
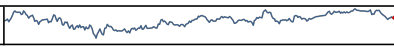



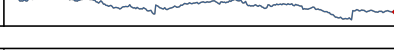


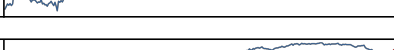

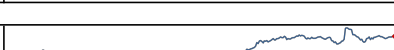
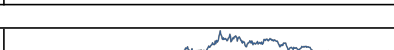
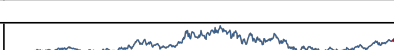
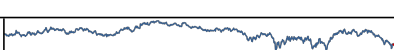



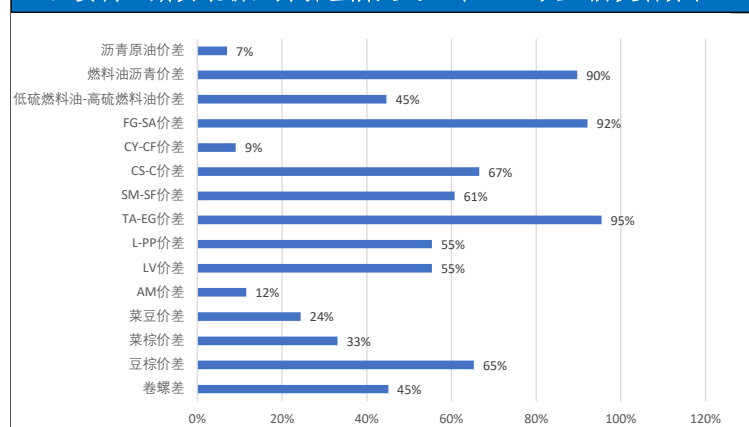
# 重要商品主力价差套利表现

制作日期

2023年9月28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  | 3767  | 热卷 - 螺纹钢价差    | 85   |    |
|      | SHFE螺纹钢  | 元/吨  | 3682  |               |      |   |
| 黑色系  | CZCE锰硅   | 元/吨  | 7026  | 锰硅 - 锰铁 价差    | -502 |    |
|      | CZCE硅铁   | 元/吨  | 7528  |               |      |   |
| 农产品  | DCE豆油    | 元/吨  | 8052  | 豆油-棕榈油价差      | 732  |    |
|      | DCE棕榈油   | 元/吨  | 7320  |               |      |   |
| 农产品  | CZCE菜油   | 元/吨  | 8758  | 菜油 - 棕榈油价差    | 1438 |    |
|      | DCE棕榈油   | 元/吨  | 7320  |               |      |   |
| 农产品  | CZCE菜油   | 元/吨  | 8758  | 菜油 - 豆油价差     | 706  |    |
|      | DCE豆油    | 元/吨  | 8052  |               |      |   |
| 农产品  | DCE豆一    | 元/吨  | 5089  | 豆一 - 豆粕价差     | 1083 |    |
|      | DCE豆粕    | 元/吨  | 4006  |               |      |   |
| 农产品  | DCE玉米淀粉  | 元/吨  | 2919  | 玉米淀粉 - 玉米价差   | 304  |    |
|      | DCE玉米    | 元/吨  | 2615  |               |      |   |
| 农产品  | CZCE棉纱   | 元/吨  | 23310 | 棉纱 - 棉花价差     | 5880 |    |
|      | CZCE棉花   | 元/吨  | 17430 |               |      |   |
| 能化品种 | DCE塑料    | 元/吨  | 8219  | 塑料 - PVC价差    | 2102 |    |
|      | DCE PVC  | 元/吨  | 6117  |               |      |   |
| 能化品种 | DCE塑料    | 元/吨  | 8219  | 塑料 - 聚丙烯价差    | 503  |   |
|      | DCE聚丙烯   | 元/吨  | 7716  |               |      |   |
| 能化品种 | CZCE PTA | 元/吨  | 6146  | PTA - 乙二醇价差   | 2007 |  |
|      | DCE乙二醇   | 元/吨  | 4139  |               |      |   |
| 能化品种 | CZCE玻璃   | 元/吨  | 1693  | 玻璃 - 纯碱价差     | -91  |  |
|      | CZCE纯碱   | 元/吨  | 1784  |               |      |   |
| 能化品种 | INE低硫燃料油 | 元/吨  | 4792  | 低硫燃料油-高硫燃料油价差 | 972  |  |
|      | SHFE燃油   | 元/吨  | 3820  |               |      |   |
| 能化品种 | INE低硫燃料油 | 元/吨  | 4792  | 低硫燃料油-沥青价差    | 861  |  |
|      | SHFE沥青   | 元/吨  | 3931  |               |      |   |
| 能化品种 | SHFE沥青   | 元/吨  | 3931  | 沥青-原油价差*7     | -978 |  |
|      | INE原油    | 元/吨  | 701   |               |      |   |

