

<http://www.shanjinqh.com>

制作：曹有明

交易咨询资格证号： Z0013162

邮箱：caoyouming@sd-gold.com

盘面套利观察

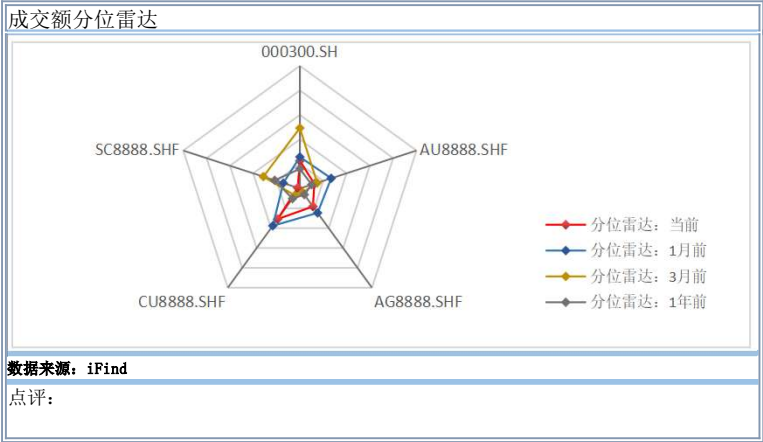
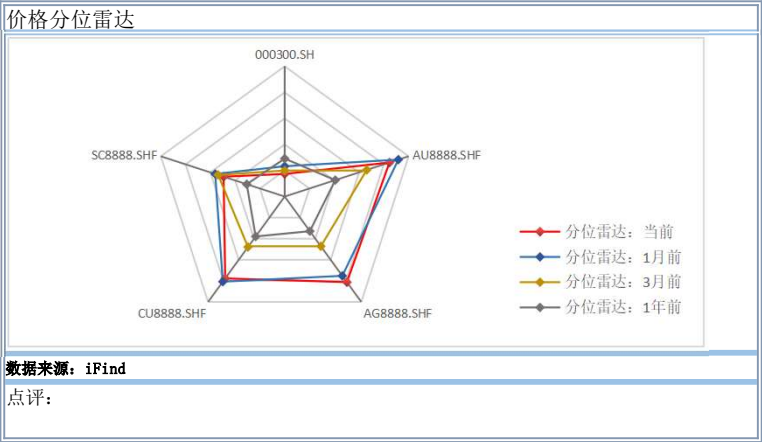
2024年6月11日

数据仅供参考，据此入市，风险自负。

说明：

- 1、本文件所列数据及图表以观察市场为主，指导交易仍需有逻辑支撑
- 2、跨品种比价、差价以品种指数为参考，并计算主力合约价差的偏离
- 3、数据最大跨度3年，不足3年的以实际数据期限为准
- 4、由于作者能力有限，表中数据难免出错，恳请沟通和指正，不胜感激。

一、宏观观察



数据起始日: 2019/6/12

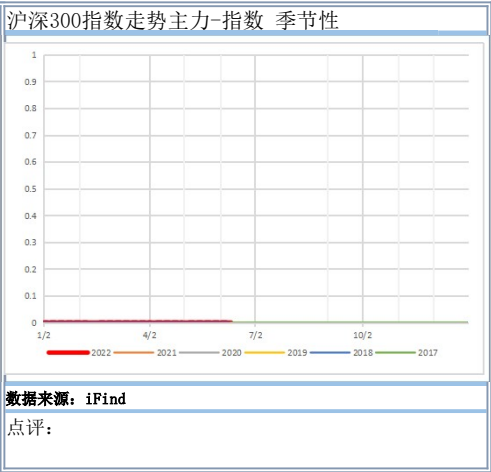
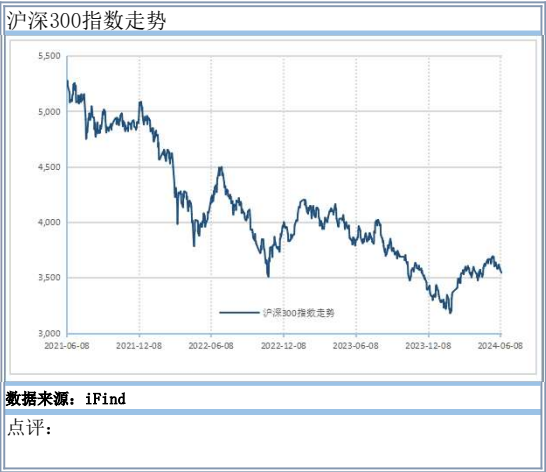
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: 3179.6276

期内最大值: 5271.4661

期内平均值: 4107.4646

当前分位值: 19.98%



数据起始日：2019/6/12

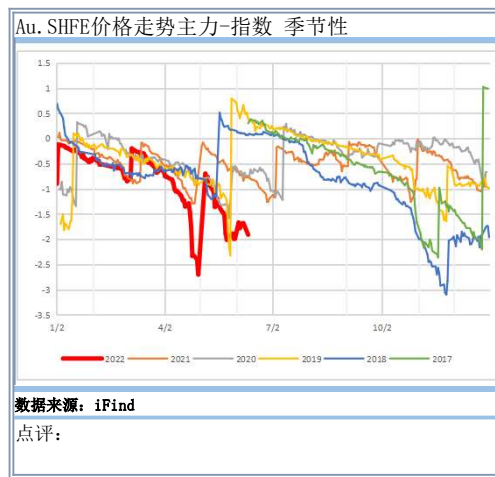
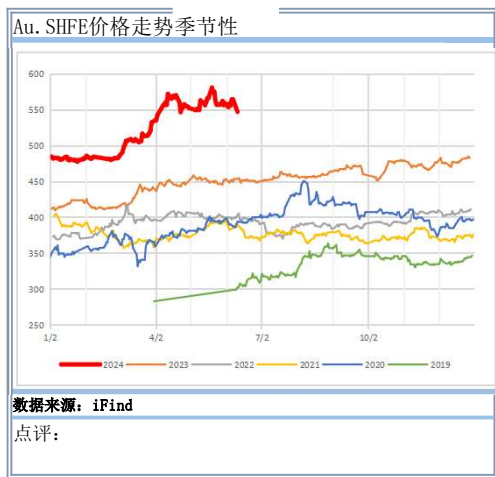
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：363.2

期内最大值：580.29

期内平均值：426.8582

当前分位值：84.52%



数据起始日：2019/6/12

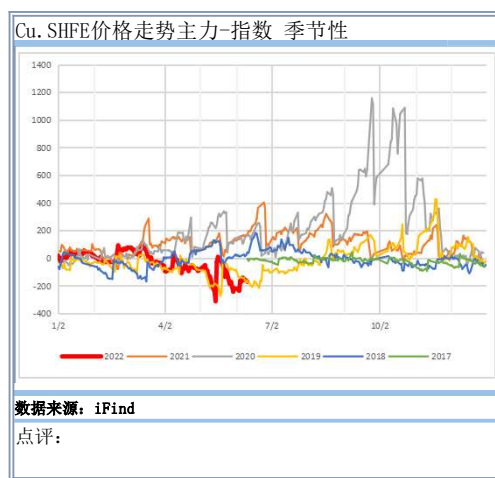
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：53367

期内最大值：87697

期内平均值：68796.5582

当前分位值：77.70%



数据起始日: 2019/6/12

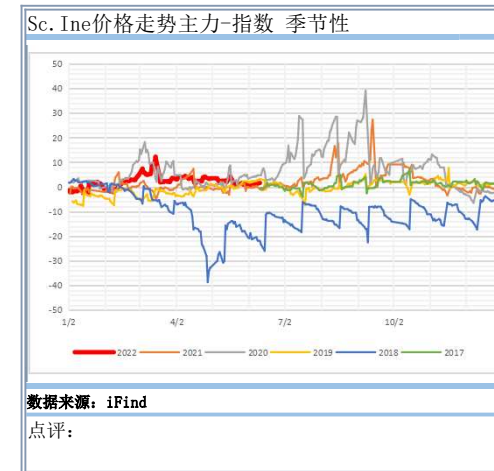
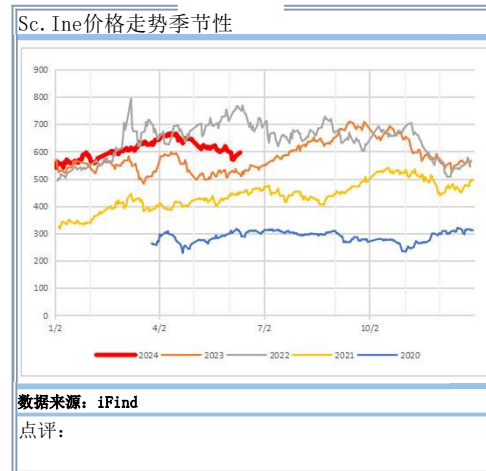
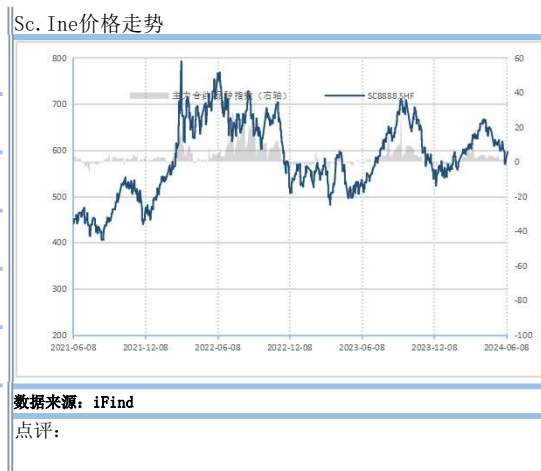
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: 405.7

期内最大值: 791.6

期内平均值: 582.8219

当前分位值: 49.31%



数据起始日: 2019/6/12

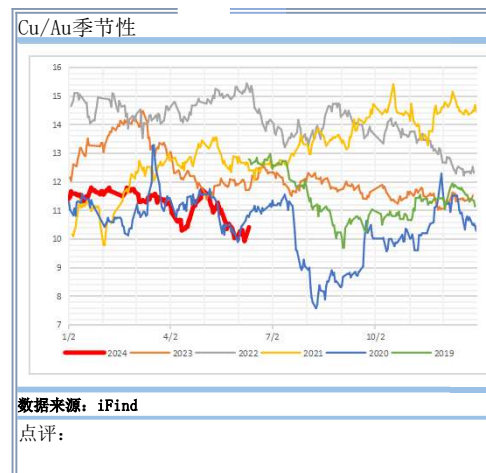
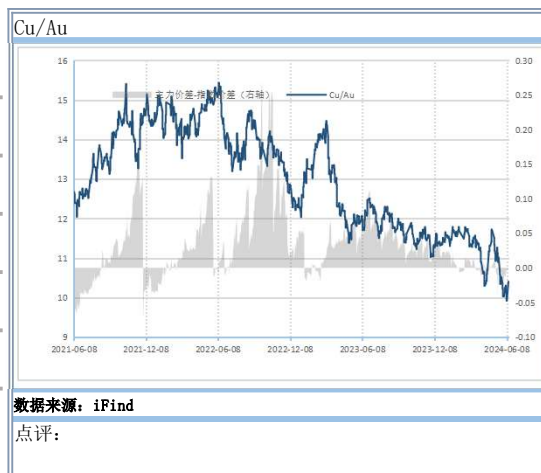
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: 9.9201

期内最大值: 15.4319

期内平均值: 12.9706

当前分位值: 8.74%



数据起始日：2019/6/12

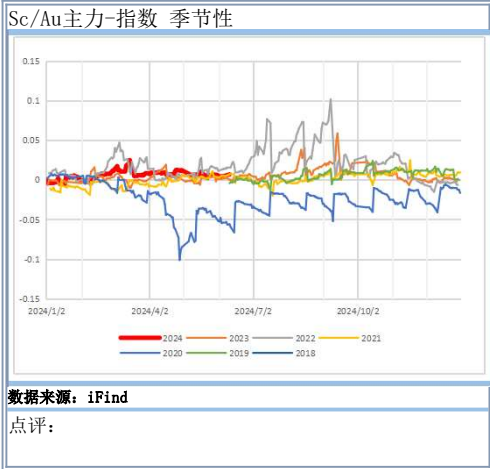
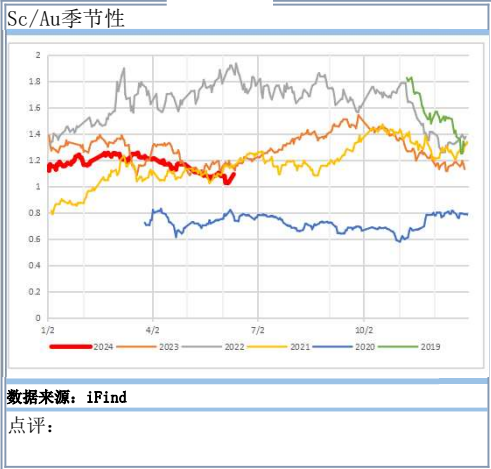
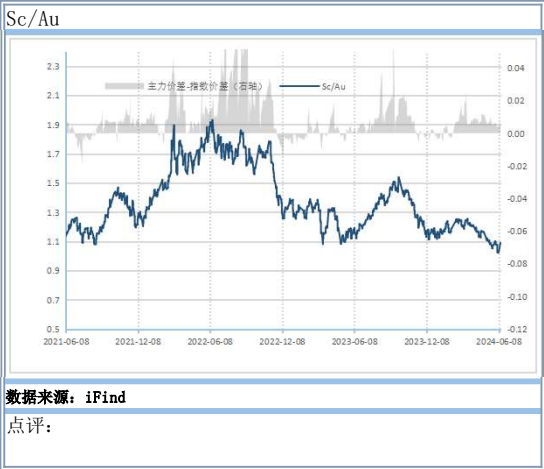
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：1.0225

期内最大值：1.9320

期内平均值：1.3782

当前分位值：7.45%



数据起始日：2019/6/12

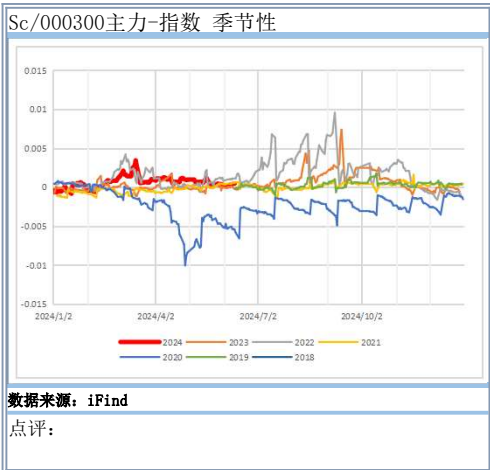
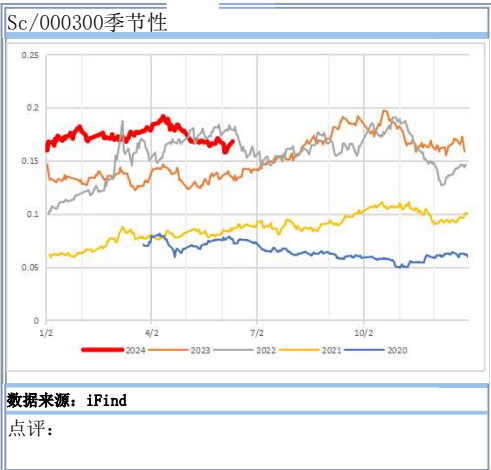
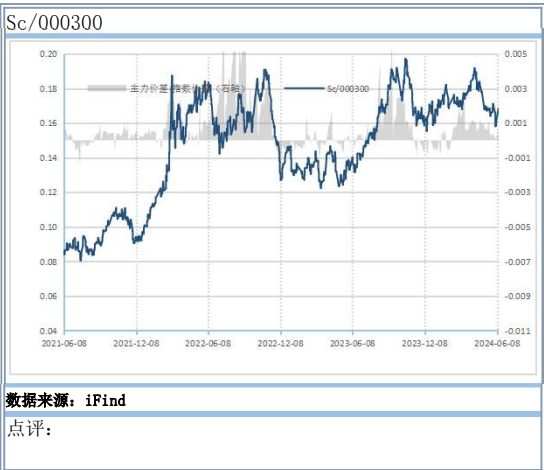
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：0.0805

