

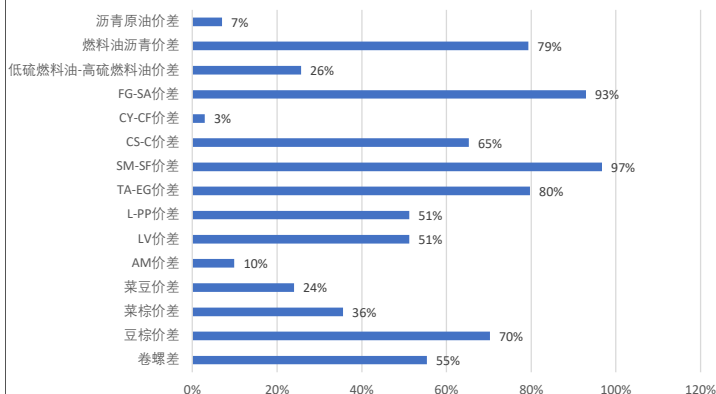
重要商品主力价差套利表现

制作日期

2023年9月12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	3851	热卷 - 螺纹钢价差	92	
	SHFE螺纹钢	元/吨	3759			
黑色系	CZCE锰硅	元/吨	7160	锰硅 - 锰铁 价差	-138	
	CZCE硅铁	元/吨	7298			
农产品	DCE豆油	元/吨	8258	豆油-棕榈油价差	812	
	DCE棕榈油	元/吨	7446			
农产品	CZCE菜油	元/吨	9009	菜油 - 棕榈油价差	1563	
	DCE棕榈油	元/吨	7446			
农产品	CZCE菜油	元/吨	9009	菜油 - 豆油价差	751	
	DCE豆油	元/吨	8258			
农产品	DCE豆一	元/吨	5157	豆一 - 豆粕价差	1054	
	DCE豆粕	元/吨	4103			
农产品	DCE玉米淀粉	元/吨	2969	玉米淀粉 - 玉米价差	301	
	DCE玉米	元/吨	2668			
农产品	CZCE棉纱	元/吨	22950	棉纱 - 棉花价差	5765	
	CZCE棉花	元/吨	17185			
能化品种	DCE塑料	元/吨	8354	塑料 - PVC价差	1892	
	DCE PVC	元/吨	6462			
能化品种	DCE塑料	元/吨	8354	塑料 - 聚丙烯价差	489	
	DCE聚丙烯	元/吨	7865			
能化品种	CZCE PTA	元/吨	6114	PTA - 乙二醇价差	1781	
	DCE乙二醇	元/吨	4333			
能化品种	CZCE玻璃	元/吨	1748	玻璃 - 纯碱价差	-89	
	CZCE纯碱	元/吨	1837			
能化品种	INE低硫燃料油	元/吨	4618	低硫燃料油-高硫燃料油价差	878	
	SHFE燃油	元/吨	3740			
能化品种	INE低硫燃料油	元/吨	4618	低硫燃料油-沥青价差	760	
	SHFE沥青	元/吨	3858			
能化品种	SHFE沥青	元/吨	3858	沥青-原油价差*7	-947	
	INE原油	元/吨	686			

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)



