

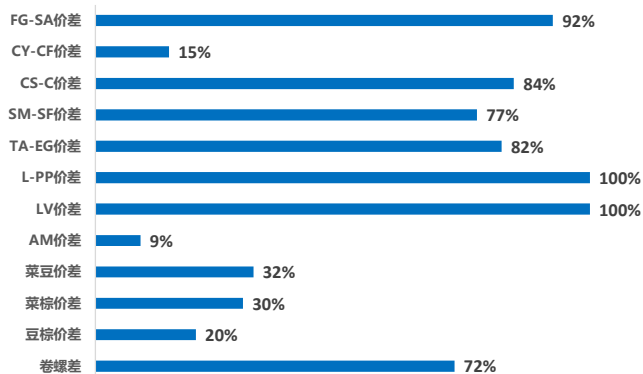
重要商品主力价差套利表现

制作日期

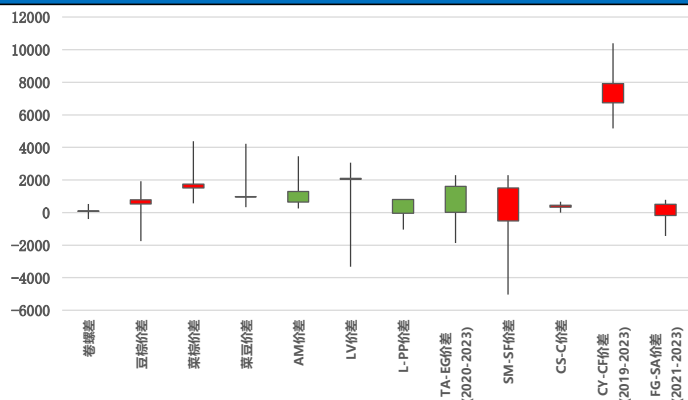
2023年6月27日

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	3755	热卷 - 螺纹钢价差	88	
	SHFE螺纹钢	元/吨	3667			
黑色系	CZCE锰硅	元/吨	6580	锰硅 - 锰铁 价差	-514	
	CZCE硅铁	元/吨	7094			
农产品	DCE豆油	元/吨	7658	豆油-棕榈油价差	536	
	DCE棕榈油	元/吨	7122			
农产品	CZCE菜油	元/吨	8630	菜油 - 棕榈油价差	1508	
	DCE棕榈油	元/吨	7122			
农产品	CZCE菜油	元/吨	8630	菜油 - 豆油价差	972	
	DCE豆油	元/吨	7658			
农产品	DCE豆一	元/吨	5089	豆一 - 豆粕价差	1302	
	DCE豆粕	元/吨	3787			
农产品	DCE玉米淀粉	元/吨	3030	玉米淀粉 - 玉米价差	339	
	DCE玉米	元/吨	2691			
农产品	CZCE棉纱	元/吨	23010	棉纱 - 棉花价差	6745	
	CZCE棉花	元/吨	16265			
能化品种	DCE塑料	元/吨	7770	塑料 - PVC价差	2053	
	DCE PVC	元/吨	5717			
能化品种	DCE塑料	元/吨	7770	塑料 - 聚丙烯价差	818	
	DCE聚丙烯	元/吨	6952			
能化品种	CZCE PTA	元/吨	5490	PTA - 乙二醇价差	1606	
	DCE乙二醇	元/吨	3884			
能化品种	CZCE玻璃	元/吨	1492	玻璃 - 纯碱价差	-183	
	CZCE纯碱	元/吨	1675			

