

台指選擇權OI匯報

日期：2021/12/16 結算日：2021/12/22					日期：2021/12/16 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	16,700	1,532	225	0	10	16,000	2,923	220
0	0	16,800	1,105	321	0	0	16,100	739	-397
1	1	16,900	2,691	1,212	0	1	16,200	1,039	147
16	17	17,000	5,110	3,499	0	0	16,300	785	-2
0	7	17,100	3,445	2,206	0	0	16,400	1,153	227
6	9	17,150	1,587	646	4	22	16,500	2,122	291
4	8	17,200	3,527	1,151	0	13	16,600	1,786	413
11	11	17,250	3,737	2,852	1	16	16,700	3,061	148
11	34	17,300	5,430	4,047	0	48	16,800	3,288	227
13	18	17,350	3,705	2,953	-1	68	16,900	2,002	442
182	261	17,400	3,833	3,029	443	562	17,000	4,020	1,034
23	73	17,450	3,371	2,745	896	1,175	17,100	3,455	1,532
48	373	17,500	5,327	4,487	184	426	17,200	3,726	430
-45	284	17,550	2,354	1,916	71	167	17,300	1,402	173
65	970	17,600	4,708	3,708	405	1,054	17,400	1,295	211
830	1,565	17,650	2,482	2,063	85	605	17,500	2,160	511
1,059	2,282	17,700	2,975	2,557	41	2,063	17,600	2,903	78
1,398	2,394	17,750	2,031	1,921	431	2,158	17,700	1,526	383
2,549	4,726	17,800	2,114	2,007	179	2,260	17,800	1,509	904
1,358	4,106	17,850	631	612	474	1,915	17,900	543	11
4,807	7,598	17,900	381	354	1,541	4,737	18,000	1,285	228
2,891	4,044	17,950	387	377	1,213	4,165	18,100	54	6
※ 6,096	8,483	18,000	186	162	861	3,956	18,200	46	5
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
36,605	55,070	1.2221	67,301	46,166	12,640	61,561	1.0925	67,255	12,574
昨日 P/C	1.1446	今日增減變化		0.0775	昨日 P/C	1.1177	今日增減變化		-0.0252

更新日期：2021年12月16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16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	75,487,454	169,903,550	-94,416,096	-3,704,576	3,025,815	2,054,819	970,996	-4,680
投信	53,956,802	51,196,998	2,759,804	2,259,829	499,174	0	499,174	7,972
自營商	60,627,125	6,651,949	53,975,176	1,482,996	1,565,812	1,237,678	328,134	223,837
	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	682,051	3,462,203	-2,780,152	-46,928	36,826	276,194	-239,368	12,334
投信	20,110	0	20,110	111	1,674	0	1,674	7
自營商	554,690	103,896	450,794	-37,520	279,541	68,630	210,911	-10,786

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16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	18,952	13,767	5,185	134	45,280	22,440	22,840	1,332
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	37,258	35,098	2,160	-98	33,374	31,711	1,663	383
特定法人(週)	1,941	0	1,941	739	0	2,728	-2,728	-200
特定法人(近月)	10,426	11,777	-1,351	244	5,859	24,353	-18,494	-3,453
特定法人(全月)	14,476	9,987	4,489	-240	15,774	37,610	-21,836	-1,886
十大交易人(週)	16,088	16,001	87	1,196	22,773	18,978	3,795	4,228
十大交易人(近月)	31,818	30,798	1,020	997	30,699	44,028	-13,329	-1,973
十大交易人(全月)	58,010	46,474	11,536	4,075	59,652	72,276	-12,624	2,090
全市場未沖銷(近月)			61,561	12,640			67,255	12,574
全市場未沖銷(全月)			133,475	51,876			154,122	59,388

更新日期：2021年12月16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	18000	買權OI最大量	18000
	賣權成交最大量	17500	賣權OI最大量	17300
	整體隱含波動率	11.43%	較前一交易日	-1.64%
	買權隱含波動率	11.75%	較前一交易日	+1.50%
	賣權隱含波動率	11.13%	較前一交易日	-4.81%
電子選擇權	買權成交最大量	855	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	1700	買權OI最大量	1680
	賣權成交最大量	1660	賣權OI最大量	1640

