

股指期货价差日报

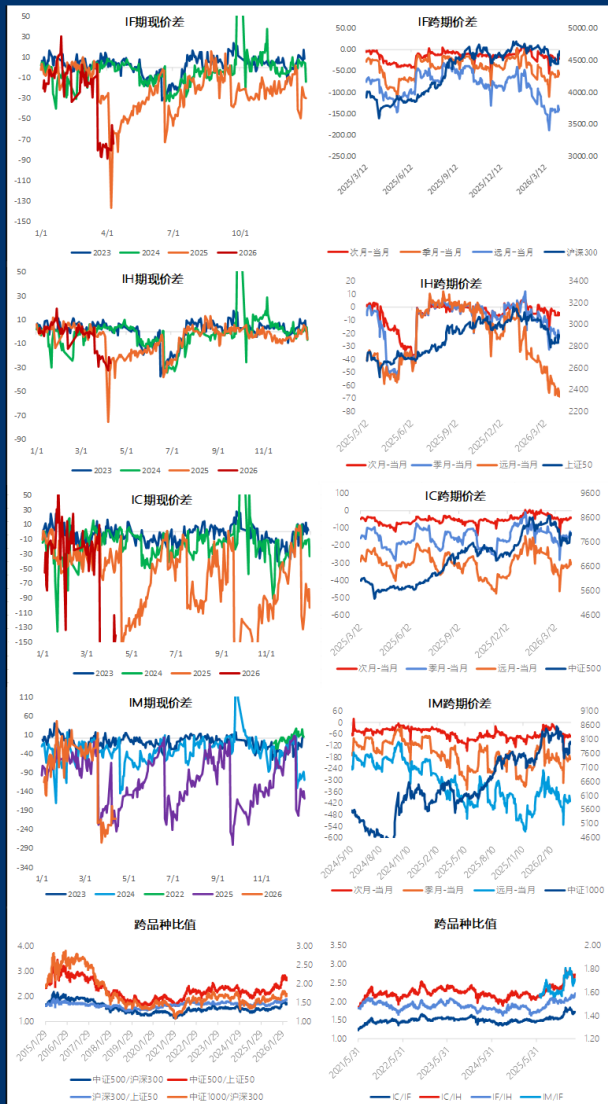
广发期货
GF FUTURES

投资咨询业务资格：证监许可【2011】1292号
2026年4月13日

叶倩宁 Z0016628

	品种	最新值	较前一日变化	历史1年分位数	全历史分位数
期现价差	IF期现价差	-74.57	-8.34	4.90%	2.60%
	IH期现价差	-26.38	-2.22	4.50%	3.80%
	IC期现价差	-140.76	9.07	11.40%	1.30%
	IM期现价差	-212.43	-0.39	65.00%	3.60%
IF跨期价差	次月-当月	-21.60	-2.20	23.30%	21.00%
	季月-当月	-58.00	-2.60	25.40%	19.90%
	远月-当月	-139.80	1.60	8.10%	9.60%
	季月-次月	-36.40	-0.40	19.60%	18.90%
	远月-次月	-118.20	3.80	9.80%	8.60%
	远月-季月	-81.80	4.20	6.10%	3.80%
IH跨期价差	次月-当月	-4.40	2.00	36.40%	35.90%
	季月-当月	-23.90	-2.40	19.20%	22.30%
	远月-当月	-68.60	-3.60	0.40%	9.10%
	季月-次月	-19.40	-4.40	7.30%	15.40%
	远月-次月	-64.20	-5.60	0.40%	6.70%
	远月-季月	-44.80	-1.20	0.80%	2.40%
IC跨期价差	次月-当月	-40.20	5.40	77.80%	45.60%
	季月-当月	-131.20	11.00	66.80%	33.80%
	远月-当月	-297.60	12.40	59.40%	22.60%
	季月-次月	-91.00	5.60	68.80%	32.30%
	远月-次月	-257.40	7.00	39.30%	17.70%
	远月-季月	-166.40	1.40	34.40%	11.70%
IM跨期价差	次月-当月	-70.80	3.60	50.00%	17.50%
	季月-当月	-189.20	2.40	50.00%	21.20%
	远月-当月	-408.80	1.20	55.00%	12.70%
	季月-次月	-118.40	-1.20	45.00%	26.00%
	远月-次月	-338.00	-2.40	45.00%	12.50%
	远月-季月	-219.60	-1.20	45.00%	6.20%
跨品种比值	中证500/沪深300	1.7188	-0.0110	81.50%	77.80%
	中证500/上证50	2.7485	0.0104	92.20%	84.90%
	沪深300/上证50	1.5990	0.0162	99.50%	99.70%
	中证1000/沪深300	1.7250	-0.0098	81.10%	68.70%
	IC/IF	1.7160	-0.0059	81.50%	96.70%
	IC/IH	2.7247	0.0159	89.70%	89.20%
	IF/IH	1.5878	0.0147	99.50%	99.90%
IM/IF	1.7067	-0.0065	76.10%	76.10%	