期内最大值：0.1972

期内平均值：0.1453

当前分位值：75.20%



数据起始日：2019/6/12

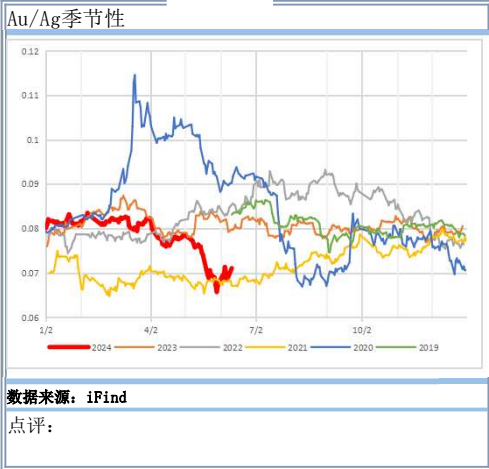
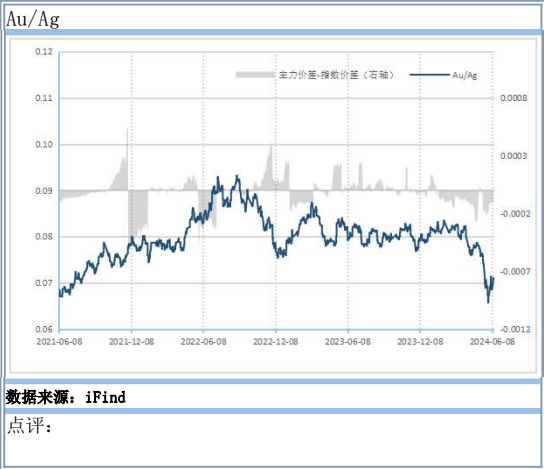
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：0.0657

期内最大值：0.0932

期内平均值：0.0798

当前分位值：19.39%



数据起始日：2019/6/12

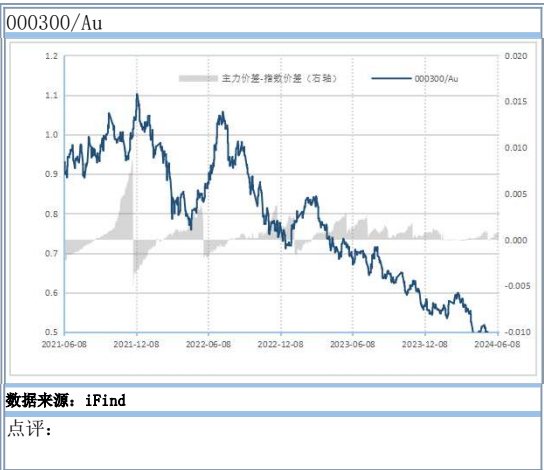
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：0.4229

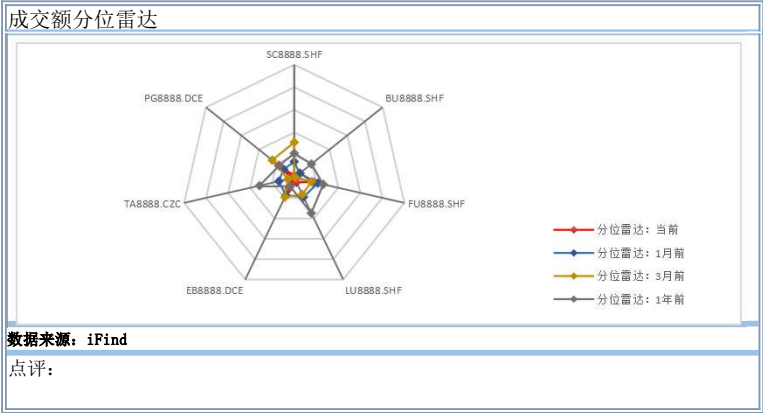
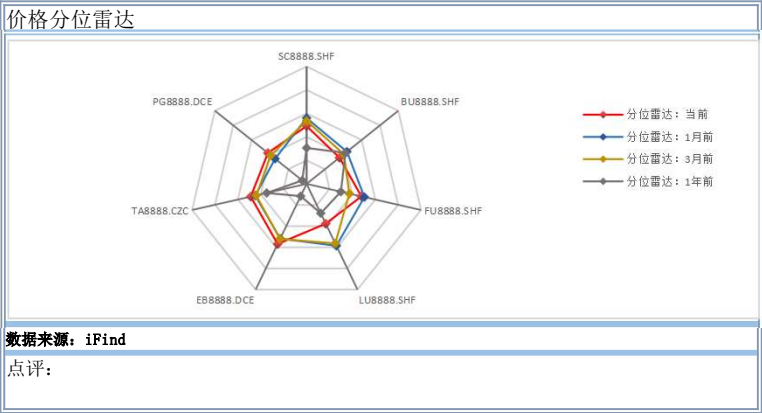
期内最大值：1.1021

期内平均值：0.7849

当前分位值：5.53%



二、原油相关



数据起始日: 2019/6/12

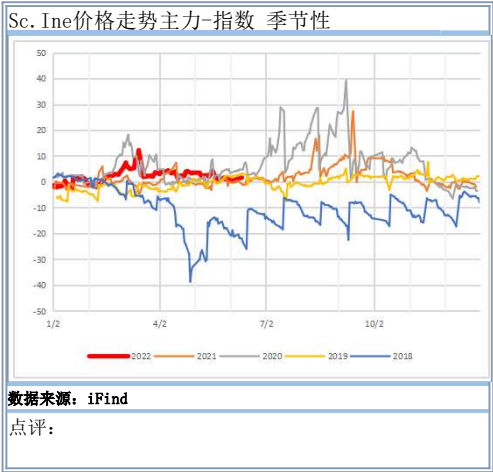
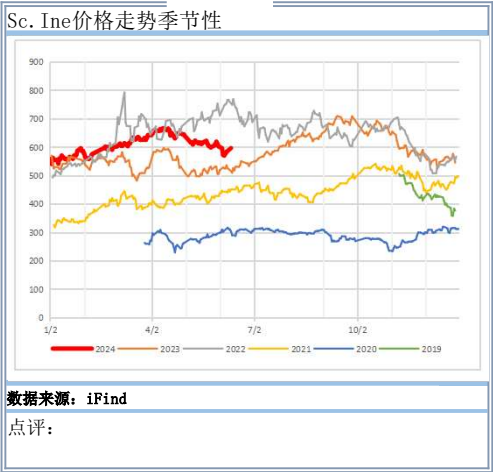
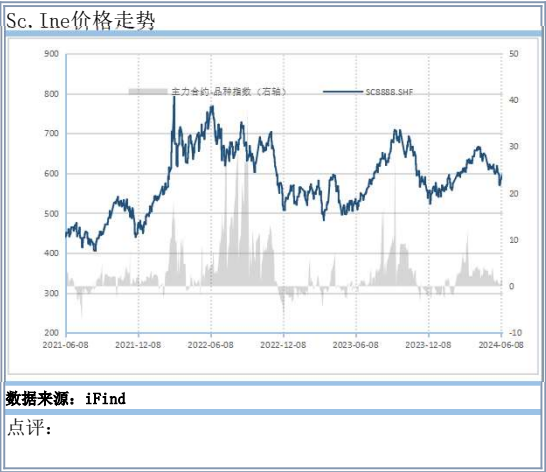
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: 405.7

期内最大值: 791.6

期内平均值: 582.8219

当前分位值: 49.31%



数据起始日：2019/6/12

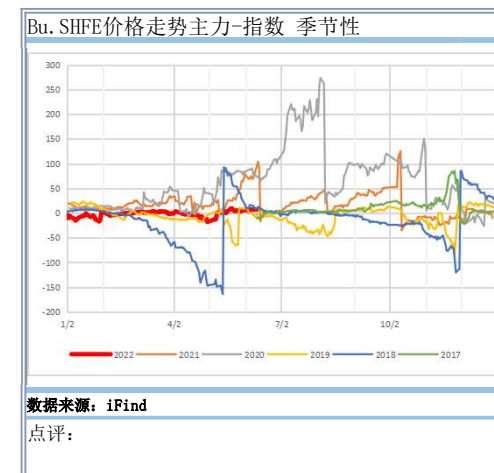
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：2821

期内最大值：4794

期内平均值：3657.7599

当前分位值：35.83%



数据起始日：2019/6/12

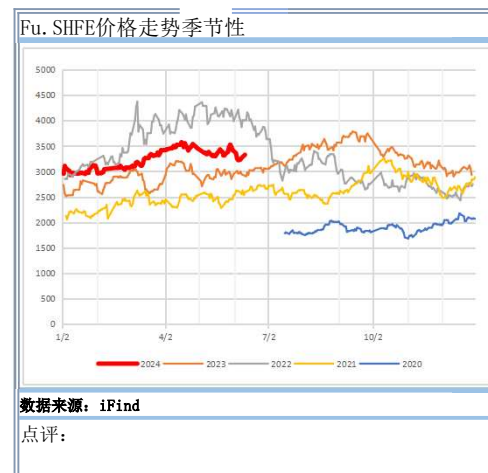
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：2366

期内最大值：4371

期内平均值：3110.3716

当前分位值：47.93%



数据起始日：2020/6/22

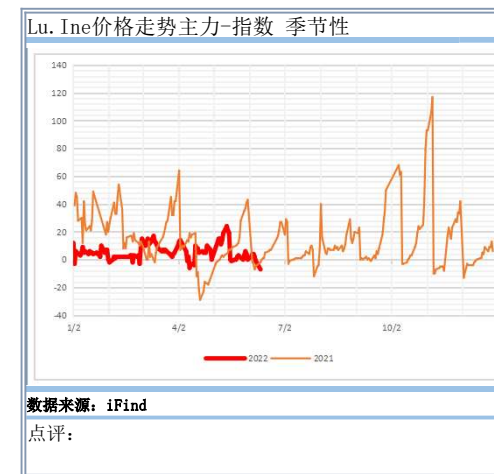
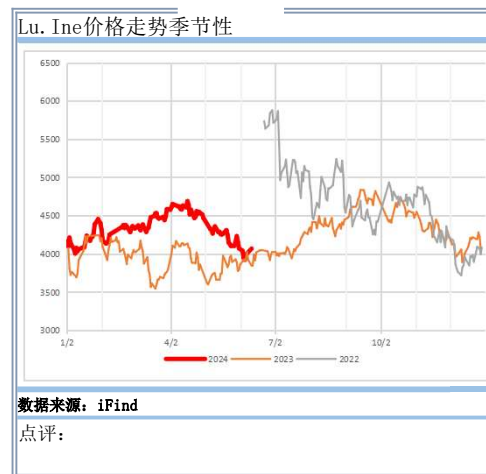
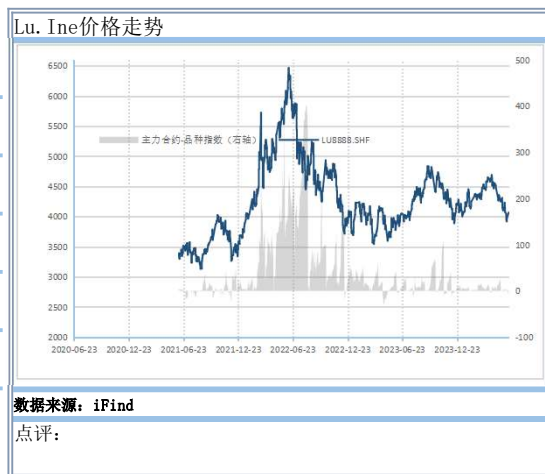
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：3544

期内最大值：4933

期内平均值：4234.6518

当前分位值：37.65%



数据起始日：2019/9/26

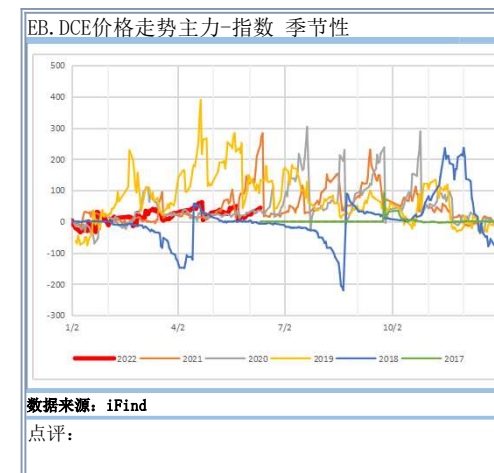
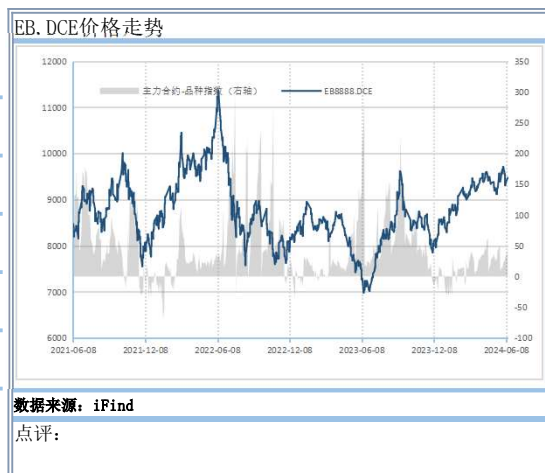
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：6978

期内最大值：11361

期内平均值：8713.3161

当前分位值：56.88%



数据起始日：2019/6/12

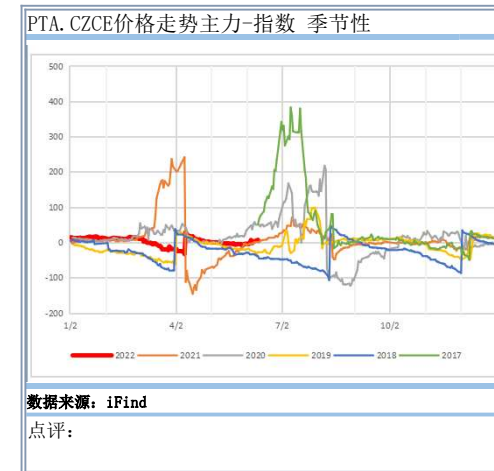
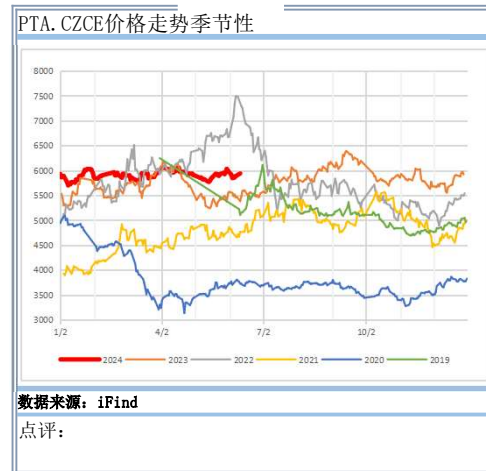
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：4462

