

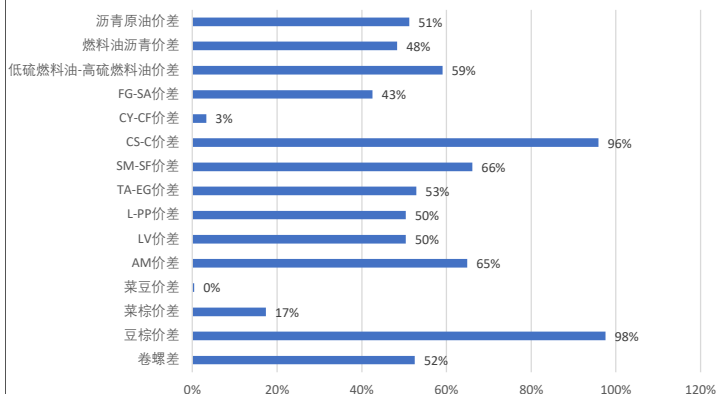
重要商品主力价差套利表现

制作日期

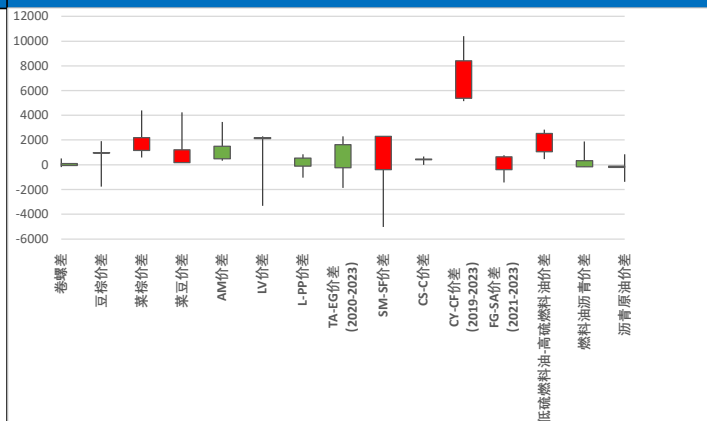
2023年12月12日

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	4122	热卷 - 螺纹钢价差	97	
	SHFE螺纹钢	元/吨	4025			
黑色系	CZCE锰硅	元/吨	6468	锰硅 - 锰铁 价差	-380	
	CZCE硅铁	元/吨	6848			
农产品	DCE豆油	元/吨	8082	豆油-棕榈油价差	966	
	DCE棕榈油	元/吨	7116			
农产品	CZCE菜油	元/吨	8260	菜油 - 棕榈油价差	1144	
	DCE棕榈油	元/吨	7116			
农产品	CZCE菜油	元/吨	8260	菜油 - 豆油价差	178	
	DCE豆油	元/吨	8082			
农产品	DCE豆一	元/吨	4920	豆一 - 豆粕价差	1502	
	DCE豆粕	元/吨	3418			
农产品	DCE玉米淀粉	元/吨	2897	玉米淀粉 - 玉米价差	410	
	DCE玉米	元/吨	2487			
农产品	CZCE棉纱	元/吨	20795	棉纱 - 棉花价差	5390	
	CZCE棉花	元/吨	15405			
能化品种	DCE塑料	元/吨	8018	塑料 - PVC价差	2188	
	DCE PVC	元/吨	5830			
能化品种	DCE塑料	元/吨	8018	塑料 - 聚丙烯价差	534	
	DCE聚丙烯	元/吨	7484			
能化品种	CZCE PTA	元/吨	5744	PTA - 乙二醇价差	1635	
	DCE乙二醇	元/吨	4109			
能化品种	CZCE玻璃	元/吨	1901	玻璃 - 纯碱价差	-395	
	CZCE纯碱	元/吨	2296			
能化品种	INE低硫燃料油	元/吨	4027	低硫燃料油-高硫燃料油价差	1055	
	SHFE燃油	元/吨	2972			
能化品种	INE低硫燃料油	元/吨	4027	低硫燃料油-沥青价差	337	
	SHFE沥青	元/吨	3690			
能化品种	SHFE沥青	元/吨	3690	沥青-原油价差*7	-203	
	INE原油	元/吨	556			

