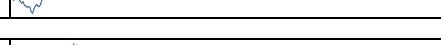
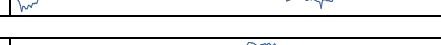
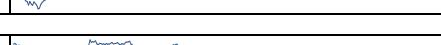
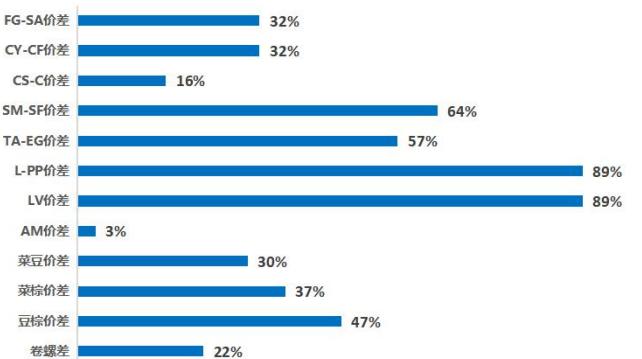
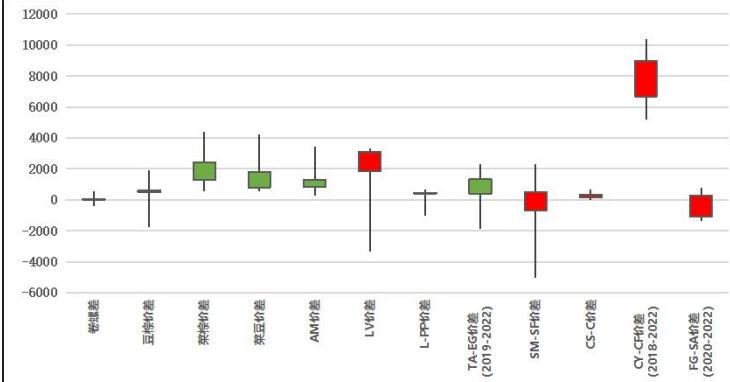


# 重要商品主力价差套利表现

制作日期

2022年12月28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	4092	热卷 - 螺纹价差	26																																											
	SHFE螺纹钢	元/吨	4066																																													
黑色系	CZCE锰硅	元/吨	7488	锰硅 - 锰铁 价差	-686																																											
	CZCE硅铁	元/吨	8174																																													
农产品	DCE豆油	元/吨	8794	豆油-棕榈油价差	624																																											
	DCE棕榈油	元/吨	8170																																													
农产品	CZCE菜油	元/吨	10605	菜油 - 棕榈油价差	2435																																											
	DCE棕榈油	元/吨	8170																																													
农产品	CZCE菜油	元/吨	10605	菜油 - 豆油价差	1811																																											
	DCE豆油	元/吨	8794																																													
农产品	DCE豆一	元/吨	5169	豆一 - 豆粕价差	1276																																											
	DCE豆粕	元/吨	3893																																													
农产品	DCE玉米淀粉	元/吨	2916	玉米淀粉 - 玉米价差	128																																											
	DCE玉米	元/吨	2788																																													
农产品	CZCE棉纱	元/吨	20900	棉纱 - 棉花价差	6680																																											
	CZCE棉花	元/吨	14220																																													
能化品种	DCE塑料	元/吨	8167	塑料 - PVC价差	1834																																											
	DCE PVC	元/吨	6333																																													
能化品种	DCE塑料	元/吨	8167	塑料 - 聚丙烯价差	392																																											
	DCE聚丙烯	元/吨	7775																																													
能化品种	CZCE PTA	元/吨	5496	PTA - 乙二醇价差	1333																																											
	DCE 乙二醇	元/吨	4163																																													
能化品种	CZCE玻璃	元/吨	1629	玻璃 - 纯碱价差	-1101																																											
	CZCE纯碱	元/吨	2730																																													
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>32%</td></tr> <tr><td>CY-CF价差</td><td>32%</td></tr> <tr><td>CS-C价差</td><td>16%</td></tr> <tr><td>SM-SF价差</td><td>64%</td></tr> <tr><td>TA-EG价差</td><td>57%</td></tr> <tr><td>L-PP价差</td><td>89%</td></tr> <tr><td>LV价差</td><td>89%</td></tr> <tr><td>AM价差</td><td>3%</td></tr> <tr><td>菜豆价差</td><td>30%</td></tr> <tr><td>菜棕价差</td><td>37%</td></tr> <tr><td>豆棕价差</td><td>47%</td></tr> <tr><td>卷螺差</td><td>22%</td></tr> </table>				FG-SA价差			32%	CY-CF价差	32%	CS-C价差	16%	SM-SF价差	64%	TA-EG价差	57%	L-PP价差	89%	LV价差	89%	AM价差	3%	菜豆价差	30%	菜棕价差	37%	豆棕价差	47%	卷螺差	22%	 <table border="1"> <tr><td>FG-SA价差</td><td>8000</td></tr> <tr><td>CY-CF价差</td><td>6000</td></tr> <tr><td>CS-C价差</td><td>4000</td></tr> <tr><td>SM-SF价差</td><td>2000</td></tr> <tr><td>TA-EG价差 (2019-2022)</td><td>2000</td></tr> <tr><td>L-PP价差</td><td>1000</td></tr> <tr><td>LV价差</td><td>1000</td></tr> <tr><td>AM价差</td><td>1000</td></tr> <tr><td>卷螺差</td><td>1000</td></tr> </table>			FG-SA价差	8000	CY-CF价差	6000	CS-C价差	4000	SM-SF价差	2000	TA-EG价差 (2019-2022)	2000	L-PP价差	1000	LV价差	1000	AM价差	1000
FG-SA价差	32%																																															
CY-CF价差	32%																																															
CS-C价差	16%																																															
SM-SF价差	64%																																															
TA-EG价差	57%																																															
L-PP价差	89%																																															
LV价差	89%																																															
AM价差	3%																																															
菜豆价差	30%																																															
菜棕价差	37%																																															
豆棕价差	47%																																															
卷螺差	22%																																															
FG-SA价差	8000																																															
CY-CF价差	6000																																															
CS-C价差	4000																																															
SM-SF价差	2000																																															
TA-EG价差 (2019-2022)	2000																																															
L-PP价差	1000																																															
LV价差	1000																																															
AM价差	1000																																															
卷螺差	1000																																															

