

商品期货波动率跟踪

2021年10月21日

20日历史波动率百分位高于90%:

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

硅铁、锰硅、动煤、焦炭、焦煤

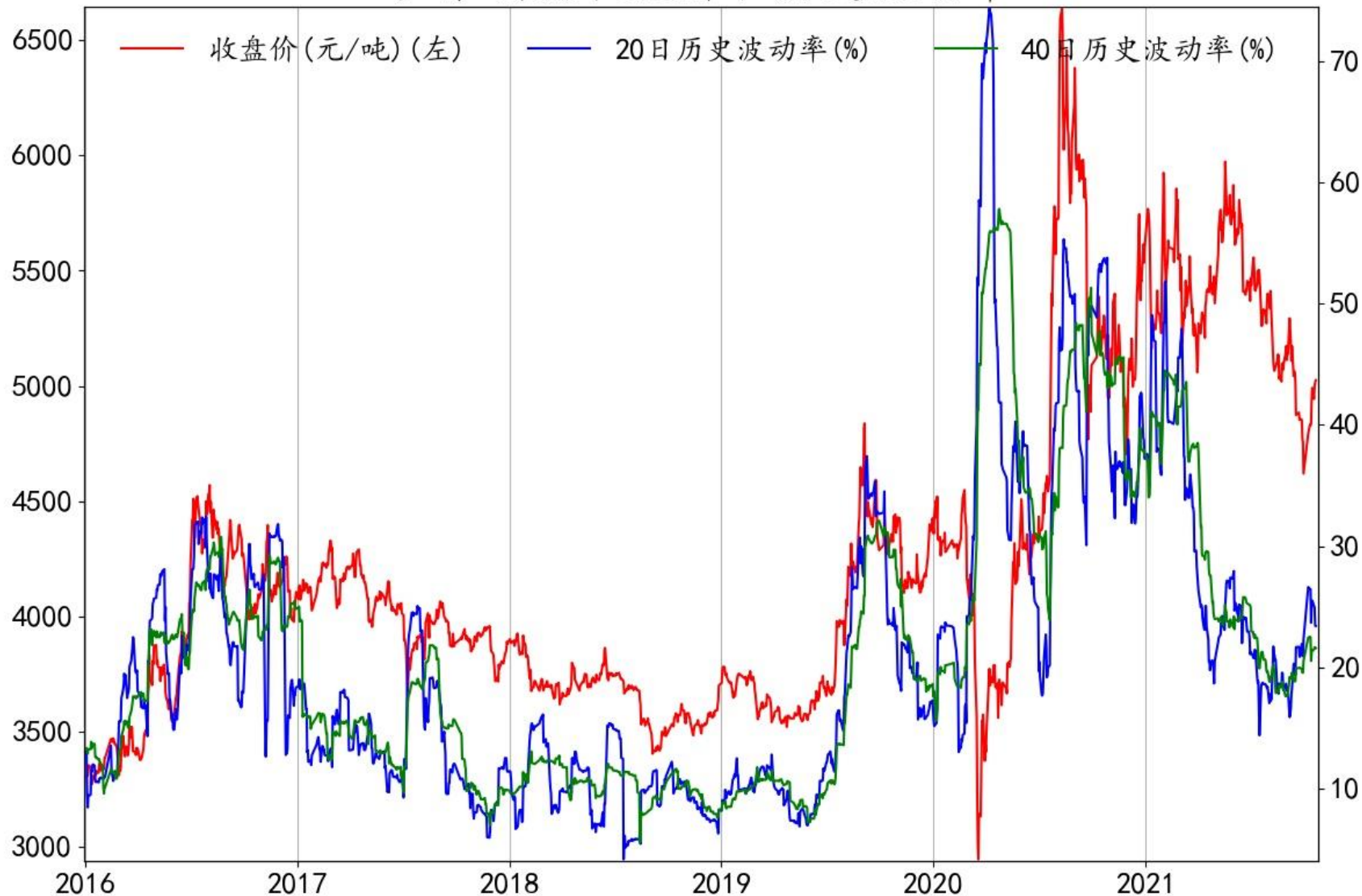
20日历史波动率绝对值后五:

沪金、郑糖、豆粕、玉米、鸡蛋

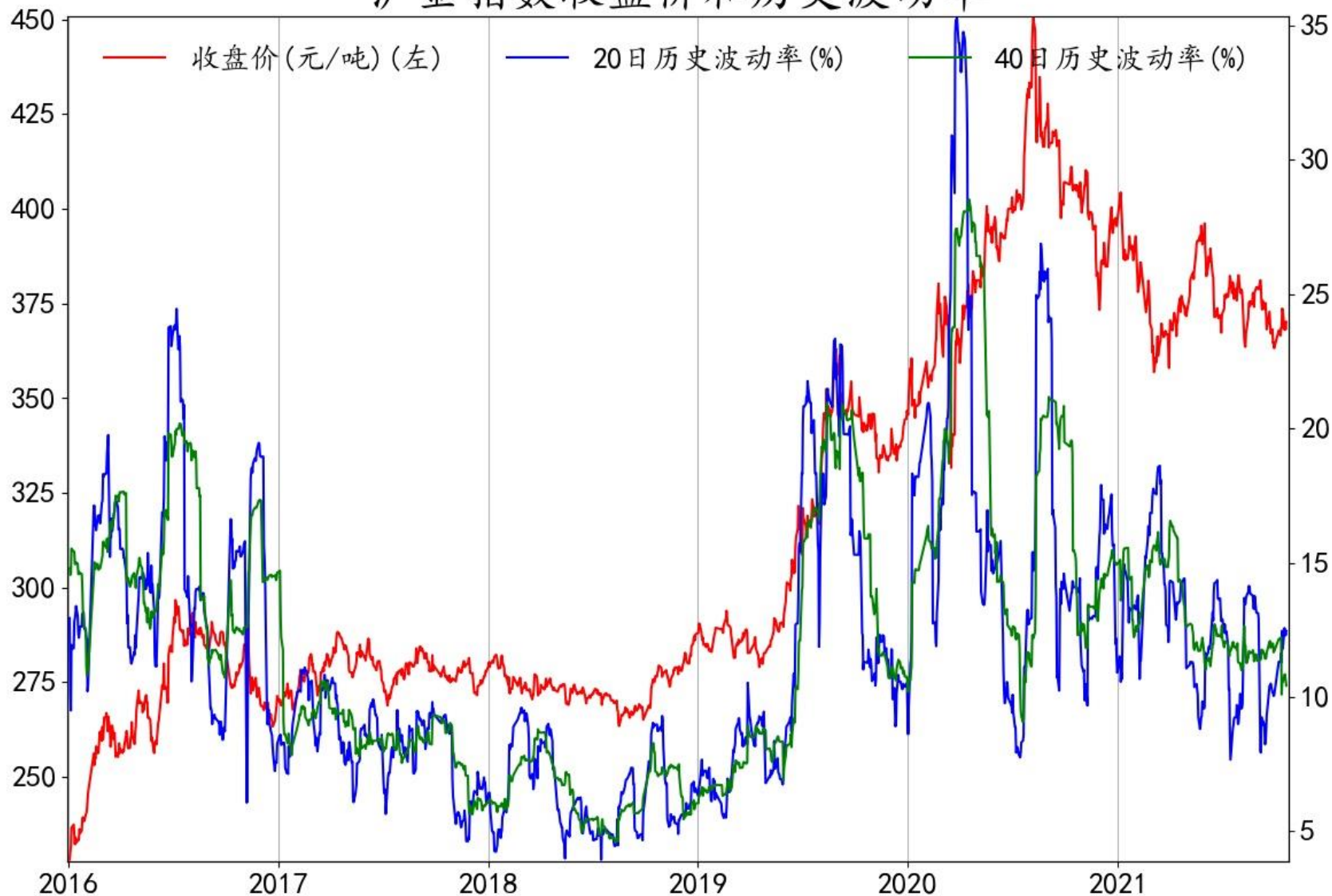
时间百分位 绝对值			时间百分位 绝对值		
沪银	67.16%	23.39%	硅铁	100.00%	94.96%
沪金	61.21%	12.46%	锰硅	99.93%	94.90%
沪铝	97.80%	31.32%	不锈钢	98.00%	42.14%
沪铜	91.84%	24.29%	玻璃	100.00%	43.55%
沪镍	73.97%	26.96%	PVC	100.00%	65.67%
沪铅	84.61%	23.04%	燃油	82.47%	38.90%
沪锡	97.52%	38.49%	低硫燃油	30.13%	26.20%
沪锌	99.93%	46.39%	LPG	98.82%	46.70%
热卷	74.82%	30.27%	原油	48.21%	28.30%
铁矿	97.16%	62.90%	动煤	100.00%	90.16%
焦炭	100.00%	78.38%	沥青	73.55%	31.97%
焦煤	99.72%	76.38%	苯乙烯	75.70%	36.02%
螺纹	87.87%	37.90%	乙二醇	100.00%	65.31%

	时间百分位	绝对值		时间百分位	绝对值
塑料	98.09%	35.79%	菜油	91.63%	24.39%
甲醇	100.00%	65.45%	棕榈	90.28%	32.60%
20号胶	60.84%	27.73%	菜粕	44.75%	17.94%
短纤	92.80%	39.81%	豆油	84.33%	22.80%
PP	97.45%	37.17%	郑棉	99.93%	46.07%
沪胶	50.78%	25.92%	郑糖	68.37%	14.12%
纯碱	100.00%	60.05%	苹果	99.14%	44.00%
纸浆	84.02%	24.01%	红枣	100.00%	54.80%
TA	94.33%	33.98%	淀粉	95.60%	22.67%
尿素	100.00%	63.74%	鸡蛋	34.04%	15.49%
玉米	81.35%	14.84%	生猪	91.80%	45.46%
豆一	81.99%	20.86%			
豆粕	39.15%	14.76%			

