

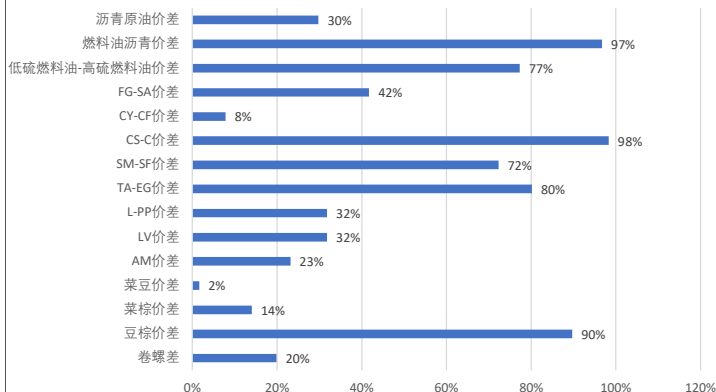
重要商品主力价差套利表现

制作日期

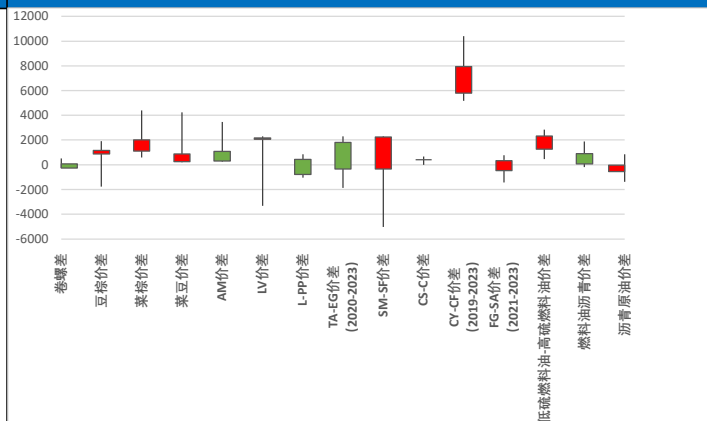
2023年11月21日

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	4047	热卷 - 螺纹钢价差	64	
	SHFE螺纹钢	元/吨	3983			
黑色系	CZCE锰硅	元/吨	6598	锰硅 - 锰铁 价差	-356	
	CZCE硅铁	元/吨	6954			
农产品	DCE豆油	元/吨	8324	豆油-棕榈油价差	872	
	DCE棕榈油	元/吨	7452			
农产品	CZCE菜油	元/吨	8575	菜油 - 棕榈油价差	1123	
	DCE棕榈油	元/吨	7452			
农产品	CZCE菜油	元/吨	8575	菜油 - 豆油价差	251	
	DCE豆油	元/吨	8324			
农产品	DCE豆一	元/吨	5080	豆一 - 豆粕价差	1093	
	DCE豆粕	元/吨	3987			
农产品	DCE玉米淀粉	元/吨	2983	玉米淀粉 - 玉米价差	411	
	DCE玉米	元/吨	2572			
农产品	CZCE棉纱	元/吨	21350	棉纱 - 棉花价差	5785	
	CZCE棉花	元/吨	15565			
能化品种	DCE塑料	元/吨	8078	塑料 - PVC价差	2064	
	DCE PVC	元/吨	6014			
能化品种	DCE塑料	元/吨	8078	塑料 - 聚丙烯价差	442	
	DCE聚丙烯	元/吨	7636			
能化品种	CZCE PTA	元/吨	6030	PTA - 乙二醇价差	1817	
	DCE乙二醇	元/吨	4213			
能化品种	CZCE玻璃	元/吨	1762	玻璃 - 纯碱价差	-474	
	CZCE纯碱	元/吨	2236			
能化品种	INE低硫燃料油	元/吨	4463	低硫燃料油-高硫燃料油价差	1266	
	SHFE燃油	元/吨	3197			
能化品种	INE低硫燃料油	元/吨	4463	低硫燃料油-沥青价差	909	
	SHFE沥青	元/吨	3554			
能化品种	SHFE沥青	元/吨	3554	沥青-原油价差*7	-553	
	INE原油	元/吨	587			

