

盘面套利观察

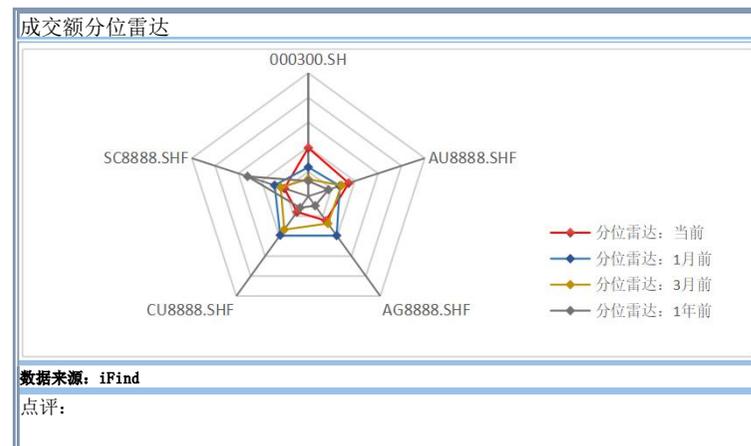
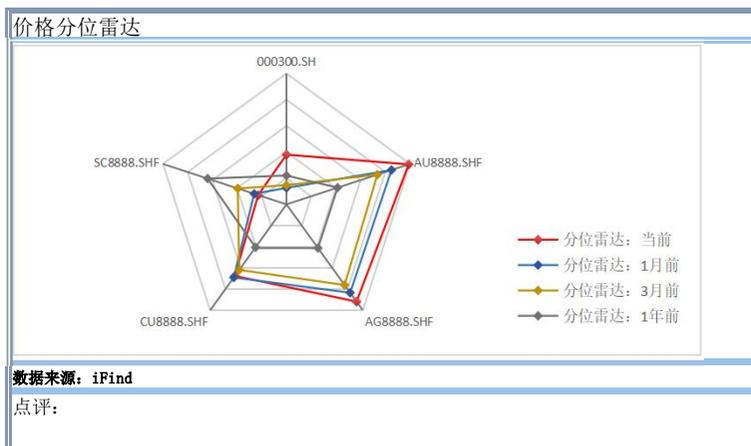
2024年10月31日

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: 2019/10/31

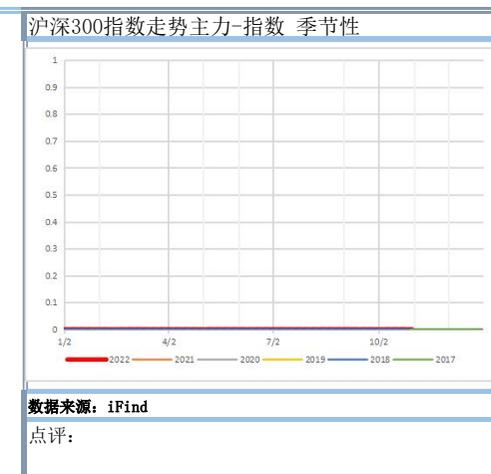
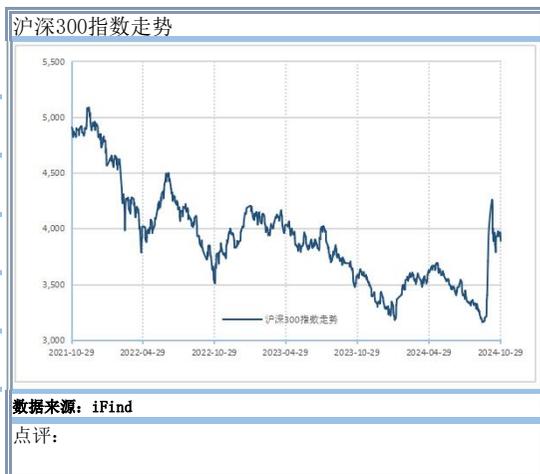
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 3159.247

期内最大值: 5083.8007

期内平均值: 3913.5874

当前分位值: 14.70%



数据起始日: 2019/10/31

数据截止日: 2024/10/31

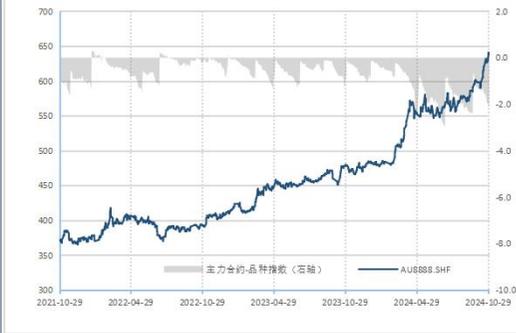
期内最小值: 365.31

期内最大值: 640.65

期内平均值: 453.4663

当前分位值: 98.98%

Au. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

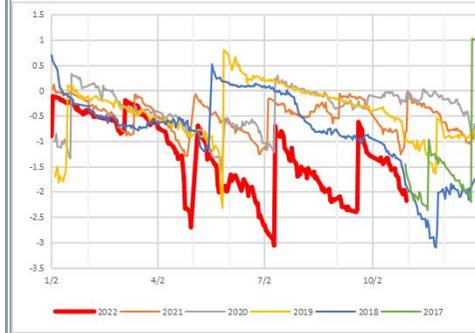
Au. SHFE价格走势季节性



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: 2019/10/31

数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 53367

期内最大值: 87697

期内平均值: 69620.1934

当前分位值: 67.54%

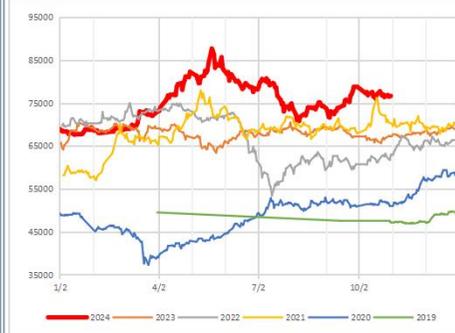
Cu. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

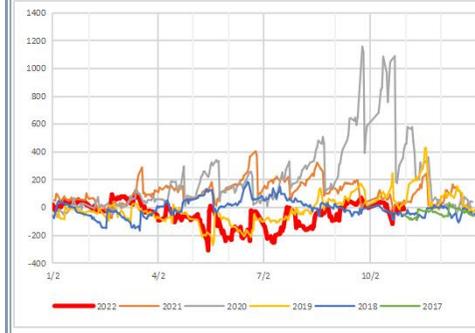
Cu. SHFE价格走势季节性



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：2019/10/31

数据截止日：2024/10/31

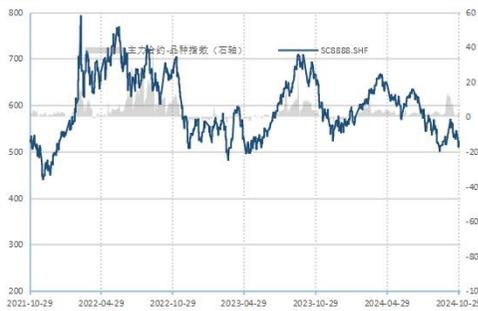
期内最小值：439.9

期内最大值：791.6

期内平均值：596.6188

当前分位值：22.92%

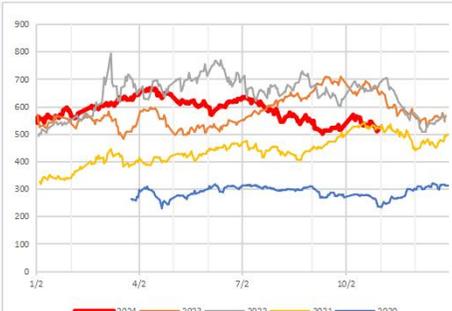
Sc. Ine价格走势



数据来源：iFind

点评：

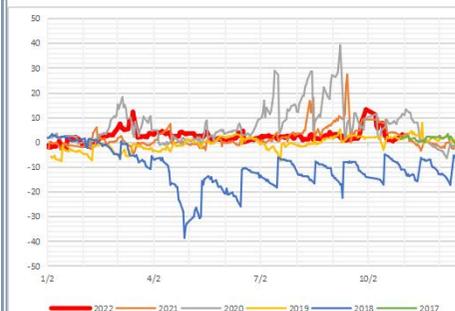
Sc. Ine价格走势季节性



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：2019/10/31

数据截止日：2024/10/31

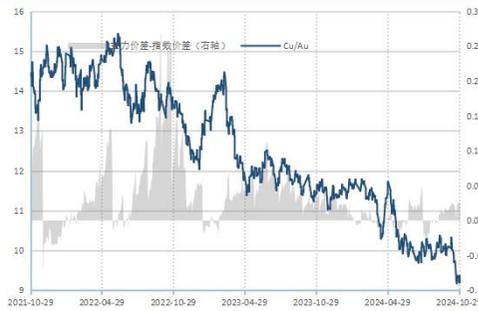
期内最小值：9.1693

期内最大值：15.4319

期内平均值：12.5162

当前分位值：3.14%

Cu/Au



数据来源：iFind

点评：

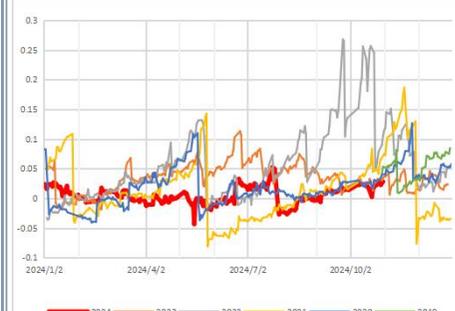
Cu/Au季节性



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：2019/10/31

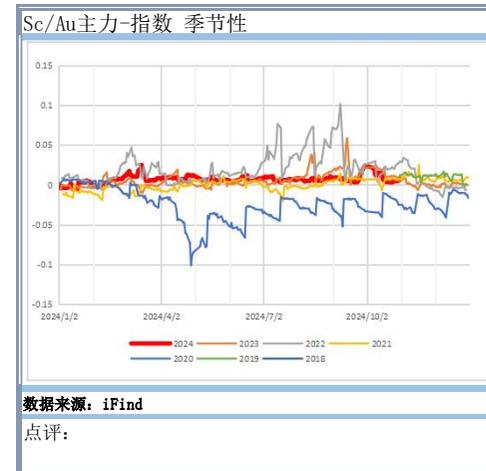
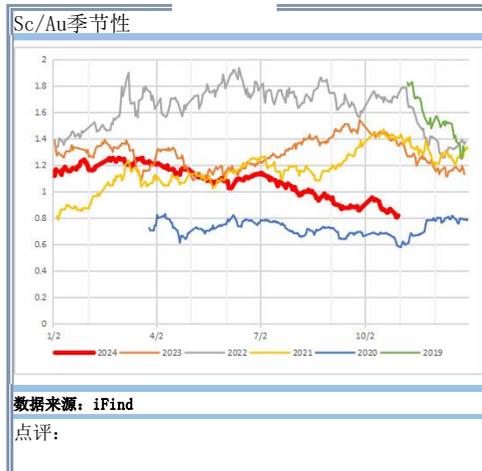
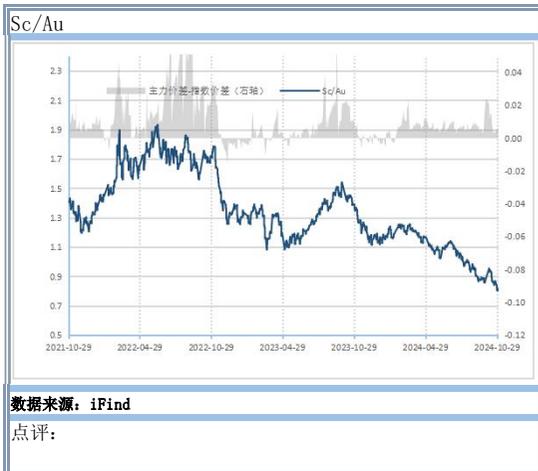
数据截止日：2024/10/31

期内最小值：0.8026

期内最大值：1.9320

期内平均值：1.3458

当前分位值：1.19%



数据起始日：2019/10/31

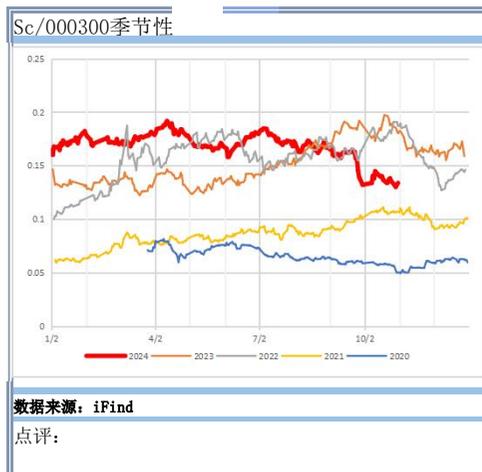
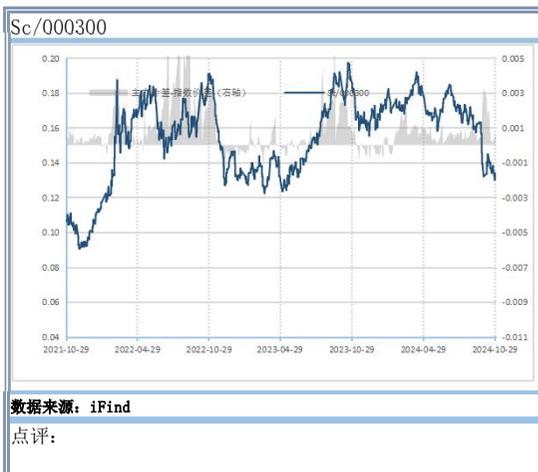
数据截止日：2024/10/31