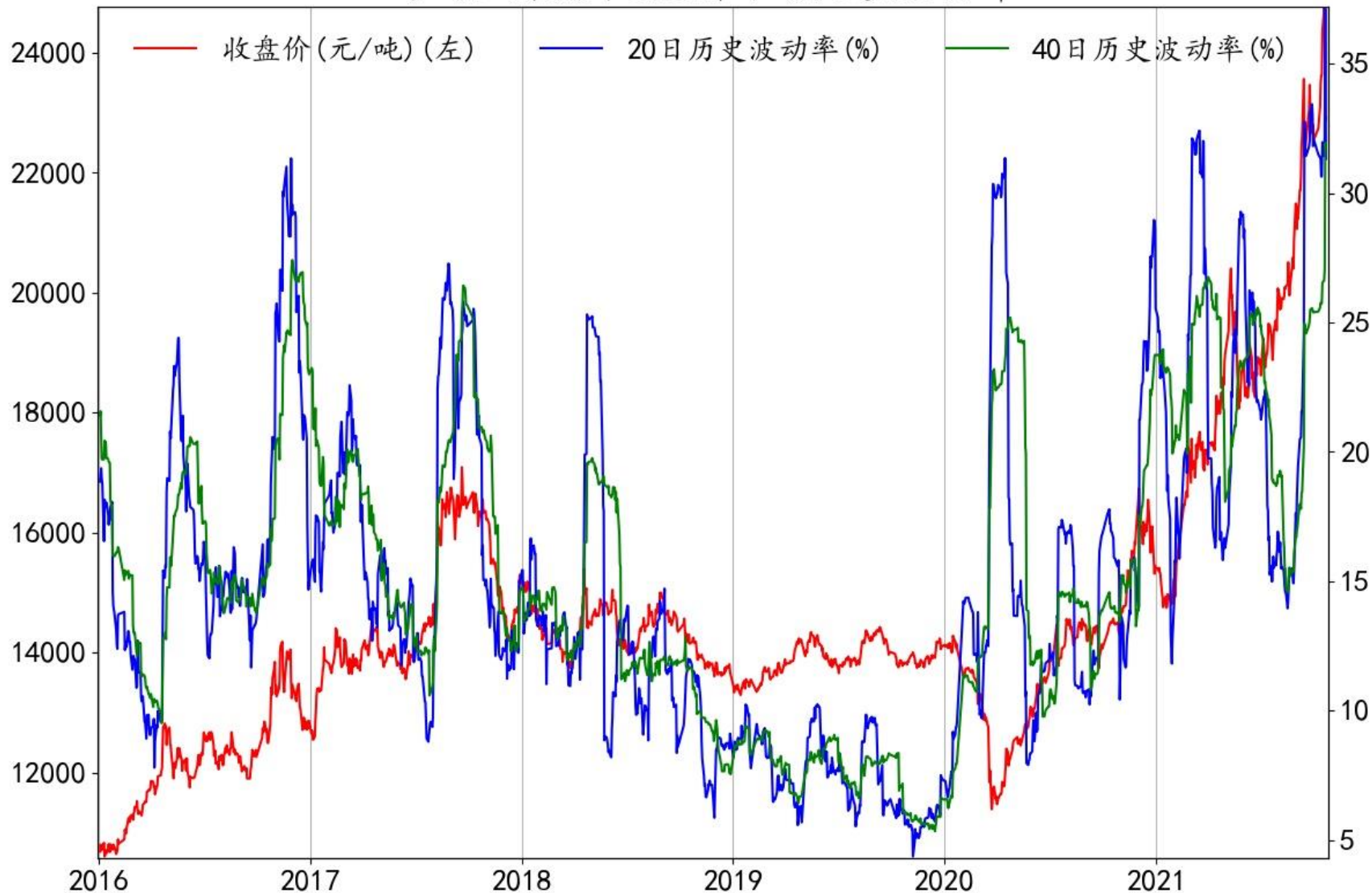
沪银指数收盘价和历史波动率



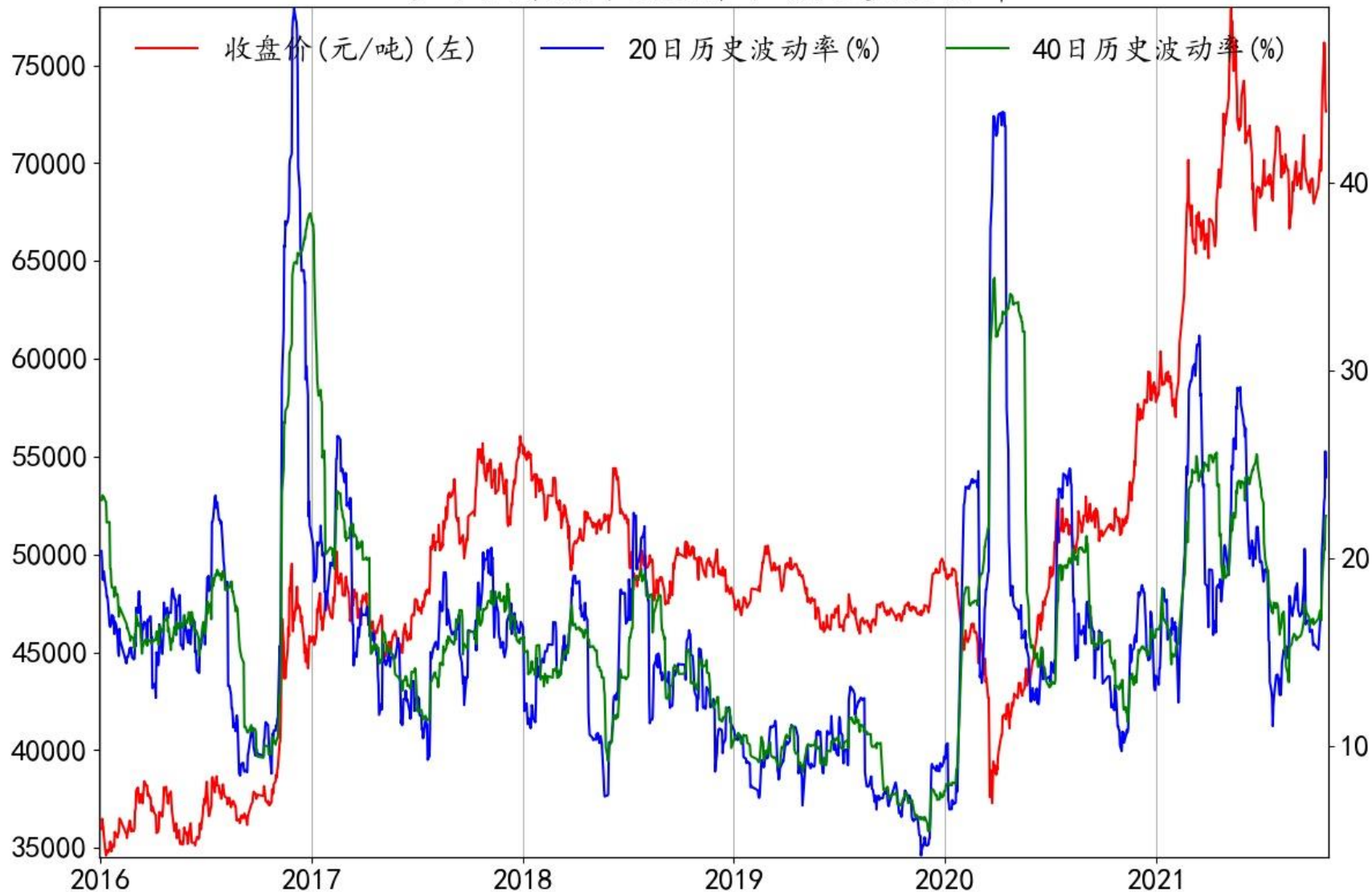
沪金指数收盘价和历史波动率



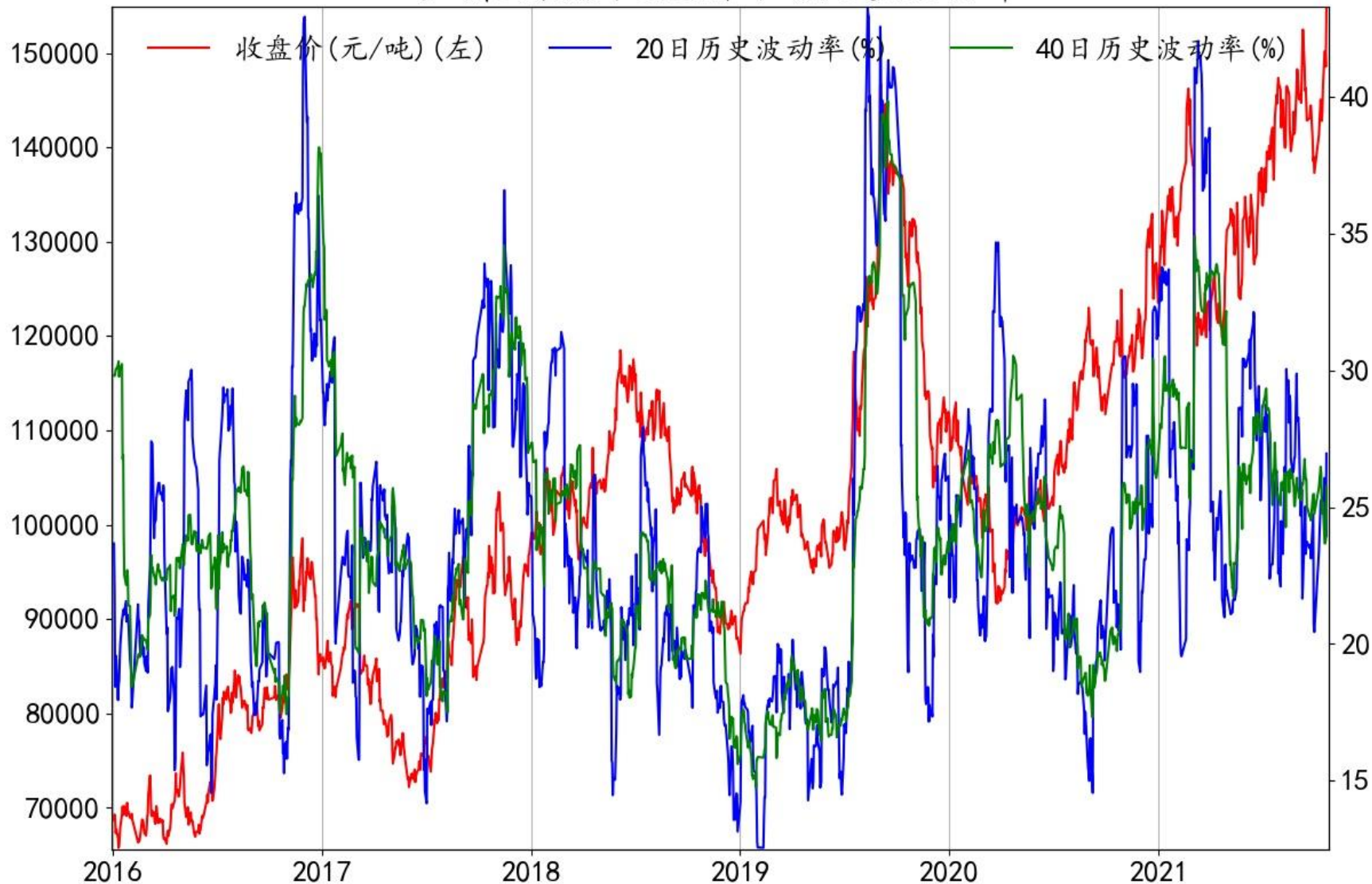
沪铝指数收盘价和历史波动率



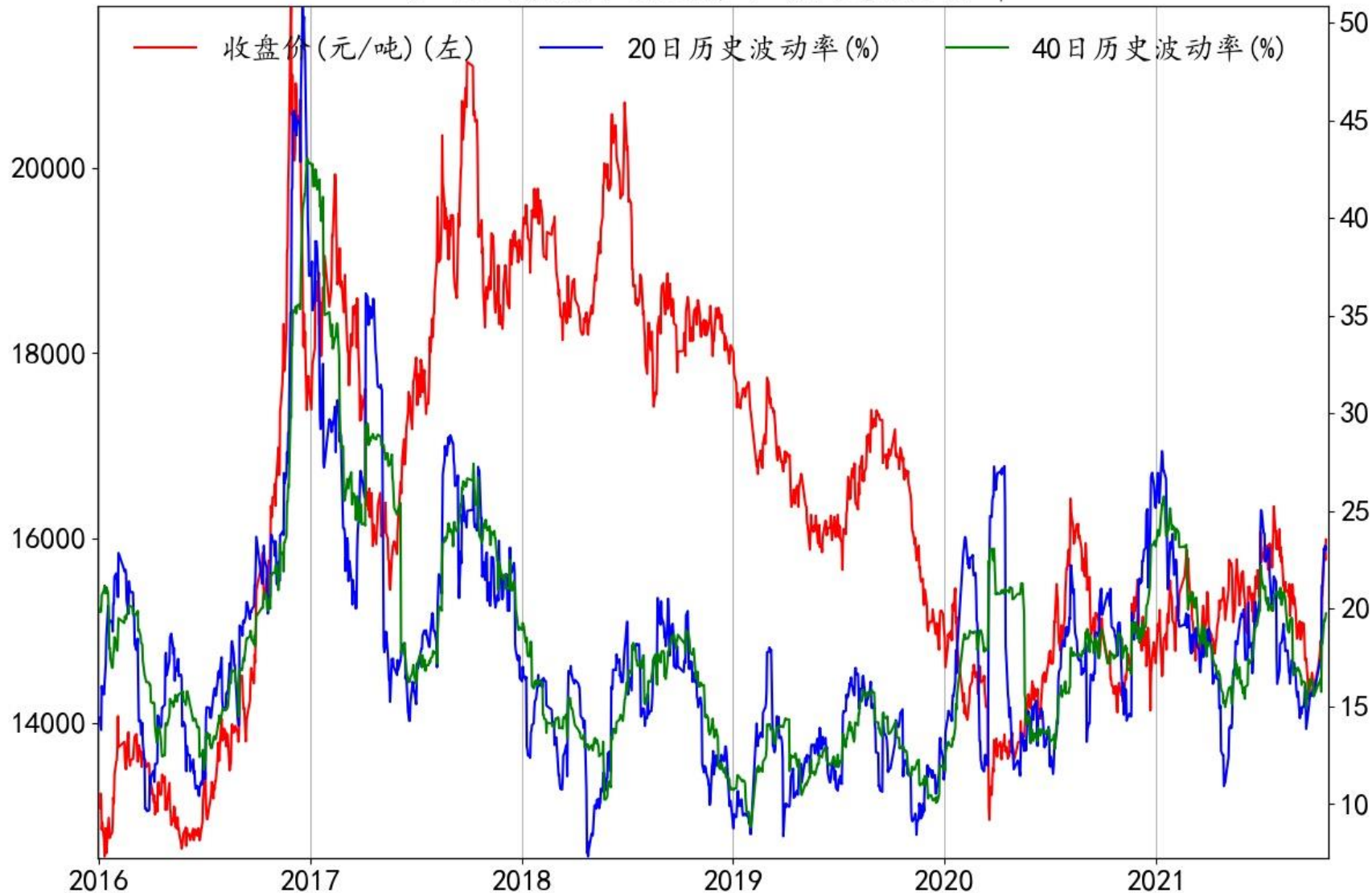
沪铜指数收盘价和历史波动率



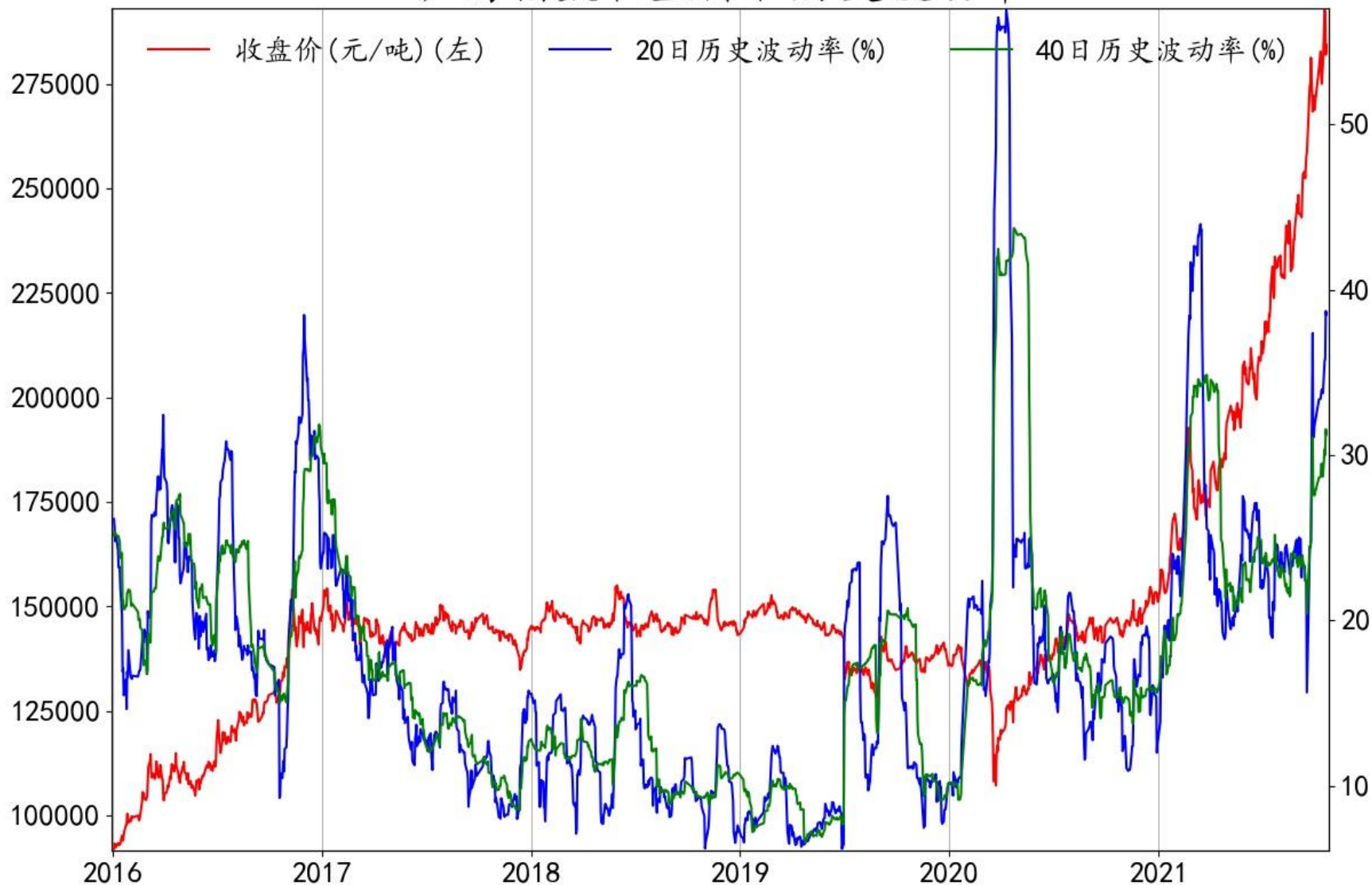
沪镍指数收盘价和历史波动率



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



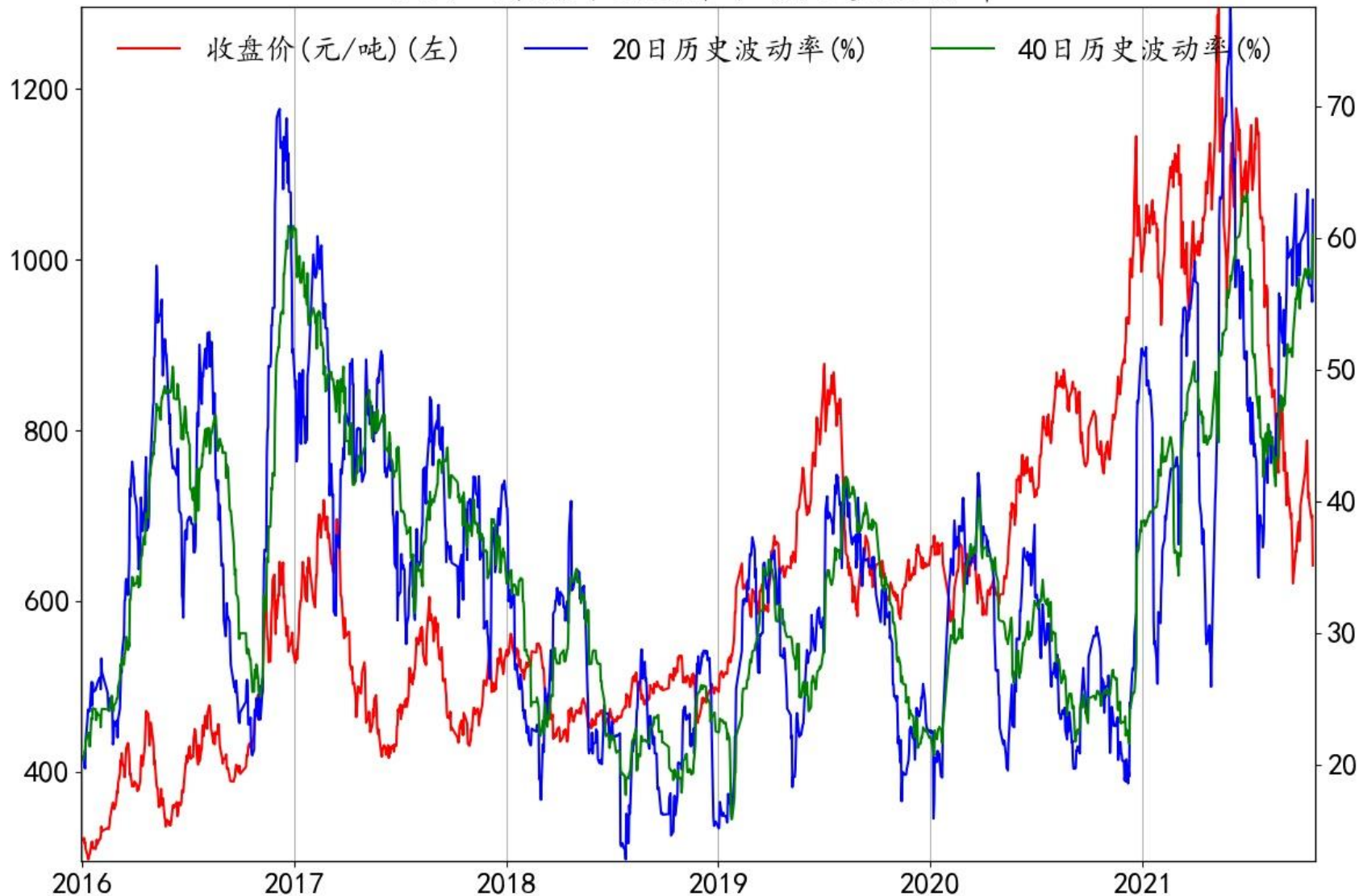
沪锌指数收盘价和历史波动率



热卷指数收盘价和历史波动率



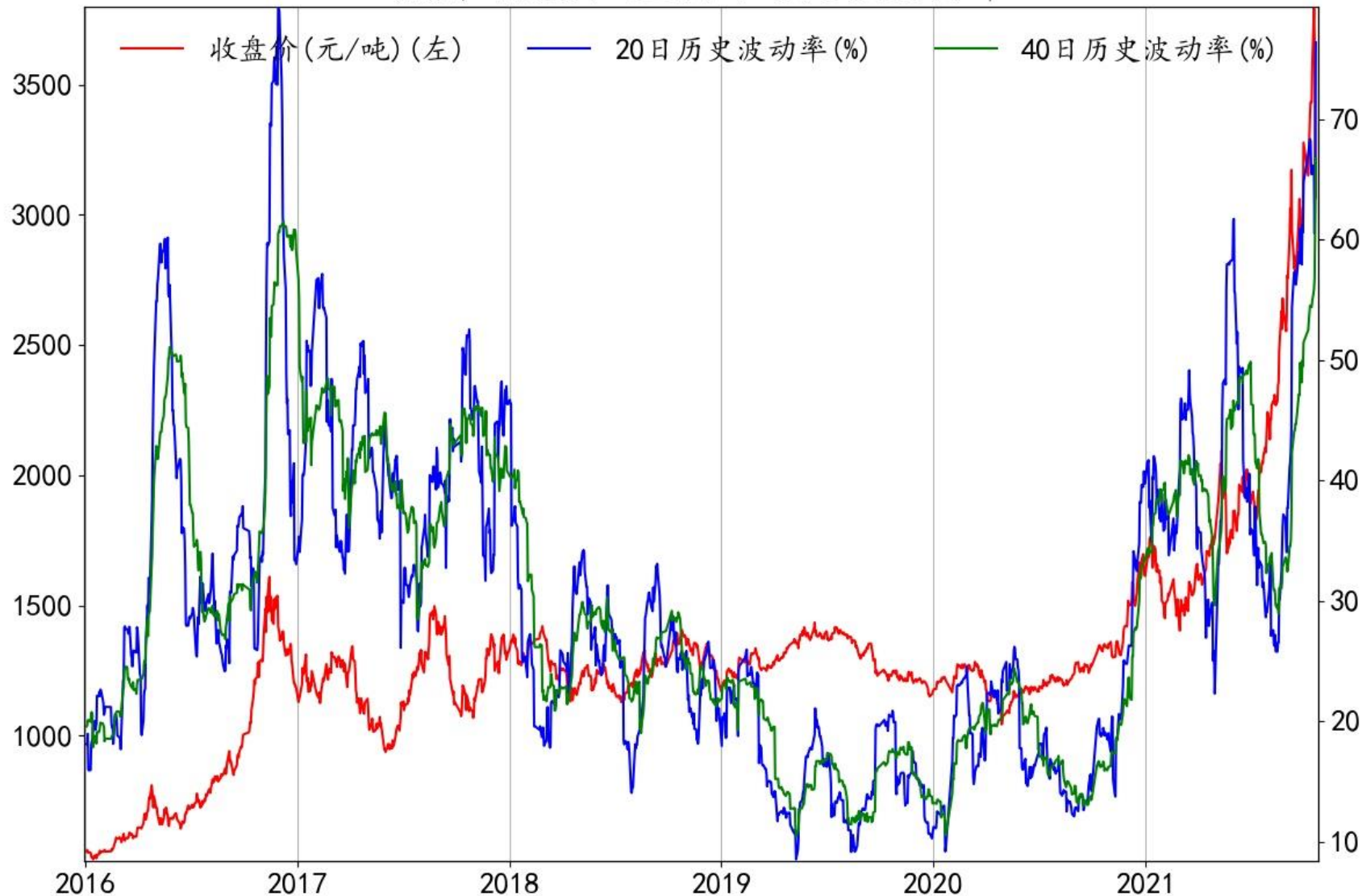
铁矿指数收盘价和历史波动率



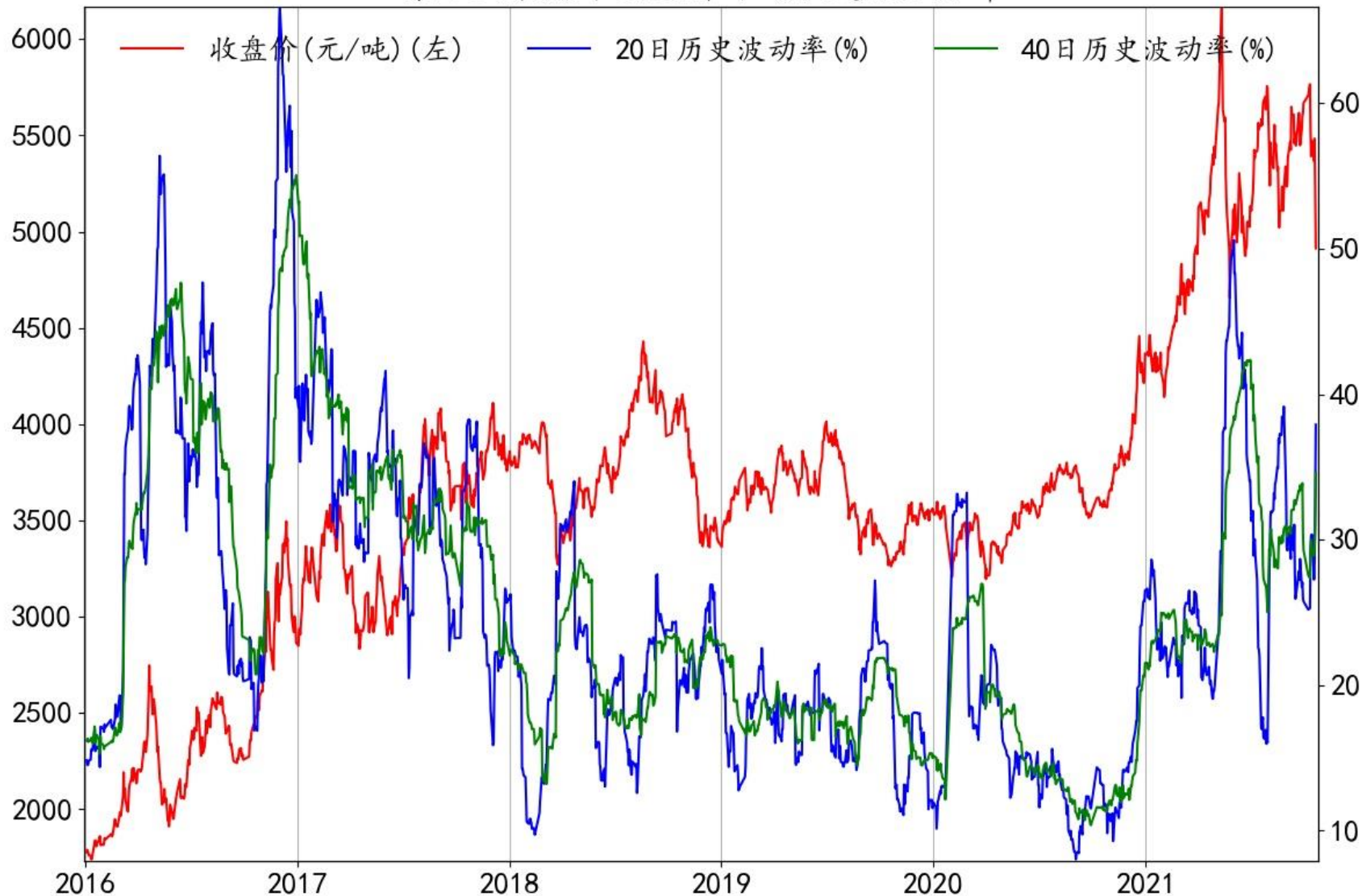
