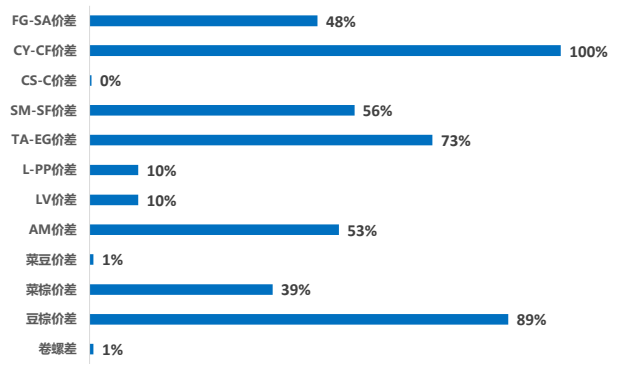
冠通期货 Guantong Futures

重要商品主力价差套利表现

研究咨询部　　2022年8月23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	3903	热卷 - 螺纹价差	-107	
	SHFE螺纹钢	元/吨	4010			
黑色系	CZCE锰硅	元/吨	7012	锰硅 - 锰铁 价差	-664	
	CZCE硅铁	元/吨	7676			
农产品	DCE豆油	元/吨	9746	豆油-棕榈油价差	1220	
	DCE棕榈油	元/吨	8526			
农产品	CZCE菜油	元/吨	11005	菜油 - 棕榈油价差	2479	
	DCE棕榈油	元/吨	8526			
农产品	CZCE菜油	元/吨	11005	菜油 - 豆油价差	1259	
	DCE豆油	元/吨	9746			
农产品	DCE豆一	元/吨	6065	豆一 - 豆粕价差	2367	
	DCE豆粕	元/吨	3698			
农产品	DCE玉米淀粉	元/吨	2936	玉米淀粉 -玉米价差	248	
	DCE玉米	元/吨	2688			
农产品	CZCE棉纱	元/吨	23980	棉纱 - 棉花价差	8965	
	CZCE棉花	元/吨	15015			
能化品种	DCE塑料	元/吨	7480	塑料 - PVC价差	868	
	DCE PVC	元/吨	6612			
能化品种	DCE塑料	元/吨	7480	塑料 - 聚丙烯价差	-96	
	DCE聚丙烯	元/吨	7576			
能化品种	CZCE PTA	元/吨	5382	PTA - 乙二醇价差	1401	
	DCE乙二醇	元/吨	3981			
能化品种	CZCE玻璃	元/吨	1486	玻璃 - 纯碱价差	-872	
	CZCE纯碱	元/吨	2358			

