

<http://www.shaninqh.com>

盘面套利观察

制作：强子益

2023年10月27日

投资咨询： Z0015283

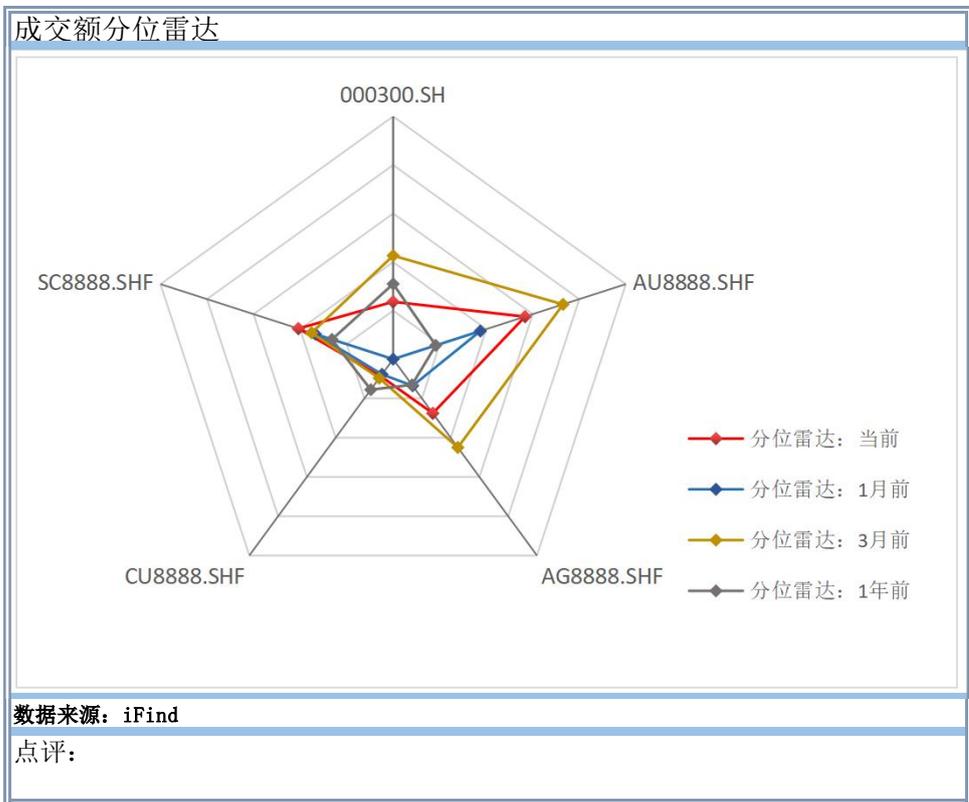
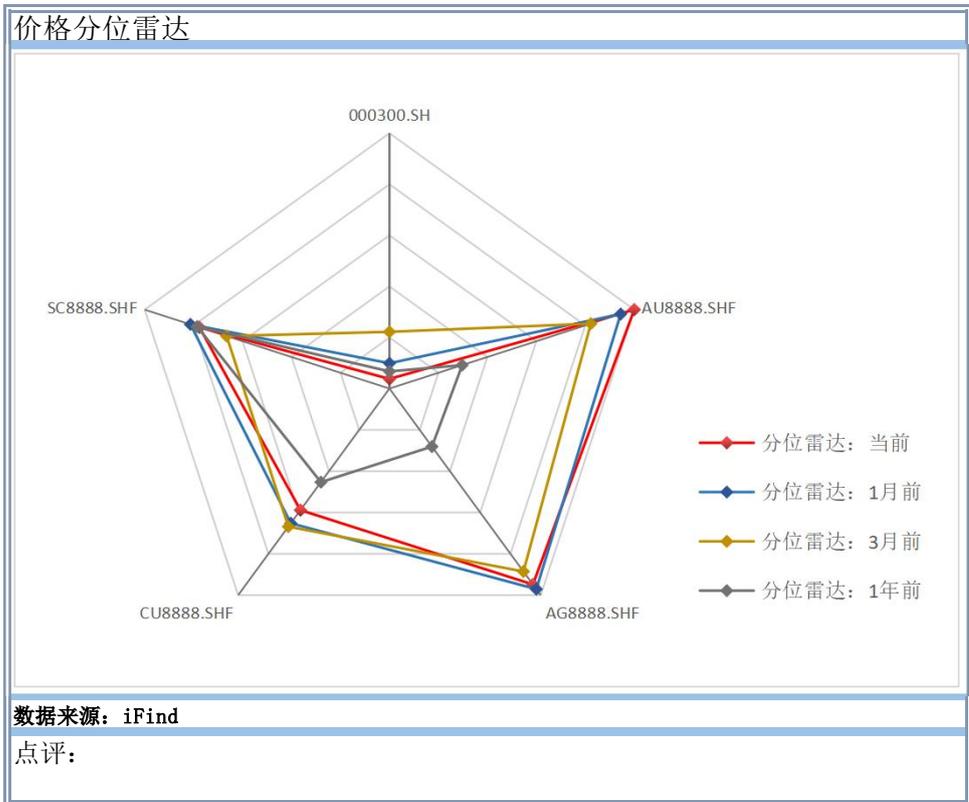
数据仅供参考，据此入市，风险自负。

邮箱： 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： 2020/10/28

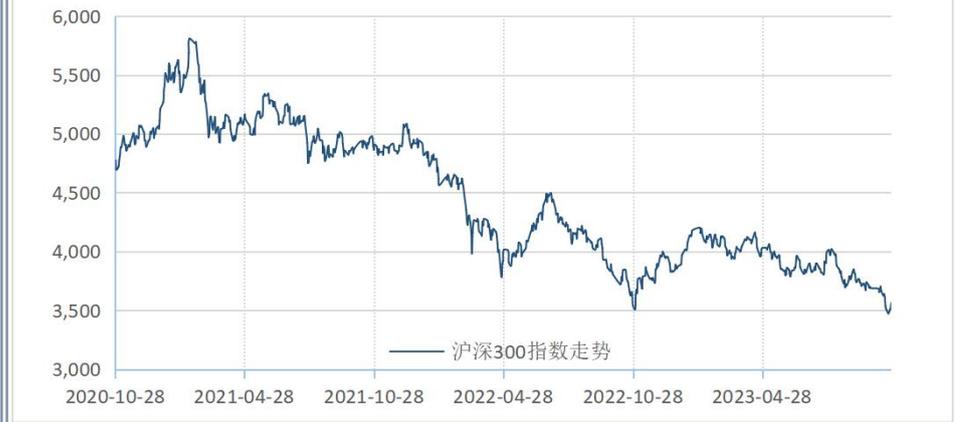
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 3474.2438

