

<http://www.shanlingh.com>

盘面套利观察

制作：强子益

2024年1月3日

投资咨询： Z0015283

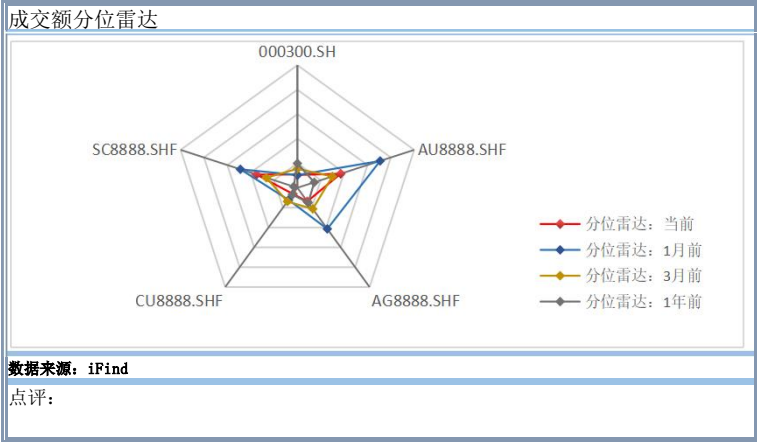
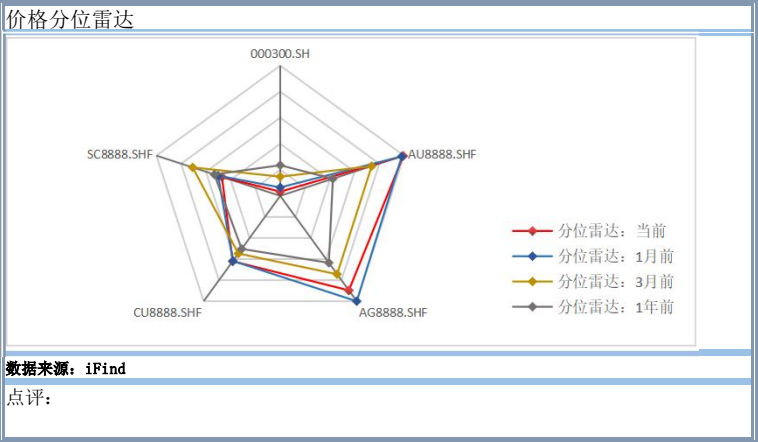
邮箱： qiangziyi@sd-gold.com

数据仅供参考，据此入市，风险自负。

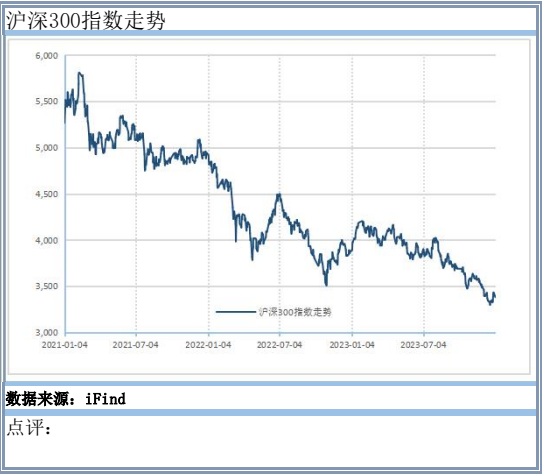
说明：

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

一、宏观观察



数据起始日: 2019/1/7
数据截止日: 2024/1/3
期内最小值: 3297.5022
期内最大值: 5807.7191
期内平均值: 4354.3523
当前分位值: 14.74%



数据起始日： 2019/1/7

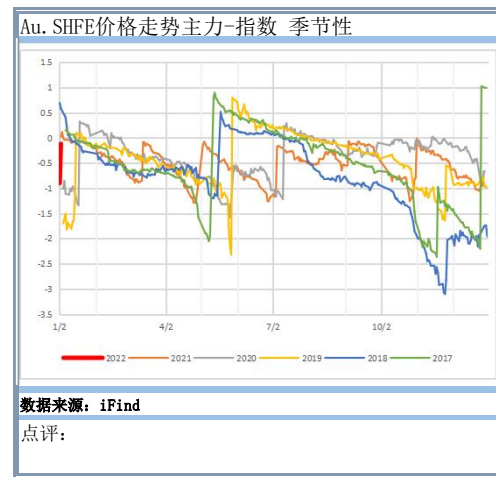
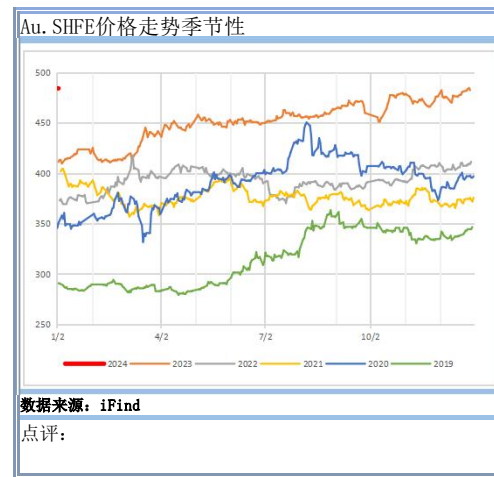
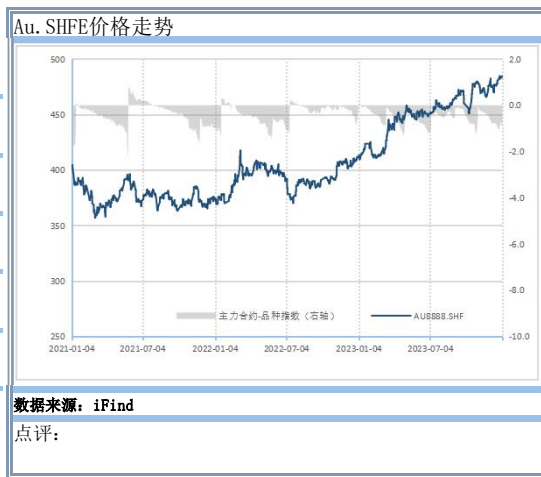
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 356.92

期内最大值： 484.56

期内平均值： 406.9351

当前分位值： 99.33%



数据起始日： 2019/1/7

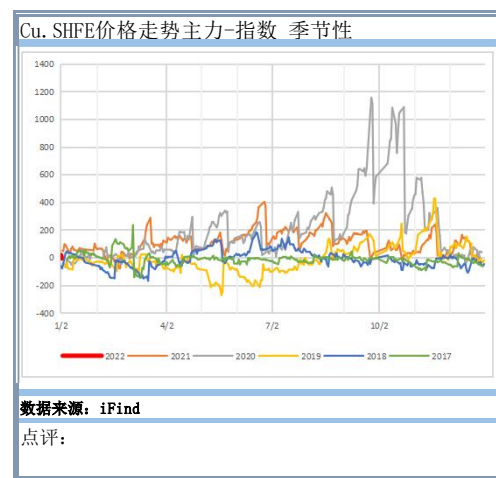
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 53367

期内最大值： 77934

期内平均值： 67687.2029

当前分位值： 62.08%



数据起始日: 2019/1/7

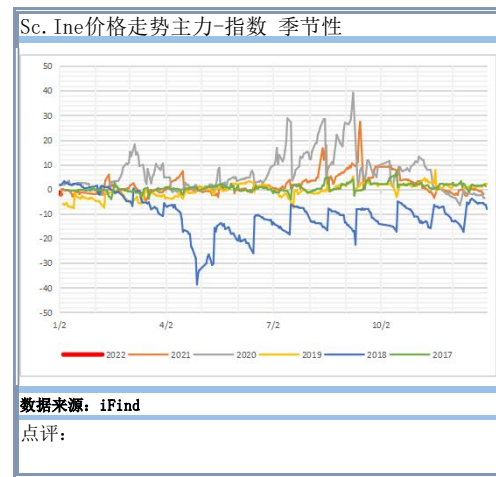
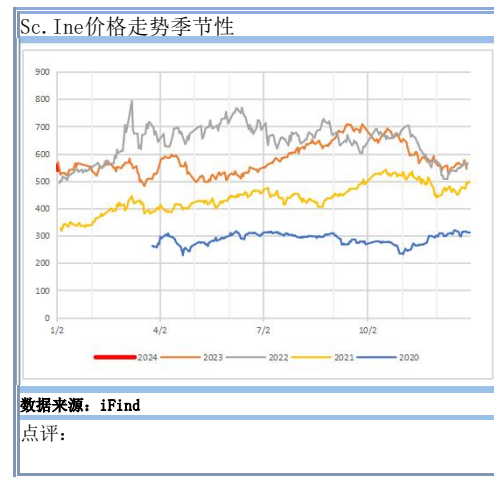
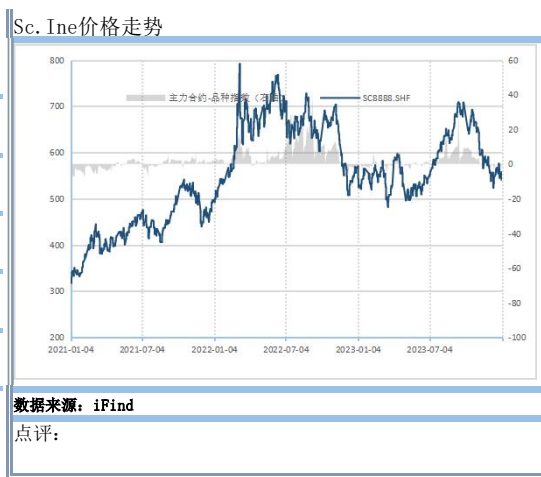
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: 317.5

期内最大值: 791.6

期内平均值: 552.9647

当前分位值: 47.08%



数据起始日: 2019/1/7

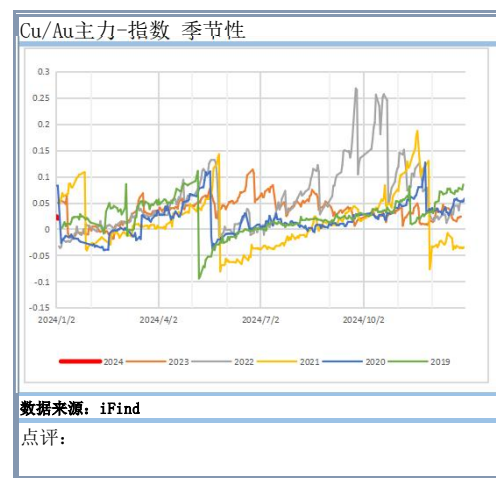
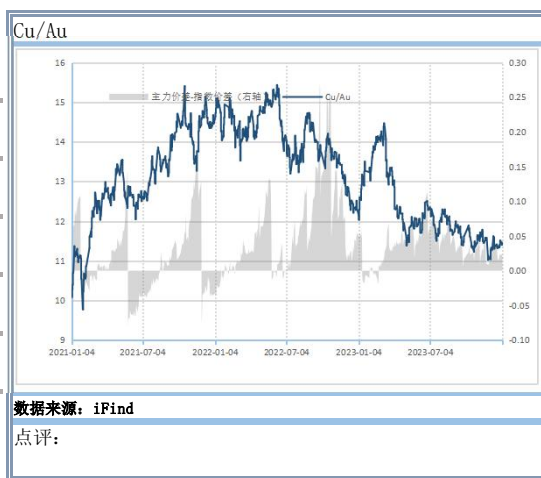
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: 9.7731

期内最大值: 15.4319

期内平均值: 13.1026

当前分位值: 29.83%



数据起始日： 2019/1/7

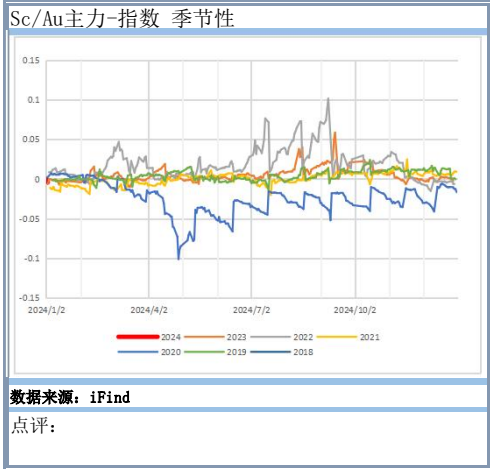
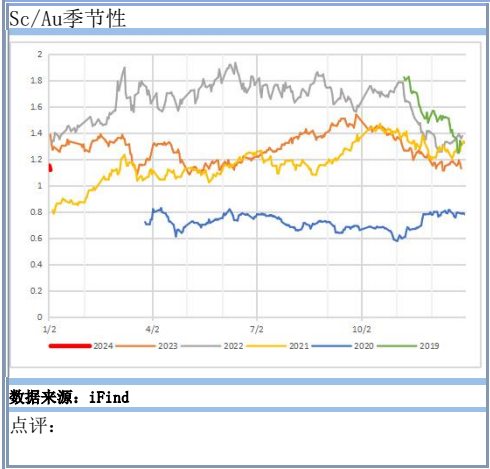
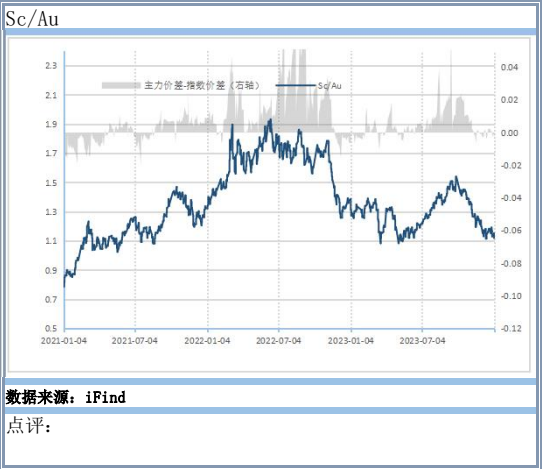
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 0.7860

期内最大值： 1.9320

期内平均值： 1.3605

当前分位值： 28.95%



数据起始日： 2019/1/7

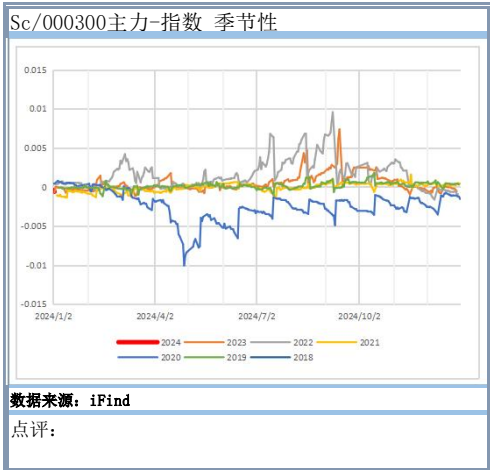
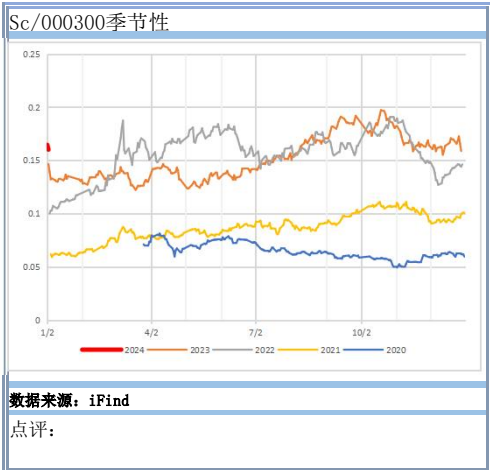
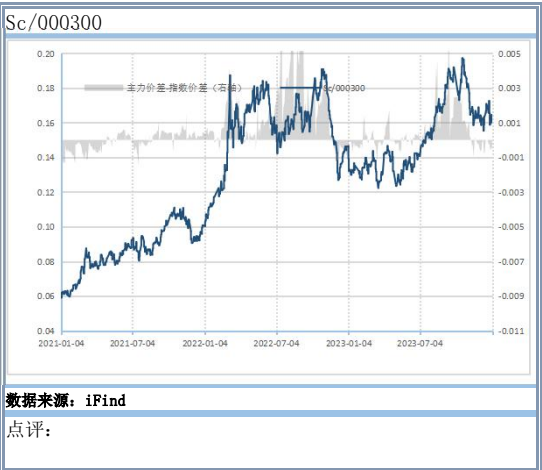
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 0.0591

