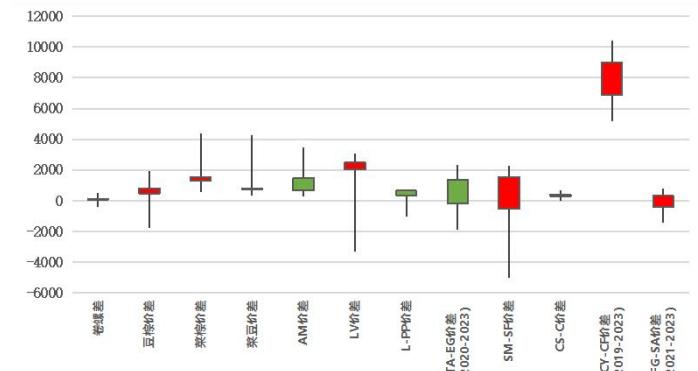


# 重要商品主力价差套利表现

制作日期

2023年4月24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	3883	热卷 - 螺纹价差	73																									
	SHFE螺纹钢	元/吨	3810																											
黑色系	CZCE锰硅	元/吨	6920	锰硅 - 锰铁 价差	-524																									
	CZCE硅铁	元/吨	7444																											
农产品	DCE豆油	元/吨	7550	豆油-棕榈油价差	470																									
	DCE棕榈油	元/吨	7080																											
农产品	CZCE菜油	元/吨	8357	菜油 - 棕榈油价差	1277																									
	DCE棕榈油	元/吨	7080																											
农产品	CZCE菜油	元/吨	8357	菜油 - 豆油价差	807																									
	DCE豆油	元/吨	7550																											
农产品	DCE豆一	元/吨	4870	豆一 - 豆粕价差	1465																									
	DCE豆粕	元/吨	3405																											
农产品	DCE玉米淀粉	元/吨	2974	玉米淀粉 - 玉米价差	302																									
	DCE玉米	元/吨	2672																											
农产品	CZCE棉纱	元/吨	21740	棉纱 - 棉花价差	6885																									
	CZCE棉花	元/吨	14855																											
能化品种	DCE塑料	元/吨	8223	塑料 - PVC价差	2025																									
	DCE PVC	元/吨	6198																											
能化品种	DCE塑料	元/吨	8223	塑料 - 聚丙烯价差	650																									
	DCE聚丙烯	元/吨	7573																											
能化品种	CZCE PTA	元/吨	5726	PTA - 乙二醇价差	1376																									
	DCE乙二醇	元/吨	4350																											
能化品种	CZCE 玻璃	元/吨	1807	玻璃 - 纯碱价差	-419																									
	CZCE纯碱	元/吨	2226																											
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）																										
<table border="1"> <tr><td>FG-SA价差</td><td>100%</td></tr> <tr><td>CY-CP价差</td><td>41%</td></tr> <tr><td>CS-C价差</td><td>78%</td></tr> <tr><td>SM-SF价差</td><td>80%</td></tr> <tr><td>TA-EG价差</td><td>41%</td></tr> <tr><td>L-PP价差</td><td>100%</td></tr> <tr><td>LV价差</td><td>100%</td></tr> <tr><td>AM价差</td><td>21%</td></tr> <tr><td>菜豆价差</td><td>12%</td></tr> <tr><td>菜棕价差</td><td>10%</td></tr> <tr><td>豆棕价差</td><td>16%</td></tr> <tr><td>卷螺差</td><td>55%</td></tr> </table>				FG-SA价差			100%	CY-CP价差	41%	CS-C价差	78%	SM-SF价差	80%	TA-EG价差	41%	L-PP价差	100%	LV价差	100%	AM价差	21%	菜豆价差	12%	菜棕价差	10%	豆棕价差	16%	卷螺差	55%	 <p>该图展示了2018年至2023年间，不同商品期货主力价差的分布情况。纵轴表示价差值，横轴列出了各种价差名称。图中包含多个柱状图，颜色各异，显示了各价差在不同年份的波动范围和平均值。</p>
FG-SA价差	100%																													
CY-CP价差	41%																													
CS-C价差	78%																													
SM-SF价差	80%																													
TA-EG价差	41%																													
L-PP价差	100%																													
LV价差	100%																													
AM价差	21%																													
菜豆价差	12%																													
菜棕价差	10%																													
豆棕价差	16%																													
卷螺差	55%																													

