

<http://www.shanqingh.com>

# 盘面套利观察

2024年5月21日

制作：曹有明

投资咨询： Z0013162

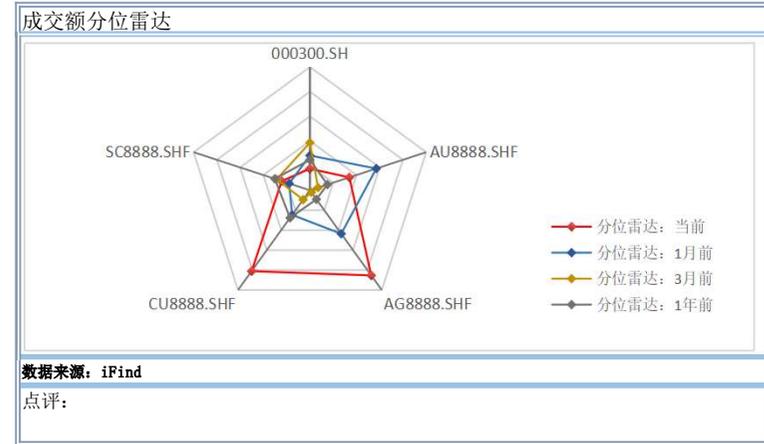
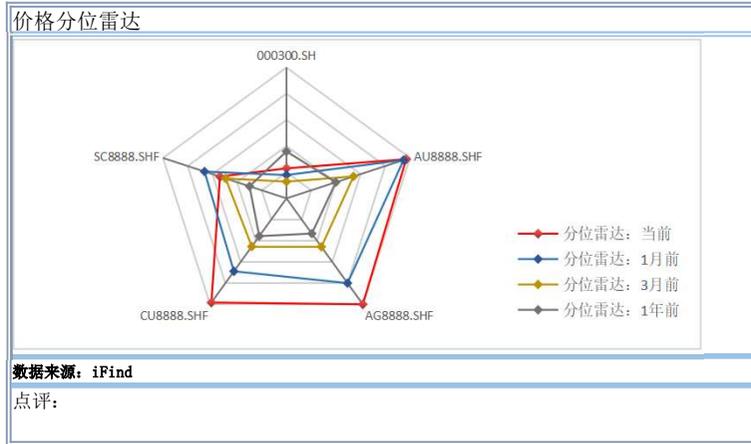
邮箱： caoyouming@sd-gold.com

数据仅供参考，据此入市，风险自担。

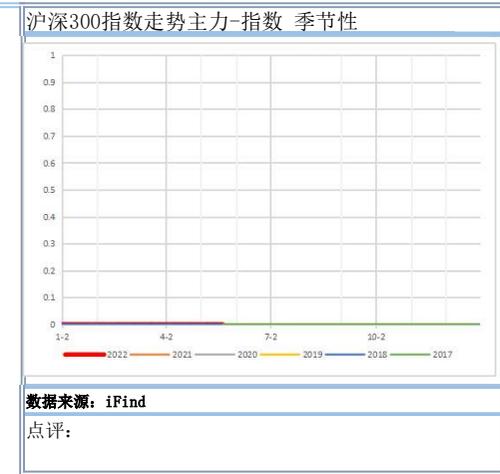
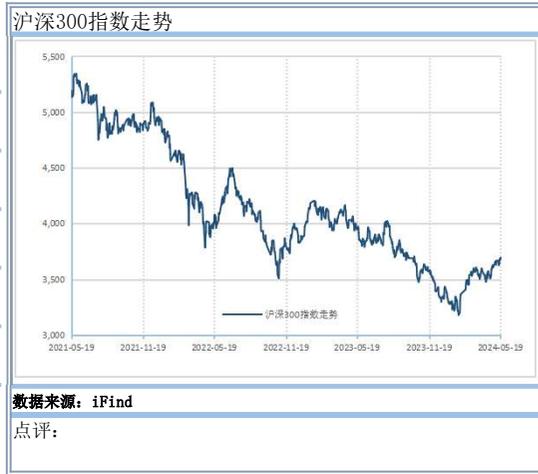
说明：

- 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: 2019-5-22  
数据截止日: 2024-5-21  
期内最小值: 3179.6276  
期内最大值: 5341.6798  
期内平均值: 4139.3664  
当前分位值: 12.82%



数据起始日: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: 363.2

期内最大值: 580.29

期内平均值: 423.6282

当前分位值: 96.96%

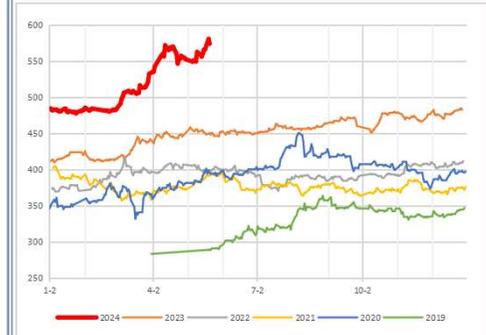
Au. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

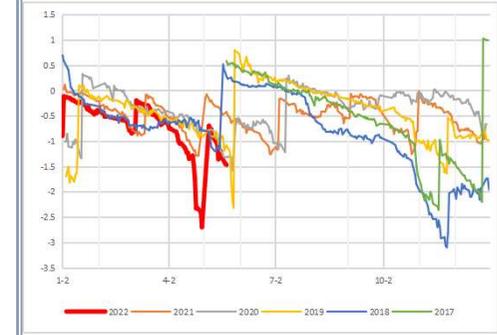
Au. SHFE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

Au. SHFE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: 53367

期内最大值: 87697

期内平均值: 68602.2701

当前分位值: 98.35%

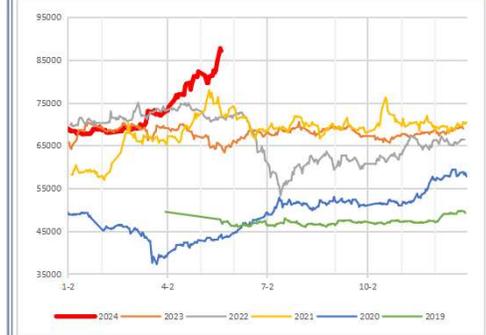
Cu. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

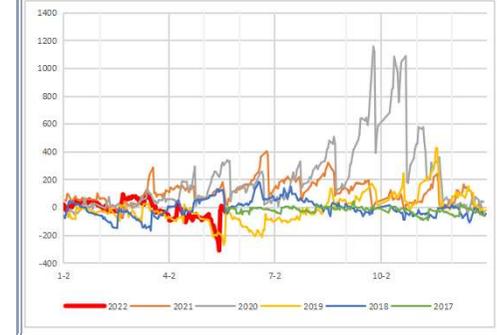
Cu. SHFE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

Cu. SHFE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日： 2019-5-22

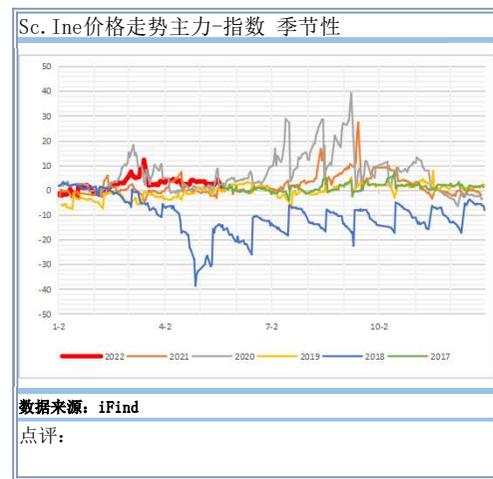
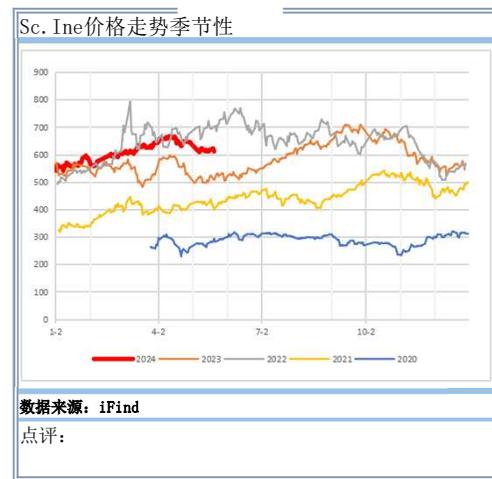
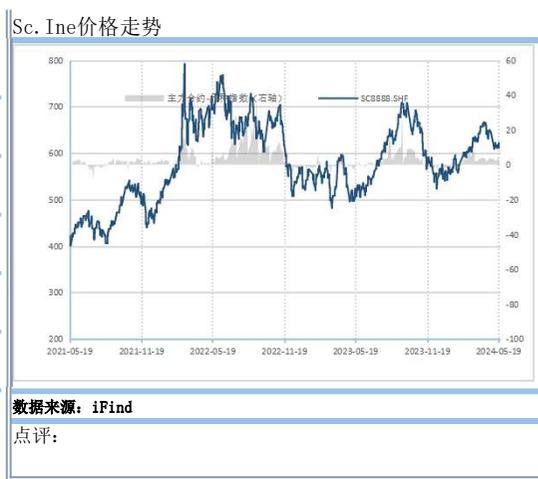
数据截止日： 2024-5-21

期内最小值： 400.6

期内最大值： 791.6

期内平均值： 579.5774

当前分位值： 53.86%



数据起始日： 2019-5-22

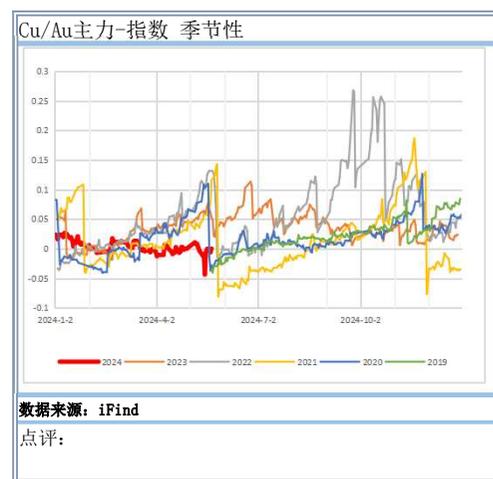
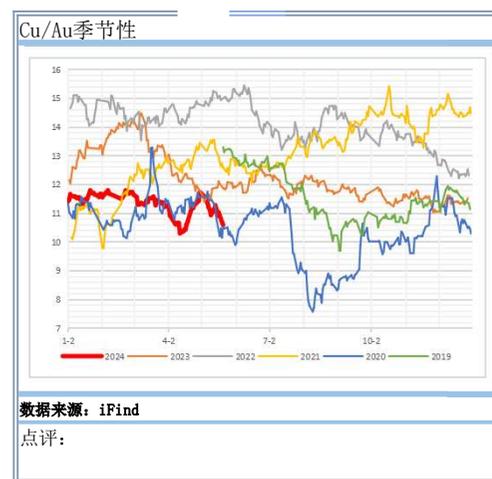
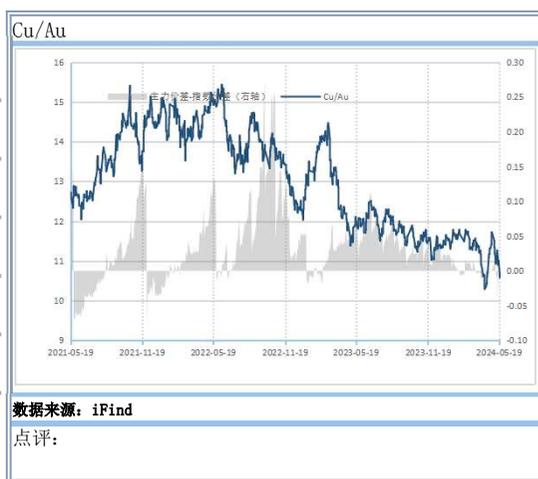
数据截止日： 2024-5-21

期内最小值： 10.2923

期内最大值： 15.4319

期内平均值： 13.0172

当前分位值： 5.61%



数据起始日: 2019-5-22

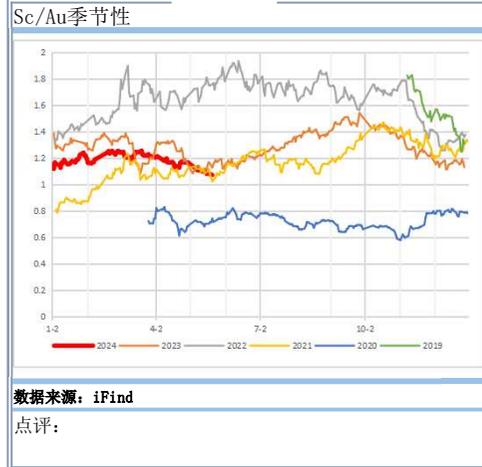
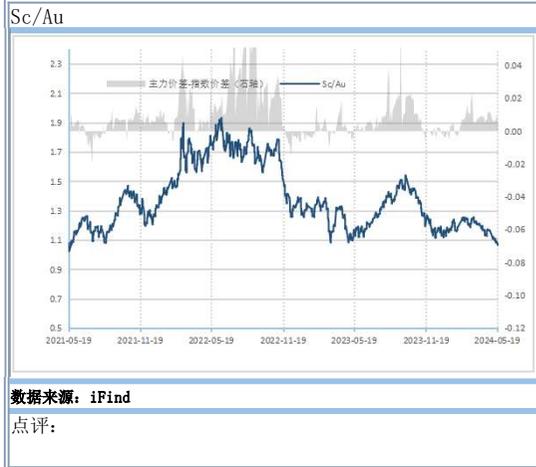
数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: 1.0233

