

<http://www.shanjinqh.com>

盘面套利观察

制作：强子益

2023年3月20日

投资咨询： Z0015283

数据仅供参考，据此入市，风险自负。

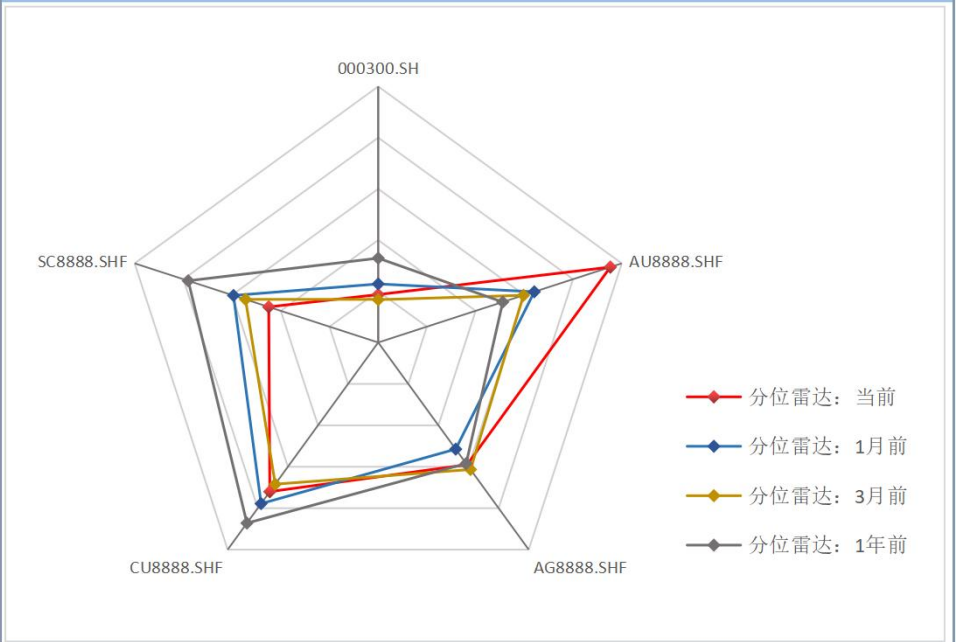
邮箱： qiangziyi@sd-gold.com

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

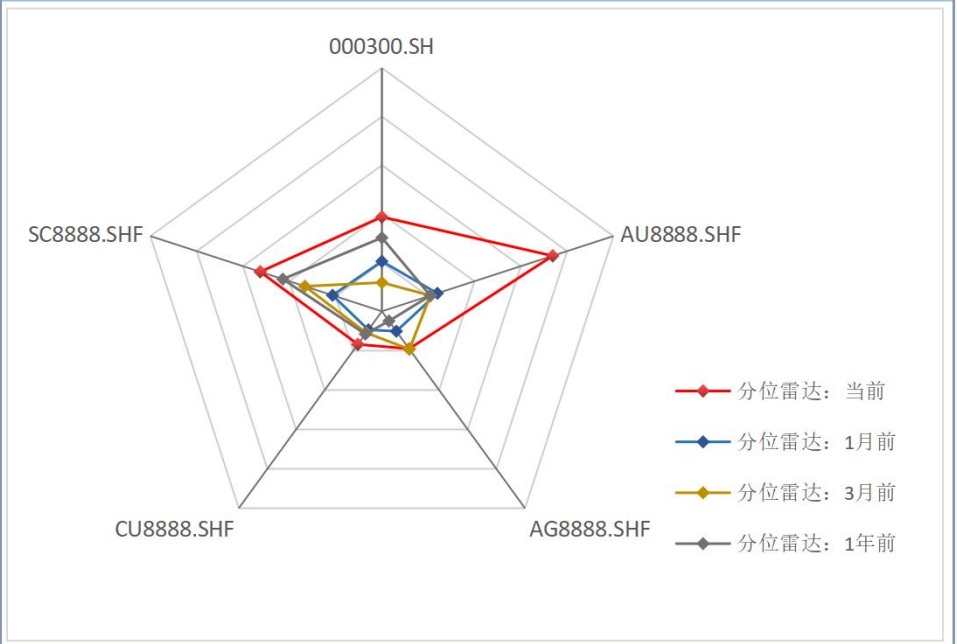
价格分位雷达



数据来源: iFind

点评:

成交额分位雷达



数据来源: iFind

点评:

