

<http://www.shanlingh.com>

# 盘面套利观察

2024年7月25日

撰写：曹有明

交易咨询资格证号：Z0013162

审核：朱美侠

交易咨询资格证号：Z0015621

复核：刘书语

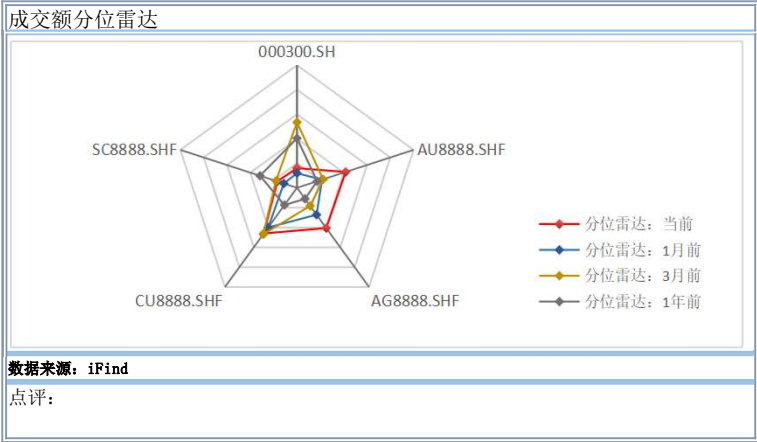
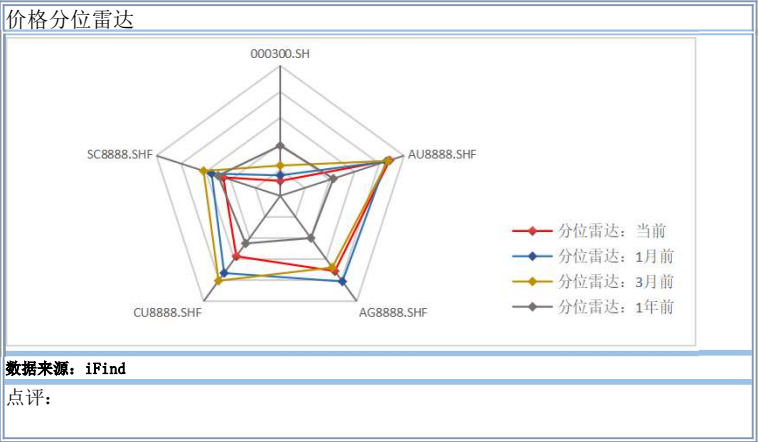
从业资格证号：F03107583

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：2019/7/26

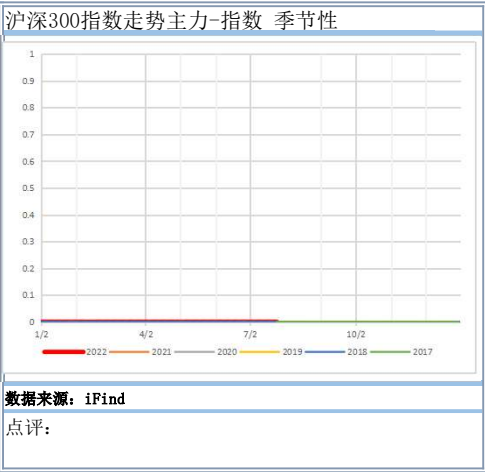
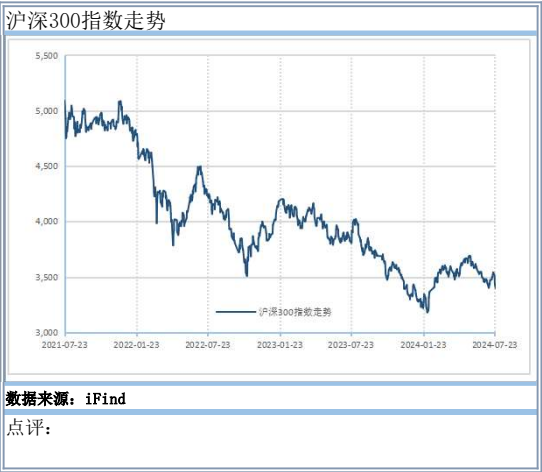
数据截止日：2024/7/25

期内最小值：3179.6276

期内最大值：5089.2282

期内平均值：4034.2451

当前分位值：23.27%



数据起始日: 2019/7/26

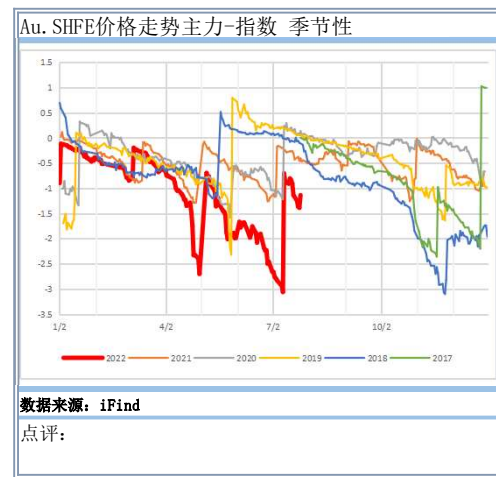
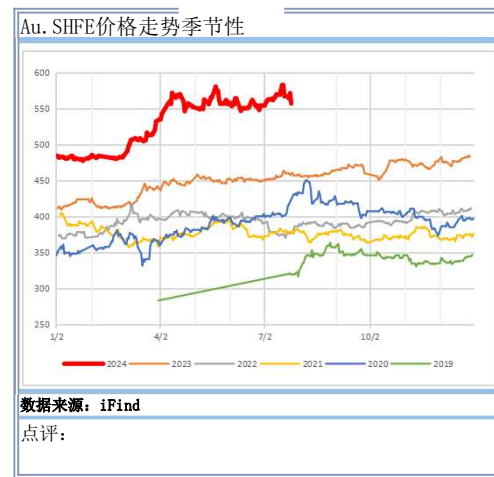
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 363.2

期内最大值: 582.4

期内平均值: 434.9112

当前分位值: 88.33%



数据起始日: 2019/7/26

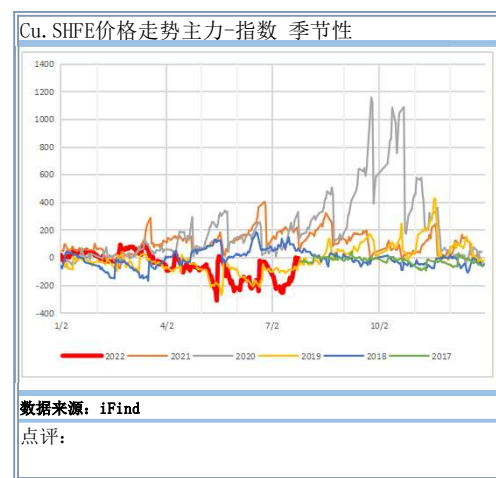
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 53367

期内最大值: 87697

期内平均值: 69215.0177

当前分位值: 57.34%



数据起始日: 2019/7/26

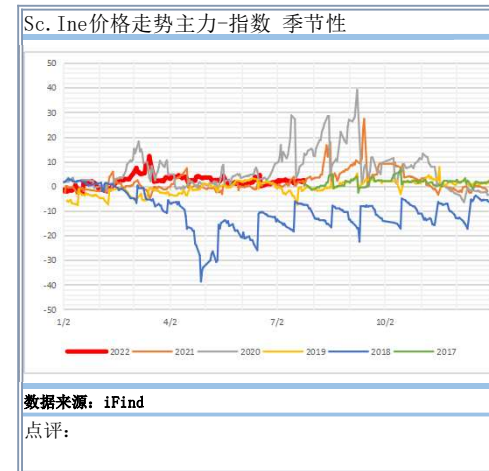
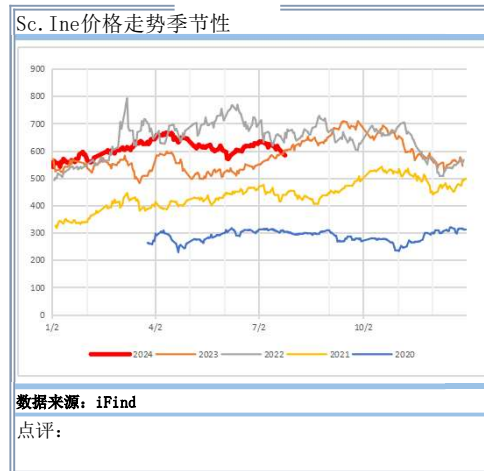
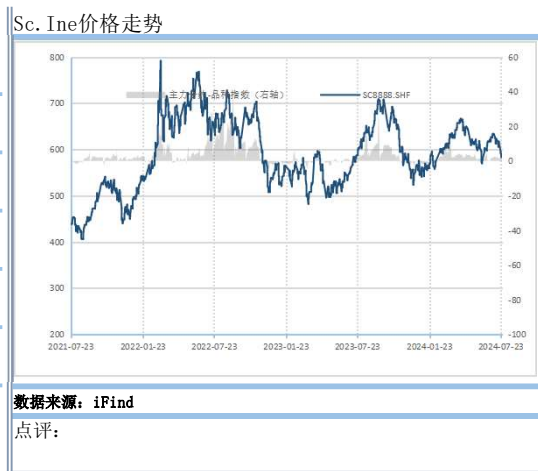
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 405.7

期内最大值: 791.6

期内平均值: 589.9543

当前分位值: 45.94%



数据起始日: 2019/7/26

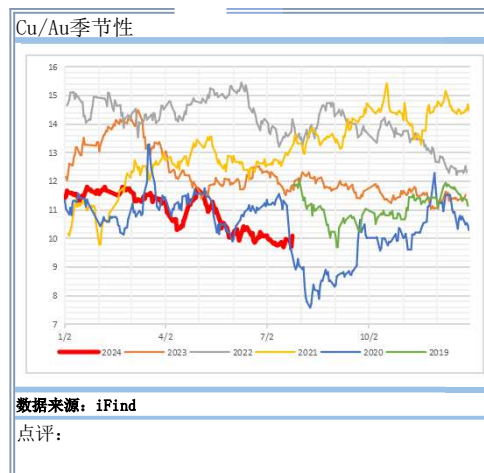
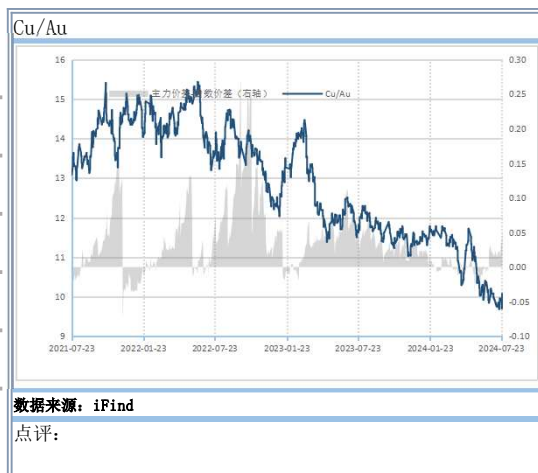
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 9.6881

期内最大值: 15.4319

期内平均值: 12.8549

当前分位值: 6.76%



数据起始日： 2019/7/26

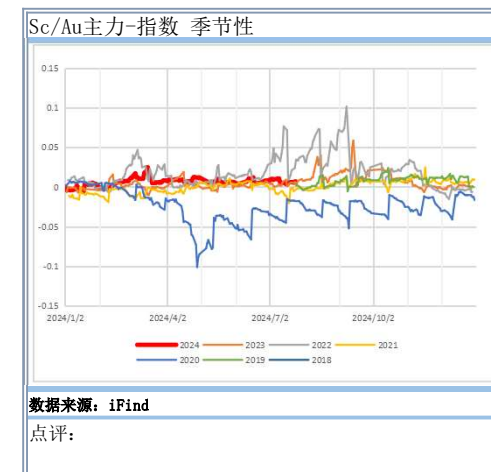
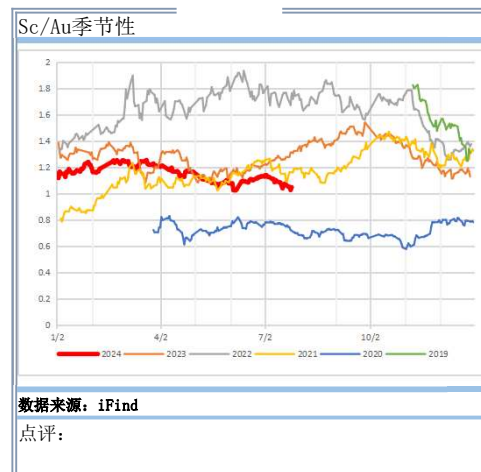
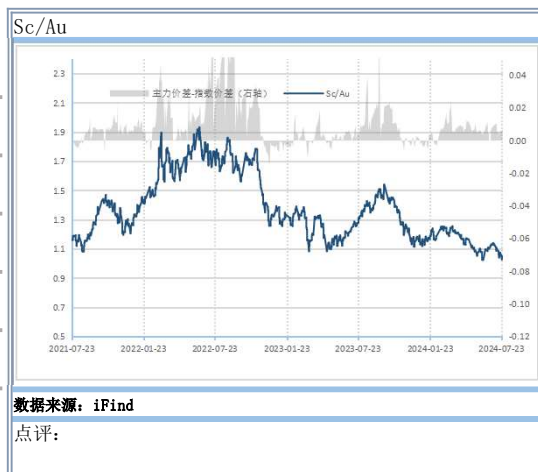
数据截止日： 2024/7/25

