

<http://www.shanjinqh.com>

# 盘面套利观察

2024年2月21日

制作：强子益

投资咨询： Z0015283

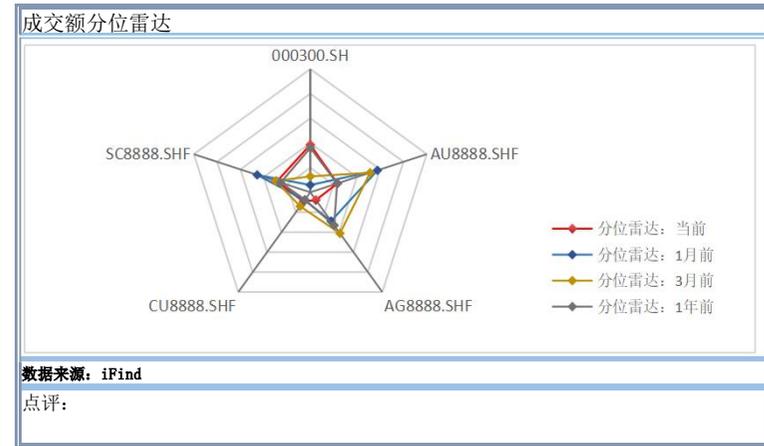
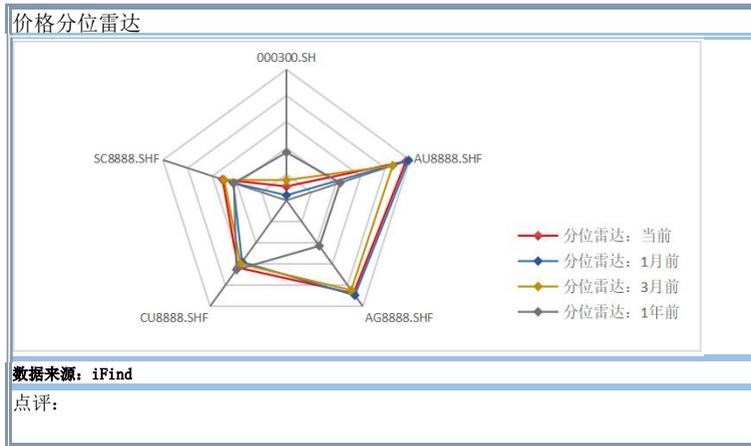
邮箱： qiangziyi@sd-gold.com

数据仅供参考，据此入市，风险自担。

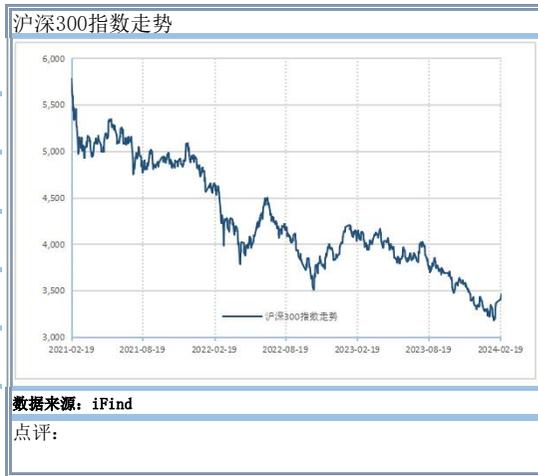
说明：

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

一、宏观观察



数据起始日: 2019/2/22  
数据截止日: 2024/2/21  
期内最小值: 3179.6276  
期内最大值: 5778.842  
期内平均值: 4266.2415  
当前分位值: 15.44%



数据起始日: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

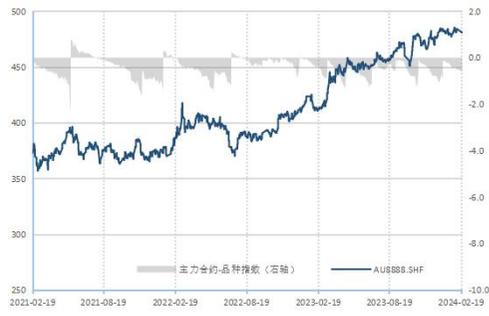
期内最小值: 356.92

期内最大值: 485.23

期内平均值: 410.5873

当前分位值: 96.70%

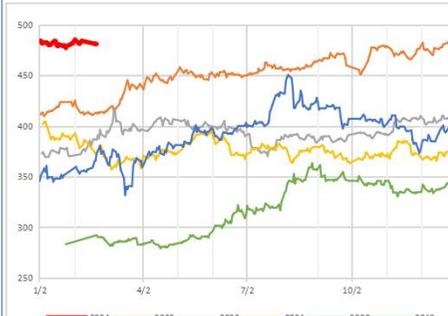
Au. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

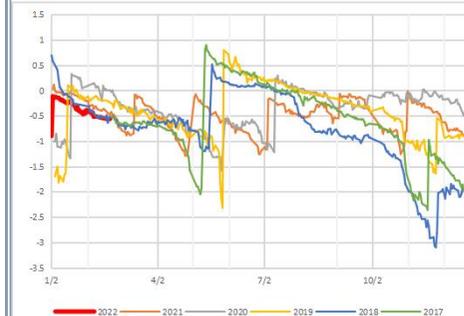
Au. SHFE价格走势季节性



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: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

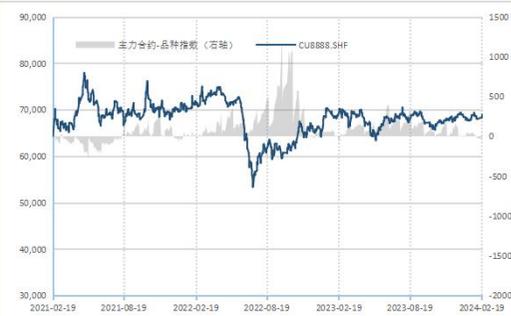
期内最小值: 53367

期内最大值: 77934

期内平均值: 68062.8778

当前分位值: 63.51%

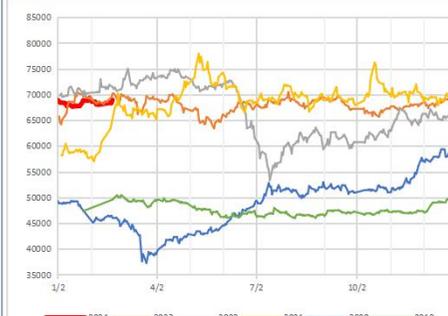
Cu. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

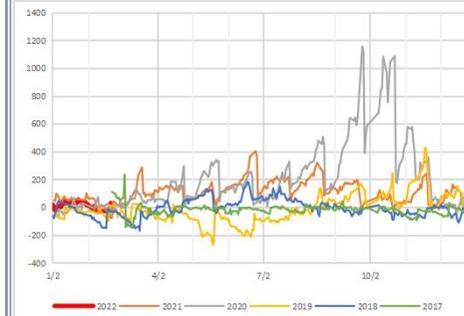
Cu. SHFE价格走势季节性



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： 2019/2/22

数据截止日： 2024/2/21

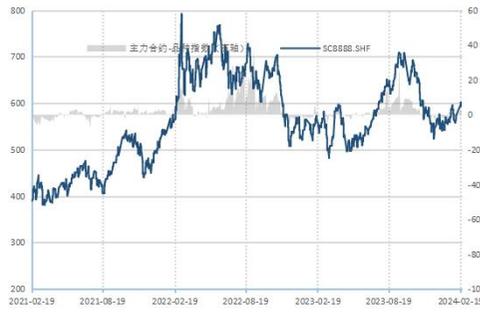
期内最小值： 380.7

期内最大值： 791.6

期内平均值： 561.8226

当前分位值： 51.72%

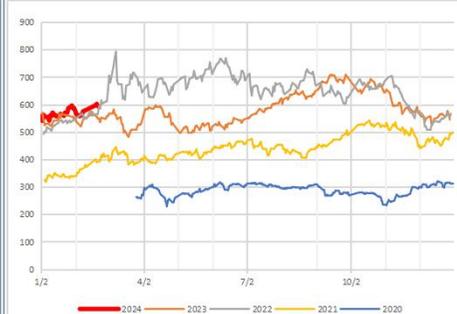
Sc. Ine价格走势



数据来源： iFind

点评：

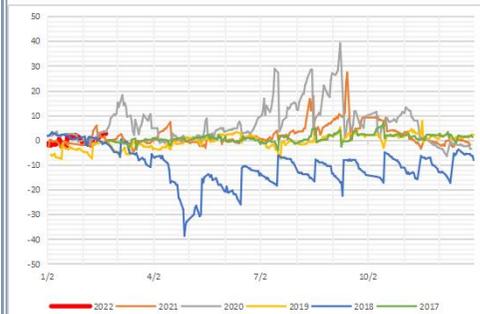
Sc. Ine价格走势季节性



数据来源： iFind

点评：

Sc. Ine价格走势主力-指数 季节性



数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2019/2/22

数据截止日： 2024/2/21

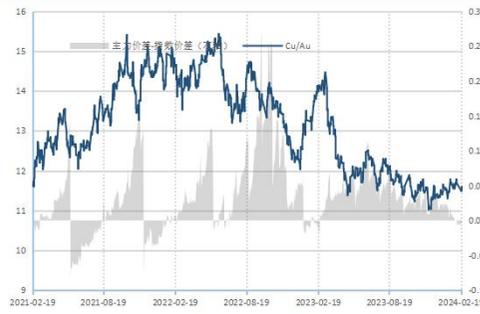
期内最小值： 11.0218

期内最大值： 15.4319

期内平均值： 13.1350

当前分位值： 13.05%

Cu/Au



数据来源： iFind

点评：

Cu/Au季节性



数据来源： iFind

点评：

Cu/Au主力-指数 季节性



数据来源： iFind

点评：

数据起始日: 2019/2/22

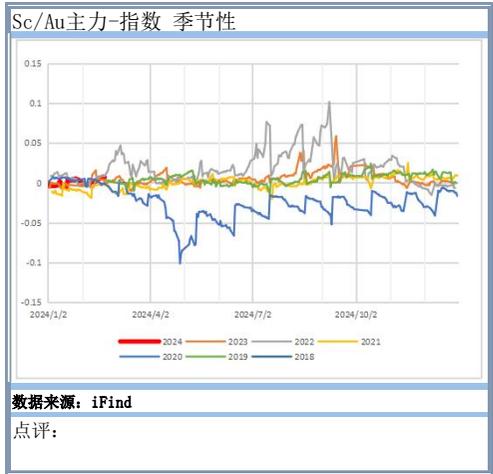
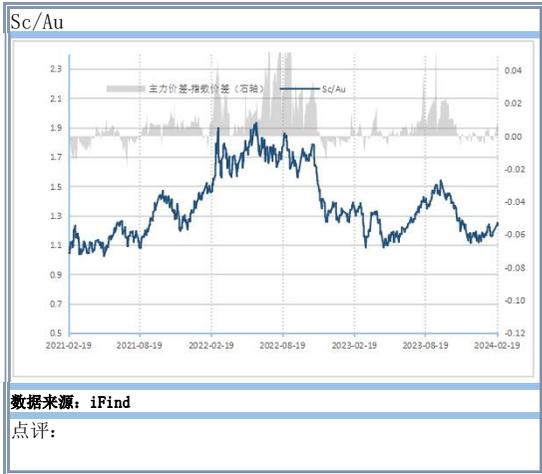
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: 1.0233

期内最大值: 1.9320

期内平均值: 1.3721

当前分位值: 23.11%



数据起始日: 2019/2/22

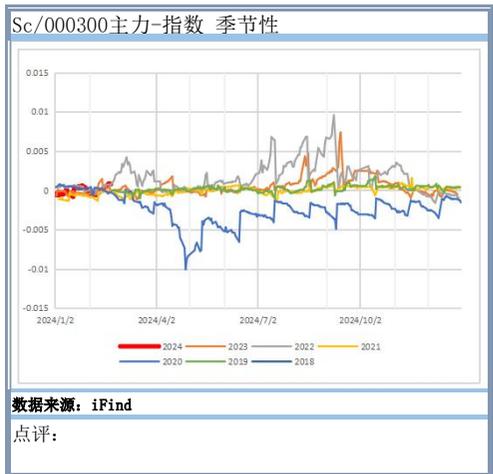
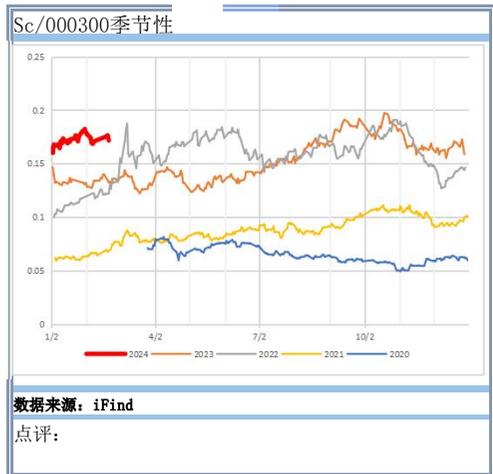
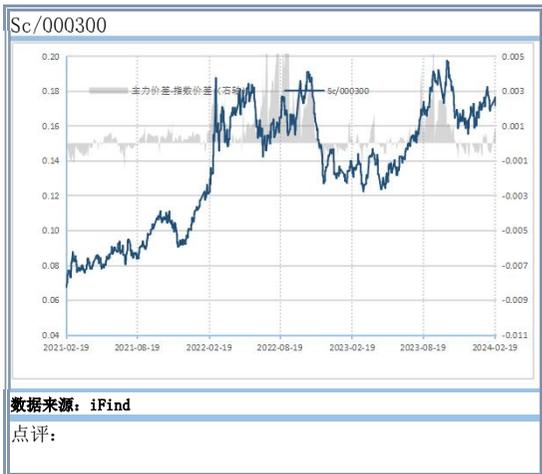
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: 0.0674