更新日期：2021年12月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

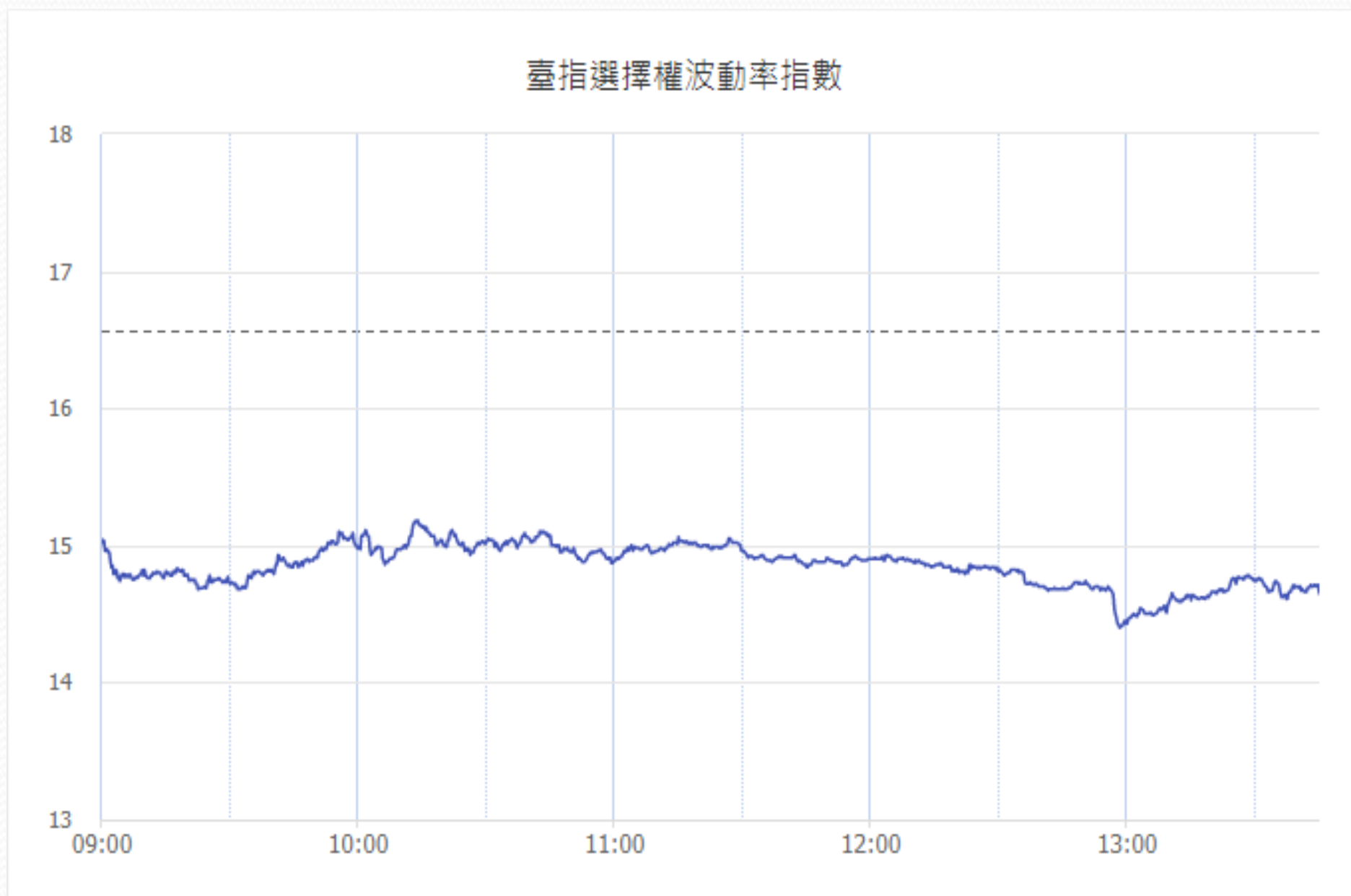
台指選擇權匯報

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	18400
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	14.67%	較前一交易日	+2.40%
	買權隱含波動率	12.47%	較前一交易日	+0.50%
	賣權隱含波動率	16.71%	較前一交易日	-4.29%
	成交量P/C_Ratio值	1.002	較前一交易日	-0.13
	未平倉P/C_Ratio值	1.092	較前一交易日	-0.03
電子選擇權	買權成交最大量	855	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	1700	買權OI最大量	1680
	賣權成交最大量	1660	賣權OI最大量	1640