沪深300指数走势

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 3508.7034

期内最大值： 5807.7191

期内平均值： 4540.7335

当前分位值： 16.73%



数据来源：iFind

点评：

Au. SHFE价格走势

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 339.82

期内最大值： 450.36

期内平均值： 390.5423

当前分位值： 95.31%



数据来源：iFind

点评：

Cu. SHFE价格走势

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 37285

期内最大值： 77934

期内平均值： 62799.0808

当前分位值： 72.01%



数据来源：iFind

点评：

Sc.Ine价格走势

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 228.9

期内最大值： 791.6

期内平均值： 473.0805

当前分位值： 44.94%



数据来源： iFind

点评：

Cu/Au

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 7.5679

期内最大值： 15.4319

期内平均值： 12.6932

当前分位值： 68.07%



数据来源： iFind

点评：

Sc/Au

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 0.5769

期内最大值： 1.9320

期内平均值： 1.2130

当前分位值： 37.29%

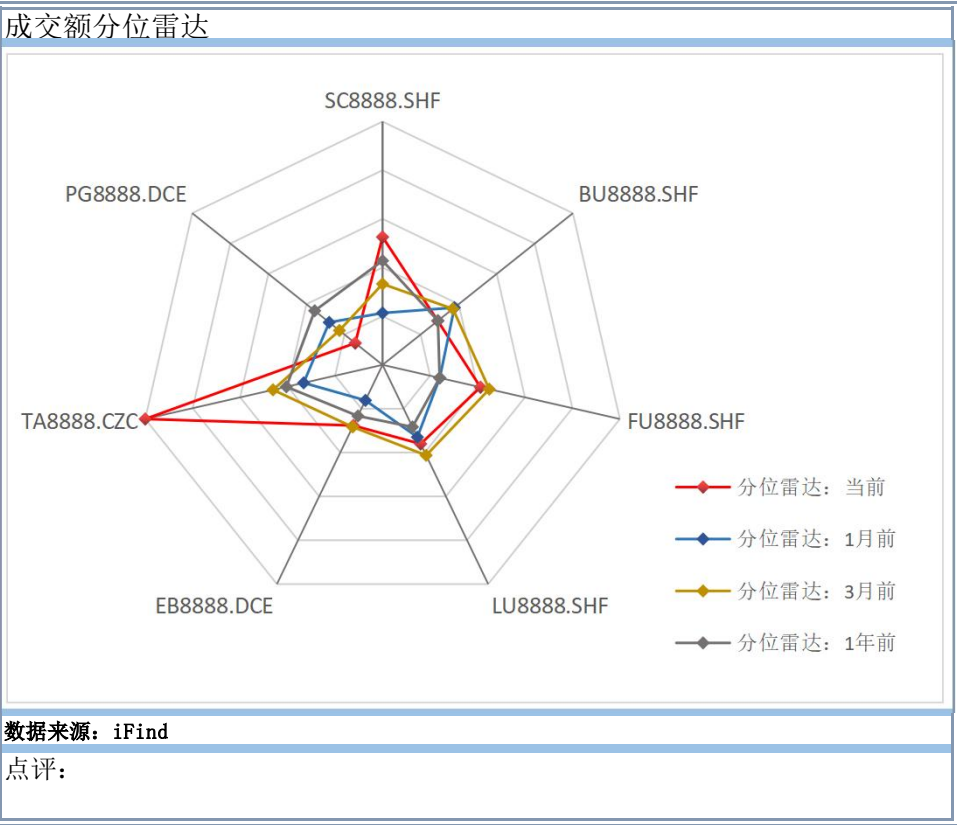
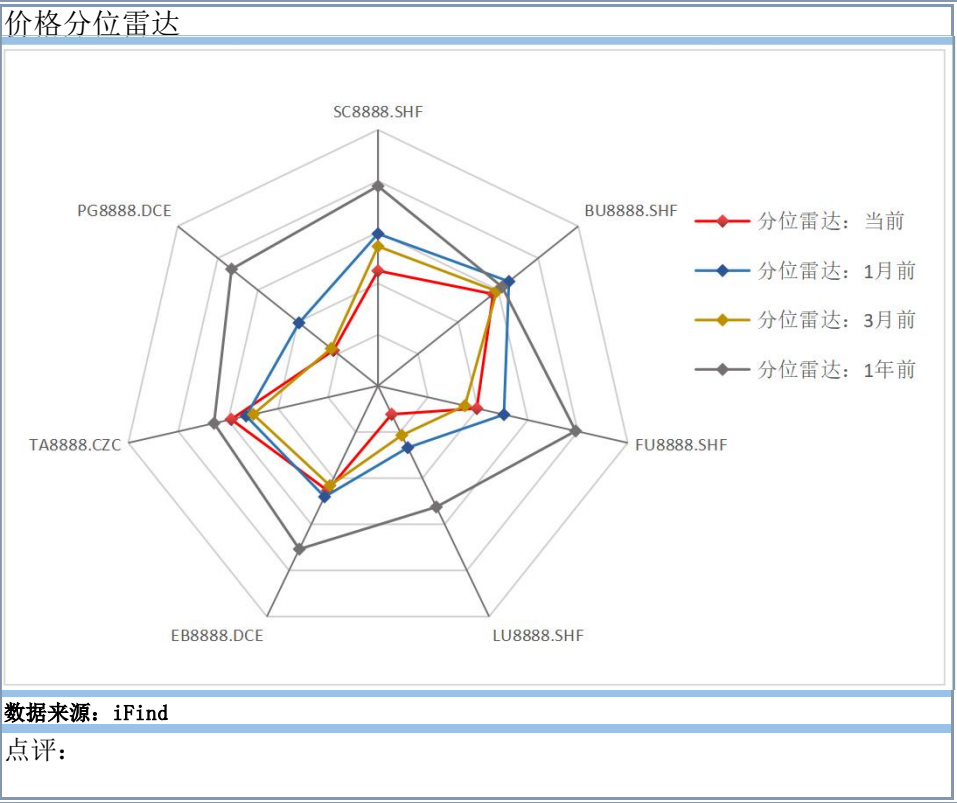


数据来源： iFind

点评：



二、原油相关



Sc. Ine价格走势

数据起始日： 2020-3-18

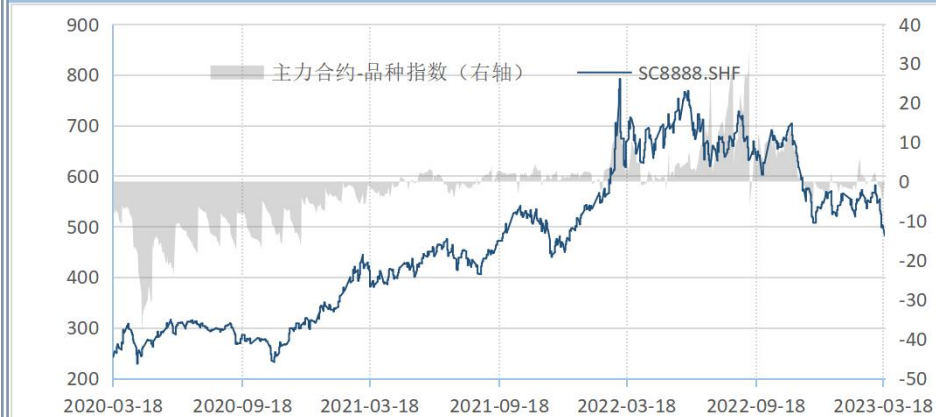
数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 228.9

