

台指選擇權OI匯報

日期：2021/12/17 結算日：2021/12/22					日期：2021/12/17 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	1,716	184	0	10	16,000	2,820	-103
0	0	16,800	1,307	202	0	0	16,100	814	75
0	1	16,900	2,750	59	0	1	16,200	1,200	161
-2	15	17,000	5,547	437	0	0	16,300	852	67
4	11	17,100	5,116	1,671	0	0	16,400	1,214	61
1	10	17,150	1,616	29	0	22	16,500	2,034	-88
0	8	17,200	4,389	862	0	13	16,600	1,837	51
0	11	17,250	3,952	215	0	16	16,700	3,143	82
4	38	17,300	5,610	180	0	48	16,800	3,258	-30
6	24	17,350	4,243	538	0	68	16,900	2,128	126
7	268	17,400	5,328	1,495	4	566	17,000	4,238	218
1	74	17,450	3,993	622	148	1,323	17,100	3,771	316
54	427	17,500	6,938	1,611	97	523	17,200	4,049	323
-19	265	17,550	4,571	2,217	195	362	17,300	2,120	718
56	1,026	17,600	8,055	3,347	53	1,107	17,400	1,393	98
-62	1,503	17,650	4,515	2,033	-20	585	17,500	2,404	244
268	2,550	17,700	4,792	1,817	36	2,099	17,600	3,017	114
746	3,140	17,750	3,836	1,805	63	2,221	17,700	2,023	497
1,321	6,047	17,800	3,669	1,555	605	2,865	17,800	1,584	75
1,668	5,774	17,850	1,659	1,028	-213	1,702	17,900	572	29
-594	7,004	17,900	1,020	639	249	4,986	18,000	1,335	50
2,837	6,881	17,950	577	190	189	4,354	18,100	65	11
※ 7,565	16,048	18,000	488	302	※ 1,152	5,108	18,200	52	6
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
27,060	82,130	1.1141	91,498	24,197	4,955	66,516	1.0728	71,358	4,103
昨日 P/C	1.2221	今日增減變化	-0.1080		昨日 P/C	1.0925	今日增減變化	-0.0197	

更新日期：2021年12月17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17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	78,295,437	168,641,687	-90,346,250	4,069,846	3,020,412	2,012,473	1,007,939	36,943
投信	54,009,488	51,145,923	2,863,565	103,761	497,159	0	497,159	-2,015
自營商	59,246,539	8,546,960	50,699,579	-3,275,597	1,433,464	1,219,062	214,402	-113,732
	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	672,480	3,678,466	-3,005,986	-225,834	38,677	282,509	-243,832	-4,464
投信	20,174	0	20,174	64	1,682	0	1,682	8
自營商	620,360	112,618	507,742	56,948	277,464	62,219	215,245	4,334

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17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	20,357	14,867	5,490	305	49,478	23,593	25,885	3,045
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	48,109	40,952	7,157	4,997	33,250	41,222	-7,972	-9,635
特定法人(週)	2,081	0	2,081	140	0	5,618	-5,618	-2,890
特定法人(近月)	10,763	12,111	-1,348	3	7,333	24,473	-17,140	1,354
特定法人(全月)	14,943	8,117	6,826	2,337	16,147	40,629	-24,482	-2,646
十大交易人(週)	26,514	27,407	-893	-980	31,009	22,565	8,444	4,649
十大交易人(近月)	34,425	31,804	2,621	1,601	31,148	45,271	-14,123	-794
十大交易人(全月)	69,892	55,258	14,634	3,098	67,506	78,660	-11,154	1,470
全市場未沖銷(近月)			66,516	4,955			71,358	4,103
全市場未沖銷(全月)			165,813	32,338			183,465	29,343

更新日期：2021年12月17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	18000
	賣權成交最大量	17700	賣權OI最大量	17600
	整體隱含波動率	11.72%	較前一交易日	+0.28%
	買權隱含波動率	9.94%	較前一交易日	-1.81%
	賣權隱含波動率	13.48%	較前一交易日	+2.35%
電子選擇權	買權成交最大量	850	買權OI最大量	840
	賣權成交最大量	830	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	1680
	賣權成交最大量	1680	賣權OI最大量	1660

