

# 台指選擇權OI匯報

日期：2021/12/24 結算日：2021/12/29					日期：2021/12/24 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	17,100	1,330	-346	0	10	16,500	1,986	-259
0	3	17,200	2,618	92	0	14	16,600	1,841	-494
0	0	17,300	2,947	211	0	16	16,700	3,279	-130
0	5	17,350	3,249	356	0	48	16,800	4,257	231
0	21	17,400	2,220	52	0	69	16,900	2,908	-235
-1	3	17,450	4,406	231	-1	558	17,000	6,010	183
-15	56	17,500	5,139	450	0	1,586	17,100	4,311	-8
-3	46	17,550	4,828	-173	-7	542	17,200	4,216	-80
-2	82	17,600	5,424	232	-6	357	17,300	4,129	989
-15	77	17,650	5,892	207	-15	1,150	17,400	3,797	830
10	285	17,700	6,378	1,494	5	591	17,500	3,997	886
-49	329	17,750	8,241	1,554	-16	2,161	17,600	4,465	595
23	803	17,800	8,205	3,813	-67	2,665	17,700	3,102	370
-61	1,071	17,850	6,454	3,223	-135	3,229	17,800	2,467	174
-1,054	1,921	17,900	4,851	1,758	-57	3,876	17,900	1,195	62
135	3,194	17,950	5,032	1,714	9	5,863	18,000	1,772	177
-772	6,200	18,000	3,858	1,873	-283	5,518	18,100	188	52
1,081	5,877	18,050	1,583	1,293	-489	7,232	18,200	150	33
-203	9,494	18,100	1,155	741	585	9,323	18,300	70	18
2,137	8,156	18,150	226	147	166	7,709	18,400	78	5
※ 3,048	10,720	18,200	278	192	65	6,618	18,500	26	20
1,354	6,978	18,250	32	23	246	5,496	18,600	7	-1
2,021	5,748	18,300	26	19	420	3,438	18,700	3	0
866	1,561	18,350	1	1	539	3,125	18,800	224	0
1,027	2,605	18,400	4	4	233	1,359	18,900	0	0
140	140	18,450	1	1	※ 2,068	4,007	19,000	0	0
366	1,160	18,500	1	0	95	772	19,100	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
10,256	67,109	1.3566	91,038	19,920	3,349	86,749	1.0701	92,834	3,517
昨日 P/C	1.2509	今日增減變化		0.1057	昨日 P/C	1.0709	今日增減變化		-0.0008

更新日期：2021年12月24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24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	82,616,088	171,102,901	-88,486,813	-2,871,103	2,276,087	2,117,682	158,405	-113,632
投信	54,039,796	50,663,710	3,376,086	29,829	519,953	0	519,953	0
自營商	63,404,811	8,098,463	55,306,348	-2,154,251	2,107,167	1,398,012	709,155	-27,560
	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	663,227	3,960,791	-3,297,564	-72,720	120,551	283,549	-162,998	-17,236
投信	33,752	0	33,752	72	1,698	0	1,698	3
自營商	749,292	114,755	634,537	26,613	482,196	312,405	169,791	22,332

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24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	24,316	19,269	5,047	2,904	51,424	24,177	27,247	-45
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	42,445	40,412	2,033	-1,588	45,258	44,250	1,008	-4,247
特定法人(週)	1,677	907	770	738	0	3,799	-3,799	-881
特定法人(近月)	12,988	15,378	-2,390	1,468	7,552	27,452	-19,900	-1,184
特定法人(全月)	18,468	12,259	6,209	2,385	14,573	40,421	-25,848	-215
十大交易人(週)	18,630	19,857	-1,227	1,731	35,850	25,940	9,910	6,793
十大交易人(近月)	44,286	38,139	6,147	793	38,666	54,270	-15,604	-210
十大交易人(全月)	71,182	55,918	15,264	381	77,179	91,053	-13,874	5,462
全市場未沖銷(近月)			86,749	3,349			92,834	3,517
全市場未沖銷(全月)			173,600	14,319			207,207	24,145