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)



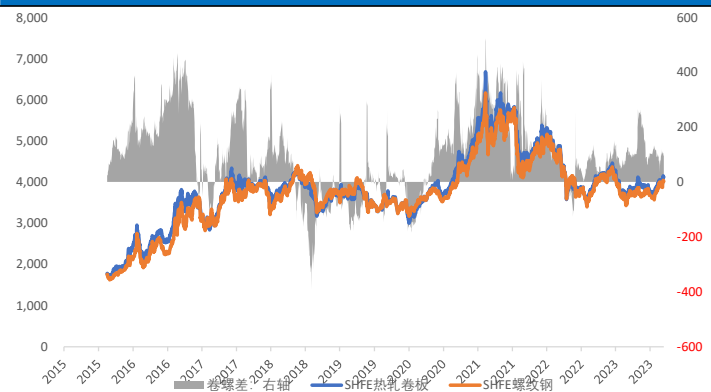
重要商品主力价差套利表现

制作日期

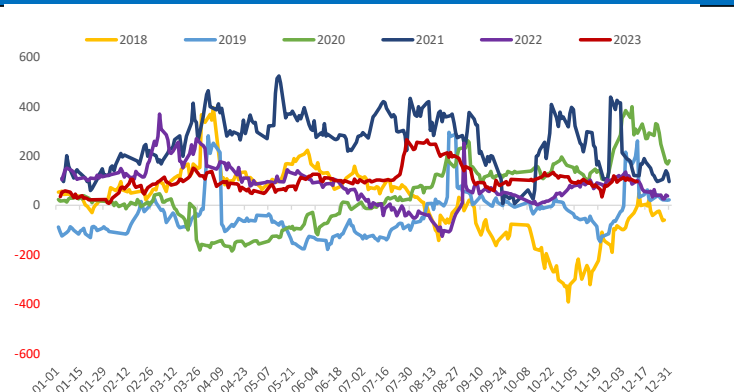
2023年12月12日

商品价差近年以来走势对比

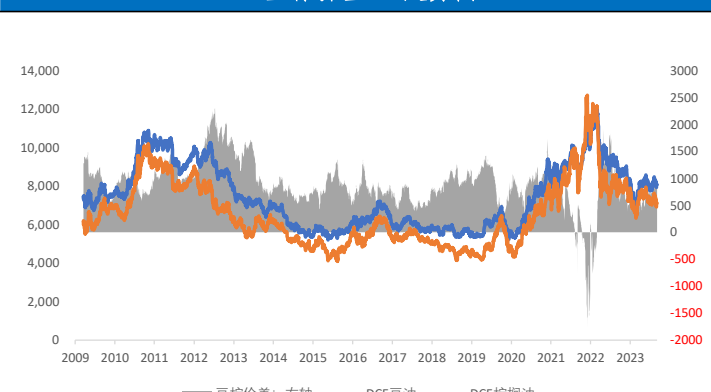
卷螺价差 - 走势图



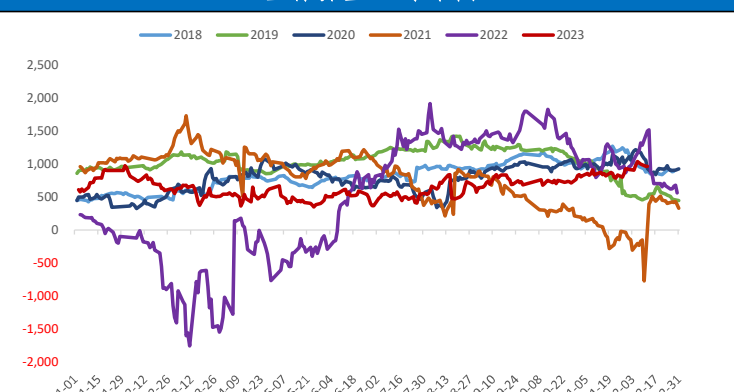
