

国债期货持仓日报

2024年10月31日



银河期货暖❤️服务
与您一起迎接未来

未来可期
Futures - Future

国债期货成交概要

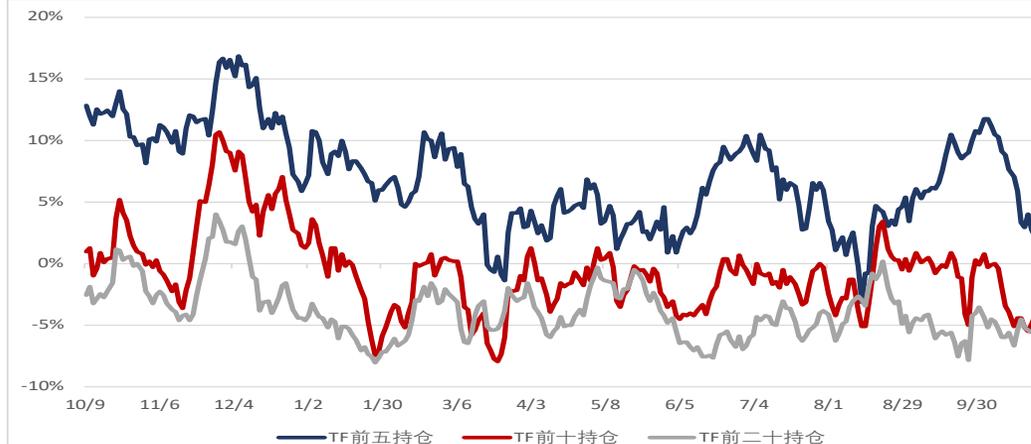
	收盘价	+/-	成交量	+/-	成交额	+/-	持仓量	+/-	持仓保证金(亿元)
T2412	105.95	0.03%	55,433	19%	587	19%	175,160	-2,464	37.1
T2503	105.84	0.03%	4,586	12%	49	12%	20,742	197	4.4
T2506	105.64	0.02%	661	11%	7	11%	3,296	148	0.7
合计			60,680	18%	643	18%	199,198	-2,119	42.2
	收盘价	+/-	成交量	+/-	成交额	+/-	持仓量	+/-	持仓保证金(亿元)
TF2412	104.70	0.02%	48,069	16%	503	16%	118,392	694	14.9
TF2503	104.68	0.01%	3,025	-11%	32	-11%	10,939	561	1.4
TF2506	104.64	0.00%	116	-43%	1	-43%	659	1	0.1
合计			51,210	14%	536	14%	129,990	1,256	16.3
	收盘价	+/-	成交量	+/-	成交额	+/-	持仓量	+/-	持仓保证金(亿元)
TL2412	111.57	0.20%	54,587	4%	608	4%	71,573	-717	27.9
TL2503	111.45	0.20%	5,969	18%	66	18%	17,122	345	6.7
TL2506	111.04	0.21%	991	41%	11	41%	4,309	217	1.7
合计			61,547	6%	685	6%	93,004	-155	36.3
	收盘价	+/-	成交量	+/-	成交额	+/-	持仓量	+/-	持仓保证金(亿元)
TS2412	102.46	0.04%	30,971	-5%	635	-5%	56,275	602	5.8
TS2503	102.41	0.04%	2,784	31%	57	31%	14,712	492	1.5
TS2506	102.40	0.04%	19	-71%	0	-71%	663	1	0.1
合计			33,774	-3%	692	-3%	71,650	1,095	7.3