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）



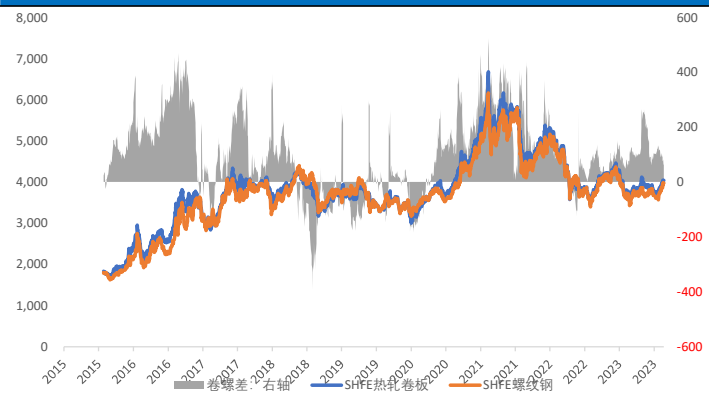
重要商品主力价差套利表现

制作日期

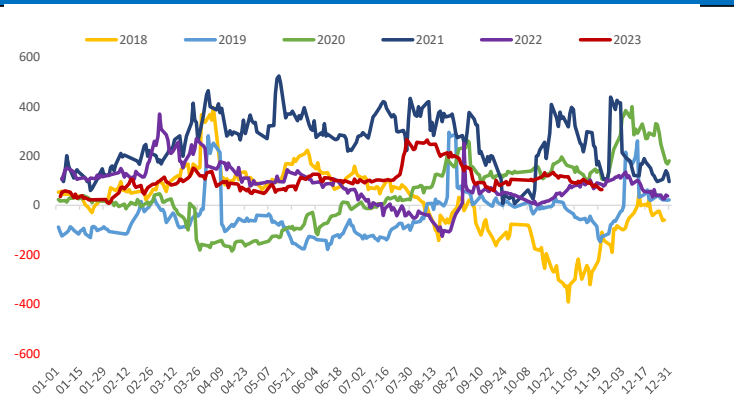
2023年11月21日

商品价差近年以来走势对比

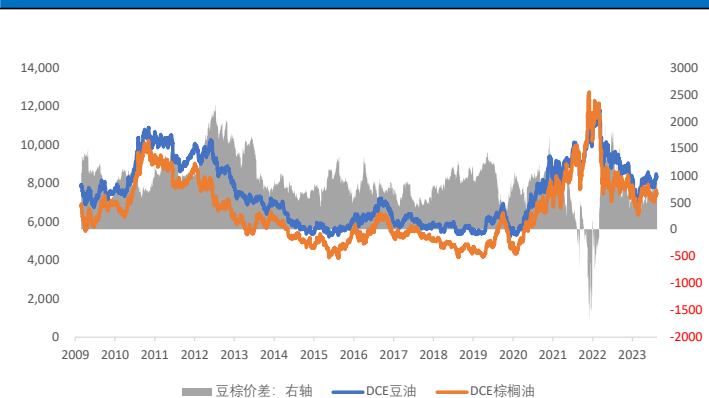
卷螺价差 - 走势图



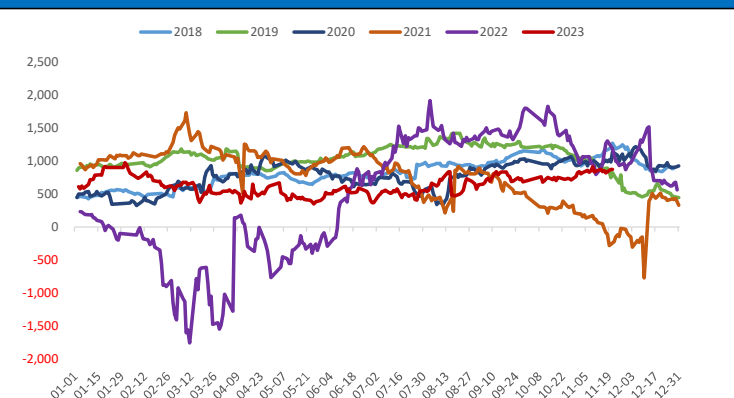
