

# 台指選擇權OI匯報

日期：2021/12/22 結算日：2021/12/29					日期：2021/12/22 結算日：2022/1/19				
202112W5					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	16,900	1,308	1,308	0	0	16,300	1,002	2
1	1	17,000	1,316	1,316	0	0	16,400	1,451	-16
0	0	17,100	728	728	0	22	16,500	2,581	-120
3	3	17,200	1,393	1,393	0	14	16,600	2,463	29
0	0	17,300	2,495	2,495	0	16	16,700	3,266	-69
5	5	17,350	917	917	0	48	16,800	3,911	126
0	0	17,400	1,422	1,422	0	69	16,900	3,183	223
2	2	17,450	1,927	1,927	-20	561	17,000	5,694	666
52	52	17,500	2,016	2,016	0	1,588	17,100	4,180	118
13	13	17,550	1,658	1,658	-3	553	17,200	4,262	88
75	75	17,600	3,397	3,397	9	400	17,300	2,868	-29
48	48	17,650	1,281	1,281	2	1,178	17,400	2,475	941
195	195	17,700	1,376	1,376	-16	656	17,500	2,519	-427
178	178	17,750	910	910	-58	2,354	17,600	3,451	75
864	864	17,800	1,674	1,674	-199	2,835	17,700	2,573	-24
1,140	1,140	17,850	988	988	210	3,559	17,800	1,855	31
1,470	1,470	17,900	502	502	499	2,709	17,900	595	16
1,473	1,473	17,950	122	122	-489	6,170	18,000	1,332	-64
2,675	2,675	18,000	189	189	805	6,137	18,100	79	8
1,633	1,633	18,050	51	51	442	7,459	18,200	54	-6
※ 2,841	2,841	18,100	73	73	※ 1,036	8,152	18,300	20	4
2,300	2,300	18,150	3	3	345	7,266	18,400	65	0
1,510	1,510	18,200	13	13	498	6,652	18,500	4	1
1,129	1,129	18,250	1	1	269	5,411	18,600	7	0
783	783	18,300	1	1	182	1,805	18,700	1	1
420	420	18,400	1	1	234	2,821	18,800	214	0
231	231	18,500	0	0	71	936	18,900	0	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
19,051	19,051	1.4185	27,023	27,023	3,819	81,034	1.0316	83,592	1,922
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化	1.4185		昨日 P/C	1.0577	今日增減變化	-0.0261	

更新日期：2021年12月22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22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	75,584,810	161,804,783	-86,219,973	4,166,208	2,929,384	2,567,478	361,906	21,866
投信	54,230,678	51,081,363	3,149,315	159,403	515,544	0	515,544	19,086
自營商	64,001,401	7,710,054	56,291,347	2,710,135	1,874,196	1,317,876	556,320	36,238
	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	632,531	3,825,382	-3,192,851	-89,492	99,657	278,702	-179,045	7,064
投信	33,556	0	33,556	13,415	1,689	0	1,689	-3
自營商	719,774	92,277	627,497	8,167	381,717	209,426	172,291	-18,896

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22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	19,566	16,855	2,711	-3,399	48,444	22,971	25,473	-1,963
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	36,799	36,558	241	-2,528	34,215	30,324	3,891	8,230
特定法人(週)	698	500	198	---	0	2,918	-2,918	---
特定法人(近月)	10,885	15,349	-4,464	-103	7,087	25,718	-18,631	1,103
特定法人(全月)	15,207	11,323	3,884	-5,775	18,808	40,881	-22,073	4,200
十大交易人(週)	6,749	8,942	-2,193	---	14,226	13,384	842	---
十大交易人(近月)	39,499	36,446	3,053	975	34,257	49,634	-15,377	1,136
十大交易人(全月)	58,788	46,788	12,000	-1,574	55,811	76,481	-20,670	-9,367
全市場未沖銷(近月)			81,034	3,819			83,592	1,922
全市場未沖銷(全月)			118,488	-91,089			132,746	-108,721

