

<http://www.shanlingh.com>

盘面套利观察

2024年8月5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

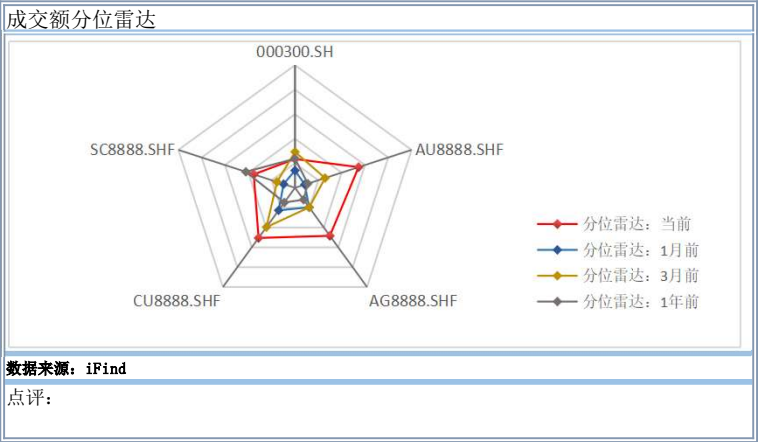
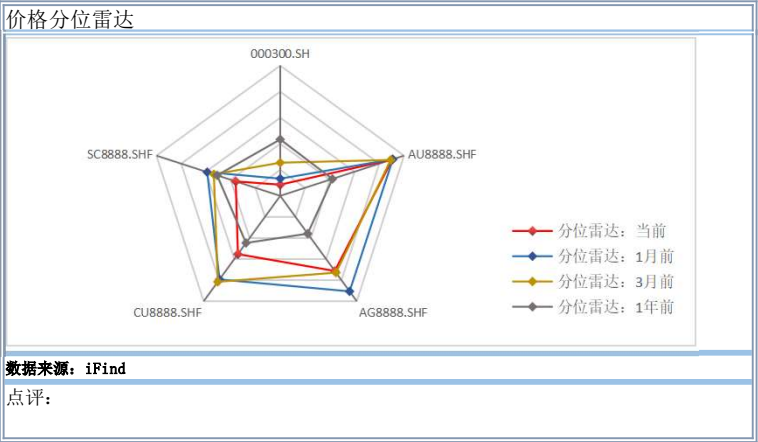
从业资格证号：F03107583

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: 2019/8/6

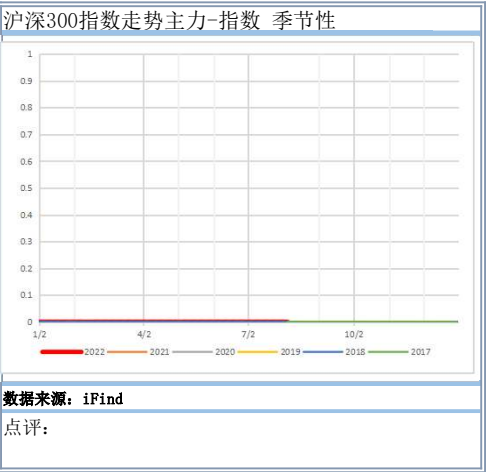
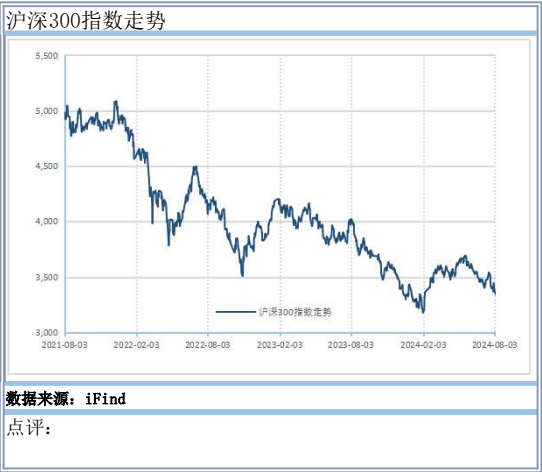
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 3179.6276

期内最大值: 5083.8007

期内平均值: 4020.0297

当前分位值: 25.47%



数据起始日: 2019/8/6

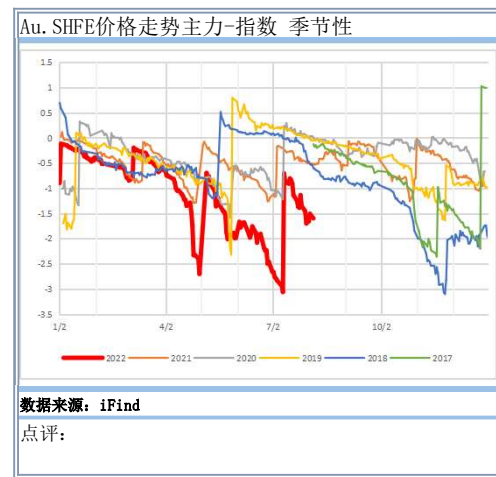
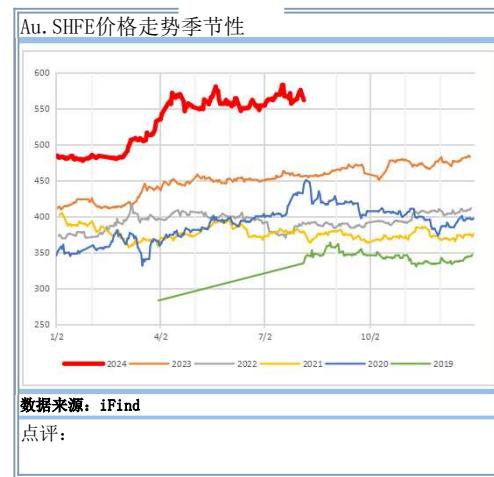
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 363.2

期内最大值: 582.4

期内平均值: 436.7062

当前分位值: 90.48%



数据起始日: 2019/8/6

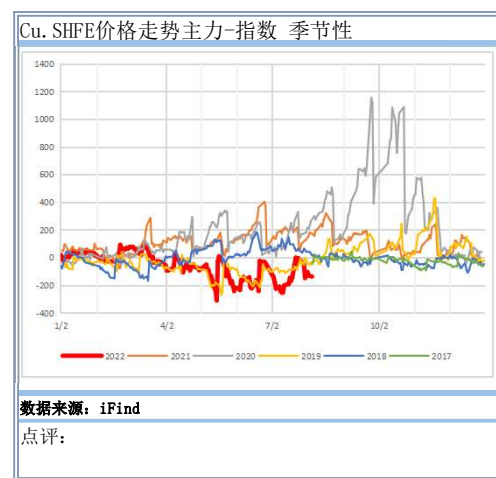
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 53367

期内最大值: 87697

期内平均值: 69240.0301

当前分位值: 55.29%



数据起始日: 2019/8/6

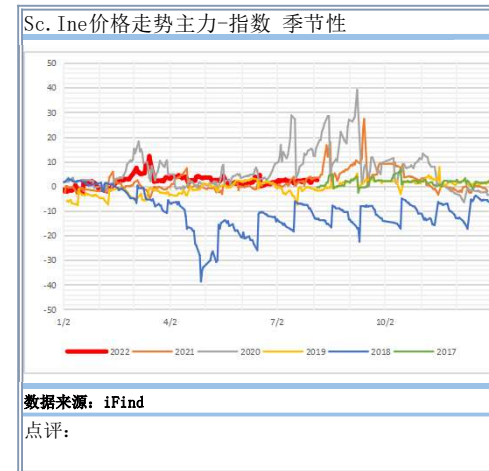
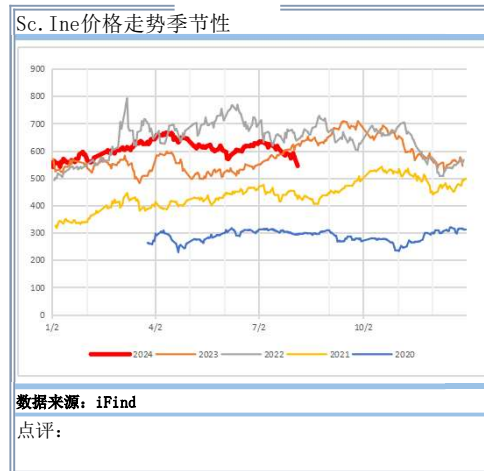
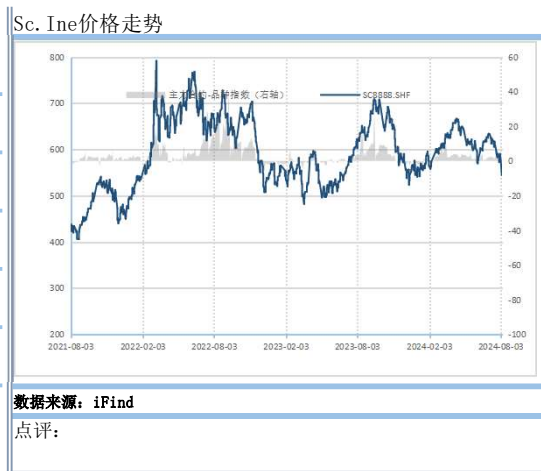
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 405.7

期内最大值: 791.6

期内平均值: 591.1979

当前分位值: 35.94%



数据起始日: 2019/8/6

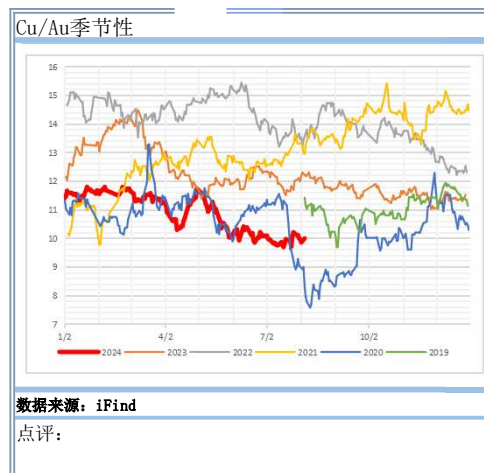
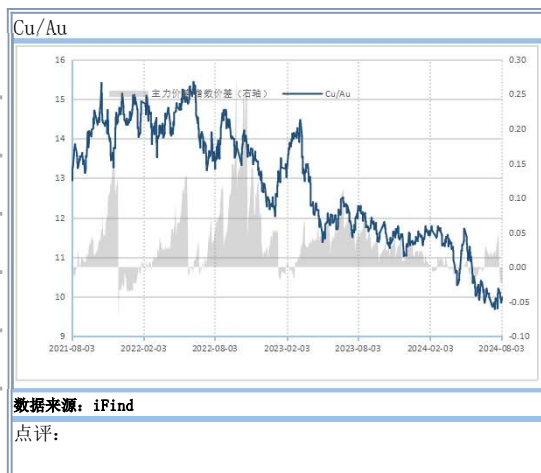
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 9.6881

期内最大值: 15.4319

期内平均值: 12.8229

当前分位值: 5.19%



数据起始日： 2019/8/6

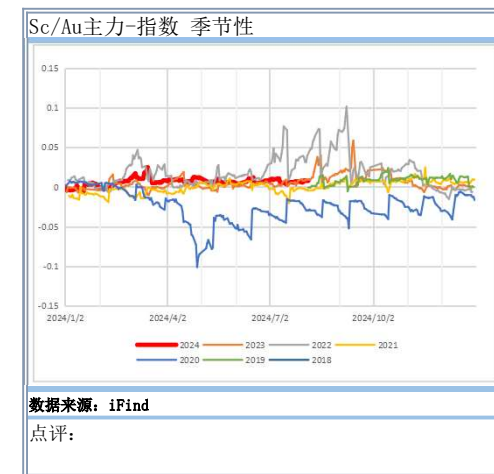
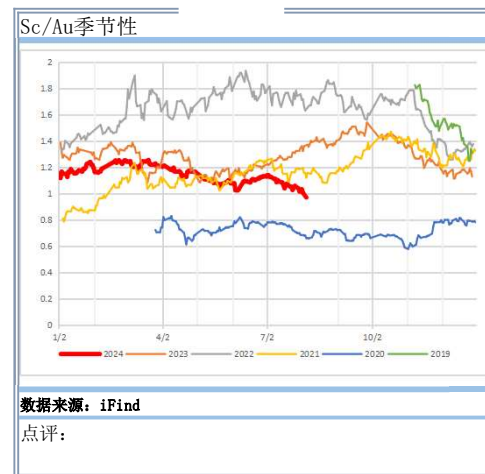
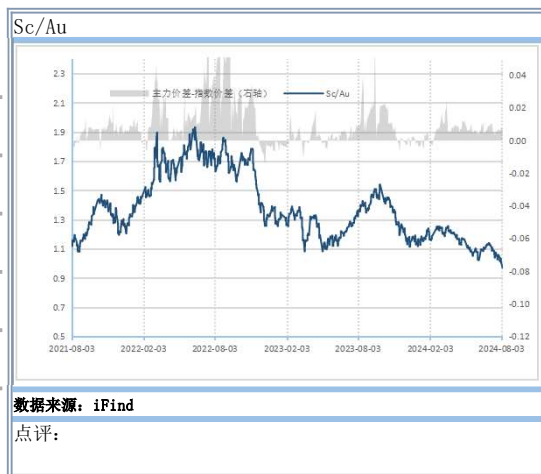
数据截止日： 2024/8/5

期内最小值： 0.9695

期内最大值： 1.9320

期内平均值： 1.3722

当前分位值： 0.00%



数据起始日： 2019/8/6

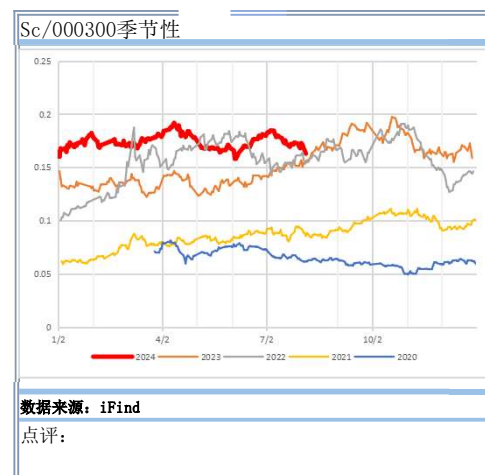
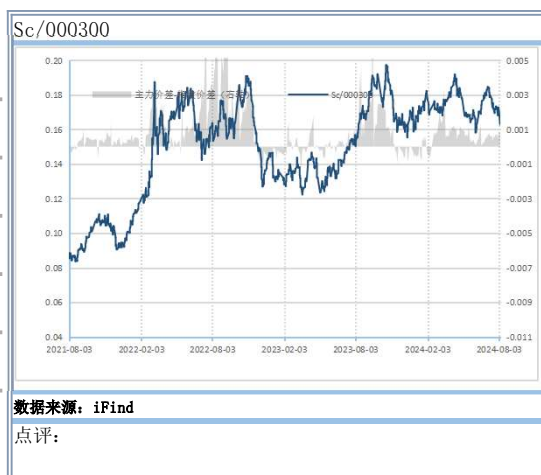
数据截止日： 2024/8/5