卷螺价差 - 季节图



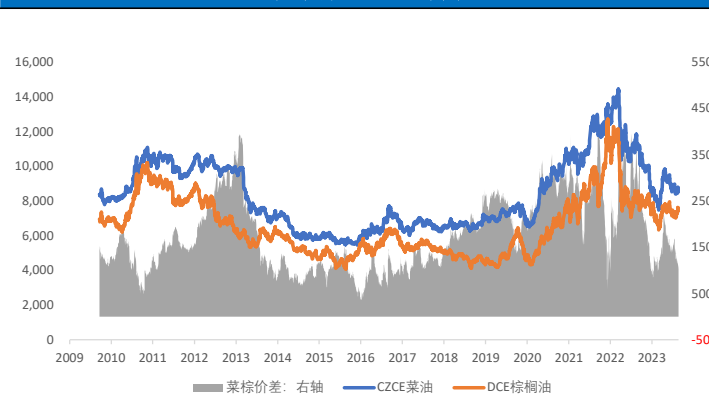
豆棕价差 - 走势图



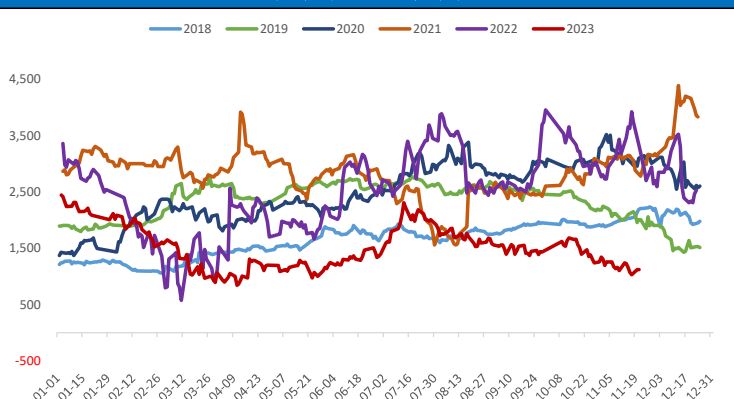
豆棕价差 - 季节图



菜棕价差 - 走势图



菜棕价差 - 季节图

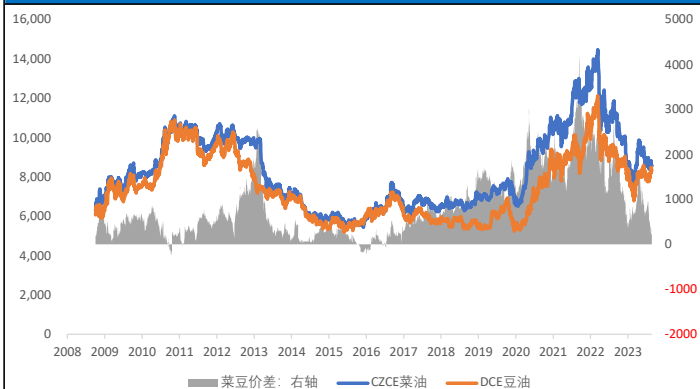


重要商品主力价差套利表现

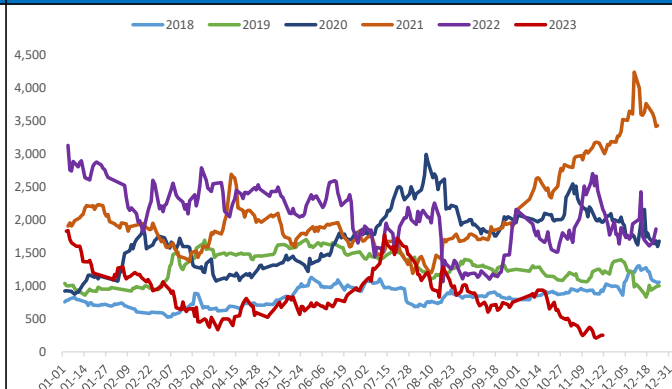
制作日期

2023年11月21日

