

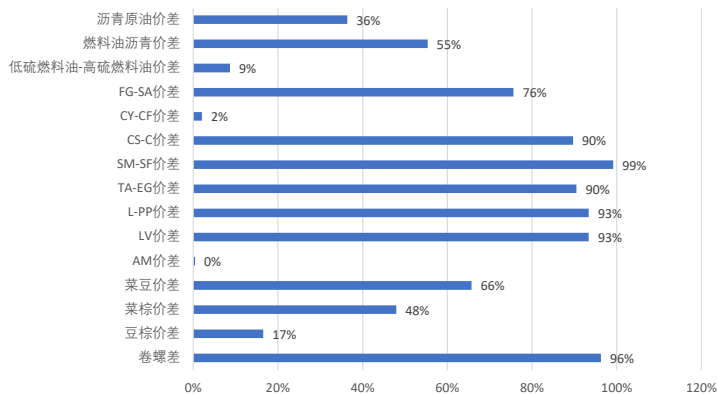
重要商品主力价差套利表现

制作日期

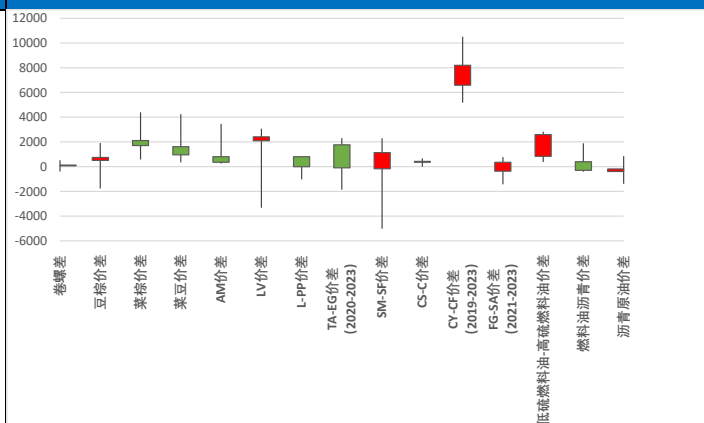
2023年7月25日

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	3918	热卷 - 螺纹钢价差	125	
	SHFE螺纹钢	元/吨	3793			
黑色系	CZCE锰硅	元/吨	6678	锰硅 - 铁矿石 价差	-170	
	CZCE硅铁	元/吨	6848			
农产品	DCE豆油	元/吨	8030	豆油-棕榈油价差	502	
	DCE棕榈油	元/吨	7528			
农产品	CZCE菜油	元/吨	9640	菜油 - 棕榈油价差	2112	
	DCE棕榈油	元/吨	7528			
农产品	CZCE菜油	元/吨	9640	菜油 - 豆油价差	1610	
	DCE豆油	元/吨	8030			
农产品	DCE豆一	元/吨	4972	豆一 - 豆粕价差	808	
	DCE豆粕	元/吨	4164			
农产品	DCE玉米淀粉	元/吨	3038	玉米淀粉 - 玉米价差	355	
	DCE玉米	元/吨	2683			
农产品	CZCE棉纱	元/吨	23645	棉纱 - 棉花价差	6590	
	CZCE棉花	元/吨	17055			
能化品种	DCE塑料	元/吨	8039	塑料 - PVC价差	2104	
	DCE PVC	元/吨	5935			
能化品种	DCE塑料	元/吨	8039	塑料 - 聚丙烯价差	805	
	DCE聚丙烯	元/吨	7234			
能化品种	CZCE PTA	元/吨	5830	PTA - 乙二醇价差	1771	
	DCE乙二醇	元/吨	4059			
能化品种	CZCE玻璃	元/吨	1642	玻璃 - 纯碱价差	-368	
	CZCE纯碱	元/吨	2010			
能化品种	INE低硫燃料油	元/吨	4131	低硫燃料油-高硫燃料油价差	842	
	SHFE燃油	元/吨	3289			
能化品种	INE低硫燃料油	元/吨	4131	低硫燃料油-沥青价差	396	
	SHFE沥青	元/吨	3735			
能化品种	SHFE沥青	元/吨	3735	沥青-原油价差*7	-392	
	INE原油	元/吨	590			

