

股指期货价差日报

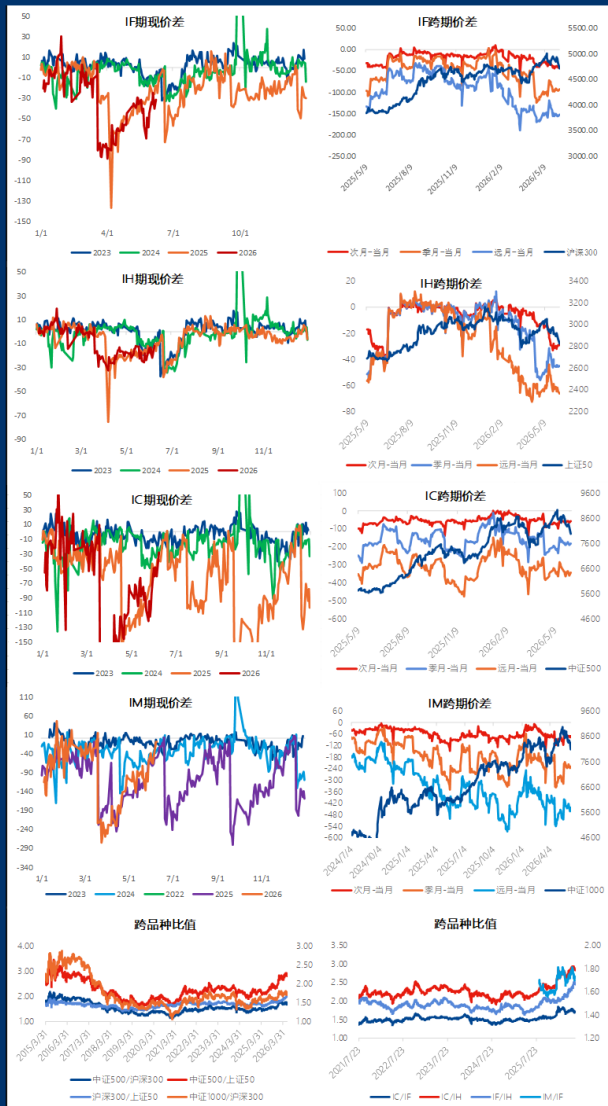
广发期货
GF FUTURES

投资咨询业务资格：证监许可【2011】1292号
2026年6月9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	-31.04	9.08	34.00%	14.00%
	IH期现价差	-12.01	9.85	28.60%	19.40%
	IC期现价差	-28.45	32.09	72.10%	42.50%
	IM期现价差	-8.46	40.70	90.00%	78.30%
IF跨期价差	次月-当月	-41.20	1.40	5.30%	6.90%
	季月-当月	-93.80	3.00	10.60%	8.70%
	远月-当月	-152.60	3.60	9.00%	8.30%
	季月-次月	-52.60	1.60	13.50%	11.60%
	远月-次月	-111.40	2.20	22.10%	10.50%
	远月-季月	-58.80	0.60	16.30%	10.60%
IH跨期价差	次月-当月	-29.00	0.40	8.10%	7.80%
	季月-当月	-45.00	1.00	8.60%	8.90%
	远月-当月	-66.60	-1.60	3.60%	8.40%
	季月-次月	-16.00	0.60	10.60%	17.40%
	远月-次月	-37.60	-2.00	23.30%	19.10%
	远月-季月	-21.60	-2.60	24.10%	22.90%
IC跨期价差	次月-当月	-58.40	5.00	34.00%	17.60%
	季月-当月	-179.60	10.20	33.60%	17.50%
	远月-当月	-342.20	19.60	32.30%	13.20%
	季月-次月	-121.20	5.20	34.00%	18.10%
	远月-次月	-283.80	14.60	30.70%	13.80%
	远月-季月	-162.60	9.40	42.20%	14.00%
IM跨期价差	次月-当月	-72.20	5.60	55.00%	17.90%
	季月-当月	-229.60	6.60	45.00%	13.90%
	远月-当月	-442.80	18.00	35.00%	8.70%
	季月-次月	-157.40	1.00	40.00%	14.60%
	远月-次月	-370.60	12.40	35.00%	8.20%
	远月-季月	-213.20	11.40	20.00%	9.30%
	中证500/沪深300	1.6895	-0.0235	60.60%	75.30%
	中证500/上证50	2.8189	-0.0602	85.60%	87.60%
沪深300/上证50	1.6685	-0.0123	96.30%	99.60%	
中证1000/沪深300	1.7144	-0.0172	64.70%	67.50%	
IC/IF	1.6946	-0.0201	64.30%	93.70%	
IC/IH	2.8208	-0.0591	88.50%	97.90%	
IF/IH	1.6646	-0.0150	96.30%	99.30%	
IM/IF	1.7240	-0.0118	65.20%	65.20%	