期内最大值: 1.9320

期内平均值: 1.3787

当前分位值: 4.63%



数据起始日: 2019-5-22

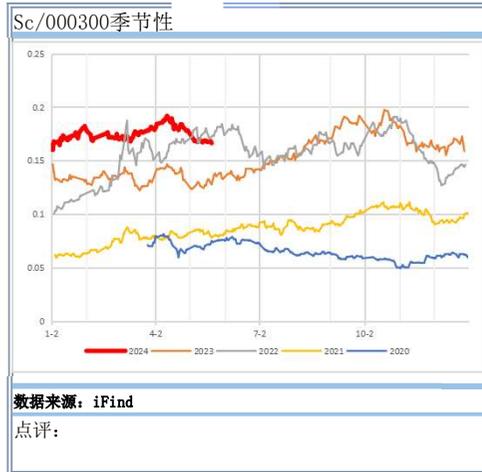
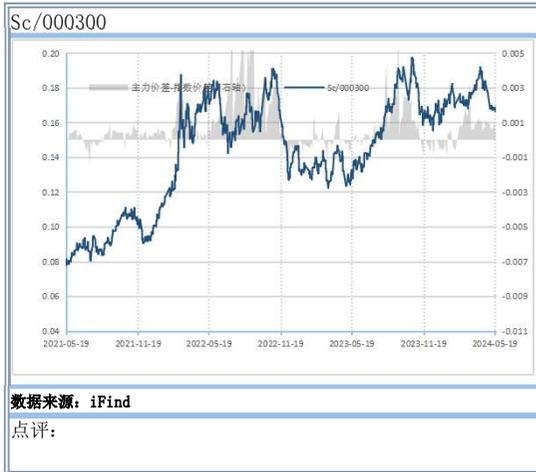
数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: 0.0780

期内最大值: 0.1972

期内平均值: 0.1437

当前分位值: 74.05%



数据起始日: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: 0.0665

期内最大值: 0.0932

期内平均值: 0.0798

当前分位值: 12.01%



数据起始日: 2019-5-22

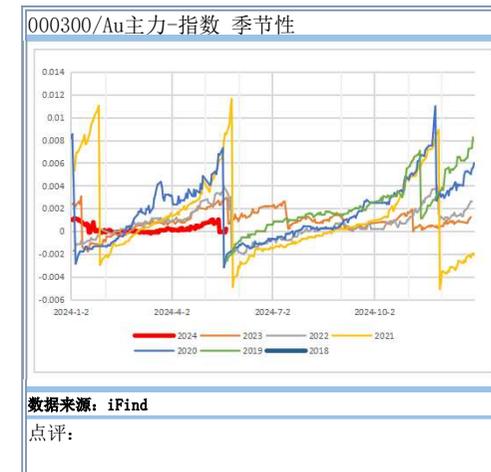
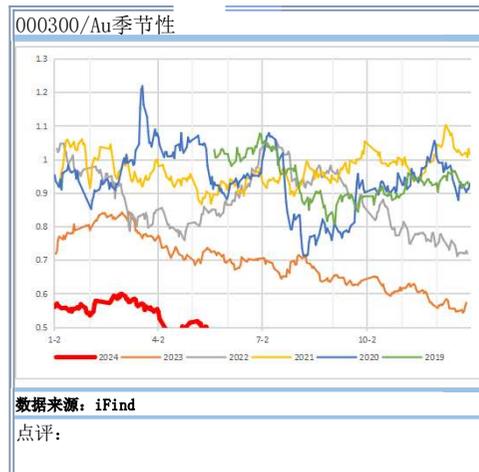
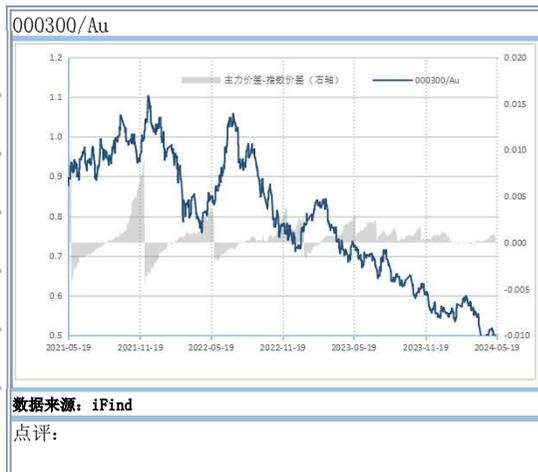
数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: 0.4464

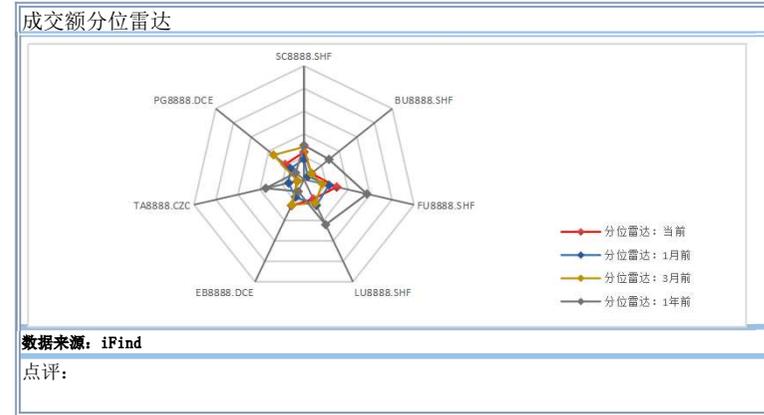
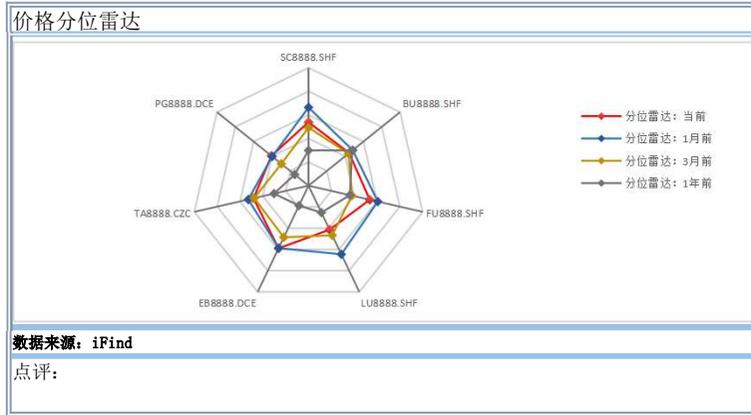
期内最大值: 1.1021

期内平均值: 0.7939

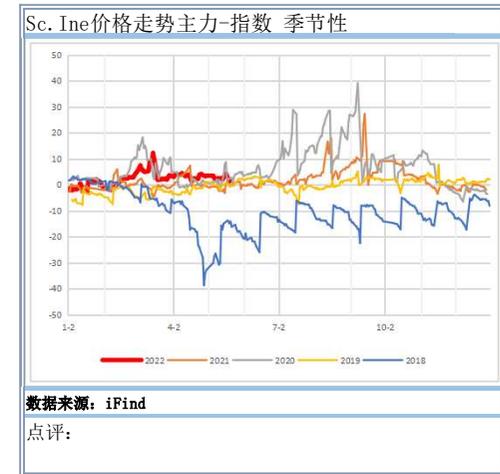
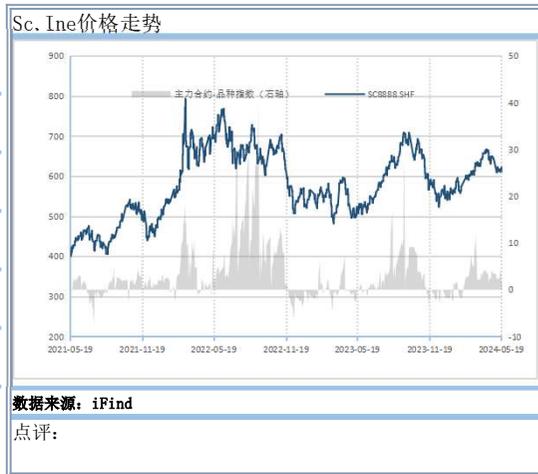
当前分位值: 0.00%



## 二、原油相关



数据起始日: 2019-5-22  
 数据截止日: 2024-5-21  
 期内最小值: 400.6  
 期内最大值: 791.6  
 期内平均值: 579.5774  
 当前分位值: 53.86%



数据起始日： 2019-5-22

数据截止日： 2024-5-21

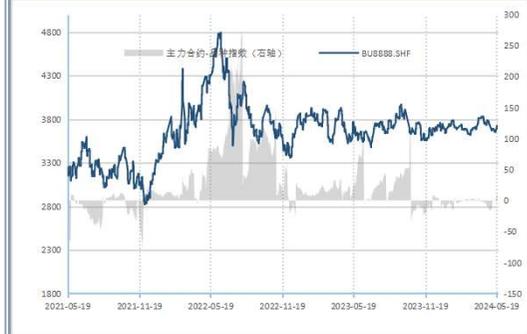
期内最小值： 2821

期内最大值： 4794

期内平均值： 3650.2743

当前分位值： 44.40%

Bu. SHFE价格走势



数据来源： iFind

点评：

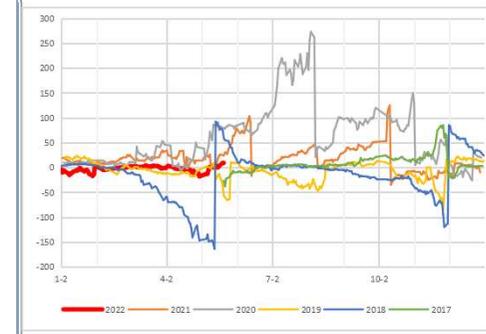
Bu. SHFE价格走势季节性



数据来源： iFind

点评：

Bu. SHFE价格走势主力-指数 季节性



数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2019-5-22

数据截止日： 2024-5-21

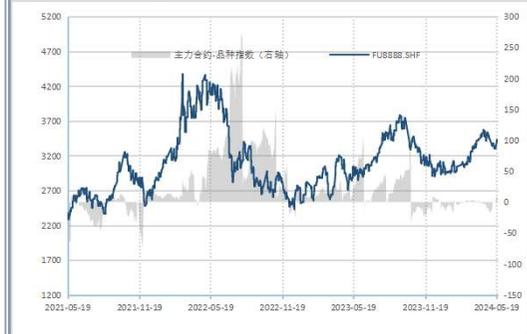
期内最小值： 2284

期内最大值： 4371

期内平均值： 3093.1412

当前分位值： 53.62%

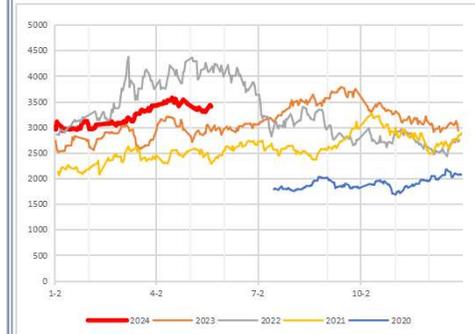
Fu. SHFE价格走势



数据来源： iFind

点评：

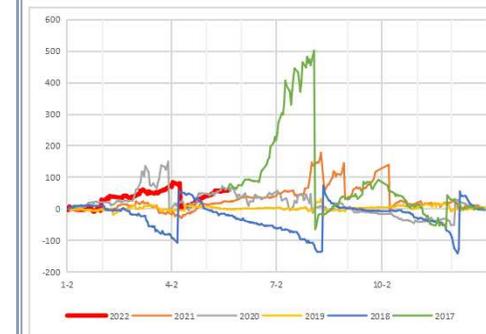
Fu. SHFE价格走势季节性



数据来源： iFind

点评：

Fu. SHFE价格走势主力-指数 季节性



数据来源： iFind

点评：

数据起始日: 2020-6-22

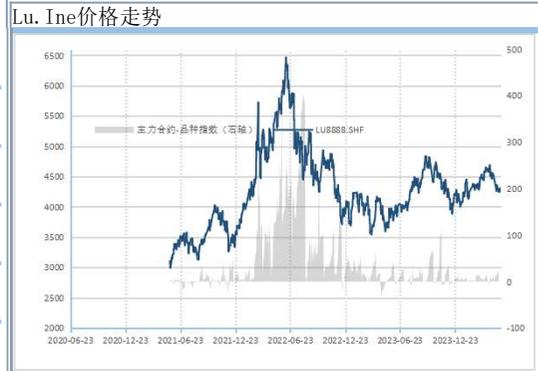
数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: 3544

期内最大值: 5239

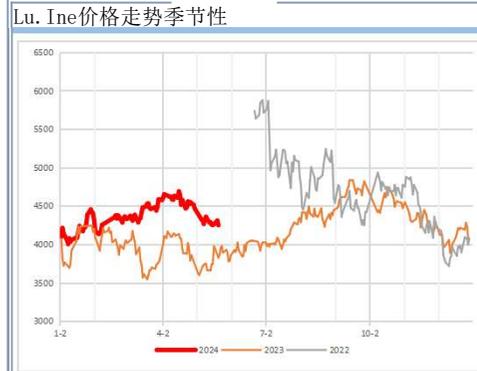
期内平均值: 4262.8800

当前分位值: 41.47%



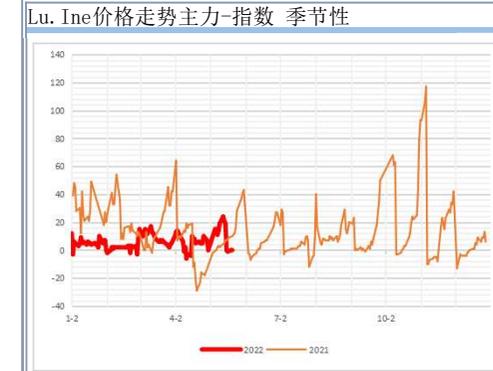
数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-9-26

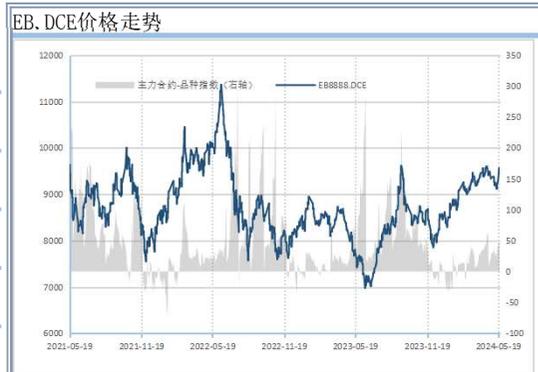
数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: 6978

