

<http://www.shanlingh.com>

盘面套利观察

制作：曹有明

2024年7月23日

交易咨询资格证号： Z0013162

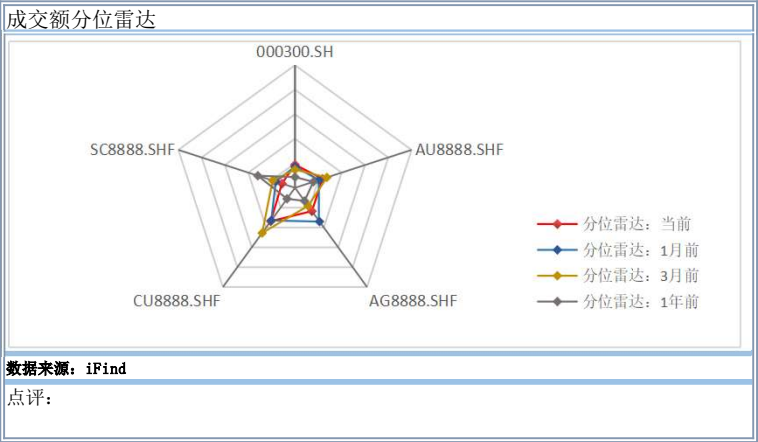
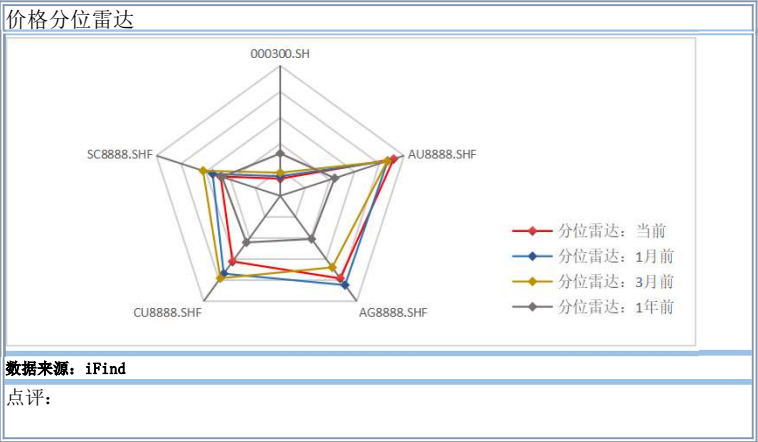
邮箱： caoyouming@sd-gold.com

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: 2019/7/24

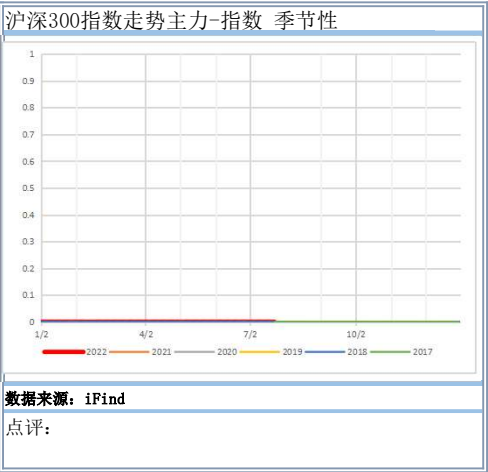
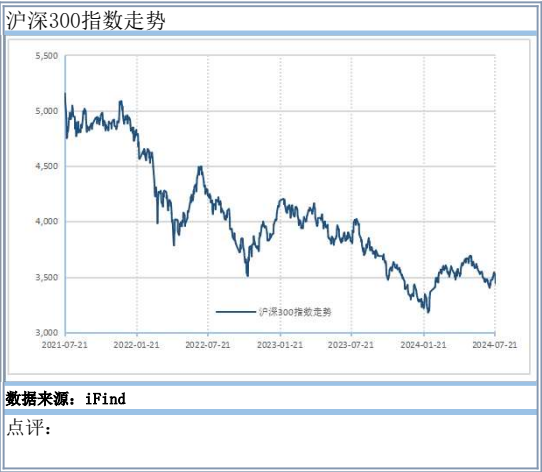
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 3179.6276

期内最大值: 5151.7517

期内平均值: 4039.0165

当前分位值: 17.78%



数据起始日： 2019/7/24

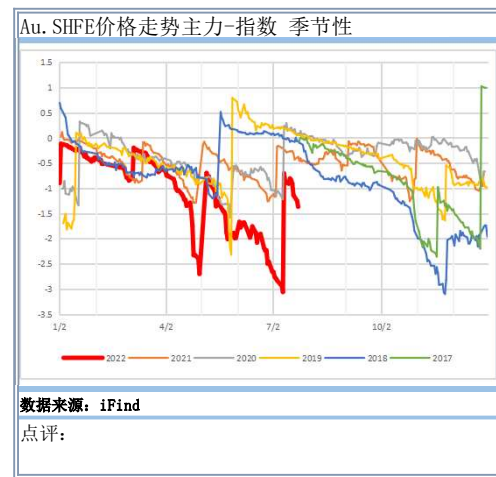
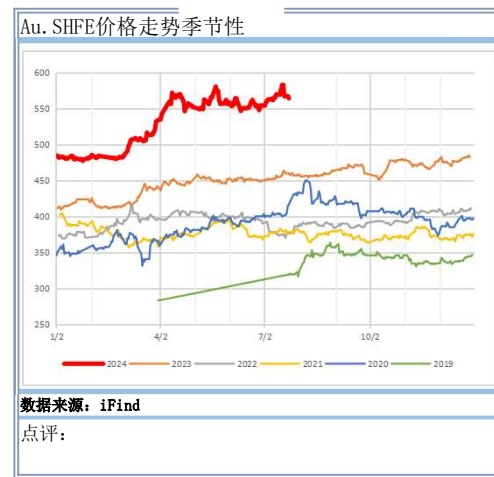
数据截止日： 2024/7/23

期内最小值： 363.2

期内最大值： 582.4

期内平均值： 434.4003

当前分位值： 91.59%



数据起始日： 2019/7/24

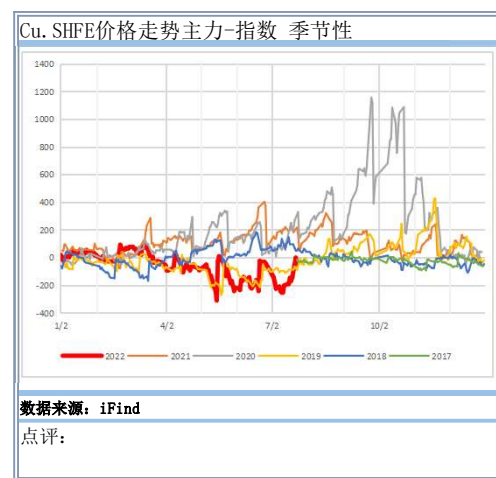
数据截止日： 2024/7/23

期内最小值： 53367

期内最大值： 87697

期内平均值： 69200.0163

当前分位值： 62.30%



数据起始日: 2019/7/24

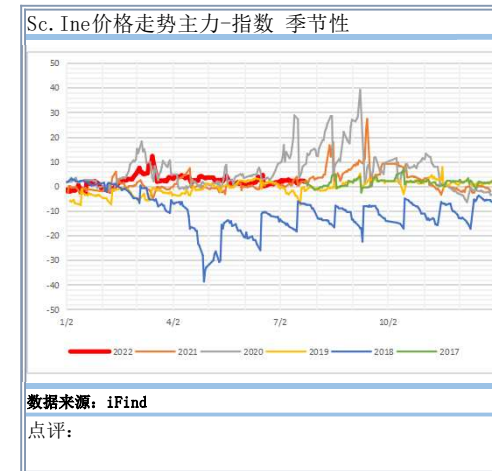
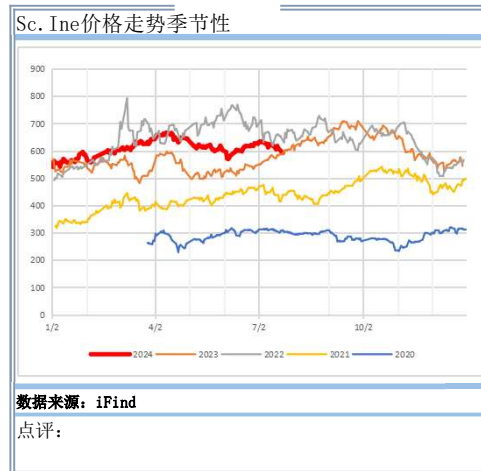
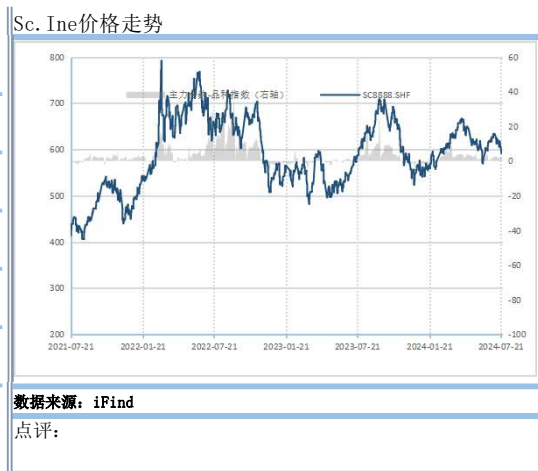
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 405.7

期内最大值: 791.6

期内平均值: 589.5034

当前分位值: 48.12%



数据起始日: 2019/7/24

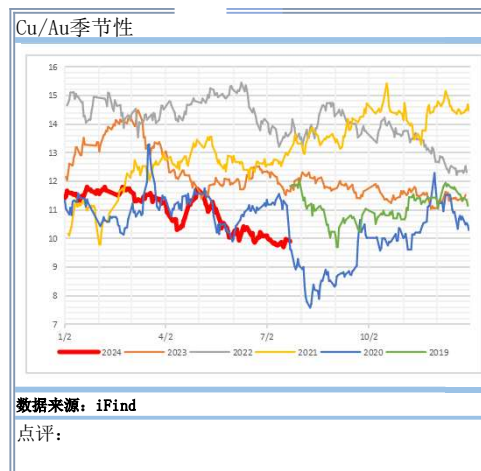
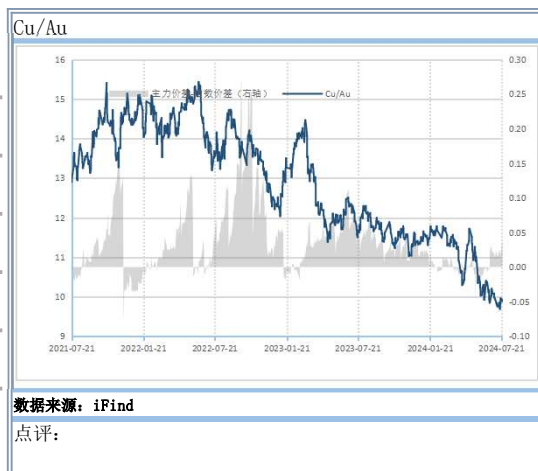
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 9.6881

期内最大值: 15.4319

期内平均值: 12.8633

当前分位值: 3.37%



数据起始日: 2019/7/24

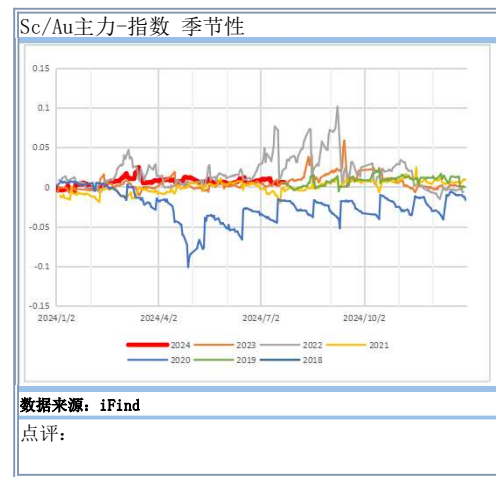
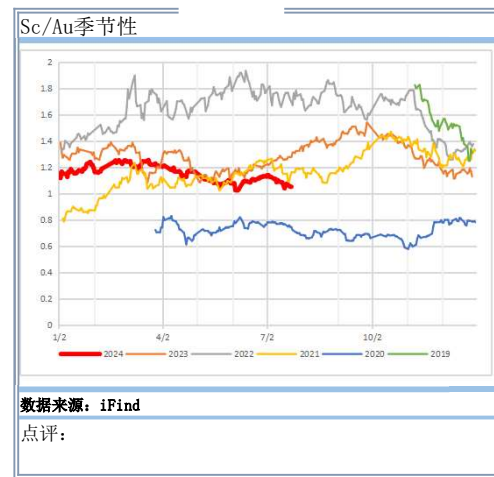
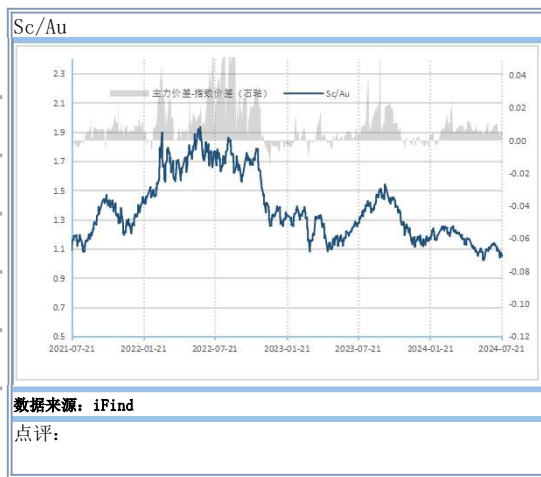
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 1.0225

期内最大值: 1.9320

期内平均值: 1.3739

当前分位值: 2.88%



数据起始日: 2019/7/24

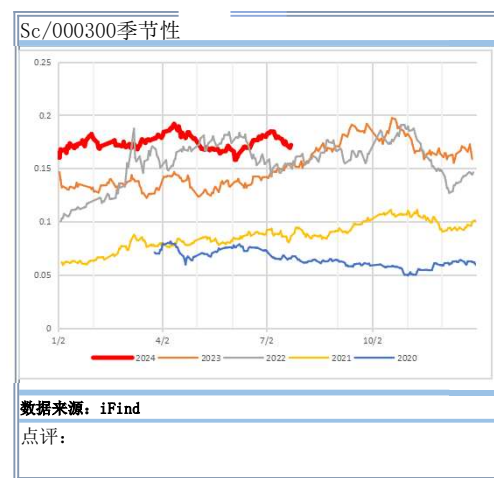
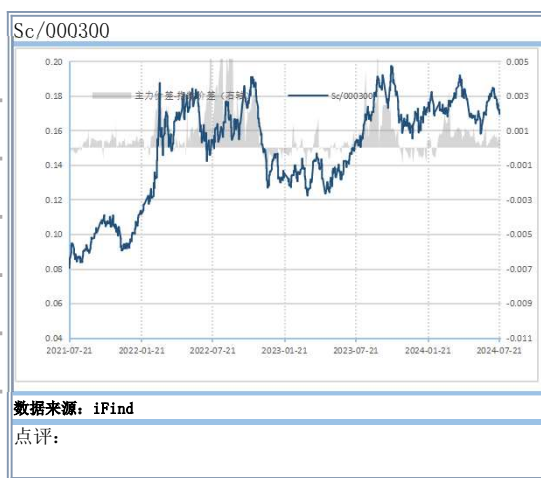
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 0.0805