备注：期现价差=主力合约收盘价-现货指数收盘价；次月-当月=次月连续合约收盘价-当月连续合约收盘价；其他跨期价差以此类推；中证500/沪深300=中证500指数收盘价和沪深300指数收盘价的比值；IC/IF=IC主力合约收盘价/IF主力合约收盘价；其他跨品种价差以此类推；分位数是指最近一年的百分位数；分位数2是指期货上市以来的百分位数。



数据来源：Wind、广发期货研究所，请仔细阅读在期货交易所声明。

免责声明

本报告中的信息均来源于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和完整性不作任何保证。本报告所载研究人员的不同观点、见解及分析方法，并不构成广发期货对任何投资建议，在任何情况下，本报告仅供参考，报告中的信息或所陈述的意见并不构成任何买卖的出价或询价。投资者据此操作，风险自担。本报告如有虚假记载、误导性陈述或其他违法违规行为的，广发期货将依法承担相应法律责任。任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制、转载、引用、刊布、重印或用于其他用途。广发期货保留所有权利。广发期货



知识固强，求实奉献，客户至上，合作共赢

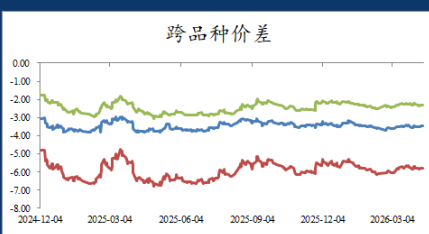
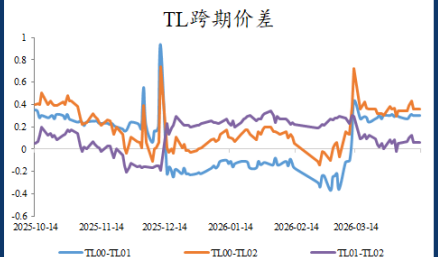
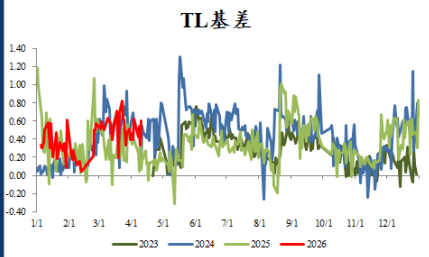
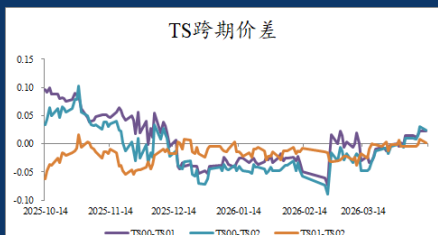
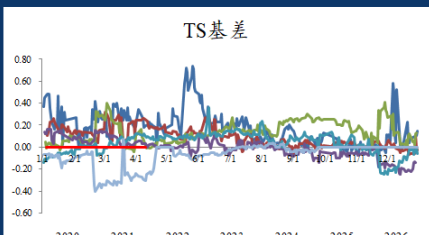
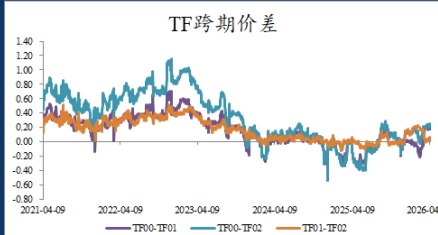
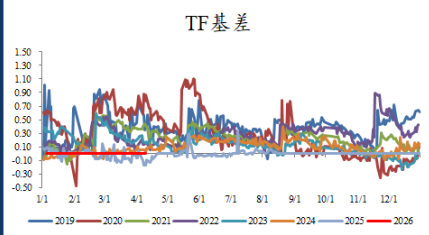
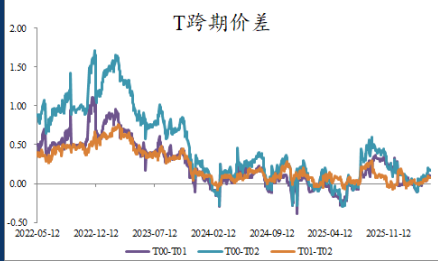
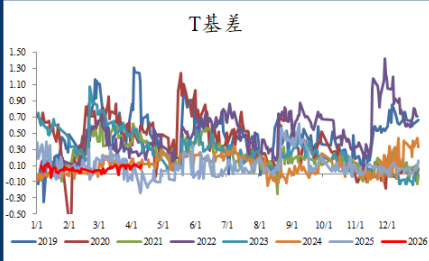
关注官方微信