期内最小值：0.0906

期内最大值：0.1972

期内平均值：0.1545

当前分位值：40.51%



数据起始日: 2019/10/31

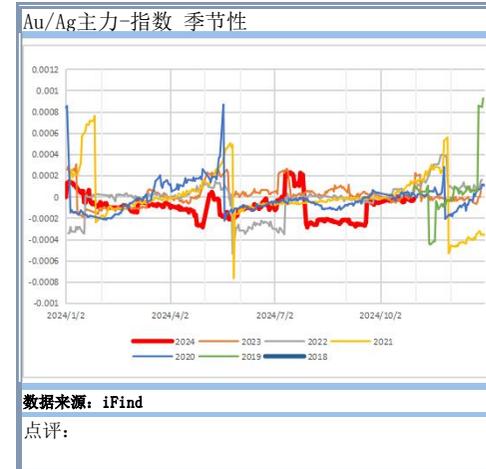
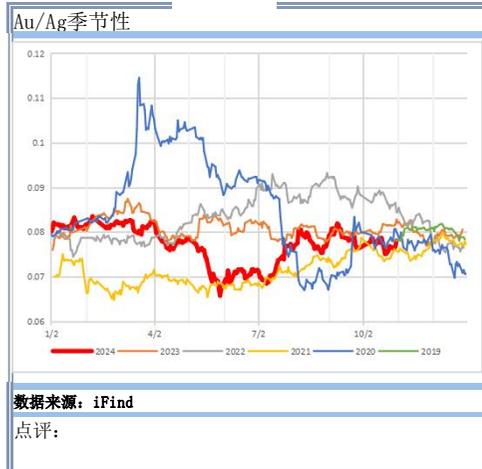
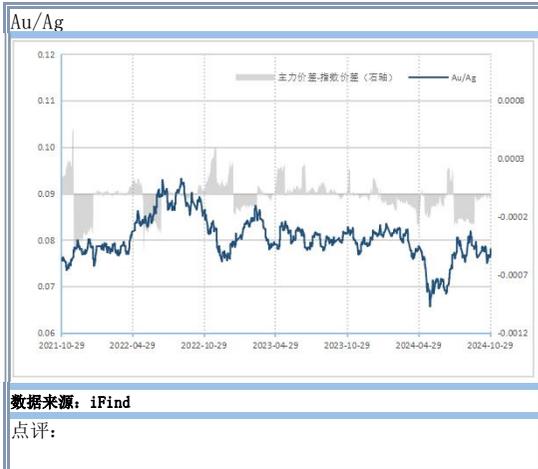
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 0.0657

期内最大值: 0.0932

期内平均值: 0.0803

当前分位值: 44.85%



数据起始日: 2019/10/31

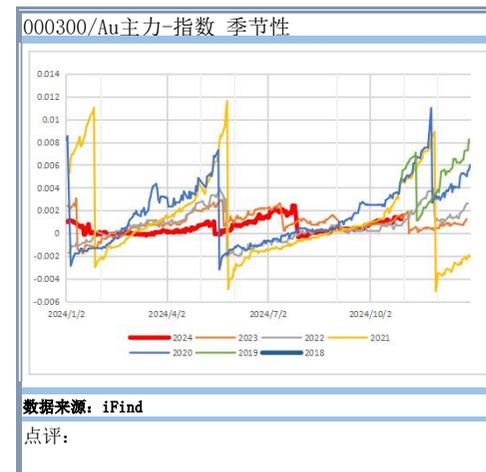
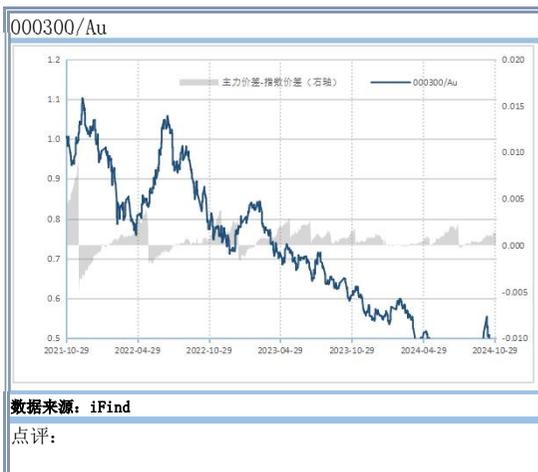
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 0.4165

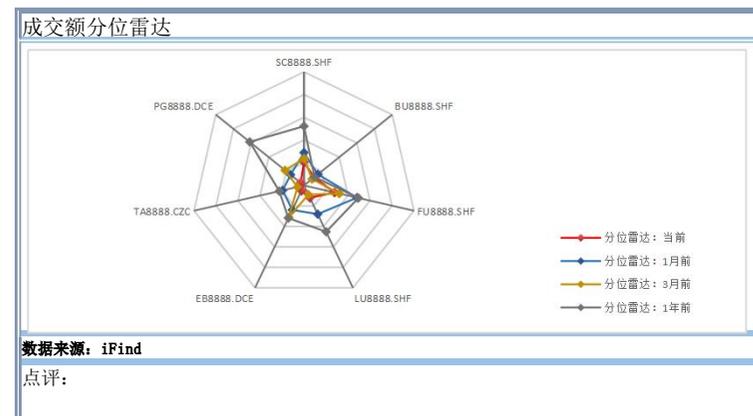
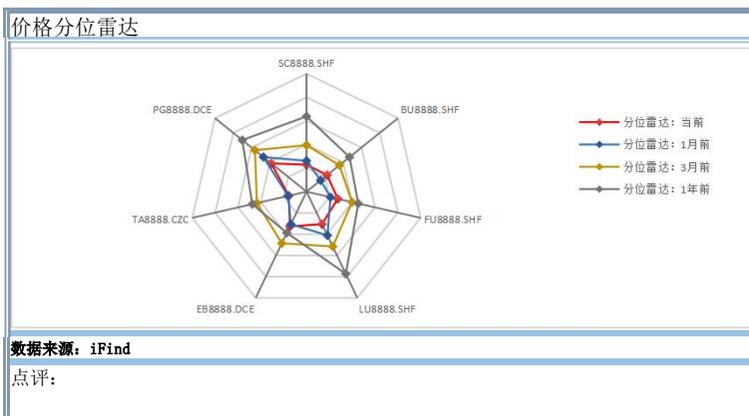
期内最大值: 1.1021

期内平均值: 0.7195

当前分位值: 8.69%



二、原油相关



数据起始日: 2019/10/31

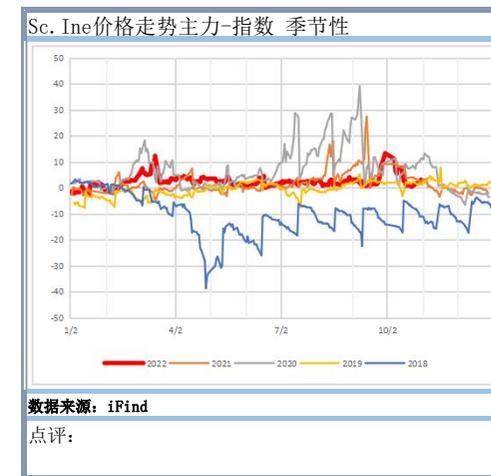
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 439.9

期内最大值: 791.6

期内平均值: 596.6188

当前分位值: 22.92%



数据起始日: 2019/10/31

数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 2821

期内最大值: 4794

期内平均值: 3676.9684

当前分位值: 22.50%

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: 2019/10/31

数据截止日: 2024/10/31

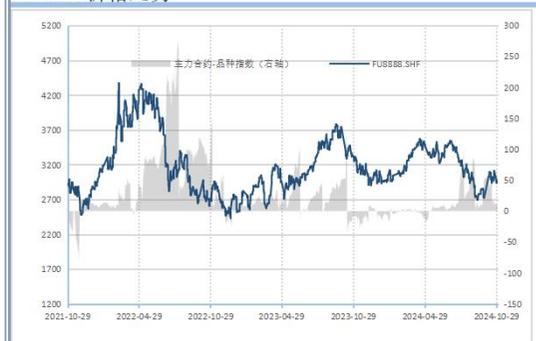
期内最小值: 2432

期内最大值: 4371

期内平均值: 3166.3594

当前分位值: 27.39%

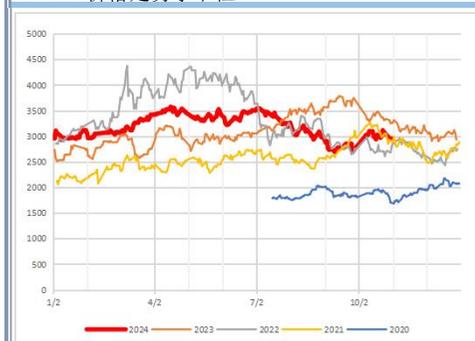
Fu. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

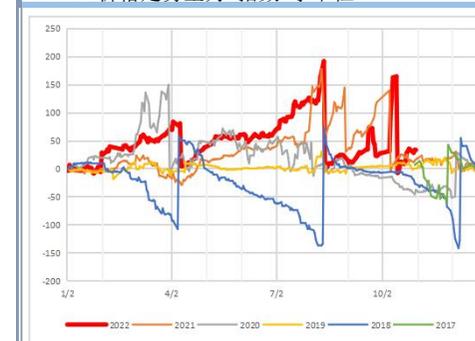
Fu. SHFE价格走势季节性



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：2024/10/31

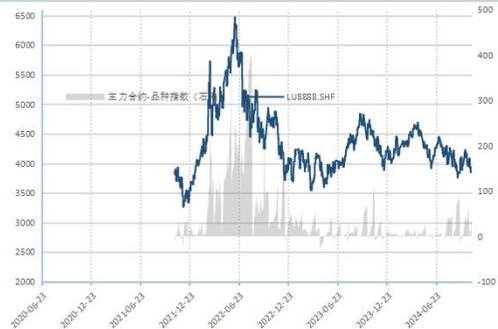
期内最小值：3544

期内最大值：4834

期内平均值：4187.5929

当前分位值：30.54%

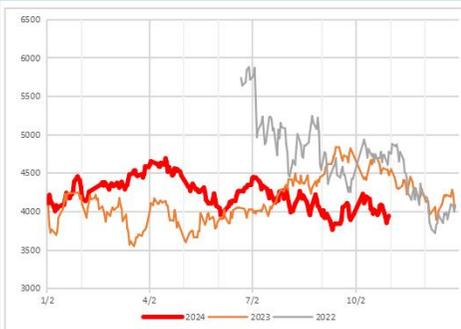
Lu. Ine价格走势



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：2024/10/31

期内最小值：6978

期内最大值：11361

期内平均值：8671.9484

当前分位值：32.76%

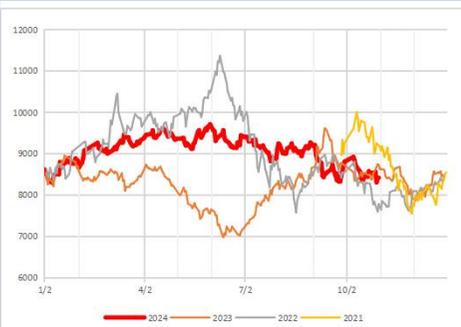
EB. DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