更新日期：2021年12月24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	18100	買權OI最大量	18200
	賣權成交最大量	17900	賣權OI最大量	17750
	整體隱含波動率	8.77%	較前一交易日	-1.67%
	買權隱含波動率	8.41%	較前一交易日	-2.09%
	賣權隱含波動率	9.14%	較前一交易日	-1.25%
電子選擇權	買權成交最大量	880	買權OI最大量	880
	賣權成交最大量	840	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	1640	賣權OI最大量	1660

更新日期：2021年12月24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

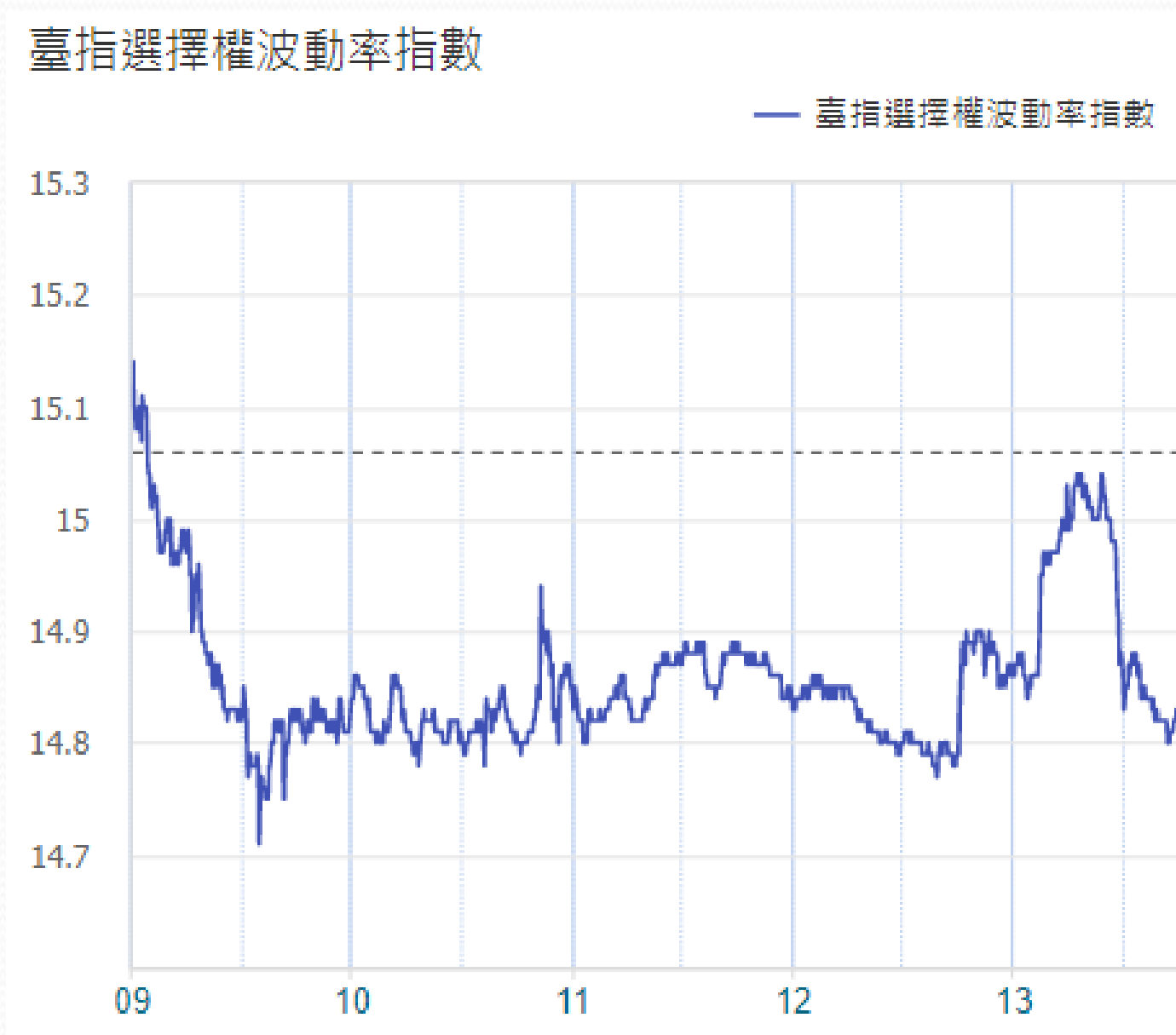
## 2022年01月選擇權分析表

台指選擇權	買權成交最大量	18300	買權OI最大量	18300
	賣權成交最大量	17500	賣權OI最大量	17000
	整體隱含波動率	13.68%	較前一交易日	+0.58%
	買權隱含波動率	11.66%	較前一交易日	-0.47%
	賣權隱含波動率	15.93%	較前一交易日	-0.44%
	成交量P/C_Ratio值	0.886	較前一交易日	-0.12
	未平倉P/C_Ratio值	1.070	較前一交易日	-0.00
電子選擇權	買權成交最大量	880	買權OI最大量	880
	賣權成交最大量	840	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	1640	賣權OI最大量	1660

