

台指選擇權OI匯報

日期：2021/12/15 結算日：2021/12/22					日期：2021/12/15 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
0	0	16,400	431	431	0	0	15,900	310	6
0	0	16,500	1,193	1,193	0	10	16,000	2,703	256
0	0	16,600	878	878	0	0	16,100	1,136	513
0	0	16,700	1,307	1,307	0	1	16,200	892	92
0	0	16,800	784	784	0	0	16,300	787	112
0	0	16,900	1,479	1,479	0	0	16,400	926	120
1	1	17,000	1,611	1,611	15	18	16,500	1,831	154
7	7	17,100	1,239	1,239	0	13	16,600	1,373	175
3	3	17,150	941	941	1	15	16,700	2,913	403
4	4	17,200	2,376	2,376	10	48	16,800	3,061	1,268
0	0	17,250	885	885	48	69	16,900	1,560	322
23	23	17,300	1,383	1,383	66	119	17,000	2,986	959
5	5	17,350	752	752	0	279	17,100	1,923	178
79	79	17,400	804	804	26	242	17,200	3,296	251
50	50	17,450	626	626	18	96	17,300	1,229	143
325	325	17,500	840	840	471	649	17,400	1,084	289
329	329	17,550	438	438	148	520	17,500	1,649	201
905	905	17,600	1,000	1,000	211	2,022	17,600	2,825	139
735	735	17,650	419	419	123	1,727	17,700	1,143	9
1,223	1,223	17,700	418	418	378	2,081	17,800	605	61
996	996	17,750	110	110	429	1,441	17,900	532	-17
2,177	2,177	17,800	107	107	824	3,196	18,000	1,057	5
2,748	2,748	17,850	19	19	874	2,952	18,100	48	-7
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
18,465	18,465	1.1446	21,135	21,135	6,464	48,921	1.1177	54,681	10,120
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化	1.1446		昨日 P/C	1.0496	今日增減變化	0.0682	

更新日期：2021年12月15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15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	73,511,746	164,223,266	-90,711,520	2,349,103	2,778,994	1,803,318	975,676	1,285,455
投信	52,649,696	52,149,721	499,975	1,398,230	491,202	0	491,202	-1,694,728
自營商	59,404,537	6,912,357	52,492,180	3,006,600	1,275,108	1,170,811	104,297	655,772
	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	653,307	3,386,531	-2,733,224	464,742	36,672	288,374	-251,702	-101,974
投信	19,999	0	19,999	-51	1,667	0	1,667	5
自營商	551,645	63,331	488,314	-284,502	260,036	38,339	221,697	98,568

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15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	12,660	7,609	5,051	-820	42,553	21,045	21,508	-23,304
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	27,512	25,254	2,258	30,332	23,274	21,994	1,280	-1,599
特定法人(週)	1,202	0	1,202	---	200	2,728	-2,528	---
特定法人(近月)	7,096	8,691	-1,595	---	8,291	23,332	-15,041	---
特定法人(全月)	10,729	6,000	4,729	1,754	18,572	38,522	-19,950	27,624
十大交易人(週)	7,175	8,284	-1,109	---	9,904	10,337	-433	---
十大交易人(近月)	25,627	25,604	23	---	25,632	36,988	-11,356	---
十大交易人(全月)	42,614	35,153	7,461	17,639	45,784	60,498	-14,714	4,807
全市場未沖銷(近月)			48,921	---			54,681	---
全市場未沖銷(全月)			81,599	-198,939			94,734	-207,894

更新日期：2021年12月15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	17900	買權OI最大量	17900
	賣權成交最大量	17200	賣權OI最大量	17200
	整體隱含波動率	13.07%	較前一交易日	+1.87%
	買權隱含波動率	10.24%	較前一交易日	-1.00%
	賣權隱含波動率	15.94%	較前一交易日	+4.77%
電子選擇權	買權成交最大量	545	買權OI最大量	840
	賣權成交最大量	790	賣權OI最大量	810
金融選擇權	買權成交最大量	1680	買權OI最大量	1740
	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1640