# 重要商品主力价差套利表现

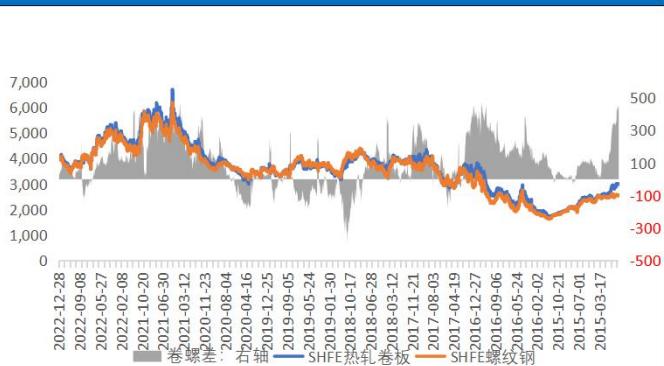
制作日期

2022年12月28日

## 商品价差近年来走势对比

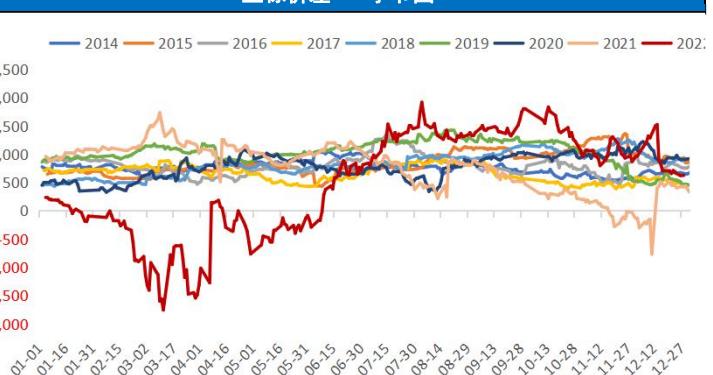
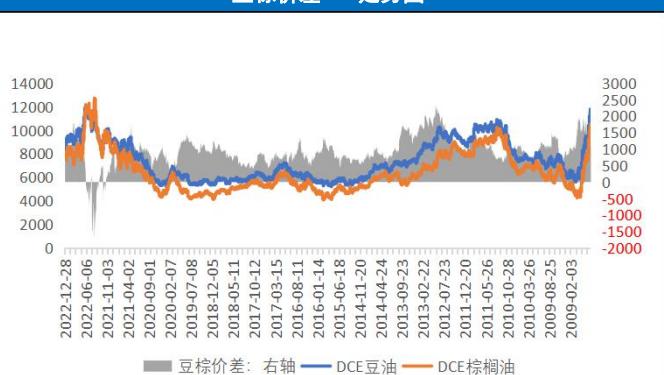
卷螺价差 - 走势图

