

<http://www.shanjinqh.com>

# 盘面套利观察

制作：强子益

2023年11月1日

投资咨询： Z0015283

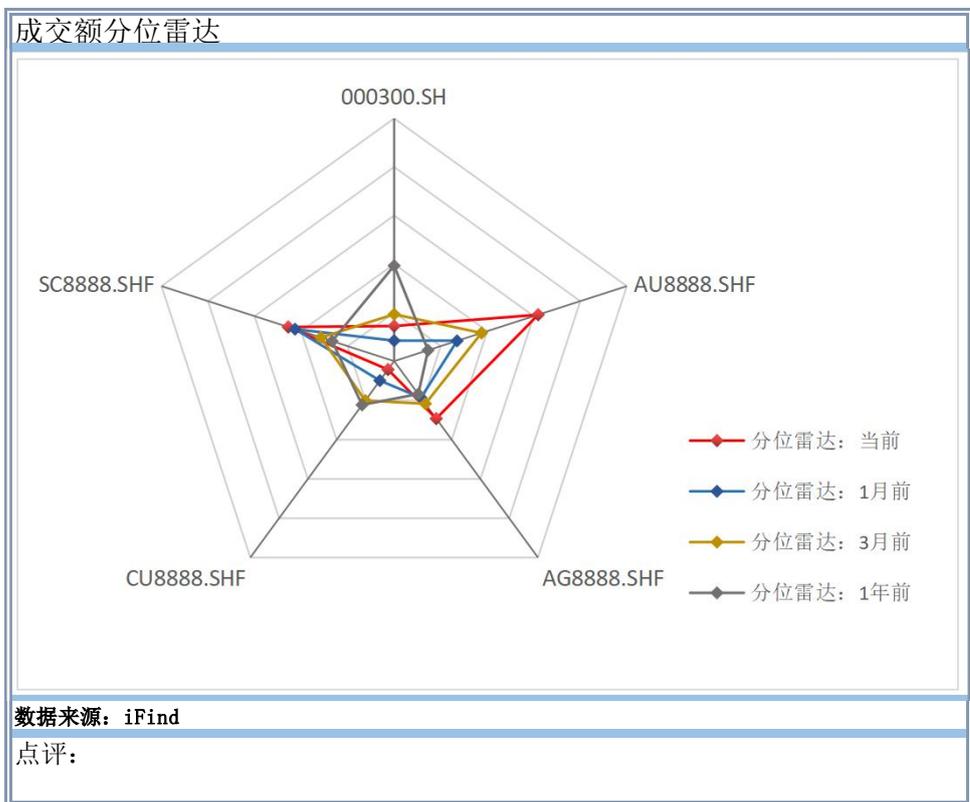
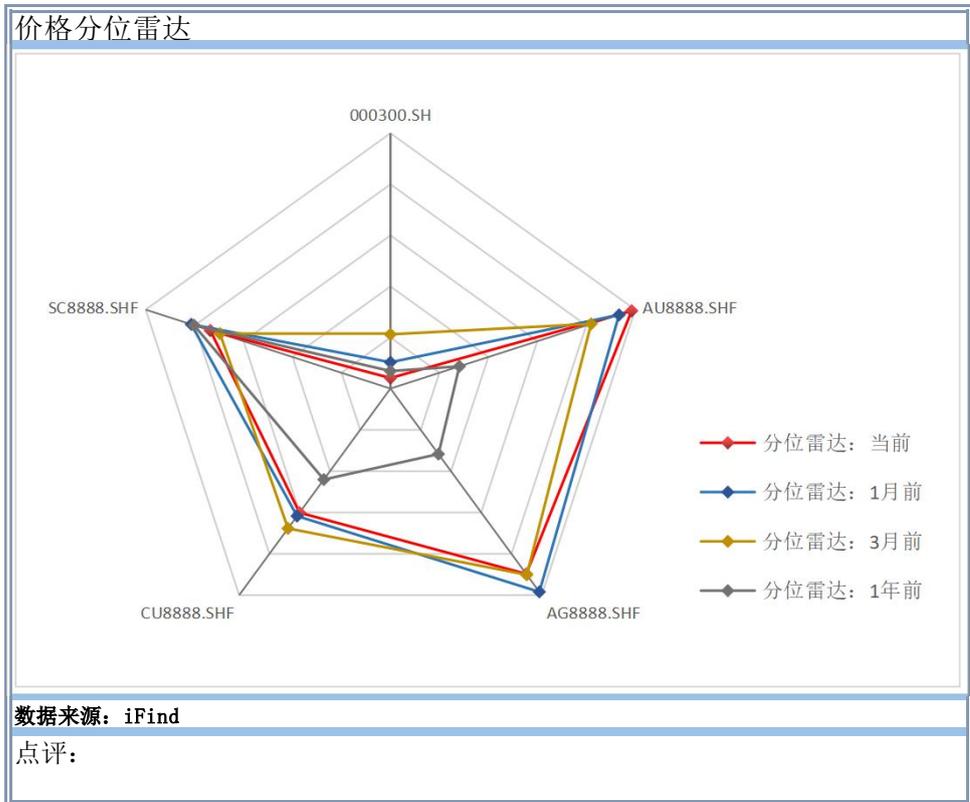
数据仅供参考，据此入市，风险自负。

邮箱：[qiangziyi@sd-gold.com](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： 2020/11/2

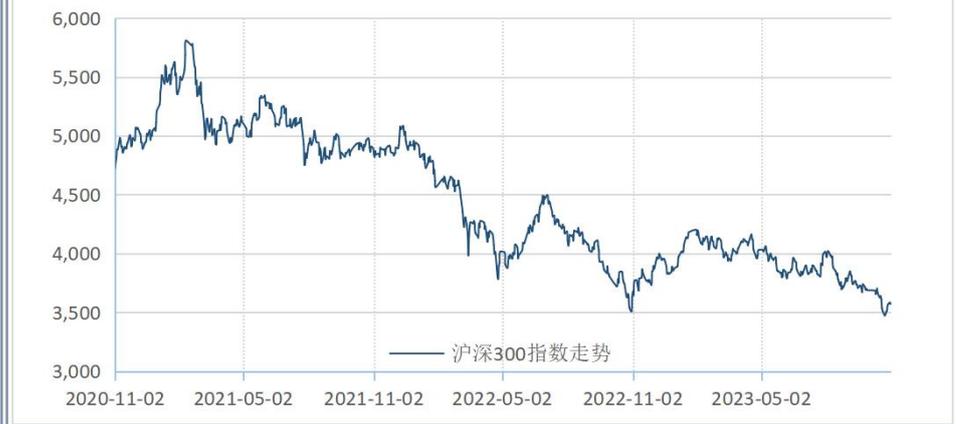
数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 3474.2438

期内最大值： 5807.7191

期内平均值： 4444.6074

当前分位值： 21.24%



数据来源： iFind

点评：

### Au. SHFE价格走势

数据起始日： 2020/11/2

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 356.92

期内最大值： 479.77

期内平均值： 401.9906

当前分位值： 98.54%



数据来源： iFind

点评：

### Cu. SHFE价格走势

数据起始日： 2020/11/2

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 51117

期内最大值： 77934

期内平均值： 66934.5239

当前分位值： 60.09%



数据来源： iFind

点评：

### Sc. Ine价格走势

数据起始日： 2020/11/2

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 232.3

期内最大值： 791.6

期内平均值： 535.6525

当前分位值： 73.59%



数据来源： iFind

点评：

### Cu/Au

数据起始日： 2020/11/2

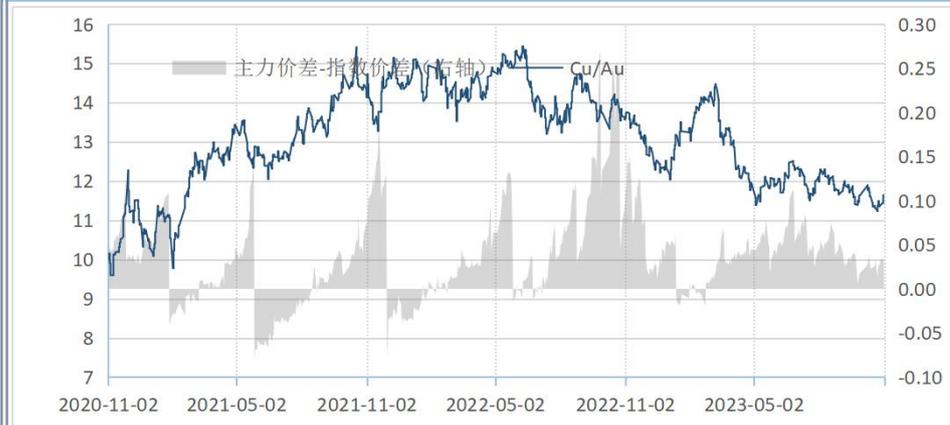
数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 9.5969

期内最大值： 15.4319

期内平均值： 13.0600

当前分位值： 35.04%



数据来源： iFind

点评：

### Sc/Au

数据起始日： 2020/11/2

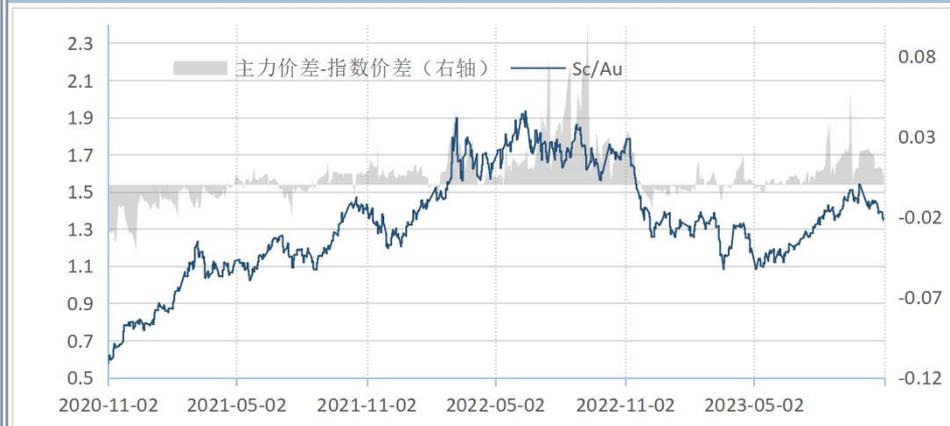
数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 0.5769

