

<http://www.shanjinqh.com>

# 盘面套利观察

制作：强子益

2023年9月13日

投资咨询： Z0015283

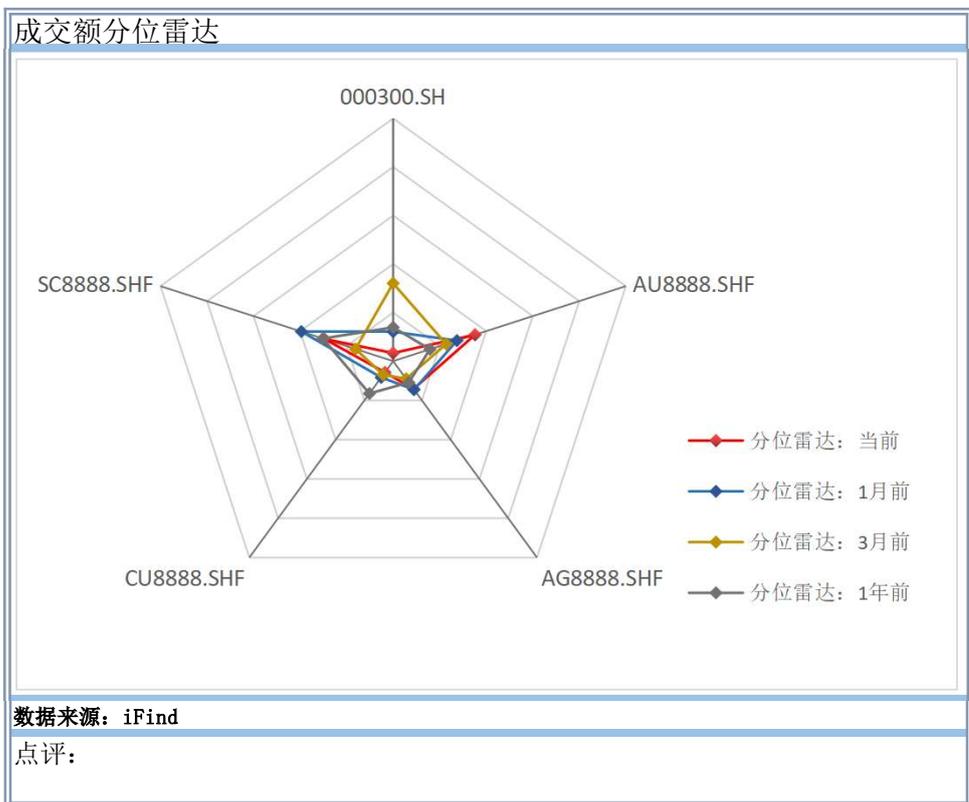
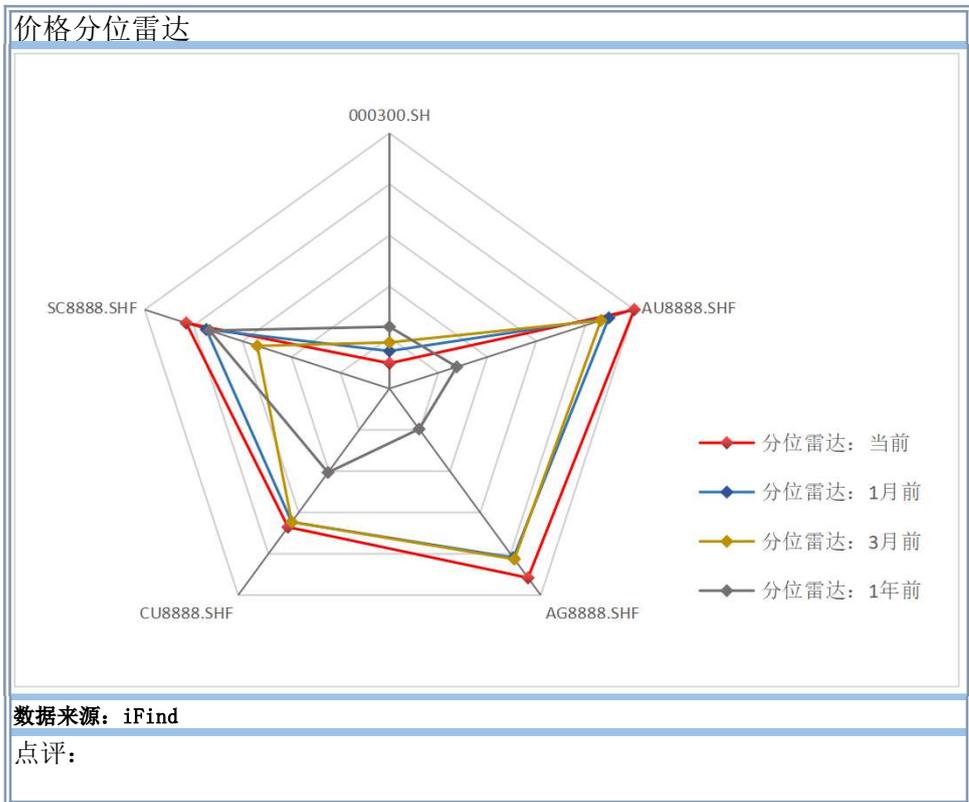
数据仅供参考，据此入市，风险自担。

