

<http://www.shanlingh.com>

盘面套利观察

2024年5月15日

制作：曹有明

投资咨询： Z0013162

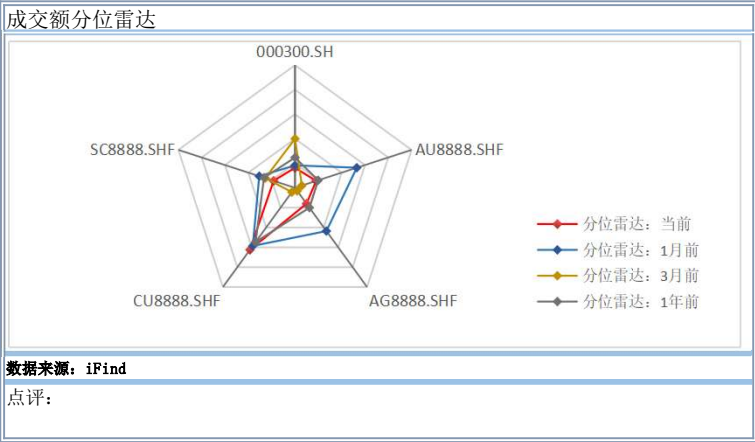
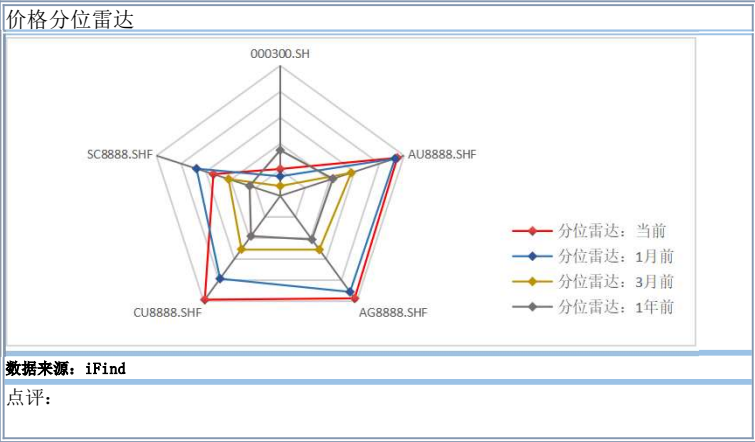
邮箱： caoyouming@sd-gold.com

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: 2019-5-16

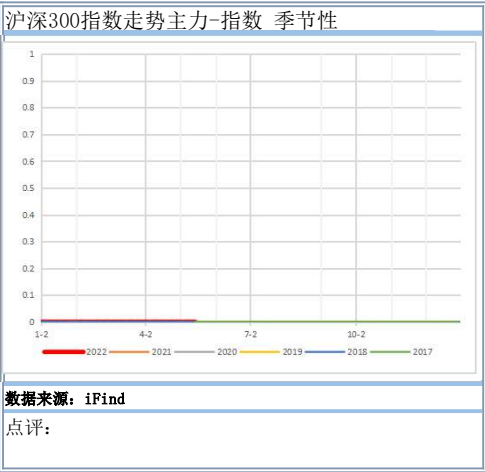
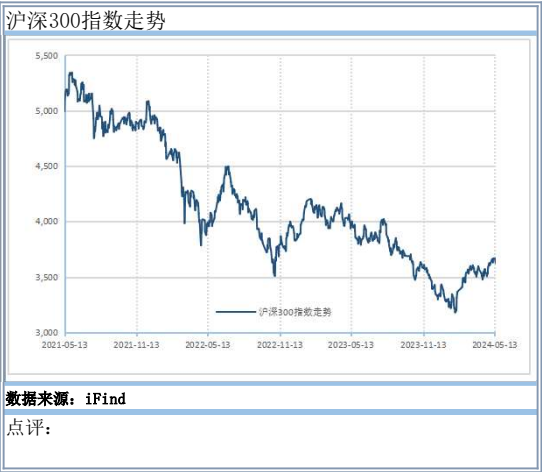
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 3179.6276

期内最大值: 5341.6798

期内平均值: 4147.3098

当前分位值: 7.59%



数据起始日： 2019-5-16

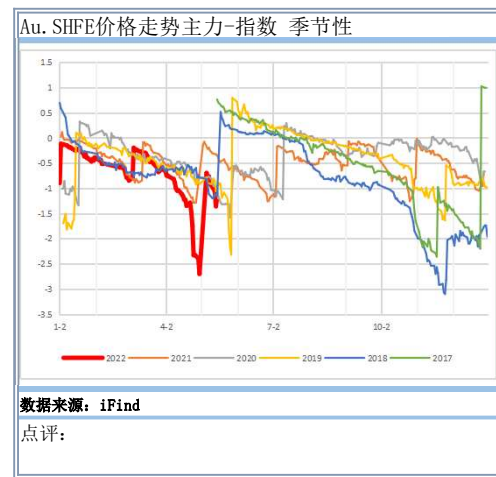
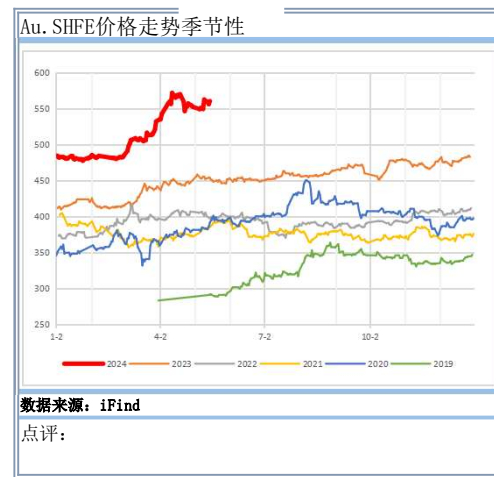
数据截止日： 2024-5-15

期内最小值： 363.2

期内最大值： 571.54

期内平均值： 422.6115

当前分位值： 94.55%



数据起始日： 2019-5-16

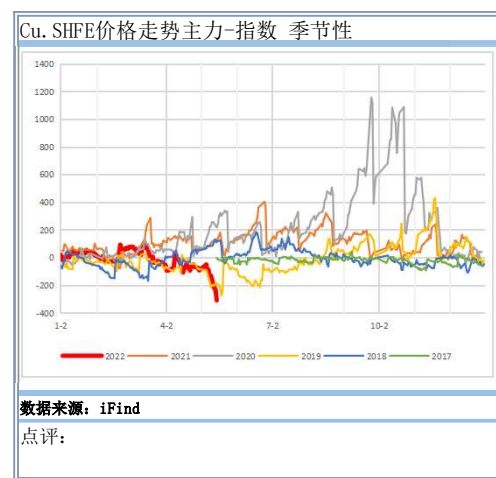
数据截止日： 2024-5-15

期内最小值： 53367

期内最大值： 82517

期内平均值： 68548.0740

当前分位值： 98.54%



数据起始日: 2019-5-16

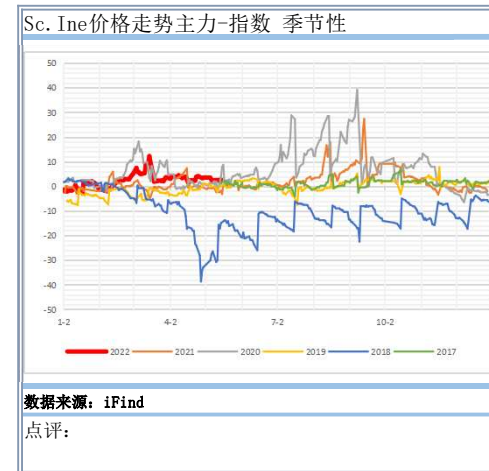
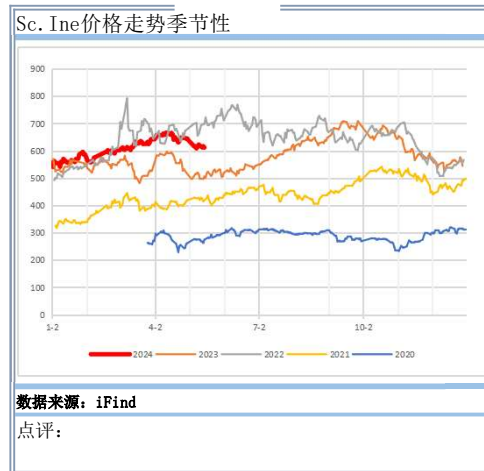
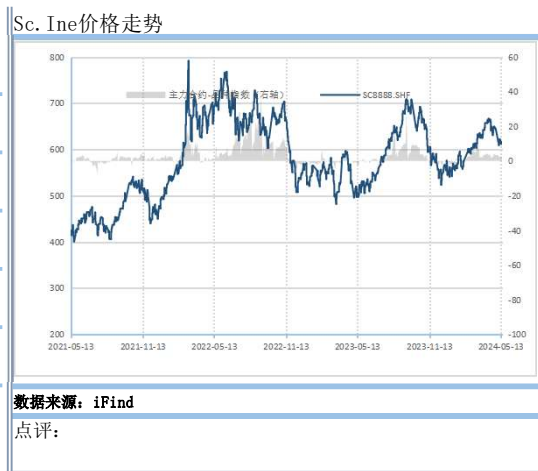
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 400.6

期内最大值: 791.6

期内平均值: 578.5376

当前分位值: 53.96%



数据起始日: 2019-5-16

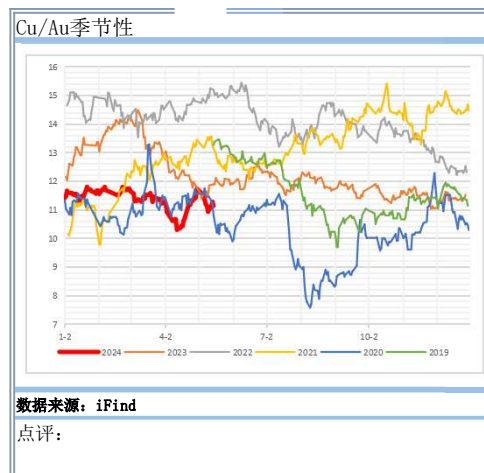
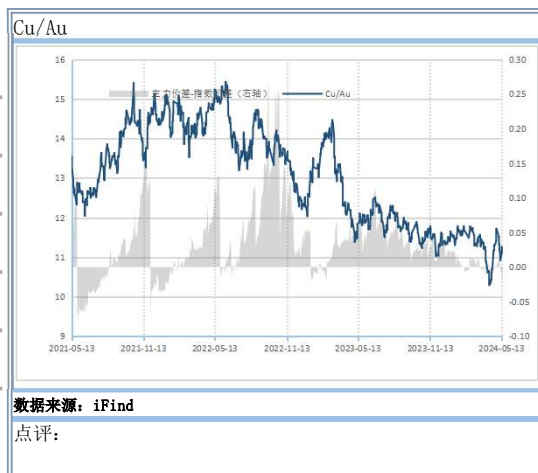
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 10.2923

期内最大值: 15.4319

期内平均值: 13.0300

当前分位值: 16.20%



数据起始日： 2019-5-16

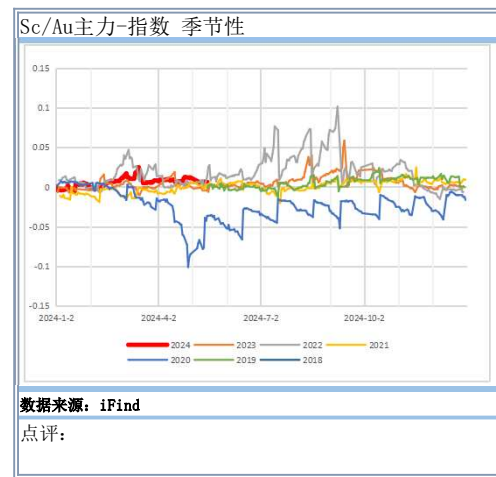
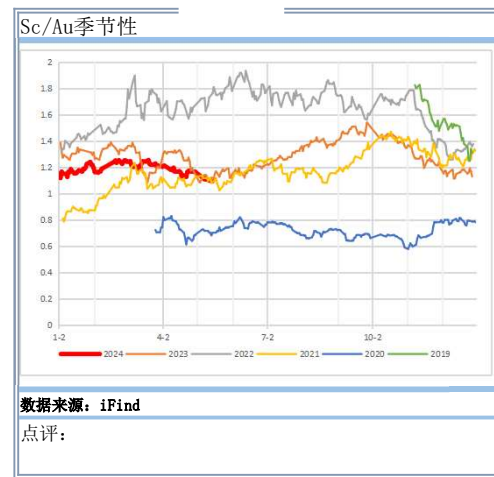
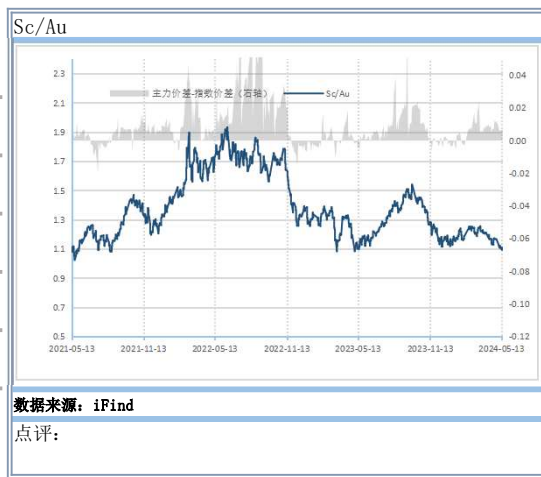
数据截止日： 2024-5-15