期内最大值： 1.9320

期内平均值： 1.3317

当前分位值： 56.84%



数据来源： iFind

点评：

### Sc/000300

数据起始日：2020/11/2

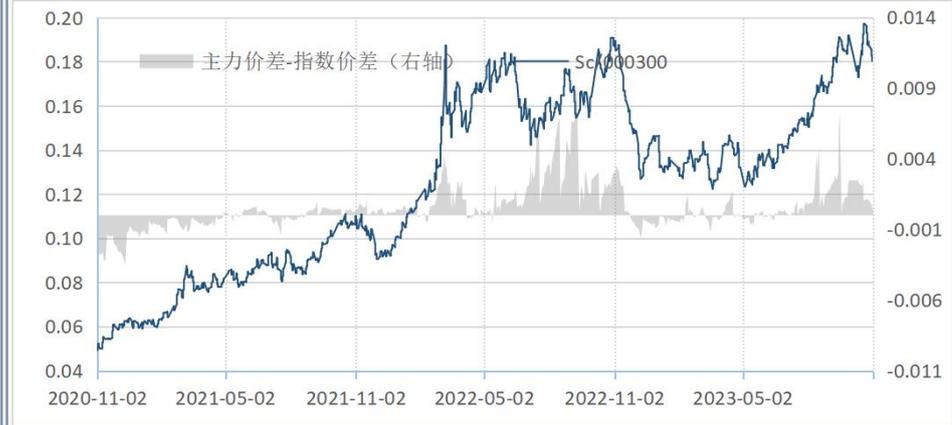
数据截止日：2023/11/1

期内最小值：0.0492

期内最大值：0.1972

期内平均值：0.1250

当前分位值：88.60%



数据来源：iFind

点评：

### Au/Ag

数据起始日：2020/11/2

数据截止日：2023/11/1

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：63.37%



数据来源：iFind

点评：

### 000300/Au

数据起始日：2020/11/2

数据截止日：2023/11/1

期内最小值：0.5939

期内最大值：1.1021

期内平均值：0.8678

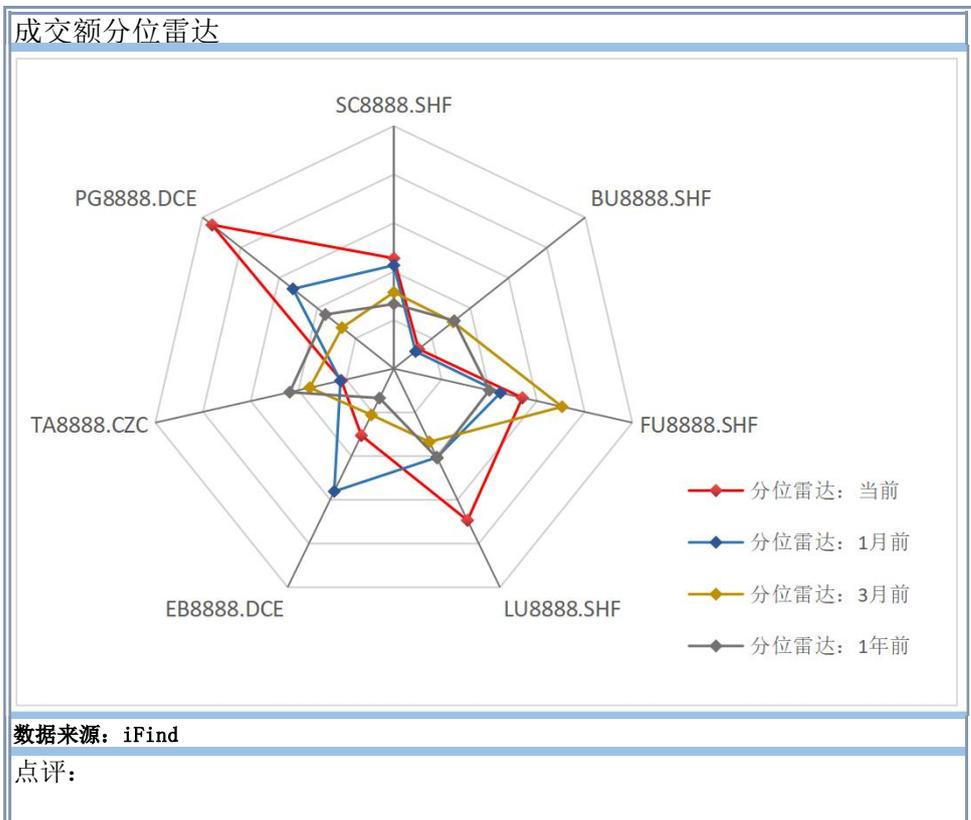
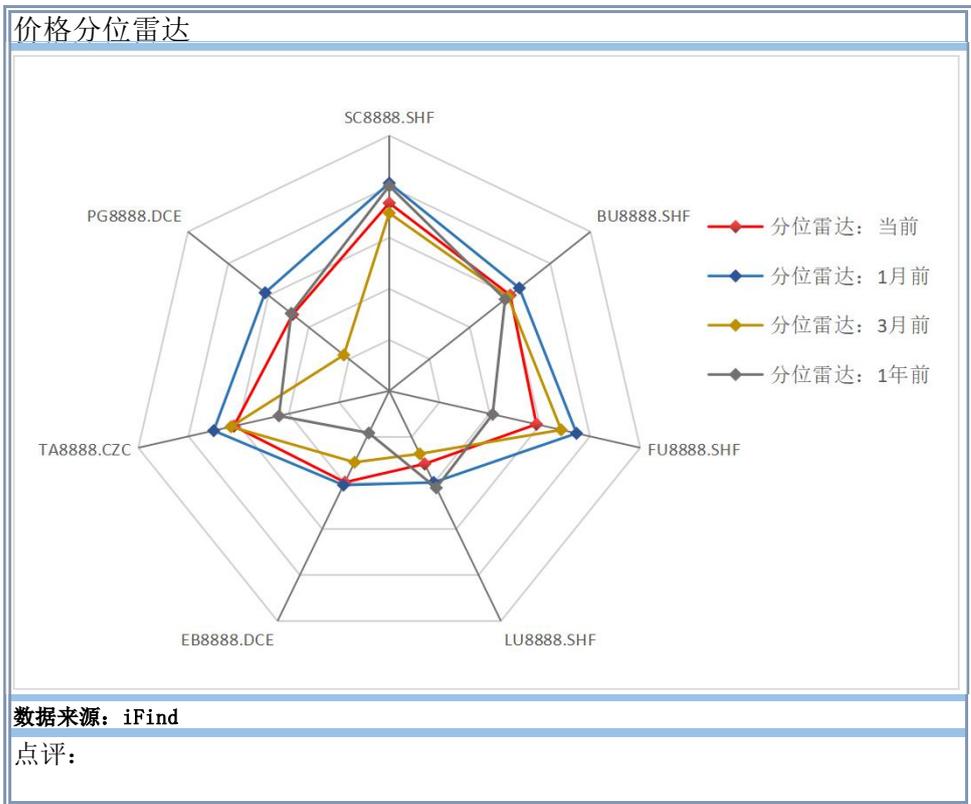
当前分位值：4.82%