焦炭指数收盘价和历史波动率



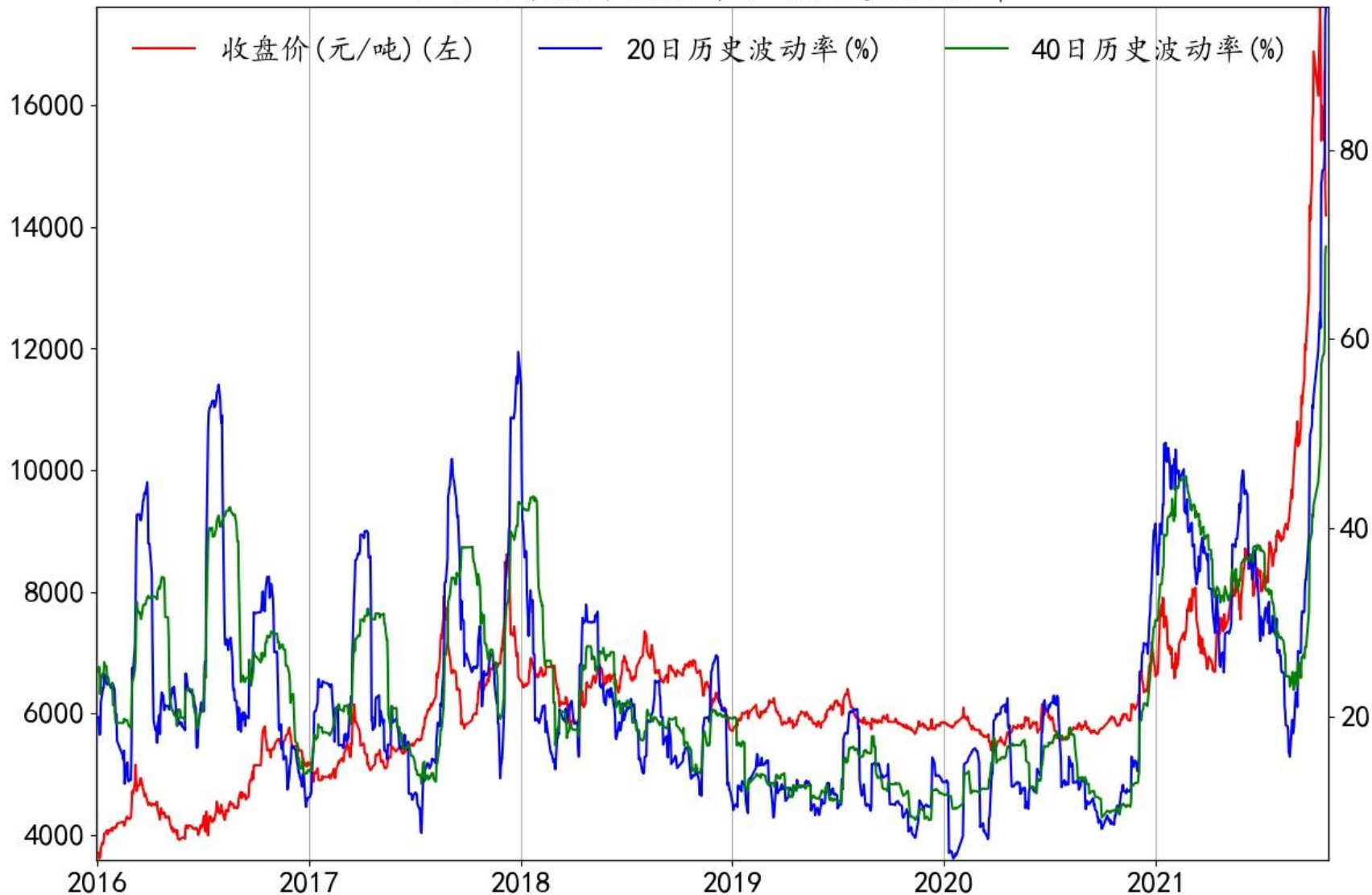
焦煤指数收盘价和历史波动率



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

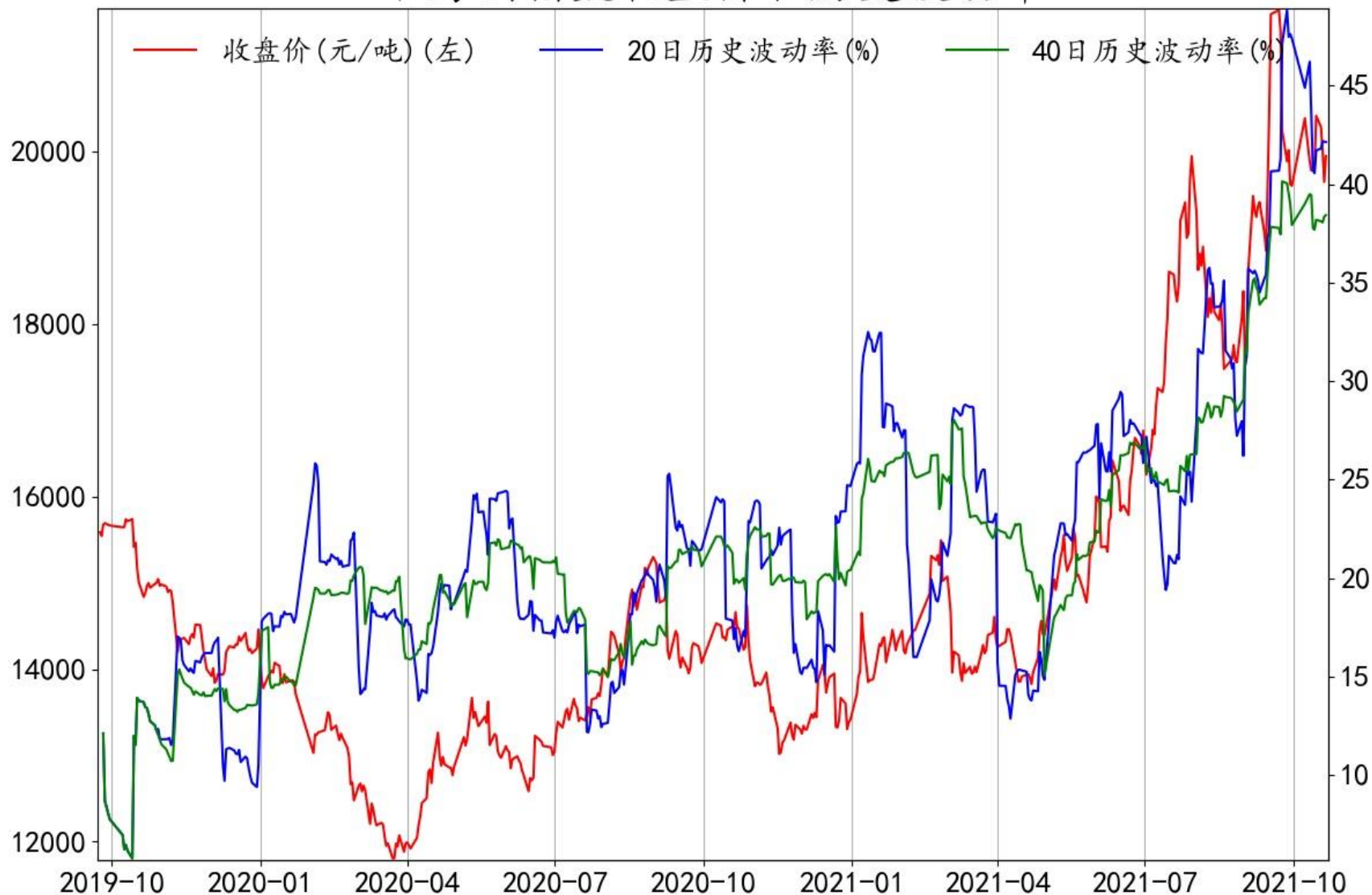


锰硅指数收盘价和历史波动率



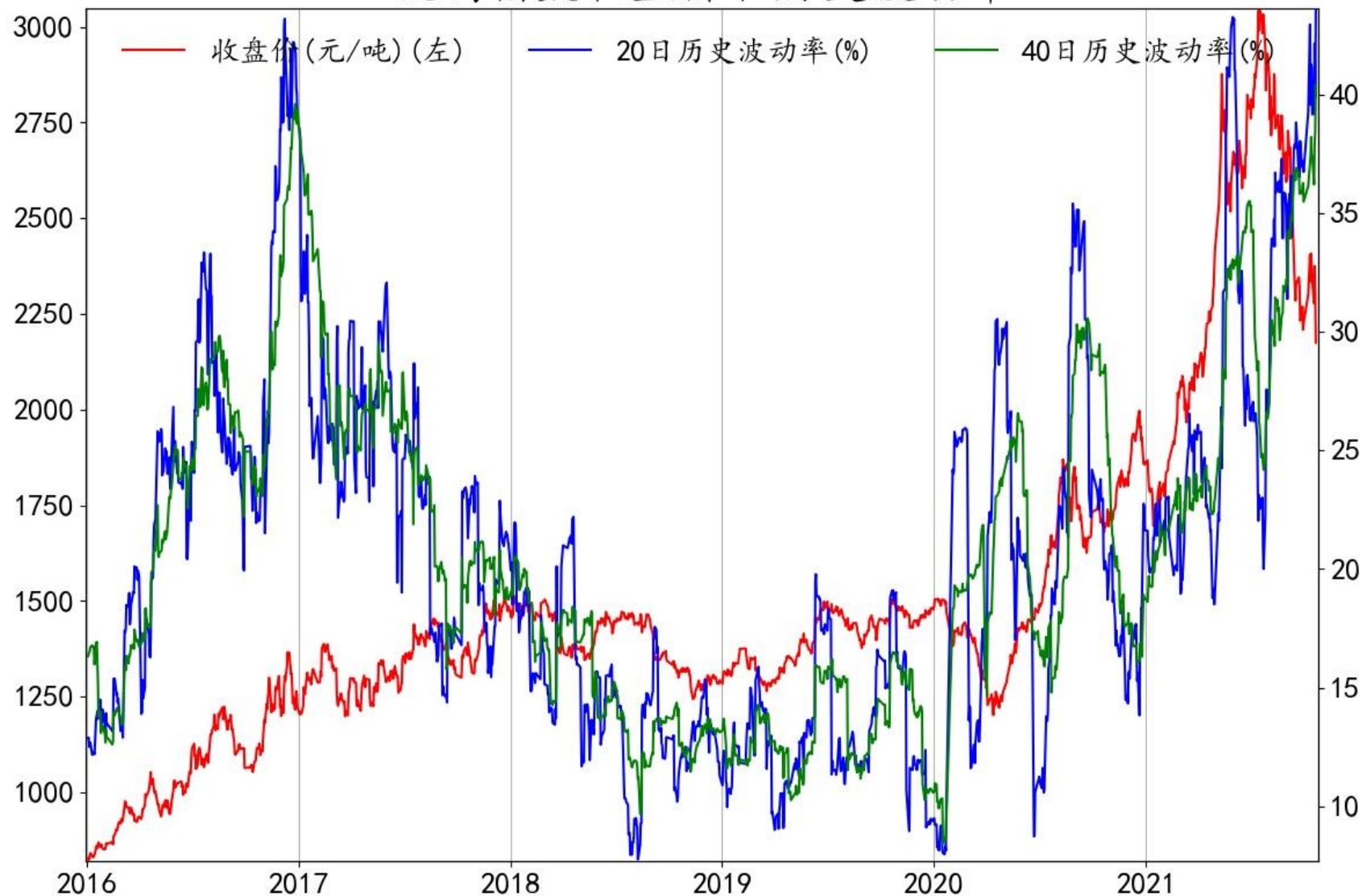
数据来源: Wind、信达期货研发中心

不锈钢指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

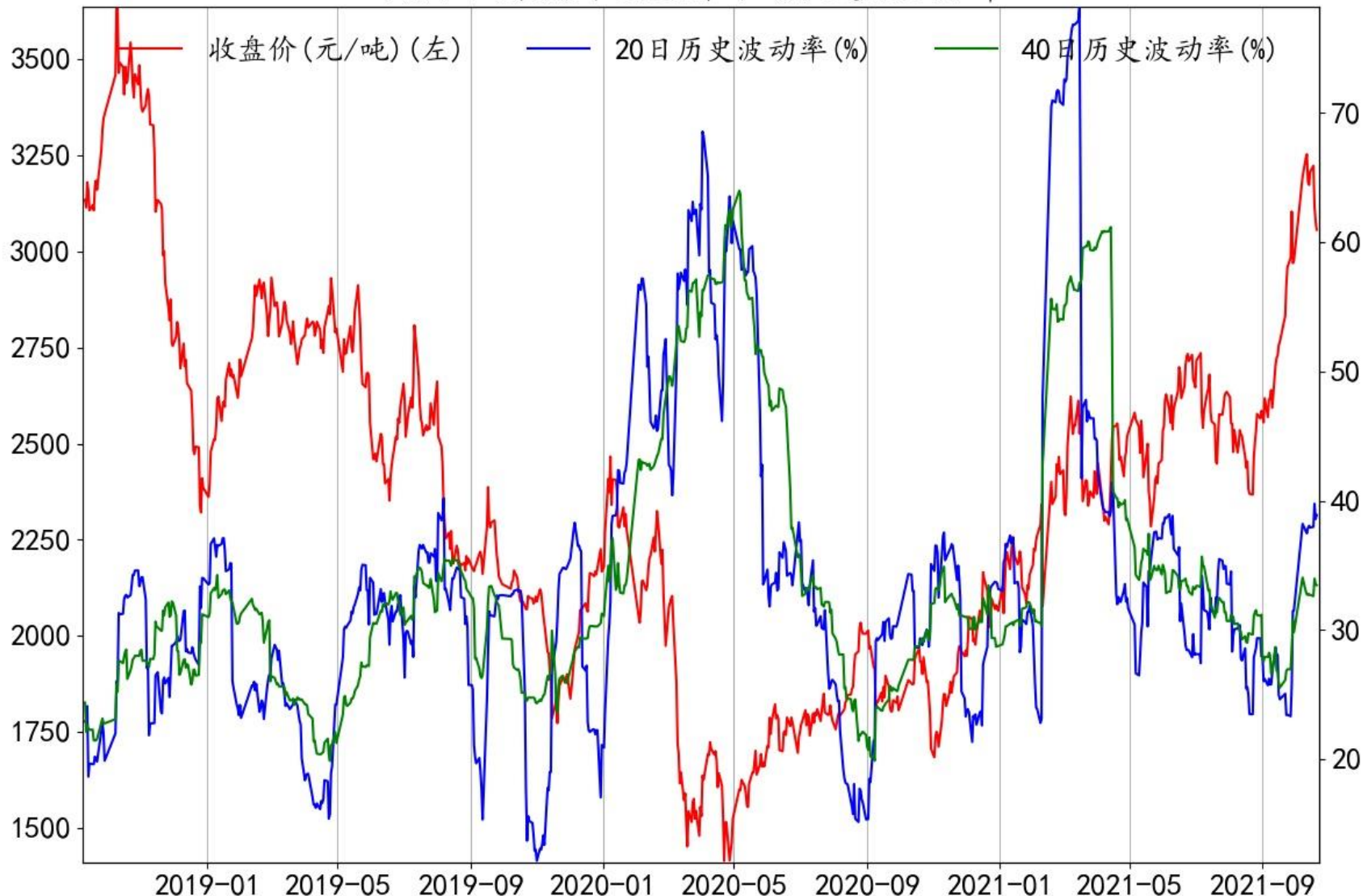
玻璃指数收盘价和历史波动率



PVC指数收盘价和历史波动率



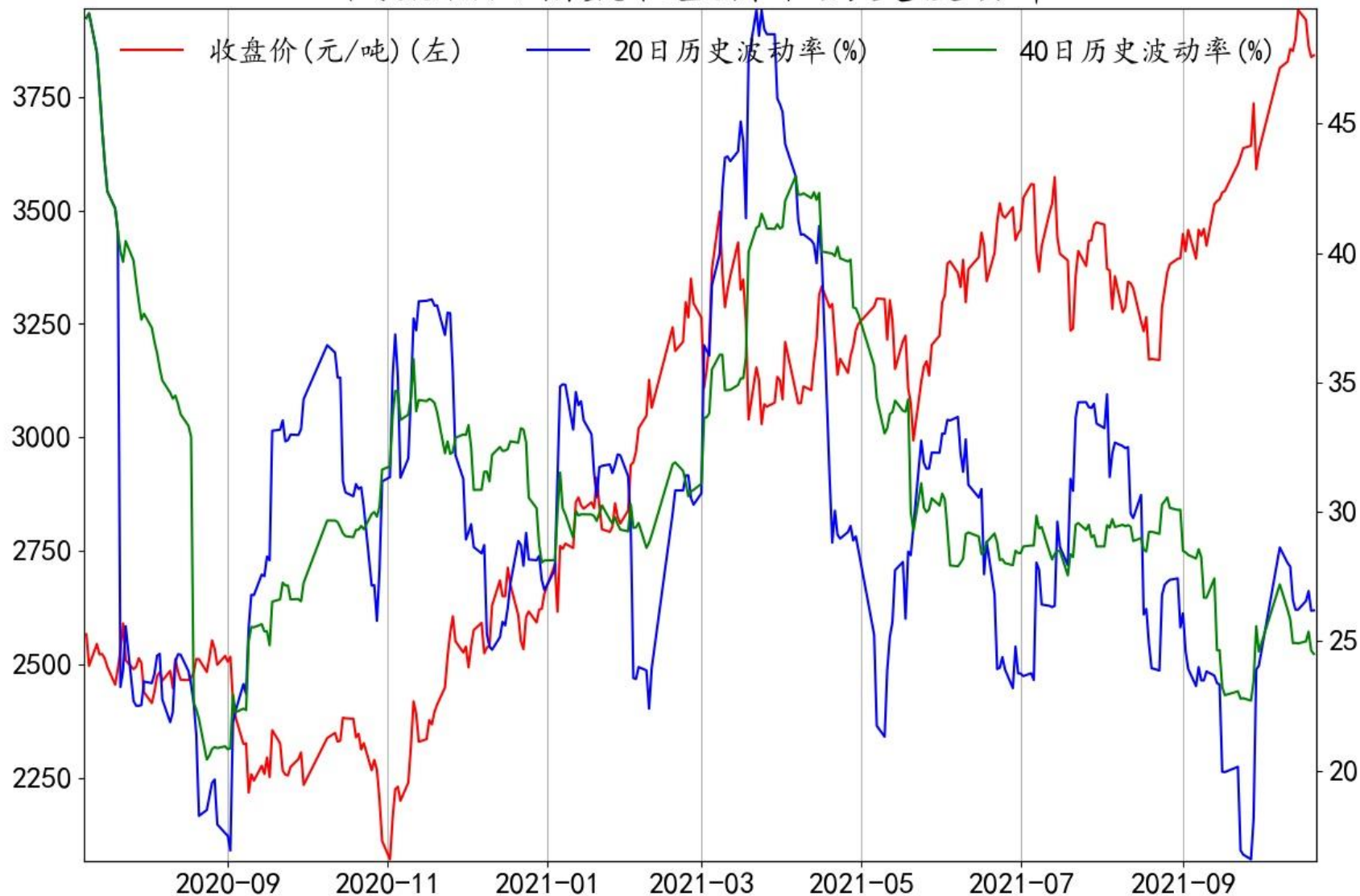
燃油指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