国债期货价差日报

种类	日期	品种	IRR (%)	最新值	较前一交易日变化	上市以来百分位数
基差	2026-04-10	TS基差	-0.6149	0.6010	0.5653	0.80%
	2026-04-10	TF基差	0.9286	0.1056	0.0338	21.10%
	2026-04-10	T基差	1.0359	0.1044	0.0347	35.50%
	2026-04-10	TL基差	0.1909	0.6033	0.2717	5.10%
TS跨期价差	2026-04-10	当季-下季	---	0.0220	0.0000	31.10%
	2026-04-10	当季-隔季	---	0.0240	-0.0060	27.90%
	2026-04-10	下季-隔季	---	0.0020	-0.0060	22.70%
TF跨期价差	2026-04-10	当季-下季	---	0.1750	-0.0250	48.70%
	2026-04-10	当季-隔季	---	0.2000	-0.0300	41.90%
	2026-04-10	下季-隔季	---	0.0250	-0.0050	29.20%
T跨期价差	2026-04-10	当季-下季	---	0.0950	-0.0050	34.90%
	2026-04-10	当季-隔季	---	0.1650	-0.0100	32.50%
	2026-04-10	下季-隔季	---	0.0700	-0.0050	29.80%
TL跨期价差	2026-04-10	当季-下季	---	0.3000	-0.0100	-
	2026-04-10	当季-隔季	---	0.3600	-0.0700	-
	2026-04-10	下季-隔季	---	0.0600	-0.0600	-
跨品种价差	2026-04-10	TS-TF	---	-3.4430	0.0500	14.60%
	2026-04-10	TS-T	---	-5.7780	0.0200	15.60%
	2026-04-10	TF-T	---	-2.3350	-0.0300	16.20%
	2026-04-10	TS-TL	---	-9.8880	-0.2500	-
	2026-04-10	TF-TL	---	-6.4450	-0.3000	-
	2026-04-10	T-TL	---	-4.1100	-0.2700	-

注：1. 基差=CTD净价（中债估值）-期货结算价（主力合约）*转换因子
2. 上市以来百分位数：基差部分指IRR自期货合约上市以来最新值的百分位数，其余均为价差最新值的百分位数
3. 价差依据期货主力合约收盘价计算得出

本报告数据来源：Wind 广发期货研究所，请仔细阅读报告末端的免责声明。



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。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，投资者据此操作，风险自担。本报告旨在发送给广发期货特定客户及专业人士，版权归广发期货所有，未经广发期货书面许可，任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制或引用、刊发，需注明出处为“广发期货”。