数据来源：iFind

点评：

二、原油相关



### Sc. Ine价格走势

数据起始日： 2020/11/2

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 232.3

期内最大值： 791.6

期内平均值： 535.6525

当前分位值： 73.59%



数据来源： iFind

点评：

### Bu. SHFE价格走势

数据起始日： 2020/11/2

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 2176

期内最大值： 4794

期内平均值： 3483.9191

当前分位值： 60.12%



数据来源： iFind

点评：

### Fu. SHFE价格走势

数据起始日： 2020/11/2

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 1682

期内最大值： 4371

期内平均值： 2921.4992

当前分位值： 58.65%



数据来源： iFind

点评：

### Lu. Ine价格走势

数据起始日：2022/1/27

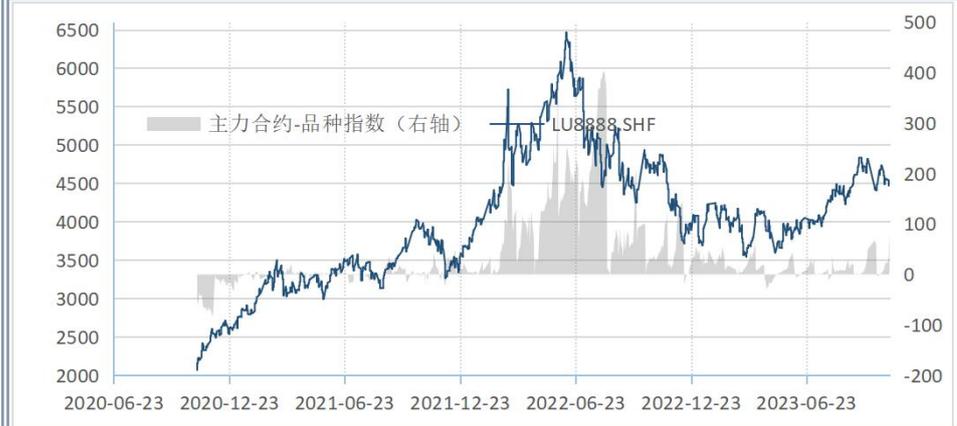
数据截止日：2023/11/1

期内最小值：3544

期内最大值：6464

期内平均值：4525.4824

当前分位值：31.71%



数据来源：iFind

点评：

### EB. DCE价格走势

数据起始日：2021/5/13

数据截止日：2023/11/1

期内最小值：6978

期内最大值：11361

期内平均值：8689.1115

当前分位值：39.70%



数据来源：iFind

点评：

### PTA. CZCE价格走势

数据起始日：2020/11/2

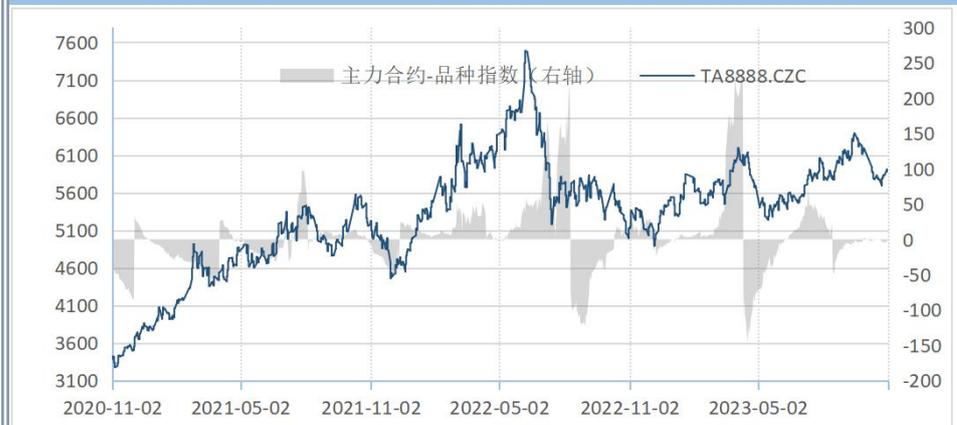
数据截止日：2023/11/1

期内最小值：3277

期内最大值：7488

期内平均值：5313.9150

当前分位值：61.89%



数据来源：iFind

点评：

数据起始日： 2021/11/8

数据截止日： 2023/11/1

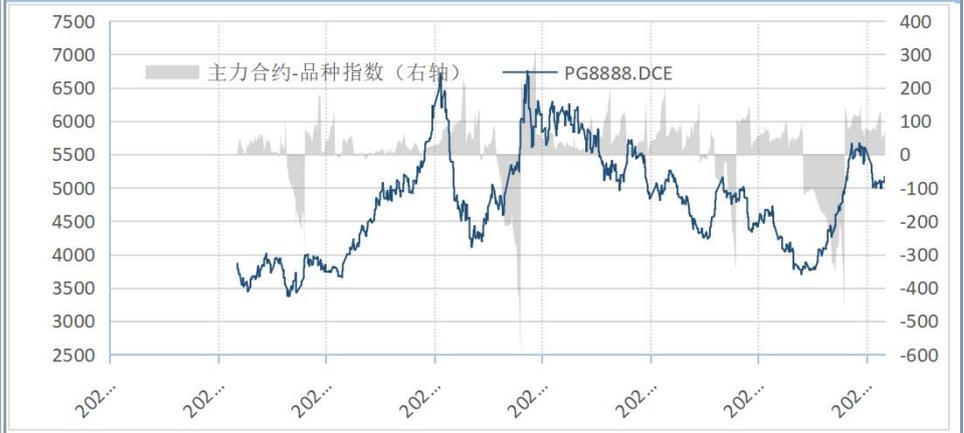
期内最小值： 3704

期内最大值： 6749

期内平均值： 4987.1286

当前分位值： 48.01%

### LPG.DCE价格走势



数据来源： iFind

点评：

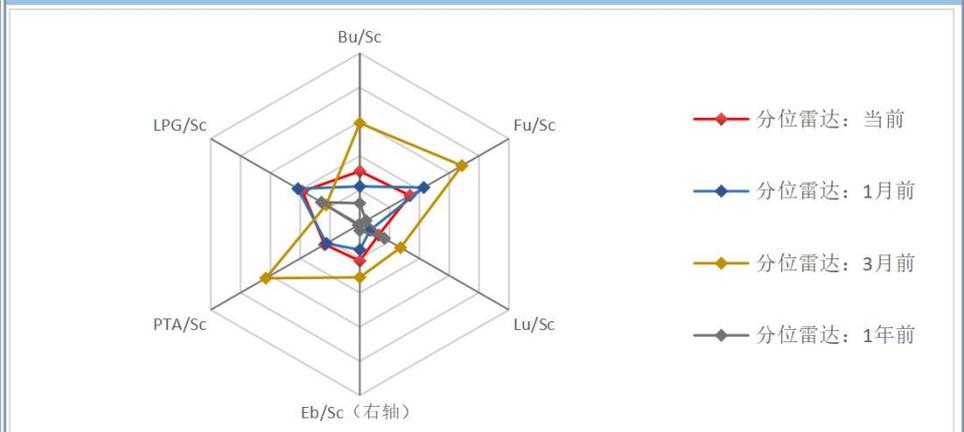
### Sc相关比价一揽子



数据来源： iFind

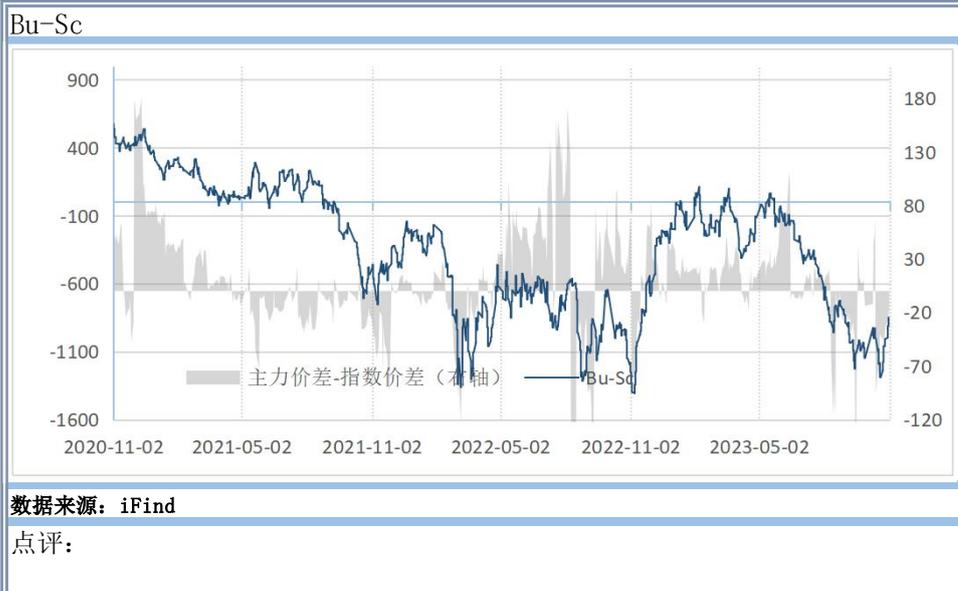
点评：

### Sc相关比价分位雷达



数据来源： iFind

点评：



数据起始日: 2020/11/2

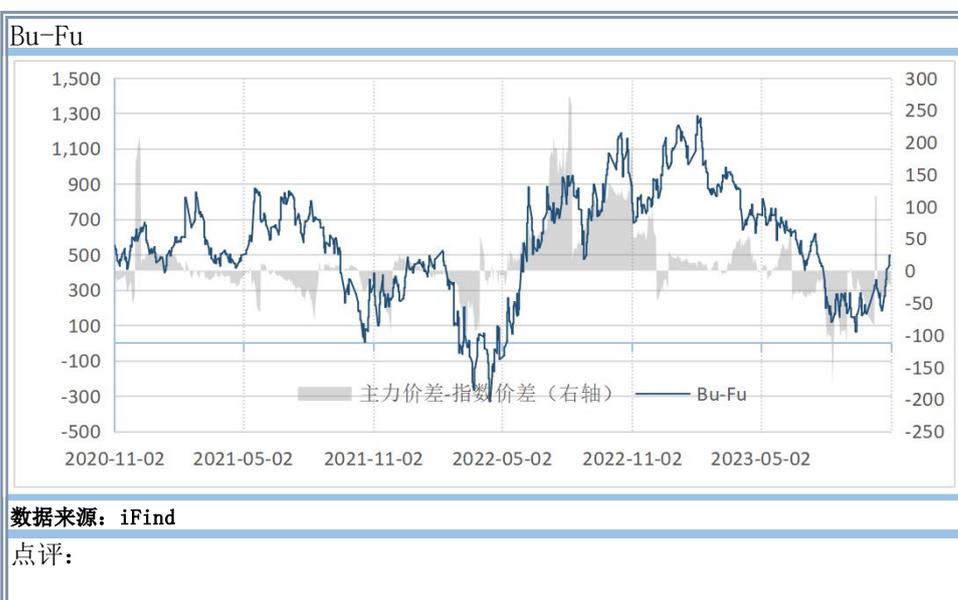
数据截止日: 2023/11/1

期内最小值: -1406.4286

期内最大值: 574.7143

期内平均值: -342.1705

当前分位值: 28.12%



数据起始日: 2020/11/2

数据截止日: 2023/11/1

期内最小值: -331.0000

期内最大值: 1284.0000

期内平均值: 562.4198

当前分位值: 50.90%



数据起始日: 2022/1/27

数据截止日: 2023/11/1

期内最小值: 749.0000

期内最大值: 2592.0000

期内平均值: 1309.1106

当前分位值: 25.07%

数据起始日： 2021/11/8

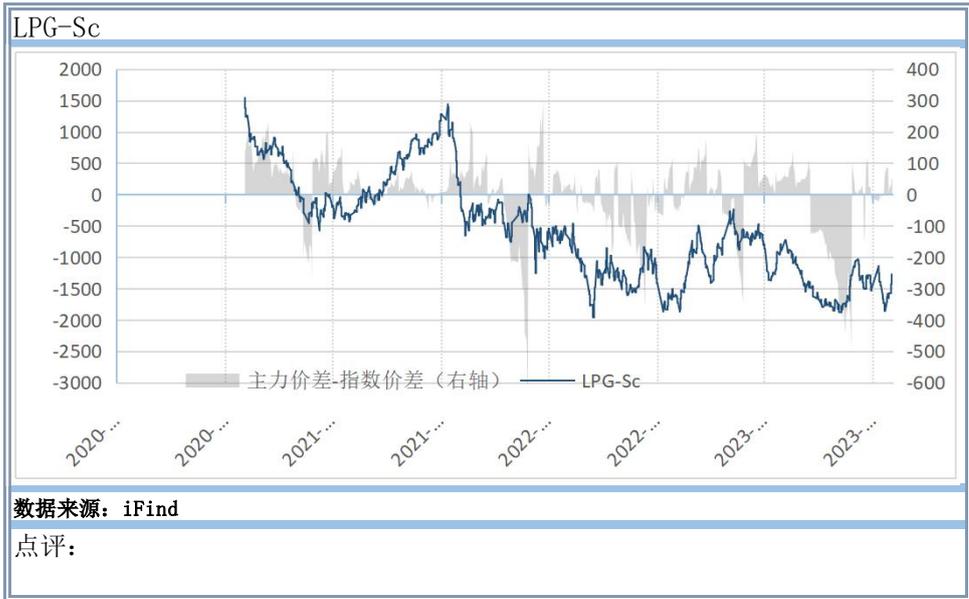
数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： -1959.0000