更新日期：2021年12月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

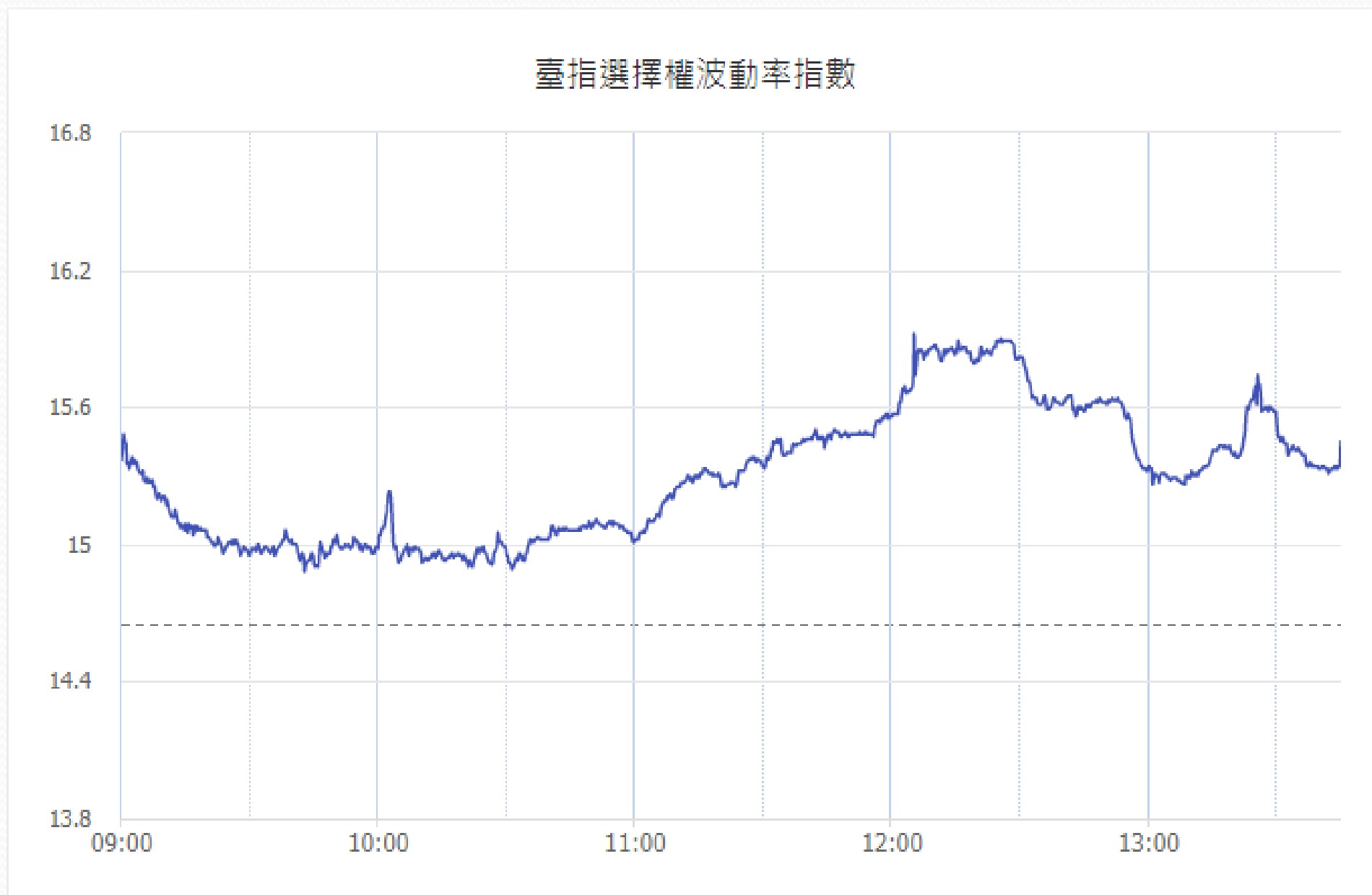
台指選擇權匯報

2022年01月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	18200	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	14.54%	較前一交易日	+0.12%
	買權隱含波動率	11.66%	較前一交易日	-0.80%
	賣權隱含波動率	17.62%	較前一交易日	+0.91%
	成交量P/C_Ratio值	0.874	較前一交易日	-0.13
	未平倉P/C_Ratio值	1.073	較前一交易日	-0.02
電子選擇權	買權成交最大量	850	買權OI最大量	840
	賣權成交最大量	830	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	1680
	賣權成交最大量	1680	賣權OI最大量	1660