期内最大值： 791.6

期内平均值： 473.0805

当前分位值： 44.94%



数据来源：iFind

点评：

Bu. SHFE价格走势

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 1842

期内最大值： 4794

期内平均值： 3232.7737

当前分位值： 57.52%



数据来源：iFind

点评：

Fu. SHFE价格走势

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 1397

期内最大值： 4371

期内平均值： 2620.8422

当前分位值： 39.58%



数据来源：iFind

点评：

Lu. Ine价格走势

数据起始日： 2021-6-21

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 3134

期内最大值： 6464

期内平均值： 4315.7882

当前分位值： 12.31%



数据来源：iFind

点评：

EB. DCE价格走势

数据起始日： 2020-9-23

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 5574

期内最大值： 11361

期内平均值： 8540.5807

当前分位值： 45.39%



数据来源：iFind

点评：

PTA. CZCE价格走势

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 3136

期内最大值： 7488

期内平均值： 4861.7695

当前分位值： 58.78%



数据来源：iFind

点评：

LPG. DCE价格走势

数据起始日： 2021-3-25

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 3657

期内最大值： 6749

期内平均值： 5069.7344

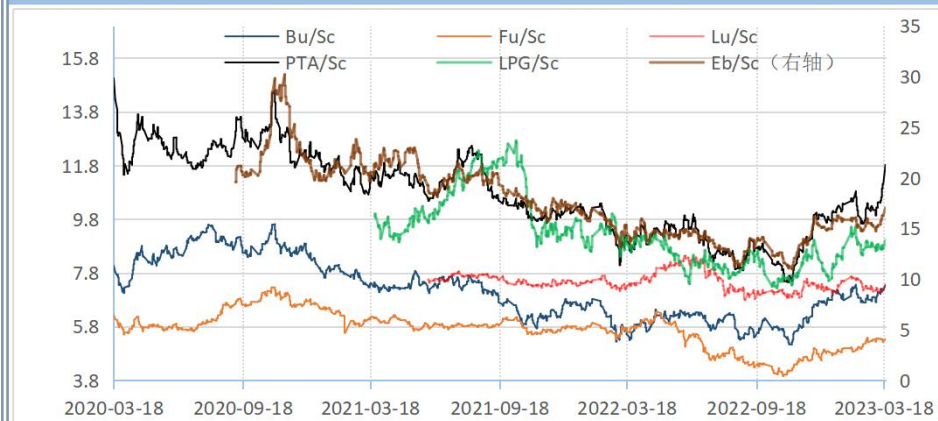
当前分位值： 22.22%



数据来源： iFind

点评：

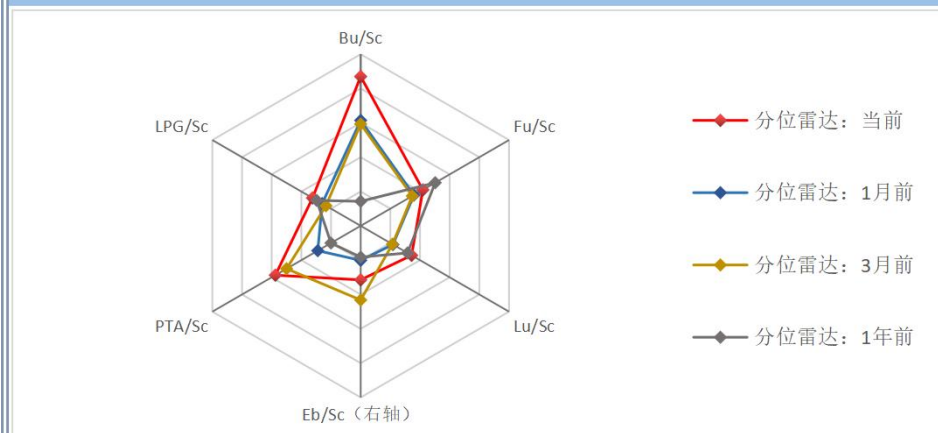
Sc相关比价一揽子



数据来源： iFind

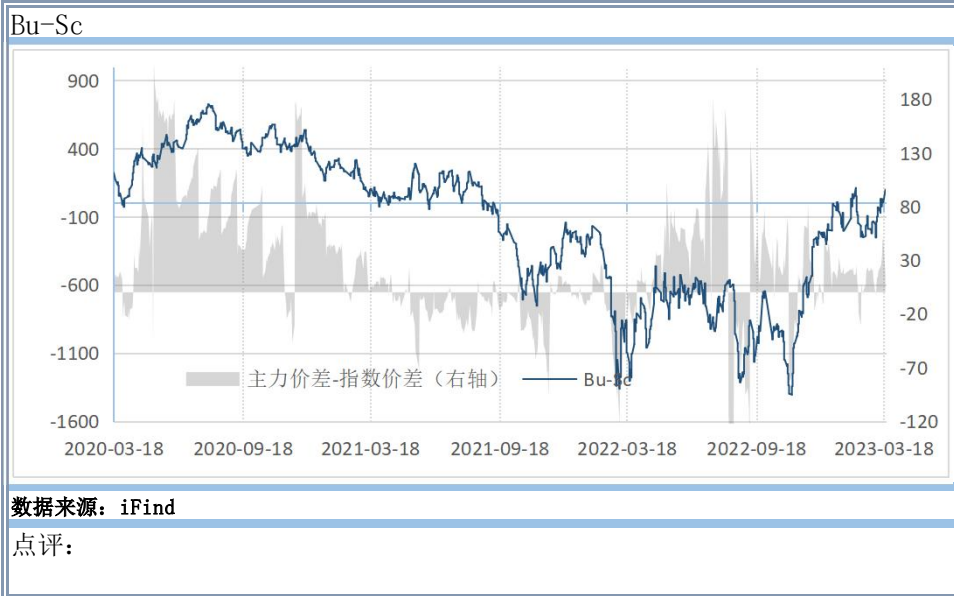
点评：

Sc相关比价分位雷达



数据来源： iFind

点评：



数据起始日: 2020-3-18

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: -1406.4286

期内最大值: 725.0000

期内平均值: -146.3729

当前分位值: 70.61%

数据起始日: 2020-3-18

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: -331.0000

期内最大值: 1284.0000

期内平均值: 611.9315

当前分位值: 80.31%

数据起始日: 2021-6-21

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: 643.0000

期内最大值: 2592.0000

期内平均值: 1261.3202

当前分位值: 16.78%



数据起始日: 2021-3-25

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: -1959.0000

期内最大值: 1436.0000

期内平均值: -517.1183

当前分位值: 43.74%

数据起始日: 2020-3-18

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: -1762.0000

期内最大值: 1221.0000

期内平均值: 130.9643

当前分位值: 88.43%

数据起始日: 2020-9-23

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: -6347.0000

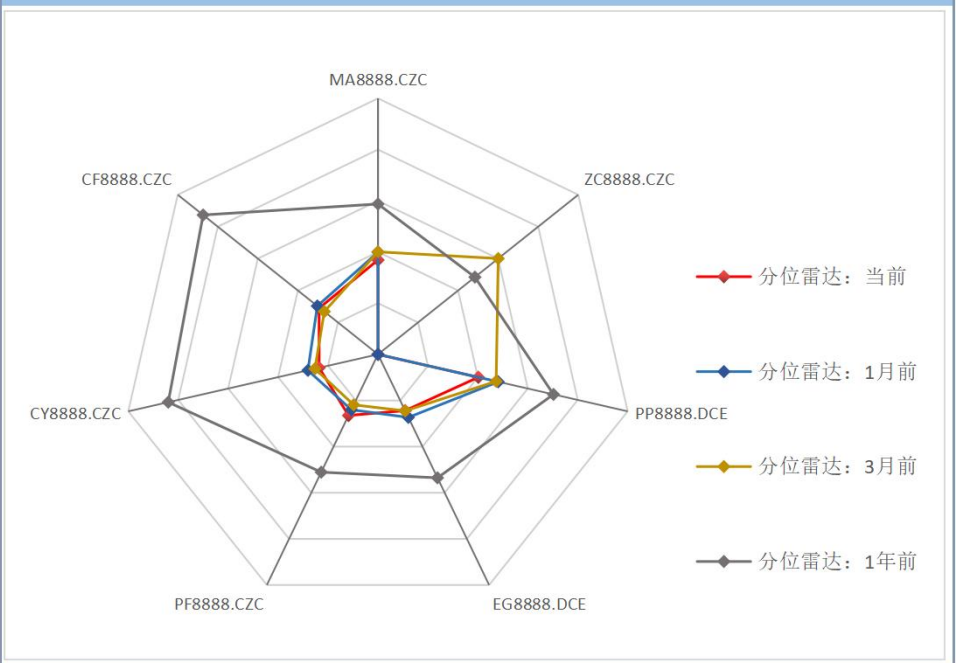
期内最大值: 2720.0000

期内平均值: -1702.8203

当前分位值: 54.17%

三、煤化工相关

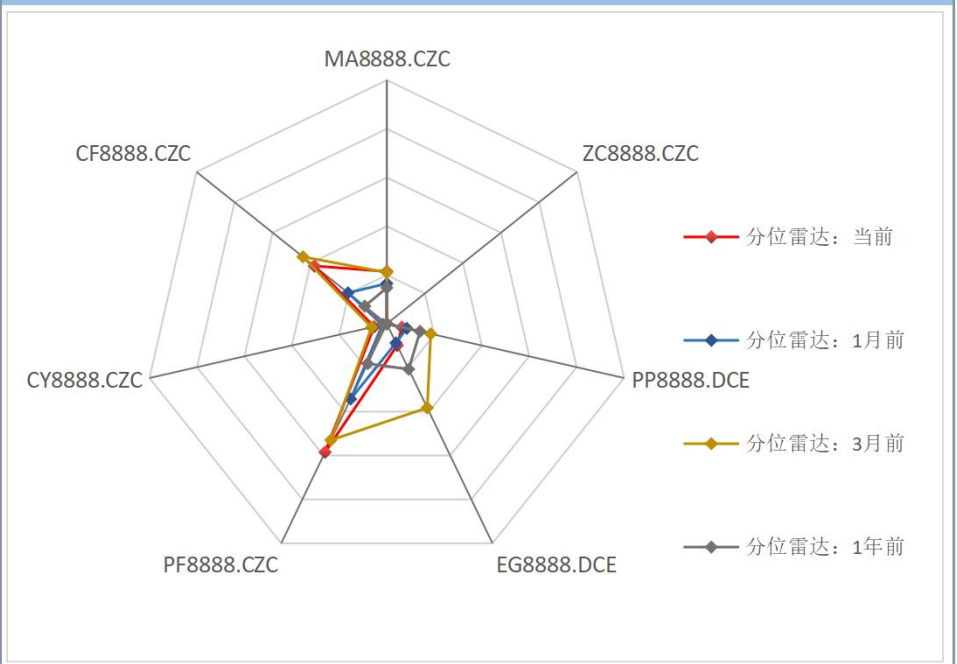
