

股指期货持仓日度跟踪

广发期货研究所

电 话：020-88818051

E-Mail: yeqianning@gf.com.cn

投资咨询业务资格：
证监许可【2011】1292 号

联系信息：

叶倩宁（投资咨询资格：Z0016628）

电话：020-88818051

邮箱：yeqianning@gf.com.cn

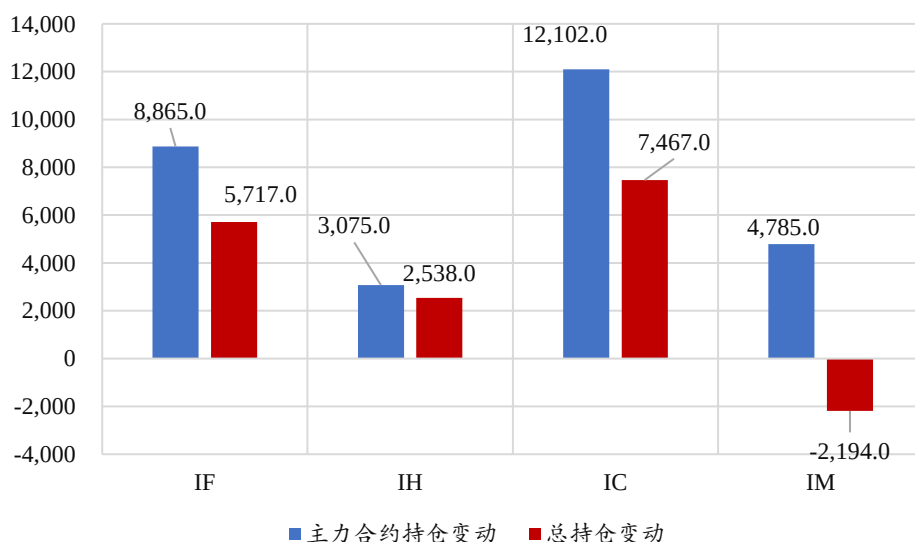
目录：

股指期货：

IF、IH、IC、IM

股指期货持仓日度变动简评

品种	主力合约	总持仓点评	前二十席位重要变动
沪深 300	IF2512	总持仓明显上升	前二十席位加仓为主
上证 50	IH2512	总持仓小幅上升	前二十席位增减仓不一
中证 500	IC2512	总持仓明显上升	国君多空头各加仓近 2000 手
中证 1000	IM2512	总持仓小幅上升	中信多头、海通空头各减仓超千手



数据来源：Wind 广发期货研究所整理

[股指期货]