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）



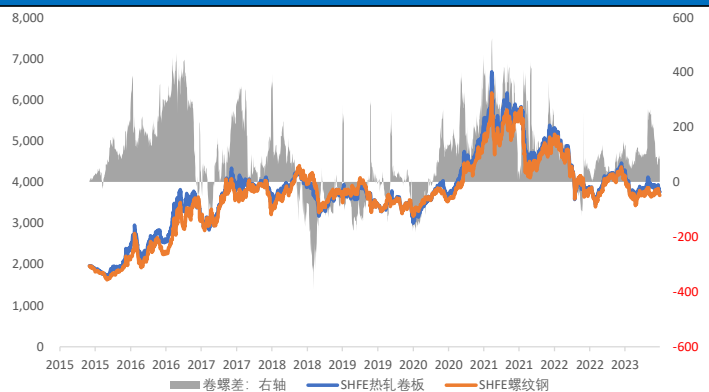
## 重要商品主力价差套利表现

制作日期

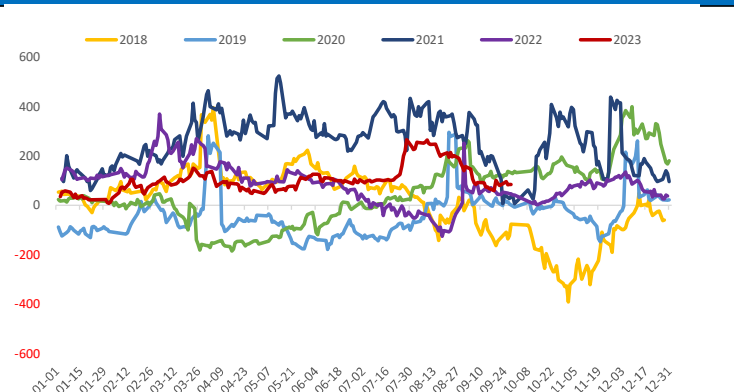
2023年9月28日

## 商品价差近年以来走势对比

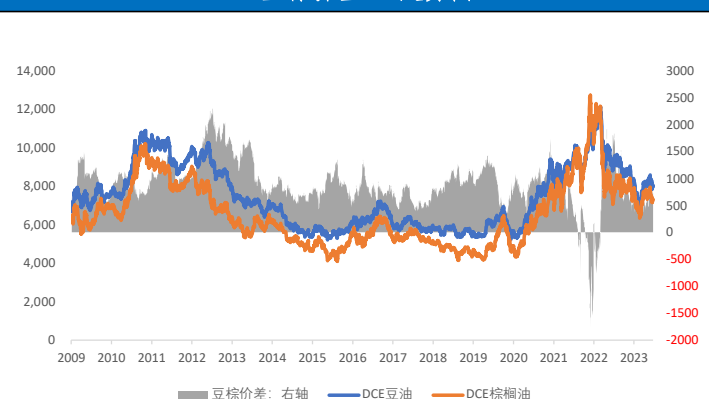
卷螺价差 - 走势图



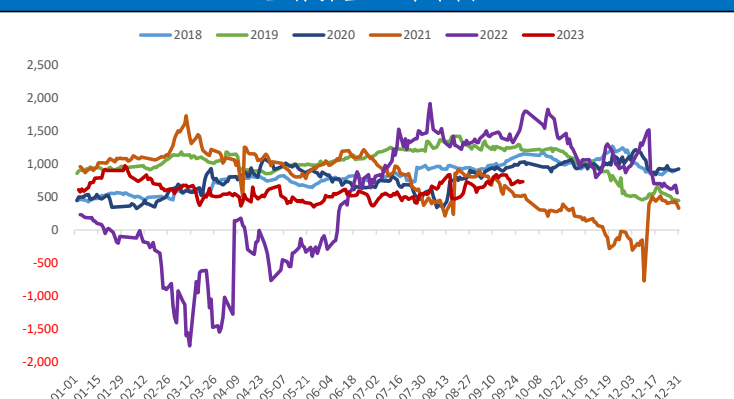
卷螺价差 - 季节图



