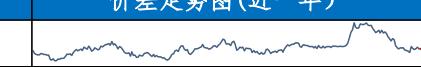
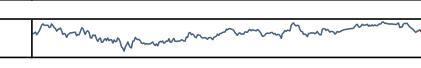
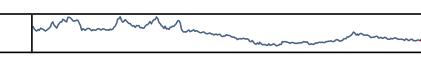
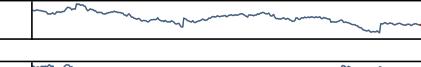
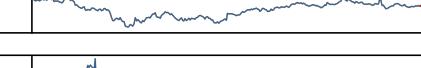
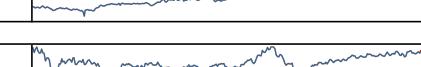
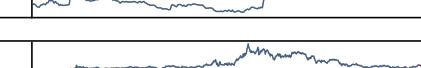
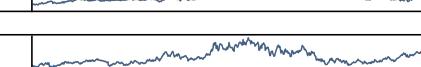
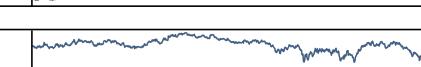
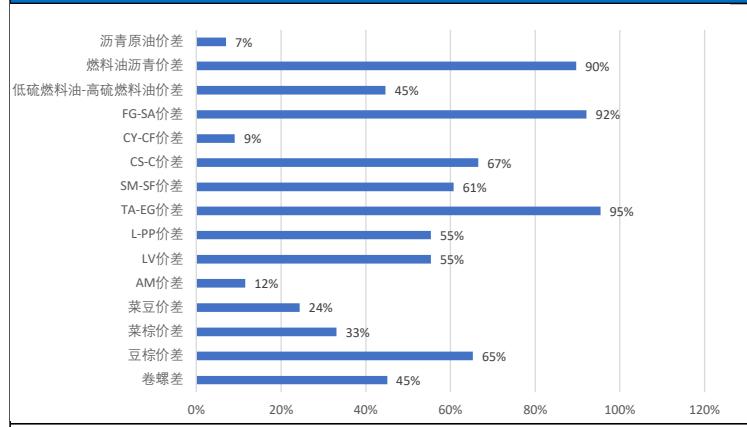
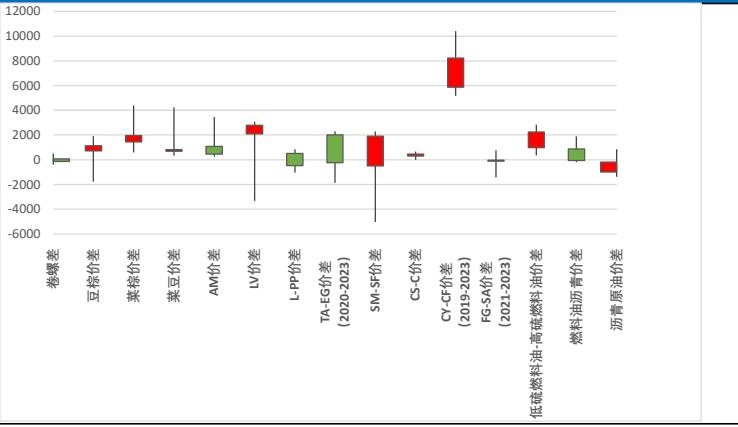


