

商品期货波动率跟踪

2021年10月20日

20日历史波动率百分位高于90%:

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

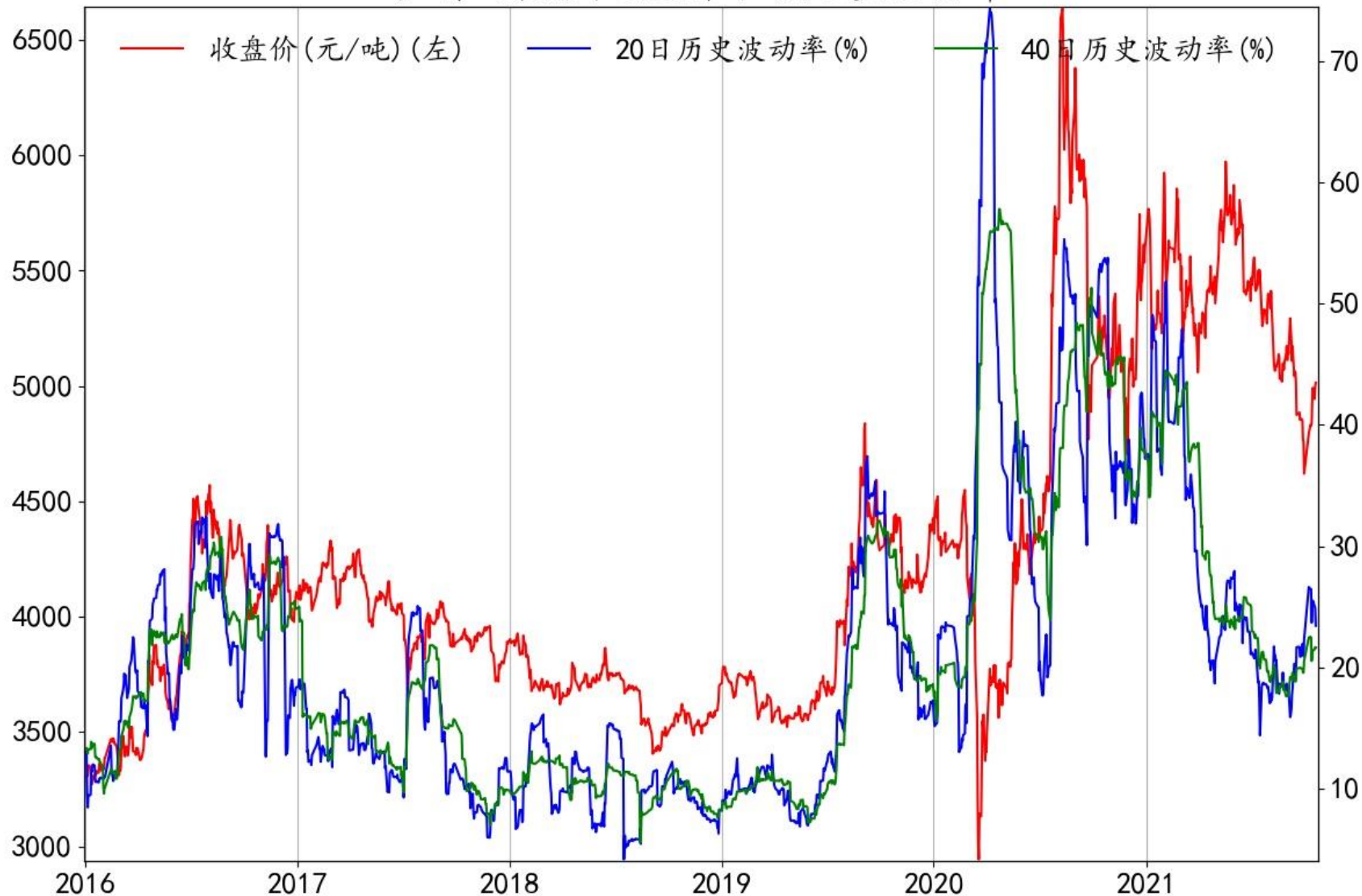
20日历史波动率绝对值后五:

沪金、郑糖、豆粕、玉米、鸡蛋

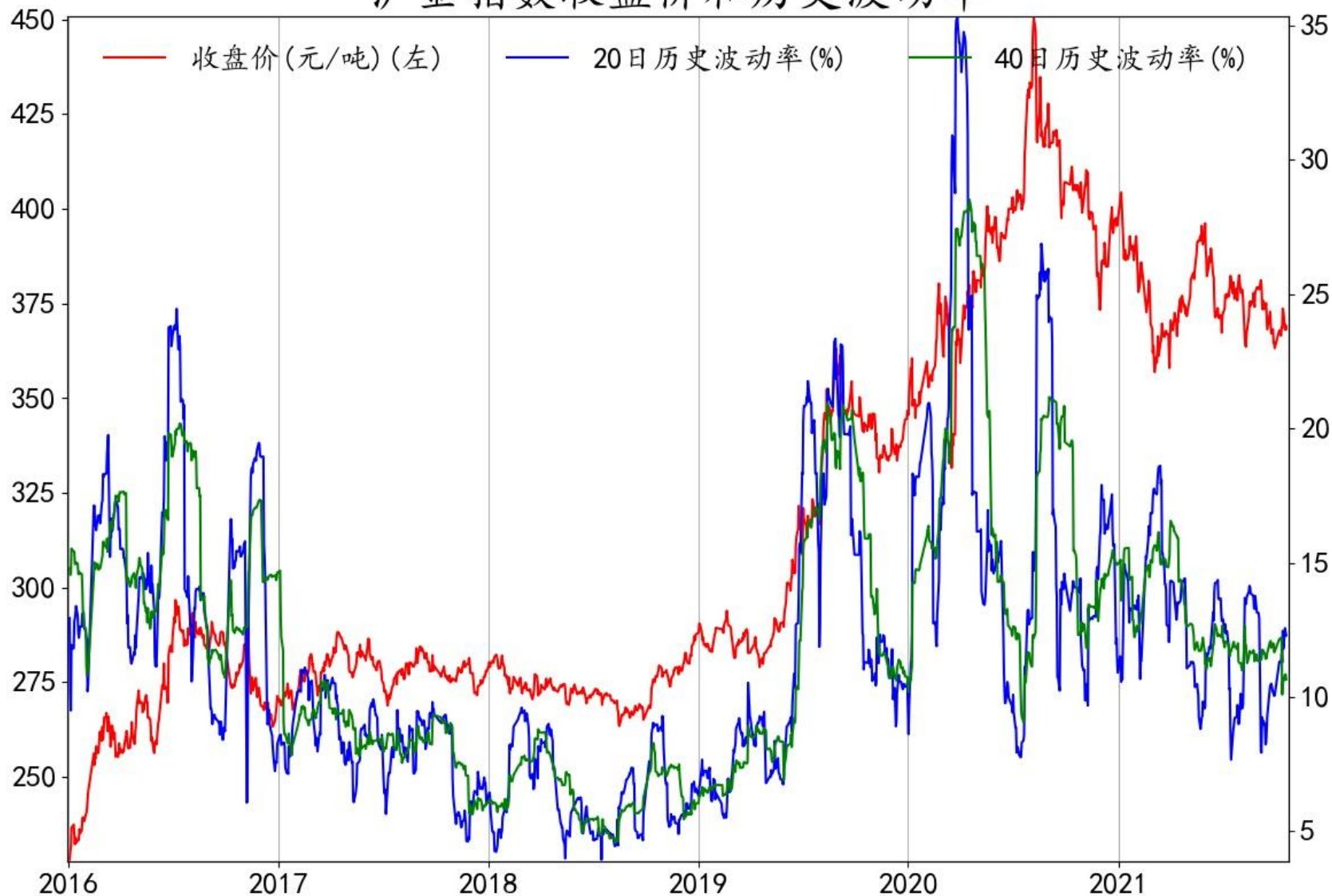
时间百分位 绝对值			时间百分位 绝对值		
沪银	67.42%	23.42%	硅铁	100.00%	93.82%
沪金	59.97%	12.30%	锰硅	100.00%	95.15%
沪铝	100.00%	37.14%	不锈钢	98.19%	42.15%
沪铜	93.47%	25.67%	玻璃	98.01%	39.86%
沪镍	56.35%	23.91%	PVC	100.00%	61.96%
沪铅	85.38%	23.23%	燃油	81.52%	38.59%
沪锡	97.59%	38.71%	低硫燃油	29.90%	26.18%
沪锌	100.00%	46.82%	LPG	99.11%	46.73%
热卷	61.75%	25.42%	原油	48.15%	28.29%
铁矿	93.04%	55.16%	动煤	100.00%	78.13%
焦炭	99.79%	69.83%	沥青	75.02%	32.34%
焦煤	98.65%	66.80%	苯乙烯	75.86%	36.13%
螺纹	75.94%	32.38%	乙二醇	100.00%	63.05%

	时间百分位	绝对值		时间百分位	绝对值
塑料	98.08%	35.73%	菜油	91.20%	24.22%
甲醇	100.00%	63.66%	棕榈	90.49%	32.62%
20号胶	58.86%	27.34%	菜粕	48.55%	18.54%
短纤	92.34%	39.73%	豆油	84.74%	22.87%
PP	97.44%	37.17%	郑棉	99.93%	45.50%
沪胶	51.88%	26.15%	郑糖	64.09%	13.71%
纯碱	100.00%	60.02%	苹果	98.70%	43.48%
纸浆	85.06%	24.20%	红枣	100.00%	54.74%
TA	94.39%	33.99%	淀粉	96.31%	23.27%
尿素	100.00%	62.12%	鸡蛋	34.35%	15.53%
玉米	83.68%	15.28%	生猪	90.66%	44.51%
豆一	74.80%	19.11%			
豆粕	39.74%	14.83%			

