

# 盘面套利观察

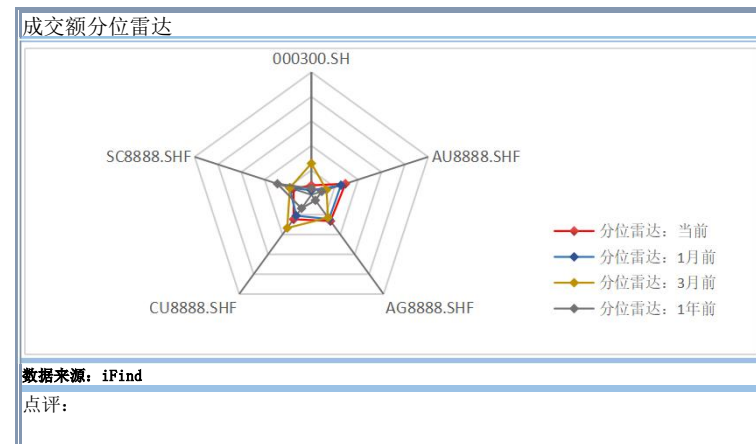
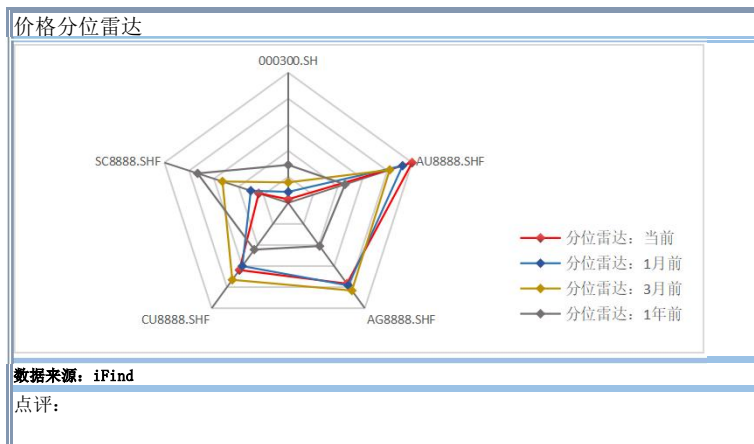
2024年9月23日

数据仅供参考，据此入市，风险自担。

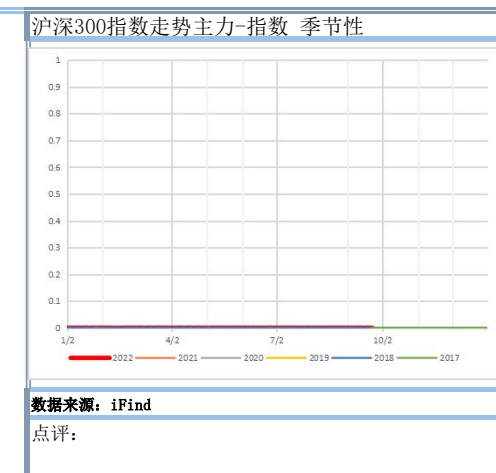
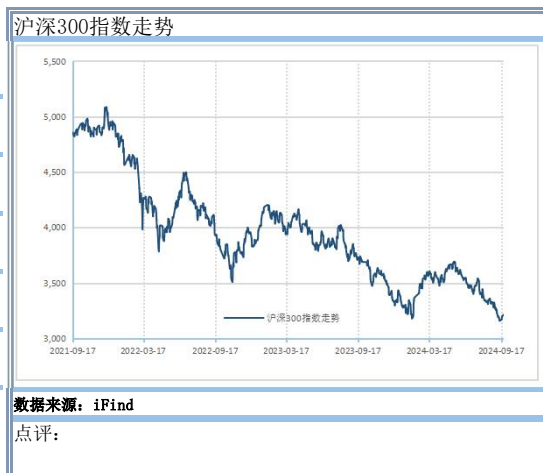
说明：

- 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: 2019/9/23  
数据截止日: 2024/9/23  
期内最小值: 3159.247  
期内最大值: 5083.8007  
期内平均值: 3946.2040  
当前分位值: 15.71%



数据起始日: 2019/9/23

数据截止日: 2024/9/23

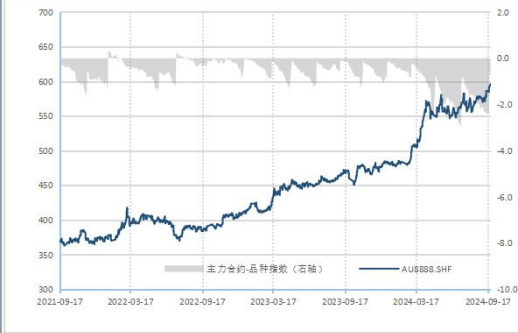
期内最小值: 363.2

期内最大值: 595.93

期内平均值: 445.7527

当前分位值: 100.00%

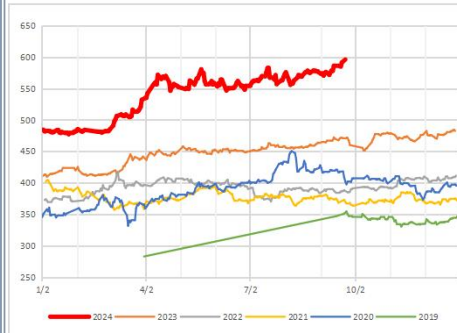
Au. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

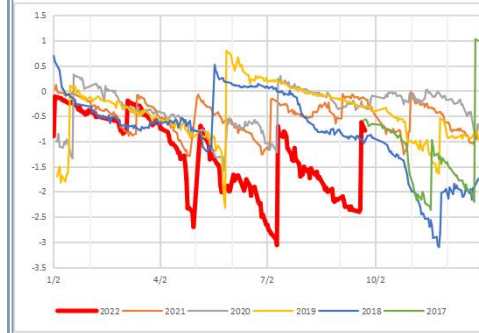
Au. SHFE价格走势季节性



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: 2019/9/23

数据截止日: 2024/9/23

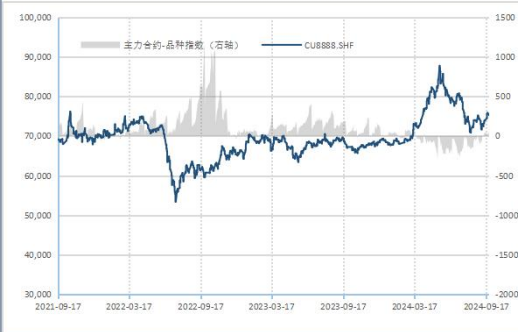
期内最小值: 53367

期内最大值: 87697

期内平均值: 69424.1715

当前分位值: 63.75%

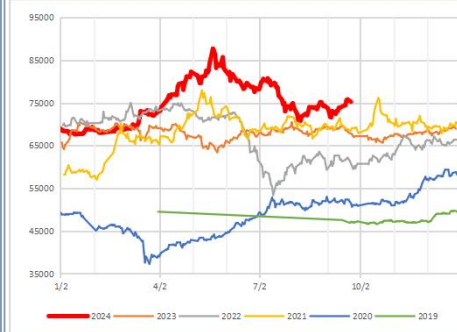
Cu. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

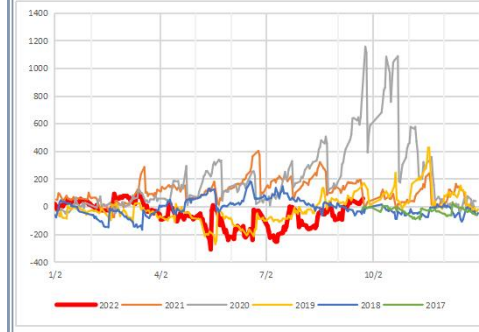
Cu. SHFE价格走势季节性



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：2019/9/23

数据截止日：2024/9/23

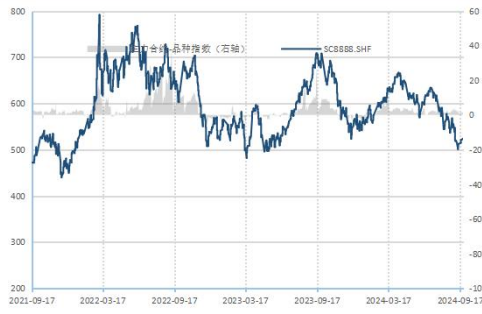
期内最小值：439.9

期内最大值：791.6

期内平均值：595.9165

当前分位值：23.80%

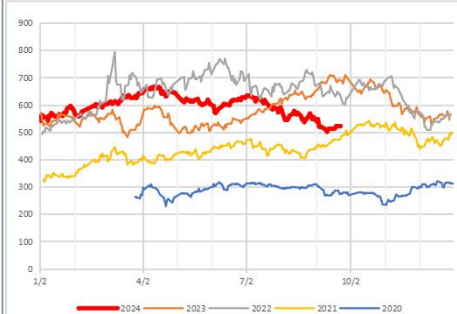
Sc. Ine价格走势



数据来源：iFind

点评：

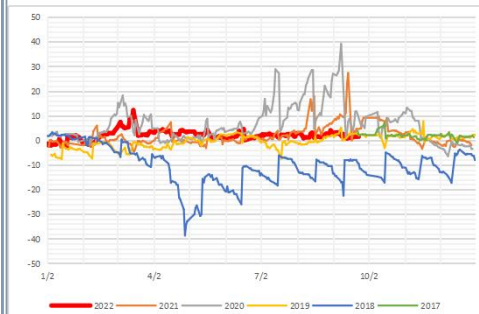
Sc. Ine价格走势季节性



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：2019/9/23

数据截止日：2024/9/23

期内最小值：9.6881

期内最大值：15.4319

期内平均值：12.6670

当前分位值：6.25%

Cu/Au



数据来源：iFind

点评：

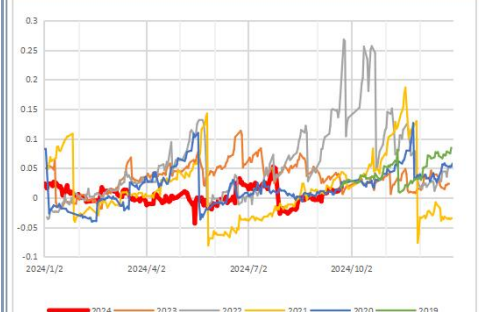
Cu/Au季节性



数据来源：iFind

点评：

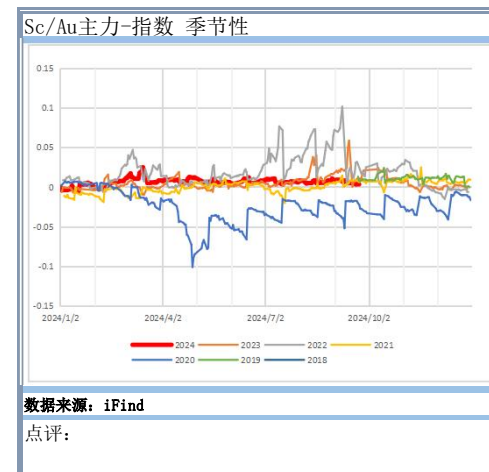
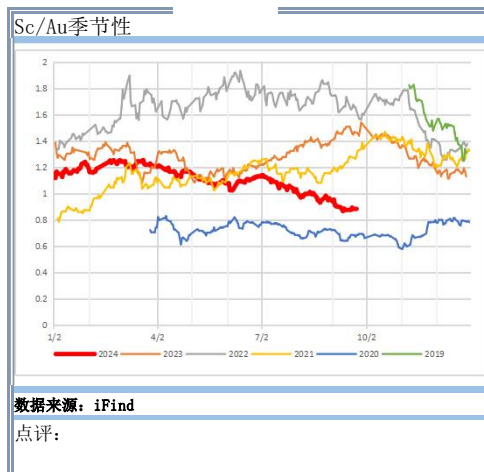
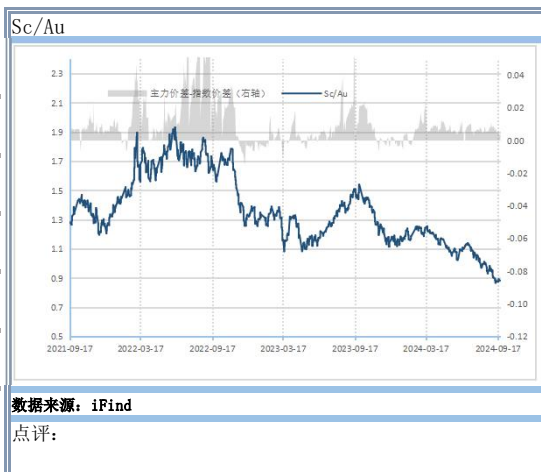
Cu/Au主力-指数 季节性



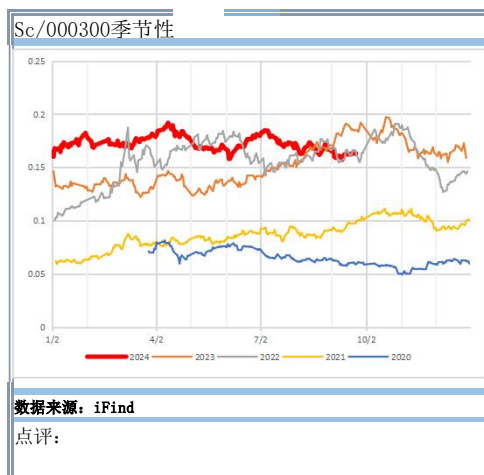
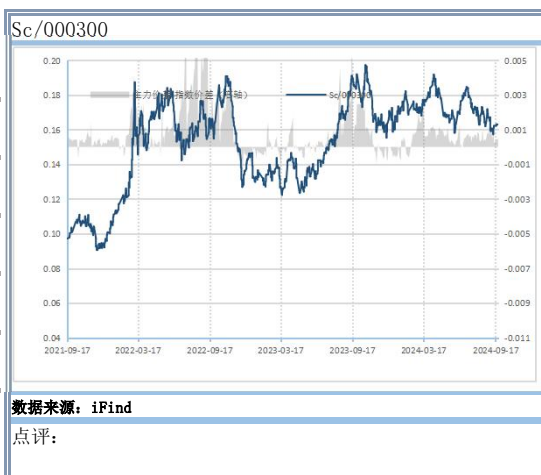
数据来源：iFind

点评：

数据起始日：2019/9/23  
 数据截止日：2024/9/23  
 期内最小值：0.8662  
 期内最大值：1.9320  
 期内平均值：1.3621  
 当前分位值：1.17%