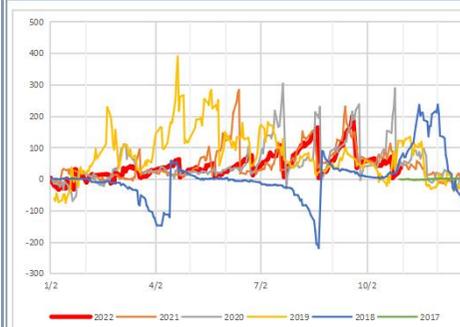
EB. DCE价格走势季节性



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： 2019/10/31

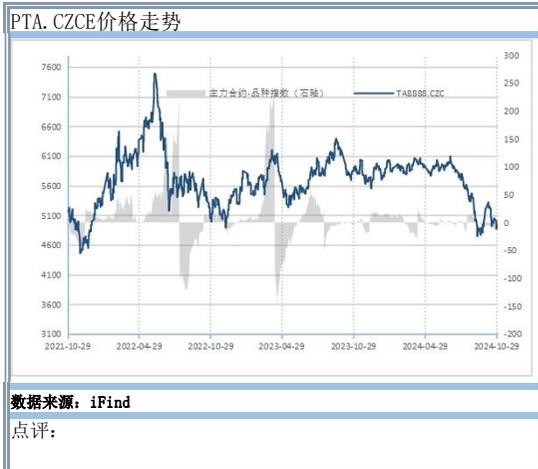
数据截止日： 2024/10/31

期内最小值： 4462

期内最大值： 7488

期内平均值： 5690.8313

当前分位值： 15.53%



数据起始日： 2020/3/30

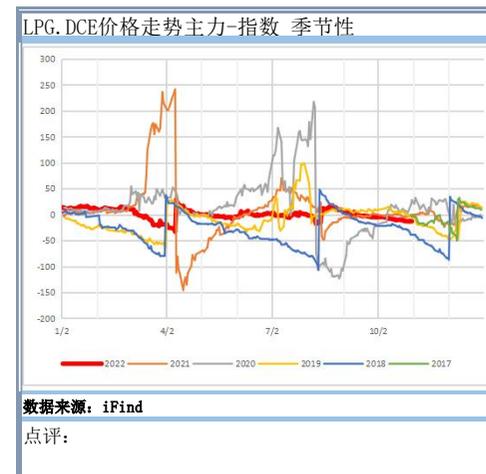
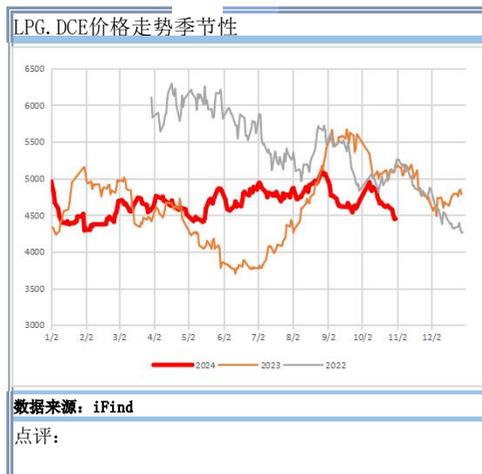
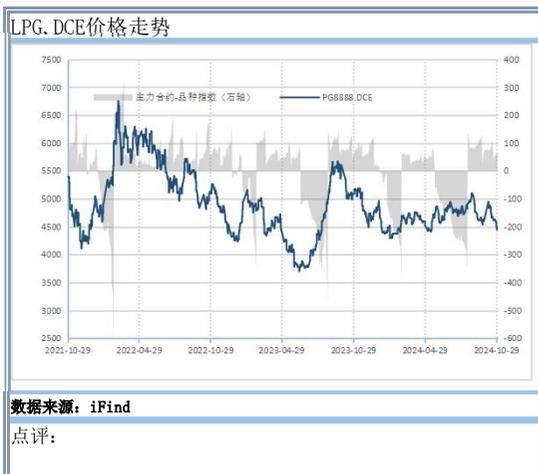
数据截止日： 2024/10/31

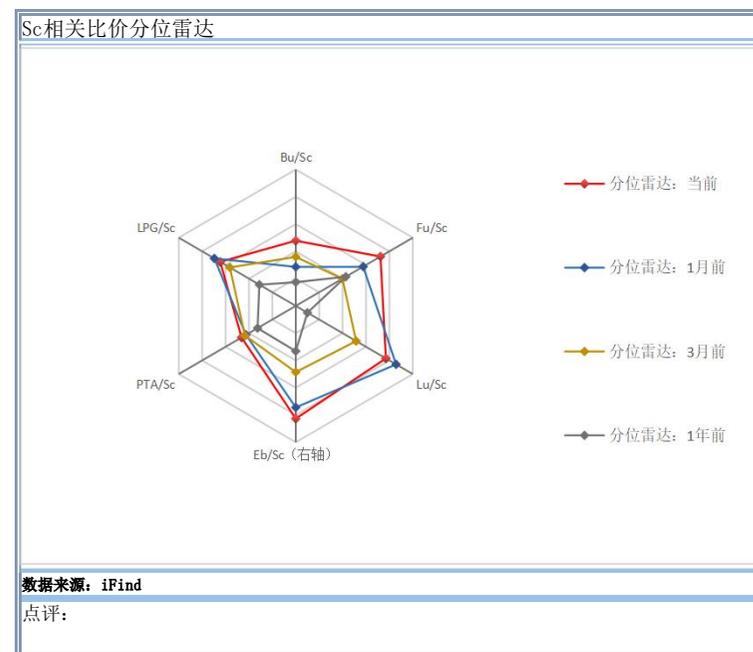
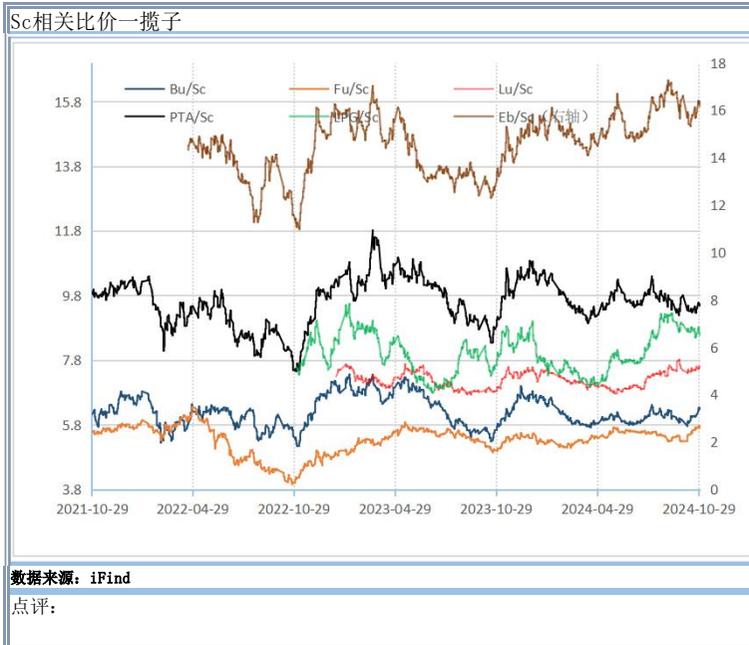
期内最小值： 3704

期内最大值： 5665

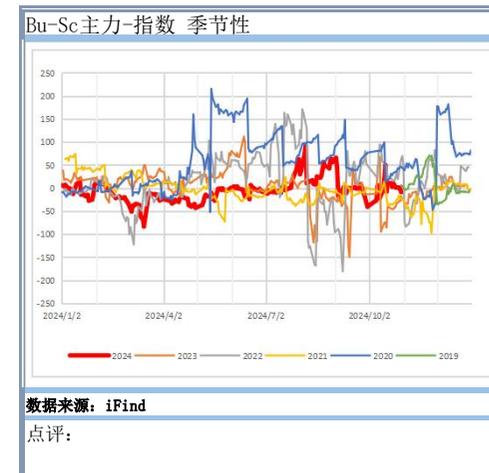
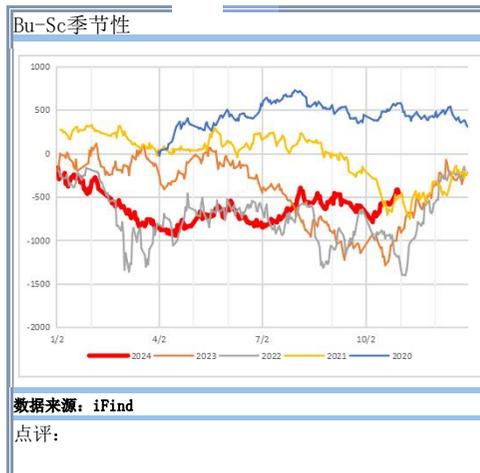
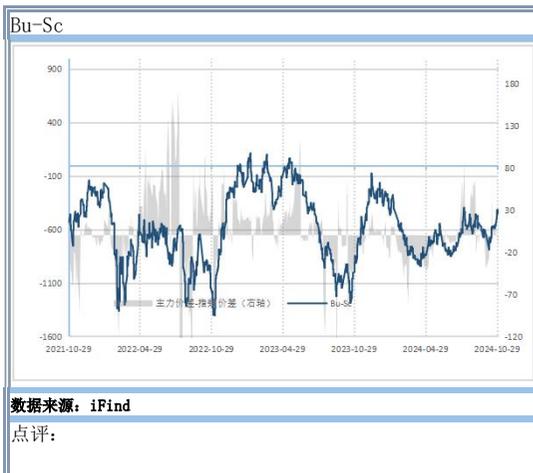
期内平均值： 4654.4461

当前分位值： 38.45%





数据起始日: 2019/10/31
 数据截止日: 2024/10/31
 期内最小值: -1406.4286
 期内最大值: 111.1429
 期内平均值: -584.5944
 当前分位值: 62.84%



数据起始日: 2019/10/31

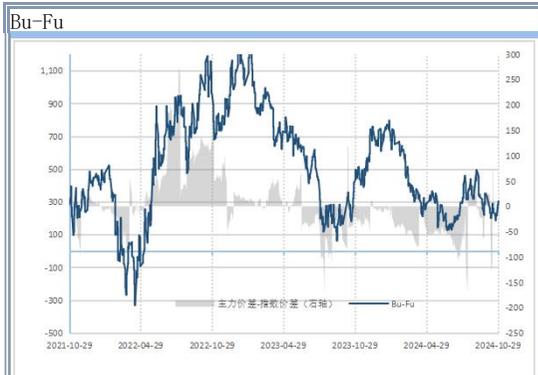
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: -331.0000

期内最大值: 1284.0000

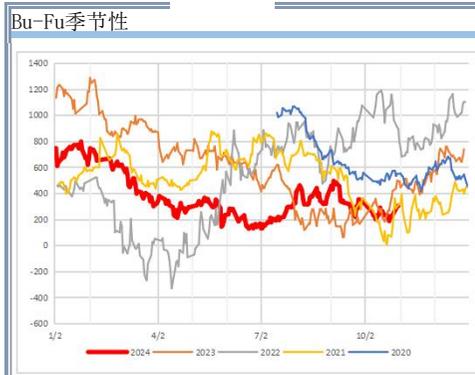
期内平均值: 510.6091

当前分位值: 39.20%



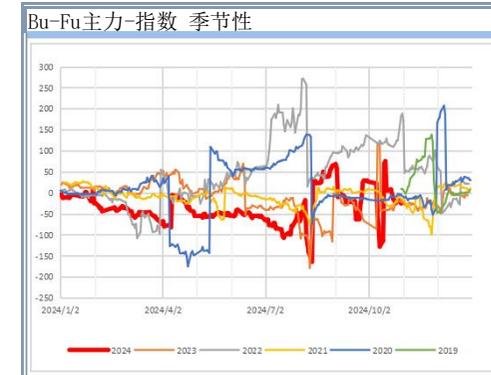
数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2021/11/22

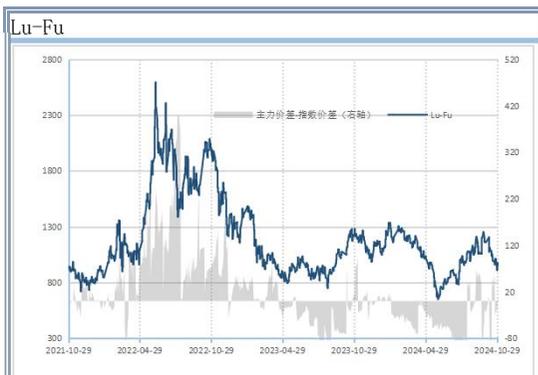
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 650.0000

期内最大值: 1473.0000

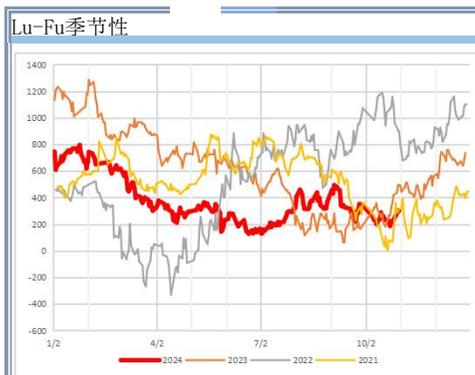
期内平均值: 1030.3082

当前分位值: 39.49%



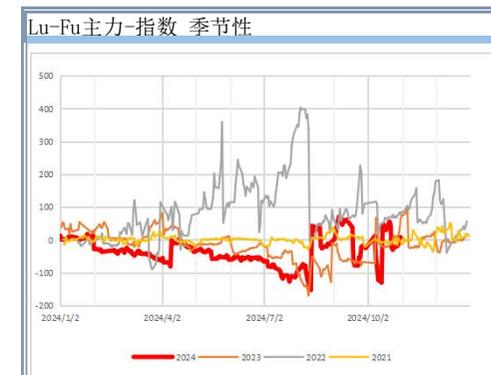
数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2021/9/27

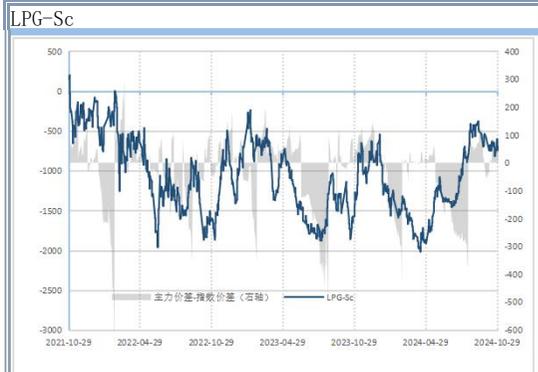
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: -2017.0000

