

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

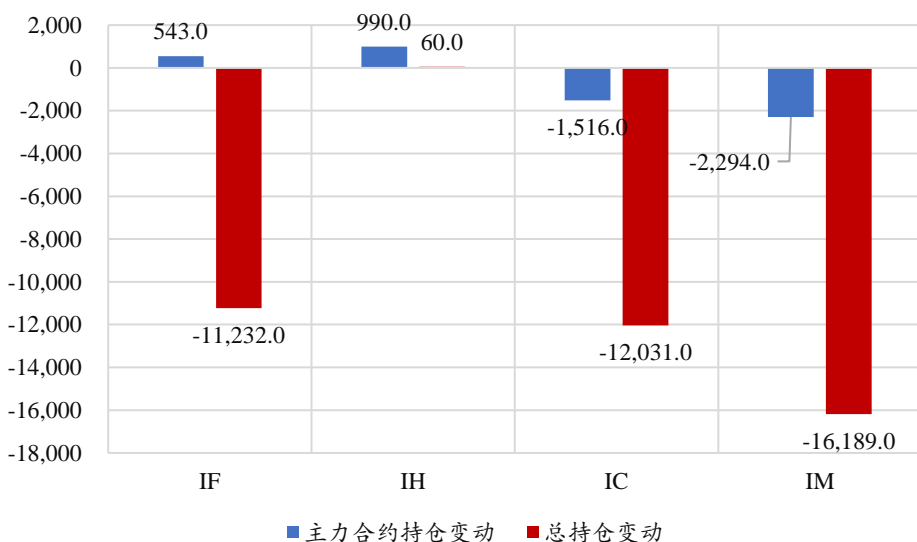
目录：

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	IF2603	总持仓明显下降	国君多空头各减仓近 2000 手
上证 50	IH2603	总持仓保持平稳	海通加仓中信减仓超千手
中证 500	IC2603	总持仓明显下降	中信多空头各减仓 2000 手左右
中证 1000	IM2603	总持仓大幅下降	中信多头减仓超 4000 手



