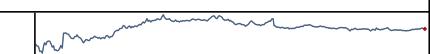
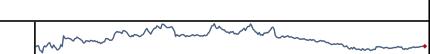
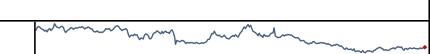
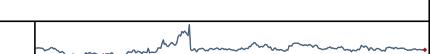
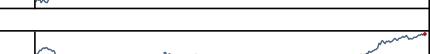
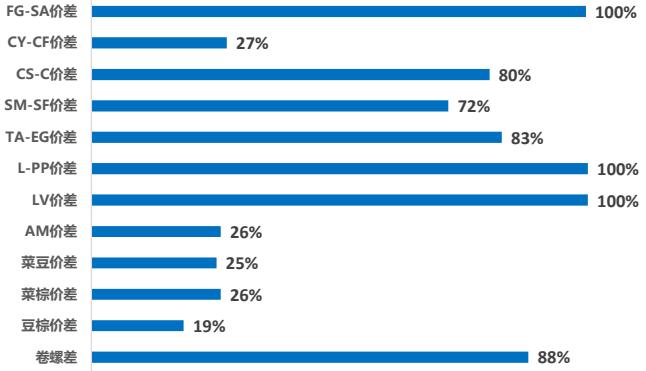


重要商品主力价差套利表现

制作日期

2023年6月15日

板块	名称	报价单位	最新收益价	价差名称	价差	价差走势图(近一年)																								
黑色系	SHFE热轧卷板	元/吨	3847	热卷 - 螺纹价差	108																									
	SHFE螺纹钢	元/吨	3739																											
黑色系	CZCE锰硅	元/吨	6540	锰硅 - 锰铁价差	-546																									
	CZCE硅铁	元/吨	7086																											
农产品	DCE豆油	元/吨	7310	豆油-棕榈油价差	536																									
	DCE棕榈油	元/吨	6774																											
农产品	CZCE菜油	元/吨	8098	菜油 - 棕榈油价差	1324																									
	DCE棕榈油	元/吨	6774																											
农产品	CZCE葵油	元/吨	8098	菜油 - 豆油价差	788																									
	DCE豆油	元/吨	7310																											
农产品	DCE豆一	元/吨	5027	豆一 - 豆粕价差	1489																									
	DCE豆粕	元/吨	3538																											
农产品	DCE玉米淀粉	元/吨	2935	玉米淀粉 - 玉米价差	328																									
	DCE玉米	元/吨	2607																											
农产品	CZCE棉纱	元/吨	23670	棉纱 - 棉花价差	6840																									
	CZCE棉花	元/吨	16830																											
能化品种	DCE塑料	元/吨	7794	塑料 - PVC价差	2038																									
	DCE PVC	元/吨	5756																											
能化品种	DCE塑料	元/吨	7794	塑料 - 聚丙烯价差	826																									
	DCE聚丙烯	元/吨	6968																											
能化品种	CZCE PTA	元/吨	5592	PTA - 乙二醇价差	1626																									
	DCE乙二醇	元/吨	3966																											
能化品种	CZCE玻璃	元/吨	1648	玻璃 - 纯碱价差	-40																									
	CZCE纯碱	元/吨	1688																											
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-CF价差</td><td>27%</td></tr> <tr><td>CS-C价差</td><td>80%</td></tr> <tr><td>SM-SF价差</td><td>72%</td></tr> <tr><td>TA-EG价差</td><td>83%</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>26%</td></tr> <tr><td>菜豆价差</td><td>25%</td></tr> <tr><td>菜棕价差</td><td>26%</td></tr> <tr><td>豆棕价差</td><td>19%</td></tr> <tr><td>卷螺差</td><td>88%</td></tr> </table>				FG-SA价差			100%	CY-CF价差	27%	CS-C价差	80%	SM-SF价差	72%	TA-EG价差	83%	L-PP价差	100%	LV价差	100%	AM价差	26%	菜豆价差	25%	菜棕价差	26%	豆棕价差	19%	卷螺差	88%	 <p>The box plot displays the distribution of price differences for various commodities across five years. The y-axis ranges from -6000 to 12000. The x-axis categories are: 布伦特 (Brent), 豆棕价差 (Soybean-Palm Oil Price Difference), 菜豆价差 (Rapeseed-Soybean Price Difference), 菜棕价差 (Rapeseed-Palm Oil Price Difference), 豆豆价差 (Soybean-Soybean Price Difference), AM价差 (Ammonium-Magnesium Price Difference), LV价差 (Lignite-Vanilla Price Difference), L-PP价差 (Lignite-Polypropylene Price Difference), TA-EG价差 (Terephthalic Acid-Ethylene Glycol Price Difference), SM-SF价差 (Soybean Meal-Soybean Price Difference), CS-C价差 (Cotton-Soybean Price Difference), CY-CF价差 (Cotton-Yarn Price Difference), FG-SA价差 (Fiberglass-Soda Ash Price Difference).</p>
FG-SA价差	100%																													
CY-CF价差	27%																													
CS-C价差	80%																													
SM-SF价差	72%																													
TA-EG价差	83%																													
L-PP价差	100%																													
LV价差	100%																													
AM价差	26%																													
菜豆价差	25%																													
菜棕价差	26%																													
豆棕价差	19%																													
卷螺差	88%																													