期内最大值： -1.0000

期内平均值： -1046.4979

当前分位值： 35.04%



数据起始日： 2020/11/2

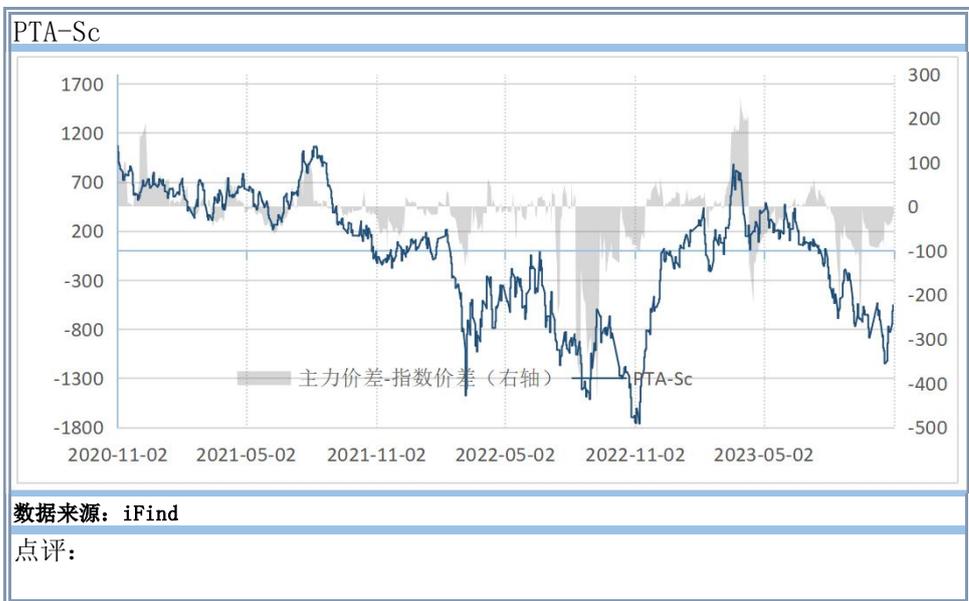
数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： -1762.0000

期内最大值： 1066.0000

期内平均值： -42.6104

当前分位值： 42.64%



数据起始日： 2021/5/13

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： -6347.0000

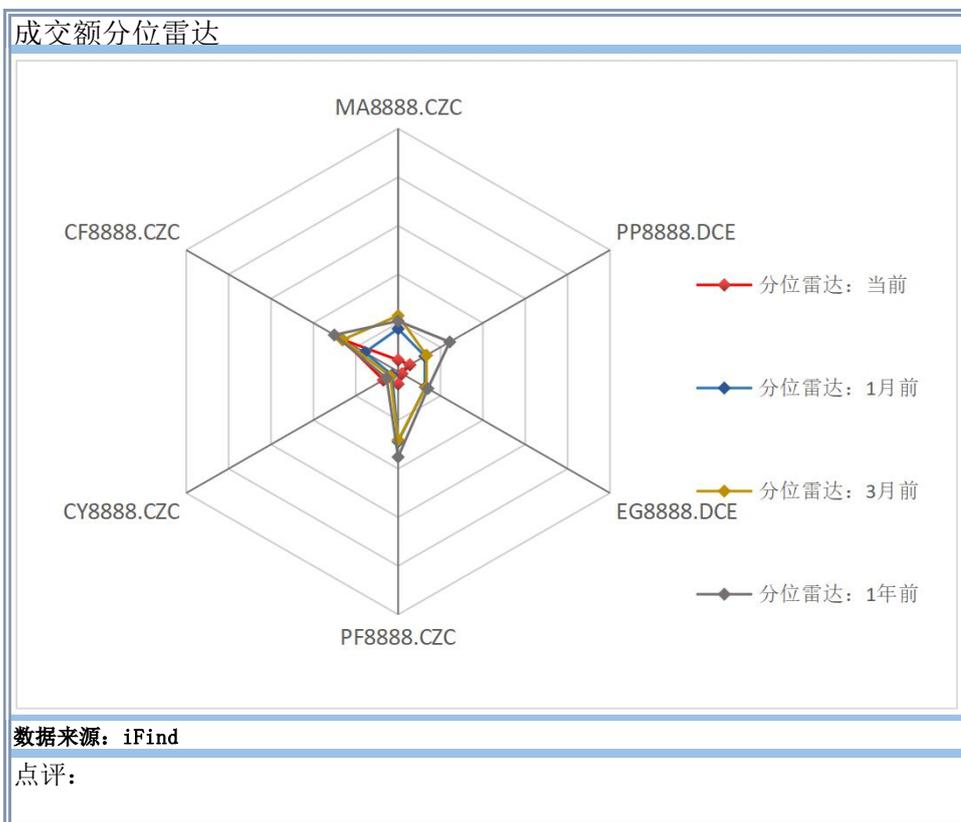
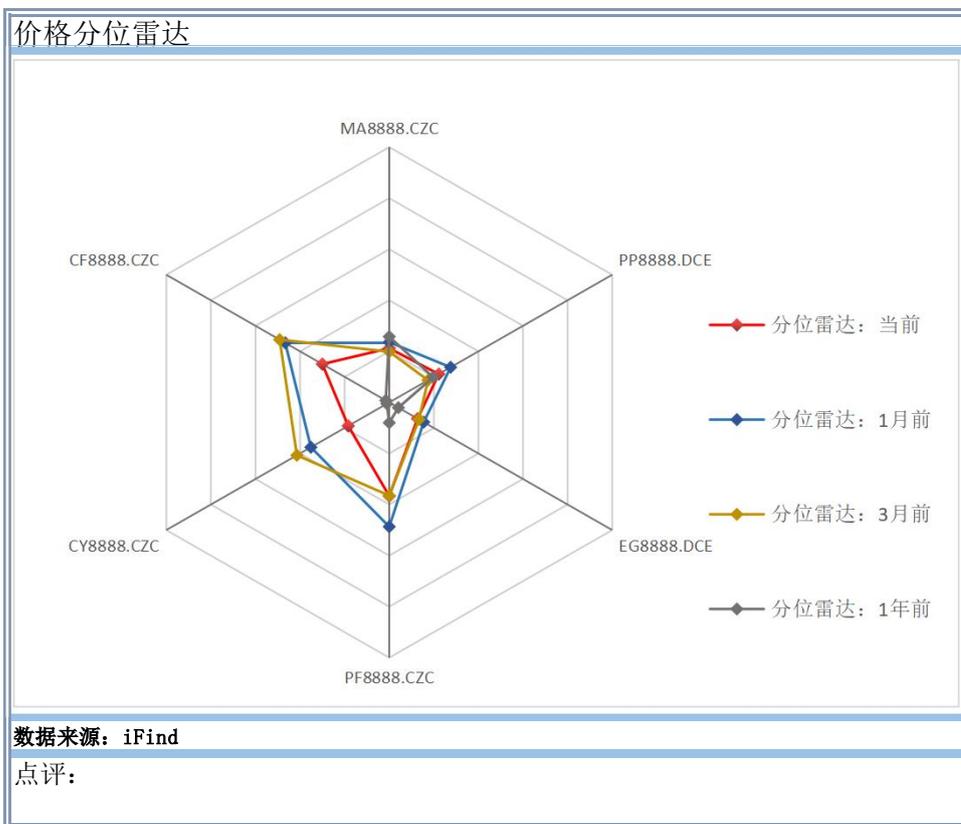
期内最大值： 1216.0000

期内平均值： -2804.1930

当前分位值： 28.92%



### 三、煤化工相关



### MA. CZCE价格走势

数据起始日：2020/11/2

数据截止日：2023/11/1

期内最小值：1982

期内最大值：4015

期内平均值：2575.8738

当前分位值：21.20%



数据来源：iFind

点评：

### PP. DCE价格走势

数据起始日：2020/11/2

数据截止日：2023/11/1

期内最小值：6865

期内最大值：10224

期内平均值：8145.1125

当前分位值：22.21%



数据来源：iFind

点评：

### EG. CZCE价格走势

数据起始日：2020/11/2

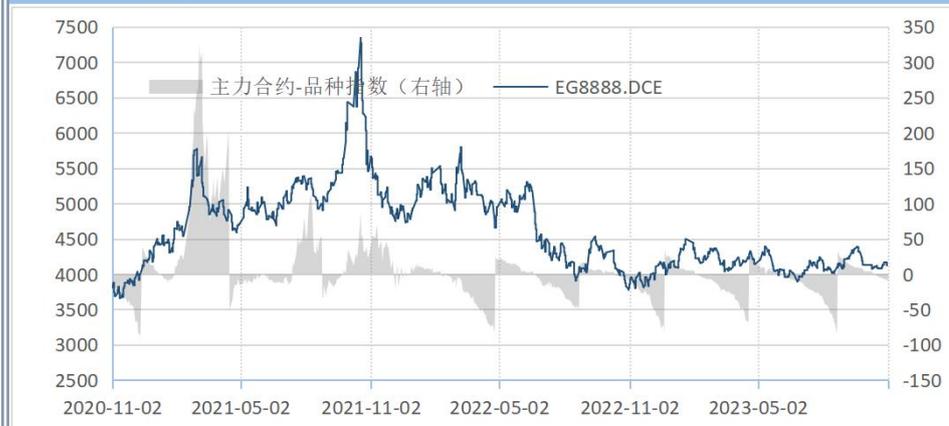
数据截止日：2023/11/1

期内最小值：3658

期内最大值：7345

期内平均值：4612.9561

当前分位值：12.72%



数据来源：iFind

点评：

### PF. CZCE价格走势

数据起始日： 2022/5/23

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 6477

期内最大值： 9022

期内平均值： 7311.6459

当前分位值： 36.66%



数据来源： iFind

点评：

### CY. CZCE价格走势

数据起始日： 2020/11/2

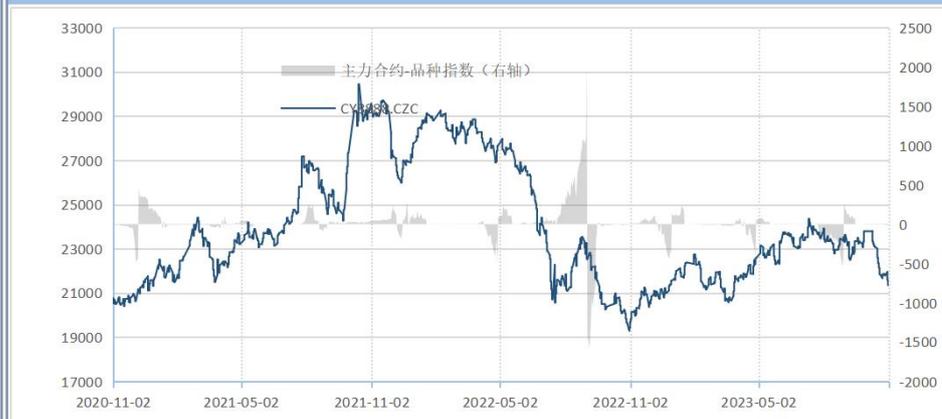
数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 19292