期内最大值： 0.1972

期内平均值： 0.1315

当前分位值： 73.11%



数据起始日： 2019/1/7

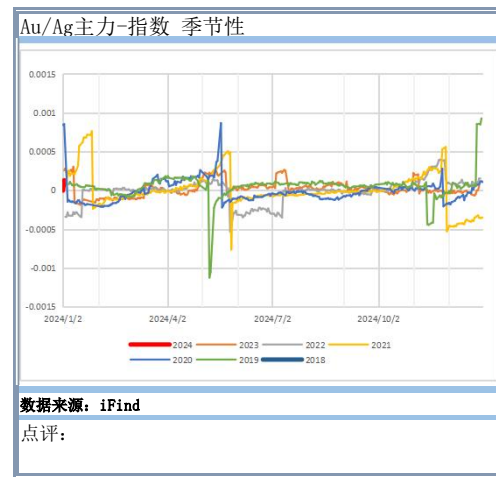
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 0.0648

期内最大值： 0.0932

期内平均值： 0.0785

当前分位值： 56.41%



数据起始日： 2019/1/7

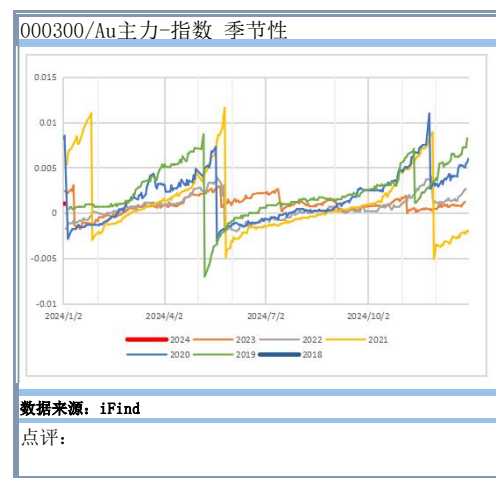
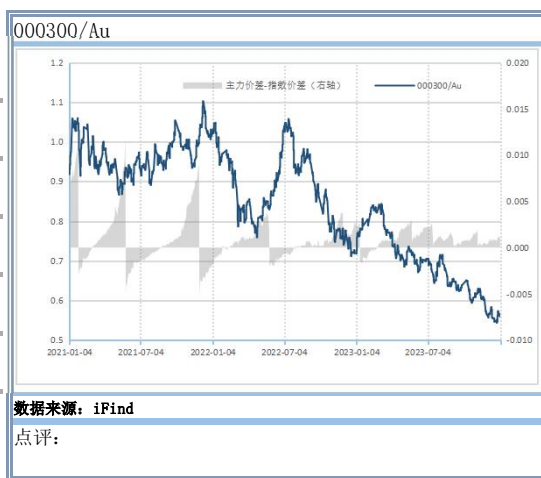
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 0.5437

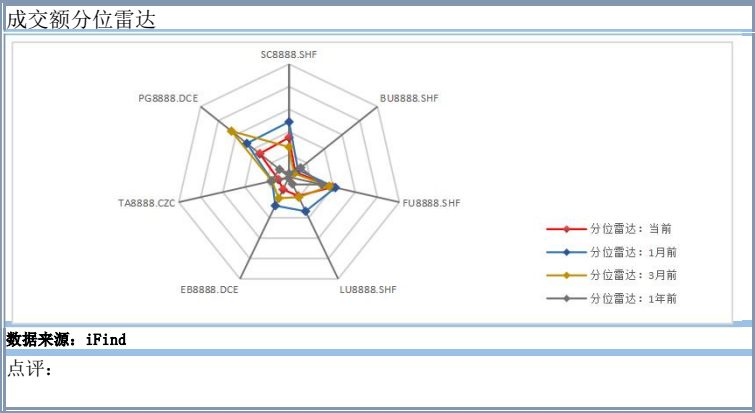
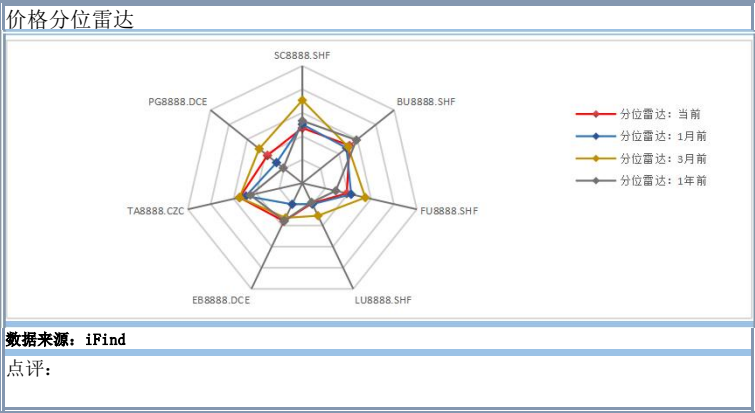
期内最大值： 1.1021

期内平均值： 0.8452

当前分位值： 3.68%



二、原油相关



数据起始日: 2019/1/7

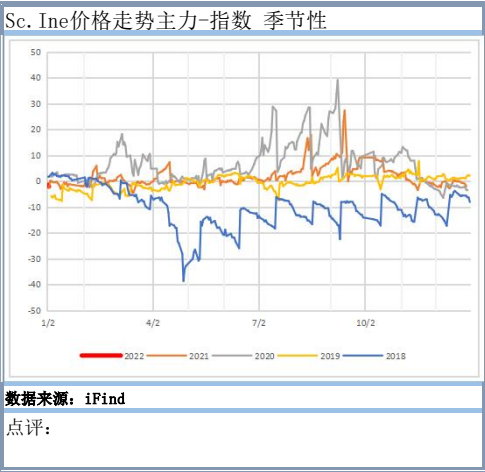
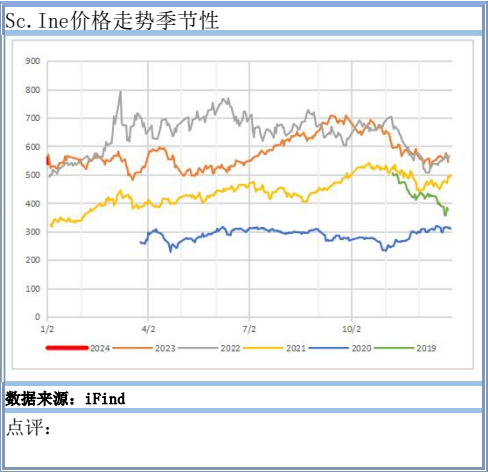
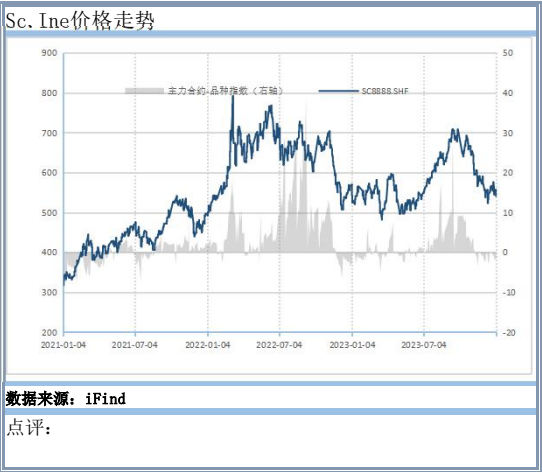
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: 317.5

期内最大值: 791.6

期内平均值: 552.9647

当前分位值: 47.08%



数据起始日: 2019/1/7

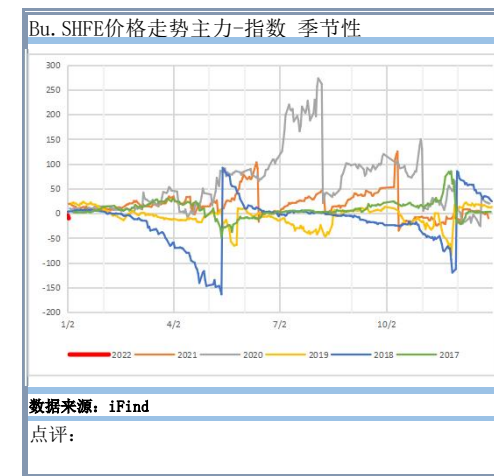
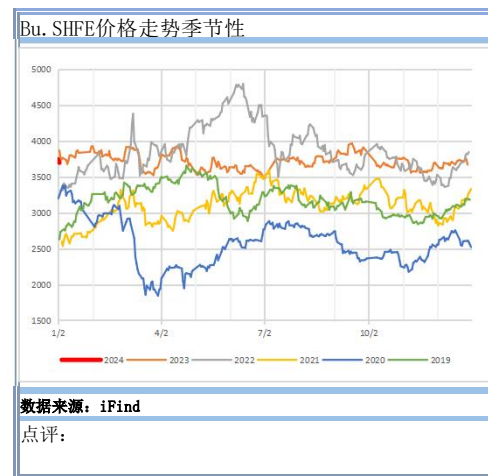
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: 2535

期内最大值: 4794

期内平均值: 3554.2263

当前分位值: 51.39%



数据起始日: 2019/1/7

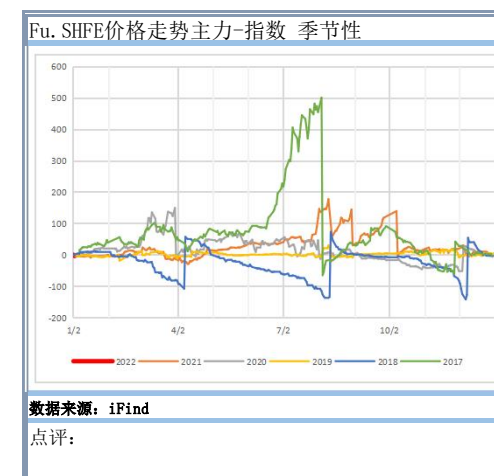
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: 2059

期内最大值: 4371

期内平均值: 2989.7077

当前分位值: 38.84%



数据起始日： 2020/6/22

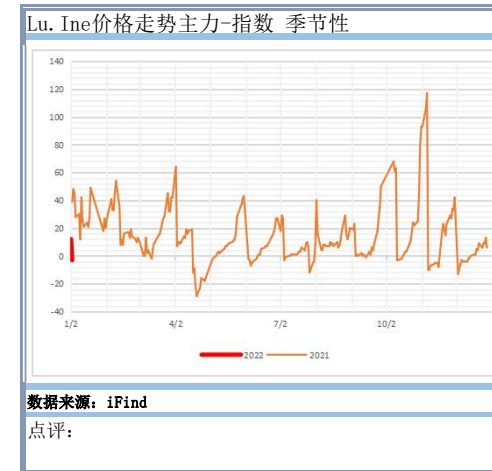
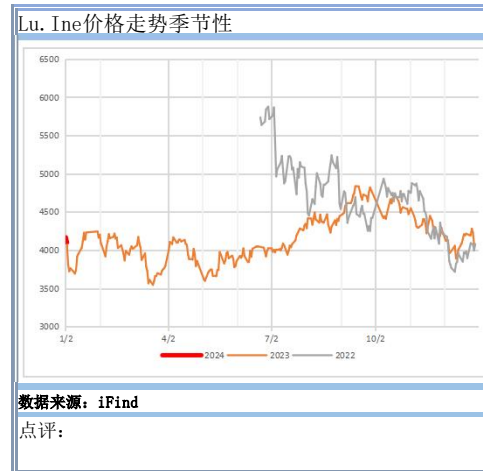
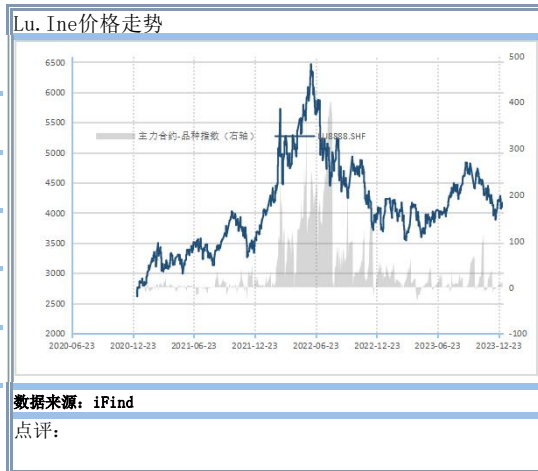
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 3544

期内最大值： 6464

期内平均值： 4477.3459

当前分位值： 18.97%



数据起始日： 2019/9/26

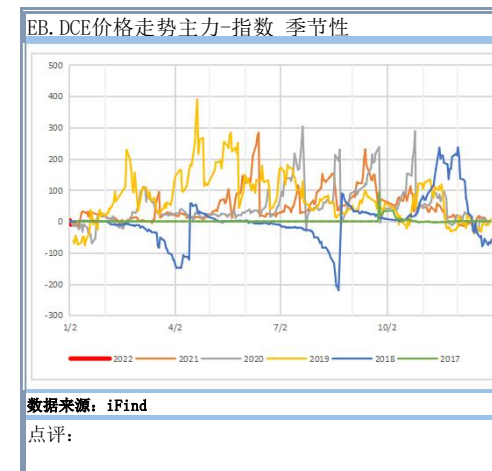
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 6978

期内最大值： 11361

期内平均值： 8650.7654

当前分位值： 35.93%



数据起始日： 2019/1/7

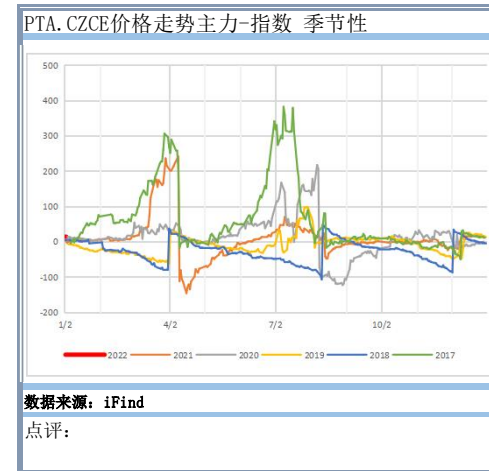
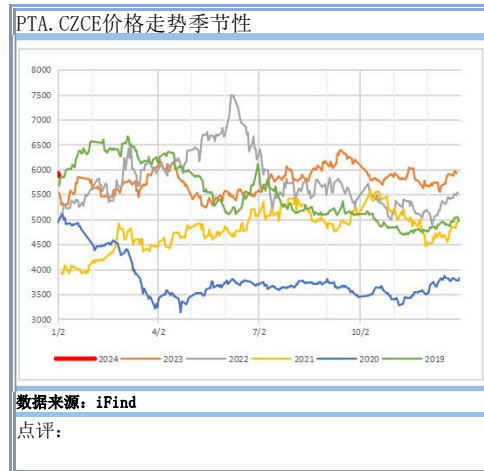
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 3898

