

台指選擇權 OI 匯報

日期：2021/12/27 結算日：2021/12/29					日期：2021/12/27 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	17,300	2,886	-61	0	10	16,500	1,936	-50
0	5	17,350	2,544	-705	0	14	16,600	2,426	585
0	21	17,400	2,324	104	0	16	16,700	3,186	-93
0	3	17,450	3,857	-549	-1	47	16,800	4,372	115
0	56	17,500	6,173	1,034	0	69	16,900	3,022	114
-5	41	17,550	4,416	-412	0	558	17,000	6,010	0
1	83	17,600	4,039	-1,385	2	1,588	17,100	4,334	23
-6	71	17,650	4,943	-949	1	543	17,200	4,260	44
-15	270	17,700	7,812	1,434	-15	342	17,300	4,440	311
-62	267	17,750	6,348	-1,893	-7	1,143	17,400	3,909	112
-171	632	17,800	9,673	1,468	2	593	17,500	4,460	463
-128	943	17,850	5,929	-525	15	2,176	17,600	5,064	599
-247	1,674	17,900	10,790	5,939	-95	2,570	17,700	3,542	440
-380	2,814	17,950	8,109	3,077	-140	3,089	17,800	2,849	382
9	6,209	18,000	8,683	4,825	-273	3,603	17,900	1,603	408
-119	5,758	18,050	5,238	3,655	-46	5,817	18,000	1,954	182
567	10,061	18,100	3,922	2,767	-441	5,077	18,100	380	192
1,885	10,041	18,150	1,560	1,334	-414	6,818	18,200	232	82
※ 4,328	15,048	18,200	872	594	-860	8,463	18,300	74	4
2,322	9,300	18,250	165	133	-335	7,374	18,400	131	53
2,610	8,358	18,300	160	134	-219	6,399	18,500	41	15
1,555	3,116	18,350	6	5	※ 268	5,764	18,600	8	1
620	3,225	18,400	15	11	183	3,621	18,700	4	1
305	445	18,450	2	1	-865	2,260	18,800	224	0
64	1,224	18,500	17	16	203	1,562	18,900	0	0
125	345	18,600	0	0	32	4,039	19,000	1	1
0	65	18,700	0	0	43	815	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
13,281	80,390	1.3925	111,942	20,904	-2,651	84,098	1.1521	96,890	4,056
昨日 P/C	1.3566	今日增減變化		0.0359	昨日 P/C	1.0701	今日增減變化		0.0820

更新日期：2021年12月27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27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	91,922,301	176,644,536	-84,722,235	3,764,578	2,388,736	2,225,543	163,193	4,788
投信	54,347,332	50,205,528	4,141,804	765,718	524,272	0	524,272	4,319
自營商	63,530,089	8,839,037	54,691,052	-615,296	2,176,737	1,364,487	812,250	103,095
	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	669,557	4,022,451	-3,352,894	-55,330	139,687	293,002	-153,315	9,683
投信	21,980	0	21,980	-11,772	1,704	0	1,704	6
自營商	801,446	131,896	669,550	35,013	465,051	306,623	158,428	-11,363

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27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	25,670	21,767	3,903	-1,144	53,173	24,491	28,682	1,435
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	45,588	38,816	6,772	4,739	43,443	49,531	-6,088	-7,096
特定法人(週)	1,881	1,060	821	51	0	2,918	-2,918	881
特定法人(近月)	13,044	16,913	-3,869	-1,479	7,661	28,303	-20,642	-742
特定法人(全月)	18,728	16,216	2,512	-3,697	14,758	41,236	-26,478	-630
十大交易人(週)	23,678	23,169	509	1,736	38,236	23,815	14,421	4,511
十大交易人(近月)	42,500	38,812	3,688	-2,459	40,966	55,216	-14,250	1,354
十大交易人(全月)	74,222	59,345	14,877	-387	81,520	89,474	-7,954	5,920
全市場未沖銷(近月)			84,098	-2,651			96,890	4,056
全市場未沖銷(全月)			184,876	11,276			233,309	26,102

