

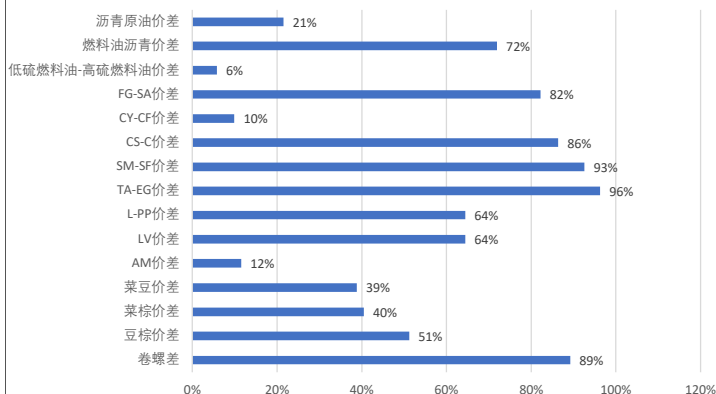
重要商品主力价差套利表现

制作日期

2023年8月31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	3870	热卷 - 螺纹钢价差	157	
	SHFE螺纹钢	元/吨	3713			
黑色系	CZCE锰硅	元/吨	6794	锰硅 - 锰铁 价差	-182	
	CZCE硅铁	元/吨	6976			
农产品	DCE豆油	元/吨	8460	豆油-棕榈油价差	656	
	DCE棕榈油	元/吨	7804			
农产品	CZCE菜油	元/吨	9478	菜油 - 棕榈油价差	1674	
	DCE棕榈油	元/吨	7804			
农产品	CZCE菜油	元/吨	9478	菜油 - 豆油价差	1018	
	DCE豆油	元/吨	8460			
农产品	DCE豆一	元/吨	5267	豆一 - 豆粕价差	1131	
	DCE豆粕	元/吨	4136			
农产品	DCE玉米淀粉	元/吨	3066	玉米淀粉 - 玉米价差	335	
	DCE玉米	元/吨	2731			
农产品	CZCE棉纱	元/吨	23790	棉纱 - 棉花价差	6180	
	CZCE棉花	元/吨	17610			
能化品种	DCE塑料	元/吨	8336	塑料 - PVC价差	2035	
	DCE PVC	元/吨	6301			
能化品种	DCE塑料	元/吨	8336	塑料 - 聚丙烯价差	600	
	DCE聚丙烯	元/吨	7736			
能化品种	CZCE PTA	元/吨	6140	PTA - 乙二醇价差	1989	
	DCE乙二醇	元/吨	4151			
能化品种	CZCE玻璃	元/吨	1716	玻璃 - 纯碱价差	-179	
	CZCE纯碱	元/吨	1895			
能化品种	INE低硫燃料油	元/吨	4420	低硫燃料油-高硫燃料油价差	772	
	SHFE燃油	元/吨	3648			
能化品种	INE低硫燃料油	元/吨	4420	低硫燃料油-沥青价差	664	
	SHFE沥青	元/吨	3756			
能化品种	SHFE沥青	元/吨	3756	沥青-原油价差*7	-756	
	INE原油	元/吨	645			

