

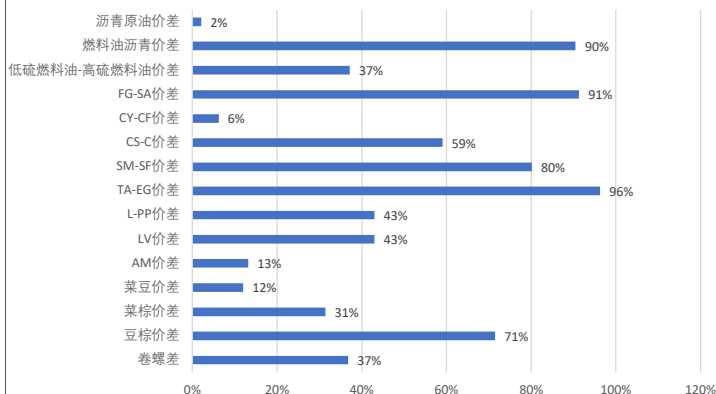
## 重要商品主力价差套利表现

制作日期

2023年9月15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  | 3868  | 热卷 - 螺纹钢价差    | 74    |            |
|      | SHFE螺纹钢  | 元/吨  | 3794  |               |       |            |
| 黑色系  | CZCE锰硅   | 元/吨  | 7082  | 锰硅 - 锰铁 价差    | -298  |            |
|      | CZCE硅铁   | 元/吨  | 7380  |               |       |            |
| 农产品  | DCE豆油    | 元/吨  | 8290  | 豆油-棕榈油价差      | 818   |            |
|      | DCE棕榈油   | 元/吨  | 7472  |               |       |            |
| 农产品  | CZCE菜油   | 元/吨  | 8927  | 菜油 - 棕榈油价差    | 1455  |            |
|      | DCE棕榈油   | 元/吨  | 7472  |               |       |            |
| 农产品  | CZCE菜油   | 元/吨  | 8927  | 菜油 - 豆油价差     | 637   |            |
|      | DCE豆油    | 元/吨  | 8290  |               |       |            |
| 农产品  | DCE豆一    | 元/吨  | 5103  | 豆一 - 豆粕价差     | 1124  |            |
|      | DCE豆粕    | 元/吨  | 3979  |               |       |            |
| 农产品  | DCE玉米淀粉  | 元/吨  | 2948  | 玉米淀粉 - 玉米价差   | 284   |            |
|      | DCE玉米    | 元/吨  | 2664  |               |       |            |
| 农产品  | CZCE棉纱   | 元/吨  | 22935 | 棉纱 - 棉花价差     | 5810  |            |
|      | CZCE棉花   | 元/吨  | 17125 |               |       |            |
| 能化品种 | DCE塑料    | 元/吨  | 8349  | 塑料 - PVC价差    | 1954  |            |
|      | DCE PVC  | 元/吨  | 6395  |               |       |            |
| 能化品种 | DCE塑料    | 元/吨  | 8349  | 塑料 - 聚丙烯价差    | 392   |            |
|      | DCE聚丙烯   | 元/吨  | 7957  |               |       |            |
| 能化品种 | CZCE PTA | 元/吨  | 6354  | PTA - 乙二醇价差   | 2008  |            |
|      | DCE乙二醇   | 元/吨  | 4346  |               |       |            |
| 能化品种 | CZCE玻璃   | 元/吨  | 1714  | 玻璃 - 纯碱价差     | -99   |            |
|      | CZCE纯碱   | 元/吨  | 1813  |               |       |            |
| 能化品种 | INE低硫燃料油 | 元/吨  | 4744  | 低硫燃料油-高硫燃料油价差 | 932   |            |
|      | SHFE燃油   | 元/吨  | 3812  |               |       |            |
| 能化品种 | INE低硫燃料油 | 元/吨  | 4744  | 低硫燃料油-沥青价差    | 895   |            |
|      | SHFE沥青   | 元/吨  | 3849  |               |       |            |
| 能化品种 | SHFE沥青   | 元/吨  | 3849  | 沥青-原油价差*7     | -1249 |            |
|      | INE原油    | 元/吨  | 728   |               |       |            |