重要商品主力价差套利表现

制作日期

2023年9月28日

板块	名称	报价单位	最新收益价	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豆油	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)																																																												
 <table border="1"> <tr> <td>沥青原油价差</td> <td>7%</td> </tr> <tr> <td>燃料油沥青价差</td> <td>90%</td> </tr> <tr> <td>低硫燃料油-高硫燃料油价差</td> <td>45%</td> </tr> <tr> <td>FG-SA价差</td> <td>92%</td> </tr> <tr> <td>CY-CF价差</td> <td>9%</td> </tr> <tr> <td>CS-C价差</td> <td>67%</td> </tr> <tr> <td>SM-SF价差</td> <td>61%</td> </tr> <tr> <td>TA-EG价差</td> <td>95%</td> </tr> <tr> <td>L-PP价差</td> <td>55%</td> </tr> <tr> <td>LV价差</td> <td>55%</td> </tr> <tr> <td>AM价差</td> <td>12%</td> </tr> <tr> <td>菜豆价差</td> <td>24%</td> </tr> <tr> <td>菜棕价差</td> <td>33%</td> </tr> <tr> <td>豆棕价差</td> <td>65%</td> </tr> <tr> <td>卷螺差</td> <td>45%</td> </tr> </table>				沥青原油价差			7%	燃料油沥青价差	90%	低硫燃料油-高硫燃料油价差	45%	FG-SA价差	92%	CY-CF价差	9%	CS-C价差	67%	SM-SF价差	61%	TA-EG价差	95%	L-PP价差	55%	LV价差	55%	AM价差	12%	菜豆价差	24%	菜棕价差	33%	豆棕价差	65%	卷螺差	45%	 <table border="1"> <tr> <td>卷螺差</td> <td>0</td> </tr> <tr> <td>豆粕价差</td> <td>2000</td> </tr> <tr> <td>菜棕价差</td> <td>2000</td> </tr> <tr> <td>菜豆价差</td> <td>2000</td> </tr> <tr> <td>AM价差</td> <td>2000</td> </tr> <tr> <td>L-PP价差</td> <td>2000</td> </tr> <tr> <td>TA-EG价差</td> <td>2000</td> </tr> <tr> <td>FG-SA价差</td> <td>2000</td> </tr> <tr> <td>SM-SF价差</td> <td>2000</td> </tr> <tr> <td>CS-C价差</td> <td>2000</td> </tr> <tr> <td>CY-CF价差</td> <td>2000</td> </tr> <tr> <td>低硫燃料油-高硫燃料油价差</td> <td>2000</td> </tr> <tr> <td>燃料油沥青价差</td> <td>2000</td> </tr> <tr> <td>沥青原油价差</td> <td>2000</td> </tr> </table>			卷螺差	0	豆粕价差	2000	菜棕价差	2000	菜豆价差	2000	AM价差	2000	L-PP价差	2000	TA-EG价差	2000	FG-SA价差	2000	SM-SF价差	2000	CS-C价差	2000	CY-CF价差	2000	低硫燃料油-高硫燃料油价差	2000	燃料油沥青价差	2000
沥青原油价差	7%																																																															
燃料油沥青价差	90%																																																															
低硫燃料油-高硫燃料油价差	45%																																																															
FG-SA价差	92%																																																															
CY-CF价差	9%																																																															
CS-C价差	67%																																																															
SM-SF价差	61%																																																															
TA-EG价差	95%																																																															
L-PP价差	55%																																																															
LV价差	55%																																																															
AM价差	12%																																																															
菜豆价差	24%																																																															
菜棕价差	33%																																																															
豆棕价差	65%																																																															
卷螺差	45%																																																															
卷螺差	0																																																															
豆粕价差	2000																																																															
菜棕价差	2000																																																															
菜豆价差	2000																																																															
AM价差	2000																																																															
L-PP价差	2000																																																															
TA-EG价差	2000																																																															
FG-SA价差	2000																																																															
SM-SF价差	2000																																																															
CS-C价差	2000																																																															
CY-CF价差	2000																																																															
低硫燃料油-高硫燃料油价差	2000																																																															
燃料油沥青价差	2000																																																															
沥青原油价差	2000																																																															