期内最大值： 30443

期内平均值： 23885.8546

当前分位值： 18.38%



数据来源： iFind

点评：

### CF. CZCE价格走势

数据起始日： 2020/11/2

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 12447

期内最大值： 22574

期内平均值： 16806.7613

当前分位值： 30.02%



数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2020/11/2

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： -2039.0000

期内最大值： 2013.0000

期内平均值： 417.4911

当前分位值： 59.50%



数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2020/11/2

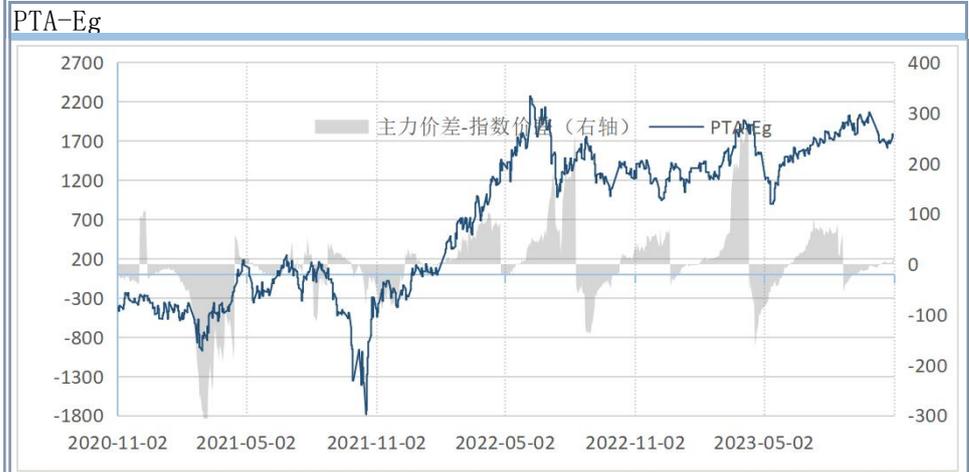
数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： -1783.0000

期内最大值： 2269.0000

期内平均值： 700.9588

当前分位值： 87.34%



数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2022/5/23

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： -1555.0000

期内最大值： 2854.0000

期内平均值： 467.9405

当前分位值： 15.13%



数据来源： iFind

点评：

### PF毛利

数据起始日： 2022/5/23

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： -264.3150

期内最大值： 112.9900

期内平均值： -88.7364

当前分位值： 48.19%



数据来源： iFind

点评：

### CY-CF

数据起始日： 2020/11/2

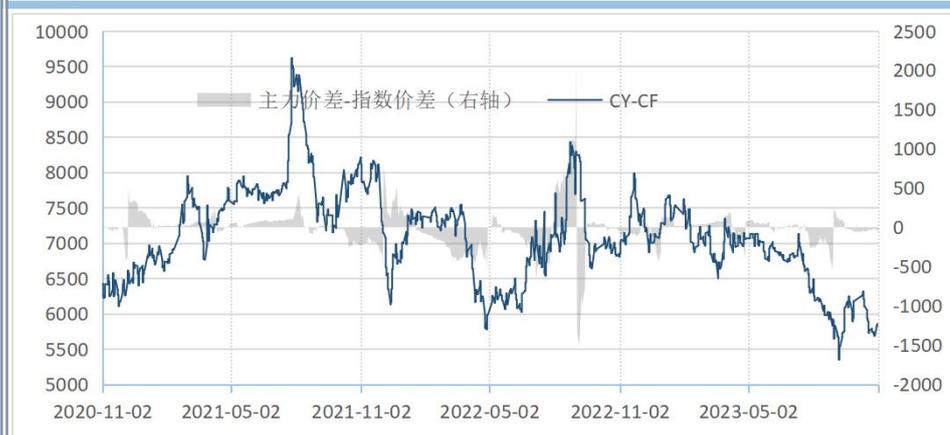
数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 5349.0000

期内最大值： 9616.0000

期内平均值： 7079.0933

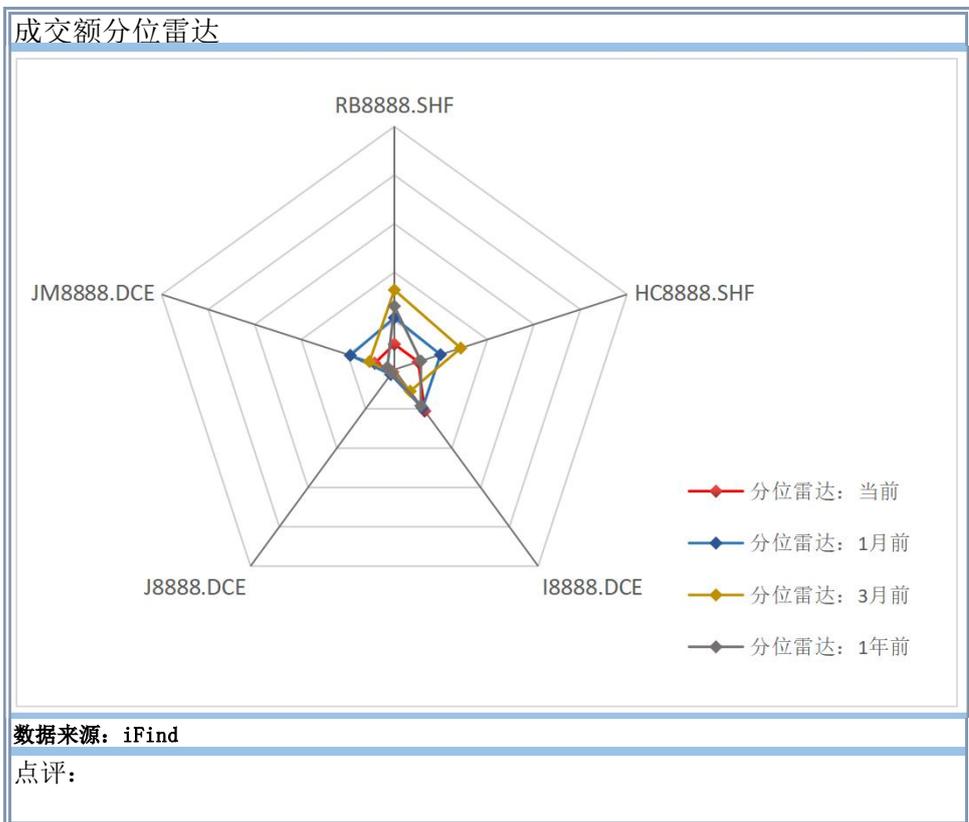
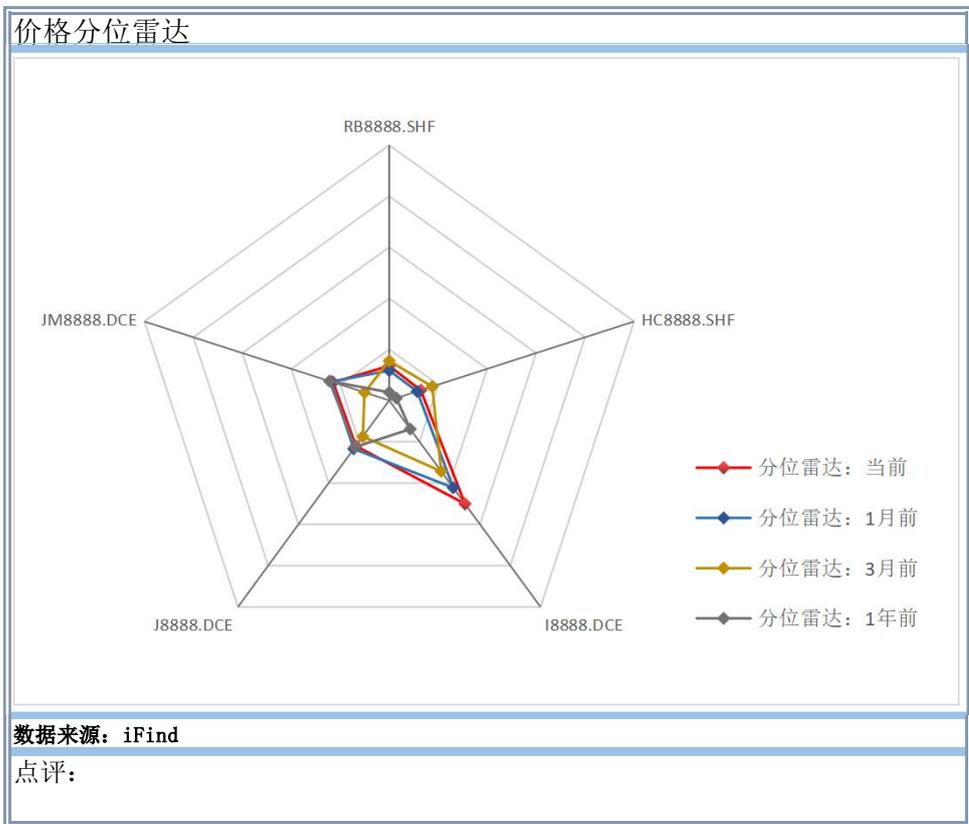
当前分位值： 11.86%



数据来源： iFind

点评：

#### 四、黑色相关



### RB. SHFE价格走势

数据起始日： 2020/11/2

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 3377

期内最大值： 6158

期内平均值： 4342.6241

当前分位值： 13.52%



数据来源： iFind

点评：

### HC. SHFE价格走势

数据起始日： 2020/11/2

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 3444

期内最大值： 6675

期内平均值： 4506.1043

当前分位值： 12.88%



数据来源： iFind

点评：

### I. DCE价格走势

数据起始日： 2020/11/2

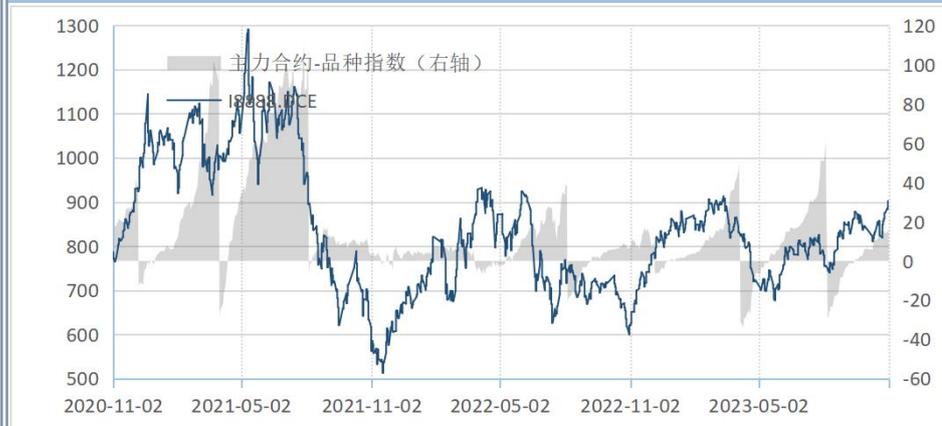
数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 512.8