主要商品期货最新主力价差所处近一年（365天）历史百分位

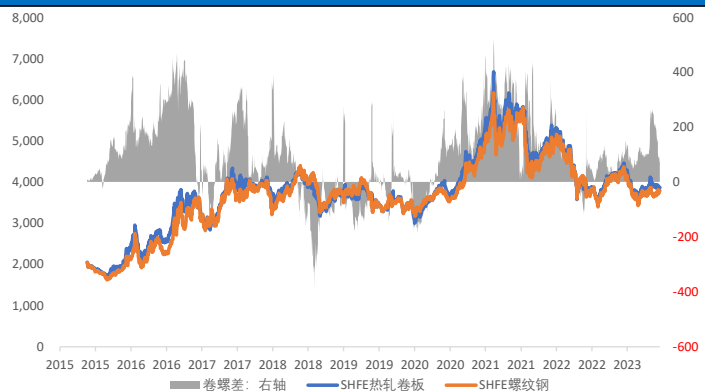


当前主要商品期货最新主力价差近五年状态（2018-2023）

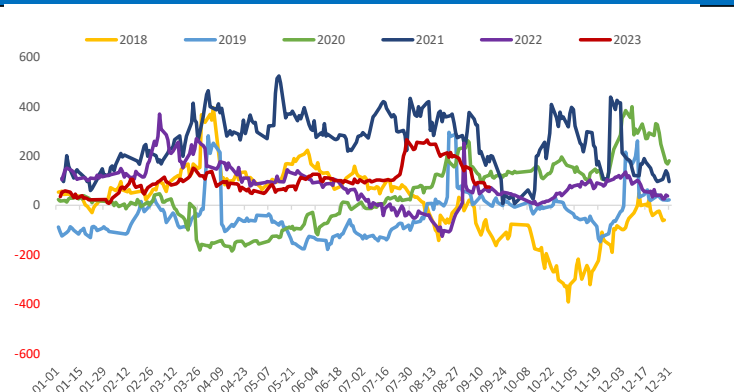


## 商品价差近年以来走势对比

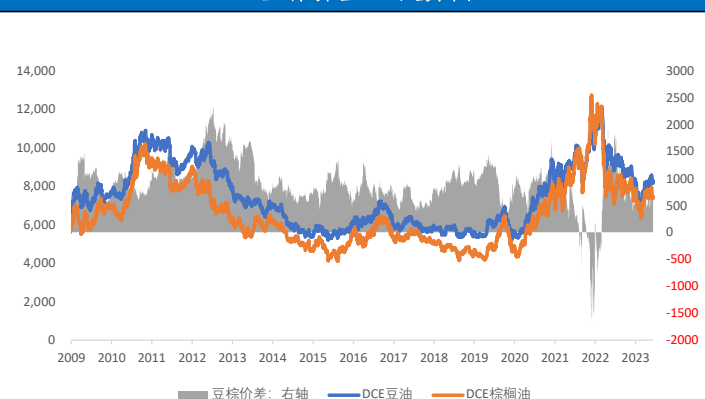
卷螺价差 - 走势图



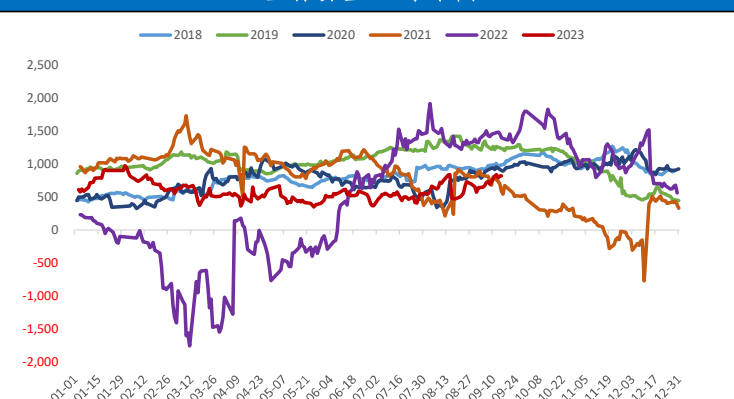
卷螺价差 - 季节图



