

<http://www.shanqingh.com>

盘面套利观察

2024年8月6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

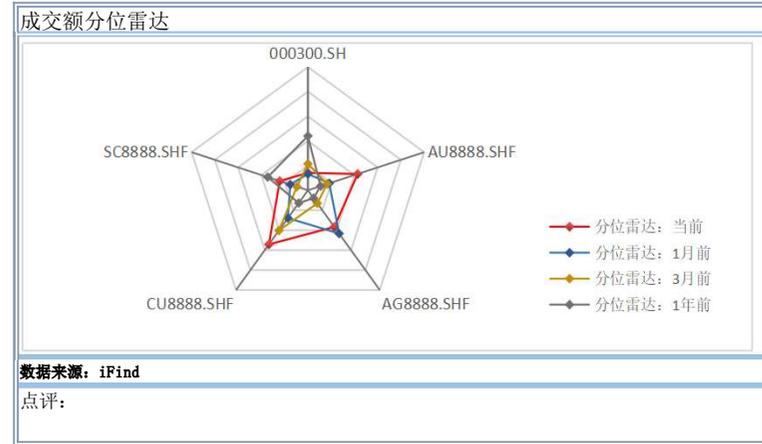
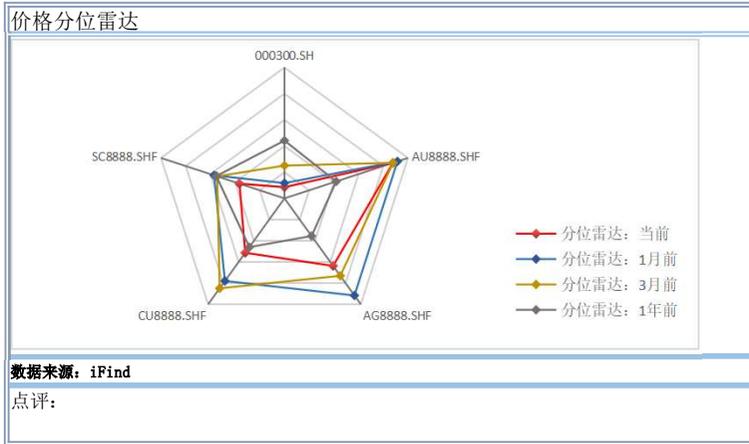
从业资格证号： F03107583

数据仅供参考，据此入市，风险自担。

说明：

- 1、本文件所列数据及图表以观察市场为主，指导交易仍需有逻辑支撑
- 2、跨品种比价、差价以品种指数为参考，并计算主力合约价差的偏离
- 3、数据最大跨度3年，不足3年的以实际数据期限为准
- 4、由于作者能力有限，表中数据难免出错，恳请沟通和指正，不胜感激。

一、宏观观察



数据起始日: 2019/8/7

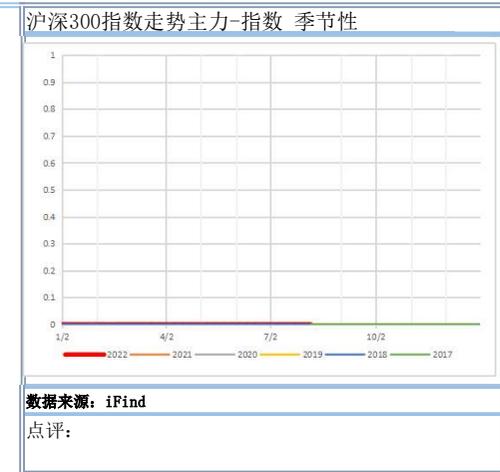
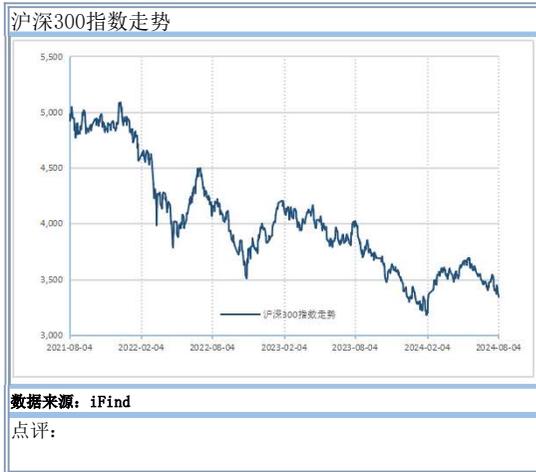
数据截止日: 2024/8/6

期内最小值: 3179.6276

期内最大值: 5083.8007

期内平均值: 4017.8466

当前分位值: 25.07%



数据起始日: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

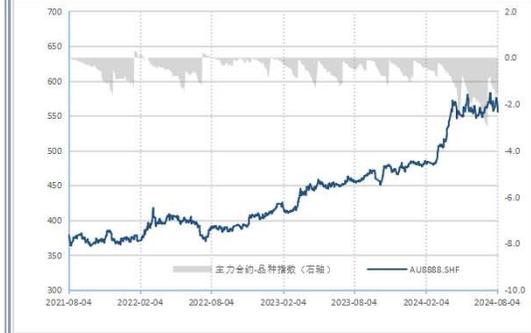
期内最小值: 363.2

期内最大值: 582.4

期内平均值: 436.9502

当前分位值: 87.84%

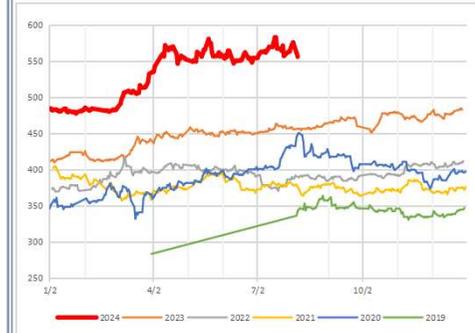
Au. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

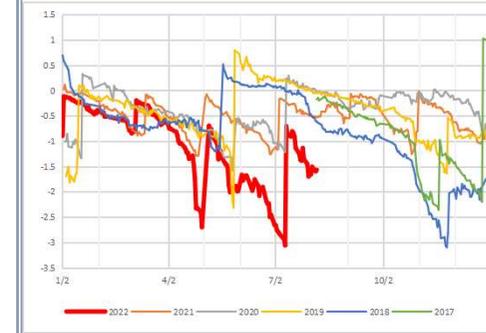
Au. SHFE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

Au. SHFE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

期内最小值: 53367

期内最大值: 87697

期内平均值: 69240.7214

当前分位值: 51.37%

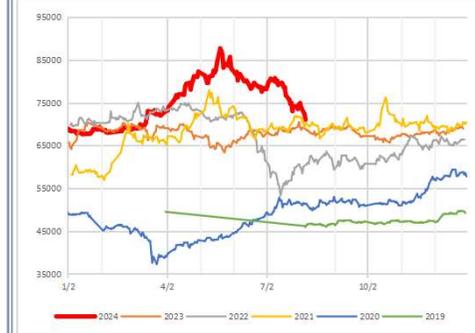
Cu. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

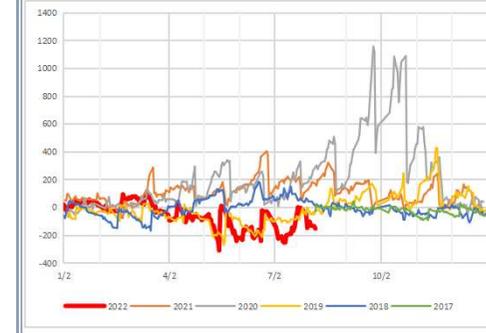
Cu. SHFE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

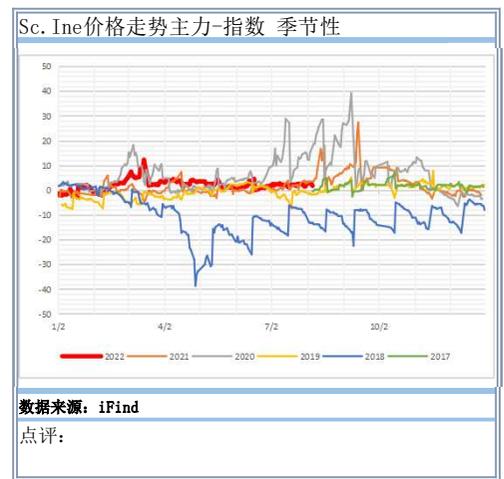
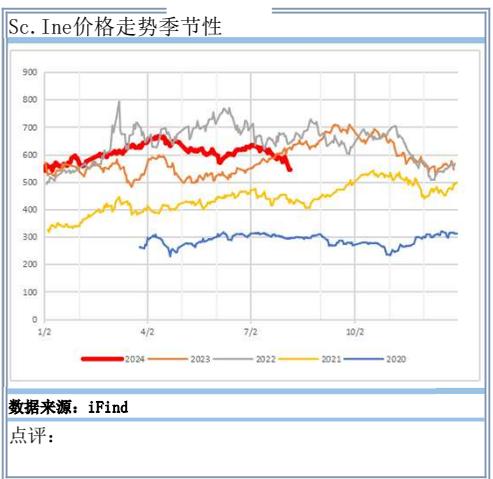
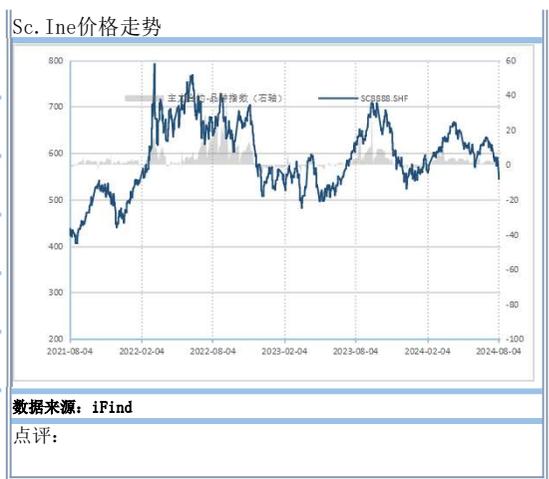
Cu. SHFE价格走势主力-指数 季节性



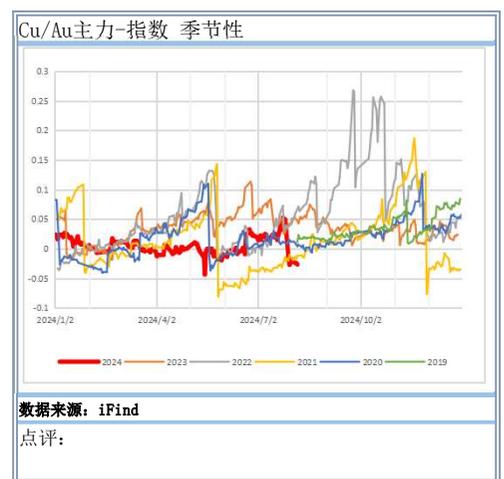
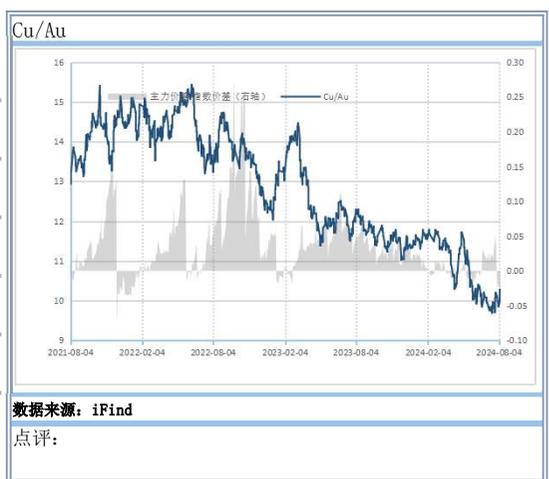
数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/8/7
 数据截止日: 2024/8/6
 期内最小值: 405.7
 期内最大值: 791.6
 期内平均值: 591.3481
 当前分位值: 36.43%



数据起始日: 2019/8/7
 数据截止日: 2024/8/6
 期内最小值: 9.6881
 期内最大值: 15.4319
 期内平均值: 12.8189
 当前分位值: 10.38%



数据起始日: 2019/8/7

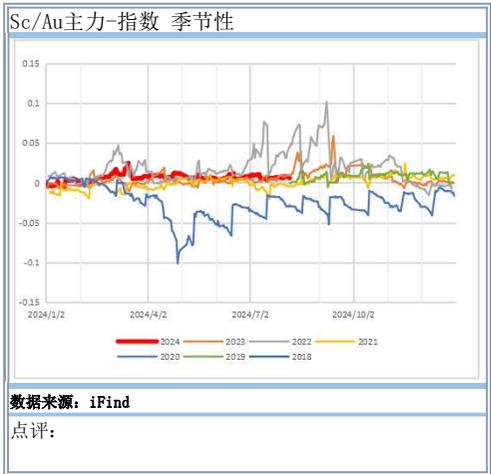
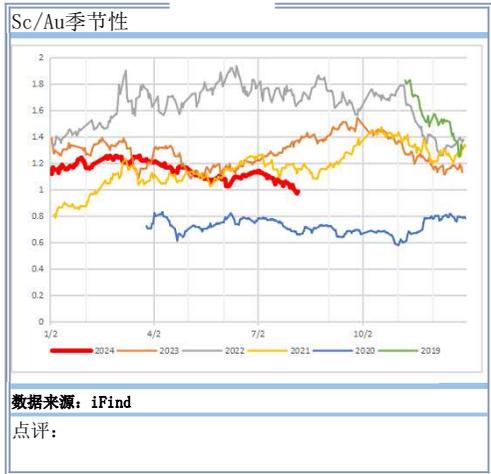
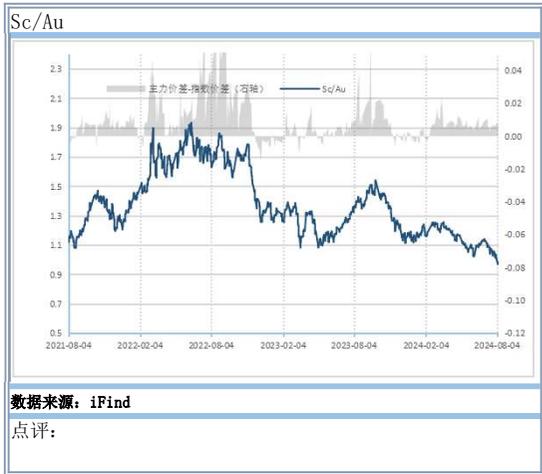
数据截止日: 2024/8/6