期内最大值: -240.0000

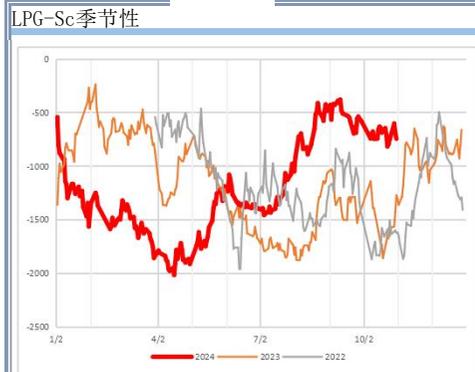
期内平均值: -1171.2718

当前分位值: 71.47%



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: 2019/10/31

数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: -1762.0000

期内最大值: 876.0000

期内平均值: -275.3567

当前分位值: 56.44%



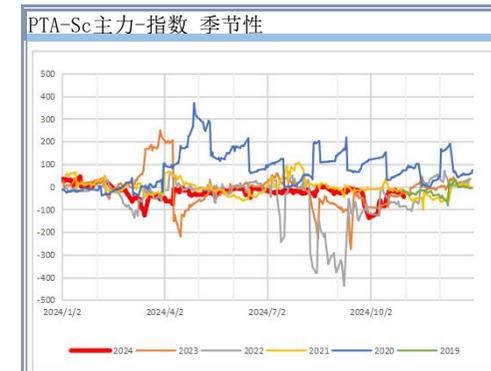
数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: #N/A

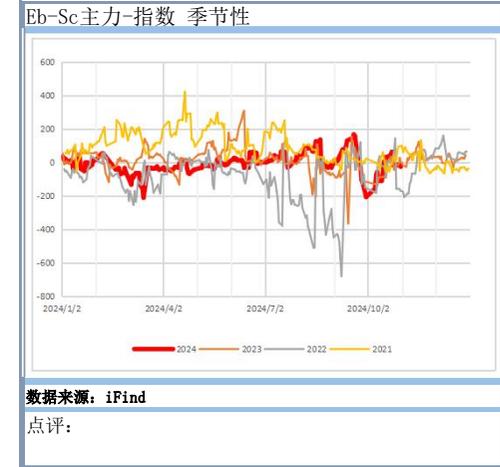
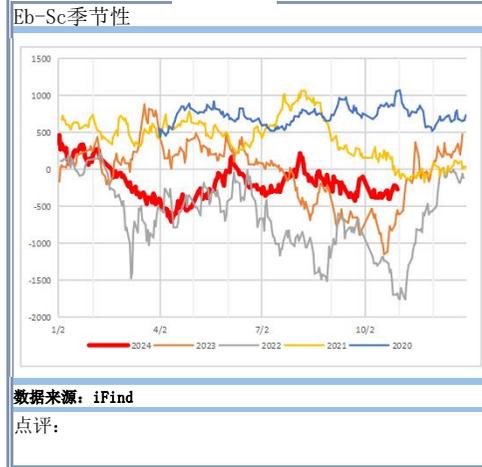
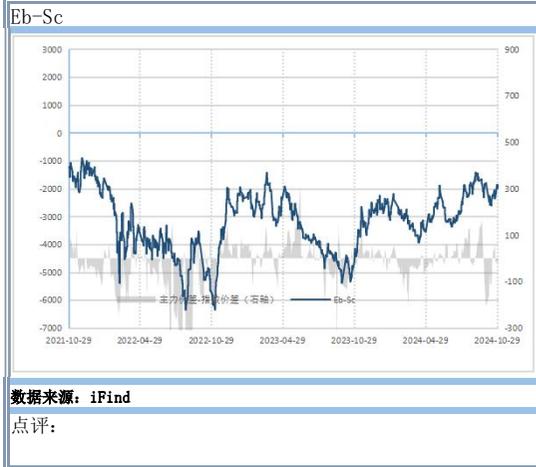
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: -6347.0000

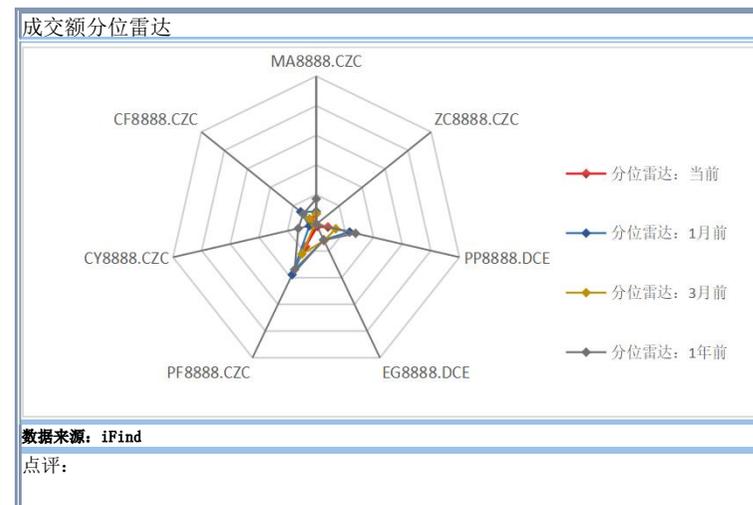
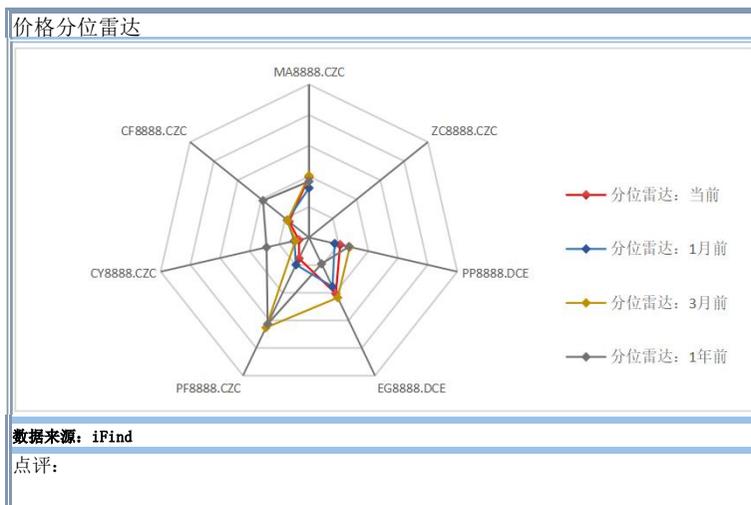
期内最大值: -1429.0000

期内平均值: -3364.2512

当前分位值: 88.47%



三、煤化工相关



数据起始日: 2019/10/31

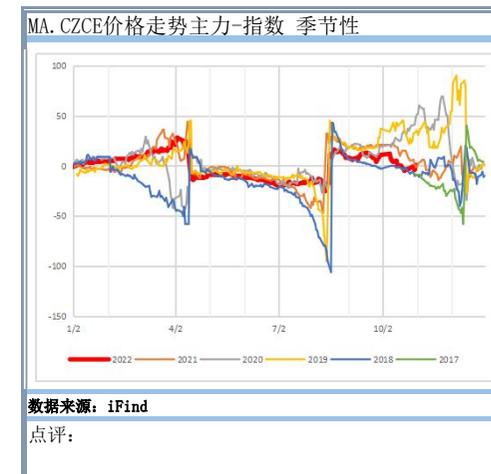
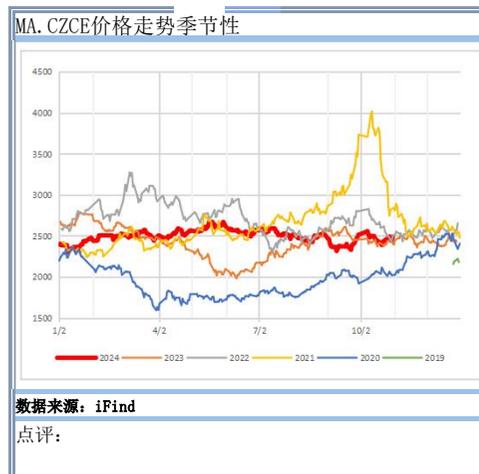
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 1982

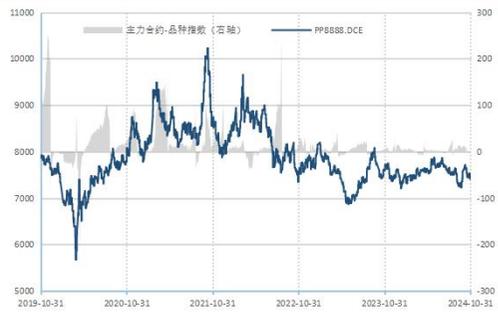
期内最大值: 3272

期内平均值: 2540.9410

当前分位值: 39.53%



PP. DCE价格走势



数据起始日: 2019/10/31

数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 6865

期内最大值: 9649

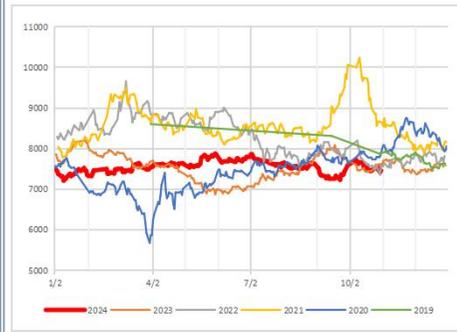
期内平均值: 7808.9534

当前分位值: 20.98%

数据来源: iFind

点评:

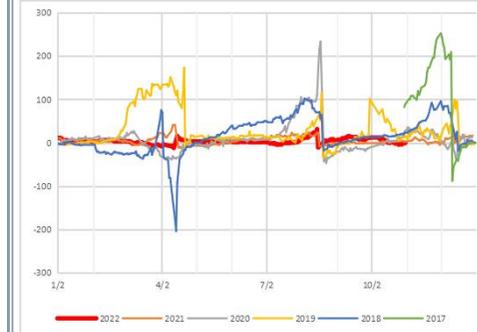
PP. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

PP. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

EG. CZCE价格走势



数据起始日: 2019/10/31

数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 3778

期内最大值: 5798

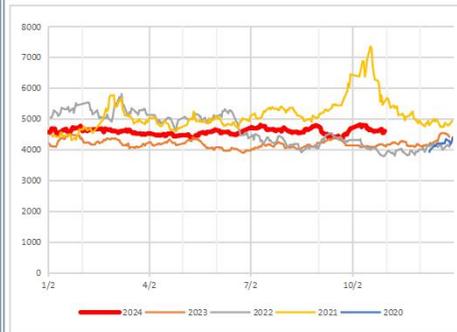
期内平均值: 4485.2483

当前分位值: 40.64%

数据来源: iFind

点评:

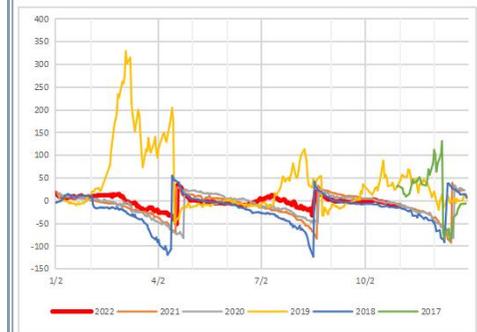
EG. CZCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

EG. CZCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020/10/12

数据截止日: 2024/10/31

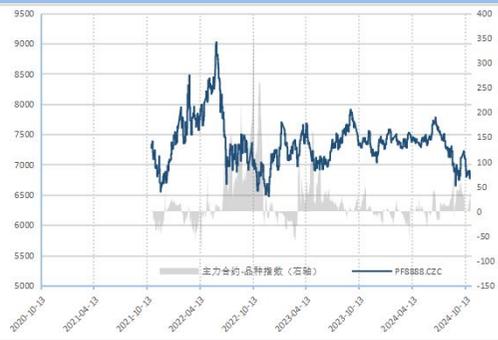
期内最小值: 6652

期内最大值: 7907

期内平均值: 7325.4759

当前分位值: 15.14%

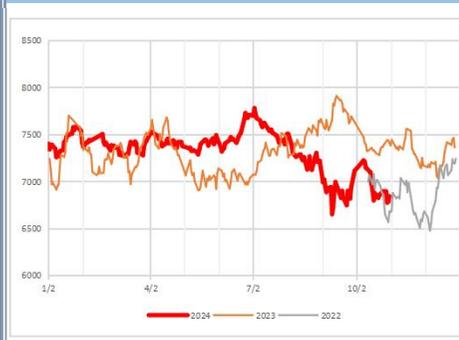
PF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