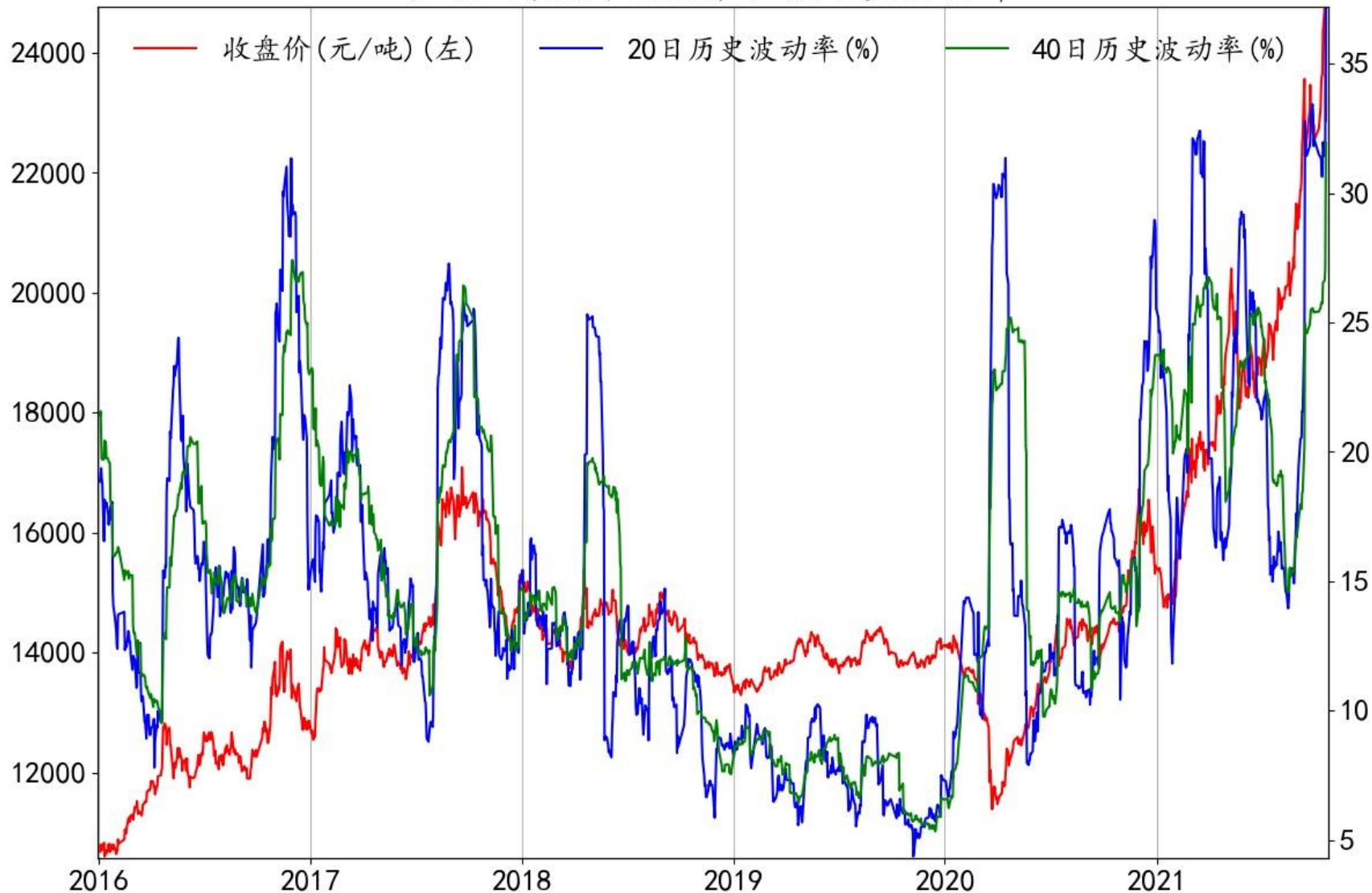
沪银指数收盘价和历史波动率



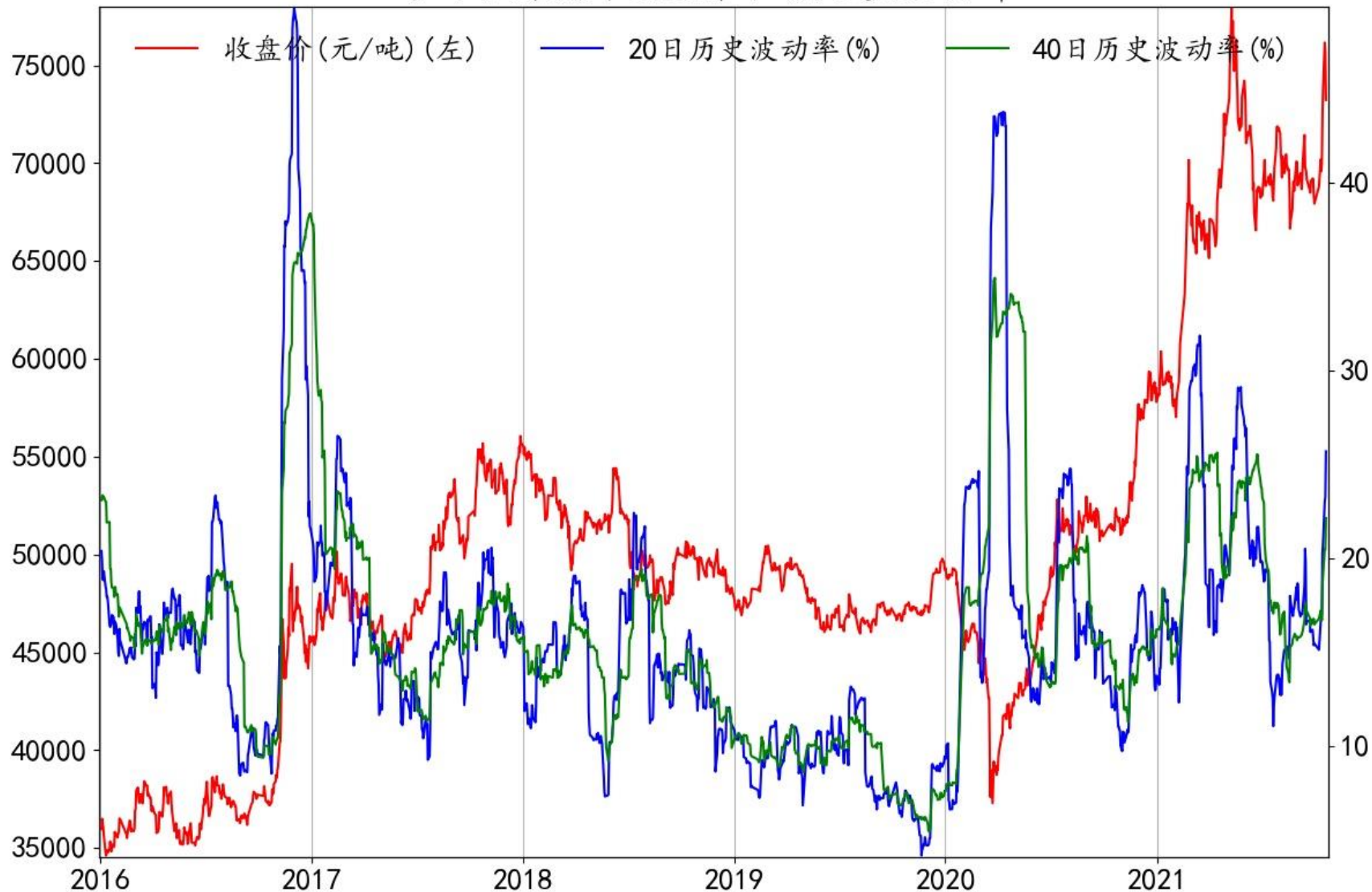
沪金指数收盘价和历史波动率



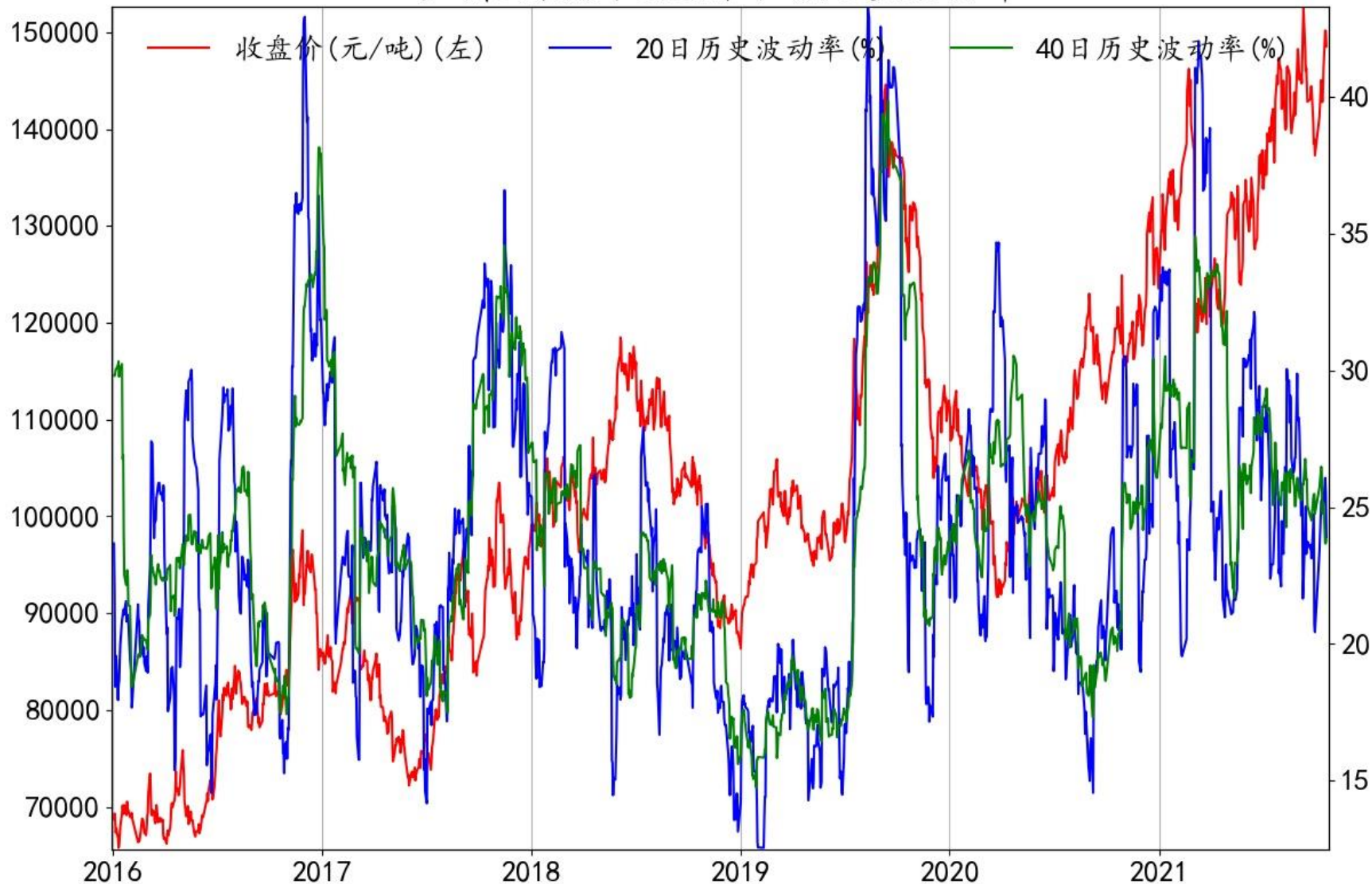
沪铝指数收盘价和历史波动率



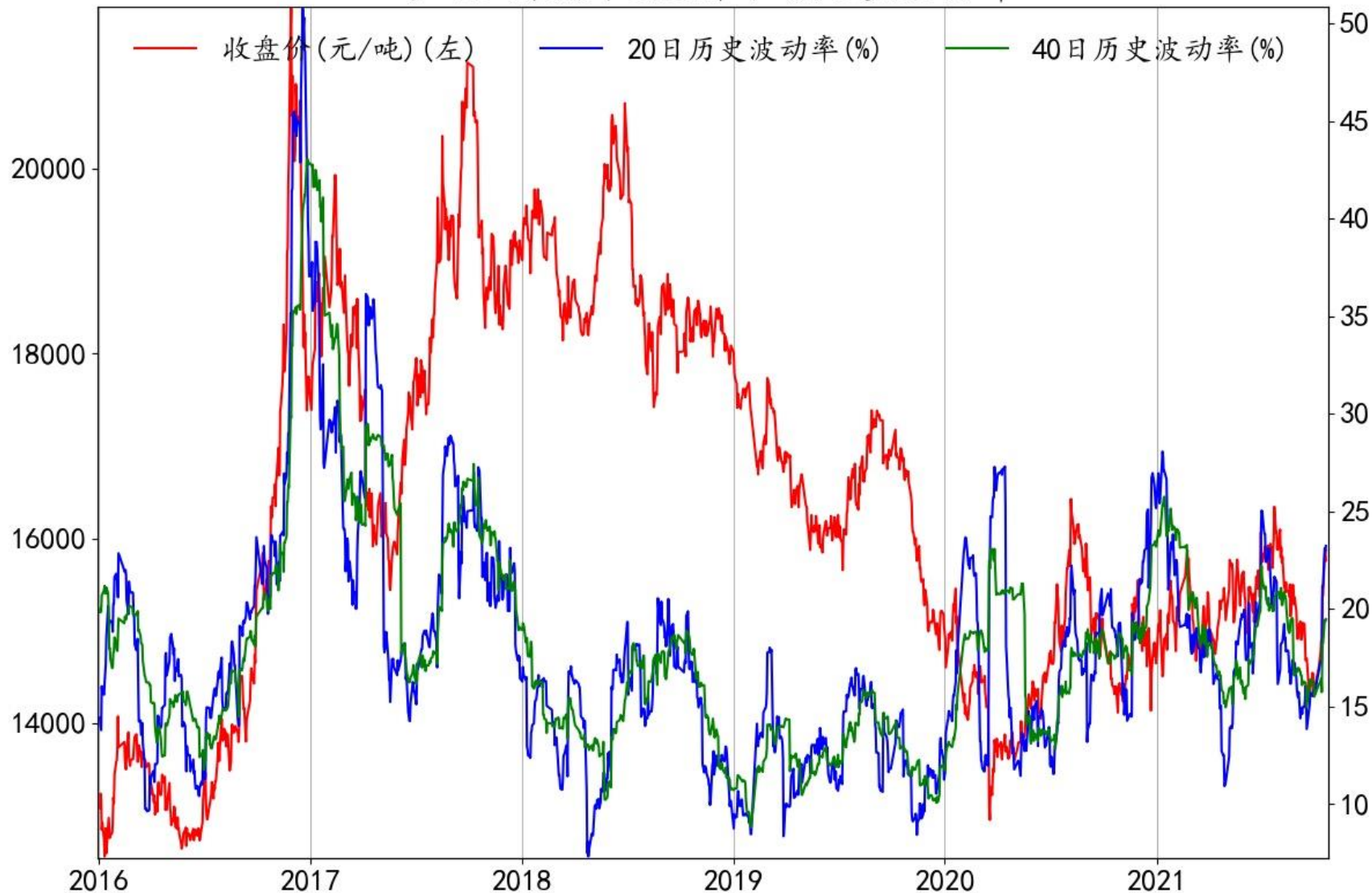
沪铜指数收盘价和历史波动率



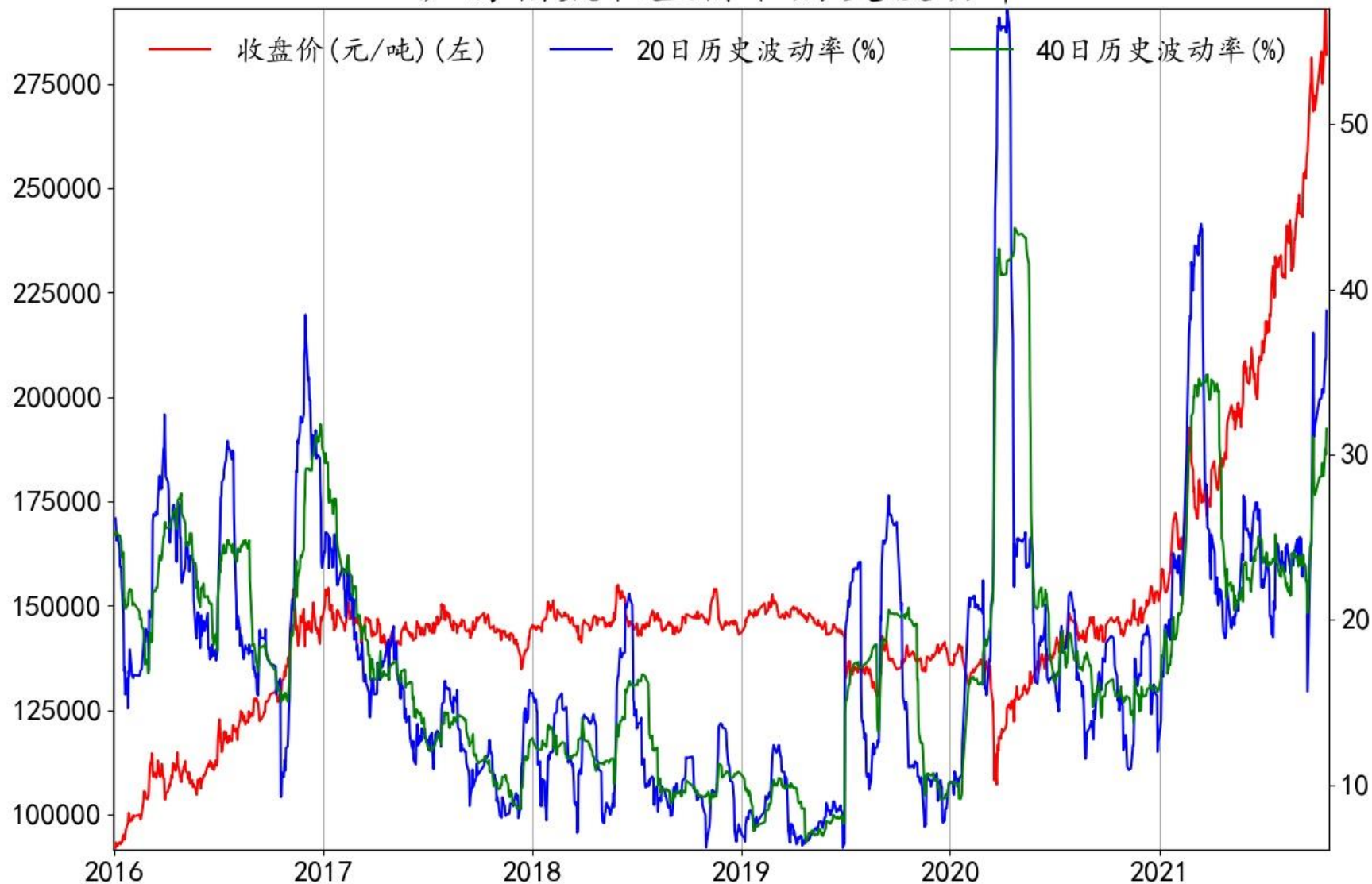
沪镍指数收盘价和历史波动率



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



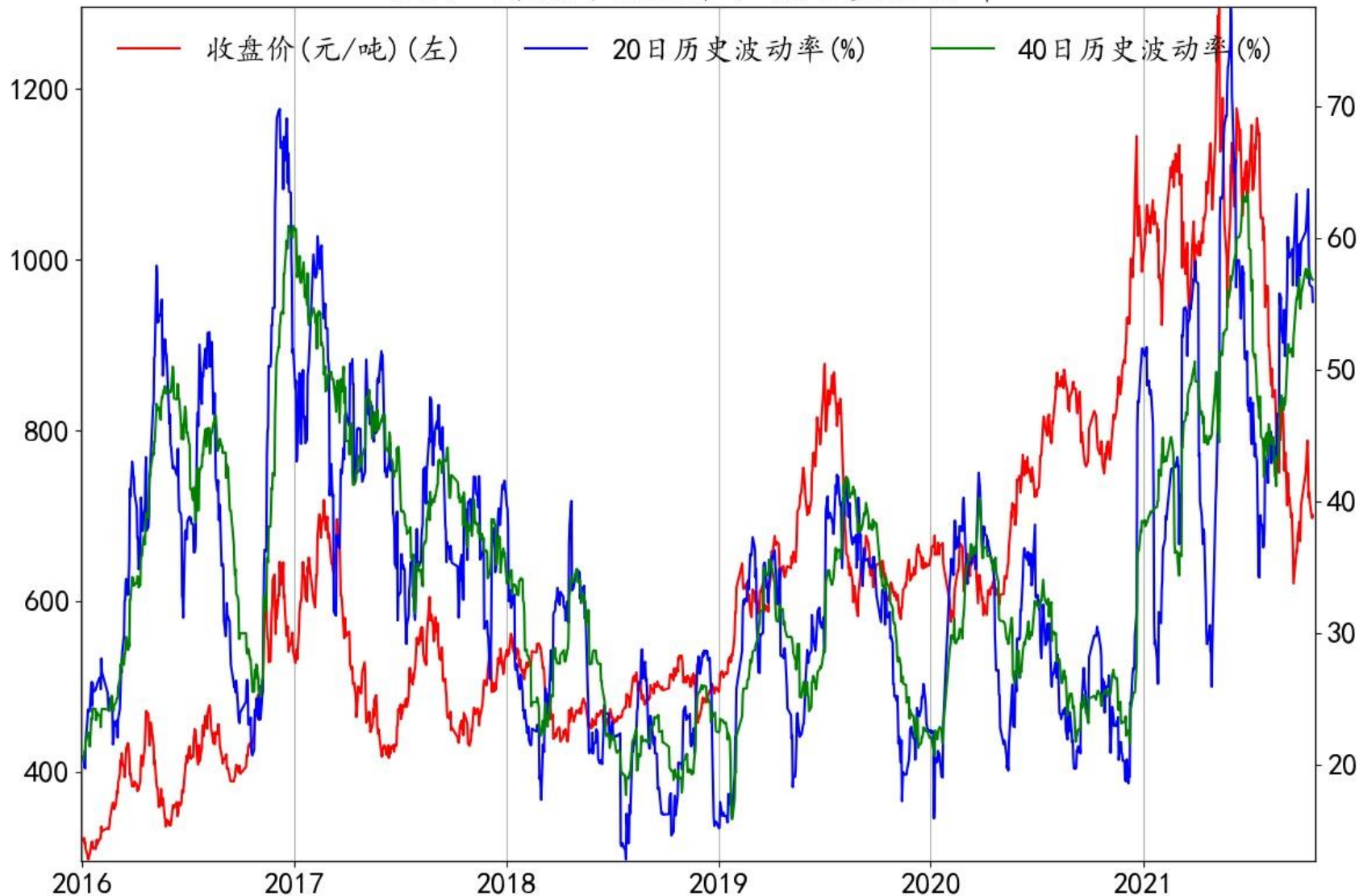
沪锌指数收盘价和历史波动率



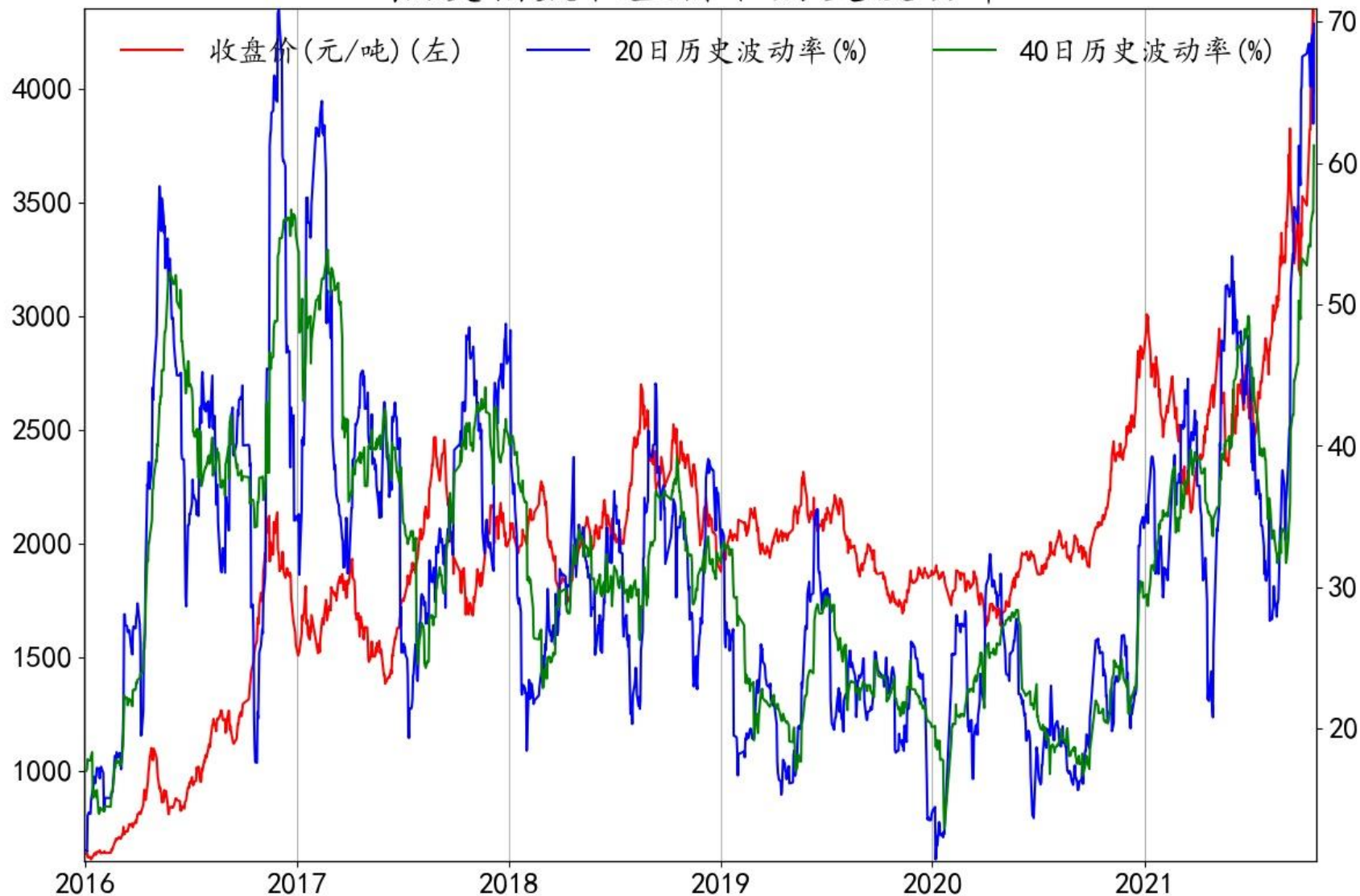
热卷指数收盘价和历史波动率



