

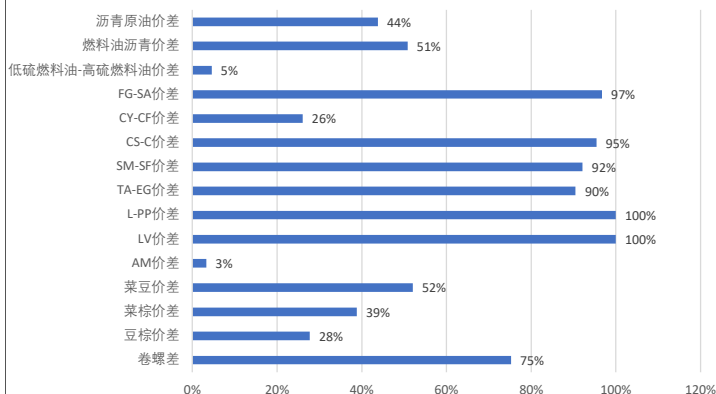
重要商品主力价差套利表现

制作日期

2023年7月10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	3766	热卷 - 螺纹钢价差	95	
	SHFE螺纹钢	元/吨	3671			
黑色系	CZCE锰硅	元/吨	6586	锰硅 - 锰铁 价差	-388	
	CZCE硅铁	元/吨	6974			
农产品	DCE豆油	元/吨	8014	豆油-棕榈油价差	556	
	DCE棕榈油	元/吨	7458			
农产品	CZCE菜油	元/吨	9265	菜油 - 棕榈油价差	1807	
	DCE棕榈油	元/吨	7458			
农产品	CZCE菜油	元/吨	9265	菜油 - 豆油价差	1251	
	DCE豆油	元/吨	8014			
农产品	DCE豆一	元/吨	5199	豆一 - 豆粕价差	1232	
	DCE豆粕	元/吨	3967			
农产品	DCE玉米淀粉	元/吨	3186	玉米淀粉 - 玉米价差	398	
	DCE玉米	元/吨	2788			
农产品	CZCE棉纱	元/吨	23520	棉纱 - 棉花价差	6840	
	CZCE棉花	元/吨	16680			
能化品种	DCE塑料	元/吨	7997	塑料 - PVC价差	2153	
	DCE PVC	元/吨	5844			
能化品种	DCE塑料	元/吨	7997	塑料 - 聚丙烯价差	851	
	DCE聚丙烯	元/吨	7146			
能化品种	CZCE PTA	元/吨	5744	PTA - 乙二醇价差	1706	
	DCE乙二醇	元/吨	4038			
能化品种	CZCE玻璃	元/吨	1595	玻璃 - 纯碱价差	-101	
	CZCE纯碱	元/吨	1696			
能化品种	INE低硫燃料油	元/吨	4004	低硫燃料油-高硫燃料油价差	832	
	SHFE燃油	元/吨	3172			
能化品种	INE低硫燃料油	元/吨	4004	低硫燃料油-沥青价差	395	
	SHFE沥青	元/吨	3609			
能化品种	SHFE沥青	元/吨	3609	沥青-原油价差*7	-317	
	INE原油	元/吨	561			