期内最小值： 0.0837

期内最大值： 0.1972

期内平均值： 0.1499

当前分位值： 69.74%



数据起始日: 2019/8/6

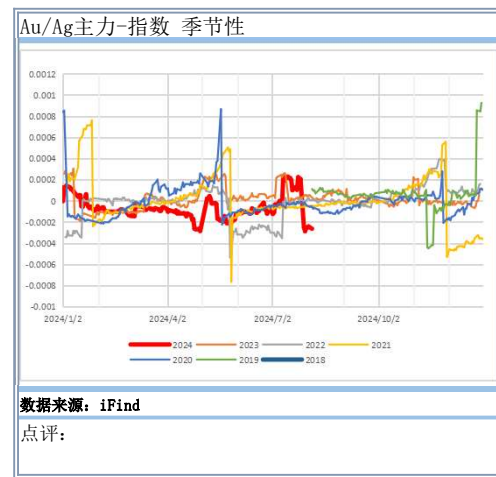
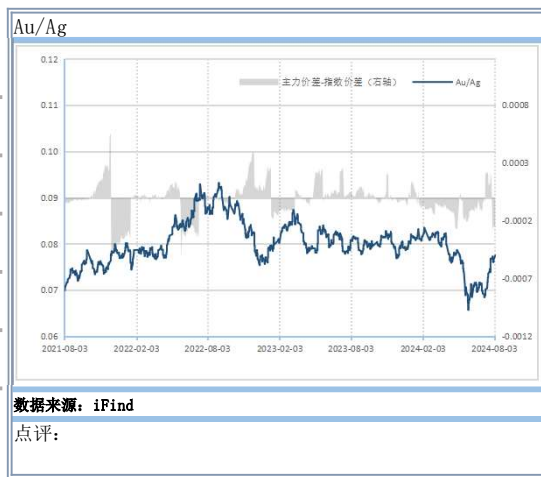
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 0.0657

期内最大值: 0.0932

期内平均值: 0.0800

当前分位值: 42.93%



数据起始日: 2019/8/6

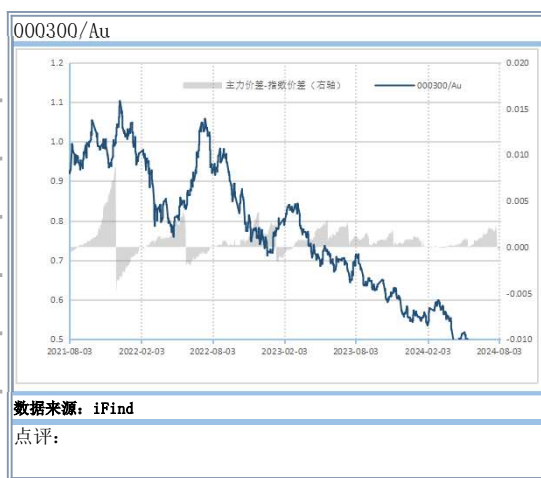
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 0.4165

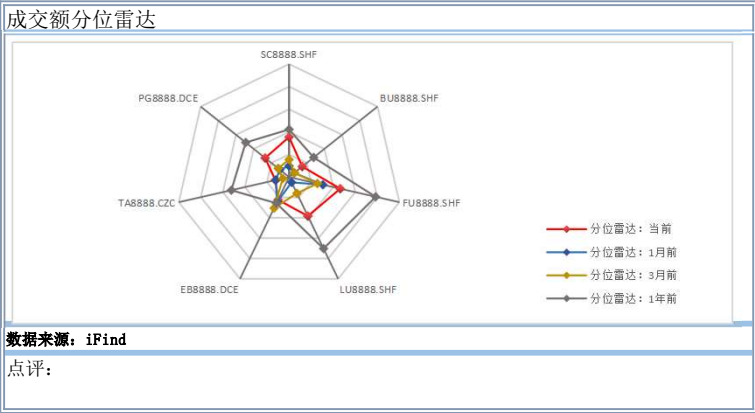
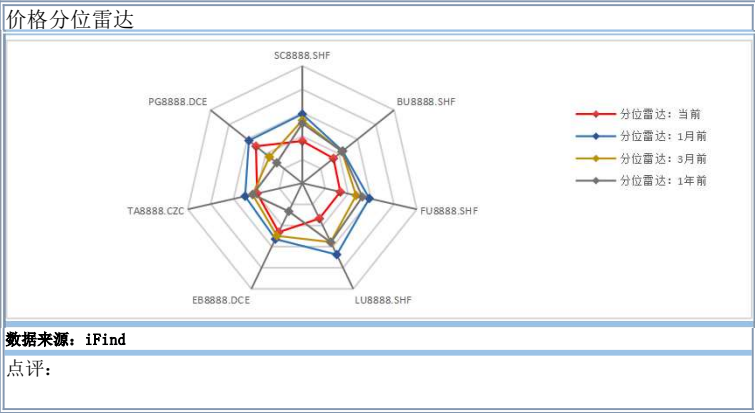
期内最大值: 1.1021

期内平均值: 0.7587

当前分位值: 6.56%



二、原油相关



数据起始日: 2019/8/6

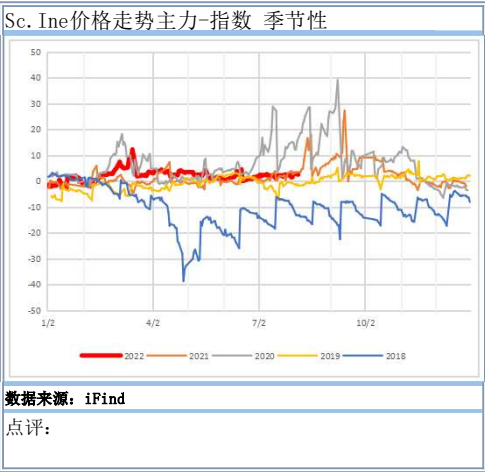
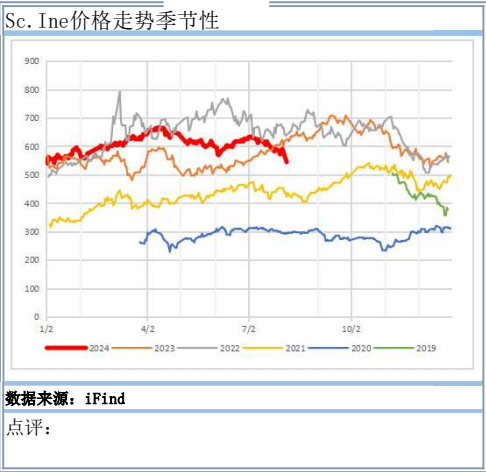
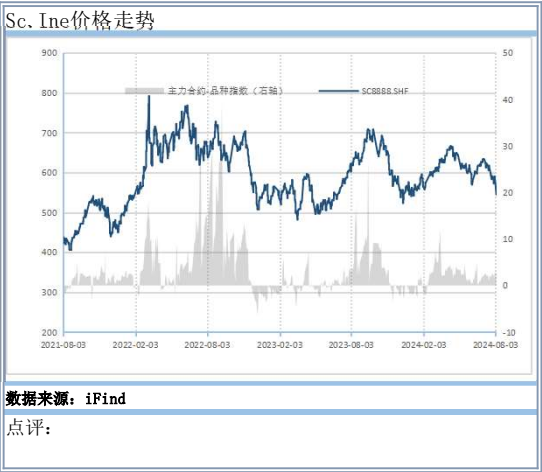
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 405.7

期内最大值: 791.6

期内平均值: 591.1979

当前分位值: 35.94%



数据起始日： 2019/8/6

数据截止日： 2024/8/5

期内最小值： 2821

期内最大值： 4794

期内平均值： 3671.4239

当前分位值： 33.91%



数据起始日： 2019/8/6

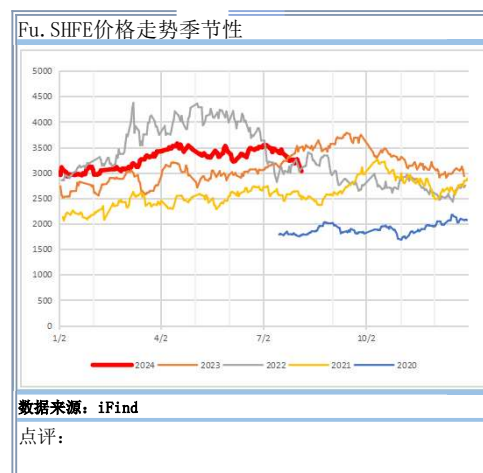
数据截止日： 2024/8/5

期内最小值： 2366

期内最大值： 4371

期内平均值： 3151.0232

当前分位值： 33.17%



数据起始日: 2020/6/22

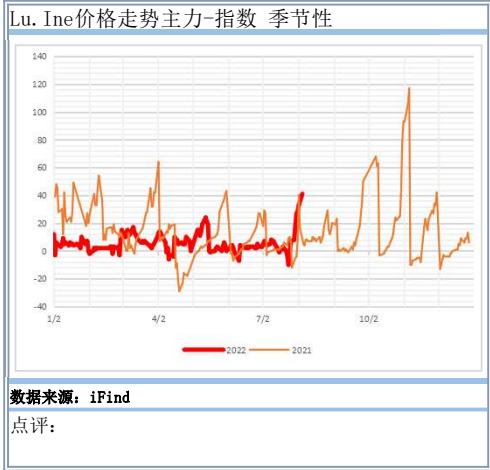
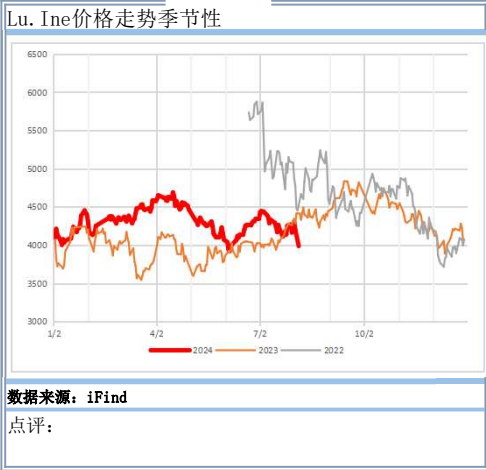
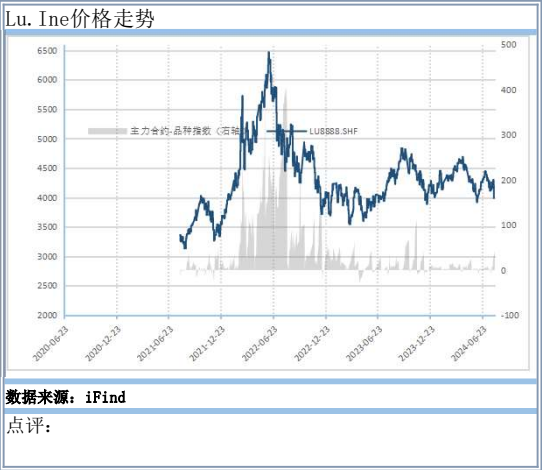
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 3544

期内最大值: 4869

期内平均值: 4200.6376

当前分位值: 33.43%



数据起始日: 2019/9/26

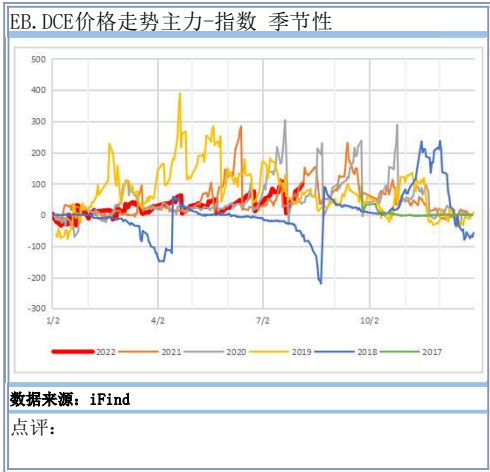
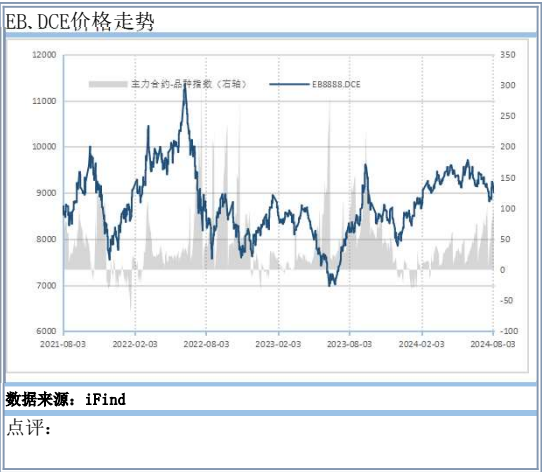
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 6978

期内最大值: 11361

期内平均值: 8754.1431

当前分位值: 46.32%



数据起始日: 2019/8/6

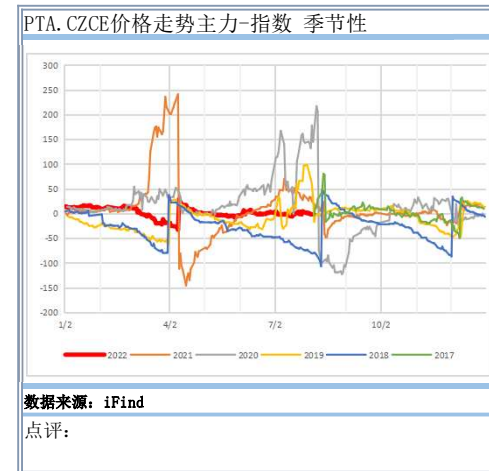
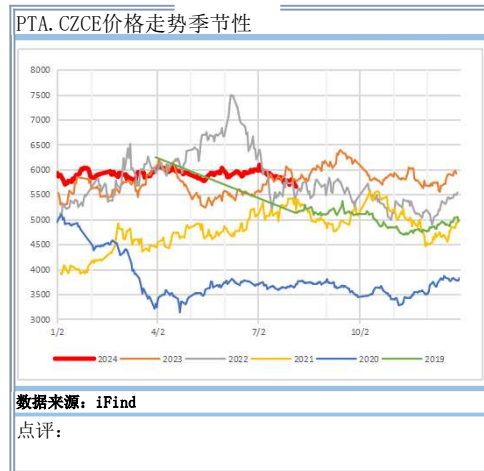
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 4462