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）



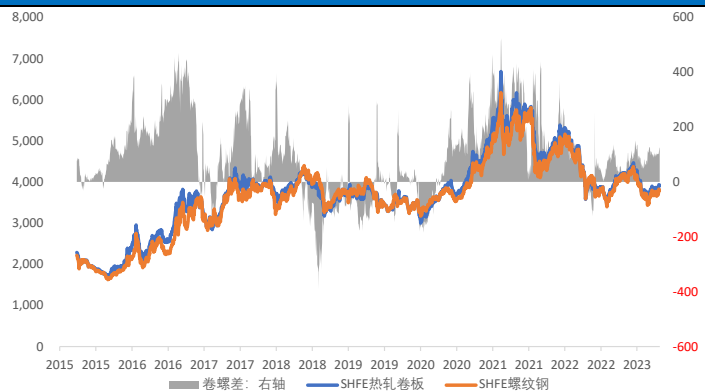
重要商品主力价差套利表现

制作日期

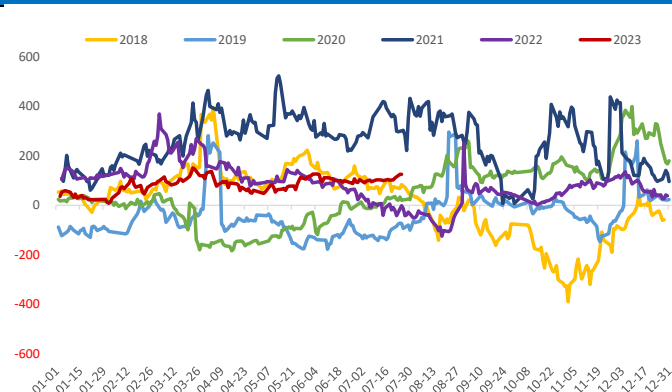
2023年7月25日

商品价差近年以来走势对比

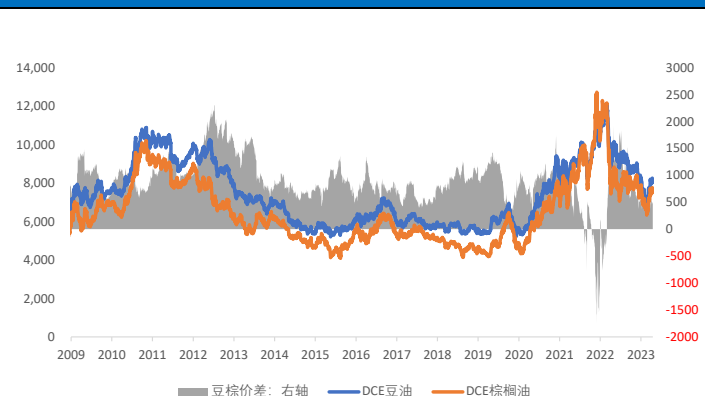
卷螺价差 - 走势图



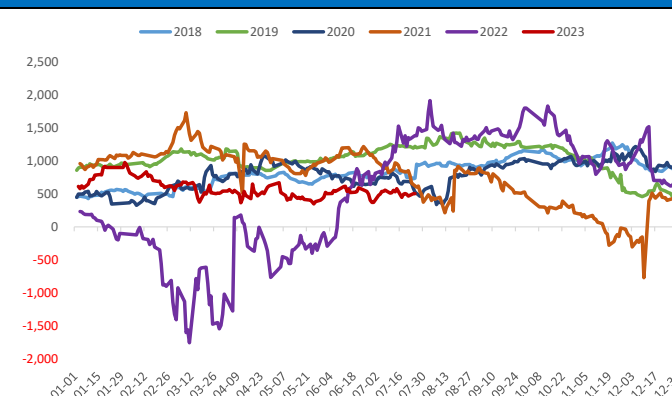
卷螺价差 - 季节图



