

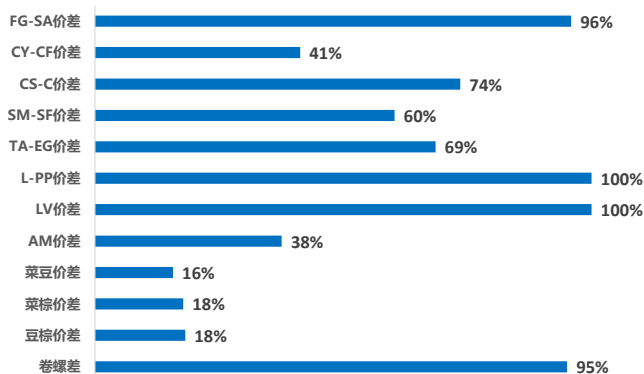
重要商品主力价差套利表现

制作日期

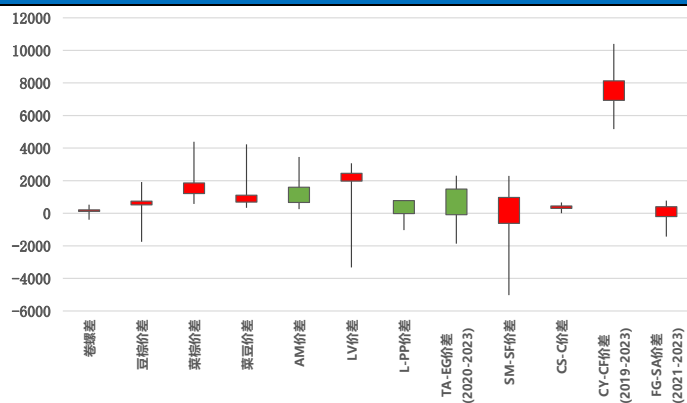
2023年6月2日

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	3664	热卷 - 螺纹钢价差	118	
	SHFE螺纹钢	元/吨	3546			
黑色系	CZCE锰硅	元/吨	6580	锰硅 - 锰铁 价差	-620	
	CZCE硅铁	元/吨	7200			
农产品	DCE豆油	元/吨	6926	豆油-棕榈油价差	522	
	DCE棕榈油	元/吨	6404			
农产品	CZCE菜油	元/吨	7612	菜油 - 棕榈油价差	1208	
	DCE棕榈油	元/吨	6404			
农产品	CZCE菜油	元/吨	7612	菜油 - 豆油价差	686	
	DCE豆油	元/吨	6926			
农产品	DCE豆一	元/吨	5040	豆一 - 豆粕价差	1596	
	DCE豆粕	元/吨	3444			
农产品	DCE玉米淀粉	元/吨	2948	玉米淀粉 - 玉米价差	297	
	DCE玉米	元/吨	2651			
农产品	CZCE棉纱	元/吨	23335	棉纱 - 棉花价差	6935	
	CZCE棉花	元/吨	16400			
能化品种	DCE塑料	元/吨	7756	塑料 - PVC价差	1979	
	DCE PVC	元/吨	5777			
能化品种	DCE塑料	元/吨	7756	塑料 - 聚丙烯价差	778	
	DCE聚丙烯	元/吨	6978			
能化品种	CZCE PTA	元/吨	5520	PTA - 乙二醇价差	1489	
	DCE乙二醇	元/吨	4031			
能化品种	CZCE玻璃	元/吨	1448	玻璃 - 纯碱价差	-201	
	CZCE纯碱	元/吨	1649			