卷螺价差 - 季节图



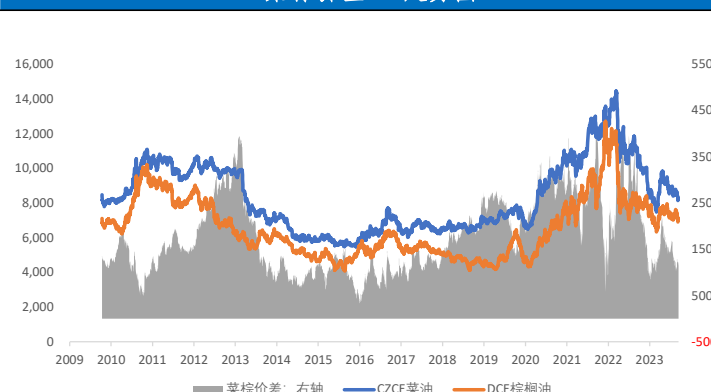
豆棕价差 - 走势图



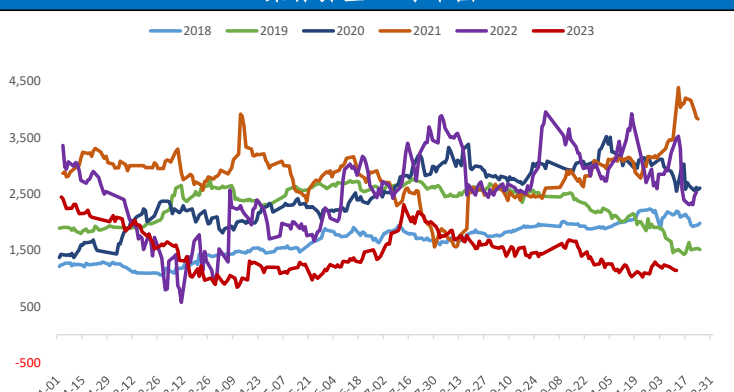
豆棕价差 - 季节图



菜棕价差 - 走势图



菜棕价差 - 季节图

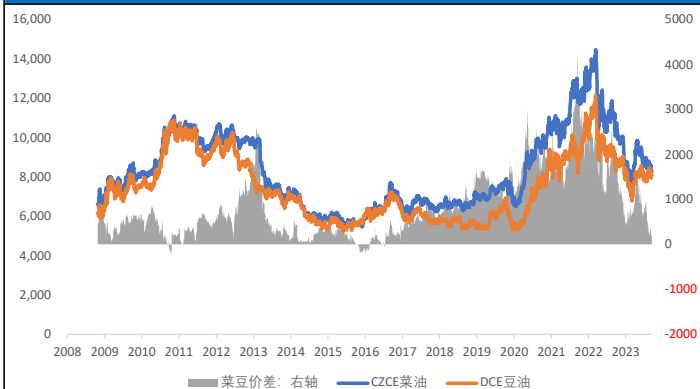


重要商品主力价差套利表现

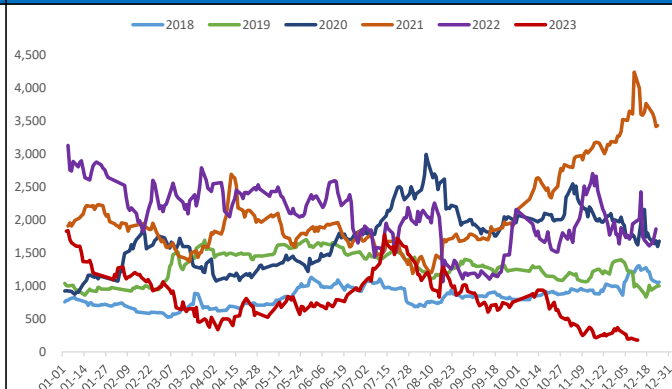
制作日期

2023年12月12日