主要商品期货最新主力价差所处近一年（365天）历史百分位

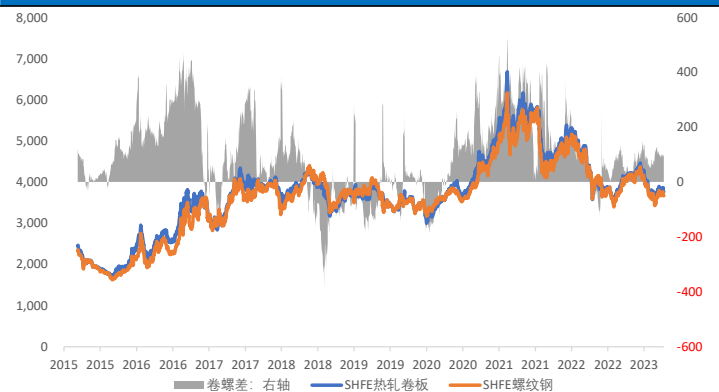


当前主要商品期货最新主力价差近五年状态（2018-2023）

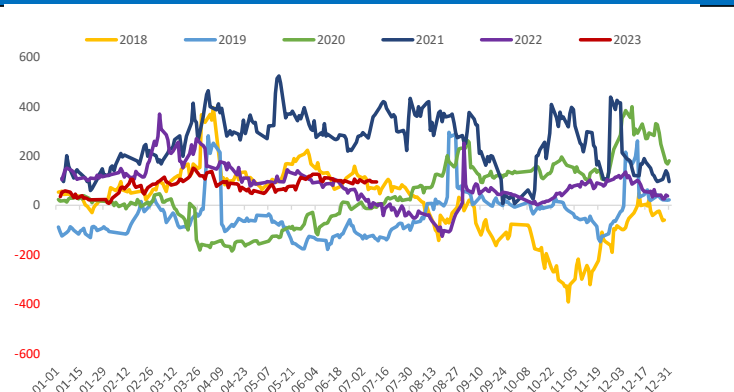


商品价差近年以来走势对比

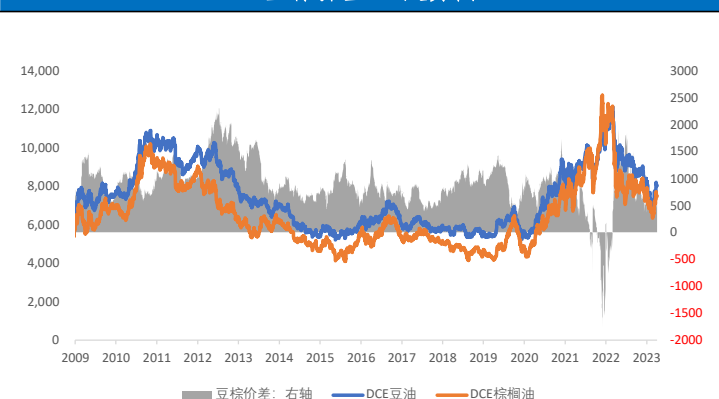
卷螺价差 - 走势图



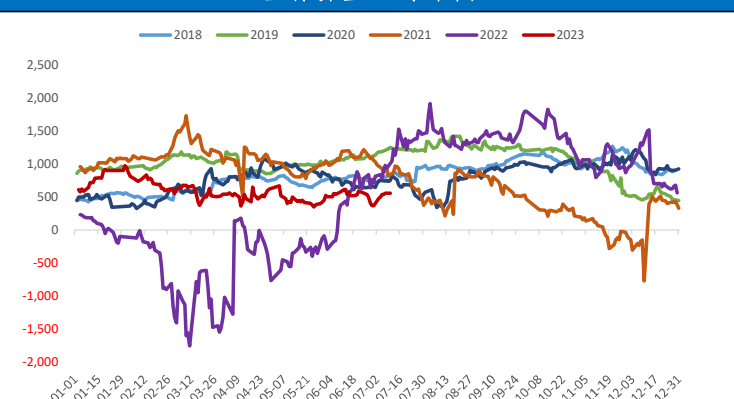
卷螺价差 - 季节图



