

<http://www.shanjinqh.com>

盘面套利观察

2024年3月13日

制作：曹有明

投资咨询： Z0013162

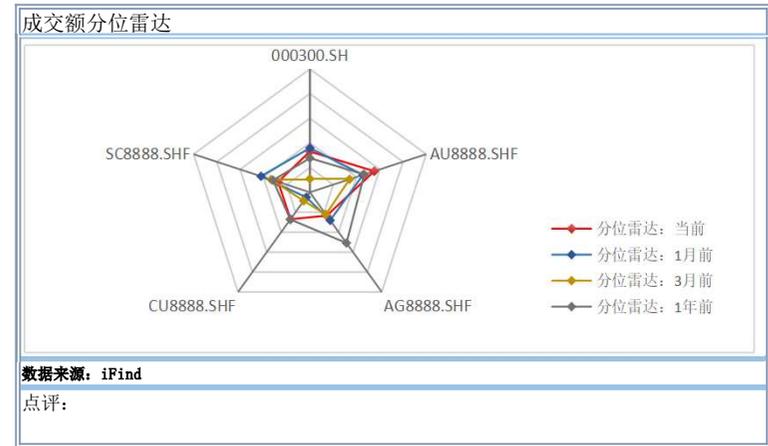
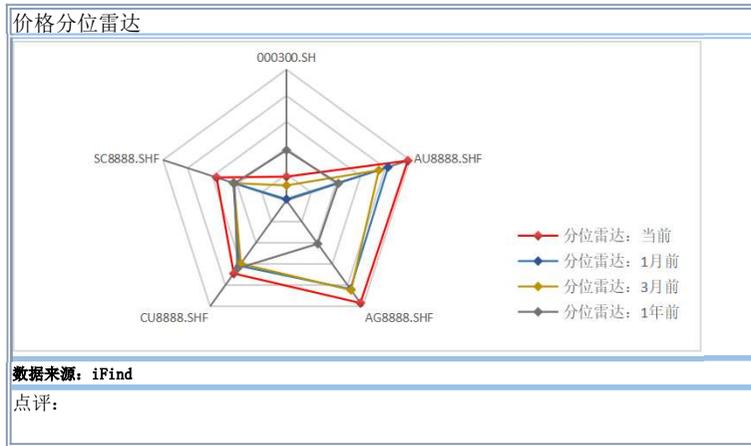
邮箱： caoyouming@sd-gold.com

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: 2019-3-15

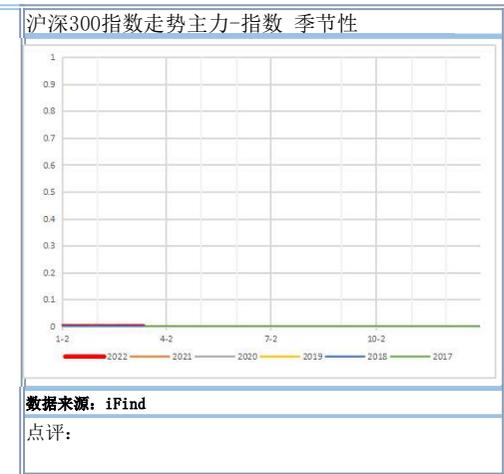
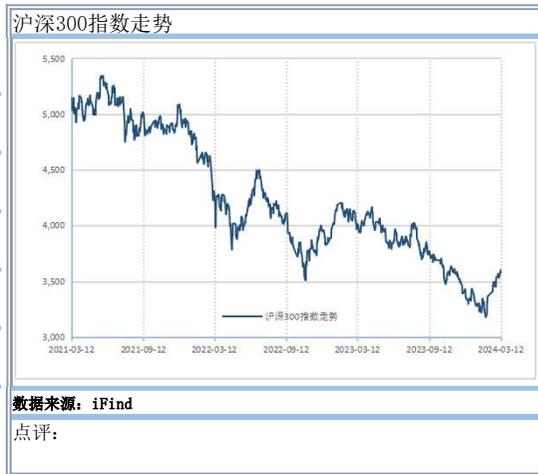
数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: 3179.6276

期内最大值: 5341.6798

期内平均值: 4228.8933

当前分位值: 11.43%



数据起始日: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: 357.99

期内最大值: 508.58

期内平均值: 413.1654

当前分位值: 98.25%

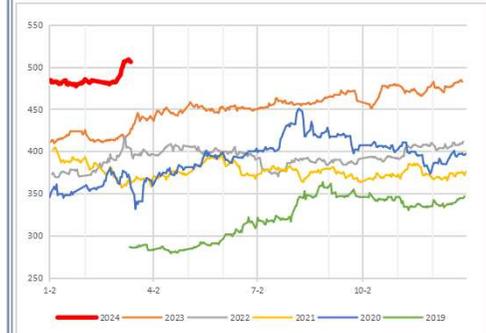
Au. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

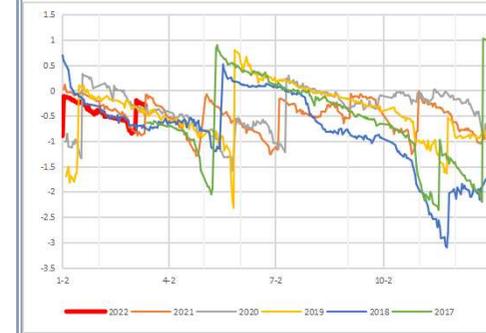
Au. SHFE价格走势季节性



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: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: 53367

期内最大值: 77934

期内平均值: 68109.3030

当前分位值: 69.03%

Cu. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

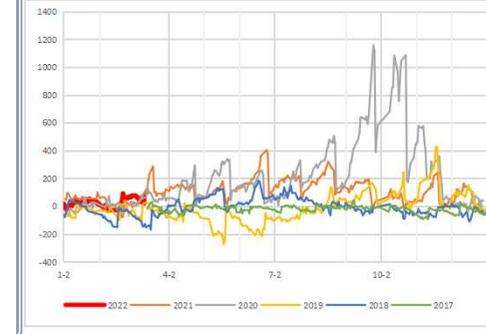
Cu. SHFE价格走势季节性



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: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

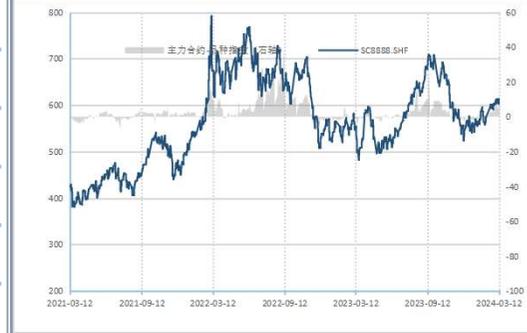
期内最小值: 380.7

期内最大值: 791.6

期内平均值: 565.7708

当前分位值: 56.53%

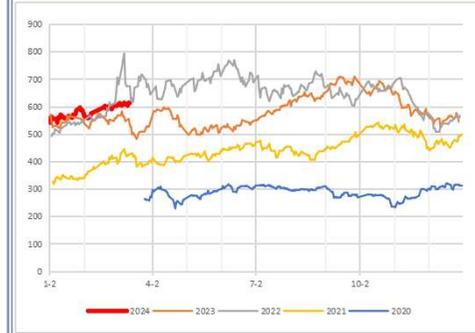
Sc. Ine价格走势



数据来源: iFind

点评:

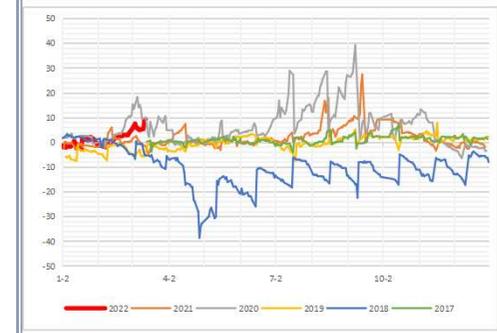
Sc. Ine价格走势季节性



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: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

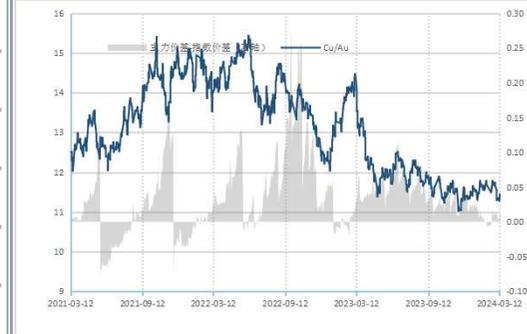
期内最小值: 11.0218

期内最大值: 15.4319

期内平均值: 13.1219

当前分位值: 9.58%

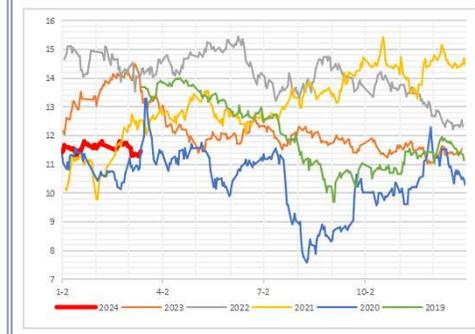
Cu/Au



数据来源: iFind

点评:

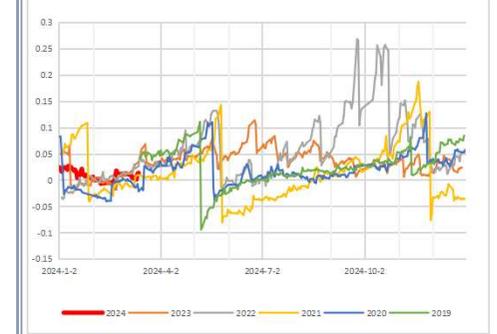
Cu/Au季节性



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： 2019-3-15

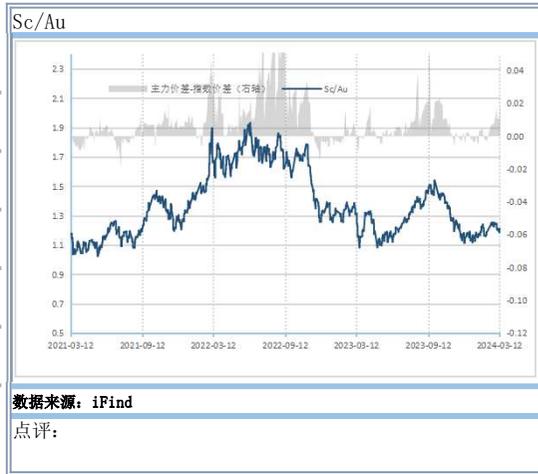
数据截止日： 2024-3-13

期内最小值： 1.0233

期内最大值： 1.9320

期内平均值： 1.3743

当前分位值： 20.73%



数据起始日： 2019-3-15

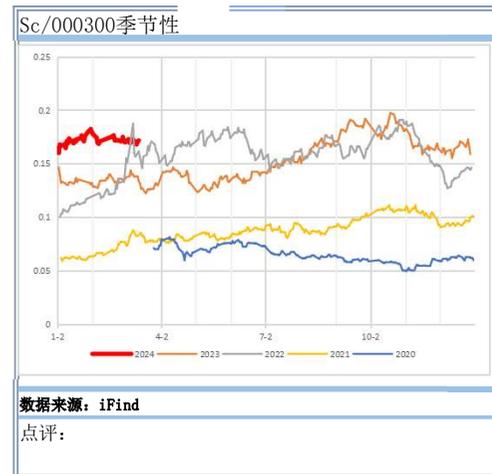
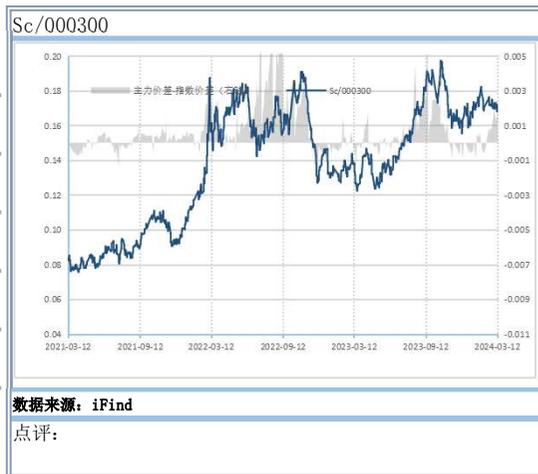
数据截止日： 2024-3-13