数据起始日：2019/9/23  
 数据截止日：2024/9/23  
 期内最小值：0.0906  
 期内最大值：0.1972  
 期内平均值：0.1534  
 当前分位值：67.91%



数据起始日: 2019/9/23

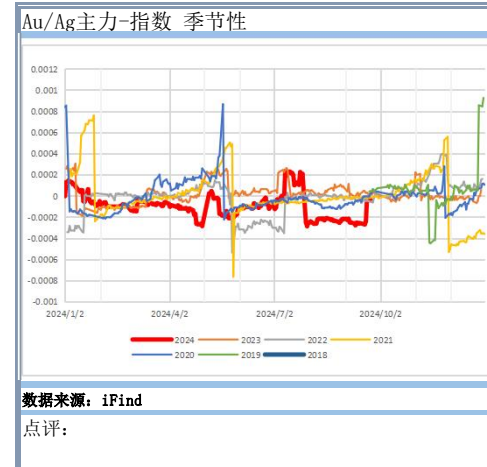
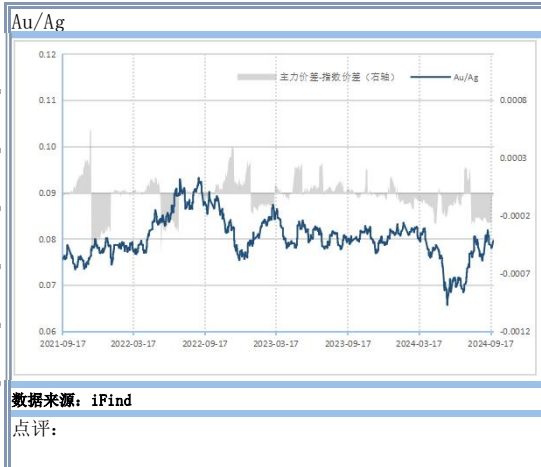
数据截止日: 2024/9/23

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: 50.42%



数据起始日: 2019/9/23

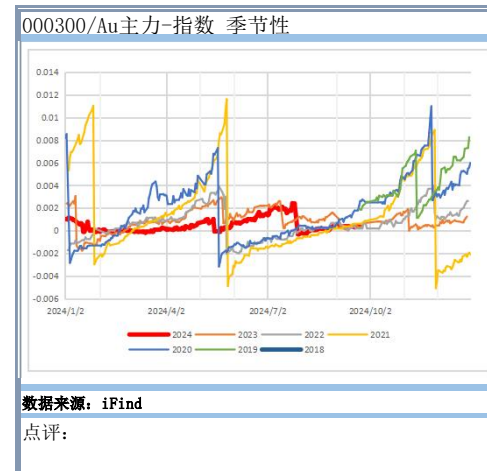
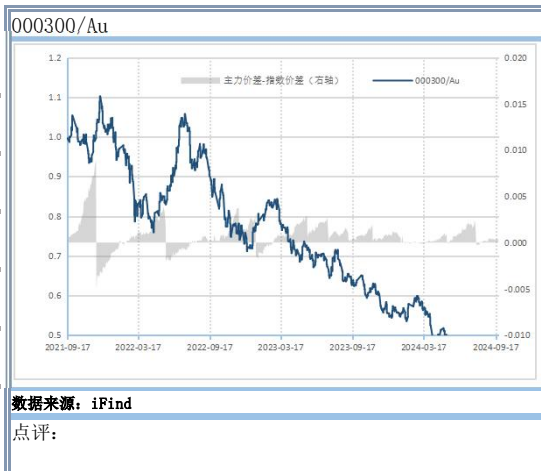
数据截止日: 2024/9/23

期内最小值: 0.4165

期内最大值: 1.1021

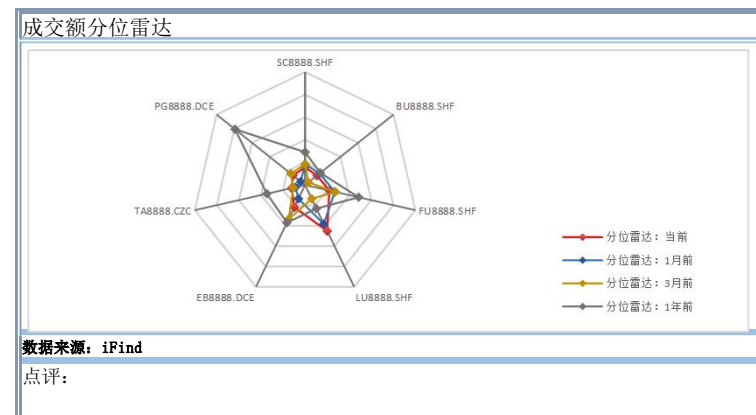
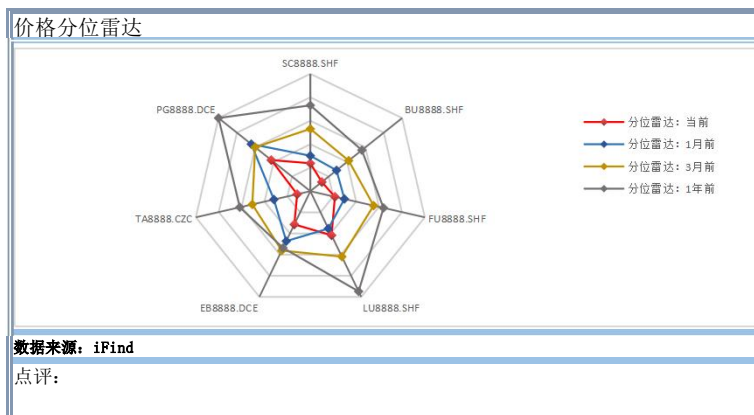
期内平均值: 0.7357

当前分位值: 1.82%





二、原油相关



数据起始日: 2019/9/23

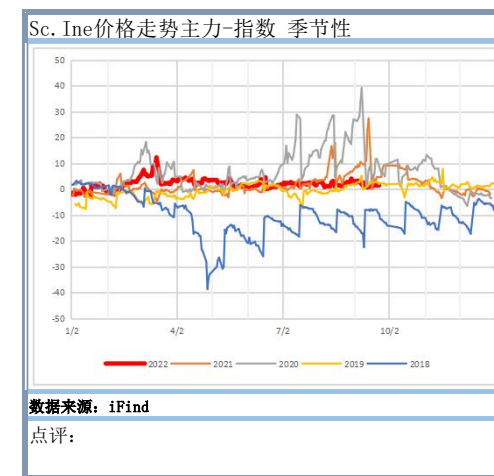
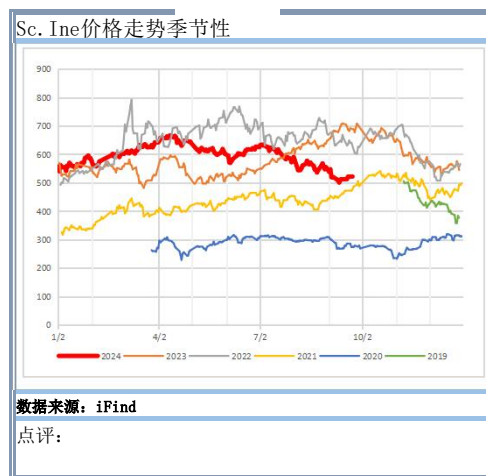
数据截止日: 2024/9/23

期内最小值: 439.9

期内最大值: 791.6

期内平均值: 595.9165

当前分位值: 23.80%



数据起始日: 2019/9/23

数据截止日: 2024/9/23

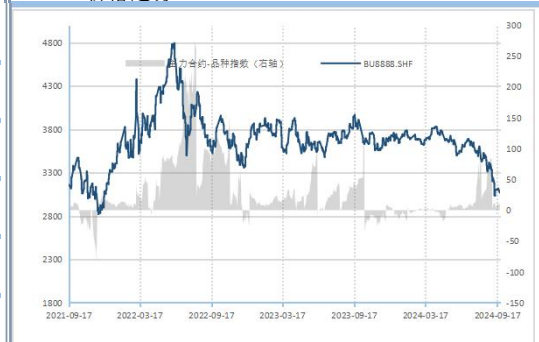
期内最小值: 2821

期内最大值: 4794

期内平均值: 3677.8436

当前分位值: 12.52%

Bu. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

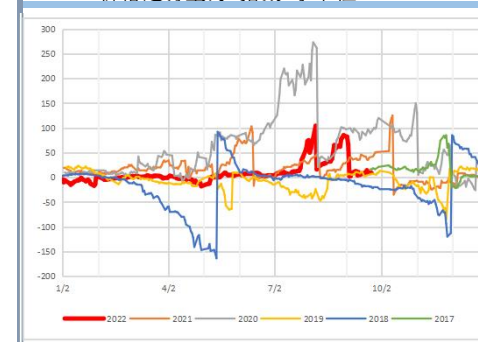
Bu. SHFE价格走势季节性



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: 2019/9/23

数据截止日: 2024/9/23

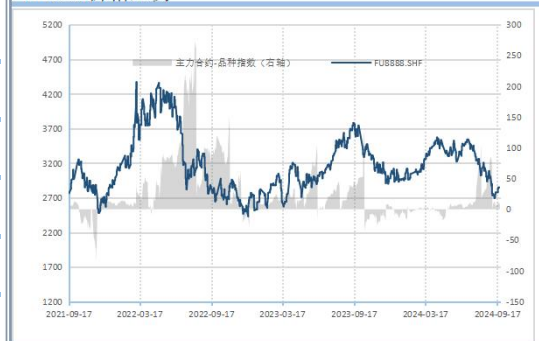
期内最小值: 2432

期内最大值: 4371

期内平均值: 3168.9753

当前分位值: 21.45%

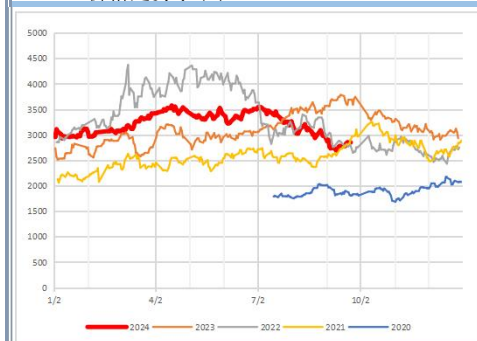
Fu. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

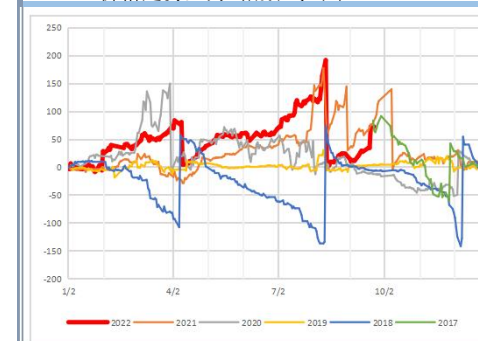
Fu. SHFE价格走势季节性



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

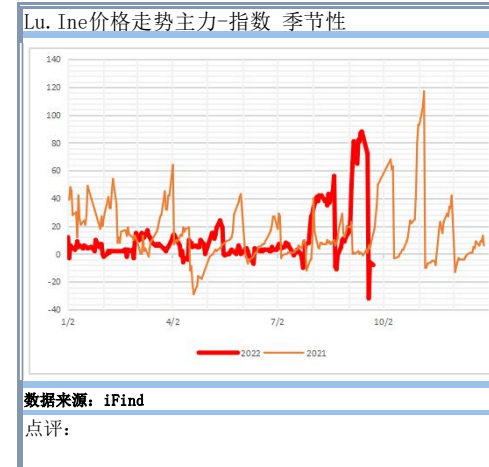
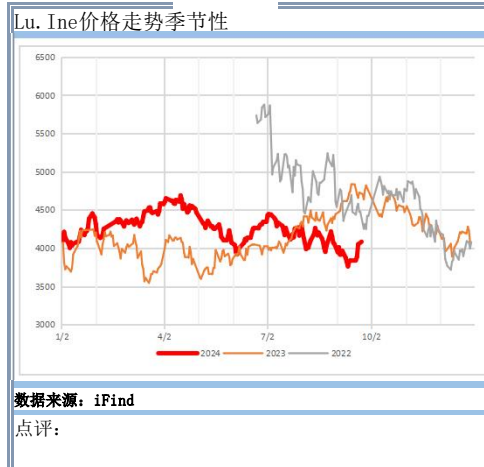
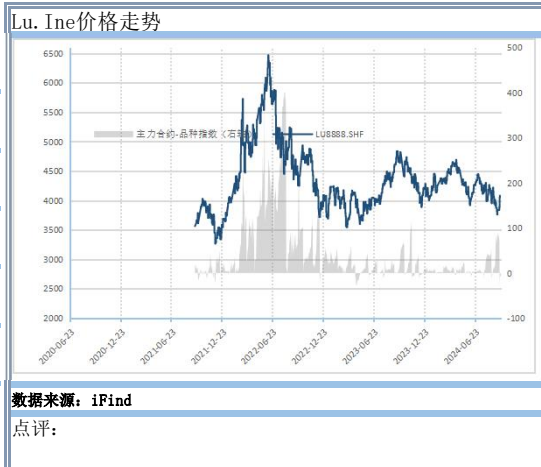
数据截止日：2024/9/23

期内最小值：3544

期内最大值：4834

期内平均值：4185.4659

当前分位值：41.71%



数据起始日：2019/9/26

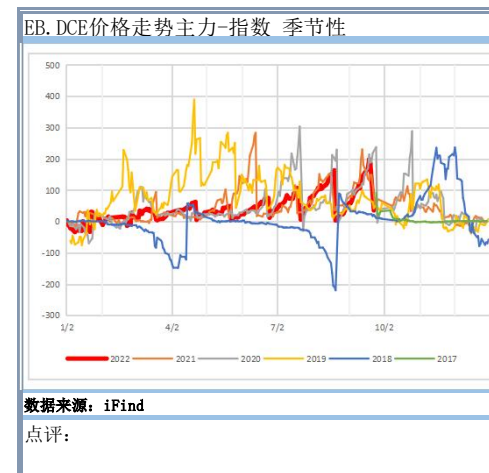
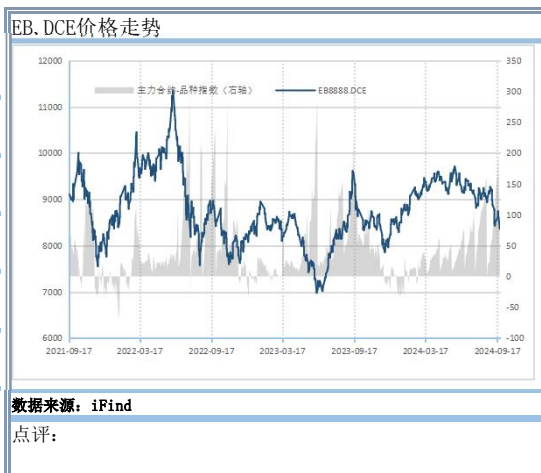
数据截止日：2024/9/23