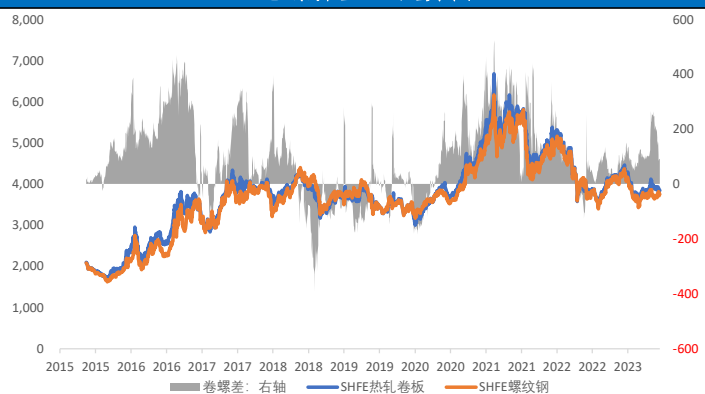
重要商品主力价差套利表现

制作日期

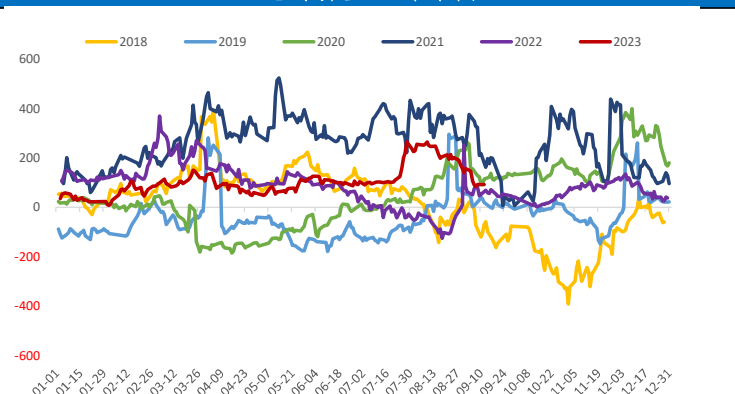
2023年9月12日

商品价差近年以来走势对比

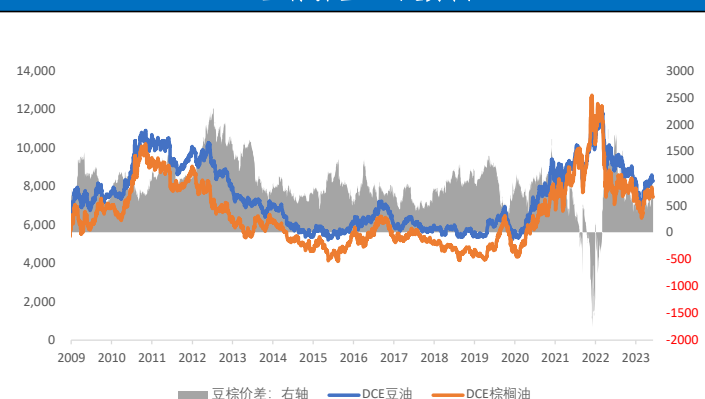
卷螺价差 - 走势图



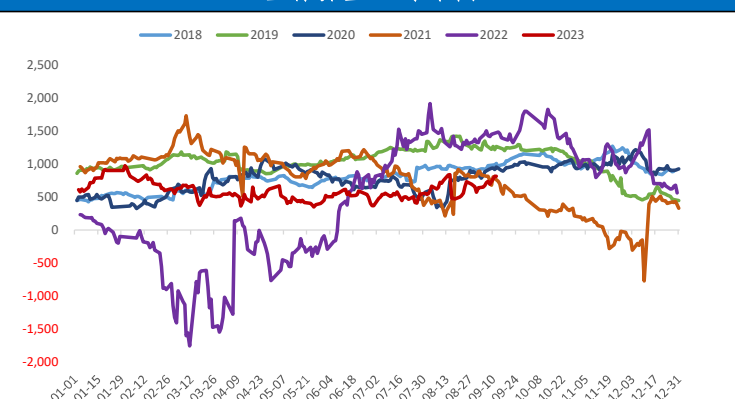
卷螺价差 - 季节图



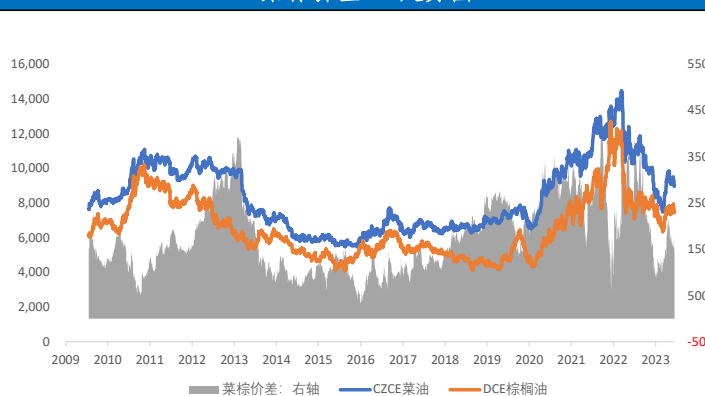
豆棕价差 - 走势图