数据来源：Wind 广发期货研究所整理

【股指期货】

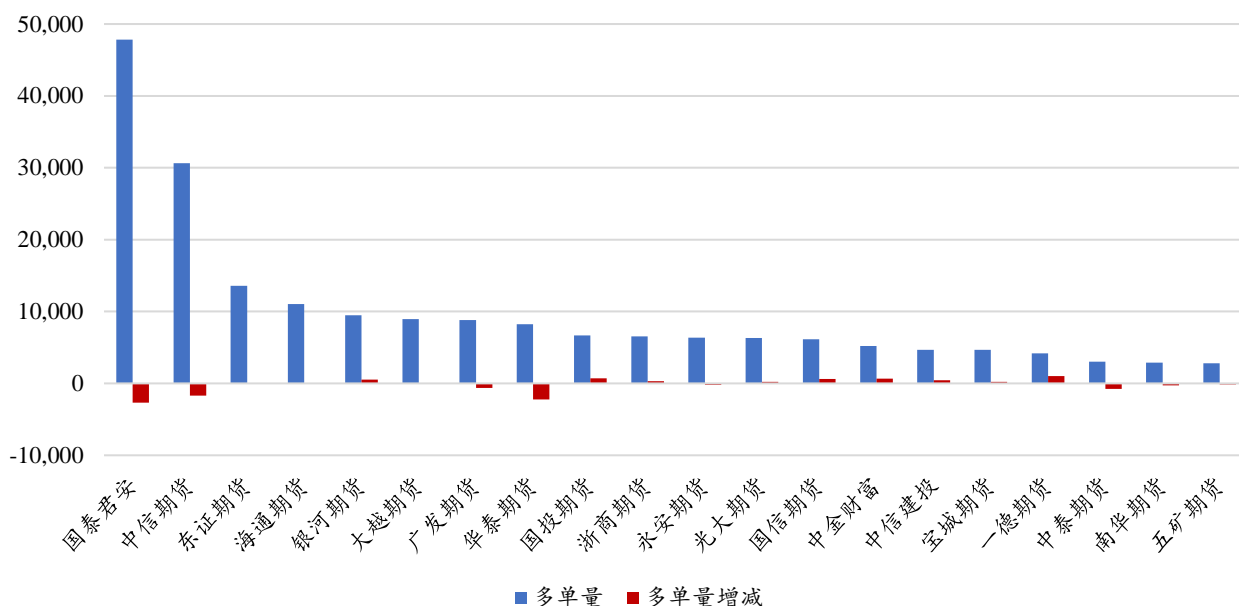
◆ IF：总持仓明显下降，国君多空头各减仓近 2000 手

【品种总持仓及主力合约持仓变化】

1 月 16 日，IF 品种总持仓下降 11232 手，其中主力合约 2603 持仓上升 543 手。

【品种前二十多头席位持仓量变动】

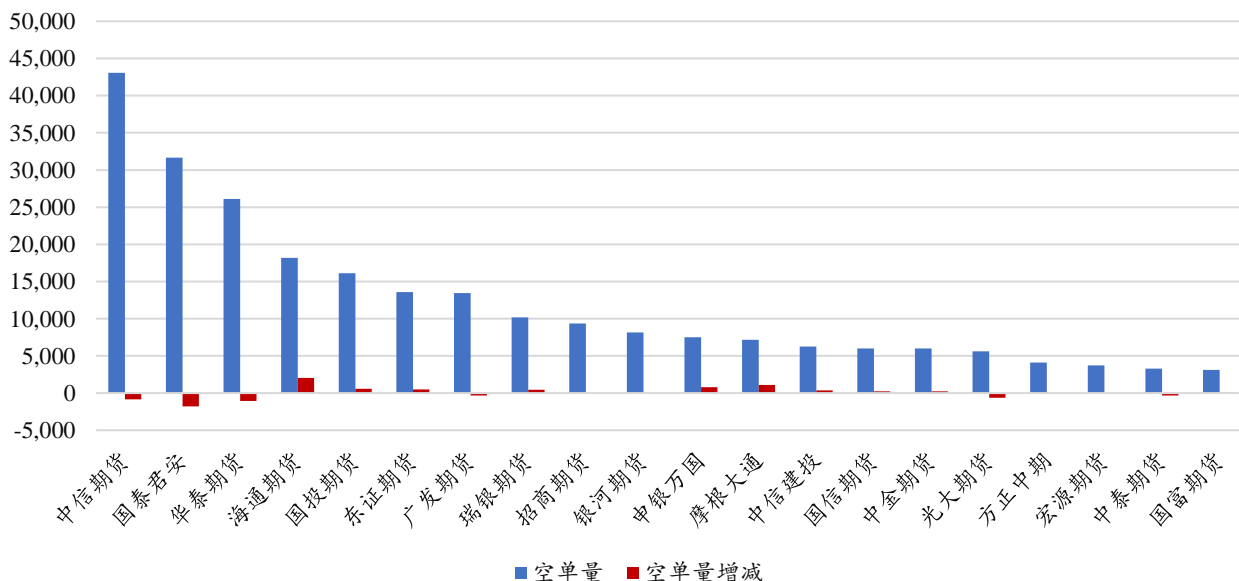
IF 品种当日前二十多头席位中，国泰君安期货排名第一，总持仓 47823 手。当日，多头增仓最多的是德期货，日内增仓 1035 手；多头减仓最多的是国泰君安期货，日内减仓 2671 手。



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 43066 手。当日，空头增仓最多的是海通期货，日内增仓 2060 手；空头减仓最多的是国泰君安期货，日内减仓 1795 手。