期内最大值： 7488

期内平均值： 5446.9726

当前分位值： 54.79%



数据起始日： 2020/3/30

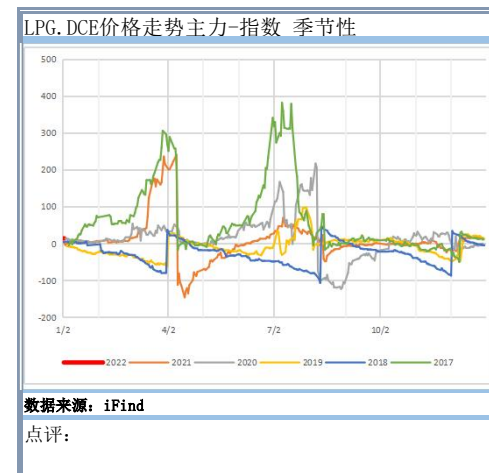
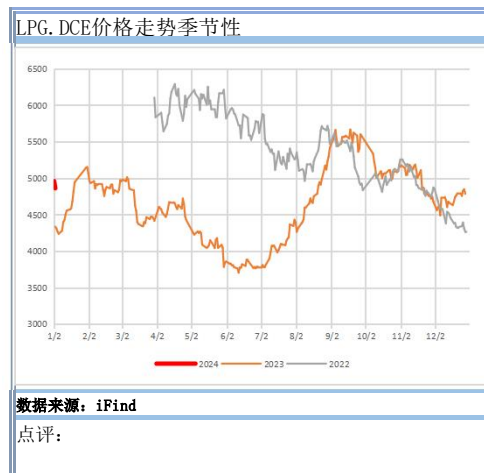
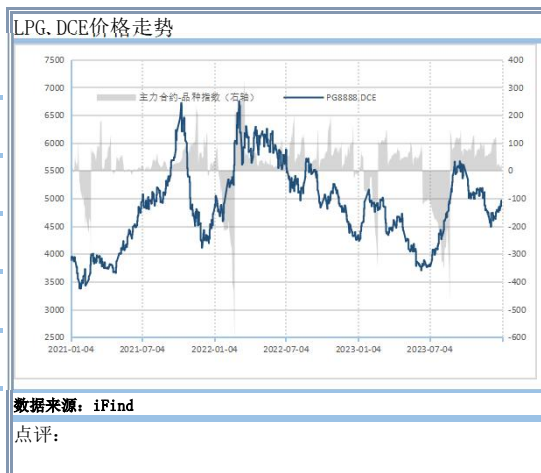
数据截止日： 2024/1/3

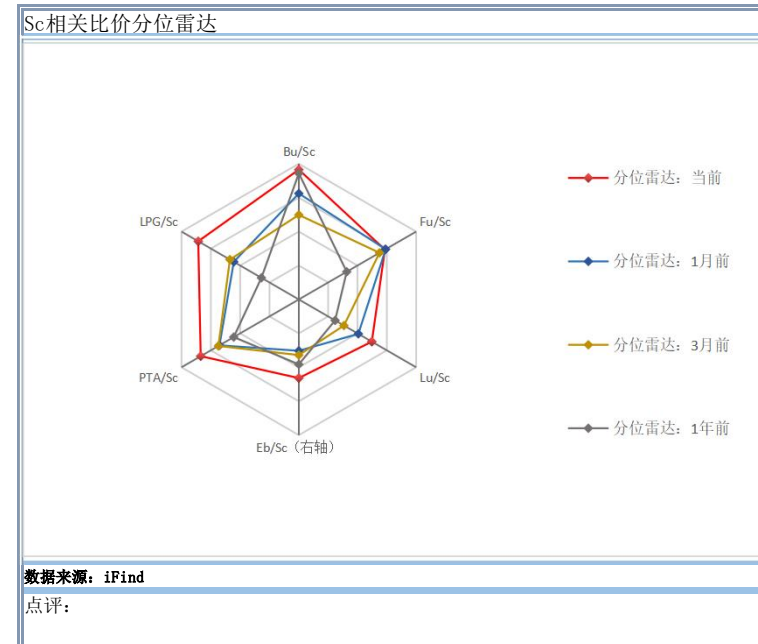
期内最小值： 3704

期内最大值： 6749

期内平均值： 5016.7863

当前分位值： 38.00%





数据起始日: 2019/1/7

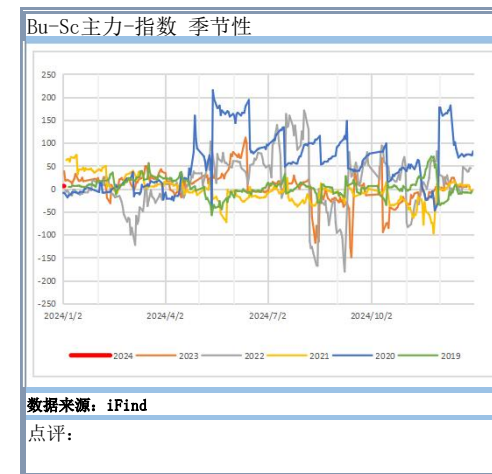
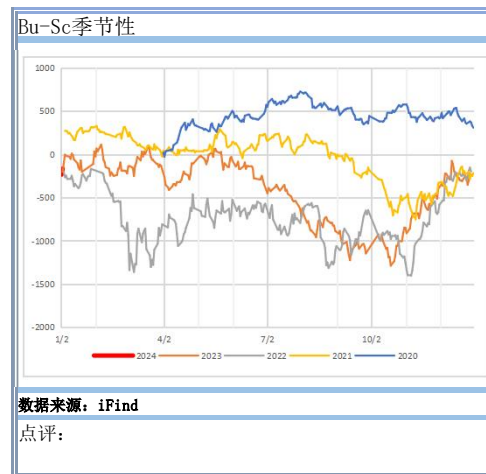
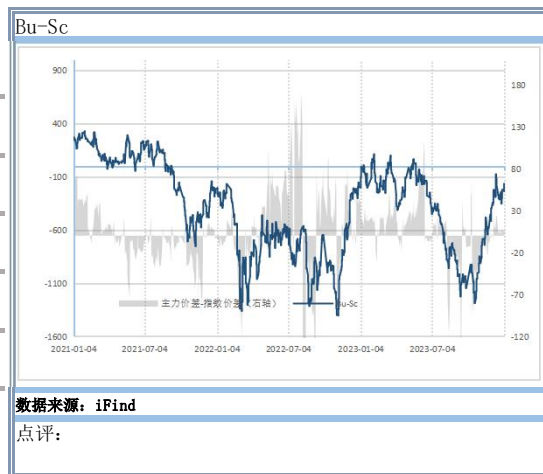
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: -1406.4286

期内最大值: 326.5714

期内平均值: -395.5218

当前分位值: 71.57%



数据起始日: 2019/1/7

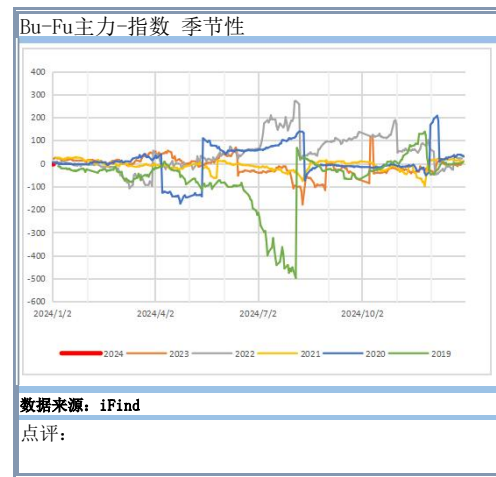
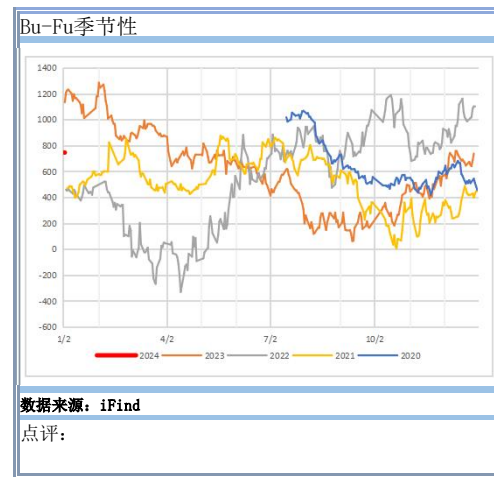
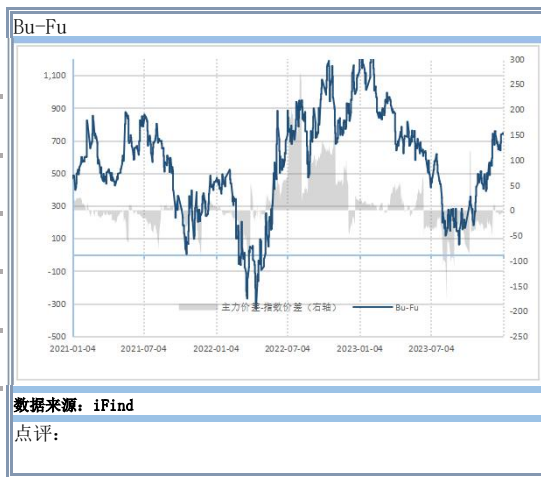
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: -331.0000

期内最大值: 1284.0000

期内平均值: 564.5186

当前分位值: 66.25%



数据起始日: 2021/8/9

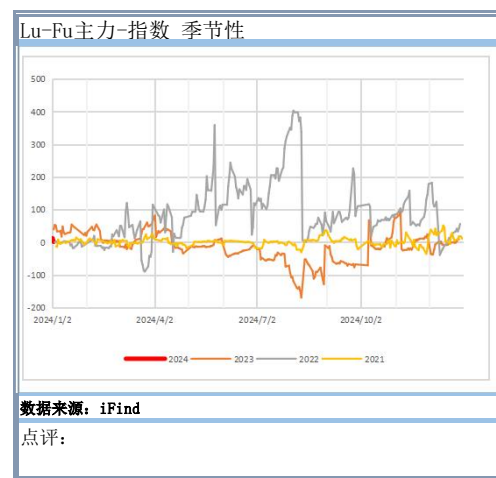
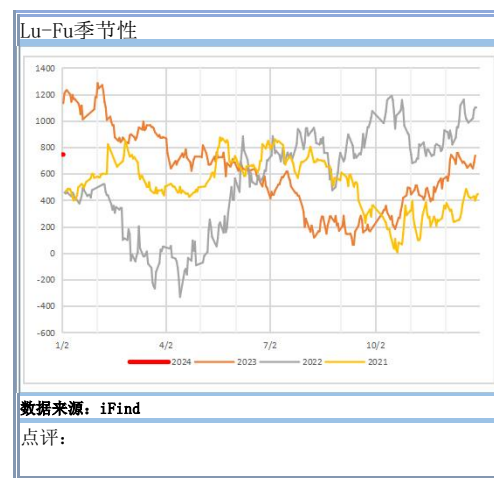
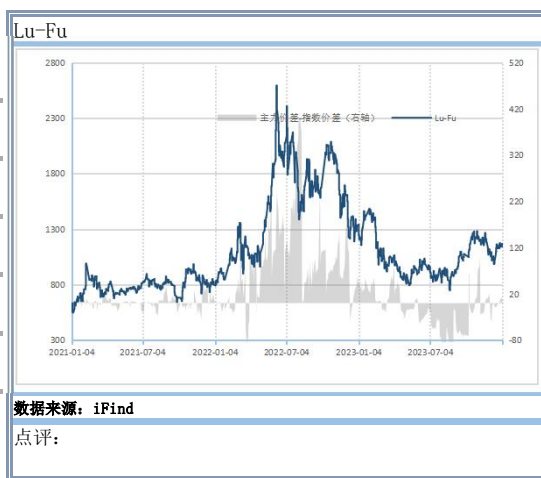
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: 749.0000

期内最大值: 2592.0000

期内平均值: 1314.9882

当前分位值: 21.27%



数据起始日: 2021/6/14

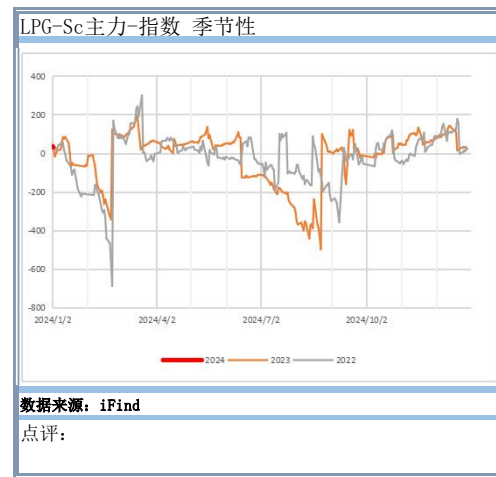
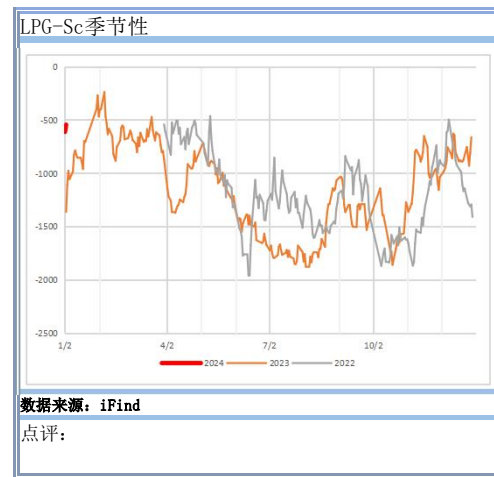
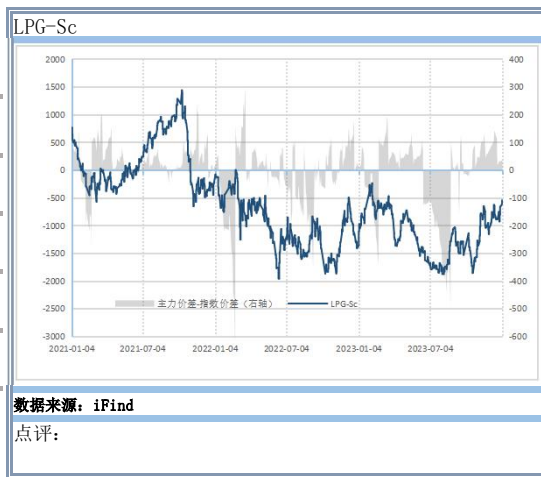
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: -1959.0000

期内最大值: -1.0000

期内平均值: -1099.3776

当前分位值: 72.17%



数据起始日: 2019/1/7

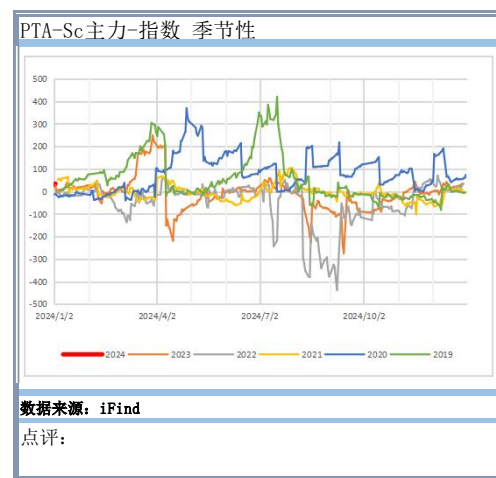
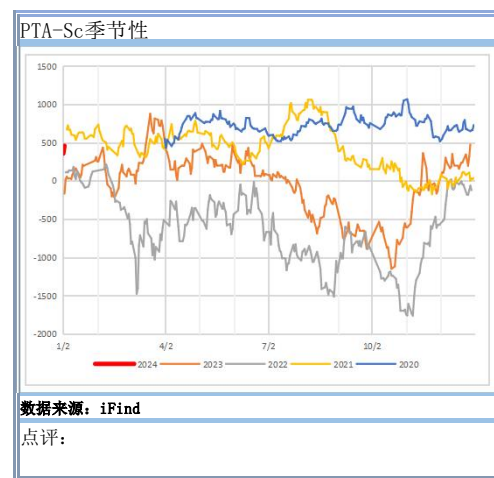
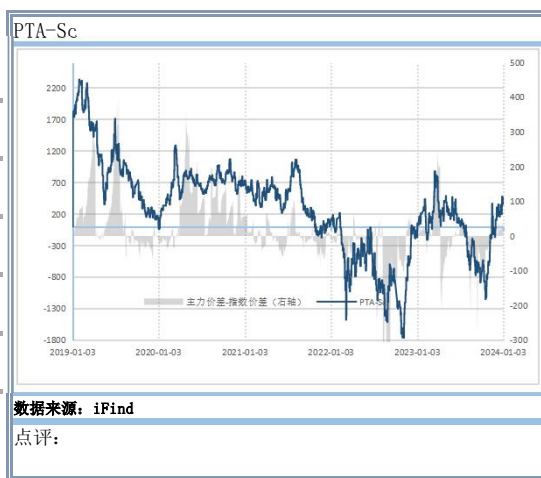
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: -1762.0000

