

股指期货价差日报

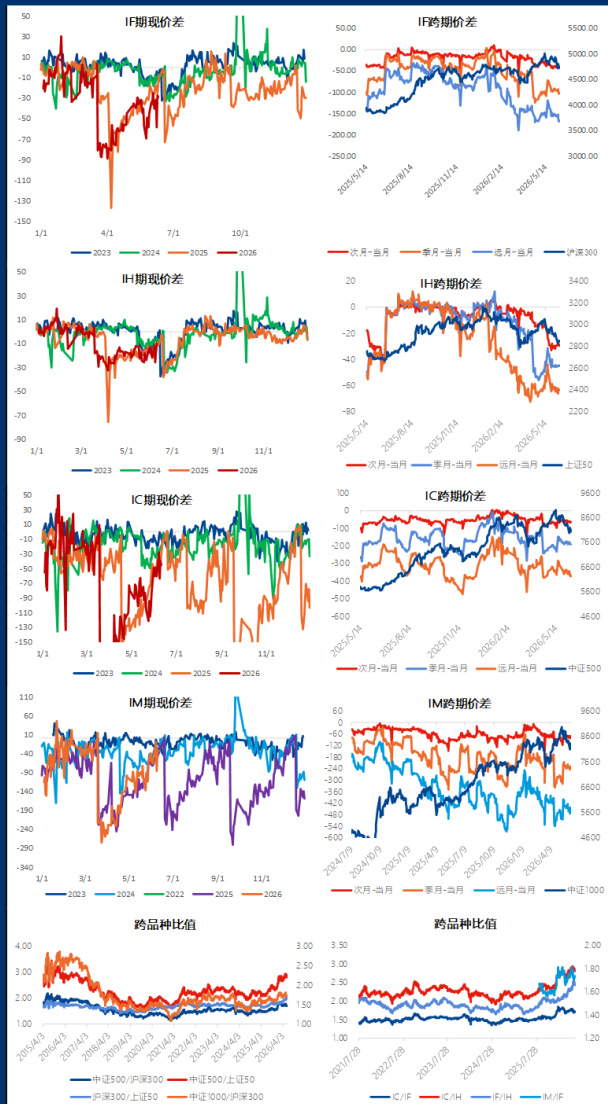


投资咨询业务资格证书：证监许可【2011】1292号
2026年06月12日

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	-29.01	-1.82	40.10%	15.90%
	IH期现价差	-10.12	6.45	31.90%	22.30%
	IC期现价差	-44.98	-5.32	63.10%	25.10%
	IM期现价差	-33.05	3.47	85.00%	51.70%
IF跨期价差	次月-当月	-42.20	-1.00	3.60%	6.60%
	季月-当月	-101.60	1.40	6.50%	7.30%
	远月-当月	-169.00	0.20	2.00%	6.10%
	季月-次月	-59.40	2.40	8.60%	8.70%
	远月-次月	-126.80	1.20	4.90%	7.10%
	远月-季月	-67.40	-1.20	13.10%	7.60%
IH跨期价差	次月-当月	-29.80	-1.00	6.50%	7.40%
	季月-当月	-45.20	-0.40	8.10%	8.90%
	远月-当月	-63.60	0.20	9.00%	9.40%
	季月-次月	-15.40	0.60	13.50%	17.90%
	远月-次月	-33.80	1.20	29.90%	24.50%
	远月-季月	-18.40	0.60	26.60%	25.80%
IC跨期价差	次月-当月	-65.60	-1.40	20.90%	11.20%
	季月-当月	-189.80	2.80	26.20%	14.40%
	远月-当月	-370.60	3.60	19.60%	9.20%
	季月-次月	-124.20	4.20	31.90%	17.00%
	远月-次月	-305.00	5.00	20.90%	9.60%
	远月-季月	-180.80	0.80	18.40%	5.70%
IM跨期价差	次月-当月	-77.40	4.60	25.00%	13.00%
	季月-当月	-239.80	5.40	15.00%	11.80%
	远月-当月	-465.80	7.20	15.00%	6.10%
	季月-次月	-162.40	0.80	15.00%	11.80%
	远月-次月	-388.40	2.60	15.00%	6.00%
	远月-季月	-226.00	1.80	15.00%	4.50%
跨品种比值	中证500/沪深300	1.7016	0.0035	63.10%	76.20%
	中证500/上证50	2.8236	-0.0054	86.40%	87.80%
	沪深300/上证50	1.6594	-0.0066	94.60%	99.50%
	中证1000/沪深300	1.7278	0.0013	68.80%	69.50%
	IC/IF	1.7026	0.0030	65.10%	93.90%
	IC/IH	2.8178	-0.0138	87.20%	97.70%
	IF/IH	1.6551	-0.0110	94.60%	99.00%
	IM/IF	1.7315	0.0027	68.30%	68.30%