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 （2017-2022）

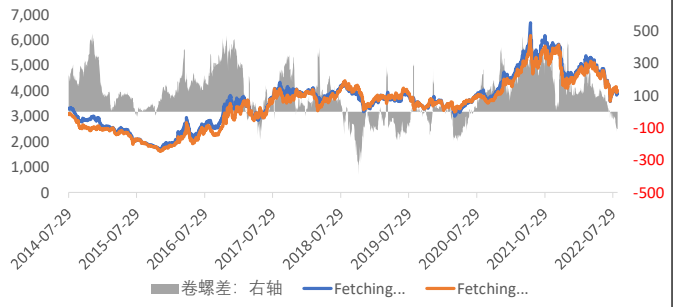
冠通期货 Guantong Futures

重要商品主力价差套利表现

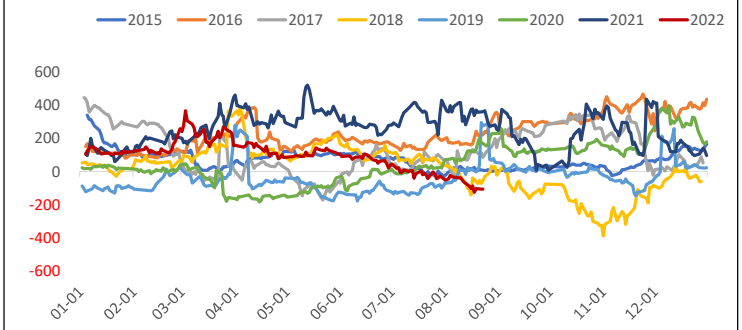
研究咨询部　　2022年8月23日

商品价差近年以来走势对比

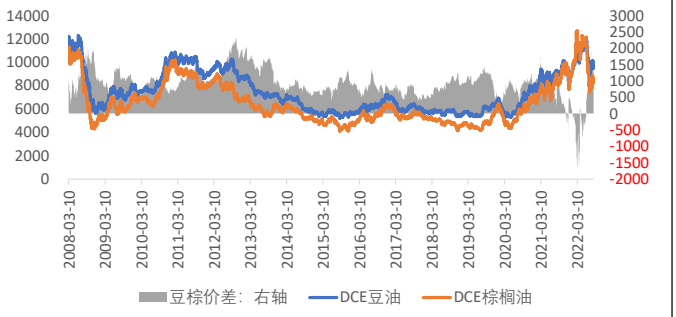
卷螺价差 – 走势图



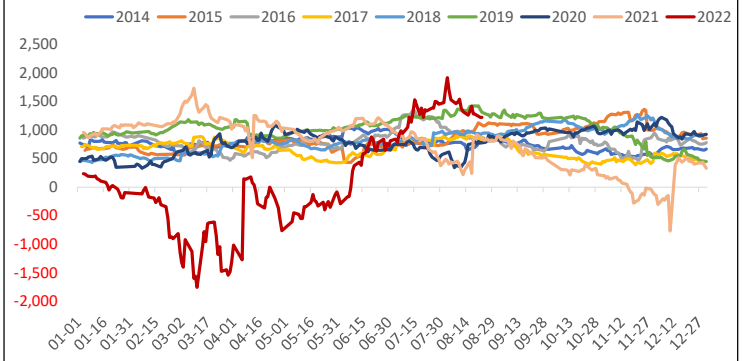
卷螺价差 – 季节图



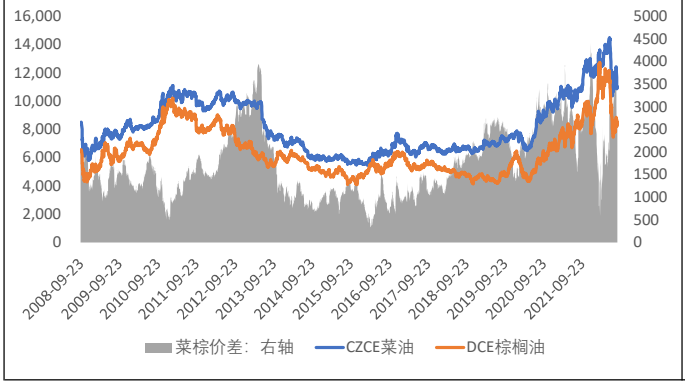