期内最小值： 1.0225

期内最大值： 1.9320

期内平均值： 1.3737

当前分位值： 2.70%



数据起始日： 2019/7/26

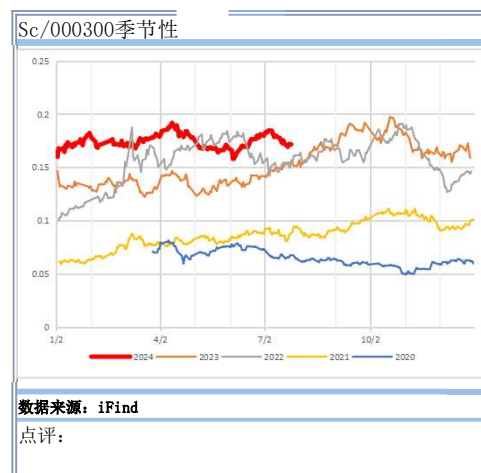
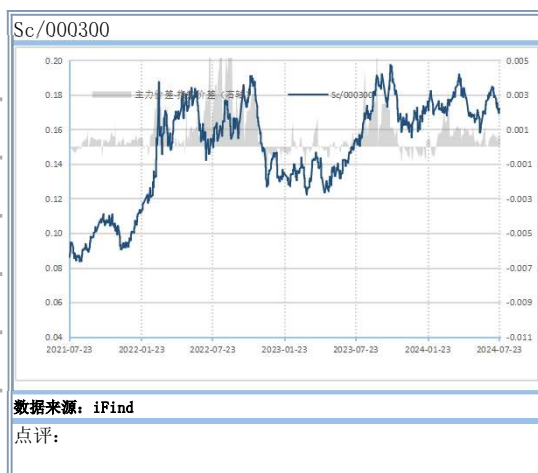
数据截止日： 2024/7/25

期内最小值： 0.0837

期内最大值： 0.1972

期内平均值： 0.1492

当前分位值： 77.38%



数据起始日: 2019/7/26

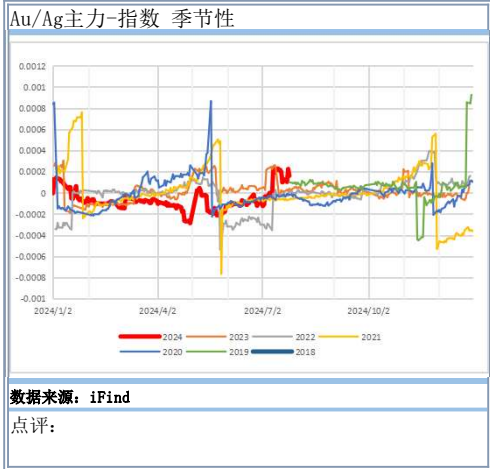
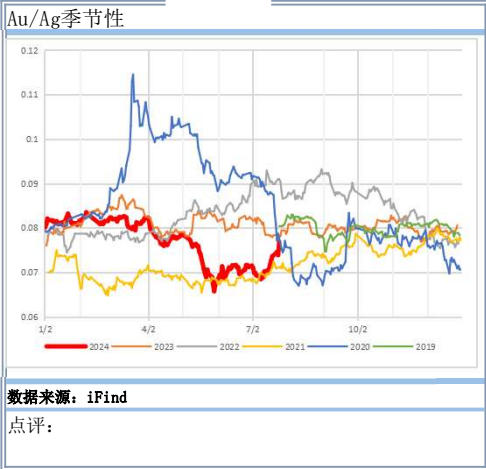
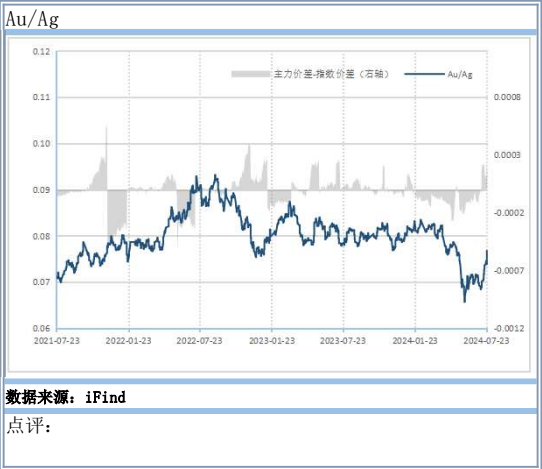
数据截止日: 2024/7/25

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: 40.37%



数据起始日: 2019/7/26

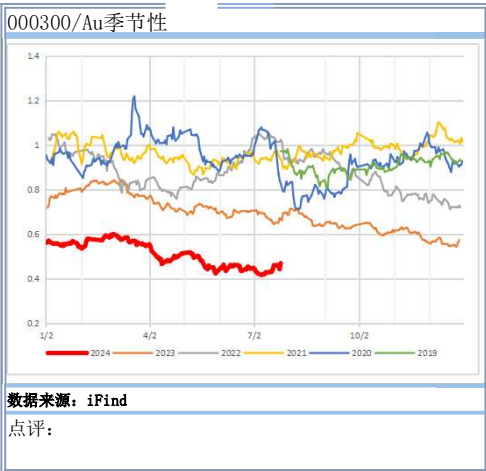
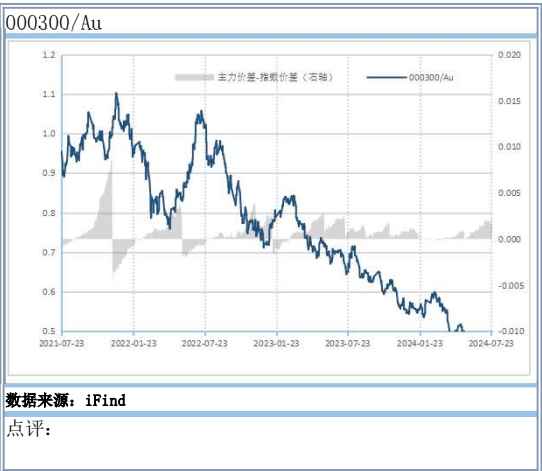
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 0.4165

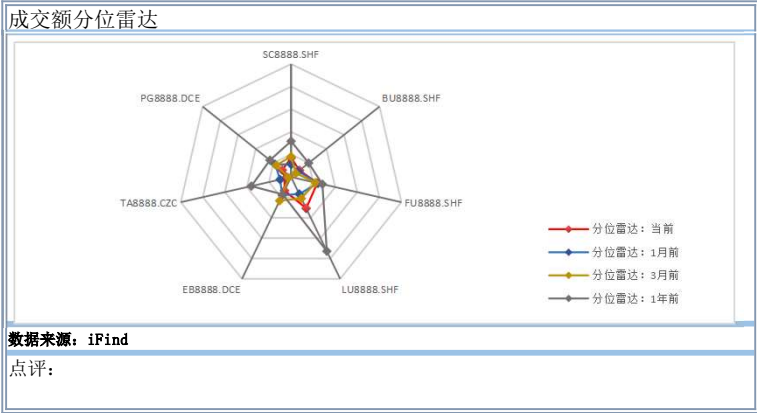
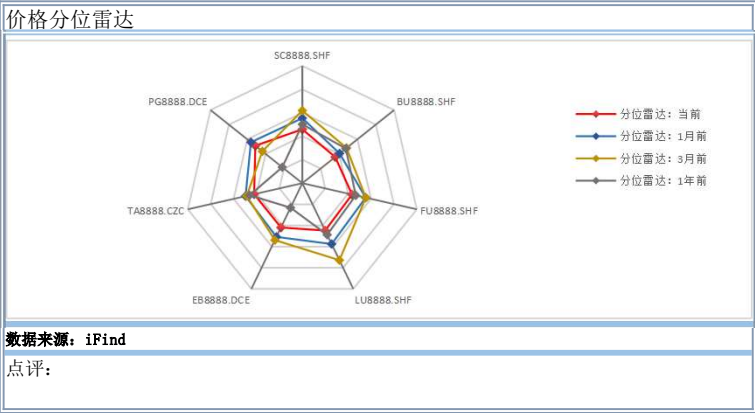
期内最大值: 1.1021

期内平均值: 0.7630

当前分位值: 7.64%



二、原油相关



数据起始日: 2019/7/26

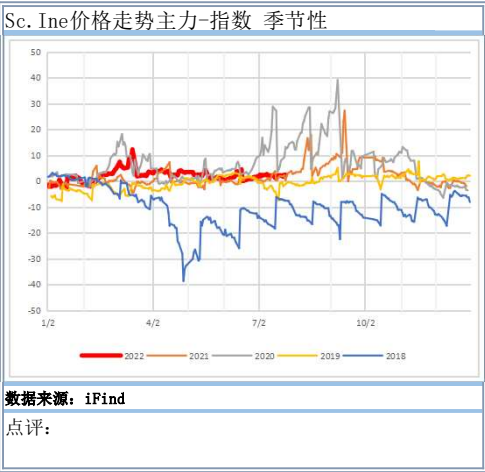
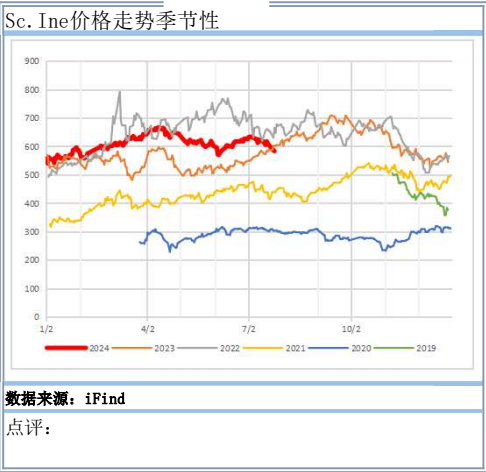
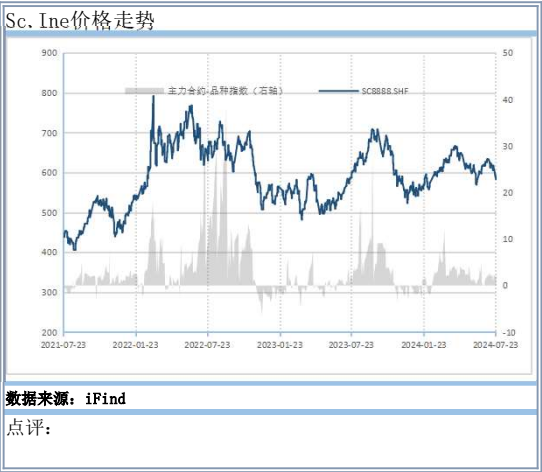
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 405.7

期内最大值: 791.6

期内平均值: 589.9543

当前分位值: 45.94%



数据起始日: 2019/7/26

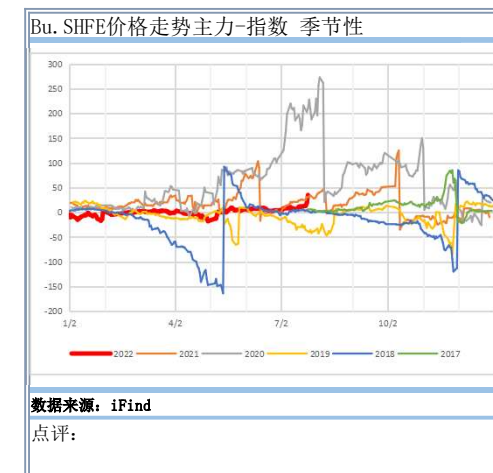
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 2821

期内最大值: 4794

期内平均值: 3668.6955

当前分位值: 35.78%



数据起始日: 2019/7/26

数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 2366

期内最大值: 4371

期内平均值: 3145.3634

当前分位值: 43.44%



数据起始日: 2020/6/22

数据截止日: 2024/7/25

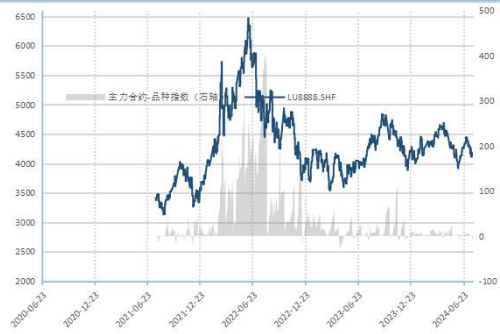
期内最小值: 3544

期内最大值: 4875

期内平均值: 4209.6753

当前分位值: 44.78%

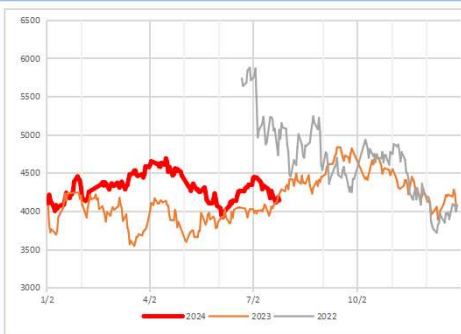
Lu. Ine价格走势



数据来源: iFind

点评:

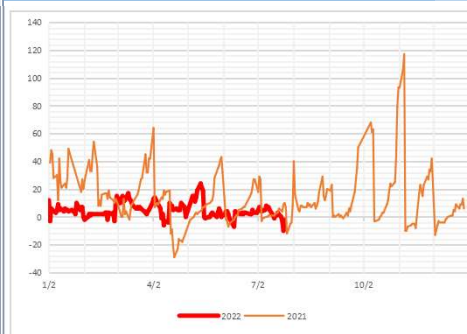
Lu. Ine价格走势季节性



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: 2024/7/25

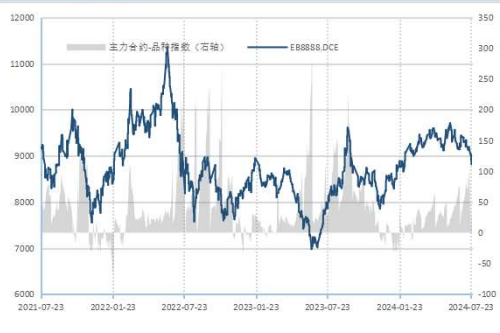
期内最小值: 6978

期内最大值: 11361

期内平均值: 8755.1231

当前分位值: 41.91%

EB. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

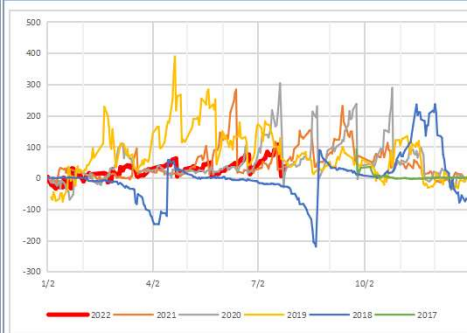
EB. DCE价格走势季节性



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: 2019/7/26

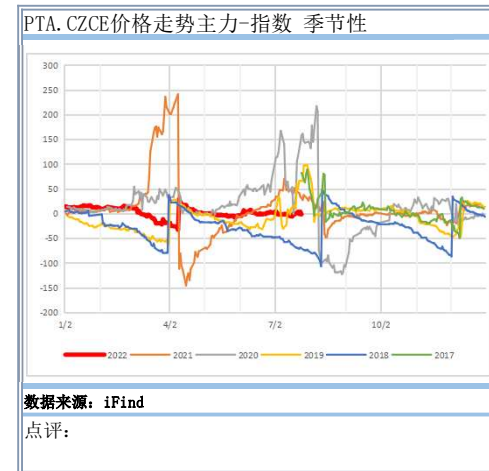
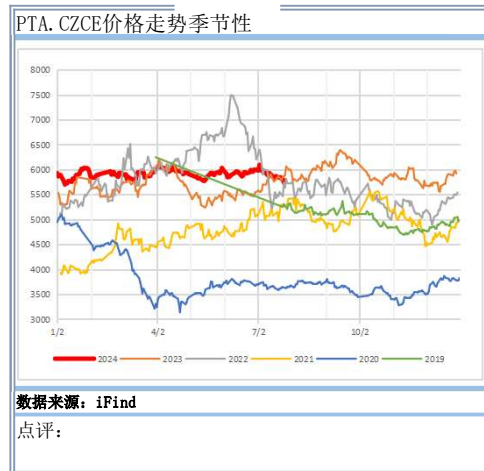
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 4462

期内最大值: 7488

期内平均值: 5685.7915

当前分位值: 42.10%



数据起始日: 2020/3/30

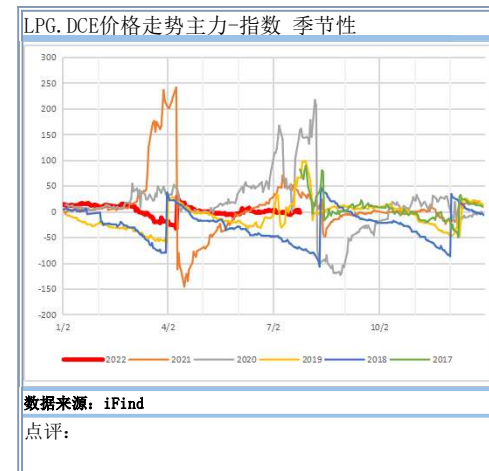
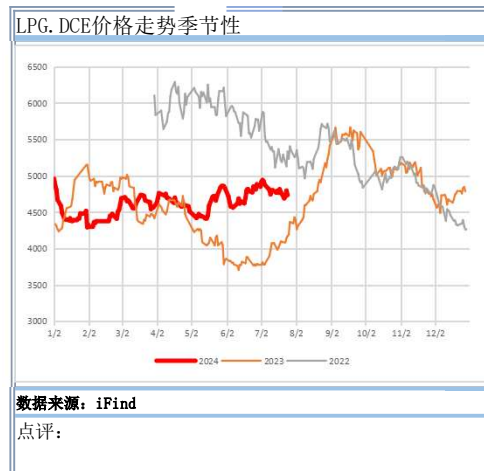
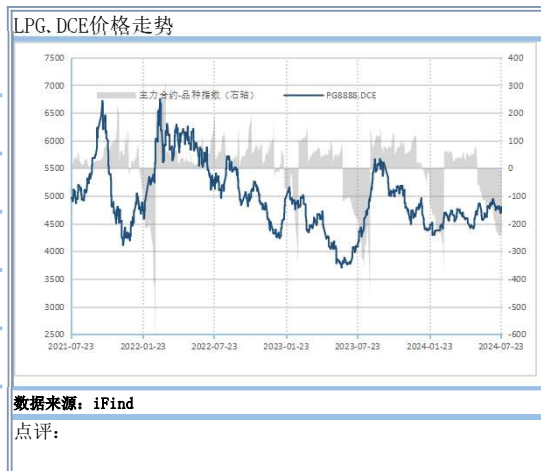
数据截止日: 2024/7/25

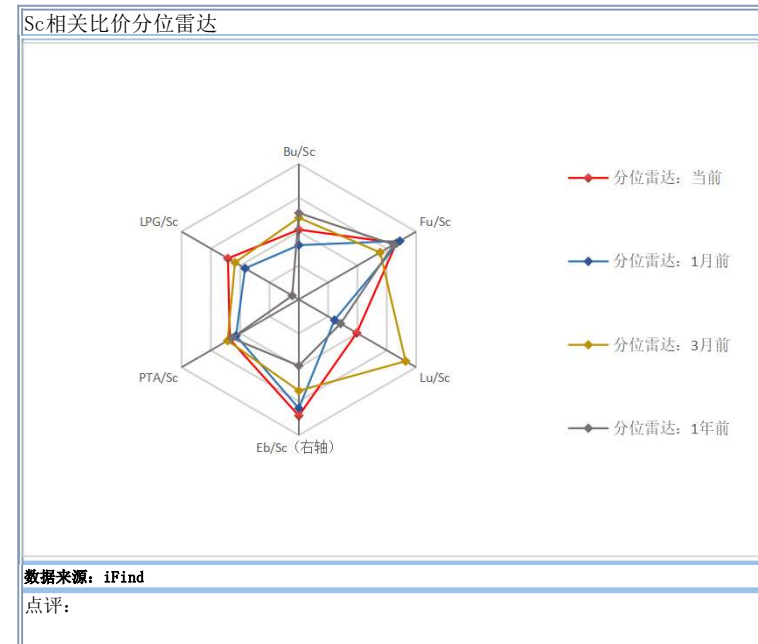
期内最小值: 3704

期内最大值: 5714

期内平均值: 4716.7427

当前分位值: 51.19%





数据起始日: 2019/7/26

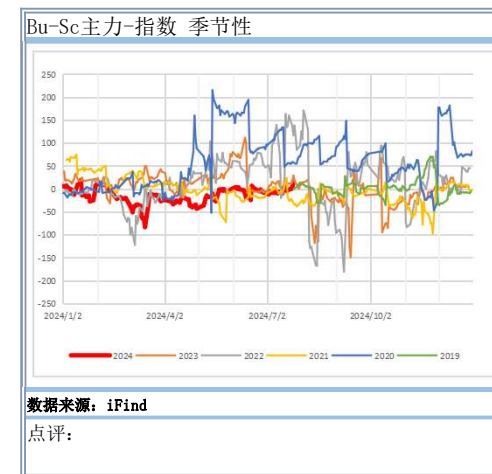
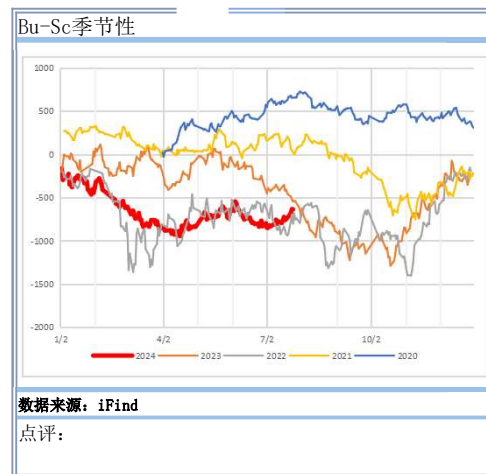
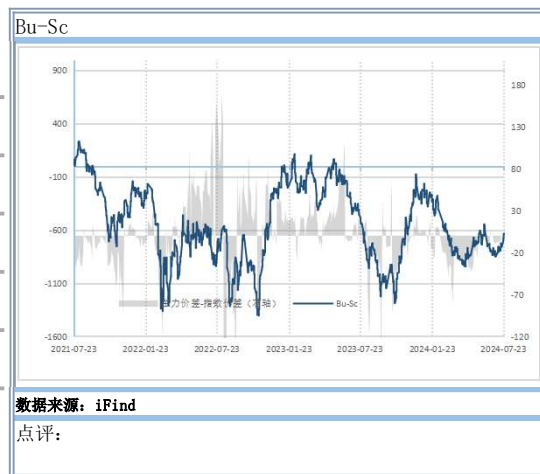
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: -1406.4286

期内最大值: 231.5714

期内平均值: -545.2640

当前分位值: 46.96%



数据起始日: 2019/7/26

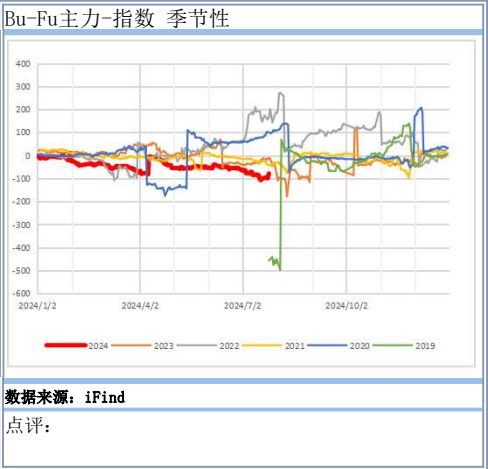
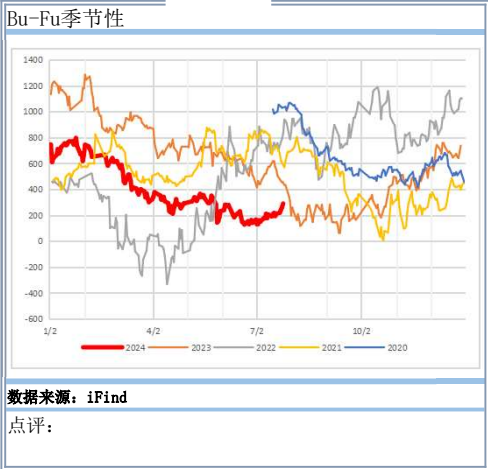
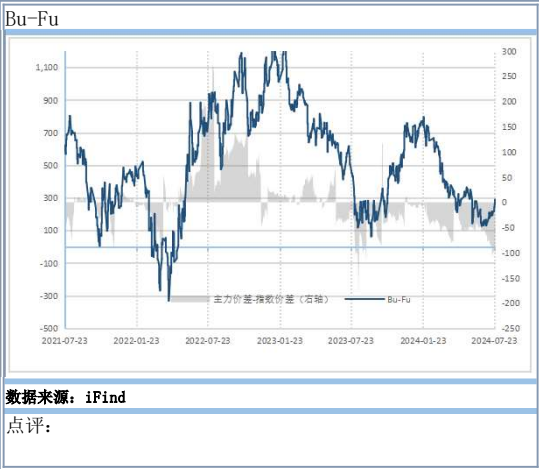
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: -331.0000

期内最大值: 1284.0000

期内平均值: 523.3321

当前分位值: 38.45%



数据起始日: 2021/10/18

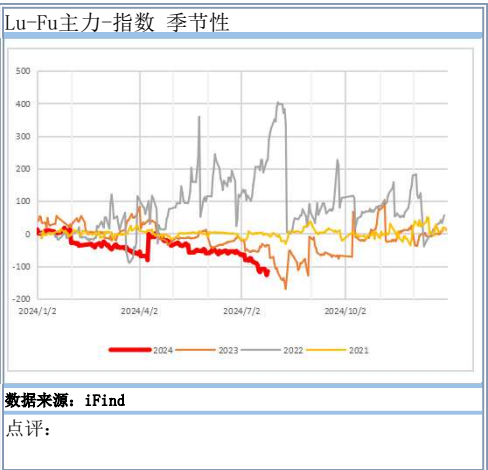
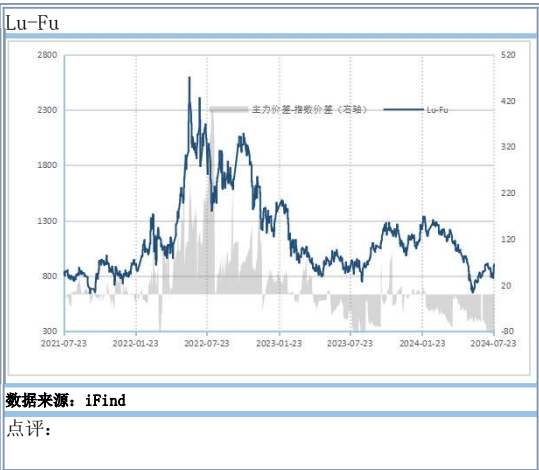
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 650.0000