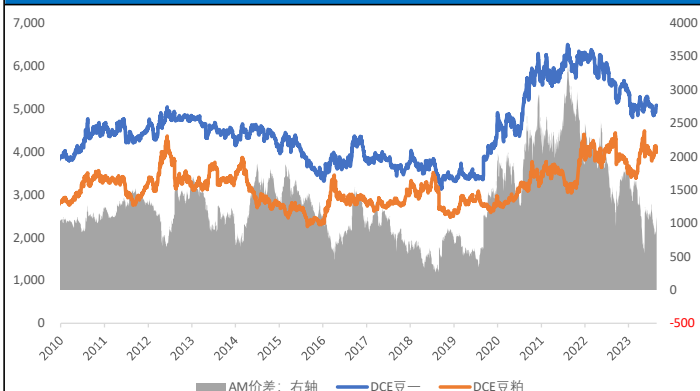
菜豆价差 - 走势图



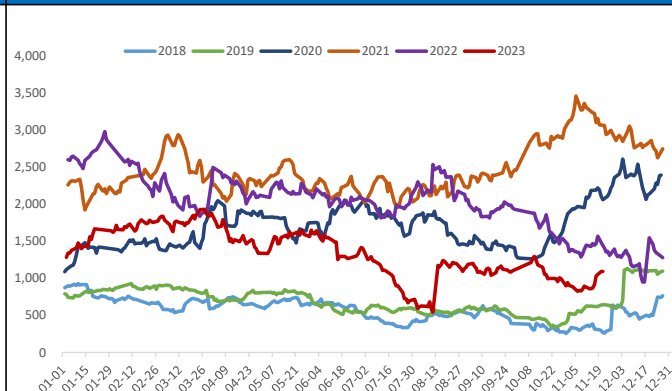
菜豆价差 - 季节图



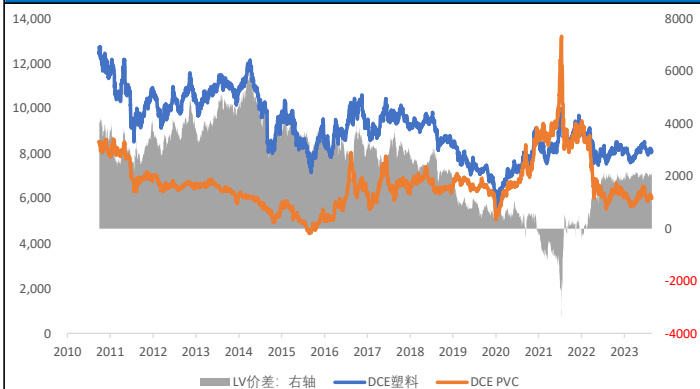
AM价差 - 走势图



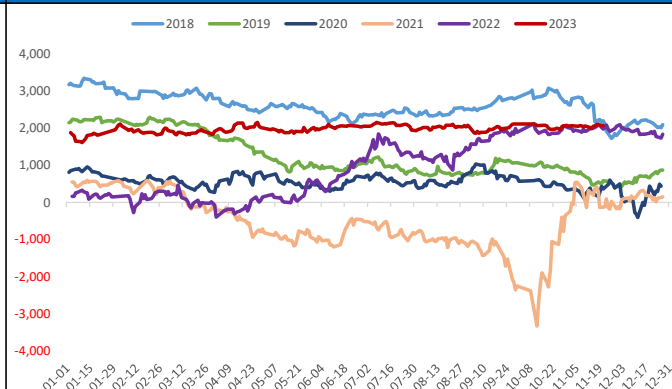
AM价差 - 季节图



LV价差 - 走势图



LV价差 - 季节图

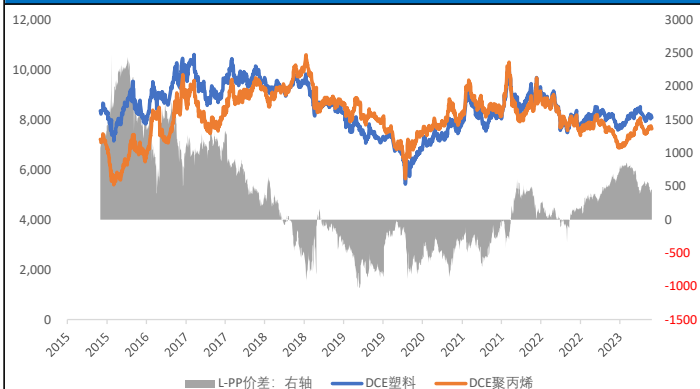