更新日期：2021年12月15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

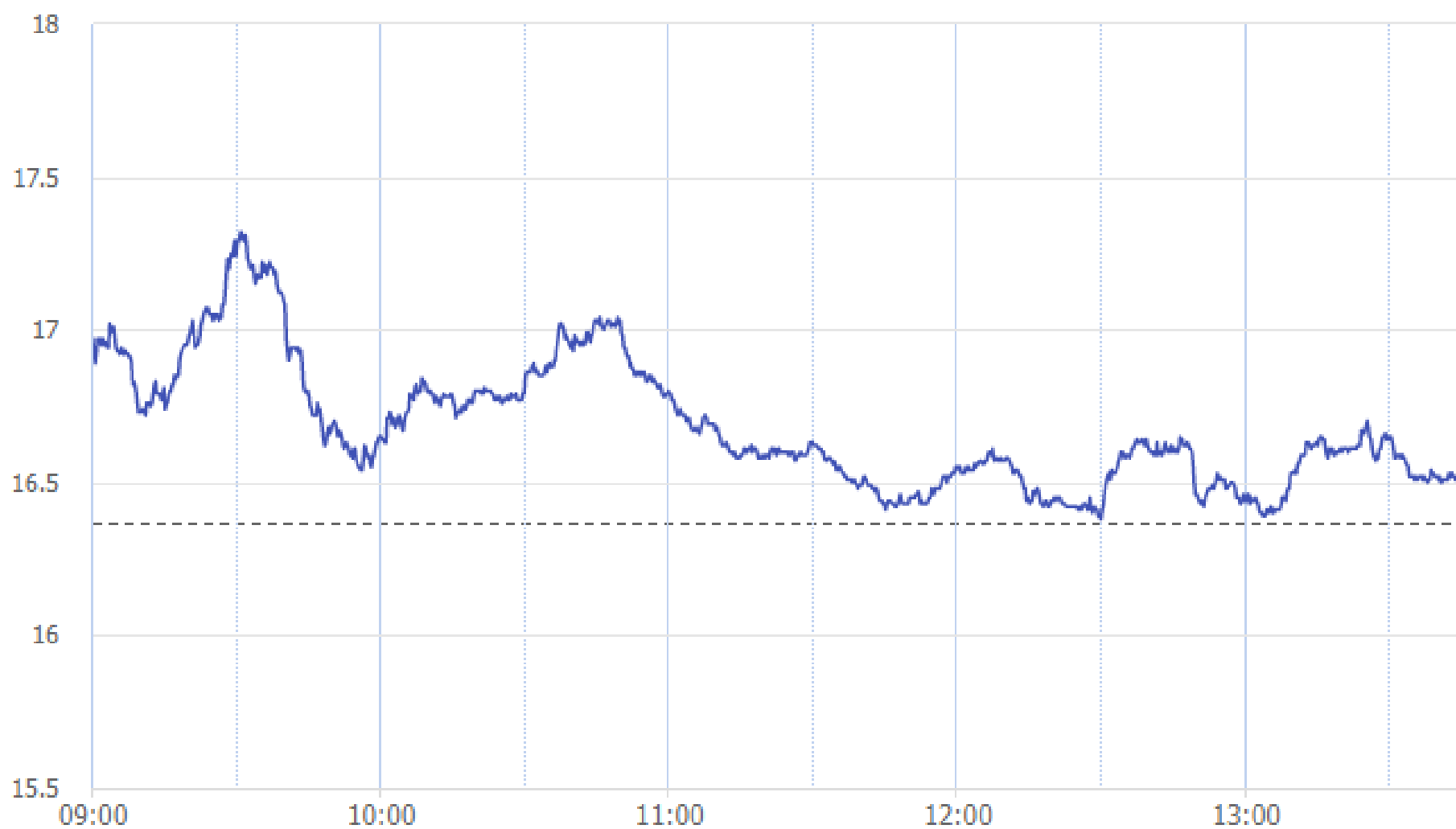
2022年01月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	18000	買權OI最大量	20600
	賣權成交最大量	16800	賣權OI最大量	17200
	整體隱含波動率	17.07%	較前一交易日	-1.65%
	買權隱含波動率	11.97%	較前一交易日	+0.02%
	賣權隱含波動率	21.00%	較前一交易日	+1.28%
	成交量P/C_Ratio值	1.134	較前一交易日	+0.33
	未平倉P/C_Ratio值	1.118	較前一交易日	+0.07
電子選擇權	買權成交最大量	615	買權OI最大量	840
	賣權成交最大量	790	賣權OI最大量	810
金融選擇權	買權成交最大量	1680	買權OI最大量	1740
	賣權成交最大量	1580	賣權OI最大量	1640