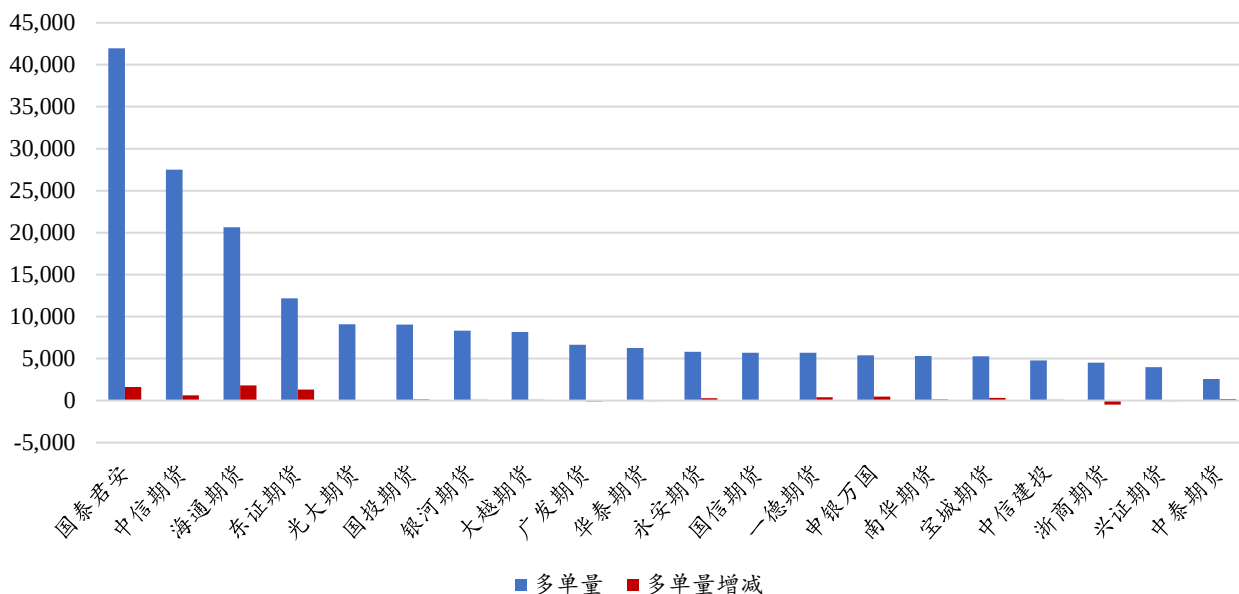
◆ IF：总持仓明显上升，前二十席位加仓为主

【品种总持仓及主力合约持仓变化】

11 月 20 日，IF 品种总持仓上升 5717 手，其中主力合约 2512 持仓上升 8865 手。

【品种前二十多头席位持仓量变动】

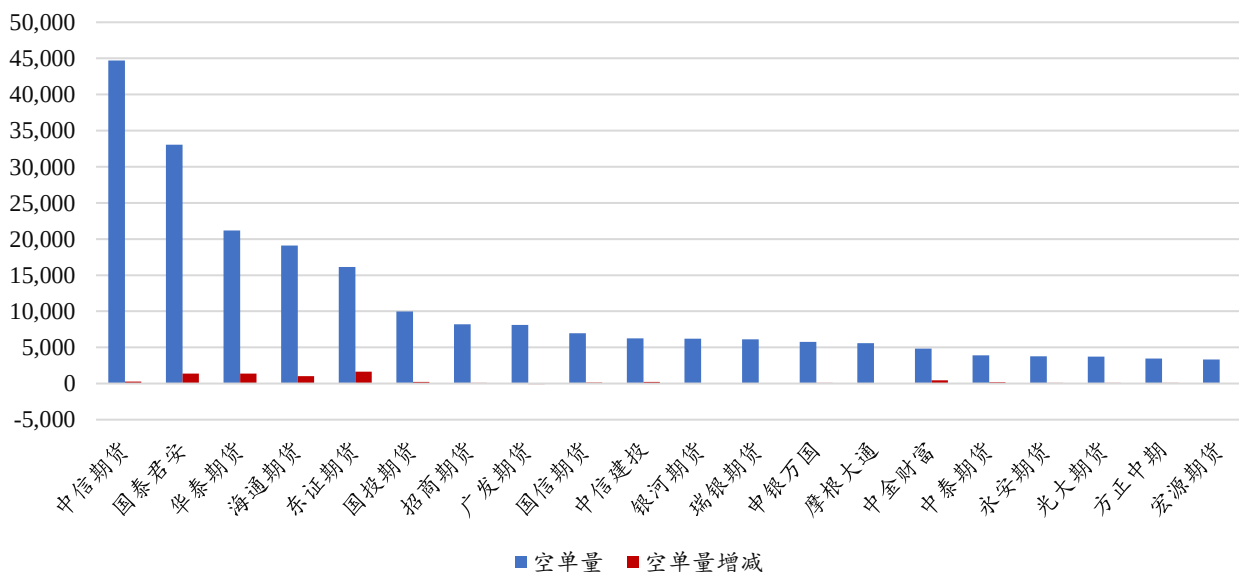
IF 品种当日前二十多头席位中，国泰君安期货排名第一，总持仓 41959 手。当日，多头增仓最多的是海通期货，日内增仓 1818 手；多头减仓最多的是浙商期货，日内减仓 473 手。



数据来源：Wind 广发期货研究所整理

【品种前二十空头席位持仓量变动】

IF 品种当日前二十空头席位中，中信期货排名第一，总持仓 44722 手。当日，空头增仓最多的是东证期货，日内增仓 1632 手；空头减仓最多的是广发期货，日内减仓 73 手。