更新日期：2021年12月27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	18000	賣權OI最大量	17900
	整體隱含波動率	10.43%	較前一交易日	+1.66%
	買權隱含波動率	11.85%	較前一交易日	+3.44%
	賣權隱含波動率	9.39%	較前一交易日	+0.25%
電子選擇權	買權成交最大量	885	買權OI最大量	860
	賣權成交最大量	865	賣權OI最大量	860
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	1680

更新日期：2021年12月27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	18500	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	14.61%	較前一交易日	-0.93%
	買權隱含波動率	12.87%	較前一交易日	+1.20%
	賣權隱含波動率	16.46%	較前一交易日	+0.53%
	成交量P/C_Ratio值	0.891	較前一交易日	+0.01
	未平倉P/C_Ratio值	1.152	較前一交易日	+0.08
電子選擇權	買權成交最大量	885	買權OI最大量	860
	賣權成交最大量	865	賣權OI最大量	860
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	1680

更新日期：2021年12月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

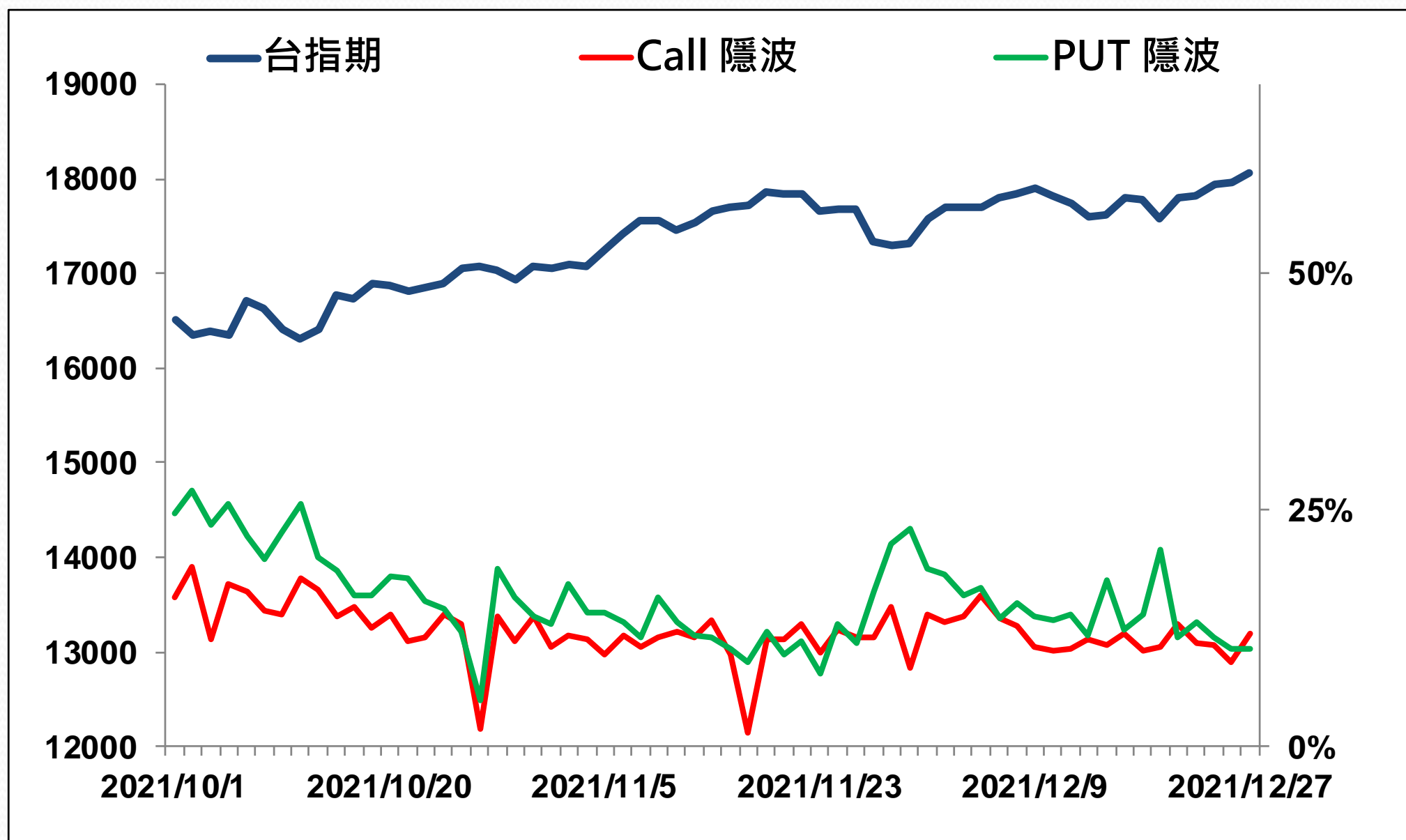
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