更新日期：2021年12月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

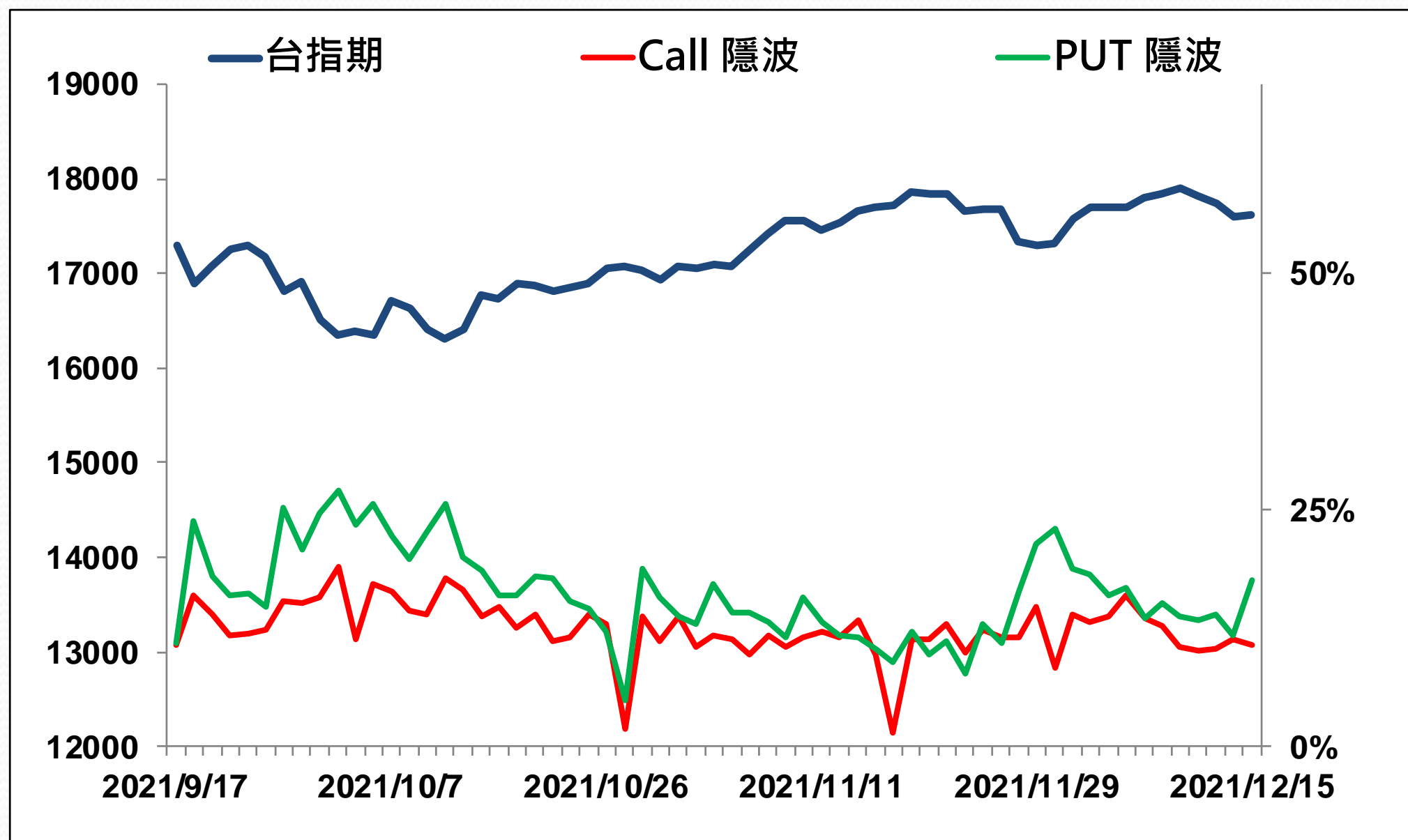
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