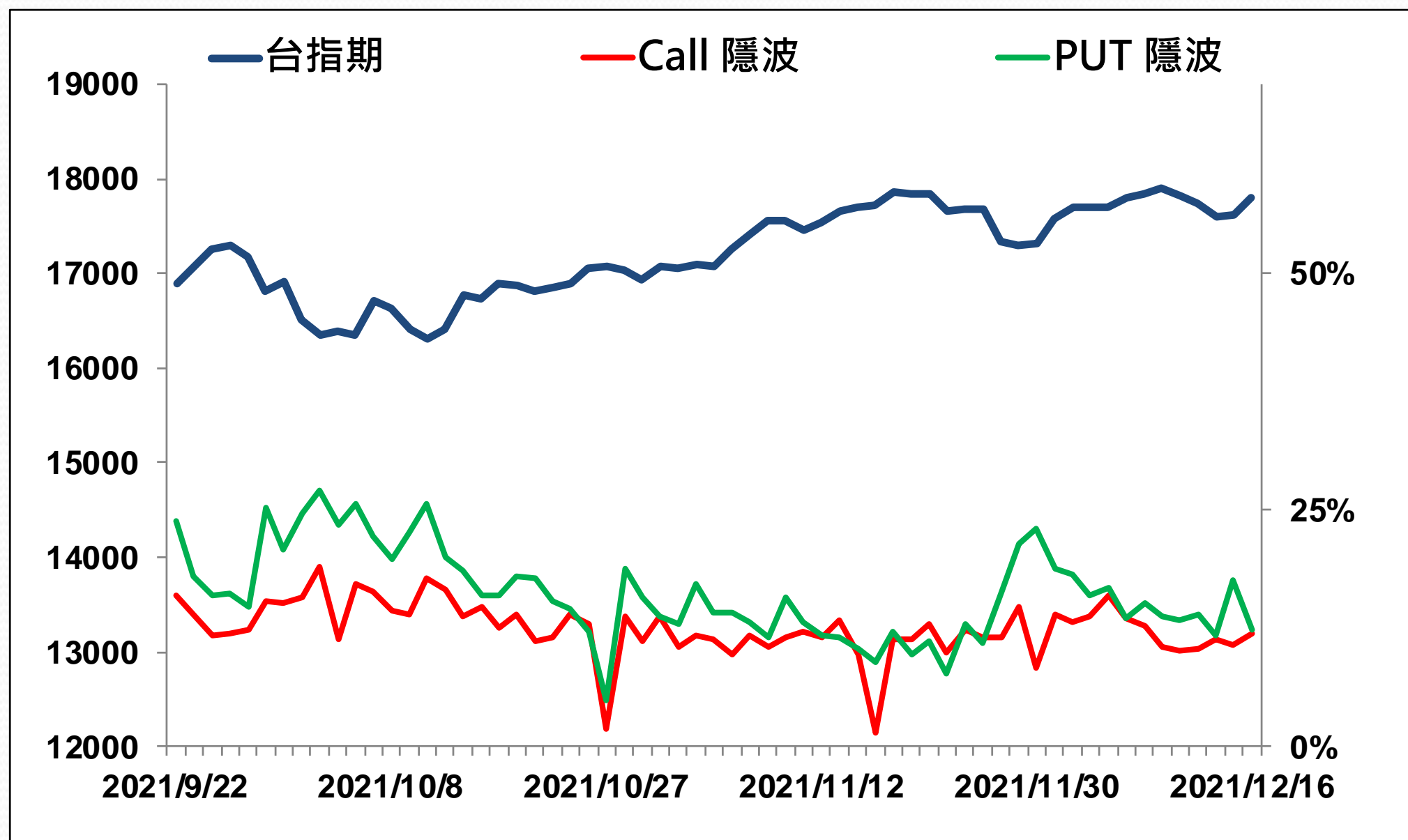
更新日期：2021年12月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