重要商品主力价差套利表现

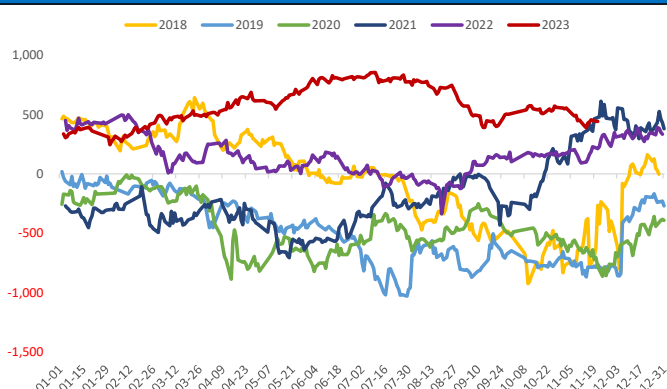
制作日期

2023年11月21日

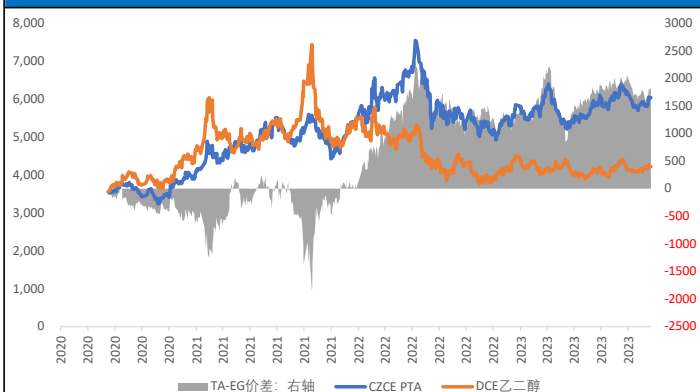
L-PP价差 - 走势图



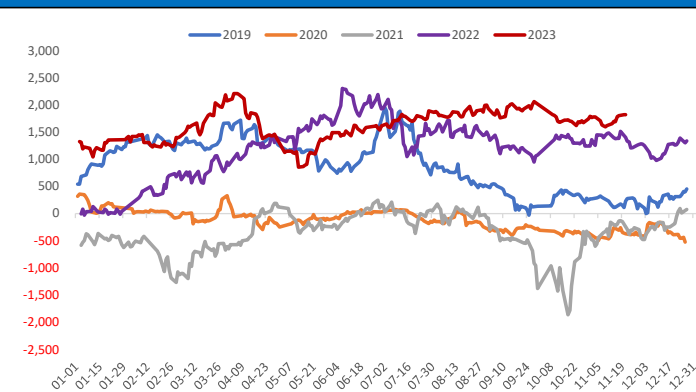
L-PP价差 - 季节图



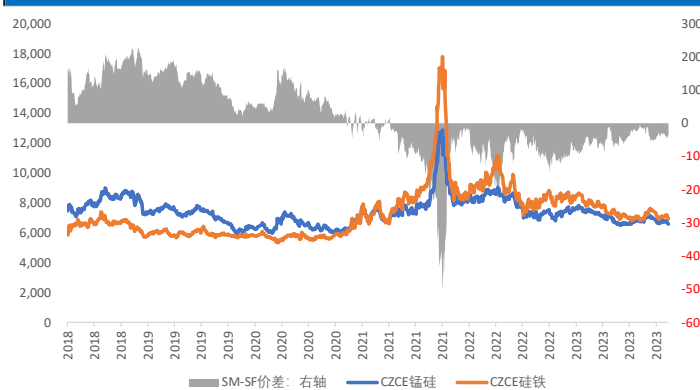
TA-EG价差 - 走势图