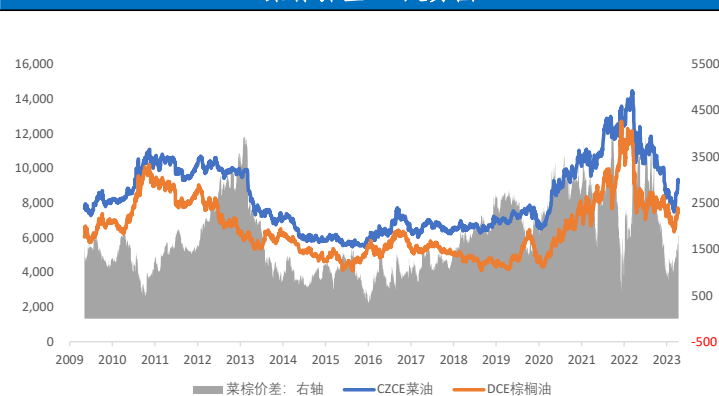
豆棕价差 - 走势图



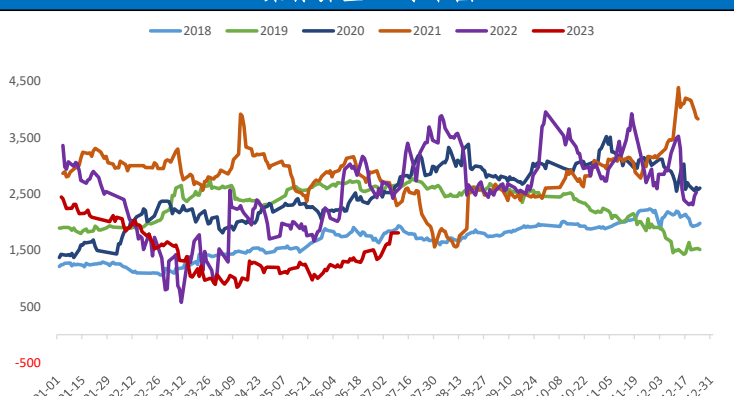
豆棕价差 - 季节图



菜棕价差 - 走势图



菜棕价差 - 季节图

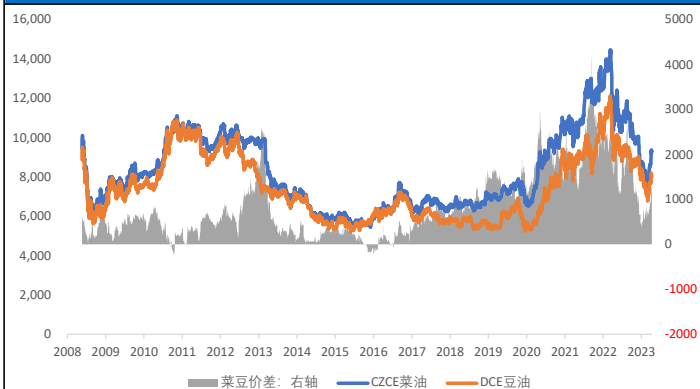


重要商品主力价差套利表现

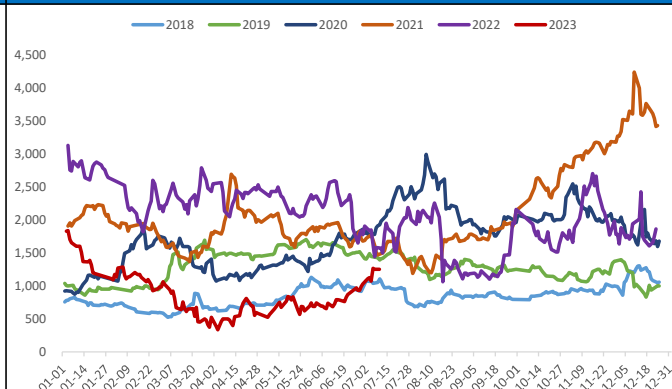
制作日期

2023年7月10日