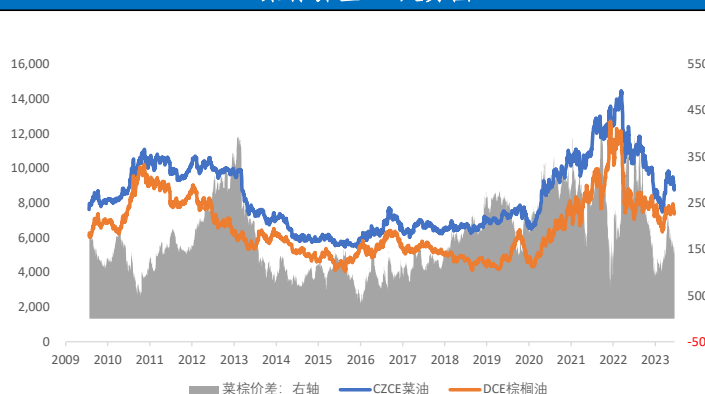
豆棕价差 - 走势图



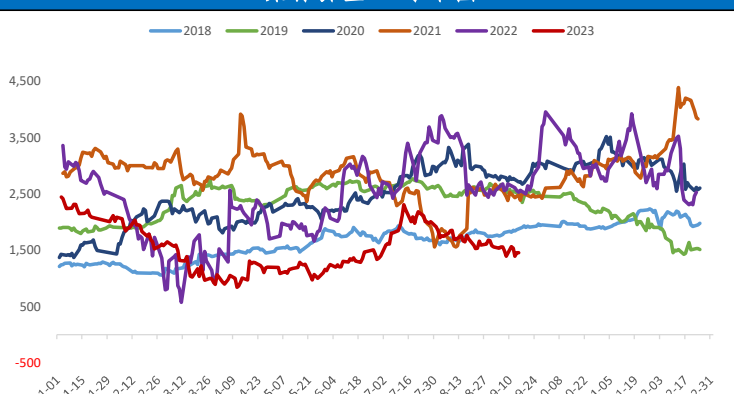
豆棕价差 - 季节图



菜棕价差 - 走势图



菜棕价差 - 季节图

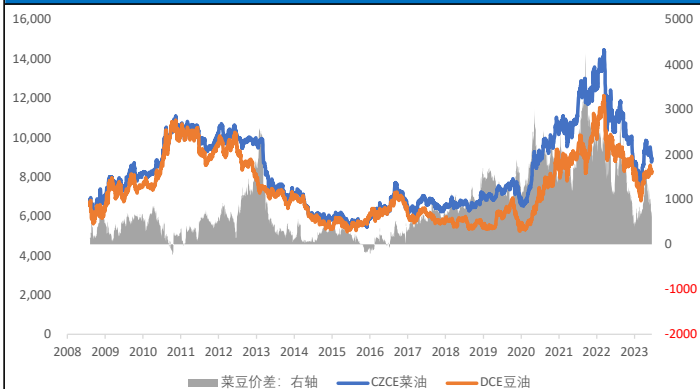


# 重要商品主力价差套利表现

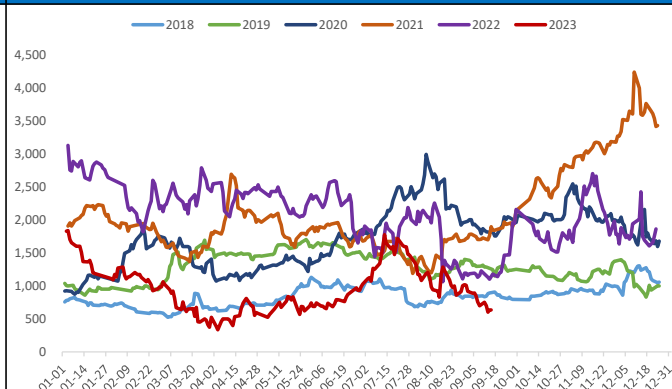
制作日期

2023年9月15日