期内最小值：6978

期内最大值：11361

期内平均值：8718.9717

当前分位值：31.42%



数据起始日： 2019/9/23

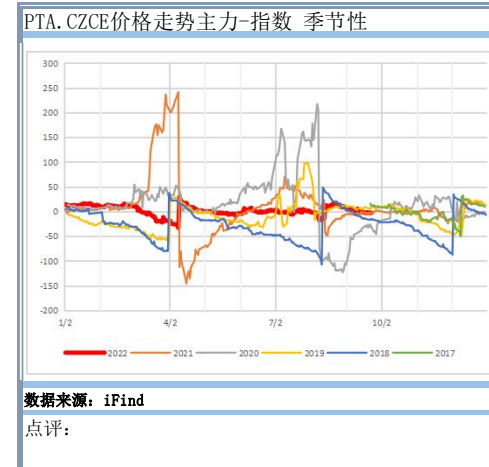
数据截止日： 2024/9/23

期内最小值： 4462

期内最大值： 7488

期内平均值： 5699.0027

当前分位值： 11.50%



数据起始日： 2020/3/30

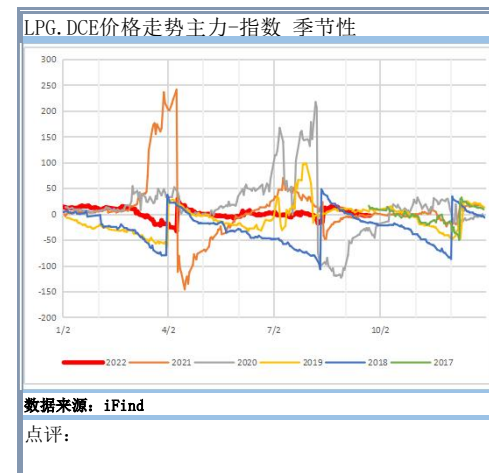
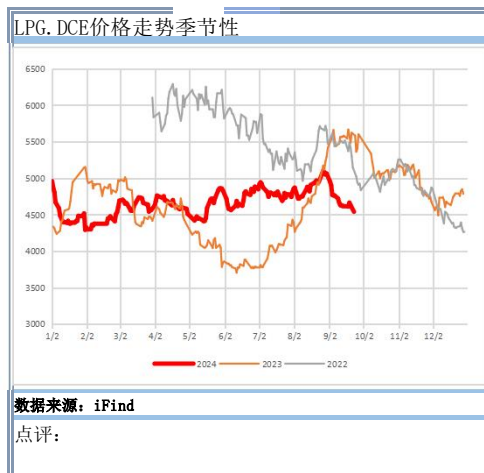
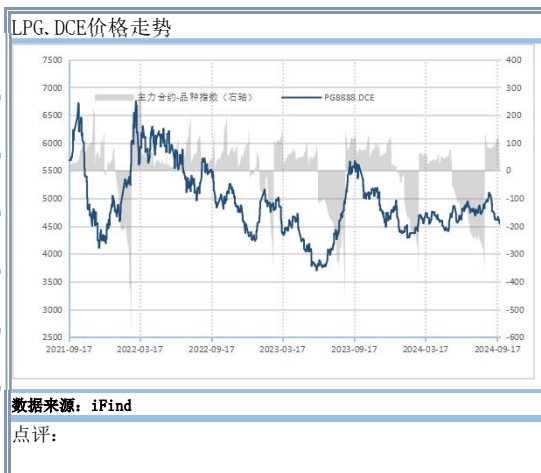
数据截止日： 2024/9/23

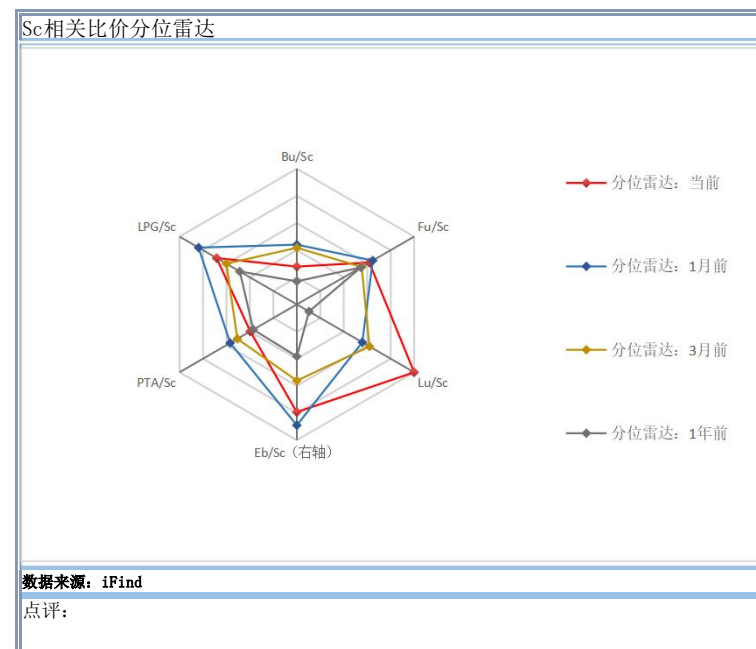
期内最小值： 3704

期内最大值： 5665

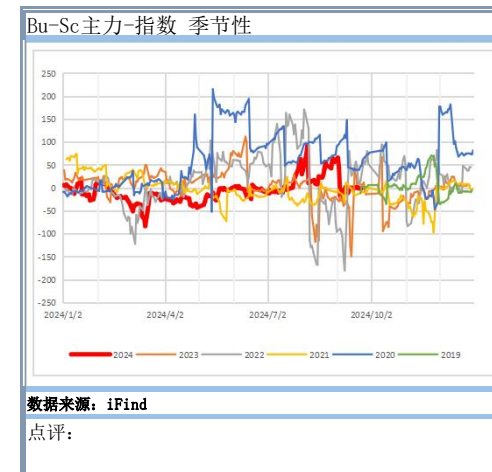
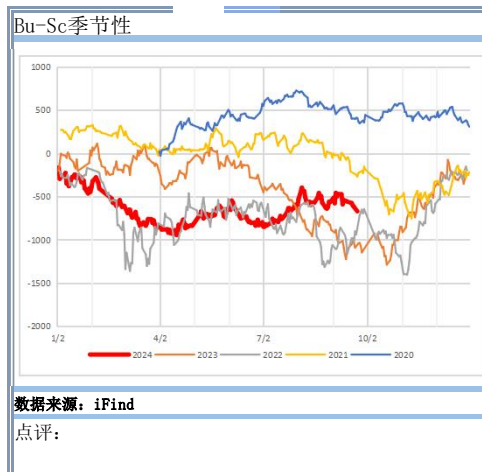
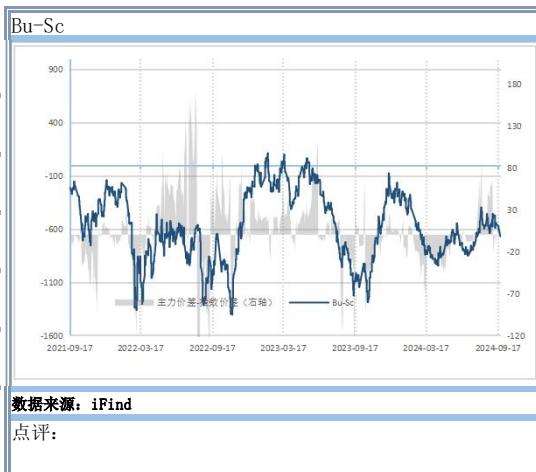
期内平均值： 4671.0290

当前分位值： 42.58%





数据起始日: 2019/9/23  
 数据截止日: 2024/9/23  
 期内最小值: -1406.4286  
 期内最大值: 111.1429  
 期内平均值: -578.7025  
 当前分位值: 48.39%



数据起始日: 2019/9/23

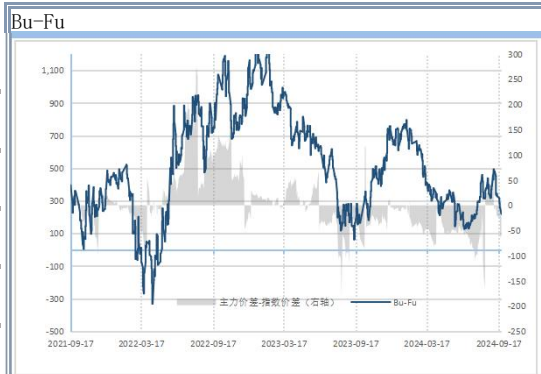
数据截止日: 2024/9/23

期内最小值: -331.0000

期内最大值: 1284.0000

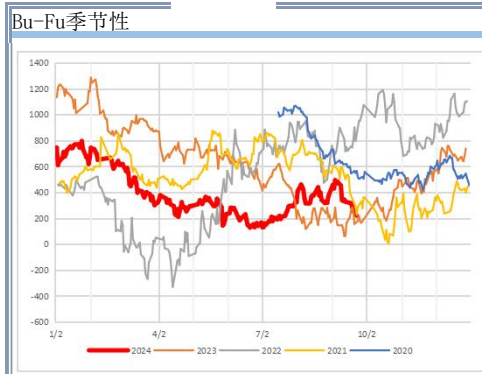
期内平均值: 508.8683

当前分位值: 34.12%



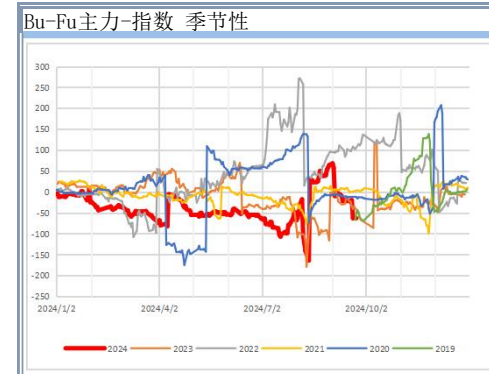
数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2021/11/7

数据截止日: 2024/9/23

期内最小值: 650.0000

期内最大值: 1483.0000

期内平均值: 1044.1388

当前分位值: 70.11%



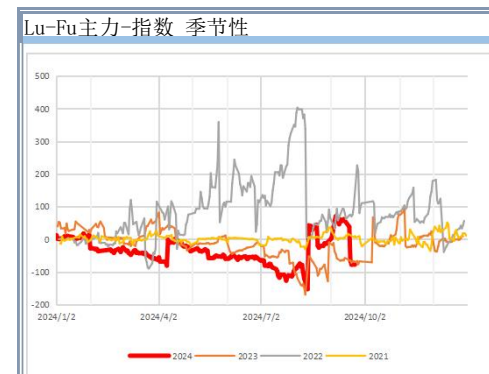
数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:

数据起始日：2021/9/12

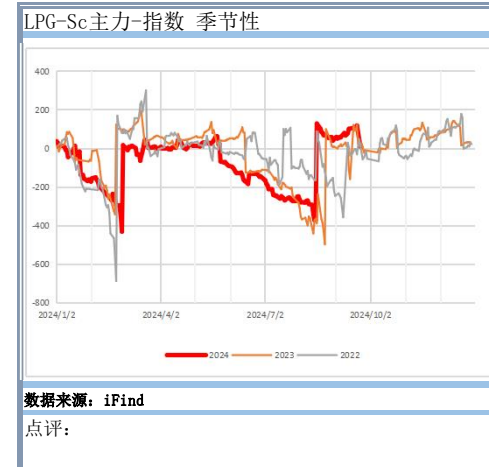
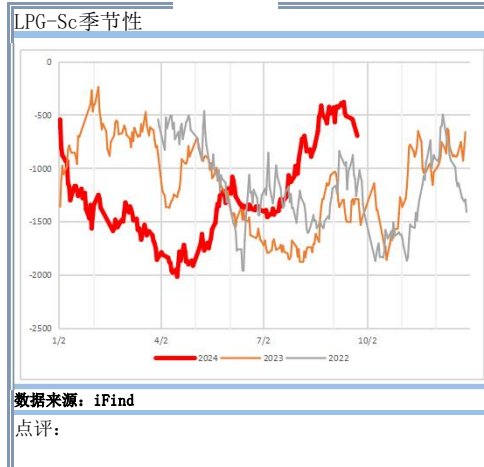
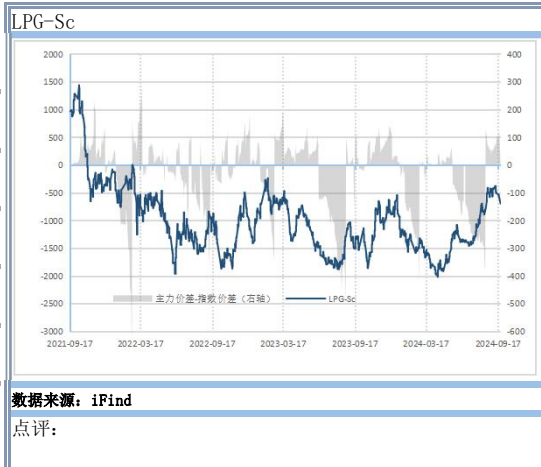
数据截止日：2024/9/23