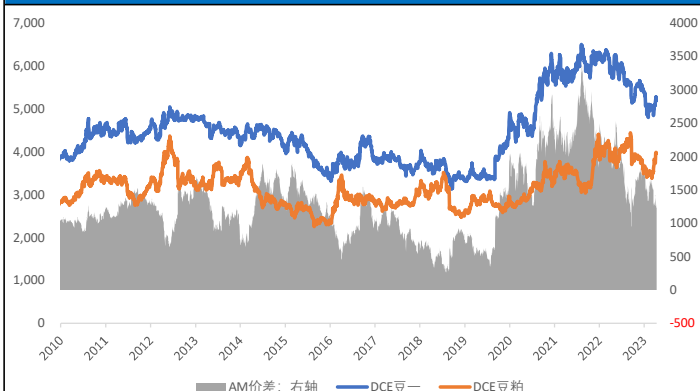
菜豆价差 - 走势图



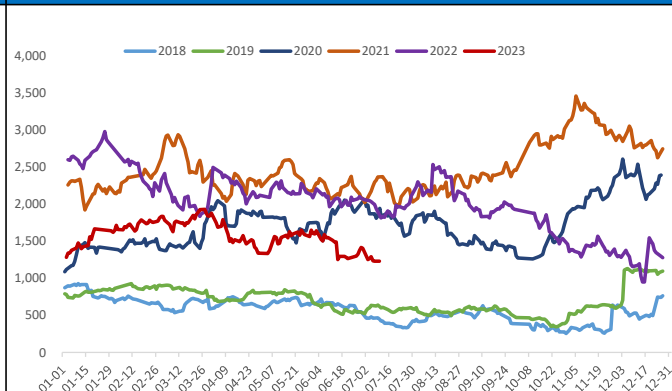
菜豆价差 - 季节图



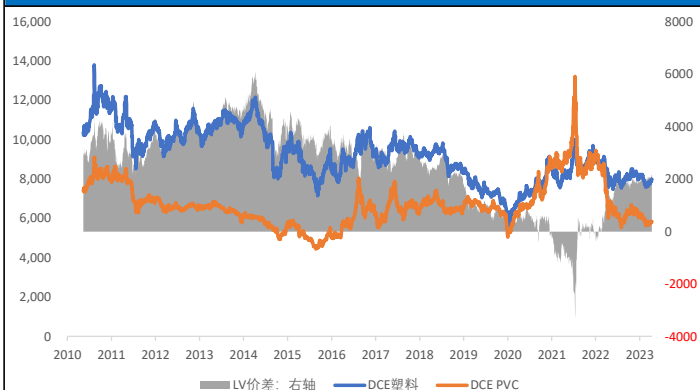
AM价差 - 走势图



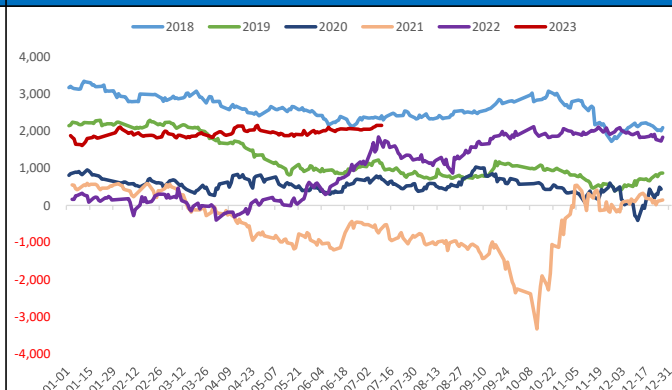
AM价差 - 季节图



LV价差 - 走势图



LV价差 - 季节图

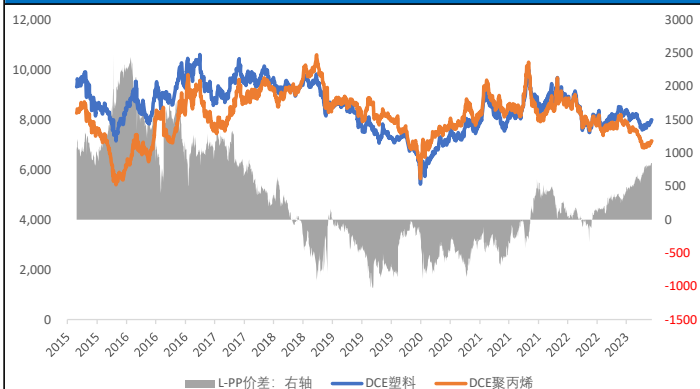


