

重要商品主力价差套利表现

制作日期

2022年12月9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	3945	热卷 - 螺纹价差	106			
	SHFE螺纹钢	元/吨	3839					
黑色系	CZCE锰硅	元/吨	7478	锰硅 - 锰铁 价差	-998			
	CZCE硅铁	元/吨	8476					
农产品	DCE豆油	元/吨	9298	豆油-棕榈油价差	1318			
	DCE棕榈油	元/吨	7980					
农产品	CZCE菜油	元/吨	11059	菜油 - 棕榈油价差	3079			
	DCE棕榈油	元/吨	7980					
农产品	CZCE菜油	元/吨	11059	菜油 - 豆油价差	1761			
	DCE豆油	元/吨	9298					
农产品	DCE豆一	元/吨	5611	豆一 - 豆粕价差	1183			
	DCE豆粕	元/吨	4428					
农产品	DCE玉米淀粉	元/吨	2961	玉米淀粉 - 玉米价差	132			
	DCE玉米	元/吨	2829					
农产品	CZCE棉纱	元/吨	20875	棉纱 - 棉花价差	7185			
	CZCE棉花	元/吨	13690					
能化品种	DCE塑料	元/吨	7994	塑料 - PVC价差	1914			
	DCE PVC	元/吨	6080					
能化品种	DCE塑料	元/吨	7994	塑料 - 聚丙烯价差	351			
	DCE聚丙烯	元/吨	7643					
能化品种	CZCE PTA	元/吨	4972	PTA - 乙二醇价差	1014			
	DCE 乙二醇	元/吨	3958					
能化品种	CZCE玻璃	元/吨	1405	玻璃 - 纯碱价差	-1165			
	CZCE纯碱	元/吨	2570					
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)				
<p>FG-SA价差 15%</p> <p>CY-CF价差 72%</p> <p>CS-C价差 12%</p> <p>SM-SF价差 32%</p> <p>TA-EG价差 32%</p> <p>L-PP价差 83%</p> <p>LV价差 83%</p> <p>AM价差 0%</p> <p>菜豆价差 23%</p> <p>菜棕价差 74%</p> <p>豆棕价差 76%</p> <p>卷螺差 59%</p>								

重要商品主力价差套利表现

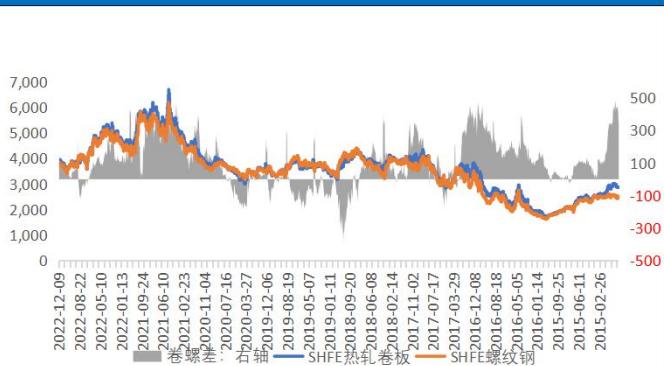
制作日期

2022年12月9日

商品价差近年来走势对比

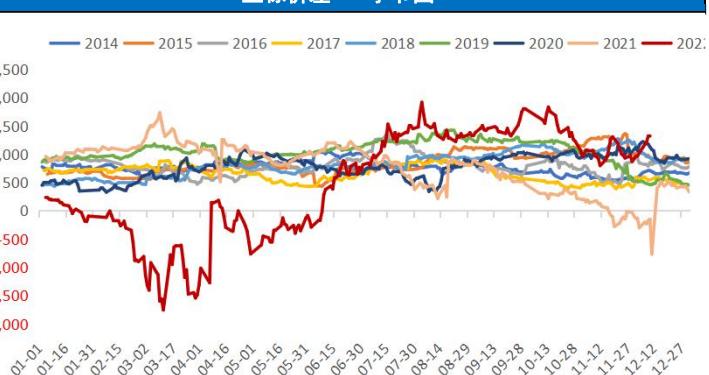
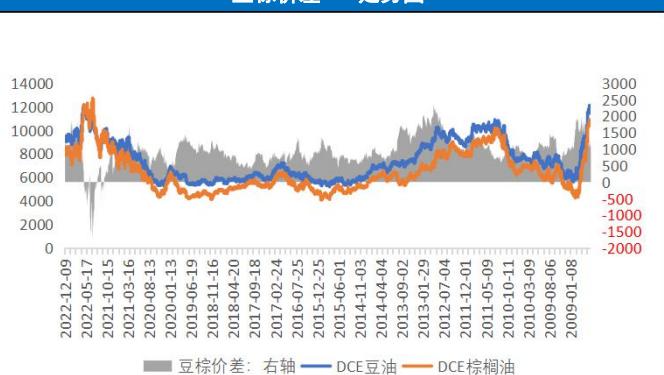
卷螺价差 - 走势图