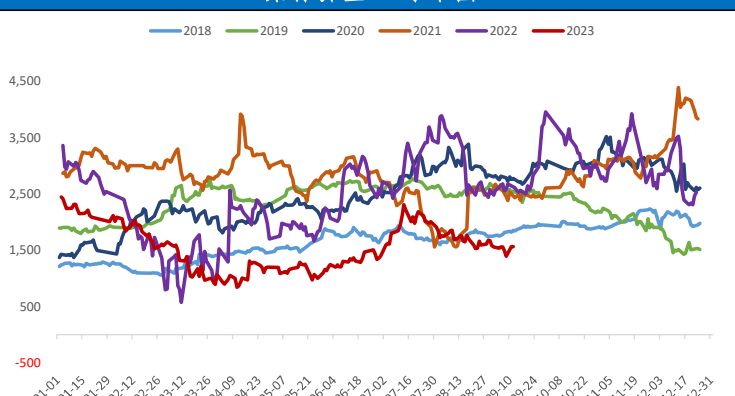
豆棕价差 - 季节图



菜棕价差 - 走势图



菜棕价差 - 季节图

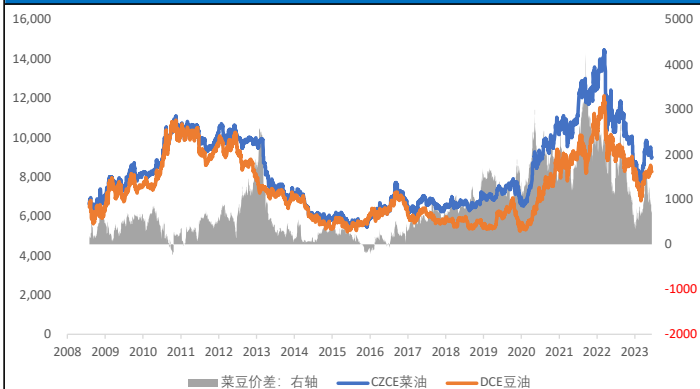


重要商品主力价差套利表现

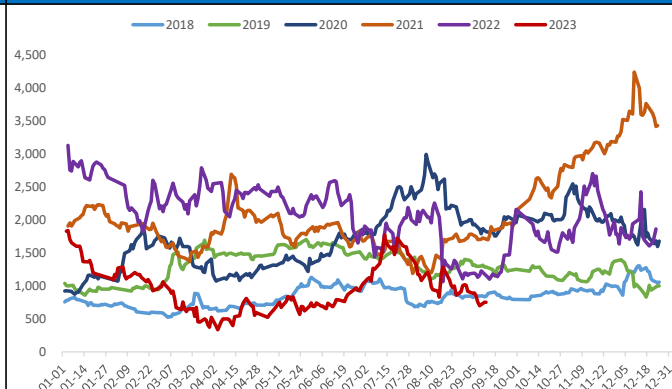
制作日期

2023年9月12日

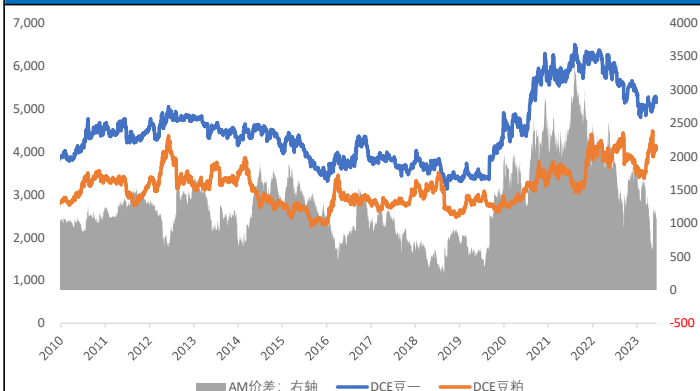
菜豆价差 - 走势图



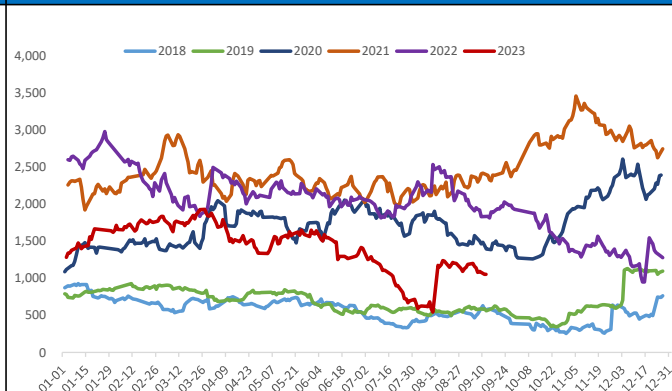
菜豆价差 - 季节图