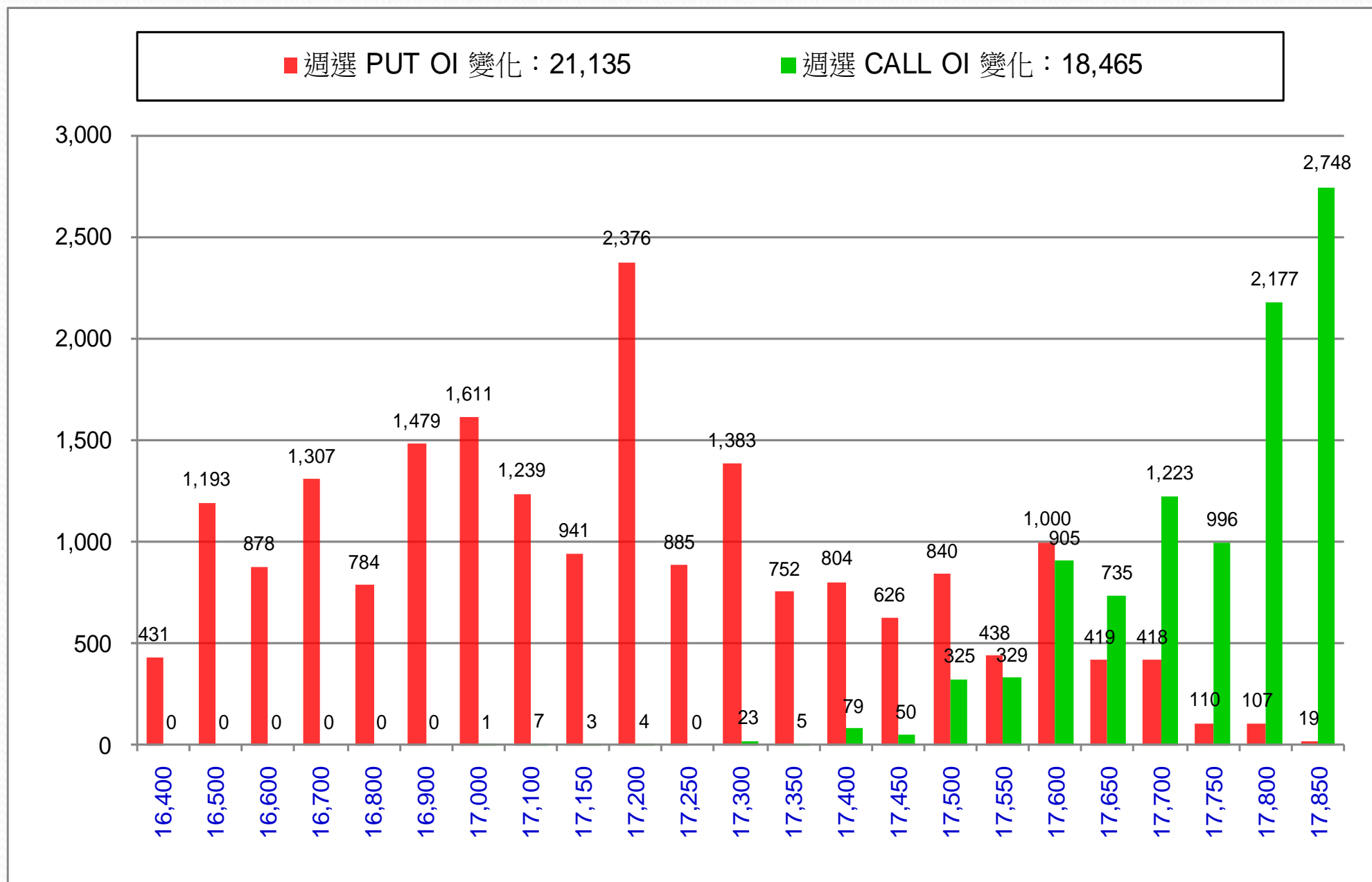
更新日期：2021年12月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