重要商品主力价差套利表现

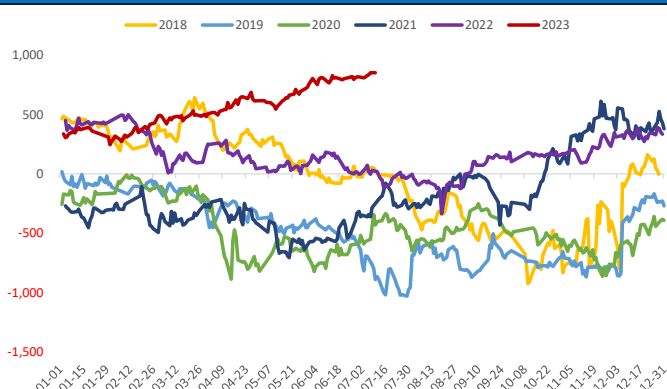
制作日期

2023年7月10日

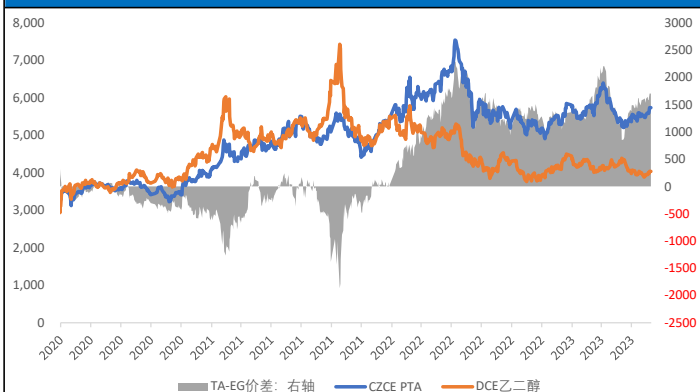
L-PP价差 - 走势图



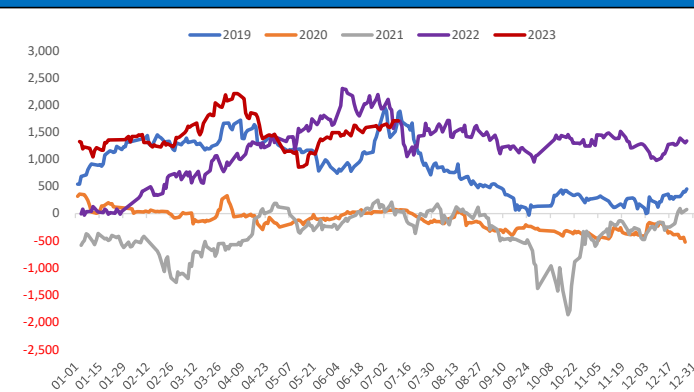
L-PP价差 - 季节图



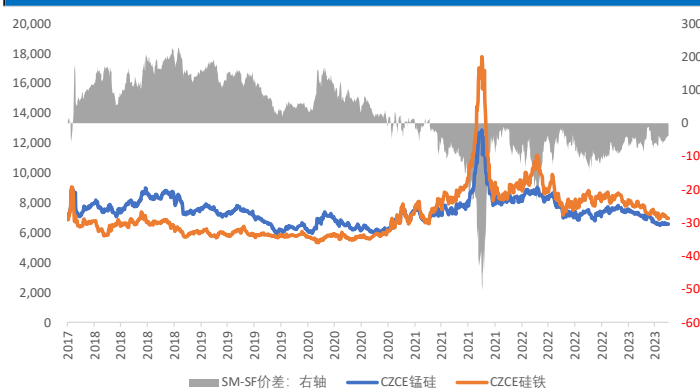
TA-EG价差 - 走势图



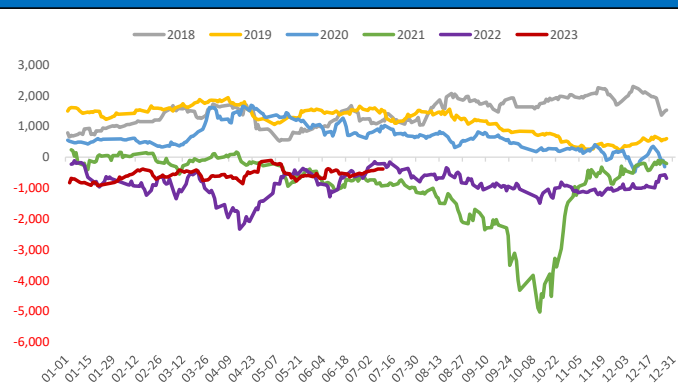