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，请仔细阅读相关风险提示。

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投资顾问的意见，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。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他专业人士，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、搬运，否则追究相关法律责任。



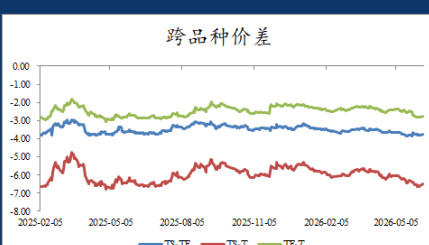
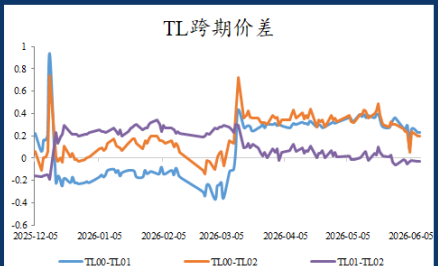
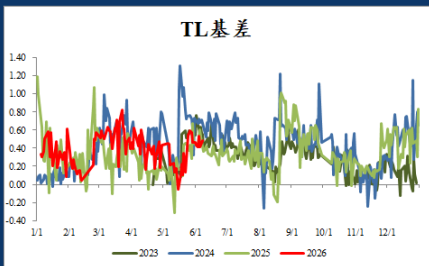
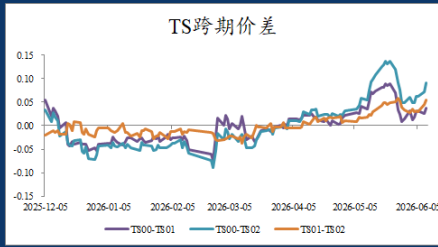
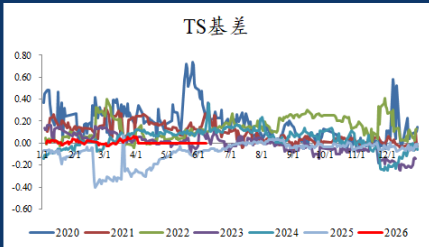
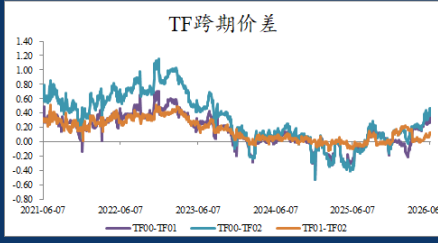
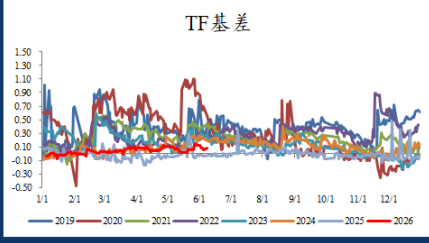
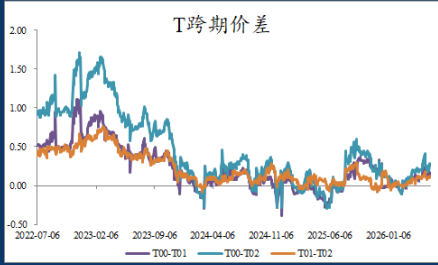
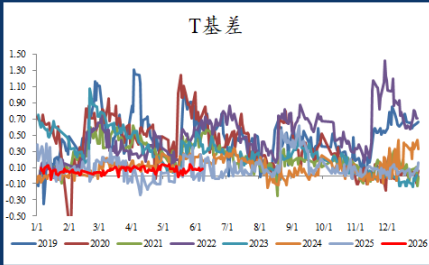
知识固强，求实奉献，客户至上，合作共赢