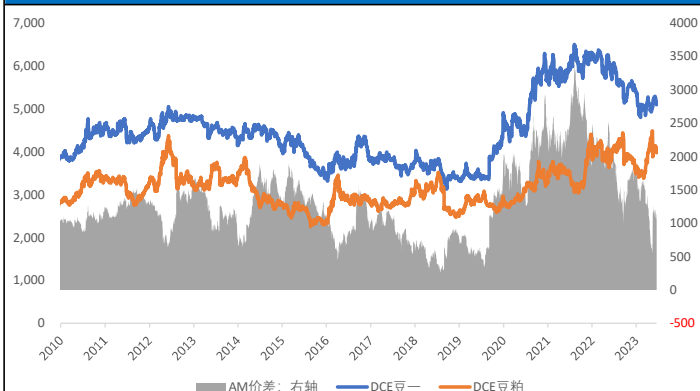
菜豆价差 - 走势图



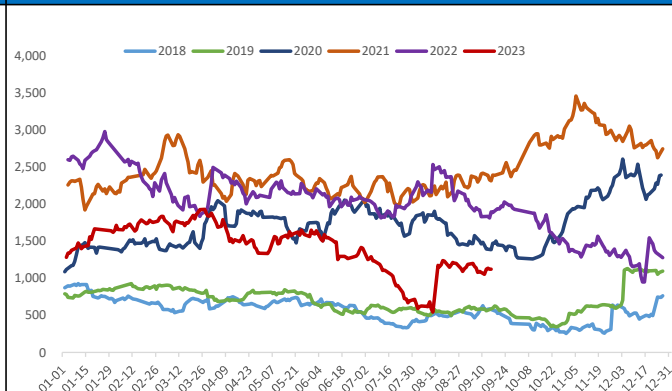
菜豆价差 - 季节图



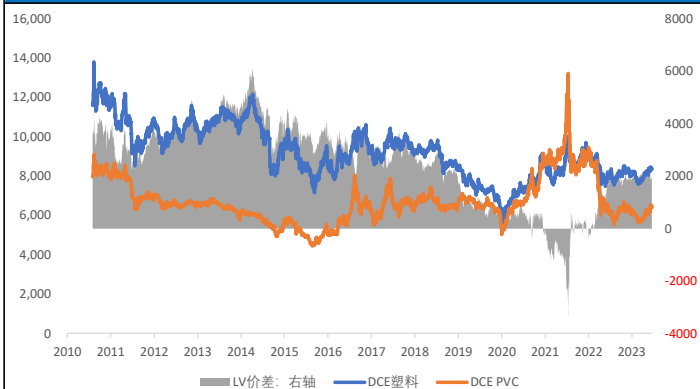
AM价差 - 走势图



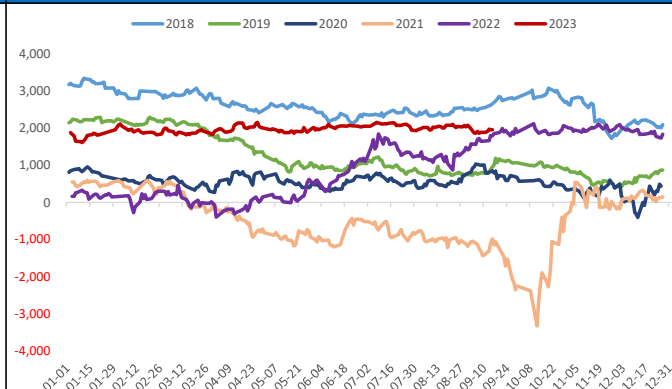
AM价差 - 季节图



LV价差 - 走势图



LV价差 - 季节图

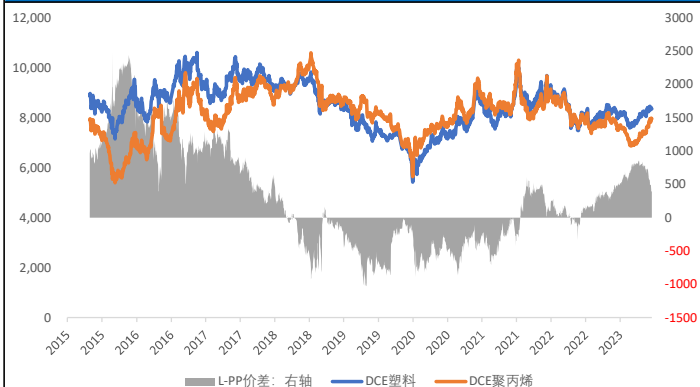