期内最大值： 1290.9

期内平均值： 833.6927

当前分位值： 50.07%



数据来源： iFind

点评：

### J. DCE价格走势

数据起始日： 2020/11/2

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 1897.9

期内最大值： 4320.8

期内平均值： 2762.5846

当前分位值： 22.06%



数据来源： iFind

点评：

### Jm. DCE价格走势

数据起始日： 2020/11/2

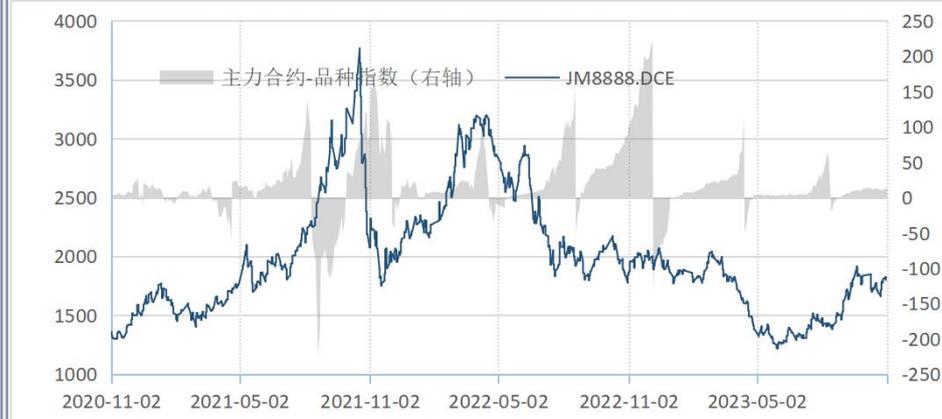
数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 1219.4

期内最大值： 3764.7

期内平均值： 1984.4001

当前分位值： 22.93%



数据来源： iFind

点评：

### 螺铁差

数据起始日： 2020/11/2

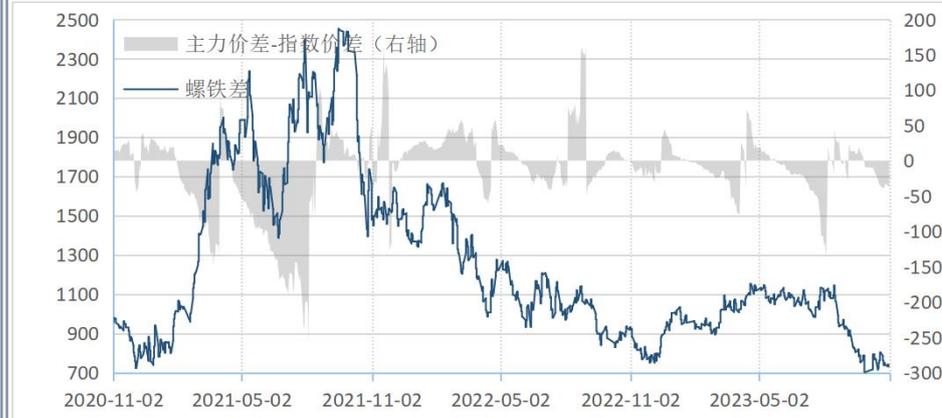
数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 701.8824