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）



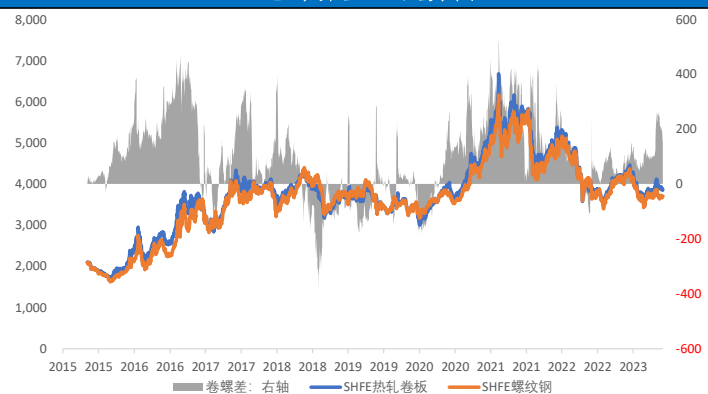
重要商品主力价差套利表现

制作日期

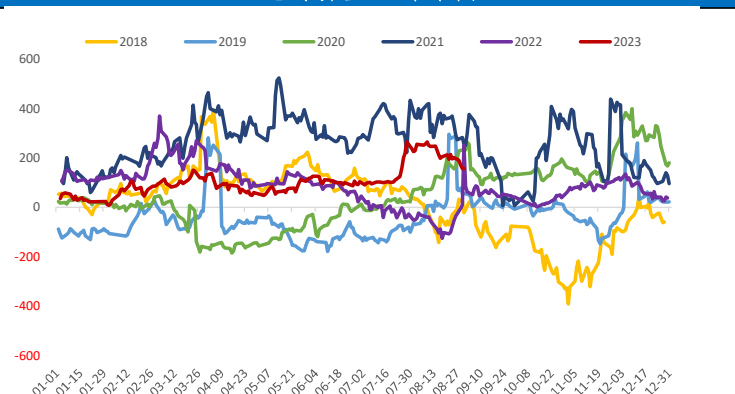
2023年8月31日

商品价差近年以来走势对比

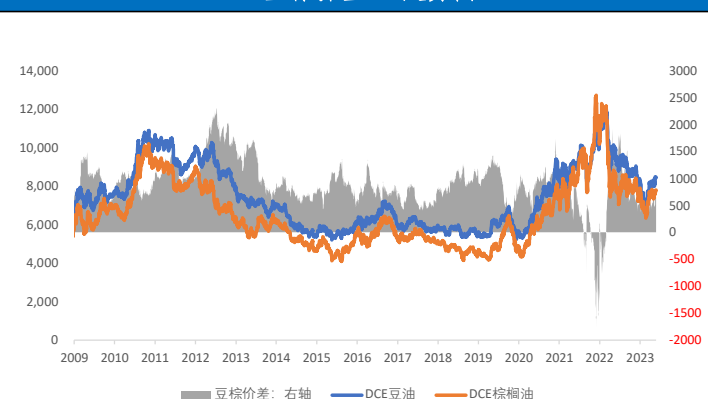
卷螺价差 - 走势图



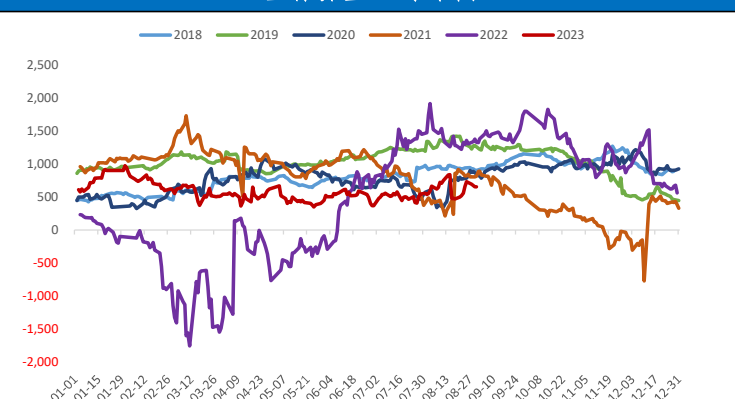