TA-EG价差 - 季节图



SM-SF价差 - 走势图



SM-SF价差 - 季节图

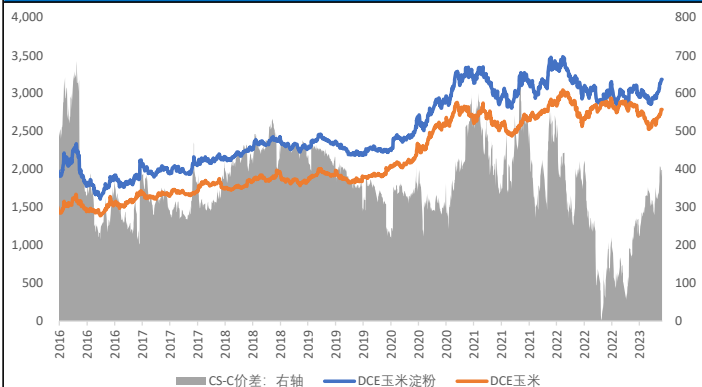


重要商品主力价差套利表现

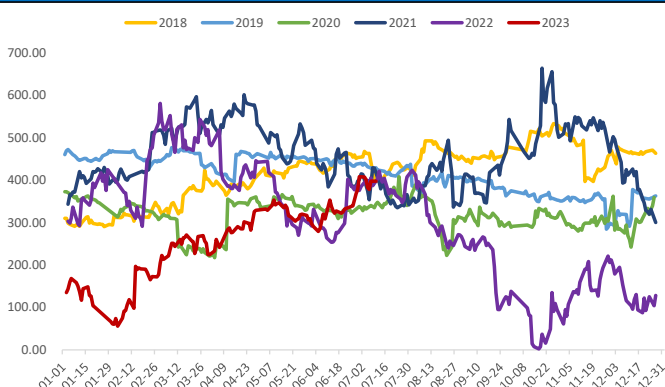
制作日期

2023年7月10日

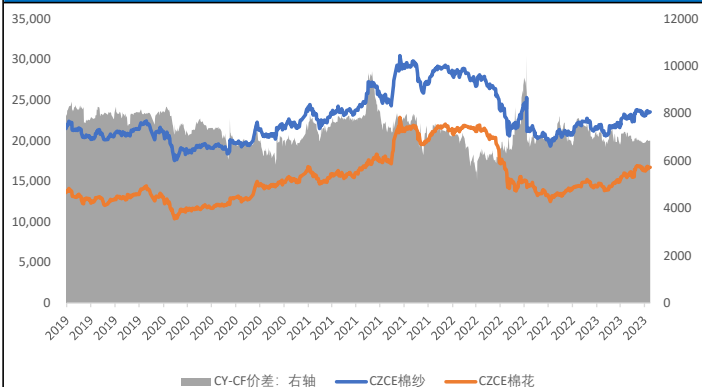
CS-C价差 - 走势图



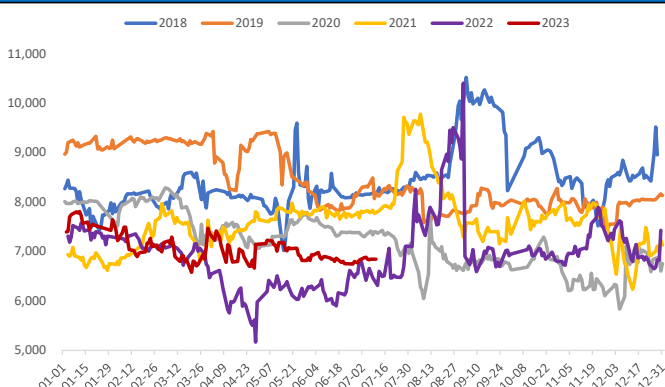
