

盘面套利观察

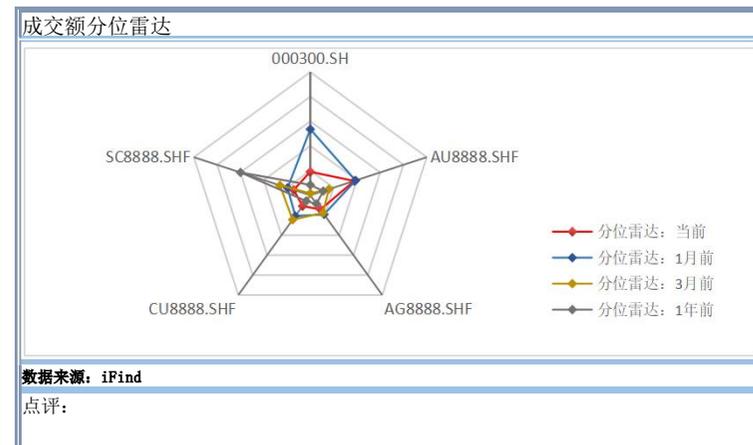
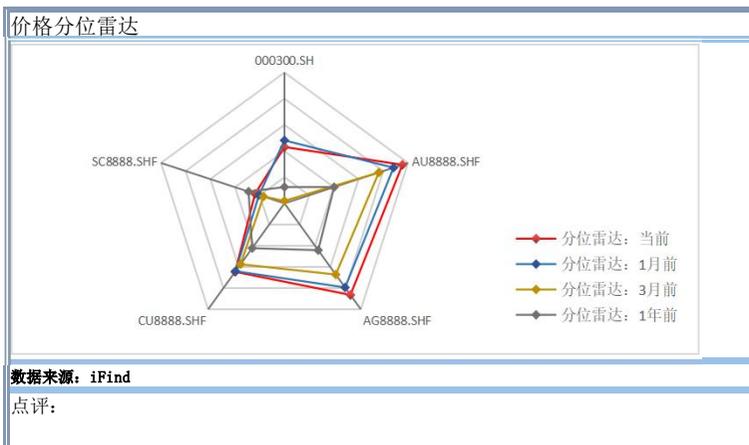
2024年12月11日

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: 2019/12/11

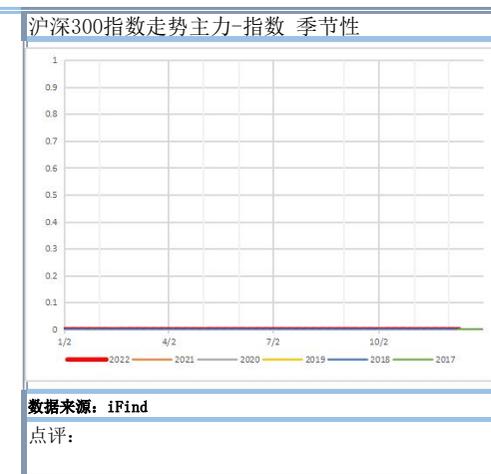
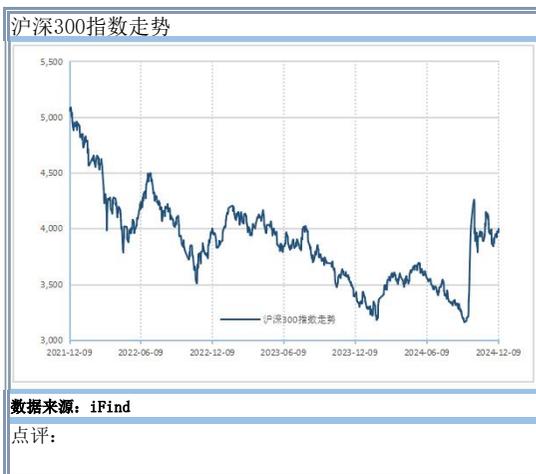
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 3159.247

期内最大值: 5083.8007

期内平均值: 3877.7438

当前分位值: 1.90%



数据起始日: 2019/12/11

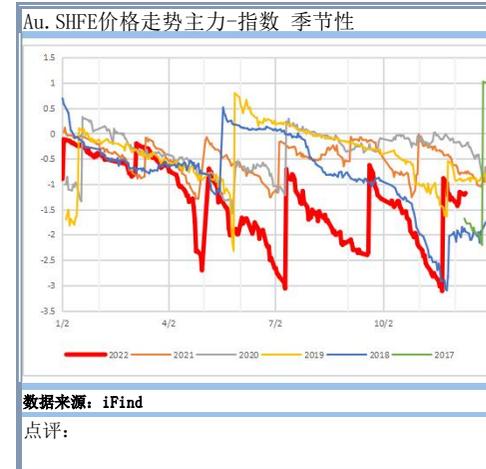
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 365.31

期内最大值: 640.65

期内平均值: 463.1052

当前分位值: 95.49%



数据起始日: 2019/12/11

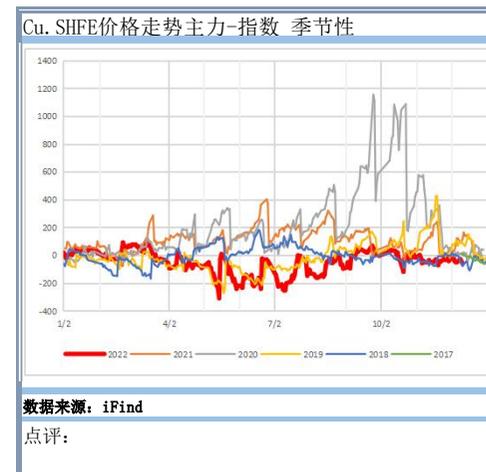
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 53367

期内最大值: 87697

期内平均值: 69816.4540

当前分位值: 64.62%



数据起始日：2019/12/11

数据截止日：2024/12/11

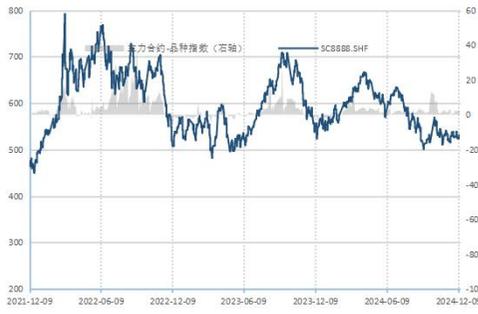
期内最小值：449.6

期内最大值：791.6

期内平均值：597.9207

当前分位值：23.80%

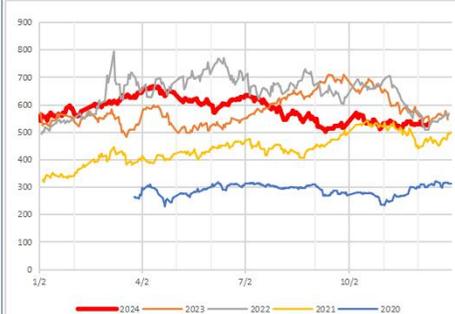
Sc. Ine价格走势



数据来源：iFind

点评：

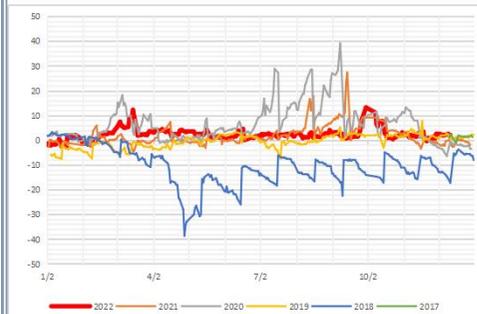
Sc. Ine价格走势季节性



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：2019/12/11

数据截止日：2024/12/11

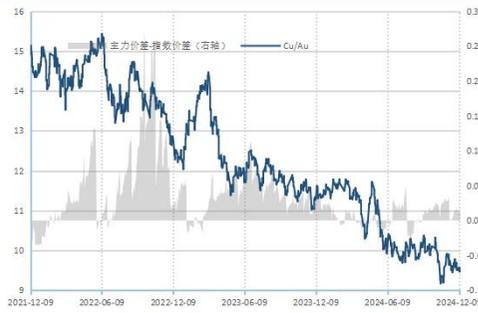
期内最小值：9.1693

期内最大值：15.4319

期内平均值：12.3356

当前分位值：5.72%

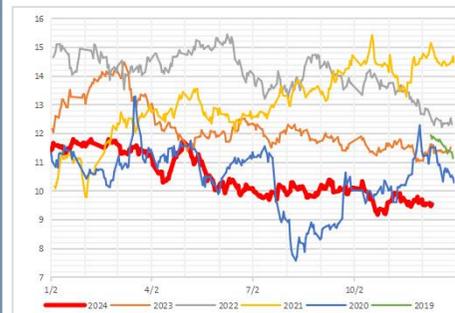
Cu/Au



数据来源：iFind

点评：

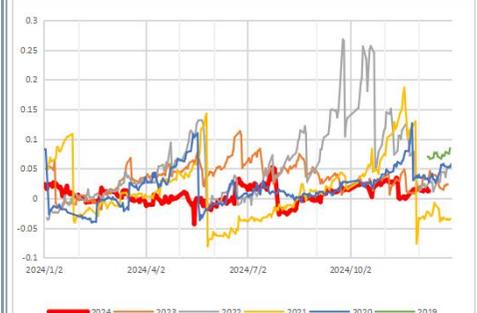
Cu/Au季节性



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：2019/12/11

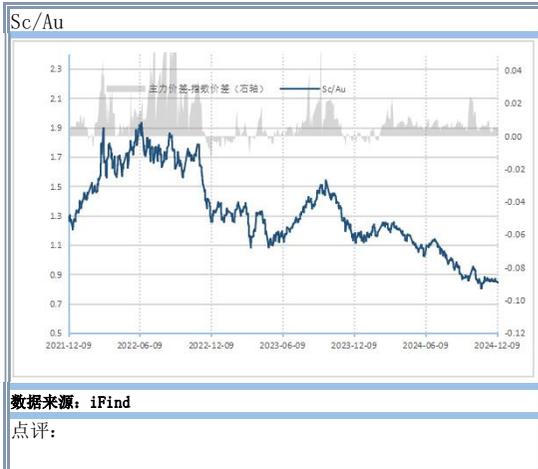
数据截止日：2024/12/11

期内最小值：0.8026

期内最大值：1.9320

期内平均值：1.3273

当前分位值：3.77%



数据起始日：2019/12/11

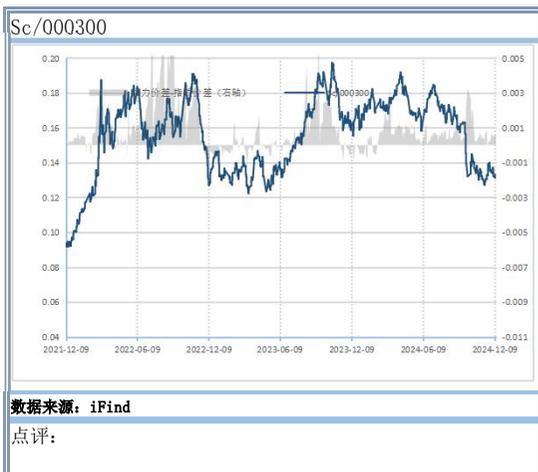
数据截止日：2024/12/11

期内最小值：0.0918

期内最大值：0.1972

期内平均值：0.1557

当前分位值：39.22%



数据起始日: 2019/12/11

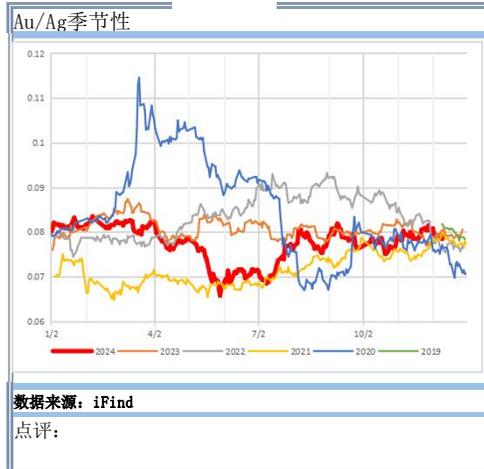
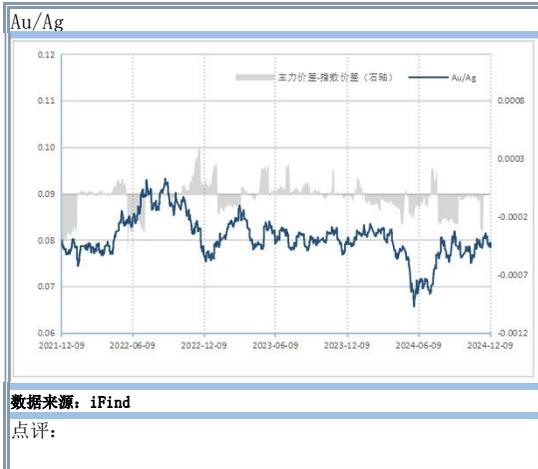
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 0.0657

