

<http://www.shaninqh.com>

# 盘面套利观察

制作：强子益

2023年3月15日

投资咨询： Z0015283

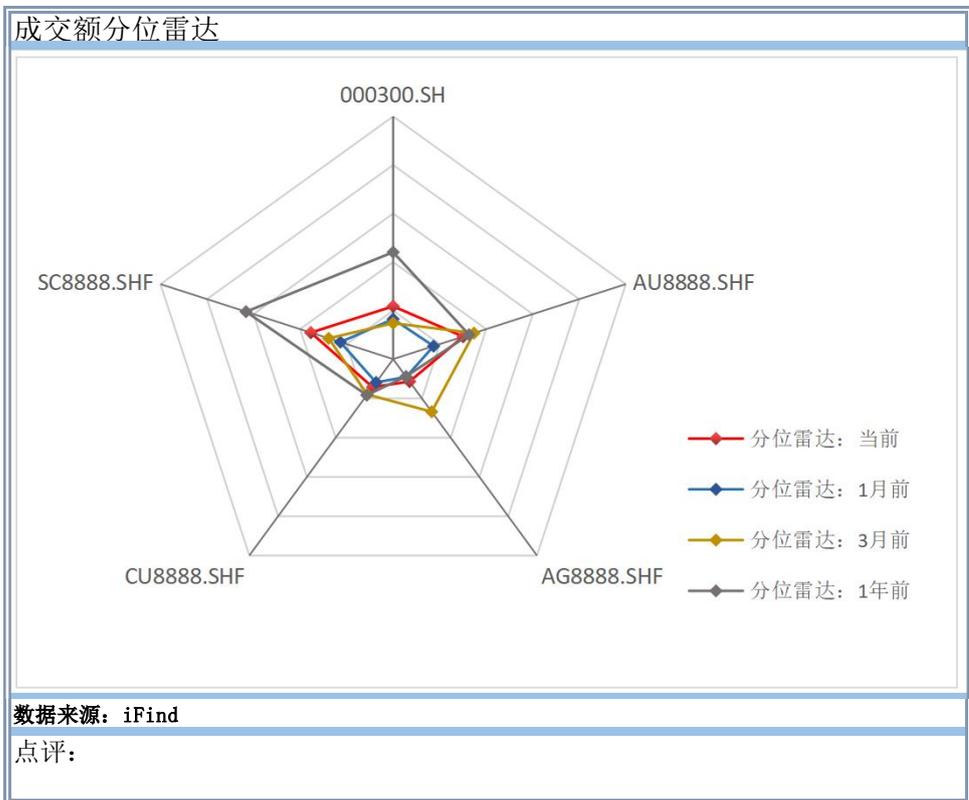
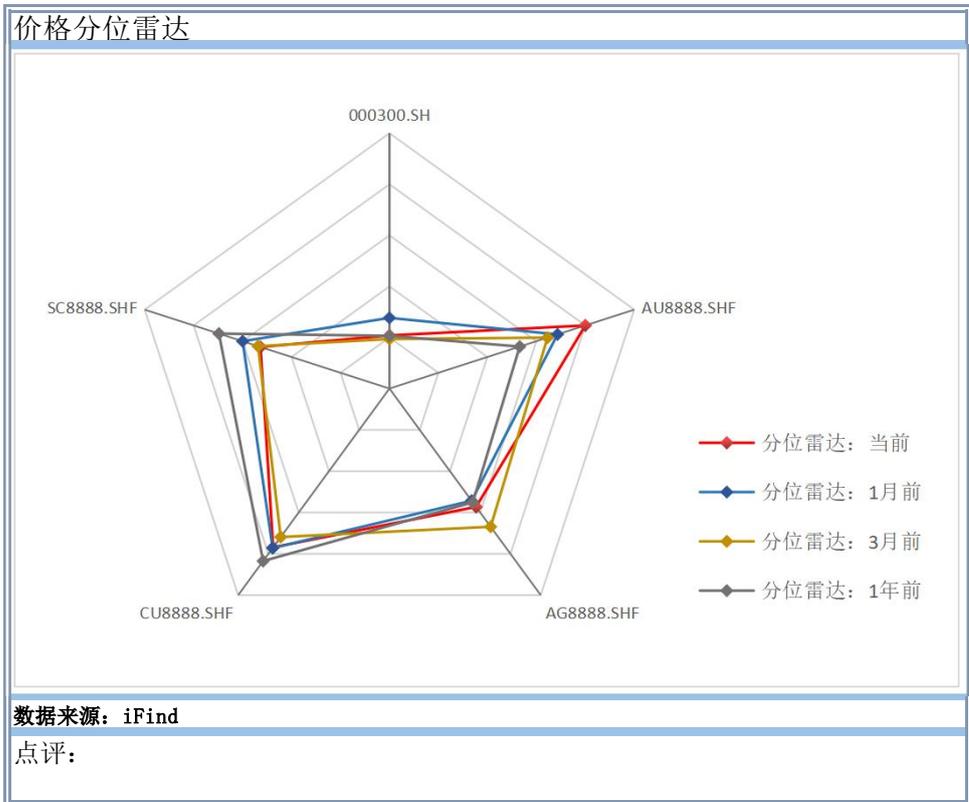
数据仅供参考，据此入市，风险自担。

邮箱： [qiangziyi@sd-gold.com](mailto:qiangziyi@sd-gold.com)