期内最大值: 0.1972

期内平均值: 0.1359

当前分位值: 80.29%



数据起始日: 2019/2/22

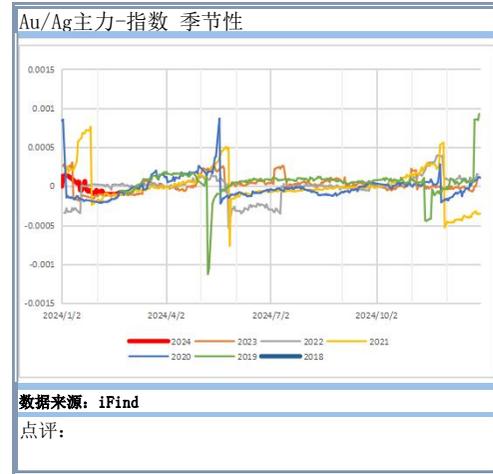
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: 0.0648

期内最大值: 0.0932

期内平均值: 0.0790

当前分位值: 56.72%



数据起始日: 2019/2/22

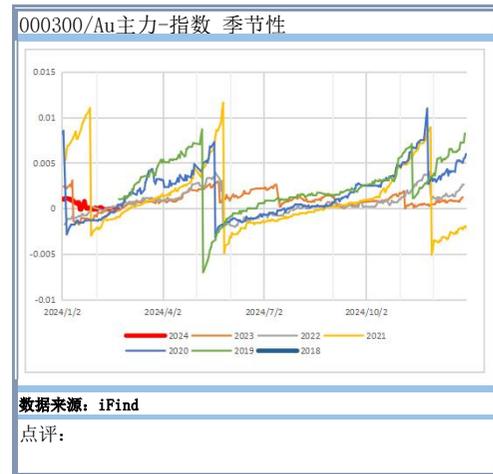
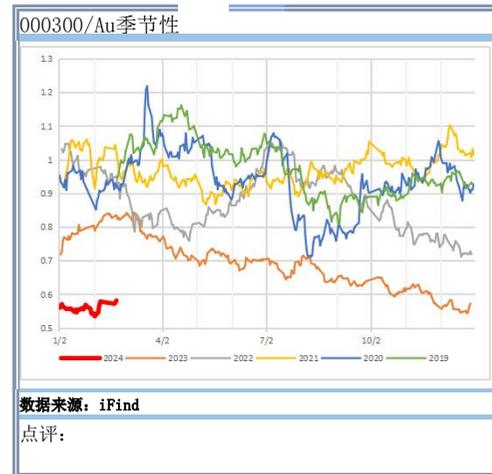
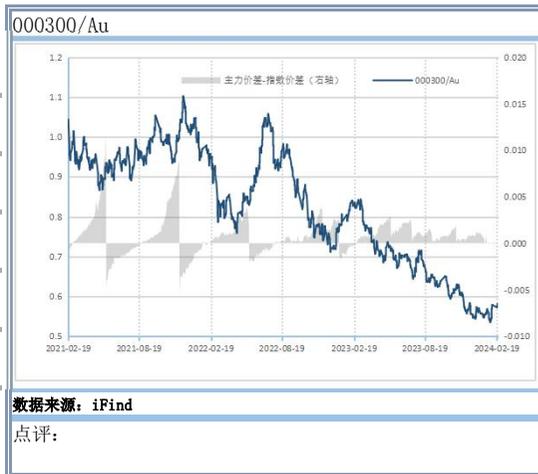
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: 0.5351

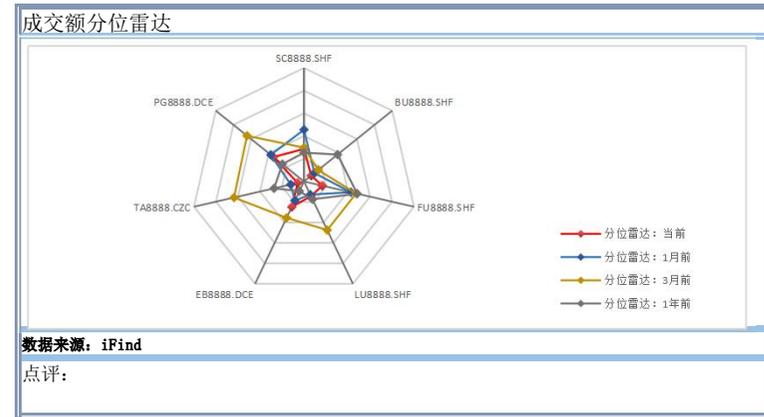
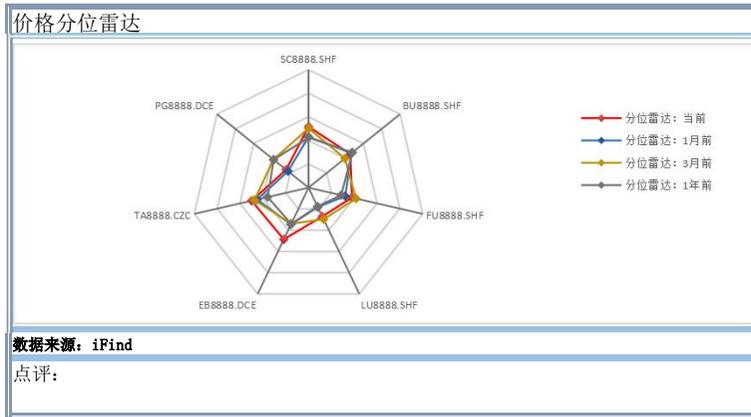
期内最大值: 1.1021

期内平均值: 0.8273

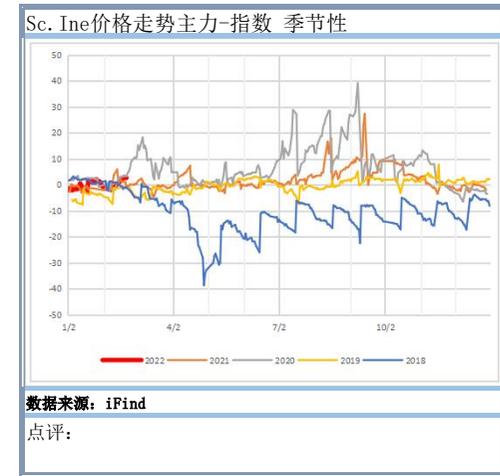
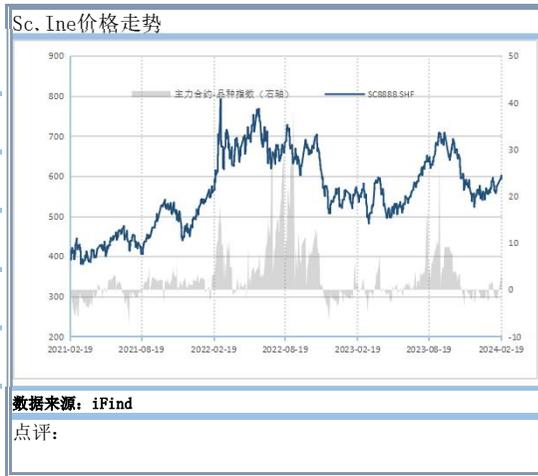
当前分位值: 8.14%



## 二、原油相关



数据起始日: 2019/2/22  
 数据截止日: 2024/2/21  
 期内最小值: 380.7  
 期内最大值: 791.6  
 期内平均值: 561.8226  
 当前分位值: 51.72%



数据起始日： 2019/2/22

数据截止日： 2024/2/21

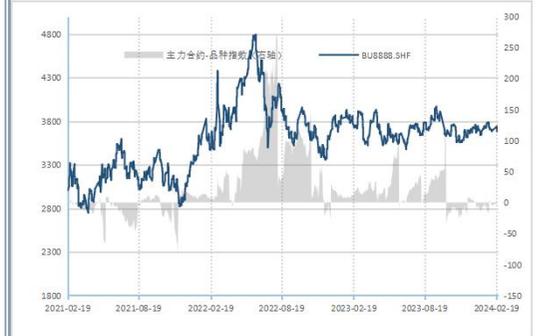
期内最小值： 2748

期内最大值： 4794

期内平均值： 3593.3525

当前分位值： 45.70%

Bu. SHFE价格走势



数据来源： iFind

点评：

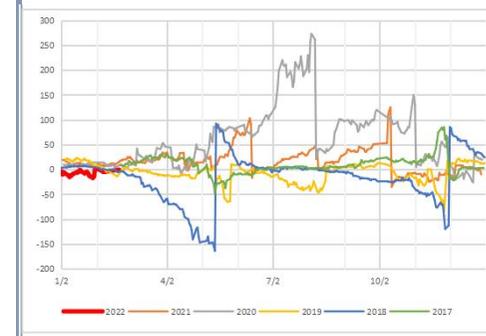
Bu. SHFE价格走势季节性



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： 2019/2/22

数据截止日： 2024/2/21

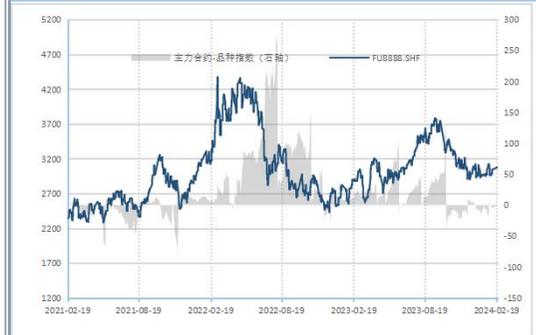
期内最小值： 2284

期内最大值： 4371

期内平均值： 3022.2660

当前分位值： 38.00%

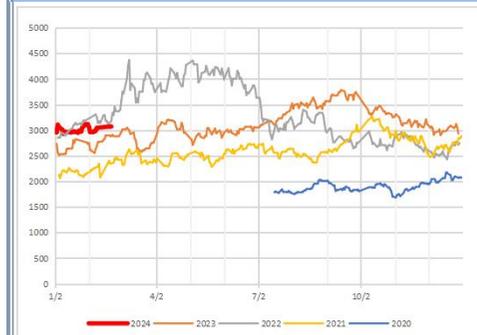
Fu. SHFE价格走势



数据来源： iFind

点评：

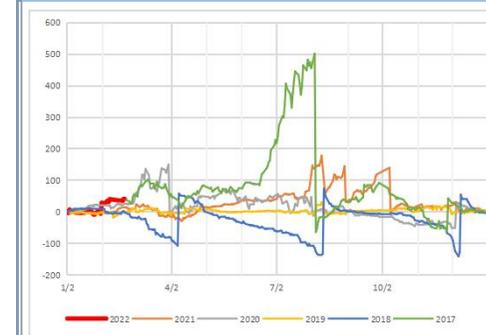
Fu. SHFE价格走势季节性



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：2024/2/21

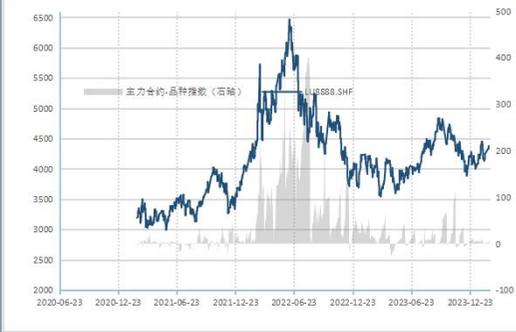
期内最小值：3544

期内最大值：6464

期内平均值：4404.5059

当前分位值：27.12%

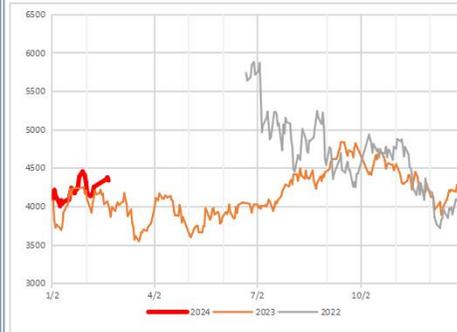
Lu. Ine价格走势



数据来源：iFind

点评：

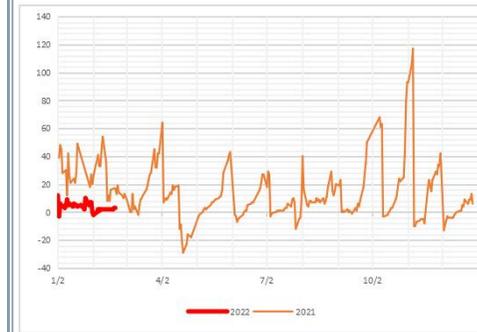
Lu. Ine价格走势季节性



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：2024/2/21

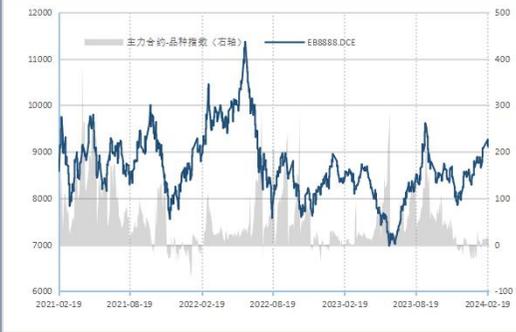
期内最小值：6978

期内最大值：11361

期内平均值：8648.9834

当前分位值：48.62%

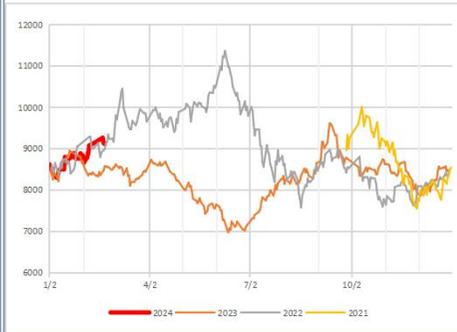
EB. DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

