

重要商品主力价差套利表现

制作日期

2023年3月14日

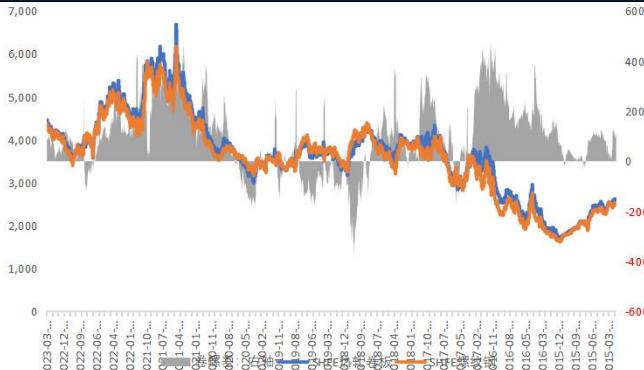
板块	名称	报价单位	最新收盘价	价差名称	价差	价差走势图 (近一年)		
黑色系	SHFE热轧卷板	元/吨	4459	热卷 - 螺纹钢价差	88			
	SHFE螺纹钢	元/吨	4371					
黑色系	CZCE锰硅	元/吨	7340	锰硅 - 锰铁 价差	-484			
	CZCE硅铁	元/吨	7824					
农产品	DCE豆油	元/吨	8544	豆油-棕榈油价差	672			
	DCE棕榈油	元/吨	7872					
农产品	CZCE菜油	元/吨	9182	菜油 - 棕榈油价差	1310			
	DCE棕榈油	元/吨	7872					
农产品	CZCE菜油	元/吨	9182	菜油 - 豆油价差	638			
	DCE豆油	元/吨	8544					
农产品	DCE豆一	元/吨	5551	豆一 - 豆粕价差	1742			
	DCE豆粕	元/吨	3809					
农产品	DCE玉米淀粉	元/吨	3095	玉米淀粉 - 玉米价差	260			
	DCE玉米	元/吨	2835					
农产品	CZCE棉纱	元/吨	21030	棉纱 - 棉花价差	6795			
	CZCE棉花	元/吨	14235					
能化品种	DCE塑料	元/吨	8227	塑料 - PVC价差	1846			
	DCE PVC	元/吨	6381					
能化品种	DCE塑料	元/吨	8227	塑料 - 聚丙烯价差	483			
	DCE聚丙烯	元/吨	7744					
能化品种	CZCE PTA	元/吨	5806	PTA - 乙二醇价差	1665			
	DCE乙二醇	元/吨	4141					
能化品种	CZCE玻璃	元/吨	1628	玻璃 - 纯碱价差	-1233			
	CZCE纯碱	元/吨	2861					
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 (2018-2023)				
<p>FG-SA价差 25%</p> <p>CY-CF价差 38%</p> <p>CS-C价差 55%</p> <p>SM-SF价差 86%</p> <p>TA-EG价差 86%</p> <p>L-PP价差 99%</p> <p>LV价差 99%</p> <p>AM价差 36%</p> <p>菜豆价差 0%</p> <p>菜棕价差 3%</p> <p>豆棕价差 36%</p> <p>卷螺差 66%</p>								

