

# 股指期货数据日报

2023年5月24日



银河期货暖❤️服务  
与您一起迎接未来

未来可期  
Futures - Future

## IF行情概要

单位：点、手、亿元

|        | 收盘价     | +/-    | 成交量    | +/- | 成交额   | +/- | 持仓量     | +/-   | 持仓保证金  |
|--------|---------|--------|--------|-----|-------|-----|---------|-------|--------|
| 沪深300  | 3859.09 | -1.38% | 13,726 | 16% | 2,118 | 11% |         |       |        |
| IF2306 | 3847.40 | -1.63% | 77,188 | 15% | 897   | 14% | 131,094 | 6,199 | 182.02 |
| IF2307 | 3821.80 | -1.70% | 5,358  | 18% | 62    | 17% | 8,391   | 1,878 | 11.58  |
| IF2309 | 3821.80 | -1.65% | 16,666 | 10% | 192   | 9%  | 70,208  | 2,491 | 96.82  |
| IF2312 | 3825.00 | -1.68% | 2,500  | 26% | 29    | 24% | 8,616   | 199   | 11.89  |

IF主力合约下跌1.63%，报收3847.4点。

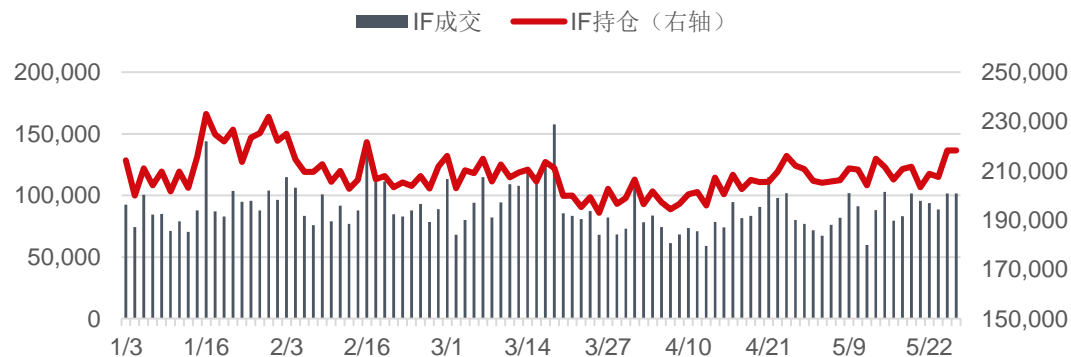
IF四合约总成交101712手，较前日增加13178手；总持仓218309手，较前日增加10767手。