期内最大值: 2046.0000

期内平均值: 1096.0541

当前分位值: 18.12%



数据起始日: 2021/8/23

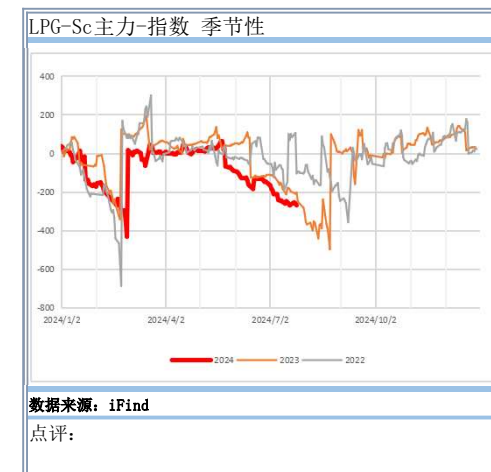
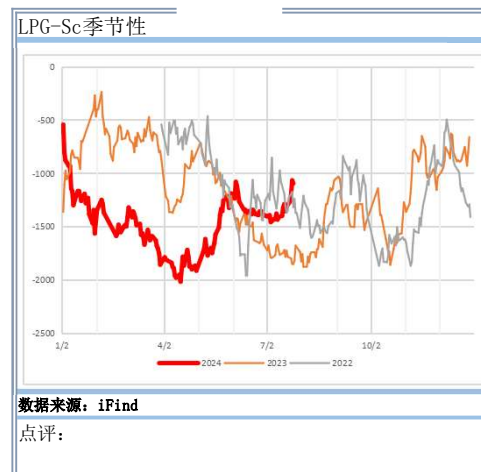
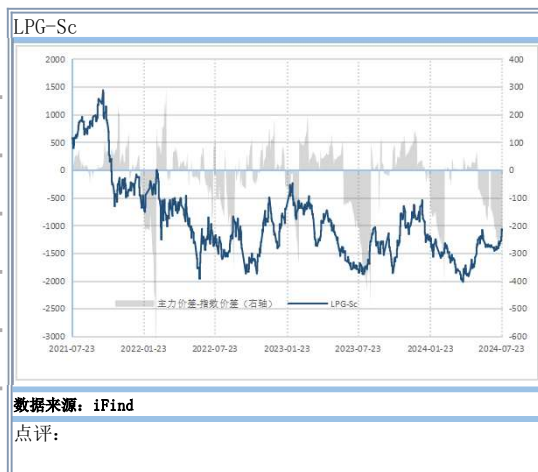
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: -2017.0000

期内最大值: -240.0000

期内平均值: -1268.5934

当前分位值: 51.77%



数据起始日: 2019/7/26

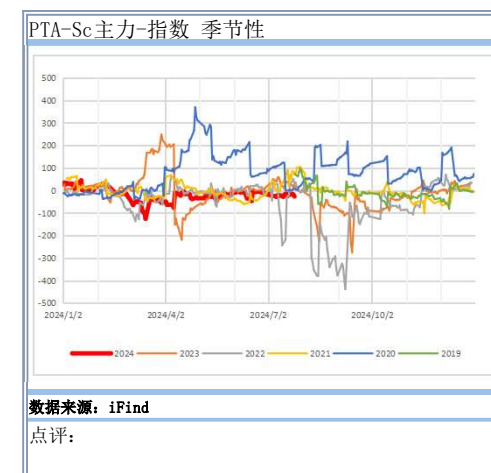
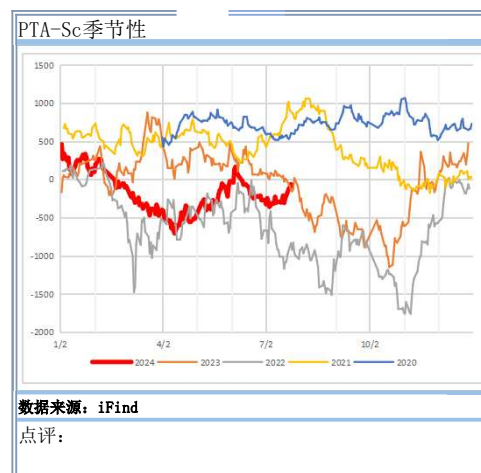
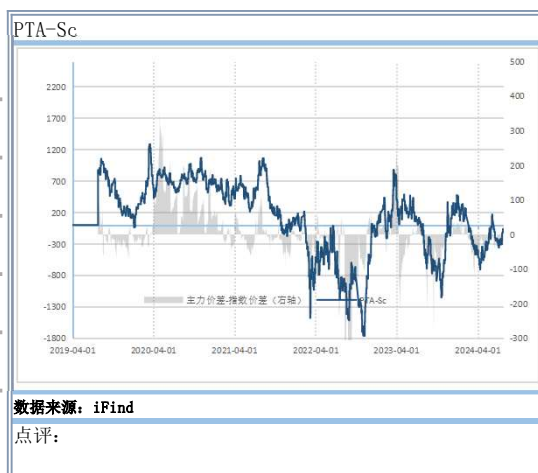
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: -1762.0000

期内最大值: 1061.0000

期内平均值: -213.7517

当前分位值: 59.09%



数据起始日: 2021/4/25

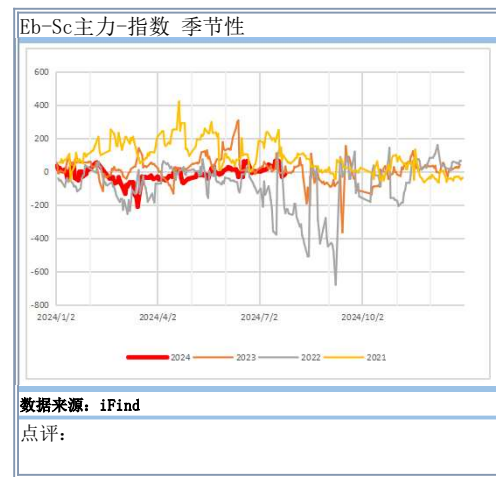
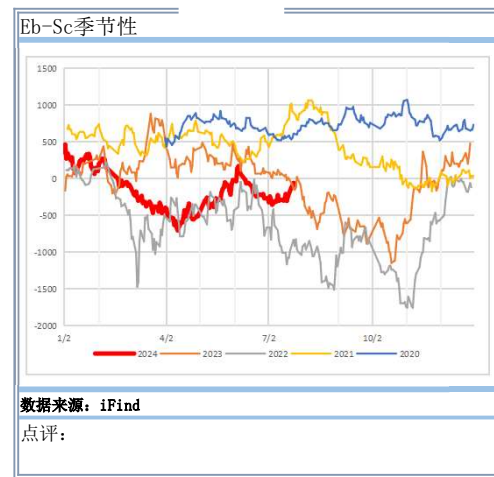
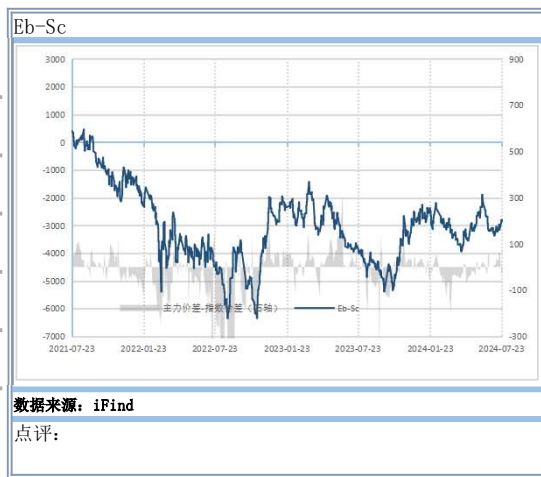
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: -6347.0000

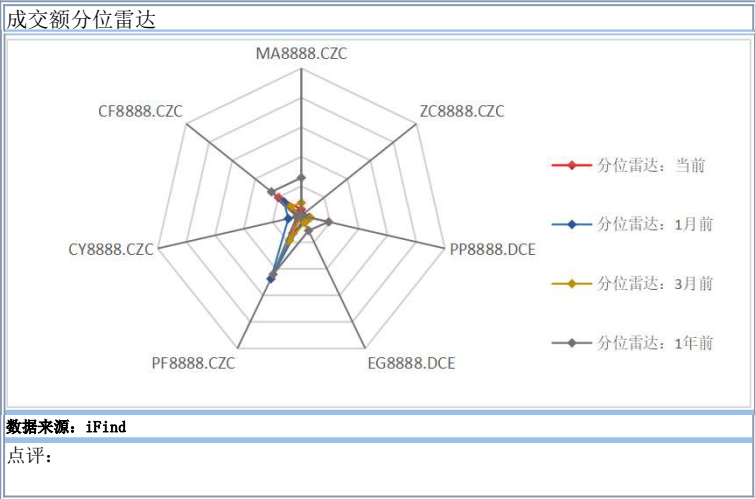
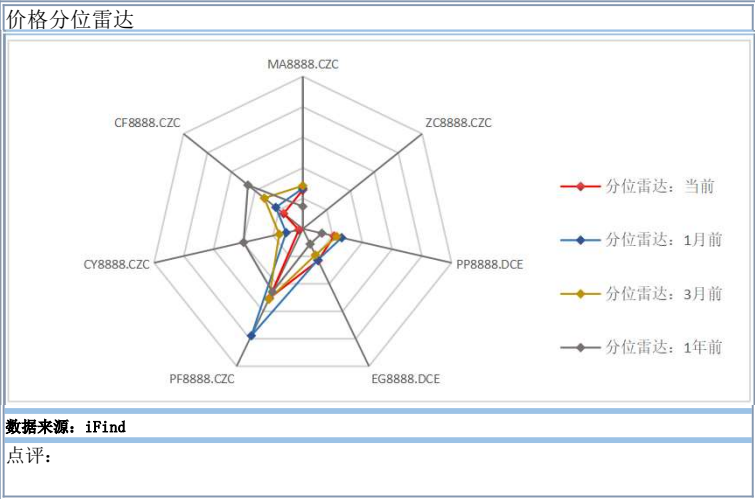
期内最大值: -1435.0000

期内平均值: -3502.9235

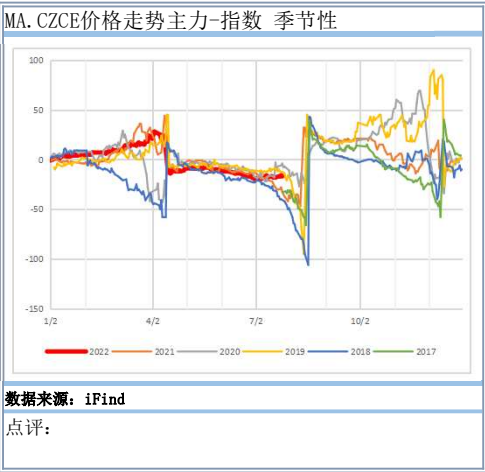
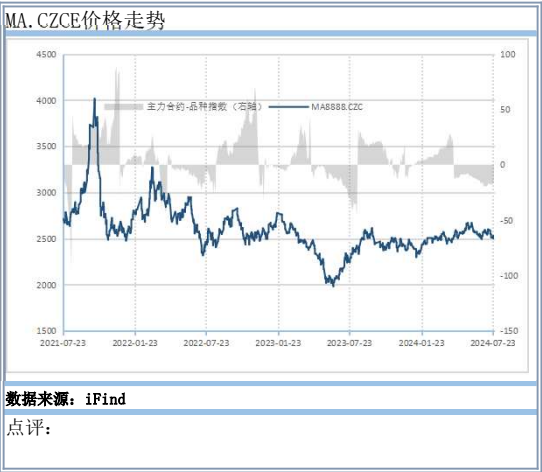
当前分位值: 71.29%



三、煤化工相关



数据起始日: 2019/7/26  
数据截止日: 2024/7/25  
期内最小值: 1982  
期内最大值: 4015  
期内平均值: 2592.2305  
当前分位值: 25.53%



数据起始日: 2019/7/26

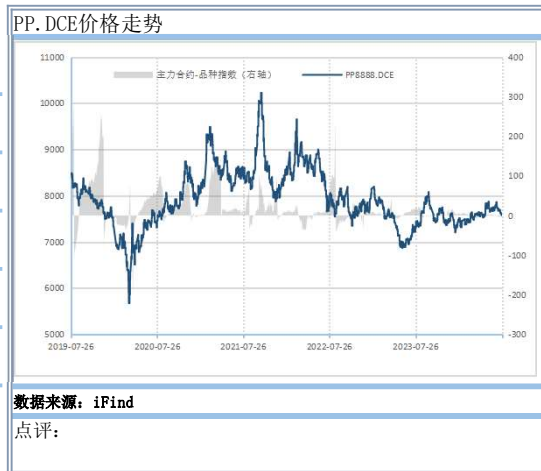
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 6865

期内最大值: 10224

期内平均值: 7921.5240

当前分位值: 21.08%



数据起始日: 2019/7/26

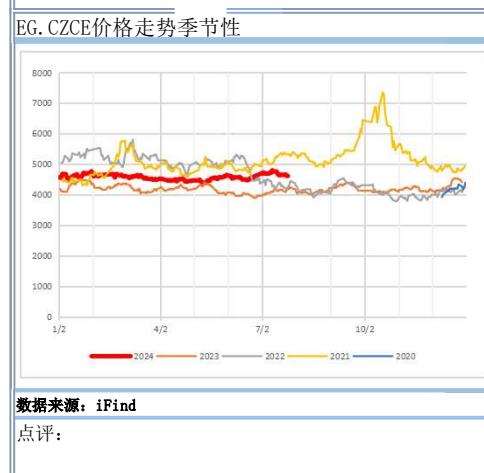
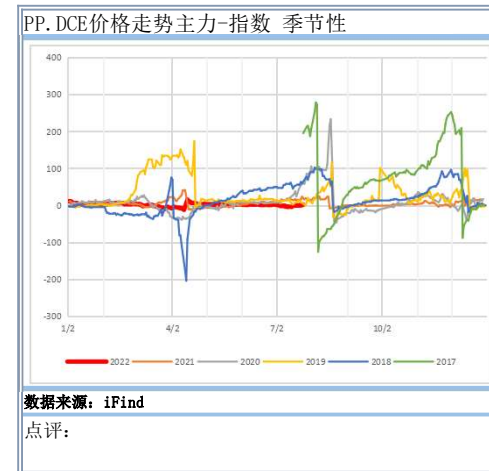
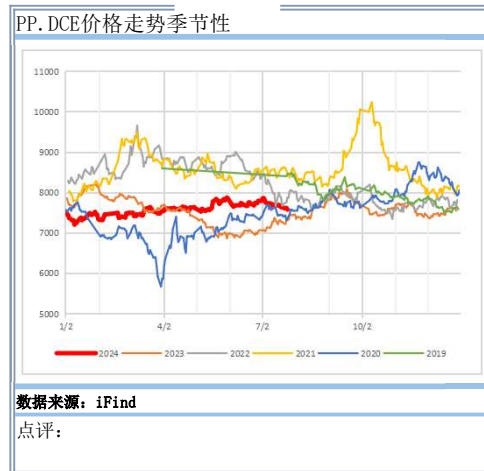
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 3778

