

台指選擇權OI匯報

日期：2021/12/21 結算日：2021/12/22					日期：2021/12/21 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
69	248	17,400	8,428	435	18	581	17,000	5,028	408
26	159	17,450	5,553	-854	-4	1,588	17,100	4,062	338
268	906	17,500	9,538	-683	29	556	17,200	4,174	254
283	929	17,550	6,878	1,794	-5	391	17,300	2,897	756
9	2,645	17,600	12,056	3,208	6	1,176	17,400	1,534	5
-420	3,612	17,650	9,324	5,086	-60	672	17,500	2,946	730
-3,191	6,325	17,700	10,439	6,459	163	2,412	17,600	3,376	309
-1,323	7,073	17,750	8,681	5,325	-5	3,034	17,700	2,597	498
-2,314	9,405	17,800	8,421	5,370	69	3,349	17,800	1,824	145
-2,631	10,438	17,850	7,381	5,922	-20	2,210	17,900	579	6
※ 948	15,733	17,900	2,405	1,178	681	6,659	18,000	1,396	10
570	9,209	17,950	742	178	350	5,332	18,100	71	11
-24	16,384	18,000	627	192	※ 1,220	7,017	18,200	60	0
-1,339	8,994	18,050	83	5	49	7,116	18,300	16	1
-399	7,742	18,100	60	10	137	6,921	18,400	65	0
-144	5,544	18,150	5	0	322	6,154	18,500	3	1
-410	3,592	18,200	26	5	672	5,142	18,600	7	-2
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
-10,312	114,339	1.2054	137,828	32,178	3,998	77,215	1.0577	81,670	6,975
昨日 P/C	0.8476	今日增減變化	0.3579		昨日 P/C	1.0202	今日增減變化	0.0375	

更新日期：2021年12月21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21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	78,667,517	169,053,698	-90,386,181	3,238,038	3,005,954	2,665,914	340,040	-123,806
投信	54,003,742	51,013,830	2,989,912	1,839,869	496,458	0	496,458	5,723
自營商	64,065,105	10,483,893	53,581,212	-1,780,591	1,798,628	1,278,546	520,082	318,592
	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	644,506	3,747,865	-3,103,359	118,416	93,055	279,164	-186,109	34,225
投信	20,141	0	20,141	161	1,692	0	1,692	23
自營商	688,142	68,812	619,330	31,585	345,128	153,941	191,187	7,575

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21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	24,397	18,287	6,110	1,815	53,999	26,563	27,436	585
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	56,092	53,323	2,769	8,538	42,341	46,680	-4,339	-12,146
特定法人(週)	3,108	0	3,108	-517	0	5,674	-5,674	-1,602
特定法人(近月)	10,852	15,213	-4,361	-1,856	6,912	26,646	-19,734	-1,038
特定法人(全月)	18,792	9,133	9,659	6,252	15,445	41,718	-26,273	-2,473
十大交易人(週)	35,852	36,472	-620	6,656	39,918	30,325	9,593	12,486
十大交易人(近月)	37,615	35,537	2,078	756	33,118	49,631	-16,513	-906
十大交易人(全月)	80,418	66,844	13,574	8,365	77,466	88,769	-11,303	11,513
全市場未沖銷(近月)			77,215	3,998			81,670	6,975
全市場未沖銷(全月)			209,577	-5,439			241,467	39,847

更新日期：2021年12月21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	17600
	整體隱含波動率	11.86%	較前一交易日	-0.26%
	買權隱含波動率	12.92%	較前一交易日	+2.75%
	賣權隱含波動率	10.92%	較前一交易日	-10.05%
電子選擇權	買權成交最大量	860	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	820	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	1680
	賣權成交最大量	1620	賣權OI最大量	1660

更新日期：2021年12月21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	18300
	賣權成交最大量	17000	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	15.61%	較前一交易日	+0.19%
	買權隱含波動率	12.82%	較前一交易日	+0.66%
	賣權隱含波動率	18.13%	較前一交易日	-2.51%
	成交量P/C_Ratio值	1.035	較前一交易日	+0.26
	未平倉P/C_Ratio值	1.058	較前一交易日	+0.04
電子選擇權	買權成交最大量	860	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	820	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	1680
	賣權成交最大量	1620	賣權OI最大量	1660