数据来源：Wind 广发期货研究所整理

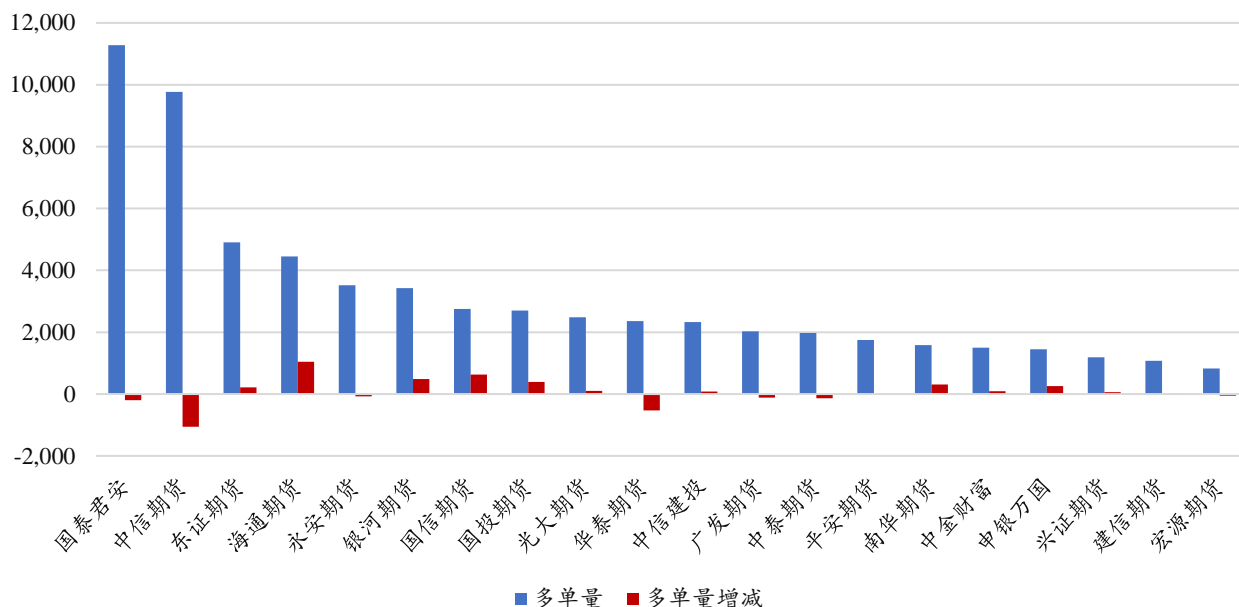
◆ **IH：总持仓保持平稳，海通加仓中信减仓超千手**

【品种总持仓及主力合约持仓变化】

1月16日，IH品种总持仓上升60手，其中主力合约2603持仓上升990手。

【品种前二十多头席位持仓变动】761

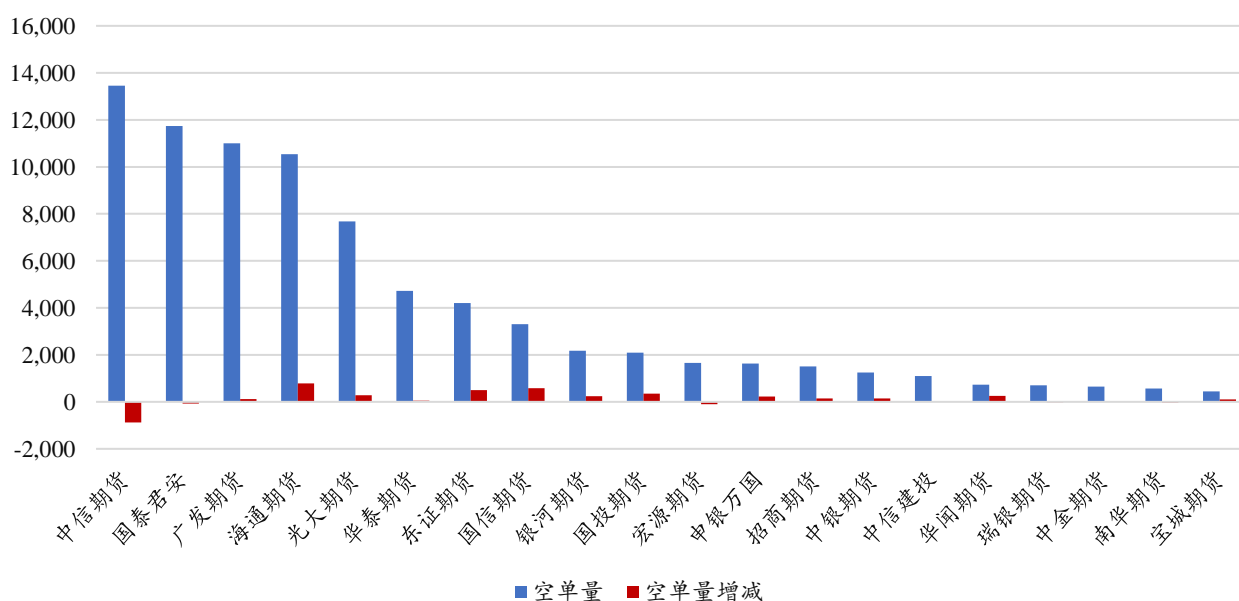
IH品种当日前二十多头席位中，国泰君安期货排名第一，总持仓11282手。当日，多头增仓最多的是海通期货，日内增仓1043手；多头减仓最多的是中信期货，日内减仓1057手。



