

# 重要商品主力价差套利表现

制作日期

2022年12月8日

板块	名称	报价单位	最新收盘价	价差名称	价差	价差走势图 (近一年)																																														
黑色系	SHFE热轧卷板	元/吨	3902	热卷 - 螺纹价差	120																																															
	SHFE螺纹钢	元/吨	3782																																																	
黑色系	CZCE锰硅	元/吨	7456	锰硅 - 锰铁 价差	-866																																															
	CZCE硅铁	元/吨	8322																																																	
农产品	DCE豆油	元/吨	9232	豆油-棕榈油价差	1204																																															
	DCE棕榈油	元/吨	8028																																																	
农产品	CZCE菜油	元/吨	10936	菜油 - 棕榈油价差	2908																																															
	DCE棕榈油	元/吨	8028																																																	
农产品	CZCE菜油	元/吨	10936	菜油 - 豆油价差	1704																																															
	DCE豆油	元/吨	9232																																																	
农产品	DCE豆一	元/吨	5577	豆一 - 豆粕价差	1292																																															
	DCE豆粕	元/吨	4285																																																	
农产品	DCE玉米淀粉	元/吨	2961	玉米淀粉 - 玉米价差	153																																															
	DCE玉米	元/吨	2808																																																	
农产品	CZCE棉纱	元/吨	20905	棉纱 - 棉花价差	7285																																															
	CZCE棉花	元/吨	13620																																																	
能化品种	DCE塑料	元/吨	7985	塑料 - PVC价差	1938																																															
	DCE PVC	元/吨	6047																																																	
能化品种	DCE塑料	元/吨	7985	塑料 - 聚丙烯价差	297																																															
	DCE聚丙烯	元/吨	7688																																																	
能化品种	CZCE PTA	元/吨	4912	PTA - 乙二醇价差	1042																																															
	DCE 乙二醇	元/吨	3870																																																	
能化品种	CZCE玻璃	元/吨	1395	玻璃 - 纯碱价差	-1126																																															
	CZCE纯碱	元/吨	2521																																																	
主要商品期货最新主力价差所处近一年 (365天) 历史百分位				当前主要商品期货最新主力价差近五年状态 (2017-2022)																																																
<table border="1"> <tr><td>FG-SA价差</td><td>22%</td></tr> <tr><td>CY-CF价差</td><td>77%</td></tr> <tr><td>CS-C价差</td><td>15%</td></tr> <tr><td>SM-SF价差</td><td>47%</td></tr> <tr><td>TA-EG价差</td><td>33%</td></tr> <tr><td>L-PP价差</td><td>77%</td></tr> <tr><td>LV价差</td><td>77%</td></tr> <tr><td>AM价差</td><td>2%</td></tr> <tr><td>菜豆价差</td><td>20%</td></tr> <tr><td>菜棕价差</td><td>62%</td></tr> <tr><td>豆棕价差</td><td>69%</td></tr> <tr><td>卷螺差</td><td>70%</td></tr> </table>				FG-SA价差			22%	CY-CF价差	77%	CS-C价差	15%	SM-SF价差	47%	TA-EG价差	33%	L-PP价差	77%	LV价差	77%	AM价差	2%	菜豆价差	20%	菜棕价差	62%	豆棕价差	69%	卷螺差	70%	<table border="1"> <tr><td>卷螺差</td><td>~ -1000 to 1000</td></tr> <tr><td>豆棕价差</td><td>~ -1000 to 1000</td></tr> <tr><td>菜棕价差</td><td>~ -1000 to 1000</td></tr> <tr><td>菜豆价差</td><td>~ -1000 to 1000</td></tr> <tr><td>AM价差</td><td>~ -1000 to 1000</td></tr> <tr><td>LV价差</td><td>~ -1000 to 1000</td></tr> <tr><td>L-PP价差</td><td>~ -1000 to 1000</td></tr> <tr><td>TA-EG价差 (2019-2022)</td><td>~ -1000 to 1000</td></tr> <tr><td>SM-SF价差</td><td>~ -1000 to 1000</td></tr> <tr><td>CS-C价差 (2018-2022)</td><td>~ -1000 to 1000</td></tr> <tr><td>FG-Sa价差 (2020-2022)</td><td>~ -1000 to 1000</td></tr> </table>			卷螺差	~ -1000 to 1000	豆棕价差	~ -1000 to 1000	菜棕价差	~ -1000 to 1000	菜豆价差	~ -1000 to 1000	AM价差	~ -1000 to 1000	LV价差	~ -1000 to 1000	L-PP价差	~ -1000 to 1000	TA-EG价差 (2019-2022)	~ -1000 to 1000	SM-SF价差	~ -1000 to 1000	CS-C价差 (2018-2022)	~ -1000 to 1000
FG-SA价差	22%																																																			
CY-CF价差	77%																																																			
CS-C价差	15%																																																			
SM-SF价差	47%																																																			
TA-EG价差	33%																																																			
L-PP价差	77%																																																			
LV价差	77%																																																			
AM价差	2%																																																			
菜豆价差	20%																																																			
菜棕价差	62%																																																			
豆棕价差	69%																																																			
卷螺差	70%																																																			
卷螺差	~ -1000 to 1000																																																			
豆棕价差	~ -1000 to 1000																																																			
菜棕价差	~ -1000 to 1000																																																			
菜豆价差	~ -1000 to 1000																																																			
AM价差	~ -1000 to 1000																																																			
LV价差	~ -1000 to 1000																																																			
L-PP价差	~ -1000 to 1000																																																			
TA-EG价差 (2019-2022)	~ -1000 to 1000																																																			
SM-SF价差	~ -1000 to 1000																																																			
CS-C价差 (2018-2022)	~ -1000 to 1000																																																			
FG-Sa价差 (2020-2022)	~ -1000 to 1000																																																			

