

研究创造价值

姓名： 何晔玮

电话： 0571-87006880

邮箱： heyewei@bcqhgs.com

股指期货日报

内容摘要：

- A股市场
- 股指期货评述
- 附录

一、A股市场

12月6日，上证综指低开2.68点（-0.08%）于3202.03点，最终收于3199.65点，下跌5.06点（-0.16%）。沪深两市成交额较上日缩小910.5亿（-17.82%）。

二、股指期货交易评述

12月6日，IF1612跌0.36%，IF1701跌0.33%，IF1703跌0.42%，IF1706跌0.44%。截至收盘，四个合约总成交12663手，总持仓39276手，减仓310手。其中当月IF1612合约成交9722手，持仓28108手，减仓1764手。次月IF1701合约成交1671手，持仓4367手，增仓849手。

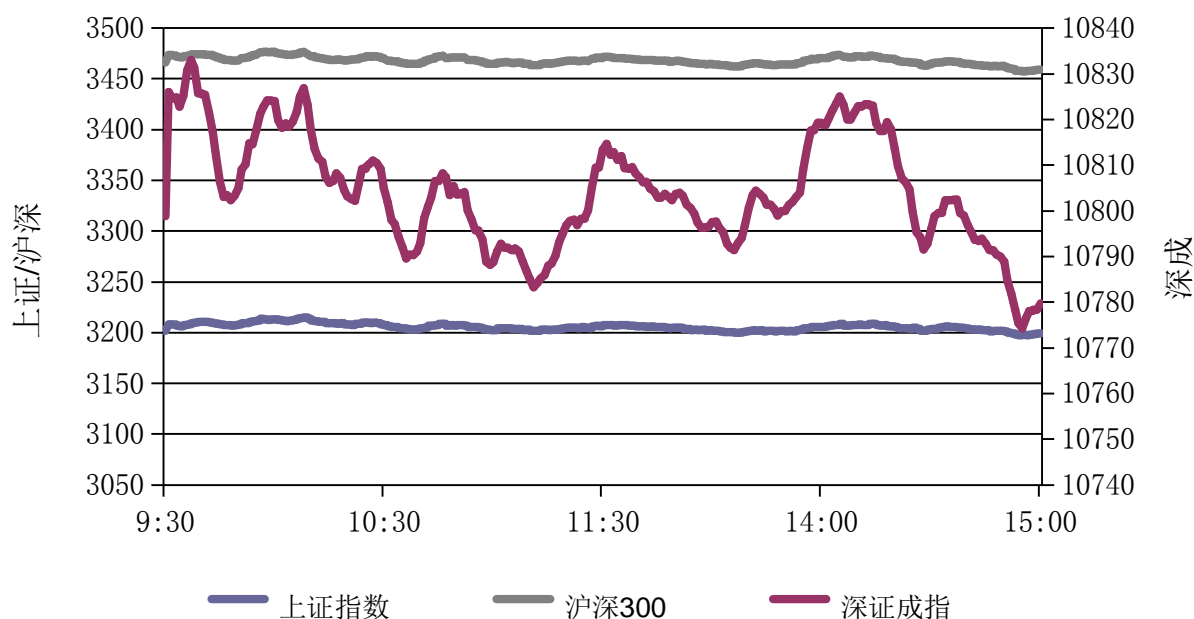
12月6日，IH1612跌0.21%，IH1701跌0.18%，IH1703跌0.24%，IH1706跌0.1%。截至收盘，四个合约总成交4987手，总持仓24443手，减仓446手。其中当月IH1612合约成交3966手，持仓16755手，减仓844手。次月IH1701合约成交582手，持仓3254手，增仓266手。

12月6日，IC1612跌0.2%，IC1701跌0.26%，IC1703跌0.26%，IC1706跌0.33%。截至收盘，四个合约总成交8986手，总持仓33369手，减仓25手。其中当月IC1612合约成交6802手，持仓20646手，减仓1082手。次月IC1701合约成交1182手，持仓3028手，增仓736手。

三、市场数据

（一）股指现货市场

1 A股市场走势图



2 A股市场指数涨跌幅统计表

指数	开盘	收盘	涨跌%	振幅%	成交金额 (亿元)	成交额变动 (%)
上证指数	3202	3200	-0.16	0.06	1771.70	-25.75
深证指数	10799	10780	-0.04	0.05	2427.62	-10.87
HS300 指数	3466	3459	-0.30	0.03	1257.28	-33.89
SZ50 指数	2371	2369	-0.28	0.03	406.51	-42.16
ZZ500 指数	6496	6491	+0.08	0.05	616.22	-18.52