期内最大值: 1061.0000

期内平均值: -82.6749

当前分位值: 78.64%



数据起始日: 2021/2/14

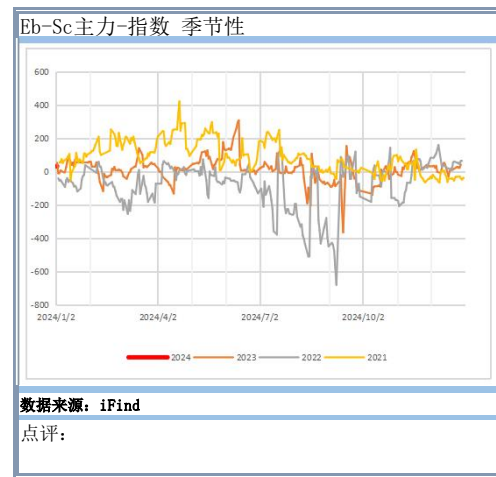
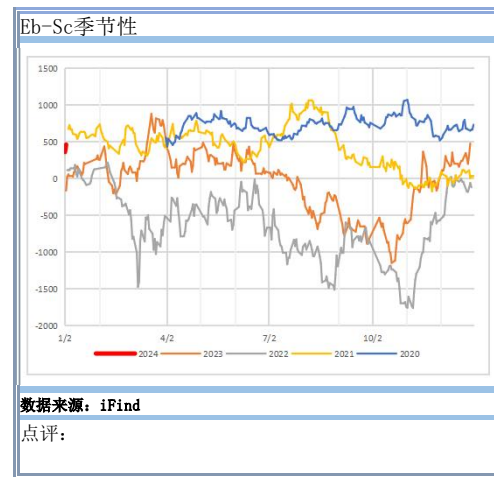
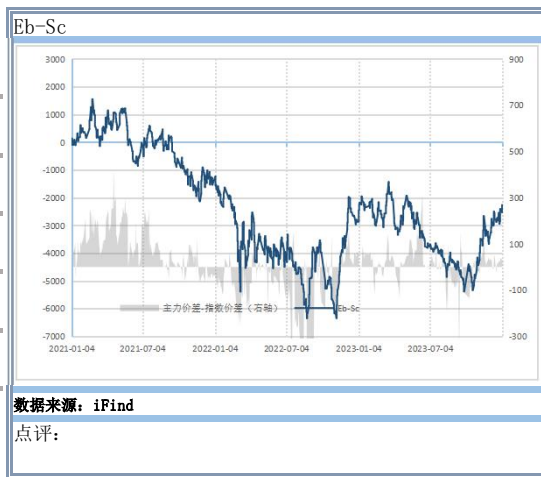
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: -6347.0000

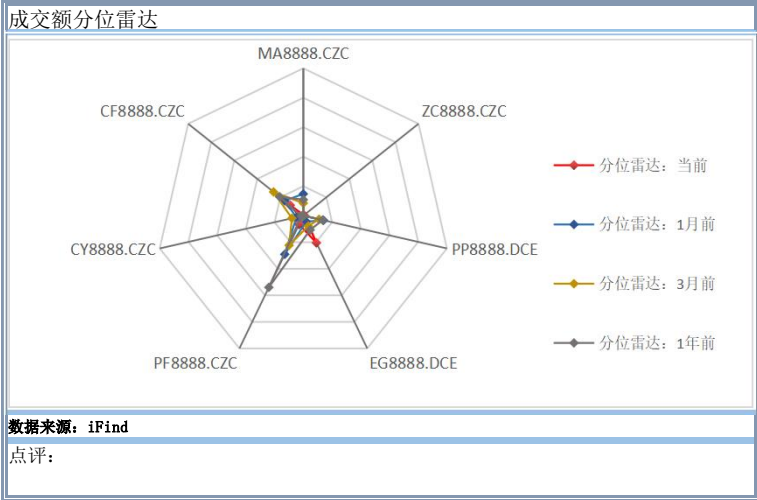
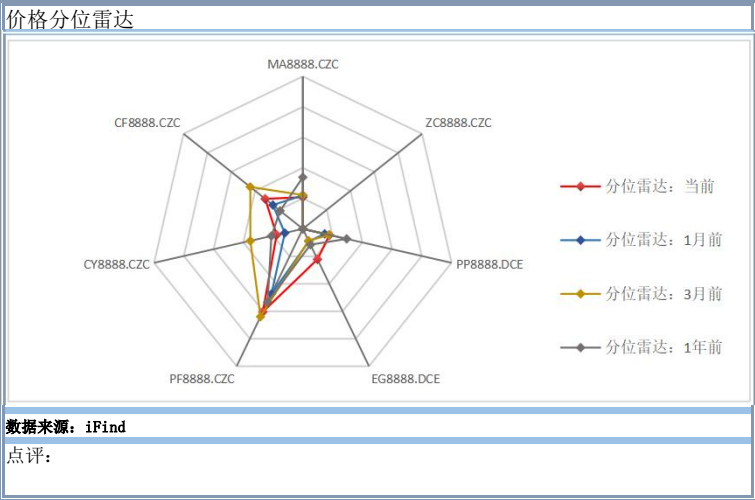
期内最大值: 590.0000

期内平均值: -3034.3927

当前分位值: 58.90%



三、煤化工相关



数据起始日: 2019/1/7

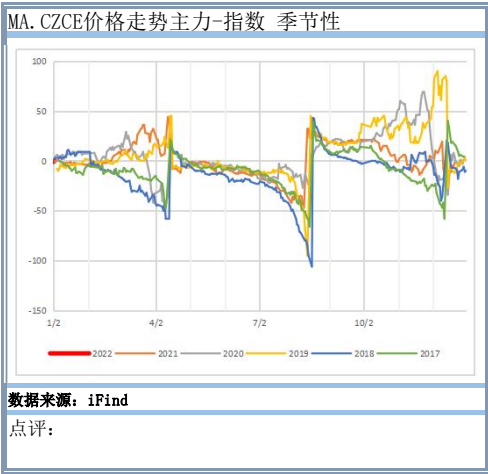
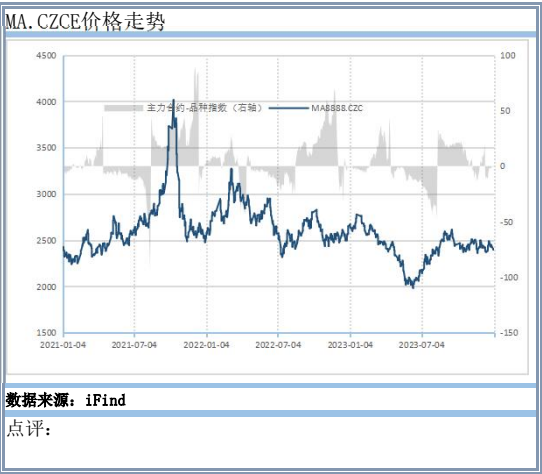
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: 1982

期内最大值: 4015

期内平均值: 2584.2291

当前分位值: 20.76%



数据起始日： 2019/1/7

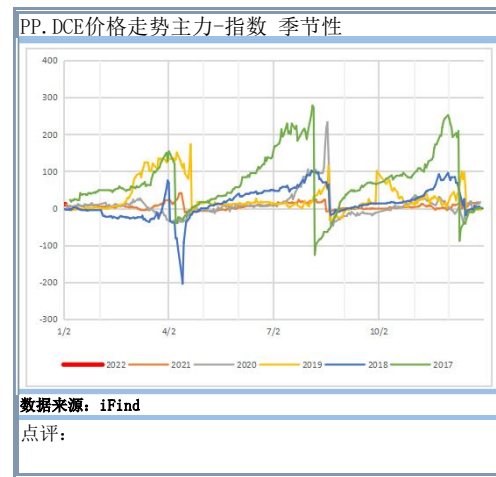
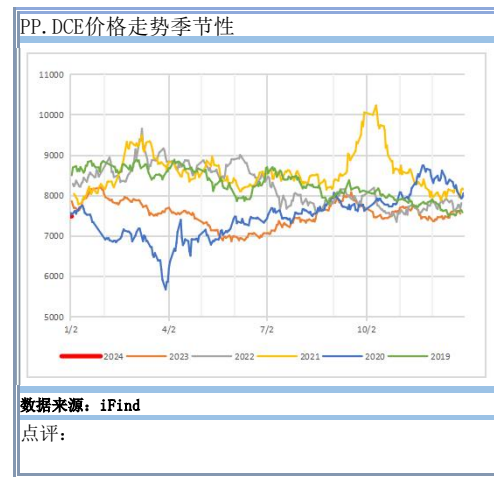
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 6865

期内最大值： 10224

期内平均值： 8100.1125

当前分位值： 17.89%



数据起始日： 2019/1/7

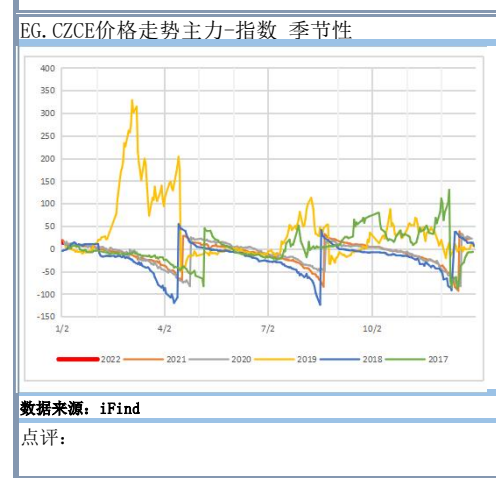
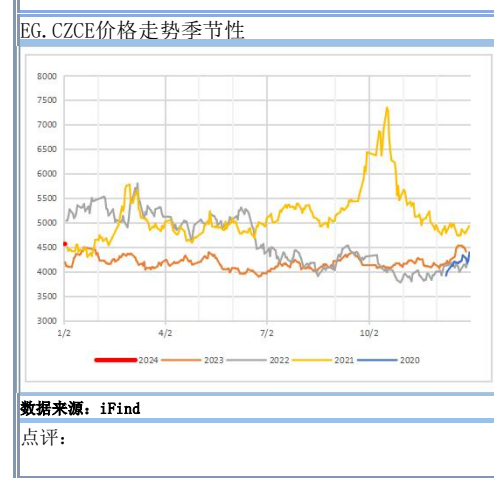
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 3778

期内最大值： 7345

期内平均值： 4630.2469

当前分位值： 22.15%



数据起始日: 2020/10/12

数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: 6477

期内最大值: 7907

期内平均值: 7225.0878

当前分位值: 60.42%

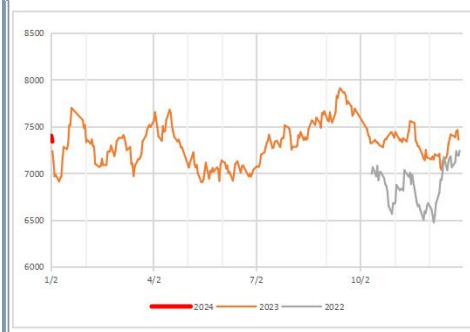
PF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

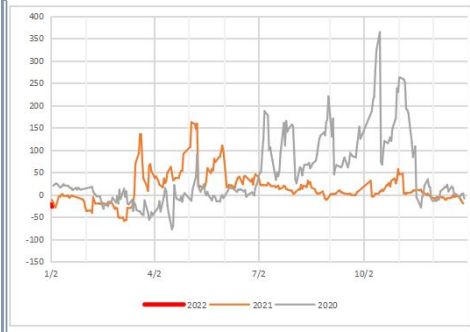
PF. CZCE价格走势季节性



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: 2019/1/7

数据截止日: 2024/1/3

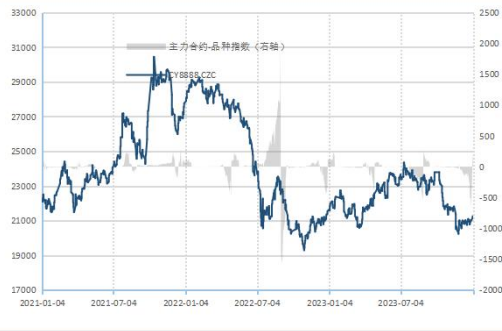
期内最小值: 19292

期内最大值: 30443

期内平均值: 23892.1152

当前分位值: 17.62%

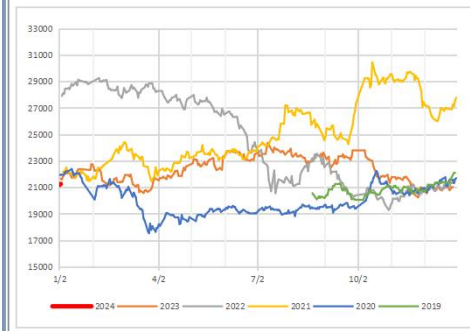
CY. CZCE价格走势



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： 2019/1/7

数据截止日： 2024/1/3

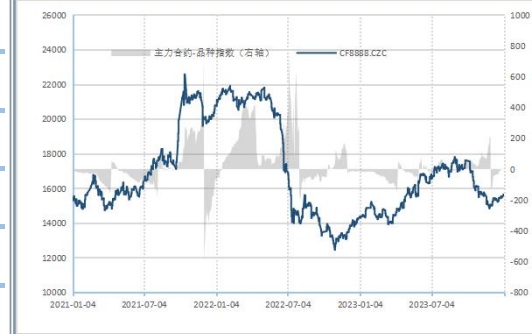
期内最小值： 12447

期内最大值： 22574

期内平均值： 16857.3086

当前分位值： 31.58%

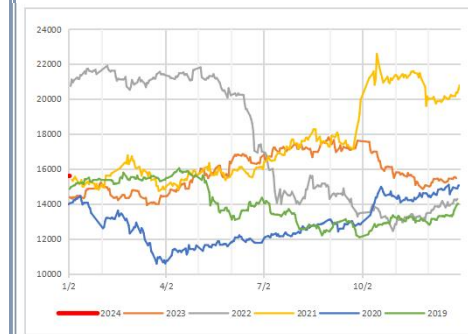
CF. CZCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