期内最大值: 11361

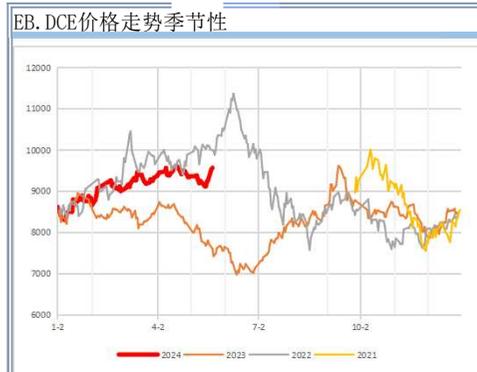
期内平均值: 8676.3328

当前分位值: 59.00%



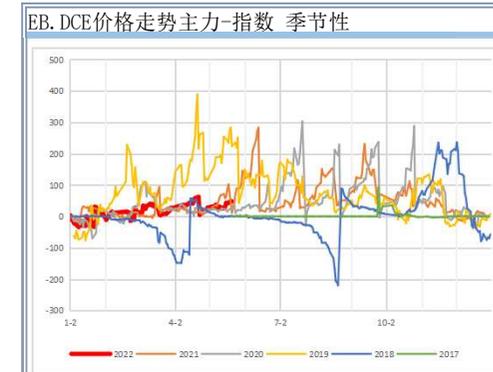
数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-5-22

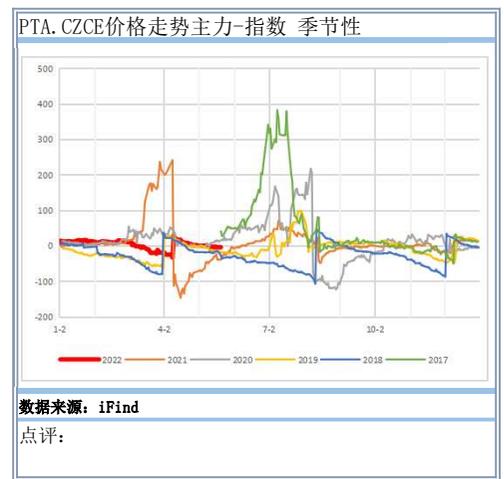
数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: 4462

期内最大值: 7488

期内平均值: 5623.4664

当前分位值: 48.15%



数据起始日: 2020-3-30

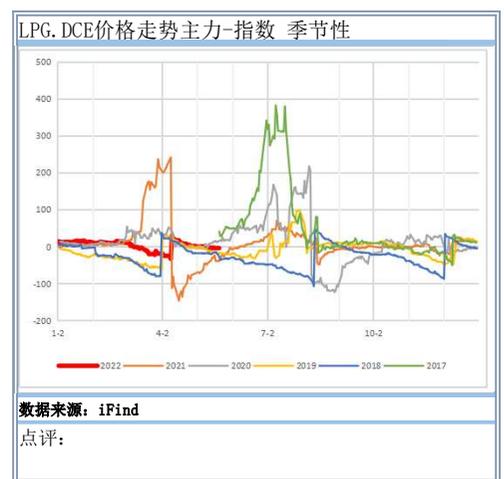
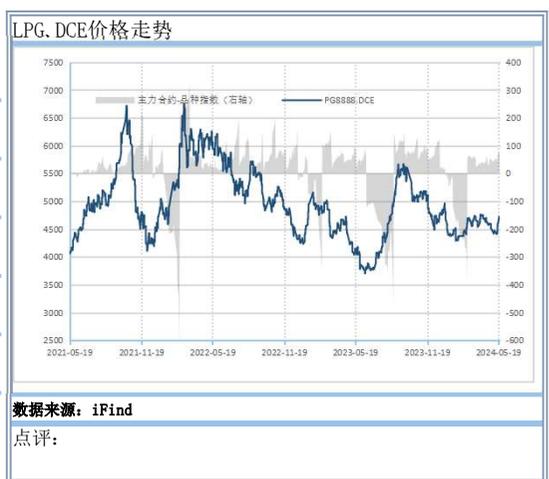
数据截止日: 2024-5-21

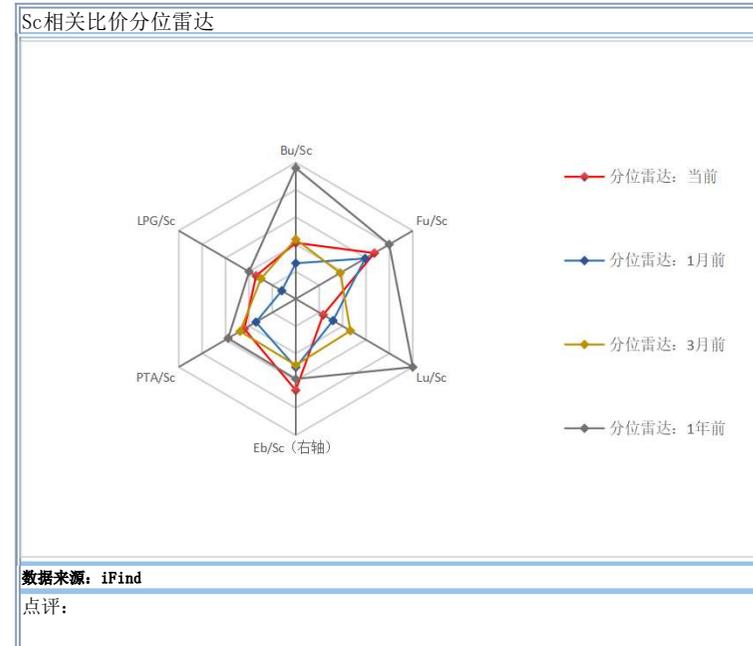
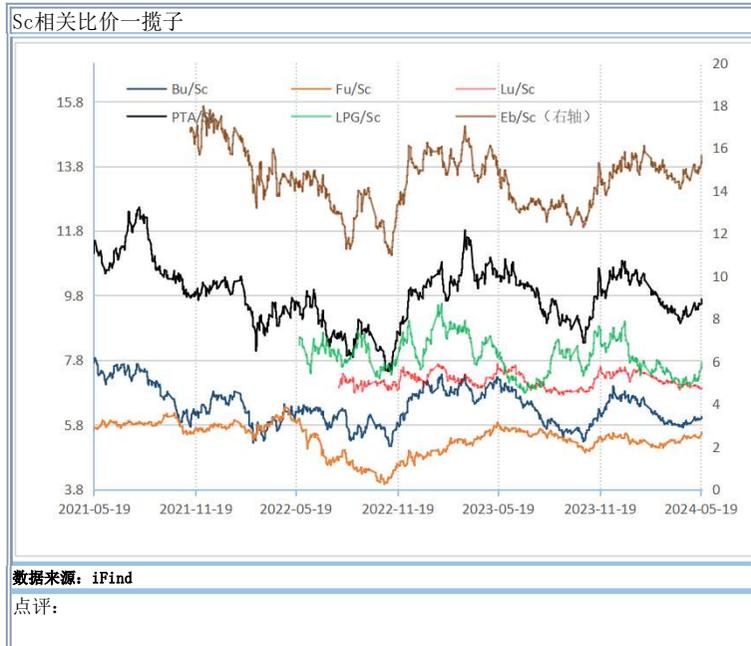
期内最小值: 3704

期内最大值: 6209

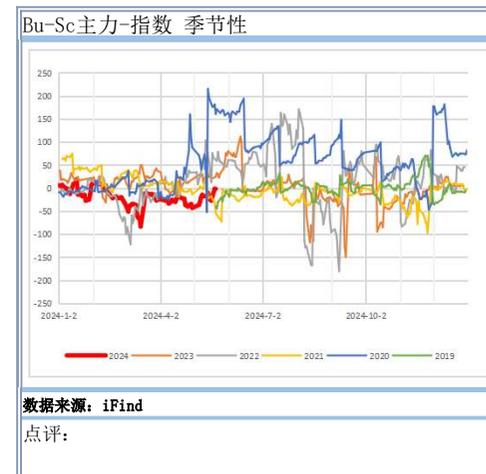
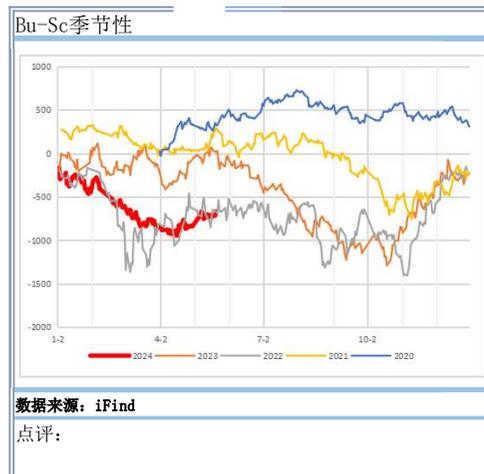
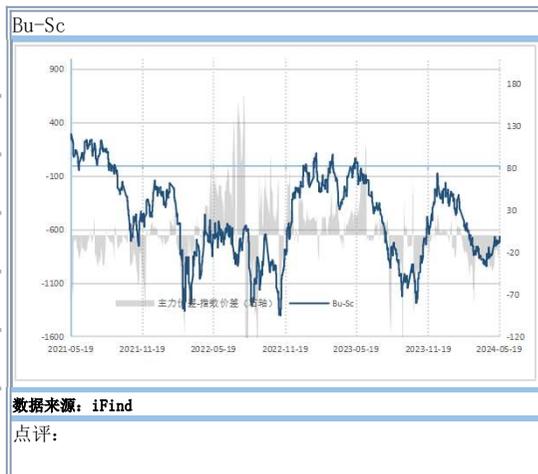
期内平均值: 4799.5166

当前分位值: 40.52%





数据起始日: 2019-5-22  
 数据截止日: 2024-5-21  
 期内最小值: -1406.4286  
 期内最大值: 289.5714  
 期内平均值: -489.5640  
 当前分位值: 43.50%



数据起始日: 2019-5-22

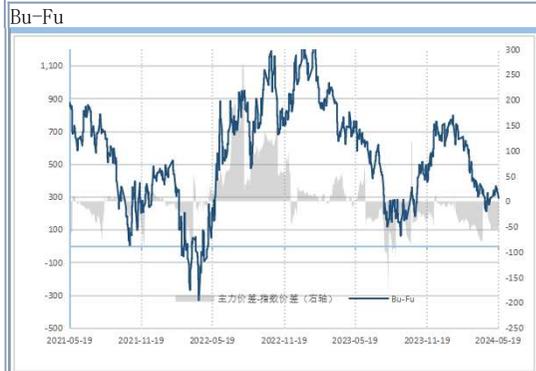
数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: -331.0000

期内最大值: 1284.0000

期内平均值: 557.1332

当前分位值: 38.70%



数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2021-9-29

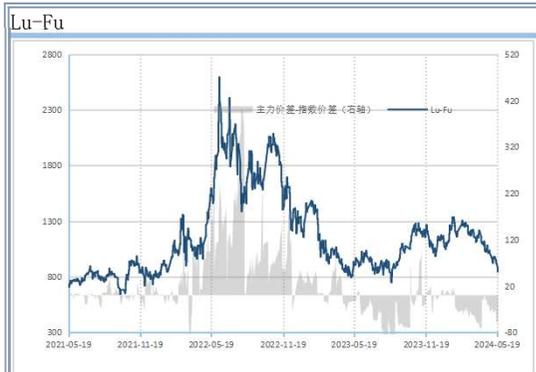
数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: 749.0000

期内最大值: 2085.0000

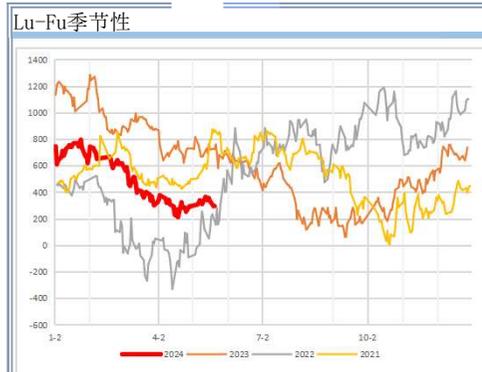
期内平均值: 1202.3600

当前分位值: 7.11%



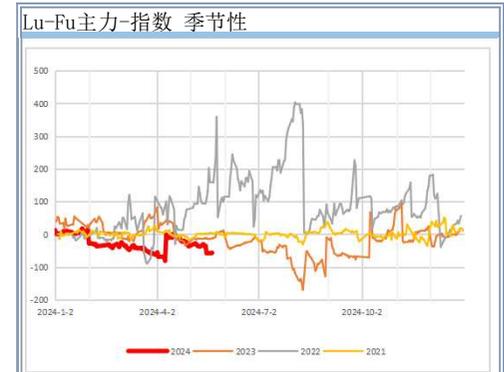
数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

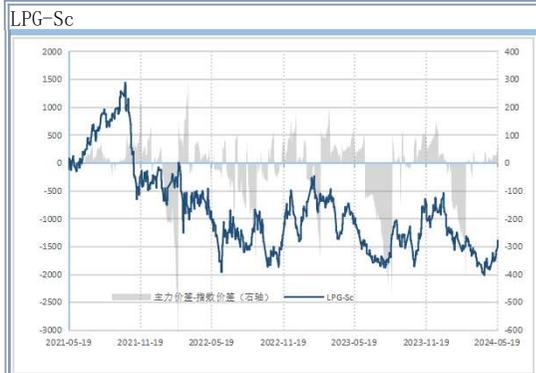
点评:



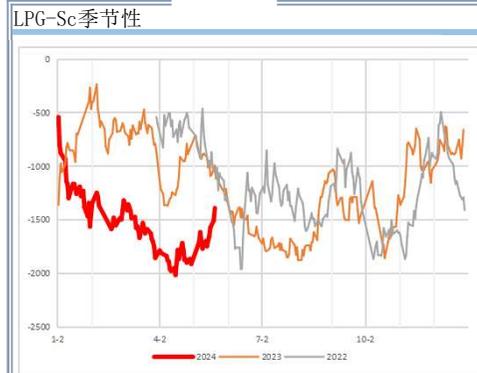
数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2021-8-4  
 数据截止日: 2024-5-21  
 期内最小值: -2017.0000  
 期内最大值: -240.0000  
 期内平均值: -1269.9481  
 当前分位值: 35.12%



数据来源: iFind  
 点评:

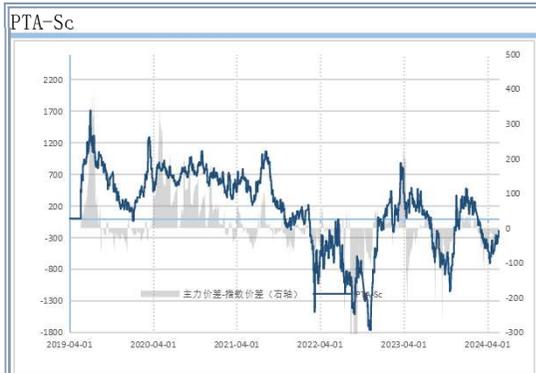


数据来源: iFind  
 点评:

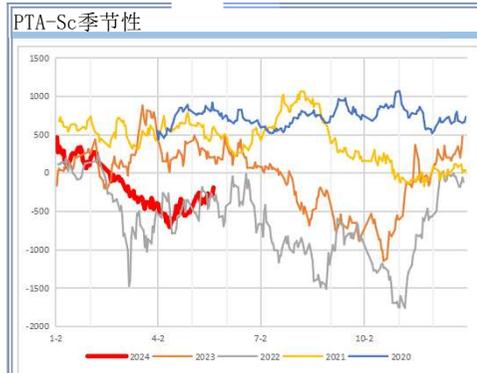


数据来源: iFind  
 点评:

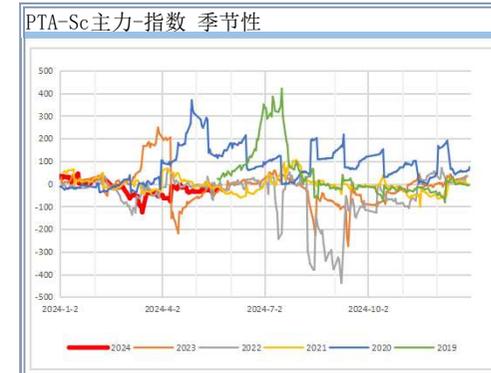
数据起始日: 2019-5-22  
 数据截止日: 2024-5-21  
 期内最小值: -1762.0000  
 期内最大值: 1061.0000  
 期内平均值: -172.3073  
 当前分位值: 55.58%



数据来源: iFind  
 点评:



数据来源: iFind  
 点评:



数据来源: iFind  
 点评:

数据起始日: 2021-4-6

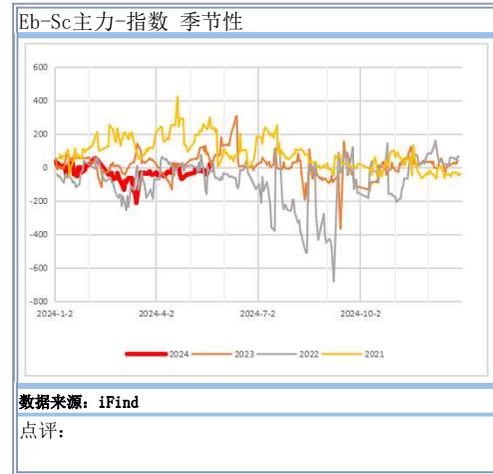
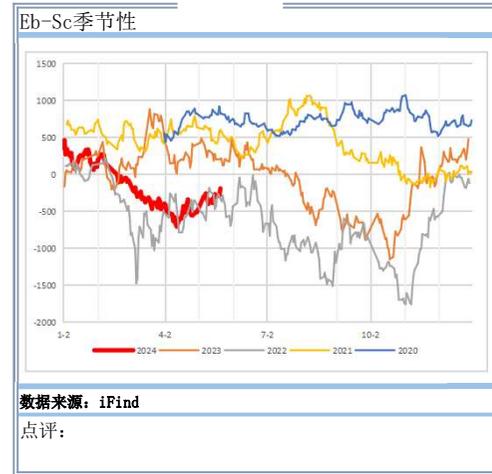
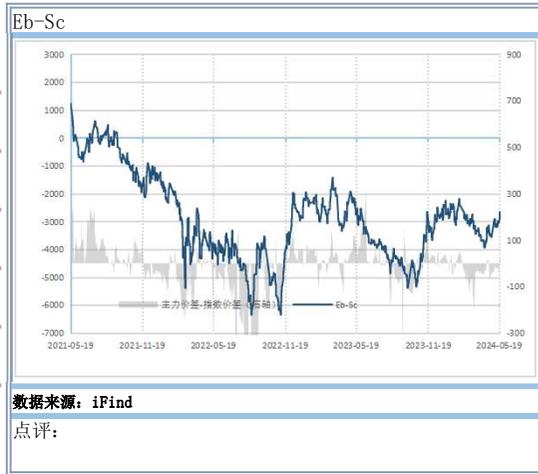
数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: -6347.0000

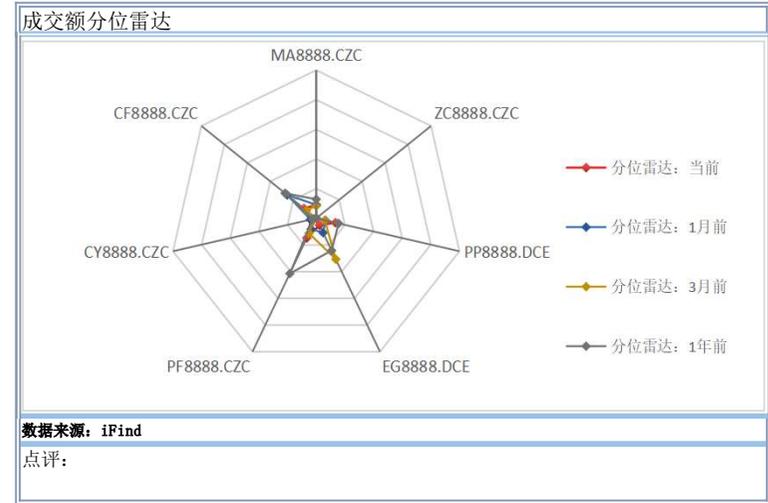
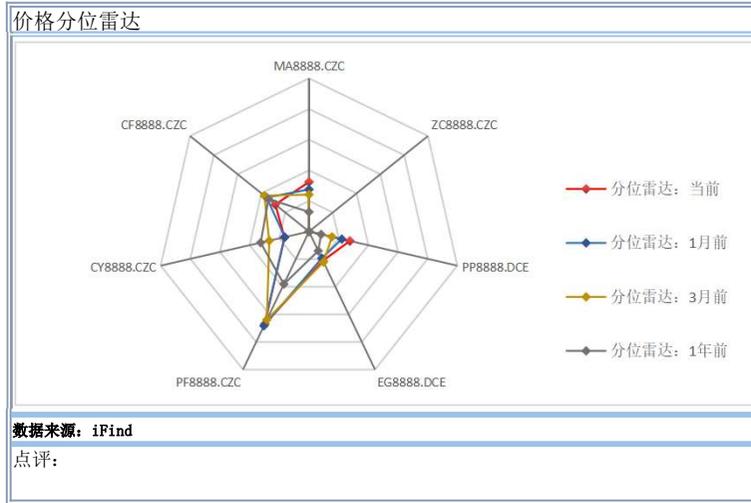
期内最大值: -910.0000

期内平均值: -3404.5557

当前分位值: 67.81%



三、煤化工相关



数据起始日: 2019-5-22

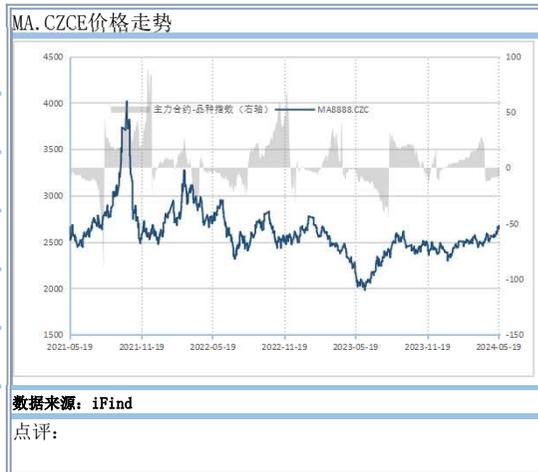
数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: 1982

期内最大值: 4015

期内平均值: 2593.0069

当前分位值: 32.37%



数据起始日: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: 6865

期内最大值: 10224

期内平均值: 7964.7737

当前分位值: 27.60%

PP. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

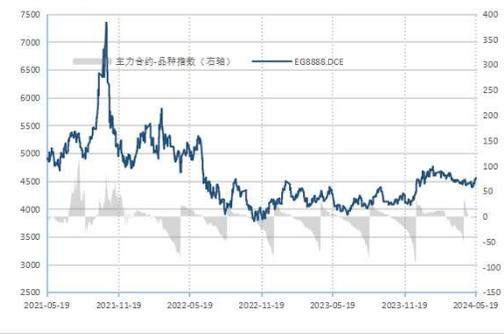
期内最小值: 3778

期内最大值: 7345

期内平均值: 4594.4362

当前分位值: 21.11%

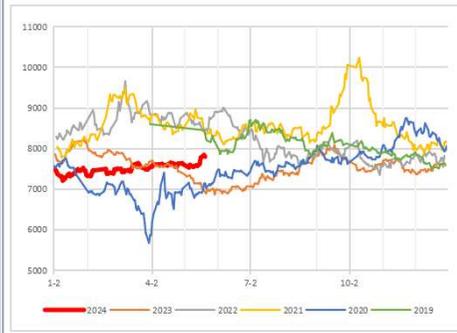
EG. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

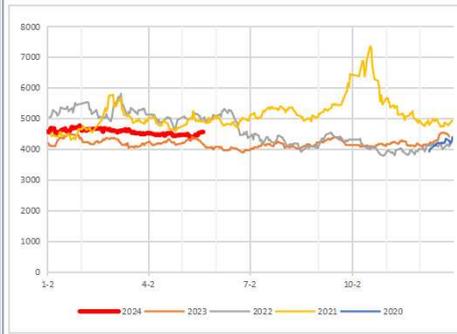
PP. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

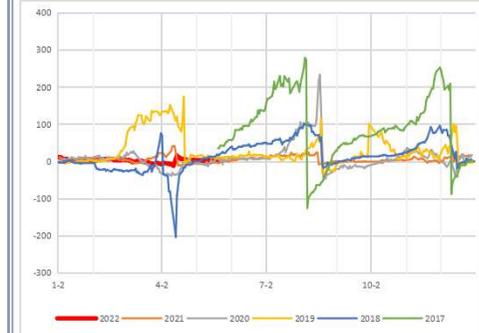
EG. CZCE价格走势季节性



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:

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: 2024-5-21

期内最小值: 6477

期内最大值: 7907

期内平均值: 7310.5382

当前分位值: 66.85%

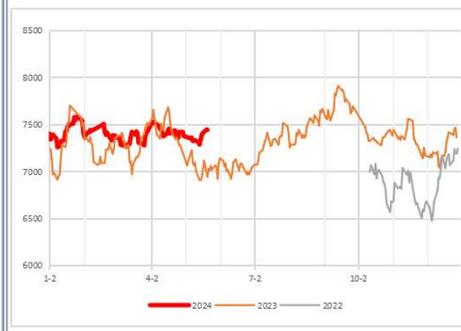
PF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

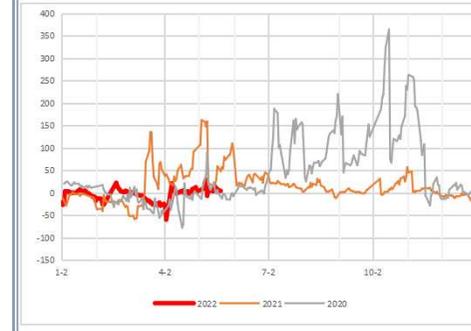
PF. CZCE价格走势季节性



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: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

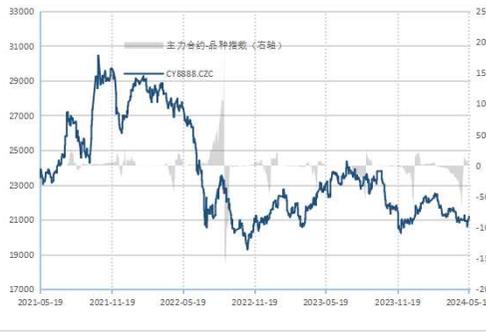
期内最小值: 19292

期内最大值: 30443

期内平均值: 23746.8093

当前分位值: 16.55%

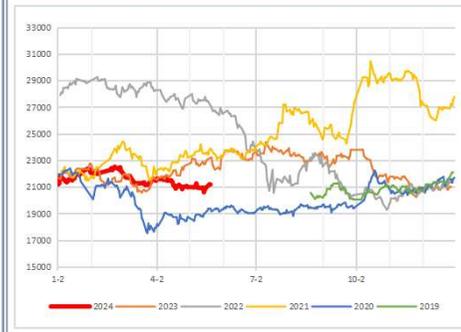
CY. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

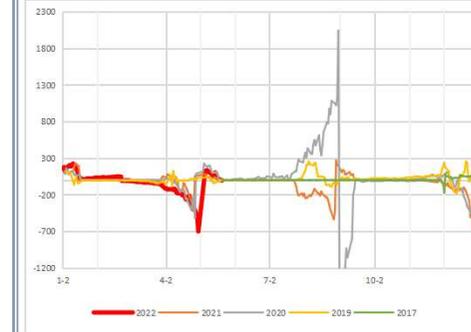
CY. CZCE价格走势季节性



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: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

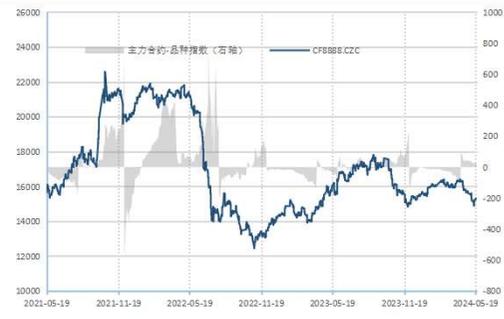
期内最小值: 12447

期内最大值: 22574

期内平均值: 16902.5926

当前分位值: 28.36%

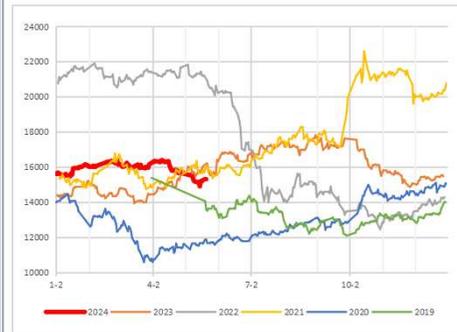
CF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