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： 2020-9-14

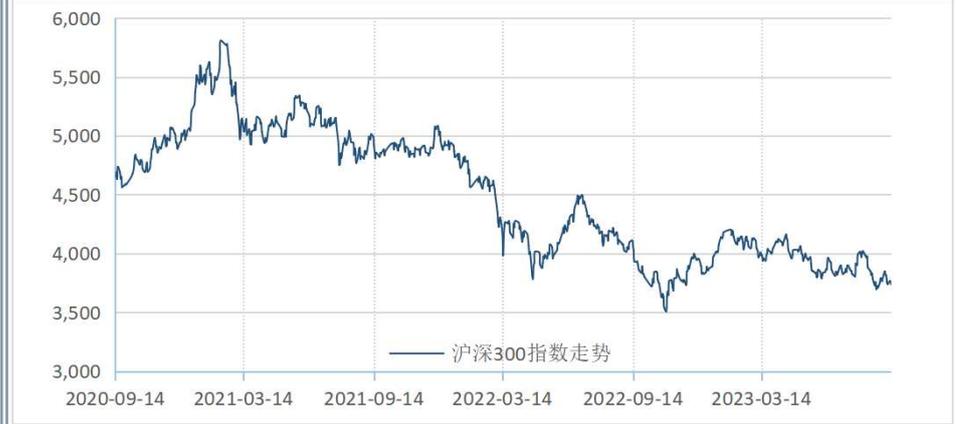
数据截止日： 2023-9-13

期内最小值： 3508.7034

期内最大值： 5807.7191

期内平均值： 4487.1932

当前分位值： 18.07%



### Au. SHFE价格走势

数据起始日： 2020-9-14

数据截止日： 2023-9-13

期内最小值： 356.92

期内最大值： 467.74

期内平均值： 399.5631

当前分位值： 100.00%



### Cu. SHFE价格走势

数据起始日： 2020-9-14

数据截止日： 2023-9-13

期内最小值： 50685

期内最大值： 77934

期内平均值： 66311.5678

当前分位值： 67.06%



### Sc. Ine价格走势

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：232.3

期内最大值：791.6

期内平均值：519.6401

当前分位值：83.05%



数据来源：iFind

点评：

### Cu/Au

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：8.7017

期内最大值：15.4319

期内平均值：12.9903

当前分位值：46.85%



数据来源：iFind

点评：

### Sc/Au

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：0.5769

期内最大值：1.9320

期内平均值：1.3010

当前分位值：67.36%



数据来源：iFind

点评：

### Sc/000300

数据起始日：2020-9-14

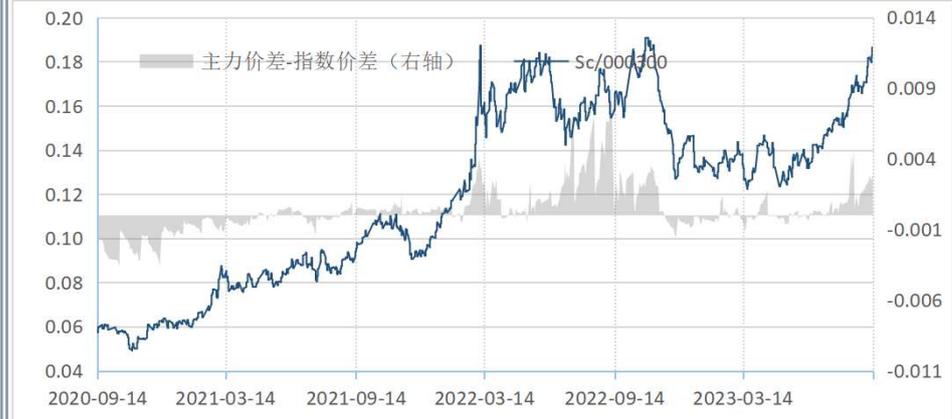
数据截止日：2023-9-13

期内最小值：0.0492

期内最大值：0.1908

期内平均值：0.1199

当前分位值：96.96%



数据来源：iFind

点评：

### Au/Ag

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：0.0648

期内最大值：0.0932

期内平均值：0.0782

当前分位值：55.07%



数据来源：iFind

点评：

### 000300/Au

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：0.6354

期内最大值：1.1021

期内平均值：0.8785

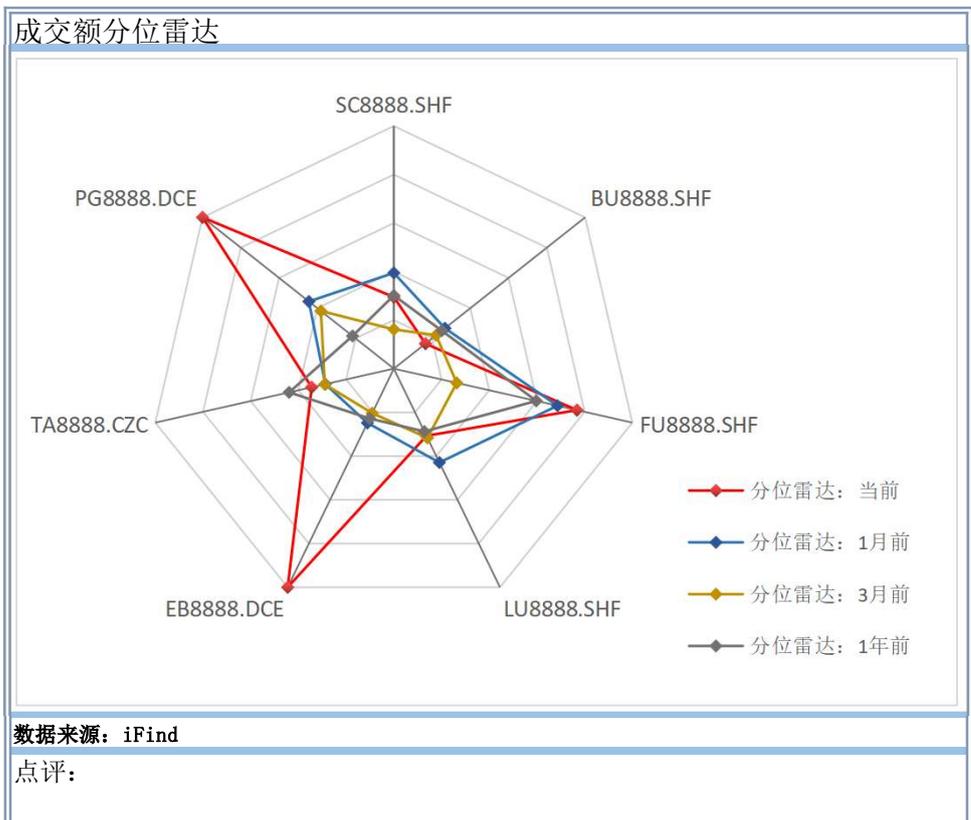
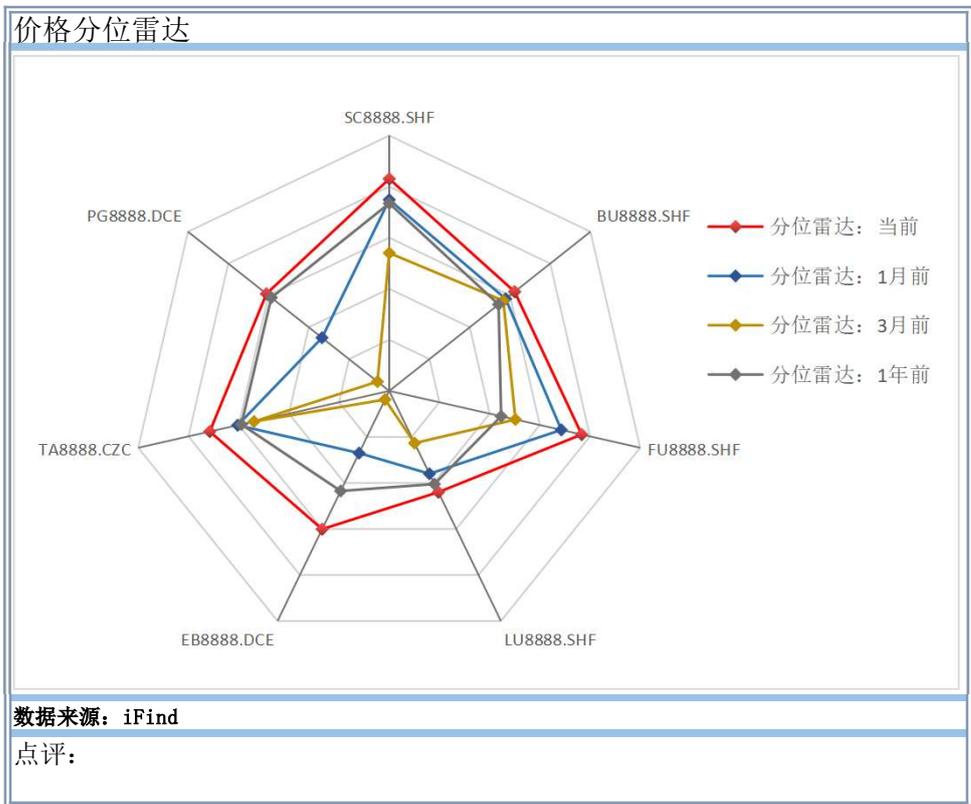
当前分位值：1.50%