国债期货净持仓情况

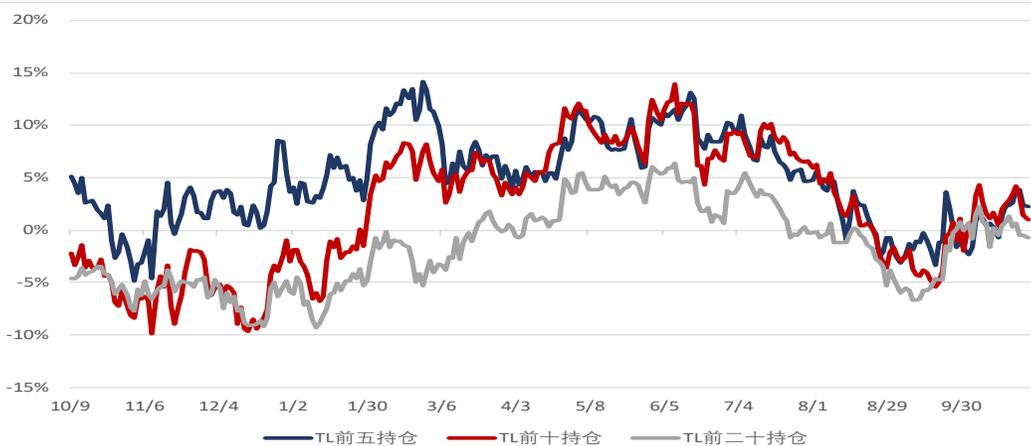
十年期国债期货净持仓



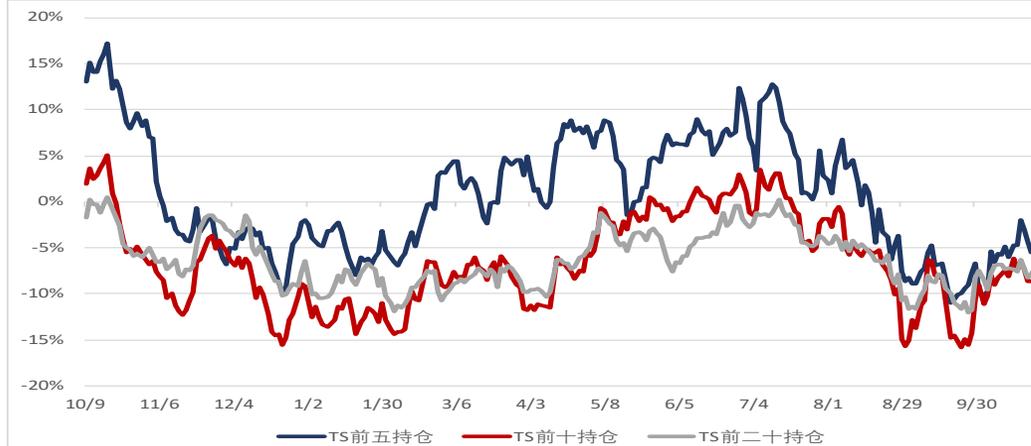
五年期国债期货净持仓



三十年期国债期货净持仓



二年期国债期货净持仓



十年期国债期货持仓情况

十年期国债期货2412合约持仓情况

名次	会员名称	成交量	前上日增减	名次	会员名称	持买单量	+/- (手)	持仓名义金额 变化 (亿元)	持仓占比	占比变化	名次	会员名称	持卖单量	+/- (手)	持仓名义金额 变化 (亿元)	持仓占比	占比变化
1	东证期货	18,256	3,962	1	中信期货	35,490	-233	1.5	20.3%	0.1%	1	中信期货	21,316	798	8.5	12.2%	-0.3%
2	国泰君安	16,830	1,680	2	东证期货	28,419	-1,021	1.8	16.2%	0.3%	2	银河期货	19,797	17	3.4	11.3%	0.3%
3	中信期货	13,567	3,090	3	国泰君安	26,165	38	3.6	14.9%	0.4%	3	招商期货	19,310	40	0.4	11.0%	0.1%
4	海通期货	7,582	1,441	4	宏源期货	10,515	-175	0.9	6.0%	0.0%	4	国泰君安	14,677	140	1.5	8.4%	0.0%
5	国金期货	6,079	1,368	5	永安期货	8,092	80	0.8	4.6%	0.0%	5	国投安信	12,210	-8	0.1	7.0%	0.1%
6	华泰期货	5,822	-369	6	平安期货	6,880	-1,223	1.1	3.9%	0.7%	6	东证期货	12,210	503	5.3	7.0%	-0.2%
7	银河期货	4,146	1,591	7	华泰期货	5,886	27	0.2	3.4%	0.2%	7	宏源期货	8,328	267	2.8	4.8%	-0.1%
8	平安期货	3,421	628	8	海通期货	5,364	-639	0.3	3.1%	0.3%	8	海通期货	7,839	173	1.8	4.5%	0.0%
9	国信期货	3,146	1,408	9	招商期货	5,288	37	0.5	3.0%	0.2%	9	华泰期货	5,422	71	0.9	3.1%	0.2%
10	中信建投	2,961	547	10	中信建投	3,774	40	0.4	2.2%	0.0%	10	平安期货	4,723	30	0.3	2.7%	0.1%
前五席位		62,314	11,541	前五席位		108,681	-1,171	-12.4	62.0%	0.1%	前五席位		87,310	-669	-7.1	49.8%	0.0%
前十席位		81,810	15,346	前十席位		135,873	-2,789	-29.5	77.6%	-0.5%	前十席位		125,832	-1,311	-13.9	71.8%	0.3%