卷螺价差 - 季节图



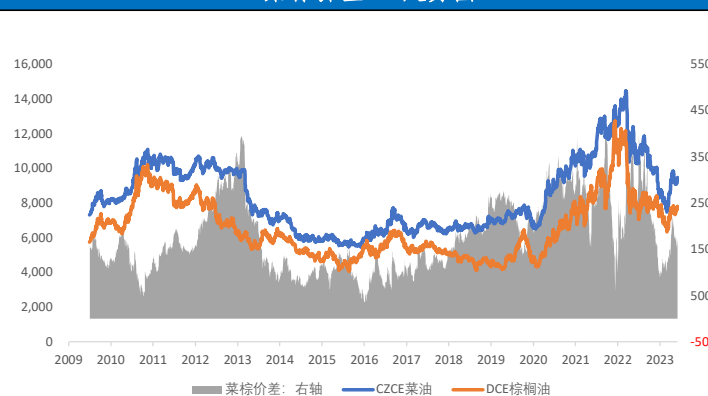
豆棕价差 - 走势图



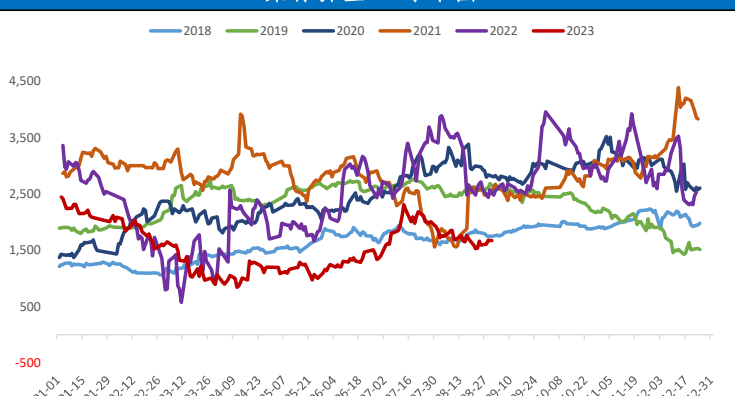
豆棕价差 - 季节图



菜棕价差 - 走势图



菜棕价差 - 季节图

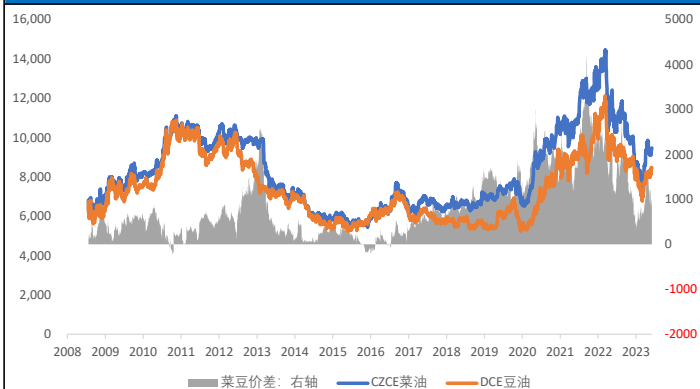


重要商品主力价差套利表现

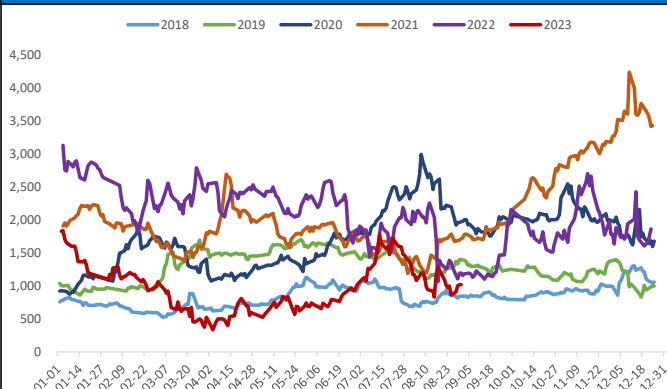
制作日期

2023年8月31日

