

盘面套利观察

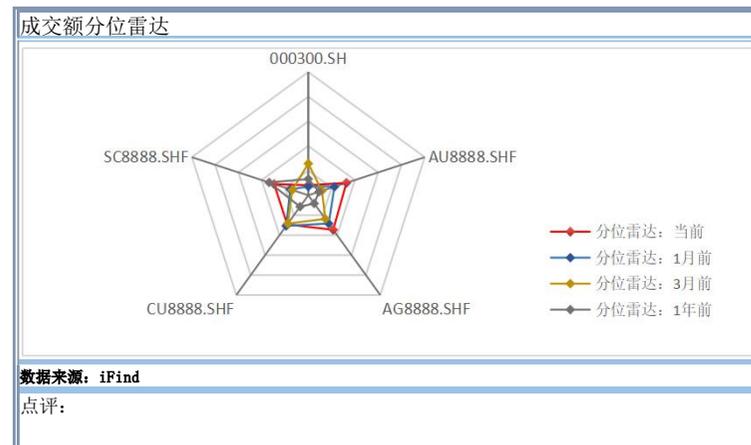
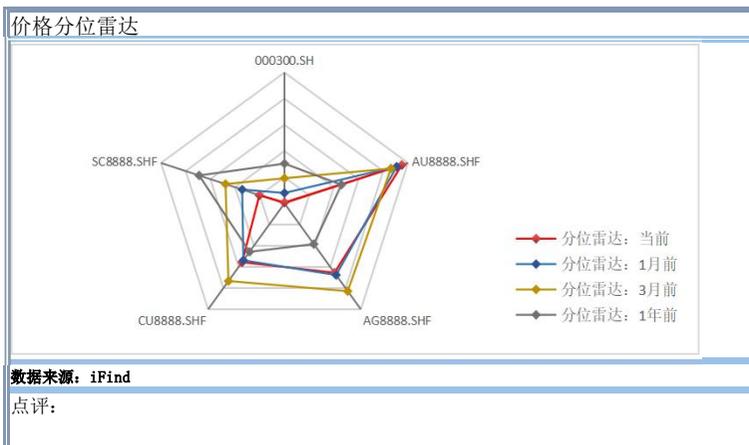
2024年9月9日

数据仅供参考，据此入市，风险自担。

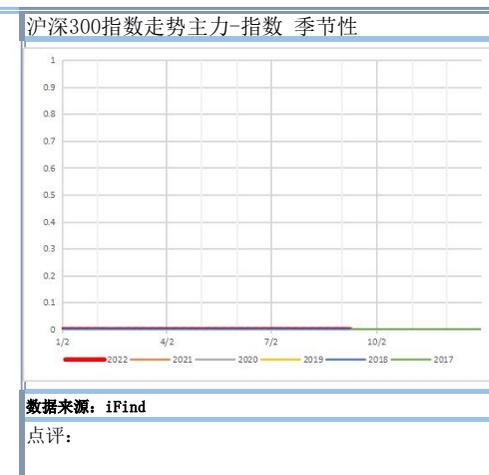
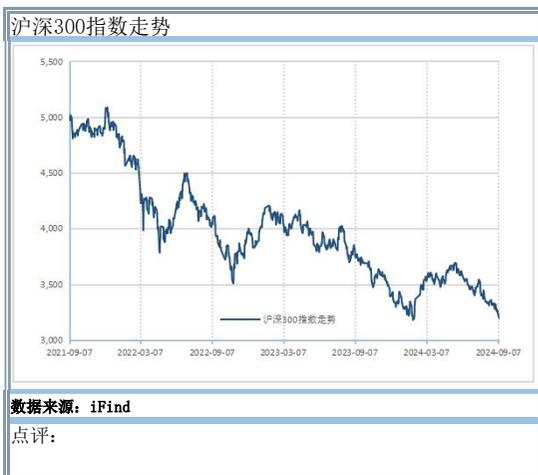
说明：

- 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: 2019/9/10
数据截止日: 2024/9/9
期内最小值: 3179.6276
期内最大值: 5083.8007
期内平均值: 3965.4603
当前分位值: 19.22%



数据起始日: 2019/9/10

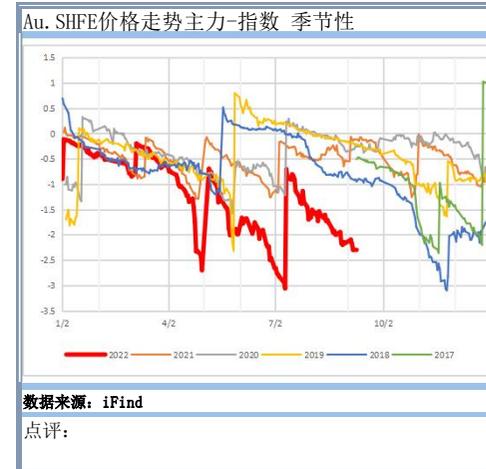
数据截止日: 2024/9/9

期内最小值: 363.2

期内最大值: 582.4

期内平均值: 443.4538

当前分位值: 95.04%



数据起始日: 2019/9/10

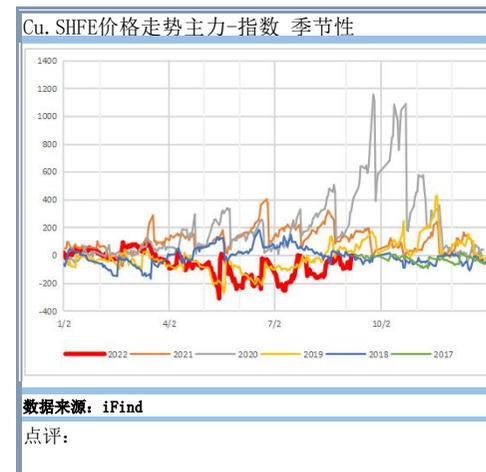
数据截止日: 2024/9/9

期内最小值: 53367

期内最大值: 87697

期内平均值: 69372.3525

当前分位值: 55.49%



数据起始日： 2019/9/10

数据截止日： 2024/9/9

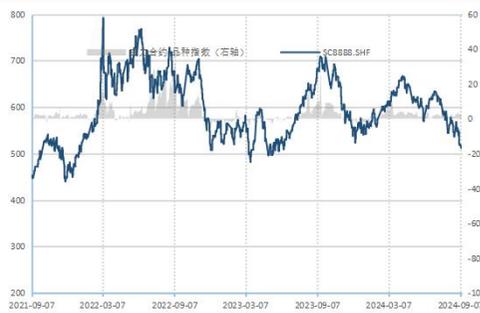
期内最小值： 439.9

期内最大值： 791.6

期内平均值： 595.2916

当前分位值： 20.27%

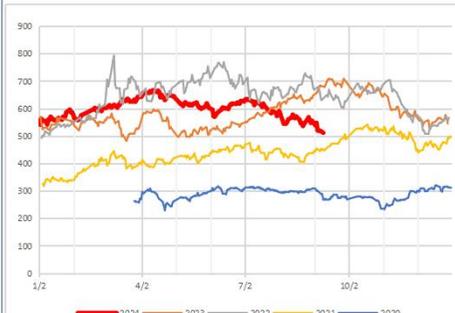
Sc. Ine价格走势



数据来源： iFind

点评：

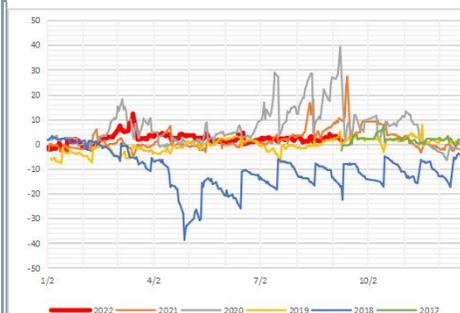
Sc. Ine价格走势季节性



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： 2019/9/10

数据截止日： 2024/9/9

期内最小值： 9.6881

期内最大值： 15.4319

期内平均值： 12.7055

当前分位值： 11.88%

Cu/Au



数据来源： iFind

点评：

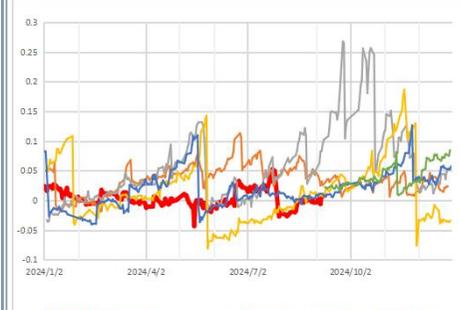
Cu/Au季节性



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：2019/9/10

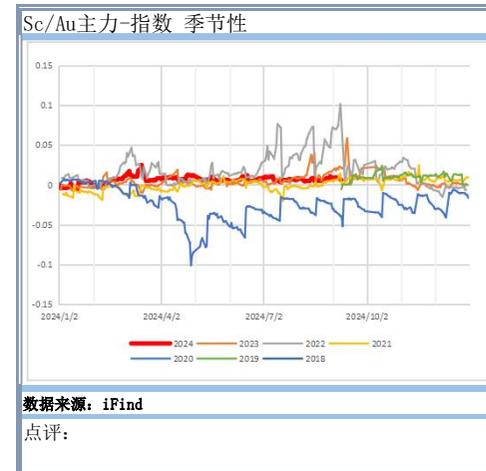
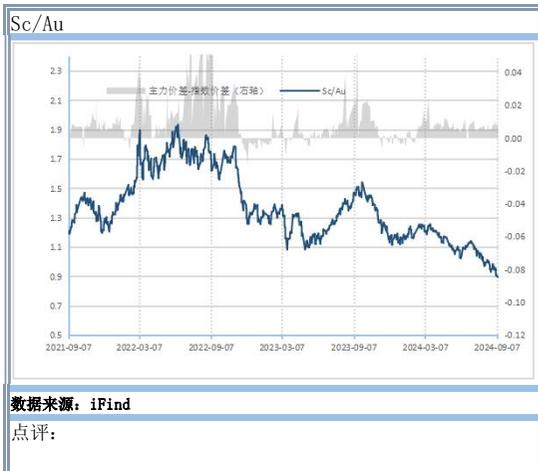
数据截止日：2024/9/9

期内最小值：0.8944

期内最大值：1.9320

期内平均值：1.3658

当前分位值：0.00%



数据起始日：2019/9/10

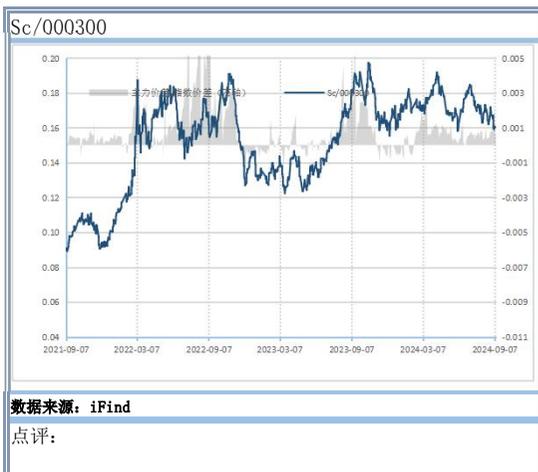
数据截止日：2024/9/9

期内最小值：0.0892

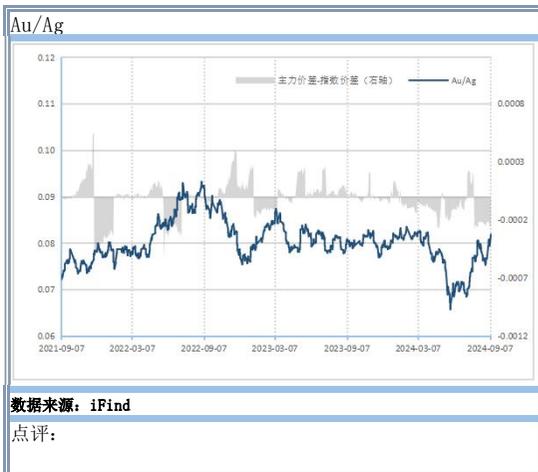
期内最大值：0.1972

期内平均值：0.1526

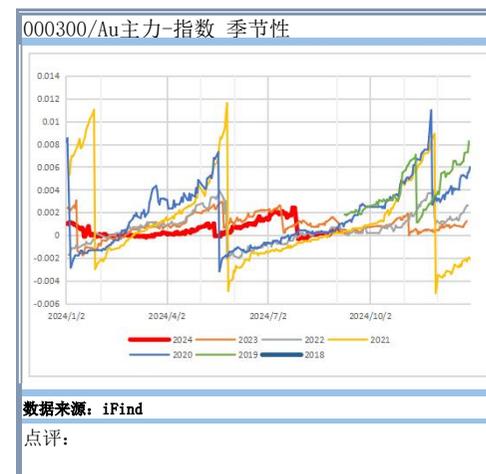
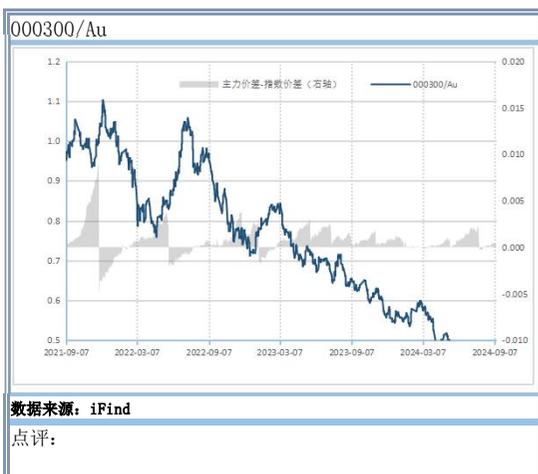
当前分位值：65.67%