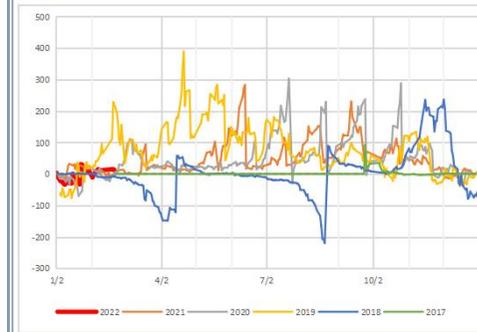
EB. DCE价格走势季节性



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: 2019/2/22

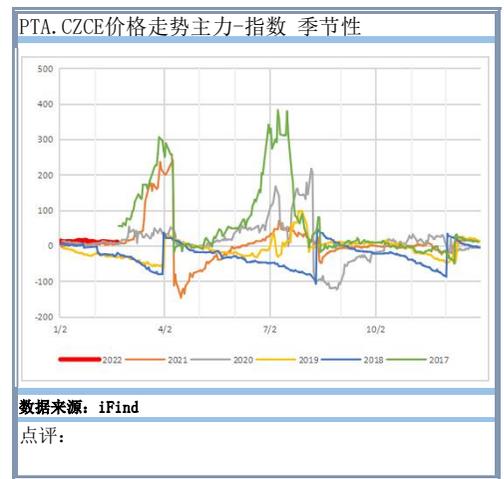
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: 4329

期内最大值: 7488

期内平均值: 5519.6653

当前分位值: 49.79%



数据起始日: 2020/3/30

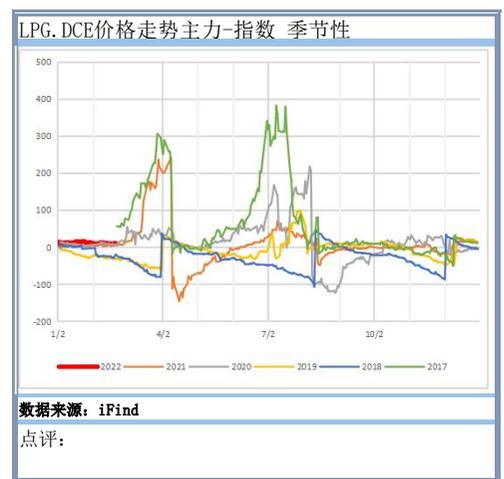
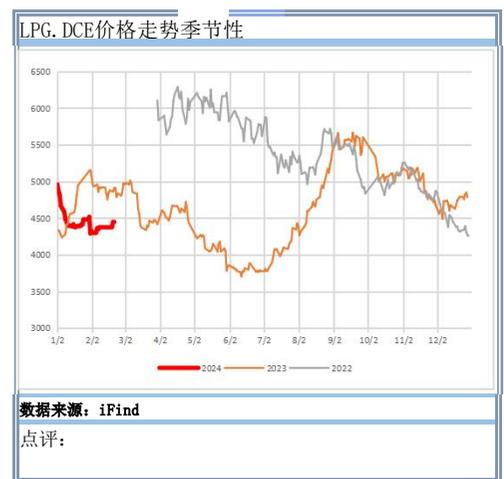
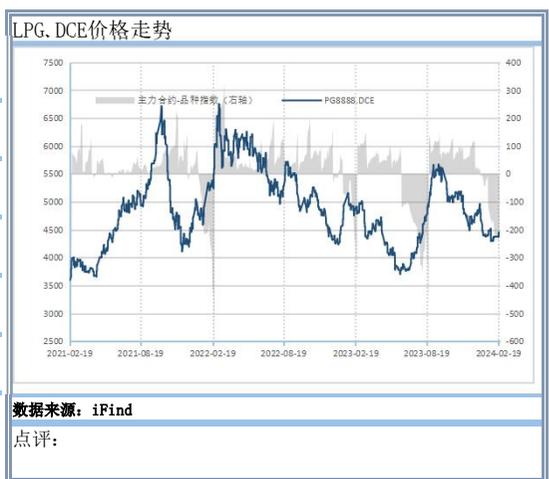
数据截止日: 2024/2/21

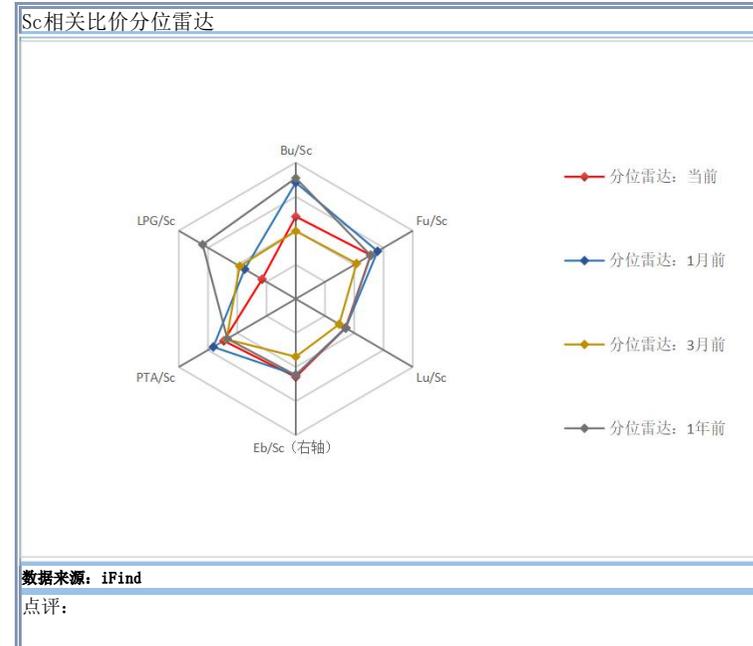
期内最小值: 3704

期内最大值: 6749

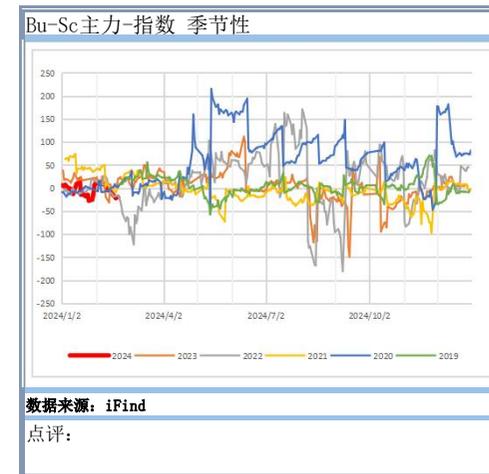
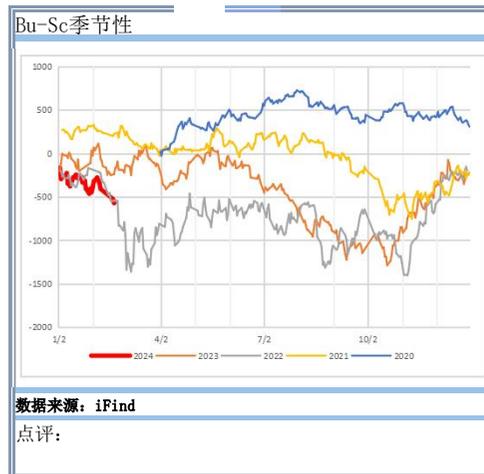
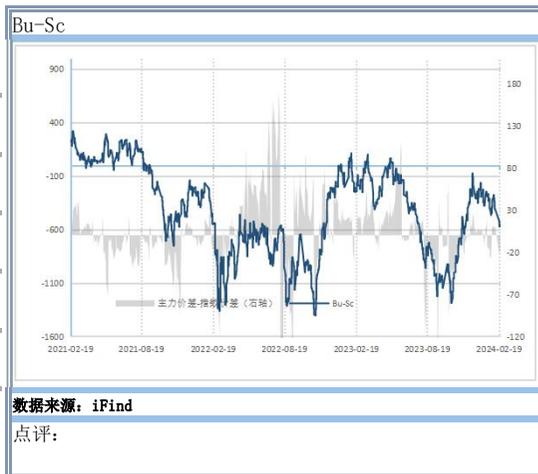
期内平均值: 4978.3361

当前分位值: 24.43%





数据起始日: 2019/2/22  
 数据截止日: 2024/2/21  
 期内最小值: -1406.4286  
 期内最大值: 317.5714  
 期内平均值: -419.6663  
 当前分位值: 49.44%



数据起始日: 2019/2/22

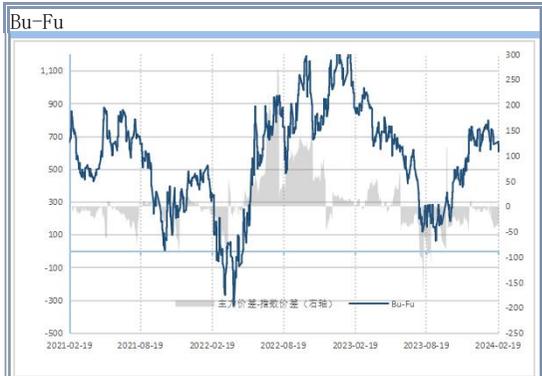
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: -331.0000

期内最大值: 1284.0000

期内平均值: 571.0865

当前分位值: 58.02%



数据来源: iFind  
点评:



数据来源: iFind  
点评:



数据来源: iFind  
点评:

数据起始日: 2021/8/29

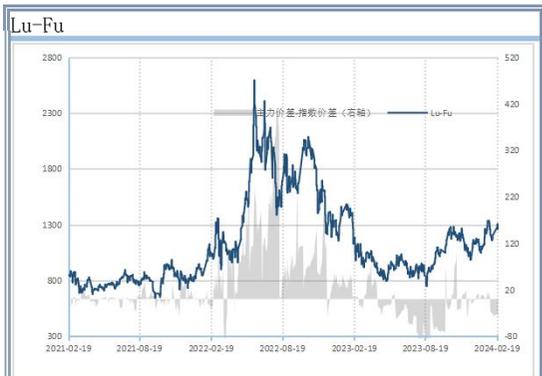
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: 749.0000

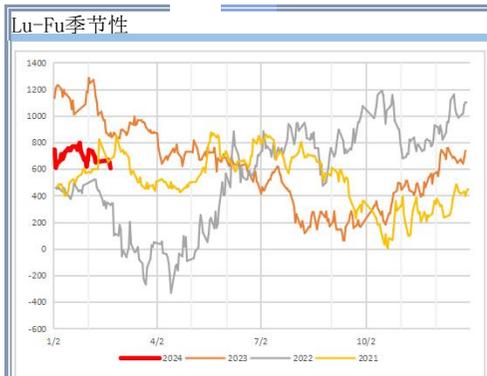
期内最大值: 2592.0000

期内平均值: 1314.1718

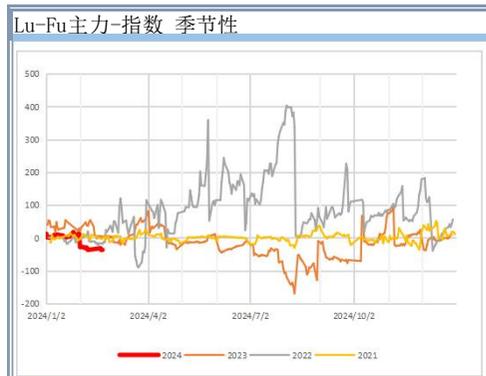
当前分位值: 27.67%



数据来源: iFind  
点评:



数据来源: iFind  
点评:



数据来源: iFind  
点评:

数据起始日: 2021/7/4

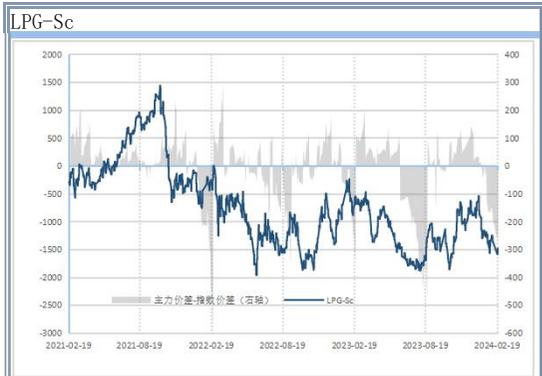
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: -1959.0000

期内最大值: -1.0000

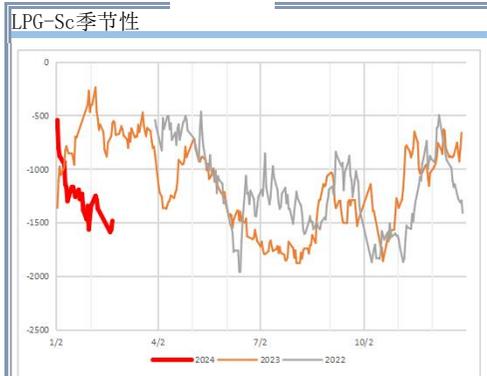
期内平均值: -1149.8838

当前分位值: 24.26%



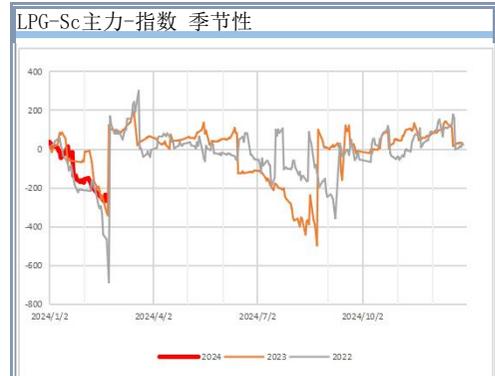
数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/2/22