数据来源：大智慧 level2 证券行情分析系统，宝城期货金融研究所。

(二) 股指期货合约基差/价差情况统计表

1 股指期货市场各合约涨跌幅统计表

股指期货	开盘	收盘	涨跌 (点)	涨跌幅 (%)	日成交 量(手)	成交量 变动(%)	日增仓量 (手)	总持仓量 (手)
IF1612	3458	3448	-12.6	-0.36	9722	-19.53	-1764	28108
IF1701	3432	3428	-11.2	-0.33	1671	+4.83	849	4367
IF1703	3401	3388	-14.2	-0.42	1075	-11.23	579	5515
IF1706	3368	3347	-14.8	-0.44	195	-37.50	26	1286
IH1612	2376	2367	-5.0	-0.21	3966	-30.11	-844	16755
IH1701	2365	2359	-4.2	-0.18	582	-28.68	266	3254
IH1703	2356	2344	-5.6	-0.24	341	-32.48	91	3476
IH1706	2343	2325	-2.4	-0.10	98	-47.87	41	958
IC1612	6452	6431	-13.2	-0.20	6802	-5.32	-1082	20646
IC1701	6360	6342	-16.8	-0.26	1182	+28.34	736	3028
IC1703	6195	6177	-16.2	-0.26	746	+55.74	208	6641
IC1706	5967	5960	-19.6	-0.33	256	-26.44	113	3054

数据来源：大智慧 level2 证券行情分析系统，宝城期货金融研究所。

2 股指期货合约开盘收盘基差/价差情况统计表

		开盘	收盘	增减值	相对变化 幅度(%)	升贴水率 变化(%)
基差	HS300-IF1612	-1.36	+10.75	+12.11	-170.81	+0.35
	HS300-IF1701	+22.04	+30.95	+8.91	-125.67	+0.26
	HS300-IF1703	+59.84	+71.35	+11.51	-162.34	+0.34
	HS300-IF1706	+99.44	+111.95	+12.51	-176.45	+0.37
价差	IF1701-IF1612	-25.80	-20.20	+5.60	-58.33	+0.16
	IF1703-IF1612	-57.00	-60.60	-3.60	+37.50	-0.11
	IF1706-IF1612	-90.20	-101.20	-11.00	+114.58	-0.33
	IF1703-IF1701	-31.20	-40.40	-9.20	+230.00	-0.27
	IF1706-IF1701	-64.40	-81.00	-16.60	+415.00	-0.49
	IF1706-IF1703	-33.20	-40.60	-7.40	+56.06	-0.22

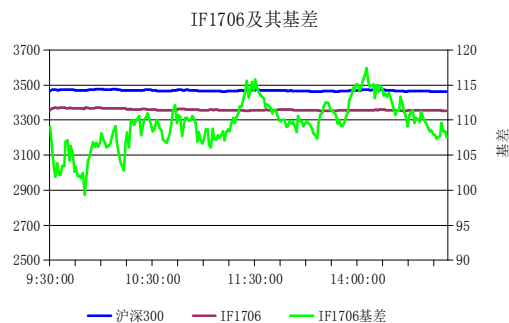
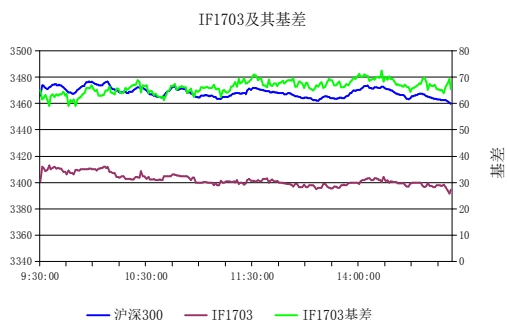
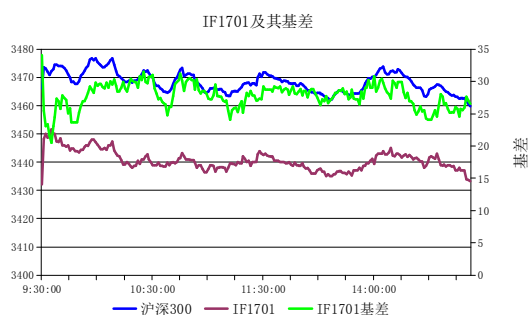
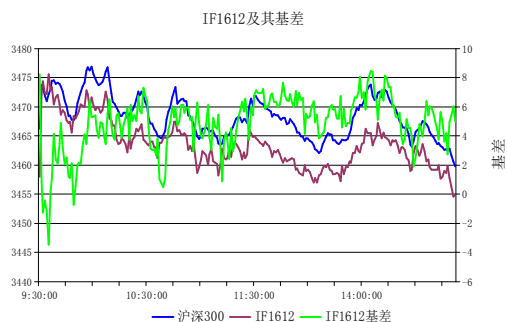
数据来源：宝城期货金融研究所。