期内最大值： 5807.7191

期内平均值： 4449.3786

当前分位值： 22.22%



Au. SHFE价格走势

数据起始日： 2020/10/28

数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 356.92

期内最大值： 478.24

期内平均值： 401.6756

当前分位值： 100.00%



Cu. SHFE价格走势

数据起始日： 2020/10/28

数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 51000

期内最大值： 77934

期内平均值： 66869.5061

当前分位值： 58.84%



Sc. Ine价格走势

数据起始日：2020/10/28

数据截止日：2023/10/27

期内最小值：232.3

期内最大值：791.6

期内平均值：533.9826

当前分位值：77.63%



数据来源：iFind

点评：

Cu/Au

数据起始日：2020/10/28

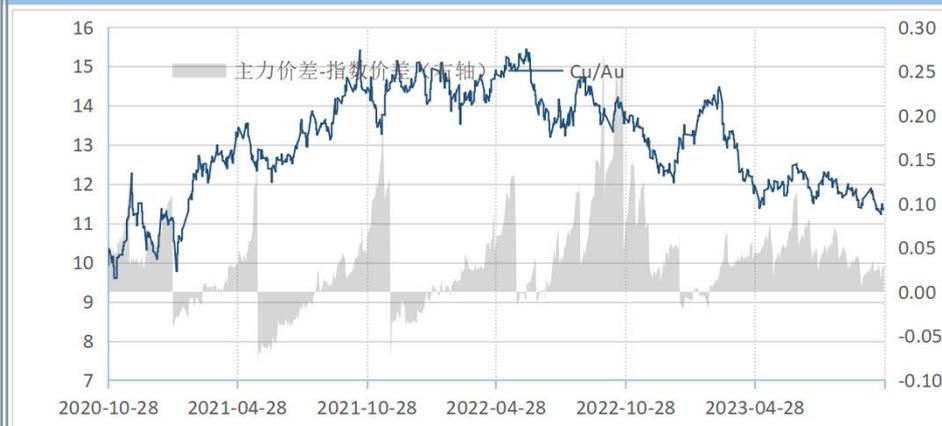
数据截止日：2023/10/27

期内最小值：9.5969

期内最大值：15.4319

期内平均值：13.0546

当前分位值：30.53%



数据来源：iFind

点评：

Sc/Au

数据起始日：2020/10/28

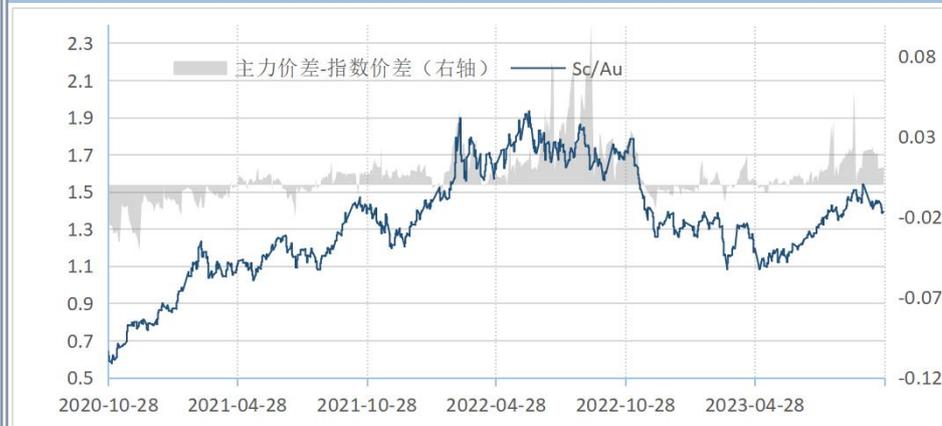
数据截止日：2023/10/27

期内最小值：0.5769

期内最大值：1.9320

期内平均值：1.3287

当前分位值：60.27%



数据来源：iFind

点评：

Sc/000300

数据起始日：2020/10/28

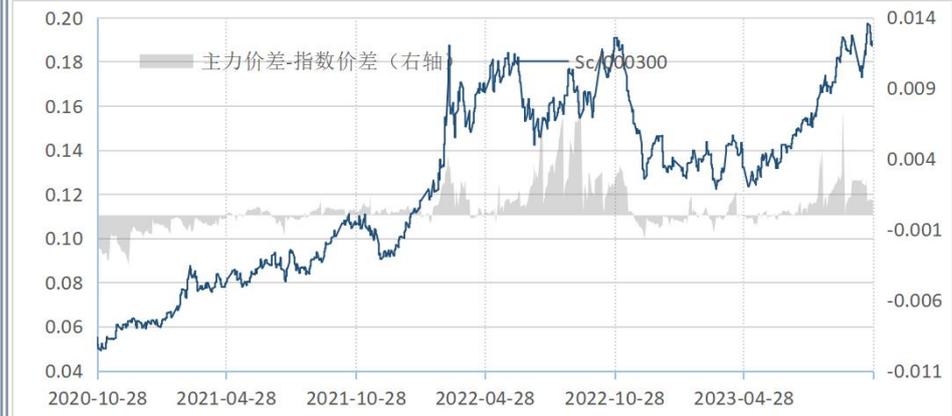
数据截止日：2023/10/27

期内最小值：0.0492

期内最大值：0.1972

期内平均值：0.1245

当前分位值：93.19%



数据来源：iFind

点评：

Au/Ag

数据起始日：2020/10/28

数据截止日：2023/10/27

期内最小值：0.0648

期内最大值：0.0932

期内平均值：0.0783

当前分位值：58.56%



数据来源：iFind

点评：

000300/Au

数据起始日：2020/10/28

数据截止日：2023/10/27

期内最小值：0.5939

期内最大值：1.1021

期内平均值：0.8691

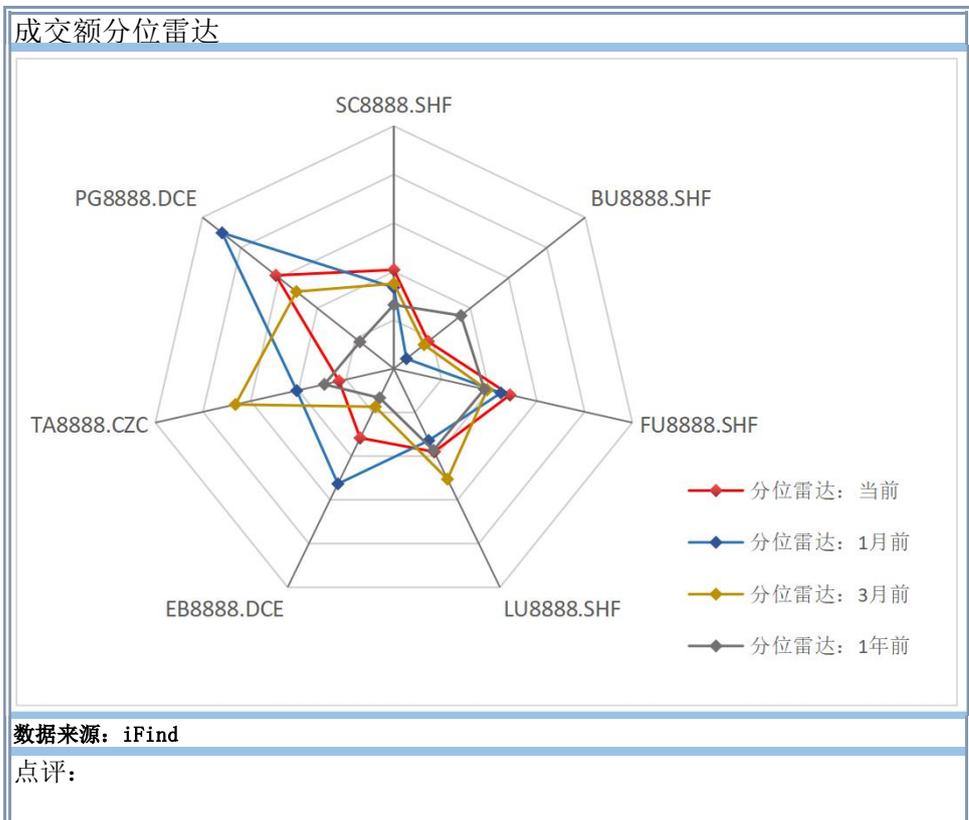
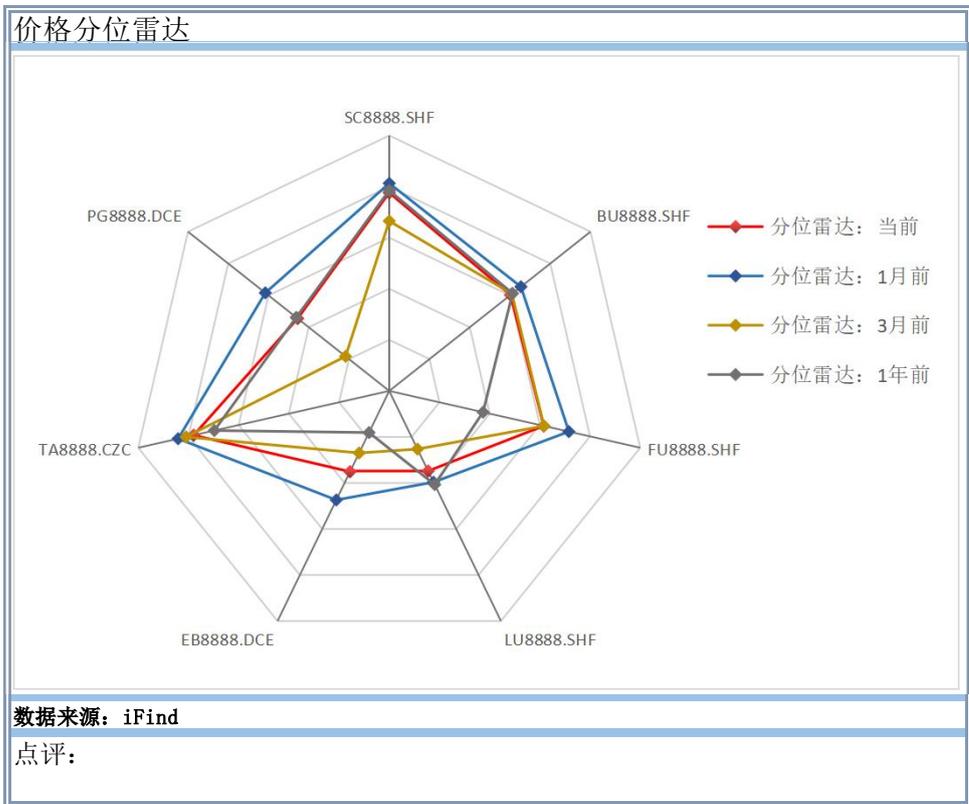
当前分位值：2.46%



数据来源：iFind

点评：

二、原油相关



Sc. Ine价格走势

数据起始日： 2020/10/28

数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 232.3

期内最大值： 791.6

期内平均值： 533.9826

当前分位值： 77.63%



数据来源： iFind

点评：

Bu. SHFE价格走势

数据起始日： 2020/10/28

数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 2176

期内最大值： 4794

期内平均值： 3478.0892

当前分位值： 60.28%



数据来源： iFind

点评：

Fu. SHFE价格走势

数据起始日： 2020/10/28

数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 1682

期内最大值： 4371

期内平均值： 2915.3538

当前分位值： 61.55%



数据来源： iFind

点评：

Lu. Ine价格走势

数据起始日： 2022/1/24

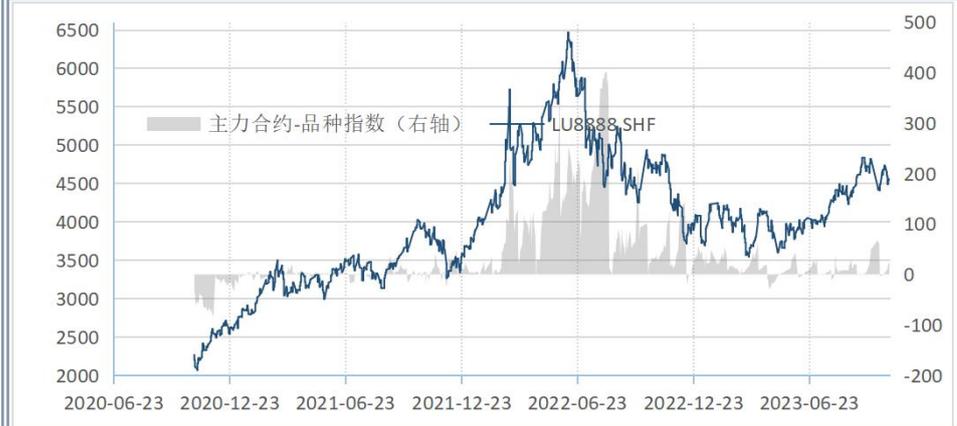
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 3544

期内最大值： 6464

期内平均值： 4521.8282

当前分位值： 34.79%



数据来源： iFind

点评：

EB. DCE价格走势

数据起始日： 2021/5/10

数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 6978

期内最大值： 11361

期内平均值： 8694.0166

当前分位值： 35.09%



数据来源： iFind

点评：

PTA. CZCE价格走势

数据起始日： 2020/10/28

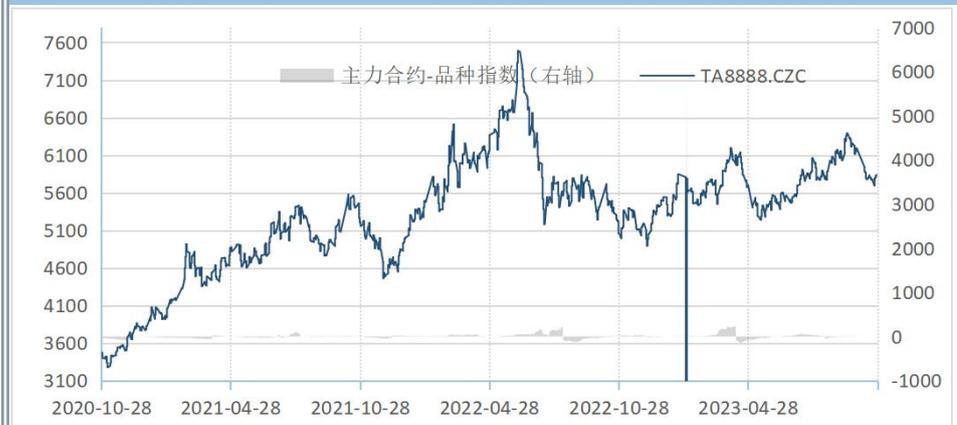
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 0