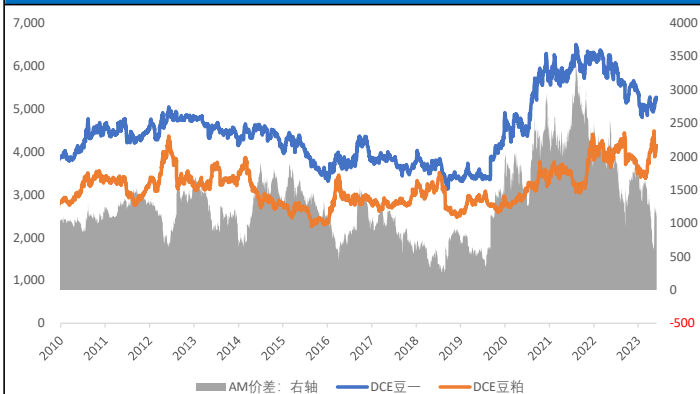
菜豆价差 - 走势图



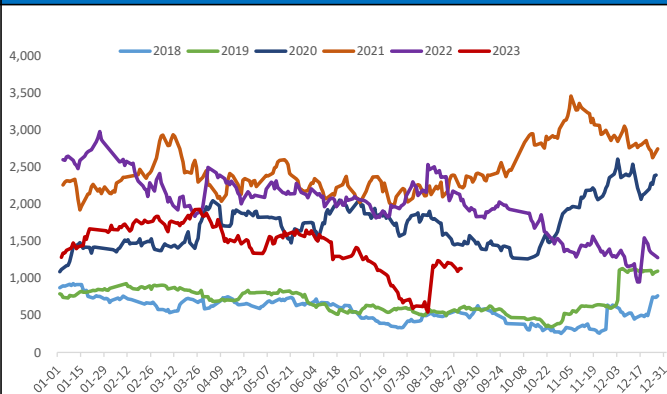
菜豆价差 - 季节图



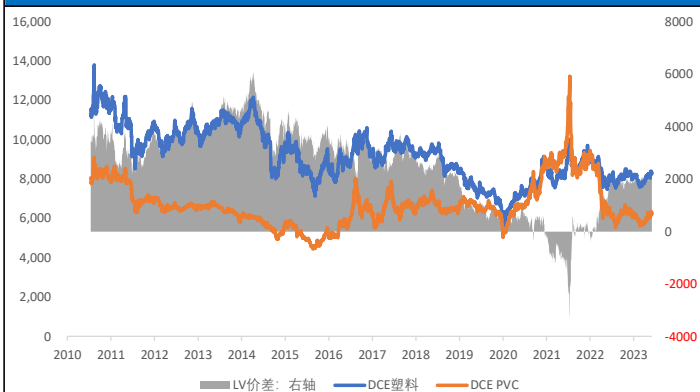
AM价差 - 走势图



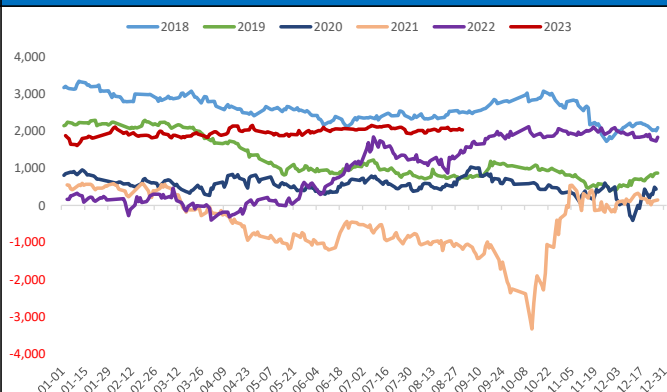
AM价差 - 季节图



LV价差 - 走势图



LV价差 - 季节图

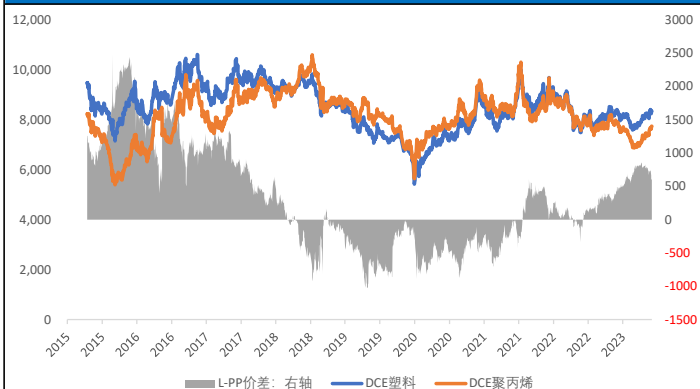