数据来源：Wind 广发期货研究所整理

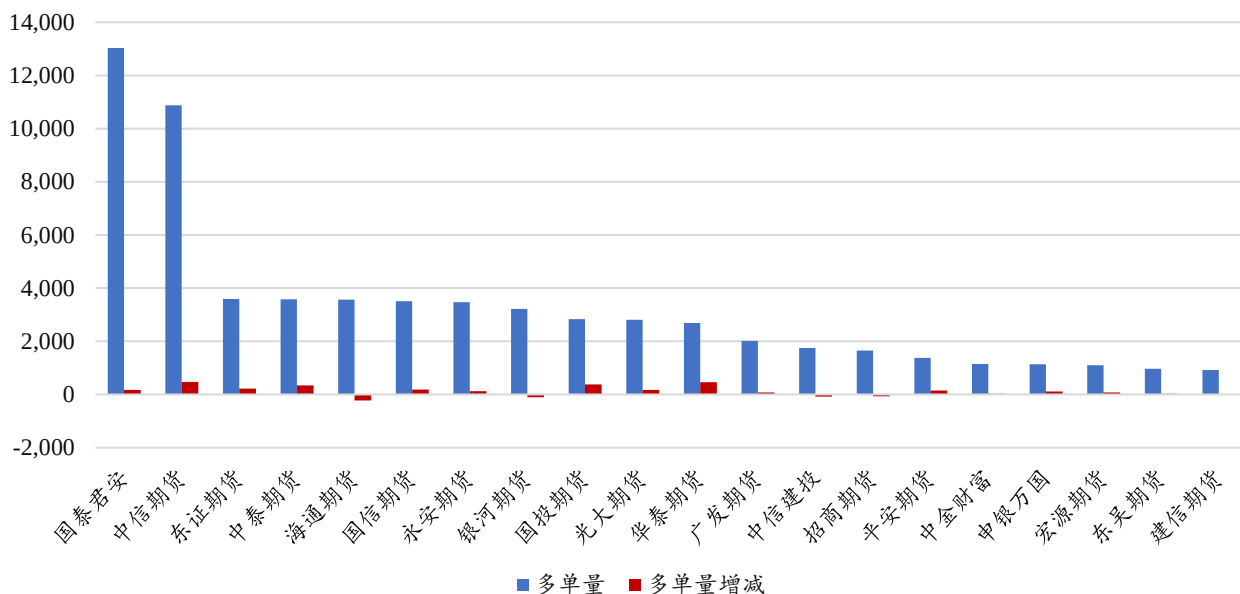
◆ **IH：总持仓小幅上升，前二十席位增减仓不一**

【品种总持仓及主力合约持仓变化】

11 月 20 日，IH 品种总持仓上升 2538 手，其中主力合约 2512 持仓上升 3075 手。

【品种前二十多头席位持仓变动】

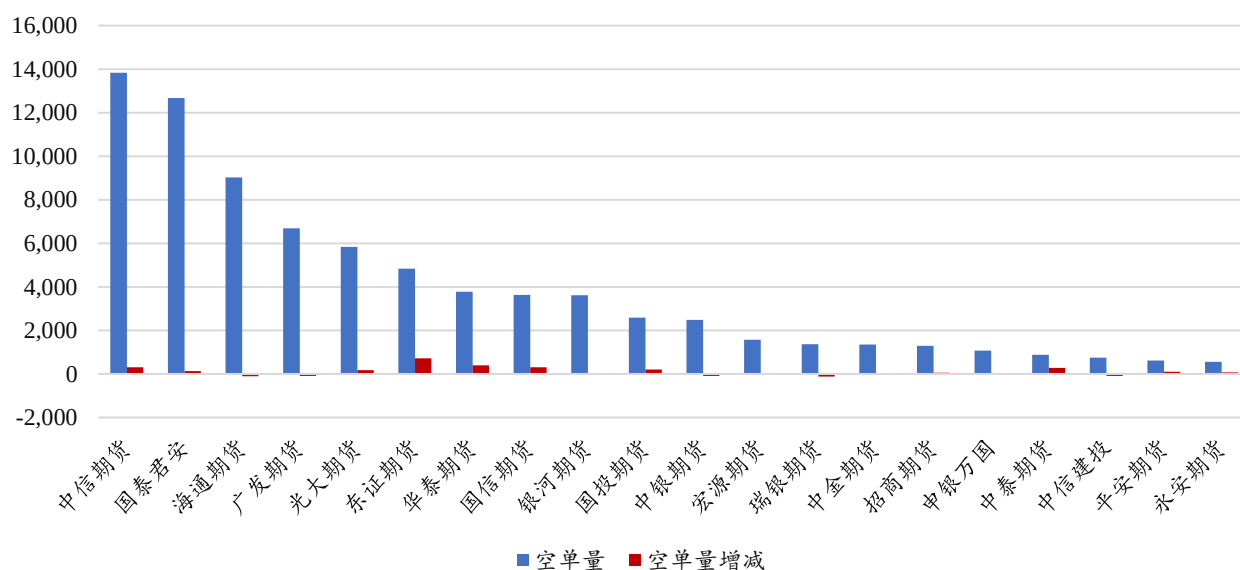
IH 品种当日前二十多头席位中，国泰君安期货排名第一，总持仓 13027 手。当日，多头增仓最多的是中信期货，日内增仓 479 手；多头减仓最多的是海通期货，日内减仓 230 手。