更新日期：2021年12月22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12W5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	18100
	賣權成交最大量	17600	賣權OI最大量	17600
	整體隱含波動率	11.10%	較前一交易日	-0.76%
	買權隱含波動率	10.35%	較前一交易日	-2.58%
	賣權隱含波動率	11.75%	較前一交易日	+0.83%
電子選擇權	買權成交最大量	850	買權OI最大量	850
	賣權成交最大量	845	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	1640	賣權OI最大量	1660

更新日期：2021年12月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

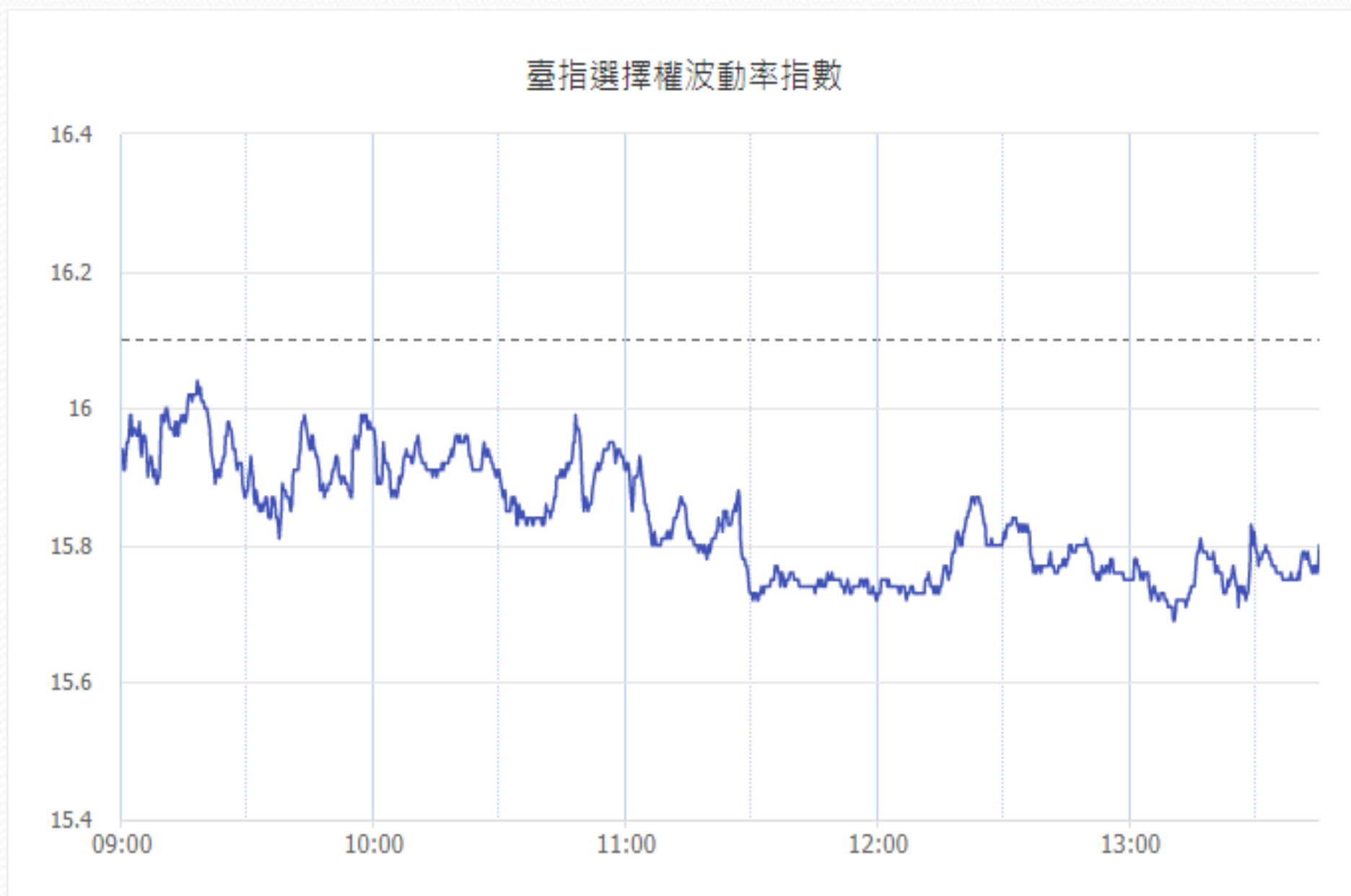