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）



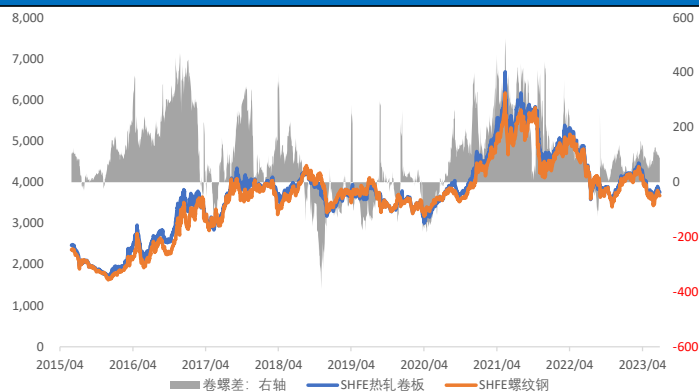
重要商品主力价差套利表现

制作日期

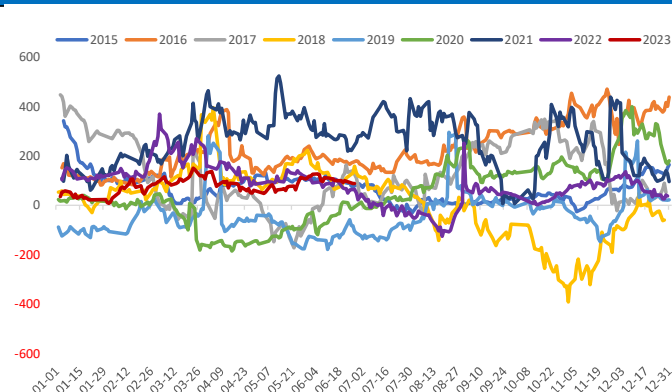
2023年6月27日

商品价差近年以来走势对比

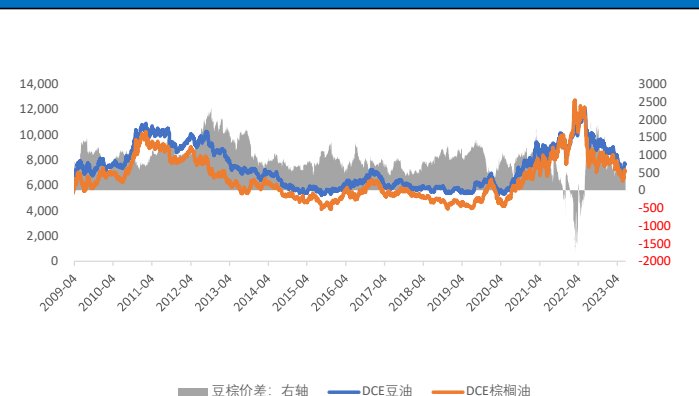
卷螺价差 - 走势图



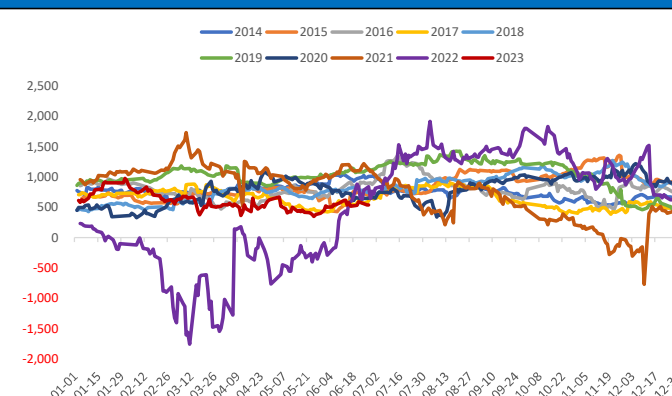
卷螺价差 - 季节图