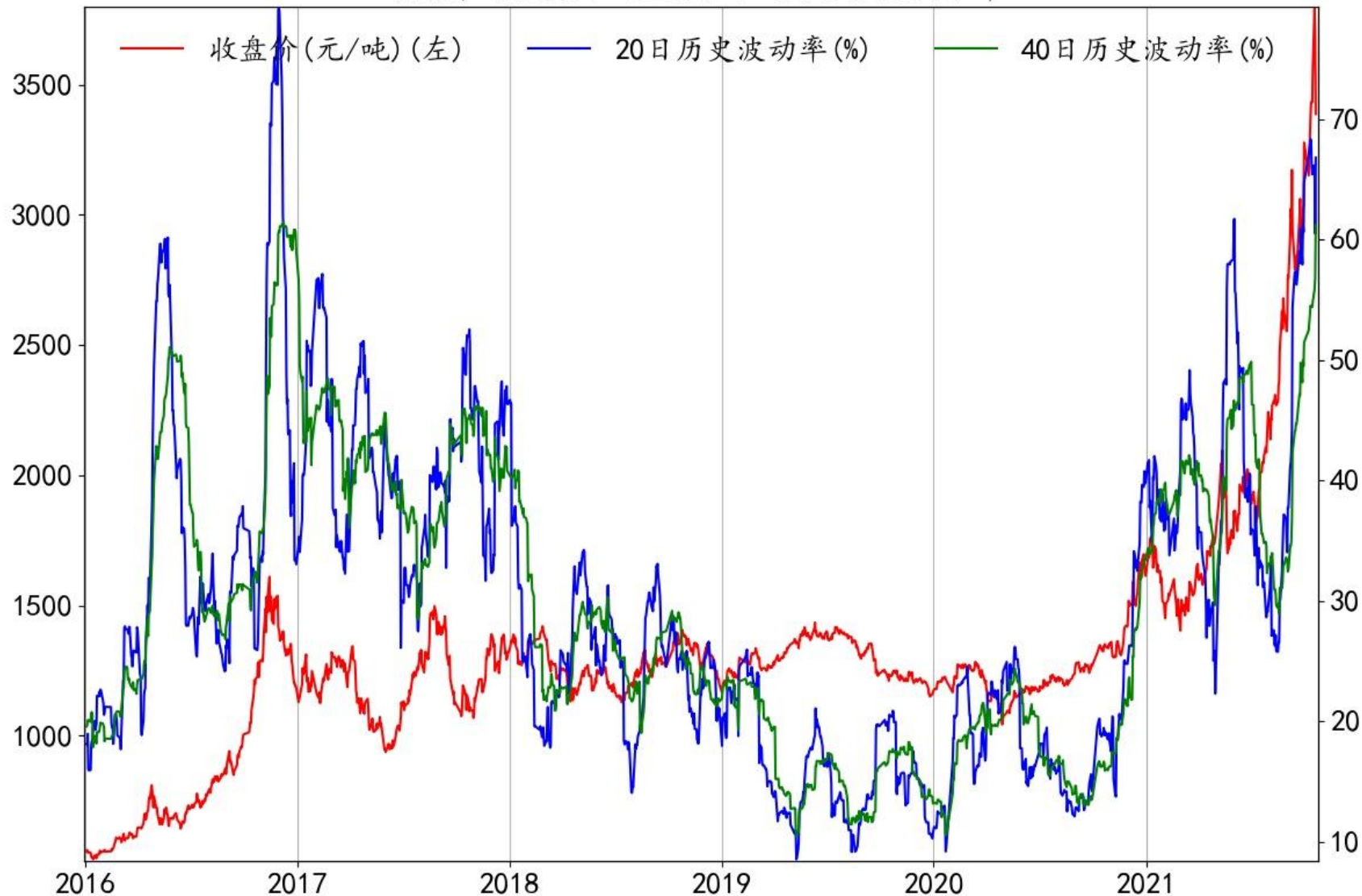
铁矿指数收盘价和历史波动率



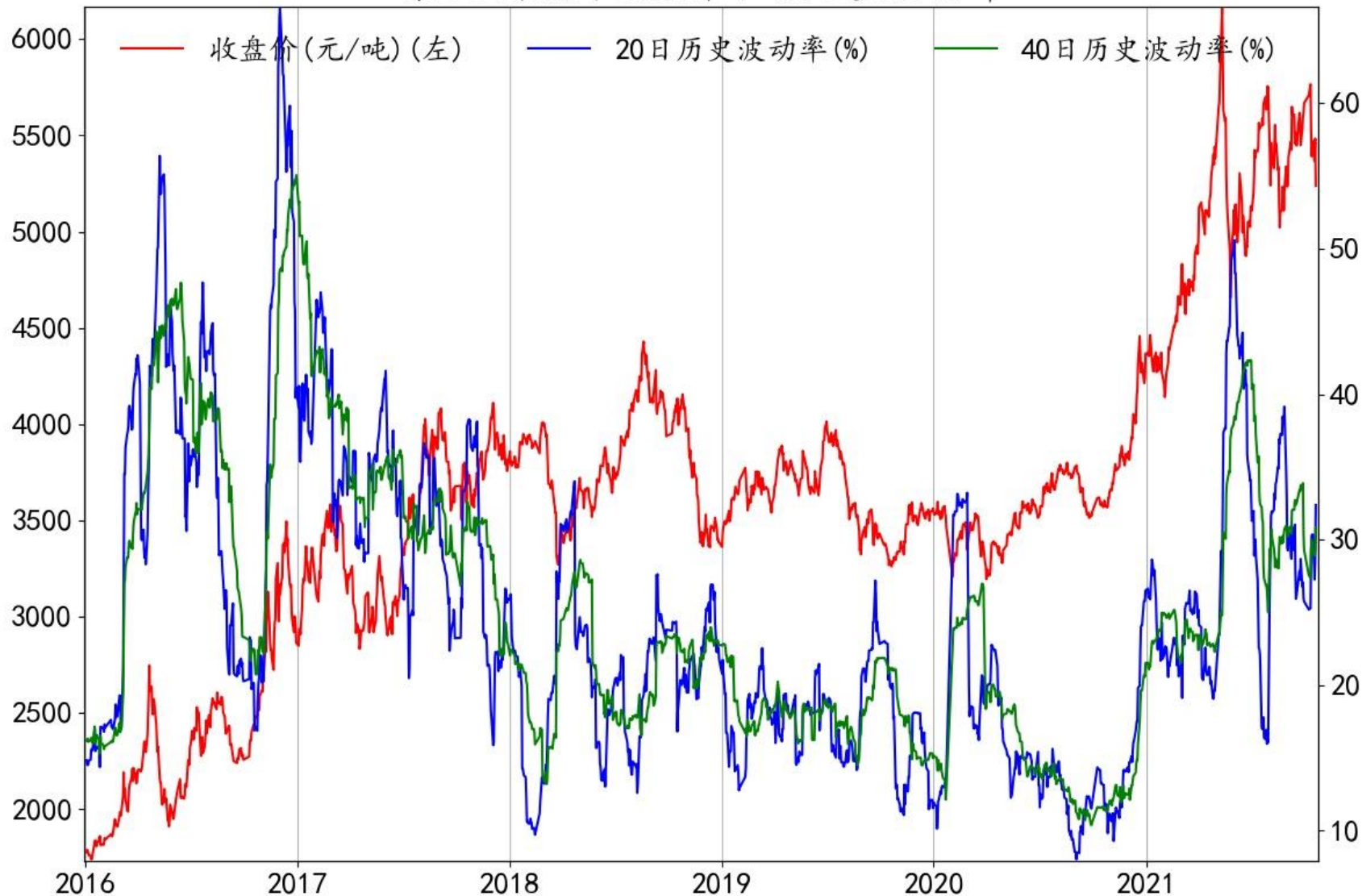
焦炭指数收盘价和历史波动率



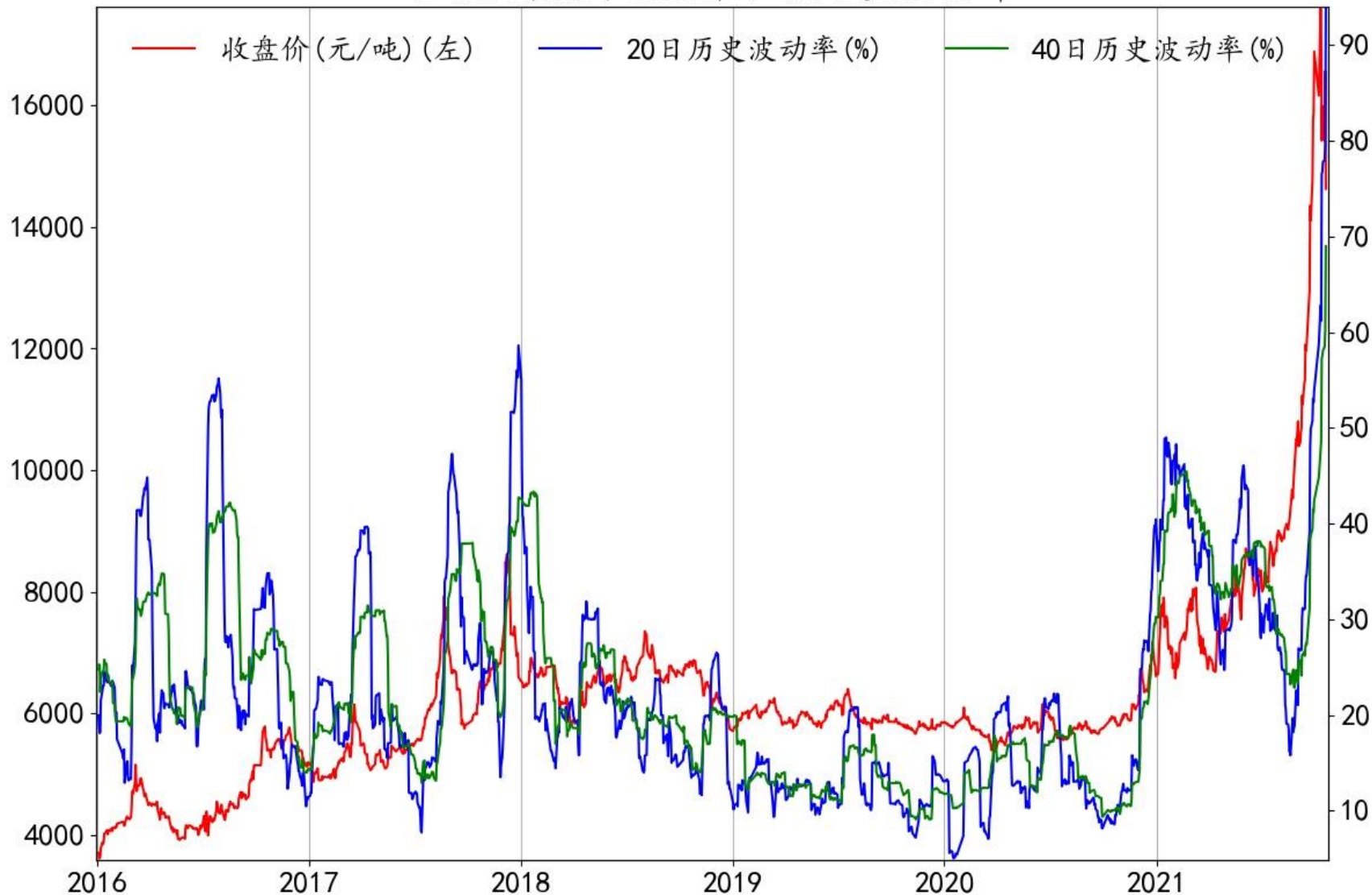
焦煤指数收盘价和历史波动率



螺纹指数收盘价和历史波动率



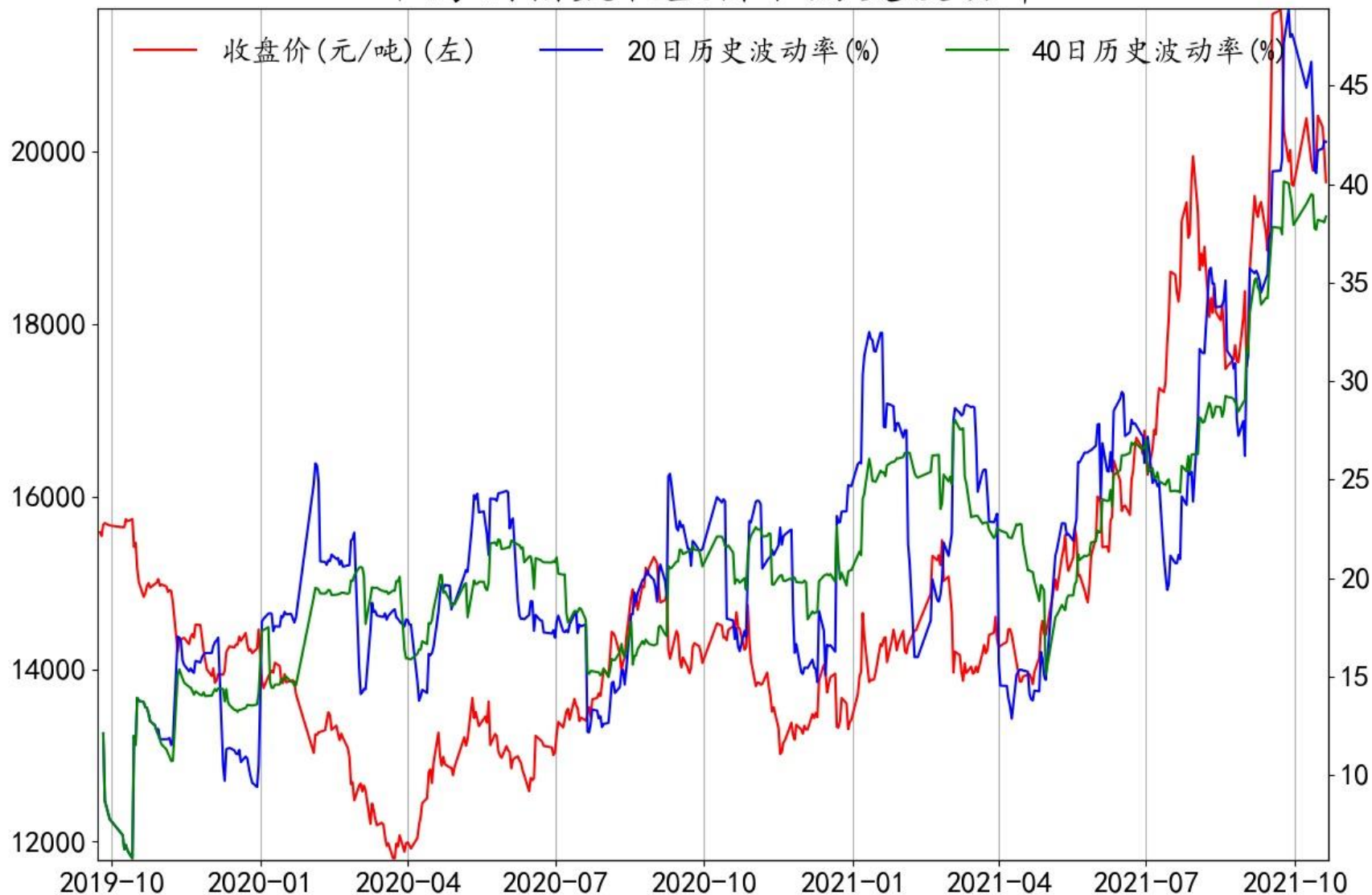
硅铁指数收盘价和历史波动率



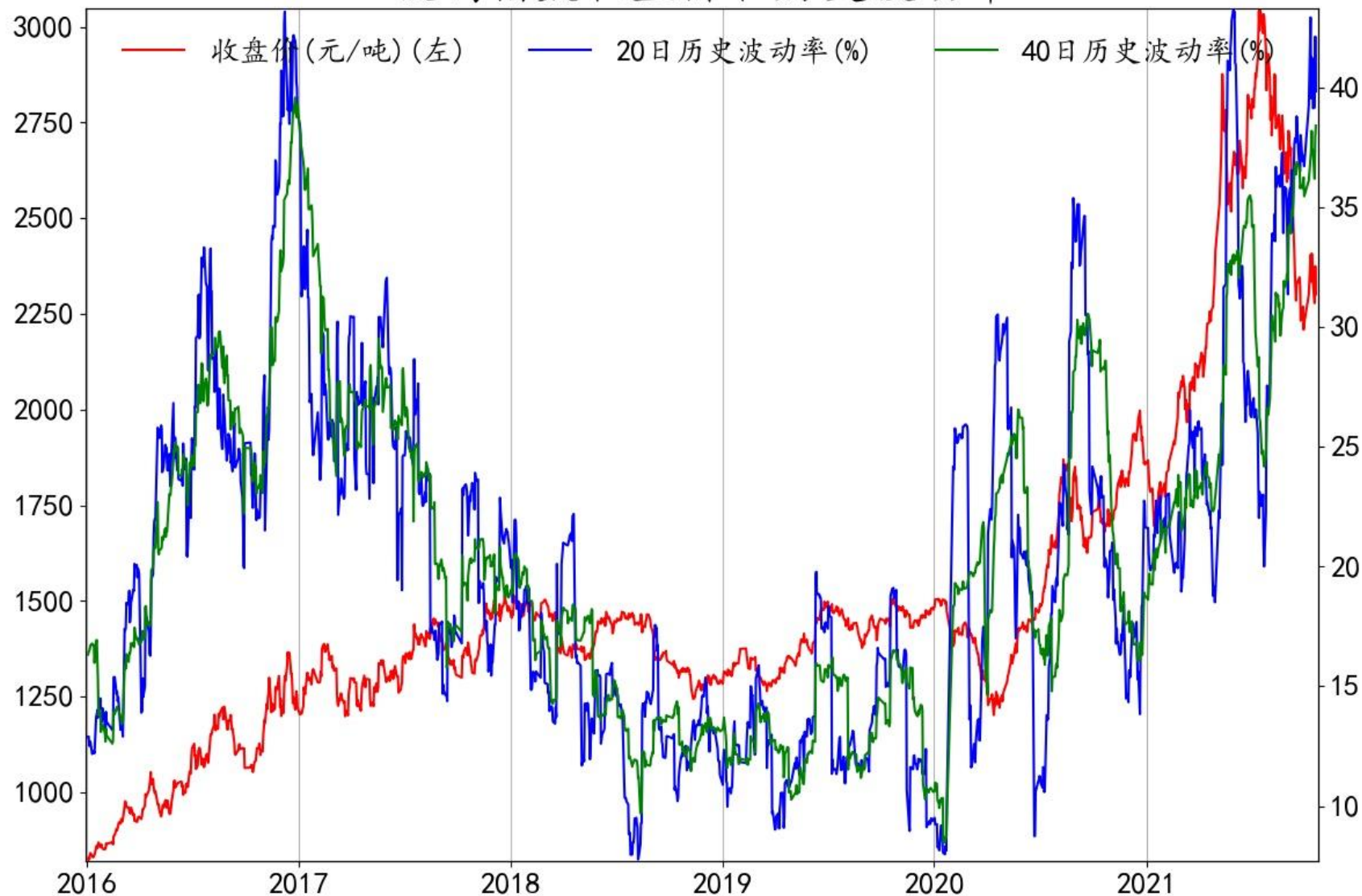
锰硅指数收盘价和历史波动率



不锈钢指数收盘价和历史波动率



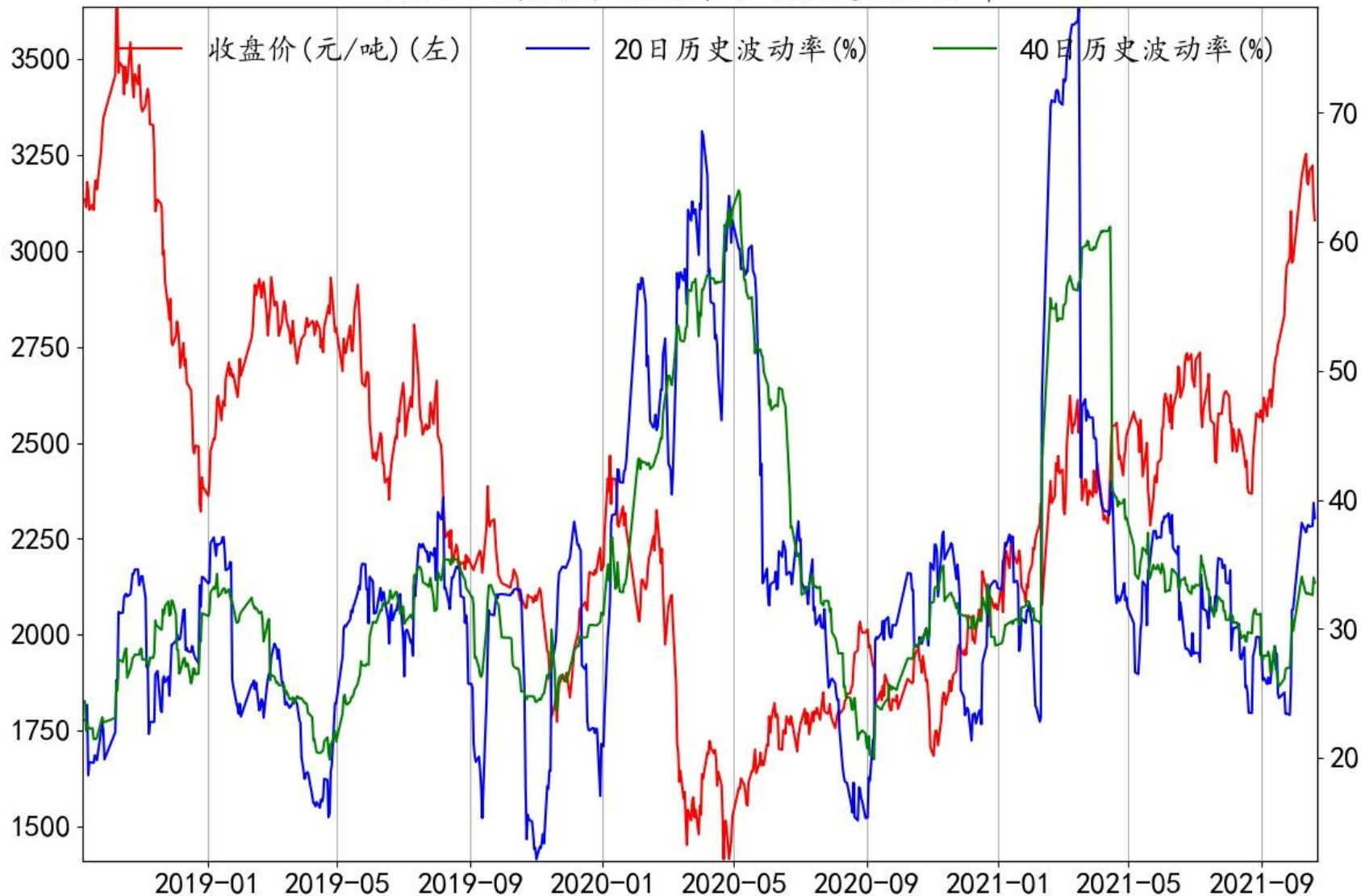
玻璃指数收盘价和历史波动率



PVC指数收盘价和历史波动率



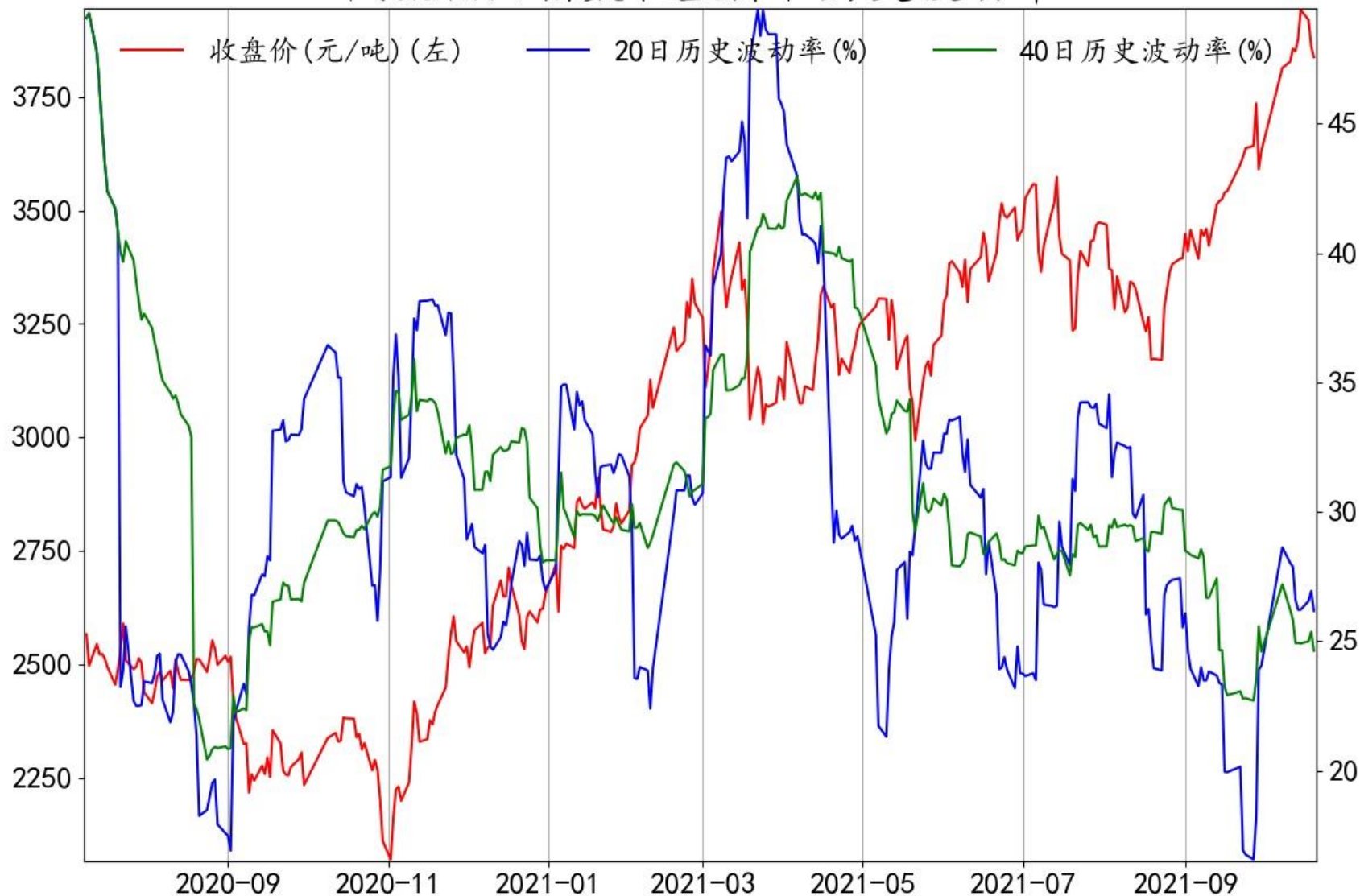
燃油指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