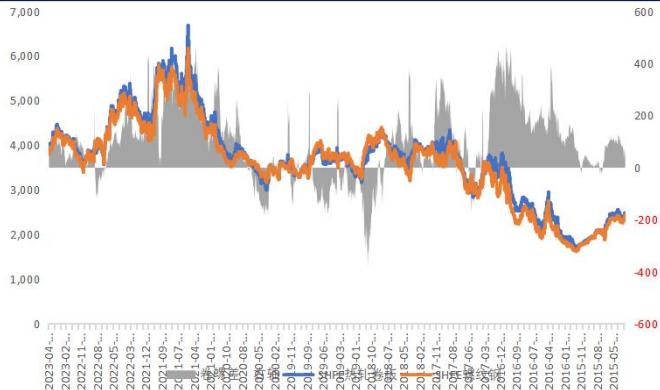
# 重要商品主力价差套利表现

制作日期

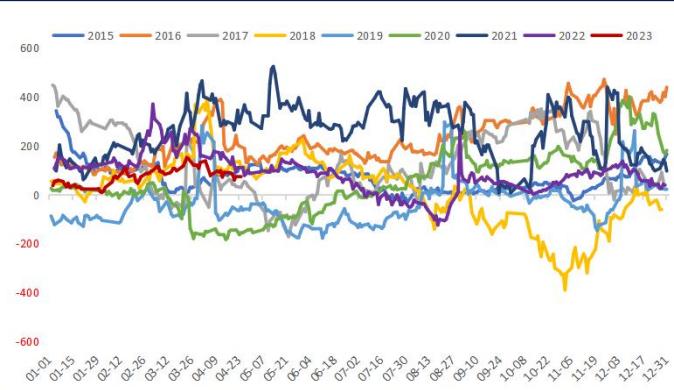
2023年4月24日

## 商品价差近年以来走势对比

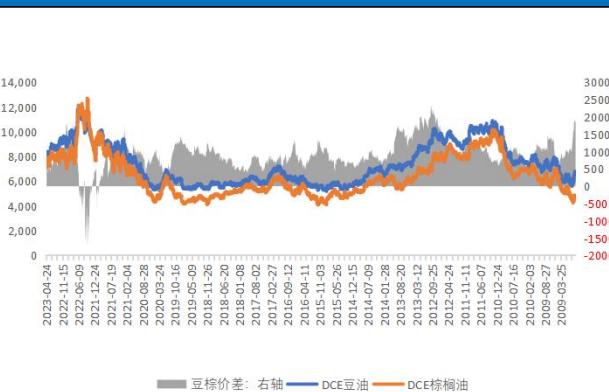
卷螺价差 - 走势图



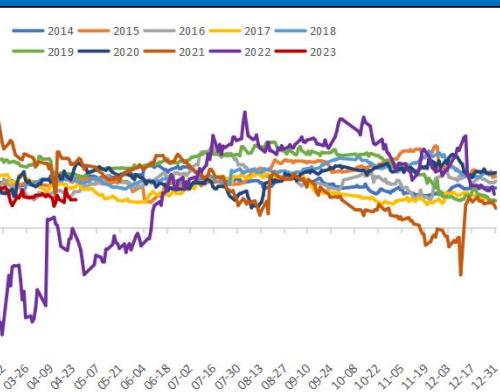
卷螺价差 - 季节图



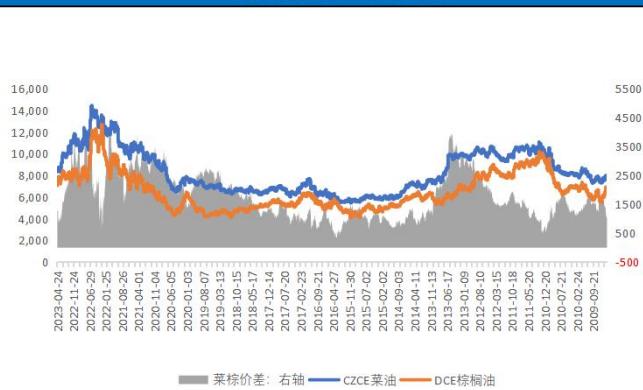