# 重要商品主力价差套利表现

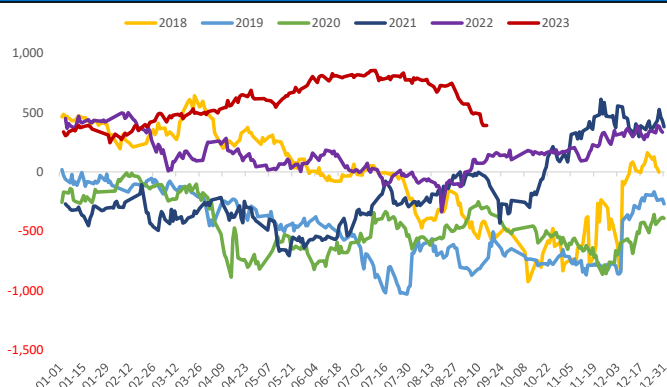
制作日期

2023年9月15日

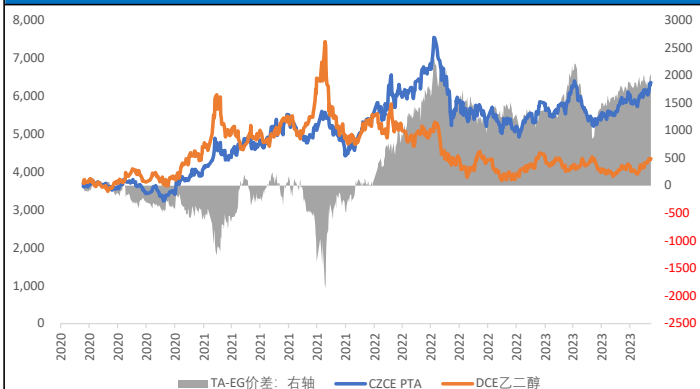
L-PP价差 - 走势图



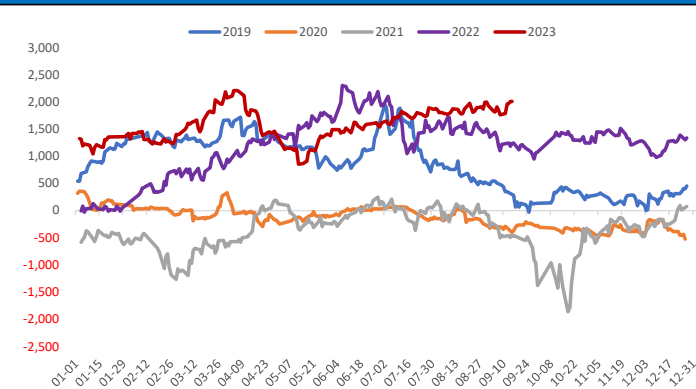
L-PP价差 - 季节图



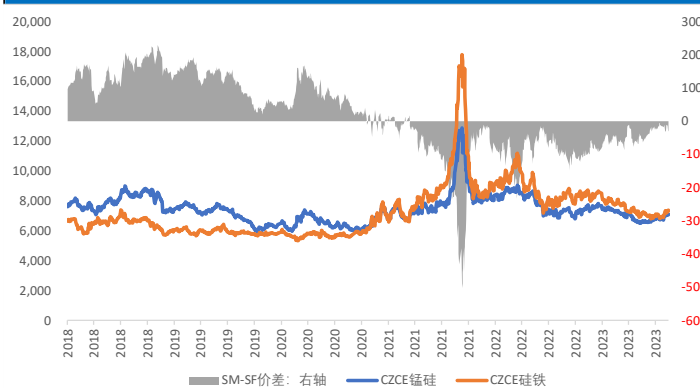
TA-EG价差 - 走势图



