

台指選擇權OI匯報

日期：2021/12/28 結算日：2021/12/29					日期：2021/12/28 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	3	17,450	3,579	-278	0	16	16,700	2,941	-245
0	56	17,500	4,822	-1,351	0	47	16,800	4,115	-257
0	41	17,550	3,723	-693	0	69	16,900	2,910	-112
-2	81	17,600	3,769	-270	-1	557	17,000	5,771	-239
-2	69	17,650	4,348	-595	-2	1,586	17,100	4,057	-277
-16	254	17,700	6,627	-1,185	-3	540	17,200	4,359	99
1	268	17,750	5,436	-912	3	345	17,300	4,673	233
-78	554	17,800	7,112	-2,561	-23	1,120	17,400	3,577	-332
-261	682	17,850	6,915	986	-39	554	17,500	4,411	-49
-237	1,437	17,900	8,599	-2,191	-7	2,169	17,600	6,173	1,109 ※
-809	2,005	17,950	7,343	-766	-40	2,530	17,700	4,167	625
-1,474	4,735	18,000	10,486	1,803	-89	3,000	17,800	3,634	785
-968	4,790	18,050	10,891	5,653	-227	3,376	17,900	2,695	1,092
-2,003	8,058	18,100	10,884	6,962	-690	5,127	18,000	2,194	240
-2,290	7,751	18,150	10,740	9,180 ※	-169	4,908	18,100	938	558
1,174	16,222	18,200	6,176	5,304	-151	6,667	18,200	504	272
※ 5,228	14,528	18,250	2,396	2,231	-197	8,266	18,300	198	124
3,764	12,122	18,300	1,460	1,300	222	7,596	18,400	446	315
2,248	5,364	18,350	121	115	※ 899	7,298	18,500	91	50
502	3,727	18,400	95	80	240	6,004	18,600	27	19
759	1,204	18,450	8	6	393	4,014	18,700	33	29
220	1,444	18,500	31	14	233	2,493	18,800	225	1
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
5,890	86,280	1.5545	134,120	22,178	718	84,816	1.1927	101,157	4,267
昨日 P/C	1.3925	今日增減變化	0.1620	昨日 P/C	1.1521	今日增減變化	0.0406		

更新日期：2021年12月28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28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	101,161,919	183,358,810	-82,196,891	2,525,344	2,588,958	2,438,513	150,445	-12,748
投信	55,054,944	49,971,641	5,083,303	941,499	545,782	0	545,782	21,510
自營商	63,306,053	10,608,178	52,697,875	-1,993,177	2,224,796	1,402,877	821,919	9,669
	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	744,473	4,090,305	-3,345,832	7,062	161,125	257,115	-95,990	57,325
投信	22,147	0	22,147	167	1,714	0	1,714	10
自營商	758,098	112,427	645,671	-23,879	467,858	375,255	92,603	-65,825

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28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	27,136	21,128	6,008	2,105	55,752	26,090	29,662	980
投信	0	0	0	0	0	49	-49	0
自營商	50,367	42,719	7,648	876	45,941	57,444	-11,503	-5,415
特定法人(週)	2,821	1,163	1,658	837	0	2,918	-2,918	0
特定法人(近月)	14,817	16,913	-2,096	1,773	7,967	29,254	-21,287	-645
特定法人(全月)	19,888	16,619	3,269	757	15,219	44,967	-29,748	-3,270
十大交易人(週)	28,074	23,754	4,320	3,811	45,943	28,557	17,386	2,965
十大交易人(近月)	43,806	38,534	5,272	1,584	42,467	55,378	-12,911	1,339
十大交易人(全月)	79,925	59,819	20,106	5,229	89,228	90,786	-1,558	6,396
全市場未沖銷(近月)			84,816	718			101,157	4,267
全市場未沖銷(全月)			192,375	7,499			260,716	27,407

更新日期：2021年12月28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	18200	買權OI最大量	18200
	賣權成交最大量	18100	賣權OI最大量	18050
	整體隱含波動率	9.06%	較前一交易日	-1.37%
	買權隱含波動率	9.90%	較前一交易日	-1.95%
	賣權隱含波動率	8.40%	較前一交易日	-0.99%
電子選擇權	買權成交最大量	895	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	850	賣權OI最大量	820
金融選擇權	買權成交最大量	1740	買權OI最大量	1680
	賣權成交最大量	1700	賣權OI最大量	1680