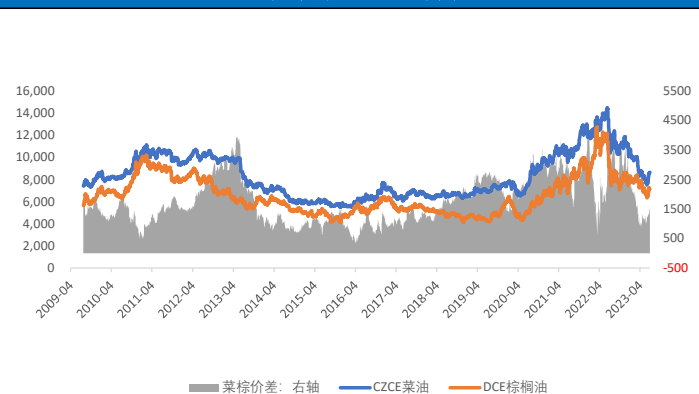
豆棕价差 - 走势图



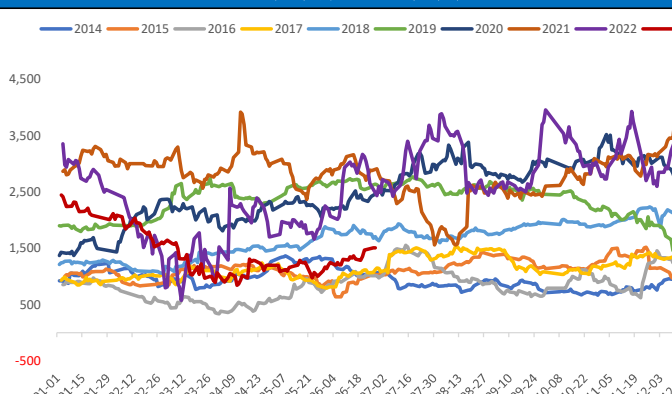
豆棕价差 - 季节图



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

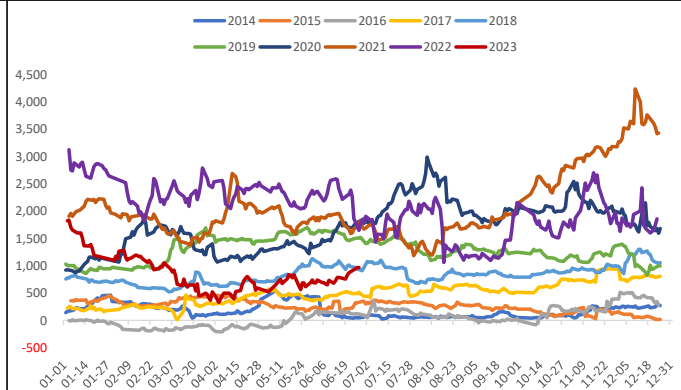
制作日期

2023年6月27日

菜豆价差 - 走势图



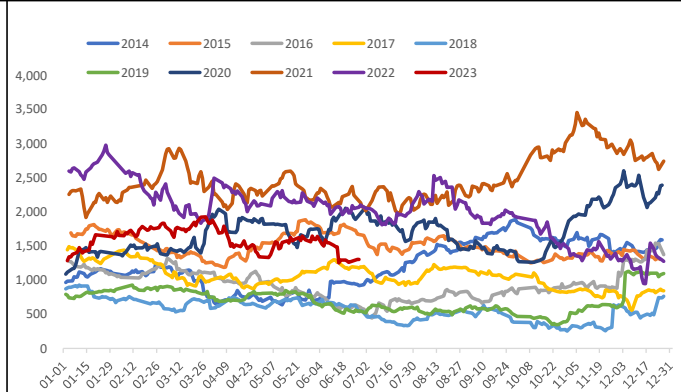
菜豆价差 - 季节图