前二十席		95,576	17,095	前二十席		154,219	-3,417	-36.2	88.0%	-0.7%	前二十席		153,706	-1,475	-15.6	87.8%	0.3%

十年期国债期货2503合约持仓情况

名次	会员名称	成交量	前上日增减	名次	会员名称	持买单量	+/- (手)	持仓名义金额 变化 (亿元)	持仓占比	占比变化	名次	会员名称	持卖单量	+/- (手)	持仓名义金额 变化 (亿元)	持仓占比	占比变化
1	中信期货	2,885	687	1	中信期货	7,633	122	1.3	36.8%	0.2%	1	银河期货	3,551	11	0.1	17.1%	-0.1%
2	东证期货	1,100	281	2	国泰君安	3,517	25	0.3	17.0%	0.0%	2	第一创业	2,948	-18	-0.2	14.2%	-0.2%
3	国泰君安	512	170	3	东证期货	1,361	9	0.1	6.6%	0.0%	3	国金期货	2,511	-3	0.0	12.1%	-0.1%
4	华闻期货	510	38	4	东吴期货	1,066	0	0.0	5.1%	0.0%	4	华泰期货	2,495	104	1.1	12.0%	0.4%
5	瑞达期货	380	79	5	银河期货	727	51	0.5	3.5%	0.2%	5	中信期货	1,440	-45	-0.5	6.9%	-0.3%
6	申银万国	366	87	6	国金期货	688	-4	0.0	3.3%	-0.1%	6	广发期货	1,245	4	0.0	6.0%	0.0%
7	东海期货	333	74	7	长江期货	583	6	0.1	2.8%	0.0%	7	国泰君安	781	23	0.2	3.8%	0.1%
8	国联期货	332	-35	8	兴证期货	486	-152	-1.6	2.3%	0.8%	8	西部期货	774	11	0.1	3.7%	0.0%
9	海通期货	298	-28	9	永安期货	369	13	0.1	1.8%	0.0%	9	首创京都	622	0	0.0	3.0%	0.0%
10	银河期货	202	-329	10	华泰期货	320	-8	-0.1	1.5%	-0.1%	10	东证期货	536	11	0.1	2.6%	0.0%
前五席位		5,387	1,255	前五席位		14,304	207	2.2	69.0%	0.3%	前五席位		12,945	49	0.5	62.4%	-0.4%
前十席位		6,918	1,024	前十席位		16,750	62	0.7	80.8%	-0.5%	前十席位		16,903	98	1.0	81.5%	-0.3%
前二十席		8,217	1,129	前二十席		18,564	302	3.2	89.5%	0.6%	前二十席		19,416	153	1.6	93.6%	-0.2%