更新日期：2021年12月28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	17600	賣權OI最大量	17600
	整體隱含波動率	14.00%	較前一交易日	+0.60%
	買權隱含波動率	12.10%	較前一交易日	-0.76%
	賣權隱含波動率	15.37%	較前一交易日	-1.08%
	成交量P/C_Ratio值	1.281	較前一交易日	+0.39
	未平倉P/C_Ratio值	1.193	較前一交易日	+0.04
電子選擇權	買權成交最大量	895	買權OI最大量	870
	賣權成交最大量	850	賣權OI最大量	820
金融選擇權	買權成交最大量	1740	買權OI最大量	1680
	賣權成交最大量	1700	賣權OI最大量	1680

更新日期：2021年12月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

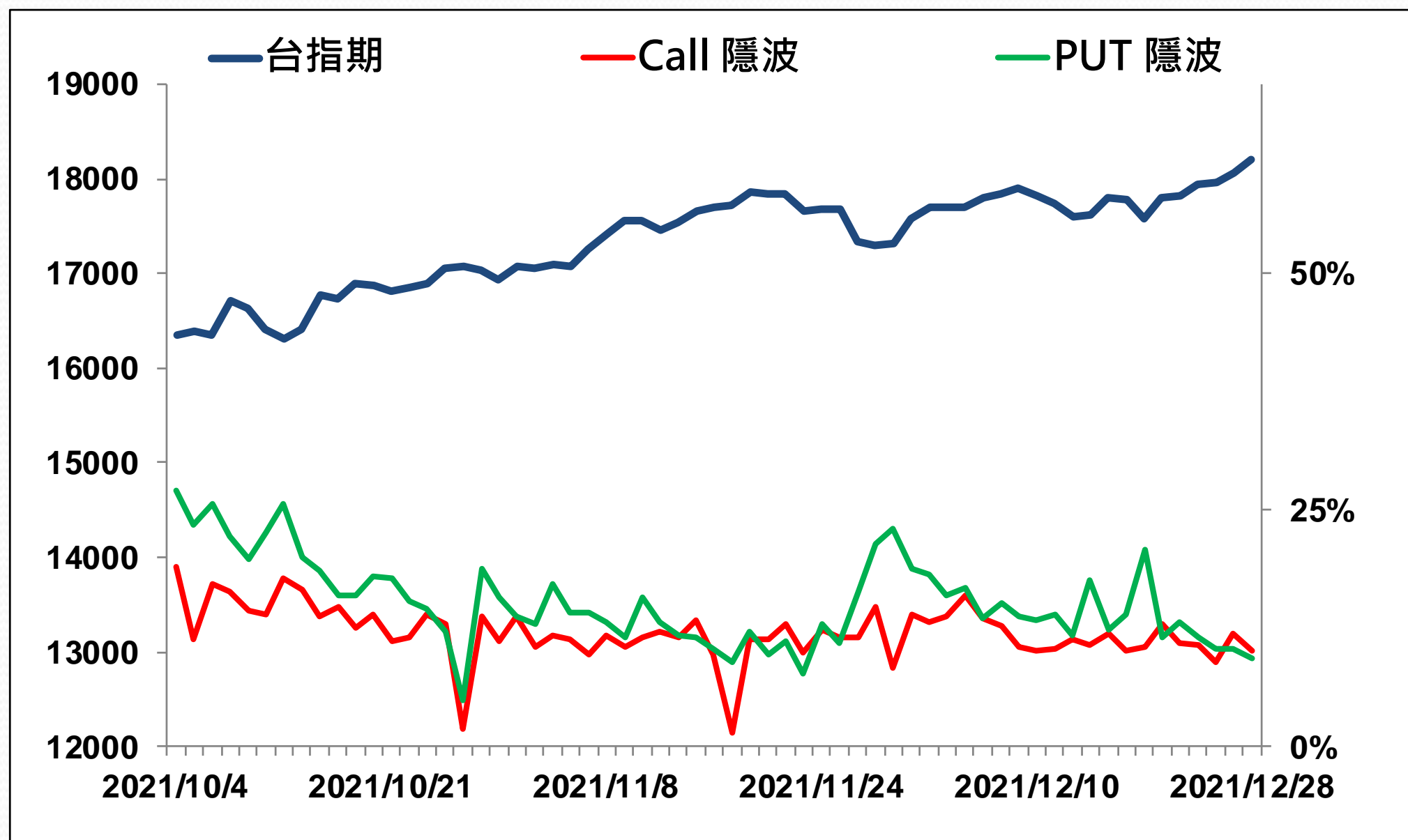
選擇權當日波動率指數

臺指選擇權波動率指數



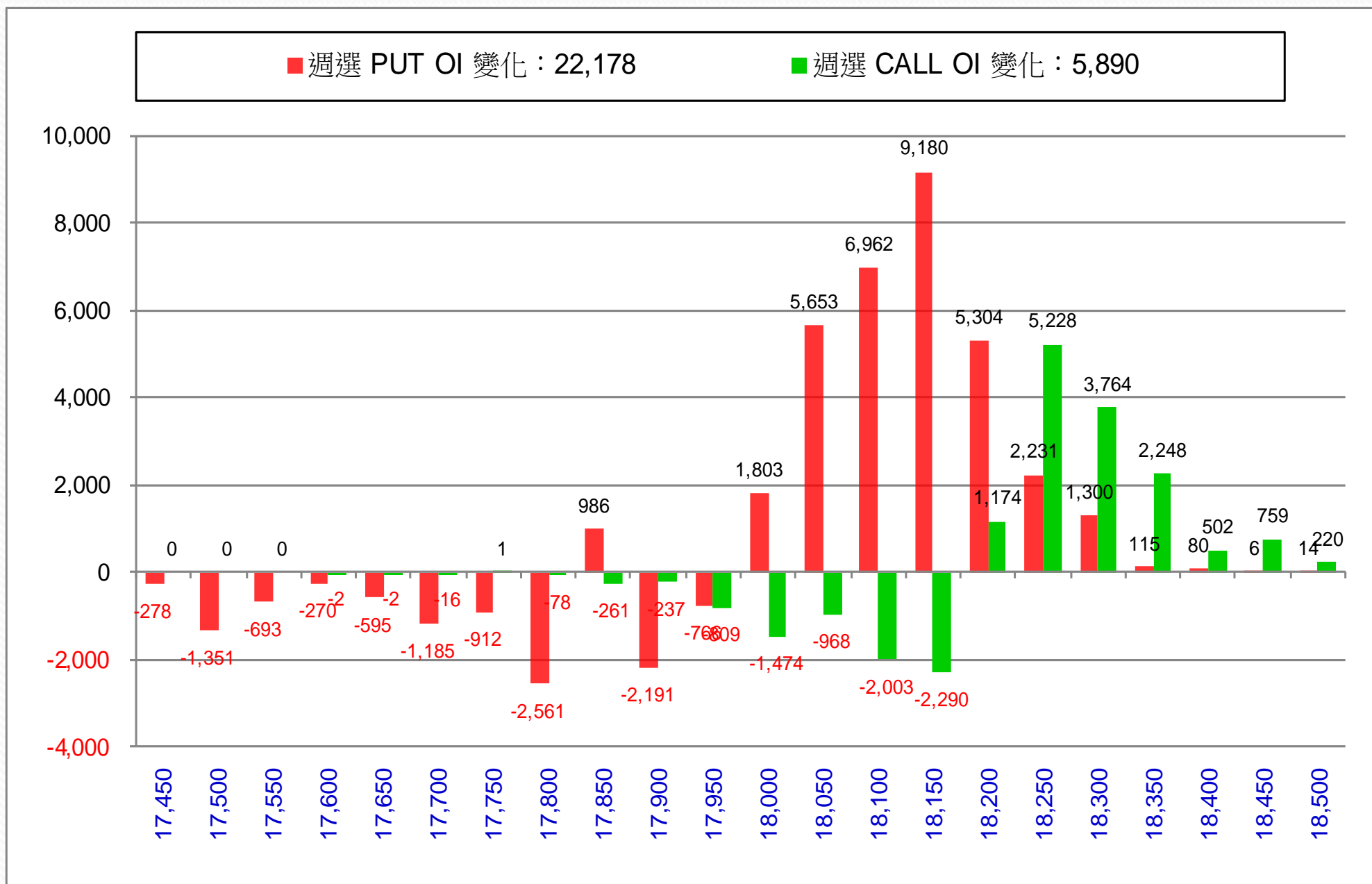
更新日期：2021年12月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指近月隱含波動度