制作日期

2023年3月14日

商品价差近年以来走势对比

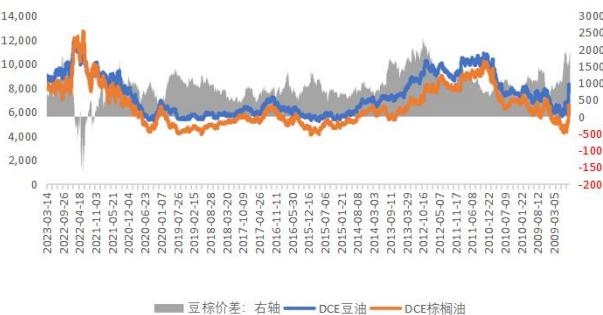
卷螺价差 - 走势图



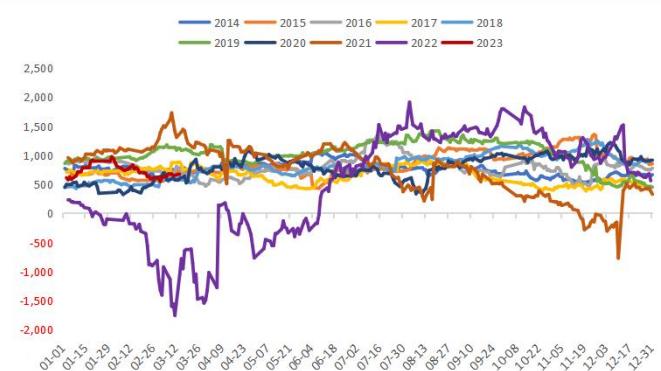
卷螺价差 - 季节图



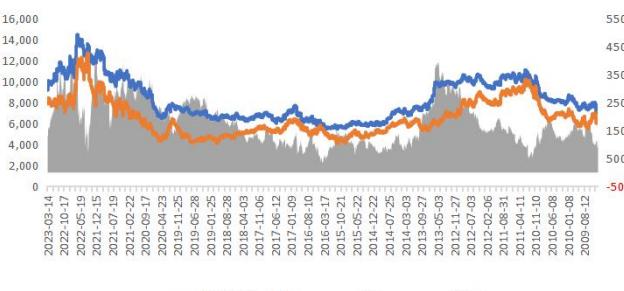
豆棕价差 - 走势图



豆棕价差 - 季节图



菜棕价差 - 走势图



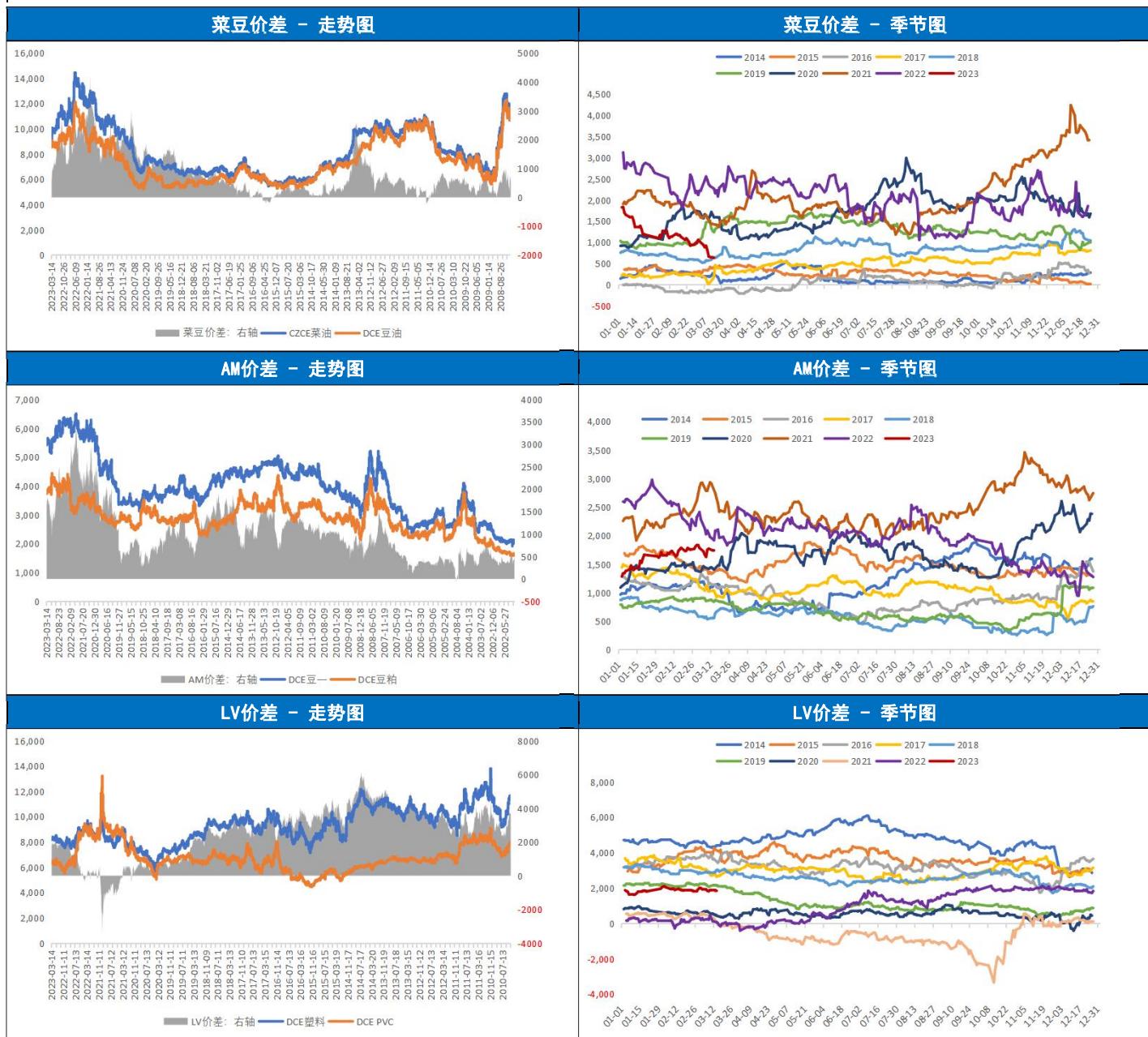