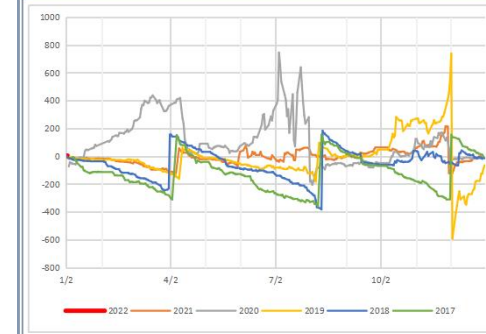
CF. CZCE价格走势季节性



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： 2019/1/7

数据截止日： 2024/1/3

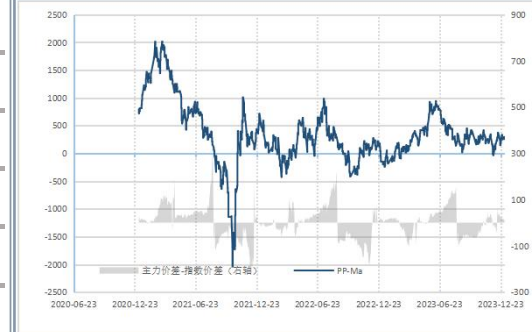
期内最小值： -2039.0000

期内最大值： 2013.0000

期内平均值： 347.4252

当前分位值： 56.59%

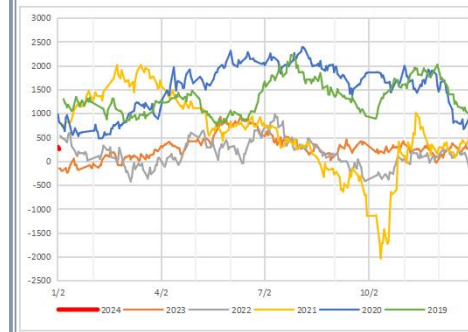
PP-Ma



数据来源：iFind

点评：

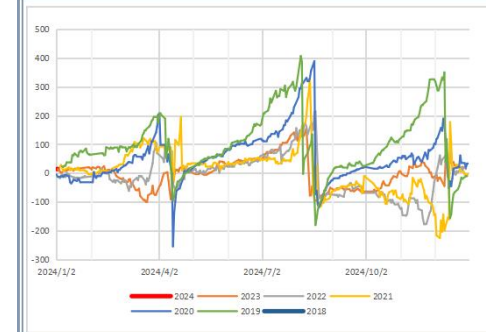
PP-Ma季节性



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： 2019/1/7

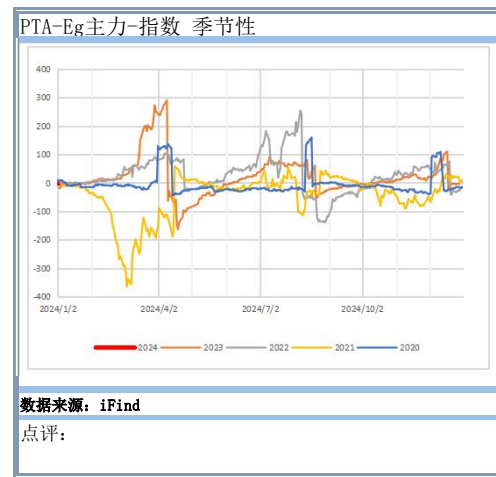
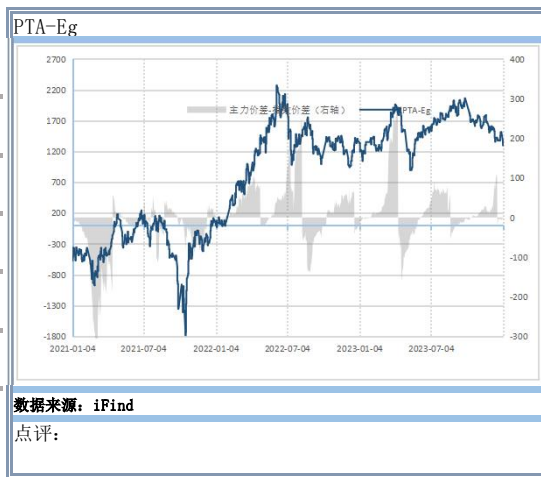
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： -1783.0000

期内最大值： 2269.0000

期内平均值： 816.7257

当前分位值： 76.01%



数据起始日： 2021/10/20

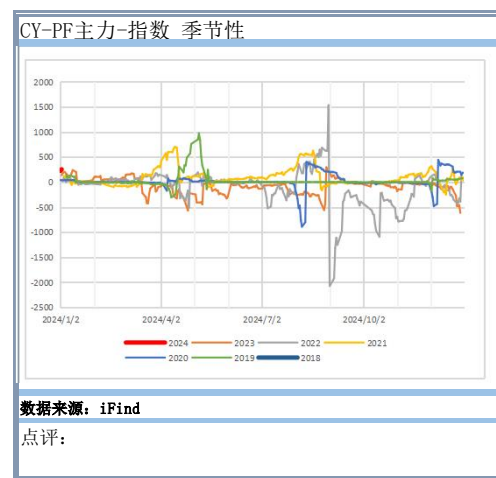
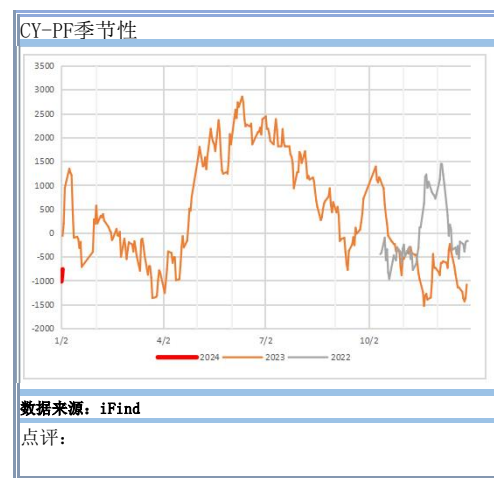
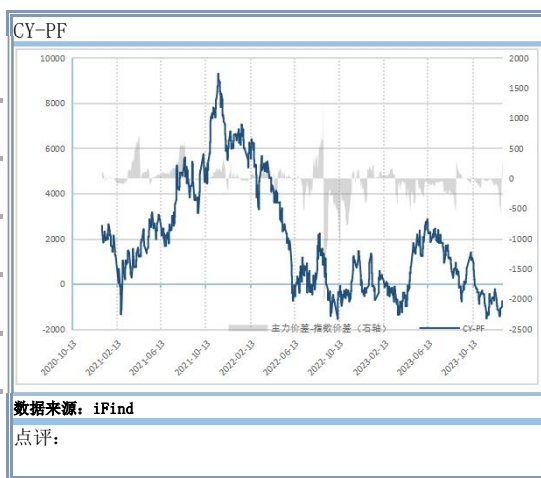
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： -1555.0000

期内最大值： 2854.0000

期内平均值： 296.3116

当前分位值： 17.90%



数据起始日: 2022/7/25

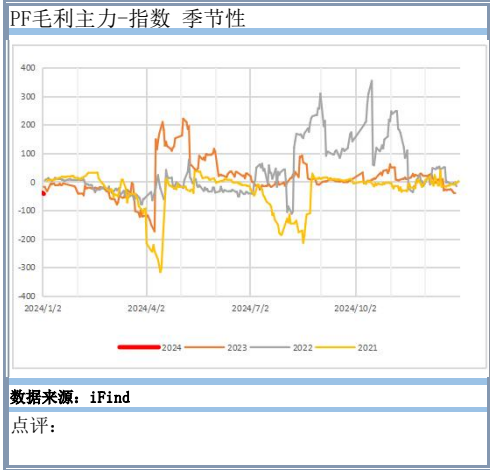
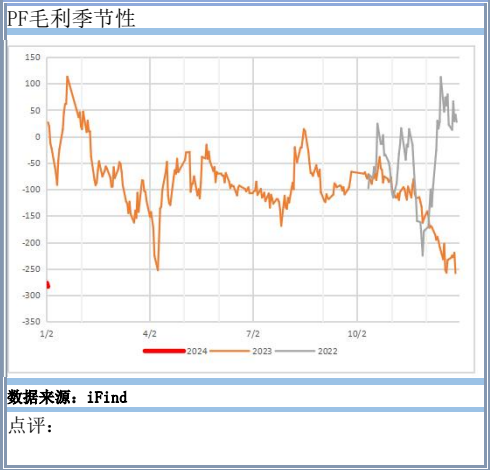
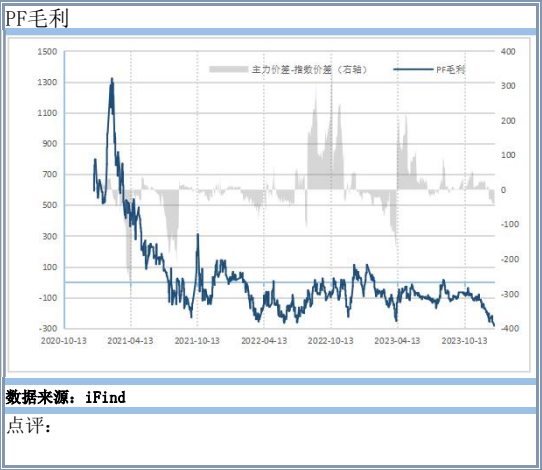
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: -283.8550

期内最大值: 112.9900

期内平均值: -84.6904

当前分位值: 0.00%



数据起始日: 2019/1/7

数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: 5338.0000

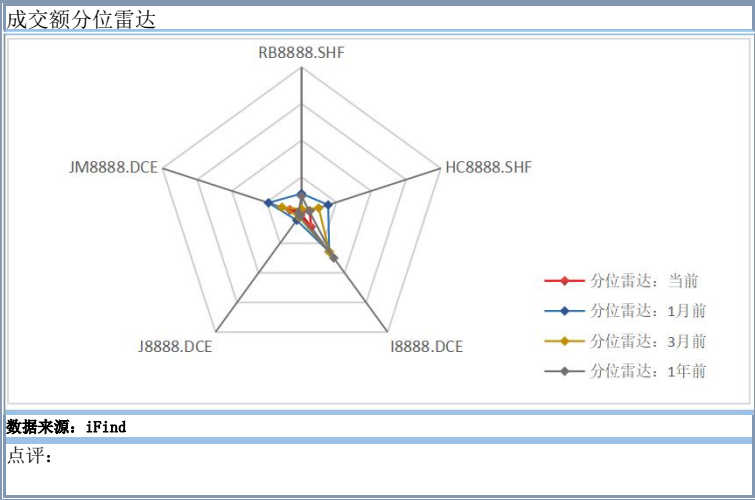
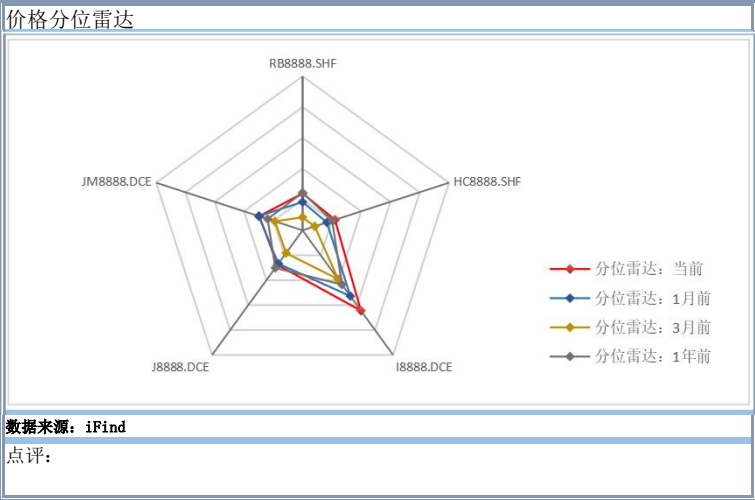
期内最大值: 9616.0000

期内平均值: 7034.8066

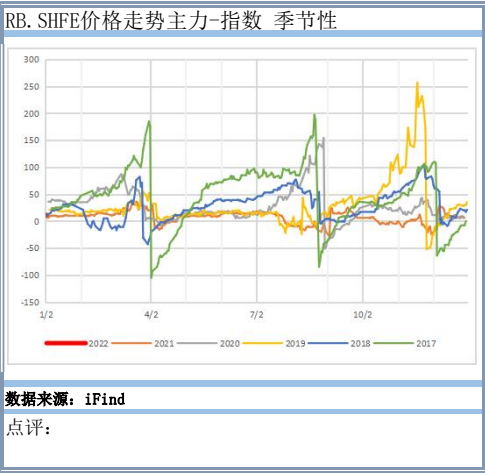
当前分位值: 6.40%



四、黑色相关



数据起始日: 2019/1/7
数据截止日: 2024/1/3
期内最小值: 3377
期内最大值: 6158
期内平均值: 4341.5624
当前分位值: 23.98%



数据起始日： 2019/1/7

数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 3444

期内最大值： 6675

期内平均值： 4497.0261

当前分位值： 22.13%



数据起始日： 2019/1/7

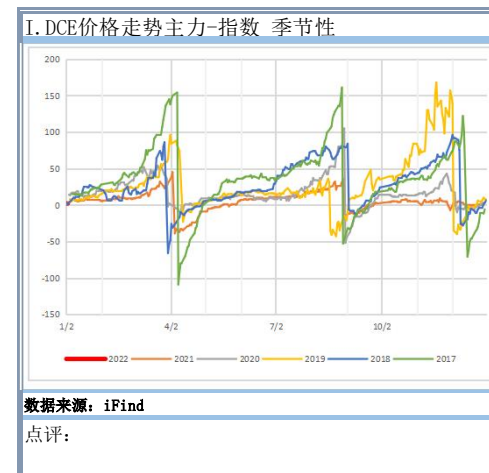
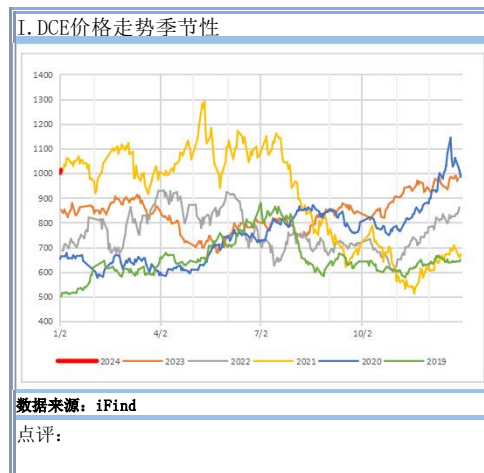
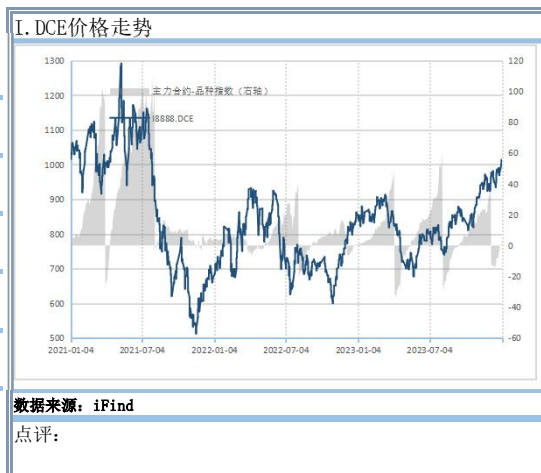
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 512.8

期内最大值： 1290.9

期内平均值： 836.0646

当前分位值： 64.36%



数据起始日： 2019/1/7

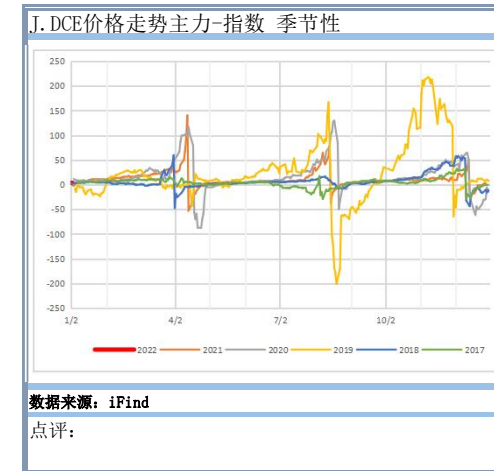
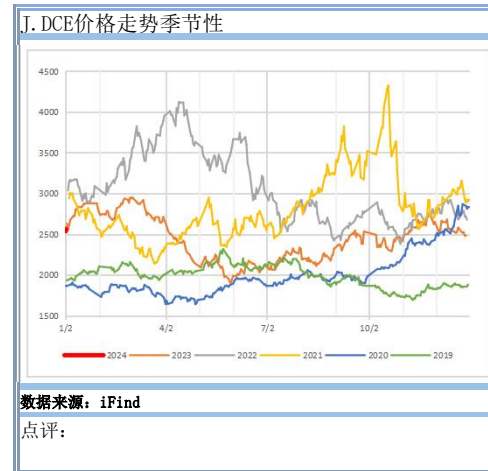
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 1897.9