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



### 沪深300指数走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：3508.7034

期内最大值：5807.7191

期内平均值：4539.6218

当前分位值：19.41%



数据来源：iFind

点评：

### Au. SHFE价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：331.6

期内最大值：450.36

期内平均值：390.1425

当前分位值：80.02%



数据来源：iFind

点评：

### Cu. SHFE价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：37285

期内最大值：77934

期内平均值：62693.6967

当前分位值：76.88%



数据来源：iFind

点评：

### Sc. Ine价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：228.9

期内最大值：791.6

期内平均值：472.0650

当前分位值：52.69%



数据来源：iFind

点评：

### Cu/Au

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：7.5679

期内最大值：15.4319

期内平均值：12.6914

当前分位值：76.00%



数据来源：iFind

点评：

### Sc/Au

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：0.5769

期内最大值：1.9320

期内平均值：1.2113

当前分位值：48.31%



数据来源：iFind

点评：

### Sc/000300

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：0.0492

期内最大值：0.1908

期内平均值：0.1069

当前分位值：58.33%



数据来源：iFind

点评：

### Au/Ag

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：0.0648

期内最大值：0.1145

期内平均值：0.0796

当前分位值：39.29%



数据来源：iFind

点评：

### 000300/Au

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：0.7117

期内最大值：1.2183

期内平均值：0.9194

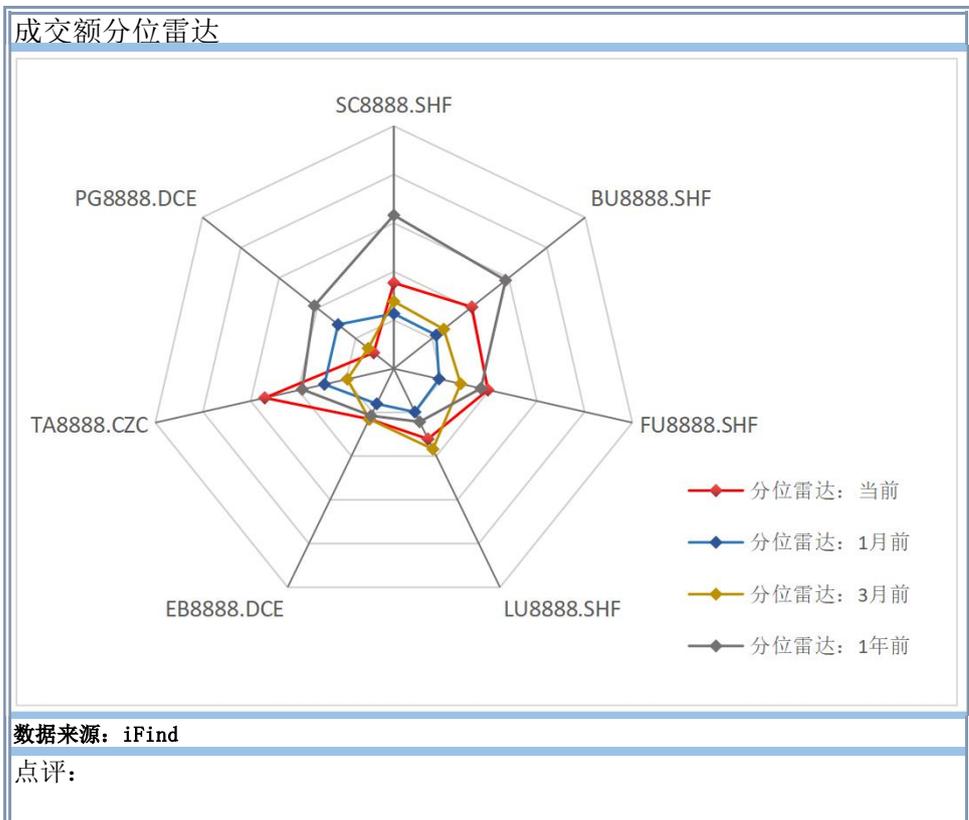
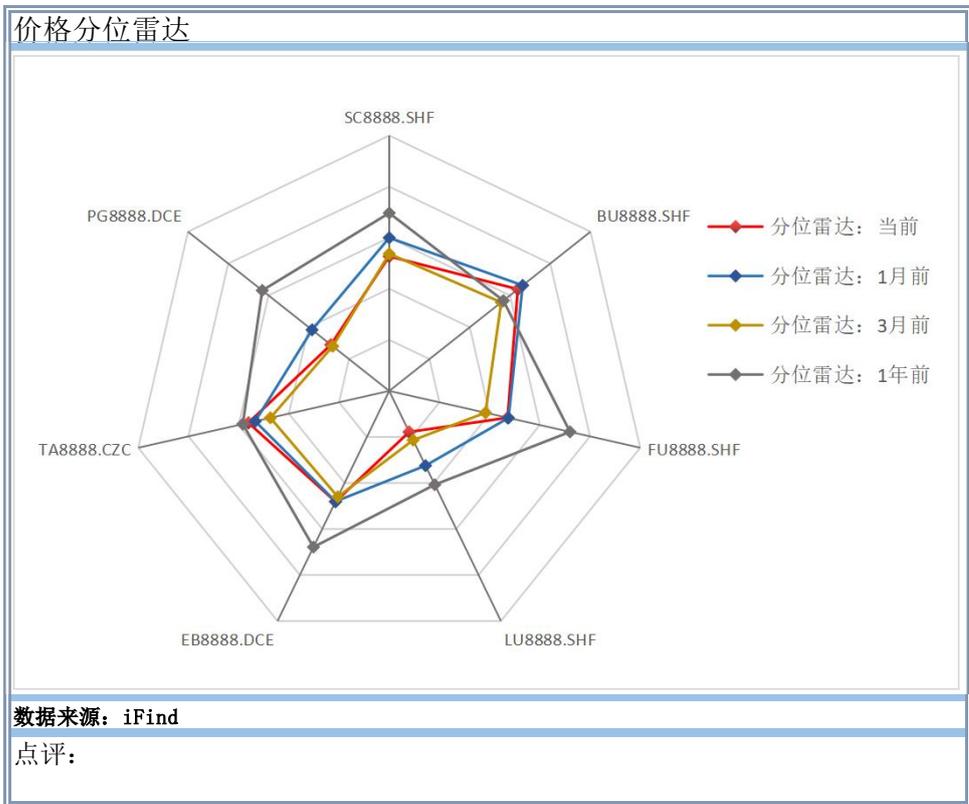
当前分位值：15.04%