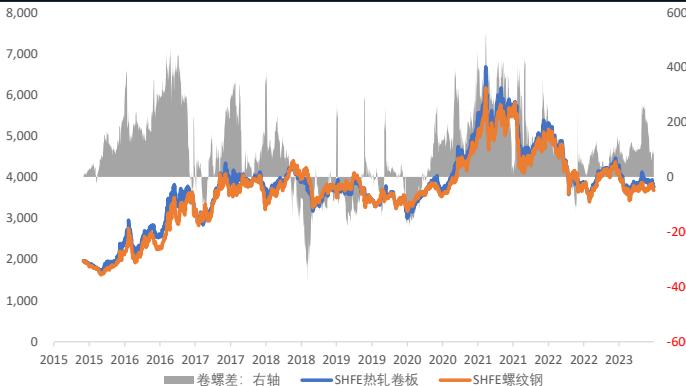
重要商品主力价差套利表现

制作日期

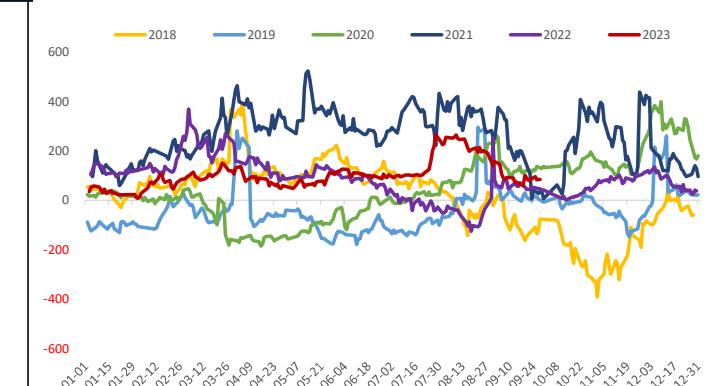
2023年9月28日

商品价差近年以来走势对比

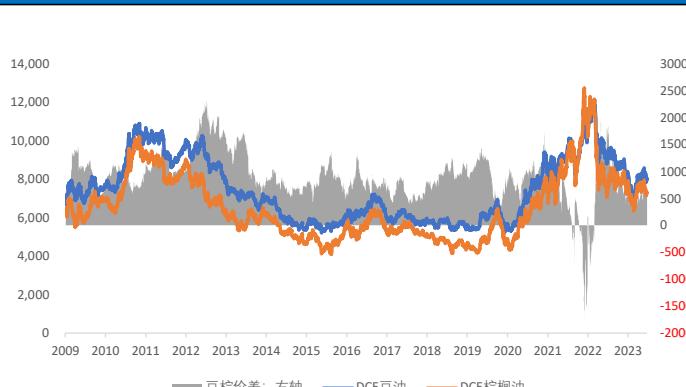
卷螺价差 - 走势图



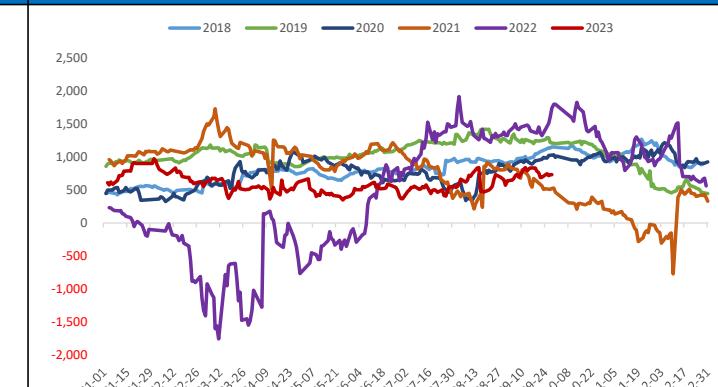
卷螺价差 - 季节图



豆棕价差 - 走势图



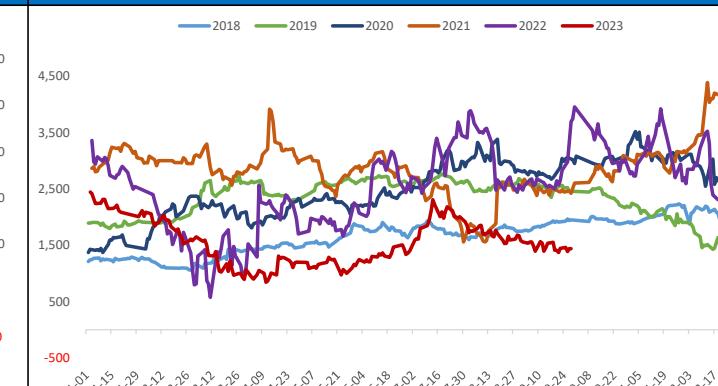
豆棕价差 - 季节图



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