更新日期：2021年12月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

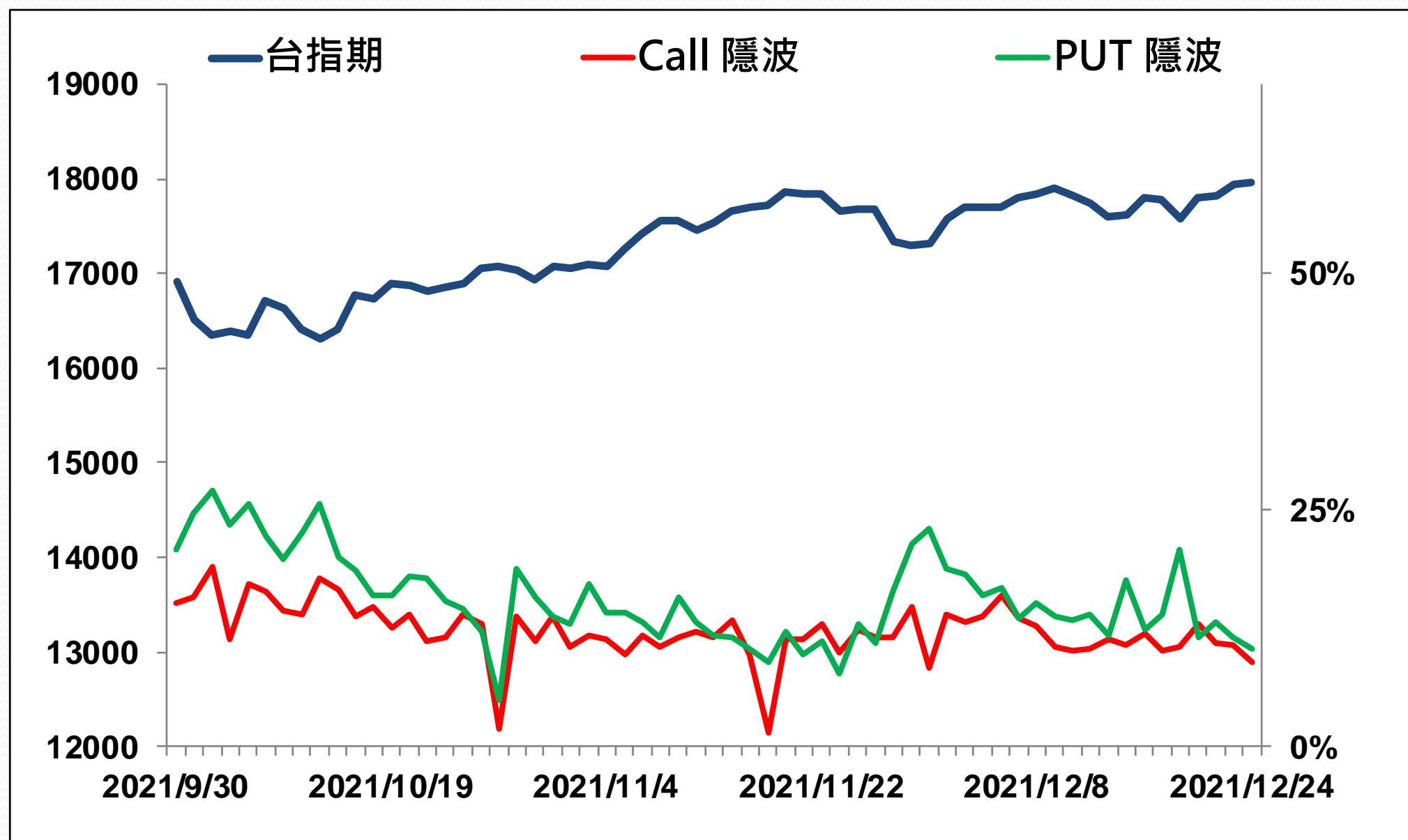