CS-C价差 - 季节图



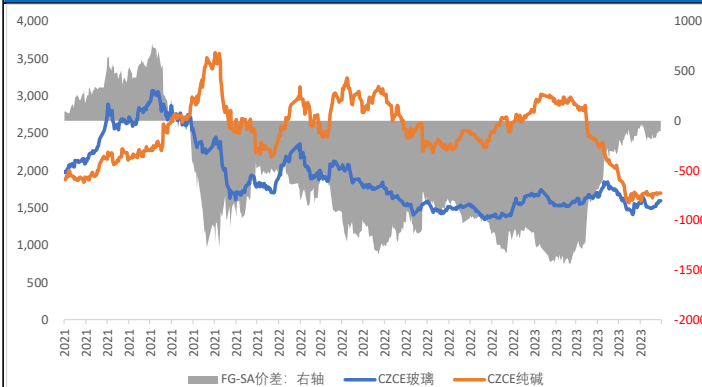
CY-CF价差 - 走势图



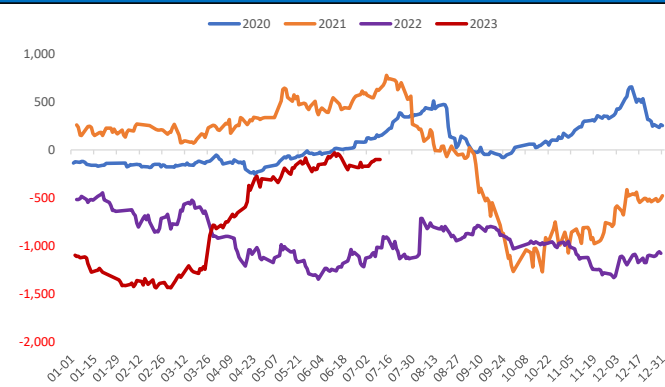
CY-CF价差 - 季节图



FG-SA价差 - 走势图



FG-SA价差 - 季节图



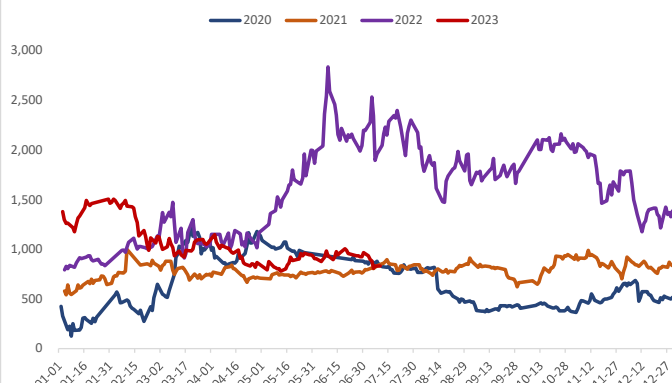
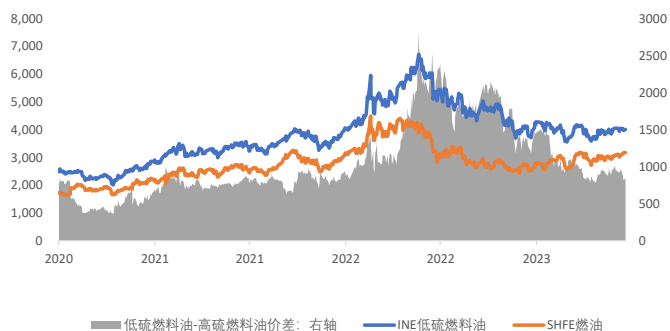
低硫燃料油-高硫燃料油价差 - 走势图