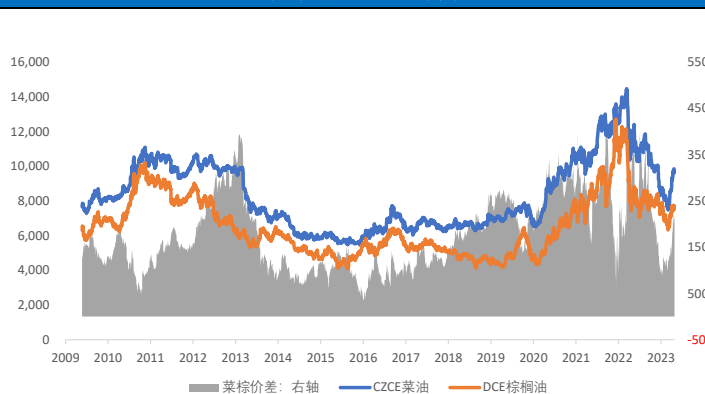
豆棕价差 - 走势图



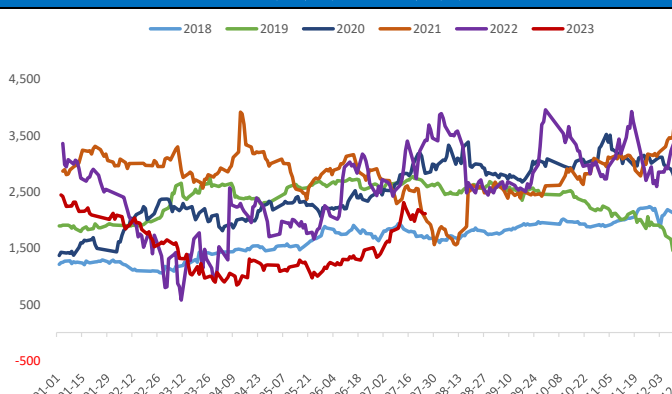
豆棕价差 - 季节图



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

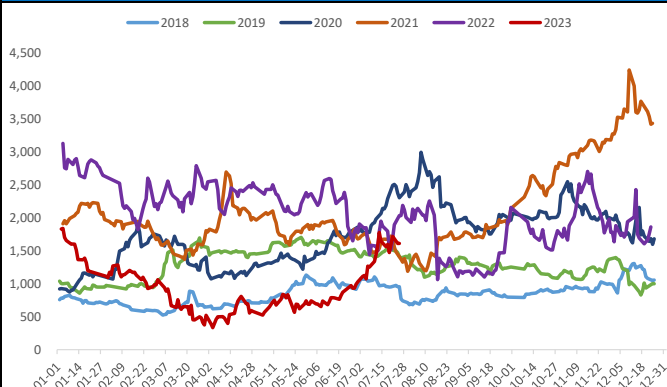
制作日期

2023年7月25日

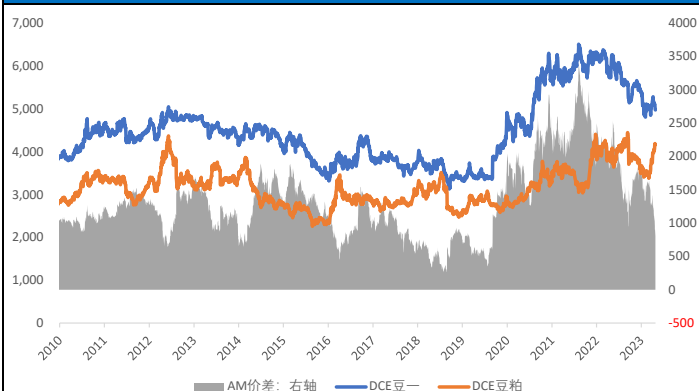
菜豆价差 - 走势图