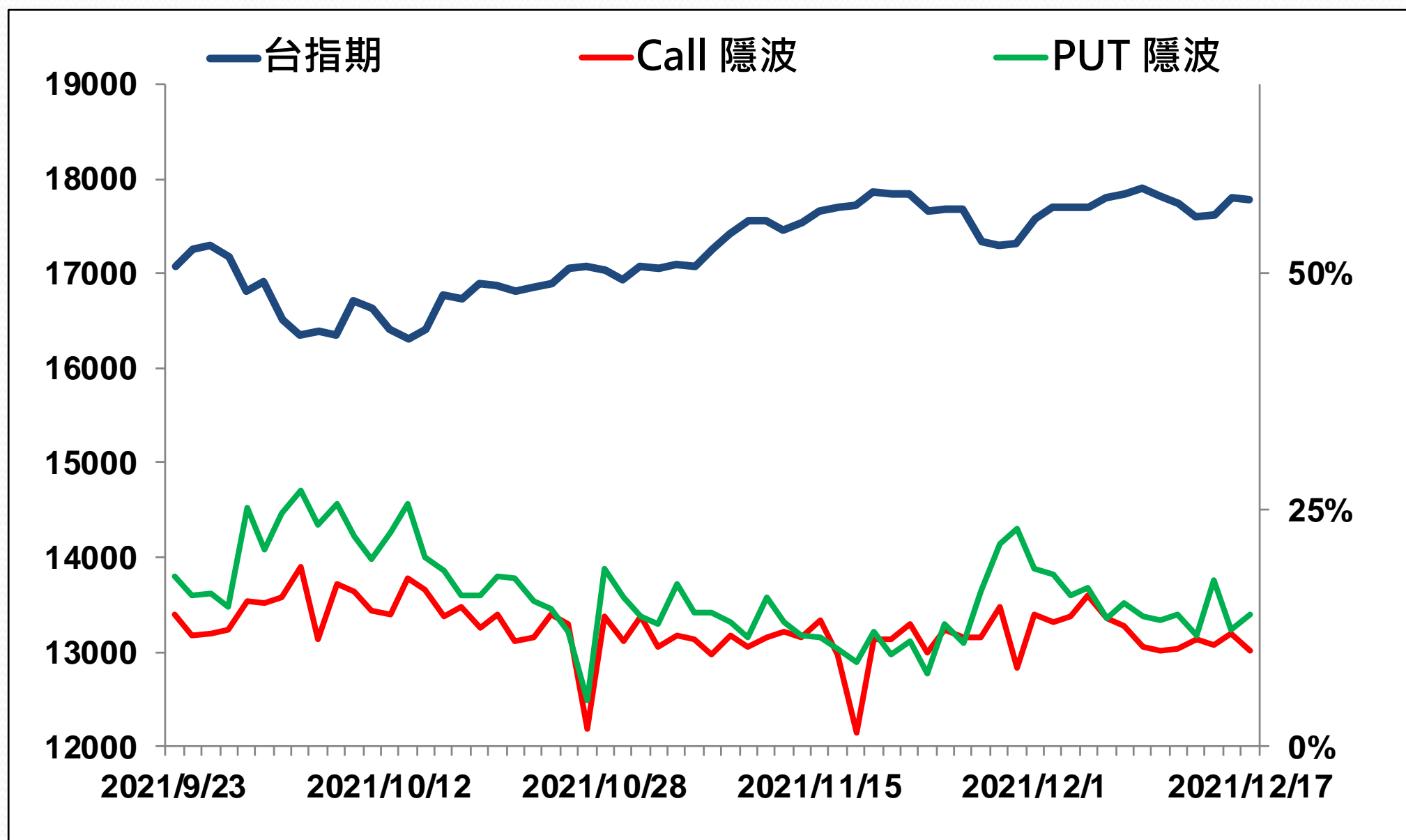
更新日期：2021年12月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