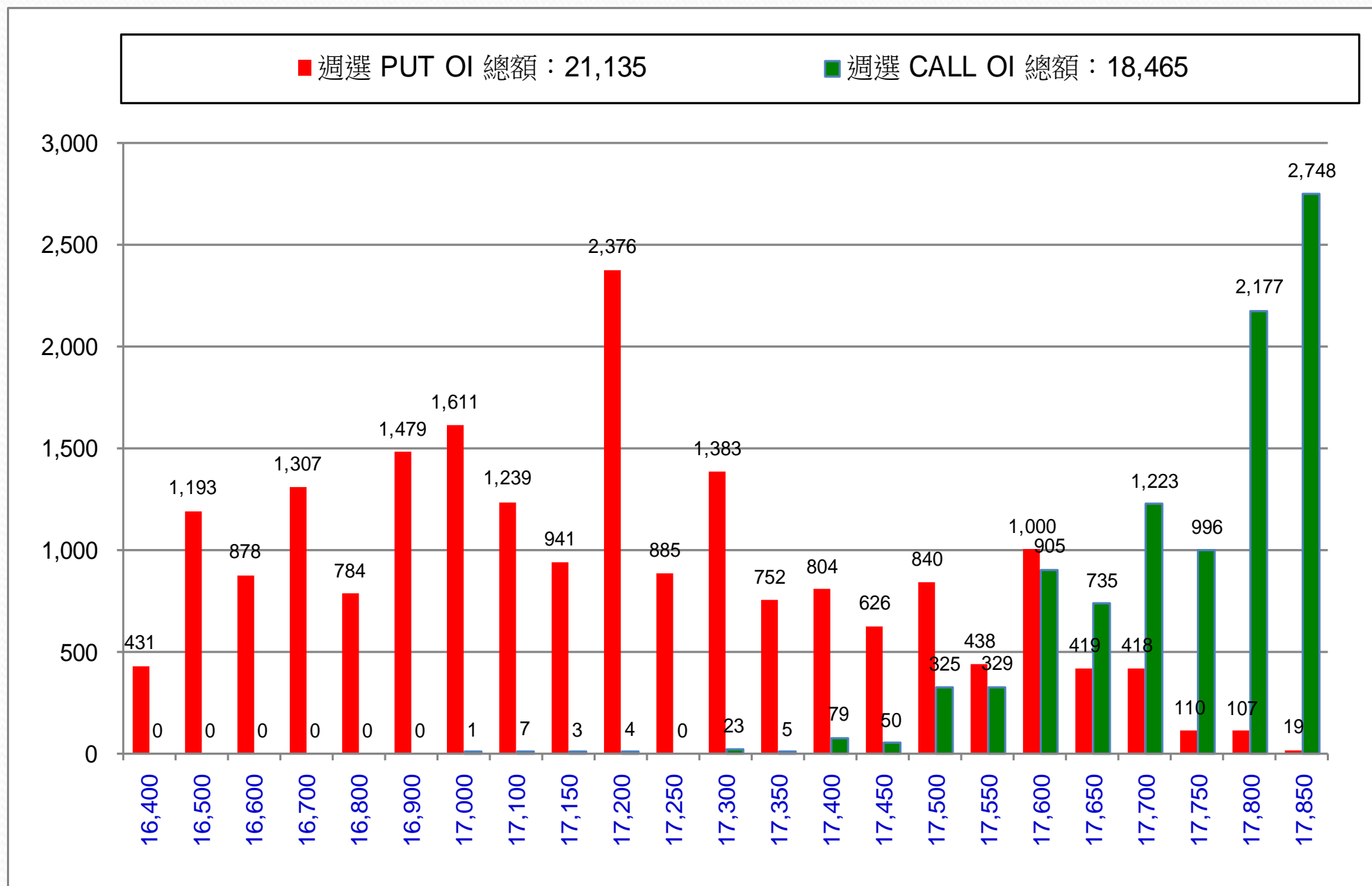
更新日期：2021年12月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2021年12月15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