期内最小值：-2017.0000

期内最大值：-240.0000

期内平均值：-1215.3195

当前分位值：74.28%



数据起始日：2019/9/23

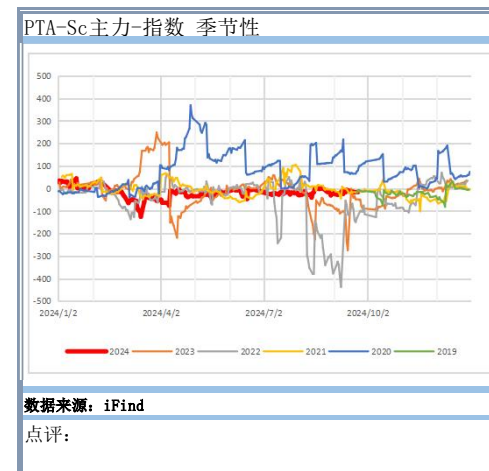
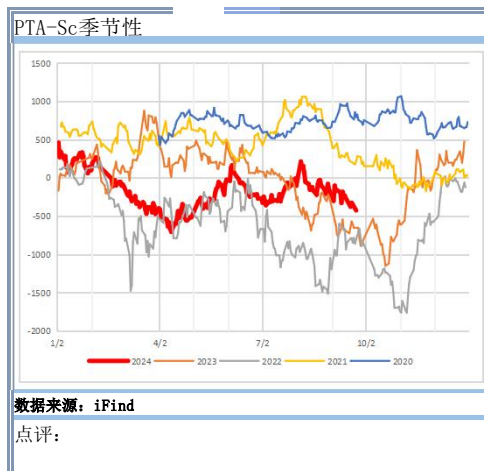
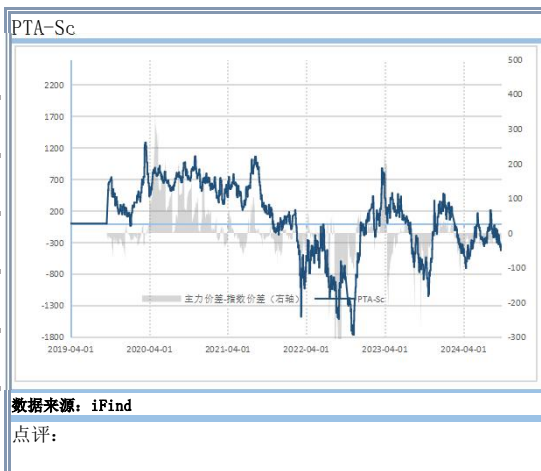
数据截止日：2024/9/23

期内最小值：-1762.0000

期内最大值：876.0000

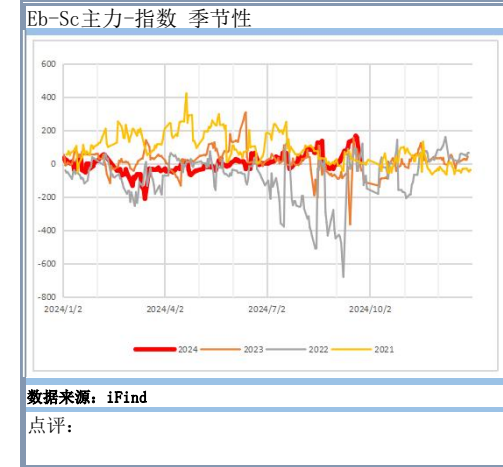
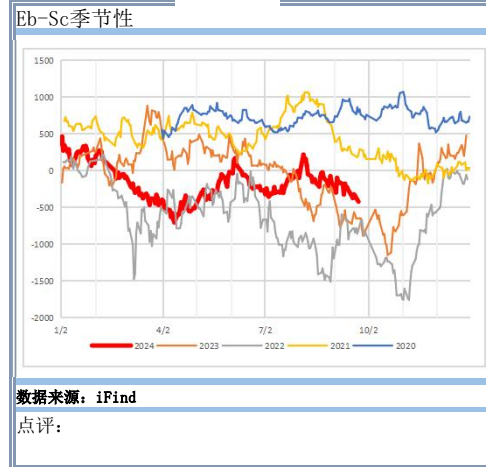
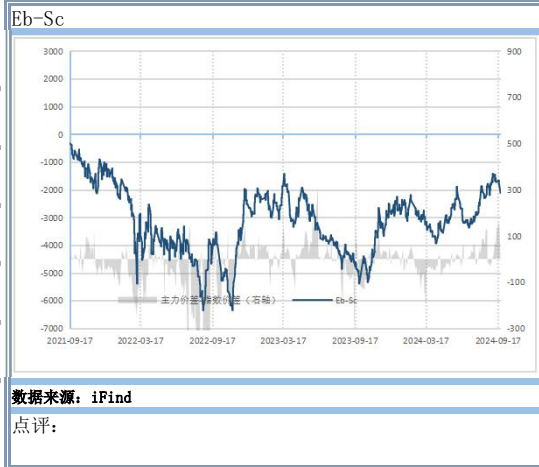
期内平均值：-260.1619

当前分位值：50.64%



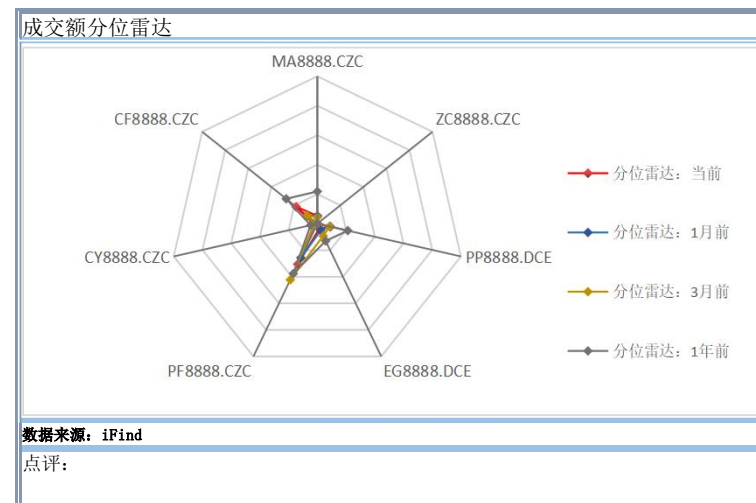
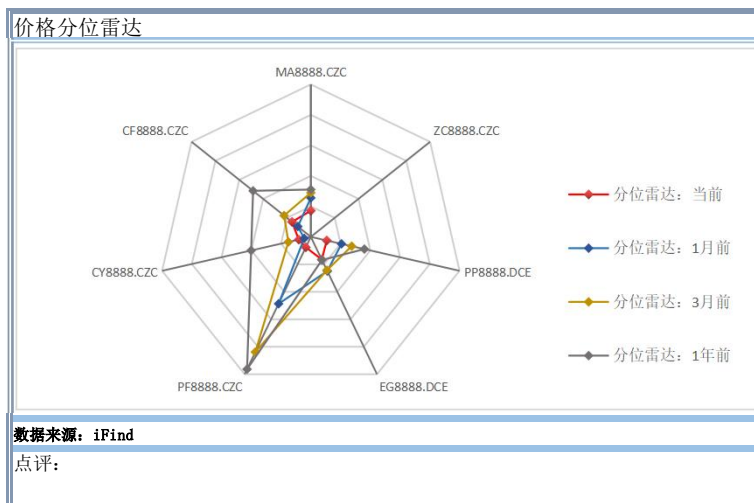


数据起始日: 2021/5/15  
 数据截止日: 2024/9/23  
 期内最小值: -6347.0000  
 期内最大值: -1429.0000  
 期内平均值: -3416.4093  
 当前分位值: 86.01%

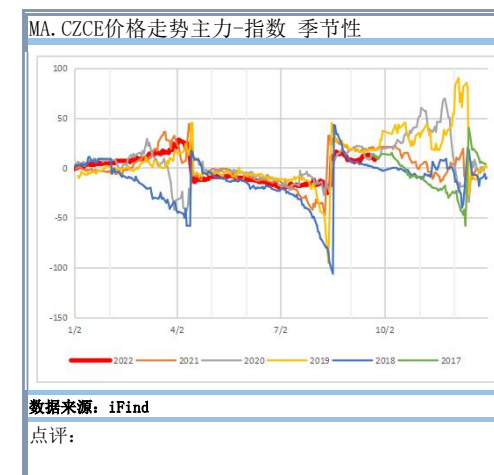
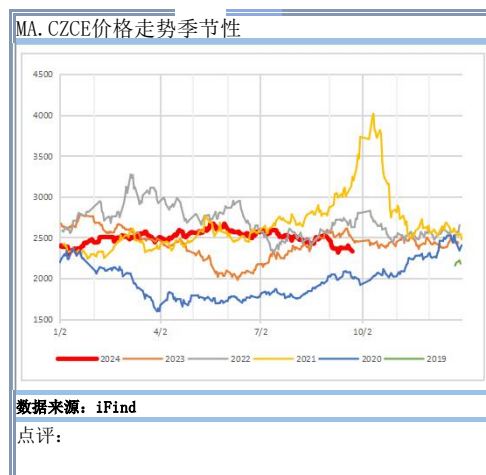




三、煤化工相关



数据起始日: 2019/9/23  
数据截止日: 2024/9/23  
期内最小值: 1982  
期内最大值: 4015  
期内平均值: 2572.0096  
当前分位值: 17.17%



数据起始日：2019/9/23

数据截止日：2024/9/23

期内最小值：6865

期内最大值：10224

期内平均值：7869.3717

当前分位值：10.72%

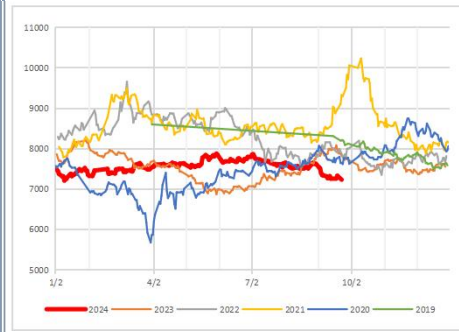
PP. DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

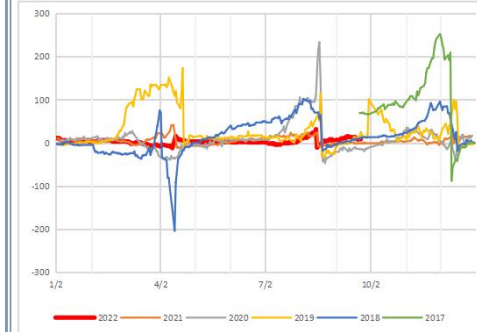
PP. DCE价格走势季节性



数据来源：iFind

点评：

PP. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源：iFind

点评：

数据起始日：2019/9/23

数据截止日：2024/9/23

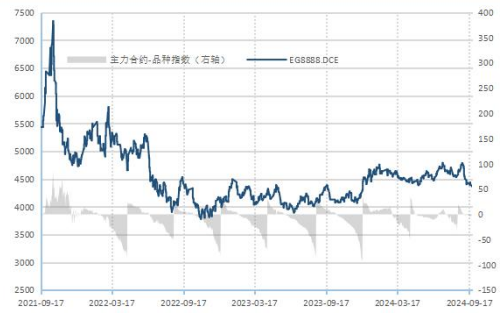
期内最小值：3778

期内最大值：7345

期内平均值：4536.8134

当前分位值：16.51%

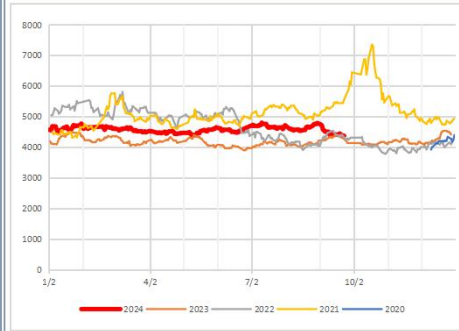
EG. CZCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

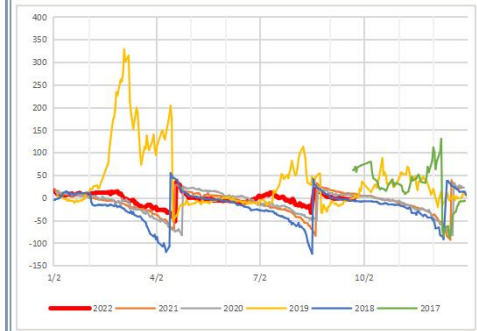
EG. CZCE价格走势季节性



数据来源：iFind

点评：

EG. CZCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源：iFind

点评：

数据起始日: 2020/10/12

数据截止日: 2024/9/23

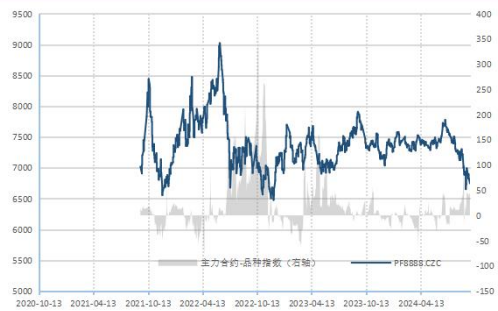
期内最小值: 6652

期内最大值: 7907

期内平均值: 7346.6912

当前分位值: 7.57%

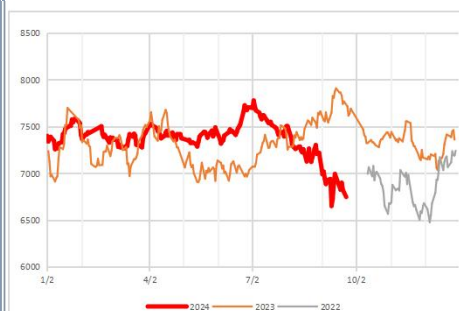
PF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

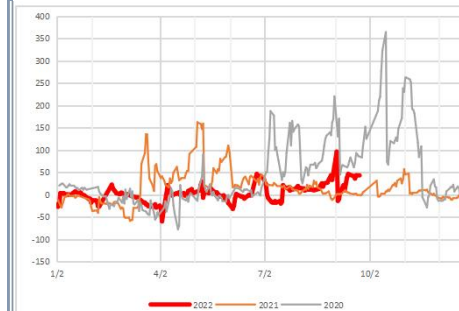
PF. CZCE价格走势季节性



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: 2019/9/23

数据截止日: 2024/9/23

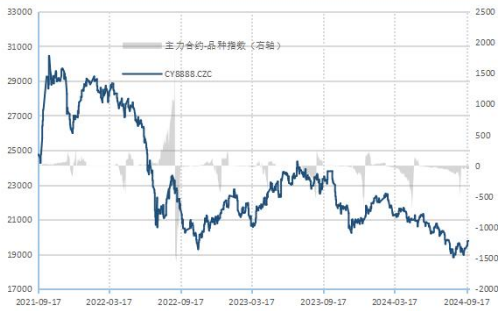
期内最小值: 18830

期内最大值: 30443

期内平均值: 23178.4129

当前分位值: 8.09%

CY. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

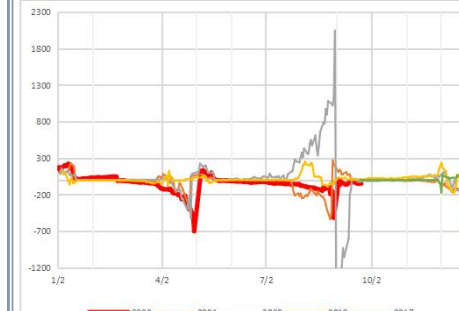
CY. CZCE价格走势季节性



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: 2019/9/23

数据截止日: 2024/9/23

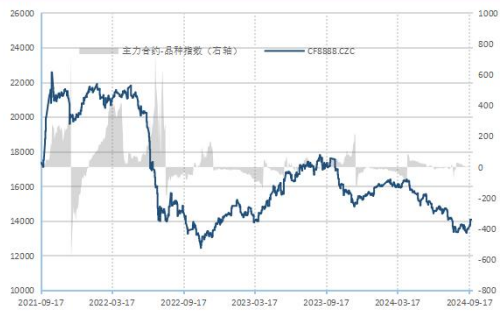
期内最小值: 12447

期内最大值: 22574

期内平均值: 16605.4362

当前分位值: 15.75%

CF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

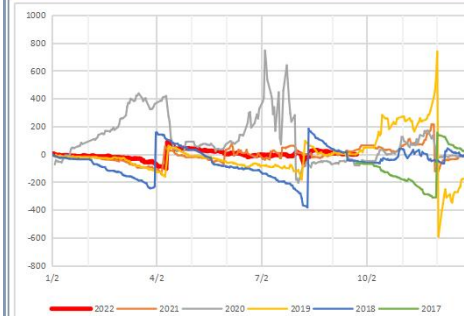
CF. CZCE价格走势季节性



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: 2019/9/23

数据截止日: 2024/9/23

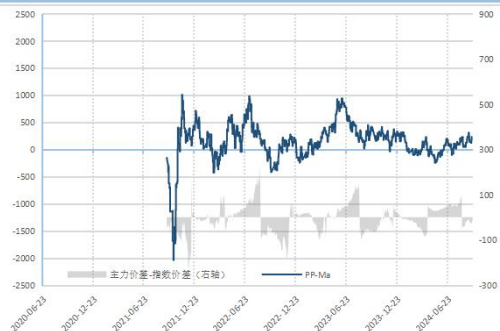
期内最小值: -2039.0000

期内最大值: 1007.0000

期内平均值: 153.3429

当前分位值: 74.56%

PP-Ma



数据来源: iFind

点评:

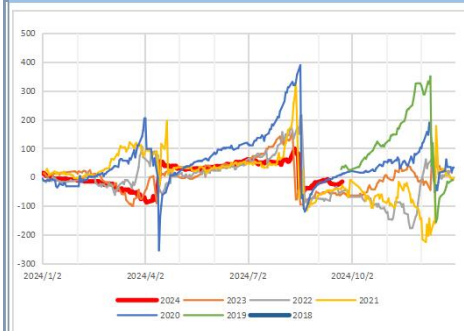
PP-Ma季节性



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：2019/9/23

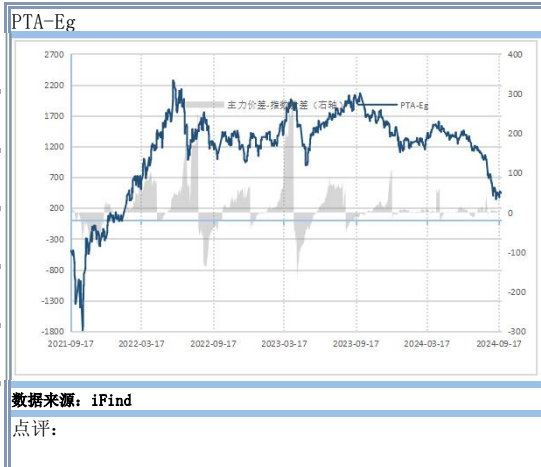
数据截止日：2024/9/23

期内最小值：-1783.0000

期内最大值：2269.0000

期内平均值：1162.1893

当前分位值：54.94%



数据起始日：2022/1/18

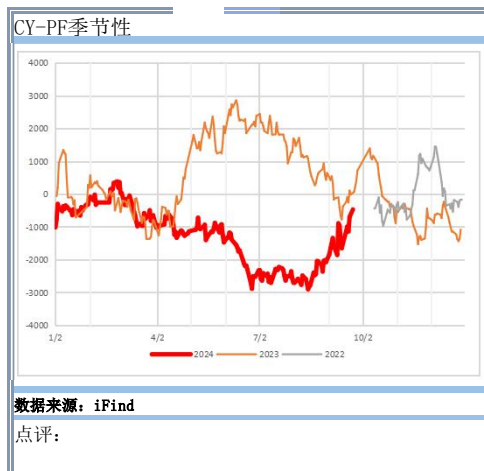
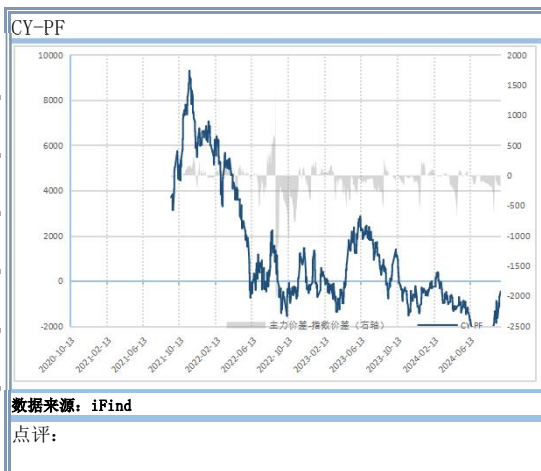
数据截止日：2024/9/23

期内最小值：-2902.0000

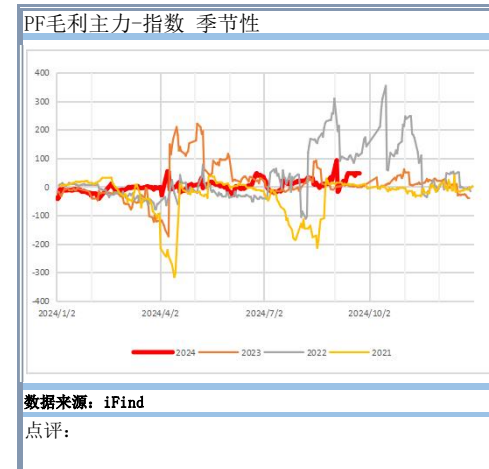
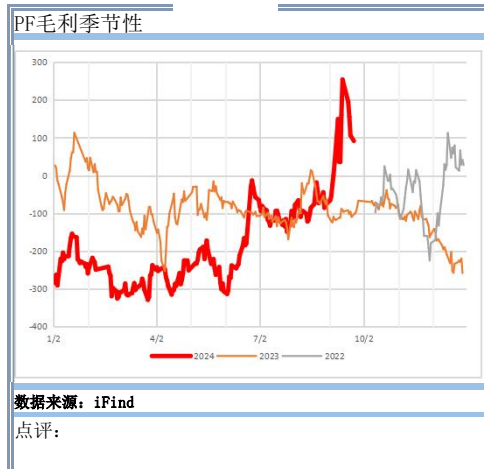
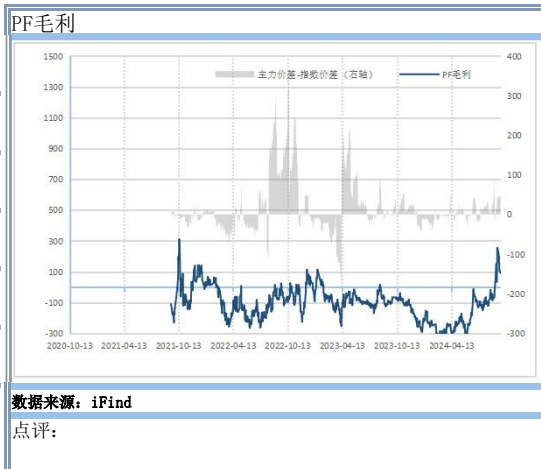
期内最大值：2854.0000

期内平均值：-344.6431

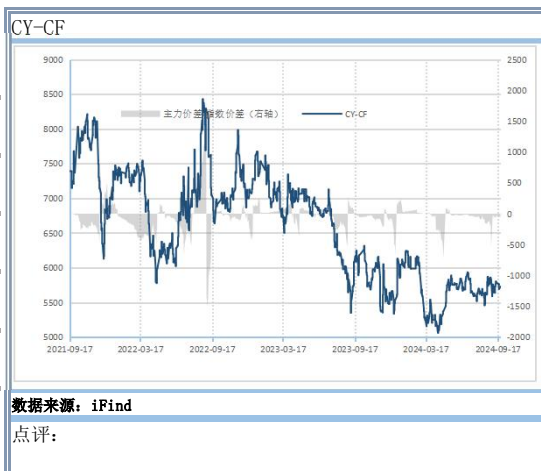
当前分位值：42.23%



数据起始日: 2023/4/12  
 数据截止日: 2024/9/23  
 期内最小值: -328.9900  
 期内最大值: 253.8400  
 期内平均值: -140.8679  
 当前分位值: 72.15%

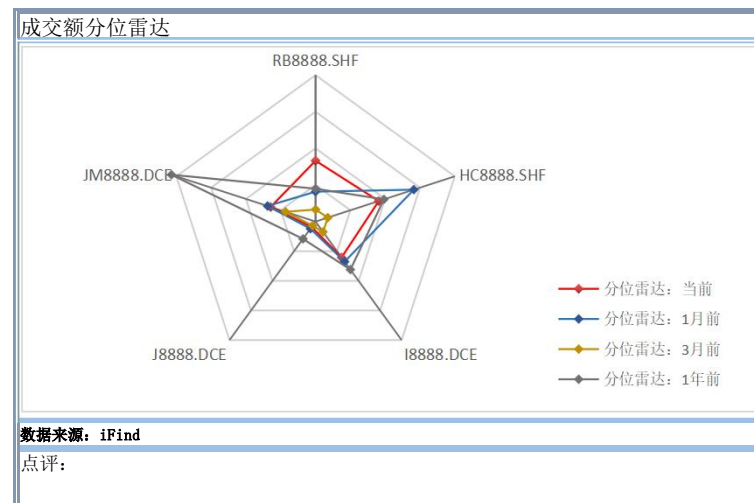
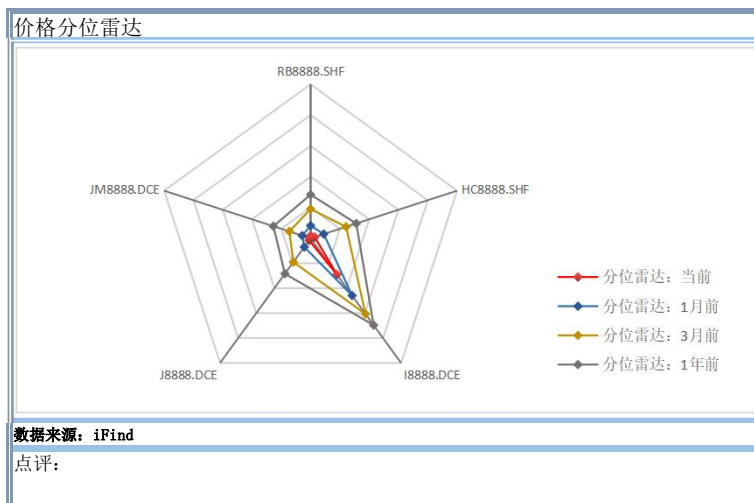


数据起始日: 2019/9/23  
 数据截止日: 2024/9/23  
 期内最小值: 5061.0000  
 期内最大值: 8428.0000  
 期内平均值: 6572.9767  
 当前分位值: 19.81%





四、黑色相关



数据起始日：2019/9/23

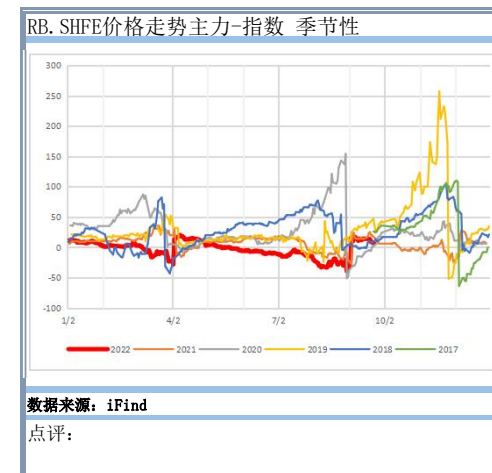
数据截止日：2024/9/23

期内最小值：3034

期内最大值：5762

期内平均值：3992.2250

当前分位值：1.72%



数据起始日: 2019/9/23

数据截止日: 2024/9/23

期内最小值: 3093

期内最大值: 5793

期内平均值: 4113.5940

当前分位值: 2.78%

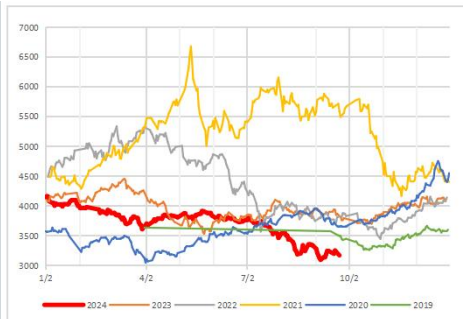
HC. SHFE价格走势



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: 2019/9/23

数据截止日: 2024/9/23

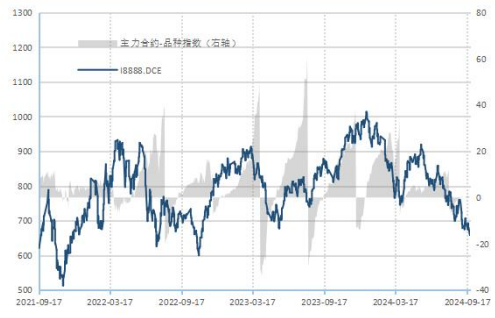
期内最小值: 512.8

期内最大值: 1013.6

期内平均值: 792.4811

当前分位值: 29.03%

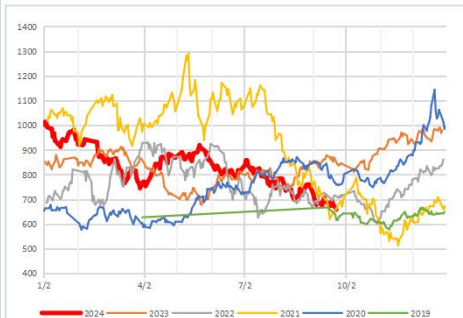
I. DCE价格走势



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：2019/9/23

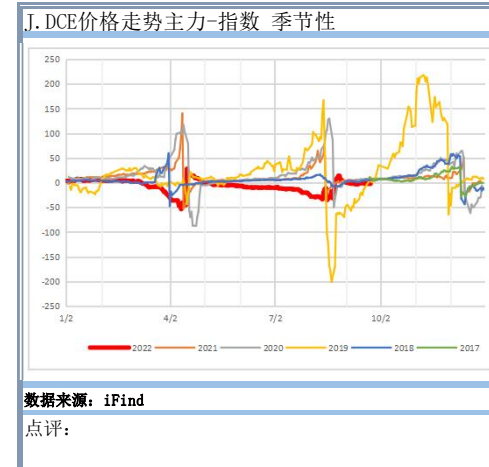
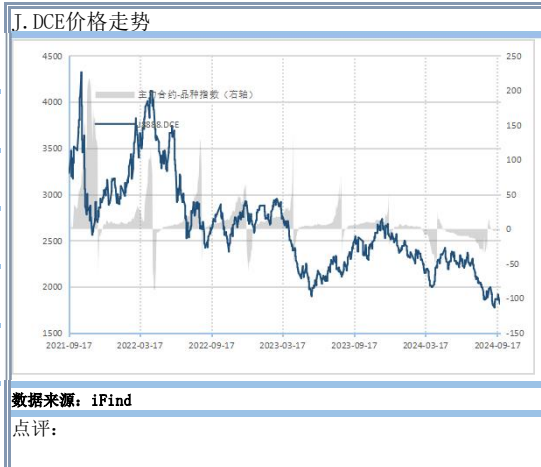
数据截止日：2024/9/23