期内最小值： 1.0233

期内最大值： 1.9320

期内平均值： 1.3789

当前分位值： 7.54%



数据起始日： 2019-5-16

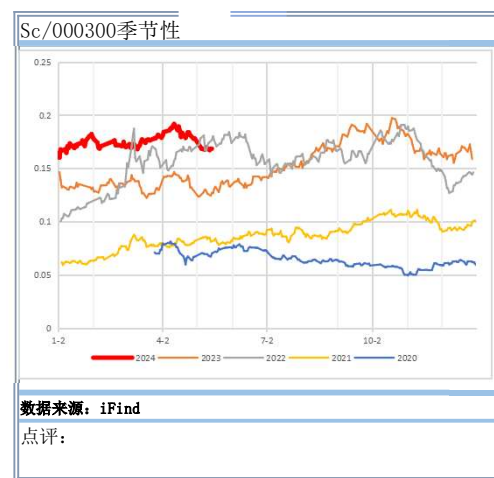
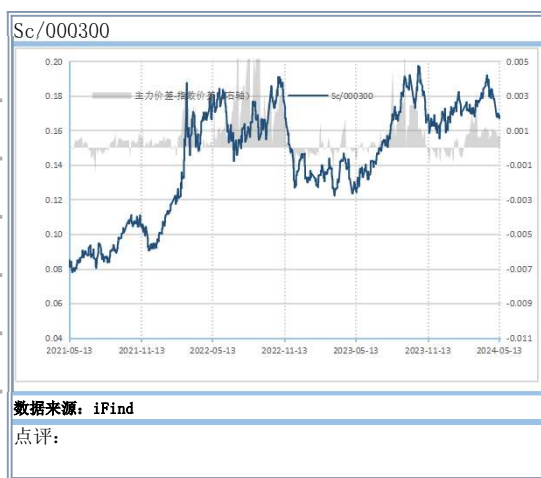
数据截止日： 2024-5-15

期内最小值： 0.0780

期内最大值： 0.1972

期内平均值： 0.1432

当前分位值： 76.07%



数据起始日： 2019-5-16

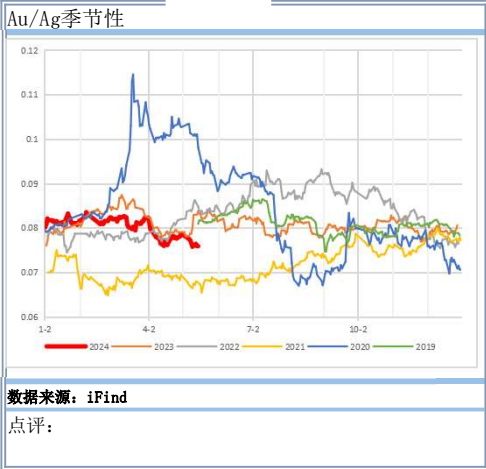
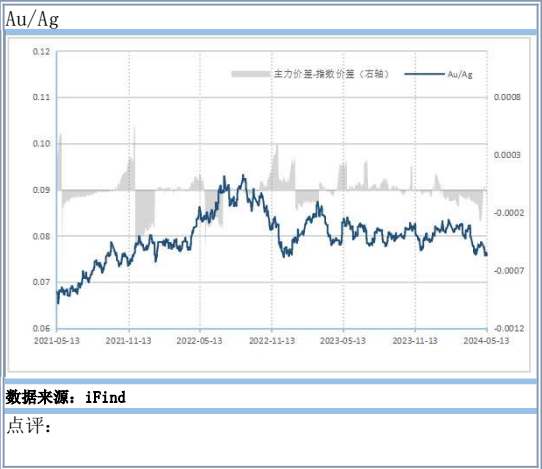
数据截止日： 2024-5-15

期内最小值： 0.0654

期内最大值： 0.0932

期内平均值： 0.0798

当前分位值： 37.84%



数据起始日： 2019-5-16

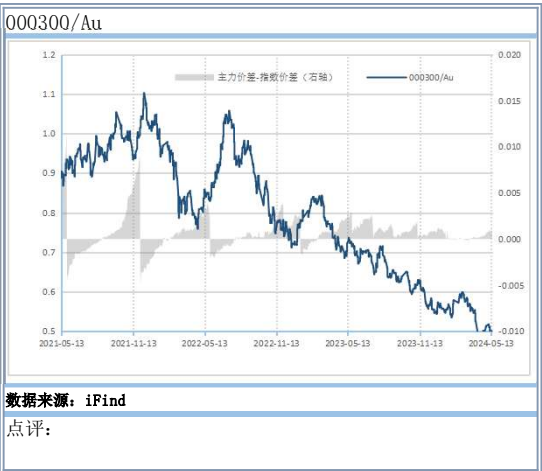
数据截止日： 2024-5-15

期内最小值： 0.4651

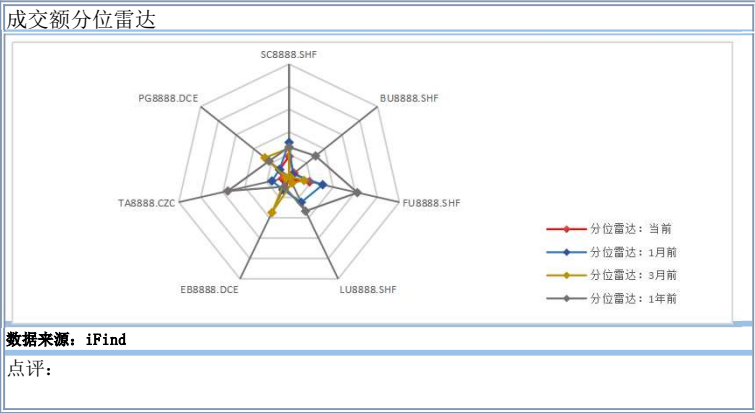
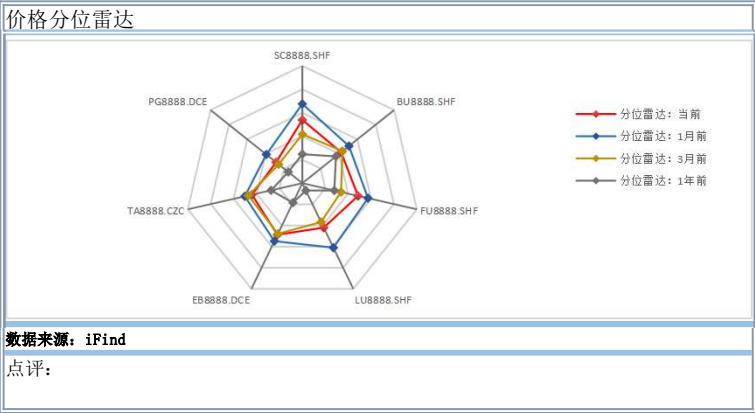
期内最大值： 1.1021

期内平均值： 0.7962

当前分位值： 4.14%



二、原油相关



数据起始日: 2019-5-16

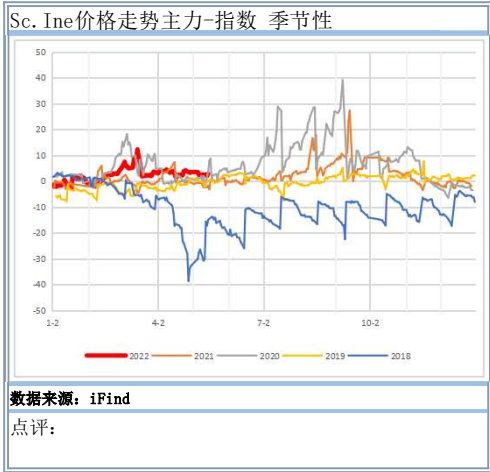
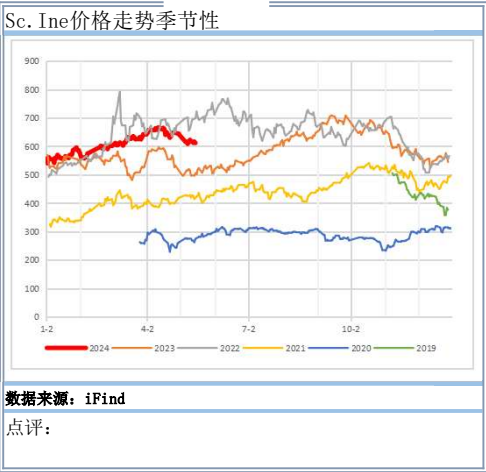
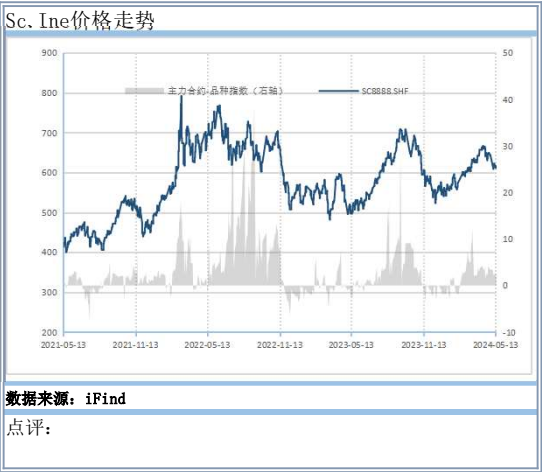
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 400.6

期内最大值: 791.6

期内平均值: 578.5376

当前分位值: 53.96%



数据起始日: 2019-5-16

数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 2821

期内最大值: 4794

期内平均值: 3647.4335

当前分位值: 42.27%



数据起始日: 2019-5-16

数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 2284

期内最大值: 4371

期内平均值: 3088.2345

当前分位值: 48.68%



数据起始日: 2020-6-22

数据截止日: 2024-5-15

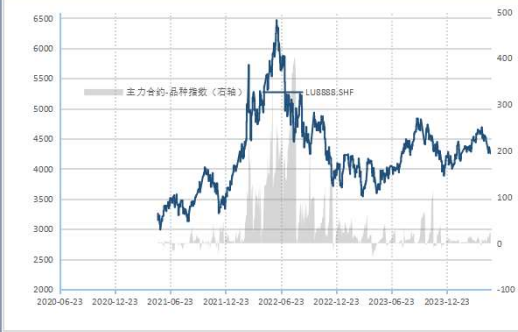
期内最小值: 3544

期内最大值: 5239

期内平均值: 4268.1576

当前分位值: 42.01%

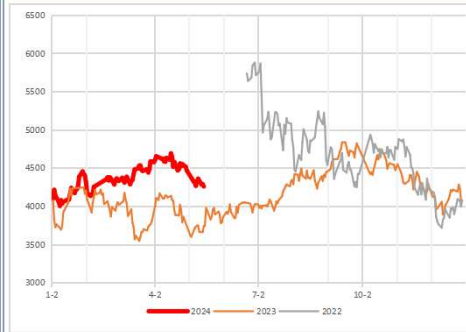
Lu. Ine价格走势



数据来源: iFind

点评:

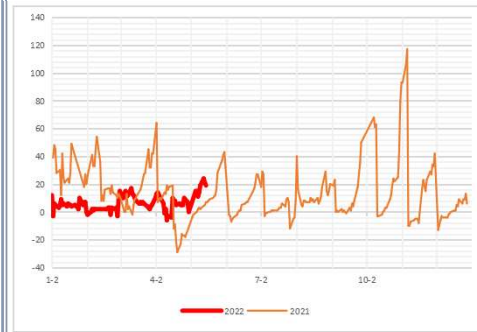
Lu. Ine价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

Lu. Ine价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-9-26

数据截止日: 2024-5-15

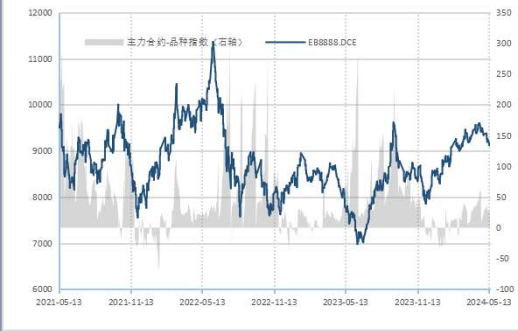
期内最小值: 6978

期内最大值: 11361

期内平均值: 8668.7088

当前分位值: 48.76%

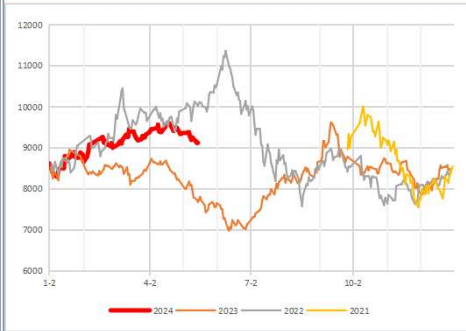
EB. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

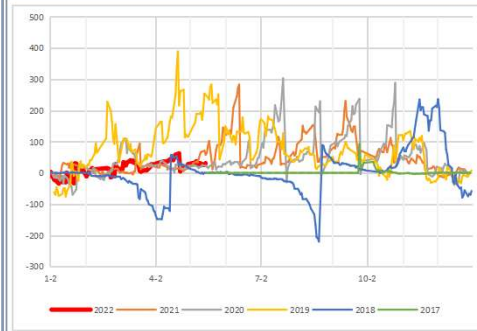
EB. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

EB. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-5-16

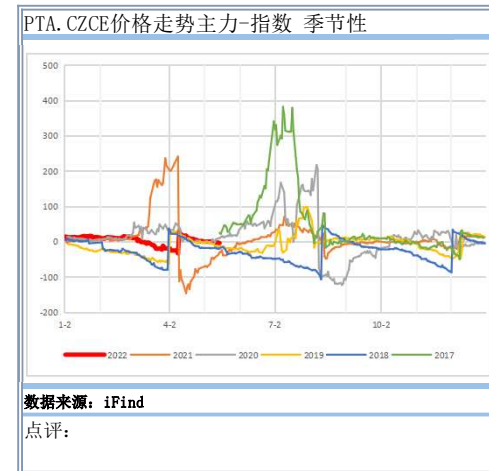
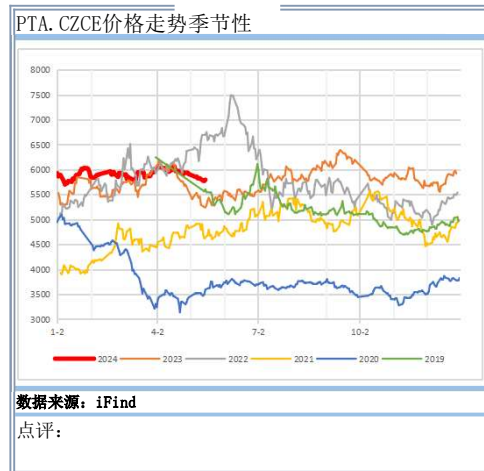
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 4462