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

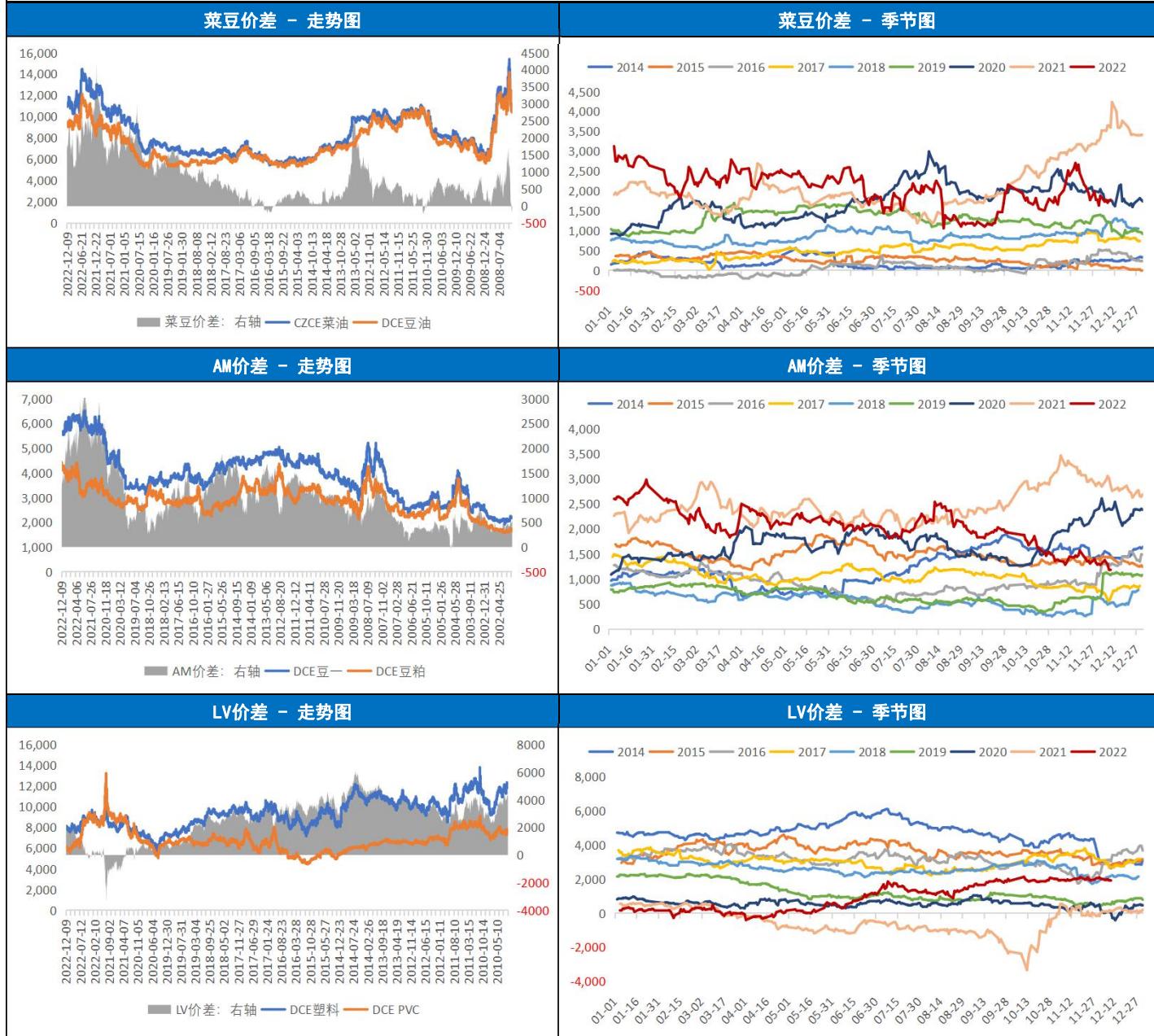
菜棕价差 - 季节图



