

<http://www.shanlingh.com>

盘面套利观察

制作：曹有明

2024年3月6日

投资咨询： Z0013162

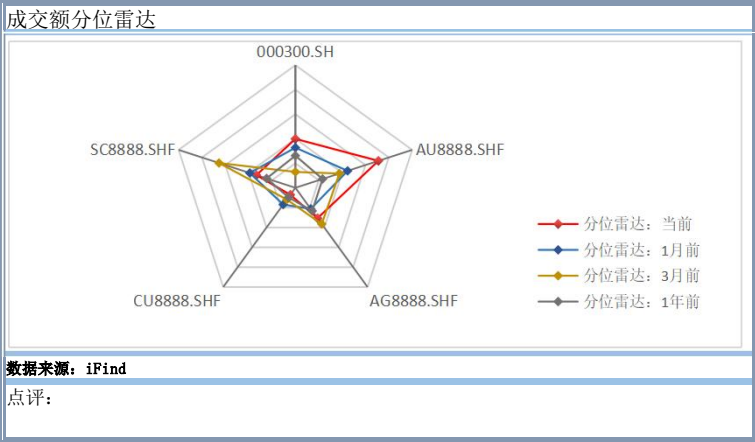
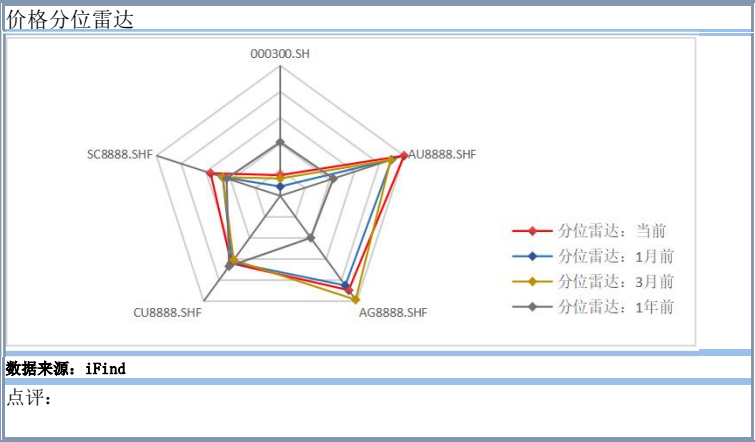
邮箱： caoyouming@sd-gold.com

数据仅供参考，据此入市，风险自负。

说明：

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

一、宏观观察



数据起始日: 2019/3/6

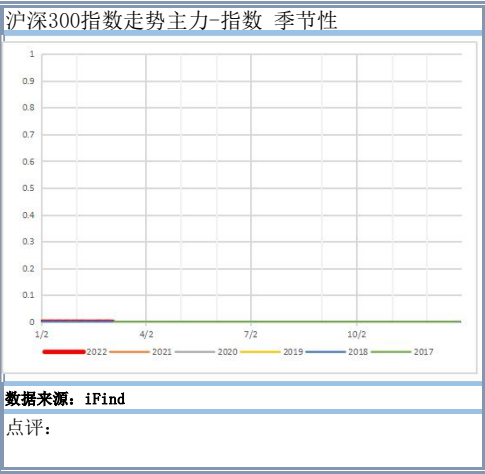
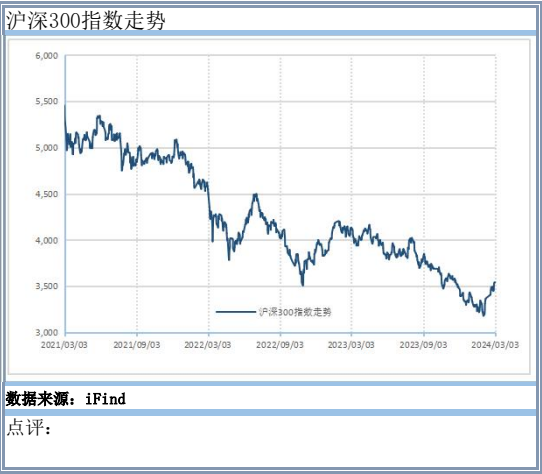
数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: 3179.6276

期内最大值: 5452.2125

期内平均值: 4244.2956

当前分位值: 13.34%



数据起始日： 2019/3/6

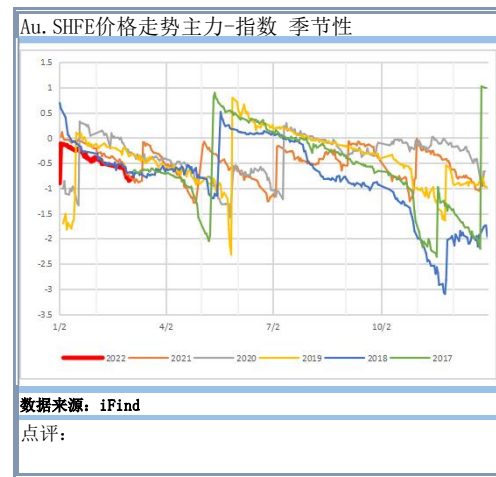
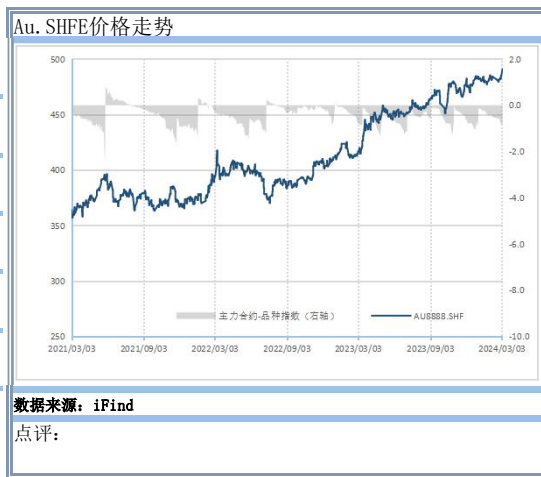
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 356.92

期内最大值： 490.89

期内平均值： 411.7917

当前分位值： 100.00%



数据起始日： 2019/3/6

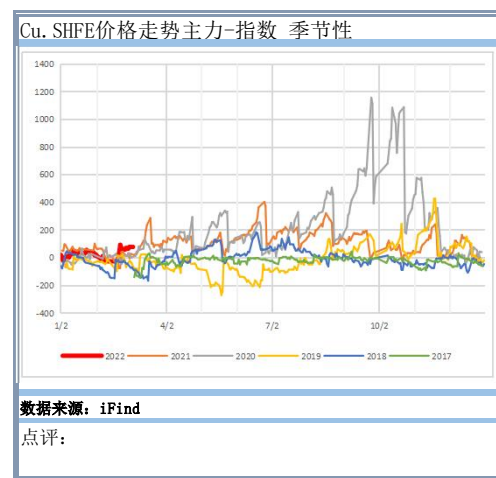
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 53367

期内最大值： 77934

期内平均值： 68079.2866

当前分位值： 64.02%



数据起始日: 2019/3/6

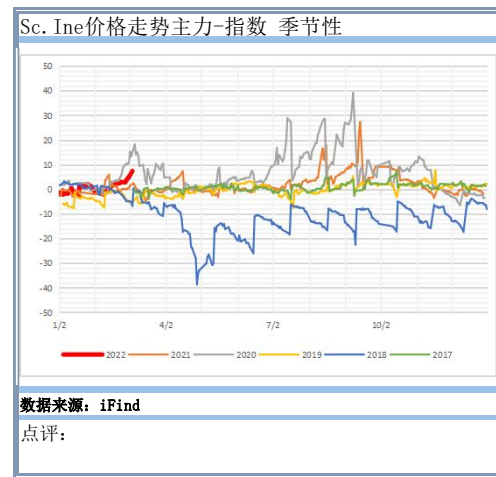
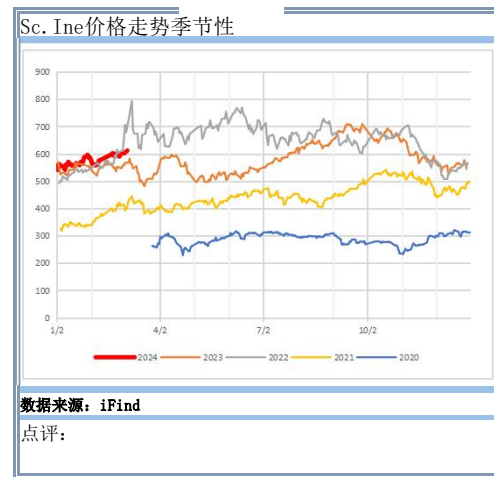
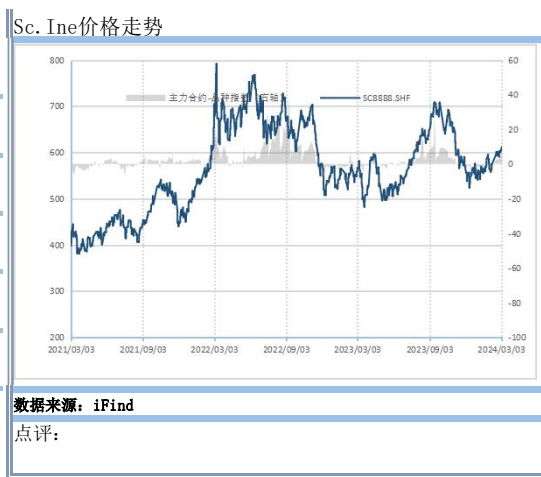
数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: 380.7

期内最大值: 791.6

期内平均值: 563.9680

当前分位值: 56.19%



数据起始日: 2019/3/6

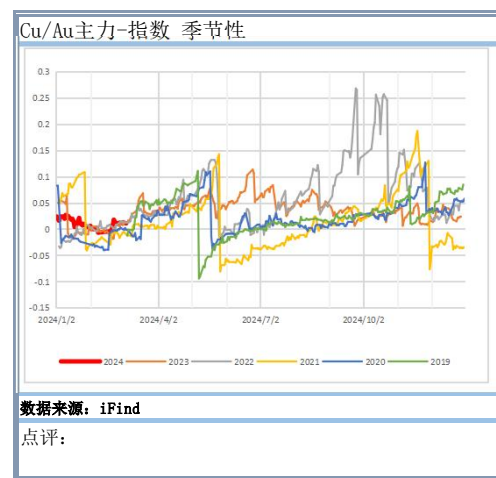
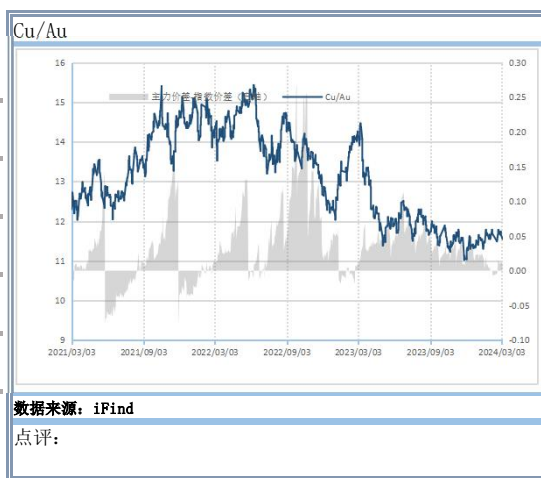
数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: 11.0218

期内最大值: 15.4319

期内平均值: 13.1321

当前分位值: 11.94%



数据起始日： 2019/3/6

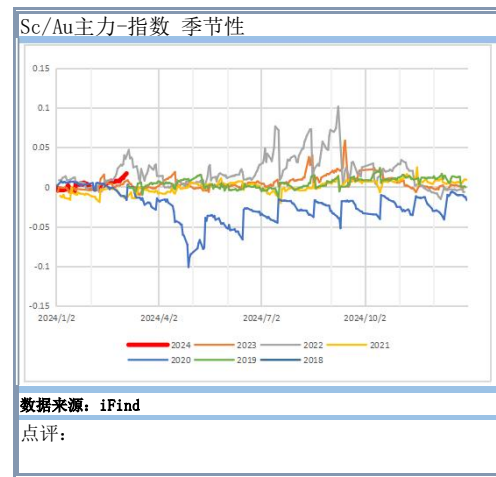
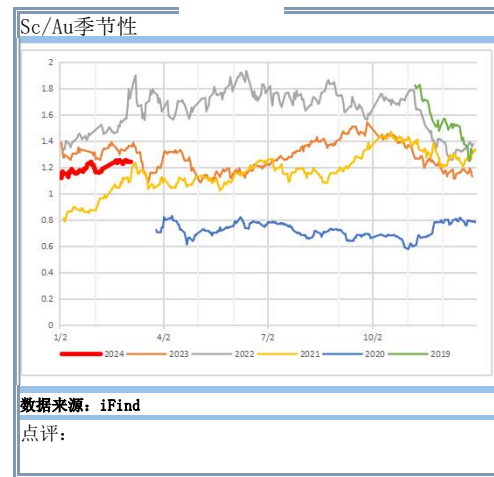
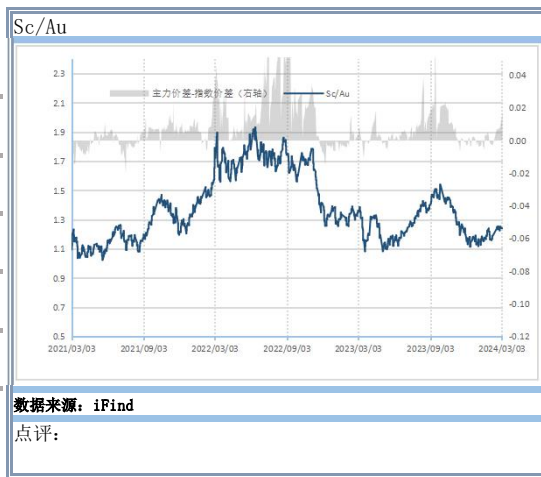
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 1.0233

期内最大值： 1.9320

期内平均值： 1.3739

当前分位值： 24.50%



数据起始日： 2019/3/6

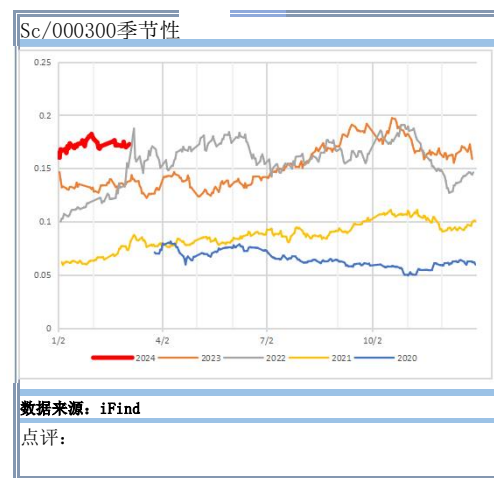
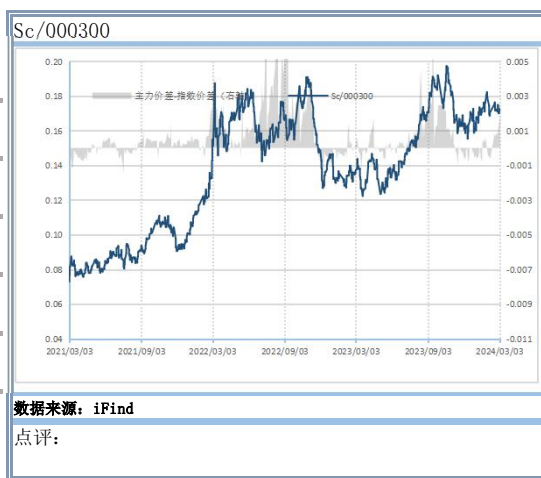
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 0.0730