# 台指選擇權匯報

## 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	14.59%	較前一交易日	+1.01%
	買權隱含波動率	12.46%	較前一交易日	-0.36%
	賣權隱含波動率	17.01%	較前一交易日	-1.12%
	成交量P/C_Ratio值	0.879	較前一交易日	-0.16
	未平倉P/C_Ratio值	1.032	較前一交易日	-0.03
電子選擇權	買權成交最大量	850	買權OI最大量	850
	賣權成交最大量	845	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	1640	賣權OI最大量	1660

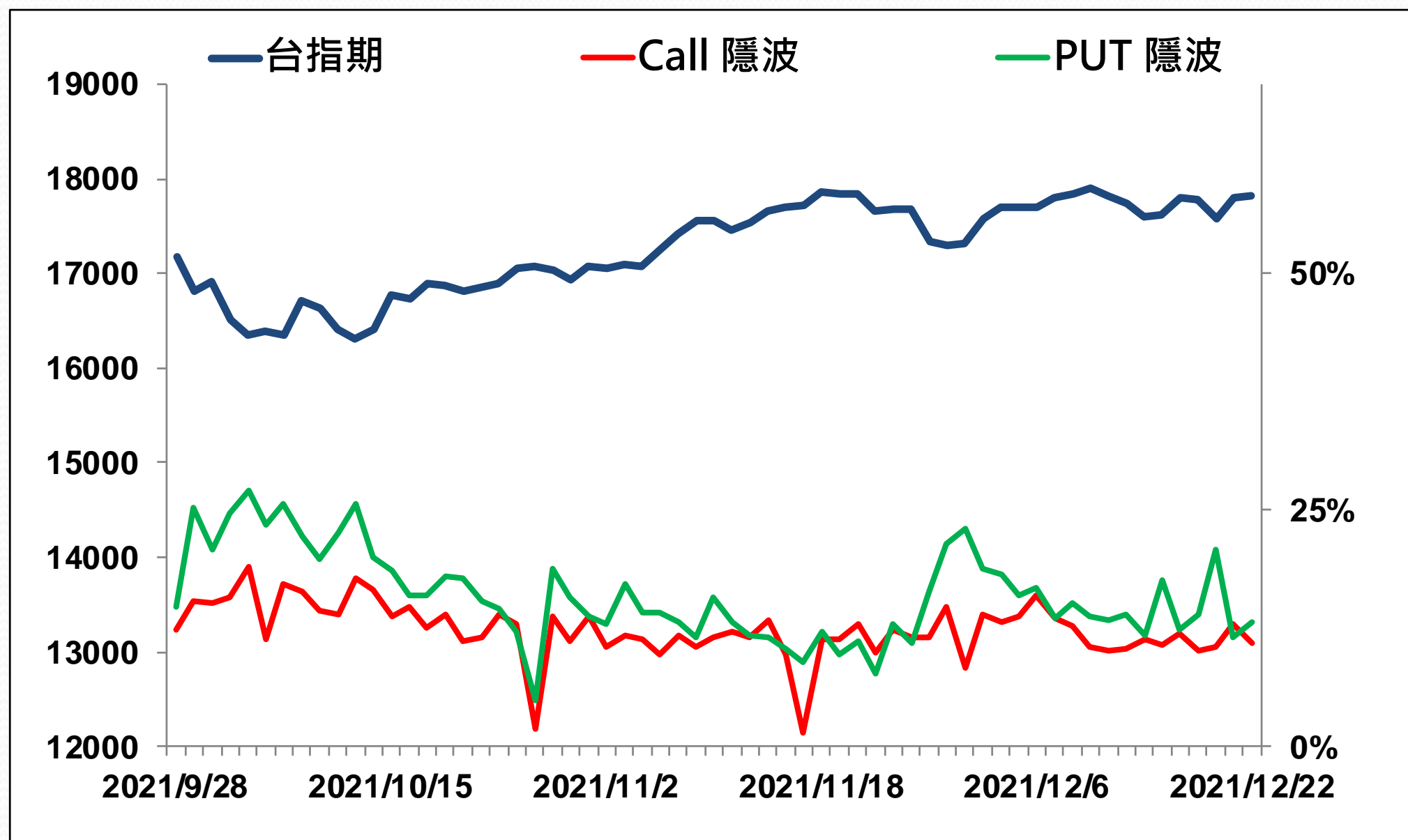
更新日期：2021年12月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權當日波動率指數