数据来源：iFind

点评：

## 二、原油相关



### Sc. Ine价格走势

数据起始日：2020-3-16

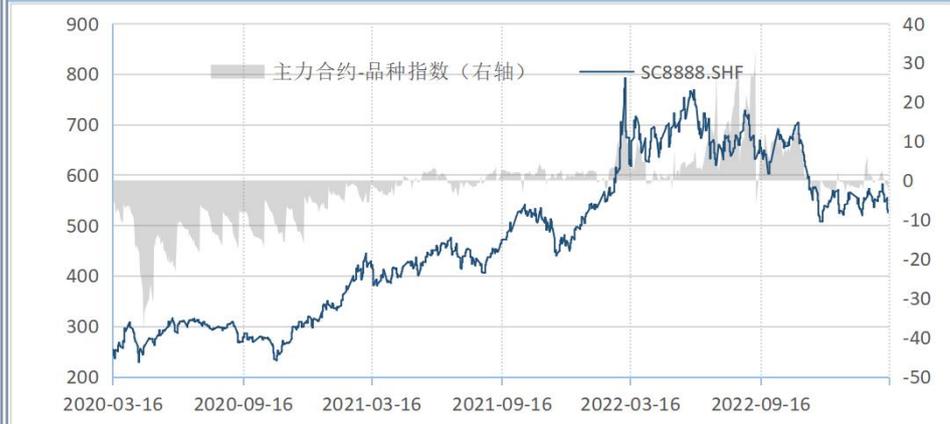
数据截止日：2023-3-15

期内最小值：228.9

期内最大值：791.6

期内平均值：472.0650

当前分位值：52.69%



数据来源：iFind

点评：

### Bu. SHFE价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：1842

期内最大值：4794

期内平均值：3226.3251

当前分位值：63.89%



数据来源：iFind

点评：

### Fu. SHFE价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：1397

期内最大值：4371

期内平均值：2616.3826

当前分位值：47.14%



数据来源：iFind

点评：

### Lu. Ine价格走势

数据起始日：2021-6-16

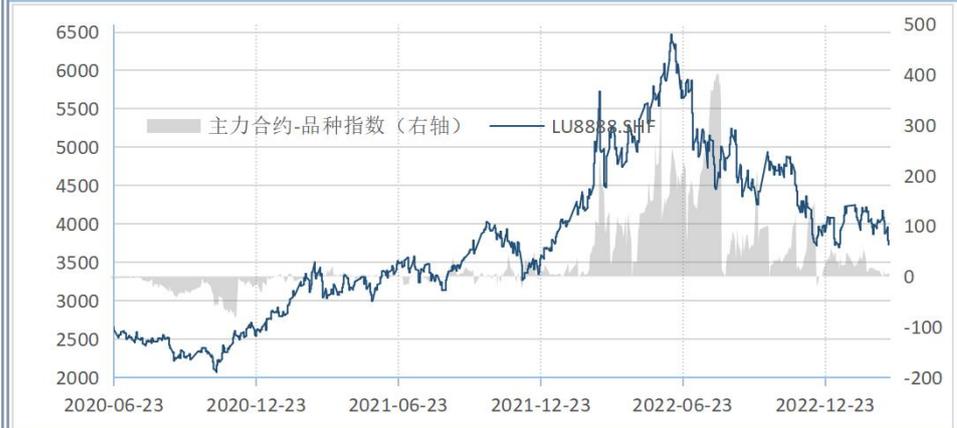
数据截止日：2023-3-15

期内最小值：3134

期内最大值：6464

期内平均值：4314.6118

当前分位值：17.84%



数据来源：iFind

点评：

### EB. DCE价格走势

数据起始日：2020-9-18

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：5574

期内最大值：11361

期内平均值：8528.3211

当前分位值：48.14%



数据来源：iFind

点评：

### PTA. CZCE价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：3136

期内最大值：7488

期内平均值：4854.0192

当前分位值：56.09%



数据来源：iFind

点评：

### LPG. DCE价格走势

数据起始日： 2021-3-22

数据截止日： 2023-3-15

期内最小值： 3657

期内最大值： 6749

期内平均值： 5066.5726