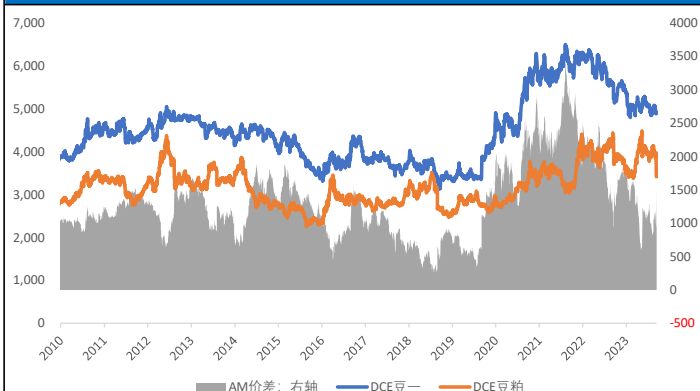
菜豆价差 - 走势图



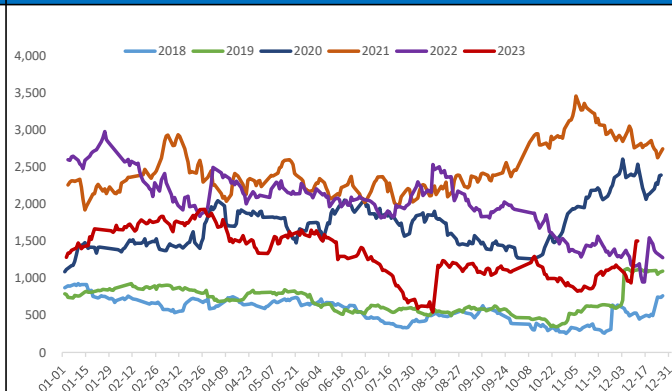
菜豆价差 - 季节图



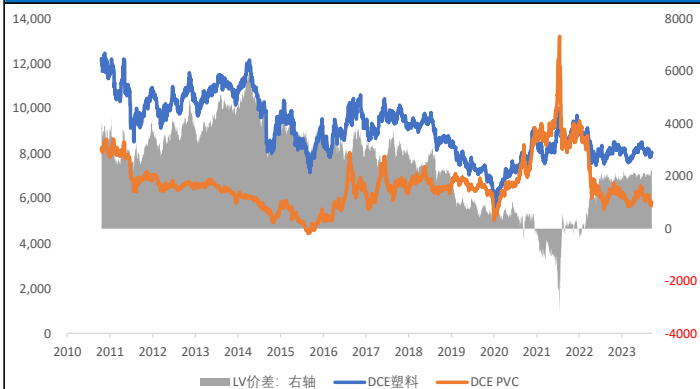
AM价差 - 走势图



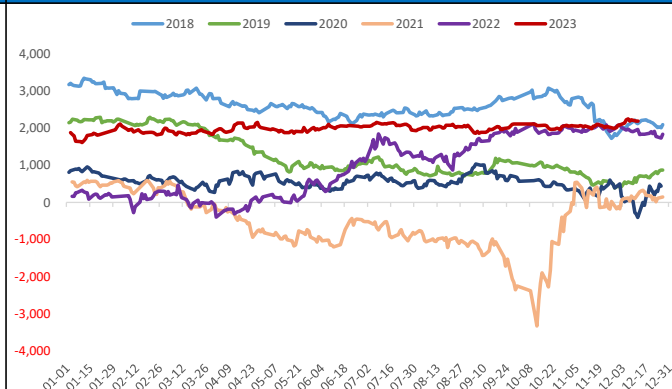
AM价差 - 季节图



LV价差 - 走势图



LV价差 - 季节图

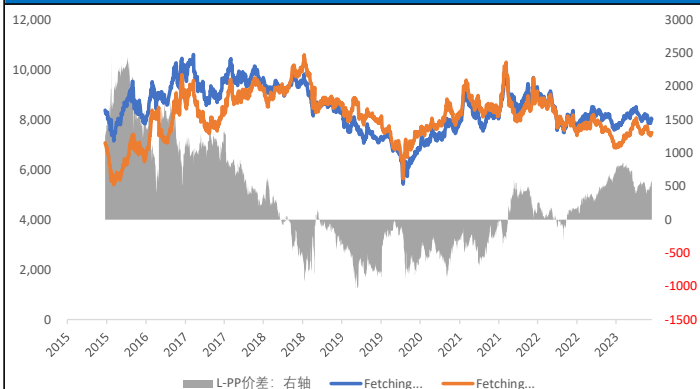