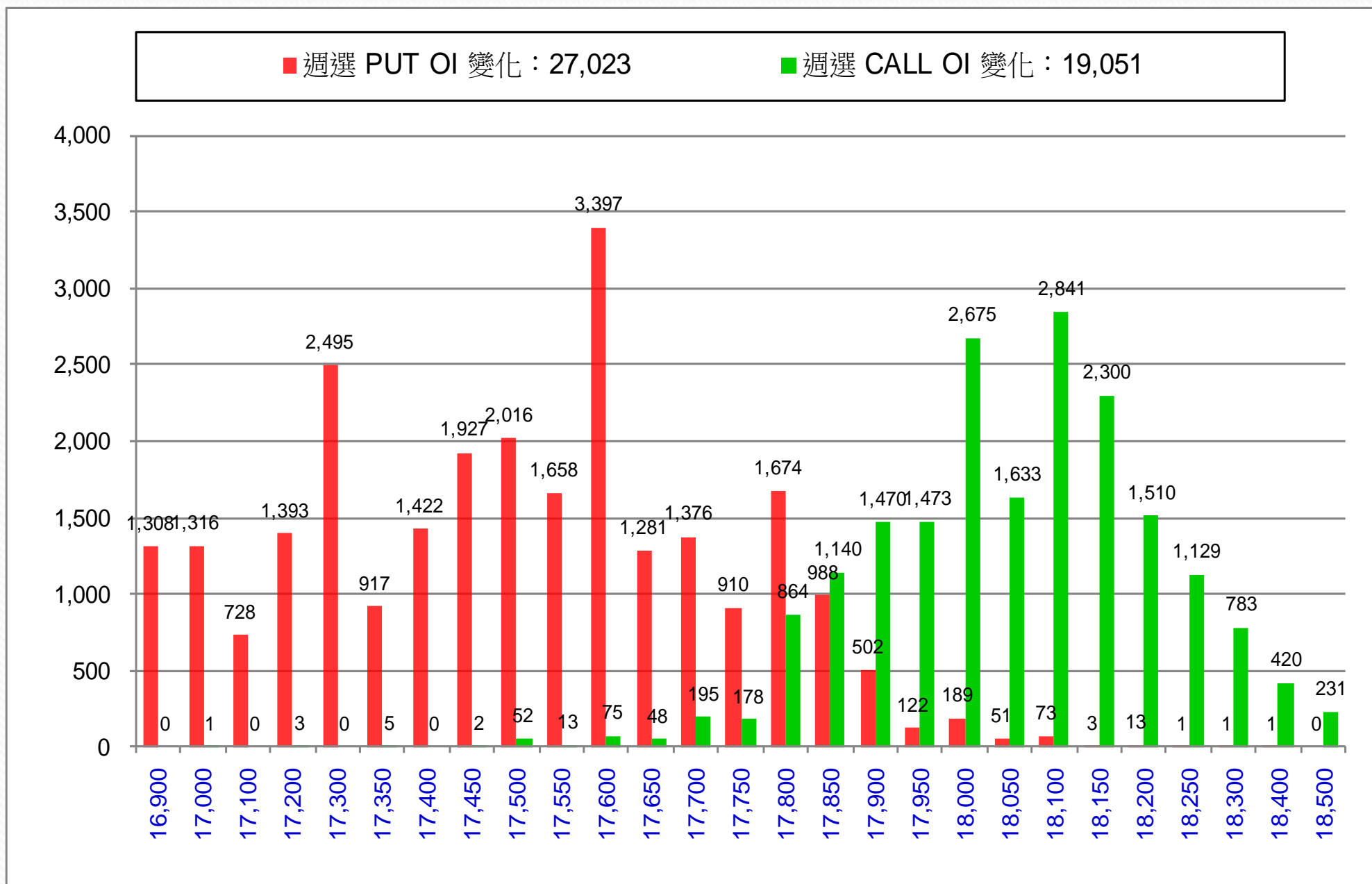
更新日期：2021年12月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2021年12月22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