期内最大值: 0.1972

期内平均值: 0.1489

当前分位值: 78.37%



数据起始日: 2019/7/24

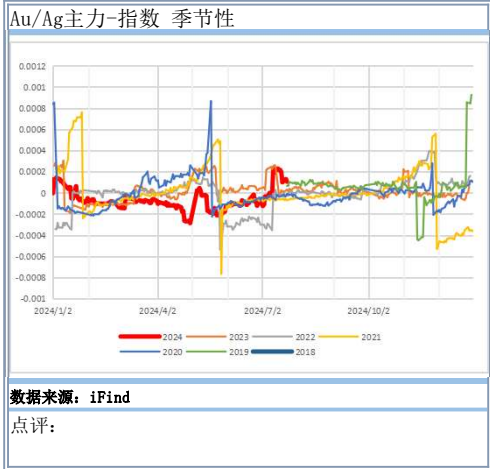
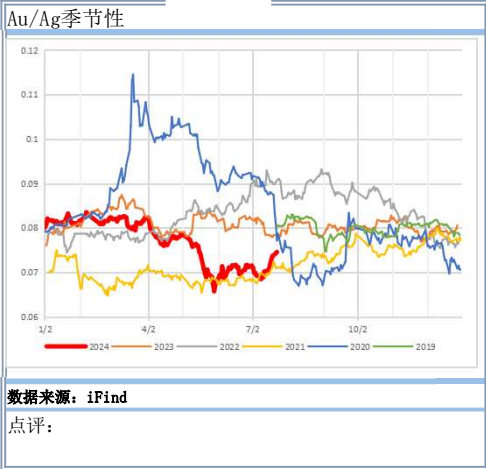
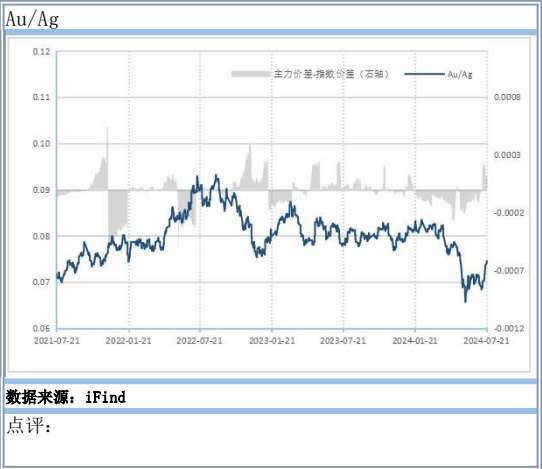
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 0.0657

期内最大值: 0.0932

期内平均值: 0.0799

当前分位值: 32.16%



数据起始日: 2019/7/24

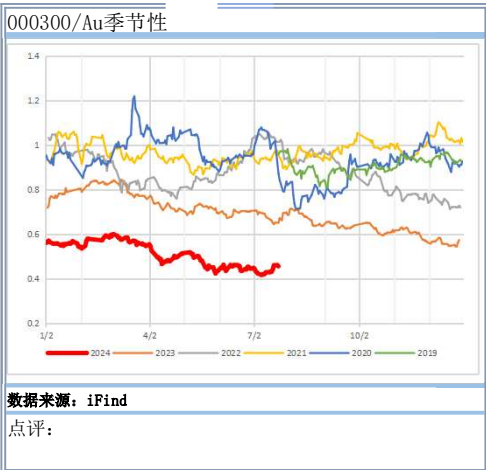
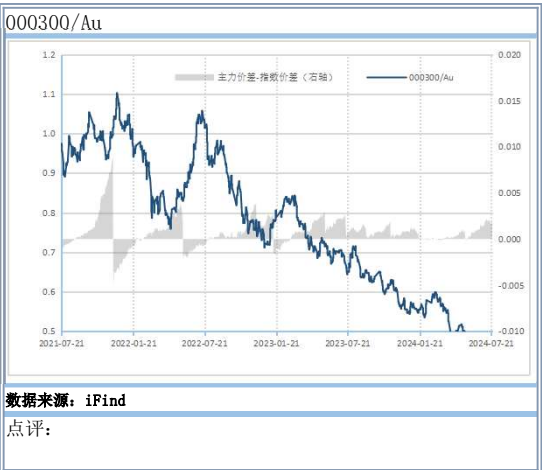
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 0.4165

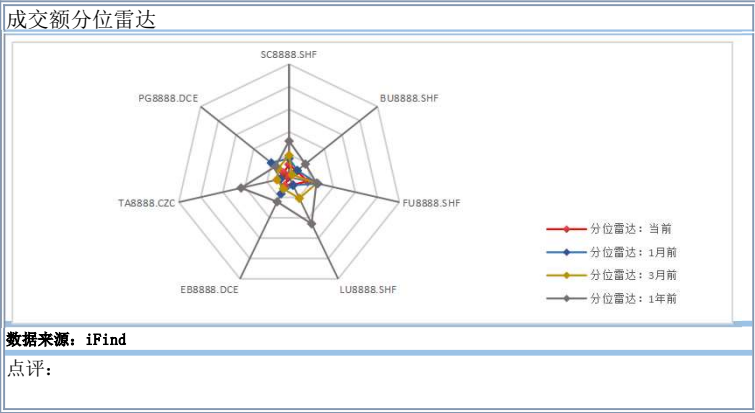
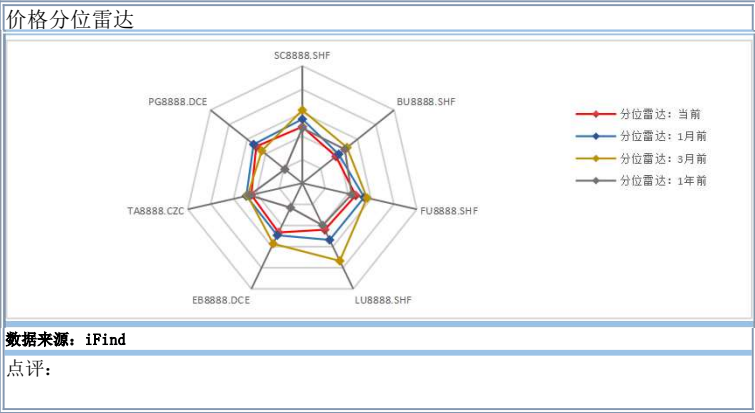
期内最大值: 1.1021

期内平均值: 0.7644

当前分位值: 5.58%



二、原油相关



数据起始日: 2019/7/24

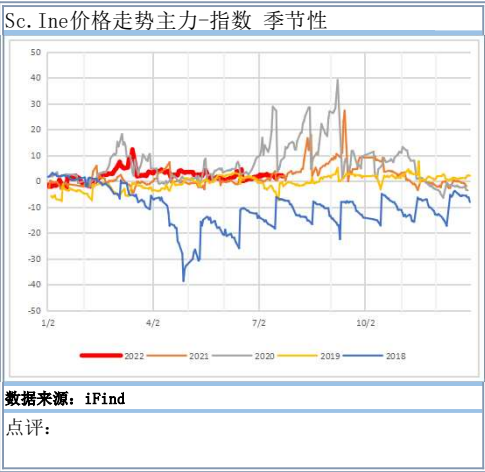
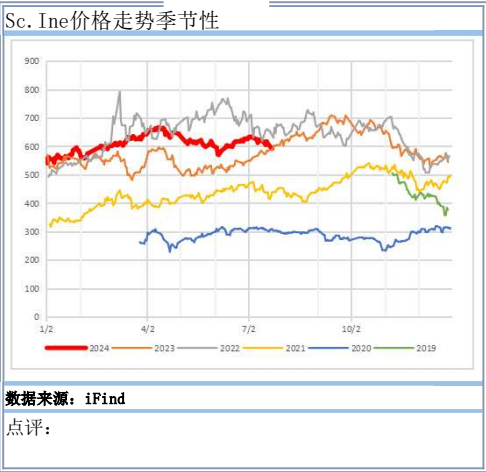
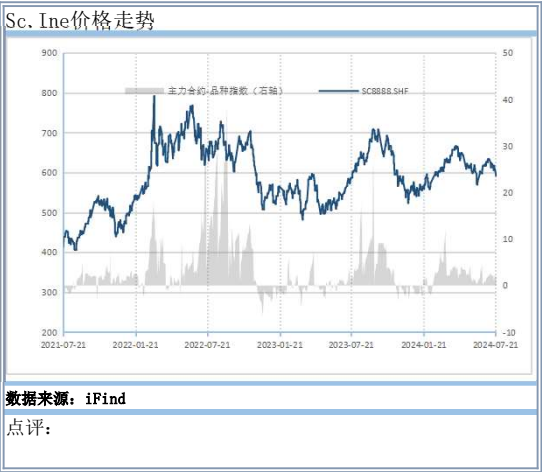
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 405.7

期内最大值: 791.6

期内平均值: 589.5034

当前分位值: 48.12%



数据起始日： 2019/7/24

数据截止日： 2024/7/23

期内最小值： 2821

期内最大值： 4794

期内平均值： 3667.6900

当前分位值： 36.59%



数据起始日： 2019/7/24

数据截止日： 2024/7/23

期内最小值： 2366

期内最大值： 4371

期内平均值： 3143.2317

当前分位值： 46.63%



数据起始日: 2020/6/22

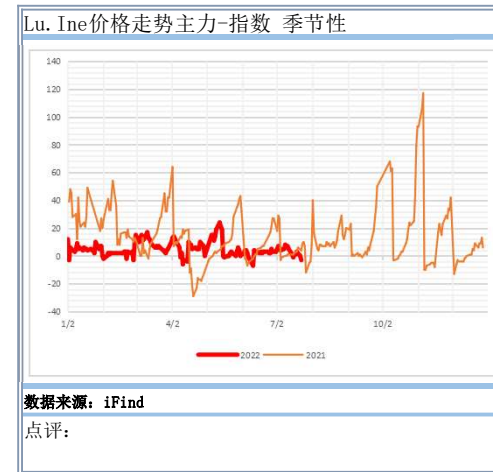
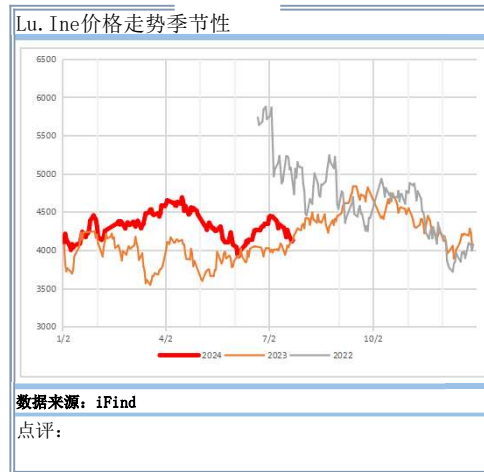
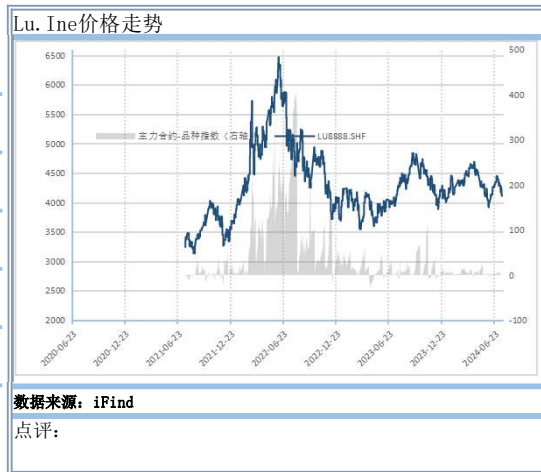
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 3544

期内最大值: 4875

期内平均值: 4212.2400

当前分位值: 44.03%



数据起始日: 2019/9/26

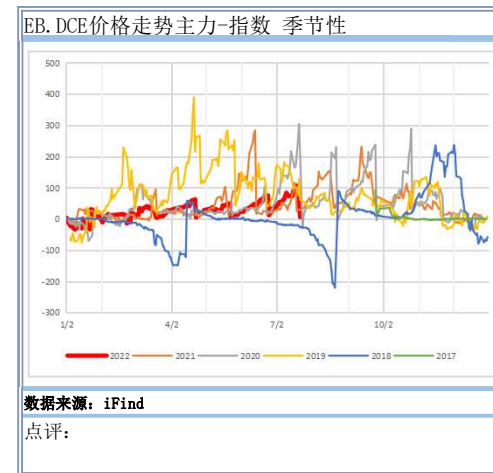
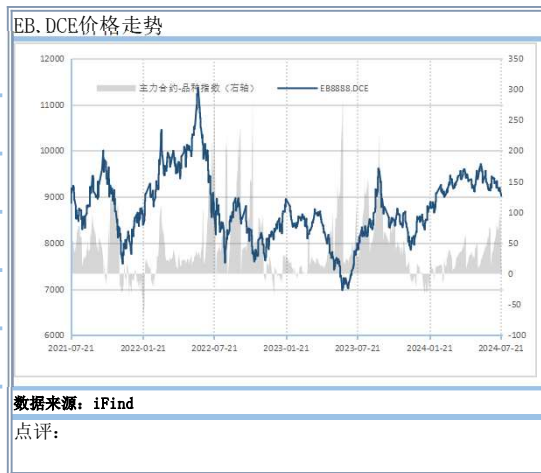
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 6978