数据来源：iFind

点评：

二、原油相关



### Sc. Ine价格走势

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：232.3

期内最大值：791.6

期内平均值：519.6401

当前分位值：83.05%



数据来源：iFind

点评：

### Bu. SHFE价格走势

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：2176

期内最大值：4794

期内平均值：3430.0014

当前分位值：62.30%



数据来源：iFind

点评：

### Fu. SHFE价格走势

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：1682

期内最大值：4371

期内平均值：2857.1055

当前分位值：76.68%



数据来源：iFind

点评：

### Lu. Ine价格走势

数据起始日：2021-12-16

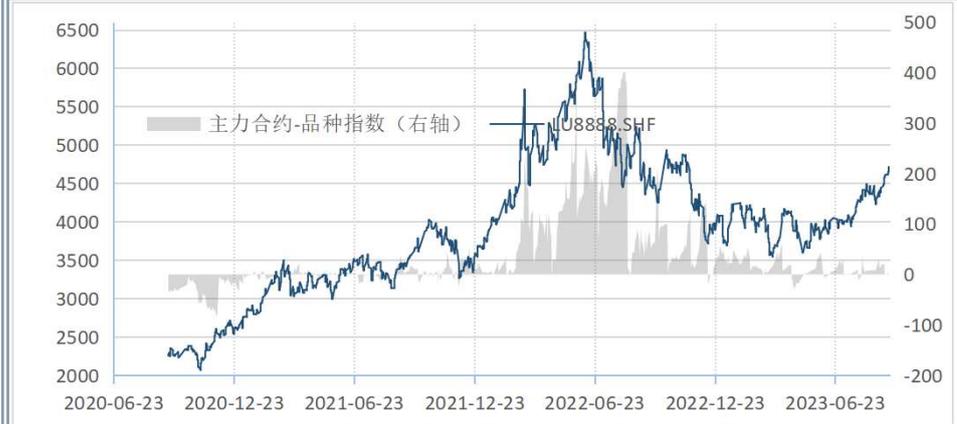
数据截止日：2023-9-13

期内最小值：3339

期内最大值：6464

期内平均值：4465.3435

当前分位值：44.00%



数据来源：iFind

点评：

### EB. DCE价格走势

数据起始日：2021-3-29

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：6978

期内最大值：11361

期内平均值：8698.9601

当前分位值：60.07%



数据来源：iFind

点评：

### PTA. CZCE价格走势

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：3277

期内最大值：7488

期内平均值：5217.2483

当前分位值：71.50%



数据来源：iFind

点评：

### LPG. DCE价格走势

数据起始日： 2021-9-17

数据截止日： 2023-9-13

期内最小值： 3704

期内最大值： 6749

期内平均值： 5024.2988

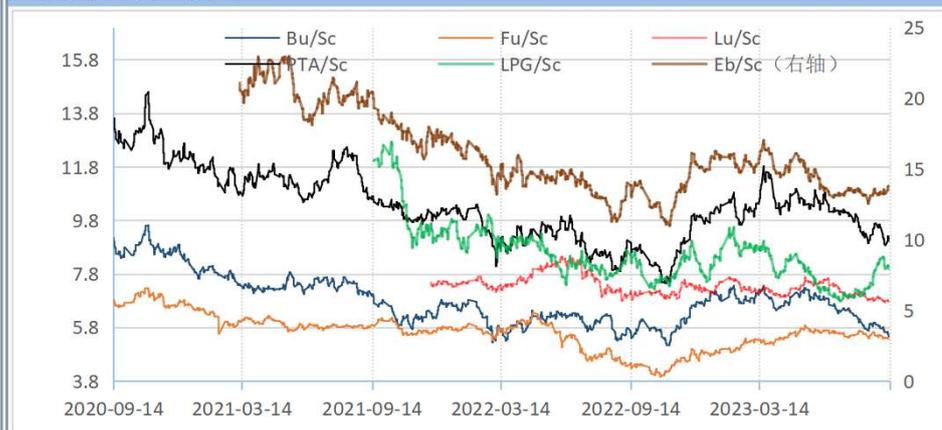
当前分位值： 61.02%



数据来源： iFind

点评：

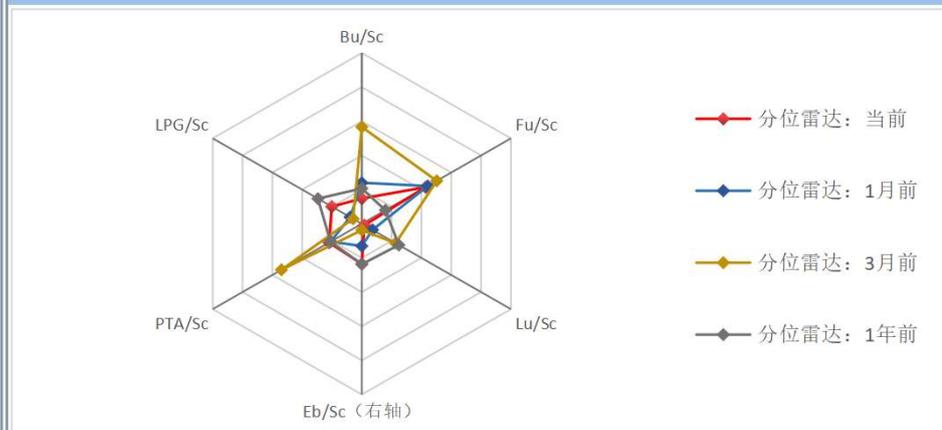
### Sc相关比价一揽子



数据来源： iFind

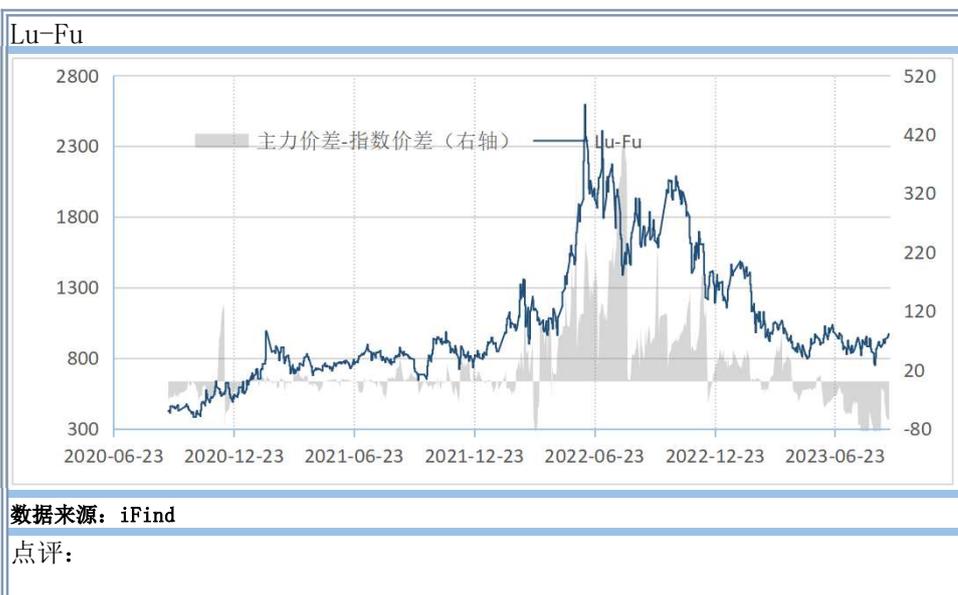
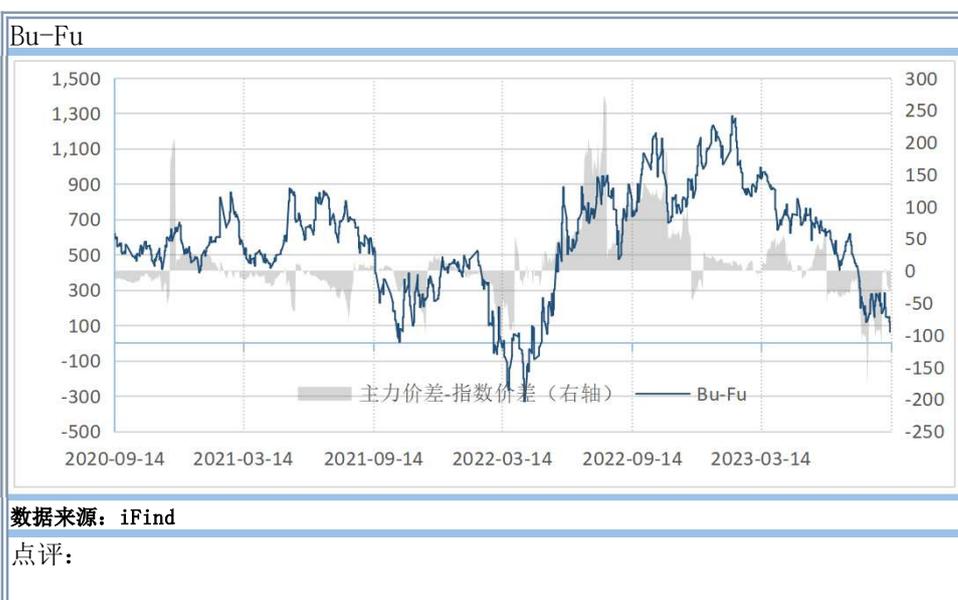
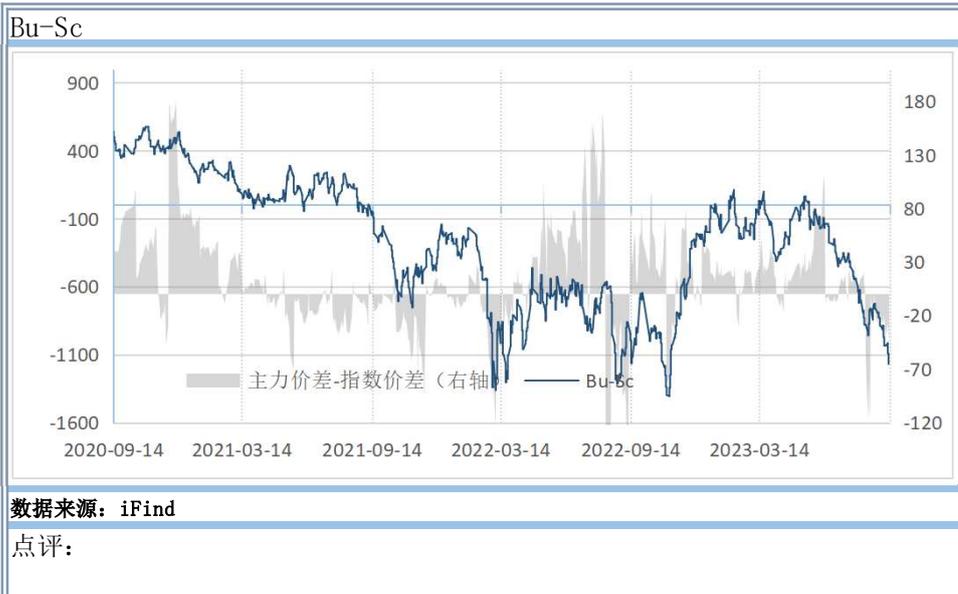
点评：