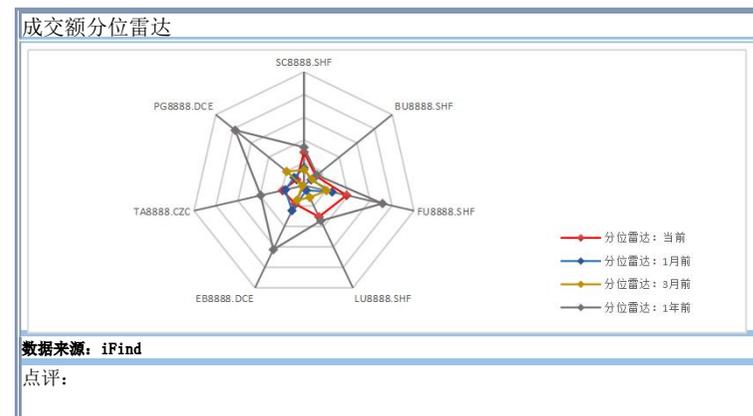
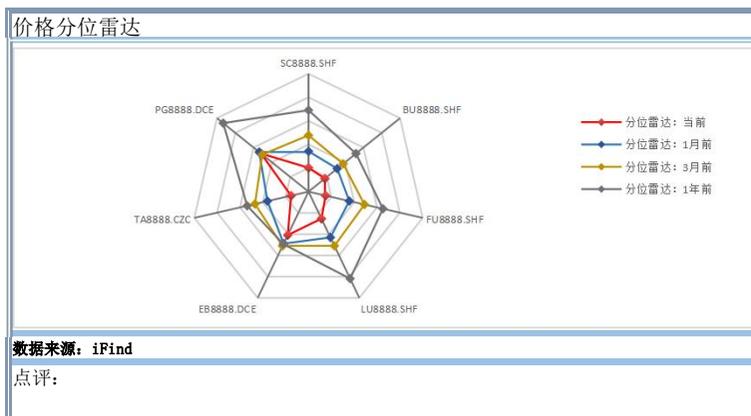
数据起始日: 2019/9/10
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: 0.0657
 期内最大值: 0.0932
 期内平均值: 0.0802
 当前分位值: 58.74%



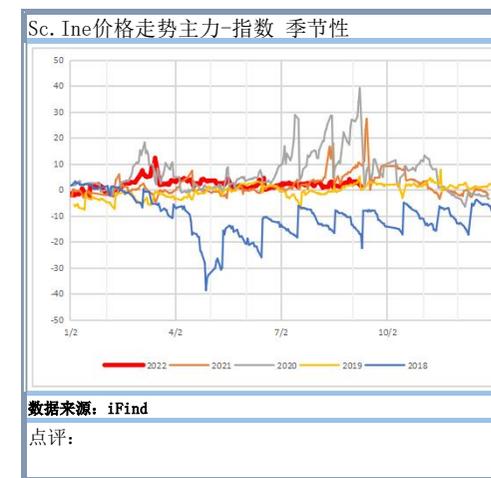
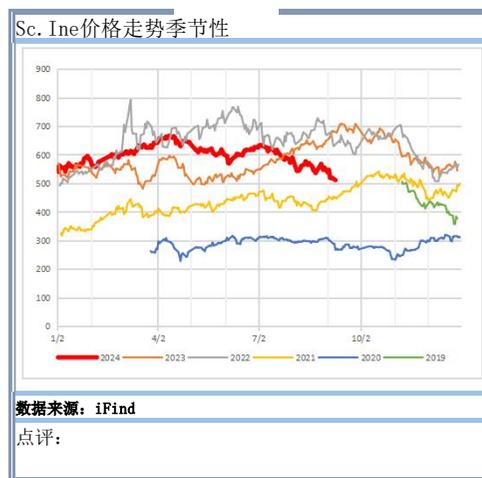
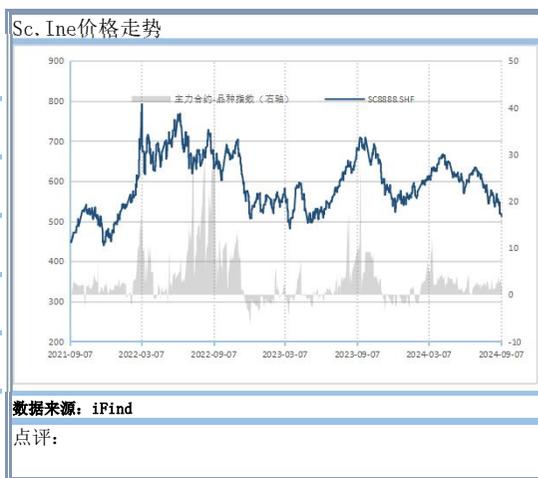
数据起始日: 2019/9/10
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: 0.4165
 期内最大值: 1.1021
 期内平均值: 0.7416
 当前分位值: 5.95%



二、原油相关



数据起始日: 2019/9/10
数据截止日: 2024/9/9
期内最小值: 439.9
期内最大值: 791.6
期内平均值: 595.2916
当前分位值: 20.27%



数据起始日：2019/9/10

数据截止日：2024/9/9

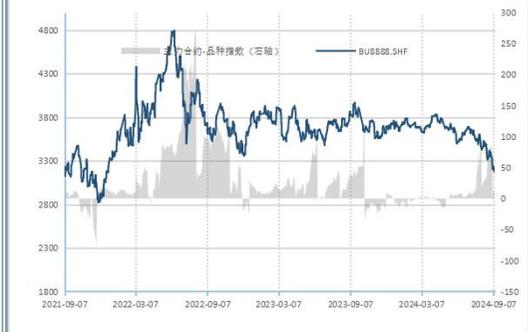
期内最小值：2821

期内最大值：4794

期内平均值：3679.2853

当前分位值：17.89%

Bu. SHFE价格走势



数据来源：iFind

点评：

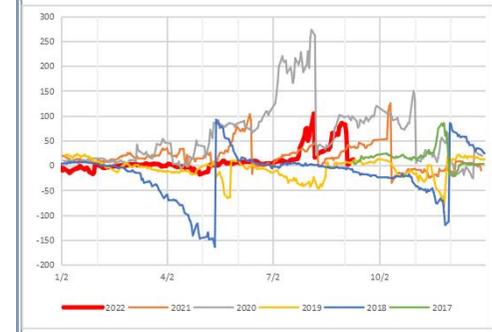
Bu. SHFE价格走势季节性



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：2019/9/10

数据截止日：2024/9/9

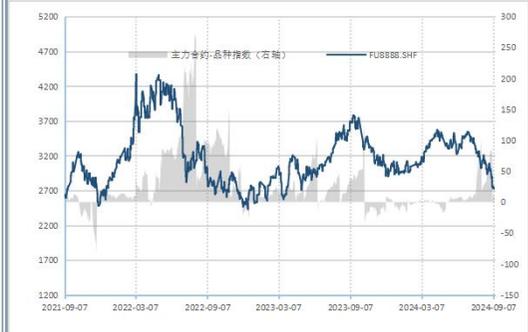
期内最小值：2432

期内最大值：4371

期内平均值：3167.7915

当前分位值：14.96%

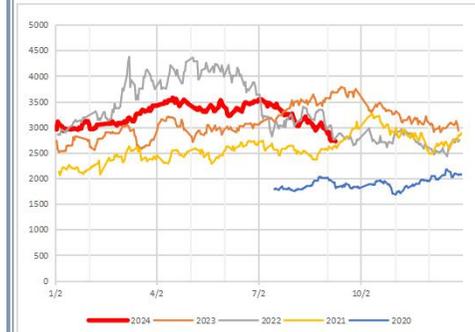
Fu. SHFE价格走势



数据来源：iFind

点评：

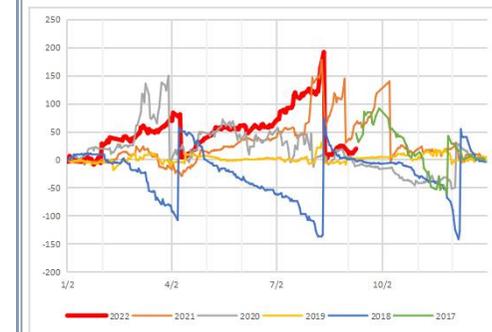
Fu. SHFE价格走势季节性



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：2024/9/9

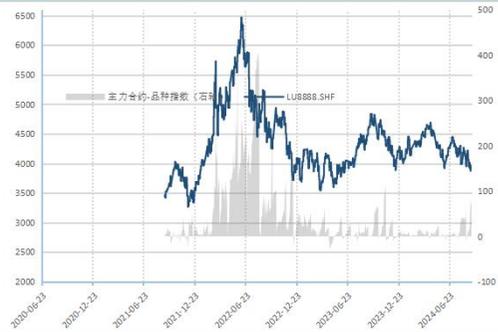
期内最小值：3544

期内最大值：4834

期内平均值：4185.3247

当前分位值：25.43%

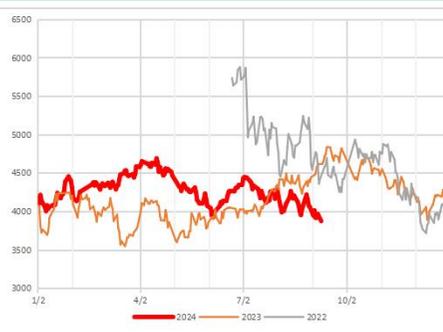
Lu. Ine价格走势



数据来源：iFind

点评：

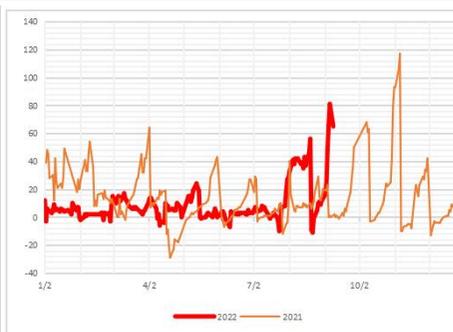
Lu. Ine价格走势季节性



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：2024/9/9

期内最小值：6978

期内最大值：11361

期内平均值：8735.9700

当前分位值：40.86%

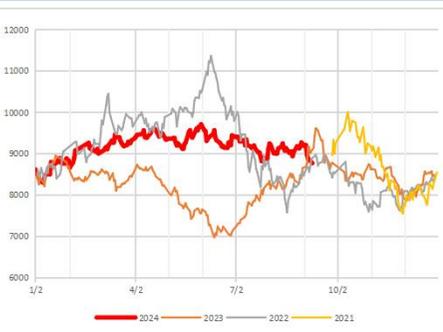
EB. DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

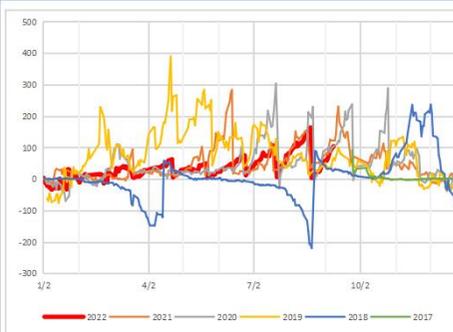
EB. DCE价格走势季节性



数据来源：iFind

点评：

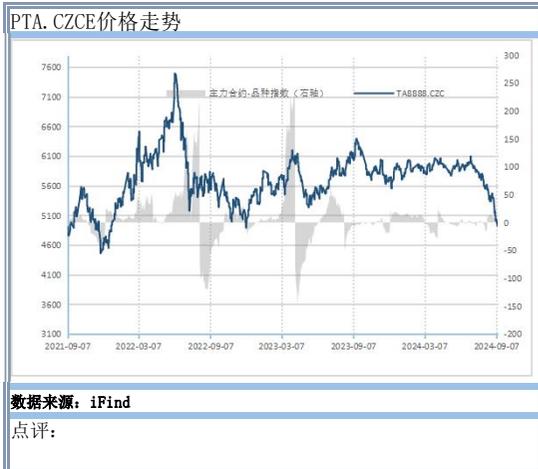
EB. DCE价格走势主力-指数 季节性



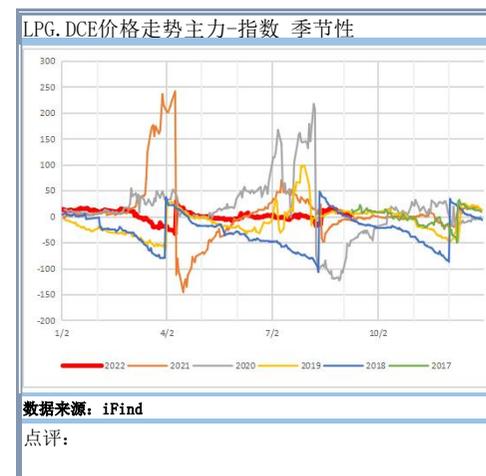
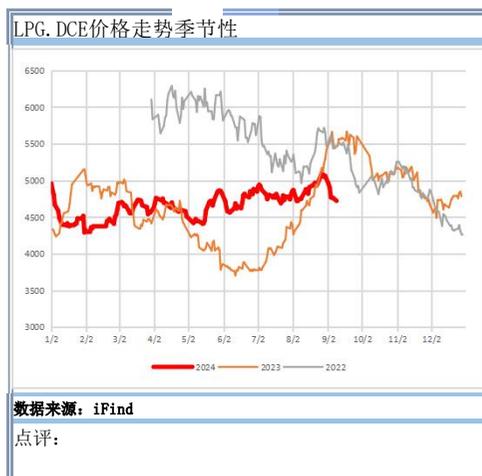
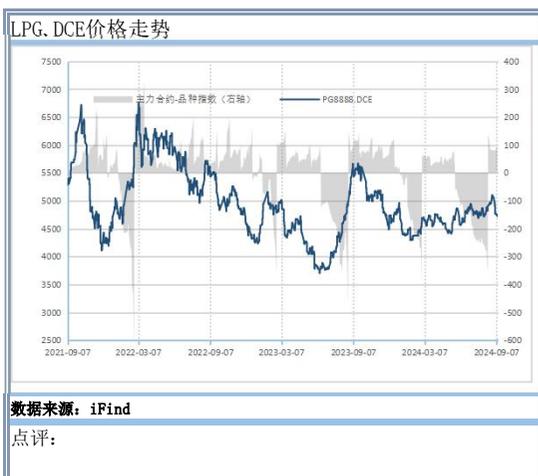
数据来源：iFind