期内最小值: 0.9695

期内最大值: 1.9320

期内平均值: 1.3720

当前分位值: 1.40%



数据起始日: 2019/8/7

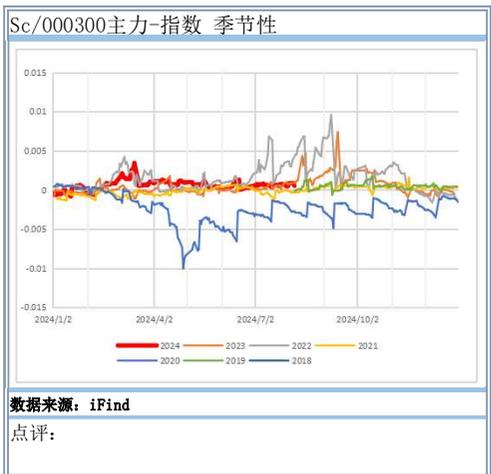
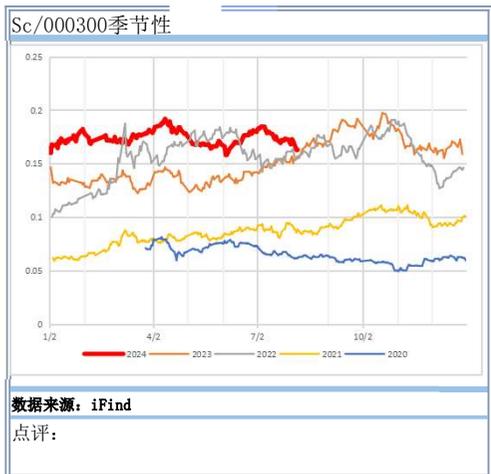
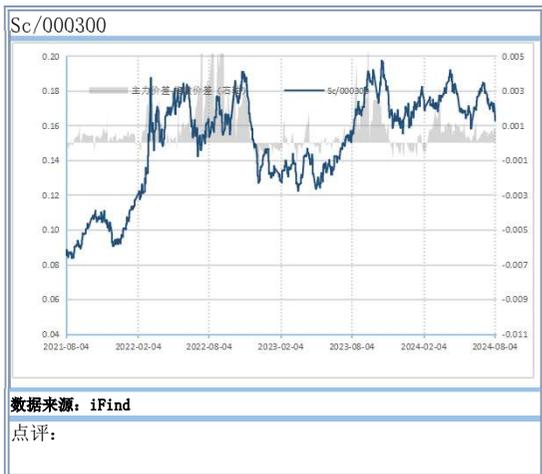
数据截止日: 2024/8/6

期内最小值: 0.0837

期内最大值: 0.1972

期内平均值: 0.1500

当前分位值: 70.25%



数据起始日: 2019/8/7

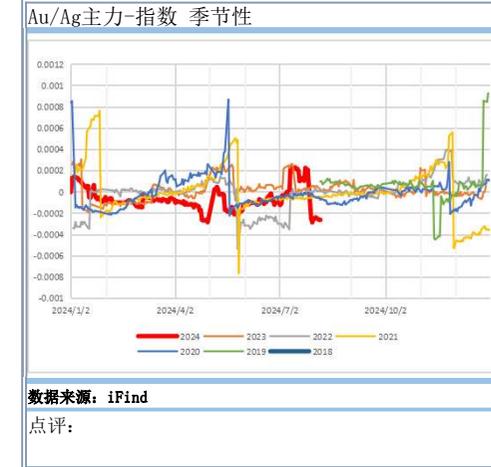
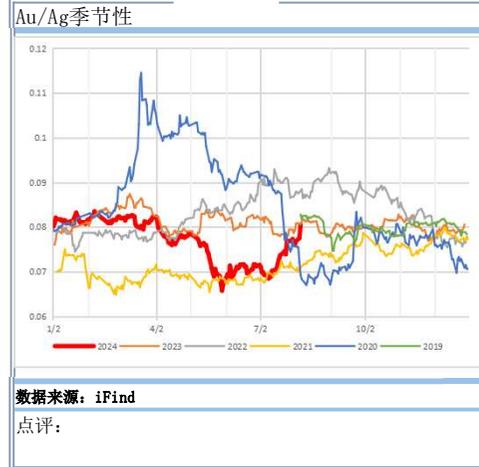
数据截止日: 2024/8/6

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: 53.82%



数据起始日: 2019/8/7

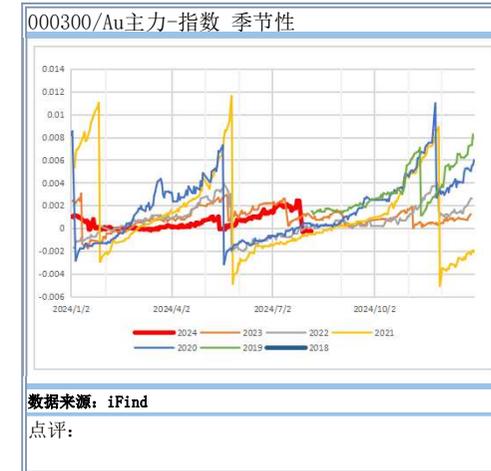
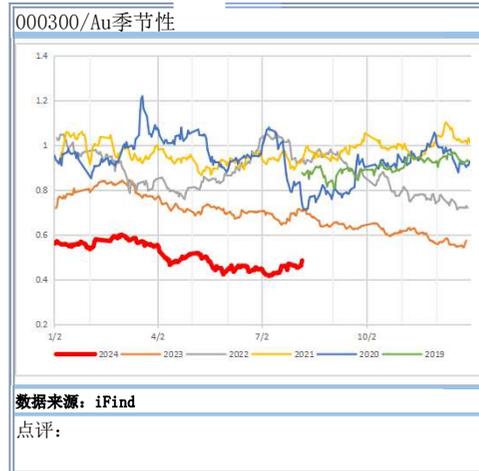
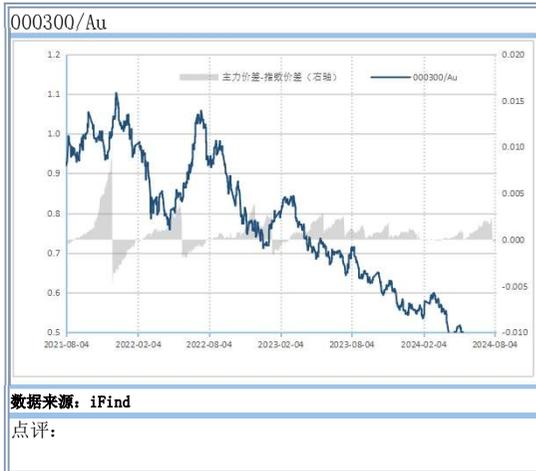
数据截止日: 2024/8/6

期内最小值: 0.4165

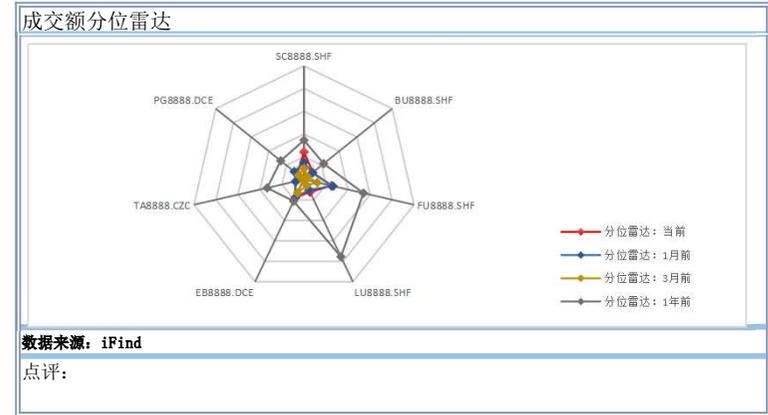
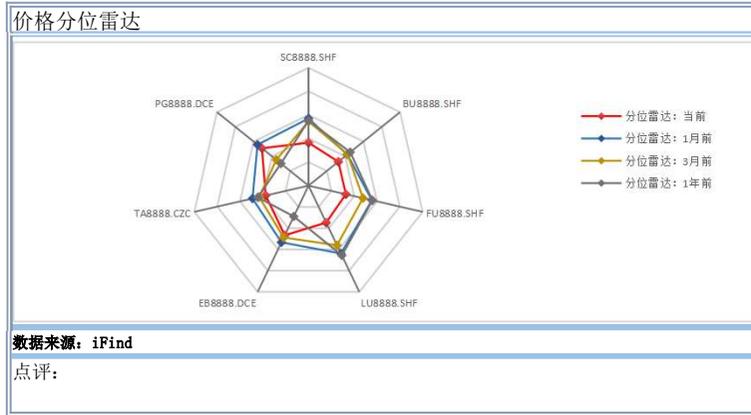
期内最大值: 1.1021

期内平均值: 0.7581

当前分位值: 9.88%



二、原油相关



数据起始日: 2019/8/7

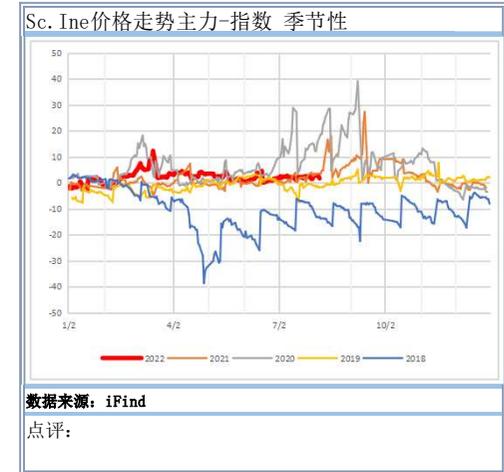
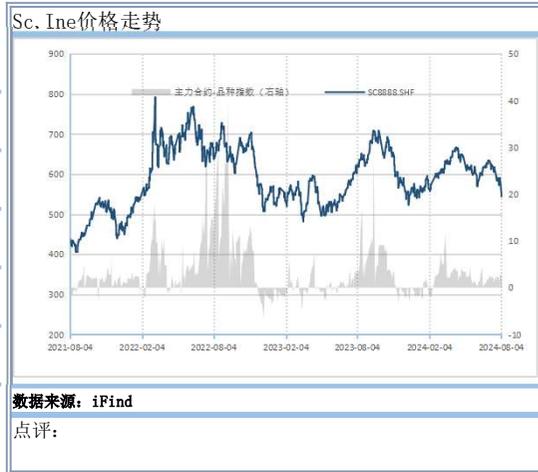
数据截止日: 2024/8/6

期内最小值: 405.7

期内最大值: 791.6

期内平均值: 591.3481

当前分位值: 36.43%



数据起始日: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

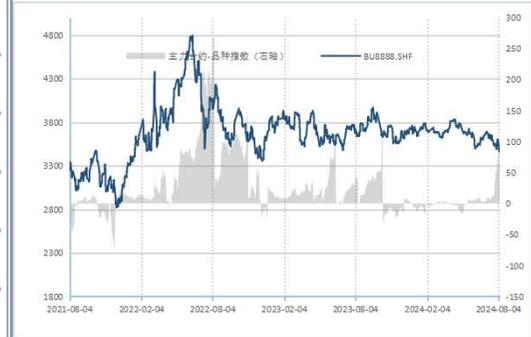
期内最小值: 2821

期内最大值: 4794

期内平均值: 3671.6941

当前分位值: 32.59%

Bu. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

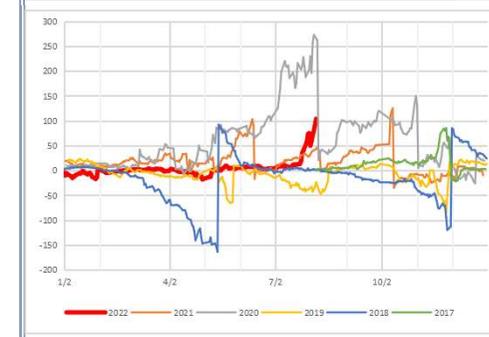
Bu. SHFE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

Bu. SHFE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

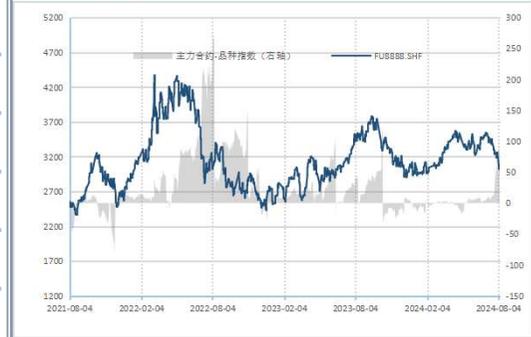
期内最小值: 2366

期内最大值: 4371

期内平均值: 3151.6679

当前分位值: 32.72%

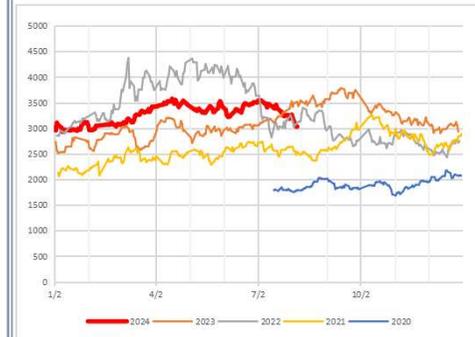
Fu. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

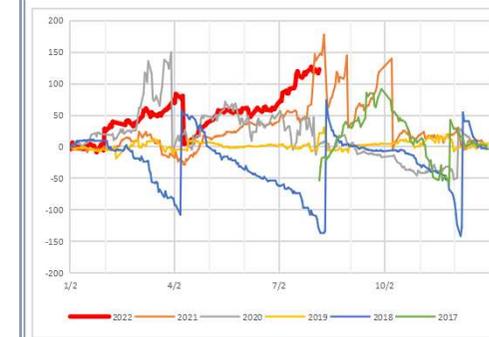
Fu. SHFE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