期内最大值: 7488

期内平均值: 5616.9342

当前分位值: 44.05%



数据起始日: 2020-3-30

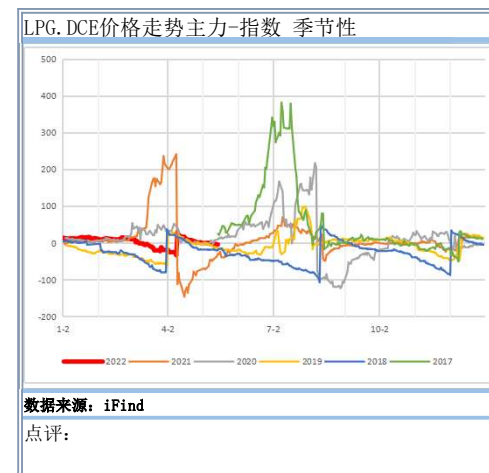
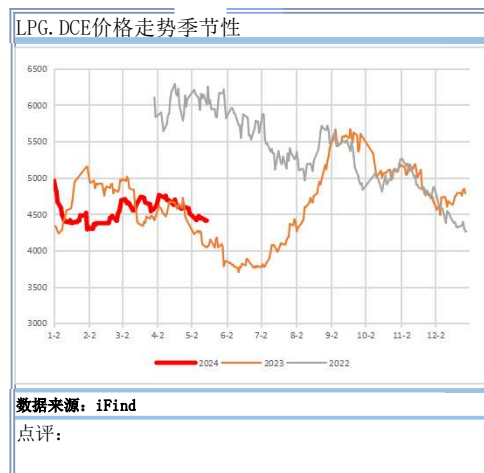
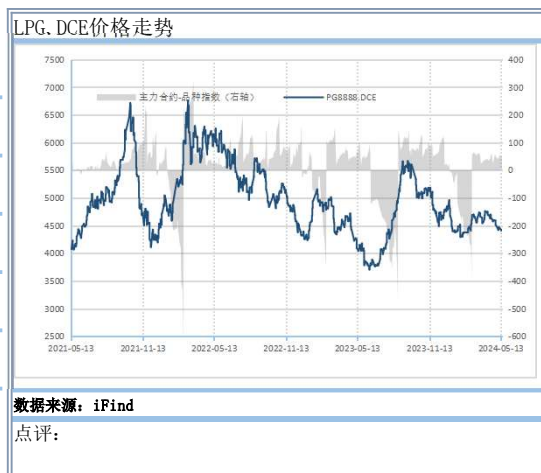
数据截止日: 2024-5-15

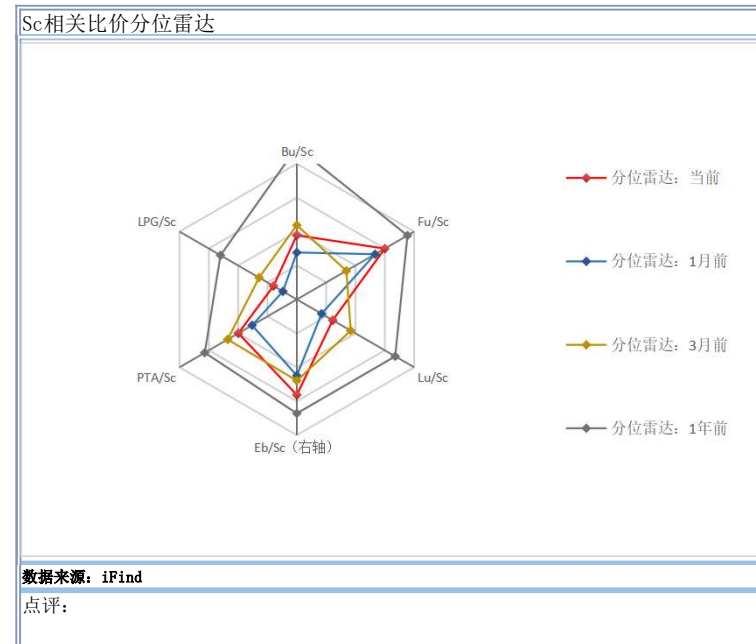
期内最小值: 3704

期内最大值: 6209

期内平均值: 4810.0768

当前分位值: 28.58%





数据起始日: 2019-5-16

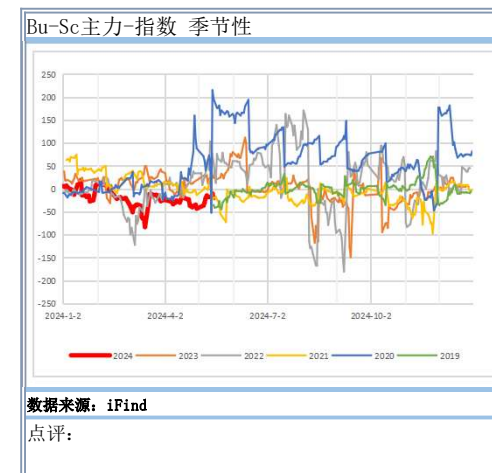
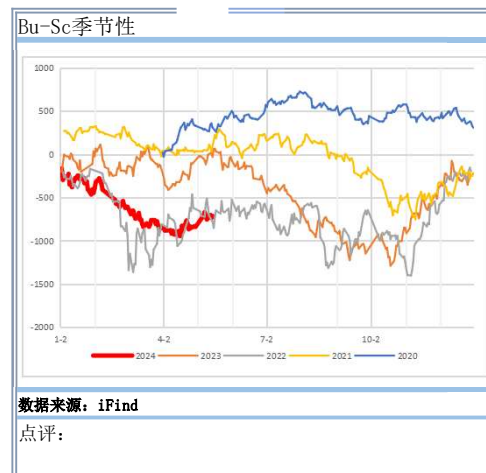
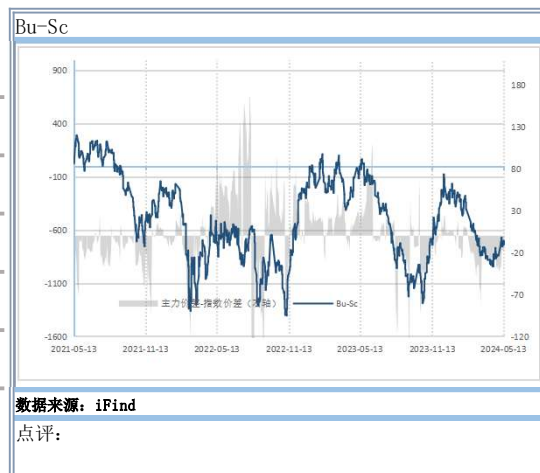
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: -1406.4286

期内最大值: 289.5714

期内平均值: -484.9779

当前分位值: 40.85%



数据起始日: 2019-5-16

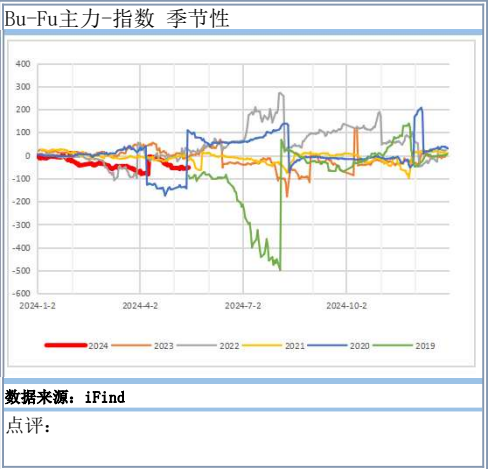
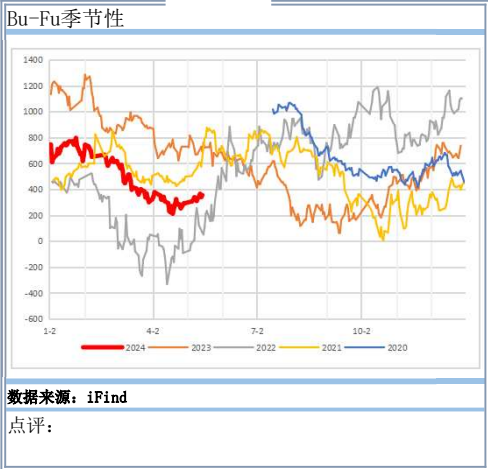
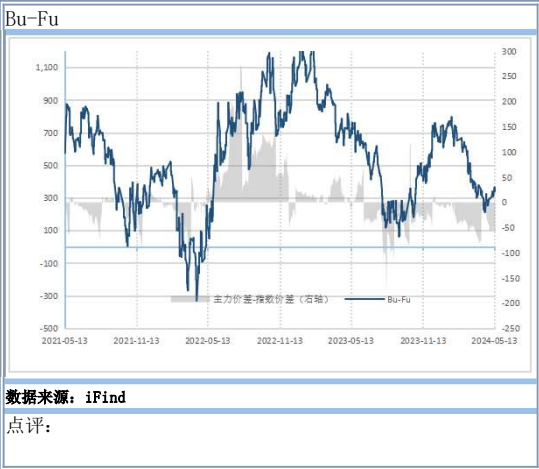
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: -331.0000

期内最大值: 1284.0000

期内平均值: 559.1990

当前分位值: 42.48%



数据起始日: 2021-9-27

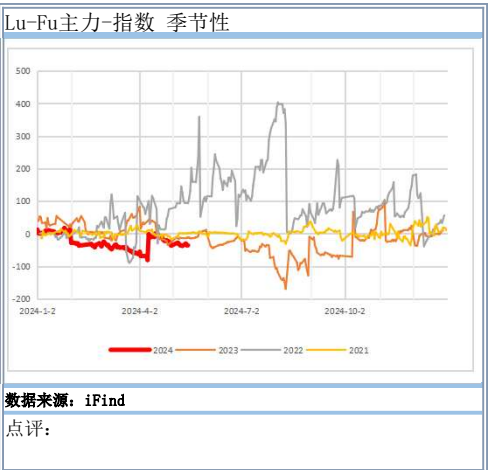
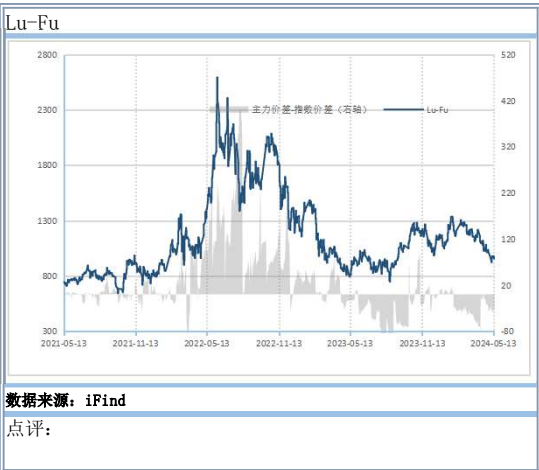
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 749.0000

期内最大值: 2085.0000

期内平均值: 1208.3059

当前分位值: 15.49%



数据起始日: 2021-8-2

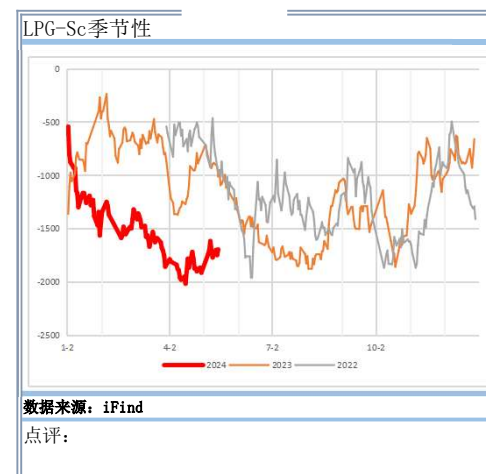
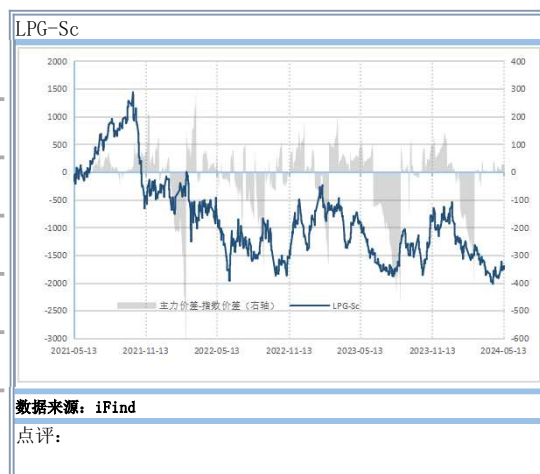
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: -2017.0000

期内最大值: -240.0000

期内平均值: -1266.2490

当前分位值: 18.06%



数据起始日: 2019-5-16

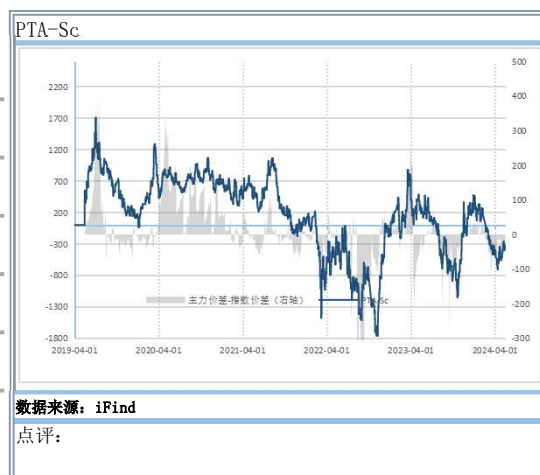
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: -1762.0000