期内最大值: 7488

期内平均值: 5689.7517

当前分位值: 39.46%



数据起始日: 2020/3/30

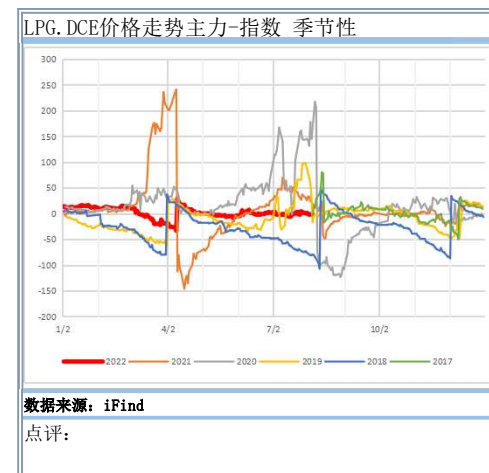
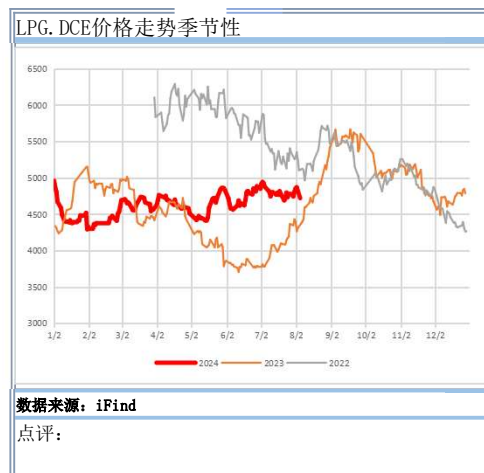
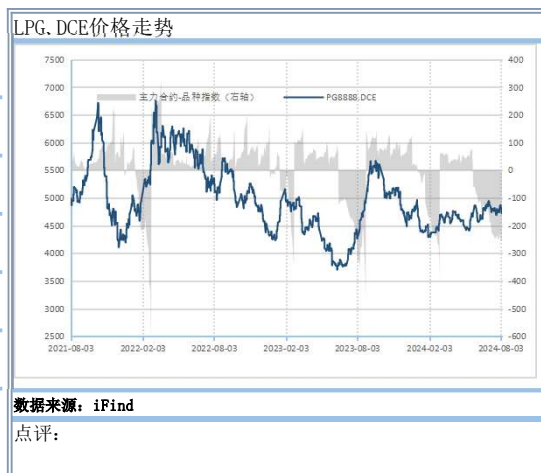
数据截止日: 2024/8/5

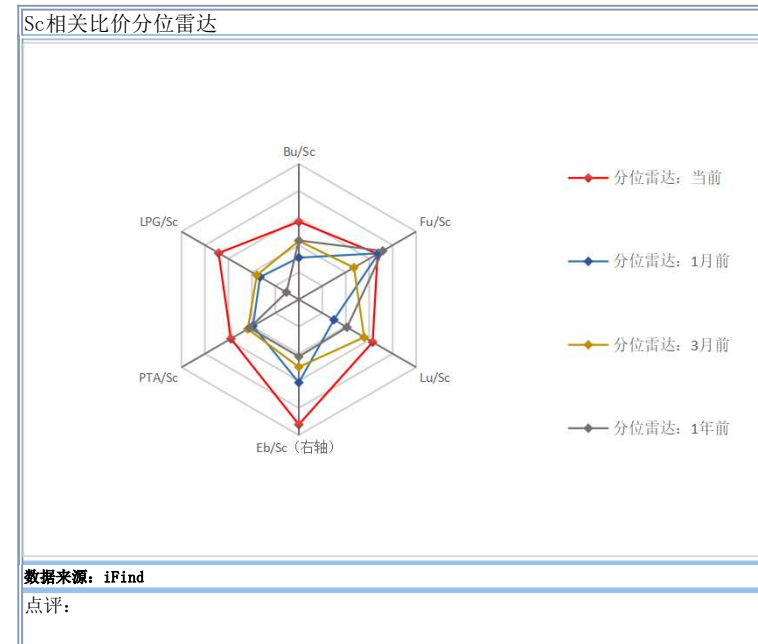
期内最小值: 3704

期内最大值: 5714

期内平均值: 4710.6888

当前分位值: 50.50%





数据起始日: 2019/8/6

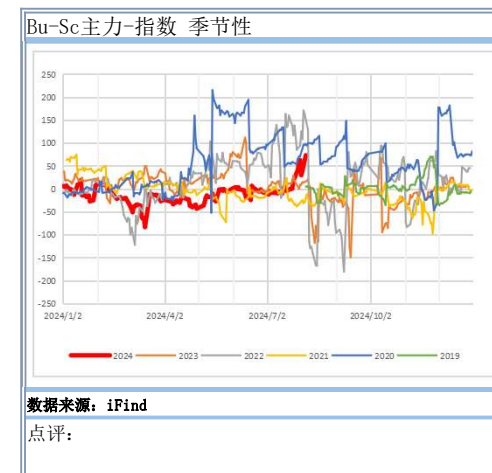
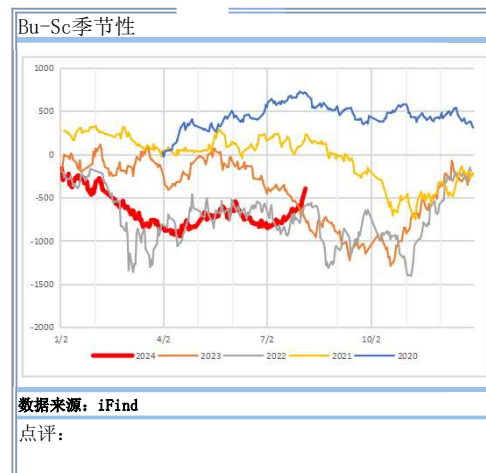
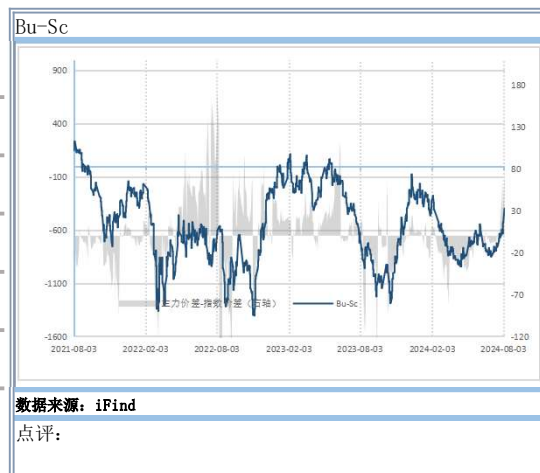
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: -1406.4286

期内最大值: 231.5714

期内平均值: -551.4186

当前分位值: 61.53%



数据起始日: 2019/8/6

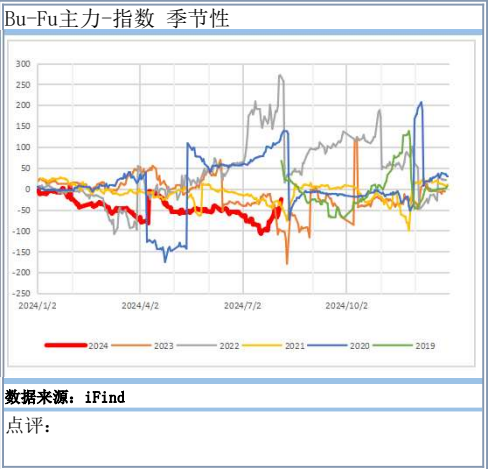
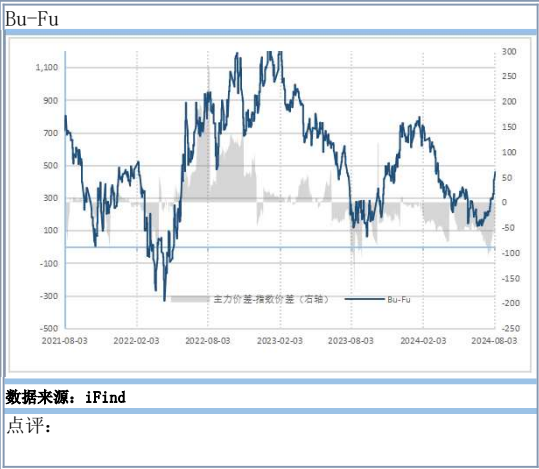
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: -331.0000

期内最大值: 1284.0000

期内平均值: 520.4006

当前分位值: 48.92%



数据起始日: 2021/10/22

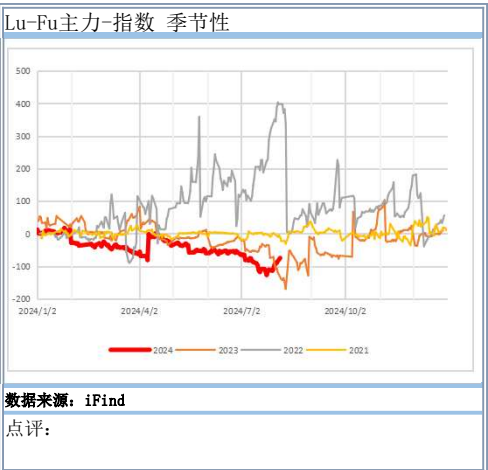
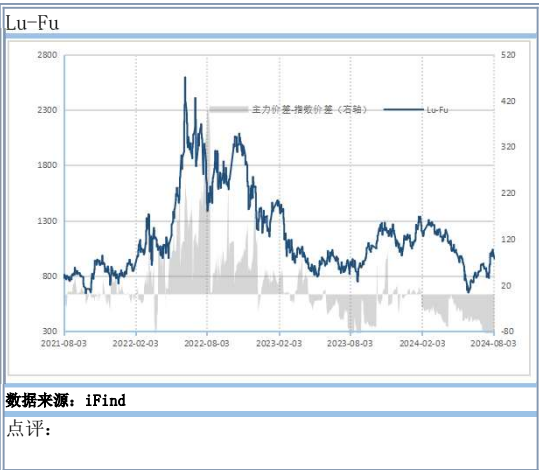
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 650.0000

期内最大值: 1922.0000

期内平均值: 1080.2047

当前分位值: 24.06%



数据起始日: 2021/8/27

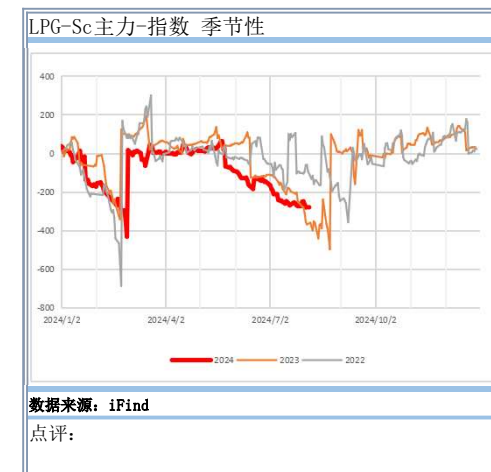
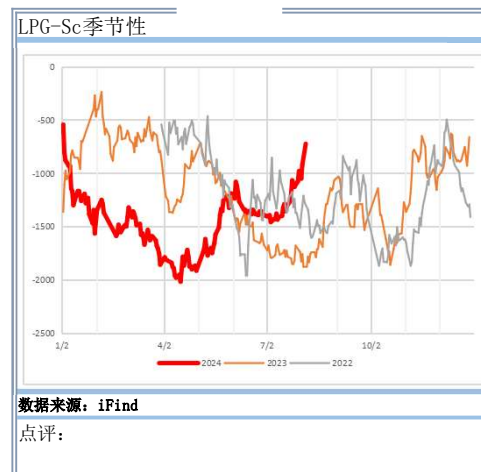
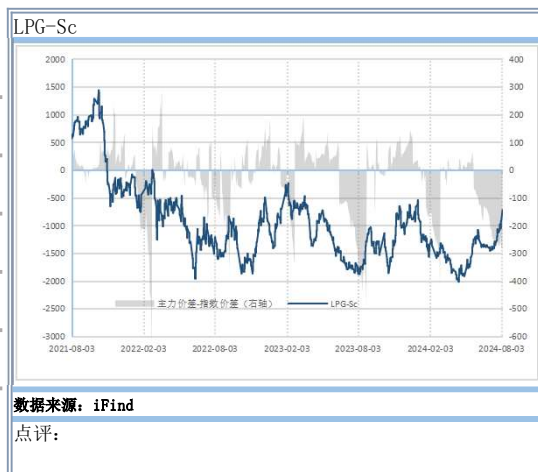
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: -2017.0000

期内最大值: -240.0000

期内平均值: -1263.2095

当前分位值: 72.71%



数据起始日: 2019/8/6

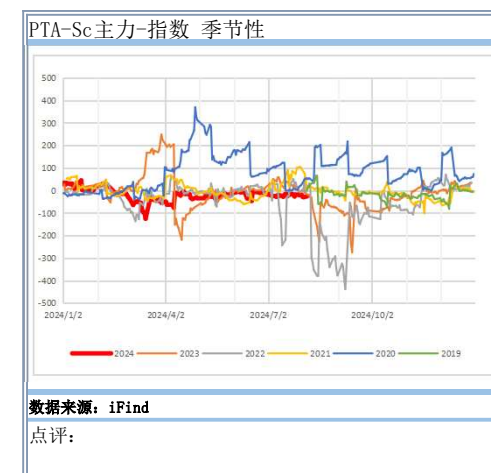
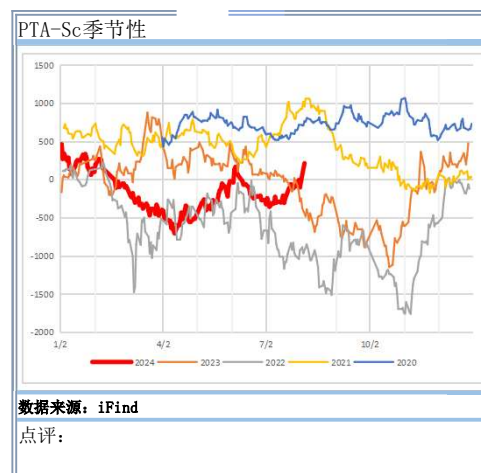
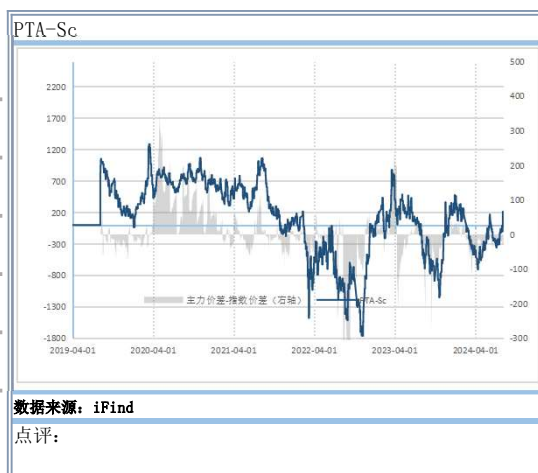
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: -1762.0000