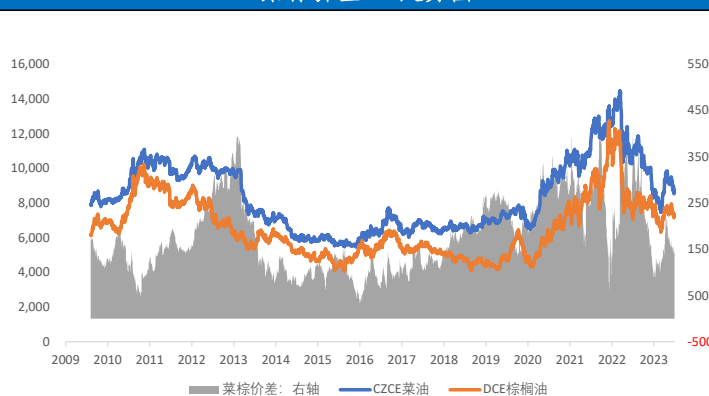
豆棕价差 - 走势图



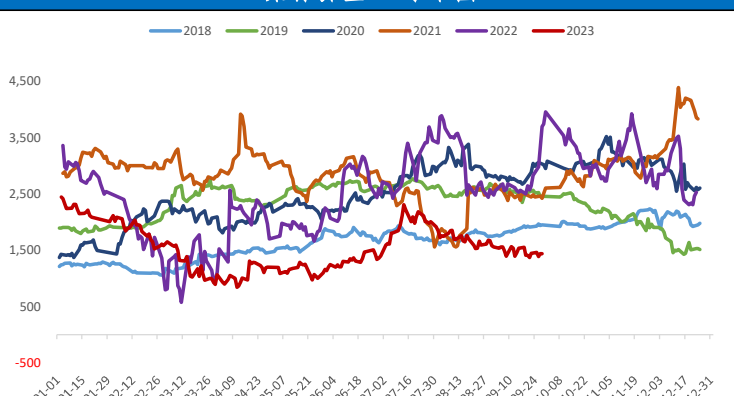
豆棕价差 - 季节图



菜棕价差 - 走势图



菜棕价差 - 季节图

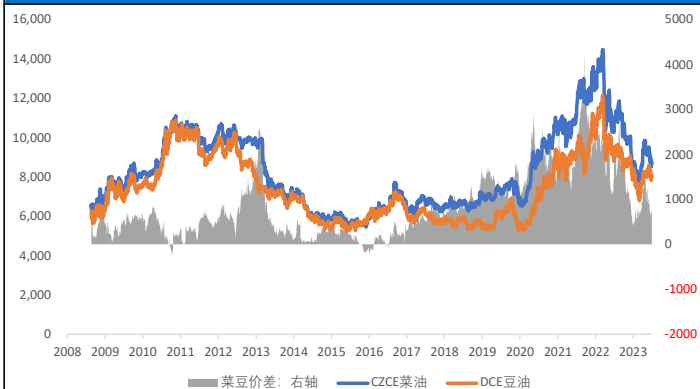


# 重要商品主力价差套利表现

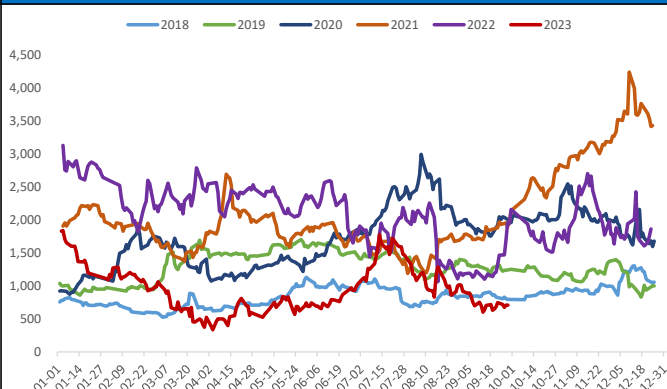
制作日期

2023年9月28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