期内最小值：1775.4

期内最大值：4320.8

期内平均值：2648.1344

当前分位值：1.57%



数据起始日：2019/9/23

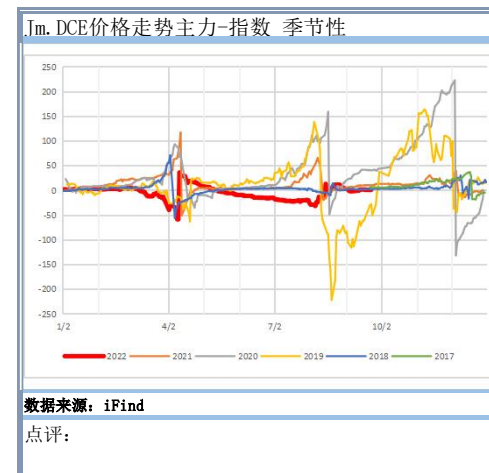
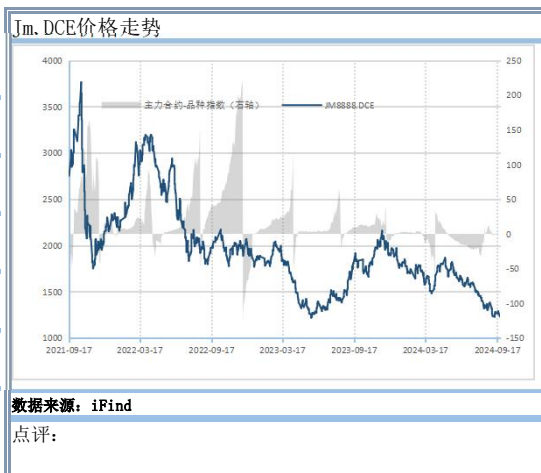
数据截止日：2024/9/23

期内最小值：1219.4

期内最大值：3764.7

期内平均值：1945.8450

当前分位值：0.46%



数据起始日: 2019/9/23

数据截止日: 2024/9/23

期内最小值: 670.1176

期内最大值: 2444.4706

期内平均值: 1036.0028

当前分位值: 10.23%

螺铁差



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/9/23

数据截止日: 2024/9/23

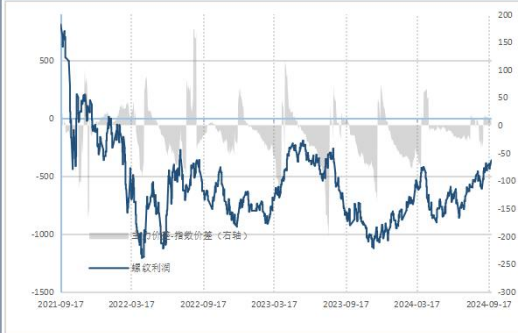
期内最小值: -1206.9091

期内最大值: 810.0000

期内平均值: -576.4820

当前分位值: 41.77%

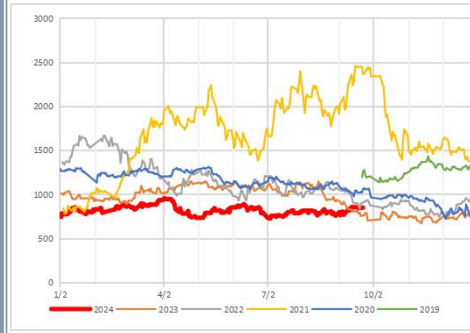
螺纹利润



数据来源: iFind

点评:

螺铁差季节性



数据来源: iFind

点评:

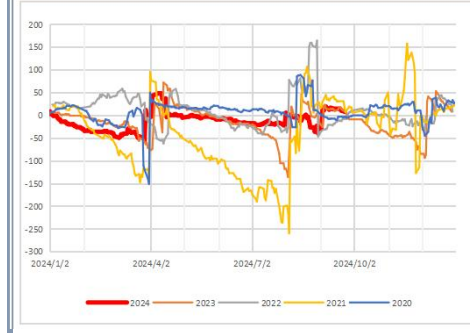
螺纹利润季节性



数据来源: iFind

点评:

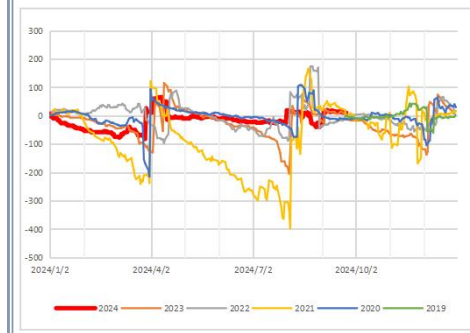
螺铁差主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

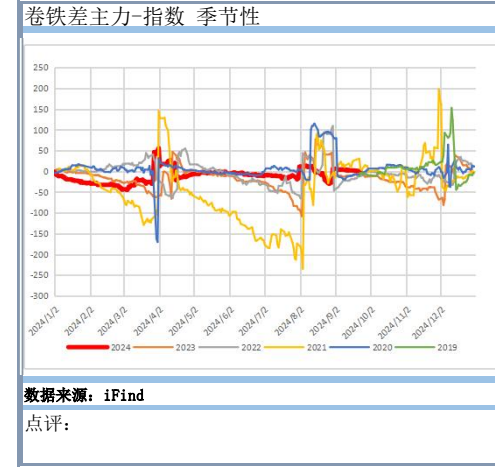
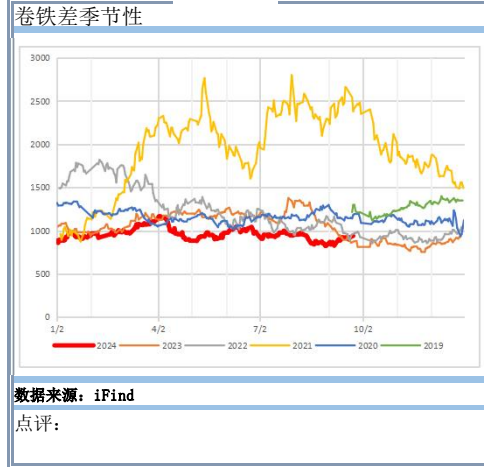
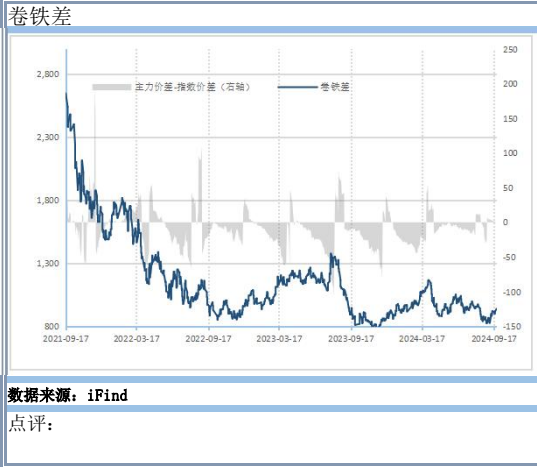
螺纹利润主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/9/23  
 数据截止日: 2024/9/23  
 期内最小值: 752.4706  
 期内最大值: 2648.4706  
 期内平均值: 1157.3718  
 当前分位值: 9.82%



数据起始日: 2019/9/23  
 数据截止日: 2024/9/23  
 期内最小值: -1073.7273  
 期内最大值: 1014.0000  
 期内平均值: -455.1130  
 当前分位值: 38.15%





数据起始日: 2019/9/23

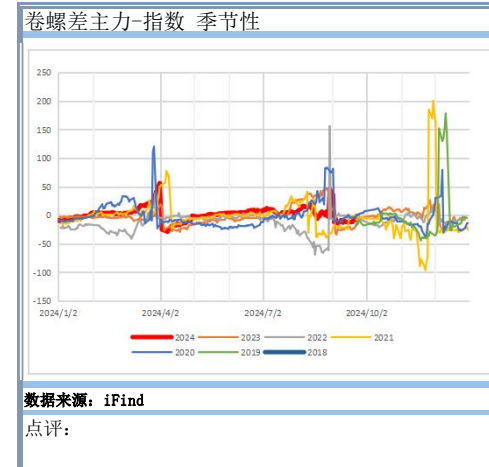
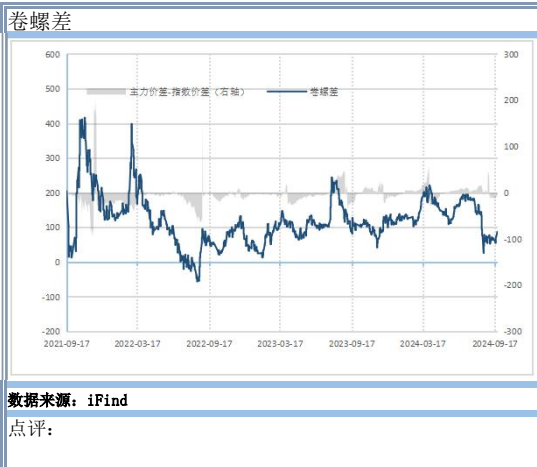
数据截止日: 2024/9/23

期内最小值: -56.0000

期内最大值: 416.0000

期内平均值: 121.3690

当前分位数: 30.30%



数据起始日: 2019/9/23

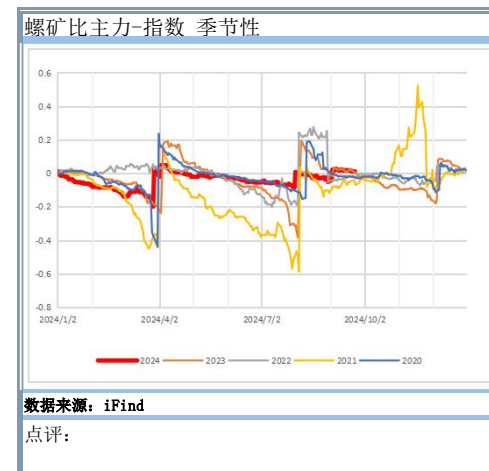
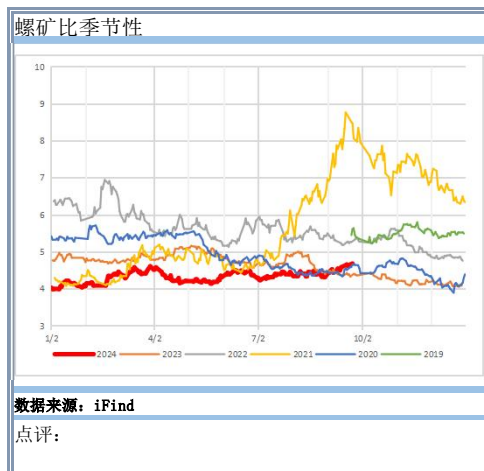
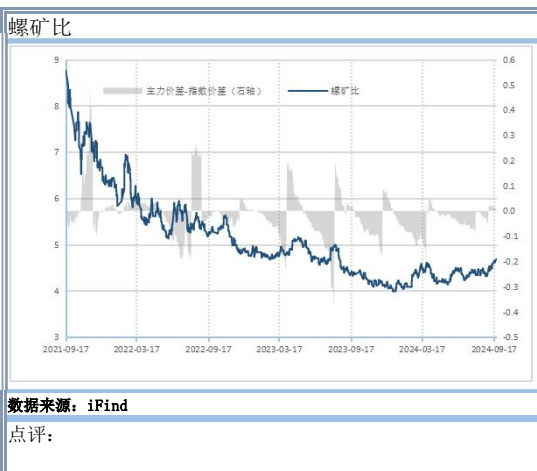
数据截止日: 2024/9/23

期内最小值: 3.9880

期内最大值: 8.7631

期内平均值: 5.1134

当前分位数: 14.51%





数据起始日： 2019/9/23

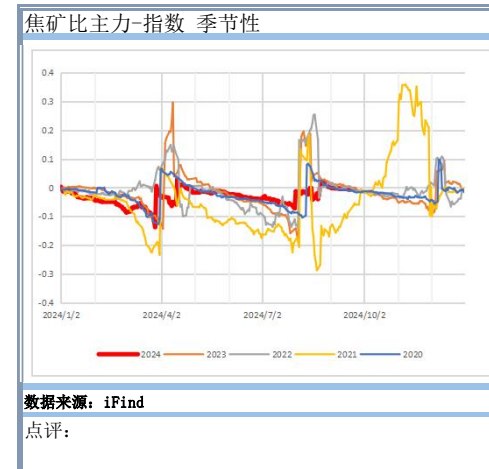
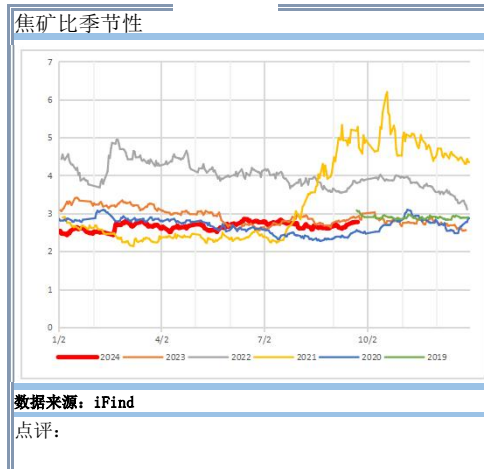
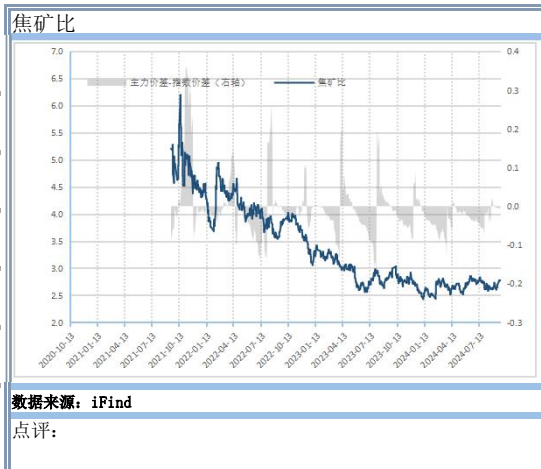
数据截止日： 2024/9/23