期内最大值: 0.0932

期内平均值: 0.0805

当前分位值: 49.18%



数据起始日: 2019/12/11

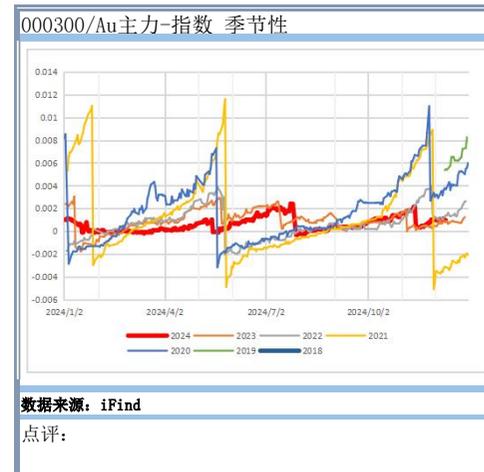
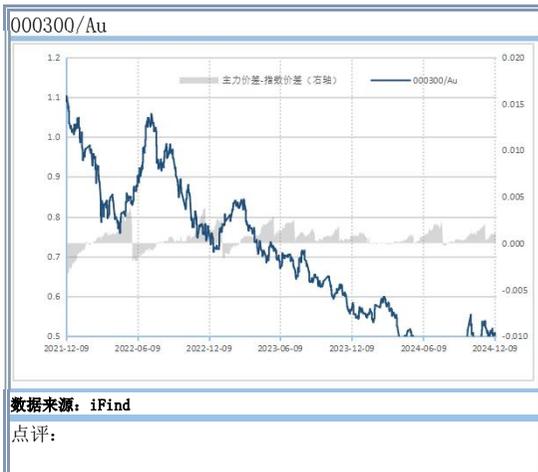
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 0.4165

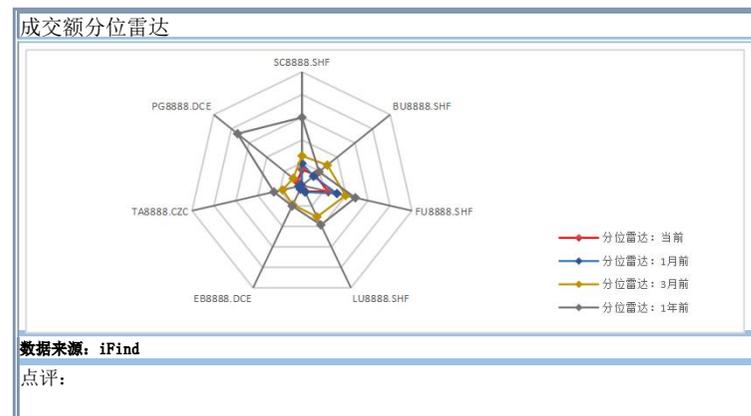
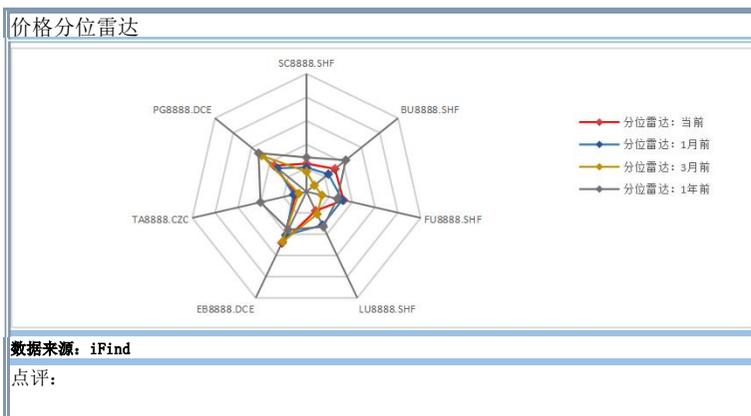
期内最大值: 1.1021

期内平均值: 0.7005

当前分位值: 12.62%



二、原油相关



数据起始日: 2019/12/11

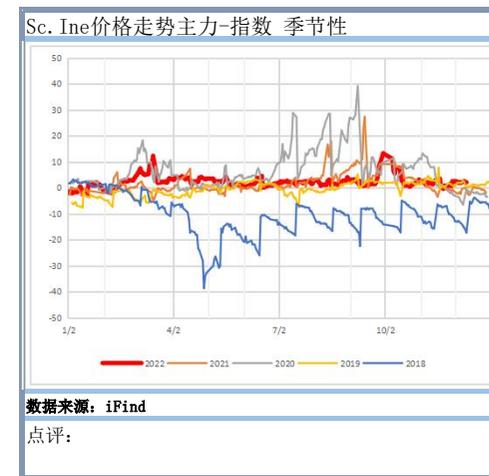
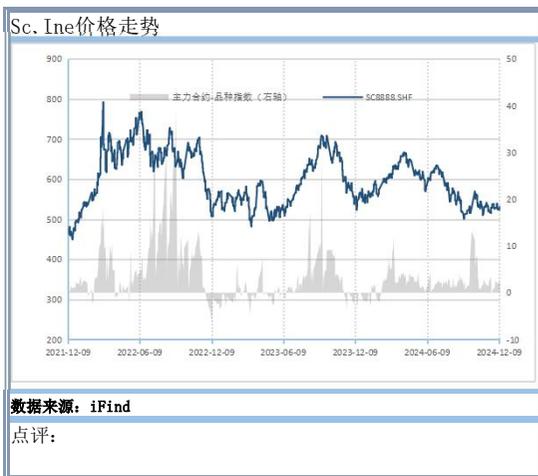
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 449.6

期内最大值: 791.6

期内平均值: 597.9207

当前分位值: 23.80%



数据起始日: 2019/12/11

数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 2872

期内最大值: 4794

期内平均值: 3691.3237

当前分位值: 31.01%

Bu. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

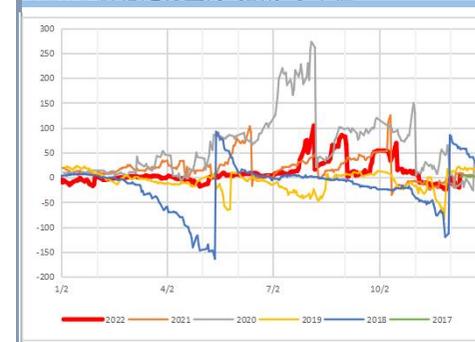
Bu. SHFE价格走势季节性



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: 2019/12/11

数据截止日: 2024/12/11

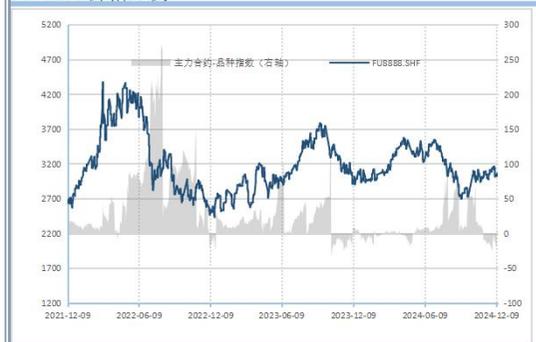
期内最小值: 2432

期内最大值: 4371

期内平均值: 3177.7586

当前分位值: 32.39%

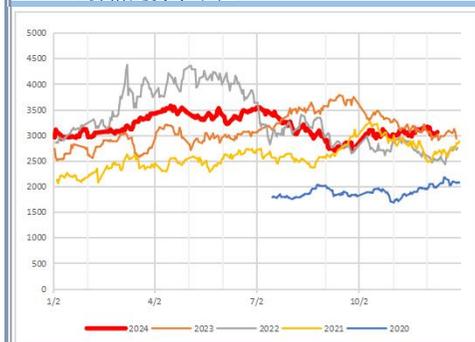
Fu. SHFE价格走势



数据来源: iFind

点评:

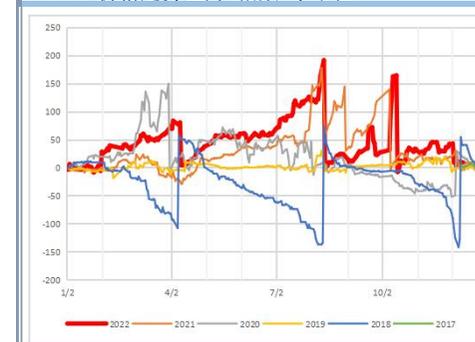
Fu. SHFE价格走势季节性



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: 2024/12/11

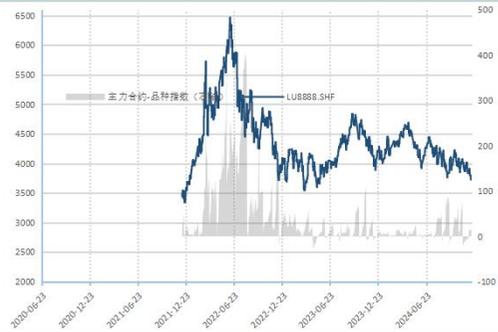
期内最小值: 3544

期内最大值: 4834

期内平均值: 4178.0988

当前分位值: 17.98%

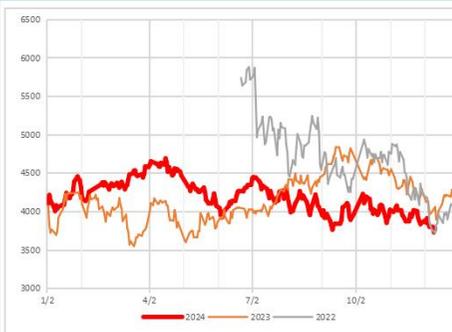
Lu. Ine价格走势



数据来源: iFind

点评:

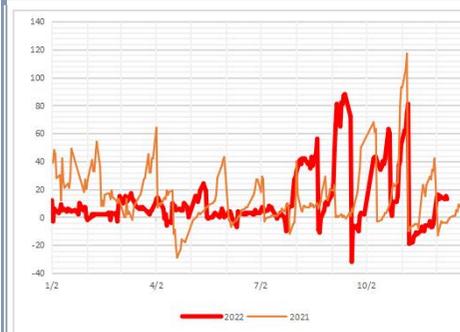
Lu. Ine价格走势季节性



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: 2024/12/11

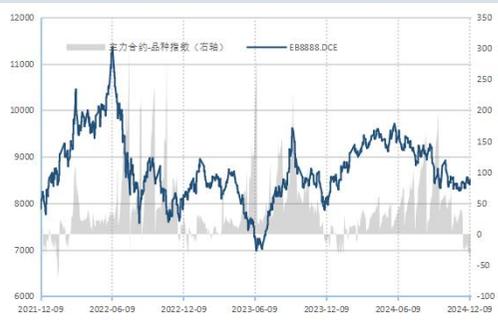
期内最小值: 6978

期内最大值: 10143

期内平均值: 8572.8336

当前分位值: 48.21%

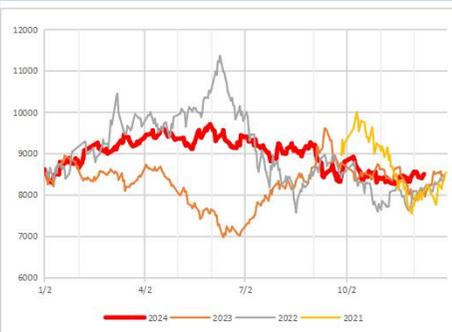
EB. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

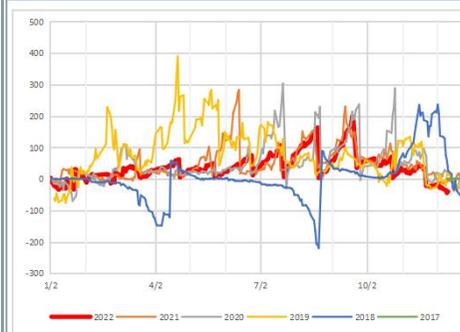
EB. DCE价格走势季节性



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： 2019/12/11

数据截止日： 2024/12/11

期内最小值： 4551

期内最大值： 7488

期内平均值： 5689.4678

当前分位值： 9.09%



数据起始日： 2020/3/30

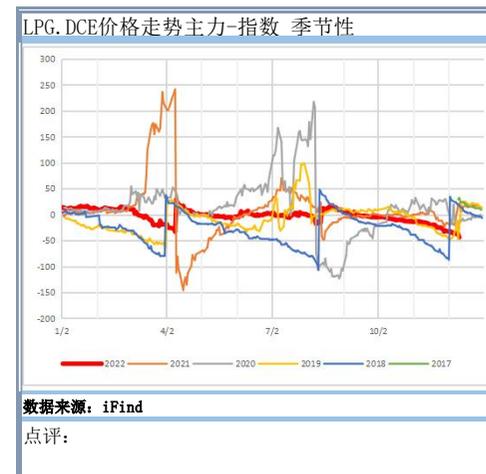
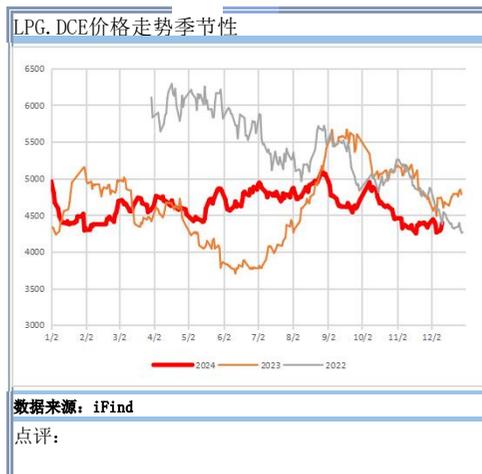
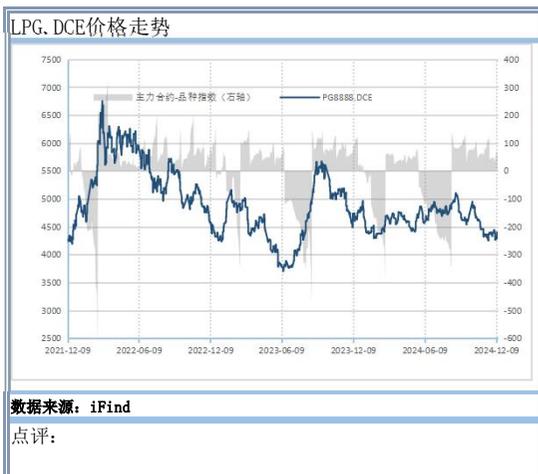
数据截止日： 2024/12/11