期内最大值：7488

期内平均值：5646.3594

当前分位值：48.81%



数据起始日：2020/3/30

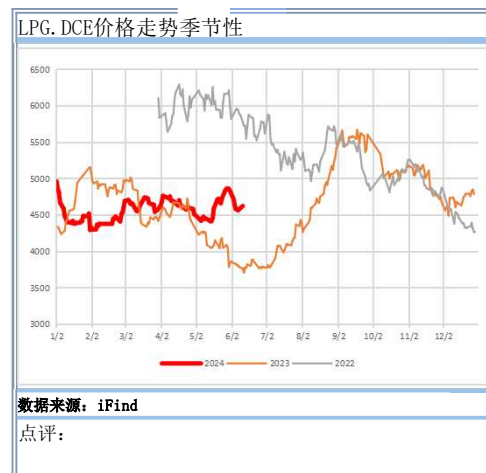
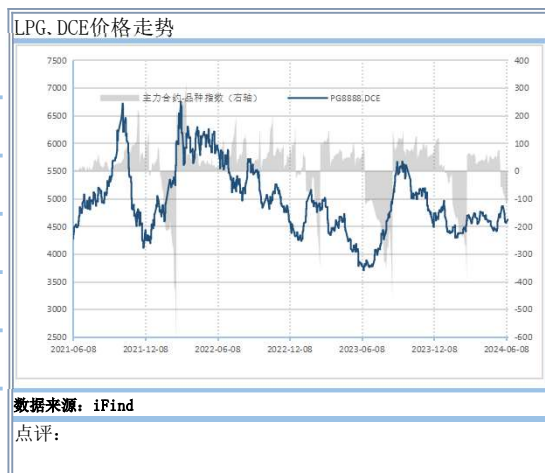
数据截止日：2024/6/11

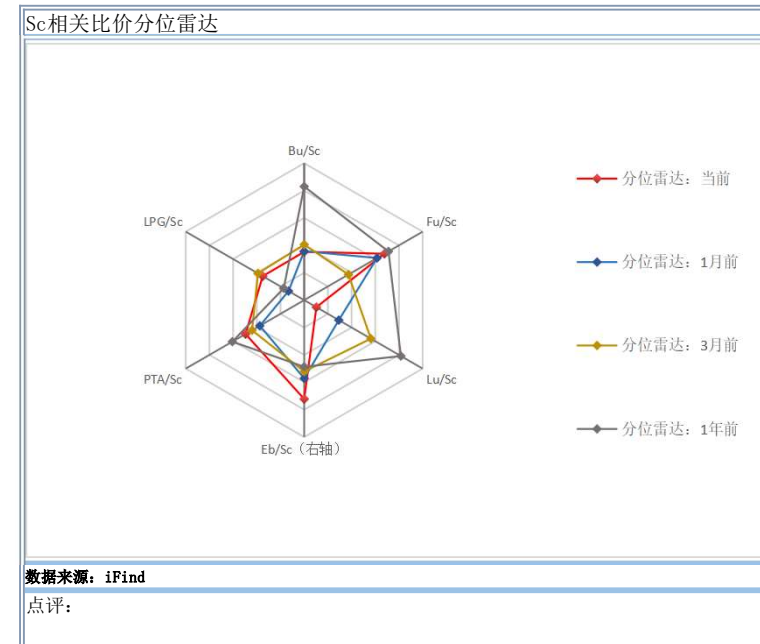
期内最小值：3704

期内最大值：5876

期内平均值：4764.3610

当前分位值：42.17%





数据起始日: 2019/6/12

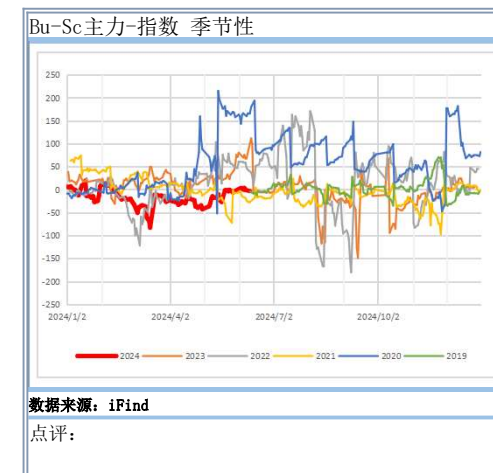
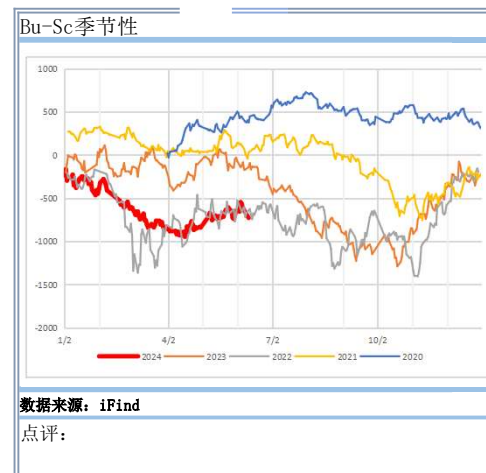
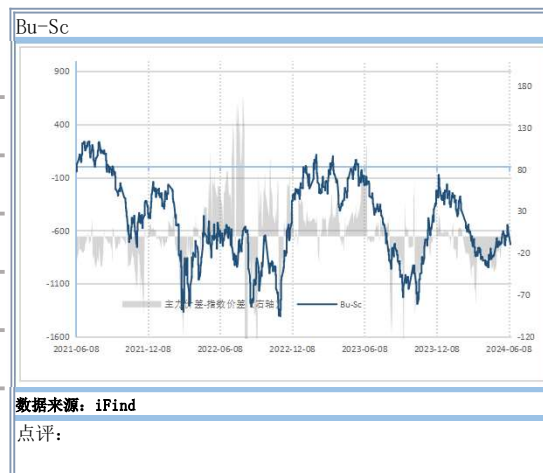
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: -1406.4286

期内最大值: 239.8571

期内平均值: -505.2540

当前分位值: 41.14%



数据起始日: 2019/6/12

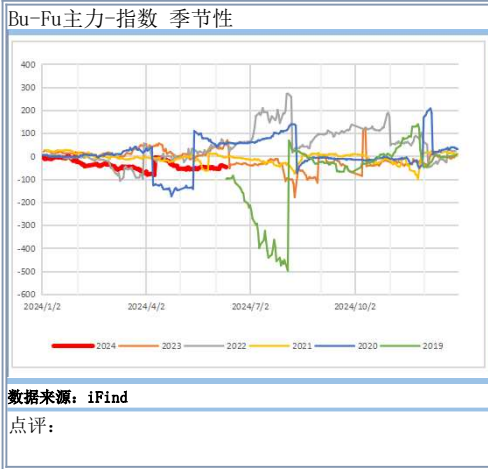
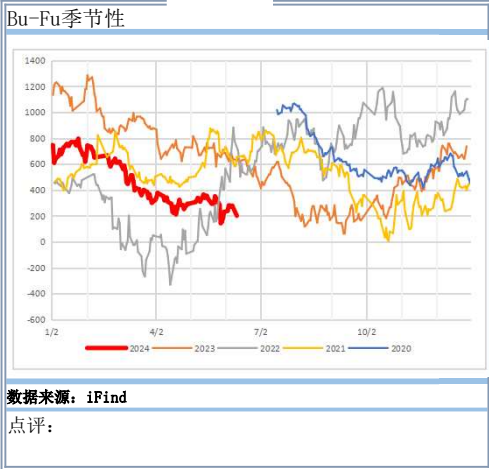
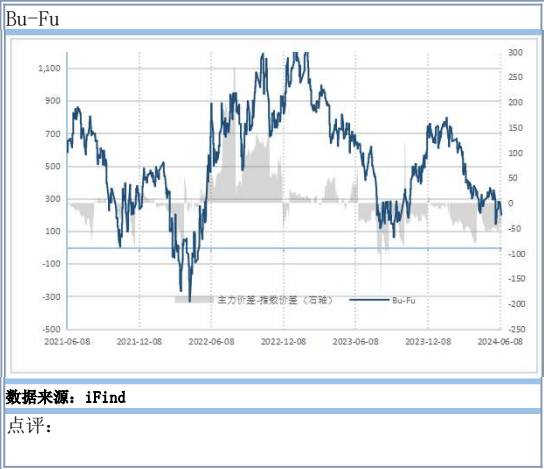
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: -331.0000

期内最大值: 1284.0000

期内平均值: 547.3883

当前分位值: 32.94%



数据起始日: 2021/10/6

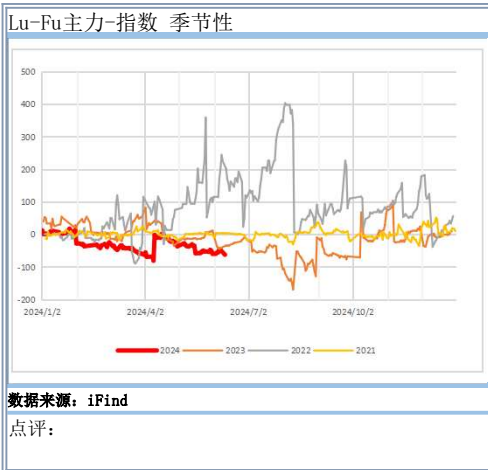
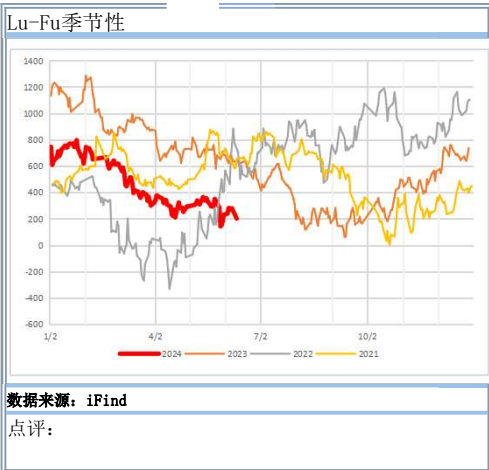
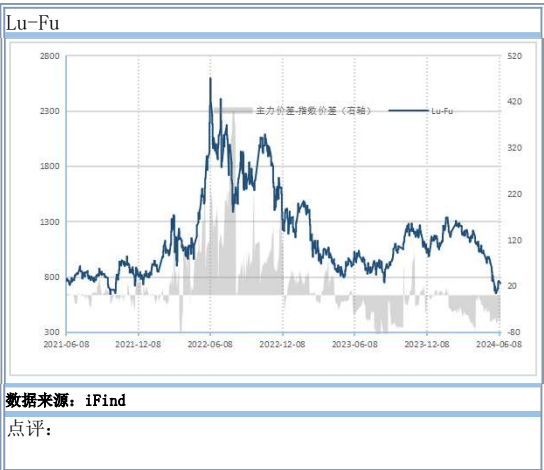
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: 650.0000

期内最大值: 2085.0000

期内平均值: 1169.3294

当前分位值: 6.27%



数据起始日：2021/8/11

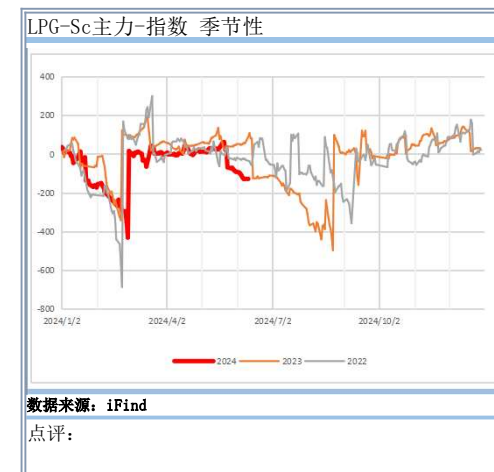
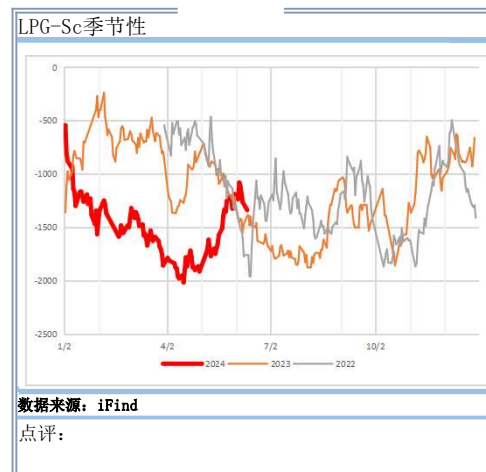
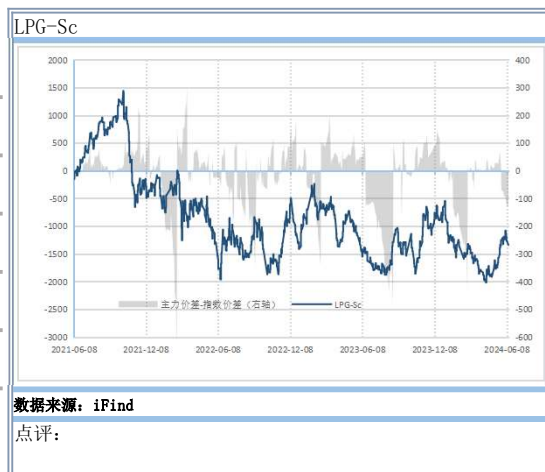
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：-2017.0000

期内最大值：-240.0000

期内平均值：-1262.2552

当前分位值：38.10%



数据起始日：2019/6/12

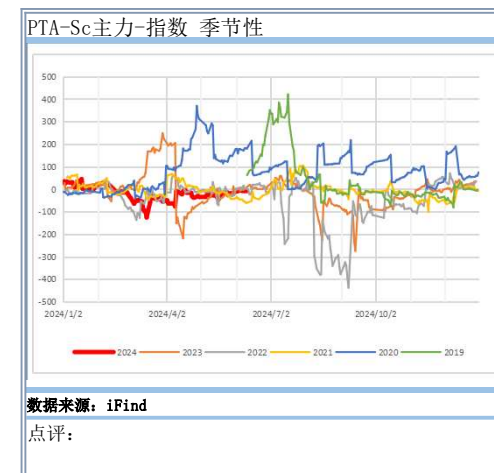
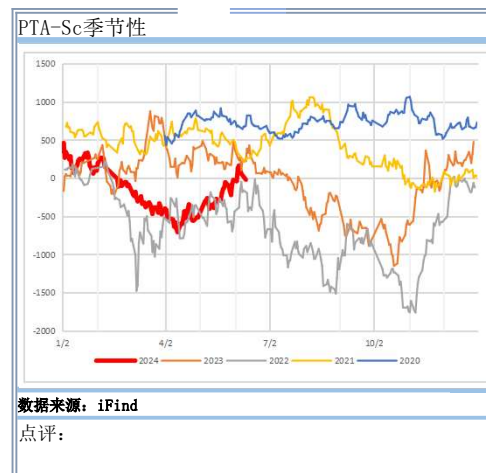
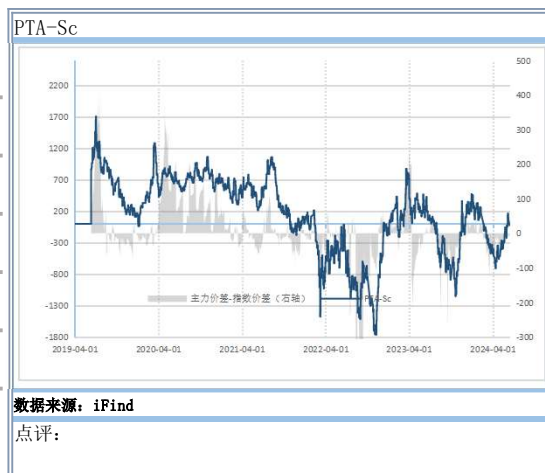
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：-1762.0000