Fu. SHFE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020/6/22

数据截止日: 2024/8/6

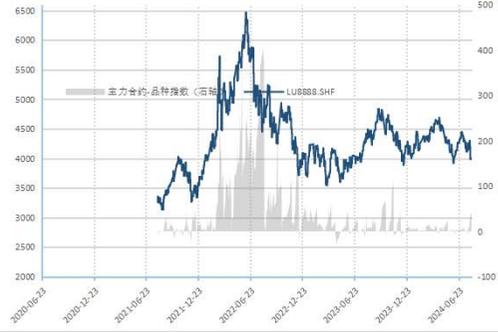
期内最小值: 3544

期内最大值: 4869

期内平均值: 4198.6588

当前分位值: 34.79%

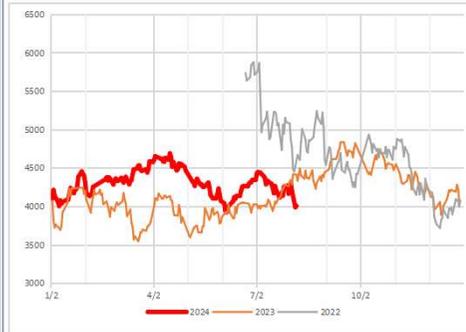
Lu. Ine价格走势



数据来源: iFind

点评:

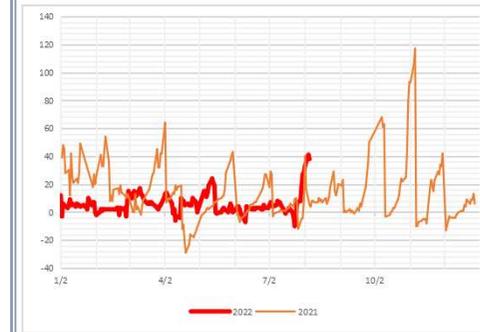
Lu. Ine价格走势季节性



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: 2024/8/6

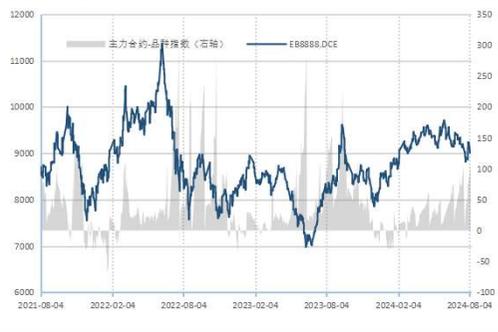
期内最小值: 6978

期内最大值: 11361

期内平均值: 8754.2829

当前分位值: 46.70%

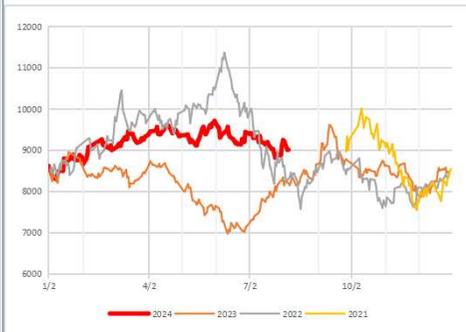
EB. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

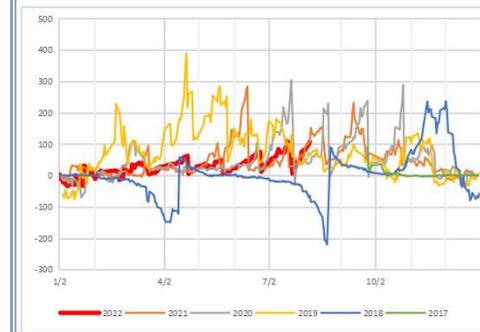
EB. DCE价格走势季节性



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: 2019/8/7

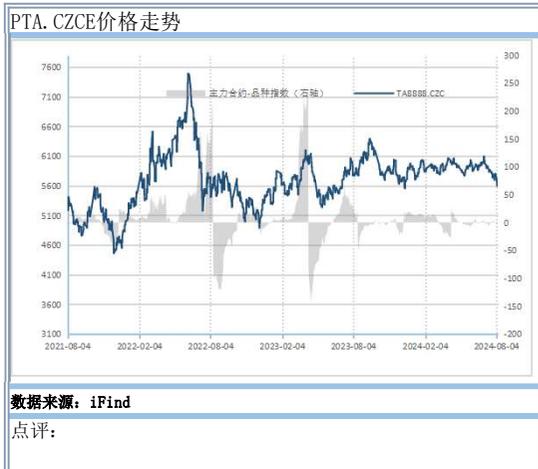
数据截止日: 2024/8/6

期内最小值: 4462

期内最大值: 7488

期内平均值: 5690.1550

当前分位值: 37.51%



数据起始日: 2020/3/30

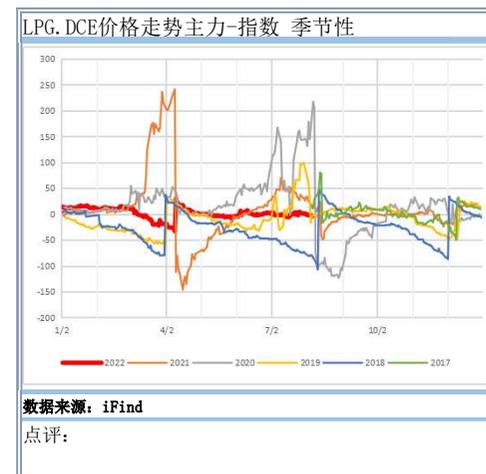
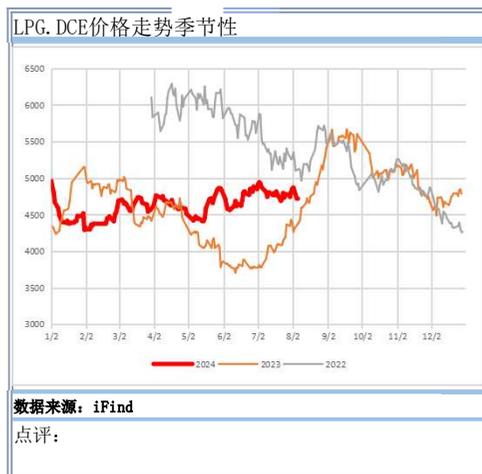
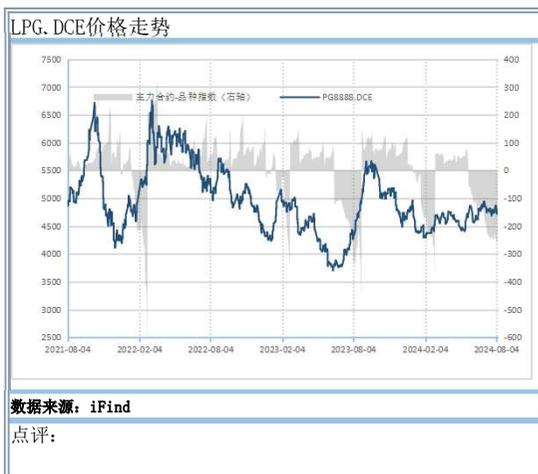
数据截止日: 2024/8/6

期内最小值: 3704

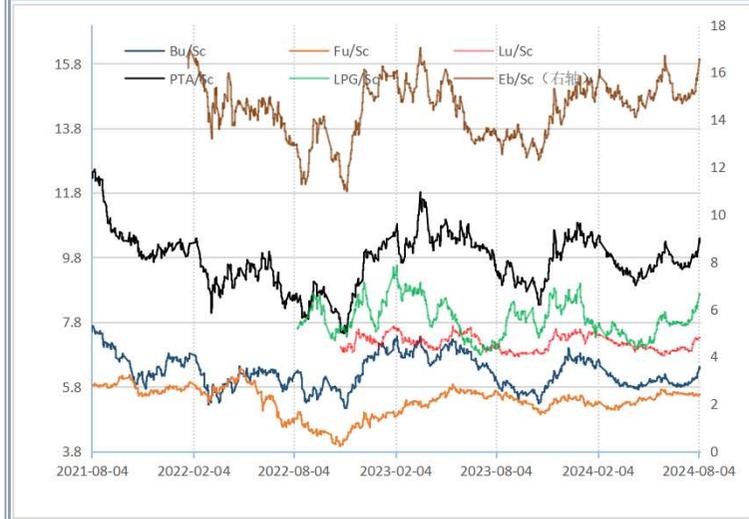
期内最大值: 5714

期内平均值: 4710.1971

当前分位值: 50.85%



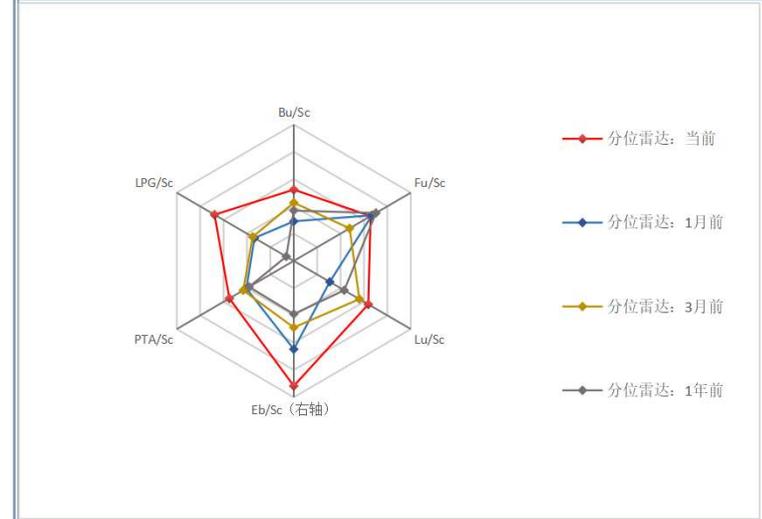
Sc相关比价一揽子



数据来源: iFind

点评:

Sc相关比价分位雷达



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

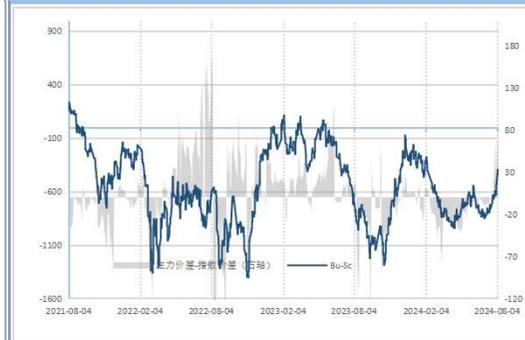
期内最小值: -1406.4286

期内最大值: 231.5714

期内平均值: -552.2212

当前分位值: 59.11%

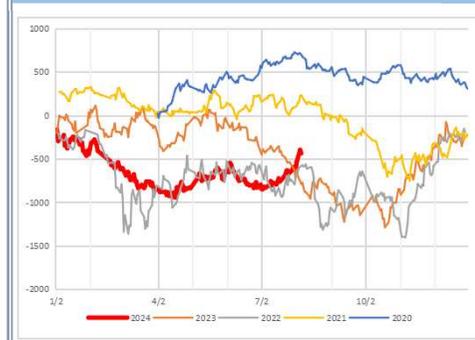
Bu-Sc



数据来源: iFind

点评:

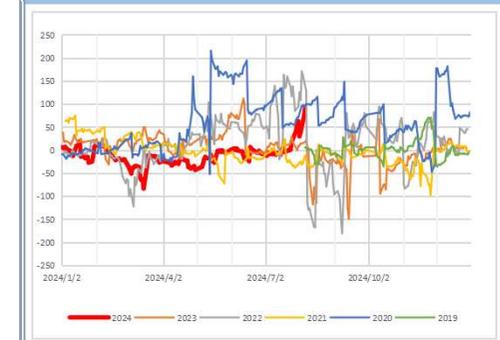
Bu-Sc季节性



数据来源: iFind

点评:

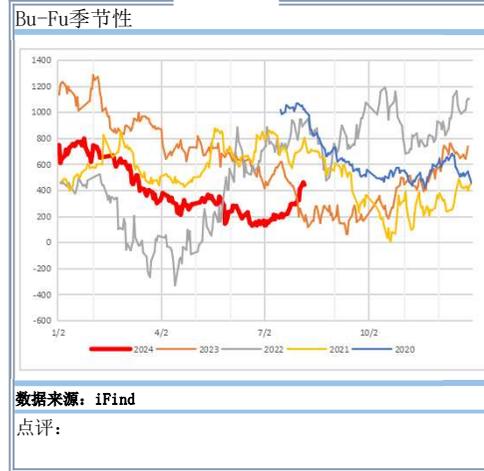
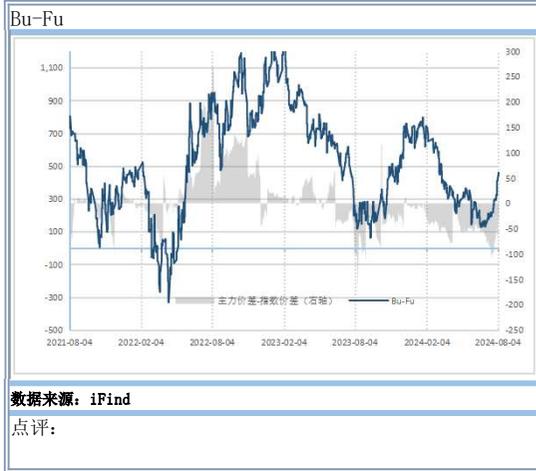
Bu-Sc主力-指数 季节性



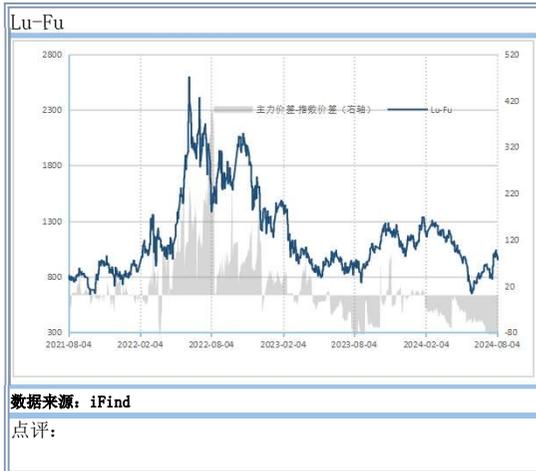
数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/8/7
 数据截止日: 2024/8/6
 期内最小值: -331.0000
 期内最大值: 1284.0000
 期内平均值: 520.0262
 当前分位值: 47.86%



