

商品期货波动率跟踪

2021年10月19日

20日历史波动率百分位高于90%:

硅铁、纯碱、PVC、郑棉、甲醇、红枣、锰硅、动煤、
沪铝、玻璃、尿素、苹果、不锈钢、焦炭、焦煤、
沪锌、沪锡、乙二醇、塑料、PP、淀粉、铁矿、
LPG、TA、生猪、菜油、棕榈

20日历史波动率百分位低于10%:

无

20日历史波动率绝对值前五:

锰硅、硅铁、动煤、焦炭、焦煤

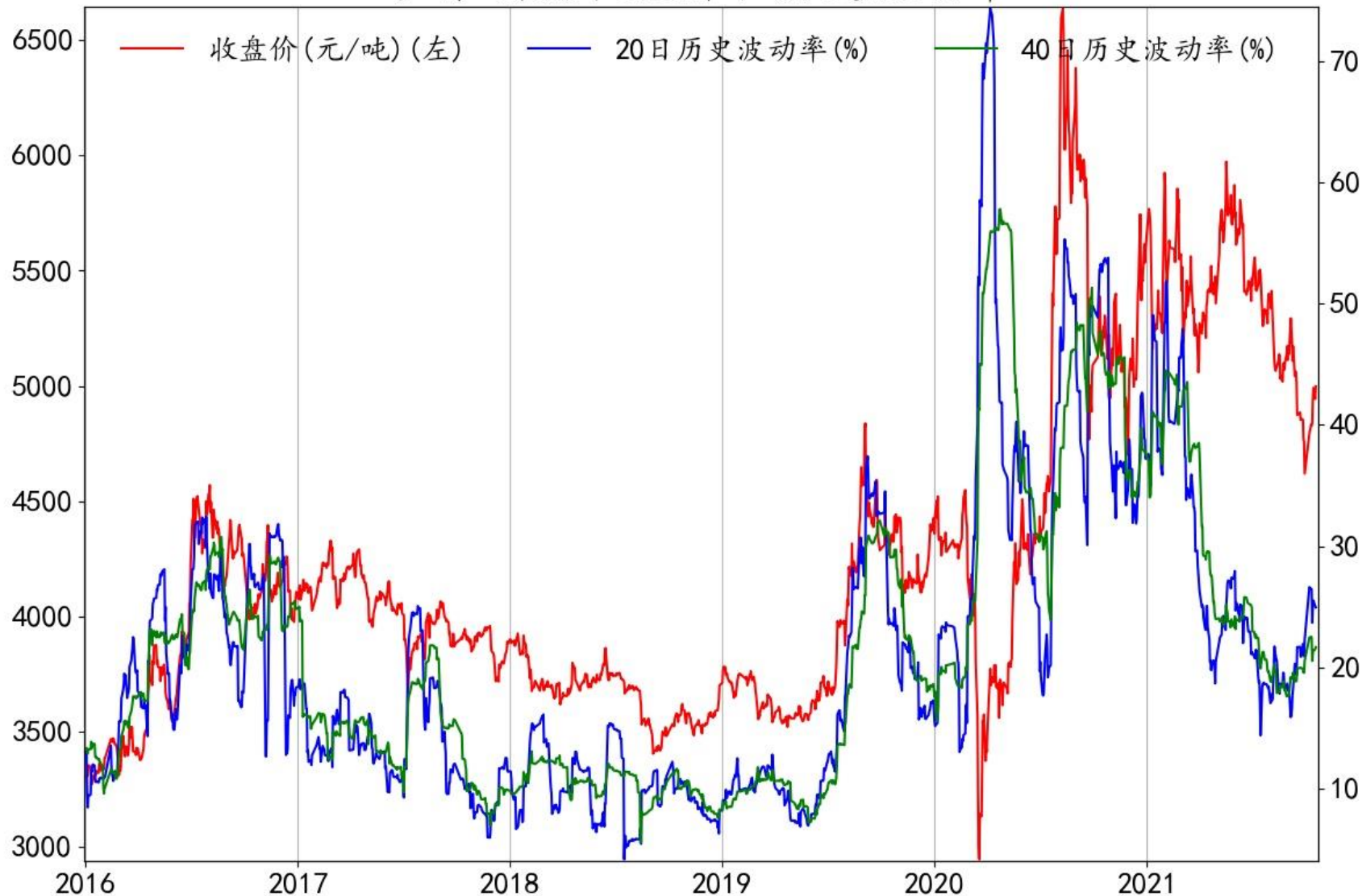
20日历史波动率绝对值后五:

沪金、郑糖、豆粕、玉米、鸡蛋

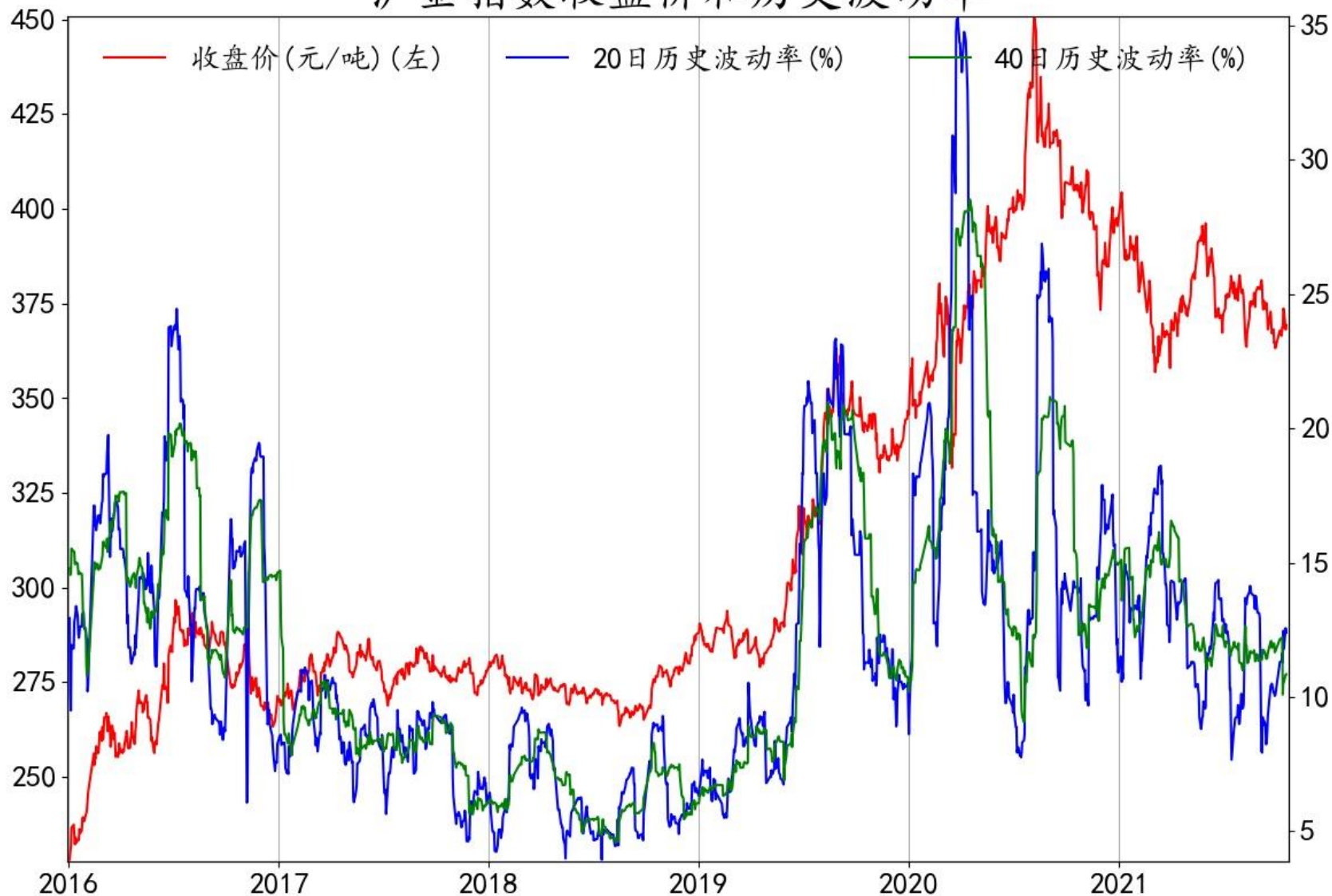
时间百分位 绝对值			时间百分位 绝对值		
沪银	70.88%	24.94%	硅铁	100.00%	79.49%
沪金	60.80%	12.40%	锰硅	99.79%	87.15%
沪铝	99.43%	32.12%	不锈钢	98.39%	42.18%
沪铜	89.56%	23.22%	玻璃	99.43%	42.14%
沪镍	66.83%	25.49%	PVC	99.93%	55.49%
沪铅	84.59%	22.99%	燃油	83.62%	39.78%
沪锡	96.73%	35.79%	低硫燃油	34.52%	26.94%
沪锌	97.66%	38.01%	LPG	92.88%	42.41%
热卷	55.18%	22.72%	原油	47.16%	28.05%
铁矿	93.61%	56.28%	动煤	99.57%	73.86%
焦炭	98.22%	62.78%	沥青	61.58%	29.43%
焦煤	97.80%	60.50%	苯乙烯	78.23%	37.13%
螺纹	68.04%	28.45%	乙二醇	96.53%	53.30%

	时间百分位	绝对值		时间百分位	绝对值
塑料	96.31%	32.12%	菜油	91.19%	24.16%
甲醇	99.86%	52.51%	棕榈	90.62%	32.66%
20号胶	59.35%	27.53%	菜粕	56.96%	19.50%
短纤	87.18%	34.29%	豆油	84.30%	22.77%
PP	94.74%	32.25%	郑棉	99.93%	45.22%
沪胶	51.56%	26.08%	郑糖	65.20%	13.84%
纯碱	100.00%	53.45%	苹果	99.13%	43.90%
纸浆	80.76%	23.06%	红枣	99.83%	54.45%
TA	92.47%	33.09%	淀粉	94.39%	21.57%
尿素	99.39%	56.22%	鸡蛋	37.14%	16.13%
玉米	84.94%	15.42%	生猪	91.71%	44.90%
豆一	74.50%	19.10%			
豆粕	43.11%	15.24%			