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	2026-06-08	TS基差	1.2039	0.0221	-0.0074	11.40%
	2026-06-08	TF基差	1.2934	0.0846	0.0210	31.70%
	2026-06-08	T基差	1.3458	0.0815	0.0150	45.60%
	2026-06-08	TL基差	1.3973	0.4801	0.0669	46.30%
TS跨期价差	2026-06-08	当季-下季	---	0.0380	0.0120	34.30%
	2026-06-08	当季-隔季	---	0.0920	0.0200	37.80%
	2026-06-08	下季-隔季	---	0.0540	0.0080	38.30%
TF跨期价差	2026-06-08	当季-下季	---	0.3350	0.0450	70.00%
	2026-06-08	当季-隔季	---	0.4600	0.0650	53.30%
	2026-06-08	下季-隔季	---	0.1250	0.0200	42.20%
T跨期价差	2026-06-08	当季-下季	---	0.1500	-0.0150	40.00%
	2026-06-08	当季-隔季	---	0.2650	-0.0200	38.70%
	2026-06-08	下季-隔季	---	0.1150	-0.0050	37.60%
TL跨期价差	2026-06-08	当季-下季	---	0.2300	-0.0300	-
	2026-06-08	当季-隔季	---	0.2000	-0.0400	-
	2026-06-08	下季-隔季	---	-0.0300	-0.0100	-
跨品种价差	2026-06-08	TS-TF	---	-3.7460	0.0490	3.30%
	2026-06-08	TS-T	---	-6.5010	0.0940	3.70%
	2026-06-08	TF-T	---	-2.7550	0.0450	5.80%
	2026-06-08	TS-TL	---	-11.1260	0.2040	-
	2026-06-08	TF-TL	---	-7.3800	0.1550	-
2026-06-08	T-TL	---	-4.6250	0.1100	-	

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，任何人不得擅自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9日

叶倩宁 Z0016628

国内期货收盘价

品种	6月8日	6月5日	涨跌	涨跌幅	单位
AU2608合约	942.20	974.02	-31.82	-3.27%	元/克
AG2608合约	16204	17528	-1324	-7.55%	元/千克
PT2608合约	437.25	466.85	-29.60	-6.34%	元/克
PD2608合约	288.20	313.55	-25.35	-8.08%	元/克

外盘期货收盘价

品种	6月8日	6月5日	涨跌	涨跌幅	单位
COMEX黄金主力合约	4353.80	4353.90	-0.10	0.00%	美元/盎司
COMEX白银主力合约	68.33	68.00	0.33	0.49%	
NYMEX铂金主力合约	1759.30	1777.40	-18.10	-1.02%	
NYMEX钯金主力合约	1222.50	1240.50	-18.00	-1.45%	

现货价格

品种	现值	前值	涨跌	涨跌幅	单位
伦敦金	4329.72	4328.92	0.80	0.02%	美元/盎司
伦敦银	68.13	67.89	0.24	0.36%	
现货铂金	1764.00	1857.00	-93.00	-5.01%	
现货钯金	1218.00	1317.00	-99.00	-7.52%	元/克
上金所黄金T+D	941.23	974.16	-32.93	-3.38%	
上金所白银T+D	16200	17520	-1320	-7.53%	
上金所铂金9995	443	473	-29	-6.20%	

基差

	现值	前值	涨跌	历史1年分位数	单位
黄金TD-沪金主力	-0.97	0.14	-1.11	46.10%	/
白银TD-沪银主力	-4	-8	4	60.60%	
伦敦金-COMEX金	-24.08	-24.98	0.90	36.10%	
伦敦银-COMEX银	-0.20	-0.11	-0.09	37.60%	

比价

	现值	前值	涨跌	涨跌幅	单位
COMEX金/银	63.72	64.03	-0.31	-0.49%	/
上期所金/银	58.15	55.57	2.58	4.64%	
NYMEX铂/钯	1.44	1.43	0.01	0.44%	
广期所铂/钯	1.52	1.49	0.03	1.90%	

利率与汇率

	现值	前值	涨跌	涨跌幅	单位
10年期美债收益率	4.56	4.55	0.01	0.2%	%
2年期美债收益率	4.15	4.17	-0.02	-0.5%	%
10年期TIPS国债收益率	2.21	2.19	0.02	0.9%	%
美元指数	100.01	100.08	-0.06	-0.06%	/
离岸人民币汇率	6.7849	6.7913	-0.0064	-0.09%	/

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	958805	972611	-13806	-1.42%	
COMEX黄金库存	28214400	28228811	-14411	-0.05%	盎司
COMEX白银库存	318809623	319191978	-382355	-0.12%	
COMEX黄金注册仓单	15158516	15260735	-102219	-0.67%	
COMEX白银注册仓单	84923904	84808791	115113	0.14%	
SPRD黄金ETF持仓	1020	1020	0.00	0.00%	吨
SLV白银ETF持仓	15061	15019	42.21	0.28%	

贵金属观点

* 市场交易利空情况下贵金属进一步承压，随着黄金跌破200日均线或向4100美元附近低点下探，短期关注美国通胀数据及6月18日美联储决议将带来更明确的货币政策风向，黄金建议保持逢高做空的思路，或构建期权熊市价差策略；价格跌破70美元在市场惯性下可能进一步下探至去年12月以来的低位，阶段支撑在60美元附近，短期波动率上升可买入平值看跌期权；铂钯价格维持偏弱震荡建议逢高做空，关注广铂金PT2608合约和远月合约之间价差在8月仓单集中注销的预期下或出现反套机会。

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