505	-1,157	7,481	26,177	-18,696	-1,556
特定法人(全月)	12,540	9,133	3,407	-3,419	18,003	41,803	-23,800	682
十大交易人(週)	35,362	42,638	-7,276	-6,383	28,687	31,580	-2,893	-11,337
十大交易人(近月)	35,436	34,114	1,322	-1,299	31,341	46,948	-15,607	-1,484
十大交易人(全月)	74,830	69,621	5,209	-9,425	65,929	88,745	-22,816	-11,662
全市場未沖銷(近月)			73,217	6,701			74,695	3,337
全市場未沖銷(全月)			215,016	49,203			201,620	18,155

更新日期：2021年12月20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12W4週選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	17800	買權OI最大量	18000
	賣權成交最大量	17600	賣權OI最大量	17500
	整體隱含波動率	12.13%	較前一交易日	+0.41%
	買權隱含波動率	10.17%	較前一交易日	+0.23%
	賣權隱含波動率	20.97%	較前一交易日	+7.48%
電子選擇權	買權成交最大量	865	買權OI最大量	840
	賣權成交最大量	825	賣權OI最大量	810
金融選擇權	買權成交最大量	1720	買權OI最大量	1700
	賣權成交最大量	1660	賣權OI最大量	1660

更新日期：2021年12月20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	18300	買權OI最大量	18300
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	15.80%	較前一交易日	-1.25%
	買權隱含波動率	12.16%	較前一交易日	+0.50%
	賣權隱含波動率	20.64%	較前一交易日	+3.02%
	成交量P/C_Ratio值	0.773	較前一交易日	-0.10
	未平倉P/C_Ratio值	1.020	較前一交易日	-0.05
電子選擇權	買權成交最大量	865	買權OI最大量	840
	賣權成交最大量	825	賣權OI最大量	810
金融選擇權	買權成交最大量	1720	買權OI最大量	1700
	賣權成交最大量	1660	賣權OI最大量	1660

更新日期：2021年12月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

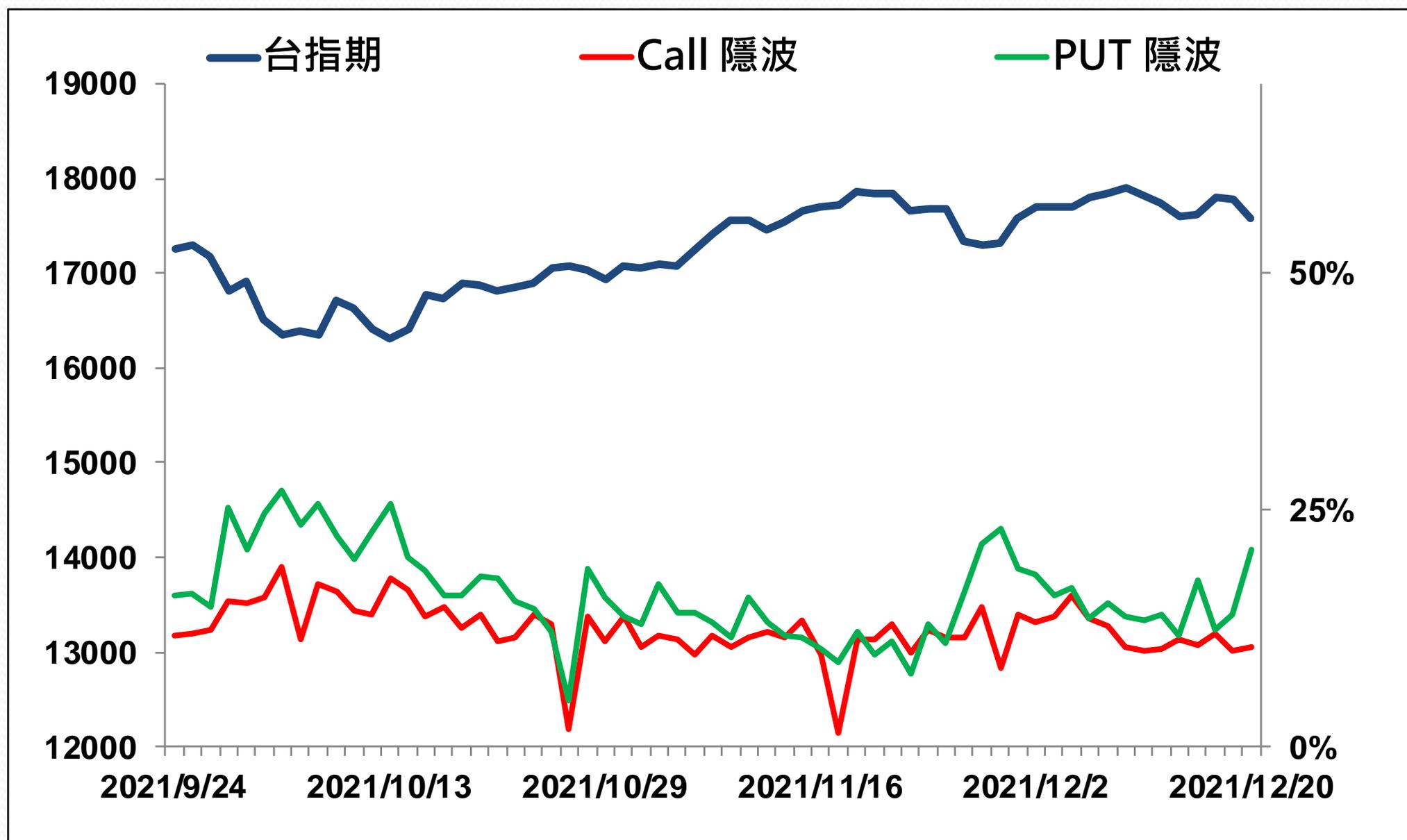
# 選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