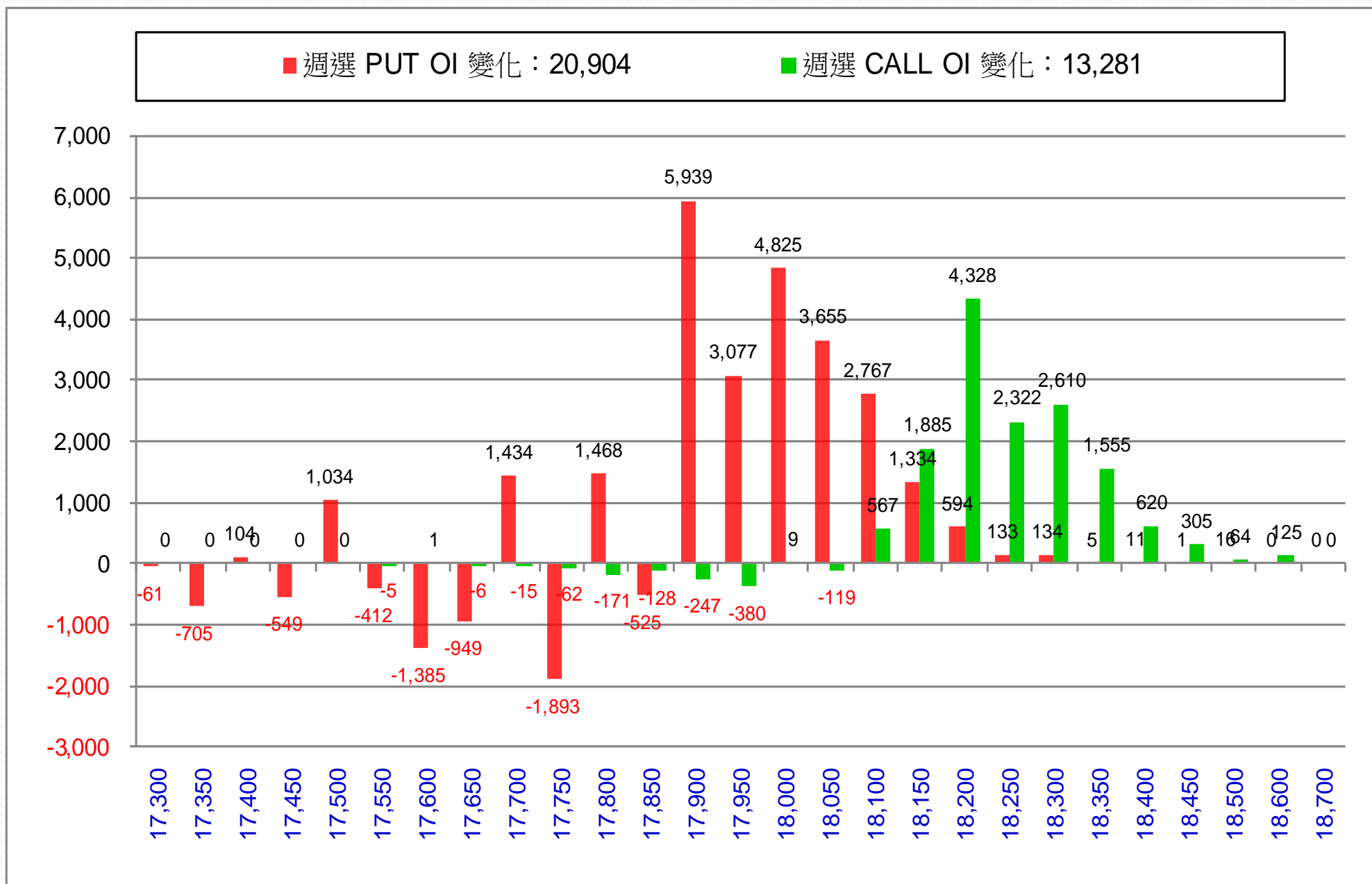
更新日期：2021年12月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2021年12月27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