期内最大值： 0.1972

期内平均值： 0.1370

当前分位值： 80.31%



数据起始日： 2019/3/6

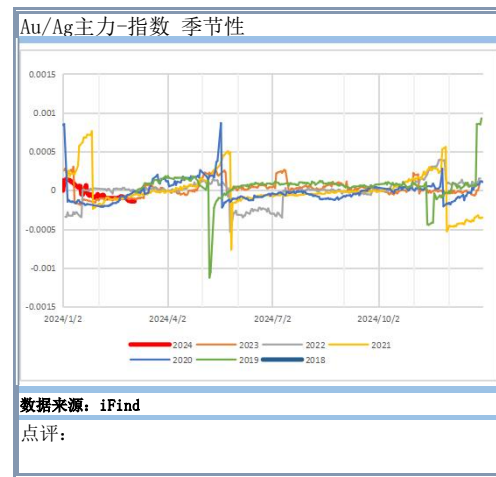
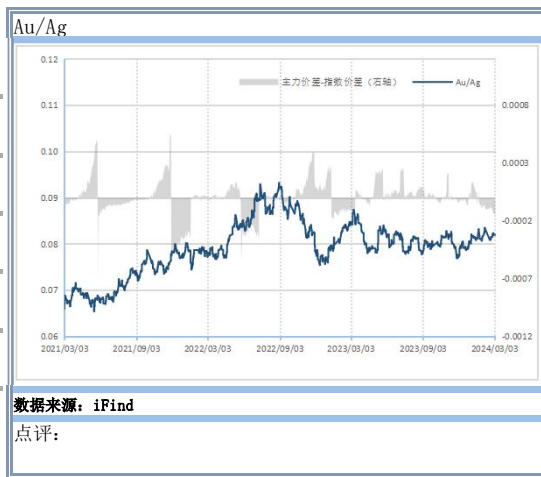
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 0.0654

期内最大值： 0.0932

期内平均值： 0.0791

当前分位值： 59.93%



数据起始日： 2019/3/6

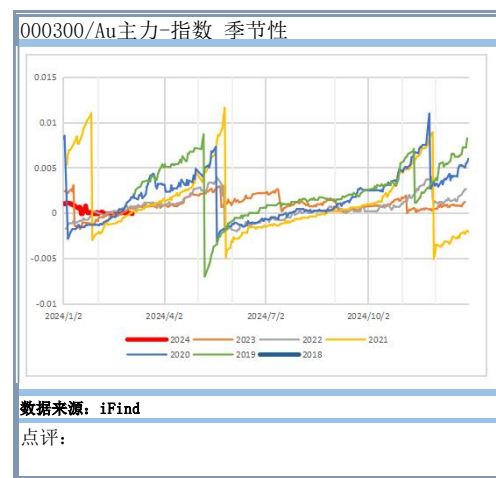
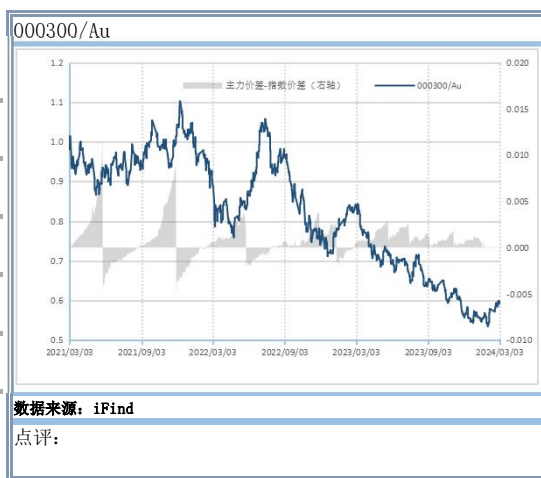
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 0.5351

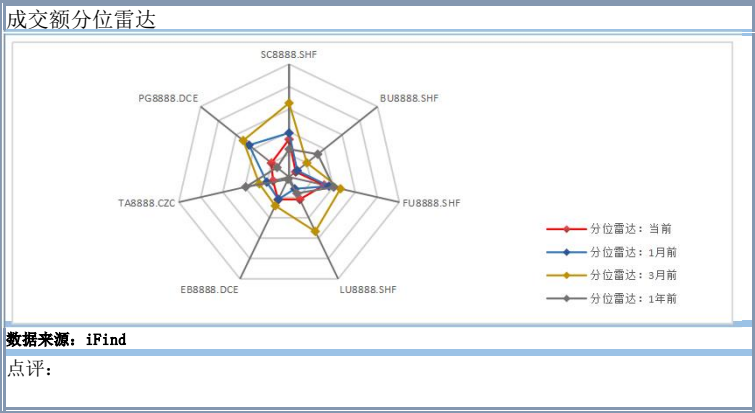
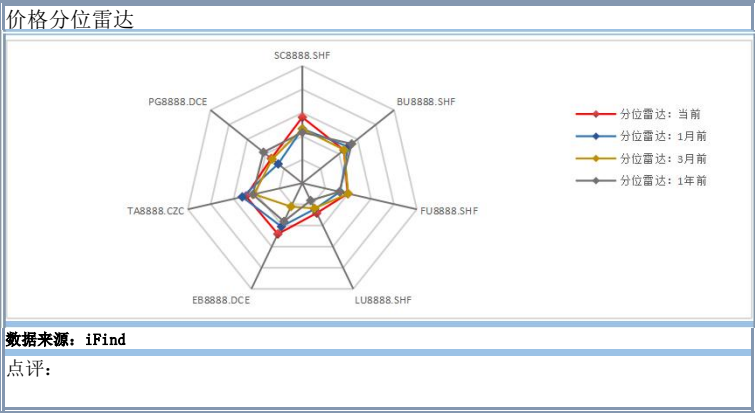
期内最大值： 1.1021

期内平均值： 0.8231

当前分位值： 10.00%



二、原油相关



数据起始日: 2019/3/6

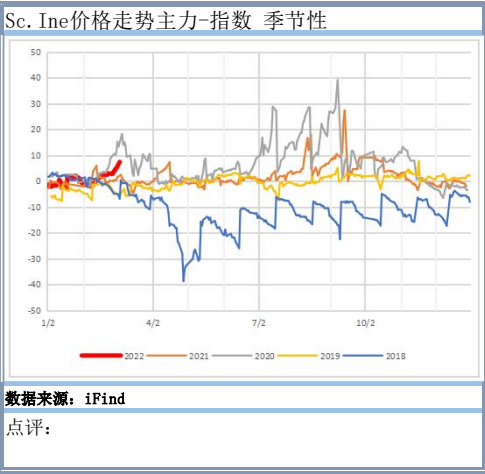
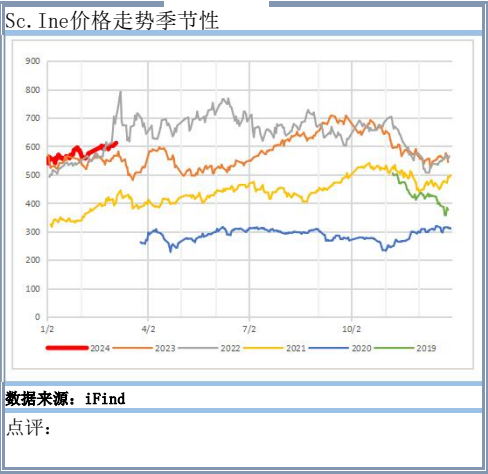
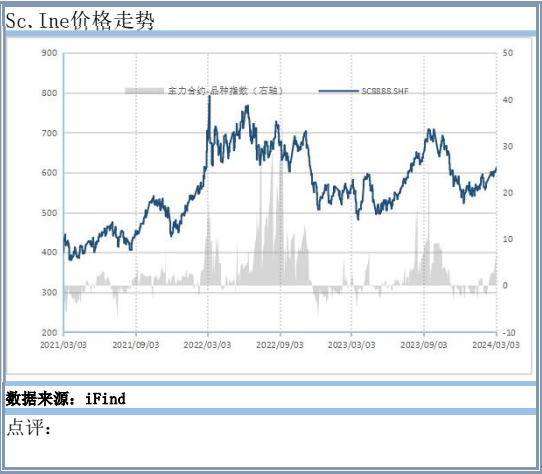
数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: 380.7

期内最大值: 791.6

期内平均值: 563.9680

当前分位值: 56.19%



数据起始日: 2019/3/6

数据截止日: 2024/3/4

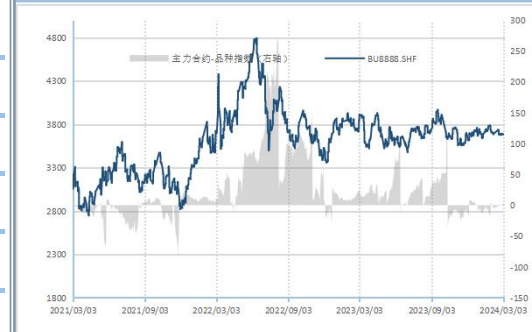
期内最小值: 2748

期内最大值: 4794

期内平均值: 3599.2853

当前分位值: 45.31%

Bu. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

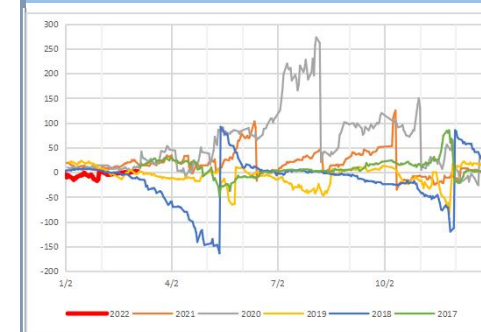
Bu. SHFE价格走势季节性



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: 2019/3/6

数据截止日: 2024/3/4

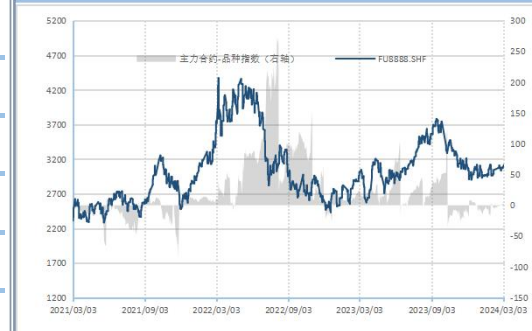
期内最小值: 2284

期内最大值: 4371

期内平均值: 3029.6789

当前分位值: 39.72%

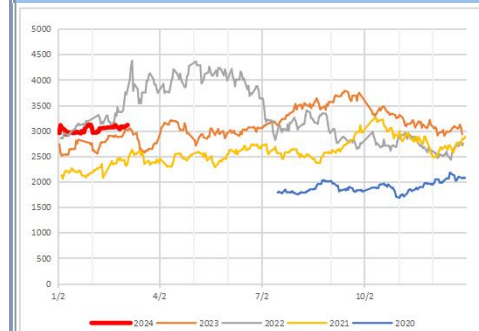
Fu. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

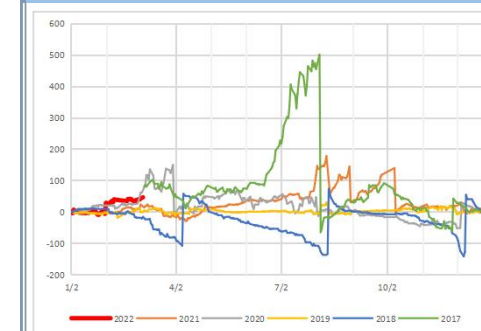
Fu. SHFE价格走势季节性



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

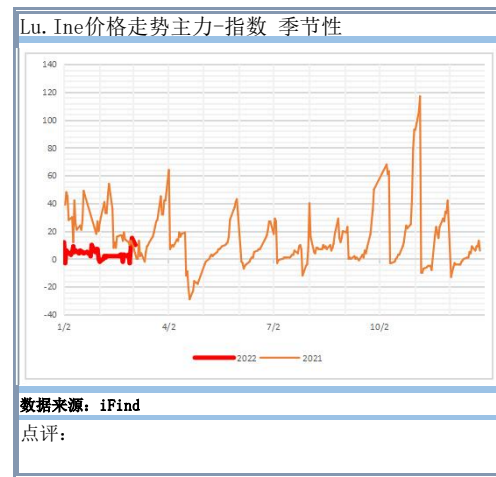
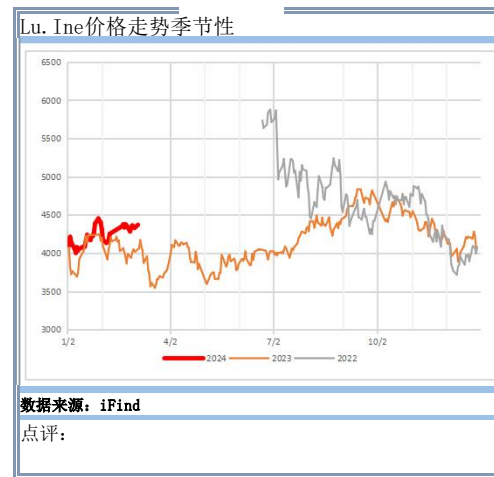
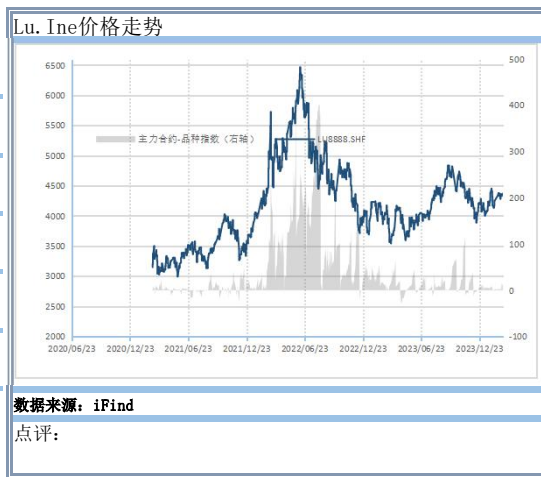
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 3544

期内最大值： 6464

期内平均值： 4376.2282

当前分位值： 28.25%



数据起始日： 2019/9/26

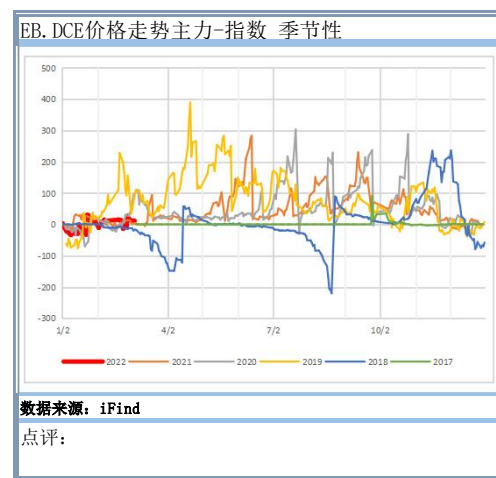
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 6978

期内最大值： 11361

期内平均值： 8654.5990

当前分位值： 48.03%



数据起始日： 2019/3/6

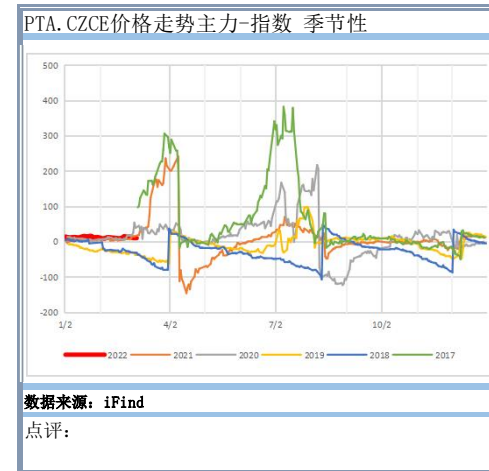
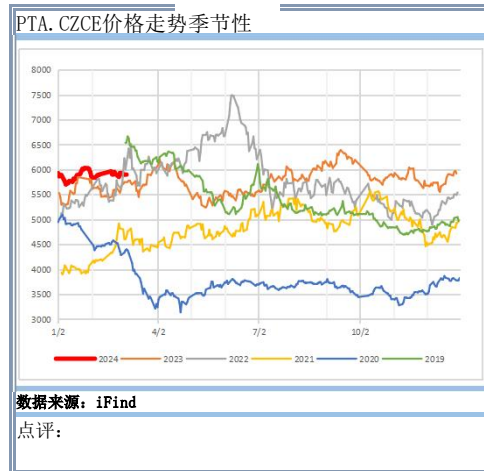
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 4356