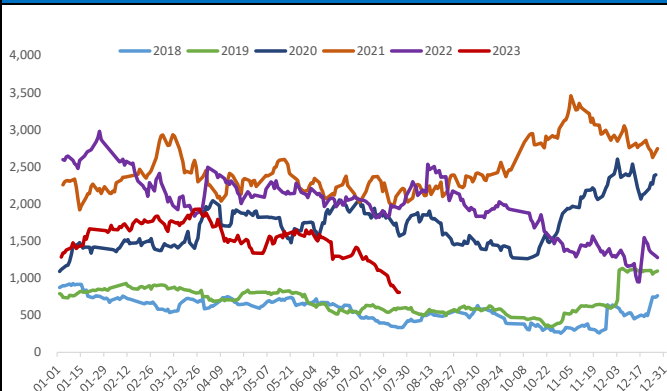
菜豆价差 - 季节图



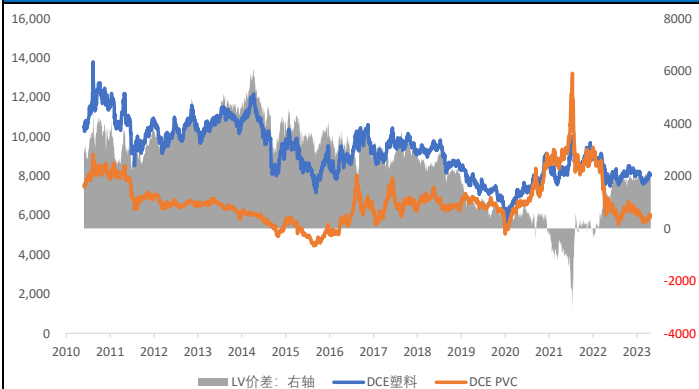
AM价差 - 走势图



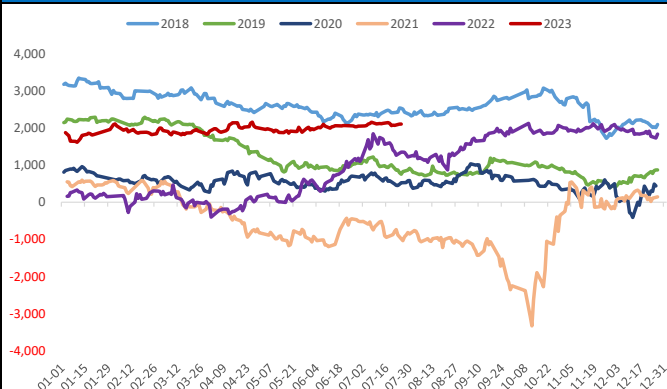
AM价差 - 季节图



LV价差 - 走势图



LV价差 - 季节图

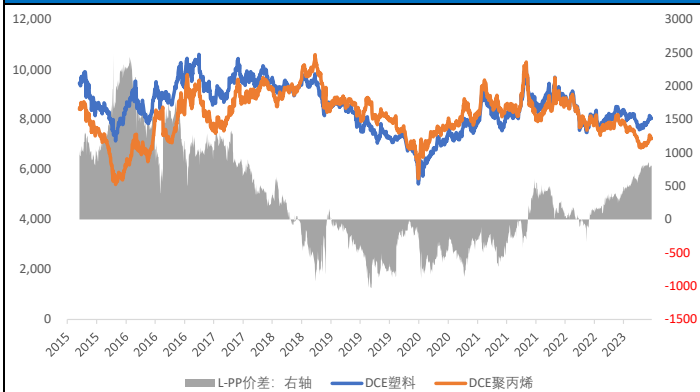


重要商品主力价差套利表现

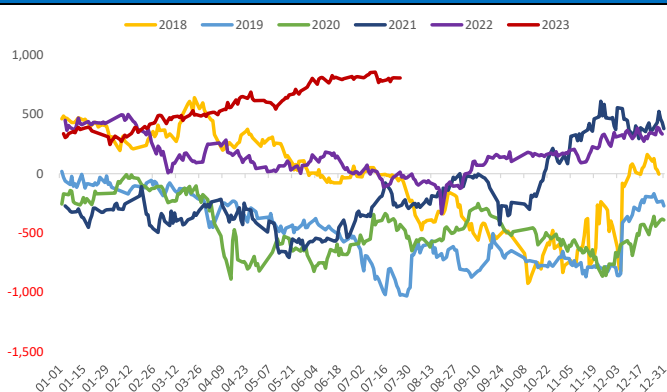
制作日期

2023年7月25日