重要商品主力价差套利表现

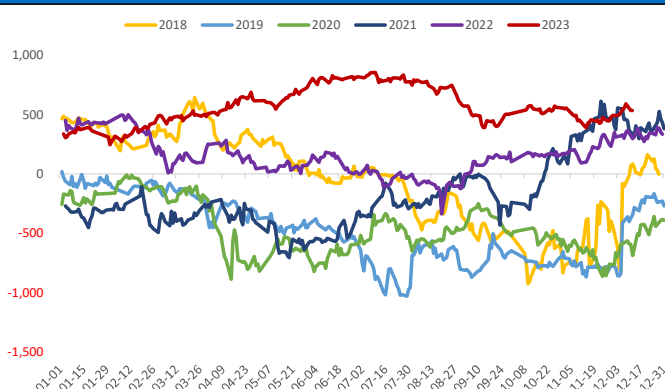
制作日期

2023年12月12日

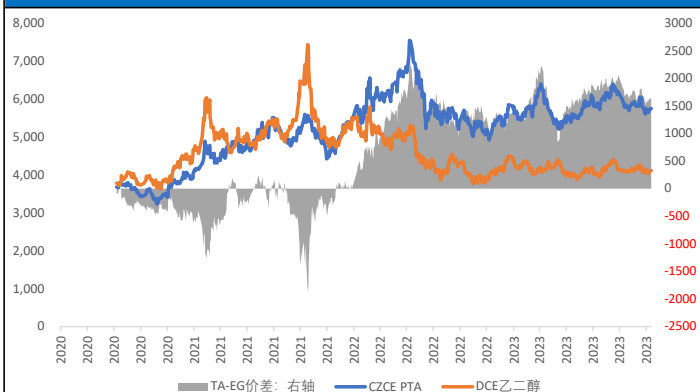
L-PP价差 - 走势图



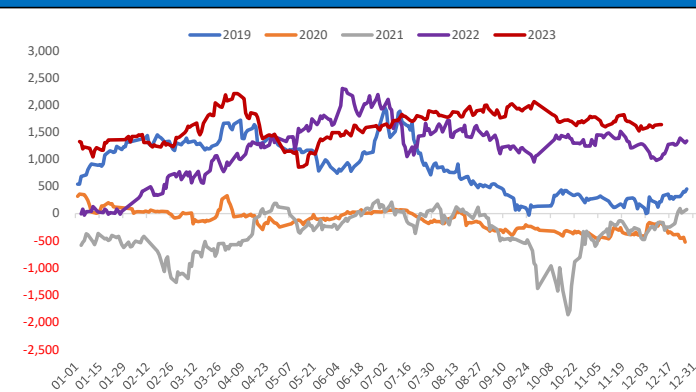
L-PP价差 - 季节图



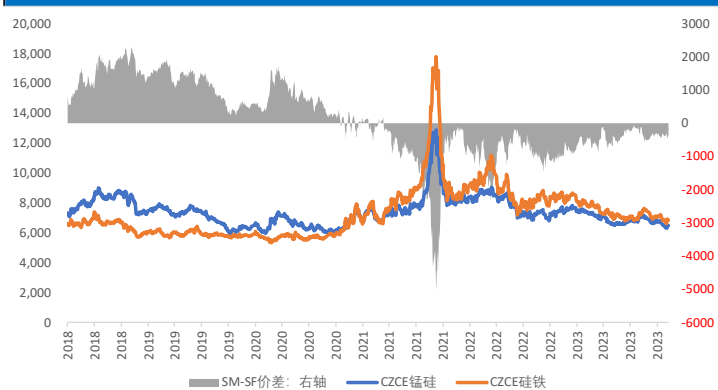
TA-EG价差 - 走势图