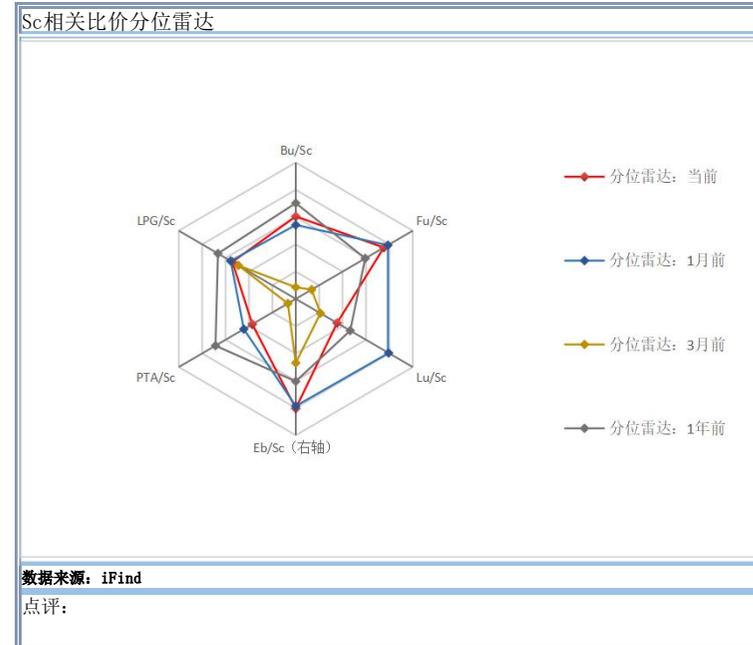
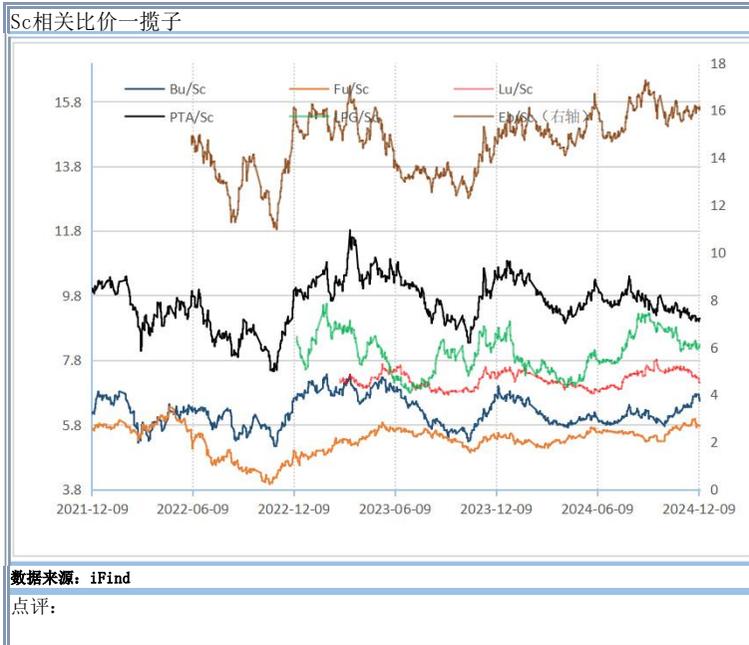
期内最小值： 3704

期内最大值： 5665

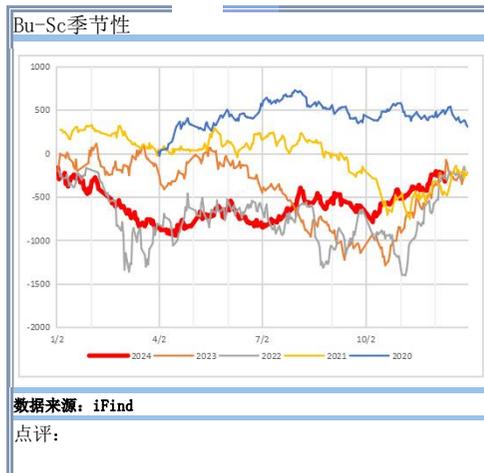
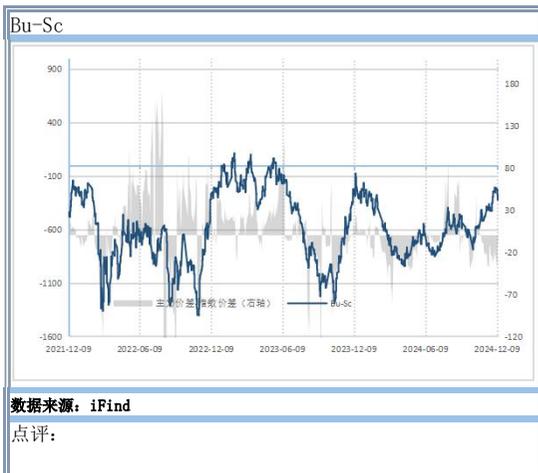
期内平均值： 4625.8714

当前分位值： 35.29%





数据起始日: 2019/12/11
 数据截止日: 2024/12/11
 期内最小值: -1406.4286
 期内最大值: 111.1429
 期内平均值: -579.5385
 当前分位值: 71.27%



数据起始日: 2019/12/11

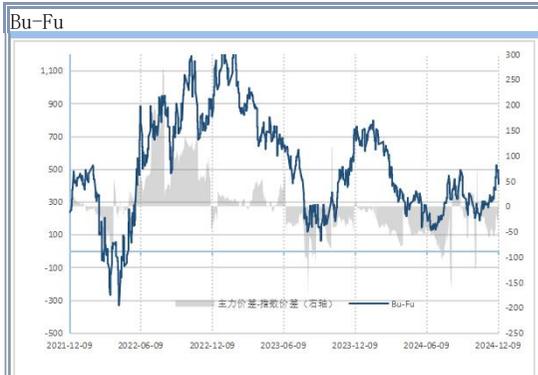
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: -331.0000

期内最大值: 1284.0000

期内平均值: 513.5652

当前分位值: 45.76%



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: 2021/12/4

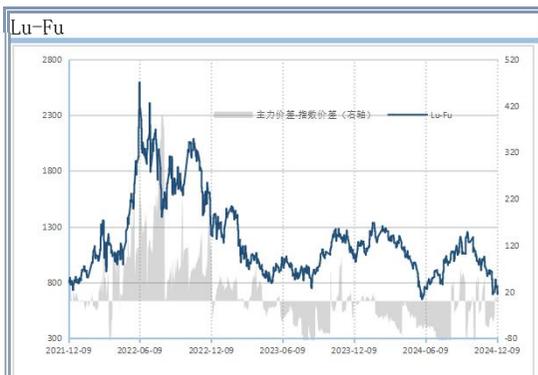
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 650.0000

期内最大值: 1334.0000

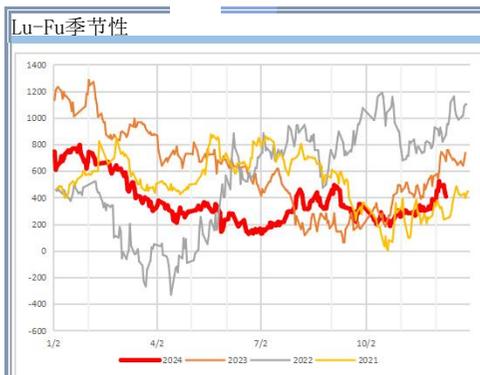
期内平均值: 1006.3482

当前分位值: 9.65%



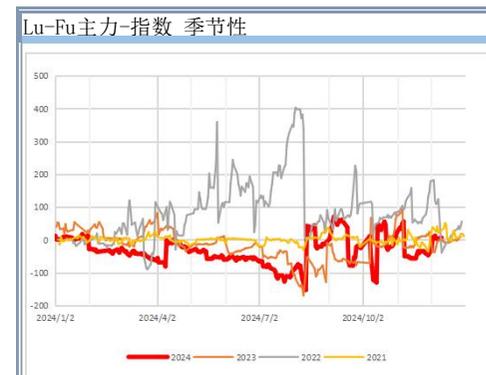
数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:



数据来源: iFind

点评:

数据起始日： 2021/10/9

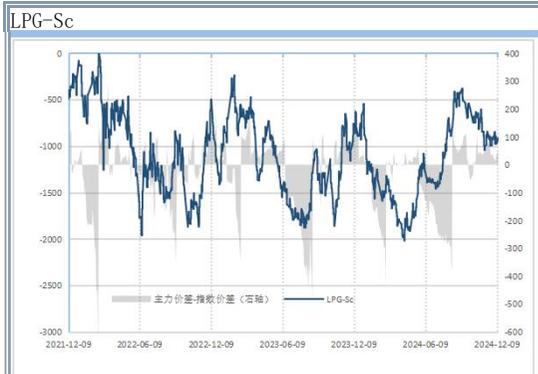
数据截止日： 2024/12/11

期内最小值： -2017.0000

期内最大值： -240.0000

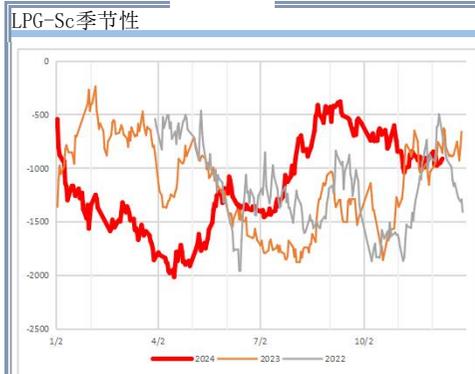
期内平均值： -1158.8714

当前分位值： 62.07%



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： 2019/12/11

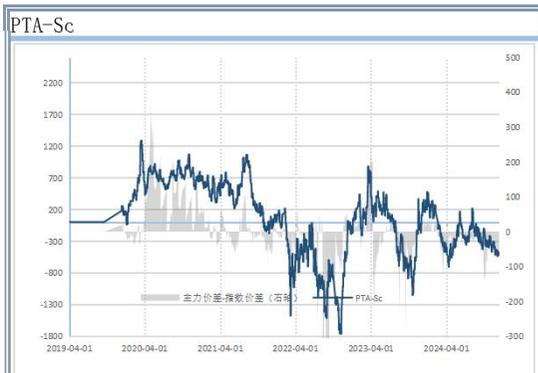
数据截止日： 2024/12/11

期内最小值： -1762.0000

期内最大值： 876.0000

期内平均值： -289.7394

当前分位值： 48.14%



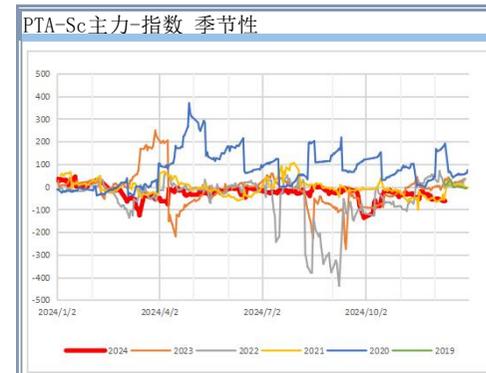
数据来源： iFind

点评：



数据来源： iFind

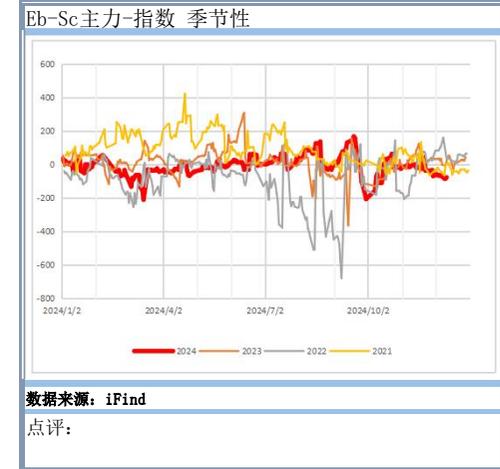
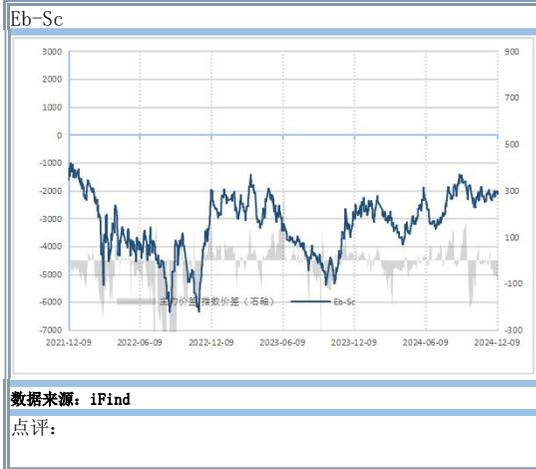
点评：