期内最大值: 7345

期内平均值: 4570.6077

当前分位值: 23.07%



数据起始日: 2020/10/12

数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 6904

期内最大值: 7907

期内平均值: 7362.8640

当前分位值: 50.45%

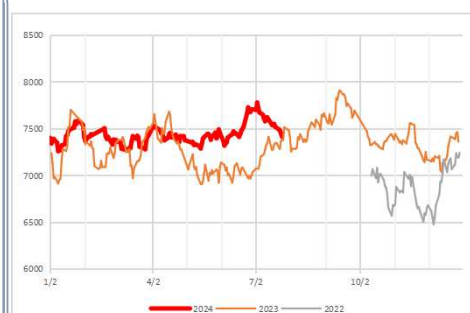
PF.CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

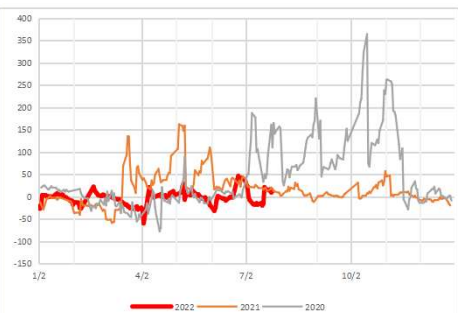
PF.CZCE价格走势季节性



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: 2019/7/26

数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 19292

期内最大值: 30443

期内平均值: 23539.1248

当前分位值: 2.70%

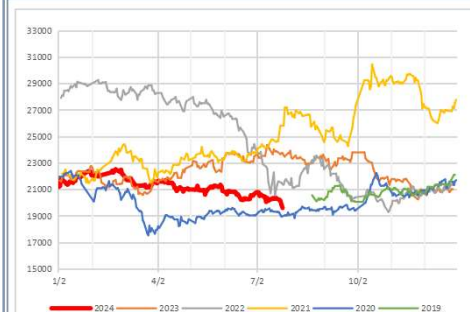
CY.CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

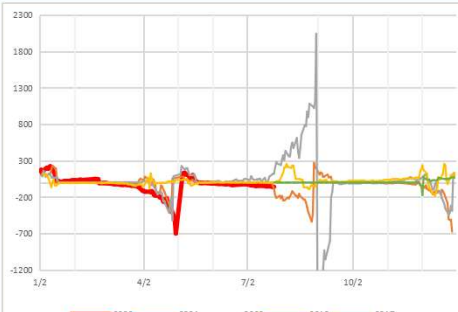
CY.CZCE价格走势季节性



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: 2019/7/26

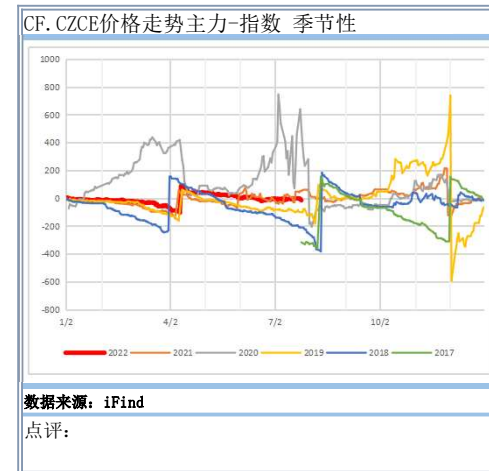
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 12447

期内最大值: 22574

期内平均值: 16821.5912

当前分位值: 16.08%



数据起始日: 2019/7/26

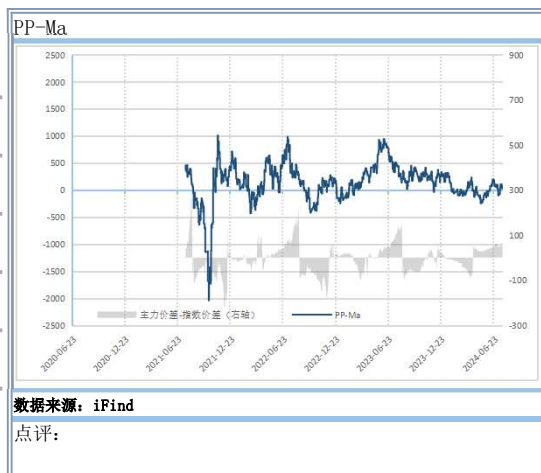
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: -2039.0000

期内最大值: 1007.0000

期内平均值: 144.8326

当前分位值: 69.24%



数据起始日: 2019/7/26

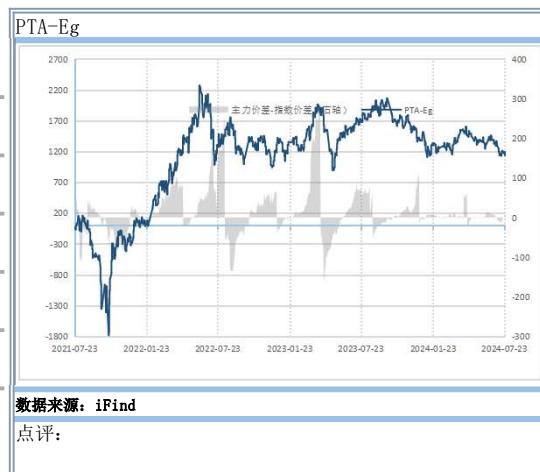
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: -1783.0000

期内最大值: 2269.0000

期内平均值: 1115.1838

当前分位值: 72.01%



数据起始日: 2021/12/29

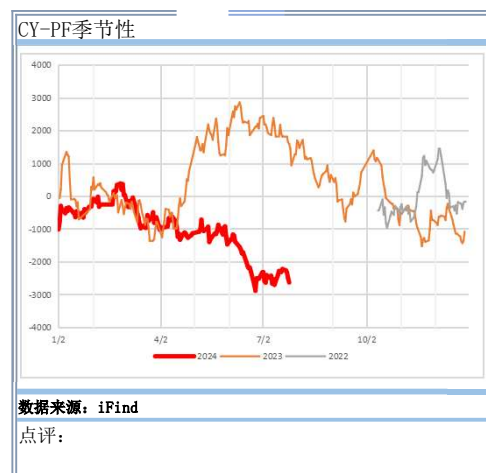
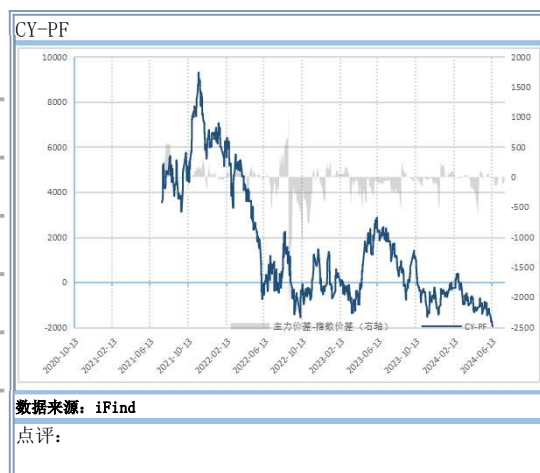
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: -2887.0000

期内最大值: 2854.0000

期内平均值: -168.5099

当前分位值: 4.35%



数据起始日: 2023/2/14

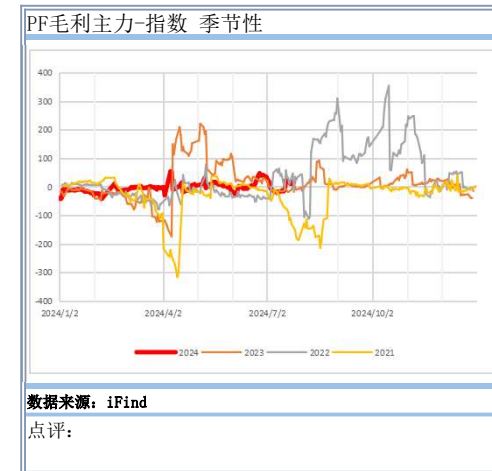
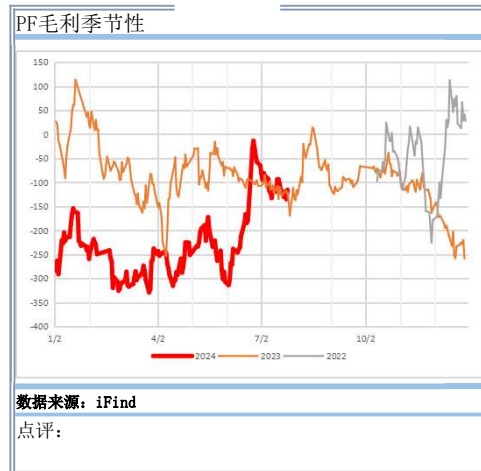
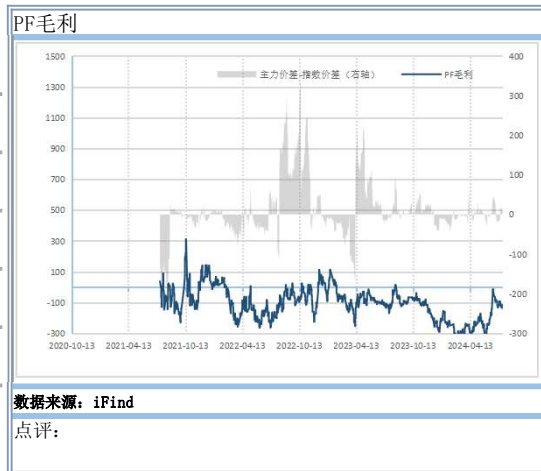
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: -328.9900

期内最大值: 13.9250

期内平均值: -149.9252

当前分位值: 62.22%



数据起始日: 2019/7/26

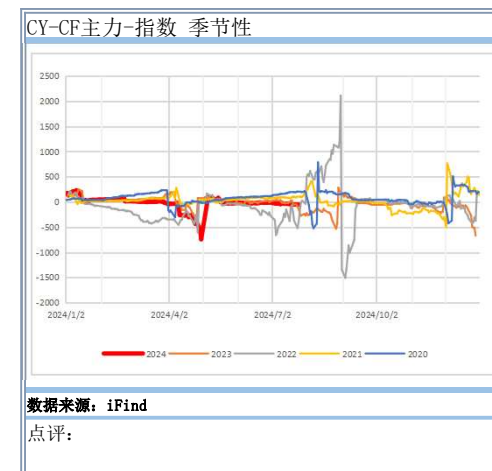
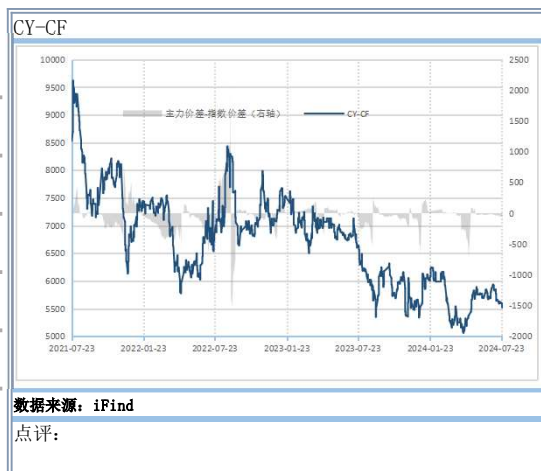
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 5061.0000

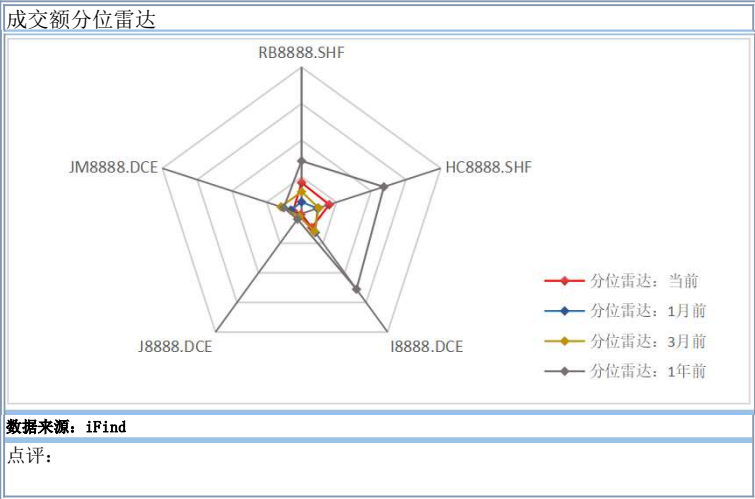
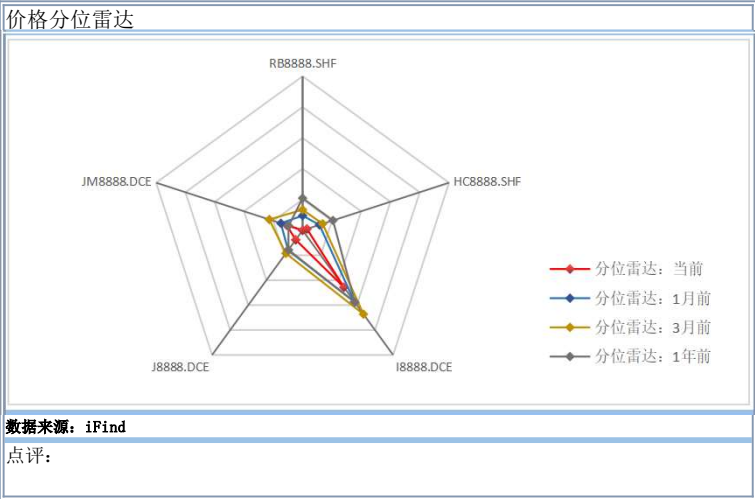
期内最大值: 9616.0000