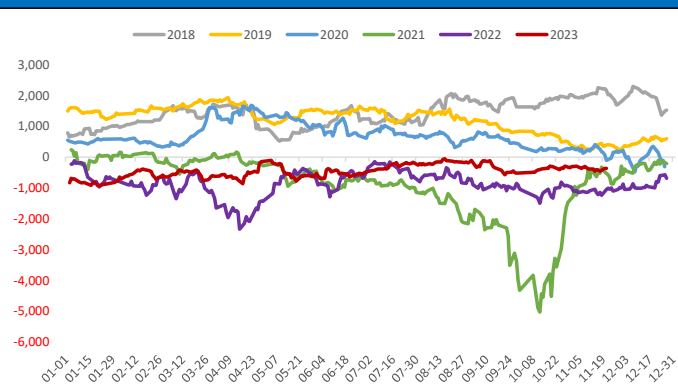
TA-EG价差 - 季节图



SM-SF价差 - 走势图



SM-SF价差 - 季节图

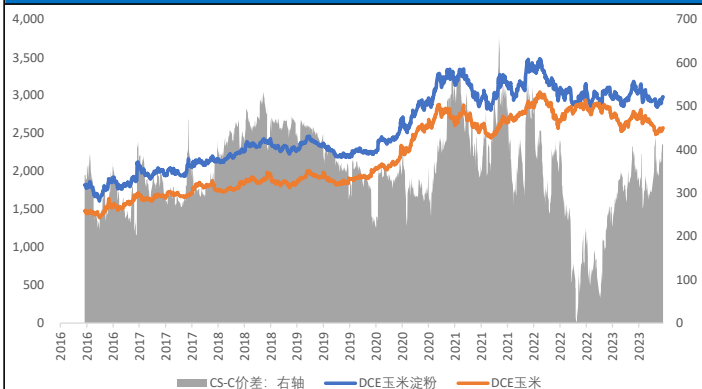


重要商品主力价差套利表现

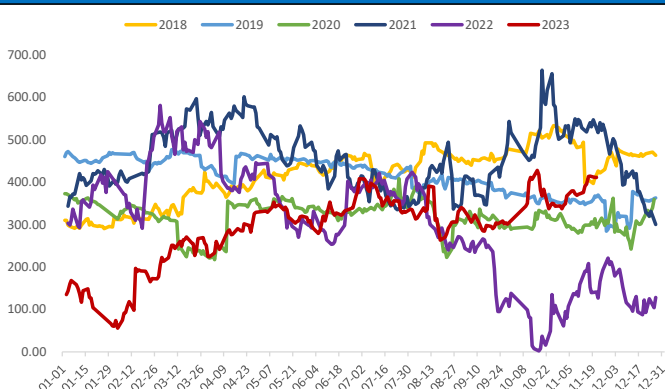
制作日期

2023年11月21日

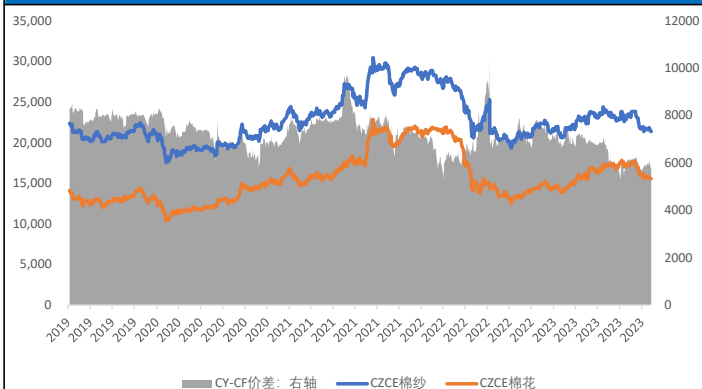
CS-C价差 - 走势图