期内最大值: 1061.0000

期内平均值: -168.4417

当前分位值: 51.04%



数据起始日: 2021-4-4

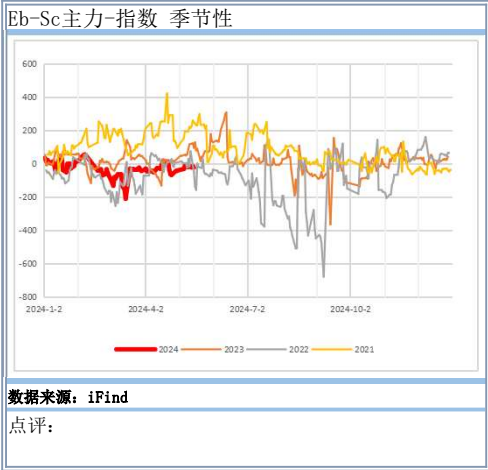
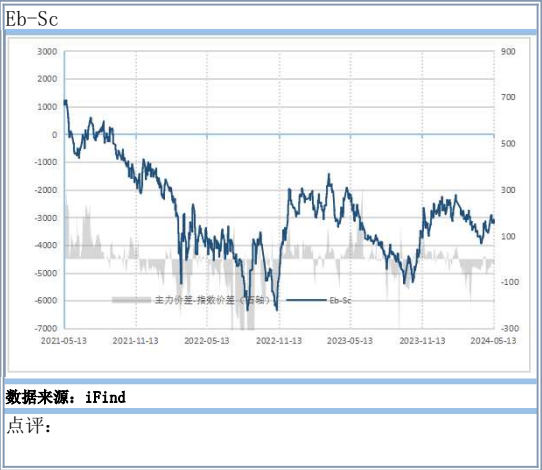
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: -6347.0000

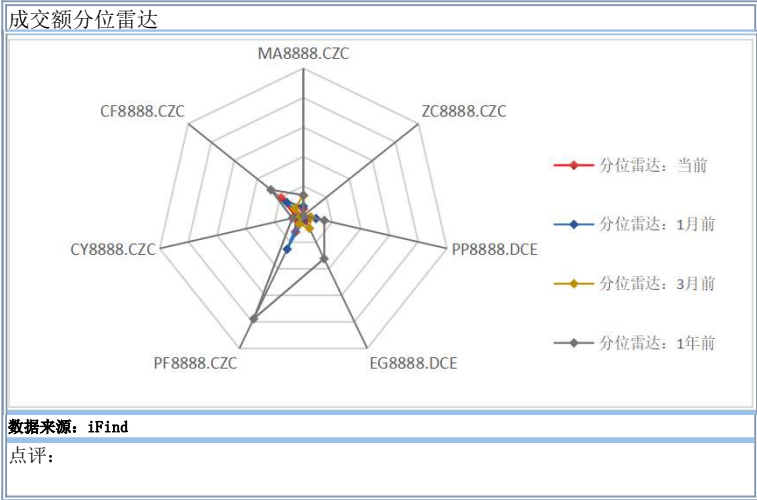
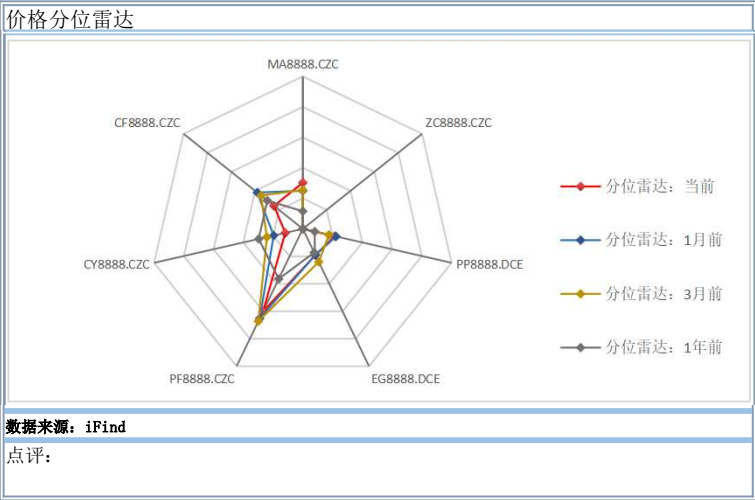
期内最大值: -910.0000

期内平均值: -3396.7288

当前分位值: 59.41%



三、煤化工相关



数据起始日: 2019-5-16

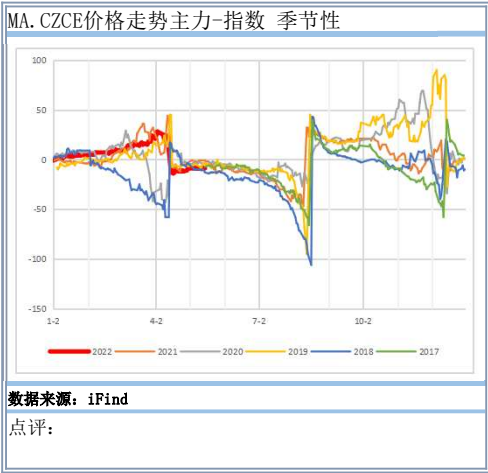
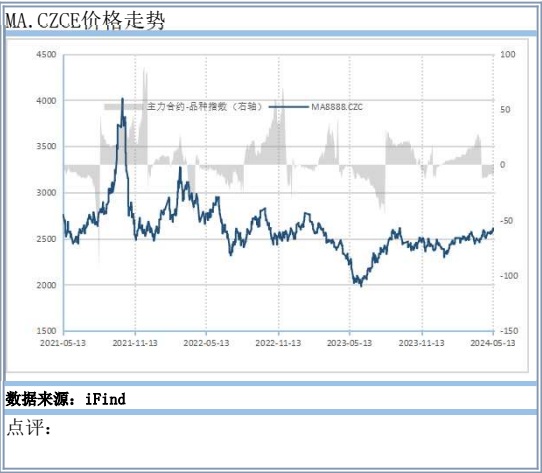
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 1982

期内最大值: 4015

期内平均值: 2593.3978

当前分位值: 30.30%



数据起始日: 2019-5-16

数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 6865

期内最大值: 10224

期内平均值: 7970.3676

当前分位值: 21.52%

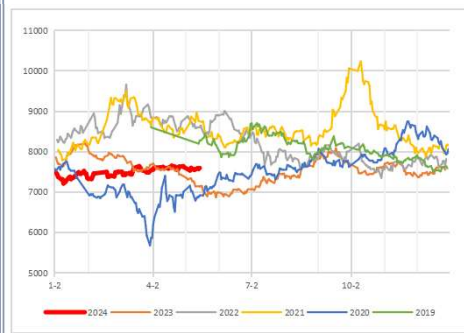
PP. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

PP. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

PP. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-5-16

数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 3778

期内最大值: 7345

期内平均值: 4596.8519

当前分位值: 19.04%

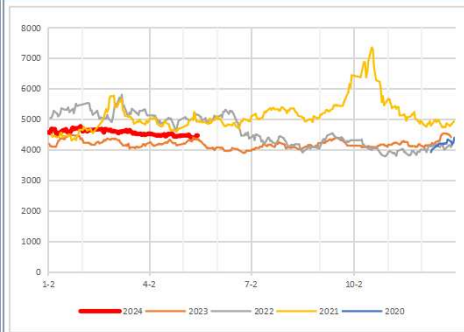
EG. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

EG. CZCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

EG. CZCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020-10-12

数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 6477

期内最大值: 7907

期内平均值: 7301.0510

当前分位值: 60.14%

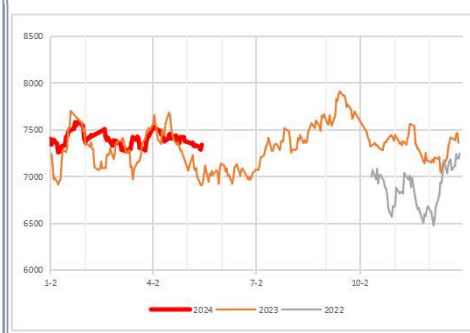
PF.CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

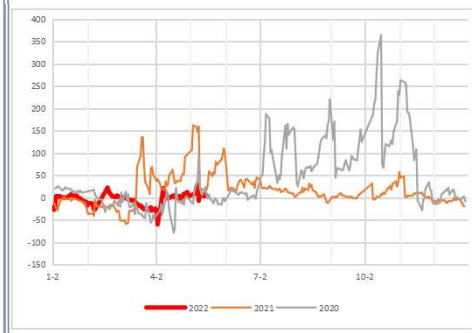
PF.CZCE价格走势季节性



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: 2019-5-16

数据截止日: 2024-5-15

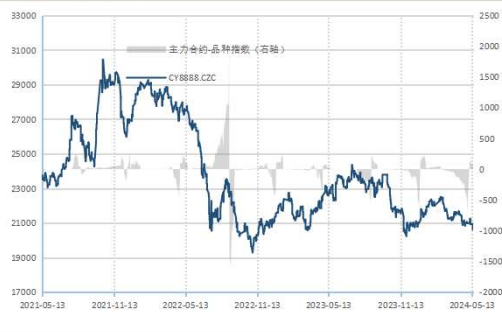
期内最小值: 19292

期内最大值: 30443

期内平均值: 23760.8436

当前分位值: 11.81%

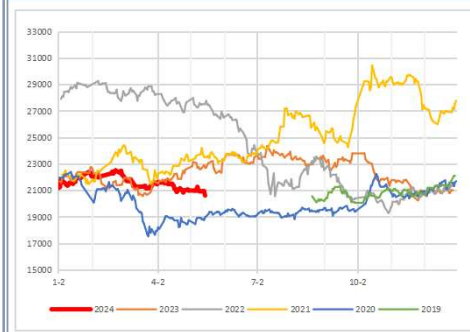
CY.CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

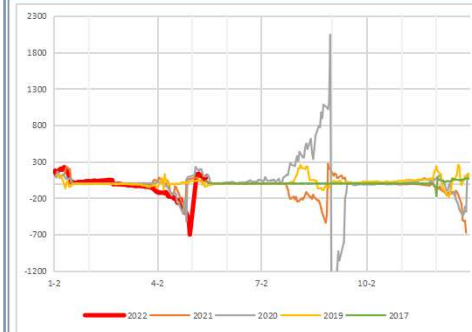
CY.CZCE价格走势季节性



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: 2019-5-16

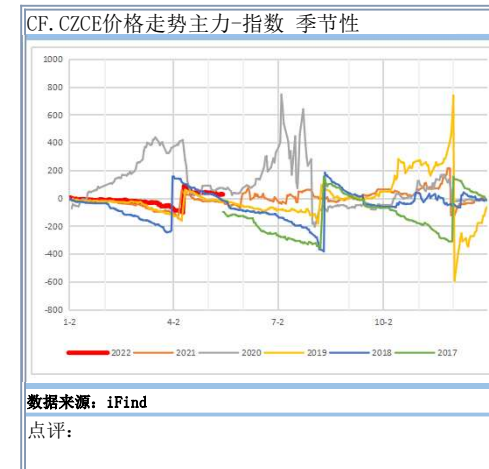
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 12447

期内最大值: 22574

期内平均值: 16905.3402

当前分位值: 24.20%



数据起始日: 2019-5-16

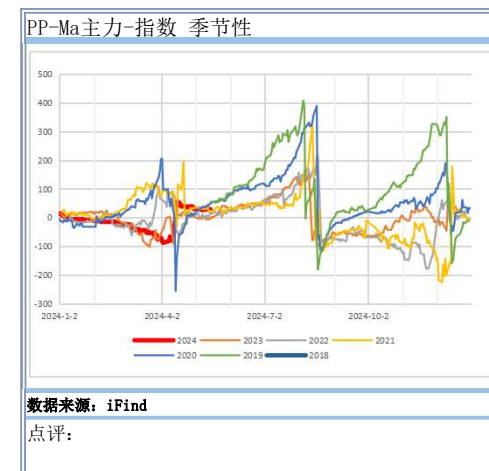
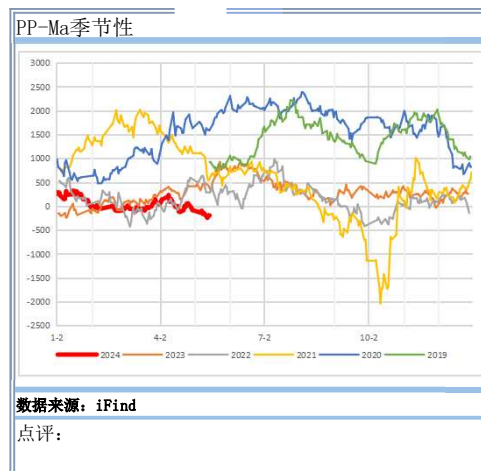
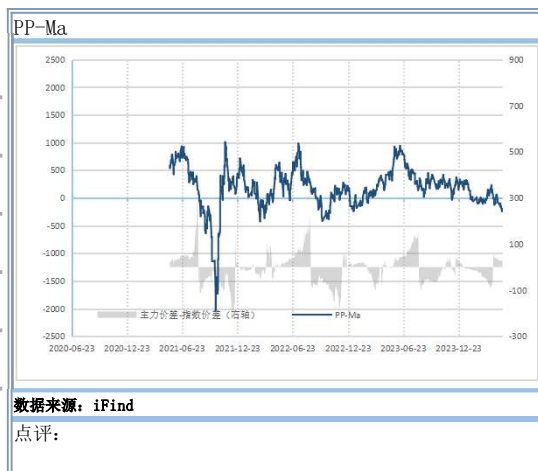
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: -2039.0000

期内最大值: 1007.0000

期内平均值: 190.1742

当前分位值: 60.18%



数据起始日: 2019-5-16

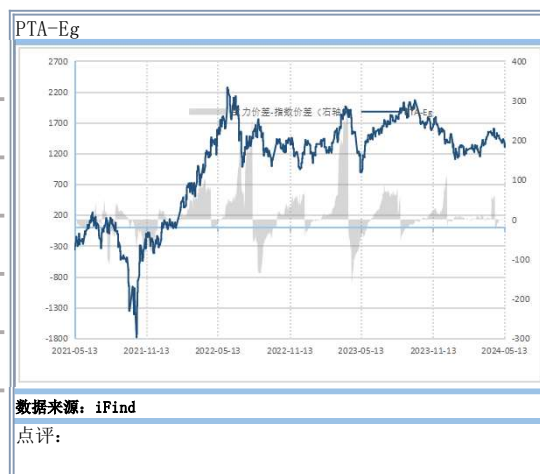
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: -1783.0000