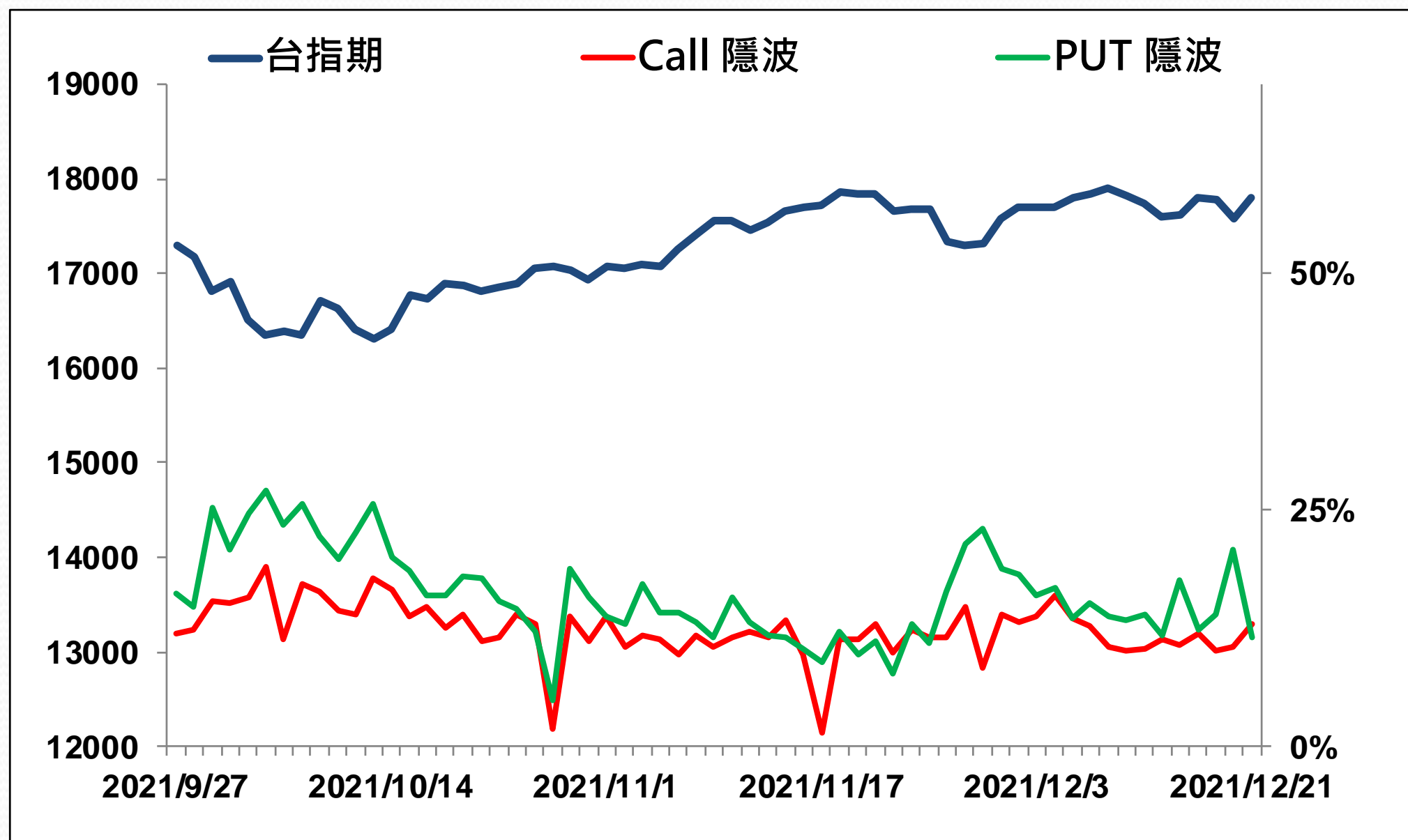
更新日期：2021年12月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權當日波動率指數