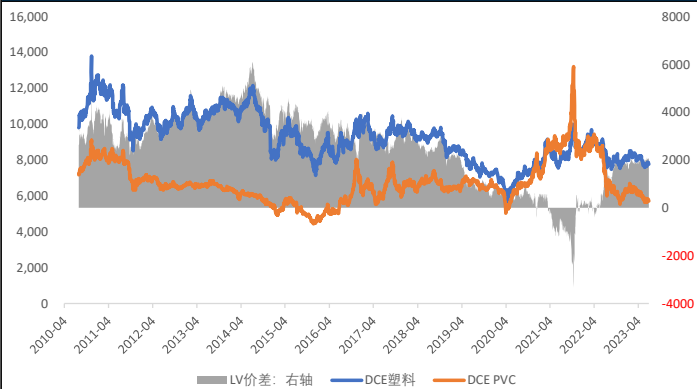
AM价差 - 走势图



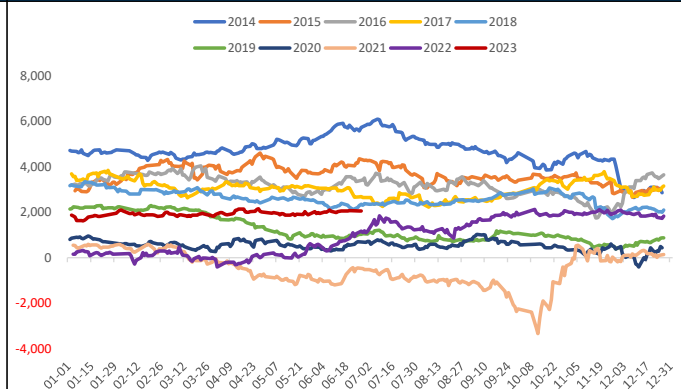
AM价差 - 季节图



LV价差 - 走势图



LV价差 - 季节图

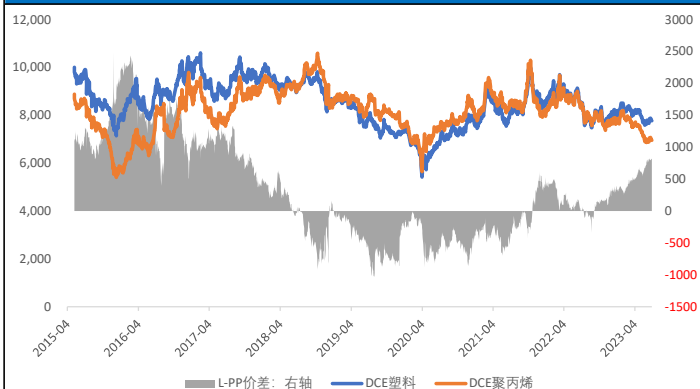


重要商品主力价差套利表现

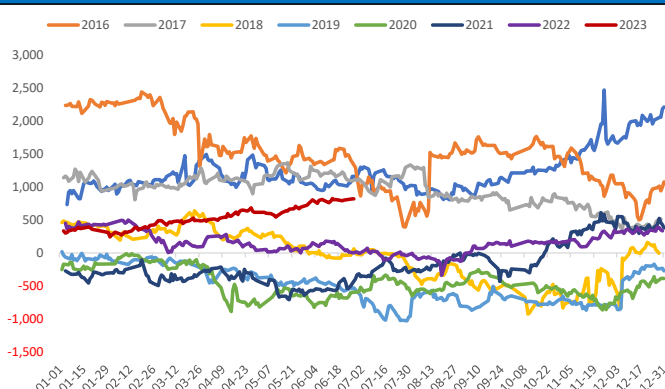
制作日期

2023年6月27日

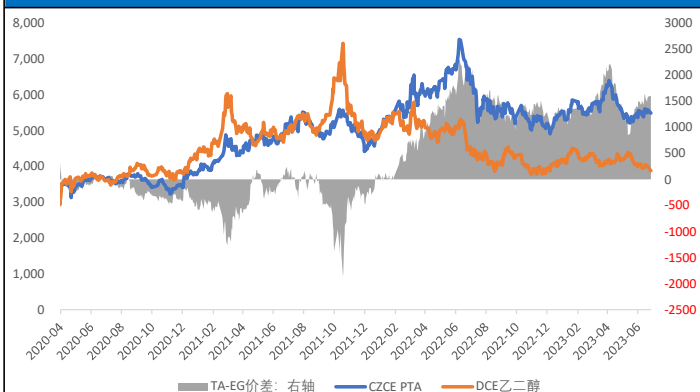
L-PP价差 - 走势图