豆棕价差 – 走势图



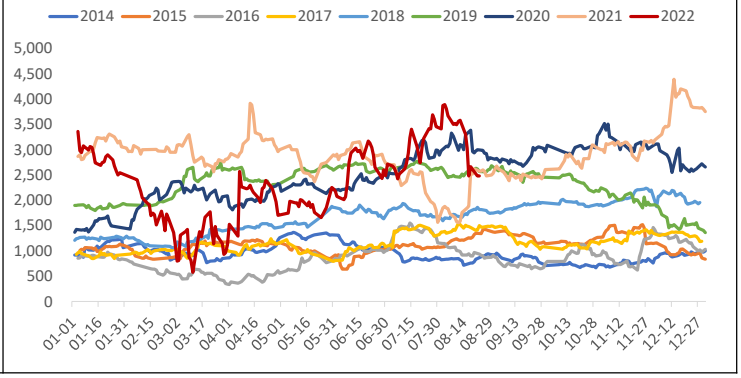
豆棕价差 – 季节图



菜棕价差 – 走势图



菜棕价差 – 季节图

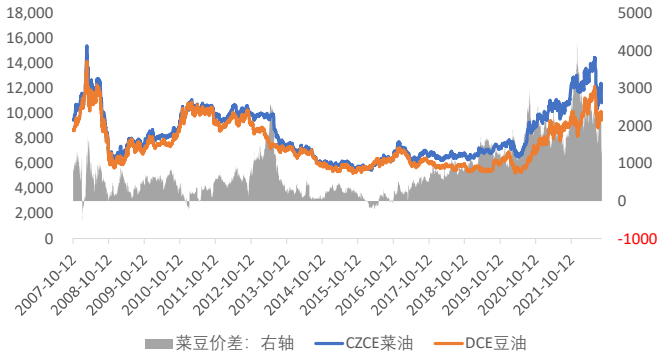


冠通期货 Guantong Futures

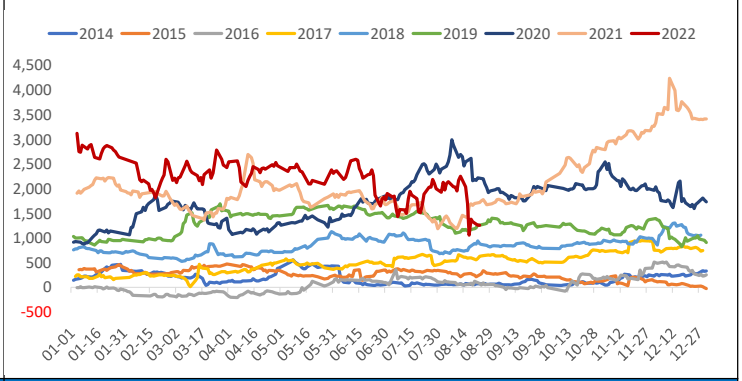
重要商品主力价差套利表现

研究咨询部　　2022年8月23日

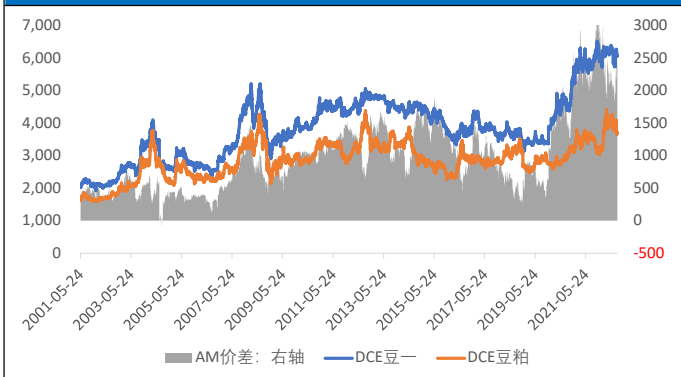
菜豆价差 – 走势图



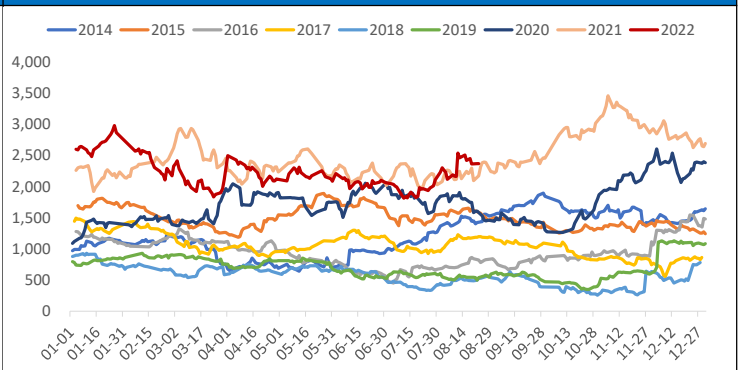
菜豆价差 – 季节图