期内最大值: 2269.0000

期内平均值: 1020.0823

当前分位值: 77.02%



数据起始日: 2021-12-8

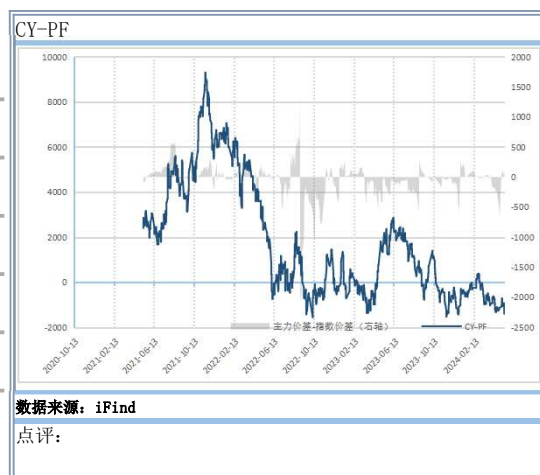
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: -1533.0000

期内最大值: 2854.0000

期内平均值: 148.3428

当前分位值: 2.99%



数据起始日: 2022-11-28

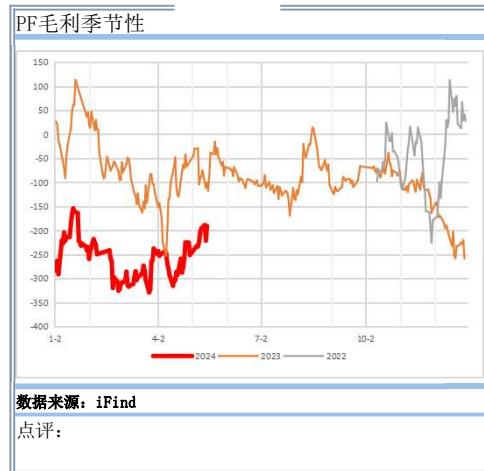
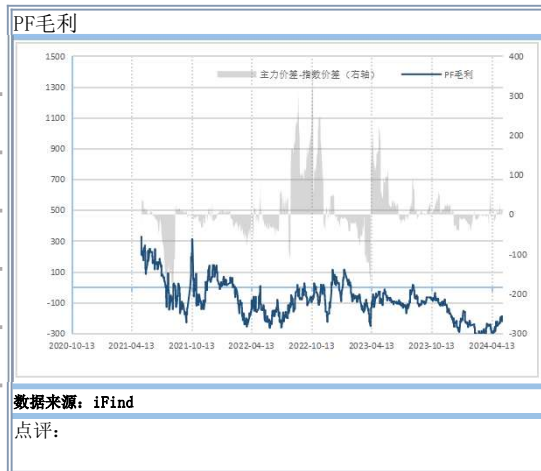
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: -328.9900

期内最大值: 112.9900

期内平均值: -128.6150

当前分位值: 31.26%



数据起始日: 2019-5-16

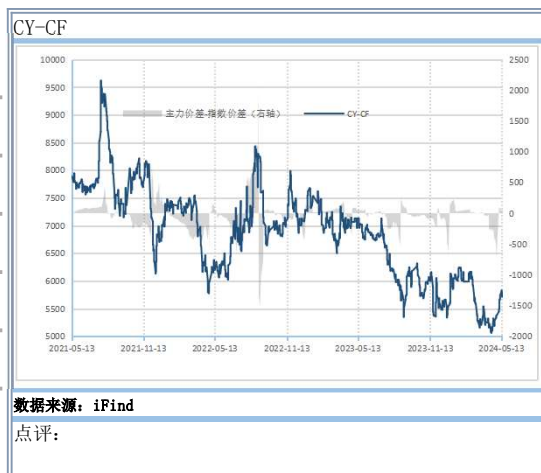
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 5061.0000

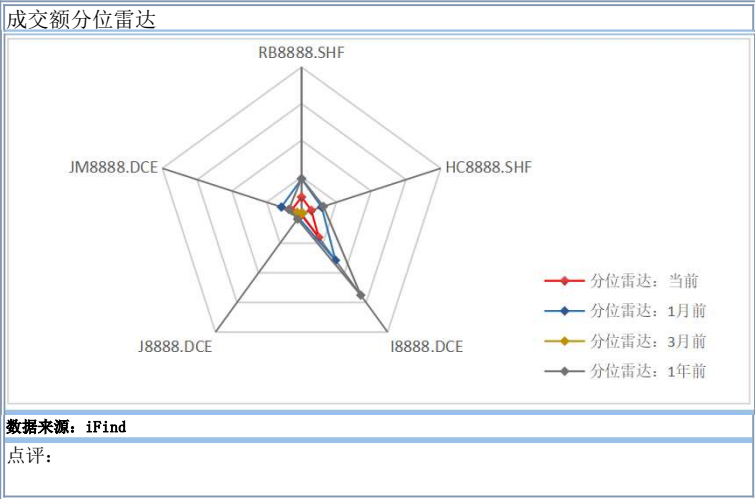
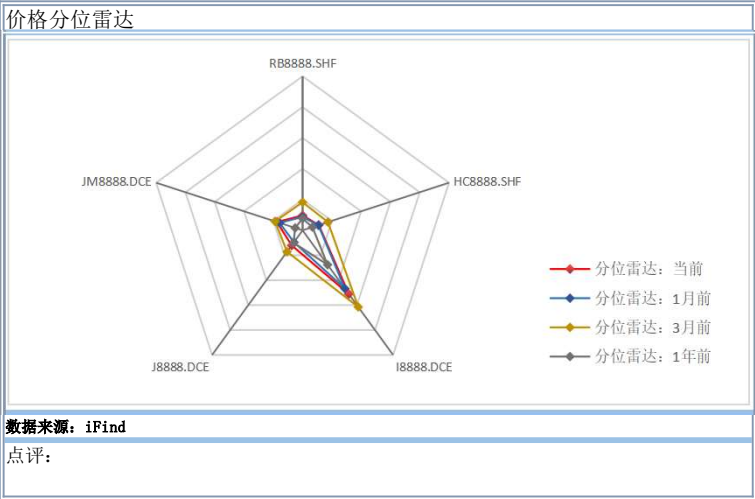
期内最大值: 9616.0000

期内平均值: 6855.5034

当前分位值: 14.27%



四、黑色相关



数据起始日: 2019-5-16

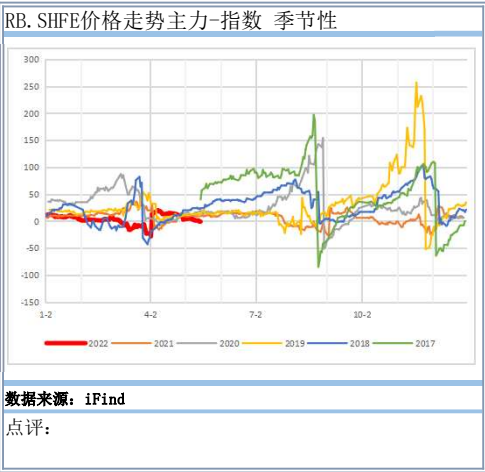
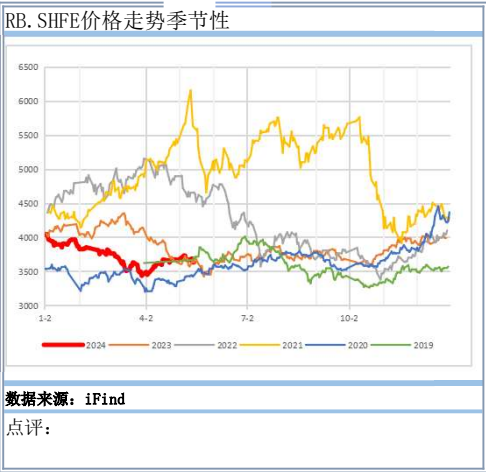
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 3377

期内最大值: 5900

期内平均值: 4221.7174

当前分位值: 9.67%



数据起始日: 2019-5-16

数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 3444

期内最大值: 6429

期内平均值: 4366.8368

当前分位值: 11.06%

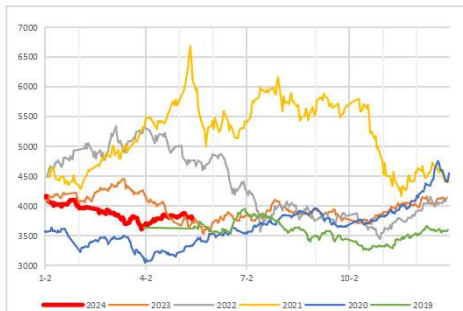
HC. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

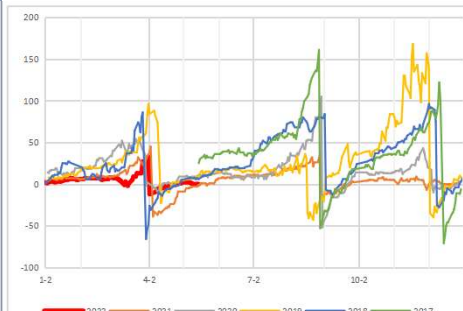
HC. SHFE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

HC. SHFE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-5-16

数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 512.8

期内最大值: 1183.2

期内平均值: 816.4230

当前分位值: 51.03%

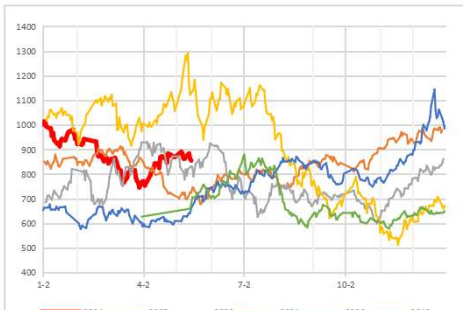
I. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

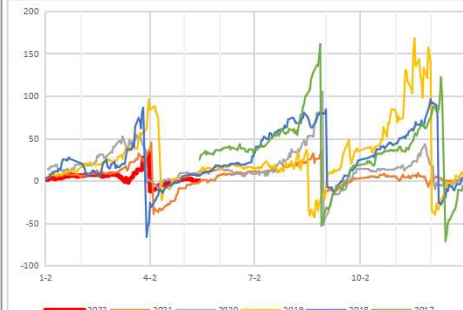
I. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

I. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-5-16

数据截止日: 2024-5-15

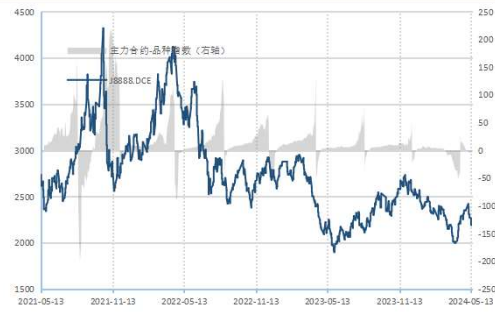
期内最小值: 1897.9

期内最大值: 4320.8

期内平均值: 2736.5377

当前分位值: 12.06%

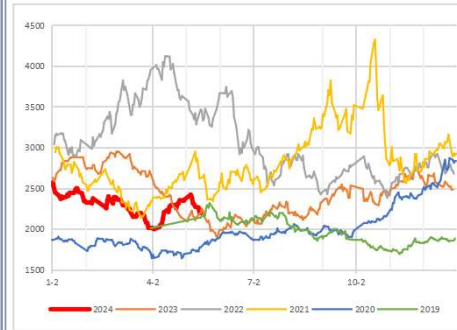
J. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

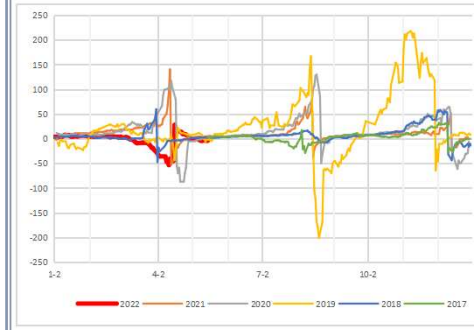
J. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

J. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-5-16

数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 1219.4

期内最大值: 3764.7

期内平均值: 2026.0739

当前分位值: 17.54%

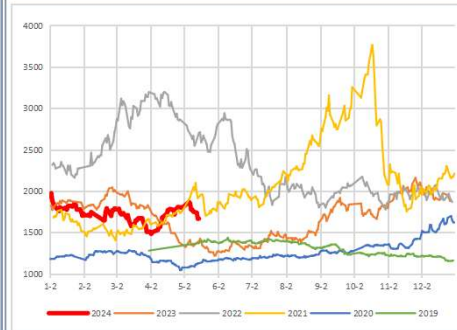
Jm. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

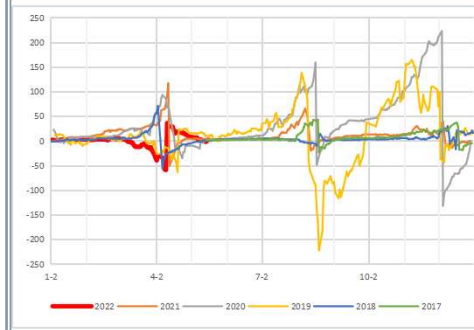
Jm. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