IF主力合约贴水-11.69点，较前日上升5.3点；年化基差率为-4.21%。

IF四合约分红影响分别为19.11点、61.08点、71.66点和74.56点。

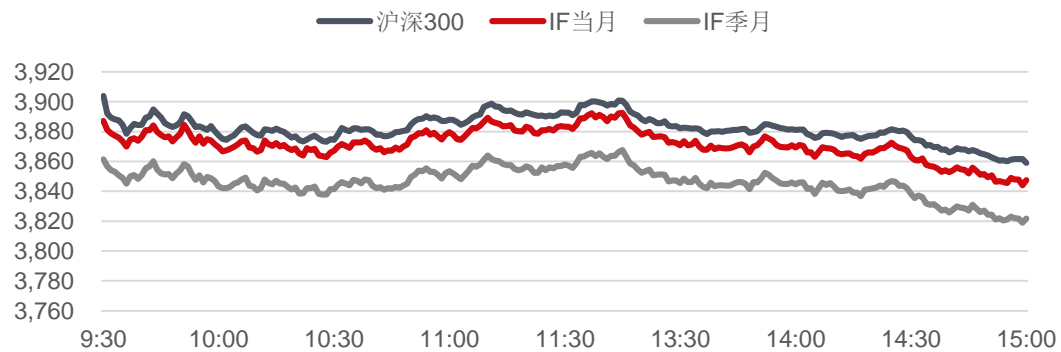
## IF成交持仓

单位：点



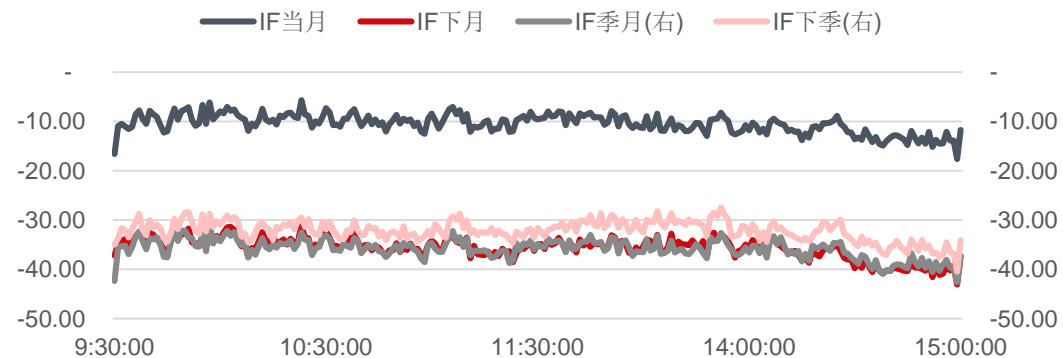
## IF日内走势

单位：点



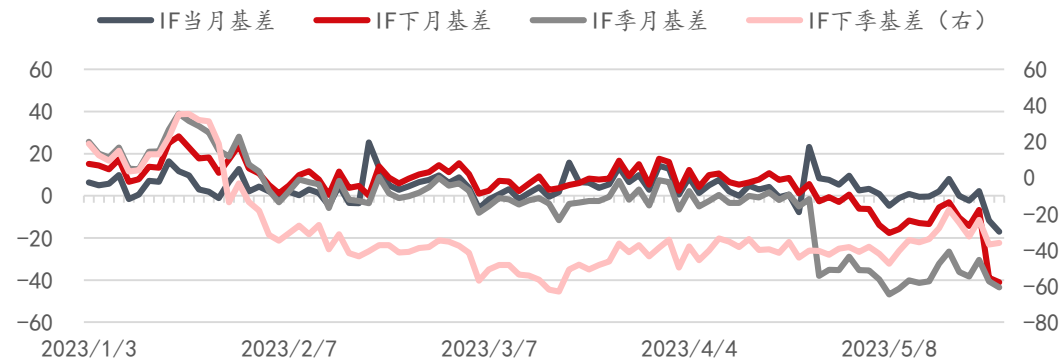
## IF日内基差

单位：点



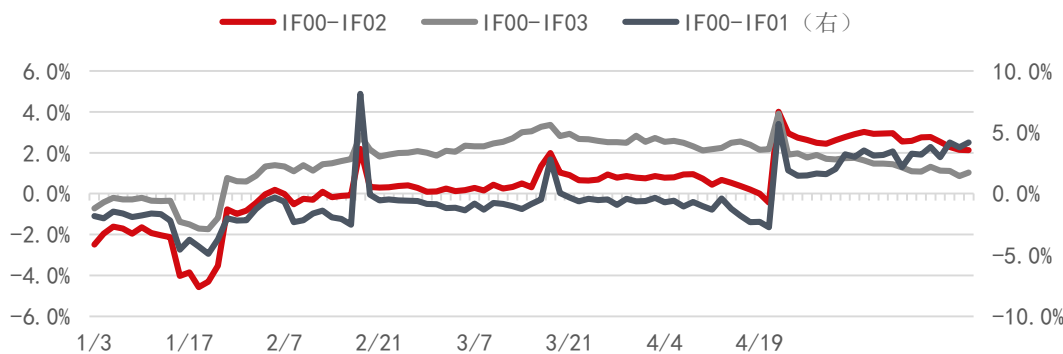
## IF基差

单位：点



## IF年化移仓成本

注：负值为移仓有收益

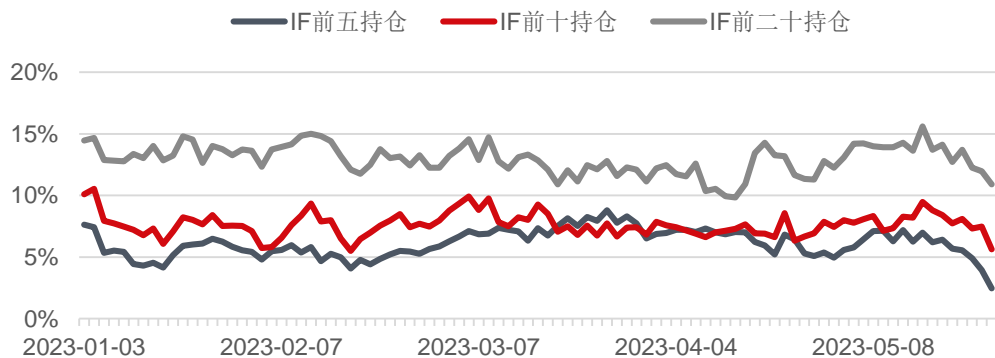


## IF分红影响

单位：点

|       | 合约 | 收盘价      | 到期日        | 剩余天数 | 分红影响  | 升贴水点数  | 升贴水率  | 年化升贴水率 |
|-------|----|----------|------------|------|-------|--------|-------|--------|
| 沪深300 | 现货 | 3,859.09 |            |      |       |        |       |        |
|       | 当月 | 3,847.40 | 2023-06-16 | 22   | 19.11 | -11.69 | -0.3% | 0.0%   |
|       | 下月 | 3,821.80 | 2023-07-21 | 57   | 61.08 | -37.29 | -1.0% | 0.0%   |
|       | 季一 | 3,821.80 | 2023-09-15 | 113  | 71.66 | -37.29 | -1.0% | 0.0%   |
|       | 季二 | 3,825.00 | 2023-12-15 | 204  | 74.56 | -34.09 | -0.9% | 0.0%   |

## IF净空头持仓占比



## IF2306主要席位

单位：手

| 名次 | 会员名称  | 成交量     | 前上日增减  | 名次 | 会员名称  | 持买单量   | 前上日增减 | 名次 | 会员名称  | 持卖单量    | 前上日增减 |
|----|-------|---------|--------|----|-------|--------|-------|----|-------|---------|-------|
| 1  | 国泰君安  | 20,873  | 3,408  | 1  | 国泰君安  | 18,717 | 2,664 | 1  | 中信期货  | 20,583  | 1,011 |
| 2  | 中信期货  | 19,299  | 3,248  | 2  | 中信期货  | 14,462 | 752   | 2  | 国泰君安  | 14,610  | 1,477 |
| 3  | 海通期货  | 9,331   | 2,433  | 3  | 华泰期货  | 6,543  | 380   | 3  | 中银期货  | 9,307   | -356  |
| 4  | 华泰期货  | 6,713   | 1,682  | 4  | 海通期货  | 5,227  | 861   | 4  | 上海东证  | 8,774   | 237   |
| 5  | 国信期货  | 6,076   | 679    | 5  | 上海东证  | 4,853  | -160  | 5  | 华泰期货  | 8,111   | -251  |
| 6  | 上海东证  | 5,949   | -106   | 6  | 广发期货  | 4,560  | 209   | 6  | 国投安信  | 4,723   | 132   |
| 7  | 永安期货  | 4,858   | 2,461  | 7  | 国投安信  | 3,962  | 257   | 7  | 海通期货  | 4,330   | 214   |
| 8  | 华闻期货  | 4,577   | 174    | 8  | 银河期货  | 3,753  | 86    | 8  | 中金期货  | 3,405   | 98    |
| 9  | 银河期货  | 3,693   | 325    | 9  | 申银万国  | 3,600  | 127   | 9  | 银河期货  | 3,311   | 519   |
| 10 | 申银万国  | 3,441   | 145    | 10 | 浙商期货  | 3,283  | 71    | 10 | 申银万国  | 3,001   | -226  |
|    | 前五席位  | 62,292  | 11,650 |    | 前五席位  | 49,802 | 4,497 |    | 前五席位  | 61,385  | 2,118 |
|    | 前十席位  | 84,810  | 14,649 |    | 前十席位  | 68,960 | 5,247 |    | 前十席位  | 80,155  | 2,855 |
|    | 前二十席位 | 109,284 | 18,283 |    | 前二十席位 | 90,466 | 4,850 |    | 前二十席位 | 102,877 | 3,941 |

## IF2309主要席位

单位：手

| 名次 | 会员名称  | 成交量    | 前上日增减 | 名次 | 会员名称  | 持买单量   | 前上日增减 | 名次 | 会员名称  | 持卖单量   | 前上日增减 |
|----|-------|--------|-------|----|-------|--------|-------|----|-------|--------|-------|
| 1  | 国泰君安  | 5,665  | -113  | 1  | 中信期货  | 10,516 | 793   | 1  | 广发期货  | 7,054  | 404   |
| 2  | 中信期货  | 4,621  | 347   | 2  | 国泰君安  | 6,421  | 499   | 2  | 国泰君安  | 6,743  | -112  |
| 3  | 海通期货  | 2,934  | 637   | 3  | 申银万国  | 5,836  | 204   | 3  | 中信期货  | 6,216  | 362   |
| 4  | 上海东证  | 1,786  | -104  | 4  | 国投安信  | 3,054  | 100   | 4  | 瑞银期货  | 5,710  | 0     |
| 5  | 华泰期货  | 1,436  | 496   | 5  | 海通期货  | 2,577  | 399   | 5  | 摩根大通  | 5,180  | -149  |
| 6  | 国信期货  | 1,424  | -84   | 6  | 永安期货  | 2,050  | -299  | 6  | 乾坤期货  | 4,781  | 0     |
| 7  | 华闻期货  | 1,419  | 91    | 7  | 华泰期货  | 1,853  | -54   | 7  | 中金期货  | 4,635  | 0     |
| 8  | 申银万国  | 902    | 20    | 8  | 浙商期货  | 1,793  | 5     | 8  | 华泰期货  | 4,593  | 840   |
| 9  | 永安期货  | 735    | 247   | 9  | 上海东证  | 1,747  | -148  | 9  | 平安期货  | 1,884  | 178   |
| 10 | 华西期货  | 703    | 229   | 10 | 银河期货  | 1,738  | -37   | 10 | 上海东证  | 1,846  | -84   |
|    | 前五席位  | 16,442 | 1,263 |    | 前五席位  | 28,404 | 1,995 |    | 前五席位  | 30,903 | 505   |
|    | 前十席位  | 21,625 | 1,766 |    | 前十席位  | 37,585 | 1,462 |    | 前十席位  | 48,642 | 1,439 |
|    | 前二十席位 | 26,383 | 2,981 |    | 前二十席位 | 48,884 | 1,749 |    | 前二十席位 | 61,435 | 1,696 |

## IC行情概要

单位：点、手、亿元

|        | 收盘价     | +/-    | 成交量    | +/- | 成交额   | +/- | 持仓量     | +/-   | 持仓保证金  |
|--------|---------|--------|--------|-----|-------|-----|---------|-------|--------|
| 中证500  | 6005.79 | -0.77% | 10,722 | -3% | 1,169 | -3% |         |       |        |
| IC2306 | 5992.80 | -0.97% | 51,894 | 23% | 624   | 22% | 152,439 | 2,460 | 219.83 |
| IC2307 | 5971.40 | -1.03% | 5,598  | 41% | 67    | 39% | 7,435   | 2,329 | 10.69  |
| IC2309 | 5950.80 | -0.99% | 13,336 | 28% | 159   | 27% | 103,707 | 1,753 | 148.54 |
| IC2312 | 5906.20 | -0.98% | 6,419  | 14% | 76    | 13% | 28,932  | 2,396 | 41.13  |