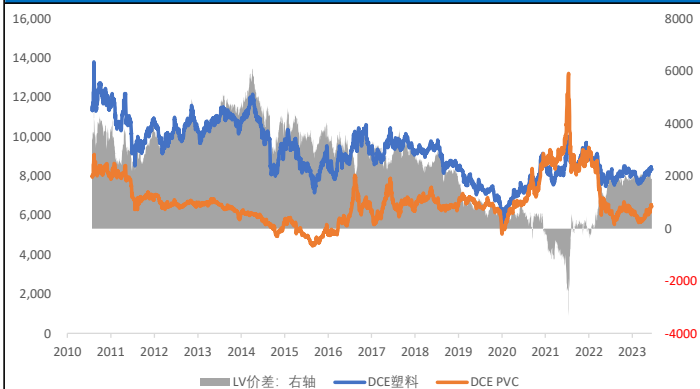
AM价差 - 走势图



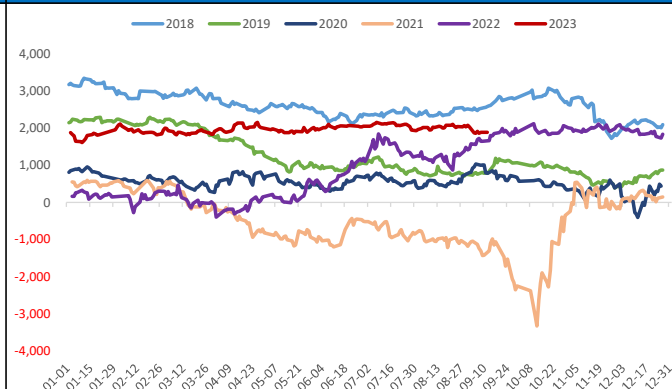
AM价差 - 季节图



LV价差 - 走势图



LV价差 - 季节图

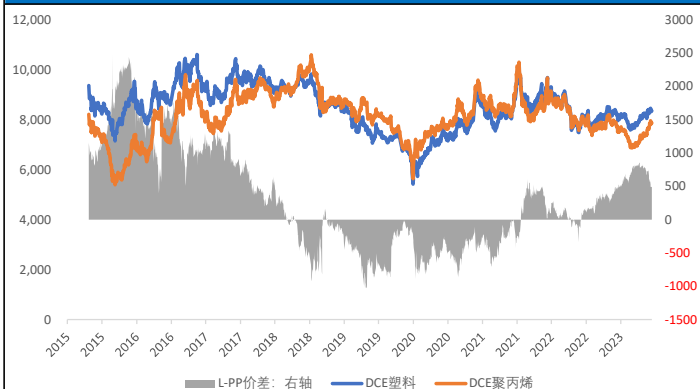


重要商品主力价差套利表现

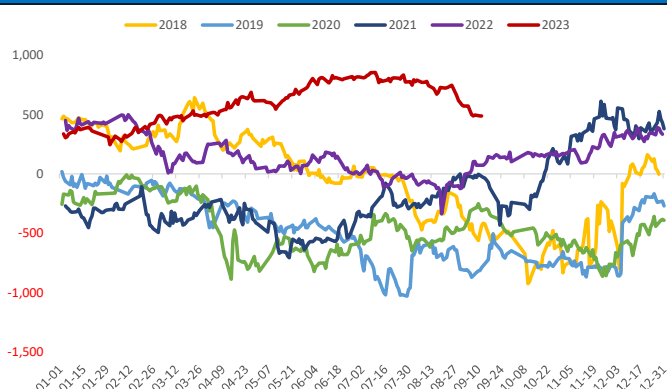
制作日期

2023年9月12日

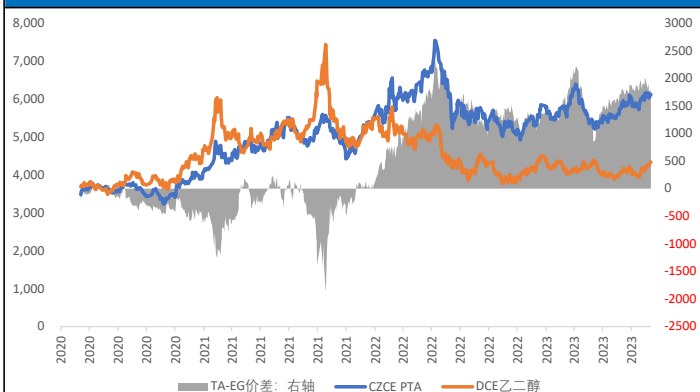
L-PP价差 - 走势图