期内最大值：1061.0000

期内平均值：-181.8601

当前分位值：61.67%



数据起始日: 2021/4/13

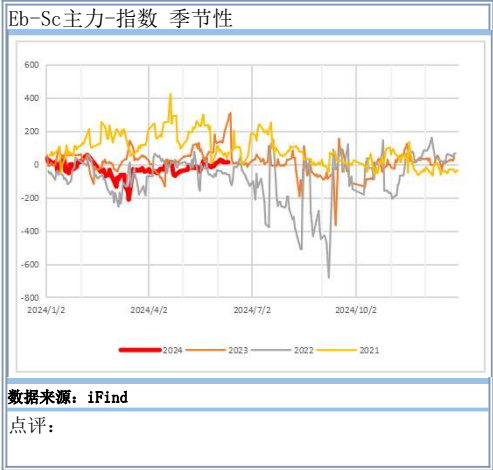
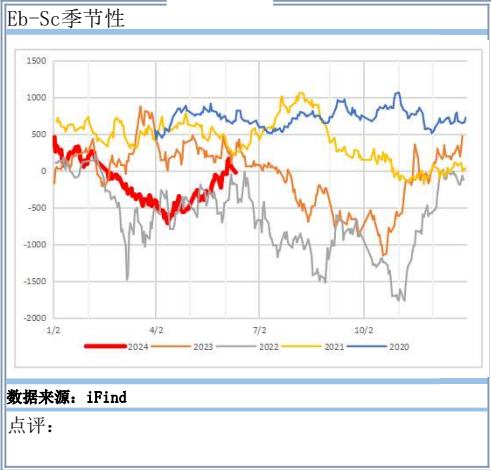
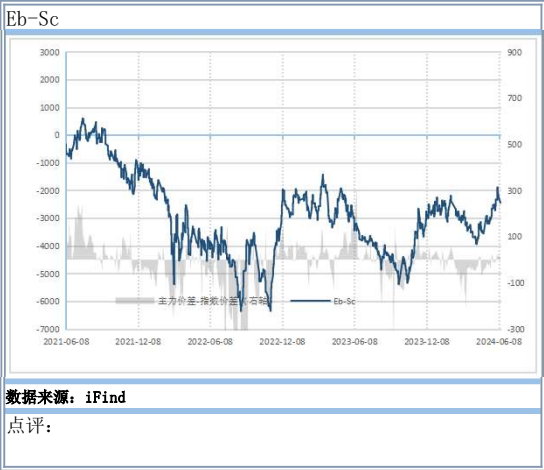
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: -6347.0000

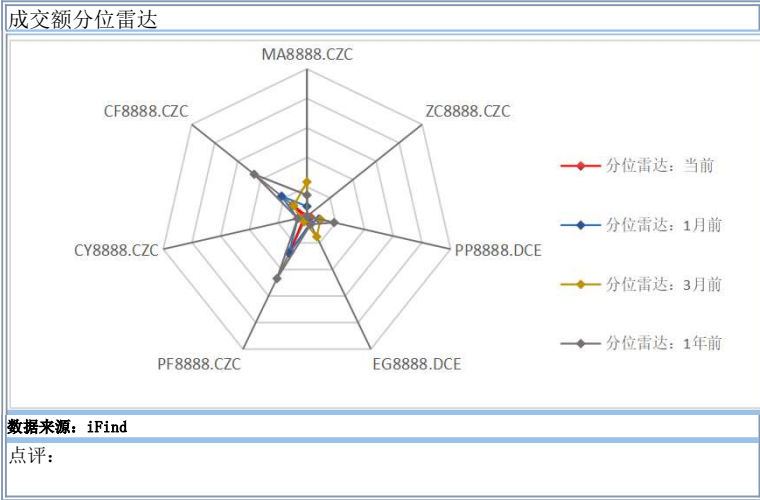
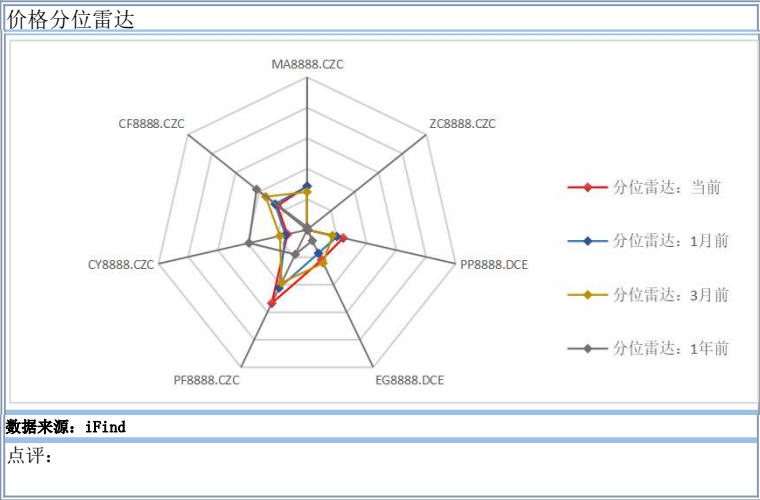
期内最大值: -1019.0000

期内平均值: -3427.9351

当前分位值: 73.16%



三、煤化工相关



数据起始日: 2019/6/12

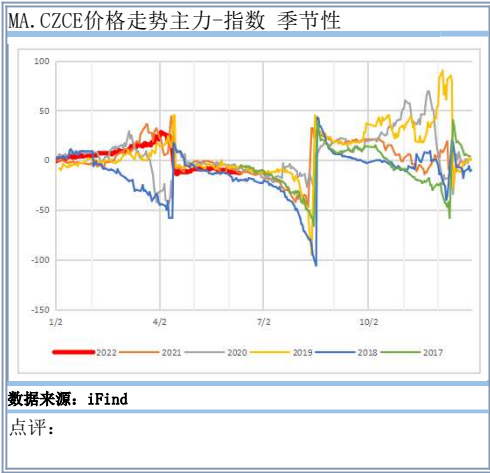
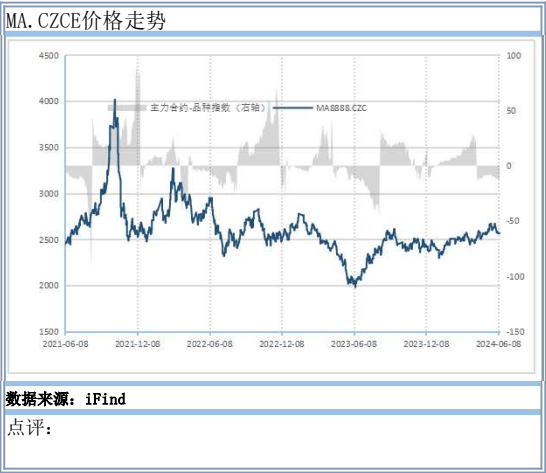
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: 1982

期内最大值: 4015

期内平均值: 2593.8272

当前分位值: 28.58%



数据起始日：2019/6/12

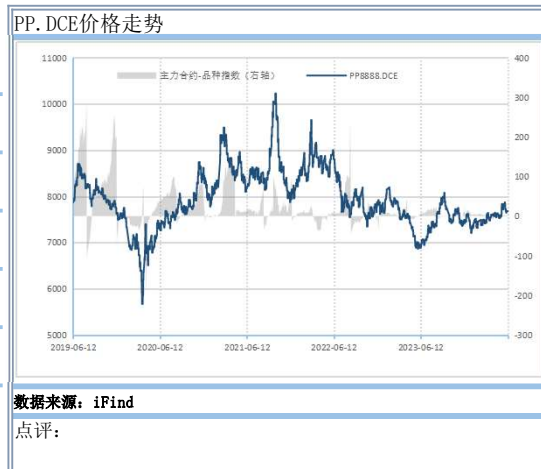
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：6865

期内最大值：10224

期内平均值：7953.0590

当前分位值：24.26%



数据起始日：2019/6/12

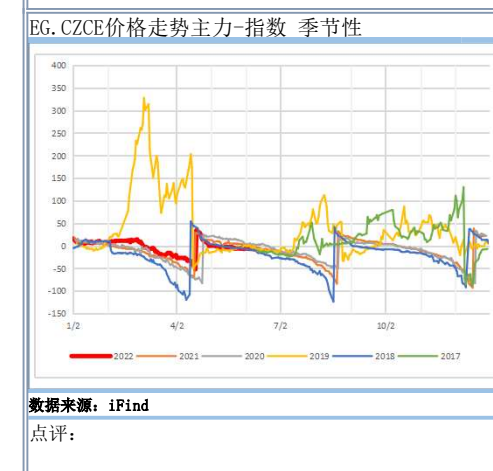
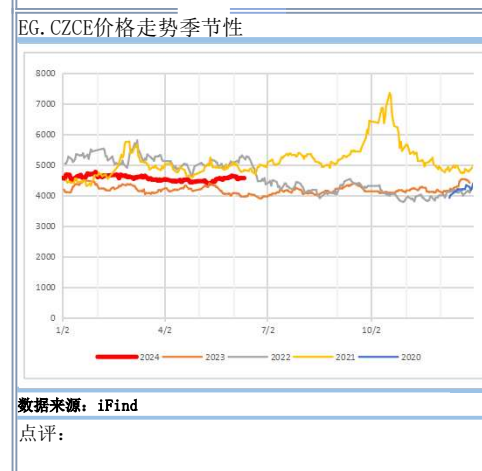
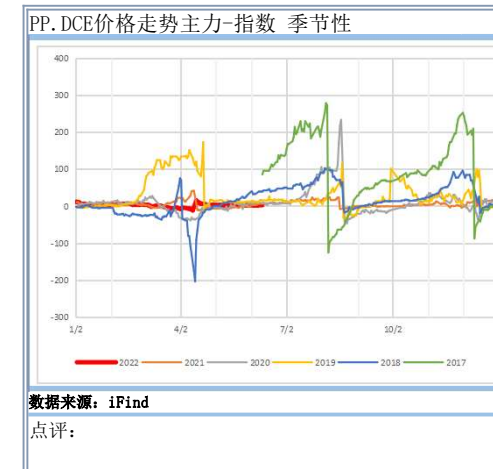
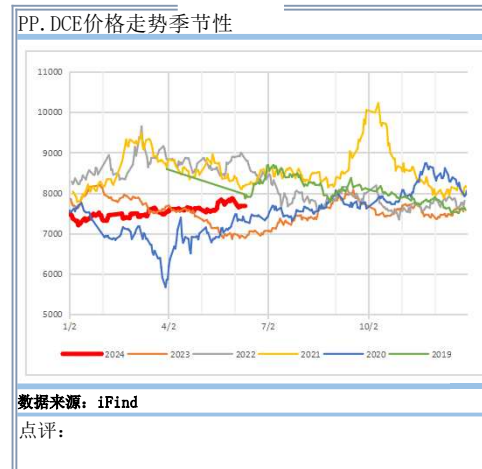
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：3778

期内最大值：7345

期内平均值：4587.3621

当前分位值：21.95%



数据起始日: 2020/10/12

数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: 6904

期内最大值: 7907

期内平均值: 7332.9887

当前分位值: 53.44%

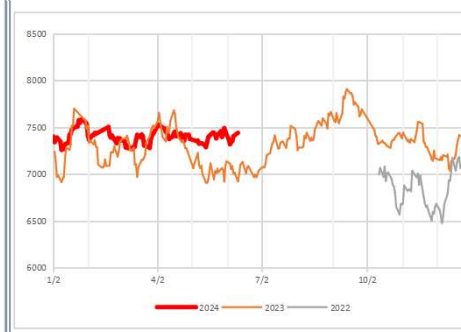
PF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

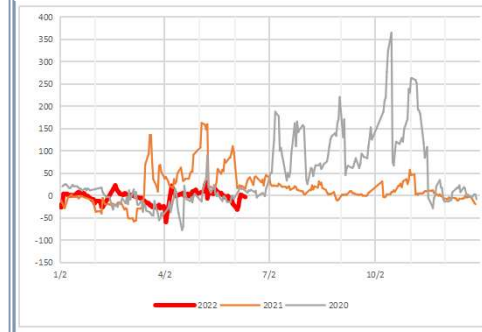
PF. CZCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

PF. CZCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/6/12

数据截止日: 2024/6/11

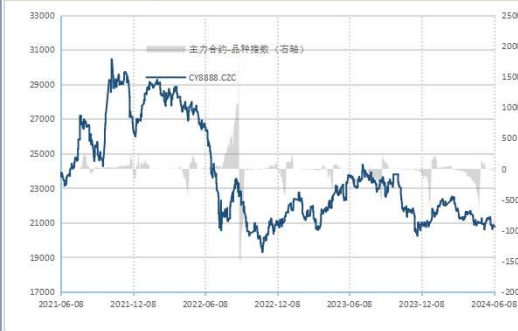
期内最小值: 19292

期内最大值: 30443

期内平均值: 23699.4609

当前分位值: 13.21%

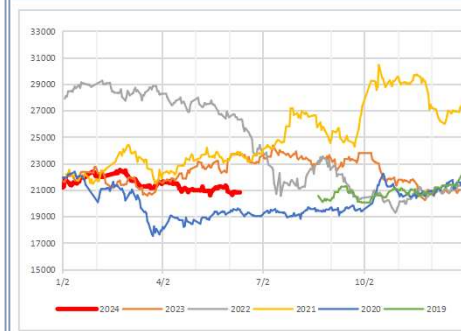
CY. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

CY. CZCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

CY. CZCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/6/12

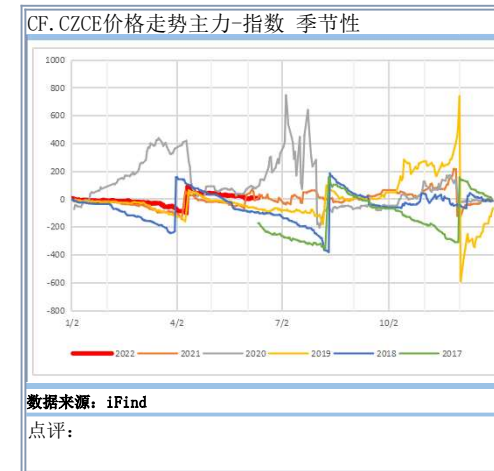
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: 12447