数据来源：Wind 广发期货研究所整理

【品种前二十空头席位持仓变动】

IH 品种当日前二十空头席位中，中信期货排名第一，总持仓 13835 手。当日，前二十席空头增仓最多的是东证期货，日内增仓 723 手；空头减仓最多的是瑞银期货，日内减仓 122 手。



数据来源：Wind 广发期货研究所整理

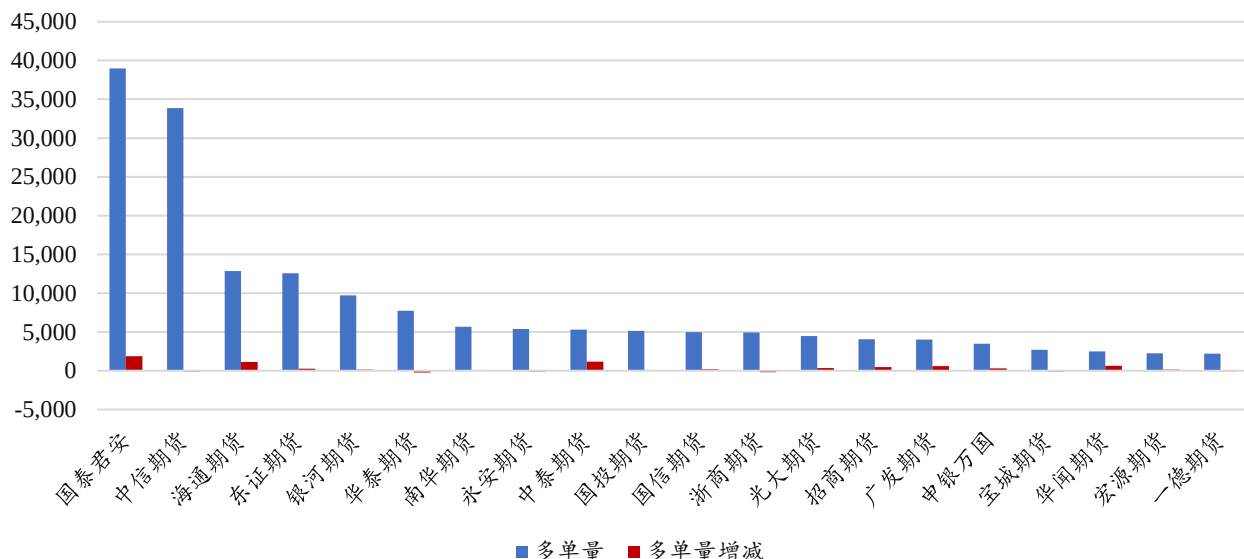
◆ IC：总持仓明显上升，国君多空头各加仓近 2000 手

【品种总持仓及主力合约持仓变化】

11 月 20 日，IC 品种总持仓上升 7467 手，主力合约 2512 上升 12102 手。

【品种前二十多头席位持仓变动】

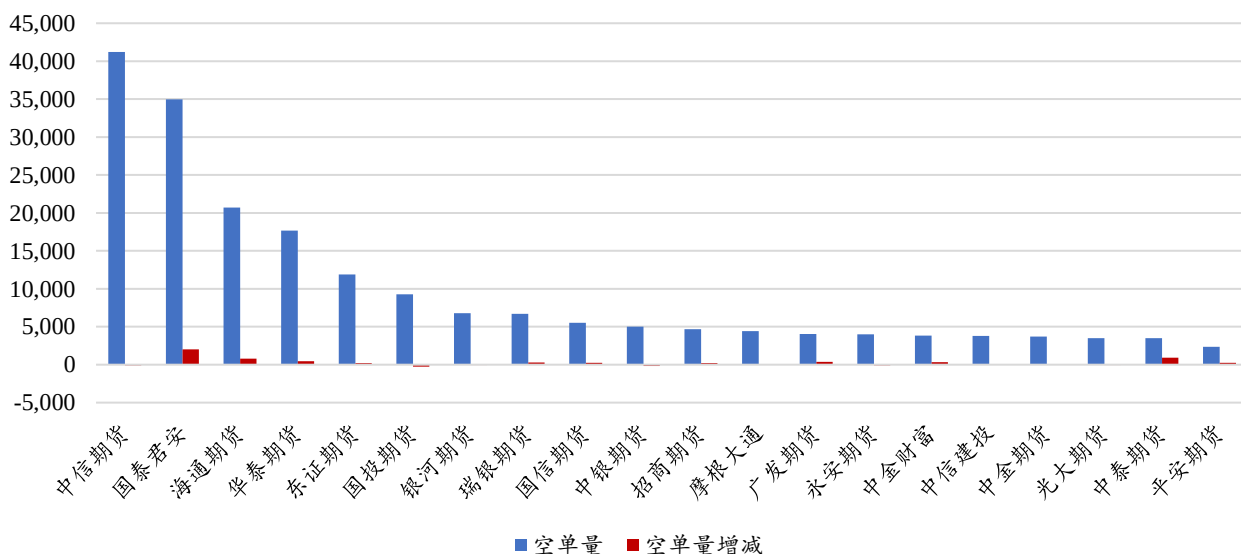
IC 品种当日前二十多头席位中，国泰君安期货排名第一，总持仓 38974 手。当日，多头增仓最多的是国泰君安期货，日内增仓 1876 手；多头减仓最多的是华泰期货，日内减仓 225 手。



数据来源：Wind 广发期货研究所整理

【品种前二十空头席位持仓变动】

IC 品种当日前二十空头席位中，中信期货排名第一，总持仓 41201 手。当日，空头增仓最多的是国泰君安期货，日内增仓 2025 手；空头减仓最多的是国投期货，日内减仓 265 手。