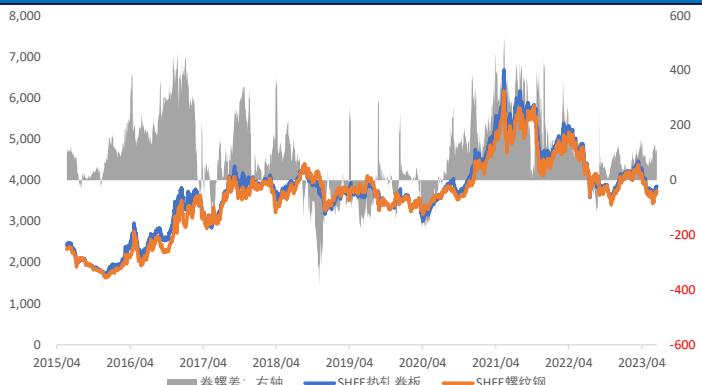
重要商品主力价差套利表现

制作日期

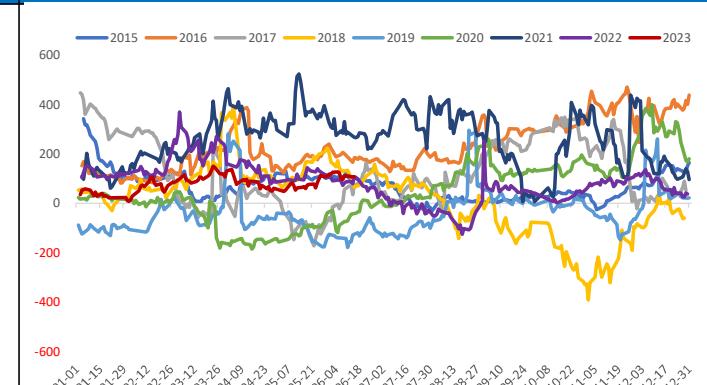
2023年6月15日

商品价差近年以来走势对比

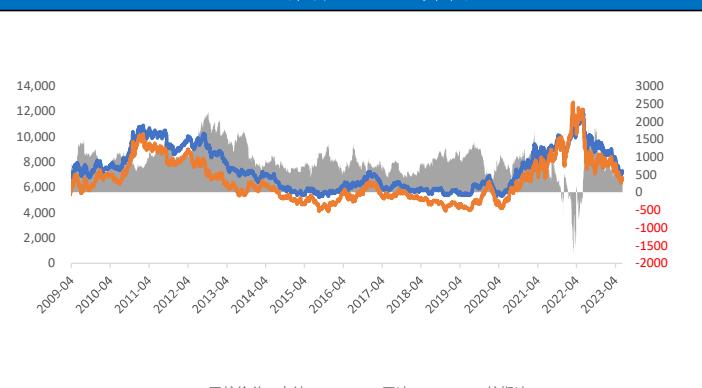
卷螺价差 - 走势图