期内最大值： 7488

期内平均值： 5295.9575

当前分位值： 77.92%



数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2021/11/3

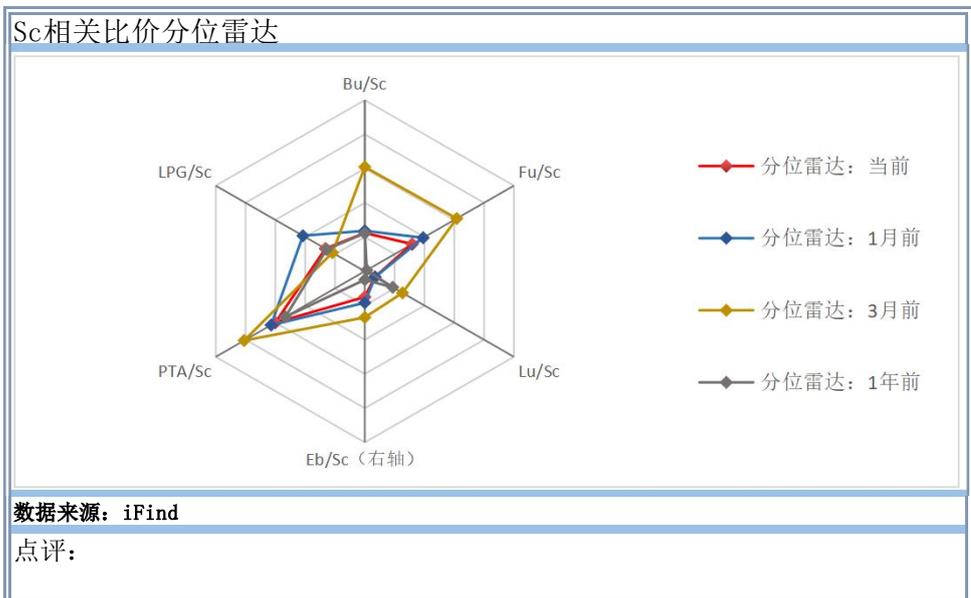
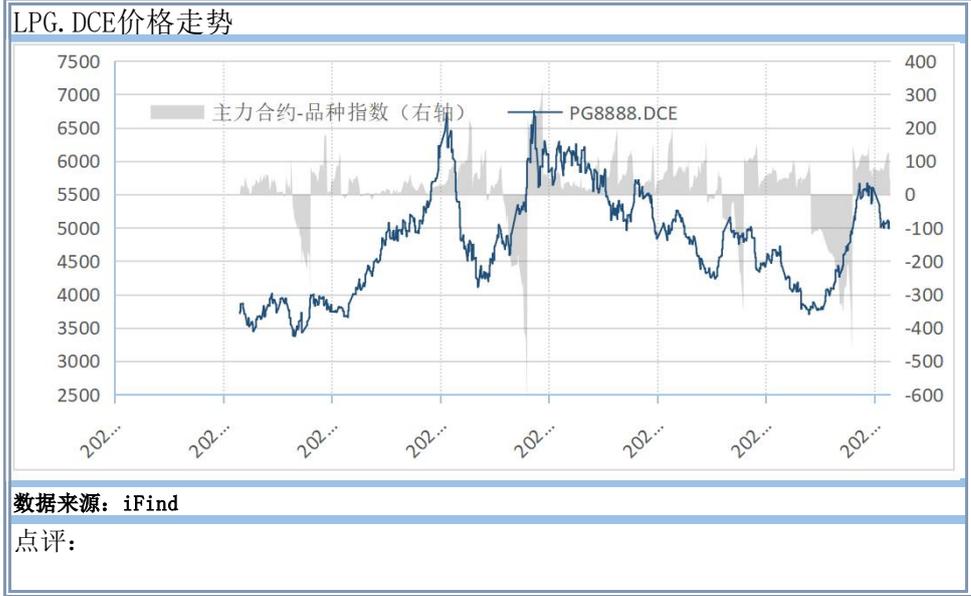
数据截止日： 2023/10/27

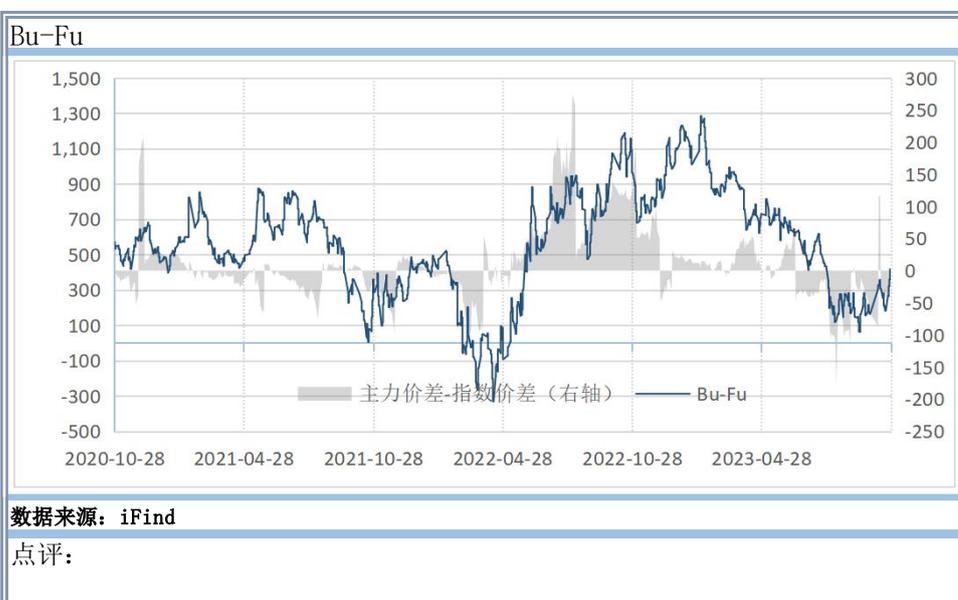
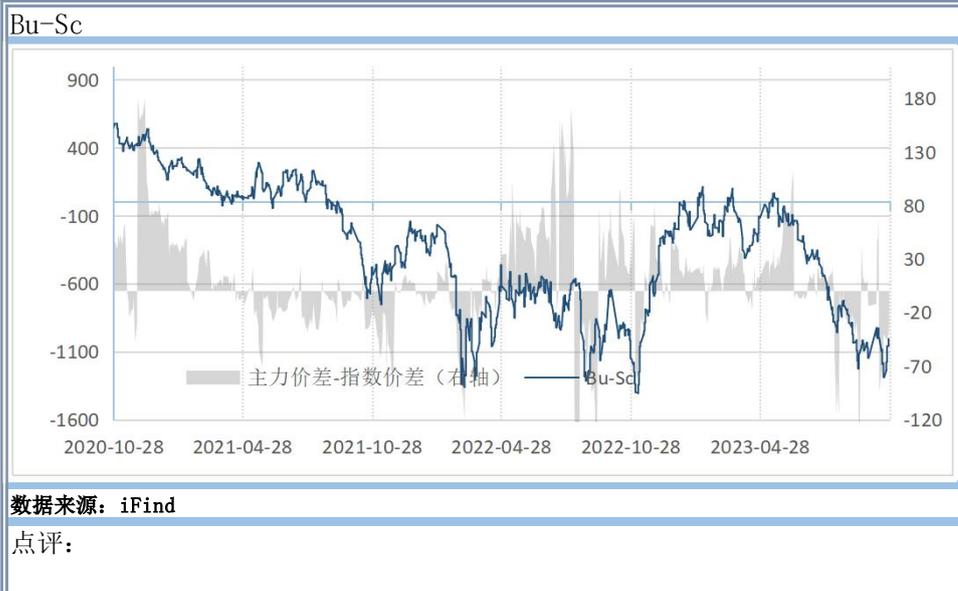
期内最小值： 3704

期内最大值： 6749

期内平均值： 4985.6577

当前分位值： 45.52%





数据起始日： 2021/11/3

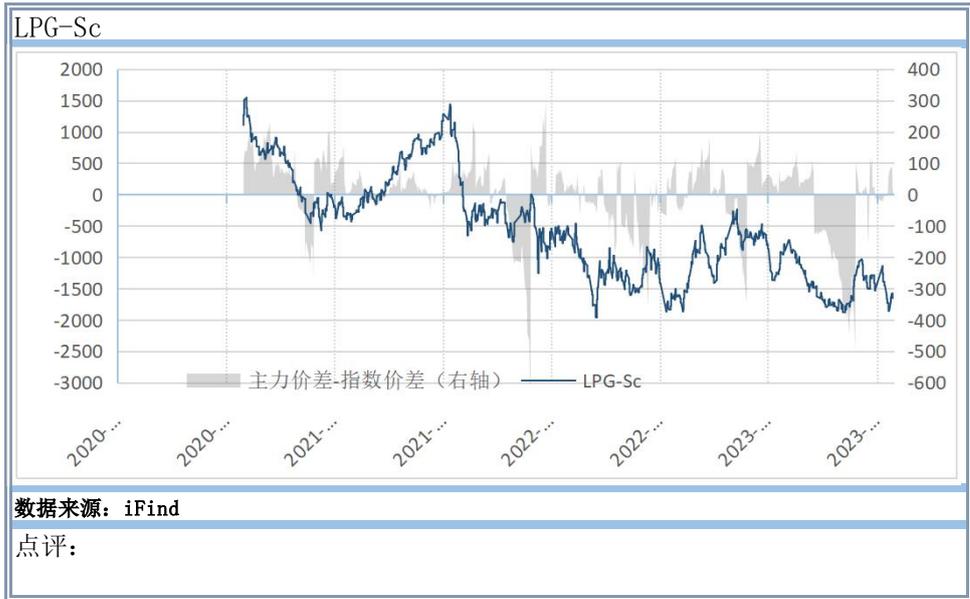
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： -1959.0000

期内最大值： -1.0000

期内平均值： -1039.1660

当前分位值： 19.61%



数据起始日： 2020/10/28

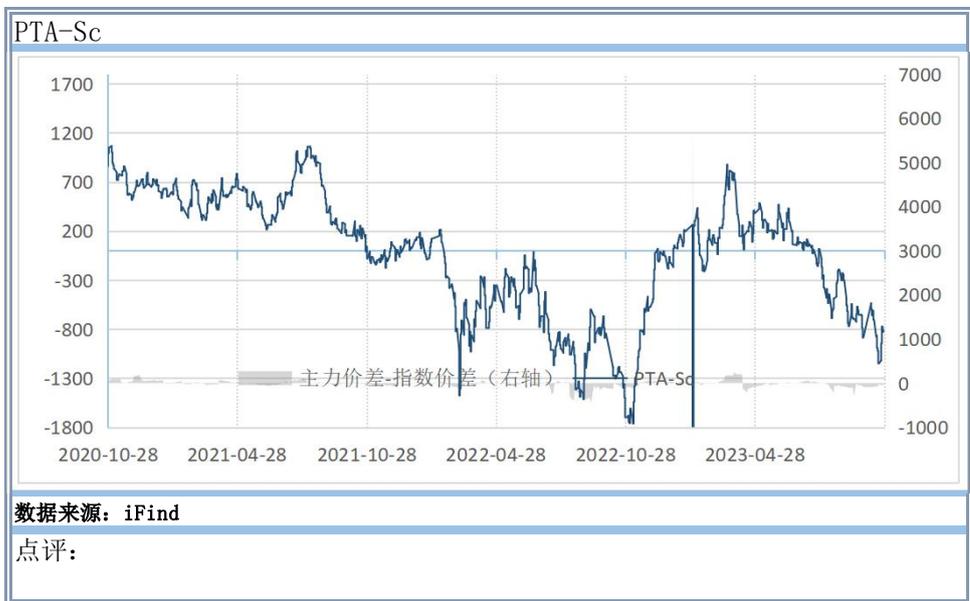
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： -5425.0000