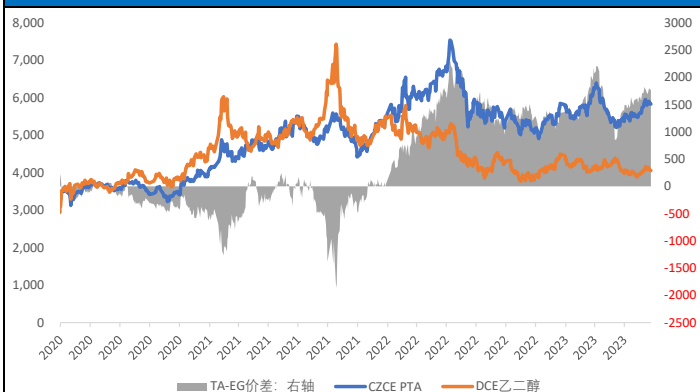
L-PP价差 - 走势图



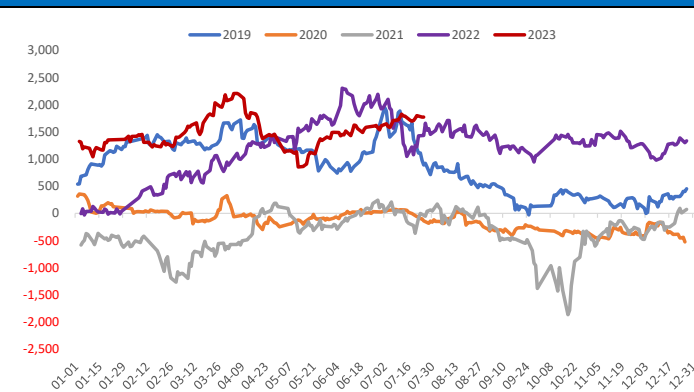
L-PP价差 - 季节图



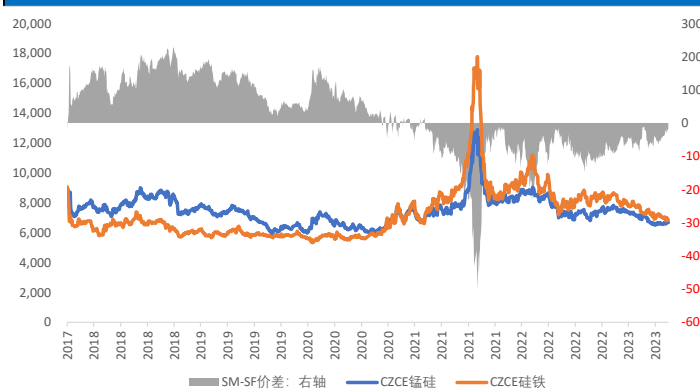
TA-EG价差 - 走势图



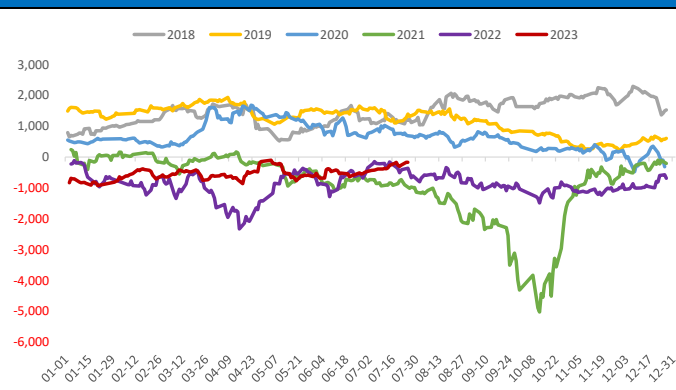
TA-EG价差 - 季节图



SM-SF价差 - 走势图



SM-SF价差 - 季节图

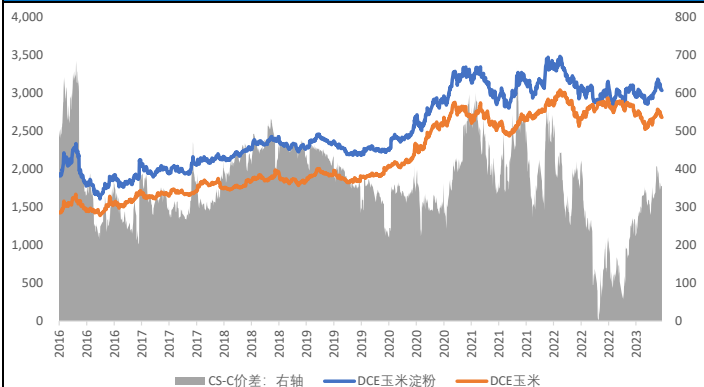