IC主力合约下跌0.97%，报收5992.8点。

IC四合约总成交77247手，较前日增加15115手；总持仓292513手，较前日增加8938手。

IC主力合约贴水-12.99点，较前日上升9.04点；年化基差率为-3%。

IC四合约分红影响分别为29.35点、59.88点、68.16点和68.45点。

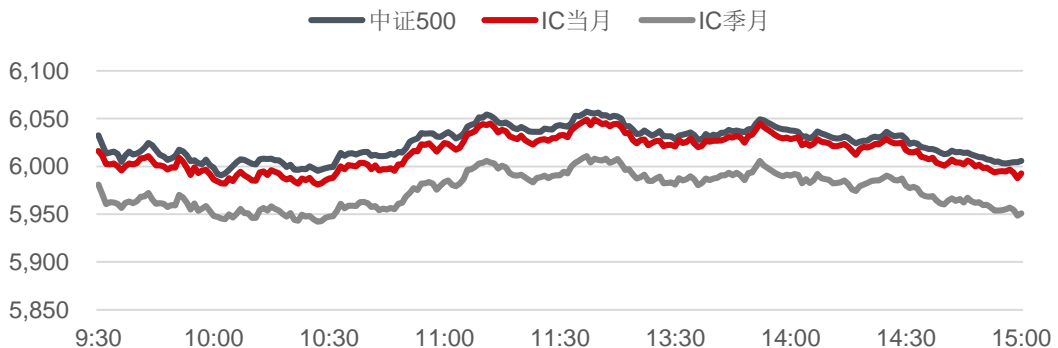
## IC成交持仓

单位：点



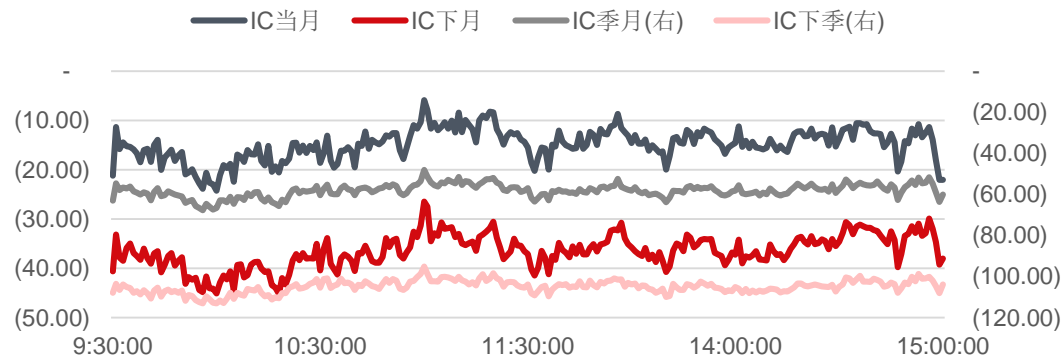
## IC日内走势

单位：点



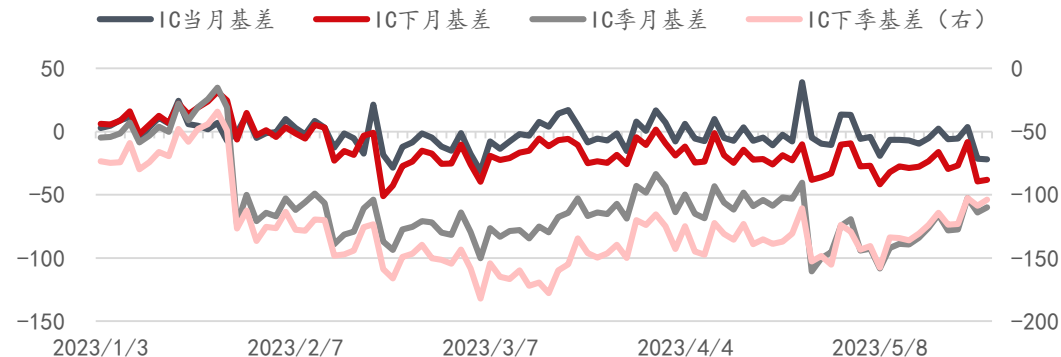
## IC日内基差

单位：点



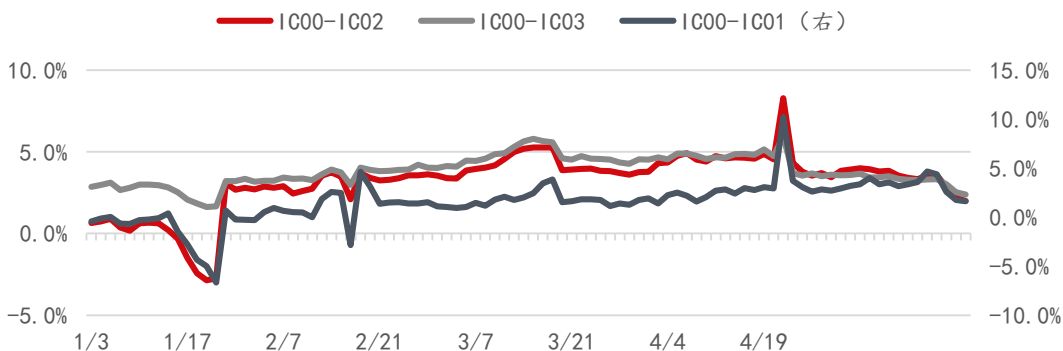
## IC基差

单位：点



## IC年化移仓成本

注：负值为移仓有收益

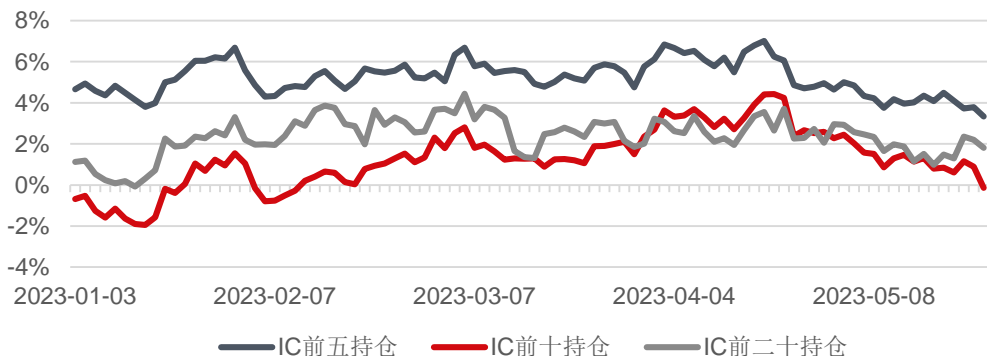


## IC分红影响

单位：点

|       | 合约 | 收盘价      | 到期日        | 剩余天数 | 分红价值  | 升贴水点数  | 升贴水率  | 年化升贴水率 |
|-------|----|----------|------------|------|-------|--------|-------|--------|
| 中证500 | 现货 | 6,005.79 |            |      |       |        |       |        |
|       | 当月 | 5,992.80 | 2023-06-16 | 22   | 29.35 | -12.99 | -0.2% | 0.0%   |
|       | 下月 | 5,971.40 | 2023-07-21 | 57   | 59.88 | -34.39 | -0.6% | 0.0%   |
|       | 季一 | 5,950.80 | 2023-09-15 | 113  | 68.16 | -54.99 | -0.9% | 0.0%   |
|       | 季二 | 5,906.20 | 2023-12-15 | 204  | 68.45 | -99.59 | -1.7% | 0.0%   |