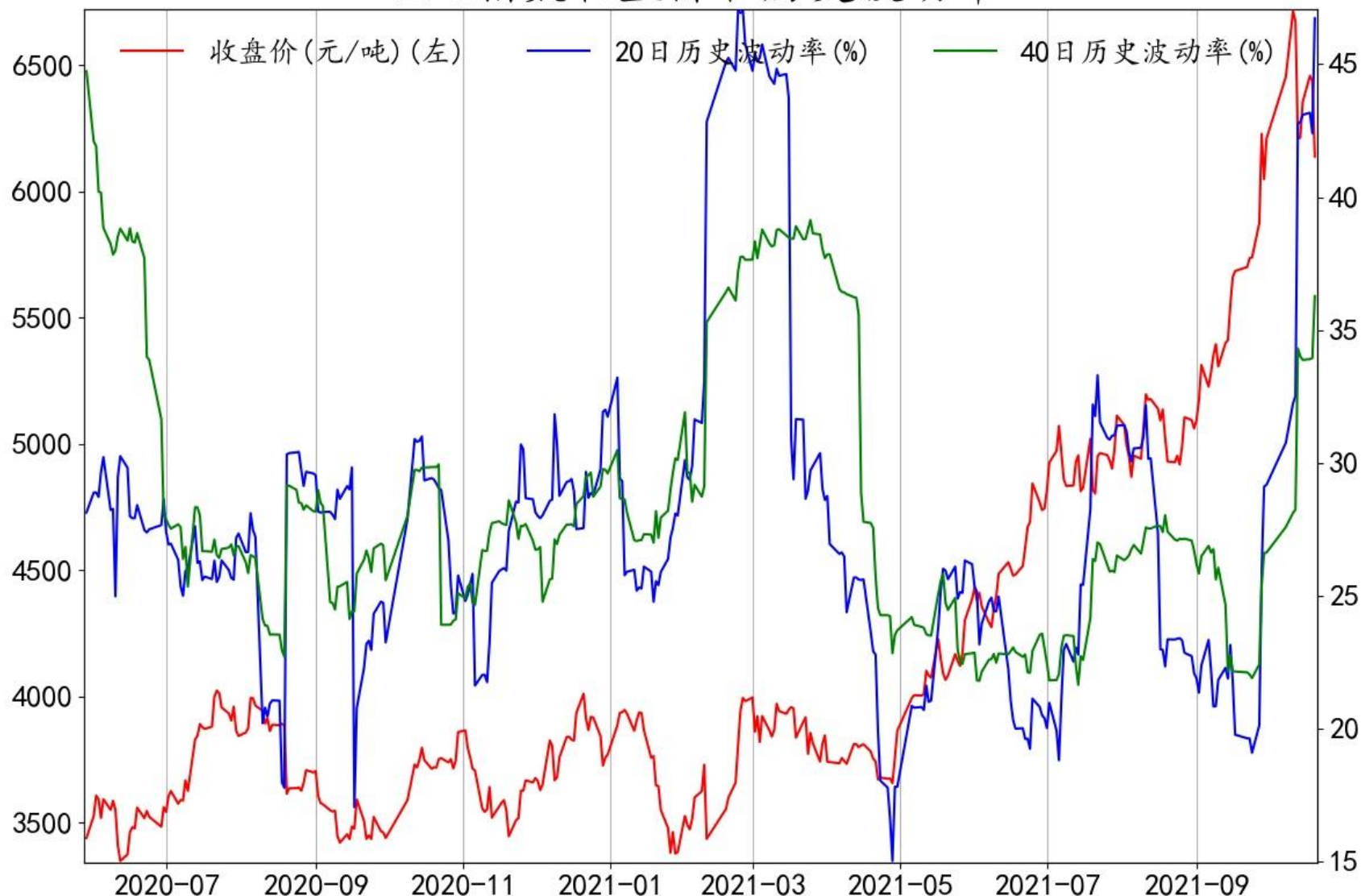
低硫燃油指数

低硫燃油指数收盘价和历史波动率



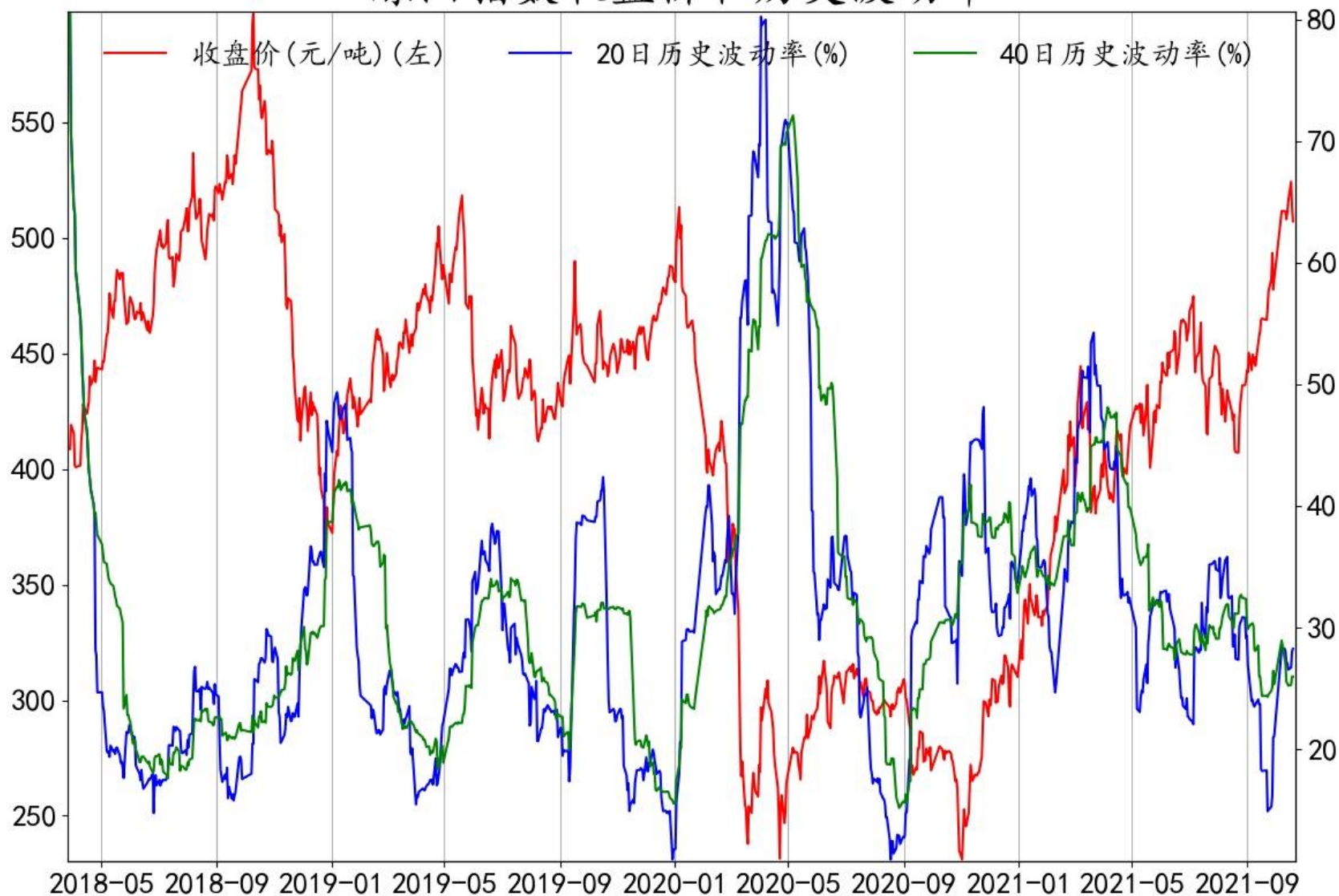
数据来源: Wind、信达期货研发中心

LPG指数收盘价和历史波动率



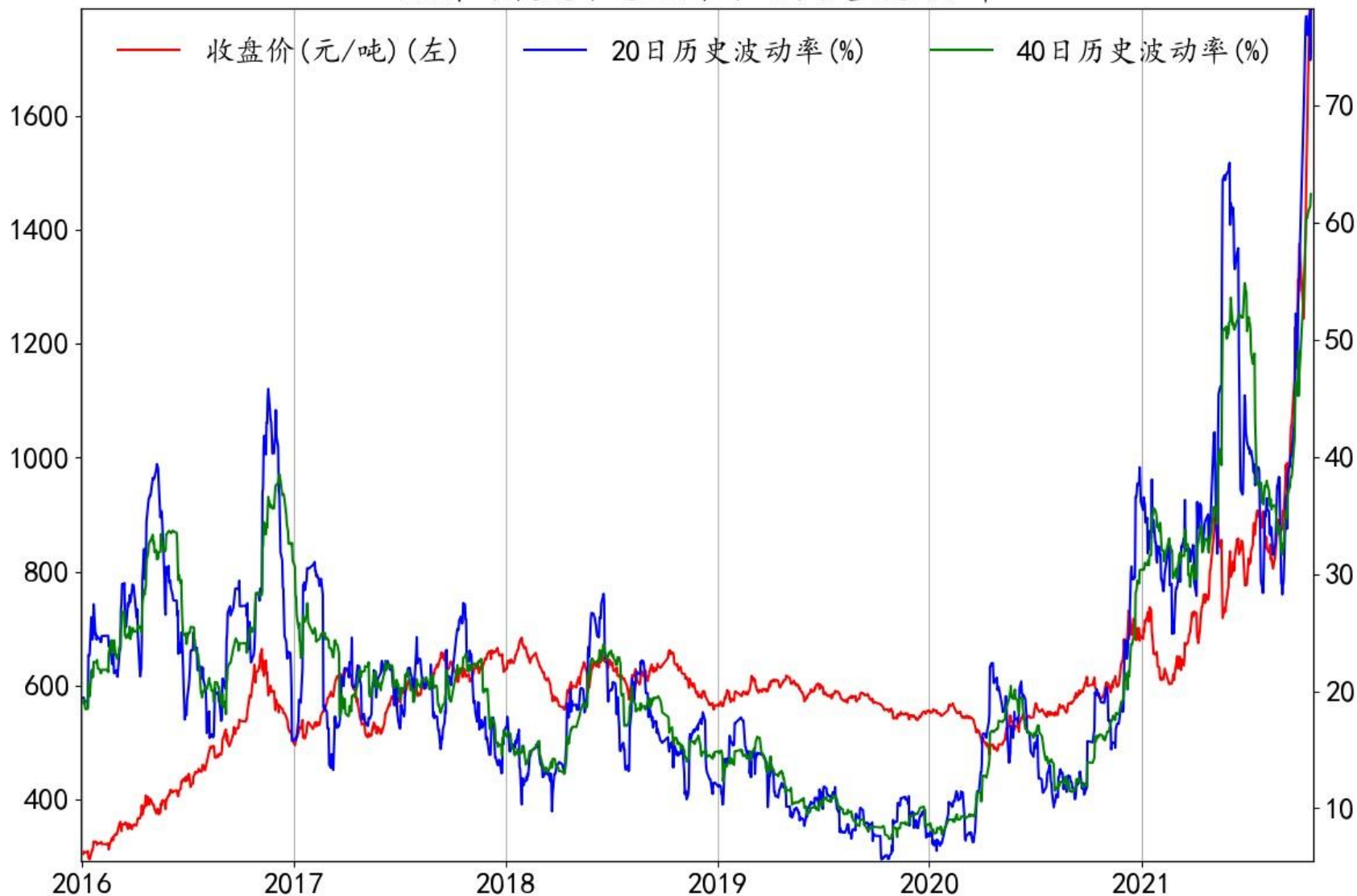
数据来源: Wind、信达期货研发中心

原油指数收盘价和历史波动率

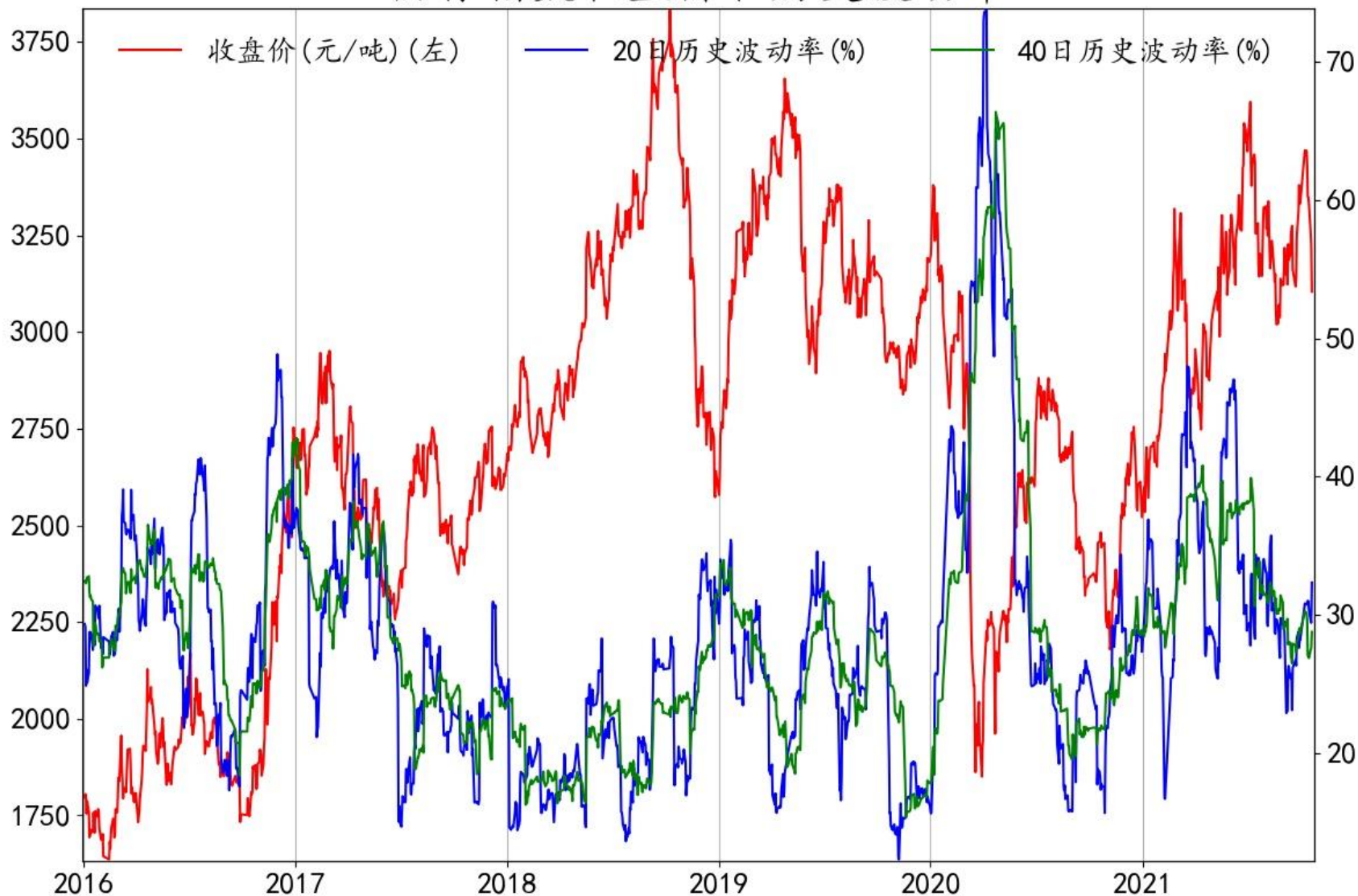


数据来源: Wind、信达期货研发中心

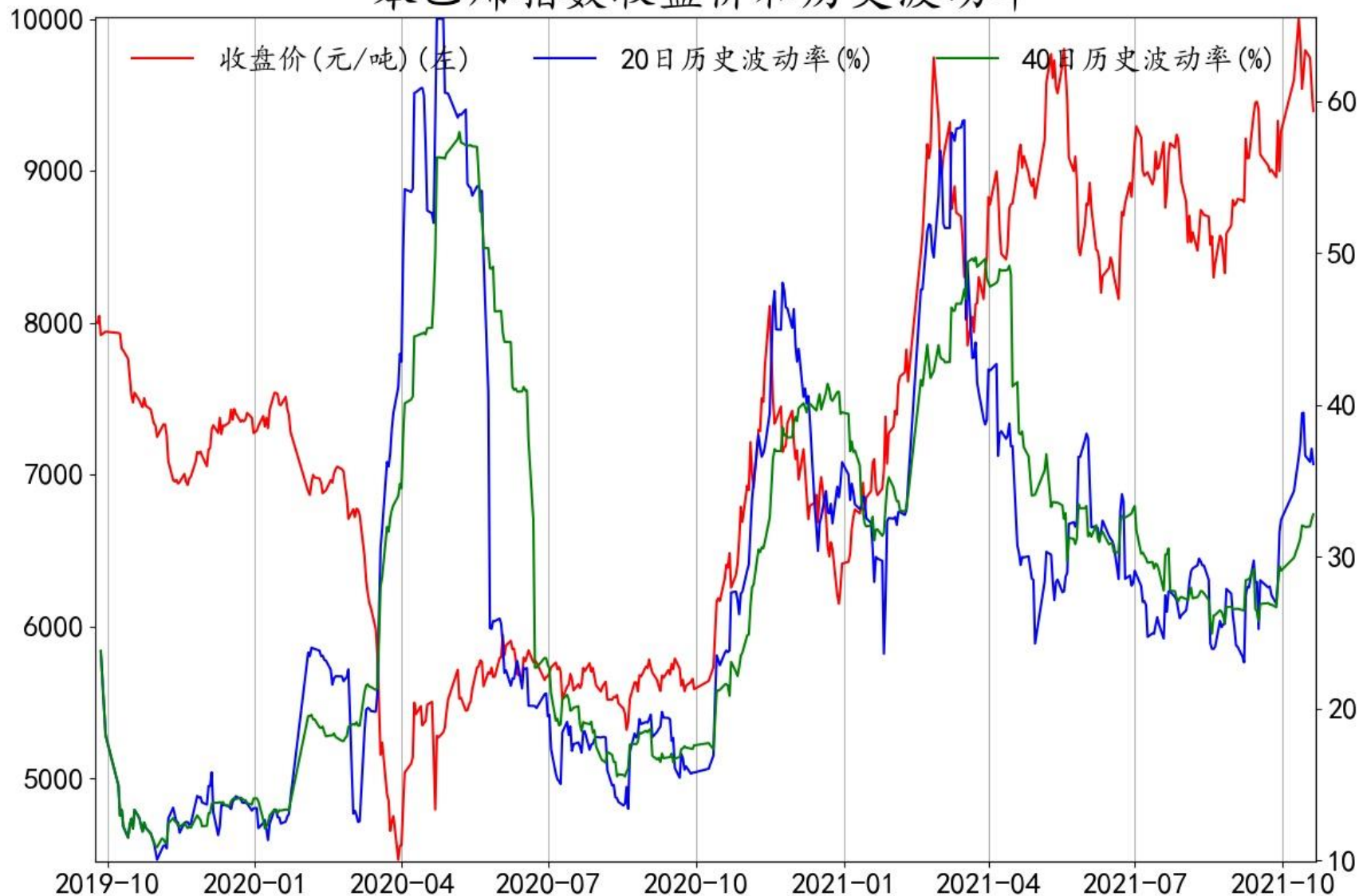
动煤指数收盘价和历史波动率



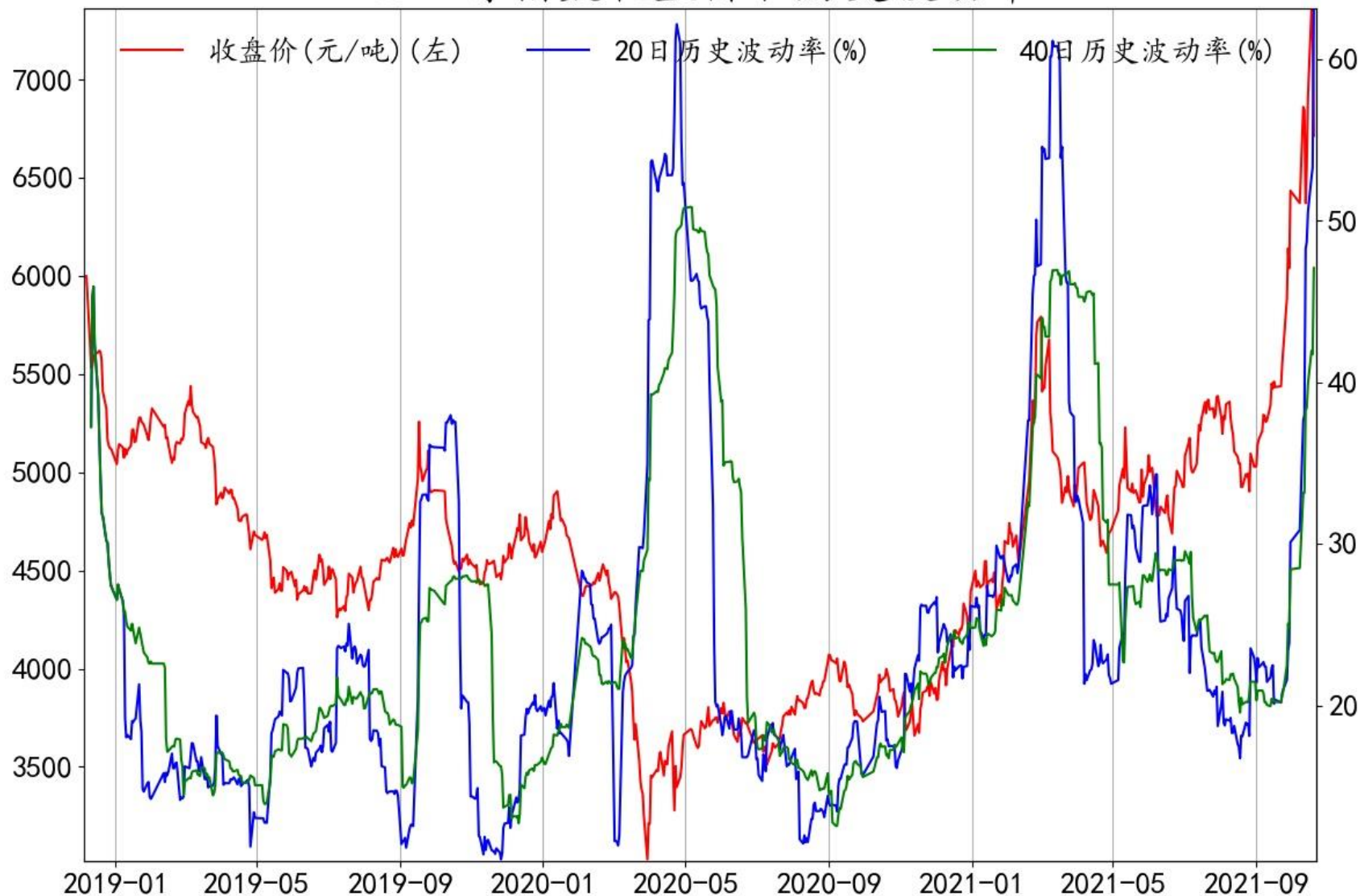