# 重要商品主力价差套利表现

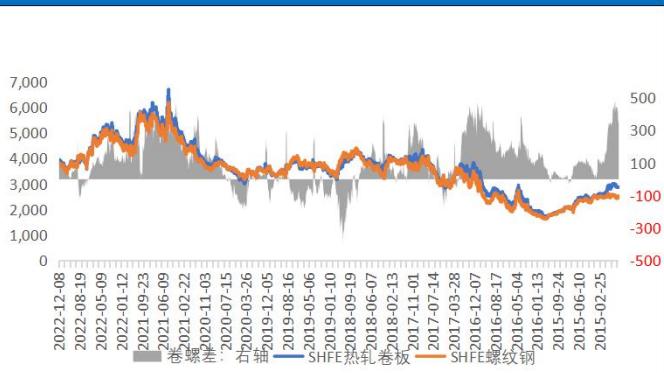
制作日期

2022年12月8日

## 商品价差近年来走势对比

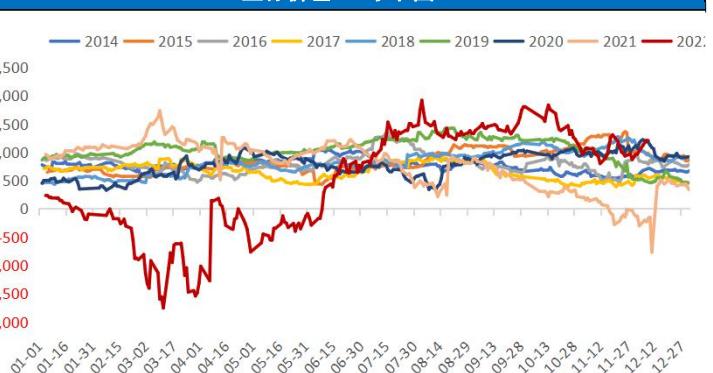
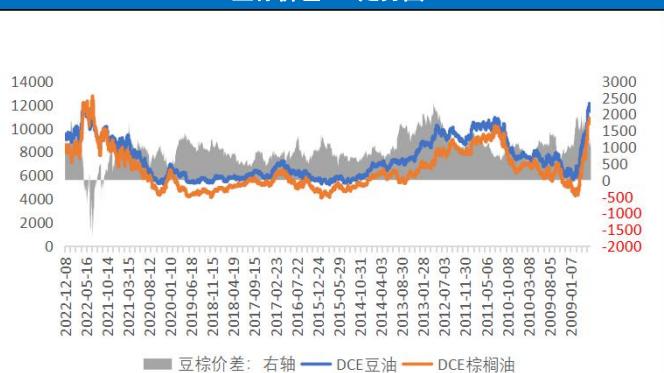
卷螺价差 - 走势图