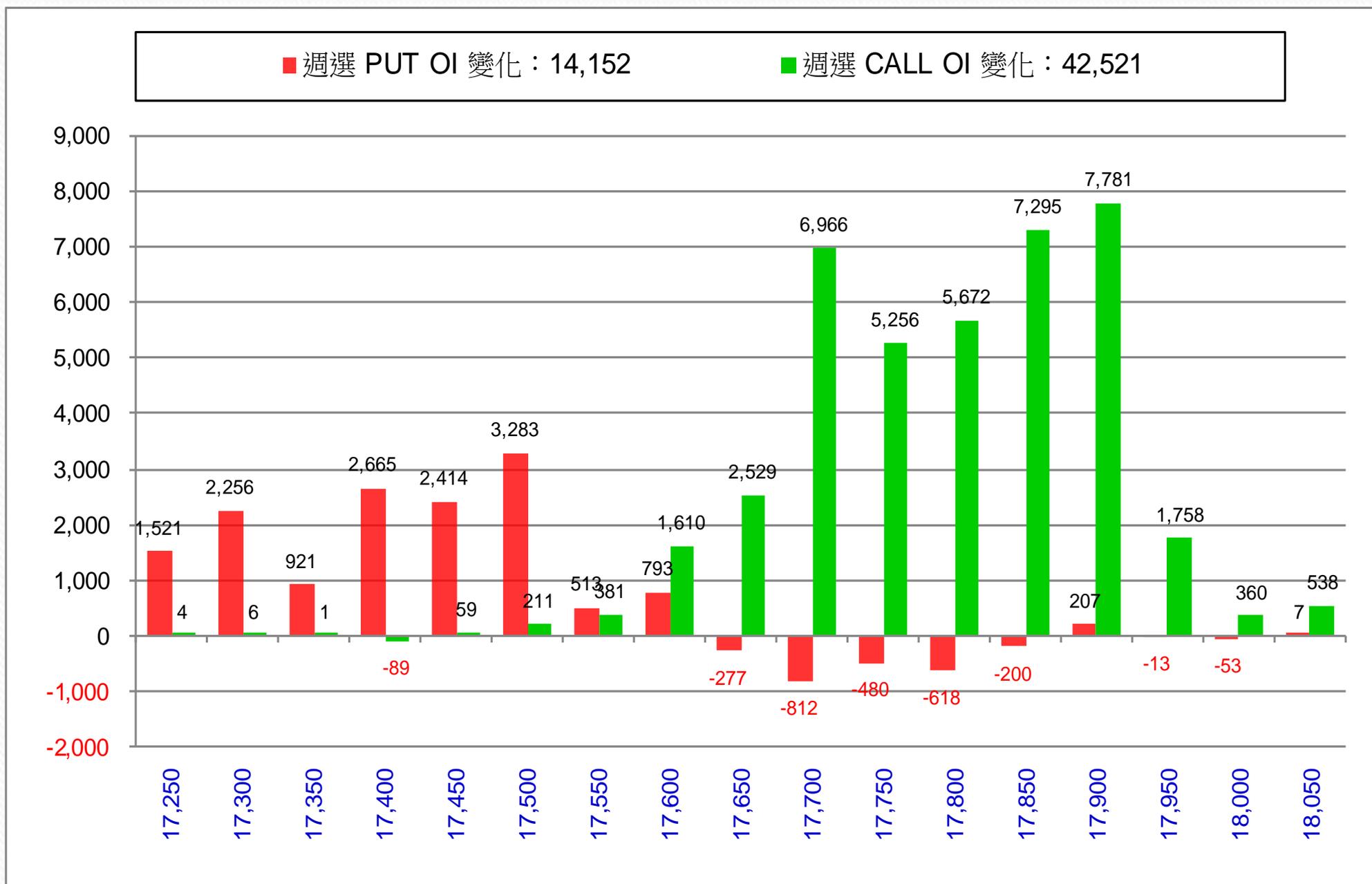
更新日期：2021年12月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2021年12月20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