期内最大值: 22574

期内平均值: 16893.8326

当前分位值: 25.05%



数据起始日: 2019/6/12

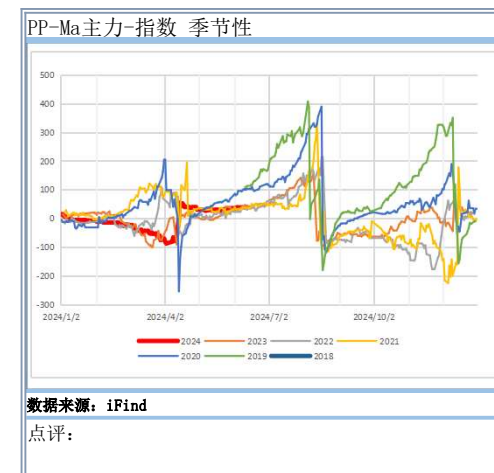
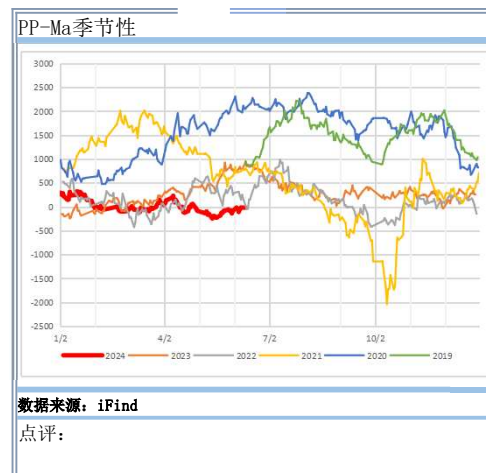
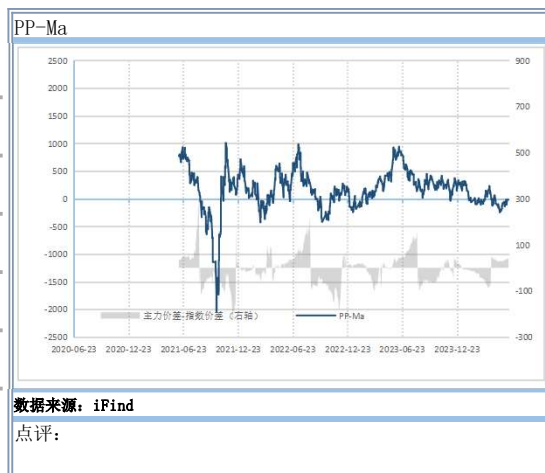
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: -2039.0000

期内最大值: 1007.0000

期内平均值: 171.5775

当前分位值: 66.64%



数据起始日: 2019/6/12

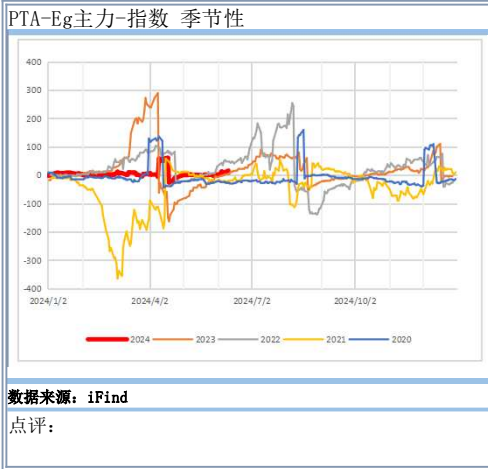
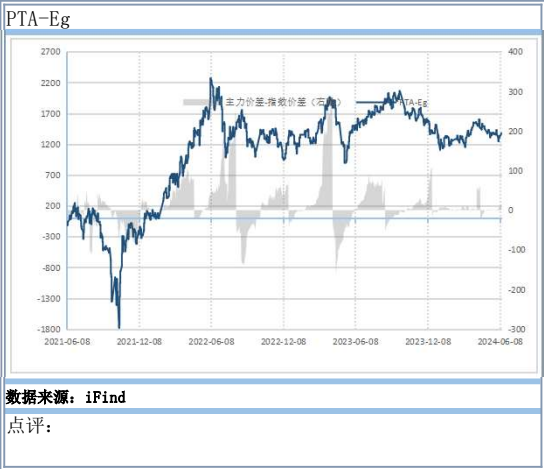
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: -1783.0000

期内最大值: 2269.0000

期内平均值: 1058.9973

当前分位值: 78.01%



数据起始日: 2021/12/17

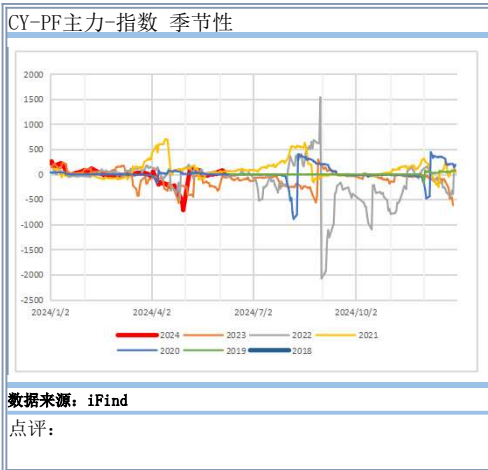
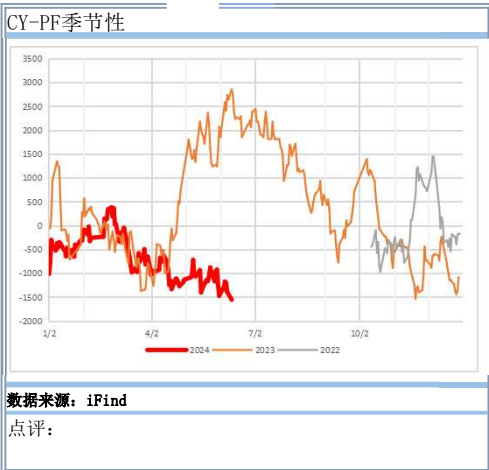
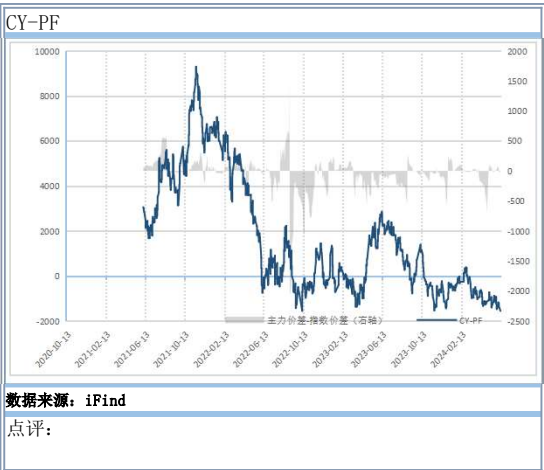
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: -1555.0000

期内最大值: 2854.0000

期内平均值: 60.7337

当前分位值: 0.00%



数据起始日: 2022/12/22

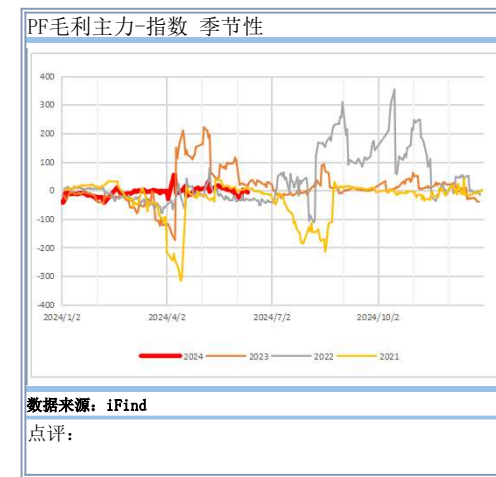
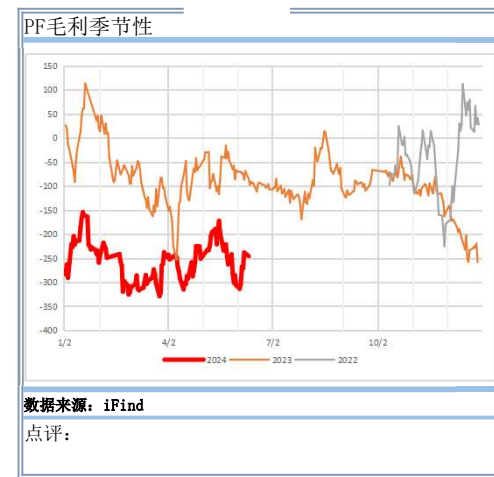
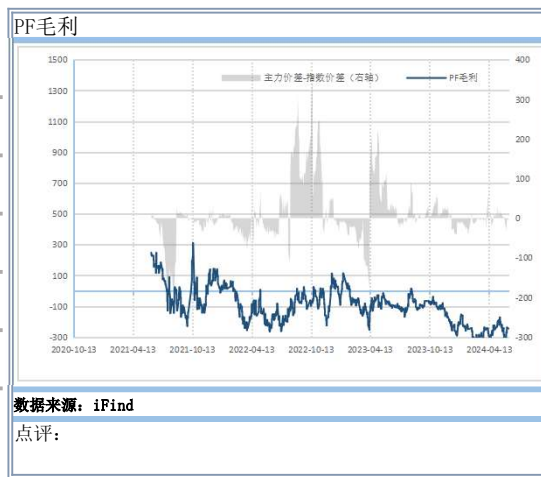
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: -328.9900

期内最大值: 112.9900

期内平均值: -138.2096

当前分位值: 18.83%



数据起始日: 2019/6/12

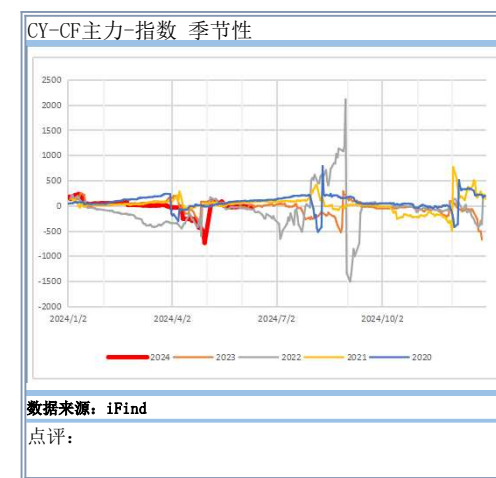
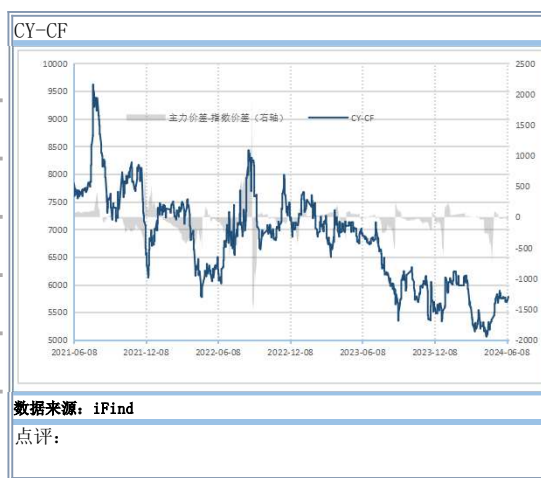
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: 5061.0000

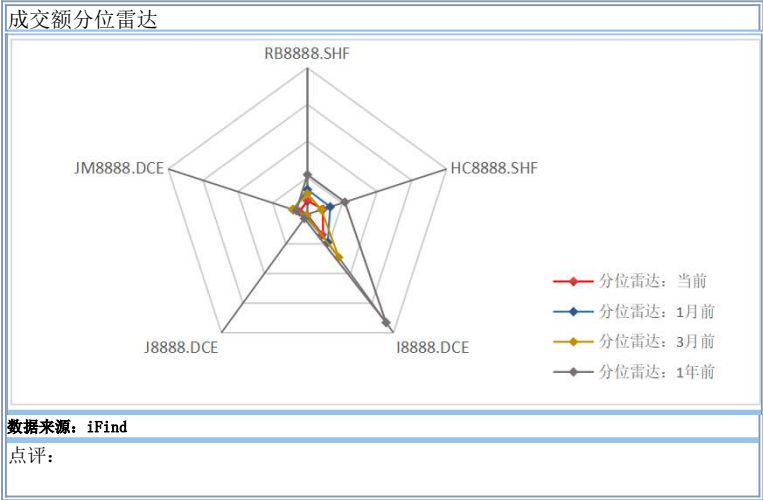
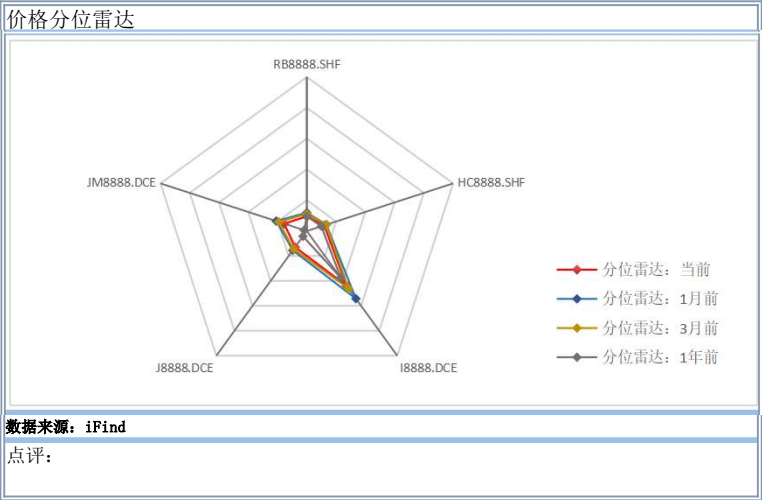
期内最大值: 9616.0000

期内平均值: 6805.6283

当前分位值: 15.81%



四、黑色相关



数据起始日: 2019/6/12

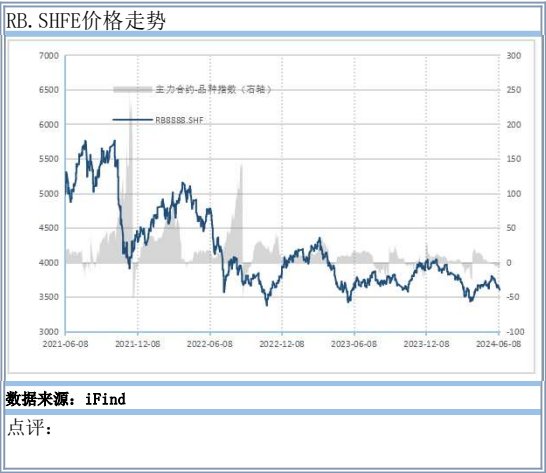
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: 3377

期内最大值: 5762

期内平均值: 4186.1289

当前分位值: 9.48%



数据起始日：2019/6/12

数据截止日：2024/6/11

期内最小值：3444

期内最大值：6152

期内平均值：4325.5117

当前分位值：11.93%



数据起始日：2019/6/12

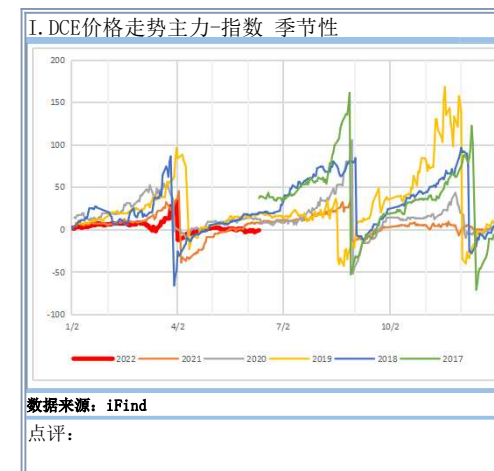
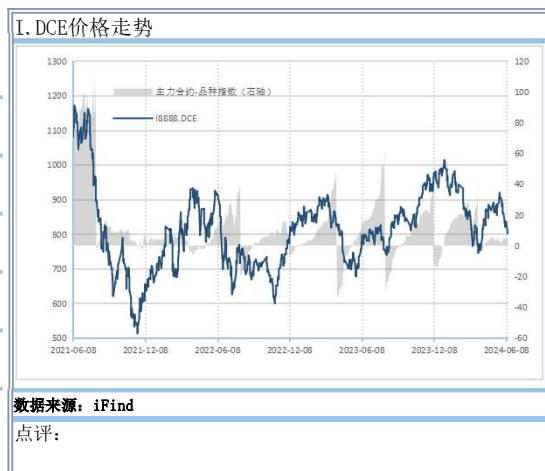
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：512.8