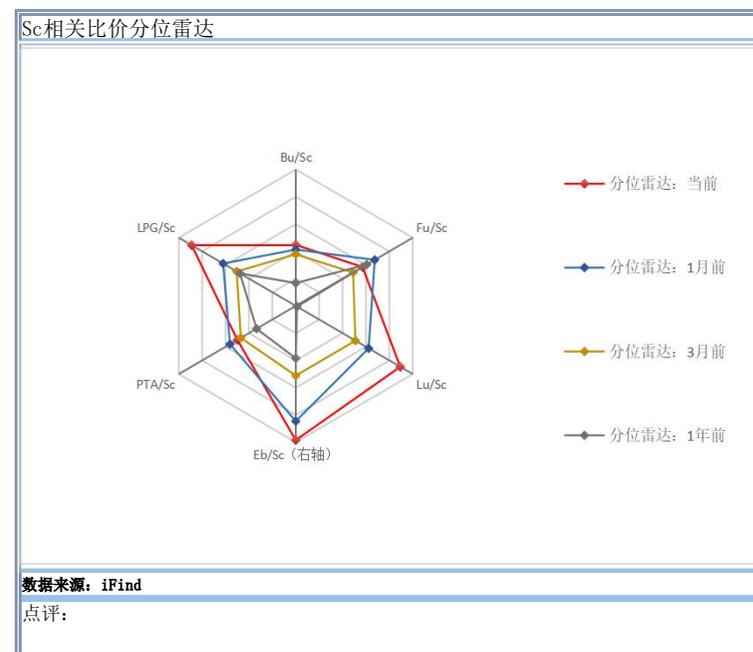
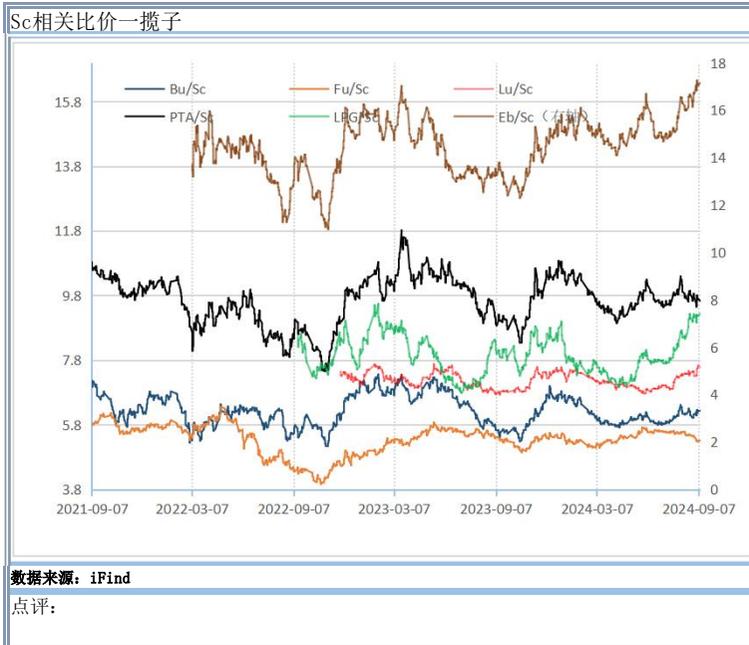
点评：

数据起始日： 2019/9/10
 数据截止日： 2024/9/9
 期内最小值： 4462
 期内最大值： 7488
 期内平均值： 5699.4060
 当前分位值： 15.27%

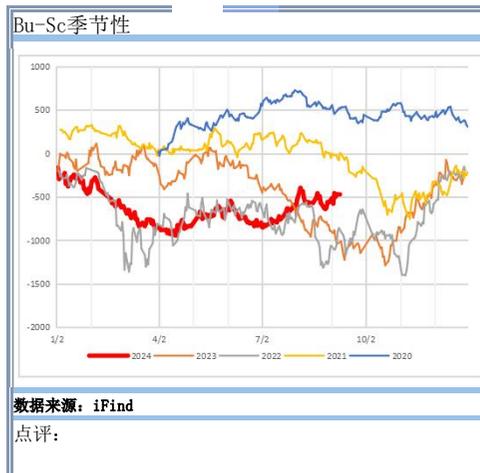
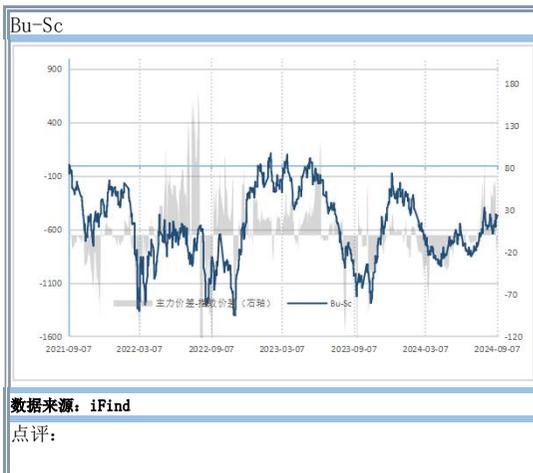


数据起始日： 2020/3/30
 数据截止日： 2024/9/9
 期内最小值： 3704
 期内最大值： 5665
 期内平均值： 4683.0000
 当前分位值： 51.86%

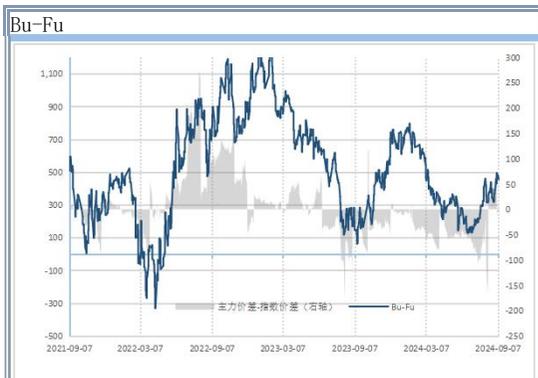




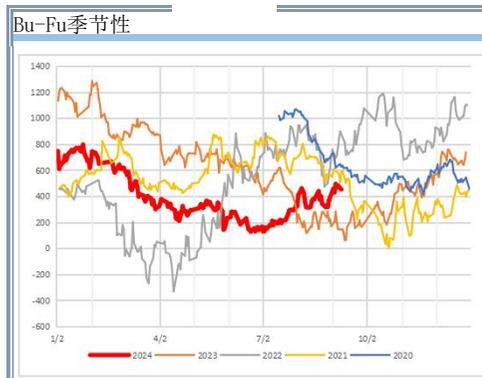
数据起始日: 2019/9/10
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: -1406.4286
 期内最大值: 111.1429
 期内平均值: -572.7978
 当前分位值: 61.22%



数据起始日：2019/9/10
 数据截止日：2024/9/9
 期内最小值：-331.0000
 期内最大值：1284.0000
 期内平均值：511.4938
 当前分位数：48.48%



数据来源：iFind
 点评：

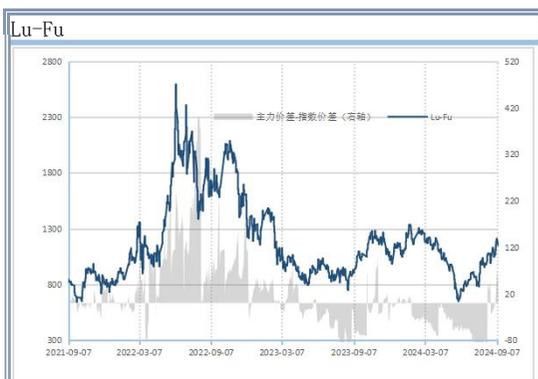


数据来源：iFind
 点评：

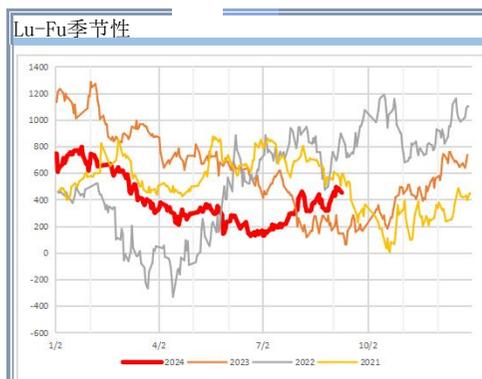


数据来源：iFind
 点评：

数据起始日：2021/11/1
 数据截止日：2024/9/9
 期内最小值：650.0000
 期内最大值：1483.0000
 期内平均值：1048.5765
 当前分位数：60.02%