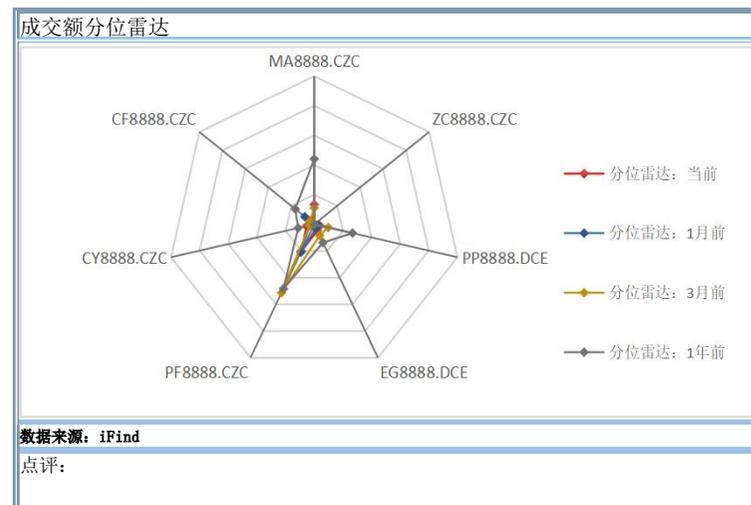
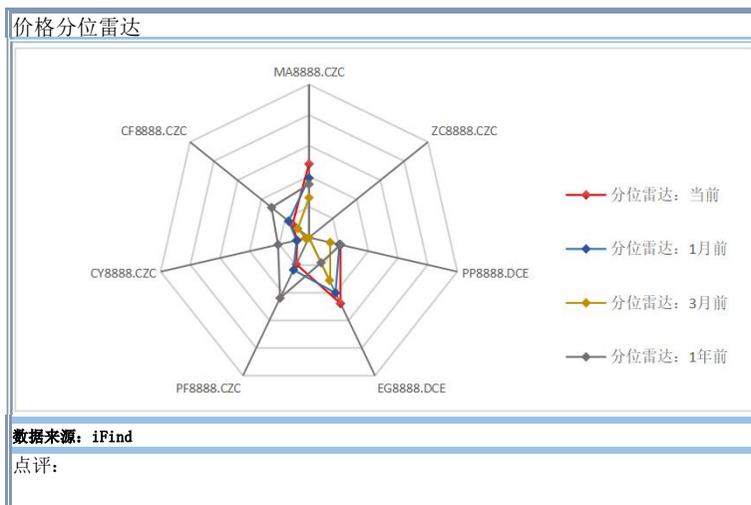
数据来源： iFind

点评：

数据起始日: #N/A
 数据截止日: 2024/12/11
 期内最小值: -6347.0000
 期内最大值: -1429.0000
 期内平均值: -3276.8869
 当前分位值: 86.03%



三、煤化工相关



数据起始日: 2019/12/11

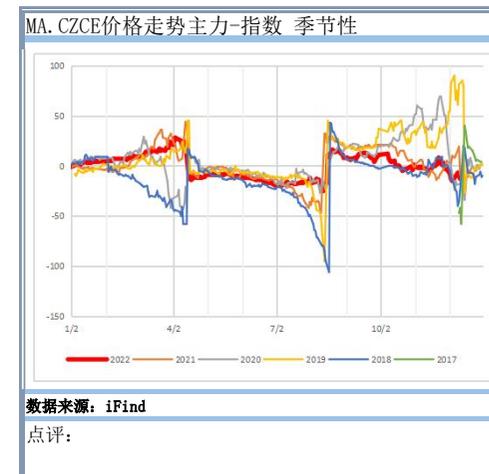
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 1982

期内最大值: 3272

期内平均值: 2536.2702

当前分位值: 48.06%



PP. DCE价格走势

数据起始日: 2019/12/11

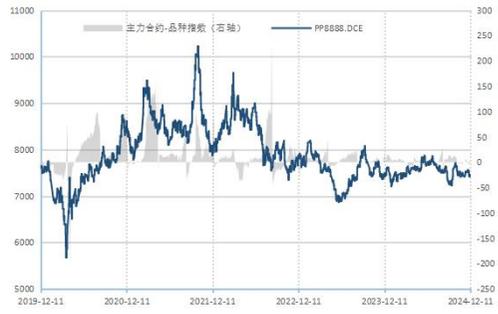
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 6865

期内最大值: 9649

期内平均值: 7774.6708

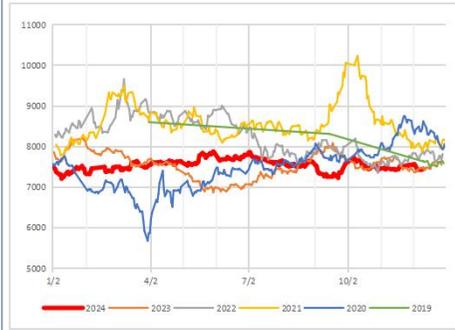
当前分位值: 21.16%



数据来源: iFind

点评:

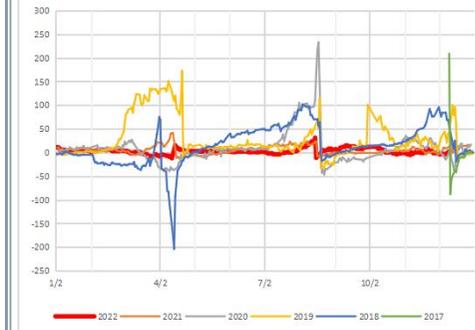
PP. DCE价格走势季节性



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: 2019/12/11

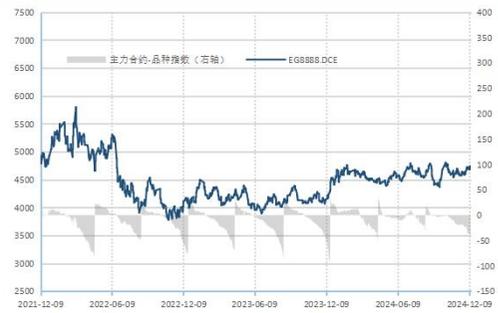
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 3778

期内最大值: 5798

期内平均值: 4464.3484

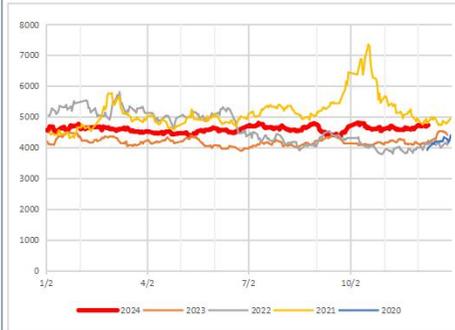
当前分位值: 47.72%



数据来源: iFind

点评:

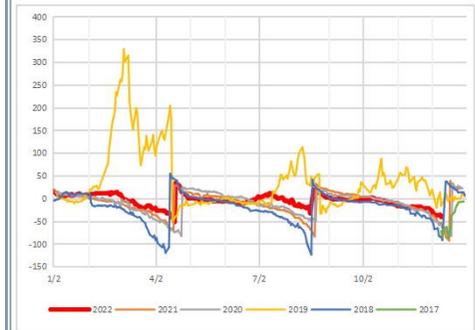
EG. CZCE价格走势季节性



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: 2024/12/11

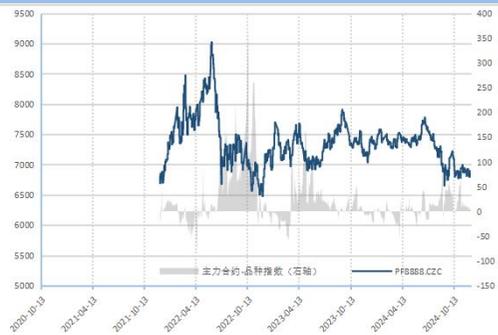
期内最小值: 6652

期内最大值: 7907

期内平均值: 7313.4986

当前分位值: 19.28%

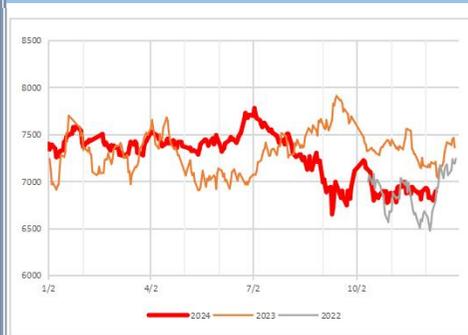
PF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

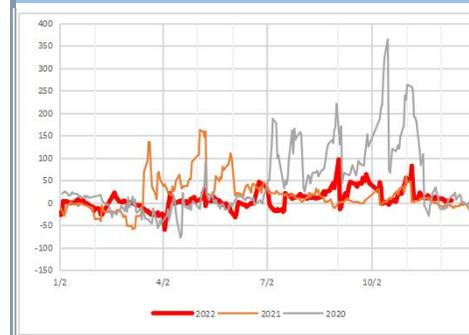
PF. CZCE价格走势季节性



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: 2019/12/11

数据截止日: 2024/12/11

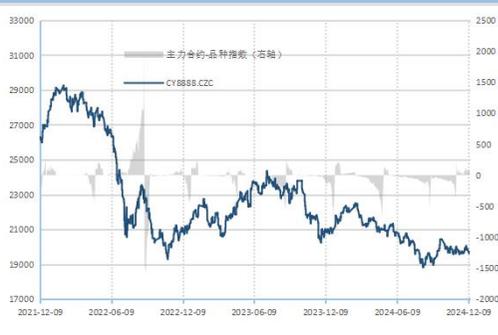
期内最小值: 18830

期内最大值: 29253

期内平均值: 22570.6255

当前分位值: 7.98%

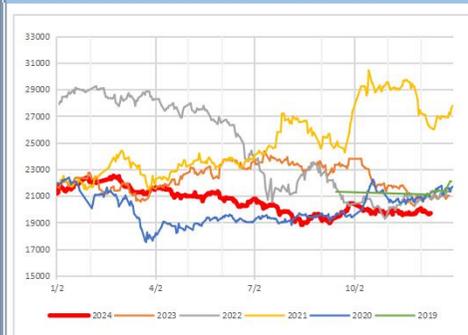
CY. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

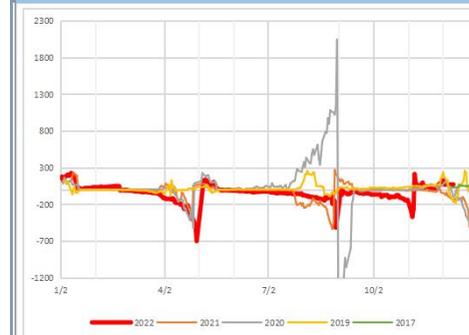
CY. CZCE价格走势季节性



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: 2019/12/11

数据截止日: 2024/12/11

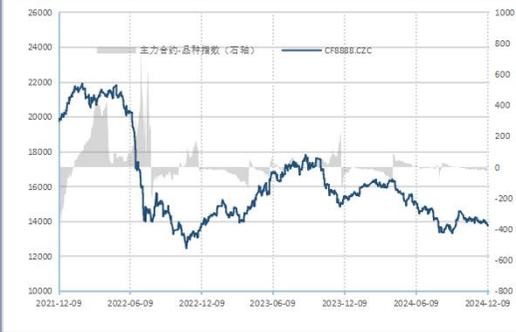
期内最小值: 12447

期内最大值: 21897

期内平均值: 16136.2936

当前分位值: 13.88%

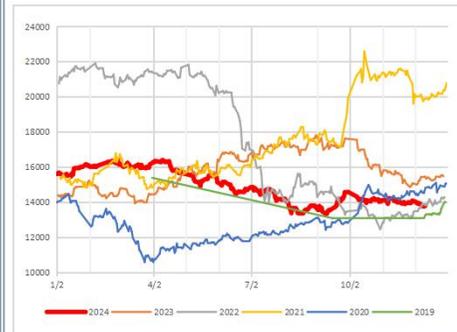
CF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