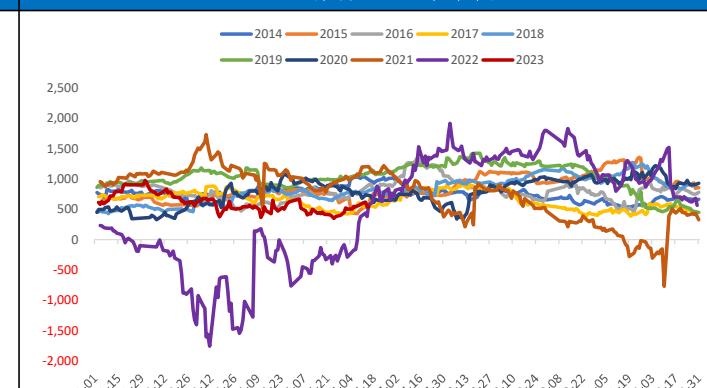
卷螺价差 - 季节图



豆棕价差 - 走势图



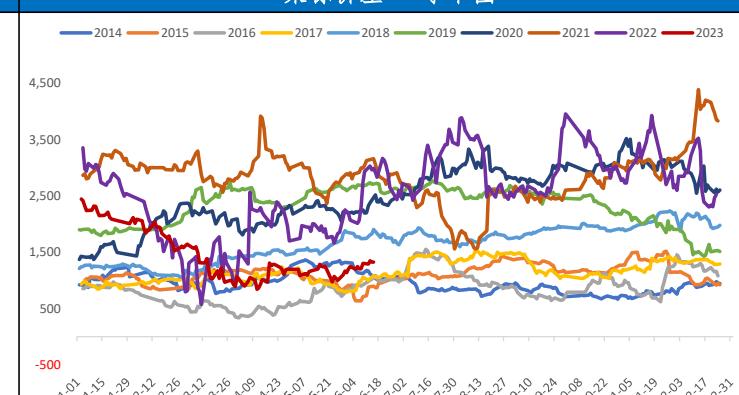
豆棕价差 - 季节图



菜棕价差 - 走势图



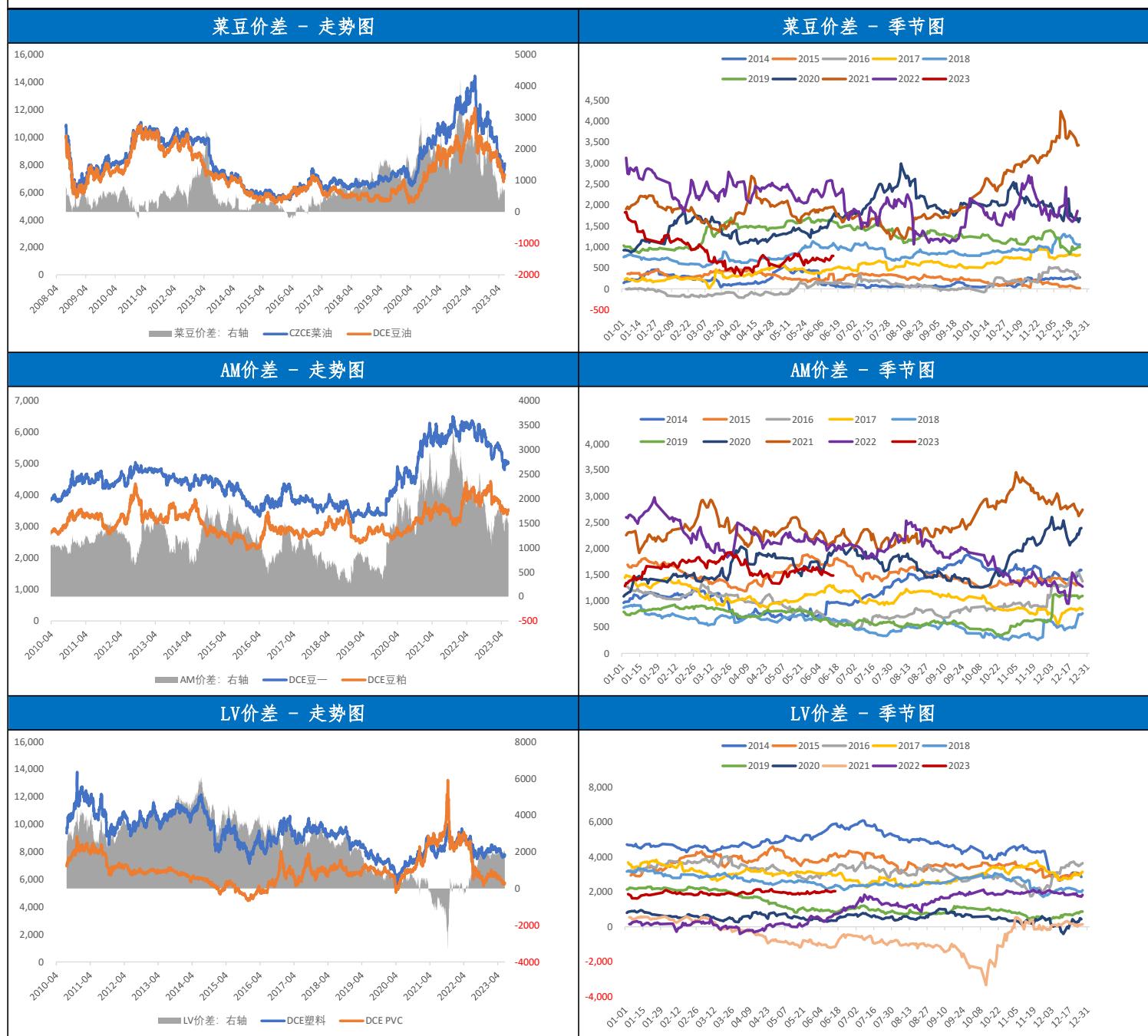