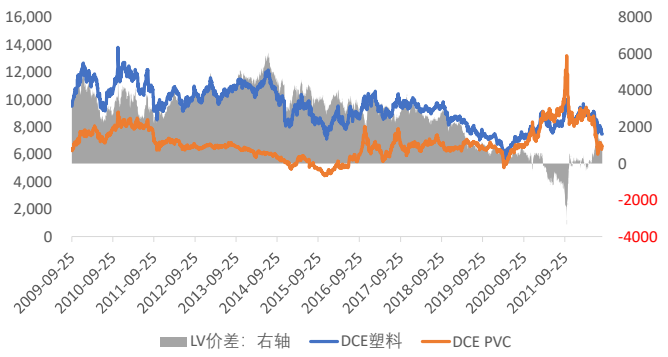
AM价差 – 走势图



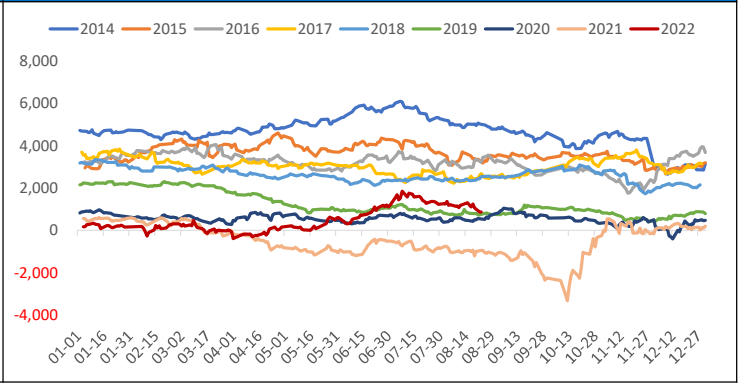
AM价差 – 季节图



LV价差 – 走势图



LV价差 – 季节图

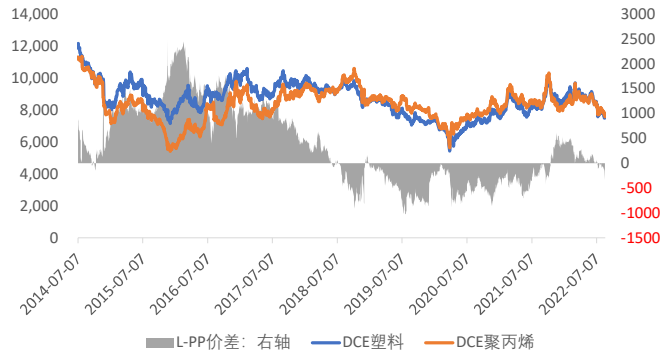


冠通期货 Guantong Futures

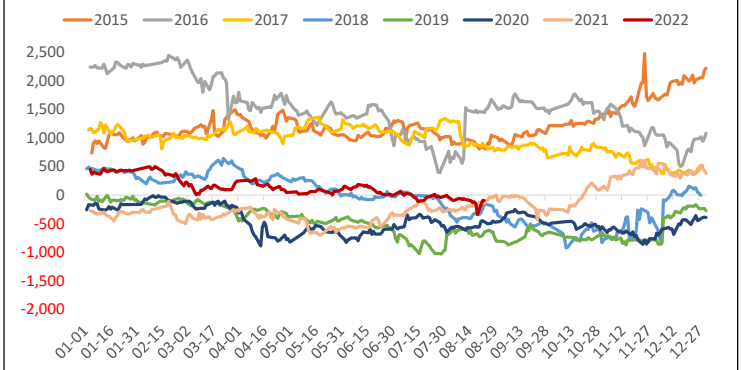
重要商品主力价差套利表现

研究咨询部　　2022年8月23日

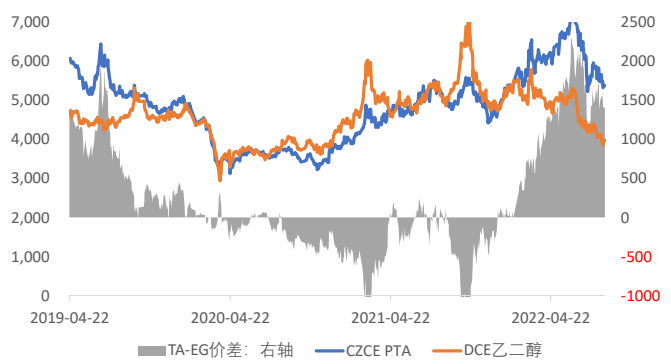
L-PP价差 – 走势图



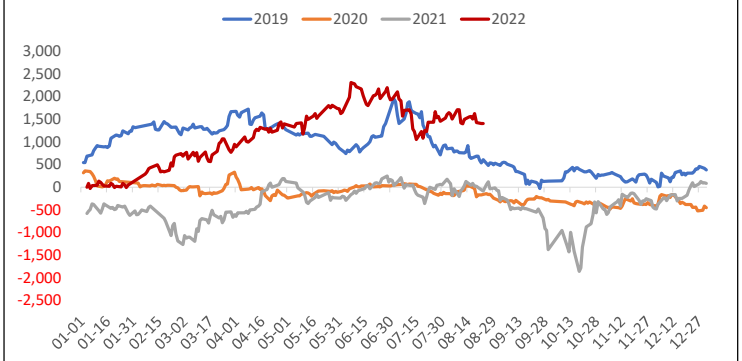