菜棕价差 - 季节图



重要商品主力价差套利表现

制作日期

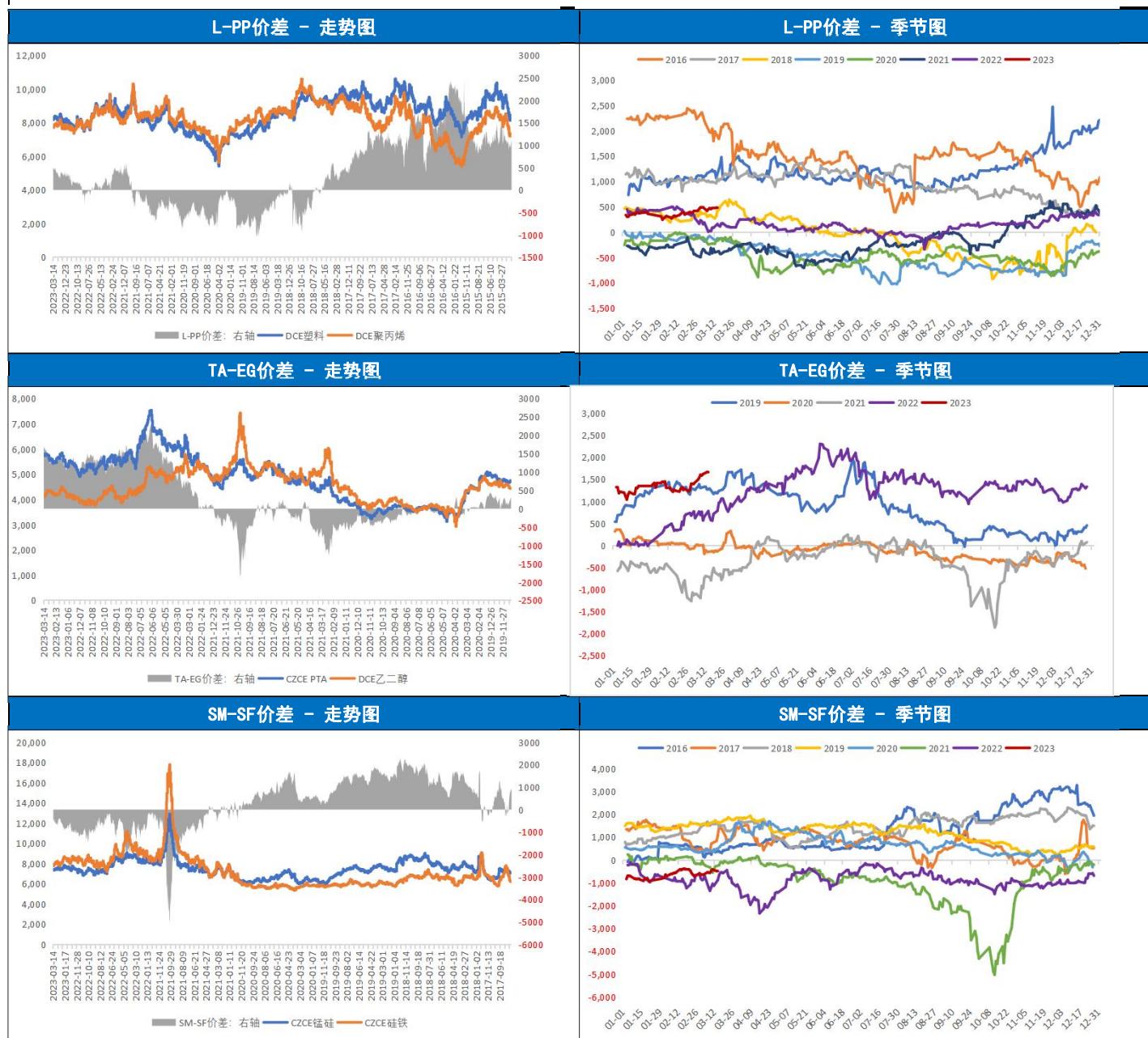
2023年3月14日



重要商品主力价差套利表现

制作日期

2023年3月14日

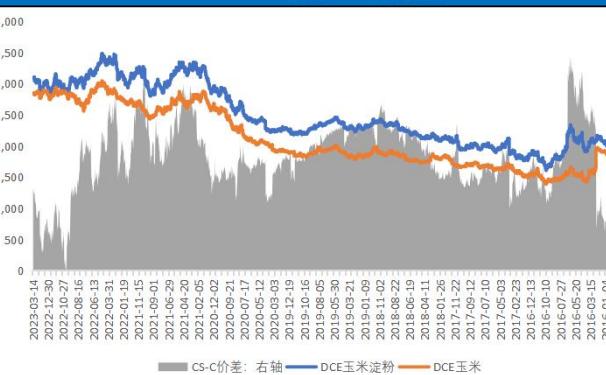


重要商品主力价差套利表现

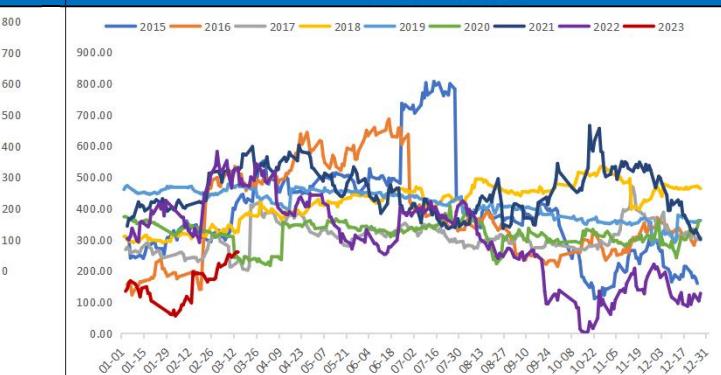
制作日期

2023年3月14日