价格分位雷达



数据来源: iFind

点评:

成交额分位雷达



数据来源: iFind

点评:

MA. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020-3-18

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: 1596

期内最大值: 4015

期内平均值: 2473.6776

当前分位值: 36.87%

ZC. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020-3-18

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: 0

期内最大值: 1703.2

期内平均值: 712.5162

当前分位值: 0.00%

PP. DCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020-3-18

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: 5672

期内最大值: 10224

期内平均值: 8132.2593

当前分位值: 40.18%

EG. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020-3-18

数据截止日: 2023-3-20

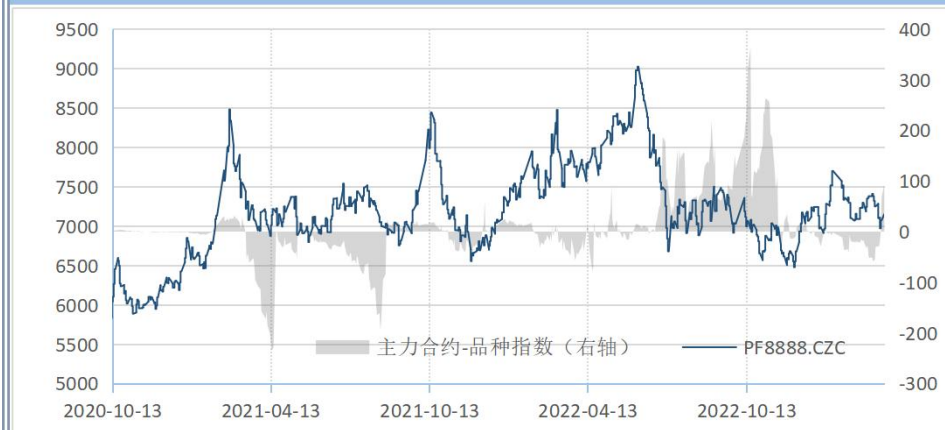
期内最小值: 3021

期内最大值: 7345

期内平均值: 4528.2305

当前分位值: 24.40%

PF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2021-10-8

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: 6477

期内最大值: 9022

期内平均值: 7390.1331

当前分位值: 26.48%

CY. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020-3-18

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: 17531

期内最大值: 30443

期内平均值: 23162.6118

当前分位值: 23.58%

CF. CZCE价格走势



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020-3-18

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: 10573

期内最大值: 22574

期内平均值: 15969.4458

当前分位值: 29.17%

Ma-Zc



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020-3-18

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: -622.7500

期内最大值: 2777.0000

期内平均值: 692.3870

当前分位值: 91.50%

PP-Ma



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020-3-18

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: -2039.0000

期内最大值: 2384.0000

期内平均值: 711.2263

当前分位值: 46.94%

PTA-Eg



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020-3-18

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: -1783.0000

期内最大值: 2269.0000

期内平均值: 333.5391

当前分位值: 83.93%

Sc/Zc



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2020-3-18

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: #DIV/0!

期内最大值: #DIV/0!

期内平均值: #DIV/0!

当前分位值: #DIV/0!