重要商品主力价差套利表现

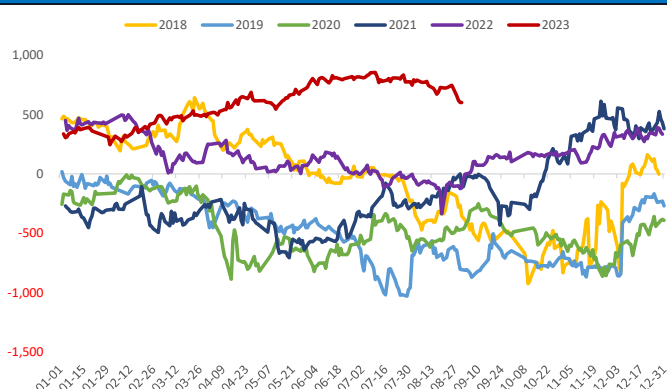
制作日期

2023年8月31日

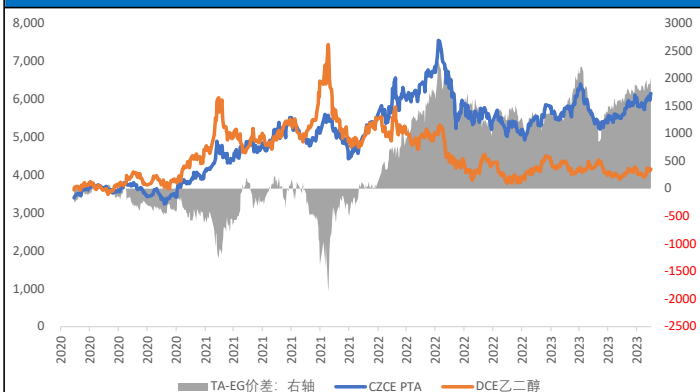
L-PP价差 - 走势图



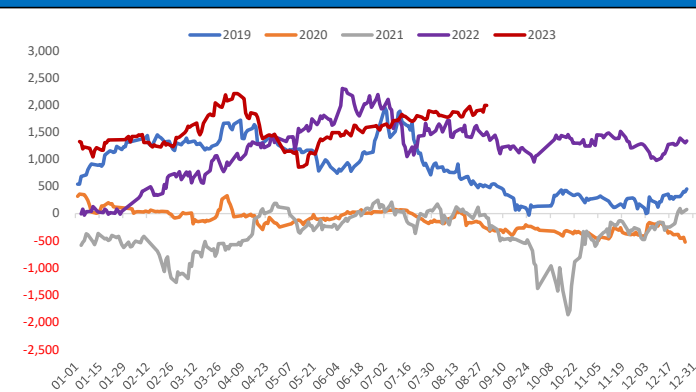
L-PP价差 - 季节图



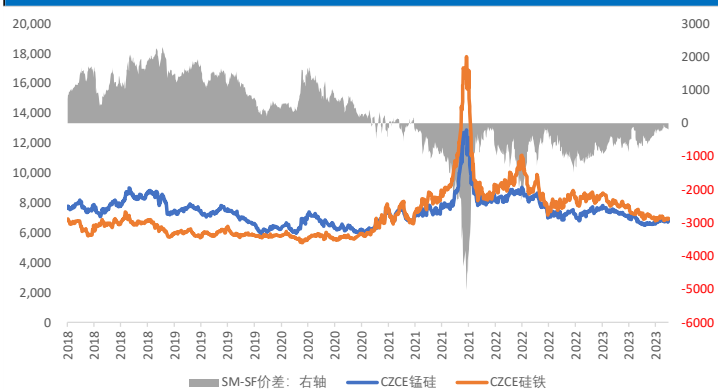
TA-EG价差 - 走势图