期内最大值: 1061.0000

期内平均值: -222.2277

当前分位值: 69.93%



数据起始日: 2021/4/29

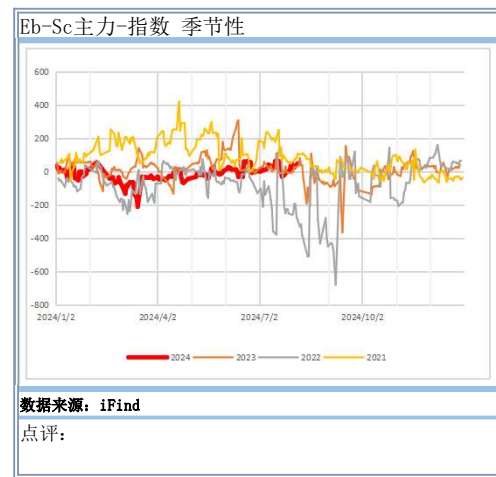
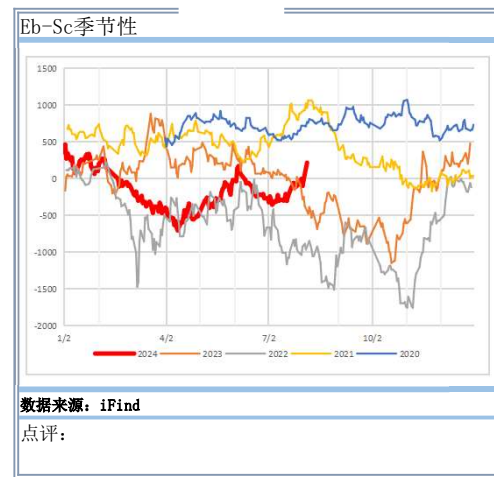
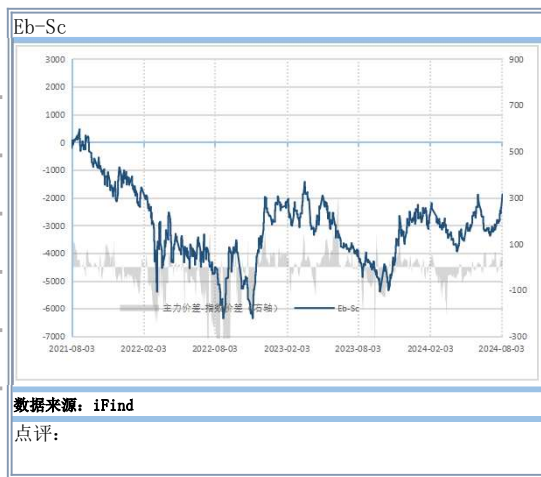
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: -6347.0000

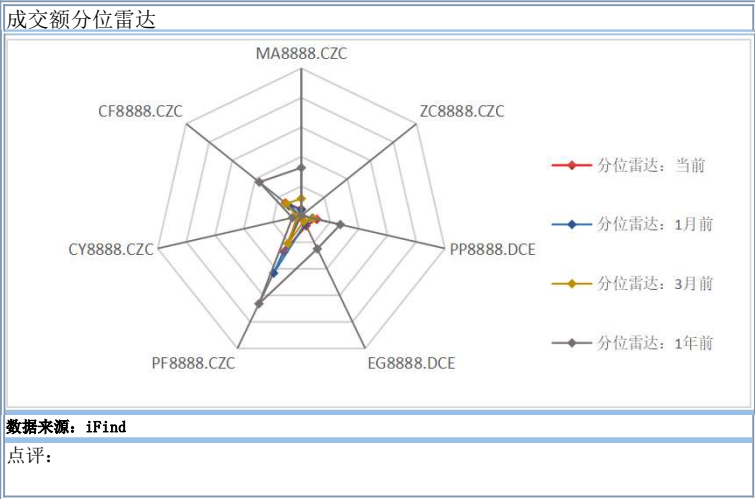
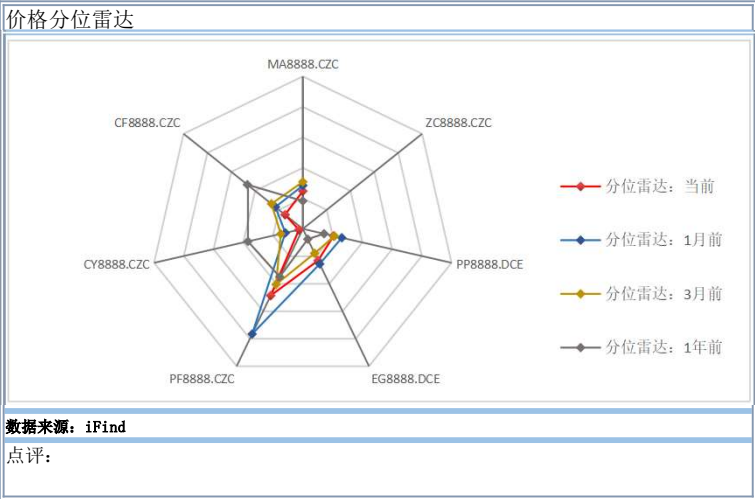
期内最大值: -1435.0000

期内平均值: -3507.8270

当前分位值: 90.94%



三、煤化工相关



数据起始日: 2019/8/6

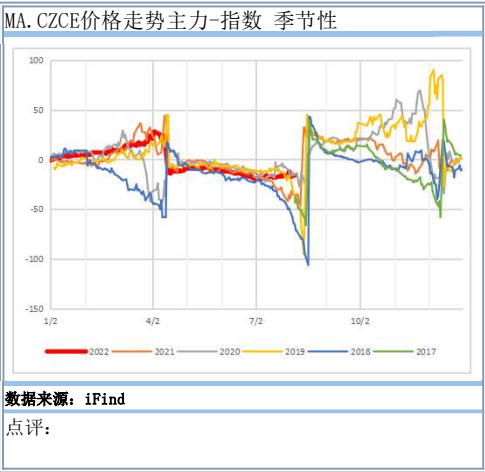
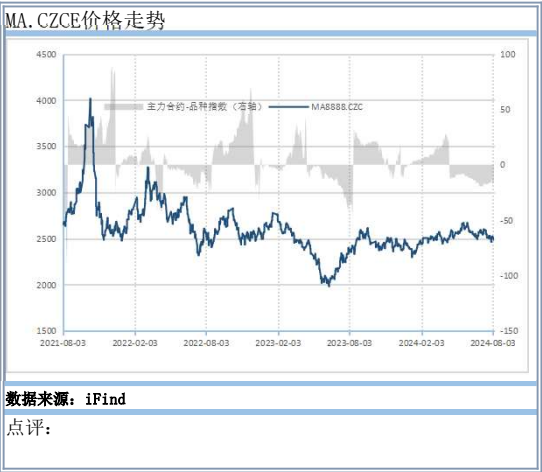
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 1982

期内最大值: 4015

期内平均值: 2590.2867

当前分位值: 24.79%



数据起始日: 2019/8/6

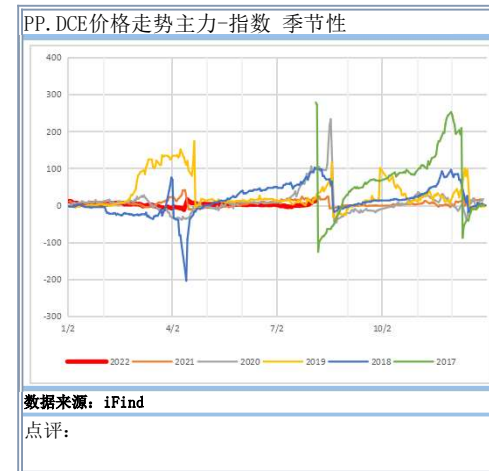
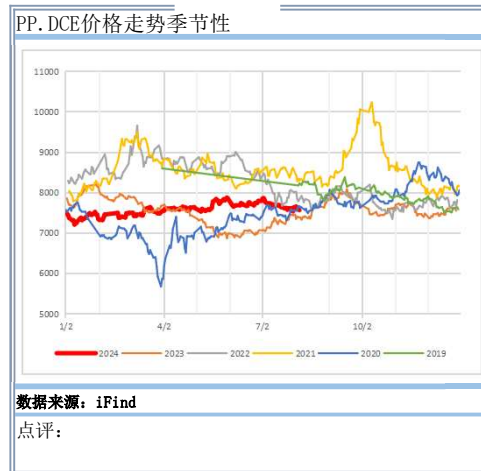
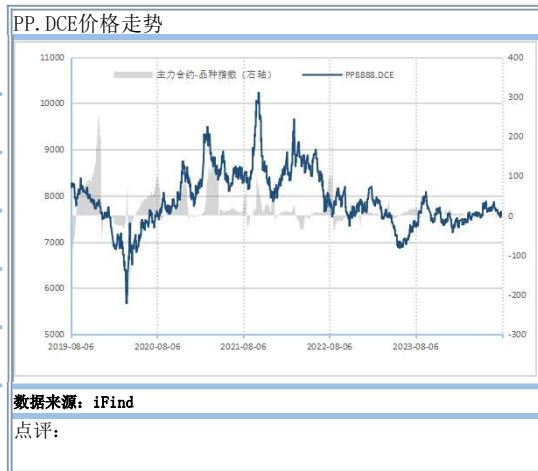
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 6865

期内最大值: 10224

期内平均值: 7913.0123

当前分位值: 20.69%



数据起始日: 2019/8/6

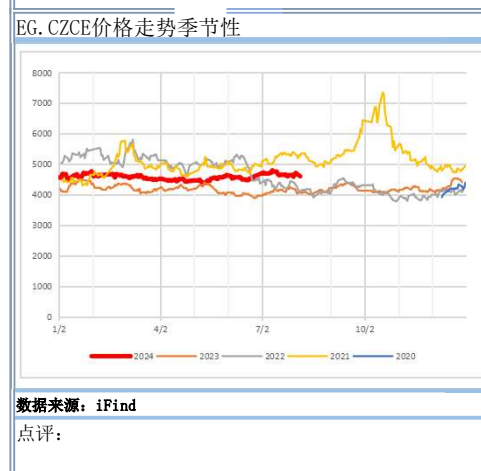
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 3778

期内最大值: 7345

期内平均值: 4564.0837

当前分位值: 23.04%



数据起始日: 2020/10/12

数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 6904

期内最大值: 7907

期内平均值: 7369.0595

当前分位值: 48.55%

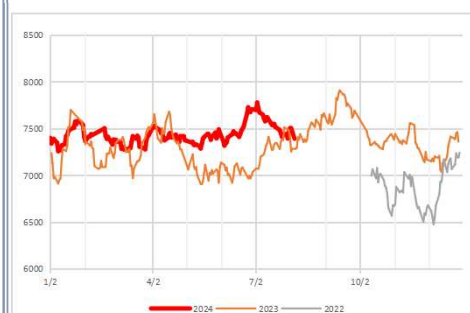
PF.CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

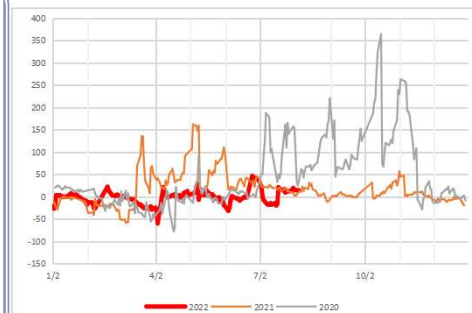
PF.CZCE价格走势季节性



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: 2019/8/6

数据截止日: 2024/8/5

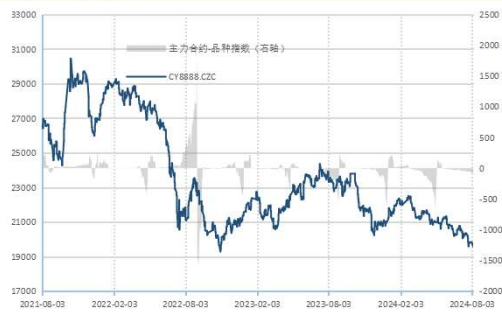
期内最小值: 19292

期内最大值: 30443

期内平均值: 23473.1152

当前分位值: 2.63%

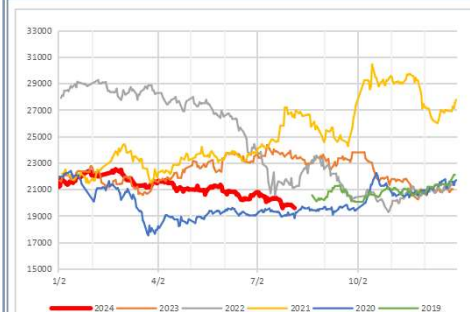
CY.CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

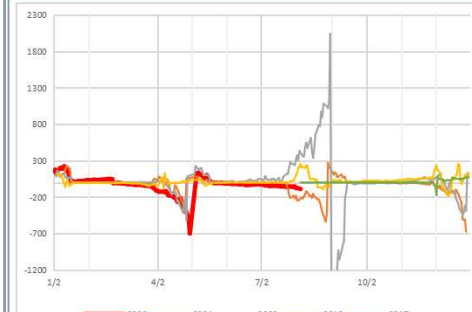
CY.CZCE价格走势季节性



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: 2019/8/6

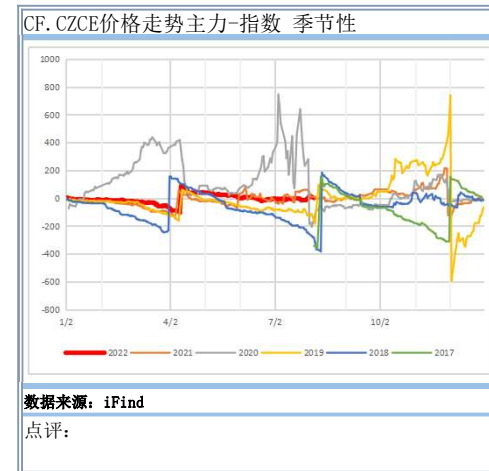
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 12447

期内最大值: 22574

期内平均值: 16789.6118

当前分位值: 14.88%



数据起始日: 2019/8/6

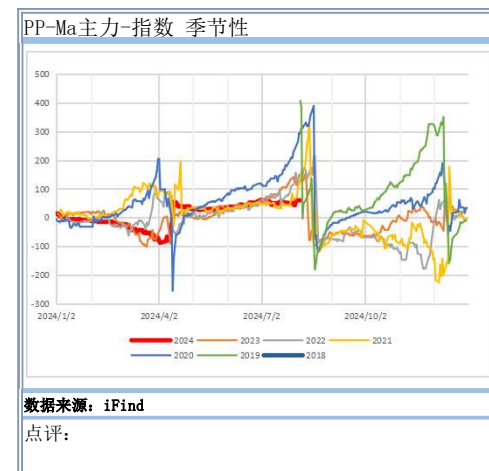
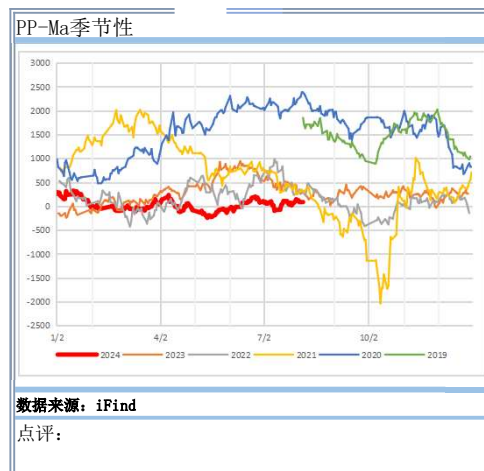
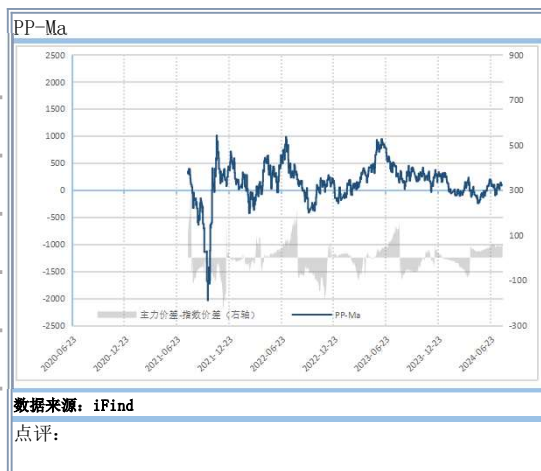
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: -2039.0000