期内最大值： 1066.0000

期内平均值： -43.8683

当前分位值： 70.79%



数据起始日： 2021/5/10

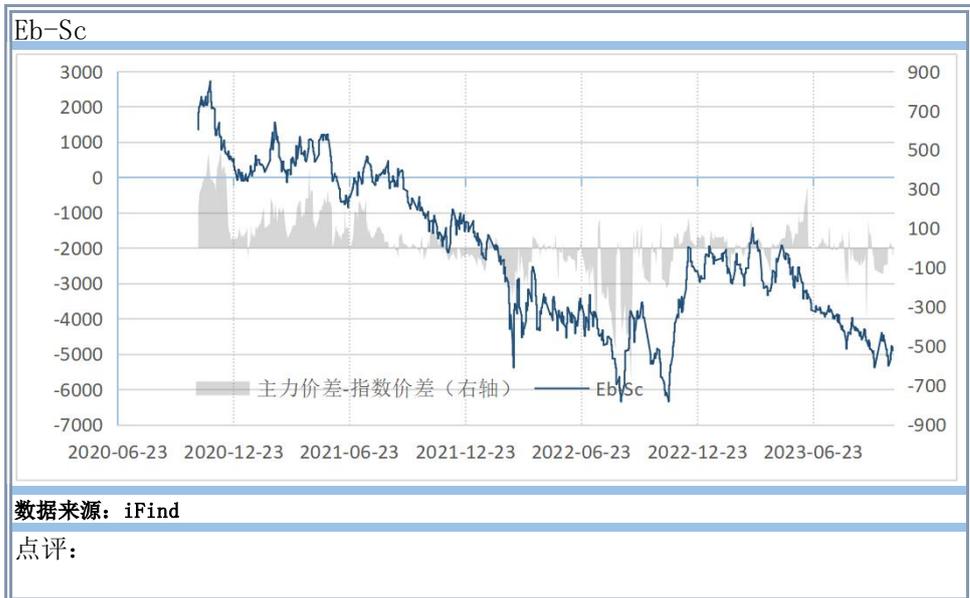
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： -6347.0000

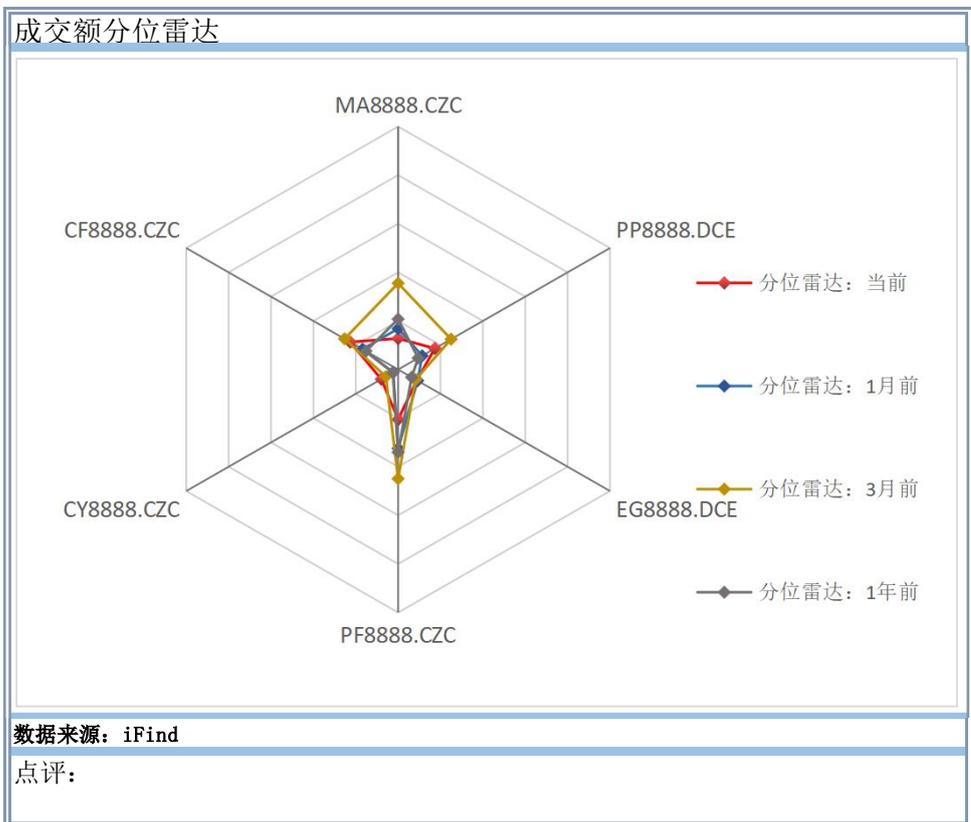
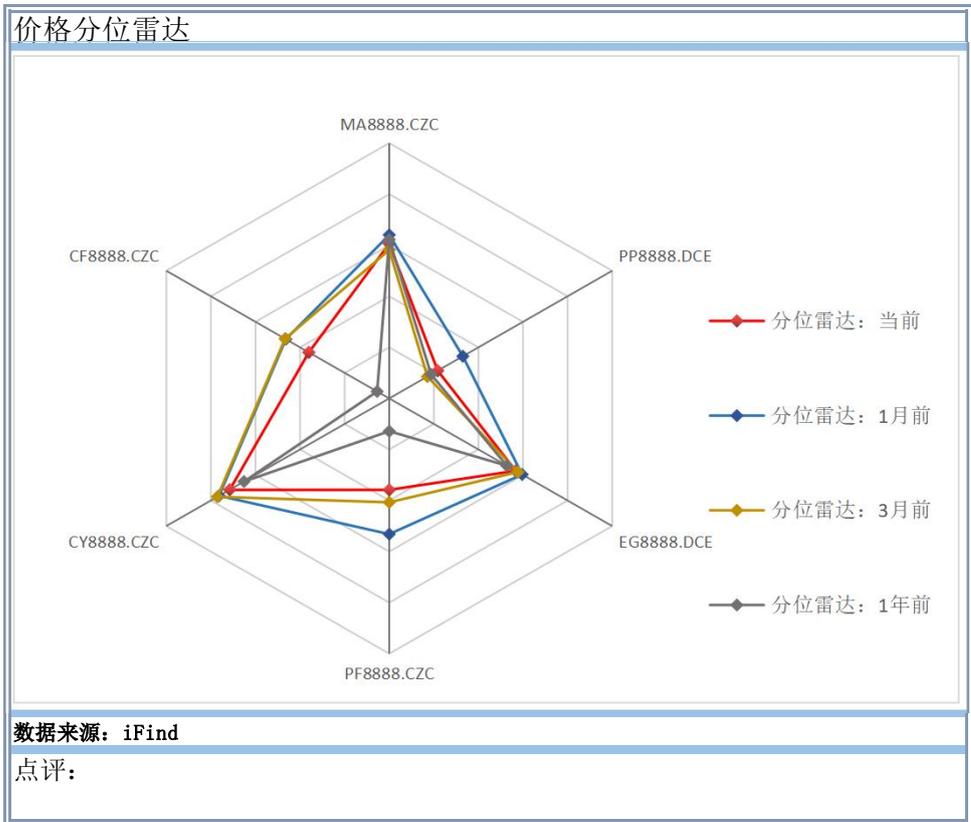
期内最大值： 1216.0000