期内最小值： 0.0757

期内最大值： 0.1972

期内平均值： 0.1378

当前分位值： 78.94%



数据起始日: 2019-3-15

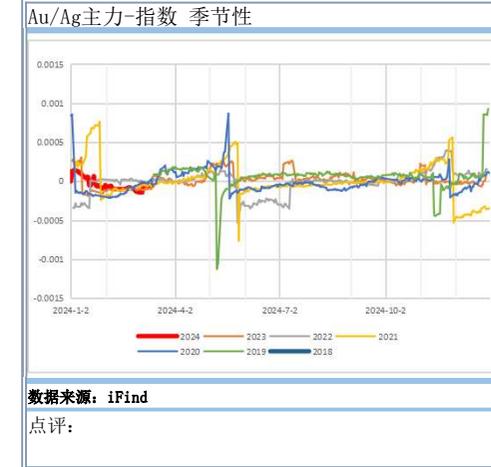
数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: 0.0654

期内最大值: 0.0932

期内平均值: 0.0793

当前分位值: 60.96%



数据起始日: 2019-3-15

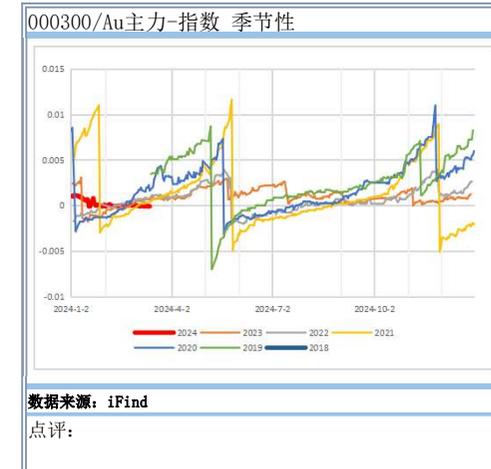
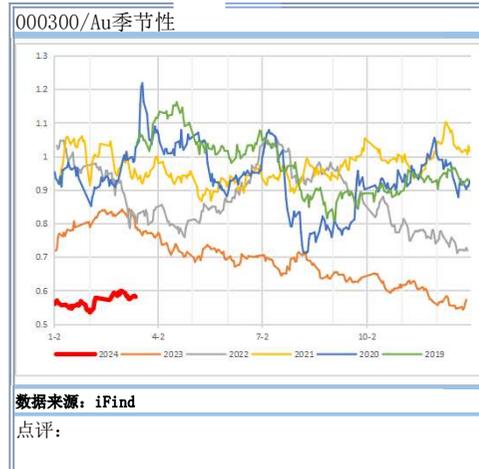
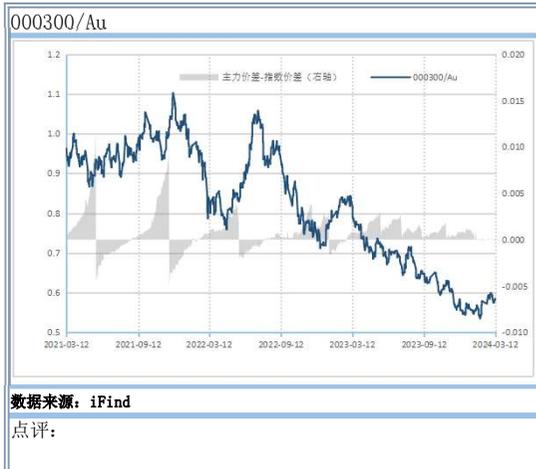
数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: 0.5351

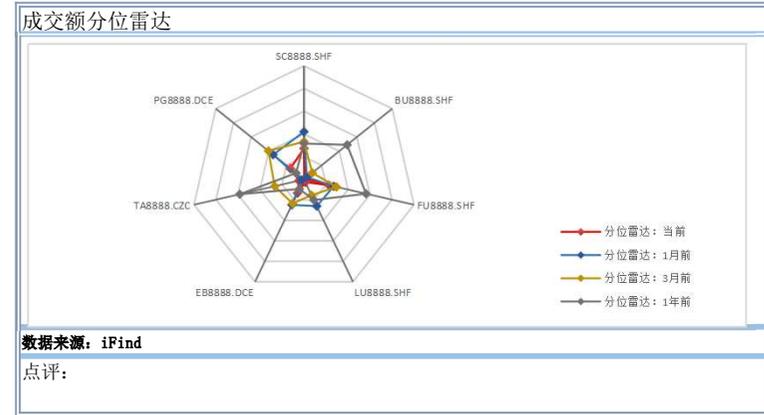
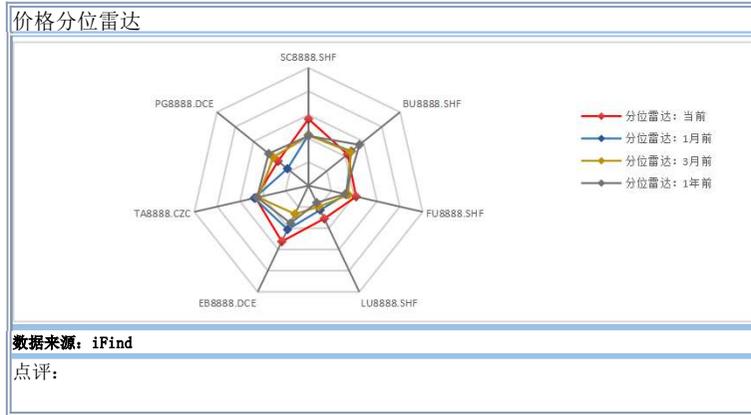
期内最大值: 1.1021

期内平均值: 0.8195

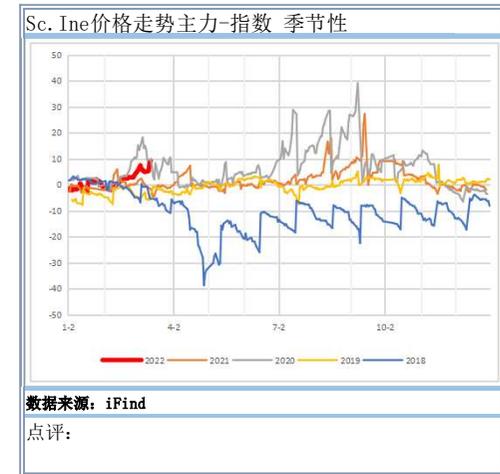
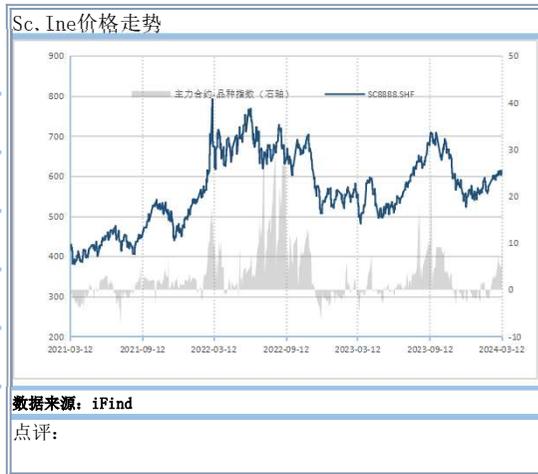
当前分位值: 8.15%



二、原油相关



数据起始日: 2019-3-15
 数据截止日: 2024-3-13
 期内最小值: 380.7
 期内最大值: 791.6
 期内平均值: 565.7708
 当前分位值: 56.53%



数据起始日: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

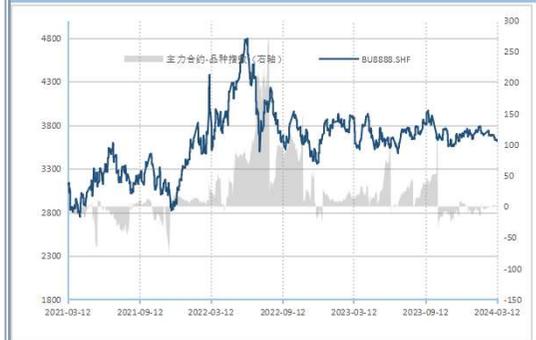
期内最小值: 2748

期内最大值: 4794

期内平均值: 3603.9671

当前分位值: 42.67%

Bu. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

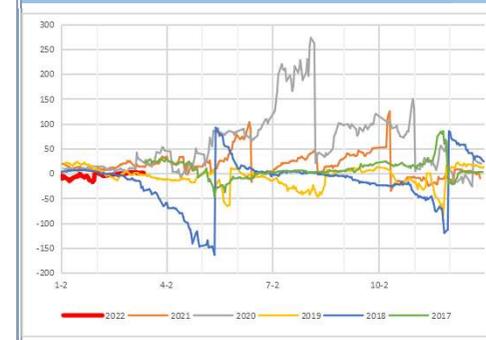
Bu. SHFE价格走势季节性



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: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

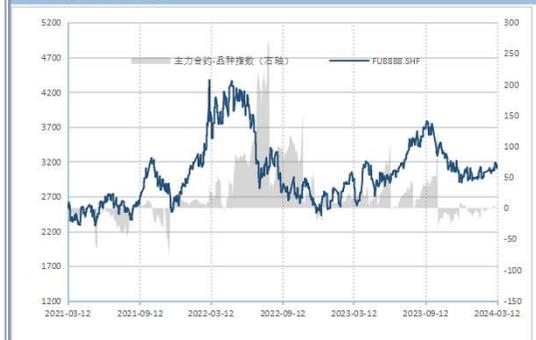
期内最小值: 2284

期内最大值: 4371

期内平均值: 3035.8408

当前分位值: 41.69%

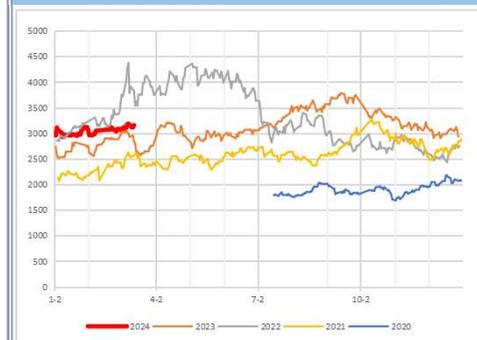
Fu. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

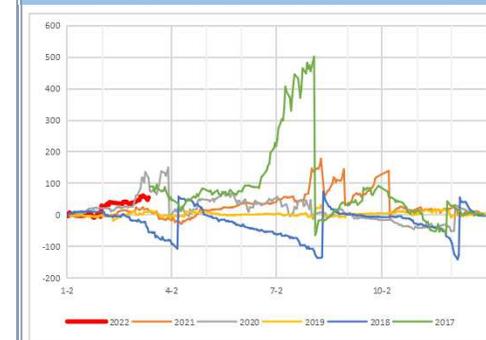
Fu. SHFE价格走势季节性



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: 2024-3-13

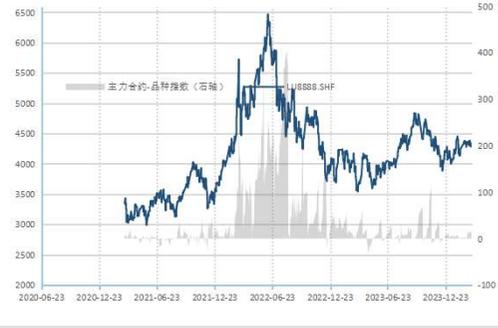
期内最小值: 3544

期内最大值: 6112

期内平均值: 4343.6376

当前分位值: 31.04%

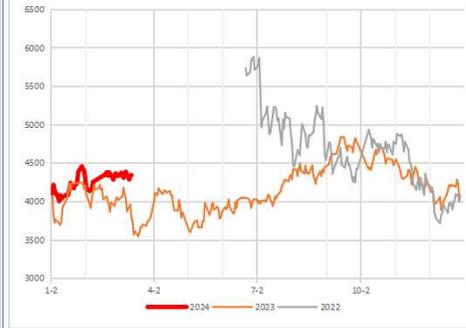
Lu. Ine价格走势



数据来源: iFind

点评:

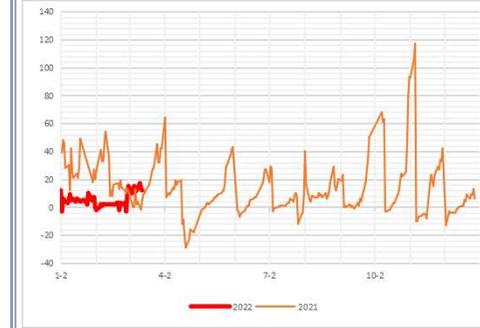
Lu. Ine价格走势季节性



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: 2024-3-13

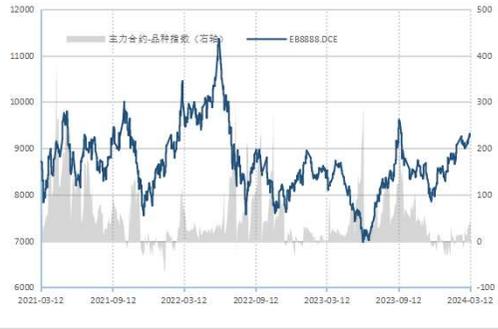
期内最小值: 6978

期内最大值: 11361

期内平均值: 8655.6589

当前分位值: 52.52%

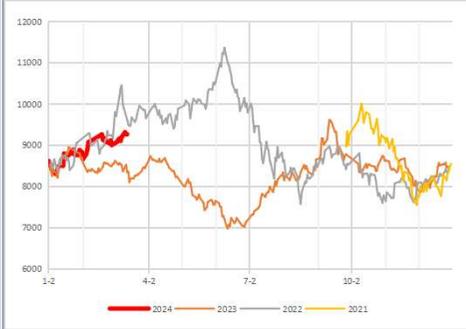
EB. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