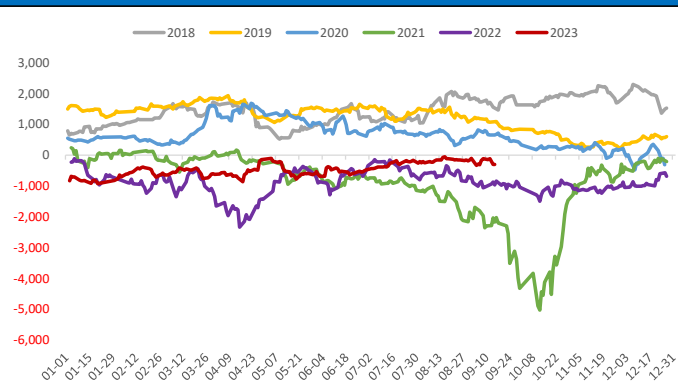
TA-EG价差 - 季节图



SM-SF价差 - 走势图



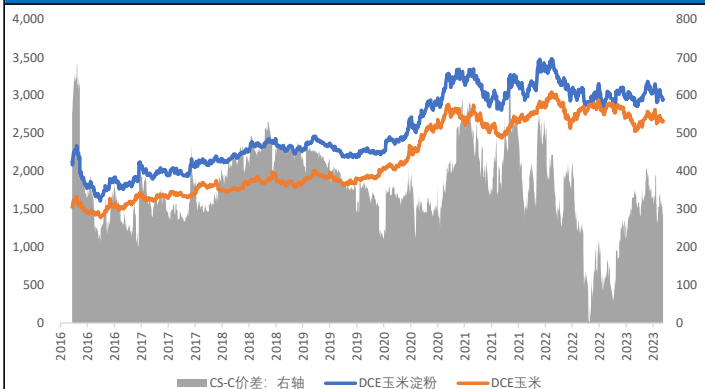
SM-SF价差 - 季节图



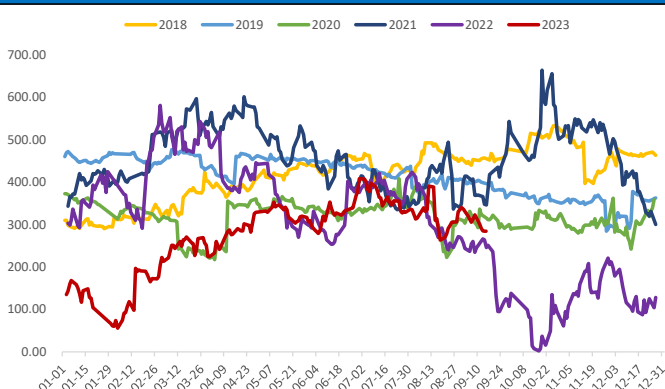
制作日期

2023年9月15日

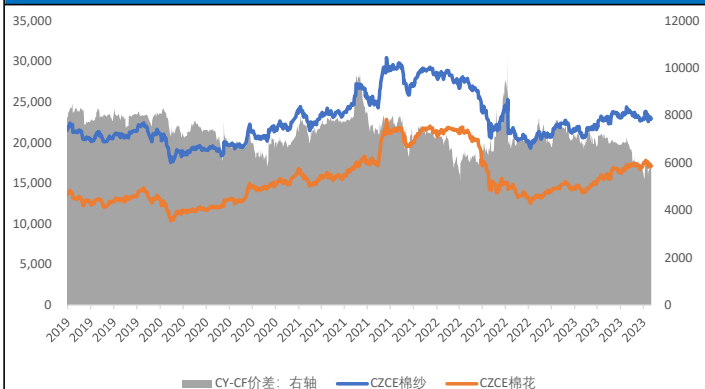
CS-C价差 - 走势图



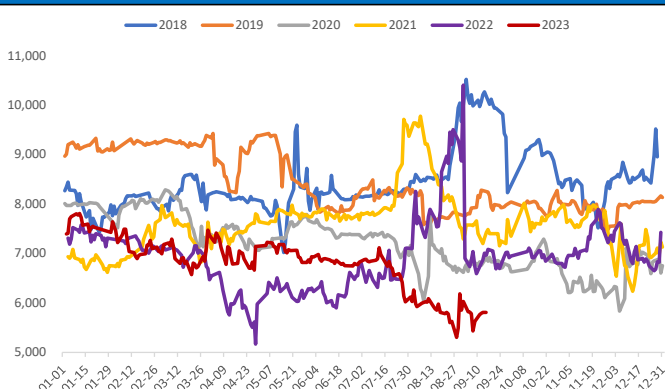