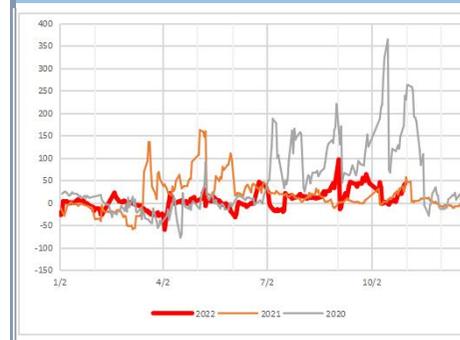
PF. CZCE价格走势季节性



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: 2019/10/31

数据截止日: 2024/10/31

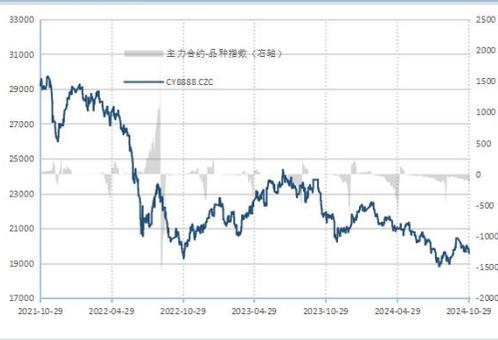
期内最小值: 18830

期内最大值: 29713

期内平均值: 22926.5665

当前分位值: 6.85%

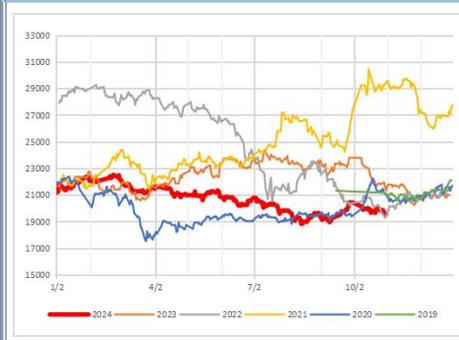
CY. CZCE价格走势



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： 2019/10/31

数据截止日： 2024/10/31

期内最小值： 12447

期内最大值： 21897

期内平均值： 16414.9300

当前分位值： 16.76%

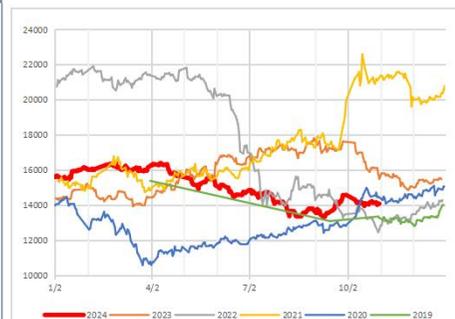
CF. CZCE价格走势



数据来源： iFind

点评：

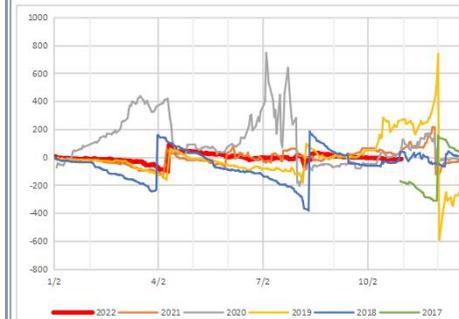
CF. CZCE价格走势季节性



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： 2019/10/31

数据截止日： 2024/10/31

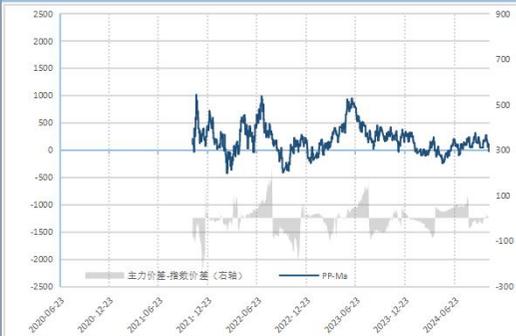
期内最小值： -427.0000

期内最大值： 1007.0000

期内平均值： 186.1303

当前分位值： 27.89%

PP-Ma



数据来源： iFind

点评：

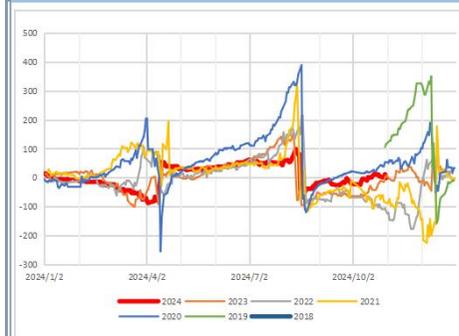
PP-Ma季节性



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: 2019/10/31

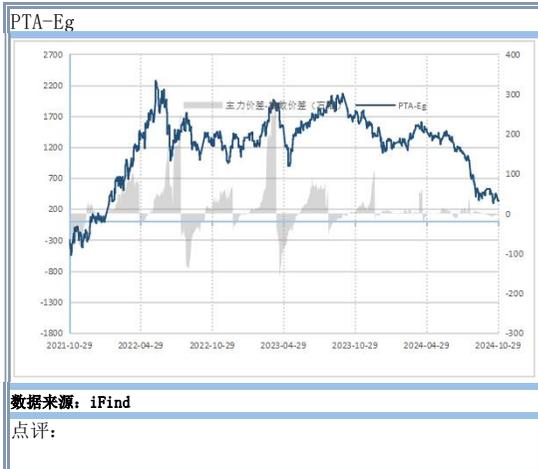
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: -541.0000

期内最大值: 2269.0000

期内平均值: 1205.5830

当前分位值: 31.10%



数据起始日: 2022/2/2

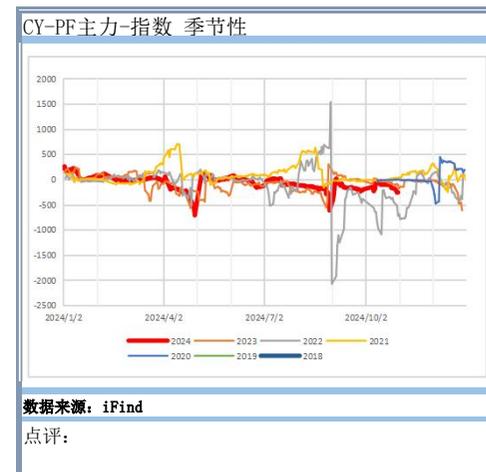
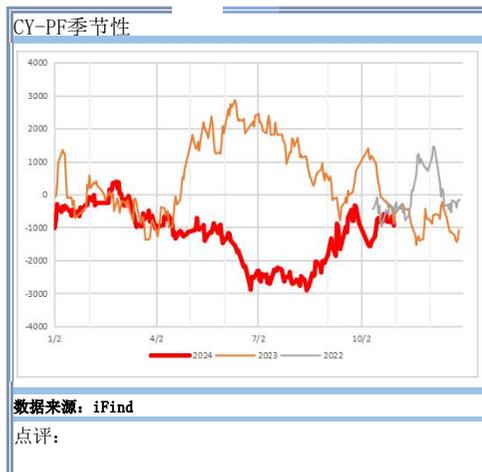
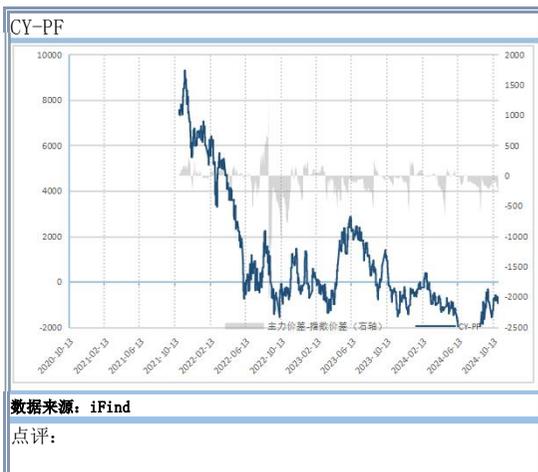
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: -2902.0000

期内最大值: 2854.0000

期内平均值: -442.9603

当前分位值: 33.91%



数据起始日: 2023/5/18

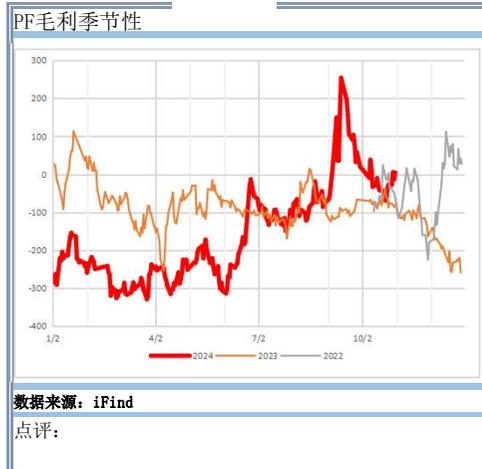
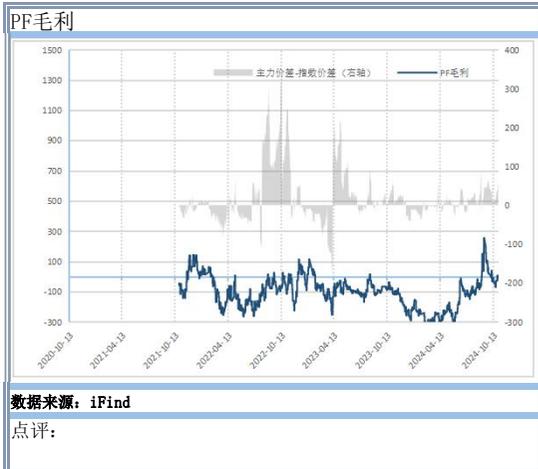
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: -328.9900

期内最大值: 253.8400

期内平均值: -135.6805

当前分位值: 57.21%



数据起始日: 2019/10/31

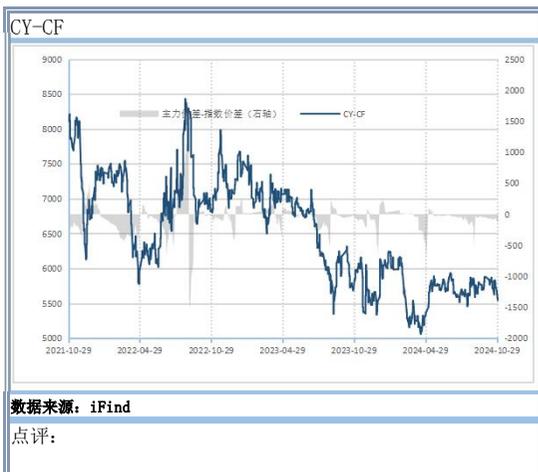
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 5061.0000

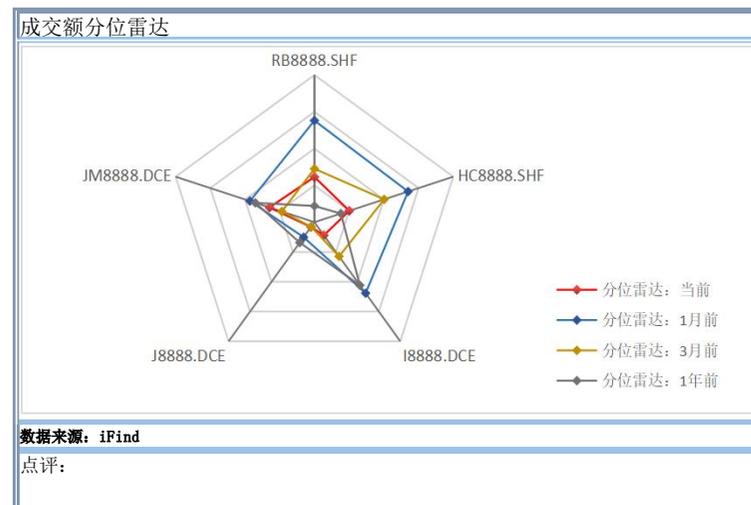
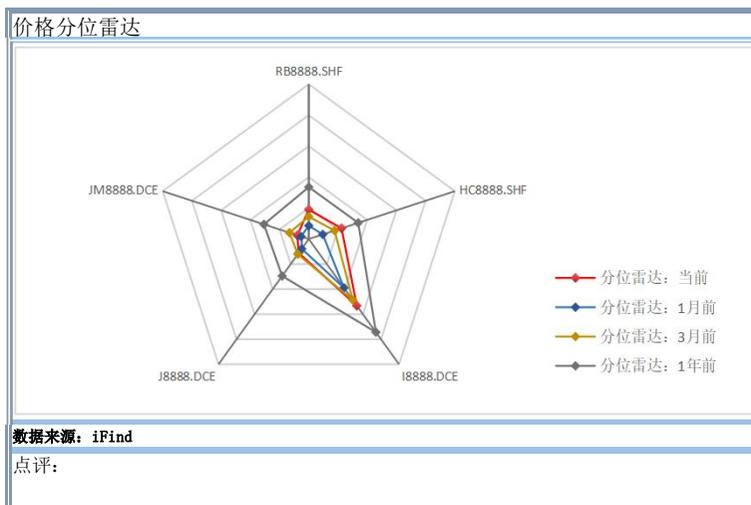
期内最大值: 8428.0000

期内平均值: 6511.6365

当前分位值: 14.37%



四、黑色相关



数据起始日: 2019/10/31

数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 3034

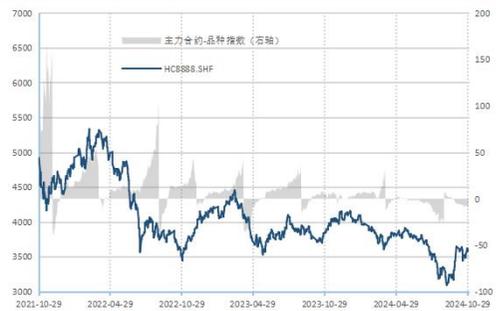
期内最大值: 5154

期内平均值: 3931.7586

当前分位值: 19.01%



HC. SHFE价格走势



数据起始日: 2019/10/31

数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 3093

期内最大值: 5333

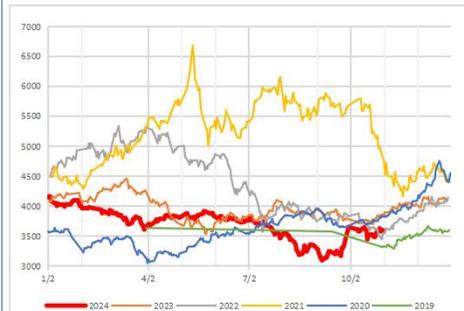
期内平均值: 4051.3059

当前分位值: 22.46%

数据来源: iFind

点评:

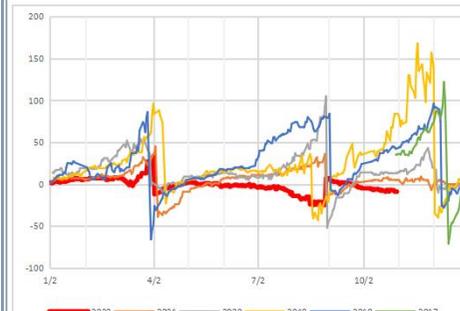
HC. SHFE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

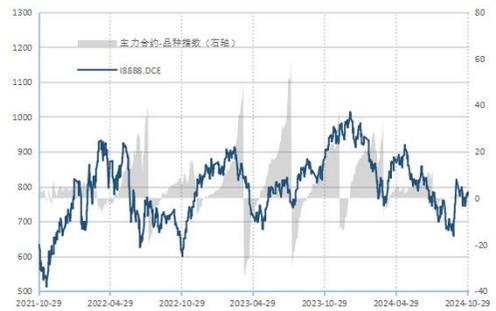
HC. SHFE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

I. DCE价格走势



数据起始日: 2019/10/31

数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 512.8

期内最大值: 1013.6

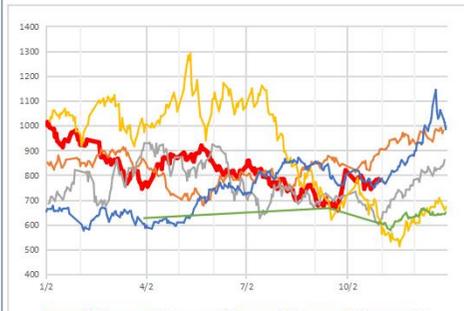
期内平均值: 794.6520

当前分位值: 53.19%

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：2019/10/31

数据截止日：2024/10/31

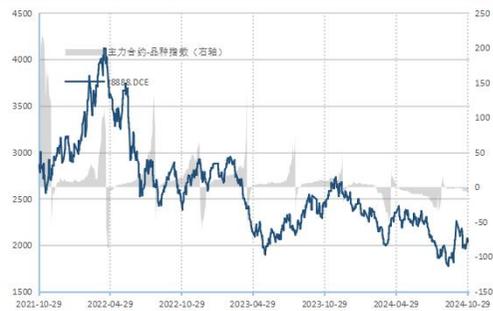
期内最小值：1775.4

期内最大值：4117.7

期内平均值：2599.8325

当前分位值：11.14%

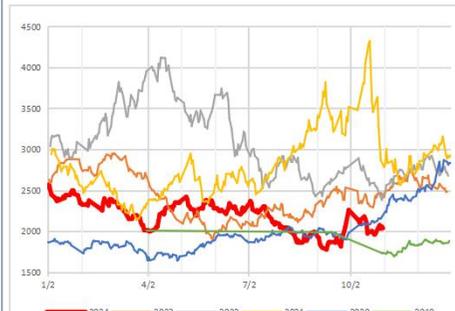
J. DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

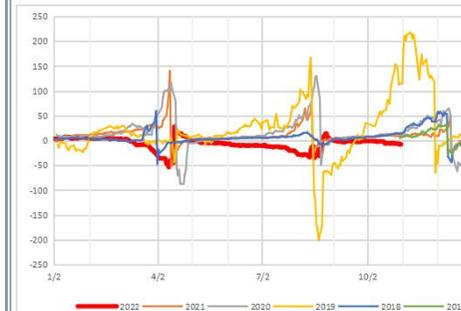
J. DCE价格走势季节性



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：2019/10/31

数据截止日：2024/10/31

期内最小值：1219.4

期内最大值：3196.2

期内平均值：1892.4078

当前分位值：7.86%

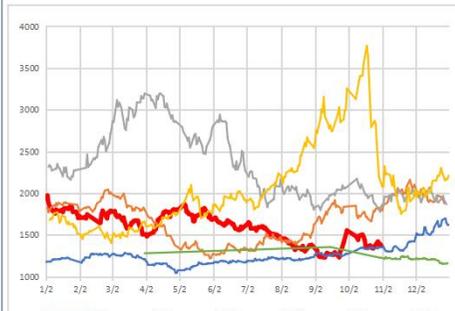
Jm. DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

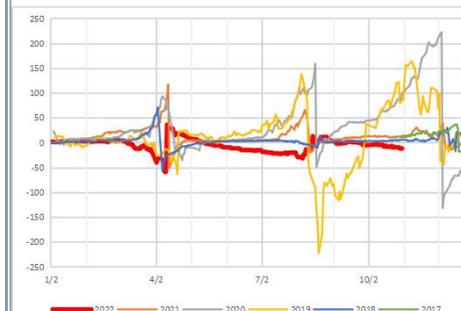
Jm. DCE价格走势季节性



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：

螺铁差

数据起始日：2019/10/31

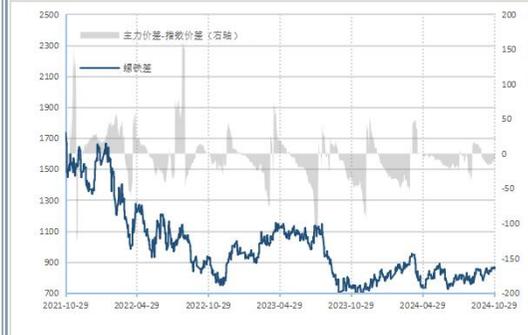
数据截止日：2024/10/31

期内最小值：670.1176

期内最大值：1735.7059

期内平均值：1000.1183

当前分位值：18.21%



数据来源：iFind

点评：

螺纹利润

数据起始日：2019/10/31

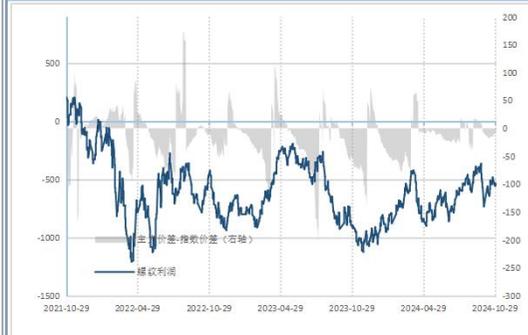
数据截止日：2024/10/31

期内最小值：-1206.9091

期内最大值：206.6364

期内平均值：-598.9582

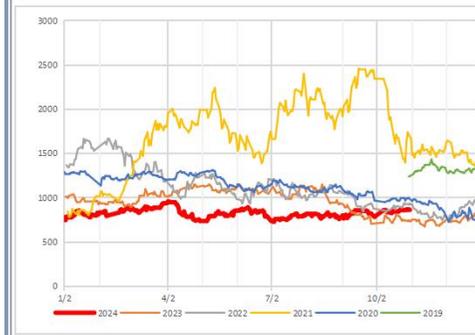
当前分位值：47.23%



数据来源：iFind

点评：

螺铁差季节性



数据来源：iFind

点评：

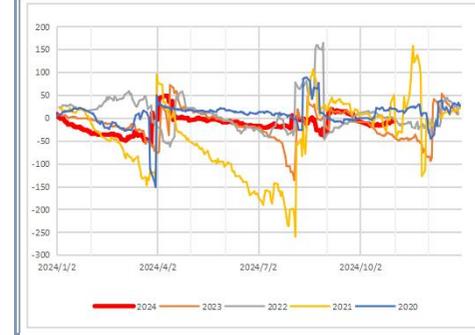
螺纹利润季节性



数据来源：iFind

点评：

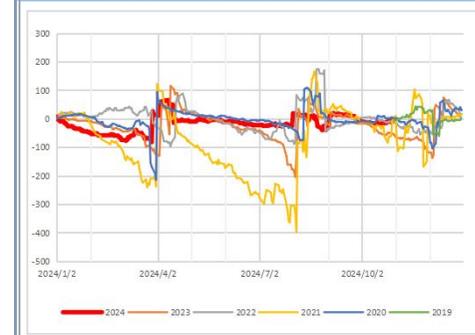
螺铁差主力-指数 季节性



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: 2019/10/31

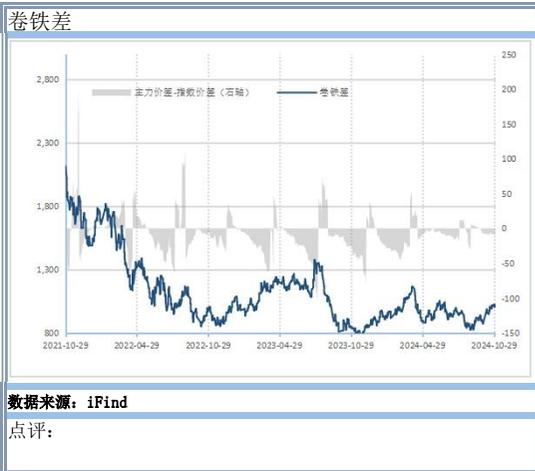
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 752.4706

期内最大值: 2115.7059

期内平均值: 1119.6656

当前分位值: 19.85%



数据起始日: 2019/10/31

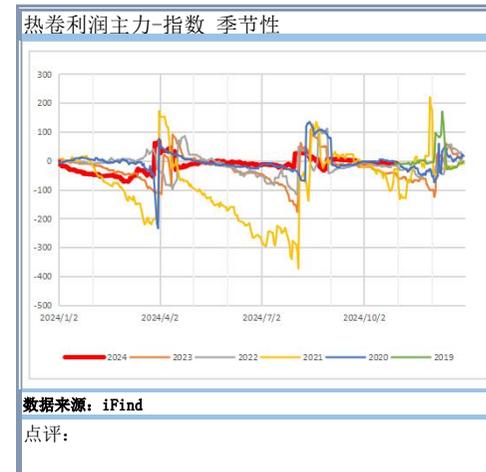
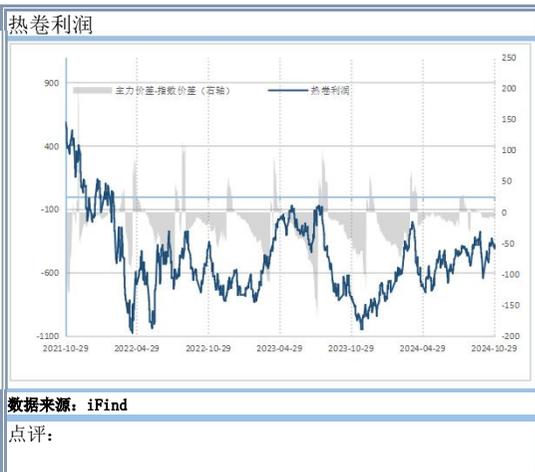
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: -1073.7273

期内最大值: 586.6364

期内平均值: -479.4109

当前分位值: 41.77%



数据起始日: 2019/10/31

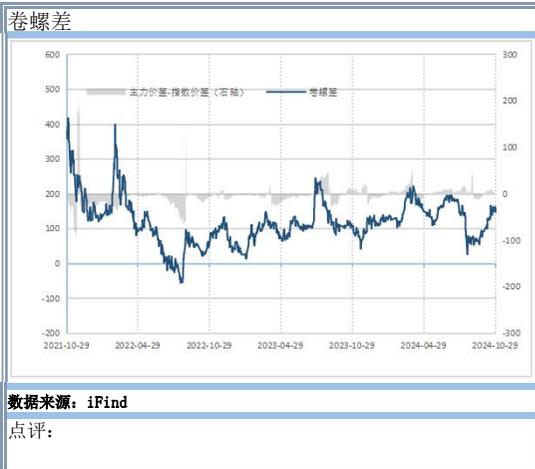
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: -56.0000

期内最大值: 416.0000

期内平均值: 119.5473

当前分位值: 45.55%



数据起始日: 2019/10/31

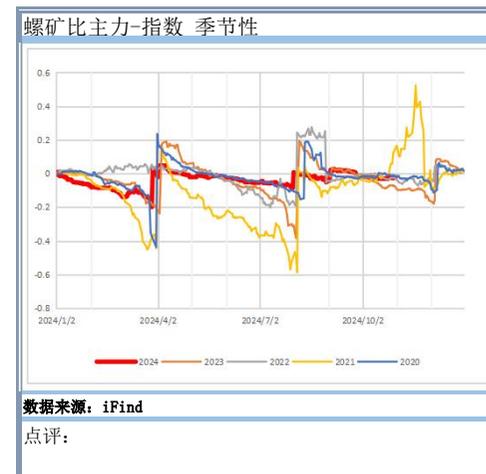
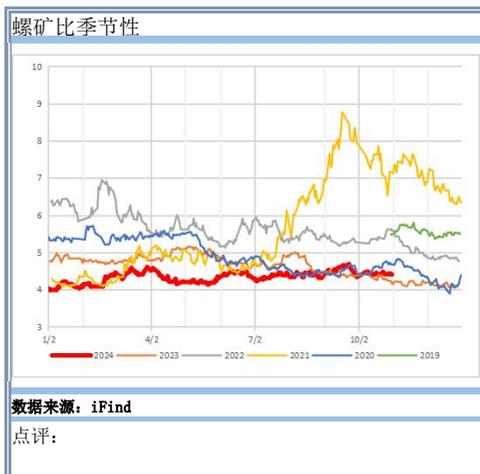
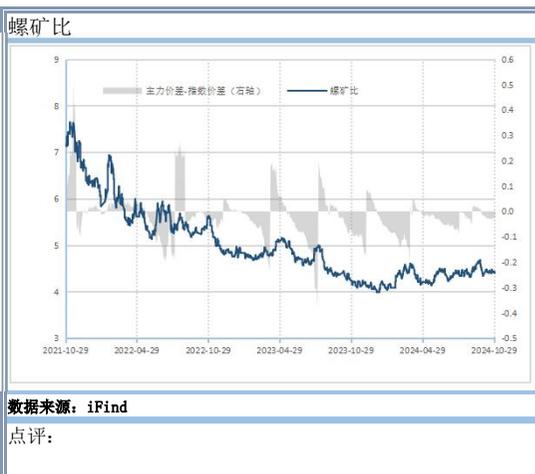
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 3.9880