沥青指数收盘价和历史波动率



苯乙烯指数收盘价和历史波动率

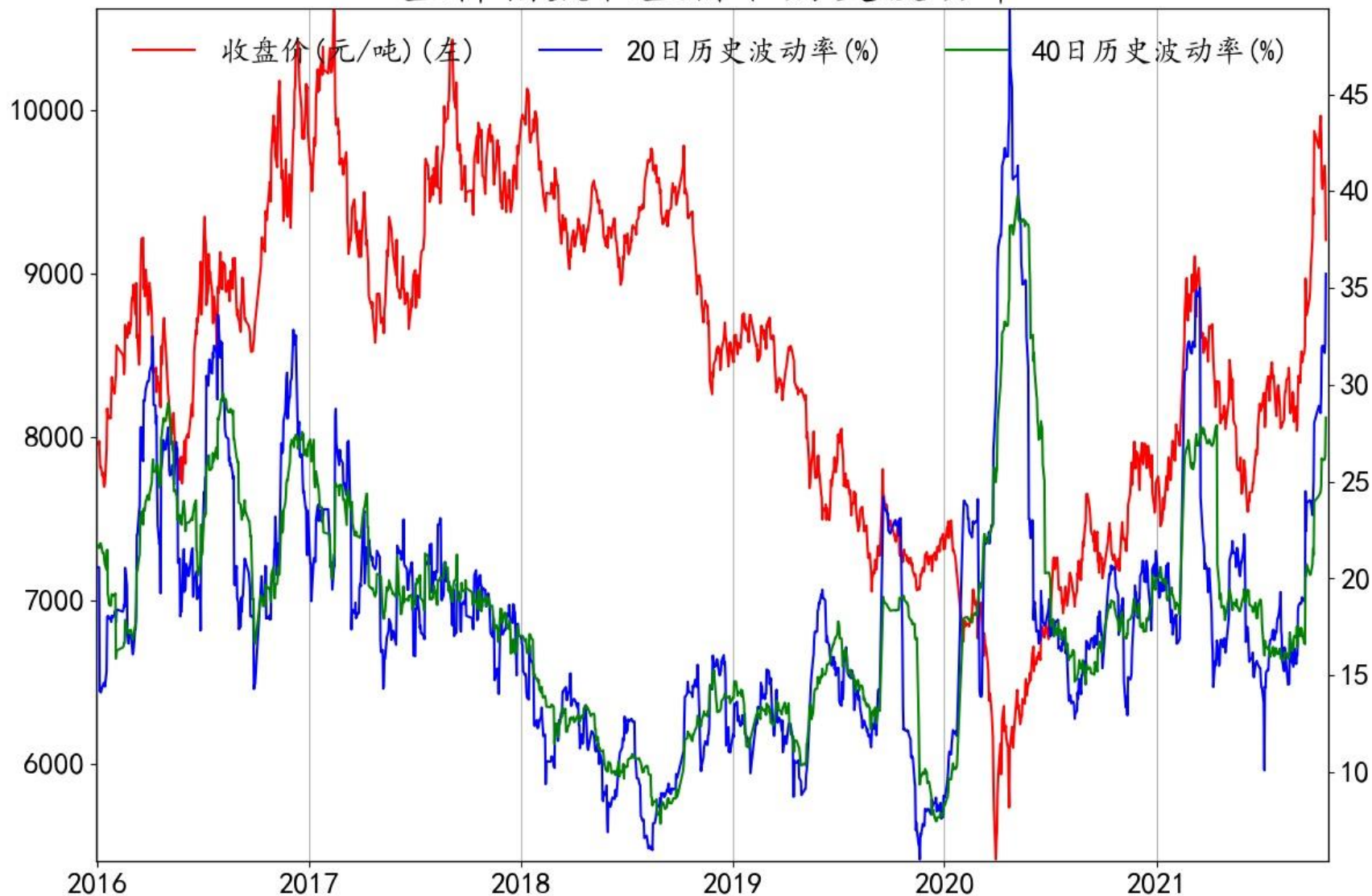


乙二醇指数收盘价和历史波动率

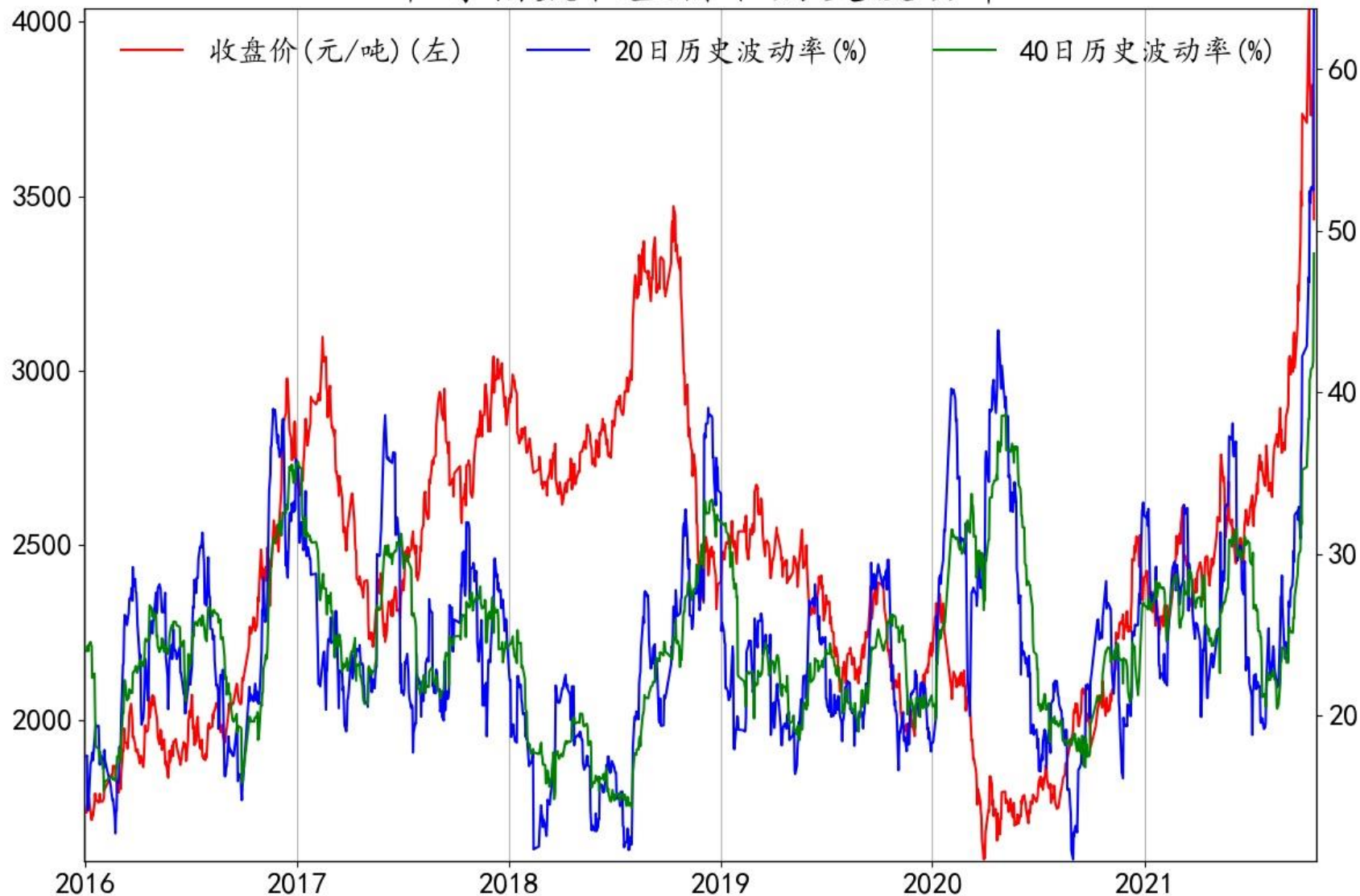


数据来源: Wind、信达期货研发中心

塑料指数收盘价和历史波动率

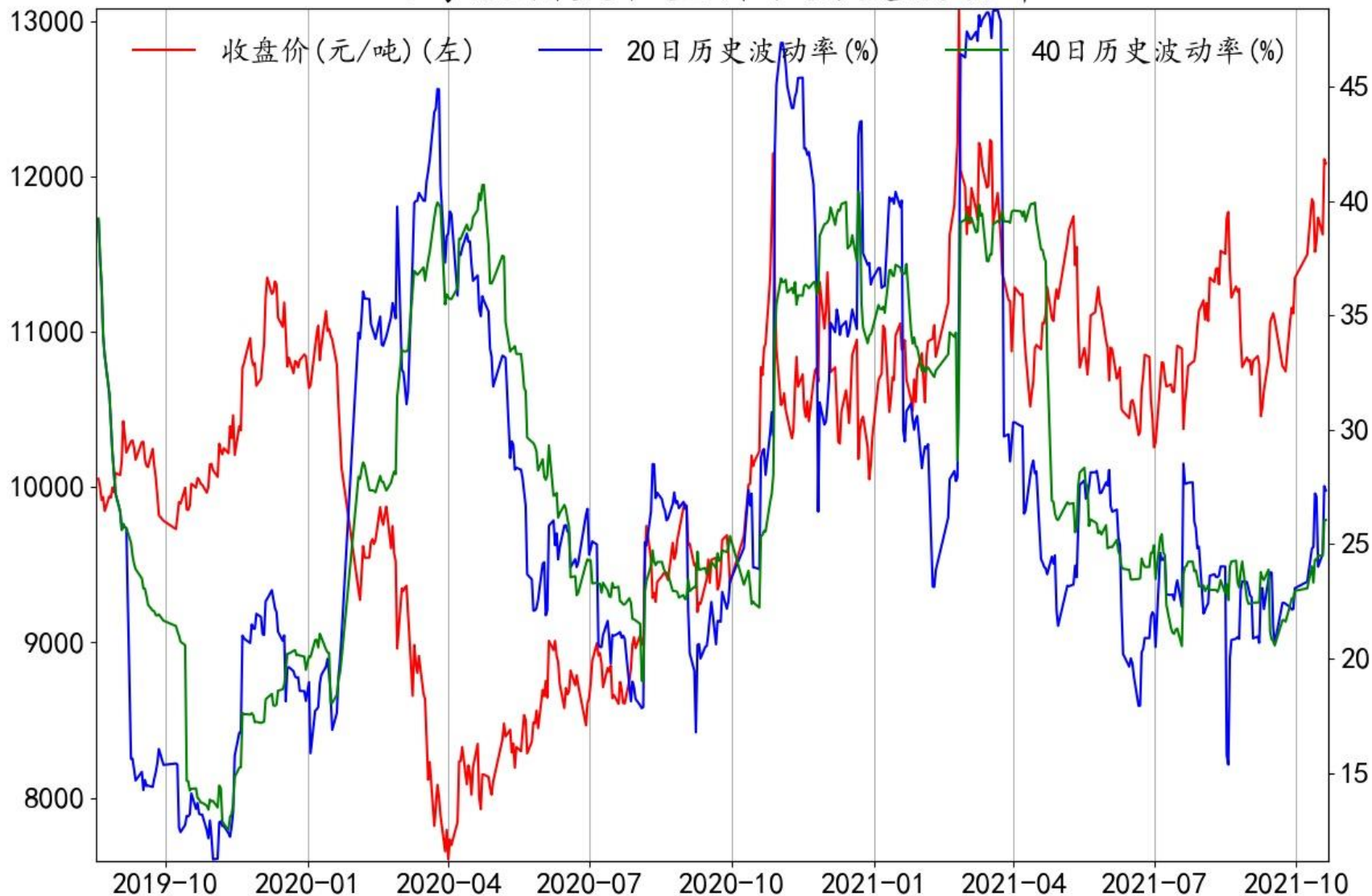


甲醇指数收盘价和历史波动率

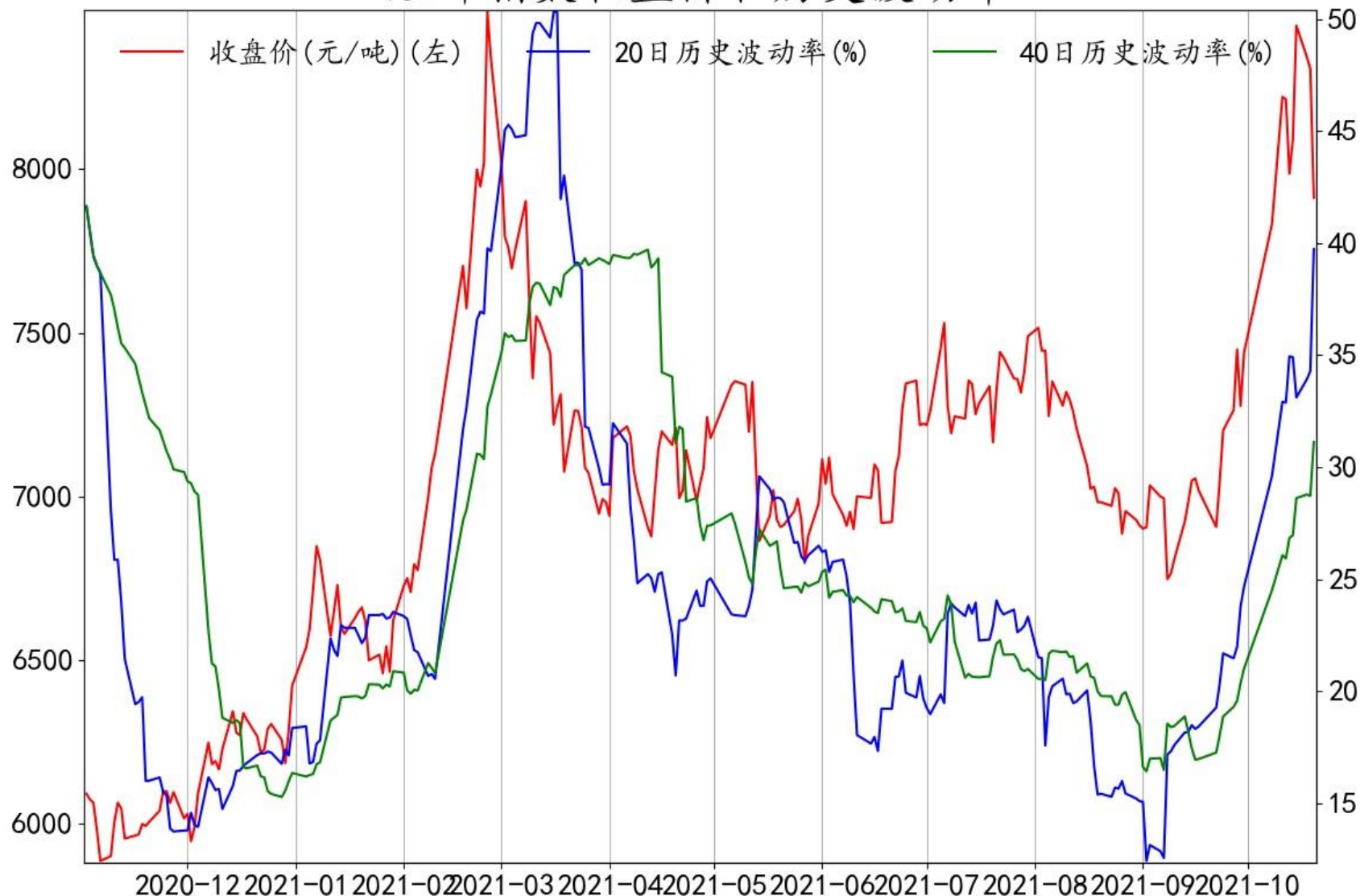


20号胶指数

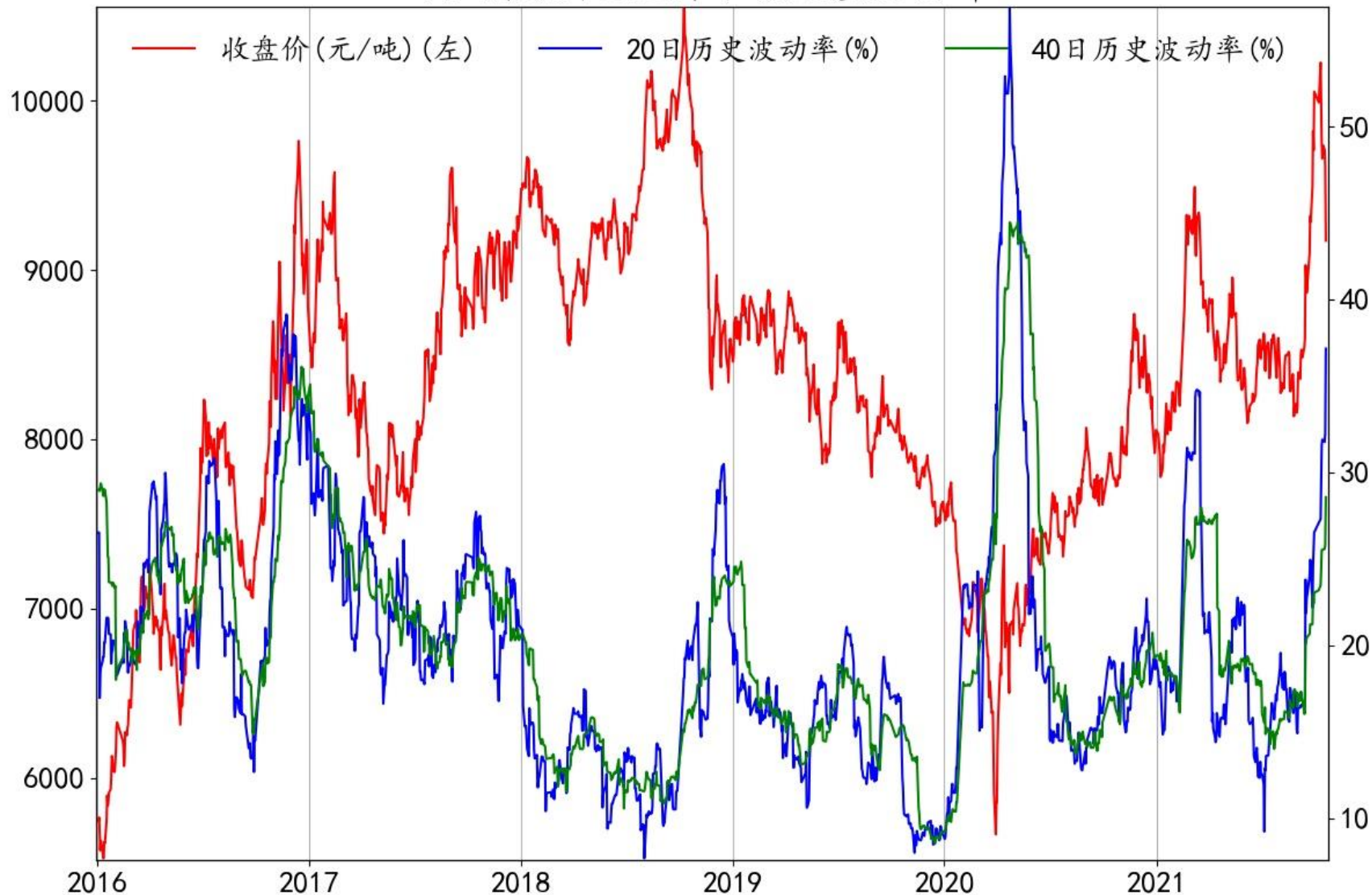
20号胶指数收盘价和历史波动率