重要商品主力价差套利表现

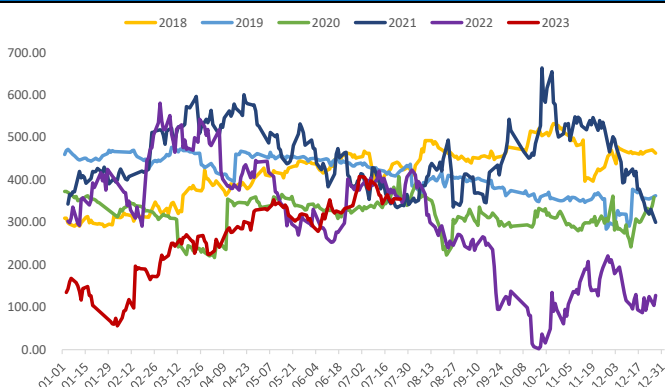
制作日期

2023年7月25日

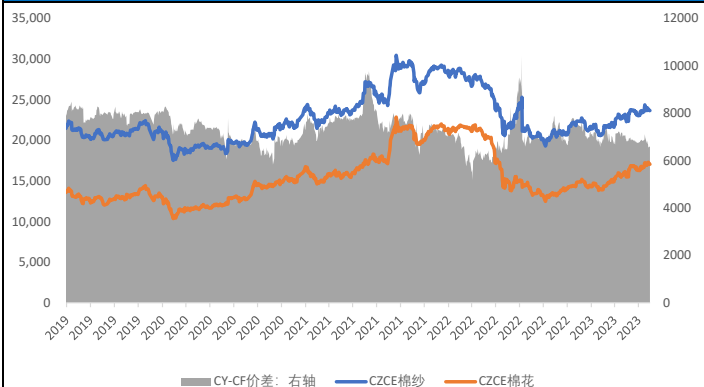
CS-C价差 - 走势图



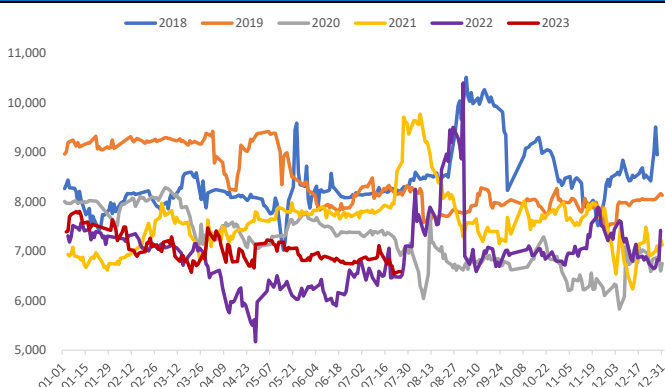
CS-C价差 - 季节图



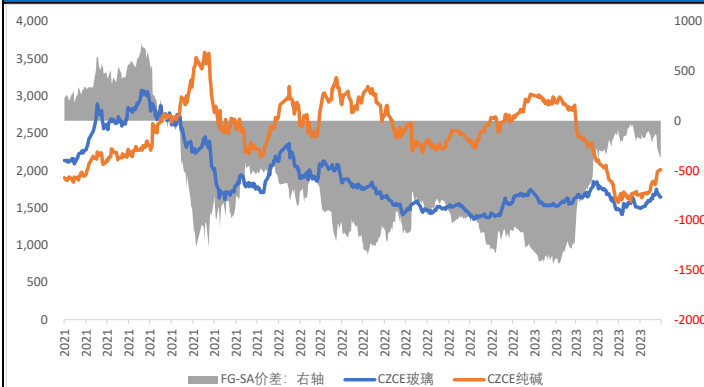
CY-CF价差 - 走势图



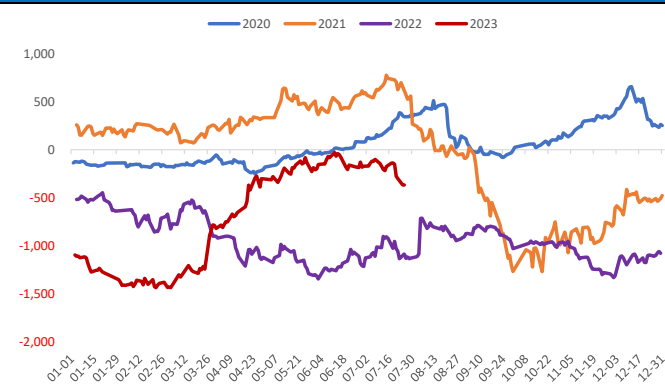