当前分位值： 29.01%



数据来源： iFind

点评：

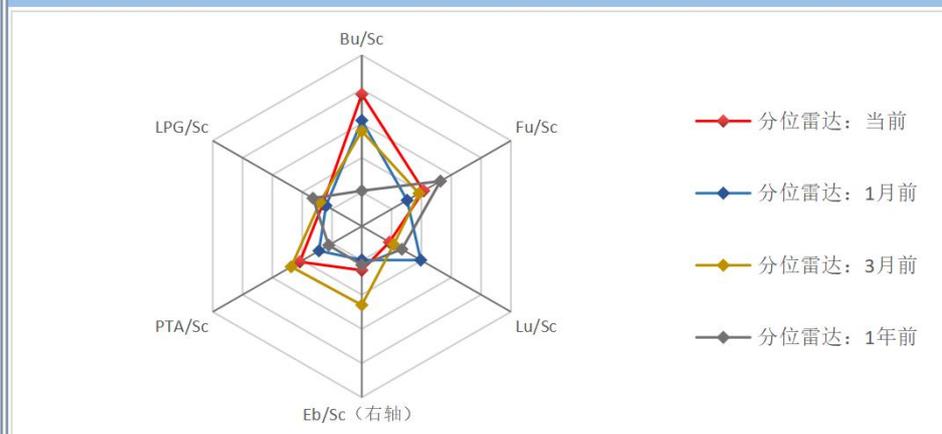
### Sc相关比价一揽子



数据来源： iFind

点评：

### Sc相关比价分位雷达



数据来源： iFind

点评：

### Bu-Sc

数据起始日： 2020-3-16

数据截止日： 2023-3-15

期内最小值： -1406.4286

期内最大值： 725.0000

期内平均值： -145.5679

当前分位值： 64.82%



数据来源： iFind

点评：

### Bu-Fu

数据起始日： 2020-3-16

数据截止日： 2023-3-15

期内最小值： -331.0000

期内最大值： 1284.0000

期内平均值： 609.9425

当前分位值： 78.02%



数据来源： iFind

点评：

### Lu-Fu

数据起始日： 2021-6-16

数据截止日： 2023-3-15

期内最小值： 643.0000

期内最大值： 2592.0000

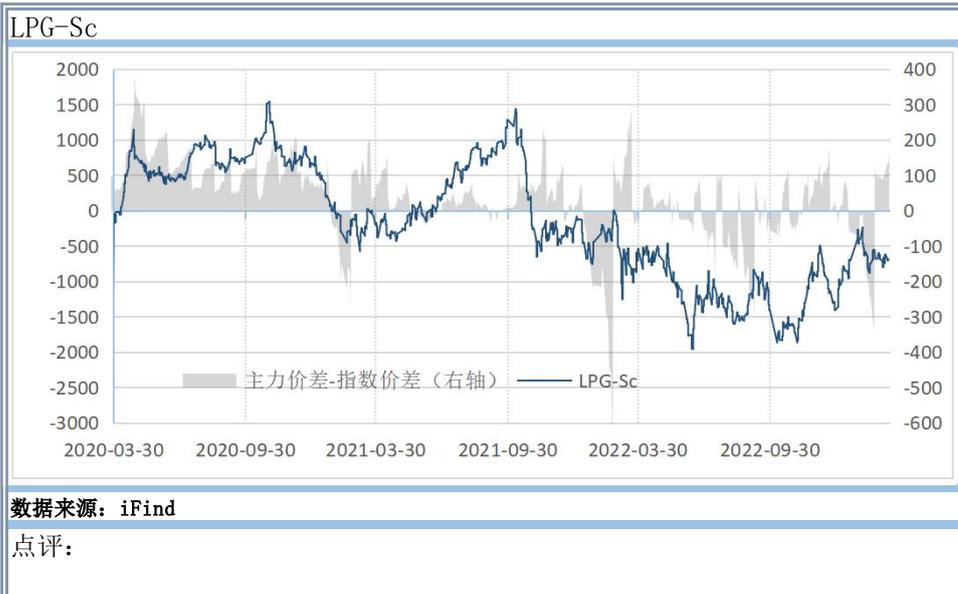
期内平均值： 1259.7860

当前分位值： 14.67%



数据来源： iFind

点评：



数据起始日: 2021-3-22

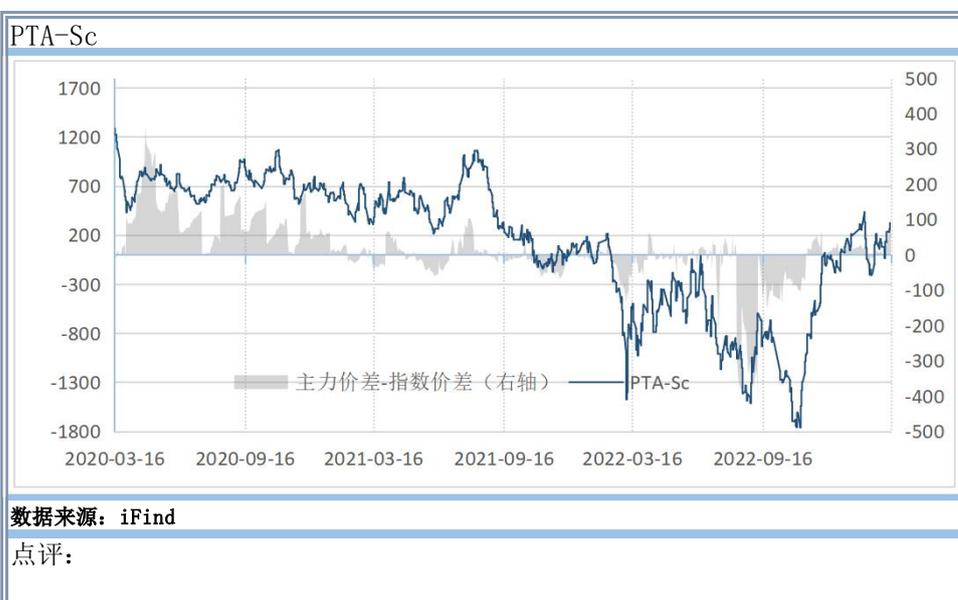
数据截止日: 2023-3-15

期内最小值: -1959.0000

期内最大值: 1436.0000

期内平均值: -513.6950

当前分位值: 37.08%



数据起始日: 2020-3-16

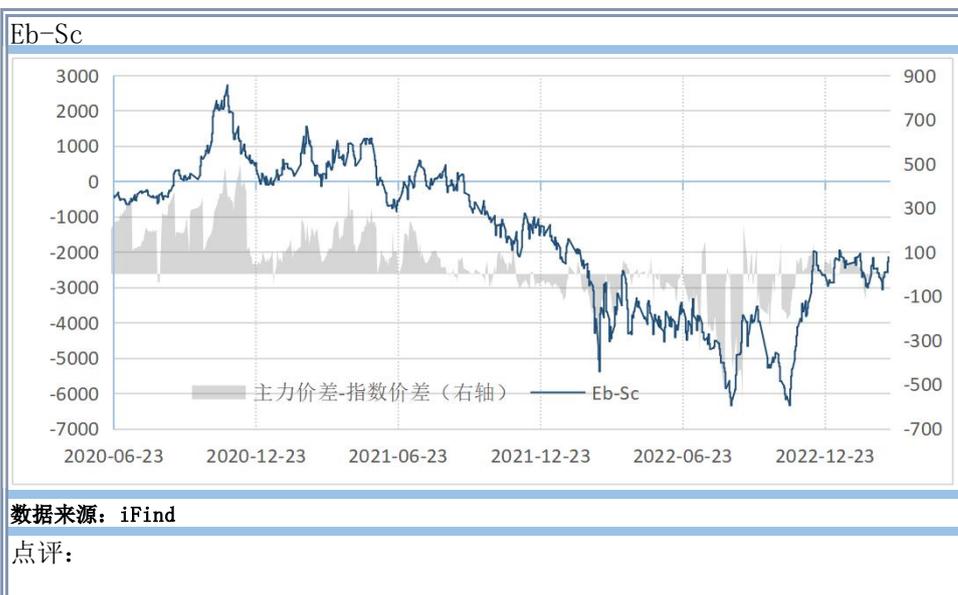
数据截止日: 2023-3-15

期内最小值: -1762.0000

期内最大值: 1284.0000

期内平均值: 133.3690

当前分位值: 68.45%



数据起始日: 2020-9-18

数据截止日: 2023-3-15

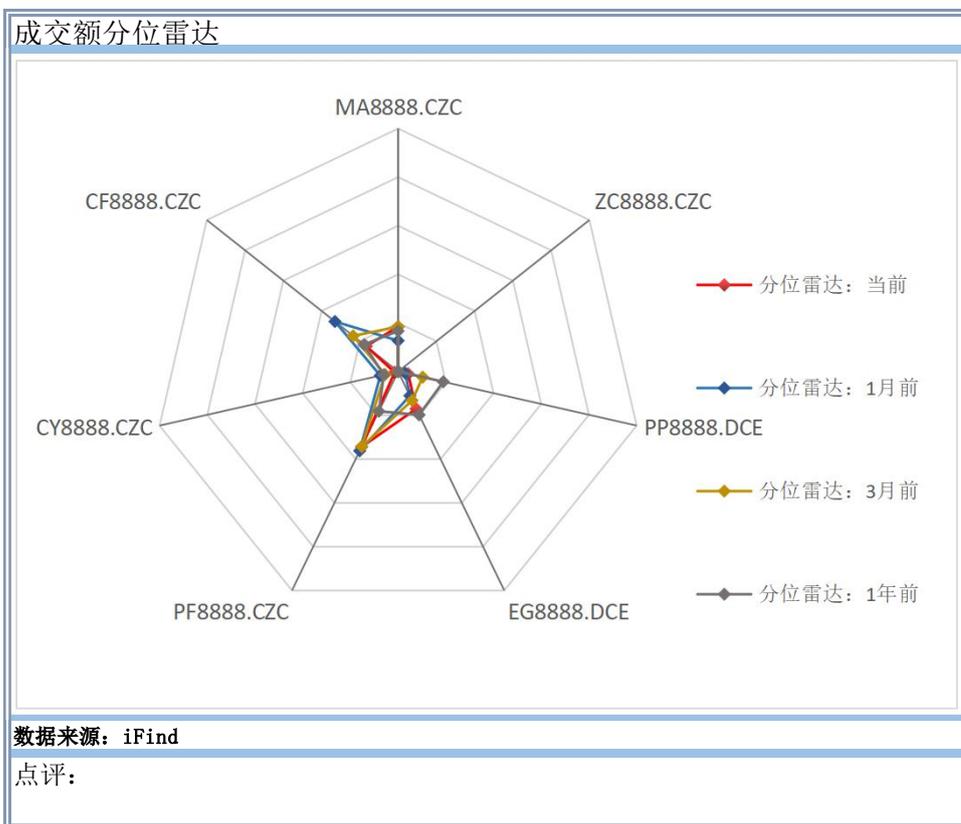
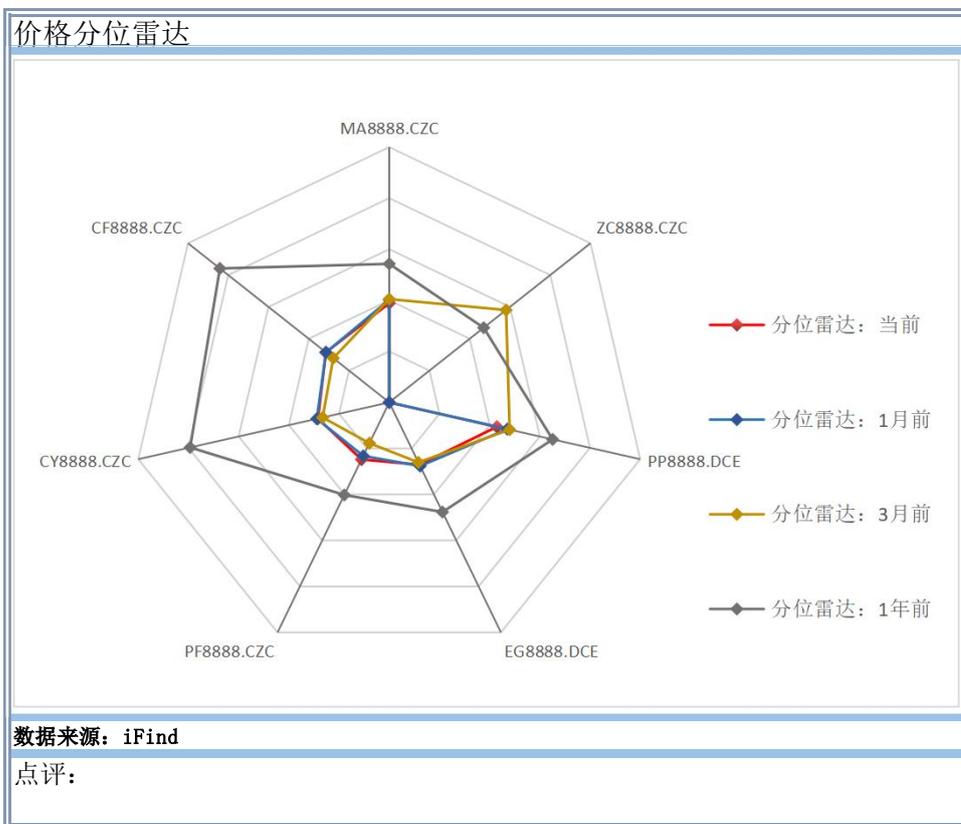
期内最小值: -6347.0000