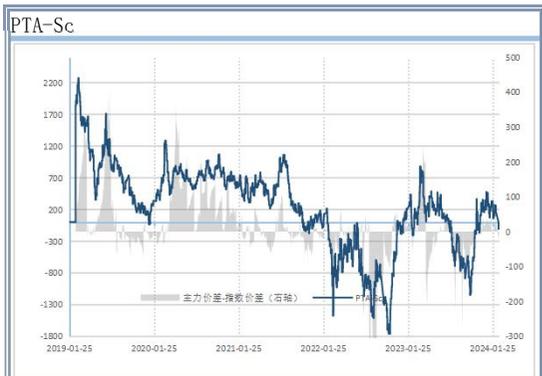
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: -1762.0000

期内最大值: 1061.0000

期内平均值: -98.5610

当前分位值: 61.35%



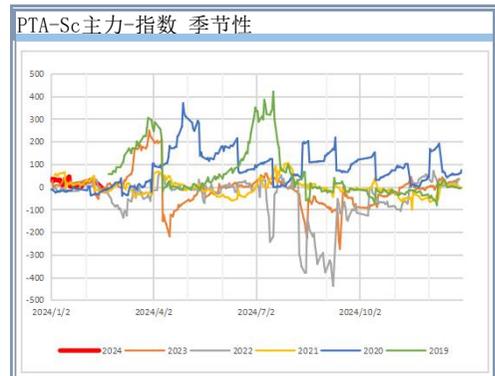
数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2021/3/6

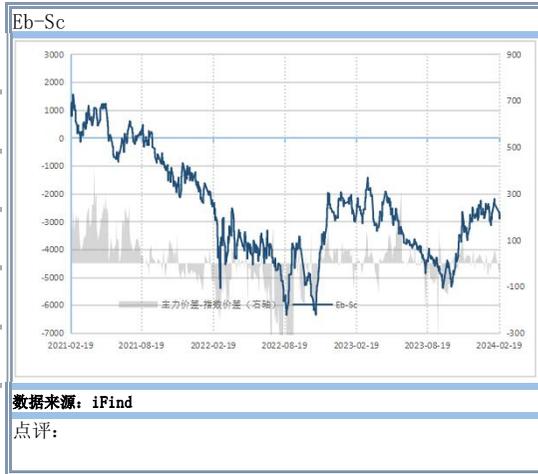
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: -6347.0000

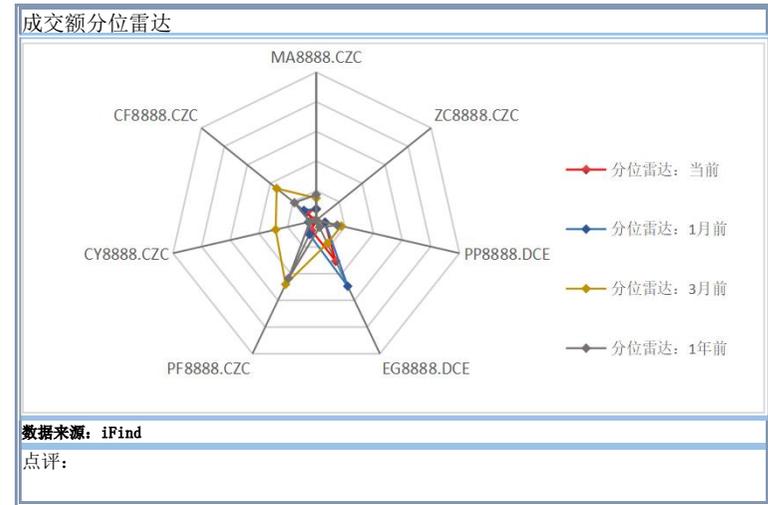
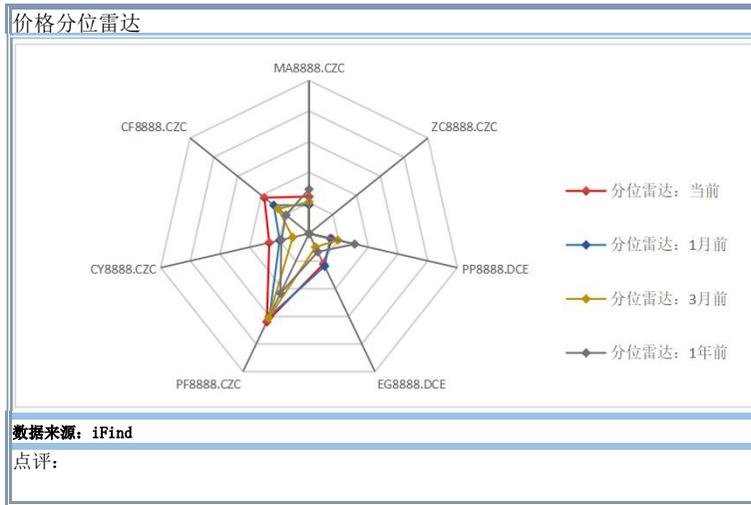
期内最大值: 238.0000

期内平均值: -3169.7388

当前分位值: 54.55%



三、煤化工相关



数据起始日: 2019/2/22  
 数据截止日: 2024/2/21  
 期内最小值: 1982  
 期内最大值: 4015  
 期内平均值: 2587.9630  
 当前分位值: 24.15%



数据起始日: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

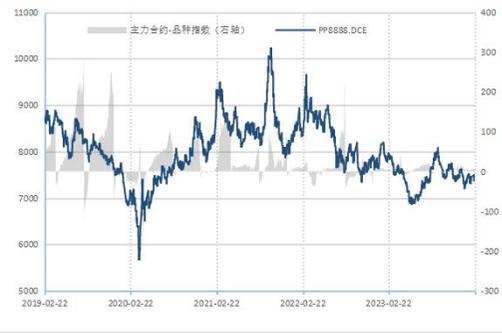
期内最小值: 6865

期内最大值: 10224

期内平均值: 8070.6914

当前分位值: 15.48%

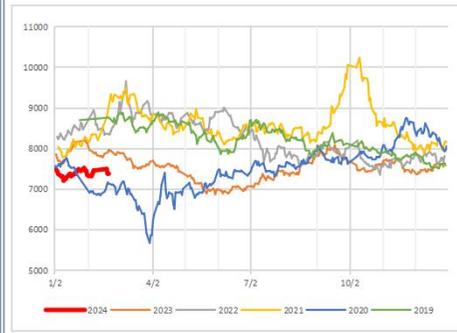
PP. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

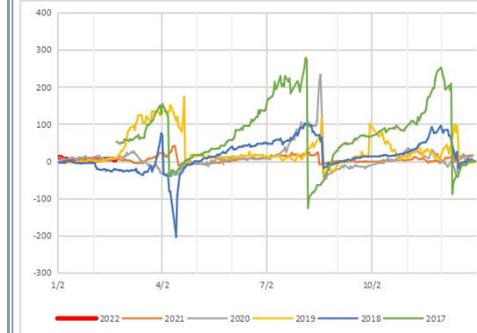
PP. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

PP. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

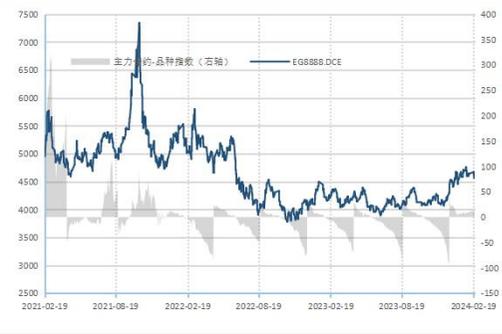
期内最小值: 3778

期内最大值: 7345

期内平均值: 4634.6214

当前分位值: 22.04%

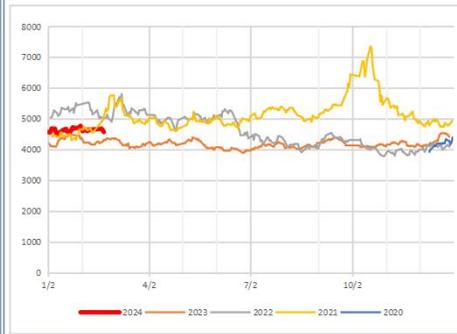
EG. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

EG. CZCE价格走势季节性



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: 2024/2/21

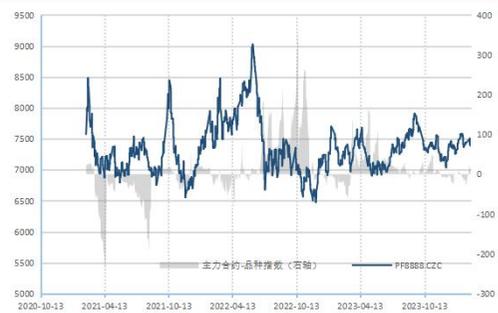
期内最小值: 6477

期内最大值: 7907

期内平均值: 7245.4051

当前分位值: 63.85%

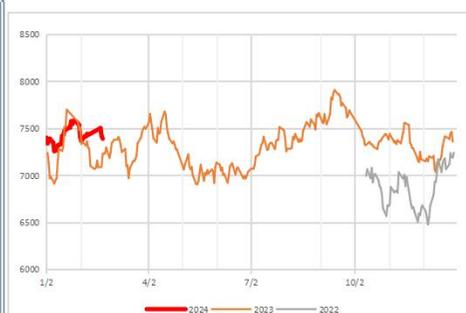
PF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

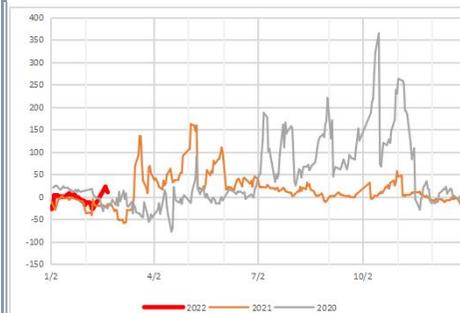
PF. CZCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

PF. CZCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

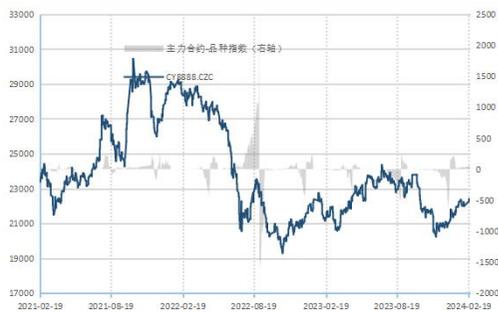
期内最小值: 19292

期内最大值: 30443

期内平均值: 23886.8134

当前分位值: 26.82%

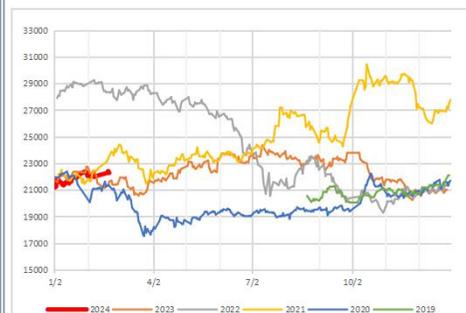
CY. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

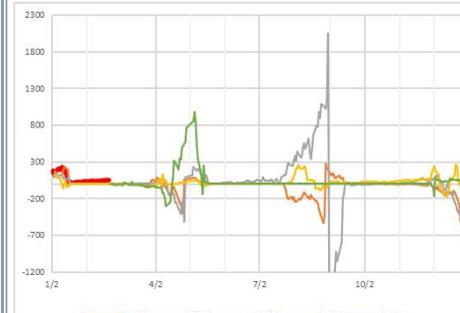
CY. CZCE价格走势季节性



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: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

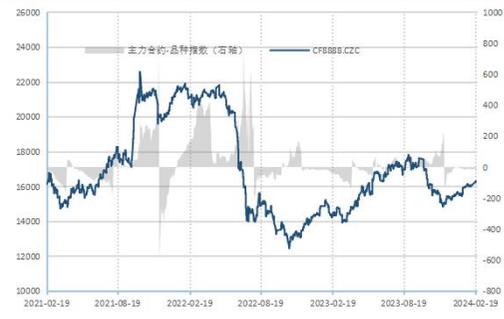
期内最小值: 12447

期内最大值: 22574

期内平均值: 16881.8176

当前分位值: 37.51%

CF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

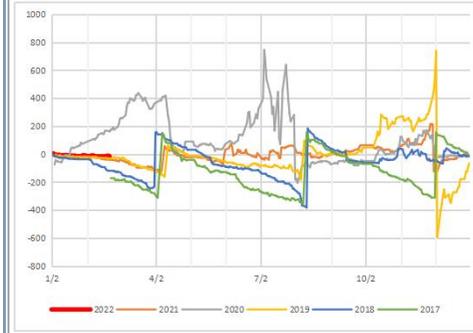
CF. CZCE价格走势季节性



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: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

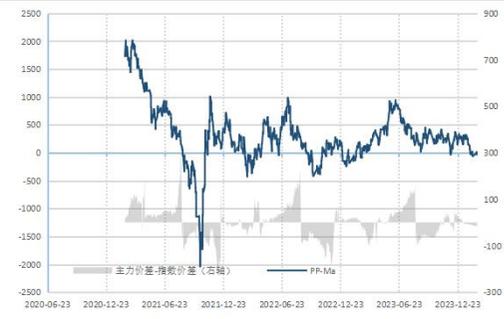
期内最小值: -2039.0000

期内最大值: 2013.0000

期内平均值: 306.8025

当前分位值: 49.48%

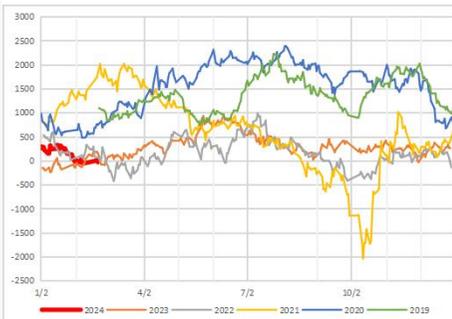
PP-Ma



数据来源: iFind

点评:

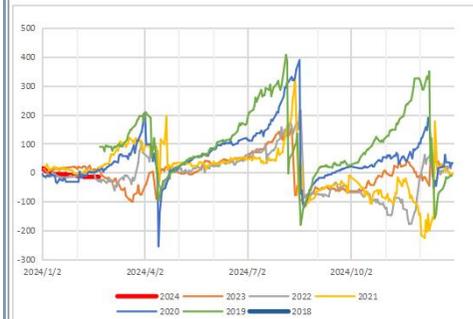
PP-Ma季节性



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: 2019/2/22

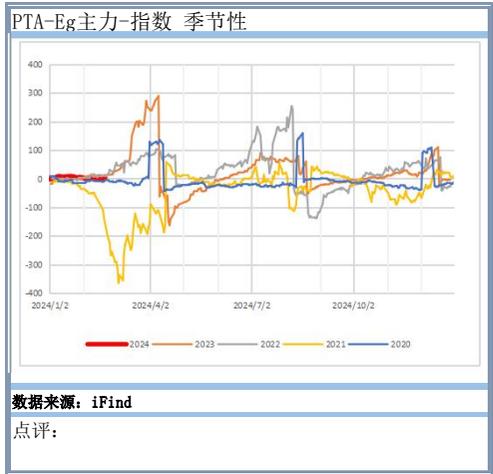
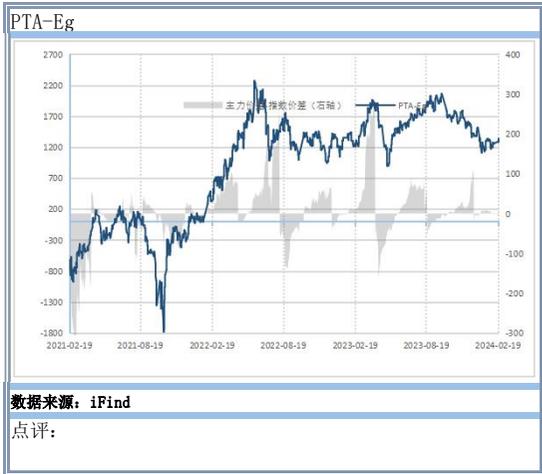
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: -1783.0000

期内最大值: 2269.0000

期内平均值: 885.0439

当前分位值: 77.02%



数据起始日: 2021/11/9

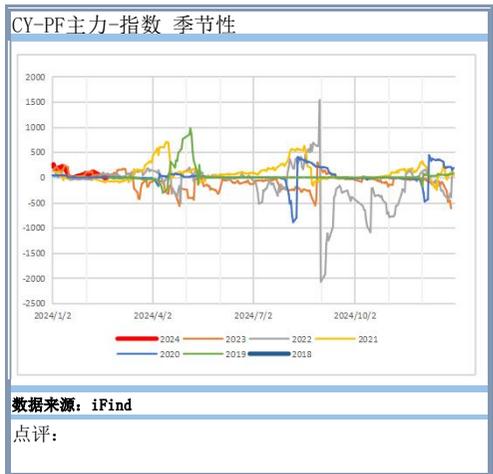
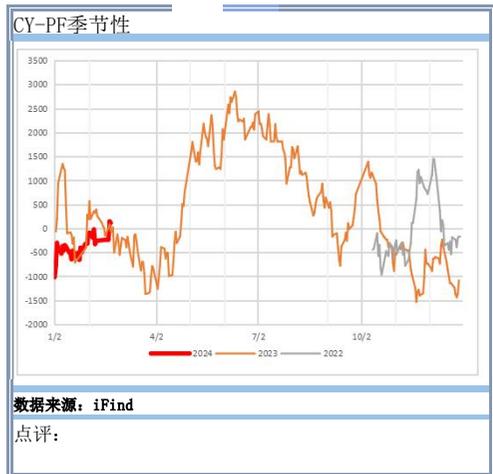
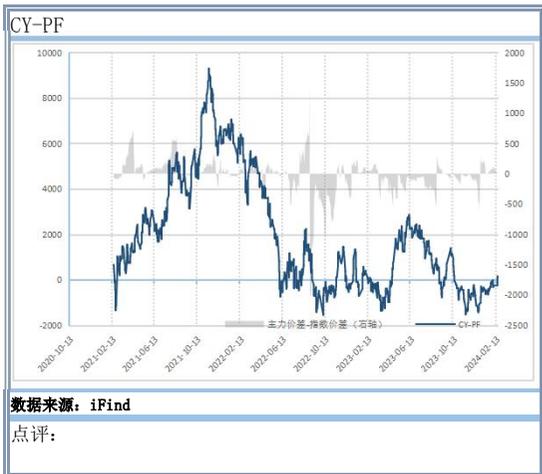
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: -1555.0000

期内最大值: 2854.0000

期内平均值: 213.7535

当前分位值: 37.83%



数据起始日: 2022/9/2

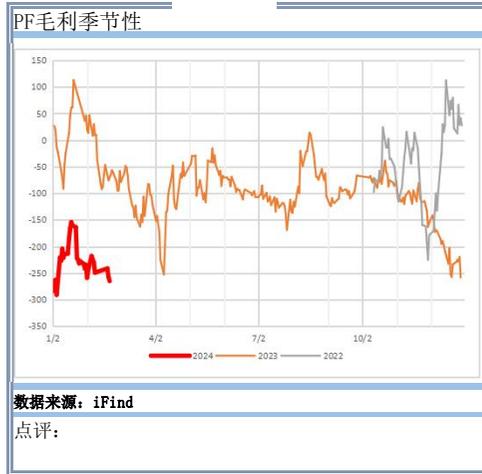
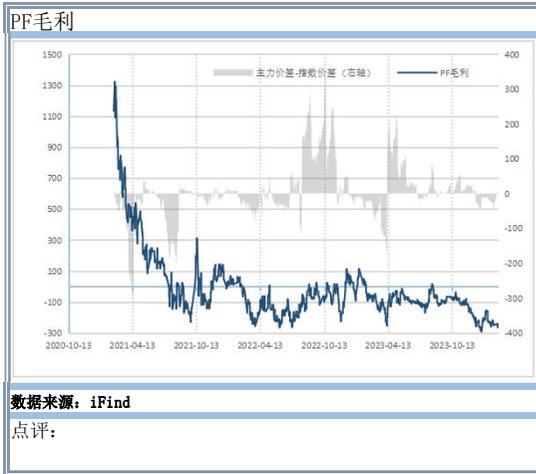
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: -291.0300

期内最大值: 112.9900

期内平均值: -93.7291

当前分位值: 6.41%



数据起始日: 2019/2/22

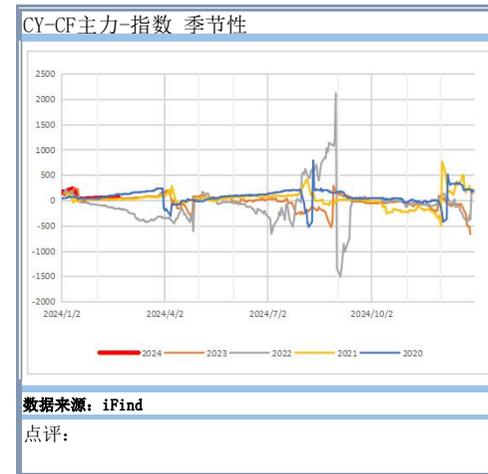
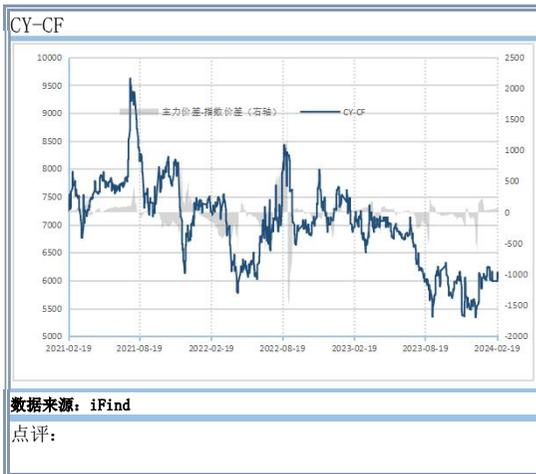
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: 5338.0000

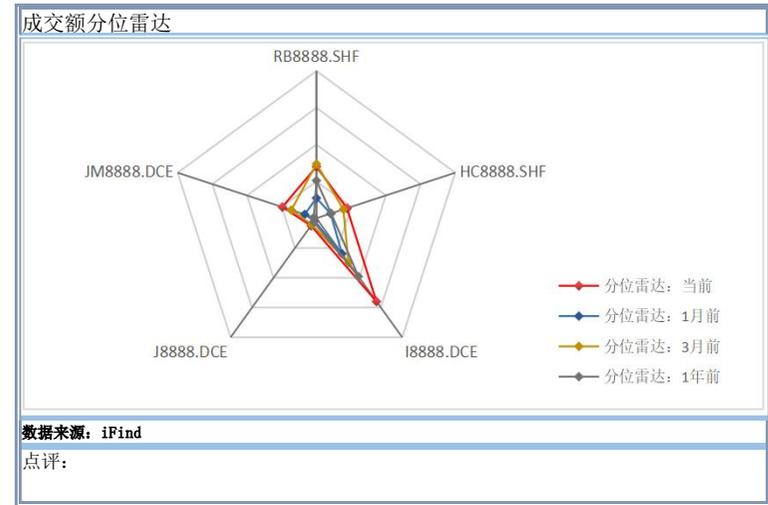
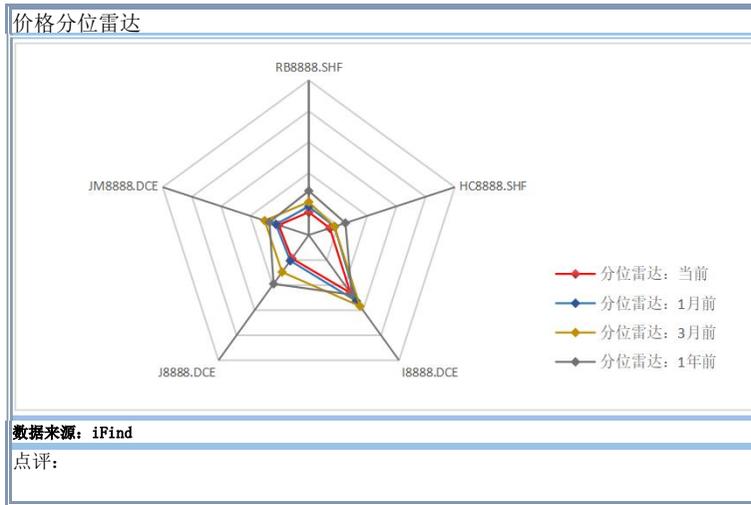
期内最大值: 9616.0000

期内平均值: 7004.9959

当前分位值: 16.34%



#### 四、黑色相关



数据起始日: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: 3377

期内最大值: 6158

期内平均值: 4324.5867

当前分位值: 14.78%



数据起始日: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

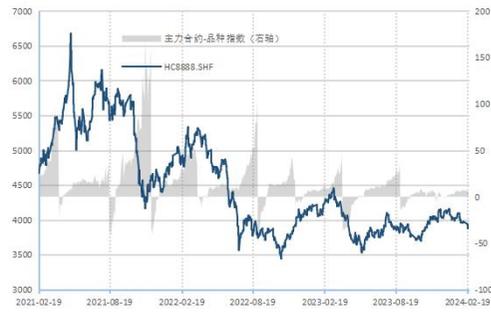
期内最小值: 3444

期内最大值: 6675

期内平均值: 4479.3964

当前分位值: 14.42%

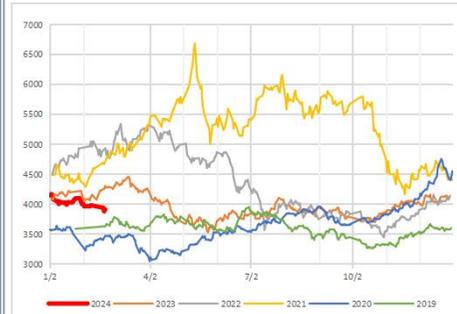
### HC.SHFE价格走势



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: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

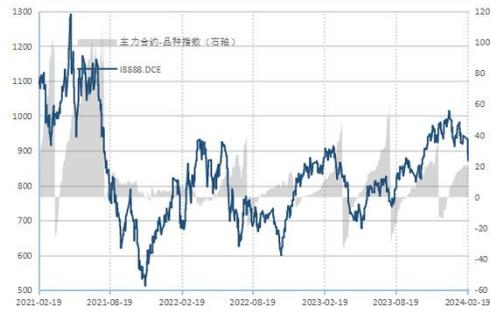
期内最小值: 512.8

期内最大值: 1290.9

期内平均值: 832.9845

当前分位值: 46.19%

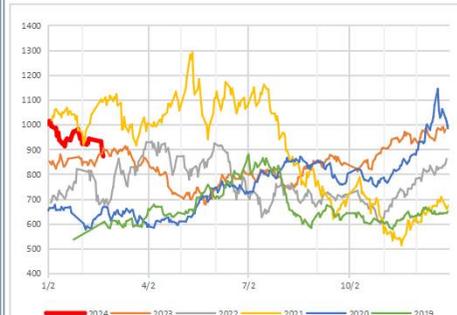
### I.DCE价格走势



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: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