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；其他跨品种价差比值以此类推；分位数是最近一年的百分位数；分位数2是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发布。

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，并不构成广发期货及附属机构的投资、咨询或提供其他服务的意见或建议，投资者应谨慎决策。本报告如有任何错误或遗漏，概与广发期货无关。本报告仅供广发期货客户及其他专业人士，未经许可不得进行任何形式的发布、复制或再行发布。请注册成为“广发期货”。



知识固强，求实奉献，客户至上，合作共赢

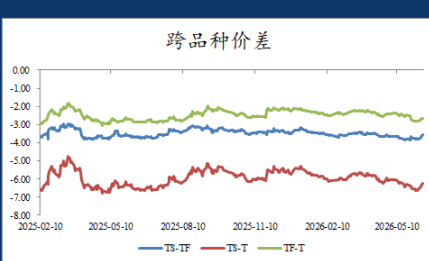
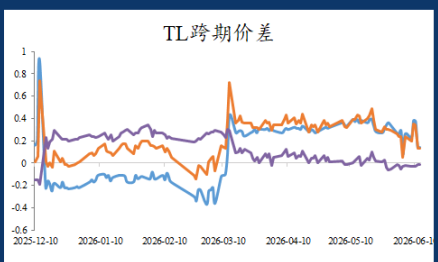
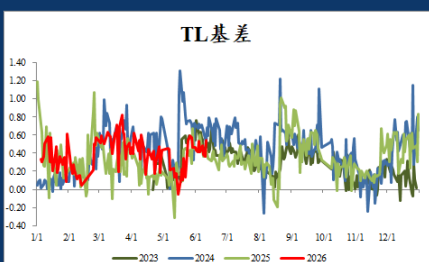
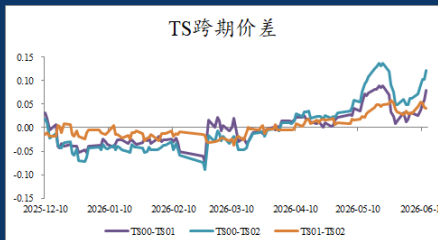
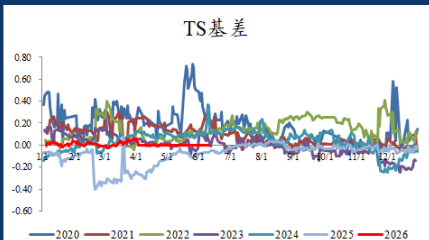
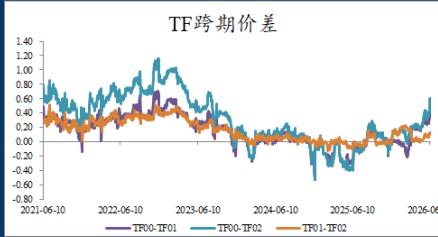
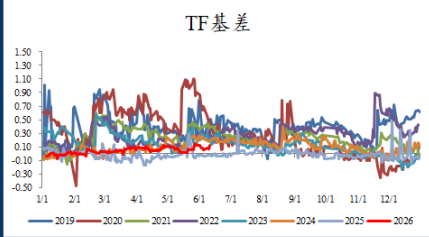
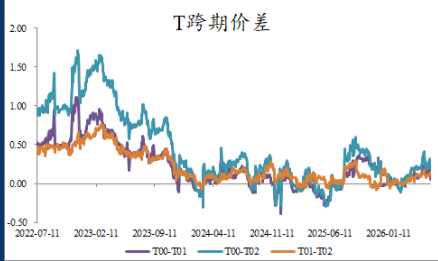
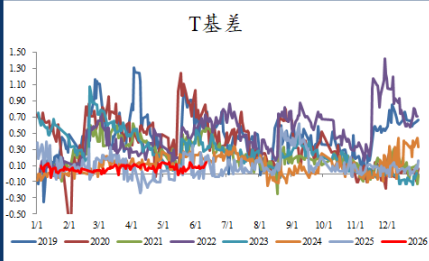
关注官方微信