期内最大值: 2720.0000

期内平均值: -1693.8419

当前分位值: 46.31%

三、煤化工相关



### MA. CZCE价格走势

数据起始日： 2020-3-16

数据截止日： 2023-3-15

期内最小值： 1596

期内最大值： 4015

期内平均值： 2470.9767

当前分位值： 38.86%



数据来源： iFind

点评：

### ZC. CZCE价格走势

数据起始日： 2020-3-16

数据截止日： 2023-3-15

期内最小值： 0

期内最大值： 1703.2

期内平均值： 714.7301

当前分位值： 0.00%



数据来源： iFind

点评：

### PP. DCE价格走势

数据起始日： 2020-3-16

数据截止日： 2023-3-15

期内最小值： 5672

期内最大值： 10224

期内平均值： 8128.6200

当前分位值： 42.90%



数据来源： iFind

点评：

### EG. CZCE价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：3021

期内最大值：7345

期内平均值：4527.2236

当前分位值：27.10%



数据来源：iFind

点评：

### PF. CZCE价格走势

数据起始日：2021-9-28

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：6477

期内最大值：9022

期内平均值：7392.8867

当前分位值：24.79%



数据来源：iFind

点评：

### CY. CZCE价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：17531

期内最大值：30443

期内平均值：23156.2812

当前分位值：28.42%



数据来源：iFind

点评：

### CF. CZCE价格走势

数据起始日： 2020-3-16

数据截止日： 2023-3-15

期内最小值： 10573

期内最大值： 22574

期内平均值： 15959.3800

当前分位值： 31.47%



数据来源： iFind

点评：

### Ma-Zc

数据起始日： 2020-3-16

数据截止日： 2023-3-15

期内最小值： -622.7500

期内最大值： 2777.0000

期内平均值： 684.1514

当前分位值： 92.91%



数据来源： iFind

点评：

### PP-Ma

数据起始日： 2020-3-16

数据截止日： 2023-3-15

期内最小值： -2039.0000

期内最大值： 2384.0000

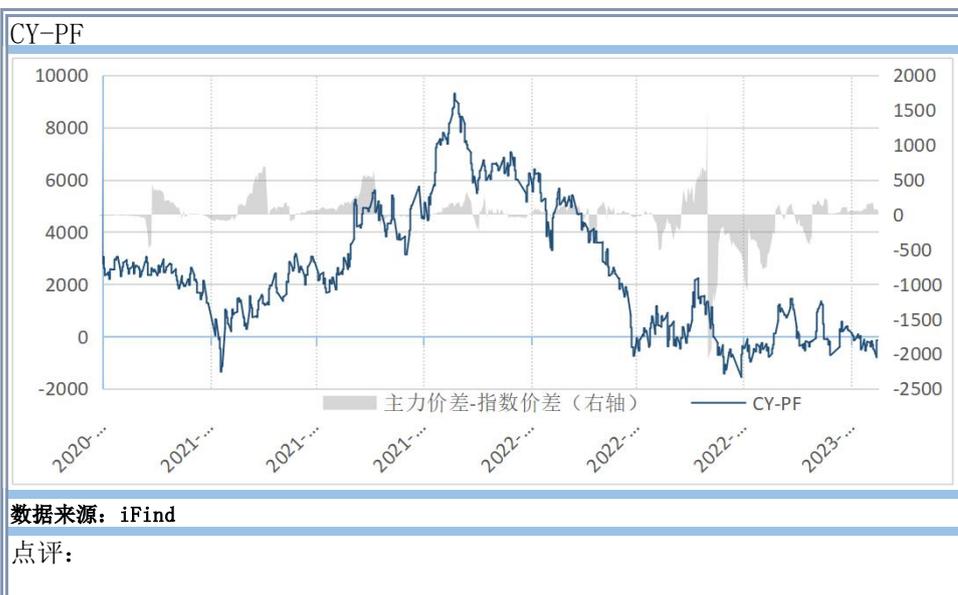
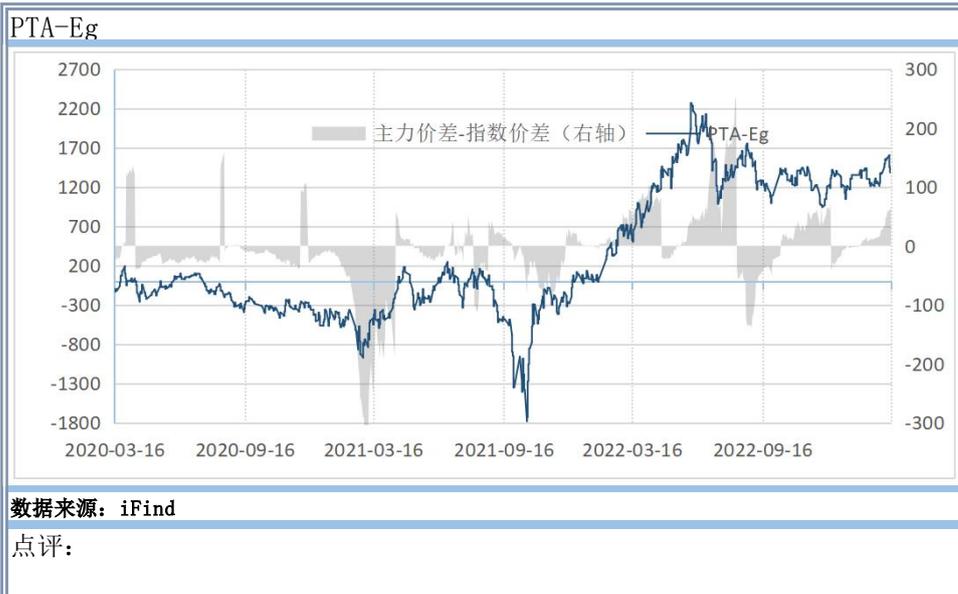
期内平均值： 715.6900

当前分位值： 46.48%



数据来源： iFind

点评：



### PF毛利

数据起始日： 2021-9-28

数据截止日： 2023-3-15

期内最小值： -264.3150

期内最大值： 310.7150

期内平均值： -66.1353

当前分位值： 20.75%



数据来源： iFind

点评：

### CY-CF

数据起始日： 2020-3-16

数据截止日： 2023-3-15

期内最小值： 5777.0000

期内最大值： 9616.0000

期内平均值： 7196.9012

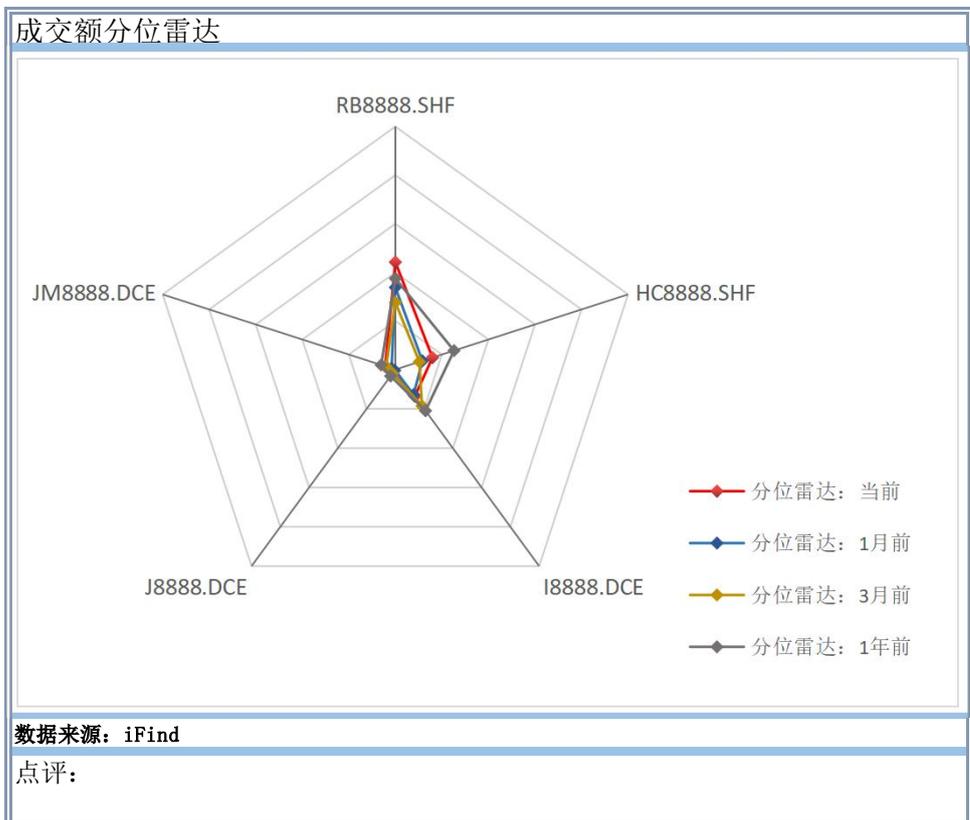
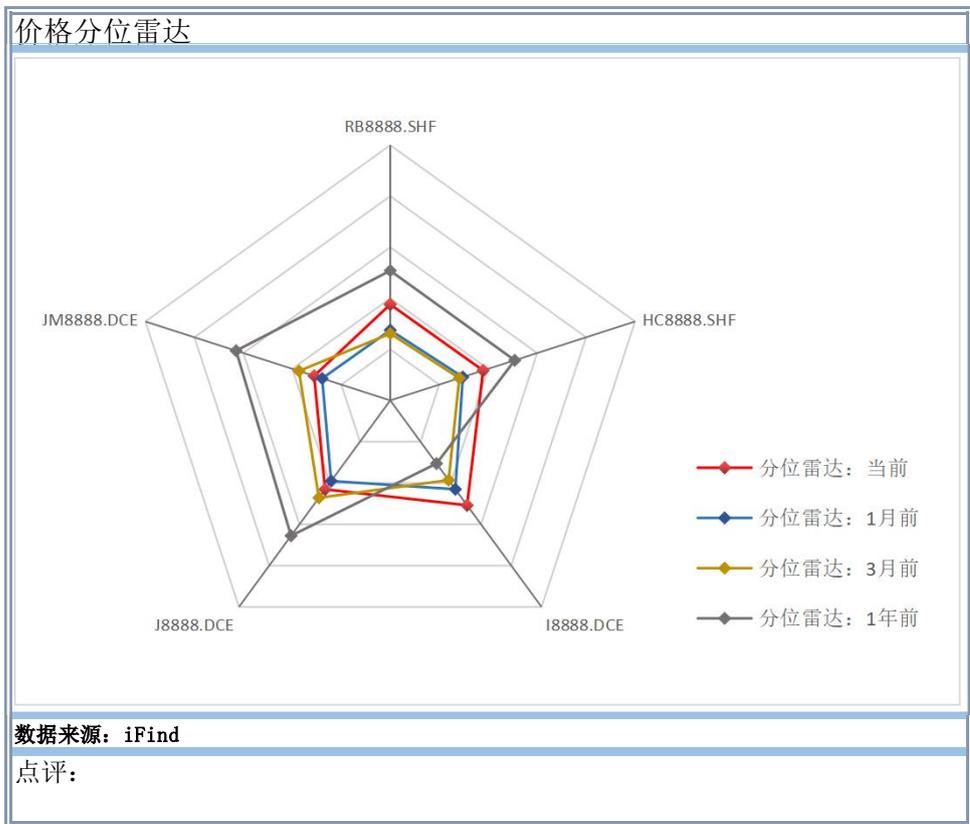
当前分位值： 27.95%