## IC净空头持仓占比



## IC2305主要席位

单位：手

| 名次    | 会员名称 | 成交量    | 前上日增减  | 名次    | 会员名称 | 持买单量    | 前上日增减 | 名次    | 会员名称 | 持卖单量    | 前上日增减 |
|-------|------|--------|--------|-------|------|---------|-------|-------|------|---------|-------|
| 1     | 国泰君安 | 16,426 | 2,354  | 1     | 中信期货 | 21,342  | -64   | 1     | 国泰君安 | 19,793  | 680   |
| 2     | 中信期货 | 15,464 | 2,574  | 2     | 国泰君安 | 14,963  | -136  | 2     | 中信期货 | 17,485  | 460   |
| 3     | 海通期货 | 7,148  | 2,433  | 3     | 国投安信 | 11,181  | -160  | 3     | 华泰期货 | 14,061  | -441  |
| 4     | 华泰期货 | 4,199  | 283    | 4     | 中信建投 | 8,792   | 26    | 4     | 海通期货 | 12,700  | 854   |
| 5     | 上海东证 | 4,191  | -259   | 5     | 上海东证 | 7,835   | 20    | 5     | 国投安信 | 7,771   | 149   |
| 6     | 申银万国 | 3,650  | 1,575  | 6     | 海通期货 | 5,750   | 508   | 6     | 上海东证 | 6,426   | 139   |
| 7     | 永安期货 | 2,898  | 1,484  | 7     | 平安期货 | 5,713   | -52   | 7     | 中银期货 | 5,881   | -380  |
| 8     | 国信期货 | 2,793  | 322    | 8     | 申银万国 | 5,682   | -235  | 8     | 银河期货 | 4,804   | 92    |
| 9     | 银河期货 | 2,675  | 674    | 9     | 华泰期货 | 5,457   | 300   | 9     | 申银万国 | 4,027   | 605   |
| 10    | 华闻期货 | 2,651  | 271    | 10    | 兴证期货 | 5,320   | -15   | 10    | 永安期货 | 4,015   | -911  |
| 前五席位  |      | 47,428 | 7,385  | 前五席位  |      | 64,113  | -314  | 前五席位  |      | 71,810  | 1,702 |
| 前十席位  |      | 62,095 | 11,711 | 前十席位  |      | 92,035  | 192   | 前十席位  |      | 96,963  | 1,247 |
| 前二十席位 |      | 77,648 | 15,200 | 前二十席位 |      | 119,311 | 994   | 前二十席位 |      | 123,508 | 2,159 |

## IC2309主要席位

单位：手

| 名次    | 会员名称 | 成交量    | 前上日增减 | 名次    | 会员名称 | 持买单量   | 前上日增减 | 名次    | 会员名称 | 持卖单量   | 前上日增减 |
|-------|------|--------|-------|-------|------|--------|-------|-------|------|--------|-------|
| 1     | 国泰君安 | 4,917  | 1,185 | 1     | 中信期货 | 14,133 | 958   | 1     | 华泰期货 | 17,004 | 48    |
| 2     | 中信期货 | 4,056  | 907   | 2     | 国投安信 | 13,751 | -27   | 2     | 中信期货 | 13,885 | 118   |
| 3     | 海通期货 | 3,059  | 1,331 | 3     | 海通期货 | 9,619  | 713   | 3     | 国泰君安 | 7,950  | 347   |
| 4     | 国信期货 | 1,453  | 313   | 4     | 申银万国 | 8,366  | -21   | 4     | 瑞银期货 | 7,664  | 31    |
| 5     | 上海东证 | 1,291  | -602  | 5     | 中泰期货 | 5,546  | 11    | 5     | 海通期货 | 6,030  | 92    |
| 6     | 申银万国 | 1,081  | 317   | 6     | 中信建投 | 4,928  | -7    | 6     | 中金期货 | 5,655  | 3     |
| 7     | 华闻期货 | 844    | 123   | 7     | 兴证期货 | 4,525  | 156   | 7     | 乾坤期货 | 4,980  | 0     |
| 8     | 华西期货 | 729    | 337   | 8     | 上海东证 | 4,027  | 112   | 8     | 国投安信 | 3,245  | 19    |
| 9     | 招商期货 | 586    | 455   | 9     | 华泰期货 | 3,643  | 26    | 9     | 上海东证 | 3,182  | 101   |
| 10    | 华泰期货 | 564    | 378   | 10    | 国信期货 | 3,190  | -47   | 10    | 摩根大通 | 3,002  | -41   |
| 前五席位  |      | 14,776 | 3,134 | 前五席位  |      | 51,415 | 1,634 | 前五席位  |      | 52,533 | 636   |
| 前十席位  |      | 18,580 | 4,744 | 前十席位  |      | 71,728 | 1,874 | 前十席位  |      | 72,597 | 718   |
| 前二十席位 |      | 22,132 | 5,540 | 前二十席位 |      | 89,168 | 1,325 | 前二十席位 |      | 89,692 | 1,230 |

## IC2312主要席位

单位：手

| 名次    | 会员名称 | 成交量    | 前上日增减 | 名次    | 会员名称 | 持买单量   | 前上日增减 | 名次    | 会员名称 | 持卖单量   | 前上日增减 |
|-------|------|--------|-------|-------|------|--------|-------|-------|------|--------|-------|
| 1     | 国泰君安 | 1,536  | 493   | 1     | 国泰君安 | 3,561  | 190   | 1     | 华泰期货 | 5,598  | 656   |
| 2     | 海通期货 | 1,492  | 158   | 2     | 中信期货 | 3,491  | 158   | 2     | 中信期货 | 2,697  | 73    |
| 3     | 中信期货 | 1,161  | 108   | 3     | 海通期货 | 3,472  | 525   | 3     | 摩根大通 | 1,884  | 35    |
| 4     | 上海东证 | 917    | -573  | 4     | 国富期货 | 2,510  | -177  | 4     | 招商期货 | 1,788  | -2    |
| 5     | 华泰期货 | 802    | -119  | 5     | 国投安信 | 2,234  | 376   | 5     | 国泰君安 | 1,460  | 108   |
| 6     | 瑞银期货 | 602    | -70   | 6     | 兴证期货 | 2,083  | 118   | 6     | 瑞银期货 | 1,335  | 597   |
| 7     | 国富期货 | 564    | 440   | 7     | 申银万国 | 1,515  | 309   | 7     | 上海东证 | 1,324  | 137   |
| 8     | 国信期货 | 556    | 123   | 8     | 上海东证 | 1,066  | 128   | 8     | 中金财富 | 1,296  | 86    |
| 9     | 国投安信 | 446    | 301   | 9     | 中泰期货 | 778    | 68    | 9     | 海通期货 | 1,188  | 139   |
| 10    | 光大期货 | 374    | 300   | 10    | 华泰期货 | 639    | 52    | 10    | 申银万国 | 1,136  | 3     |
| 前五席位  |      | 5,908  | 67    | 前五席位  |      | 15,268 | 1,072 | 前五席位  |      | 13,427 | 870   |
| 前十席位  |      | 8,450  | 1,161 | 前十席位  |      | 21,349 | 1,747 | 前十席位  |      | 19,706 | 1,832 |
| 前二十席位 |      | 10,953 | 1,936 | 前二十席位 |      | 25,533 | 2,312 | 前二十席位 |      | 25,912 | 2,390 |

## IM行情概要

单位：点、手、亿元

|        | 收盘价     | +/-    | 成交量    | +/- | 成交额   | +/- | 持仓量    | +/-  | 持仓保证金  |
|--------|---------|--------|--------|-----|-------|-----|--------|------|--------|
| 中证1000 | 6513.18 | -0.23% | 12,586 | -2% | 1,635 | 3%  |        |      |        |
| IM2306 | 6497.00 | -0.51% | 39,161 | 12% | 510   | 11% | 90,114 | -363 | 140.92 |
| IM2307 | 6482.00 | -0.50% | 2,431  | 54% | 32    | 53% | 2,465  | 781  | 3.84   |
| IM2309 | 6450.40 | -0.48% | 9,783  | 24% | 126   | 23% | 55,125 | 795  | 85.57  |
| IM2312 | 6409.00 | -0.39% | 2,959  | 16% | 38    | 15% | 18,120 | 662  | 27.93  |