数据起始日: 2021/10/22
 数据截止日: 2024/8/6
 期内最小值: 650.0000
 期内最大值: 1908.0000
 期内平均值: 1077.9953
 当前分位值: 26.47%



数据起始日: 2021/8/27

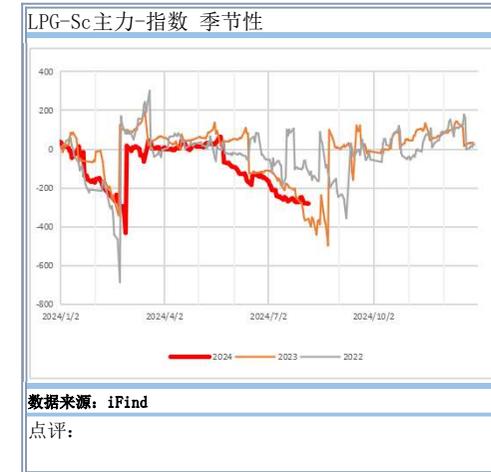
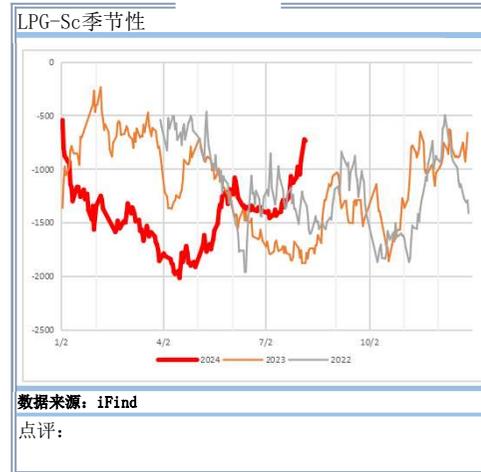
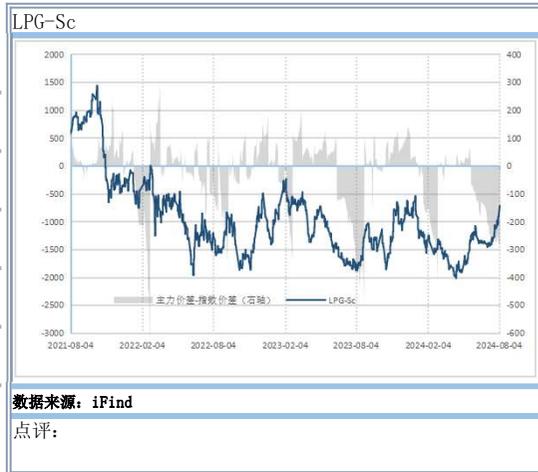
数据截止日: 2024/8/6

期内最小值: -2017.0000

期内最大值: -240.0000

期内平均值: -1261.4834

当前分位值: 72.03%



数据起始日: 2019/8/7

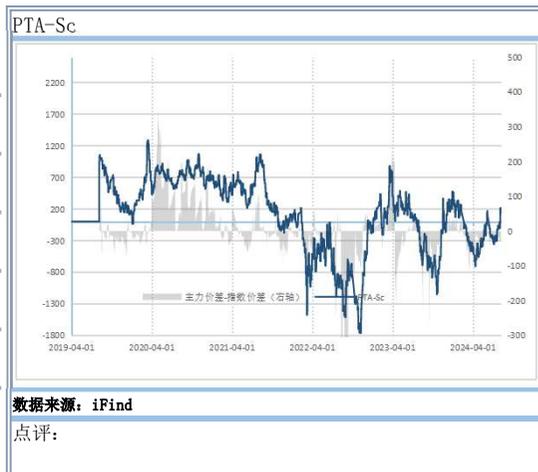
数据截止日: 2024/8/6

期内最小值: -1762.0000

期内最大值: 1061.0000

期内平均值: -223.3265

当前分位值: 67.16%



数据起始日: 2021/4/29

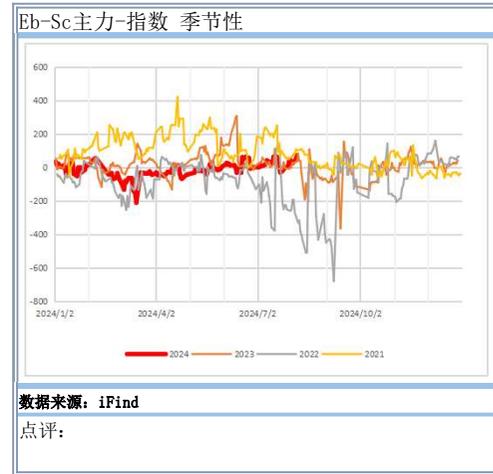
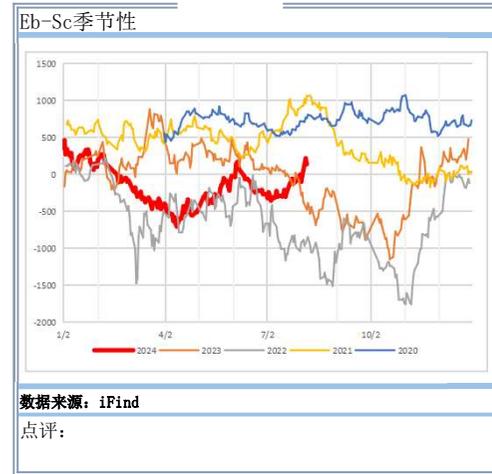
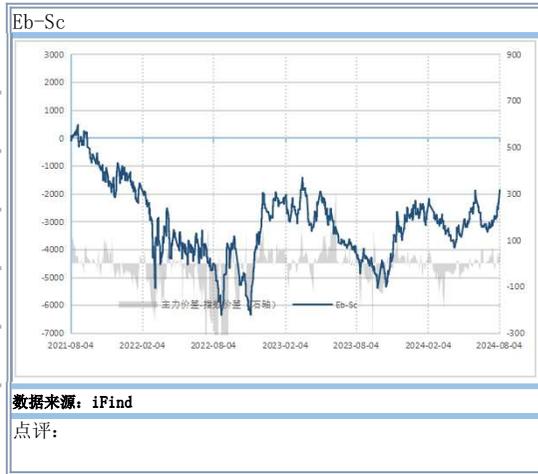
数据截止日: 2024/8/6

期内最小值: -6347.0000

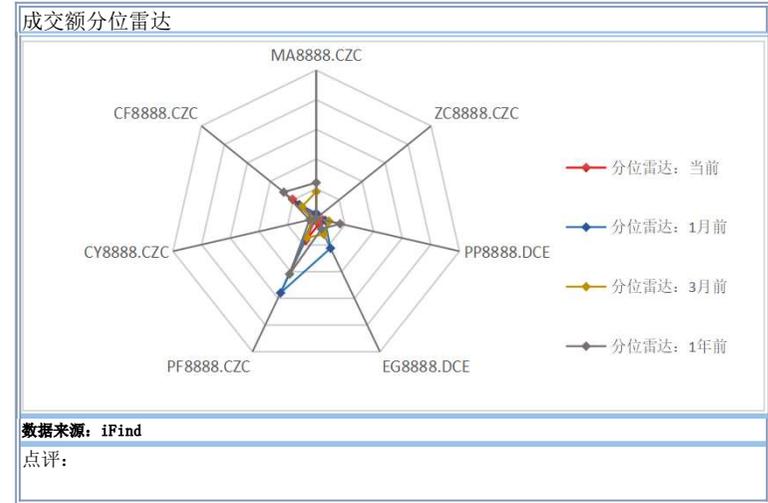
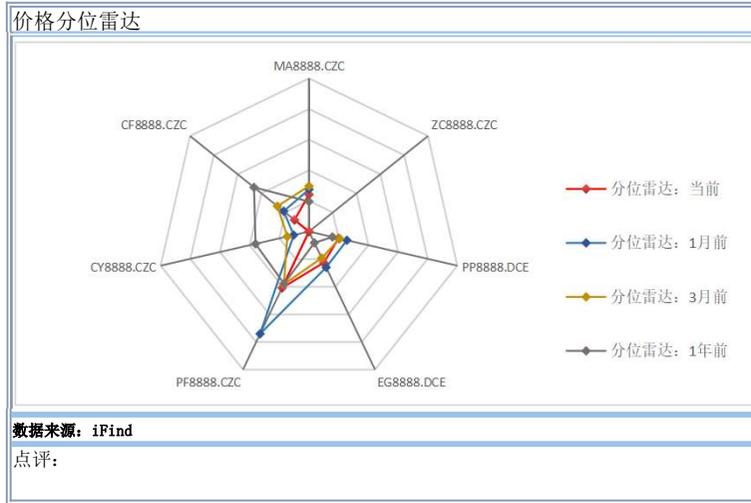
期内最大值: -1435.0000

期内平均值: -3507.2646

当前分位值: 90.51%



三、煤化工相关



数据起始日: 2019/8/7

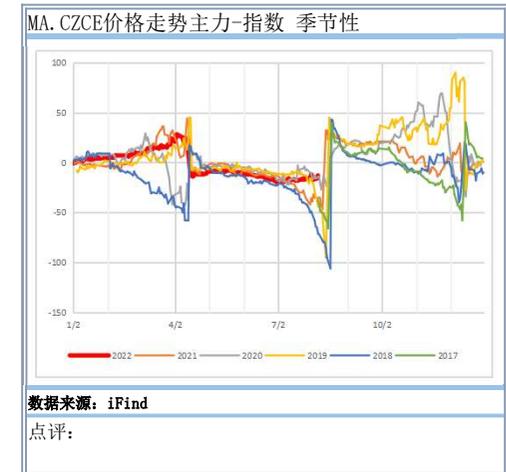
数据截止日: 2024/8/6

期内最小值: 1982

期内最大值: 4015

期内平均值: 2590.0384

当前分位值: 24.20%



数据起始日: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

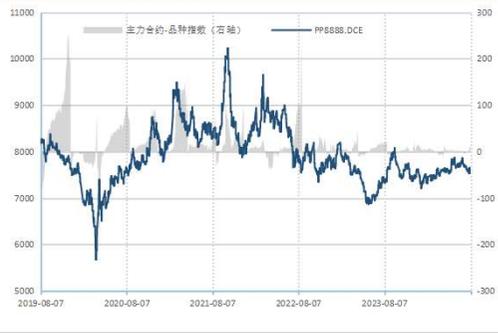
期内最小值: 6865

期内最大值: 10224

期内平均值: 7911.9973

当前分位值: 19.95%

PP. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

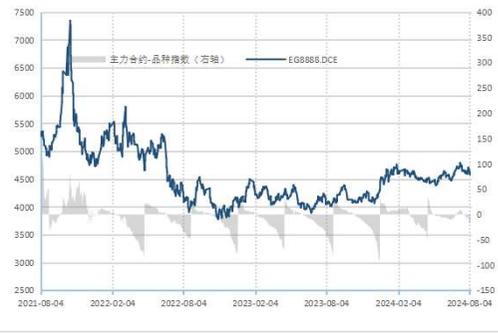
期内最小值: 3778

期内最大值: 7345

期内平均值: 4563.2373

当前分位值: 22.48%

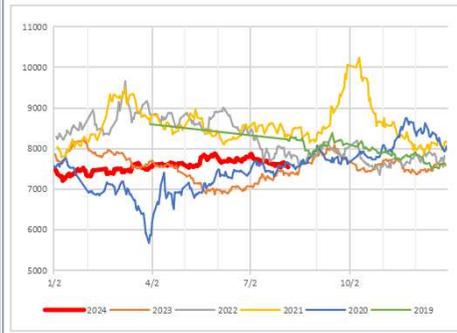
EG. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

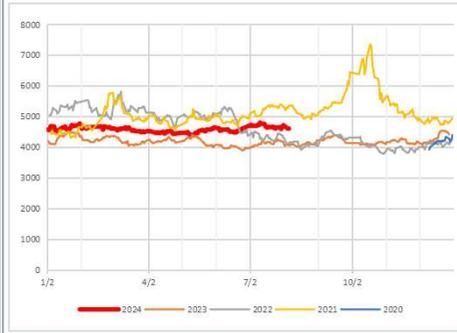
PP. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

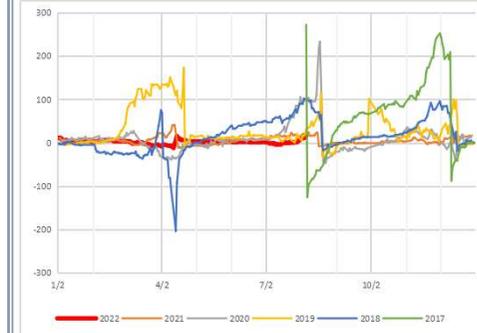
EG. CZCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

PP. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

EG. CZCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020/10/12

数据截止日: 2024/8/6

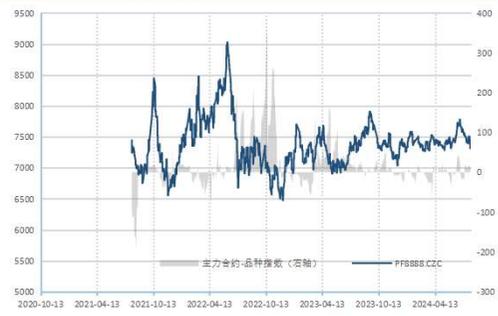
期内最小值: 6904

期内最大值: 7907

期内平均值: 7369.2918

当前分位值: 40.78%

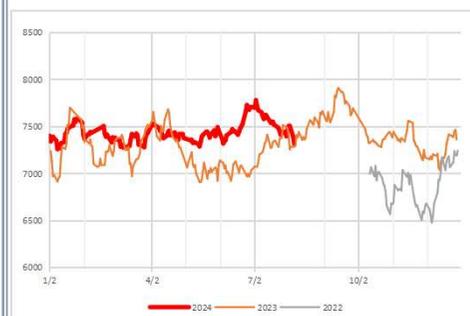
PF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

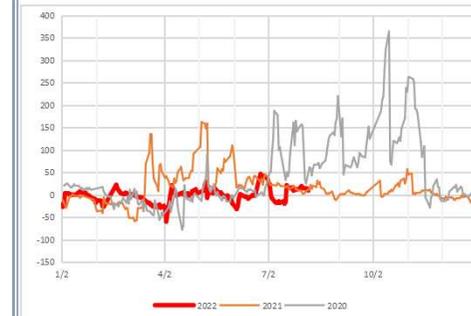
PF. CZCE价格走势季节性



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: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