期内最大值： 4320.8

期内平均值： 2766.4354

当前分位值： 27.69%



数据起始日： 2019/1/7

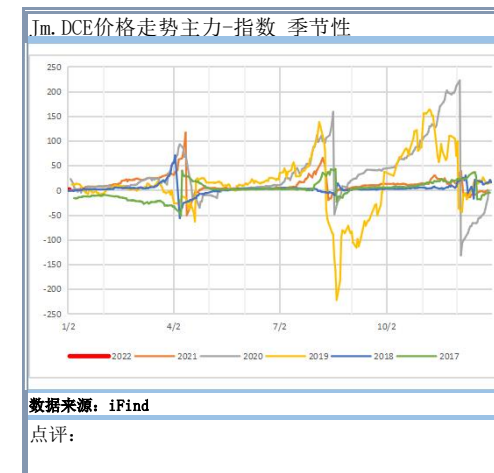
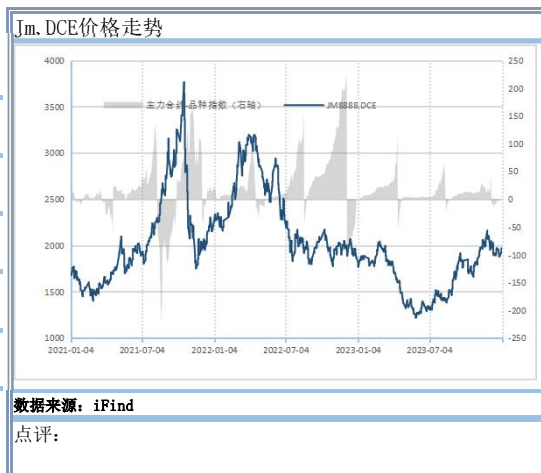
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 1219.4

期内最大值： 3764.7

期内平均值： 2014.9701

当前分位值： 29.54%



数据起始日： 2019/1/7

数据截止日： 2024/1/3

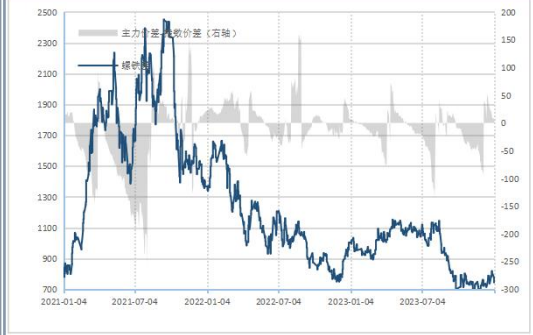
期内最小值： 670.1176

期内最大值： 2451.8235

期内平均值： 1238.8393

当前分位值： 4.16%

螺铁差



数据来源：iFind

点评：

数据起始日： 2019/1/7

数据截止日： 2024/1/3

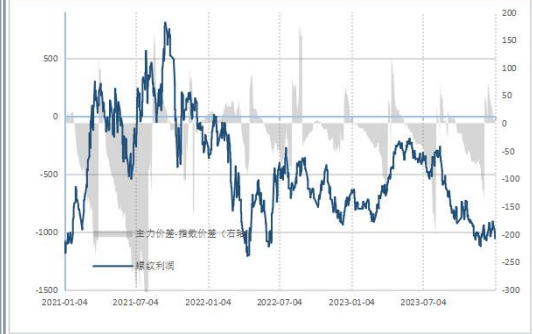
期内最小值： -1206.9091

期内最大值： 810.0000

期内平均值： -453.5551

当前分位值： 7.50%

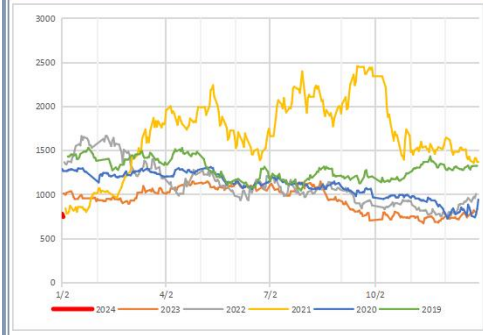
螺纹利润



数据来源：iFind

点评：

螺铁差季节性



数据来源：iFind

点评：

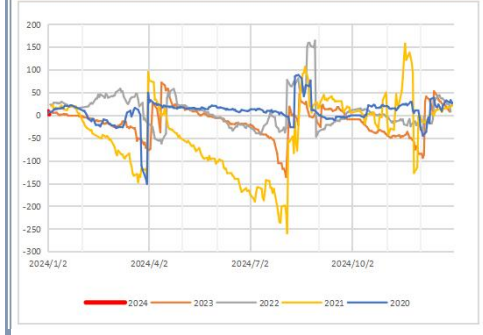
螺纹利润季节性



数据来源：iFind

点评：

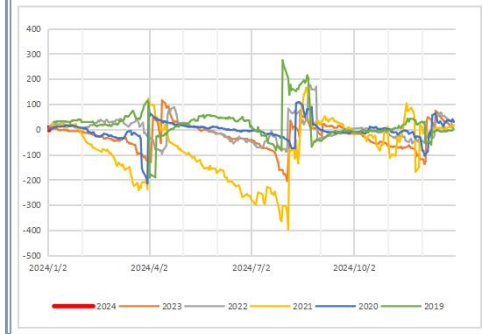
螺铁差主力-指数 季节性



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: 2019/1/7

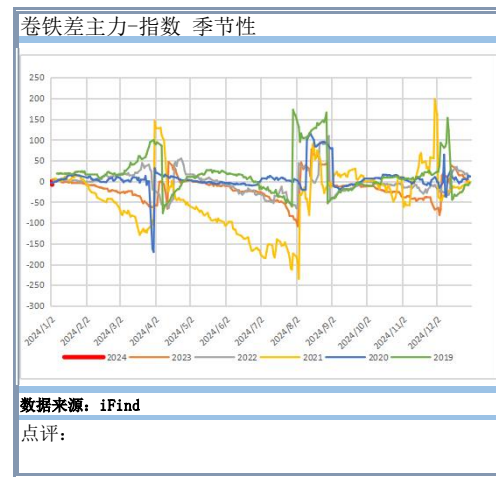
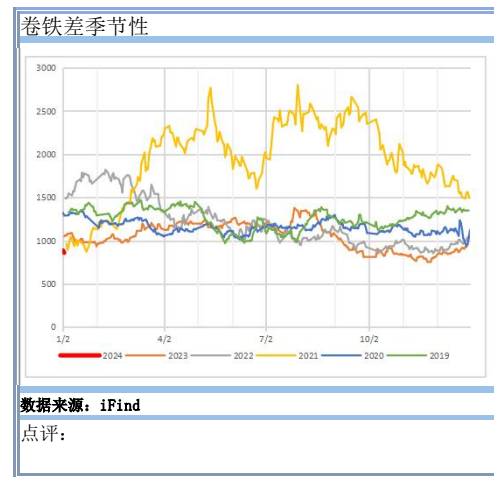
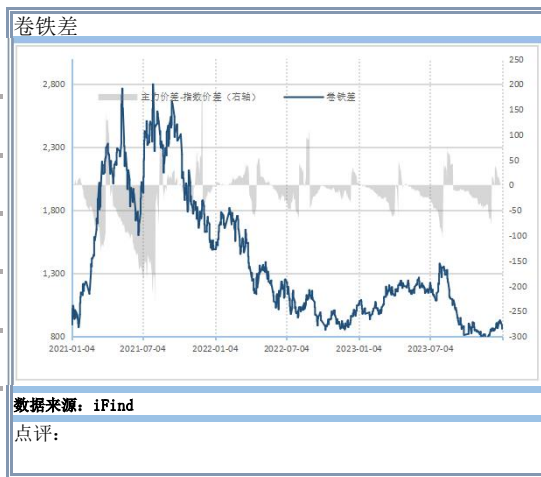
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: 752.4706

期内最大值: 2799.4118

期内平均值: 1394.3030

当前分位值: 5.22%



数据起始日: 2019/1/7

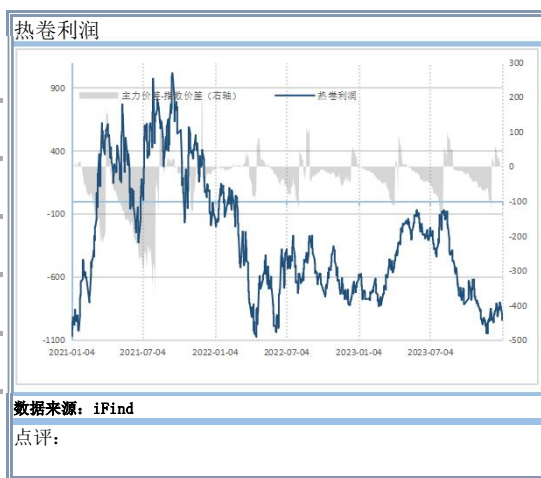
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: -1073.7273

期内最大值: 1014.0000

期内平均值: -298.0914

当前分位值: 6.38%



数据起始日: 2019/1/7

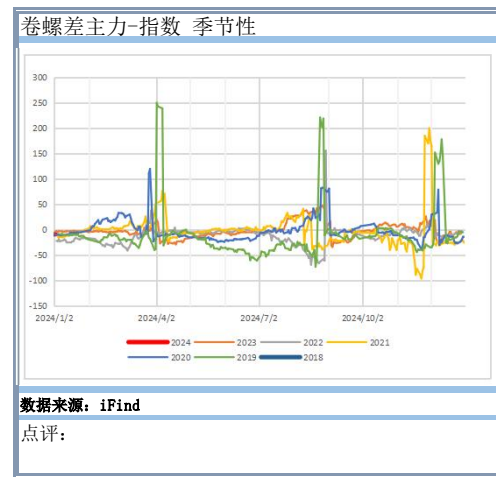
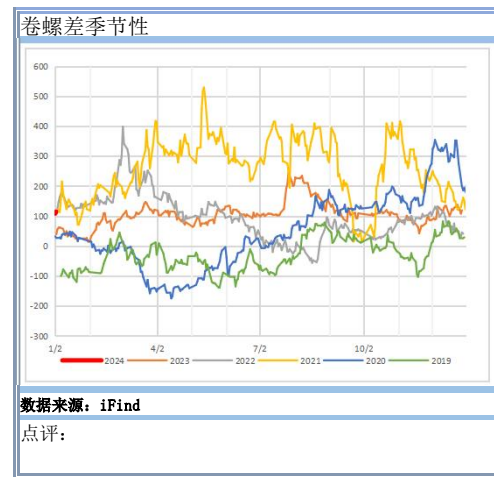
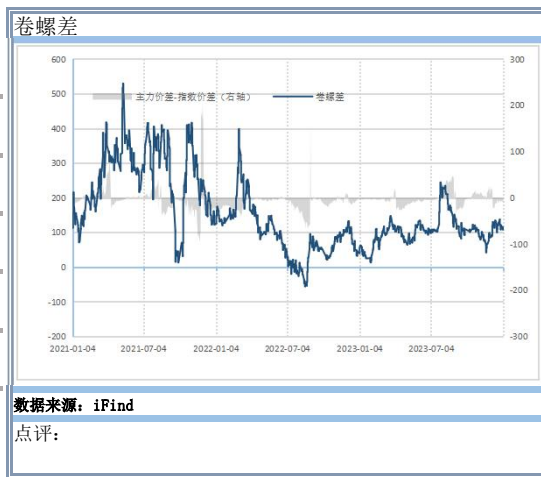
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: -56.0000

期内最大值: 529.0000

期内平均值: 155.4636

当前分位值: 29.23%



数据起始日: 2019/1/7

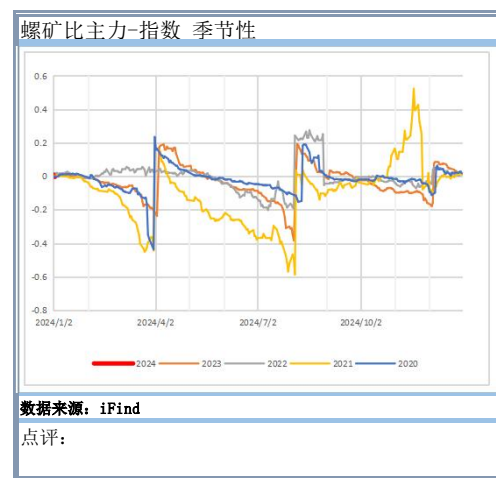
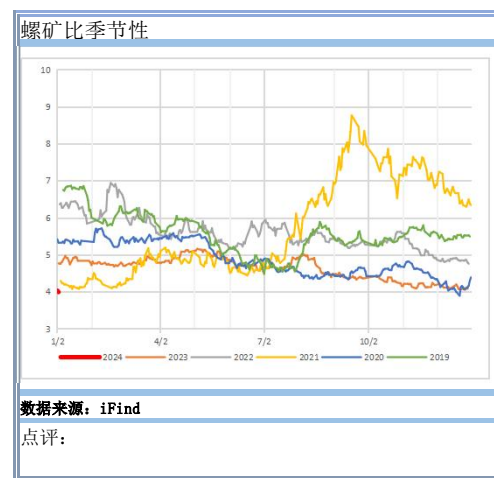
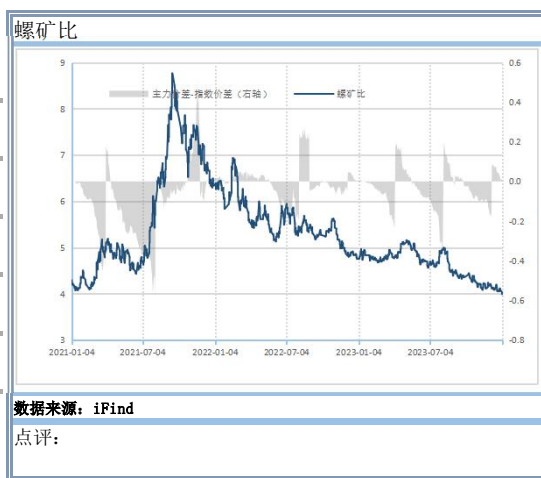
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: 3.9897

期内最大值: 8.7631

期内平均值: 5.2935

当前分位值: 0.00%



数据起始日： 2019/1/7

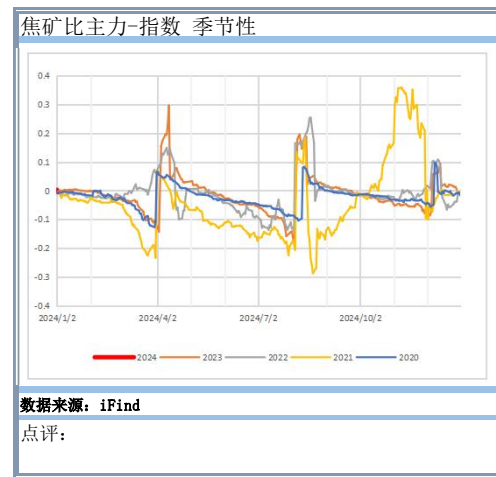
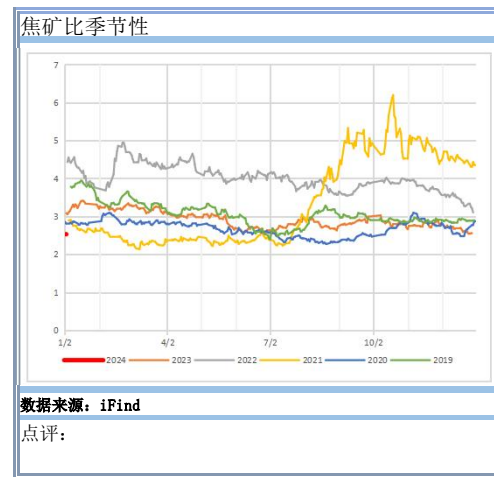
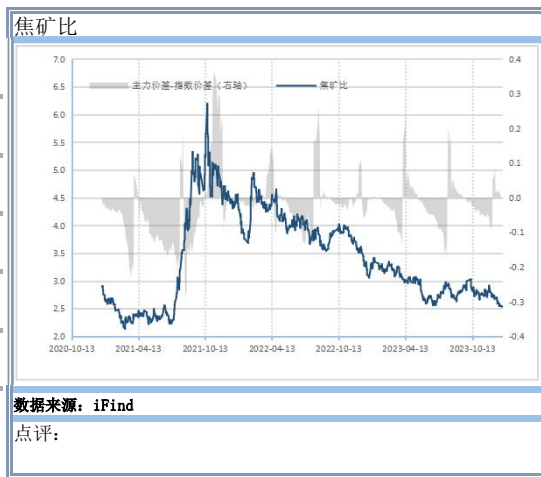
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 2.1354