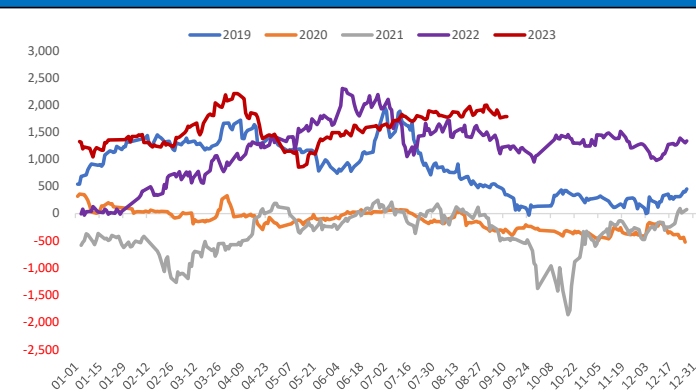
L-PP价差 - 季节图



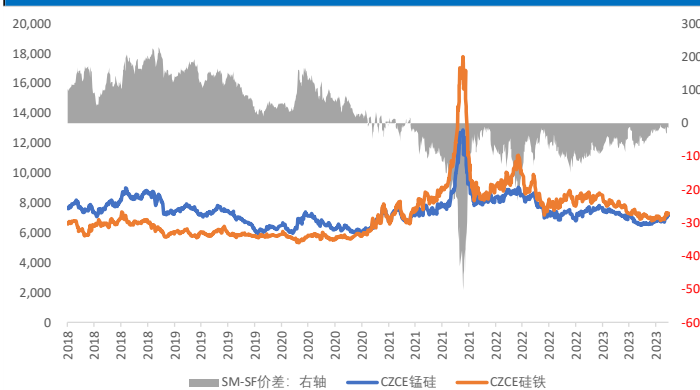
TA-EG价差 - 走势图



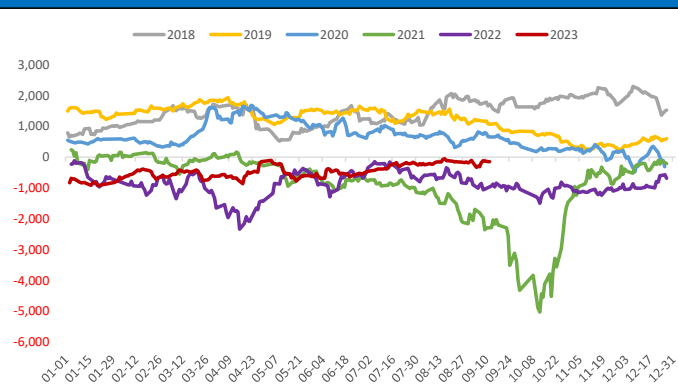
TA-EG价差 - 季节图



SM-SF价差 - 走势图



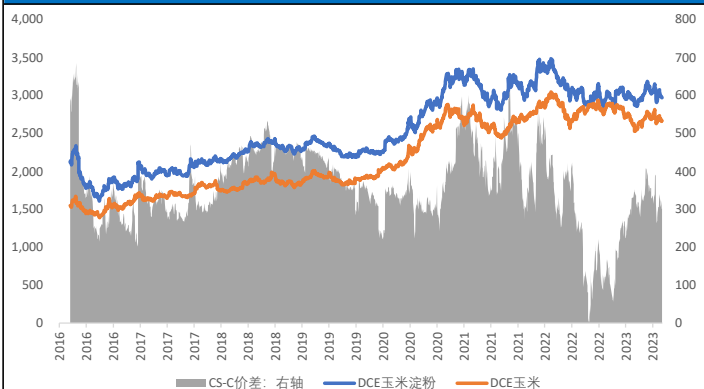
SM-SF价差 - 季节图



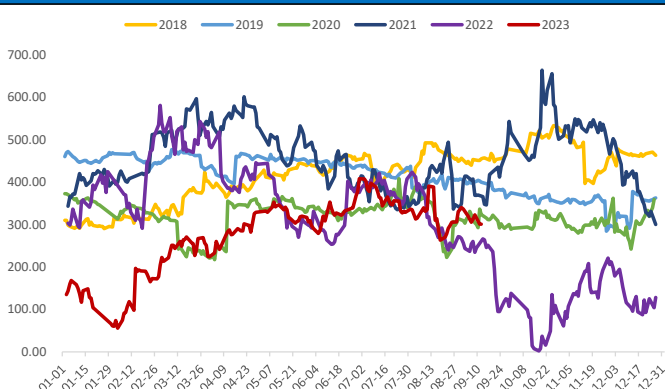
制作日期

2023年9月12日