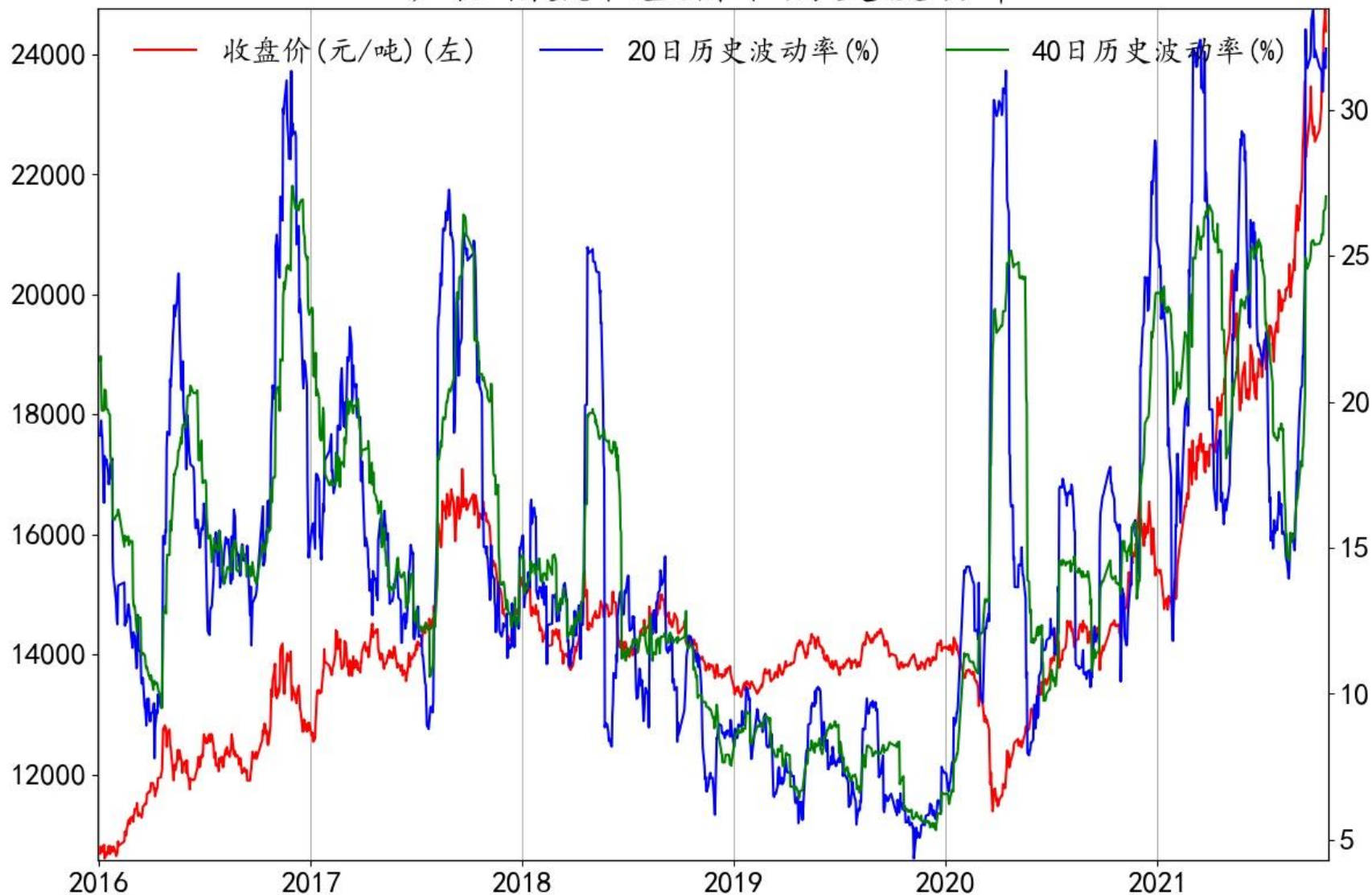
沪银指数收盘价和历史波动率



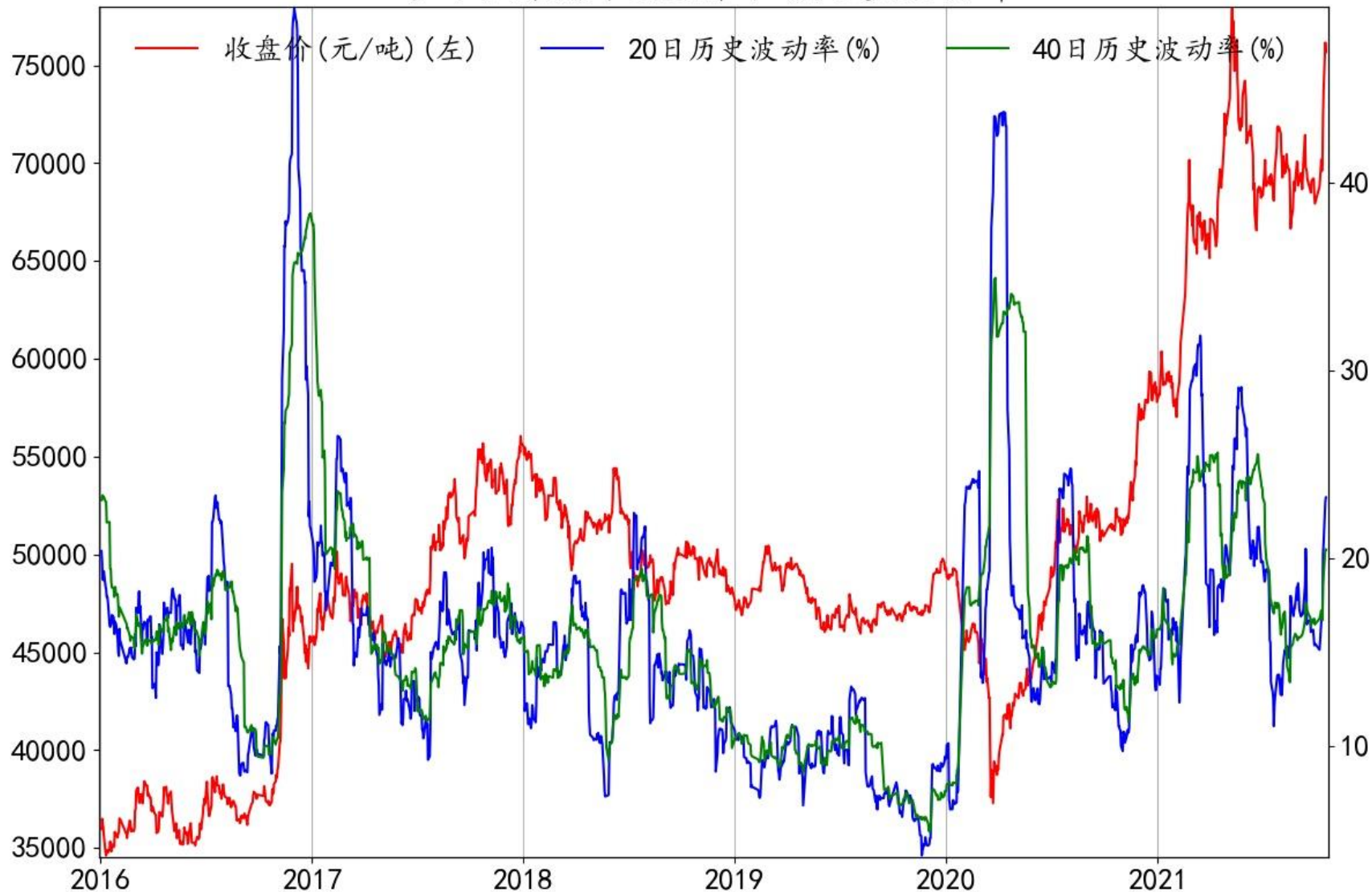
沪金指数收盘价和历史波动率



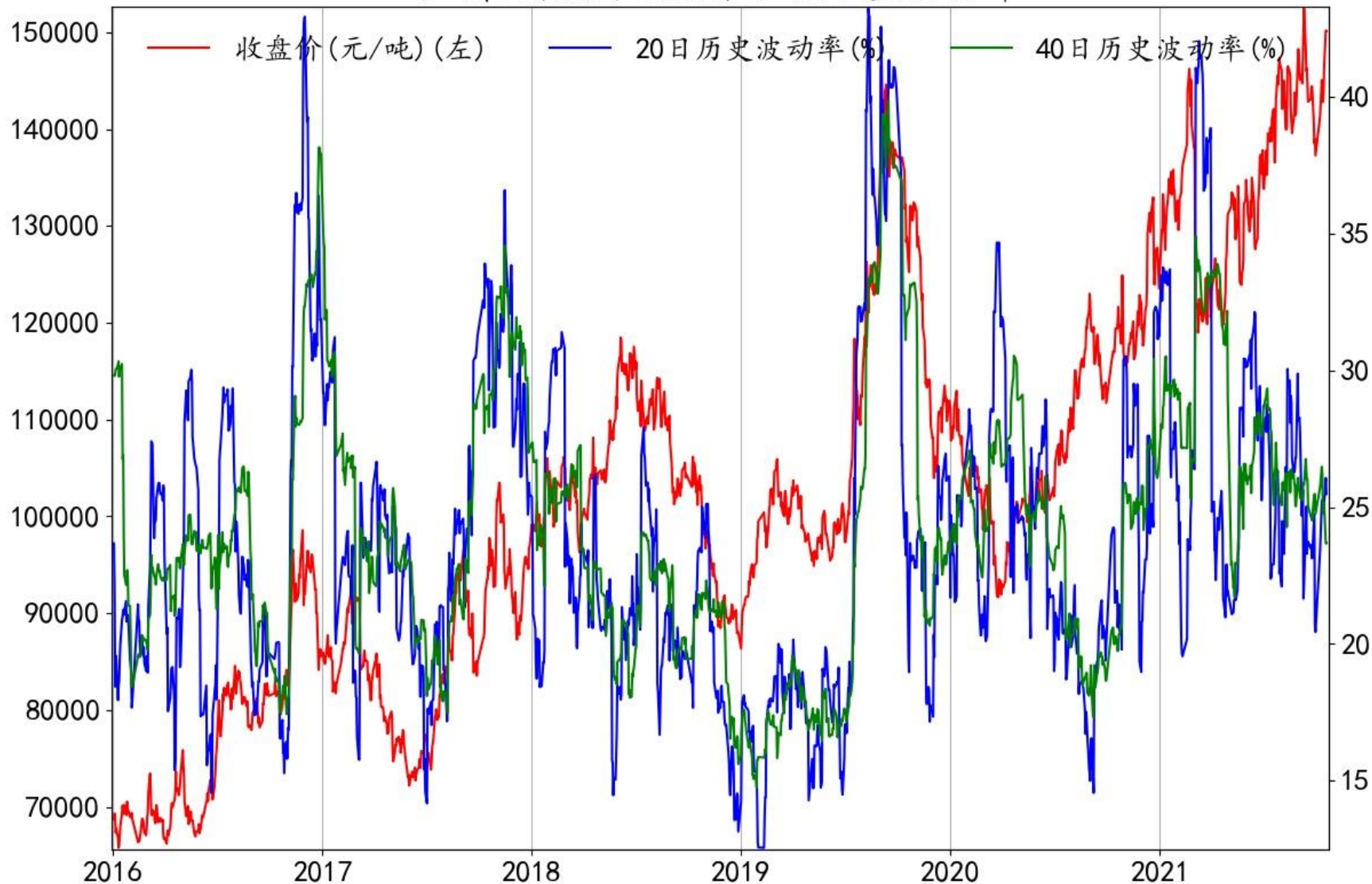
沪铝指数收盘价和历史波动率



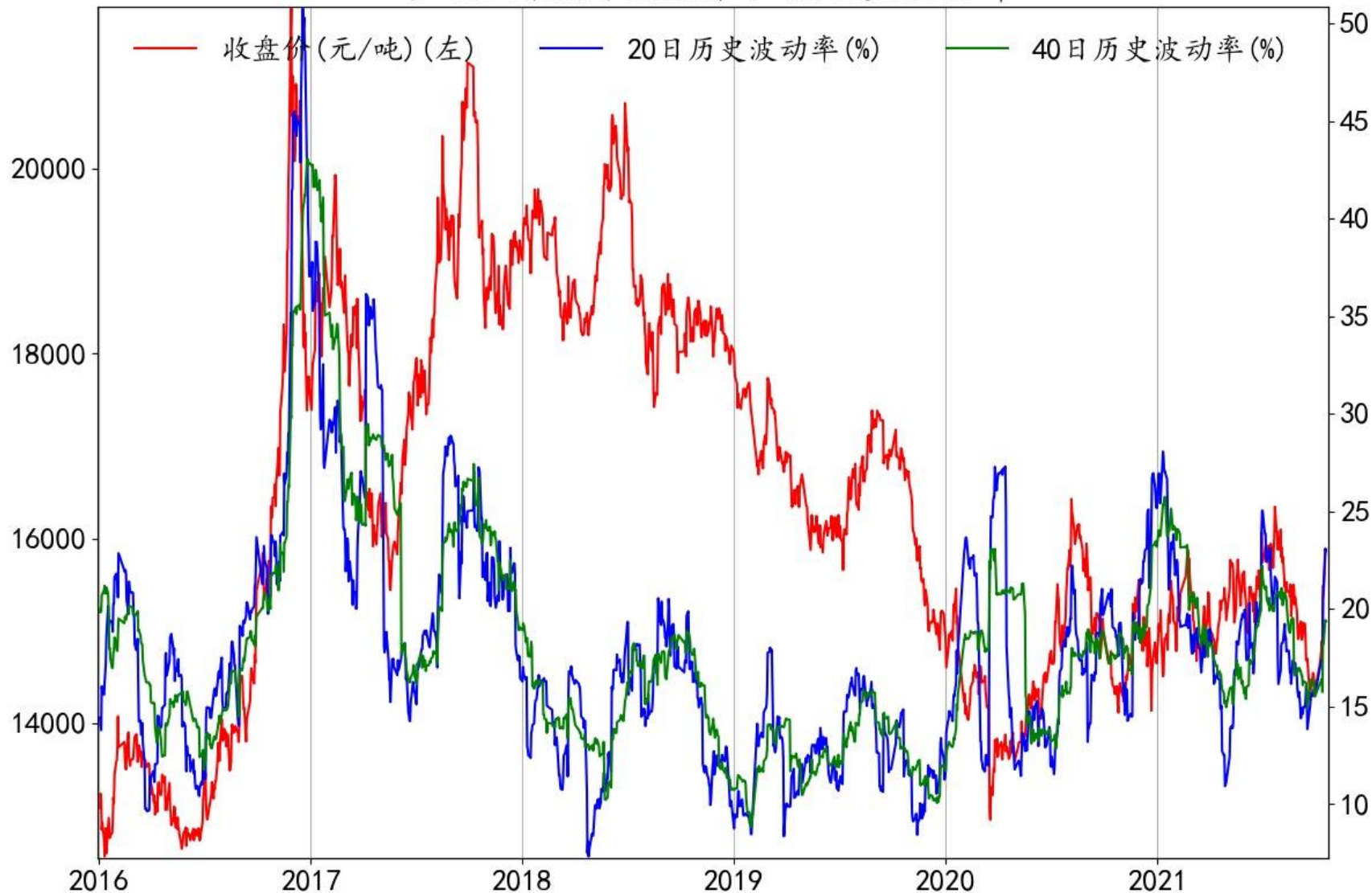
沪铜指数收盘价和历史波动率



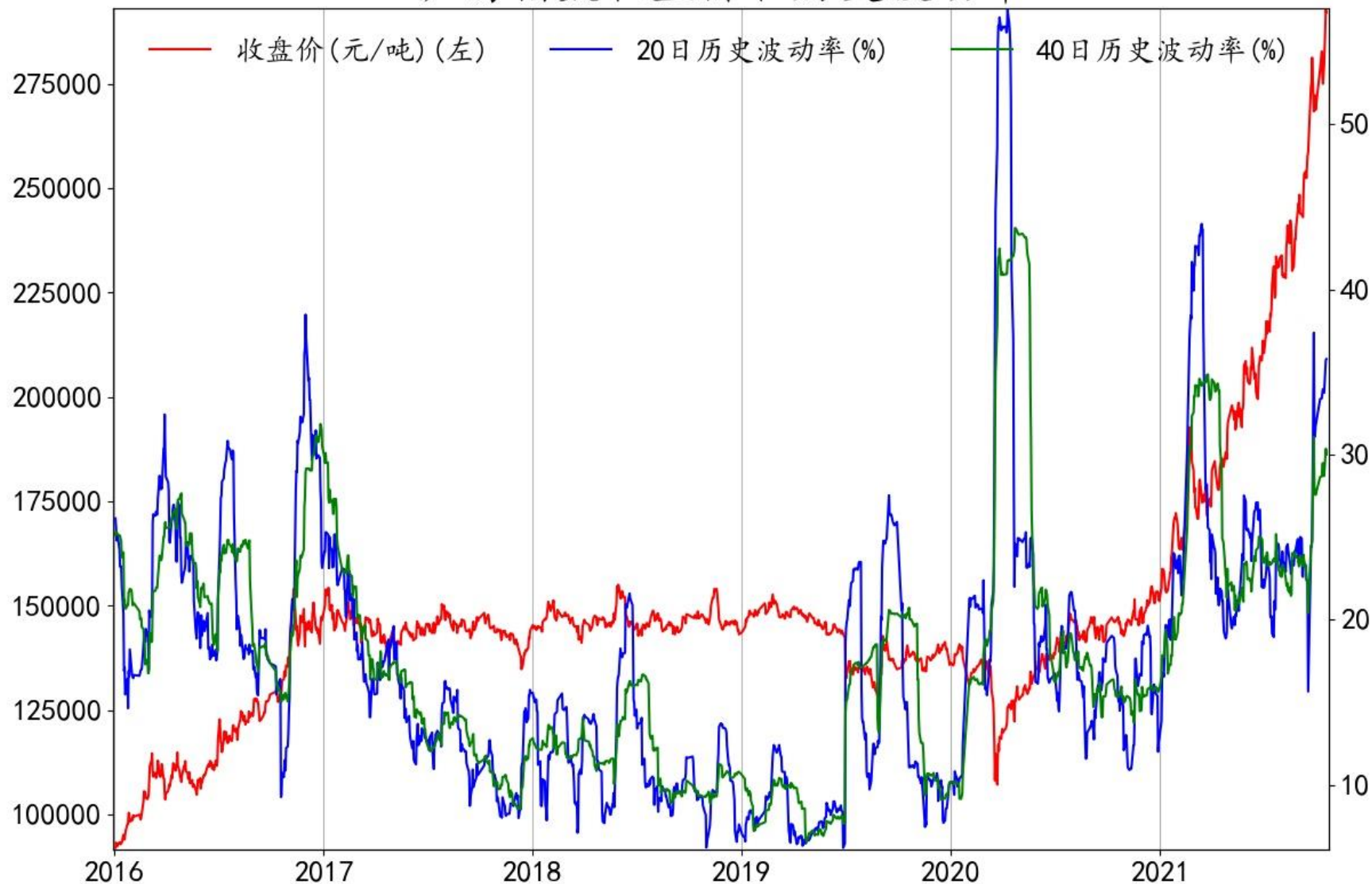
沪镍指数收盘价和历史波动率



沪铅指数收盘价和历史波动率



沪锡指数收盘价和历史波动率



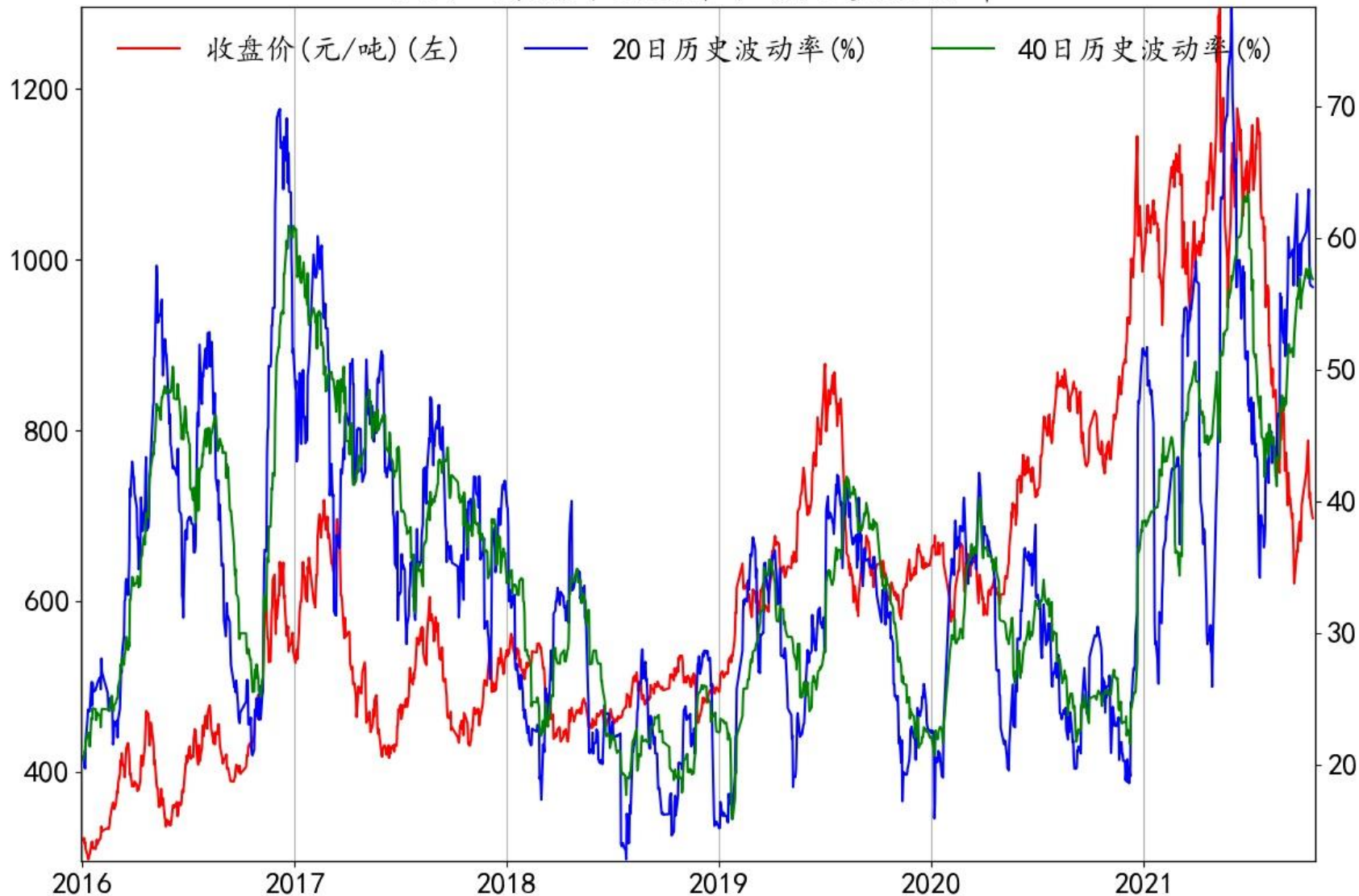
沪锌指数收盘价和历史波动率



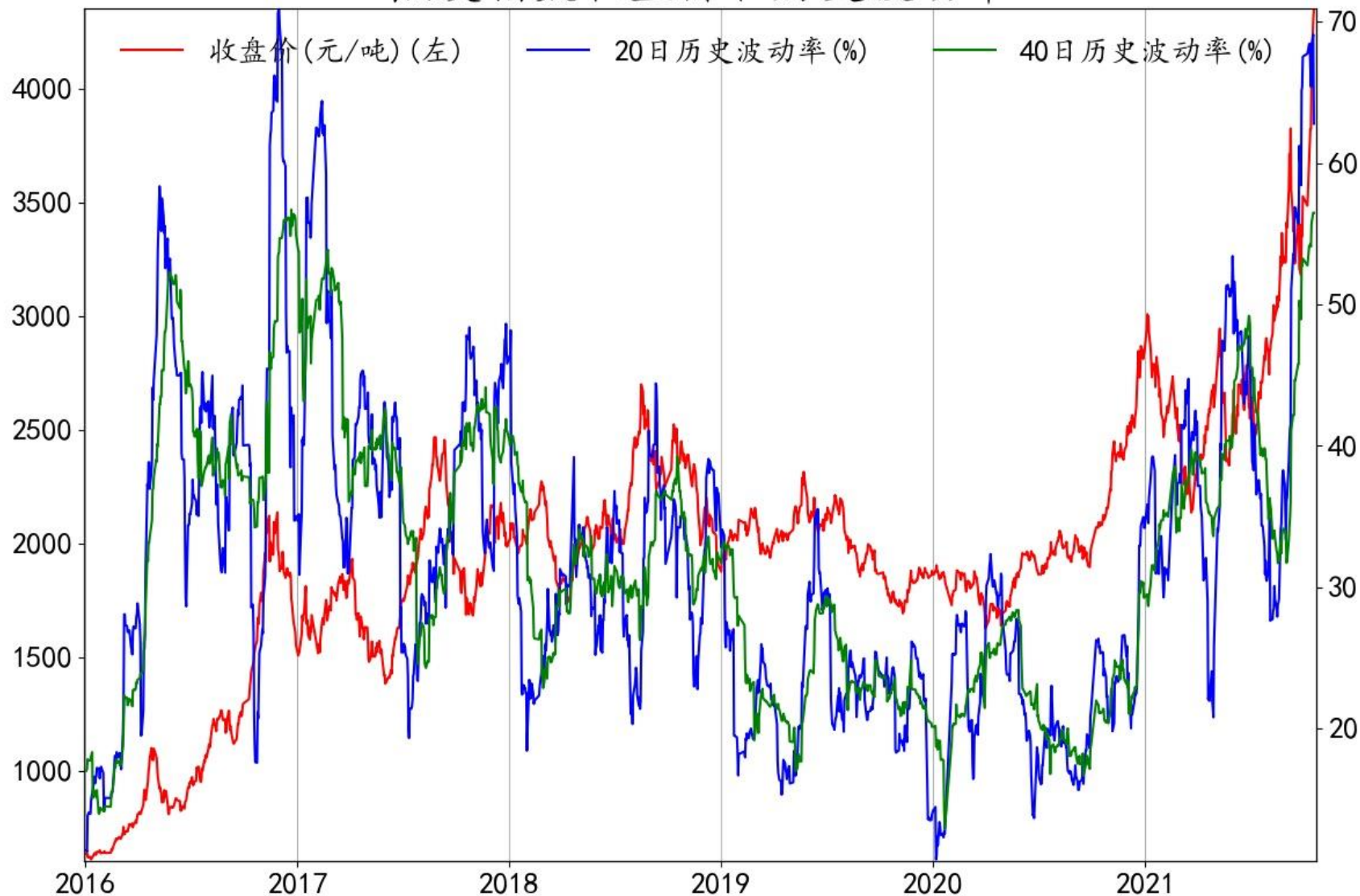
热卷指数收盘价和历史波动率



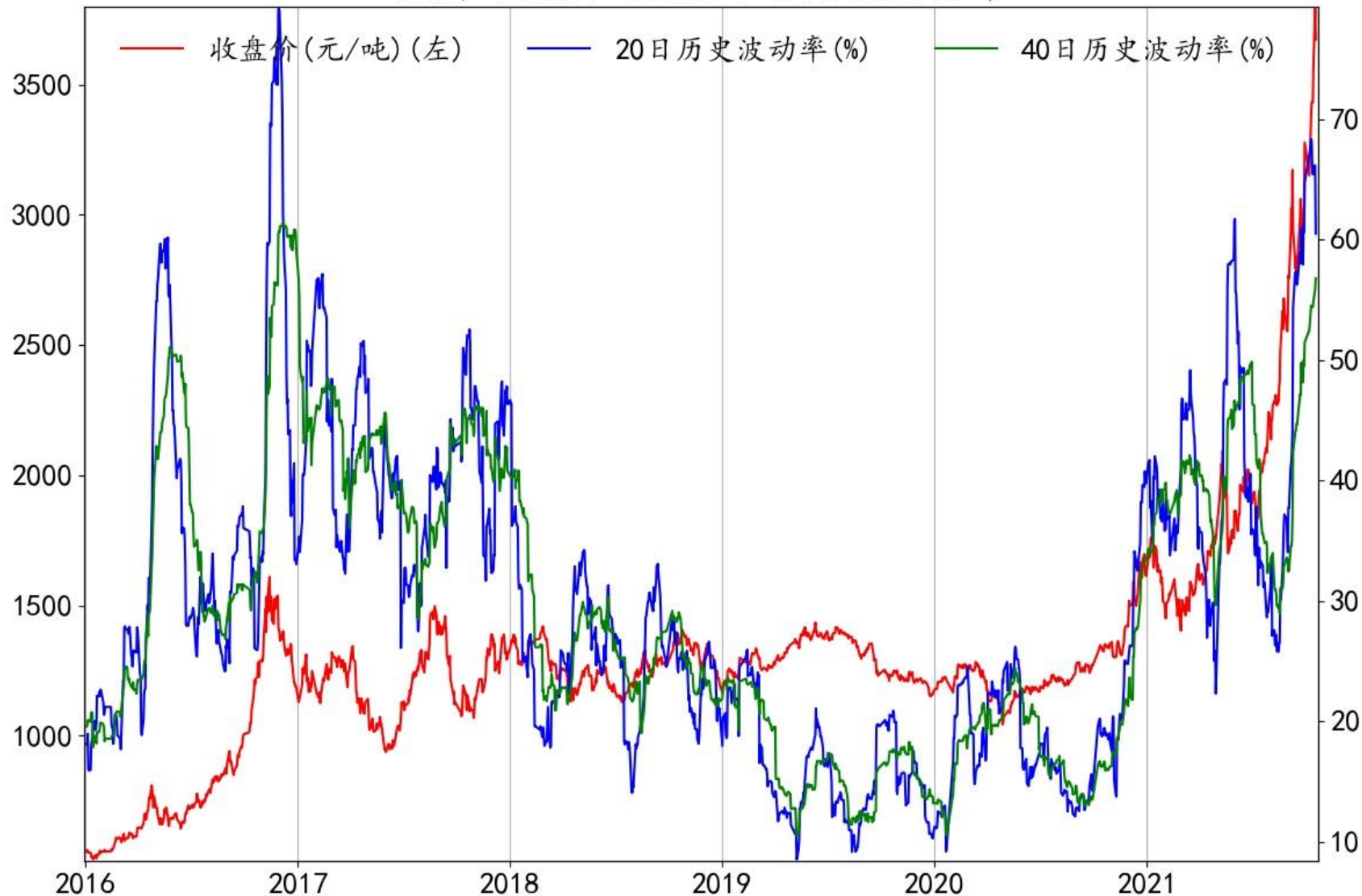