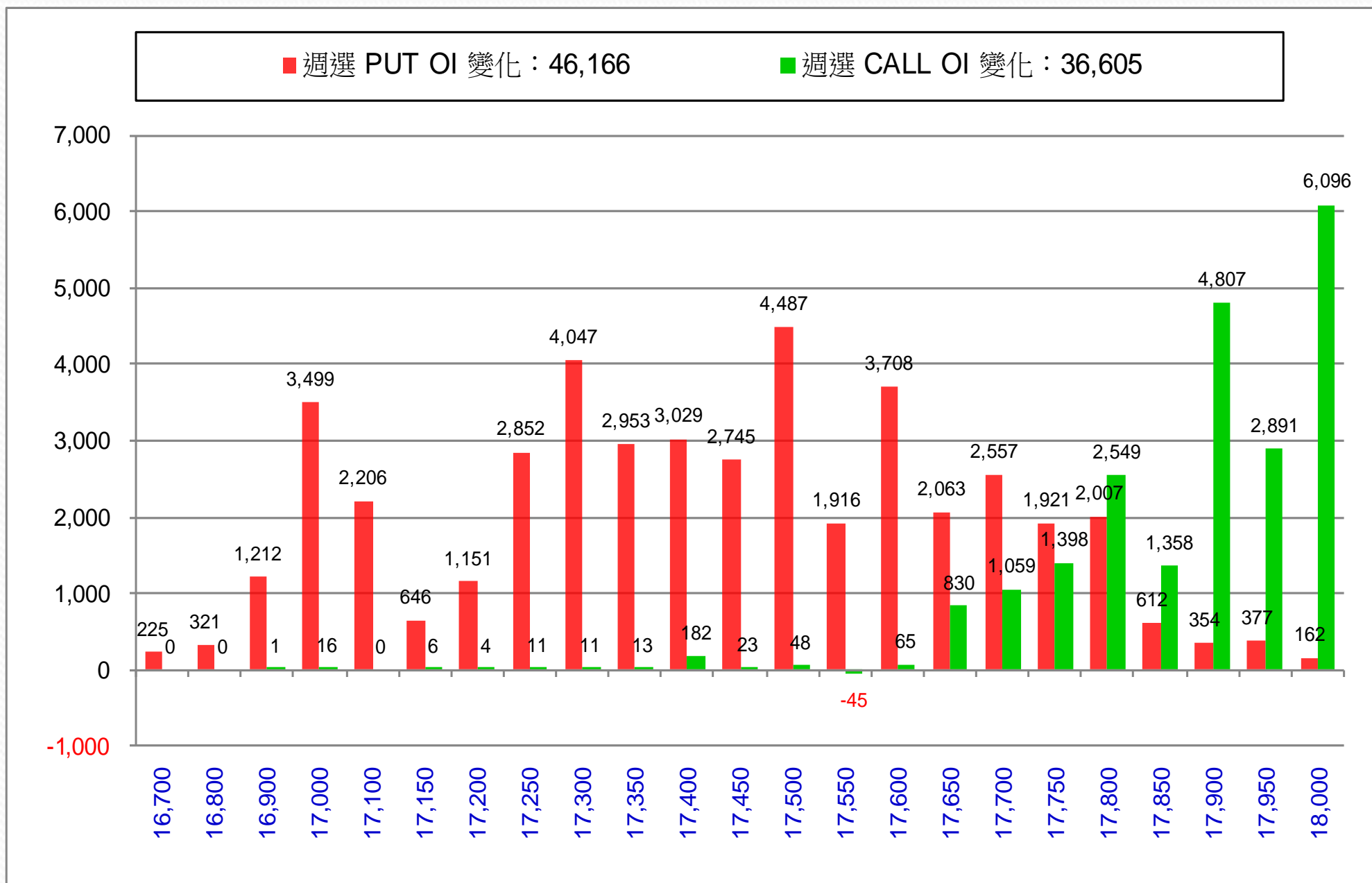
更新日期：2021年12月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2021年12月16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