更新日期：2021年12月28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

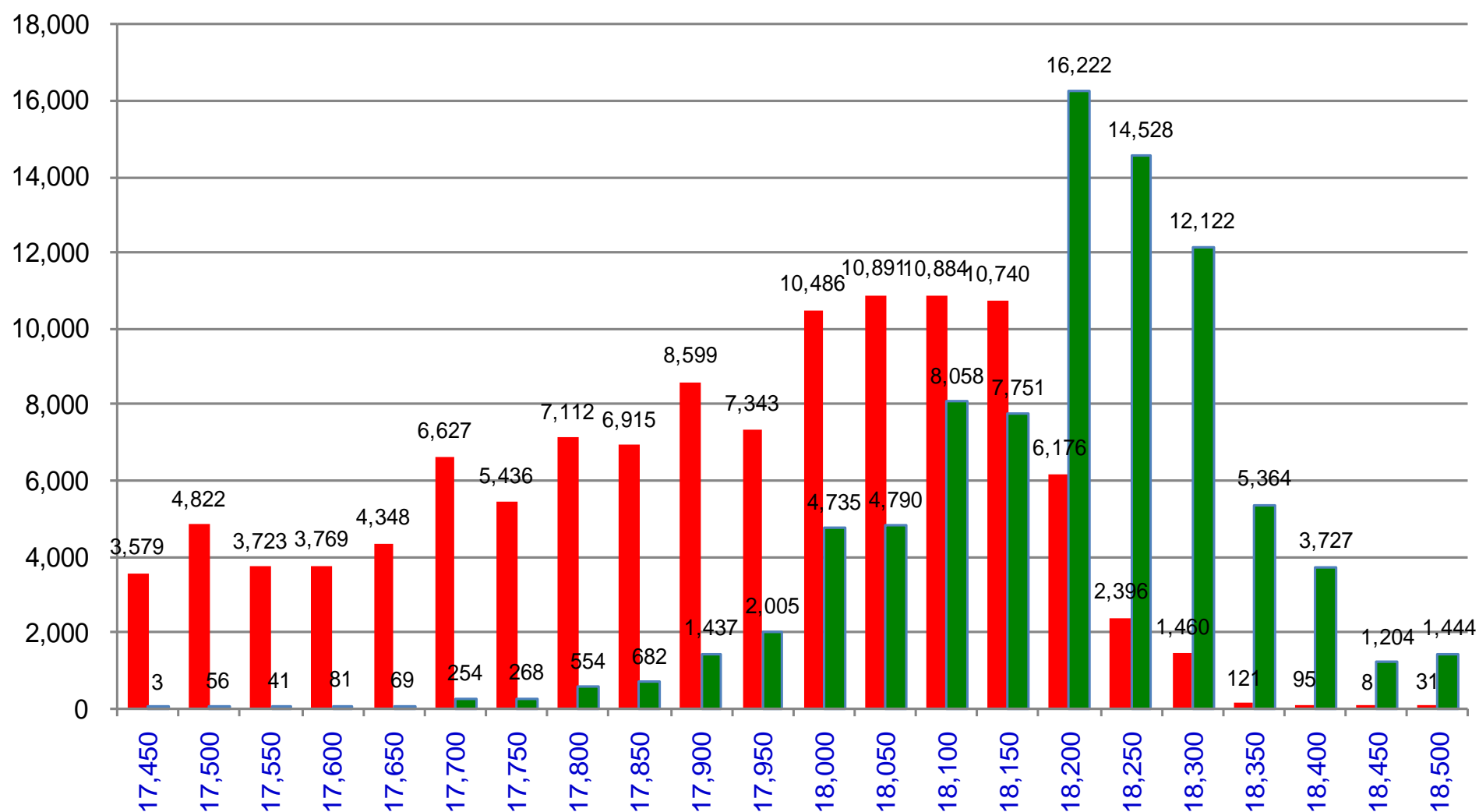


更新日期：2021年12月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