期内最大值： 6.1947

期内平均值： 3.4132

当前分位值： 9.82%



数据起始日： 2019/1/7

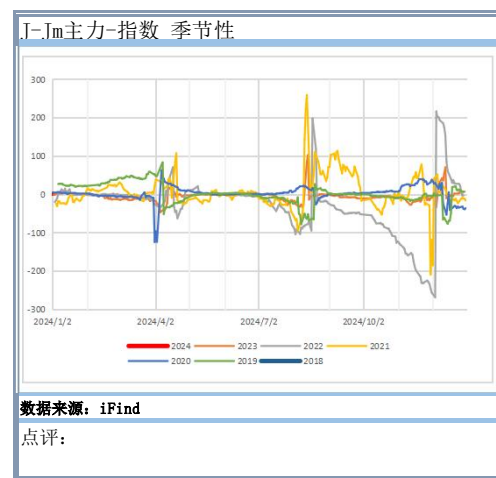
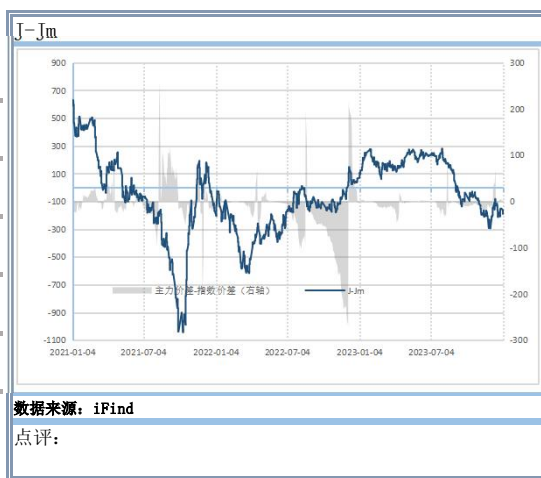
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： -1043.0800

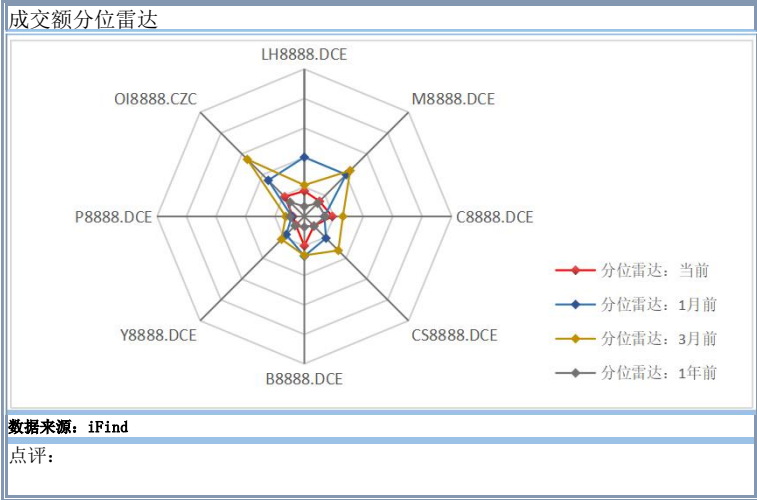
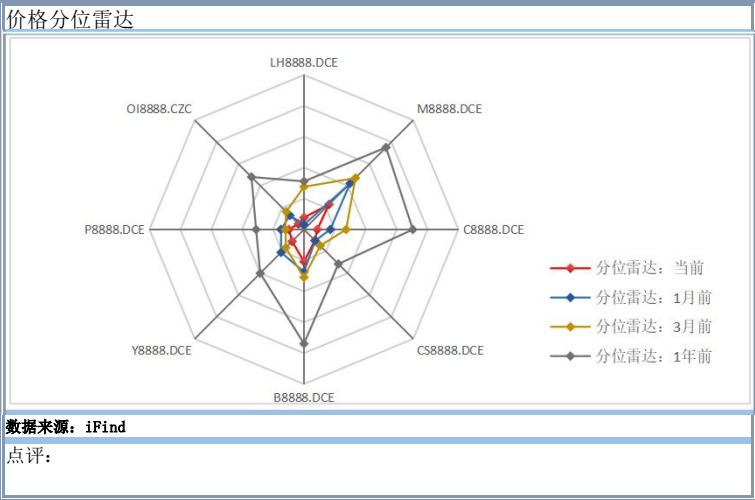
期内最大值： 629.9200

期内平均值： -54.5227

当前分位值： 50.92%



五、农产品相关



数据起始日: 2021/1/8

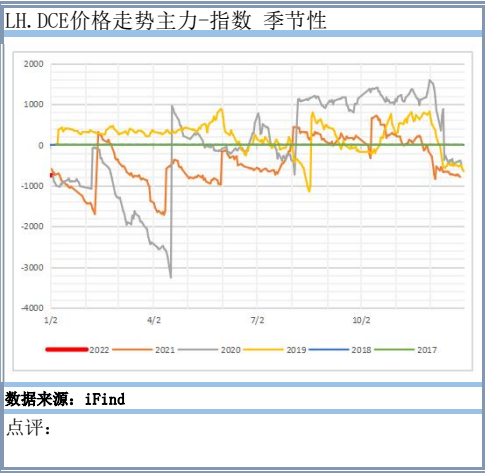
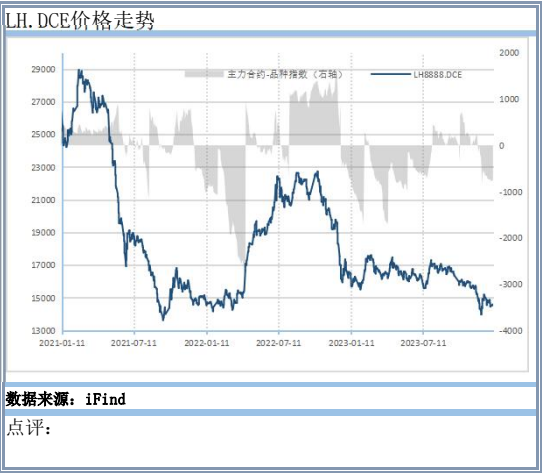
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: 13971

期内最大值: 21166

期内平均值: 16658.6069

当前分位值: 7.73%



数据起始日： 2019/1/7

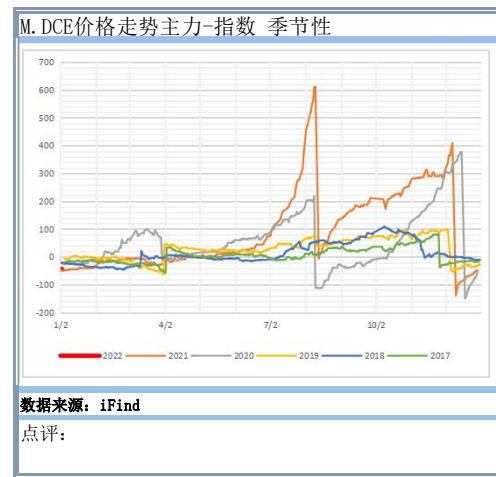
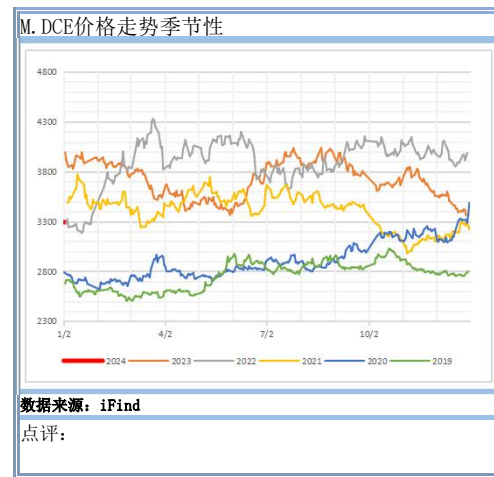
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 2980

期内最大值： 4328

期内平均值： 3675.3608

当前分位值： 22.92%



数据起始日： 2019/1/7

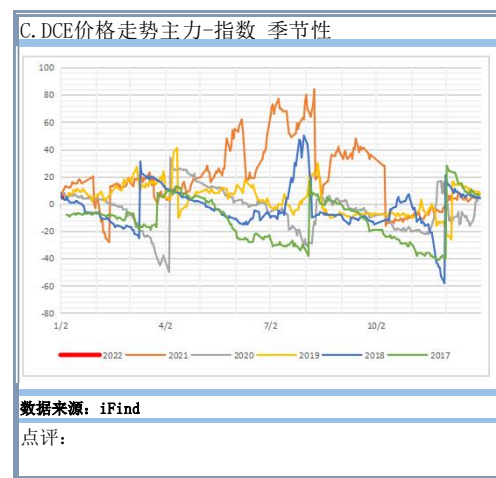
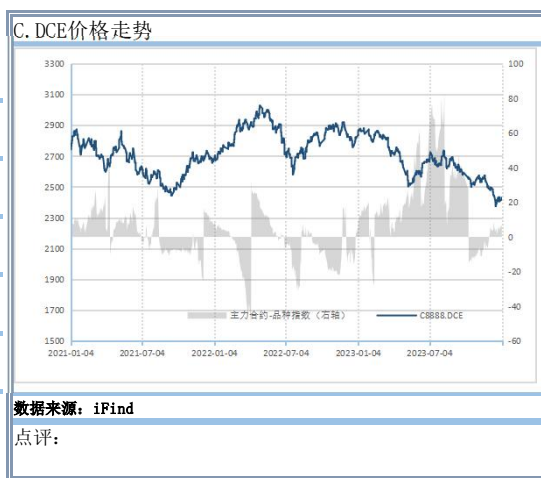
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 2374

期内最大值： 3027

期内平均值： 2712.6008

当前分位值： 8.58%



数据起始日: 2019/1/7

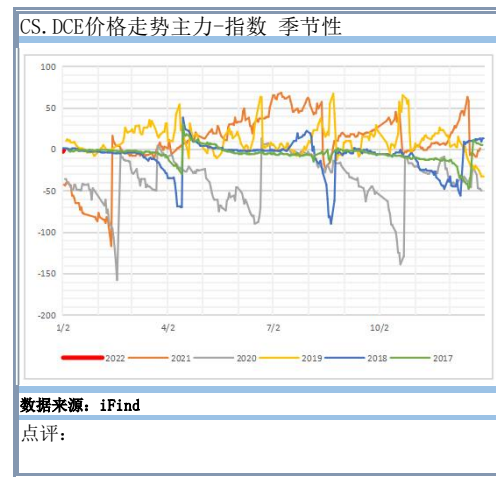
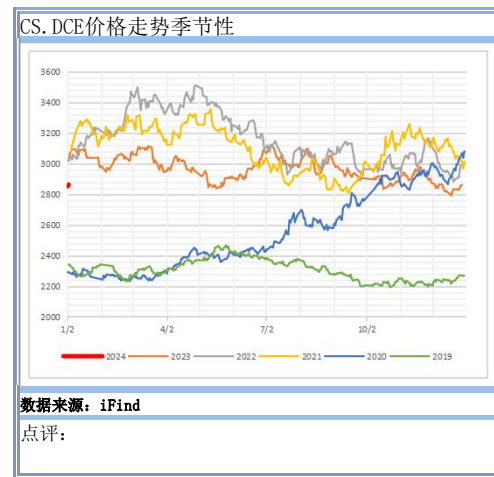
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: 2791

期内最大值: 3512

期内平均值: 3076.7942

当前分位值: 9.99%



数据起始日: 2019/1/7

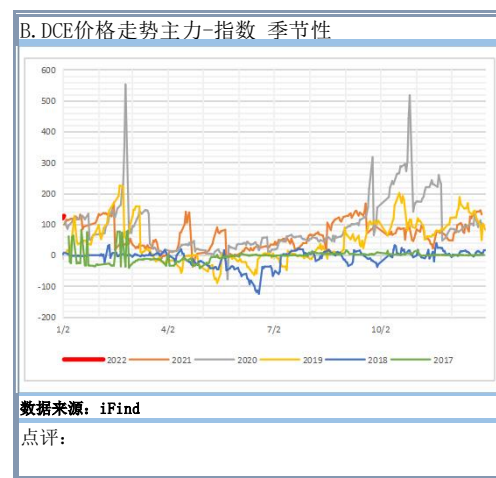
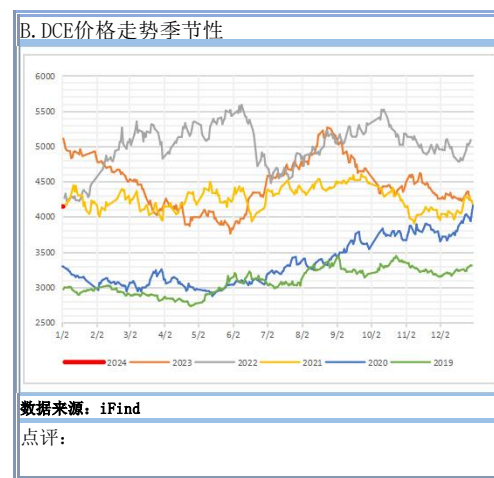
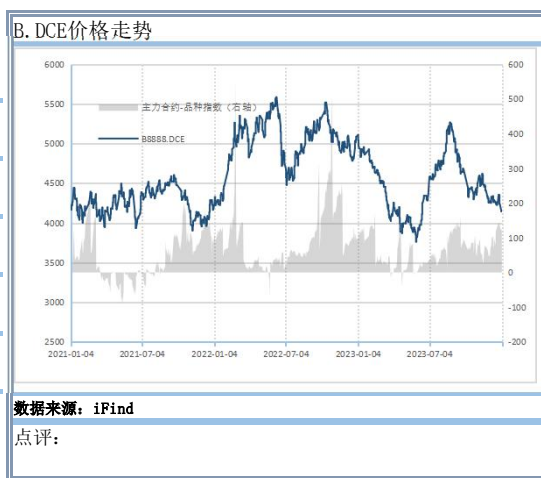
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: 3762

期内最大值: 5585

期内平均值: 4575.8230

当前分位值: 20.79%



数据起始日: 2019/1/7

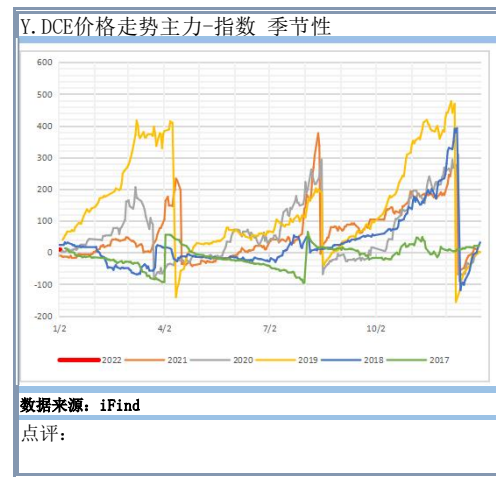
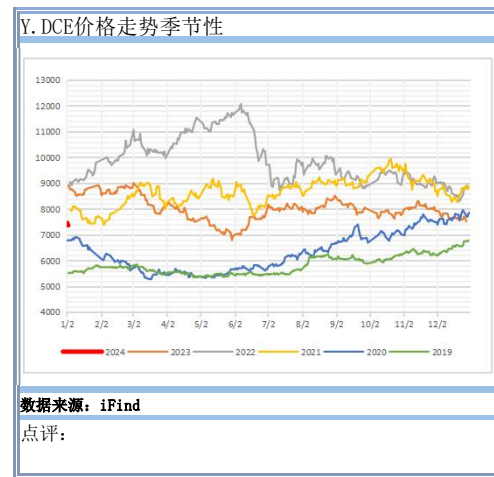
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: 6793