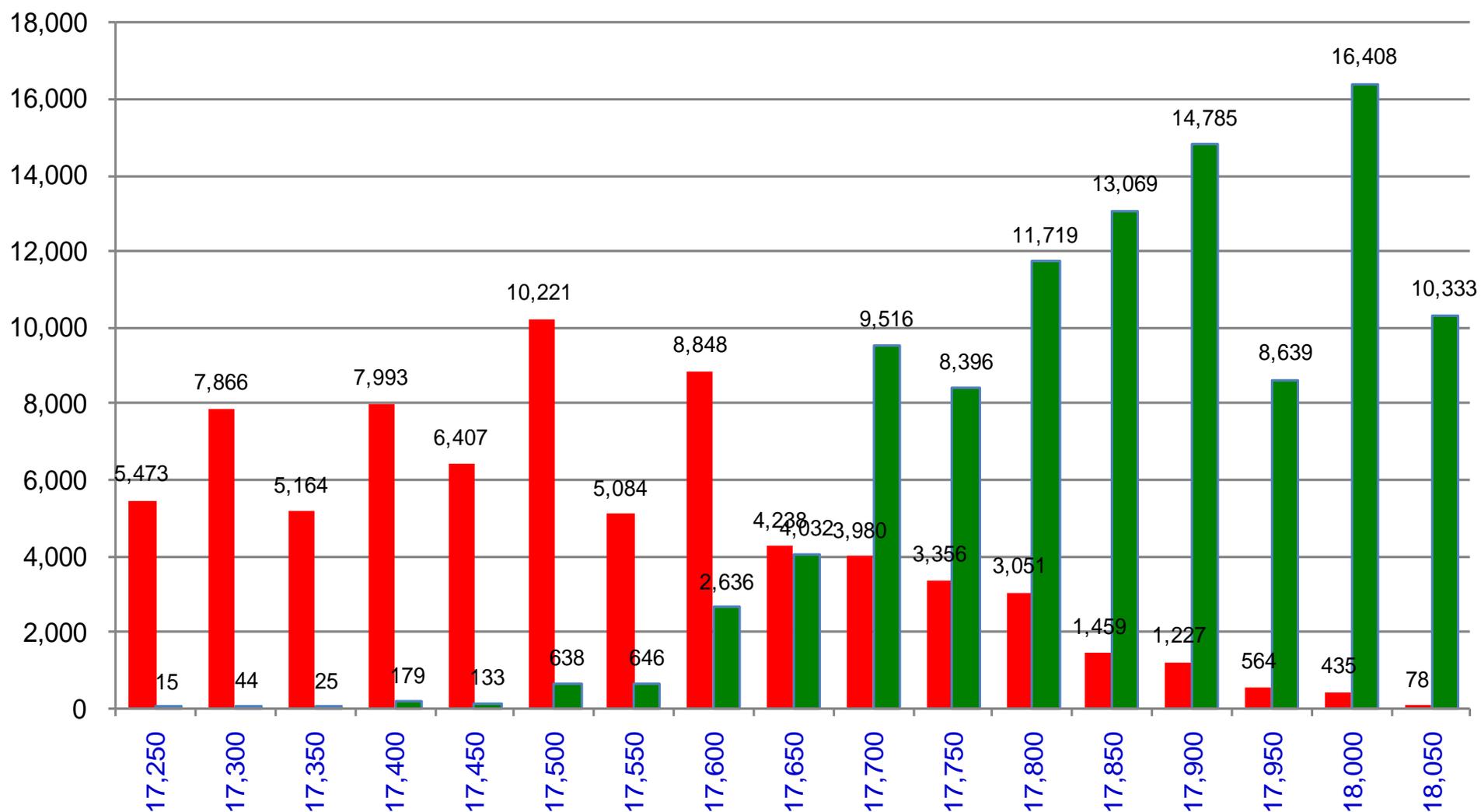


更新日期：2021年12月20日    資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：105,650