期内最大值： 2451.8235

期内平均值： 1246.3519

当前分位值： 1.59%



数据来源： iFind

点评：

### 螺纹利润

数据起始日：2020/11/2

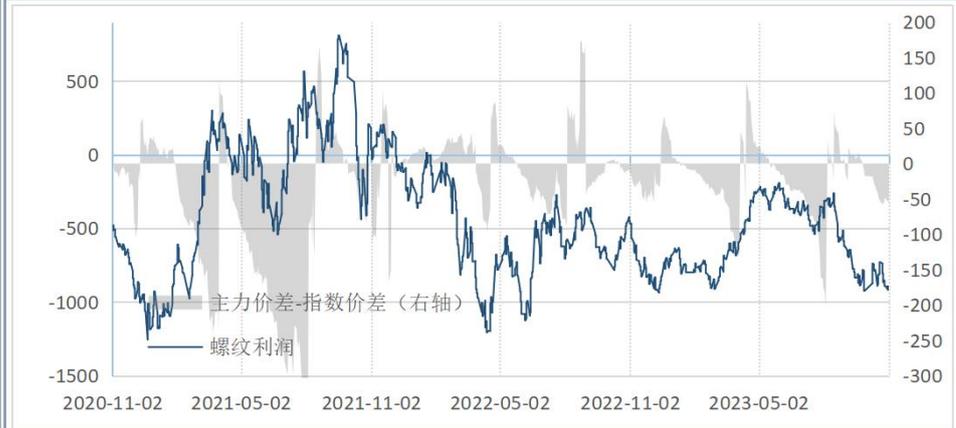
数据截止日：2023/11/1

期内最小值：-1255.7273

期内最大值：810.0000

期内平均值：-442.5239

当前分位值：16.28%



数据来源：iFind

点评：

### 卷铁差

数据起始日：2020/11/2

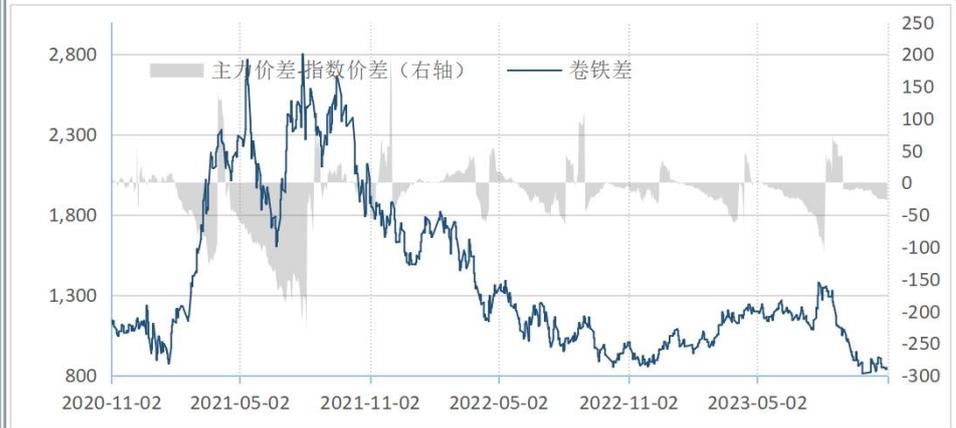
数据截止日：2023/11/1

期内最小值：810.8824

期内最大值：2799.4118

期内平均值：1409.8320

当前分位值：1.30%



数据来源：iFind

点评：

### 热卷利润

数据起始日：2020/11/2

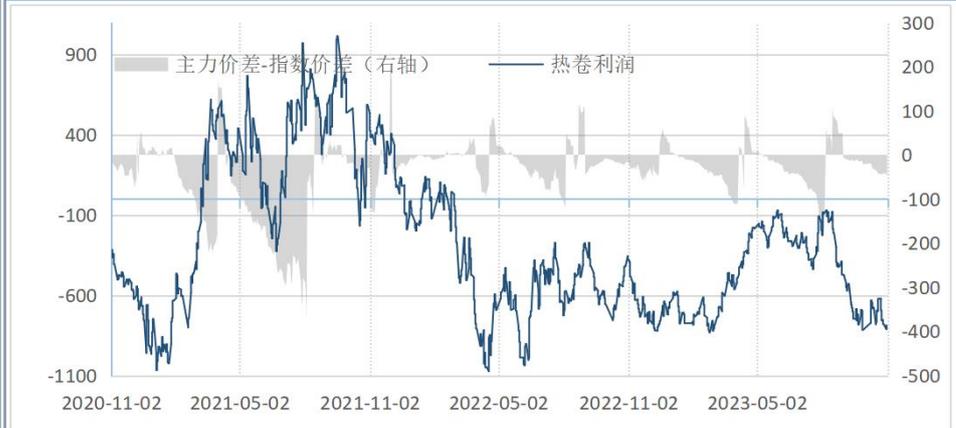
数据截止日：2023/11/1

期内最小值：-1073.7273

期内最大值：1014.0000

期内平均值：-279.0438

当前分位值：12.52%



数据来源：iFind

点评：

### 卷螺差

数据起始日：2020/11/2

数据截止日：2023/11/1

期内最小值：-56.0000

期内最大值：529.0000

期内平均值：163.4801

当前分位值：27.86%



数据来源：iFind

点评：

### 螺矿比

数据起始日：2020/11/2

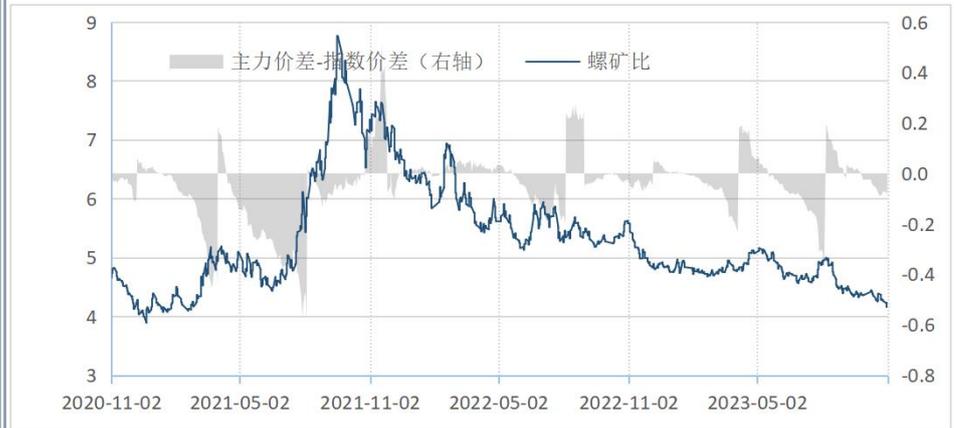
数据截止日：2023/11/1

期内最小值：3.8923

期内最大值：8.7631

期内平均值：5.3069

当前分位值：5.47%



数据来源：iFind

点评：

### 焦矿比

数据起始日：2020/11/2

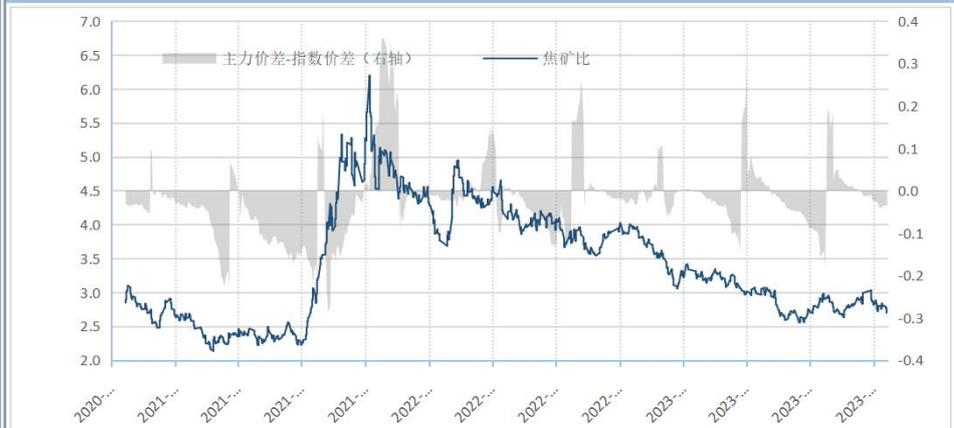
数据截止日：2023/11/1

期内最小值：2.1354

期内最大值：6.1947

期内平均值：3.4168

当前分位值：13.80%



数据来源：iFind

点评：

数据起始日： 2020/11/2

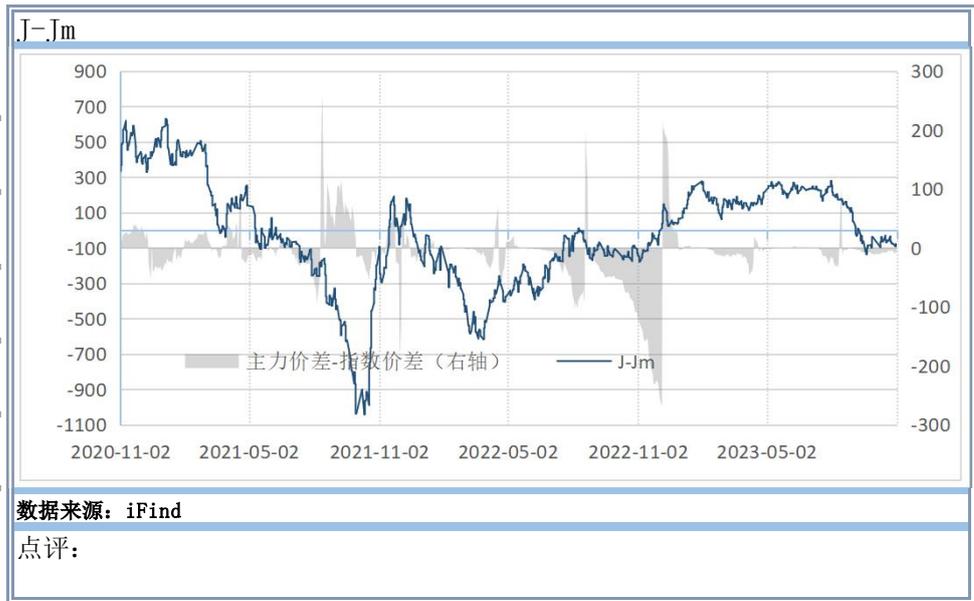
数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： -1043.0800

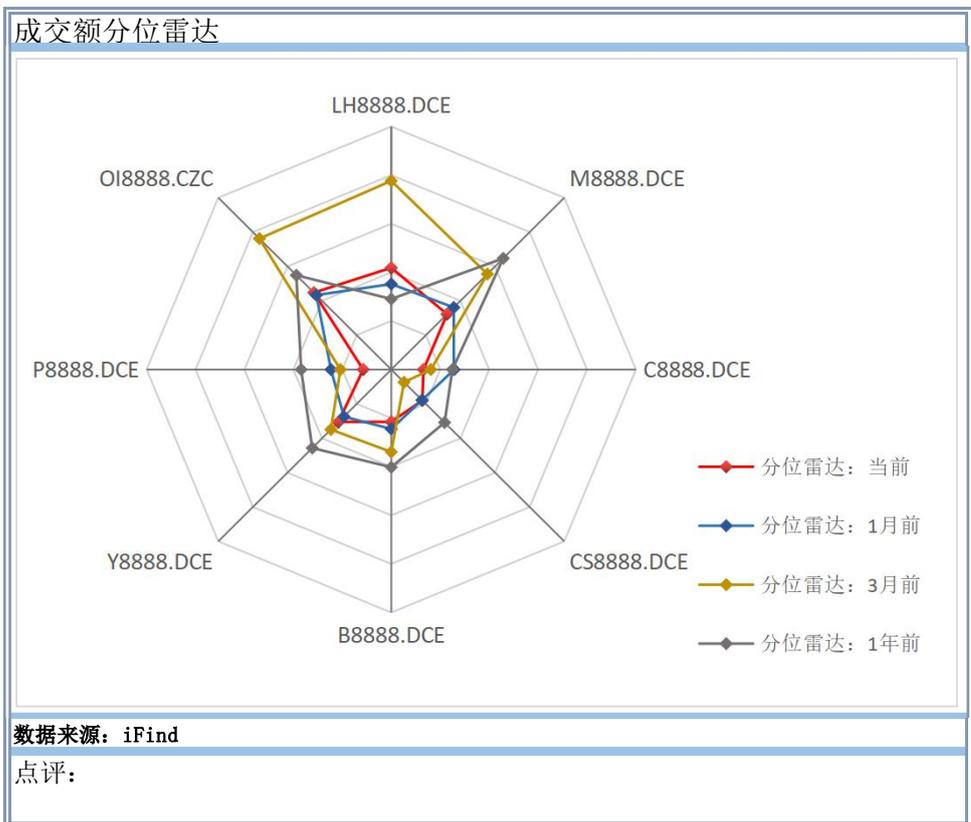
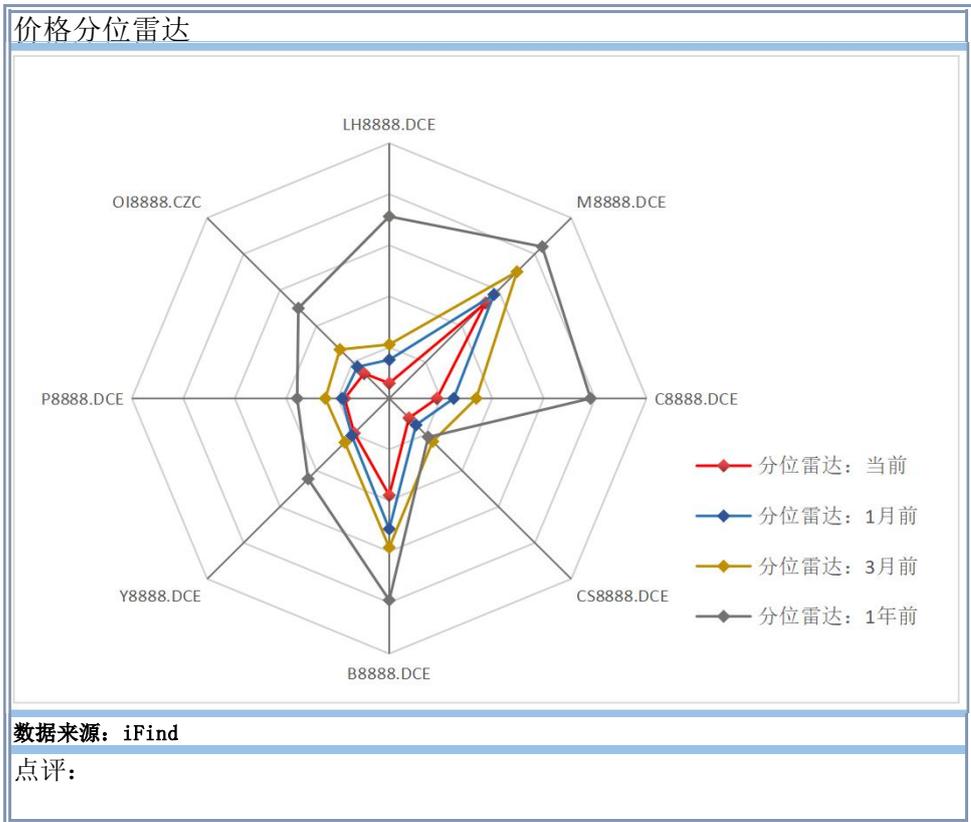
期内最大值： 629.9200

期内平均值： -15.5756

当前分位值： 56.86%



五、农产品相关



### LH. DCE价格走势

数据起始日： 2022/8/19

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 15507

期内最大值： 22735

期内平均值： 17717.4586

当前分位值： 5.96%



数据来源： iFind

点评：

### M. DCE价格走势

数据起始日： 2020/11/2

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 2980

期内最大值： 4328

期内平均值： 3651.2524

当前分位值： 52.89%



数据来源： iFind

点评：

### C. DCE价格走势

数据起始日： 2020/11/2

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 2444

期内最大值： 3027

期内平均值： 2720.2222

当前分位值： 18.52%



数据来源： iFind

点评：

### CS. DCE价格走势

数据起始日： 2020/11/2

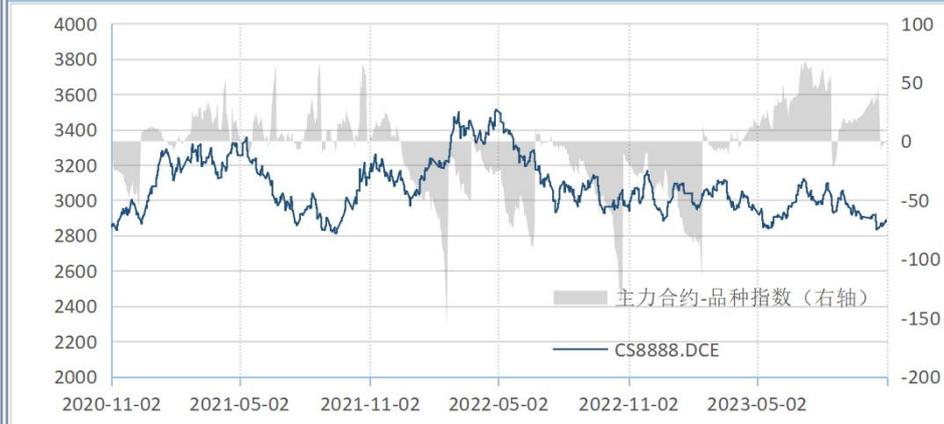
数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 2812