铁矿指数收盘价和历史波动率



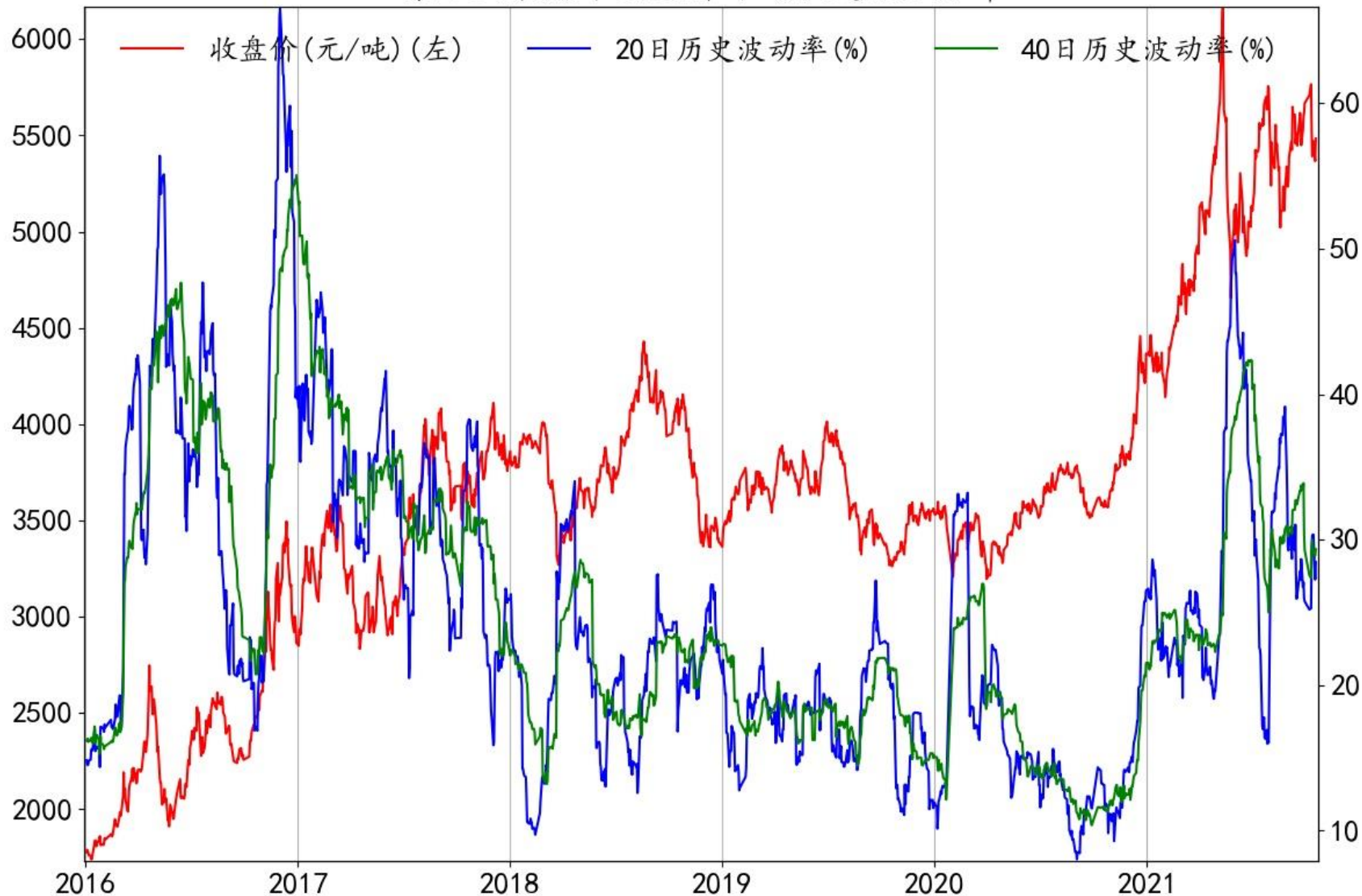
焦炭指数收盘价和历史波动率



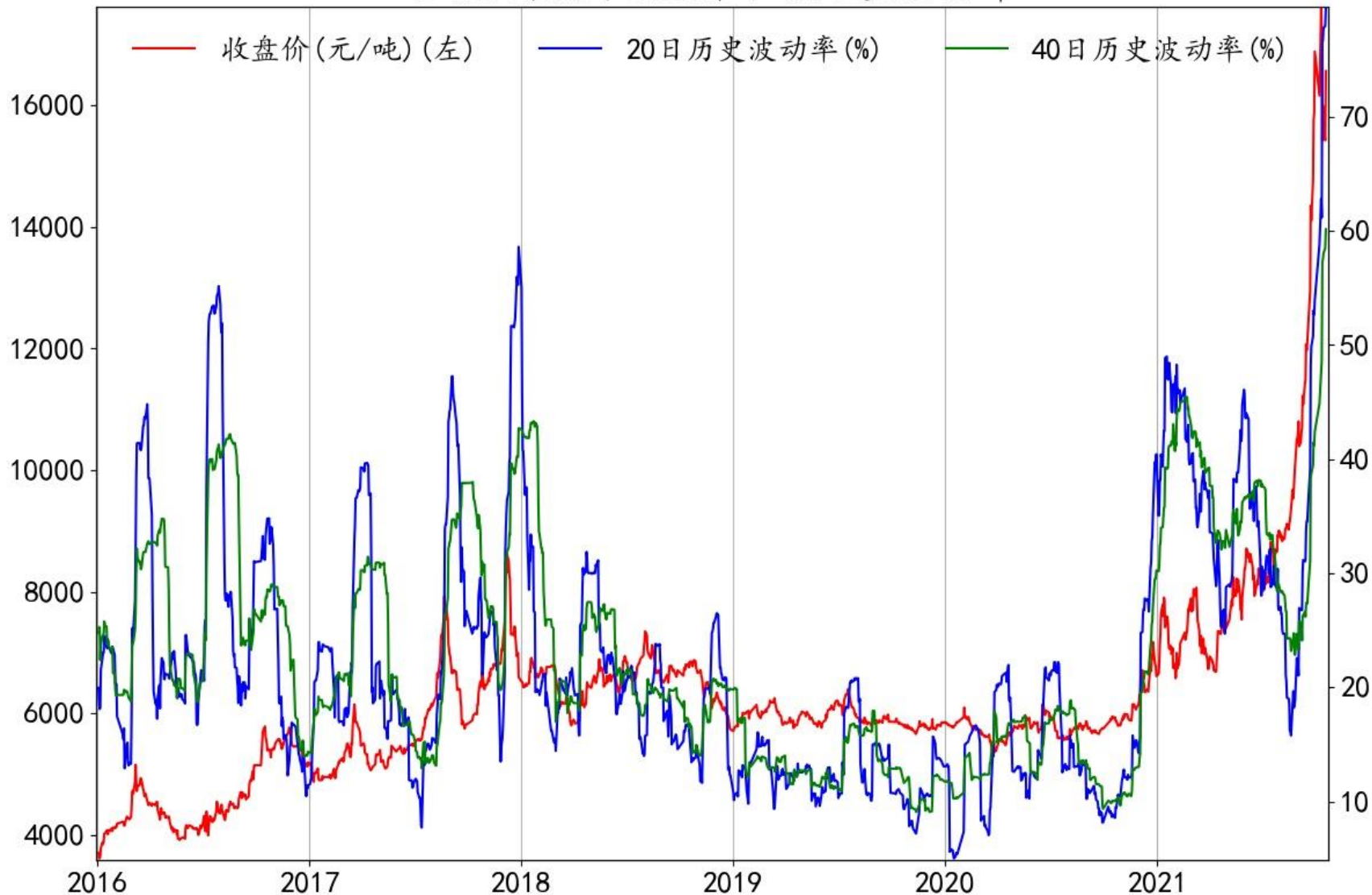
焦煤指数收盘价和历史波动率



螺纹指数收盘价和历史波动率



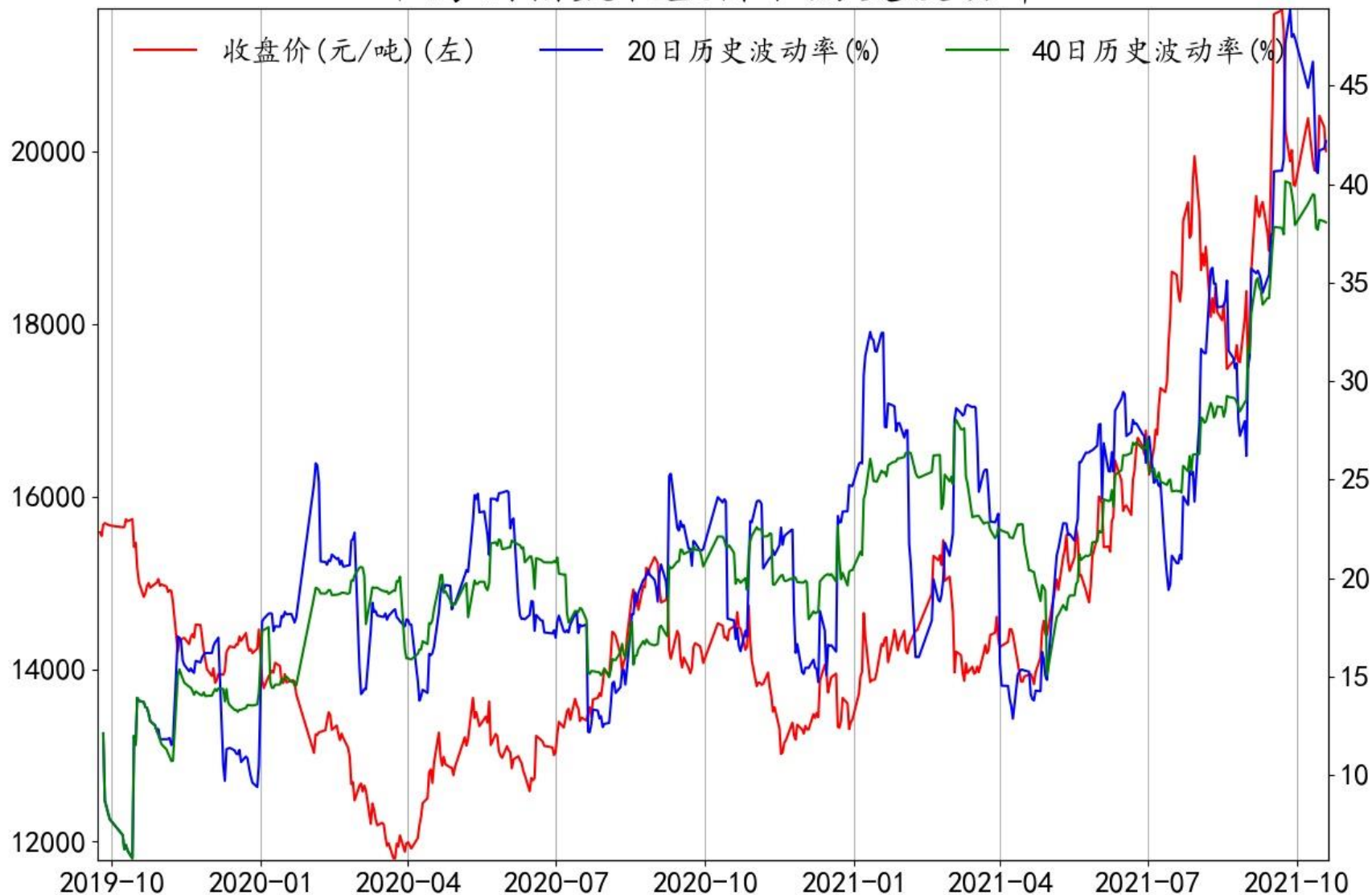
硅铁指数收盘价和历史波动率



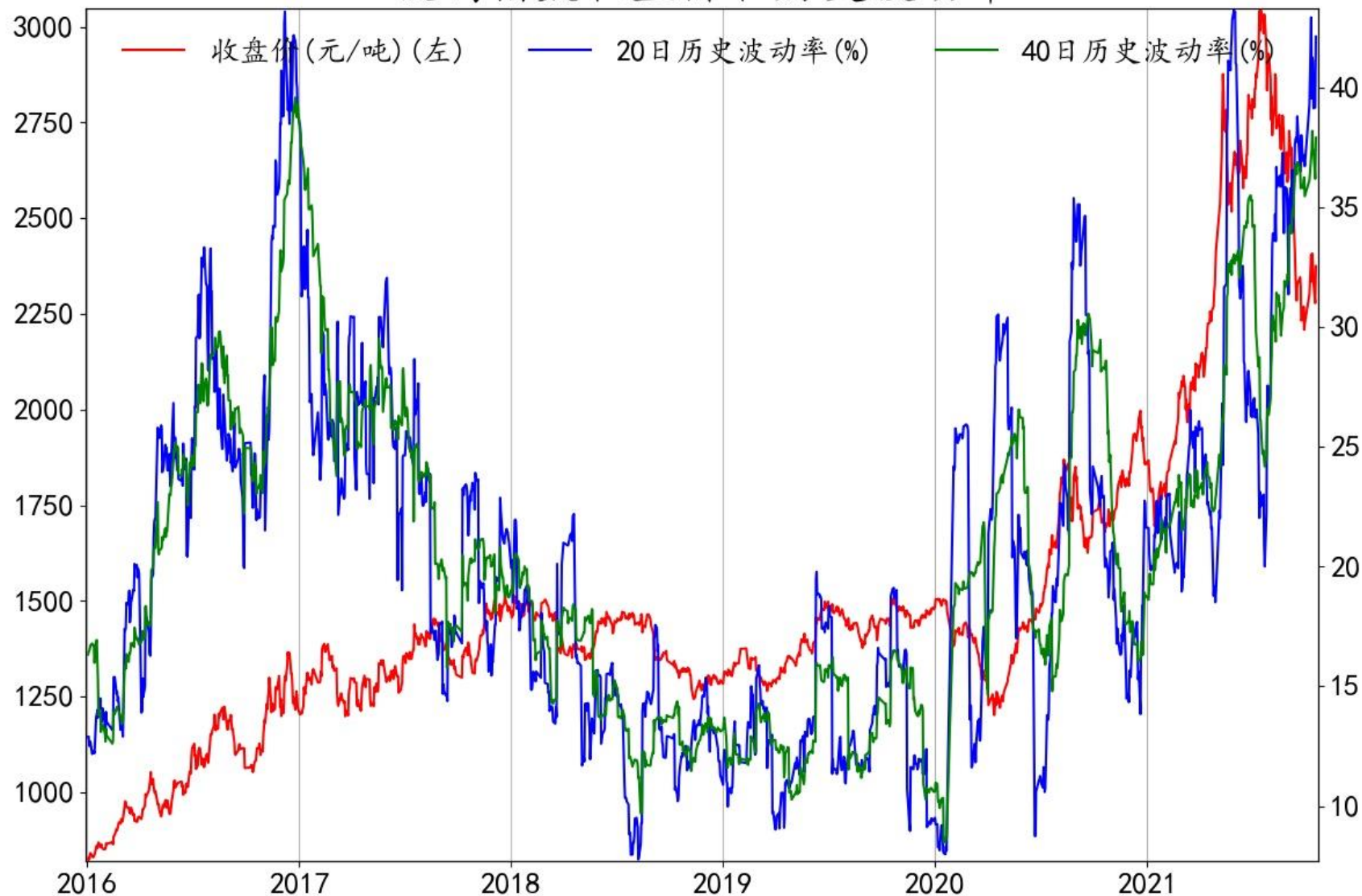
锰硅指数收盘价和历史波动率



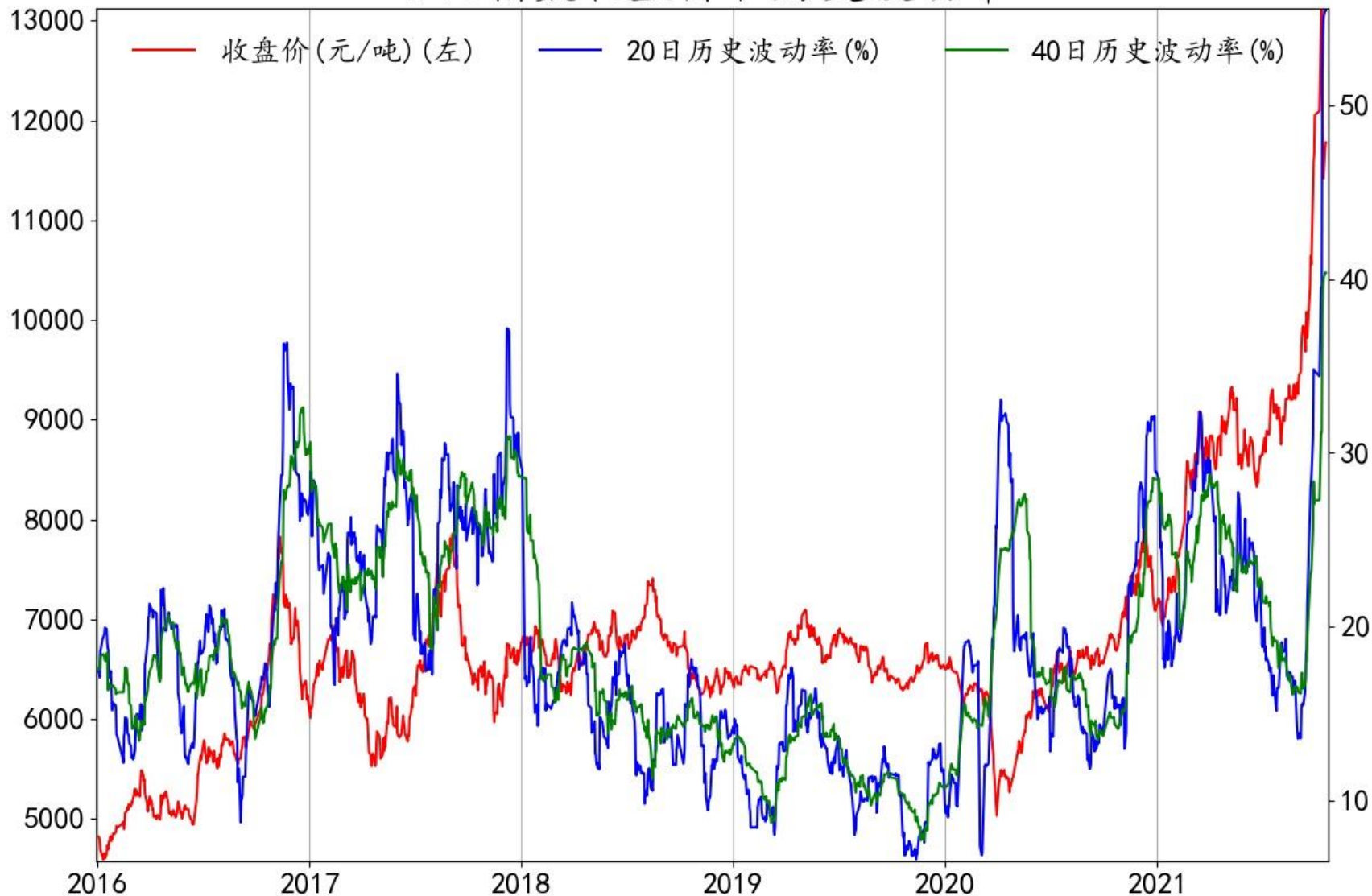
不锈钢指数收盘价和历史波动率



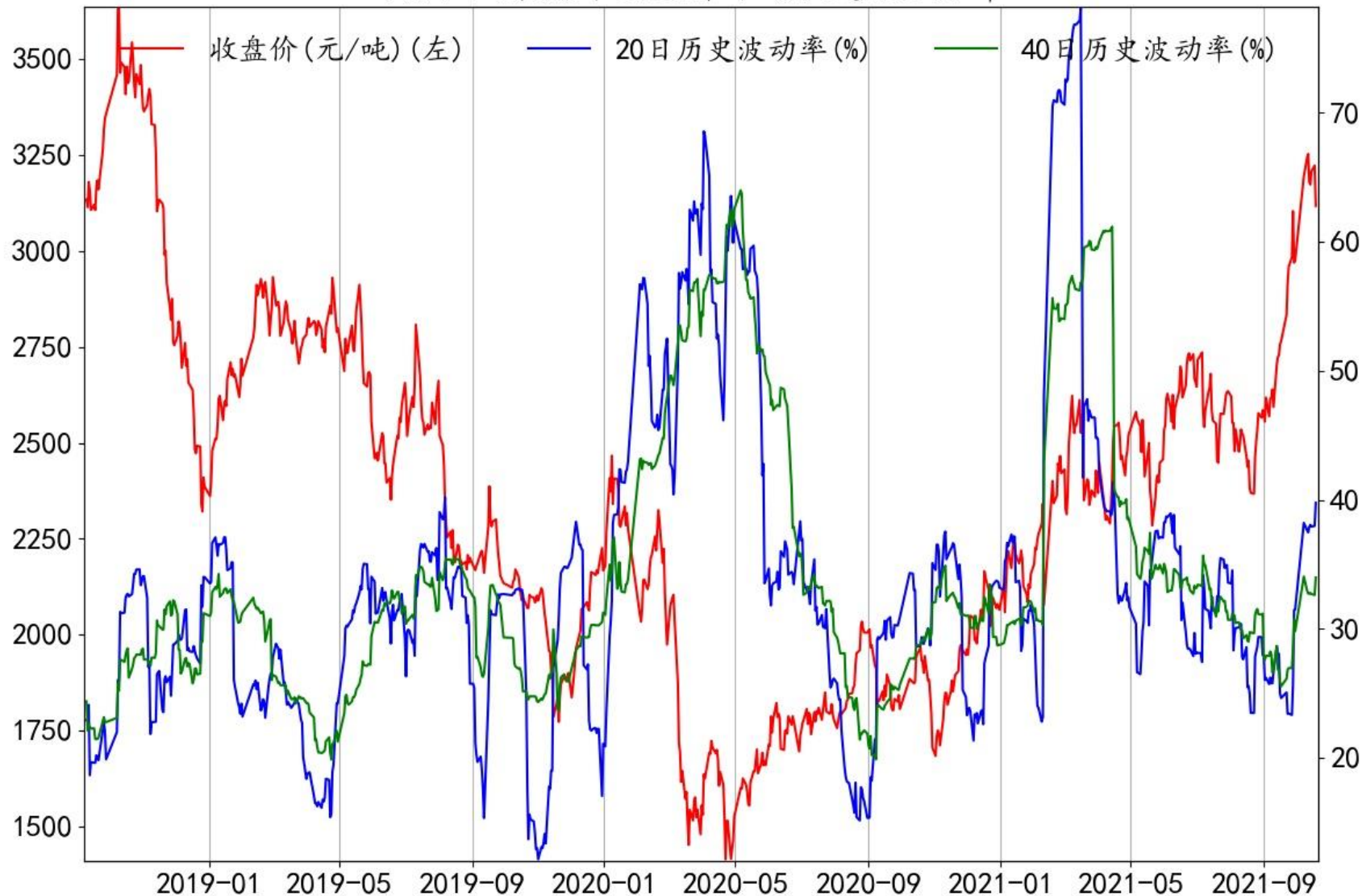
玻璃指数收盘价和历史波动率



PVC指数收盘价和历史波动率

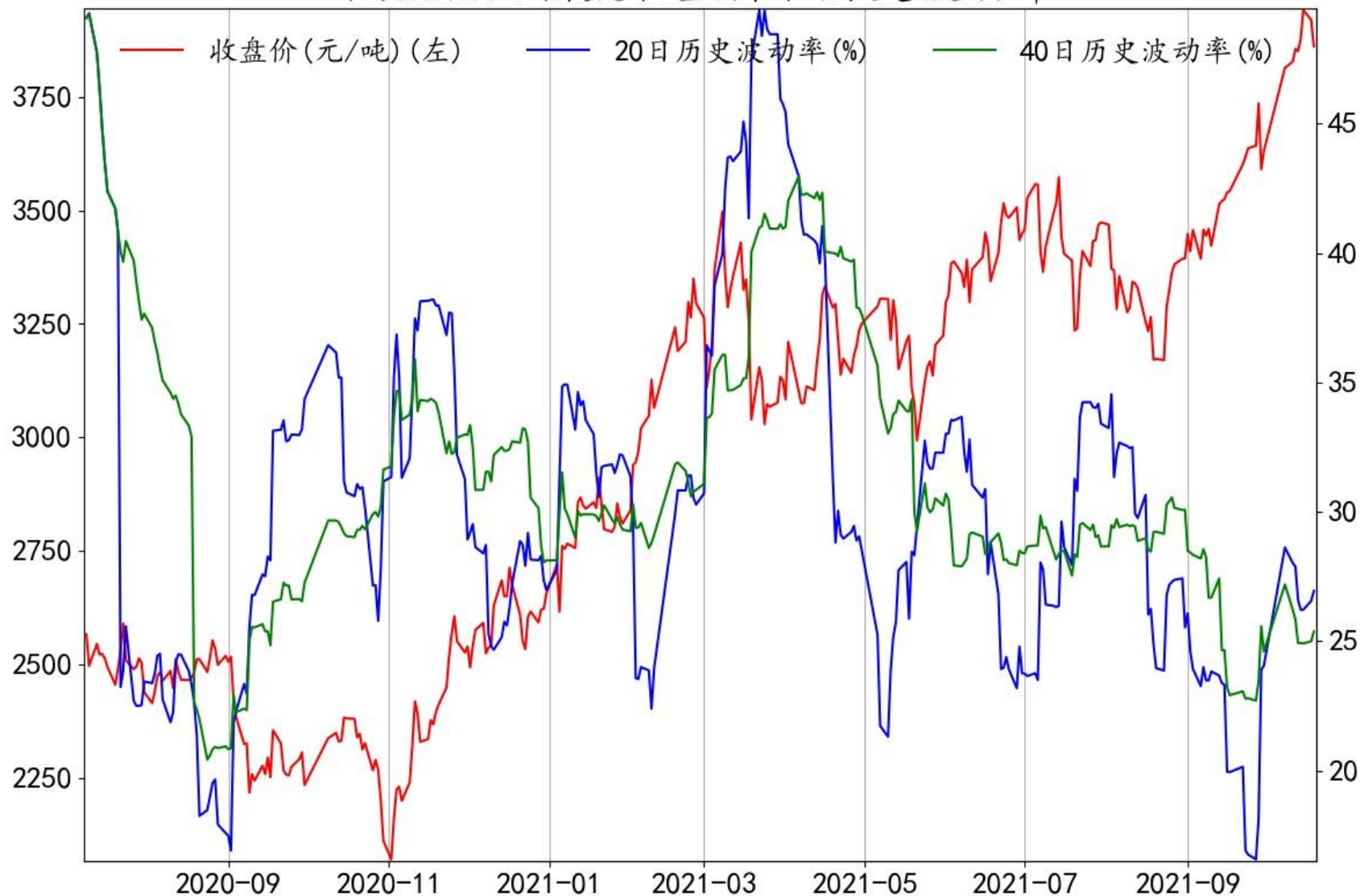


燃油指数收盘价和历史波动率



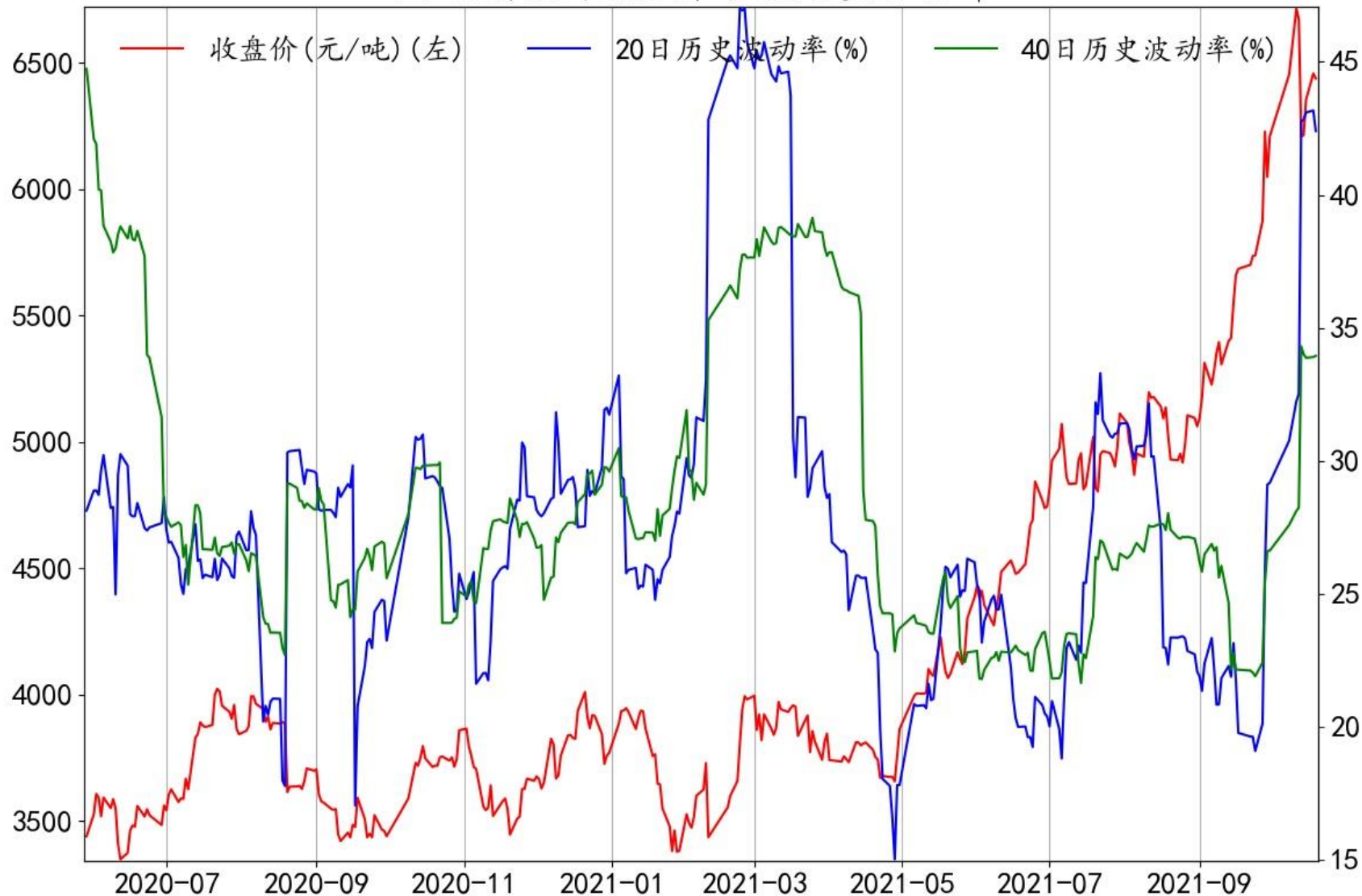