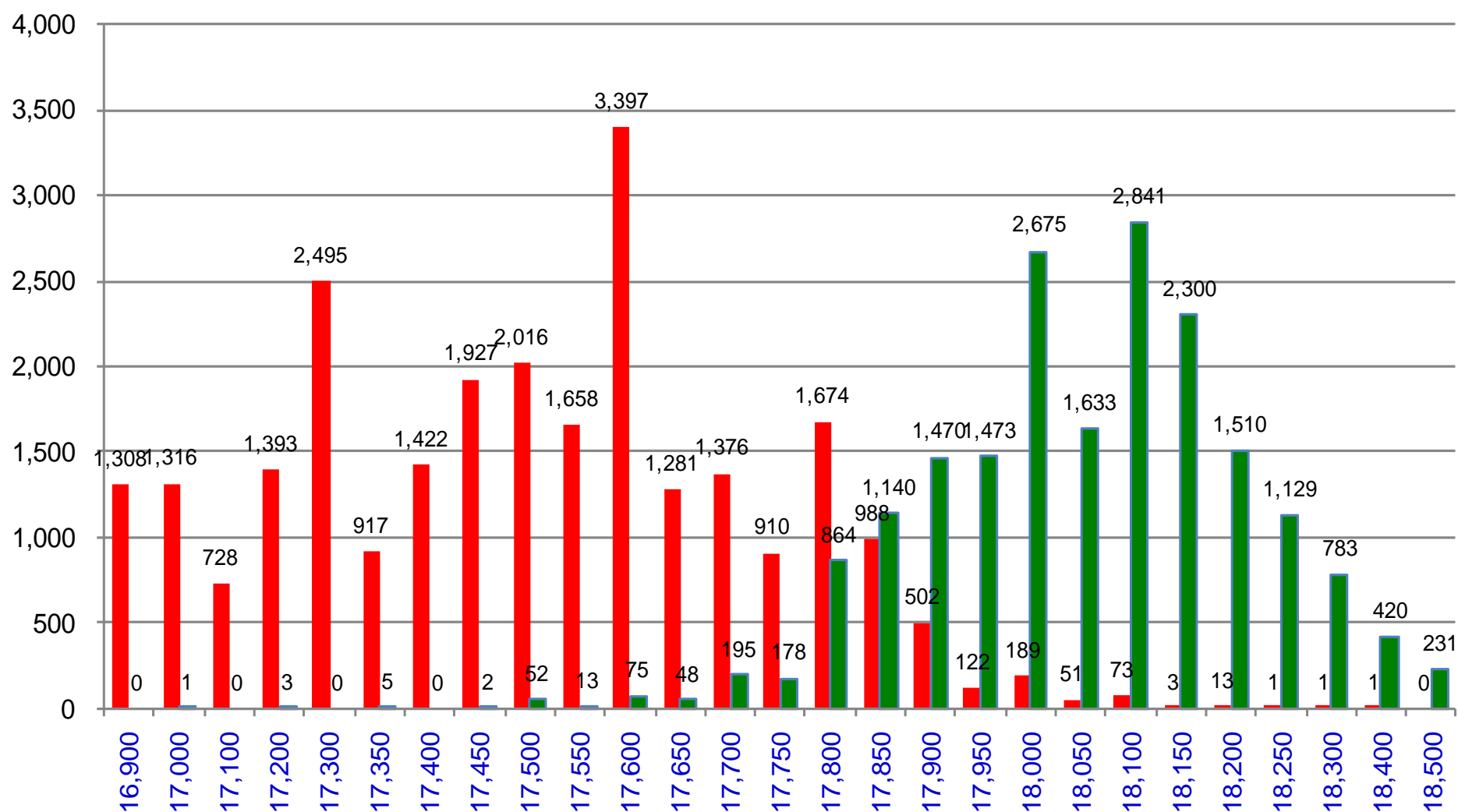


更新日期：2021年12月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：27,023

週選 CALL OI 總額：19,051



更新日期：2021年12月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