卷螺价差 - 季节图



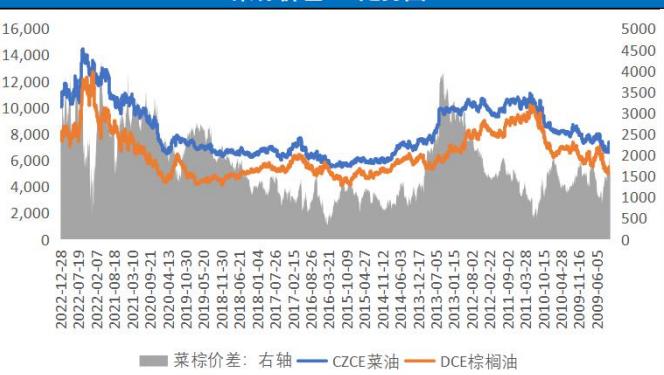
豆棕价差 - 走势图

豆棕价差 - 季节图



菜棕价差 - 走势图

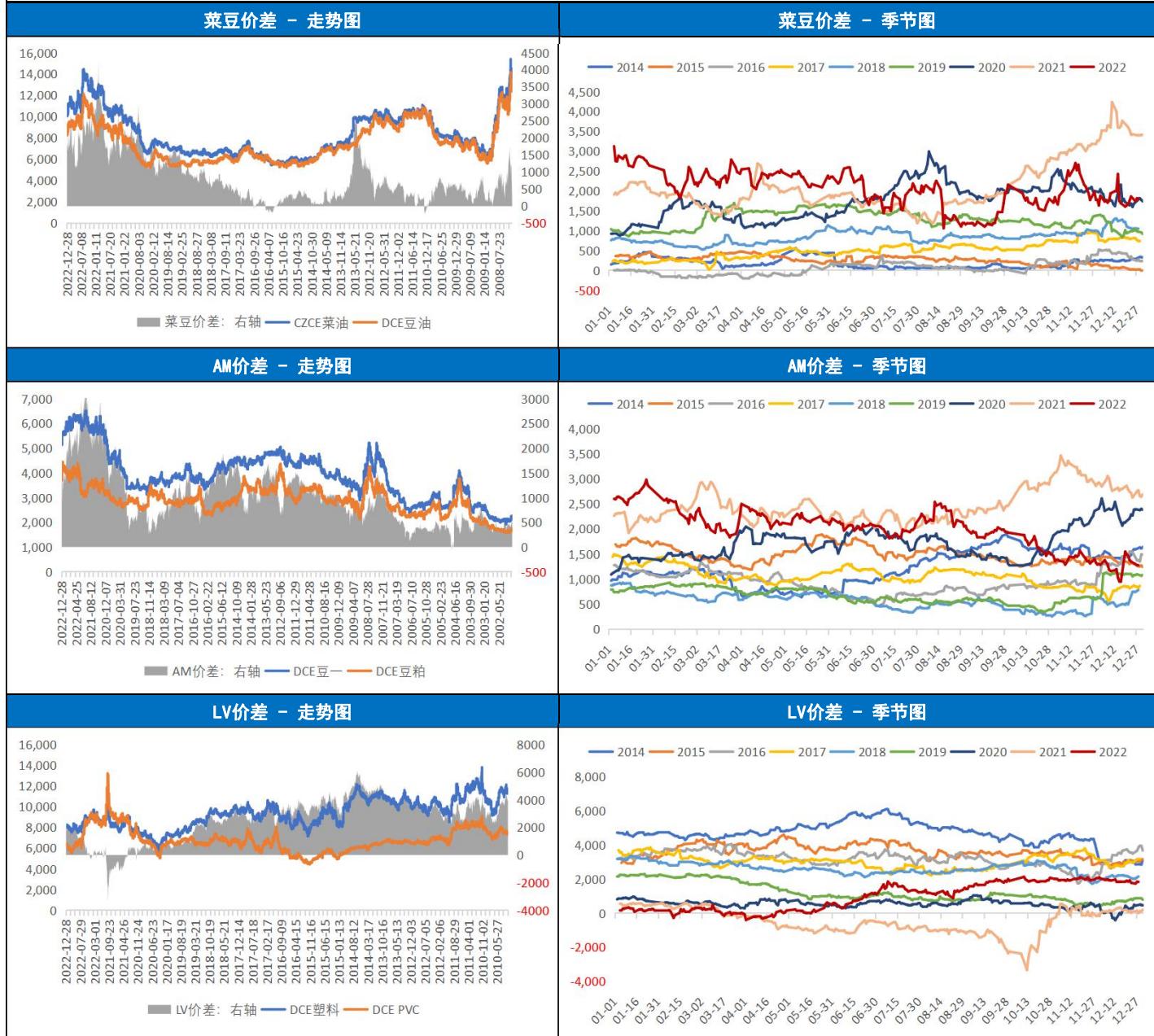