CS-C价差 - 季节图



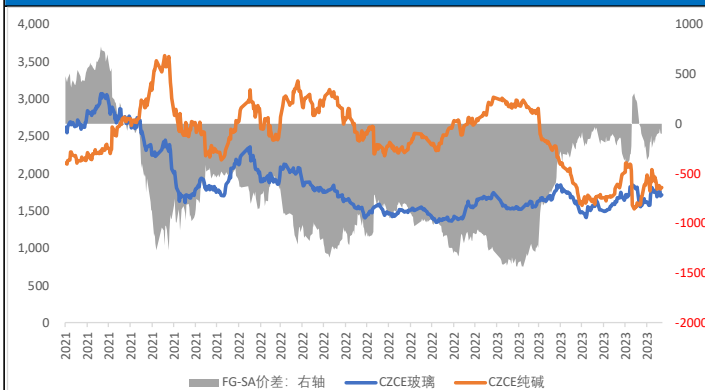
CY-CF价差 - 走势图



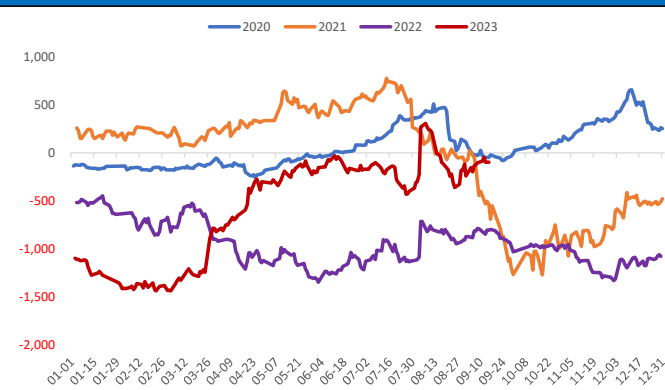
CY-CF价差 - 季节图



FG-SA价差 - 走势图



FG-SA价差 - 季节图

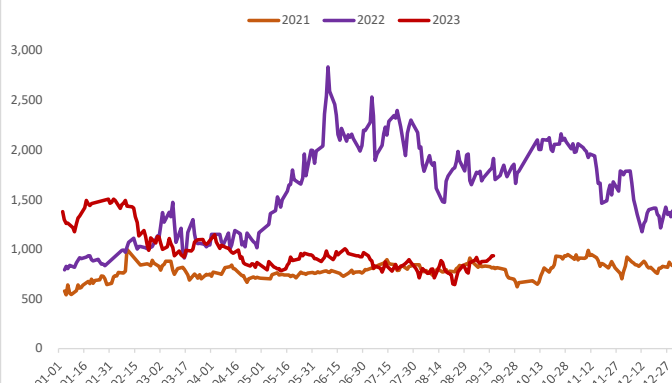


低硫燃料油-高硫燃料油价差 - 走势图

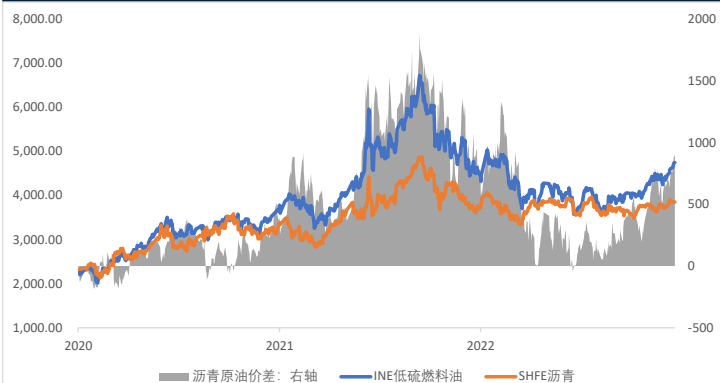