期内平均值： -2776.5092

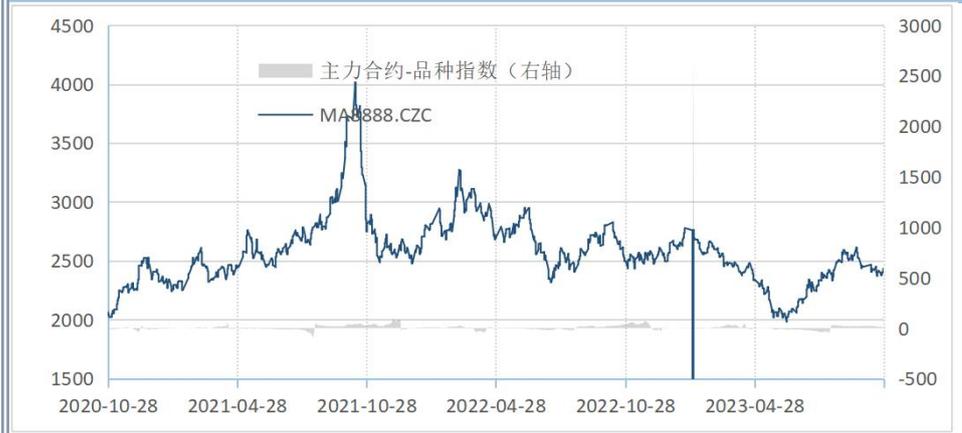
当前分位值： 20.27%



三、煤化工相关



MA. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020/10/28

数据截止日: 2023/10/27

期内最小值: 0

期内最大值: 4015

期内平均值: 2570.4911

当前分位值: 60.57%

PP. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020/10/28

数据截止日: 2023/10/27

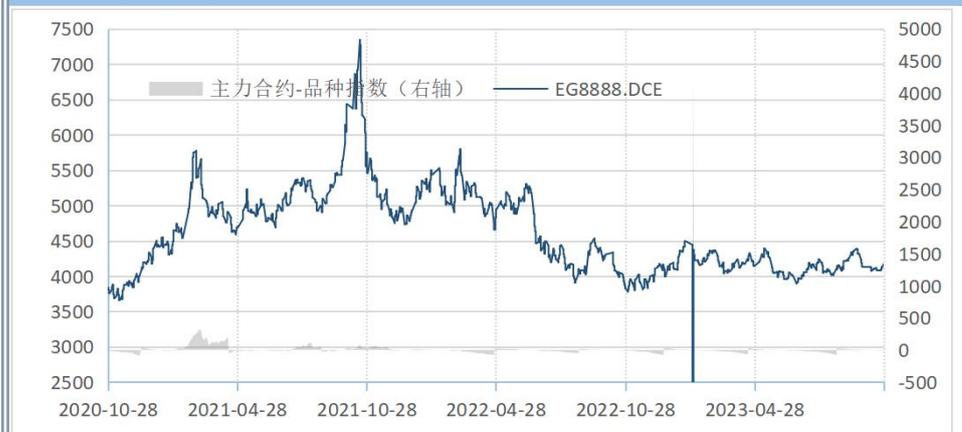
期内最小值: 6865

期内最大值: 10224

期内平均值: 8145.8628

当前分位值: 21.73%

EG. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020/10/28

数据截止日: 2023/10/27

期内最小值: 0

期内最大值: 7345

期内平均值: 4605.5981

当前分位值: 56.72%

PF. CZCE价格走势

数据起始日：2022/5/18

数据截止日：2023/10/27

期内最小值：6477

期内最大值：9022

期内平均值：7319.1218

当前分位值：35.83%



数据来源：iFind

点评：

CY. CZCE价格走势

数据起始日：2020/10/28

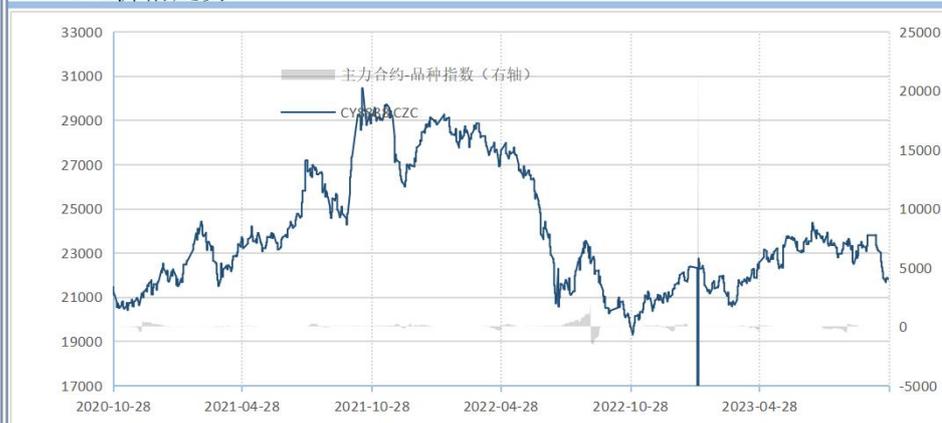
数据截止日：2023/10/27

期内最小值：0

期内最大值：30443

期内平均值：23853.1084

当前分位值：71.56%



数据来源：iFind

点评：

CF. CZCE价格走势

数据起始日：2020/10/28

数据截止日：2023/10/27

期内最小值：12447

期内最大值：22574

期内平均值：16801.6516

当前分位值：36.07%



数据来源：iFind

点评：

数据起始日： 2020/10/28

数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： -2039.0000

期内最大值： 8144.0000

期内平均值： 434.3896

当前分位值： 22.96%



数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2020/10/28

数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： -1783.0000

期内最大值： 2269.0000

期内平均值： 690.3594

当前分位值： 85.19%



数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2022/5/18

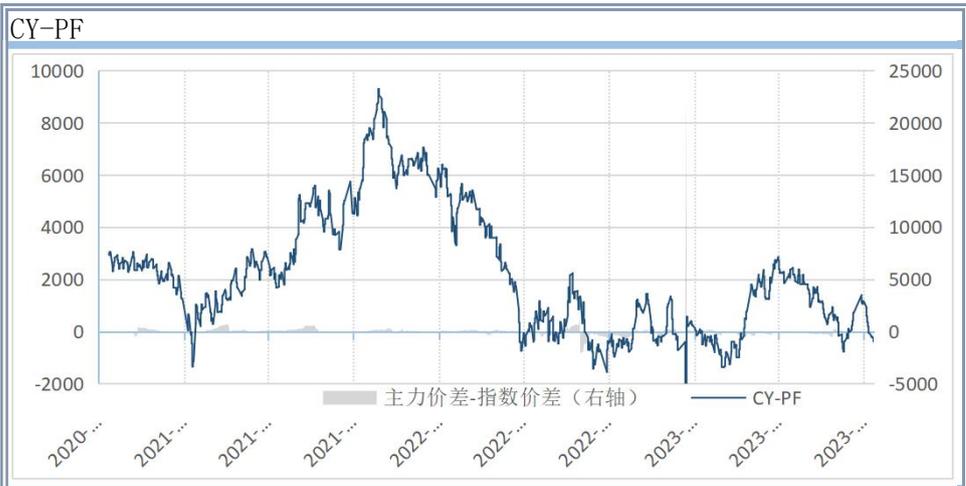
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： -22455.0000

期内最大值： 2854.0000

期内平均值： 430.5014

当前分位值： 87.21%



数据来源： iFind

点评：

PF毛利

数据起始日： 2022/5/18

数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： -264.3150

期内最大值： 6405.0000

期内平均值： -71.1080

当前分位值： 2.83%



数据来源： iFind

点评：

CY-CF

数据起始日： 2020/10/28

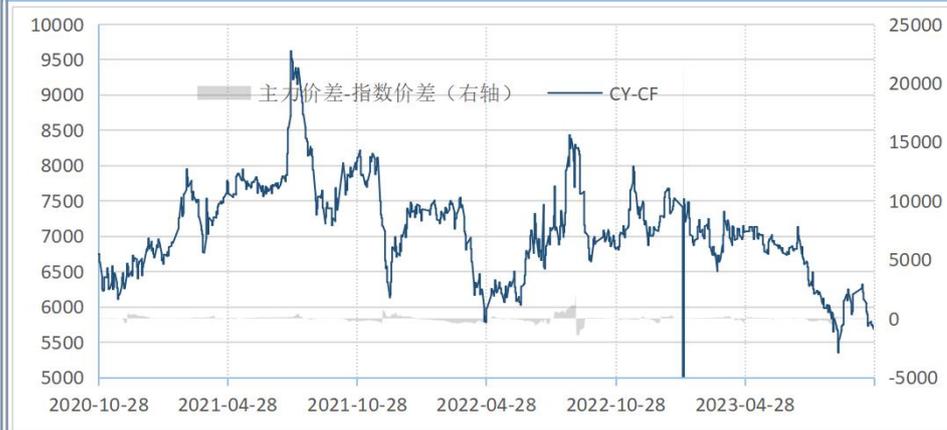
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： -15118.0000

期内最大值： 9616.0000

期内平均值： 7051.4568

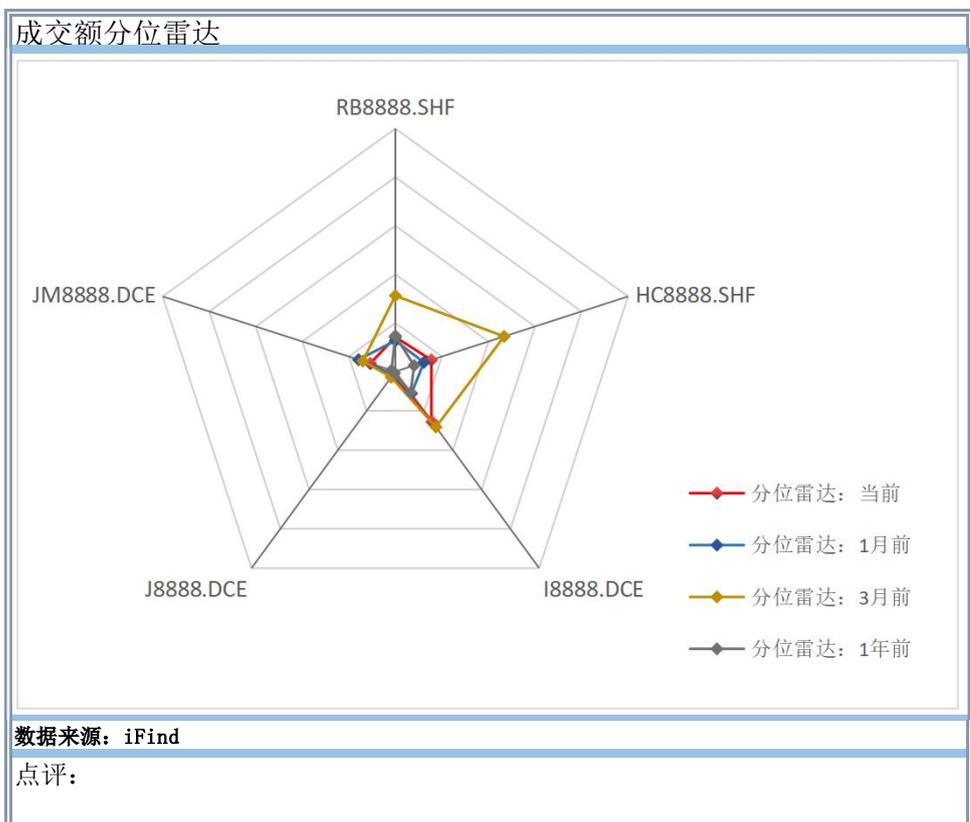
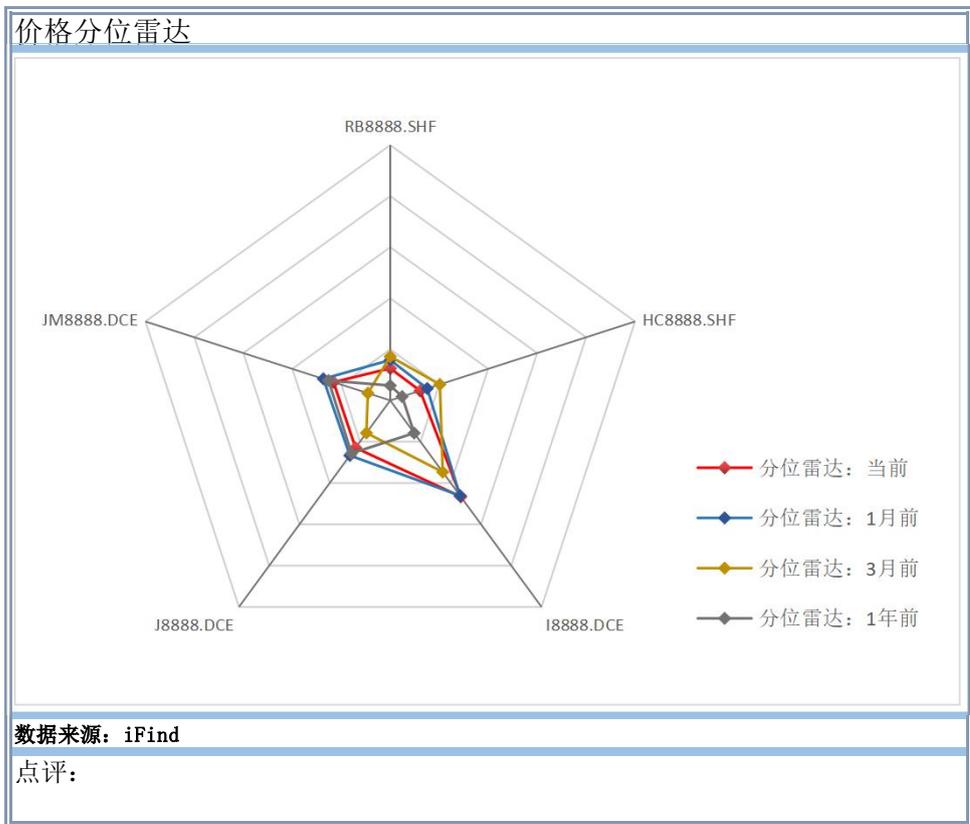
当前分位值： 84.11%



数据来源： iFind

点评：

四、黑色相关



RB. SHFE价格走势

数据起始日： 2020/10/28

数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 3377

期内最大值： 6158

期内平均值： 4342.1331

当前分位值： 12.55%



数据来源： iFind

点评：

HC. SHFE价格走势

数据起始日： 2020/10/28

数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 3444

期内最大值： 6675

期内平均值： 4505.9328

当前分位值： 12.23%



数据来源： iFind

点评：

I. DCE价格走势

数据起始日： 2020/10/28

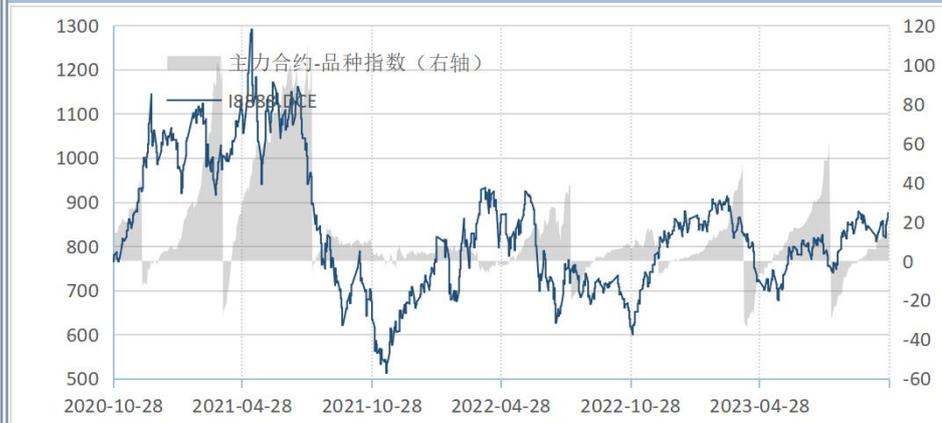
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 512.8