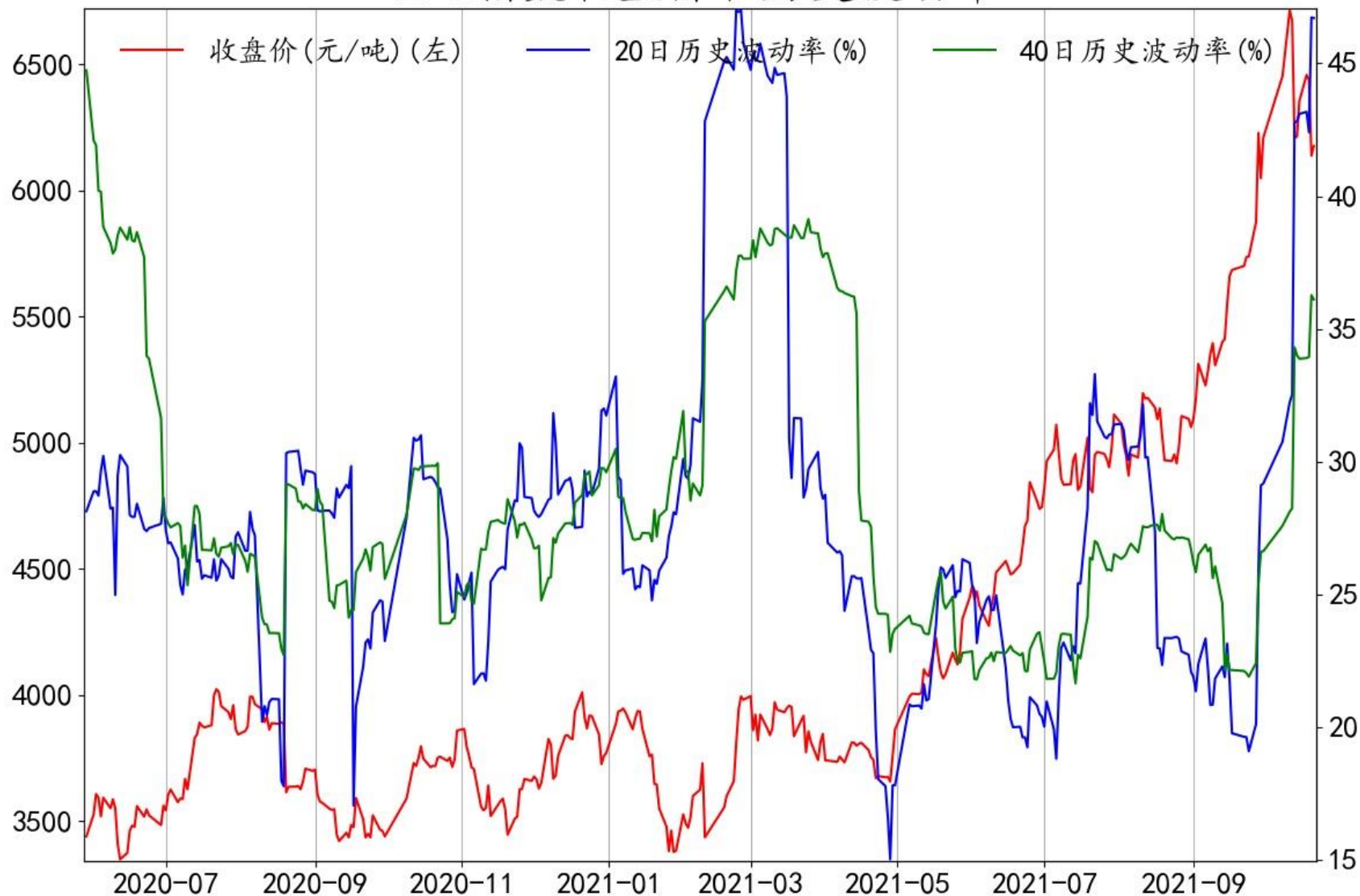
低硫燃油指数

低硫燃油指数收盘价和历史波动率



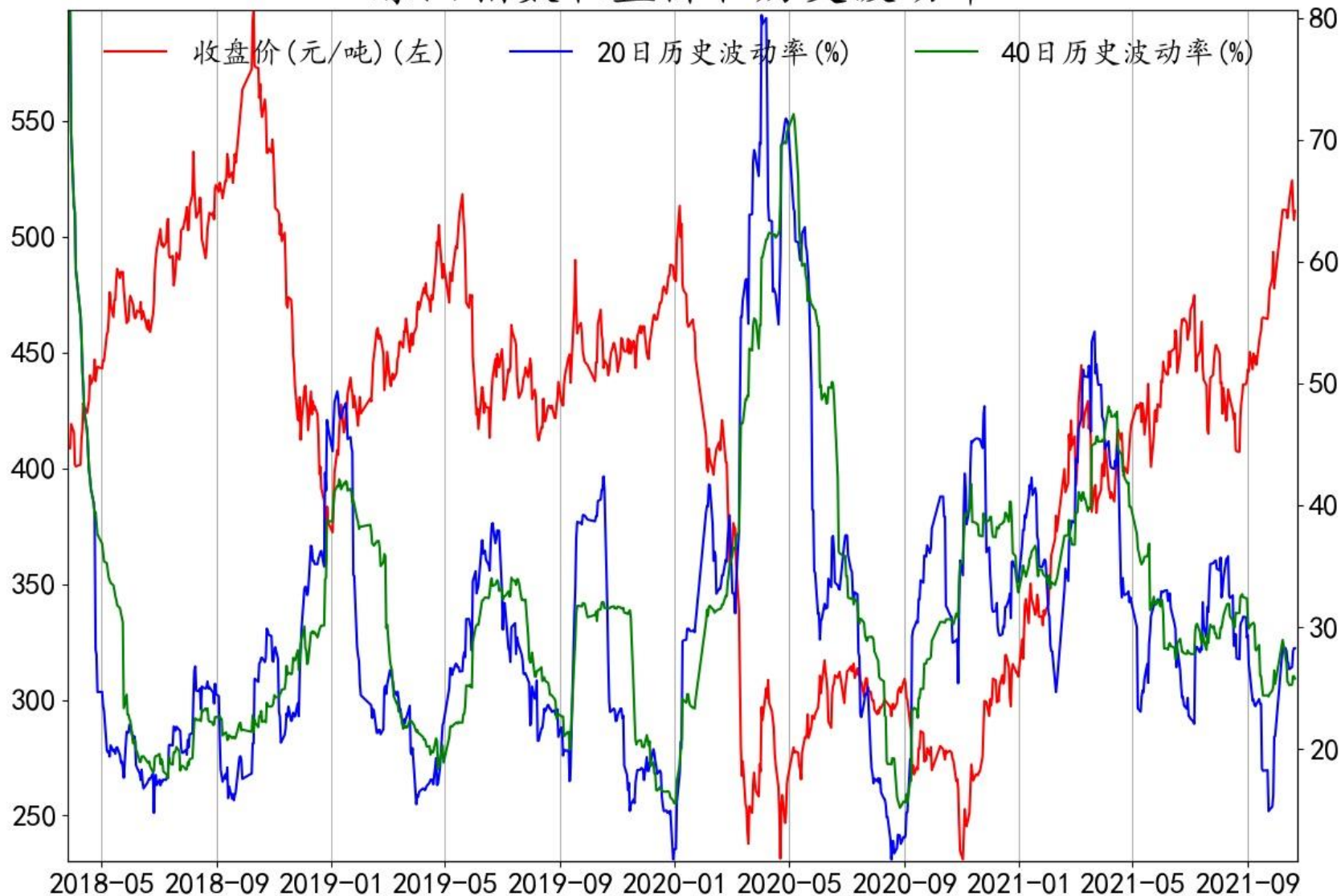
数据来源: Wind、信达期货研发中心

LPG指数收盘价和历史波动率



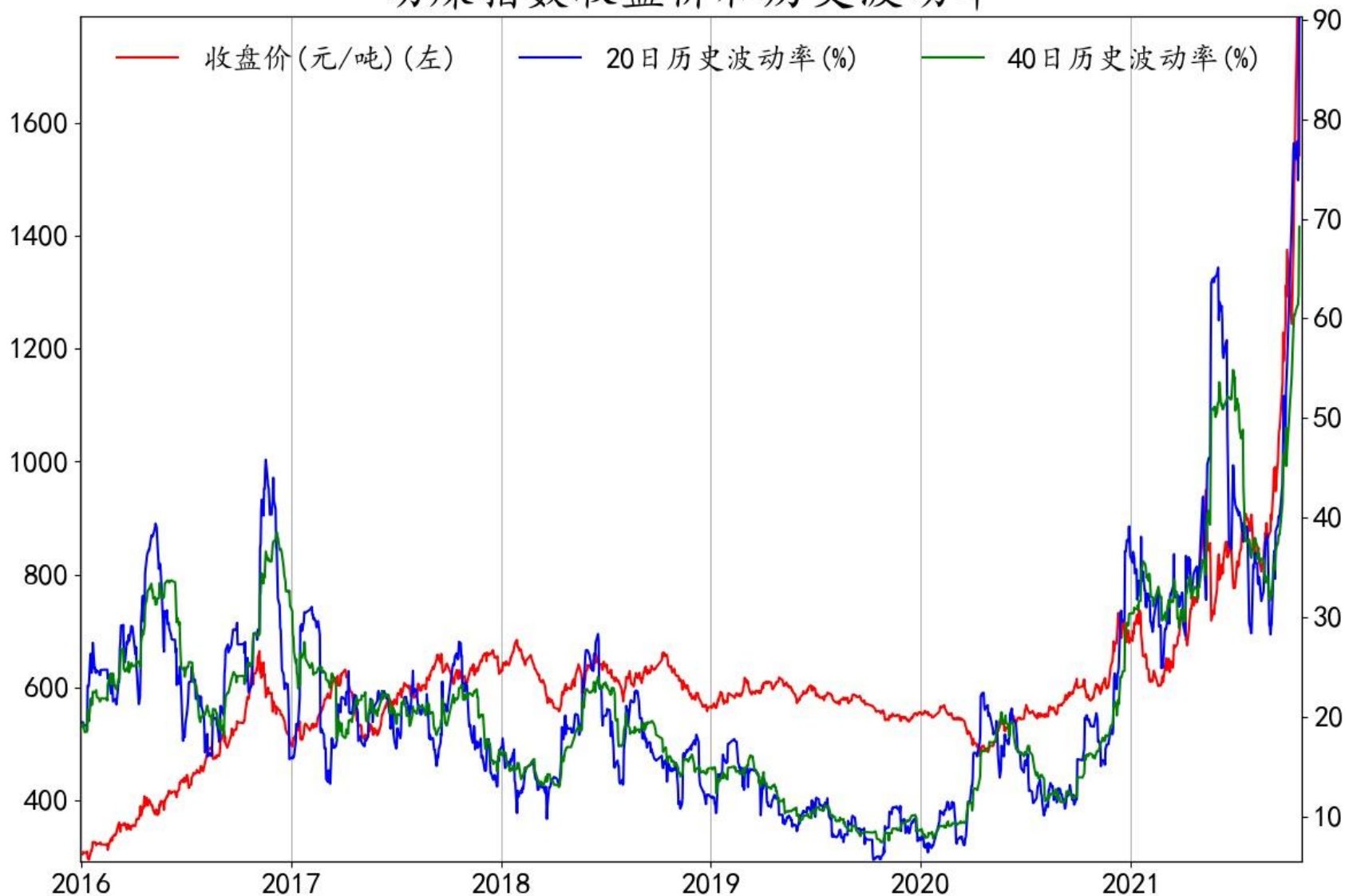
数据来源: Wind、信达期货研发中心

原油指数收盘价和历史波动率

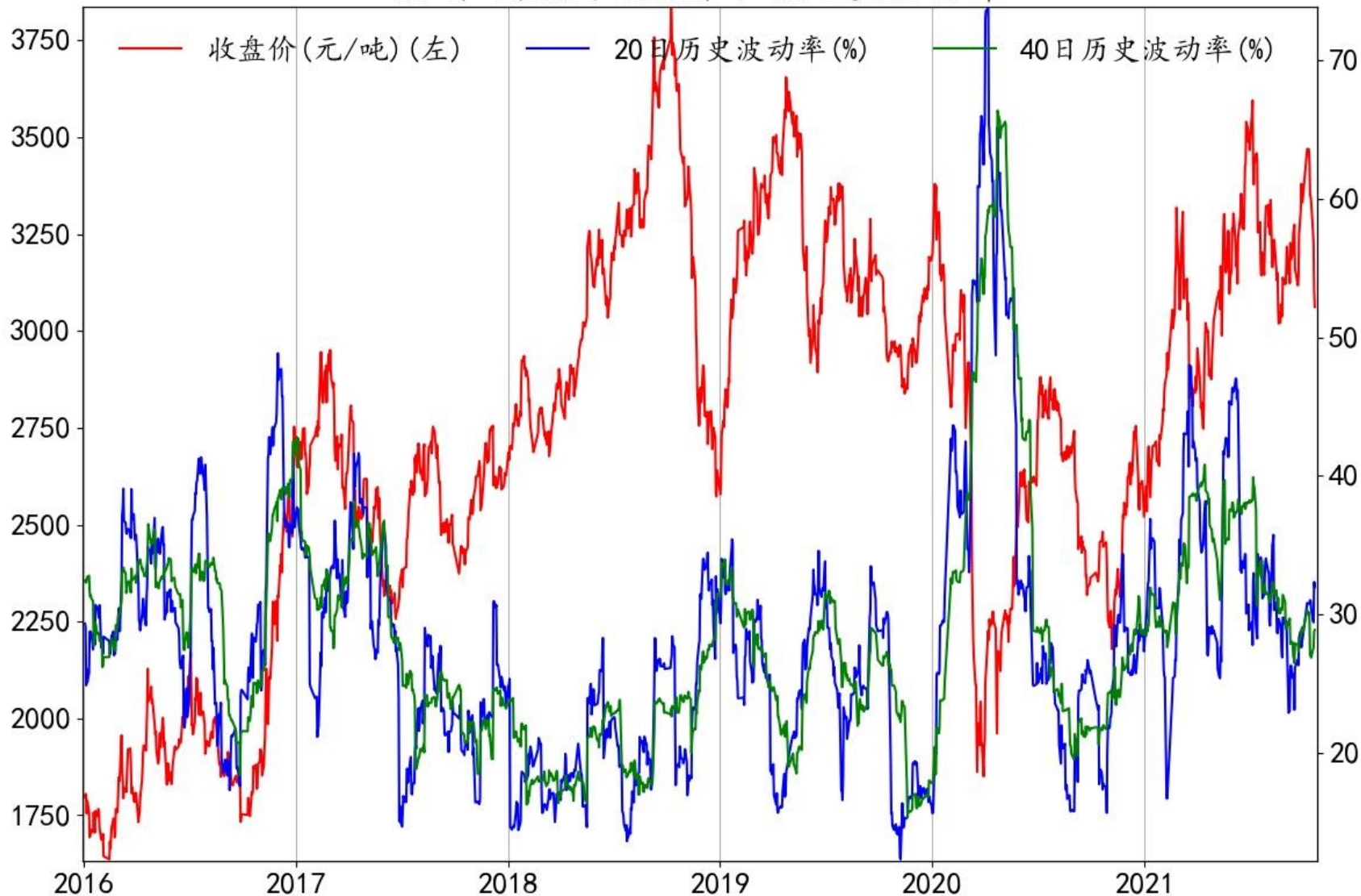


数据来源: Wind、信达期货研发中心

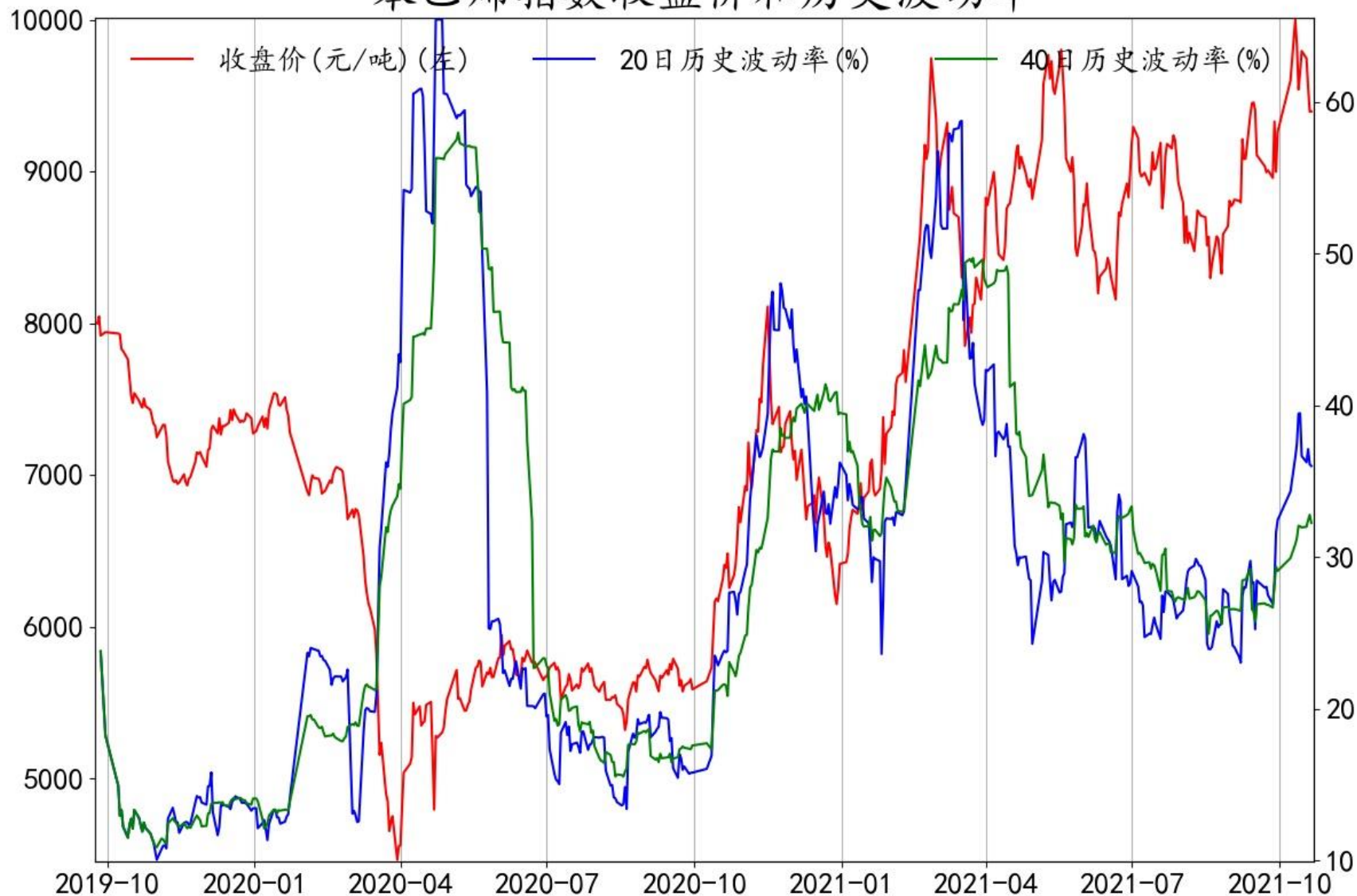