豆棕价差 - 走势图



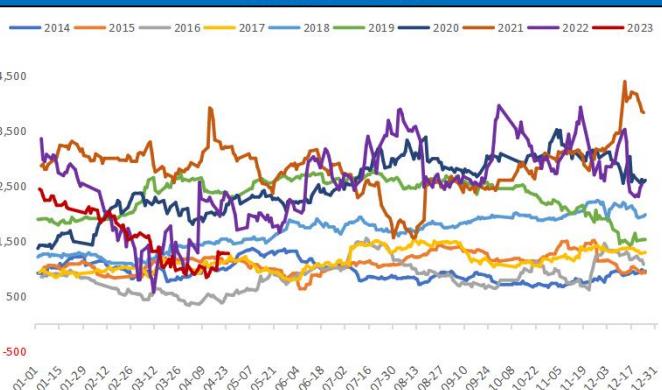
豆棕价差 - 季节图



菜棕价差 - 走势图



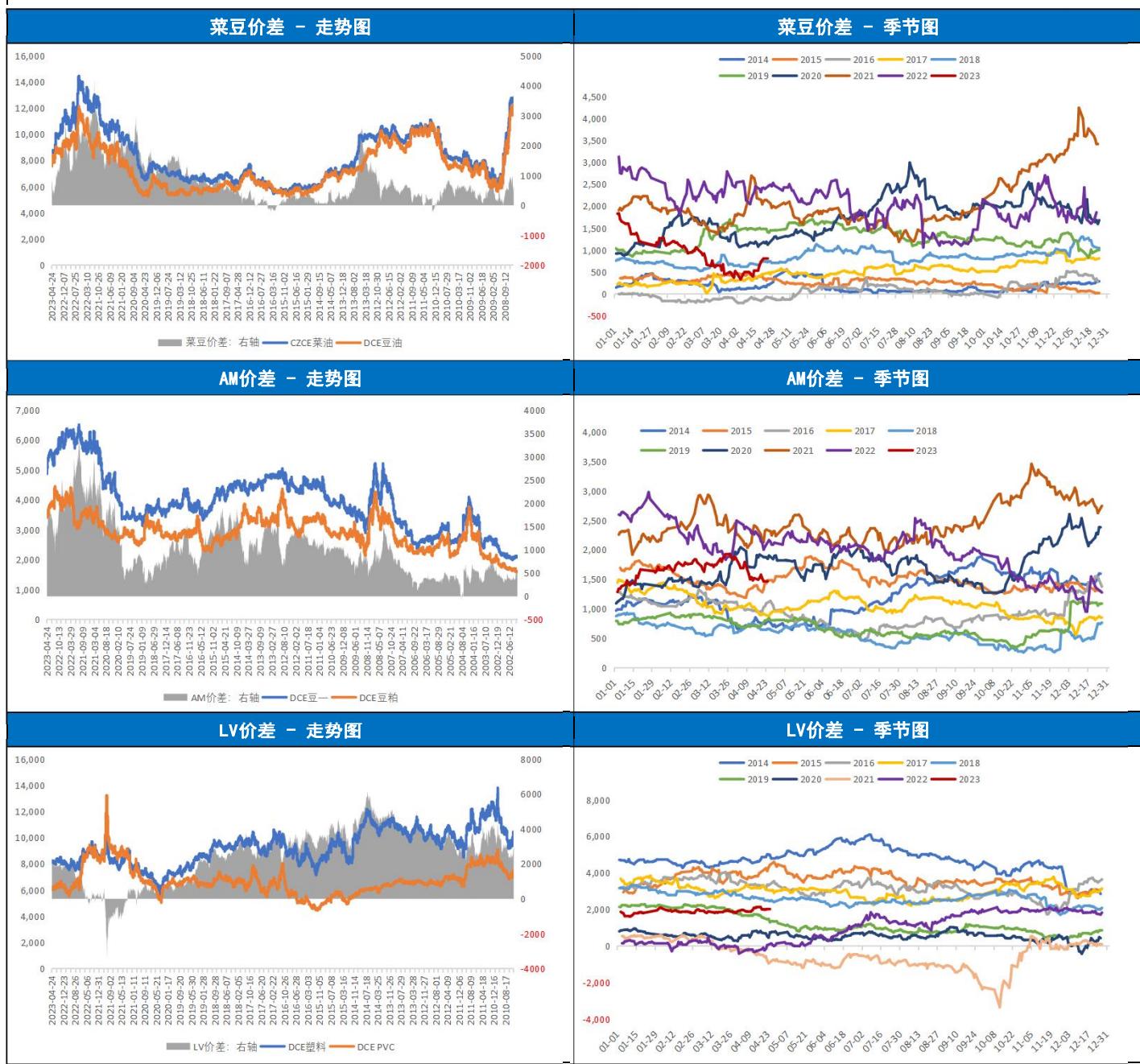
菜棕价差 - 季节图



# 重要商品主力价差套利表现

制作日期

2023年4月24日

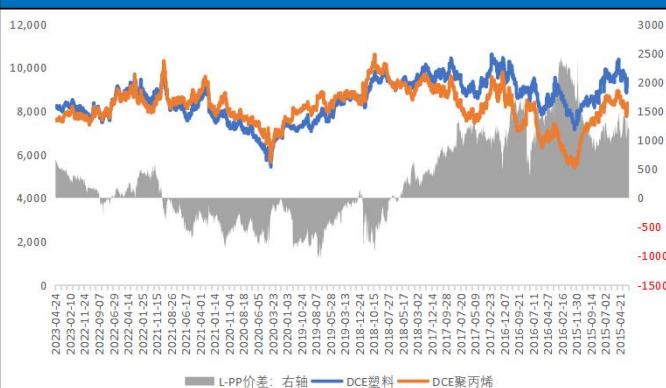


# 重要商品主力价差套利表现

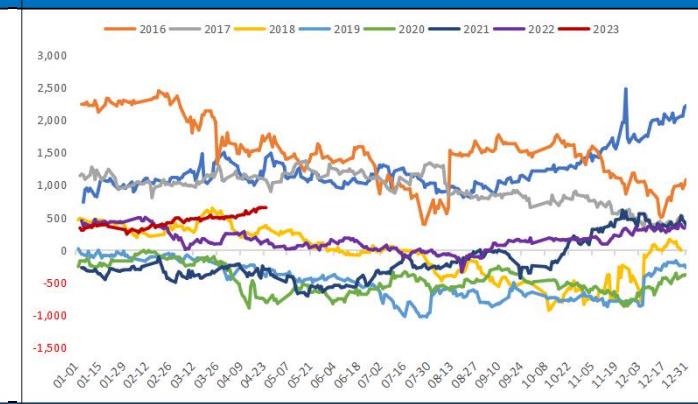