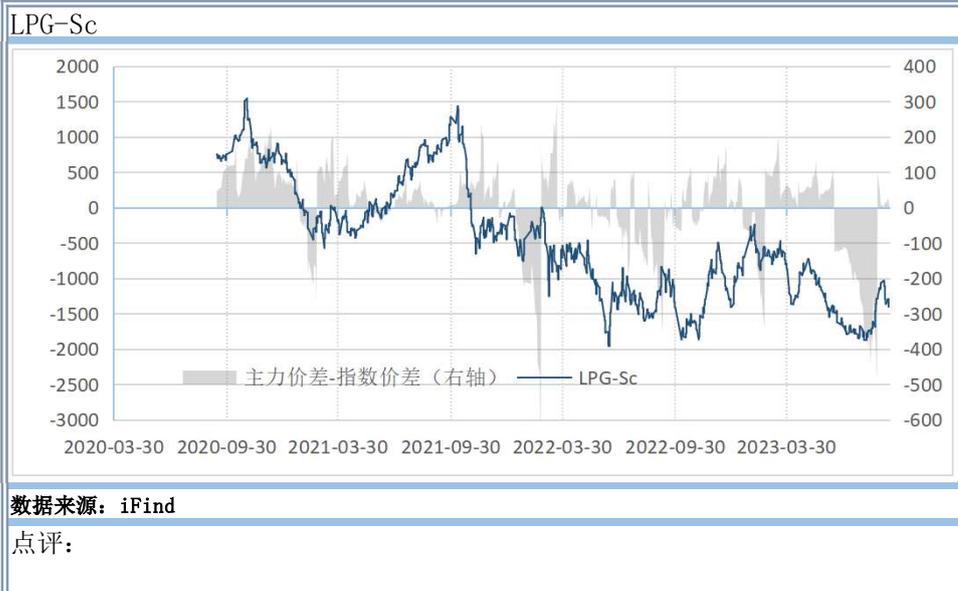
### Sc相关比价分位雷达



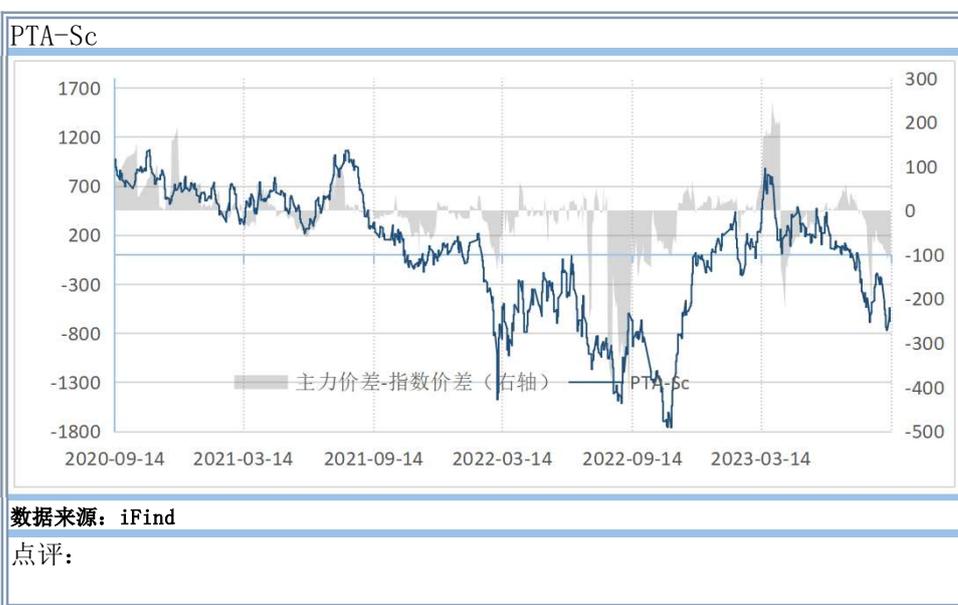
数据来源： iFind

点评：

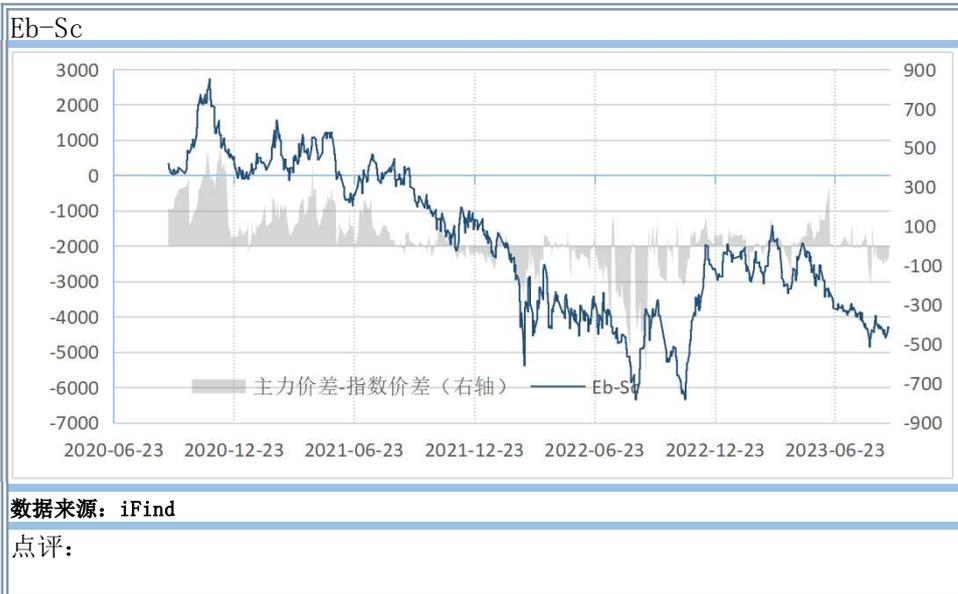




数据起始日: 2021-9-17  
 数据截止日: 2023-9-13  
 期内最小值: -1959.0000  
 期内最大值: 1436.0000  
 期内平均值: -912.5311  
 当前分位值: 16.29%

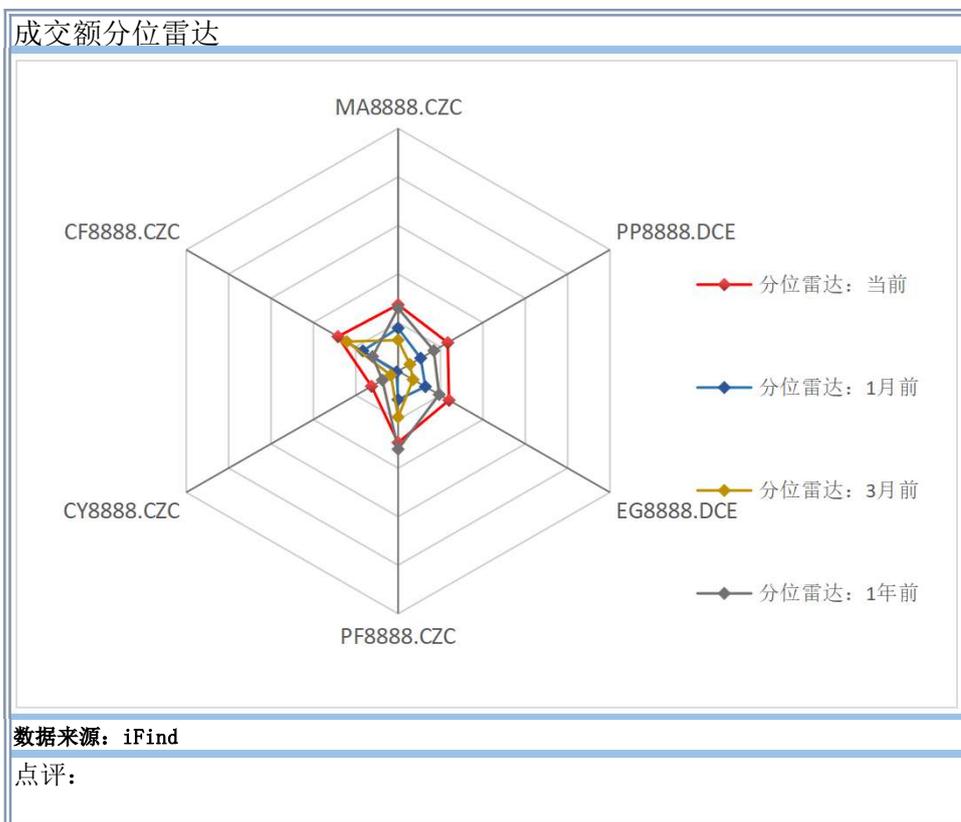
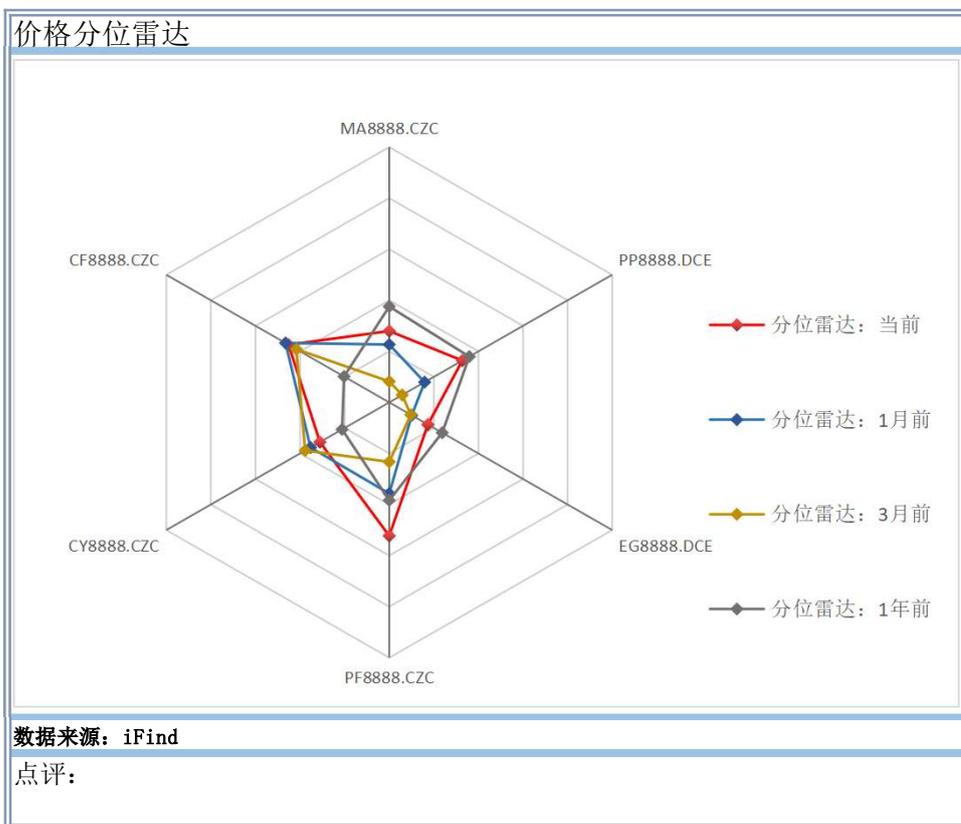