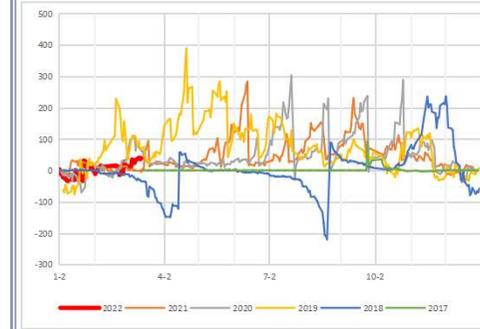
EB. DCE价格走势季节性



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：2019-3-15

数据截止日：2024-3-13

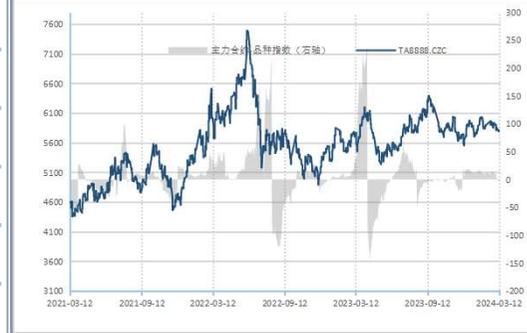
期内最小值：4356

期内最大值：7488

期内平均值：5544.6324

当前分位值：46.36%

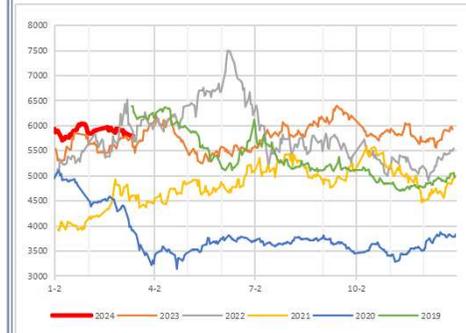
PTA, CZCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

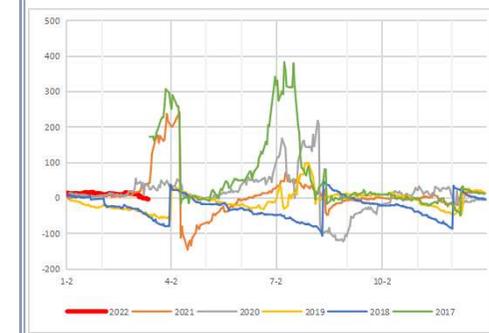
PTA, CZCE价格走势季节性



数据来源：iFind

点评：

PTA, CZCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源：iFind

点评：

数据起始日：2020-3-30

数据截止日：2024-3-13

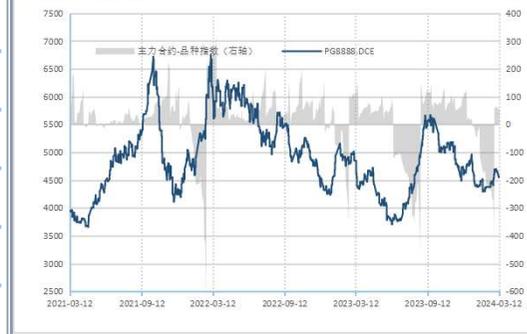
期内最小值：3704

期内最大值：6297

期内平均值：4929.1950

当前分位值：33.28%

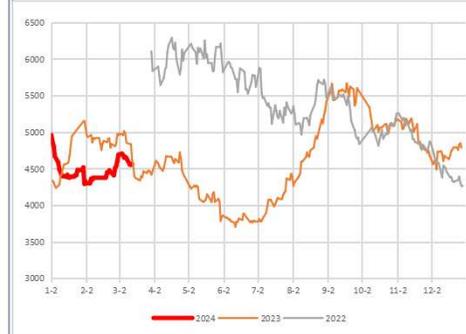
LPG, DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

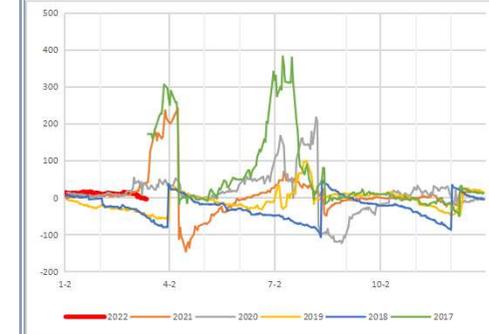
LPG, DCE价格走势季节性



数据来源：iFind

点评：

LPG, DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源：iFind

点评：

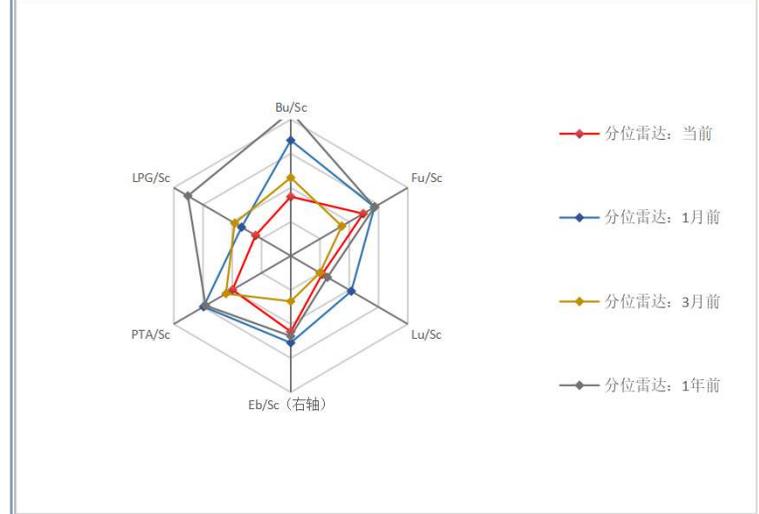
Sc相关比价一揽子



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: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

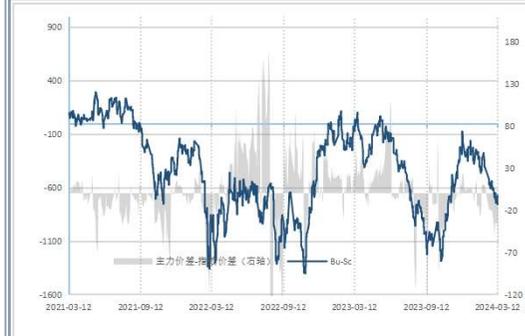
期内最小值: -1406.4286

期内最大值: 289.5714

期内平均值: -437.2528

当前分位值: 38.26%

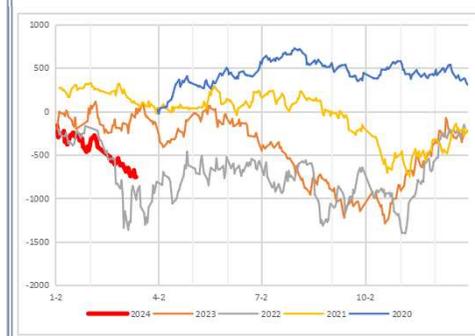
Bu-Sc



数据来源: iFind

点评:

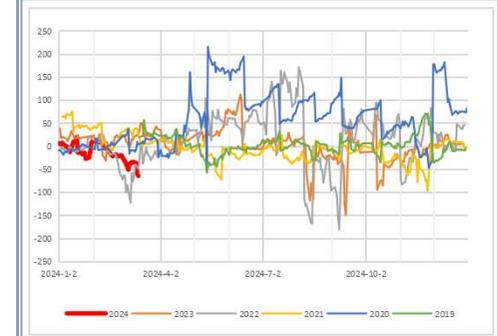
Bu-Sc季节性



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: 2019-3-15

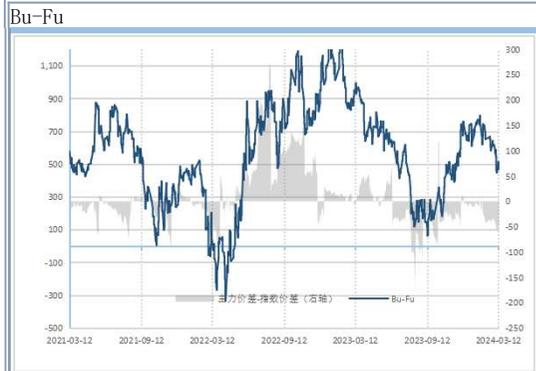
数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: -331.0000

期内最大值: 1284.0000

期内平均值: 568.1263

当前分位值: 49.41%



数据起始日: 2021-9-4

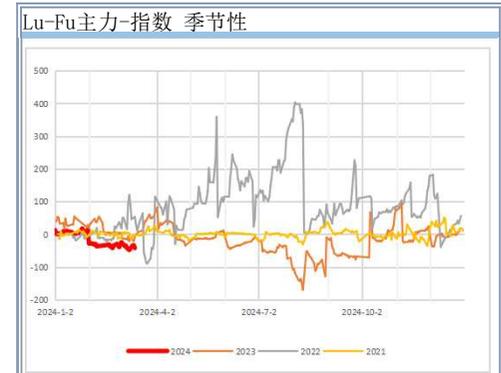
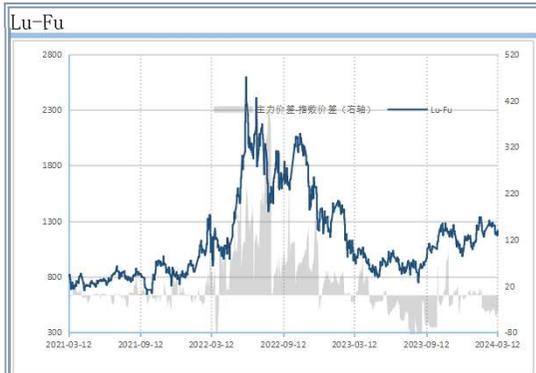
数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: 749.0000

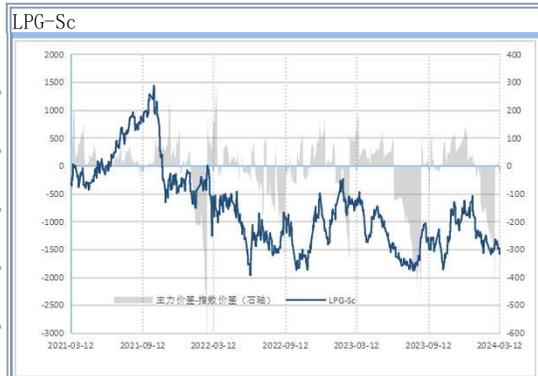
期内最大值: 2406.0000

期内平均值: 1288.3647

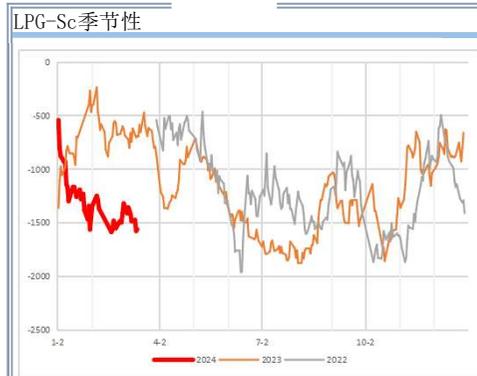
当前分位值: 26.43%



数据起始日: 2021-7-10
 数据截止日: 2024-3-13
 期内最小值: -1959.0000
 期内最大值: -240.0000
 期内平均值: -1178.1266
 当前分位值: 23.04%



数据来源: iFind
 点评:

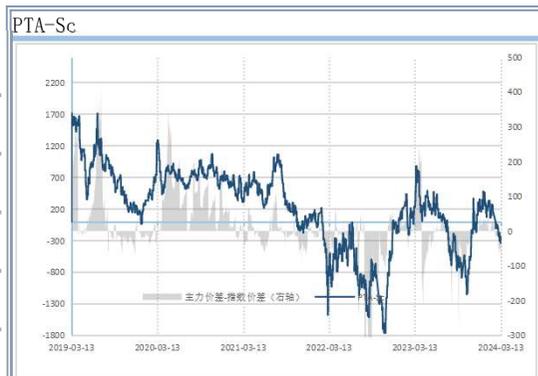


数据来源: iFind
 点评:



数据来源: iFind
 点评:

数据起始日: 2019-3-15
 数据截止日: 2024-3-13
 期内最小值: -1762.0000
 期内最大值: 1061.0000
 期内平均值: -113.0754
 当前分位值: 51.01%



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: 2021-3-12

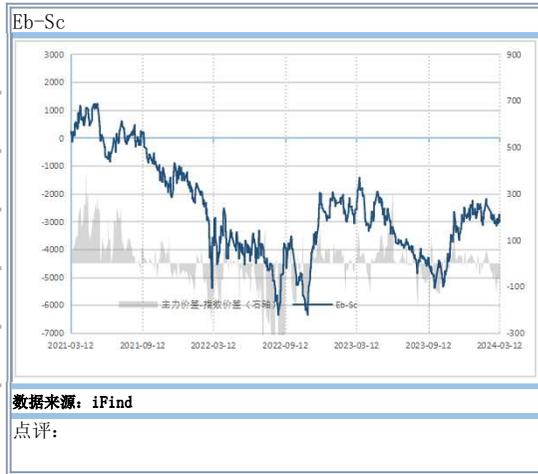
数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: -6347.0000

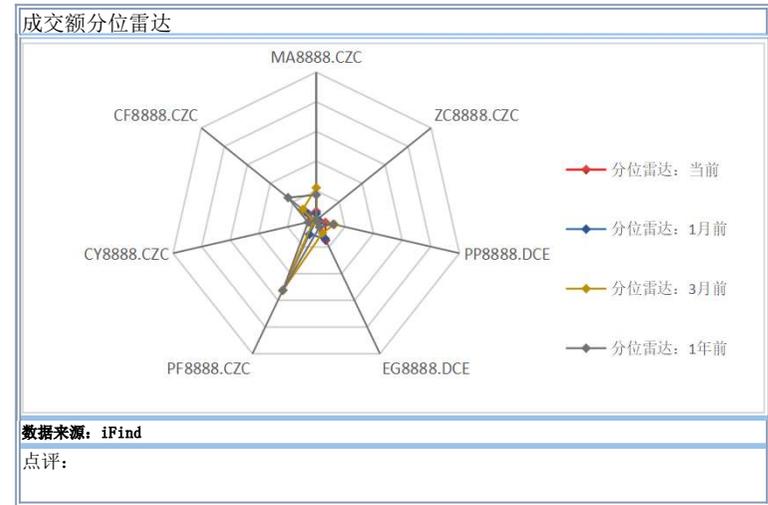
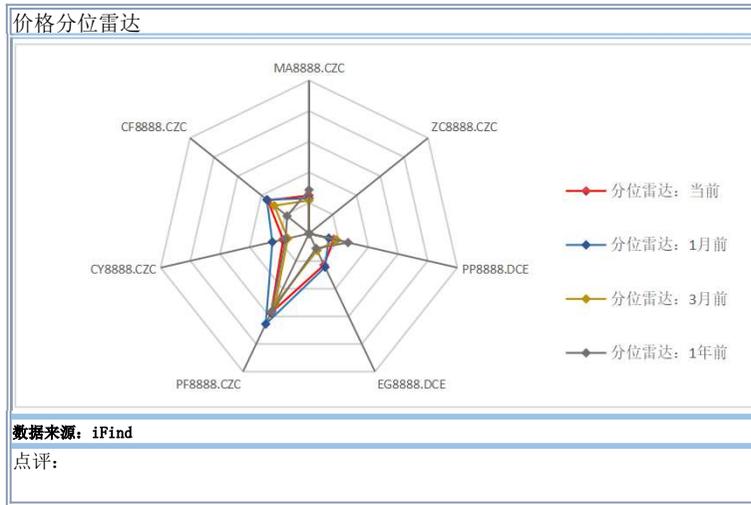
期内最大值: 162.0000

期内平均值: -3242.4110

当前分位值: 51.73%



三、煤化工相关



数据起始日: 2019-3-15

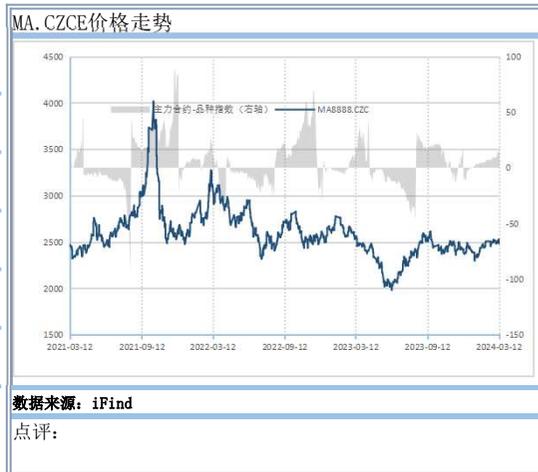
数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: 1982

期内最大值: 4015

期内平均值: 2588.0055

当前分位值: 24.89%



数据起始日: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

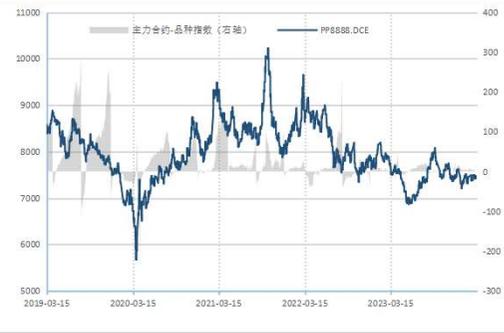
期内最小值: 6865

期内最大值: 10224

期内平均值: 8034.1454

当前分位值: 16.70%

PP. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: 3778

期内最大值: 7345

期内平均值: 4618.2689

当前分位值: 22.74%

EG. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

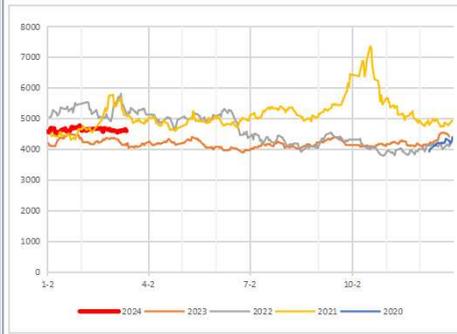
PP. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

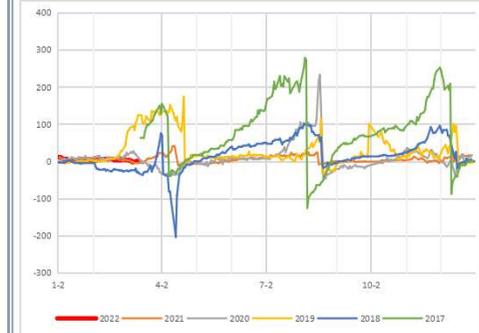
EG. CZCE价格走势季节性



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: 2024-3-13

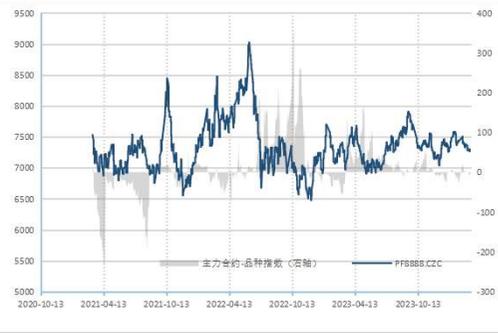
期内最小值: 6477

期内最大值: 7907

期内平均值: 7245.2606

当前分位值: 57.41%

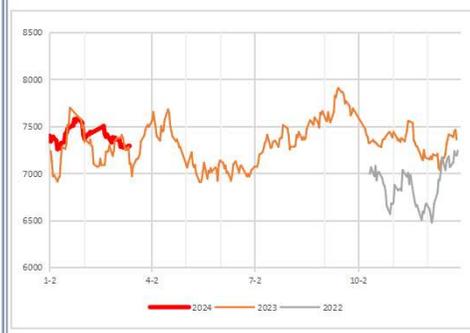
PF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

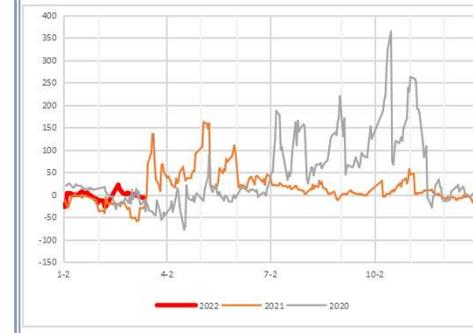
PF. CZCE价格走势季节性



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: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

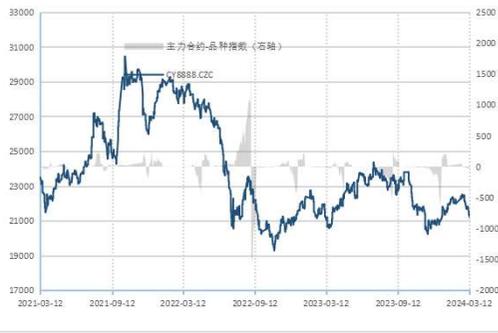
期内最小值: 19292

期内最大值: 30443

期内平均值: 23848.2359

当前分位值: 17.42%

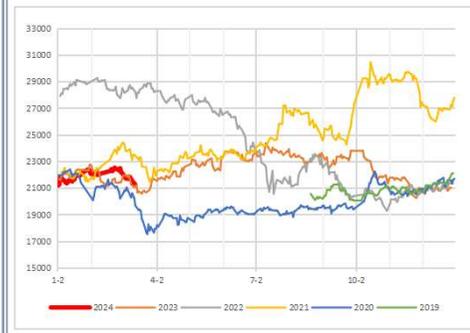
CY. CZCE价格走势



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: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: 12447

期内最大值: 22574

期内平均值: 16880.3416

当前分位值: 34.64%

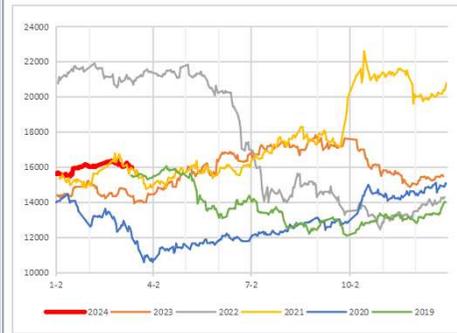
CF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

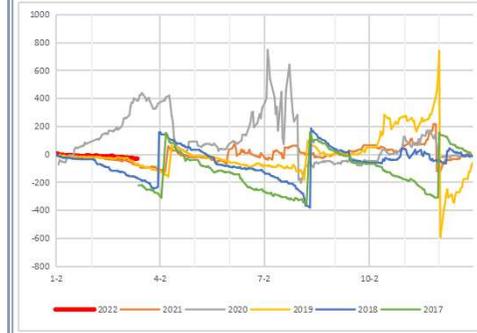
CF. CZCE价格走势季节性



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: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

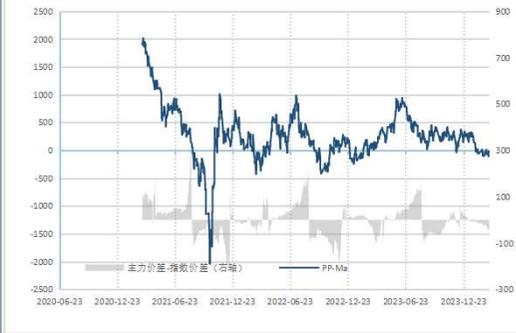
期内最小值: -2039.0000

期内最大值: 2013.0000

期内平均值: 270.1289

当前分位值: 49.38%

PP-Ma



数据来源: iFind

点评:

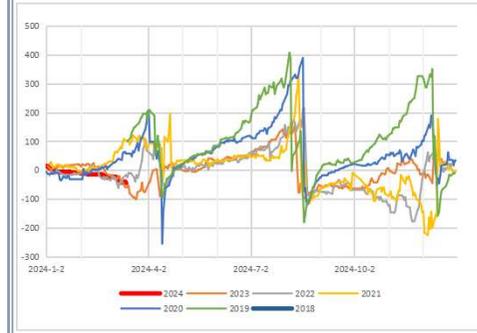
PP-Ma季节性



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: 2019-3-15

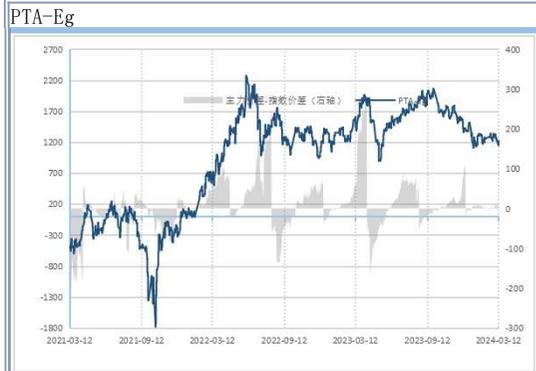
数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: -1783.0000