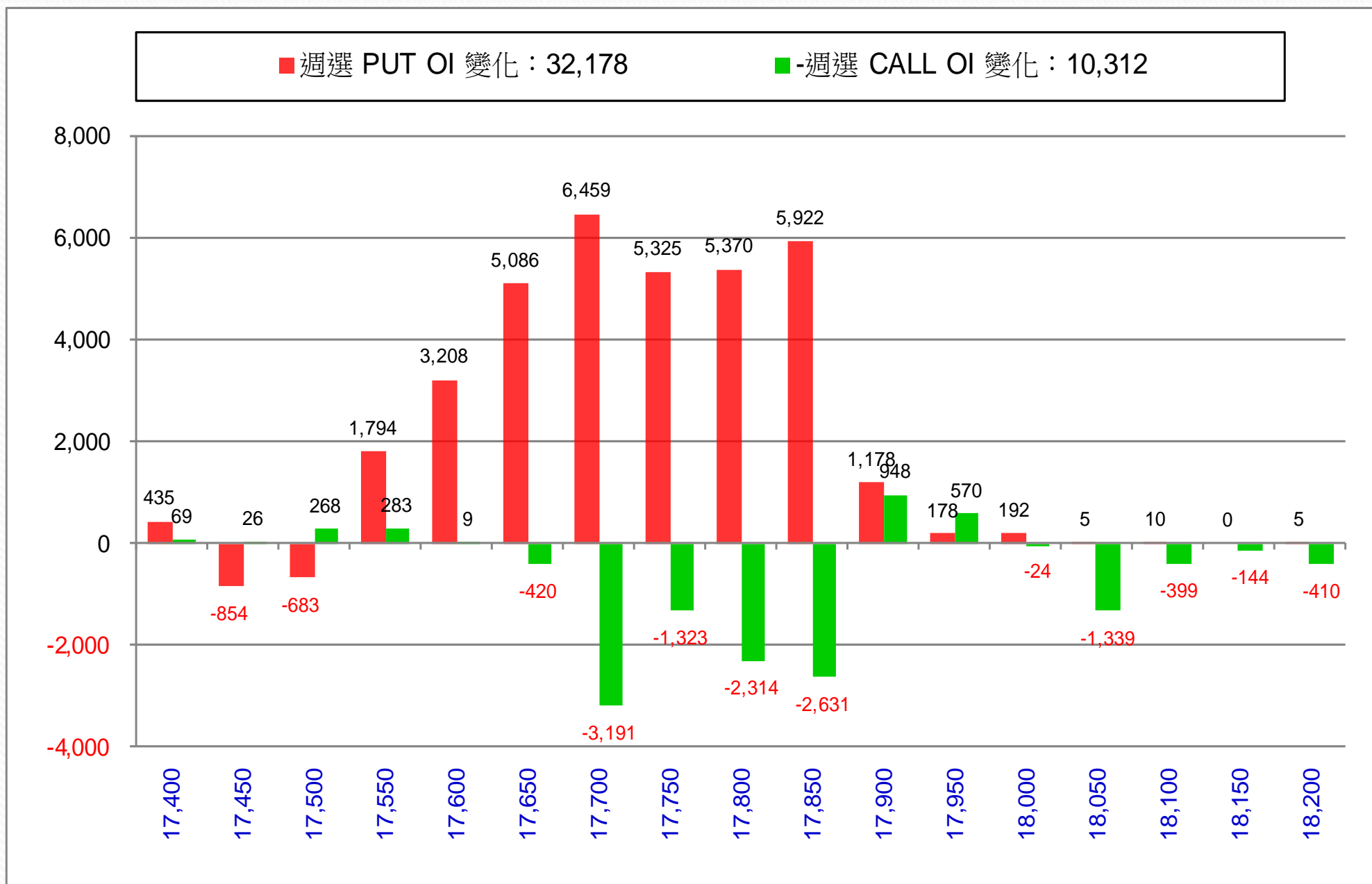
更新日期：2021年12月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2021年12月21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