五年期国债期货持仓情况

五年期国债期货2412合约持仓情况

名次	会员名称	成交量	前上日增减	名次	会员名称	持买单量	+/- (手)	持仓名义金额 变化 (亿元)	持仓占比	占比变化	名次	会员名称	持卖单量	+/- (手)	持仓名义金额 变化 (亿元)	持仓占比	占比变化
1	东证期货	18,256	3,174	1	中信期货	30,195	714	7.5	25.5%	0.5%	1	银河期货	22,626	394	4.1	19.1%	0.2%
2	国泰君安	13,852	2,290	2	国泰君安	13,115	177	1.9	11.1%	0.1%	2	中信期货	14,539	139	1.5	12.3%	0.0%
3	中信期货	12,241	4,084	3	宏源期货	9,957	355	3.7	8.4%	0.3%	3	国泰君安	12,901	-219	-2.3	0.9%	-0.3%
4	华泰期货	9,377	1,267	4	海通期货	9,220	18	0.2	7.8%	0.0%	4	华泰期货	9,018	512	5.4	7.6%	0.4%
5	银河期货	5,510	1,224	5	东证期货	6,464	-618	-6.5	5.5%	0.6%	5	招商期货	8,396	104	1.1	7.1%	0.0%
6	海通期货	4,712	64	6	平安期货	4,682	222	2.3	4.0%	0.2%	6	宏源期货	7,641	-323	-3.4	6.5%	-0.3%
7	招商期货	4,574	1,041	7	招商期货	3,403	378	4.0	2.9%	0.3%	7	平安期货	5,542	426	4.5	4.7%	0.3%
8	中信建投	3,514	-385	8	中信建投	3,145	-101	-1.1	2.7%	0.1%	8	海通期货	5,069	-174	-1.8	4.3%	-0.2%
9	平安期货	3,116	1,265	9	申银万国	3,013	-551	-5.8	2.5%	0.5%	9	东证期货	3,914	-574	-6.0	3.3%	-0.5%
10	紫金天风	2,924	1,154	10	银河期货	2,494	126	1.3	2.1%	0.1%	10	广发期货	3,744	762	8.0	3.2%	0.6%
前五席位		59,236	12,039	前五席位		68,951	646	6.8	58.2%	0.2%	前五席位		67,480	930	9.7	57.0%	0.5%
前十席位		78,076	15,178	前十席位		85,688	720	7.5	72.4%	0.2%	前十席位		93,390	1,047	11.0	78.9%	0.1%
前二十席		89,437	16,591	前二十席		101,808	779	8.2	86.0%	0.2%	前二十席		109,775	1,071	11.2	92.7%	0.2%