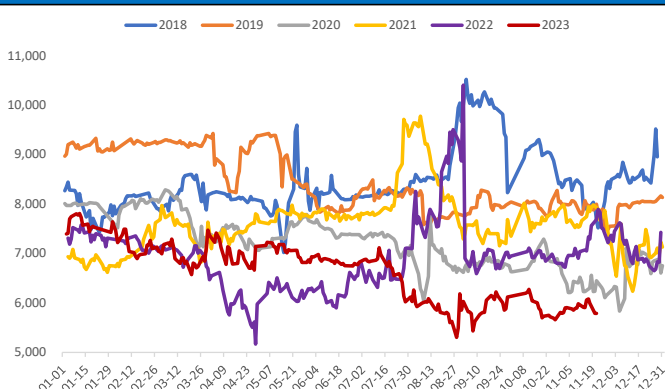
CS-C价差 - 季节图



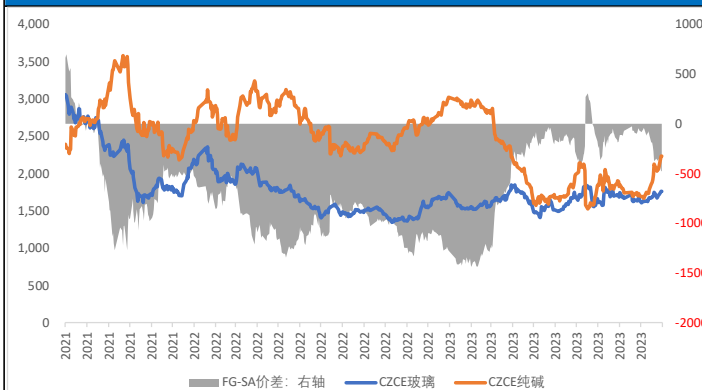
CY-CF价差 - 走势图



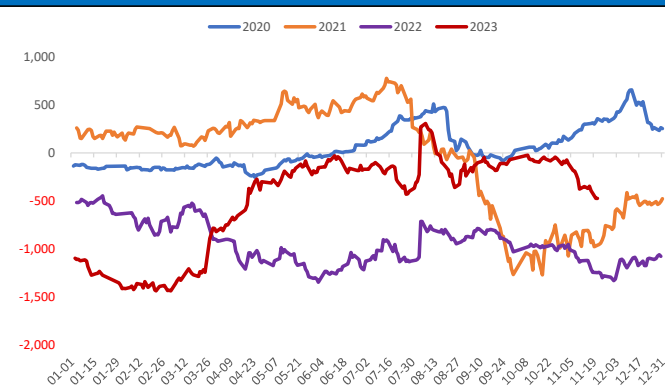
CY-CF价差 - 季节图



FG-SA价差 - 走势图



FG-SA价差 - 季节图

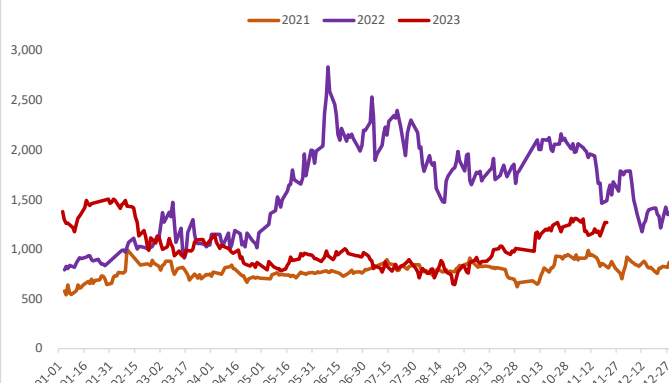


低硫燃料油-高硫燃料油价差 - 走势图

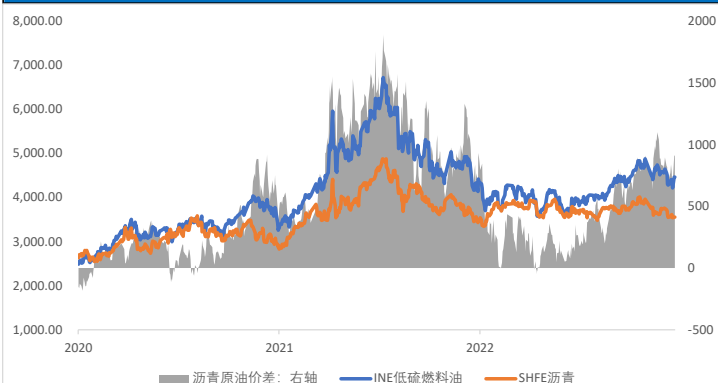