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：2021/9/6

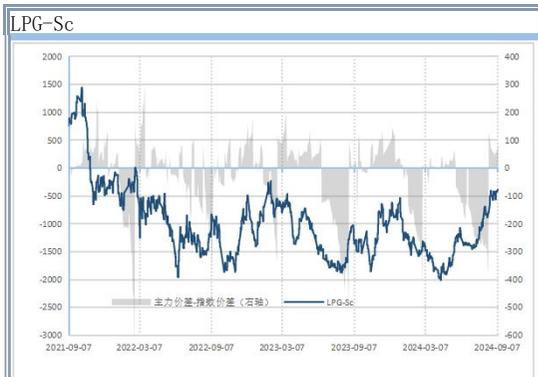
数据截止日：2024/9/9

期内最小值：-2017.0000

期内最大值：-240.0000

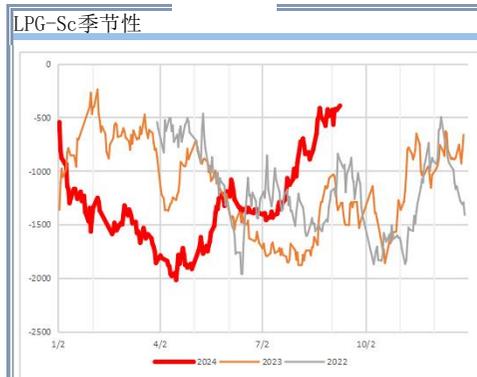
期内平均值：-1224.3216

当前分位值：91.50%



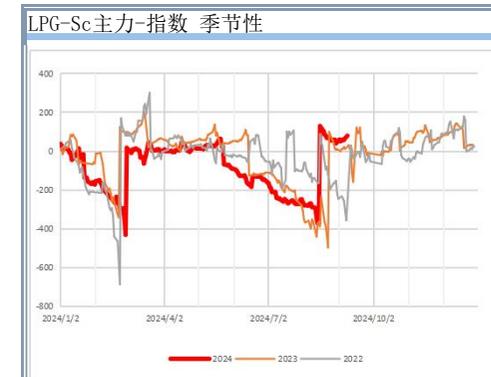
数据来源：iFind

点评：



数据来源：iFind

点评：



数据来源：iFind

点评：

数据起始日：2019/9/10

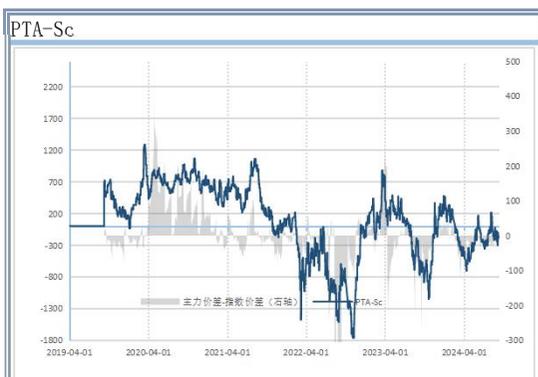
数据截止日：2024/9/9

期内最小值：-1762.0000

期内最大值：876.0000

期内平均值：-253.5103

当前分位值：59.67%



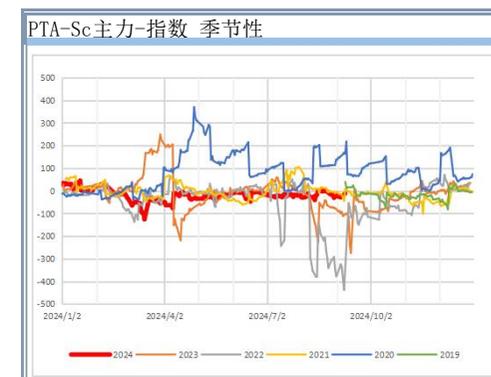
数据来源：iFind

点评：



数据来源：iFind

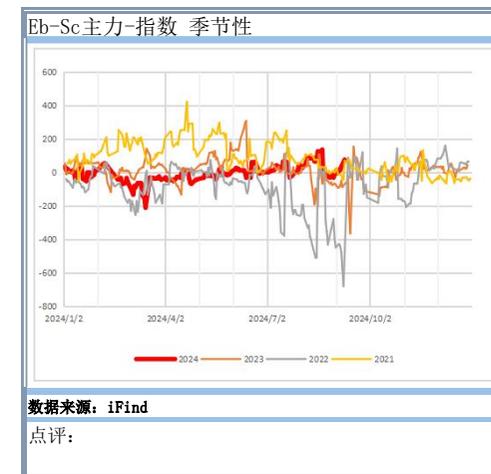
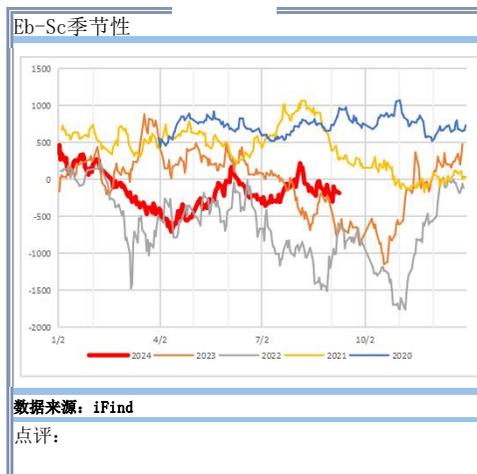
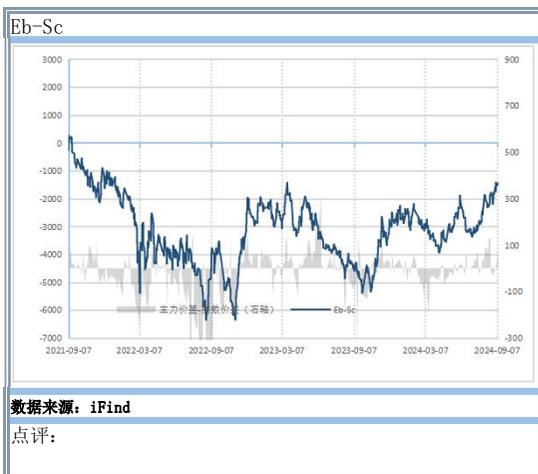
点评：



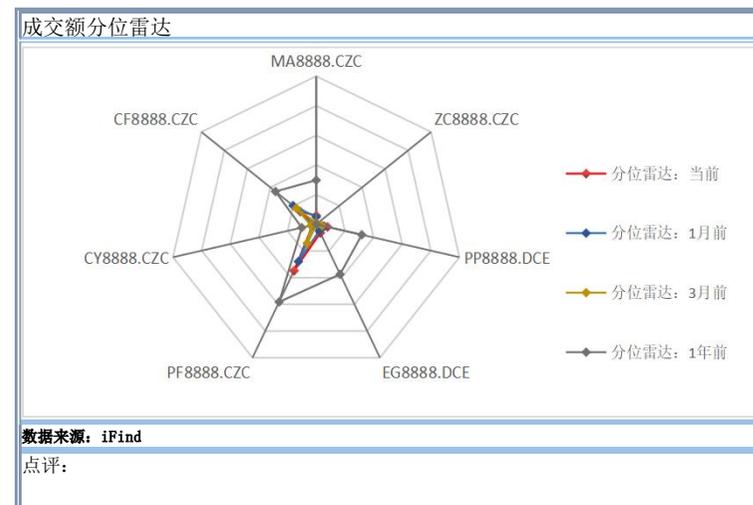
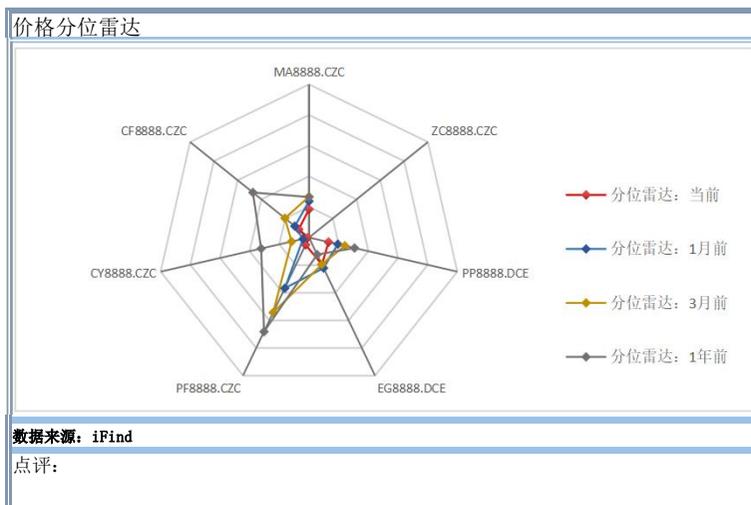
数据来源：iFind

点评：

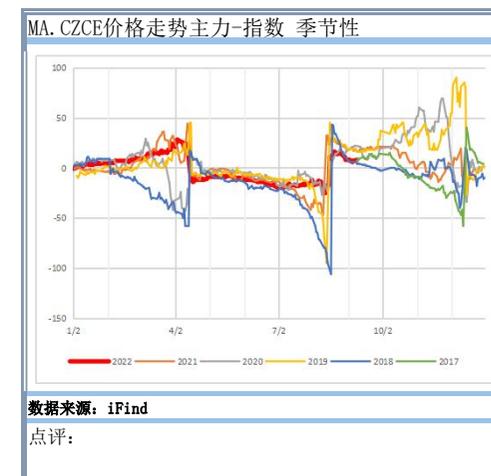
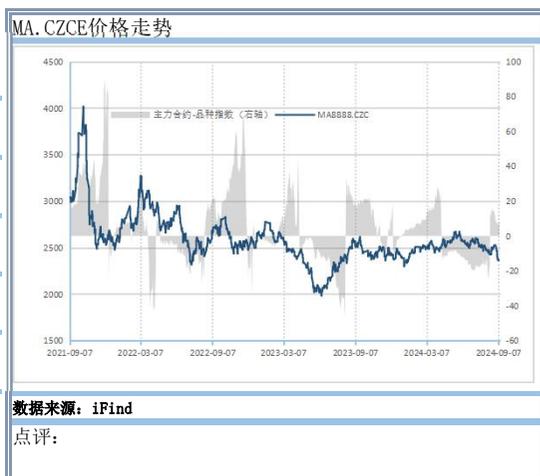
数据起始日: 2021/5/9
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: -6347.0000
 期内最大值: -1429.0000
 期内平均值: -3444.8120
 当前分位值: 99.47%



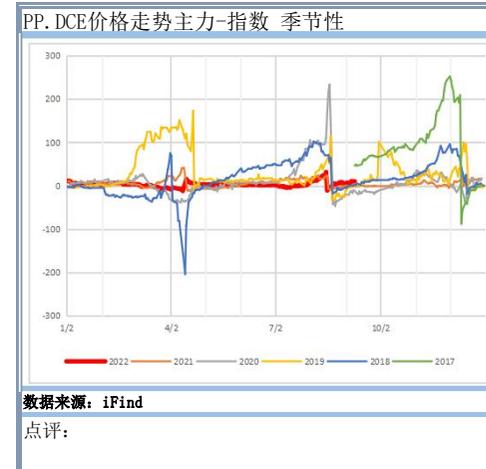
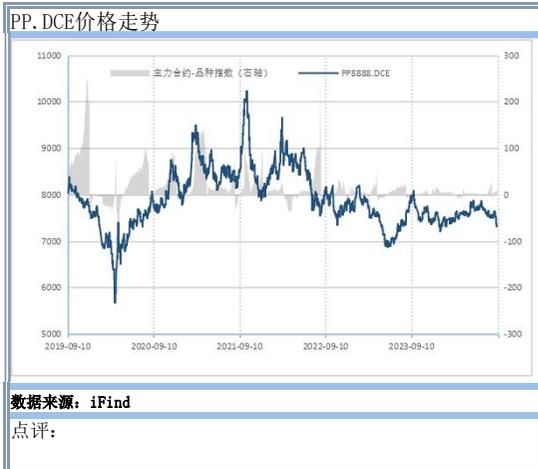
三、煤化工相关



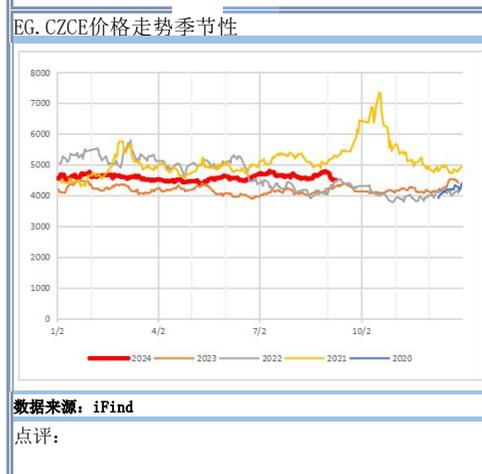
数据起始日: 2019/9/10
数据截止日: 2024/9/9
期内最小值: 1982
期内最大值: 4015
期内平均值: 2579.4842
当前分位值: 18.49%



数据起始日: 2019/9/10
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: 6865
 期内最大值: 10224
 期内平均值: 7884.4362
 当前分位值: 13.16%



数据起始日: 2019/9/10
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: 3778
 期内最大值: 7345
 期内平均值: 4547.0919
 当前分位值: 19.60%



数据起始日: 2020/10/12

数据截止日: 2024/9/9

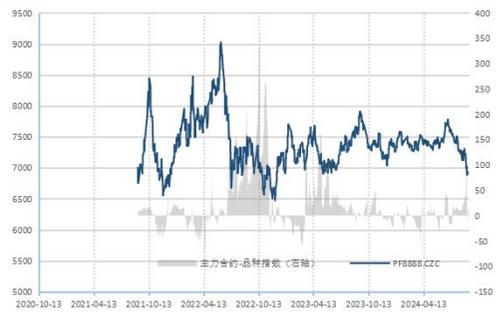
期内最小值: 6886

期内最大值: 7907

期内平均值: 7362.0255

当前分位值: 5.19%

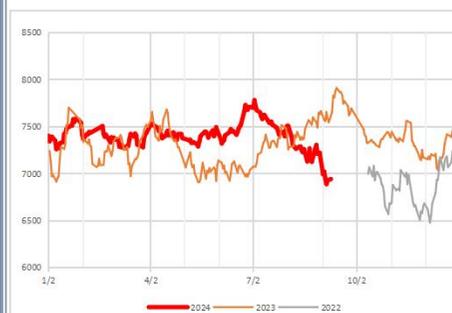
PF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

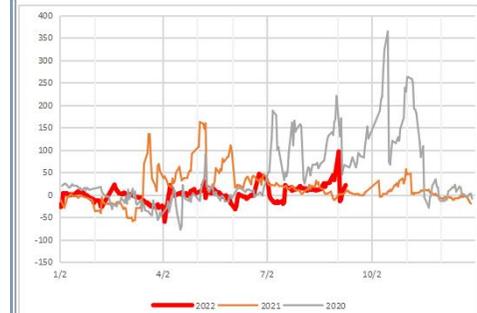
PF. CZCE价格走势季节性



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: 2019/9/10

数据截止日: 2024/9/9

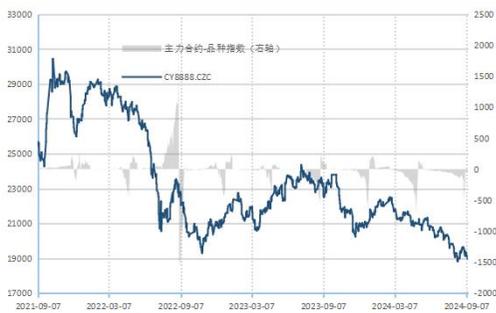
期内最小值: 18830

期内最大值: 30443

期内平均值: 23240.6351

当前分位值: 1.12%

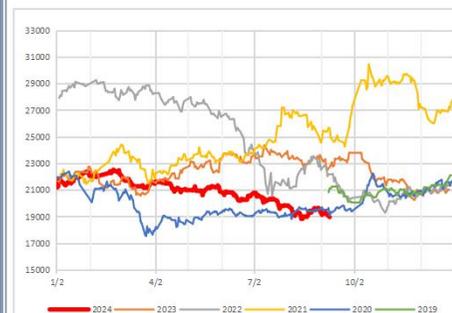
CY. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

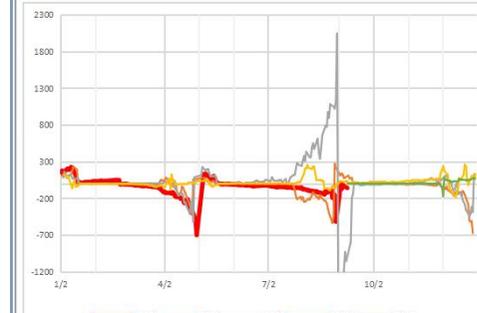
CY. CZCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