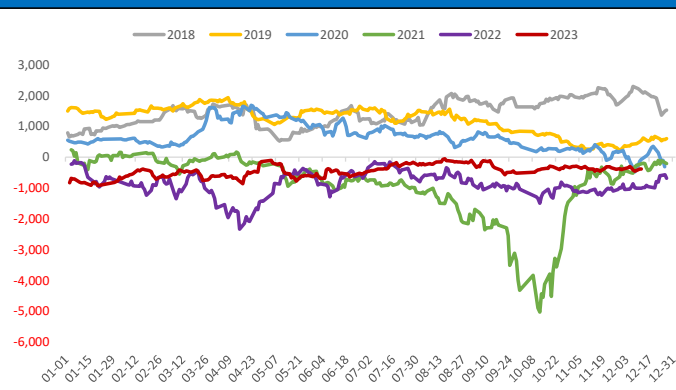
TA-EG价差 - 季节图



SM-SF价差 - 走势图



SM-SF价差 - 季节图

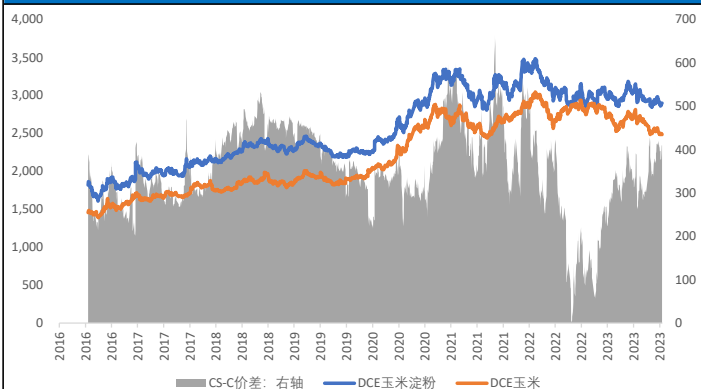


重要商品主力价差套利表现

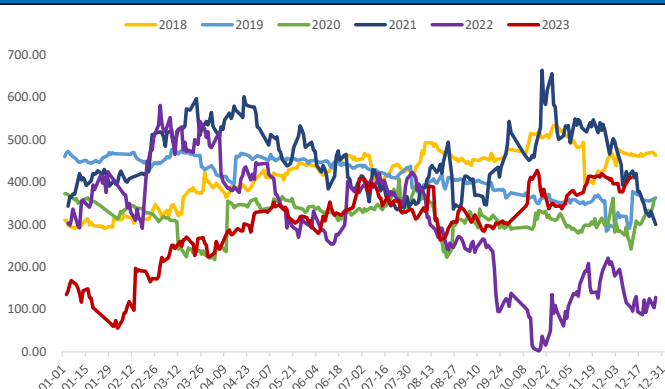
制作日期

2023年12月12日

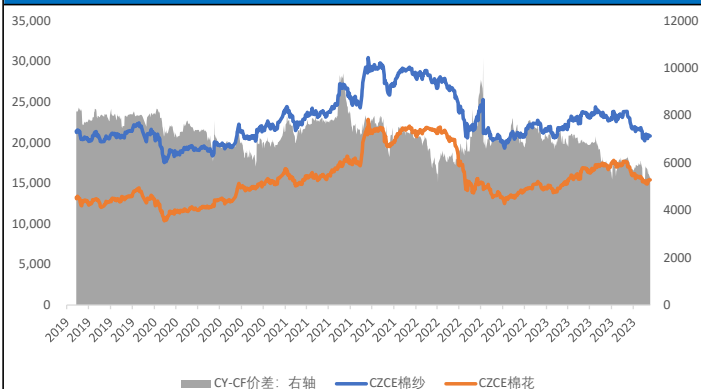
CS-C价差 - 走势图