数据来源： iFind

点评：

#### 四、黑色相关



### RB. SHFE价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：3200

期内最大值：6158

期内平均值：4301.9863

当前分位值：37.59%



数据来源：iFind

点评：

### HC. SHFE价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：3048

期内最大值：6675

期内平均值：4442.5583

当前分位值：37.94%



数据来源：iFind

点评：

### I. DCE价格走势

数据起始日：2020-3-16

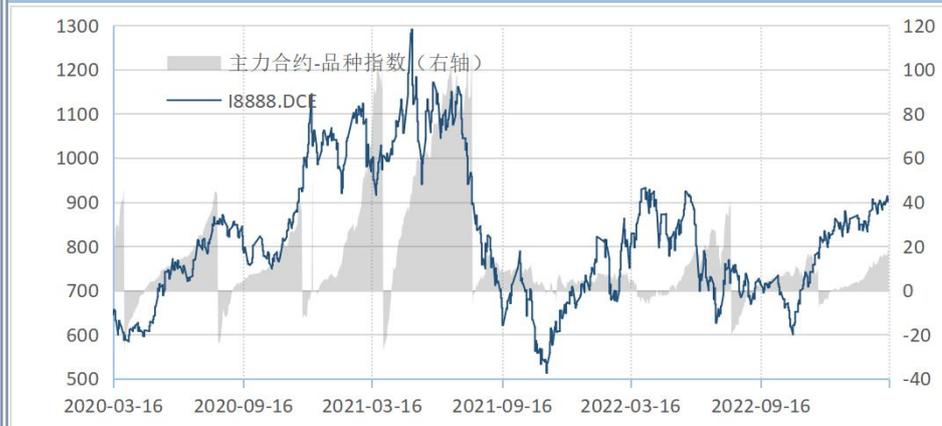
数据截止日：2023-3-15

期内最小值：512.8

期内最大值：1290.9

期内平均值：821.4791

当前分位值：50.78%



数据来源：iFind

点评：

### J. DCE价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：1640.6

期内最大值：4320.8

期内平均值：2682.9538

当前分位值：43.08%



数据来源：iFind

点评：

### Jm. DCE价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：1043.1

期内最大值：3764.7

期内平均值：1916.3435

当前分位值：31.08%



数据来源：iFind

点评：

### 螺铁差

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：722.1765

期内最大值：2451.8235

期内平均值：1274.1091

当前分位值：19.86%



数据来源：iFind

点评：

### 螺纹利润

数据起始日：2020-3-16

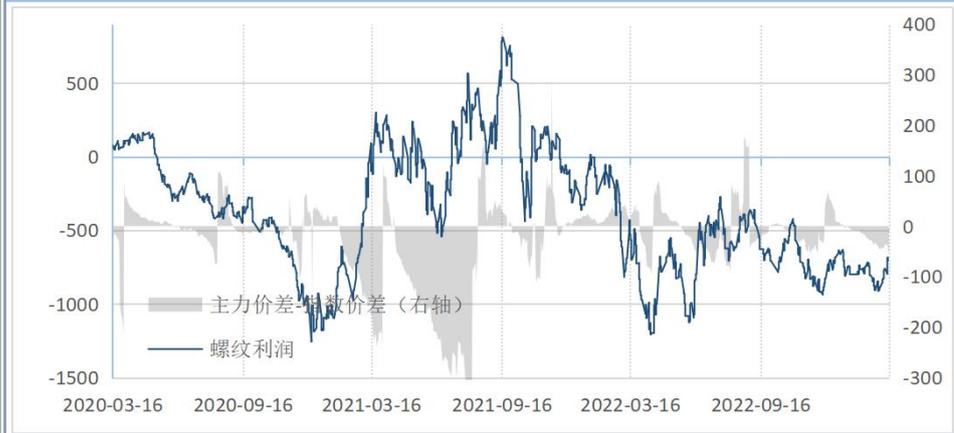
数据截止日：2023-3-15

期内最小值：-1255.7273

期内最大值：810.0000

期内平均值：-377.4603

当前分位值：26.66%



数据来源：iFind

点评：