IM主力合约下跌0.51%，报收6497点。

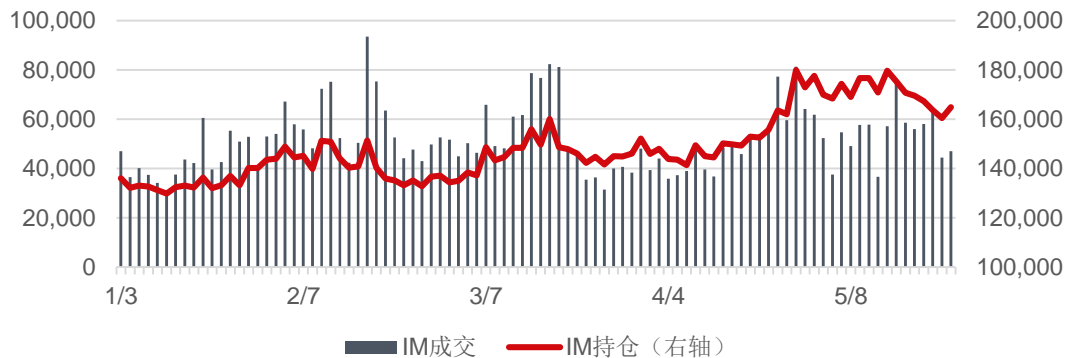
IM四合约总成交54334手，较前日增加7252手；总持仓165824手，较前日增加875手。

IM主力合约贴水-16.18点，较前日下降0.73点；年化基差率为-3.45%。

IM四合约分红影响分别为25.93点、37.24点、43.6点和44.27点。

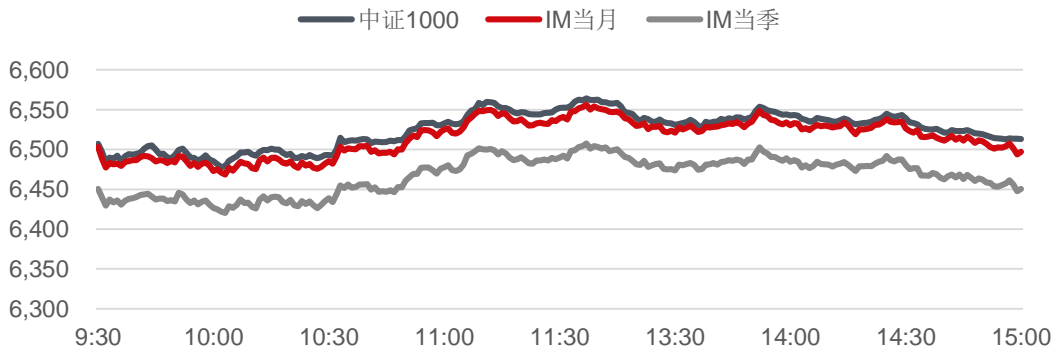
## IM成交持仓

单位：点



## IM日内走势

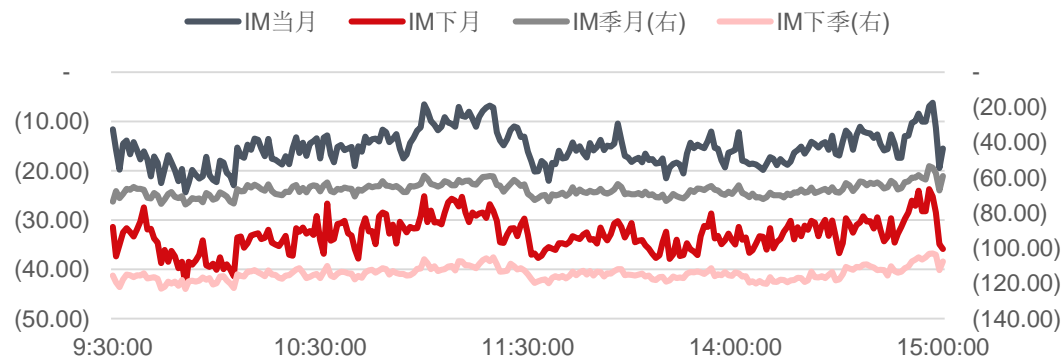
单位：点





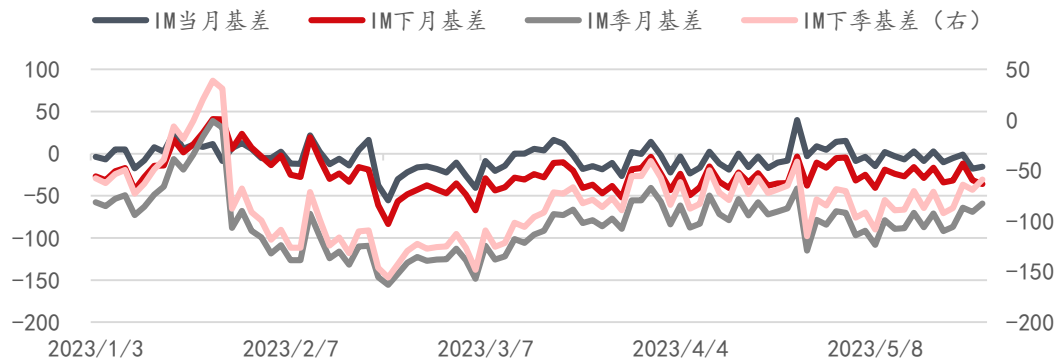
## IM日内基差

单位：点



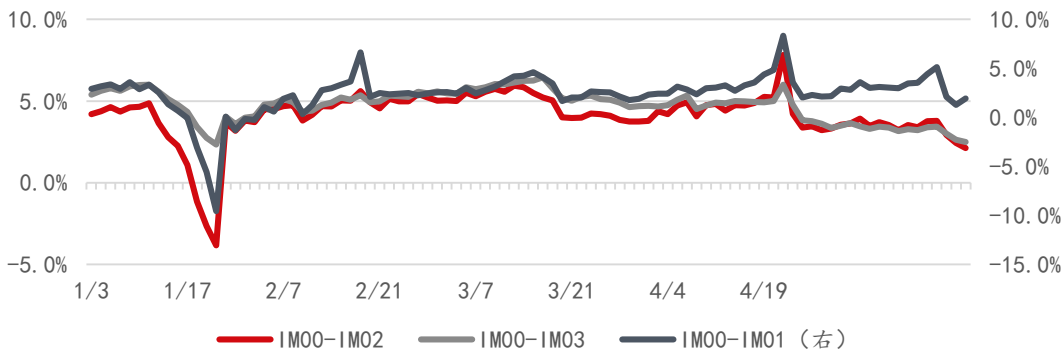
## IM基差

单位：点



## IM年化移仓成本

注：负值为移仓有收益

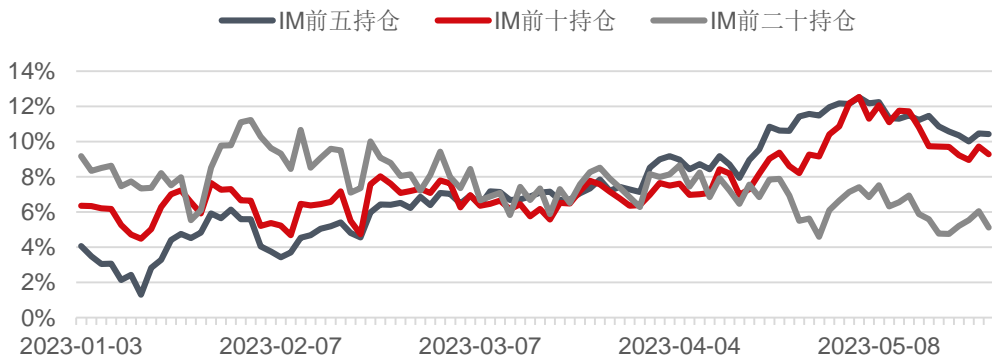


## IM分红影响

单位：点

|        | 合约 | 收盘价      | 到期日        | 剩余天数 | 分红价值  | 升贴水点数   | 升贴水率  | 年化升贴水率 |
|--------|----|----------|------------|------|-------|---------|-------|--------|
| 中证1000 | 现货 | 6,513.18 |            |      |       |         |       |        |
|        | 当月 | 6,497.00 | 2023-06-16 | 22   | 25.93 | -16.18  | -0.3% | 0.0%   |
|        | 下月 | 6,482.00 | 2023-07-21 | 57   | 37.24 | -31.18  | -0.5% | 0.0%   |
|        | 季一 | 6,450.40 | 2023-09-15 | 113  | 43.60 | -62.78  | -1.0% | 0.0%   |
|        | 季二 | 6,409.00 | 2023-12-15 | 204  | 44.27 | -104.18 | -1.7% | 0.0%   |