期内最大值: 11361

期内平均值: 8755.7654

当前分位值: 46.59%



数据起始日: 2019/7/24

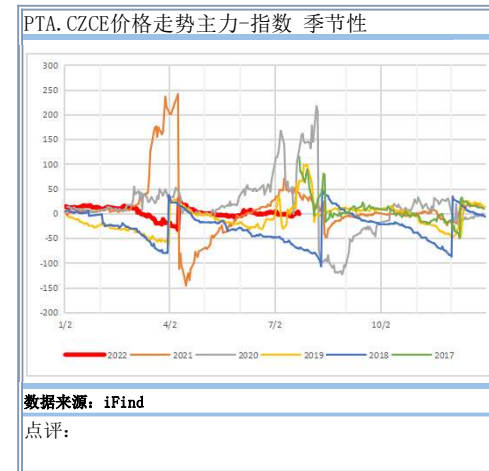
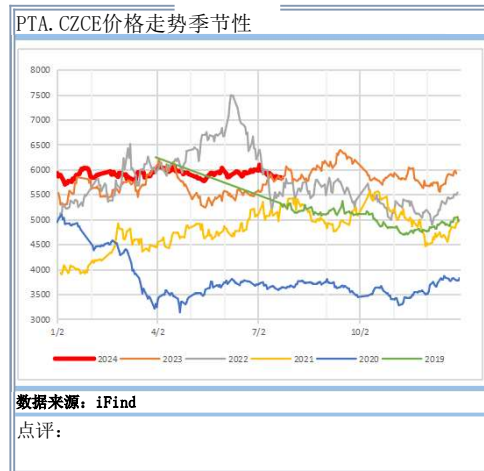
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 4462

期内最大值: 7488

期内平均值: 5684.2497

当前分位值: 44.58%



数据起始日: 2020/3/30

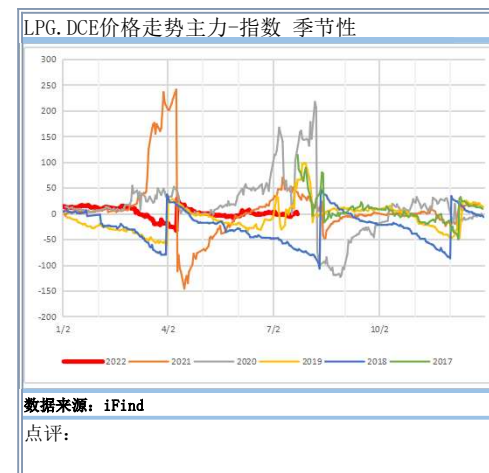
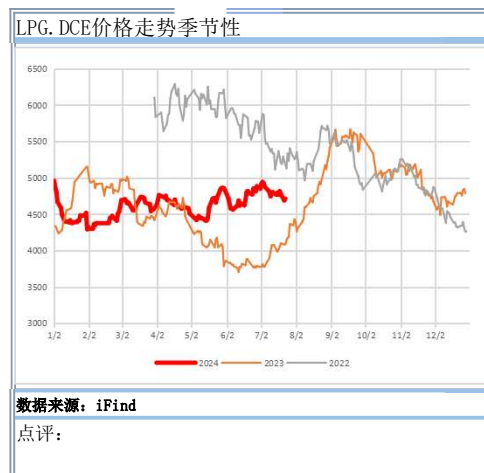
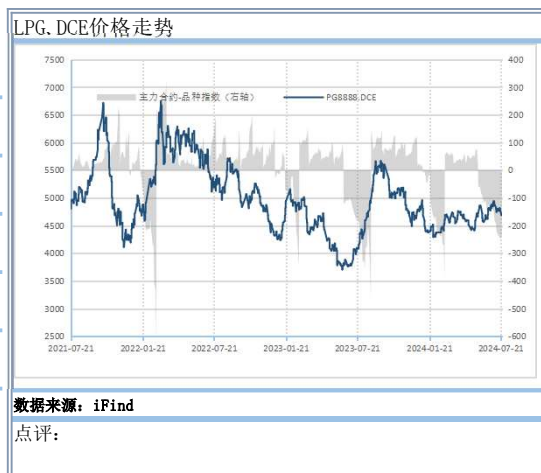
数据截止日: 2024/7/23

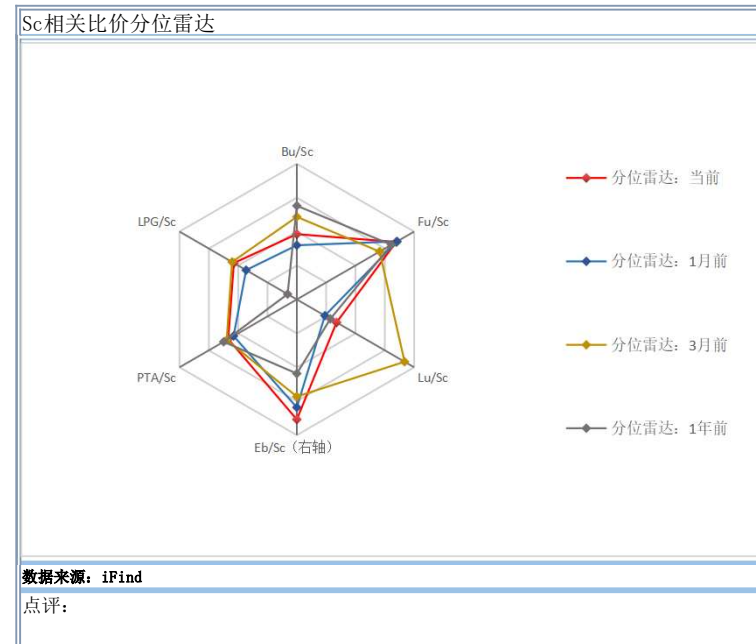
期内最小值: 3704

期内最大值: 5714

期内平均值: 4719.2822

当前分位值: 50.20%





数据起始日: 2019/7/24

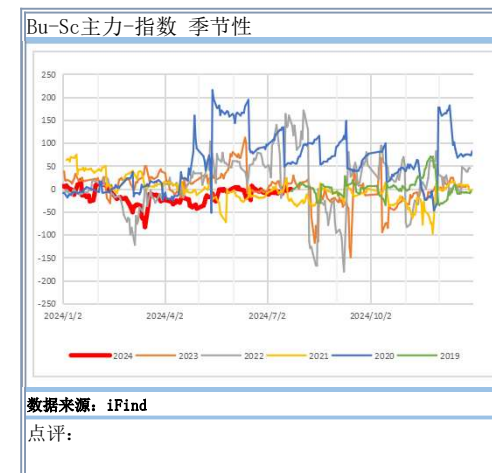
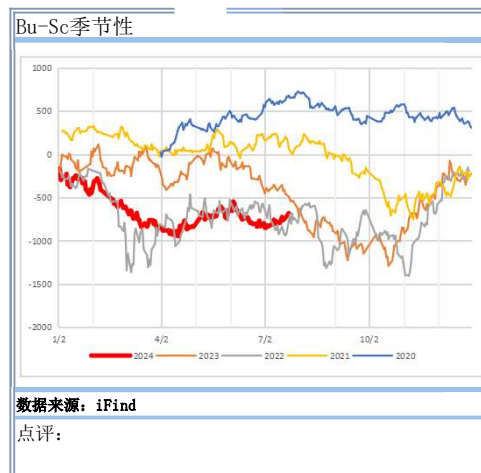
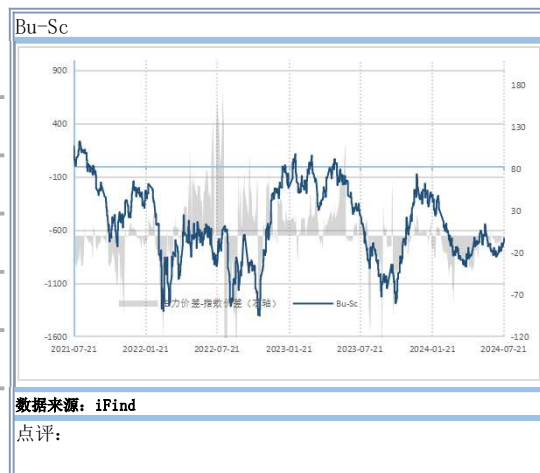
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: -1406.4286

期内最大值: 231.5714

期内平均值: -543.0488

当前分位值: 44.27%



数据起始日: 2019/7/24

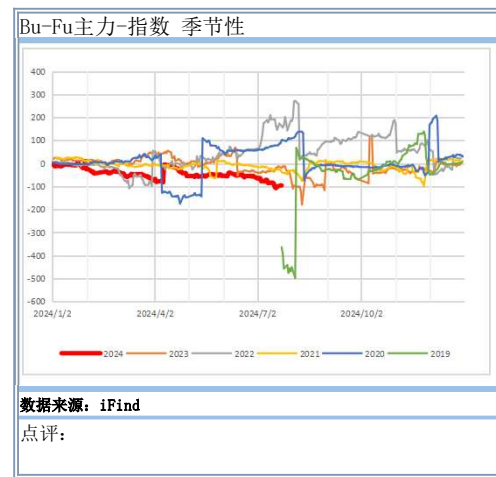
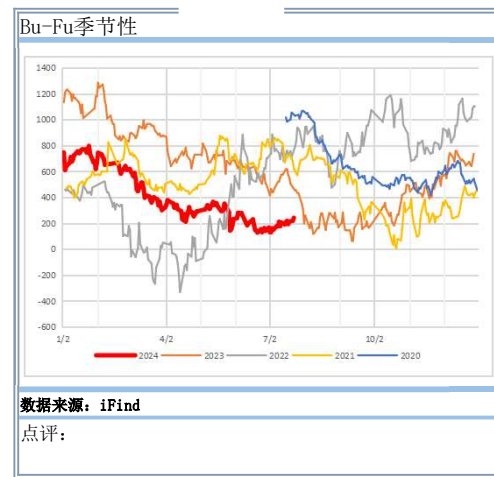
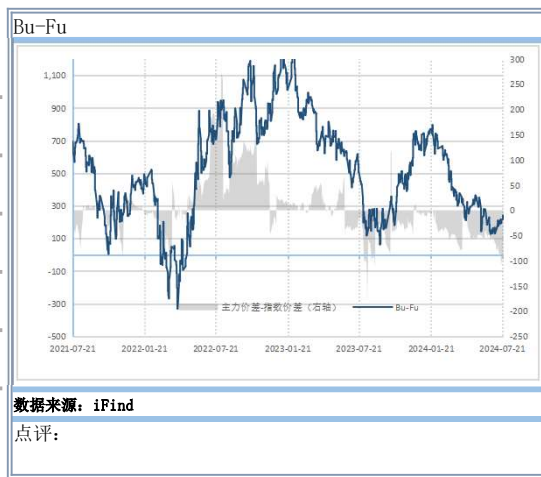
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: -331.0000

期内最大值: 1284.0000

期内平均值: 524.4583

当前分位值: 35.48%



数据起始日: 2021/10/18

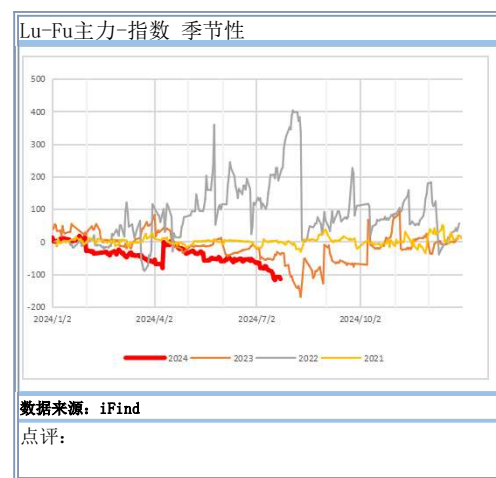
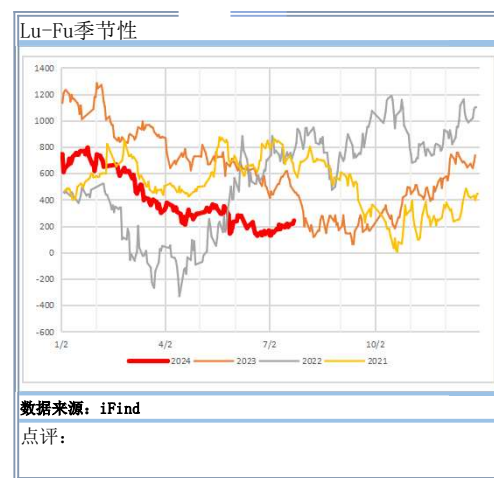
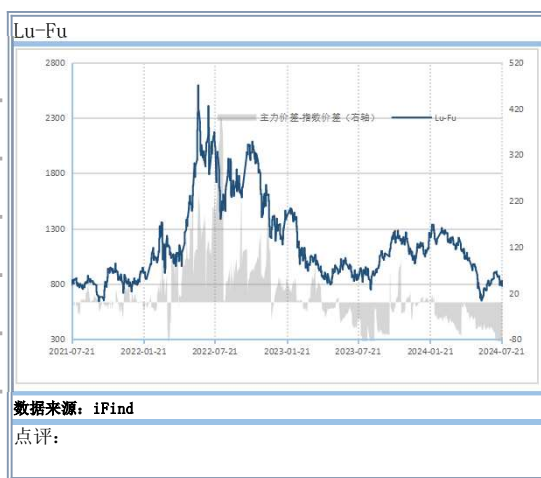
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 650.0000

期内最大值: 2085.0000

期内平均值: 1101.5176

当前分位值: 12.47%



数据起始日: 2021/8/23

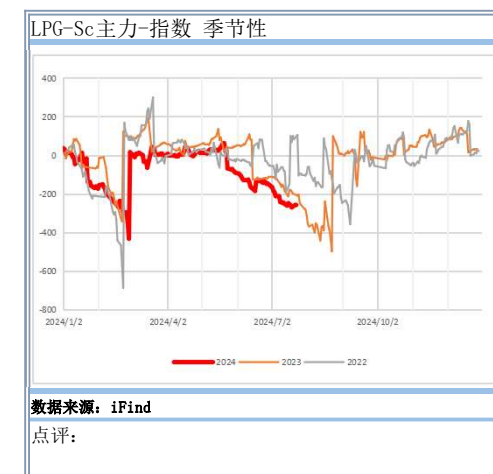
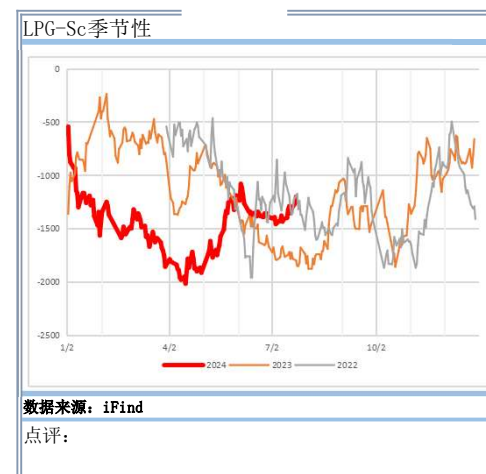
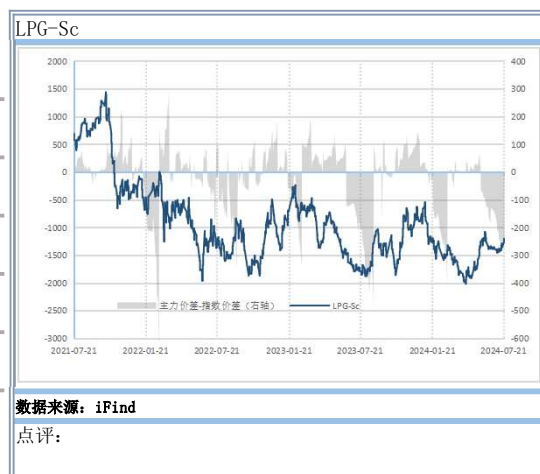
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: -2017.0000