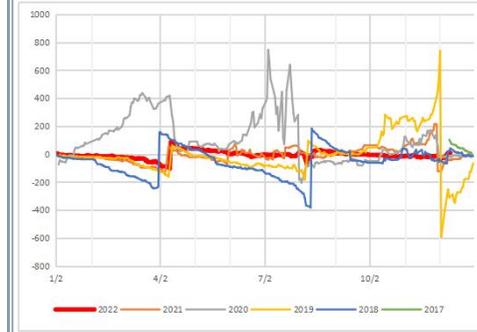
CF. CZCE价格走势季节性



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: 2019/12/11

数据截止日: 2024/12/11

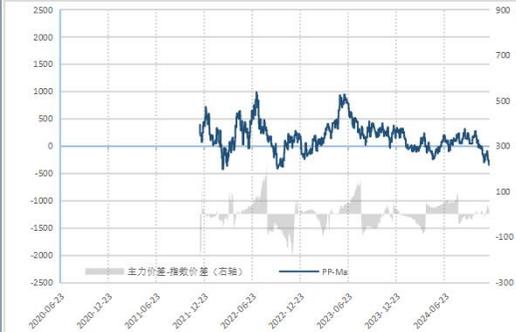
期内最小值: -427.0000

期内最大值: 982.0000

期内平均值: 165.8601

当前分位值: 5.32%

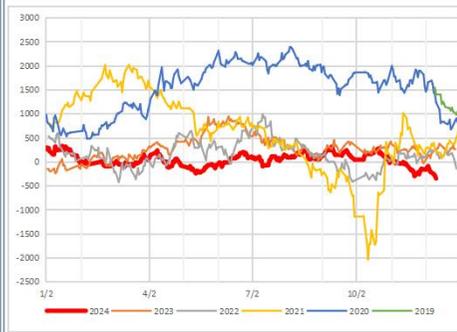
PP-Ma



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: 2019/12/11

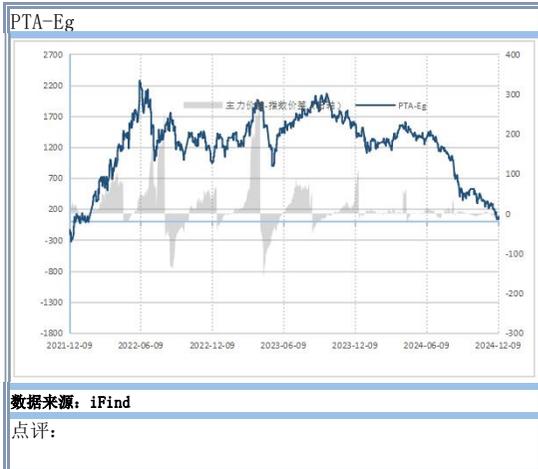
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: -323.0000

期内最大值: 2269.0000

期内平均值: 1225.1193

当前分位值: 15.39%



数据起始日: 2022/2/14

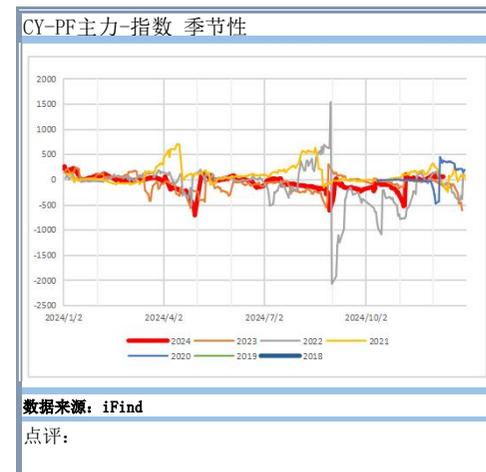
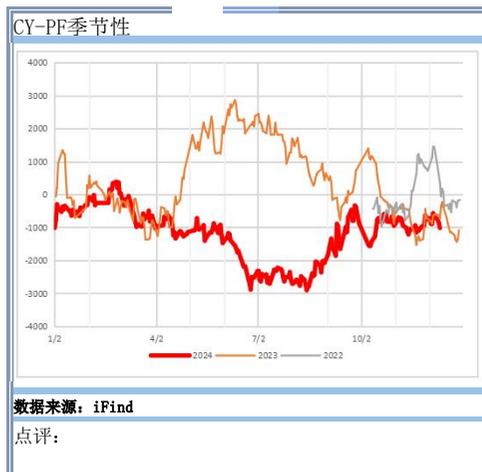
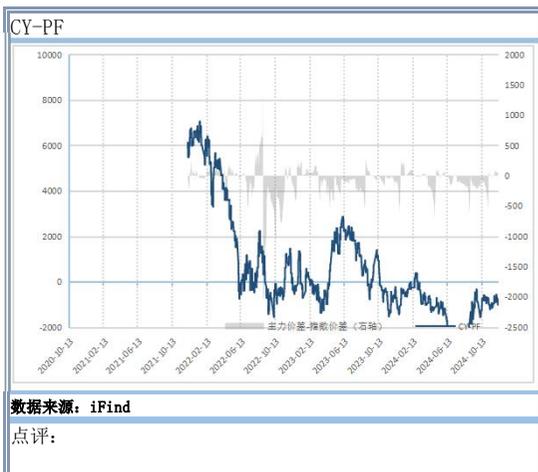
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: -2902.0000

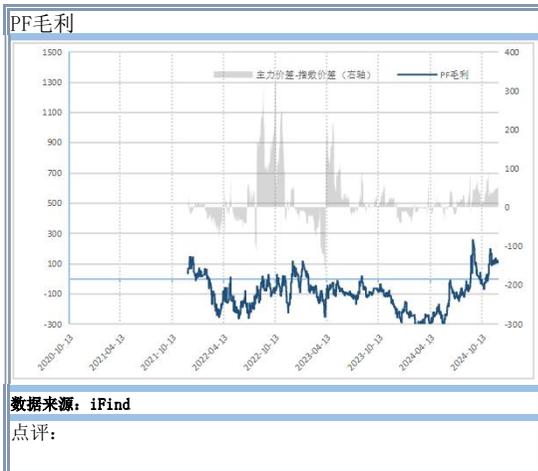
期内最大值: 2440.0000

期内平均值: -688.2040

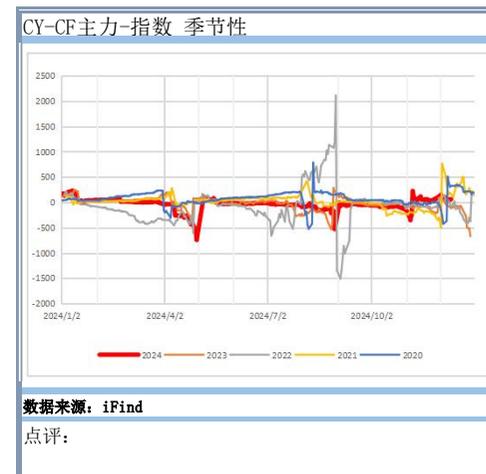
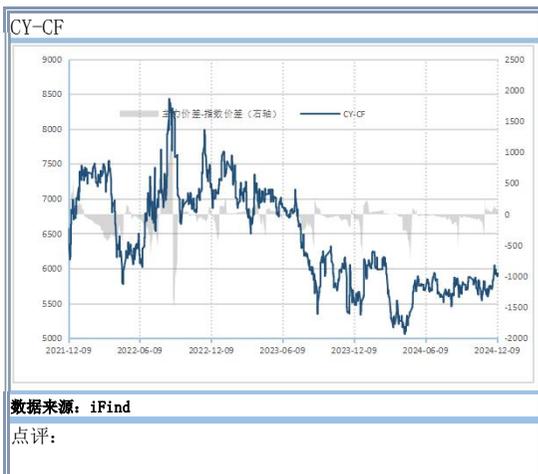
当前分位值: 35.23%



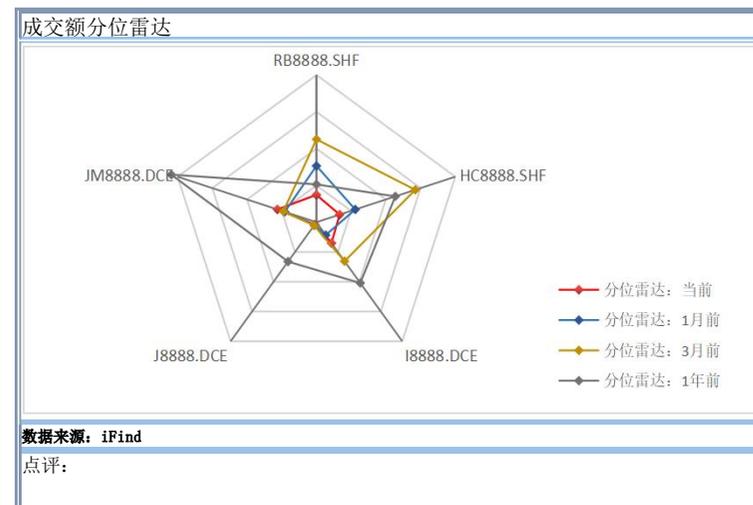
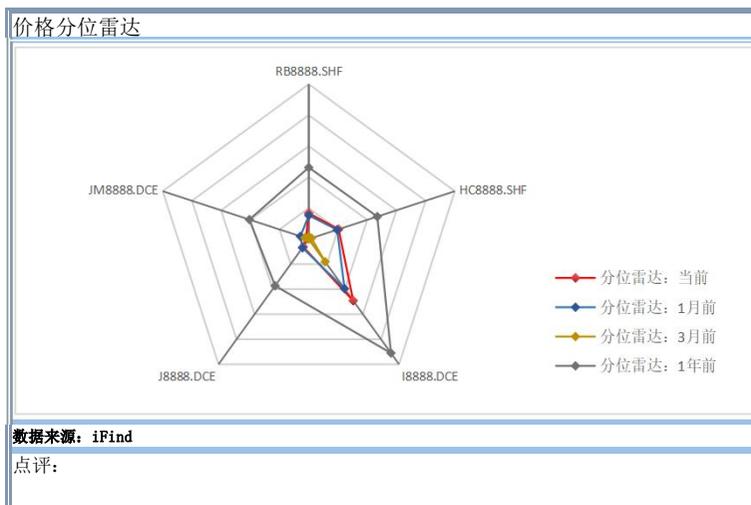
数据起始日: 2023/6/30
 数据截止日: 2024/12/11
 期内最小值: -328.9900
 期内最大值: 253.8400
 期内平均值: -121.3470
 当前分位值: 74.64%



数据起始日: 2019/12/11
 数据截止日: 2024/12/11
 期内最小值: 5061.0000
 期内最大值: 8428.0000
 期内平均值: 6434.3320
 当前分位值: 25.01%



四、黑色相关



数据起始日：2019/12/11

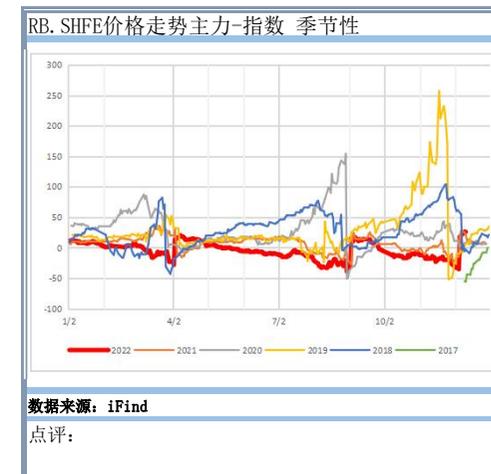
数据截止日：2024/12/11

期内最小值：3034

期内最大值：5154

期内平均值：3897.8738

当前分位值：16.65%



HC. SHFE价格走势

数据起始日: 2019/12/11

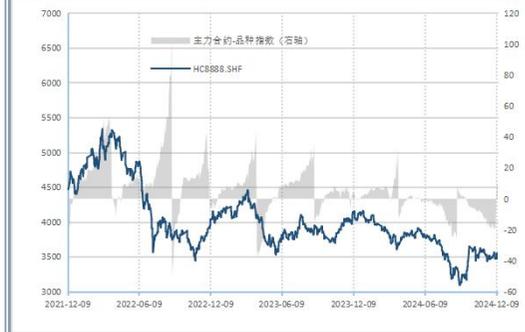
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 3093

期内最大值: 5333

期内平均值: 4013.1907

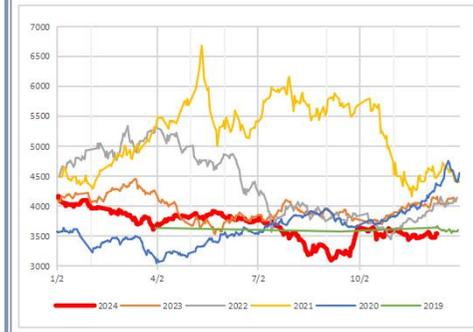
当前分位值: 20.45%



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: 2019/12/11

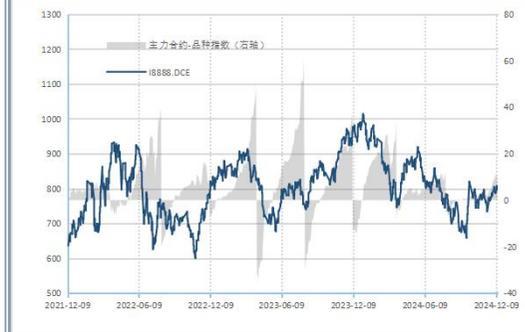
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 600.1