# 選擇權當日波動率指數



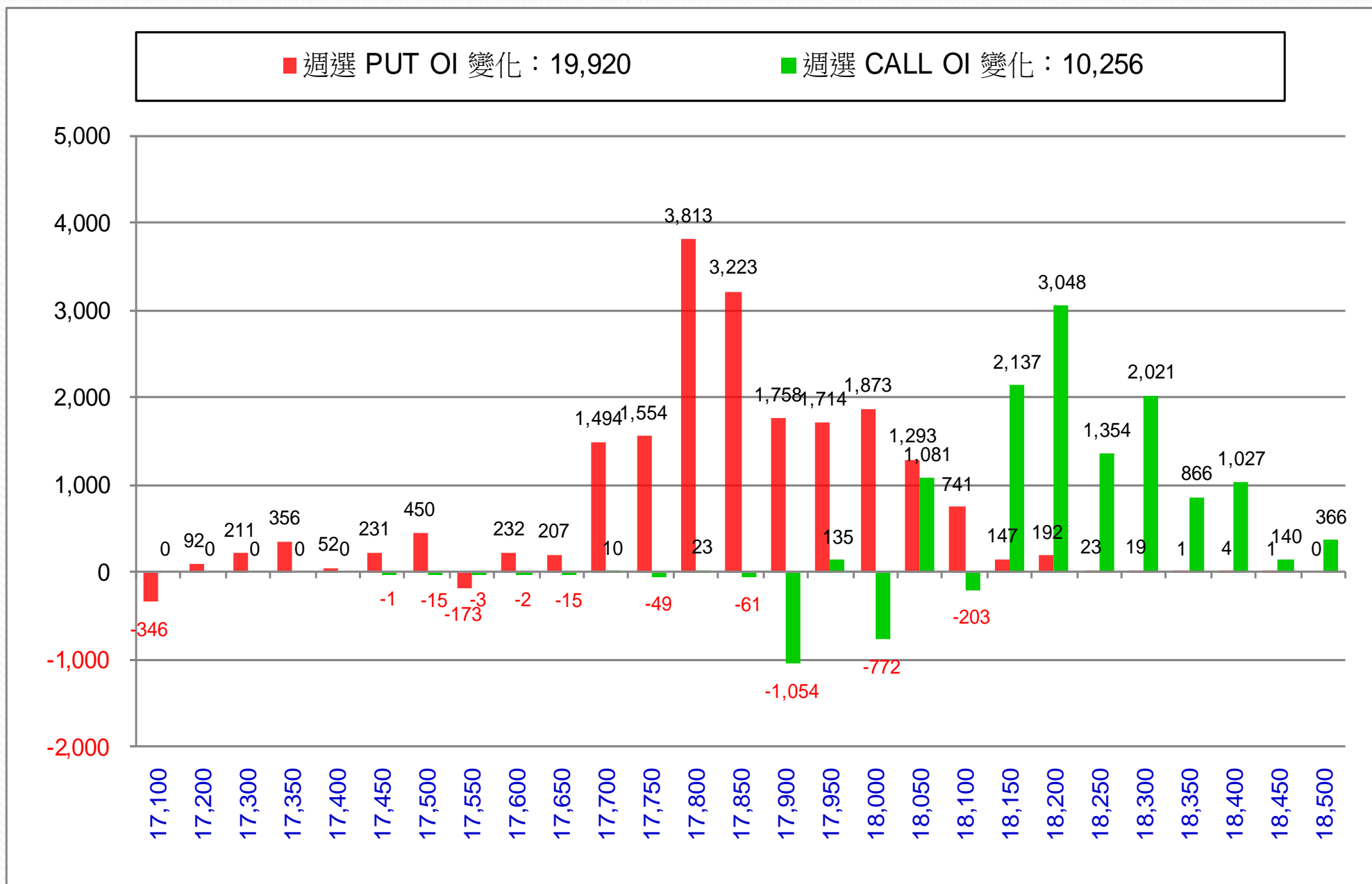
更新日期：2021年12月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