期内最大值: 2269.0000

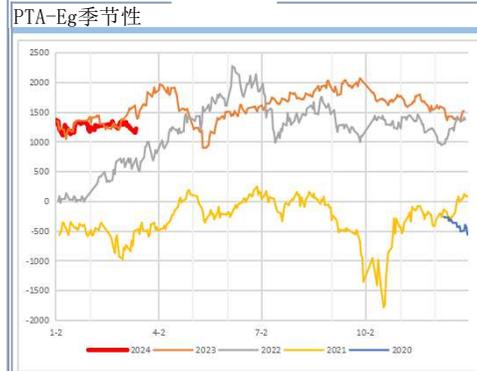
期内平均值: 926.3635

当前分位值: 74.09%



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: 2021-11-15

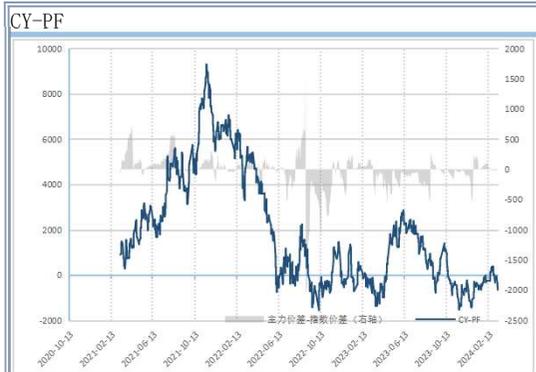
数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: -1555.0000

期内最大值: 2854.0000

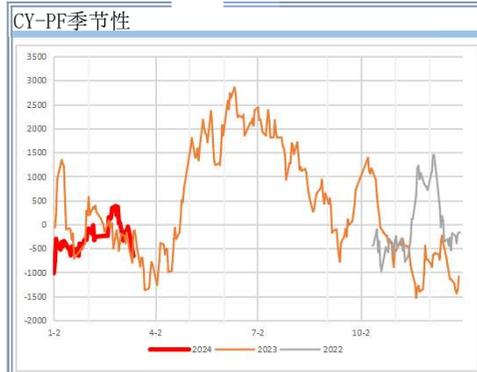
期内平均值: 219.9263

当前分位值: 20.30%



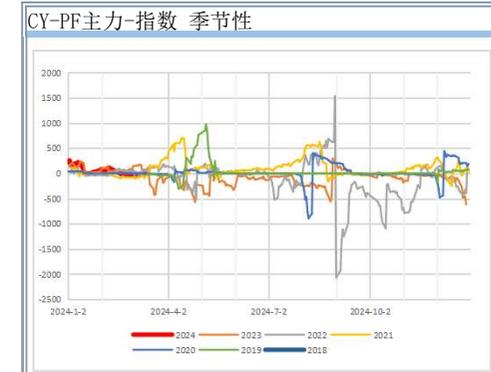
数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2022-9-26

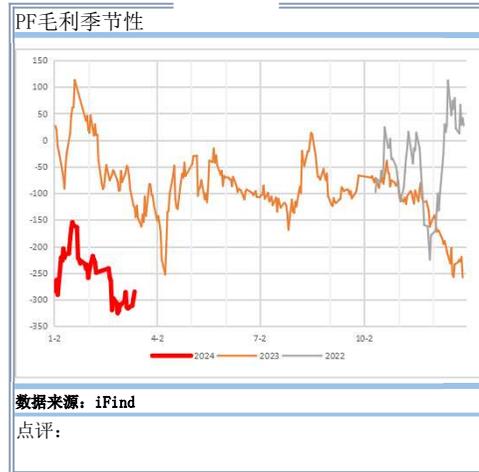
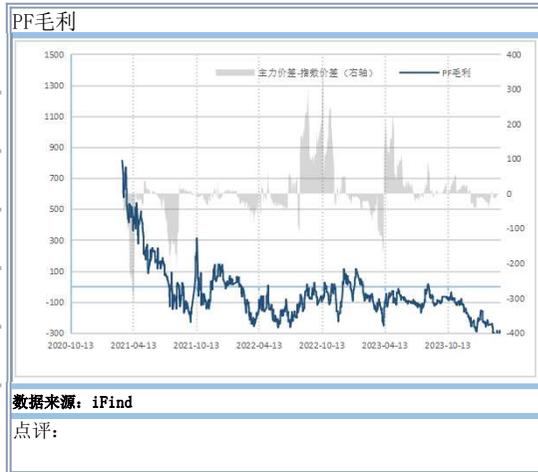
数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: -325.5650

期内最大值: 112.9900

期内平均值: -105.0159

当前分位值: 9.21%



数据起始日: 2019-3-15

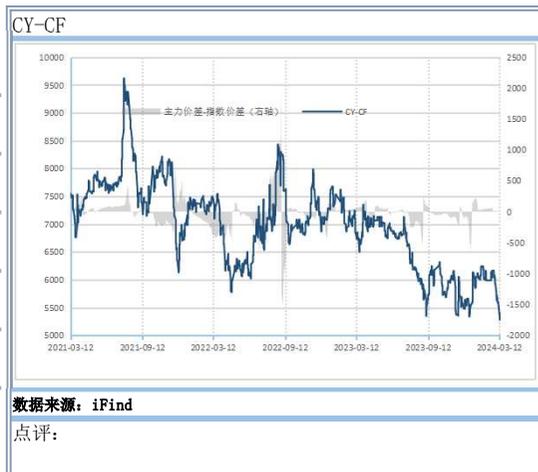
数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: 5279.0000

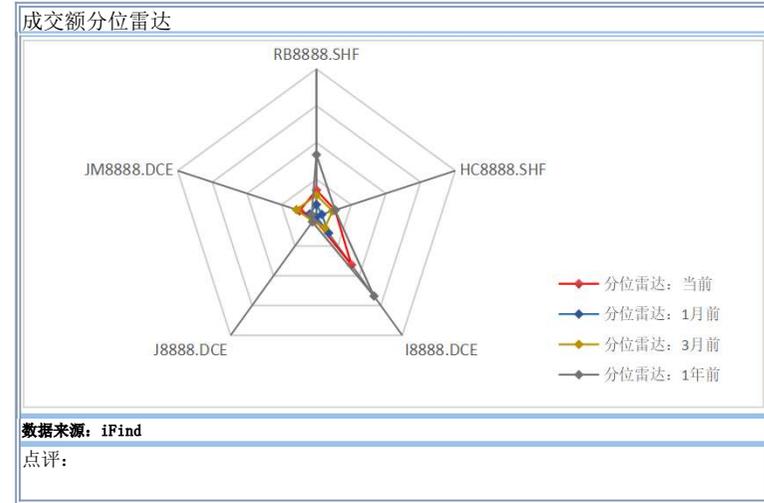
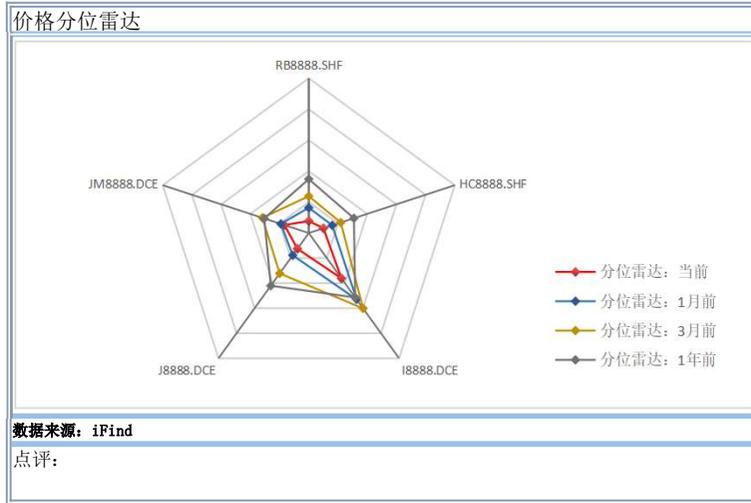
期内最大值: 9616.0000

期内平均值: 6967.8944

当前分位值: 0.00%



四、黑色相关



数据起始日: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: 3377

期内最大值: 6158

期内平均值: 4305.6763

当前分位值: 7.77%



数据起始日: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: 3444

期内最大值: 6675

期内平均值: 4459.0165

当前分位值: 10.03%

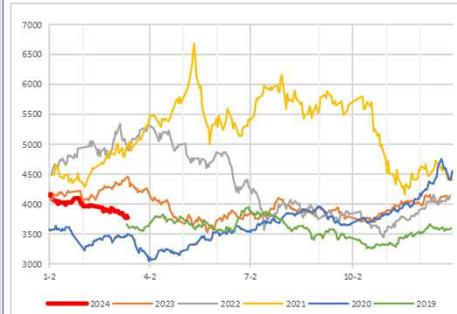
HC.SHFE价格走势



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: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

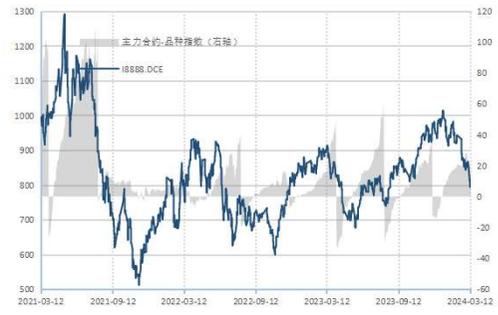
期内最小值: 512.8

期内最大值: 1290.9

期内平均值: 828.2922

当前分位值: 36.15%

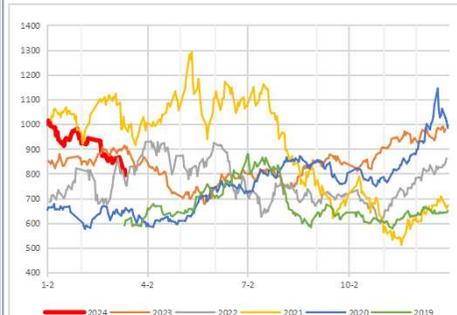
I.DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

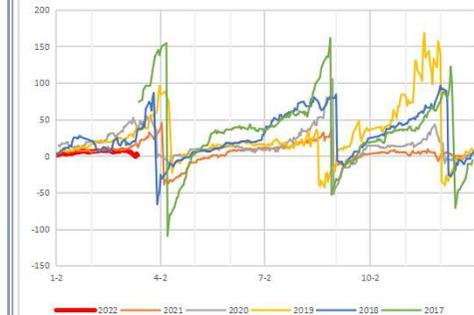
I.DCE价格走势季节性



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: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

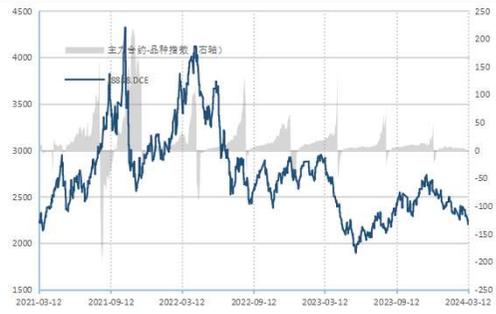
期内最小值: 1897.9

期内最大值: 4320.8

期内平均值: 2750.5609

当前分位值: 12.55%

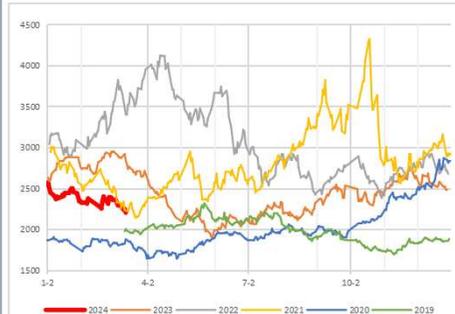
J.DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

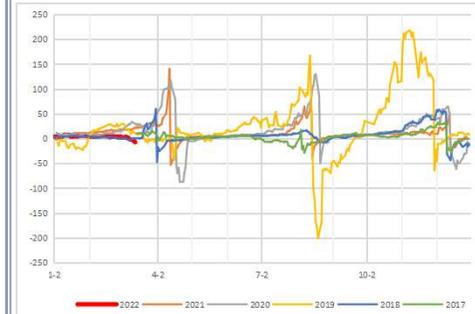
J.DCE价格走势季节性



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: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