期内最大值: 1007.0000

期内平均值: 142.1523

当前分位值: 70.29%



数据起始日: 2019/8/6

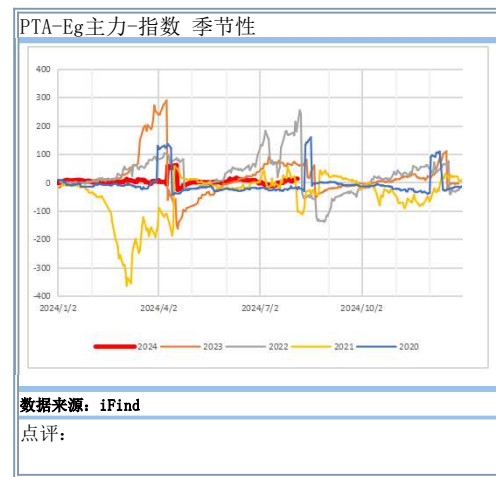
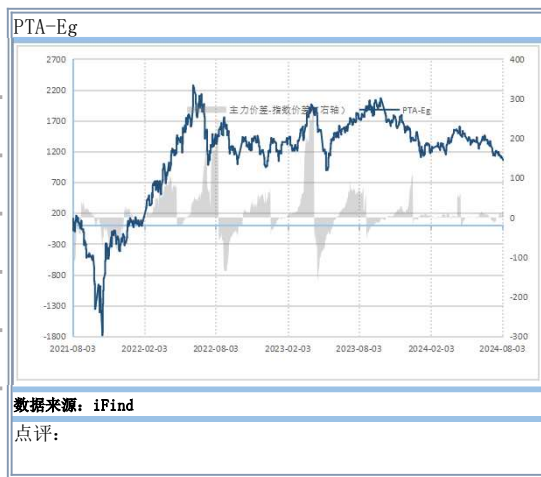
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: -1783.0000

期内最大值: 2269.0000

期内平均值: 1125.6680

当前分位值: 70.06%



数据起始日: 2022/1/2

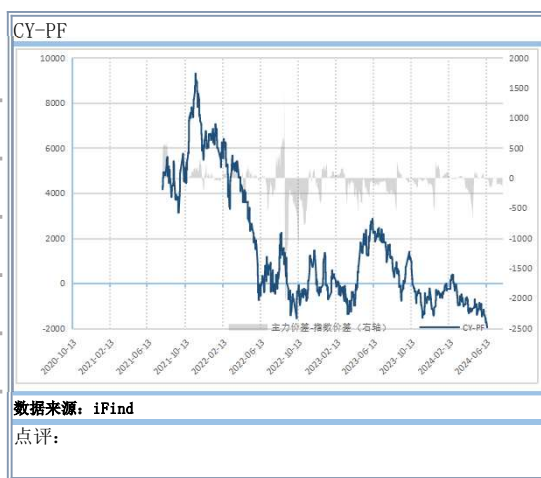
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: -2887.0000

期内最大值: 2854.0000

期内平均值: -218.6261

当前分位值: 5.21%



数据起始日: 2023/2/23

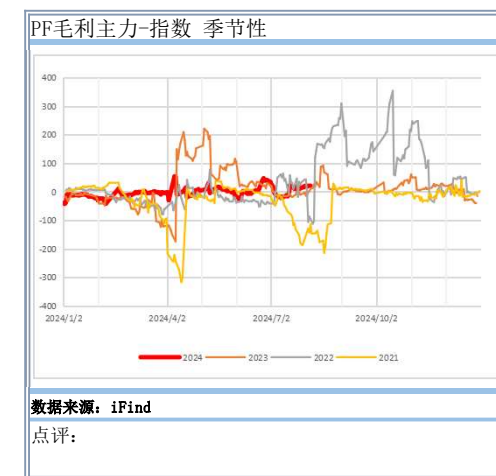
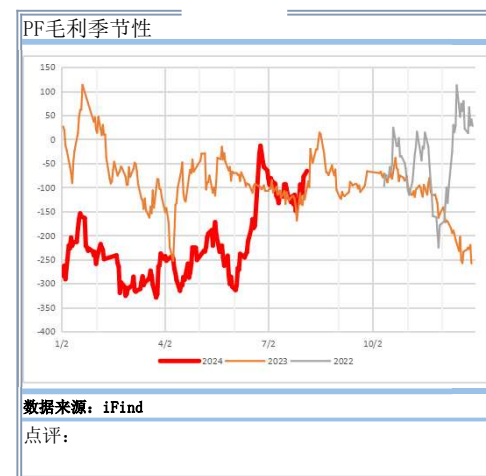
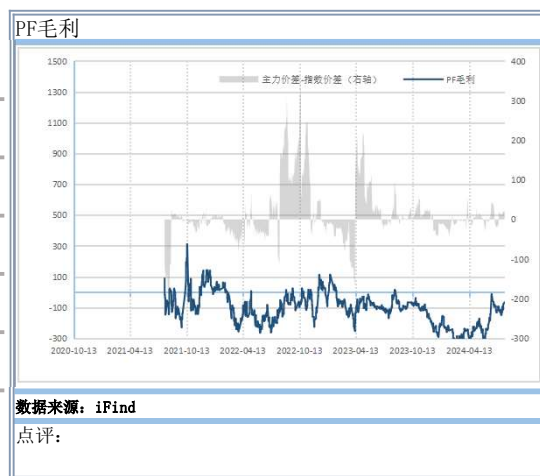
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: -328.9900

期内最大值: 13.9250

期内平均值: -150.5764

当前分位值: 76.73%



数据起始日: 2019/8/6

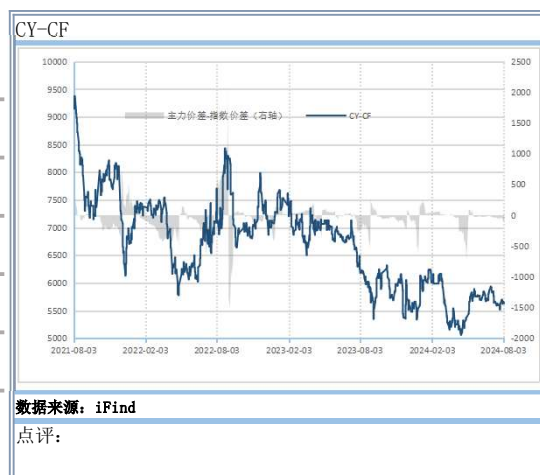
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 5061.0000

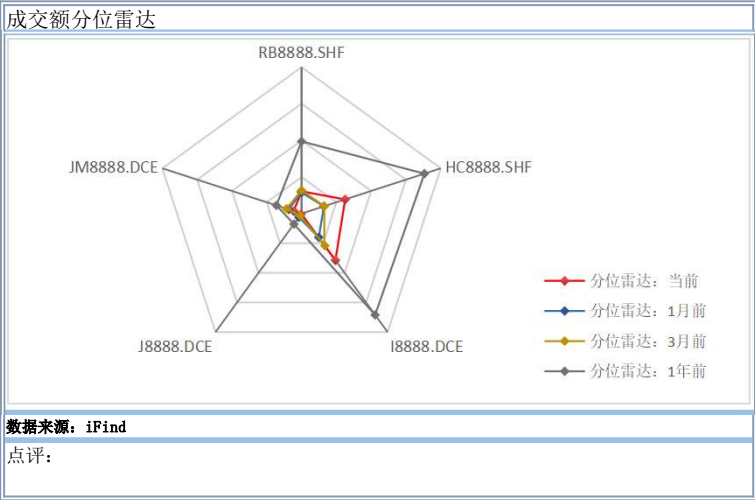
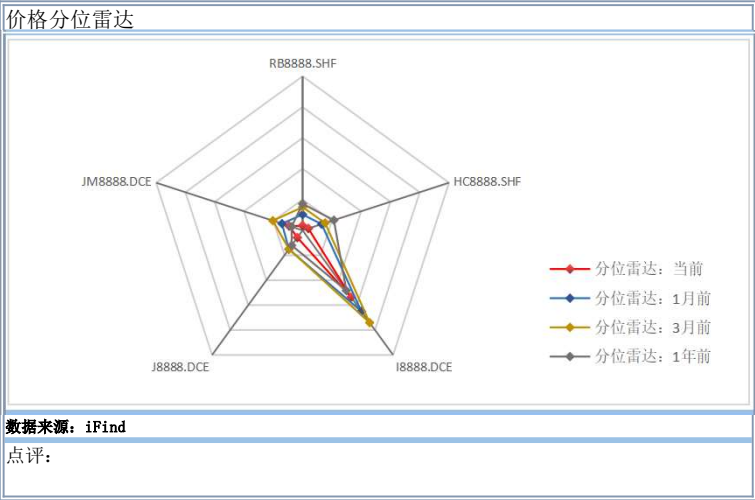
期内最大值: 9373.0000

期内平均值: 6683.5034

当前分位值: 13.22%



四、黑色相关



数据起始日: 2019/8/6

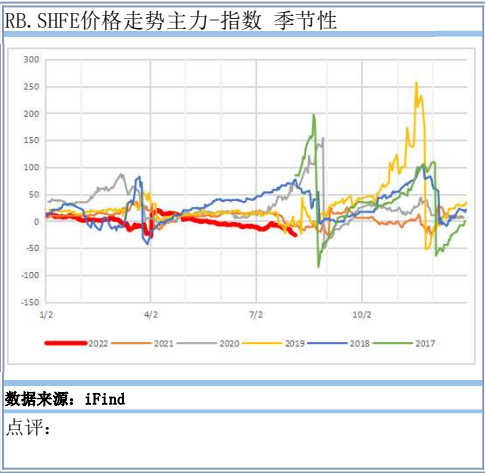
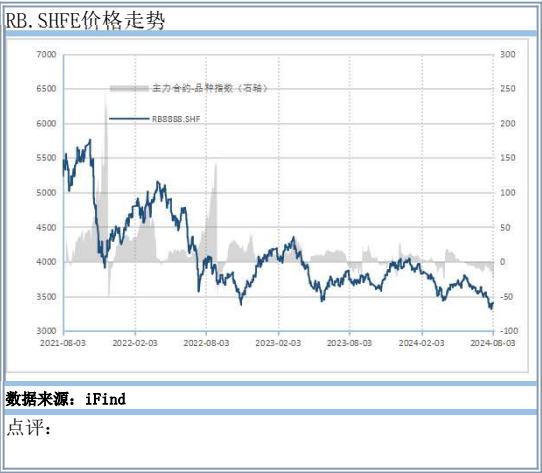
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 3316

期内最大值: 5762

期内平均值: 4090.1838

当前分位值: 3.15%



数据起始日: 2019/8/6

数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 3444

期内最大值: 5888

期内平均值: 4222.5624

当前分位值: 3.93%

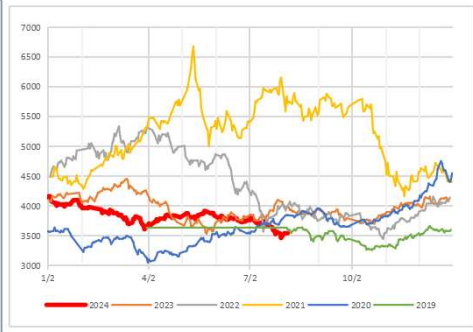
HC.SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

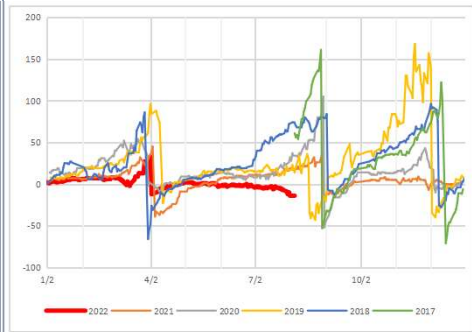
HC.SHFE价格走势季节性



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: 2019/8/6

数据截止日: 2024/8/5

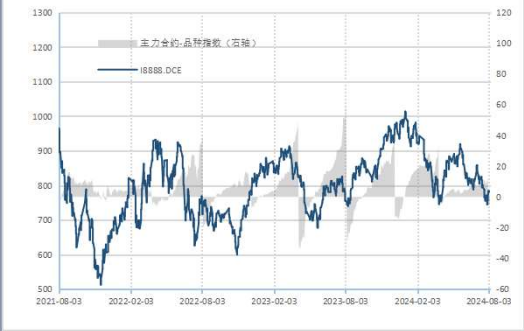
期内最小值: 512.8

期内最大值: 1013.6

期内平均值: 795.9989

当前分位值: 53.61%

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： 2019/8/6

数据截止日： 2024/8/5

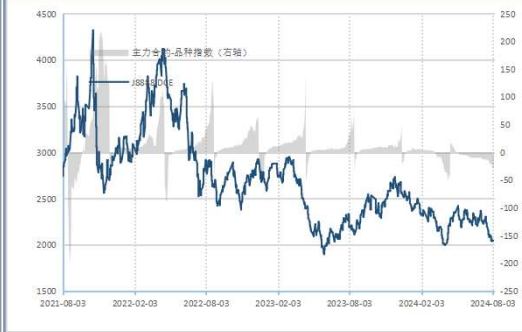
期内最小值： 1897.9

期内最大值： 4320.8

期内平均值： 2707.1830

当前分位值： 5.81%

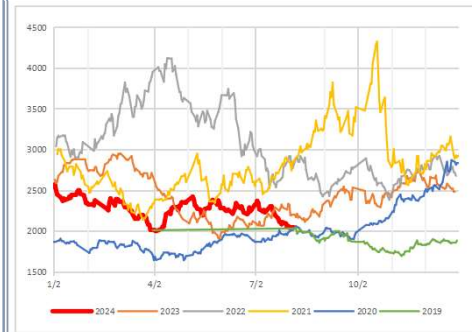
J.DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