CY-PF



数据来源: iFind

点评:

数据起始日: 2021-10-8

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: -1555.0000

期内最大值: 9298.0000

期内平均值: 2515.5581

当前分位值: 6.25%



数据起始日: 2021-10-8

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: -264.3150

期内最大值: 310.7150

期内平均值: -65.9960

当前分位值: 17.65%



数据起始日: 2020-3-18

数据截止日: 2023-3-20

期内最小值: 5777.0000

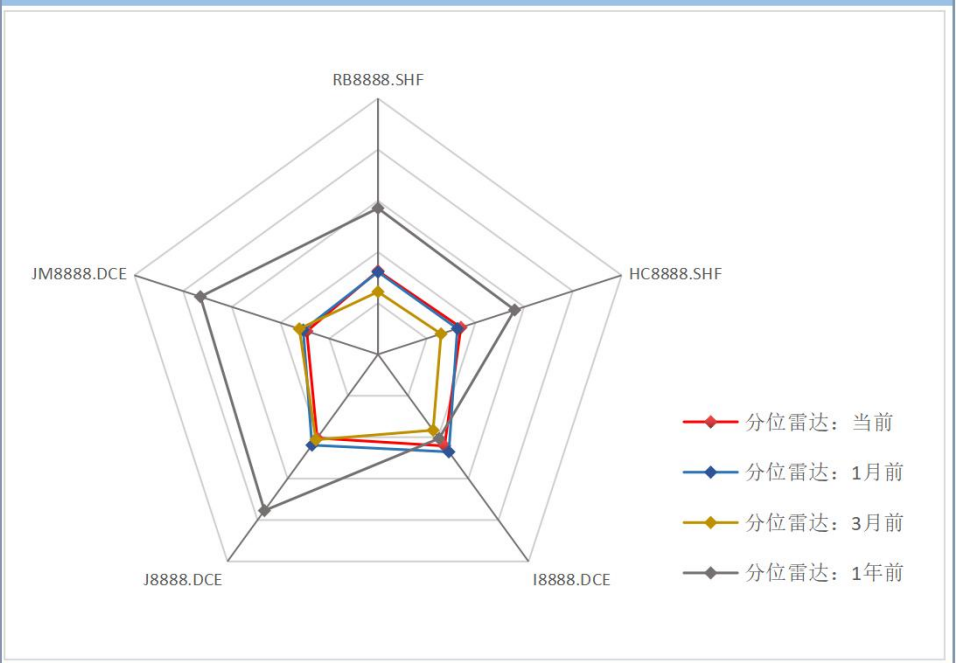
期内最大值: 9616.0000

期内平均值: 7193.1660

当前分位值: 18.89%

四、黑色相关

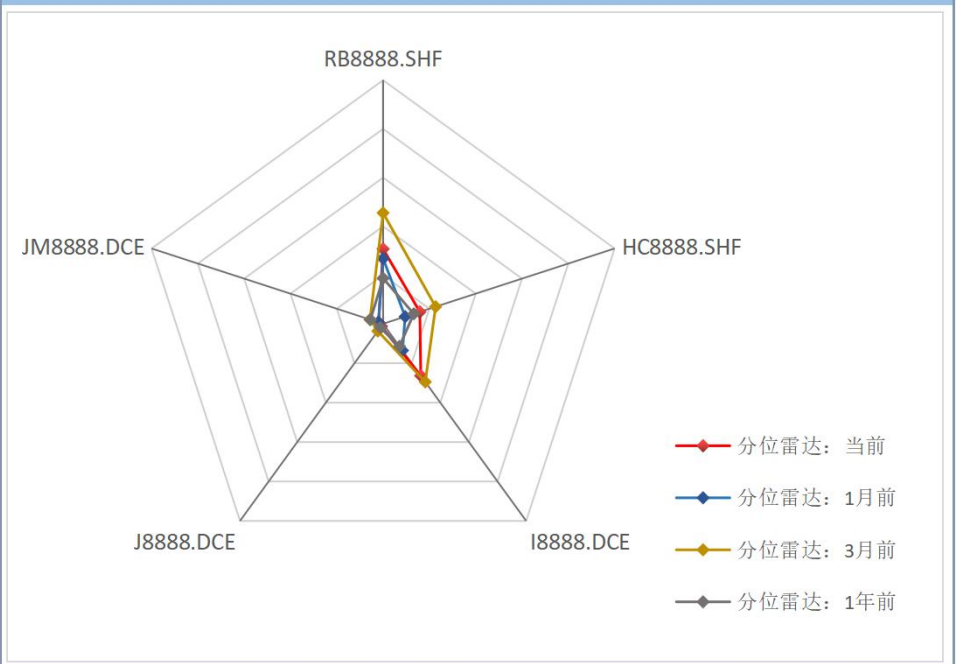
价格分位雷达



数据来源：iFind

点评：

成交额分位雷达



数据来源：iFind

点评：

RB. SHFE价格走势

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 3200

期内最大值： 6158

期内平均值： 4304.8176

当前分位值： 32.59%



数据来源：iFind

点评：

HC. SHFE价格走势

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 3048

期内最大值： 6675

期内平均值： 4446.1111

当前分位值： 34.02%



数据来源：iFind

点评：

I. DCE价格走势

数据起始日： 2020-3-18

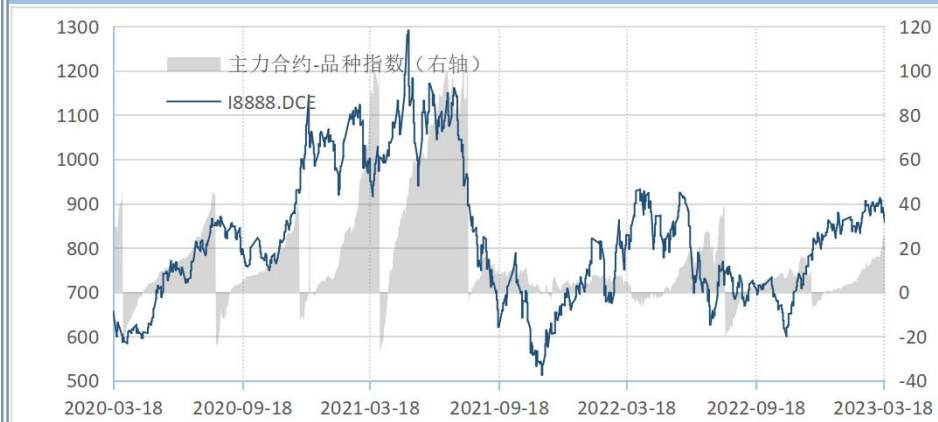
数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 512.8