数据来源: Wind、信达期货研发中心

低硫燃油指数收盘价和历史波动率



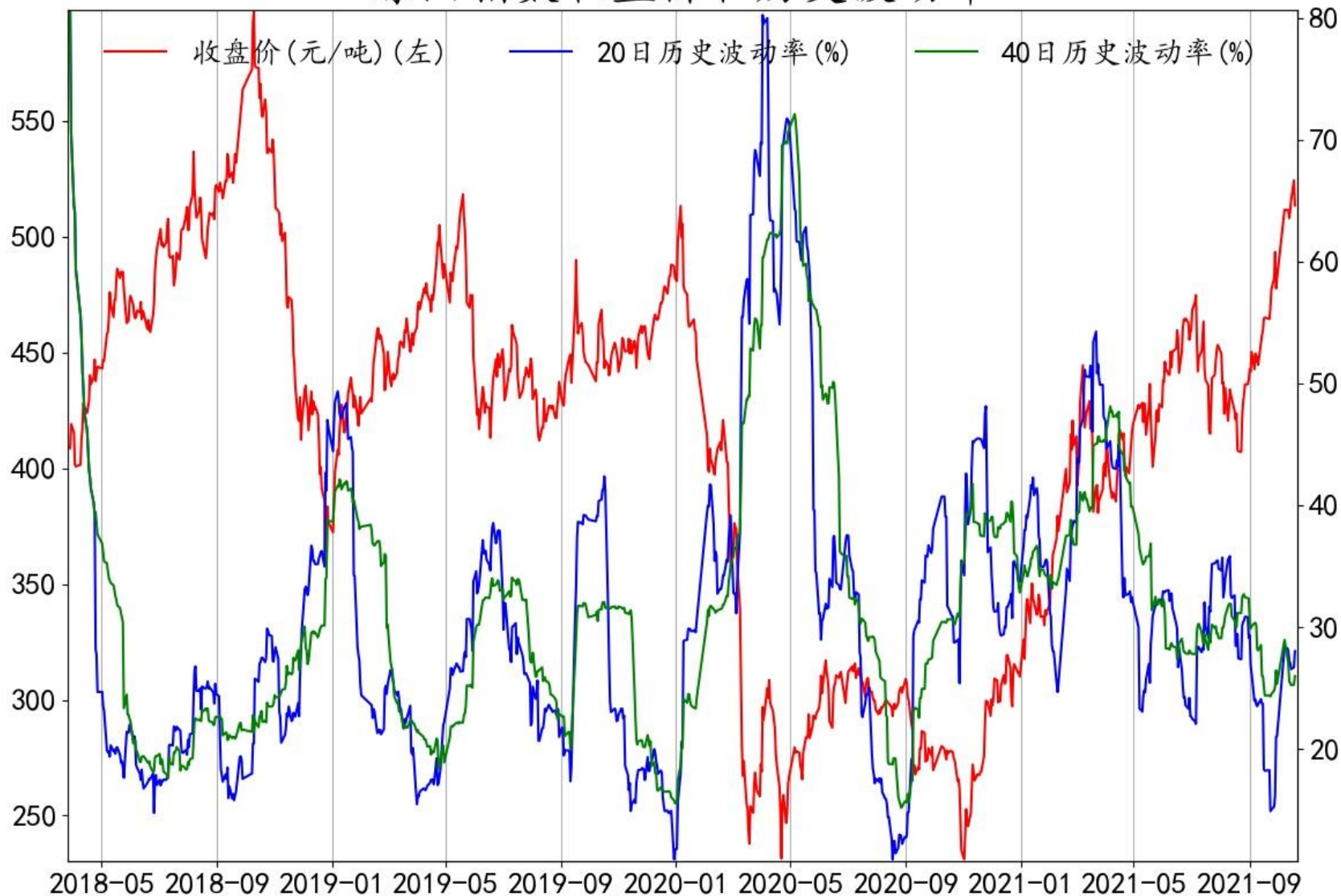
数据来源: Wind、信达期货研发中心

LPG指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

原油指数收盘价和历史波动率

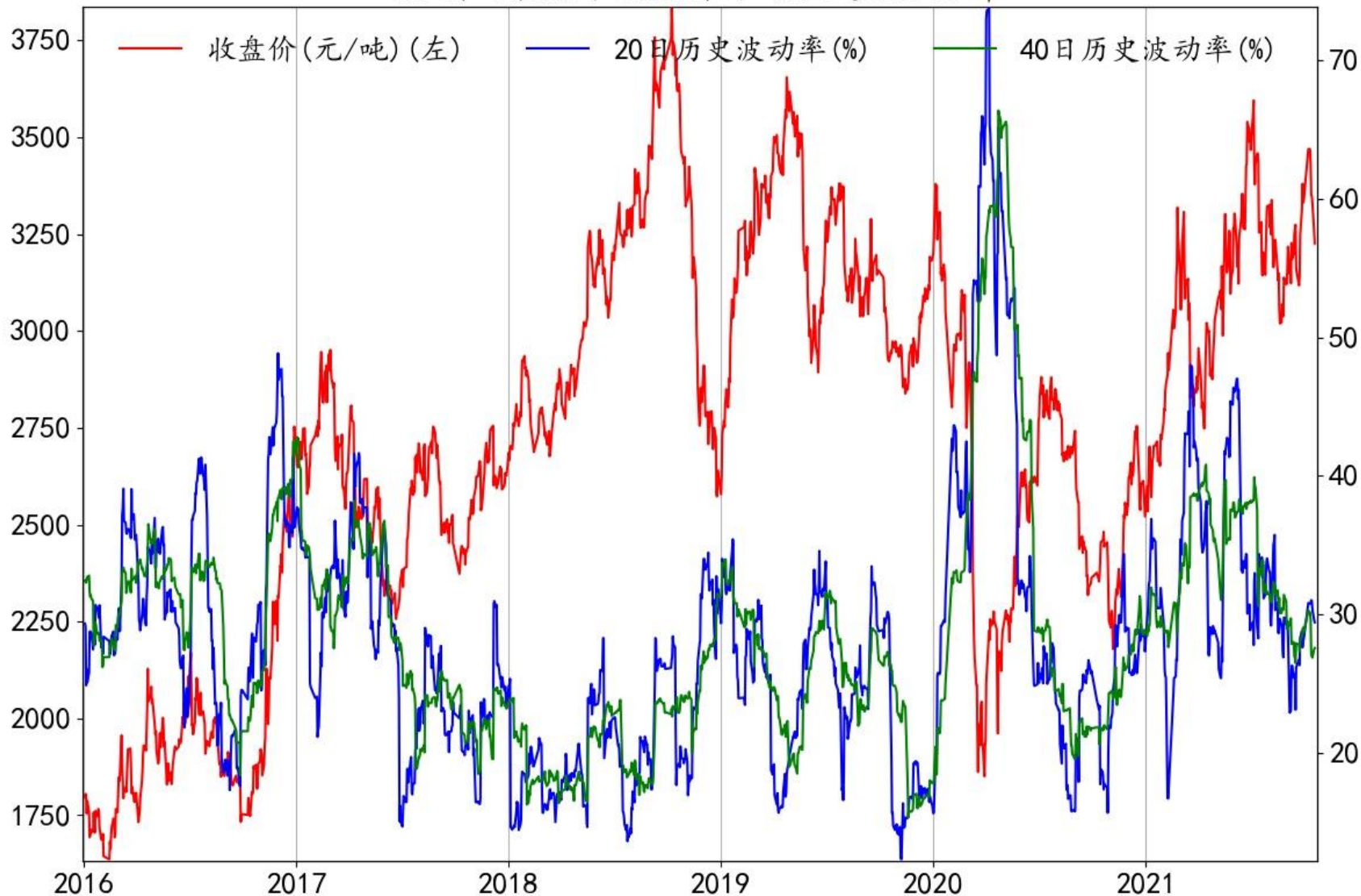


数据来源: Wind、信达期货研发中心

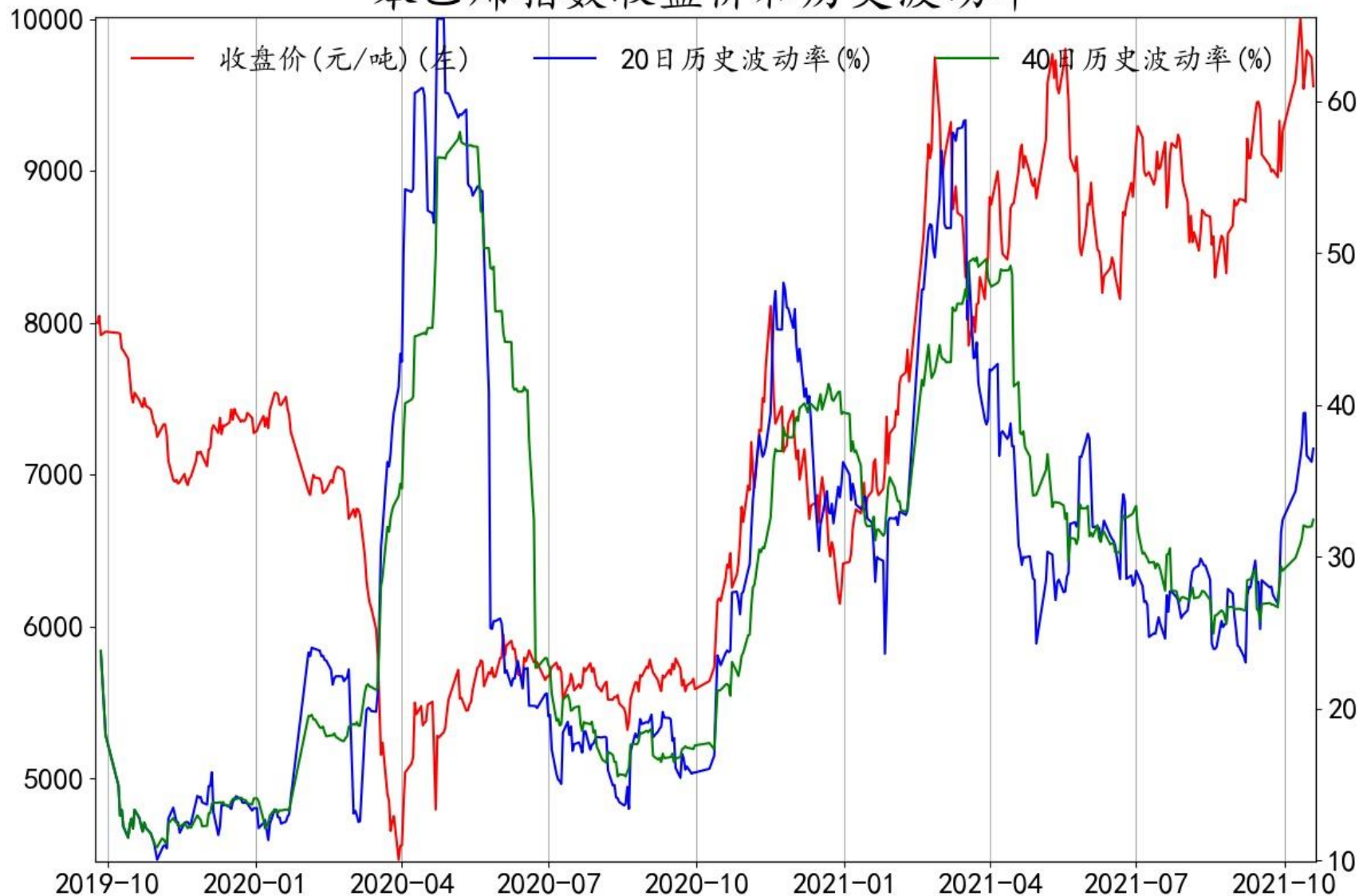
动煤指数收盘价和历史波动率



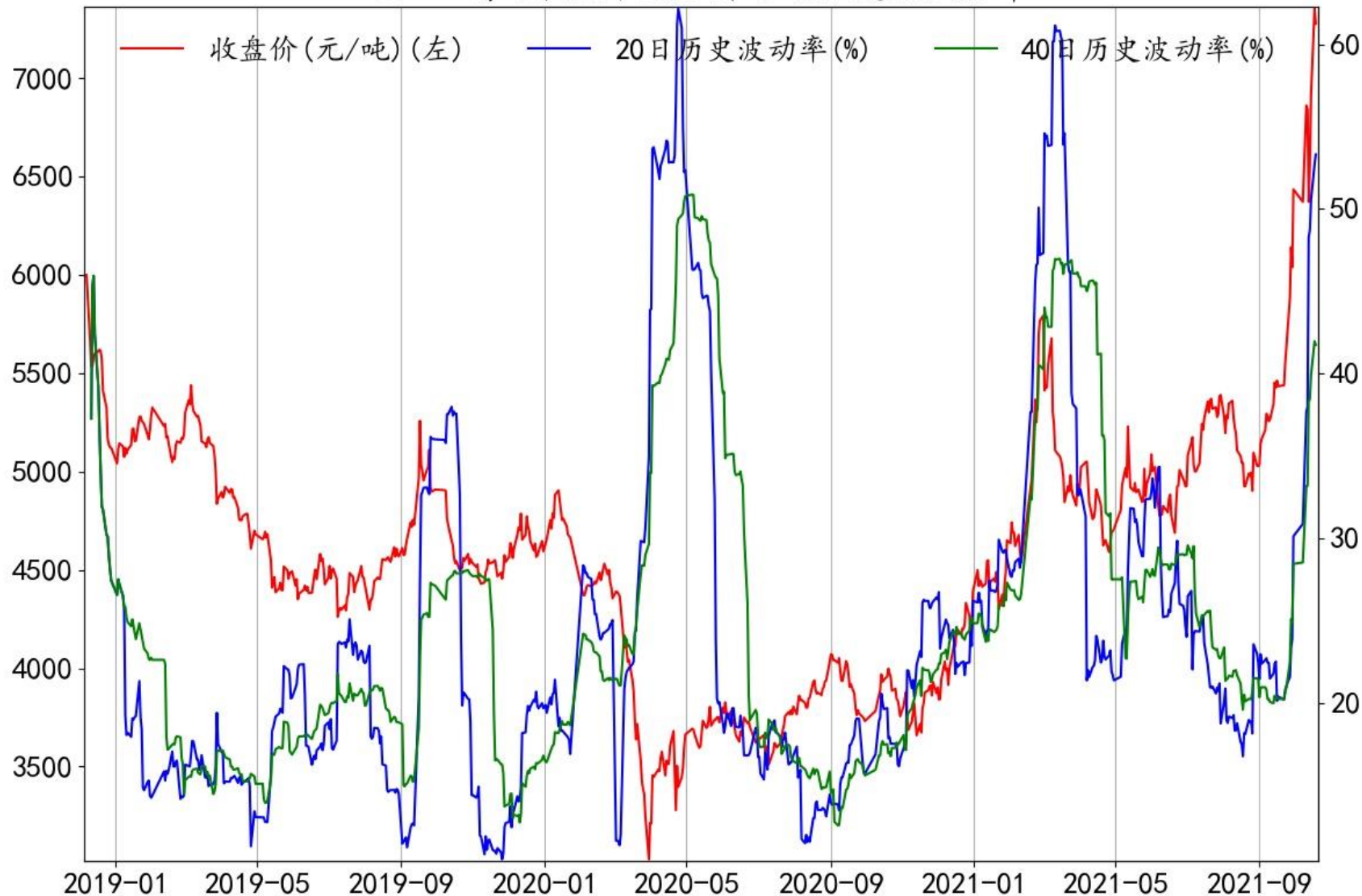
沥青指数收盘价和历史波动率



苯乙烯指数收盘价和历史波动率

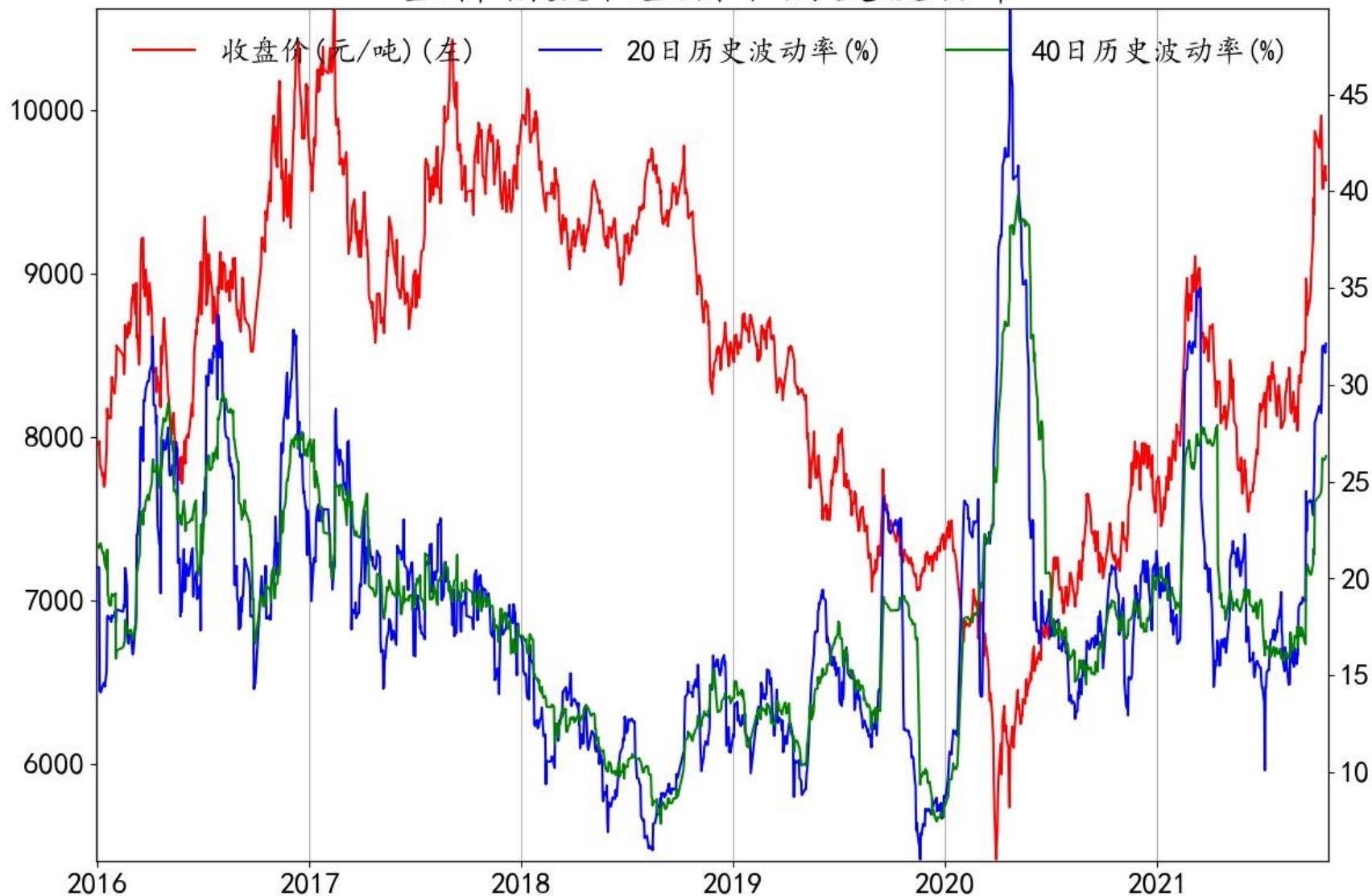


乙二醇指数收盘价和历史波动率

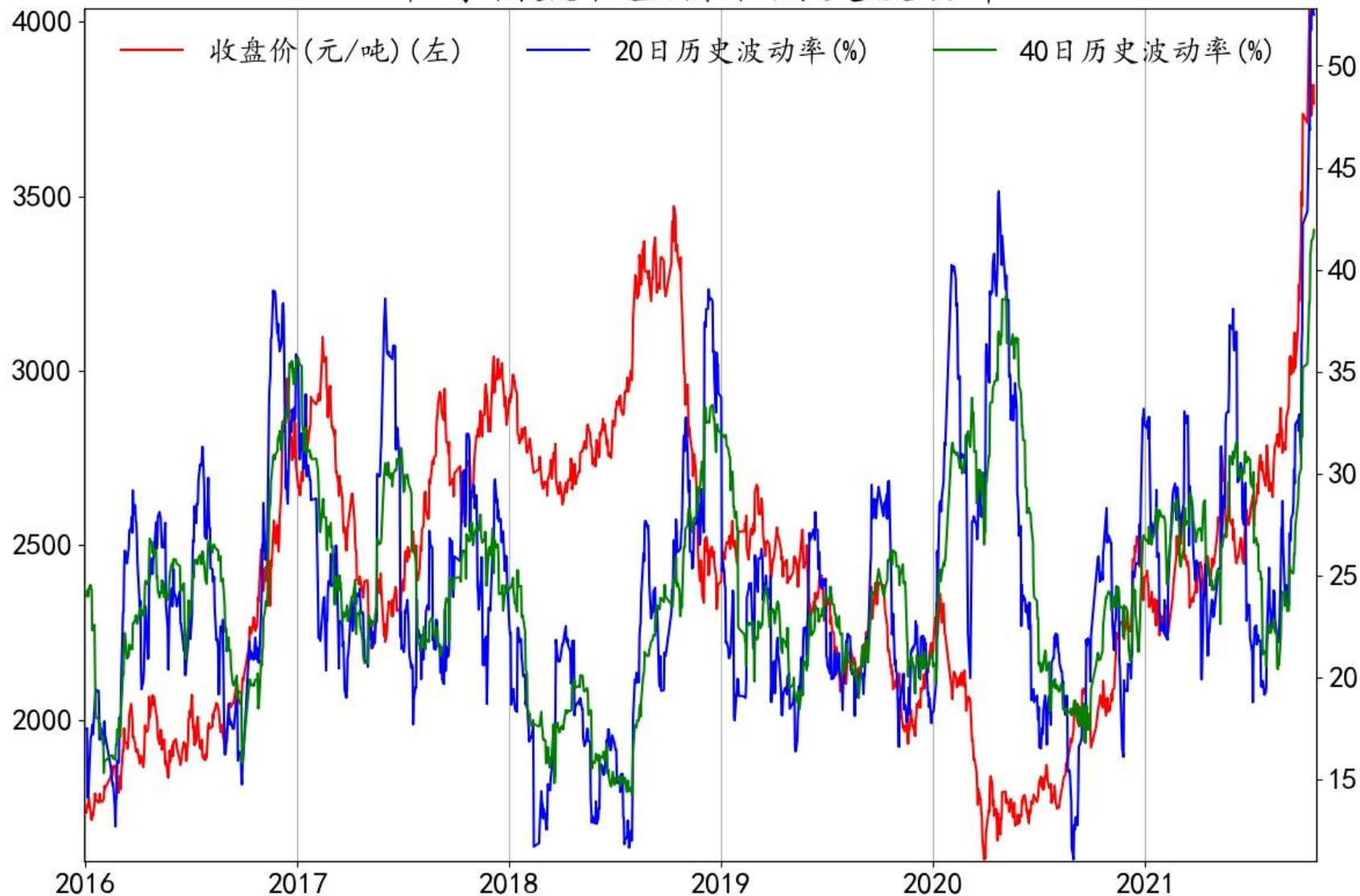