3 股指期货合约最小最大基差/价差情况统计表

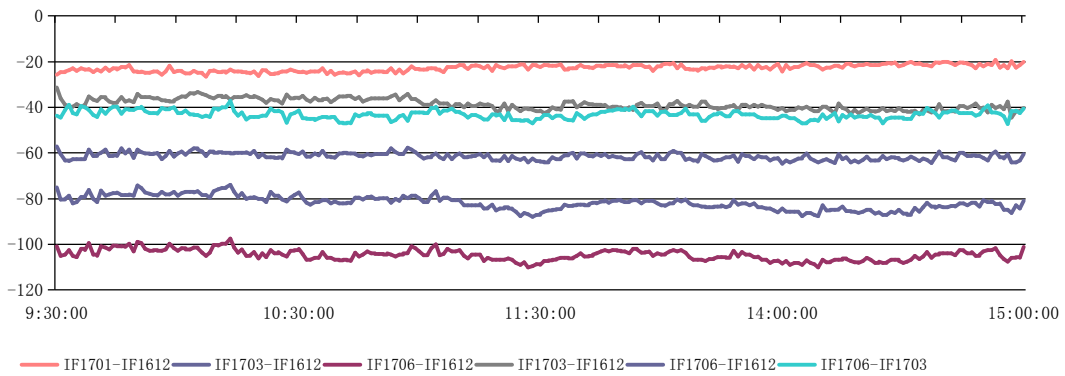
		MIN	MAX	极差	极差相对 变化幅度(%)	极值升贴水 率变化(%)
基差	HS300-IF1612	-3.46	+10.75	+14.21	-109.39	+0.41
	HS300-IF1701	+20.54	+34.04	+13.50	-228.82	+0.39
	HS300-IF1703	+59.13	+72.52	+13.39	+305.01	+0.38
	HS300-IF1706	+99.33	+117.45	+18.12	+340.60	+0.52
价差	IF1701-IF1612	-26.60	-19.20	+7.40	-39.36	+0.21
	IF1703-IF1612	-64.60	-57.00	+7.60	-135.71	+0.22
	IF1706-IF1612	-110.20	-97.40	+12.80	-711.08	+0.37
	IF1703-IF1701	-44.40	-31.20	+13.20	-1320.00	+0.38
	IF1706-IF1701	-88.00	-73.80	+14.20	-443.75	+0.41
	IF1706-IF1703	-47.20	-37.20	+10.00	+100.00	+0.30

数据来源：宝城期货金融研究所。

(三) 股指期货合约日内基差/价差图



股指期货价差走势图



数据来源：大智慧 level2 证券行情分析系统，宝城期货金融研究所。

宝城期货各地营业部

宝城期货临海营业部

地址：临海市大洋街道临海大道（中）45号

电话：0576-85320333

宝城期货南昌营业部

地址：南昌市西湖区中山路150号地王广场写字楼7-V

电话：0791-6259955

宝城期货南宁营业部

地址：南宁市金湖路26-1号东方国际商务港A座6层

电话：0771-5532168

宝城期货大连营业部

地址：大连市沙河口区会展路129号期货大厦2001、2006B

电话：0411-84807257

宝城期货深圳营业部

地址：深圳市福田区滨河路与彩田路交汇处联合广场A栋塔楼A2803

电话：0755-83209976

宝城期货昆明营业部

地址：昆明市白云路与万华路交汇处滨江俊园3幢3-05室

电话：0871-65732732

宝城期货沈阳营业部

地址：沈阳市和平区南五马路3号（胜利大街和南五马路交界处）中驰国际大厦21层2104、2105、2106

电话：024-31257633

宝城期货长沙营业部

地址：长沙市五一大道618号银华大酒店22楼2222室

电话：0731-85239858

宝城期货郑州营业部

地址：郑州市未来大道69号未来大厦1201室

电话：0371-65612832

宝城期货青岛营业部

地址：青岛经济技术开发区紫金山路117栋1单元14楼1401号

电话：0532-86108719

宝城期货武汉营业部

地址：武汉市武昌区中山路347号中铁大厦705-707

电话：027-88221981

宝城期货温州营业部

地址：温州鹿城区矮凳桥228号10幢1013室

电话：0577-89999719

北京营业部

地址：北京市朝阳区望京西路甲 50 号 1 号楼 7 层 1-09 内 701-02 单元 电话：010-64795360

宝城期货邯郸营业部

地址：河北省邯郸市丛台区人民路 408 号锦林大厦 1201-1203 室 电话:0310-2076686

免责声明

客户不应视本报告为作出投资决策的惟一因素。本报告中所指的投资及服务可能不适合个别客户，不构成客户私人咨询建议。本公司未确保本报告充分考虑到个别客户特殊的投资目标、财务状况或需要。本公司建议客户应考虑本报告的任何意见或建议是否符合其特定状况，以及（若有必要）咨询独立投资顾问。

在任何情况下，本报告中的信息或所表述的意见并不构成对任何人的投资建议。在任何情况下，本公司不对任何人因使用本报告中的任何内容所引致的任何损失负任何责任。

若本报告的接收人非本公司的客户，应在基于本报告作出任何投资决定或就本报告要求任何解释前咨询独立投资顾问。