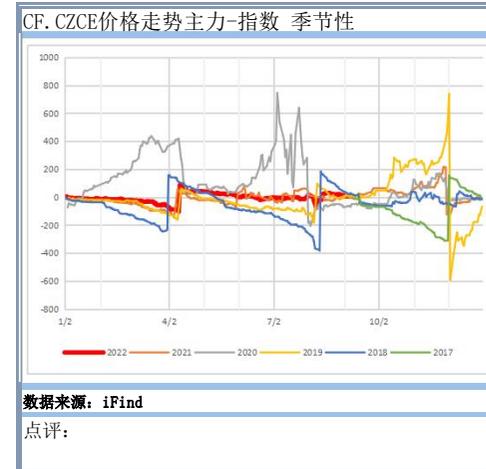
CY. CZCE价格走势主力-指数 季节性



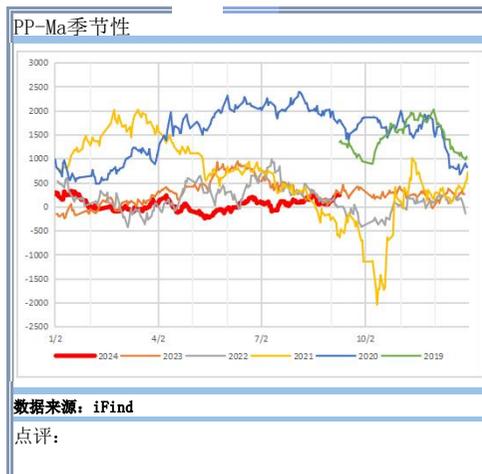
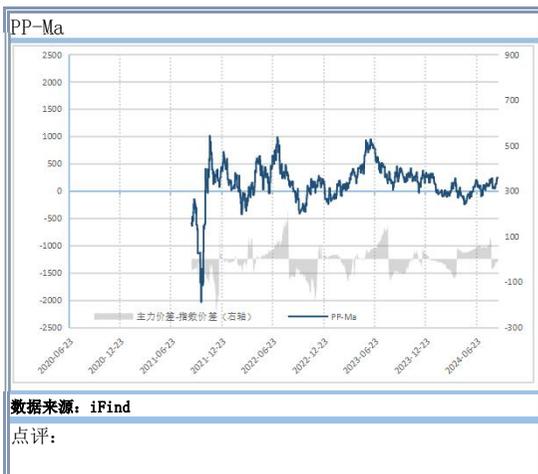
数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/9/10
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: 12447
 期内最大值: 22574
 期内平均值: 16649.2099
 当前分位值: 8.64%



数据起始日: 2019/9/10
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: -2039.0000
 期内最大值: 1007.0000
 期内平均值: 145.9835
 当前分位值: 74.59%



数据起始日: 2019/9/10

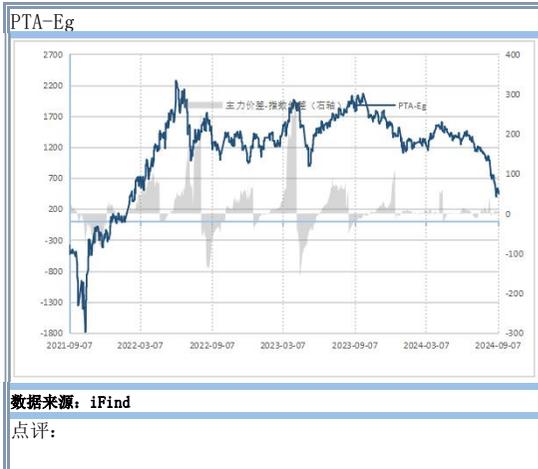
数据截止日: 2024/9/9

期内最小值: -1783.0000

期内最大值: 2269.0000

期内平均值: 1152.3141

当前分位值: 55.03%



数据起始日: 2022/1/12

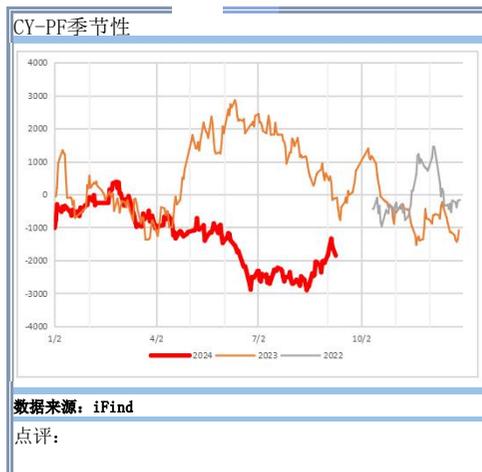
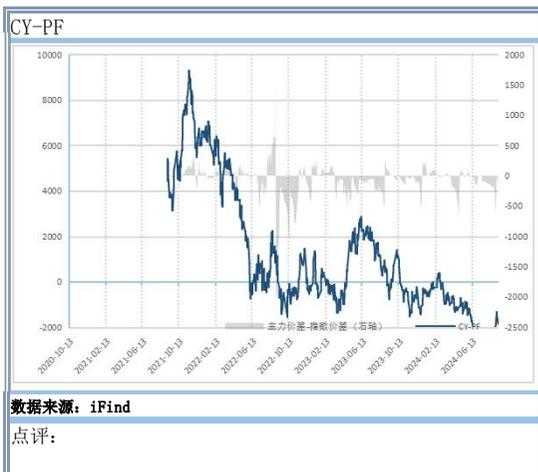
数据截止日: 2024/9/9

期内最小值: -2902.0000

期内最大值: 2854.0000

期内平均值: -339.2663

当前分位值: 18.15%



数据起始日: 2023/3/30

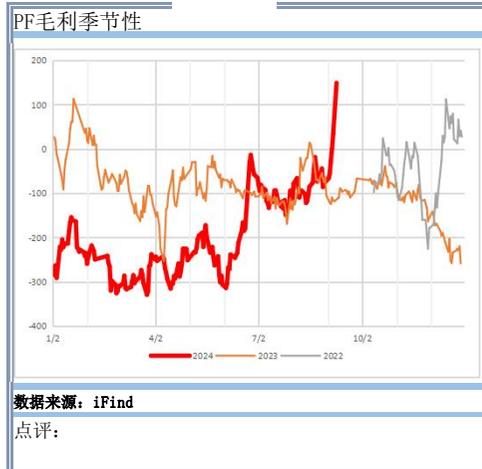
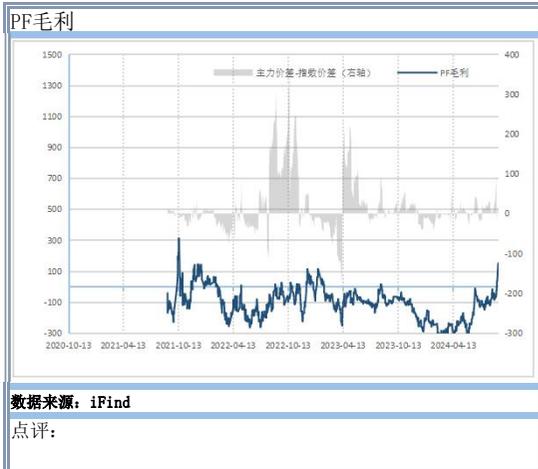
数据截止日: 2024/9/9

期内最小值: -328.9900

期内最大值: 149.1850

期内平均值: -147.6816

当前分位值: 100.00%



数据起始日: 2019/9/10

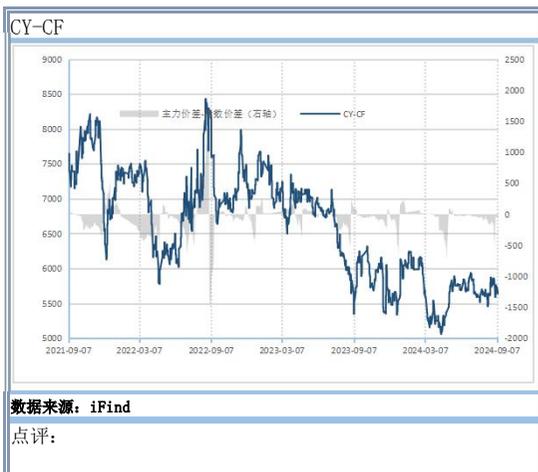
数据截止日: 2024/9/9

期内最小值: 5061.0000

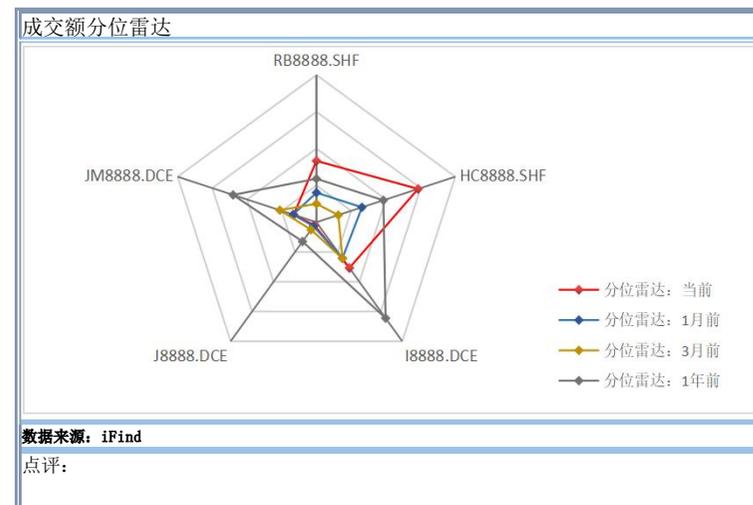
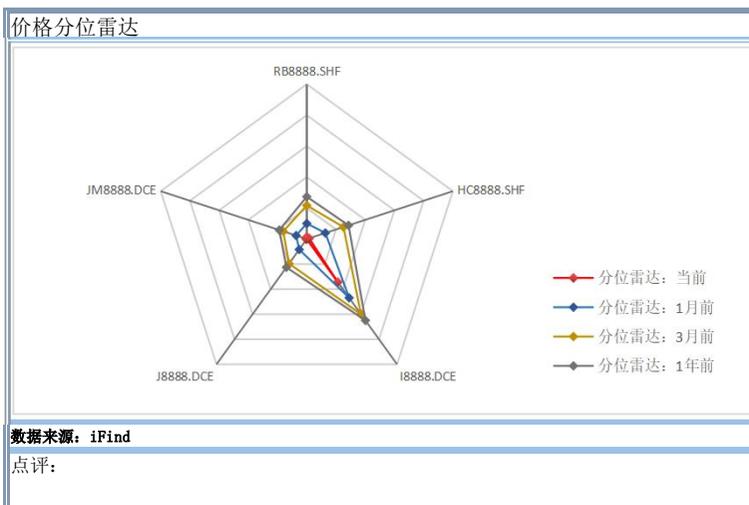
期内最大值: 8428.0000

期内平均值: 6591.4252

当前分位值: 17.14%



四、黑色相关



数据起始日: 2019/9/10

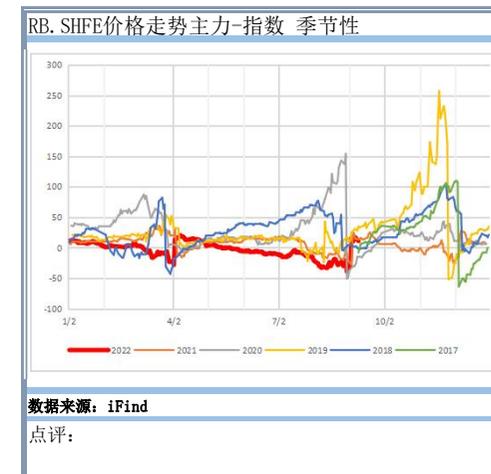
数据截止日: 2024/9/9

期内最小值: 3034

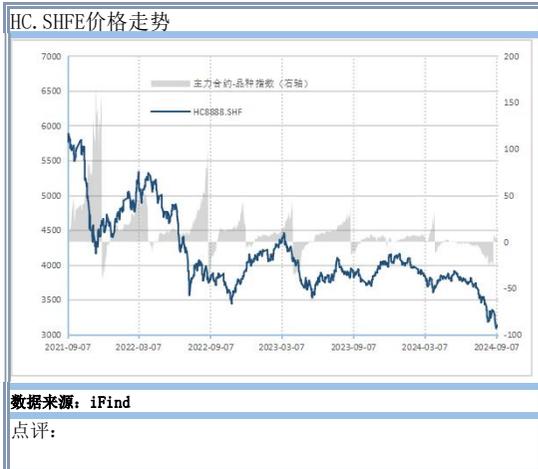
期内最大值: 5762

期内平均值: 4018.4047

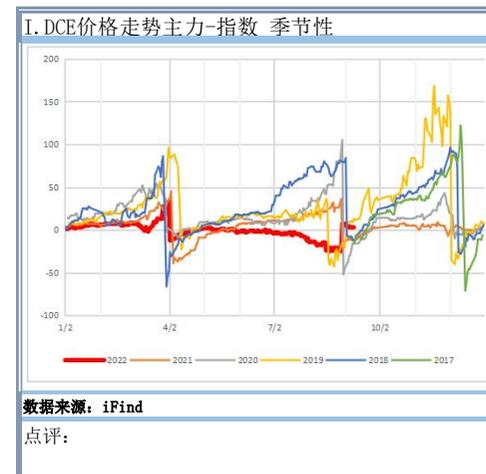
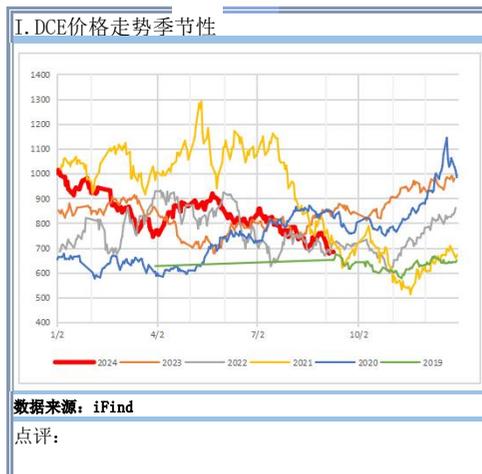
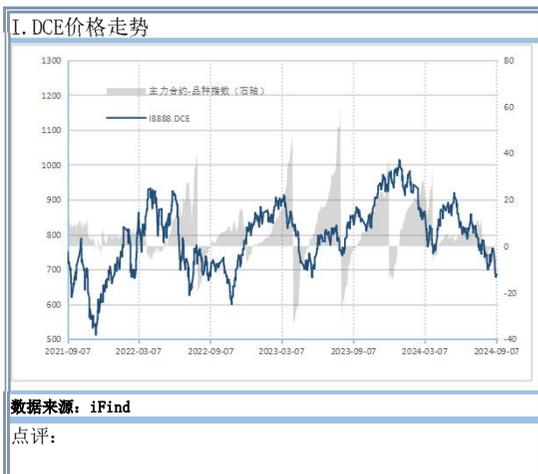
当前分位值: 1.21%