数据来源: Wind、信达期货研发中心

塑料指数收盘价和历史波动率

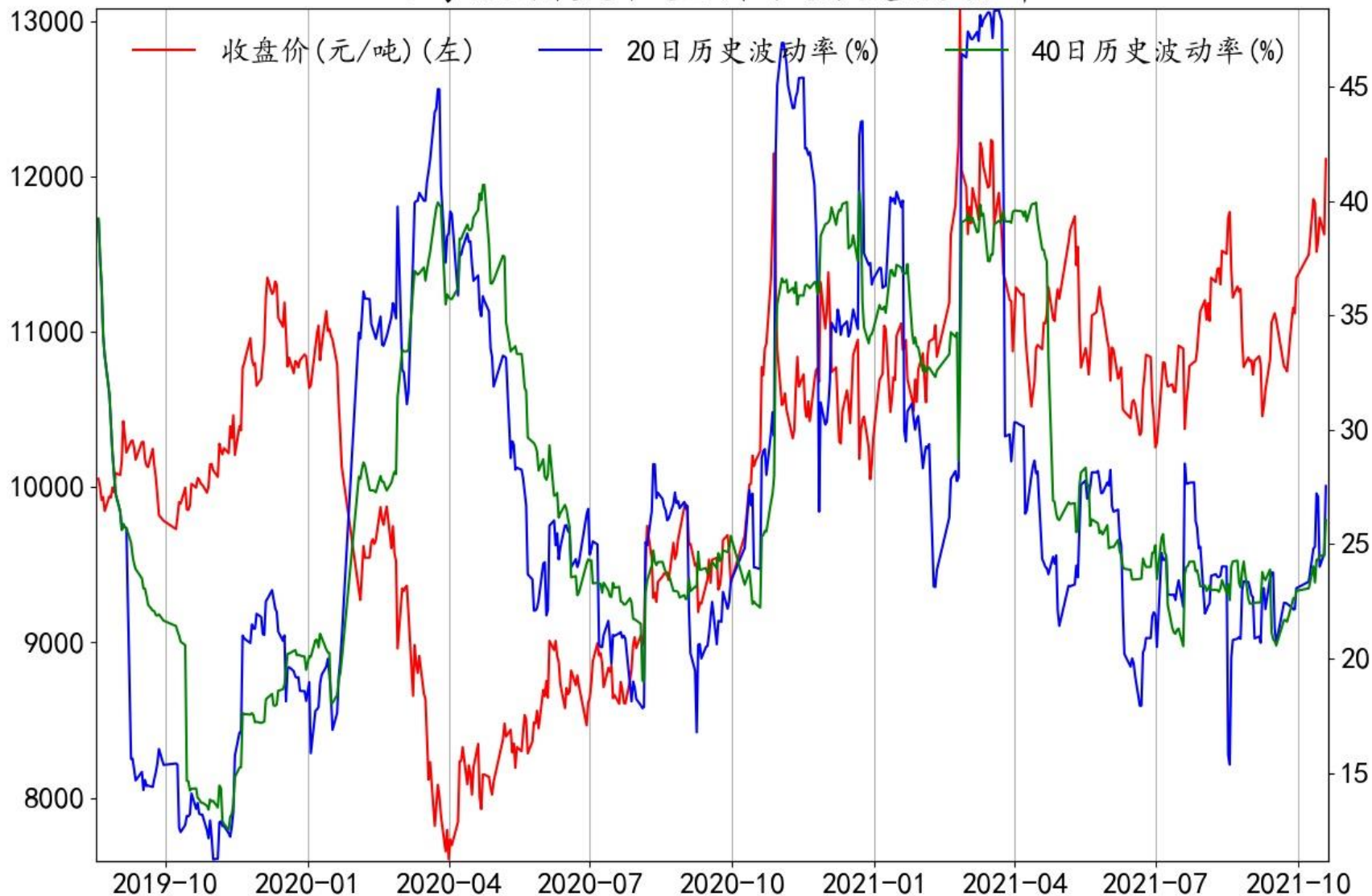


甲醇指数收盘价和历史波动率



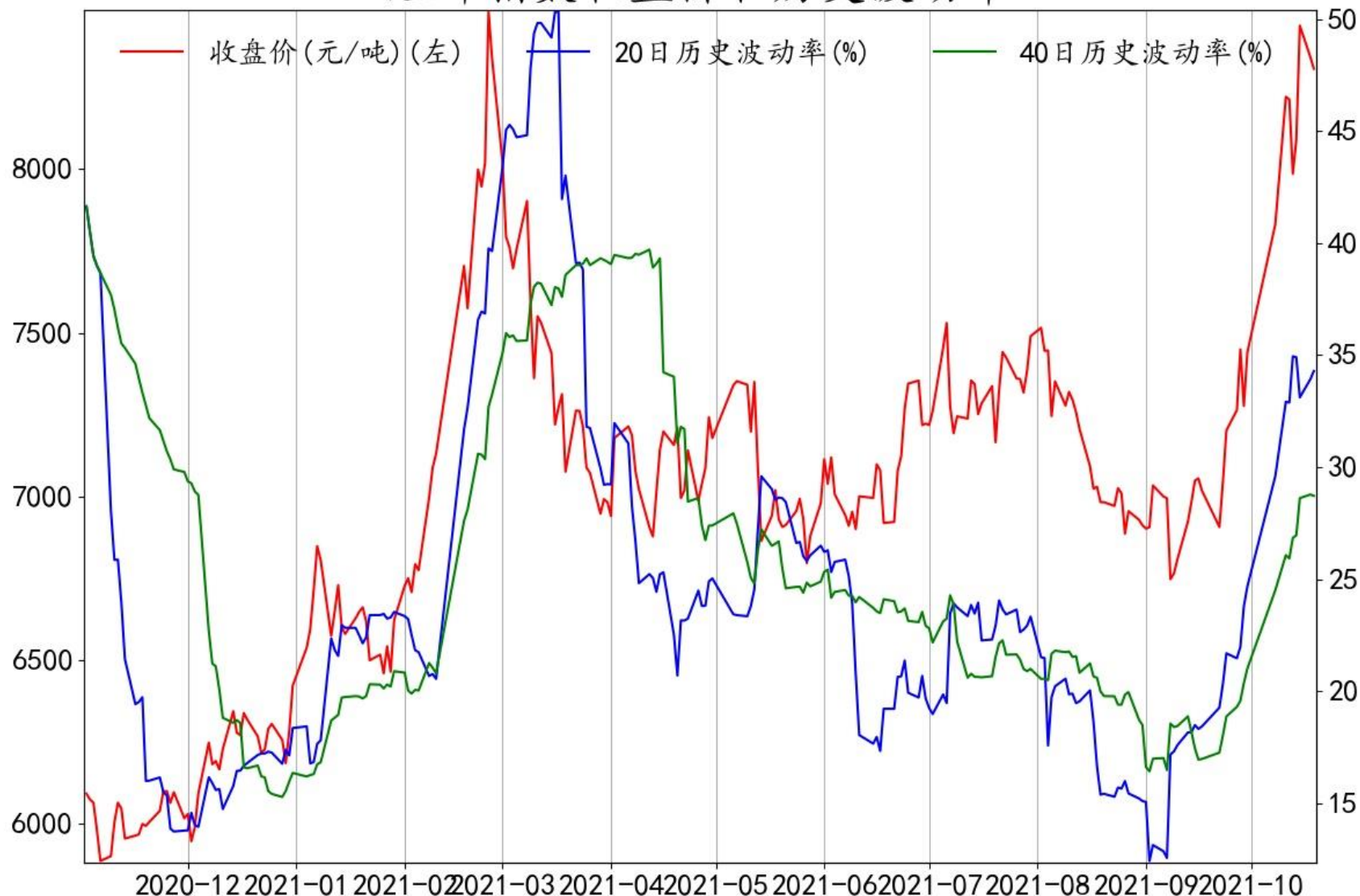
20号胶指数

20号胶指数收盘价和历史波动率

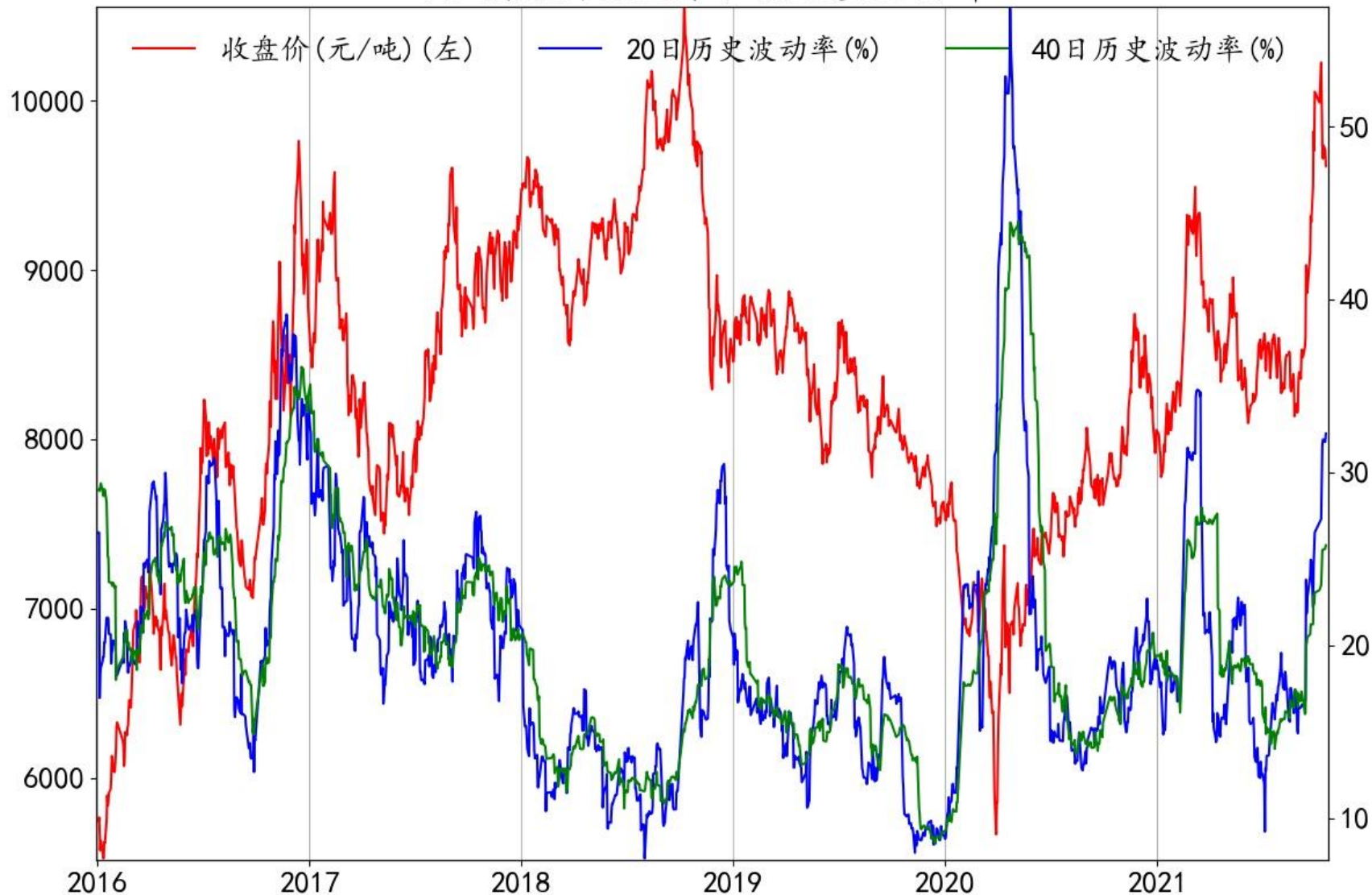


数据来源: Wind、信达期货研发中心

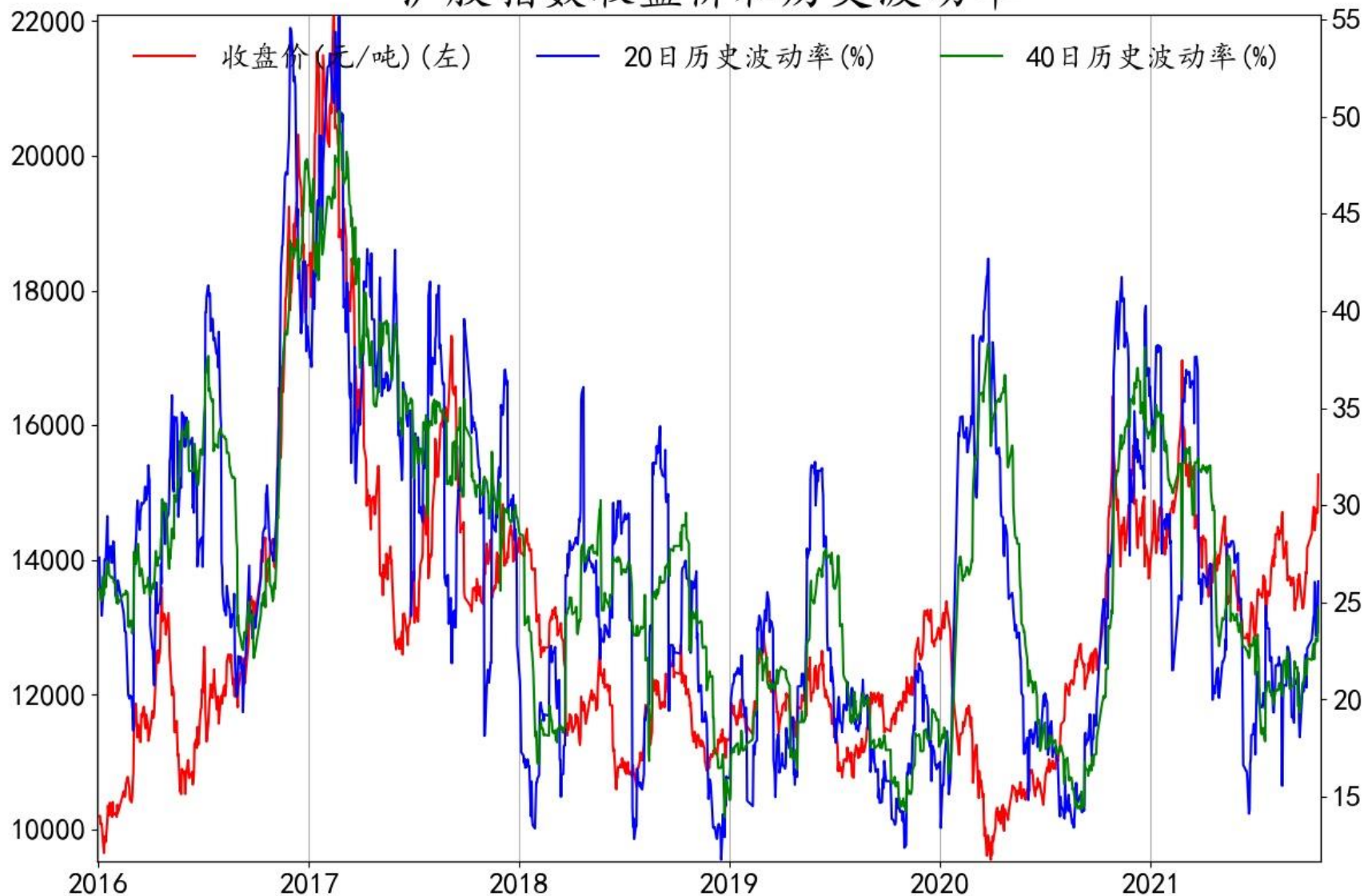
短纤指数收盘价和历史波动率



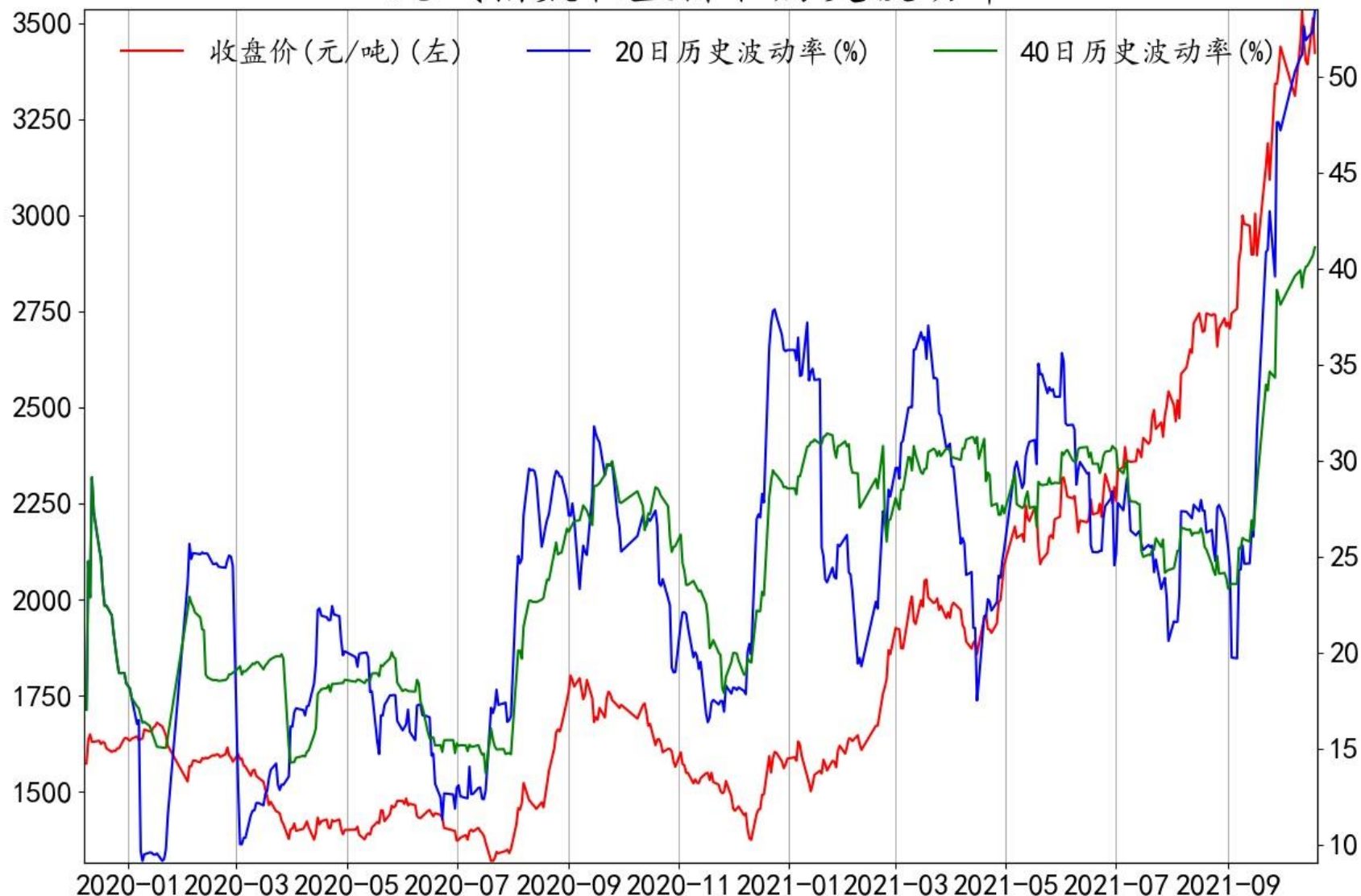
PP指数收盘价和历史波动率



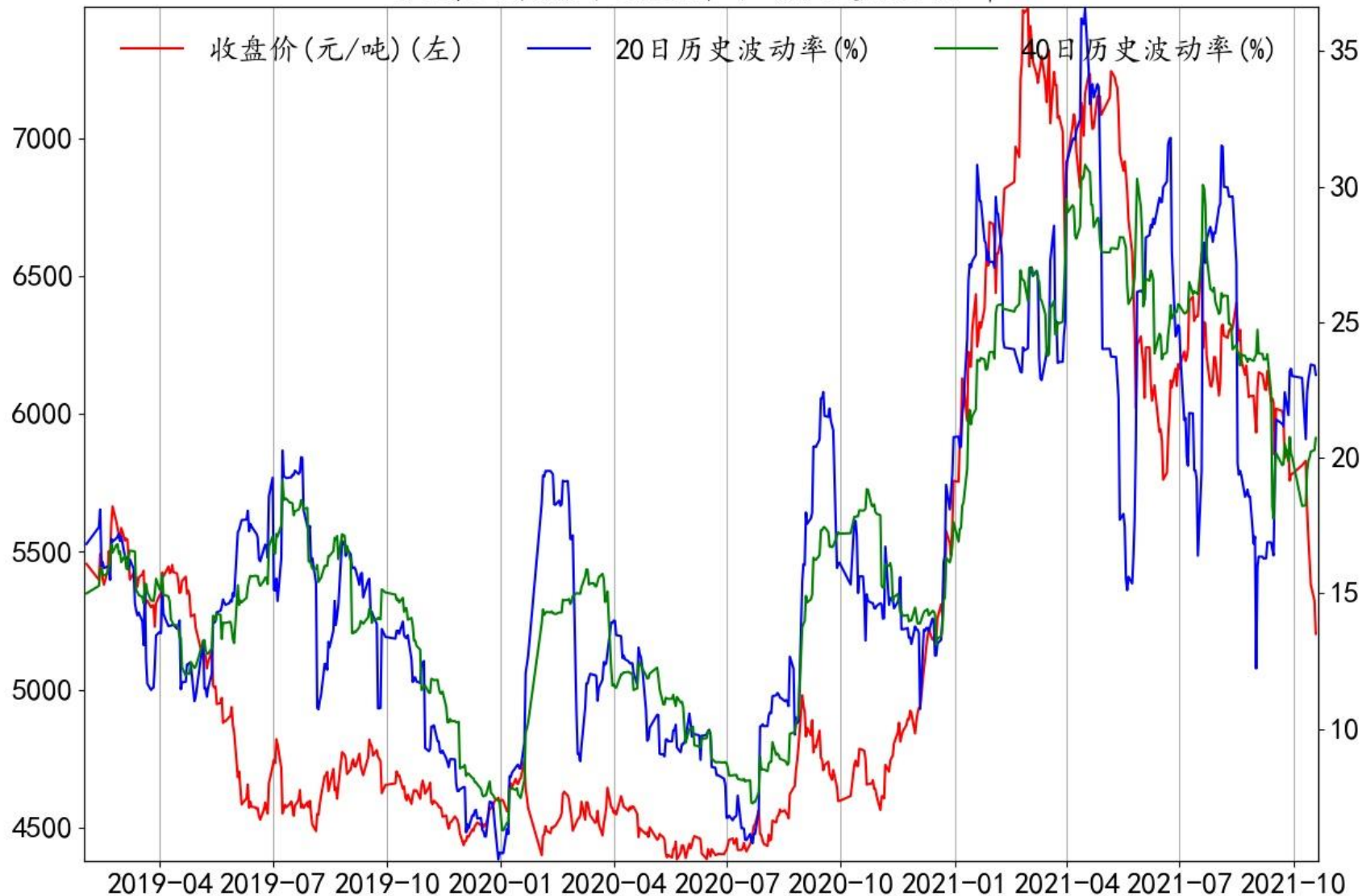
沪胶指数收盘价和历史波动率



纯碱指数收盘价和历史波动率

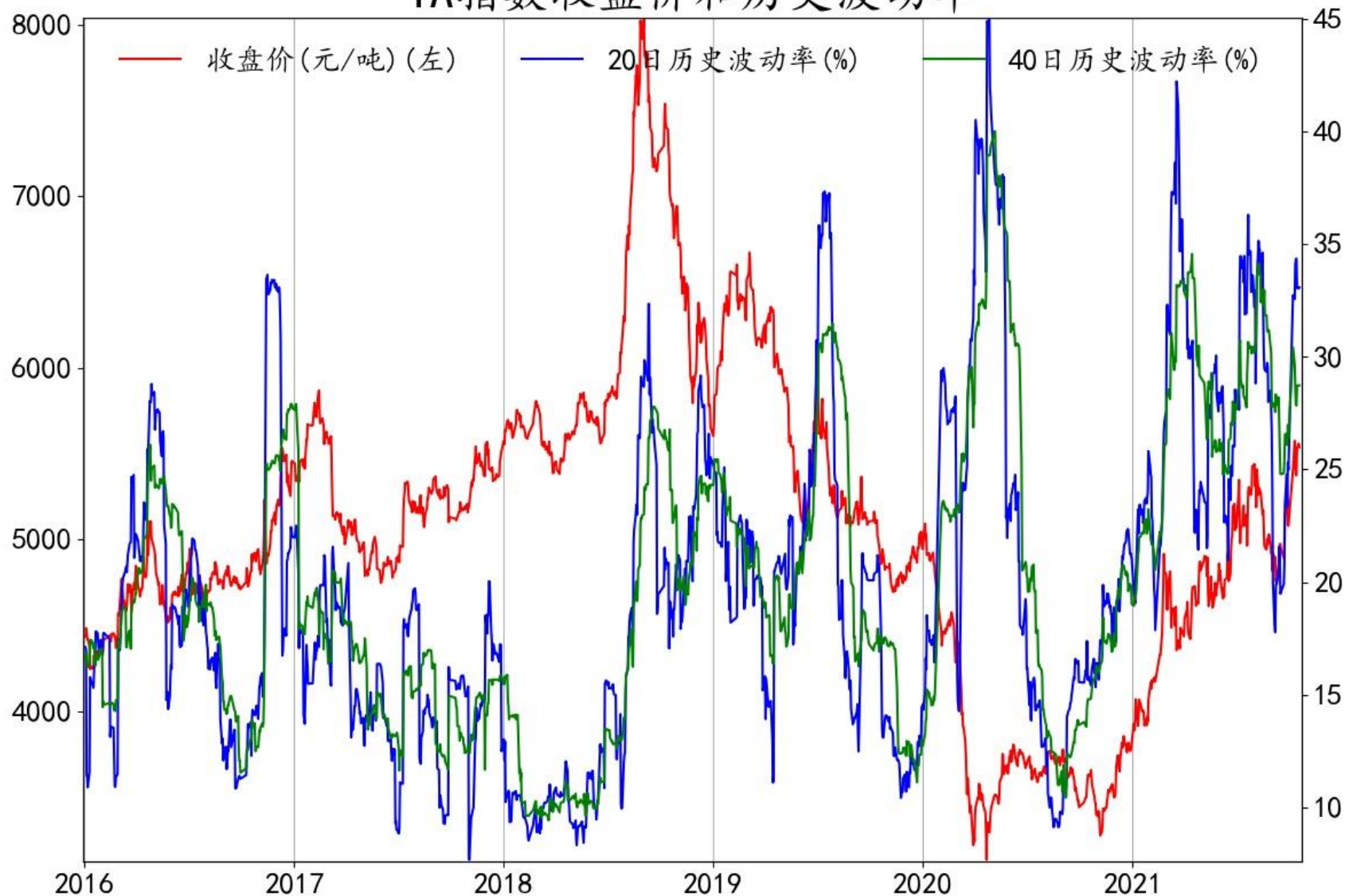