期内最大值: 12065

期内平均值: 8836.1180

当前分位值: 10.83%



数据起始日: 2019/1/7

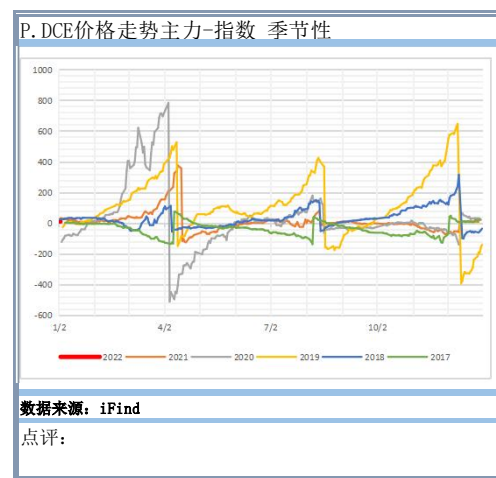
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: 6349

期内最大值: 12479

期内平均值: 8254.5967

当前分位值: 9.72%



数据起始日： 2019/1/7

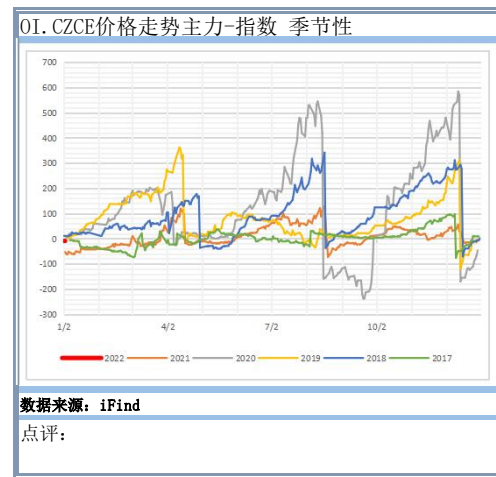
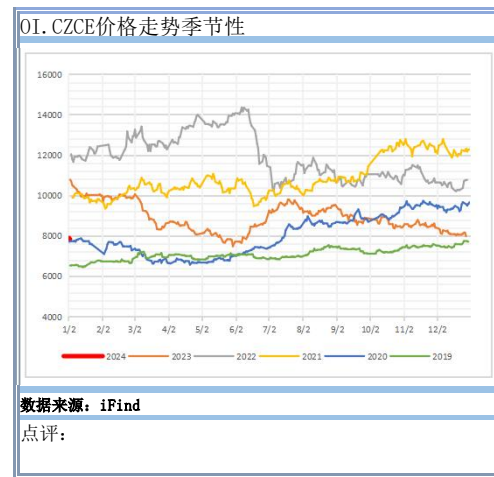
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 7475

期内最大值： 14344

期内平均值： 10517.0796

当前分位值： 5.12%



数据起始日： 2021/12/22

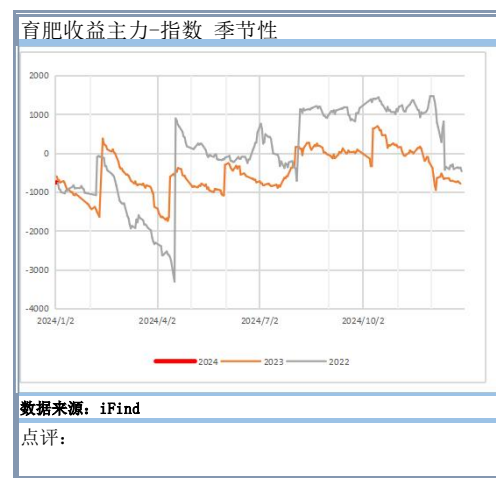
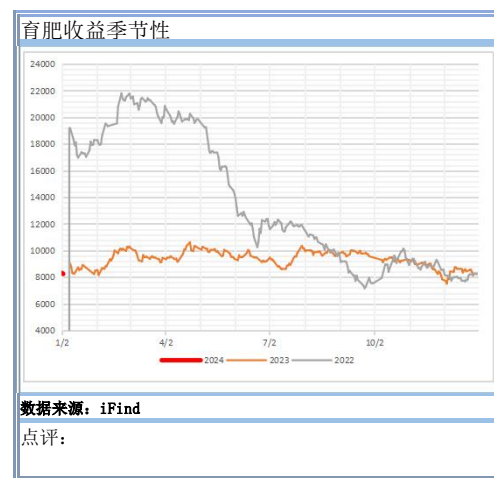
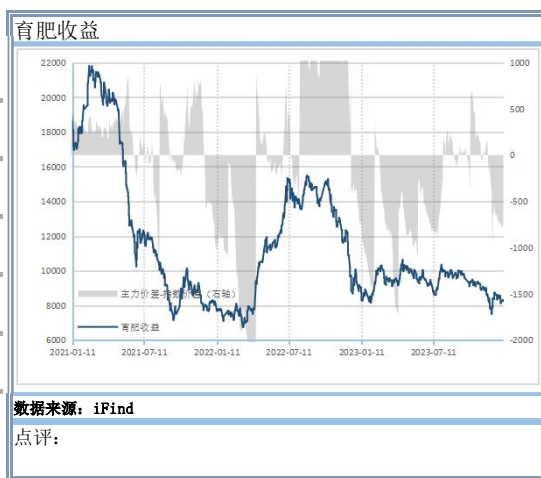
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 7508.2500

期内最大值： 13673.7500

期内平均值： 9685.0931

当前分位值： 11.82%



数据起始日： 2021/1/8

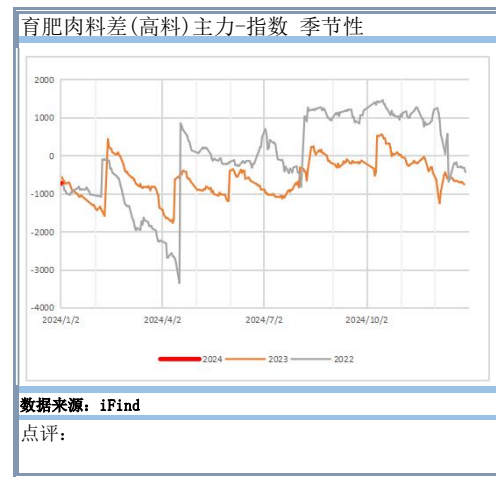
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 246.0000

期内最大值： 5582.0000

期内平均值： 2172.1552

当前分位值： 23.84%



数据起始日： 2019/1/7

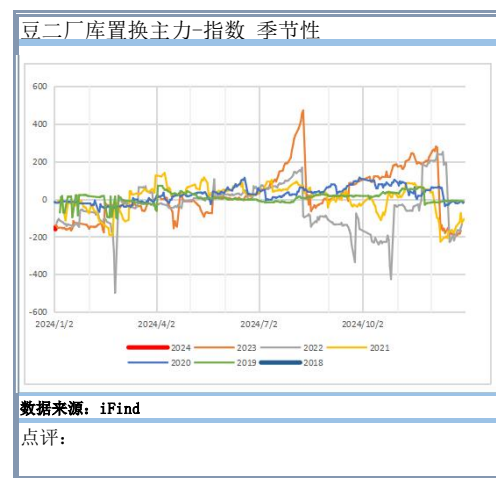
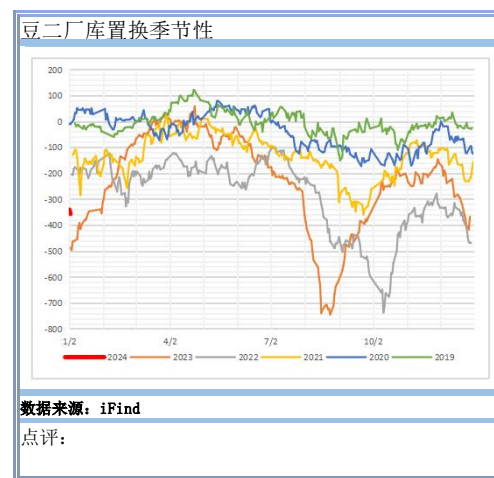
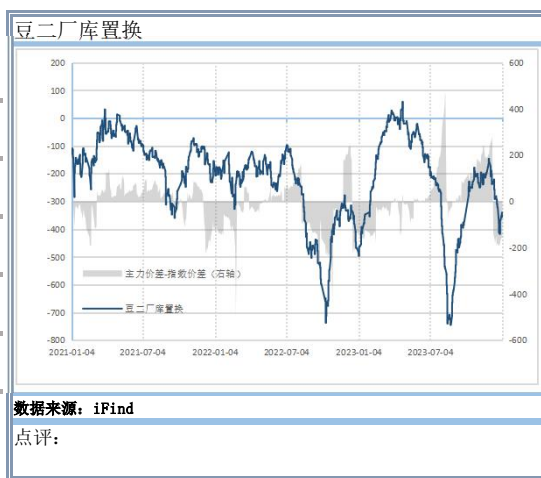
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： -745.0200

期内最大值： 58.2450

期内平均值： -215.9830

当前分位值： 48.33%



数据起始日: 2019/1/7

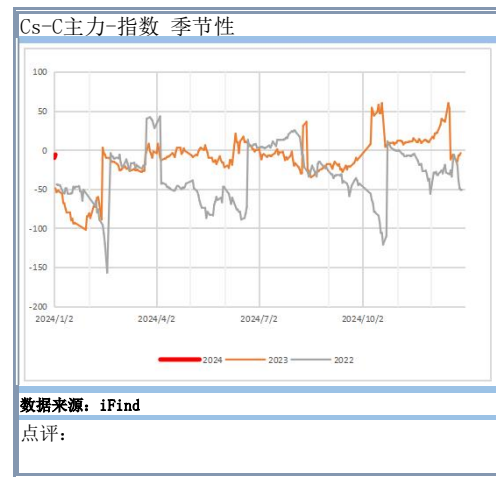
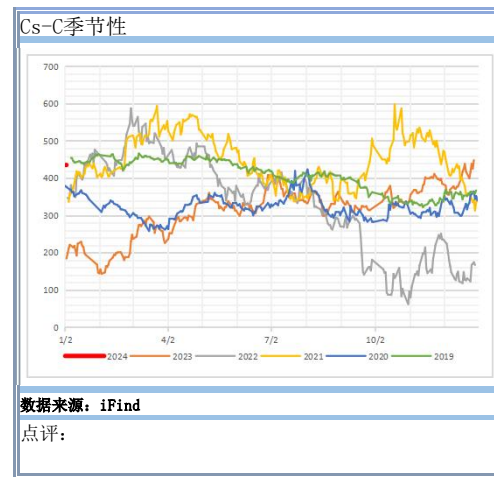
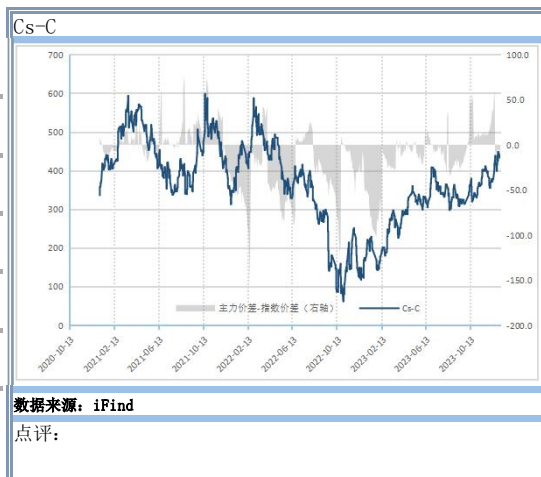
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: 62.0000

期内最大值: 598.0000

期内平均值: 364.1934

当前分位值: 69.22%



数据起始日: 2019/1/7

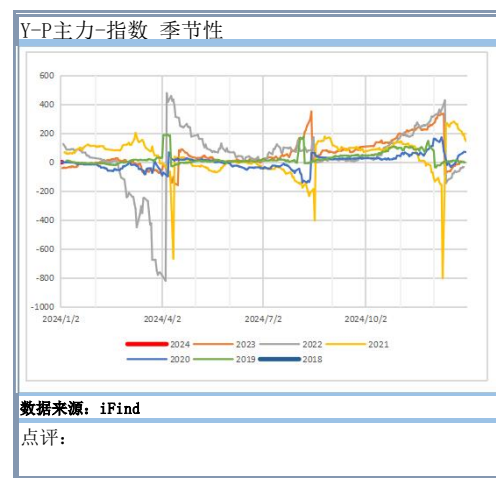
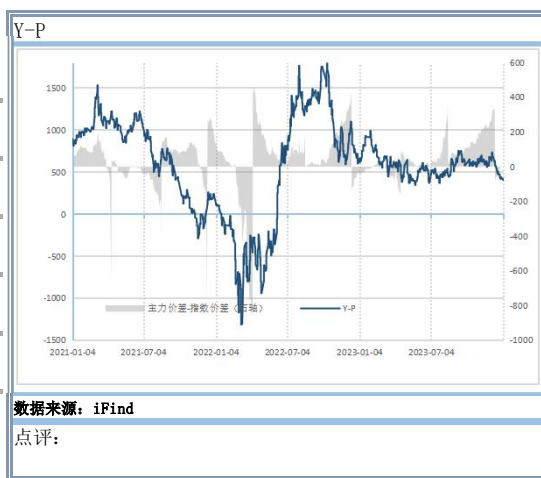
数据截止日: 2024/1/3

期内最小值: -1313.0000

期内最大值: 1788.0000

期内平均值: 581.5213

当前分位值: 55.85%



数据起始日： 2019/1/7

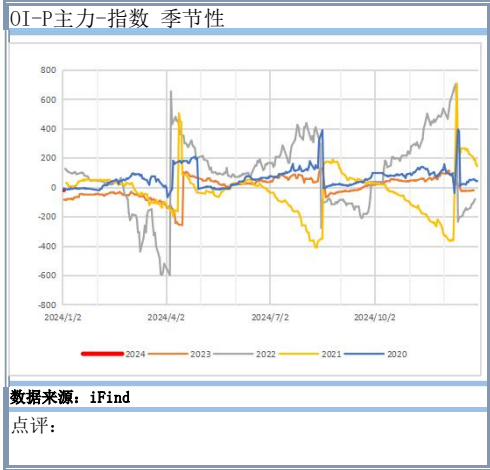
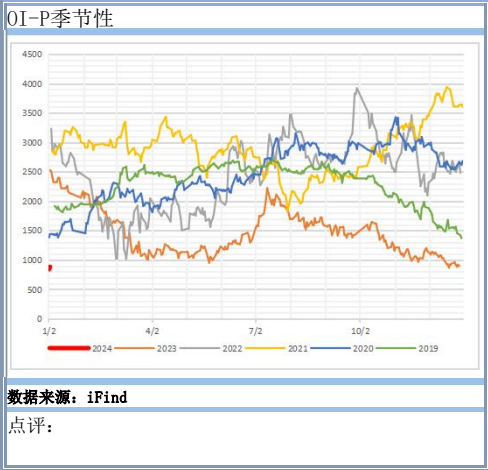
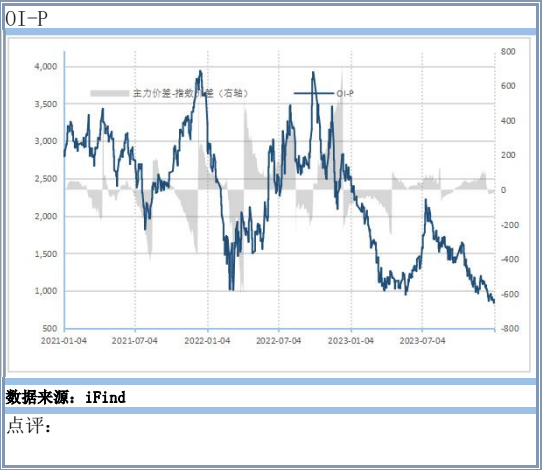
数据截止日： 2024/1/3

期内最小值： 840.0000

期内最大值： 3919.0000

期内平均值： 1883.3173

当前分位值： 1.36%



免责声明

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