CY-CF价差 - 季节图



FG-SA价差 - 走势图



FG-SA价差 - 季节图



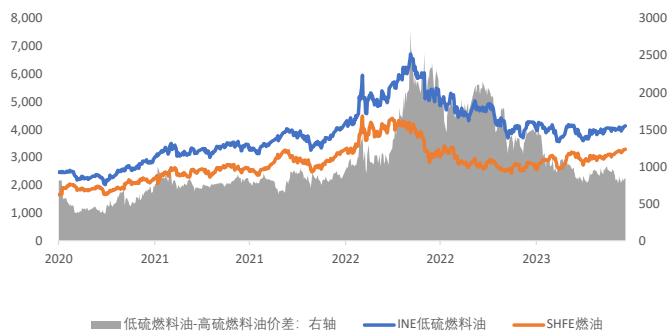
低硫燃料油-高硫燃料油价差 - 走势图

低硫燃料油-高硫燃料油价差 - 季节图

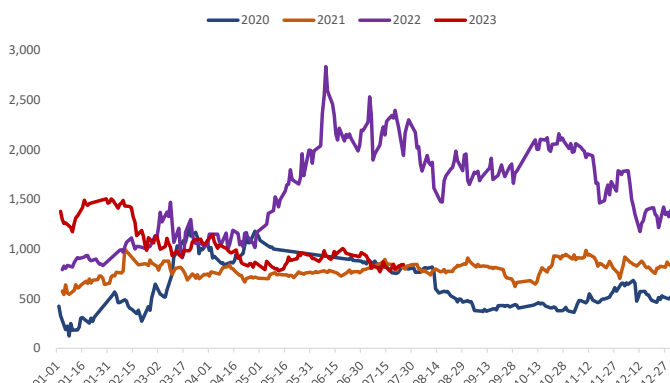
重要商品主力价差套利表现

制作日期

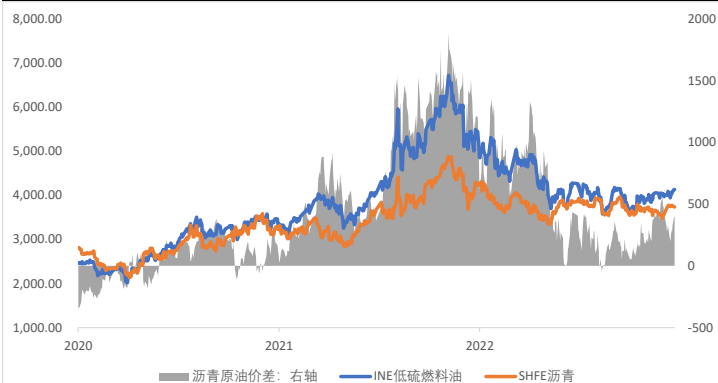
2023年7月25日



低硫燃料油-高硫燃料油价差：右轴 INE低硫燃料油 SHFE燃油