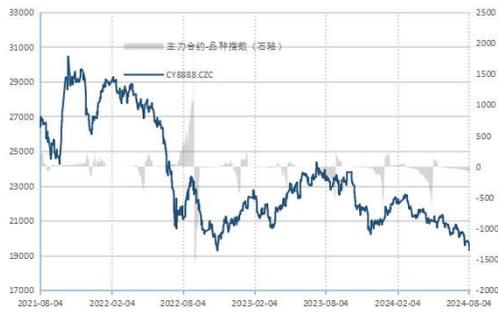
期内最小值: 19292

期内最大值: 30443

期内平均值: 23463.2442

当前分位值: 0.04%

CY. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

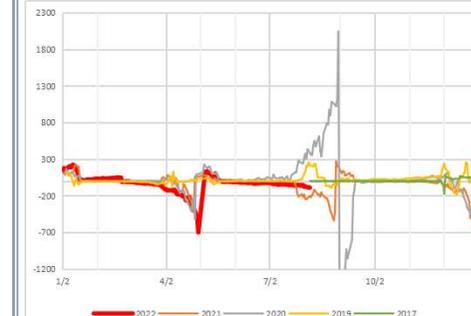
CY. CZCE价格走势季节性



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: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

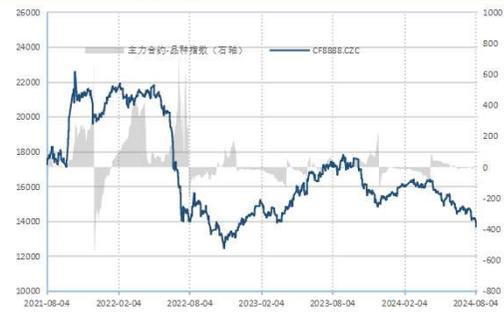
期内最小值: 12447

期内最大值: 22574

期内平均值: 16784.8272

当前分位值: 12.18%

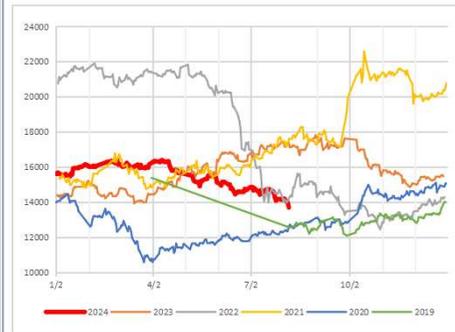
CF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

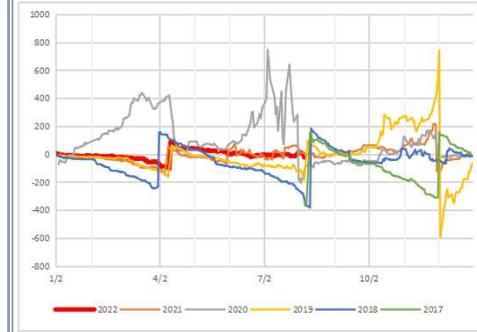
CF. CZCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

CF. CZCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

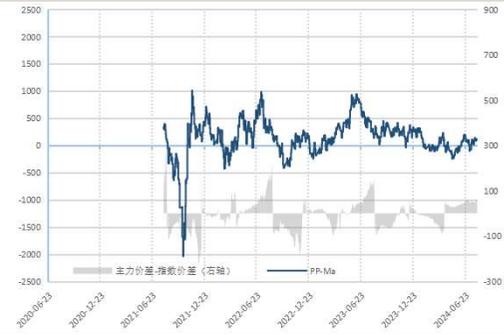
期内最小值: -2039.0000

期内最大值: 1007.0000

期内平均值: 141.8820

当前分位值: 70.65%

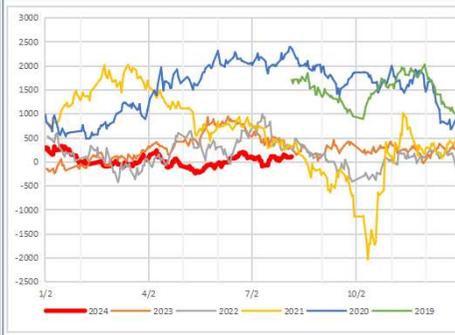
PP-Ma



数据来源: iFind

点评:

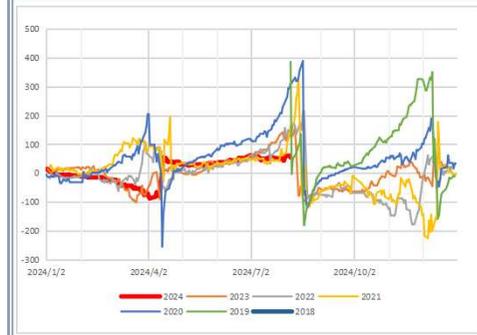
PP-Ma季节性



数据来源: iFind

点评:

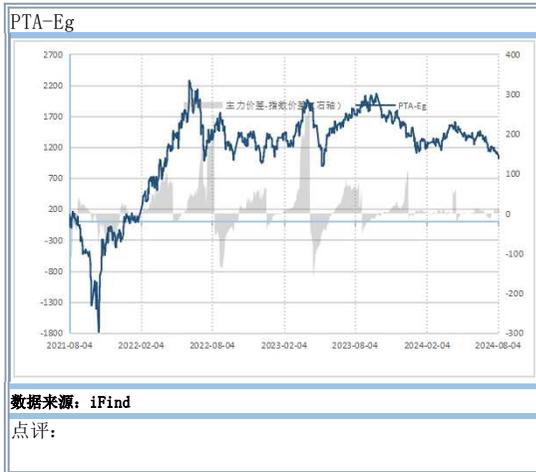
PP-Ma主力-指数 季节性



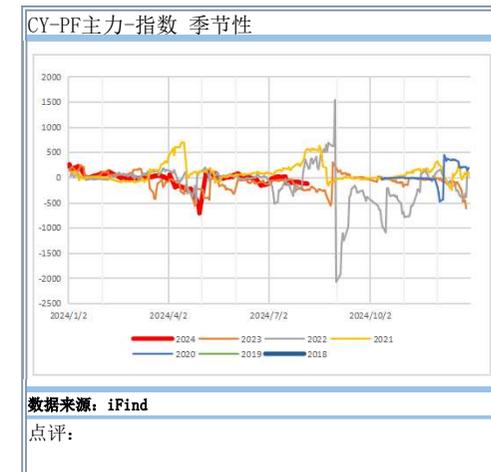
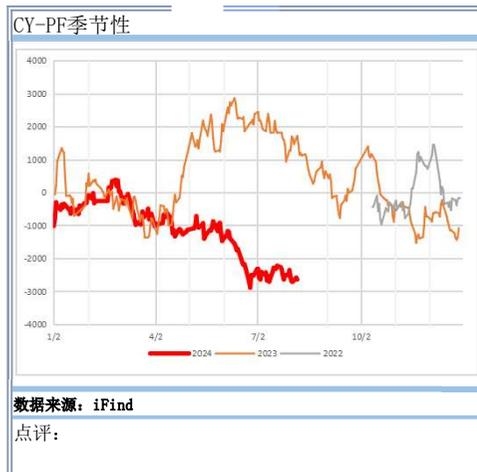
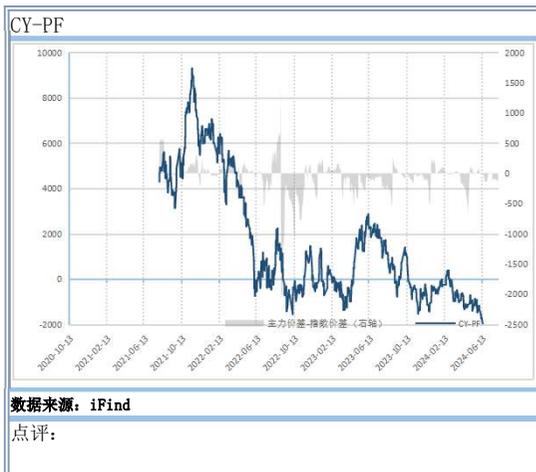
数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/8/7
 数据截止日: 2024/8/6
 期内最小值: -1783.0000
 期内最大值: 2269.0000
 期内平均值: 1126.9177
 当前分位值: 69.10%



数据起始日: 2022/1/2
 数据截止日: 2024/8/6
 期内最小值: -2887.0000
 期内最大值: 2854.0000
 期内平均值: -226.1700
 当前分位值: 4.25%



数据起始日: 2023/2/24

数据截止日: 2024/8/6

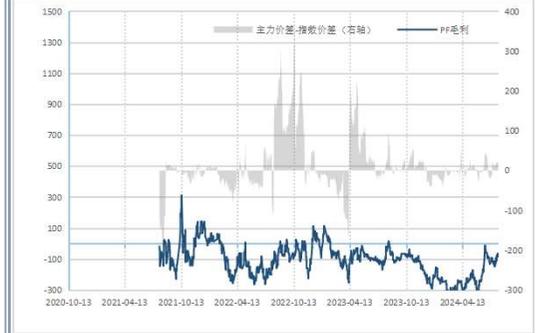
期内最小值: -328.9900

期内最大值: 13.9250

期内平均值: -150.6616

当前分位值: 70.65%

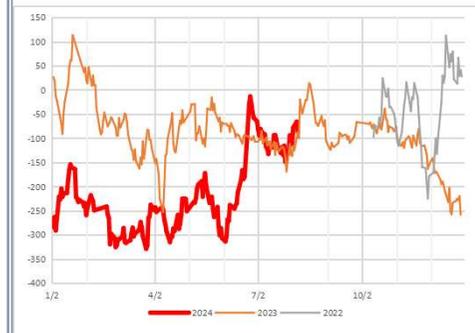
PF毛利



数据来源: iFind

点评:

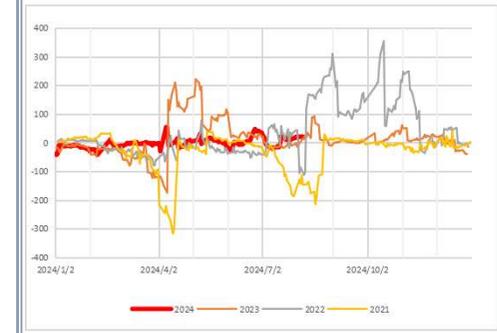
PF毛利季节性



数据来源: iFind

点评:

PF毛利主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

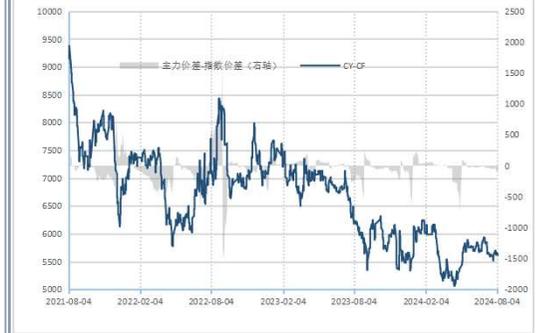
期内最小值: 5061.0000

期内最大值: 9373.0000

期内平均值: 6678.4170

当前分位值: 12.87%

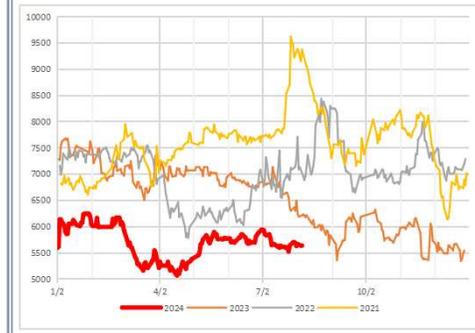
CY-CF



数据来源: iFind

点评:

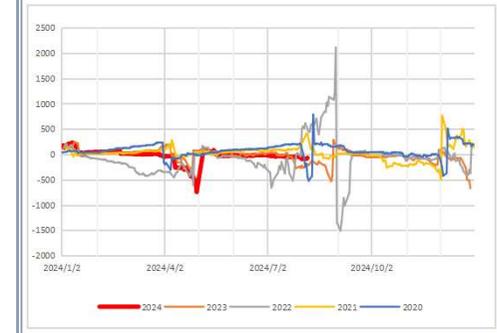
CY-CF季节性



数据来源: iFind

点评:

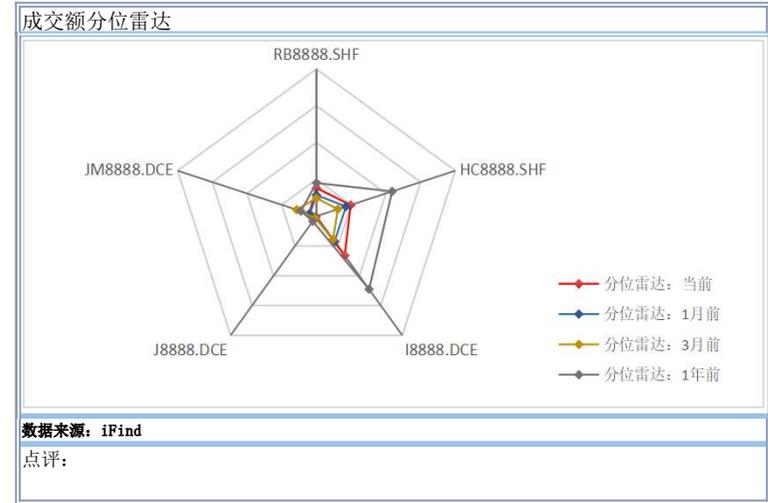
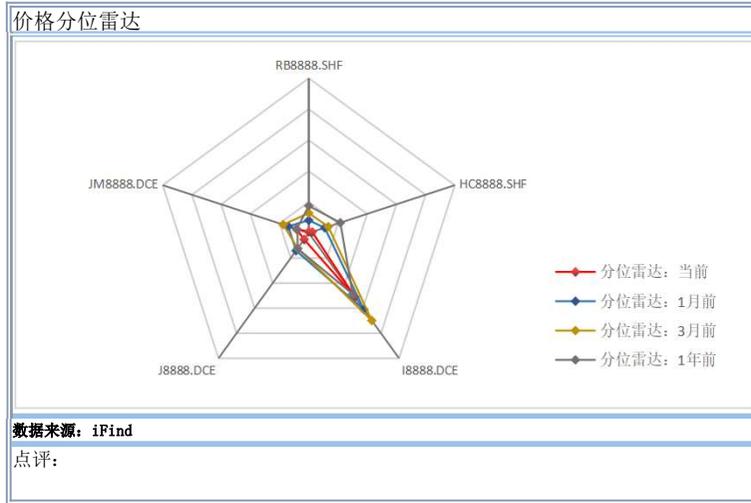
CY-CF主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