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13456手。当日，前二十席空头增仓最多的是海通期货，日内增仓783手；空头减仓最多的是中信期货，日内减仓875手。



数据来源：Wind 广发期货研究所整理

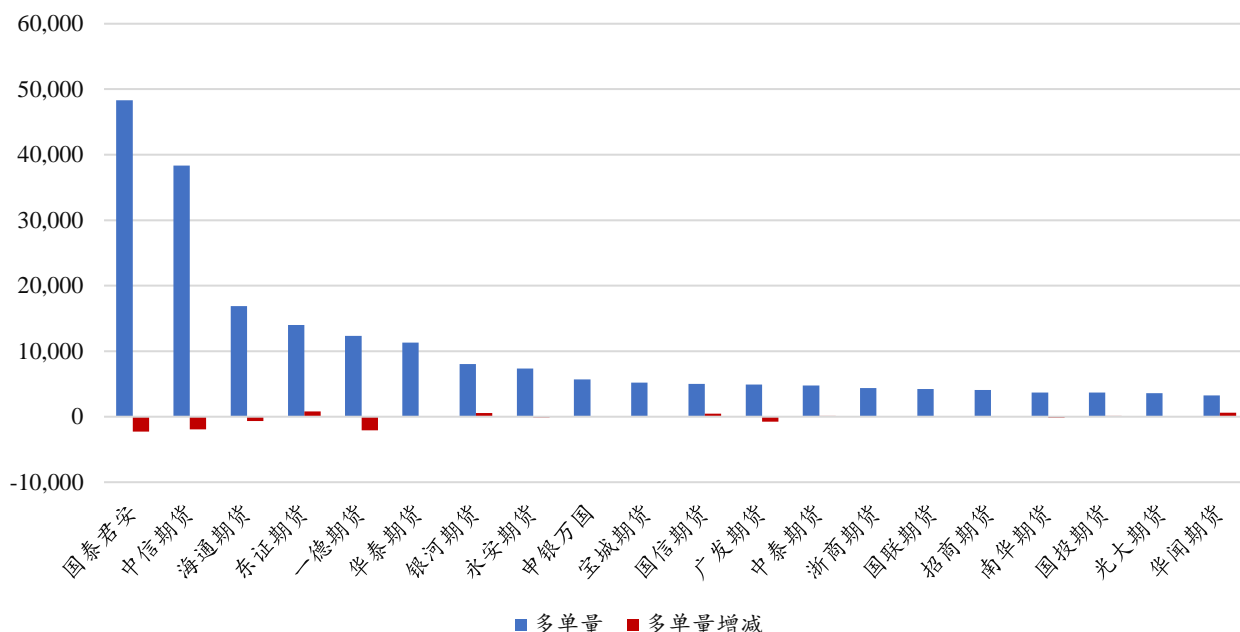
◆ IC：总持仓明显下降，中信多空头各减仓 2000 手左右

【品种总持仓及主力合约持仓变化】

1月16日，IC品种总持仓下降12031手，主力合约2603持仓下降1516手。