Jm. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日： 2019-5-16

数据截止日： 2024-5-15

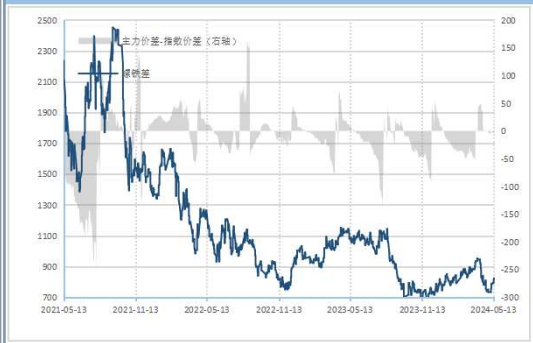
期内最小值： 670.1176

期内最大值： 2451.8235

期内平均值： 1171.2428

当前分位值： 8.64%

螺铁差



数据来源：iFind

点评：

数据起始日： 2019-5-16

数据截止日： 2024-5-15

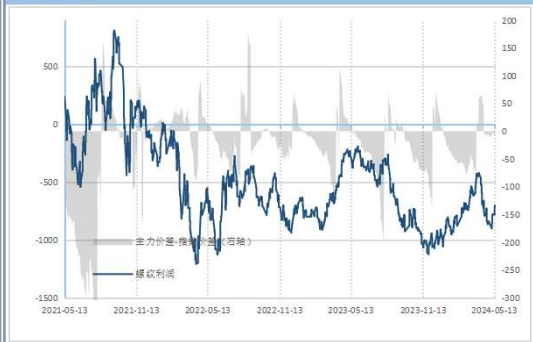
期内最小值： -1206.9091

期内最大值： 810.0000

期内平均值： -492.6525

当前分位值： 25.06%

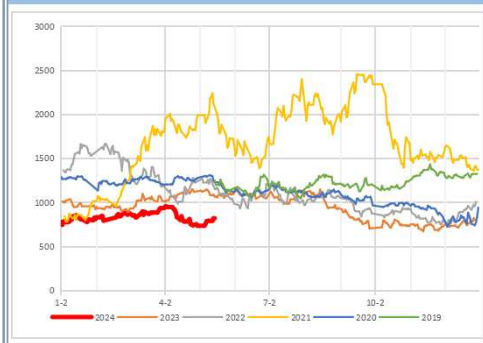
螺纹利润



数据来源：iFind

点评：

螺铁差季节性



数据来源：iFind

点评：

螺纹利润季节性



数据来源：iFind

点评：

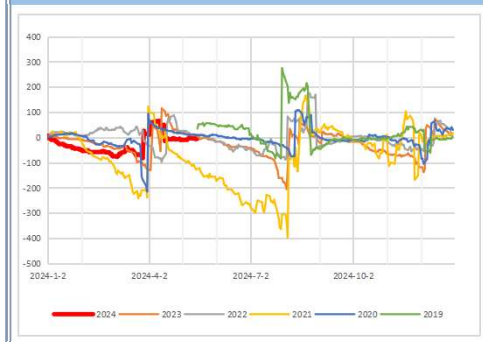
螺铁差主力-指数 季节性



数据来源：iFind

点评：

螺纹利润主力-指数 季节性



数据来源：iFind

点评：

数据起始日: 2019-5-16

数据截止日: 2024-5-15

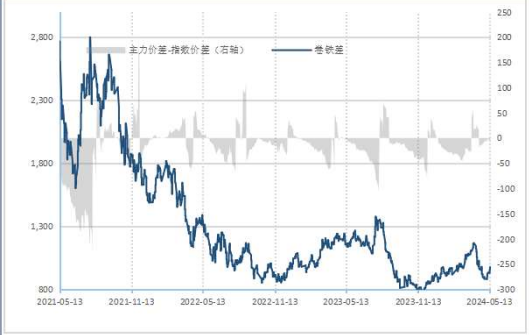
期内最小值: 752.4706

期内最大值: 2799.4118

期内平均值: 1316.3621

当前分位值: 10.97%

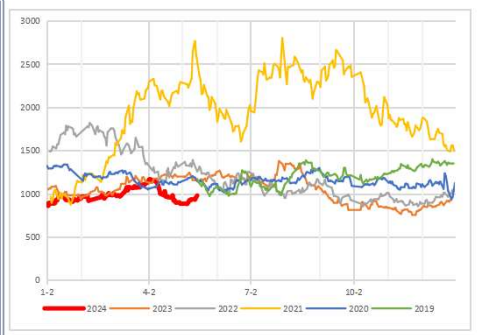
卷铁差



数据来源: iFind

点评:

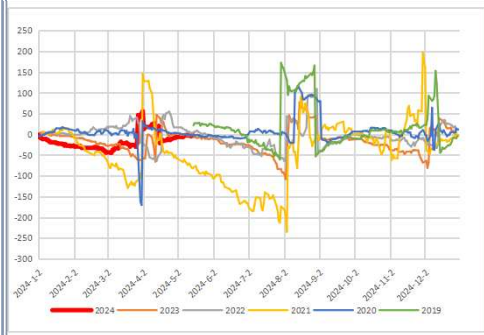
卷铁差季节性



数据来源: iFind

点评:

卷铁差主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-5-16

数据截止日: 2024-5-15

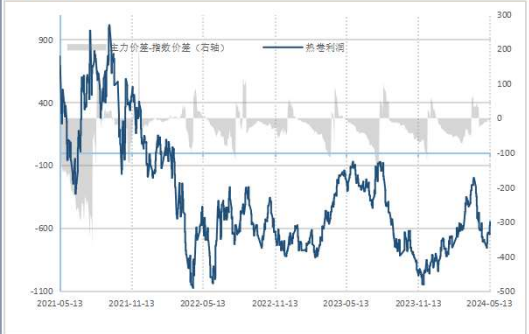
期内最小值: -1073.7273

期内最大值: 1014.0000

期内平均值: -347.5331

当前分位值: 25.16%

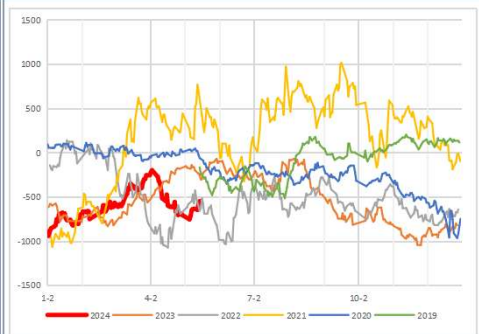
热卷利润



数据来源: iFind

点评:

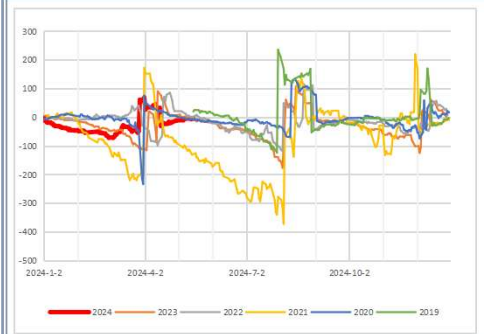
热卷利润季节性



数据来源: iFind

点评:

热卷利润主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日： 2019-5-16

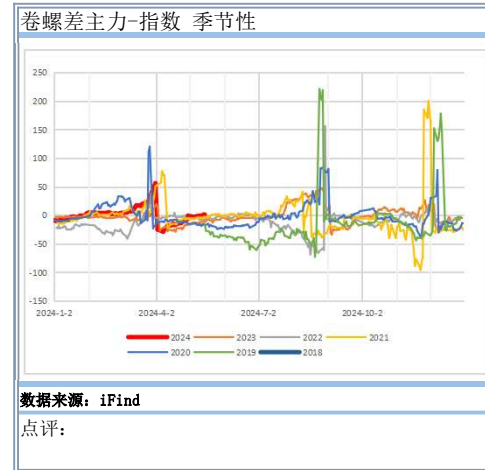
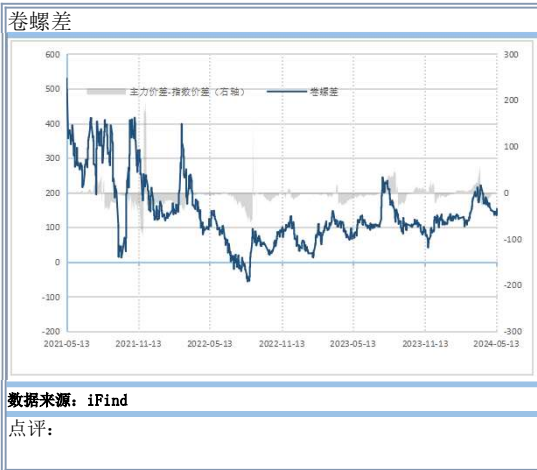
数据截止日： 2024-5-15

期内最小值： -56.0000

期内最大值： 529.0000

期内平均值： 145.1193

当前分位值： 35.73%



数据起始日： 2019-5-16

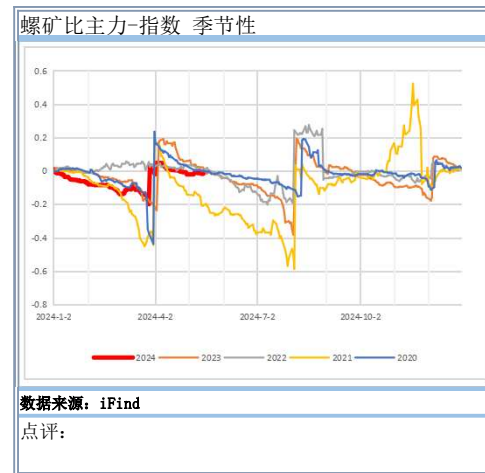
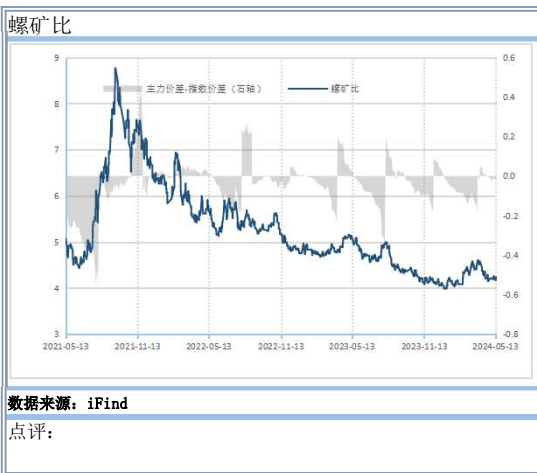
数据截止日： 2024-5-15

期内最小值： 3.9880

期内最大值： 8.7631

期内平均值： 5.2596

当前分位值： 5.18%



数据起始日: 2019-5-16

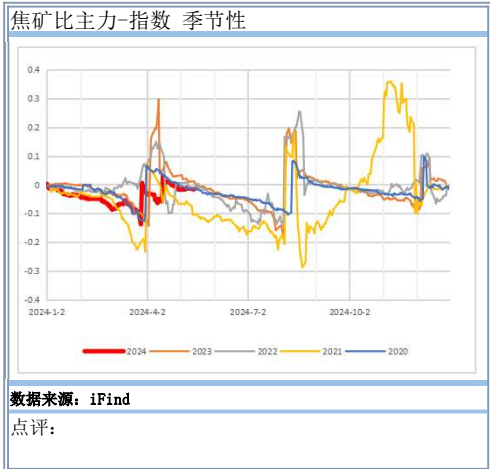
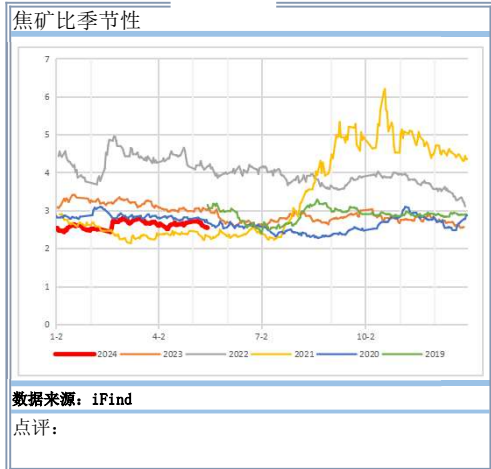
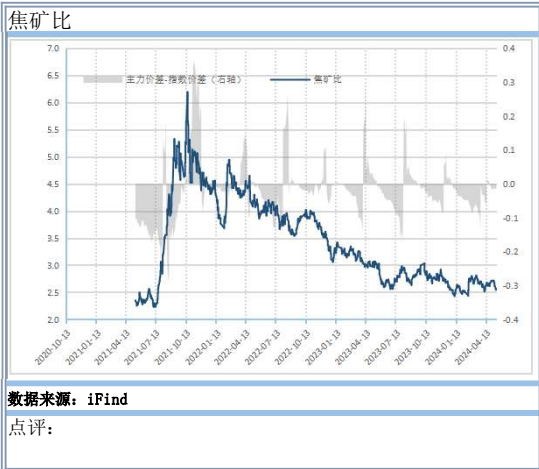
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 2.2287

期内最大值: 6.1947

期内平均值: 3.4341

当前分位值: 8.40%



数据起始日: 2019-5-16

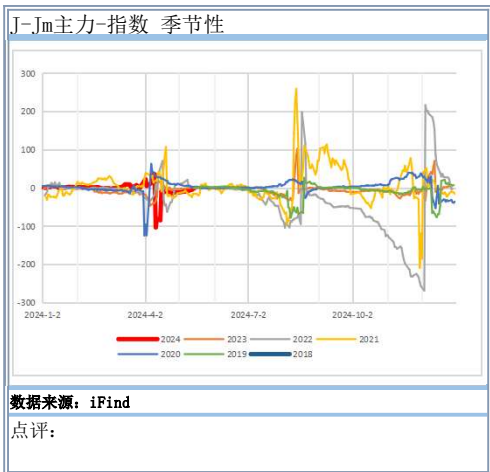
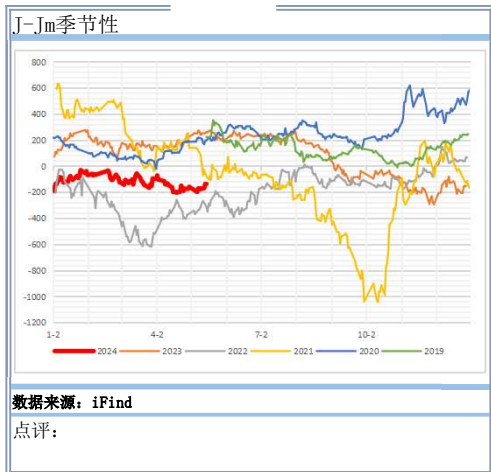
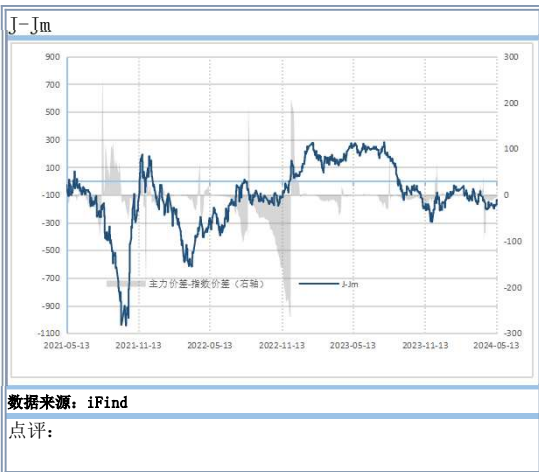
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: -1043.0800