期内最大值： 1290.9

期内平均值： 822.4073

当前分位值： 44.21%



数据来源：iFind

点评：

J. DCE价格走势

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 1640.6

期内最大值： 4320.8

期内平均值： 2686.6776

当前分位值： 40.42%



数据来源： iFind

点评：

Jm. DCE价格走势

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 1043.1

期内最大值： 3764.7

期内平均值： 1918.6896

当前分位值： 29.23%



数据来源： iFind

点评：

螺铁差

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 722.1765

期内最大值： 2451.8235

期内平均值： 1273.1120

当前分位值： 18.93%



数据来源： iFind

点评：

螺纹利润

数据起始日： 2020-3-18

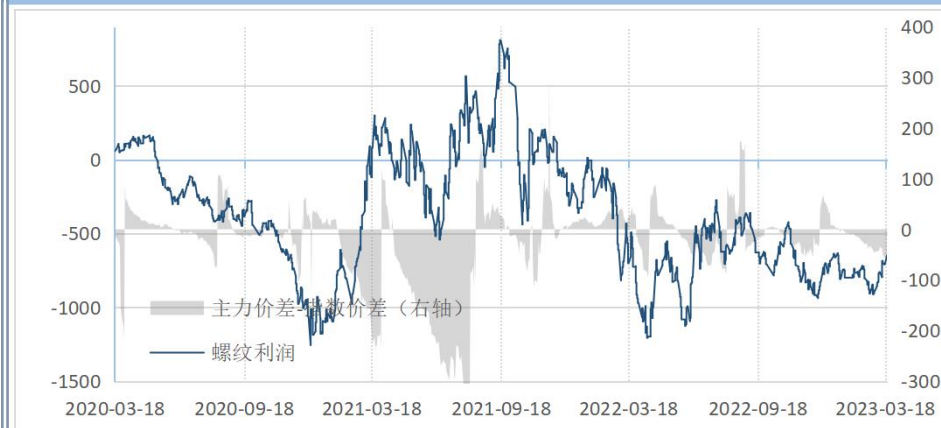
数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： -1255.7273

期内最大值： 810.0000

期内平均值： -380.5456

当前分位值： 29.37%



数据来源：iFind

点评：

卷铁差

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 851.9412

期内最大值： 2799.4118

期内平均值： 1414.4056

当前分位值： 16.21%



数据来源：iFind

点评：

热卷利润

数据起始日： 2020-3-18

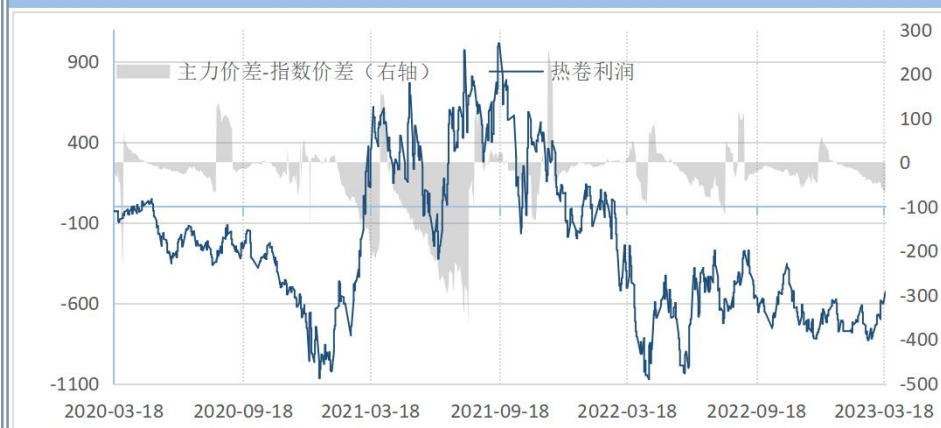
数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： -1073.7273

期内最大值： 1014.0000

期内平均值： -239.2520

当前分位值： 25.99%



数据来源：iFind

点评：

卷螺差

数据起始日： 2020-3-18

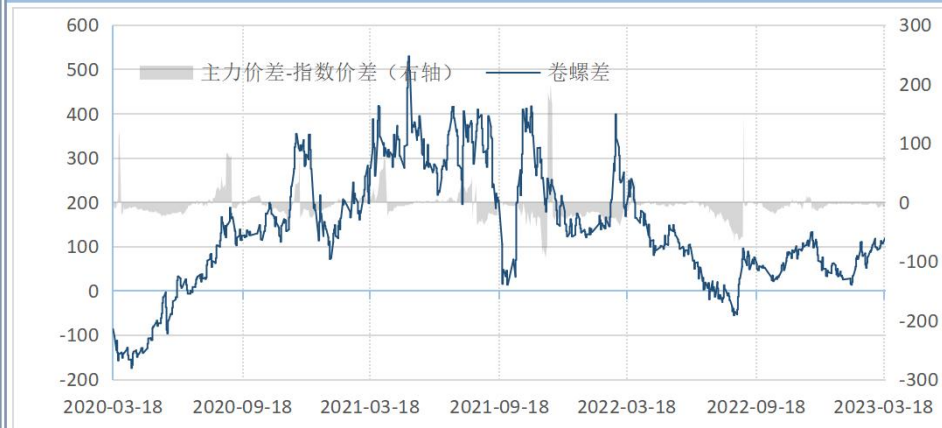
数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： -175.0000