期内最大值： 1290.9

期内平均值： 833.2091

当前分位值： 46.59%



数据来源： iFind

点评：

J. DCE价格走势

数据起始日：2020/10/28

数据截止日：2023/10/27

期内最小值：1897.9

期内最大值：4320.8

期内平均值：2761.4052

当前分位值：22.94%



数据来源：iFind

点评：

Jm. DCE价格走势

数据起始日：2020/10/28

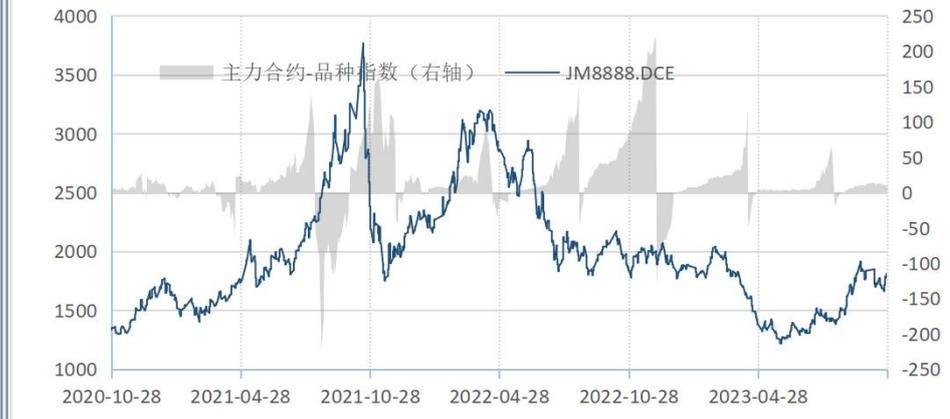
数据截止日：2023/10/27

期内最小值：1219.4

期内最大值：3764.7

期内平均值：1982.4878

当前分位值：23.18%



数据来源：iFind

点评：

螺铁差

数据起始日：2020/10/28

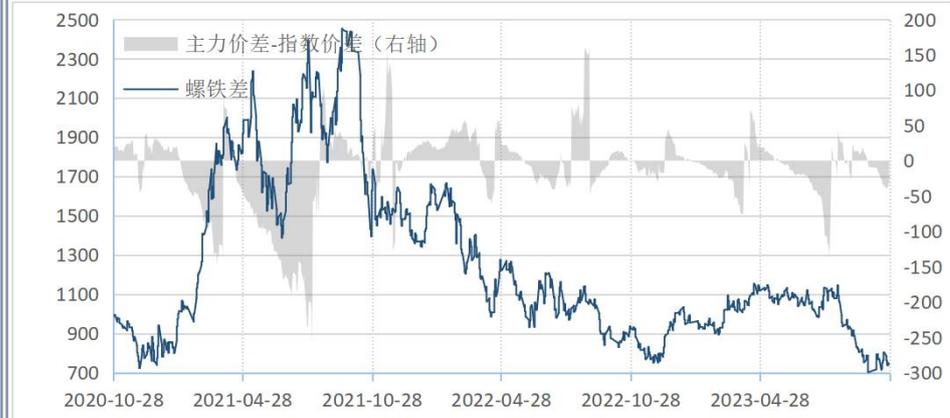
数据截止日：2023/10/27

期内最小值：701.8824

期内最大值：2451.8235

期内平均值：1247.4081

当前分位值：2.07%



数据来源：iFind

点评：

螺纹利润

数据起始日： 2020/10/28

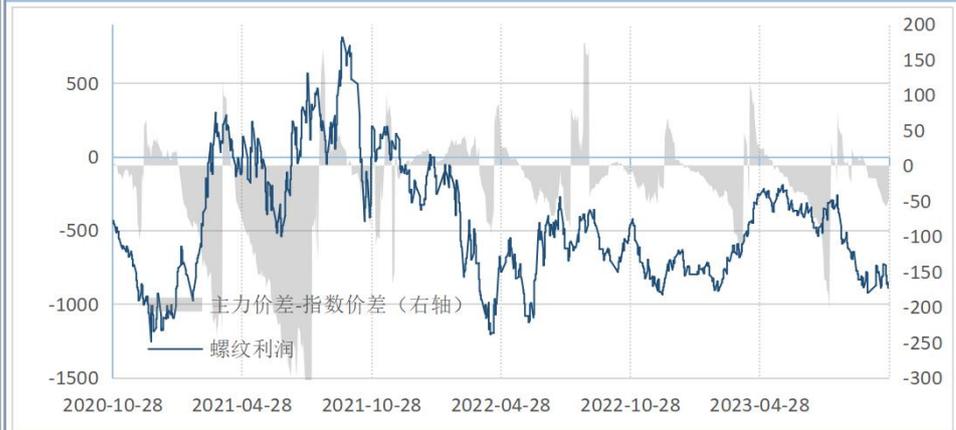
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： -1255.7273

期内最大值： 810.0000

期内平均值： -440.6236

当前分位值： 17.62%



数据来源：iFind

点评：

卷铁差

数据起始日： 2020/10/28

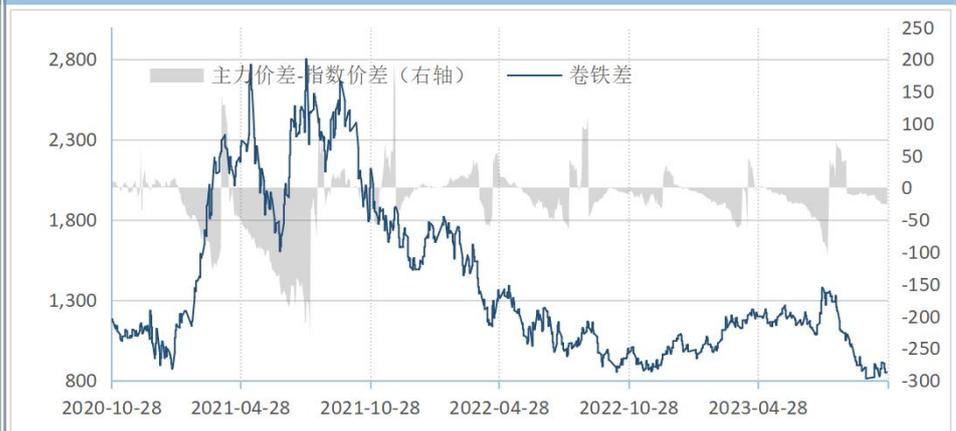
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 810.8824

期内最大值： 2799.4118

期内平均值： 1411.2079

当前分位值： 2.02%



数据来源：iFind

点评：

热卷利润

数据起始日： 2020/10/28

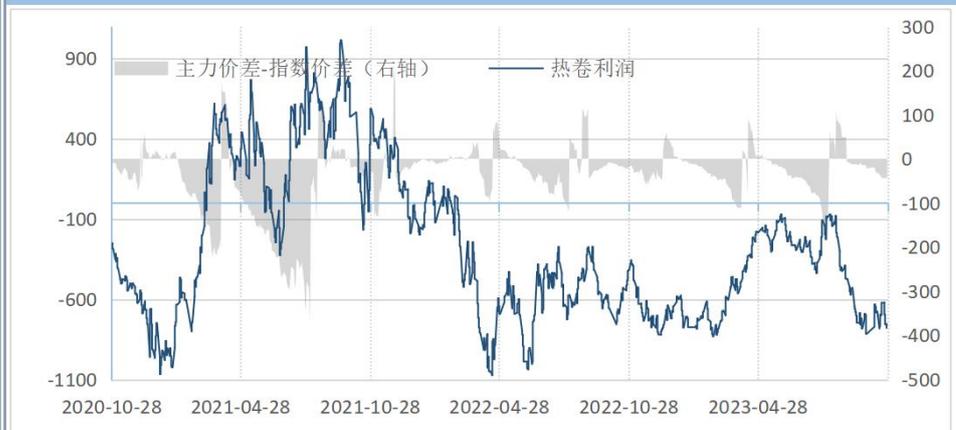
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： -1073.7273

期内最大值： 1014.0000

期内平均值： -276.8239

当前分位值： 14.13%



数据来源：iFind

点评：

卷螺差

数据起始日： 2020/10/28

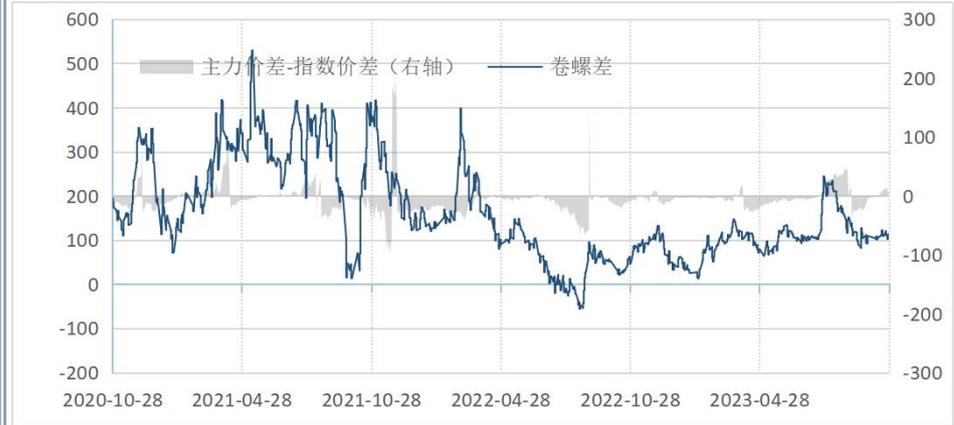
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： -56.0000

期内最大值： 529.0000

期内平均值： 163.7997

当前分位值： 28.89%



数据来源： iFind

点评：

螺矿比

数据起始日： 2020/10/28

数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 3.8923

期内最大值： 8.7631

期内平均值： 5.3089

当前分位值： 7.48%



数据来源： iFind

点评：

焦矿比

数据起始日： 2020/10/28

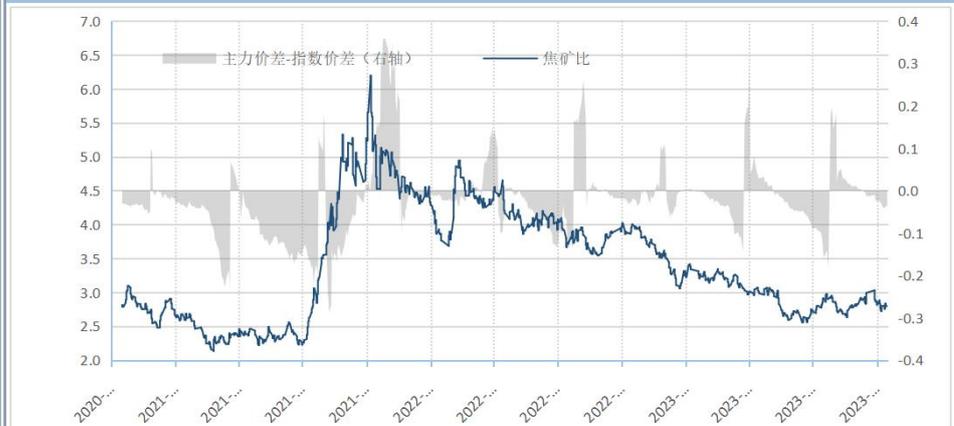
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 2.1354