### 卷铁差

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：851.9412

期内最大值：2799.4118

期内平均值：1414.6811

当前分位值：16.72%



数据来源：iFind

点评：

### 热卷利润

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：-1073.7273

期内最大值：1014.0000

期内平均值：-236.8883

当前分位值：23.02%



数据来源：iFind

点评：

### 卷螺差

数据起始日：2020-3-16

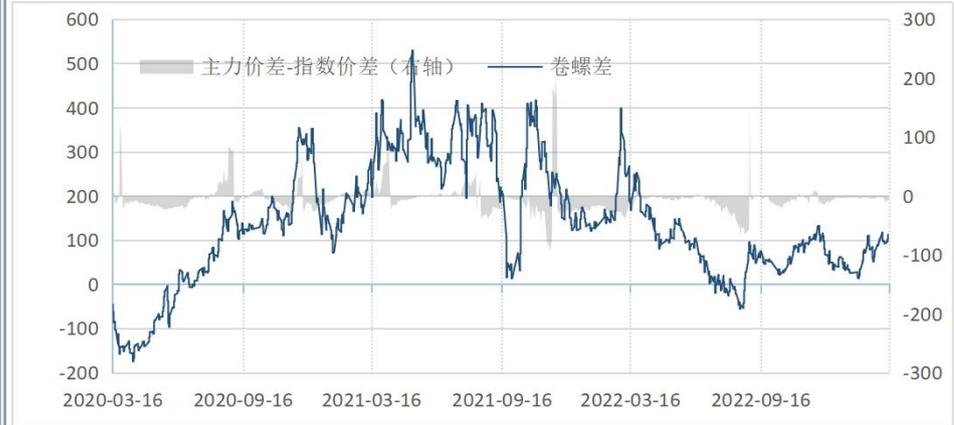
数据截止日：2023-3-15

期内最小值：-175.0000

期内最大值：529.0000

期内平均值：140.5720

当前分位值：40.77%



数据来源：iFind

点评：

### 螺矿比

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：3.8923

期内最大值：8.7631

期内平均值：5.3361

当前分位值：17.60%



数据来源：iFind

点评：

### 焦矿比

数据起始日：2020-3-16

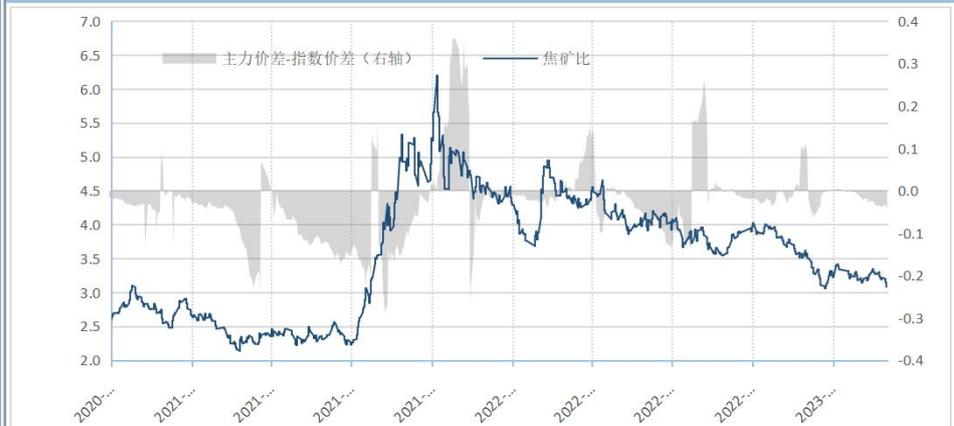
数据截止日：2023-3-15

期内最小值：2.1354

期内最大值：6.1947

期内平均值：3.3601

当前分位值：23.24%



数据来源：iFind

点评：

数据起始日： 2020-3-16

数据截止日： 2023-3-15

期内最小值： -1043.0800

期内最大值： 629.9200

期内平均值： 0.0729

当前分位值： 71.35%



数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2020-3-16

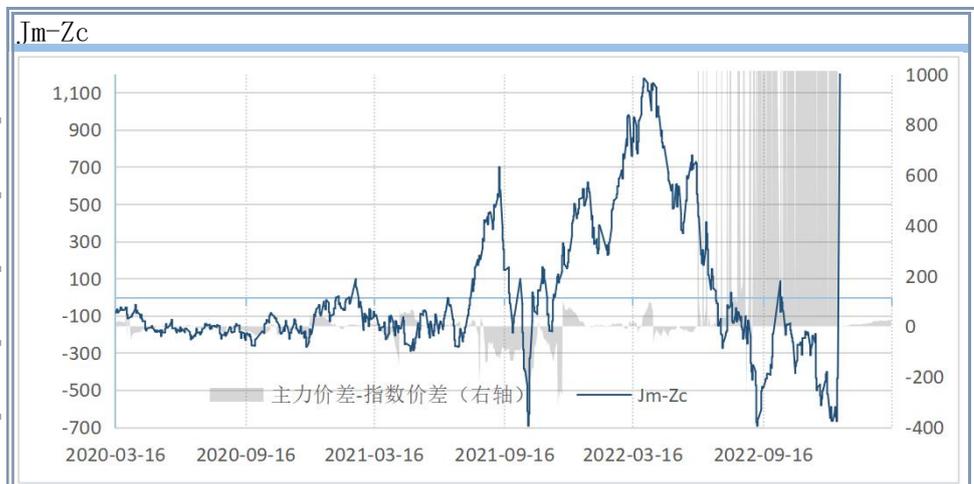
数据截止日： 2023-3-15

期内最小值： -692.4588

期内最大值： 2042.0000

期内平均值： 129.5182

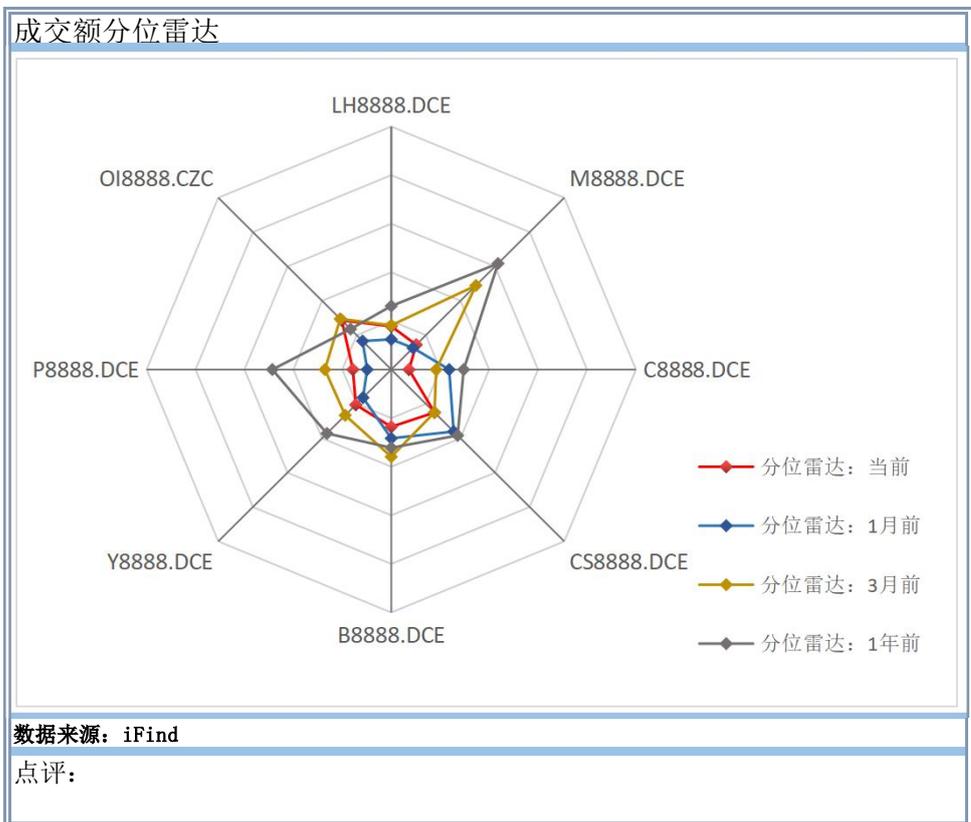
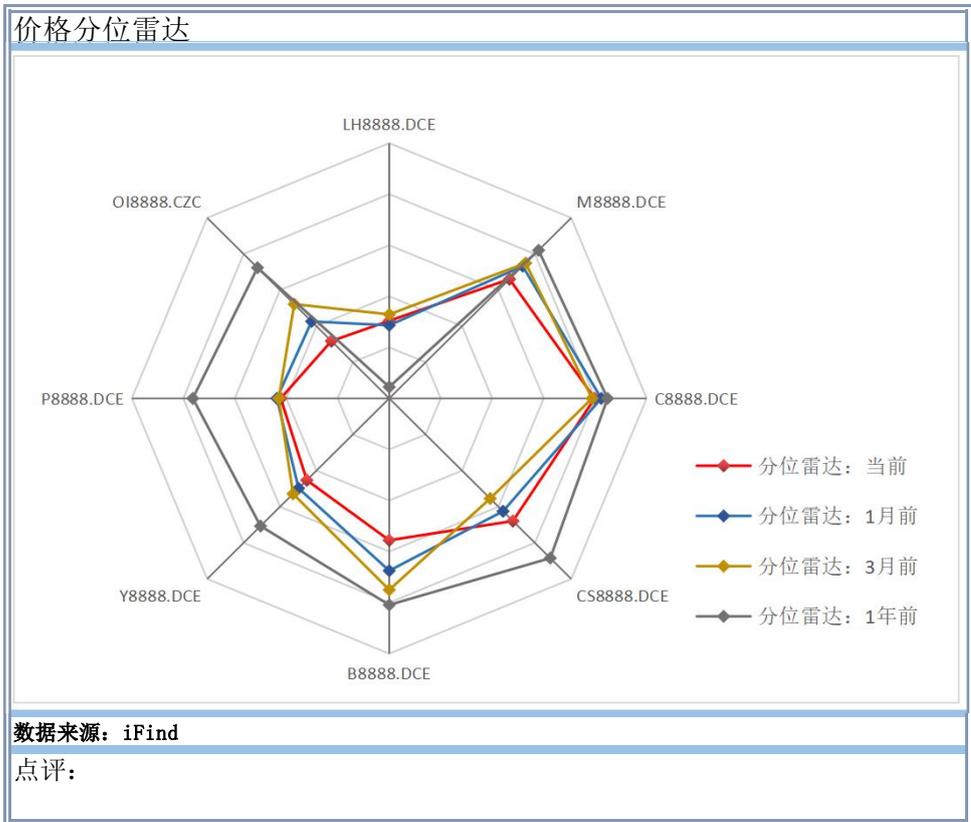
当前分位值： 94.40%