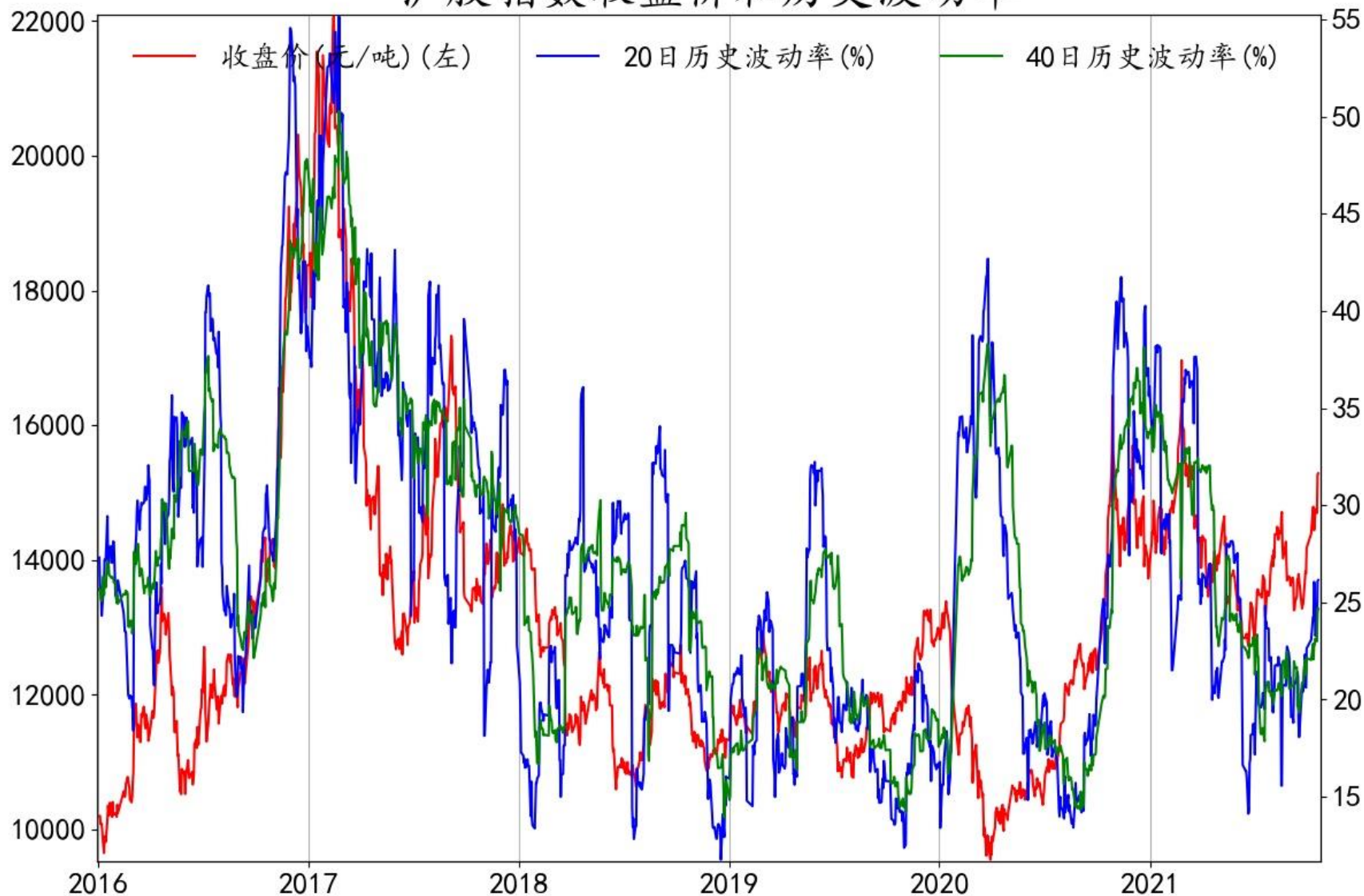
短纤指数收盘价和历史波动率



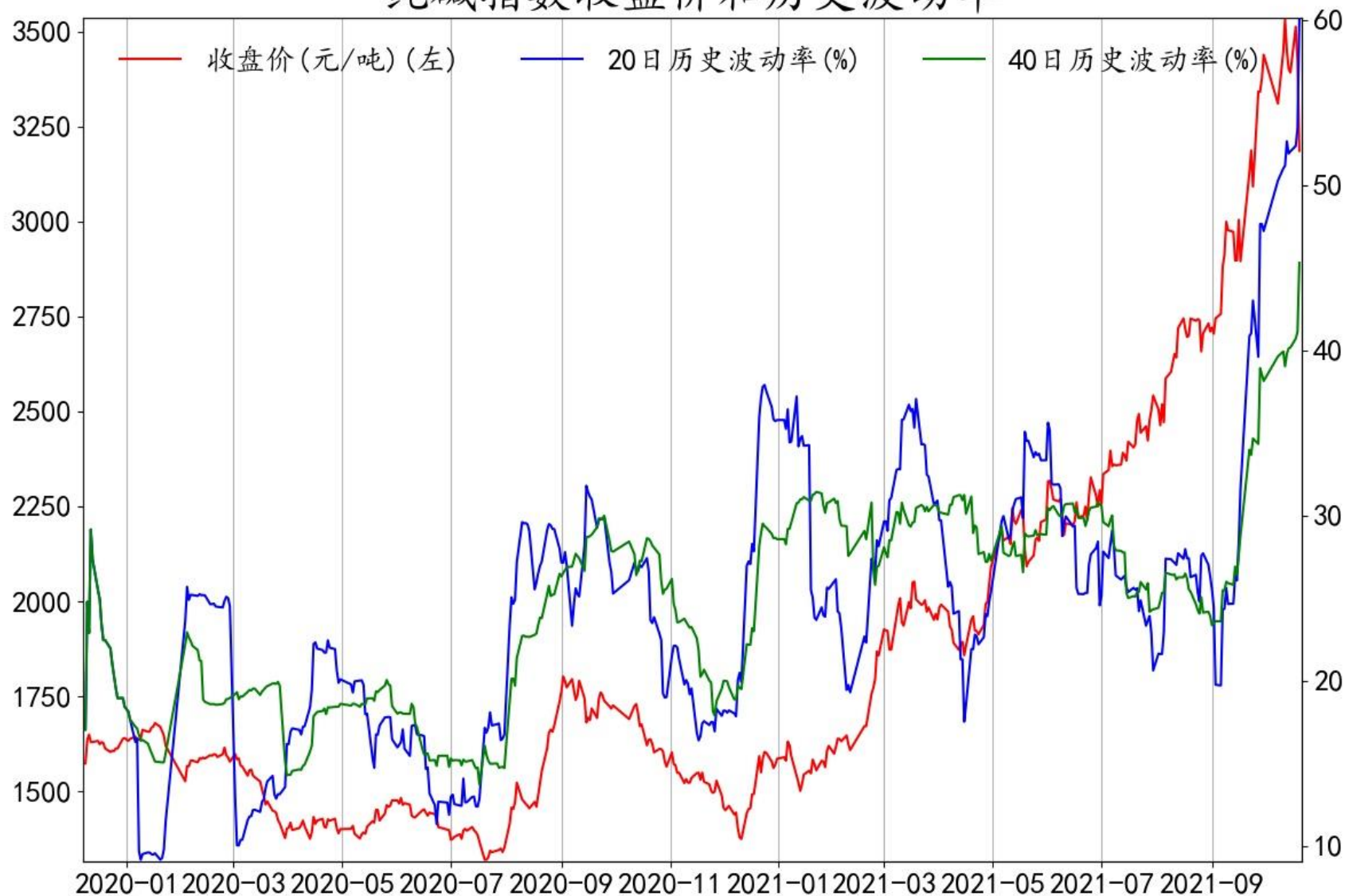
PP指数收盘价和历史波动率



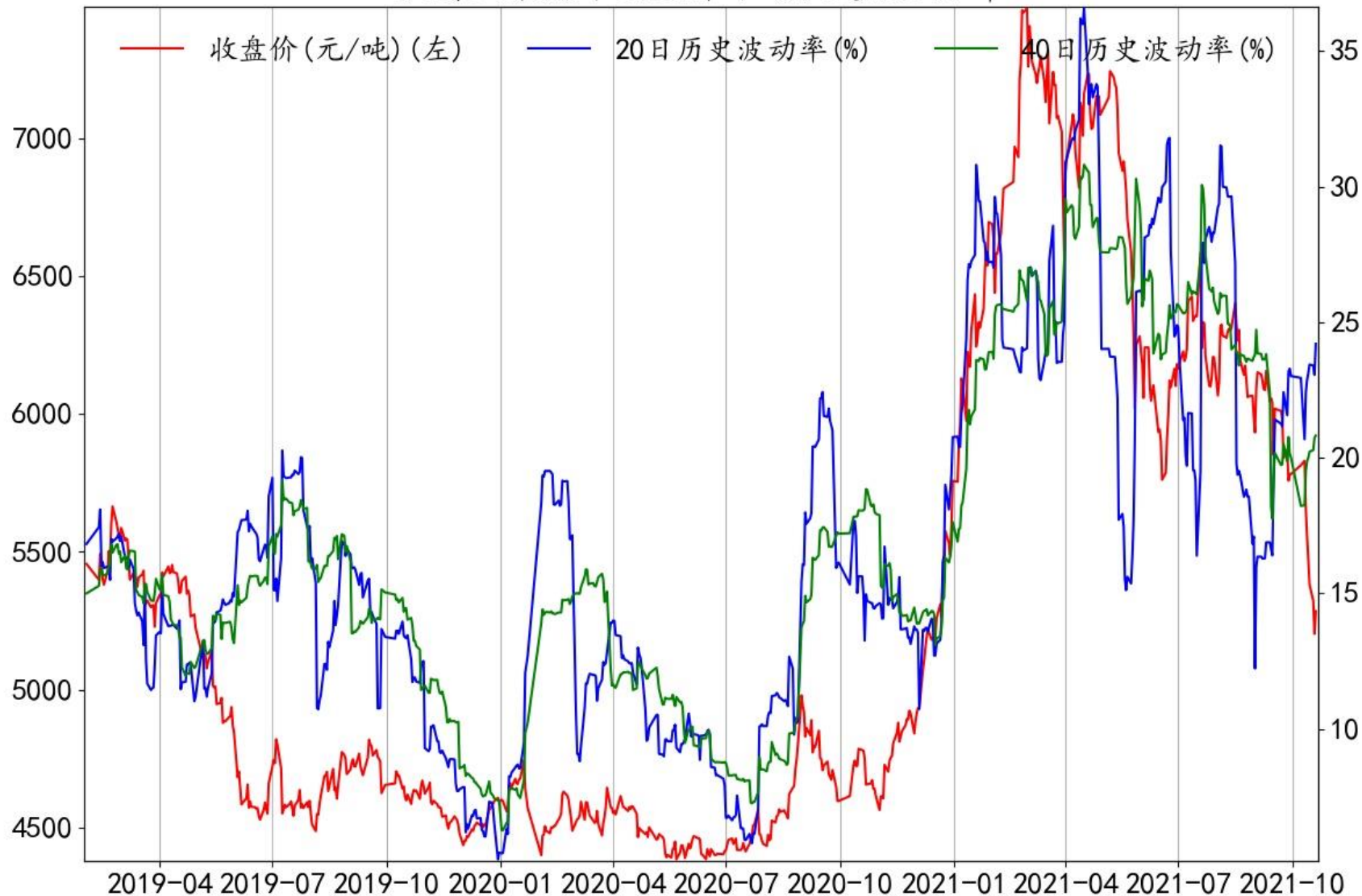
沪胶指数收盘价和历史波动率



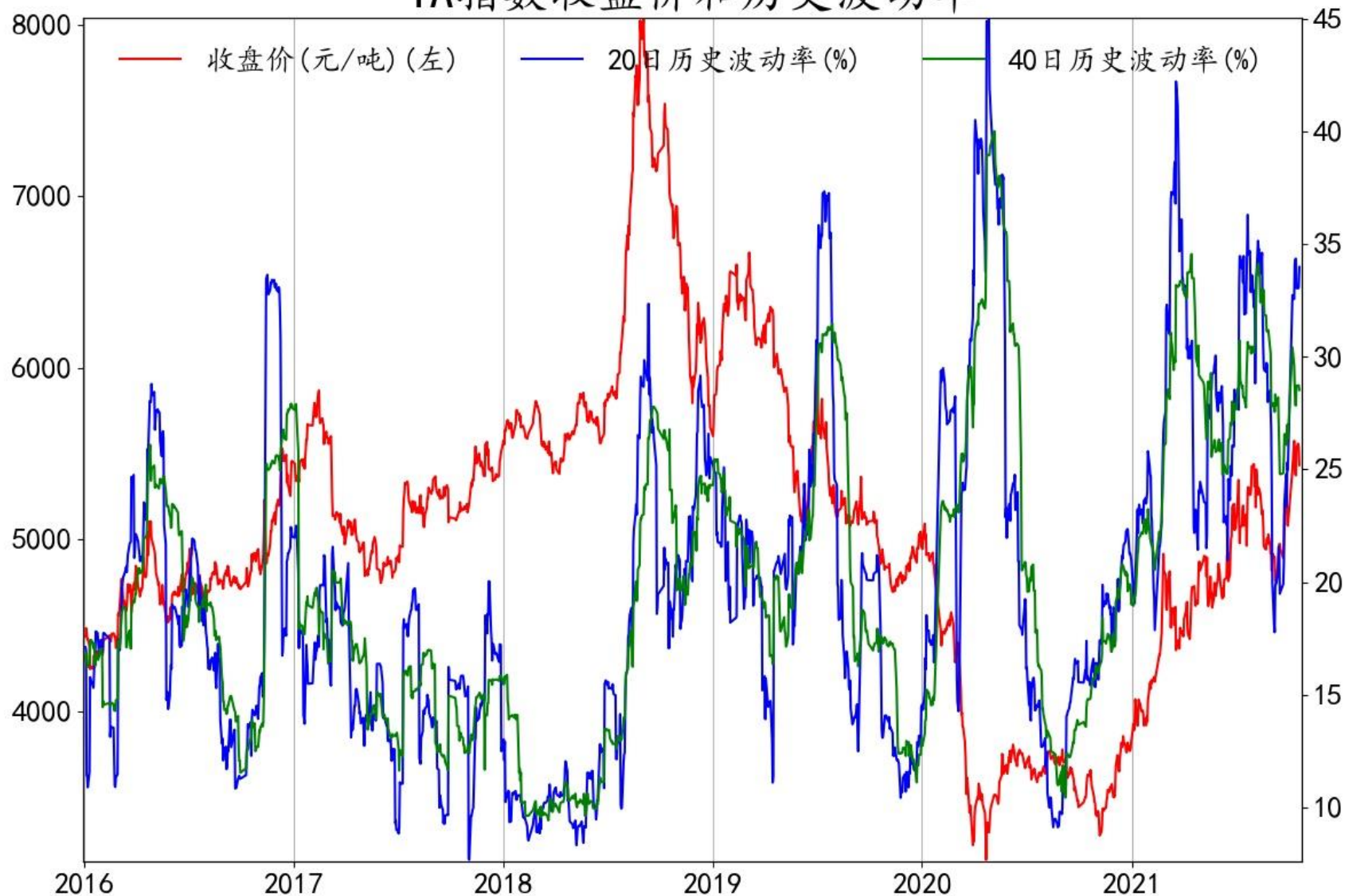
纯碱指数收盘价和历史波动率



纸浆指数收盘价和历史波动率



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

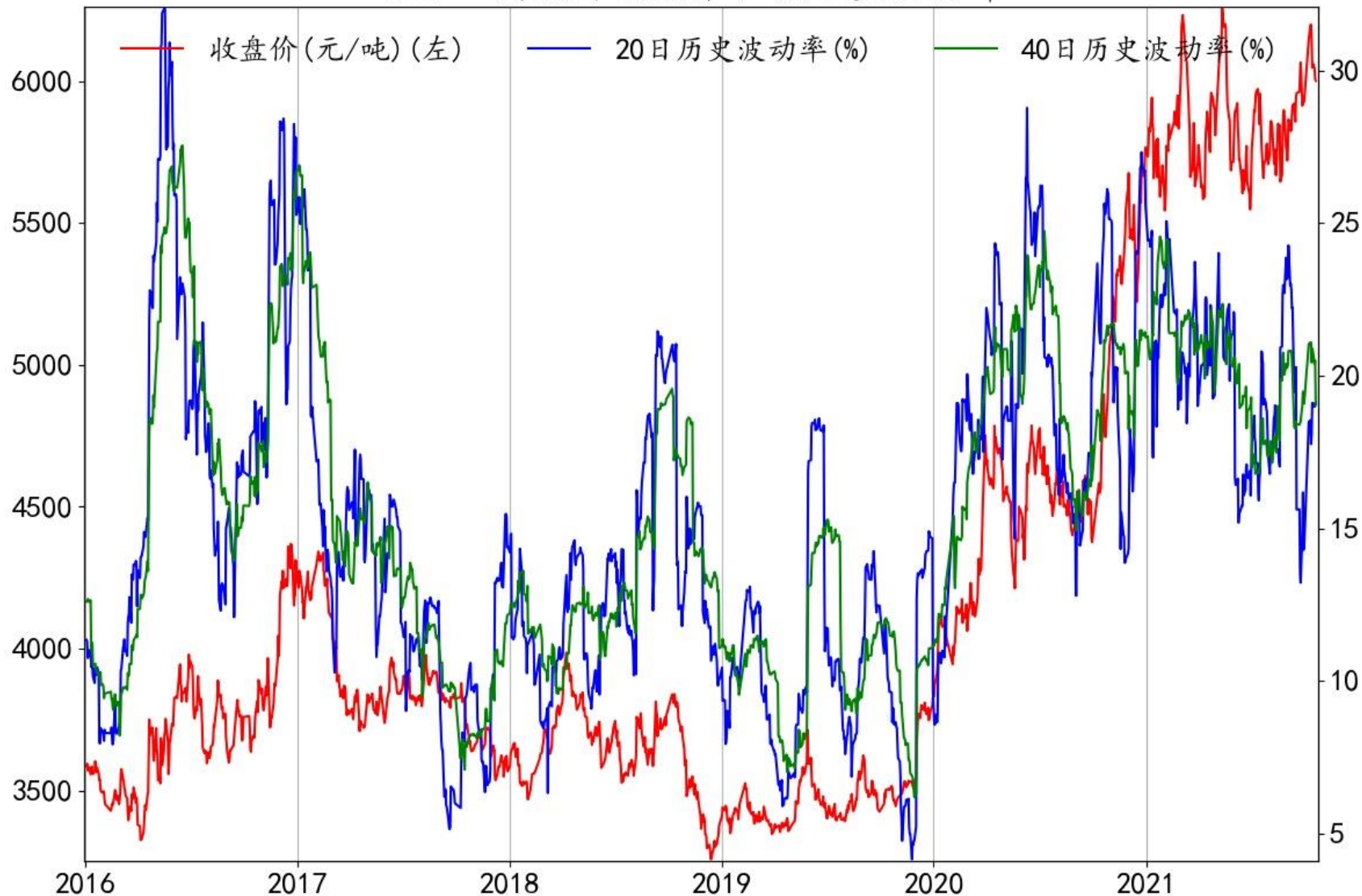


数据来源: Wind、信达期货研发中心

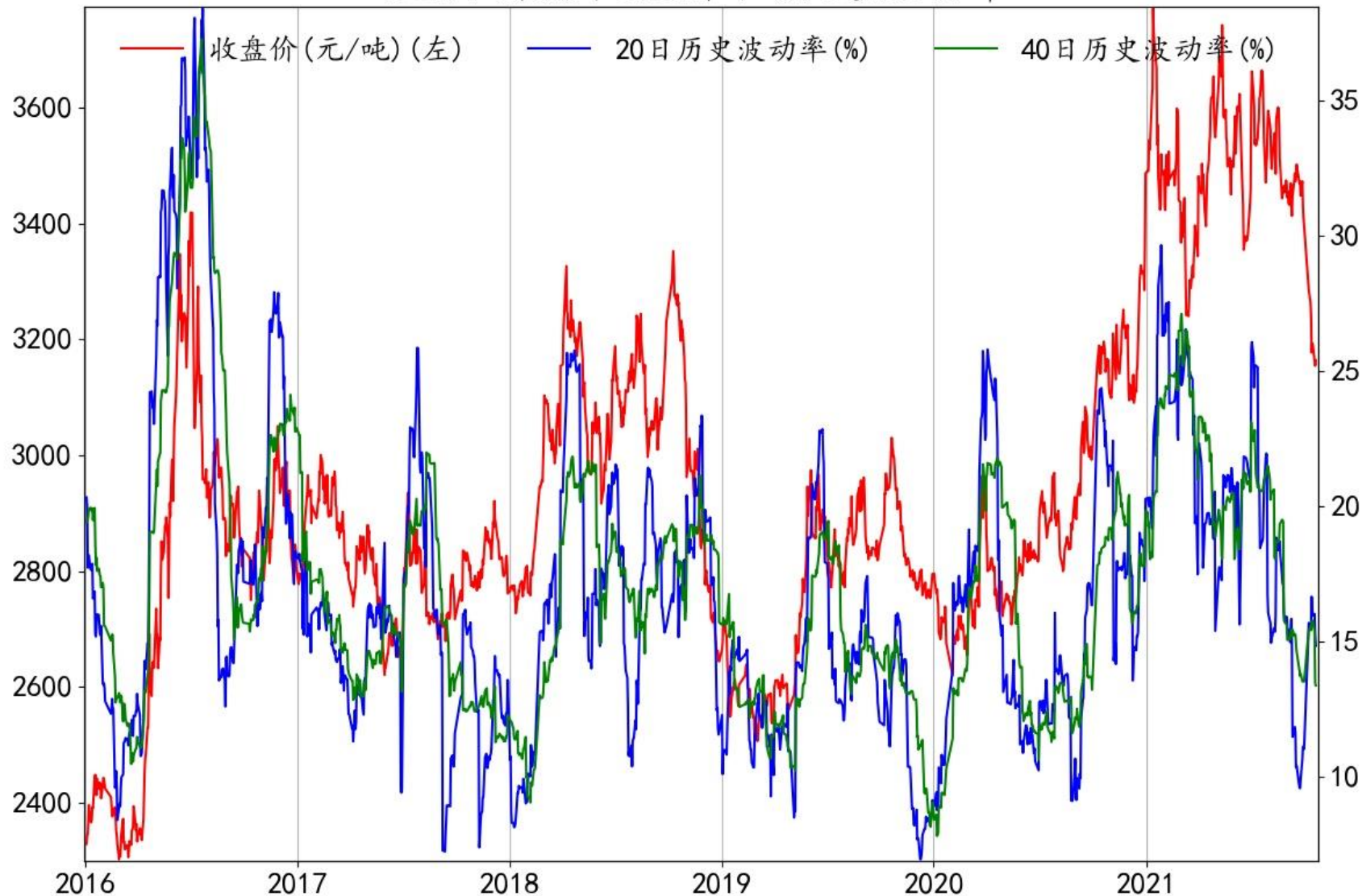