台指週選擇權OI 每日總量

週選 PUT OI 總額：134,120

週選 CALL OI 總額：86,280



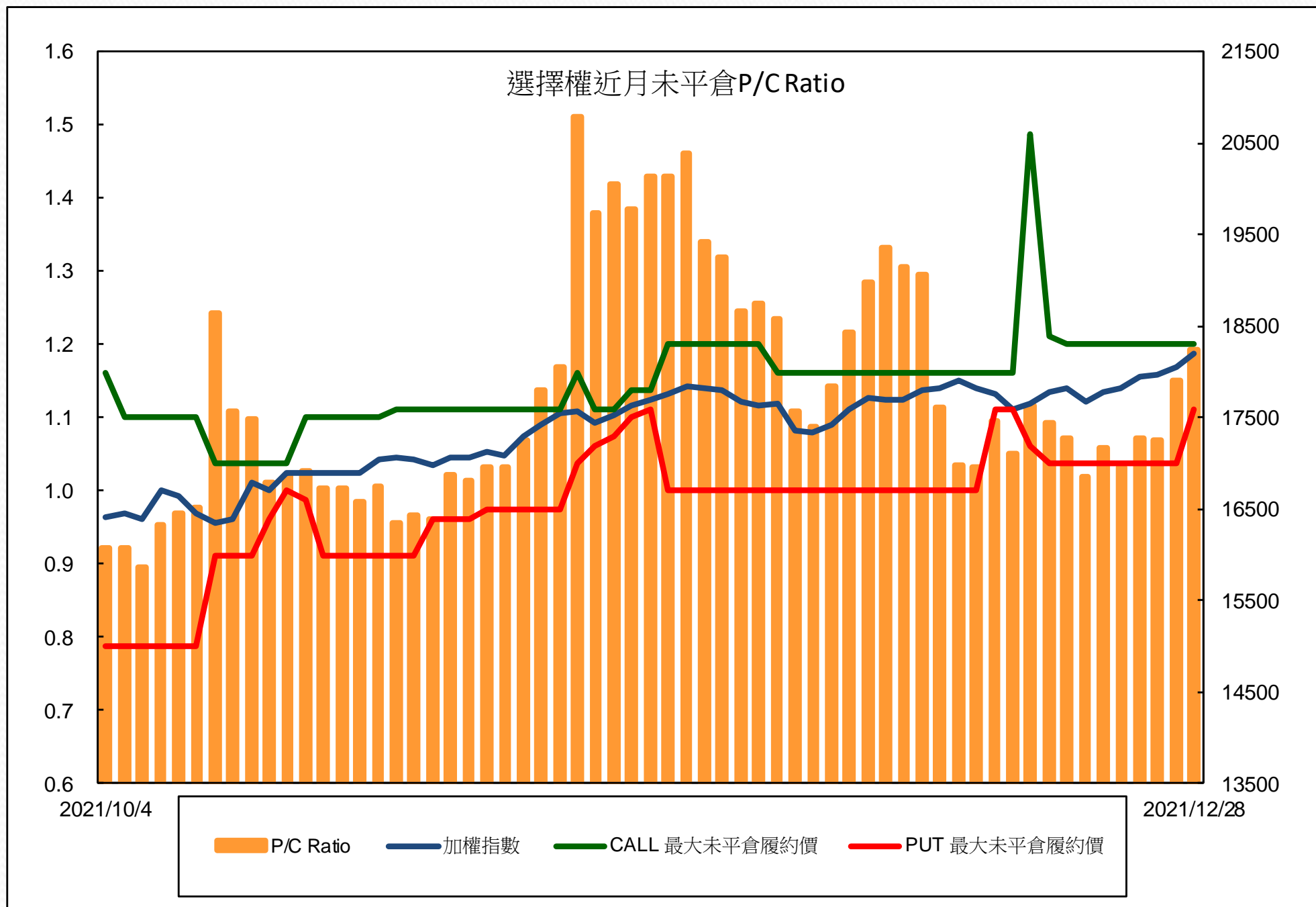
更新日期：2021年12月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