菜棕价差 - 季节图



# 重要商品主力价差套利表现

制作日期

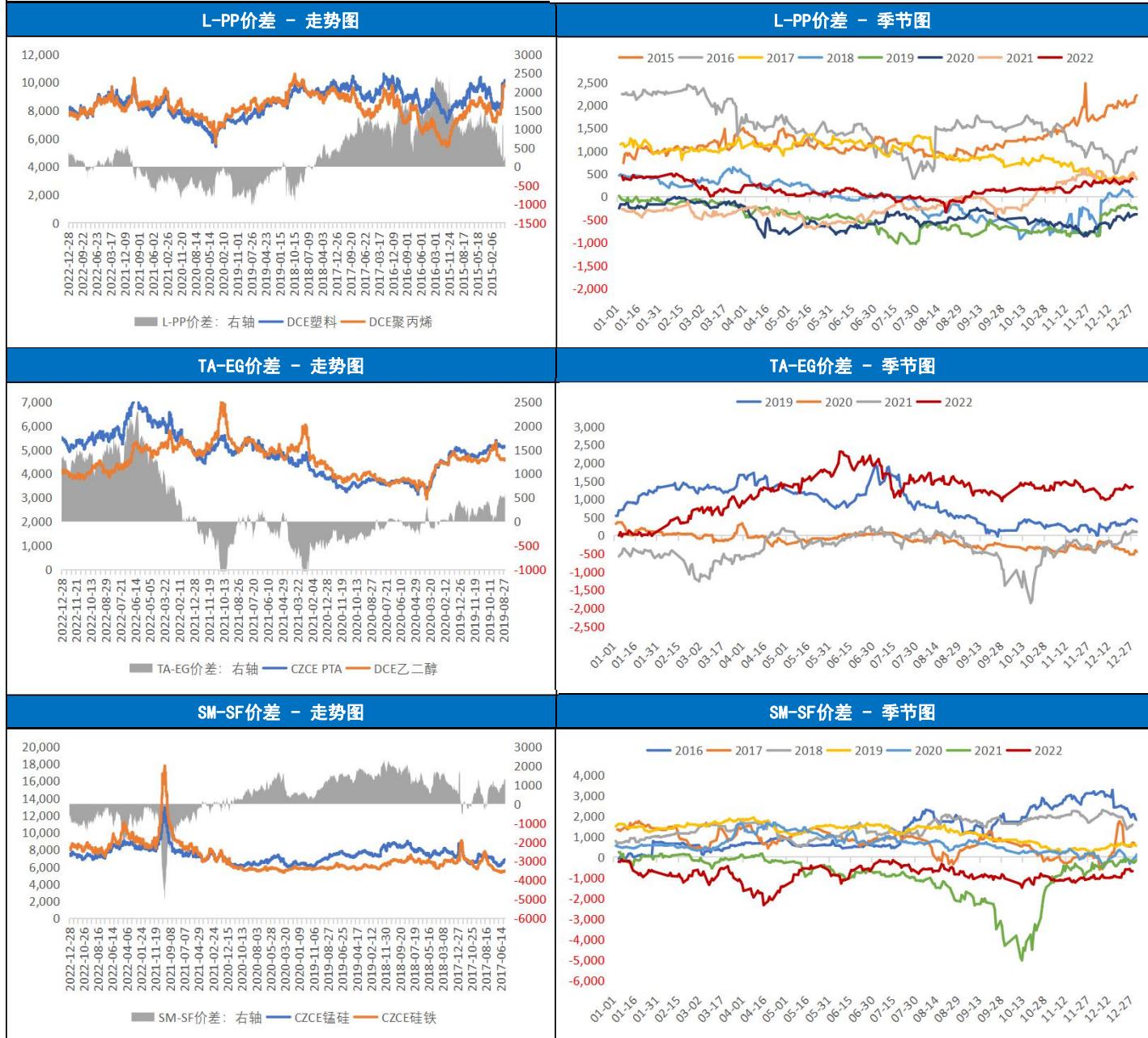
2022年12月28日



# 重要商品主力价差套利表现

制作日期