数据来源： iFind

点评：

五、农产品相关



### LH. DCE价格走势

数据起始日：2021-12-31

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：14165

期内最大值：22735

期内平均值：18349.0517

当前分位值：30.40%



数据来源：iFind

点评：

### M. DCE价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：2707

期内最大值：4328

期内平均值：3479.4458

当前分位值：66.07%



数据来源：iFind

点评：

### C. DCE价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：1967

期内最大值：3027

期内平均值：2630.6200

当前分位值：79.81%



数据来源：iFind

点评：

### CS. DCE价格走势

数据起始日：2020-3-16

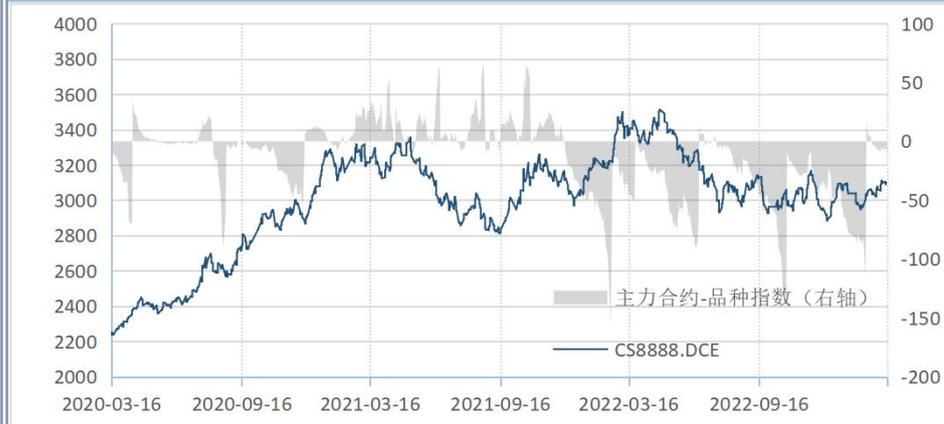
数据截止日：2023-3-15

期内最小值：2237

期内最大值：3512

期内平均值：2989.5940

当前分位值：67.92%



数据来源：iFind

点评：

### B. DCE价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：2875

期内最大值：5585

期内平均值：4302.0700

当前分位值：55.57%



数据来源：iFind

点评：

### Y. DCE价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：5275

期内最大值：12065

期内平均值：8449.3841

当前分位值：45.29%



数据来源：iFind

点评：

### P. DCE价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：4354

期内最大值：12479

期内平均值：7789.1646

当前分位值：42.15%



数据来源：iFind

点评：

### OI. CZCE价格走势

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：6571

期内最大值：14344

期内平均值：10395.8272

当前分位值：31.78%



数据来源：iFind

点评：

### 育肥收益

数据起始日：2021-12-31

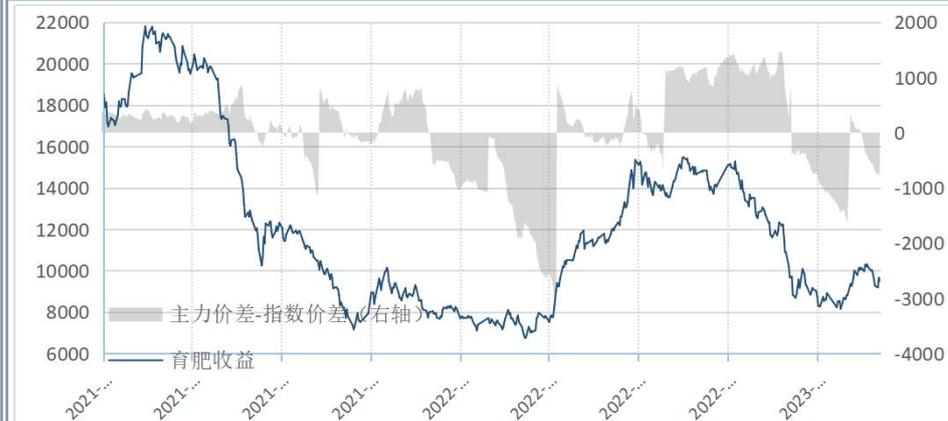
数据截止日：2023-3-15

期内最小值：6748.7500

期内最大值：15480.0000

期内平均值：11007.0302

当前分位值：31.47%



数据来源：iFind

点评：

### 育肥肉料差(高料)

数据起始日：2021-12-31

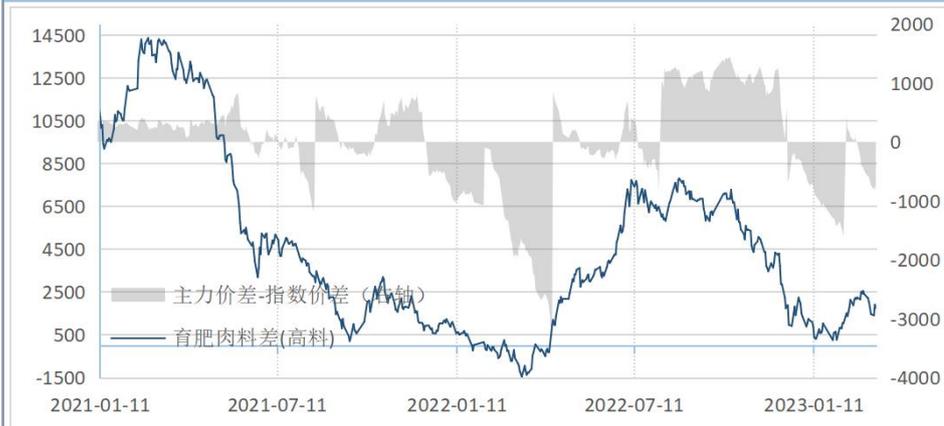
数据截止日：2023-3-15

期内最小值：-1474.0000

期内最大值：7791.0000

期内平均值：3134.8966

当前分位值：34.69%



数据来源：iFind

点评：

### 豆二厂库置换

数据起始日：2020-3-16

数据截止日：2023-3-15

期内最小值：-737.5300

期内最大值：79.6850

期内平均值：-167.5689

当前分位值：86.51%



数据来源：iFind

点评：

### Cs-C

数据起始日：2020-3-16

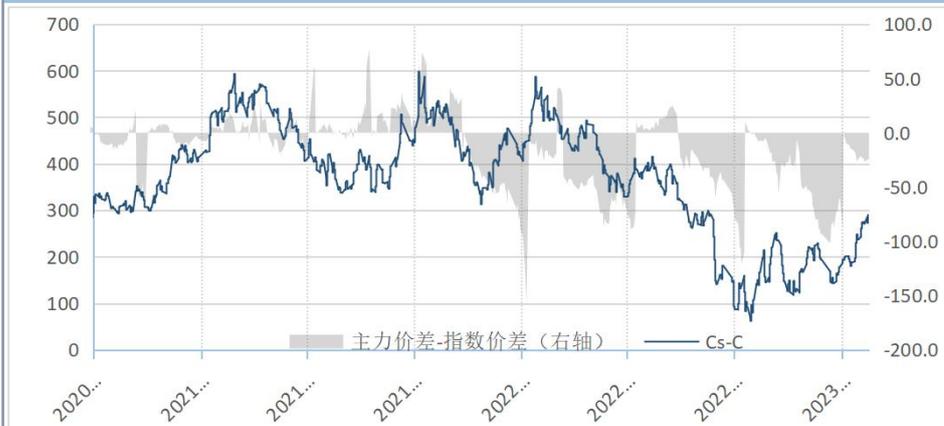
数据截止日：2023-3-15

期内最小值：62.0000

期内最大值：598.0000

期内平均值：358.9739

当前分位值：42.54%



数据来源：iFind

点评：

数据起始日： 2020-3-16

数据截止日： 2023-3-15

期内最小值： -1313.0000

期内最大值： 1788.0000

期内平均值： 660.2195

当前分位值： 60.75%



数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2021-9-28

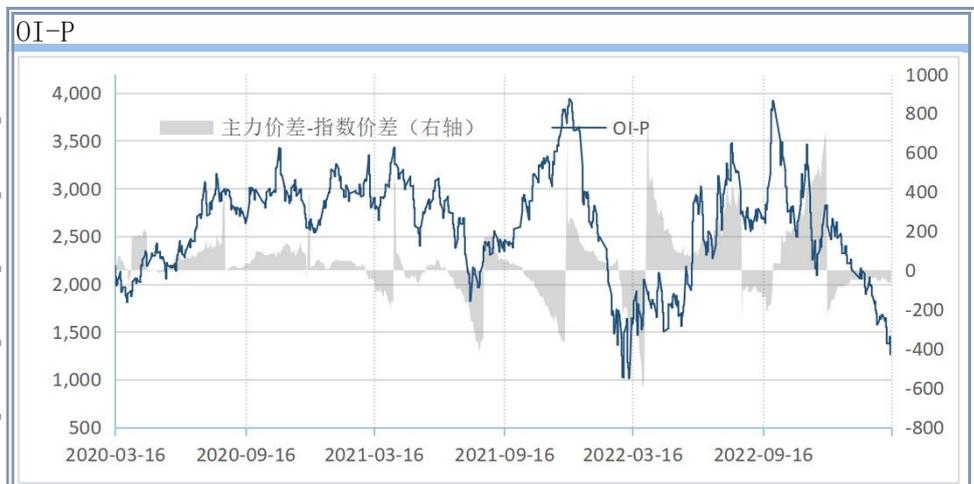
数据截止日： 2023-3-15

期内最小值： 1014.0000

期内最大值： 3936.0000

期内平均值： 2528.2153

当前分位值： 8.49%



数据来源： iFind

点评：

## 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。