数据起始日: 2019/9/10
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: 3093
 期内最大值: 5880
 期内平均值: 4141.7462
 当前分位值: 1.61%



数据起始日: 2019/9/10
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: 512.8
 期内最大值: 1013.6
 期内平均值: 792.7450
 当前分位值: 34.37%



数据起始日: 2019/9/10

数据截止日: 2024/9/9

期内最小值: 1782.3

期内最大值: 4320.8

期内平均值: 2666.3813

当前分位值: 0.00%

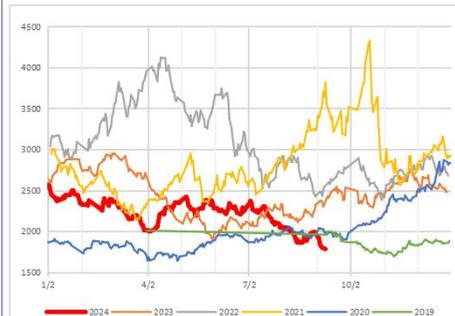
J. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

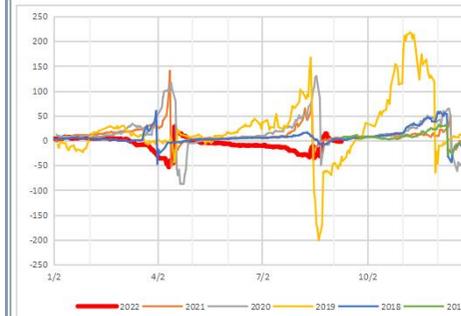
J. DCE价格走势季节性



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: 2019/9/10

数据截止日: 2024/9/9

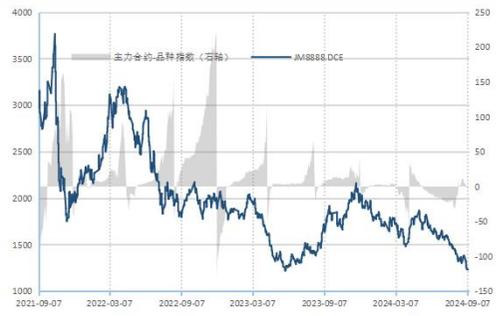
期内最小值: 1219.4

期内最大值: 3764.7

期内平均值: 1963.8262

当前分位值: 0.47%

Jm. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

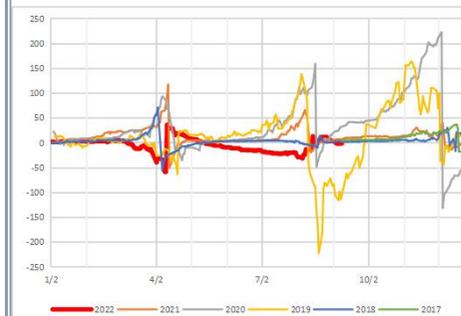
Jm. DCE价格走势季节性



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: 2019/9/10

数据截止日: 2024/9/9

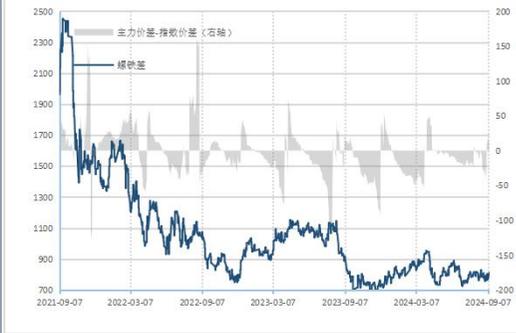
期内最小值: 670.1176

期内最大值: 2451.8235

期内平均值: 1050.9833

当前分位值: 7.85%

螺铁差



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/9/10

数据截止日: 2024/9/9

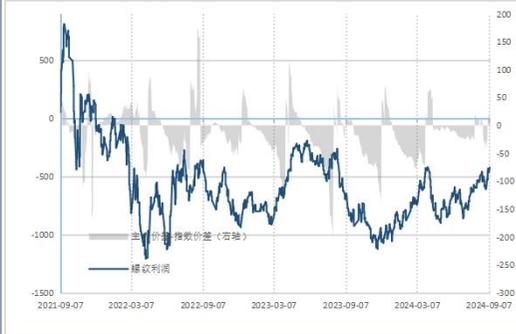
期内最小值: -1206.9091

期内最大值: 810.0000

期内平均值: -567.6102

当前分位值: 38.96%

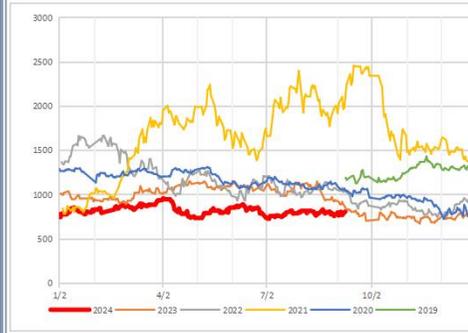
螺纹利润



数据来源: iFind

点评:

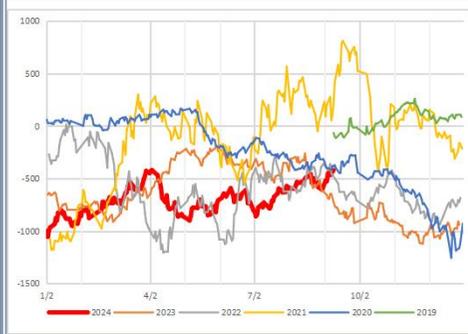
螺铁差季节性



数据来源: iFind

点评:

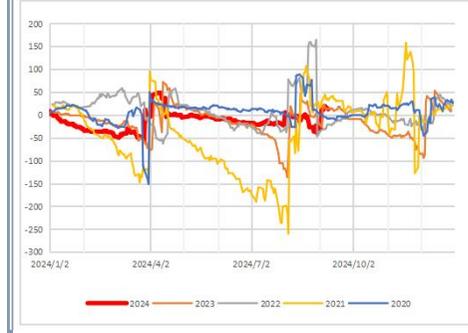
螺纹利润季节性



数据来源: iFind

点评:

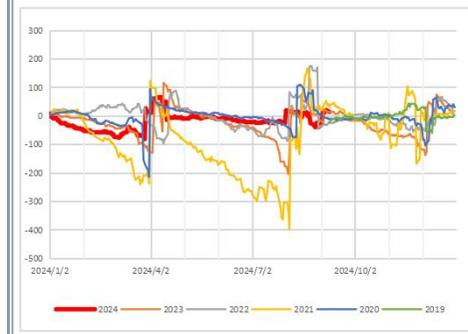
螺铁差主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

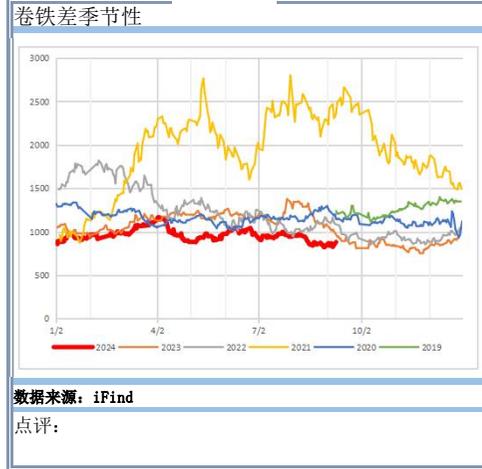
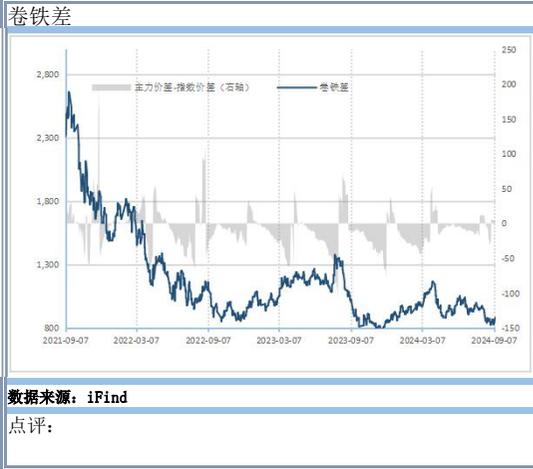
螺纹利润主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

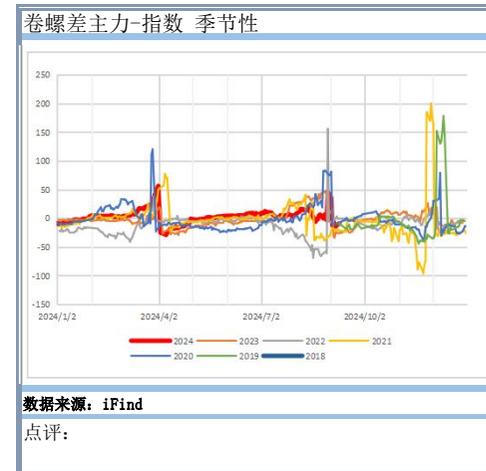
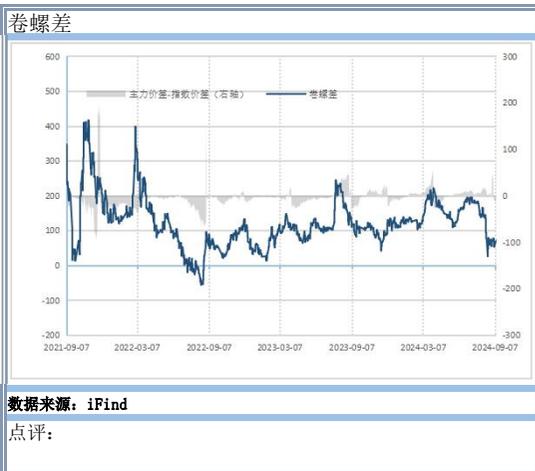
数据起始日：2019/9/10
 数据截止日：2024/9/9
 期内最小值：752.4706
 期内最大值：2661.8235
 期内平均值：1174.3249
 当前分位值：6.73%



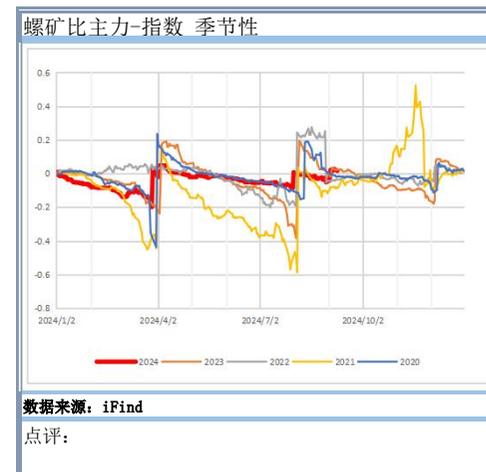
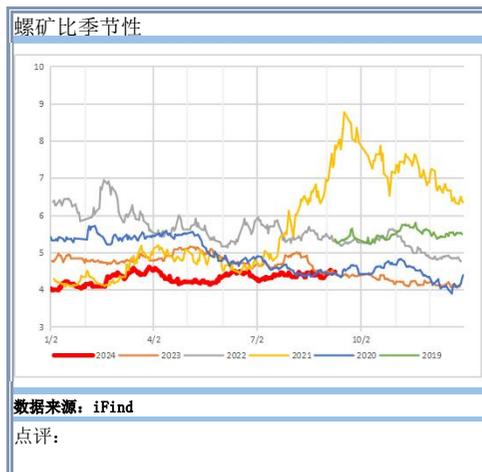
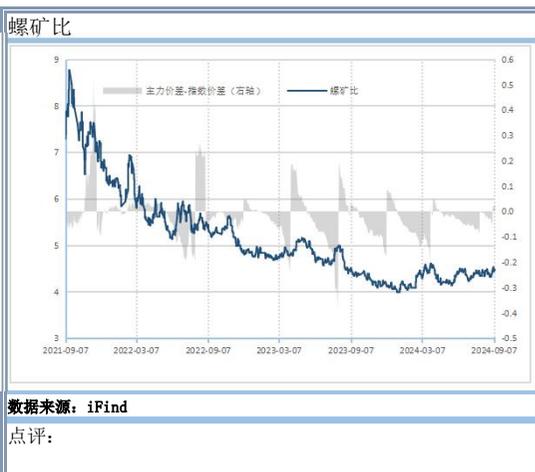
数据起始日：2019/9/10
 数据截止日：2024/9/9
 期内最小值：-1073.7273
 期内最大值：1014.0000
 期内平均值：-444.2686
 当前分位值：34.66%