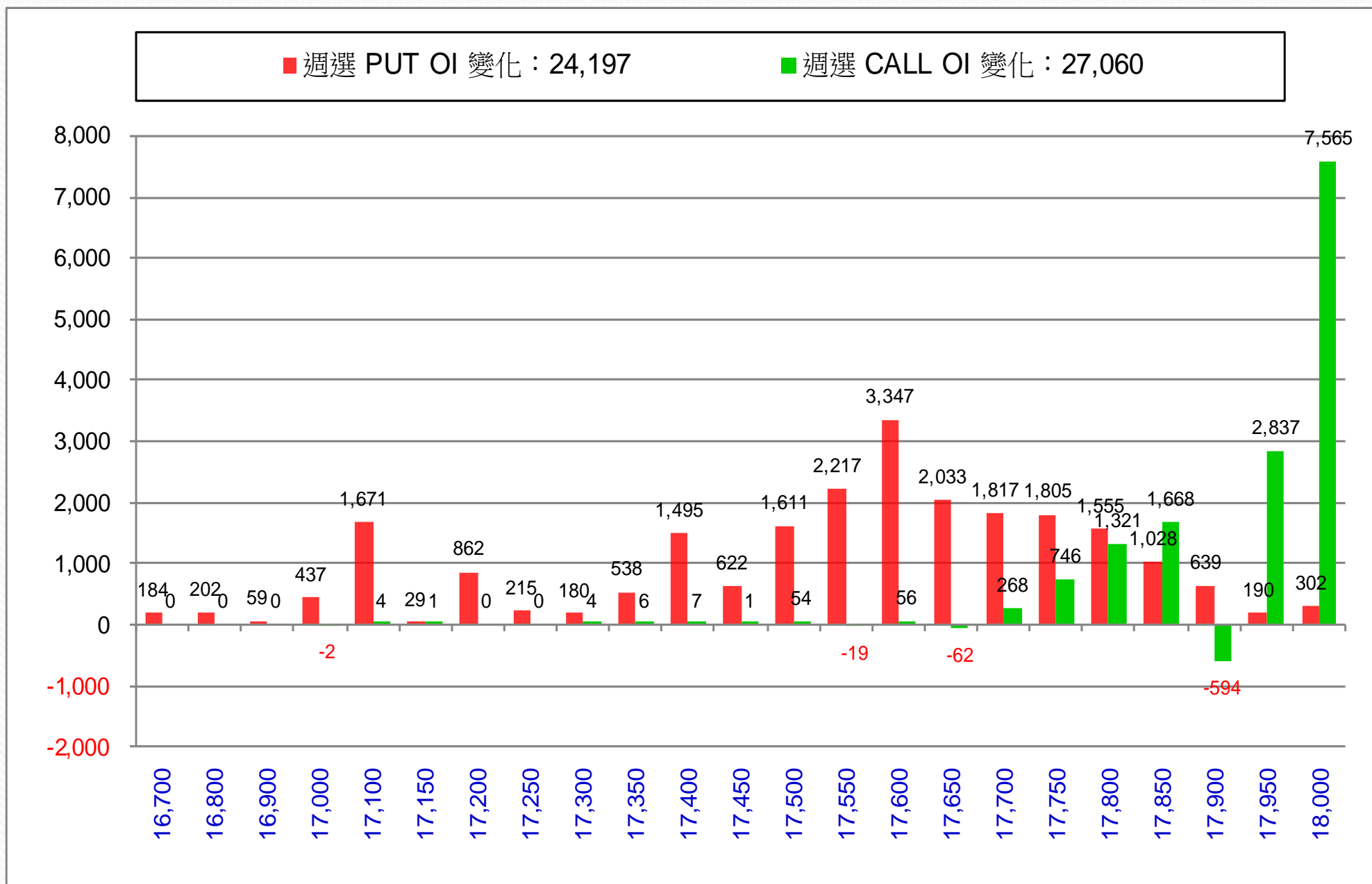
更新日期：2021年12月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