期内平均值: 6717.5336

当前分位值: 10.03%



四、黑色相关



数据起始日： 2019/7/26

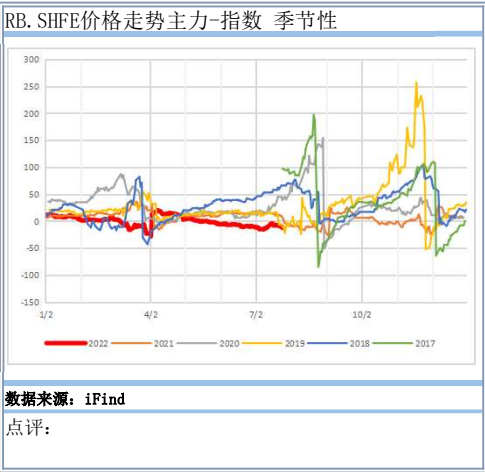
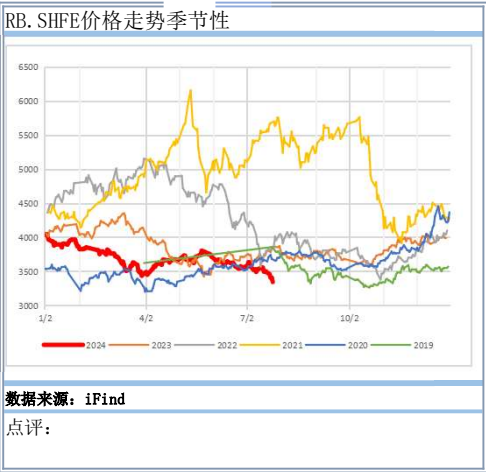
数据截止日： 2024/7/25

期内最小值： 3342

期内最大值： 5762

期内平均值： 4112.1427

当前分位值： 0.00%



数据起始日: 2019/7/26

数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 3444

期内最大值: 6152

期内平均值: 4245.9300

当前分位值: 2.99%



数据起始日: 2019/7/26

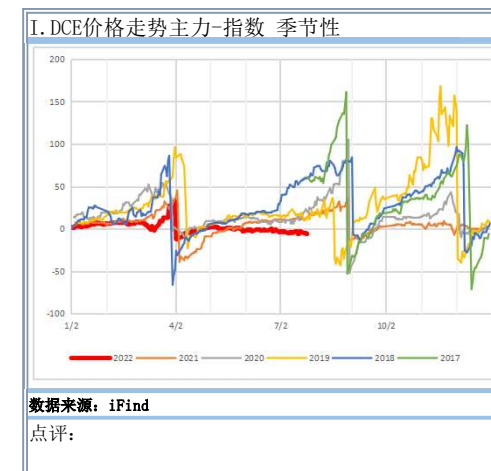
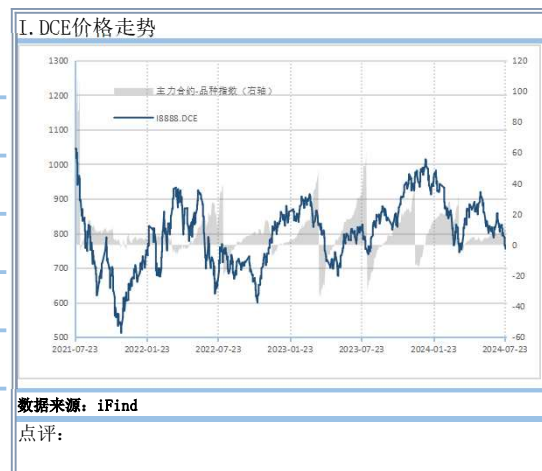
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 512.8

期内最大值: 1044.3

期内平均值: 798.2903

当前分位值: 45.64%



数据起始日: 2019/7/26

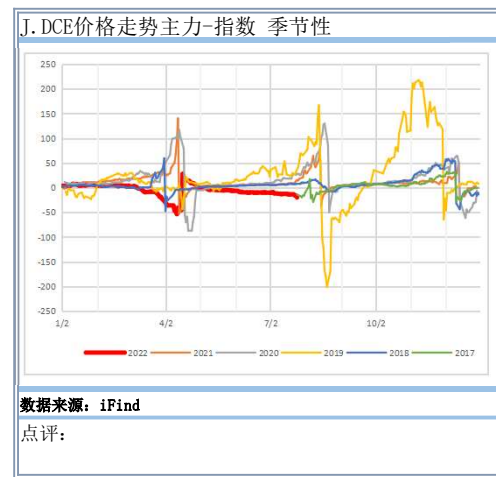
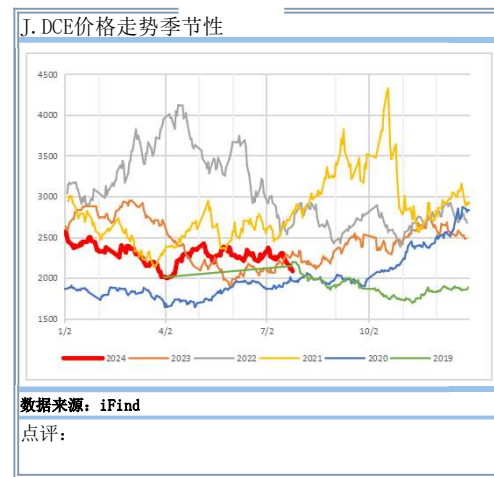
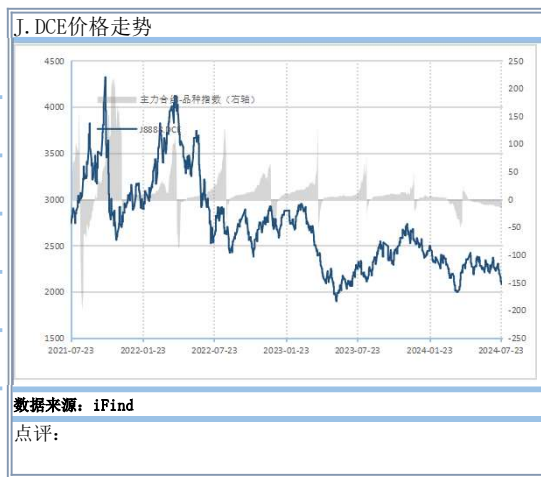
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 1897.9

期内最大值: 4320.8

期内平均值: 2714.6488

当前分位值: 7.60%



数据起始日: 2019/7/26

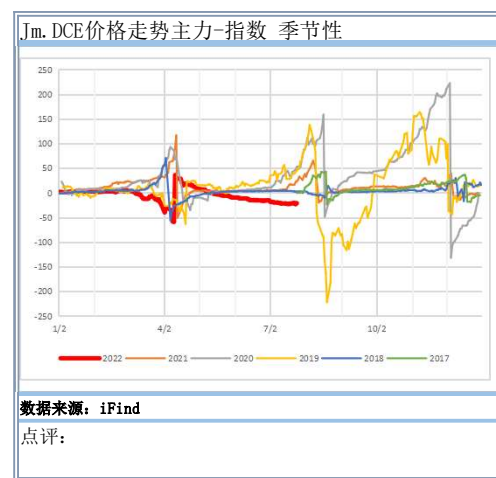
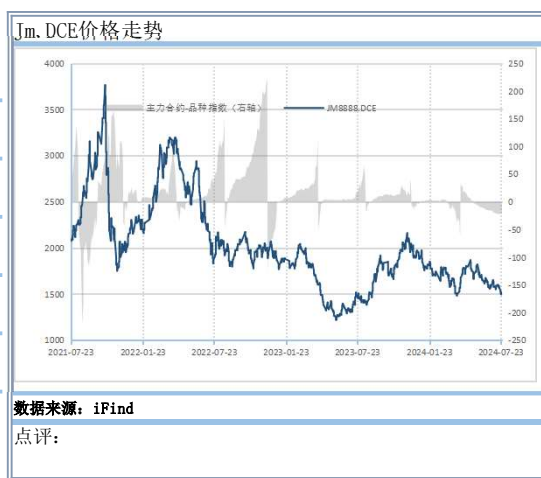
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 1219.4

期内最大值: 3764.7

期内平均值: 2008.0455

当前分位值: 10.83%



数据起始日： 2019/7/26

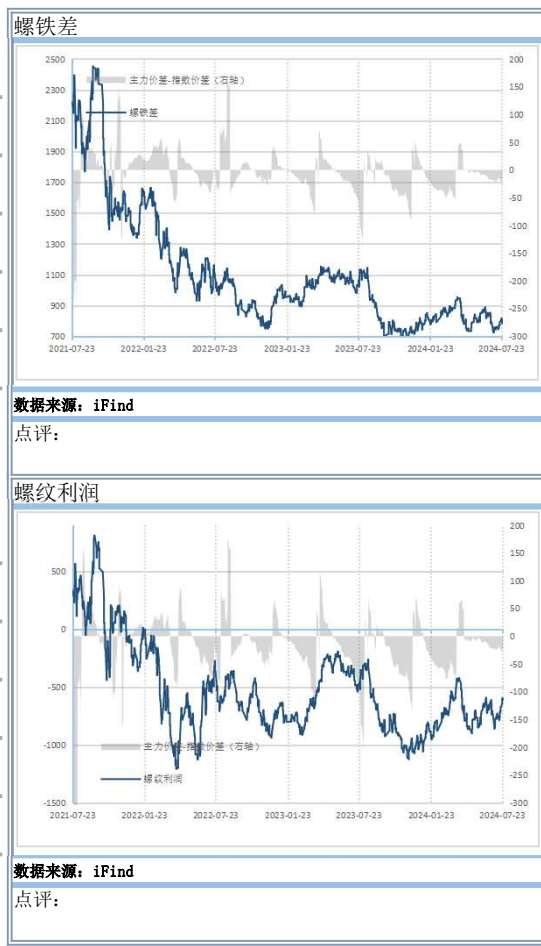
数据截止日： 2024/7/25

期内最小值： 670.1176

期内最大值： 2451.8235

期内平均值： 1106.5429

当前分位值： 6.40%



数据起始日: 2019/7/26

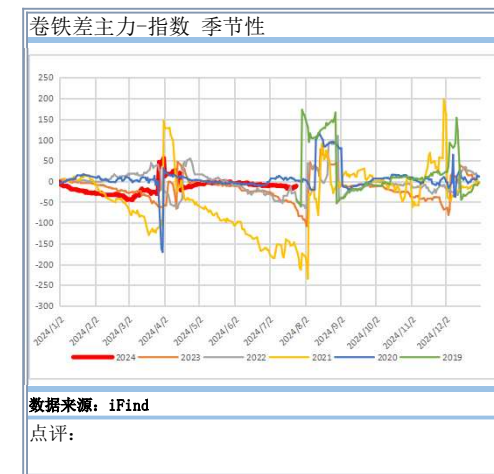
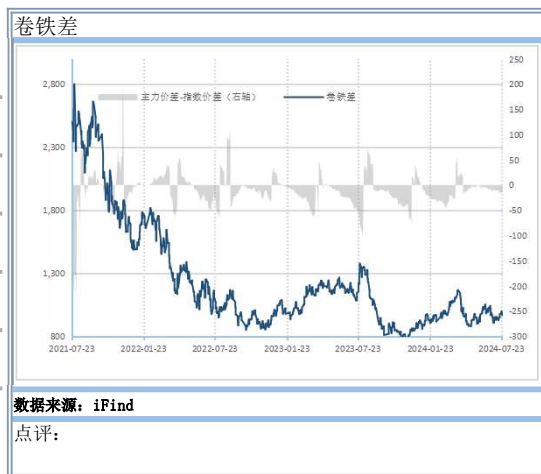
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 752.4706

期内最大值: 2799.4118

期内平均值: 1240.3303

当前分位值: 10.49%



数据起始日: 2019/7/26

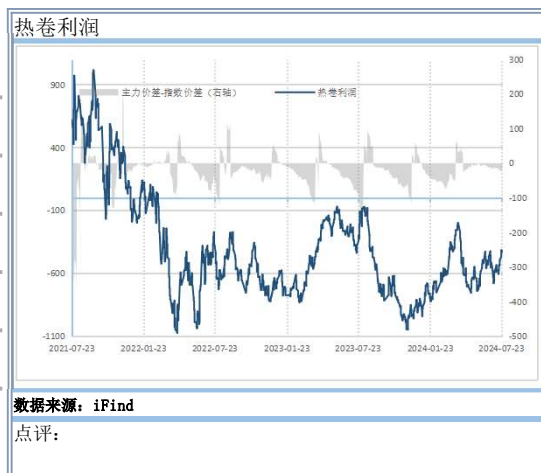
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: -1073.7273

期内最大值: 1014.0000

期内平均值: -399.0878

当前分位值: 30.93%



数据起始日: 2019/7/26

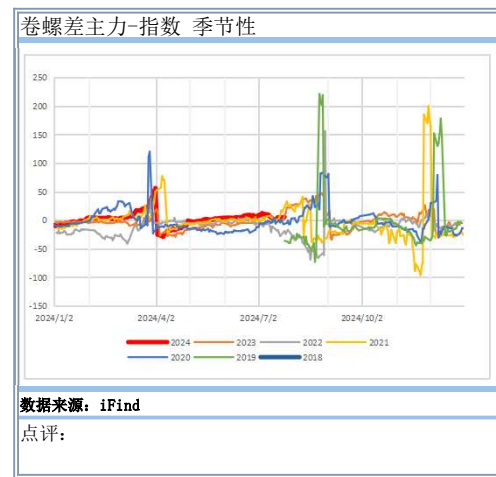
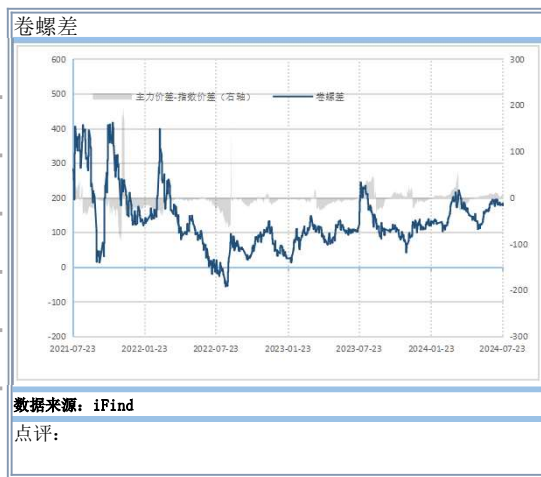
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: -56.0000