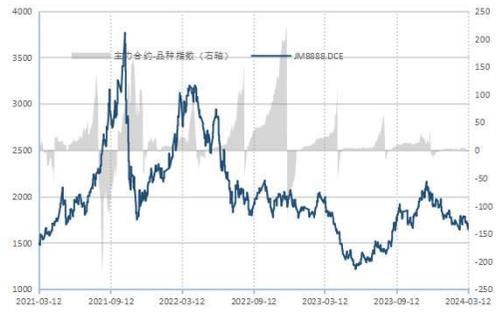
期内最小值: 1219.4

期内最大值: 3764.7

期内平均值: 2026.0041

当前分位值: 16.72%

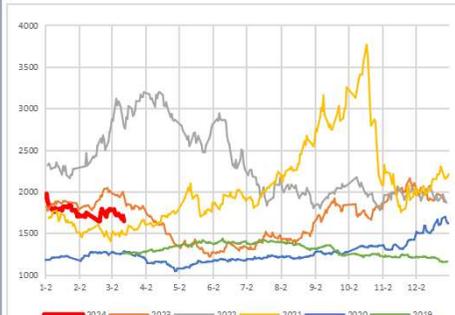
Jm.DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

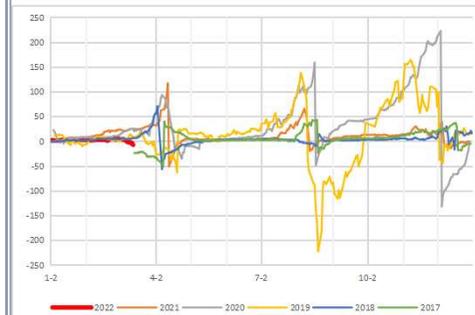
Jm.DCE价格走势季节性



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：2019-3-15

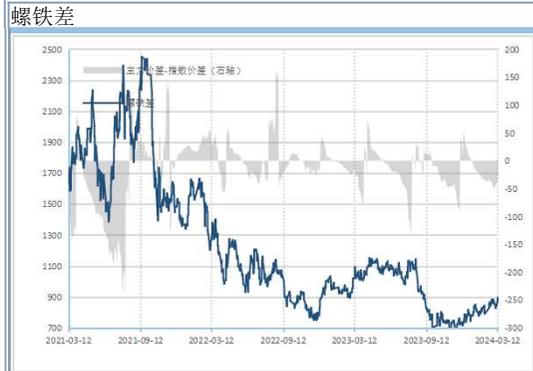
数据截止日：2024-3-13

期内最小值：670.1176

期内最大值：2451.8235

期内平均值：1226.0072

当前分位值：12.70%



数据起始日：2019-3-15

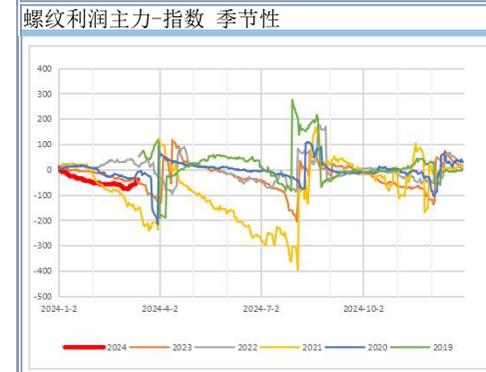
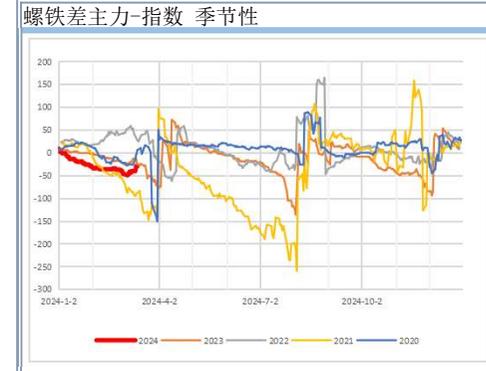
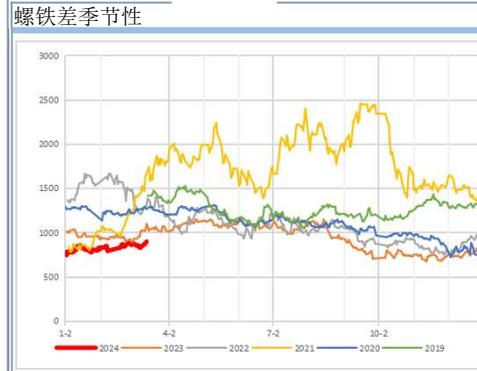
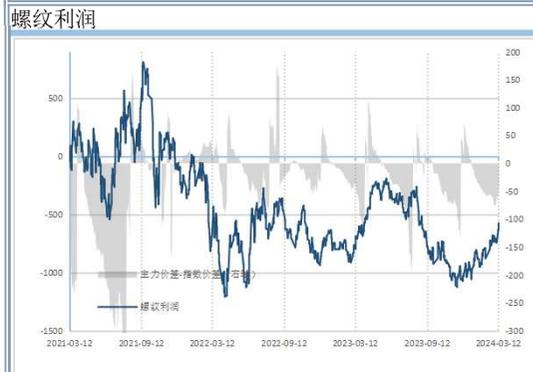
数据截止日：2024-3-13

期内最小值：-1206.9091

期内最大值：810.0000

期内平均值：-453.8123

当前分位值：31.35%



数据起始日： 2019-3-15

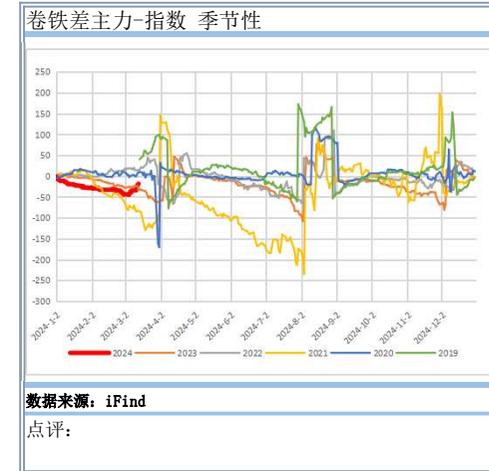
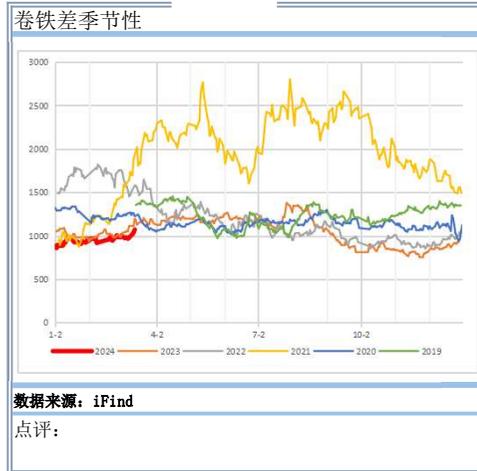
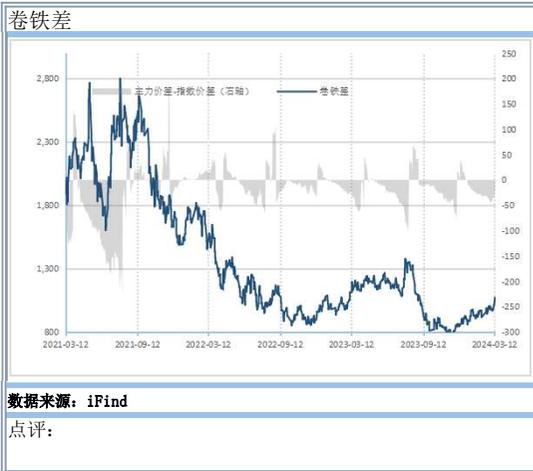
数据截止日： 2024-3-13

期内最小值： 752.4706

期内最大值： 2799.4118

期内平均值： 1379.3474

当前分位值： 15.58%



数据起始日： 2019-3-15

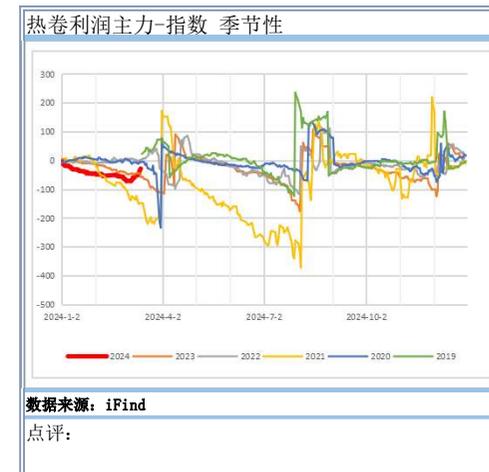
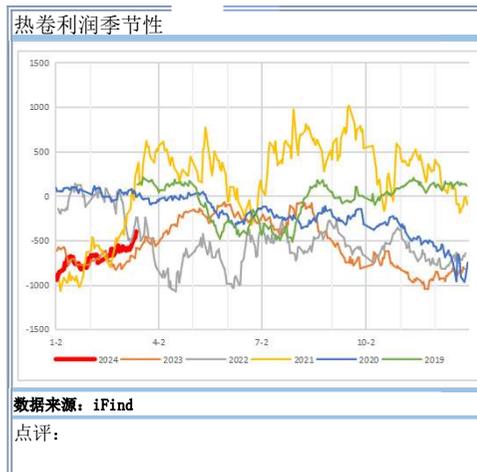
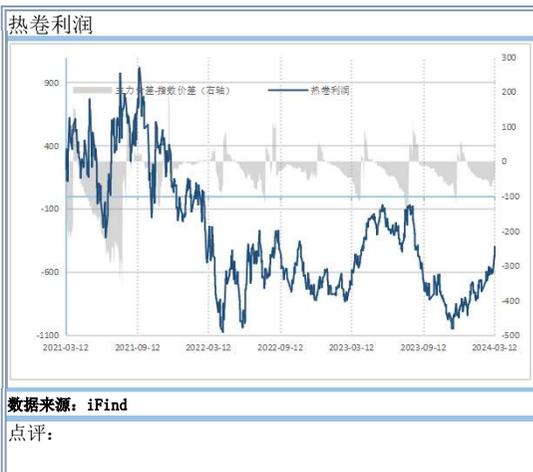
数据截止日： 2024-3-13

期内最小值： -1073.7273

期内最大值： 1014.0000

期内平均值： -300.4721

当前分位值： 32.29%



数据起始日: 2019-3-15

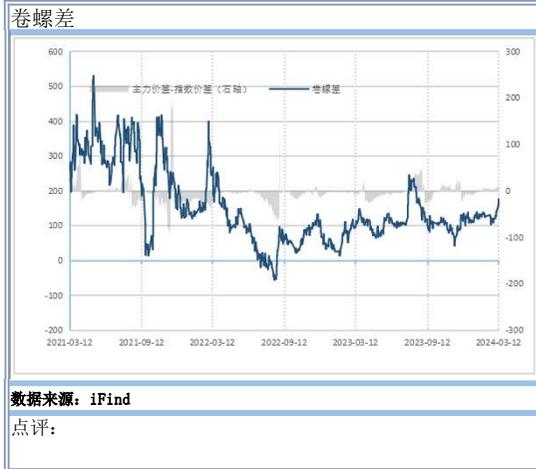
数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: -56.0000

期内最大值: 529.0000

期内平均值: 153.3402

当前分位值: 39.49%



数据起始日: 2019-3-15

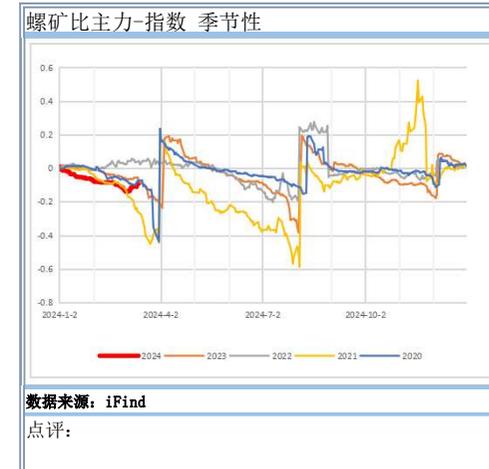
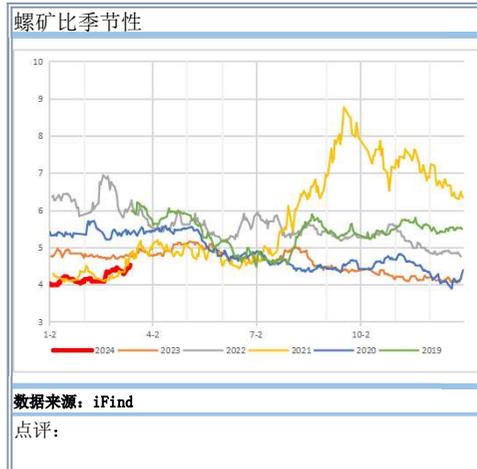
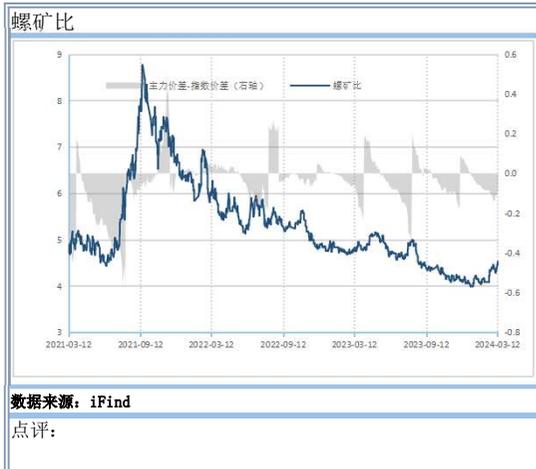
数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: 3.9880