期内最小值： 2.4279

期内最大值： 6.1947

期内平均值： 3.3929

当前分位值： 8.76%



数据起始日： 2019/9/23

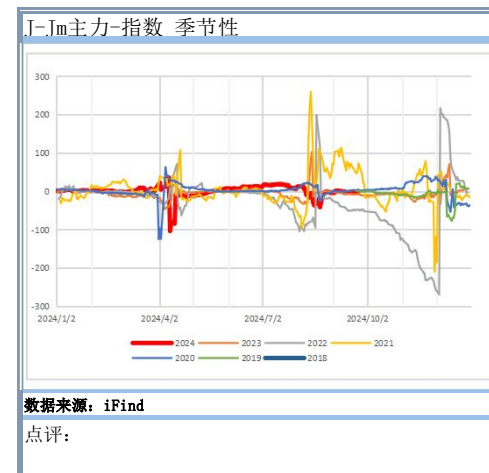
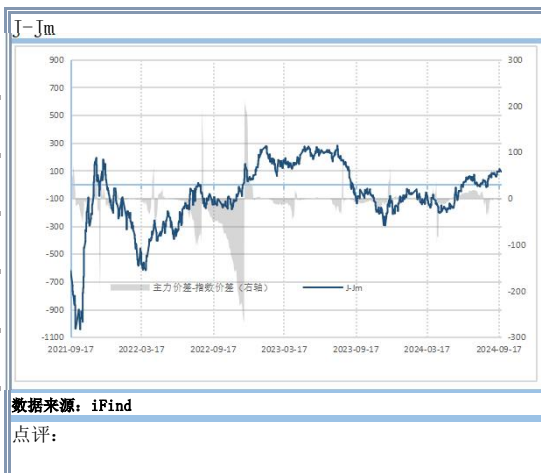
数据截止日： 2024/9/23

期内最小值： -1043.0800

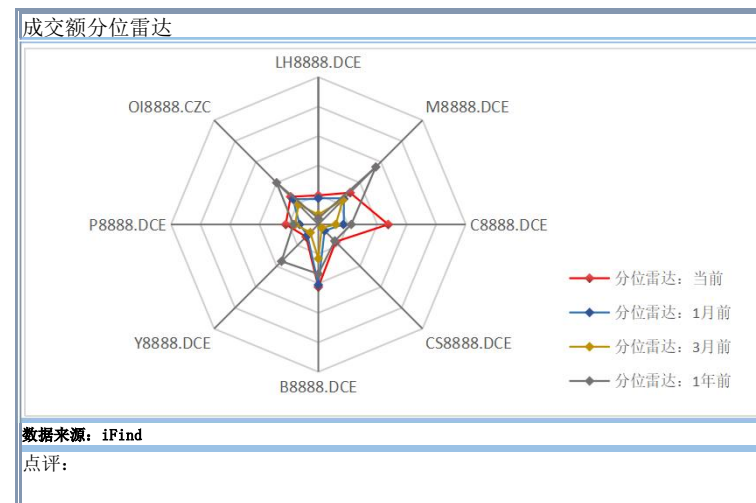
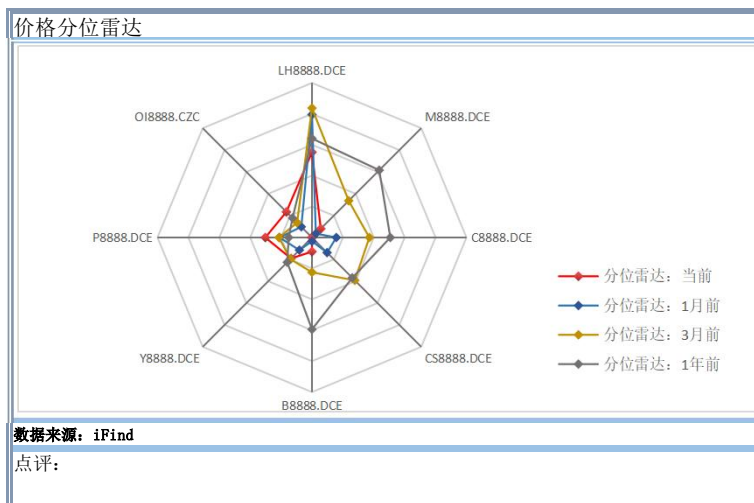
期内最大值： 279.1600

期内平均值： -76.0486

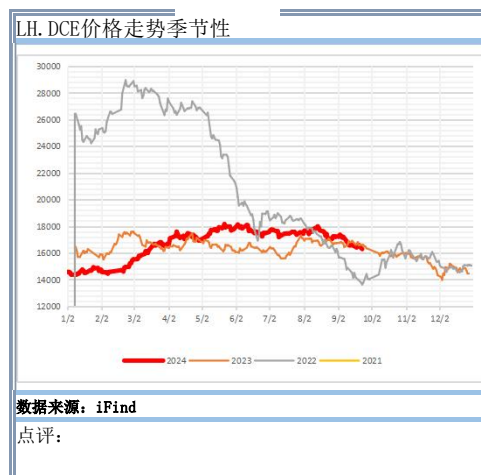
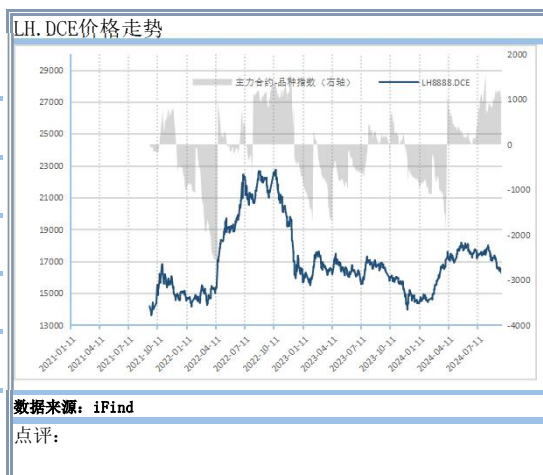
当前分位值： 85.83%



五、农产品相关



数据起始日: 2021/1/8  
数据截止日: 2024/9/23  
期内最小值: 13971  
期内最大值: 18158  
期内平均值: 16423.6000  
当前分位值: 55.17%



数据起始日: 2019/9/23

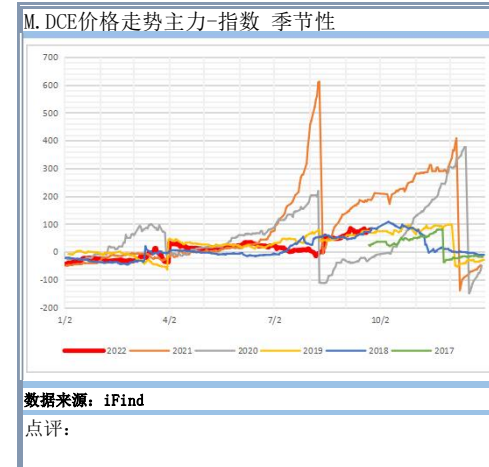
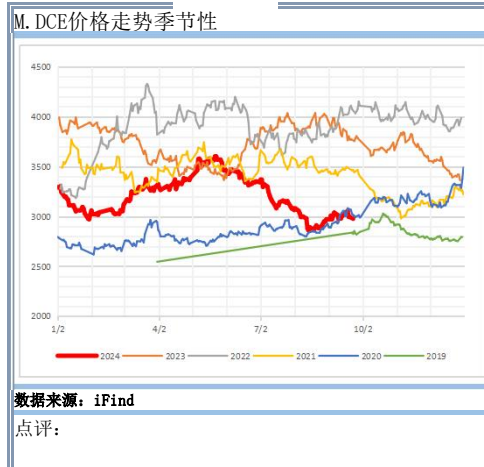
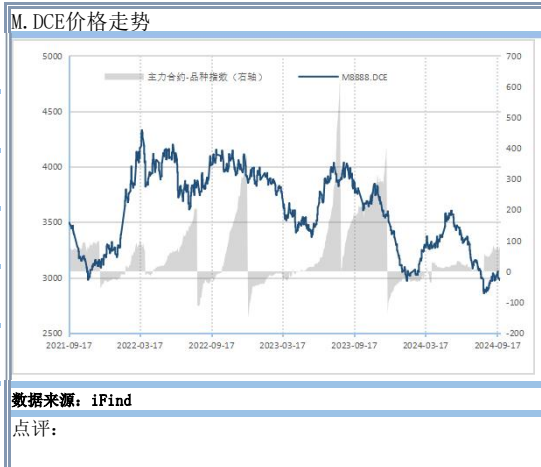
数据截止日: 2024/9/23

期内最小值: 2858

期内最大值: 4328

期内平均值: 3604.7901

当前分位值: 8.03%



数据起始日: 2019/9/23

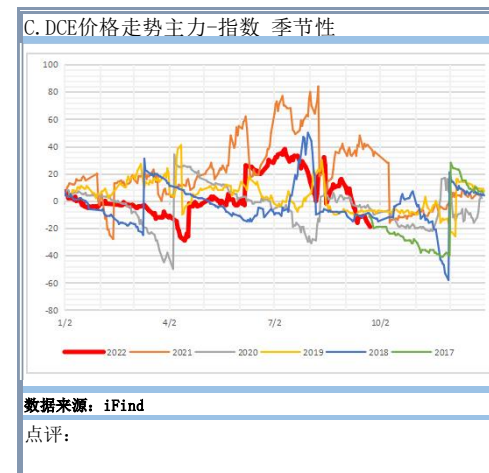
数据截止日: 2024/9/23

期内最小值: 2157

期内最大值: 3027

期内平均值: 2645.5213

当前分位值: 0.00%



数据起始日：2019/9/23

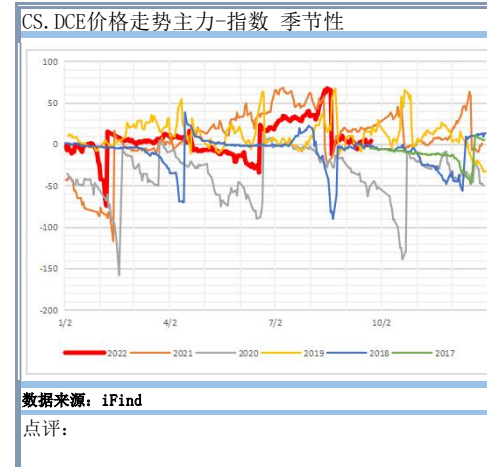
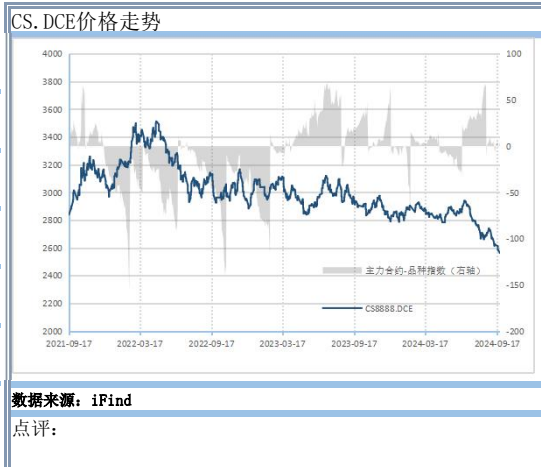
数据截止日：2024/9/23

期内最小值：2563

期内最大值：3512

期内平均值：3006.6420

当前分位值：0.00%



数据起始日：2019/9/23

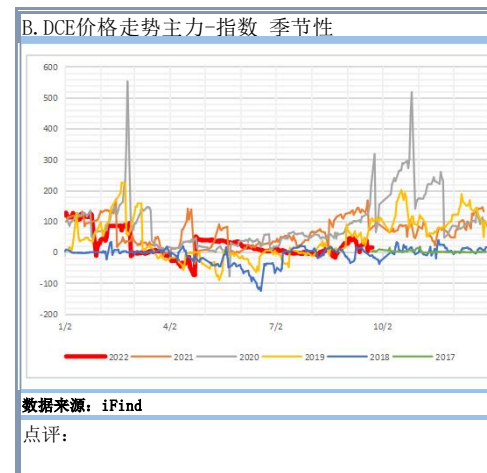
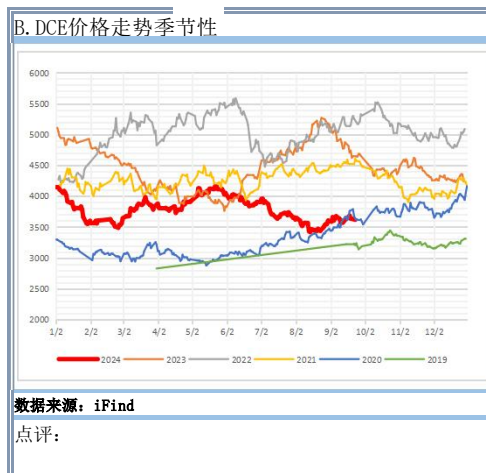
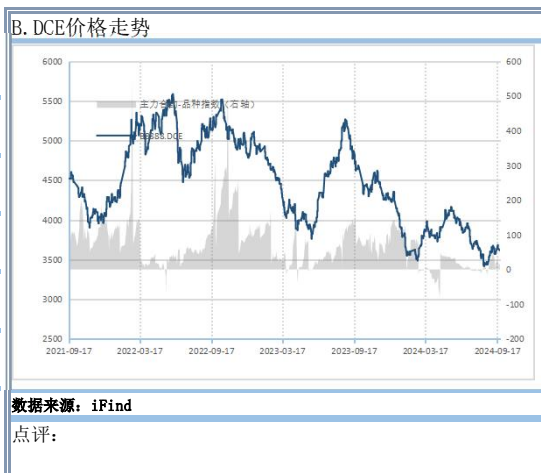
数据截止日：2024/9/23