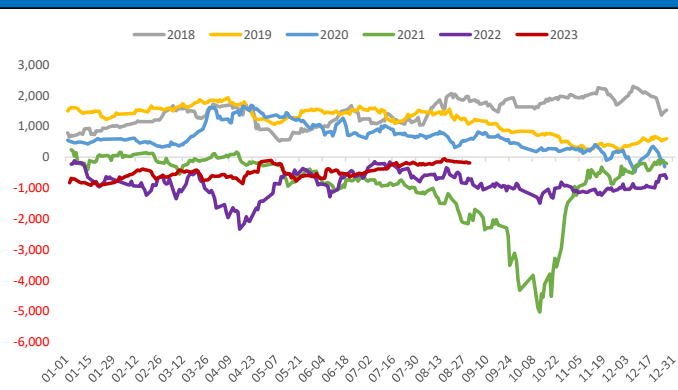
TA-EG价差 - 季节图



SM-SF价差 - 走势图



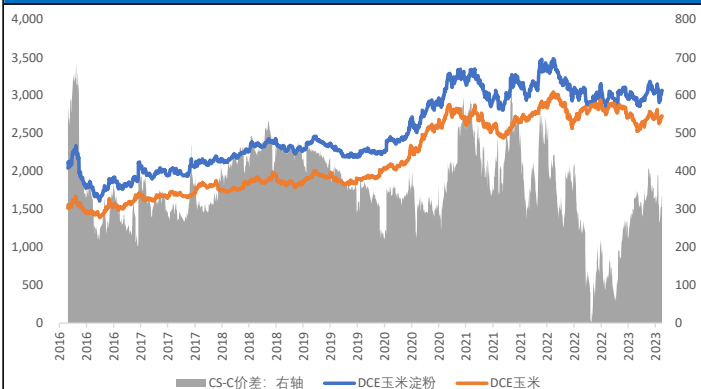
SM-SF价差 - 季节图



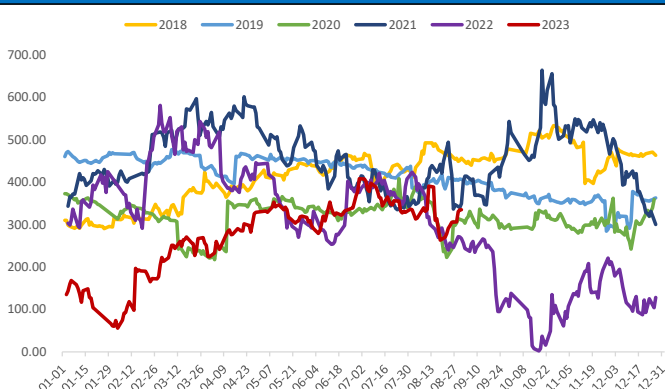
制作日期

2023年8月31日

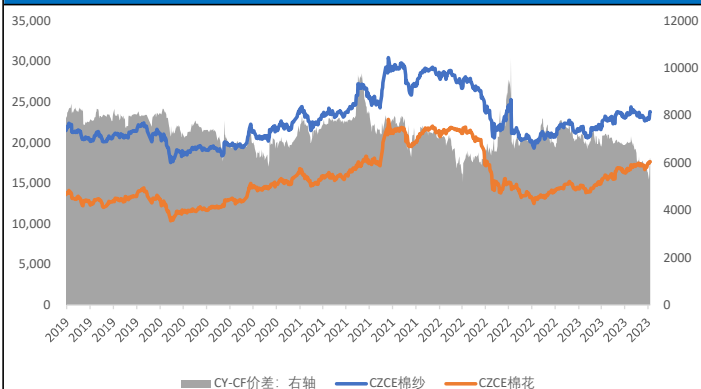
CS-C价差 - 走势图



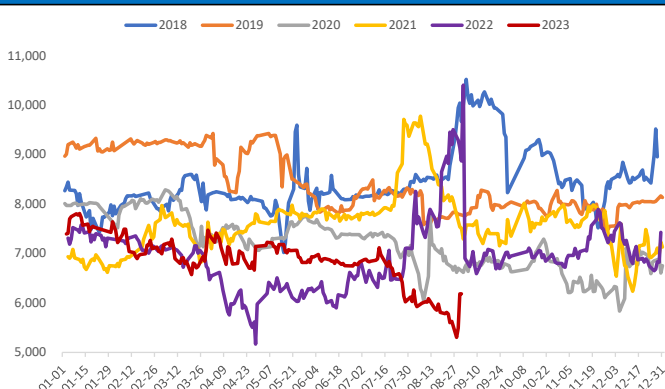