菜棕价差 - 季节图



重要商品主力价差套利表现

制作日期

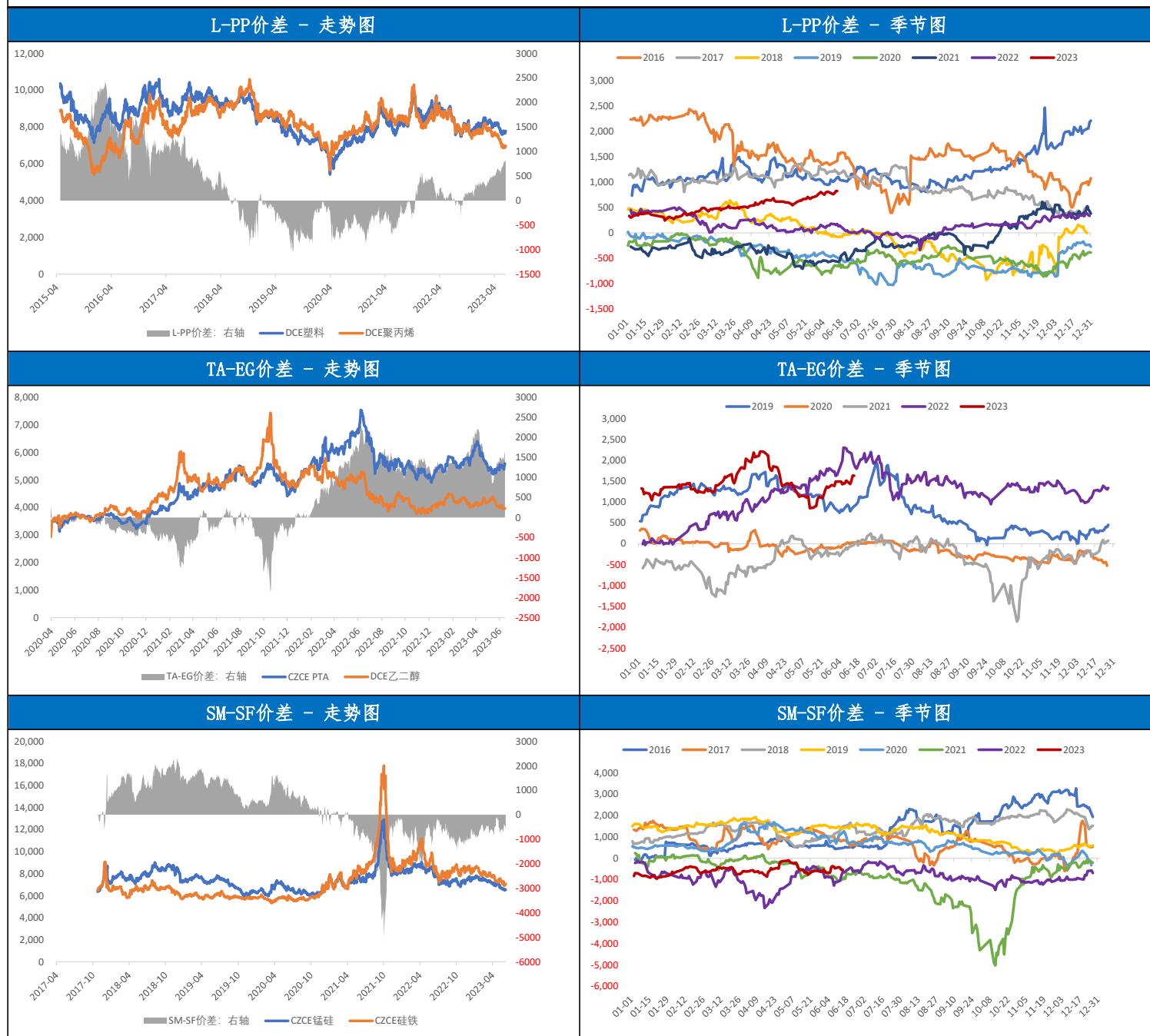
2023年6月15日



重要商品主力价差套利表现

制作日期

2023年6月15日

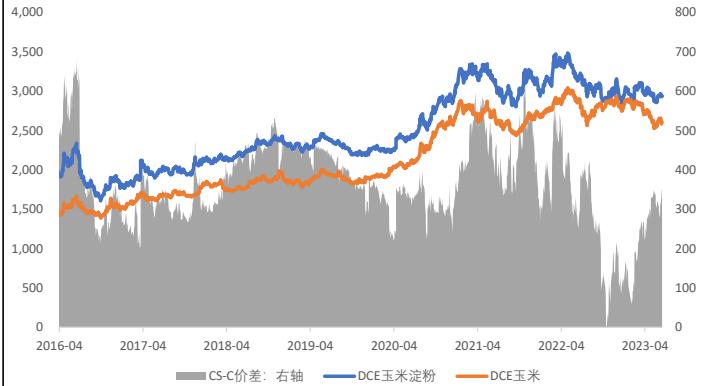


重要商品主力价差套利表现