动煤指数收盘价和历史波动率



沥青指数收盘价和历史波动率

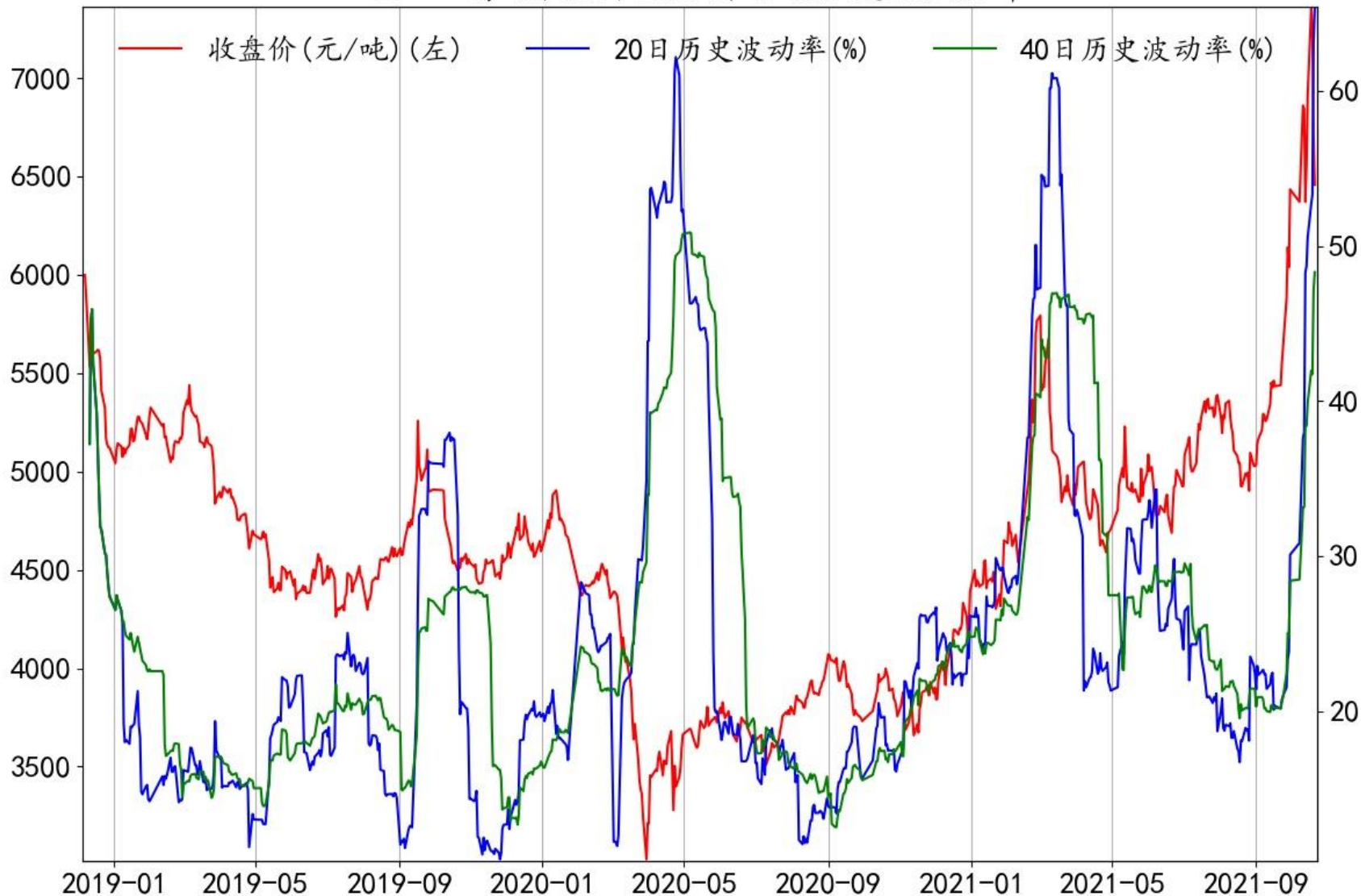


苯乙烯指数收盘价和历史波动率



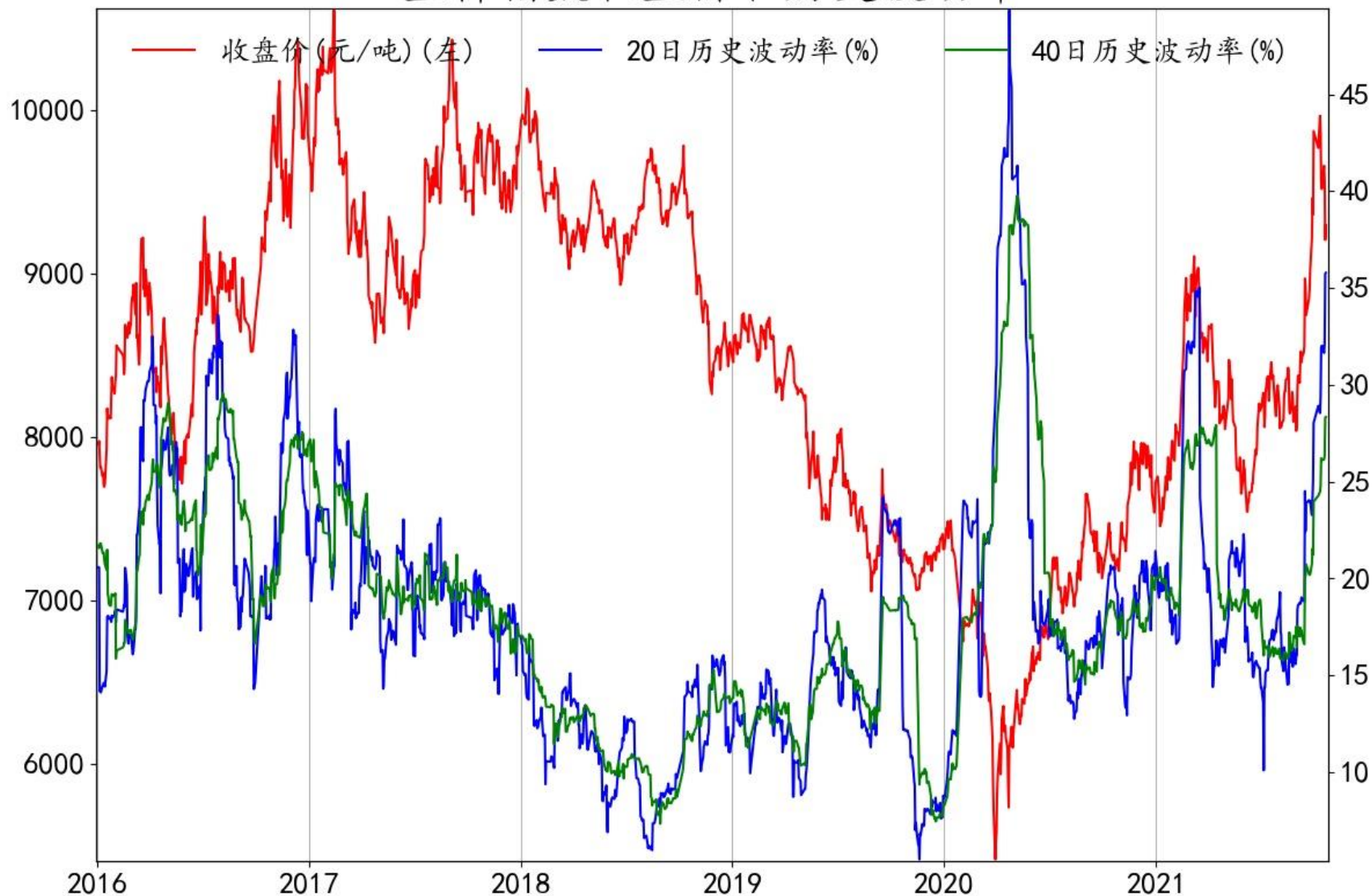
数据来源: Wind、信达期货研发中心

乙二醇指数收盘价和历史波动率

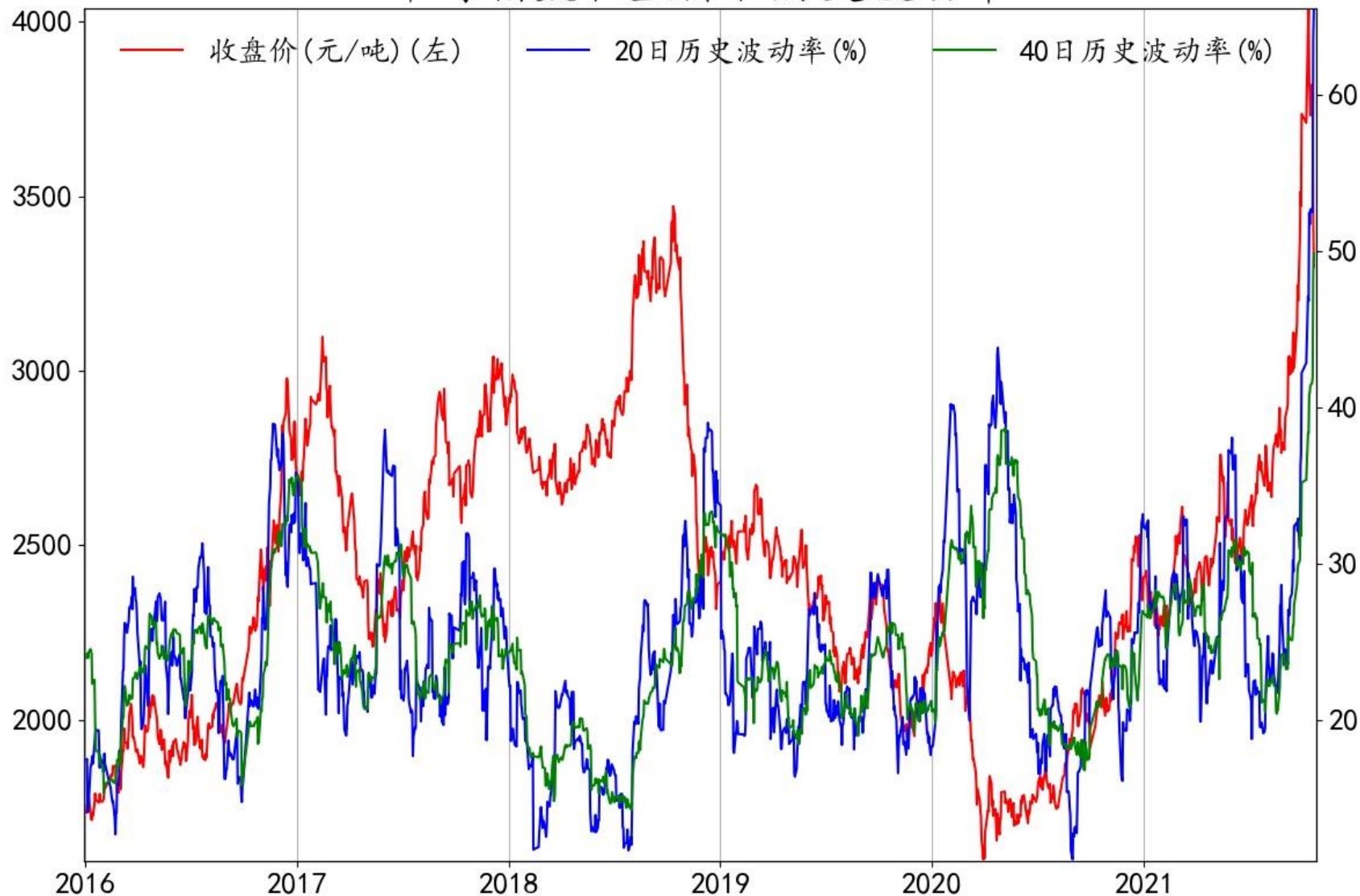


数据来源: Wind、信达期货研发中心

塑料指数收盘价和历史波动率

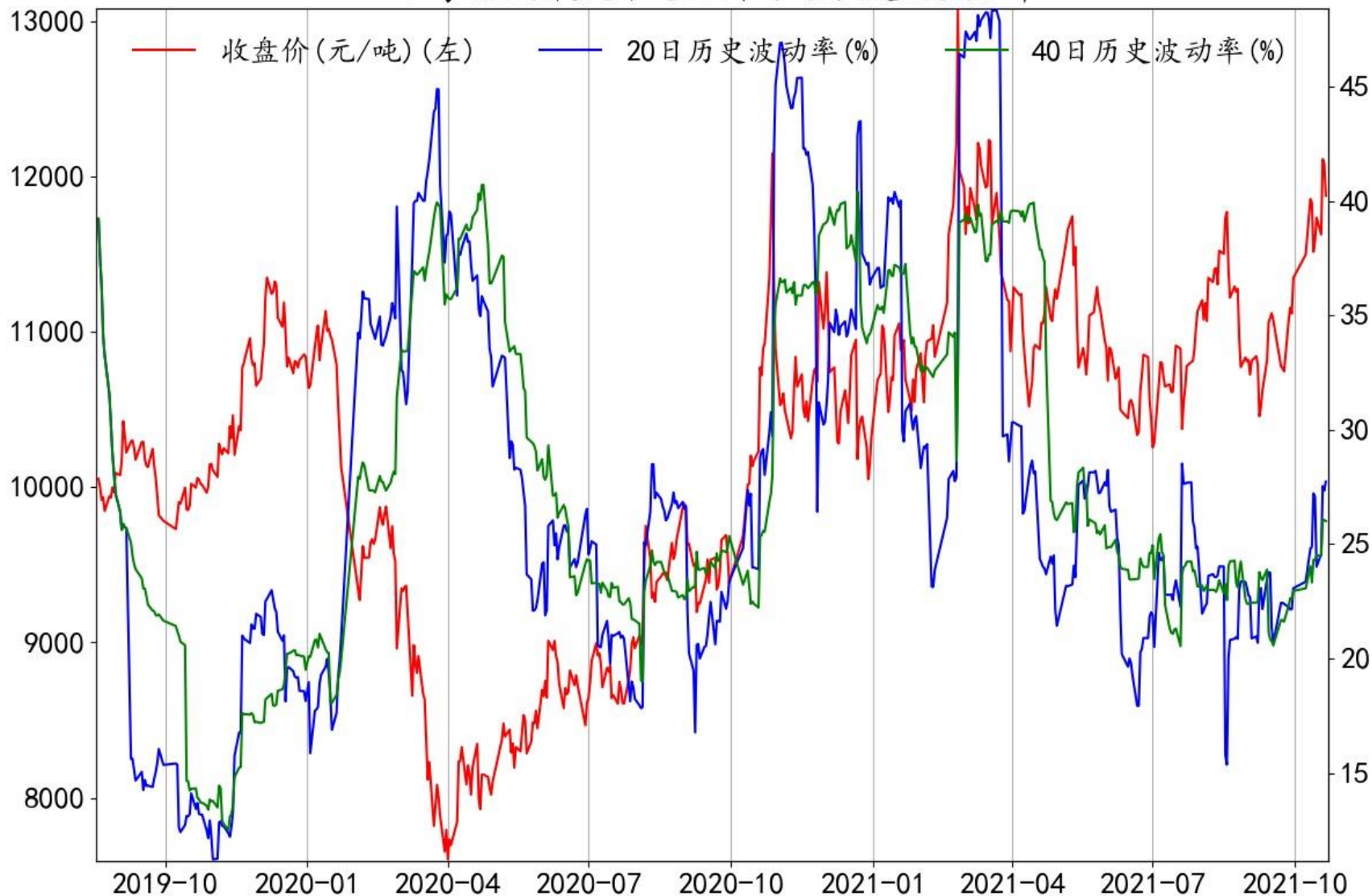


甲醇指数收盘价和历史波动率