CS-C价差 - 季节图



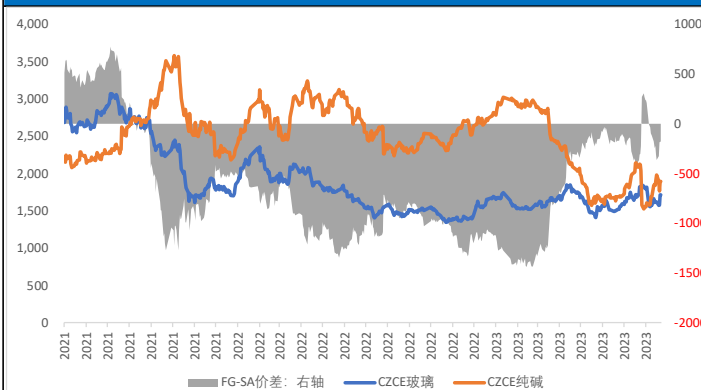
CY-CF价差 - 走势图



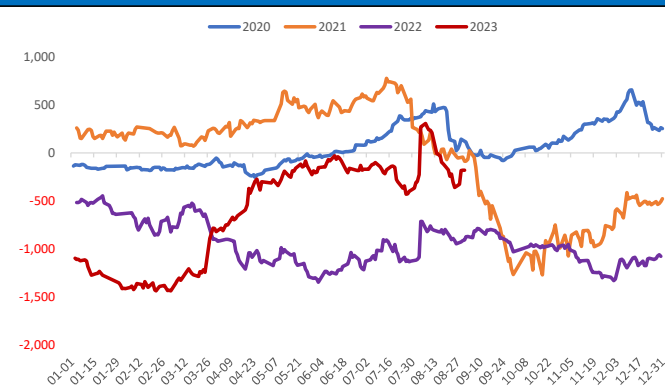
CY-CF价差 - 季节图



FG-SA价差 - 走势图



FG-SA价差 - 季节图



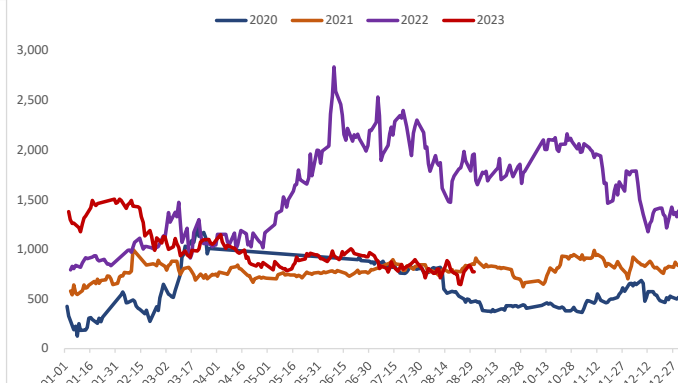
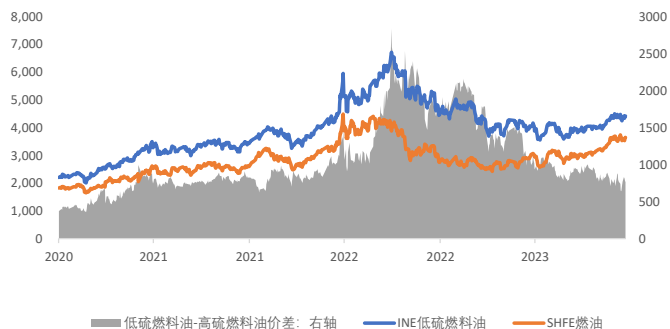
低硫燃料油-高硫燃料油价差 - 走势图