期内最大值：1171.2

期内平均值：811.3119

当前分位值：43.82%



数据起始日：2019/6/12

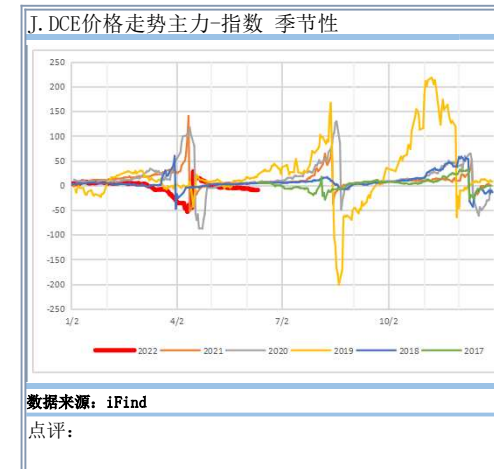
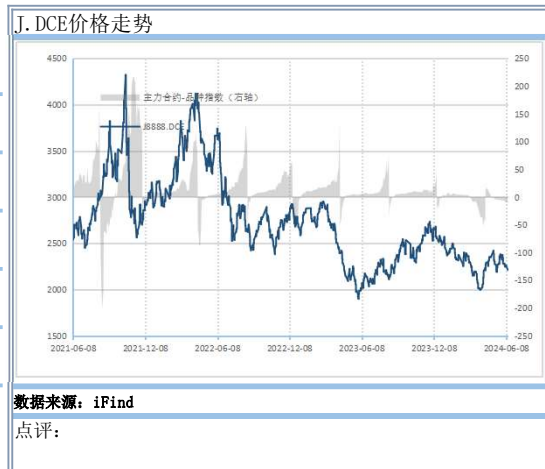
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：1897.9

期内最大值：4320.8

期内平均值：2731.1060

当前分位值：12.92%



数据起始日：2019/6/12

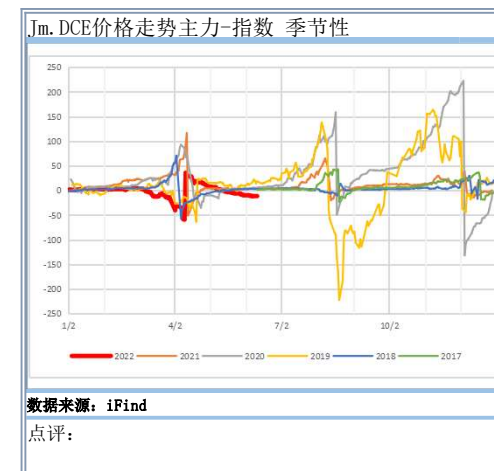
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：1219.4

期内最大值：3764.7

期内平均值：2023.2697

当前分位值：15.50%



数据起始日：2019/6/12

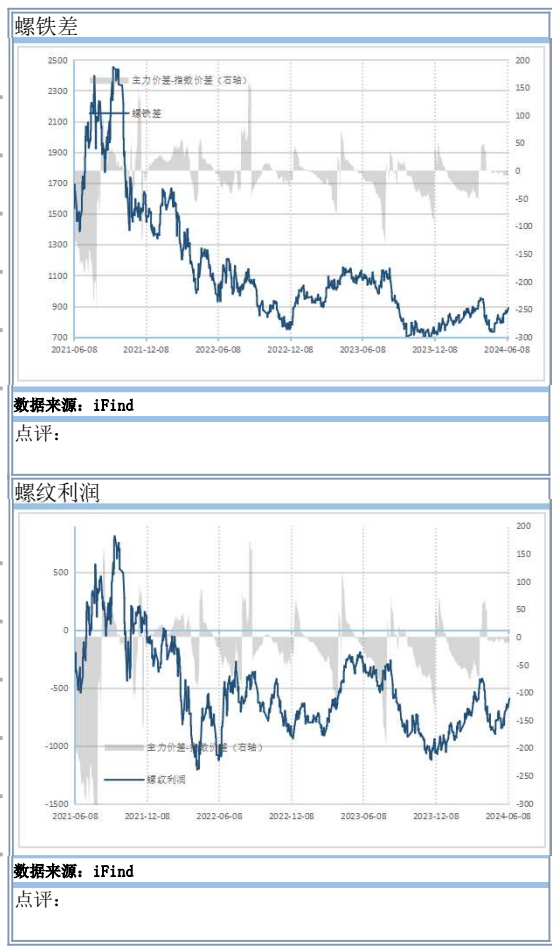
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：670.1176

期内最大值：2451.8235

期内平均值：1147.8690

当前分位值：12.25%



数据起始日: 2019/6/12

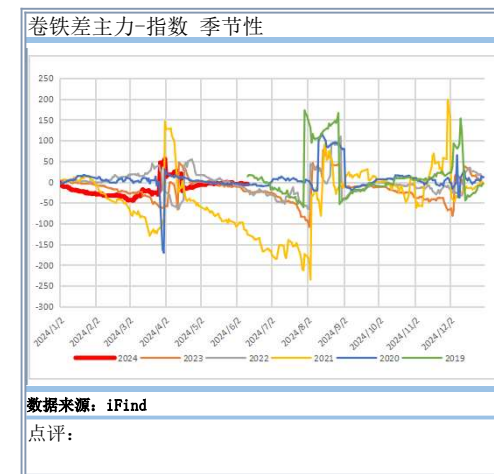
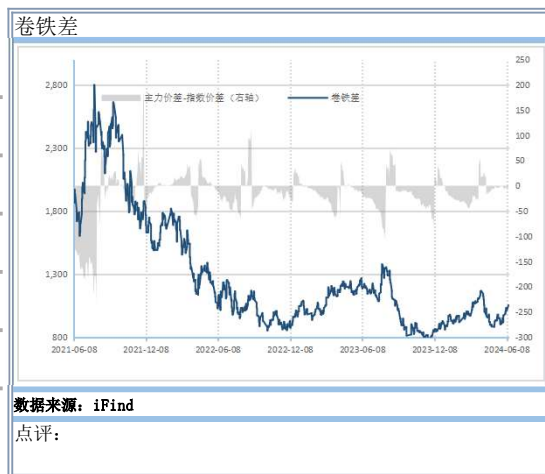
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: 752.4706

期内最大值: 2799.4118

期内平均值: 1287.2518

当前分位值: 14.65%



数据起始日: 2019/6/12

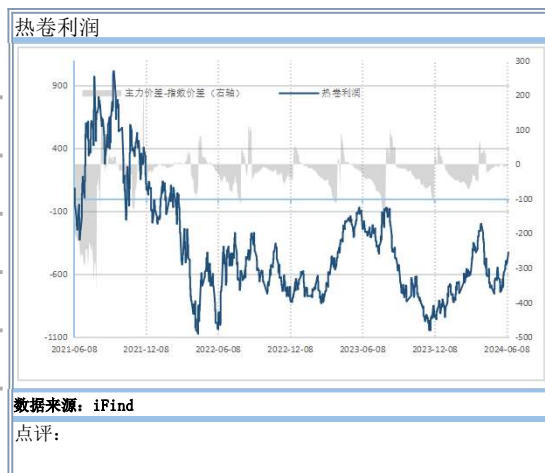
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: -1073.7273

期内最大值: 1014.0000

期内平均值: -369.9809

当前分位值: 30.91%



数据起始日：2019/6/12

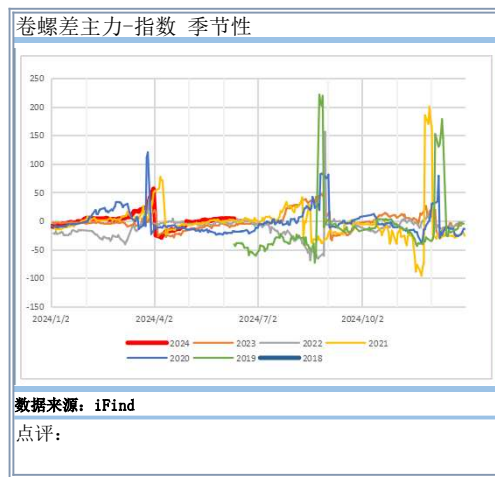
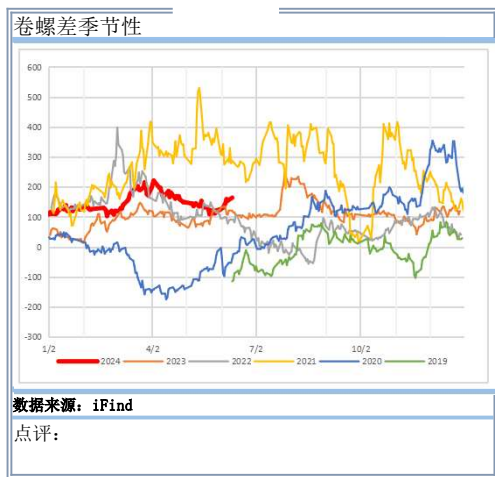
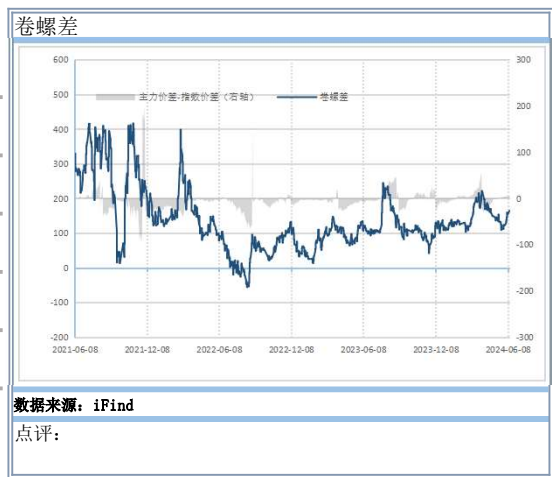
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：-56.0000

期内最大值：416.0000

期内平均值：139.3827

当前分位值：46.61%



数据起始日：2019/6/12

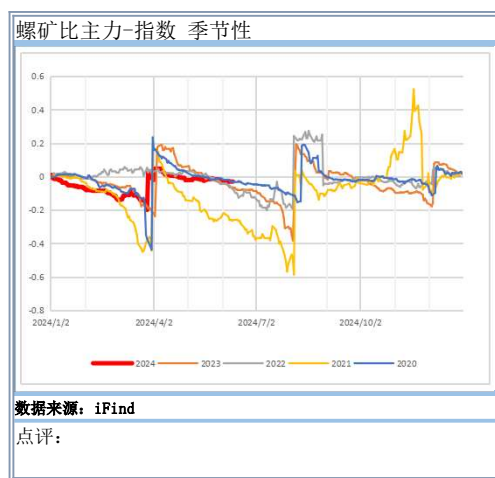
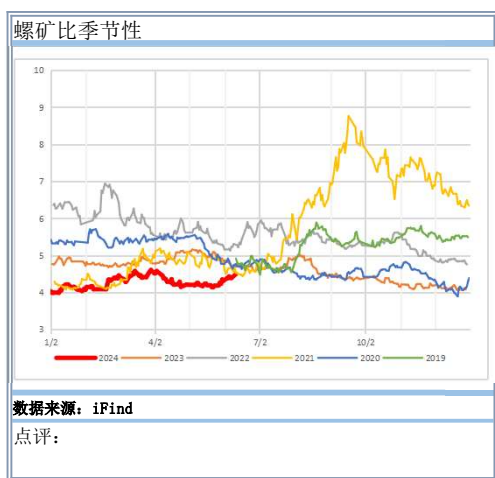
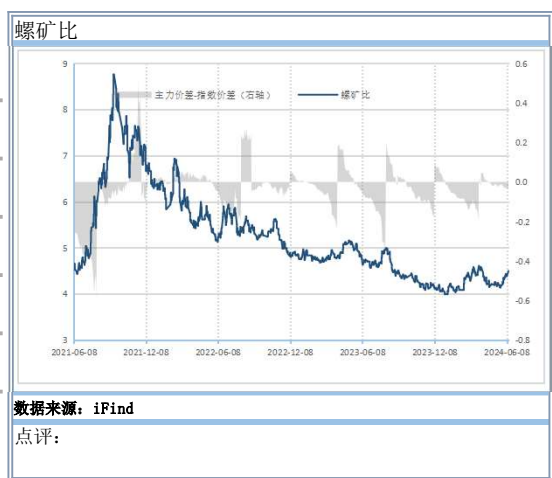
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：3.9880

期内最大值：8.7631

期内平均值：5.2469

当前分位值：10.65%



数据起始日: 2019/6/12

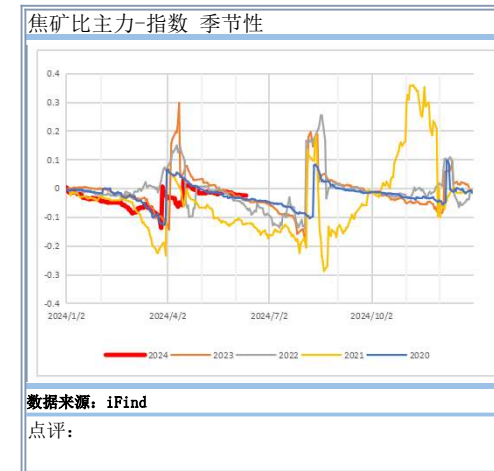
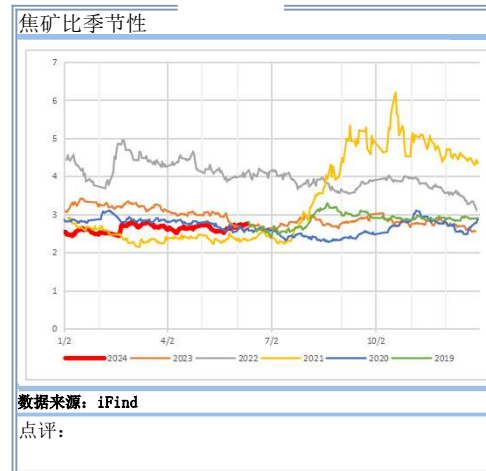
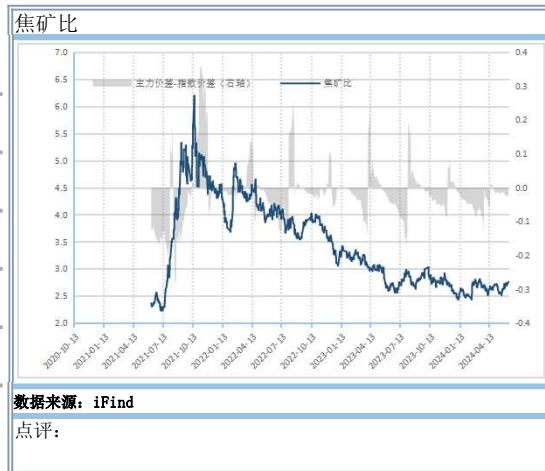
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: 2.2287