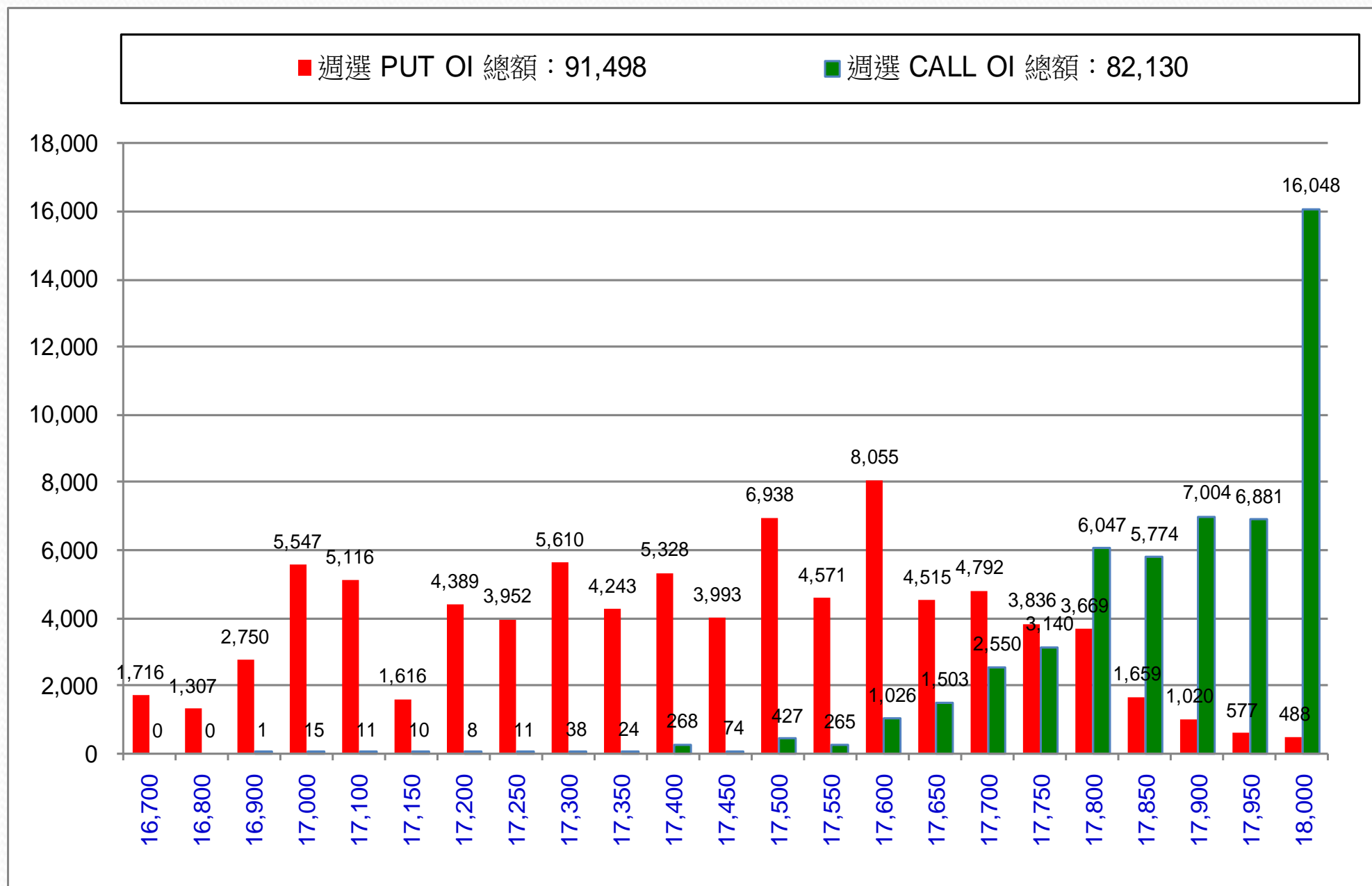
更新日期：2021年12月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2021年12月17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