期内最大值: 1013.6

期内平均值: 802.4627

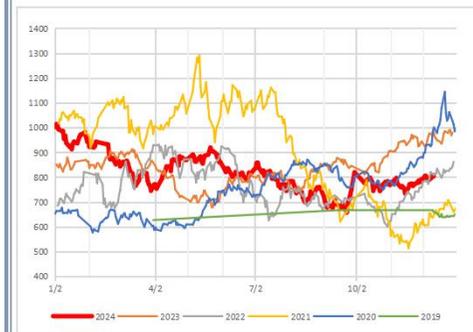
当前分位值: 49.17%



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:

J. DCE价格走势

数据起始日: 2019/12/11

数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 1775.4

期内最大值: 4117.7

期内平均值: 2565.8428

当前分位值: 6.22%



数据来源: iFind

点评:

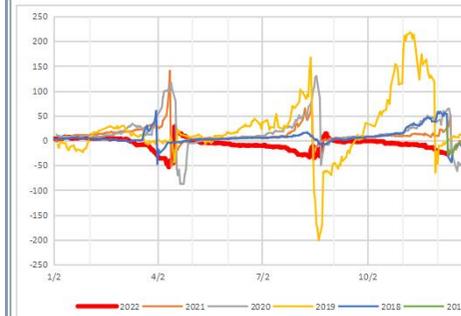
J. DCE价格走势季节性



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:

Jm. DCE价格走势

数据起始日: 2019/12/11

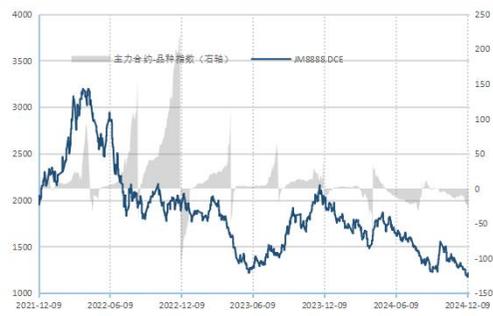
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 1175.1

期内最大值: 3196.2

期内平均值: 1862.8509

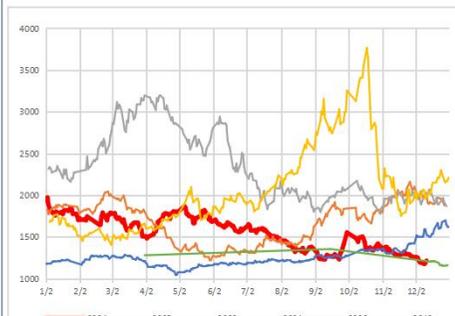
当前分位值: 1.97%



数据来源: iFind

点评:

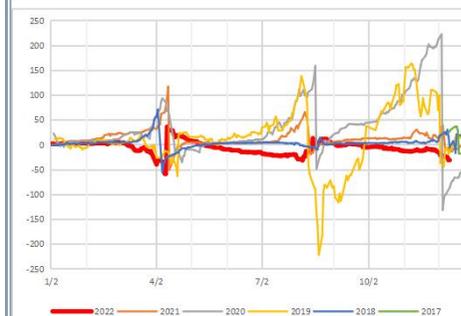
Jm. DCE价格走势季节性



数据来源: iFind

点评:

Jm. DCE价格走势主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/12/11

数据截止日: 2024/12/11

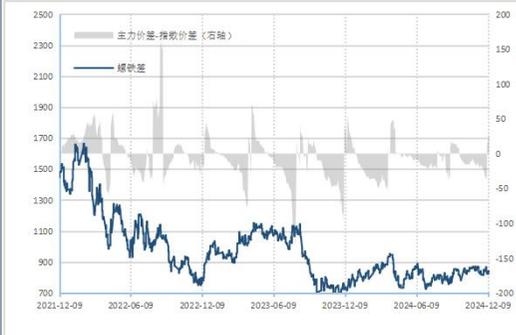
期内最小值: 670.1176

期内最大值: 1664.5294

期内平均值: 972.4439

当前分位值: 17.00%

螺铁差



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/12/11

数据截止日: 2024/12/11

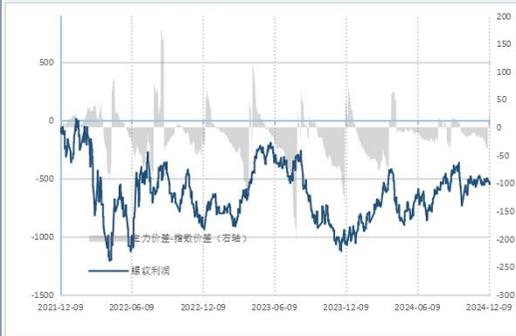
期内最小值: -1206.9091

期内最大值: 12.4545

期内平均值: -623.2452

当前分位值: 53.83%

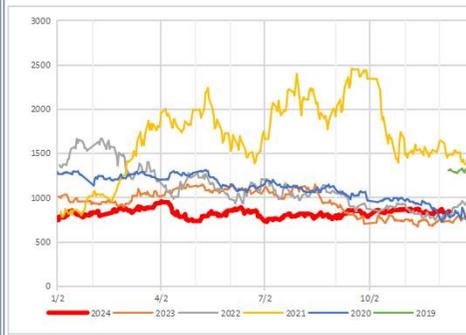
螺纹利润



数据来源: iFind

点评:

螺铁差季节性



数据来源: iFind

点评:

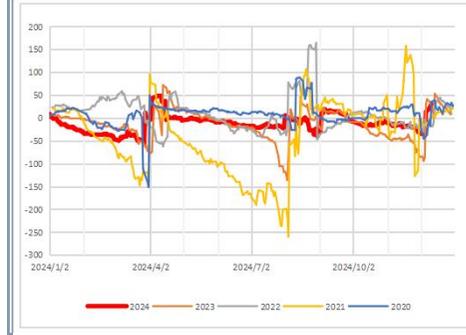
螺纹利润季节性



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: 2019/12/11

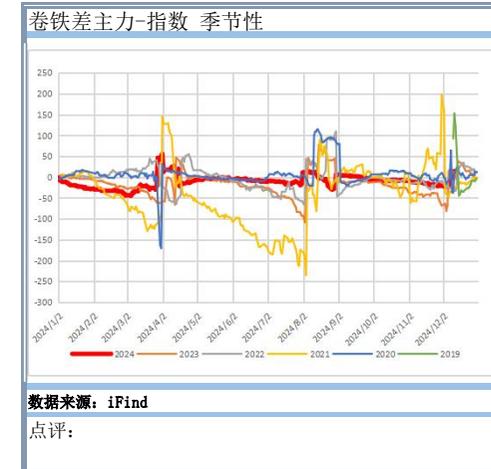
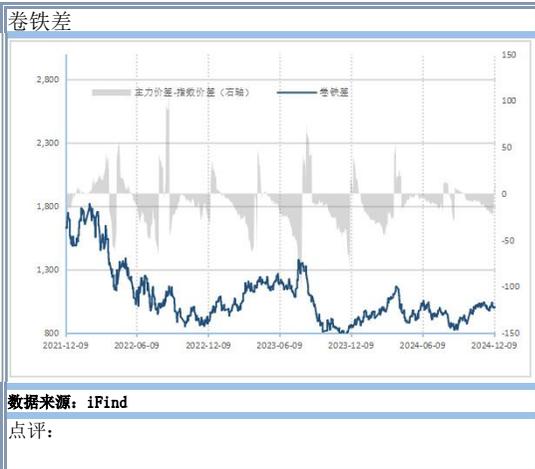
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 752.4706

期内最大值: 1818.2941

期内平均值: 1087.7608

当前分位值: 23.52%



数据起始日: 2019/12/11

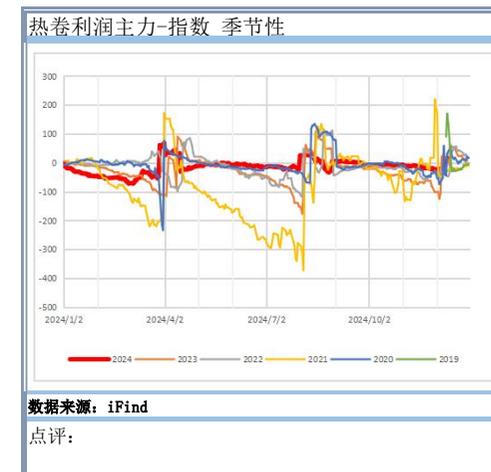
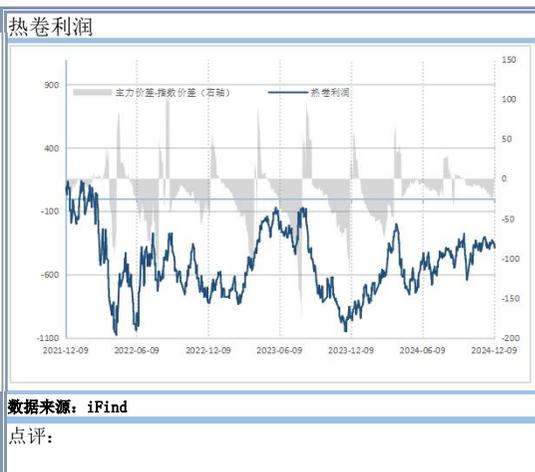
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: -1073.7273

期内最大值: 137.4545

期内平均值: -507.9283

当前分位值: 56.74%



数据起始日: 2019/12/11

数据截止日: 2024/12/11

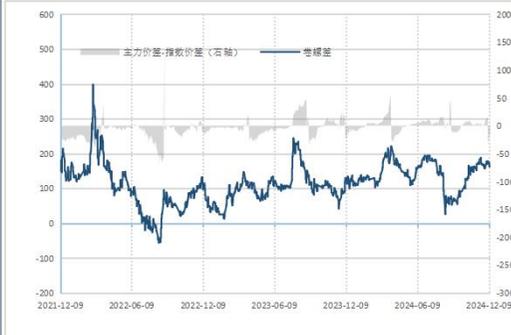
期内最小值: -56.0000

期内最大值: 398.0000

期内平均值: 115.3169

当前分位值: 48.46%

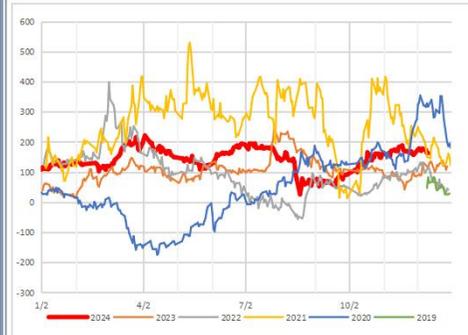
卷螺差



数据来源: iFind

点评:

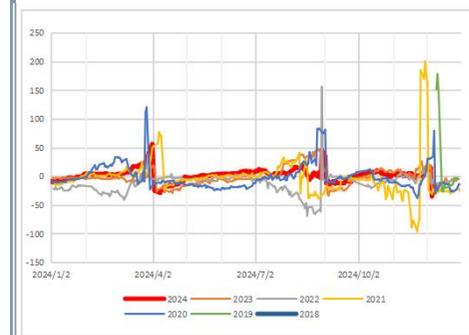
卷螺差季节性



数据来源: iFind

点评:

卷螺差主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/12/11

数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 3.9880

期内最大值: 6.9356

期内平均值: 4.8960

当前分位值: 7.73%

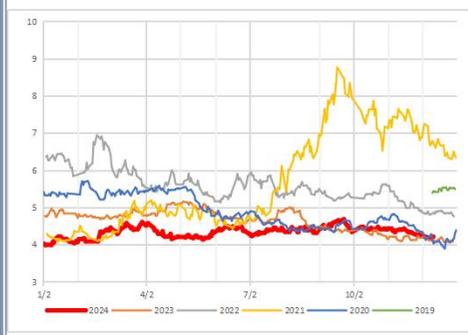
螺矿比



数据来源: iFind

点评:

螺矿比季节性



数据来源: iFind

点评:

螺矿比主力-指数 季节性



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2019/12/11

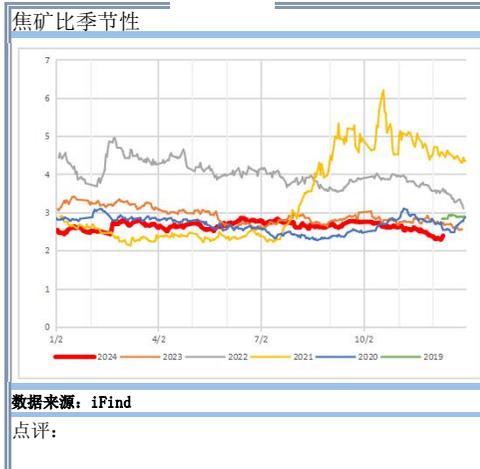
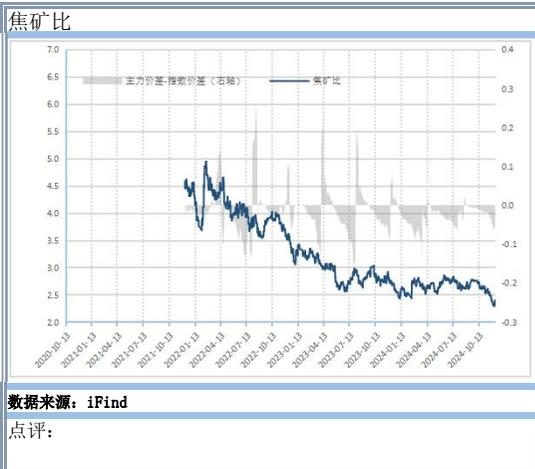
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 2.2894