卷螺价差 - 季节图



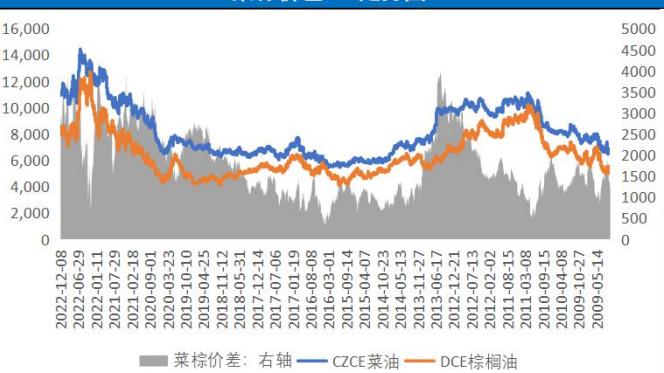
豆棕价差 - 走势图

豆棕价差 - 季节图



菜棕价差 - 走势图

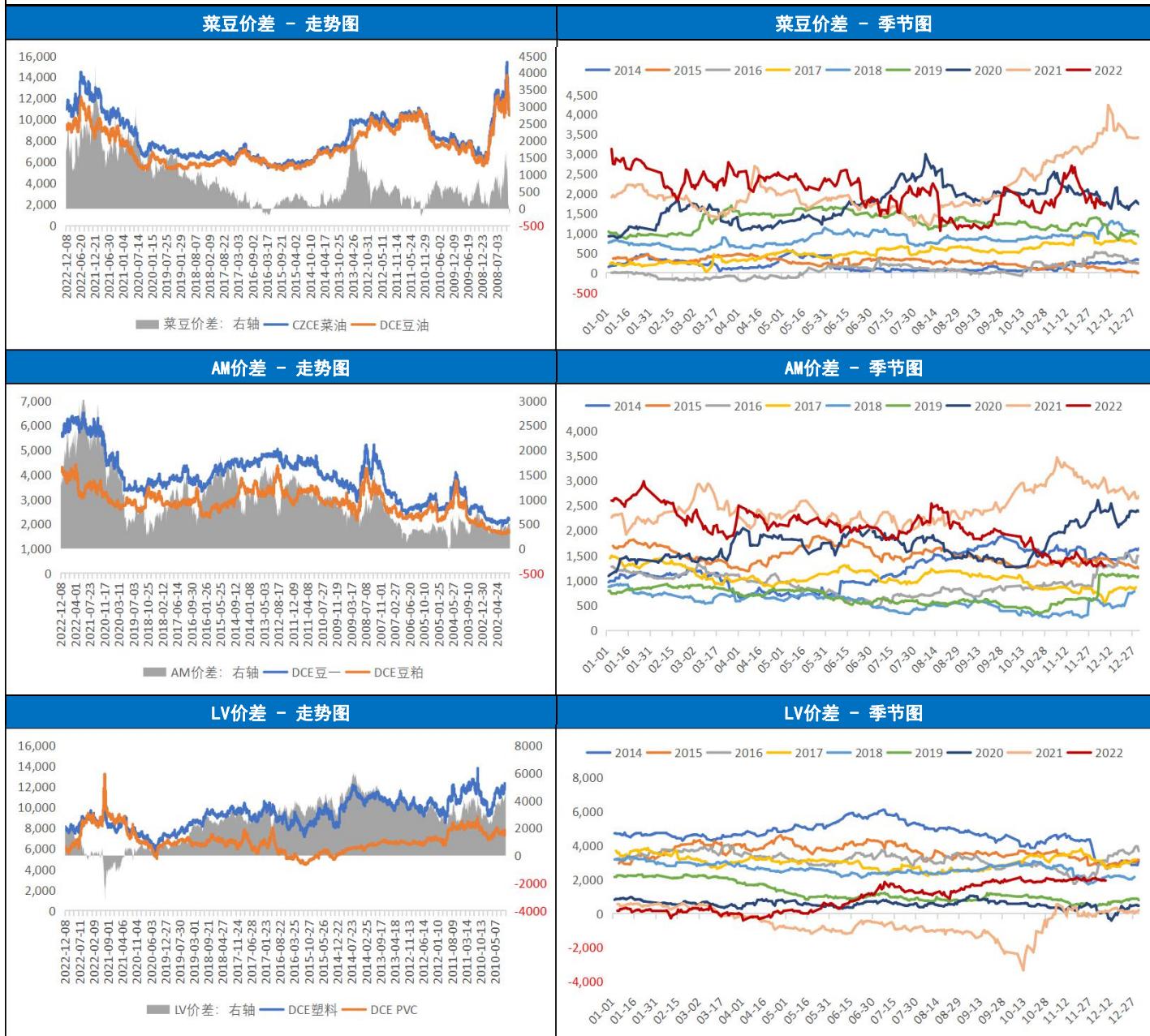
菜棕价差 - 季节图



# 重要商品主力价差套利表现

制作日期

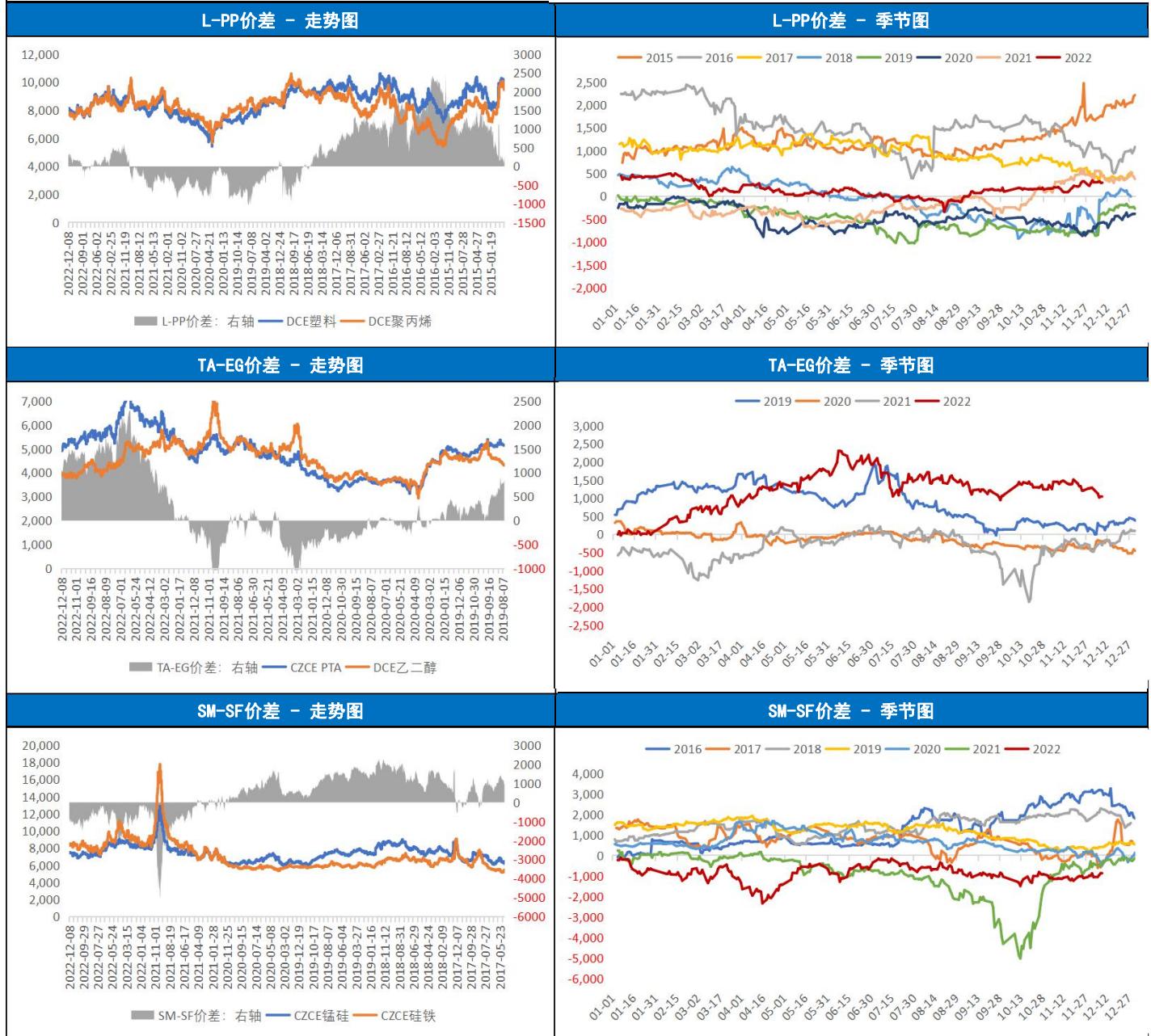