期内最大值： 7488

期内平均值： 5533.4115

当前分位值： 49.33%



数据起始日： 2020/3/30

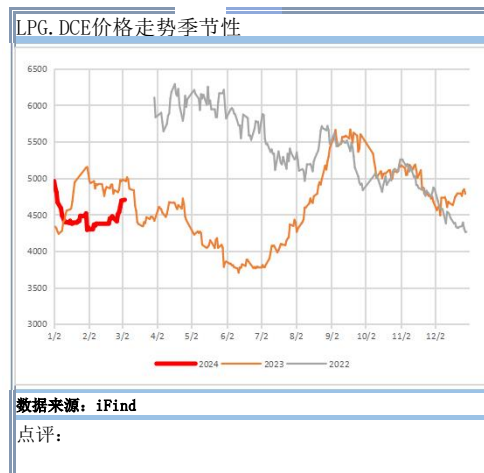
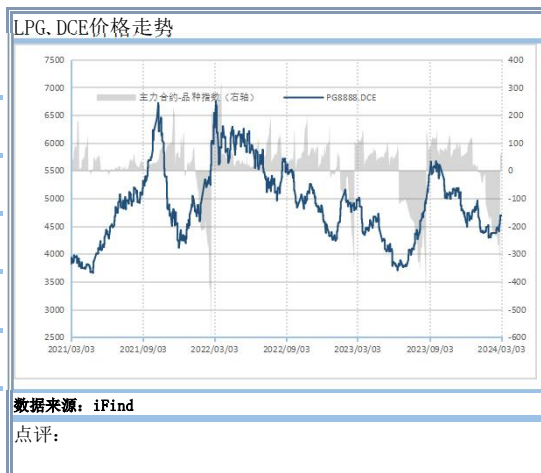
数据截止日： 2024/3/4

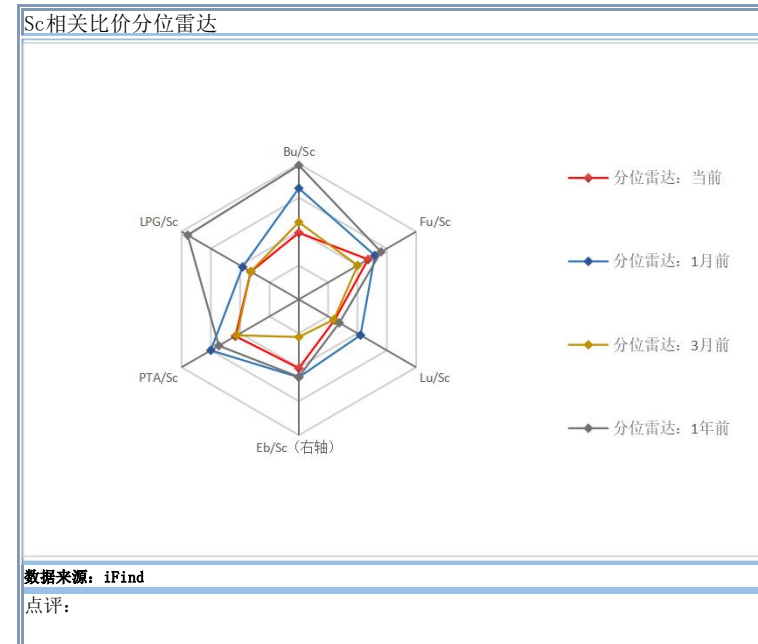
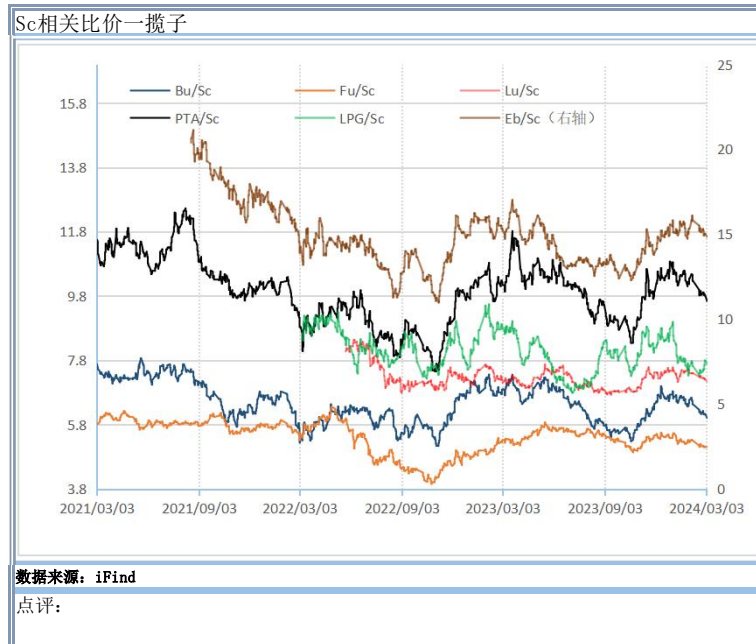
期内最小值： 3704

期内最大值： 6661

期内平均值： 4948.8299

当前分位值： 33.78%





数据起始日: 2019/3/6

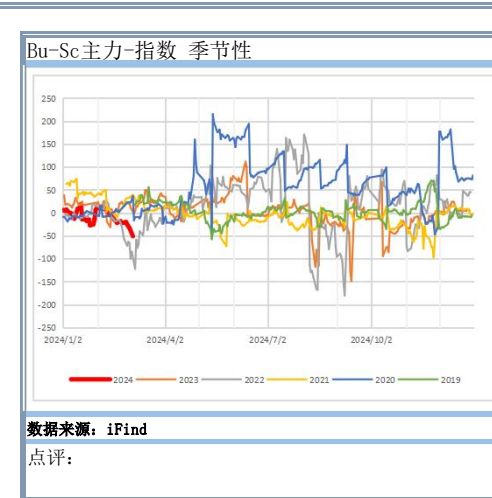
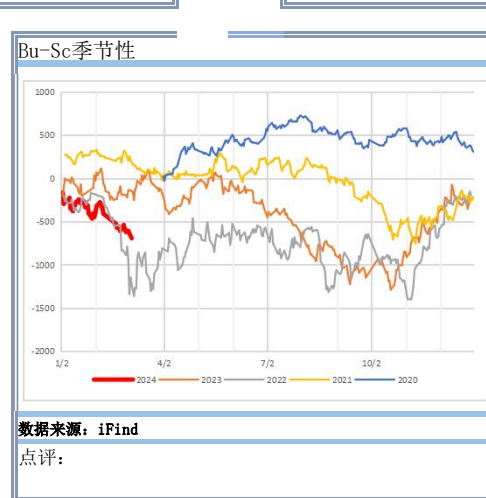
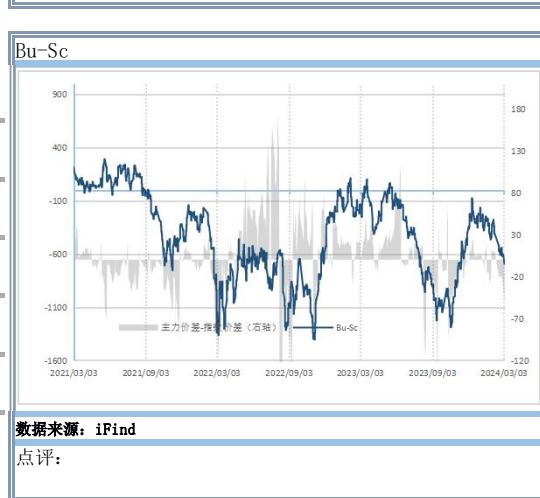
数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: -1406.4286

期内最大值: 289.5714

期内平均值: -429.0578

当前分位值: 42.03%



数据起始日: 2019/3/6

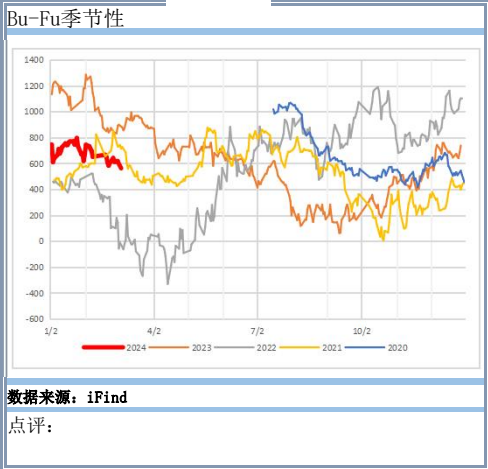
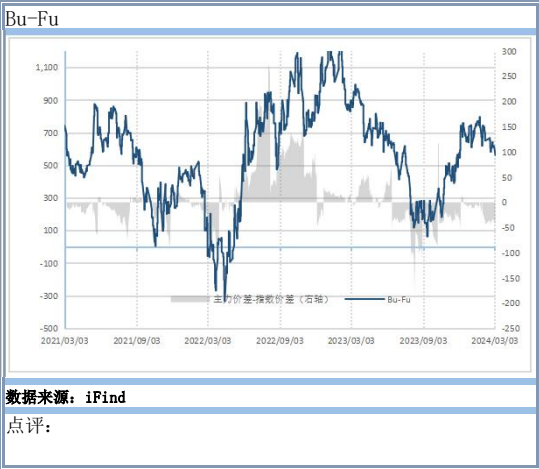
数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: -331.0000

期内最大值: 1284.0000

期内平均值: 569.6064

当前分位值: 55.29%



数据起始日: 2021/9/4

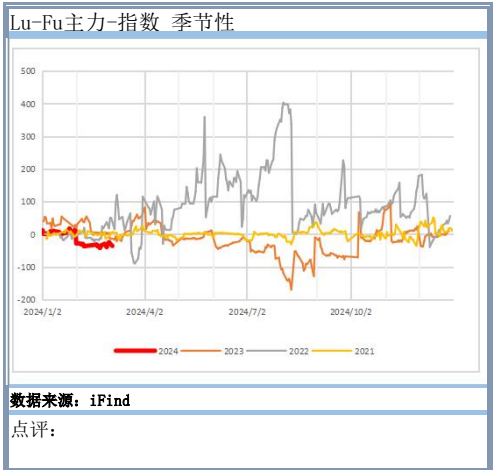
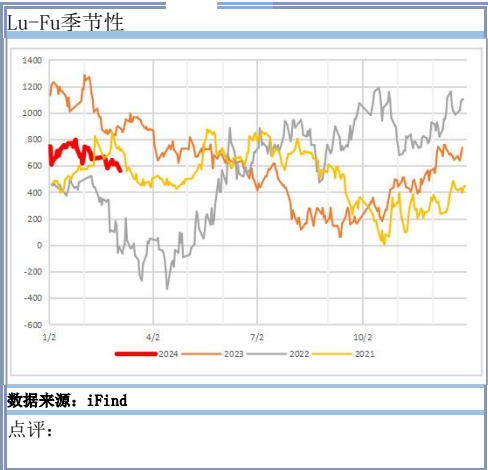
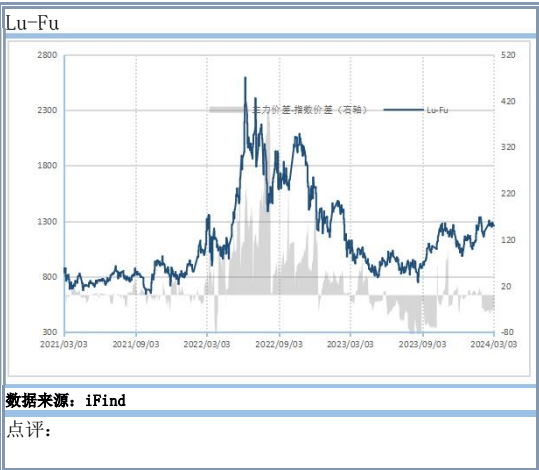
数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: 749.0000

期内最大值: 2592.0000

期内平均值: 1305.9082

当前分位值: 27.51%



数据起始日: 2021/7/10

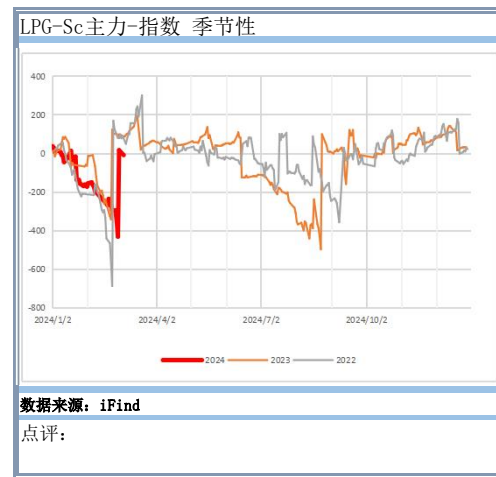
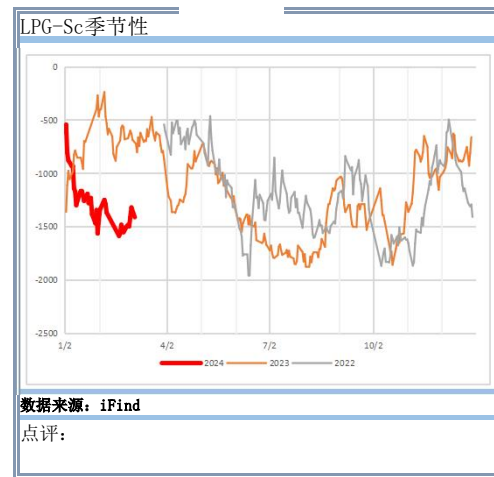
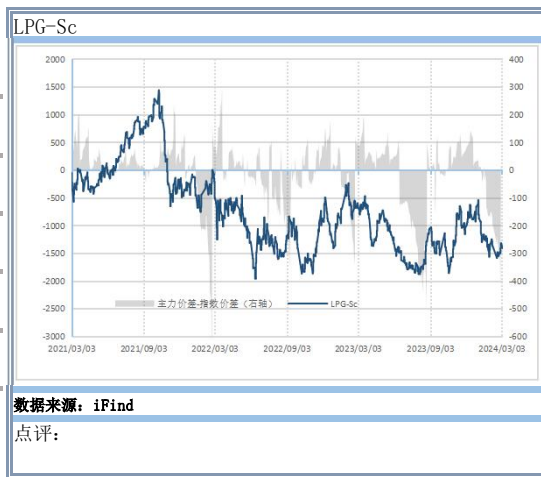
数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: -1959.0000

期内最大值: -240.0000

期内平均值: -1167.5207

当前分位值: 31.76%



数据起始日: 2019/3/6

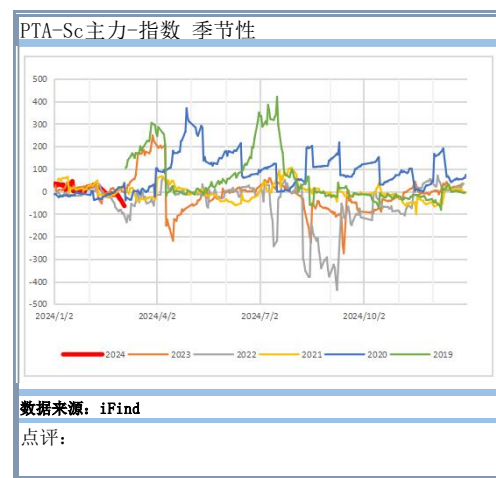
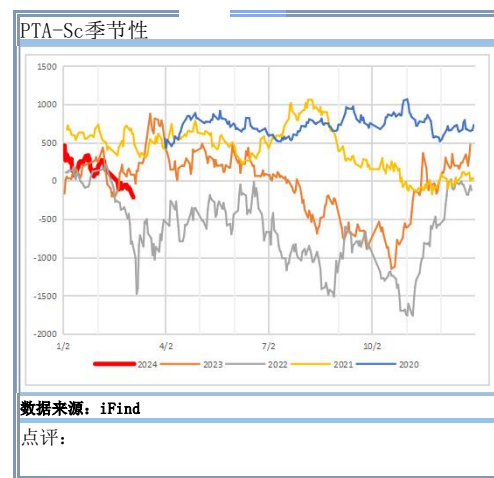
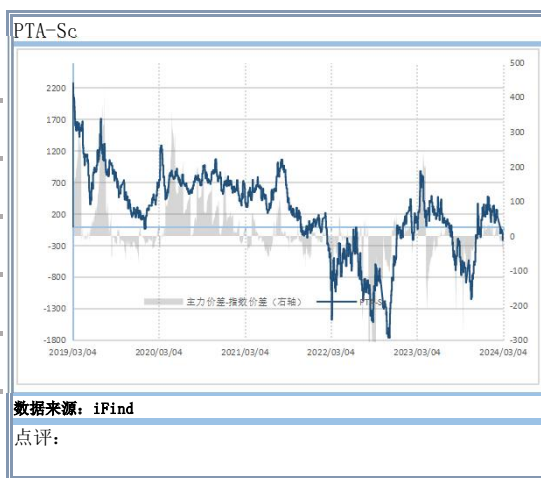
数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: -1762.0000