重要商品主力价差套利表现

制作日期

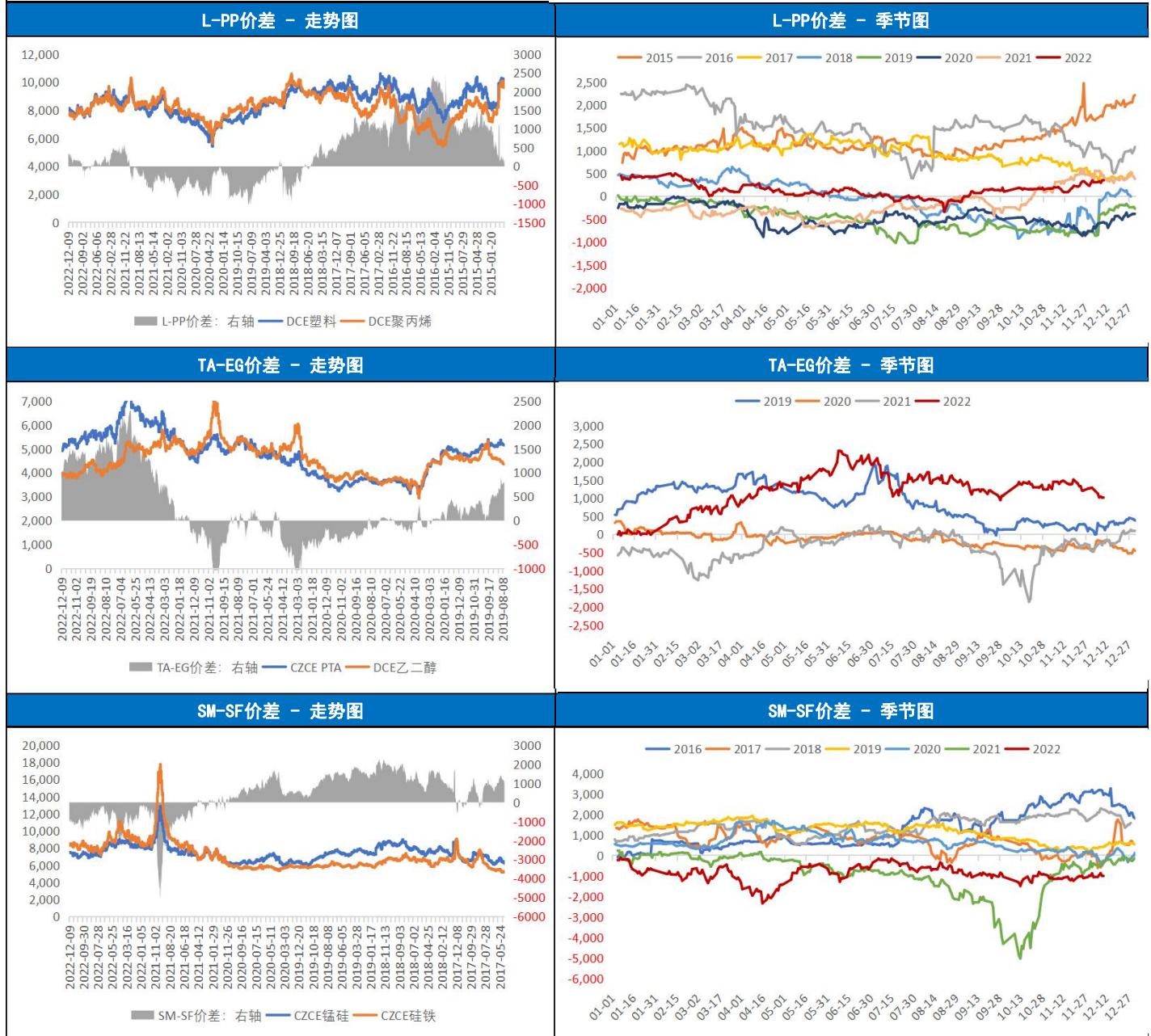
2022年12月9日



重要商品主力价差套利表现

制作日期

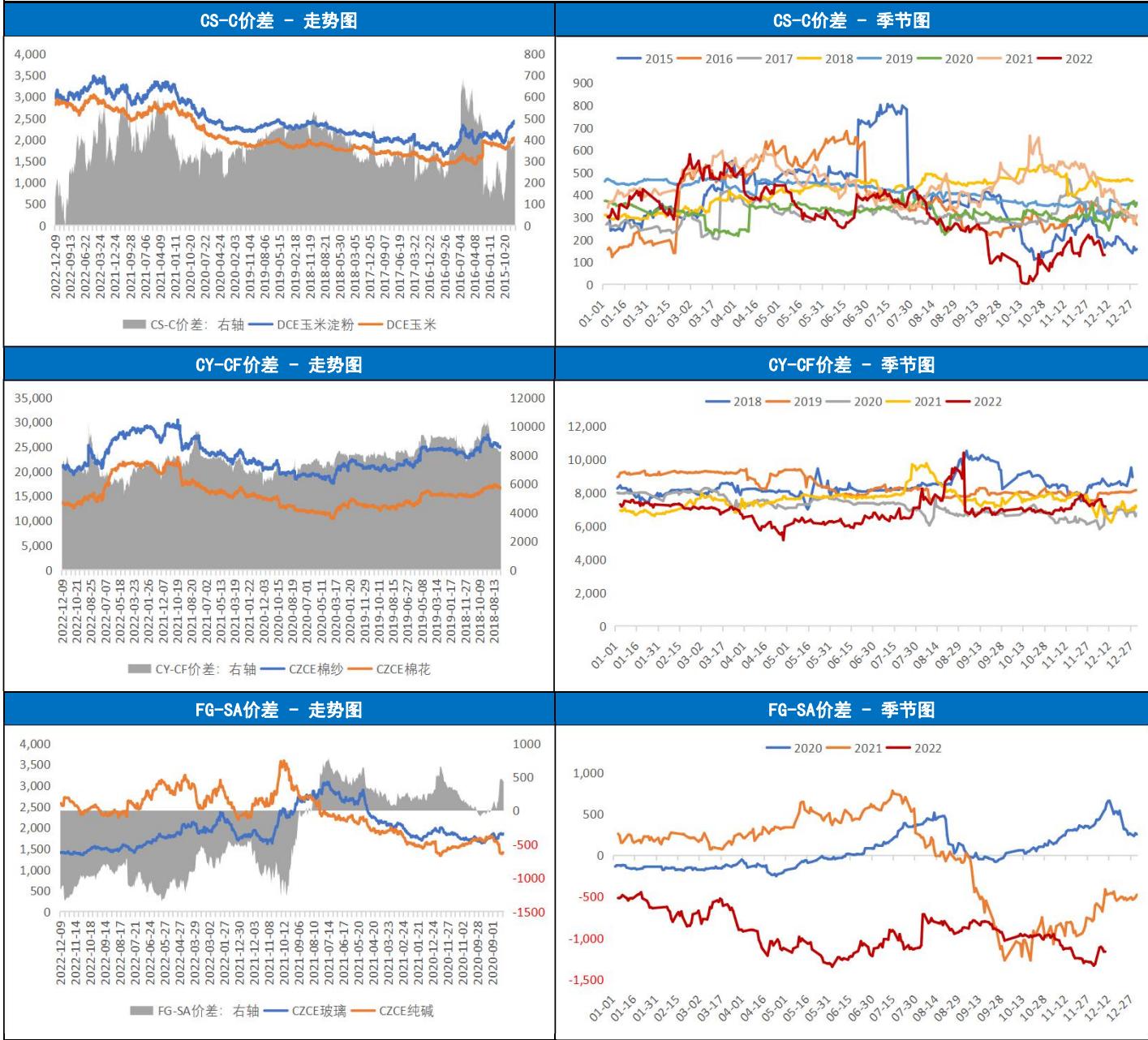
2022年12月9日



重要商品主力价差套利表现

制作日期

2022年12月9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