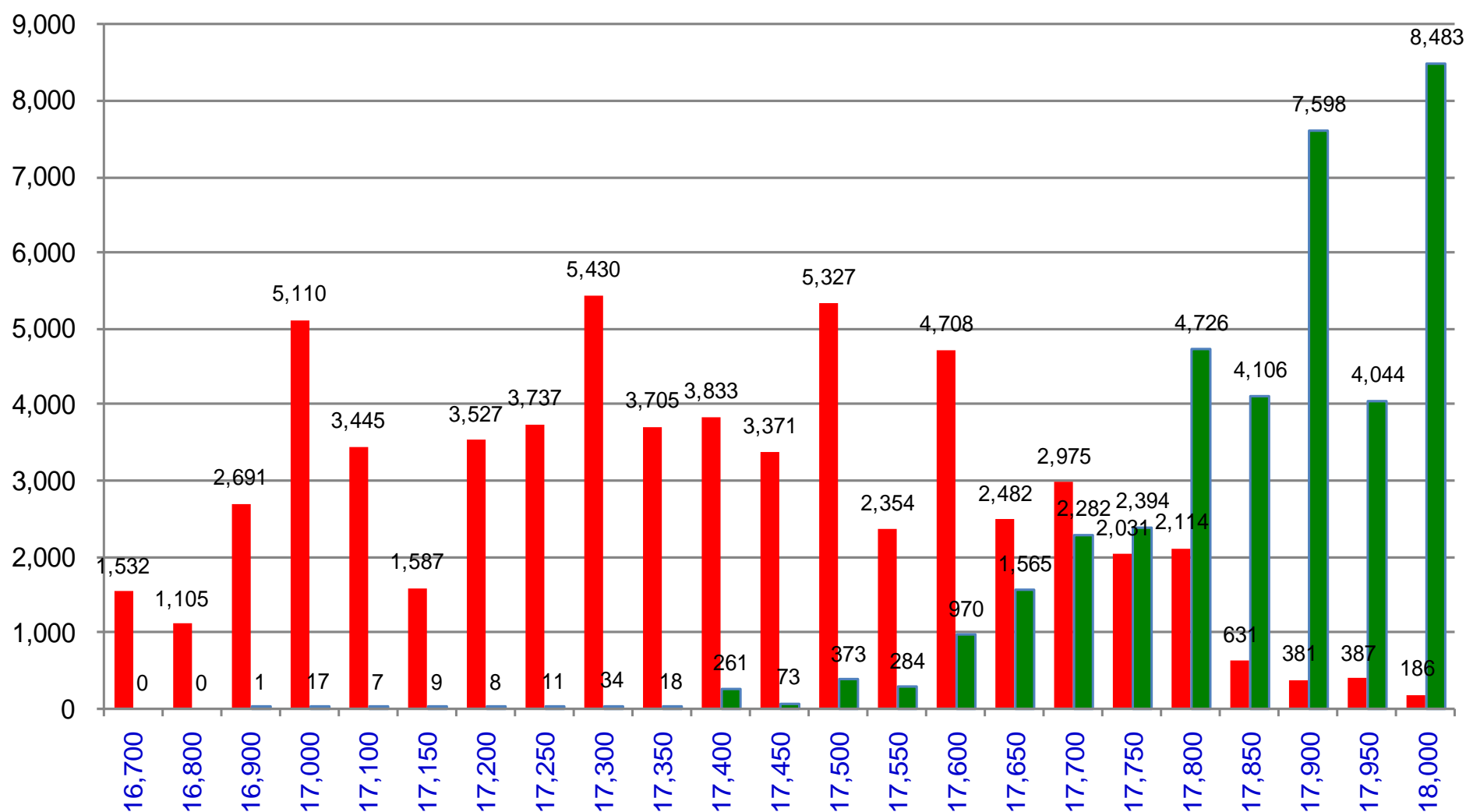


更新日期：2021年12月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：67,301

週選 CALL OI 總額：55,070



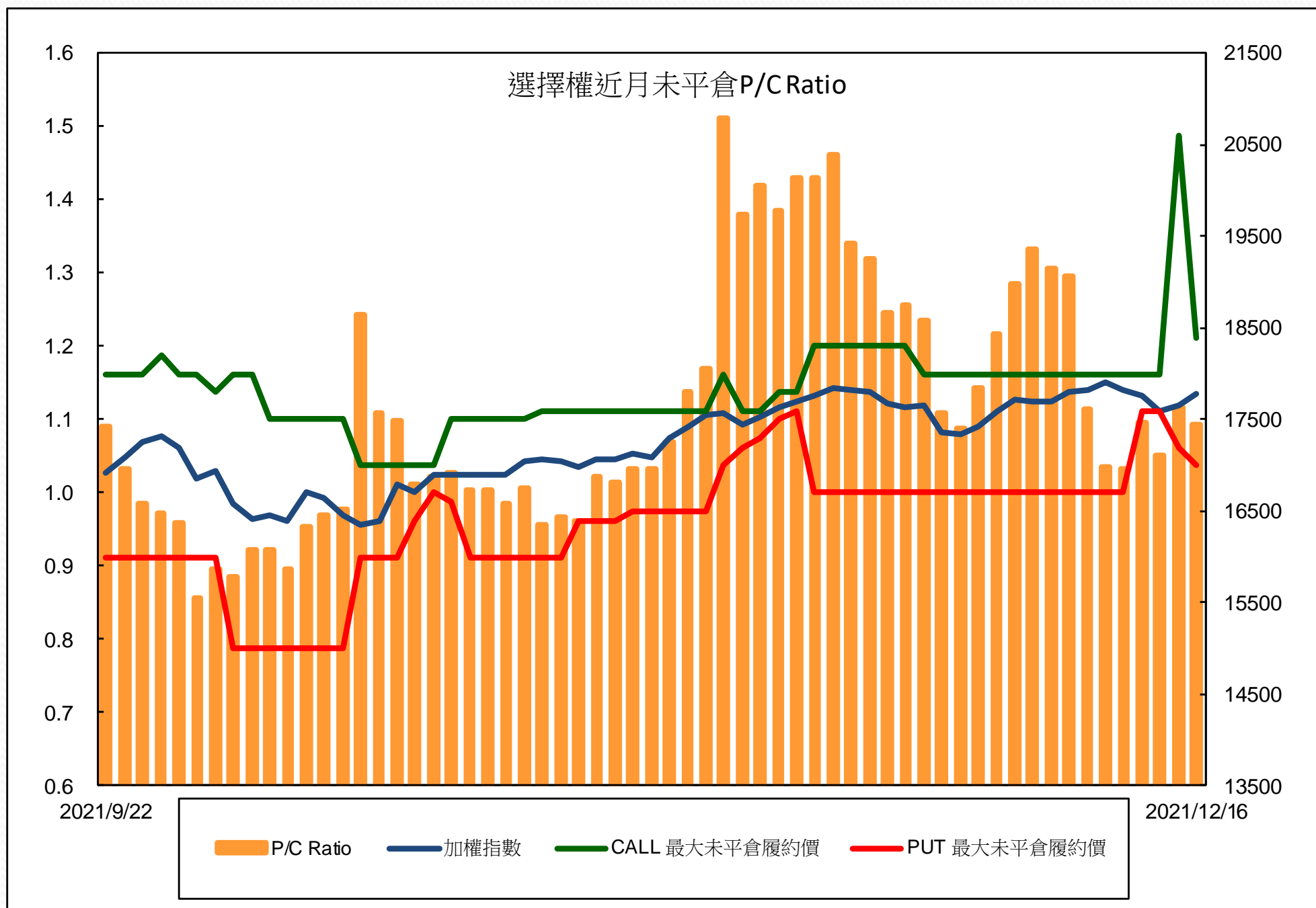
更新日期：2021年12月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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15日	27,512	25,254	2,258
	12月16日	37,258	35,098	2,160
Put	12月15日	23,274	21,994	1,280
	12月16日	33,374	31,711	1,663