期内最大值: 1061.0000

期内平均值: -106.2689

当前分位值: 54.80%



数据起始日: 2021/3/12

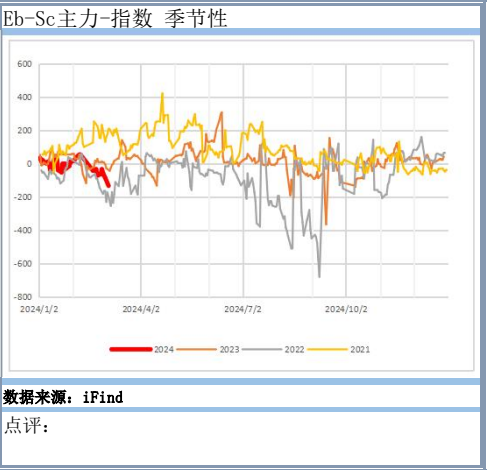
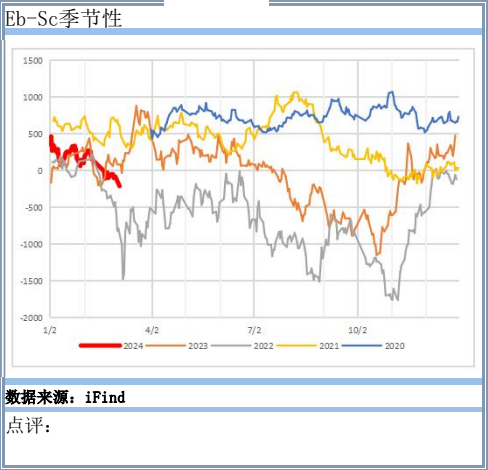
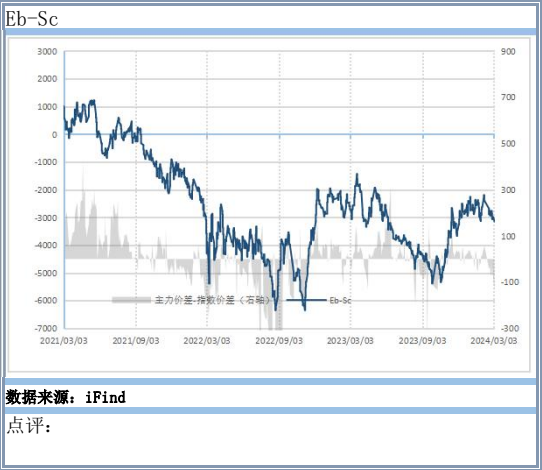
数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: -6347.0000

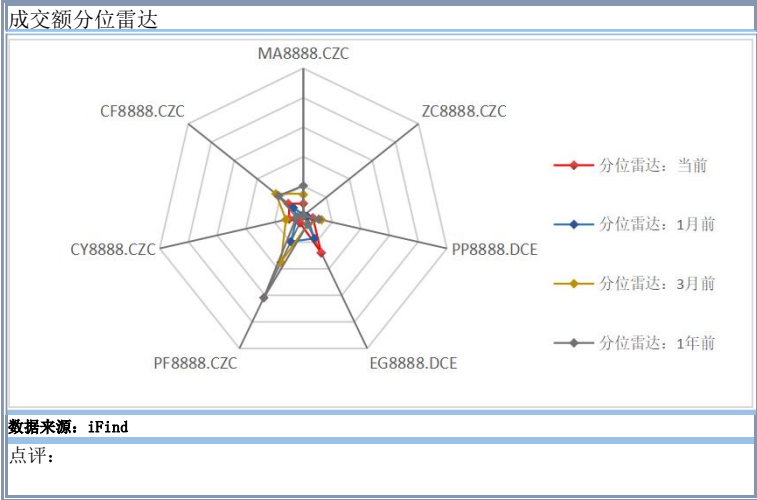
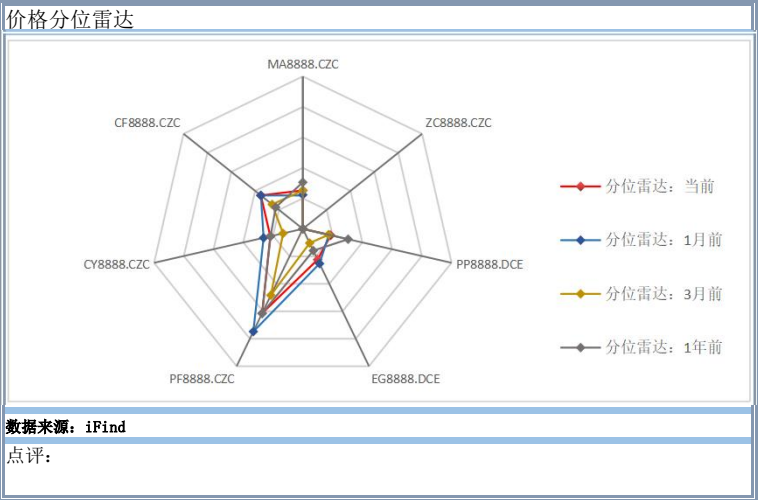
期内最大值: 238.0000

期内平均值: -3207.1381

当前分位值: 48.56%



三、煤化工相关



数据起始日: 2019/3/6

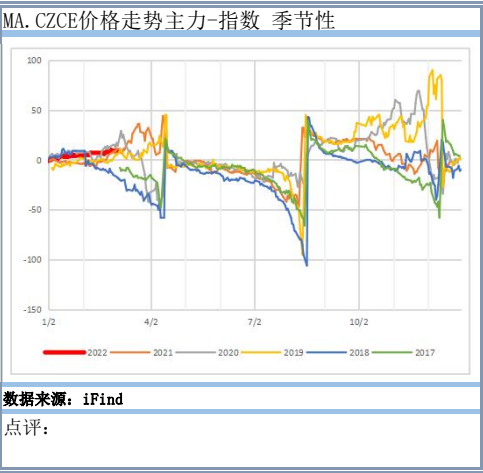
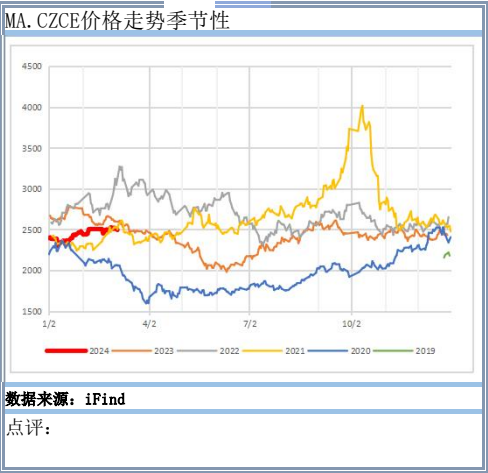
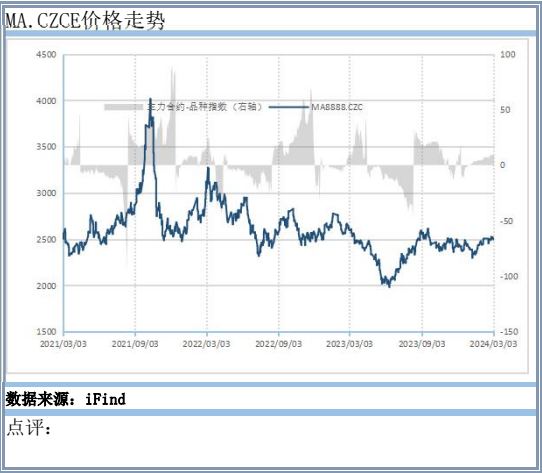
数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: 1982

期内最大值: 4015

期内平均值: 2588.3182

当前分位值: 25.23%



数据起始日： 2019/3/6

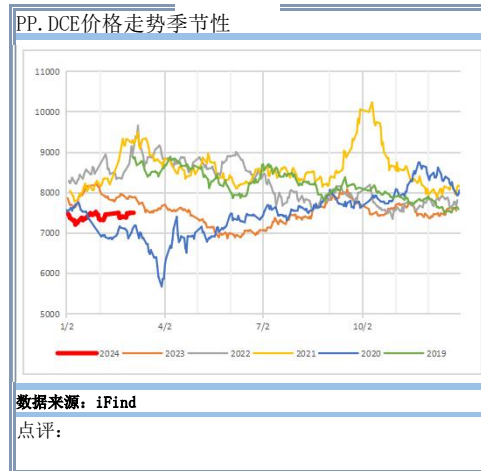
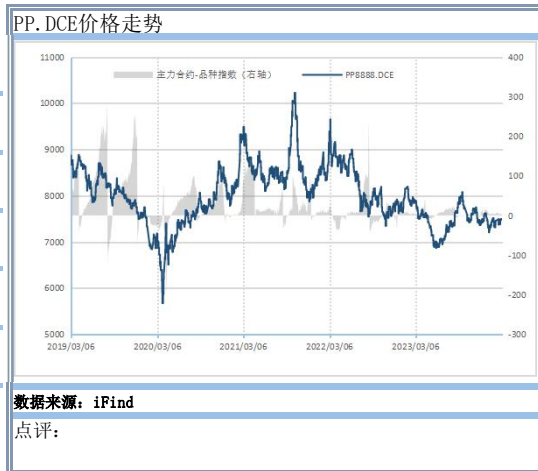
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 6865

期内最大值： 10224

期内平均值： 8051.4266

当前分位值： 18.70%



数据起始日： 2019/3/6

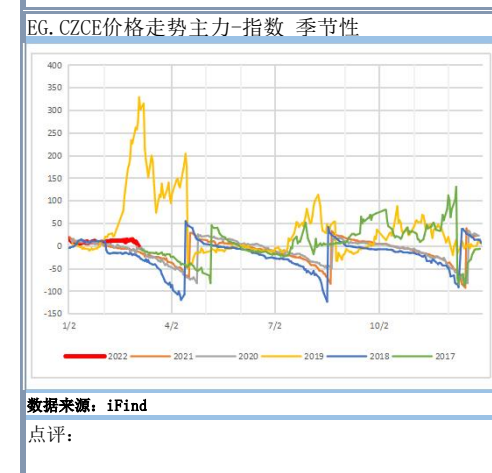
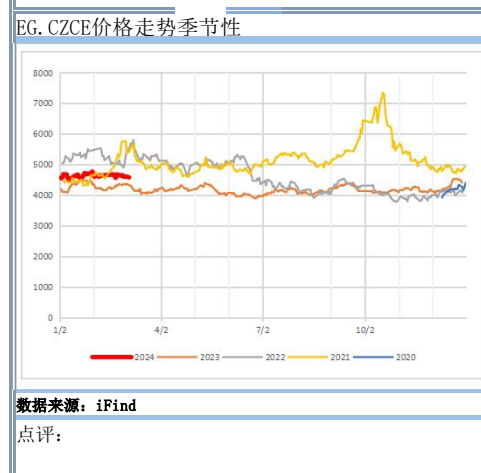
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 3778

期内最大值： 7345

期内平均值： 4625.7654

当前分位值： 22.40%



数据起始日: 2020/10/12

数据截止日: 2024/3/4

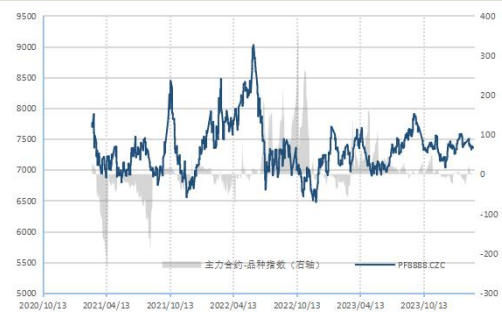
期内最小值: 6477

期内最大值: 7907

期内平均值: 7246.2833

当前分位值: 61.40%

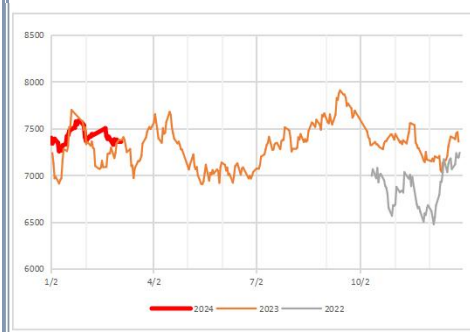
PF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

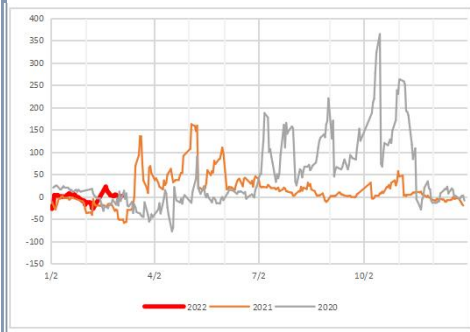
PF. CZCE价格走势季节性



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: 2019/3/6

数据截止日: 2024/3/4

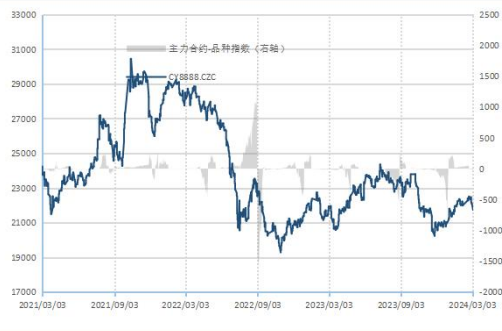
期内最小值: 19292

期内最大值: 30443

期内平均值: 23868.5706

当前分位值: 21.87%

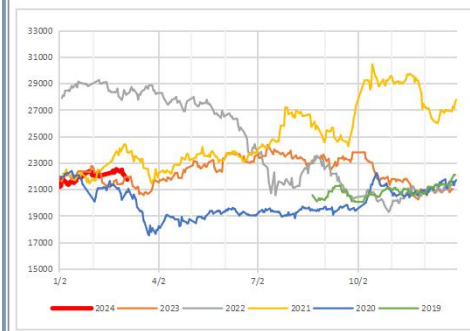
CY. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

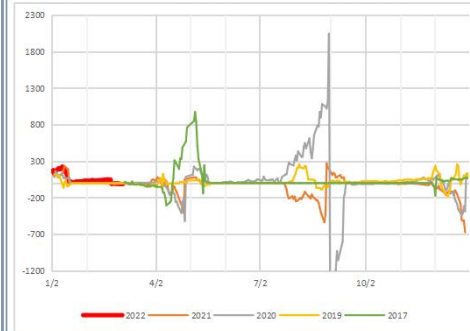
CY. CZCE价格走势季节性



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： 2019/3/6

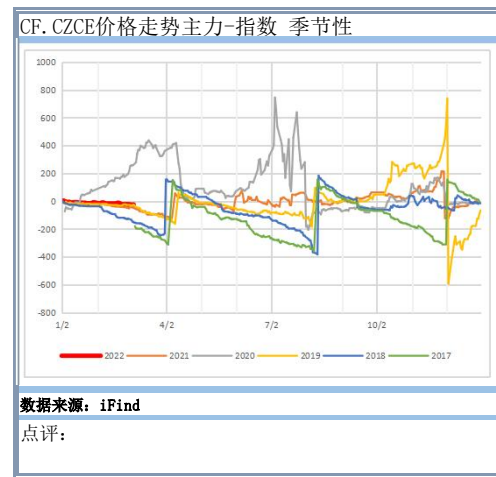
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 12447

期内最大值： 22574

期内平均值： 16879.8134

当前分位值： 35.19%



数据起始日： 2019/3/6

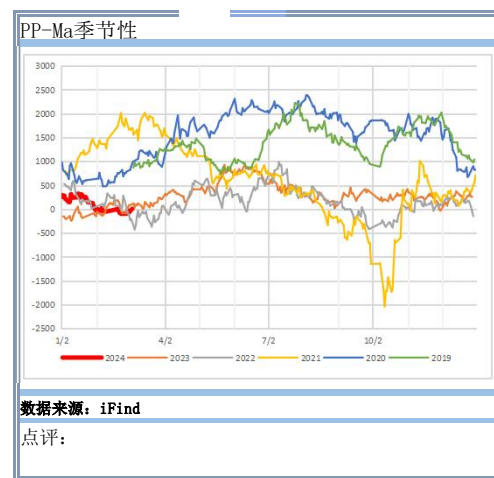
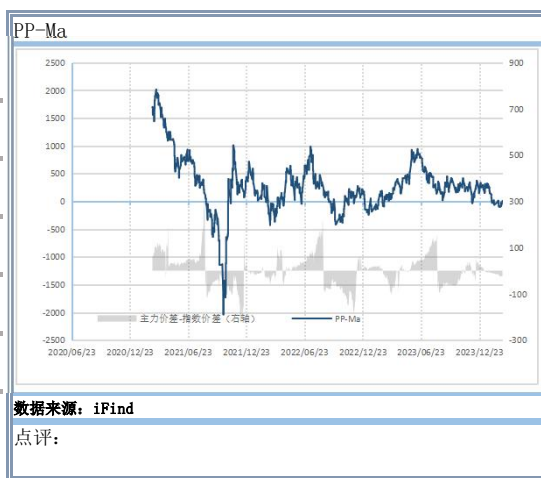
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： -2039.0000