期内最大值: 8.7631

期内平均值: 5.2906

当前分位值: 11.24%



数据起始日: 2019-3-15

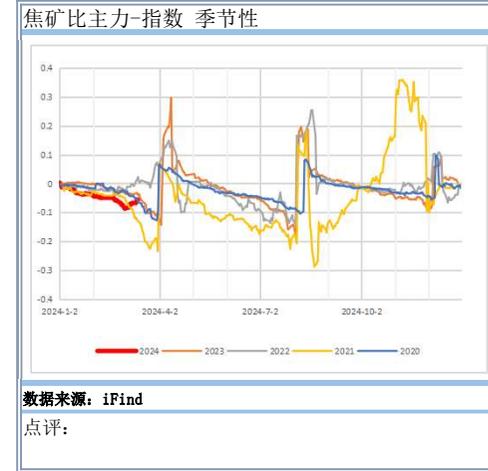
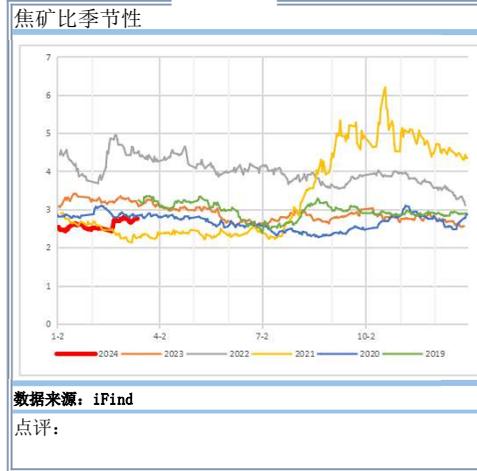
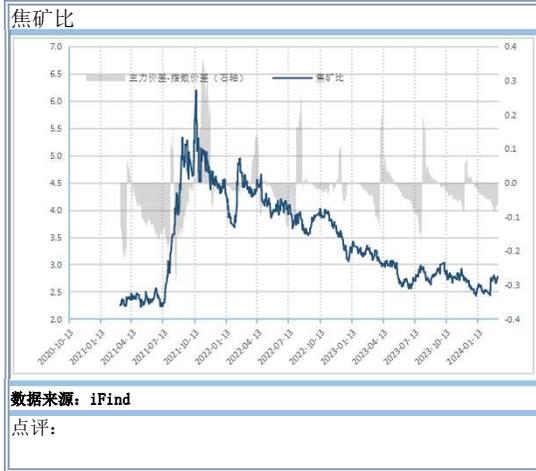
数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: 2.2197

期内最大值: 6.1947

期内平均值: 3.4174

当前分位值: 13.92%



数据起始日: 2019-3-15

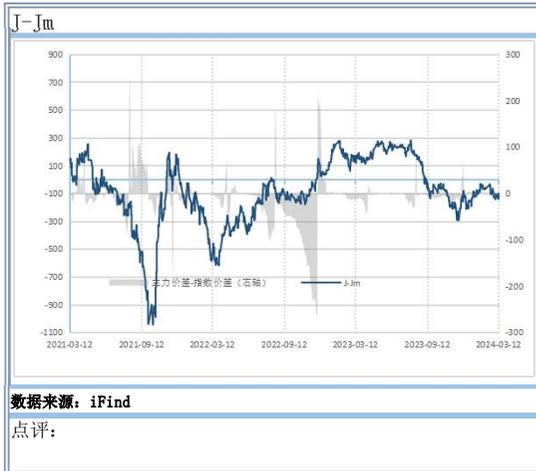
数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: -1043.0800

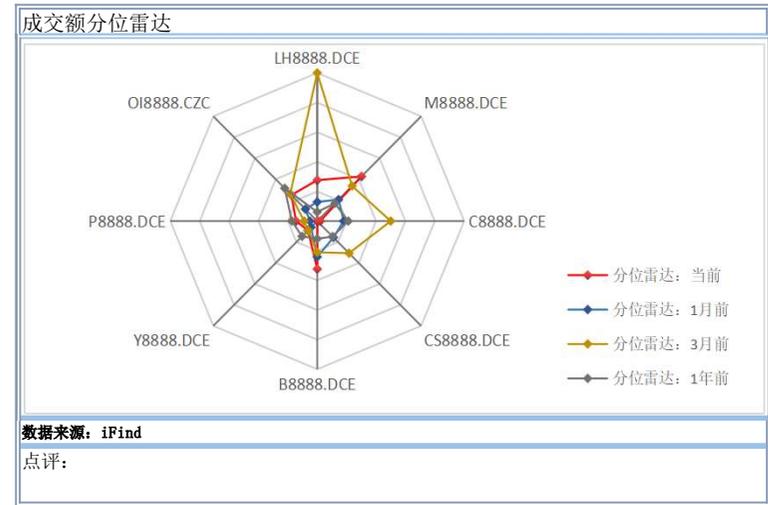
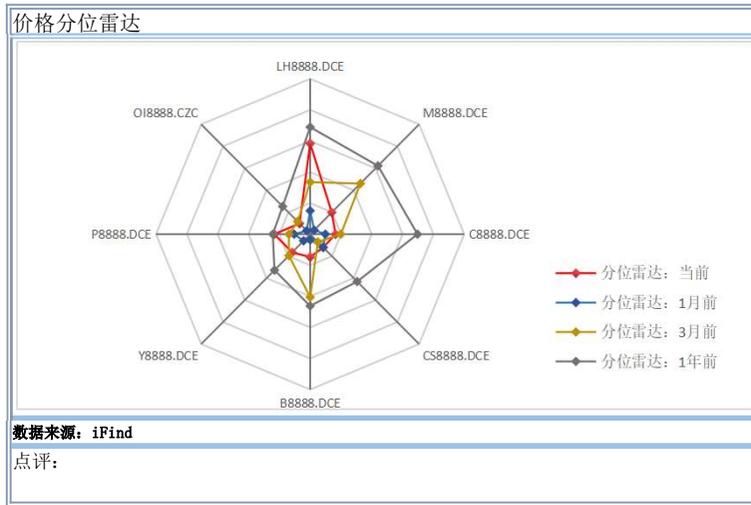
期内最大值: 279.1600

期内平均值: -85.8449

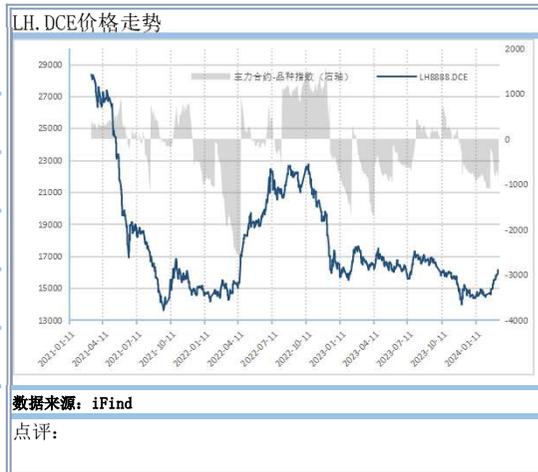
当前分位值: 71.24%



五、农产品相关



数据起始日: 2021-1-8
 数据截止日: 2024-3-13
 期内最小值: 13971
 期内最大值: 17601
 期内平均值: 16038.5138
 当前分位值: 58.40%



数据起始日： 2019-3-15

数据截止日： 2024-3-13

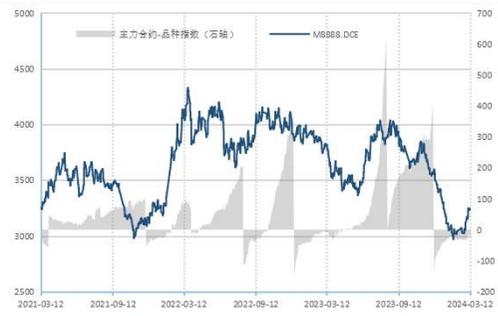
期内最小值： 2970

期内最大值： 4328

期内平均值： 3650.9698

当前分位值： 19.81%

M. DCE价格走势



数据来源： iFind

点评：

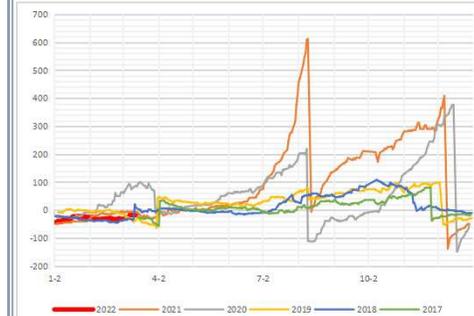
M. DCE价格走势季节性



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： 2019-3-15

数据截止日： 2024-3-13

期内最小值： 2328

期内最大值： 3027

期内平均值： 2689.7558

当前分位值： 16.45%

C. DCE价格走势



数据来源： iFind

点评：

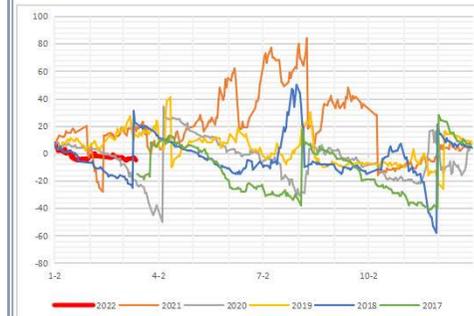
C. DCE价格走势季节性



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: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

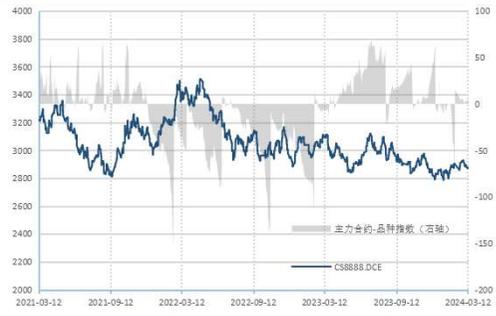
期内最小值: 2788

期内最大值: 3512

期内平均值: 3055.5034

当前分位值: 12.02%

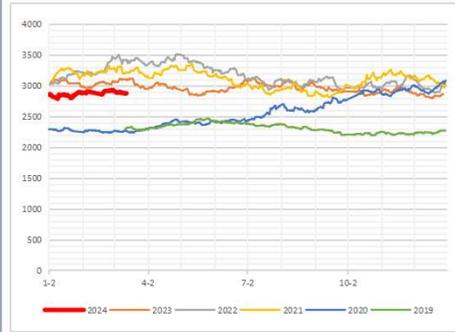
CS. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

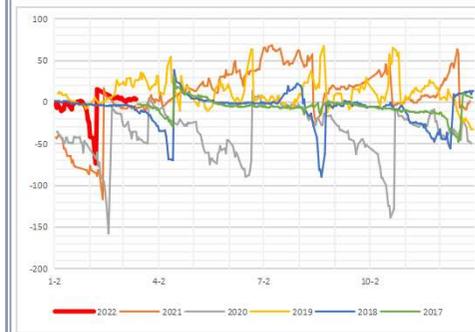
CS. DCE价格走势季节性



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: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