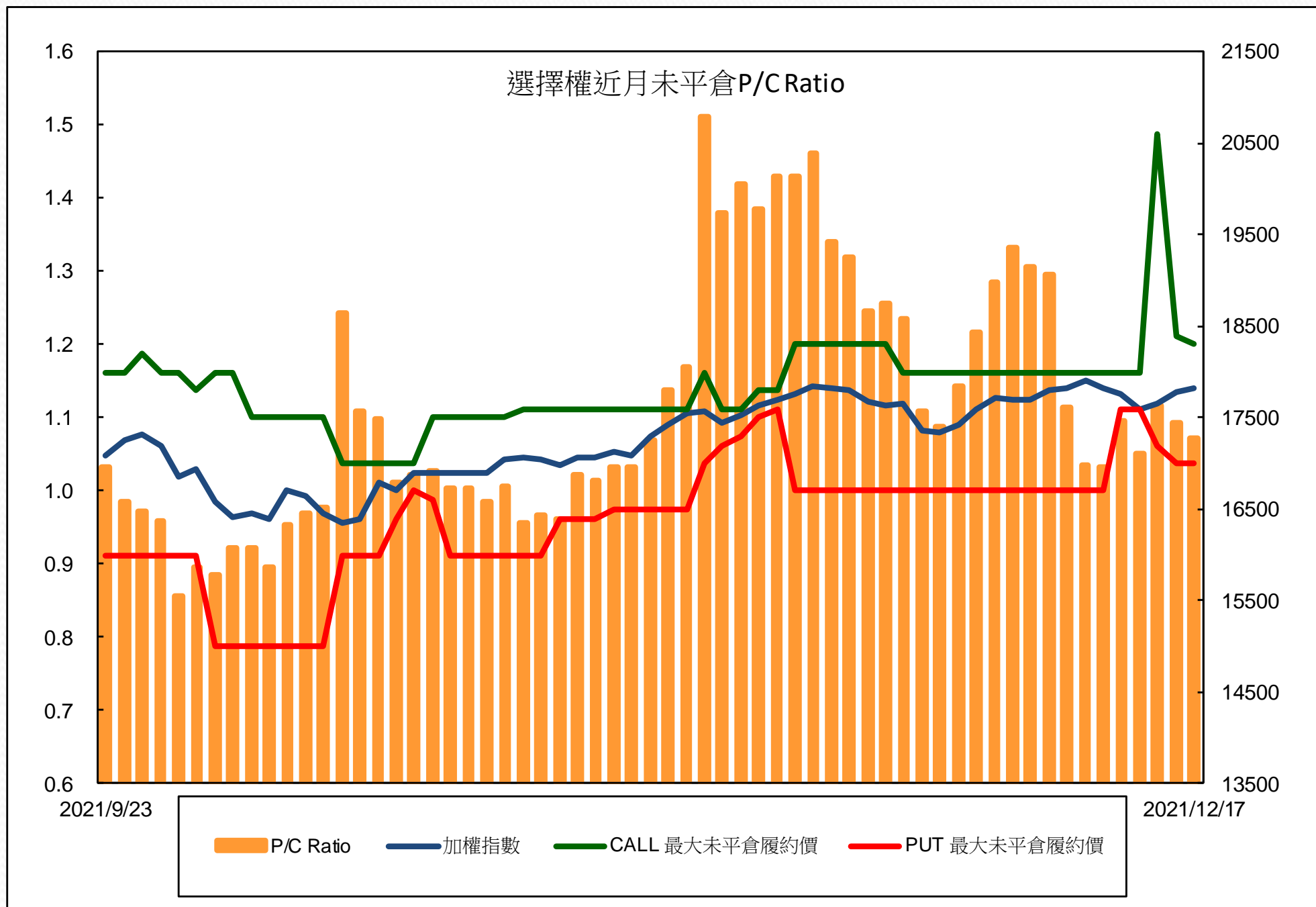
更新日期：2021年12月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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16日	37,258	35,098	2,160
	12月17日	48,109	40,952	7,157
Put	12月16日	33,374	31,711	1,663
	12月17日	33,250	41,222	-7,972