制作日期

2023年4月24日

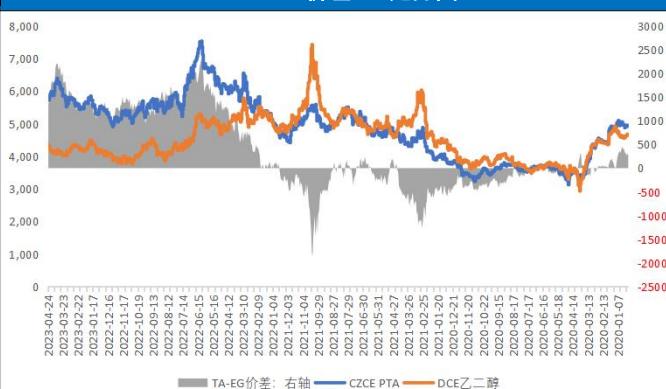
L-PP价差 - 走势图



L-PP价差 - 季节图



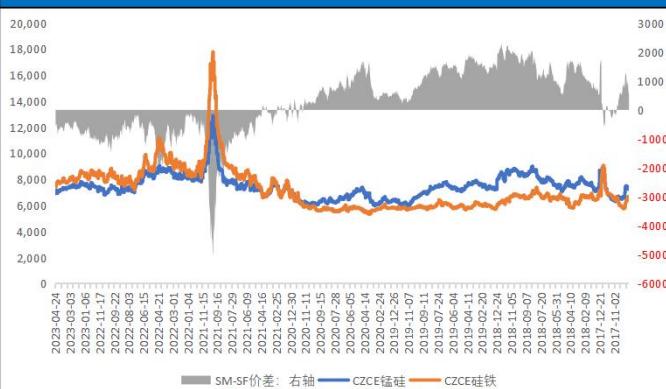
TA-EG价差 - 走势图



TA-EG价差 - 季节图



SM-SF价差 - 走势图



SM-SF价差 - 季节图

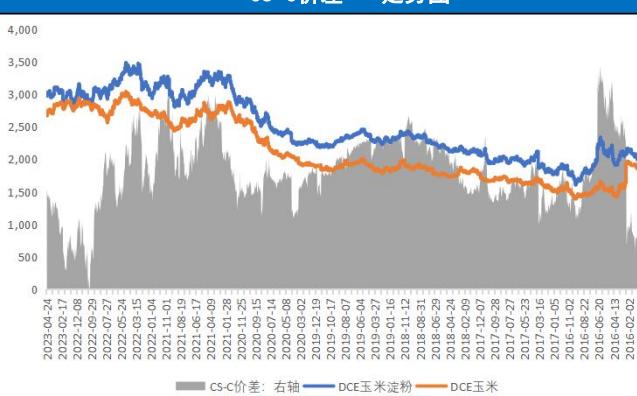


# 重要商品主力价差套利表现

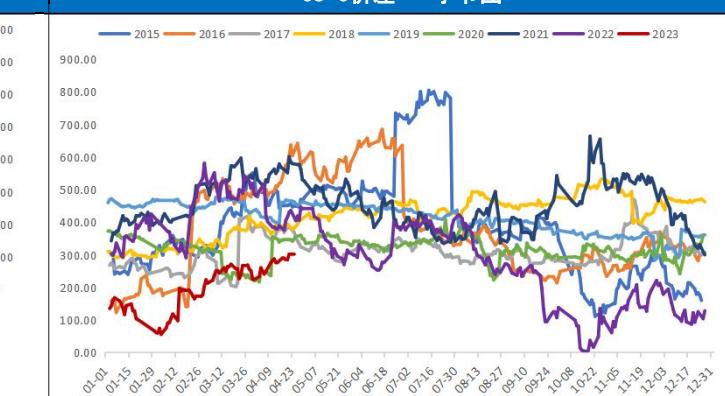