# 台指近月隱含波動度



更新日期：2021年12月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

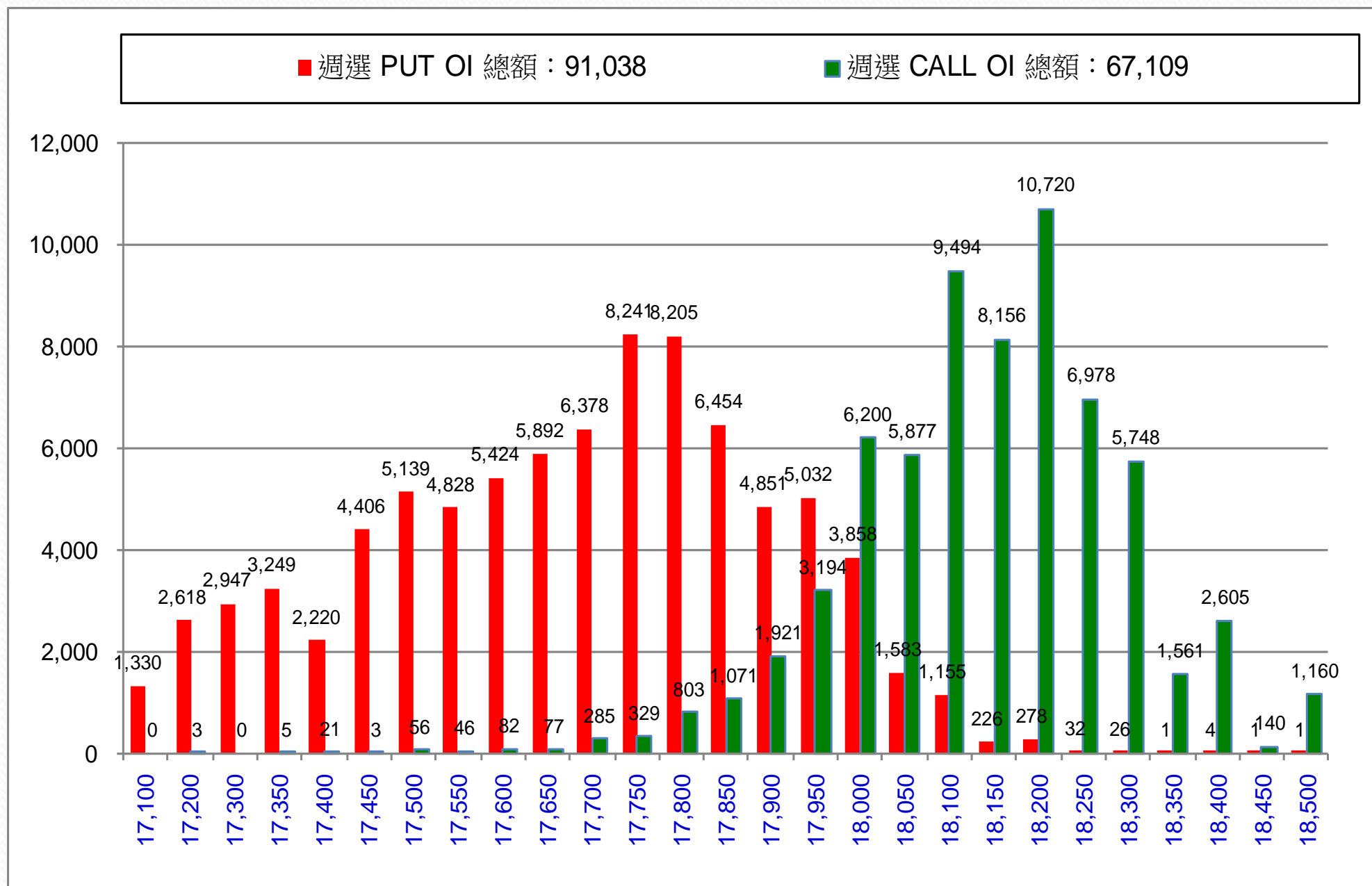
# 台指週選擇權OI每日變化量



更新日期：2021年12月24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24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