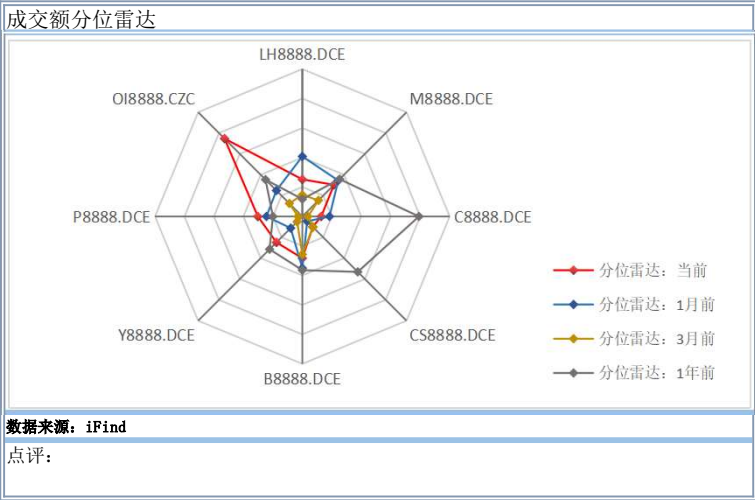
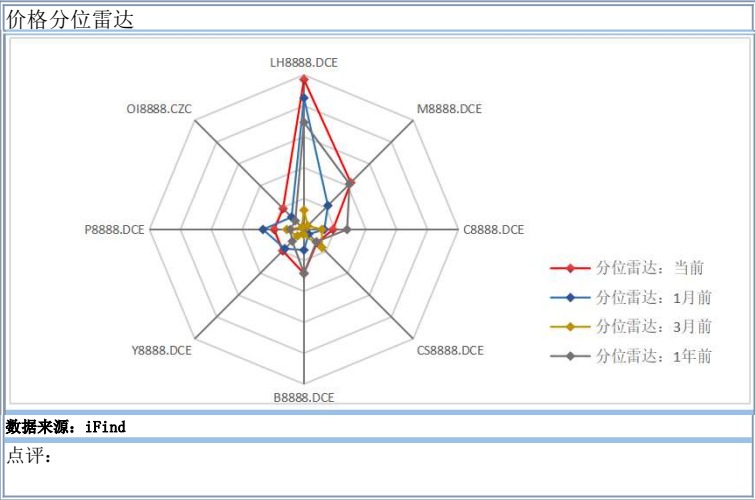
期内最大值: 279.1600

期内平均值: -99.9658

当前分位值: 68.14%



五、农产品相关



数据起始日: 2021-1-8

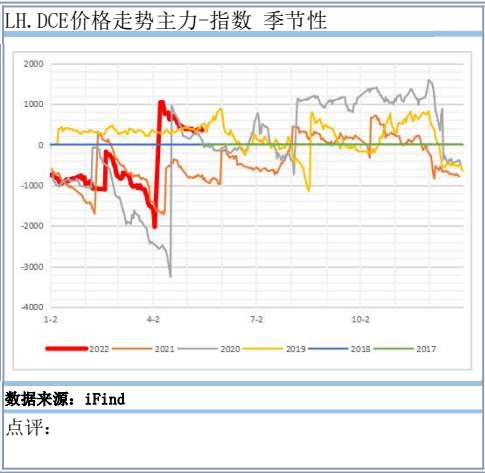
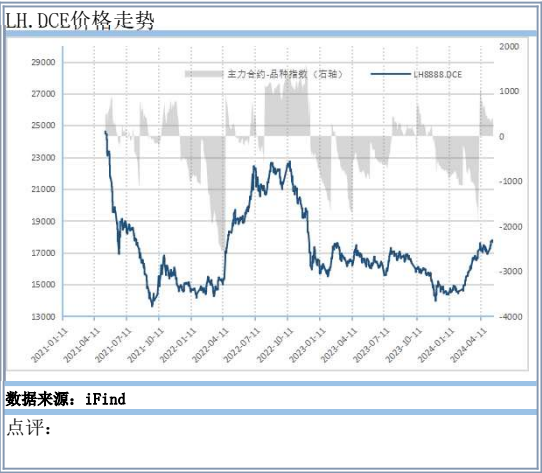
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 13971

期内最大值: 17776

期内平均值: 16116.9862

当前分位值: 97.00%



数据起始日： 2019-5-16

数据截止日： 2024-5-15

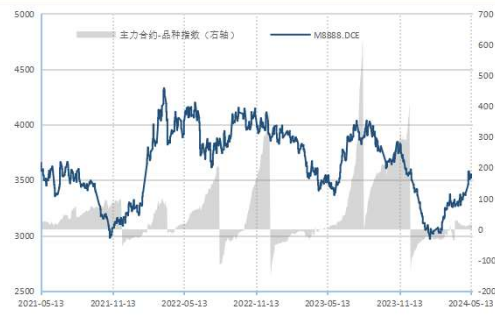
期内最小值： 2970

期内最大值： 4328

期内平均值： 3645.0878

当前分位值： 42.86%

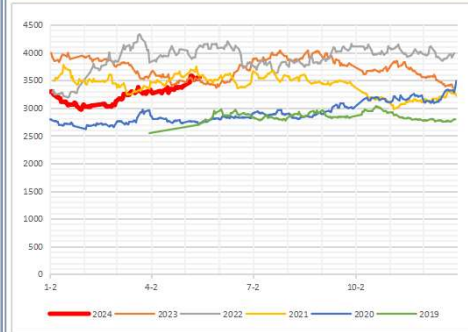
M. DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

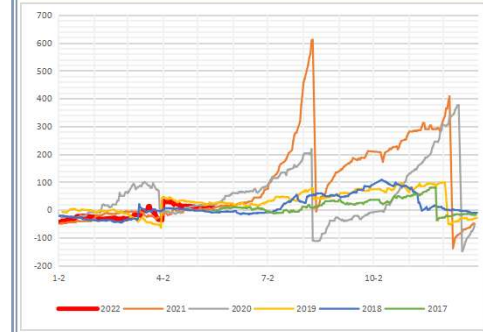
M. DCE价格走势季节性



数据来源：iFind

点评：

M. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源：iFind

点评：

数据起始日： 2019-5-16

数据截止日： 2024-5-15

期内最小值： 2328

期内最大值： 3027

期内平均值： 2674.5377

当前分位值： 18.74%

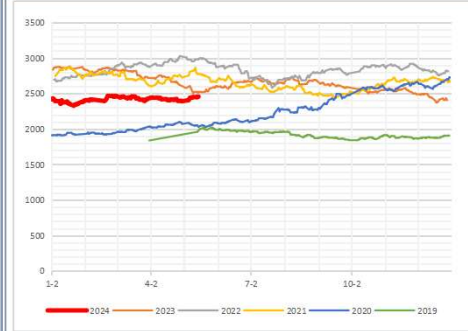
C. DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

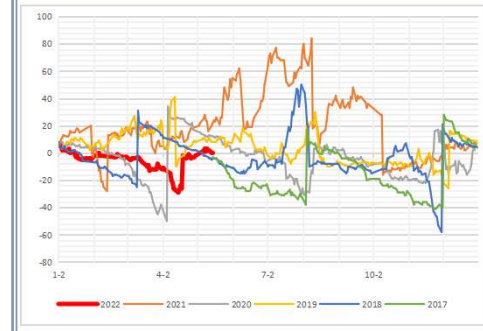
C. DCE价格走势季节性



数据来源：iFind

点评：

C. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源：iFind

点评：

数据起始日: 2019-5-16

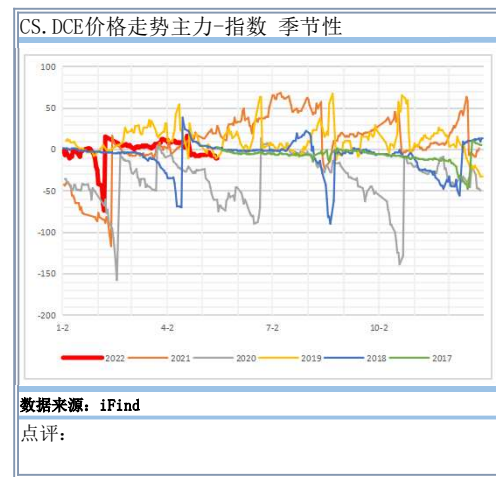
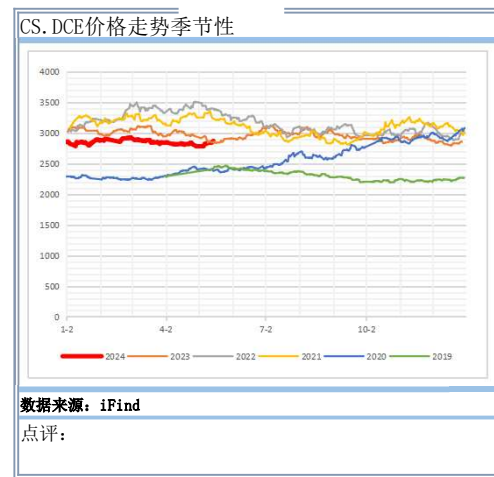
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 2784

期内最大值: 3512

期内平均值: 3033.1550

当前分位值: 11.95%



数据起始日: 2019-5-16

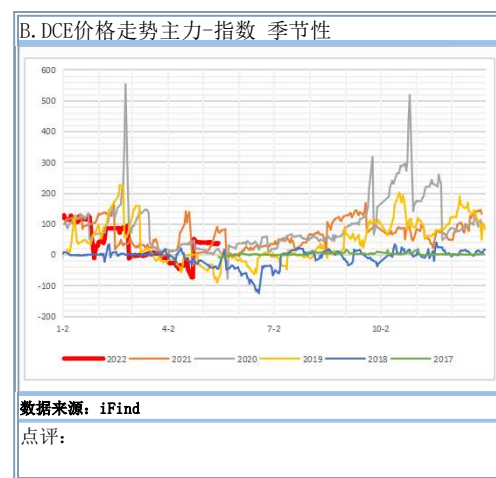
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 3487

期内最大值: 5585

期内平均值: 4529.9438

当前分位值: 28.46%



数据起始日： 2019-5-16

数据截止日： 2024-5-15

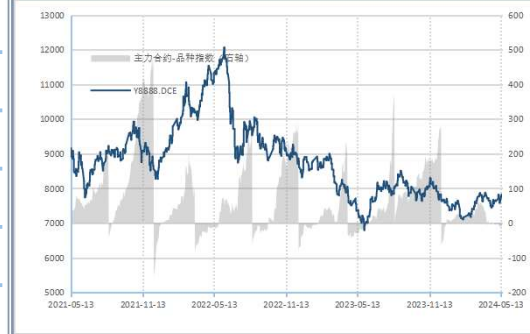
期内最小值： 6793

期内最大值： 12065

期内平均值： 8752.9561

当前分位值： 19.48%

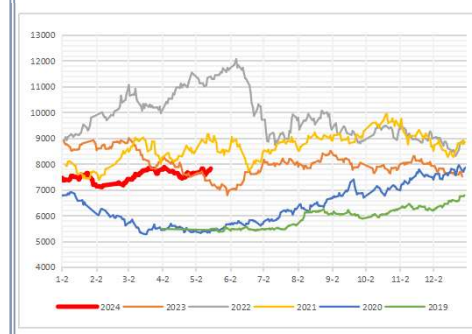
Y. DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

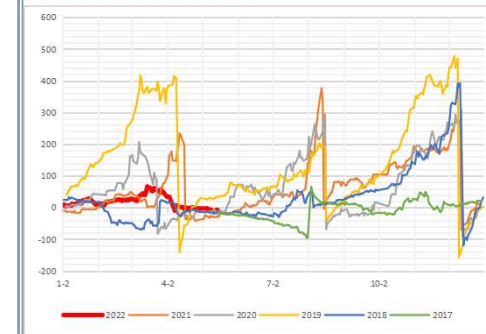
Y. DCE价格走势季节性



数据来源：iFind

点评：

Y. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源：iFind

点评：

数据起始日： 2019-5-16

数据截止日： 2024-5-15

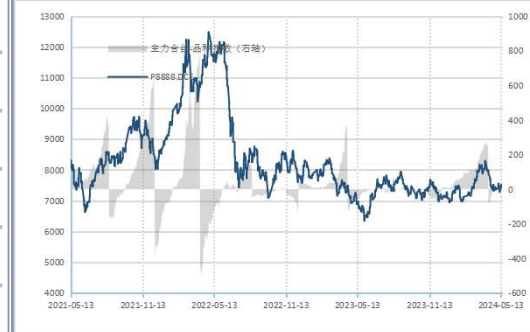
期内最小值： 6349

期内最大值： 12479

期内平均值： 8290.4225

当前分位值： 19.23%

P. DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

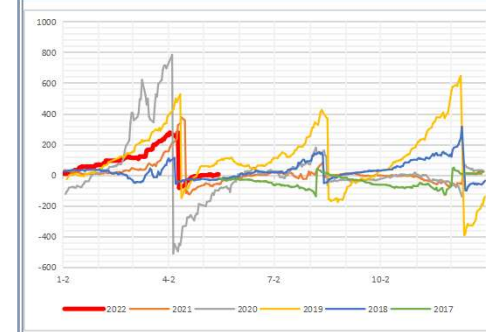
P. DCE价格走势季节性



数据来源：iFind

点评：

P. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源：iFind

点评：

数据起始日: 2019-5-16

数据截止日: 2024-5-15

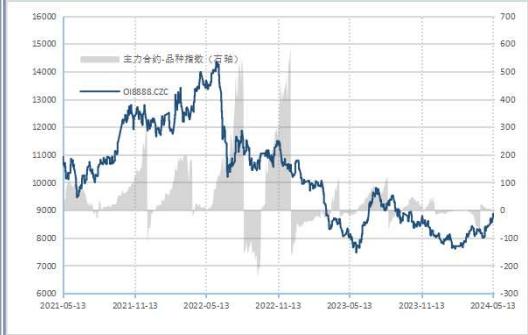
期内最小值: 7475

期内最大值: 14344

期内平均值: 10271.5528

当前分位值: 19.14%

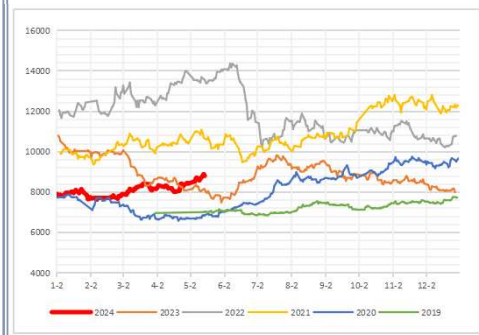
OI.CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