玉米指数收盘价和历史波动率



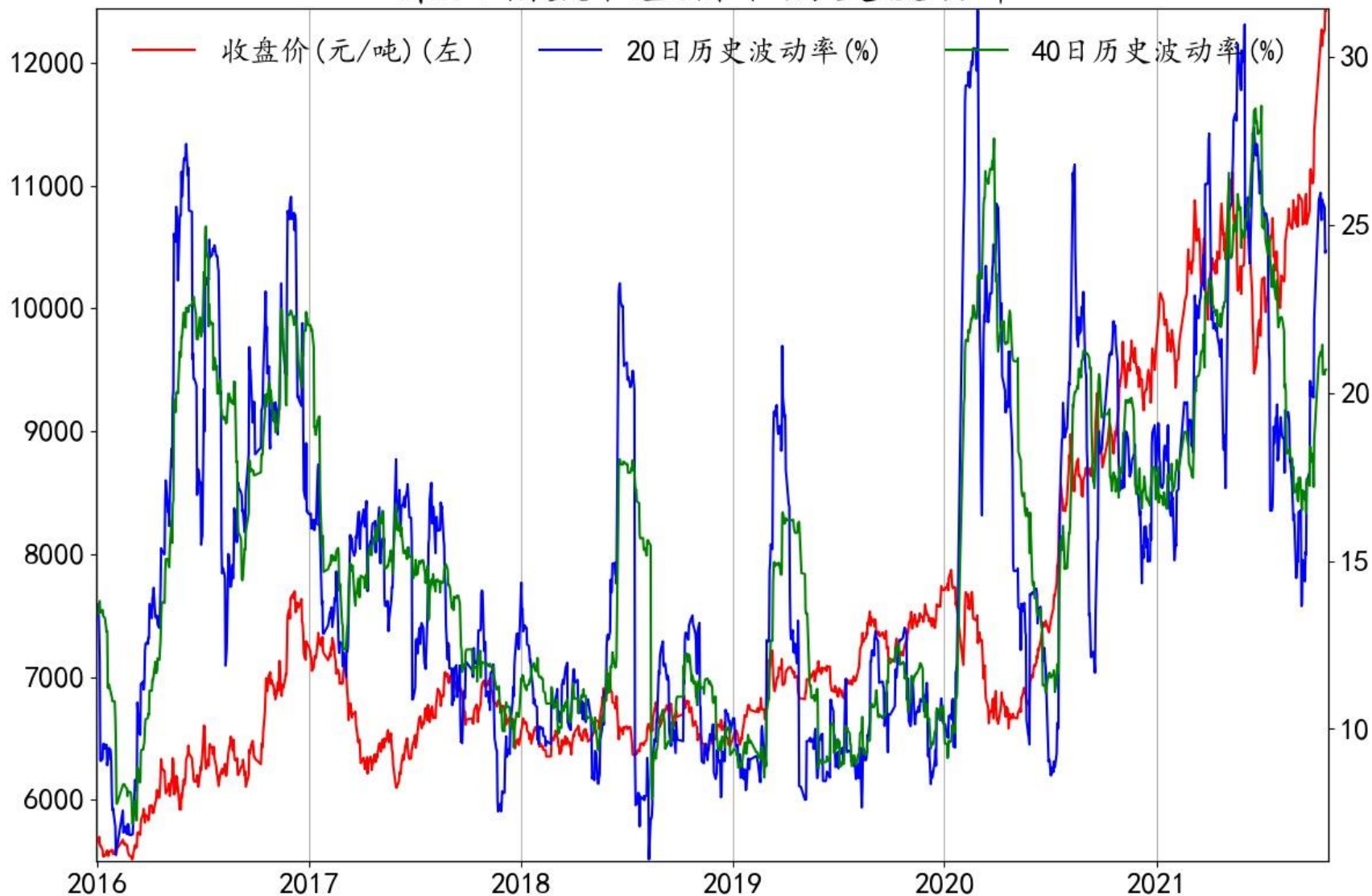
豆一指数收盘价和历史波动率



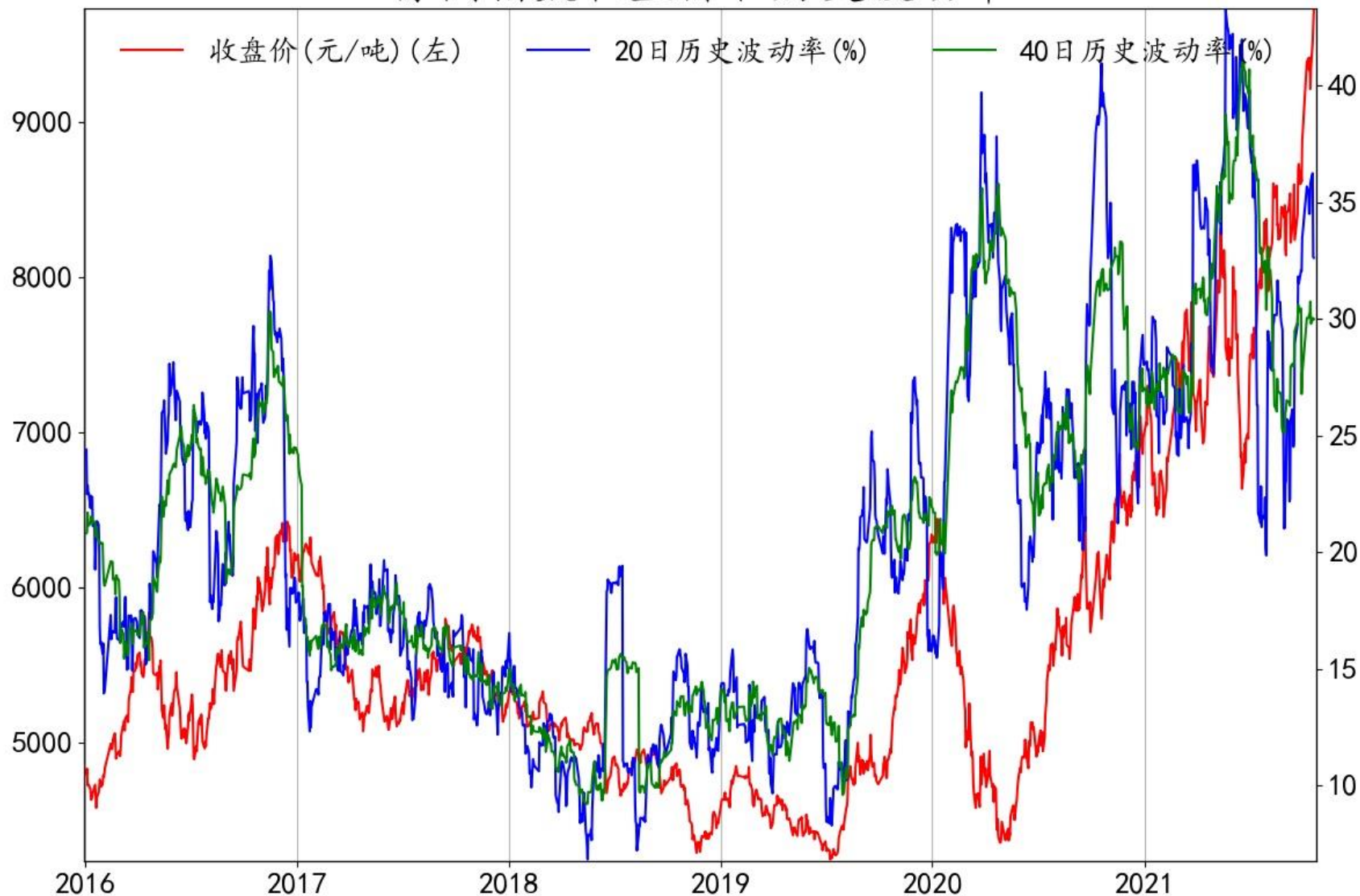
豆粕指数收盘价和历史波动率



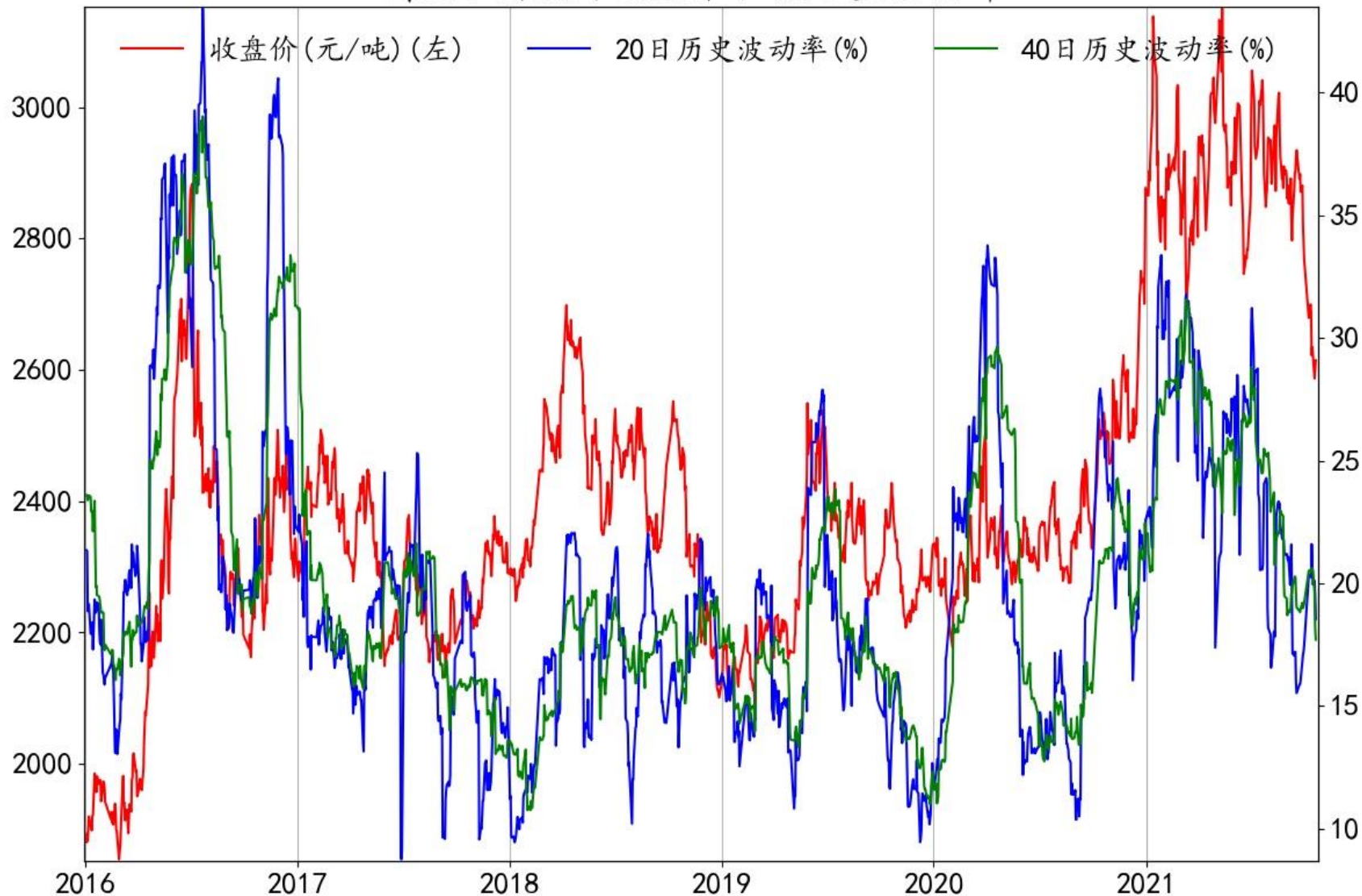
菜油指数收盘价和历史波动率



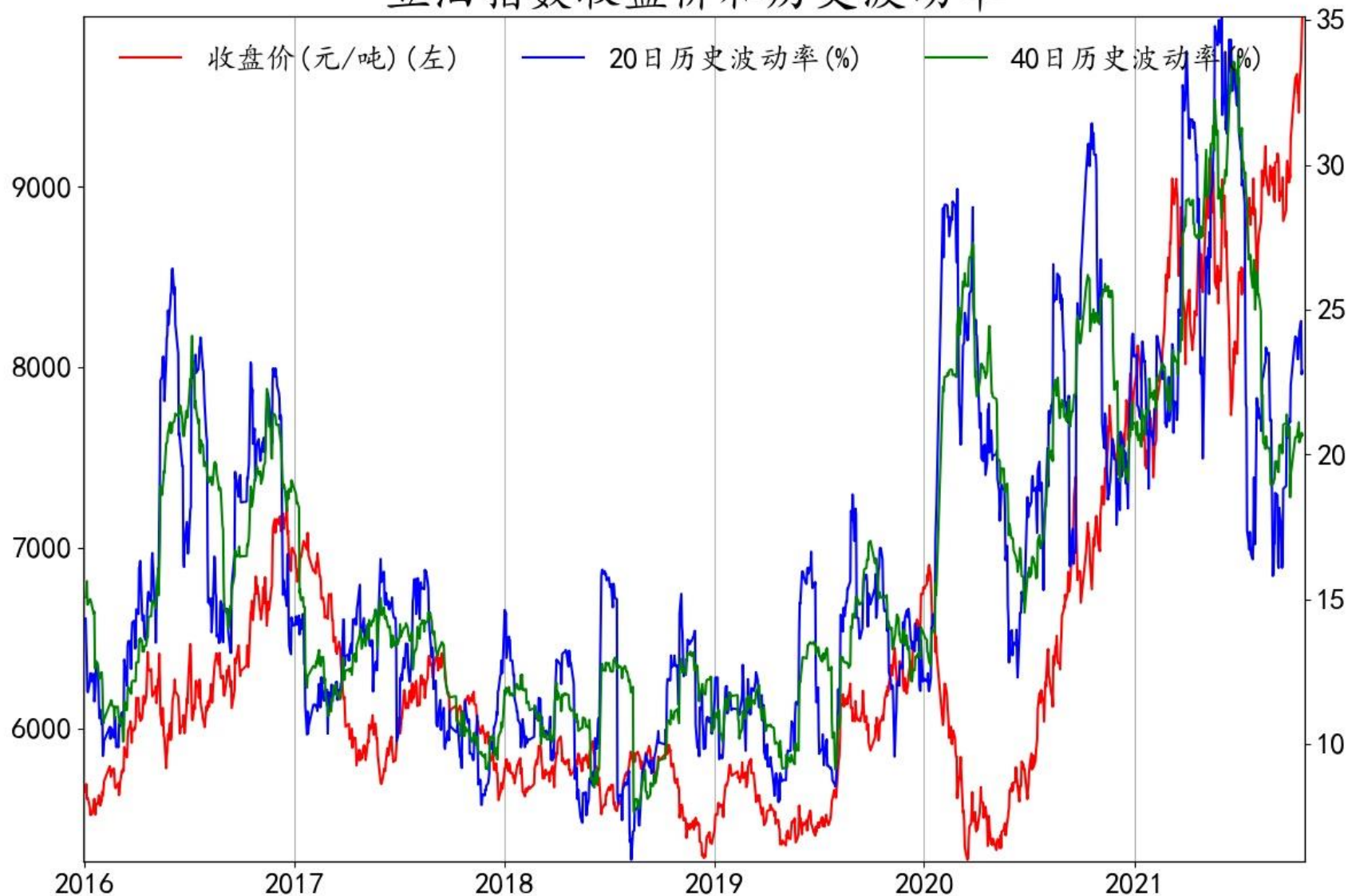
棕榈指数收盘价和历史波动率



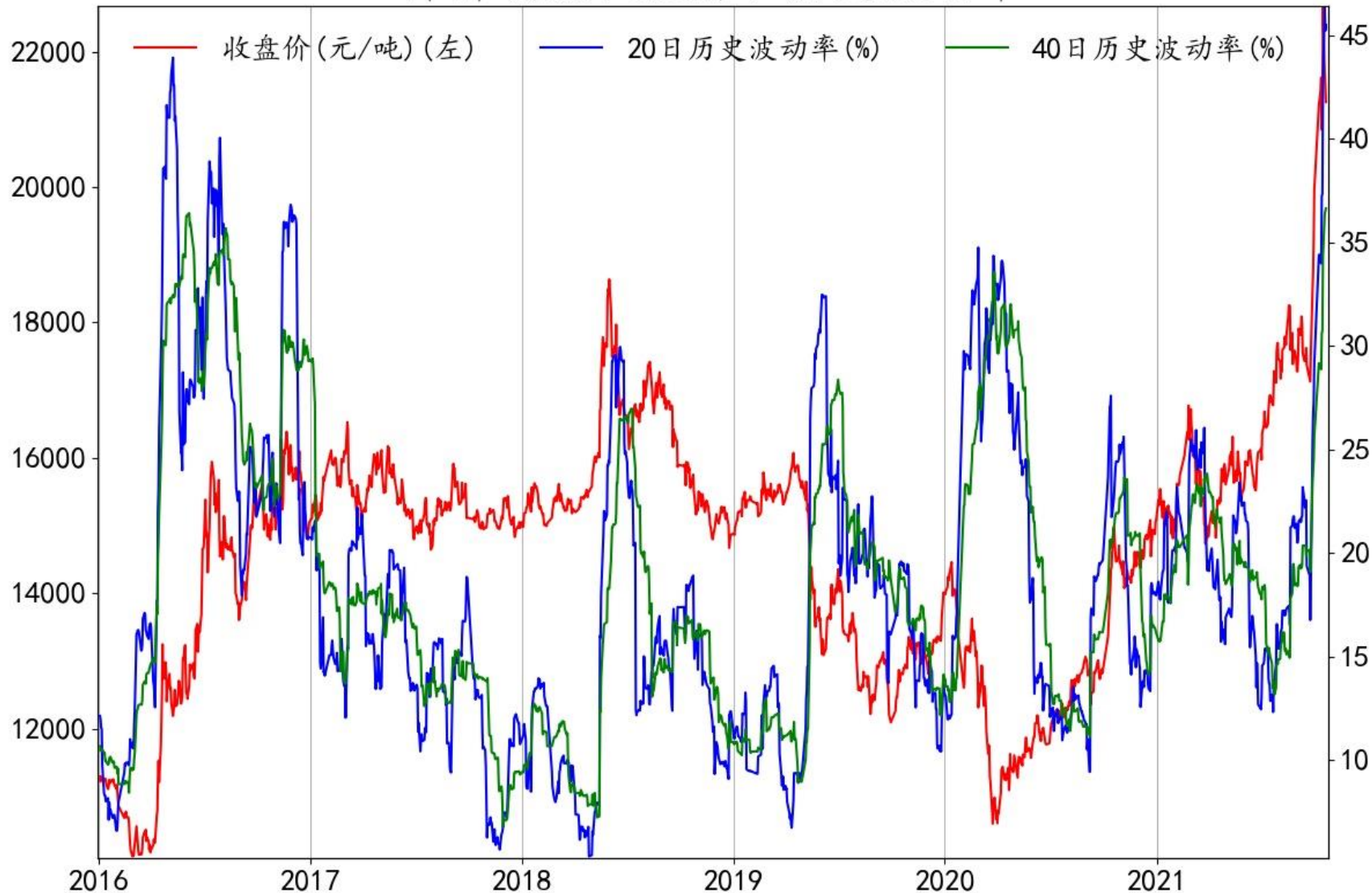
菜粕指数收盘价和历史波动率



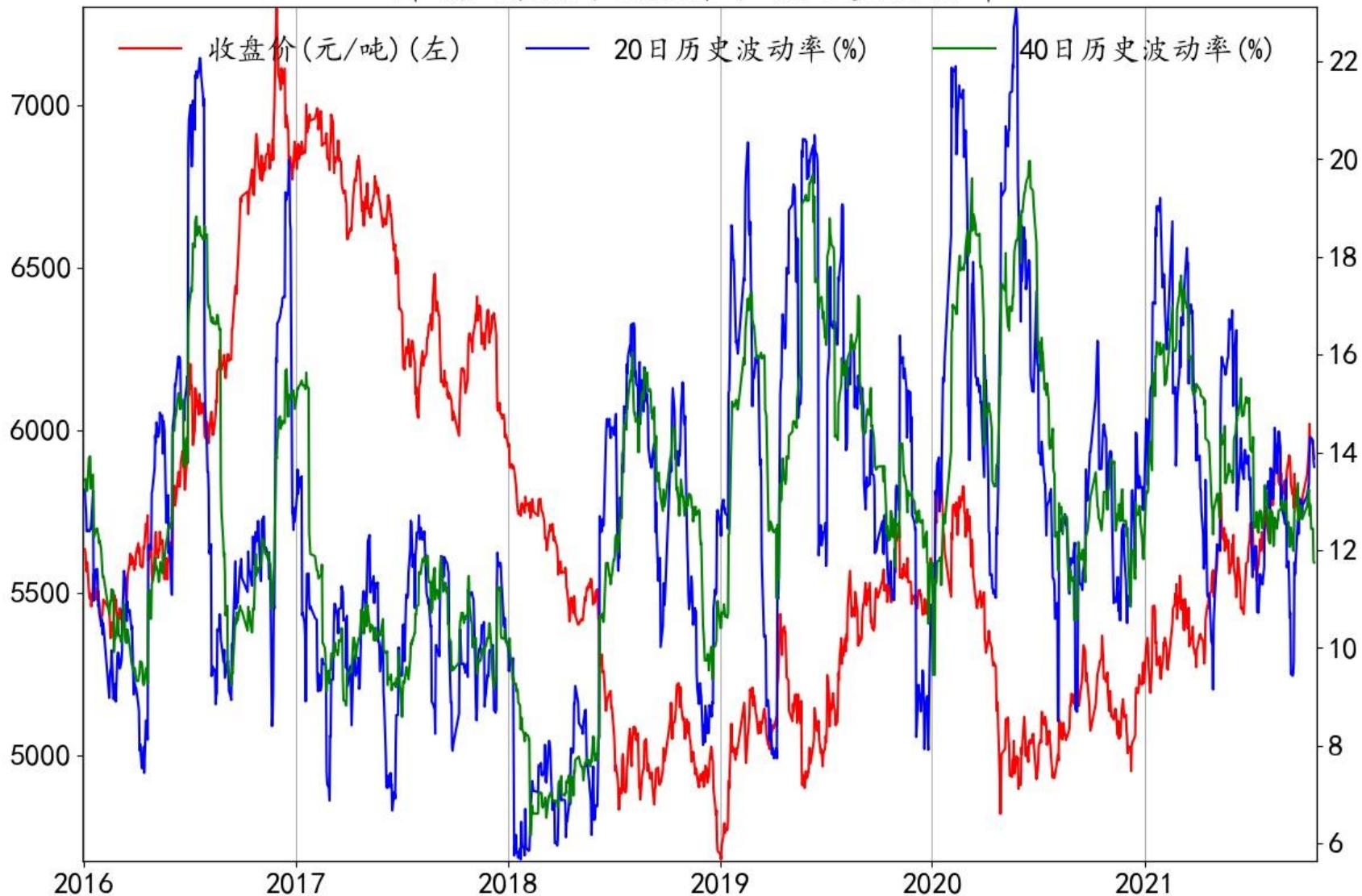