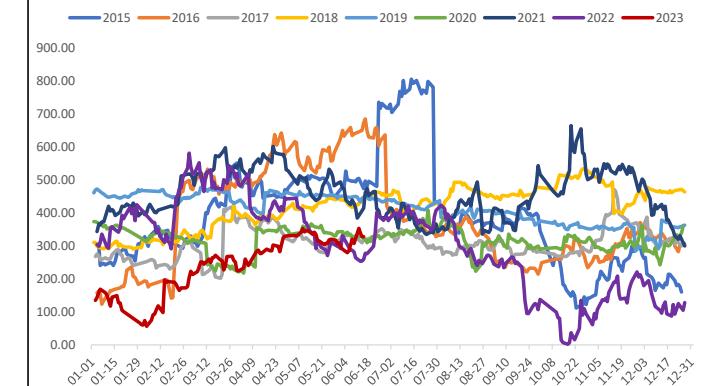
制作日期

2023年6月15日

CS-C价差 - 走势图



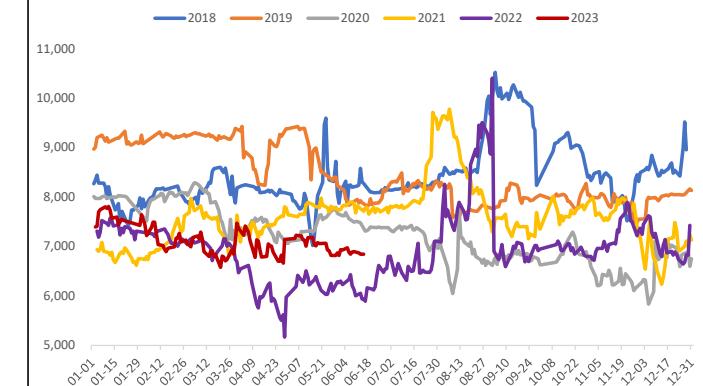
CS-C价差 - 季节图



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