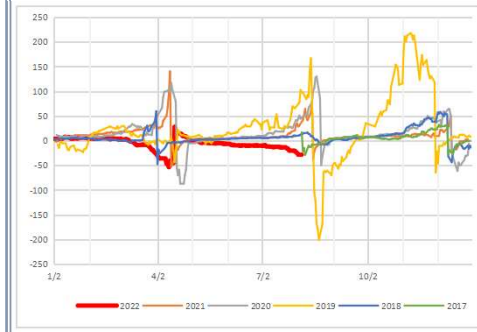
J.DCE价格走势季节性



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： 2019/8/6

数据截止日： 2024/8/5

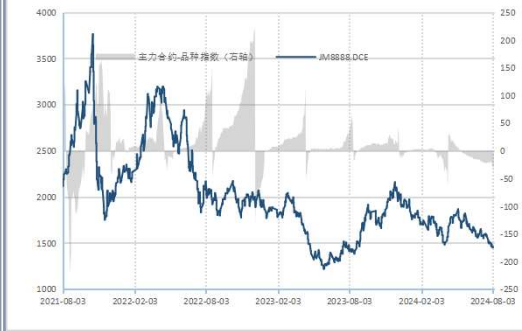
期内最小值： 1219.4

期内最大值： 3764.7

期内平均值： 2001.5867

当前分位值： 9.20%

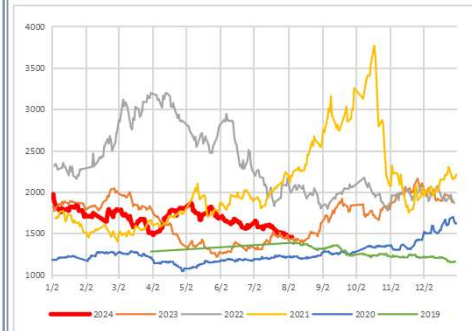
Jm.DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

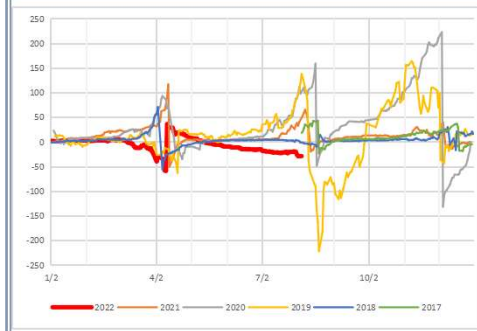
Jm.DCE价格走势季节性



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： 2019/8/6

数据截止日： 2024/8/5

期内最小值： 670.1176

期内最大值： 2451.8235

期内平均值： 1093.0193

当前分位值： 8.13%

螺铁差



数据来源：iFind

点评：

数据起始日： 2019/8/6

数据截止日： 2024/8/5

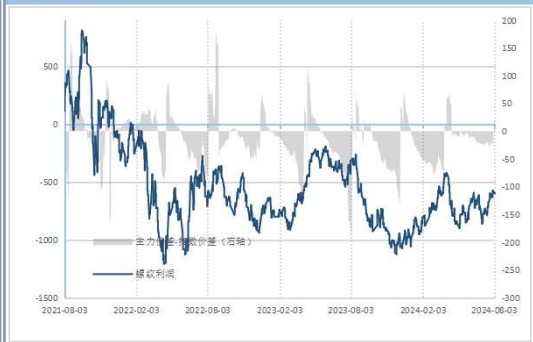
期内最小值： -1206.9091

期内最大值： 810.0000

期内平均值： -541.7977

当前分位值： 30.53%

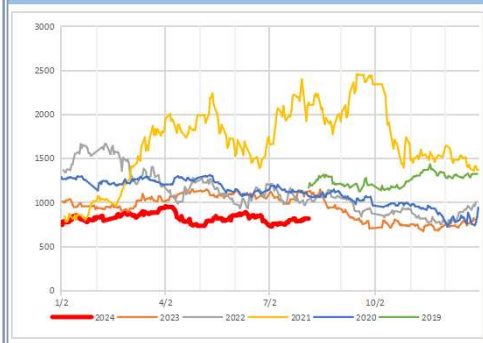
螺纹利润



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：

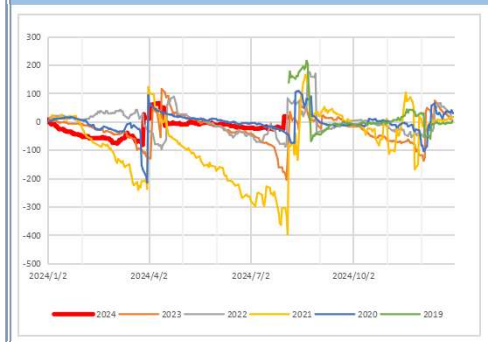
螺铁差主力-指数 季节性



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: 2019/8/6

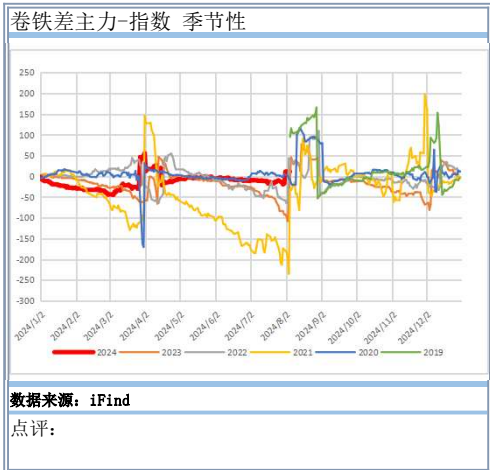
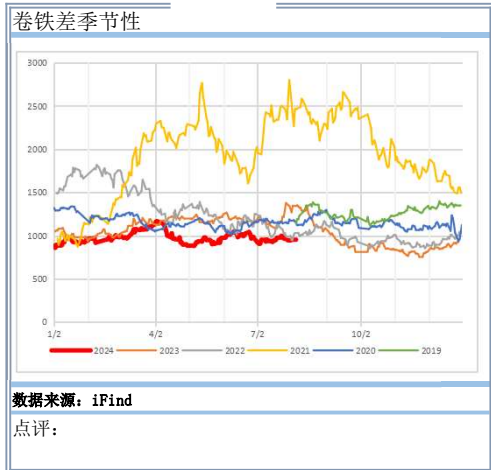
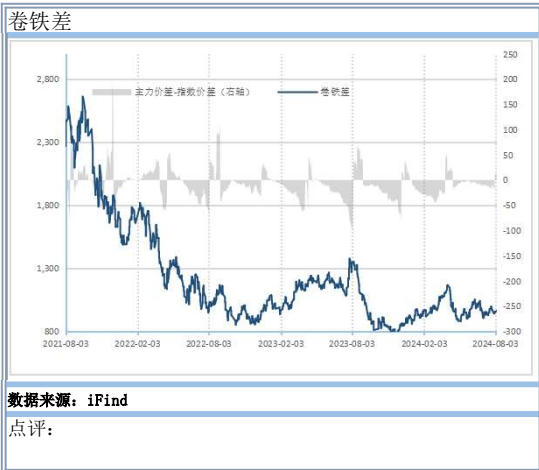
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 752.4706

期内最大值: 2661.8235

期内平均值: 1225.3979

当前分位值: 10.98%



数据起始日: 2019/8/6

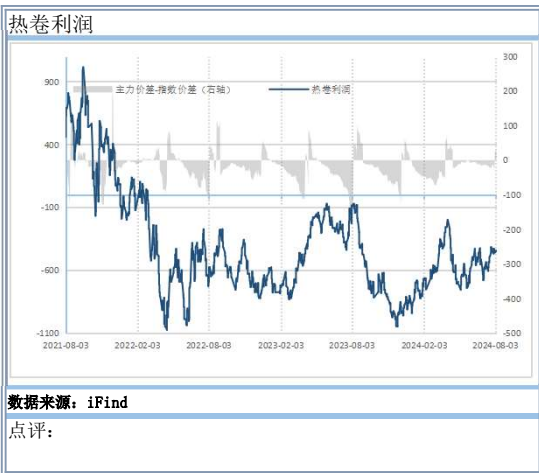
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: -1073.7273

期内最大值: 1014.0000

期内平均值: -409.4191

当前分位值: 30.16%



数据起始日: 2019/8/6

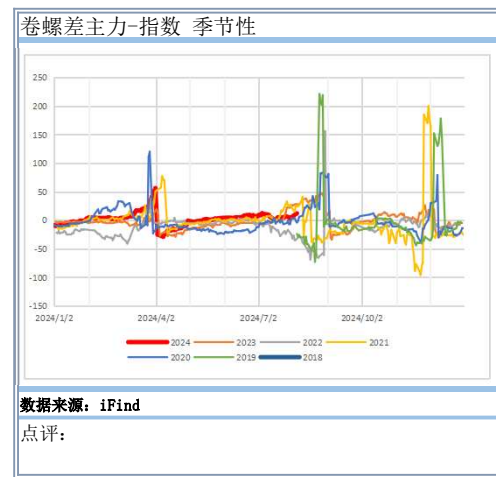
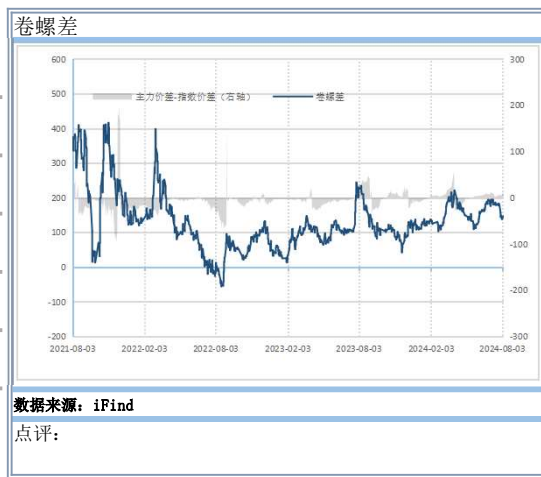
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: -56.0000

期内最大值: 416.0000

期内平均值: 132.3786

当前分位值: 43.01%



数据起始日: 2019/8/6

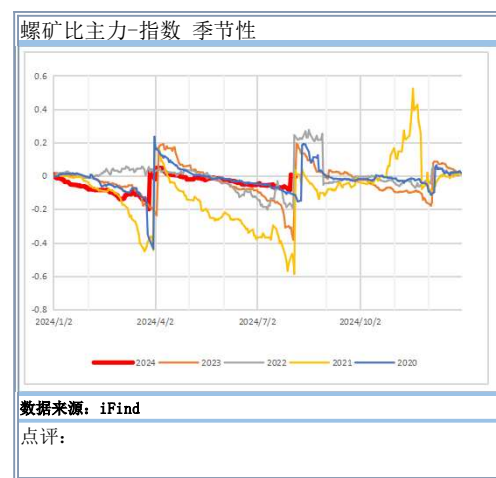
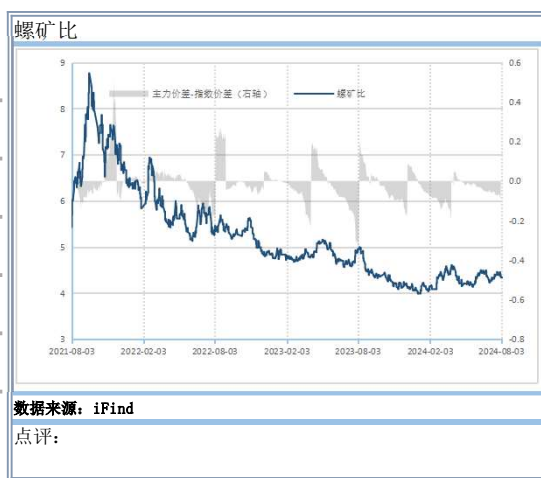
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 3.9880

期内最大值: 8.7631

期内平均值: 5.2196

当前分位值: 7.43%



数据起始日: 2019/8/6

数据截止日: 2024/8/5

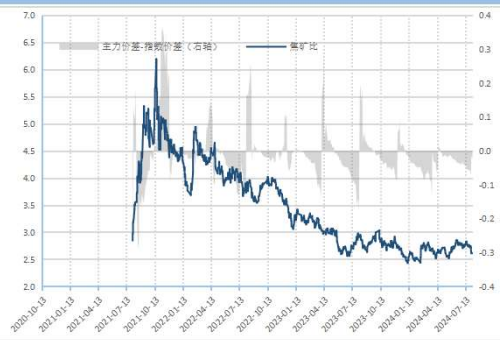
期内最小值: 2.4279

期内最大值: 6.1947

期内平均值: 3.4580

当前分位值: 4.81%

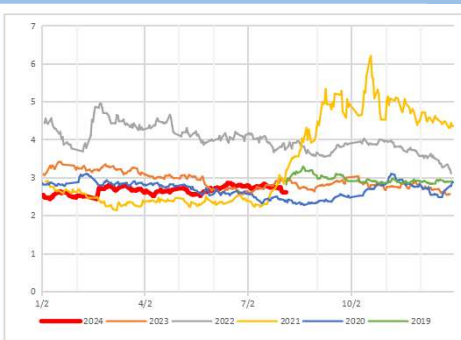
焦矿比



数据来源: iFind

点评:

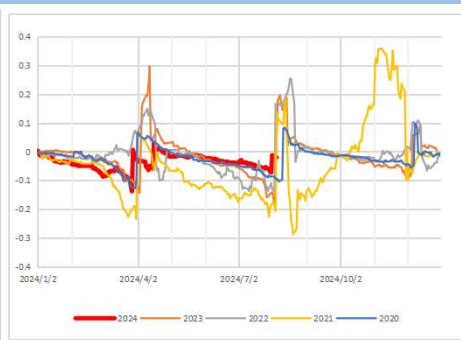
焦矿比季节性



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: 2019/8/6

数据截止日: 2024/8/5

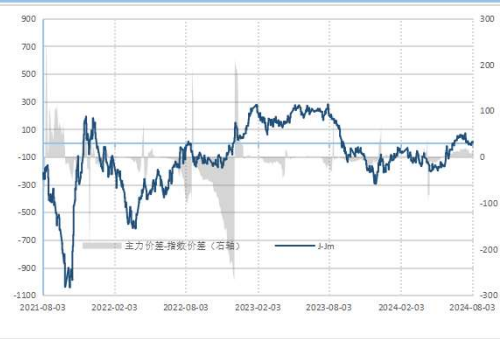
期内最小值: -1043.0800

期内最大值: 279.1600

期内平均值: -95.0384

当前分位值: 79.16%

J-Jm



数据来源: iFind

点评:

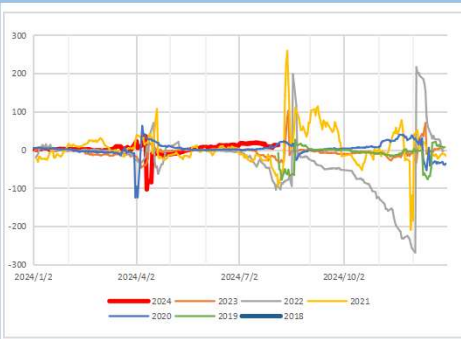
J-Jm季节性



数据来源: iFind

点评:

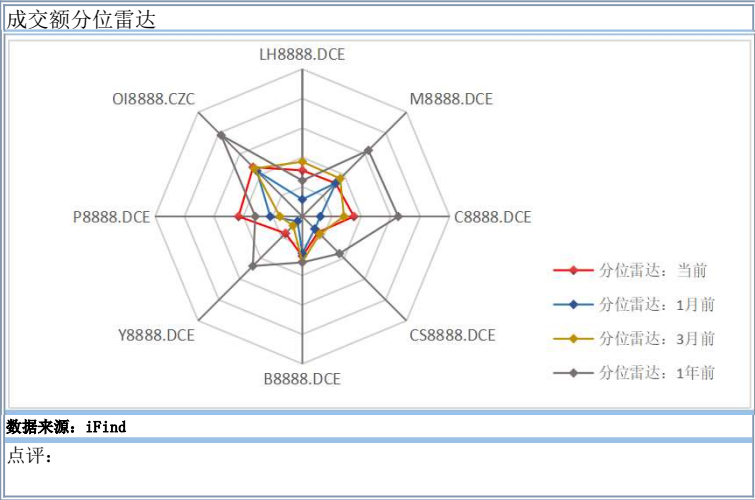
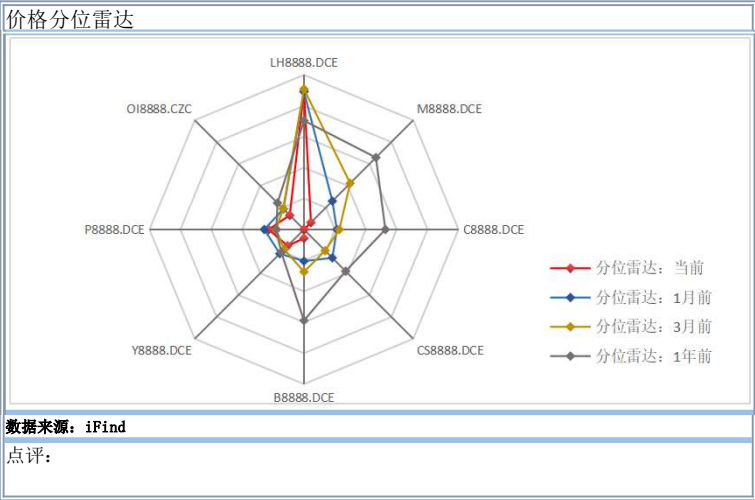
J-Jm主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

五、农产品相关



数据起始日: 2021/1/8

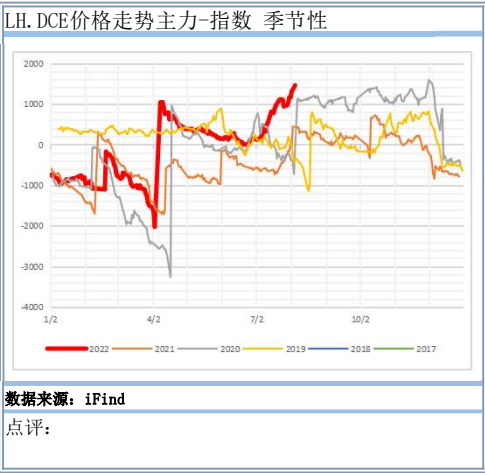
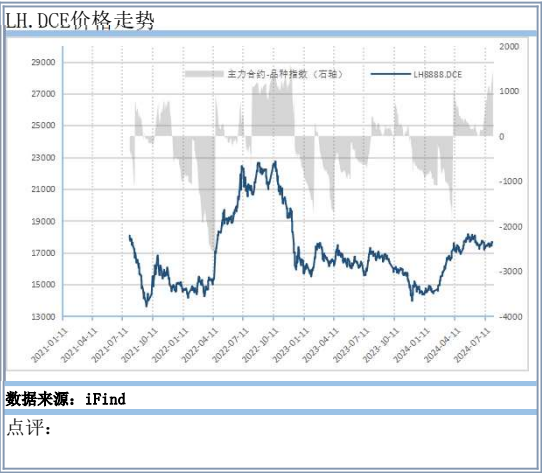
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 13971

期内最大值: 18158

期内平均值: 16310.3586

当前分位值: 89.44%



数据起始日: 2019/8/6

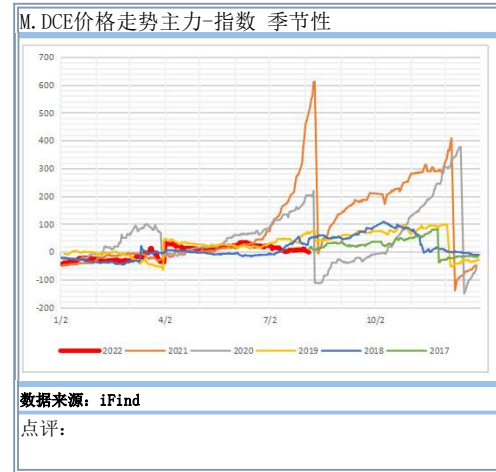
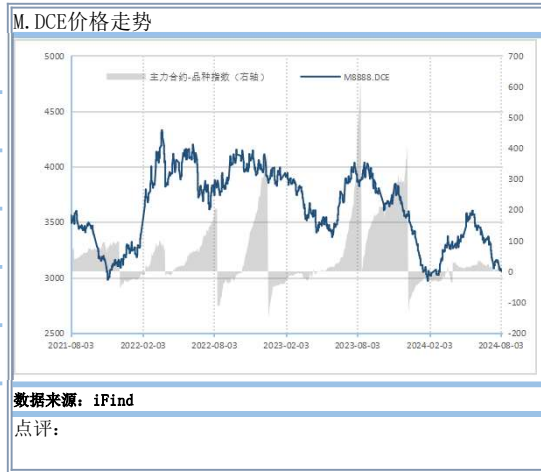
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 2970

期内最大值: 4328

期内平均值: 3628.7407

当前分位值: 6.41%



数据起始日: 2019/8/6

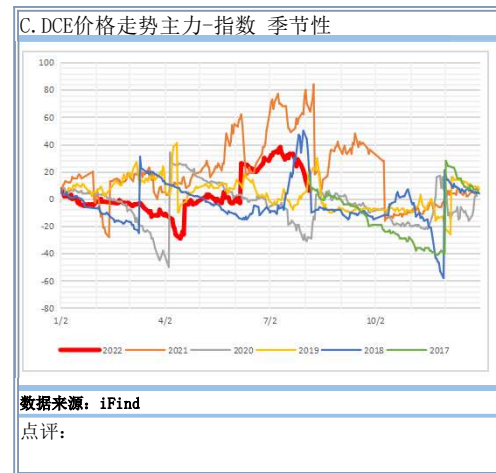
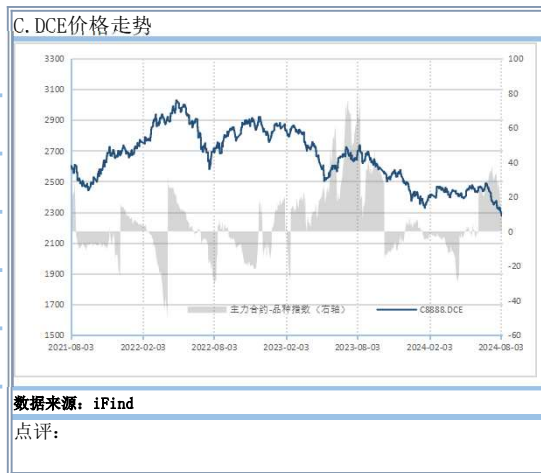
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 2275

期内最大值: 3027

期内平均值: 2657.2126

当前分位值: 0.00%



数据起始日: 2019/8/6

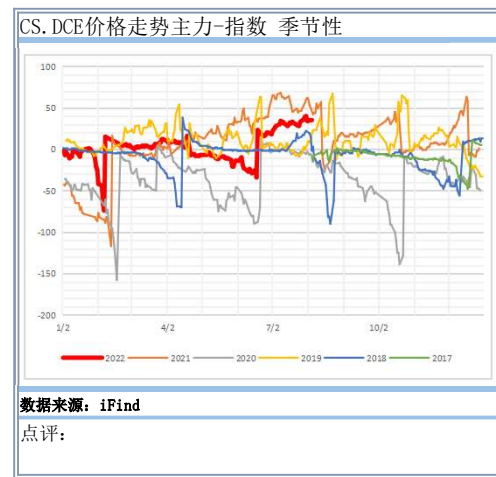
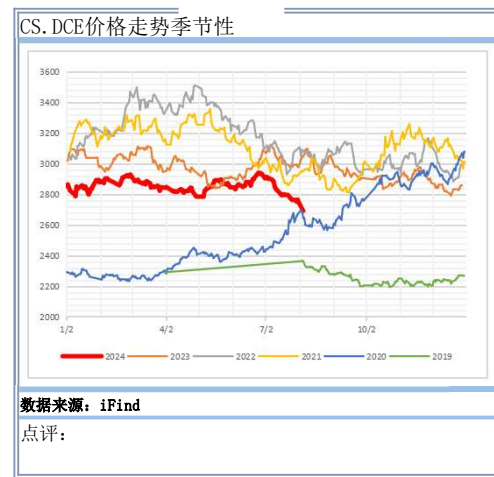
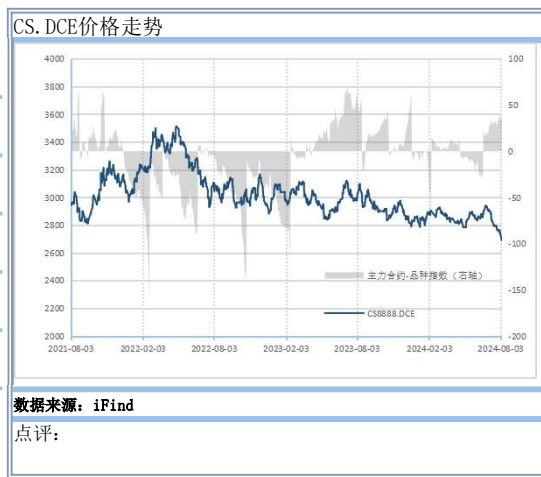
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 2691

期内最大值: 3512

期内平均值: 3017.2291

当前分位值: 0.00%



数据起始日: 2019/8/6

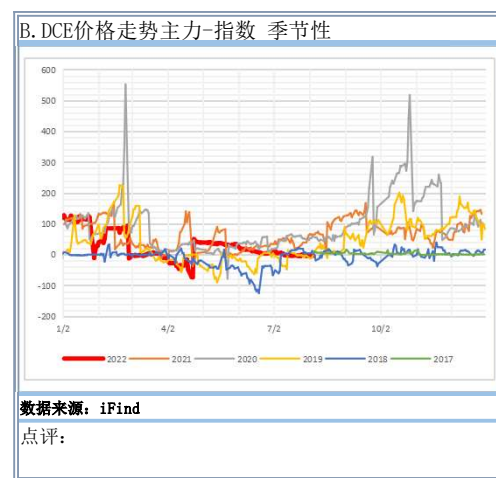
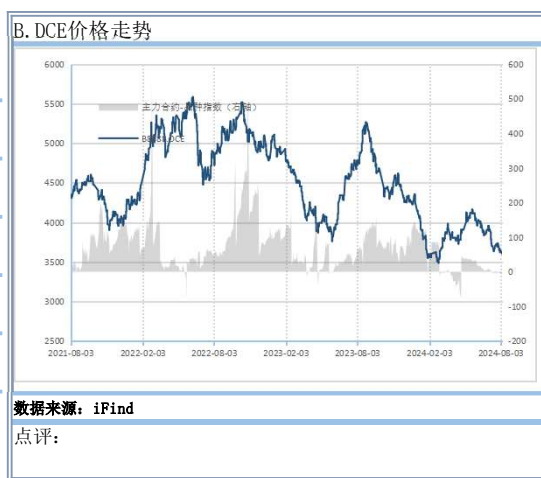
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 3487

期内最大值: 5585

期内平均值: 4497.6433

当前分位值: 5.67%



数据起始日: 2019/8/6

数据截止日: 2024/8/5

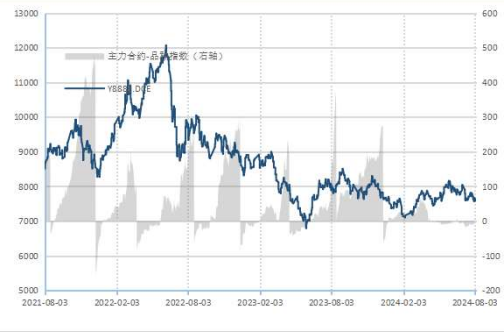
期内最小值: 6793

期内最大值: 12065

期内平均值: 8695.6502

当前分位值: 14.97%

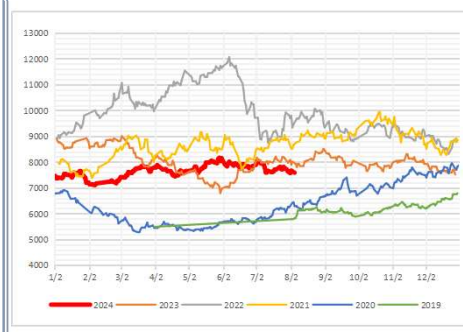
Y. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

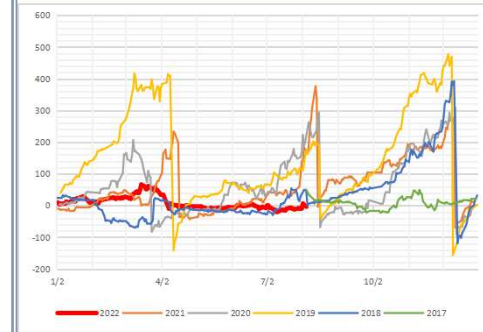
Y. DCE价格走势季节性



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: 2019/8/6

数据截止日: 2024/8/5

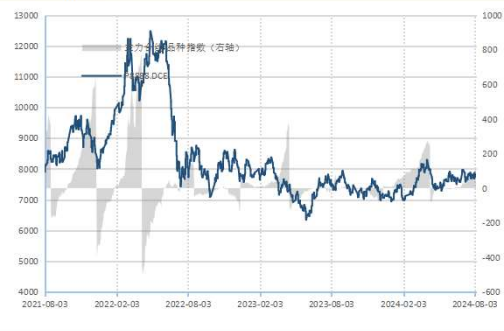
期内最小值: 6349

期内最大值: 12479

期内平均值: 8298.9781

当前分位值: 22.77%

P. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

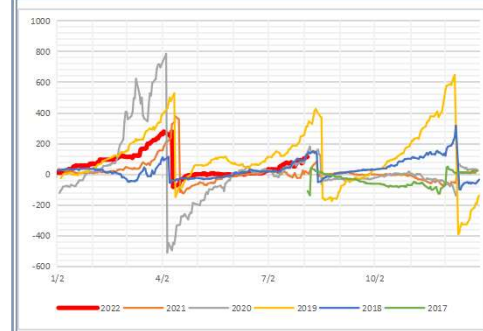
P. DCE价格走势季节性



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: 2019/8/6

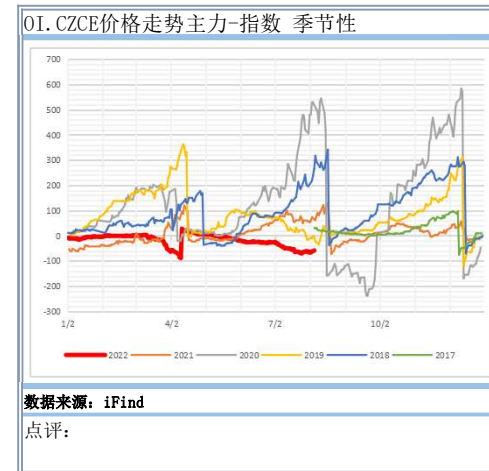
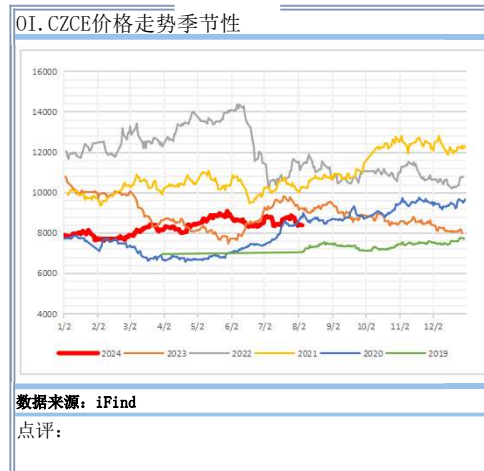
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 7475