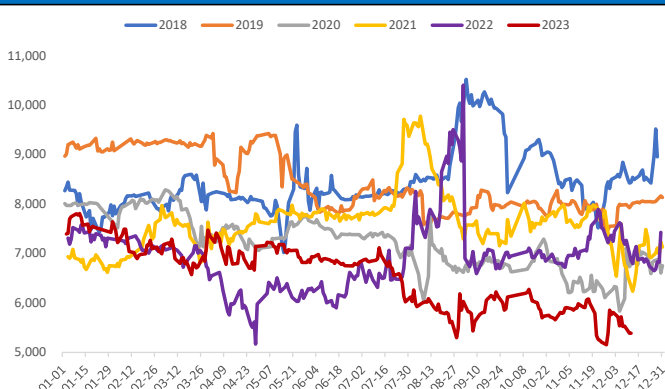
CS-C价差 - 季节图



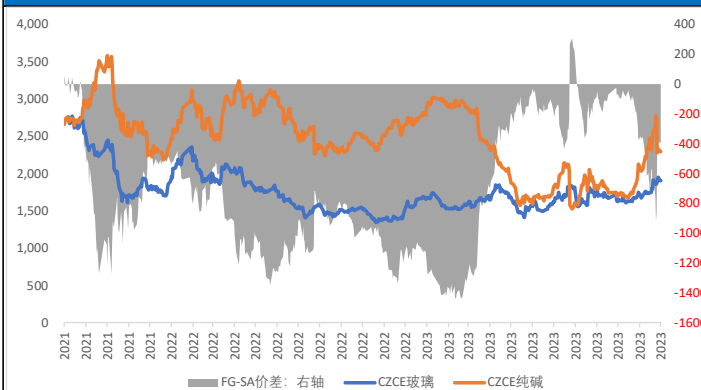
CY-CF价差 - 走势图



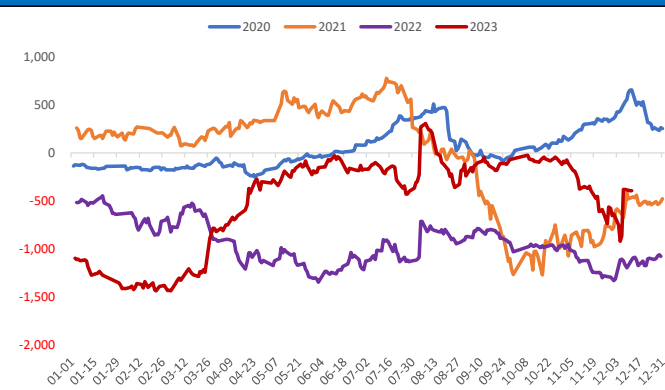
CY-CF价差 - 季节图



FG-SA价差 - 走势图



FG-SA价差 - 季节图

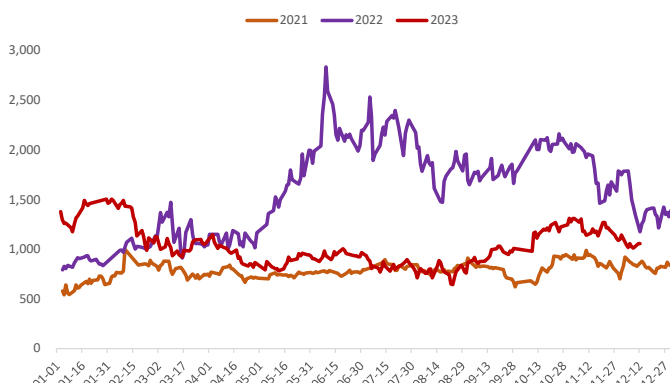


低硫燃料油-高硫燃料油价差 - 走势图

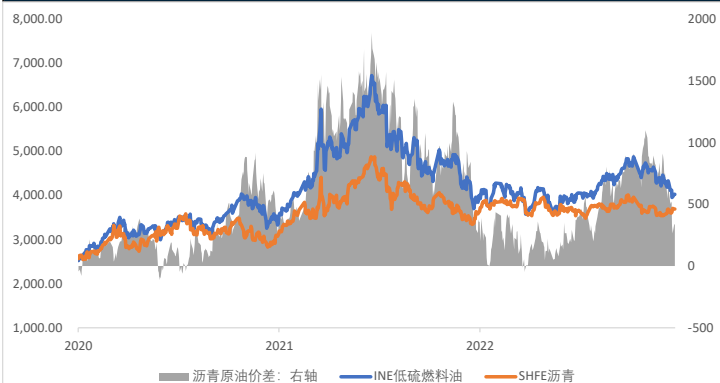