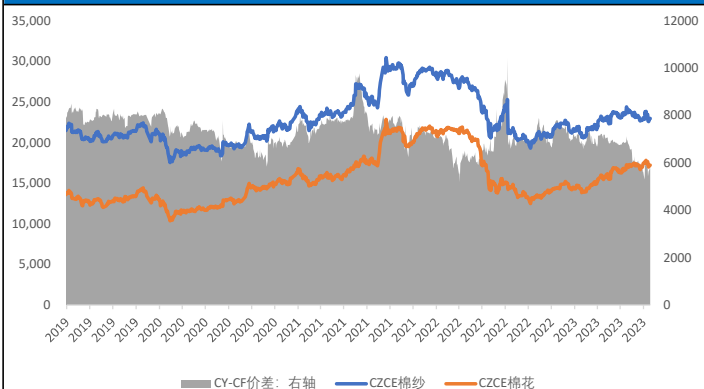
CS-C价差 - 走势图



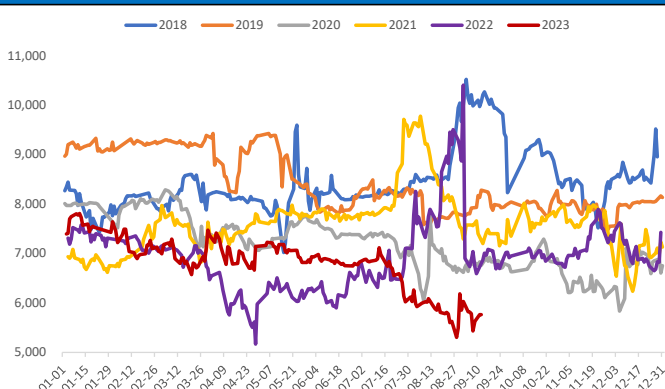
CS-C价差 - 季节图



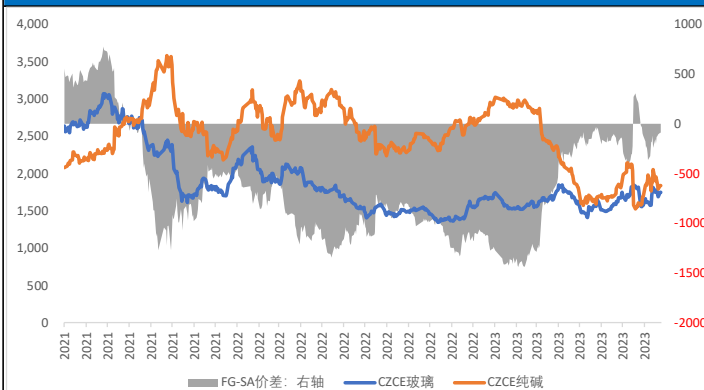
CY-CF价差 - 走势图



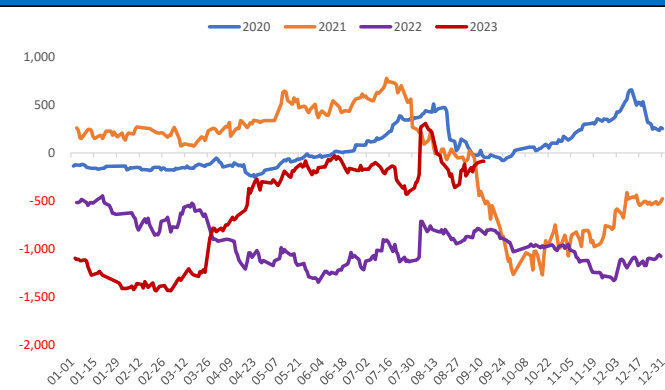
CY-CF价差 - 季节图



FG-SA价差 - 走势图



FG-SA价差 - 季节图

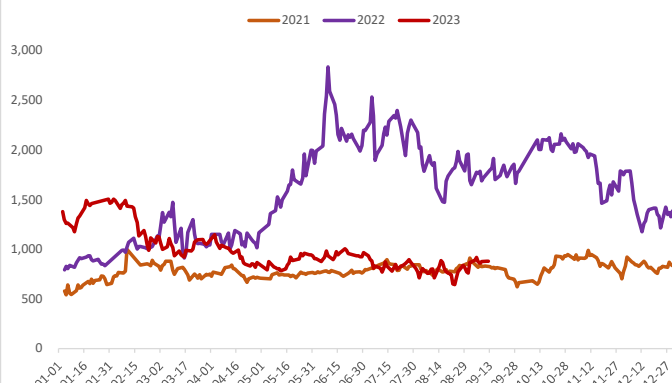