低硫燃料油-高硫燃料油价差 - 季节图

制作日期

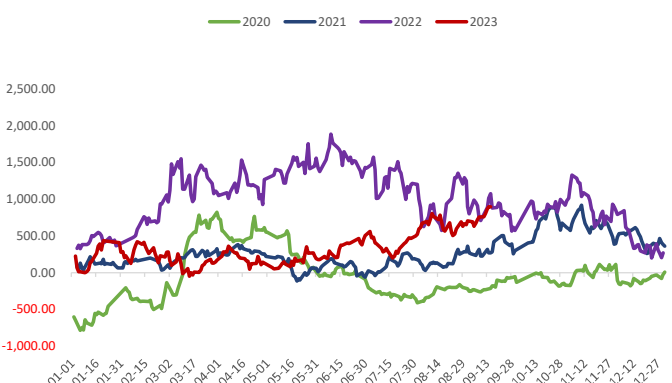
2023年9月15日



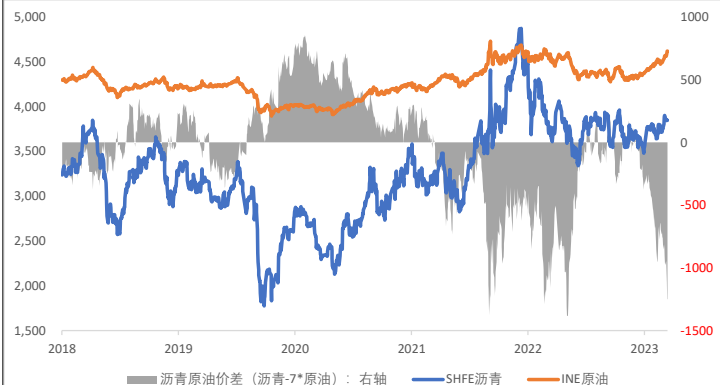
燃料油-沥青价差 - 走势图



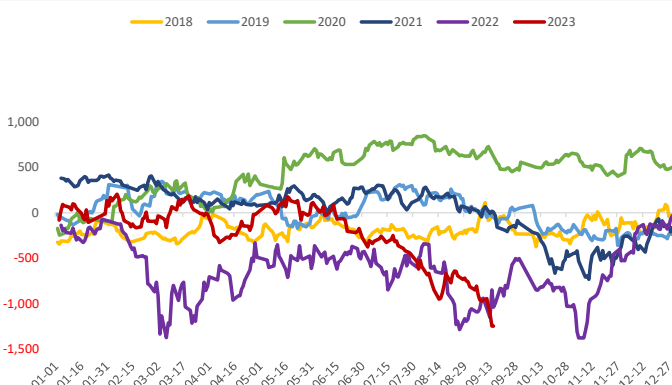
燃料油-沥青价差 - 季节图



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