## IM净空头持仓占比



## IM2306主要席位

单位：手

| 名次    | 会员名称 | 成交量    | 前上日增减 | 名次    | 会员名称 | 持买单量   | 前上日增减  | 名次    | 会员名称 | 持卖单量   | 前上日增减  |
|-------|------|--------|-------|-------|------|--------|--------|-------|------|--------|--------|
| 1     | 国泰君安 | 13,481 | 1,849 | 1     | 国泰君安 | 13,877 | 18     | 1     | 国泰君安 | 15,978 | 19     |
| 2     | 中信期货 | 11,722 | 1,732 | 2     | 中信期货 | 8,517  | 27     | 2     | 中信期货 | 10,384 | 7      |
| 3     | 海通期货 | 5,555  | 1,397 | 3     | 国投安信 | 5,350  | 37     | 3     | 华泰期货 | 7,575  | 11     |
| 4     | 上海东证 | 3,745  | 207   | 4     | 银河期货 | 4,032  | -4     | 4     | 上海东证 | 5,363  | 29     |
| 5     | 华闻期货 | 2,421  | -77   | 5     | 上海东证 | 3,962  | 44     | 5     | 中银期货 | 3,432  | 4      |
| 6     | 申银万国 | 2,361  | 209   | 6     | 中信建投 | 3,804  | 20     | 6     | 海通期货 | 3,160  | 10     |
| 7     | 银河期货 | 2,274  | -53   | 7     | 华泰期货 | 3,657  | 32     | 7     | 中金期货 | 3,059  | 10     |
| 8     | 华泰期货 | 1,965  | -111  | 8     | 海通期货 | 3,473  | 41     | 8     | 银河期货 | 2,939  | 2      |
| 9     | 国信期货 | 1,931  | 165   | 9     | 永安期货 | 2,679  | 40     | 9     | 国投安信 | 2,879  | 8      |
| 10    | 招商期货 | 1,860  | -582  | 10    | 申银万国 | 2,328  | 74     | 10    | 申银万国 | 2,694  | 10     |
| 前五席位  |      | 36,924 | 5,108 | 前五席位  |      | 35,738 | -706   | 前五席位  |      | 42,732 | -1,553 |
| 前十席位  |      | 47,315 | 4,736 | 前十席位  |      | 51,679 | -1,169 | 前十席位  |      | 57,463 | -1,275 |
| 前二十席位 |      | 59,220 | 6,477 | 前二十席位 |      | 69,571 | -573   | 前二十席位 |      | 70,856 | -1,626 |

## IM2309主要席位

单位：手

| 名次    | 会员名称 | 成交量    | 前上日增减 | 名次    | 会员名称 | 持买单量   | 前上日增减 | 名次    | 会员名称 | 持卖单量   | 前上日增减 |
|-------|------|--------|-------|-------|------|--------|-------|-------|------|--------|-------|
| 1     | 国泰君安 | 3,791  | 635   | 1     | 华泰期货 | 5,457  | 139   | 1     | 中信期货 | 11,731 | 37    |
| 2     | 中信期货 | 2,309  | 484   | 2     | 国泰君安 | 4,815  | 190   | 2     | 国泰君安 | 4,737  | -133  |
| 3     | 海通期货 | 1,737  | 819   | 3     | 海通期货 | 3,436  | 134   | 3     | 瑞银期货 | 4,495  | -11   |
| 4     | 上海东证 | 1,646  | 234   | 4     | 中信期货 | 3,057  | 80    | 4     | 上海东证 | 4,109  | 63    |
| 5     | 国信期货 | 981    | 73    | 5     | 兴证期货 | 2,961  | 119   | 5     | 华泰期货 | 3,806  | 241   |
| 6     | 华泰期货 | 934    | 239   | 6     | 中泰期货 | 2,805  | -74   | 6     | 乾坤期货 | 3,500  | 0     |
| 7     | 华闻期货 | 889    | 296   | 7     | 国信期货 | 2,768  | -7    | 7     | 国投安信 | 3,365  | 52    |
| 8     | 招商期货 | 553    | 430   | 8     | 长江期货 | 2,249  | -49   | 8     | 中金期货 | 2,840  | 0     |
| 9     | 华西期货 | 442    | 79    | 9     | 招商期货 | 2,217  | 67    | 9     | 海通期货 | 1,299  | -15   |
| 10    | 东兴期货 | 372    | 221   | 10    | 中信建投 | 2,100  | 44    | 10    | 申银万国 | 1,179  | 32    |
| 前五席位  |      | 10,464 | 2,245 | 前五席位  |      | 19,726 | 682   | 前五席位  |      | 28,878 | 197   |
| 前十席位  |      | 13,654 | 3,510 | 前十席位  |      | 31,865 | 663   | 前十席位  |      | 41,061 | 266   |
| 前二十席位 |      | 16,296 | 3,428 | 前二十席位 |      | 45,744 | 811   | 前二十席位 |      | 48,735 | 506   |

## IM2312主要席位

单位：手

| 名次    | 会员名称 | 成交量   | 前上日增减 | 名次    | 会员名称 | 持买单量   | 前上日增减 | 名次    | 会员名称 | 持卖单量   | 前上日增减 |
|-------|------|-------|-------|-------|------|--------|-------|-------|------|--------|-------|
| 1     | 国泰君安 | 1,047 | 347   | 1     | 国泰君安 | 4,637  | 150   | 1     | 海通期货 | 3,221  | 36    |
| 2     | 上海东证 | 832   | -146  | 2     | 兴证期货 | 1,760  | 73    | 2     | 国泰君安 | 2,827  | 79    |
| 3     | 中信期货 | 659   | 196   | 3     | 广发期货 | 1,364  | -6    | 3     | 中信期货 | 1,937  | 108   |
| 4     | 海通期货 | 597   | 104   | 4     | 国富期货 | 1,296  | -1    | 4     | 上海东证 | 1,537  | 209   |
| 5     | 华西期货 | 240   | -21   | 5     | 海通期货 | 1,212  | 47    | 5     | 摩根大通 | 1,065  | 98    |
| 6     | 华泰期货 | 215   | -25   | 6     | 中信期货 | 1,127  | 113   | 6     | 中金期货 | 947    | 0     |
| 7     | 国信期货 | 207   | -20   | 7     | 永安期货 | 916    | 2     | 7     | 银河期货 | 781    | 11    |
| 8     | 华闻期货 | 151   | 57    | 8     | 申银万国 | 904    | 133   | 8     | 瑞银期货 | 781    | 57    |
| 9     | 申银万国 | 148   | 125   | 9     | 华泰期货 | 573    | -14   | 9     | 光大期货 | 654    | 7     |
| 10    | 兴证期货 | 119   | -25   | 10    | 上海东证 | 539    | 241   | 10    | 国信期货 | 573    | 20    |
| 前五席位  |      | 3,375 | 480   | 前五席位  |      | 10,269 | 263   | 前五席位  |      | 10,587 | 530   |
| 前十席位  |      | 4,215 | 592   | 前十席位  |      | 14,328 | 738   | 前十席位  |      | 14,323 | 625   |
| 前二十席位 |      | 5,033 | 777   | 前二十席位 |      | 16,184 | 708   | 前二十席位 |      | 17,098 | 702   |

## IH行情概要

单位：点、手、亿元

|        | 收盘价     | +/-    | 成交量    | +/- | 成交额 | +/- | 持仓量    | +/-  | 持仓保证金 |
|--------|---------|--------|--------|-----|-----|-----|--------|------|-------|
| 上证50   | 2577.34 | +1.54% | 3,691  | 21% | 561 | 12% |        |      |       |
| IH2306 | 2558.20 | -2.03% | 51,521 | 16% | 399 | 14% | 77,965 | 3492 | 72.11 |
| IH2307 | 2527.40 | -2.18% | 5,608  | 5%  | 43  | 3%  | 9,511  | 1785 | 8.69  |
| IH2309 | 2530.20 | -2.07% | 14,201 | 21% | 109 | 19% | 41,929 | 1010 | 38.34 |
| IH2312 | 2542.40 | -2.03% | 2,561  | 17% | 20  | 15% | 6,027  | 717  | 5.54  |