数据起始日: 2020-9-14  
 数据截止日: 2023-9-13  
 期内最小值: -1762.0000  
 期内最大值: 1066.0000  
 期内平均值: 20.8477  
 当前分位值: 38.26%



数据起始日: 2021-3-29  
 数据截止日: 2023-9-13  
 期内最小值: -6347.0000  
 期内最大值: 1216.0000  
 期内平均值: -2534.8602  
 当前分位值: 26.74%

### 三、煤化工相关



### MA. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020-9-14

数据截止日: 2023-9-13

期内最小值: 1920

期内最大值: 4015

期内平均值: 2559.2387

当前分位值: 27.97%

### PP. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020-9-14

数据截止日: 2023-9-13

期内最小值: 6865

期内最大值: 10224

期内平均值: 8149.7133

当前分位值: 32.78%

### EG. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020-9-14

数据截止日: 2023-9-13

期内最小值: 3658

期内最大值: 7345

期内平均值: 4600.9520

当前分位值: 17.33%

### PF. CZCE价格走势

数据起始日： 2022-4-7

数据截止日： 2023-9-13

期内最小值： 6477

期内最大值： 9022

期内平均值： 7350.8895

当前分位值： 52.26%



数据来源：iFind

点评：

### CY. CZCE价格走势

数据起始日： 2020-9-14

数据截止日： 2023-9-13

期内最小值： 19292

期内最大值： 30443

期内平均值： 23799.6145

当前分位值： 31.09%



数据来源：iFind

点评：

### CF. CZCE价格走势

数据起始日： 2020-9-14

数据截止日： 2023-9-13

期内最小值： 12447

期内最大值： 22574

期内平均值： 16686.7339

当前分位值： 45.19%



数据来源：iFind

点评：

数据起始日： 2020-9-14

数据截止日： 2023-9-13

期内最小值： -2039.0000

期内最大值： 2013.0000

期内平均值： 471.9973

当前分位值： 61.38%



数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2020-9-14

数据截止日： 2023-9-13

期内最小值： -1783.0000

期内最大值： 2269.0000

期内平均值： 616.2963

当前分位值： 93.14%



数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2022-4-7

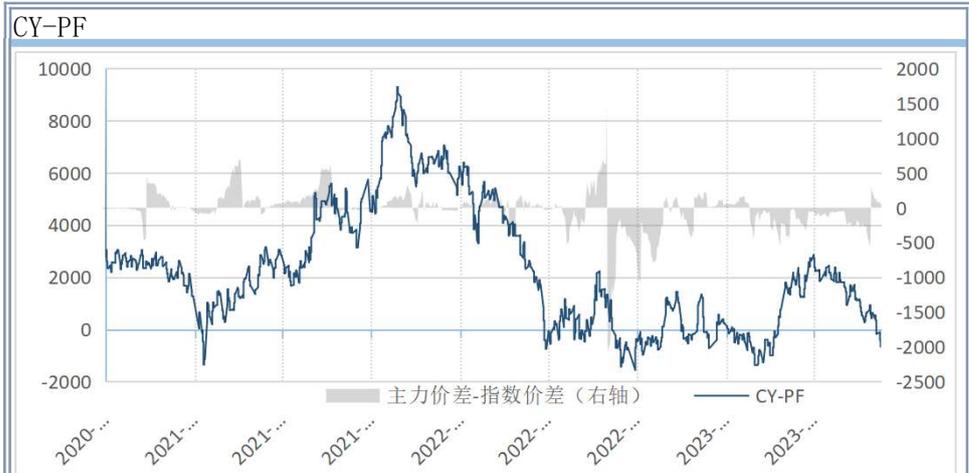
数据截止日： 2023-9-13

期内最小值： -1555.0000

期内最大值： 4707.0000

期内平均值： 746.9518

当前分位值： 14.26%



数据来源： iFind

点评：

### PF毛利

数据起始日：2022-4-7

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：-264.3150

期内最大值：112.9900

期内平均值：-91.8281

当前分位值：46.54%



数据来源：iFind

点评：

### CY-CF

数据起始日：2020-9-14

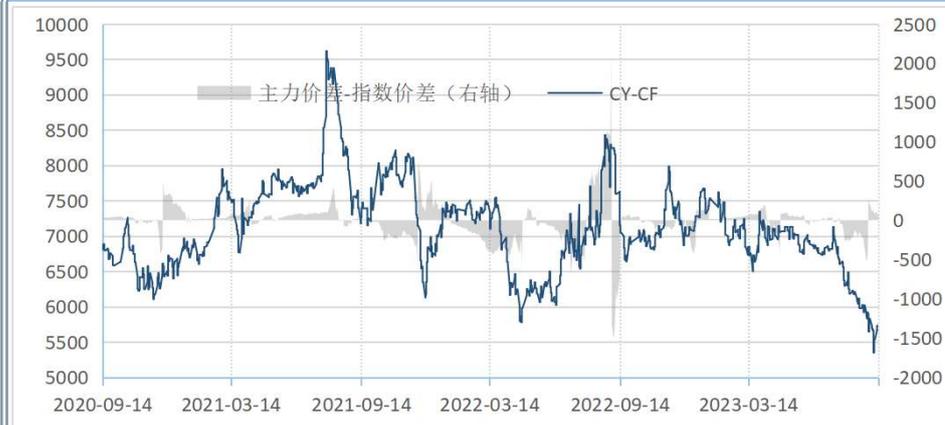
数据截止日：2023-9-13

期内最小值：5349.0000

期内最大值：9616.0000

期内平均值：7112.8807

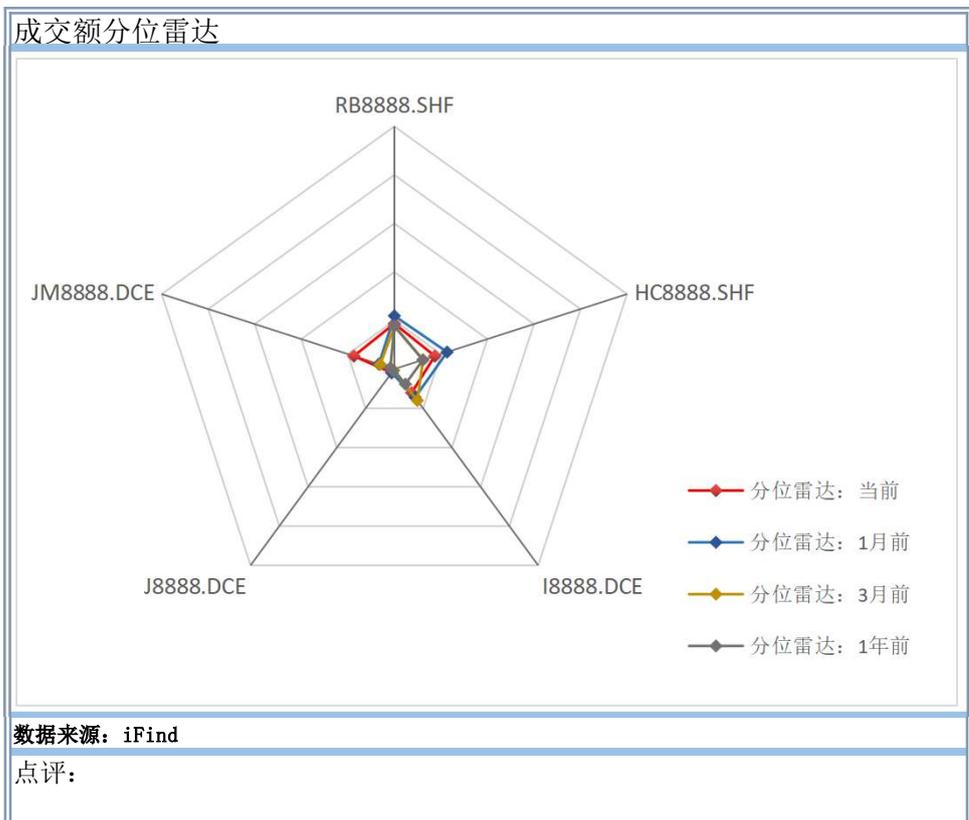
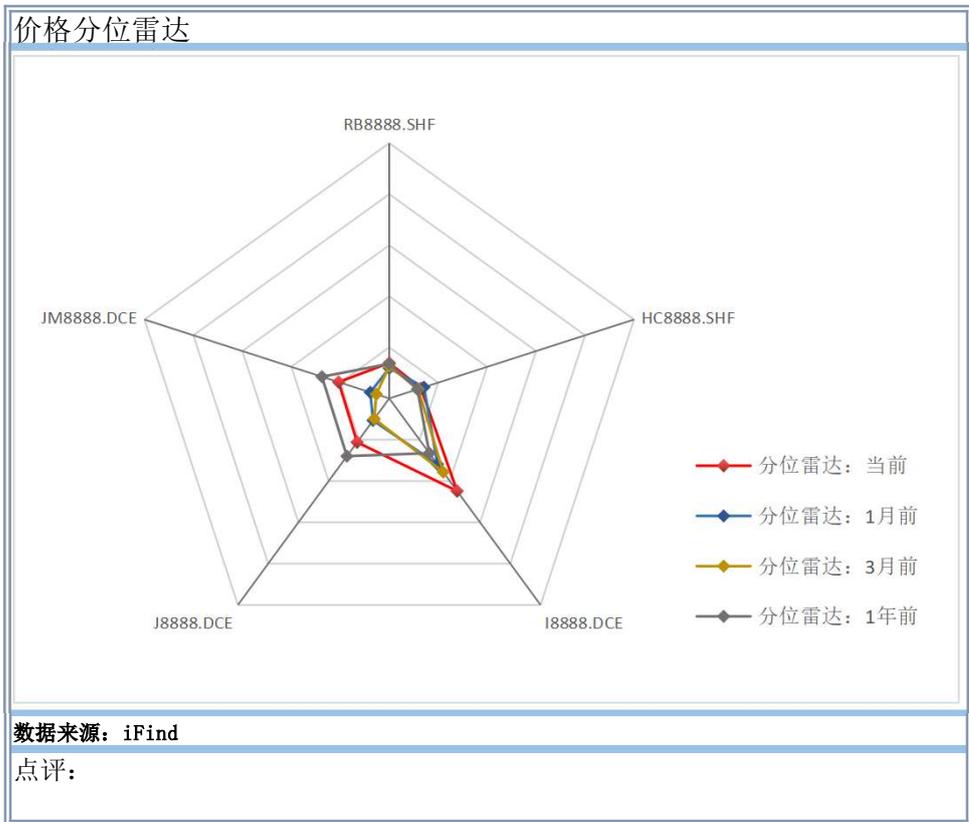
当前分位值：9.07%