期内最大值: 4.9436

期内平均值: 3.2231

当前分位值: 3.84%



数据起始日: 2019/12/11

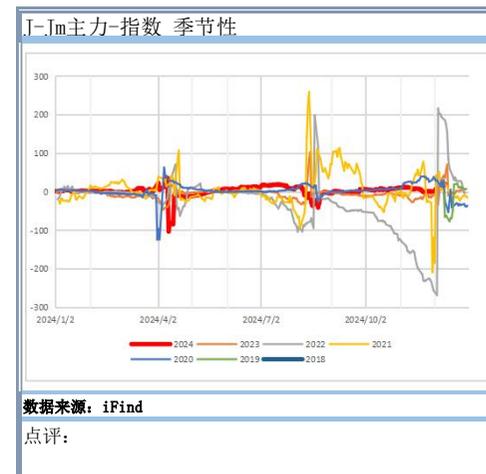
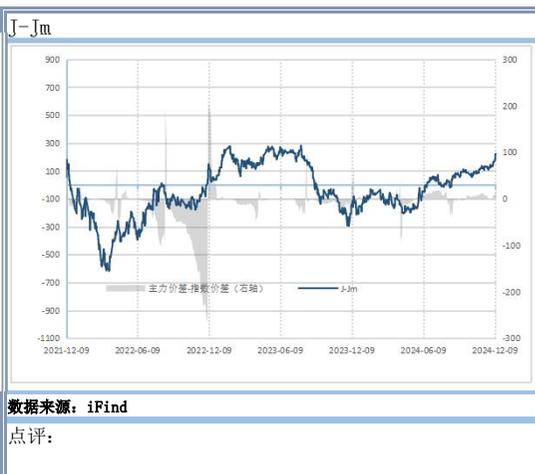
数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: -617.4400

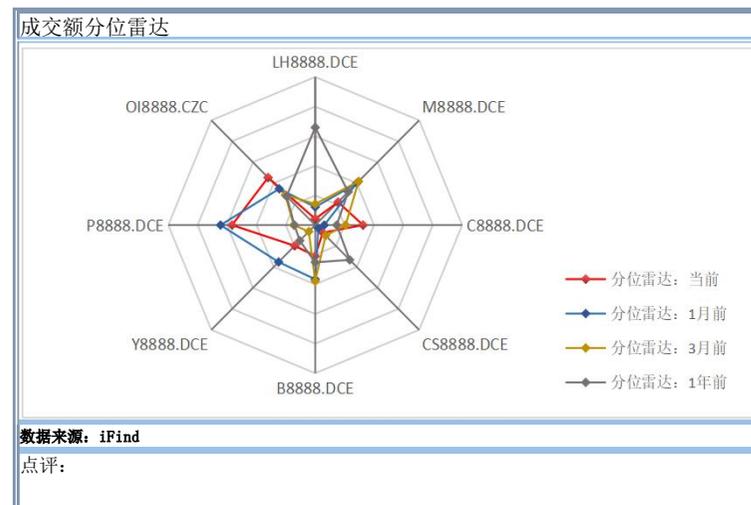
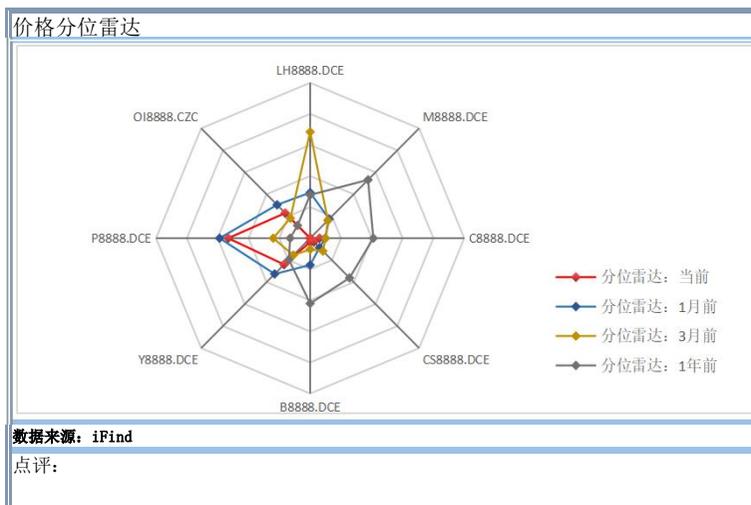
期内最大值: 279.1600

期内平均值: -42.1484

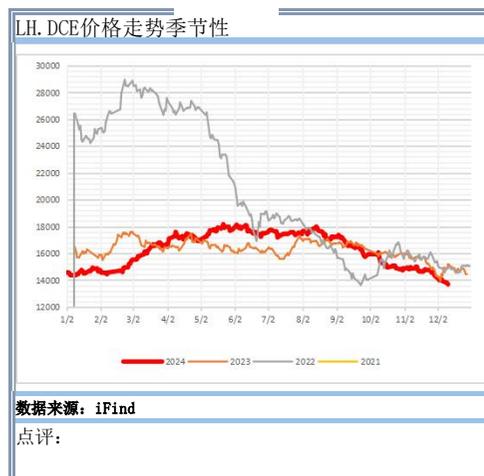
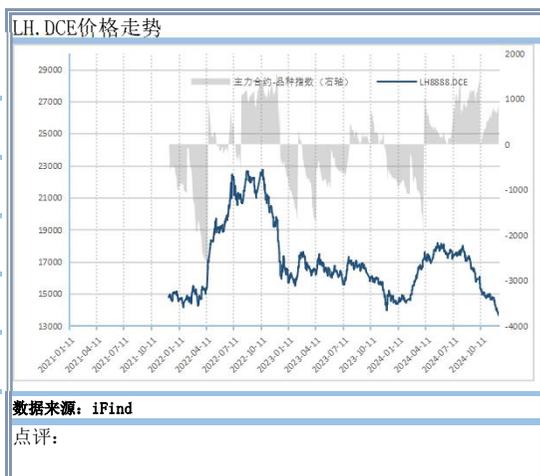
当前分位值: 93.43%



五、农产品相关



数据起始日: 2021/1/8
数据截止日: 2024/12/11
期内最小值: 13677
期内最大值: 18158
期内平均值: 16098.7793
当前分位值: 0.00%



数据起始日：2019/12/11

数据截止日：2024/12/11

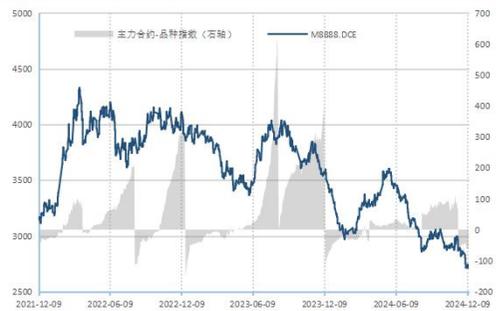
期内最小值：2711

期内最大值：4328

期内平均值：3584.5885

当前分位值：0.00%

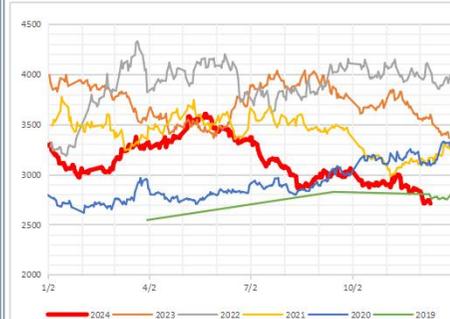
M. DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