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）



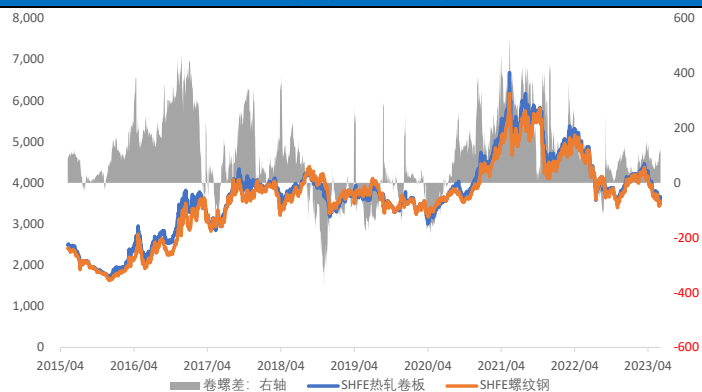
重要商品主力价差套利表现

制作日期

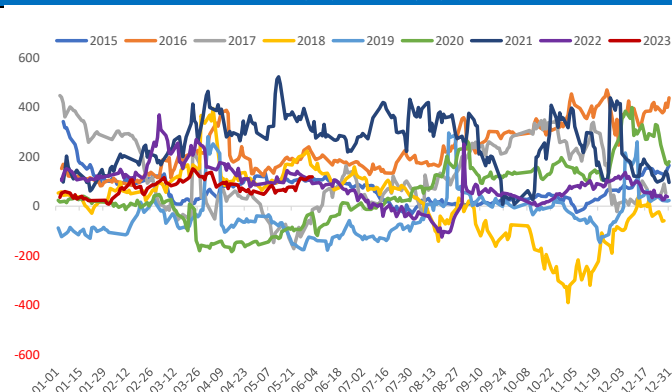
2023年6月2日

商品价差近年以来走势对比

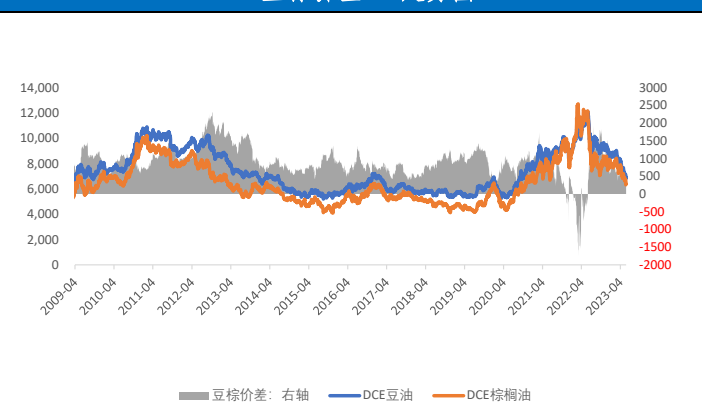
卷螺价差 - 走势图



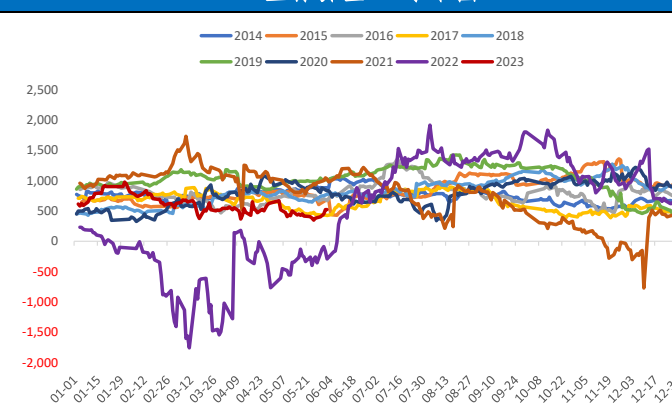
卷螺价差 - 季节图



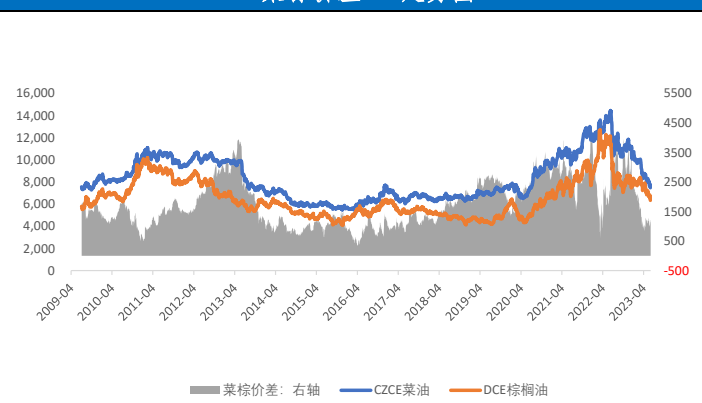