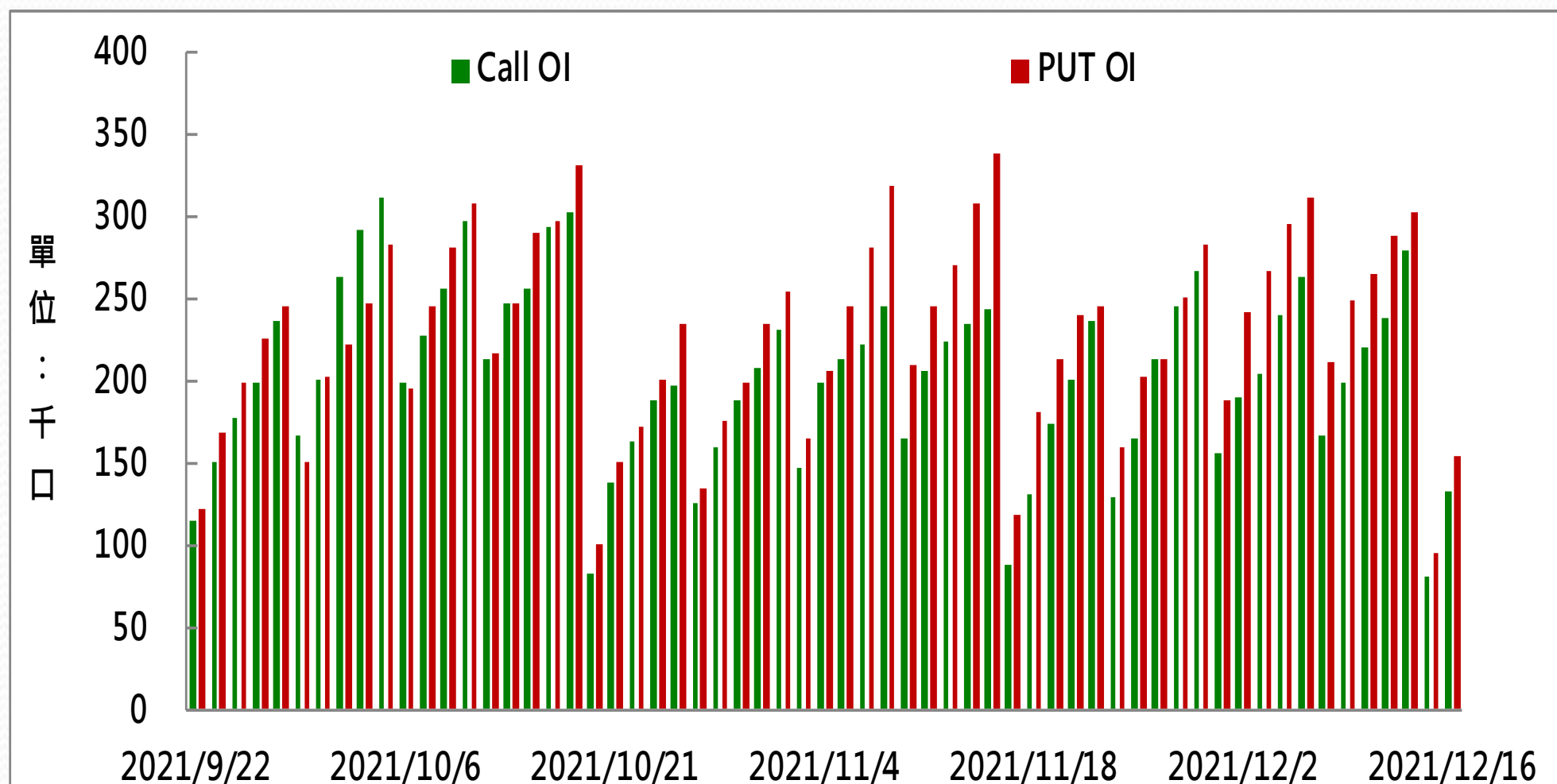
更新日期：2021年12月16日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2021年12月16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16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16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