四、黑色相关



数据起始日: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

期内最小值: 3316

期内最大值: 5762

期内平均值: 4087.5734

当前分位值: 0.82%



数据起始日: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

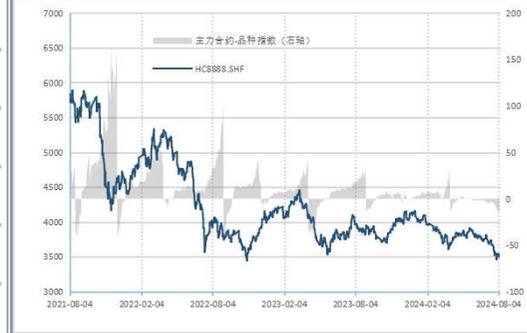
期内最小值: 3444

期内最大值: 5888

期内平均值: 4219.7037

当前分位值: 2.33%

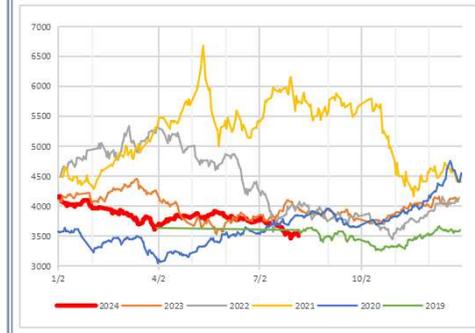
HC.SHFE价格走势



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: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

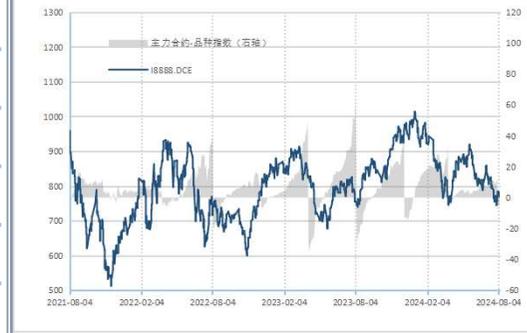
期内最小值: 512.8

期内最大值: 1013.6

期内平均值: 795.7299

当前分位值: 51.10%

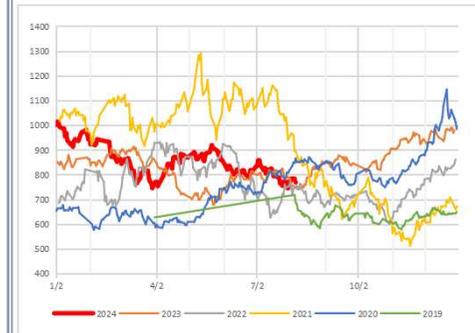
I.DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

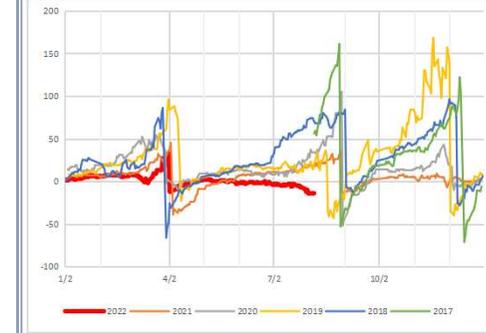
I.DCE价格走势季节性



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: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

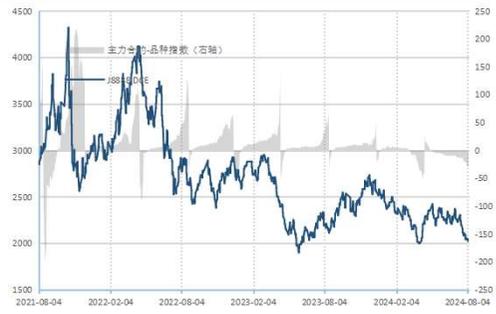
期内最小值: 1897.9

期内最大值: 4320.8

期内平均值: 2706.1945

当前分位值: 5.11%

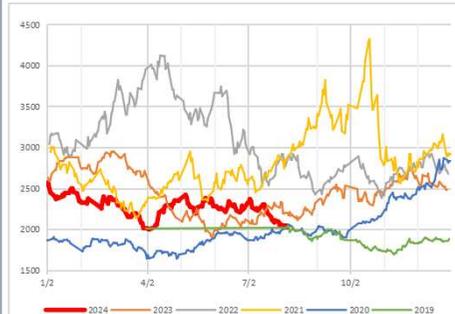
J. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

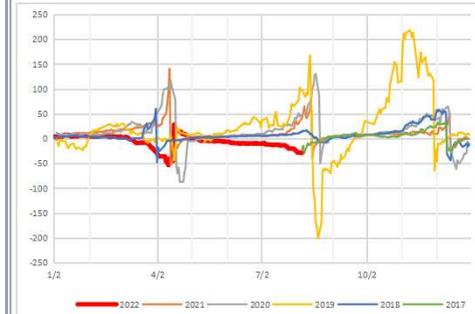
J. DCE价格走势季节性



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: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

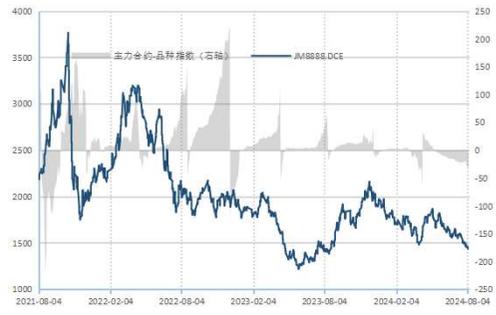
期内最小值: 1219.4

期内最大值: 3764.7

期内平均值: 2000.6488

当前分位值: 8.44%

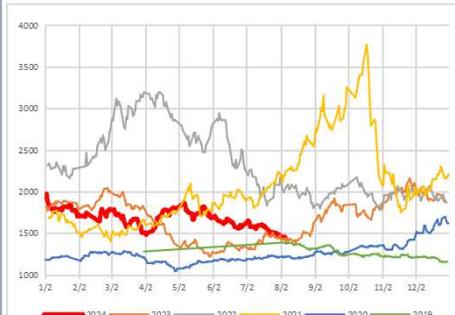
Jm. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

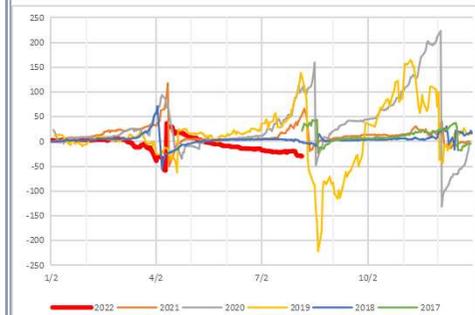
Jm. DCE价格走势季节性



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: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

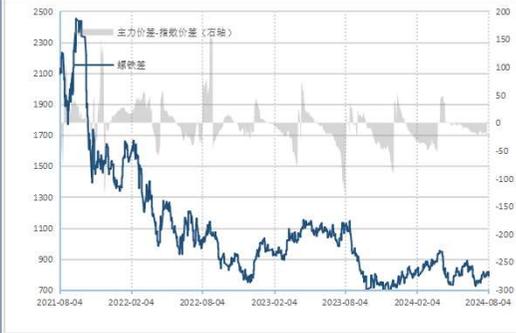
期内最小值: 670.1176

期内最大值: 2451.8235

期内平均值: 1091.4650

当前分位值: 6.74%

螺铁差



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

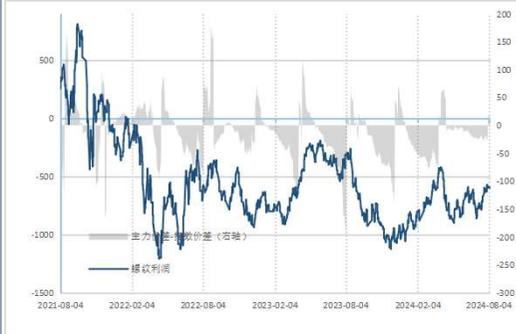
期内最小值: -1206.9091

期内最大值: 810.0000

期内平均值: -542.7759

当前分位值: 30.17%

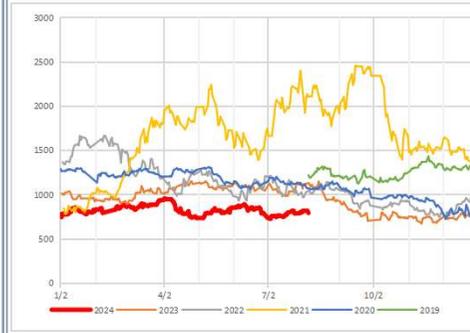
螺纹利润



数据来源: iFind

点评:

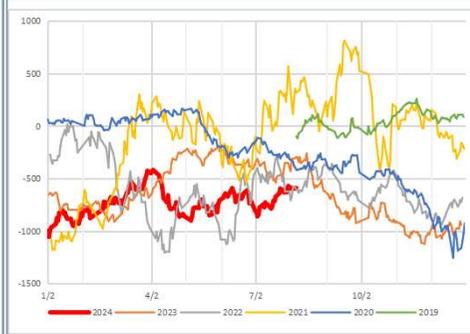
螺铁差季节性



数据来源: iFind

点评:

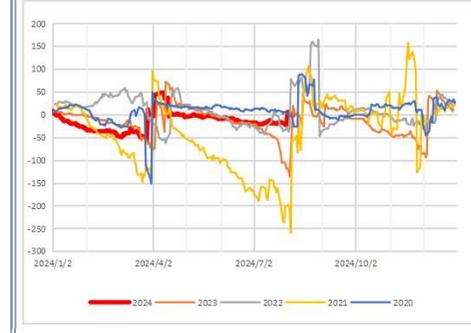
螺纹利润季节性



数据来源: iFind

点评:

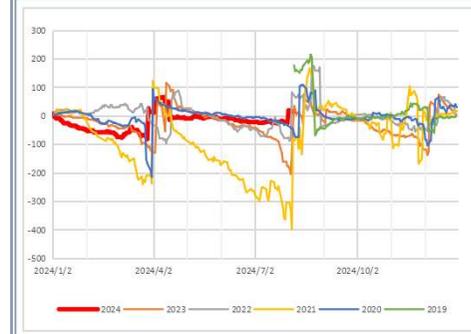
螺铁差主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

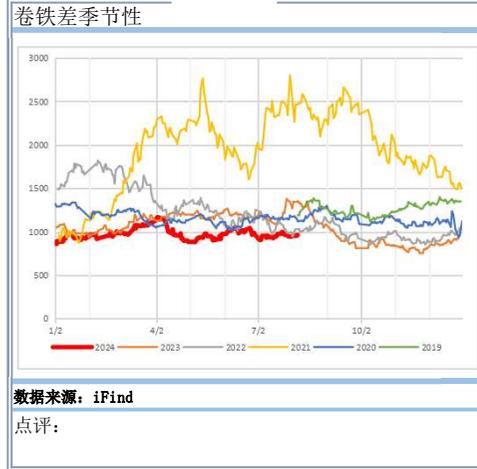
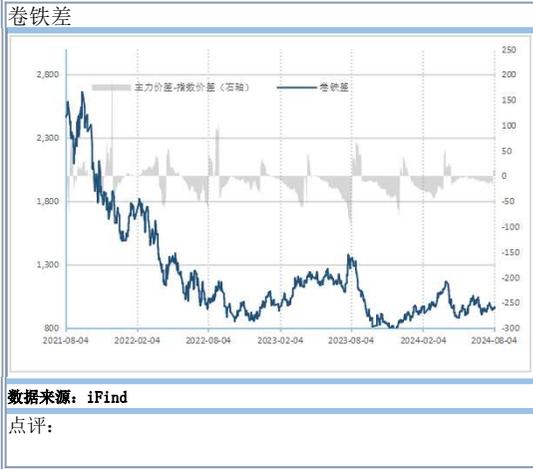
螺纹利润主力-指数 季节性



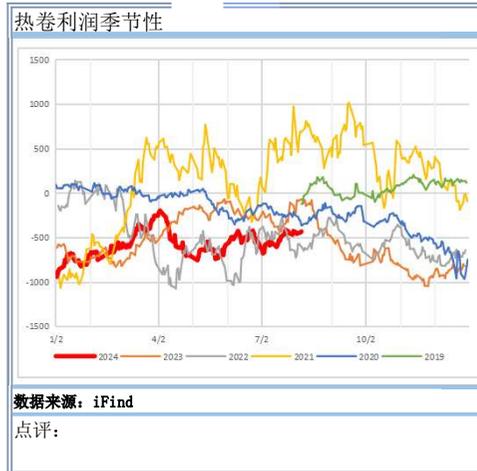
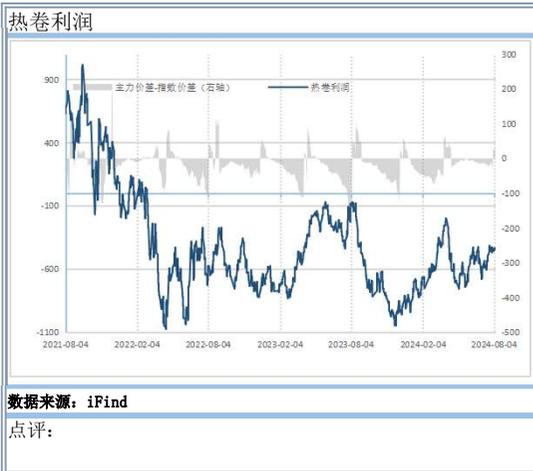
数据来源: iFind

点评:

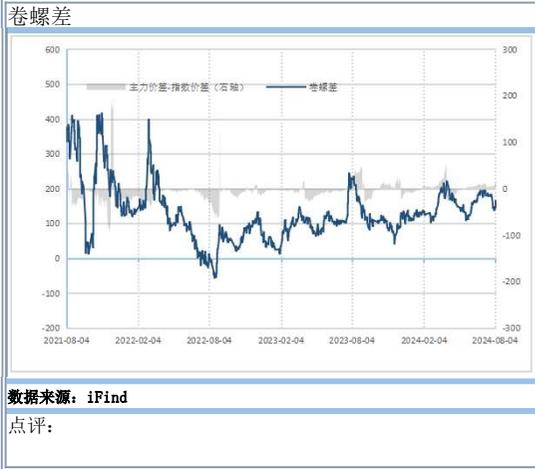
数据起始日: 2019/8/7
 数据截止日: 2024/8/6
 期内最小值: 752.4706
 期内最大值: 2661.8235
 期内平均值: 1223.5953
 当前分位值: 10.62%



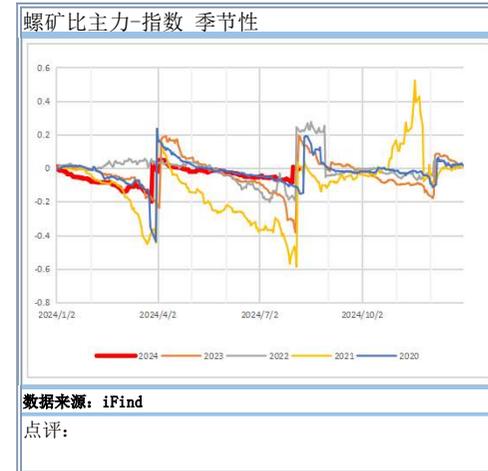
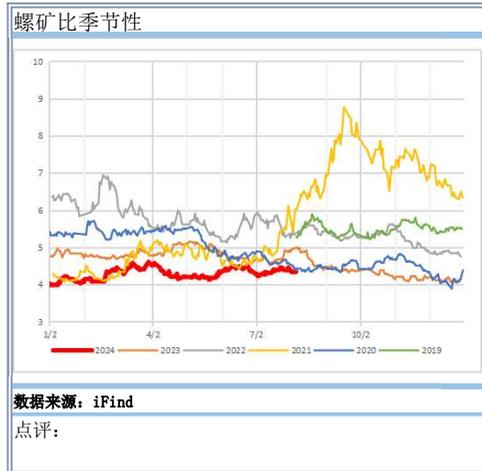
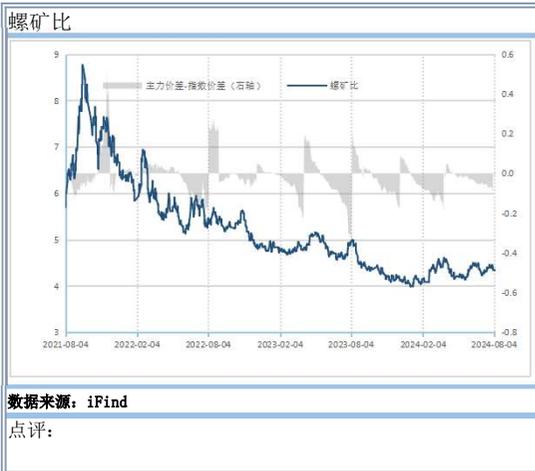
数据起始日: 2019/8/7
 数据截止日: 2024/8/6
 期内最小值: -1073.7273
 期内最大值: 1014.0000
 期内平均值: -410.6456
 当前分位值: 30.67%



数据起始日: 2019/8/7
 数据截止日: 2024/8/6
 期内最小值: -56.0000
 期内最大值: 416.0000
 期内平均值: 132.1303
 当前分位值: 46.82%



数据起始日: 2019/8/7
 数据截止日: 2024/8/6
 期内最小值: 3.9880
 期内最大值: 8.7631
 期内平均值: 5.2181
 当前分位值: 7.37%



数据起始日: 2019/8/7

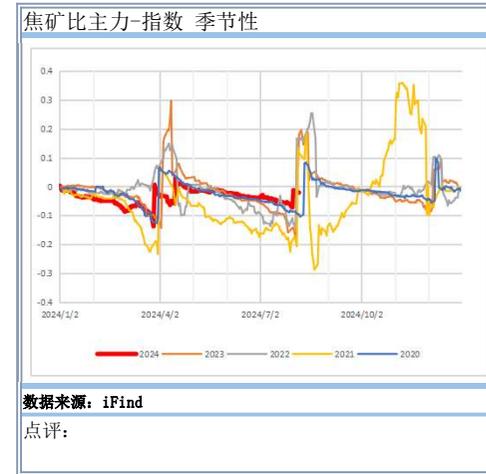
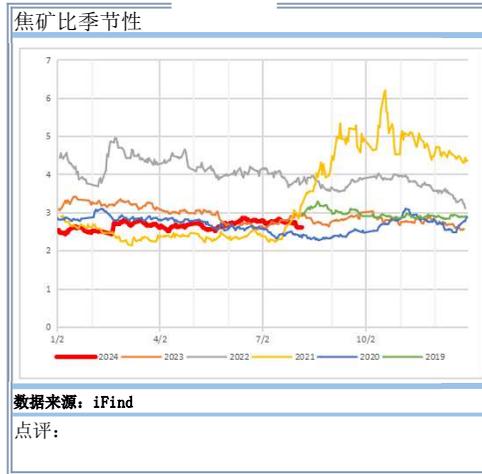
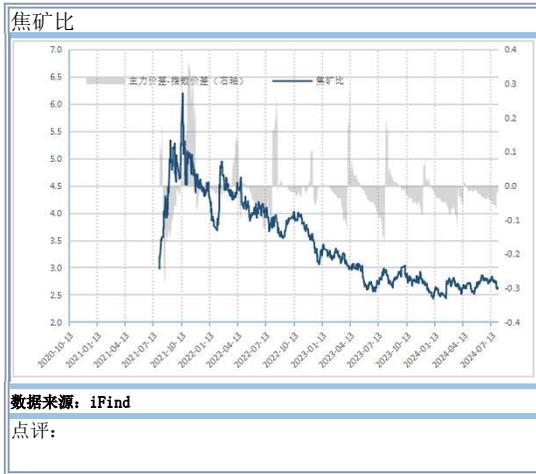
数据截止日: 2024/8/6

期内最小值: 2.4279

期内最大值: 6.1947

期内平均值: 3.4577

当前分位值: 5.37%



数据起始日: 2019/8/7

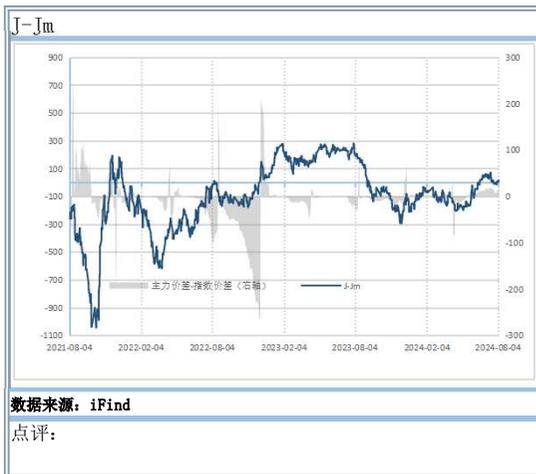
数据截止日: 2024/8/6

期内最小值: -1043.0800

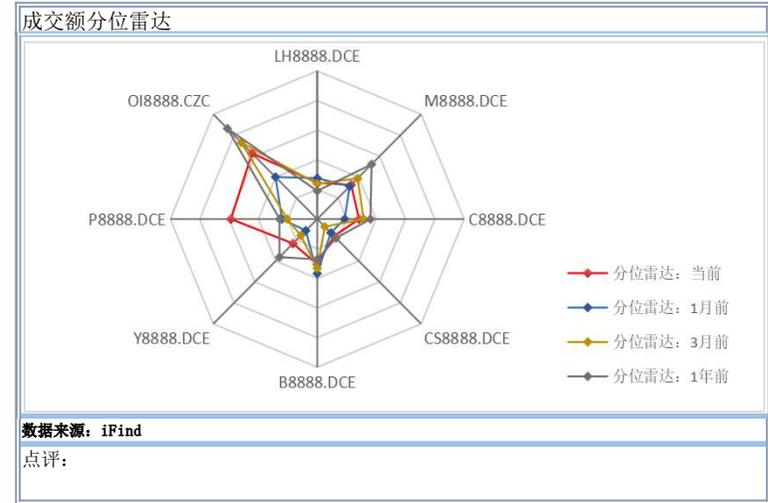
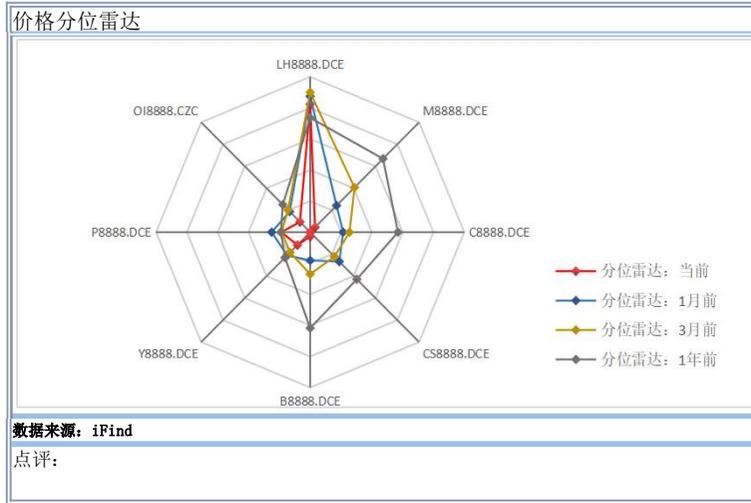
期内最大值: 279.1600

期内平均值: -94.7139

当前分位值: 79.95%



五、农产品相关



数据起始日: 2021/1/8

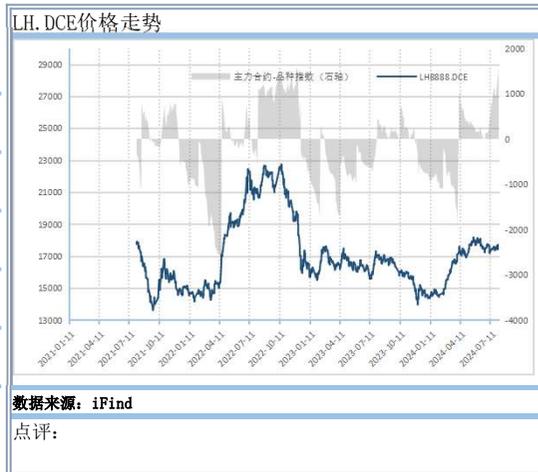
数据截止日: 2024/8/6

期内最小值: 13971

期内最大值: 18158

期内平均值: 16313.7414

当前分位值: 82.33%



数据起始日: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

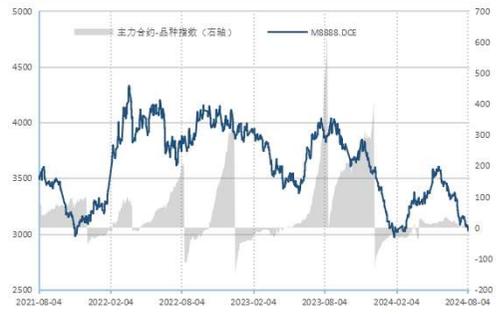
期内最小值: 2970

期内最大值: 4328

期内平均值: 3628.0151

当前分位值: 4.49%

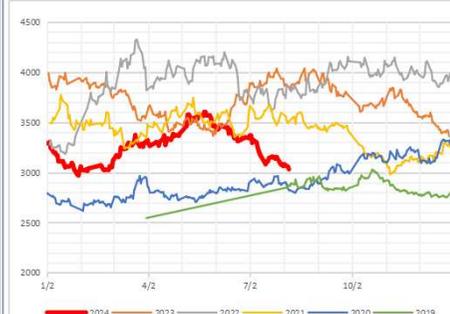
M. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

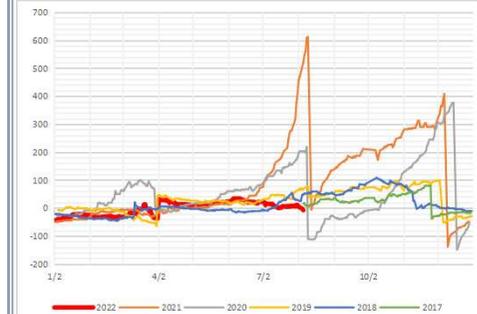
M. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

M. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

期内最小值: 2260

期内最大值: 3027

期内平均值: 2656.7449

当前分位值: 0.00%

C. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

C. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

C. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

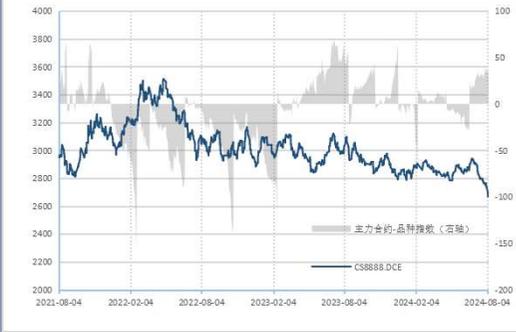
期内最小值: 2667

期内最大值: 3512

期内平均值: 3016.8450

当前分位值: 0.00%

CS. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

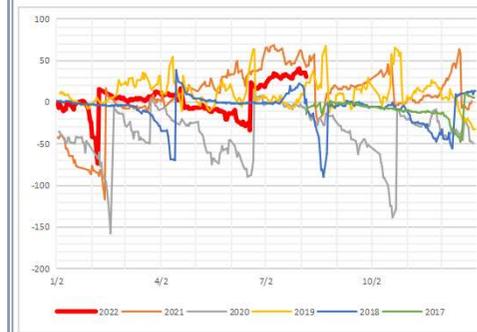
CS. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