低硫燃料油-高硫燃料油价差 - 季节图

制作日期

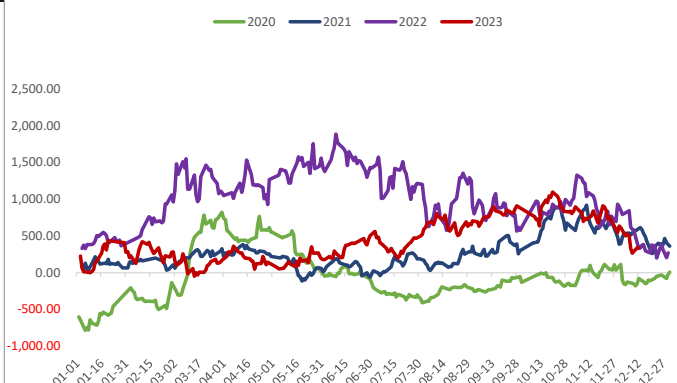
2023年12月12日



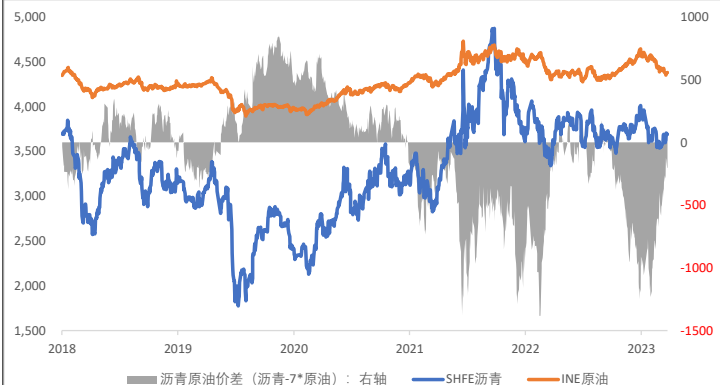
燃料油-沥青价差 - 走势图



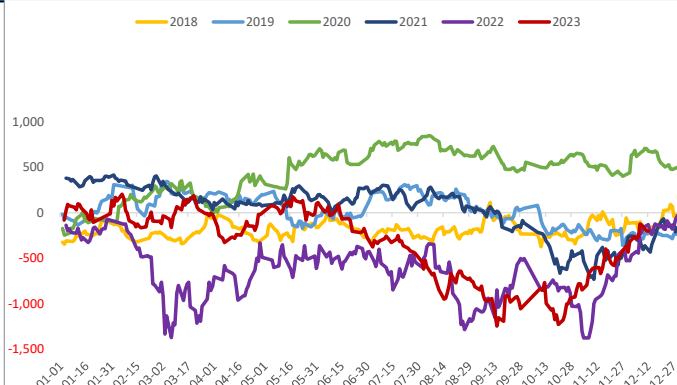
燃料油-沥青价差 - 季节图



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