五年期国债期货2503合约持仓情况

名次	会员名称	成交量	前上日增减	名次	会员名称	持买单量	+/- (手)	持仓名义金额 变化 (亿元)	持仓占比	占比变化	名次	会员名称	持卖单量	+/- (手)	持仓名义金额 变化 (亿元)	持仓占比	占比变化
1	东证期货	1,533	-40	1	中信期货	3,065	2	0.0	28.0%	-1.5%	1	东证期货	2,846	-17	-0.2	26.0%	-1.6%
2	中信期货	826	-363	2	国泰君安	1,402	-11	-0.1	12.8%	-0.8%	2	中信期货	1,551	38	0.4	14.2%	-0.4%
3	银河期货	574	445	3	江西瑞奇	920	356	3.7	8.4%	3.0%	3	华泰期货	1,034	0	0.0	9.5%	-0.5%
4	招商期货	525	18	4	平安期货	613	-156	-1.6	5.6%	-1.8%	4	银河期货	999	483	5.1	9.1%	4.2%
5	国泰君安	413	-220	5	申银万国	532	70	0.7	4.9%	0.4%	5	广发期货	803	1	0.0	7.3%	-0.4%
6	江西瑞奇	356	235	6	华融融达	387	1	0.0	3.5%	-0.2%	6	永安期货	393	0	0.0	3.6%	-0.2%
7	平安期货	173	-265	7	东证期货	351	18	0.2	3.2%	0.0%	7	华西期货	326	0	0.0	3.0%	-0.2%
8	华闻期货	141	25	8	兴证期货	346	0	0.0	3.2%	-0.2%	8	南华期货	310	4	0.0	2.8%	-0.1%
9	申银万国	141	23	9	金瑞期货	331	-2	0.0	3.0%	-0.2%	9	国金期货	223	6	0.1	2.0%	-0.1%
10	中原期货	121	82	10	广发期货	298	84	0.9	2.7%	2.5%	10	西南期货	202	-2	0.0	1.8%	1.7%
前五席位		3,871	-160	前五席位		6,532	261	2.7	59.7%	-0.7%	前五席位		7,233	505	5.3	66.1%	1.3%
前十席位		4,803	-60	前十席位		8,245	362	3.8	75.4%	-0.8%	前十席位		8,687	513	5.4	79.4%	0.5%
前二十席		5,583	-226	前二十席		9,769	470	4.9	89.3%	-1.1%	前二十席		10,148	601	6.3	92.8%	0.8%

三十年期国债期货持仓情况

三十年期国债期货2412合约持仓情况

名次	会员名称	成交量	前上日增减	名次	会员名称	持买单量	+/- (手)	持仓名义金额 变化 (亿元)	持仓占比	占比变化	名次	会员名称	持卖单量	+/- (手)	持仓名义金额 变化 (亿元)	持仓占比	占比变化
1	中信期货	18,124	109	1	中信期货	12,434	-7	-0.1	17.4%	0.2%	1	中信期货	12,549	21	0.2	17.5%	0.2%
2	东证期货	13,955	873	2	国泰君安	10,134	81	2.0	14.2%	-0.1%	2	国泰君安	10,696	191	2.1	14.9%	0.4%
3	国泰君安	11,942	-244	3	招商期货	6,311	32	1.5	8.8%	0.3%	3	东证期货	6,549	166	1.9	9.2%	0.3%
4	海通期货	5,289	-370	4	宏源期货	4,046	19	-0.2	5.7%	0.0%	4	宏源期货	5,201	-67	-0.7	7.3%	0.0%
5	中信建投	4,959	652	5	平安期货	3,139	87	2.1	4.4%	0.3%	5	招商期货	3,162	24	0.3	4.4%	0.1%
6	国信期货	4,603	875	6	银河期货	3,087	2	0.0	4.3%	0.0%	6	国投安信	3,155	-46	-0.5	4.4%	0.0%
7	光大期货	4,601	516	7	华泰期货	2,873	333	3.7	4.0%	0.4%	7	华泰期货	3,093	96	1.1	4.3%	0.2%
8	华泰期货	3,915	562	8	东证期货	2,801	63	0.7	3.9%	0.1%	8	永安期货	2,543	-23	-0.3	3.6%	0.0%
9	国金期货	3,310	1,004	9	海通期货	2,220	15	1.3	3.1%	0.2%	9	海通期货	1,992	-16	-0.2	2.8%	0.0%
10	银河期货	2,493	-194	10	国金期货	1,819	34	6.0	2.5%	0.7%	10	国金期货	1,817	154	1.7	2.5%	0.2%
	前五席位	54,269	1,020		前五席位	36,064	112	1.2	50.4%	0.3%		前五席位	38,157	335	3.7	53.3%	0.9%
	前十席位	73,191	3,784		前十席位	48,864	-575	-6.4	68.3%	-0.1%		前十席位	50,757	500	5.6	70.9%	0.9%
	前二十席	88,273	5,504		前二十席	60,377	-608	-6.8	84.4%	0.0%		前二十席	61,401	-321	-3.6	85.8%	0.3%