週選 CALL OI 總額：124,651



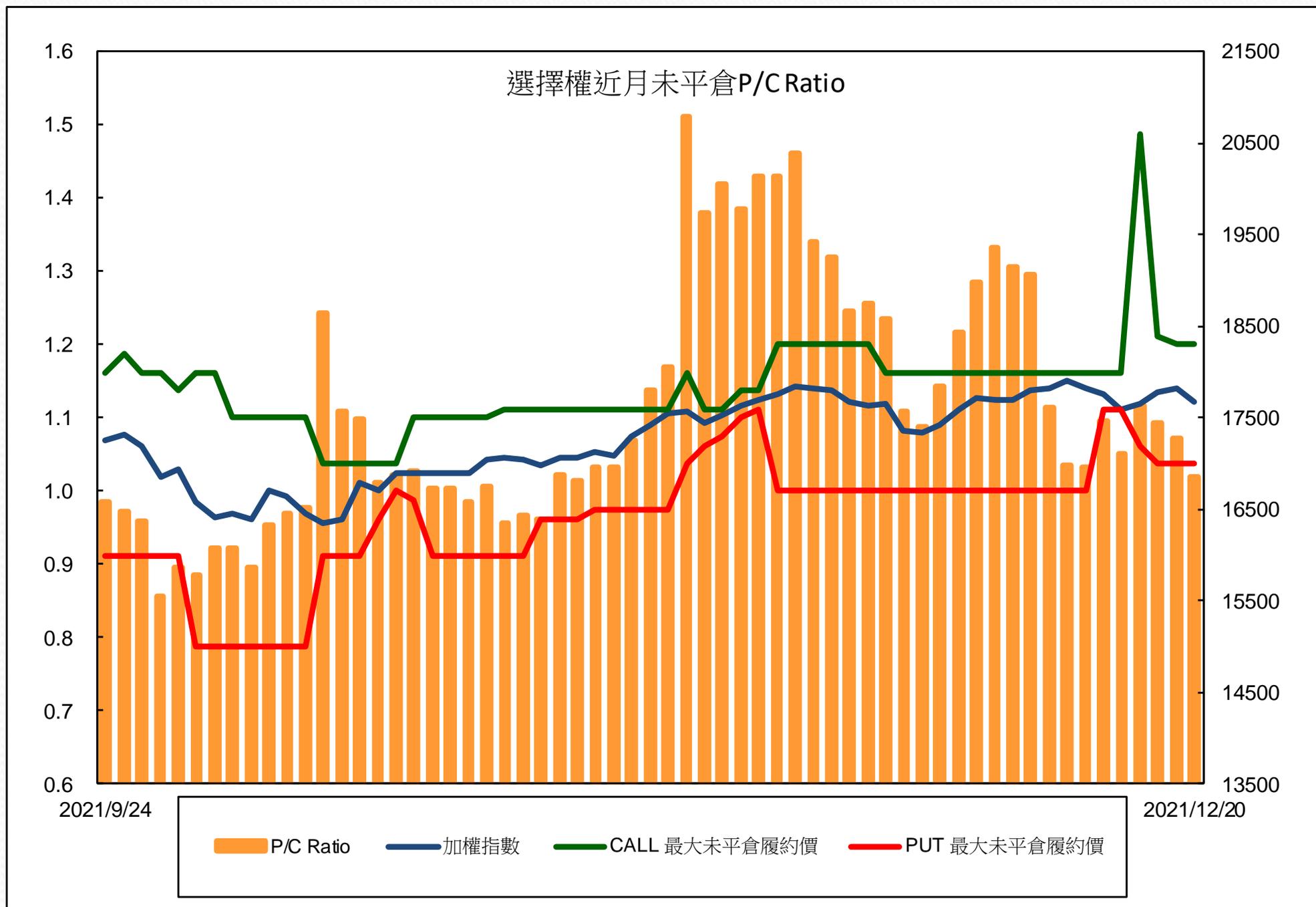
更新日期：2021年12月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 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17日	48,109	40,952	7,157
	12月20日	49,920	55,689	-5,769
Put	12月17日	33,250	41,222	-7,972
	12月20日	43,714	35,907	7,807