期内最大值: -240.0000

期内平均值: -1269.7988

当前分位值: 45.92%



数据起始日: 2019/7/24

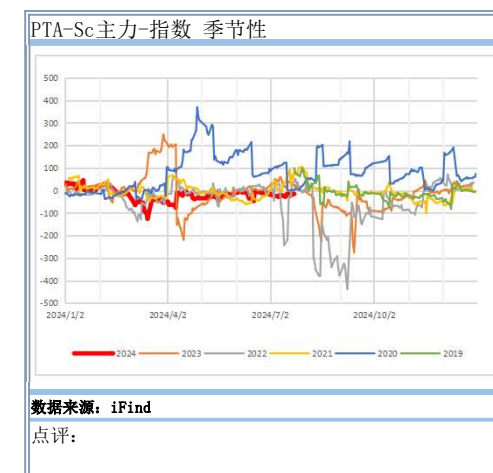
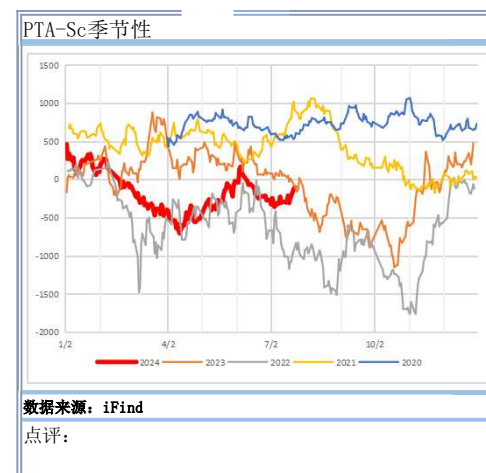
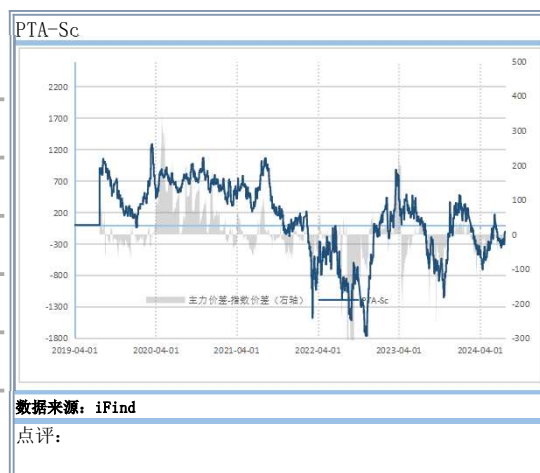
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: -1762.0000

期内最大值: 1061.0000

期内平均值: -210.7846

当前分位值: 58.77%



数据起始日: 2021/4/25

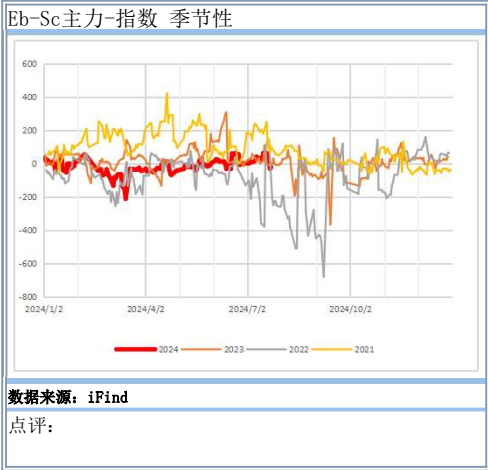
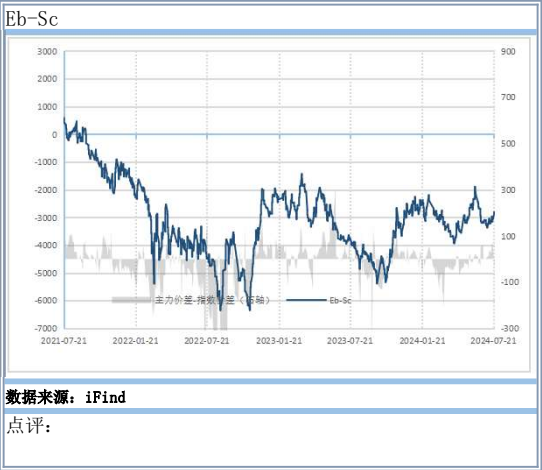
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: -6347.0000

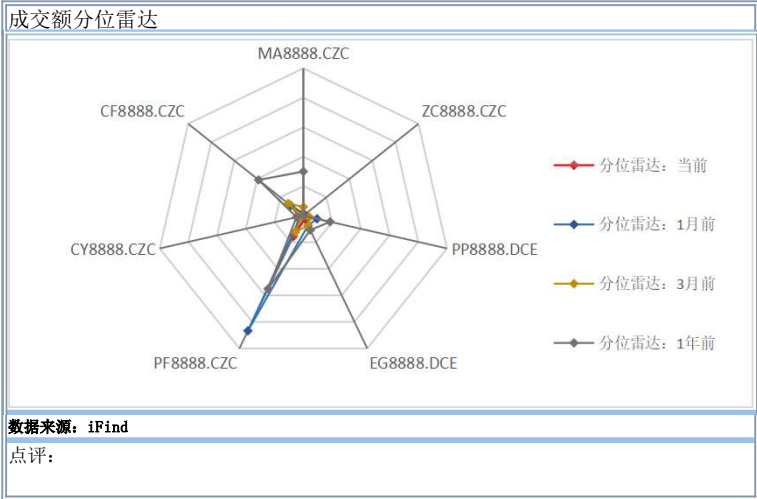
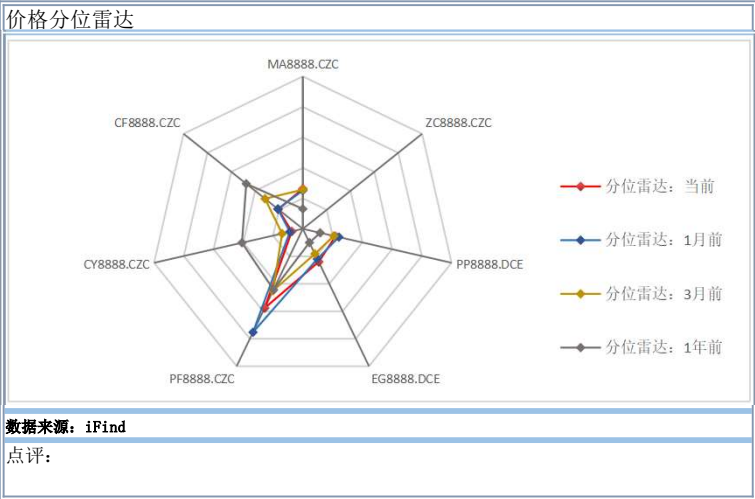
期内最大值: -1435.0000

期内平均值: -3499.1730

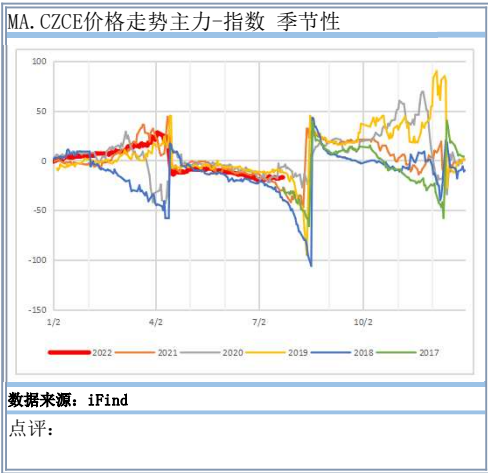
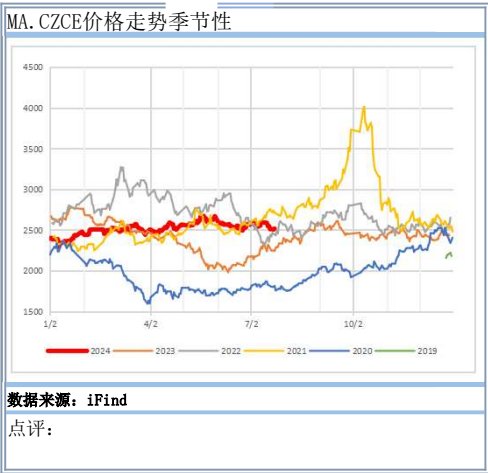
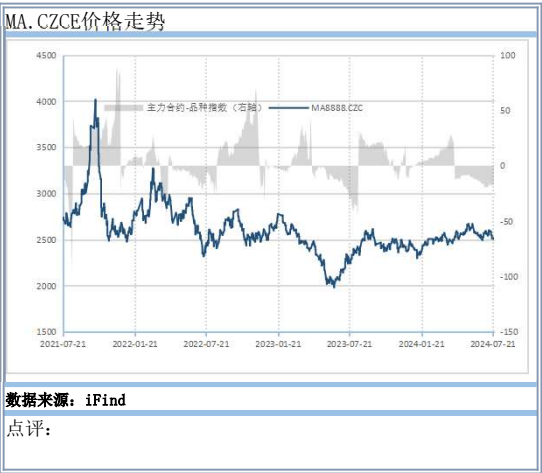
当前分位值: 72.05%



三、煤化工相关



数据起始日: 2019/7/24
数据截止日: 2024/7/23
期内最小值: 1982
期内最大值: 4015
期内平均值: 2592.8121
当前分位值: 26.32%



数据起始日: 2019/7/24

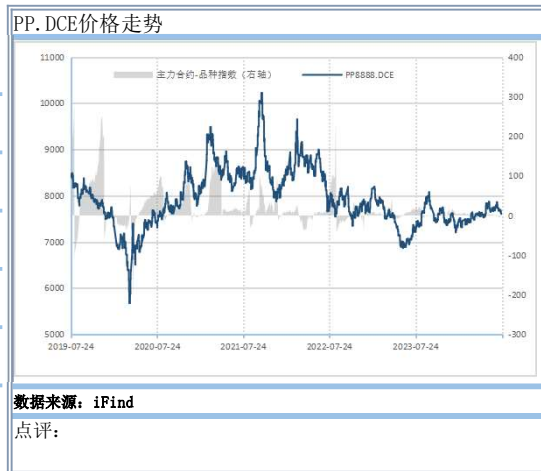
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 6865

期内最大值: 10224

期内平均值: 7924.3347

当前分位值: 21.97%



数据起始日: 2019/7/24

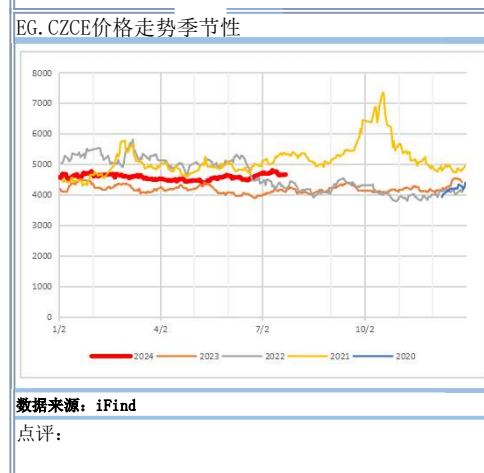
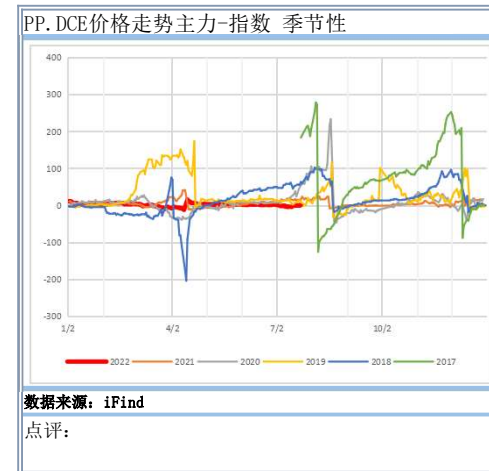
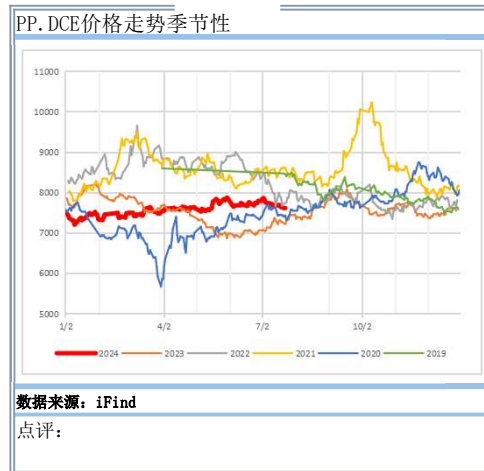
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 3778

期内最大值: 7345

期内平均值: 4572.6968

当前分位值: 24.00%



数据起始日: 2020/10/12

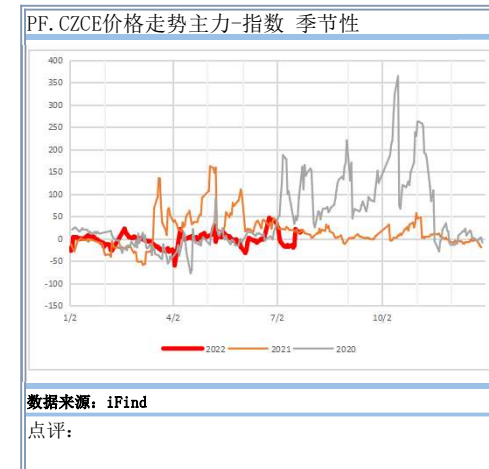
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 6904