【品种前二十多头席位持仓变动】

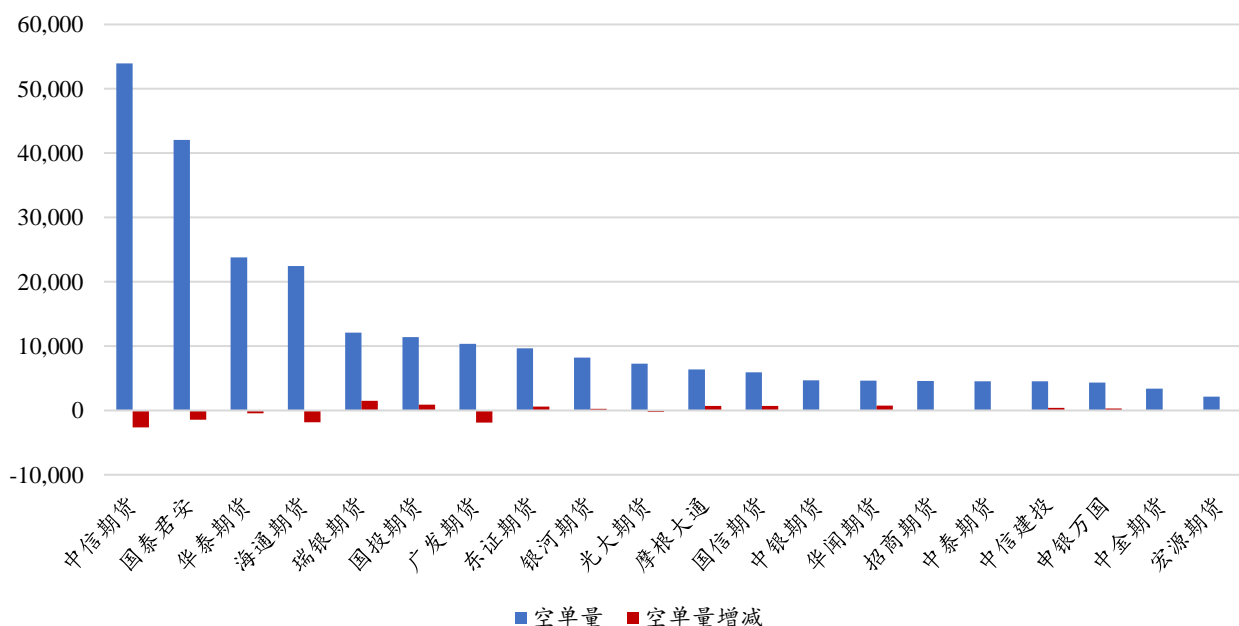
IC品种当日前二十多头席位中，国泰君安期货排名第一，总持仓48316手。当日，多头增仓最多的是东证期货，日内增仓824手；多头减仓最多的是国泰君安期货，日内减仓2265手。



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53969手。当日，空头增仓最多的是瑞银期货，日内增仓113手；空头减仓最多的是中信期货，日内减仓2634手。