低硫燃料油-高硫燃料油价差 - 季节图

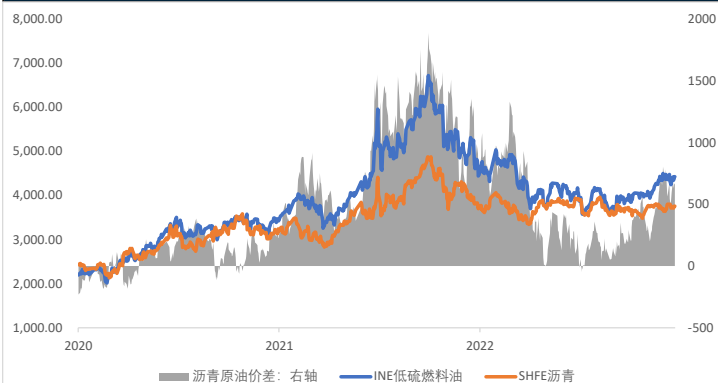
重要商品主力价差套利表现

制作日期

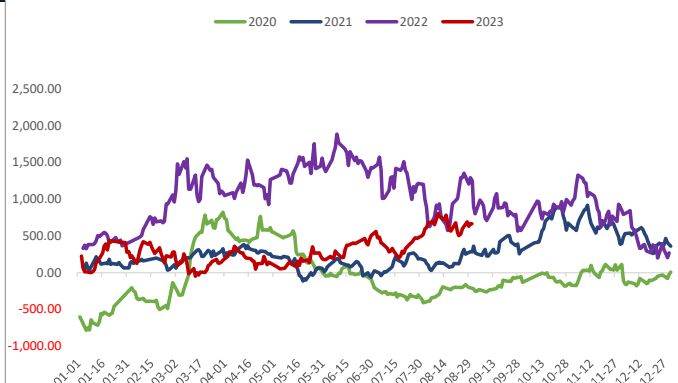
2023年8月31日



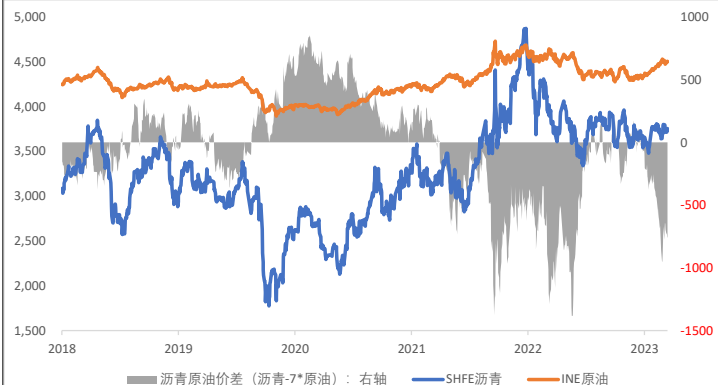
燃料油-沥青价差 - 走势图



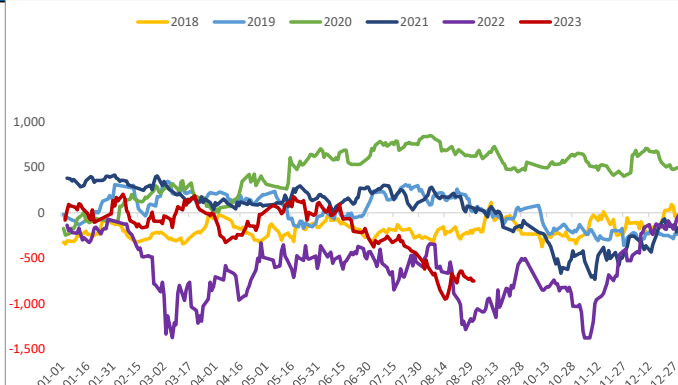
燃料油-沥青价差 - 季节图



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