期内最大值: 7907

期内平均值: 7360.9235

当前分位值: 57.63%



数据起始日: 2019/7/24

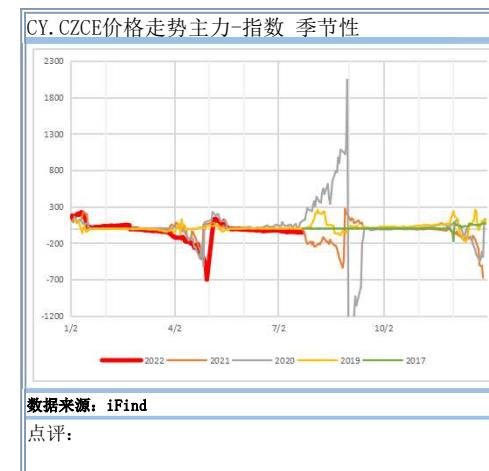
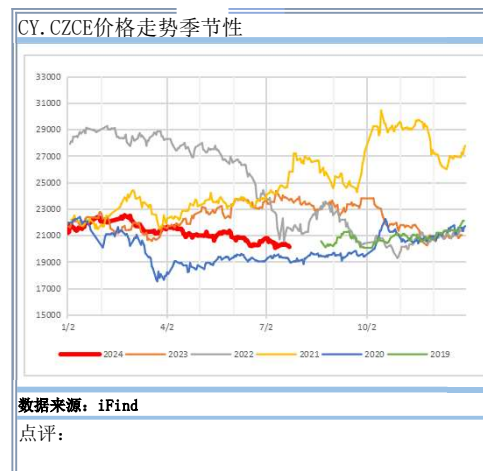
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 19292

期内最大值: 30443

期内平均值: 23553.4966

当前分位值: 7.45%



数据起始日: 2019/7/24

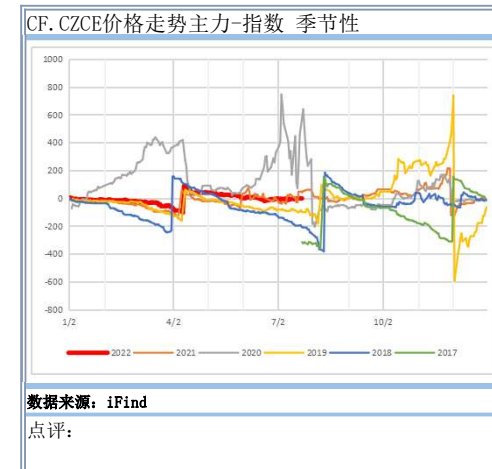
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 12447

期内最大值: 22574

期内平均值: 16829.2181

当前分位值: 20.62%



数据起始日: 2019/7/24

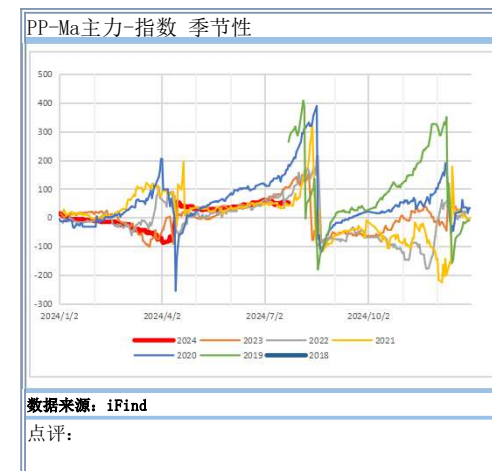
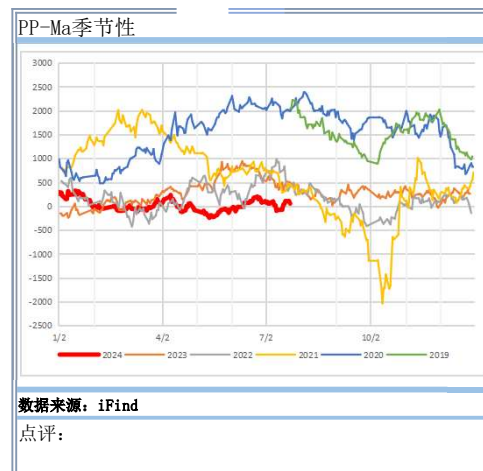
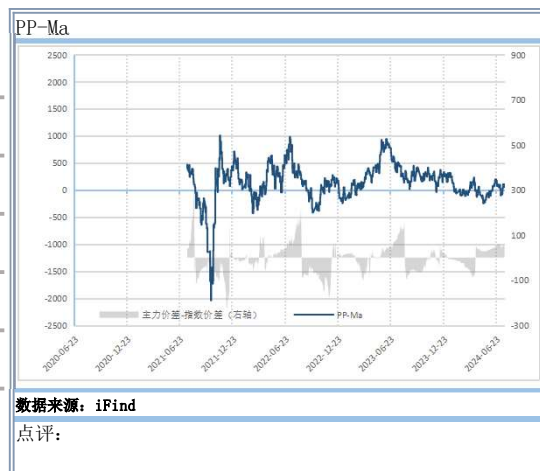
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: -2039.0000

期内最大值: 1007.0000

期内平均值: 145.8985

当前分位值: 68.65%



数据起始日: 2019/7/24

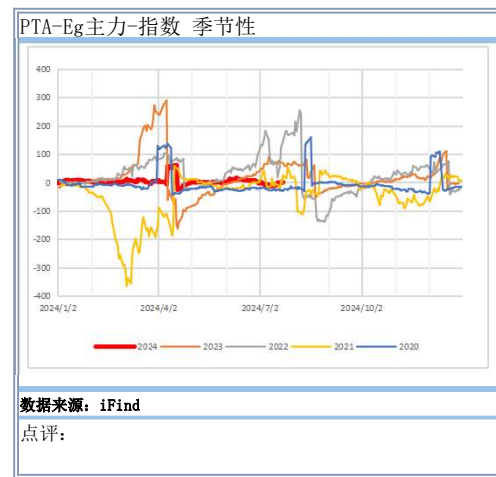
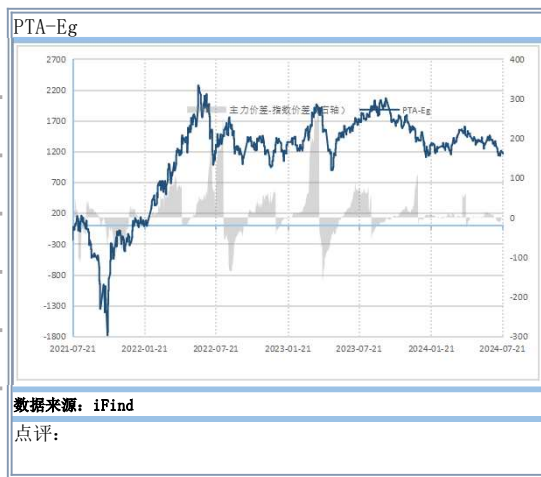
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: -1783.0000

期内最大值: 2269.0000

期内平均值: 1111.5528

当前分位值: 73.05%



数据起始日: 2021/12/29

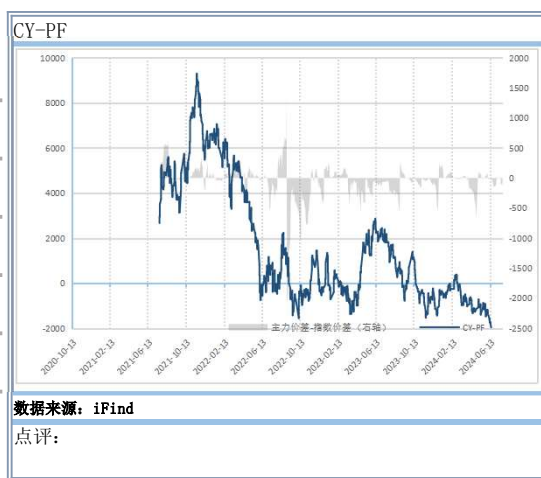
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: -2887.0000

期内最大值: 2854.0000

期内平均值: -152.9830

当前分位值: 9.82%



数据起始日: 2023/2/10

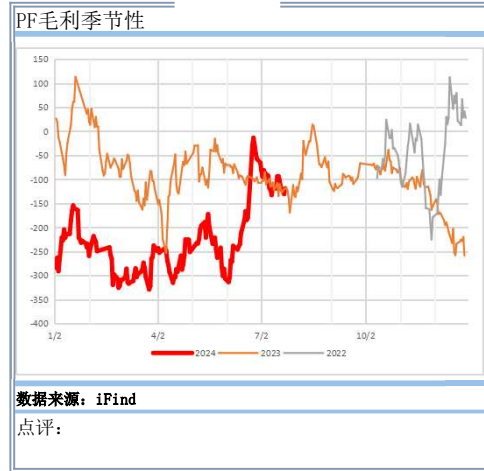
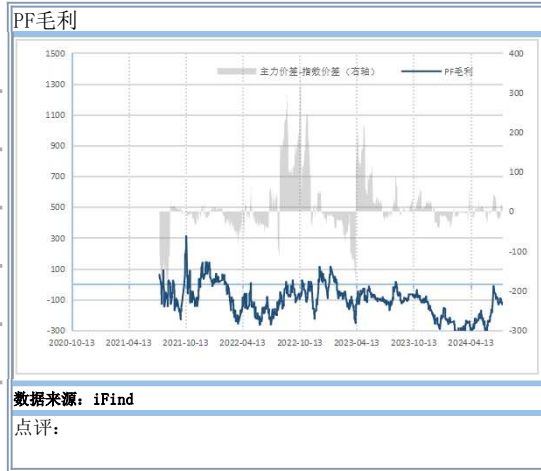
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: -328.9900

期内最大值: 13.9250

期内平均值: -149.5555

当前分位值: 61.30%



数据起始日: 2019/7/24

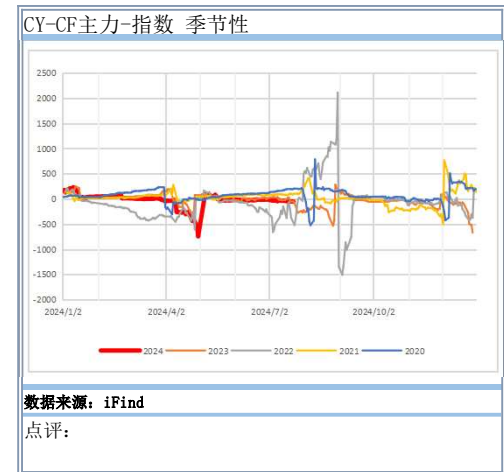
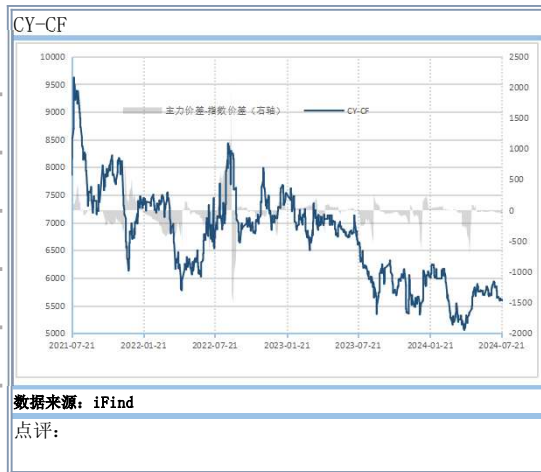
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 5061.0000

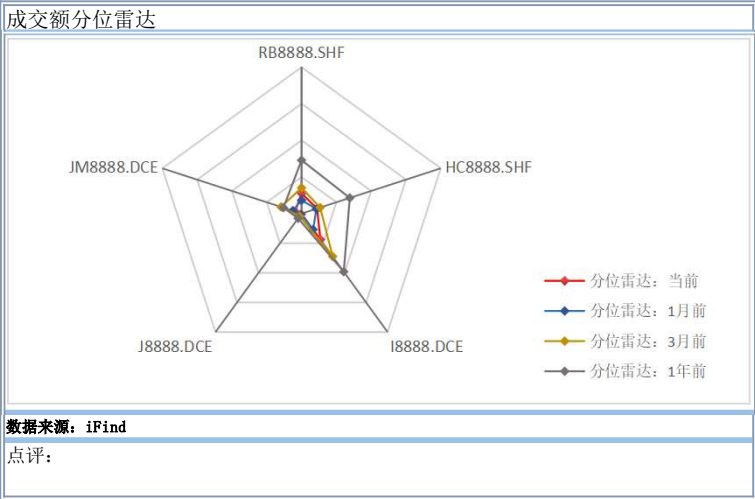
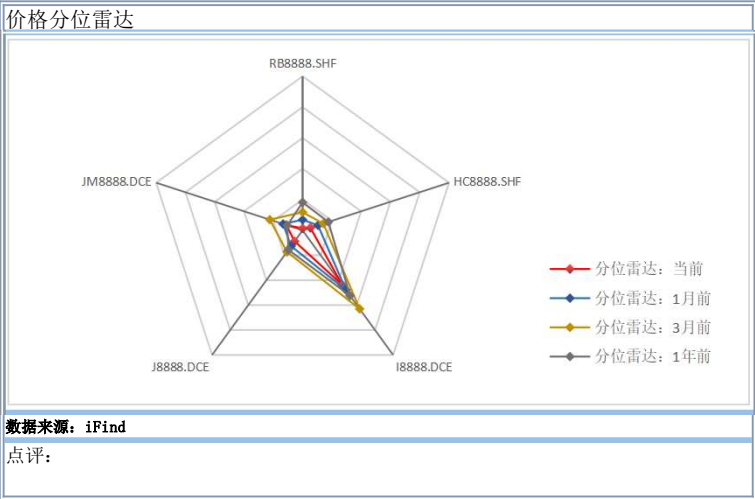
期内最大值: 9616.0000