豆油指数收盘价和历史波动率



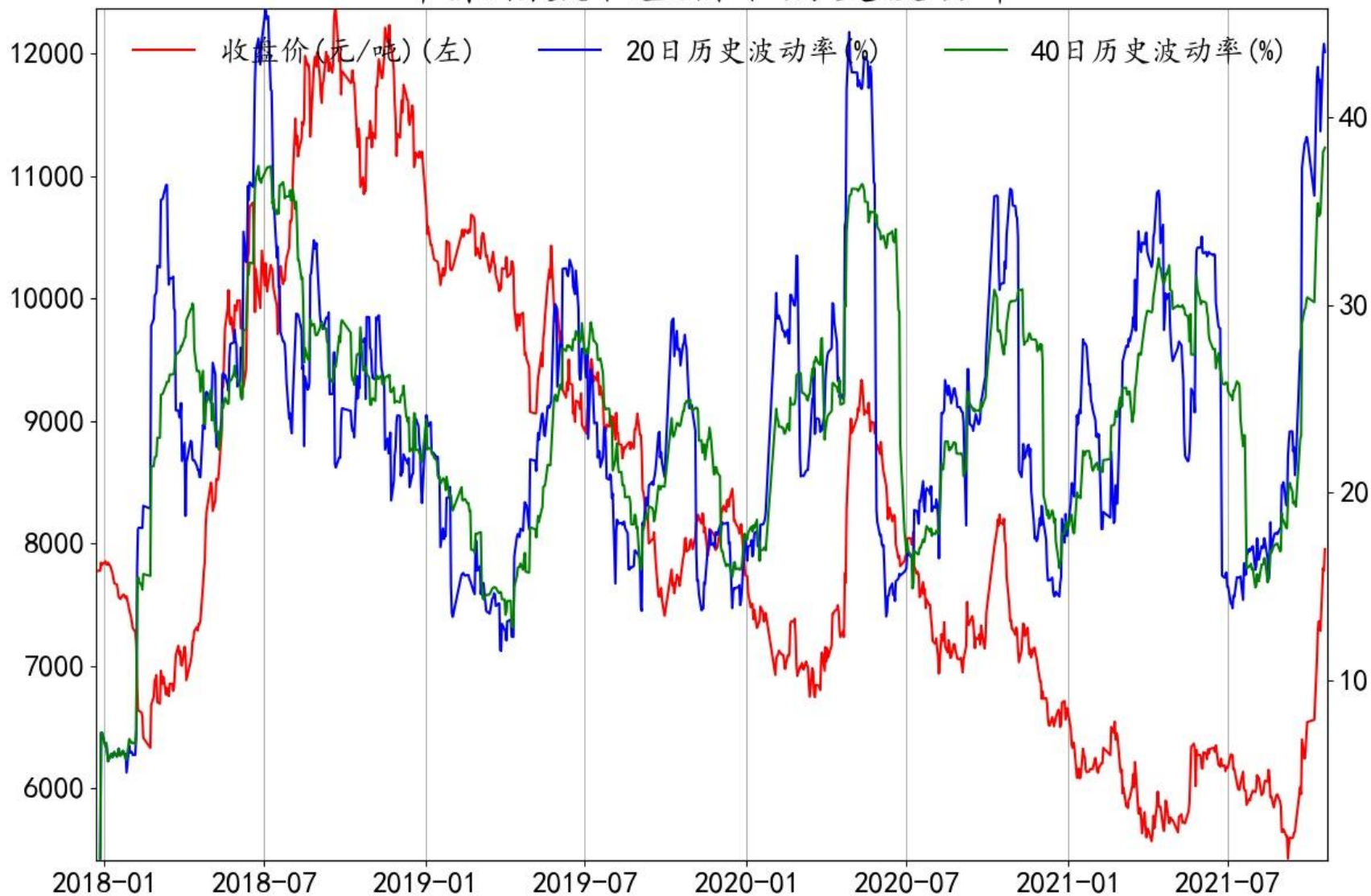
郑棉指数收盘价和历史波动率



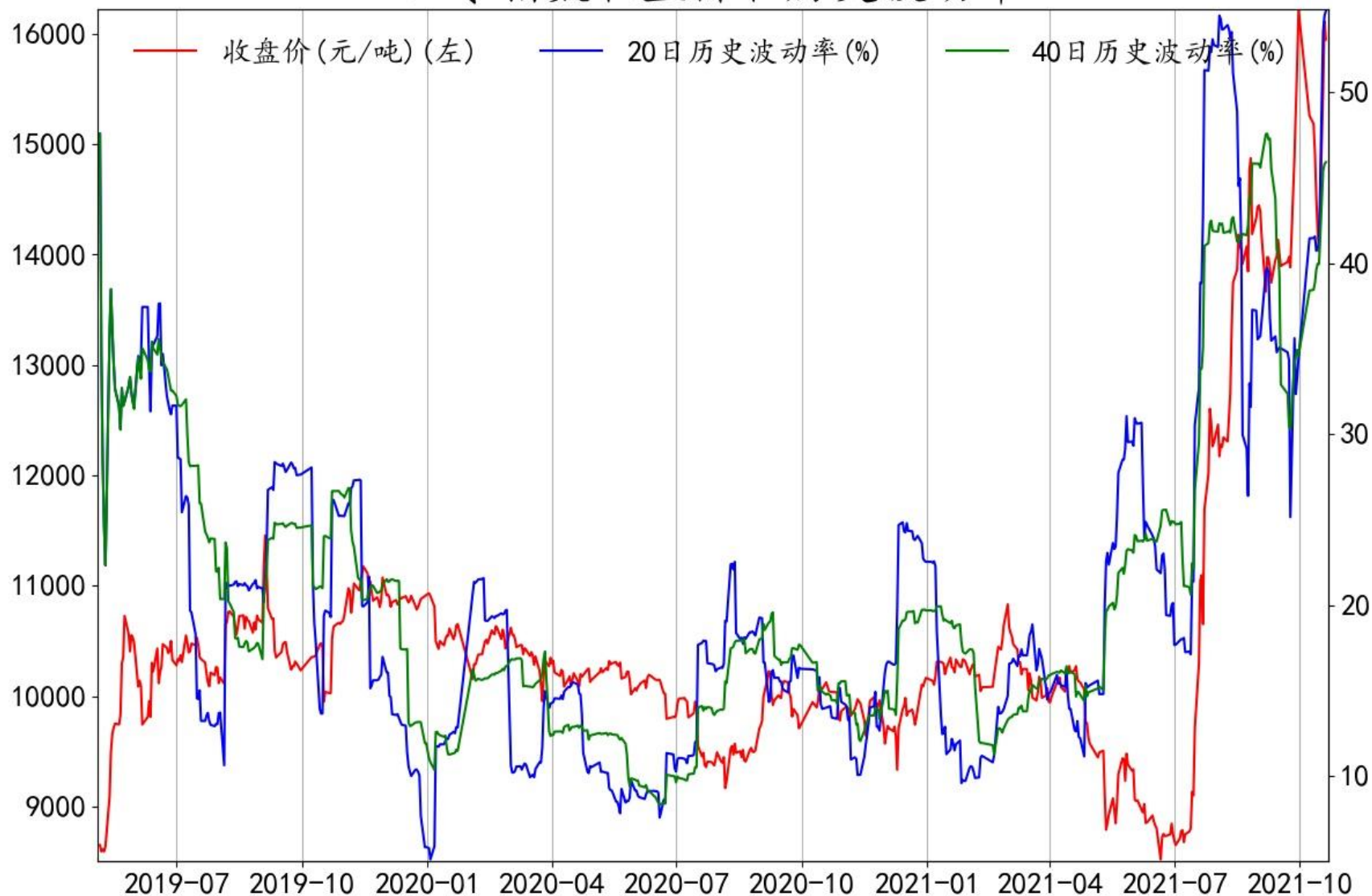
郑糖指数收盘价和历史波动率



苹果指数收盘价和历史波动率

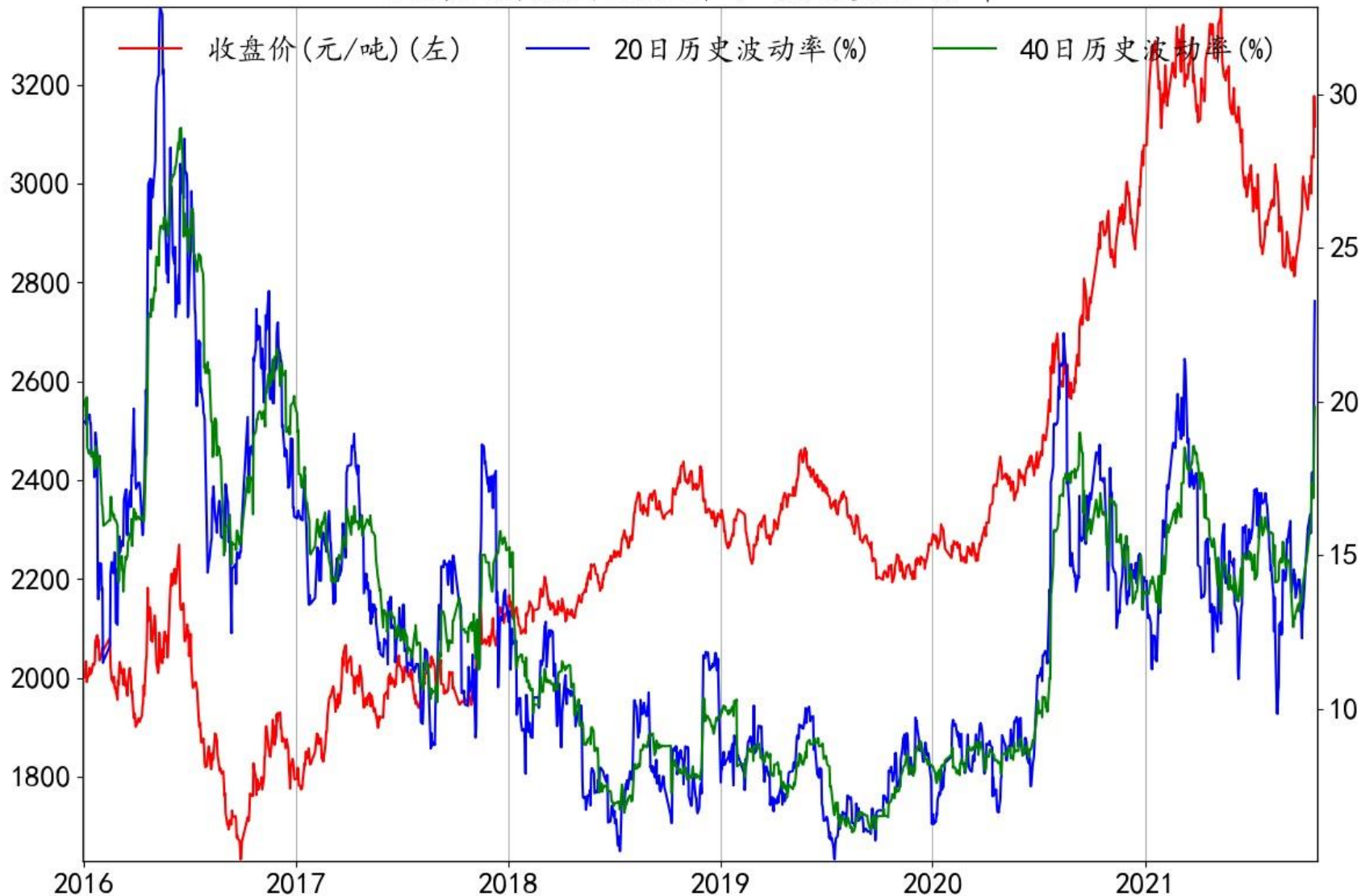


红枣指数收盘价和历史波动率

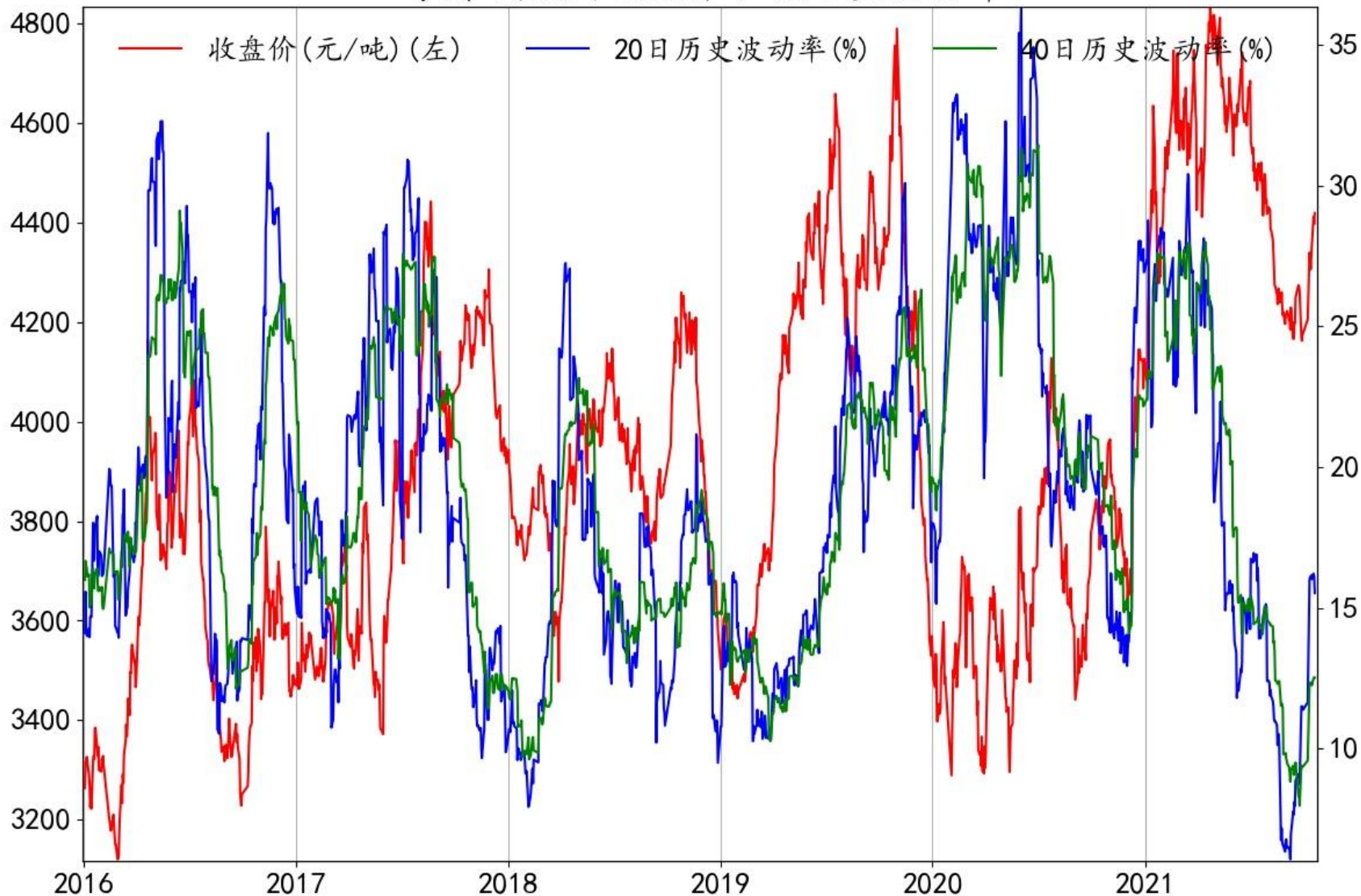


数据来源: Wind、信达期货研发中心

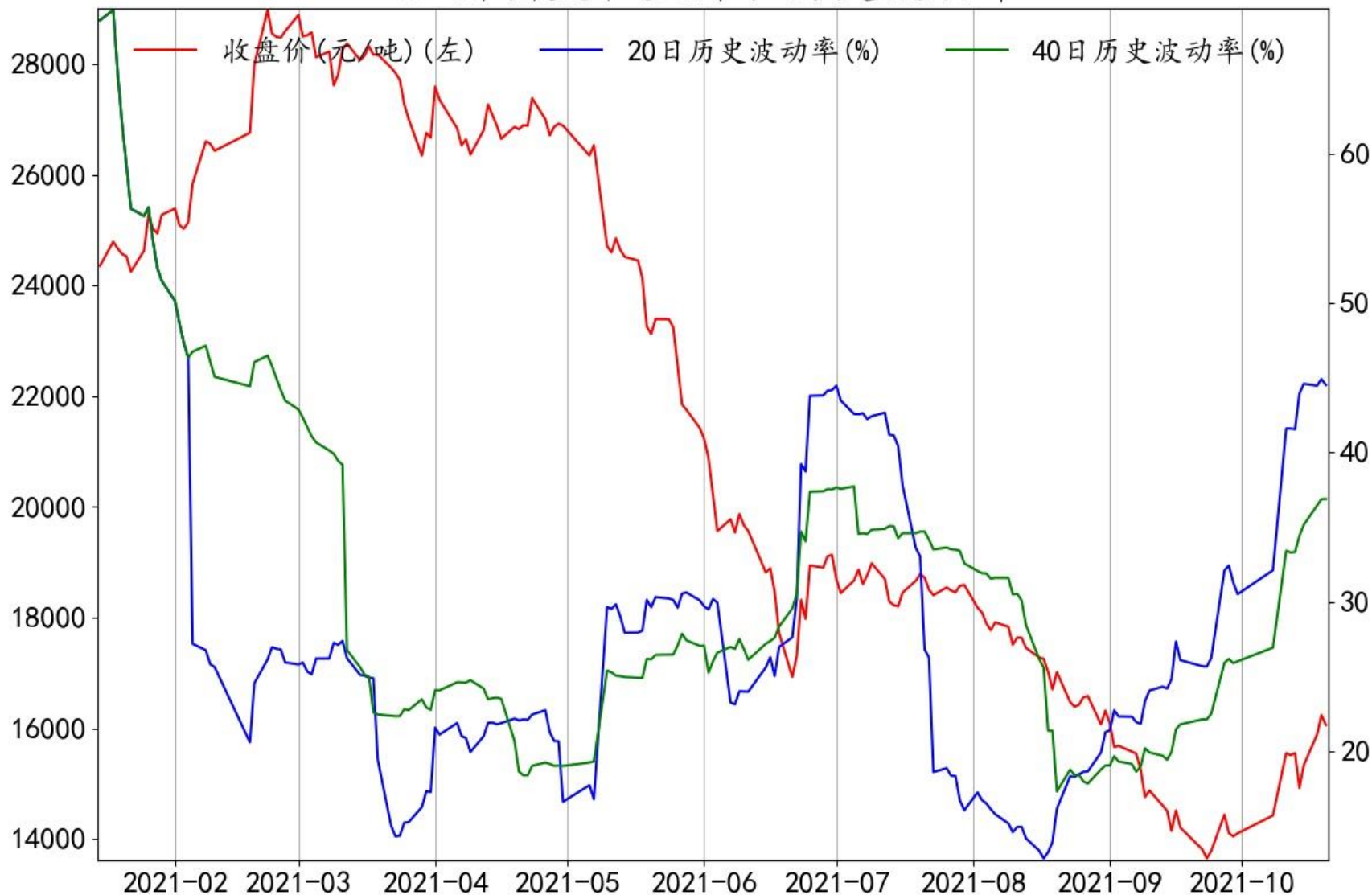
淀粉指数收盘价和历史波动率



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