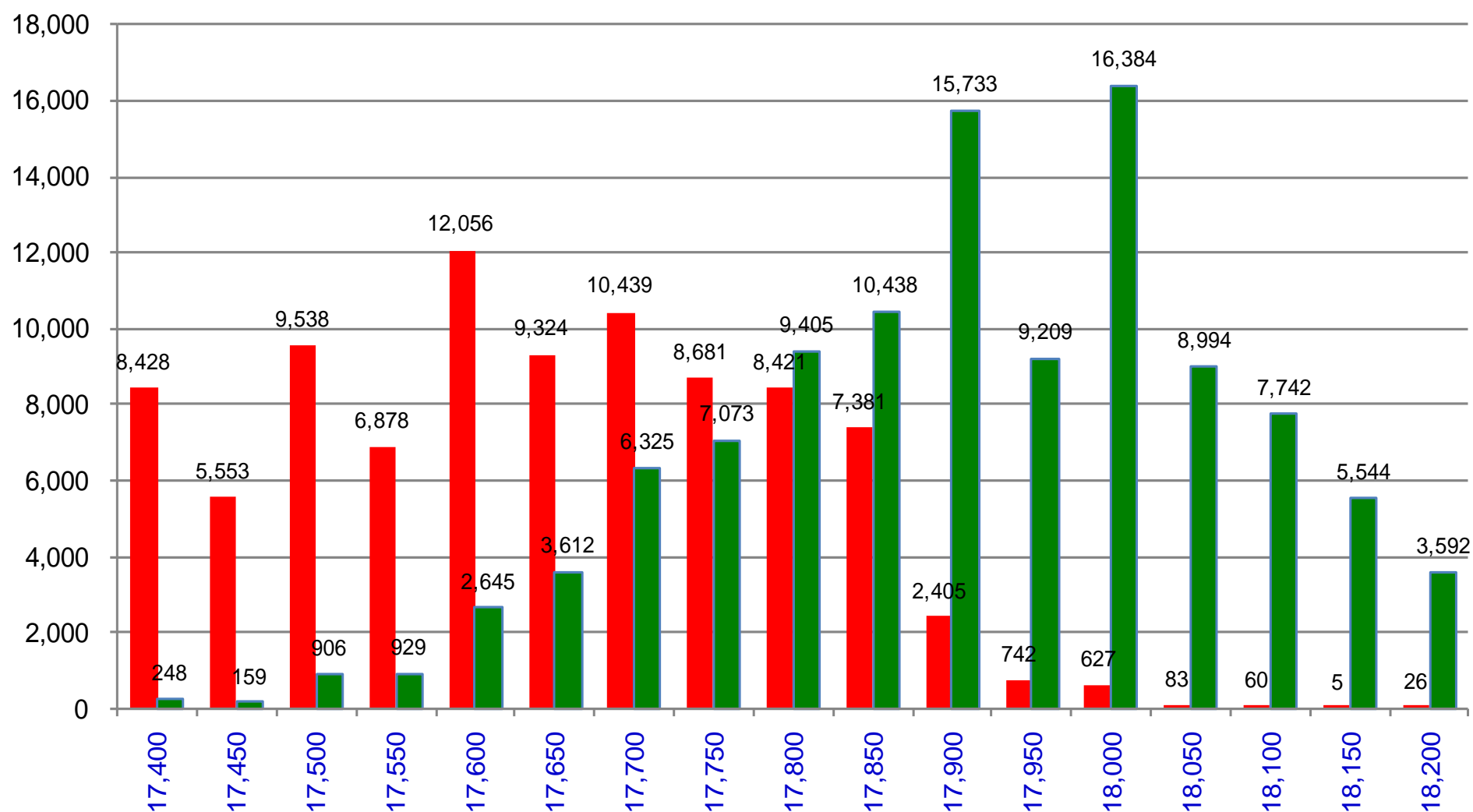


更新日期：2021年12月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

■ 週選 PUT OI 總額：137,828

■ 週選 CALL OI 總額：114,339



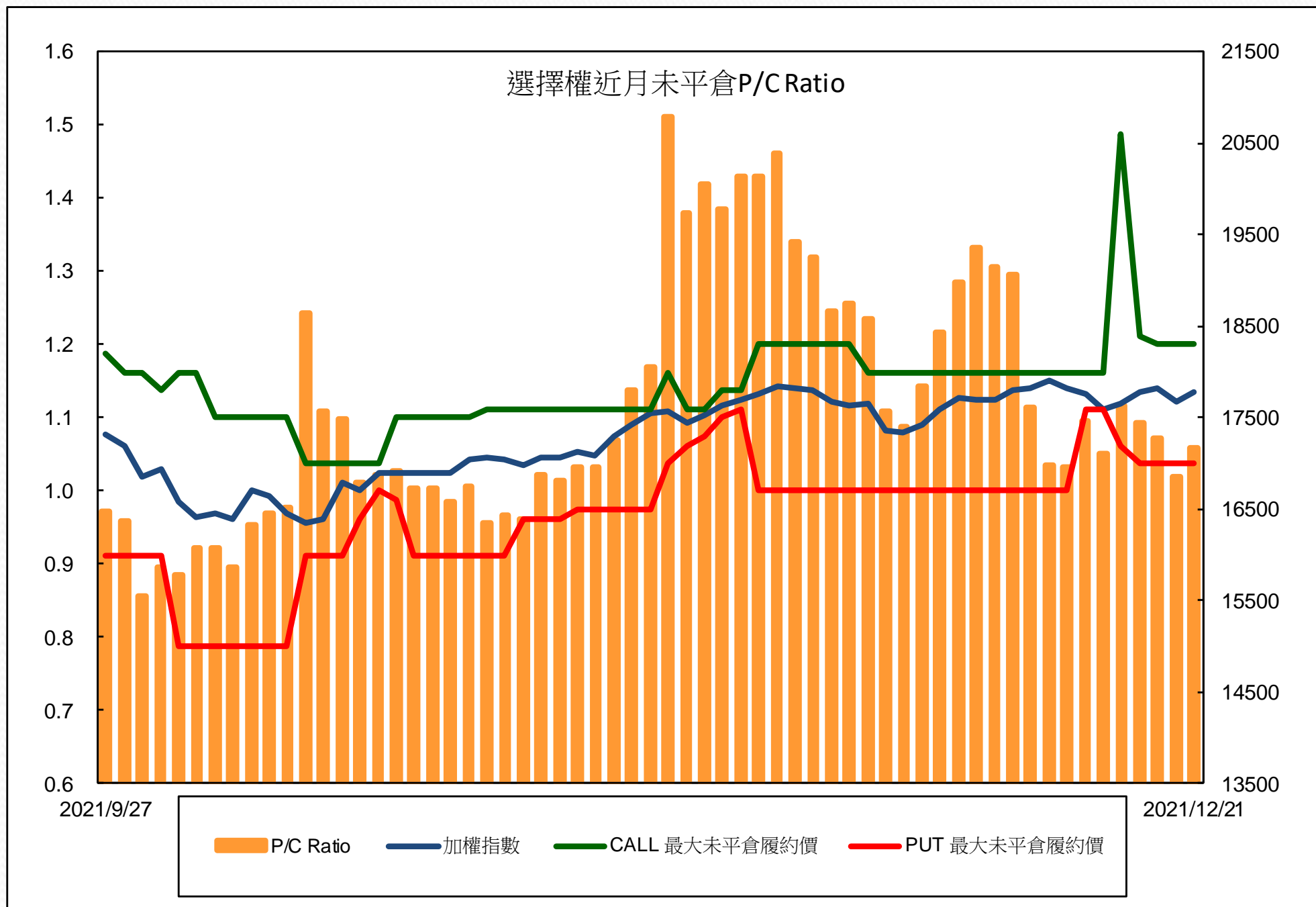
更新日期：2021年12月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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20日	49,920	55,689	-5,769
	12月21日	56,092	53,323	2,769
Put	12月20日	43,714	35,907	7,807
	12月21日	42,341	46,680	-4,339