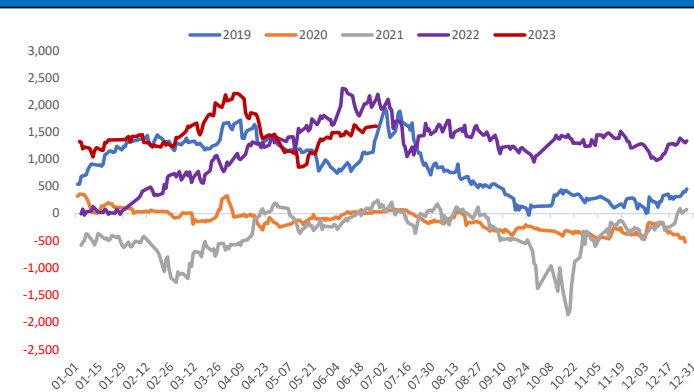
L-PP价差 - 季节图



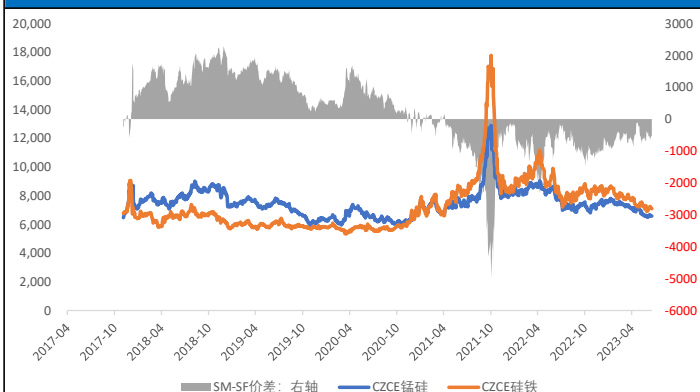
TA-EG价差 - 走势图



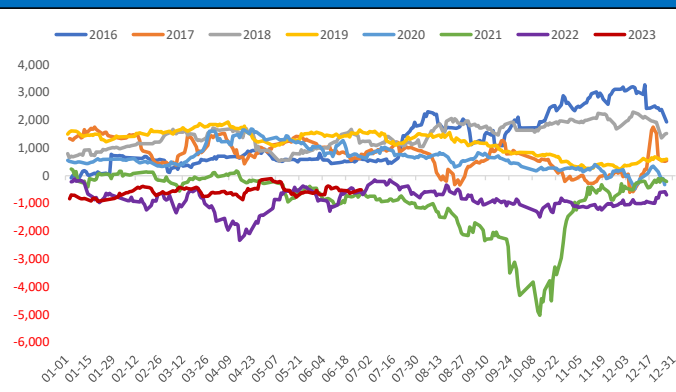
TA-EG价差 - 季节图



SM-SF价差 - 走势图



SM-SF价差 - 季节图

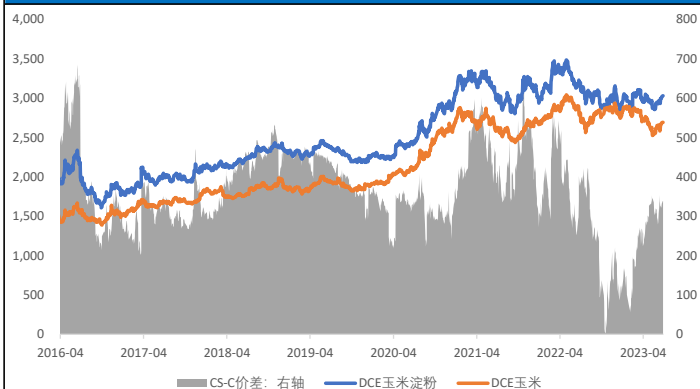


重要商品主力价差套利表现

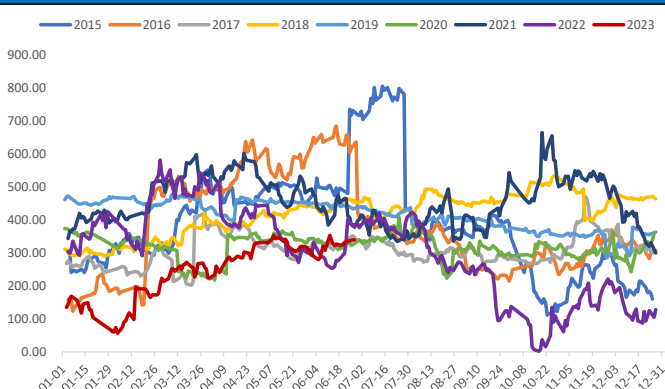