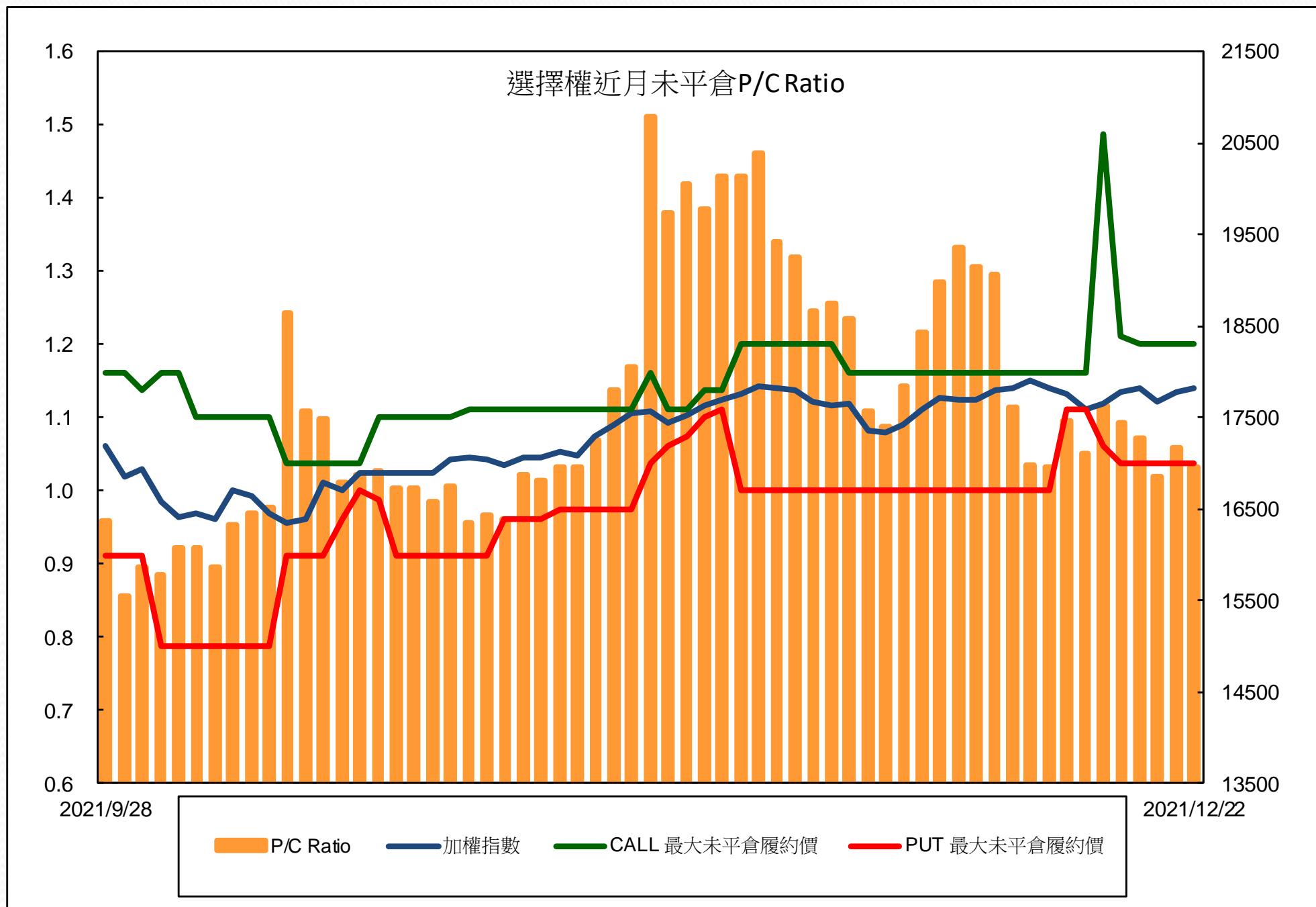


# 自營商選擇權OI部位統計

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21日	56,092	53,323	2,769
	12月22日	36,799	36,558	241
Put	12月21日	42,341	46,680	-4,339
	12月22日	34,215	30,324	3,891