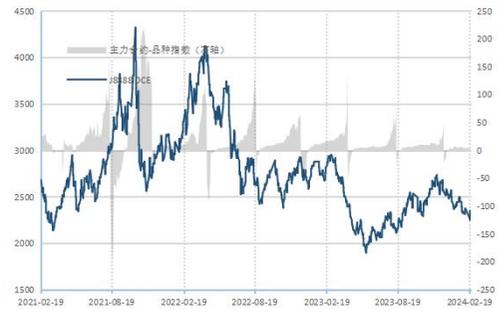
期内最小值: 1897.9

期内最大值: 4320.8

期内平均值: 2753.4495

当前分位值: 18.70%

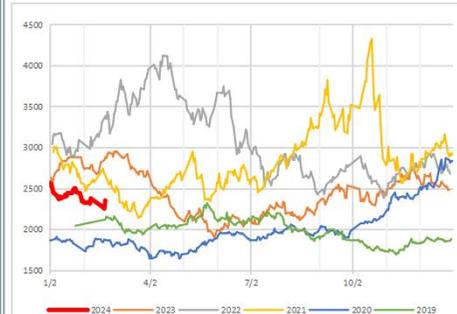
J. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

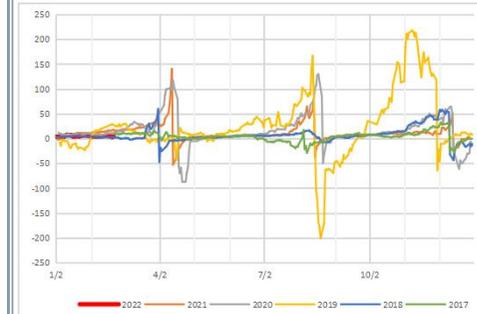
J. DCE价格走势季节性



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: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: 1219.4

期内最大值: 3764.7

期内平均值: 2020.9494

当前分位值: 20.64%

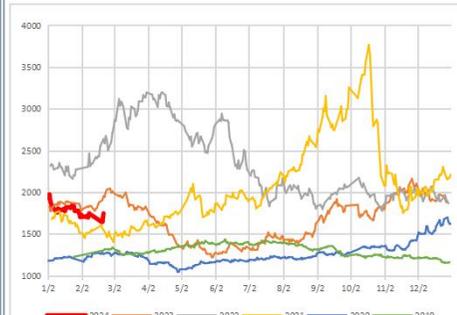
Jm. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

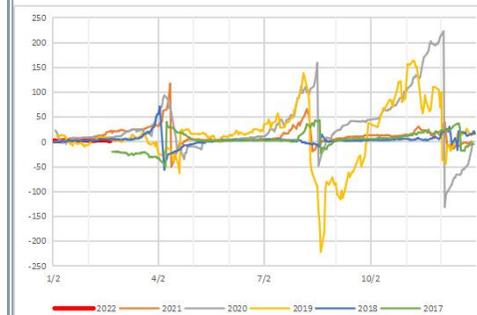
Jm. DCE价格走势季节性



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: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

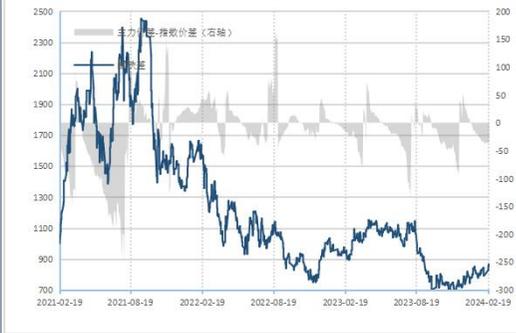
期内最小值: 670.1176

期内最大值: 2451.8235

期内平均值: 1234.9369

当前分位值: 10.99%

### 螺铁差



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

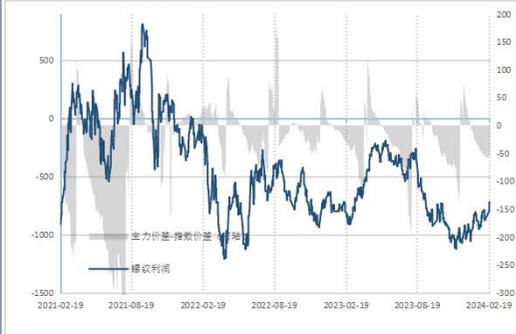
期内最小值: -1206.9091

期内最大值: 810.0000

期内平均值: -450.3261

当前分位值: 23.74%

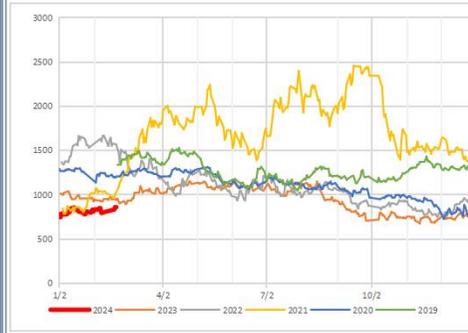
### 螺纹利润



数据来源: iFind

点评:

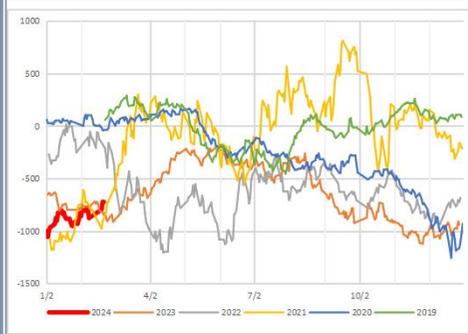
### 螺铁差季节性



数据来源: iFind

点评:

### 螺纹利润季节性



数据来源: iFind

点评:

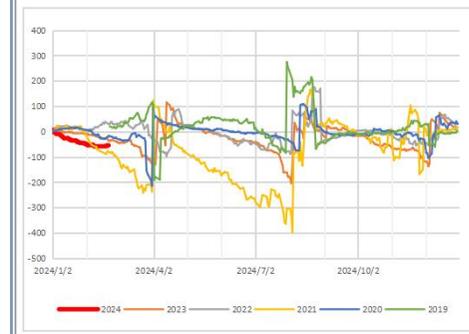
### 螺铁差主力-指数 季节性



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: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

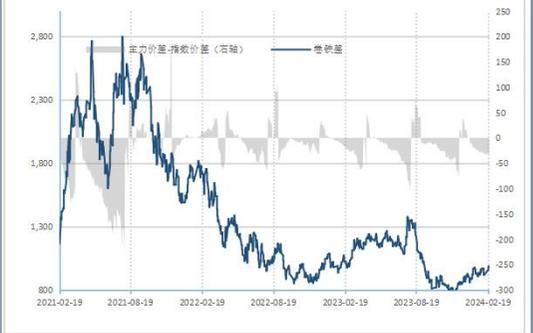
期内最小值: 752.4706

期内最大值: 2799.4118

期内平均值: 1389.7476

当前分位值: 11.50%

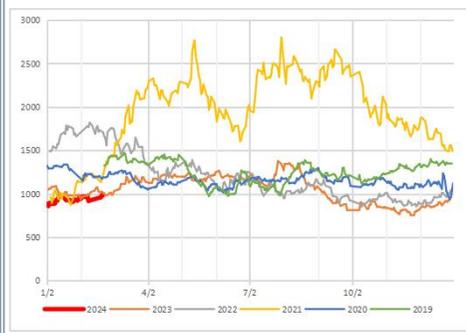
### 卷铁差



数据来源: iFind

点评:

### 卷铁差季节性



数据来源: iFind

点评:

### 卷铁差主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

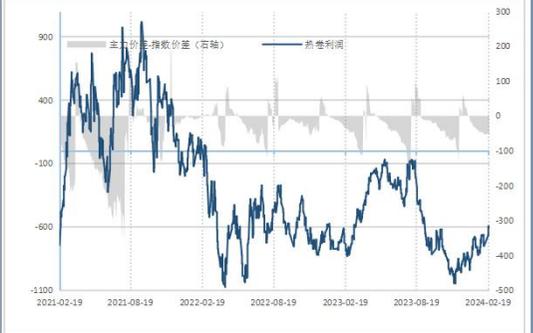
期内最小值: -1073.7273

期内最大值: 1014.0000

期内平均值: -295.5154

当前分位值: 22.40%

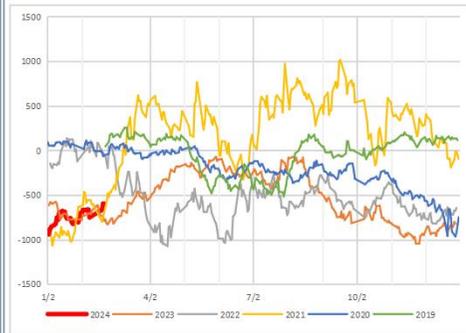
### 热卷利润



数据来源: iFind

点评:

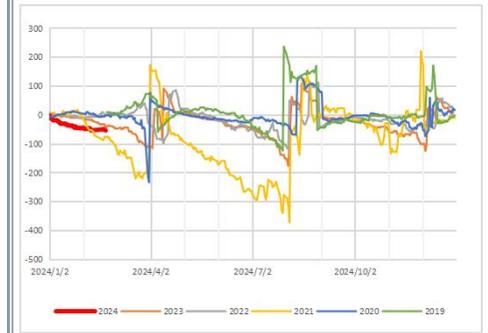
### 热卷利润季节性



数据来源: iFind

点评:

### 热卷利润主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/2/22

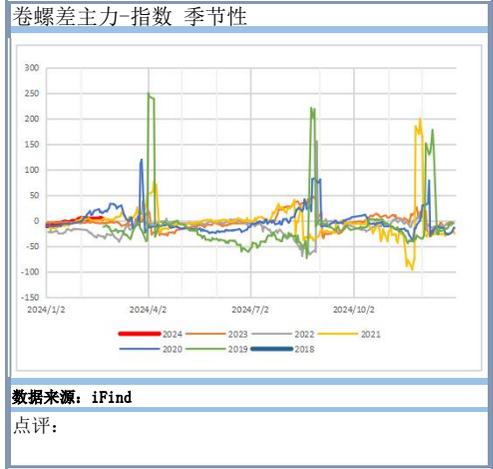
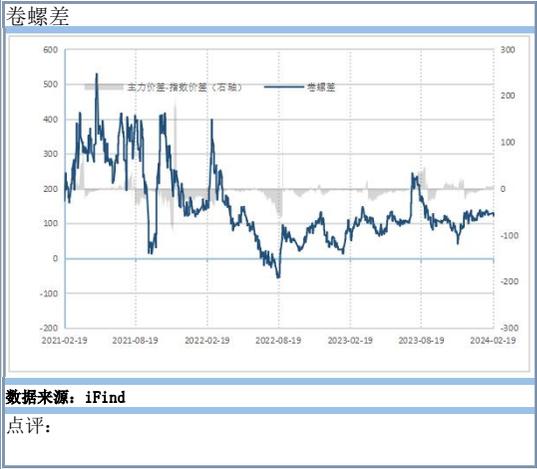
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: -56.0000

期内最大值: 529.0000

期内平均值: 154.8107

当前分位值: 30.43%



数据起始日: 2019/2/22

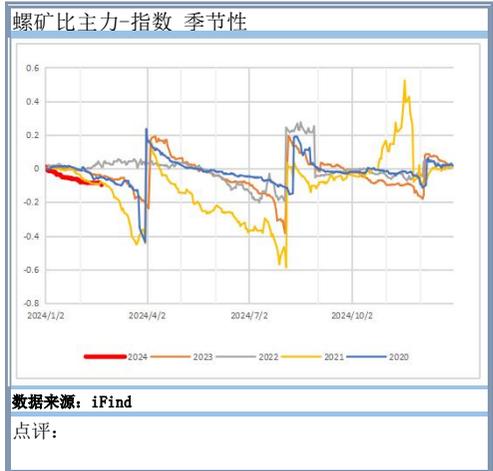
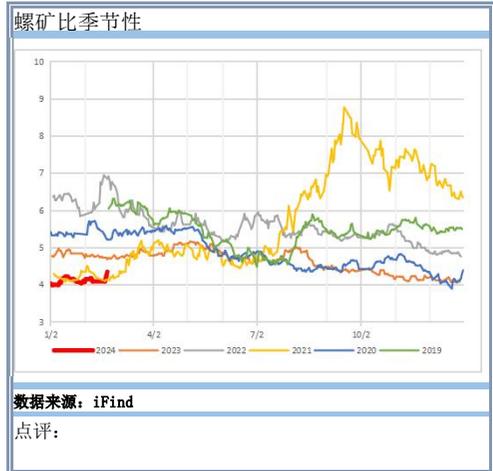
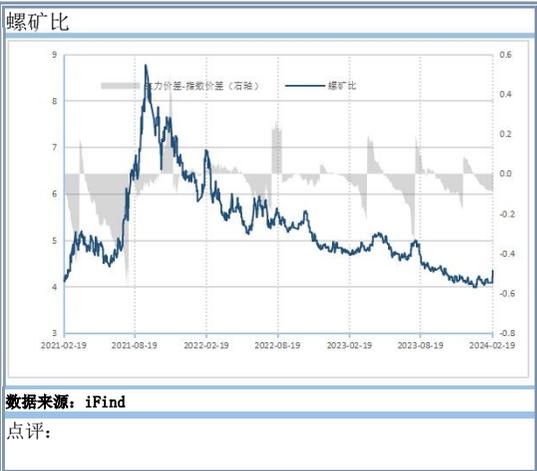
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: 3.9880