期内最大值: 14344

期内平均值: 10141.8080

当前分位值: 13.04%



数据起始日: 2022/3/6

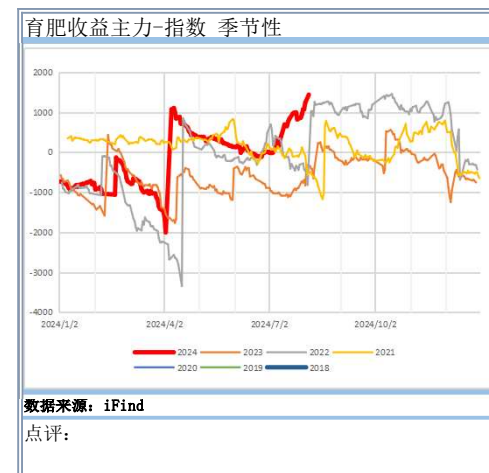
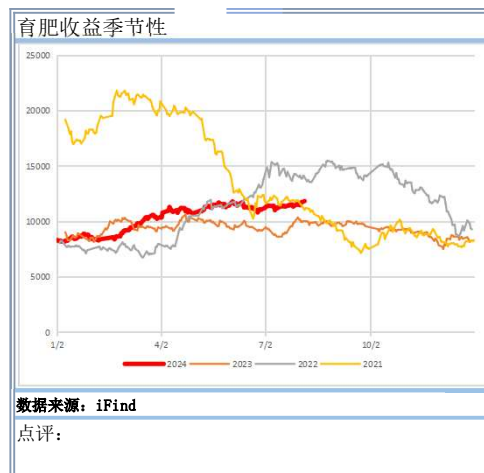
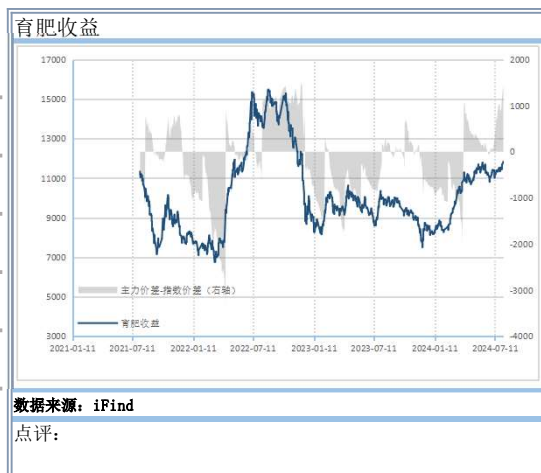
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 7508.2500

期内最大值: 11833.0000

期内平均值: 9801.8776

当前分位值: 100.00%



数据起始日: 2021/1/8

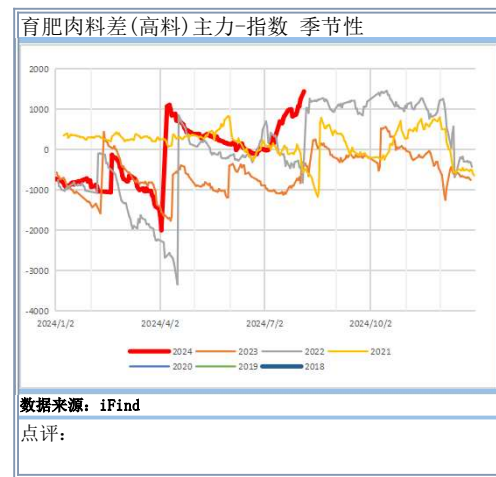
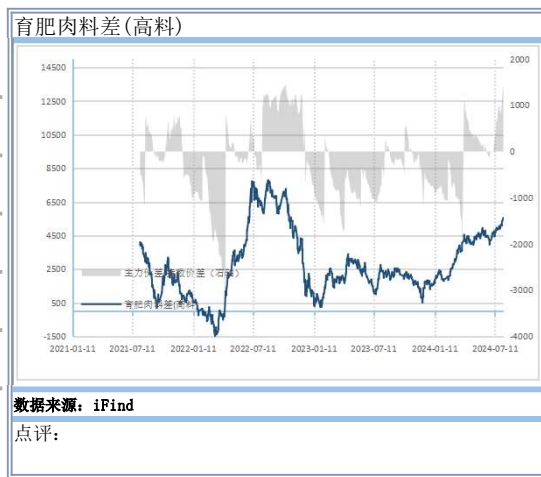
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 515.0000

期内最大值: 5559.0000

期内平均值: 2793.7448

当前分位值: 100.00%



数据起始日: 2019/8/6

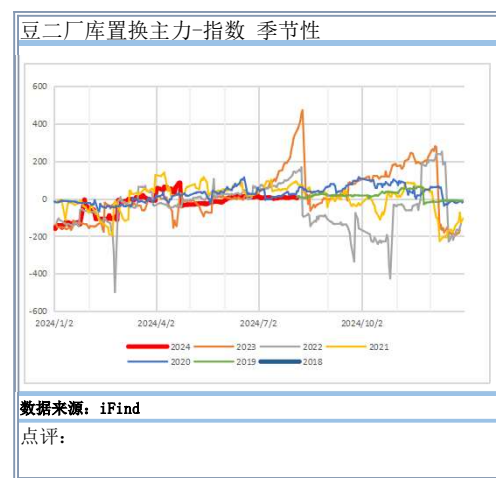
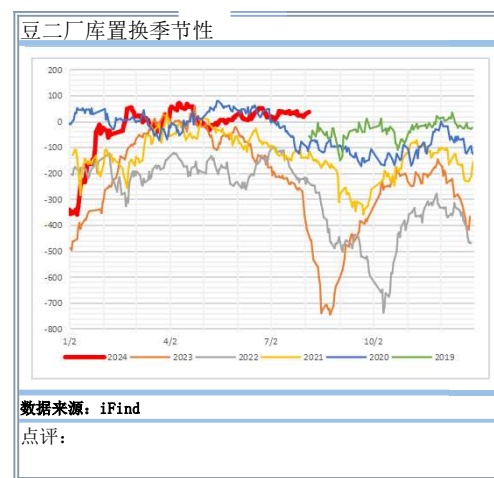
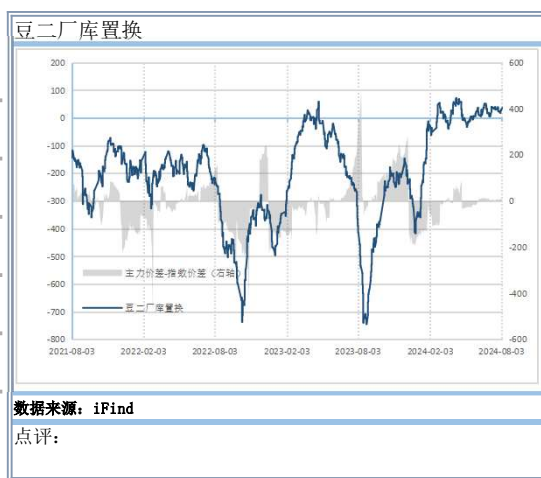
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: -745.0200

期内最大值: 71.2200

期内平均值: -200.3866

当前分位值: 95.74%



数据起始日: 2019/8/6

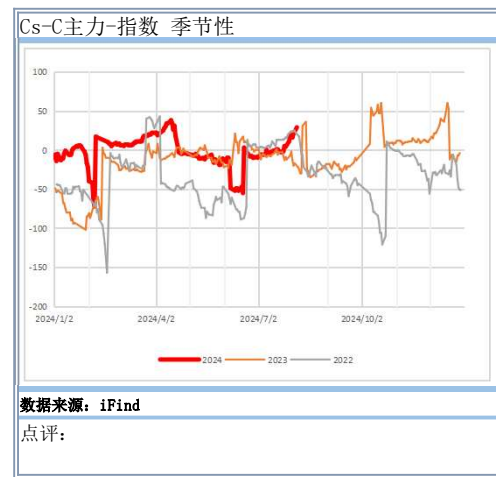
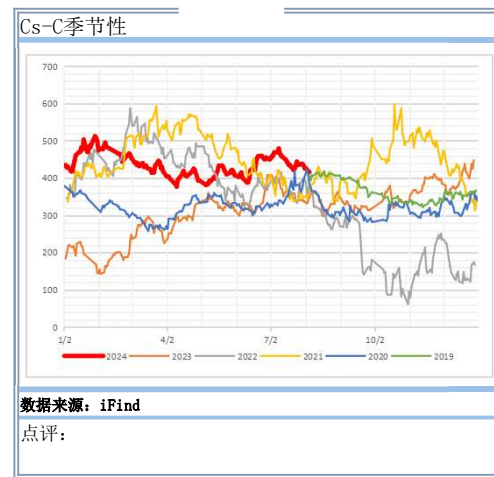
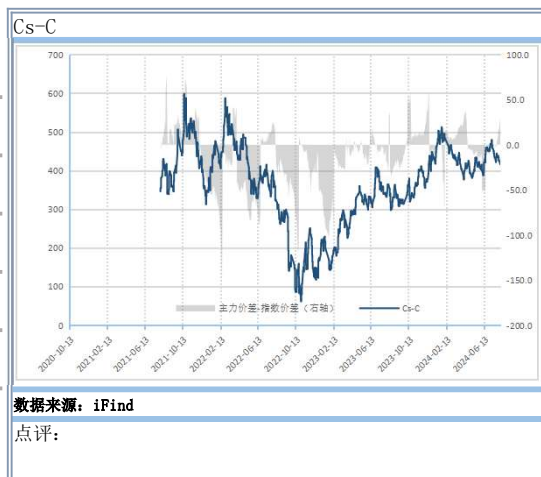
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: 62.0000

期内最大值: 598.0000

期内平均值: 360.0165

当前分位值: 66.04%



数据起始日: 2019/8/6

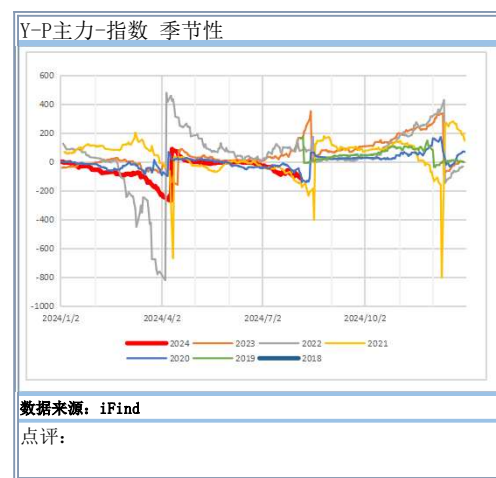
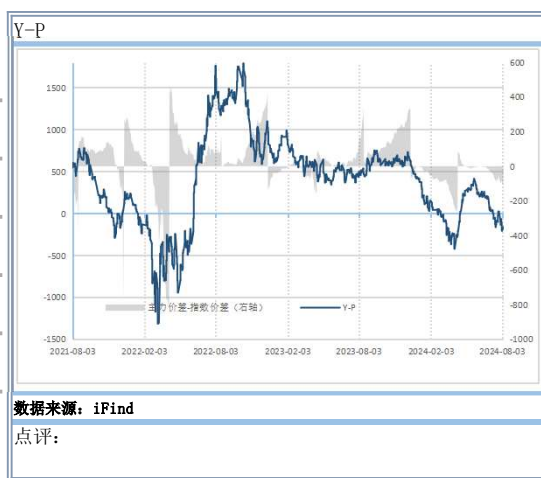
数据截止日: 2024/8/5

期内最小值: -1313.0000

期内最大值: 1788.0000

期内平均值: 396.6722

当前分位值: 37.08%



数据起始日： 2019/8/6

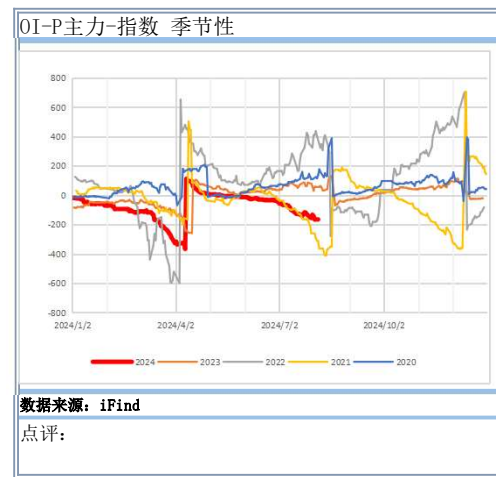
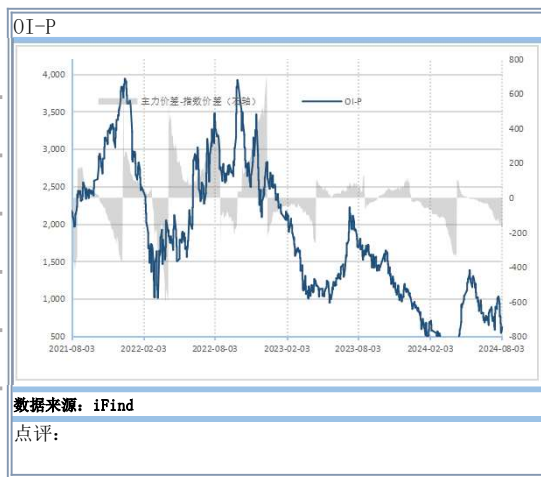
数据截止日： 2024/8/5

期内最小值： 19.0000

期内最大值： 2220.0000

期内平均值： 1093.7620

当前分位值： 27.58%



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。