期内最大值： 529.0000

期内平均值： 141.2936

当前分位值： 41.62%



数据来源：iFind

点评：

螺矿比

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 3.8923

期内最大值： 8.7631

期内平均值： 5.3336

当前分位值： 19.87%



数据来源：iFind

点评：

焦矿比

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 2.1354

期内最大值： 6.1947

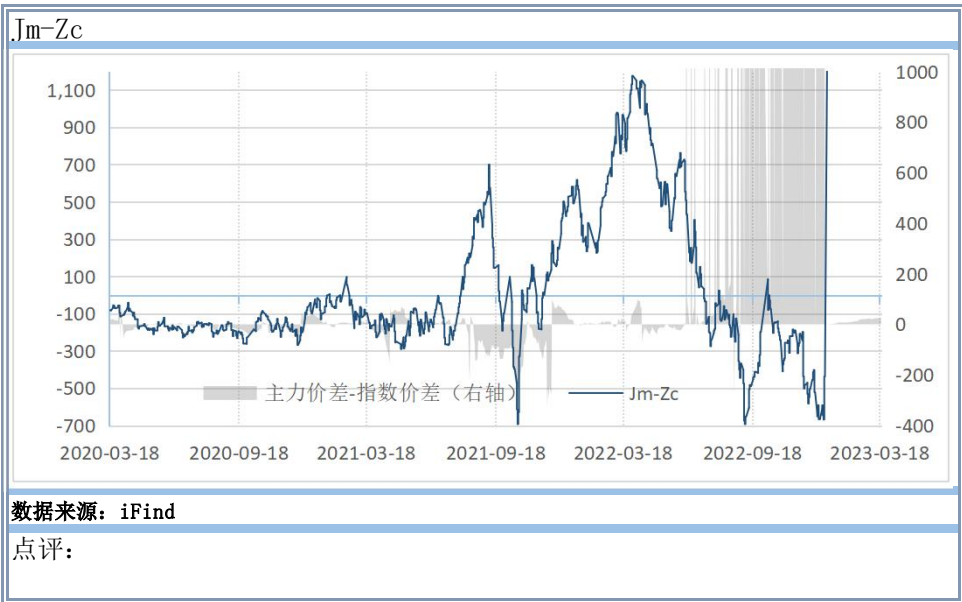
期内平均值： 3.3614

当前分位值： 25.72%

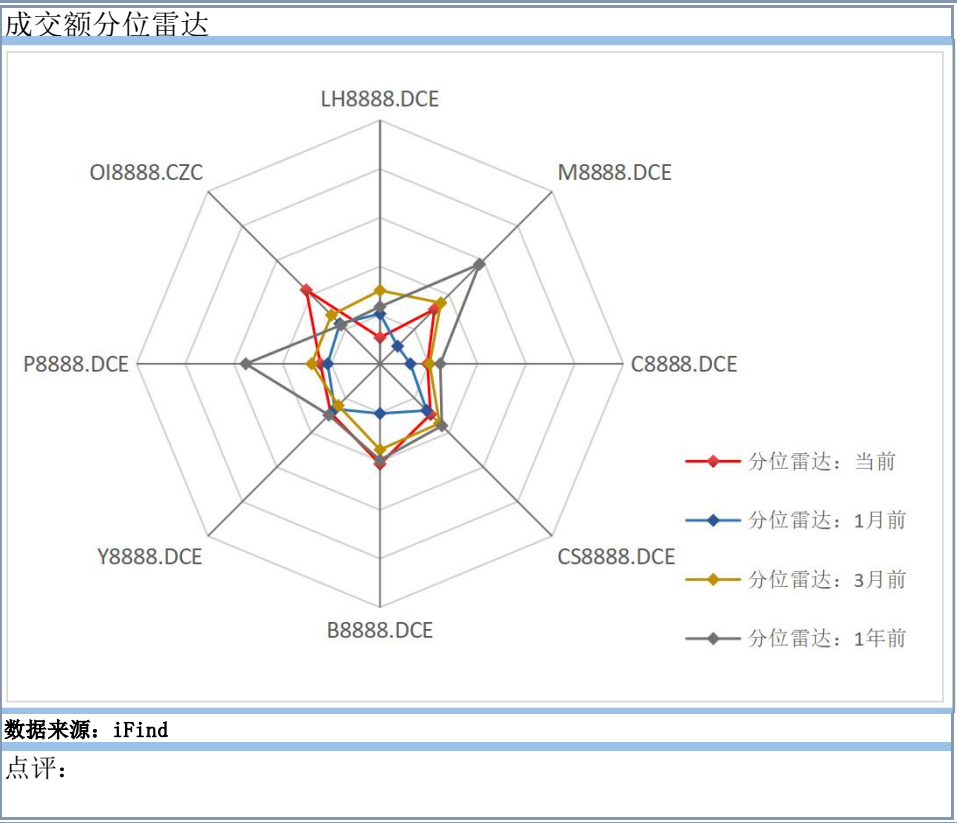
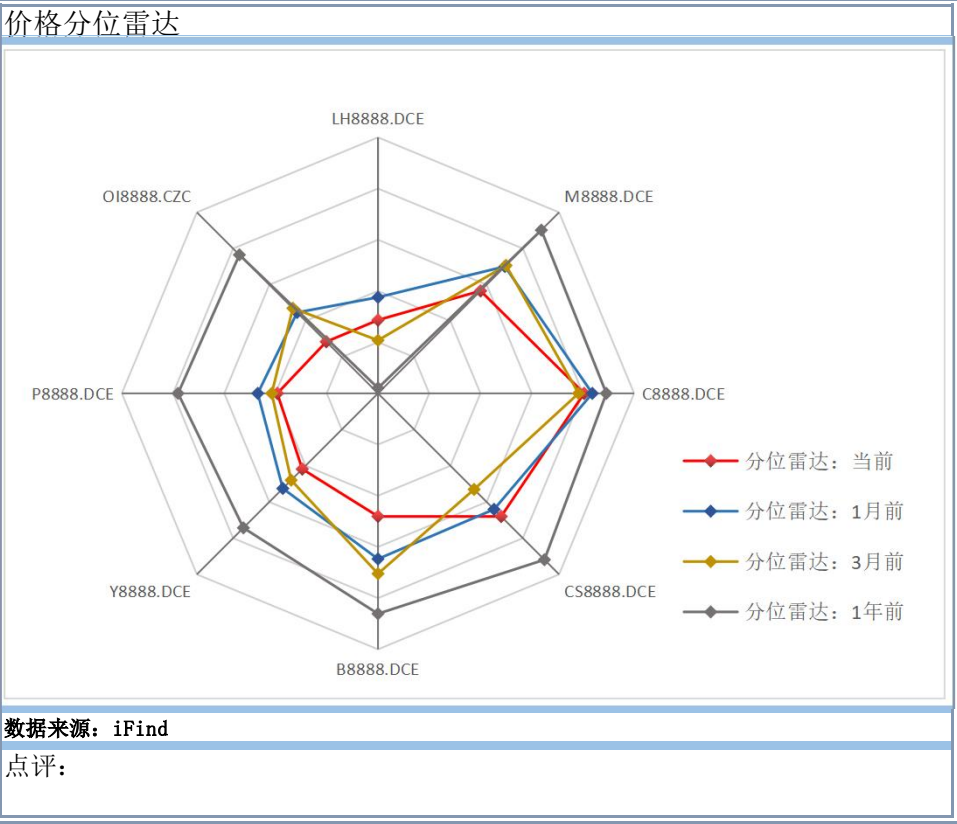


数据来源：iFind

点评：



五、农产品相关



LH. DCE价格走势

数据起始日： 2022-1-6

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 14165

期内最大值： 22735

期内平均值： 18366.3897

当前分位值： 28.65%



数据来源： iFind

点评：

M. DCE价格走势

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 2707

期内最大值： 4328

期内平均值： 3483.3416

当前分位值： 56.63%



数据来源： iFind

点评：

C. DCE价格走势

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 1967

期内最大值： 3027

期内平均值： 2634.0782

当前分位值： 80.47%



数据来源： iFind

点评：

CS.DCE价格走势

数据起始日： 2020-3-18

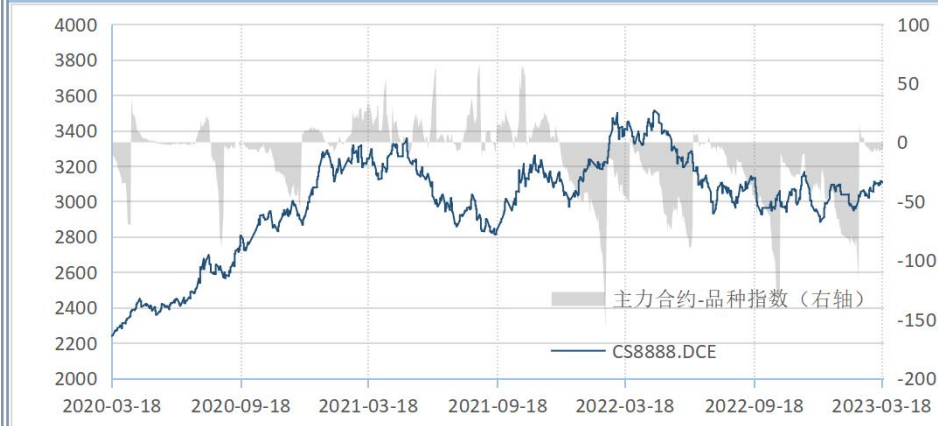
数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 2240