贵金属期现日报

广发期货
GF FUTURES

投资咨询业务资格：证监许可【2011】1292号
2026年4月13日

叶倩宁 Z0016628

国内期货收盘价

品种	4月10日	4月9日	涨跌	涨跌幅	单位
AU2606合约	1048.36	1041.32	7.04	0.68%	元/克
AG2606合约	18583	18225	358	1.96%	元/千克
PT2606合约	521.45	511.60	9.85	1.93%	元/克
PD2606合约	385.05	387.35	-2.30	-0.59%	元/克

外盘期货收盘价

品种	4月10日	4月9日	涨跌	涨跌幅	单位
COMEX黄金主力合约	4771.00	4790.50	-19.50	-0.41%	美元/盎司
COMEX白银主力合约	76.03	75.48	0.55	0.73%	
NYMEX铂金主力合约	2055.30	2115.50	-60.20	-2.85%	
NYMEX钯金主力合约	1538.00	1563.50	-25.50	-1.63%	

现货价格

品种	现值	前值	涨跌	涨跌幅	单位
伦敦金	4746.90	4763.45	-16.55	-0.35%	美元/盎司
伦敦银	75.83	75.32	0.52	0.69%	
现货铂金	2062.00	2039.00	23.00	1.13%	
现货钯金	1525.00	1548.00	-23.00	-1.49%	
上金所黄金T+D	1046.45	1037.92	8.53	0.82%	元/克
上金所白银T+D	18560	18130	430	2.37%	元/千克
上金所铂金9995	521	508	13	2.56%	元/克

基差

	现值	前值	涨跌	历史1年分位数	单位
黄金TD-沪金主力	-1.91	-3.40	1.49	46.10%	/
白银TD-沪银主力	-23	-95	72	60.60%	
伦敦金-COMEX金	-24.10	-27.05	2.95	34.60%	
伦敦银-COMEX银	-0.19	-0.16	-0.03	34.30%	

比价

	现值	前值	涨跌	涨跌幅	单位
COMEX金/银	62.76	63.47	-0.72	-1.13%	/
上期所金/银	56.42	57.14	-0.72	-1.26%	
NYMEX铂/钯	1.34	1.35	-0.02	-1.23%	
广期所铂/钯	1.35	1.32	0.03	2.53%	

利率与汇率

	现值	前值	涨跌	涨跌幅	单位
10年期美债收益率	4.31	4.29	0.02	0.5%	%
2年期美债收益率	3.81	3.78	0.03	0.8%	%
10年期TIPS国债收益率	1.95	1.95	0.00	0.0%	%
美元指数	98.70	98.82	-0.12	-0.12%	/
离岸人民币汇率	6.8248	6.8280	-0.0032	-0.05%	/

库存与持仓

	现值	前值	涨跌	涨跌幅	单位
上期所黄金库存	108663	108663	0	0.00%	千克
上期所白银库存	421461	393729	27732	7.04%	
COMEX黄金库存	30550858	30613229	-62370	-0.20%	盎司
COMEX白银库存	327934720	325122044	2812676	0.87%	
COMEX黄金注册仓单	16012811	16012811	0	0.00%	
COMEX白银注册仓单	76840193	76840193	0	0.00%	
SPRD黄金ETF持仓	1052	1052	0.00	0.00%	吨
SLV白银ETF持仓	15291	15310	-18.30	-0.12%	

贵金属观点

* 地缘局势对贵金属仍有冲击但总体或边际递减，然而中东地区实现和平的路程仍曲折使金融资产短期波动反复，需关注近两周美伊谈判的进展，黄金价格在20日线上方若逐步企稳，建议逢低波段做多，上方5000美元存在较大阻力，可逢高做黄金虚值期权双卖策略；白银技术面有待修复，阶段支撑在70美元附近，上方阻力在80美元，市场波动率持续回落建议持续卖出虚值期权；铂金价格站上20日均线保持偏强运行，支撑在1950美元附近，钯金保持在1400美元上方表现偏强，日内可逢低买入把握波段行情。

数据来源：Wind、广发期货研究所。请仔细阅读报告尾页免责声明。

免责声明

本报告中的信息均来源于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所属机构的立场。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”。

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！

知识图强，求实奉献，客户至上，合作共赢



关注微信公众号