制作日期

2023年4月24日

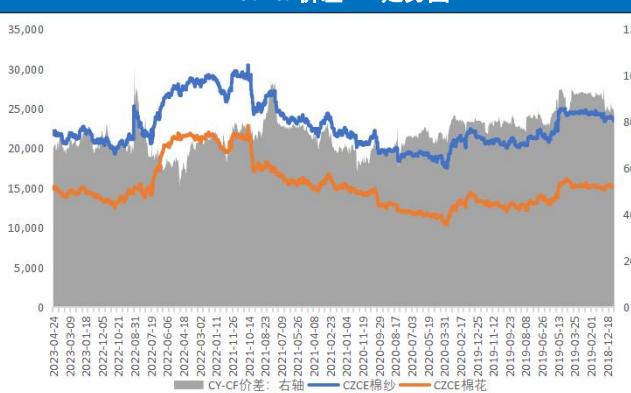
CS-C价差 - 走势图



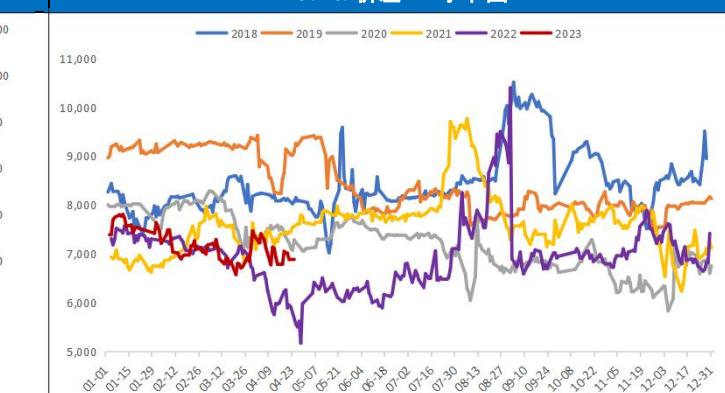
CS-C价差 - 季节图



CY-CF价差 - 走势图



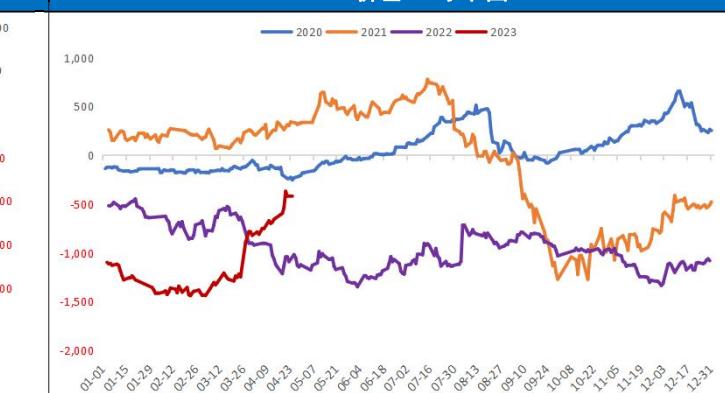
CY-CF价差 - 季节图



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