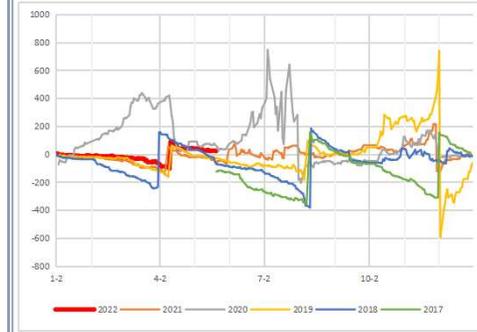
CF. CZCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

CF. CZCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

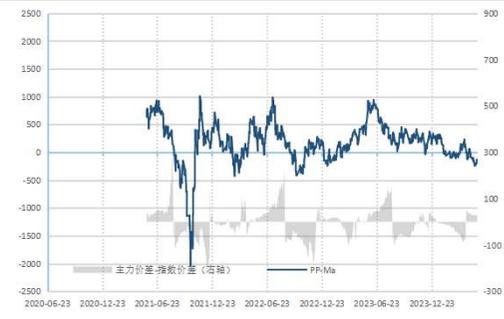
期内最小值: -2039.0000

期内最大值: 1007.0000

期内平均值: 185.7531

当前分位值: 62.74%

PP-Ma



数据来源: iFind

点评:

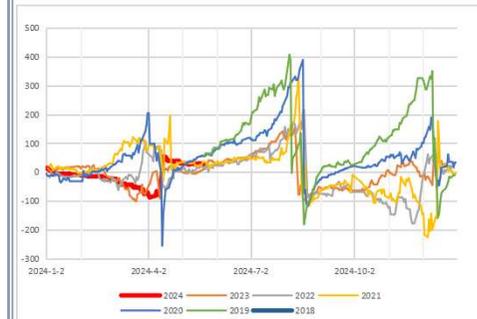
PP-Ma季节性



数据来源: iFind

点评:

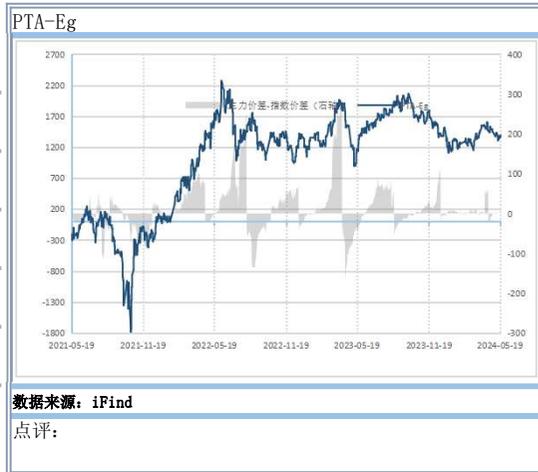
PP-Ma主力-指数 季节性



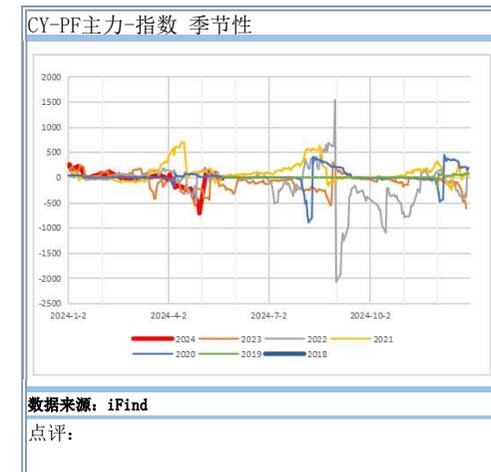
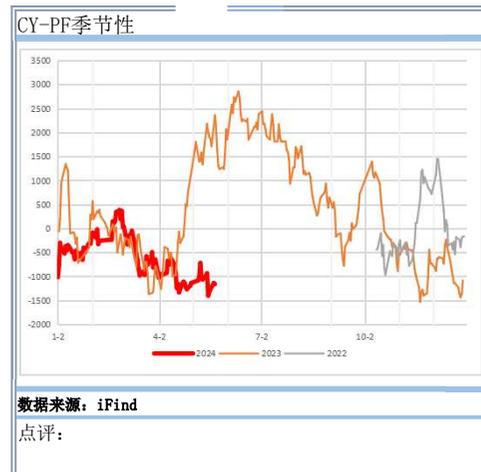
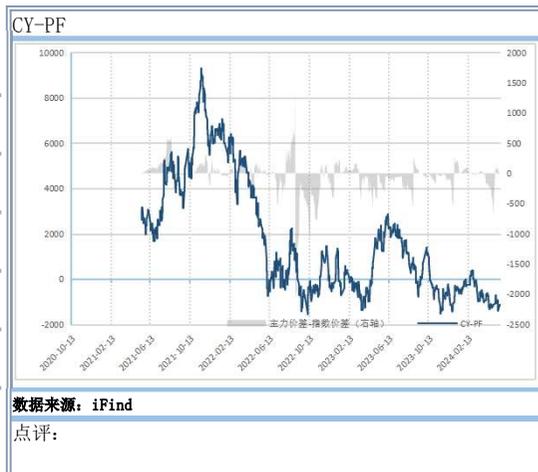
数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-5-22  
 数据截止日: 2024-5-21  
 期内最小值: -1783.0000  
 期内最大值: 2269.0000  
 期内平均值: 1029.0302  
 当前分位值: 78.26%



数据起始日: 2021-12-10  
 数据截止日: 2024-5-21  
 期内最小值: -1533.0000  
 期内最大值: 2854.0000  
 期内平均值: 125.5297  
 当前分位值: 8.48%



数据起始日: 2022-12-2

数据截止日: 2024-5-21

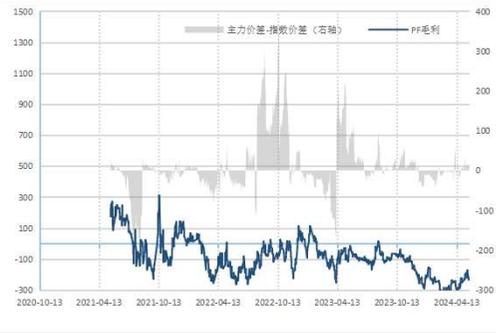
期内最小值: -328.9900

期内最大值: 112.9900

期内平均值: -128.8184

当前分位值: 23.39%

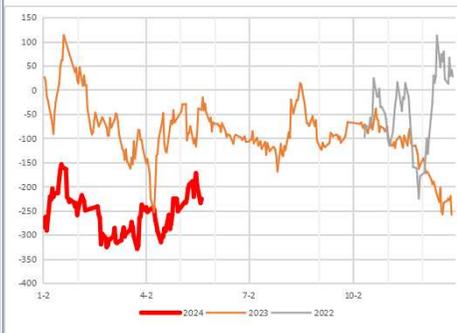
### PF毛利



数据来源: iFind

点评:

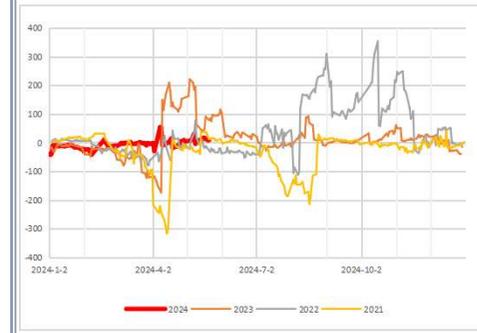
### PF毛利季节性



数据来源: iFind

点评:

### PF毛利主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

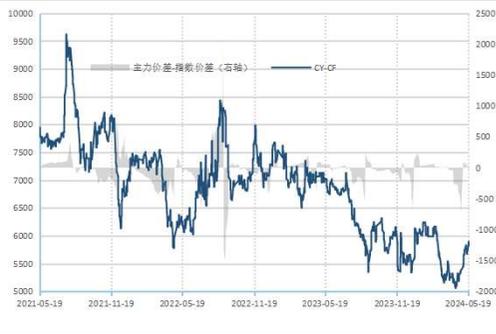
期内最小值: 5061.0000

期内最大值: 9616.0000

期内平均值: 6844.2167

当前分位值: 16.64%

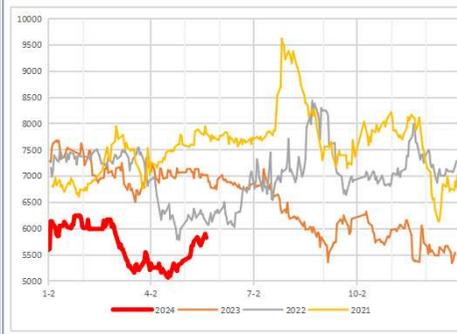
### CY-CF



数据来源: iFind

点评:

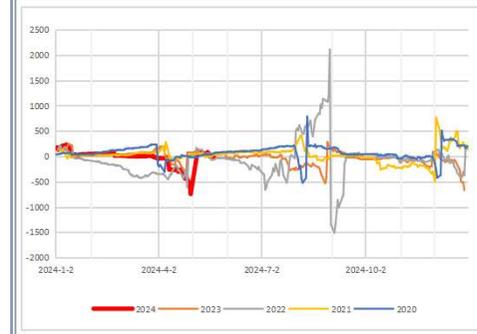
### CY-CF季节性



数据来源: iFind

点评:

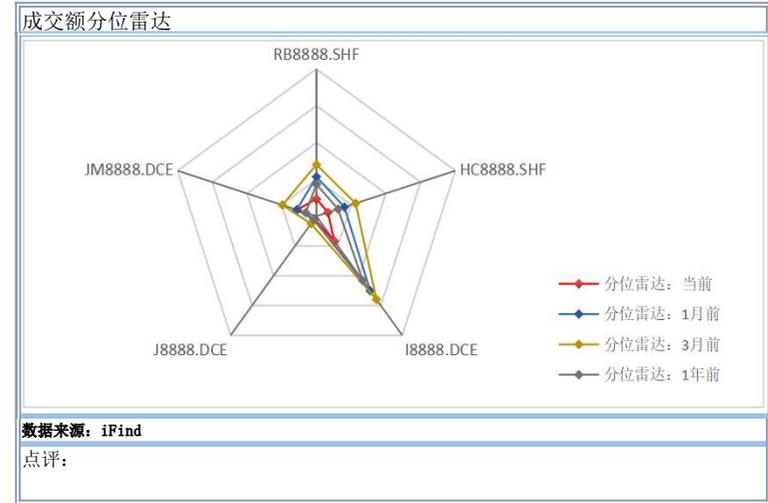
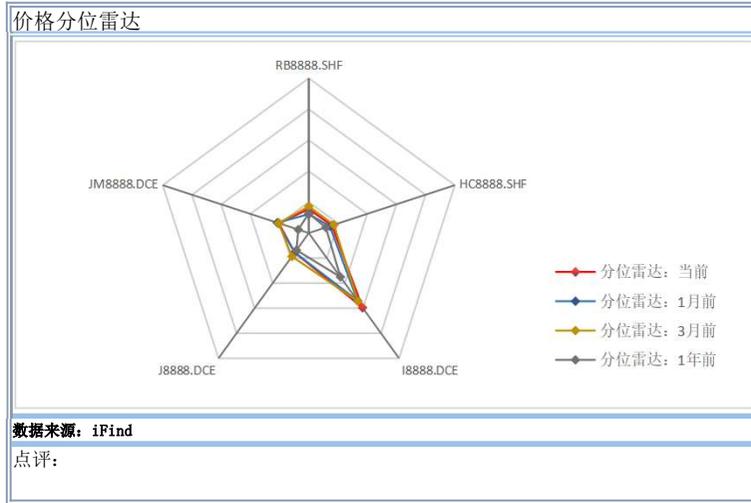
### CY-CF主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

四、黑色相关



数据起始日: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: 3377

期内最大值: 5762

期内平均值: 4211.0233

当前分位值: 15.51%



数据起始日: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: 3444

期内最大值: 6152

期内平均值: 4354.4499

当前分位值: 15.84%

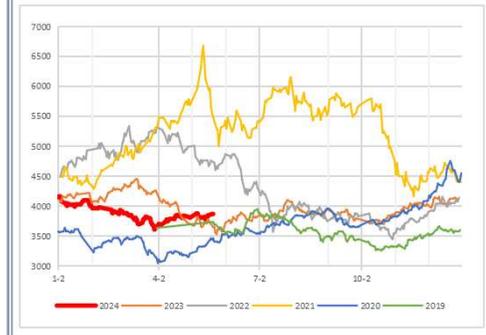
HC.SHFE价格走势



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: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

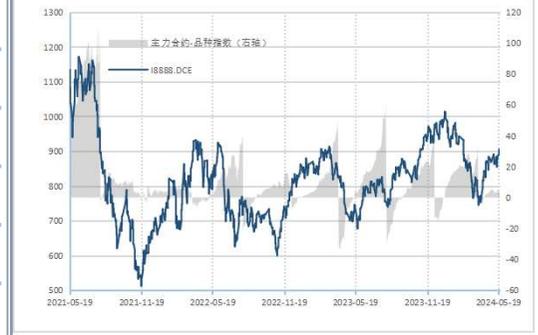
期内最小值: 512.8

期内最大值: 1171.2

期内平均值: 814.9746

当前分位值: 59.54%

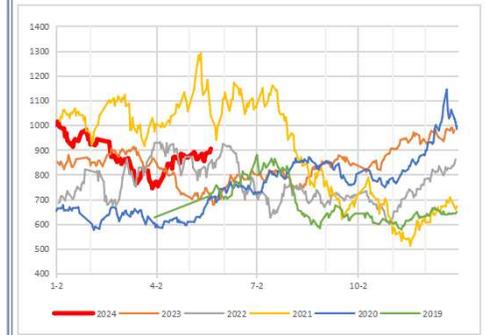
I.DCE价格走势



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: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: 1897.9