期内最大值: 6.1947

期内平均值: 3.4416

当前分位值: 13.38%



数据起始日: 2019/6/12

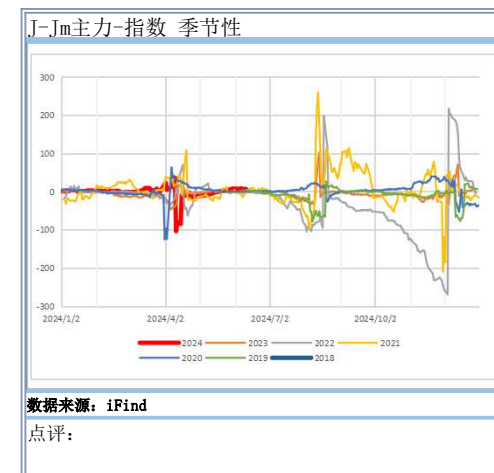
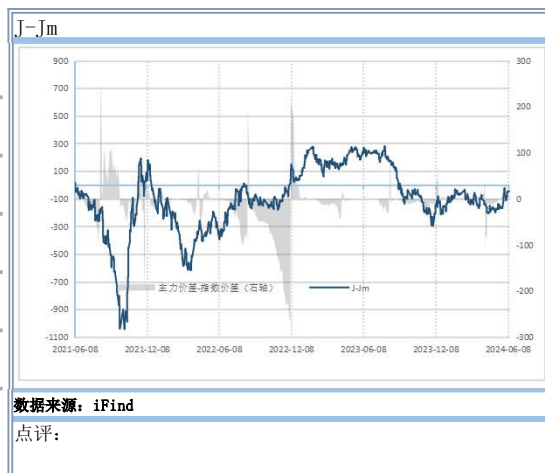
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: -1043.0800

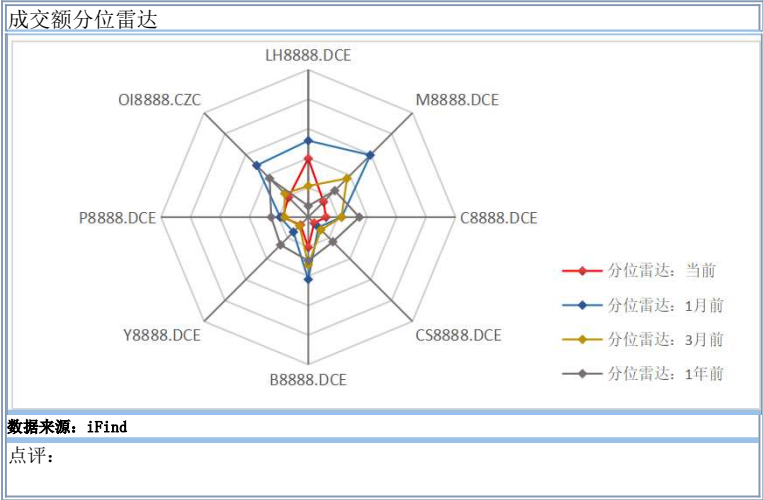
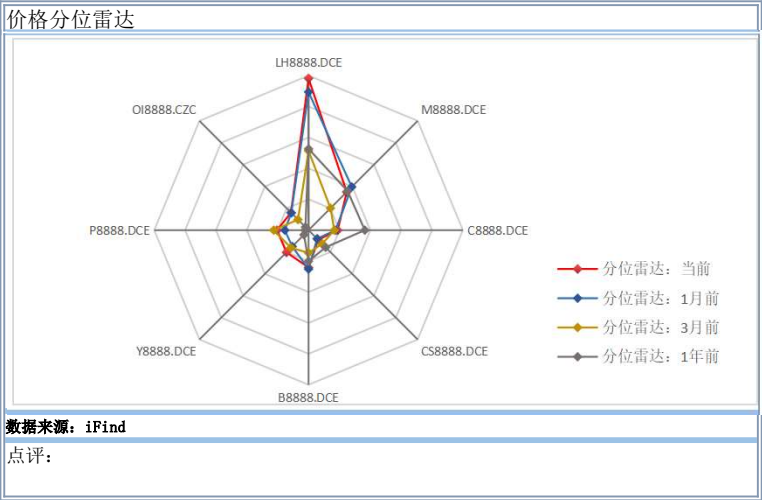
期内最大值: 279.1600

期内平均值: -101.4715

当前分位值: 75.21%



五、农产品相关



数据起始日: 2021/1/8

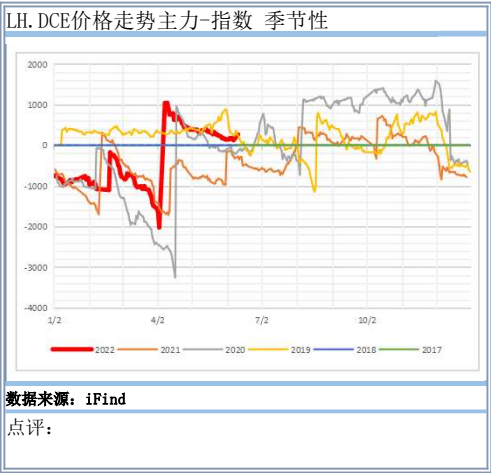
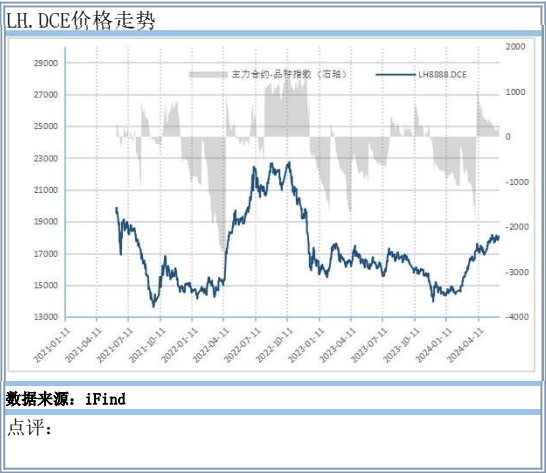
数据截止日: 2024/6/11

期内最小值: 13971

期内最大值: 18158

期内平均值: 16186.6517

当前分位值: 98.18%



数据起始日：2019/6/12

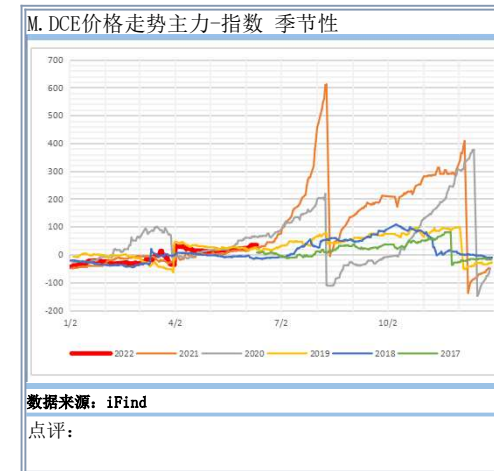
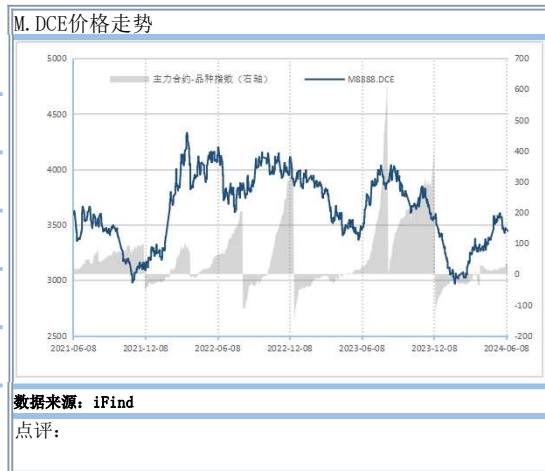
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：2970

期内最大值：4328

期内平均值：3644.4184

当前分位值：34.98%



数据起始日：2019/6/12

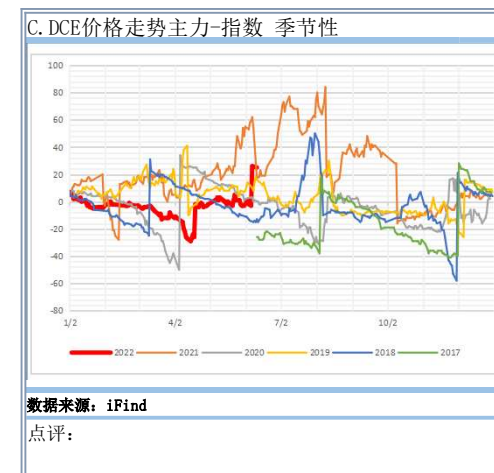
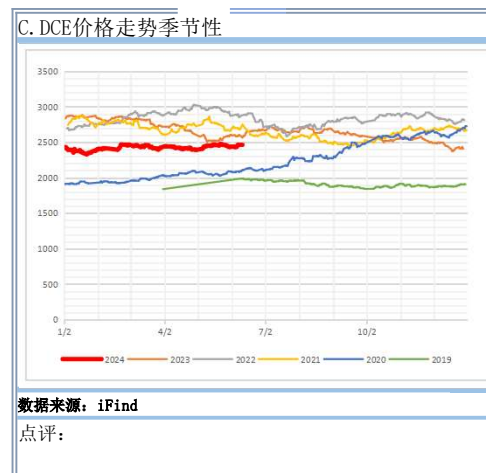
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：2328

期内最大值：3027

期内平均值：2667.8807

当前分位值：18.88%



数据起始日：2019/6/12

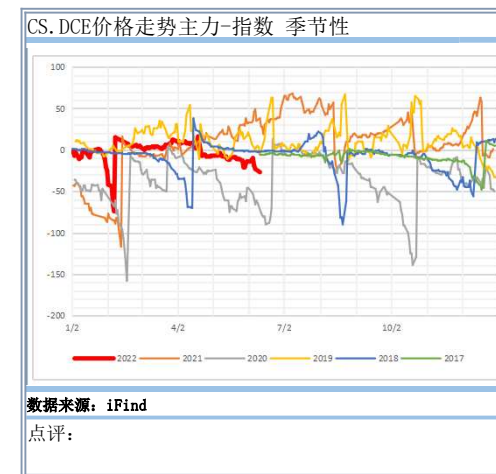
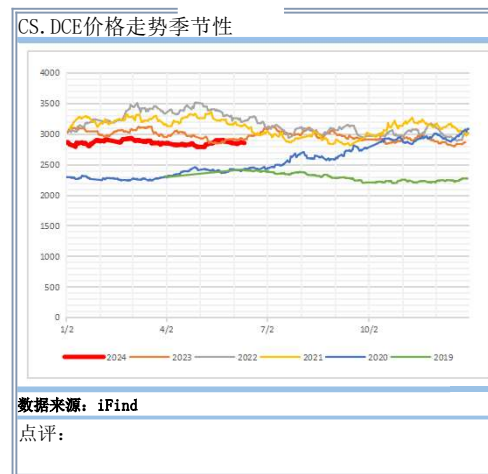
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：2784

期内最大值：3512

期内平均值：3025.0261

当前分位值：8.79%



数据起始日：2019/6/12

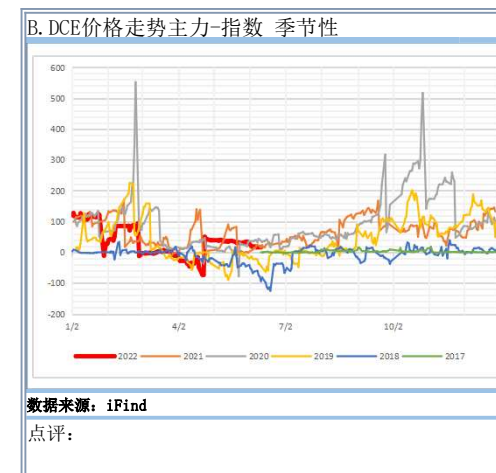
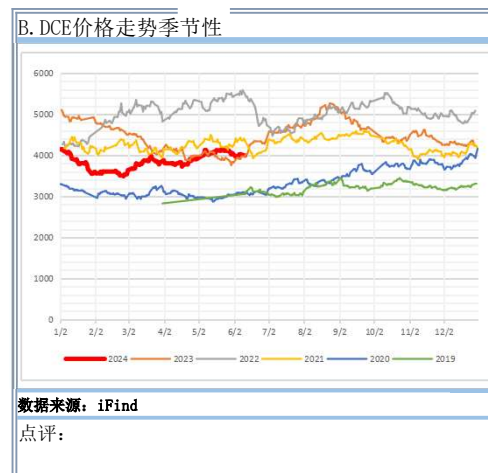
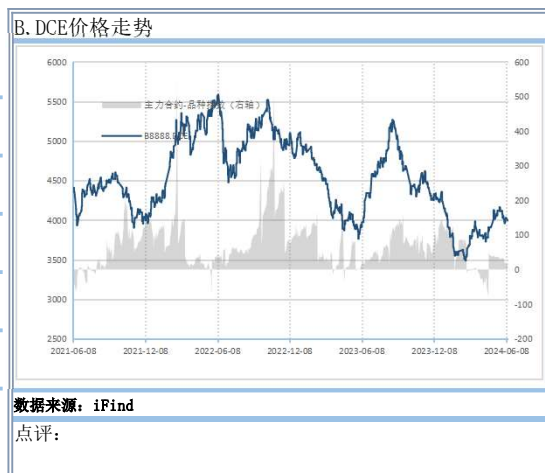
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：3487

期内最大值：5585

期内平均值：4524.2757

当前分位值：24.12%



数据起始日：2019/6/12

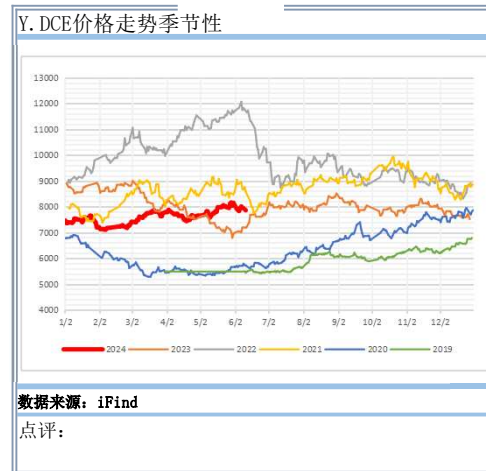
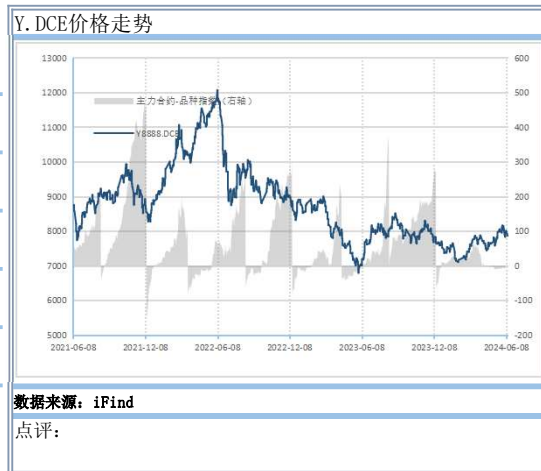
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：6793