期内最大值： 3512

期内平均值： 2993.1454

当前分位值： 68.00%



数据来源：iFind

点评：

B.DCE价格走势

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 2875

期内最大值： 5585

期内平均值： 4307.1756

当前分位值： 48.04%



数据来源：iFind

点评：

Y.DCE价格走势

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 5284

期内最大值： 12065

期内平均值： 8461.0631

当前分位值： 41.81%



数据来源：iFind

点评：

P. DCE价格走势

数据起始日：2020-3-18

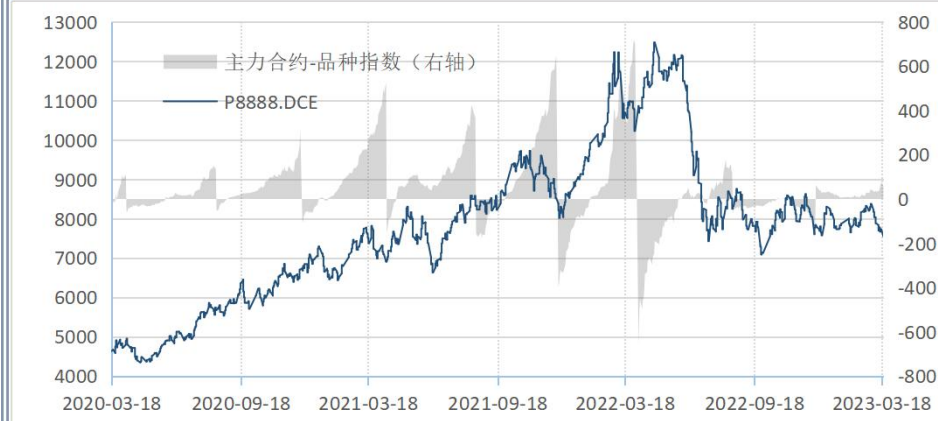
数据截止日：2023-3-20

期内最小值：4354

期内最大值：12479

期内平均值：7801.5597

当前分位值：39.30%



数据来源：iFind

点评：

OI. CZCE价格走势

数据起始日：2020-3-18

数据截止日：2023-3-20

期内最小值：6571

期内最大值：14344

期内平均值：10404.4129

当前分位值：28.53%



数据来源：iFind

点评：

育肥收益

数据起始日：2022-1-6

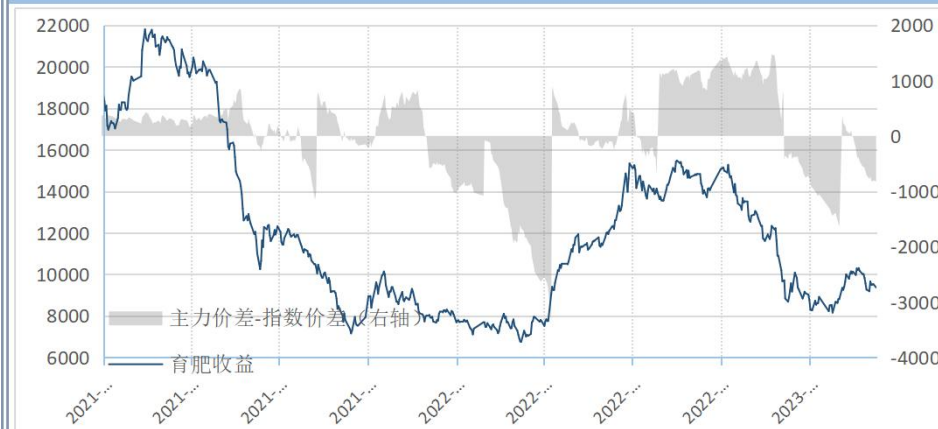
数据截止日：2023-3-20

期内最小值：6748.7500

期内最大值：15480.0000

期内平均值：11020.3078

当前分位值：30.01%



数据来源：iFind

点评：

育肥肉料差(高料)

数据起始日： 2022-1-6

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： -1474.0000

期内最大值： 7791.0000

期内平均值： 3142.5621

当前分位值： 34.42%



数据来源：iFind

点评：

豆二厂库置换

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： -737.5300

期内最大值： 79.6850

期内平均值： -167.4558

当前分位值： 91.55%



数据来源：iFind

点评：

Cs-C

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： 62.0000

期内最大值： 598.0000

期内平均值： 359.0672

当前分位值： 41.60%



数据来源：iFind

点评：

数据起始日： 2020-3-18

数据截止日： 2023-3-20

期内最小值： -1313.0000

期内最大值： 1788.0000

期内平均值： 659.5034

当前分位值： 60.79%

Y-P



数据来源：iFind

点评：

数据起始日： 2021-10-8

数据截止日： 2023-3-20

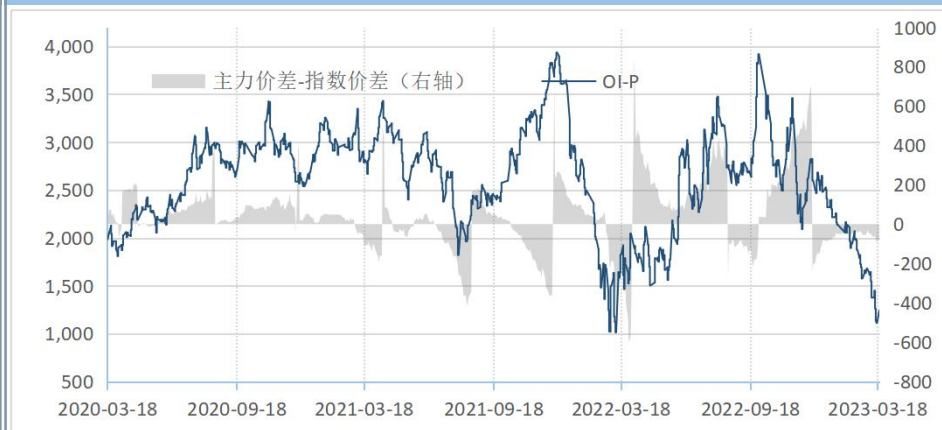
期内最小值： 1014.0000

期内最大值： 3936.0000

期内平均值： 2517.0227

当前分位值： 7.80%

OI-P



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。