期内最大值： 2013.0000

期内平均值： 286.4719

当前分位值： 50.52%



数据起始日： 2019/3/6

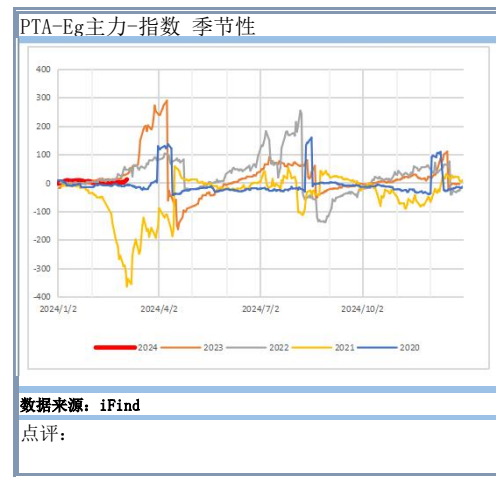
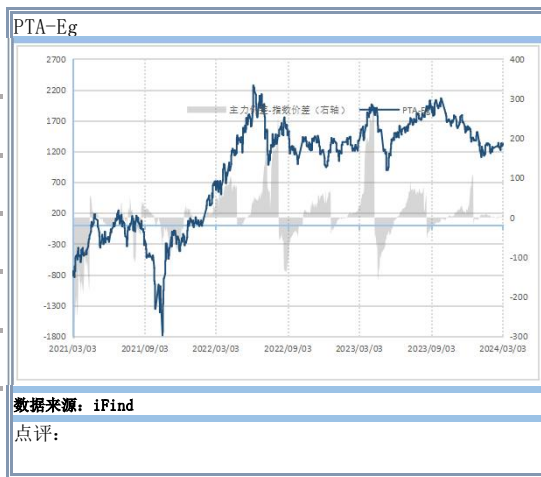
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： -1783.0000

期内最大值： 2269.0000

期内平均值： 907.6461

当前分位值： 76.68%



数据起始日： 2021/11/15

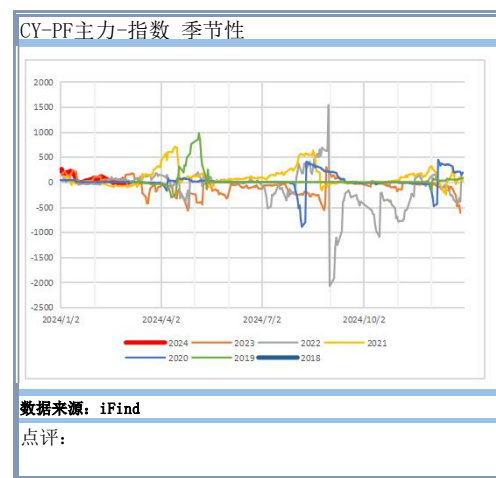
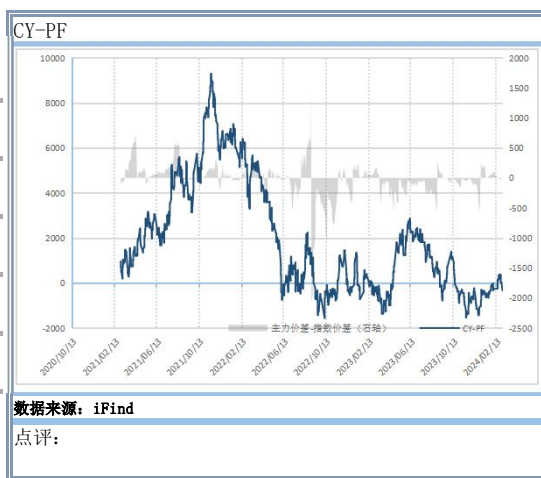
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： -1555.0000

期内最大值： 2854.0000

期内平均值： 208.7167

当前分位值： 27.69%



数据起始日: 2022/9/15

数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: -325.5650

期内最大值: 112.9900

期内平均值: -99.3412

当前分位值: 5.00%

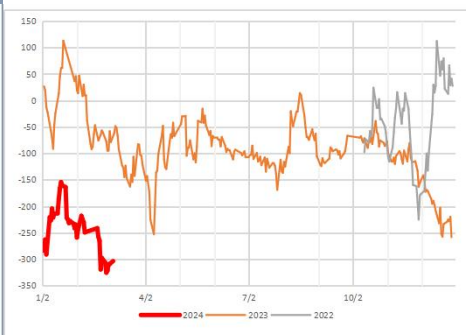
PF毛利



数据来源: iFind

点评:

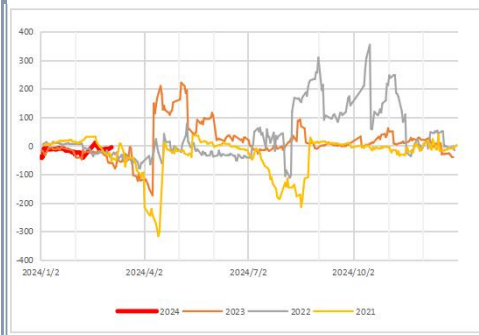
PF毛利季节性



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: 2019/3/6

数据截止日: 2024/3/4

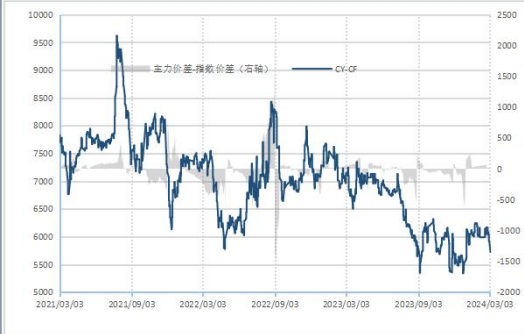
期内最小值: 5338.0000

期内最大值: 9616.0000

期内平均值: 6988.7572

当前分位值: 8.93%

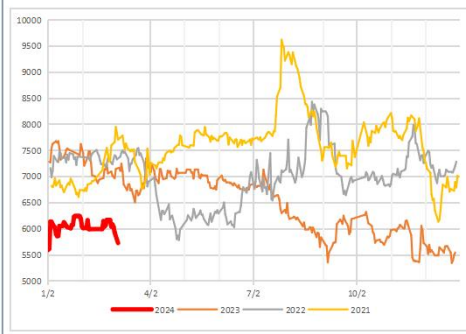
CY-CF



数据来源: iFind

点评:

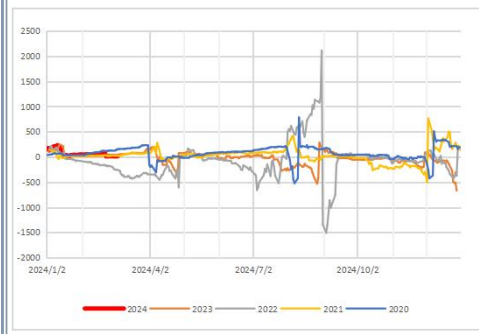
CY-CF季节性



数据来源: iFind

点评:

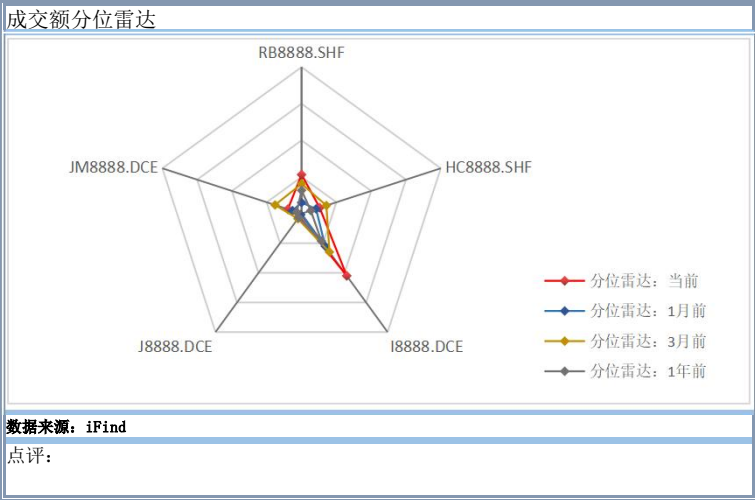
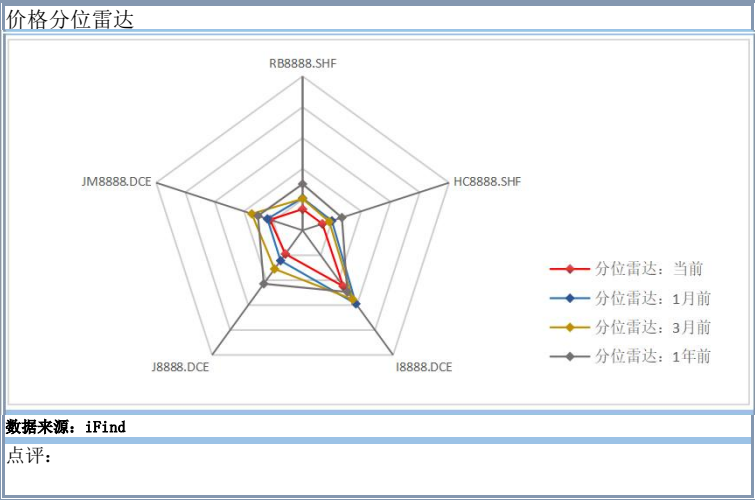
CY-CF主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

四、黑色相关



数据起始日: 2019/3/6

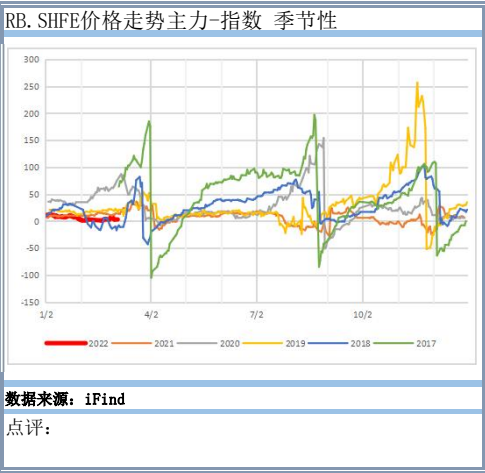
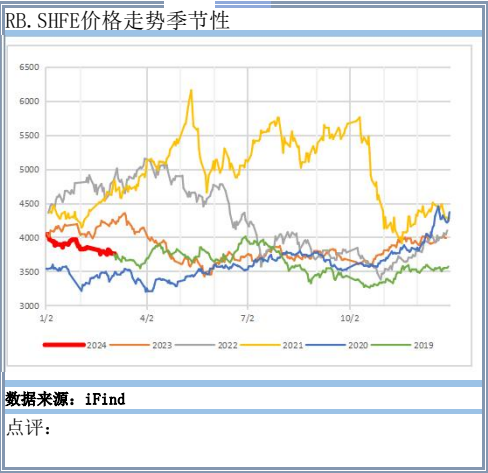
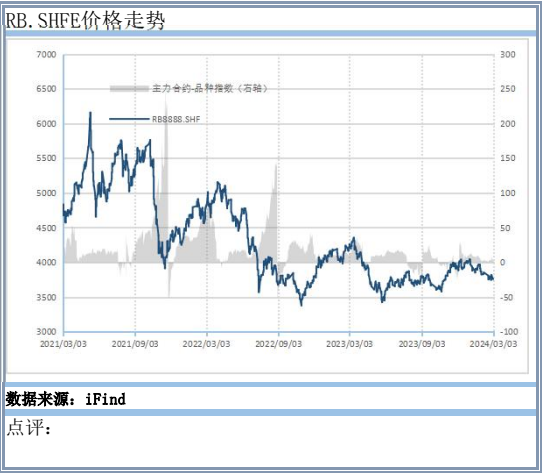
数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: 3377

期内最大值: 6158

期内平均值: 4315.5391

当前分位值: 13.77%



数据起始日： 2019/3/6

数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 3444

期内最大值： 6675

期内平均值： 4469.3525

当前分位值： 13.53%



数据起始日： 2019/3/6

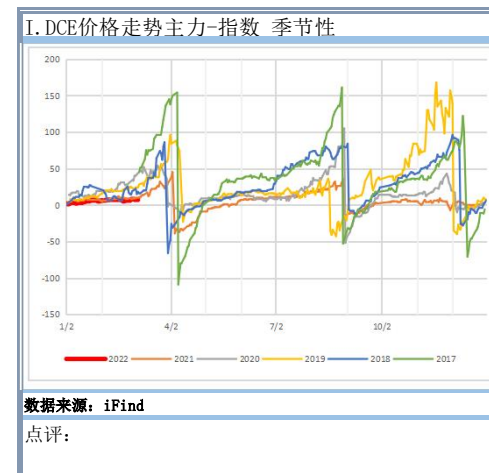
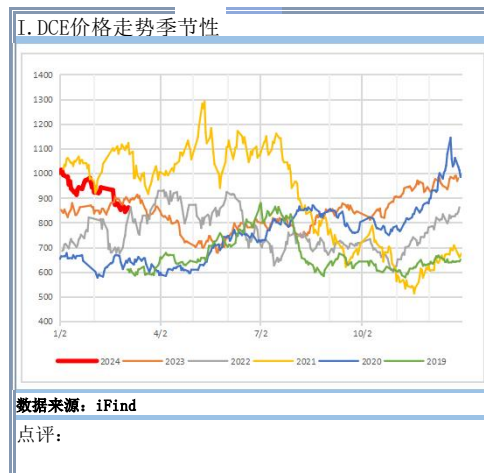
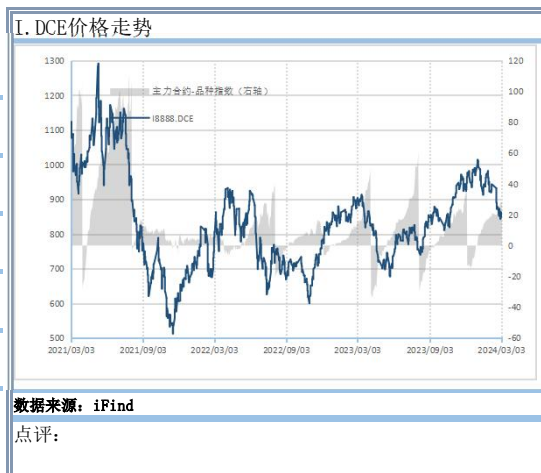
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 512.8