期内最大值：12065

期内平均值：8734.1948

当前分位值：20.24%



数据起始日：2019/6/12

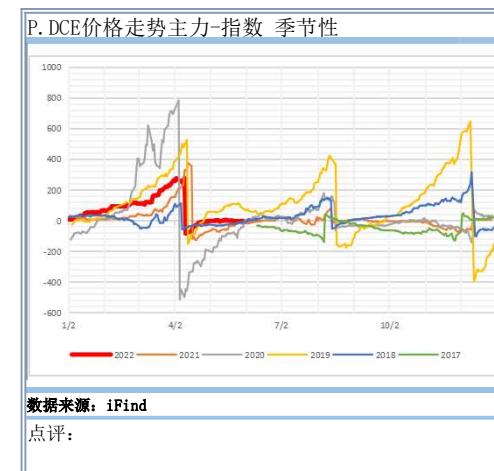
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：6349

期内最大值：12479

期内平均值：8287.7654

当前分位值：20.41%



数据起始日：2019/6/12

数据截止日：2024/6/11

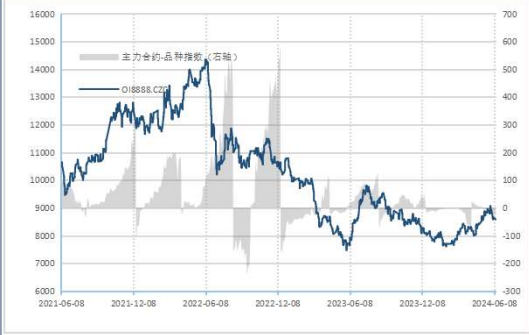
期内最小值：7475

期内最大值：14344

期内平均值：10229.5158

当前分位值：16.09%

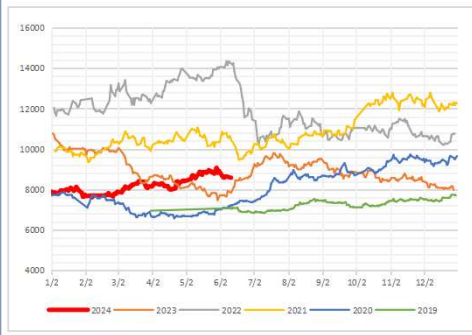
OI.CZCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

OI.CZCE价格走势季节性



数据来源：iFind

点评：

OI.CZCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源：iFind

点评：

数据起始日：2022/2/18

数据截止日：2024/6/11

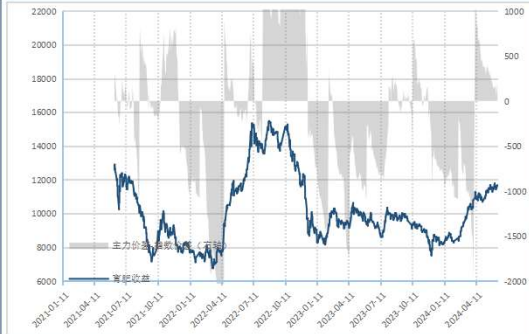
期内最小值：7508.2500

期内最大值：11785.0000

期内平均值：9597.4138

当前分位值：97.68%

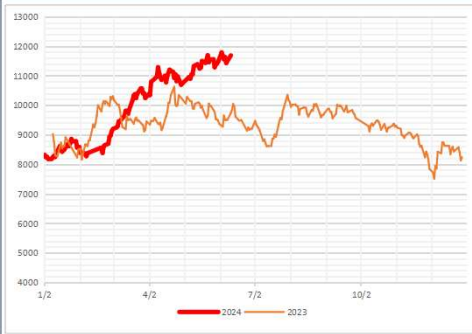
育肥收益



数据来源：iFind

点评：

育肥收益季节性



数据来源：iFind

点评：

育肥收益主力-指数 季节性



数据来源：iFind

点评：

数据起始日：2021/1/8

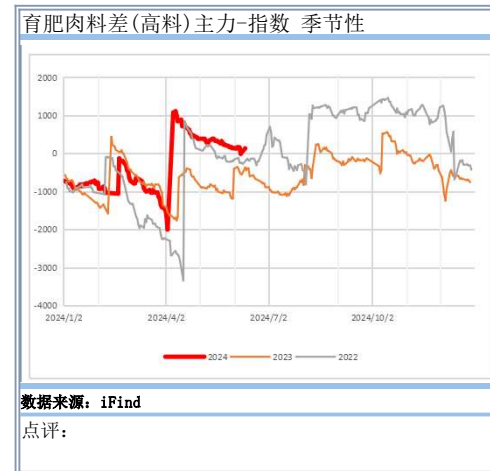
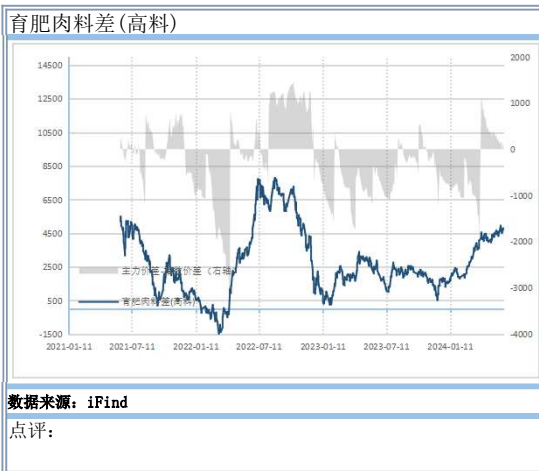
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：515.0000

期内最大值：4950.0000

期内平均值：2505.8379

当前分位值：96.55%



数据起始日：2019/6/12

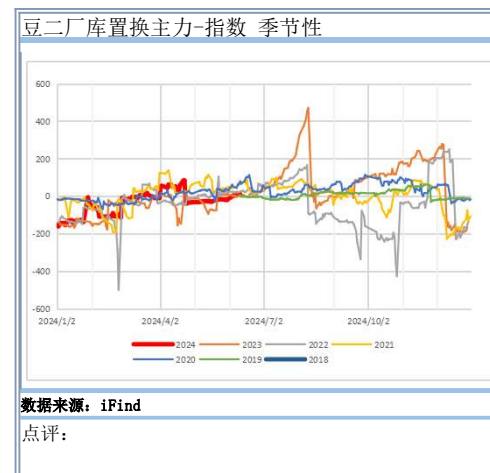
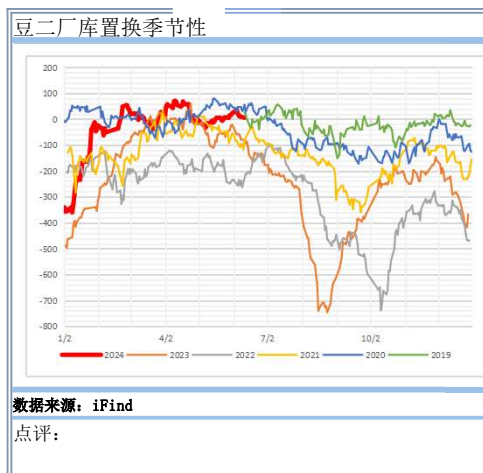
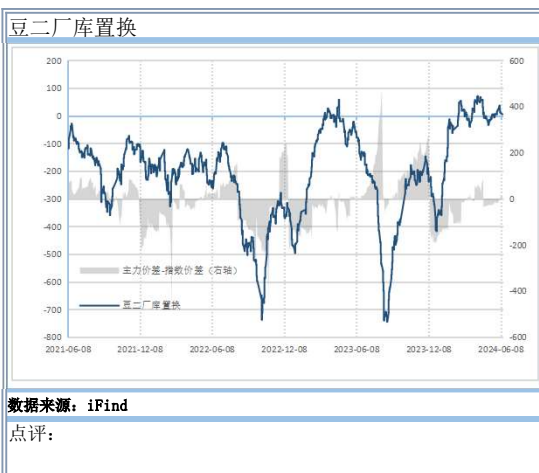
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：-745.0200

期内最大值：71.2200

期内平均值：-207.5813

当前分位值：91.94%



数据起始日：2019/6/12

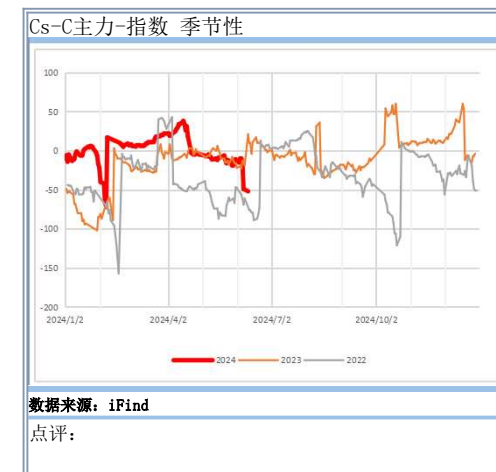
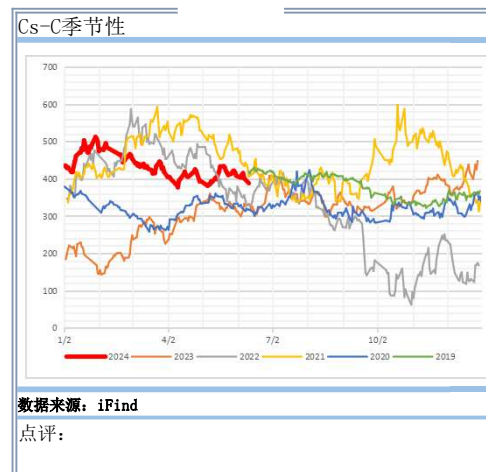
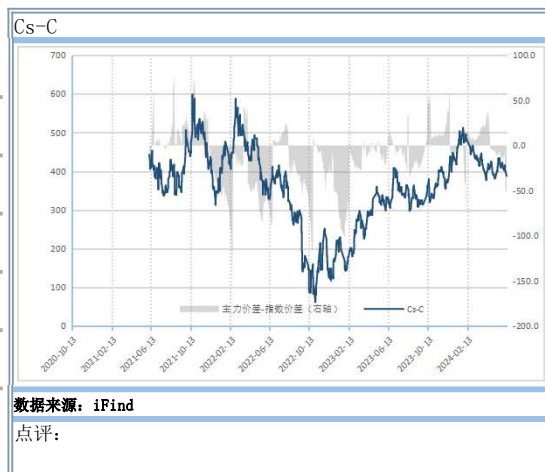
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：62.0000

期内最大值：598.0000

期内平均值：357.1454

当前分位值：60.82%



数据起始日：2019/6/12

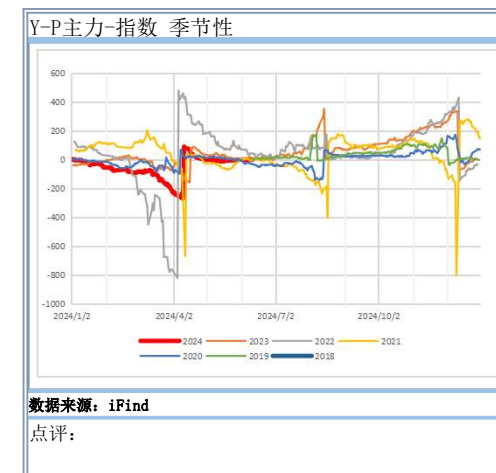
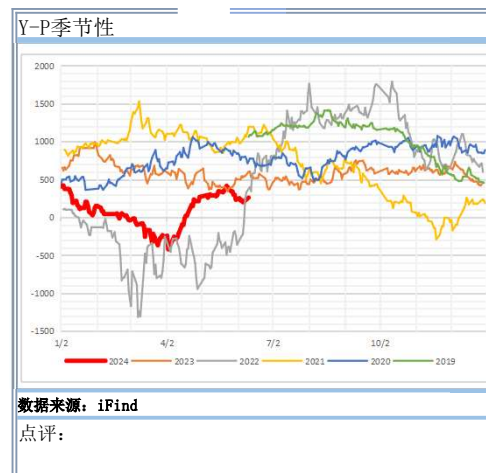
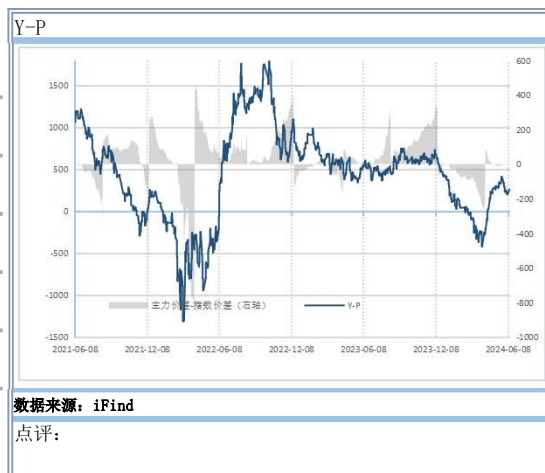
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：-1313.0000

期内最大值：1788.0000

期内平均值：446.4294

当前分位值：50.73%



数据起始日：2019/6/12

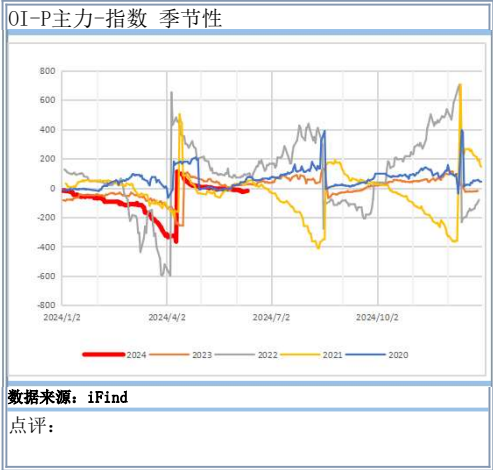
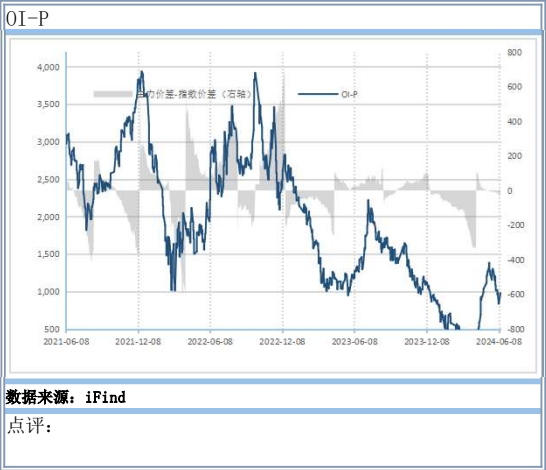
数据截止日：2024/6/11

期内最小值：19.0000

期内最大值：2683.0000

期内平均值：1250.4986

当前分位值：36.07%



免责声明

本报告由山金期货投资咨询部制作，未获得山金期货有限公司的书面授权，任何人和单位不得对本报告进行任何形式的修改、发布和复制。本报告基于本公司期货研究人员采用可信的公开资料和实地调研资料，但本公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，且本报告中的资料、建议、预测均反映报告初次发布时的判断，可能会随时调整，报告中的信息或所表达的意见不构成投资、法律、会计或税务的最终操作建议，本公司不就报告中的内容对最终操作建议作任何担保。在山金期货有限公司及其研究人员知情的范围内，山金期货有限公司及其期货研究人员以及财产上的利害关系人与所评价或推荐的产品不存在任何利害关系，同时提醒期货投资者，期市有风险，入市须谨慎，了解市场风险，投资量力而行。