期内平均值: 6724.2785

当前分位值: 11.57%



四、黑色相关



数据起始日： 2019/7/24

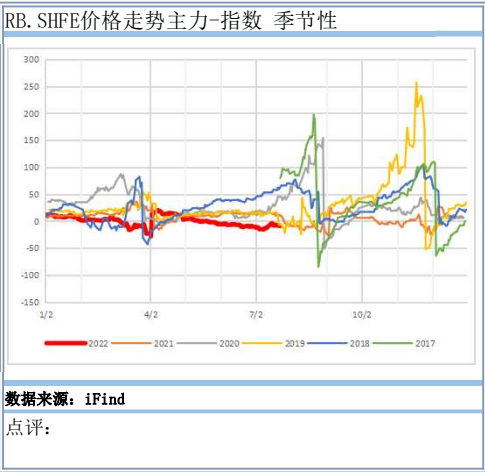
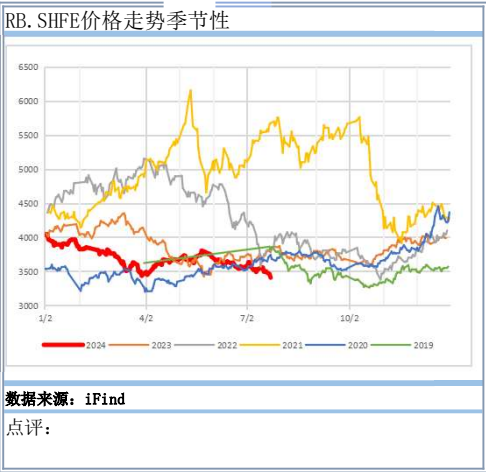
数据截止日： 2024/7/23

期内最小值： 3377

期内最大值： 5762

期内平均值： 4118.2689

当前分位值： 1.26%



数据起始日: 2019/7/24

数据截止日: 2024/7/23

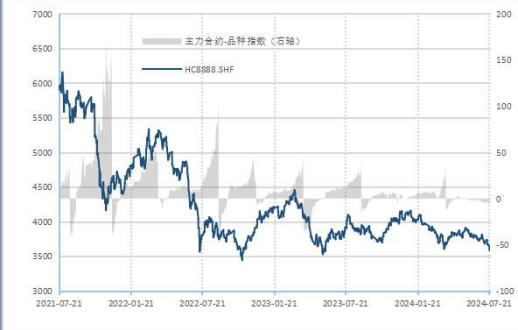
期内最小值: 3444

期内最大值: 6152

期内平均值: 4252.4266

当前分位值: 5.32%

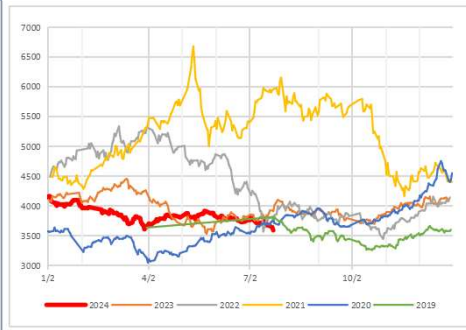
HC.SHFE价格走势



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: 2019/7/24

数据截止日: 2024/7/23

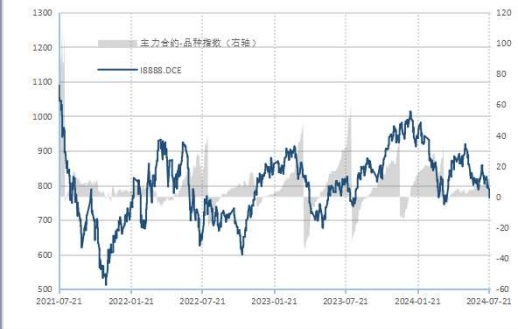
期内最小值: 512.8

期内最大值: 1088.6

期内平均值: 799.1431

当前分位值: 43.70%

I.DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

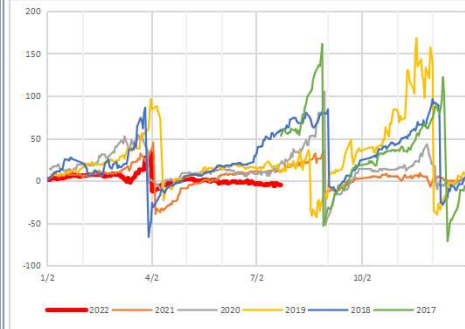
I.DCE价格走势季节性



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: 2019/7/24

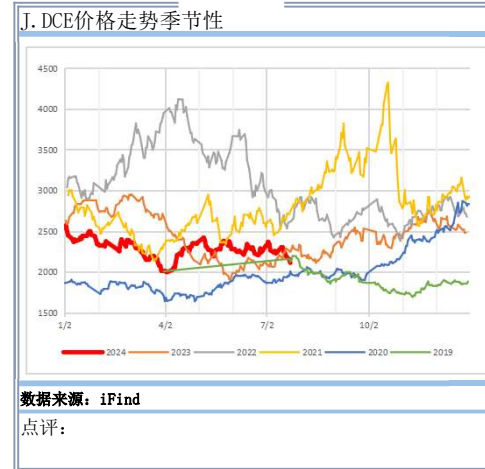
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 1897.9

期内最大值: 4320.8

期内平均值: 2716.3246

当前分位值: 8.80%



数据起始日: 2019/7/24

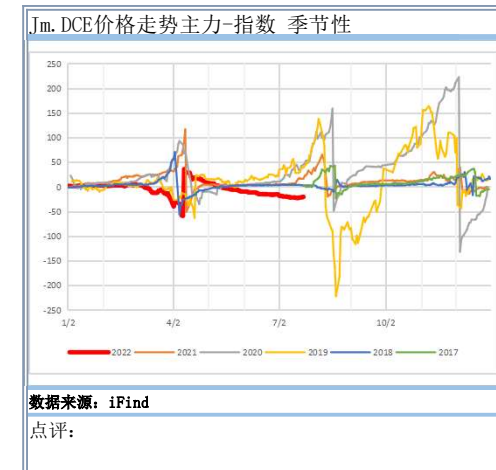
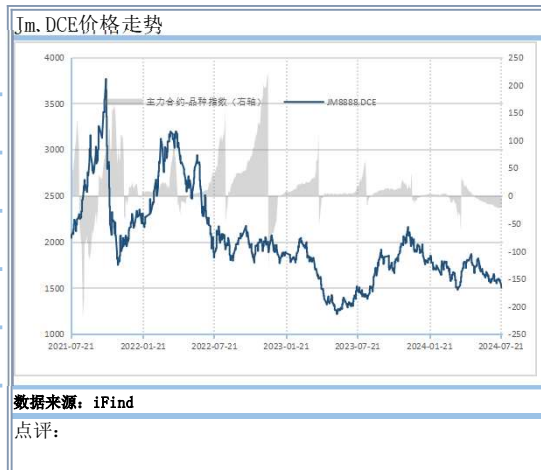
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 1219.4

期内最大值: 3764.7

期内平均值: 2009.5414

当前分位值: 11.18%



数据起始日： 2019/7/24

数据截止日： 2024/7/23

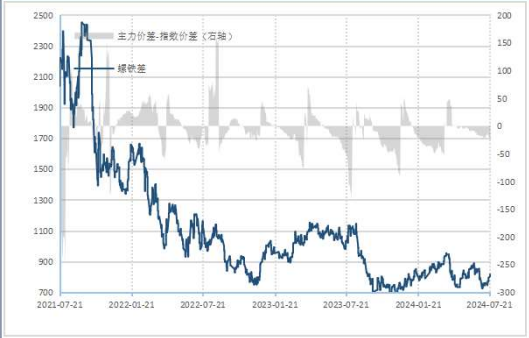
期内最小值： 670.1176

期内最大值： 2451.8235

期内平均值： 1110.1784

当前分位值： 8.20%

螺铁差



数据来源：iFind

点评：

数据起始日： 2019/7/24

数据截止日： 2024/7/23

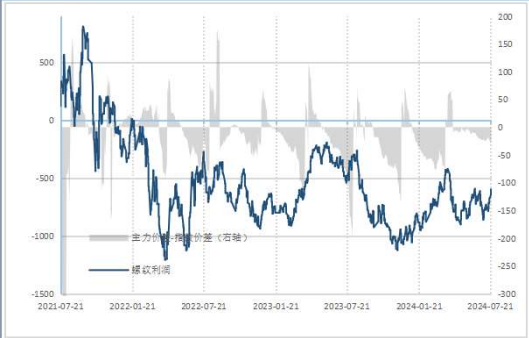
期内最小值： -1206.9091

期内最大值： 810.0000

期内平均值： -530.5982

当前分位值： 30.25%

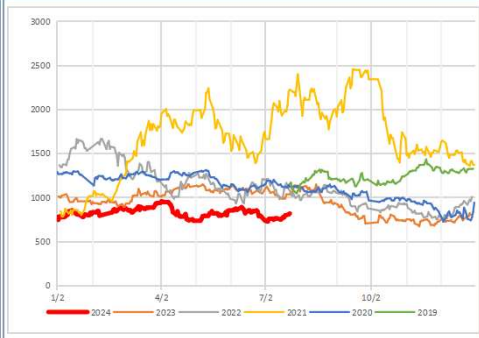
螺纹利润



数据来源：iFind

点评：

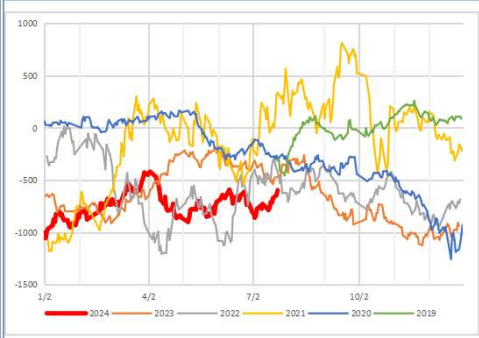
螺铁差季节性



数据来源：iFind

点评：

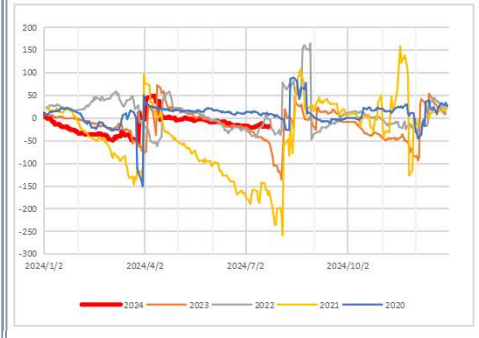
螺纹利润季节性



数据来源：iFind

点评：

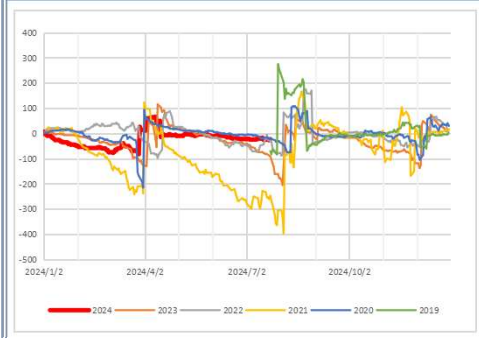
螺铁差主力-指数 季节性



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: 2019/7/24

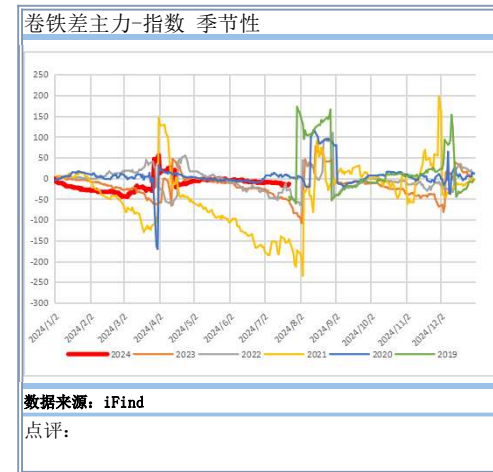
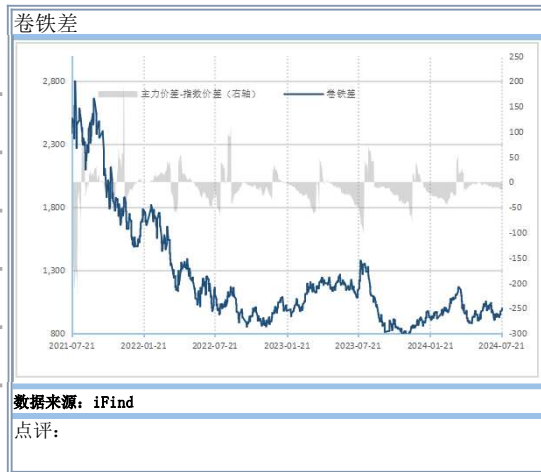
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 752.4706

期内最大值: 2799.4118

期内平均值: 1244.3362

当前分位值: 11.96%



数据起始日: 2019/7/24

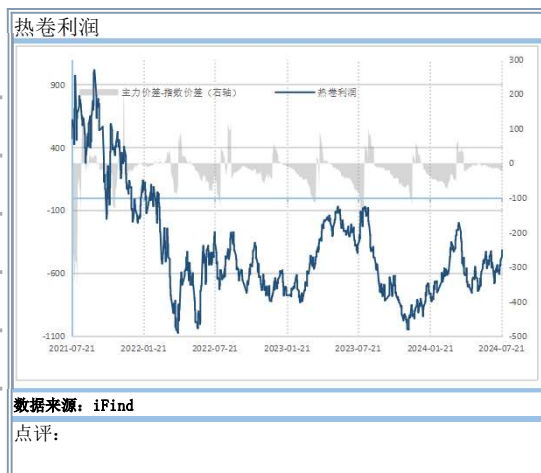
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: -1073.7273

期内最大值: 1014.0000

期内平均值: -396.4405

当前分位值: 31.51%



数据起始日: 2019/7/24

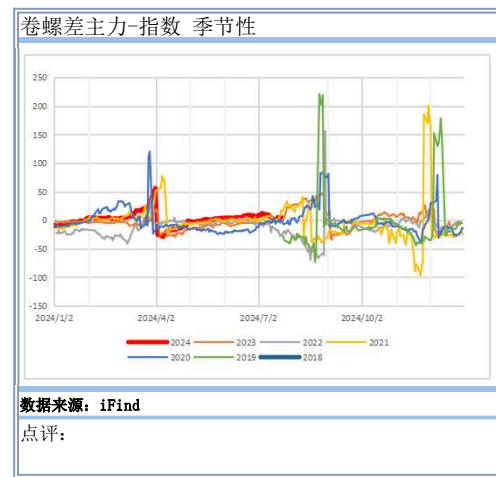
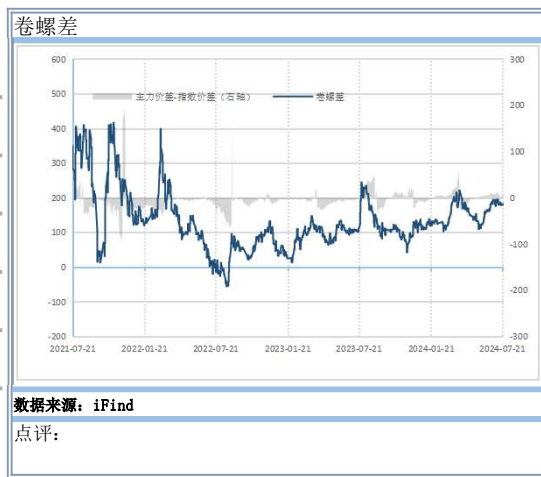
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: -56.0000