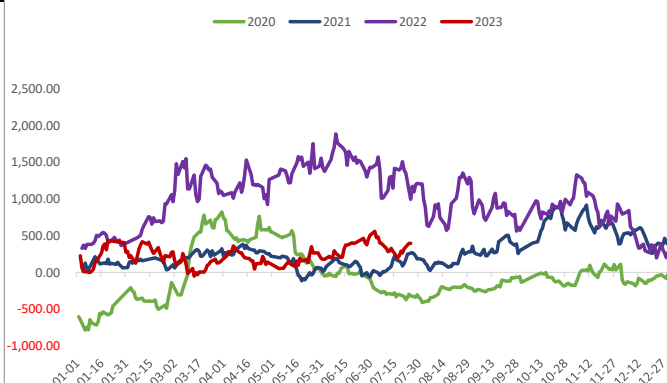


燃料油-沥青价差 - 走势图

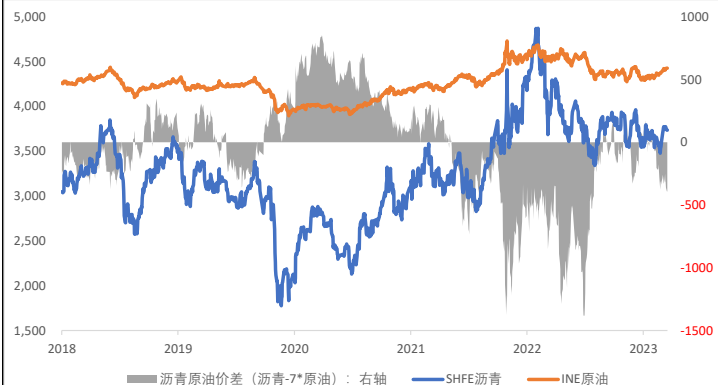


沥青原油价差：右轴 INE低硫燃料油 SHFE沥青

燃料油-沥青价差 - 季节图

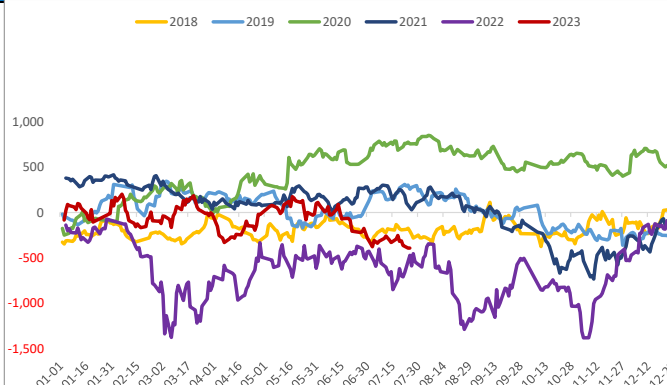


沥青-原油价差 - 走势图



沥青原油价差（沥青-7*原油）：右轴 SHFE沥青 INE原油

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