L-PP价差 – 季节图



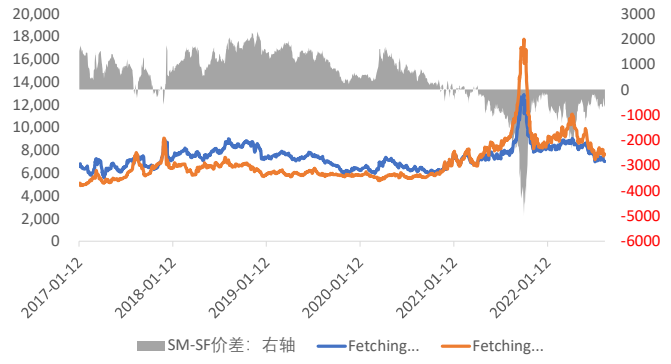
TA-EG价差 – 走势图



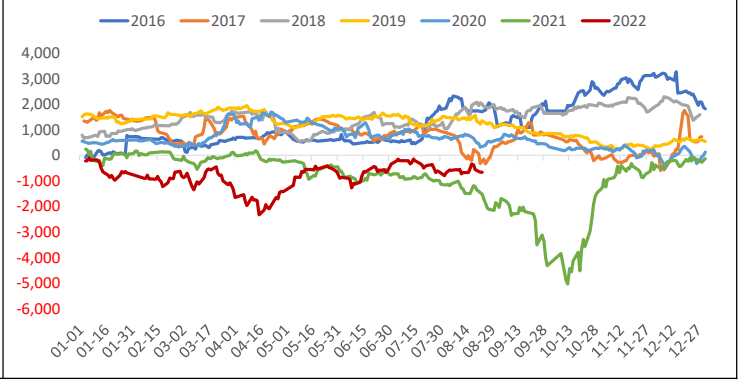
TA-EG价差 – 季节图



SM-SF价差 – 走势图



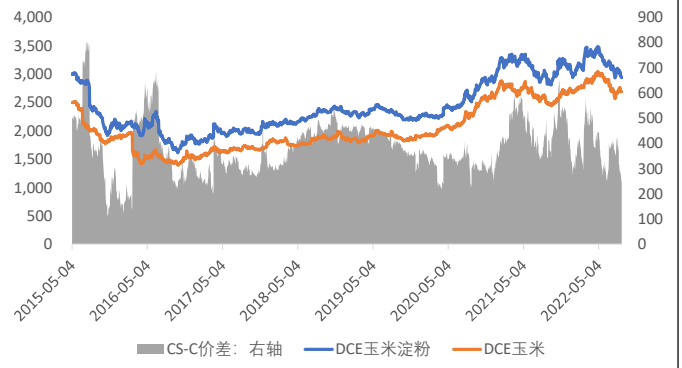
SM-SF价差 – 季节图



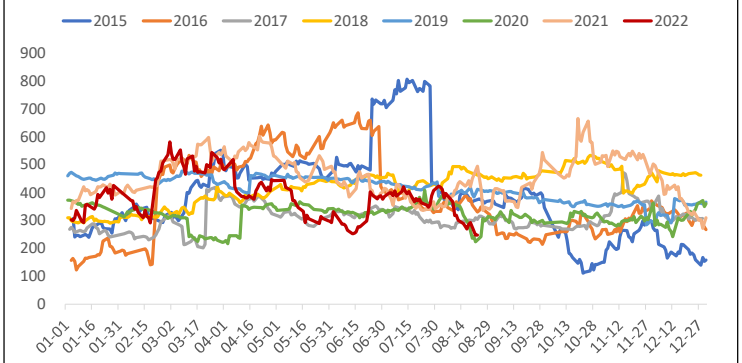
重要商品主力价差套利表现

研究咨询部　　2022年8月23日

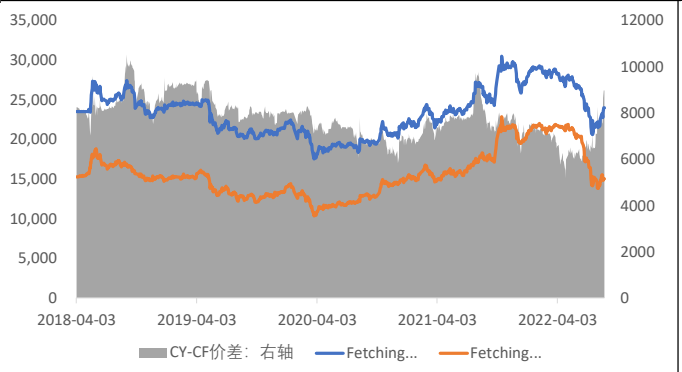
CS-C价差 - 走势图