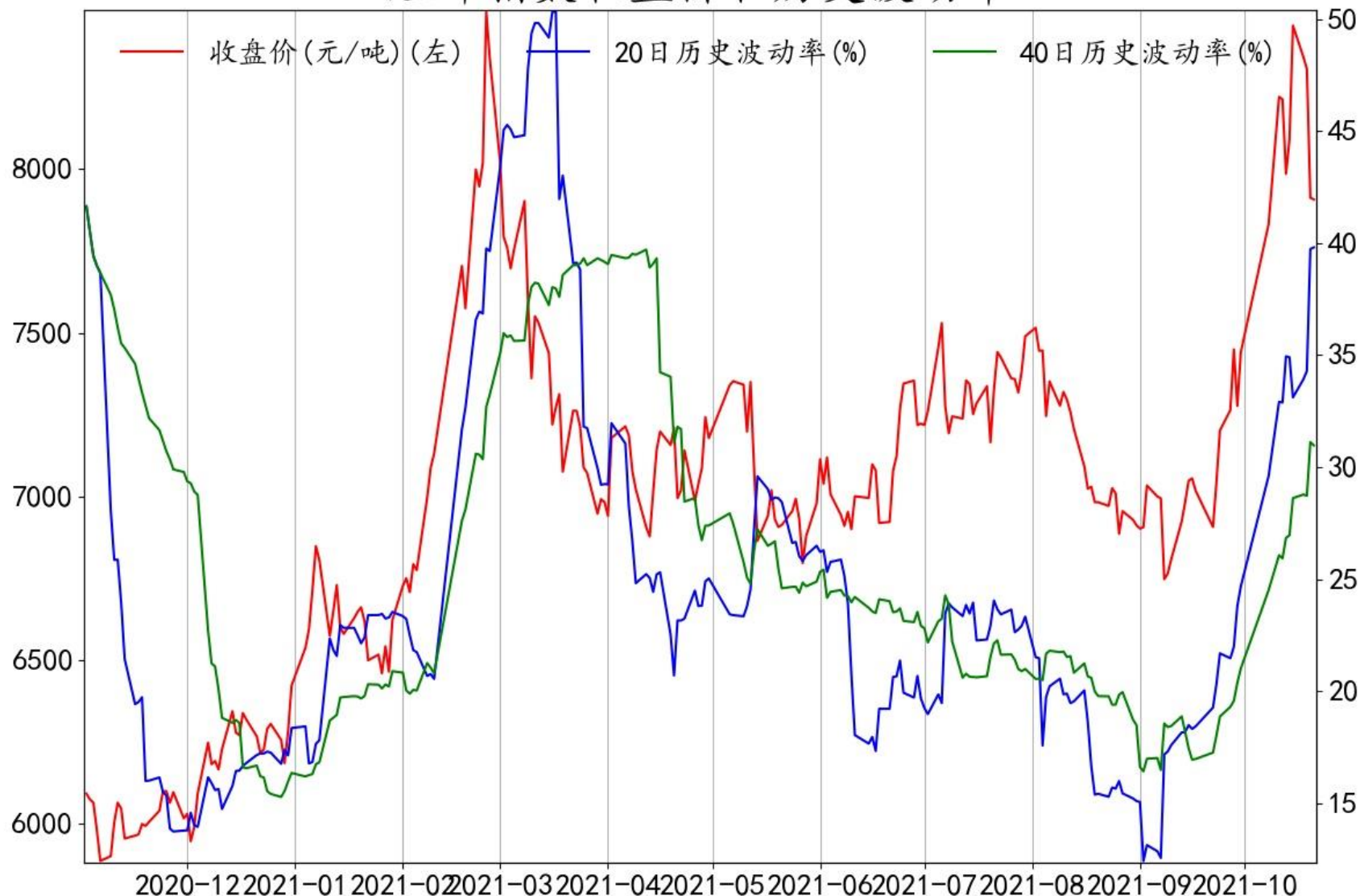
20号胶指数

20号胶指数收盘价和历史波动率

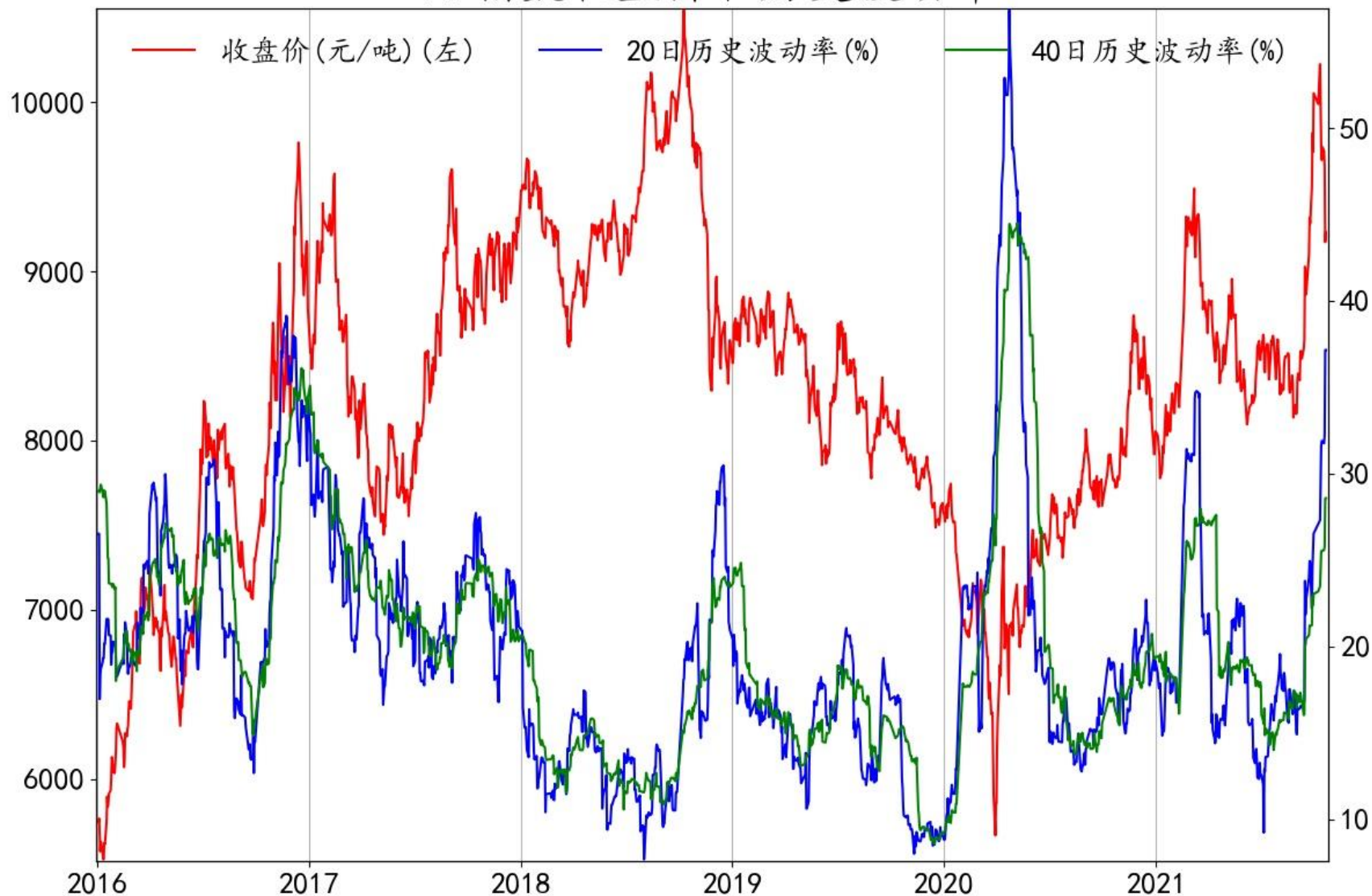


数据来源: Wind、信达期货研发中心

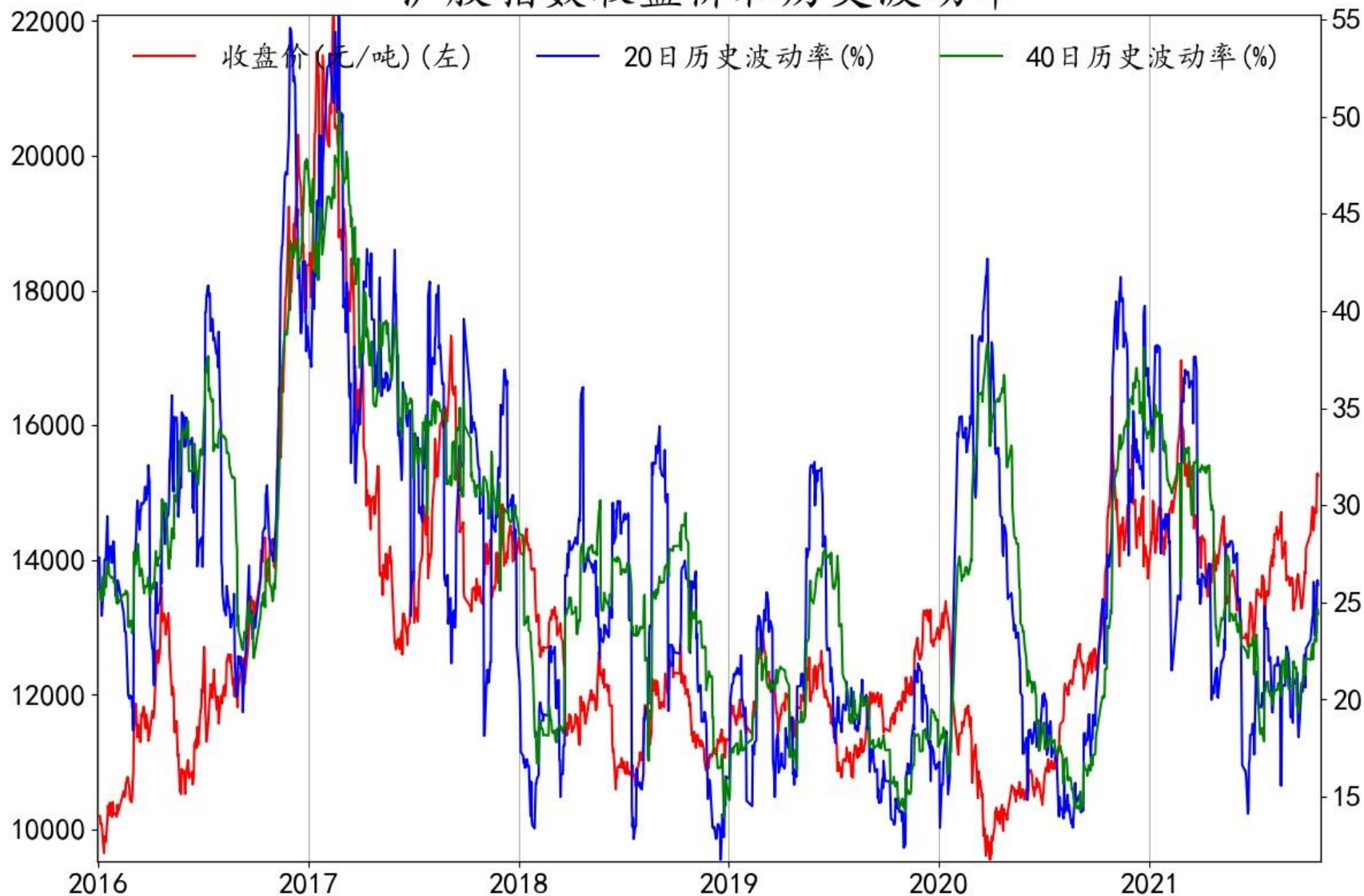
短纤指数收盘价和历史波动率



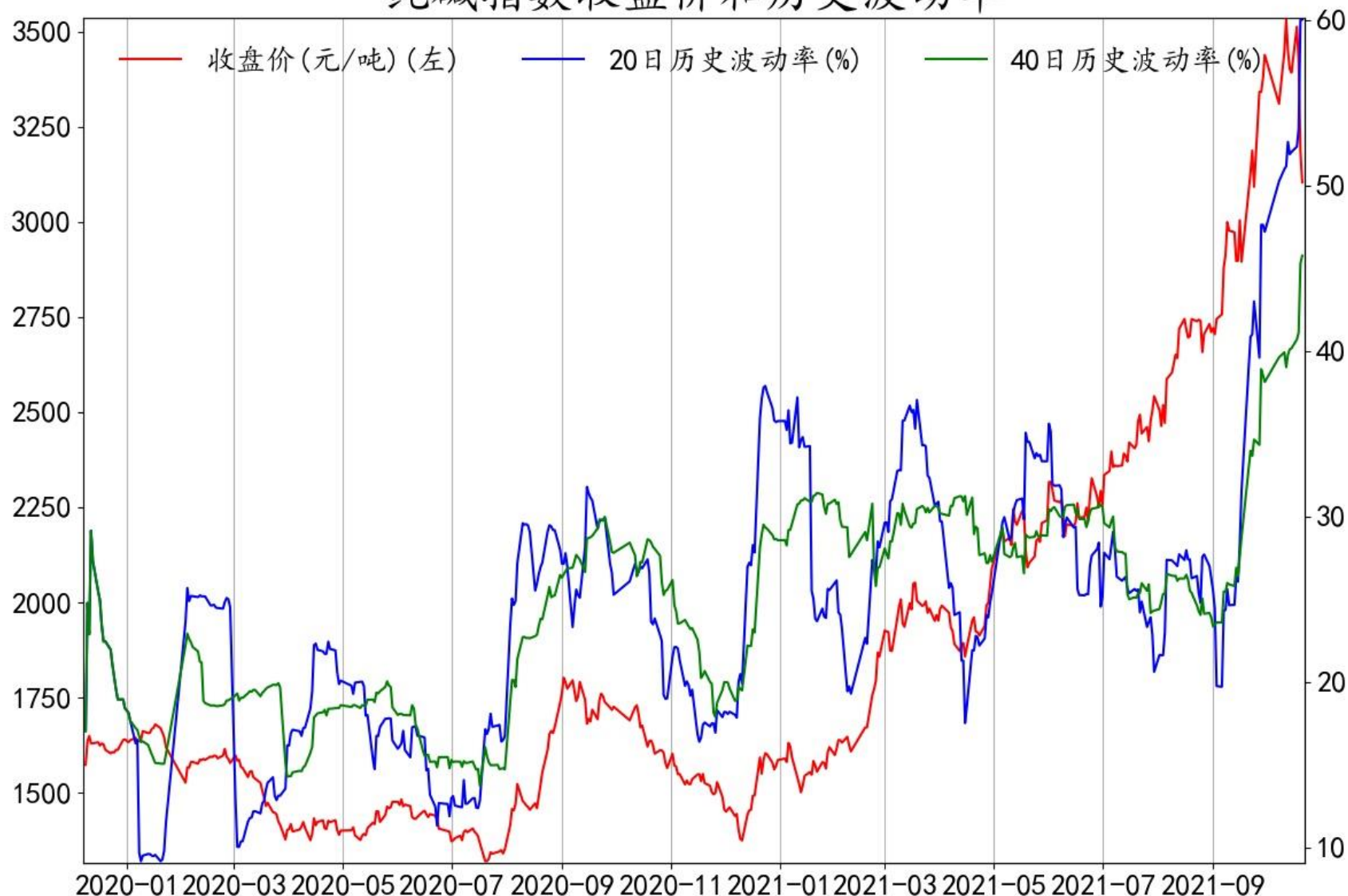
PP指数收盘价和历史波动率



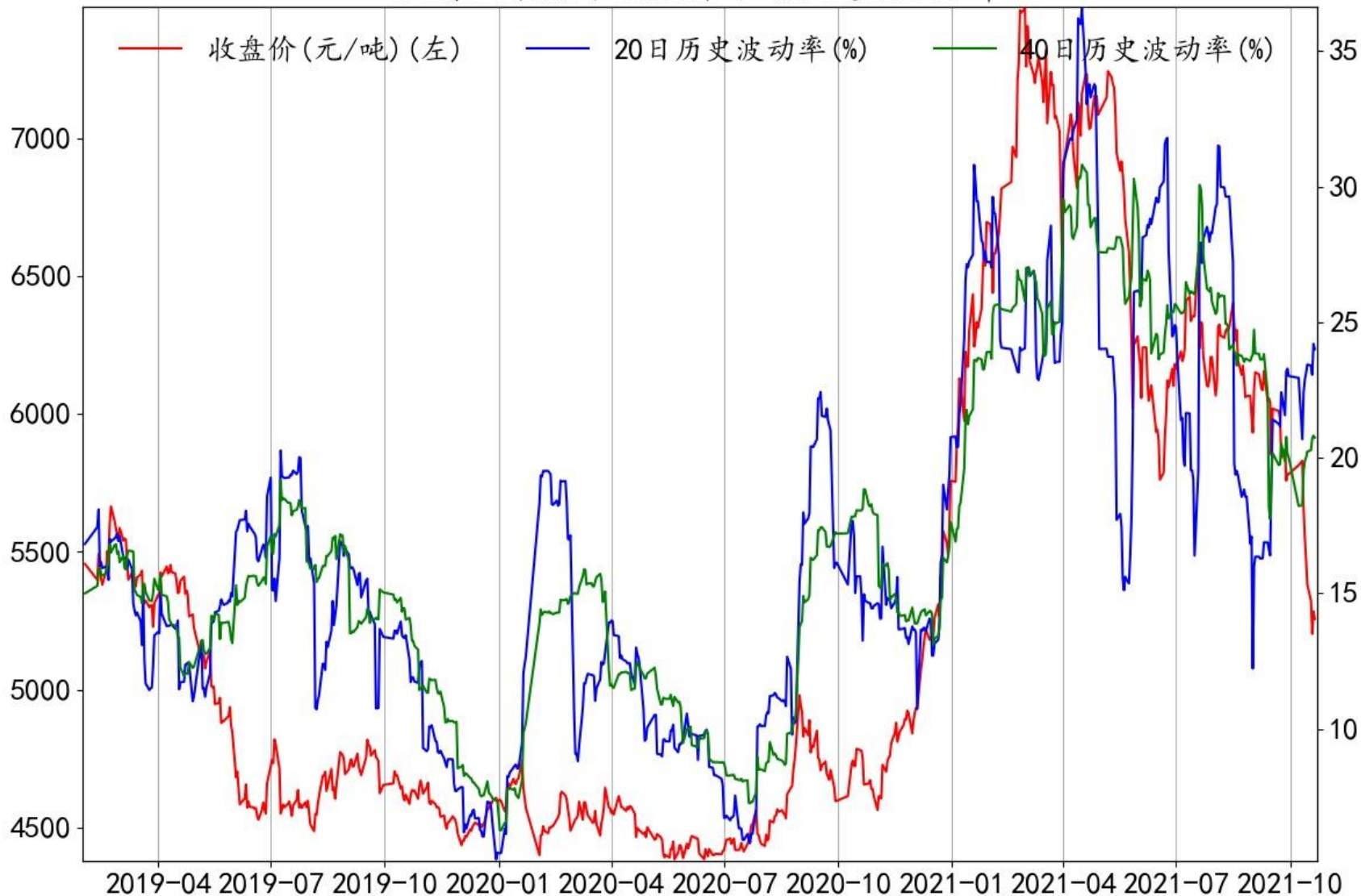
沪胶指数收盘价和历史波动率