数据起始日: 2019/9/10
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: -56.0000
 期内最大值: 416.0000
 期内平均值: 123.3416
 当前分位值: 26.91%



数据起始日: 2019/9/10
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: 3.9880
 期内最大值: 8.7631
 期内平均值: 5.1488
 当前分位值: 10.26%



数据起始日: 2019/9/10

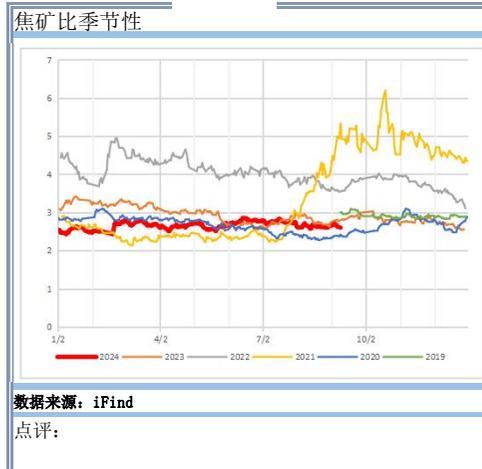
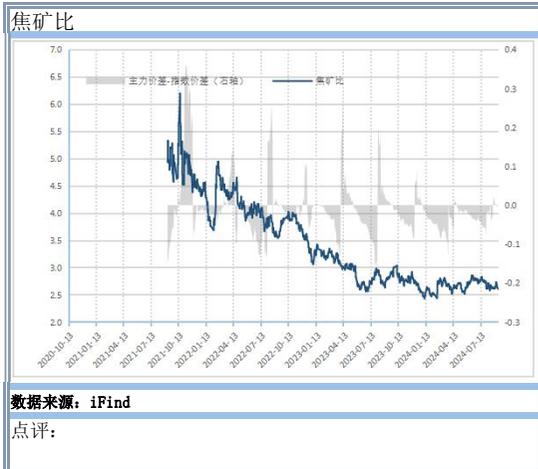
数据截止日: 2024/9/9

期内最小值: 2.4279

期内最大值: 6.1947

期内平均值: 3.4176

当前分位值: 4.63%



数据起始日: 2019/9/10

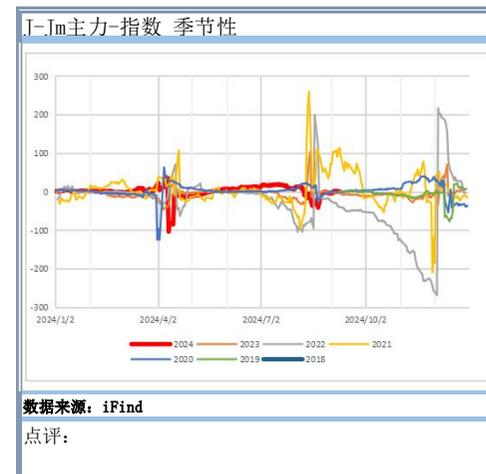
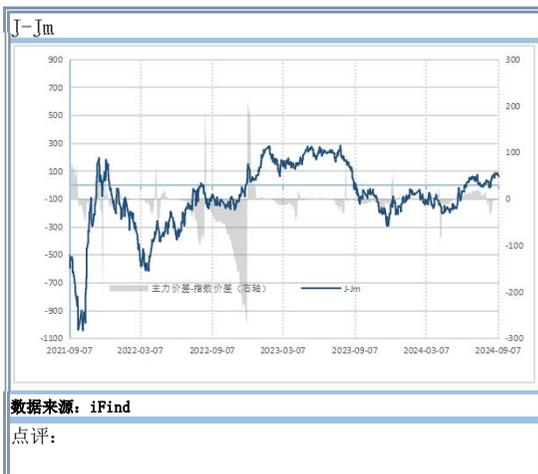
数据截止日: 2024/9/9

期内最小值: -1043.0800

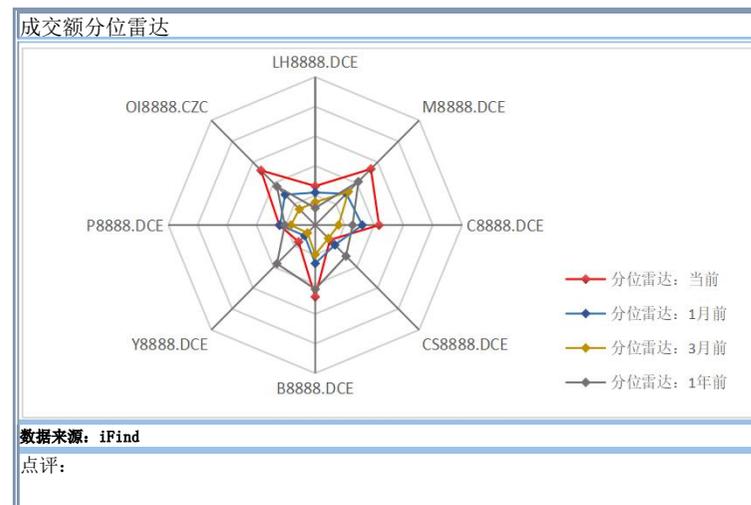
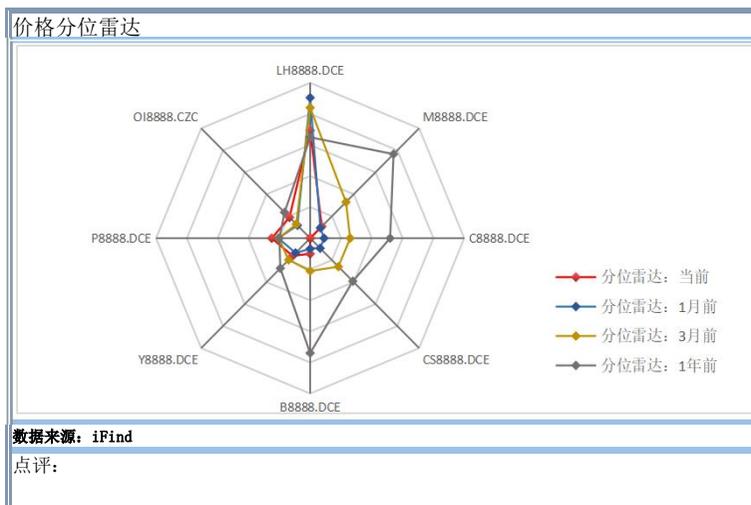
期内最大值: 279.1600

期内平均值: -82.9753

当前分位值: 83.30%



五、农产品相关



数据起始日: 2021/1/8

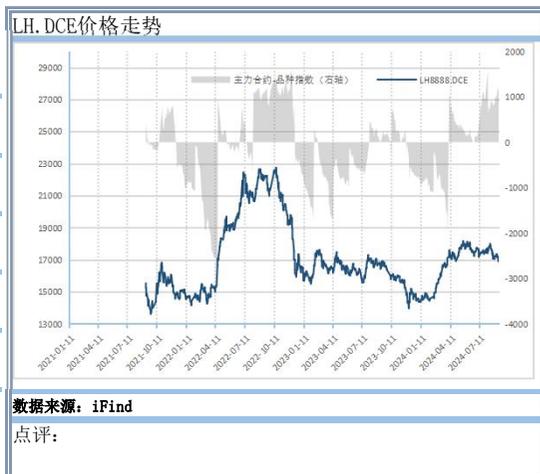
数据截止日: 2024/9/9

期内最小值: 13971

期内最大值: 18158

期内平均值: 16406.5897

当前分位值: 69.41%



数据起始日： 2019/9/10

数据截止日： 2024/9/9

期内最小值： 2858

期内最大值： 4328

期内平均值： 3609.8189

当前分位值： 10.68%

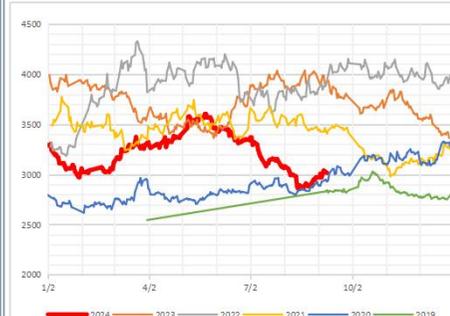
M. DCE价格走势



数据来源： iFind

点评：

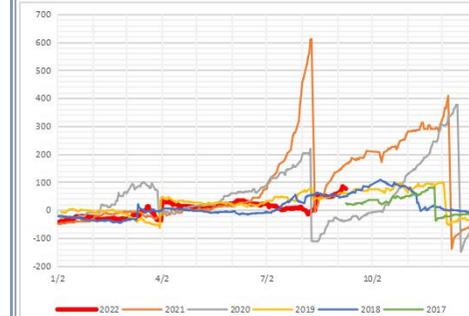
M. DCE价格走势季节性



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： 2019/9/10

数据截止日： 2024/9/9

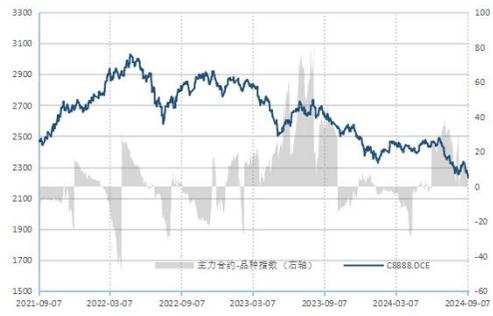
期内最小值： 2229

期内最大值： 3027

期内平均值： 2648.4609

当前分位值： 0.00%

C. DCE价格走势



数据来源： iFind

点评：

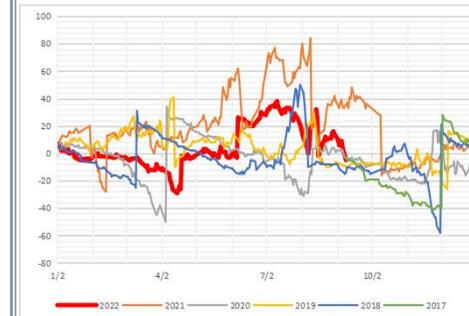
C. DCE价格走势季节性



数据来源： iFind

点评：

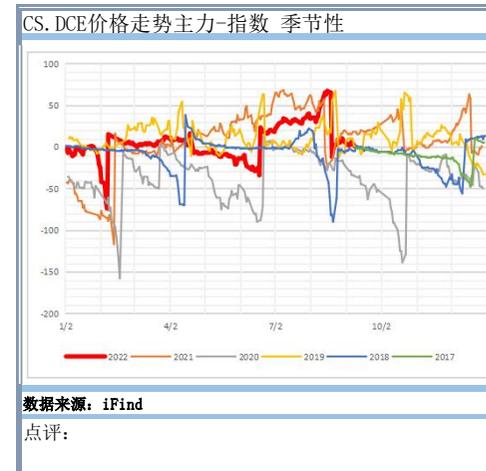
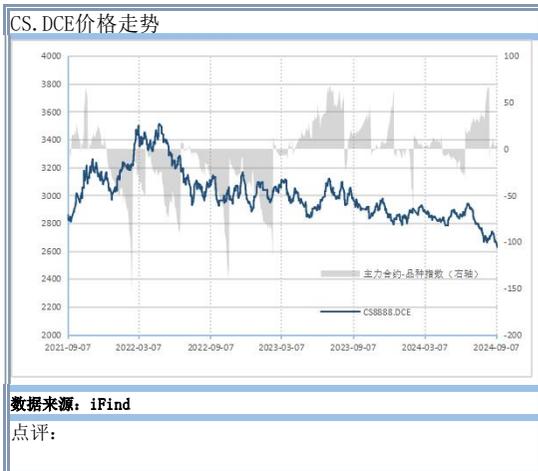
C. DCE价格走势主力-指数 季节性



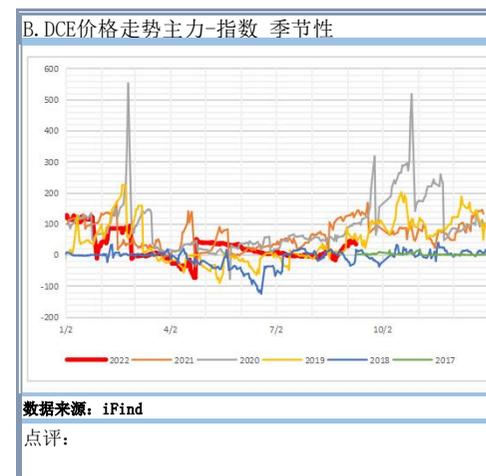
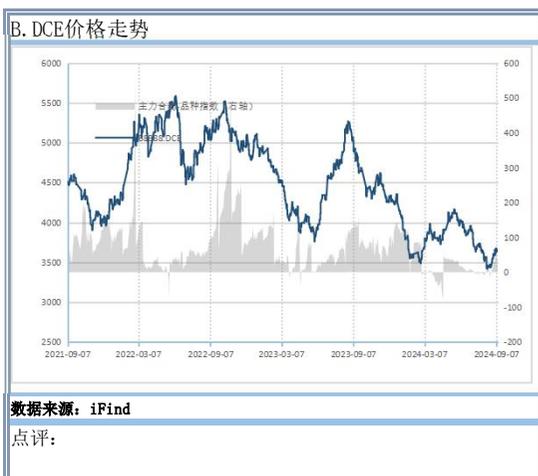
数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2019/9/10
 数据截止日： 2024/9/9
 期内最小值： 2628
 期内最大值： 3512
 期内平均值： 3009.1152
 当前分位值： 0.00%