期内最大值: 4320.8

期内平均值: 2734.3610

当前分位值: 15.58%

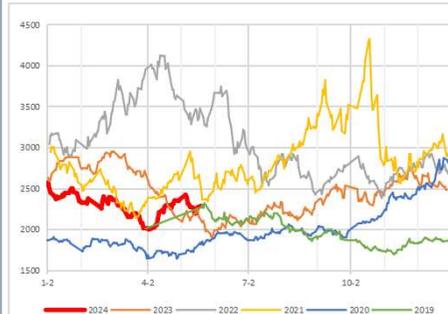
J.DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

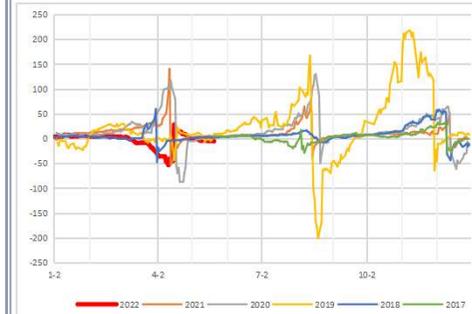
J.DCE价格走势季节性



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: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

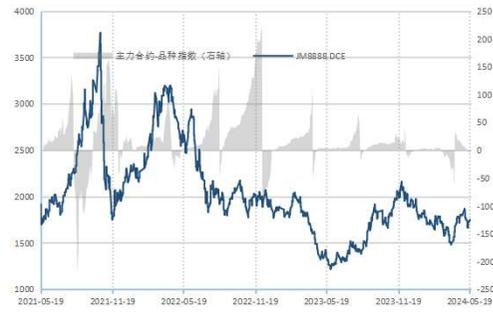
期内最小值: 1219.4

期内最大值: 3764.7

期内平均值: 2024.8920

当前分位值: 20.52%

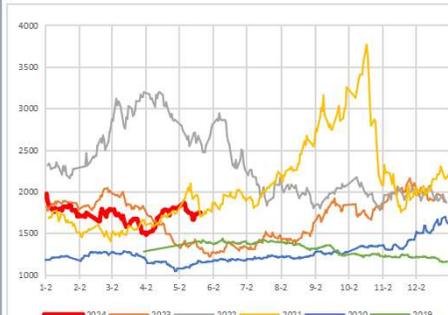
Jm.DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

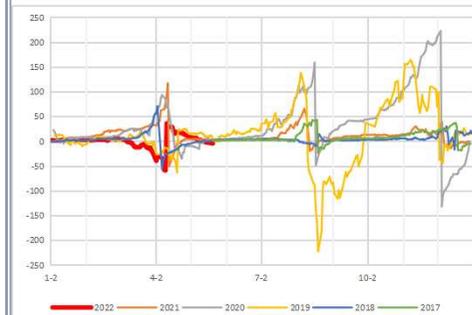
Jm.DCE价格走势季节性



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: 2019-5-22

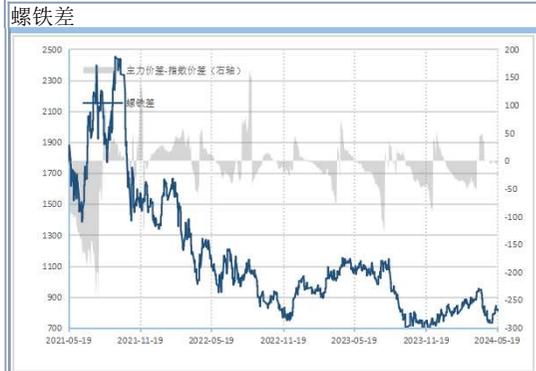
数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: 670.1176

期内最大值: 2451.8235

期内平均值: 1164.3851

当前分位值: 7.96%



数据来源: iFind  
点评:

数据起始日: 2019-5-22

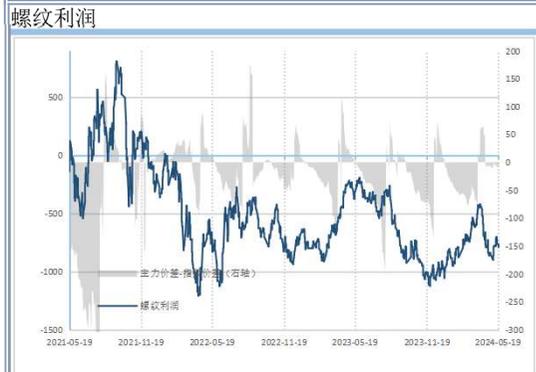
数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: -1206.9091

期内最大值: 810.0000

期内平均值: -497.4175

当前分位值: 20.72%



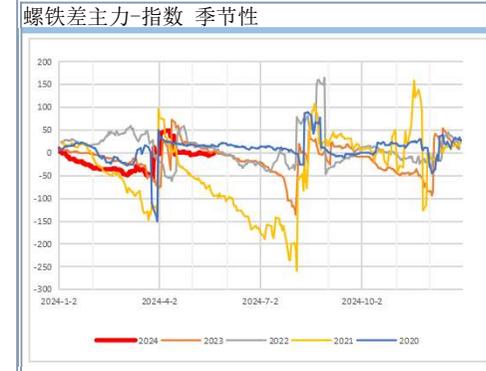
数据来源: iFind  
点评:



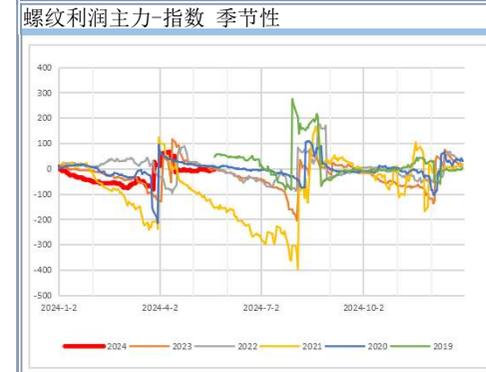
数据来源: iFind  
点评:



数据来源: iFind  
点评:



数据来源: iFind  
点评:



数据来源: iFind  
点评:

数据起始日: 2019-5-22

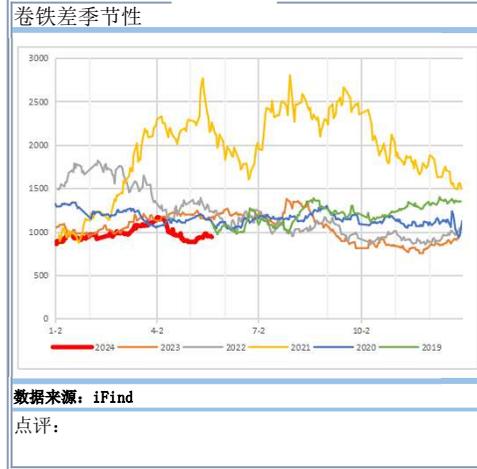
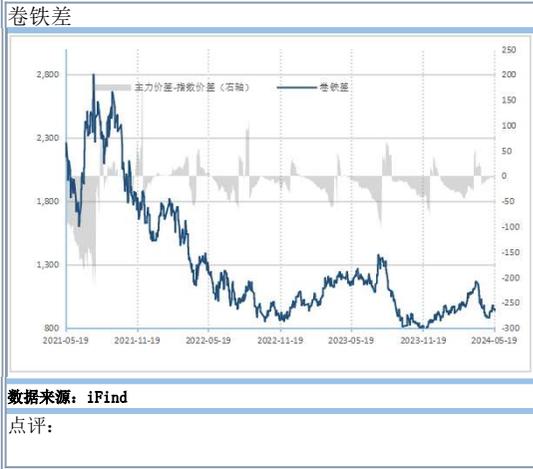
数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: 752.4706

期内最大值: 2799.4118

期内平均值: 1307.8117

当前分位值: 9.06%



数据起始日: 2019-5-22

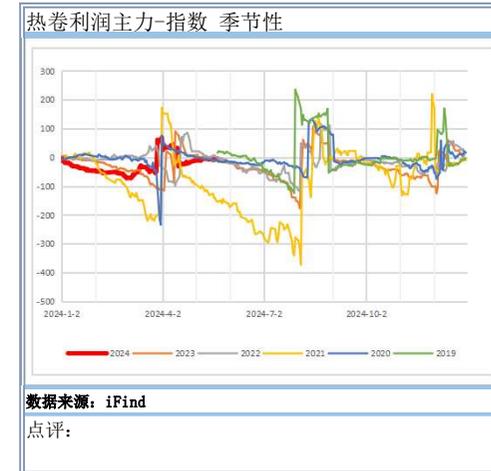
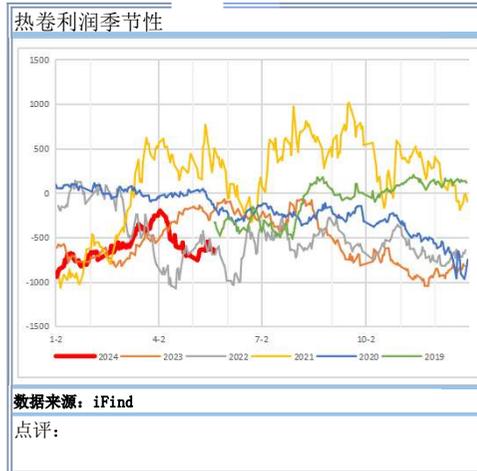
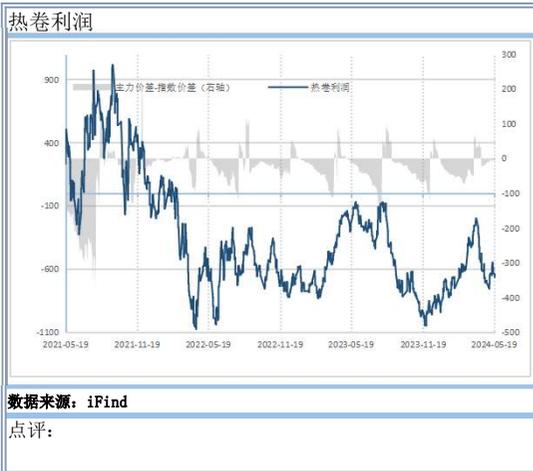
数据截止日: 2024-5-21

期内最小值: -1073.7273

期内最大值: 1014.0000

期内平均值: -353.9909

当前分位值: 19.67%



数据起始日： 2019-5-22

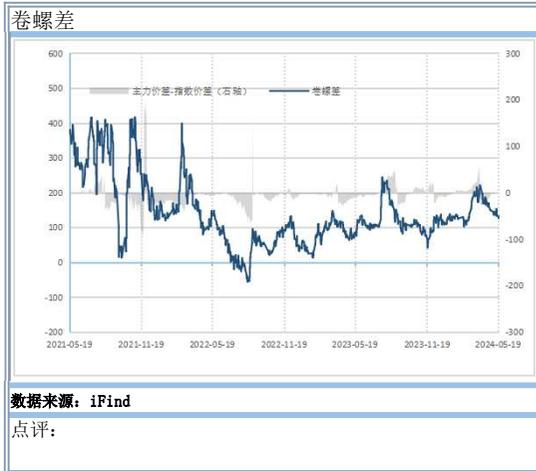
数据截止日： 2024-5-21

期内最小值： -56.0000

期内最大值： 416.0000

期内平均值： 143.4266

当前分位值： 38.56%



数据起始日： 2019-5-22

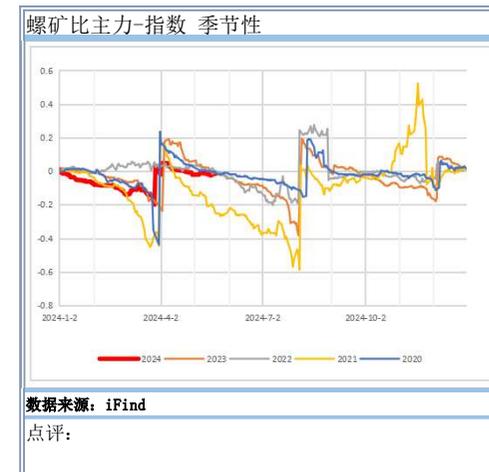
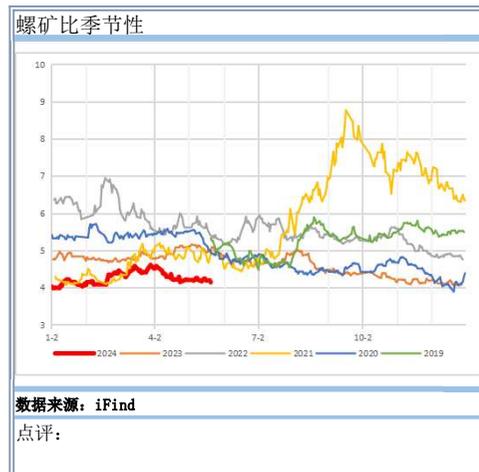
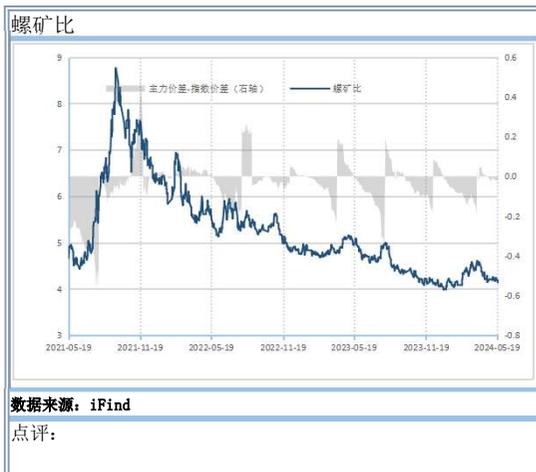
数据截止日： 2024-5-21

期内最小值： 3.9880

期内最大值： 8.7631

期内平均值： 5.2556

当前分位值： 3.21%



数据起始日: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

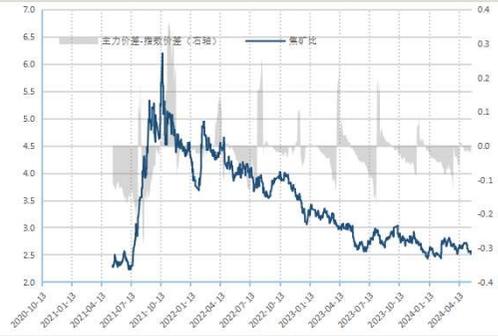
期内最小值: 2.2287

期内最大值: 6.1947

期内平均值: 3.4354

当前分位值: 7.21%

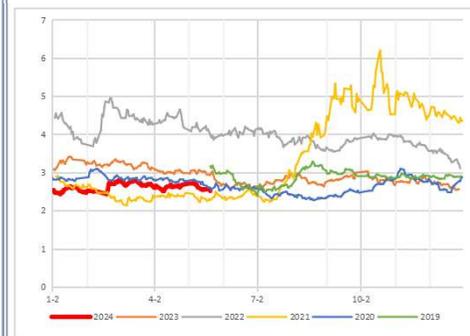
### 焦煤比



数据来源: iFind

点评:

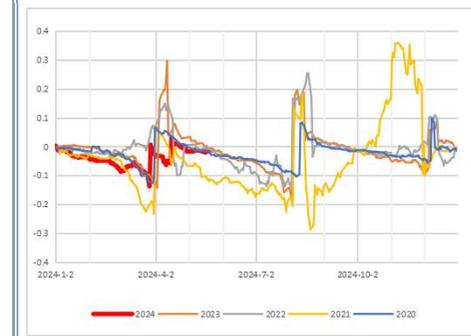
### 焦煤比季节性



数据来源: iFind

点评:

### 焦煤比主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

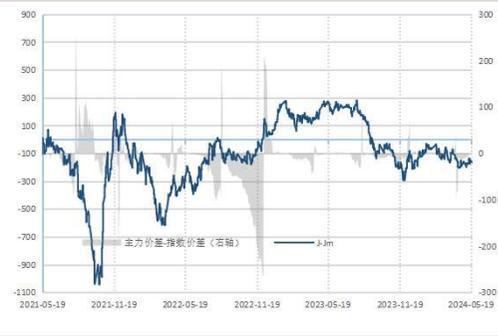
期内最小值: -1043.0800

期内最大值: 279.1600

期内平均值: -100.4878

当前分位值: 66.54%

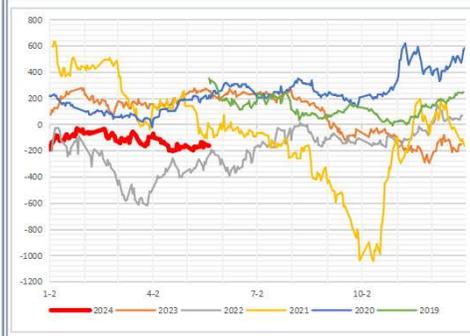
### J-Jm



数据来源: iFind

点评:

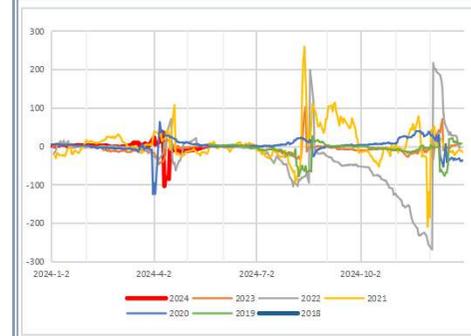
### J-Jm季节性



数据来源: iFind

点评:

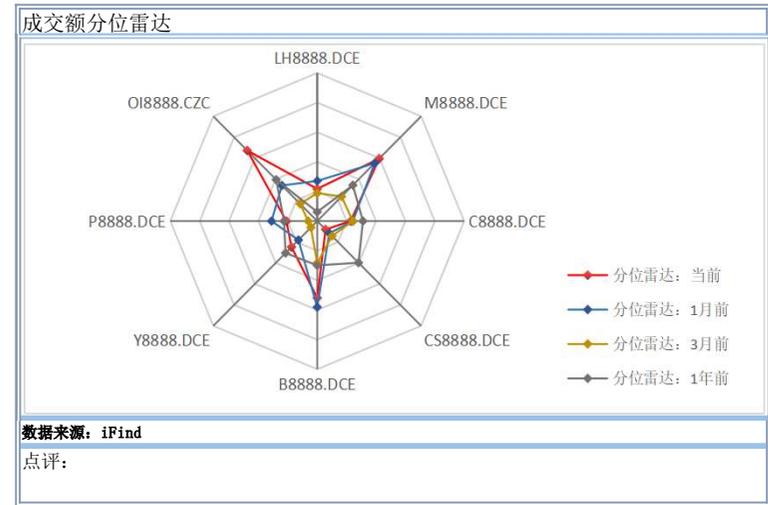
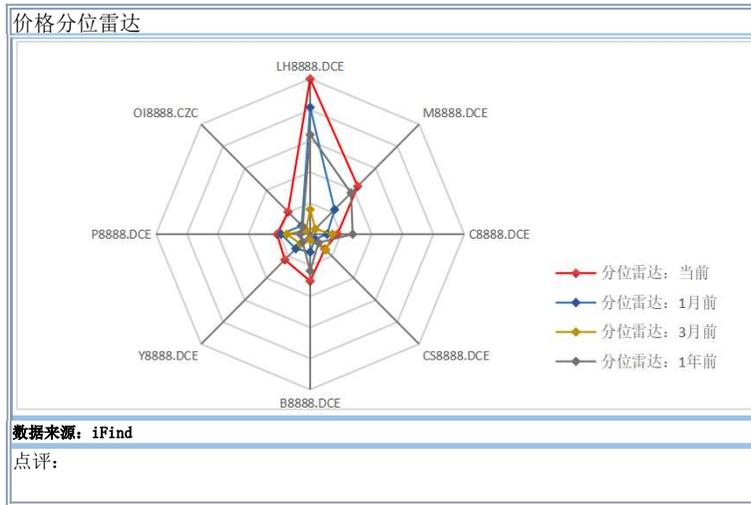
### J-Jm主力-指数 季节性



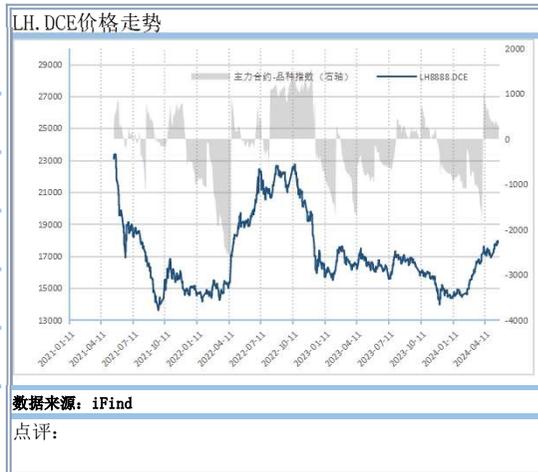
数据来源: iFind

点评:

五、农产品相关



数据起始日: 2021-1-8  
 数据截止日: 2024-5-21  
 期内最小值: 13971  
 期内最大值: 17948  
 期内平均值: 16124.5345  
 当前分位值: 100.00%



数据起始日：2019-5-22

数据截止日：2024-5-21

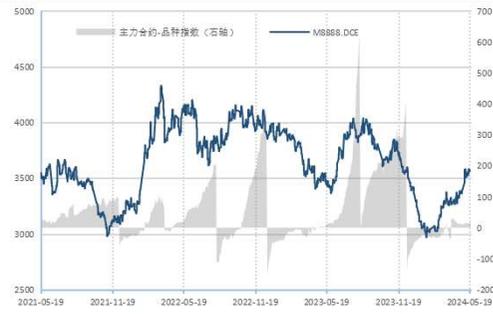
期内最小值：2970

期内最大值：4328

期内平均值：3644.8477

当前分位值：43.59%

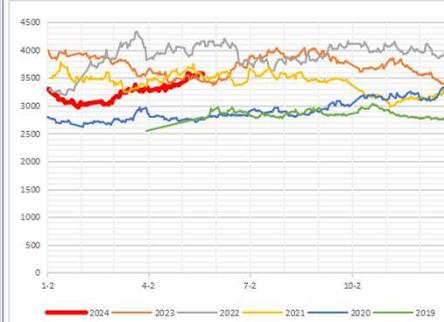
M. DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

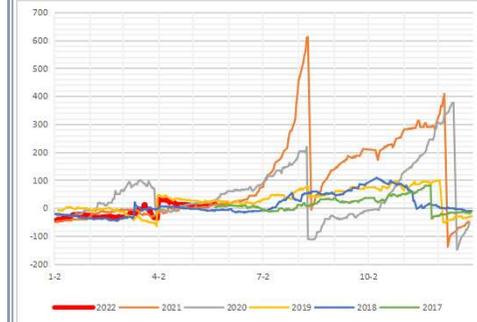
M. DCE价格走势季节性



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：2019-5-22

数据截止日：2024-5-21

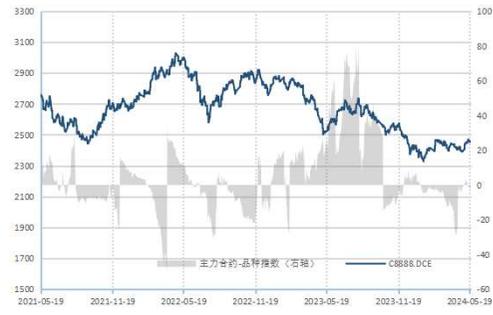
期内最小值：2328

期内最大值：3027

期内平均值：2672.8066

当前分位值：17.74%

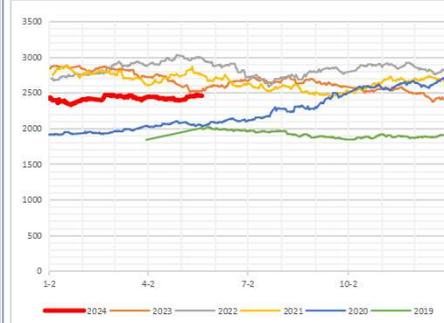
C. DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

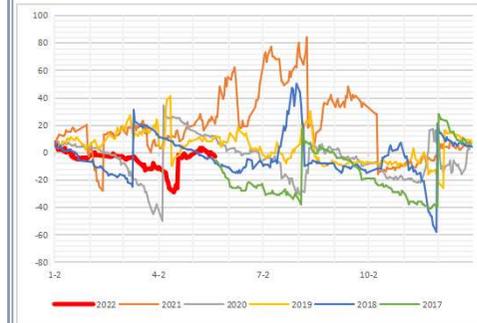
C. DCE价格走势季节性



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: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

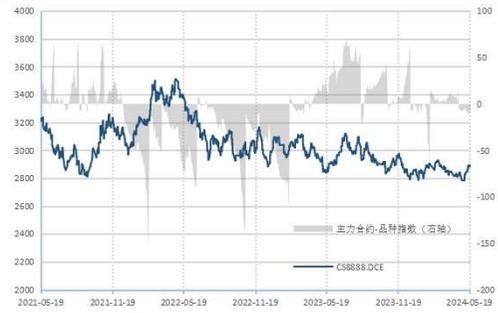
期内最小值: 2784

期内最大值: 3512

期内平均值: 3031.2181

当前分位值: 13.46%

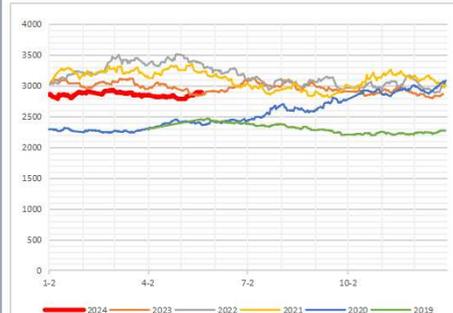
CS. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

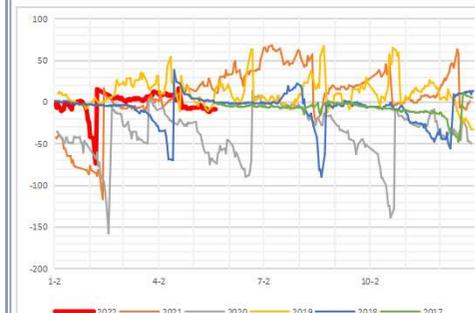
CS. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

CS. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

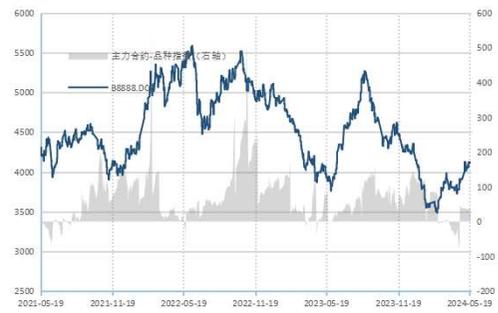
期内最小值: 3487

期内最大值: 5585

期内平均值: 4528.4582

当前分位值: 30.17%

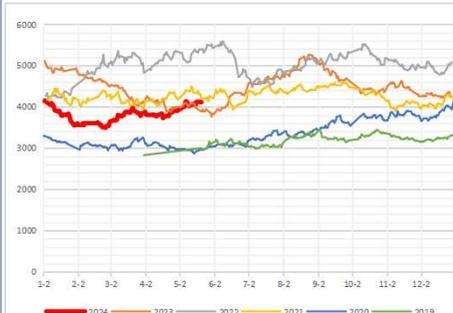
B. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

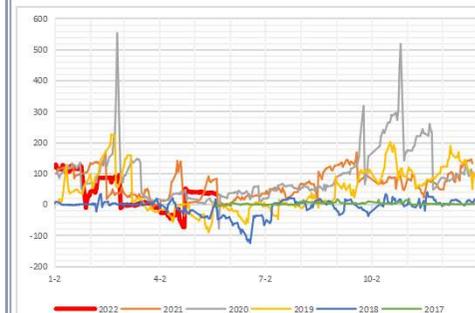
B. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

B. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

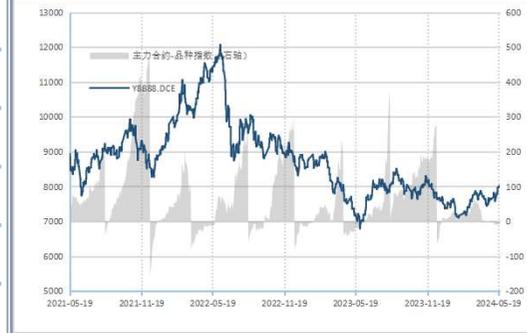
期内最小值: 6793

期内最大值: 12065

期内平均值: 8747.1344

当前分位值: 23.22%

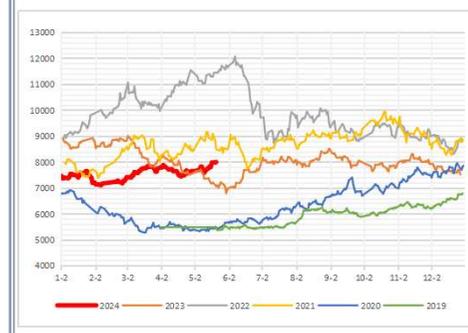
Y. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