期内最大值: 416.0000

期内平均值: 133.7874

当前分位值: 50.64%



数据起始日: 2019/7/26

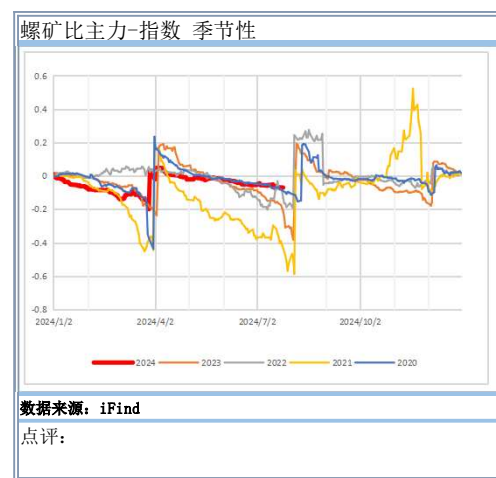
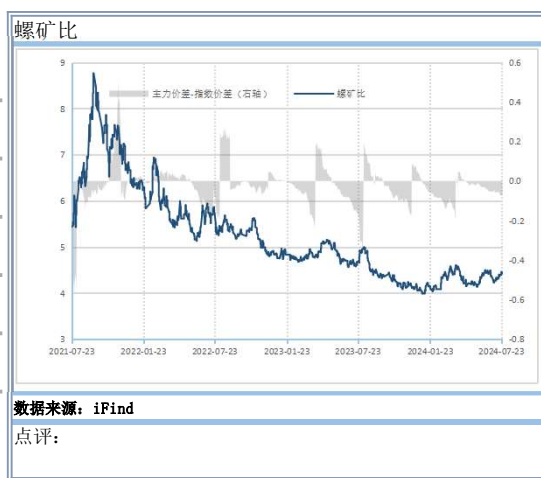
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 3.9880

期内最大值: 8.7631

期内平均值: 5.2315

当前分位值: 9.13%



数据起始日: 2019/7/26

数据截止日: 2024/7/25

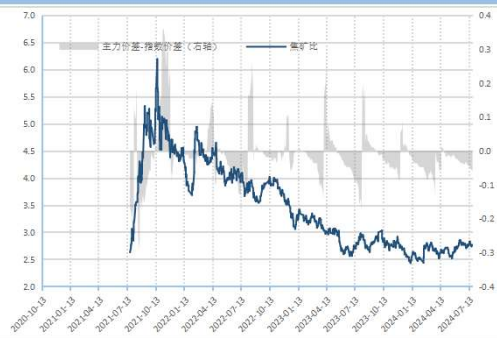
期内最小值: 2.4279

期内最大值: 6.1947

期内平均值: 3.4593

当前分位值: 8.71%

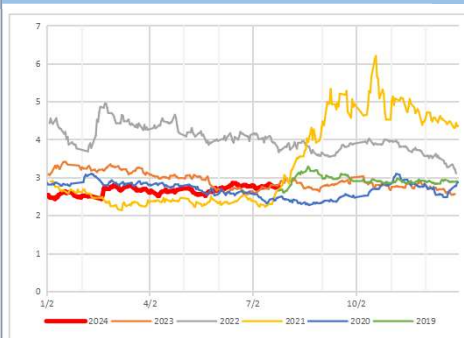
焦矿比



数据来源: iFind

点评:

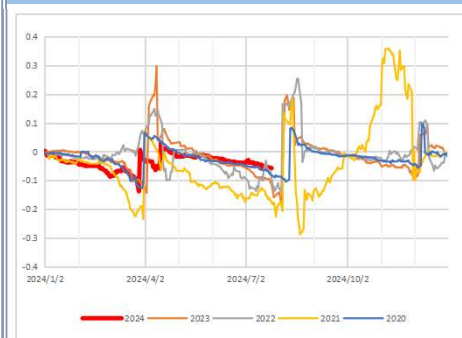
焦矿比季节性



数据来源: iFind

点评:

焦矿比主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/7/26

数据截止日: 2024/7/25

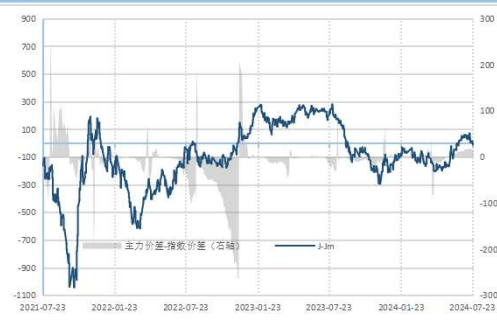
期内最小值: -1043.0800

期内最大值: 279.1600

期内平均值: -96.6149

当前分位值: 78.04%

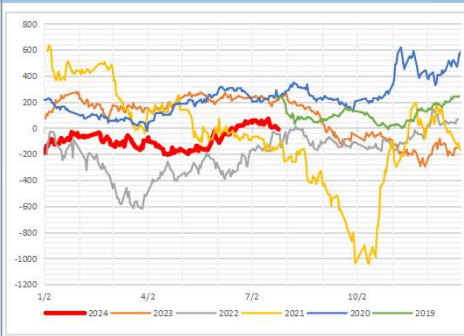
J-Jm



数据来源: iFind

点评:

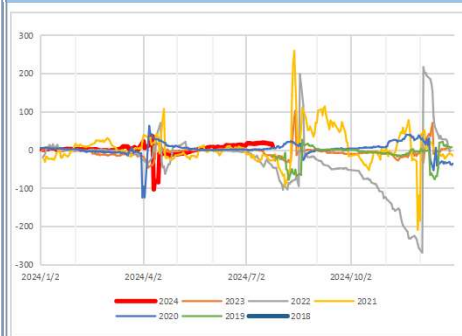
J-Jm季节性



数据来源: iFind

点评:

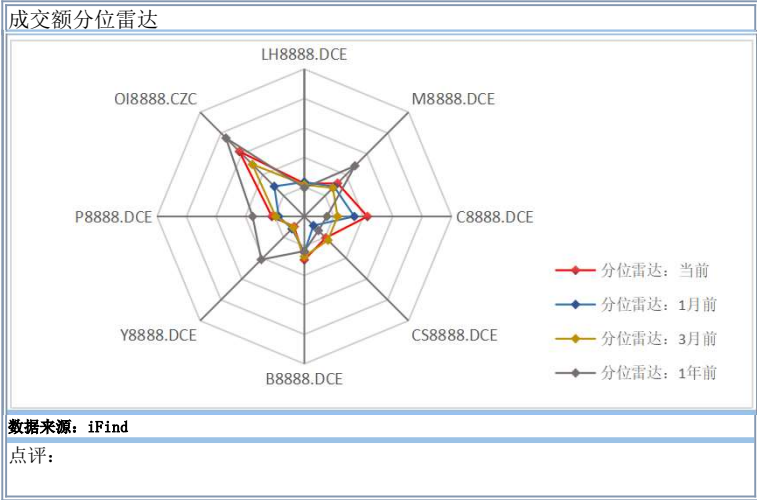
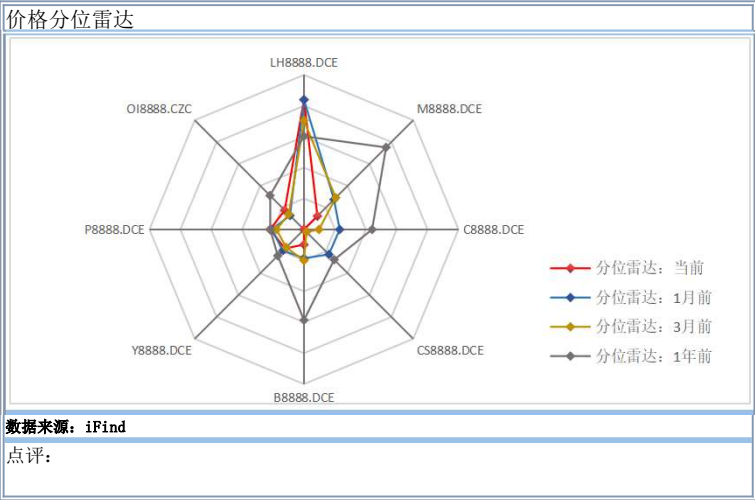
J-Jm主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

五、农产品相关



数据起始日: 2021/1/8

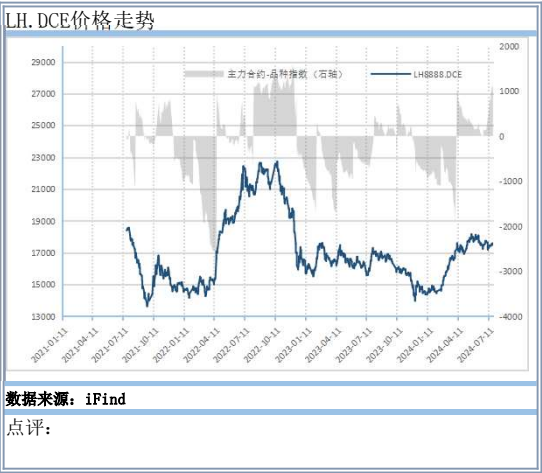
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 13971

期内最大值: 18158

期内平均值: 16283.7517

当前分位值: 83.97%



数据起始日: 2019/7/26

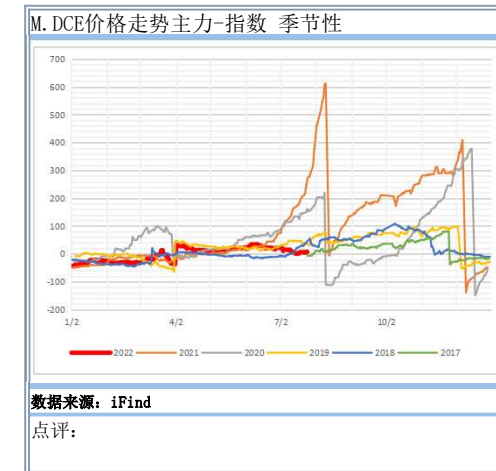
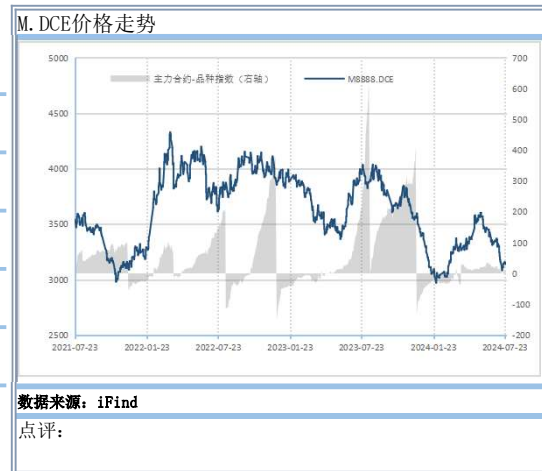
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 2970

期内最大值: 4328

期内平均值: 3633.0576

当前分位值: 12.30%



数据起始日: 2019/7/26

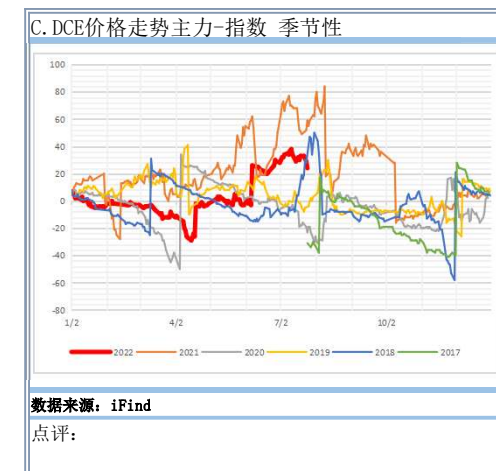
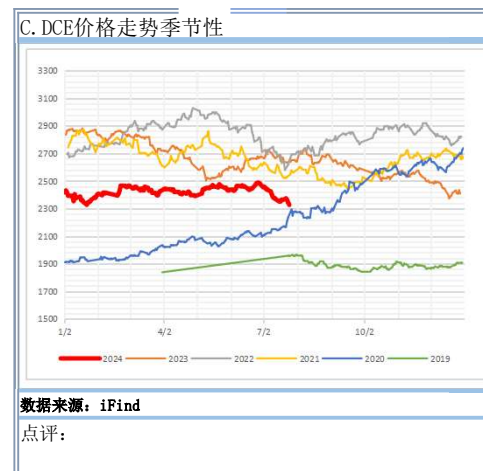
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 2326

期内最大值: 3027

期内平均值: 2659.5953

当前分位值: 0.00%



数据起始日: 2019/7/26

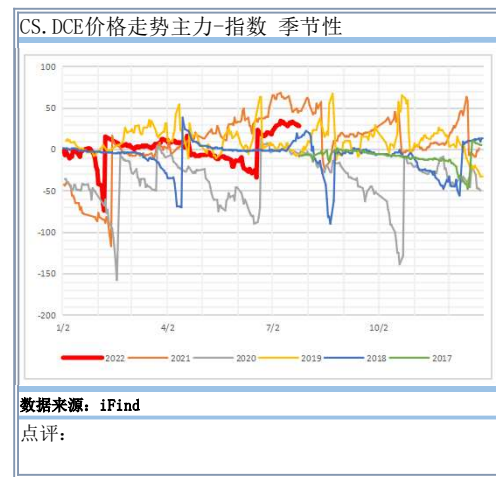
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 2770