期内最大值: 8.7631

期内平均值: 5.2892

当前分位值: 7.43%



数据起始日: 2019/2/22

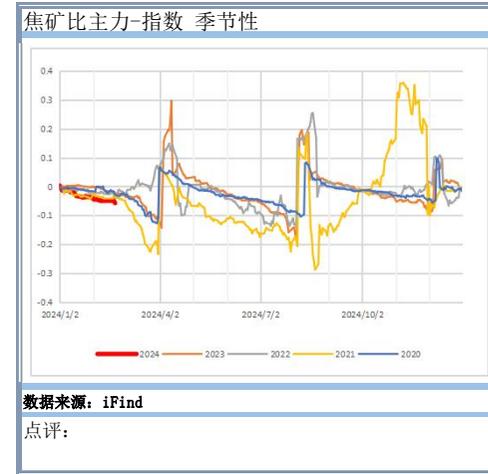
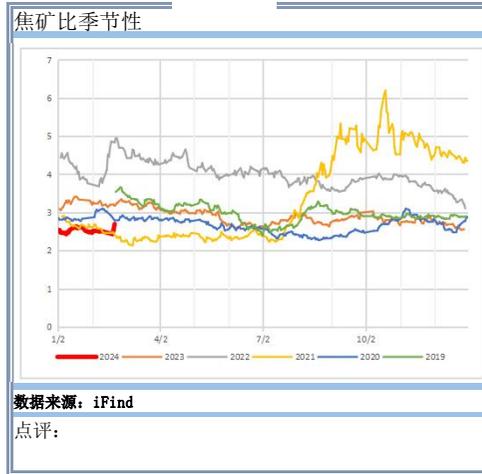
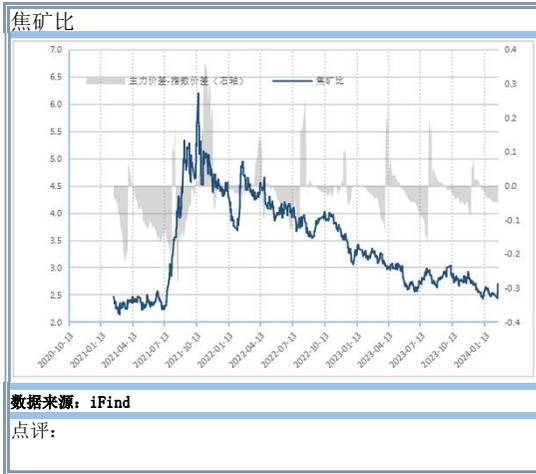
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: 2.1354

期内最大值: 6.1947

期内平均值: 3.4082

当前分位值: 13.80%



数据起始日: 2019/2/22

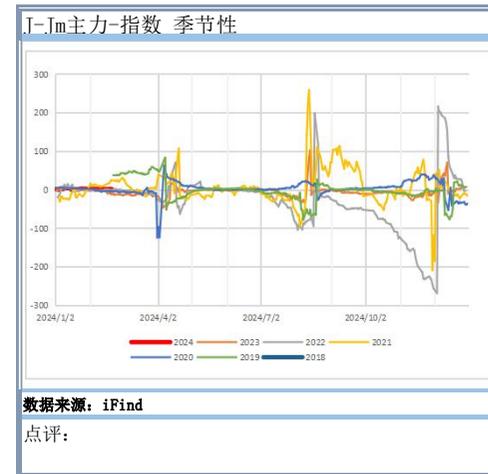
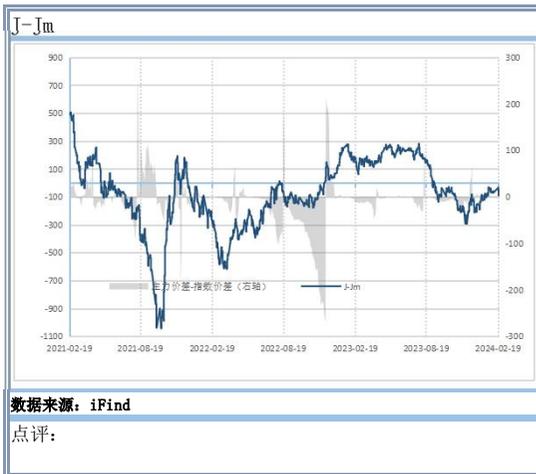
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: -1043.0800

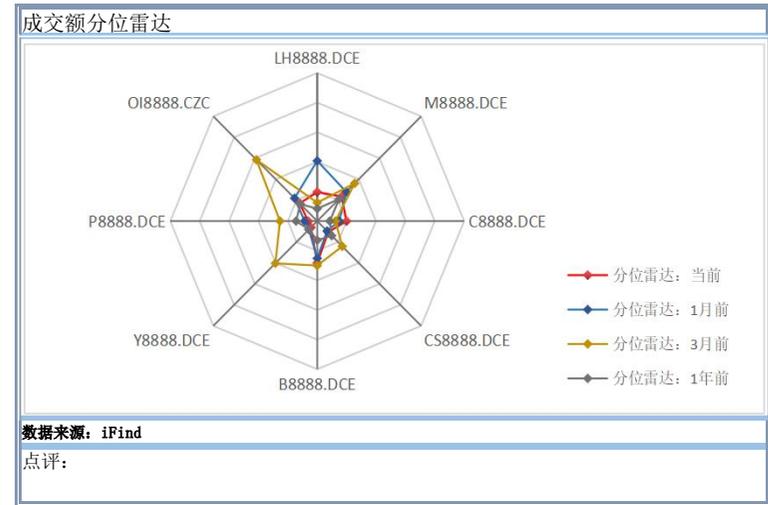
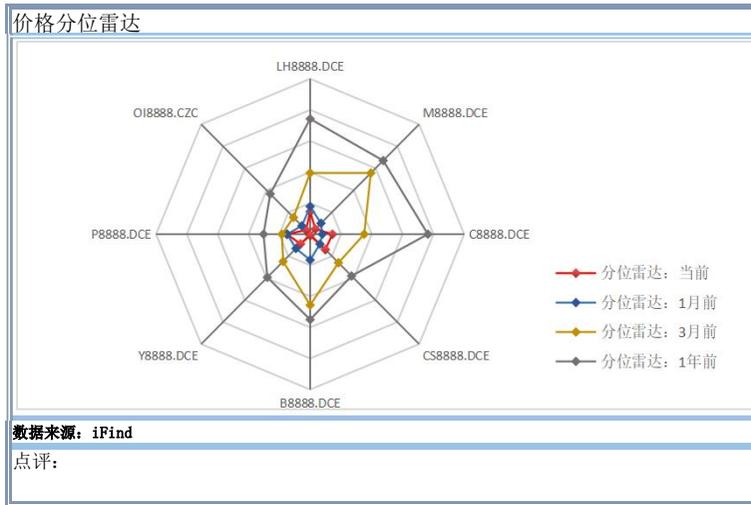
期内最大值: 504.2600

期内平均值: -75.8796

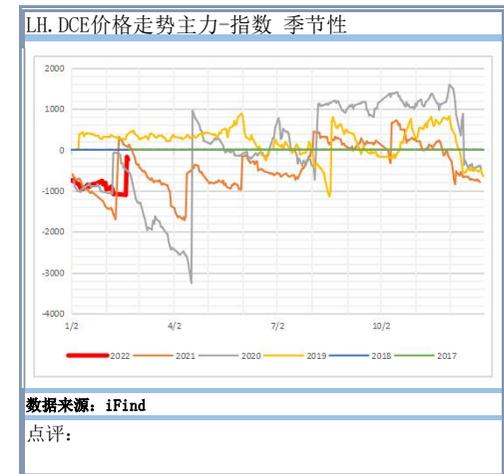
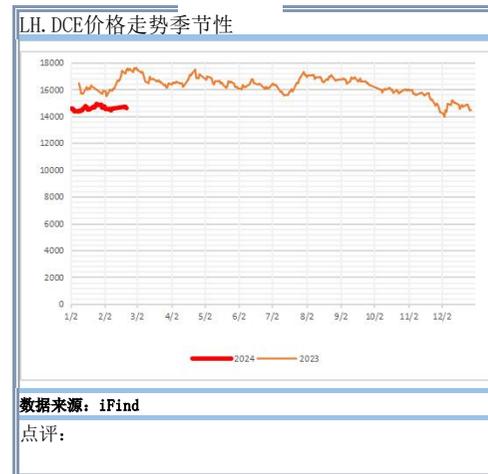
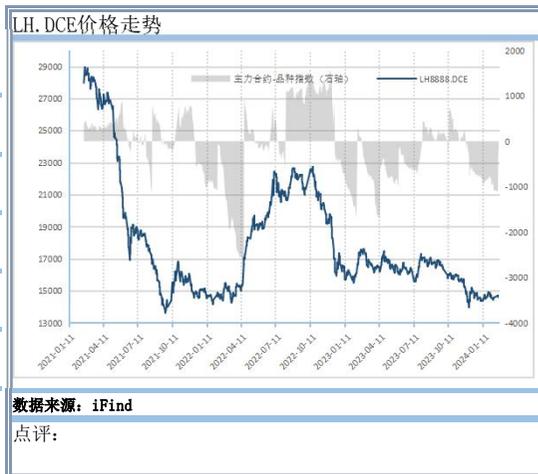
当前分位值: 61.48%



五、农产品相关



数据起始日: 2021/1/8  
 数据截止日: 2024/2/21  
 期内最小值: 13971  
 期内最大值: 18315  
 期内平均值: 16113.4793  
 当前分位值: 14.59%



数据起始日: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

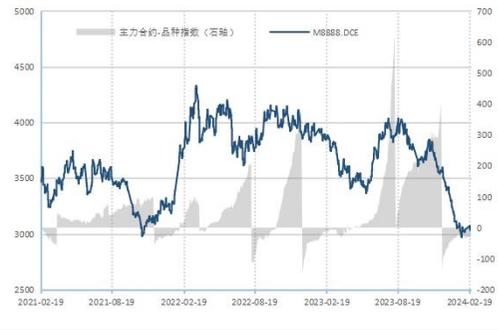
期内最小值: 2970

期内最大值: 4328

期内平均值: 3657.2414

当前分位值: 4.71%

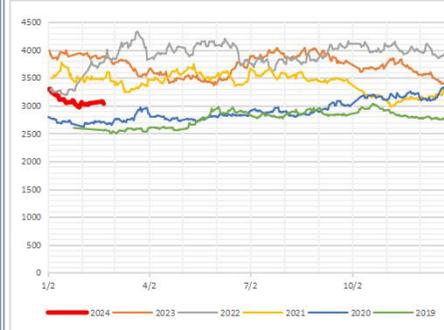
M. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

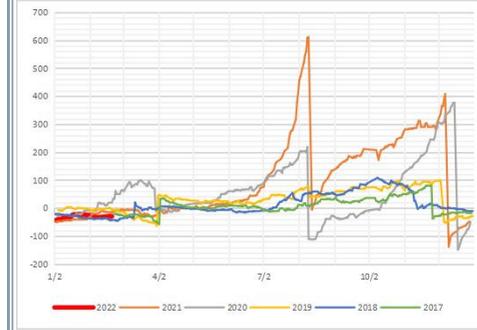
M. DCE价格走势季节性



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: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: 2328

期内最大值: 3027

期内平均值: 2696.1866

当前分位值: 14.45%

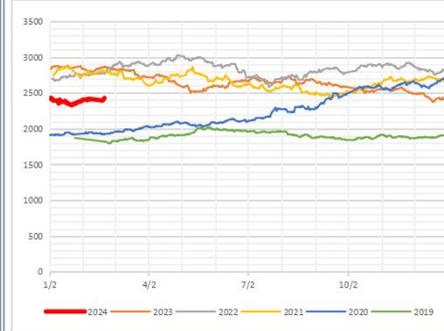
C. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

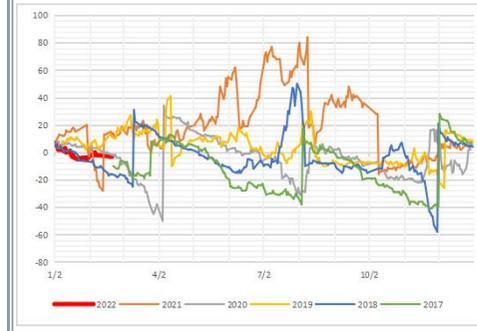
C. DCE价格走势季节性



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: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

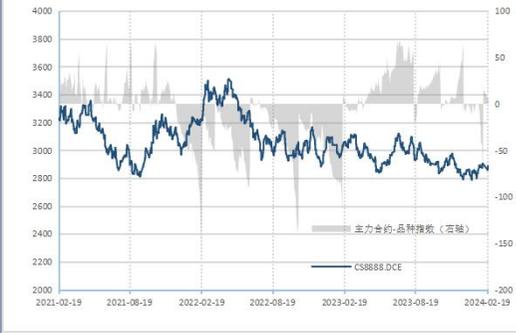
期内最小值: 2788

期内最大值: 3512

期内平均值: 3062.8546

当前分位值: 13.95%

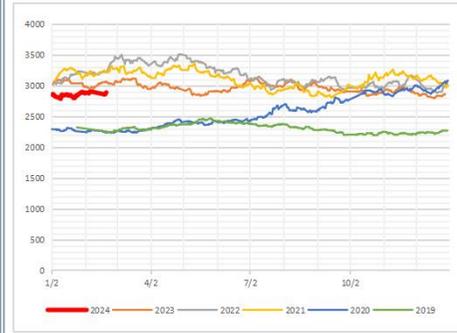
CS. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