IH主力合约下跌2.03%，报收2558.2点。

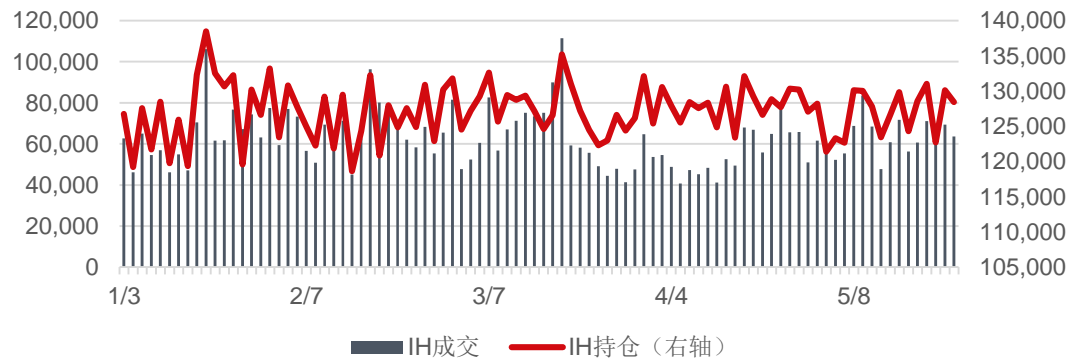
IH四合约总成交73891手，较前日增加10195手；总持仓135432手，较前日增加7004手。

IH主力合约贴水-19.14点，较前日下降3.2点；年化基差率为-10.32%。

IH四合约分红影响分别为17.21点、63.82点、67.86点和72.16点。

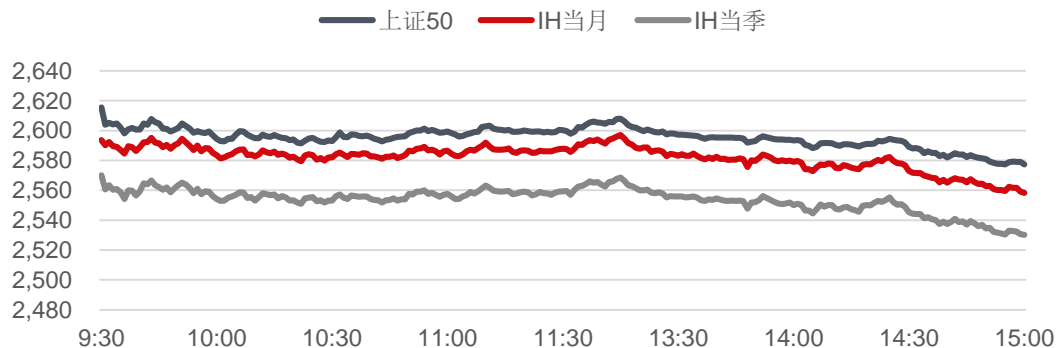
## IH成交持仓

单位：点



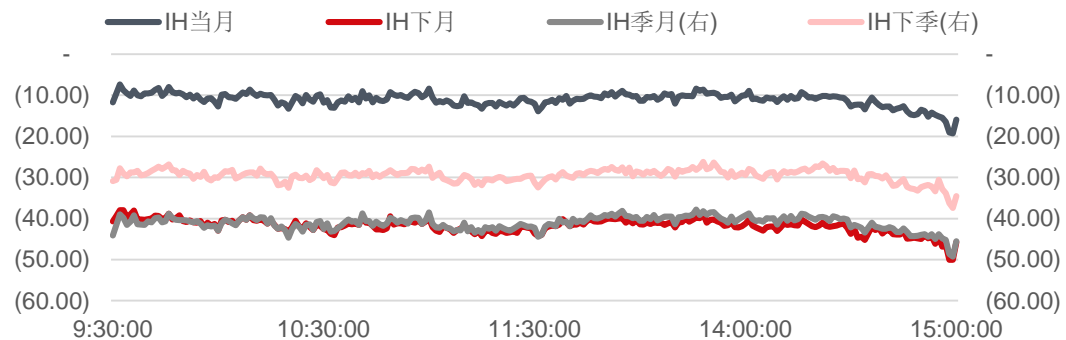
## IH日内走势

单位：点



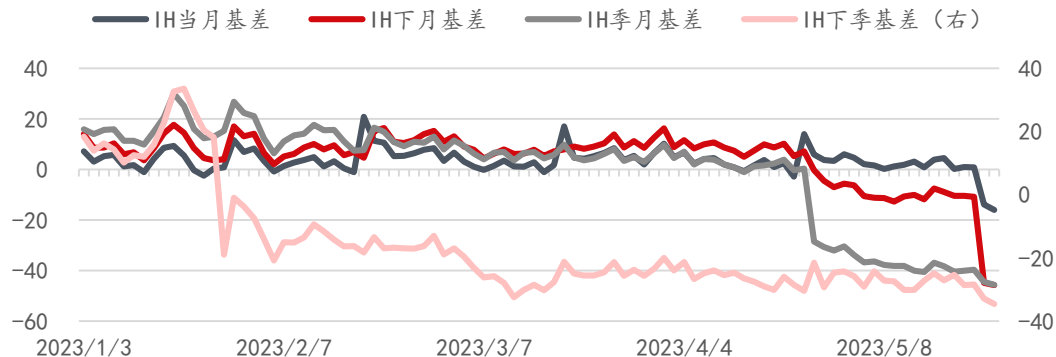
## IH日内基差

单位：点



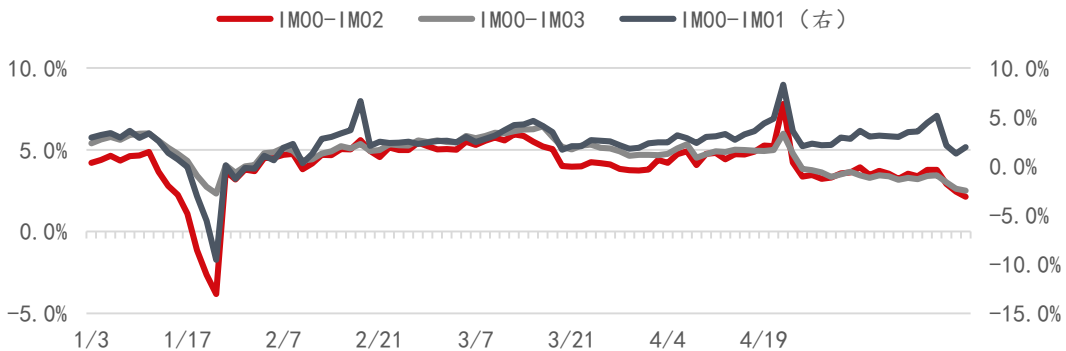
## IH基差

单位：点



## IH年化移仓成本

注：负值为移仓有收益

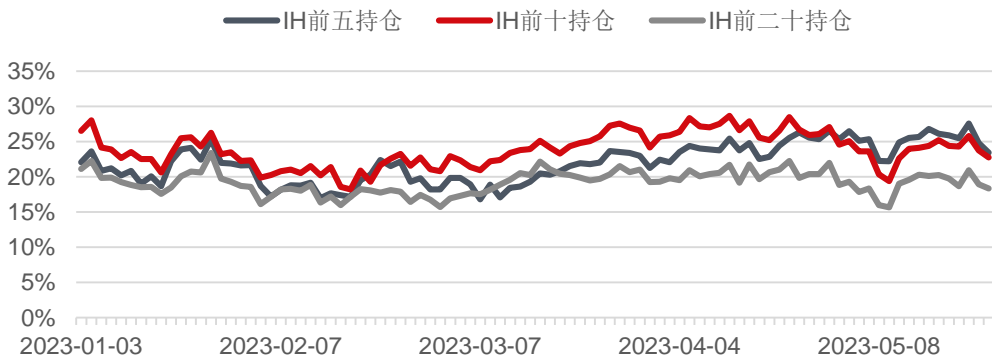


## IH分红影响

单位：点

|      | 合约 | 收盘价      | 到期日        | 剩余天数 | 分红价值  | 升贴水点数  | 升贴水率  | 年化升贴水率 |
|------|----|----------|------------|------|-------|--------|-------|--------|
| 上证50 | 现货 | 2,577.34 |            |      |       |        |       |        |
|      | 当月 | 2,558.20 | 2023-06-16 | 22   | 17.21 | -19.14 | -0.7% | 0.0%   |
|      | 下月 | 2,527.40 | 2023-07-21 | 57   | 63.82 | -49.94 | -1.9% | 0.0%   |
|      | 季一 | 2,530.20 | 2023-09-15 | 113  | 67.86 | -47.14 | -1.8% | 0.0%   |
|      | 季二 | 2,542.40 | 2023-12-15 | 204  | 72.16 | -34.94 | -1.4% | 0.0%   |