纸浆指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

TA指数收盘价和历史波动率



尿素指数收盘价和历史波动率

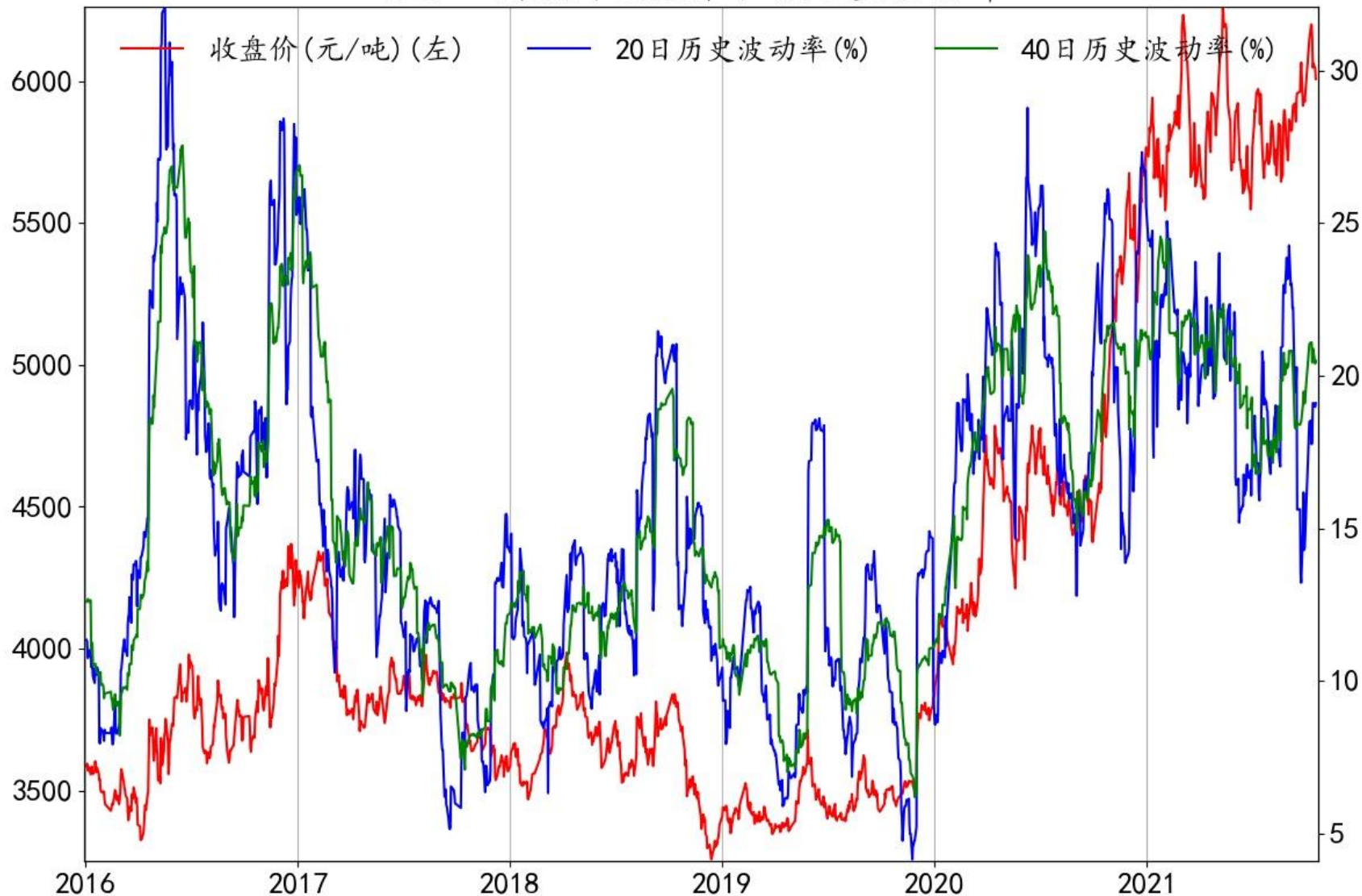


数据来源: Wind、信达期货研发中心

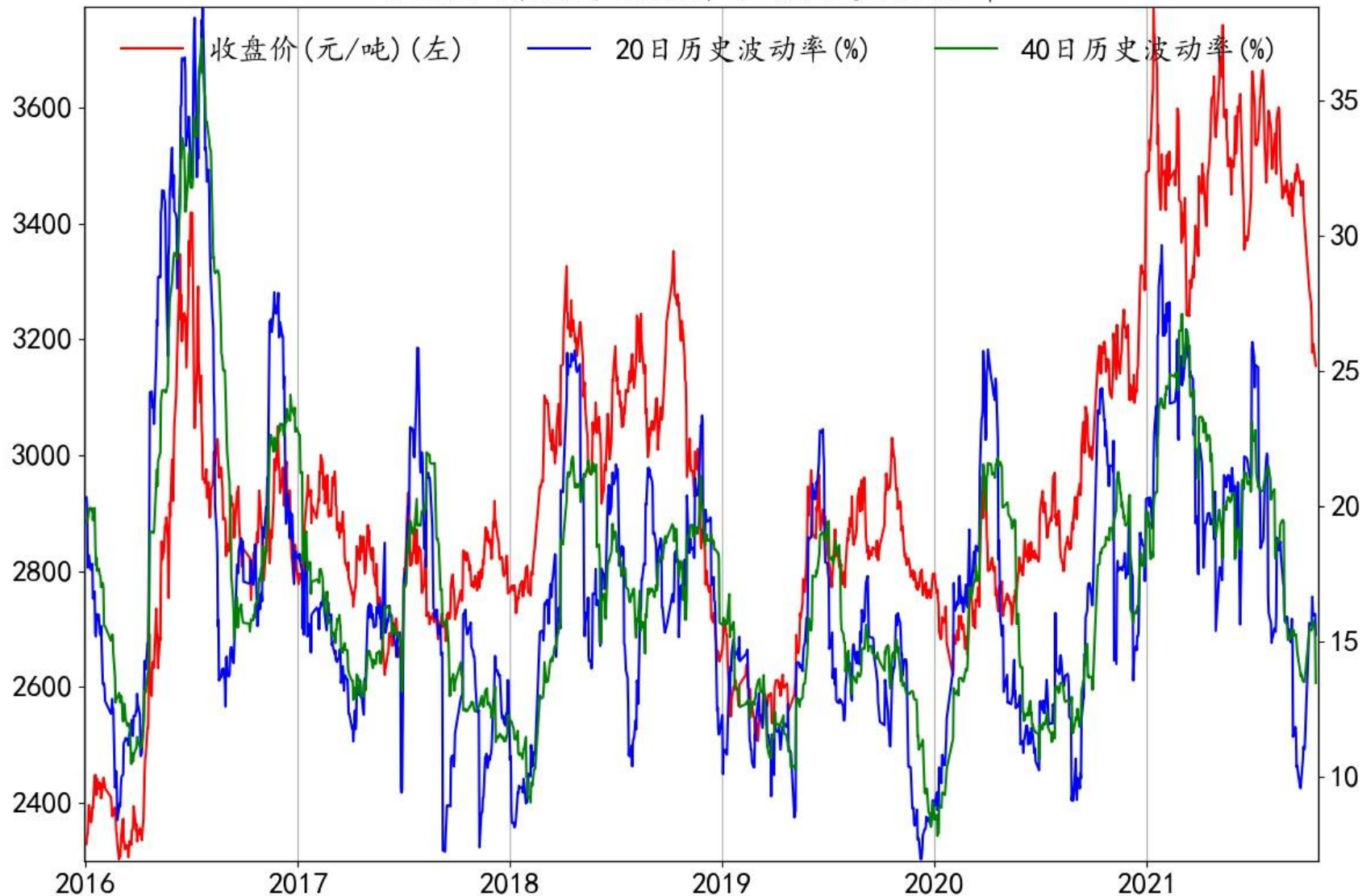
玉米指数收盘价和历史波动率



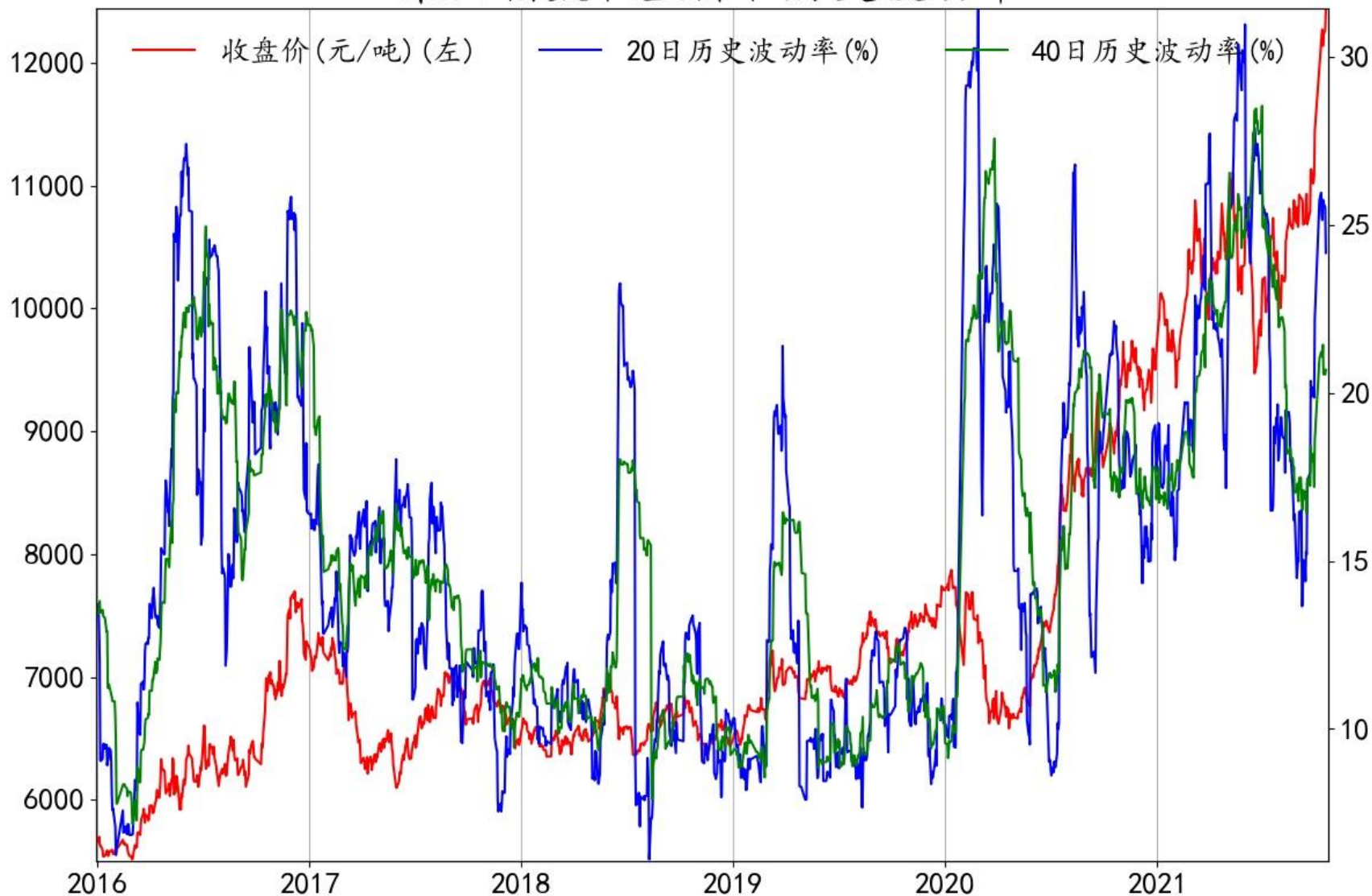
豆一指数收盘价和历史波动率



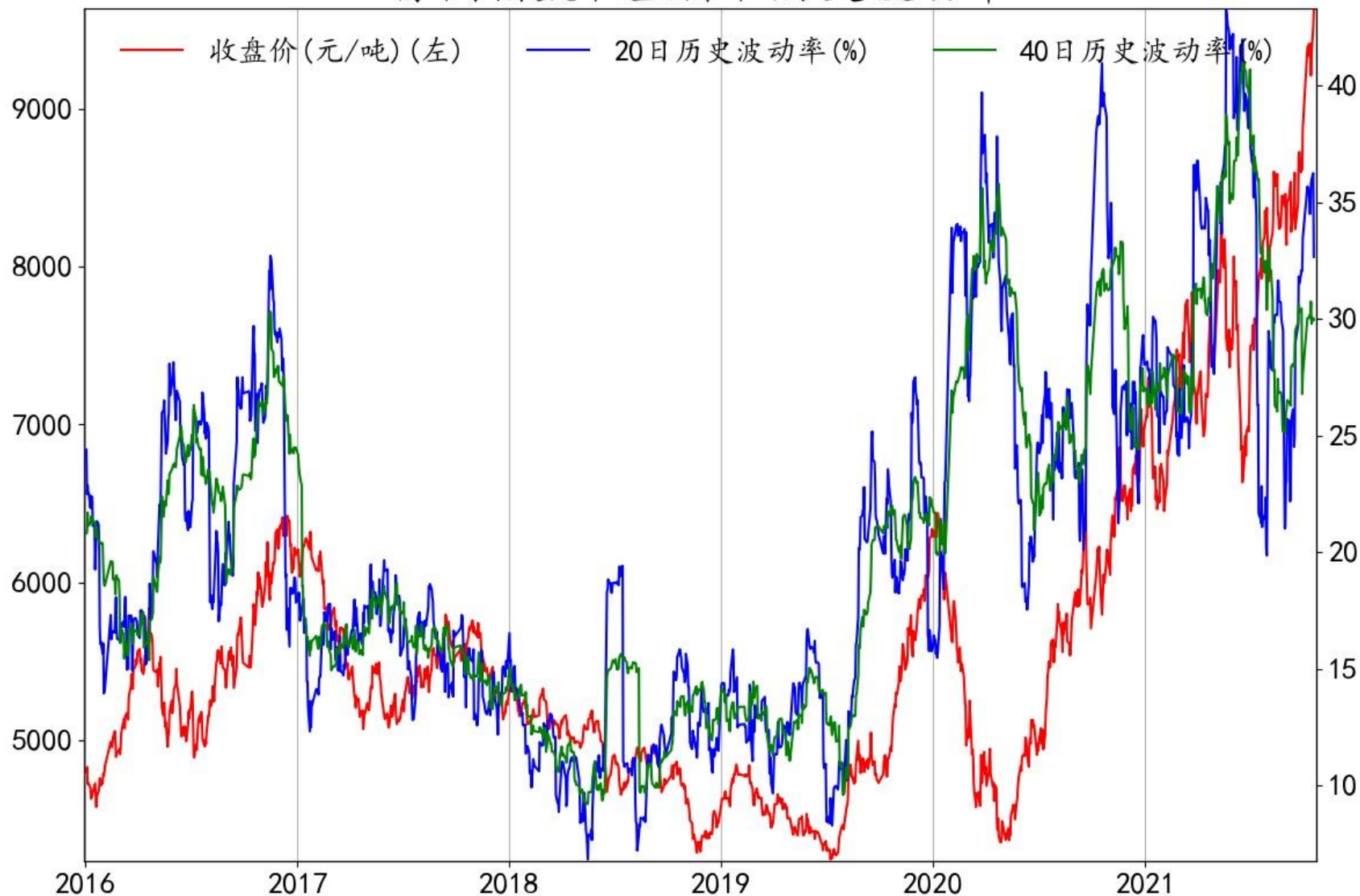
豆粕指数收盘价和历史波动率



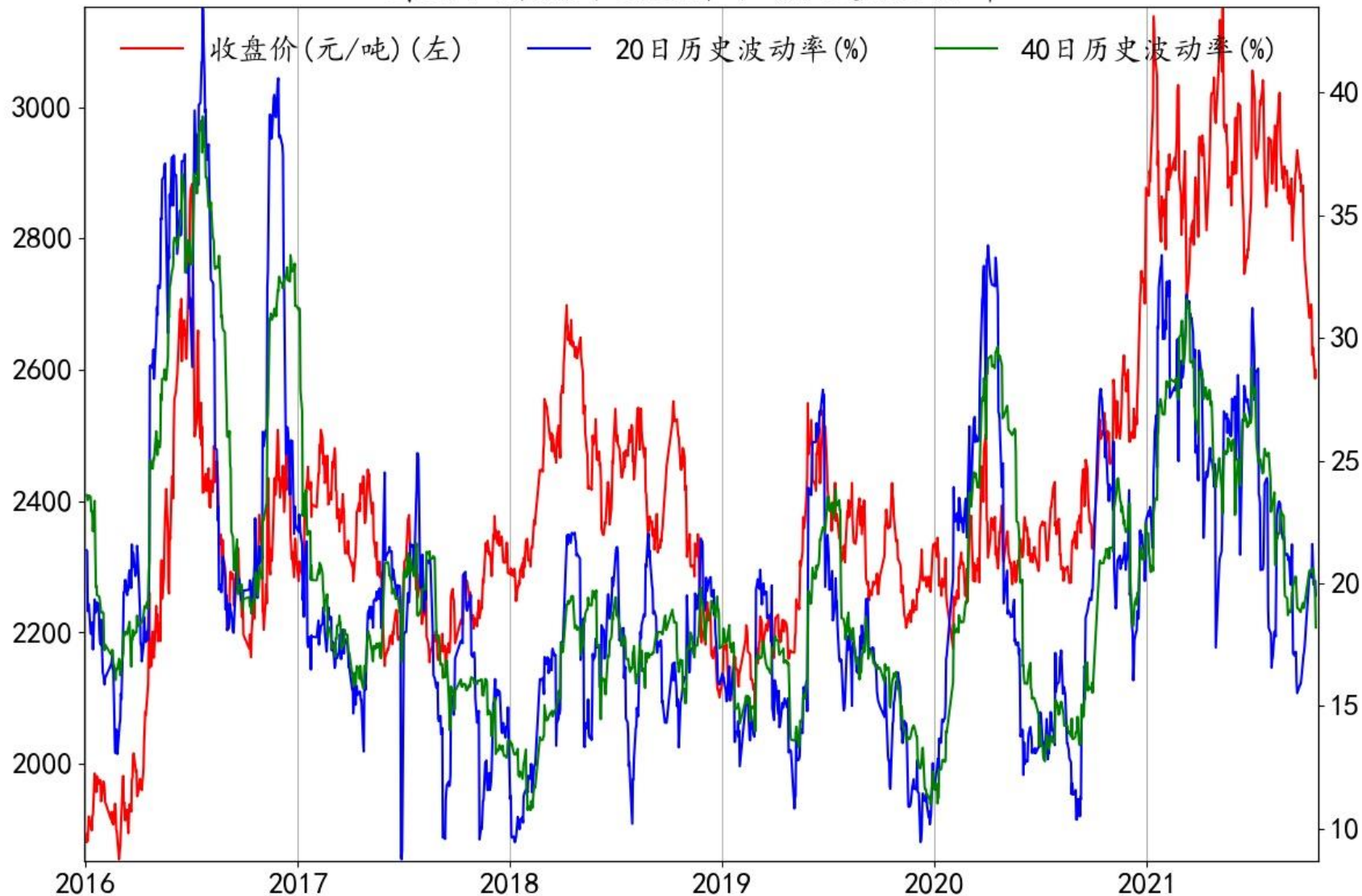
菜油指数收盘价和历史波动率



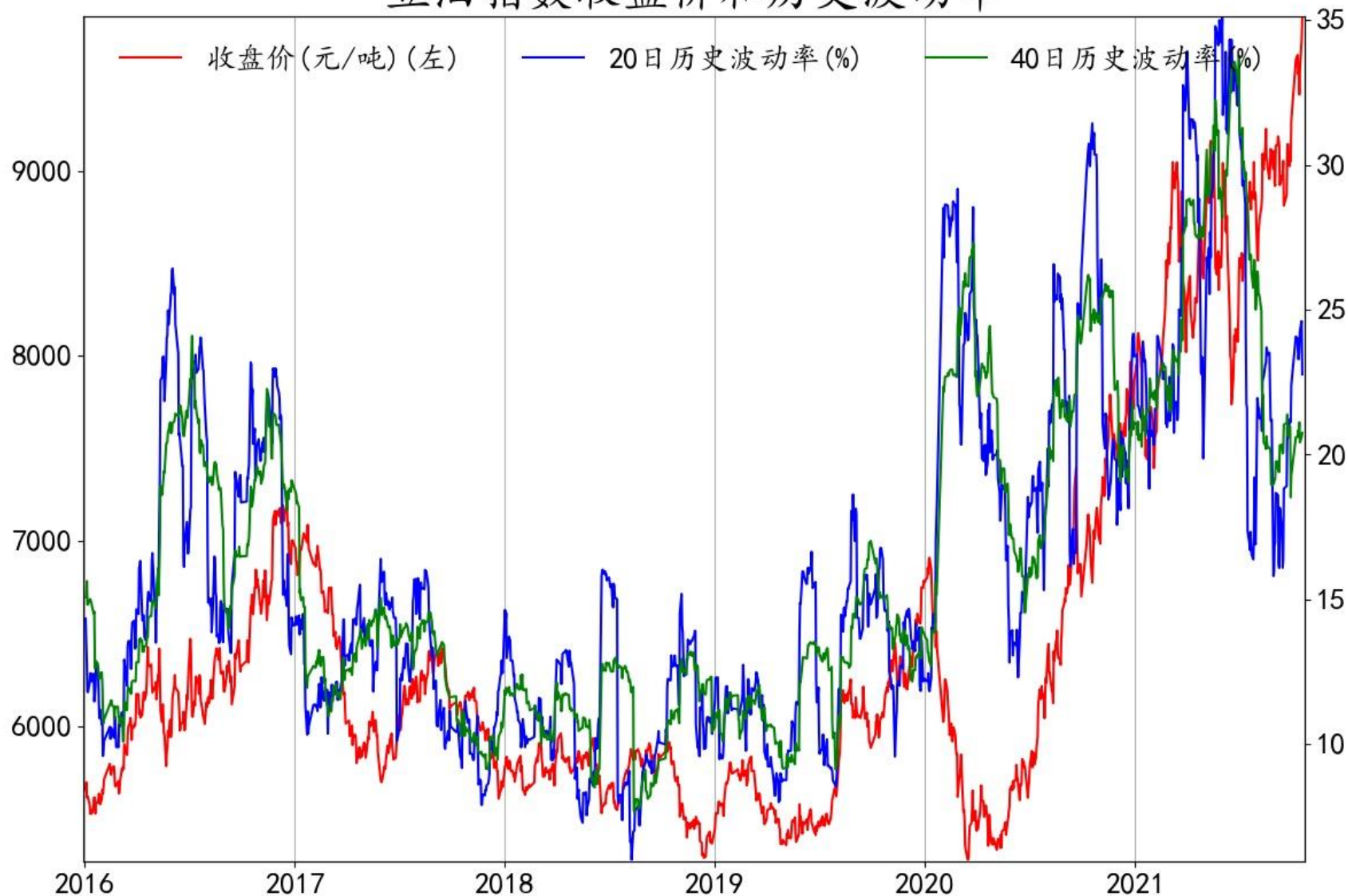
棕榈指数收盘价和历史波动率



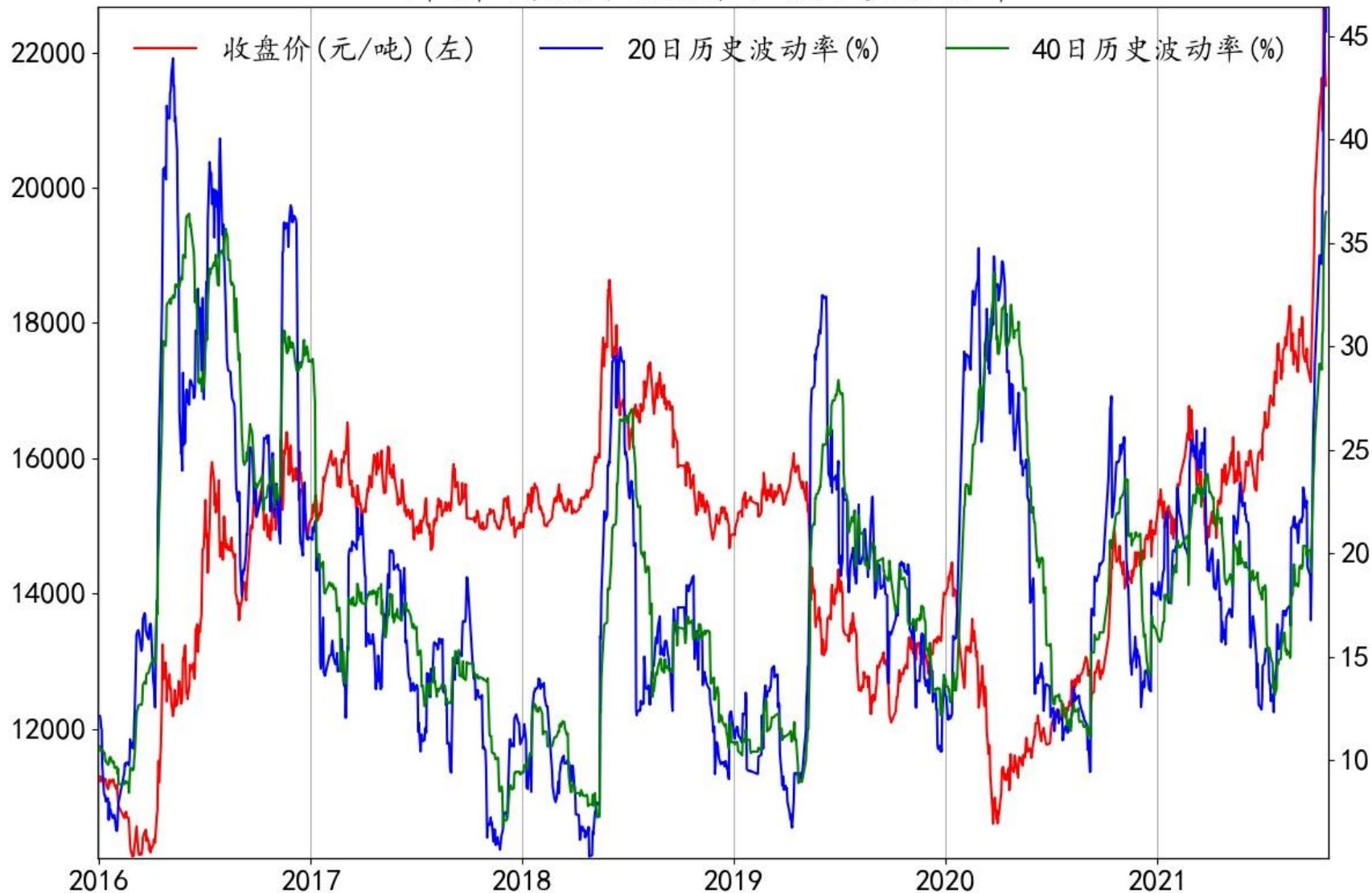
菜粕指数收盘价和历史波动率