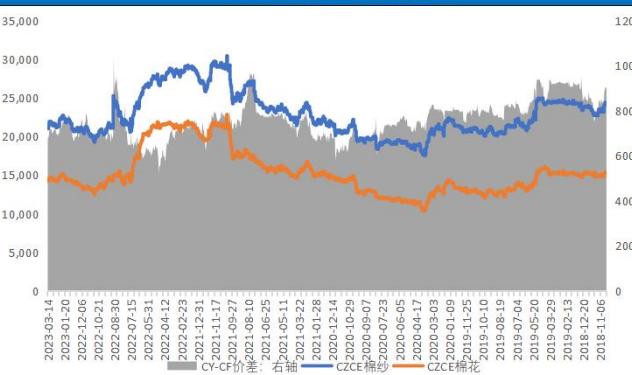
CS-C价差 - 走势图



CS-C价差 - 季节图



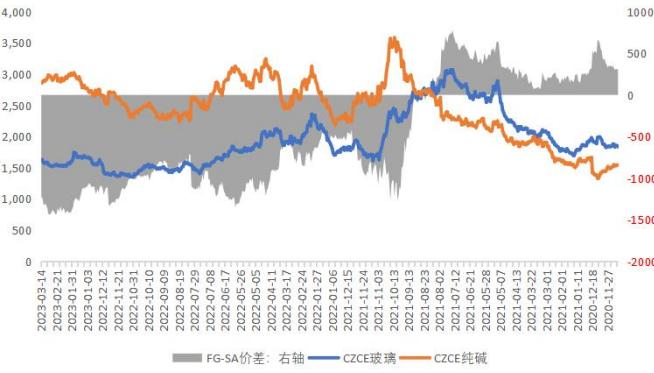
CY-CF价差 - 走势图



CY-CF价差 - 季节图



FG-SA价差 - 走势图



FG-SA价差 - 季节图



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/Z0000771

联系方式：010-85356618