低硫燃料油-高硫燃料油价差 - 季节图

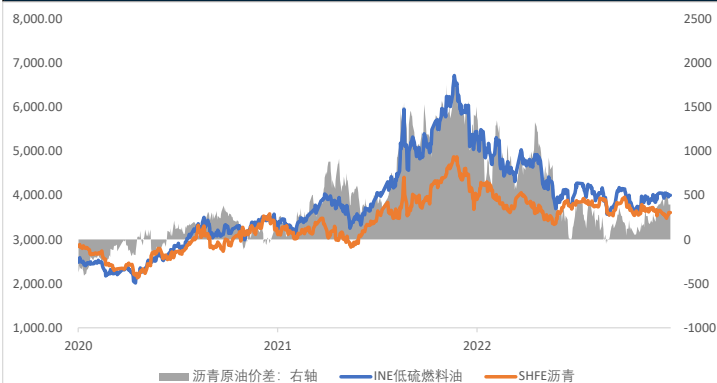
重要商品主力价差套利表现

制作日期

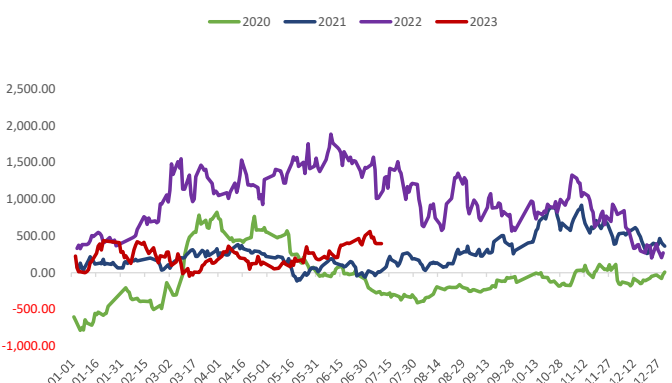
2023年7月10日



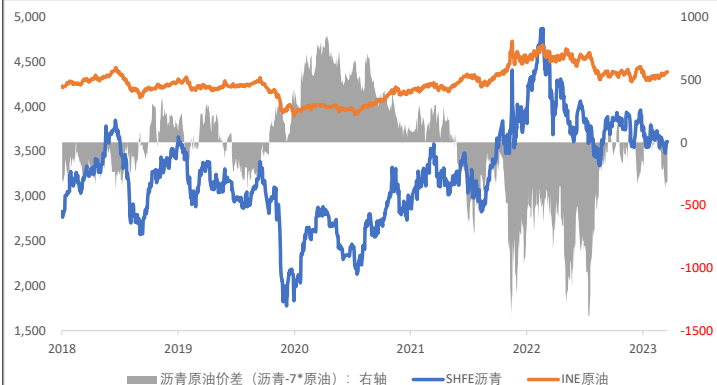
燃料油-沥青价差 - 走势图



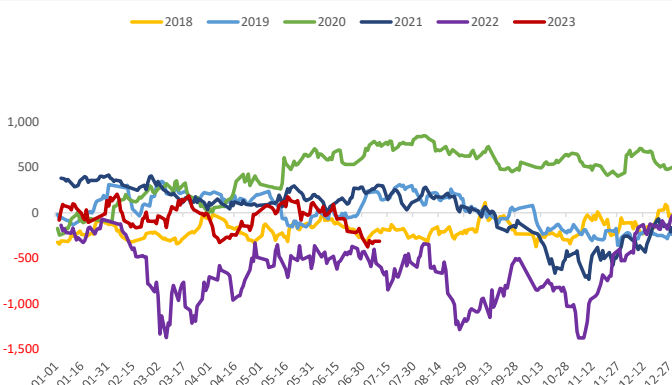
燃料油-沥青价差 - 季节图



沥青-原油价差 - 走势图



沥青-原油价差 - 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