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	2026-06-11	TS基差	1.1340	0.0400	0.0124	8.80%
	2026-06-11	TF基差	1.1580	0.1189	0.0426	27.60%
	2026-06-11	T基差	1.1710	0.1423	0.0308	39.40%
	2026-06-11	TL基差	1.1664	0.5440	0.1833	32.30%
TS跨期价差	2026-06-11	当季-下季	---	0.0800	0.0220	45.50%
	2026-06-11	当季-隔季	---	0.1220	0.0200	41.40%
	2026-06-11	下季-隔季	---	0.0420	-0.0020	36.10%
TF跨期价差	2026-06-11	当季-下季	---	0.4850	0.0700	87.40%
	2026-06-11	当季-隔季	---	0.6050	0.0750	66.20%
	2026-06-11	下季-隔季	---	0.1200	0.0050	42.00%
T跨期价差	2026-06-11	当季-下季	---	0.0550	-0.1650	29.20%
	2026-06-11	当季-隔季	---	0.2000	-0.1250	34.80%
	2026-06-11	下季-隔季	---	0.1450	0.0400	40.80%
TL跨期价差	2026-06-11	当季-下季	---	0.1400	-0.2300	-
	2026-06-11	当季-隔季	---	0.1300	-0.2100	-
	2026-06-11	下季-隔季	---	-0.0100	0.0200	-
跨品种价差	2026-06-11	TS-TF	---	-3.5630	0.0480	11.60%
	2026-06-11	TS-T	---	-6.2330	0.0480	9.60%
	2026-06-11	TF-T	---	-2.6700	0.0000	8.70%
	2026-06-11	TS-TL	---	-10.4180	0.0980	-
	2026-06-11	TF-TL	---	-6.8550	0.0500	-
2026-06-11	T-TL	---	-4.1850	0.0500	-	

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其专业人士，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6月12日

叶倩宁 Z0016628

国内期货收盘价

品种	6月11日	6月10日	涨跌	涨跌幅	单位
AU2608合约	895.00	919.32	-24.32	-2.65%	元/克
AG2608合约	15416	15622	-206	-1.32%	元/千克
PT2608合约	417.80	417.00	0.80	0.19%	元/克
PD2608合约	301.50	289.55	11.95	4.13%	

外盘期货收盘价

品种	6月11日	6月10日	涨跌	涨跌幅	单位
COMEX黄金主力合约	4233.80	4094.10	139.70	3.41%	美元/盎司
COMEX白银主力合约	67.49	63.50	3.99	6.28%	
NYMEX铂金主力合约	1724.80	1665.10	59.70	3.59%	
NYMEX钯金主力合约	1283.50	1225.50	58.00	4.73%	

现货价格

品种	现值	前值	涨跌	涨跌幅	单位
伦敦金	4212.22	4071.67	140.55	3.45%	美元/盎司
伦敦银	67.35	63.39	3.96	6.25%	
现货铂金	1668.00	1681.00	-13.00	-0.77%	元/克
现货钯金	1241.00	1239.00	2.00	0.16%	
上金所黄金T+D	895.82	915.49	-19.67	-2.15%	元/克
上金所白银T+D	15433	15503	-70	-0.45%	元/千克
上金所铂金9995	419	421	-2	-0.54%	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	0.82	-3.83	4.65	46.10%	/
白银TD-沪银主力	17	-119	136	60.60%	
伦敦金-COMEX金	-21.58	-22.43	0.85	41.60%	
伦敦银-COMEX银	-0.14	-0.11	-0.03	49.40%	

比价

	现值	前值	涨跌	涨跌幅	单位
COMEX金/银	62.73	64.47	-1.74	-2.70%	/
上期所金/银	58.06	58.85	-0.79	-1.34%	
NYMEX铂/钯	1.34	1.36	-0.01	-1.10%	
广期所铂/钯	1.39	1.44	-0.05	-3.78%	

利率与汇率

	现值	前值	涨跌	涨跌幅	单位
10年期美债收益率	4.45	4.55	-0.10	-2.2%	%
2年期美债收益率	4.05	4.13	-0.08	-1.9%	%
10年期TIPS国债收益率	2.16	2.21	-0.05	-2.3%	%
美元指数	99.69	100.04	-0.35	-0.35%	/
离岸人民币汇率	6.7633	6.7762	-0.0129	-0.19%	/

库存与持仓

	现值	前值	涨跌	涨跌幅	单位
上期所黄金库存	111663	111663	0	0.00%	千克
上期所白银库存	895265	916380	-21115	-2.30%	
COMEX黄金库存	28013782	28080934	-67152	-0.24%	盎司
COMEX白银库存	319342806	319952742	-609936	-0.19%	
COMEX黄金注册仓单	15412817	15159049	253768	1.67%	吨
COMEX白银注册仓单	85189165	85189165	0	0.00%	
SPRD黄金ETF持仓	1014	1014	0.00	0.00%	吨
SLV白银ETF持仓	15004	15028	-23.91	-0.16%	

贵金属观点

* 在市场交易利空叠加流动性收紧打压下，黄金下行压力仍存但在4000美元附近或存在支撑，短期地缘冲突形势可能存在较大反复使价格波动上升，单边交易建议暂时离场暂时观望，后续关注6月18日美联储决议将带来更明确的货币政策风向；白银在美联储货币紧缩预期及美伊局势扰动反复下建议保持观望；铂钯总体跟随金银价格宽幅震荡，钯金现货供应有所收紧对价格形成支撑短期在1200美元附近筑底存在反弹空间。

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、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