期内最大值: 7.6431

期内平均值: 5.0124

当前分位值: 11.57%



数据起始日: 2019/10/31

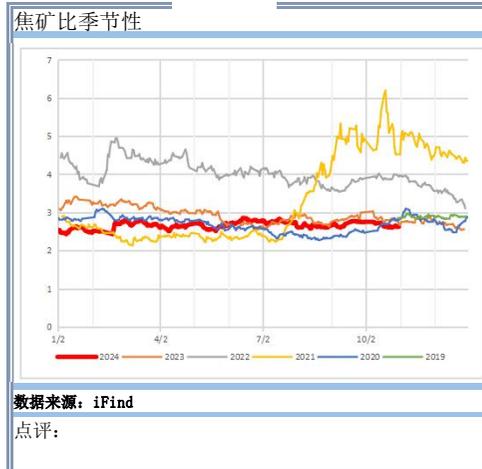
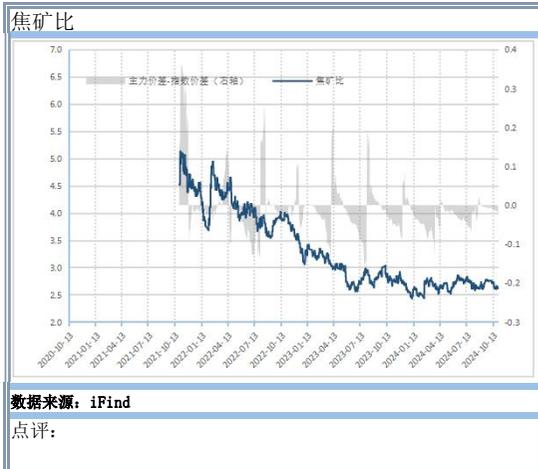
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 2.4279

期内最大值: 5.1291

期内平均值: 3.3150

当前分位值: 6.86%



数据起始日: 2019/10/31

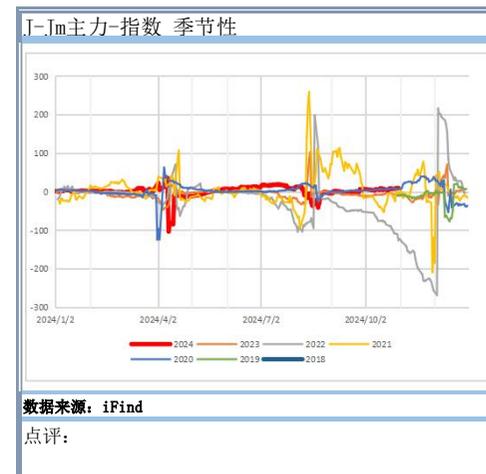
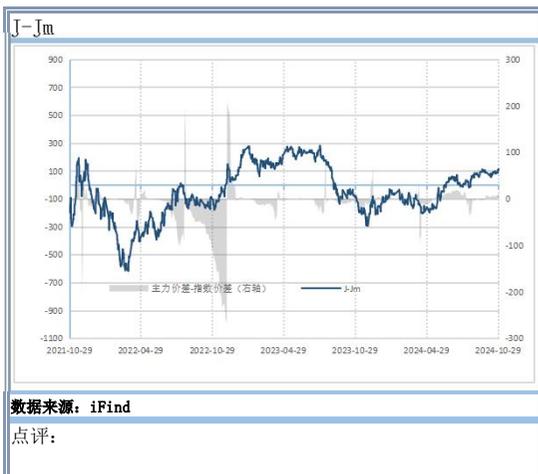
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: -617.4400

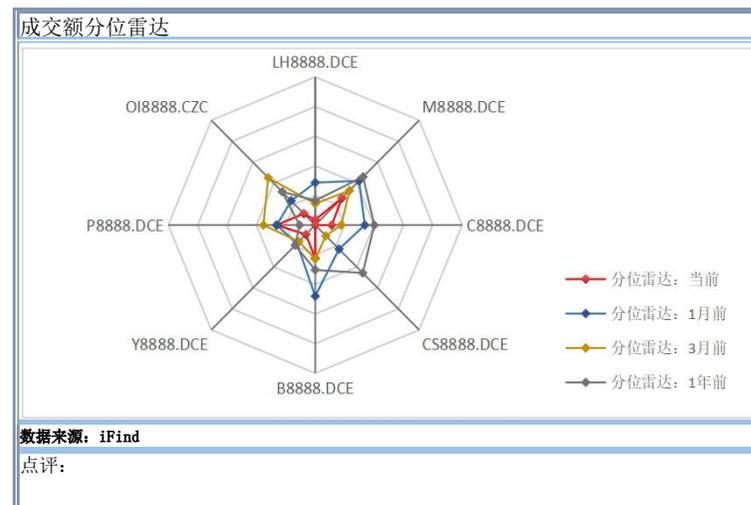
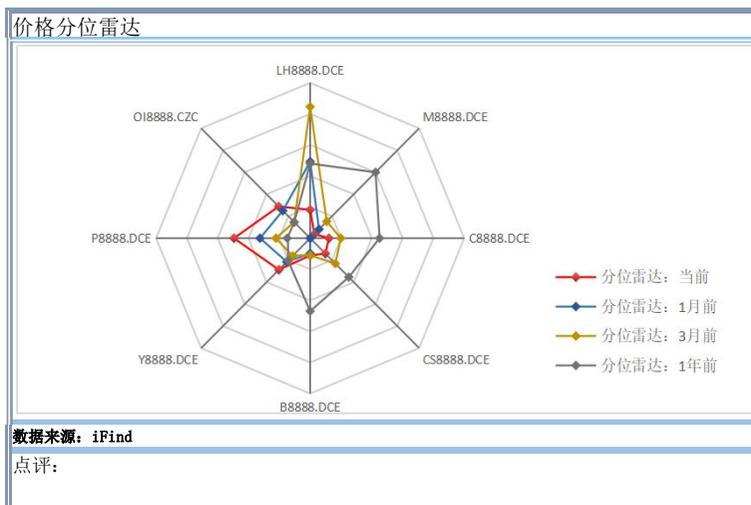
期内最大值: 279.1600

期内平均值: -49.5384

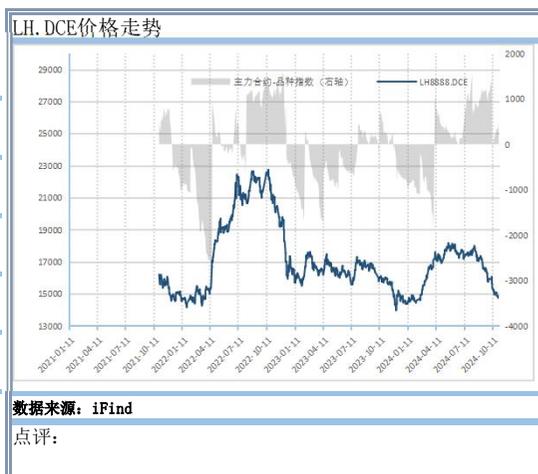
当前分位值: 81.31%



五、农产品相关



数据起始日: 2021/1/8
数据截止日: 2024/10/31
期内最小值: 13971
期内最大值: 18158
期内平均值: 16318.4966
当前分位值: 18.27%



数据起始日: 2019/10/31

数据截止日: 2024/10/31

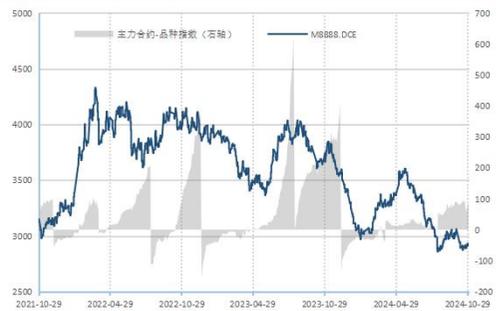
期内最小值: 2858

期内最大值: 4328

期内平均值: 3593.9451

当前分位值: 3.81%

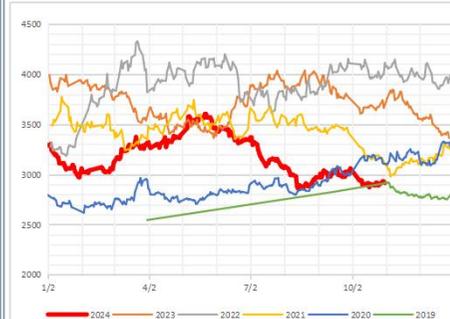
M. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

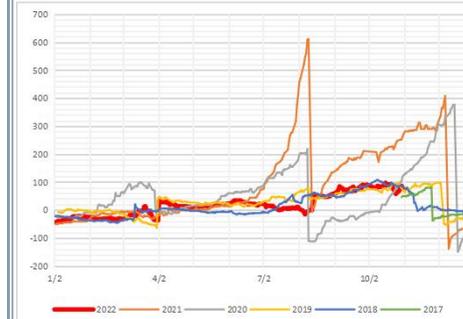
M. DCE价格走势季节性



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: 2019/10/31

数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 2157

期内最大值: 3027

期内平均值: 2635.2250

当前分位值: 12.18%

C. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

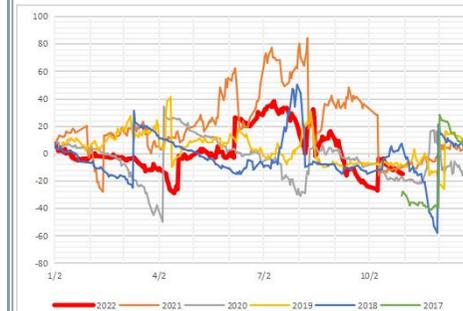
C. DCE价格走势季节性



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: 2019/10/31

数据截止日: 2024/10/31

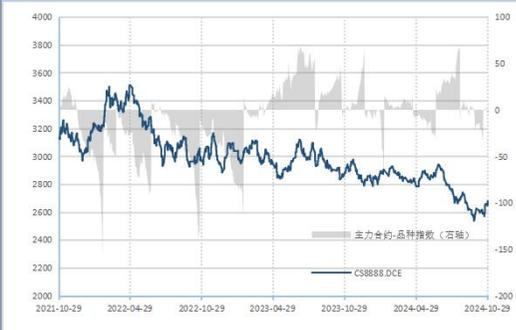
期内最小值: 2538

期内最大值: 3512

期内平均值: 2993.6831

当前分位值: 13.96%

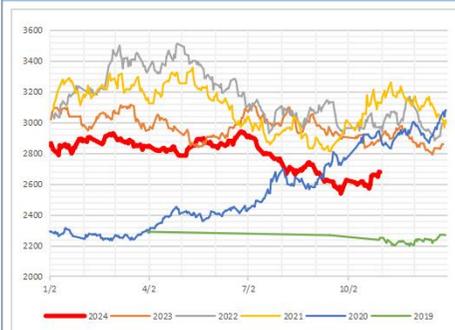
CS. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