期内最大值： 3512

期内平均值： 3080.0233

当前分位值： 10.86%



数据来源： iFind

点评：

### B. DCE价格走势

数据起始日： 2020/11/2

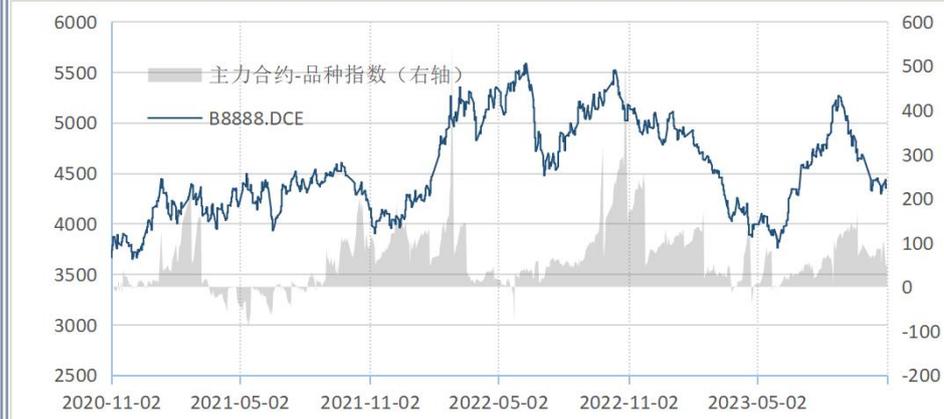
数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 3651

期内最大值： 5585

期内平均值： 4543.1632

当前分位值： 37.95%



数据来源： iFind

点评：

### Y. DCE价格走势

数据起始日： 2020/11/2

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 6793

期内最大值： 12065

期内平均值： 8816.7956

当前分位值： 19.25%



数据来源： iFind

点评：

### P. DCE价格走势

数据起始日：2020/11/2

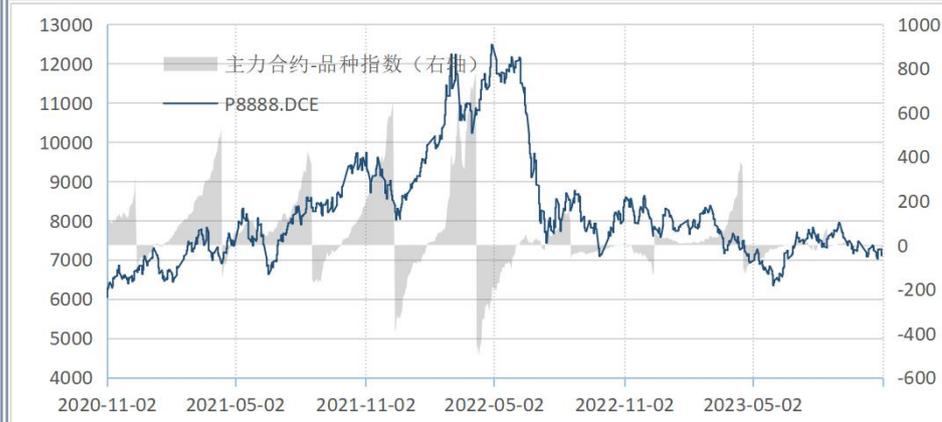
数据截止日：2023/11/1

期内最小值：6045

期内最大值：12479

期内平均值：8214.1838

当前分位值：17.31%



数据来源：iFind

点评：

### OI. CZCE价格走势

数据起始日：2020/11/2

数据截止日：2023/11/1

期内最小值：7475

期内最大值：14344

期内平均值：10586.3210

当前分位值：13.79%



数据来源：iFind

点评：

### 育肥收益

数据起始日：2022/8/19

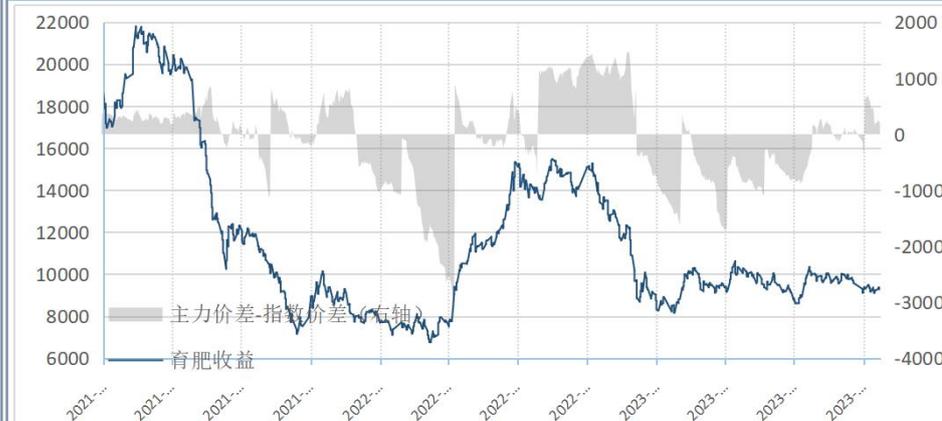
数据截止日：2023/11/1

期内最小值：8156.2500

期内最大值：15480.0000

期内平均值：10617.2871

当前分位值：15.24%



数据来源：iFind

点评：

### 育肥肉料差(高料)

数据起始日： 2022/8/19

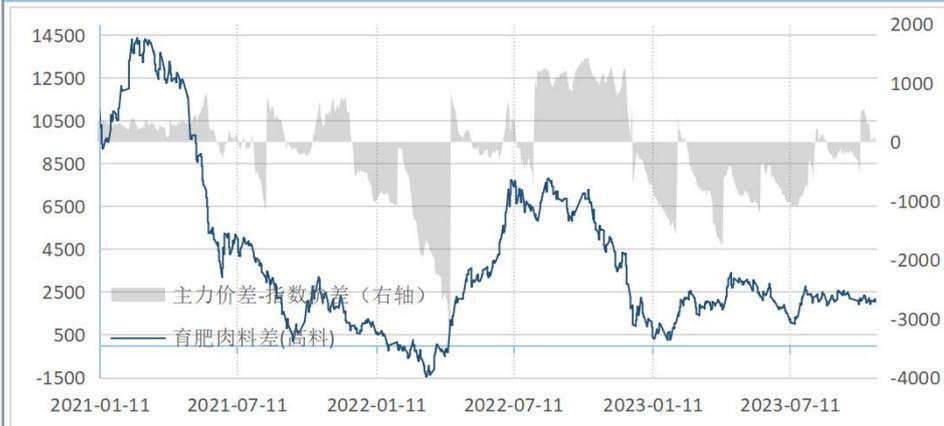
数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 246.0000

期内最大值： 7791.0000

期内平均值： 2973.8241

当前分位值： 23.74%



数据来源： iFind

点评：

### 豆二厂库置换

数据起始日： 2020/11/2

数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： -745.0200

期内最大值： 58.2450

期内平均值： -205.8229

当前分位值： 67.66%



数据来源： iFind

点评：

### Cs-C

数据起始日： 2020/11/2

数据截止日： 2023/11/1

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： 51.12%



数据来源： iFind

点评：

数据起始日： 2020/11/2

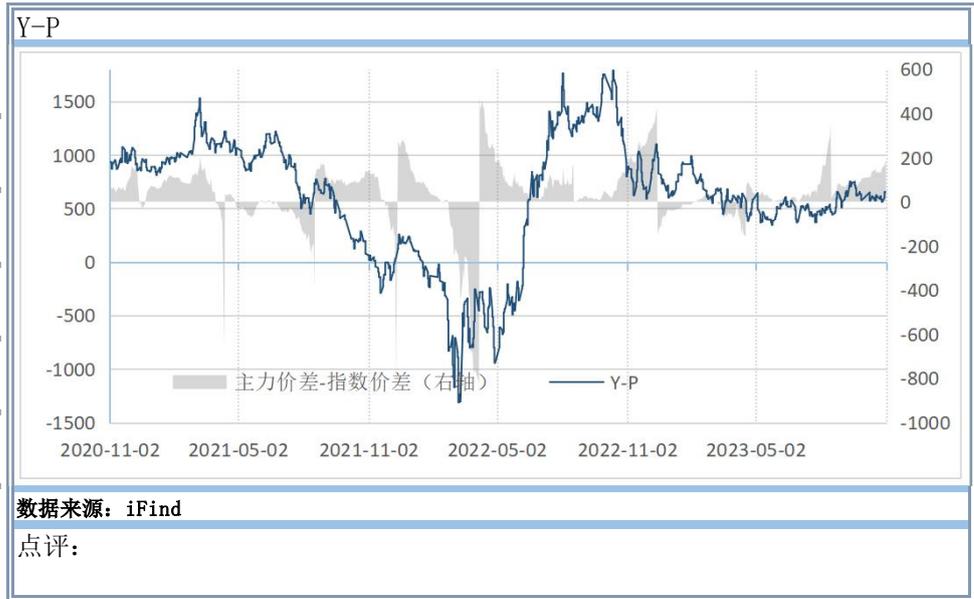
数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： -1313.0000

期内最大值： 1788.0000

期内平均值： 602.6118

当前分位值： 63.27%



数据起始日： 2022/5/23

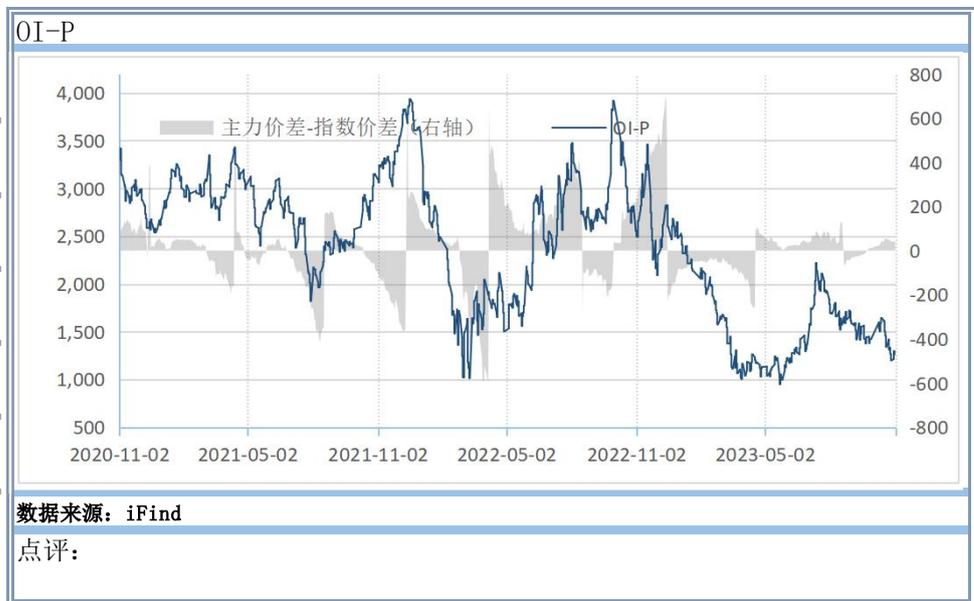
数据截止日： 2023/11/1

期内最小值： 950.0000

期内最大值： 3919.0000

期内平均值： 2060.2238

当前分位值： 10.54%



## 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。