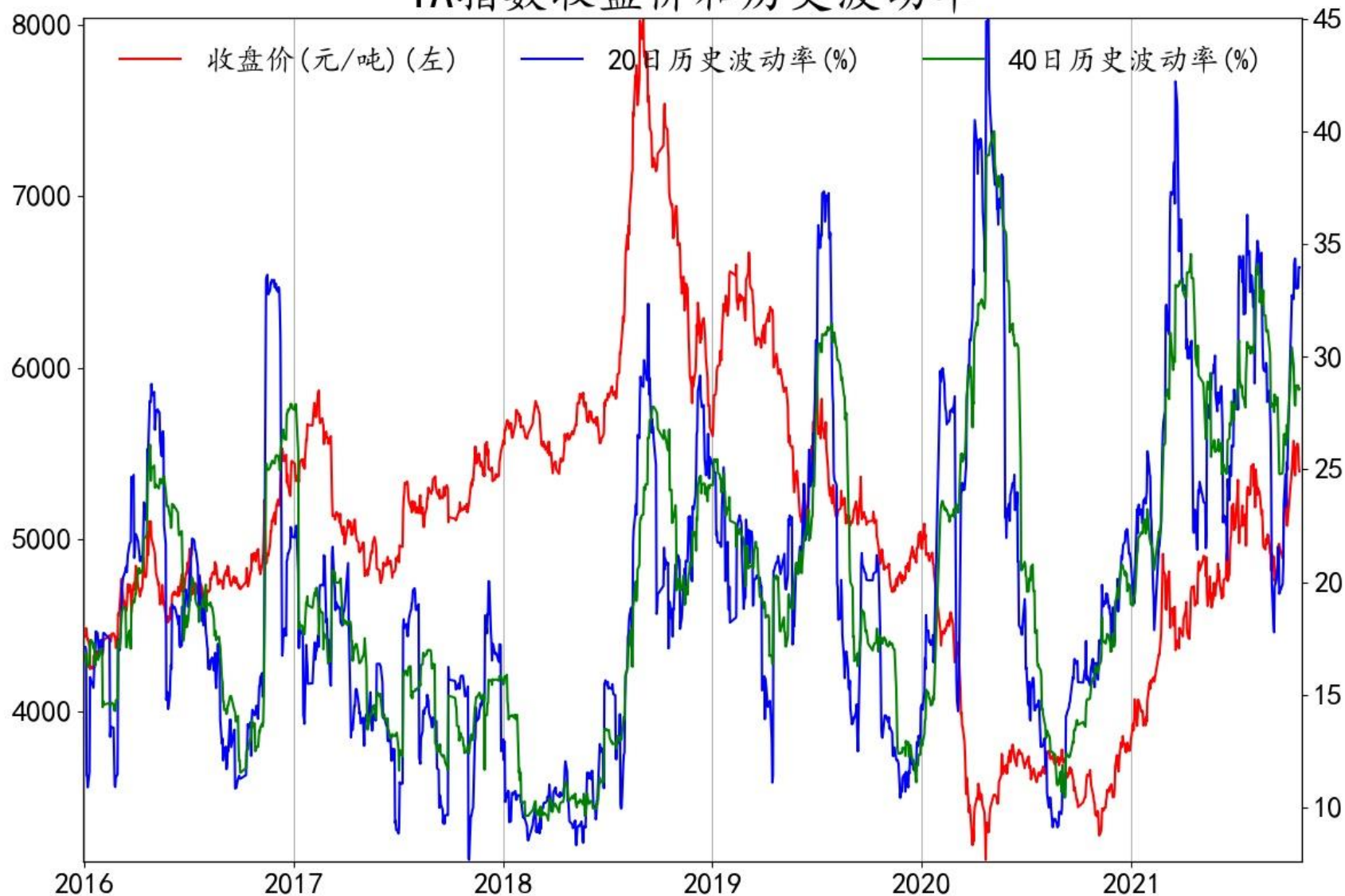
纯碱指数收盘价和历史波动率



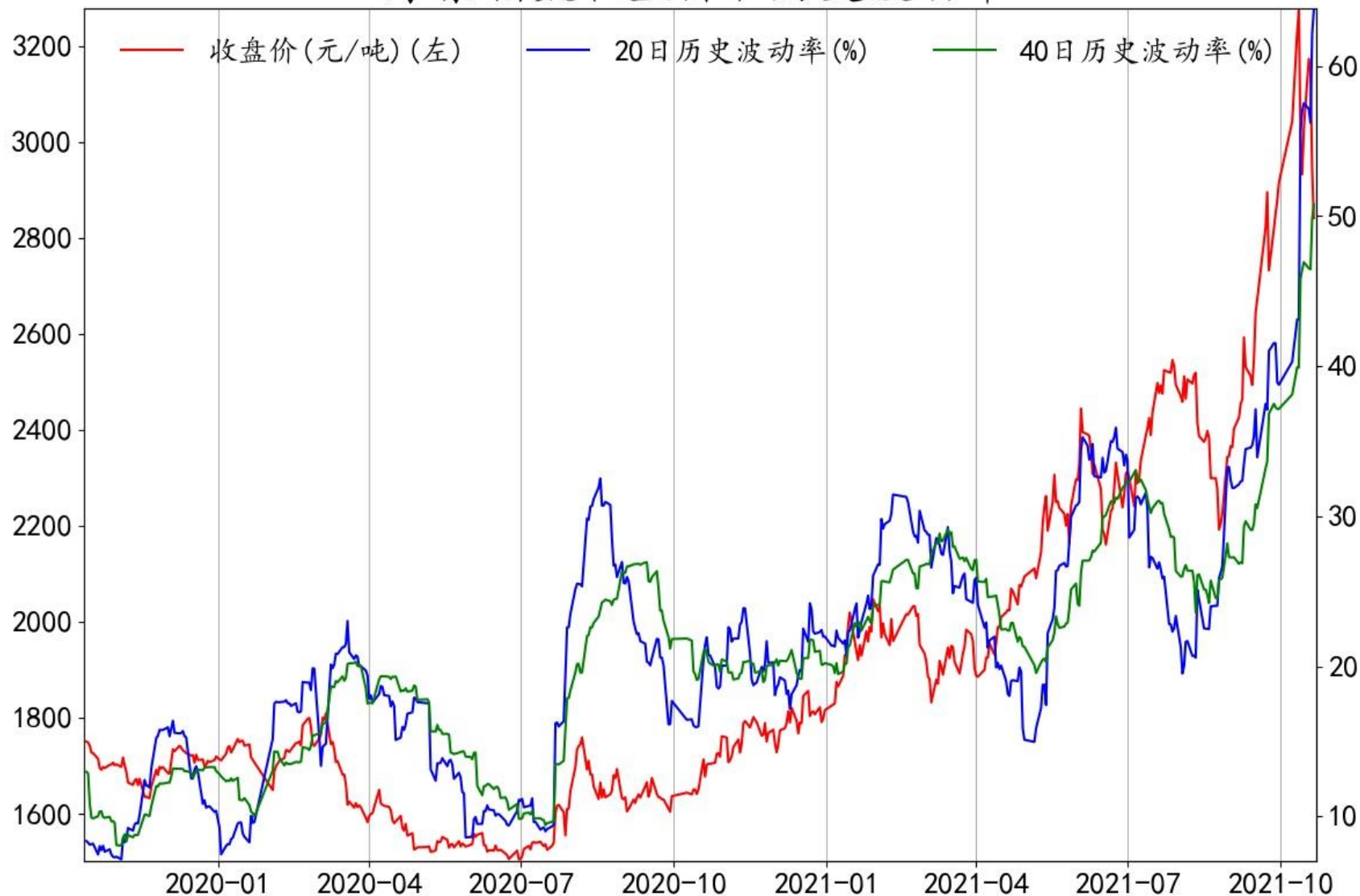
纸浆指数收盘价和历史波动率



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

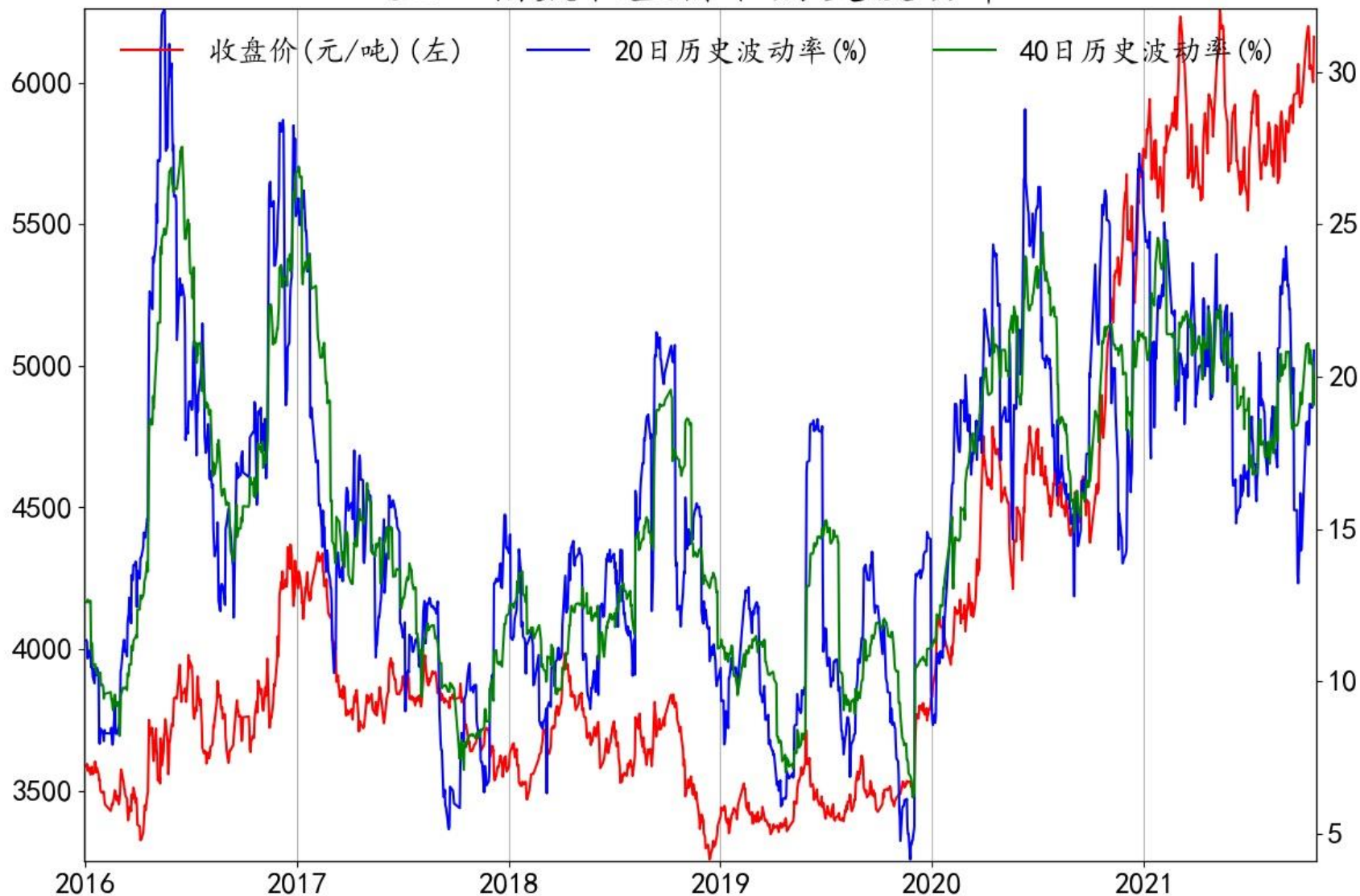


数据来源: Wind、信达期货研发中心

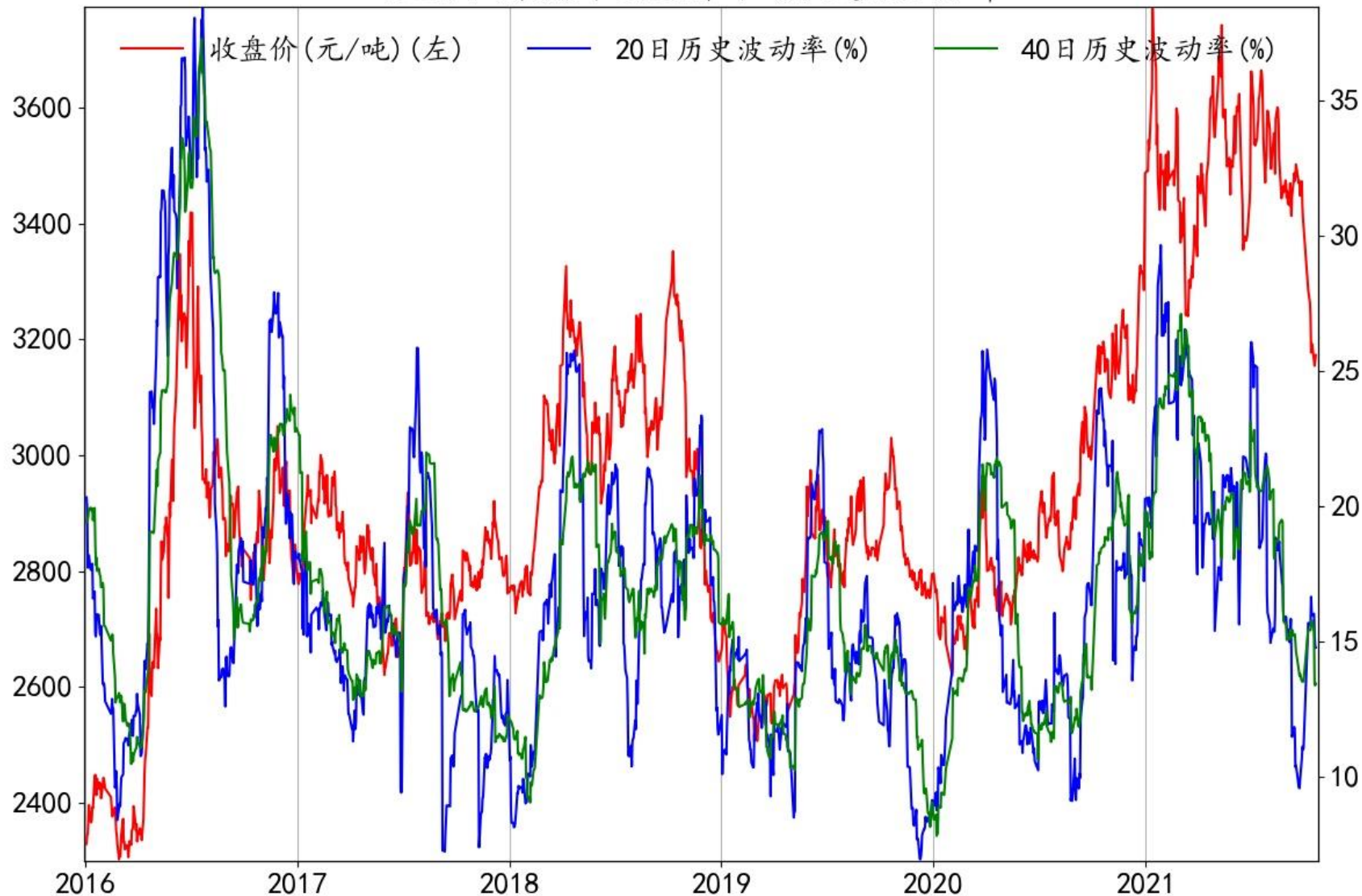
玉米指数收盘价和历史波动率



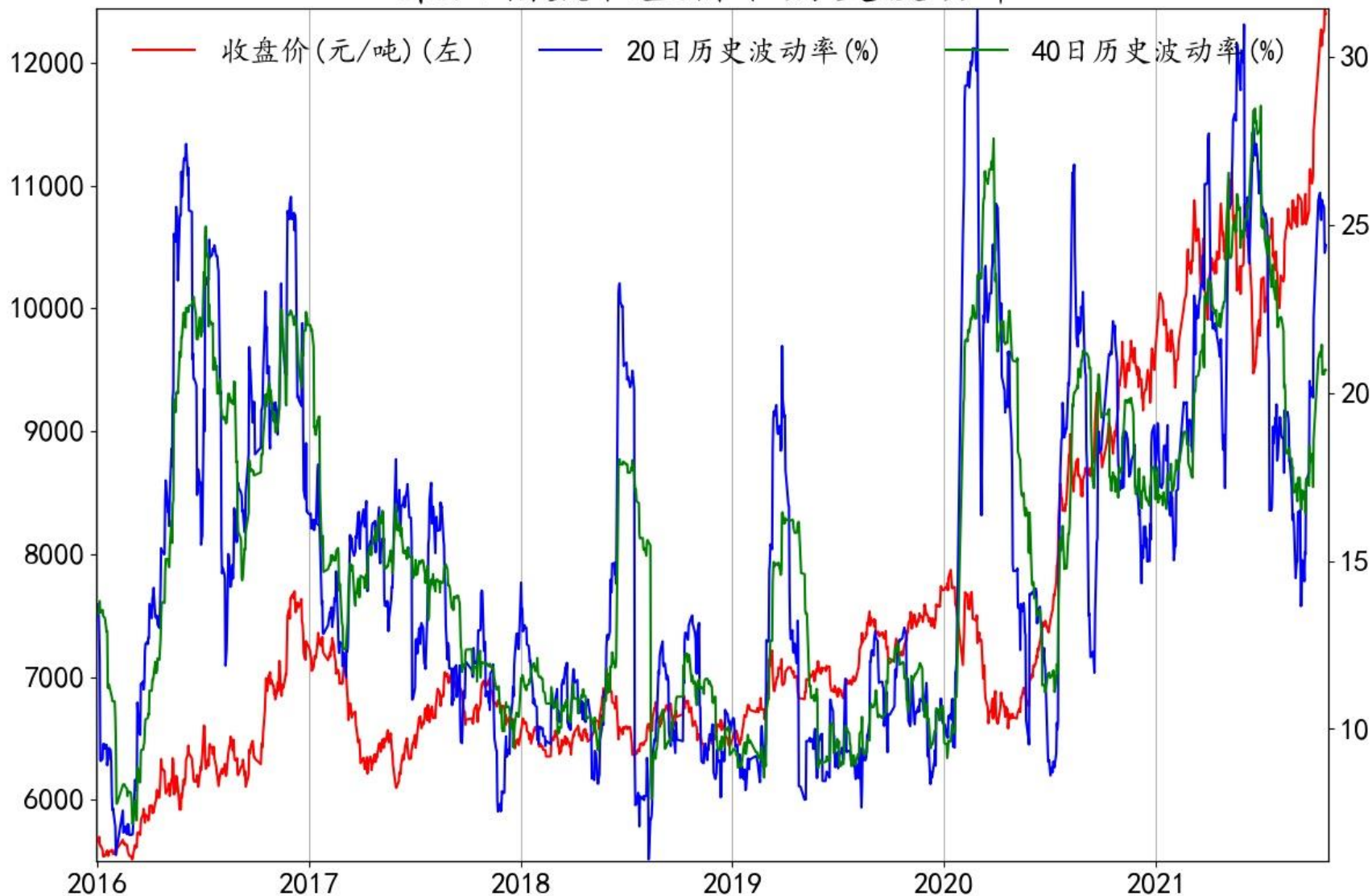