期内最小值：3417

期内最大值：5585

期内平均值：4456.9369

当前分位值：9.13%



数据起始日： 2019/9/23

数据截止日： 2024/9/23

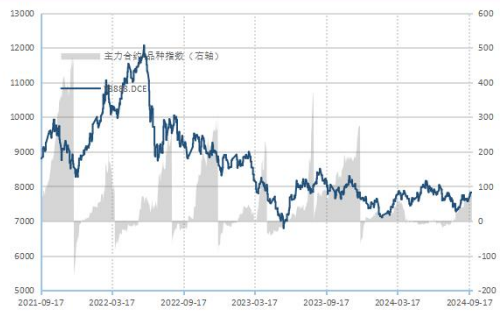
期内最小值： 6793

期内最大值： 12065

期内平均值： 8630.3292

当前分位值： 19.18%

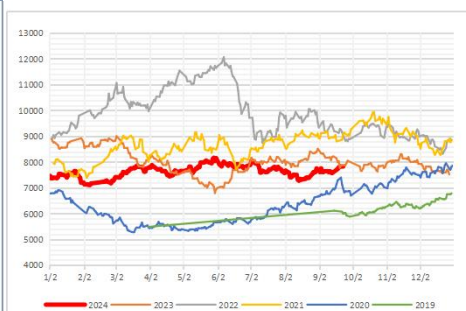
Y. DCE价格走势



数据来源： iFind

点评：

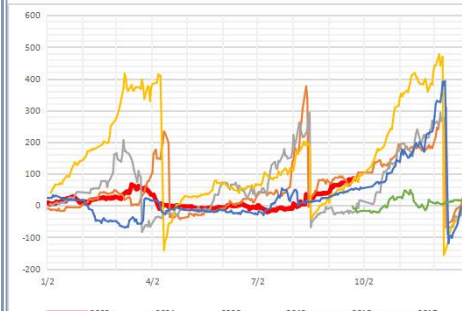
Y. DCE价格走势季节性



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： 2019/9/23

数据截止日： 2024/9/23

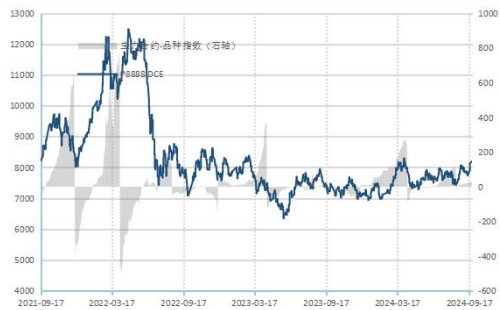
期内最小值： 6349

期内最大值： 12479

期内平均值： 8273.5898

当前分位值： 30.20%

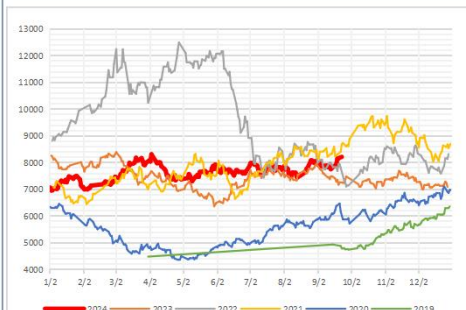
P. DCE价格走势



数据来源： iFind

点评：

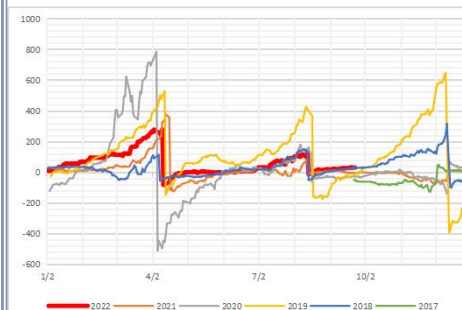
P. DCE价格走势季节性



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： 2019/9/23

数据截止日： 2024/9/23

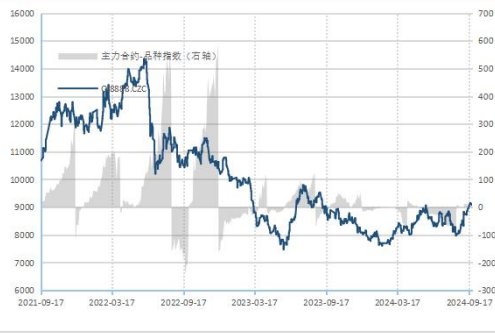
期内最小值： 7475

期内最大值： 14344

期内平均值： 10042.6735

当前分位值： 23.42%

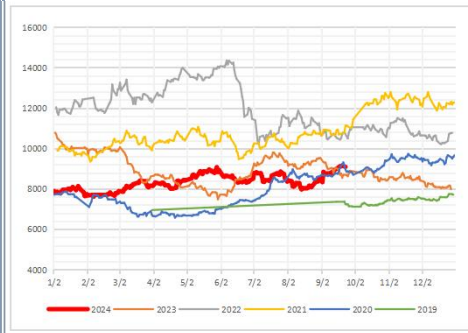
OI.CZCE价格走势



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： 2022/3/22

数据截止日： 2024/9/23

期内最小值： 7508.2500

期内最大值： 12199.0000

期内平均值： 10030.9414

当前分位值： 67.70%

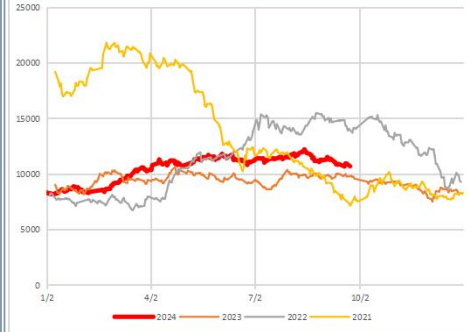
盲肥收益



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: 2024/9/23

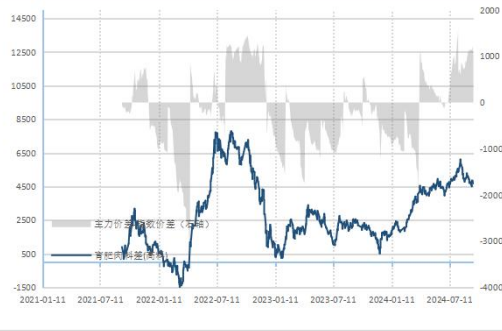
期内最小值: 515.0000

期内最大值: 6111.0000

期内平均值: 3156.5862

当前分位值: 74.37%

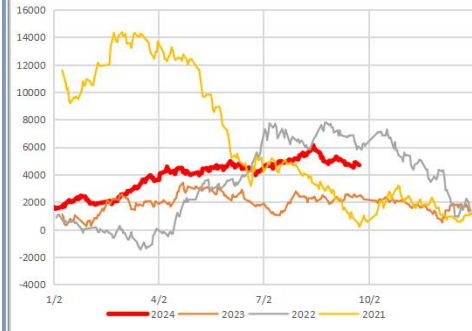
育肥肉料差(高料)



数据来源: iFind

点评:

育肥肉料差(高料)季节性



数据来源: iFind

点评:

育肥肉料差(高料)主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/9/23

数据截止日: 2024/9/23

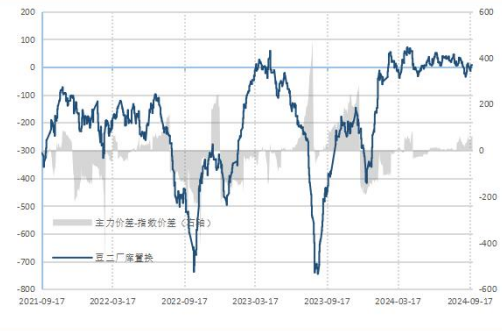
期内最小值: -745.0200

期内最大值: 71.2200

期内平均值: -190.5657

当前分位值: 91.87%

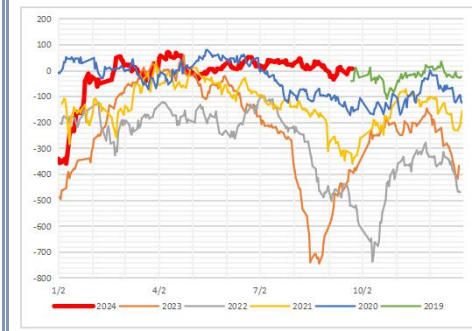
豆二厂库置换



数据来源: iFind

点评:

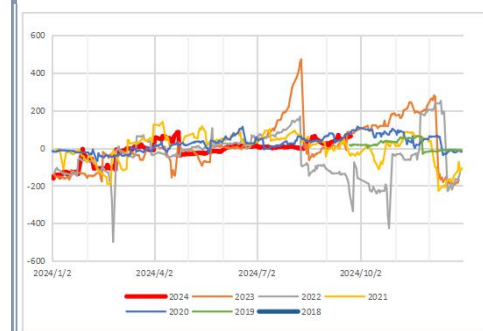
豆二厂库置换季节性



数据来源: iFind

点评:

豆二厂库置换主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/9/23

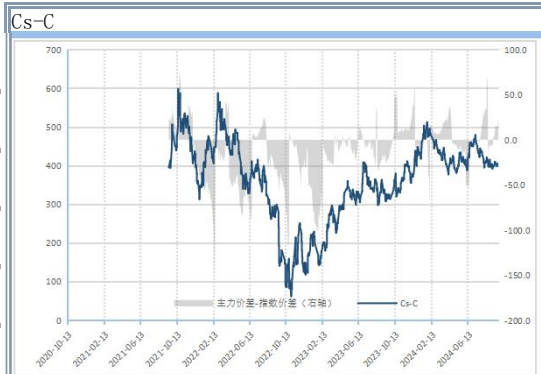
数据截止日: 2024/9/23

期内最小值: 62.0000

期内最大值: 598.0000

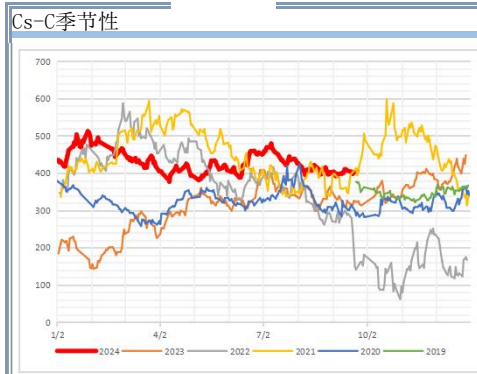
期内平均值: 361.1207

当前分位值: 64.18%



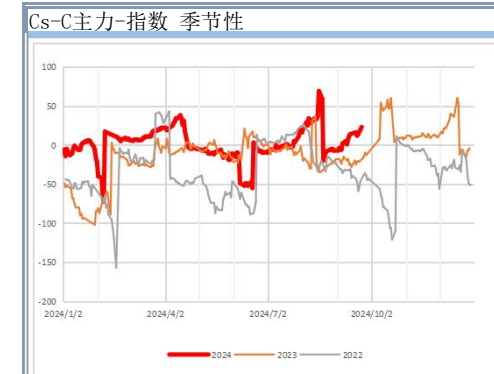
数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/9/23

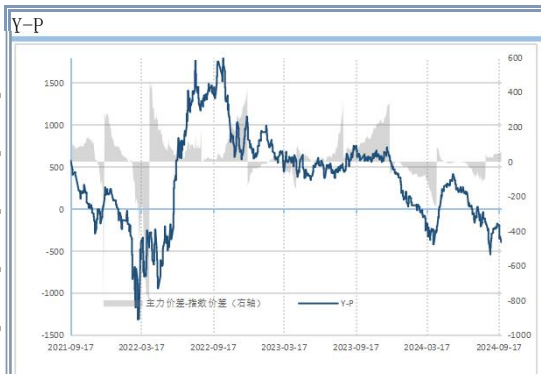
数据截止日: 2024/9/23

期内最小值: -1313.0000

期内最大值: 1788.0000

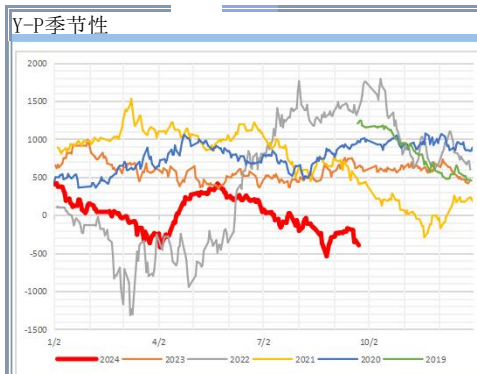
期内平均值: 356.7394

当前分位值: 29.57%



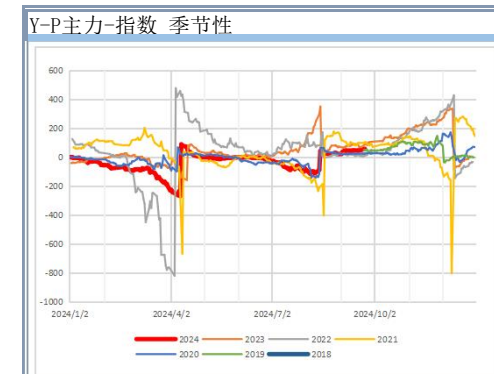
数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:

数据起始日： 2019/9/23

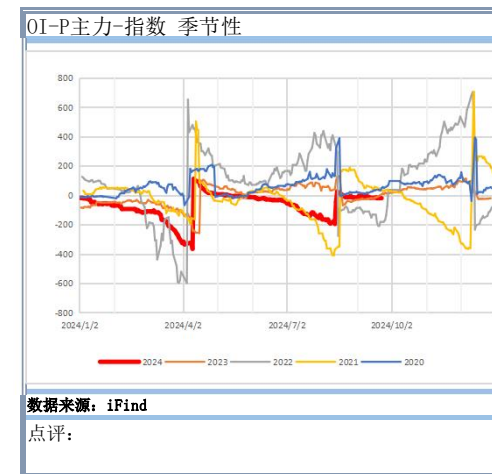
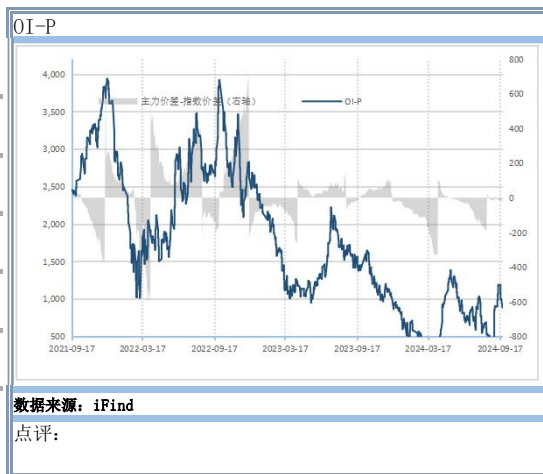
数据截止日： 2024/9/23

期内最小值： 19.0000

期内最大值： 2220.0000

期内平均值： 1033.6544

当前分位值： 39.30%



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。