豆棕价差 - 走势图



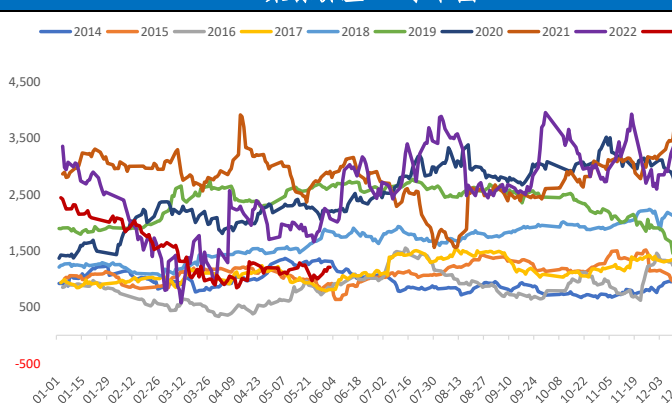
豆棕价差 - 季节图



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

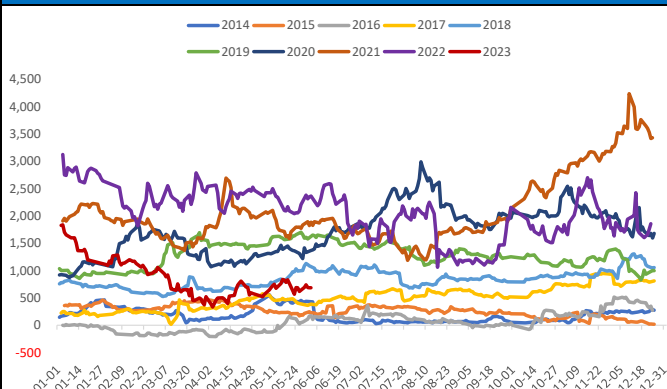
制作日期

2023年6月2日

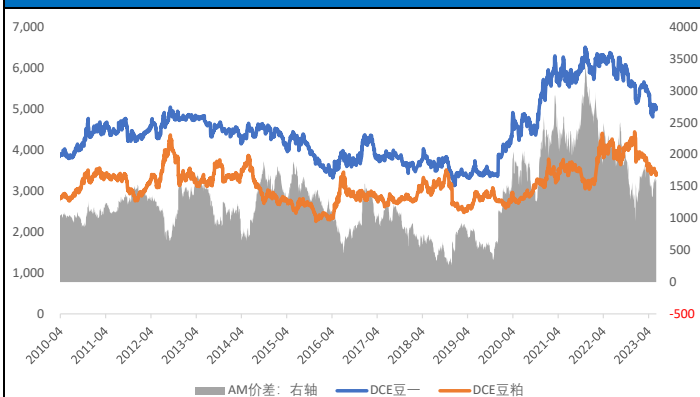
菜豆价差 - 走势图



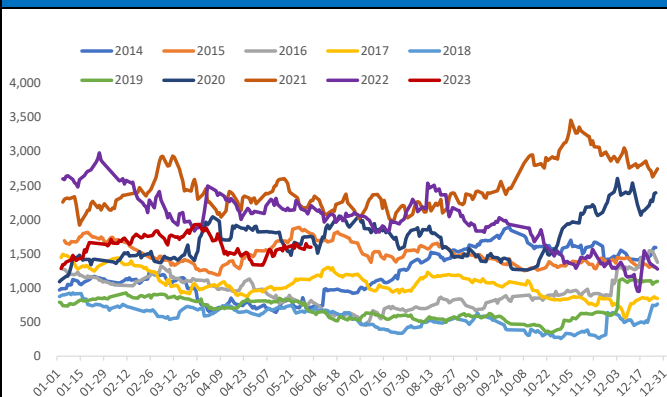
菜豆价差 - 季节图