数据来源：iFind

点评：

#### 四、黑色相关



### RB. SHFE价格走势

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：3377

期内最大值：6158

期内平均值：4338.0645

当前分位值：13.88%



数据来源：iFind

点评：

### HC. SHFE价格走势

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：3444

期内最大值：6675

期内平均值：4502.9410

当前分位值：12.97%



数据来源：iFind

点评：

### I. DCE价格走势

数据起始日：2020-9-14

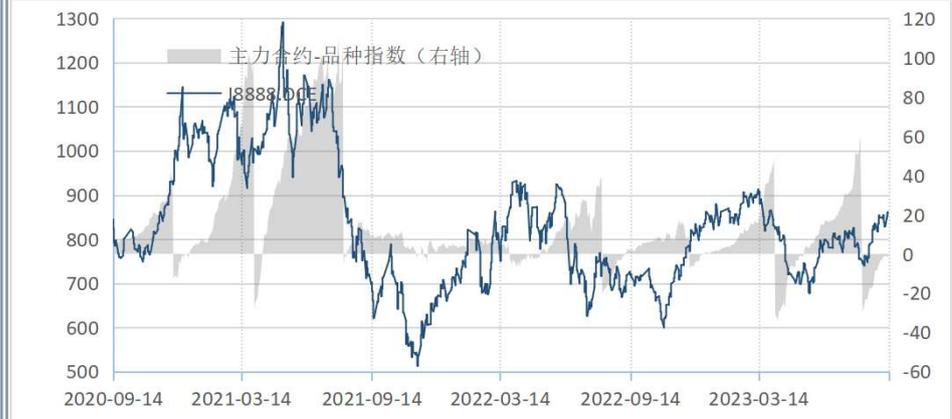
数据截止日：2023-9-13

期内最小值：512.8

期内最大值：1290.9

期内平均值：830.9132

当前分位值：44.84%



数据来源：iFind

点评：

### J. DCE价格走势

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：1896.9

期内最大值：4320.8

期内平均值：2747.3309

当前分位值：21.22%



数据来源：iFind

点评：

### Jm. DCE价格走势

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：1219.4

期内最大值：3764.7

期内平均值：1965.3889

当前分位值：20.67%



数据来源：iFind

点评：

### 螺铁差

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：722.1765

期内最大值：2451.8235

期内平均值：1255.6701

当前分位值：5.88%



数据来源：iFind

点评：

### 螺纹利润

数据起始日：2020-9-14

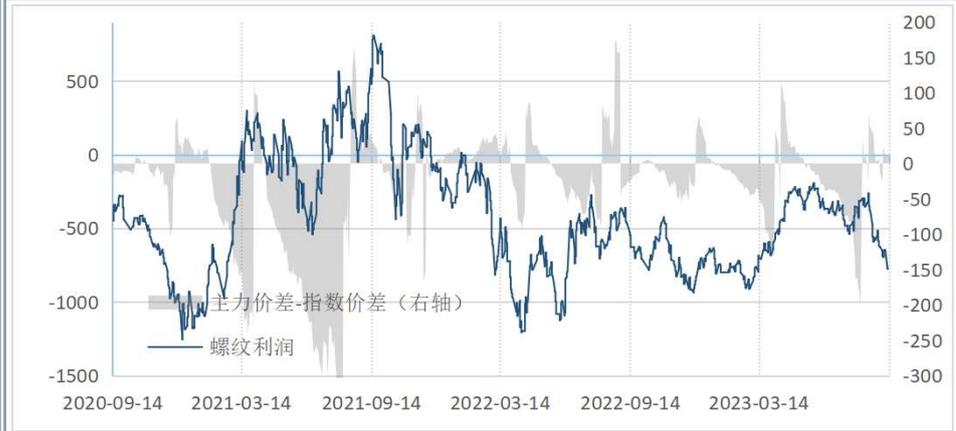
数据截止日：2023-9-13

期内最小值：-1255.7273

期内最大值：810.0000