期内最大值： 1290.9

期内平均值： 830.3937

当前分位值： 44.85%



数据起始日： 2019/3/6

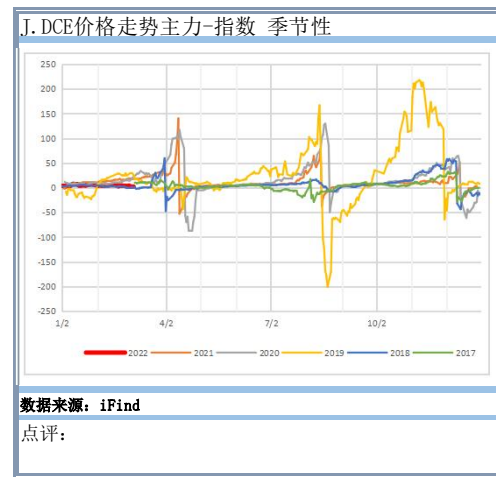
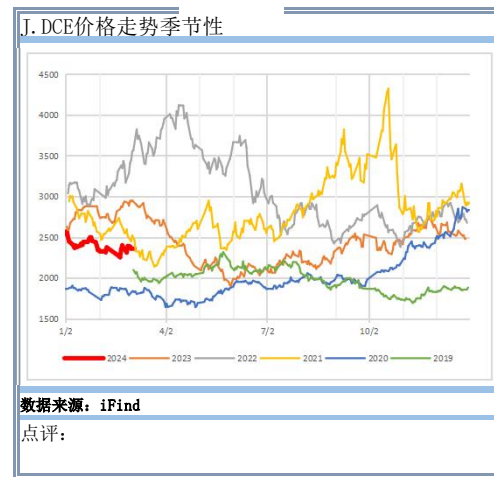
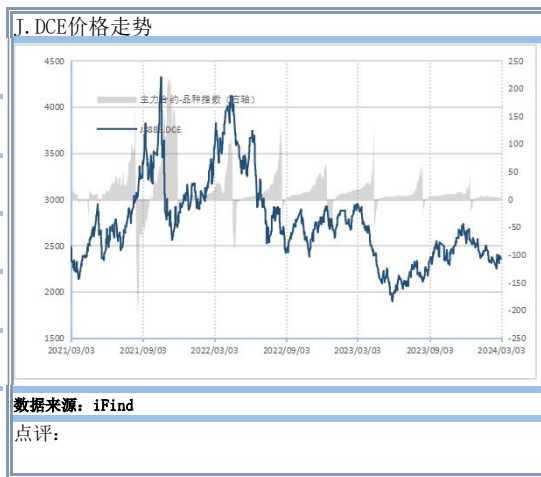
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 1897.9

期内最大值： 4320.8

期内平均值： 2751.3871

当前分位值： 18.98%



数据起始日： 2019/3/6

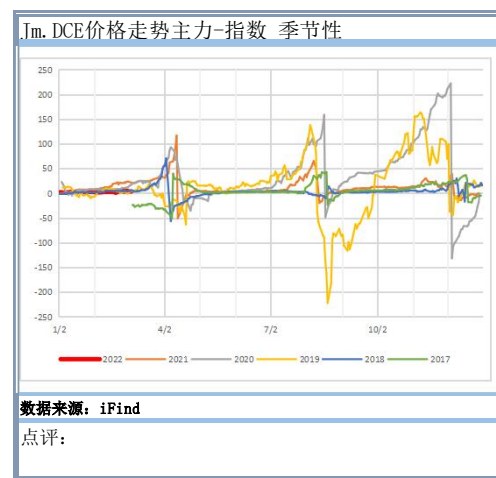
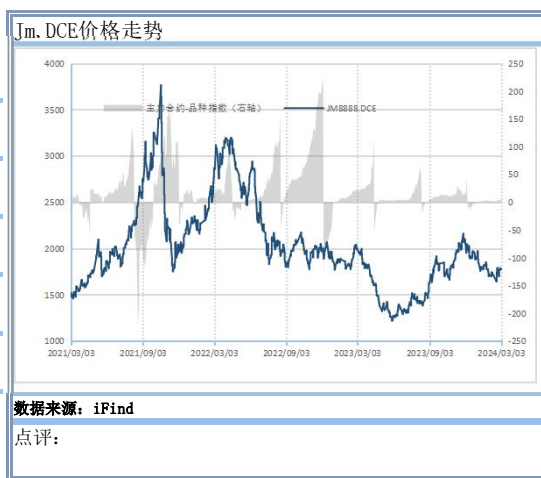
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 1219.4

期内最大值： 3764.7

期内平均值： 2024.0219

当前分位值： 22.26%



数据起始日： 2019/3/6

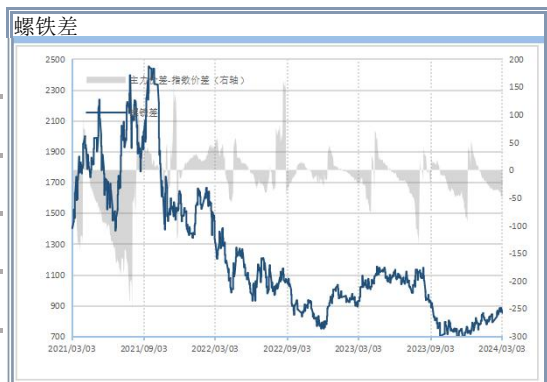
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 670.1176

期内最大值： 2451.8235

期内平均值： 1231.6755

当前分位值： 10.22%



数据起始日： 2019/3/6

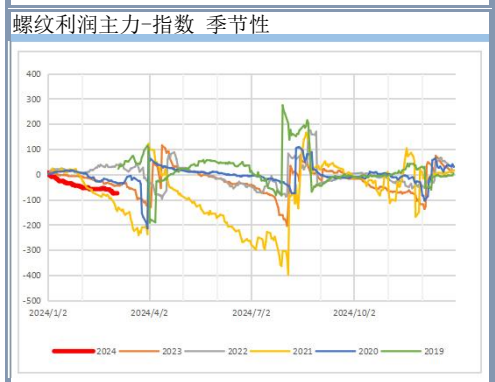
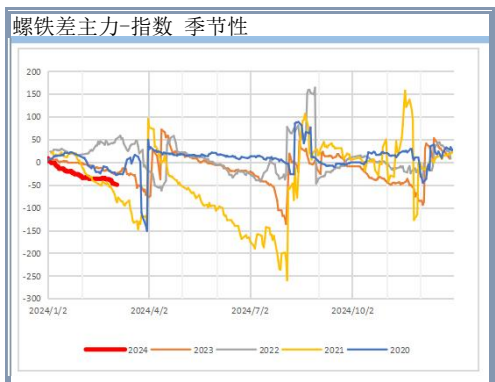
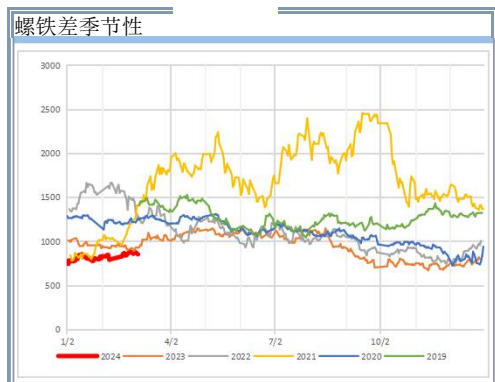
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： -1206.9091

期内最大值： 810.0000

期内平均值： -450.4320

当前分位值： 23.46%



数据起始日： 2019/3/6

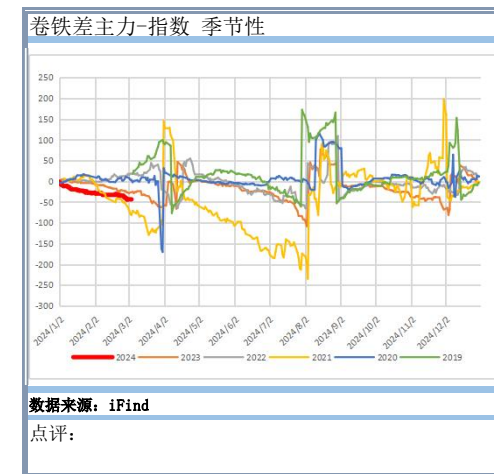
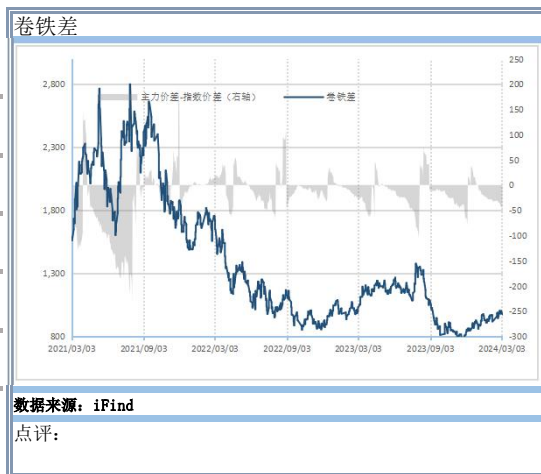
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 752.4706

期内最大值： 2799.4118

期内平均值： 1385.4889

当前分位值： 10.79%



数据起始日： 2019/3/6

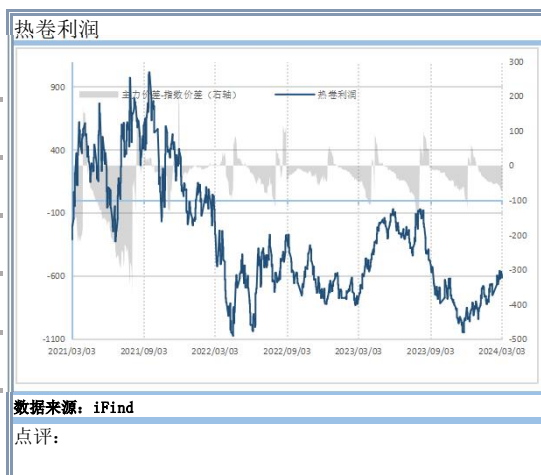
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： -1073.7273

期内最大值： 1014.0000

期内平均值： -296.6185

当前分位值： 22.08%



数据起始日： 2019/3/6

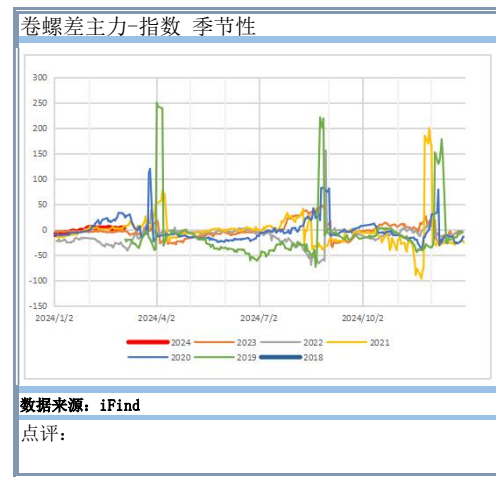
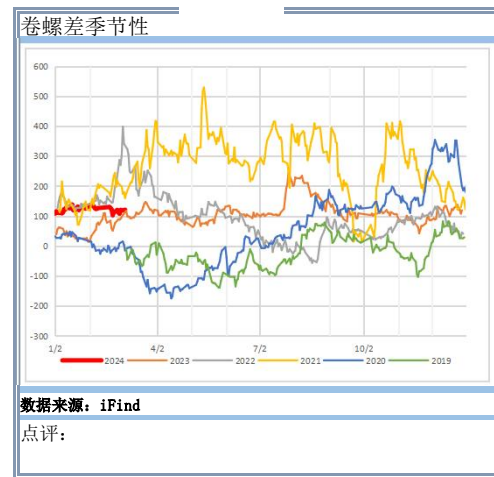
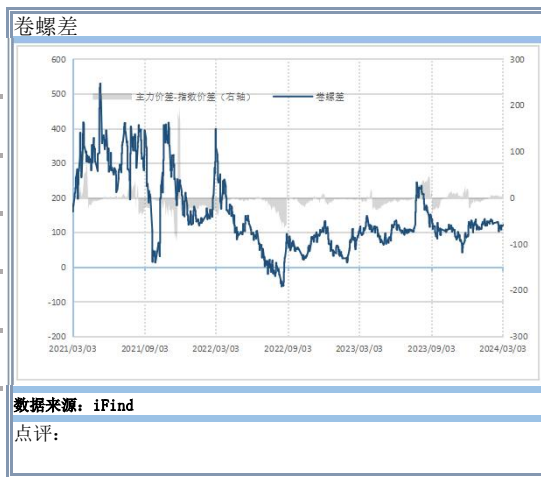
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： -56.0000

期内最大值： 529.0000

期内平均值： 153.8134

当前分位值： 30.26%



数据起始日： 2019/3/6

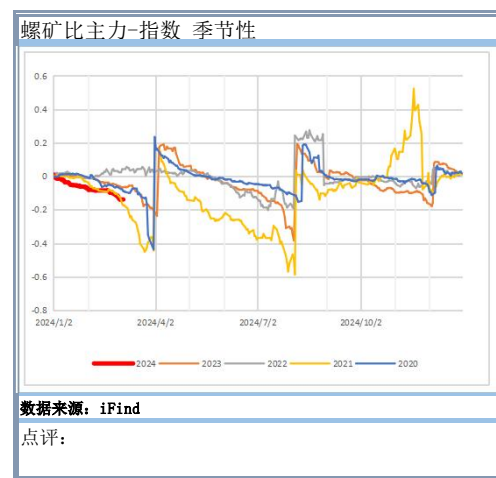
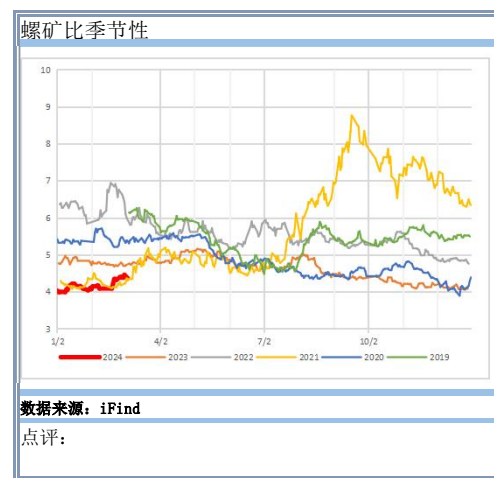
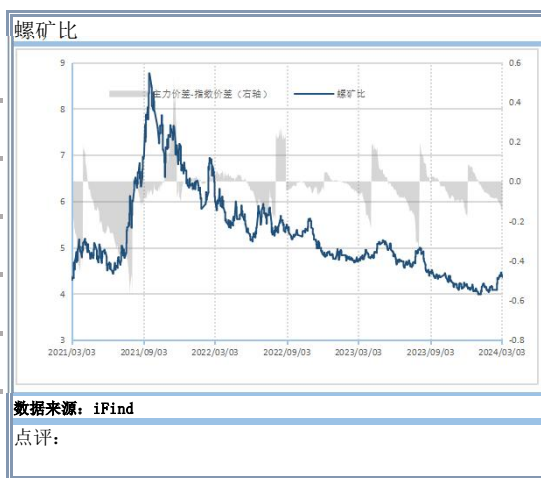
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 3.9880

期内最大值： 8.7631

期内平均值： 5.2913

当前分位值： 7.85%



数据起始日: 2019/3/6

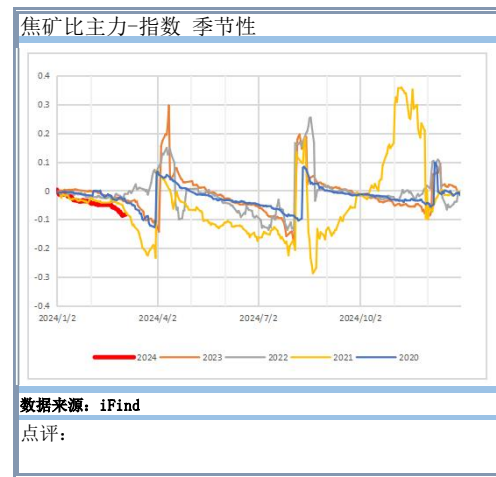
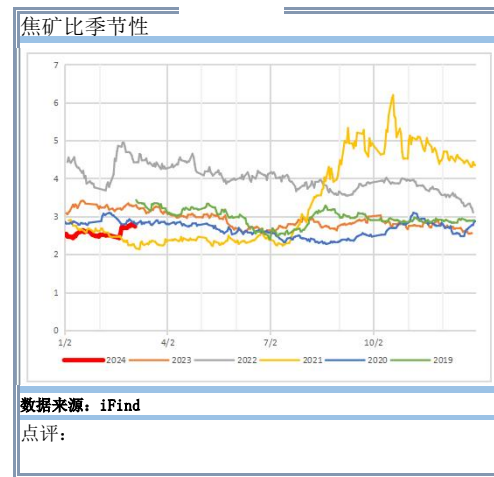
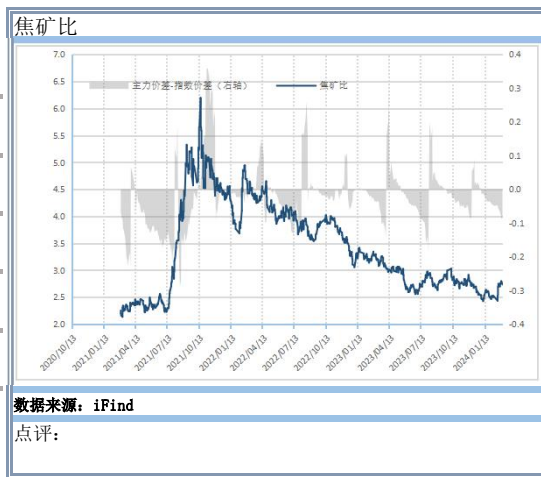
数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: 2.1354