期内最大值: 3512

期内平均值: 3018.8409

当前分位值: 0.00%



数据起始日: 2019/7/26

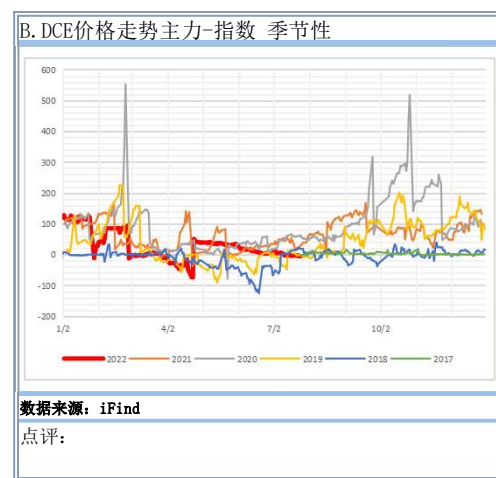
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 3487

期内最大值: 5585

期内平均值: 4504.5748

当前分位值: 9.72%



数据起始日: 2019/7/26

数据截止日: 2024/7/25

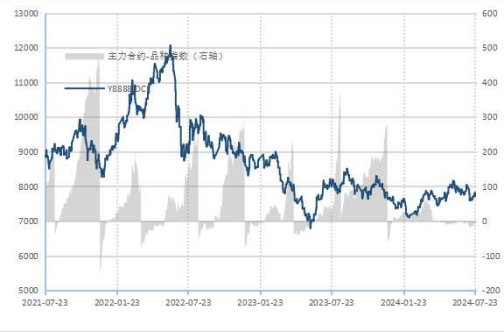
期内最小值: 6793

期内最大值: 12065

期内平均值: 8707.0384

当前分位值: 17.43%

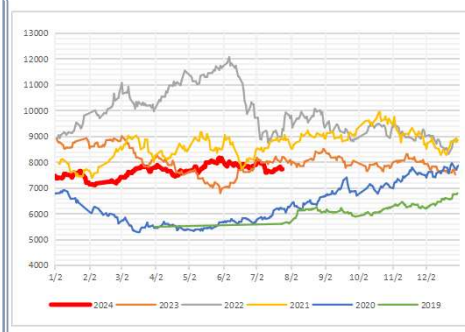
Y. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

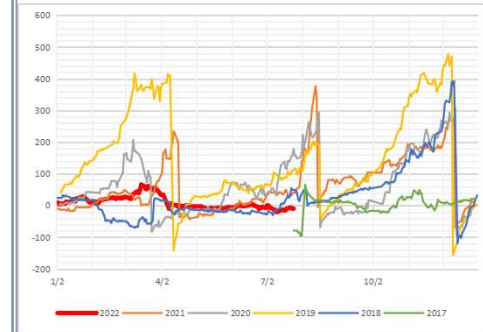
Y. DCE价格走势季节性



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: 2019/7/26

数据截止日: 2024/7/25

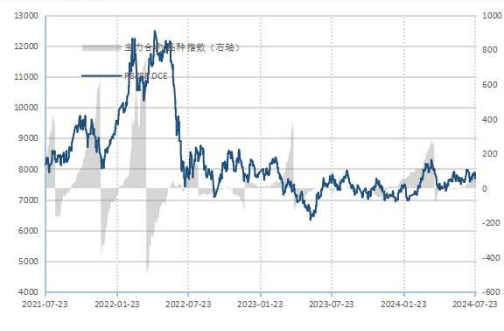
期内最小值: 6349

期内最大值: 12479

期内平均值: 8303.1454

当前分位值: 21.92%

P. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

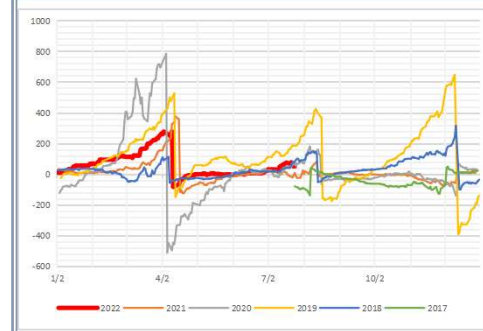
P. DCE价格走势季节性



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: 2019/7/26

数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 7475

期内最大值: 14344

期内平均值: 10158.6708

当前分位值: 17.63%

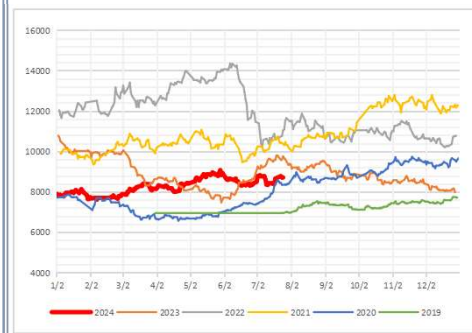
OI.CZCE价格走势



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: 2024/7/25

期内最小值: 7508.2500

期内最大值: 11785.0000

期内平均值: 9760.9388

当前分位值: 92.62%

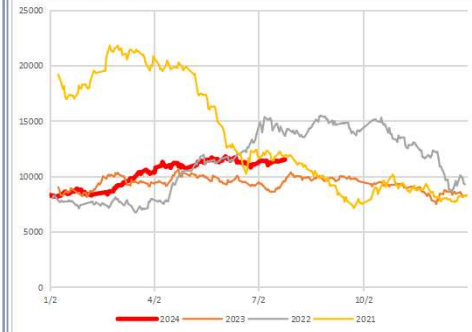
育肥收益



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

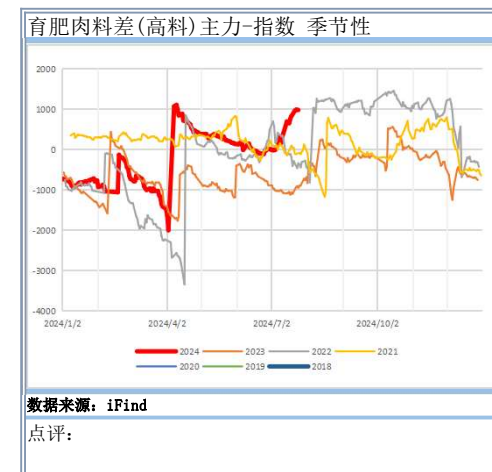
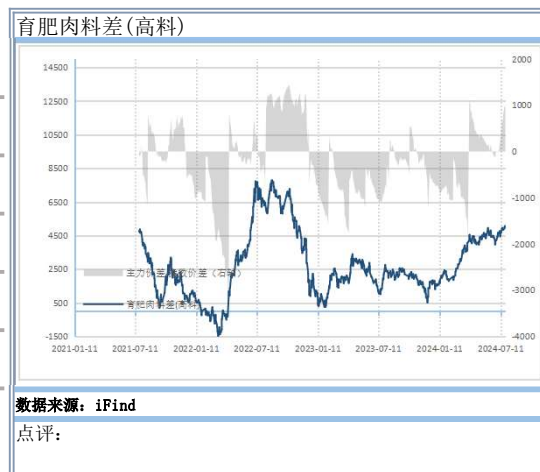
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 515.0000

期内最大值: 5060.0000

期内平均值: 2736.8621

当前分位值: 99.69%



数据起始日: 2019/7/26

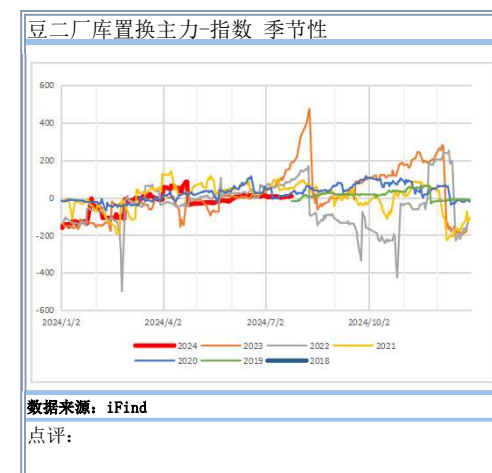
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: -745.0200

期内最大值: 71.2200

期内平均值: -201.8224

当前分位值: 95.96%



数据起始日: 2019/7/26

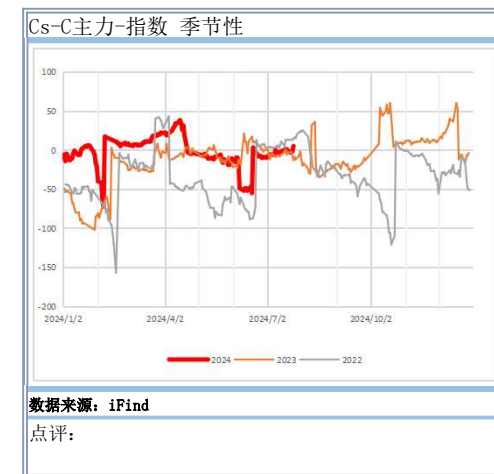
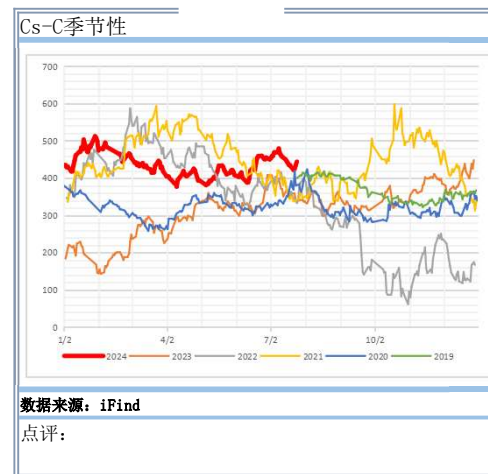
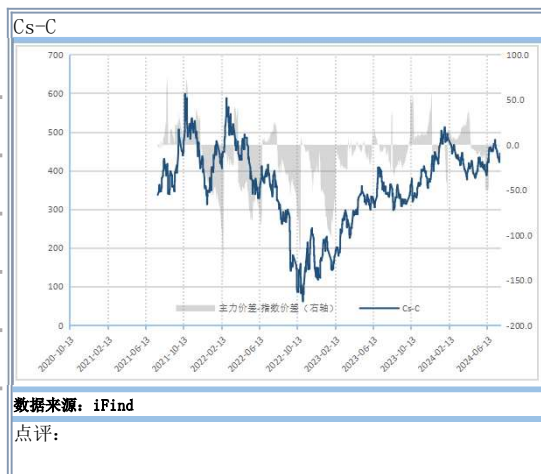
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: 62.0000

期内最大值: 598.0000

期内平均值: 359.2455

当前分位值: 71.27%



数据起始日: 2019/7/26

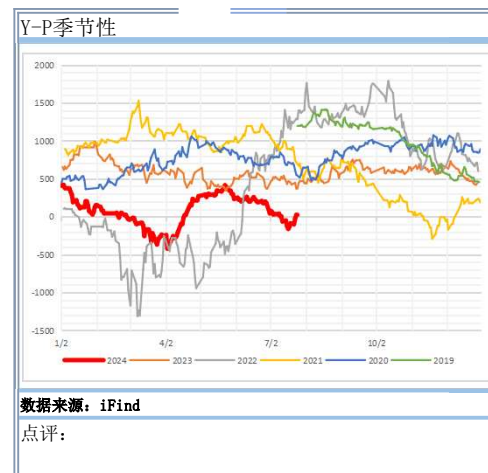
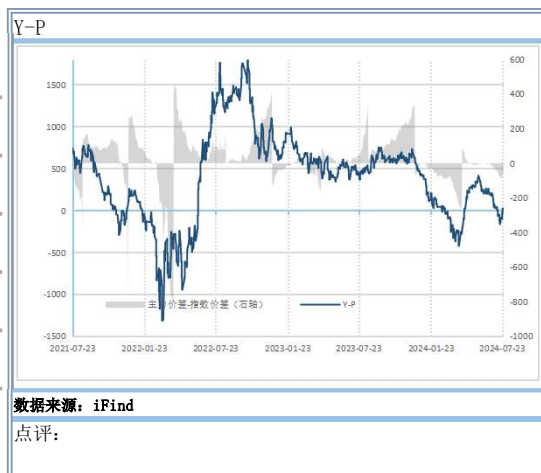
数据截止日: 2024/7/25

期内最小值: -1313.0000

期内最大值: 1788.0000

期内平均值: 403.8930

当前分位值: 42.95%



数据起始日： 2019/7/26

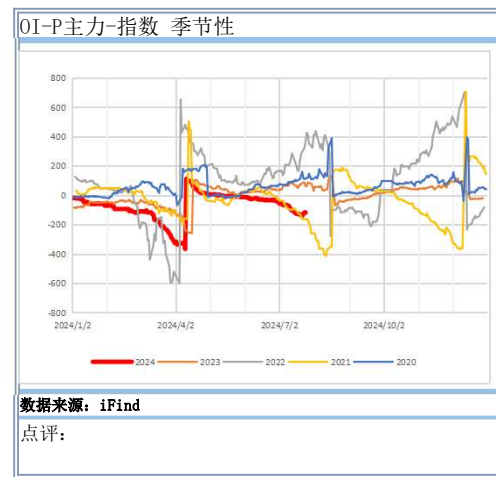
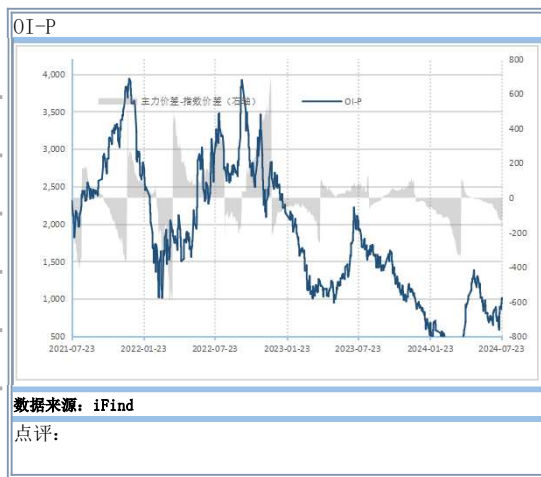
数据截止日： 2024/7/25

期内最小值： 19.0000

期内最大值： 2220.0000

期内平均值： 1115.9122

当前分位值： 44.25%



### 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。