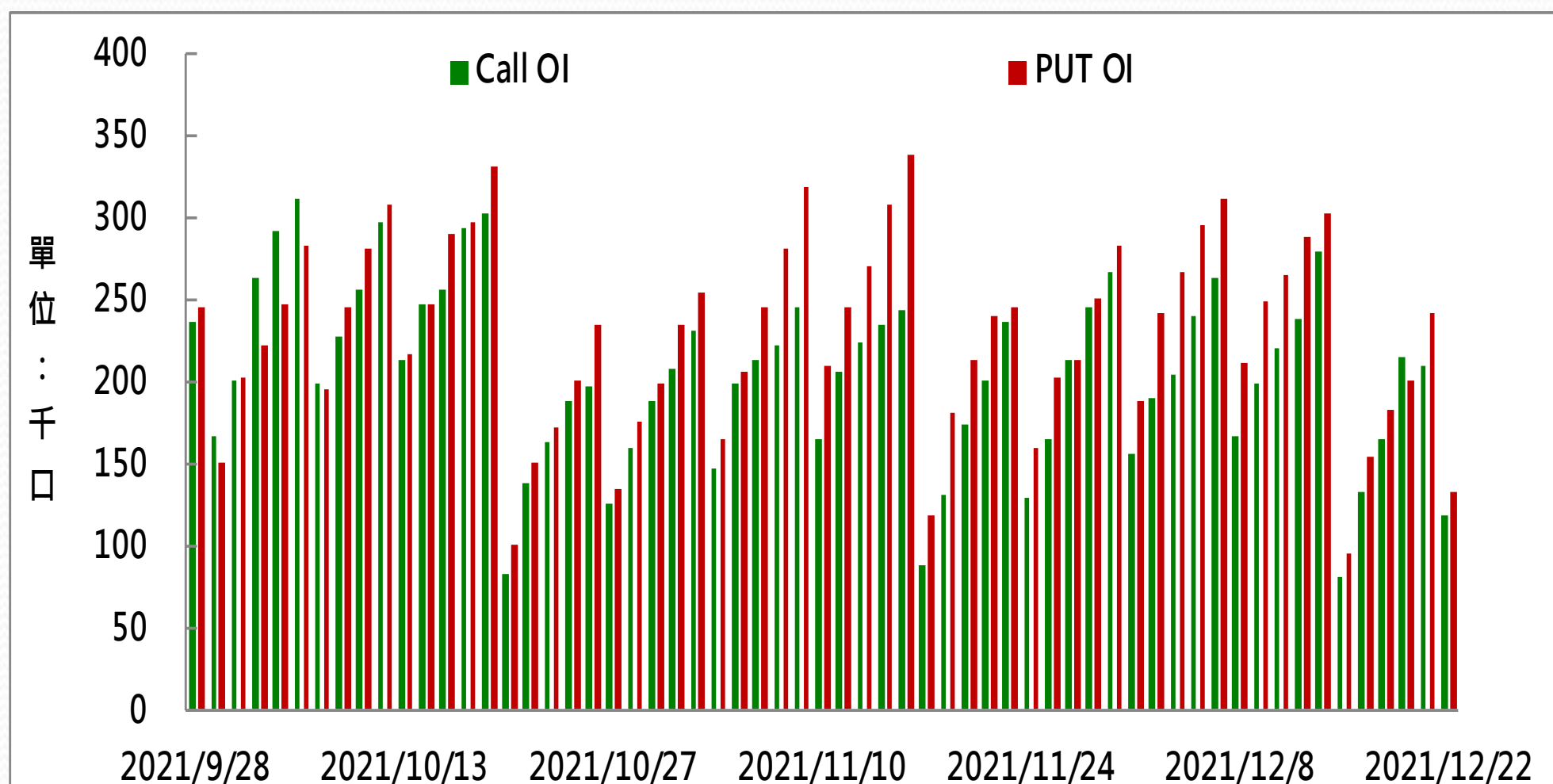
更新日期：2021年12月22日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2021年12月22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22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22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