数据来源：Wind 广发期货研究所整理

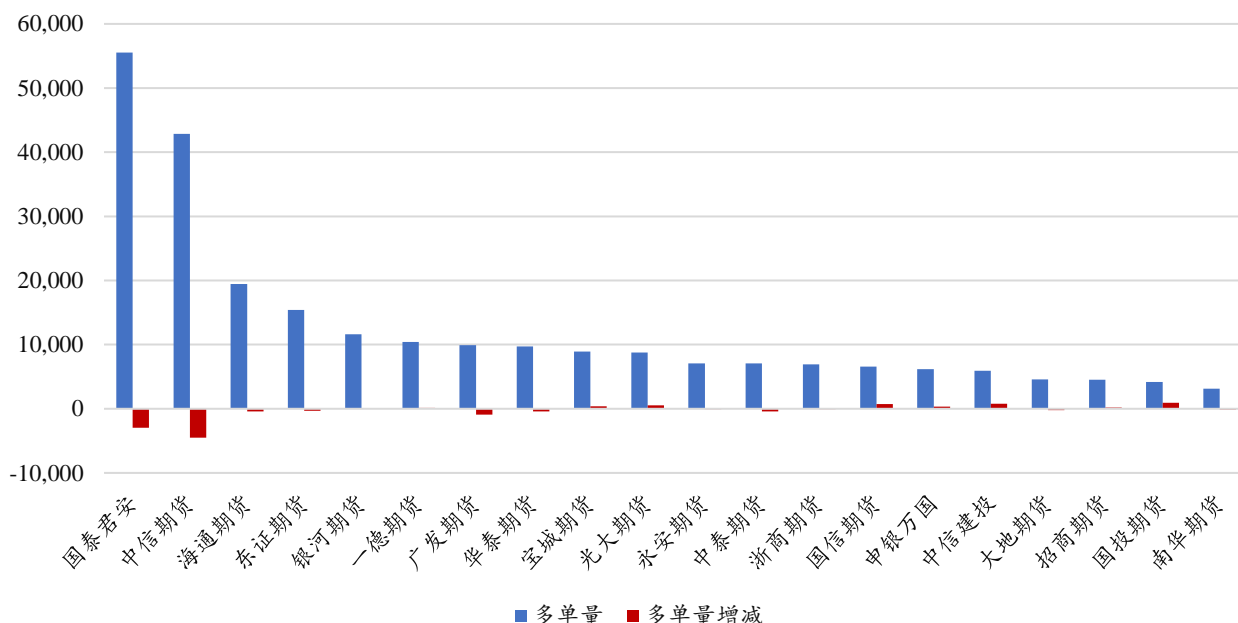
◆ **IM：总持仓大幅下降，中信多头减仓超 4000 手**

【品种总持仓及主力合约持仓变化】

1 月 16 日，IM 品种总持仓下降 16189 手，其中主力合约 2603 持仓下降 2294 手。

【品种前二十多头席位持仓变动】

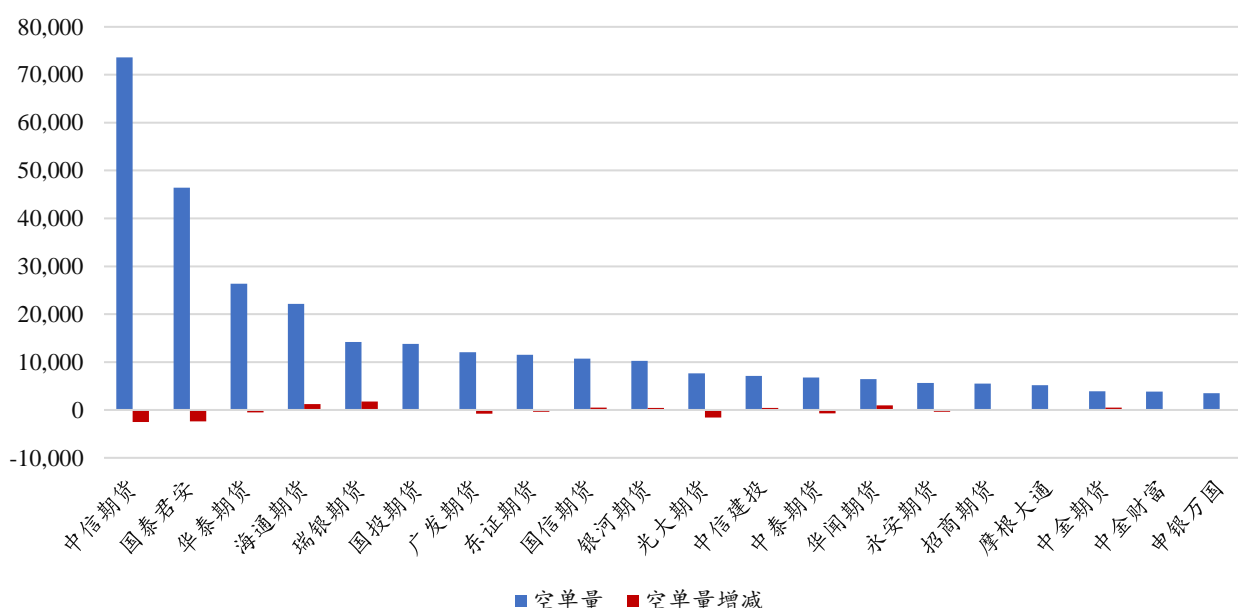
IM 品种当日前二十多头席位中，国泰君安期货排名第一，总持仓 55546 手。当日，多头增仓最多的是国投期货，日内增仓 931 手；多头减仓最多的是中信期货，日内减仓 4506 手。



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 73630 手。当日，空头增仓最多的是瑞银期货，日内加仓 1735 手；空头减仓最多的是中信期货，日内减仓 2548 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