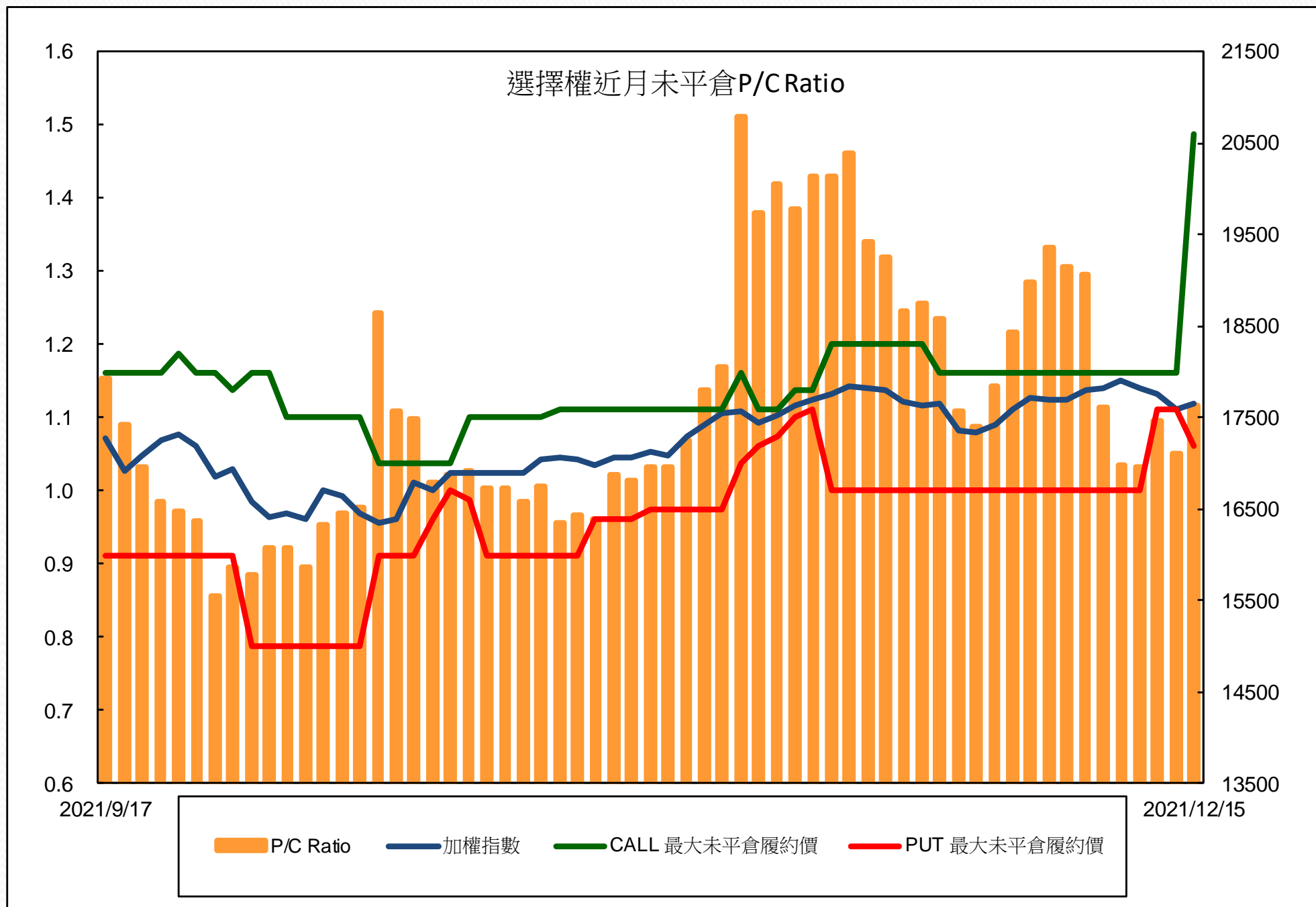
更新日期：2021年12月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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14日	49,800	77,874	-28,074
	12月15日	27,512	25,254	2,258
Put	12月14日	62,007	59,128	2,879
	12月15日	23,274	21,994	1,280