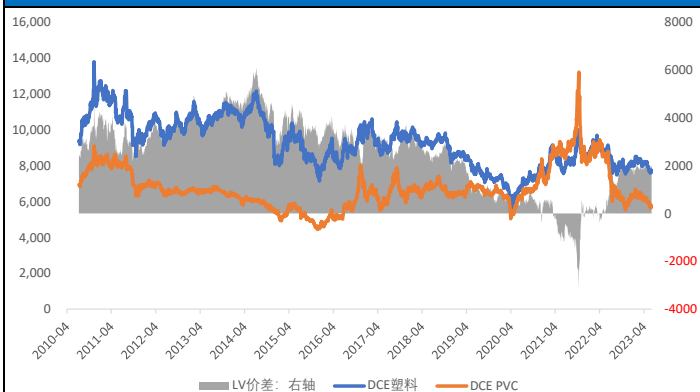
AM价差 - 走势图



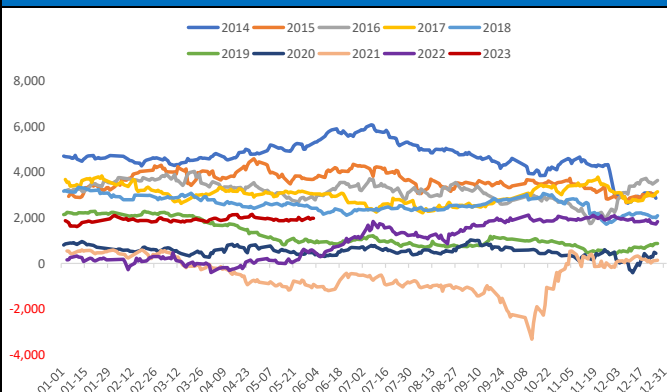
AM价差 - 季节图



LV价差 - 走势图



LV价差 - 季节图

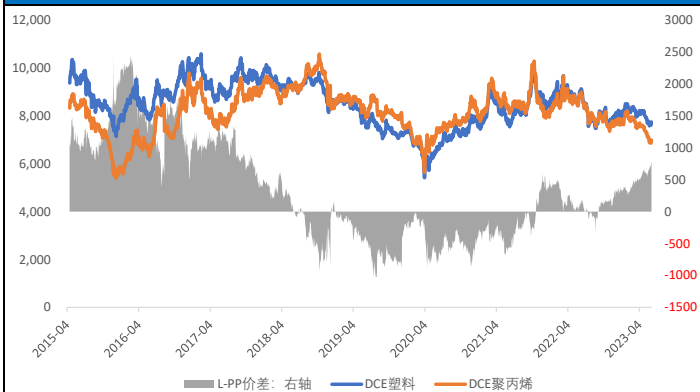


重要商品主力价差套利表现

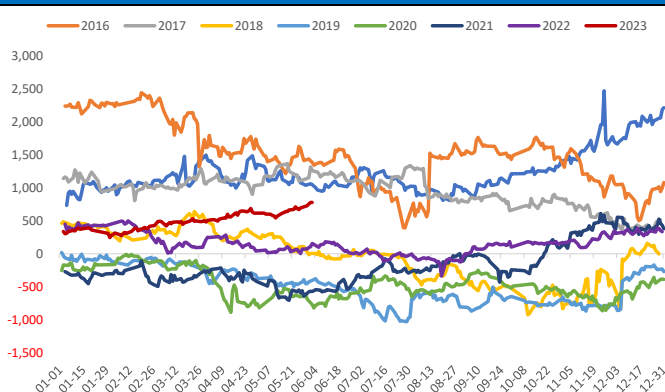
制作日期

2023年6月2日

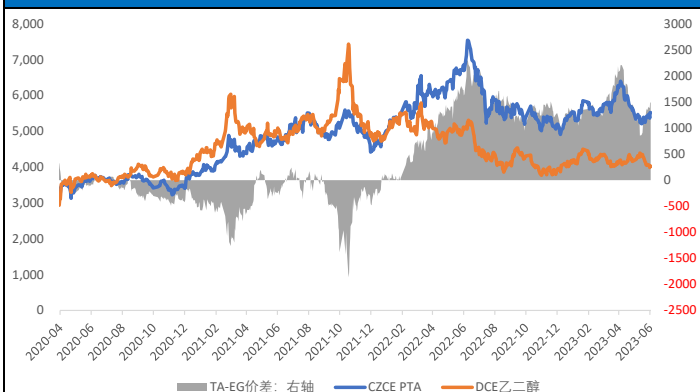
L-PP价差 - 走势图



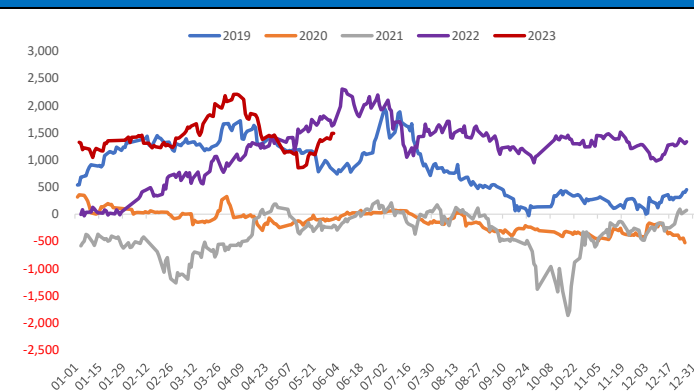