期内最大值: 6.1947

期内平均值: 3.4128

当前分位值: 14.79%



数据起始日: 2019/3/6

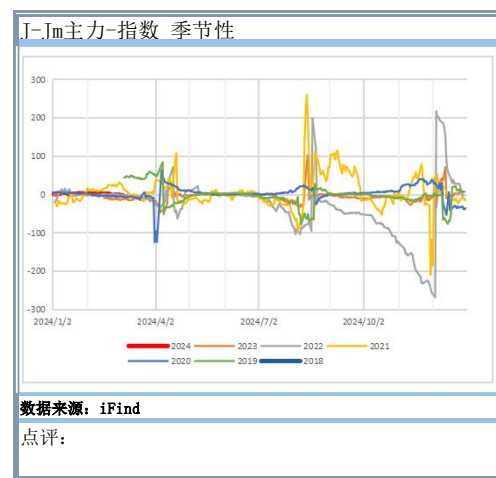
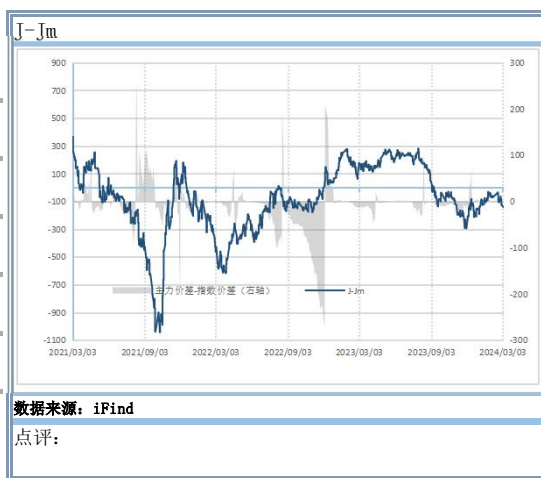
数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: -1043.0800

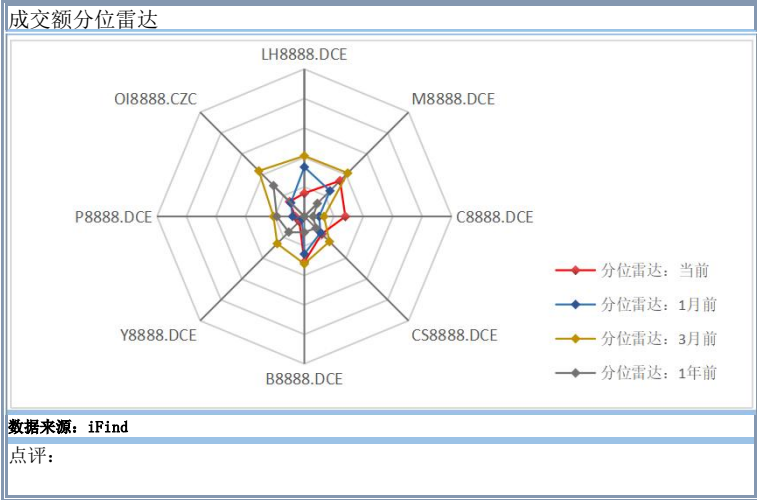
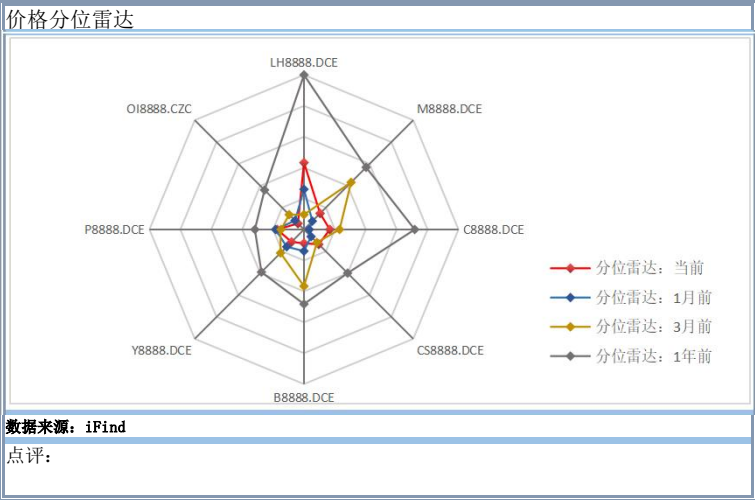
期内最大值: 364.9400

期内平均值: -82.2436

当前分位值: 63.94%



五、农产品相关



数据起始日: 2021/1/8

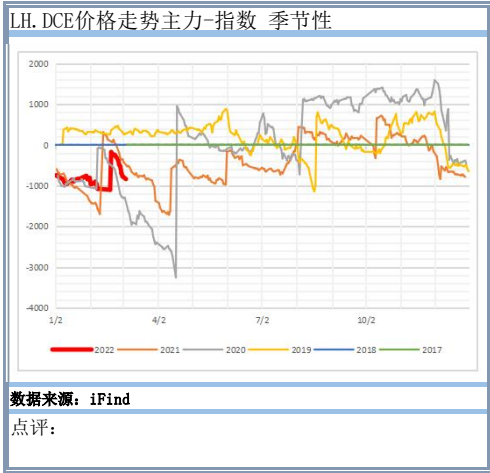
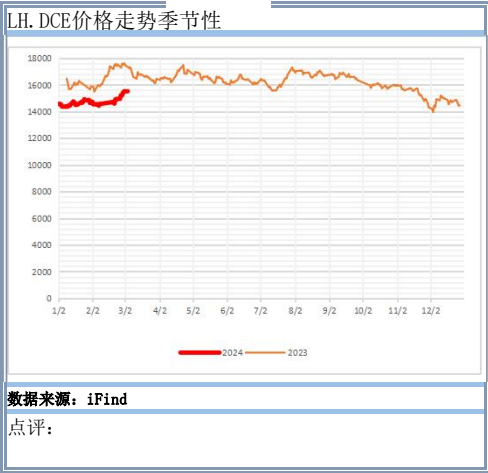
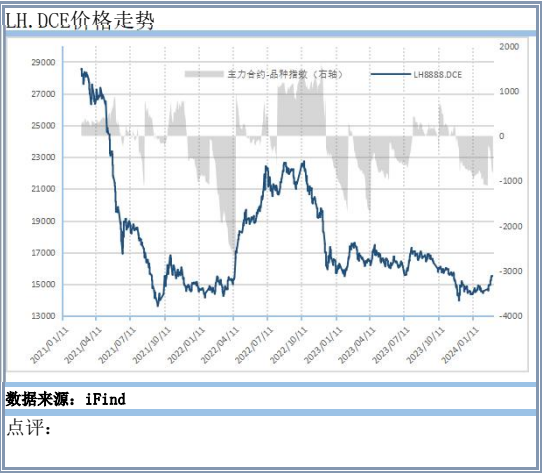
数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: 13971

期内最大值: 17601

期内平均值: 16060.3207

当前分位值: 43.22%



数据起始日： 2019/3/6

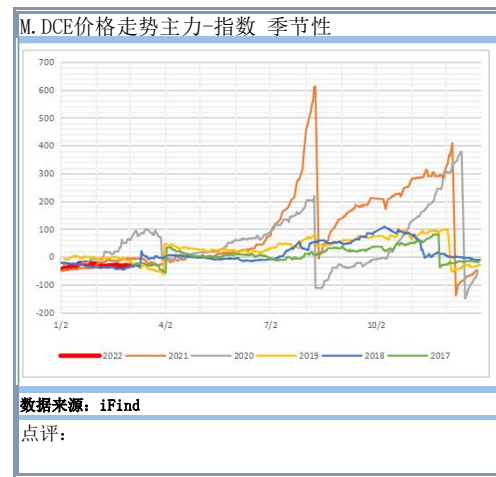
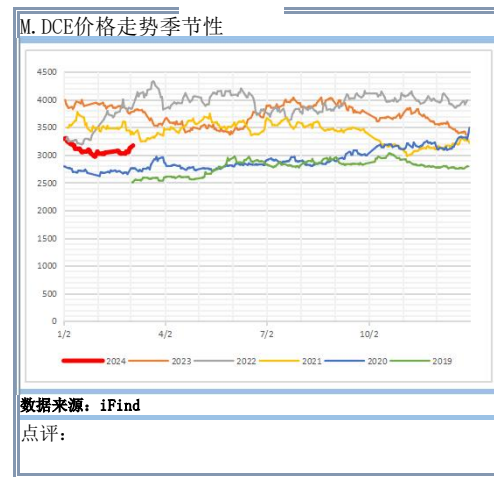
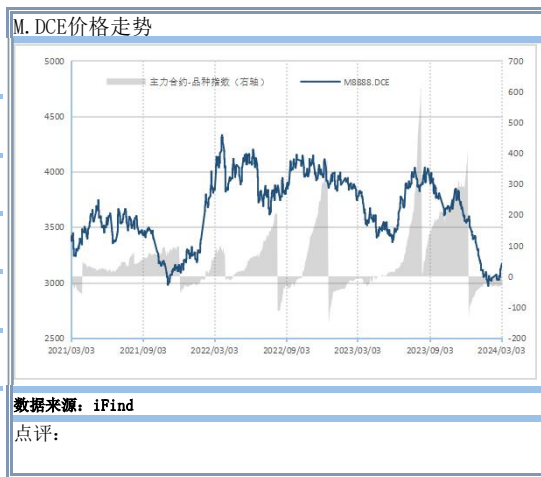
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 2970

期内最大值： 4328

期内平均值： 3652.4829

当前分位值： 14.73%



数据起始日： 2019/3/6

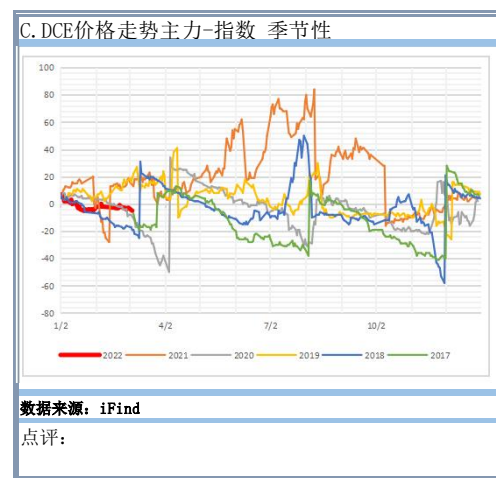
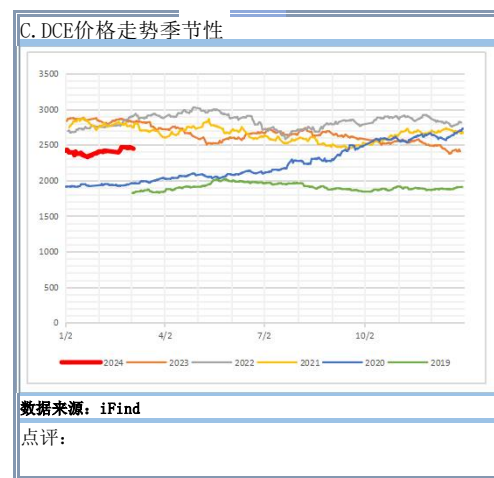
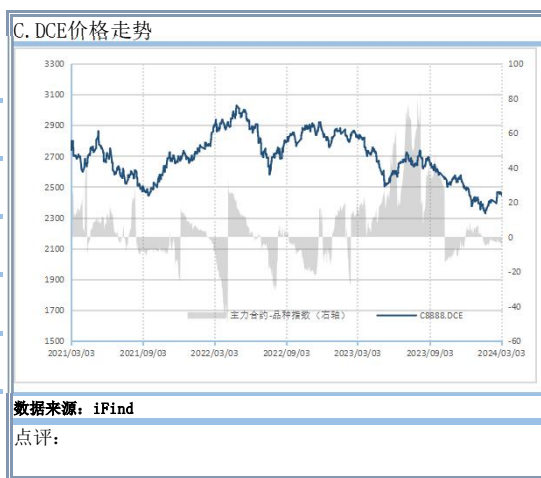
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 2328

期内最大值： 3027

期内平均值： 2692.6406

当前分位值： 16.74%



数据起始日: 2019/3/6

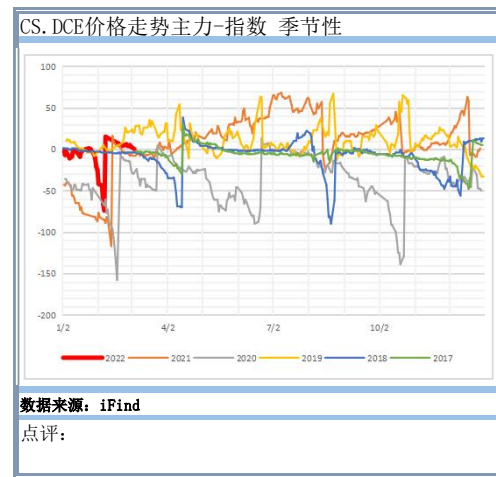
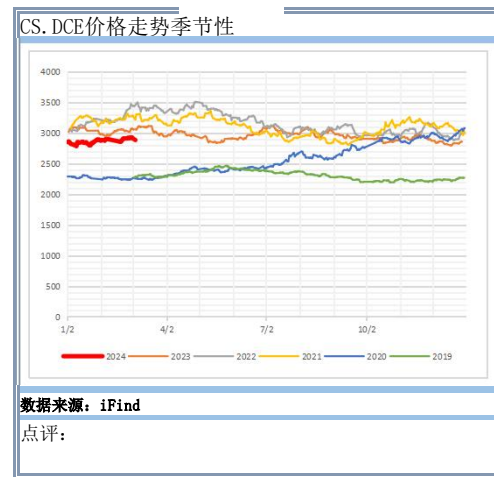
数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: 2788

期内最大值: 3512

期内平均值: 3059.0055

当前分位值: 13.54%



数据起始日: 2019/3/6

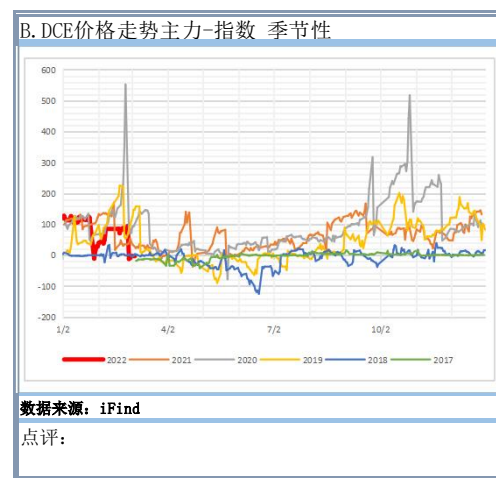
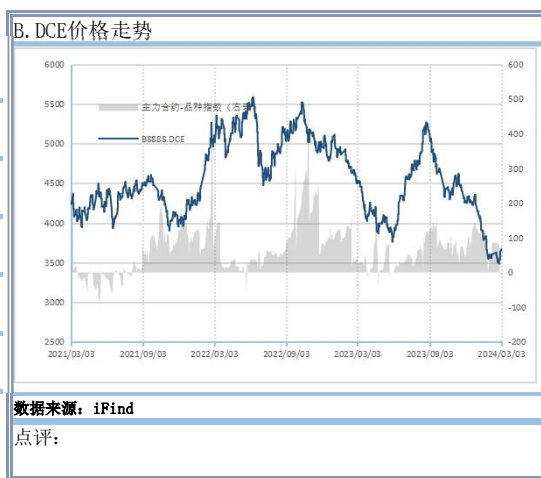
数据截止日: 2024/3/4