数据来源：Wind 广发期货研究所整理

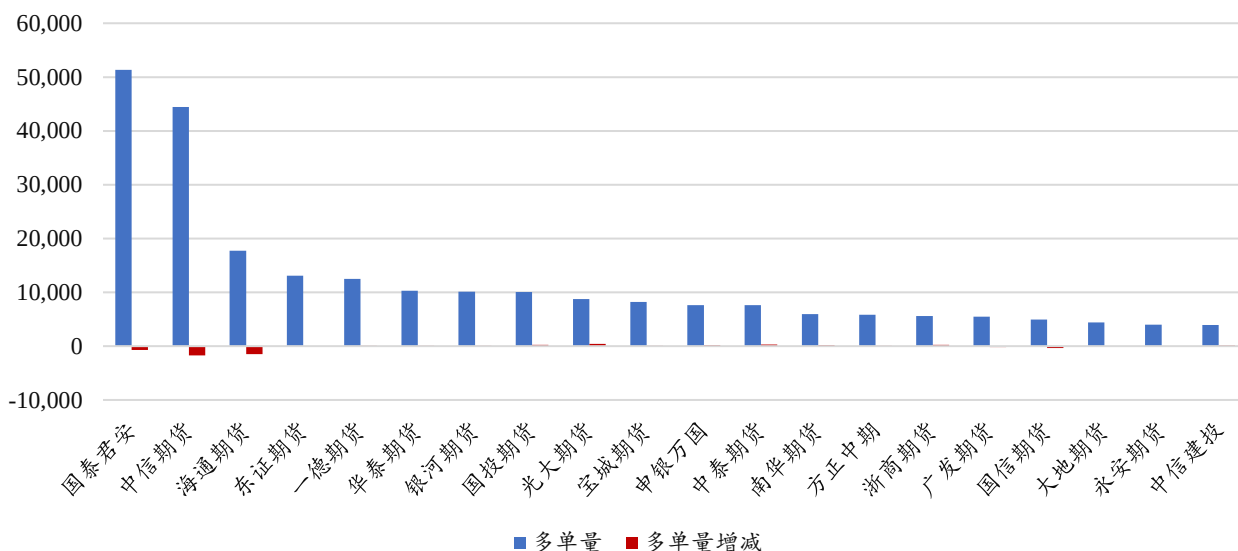
◆ **IM：总持仓小幅下降，中信多头、海通空头各减仓超千手**

【品种总持仓及主力合约持仓变化】

11 月 20 日，IM 品种总持仓下降 2194 手，其中主力合约 2512 持仓下降 4785 手。

【品种前二十多头席位持仓变动】

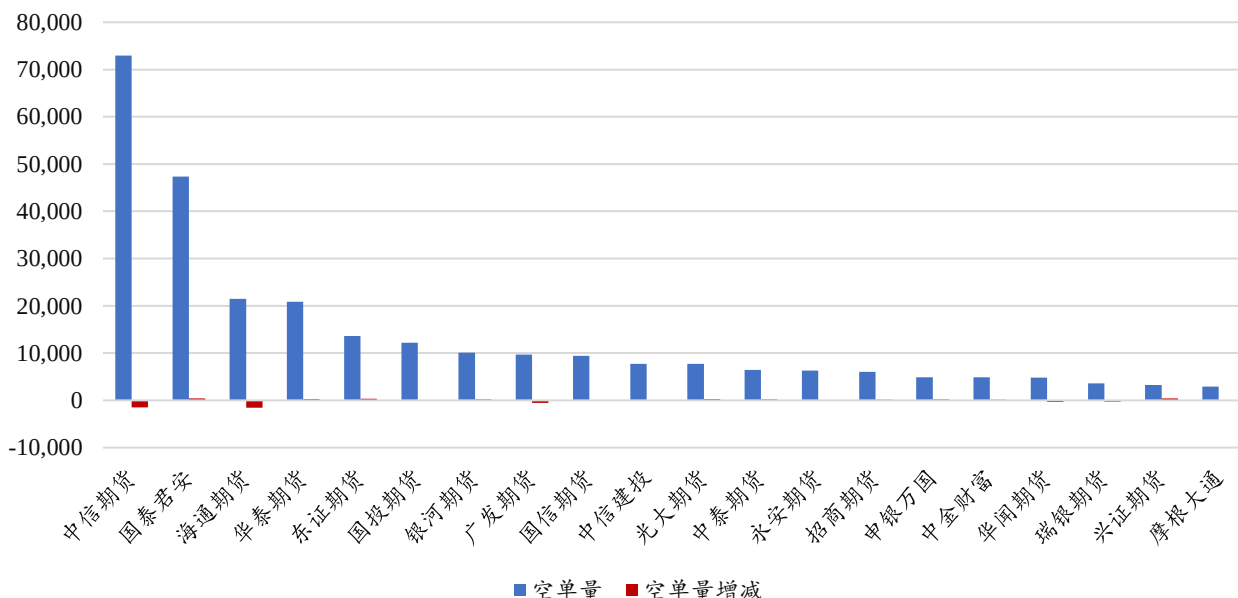
IM 品种当日前二十多头席位中，国泰君安期货排名第一，总持仓 51352 手。当日，多头增仓最多的是光大期货，日内增仓 415 手；多头减仓最多的是中信期货，日内减仓 1745 手。



数据来源：Wind 广发期货研究所整理

【品种前二十空头席位持仓变动】

IM 品种当日前二十空头席位中，中信期货排名第一，总持仓 72970 手。当日，前二十席位空头增仓最多的是国泰君安期货，日内增仓 403 手；空头减仓最多的是海通期货，日内减仓 1570 手。



数据来源：Wind 广发期货研究所整理

免责声明

本报告中的信息均来源于被广发期货有限公司认为可靠的已公开资料，但广发期货对这些信息的准确性及完整性不作任何保证。

本报告反映研究人员的不同观点、见解及分析方法，并不代表广发期货或其附属机构的立场。报告所载资料、意见及推测仅反映研究人员于发出本报告当日的判断，可随时更改且不予通告。

在任何情况下，报告内容仅供参考，报告中的信息或所表达的意见并不构成所述品种买卖的出价或询价，投资者据此投资，风险自担。

本报告旨在发送给广发期货特定客户及其他专业人士，版权归广发期货所有，未经广发期货书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制。如引用、刊发，需注明出处为“广发期货”，且不得对本报告进行有悖原意的删节和修改。

广发期货有限公司提醒广大投资者：期市有风险 入市需谨慎！

相关信息

数据来源：Wind、极羽、广发期货研究所

广发期货研究所

<http://www.gfqh.cn>

电话：020-88800000

地址：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 41 楼

邮政编码：510620