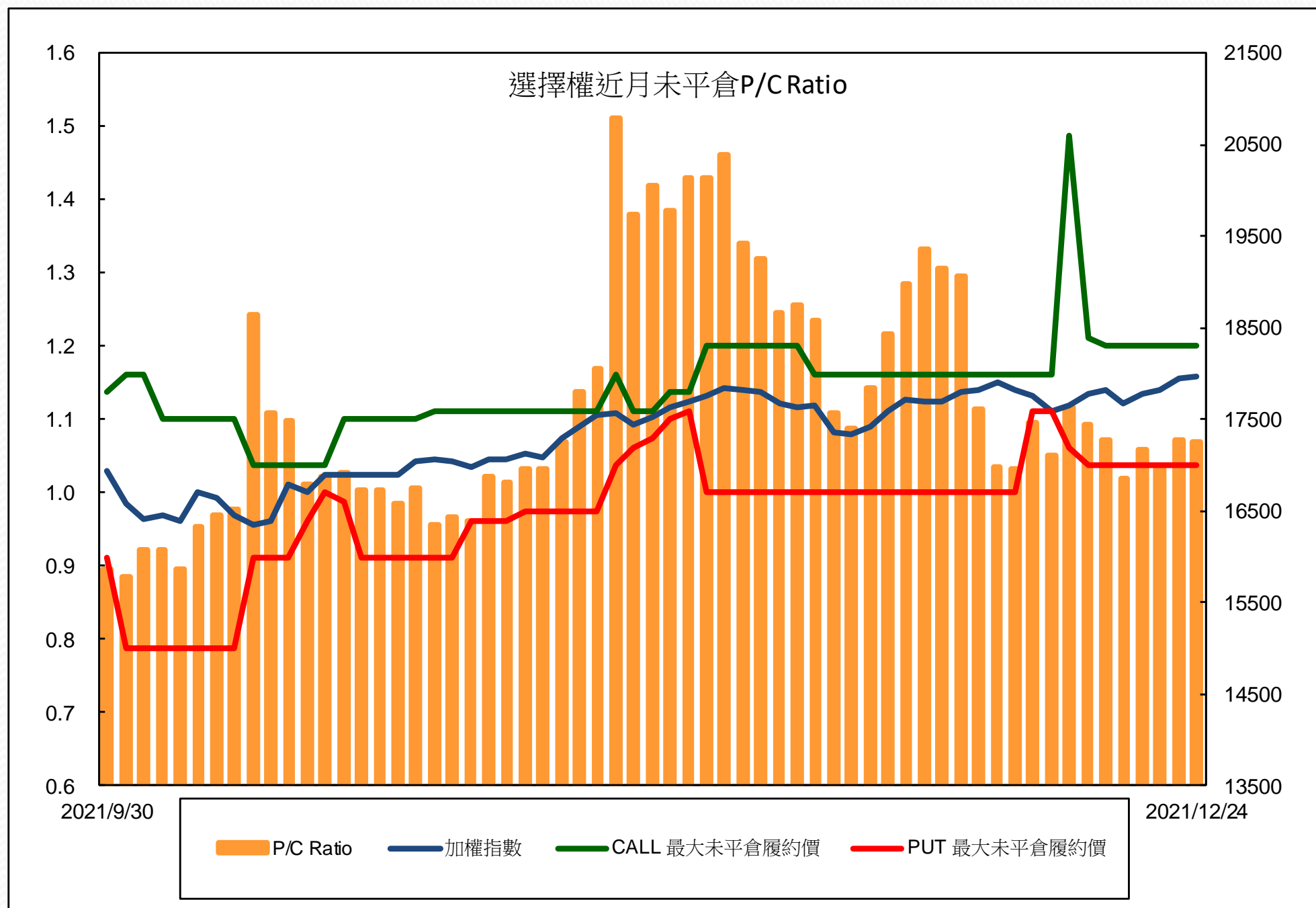


# 自營商選擇權OI部位統計

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23日	44,510	40,889	3,621
	12月24日	42,445	40,412	2,033
Put	12月23日	43,755	38,500	5,255
	12月24日	45,258	44,250	1,008