L-PP价差 - 季节图



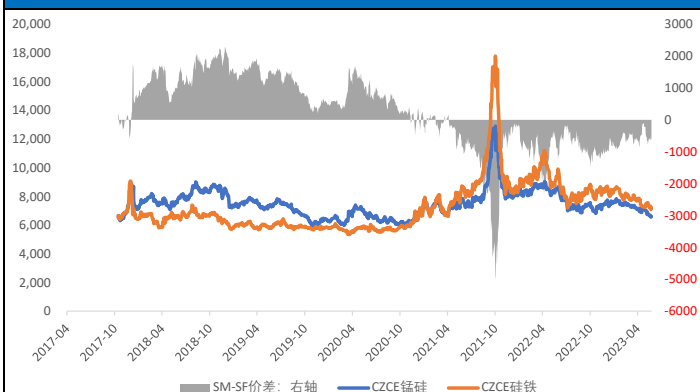
TA-EG价差 - 走势图



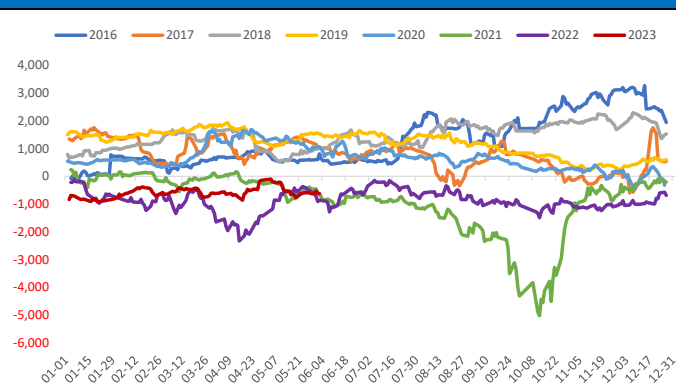
TA-EG价差 - 季节图



SM-SF价差 - 走势图



SM-SF价差 - 季节图

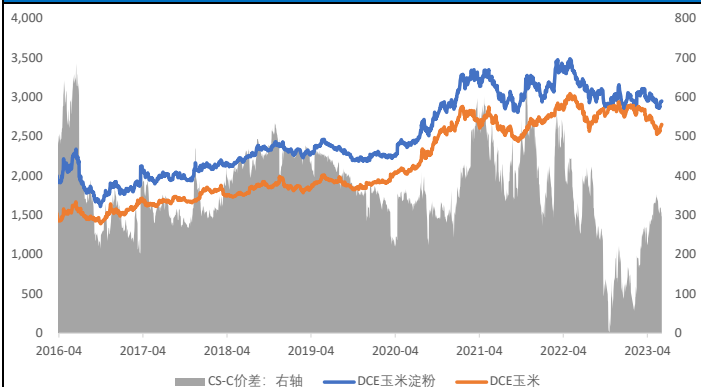


重要商品主力价差套利表现

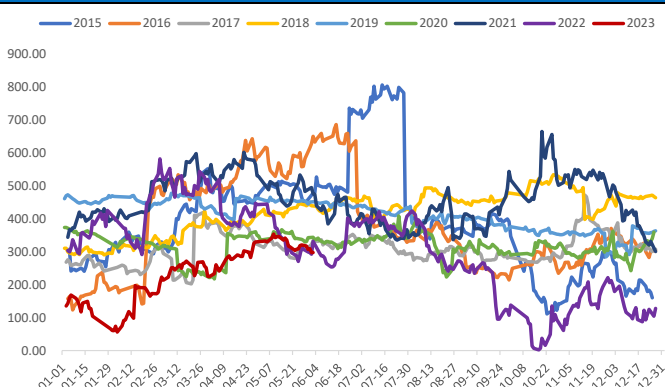
制作日期

2023年6月2日