期内最大值: 416.0000

期内平均值: 134.1578

当前分位值: 50.21%



数据起始日: 2019/7/24

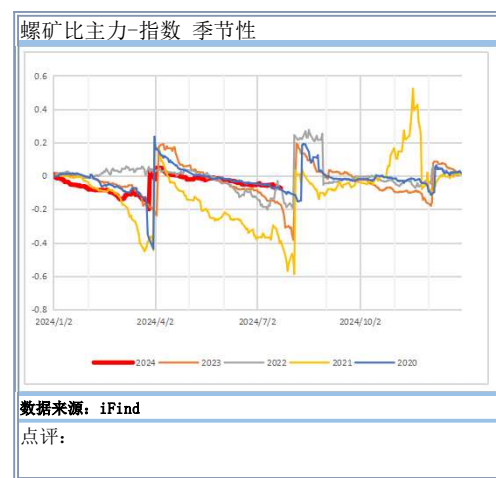
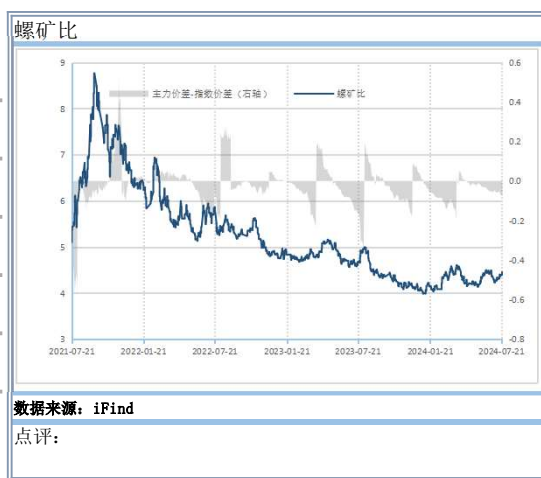
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 3.9880

期内最大值: 8.7631

期内平均值: 5.2337

当前分位值: 9.82%



数据起始日: 2019/7/24

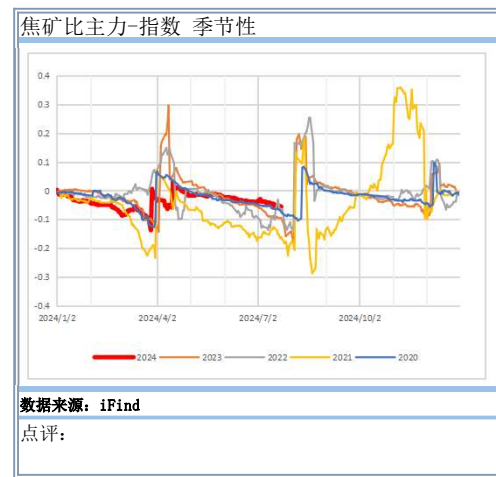
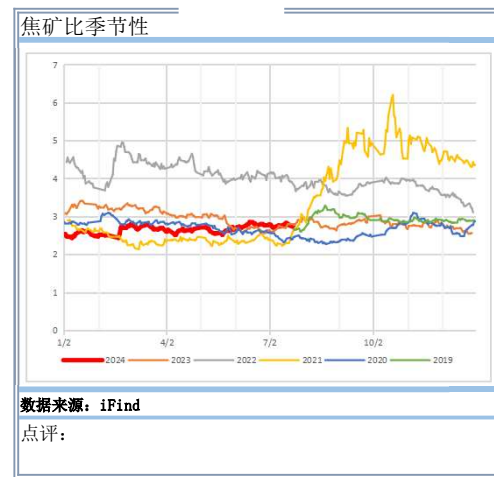
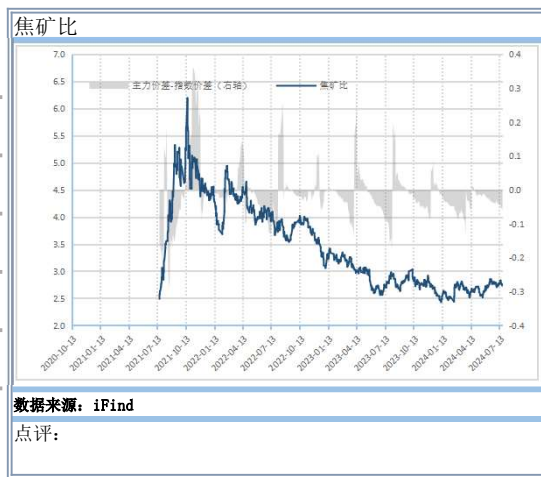
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 2.4279

期内最大值: 6.1947

期内平均值: 3.4587

当前分位值: 8.86%



数据起始日: 2019/7/24

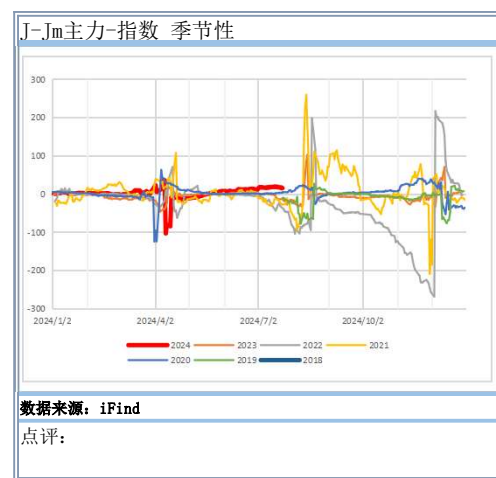
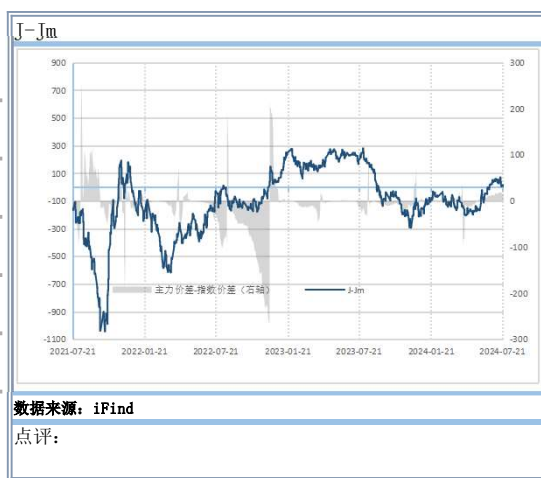
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: -1043.0800

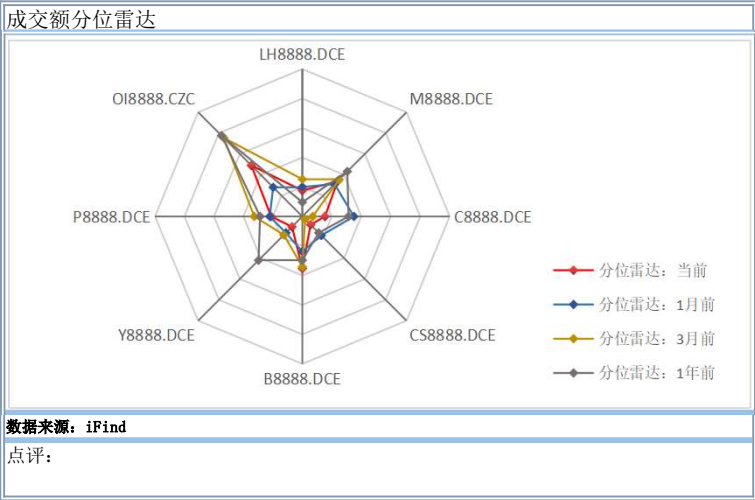
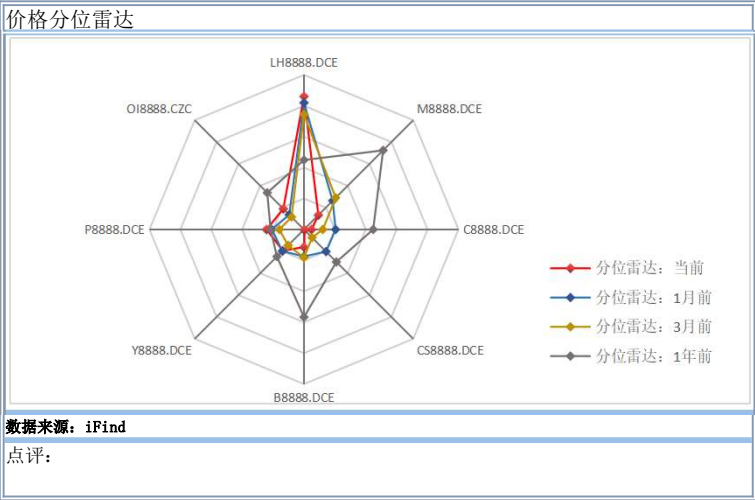
期内最大值: 279.1600

期内平均值: -97.0334

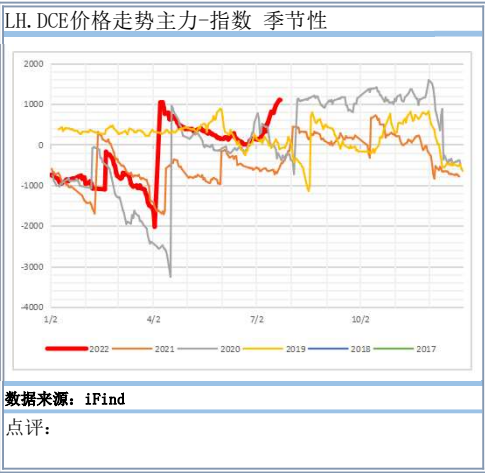
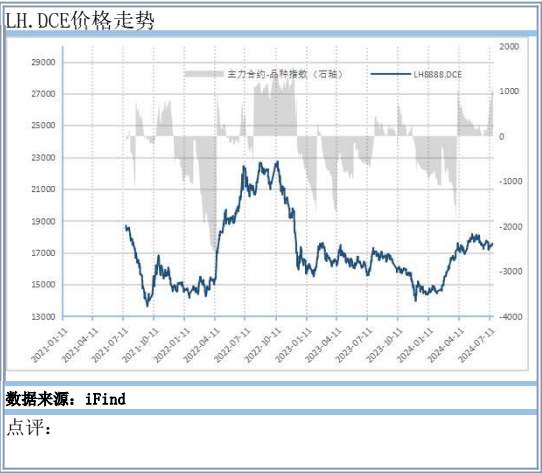
当前分位值: 79.30%



五、农产品相关



数据起始日: 2021/1/8
数据截止日: 2024/7/23
期内最小值: 13971
期内最大值: 18158
期内平均值: 16276.8724
当前分位值: 86.03%



数据起始日: 2019/7/24

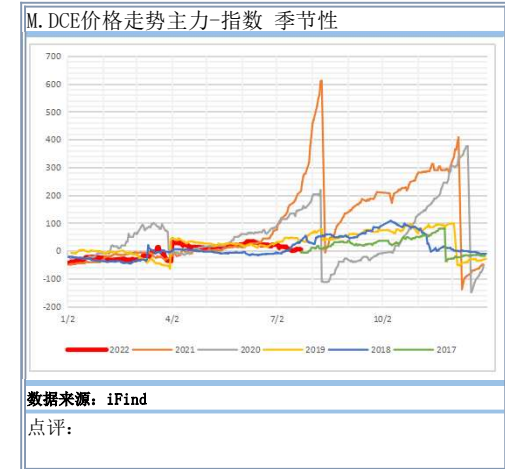
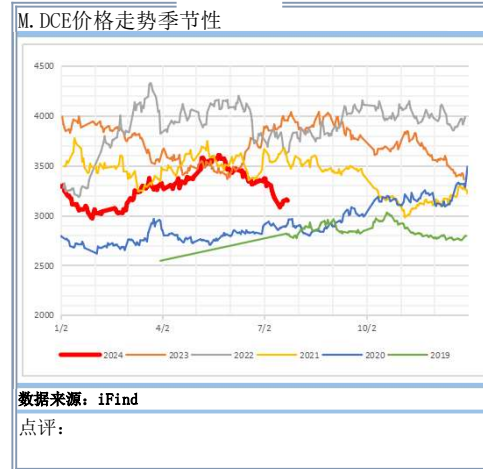
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 2970

期内最大值: 4328

期内平均值: 3634.3539

当前分位值: 13.18%



数据起始日: 2019/7/24

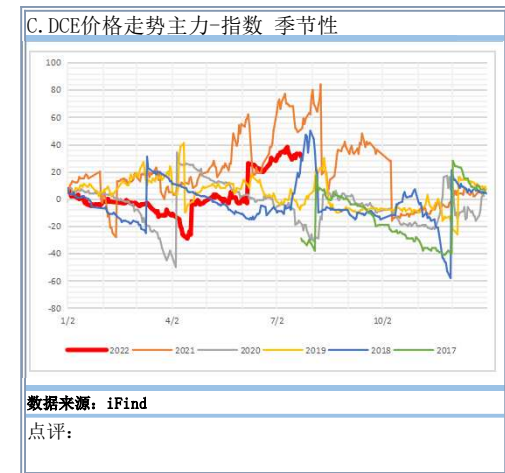
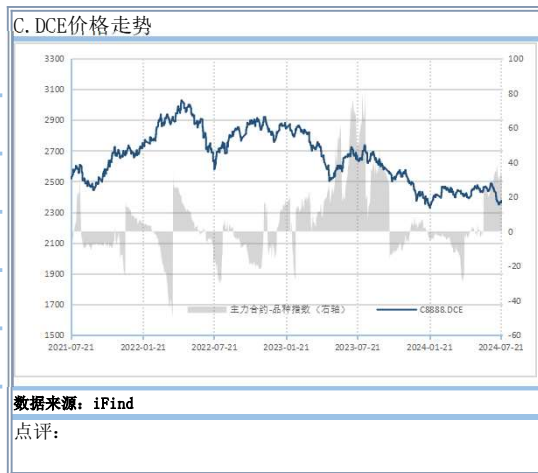
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 2328