制作日期

2023年6月27日

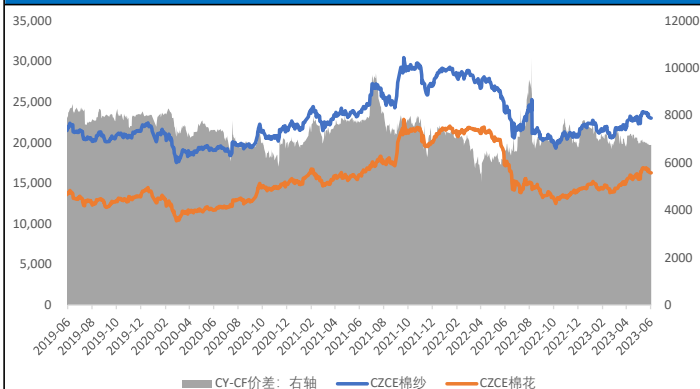
CS-C价差 - 走势图



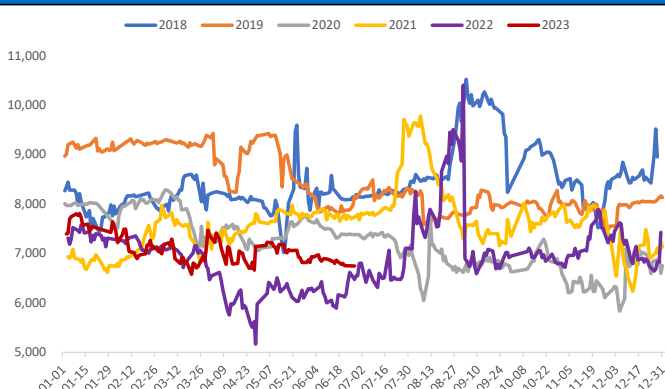
CS-C价差 - 季节图



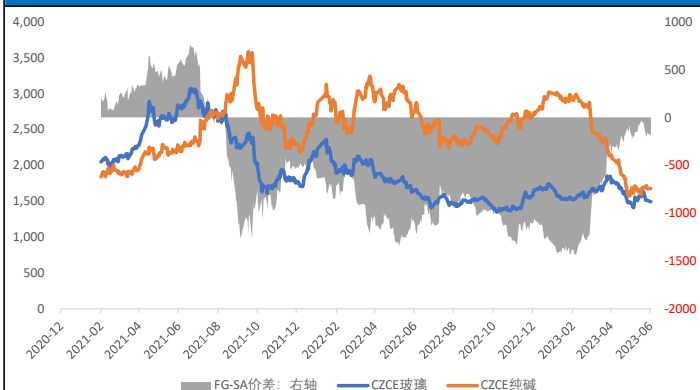
CY-CF价差 - 走势图



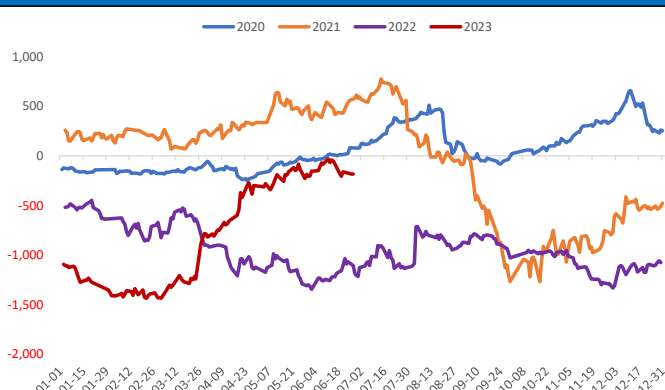
CY-CF价差 - 季节图



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