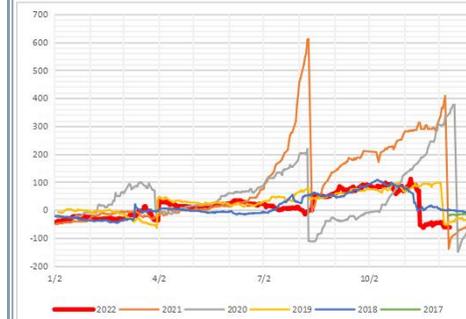
M. DCE价格走势季节性



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：2019/12/11

数据截止日：2024/12/11

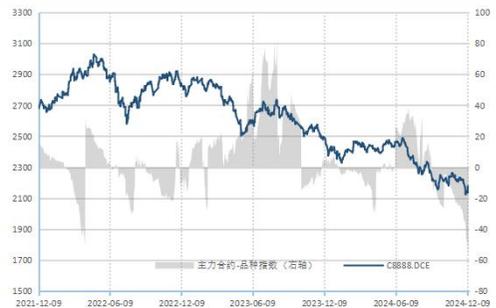
期内最小值：2124

期内最大值：3027

期内平均值：2616.4938

当前分位值：6.09%

C. DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

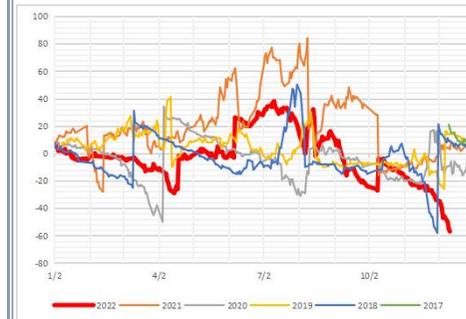
C. DCE价格走势季节性



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： 2019/12/11

数据截止日： 2024/12/11

期内最小值： 2496

期内最大值： 3512

期内平均值： 2970.3498

当前分位值： 3.35%

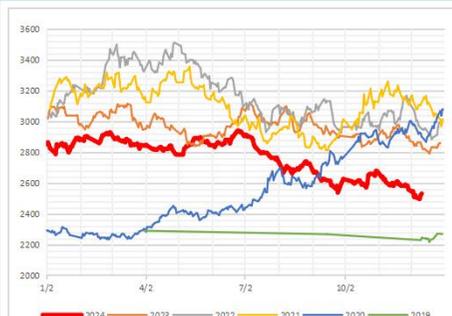
CS. DCE价格走势



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： 2019/12/11

数据截止日： 2024/12/11

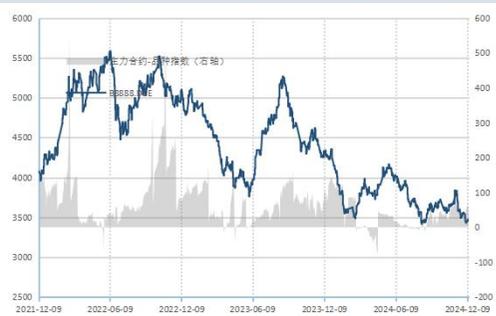
期内最小值： 3417

期内最大值： 5585

期内平均值： 4414.3484

当前分位值： 2.49%

B. DCE价格走势



数据来源：iFind

点评：

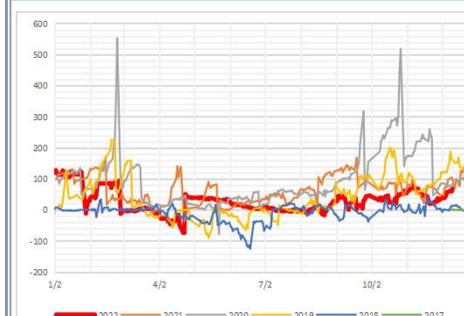
B. DCE价格走势季节性



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： 2019/12/11

数据截止日： 2024/12/11

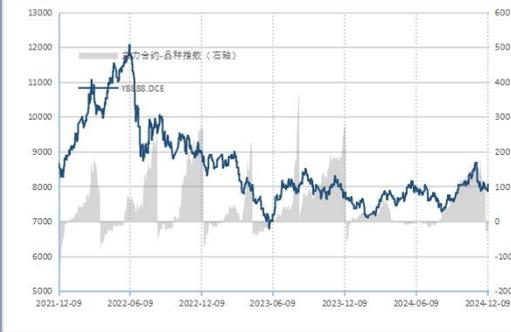
期内最小值： 6793

期内最大值： 12065

期内平均值： 8552.3429

当前分位数： 23.94%

Y. DCE价格走势



数据来源： iFind

点评：

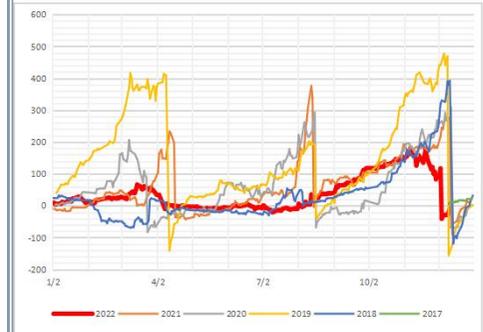
Y. DCE价格走势季节性



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： 2019/12/11

数据截止日： 2024/12/11

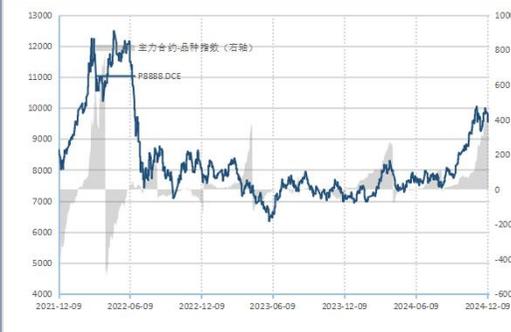
期内最小值： 6349

期内最大值： 12479

期内平均值： 8285.1509

当前分位数： 53.20%

P. DCE价格走势



数据来源： iFind

点评：

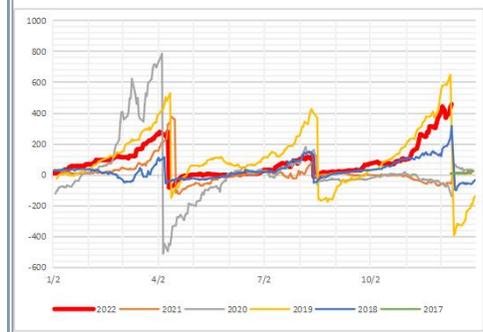
P. DCE价格走势季节性



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: 2019/12/11

数据截止日: 2024/12/11

期内最小值: 7475

期内最大值: 14344

期内平均值: 9837.4842

当前分位值: 22.89%

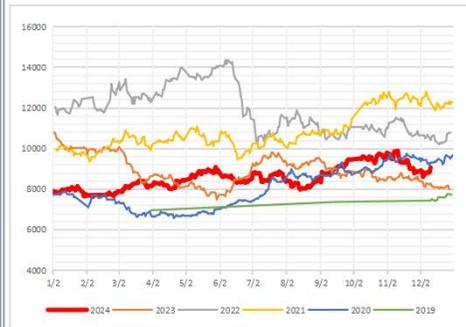
OI.CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

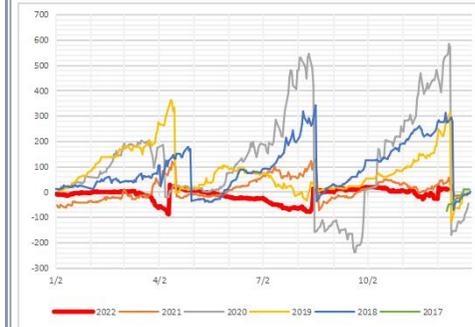
OI.CZCE价格走势季节性



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: 2022/4/18

数据截止日: 2024/12/11

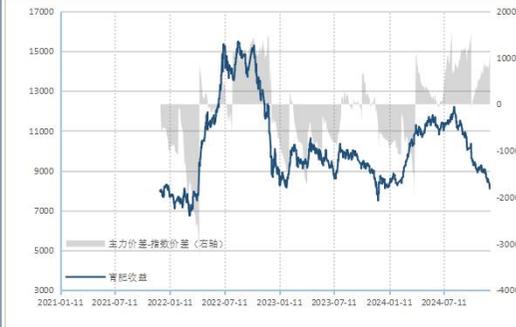
期内最小值: 7508.2500

期内最大值: 12199.0000

期内平均值: 9929.8086

当前分位值: 12.54%

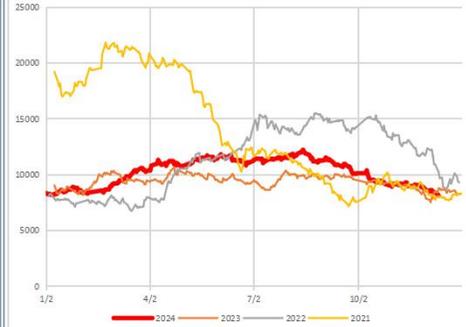
盲肥收益



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: 2024/12/11

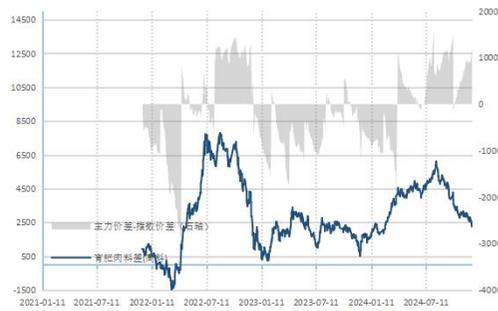
期内最小值: 515.0000

期内最大值: 6111.0000

期内平均值: 3330.9828

当前分位值: 31.00%

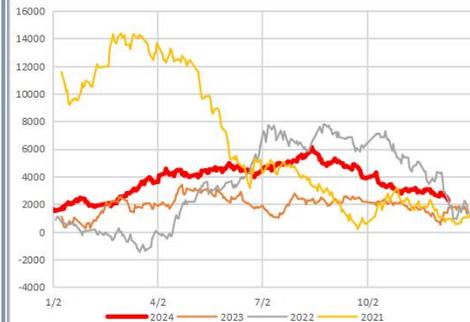
育肥肉料差(高料)



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: 2019/12/11

数据截止日: 2024/12/11

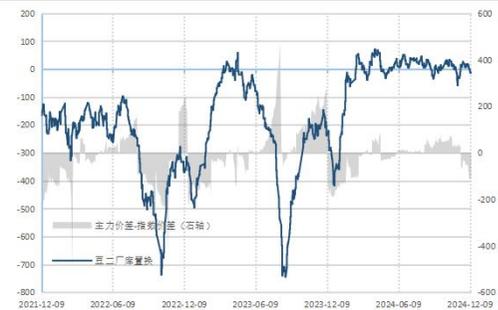
期内最小值: -745.0200

期内最大值: 71.2200

期内平均值: -178.2630

当前分位值: 89.72%

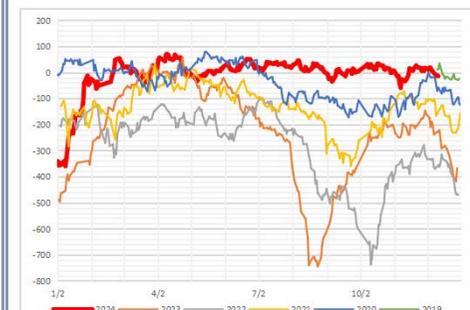
豆二厂库置换



数据来源: iFind

点评:

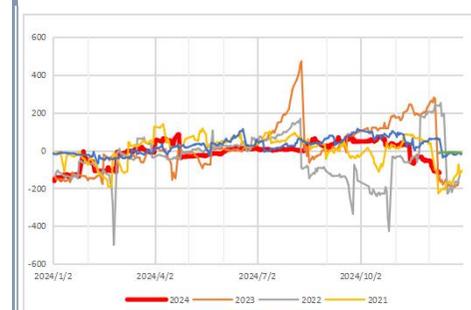
豆二厂库置换季节性



数据来源: iFind

点评:

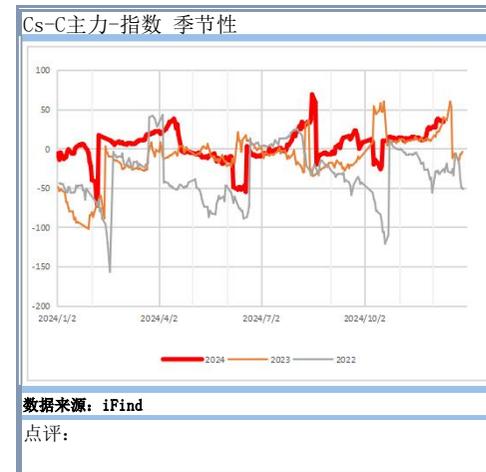
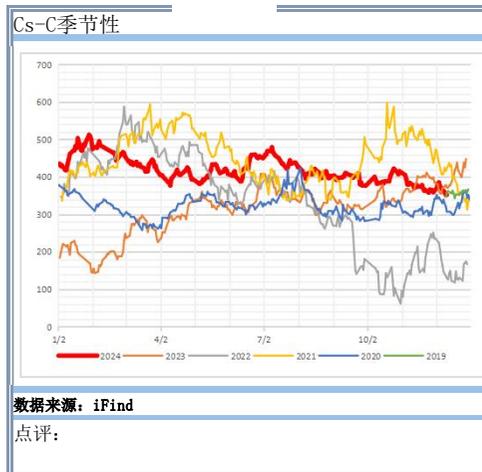
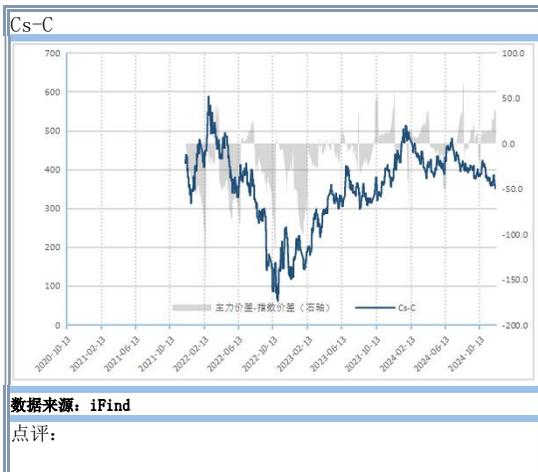
豆二厂库置换主力-指数 季节性



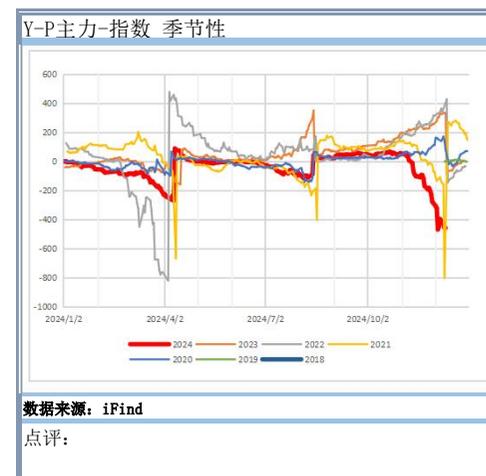
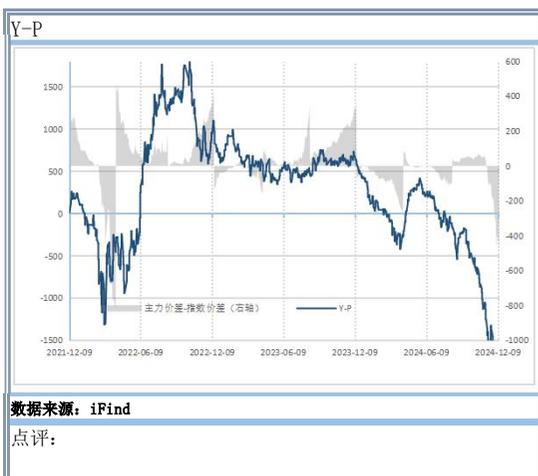
数据来源: iFind

点评:

数据起始日： 2019/12/11
 数据截止日： 2024/12/11
 期内最小值： 62.0000
 期内最大值： 587.0000
 期内平均值： 353.8560
 当前分位值： 55.05%



数据起始日： 2019/12/11
 数据截止日： 2024/12/11
 期内最小值： -2047.0000
 期内最大值： 1788.0000
 期内平均值： 267.1920
 当前分位值： 12.83%



数据起始日： 2019/12/11

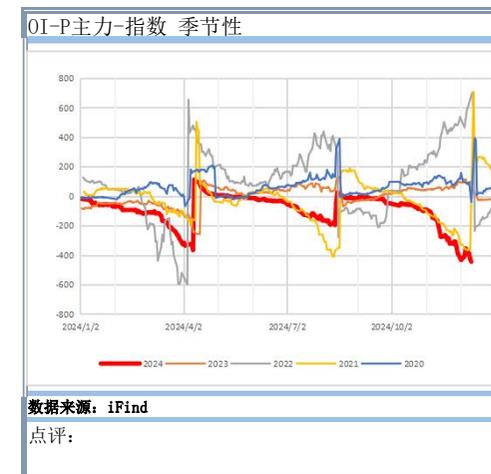
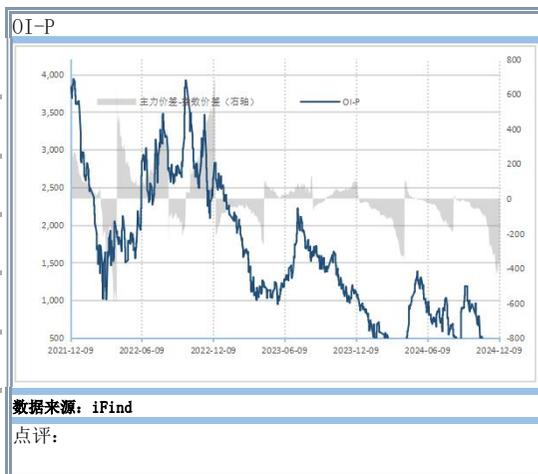
数据截止日： 2024/12/11

期内最小值： -1305.0000

期内最大值： 2220.0000

期内平均值： 861.5042

当前分位值： 21.05%



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。