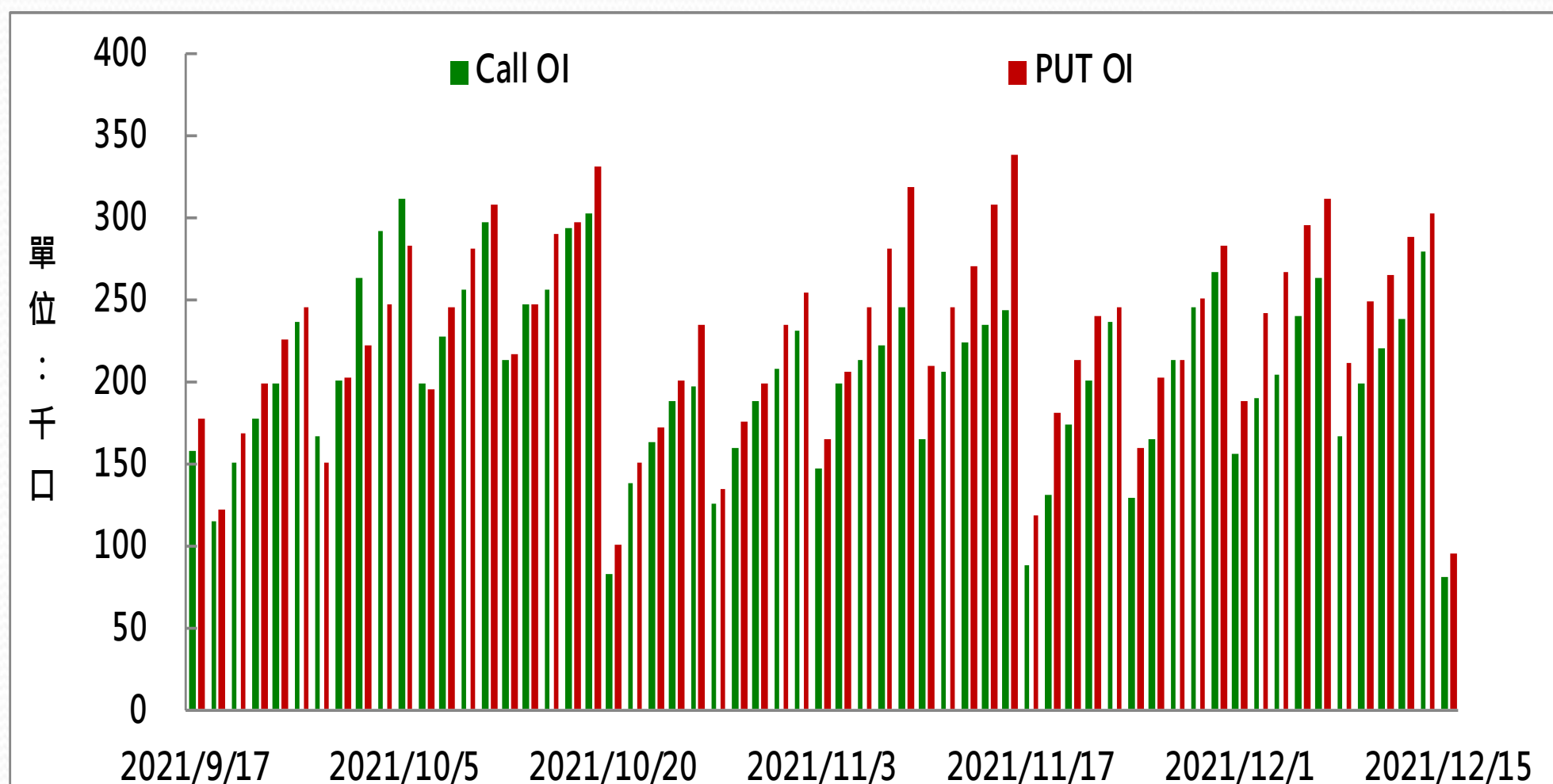
更新日期：2021年12月15日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2021年12月15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15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15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