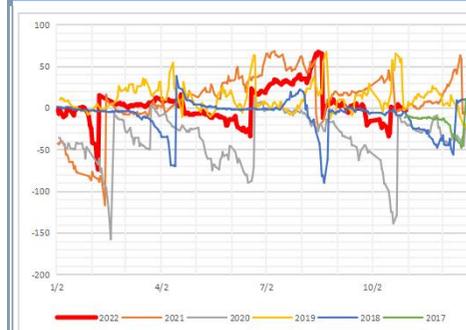
CS. DCE价格走势季节性



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: 2019/10/31

数据截止日: 2024/10/31

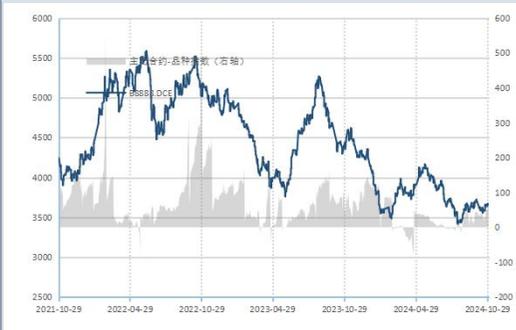
期内最小值: 3417

期内最大值: 5585

期内平均值: 4432.7298

当前分位值: 11.12%

B. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

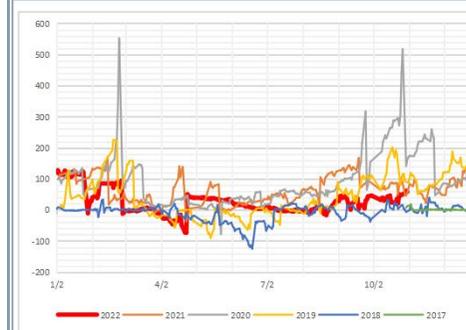
B. DCE价格走势季节性



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： 2019/10/31

数据截止日： 2024/10/31

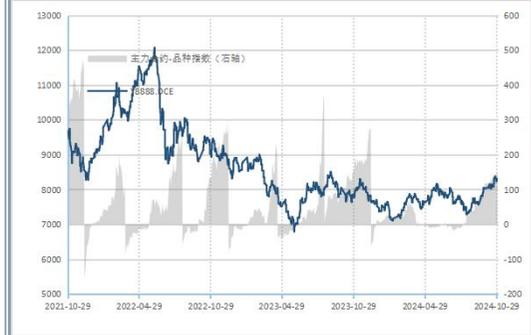
期内最小值： 6793

期内最大值： 12065

期内平均值： 8589.4060

当前分位值： 28.70%

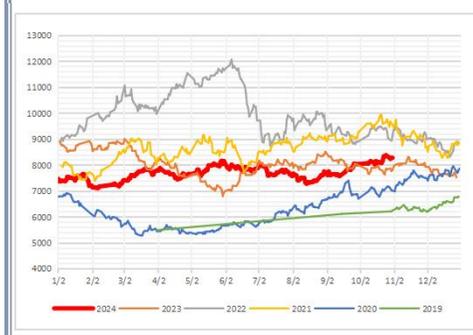
Y. DCE价格走势



数据来源： iFind

点评：

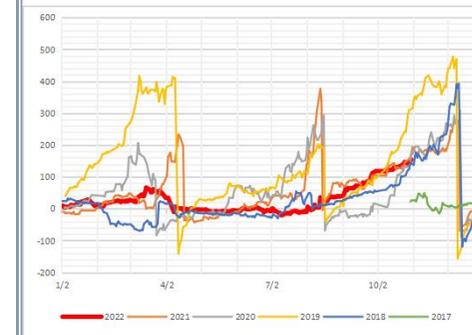
Y. DCE价格走势季节性



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： 2019/10/31

数据截止日： 2024/10/31

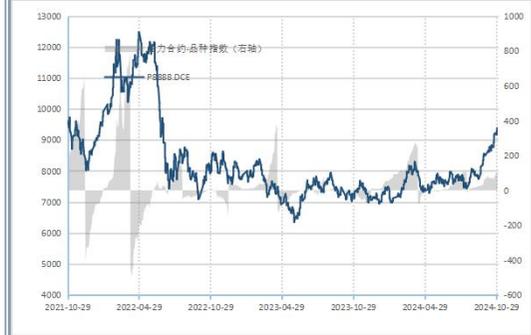
期内最小值： 6349

期内最大值： 12479

期内平均值： 8263.4102

当前分位值： 49.45%

P. DCE价格走势



数据来源： iFind

点评：

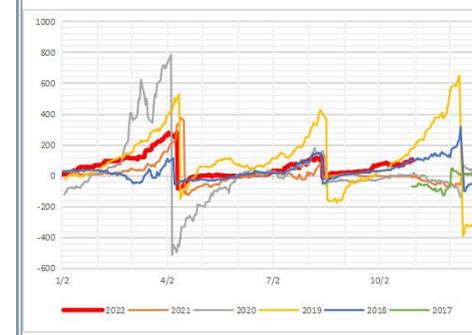
P. DCE价格走势季节性



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: 2019/10/31

数据截止日: 2024/10/31

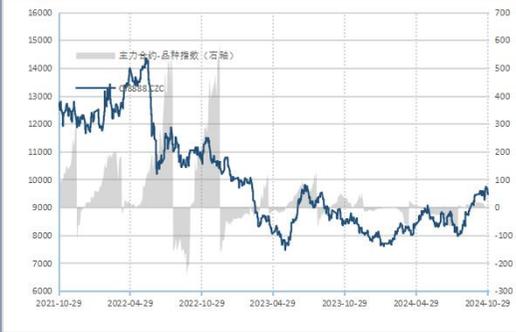
期内最小值: 7475

期内最大值: 14344

期内平均值: 9967.5830

当前分位数: 28.90%

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: 2022/4/6

数据截止日: 2024/10/31

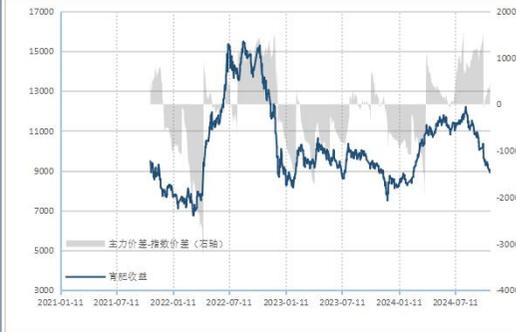
期内最小值: 7508.2500

期内最大值: 12199.0000

期内平均值: 10026.1905

当前分位数: 30.01%

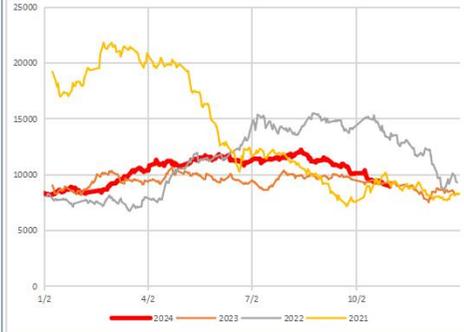
盲肥收益



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

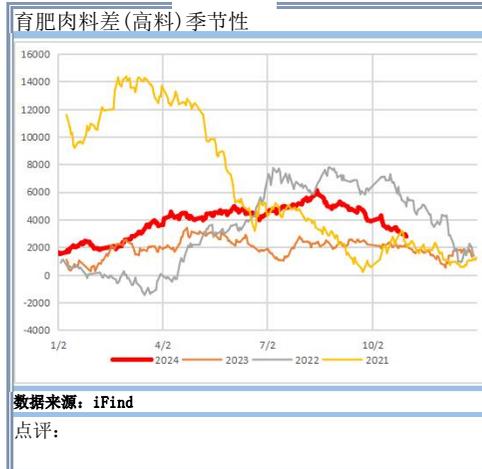
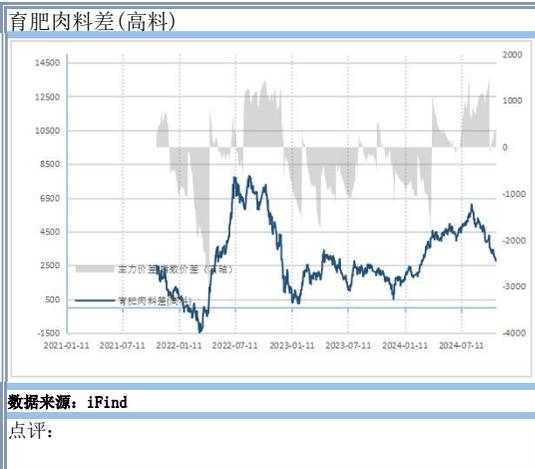
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: 515.0000

期内最大值: 6111.0000

期内平均值: 3273.3759

当前分位值: 40.30%



数据起始日: 2019/10/31

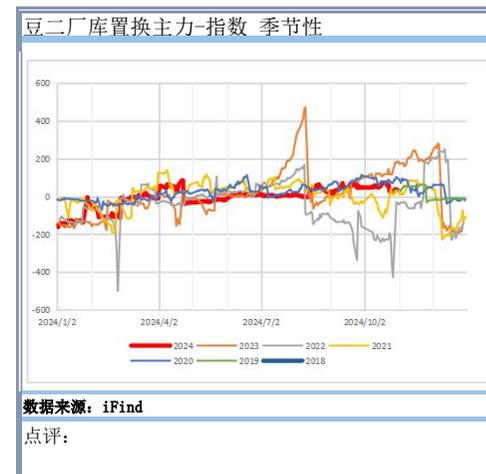
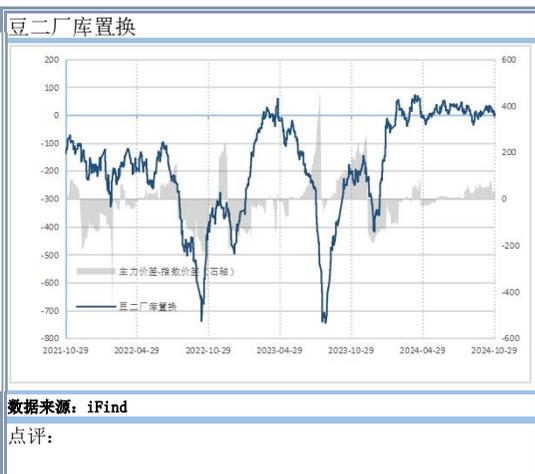
数据截止日: 2024/10/31

期内最小值: -745.0200

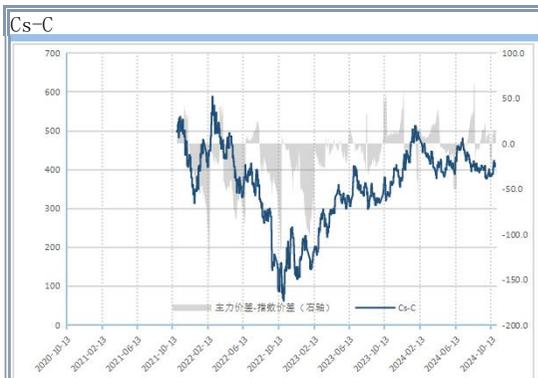
期内最大值: 71.2200

期内平均值: -182.4427

当前分位值: 92.02%



数据起始日: 2019/10/31
 数据截止日: 2024/10/31
 期内最小值: 62.0000
 期内最大值: 587.0000
 期内平均值: 358.4582
 当前分位值: 66.48%



数据来源: iFind
 点评:

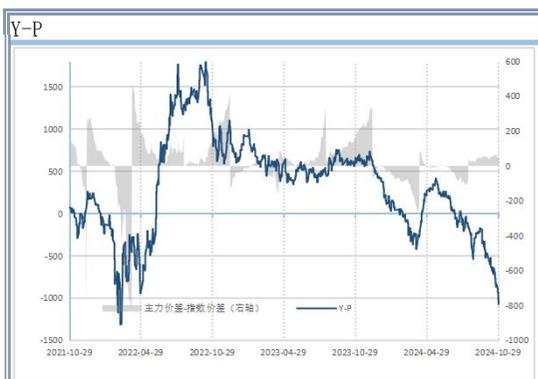


数据来源: iFind
 点评:



数据来源: iFind
 点评:

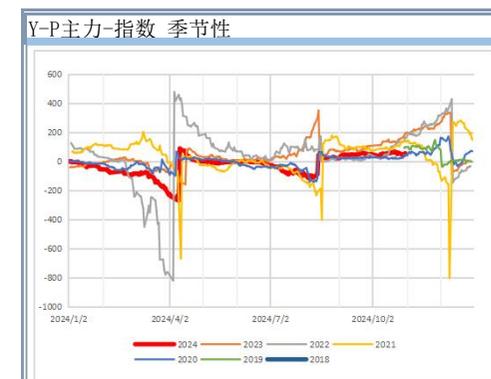
数据起始日: 2019/10/31
 数据截止日: 2024/10/31
 期内最小值: -1313.0000
 期内最大值: 1788.0000
 期内平均值: 325.9959
 当前分位值: 7.71%



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：2019/10/31

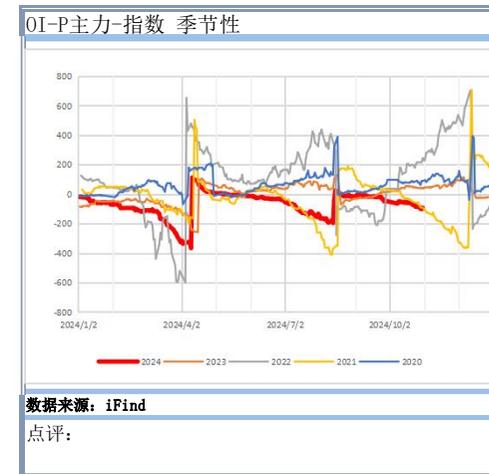
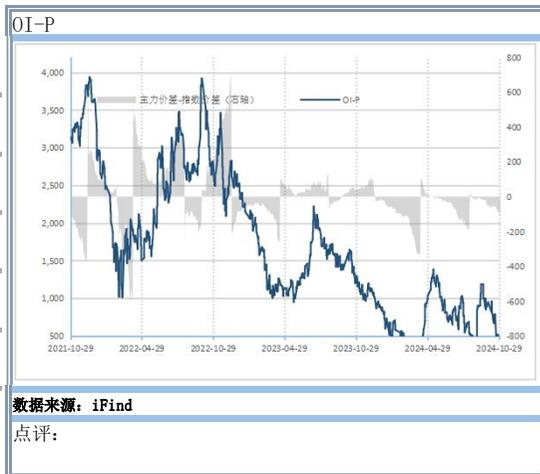
数据截止日：2024/10/31

期内最小值：19.0000

期内最大值：2220.0000

期内平均值：1002.3399

当前分位值：2.77%



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。