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27日	45,588	38,816	6,772
	12月28日	50,367	42,719	7,648
Put	12月27日	43,443	49,531	-6,088
	12月28日	45,941	57,444	-11,503

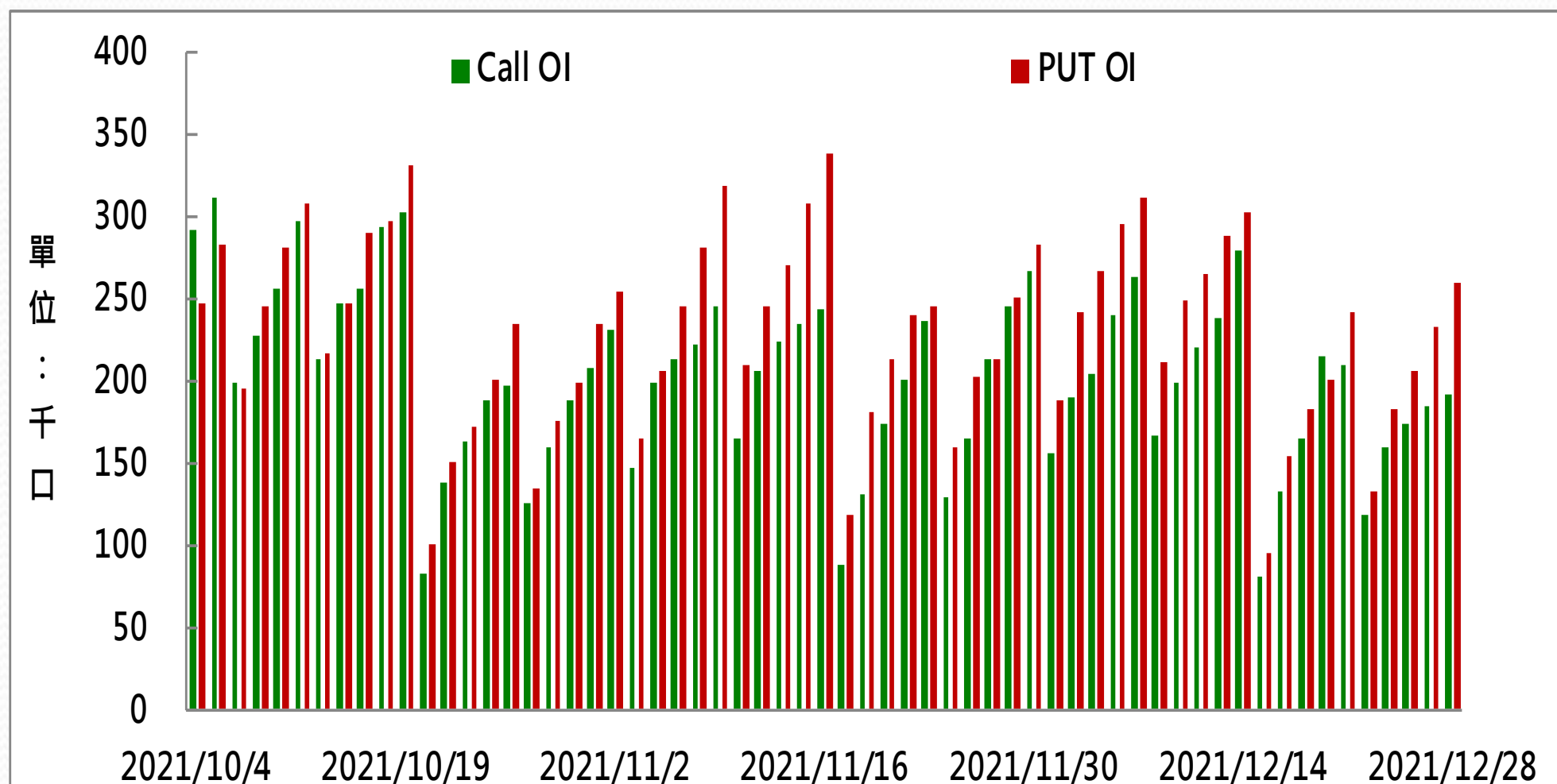
更新日期：2021年12月28日 資料來源：台灣期貨交易所，凱基期貨整理

選擇權近月未平倉P/C Ratio



更新日期：2021年12月28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28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28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