2022年12月8日



# 重要商品主力价差套利表现

制作日期

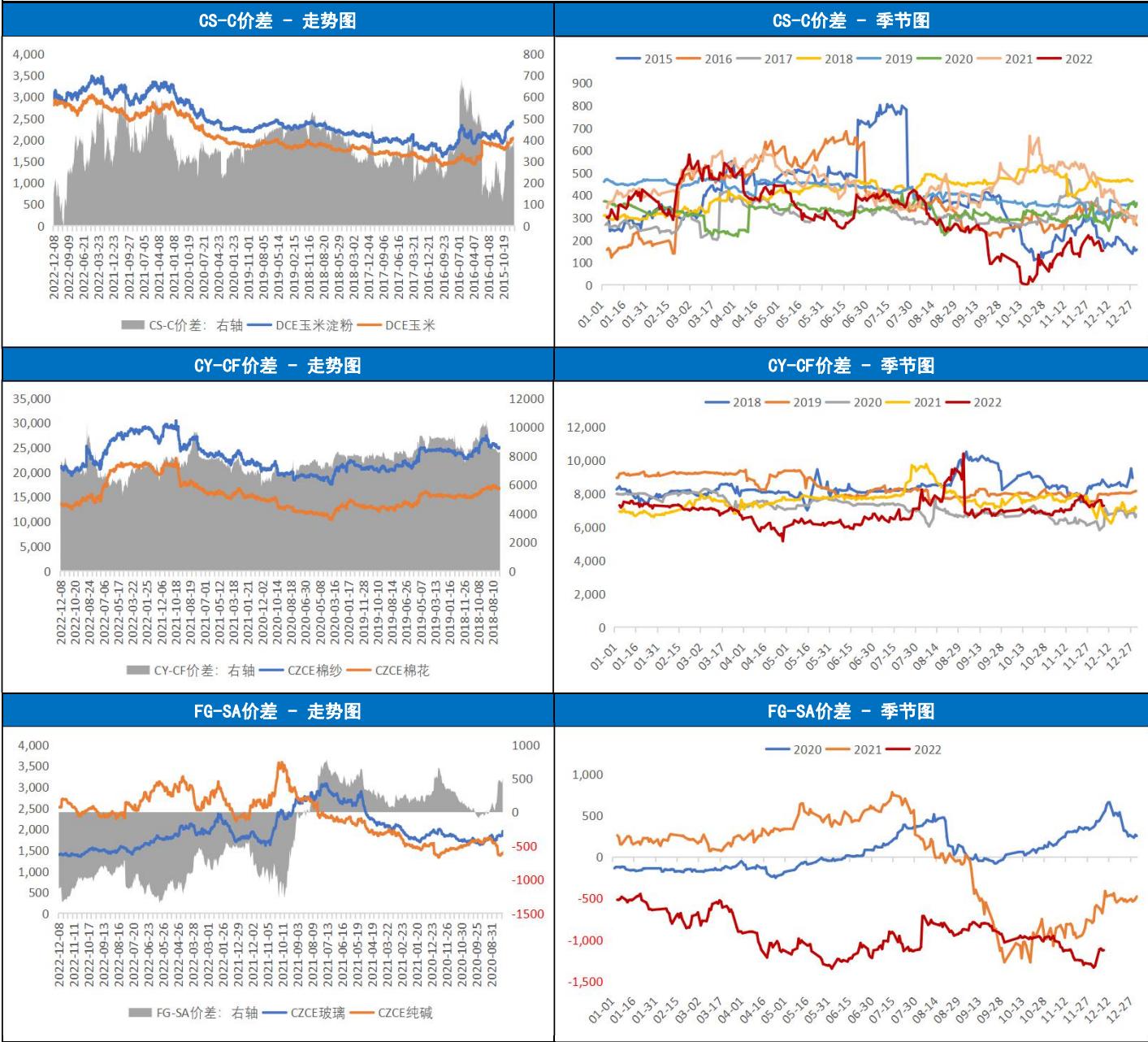
2022年12月8日



# 重要商品主力价差套利表现

制作日期

2022年12月8日



## 免责声明：

本报告中的信息均来源于公开资料，我公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证。报告中的内容和意见仅供参考，并不构成对所述品种买卖的出价或征价。我公司及其雇员对使用本报告及其内容所引发的任何直接或间接损失概不负责。本报告仅向特定客户传送，版权归冠通期货所有。未经我公司书面许可，任何机构和个人均不得以任何形式翻版，复制，引用或转载。如引用、转载、刊发，须注明出处为冠通期货股份有限公司。

冠通期货研究咨询部

王静，执业资格证号F0235424/Z00000771

联系方式：010-85356618