2016 年 01 月 13 日 股指期货早报

发展研究中心股指组
联系电话：020-85594596

市场弱势反抽，企稳等待时日

股指期货合约行情数据

行情数据（成交-手；持仓-手）

品种	合约	收盘价	涨跌幅(%)	成交	△成交	持仓	△持仓
IF	IF1601	3196.6	-0.26%	18644	-1792	22218	-3531
	IF1602	3133.2	-0.32%	3940	1682	6145	2373
	IF1603	3088	-0.41%	2596	123	8462	873
	IF1606	2975	-0.30%	313	-140	1763	41
合计				**25493**	**-127**	**38588**	**-244**
IH	IH1601	2121.2	-0.64%	6770	-912	9483	-1367
	IH1602	2088.6	-0.56%	1147	422	2041	701
	IH1603	2068.6	-0.82%	905	8	4191	214
	IH1606	2023.8	-0.51%	60	-82	801	2
合计				**8882**	**-564**	**16516**	**-450**
IC	IC1601	6074.8	0.12%	11013	-223	11939	-1661
	IC1602	5820.4	-0.40%	2554	1186	3669	1676
	IC1603	5609	-0.54%	1268	-289	2966	271
	IC1609	5205.2	-1.11%	156	-190	1152	16
合计				**14991**	**484**	**19726**	**302**

股指期货合约基差数据

基差数据（-点）

品种	合约	交割日	剩余天数	前一日基差	最新基差
IF	IF1601	2016/1/15	3	41	19
	IF1602	2016/2/19	38	105	83
	IF1603	2016/3/18	66	146	128
	IF1606	2016/6/18	158	242	241
IH	IH1601	2016/1/15	3	11	10
	IH1602	2016/2/19	38	42	43
	IH1603	2016/3/18	66	64	63
	IH1606	2016/6/18	158	110	108
IC	IC1601	2016/1/15	3	188	62
	IC1602	2016/2/19	38	429	316
	IC1603	2016/3/18	66	616	528
	IC1606	2016/6/18	158	935	931

财经要闻

交易提示

本报告中的信息均来源于已公开的资料，我公司对这些信息的准确性及完整性不作任何保证，不保证该信息未经任何更新，也不保证本公司做出的任何建议不会发生任何变更。在任何情况下，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。未经我司书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制或对本报告进行有悖原意的删节和修改。**期市有风险 入市需谨慎！**

股指期货合约净持仓数据

持仓数据（手）

品种	合约	前5	前10	前20	前5变动	前10变动	前20变动
IF	IF1601	-317	312	-380	19	-724	-332
	IF1602	/	/	/	/	/	/
	IF1603	/	/	/	/	/	/
	合计			**-380**			**-332**
IH	IH1601	1160	643	149	-376	-87	-150
	IH1602	/	/	/	/	/	/
	IH1603	/	/	/	/	/	/
	合计			**149**			**-150**
IC	IC1601	-262	-42	137	-1361	-432	218
	IC1602	/	/	/	/	/	/
	IC1603	/	/	/	/	/	/
	合计			**137**			**218**

注：净持仓=多头持仓-空头持仓，前 5 净持仓变动为最近一个交易日与上一交易日之差

资金利率变动数据

期限	2016/1/12	2016/1/11	变动（BP）
银行间质押回购加权利率			
R001	1.98%	2.26%	-28.0
R007	2.39%	2.41%	-2.0
上海银行间同业拆放利率（Shibor）			
O/N_Shibor	1.95%	1.95%	0.0
3M_Shibor	3.05%	3.06%	-0.6
银行间同业拆借加权利率			
1天	2.00%	2.30%	-30.0
7天	2.50%	2.30%	20.0

表数据来源：Wind 资讯 广发期货发展研究中心

本报告中的信息均来源于已公开的资料，我公司对这些信息的准确性及完整性不作任何保证，不保证该信息未经任何更新，也不保证本公司做出的任何建议不会发生任何变更。在任何情况下，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。未经我司书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制或对本报告进行有悖原意的删节和修改。**期市有风险 入市需谨慎!**

[市场表现]

现货方面，沪指昨日震荡至 3000 点左右迎来小幅反抽，创业板指数也出现大幅反弹。盘面上看，反抽中热点分散且量能未能有效放大，凸显市场反抽力度较弱。期指方面，三大期指表现不一。

[行情分析]

消息面上暂无明显利好，技术面上昨日沪指下触 3000 点后出现反抽，但是反抽中量能的萎缩和市场热点的溃散均说明力度较弱，短期难成气候。股指目前面临的风险因素和压制仍然存在，预计将在当前位置上弱势震荡。操作上由于市场机会缺乏和较高风险，建议投资者继续观望，谨慎参与反抽。

[操作建议]

操作上由于市场机会缺乏和较高风险，建议投资者继续观望，谨慎参与反抽。IF1601、IH1601、IC1601 关注支撑 3100、2090、5950 点。

本报告中的信息均来源于已公开的资料，我公司对这些信息的准确性及完整性不作任何保证，不保证该信息未经任何更新，也不保证本公司做出的任何建议不会发生任何变更。在任何情况下，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。未经我司书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制或对本报告进行有悖原意的删节和修改。**期市有风险 入市需谨慎!**