期内平均值：-425.6359

当前分位值：23.07%



数据来源：iFind

点评：

### 卷铁差

数据起始日：2020-9-14

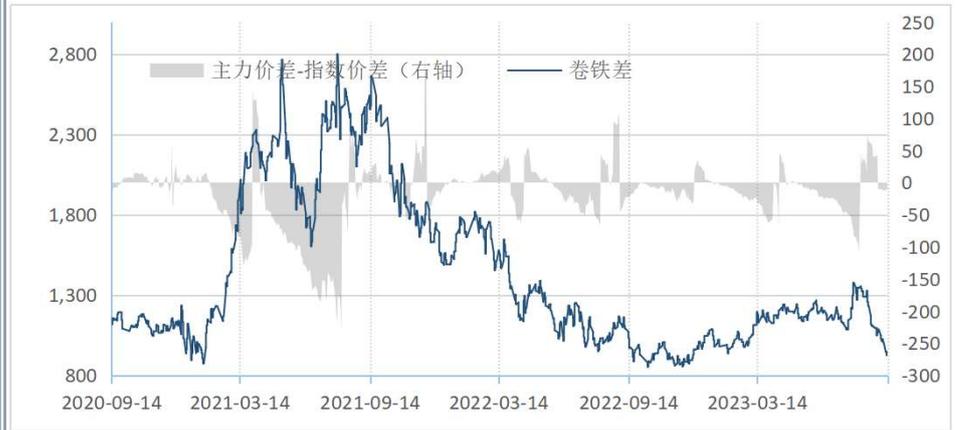
数据截止日：2023-9-13

期内最小值：851.9412

期内最大值：2799.4118

期内平均值：1420.5467

当前分位值：3.70%



数据来源：iFind

点评：

### 热卷利润

数据起始日：2020-9-14

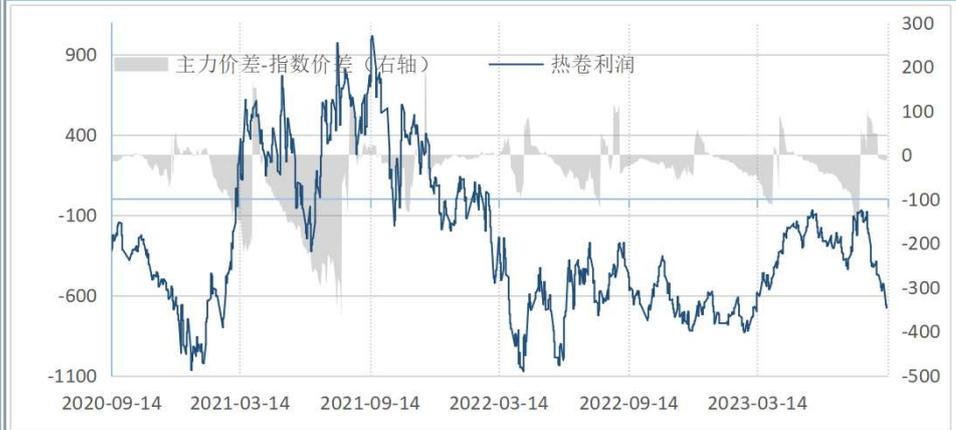
数据截止日：2023-9-13

期内最小值：-1073.7273

期内最大值：1014.0000

期内平均值：-260.7593

当前分位值：18.90%



数据来源：iFind

点评：

### 卷螺差

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：-56.0000

期内最大值：529.0000

期内平均值：164.8765

当前分位值：26.67%



数据来源：iFind

点评：

### 螺矿比

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：3.8923

期内最大值：8.7631

期内平均值：5.3165

当前分位值：9.74%



数据来源：iFind

点评：

### 焦矿比

数据起始日：2020-9-14

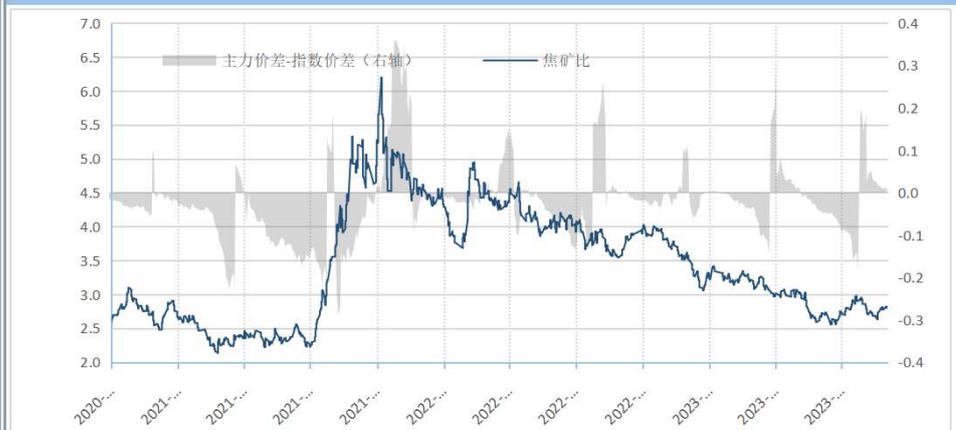
数据截止日：2023-9-13

期内最小值：2.1354

期内最大值：6.1947

期内平均值：3.4075

当前分位值：16.33%



数据来源：iFind

点评：

J-Jm

数据起始日： 2020-9-14

数据截止日： 2023-9-13

期内最小值： -1043.0800

期内最大值： 629.9200

期内平均值： -4.2136

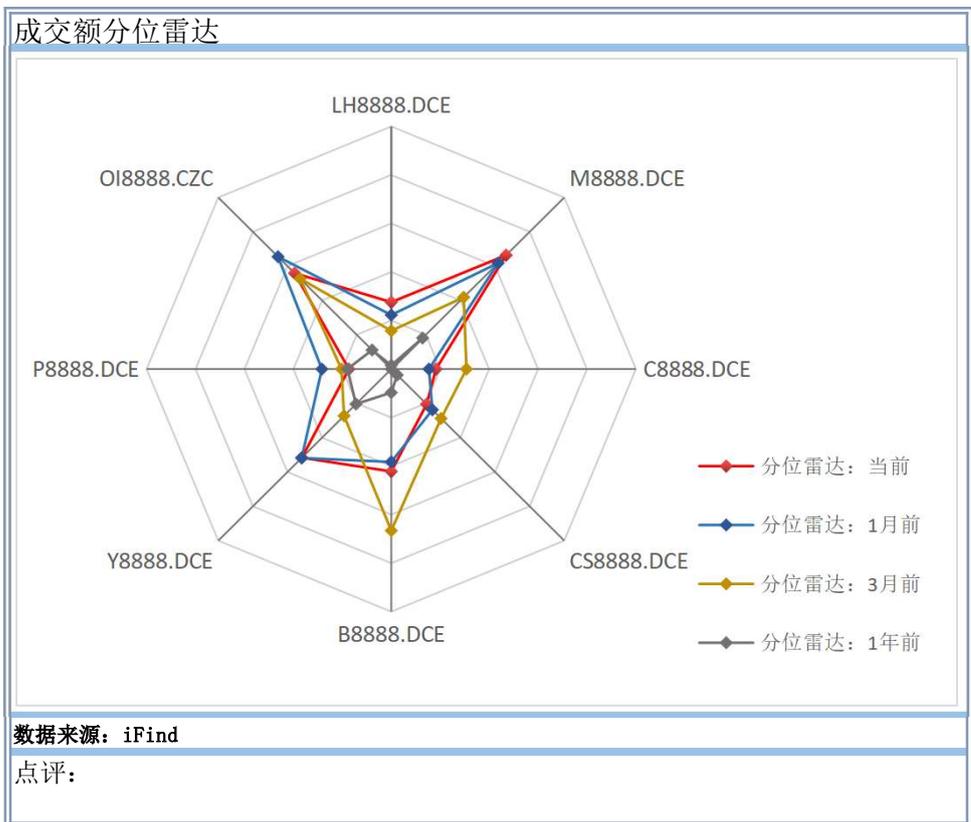
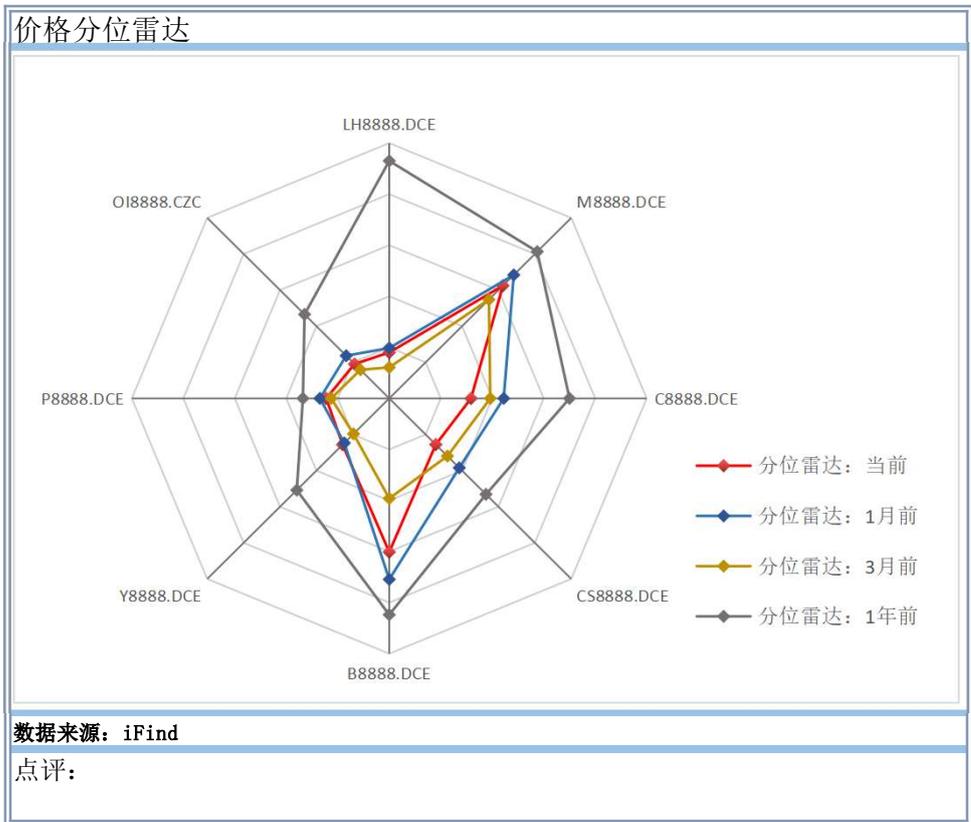
当前分位值： 60.40%