三十年期国债期货2503合约持仓情况

名次	会员名称	成交量	前上日增减	名次	会员名称	持买单量	+/- (手)	持仓名义金额 变化 (亿元)	持仓占比	占比变化	名次	会员名称	持卖单量	+/- (手)	持仓名义金额 变化 (亿元)	持仓占比	占比变化
1	中信期货	2,962	300	1	中信期货	4,444	137	1.5	26.0%	0.3%	1	国金期货	1,985	-260	-2.9	11.6%	0.8%
2	东证期货	1,463	303	2	国泰君安	2,822	18	0.2	15.5%	-0.2%	2	宏源期货	1,353	206	2.3	7.9%	0.1%
3	国泰君安	970	16	3	第一创业	1,493	-2	0.0	8.7%	-0.2%	3	银河期货	1,287	-6	-0.1	7.5%	0.2%
4	华闻期货	738	192	4	银河期货	1,261	20	0.2	7.4%	0.0%	4	中信期货	1,283	-31	-0.3	7.5%	0.3%
5	紫金天风	729	713	5	平安期货	985	2	0.0	5.8%	-0.1%	5	兴证期货	1,032	-15	-0.2	6.0%	0.2%
6	申银万国	661	523	6	永安期货	647	36	0.4	3.8%	0.1%	6	金元期货	823	0	0.0	4.8%	-0.1%
7	广发期货	434	285	7	东证期货	598	-9	-0.1	3.5%	-0.1%	7	东证期货	786	26	0.3	4.6%	0.1%
8	国信期货	410	131	8	首创京都	439	0	0.0	2.6%	-0.1%	8	南华期货	739	5	0.1	4.3%	-0.1%
9	瑞达期货	410	200	9	华泰期货	374	13	0.1	2.2%	0.0%	9	国海良时	698	-3	0.0	4.1%	-0.1%
10	国金期货	303	262	10	长江期货	331	0	0.0	1.9%	0.0%	10	申银万国	612	1	0.0	3.6%	-0.1%
	前五席位	6,862	1,524		前五席位	11,005	175	2.0	64.3%	-0.3%		前五席位	6,940	-106	-1.2	40.5%	-1.5%
	前十席位	9,080	2,925		前十席位	13,394	215	2.4	78.2%	-0.3%		前十席位	10,598	-77	-0.9	61.9%	-1.7%
	前二十席	10,561	2,853		前二十席	15,232	221	2.5	89.0%	-0.5%		前二十席	14,842	296	3.3	86.7%	-0.5%

二年期国债期货持仓情况

二年期国债期货2412合约持仓情况

名次	会员名称	成交量	前上日增减	名次	会员名称	持买单量	+/- (手)	持仓名义金额 变化 (亿元)	持仓占比	占比变化	名次	会员名称	持卖单量	+/- (手)	持仓名义金额 变化 (亿元)	持仓占比	占比变化
1	东证期货	13,197	39	1	中信期货	10,168	204	4.2	18.1%	0.2%	1	平安期货	8,857	131	2.7	15.7%	-0.1%
2	中信期货	7,801	-18	2	国泰君安	8,664	240	5.3	15.4%	0.3%	2	国泰君安	8,157	-28	0.6	14.5%	-0.1%
3	国泰君安	7,218	-87	3	海通期货	7,015	269	5.5	12.5%	0.3%	3	东证期货	6,845	18	2.4	12.2%	0.1%
4	银河期货	5,652	587	4	东证期货	3,433	-41	-0.8	6.1%	-0.1%	4	中信期货	4,165	43	0.9	7.4%	0.0%
5	海通期货	4,101	-30	5	银河期货	3,022	312	6.4	5.4%	0.5%	5	申银万国	3,735	67	1.4	6.6%	0.0%
6	华泰期货	3,762	-57	6	光大期货	2,617	66	1.4	4.7%	0.1%	6	海通期货	3,478	-2	0.0	6.2%	-0.1%
7	中信建投	3,565	488	7	国贸期货	2,420	-17	-0.3	4.3%	-0.1%	7	华泰期货	3,180	39	0.8	5.7%	0.0%
8	招商期货	3,387	46	8	招商期货	1,384	-14	-0.3	2.5%	-0.1%	8	国贸期货	2,335	6	0.1	4.1%	0.0%
9	平安期货	1,890	23	9	国投安信	1,234	54	1.1	2.2%	0.1%	9	光大期货	1,708	1	0.0	3.0%	0.0%
10	国金期货	1,841	16	10	广发期货	1,107	16	0.3	2.0%	0.0%	10	银河期货	1,436	248	5.1	2.6%	-0.1%
前五席位		37,969	-3,087	前五席位		32,302	1,004	20.6	57.4%	1.2%	前五席位		31,759	69	1.4	56.4%	-0.5%
前十席位		52,414	-2,267	前十席位		41,064	1,109	22.7	73.0%	1.1%	前十席位		43,896	-135	-2.8	78.0%	-1.1%
前二十席		58,905	-3,018	前二十席		48,523	860	17.6	86.2%	0.6%	前二十席		52,458	679	13.9	93.2%	0.2%