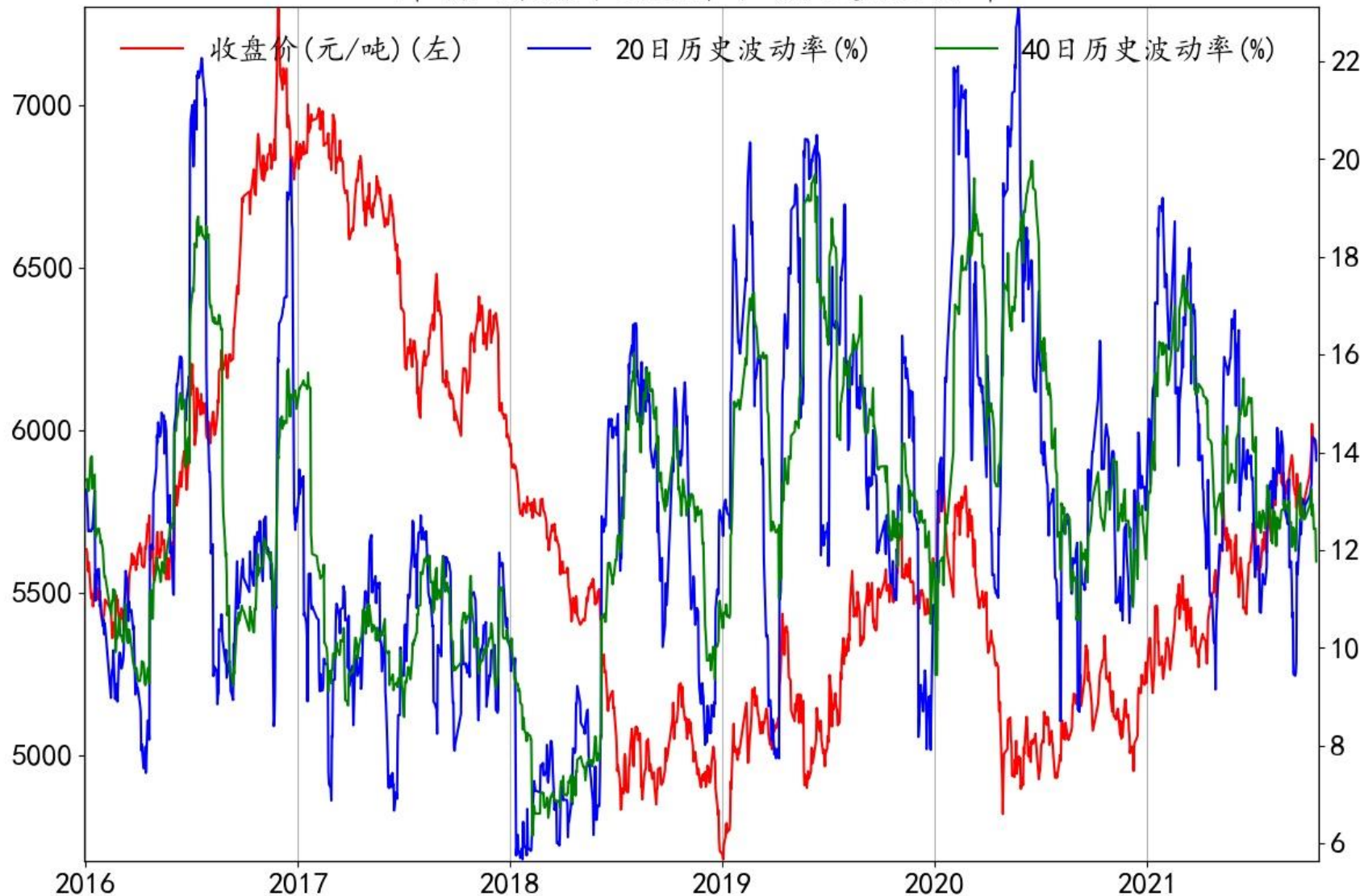
豆油指数收盘价和历史波动率



郑棉指数收盘价和历史波动率

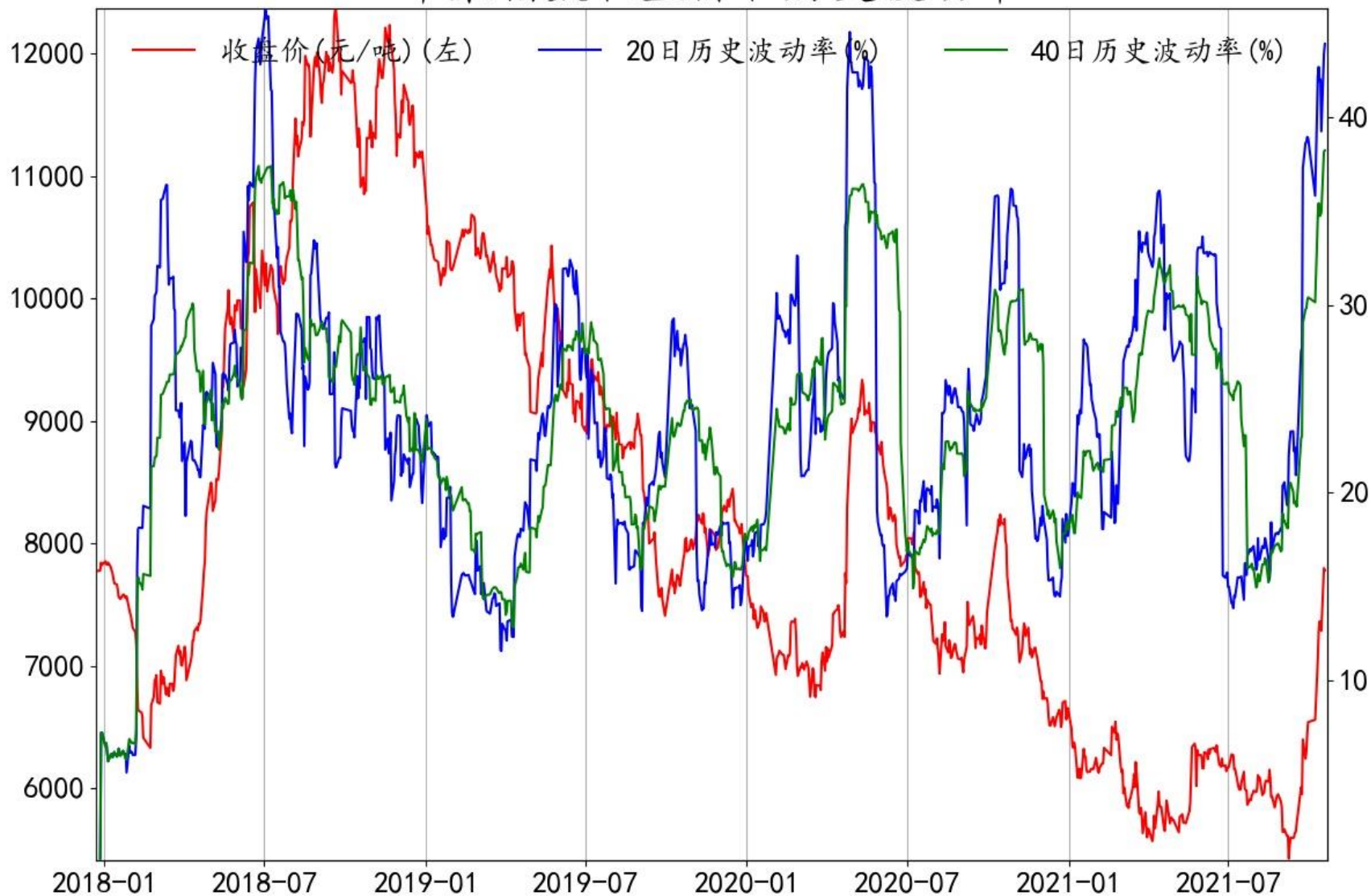


郑糖指数收盘价和历史波动率

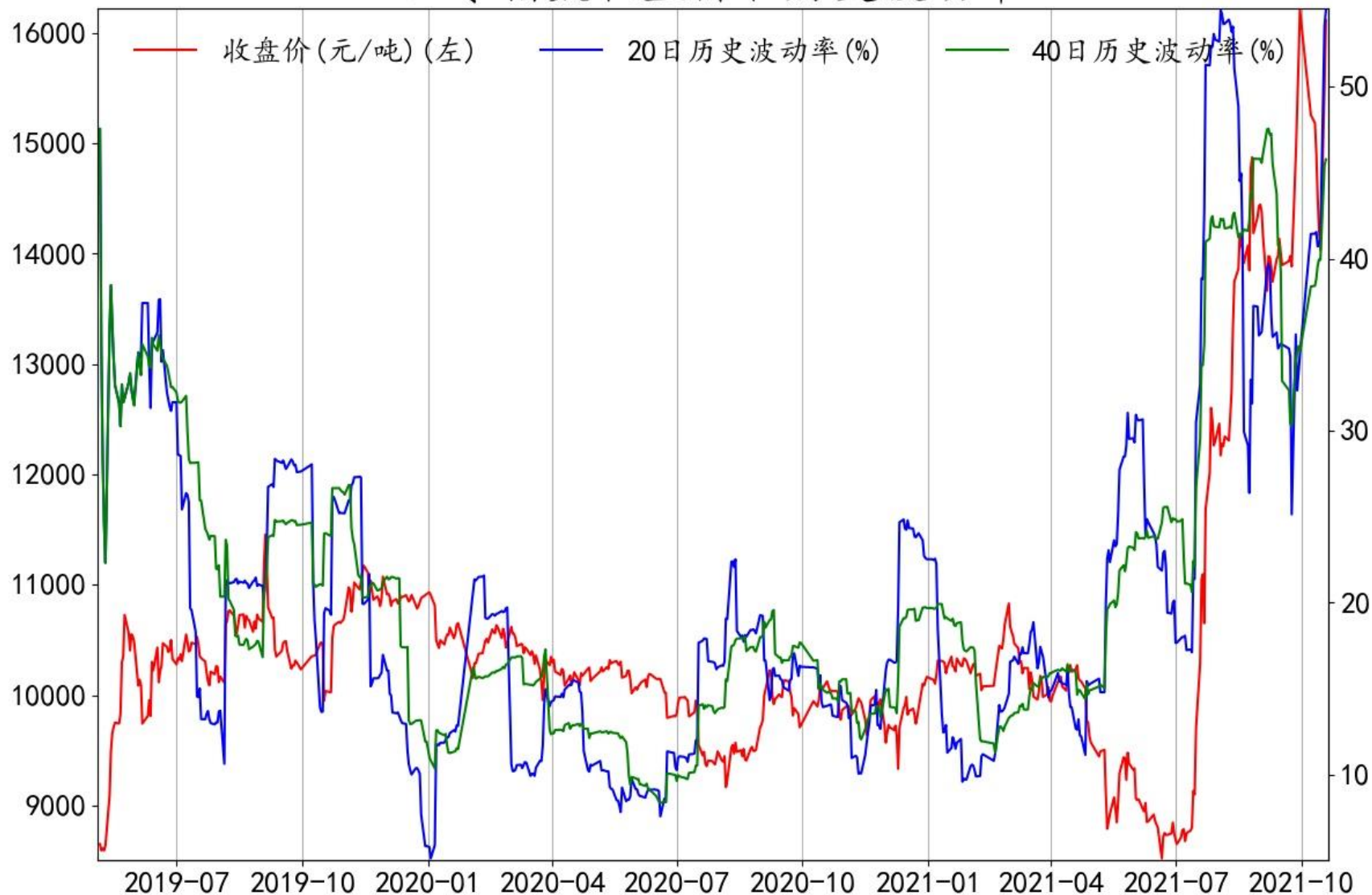


数据来源: Wind、信达期货研发中心

苹果指数收盘价和历史波动率

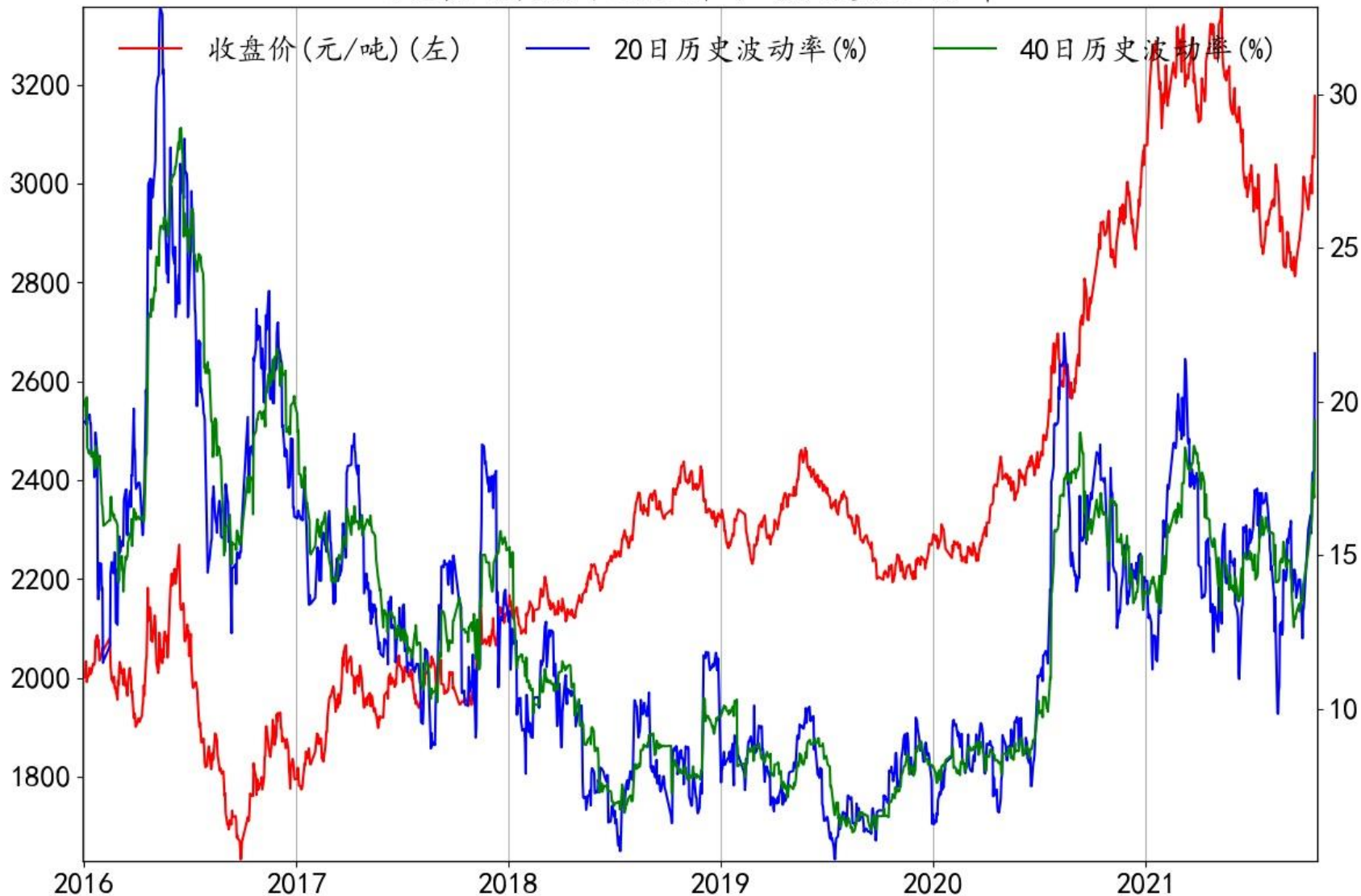


红枣指数收盘价和历史波动率

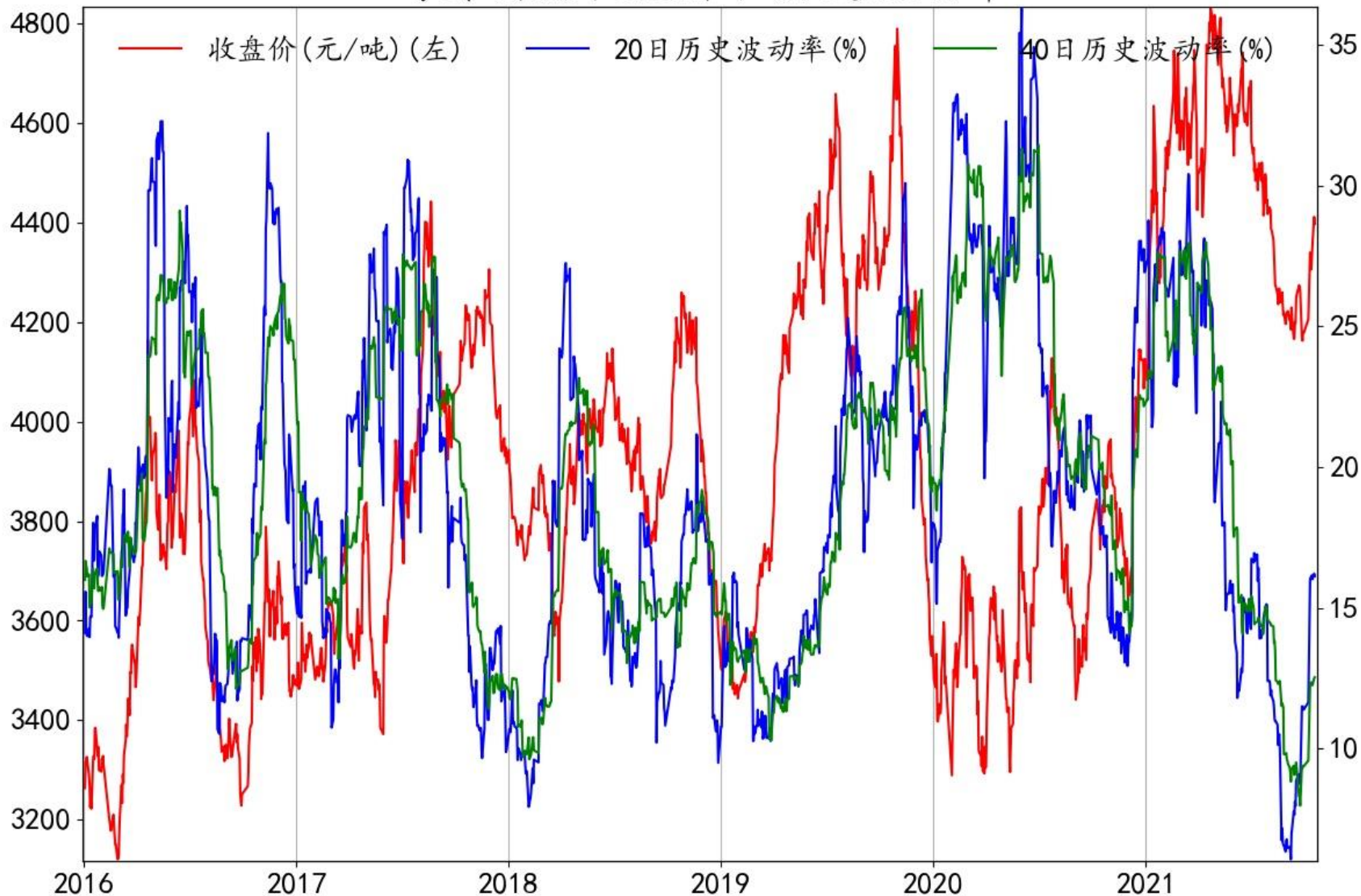


数据来源: Wind、信达期货研发中心

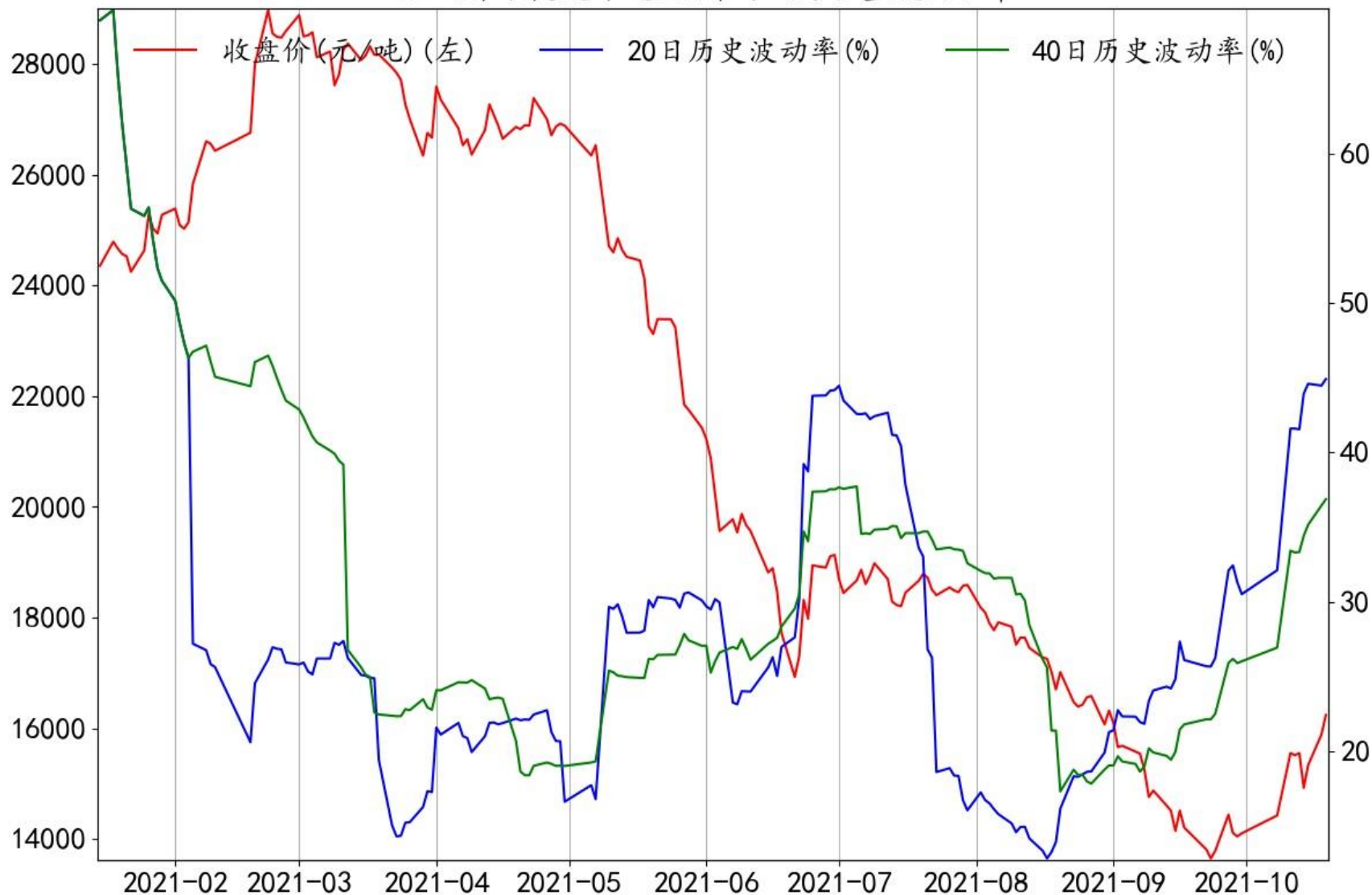
淀粉指数收盘价和历史波动率



鸡蛋指数收盘价和历史波动率



生猪指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

重要声明



报告中的信息均来源于公开可获得的资料，信达期货有限公司力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。本报告不构成个人投资建议，也没有考虑到个别客户特殊的投资目标、财政状况或需要。客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定情况。期市有风险，入市需谨慎。

未经信达期货有限公司授权许可，任何引用、转载以及向第三方传播本报告的行为均可能承担法律责任。

信达期货研发中心

电话：0571-28132535

地址：杭州市萧山区钱江世纪城天人大厦19-20层

邮编：311215

电话：0571-28132578

网址：www.cindaqh.com



(截至2021年7月)

公司分支机构分布

7家分公司 9家营业部

金华分公司、台州分公司、深圳分公司

苏州分公司、四川分公司、福建分公司、宁波分公司

北京营业部、上海营业部、广州营业部

哈尔滨营业部、大连营业部、沈阳营业部、石家庄营业部

乐清营业部、富阳营业部