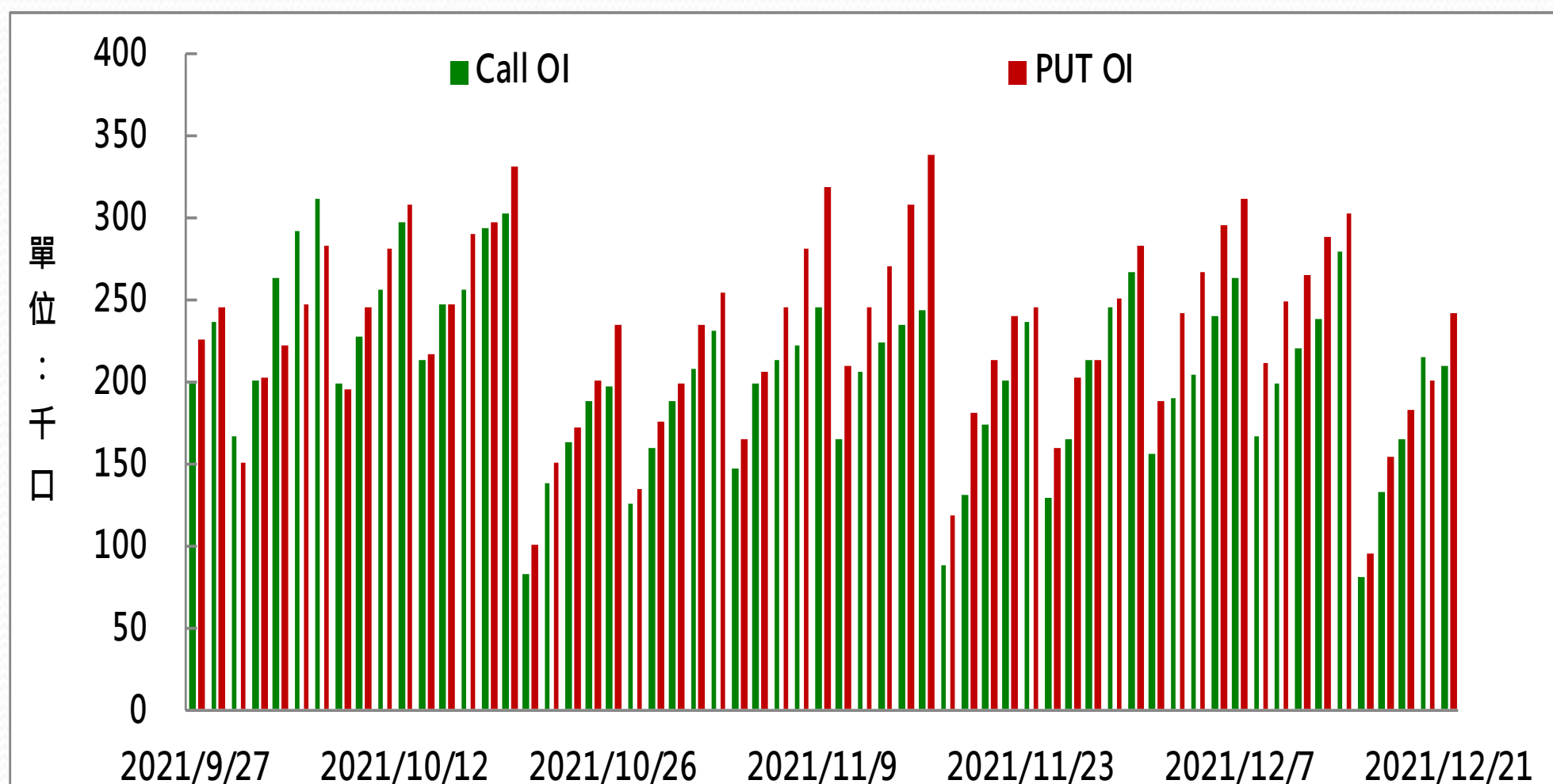
更新日期：2021年12月21日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2021年12月21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21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21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