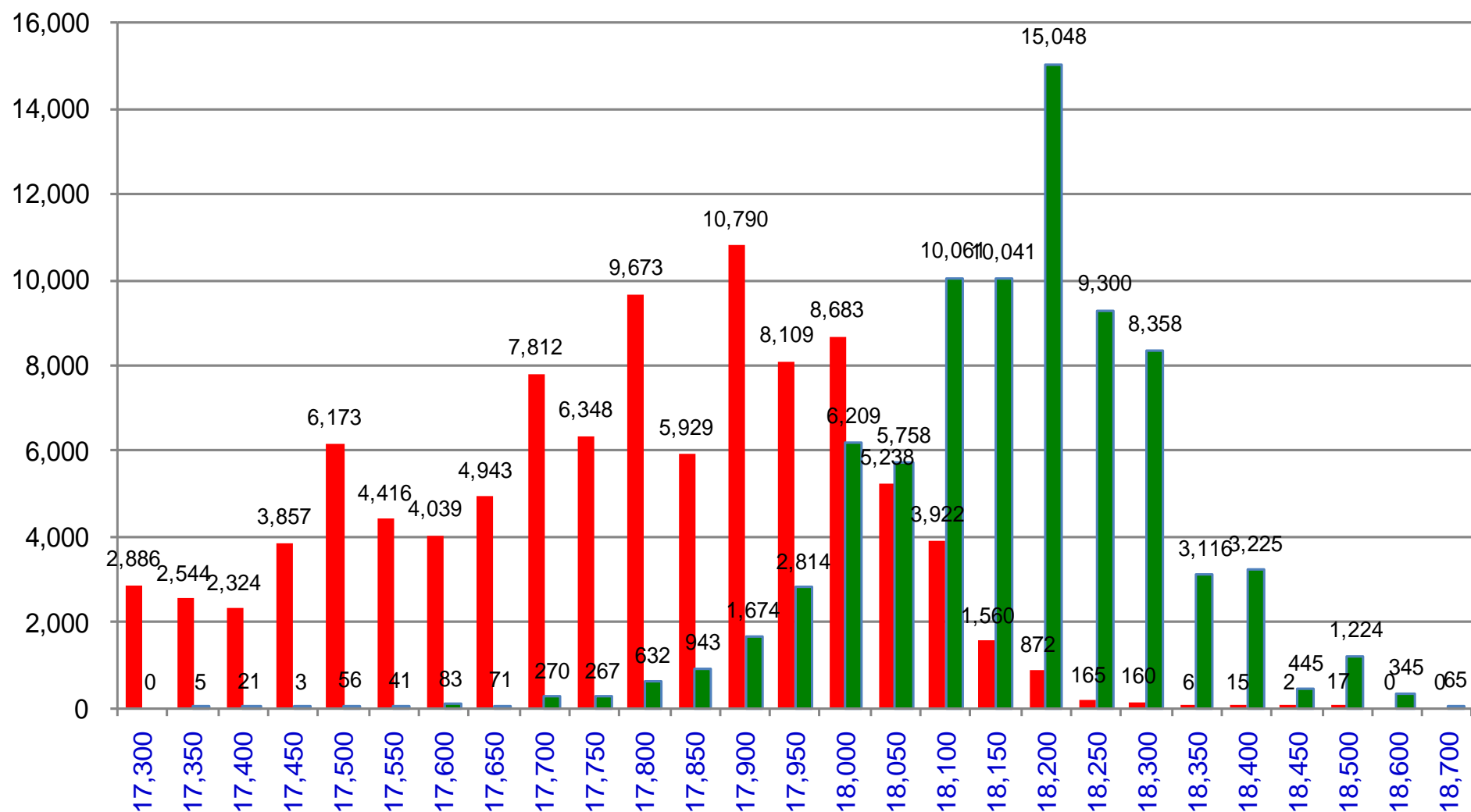


更新日期：2021年12月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：111,942

週選 CALL OI 總額：80,390



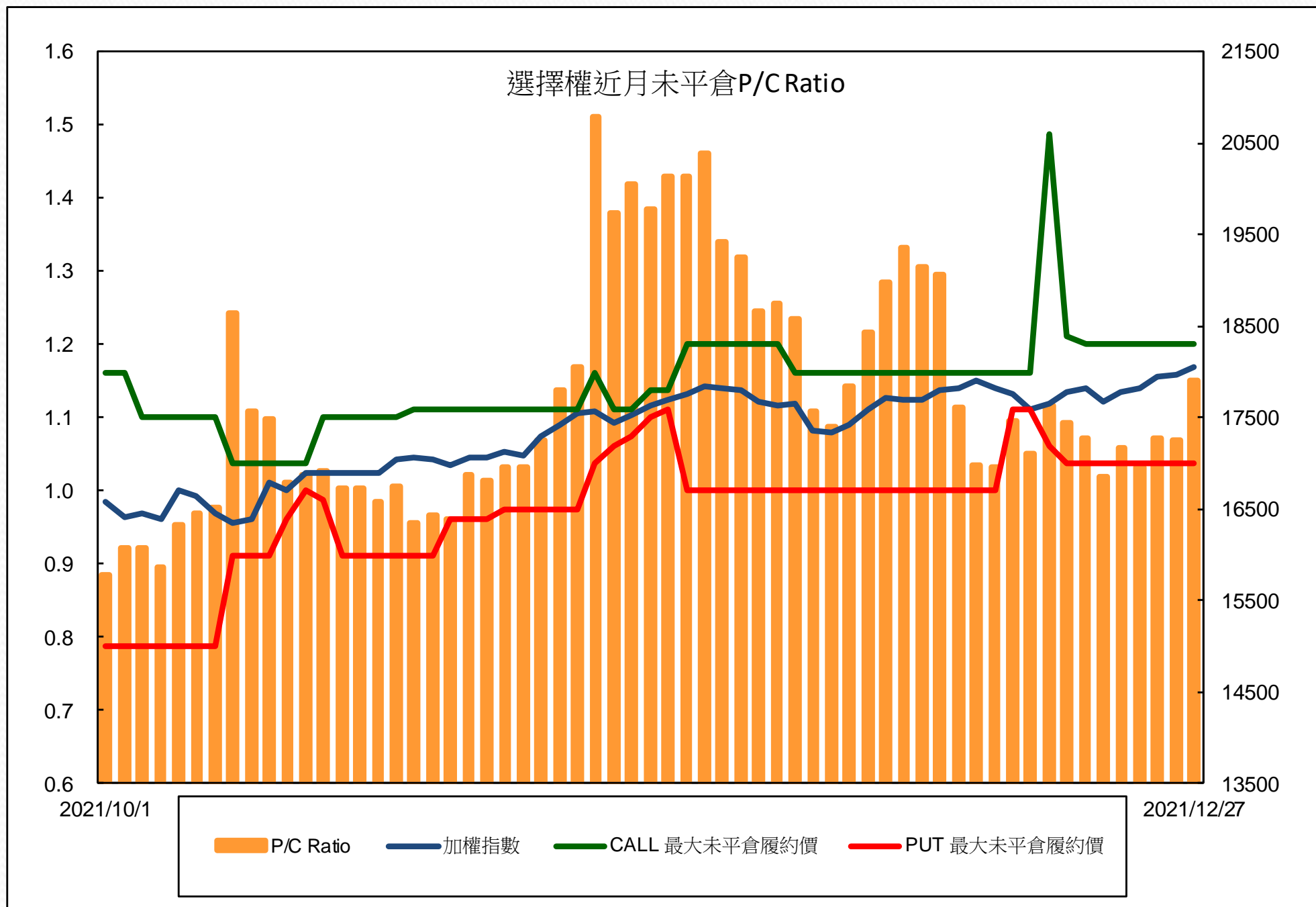
更新日期：2021年12月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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24日	42,445	40,412	2,033
	12月27日	45,588	38,816	6,772
Put	12月24日	45,258	44,250	1,008
	12月27日	43,443	49,531	-6,088