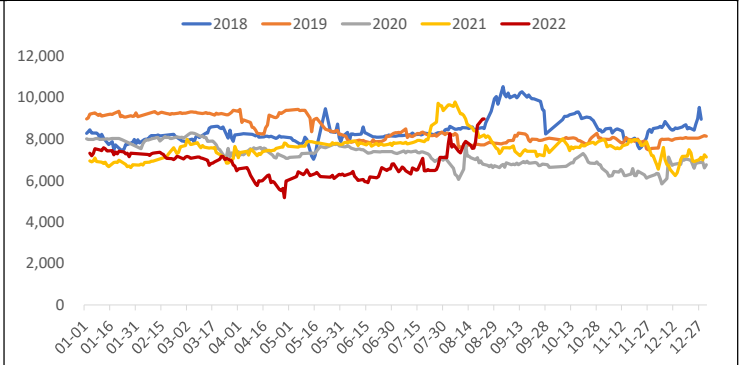
CS-C价差 - 季节图



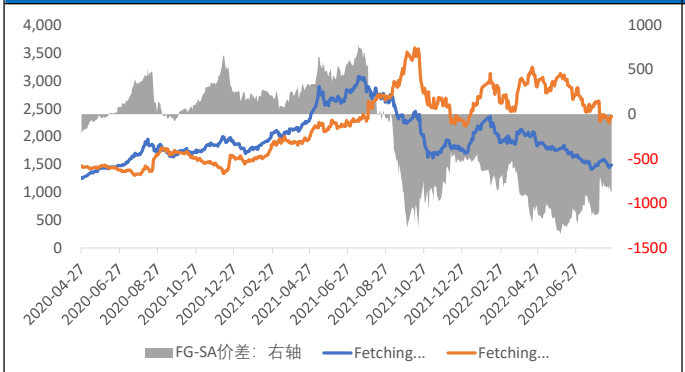
CY-CF价差 - 走势图



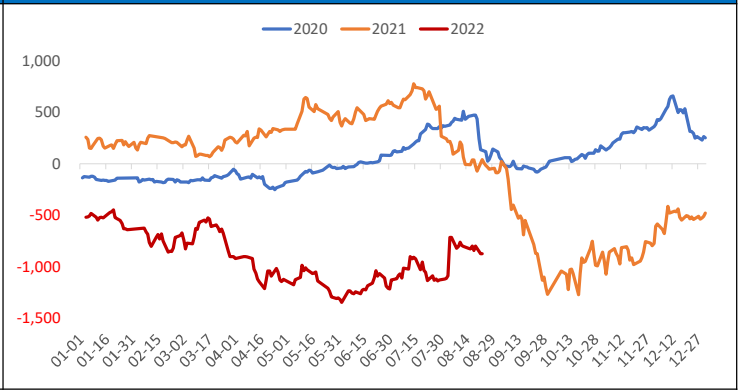
CY-CF价差 - 季节图



FG-SA价差 - 走势图



FG-SA价差 - 季节图



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送，版权归冠通期货所有。未经我公司书面许可，任何机构和个人均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
联系方式：010-85356618