低硫燃料油-高硫燃料油价差 - 季节图

制作日期

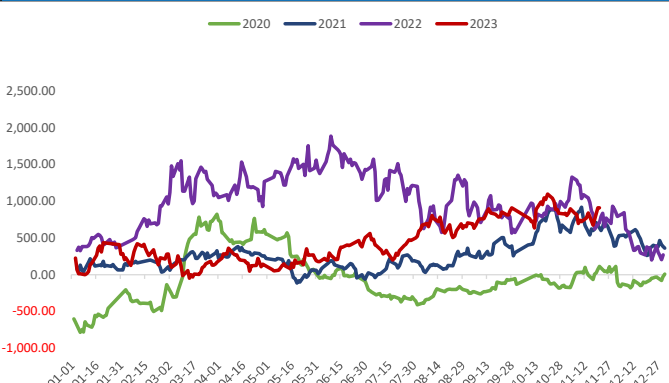
2023年11月21日



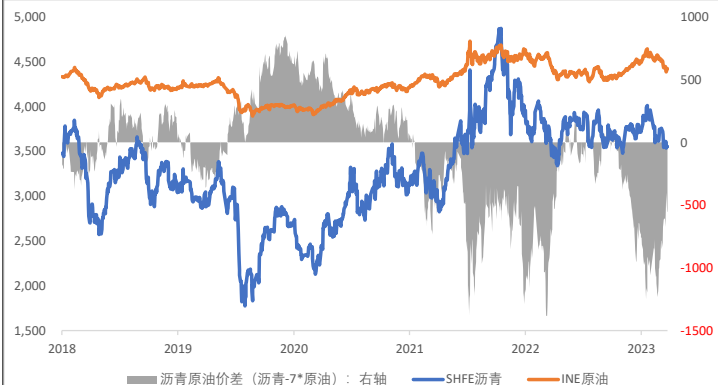
燃料油-沥青价差 - 走势图



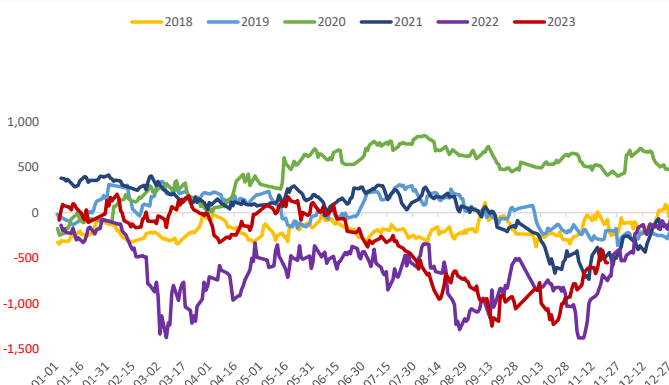
燃料油-沥青价差 - 季节图



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