期内最大值： 6.1947

期内平均值： 3.4170

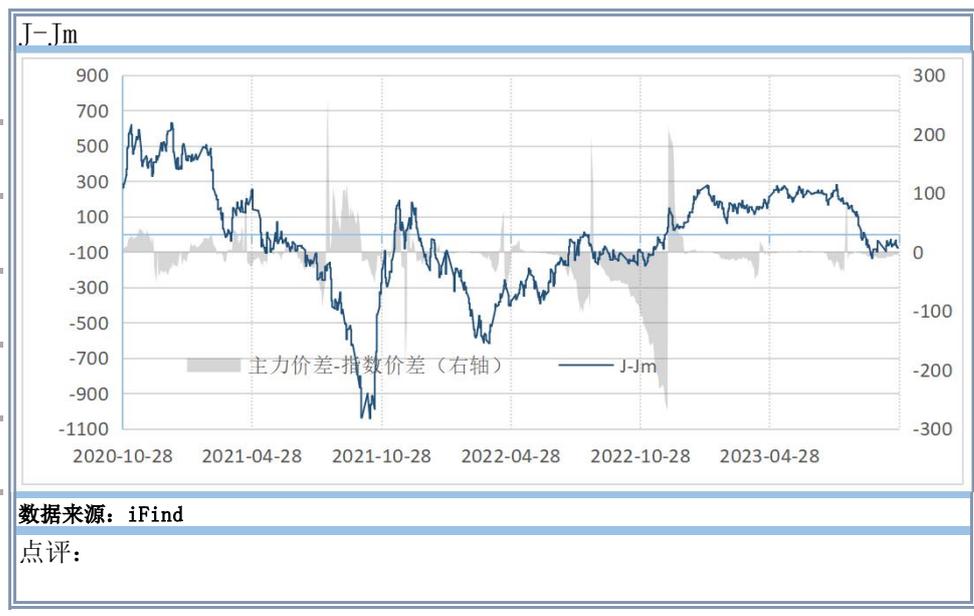
当前分位值： 16.45%



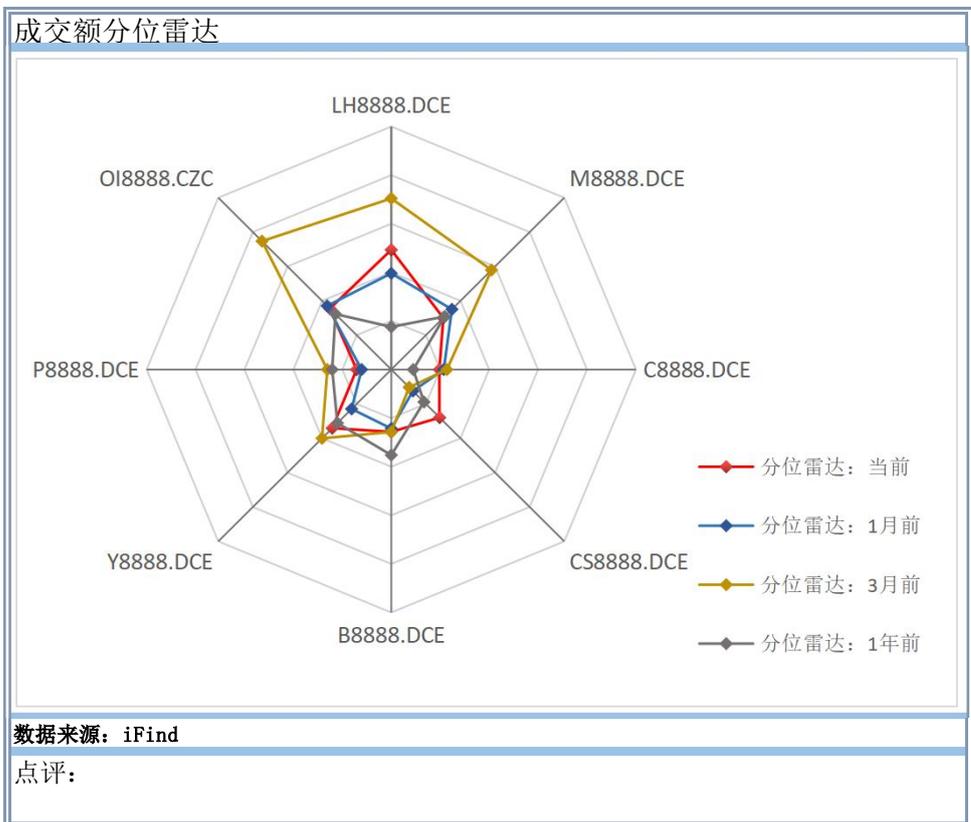
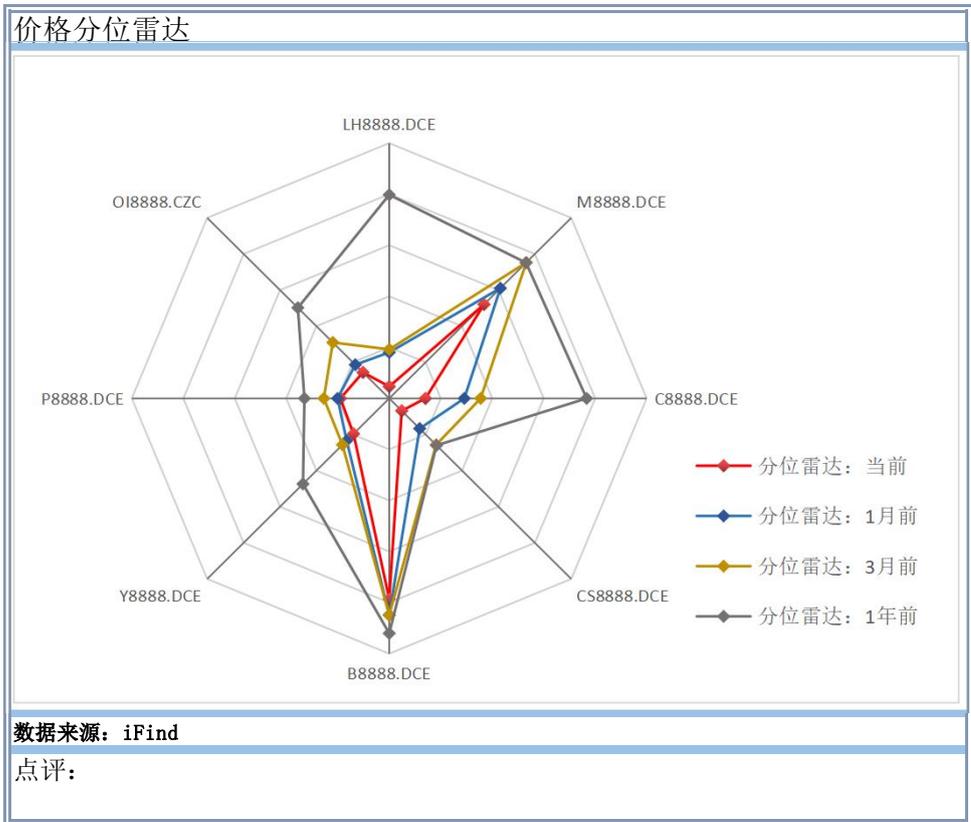
数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2020/10/28
数据截止日： 2023/10/27
期内最小值： -1043.0800
期内最大值： 629.9200
期内平均值： -14.0777
当前分位值： 57.60%



五、农产品相关



LH. DCE价格走势

数据起始日：2022/8/16

数据截止日：2023/10/27

期内最小值：15507

期内最大值：22735

期内平均值：17773.7483

当前分位值：4.66%



数据来源：iFind

点评：

M. DCE价格走势

数据起始日：2020/10/28

数据截止日：2023/10/27

期内最小值：2980

期内最大值：4328

期内平均值：3648.9012

当前分位值：52.08%



数据来源：iFind

点评：

C. DCE价格走势

数据起始日：2020/10/28

数据截止日：2023/10/27

期内最小值：2444

期内最大值：3027

期内平均值：2720.4499

当前分位值：14.07%



数据来源：iFind

点评：

CS. DCE价格走势

数据起始日： 2020/10/28

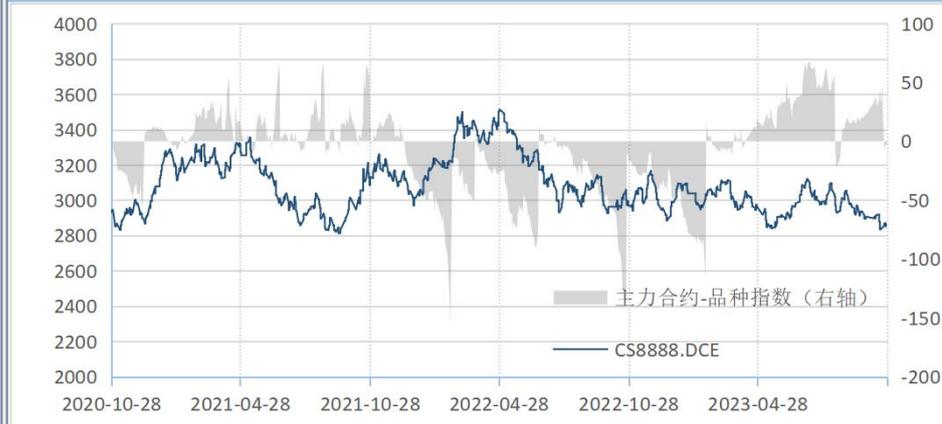
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 2812

期内最大值： 3512

期内平均值： 3080.2510

当前分位值： 6.86%



数据来源： iFind

点评：

B. DCE价格走势

数据起始日： 2020/10/28

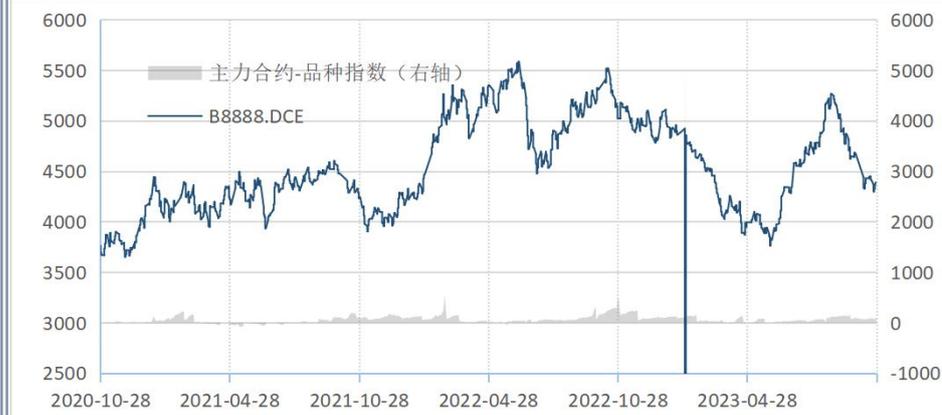
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 0