## IH净空头持仓占比



## IH2306主要席位

单位：手

| 名次    | 会员名称 | 成交量    | 前上日增减  | 名次    | 会员名称 | 持买单量   | 前上日增减  | 名次    | 会员名称 | 持卖单量   | 前上日增减 |
|-------|------|--------|--------|-------|------|--------|--------|-------|------|--------|-------|
| 1     | 中信期货 | 15,091 | 504    | 1     | 国泰君安 | 11,686 | 353    | 1     | 中信期货 | 13,257 | 564   |
| 2     | 国泰君安 | 13,030 | 3,253  | 2     | 中信期货 | 7,868  | 475    | 2     | 国泰君安 | 12,850 | 1,983 |
| 3     | 海通期货 | 5,878  | 1,462  | 3     | 上海东证 | 3,935  | 508    | 3     | 广发期货 | 8,758  | -584  |
| 4     | 上海东证 | 5,366  | 1,583  | 4     | 平安期货 | 3,043  | -33    | 4     | 海通期货 | 6,549  | -248  |
| 5     | 国信期货 | 4,331  | 283    | 5     | 广发期货 | 3,028  | 530    | 5     | 上海东证 | 4,859  | 282   |
| 6     | 华闻期货 | 3,270  | -343   | 6     | 永安期货 | 2,977  | -1,004 | 6     | 国投安信 | 3,149  | -201  |
| 7     | 申银万国 | 3,093  | 46     | 7     | 华泰期货 | 2,805  | -86    | 7     | 中银期货 | 2,255  | 37    |
| 8     | 广发期货 | 2,950  | 740    | 8     | 海通期货 | 2,797  | 362    | 8     | 银河期货 | 2,234  | 113   |
| 9     | 银河期货 | 2,866  | -502   | 9     | 银河期货 | 2,720  | 59     | 9     | 中金期货 | 2,076  | -619  |
| 10    | 永安期货 | 2,741  | 1,564  | 10    | 申银万国 | 2,032  | -274   | 10    | 国信期货 | 1,766  | 122   |
| 前五席位  |      | 43,696 | 7,085  | 前五席位  |      | 29,560 | 2,833  | 前五席位  |      | 46,273 | 1,997 |
| 前十席位  |      | 58,616 | 8,590  | 前十席位  |      | 42,891 | 1,890  | 前十席位  |      | 57,753 | 1,449 |
| 前二十席位 |      | 77,225 | 10,900 | 前二十席位 |      | 56,903 | 2,904  | 前二十席位 |      | 66,807 | 2,520 |

## IH2309主要席位

单位：手

| 名次    | 会员名称 | 成交量    | 前上日增减 | 名次    | 会员名称 | 持买单量   | 前上日增减 | 名次    | 会员名称 | 持卖单量   | 前上日增减 |
|-------|------|--------|-------|-------|------|--------|-------|-------|------|--------|-------|
| 1     | 中信期货 | 4,111  | 541   | 1     | 国泰君安 | 4,330  | 250   | 1     | 广发期货 | 11,773 | 608   |
| 2     | 国泰君安 | 3,403  | 329   | 2     | 中信期货 | 3,999  | 445   | 2     | 海通期货 | 7,274  | -79   |
| 3     | 海通期货 | 2,081  | 203   | 3     | 华泰期货 | 2,014  | -46   | 3     | 国泰君安 | 5,035  | 139   |
| 4     | 华泰期货 | 1,643  | 513   | 4     | 上海东证 | 1,965  | 146   | 4     | 乾坤期货 | 4,374  | -10   |
| 5     | 上海东证 | 1,573  | 443   | 5     | 海通期货 | 1,631  | 192   | 5     | 中信期货 | 2,717  | 470   |
| 6     | 国信期货 | 1,399  | 302   | 6     | 银河期货 | 1,333  | 15    | 6     | 中金期货 | 1,931  | 0     |
| 7     | 国投安信 | 1,157  | 49    | 7     | 广发期货 | 1,225  | -126  | 7     | 瑞银期货 | 1,642  | -3    |
| 8     | 广发期货 | 1,142  | 51    | 8     | 永安期货 | 1,182  | -18   | 8     | 上海东证 | 925    | -1    |
| 9     | 华闻期货 | 1,024  | 4     | 9     | 申银万国 | 1,178  | 208   | 9     | 招商期货 | 775    | 248   |
| 10    | 方正中期 | 713    | 216   | 10    | 国投安信 | 1,070  | 10    | 10    | 银河期货 | 767    | -20   |
| 前五席位  |      | 12,811 | 2,029 | 前五席位  |      | 13,939 | 987   | 前五席位  |      | 31,173 | 1,128 |
| 前十席位  |      | 18,246 | 3,111 | 前十席位  |      | 19,927 | 1,076 | 前十席位  |      | 37,213 | 1,352 |
| 前二十席位 |      | 22,208 | 3,951 | 前二十席位 |      | 27,680 | 1,112 | 前二十席位 |      | 40,167 | 1,001 |

## 作者承诺

本人具有中国期货业协会授予的期货从业资格证书，本人承诺以勤勉的职业态度，独立、客观地出具本报告。本报告清晰准确地反映了本人的研究观点。本人不曾因，不因，也将不会因本报告中的具体推荐意见或观点而直接或间接接收到任何形式的报酬。

## 免责声明

本报告由银河期货有限公司（以下简称银河期货，投资咨询业务许可证号30220000）向其机构或个人客户（以下简称客户）提供，无意针对或打算违反任何地区、国家、城市或其它法律管辖区域内的法律法规。除非另有说明，所有本报告的版权属于银河期货。未经银河期货事先书面授权许可，任何机构或个人不得更改或以任何方式发送、传播或复印本报告。

本报告所载的全部内容只提供给客户做参考之用，并不构成对客户的投资建议。银河期货认为本报告所载内容及观点客观公正，但不担保其内容的准确性或完整性。客户不应单纯依靠本报告而取代个人的独立判断。本报告所载内容反映的是银河期货在最初发表本报告日期当日的判断，银河期货可发出其它与本报告所载内容不一致或有不同结论的报告，但银河期货没有义务和责任去及时更新本报告涉及的内容并通知客户。银河期货不对因客户使用本报告而导致的损失负任何责任。

银河期货不需要采取任何行动以确保本报告涉及的内容适合于客户。银河期货建议客户独自进行投资判断。本报告并不构成投资、法律、会计或税务建议或担保任何内容适合客户，本报告不构成给予客户个人咨询建议。银河期货版权所有并保留一切权利。

## 联系方式

### 银河期货有限公司 金融衍生品研究所

北京：北京市朝阳区建国门外大街8号楼31层

上海：上海市虹口区东大名路501号白玉兰广场28层

网址：[www.yhqh.com.cn](http://www.yhqh.com.cn)

邮箱：[yqhjrscb@chinastock.com.cn](mailto:yqhjrscb@chinastock.com.cn)

电话：400-886-7799

### 研究员：孙锋

期货从业证号：F0211891

投资咨询证号：Z000567

Tel.: 021-56789277

邮箱：[sunfeng@chinastock.com.cn](mailto:sunfeng@chinastock.com.cn)