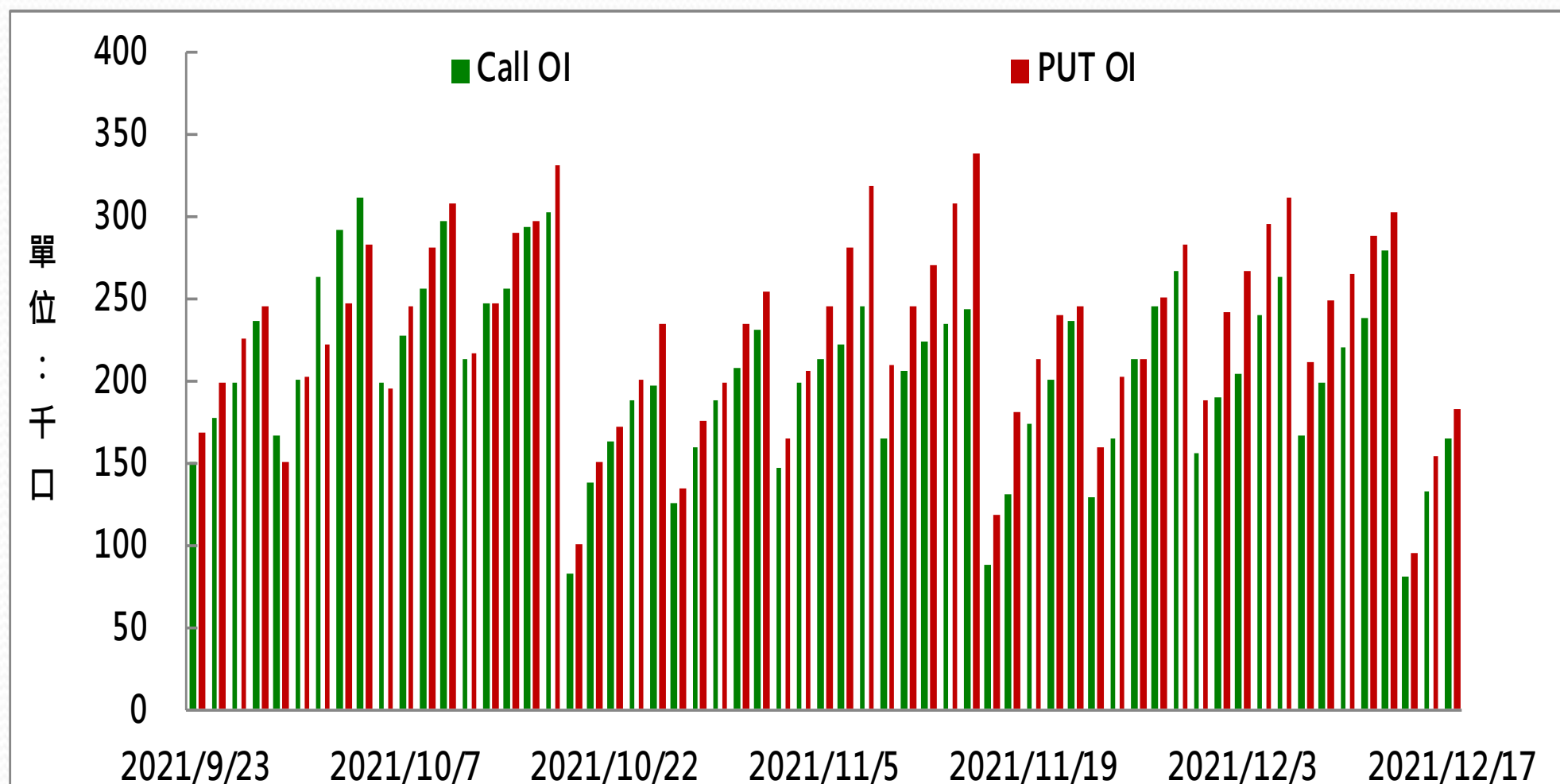
更新日期：2021年12月17日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2021年12月17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17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17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