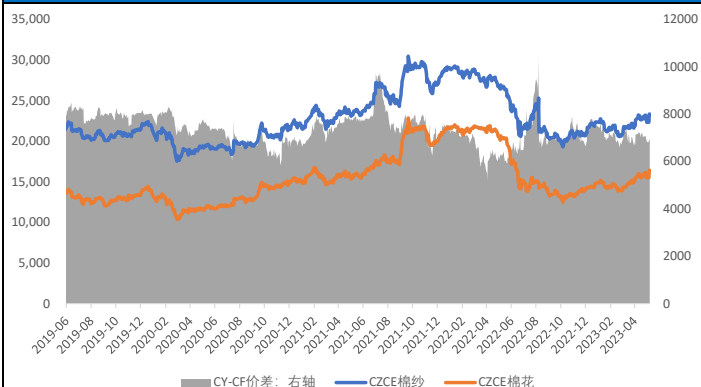
CS-C价差 - 走势图



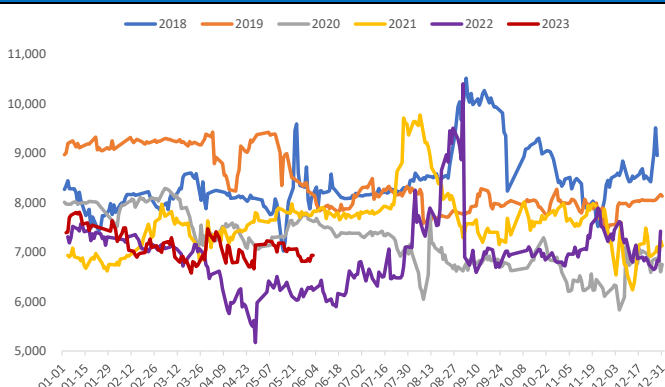
CS-C价差 - 季节图



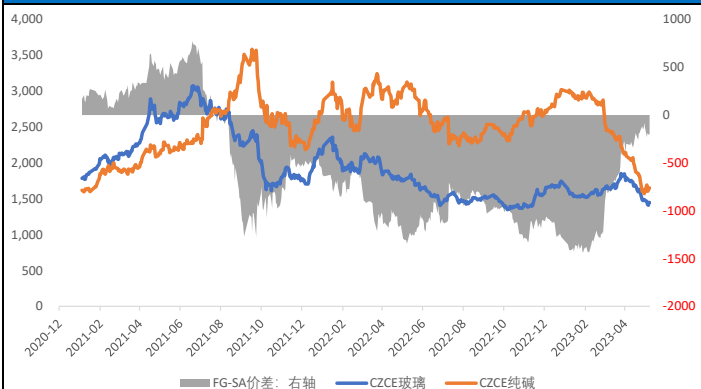
CY-CF价差 - 走势图



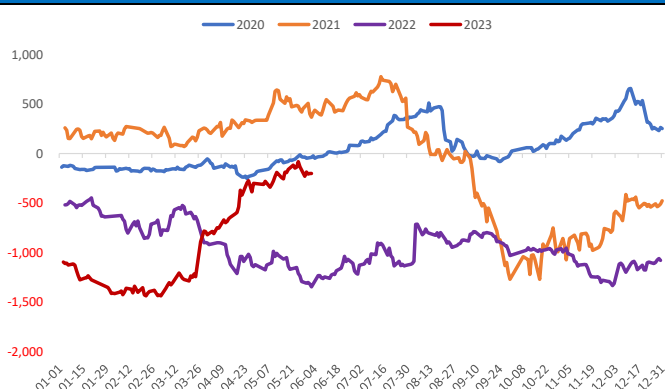
CY-CF价差 - 季节图



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递, 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