CS. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

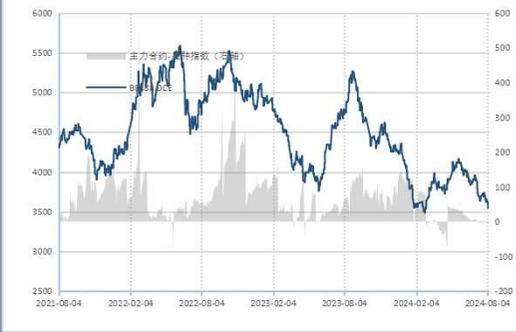
期内最小值: 3487

期内最大值: 5585

期内平均值: 4496.5405

当前分位值: 2.76%

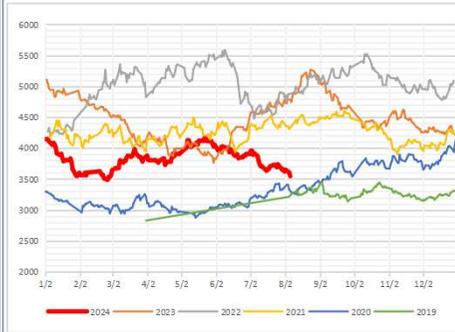
B. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

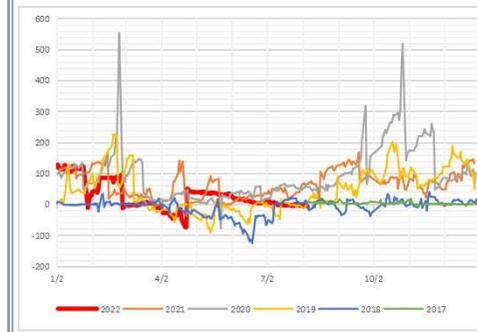
B. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

B. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

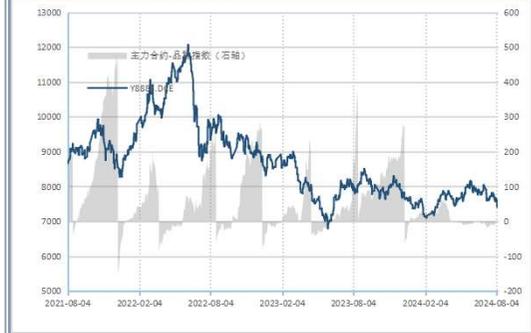
期内最小值: 6793

期内最大值: 12065

期内平均值: 8694.1358

当前分位值: 11.67%

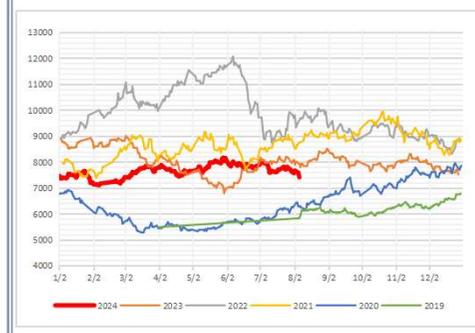
Y. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

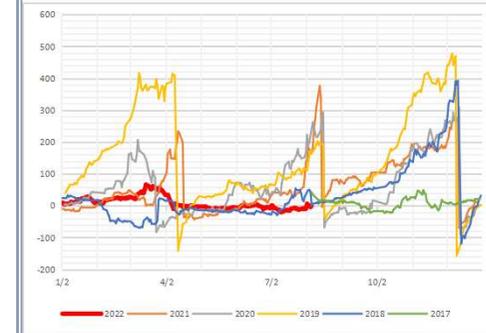
Y. DCE价格走势季节性



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: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

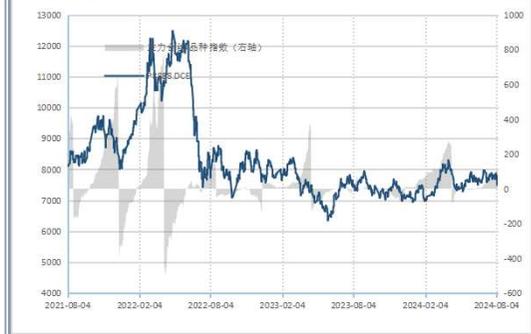
期内最小值: 6349

期内最大值: 12479

期内平均值: 8298.4225

当前分位值: 18.79%

P. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

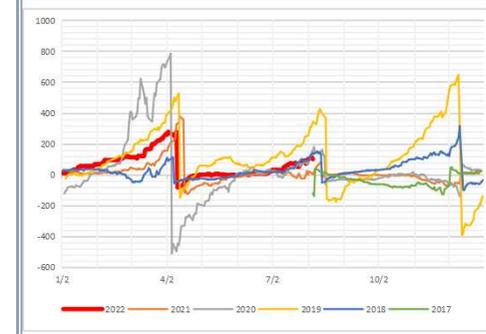
P. DCE价格走势季节性



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: 2019/8/7

数据截止日: 2024/8/6

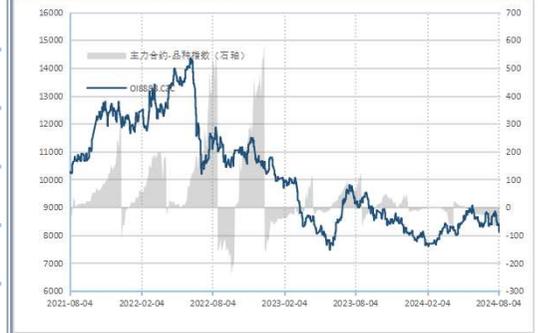
期内最小值: 7475

期内最大值: 14344

期内平均值: 10139.1193

当前分位值: 9.38%

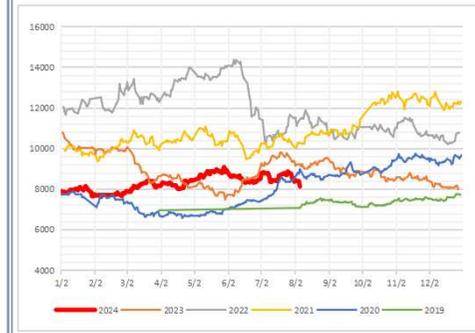
OI.CZCE价格走势



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: 2022/3/6

数据截止日: 2024/8/6

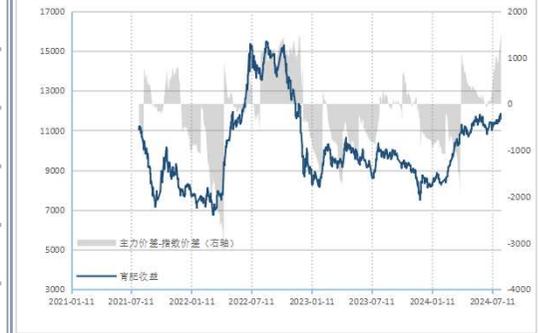
期内最小值: 7508.2500

期内最大值: 11833.0000

期内平均值: 9808.1009

当前分位值: 94.04%

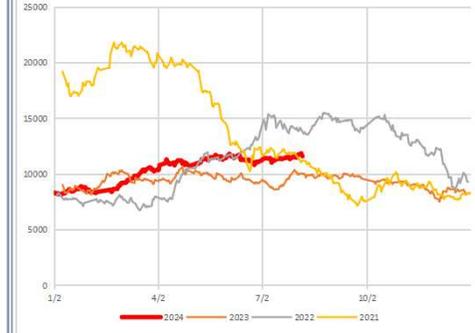
育肥收益



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: 2024/8/6
 期内最小值: 515.0000
 期内最大值: 5559.0000
 期内平均值: 2802.9034
 当前分位值: 95.80%



数据来源: iFind
 点评:

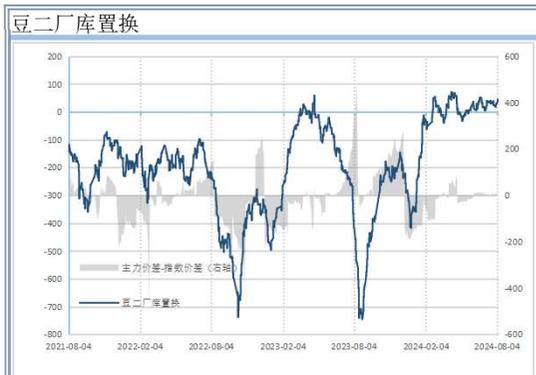


数据来源: iFind
 点评:



数据来源: iFind
 点评:

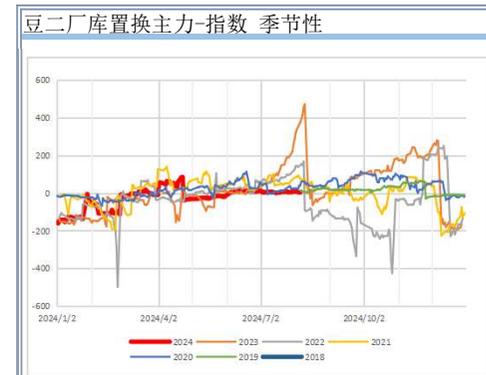
数据起始日: 2019/8/7
 数据截止日: 2024/8/6
 期内最小值: -745.0200
 期内最大值: 71.2200
 期内平均值: -200.1335
 当前分位值: 96.77%



数据来源: iFind
 点评:

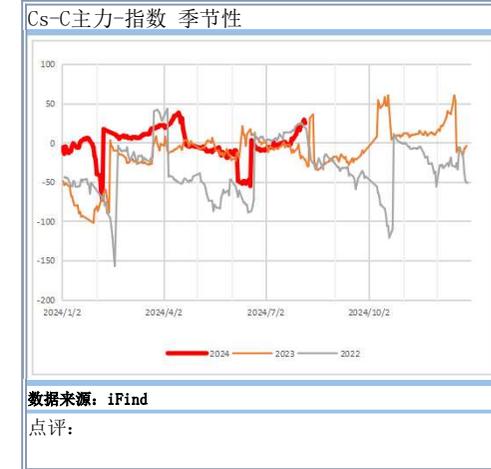
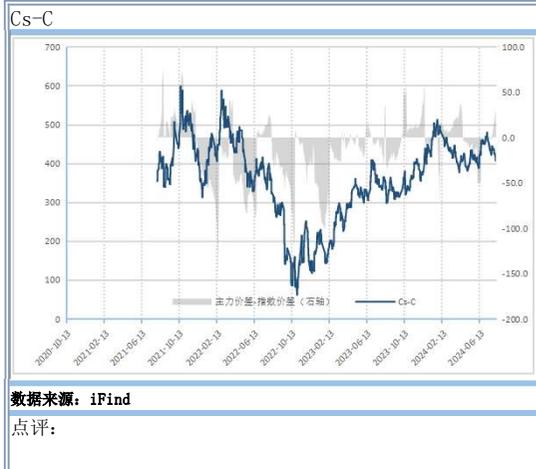


数据来源: iFind
 点评:

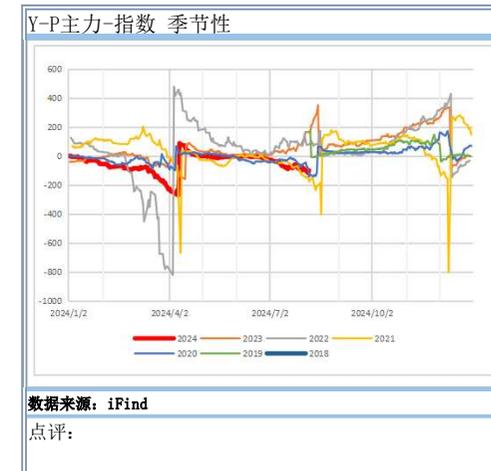
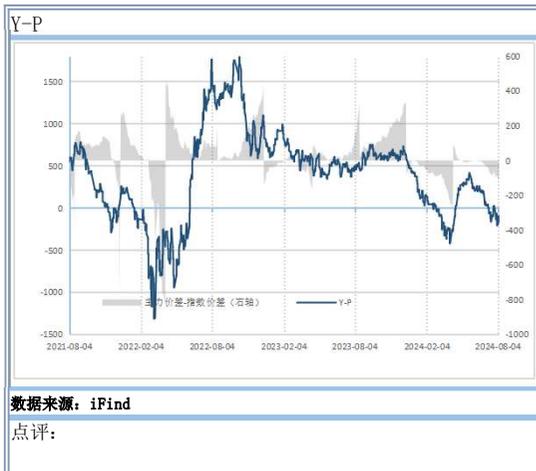


数据来源: iFind
 点评:

数据起始日: 2019/8/7
 数据截止日: 2024/8/6
 期内最小值: 62.0000
 期内最大值: 598.0000
 期内平均值: 360.1001
 当前分位值: 64.37%



数据起始日: 2019/8/7
 数据截止日: 2024/8/6
 期内最小值: -1313.0000
 期内最大值: 1788.0000
 期内平均值: 395.7133
 当前分位值: 39.34%



数据起始日： 2019/8/7

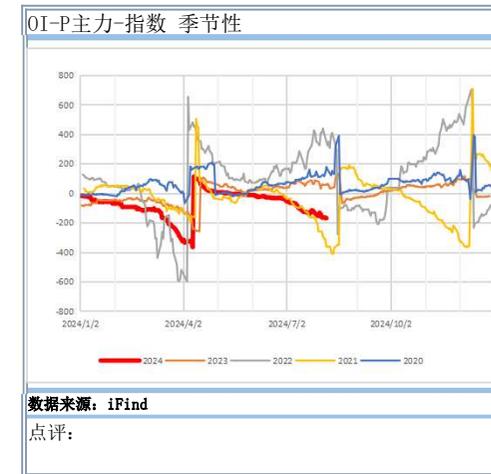
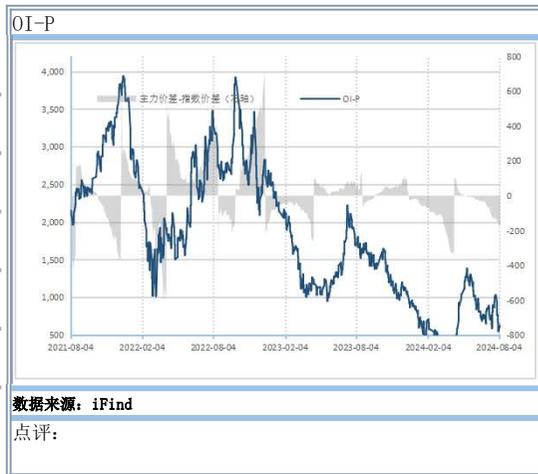
数据截止日： 2024/8/6

期内最小值： 19.0000

期内最大值： 2220.0000

期内平均值： 1090.7139

当前分位值： 27.21%



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。