期内最小值: 3487

期内最大值: 5585

期内平均值: 4550.5158

当前分位值: 8.91%



数据起始日： 2019/3/6

数据截止日： 2024/3/4

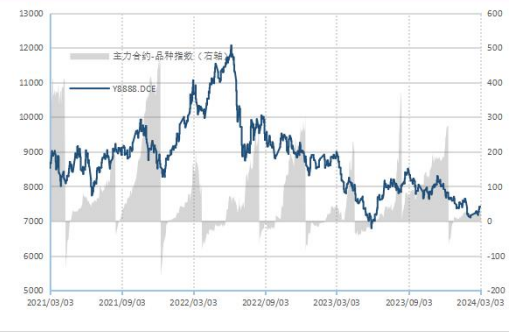
期内最小值： 6793

期内最大值： 12065

期内平均值： 8810.9314

当前分位值： 11.40%

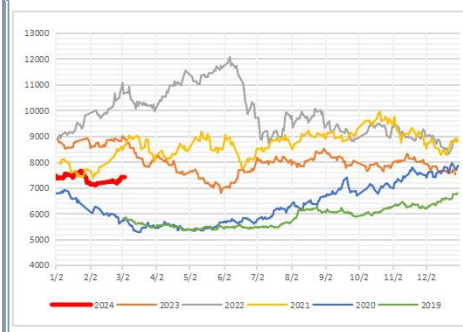
Y. DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

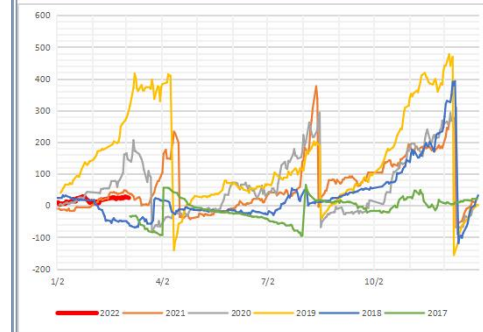
Y. DCE价格走势季节性



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： 2019/3/6

数据截止日： 2024/3/4

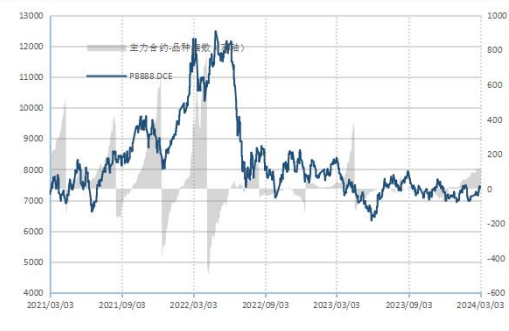
期内最小值： 6349

期内最大值： 12479

期内平均值： 8271.5171

当前分位值： 17.31%

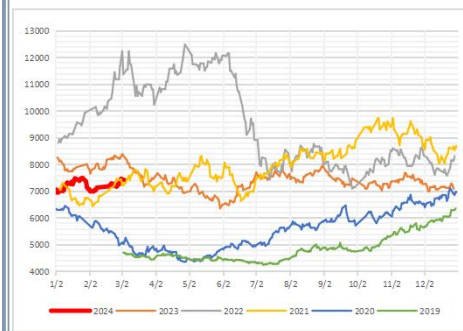
P. DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

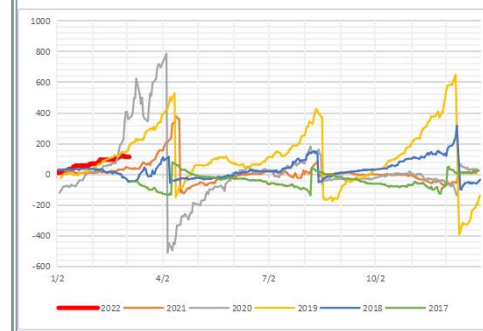
P. DCE价格走势季节性



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： 2019/3/6

数据截止日： 2024/3/4

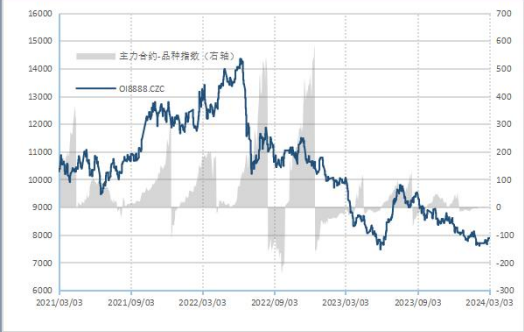
期内最小值： 7475

期内最大值： 14344

期内平均值： 10412.4654

当前分位值： 5.53%

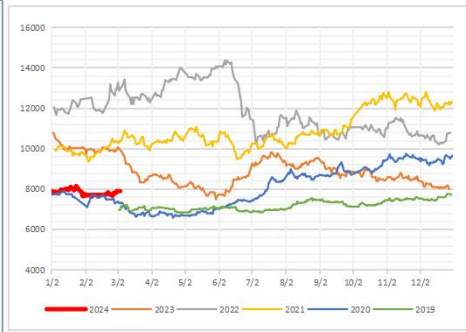
OI.CZCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

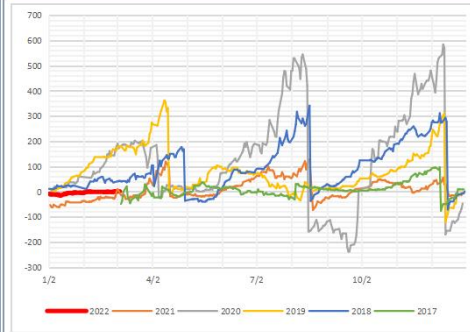
OI.CZCE价格走势季节性



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： 2022/1/17

数据截止日： 2024/3/4

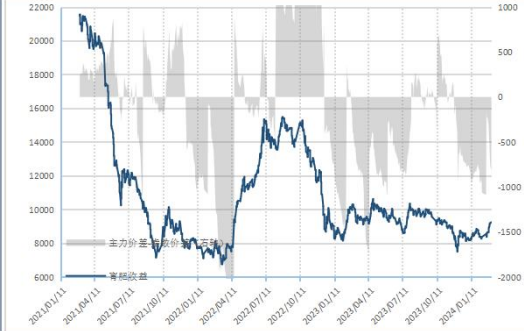
期内最小值： 7508.2500

期内最大值： 10624.2500

期内平均值： 9249.8250

当前分位值： 55.78%

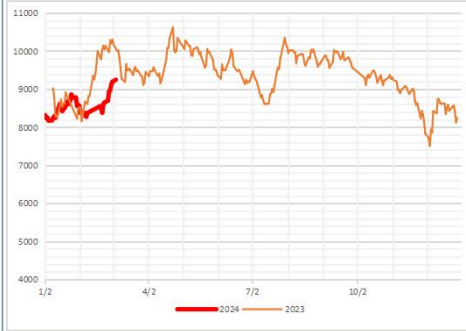
育肥收益



数据来源：iFind

点评：

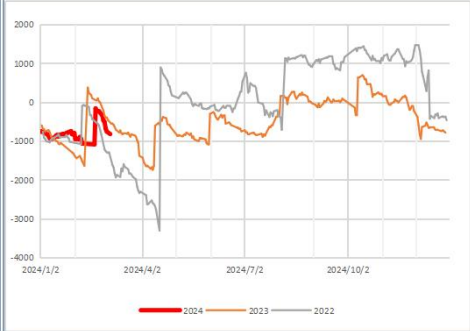
育肥收益季节性



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： 2024/3/4

期内最小值： 246.0000

期内最大值： 3391.0000

期内平均值： 1929.4414

当前分位值： 74.53%

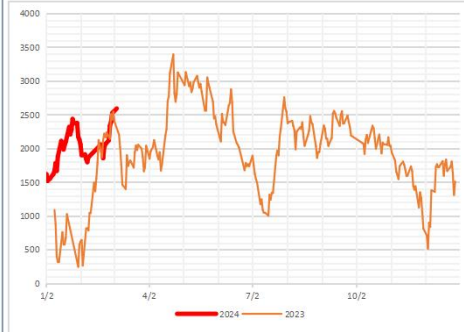
育肥肉料差(高料)



数据来源：iFind

点评：

育肥肉料差(高料)季节性



数据来源：iFind

点评：

育肥肉料差(高料)主力-指数 季节性



数据来源：iFind

点评：

数据起始日： 2019/3/6

数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： -745.0200

期内最大值： 58.2450

期内平均值： -213.2944

当前分位值： 95.53%

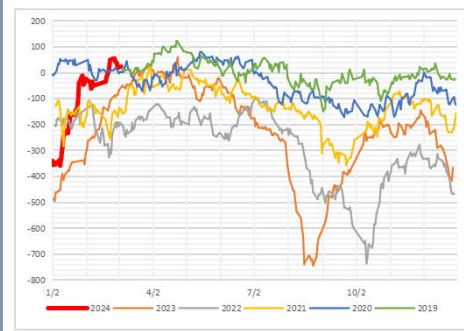
豆二厂库置换



数据来源：iFind

点评：

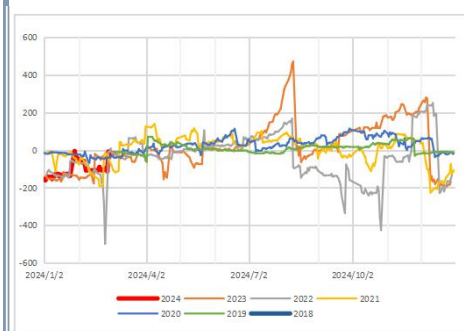
豆二厂库置换季节性



数据来源：iFind

点评：

豆二厂库置换主力-指数 季节性



数据来源：iFind

点评：

数据起始日： 2019/3/6

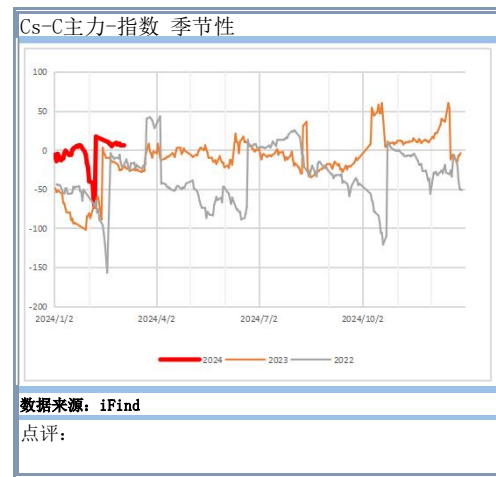
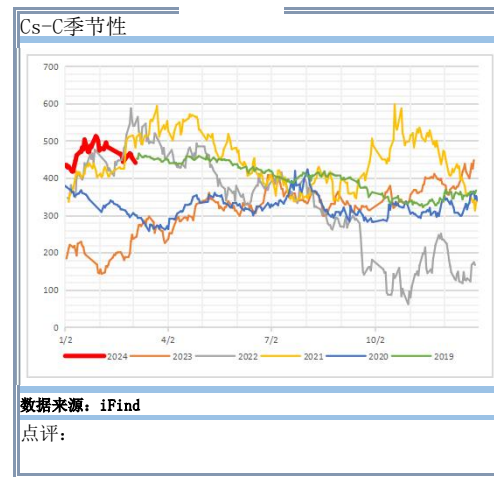
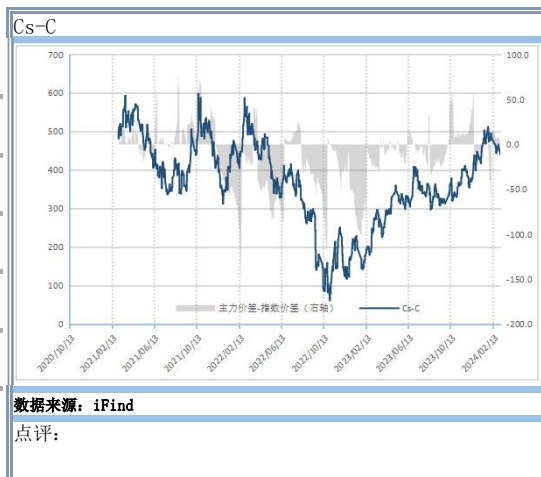
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 62.0000

期内最大值： 598.0000

期内平均值： 366.3649

当前分位值： 70.71%



数据起始日： 2019/3/6

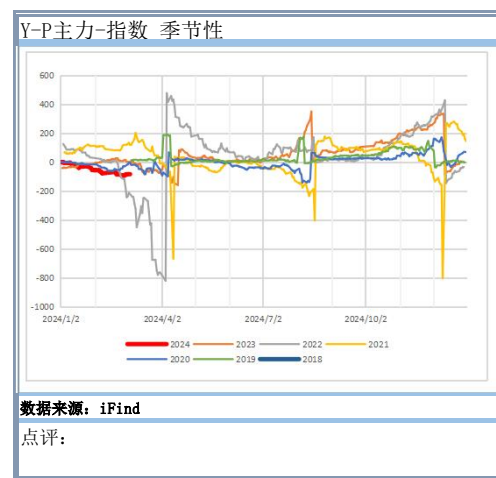
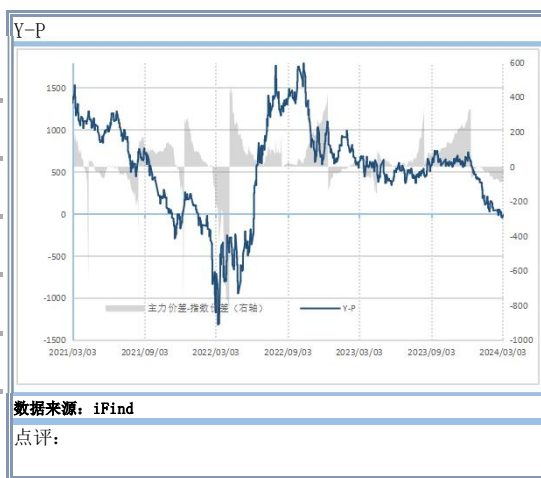
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： -1313.0000

期内最大值： 1788.0000

期内平均值： 539.4143

当前分位值： 41.83%



数据起始日： 2019/3/6

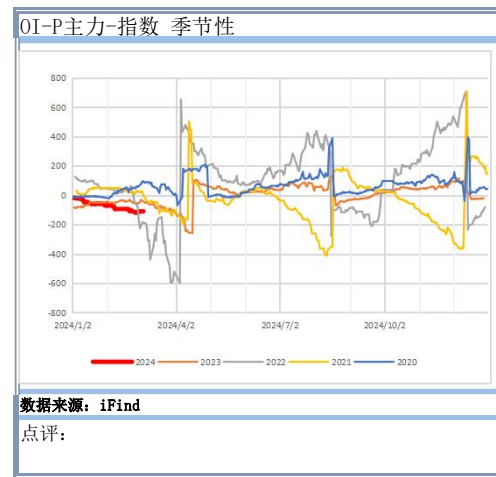
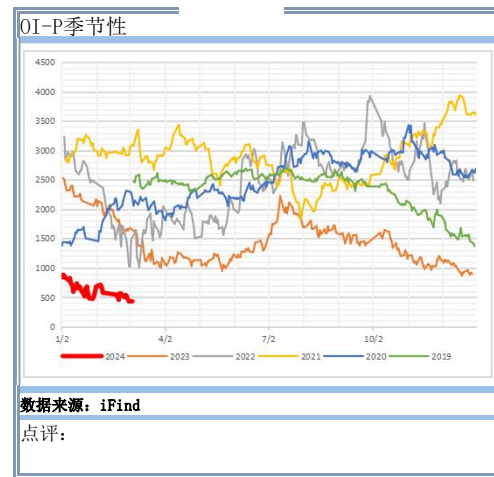
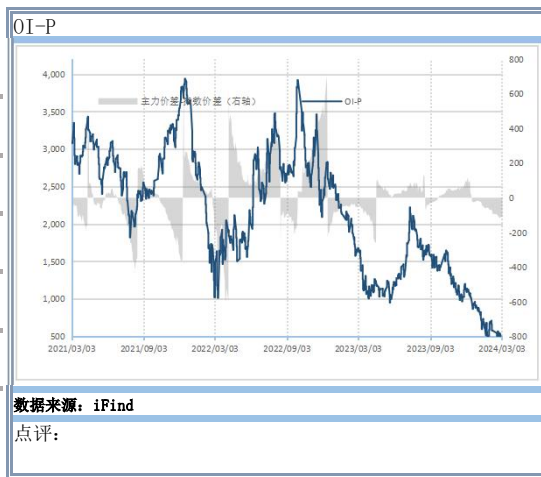
数据截止日： 2024/3/4

期内最小值： 431.0000

期内最大值： 3919.0000

期内平均值： 1641.9008

当前分位值： 0.40%



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。