更新日期：2021年12月24日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

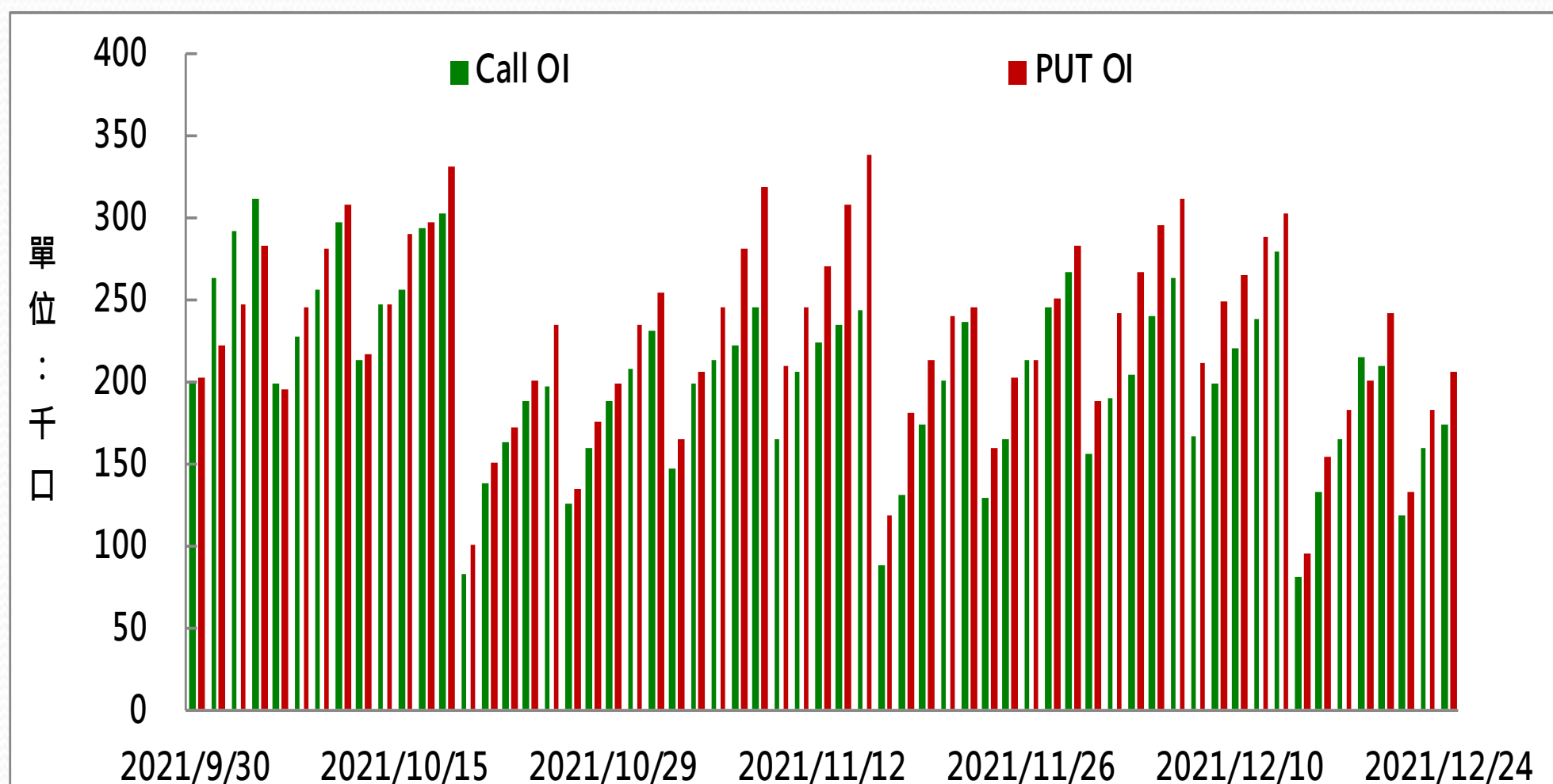
# 選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2021年12月24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24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24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