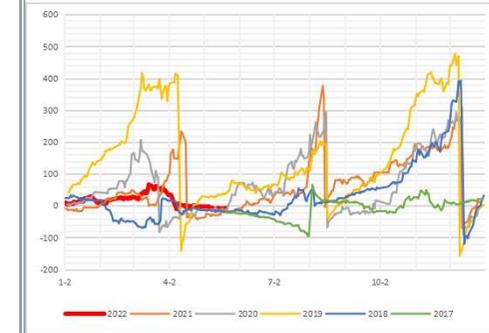
Y. DCE价格走势季节性



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: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

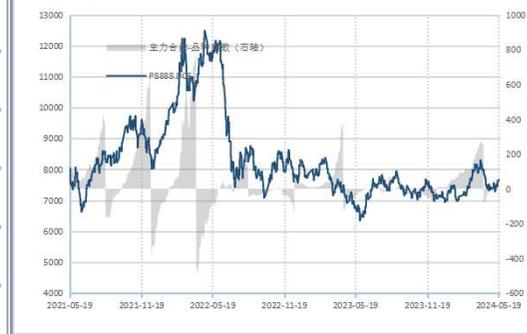
期内最小值: 6349

期内最大值: 12479

期内平均值: 8287.5391

当前分位值: 21.45%

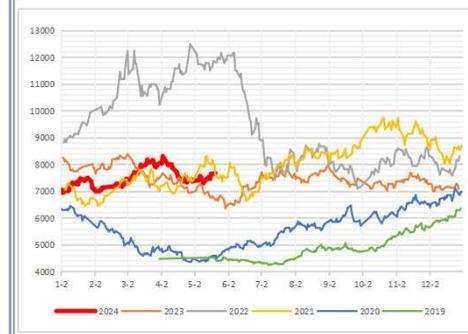
P. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

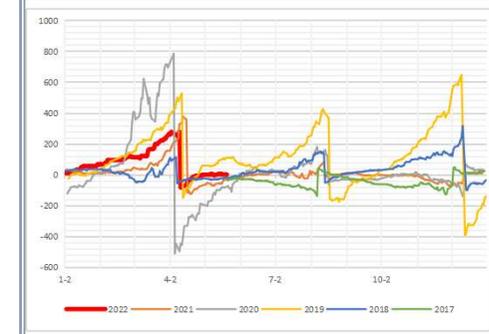
P. DCE价格走势季节性



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: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

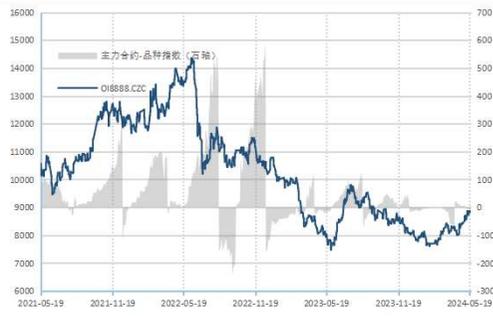
期内最小值: 7475

期内最大值: 14344

期内平均值: 10261.1495

当前分位值: 20.31%

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: 2022-2-11

数据截止日: 2024-5-21

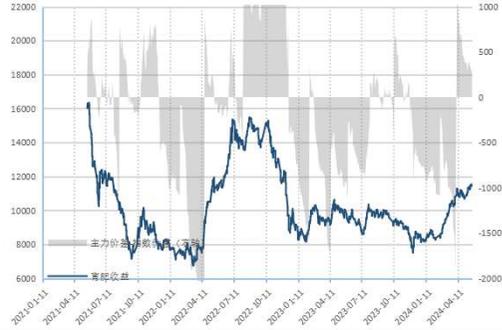
期内最小值: 7508.2500

期内最大值: 11540.5000

期内平均值: 9496.6000

当前分位值: 100.00%

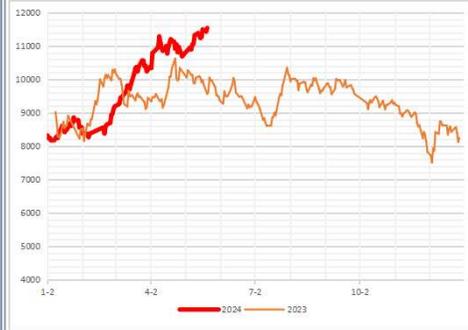
育肥收益



数据来源: iFind

点评:

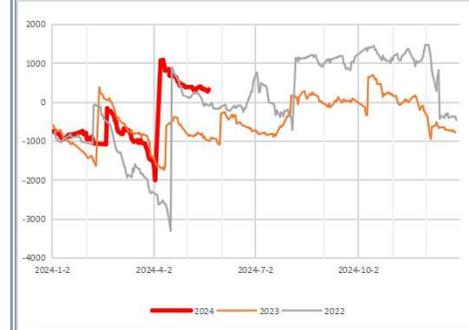
育肥收益季节性



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: 2024-5-21

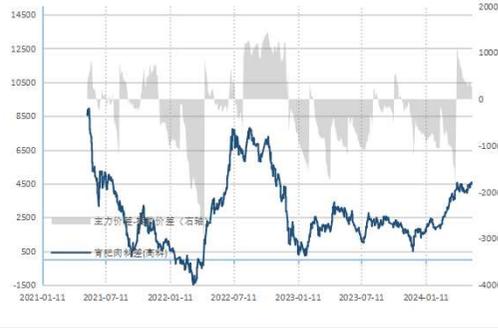
期内最小值: 515.0000

期内最大值: 4578.0000

期内平均值: 2370.0552

当前分位值: 100.00%

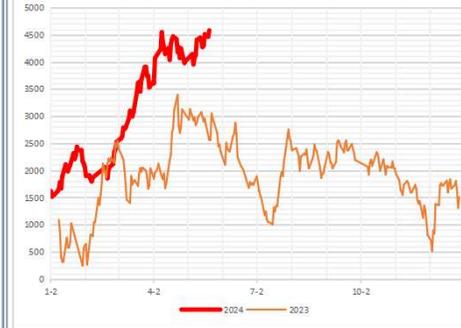
### 育肥肉料差(高料)



数据来源: iFind

点评:

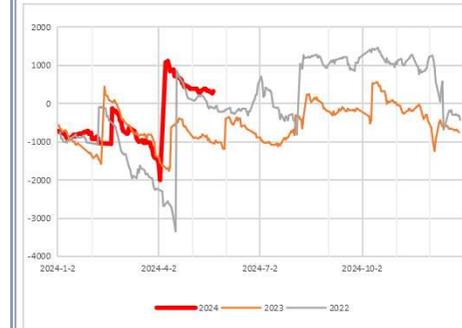
### 育肥肉料差(高料)季节性



数据来源: iFind

点评:

### 育肥肉料差(高料)主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-5-22

数据截止日: 2024-5-21

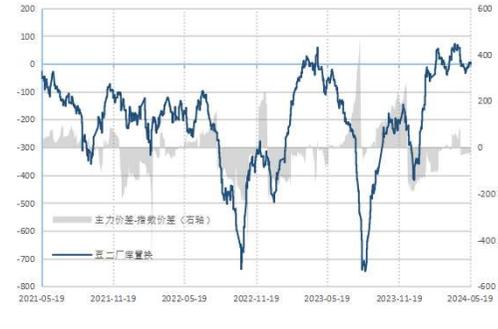
期内最小值: -745.0200

期内最大值: 71.2200

期内平均值: -209.0328

当前分位值: 91.19%

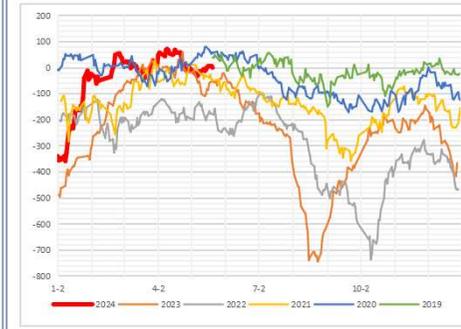
### 豆二厂库置换



数据来源: iFind

点评:

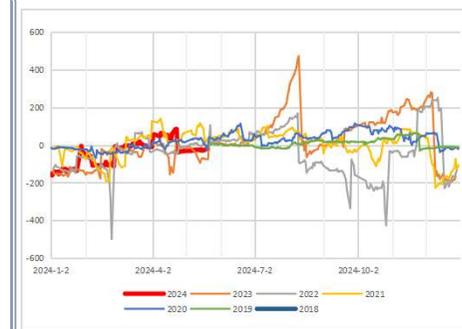
### 豆二厂库置换季节性



数据来源: iFind

点评:

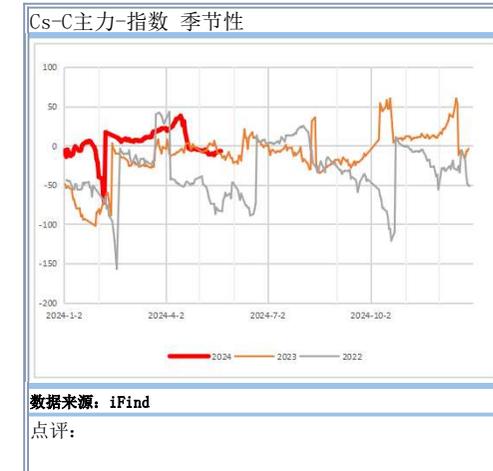
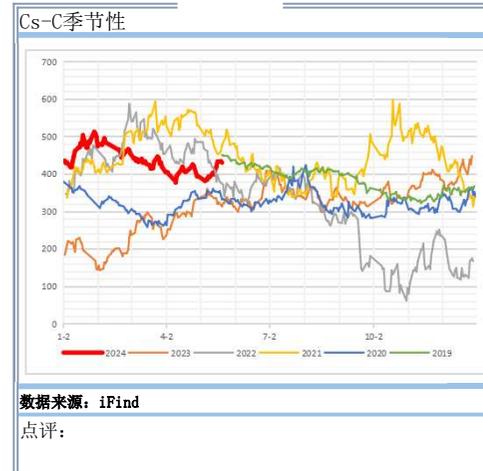
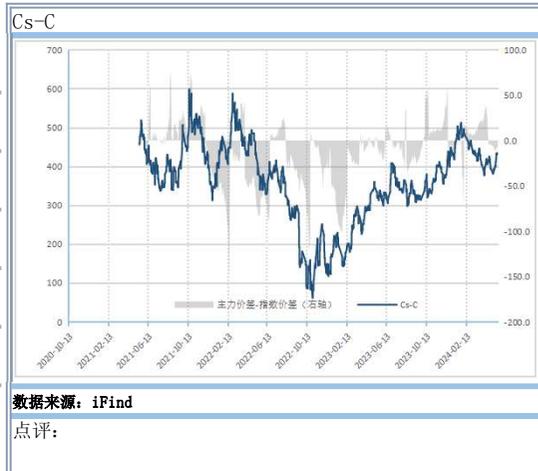
### 豆二厂库置换主力-指数 季节性



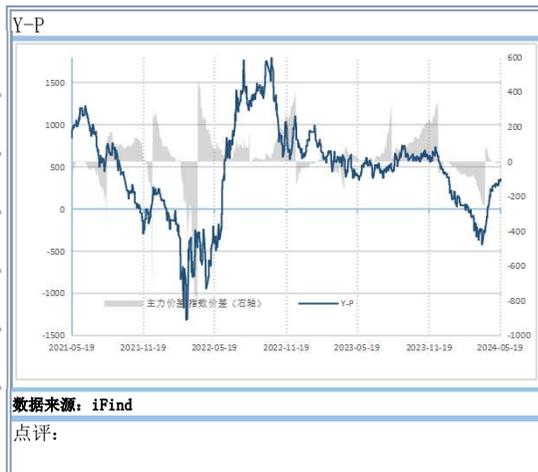
数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-5-22  
 数据截止日: 2024-5-21  
 期内最小值: 62.0000  
 期内最大值: 598.0000  
 期内平均值: 358.4115  
 当前分位值: 68.66%



数据起始日: 2019-5-22  
 数据截止日: 2024-5-21  
 期内最小值: -1313.0000  
 期内最大值: 1788.0000  
 期内平均值: 459.5953  
 当前分位值: 53.72%



数据起始日：2019-5-22

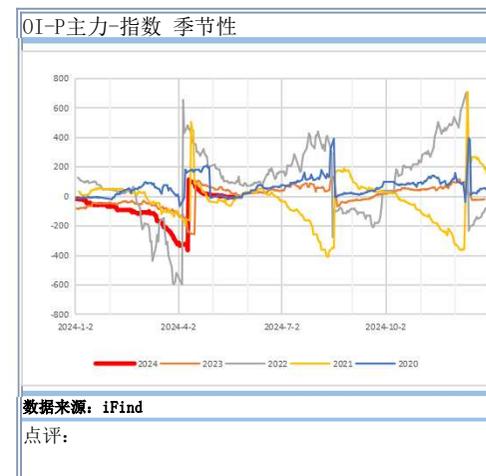
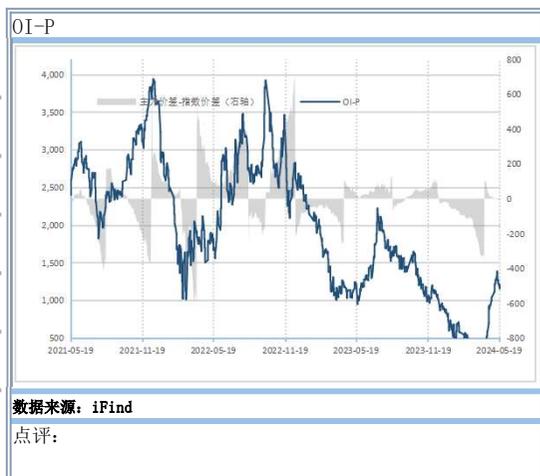
数据截止日：2024-5-21

期内最小值：19.0000

期内最大值：2825.0000

期内平均值：1309.3513

当前分位值：42.30%



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。