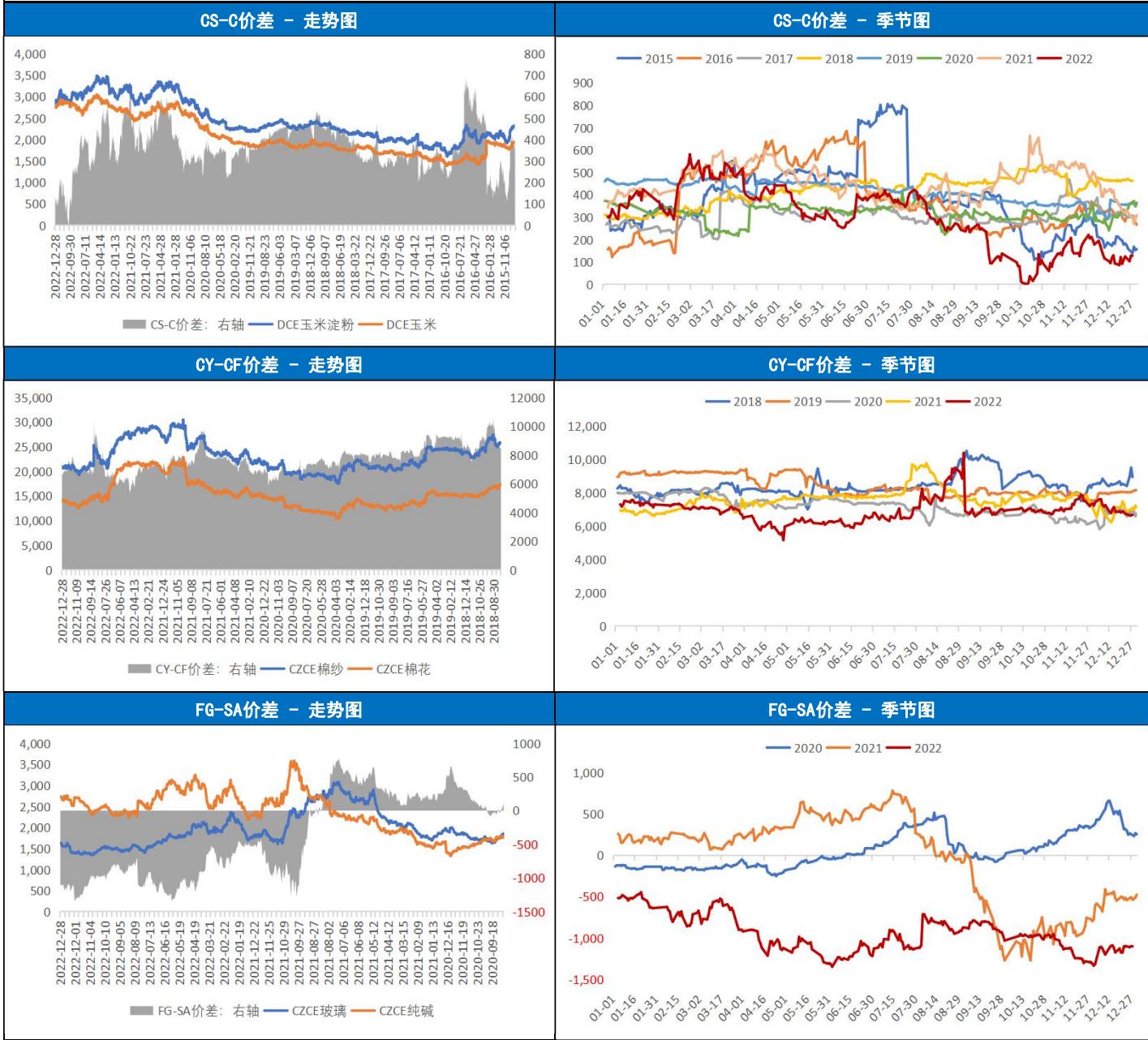
2022年12月28日



# 重要商品主力价差套利表现

制作日期

2022年12月28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