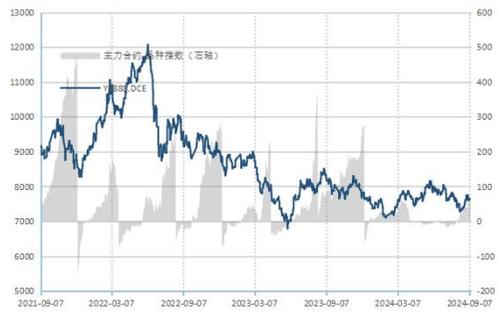


数据起始日： 2019/9/10
 数据截止日： 2024/9/9
 期内最小值： 3417
 期内最大值： 5585
 期内平均值： 4466.9067
 当前分位值： 10.06%



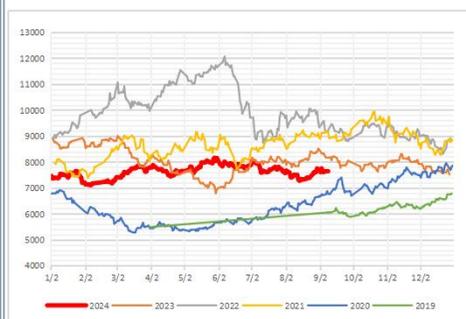
Y. DCE价格走势

数据起始日: 2019/9/10
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: 6793
 期内最大值: 12065
 期内平均值: 8645.0041
 当前分位值: 16.10%



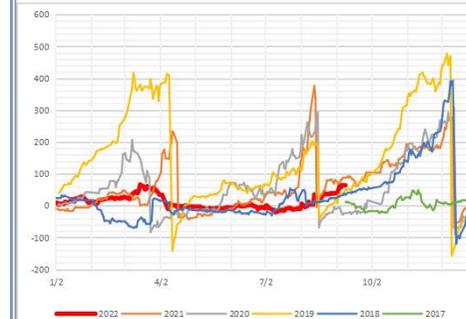
数据来源: iFind
 点评:

Y. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind
 点评:

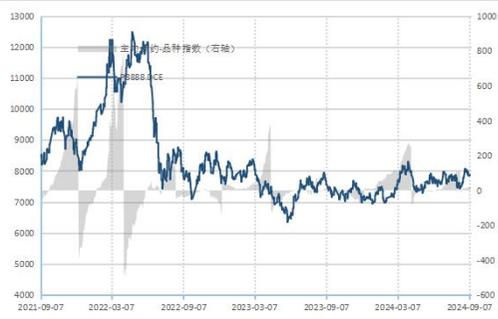
Y. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind
 点评:

P. DCE价格走势

数据起始日: 2019/9/10
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: 6349
 期内最大值: 12479
 期内平均值: 8278.6502
 当前分位值: 24.94%



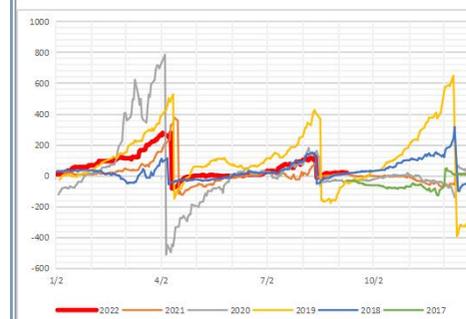
数据来源: iFind
 点评:

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： 2019/9/10

数据截止日： 2024/9/9

期内最小值： 7475

期内最大值： 14344

期内平均值： 10062.8505

当前分位值： 19.00%

OI.CZCE价格走势



数据来源： iFind

点评：

OI.CZCE价格走势季节性



数据来源： iFind

点评：

OI.CZCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2022/3/16

数据截止日： 2024/9/9

期内最小值： 7508.2500

期内最大值： 12199.0000

期内平均值： 9977.2310

当前分位值： 76.74%

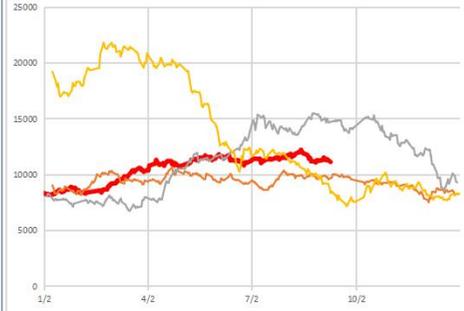
盲肥收益



数据来源： iFind

点评：

盲肥收益季节性



数据来源： iFind

点评：

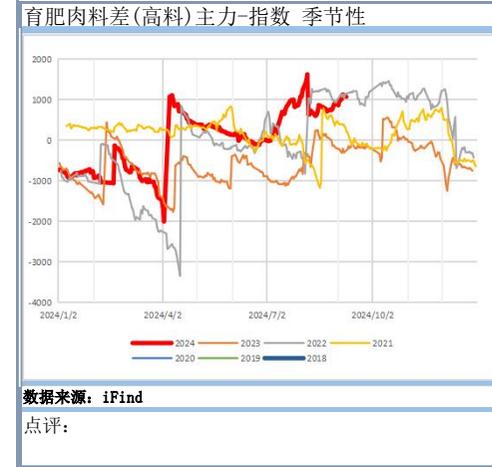
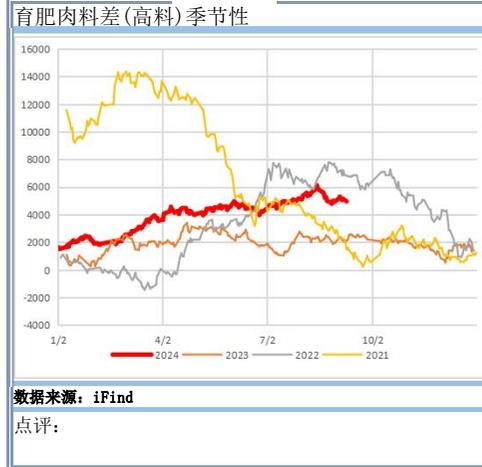
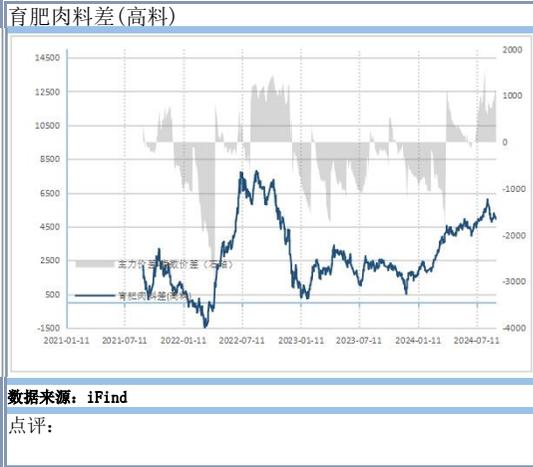
盲肥收益主力-指数 季节性



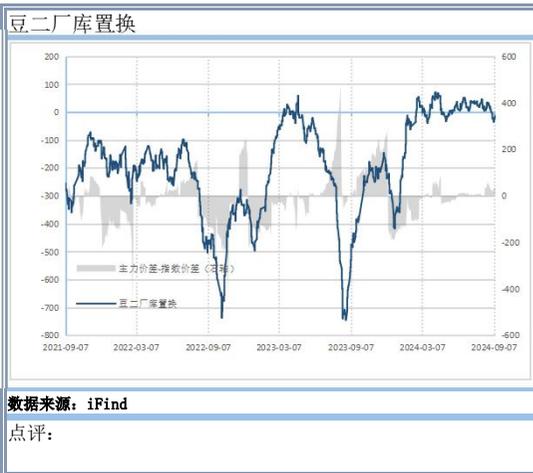
数据来源： iFind

点评：

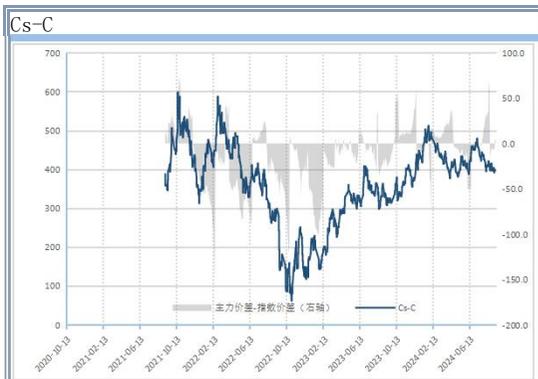
数据起始日: 2021/1/8
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: 515.0000
 期内最大值: 6111.0000
 期内平均值: 3060.9138
 当前分位值: 79.18%



数据起始日: 2019/9/10
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: -745.0200
 期内最大值: 71.2200
 期内平均值: -193.8731
 当前分位值: 89.50%



数据起始日: 2019/9/10
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: 62.0000
 期内最大值: 598.0000
 期内平均值: 360.6543
 当前分位值: 62.87%



数据来源: iFind
 点评:

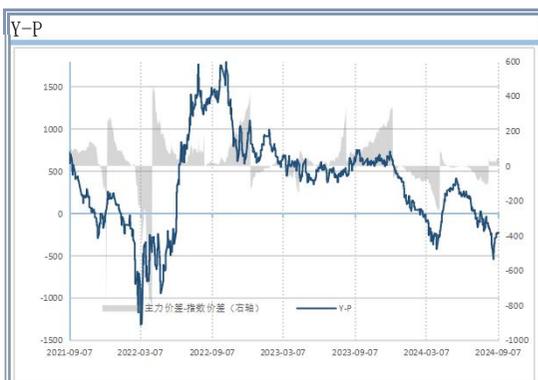


数据来源: iFind
 点评:



数据来源: iFind
 点评:

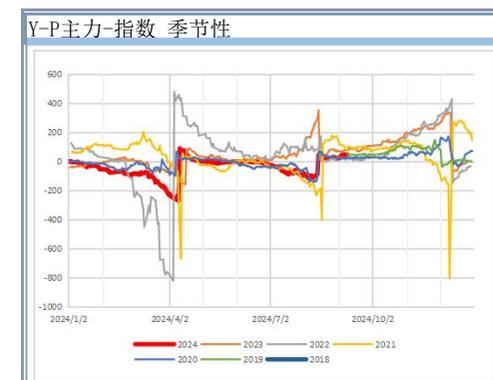
数据起始日: 2019/9/10
 数据截止日: 2024/9/9
 期内最小值: -1313.0000
 期内最大值: 1788.0000
 期内平均值: 366.3539
 当前分位值: 34.73%



数据来源: iFind
 点评:

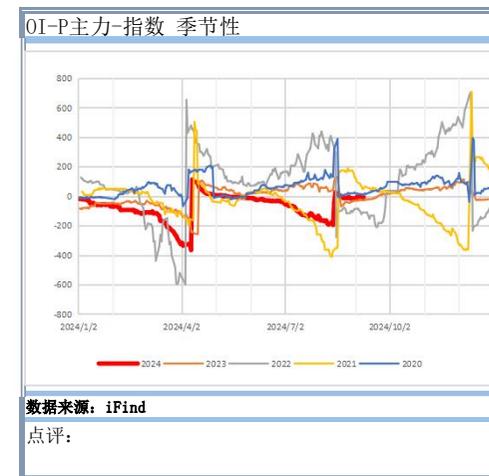
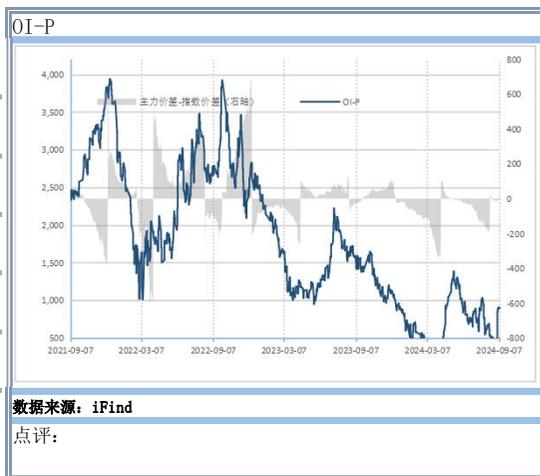


数据来源: iFind
 点评:



数据来源: iFind
 点评:

数据起始日： 2019/9/10
 数据截止日： 2024/9/9
 期内最小值： 19.0000
 期内最大值： 2220.0000
 期内平均值： 1035.4108
 当前分位值： 40.12%



作者：曹有明
 交易咨询资格证号：Z0013162
 邮箱：caoyouming@sd-gold.com
 审核：林振龙
 复核：刘书语

从业资格号：F3038998
 电话：021-20627258
 交易咨询从业资格号：Z0018476
 期货从业资格号：F03107583

免责声明

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