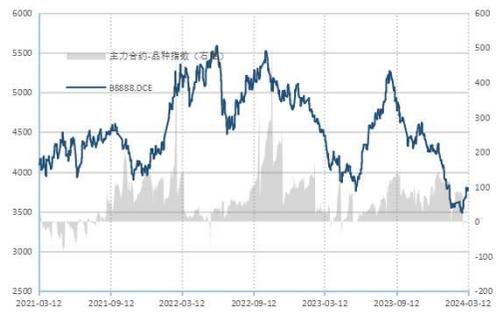
期内最小值: 3487

期内最大值: 5585

期内平均值: 4545.8368

当前分位值: 14.73%

B. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

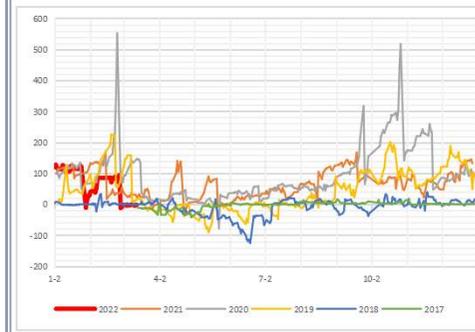
B. DCE价格走势季节性



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: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

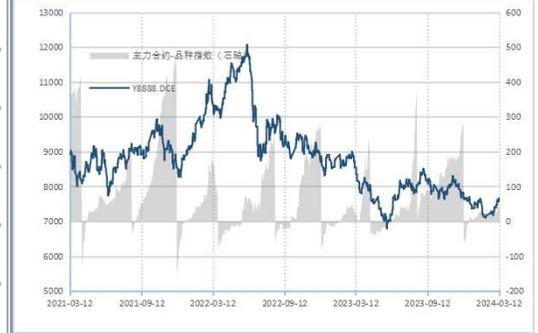
期内最小值: 6793

期内最大值: 12065

期内平均值: 8798.8628

当前分位值: 16.52%

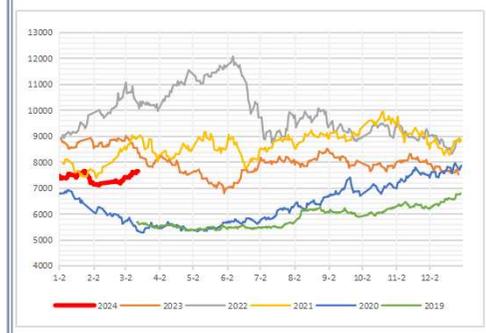
Y. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

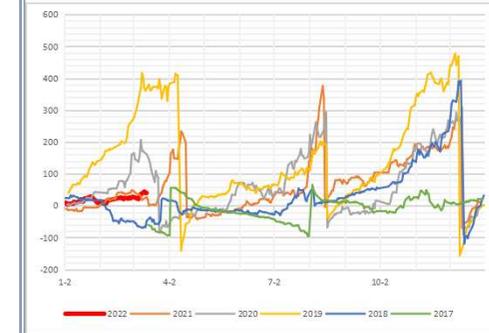
Y. DCE价格走势季节性



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: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

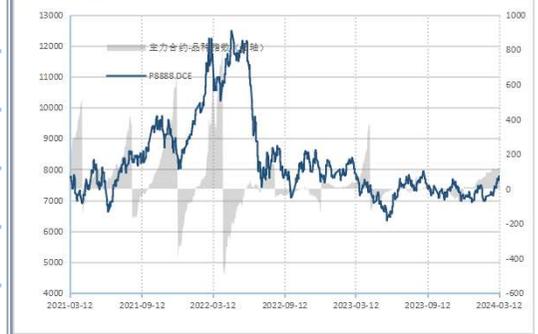
期内最小值: 6349

期内最大值: 12479

期内平均值: 8273.5254

当前分位值: 23.31%

P. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

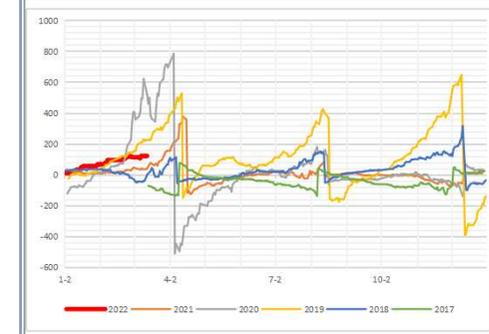
P. DCE价格走势季节性



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: 2019-3-15

数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: 7475

期内最大值: 14344

期内平均值: 10388.3978

当前分位值: 9.75%

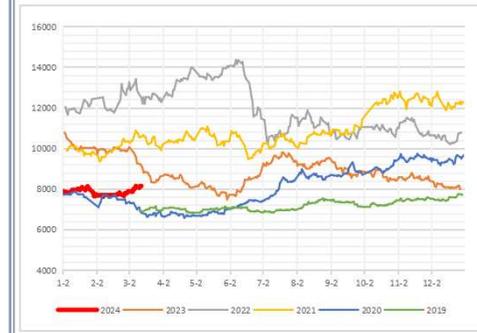
OI.CZCE价格走势



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: 2024-3-13

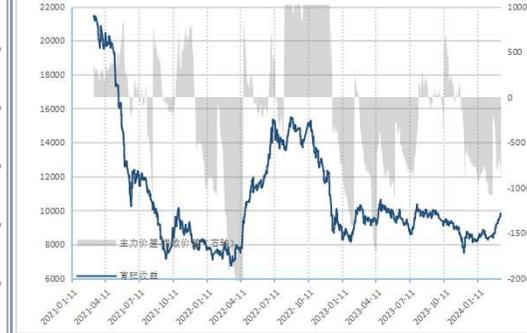
期内最小值: 7508.2500

期内最大值: 10624.2500

期内平均值: 9250.3974

当前分位值: 73.05%

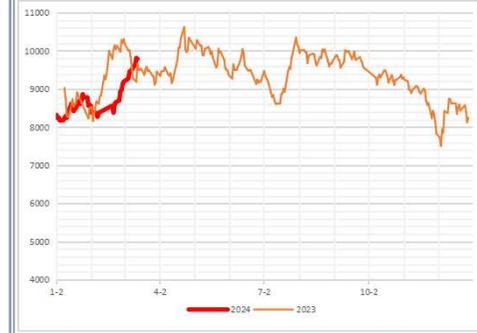
育肥收益



数据来源: iFind

点评:

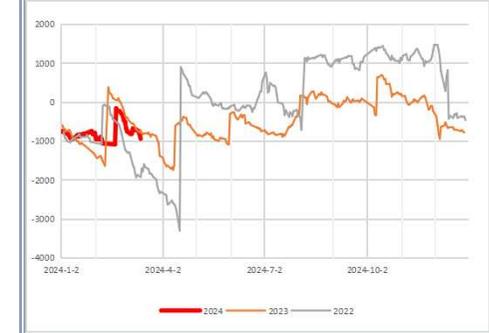
育肥收益季节性



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

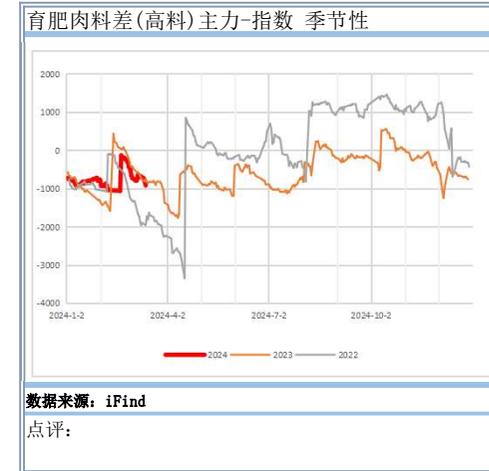
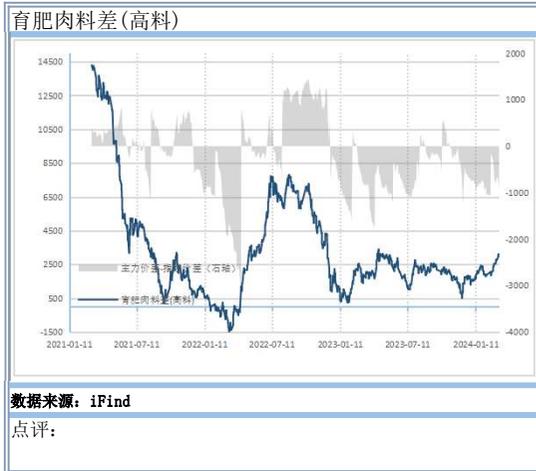
数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: 246.0000

期内最大值: 3391.0000

期内平均值: 1956.8586

当前分位值: 90.11%



数据起始日: 2019-3-15

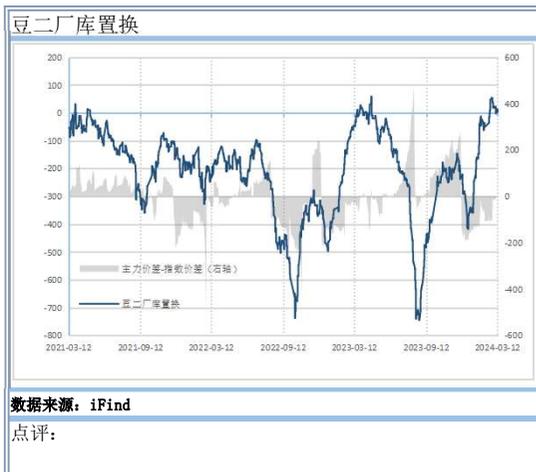
数据截止日: 2024-3-13

期内最小值: -745.0200

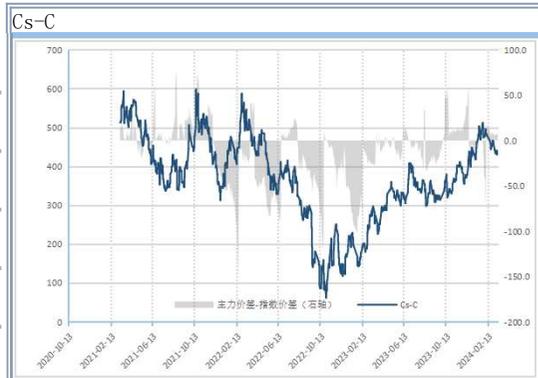
期内最大值: 58.2450

期内平均值: -212.0358

当前分位值: 93.30%



数据起始日: 2019-3-15
 数据截止日: 2024-3-13
 期内最小值: 62.0000
 期内最大值: 598.0000
 期内平均值: 365.7476
 当前分位值: 69.03%



数据来源: iFind
 点评:

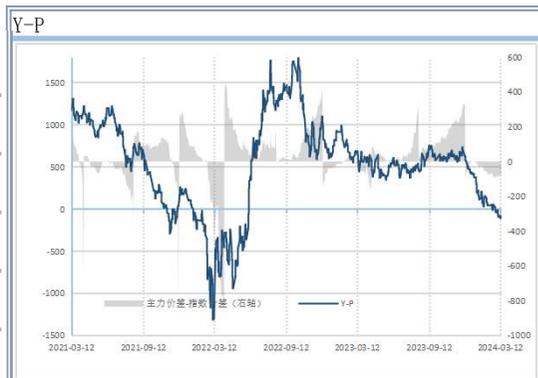


数据来源: iFind
 点评:



数据来源: iFind
 点评:

数据起始日: 2019-3-15
 数据截止日: 2024-3-13
 期内最小值: -1313.0000
 期内最大值: 1788.0000
 期内平均值: 525.3374
 当前分位值: 38.66%



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： 2019-3-15

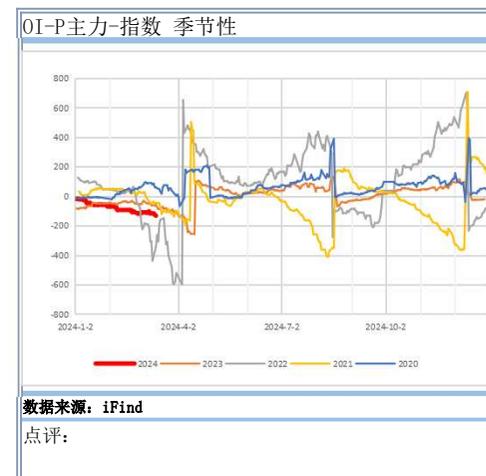
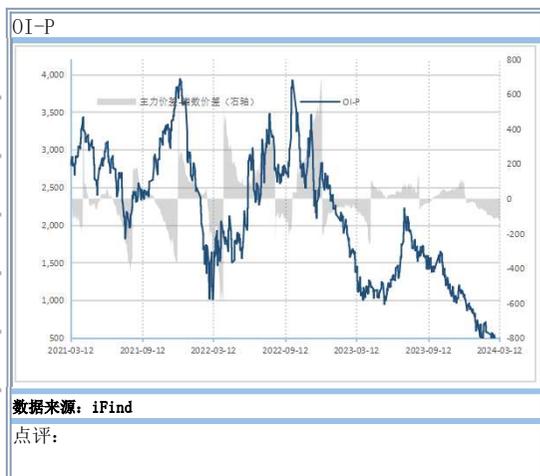
数据截止日： 2024-3-13

期内最小值： 367.0000

期内最大值： 3919.0000

期内平均值： 1595.0708

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。