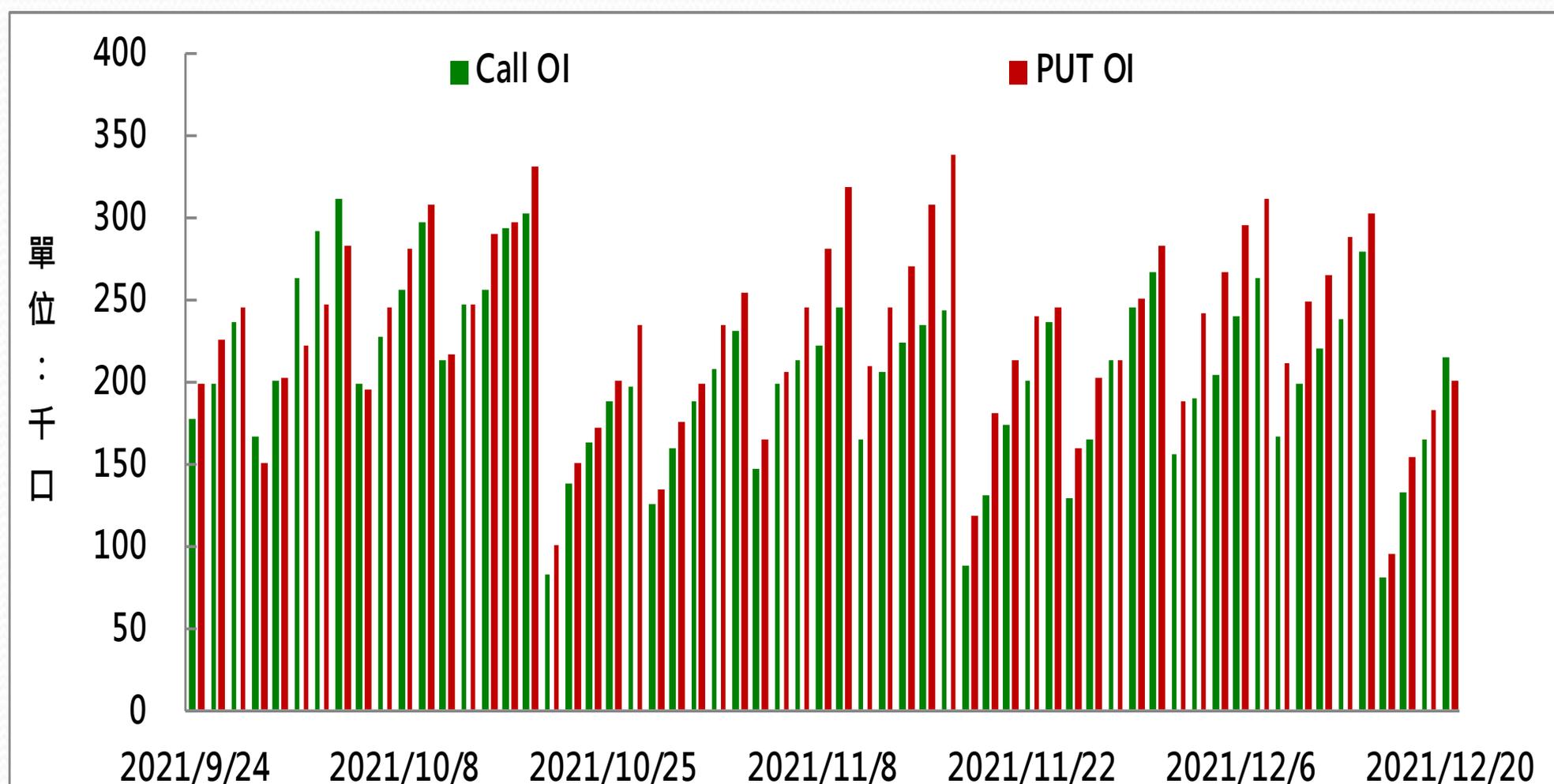
更新日期：2021年12月20日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2021年12月20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20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20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