数据来源： iFind

点评：

五、农产品相关



### LH. DCE价格走势

数据起始日：2022-7-11

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：15507

期内最大值：22735

期内平均值：18221.0724

当前分位值：18.00%



数据来源：iFind

点评：

### M. DCE价格走势

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：2980

期内最大值：4328

期内平均值：3626.6790

当前分位值：62.46%



数据来源：iFind

点评：

### C. DCE价格走势

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：2413

期内最大值：3027

期内平均值：2718.7339

当前分位值：31.76%



数据来源：iFind

点评：

### CS. DCE价格走势

数据起始日： 2020-9-14

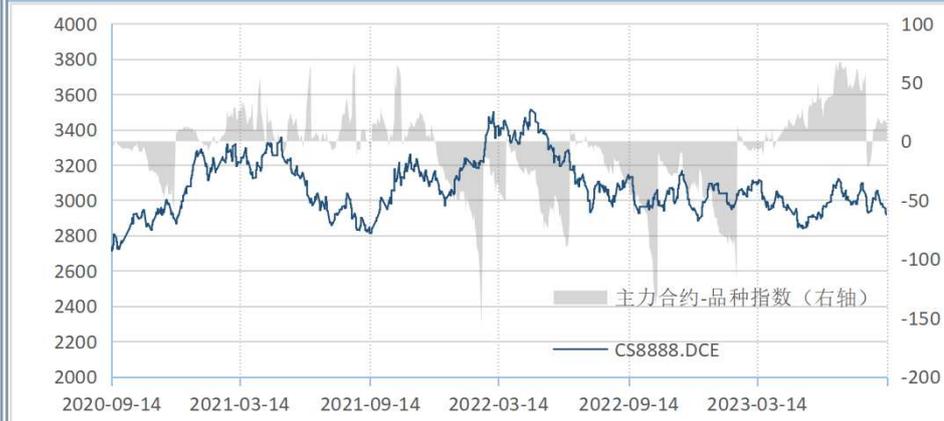
数据截止日： 2023-9-13

期内最小值： 2714

期内最大值： 3512

期内平均值： 3077.6049

当前分位值： 25.56%



数据来源： iFind

点评：

### B. DCE价格走势

数据起始日： 2020-9-14

数据截止日： 2023-9-13

期内最小值： 3541

期内最大值： 5585

期内平均值： 4511.2483

当前分位值： 60.18%



数据来源： iFind

点评：

### Y. DCE价格走势

数据起始日： 2020-9-14

数据截止日： 2023-9-13

期内最小值： 6698

期内最大值： 12065

期内平均值： 8782.3100

当前分位值： 25.60%



数据来源： iFind

点评：

### P. DCE价格走势

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：5709

期内最大值：12479

期内平均值：8166.9465

当前分位值：24.49%



数据来源：iFind

点评：

### OI. CZCE价格走势

数据起始日：2020-9-14

数据截止日：2023-9-13

期内最小值：7475

期内最大值：14344

期内平均值：10597.6612

当前分位值：19.04%



数据来源：iFind

点评：

### 育肥收益

数据起始日：2022-7-11

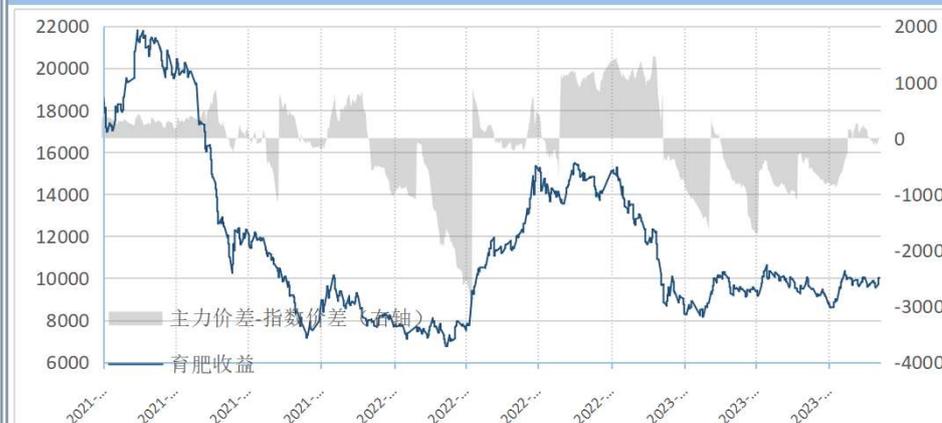
数据截止日：2023-9-13

期内最小值：8156.2500

期内最大值：15480.0000

期内平均值：11089.7302

当前分位值：24.96%



数据来源：iFind

点评：

### 育肥肉料差(高料)

数据起始日: 2022-7-11

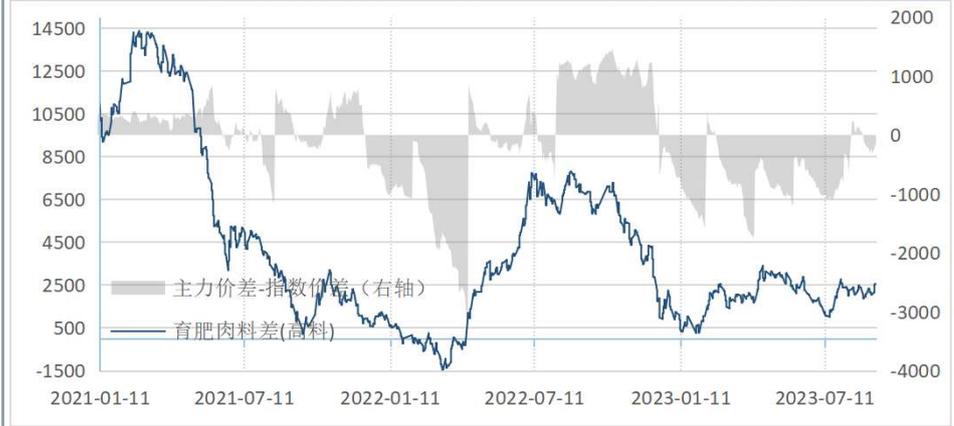
数据截止日: 2023-9-13

期内最小值: 246.0000

期内最大值: 7791.0000

期内平均值: 3418.2207

当前分位值: 30.59%



数据来源: iFind

点评:

### 豆二厂库置换

数据起始日: 2020-9-14

数据截止日: 2023-9-13

期内最小值: -745.0200

期内最大值: 58.2450

期内平均值: -199.5779

当前分位值: 38.29%



数据来源: iFind

点评:

### Cs-C

数据起始日: 2020-9-14

数据截止日: 2023-9-13

期内最小值: 62.0000

期内最大值: 598.0000

期内平均值: 358.8711

当前分位值: 46.27%



数据来源: iFind

点评:

数据起始日： 2020-9-14

数据截止日： 2023-9-13

期内最小值： -1313.0000

期内最大值： 1788.0000

期内平均值： 615.3635

当前分位值： 65.08%



数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2022-4-7

数据截止日： 2023-9-13

期内最小值： 950.0000

期内最大值： 3919.0000

期内平均值： 2090.3626

当前分位值： 15.70%



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。