二年期国债期货2503合约持仓情况

名次	会员名称	成交量	前上日增减	名次	会员名称	持买单量	+/- (手)	持仓名义金额 变化 (亿元)	持仓占比	占比变化	名次	会员名称	持卖单量	+/- (手)	持仓名义金额 变化 (亿元)	持仓占比	占比变化
1	东证期货	1,188	39	1	中信期货	2,153	27	0.6	14.6%	-0.3%	1	国投安信	2,415	0	0.0	16.4%	-0.6%
2	国泰君安	521	47	2	海通期货	1,738	65	1.3	11.8%	0.0%	2	海通期货	2,071	2	0.0	14.1%	-0.5%
3	平安期货	498	342	3	银河期货	1,264	-5	-0.1	8.6%	-0.3%	3	格林大华	1,808	-1	0.0	12.3%	-0.4%
4	申银万国	385	305	4	平安期货	1,041	46	0.9	7.1%	0.1%	4	中信期货	1,388	111	2.3	9.4%	0.5%
5	浙商期货	382	375	5	申银万国	944	-66	-1.4	6.4%	-0.7%	5	银河期货	1,283	1	0.0	8.7%	-0.3%
6	招商期货	355	-199	6	东证期货	726	-37	-0.8	4.9%	-0.4%	6	平安期货	1,074	350	7.2	7.3%	2.2%
7	中信期货	330	111	7	国金期货	683	184	3.8	4.6%	3.7%	7	东证期货	825	-7	-0.1	5.6%	-0.2%
8	国金期货	297	211	8	兴证期货	659	0	0.0	4.5%	-0.2%	8	国海良时	629	150	3.1	4.3%	0.9%
9	华泰期货	248	164	9	招商期货	625	7	0.1	4.2%	-0.1%	9	国金期货	492	17	0.3	3.3%	0.0%
10	广发期货	163	116	10	宏源期货	616	-65	-1.3	4.2%	-0.6%	10	中银期货	300	0	0.0	2.0%	-0.1%
前五席位		2,974	1,108	前五席位		7,140	67	1.4	48.5%	-1.2%	前五席位		8,965	113	2.3	60.9%	-1.3%
前十席位		4,367	1,511	前十席位		10,449	156	3.2	71.0%	-2.0%	前十席位		12,285	623	12.8	83.5%	1.5%
前二十席		5,150	1,548	前二十席		13,395	530	10.9	91.0%	0.6%	前二十席		13,965	643	13.2	94.9%	0.4%

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

电话：400-886-7799

研究员：沈忱

期货从业证号：F3035416

投资咨询证号：Z0015142

Tel.: 021-65789257

邮箱：shenchen_qh@chinastock.com.cn