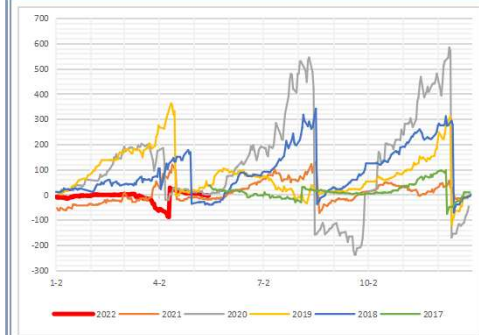
OI.CZCE价格走势季节性



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: 2022-2-9

数据截止日: 2024-5-15

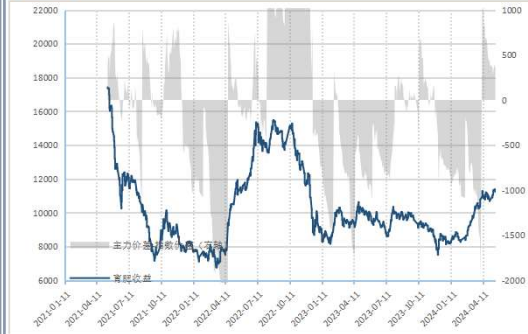
期内最小值: 7508.2500

期内最大值: 11384.2500

期内平均值: 9476.8940

当前分位值: 96.31%

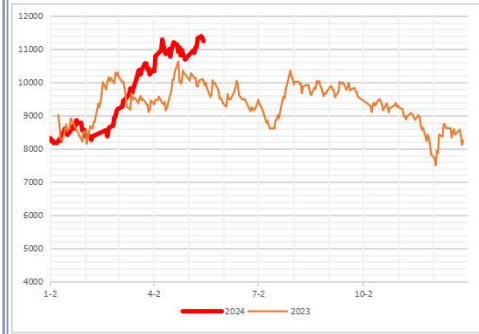
育肥收益



数据来源: iFind

点评:

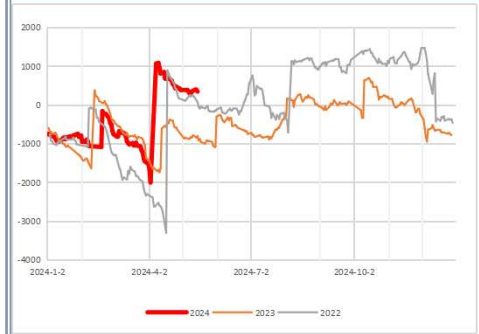
育肥收益季节性



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

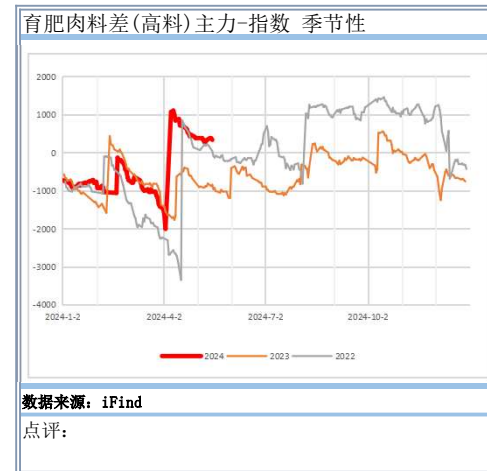
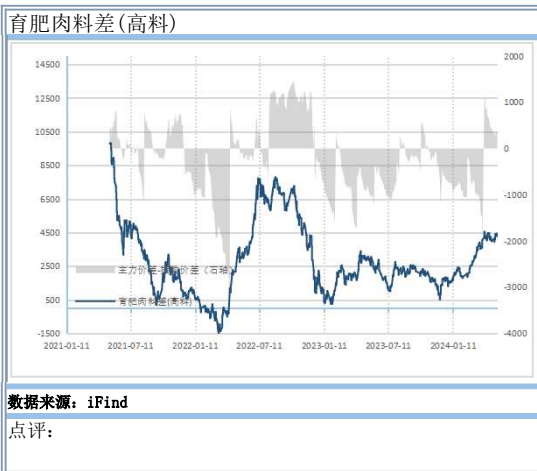
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 515.0000

期内最大值: 4545.0000

期内平均值: 2339.1000

当前分位值: 93.28%



数据起始日: 2019-5-16

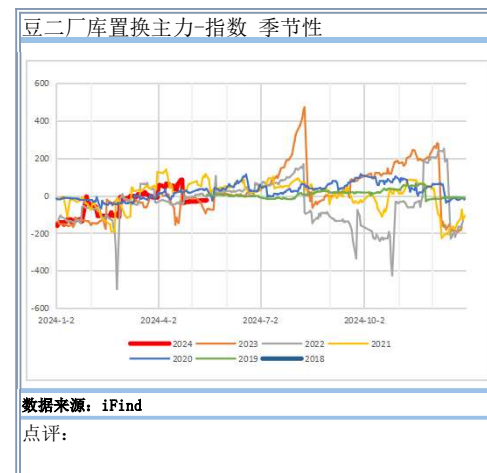
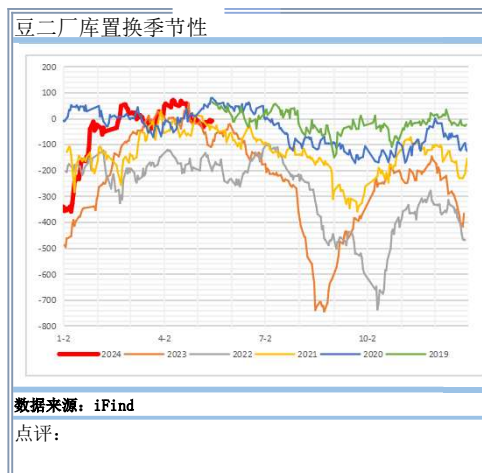
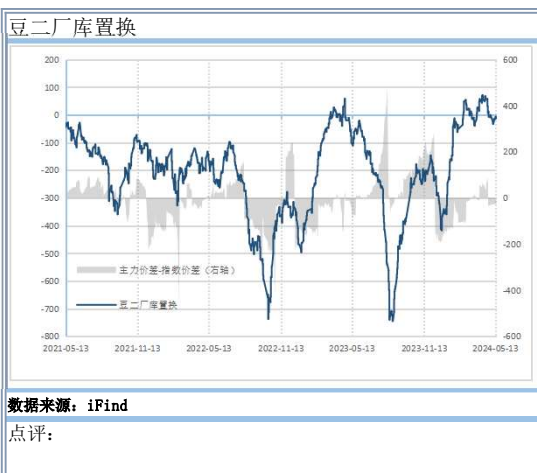
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: -745.0200

期内最大值: 71.2200

期内平均值: -209.2530

当前分位值: 90.17%



数据起始日: 2019-5-16

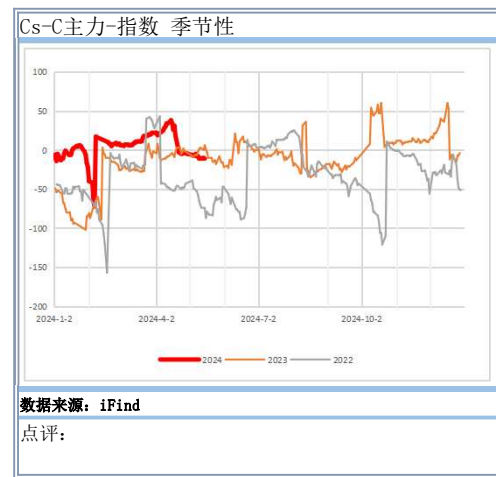
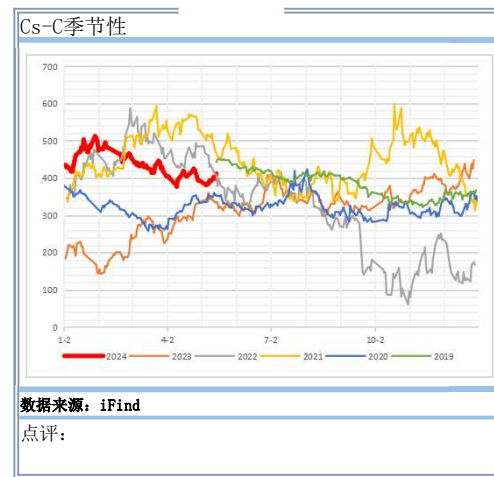
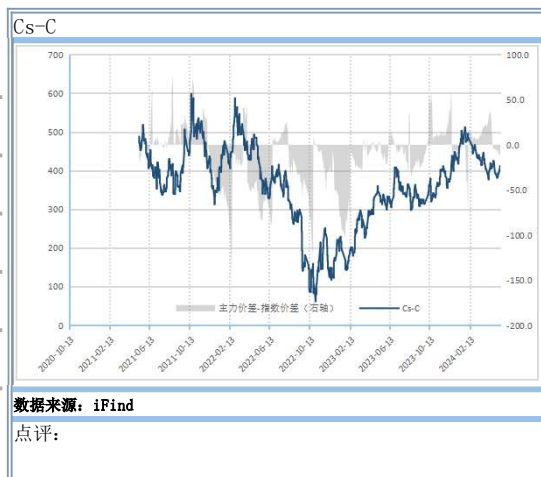
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: 62.0000

期内最大值: 598.0000

期内平均值: 358.6173

当前分位值: 65.30%



数据起始日: 2019-5-16

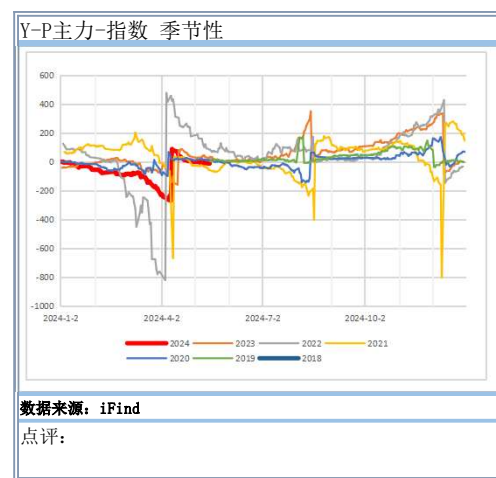
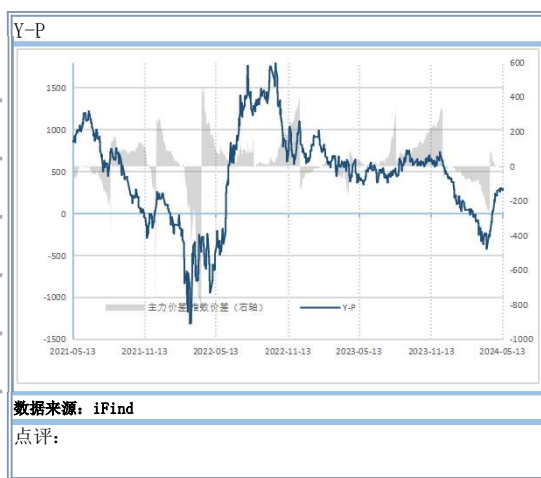
数据截止日: 2024-5-15

期内最小值: -1313.0000

期内最大值: 1788.0000

期内平均值: 462.5336

当前分位值: 51.76%



数据起始日： 2019-5-16

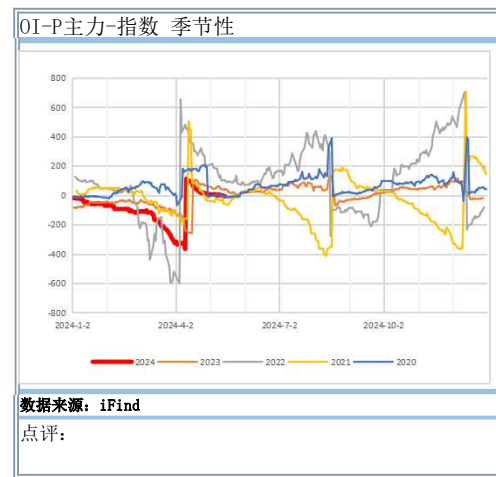
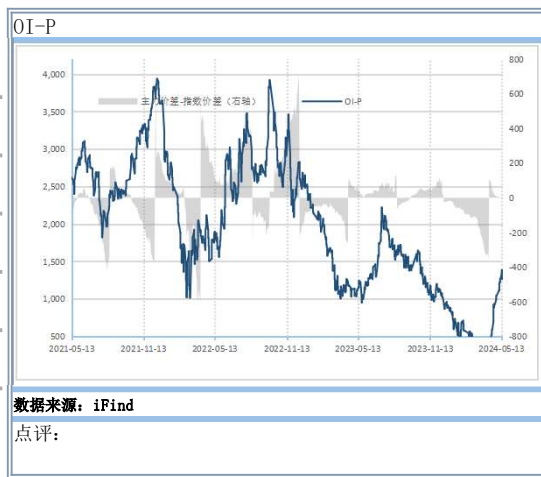
数据截止日： 2024-5-15

期内最小值： 19.0000

期内最大值： 2825.0000

期内平均值： 1320.8697

当前分位值： 44.30%



免责声明

本报告由山金期货研究部制作，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。