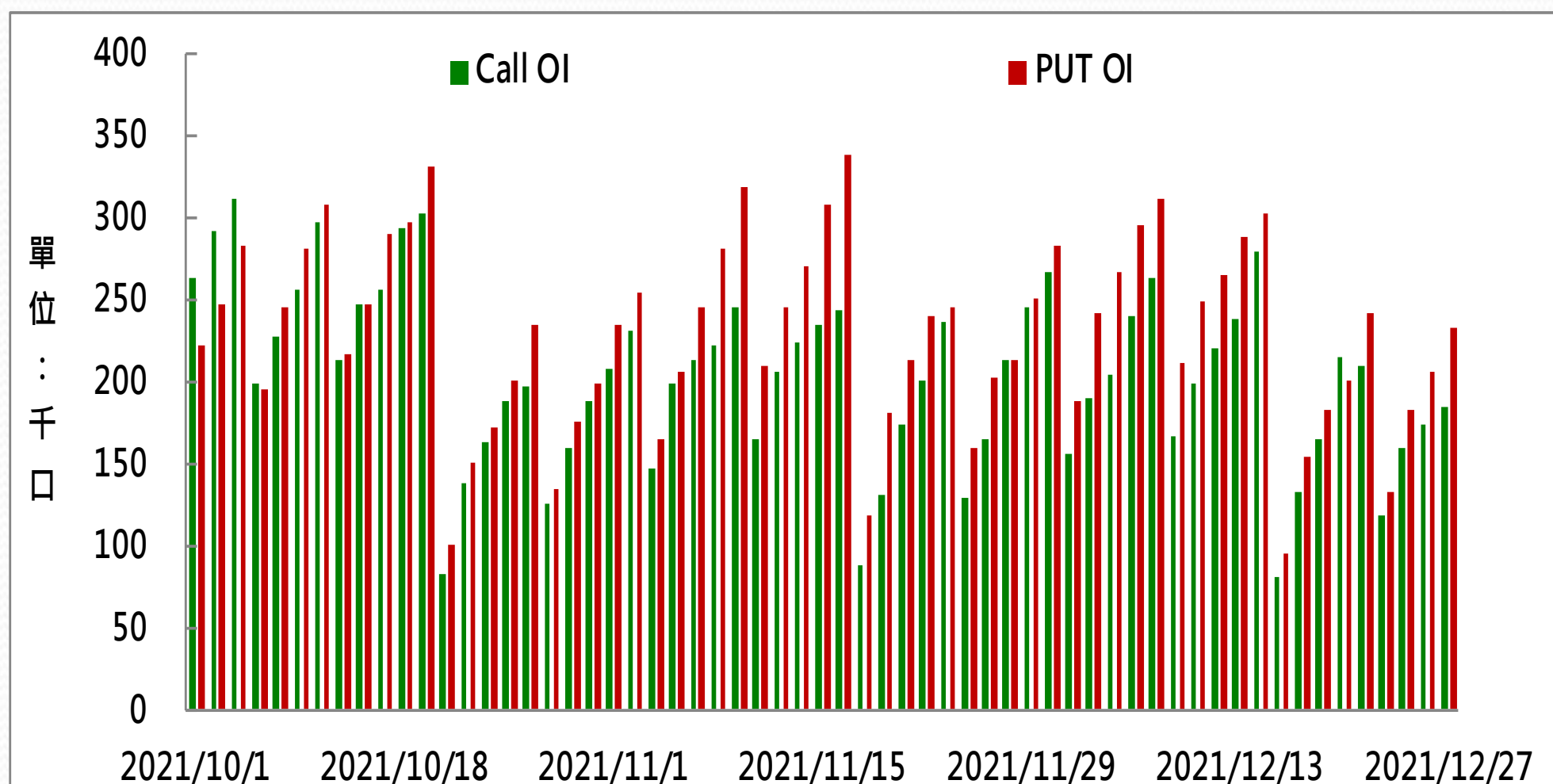
更新日期：2021年12月27日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2021年12月27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27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27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