期内最大值： 5585

期内平均值： 4533.5871

当前分位值： 78.59%



数据来源： iFind

点评：

Y. DCE价格走势

数据起始日： 2020/10/28

数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 6793

期内最大值： 12065

期内平均值： 8813.8011

当前分位值： 19.61%



数据来源： iFind

点评：

P. DCE价格走势

数据起始日：2020/10/28

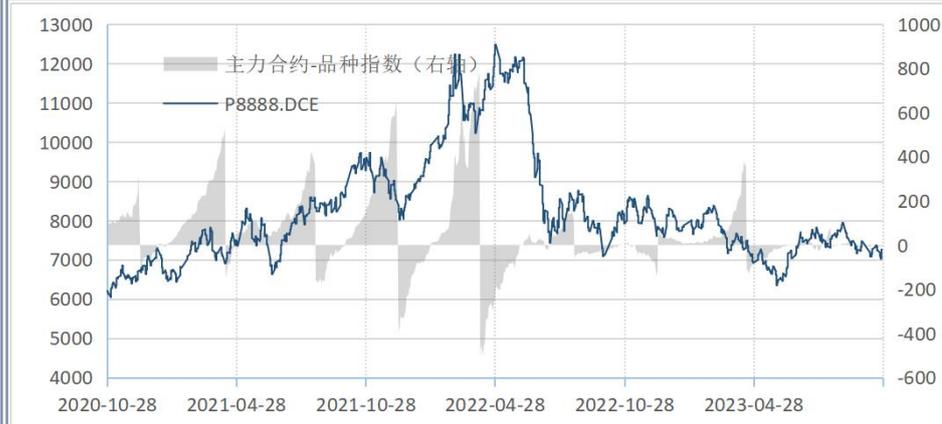
数据截止日：2023/10/27

期内最小值：6045

期内最大值：12479

期内平均值：8210.0631

当前分位值：18.98%



数据来源：iFind

点评：

OI. CZCE价格走势

数据起始日：2020/10/28

数据截止日：2023/10/27

期内最小值：7475

期内最大值：14344

期内平均值：10589.9136

当前分位值：14.43%



数据来源：iFind

点评：

育肥收益

数据起始日：2022/8/16

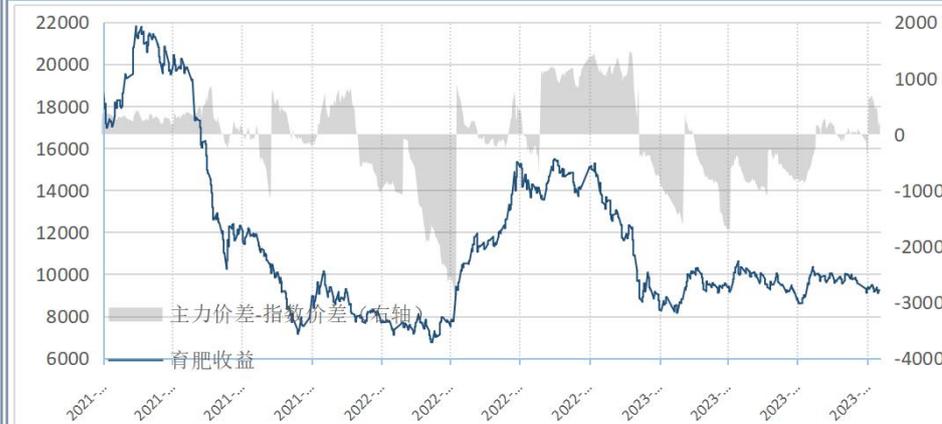
数据截止日：2023/10/27

期内最小值：8156.2500

期内最大值：15480.0000

期内平均值：10669.5129

当前分位值：14.80%



数据来源：iFind

点评：

育肥肉料差(高料)

数据起始日： 2022/8/16

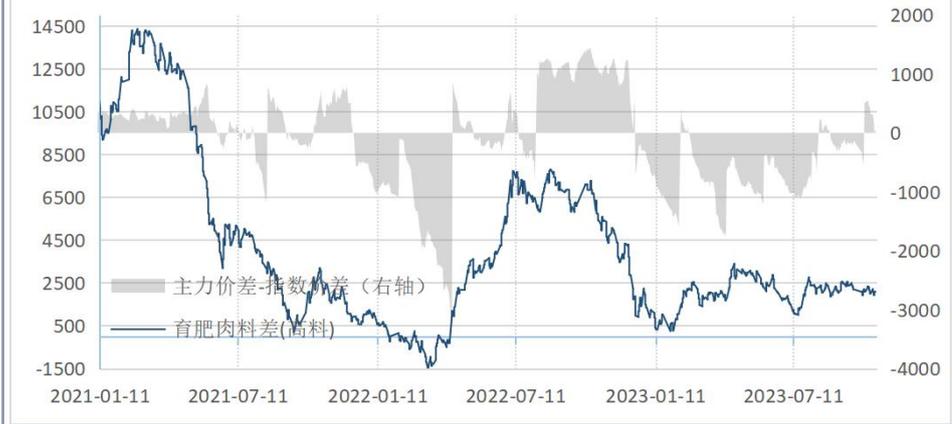
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 246.0000

期内最大值： 7791.0000

期内平均值： 3022.5138

当前分位值： 24.02%



数据来源： iFind

点评：

豆二厂库置换

数据起始日： 2020/10/28

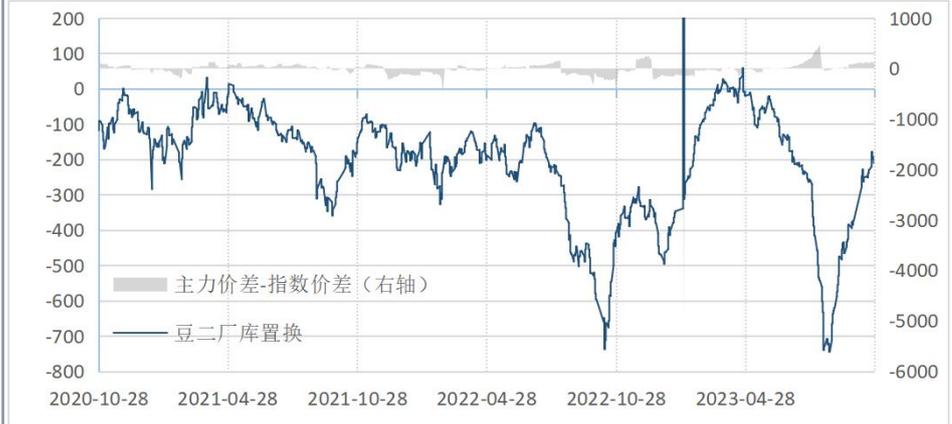
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： -745.0200

期内最大值： 4572.7850

期内平均值： -198.6464

当前分位值： 10.05%



数据来源： iFind

点评：

Cs-C

数据起始日： 2020/10/28

数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 62.0000

期内最大值： 598.0000

期内平均值： 359.8011

当前分位值： 50.75%



数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2020/10/28

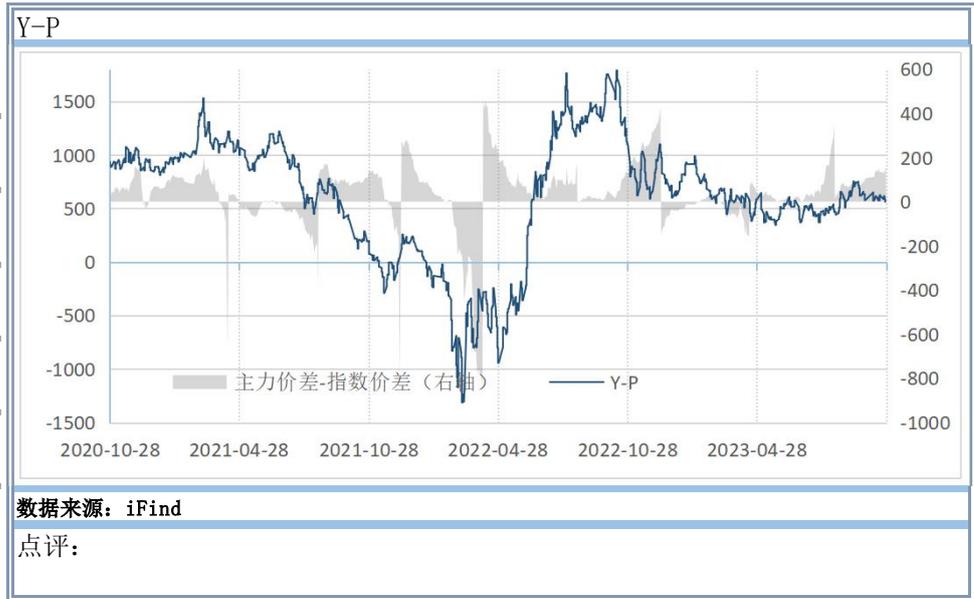
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： -1313.0000

期内最大值： 1788.0000

期内平均值： 603.7380

当前分位值： 60.43%



数据起始日： 2022/5/18

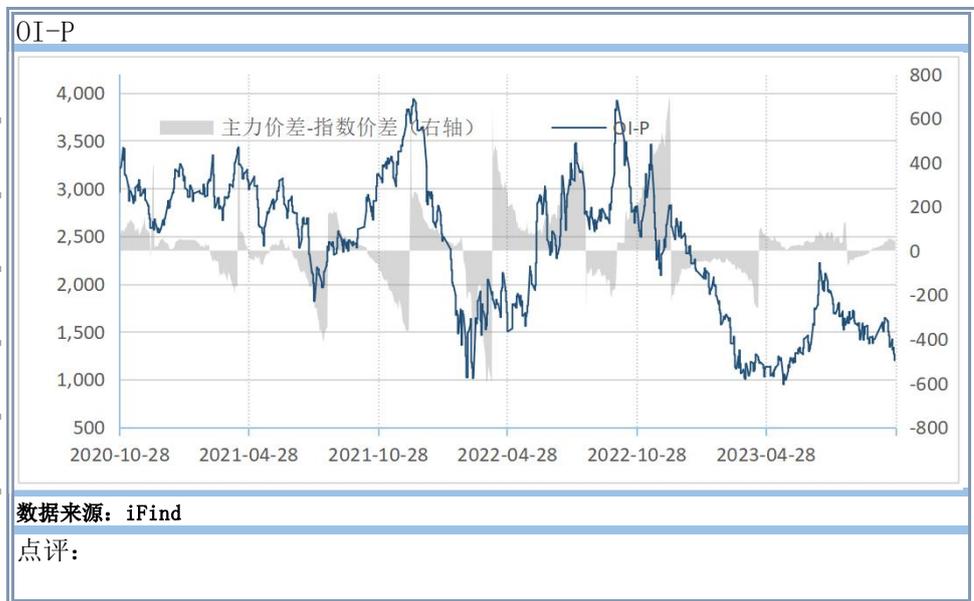
数据截止日： 2023/10/27

期内最小值： 950.0000

期内最大值： 3919.0000

期内平均值： 2064.4164

当前分位值： 8.42%



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。