低硫燃料油-高硫燃料油价差 - 走势图

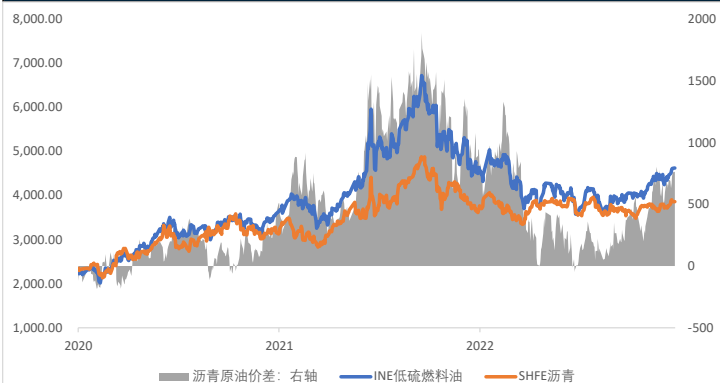
低硫燃料油-高硫燃料油价差 - 季节图

制作日期

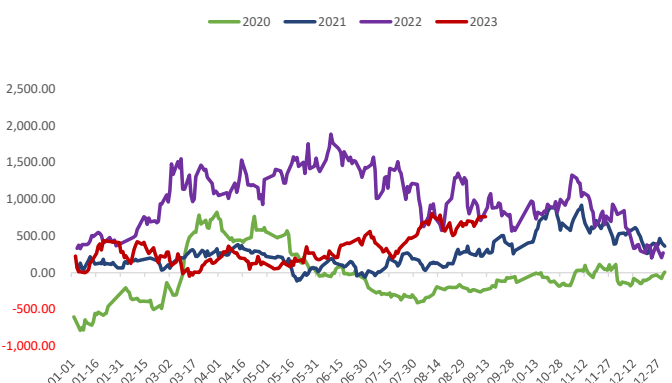
2023年9月12日



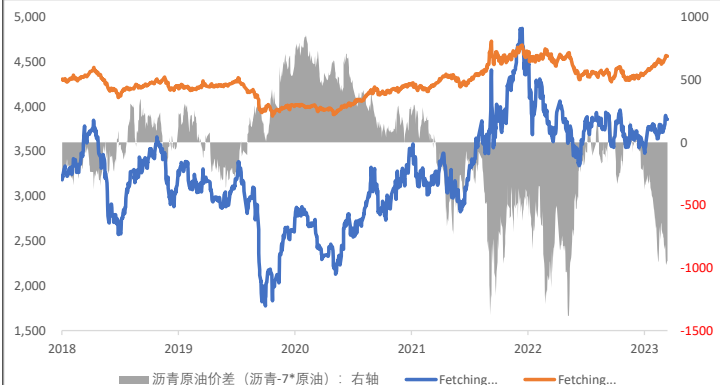
燃料油-沥青价差 - 走势图



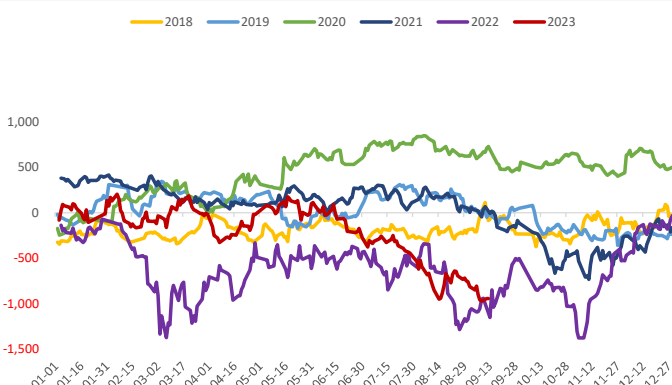
燃料油-沥青价差 - 季节图



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