期内最大值: 3027

期内平均值: 2660.1125

当前分位值: 4.86%



数据起始日: 2019/7/24

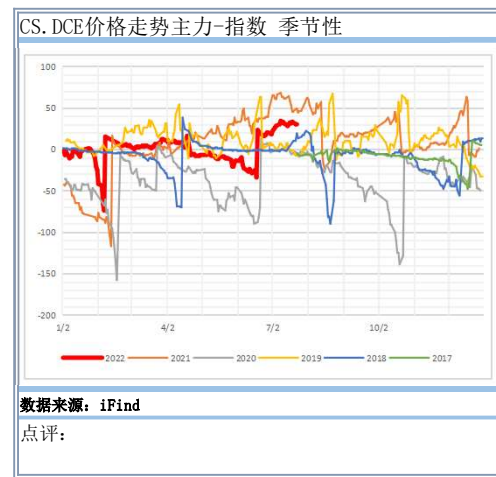
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 2784

期内最大值: 3512

期内平均值: 3019.0933

当前分位值: 0.41%



数据起始日: 2019/7/24

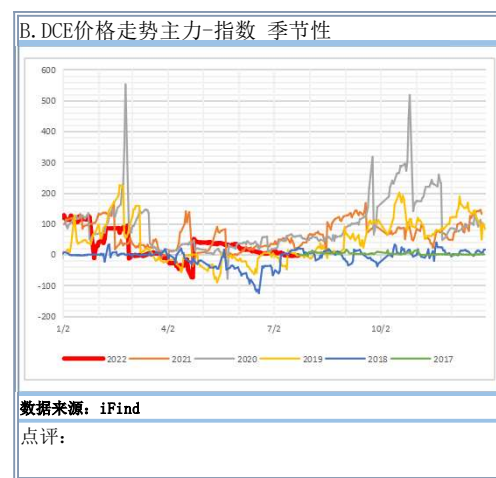
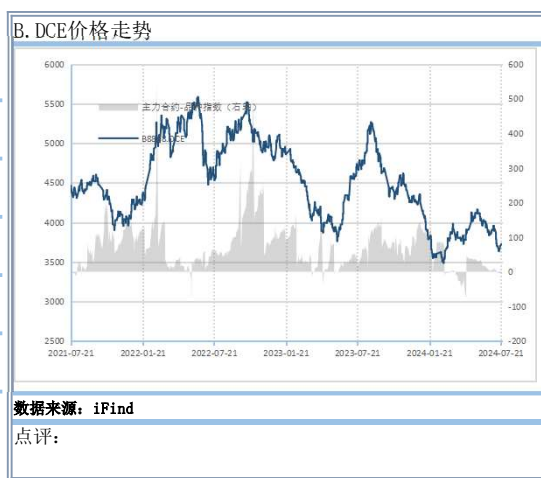
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 3487

期内最大值: 5585

期内平均值: 4506.5871

当前分位值: 11.39%



数据起始日: 2019/7/24

数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 6793

期内最大值: 12065

期内平均值: 8710.0453

当前分位值: 19.35%



数据起始日: 2019/7/24

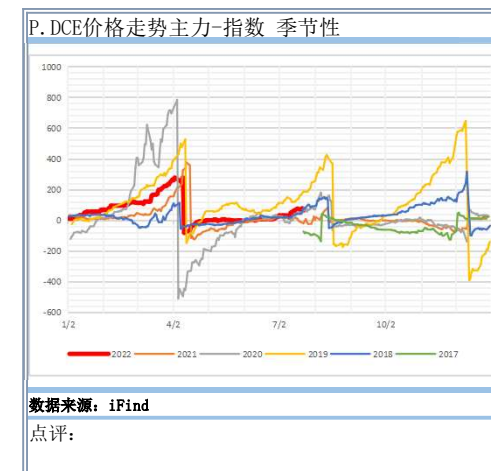
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 6349

期内最大值: 12479

期内平均值: 8303.7764

当前分位值: 24.26%



数据起始日: 2019/7/24

数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 7475

期内最大值: 14344

期内平均值: 10163.6626

当前分位值: 18.91%

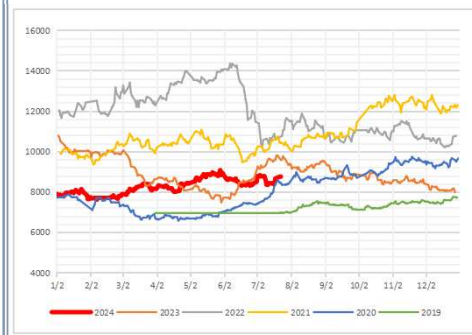
OI.CZCE价格走势



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: 2022/3/2

数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 7508.2500

期内最大值: 11785.0000

期内平均值: 9750.5129

当前分位值: 92.66%

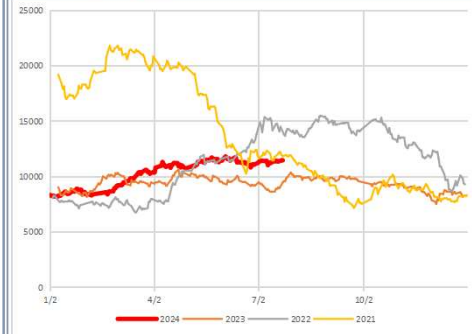
育肥收益



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

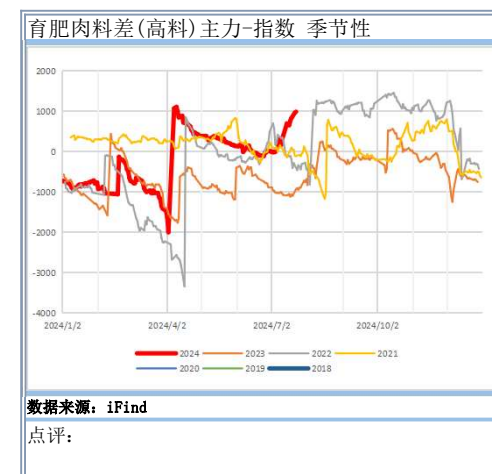
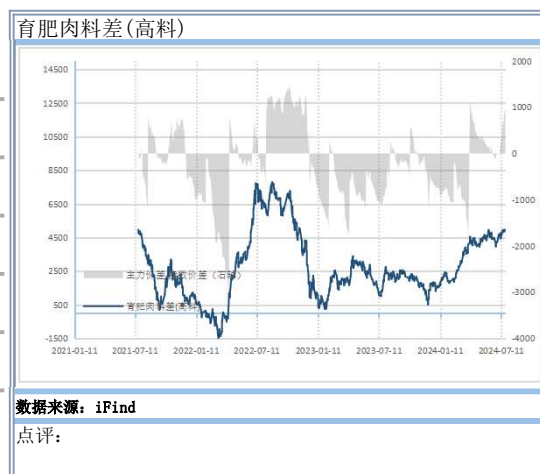
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 515.0000

期内最大值: 4976.0000

期内平均值: 2722.2966

当前分位值: 100.00%



数据起始日: 2019/7/24

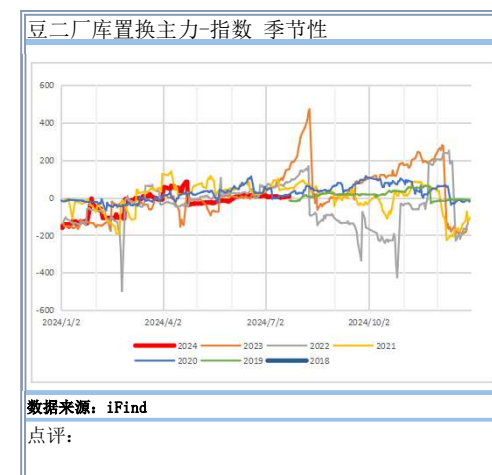
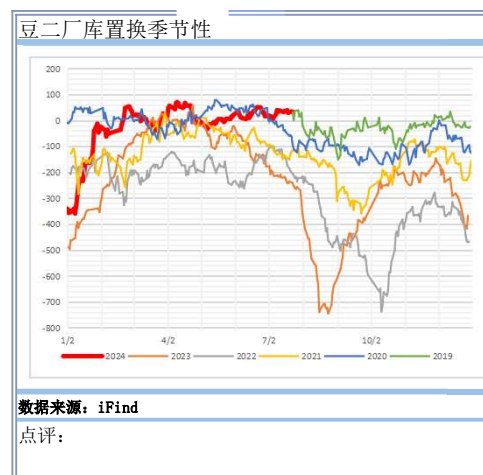
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: -745.0200

期内最大值: 71.2200

期内平均值: -202.2609

当前分位值: 95.12%



数据起始日: 2019/7/24

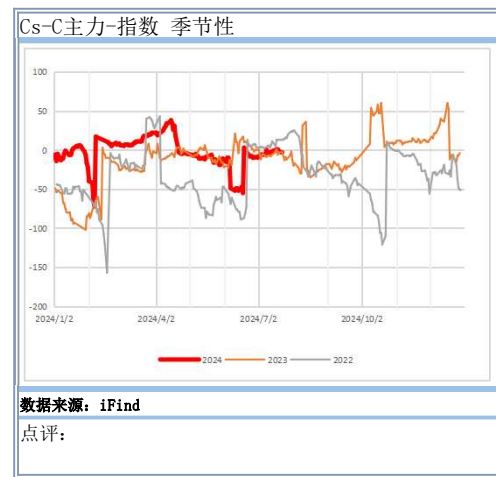
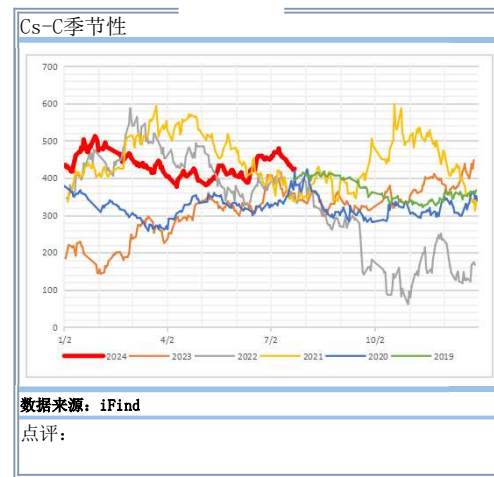
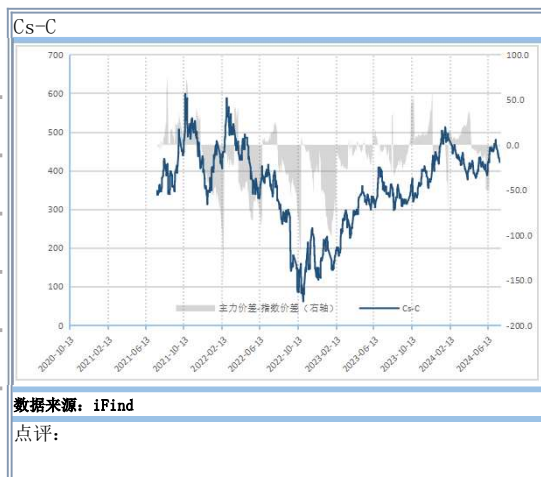
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: 62.0000

期内最大值: 598.0000

期内平均值: 358.9808

当前分位值: 67.72%



数据起始日: 2019/7/24

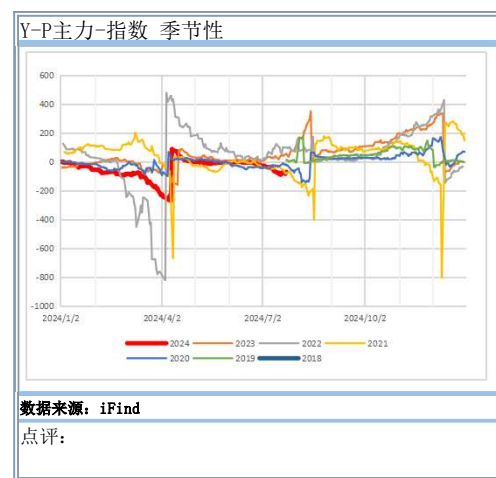
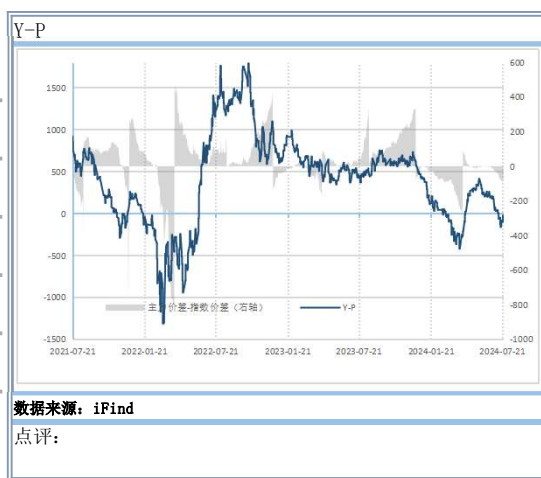
数据截止日: 2024/7/23

期内最小值: -1313.0000

期内最大值: 1788.0000

期内平均值: 406.2689

当前分位值: 41.60%



数据起始日： 2019/7/24

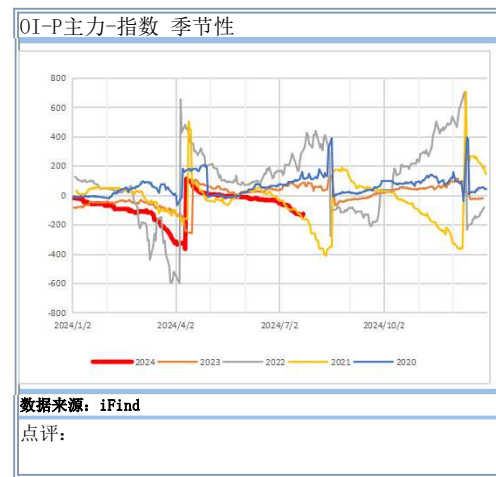
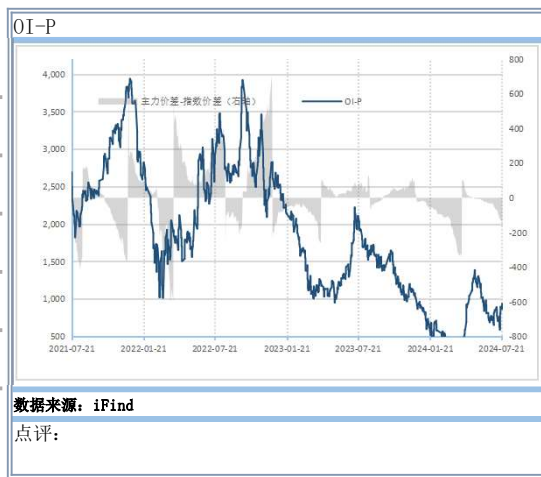
数据截止日： 2024/7/23

期内最小值： 19.0000

期内最大值： 2220.0000

期内平均值： 1121.6232

当前分位值： 41.75%



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。