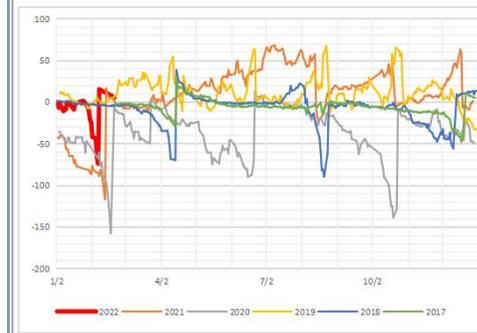
CS. DCE价格走势季节性



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: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

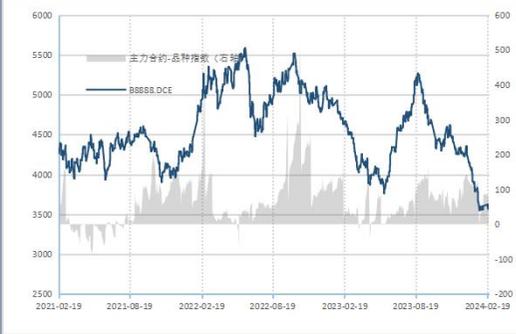
期内最小值: 3549

期内最大值: 5585

期内平均值: 4558.7572

当前分位值: 0.83%

B. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

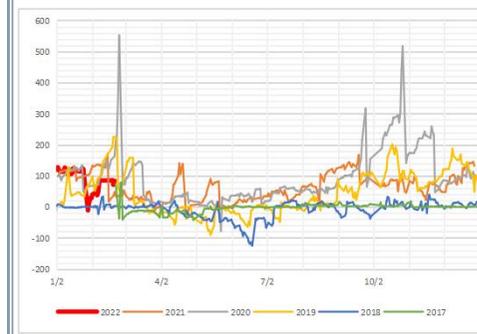
B. DCE价格走势季节性



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: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

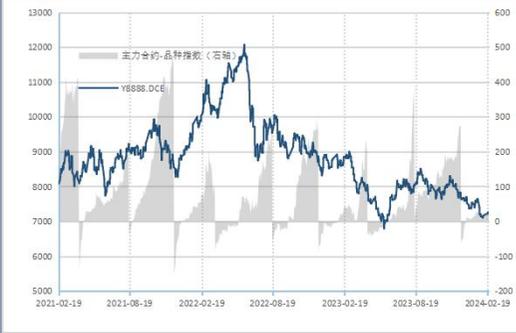
期内最小值: 6793

期内最大值: 12065

期内平均值: 8822.6104

当前分位值: 8.86%

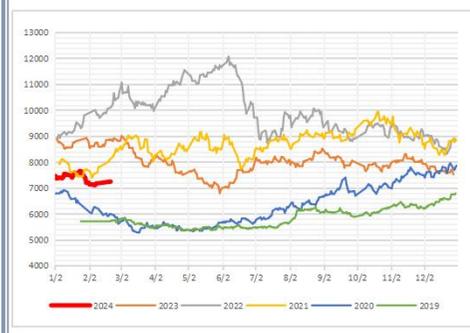
Y. DCE价格走势



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: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

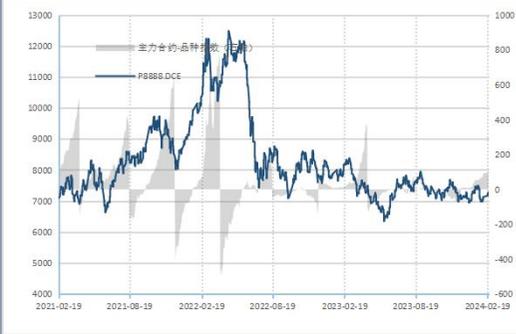
期内最小值: 6349

期内最大值: 12479

期内平均值: 8271.5460

当前分位值: 15.09%

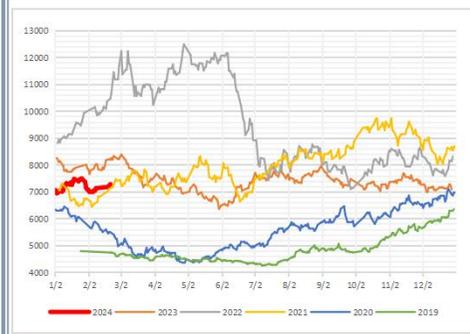
P. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

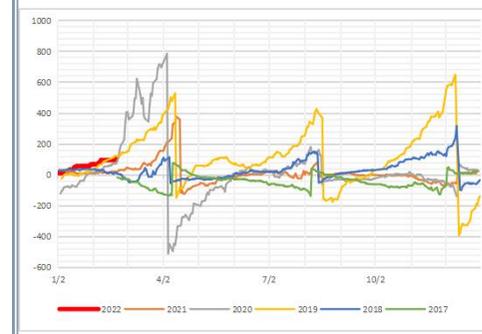
P. DCE价格走势季节性



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: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: 7475

期内最大值: 14344

期内平均值: 10439.5995

当前分位值: 3.76%

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: 2022/1/11

数据截止日: 2024/2/21

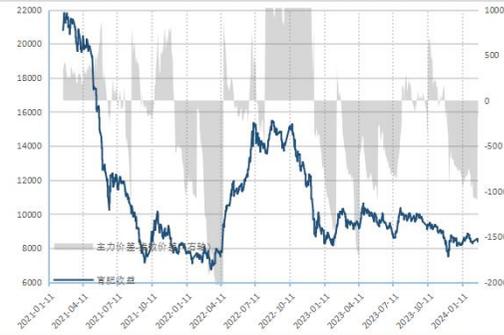
期内最小值: 7508.2500

期内最大值: 10899.5000

期内平均值: 9274.5112

当前分位值: 25.74%

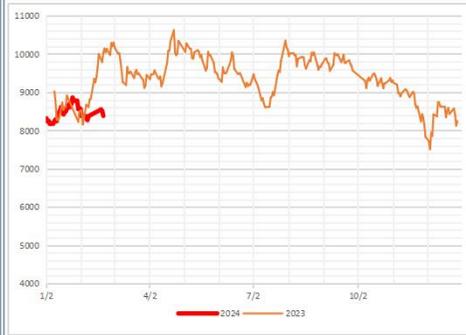
育肥收益



数据来源: iFind

点评:

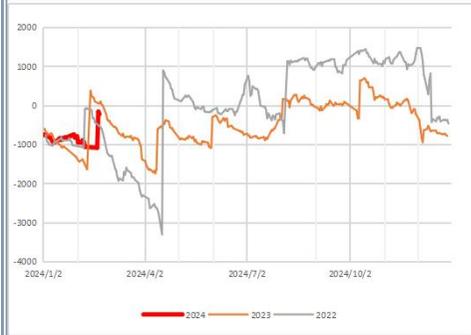
育肥收益季节性



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

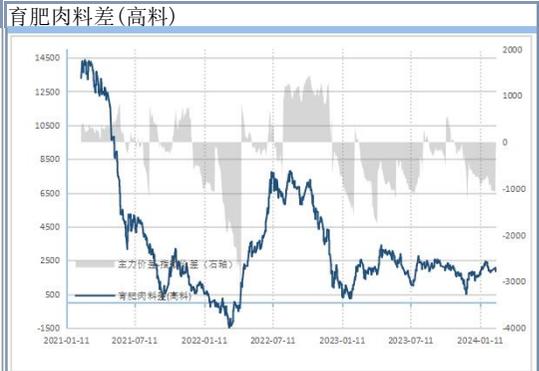
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: 246.0000

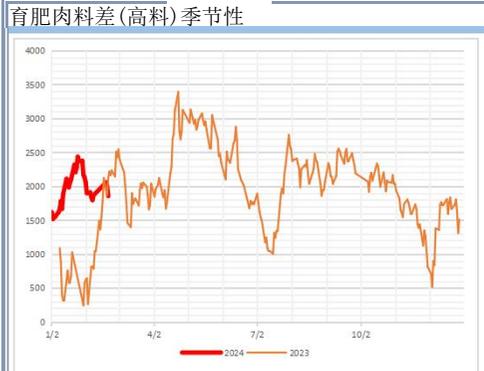
期内最大值: 3391.0000

期内平均值: 1917.9690

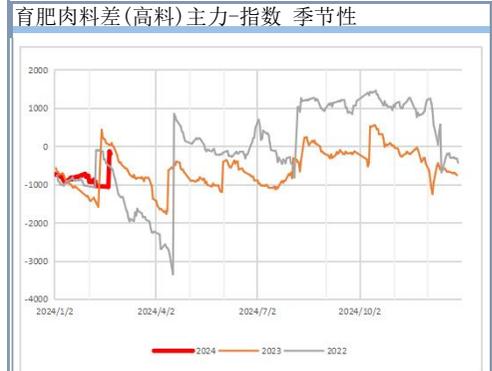
当前分位值: 51.16%



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: 2019/2/22

数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: -745.0200

期内最大值: 58.2450

期内平均值: -215.6398

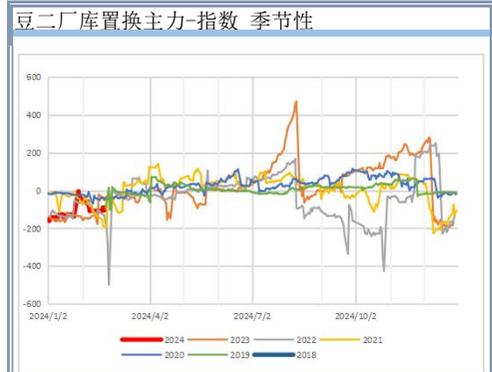
当前分位值: 92.60%



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: 2019/2/22

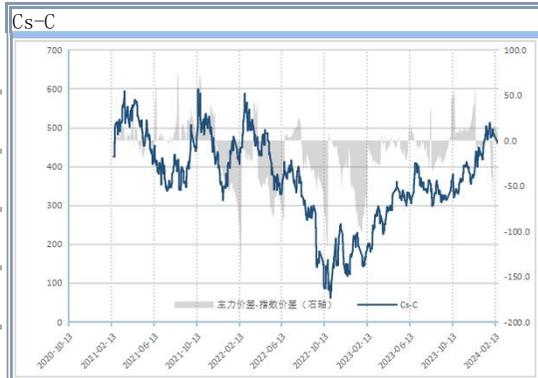
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: 62.0000

期内最大值: 598.0000

期内平均值: 366.6680

当前分位值: 74.25%



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: 2019/2/22

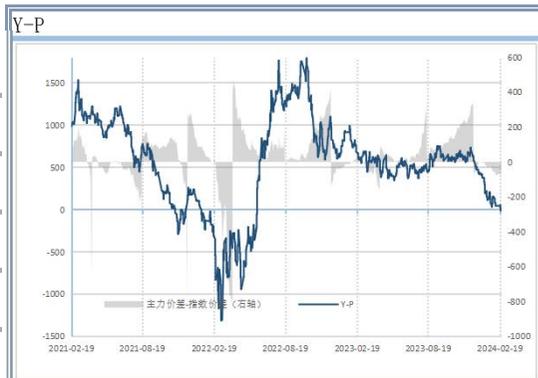
数据截止日: 2024/2/21

期内最小值: -1313.0000

期内最大值: 1788.0000

期内平均值: 551.0645

当前分位值: 41.89%



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： 2019/2/22

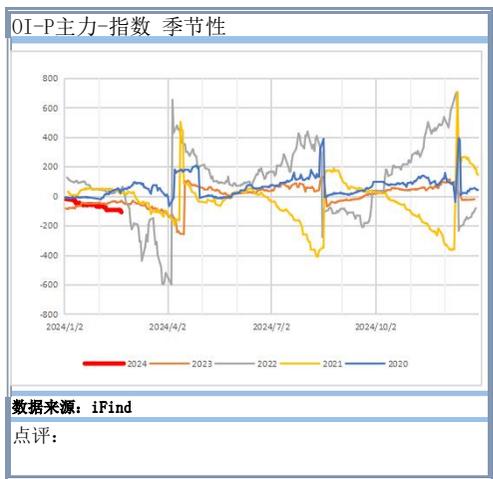
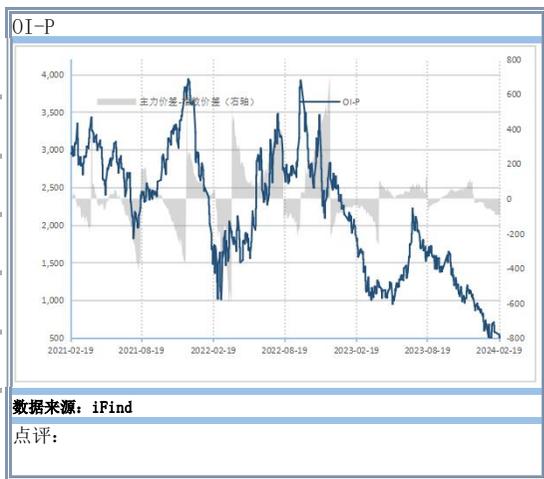
数据截止日： 2024/2/21

期内最小值： 459.0000

期内最大值： 3919.0000

期内平均值： 1692.0142

当前分位值： 0.00%



**免责声明**

本报告由山金期货研究部制作，未获得山金期货有限公司的书面授权，任何人和单位不得对本报告进行任何形式的修改、发布和复制。本报告基于本公司期货研究人员采用可信的公开资料和实地调研资料，但本公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，且本报告中的资料、建议、预测均反映报告初次发布时的判断，可能会随时调整，报告中的信息或所表达的意见不构成投资、法律、会计或税务的最终操作建议，本公司不就报告中的内容对最终操作建议作任何担保。在山金期货有限公司及其研究人员知情的范围内，山金期货有限公司及其期货研究人员以及财产上的利害关系人与所评价或推荐的产品不存在任何利害关系，同时提醒期货投资者，期市有风险，入市须谨慎，了解市场风险，投资量力而行。