豆一指数收盘价和历史波动率



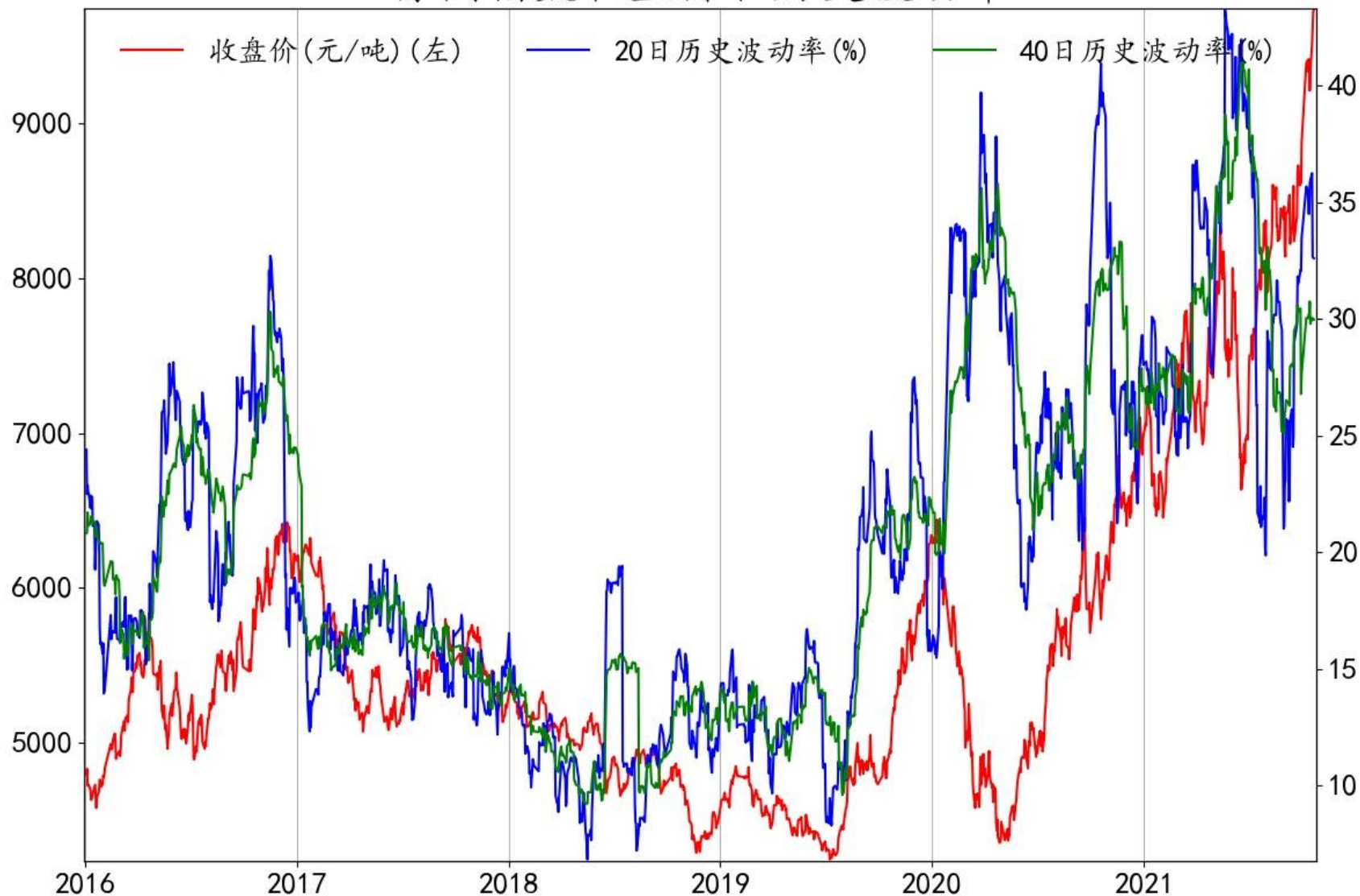
豆粕指数收盘价和历史波动率



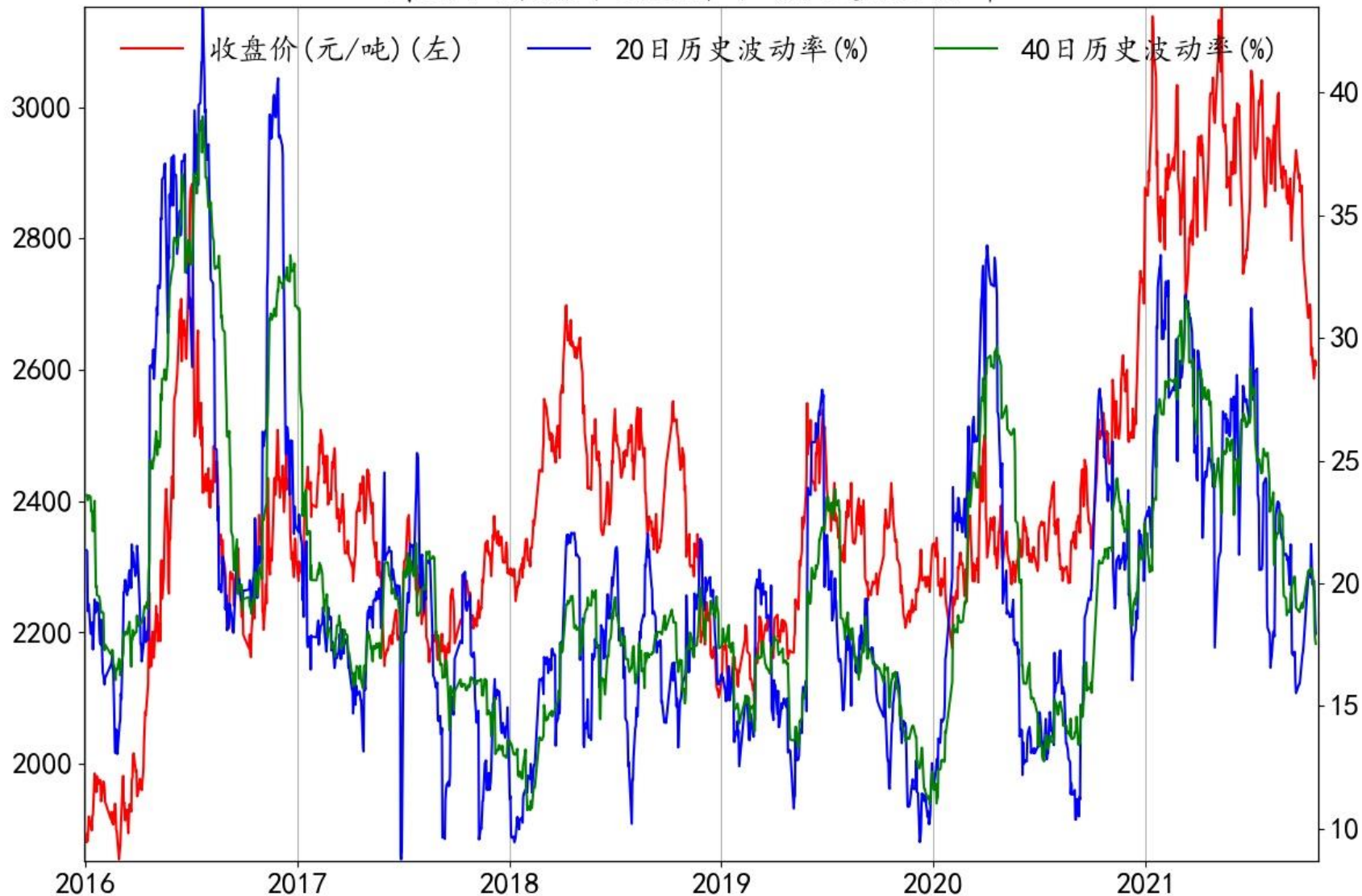
菜油指数收盘价和历史波动率



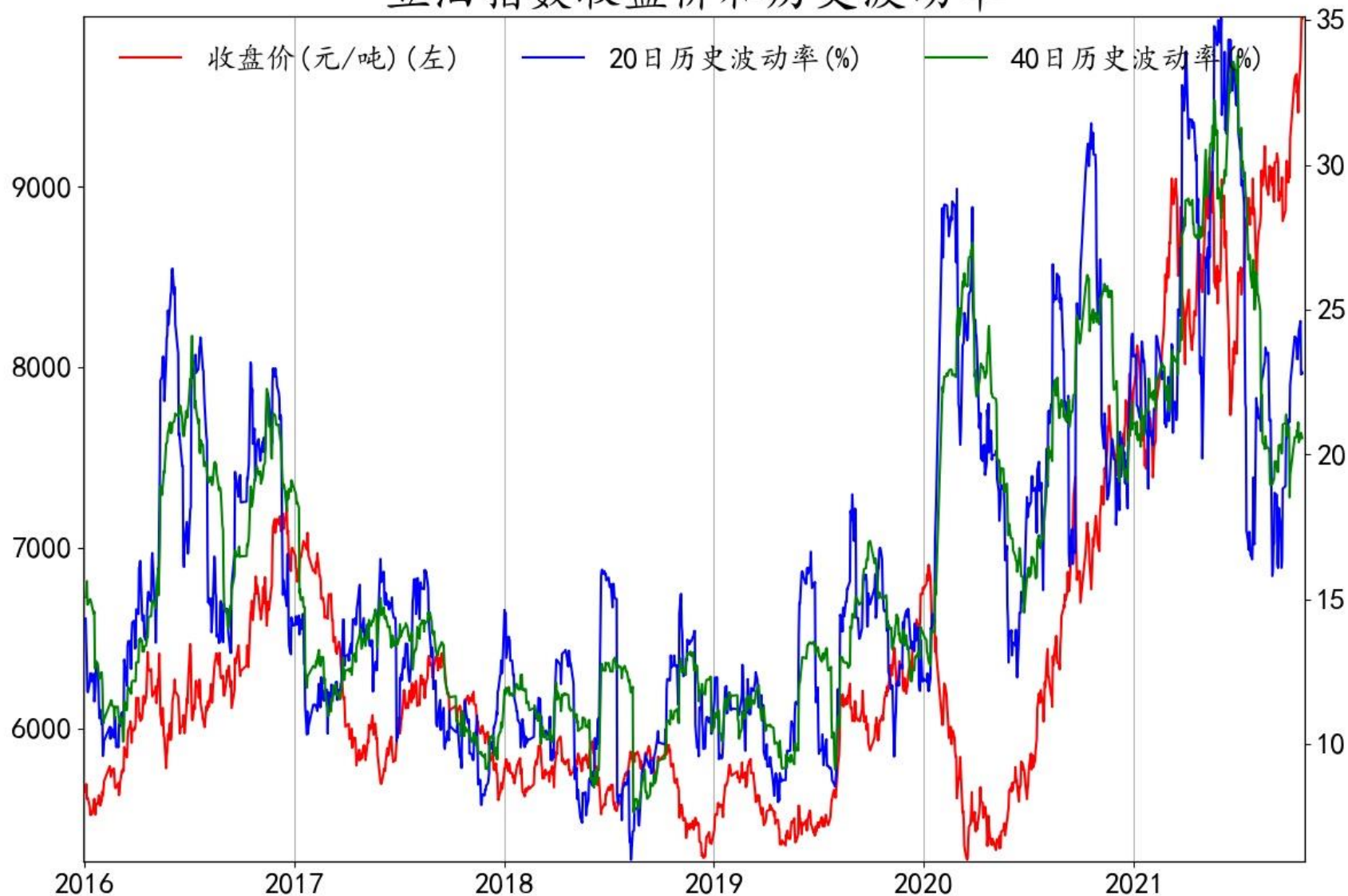
棕榈指数收盘价和历史波动率



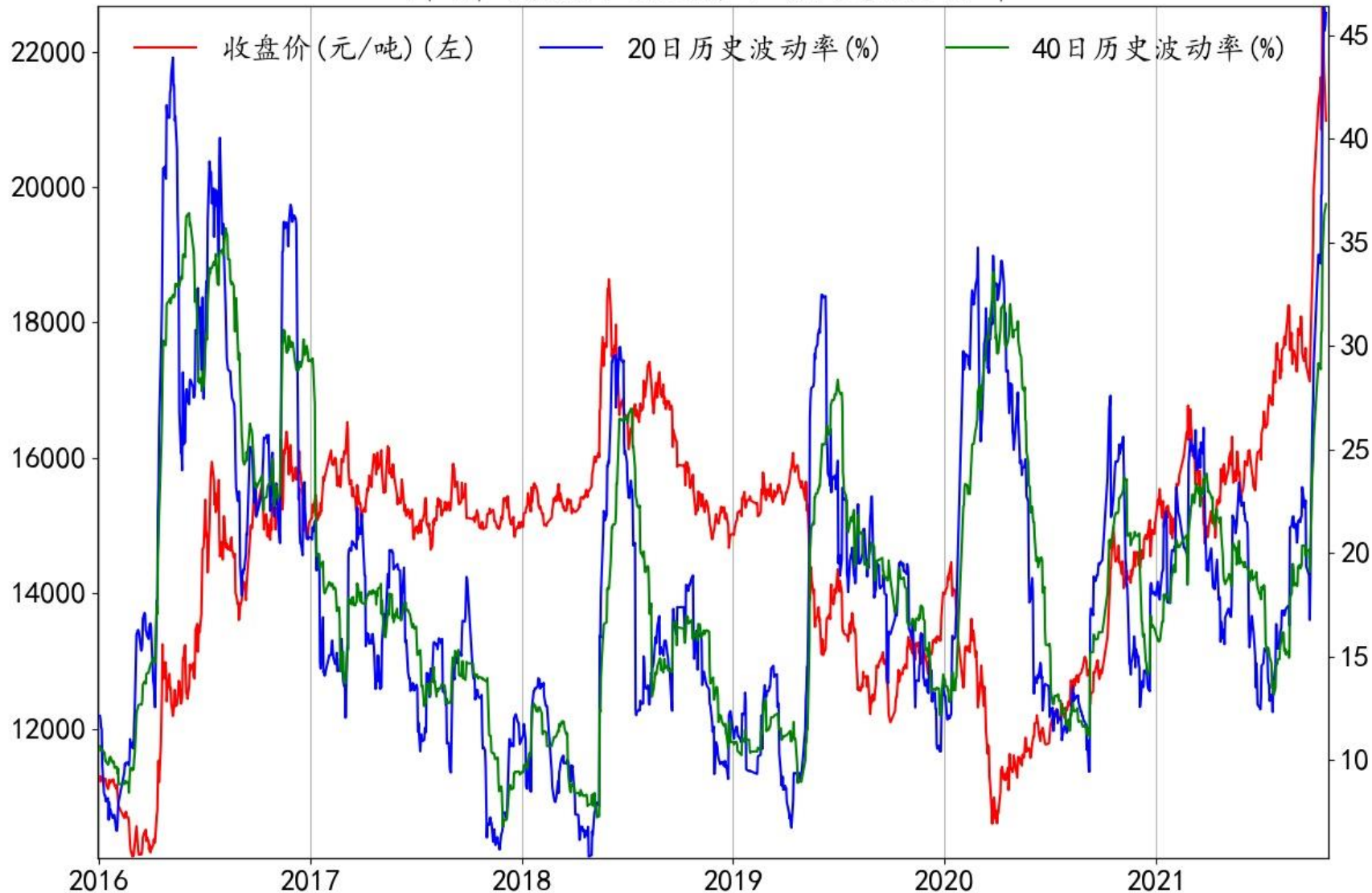
菜粕指数收盘价和历史波动率



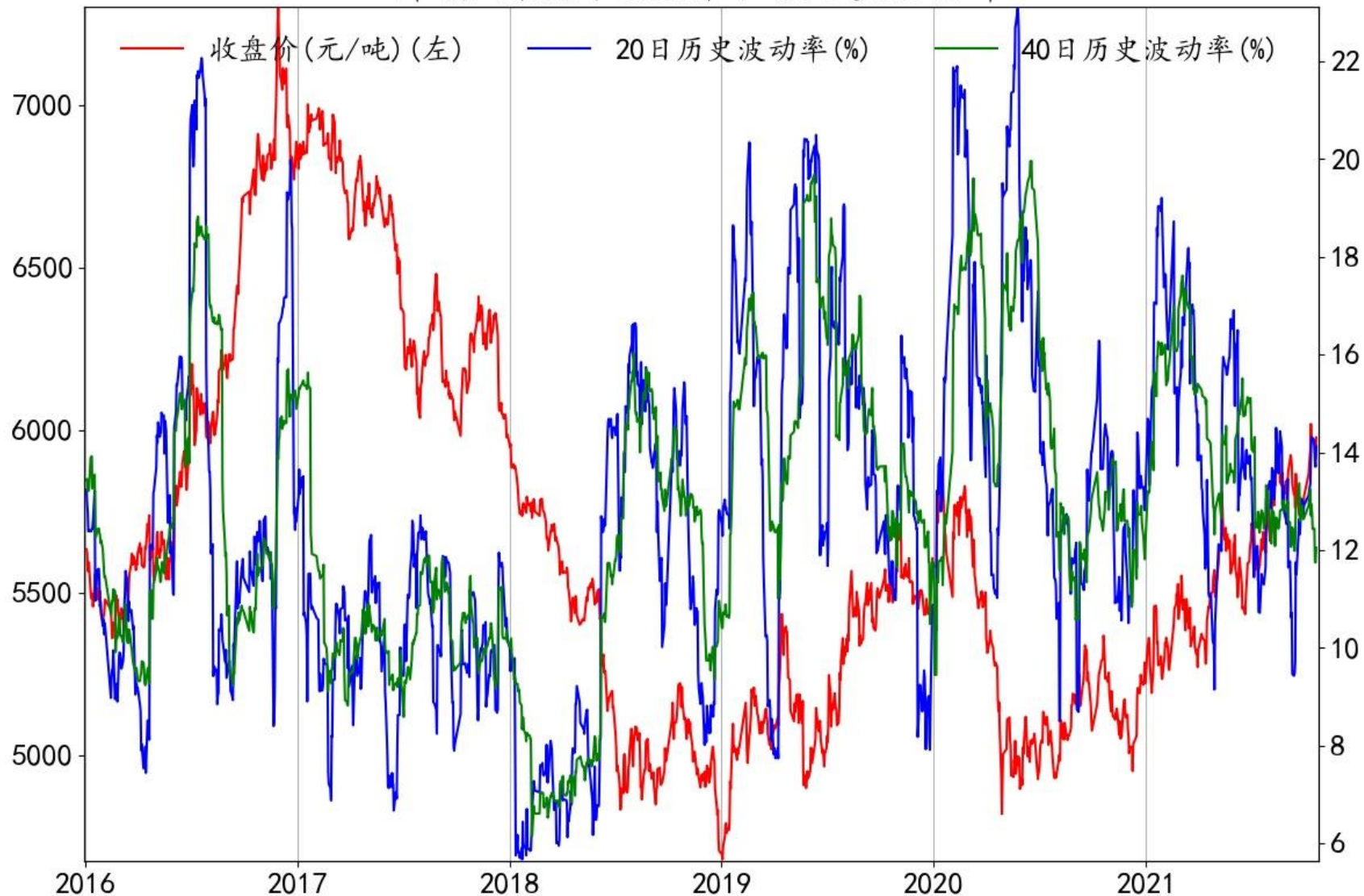
豆油指数收盘价和历史波动率



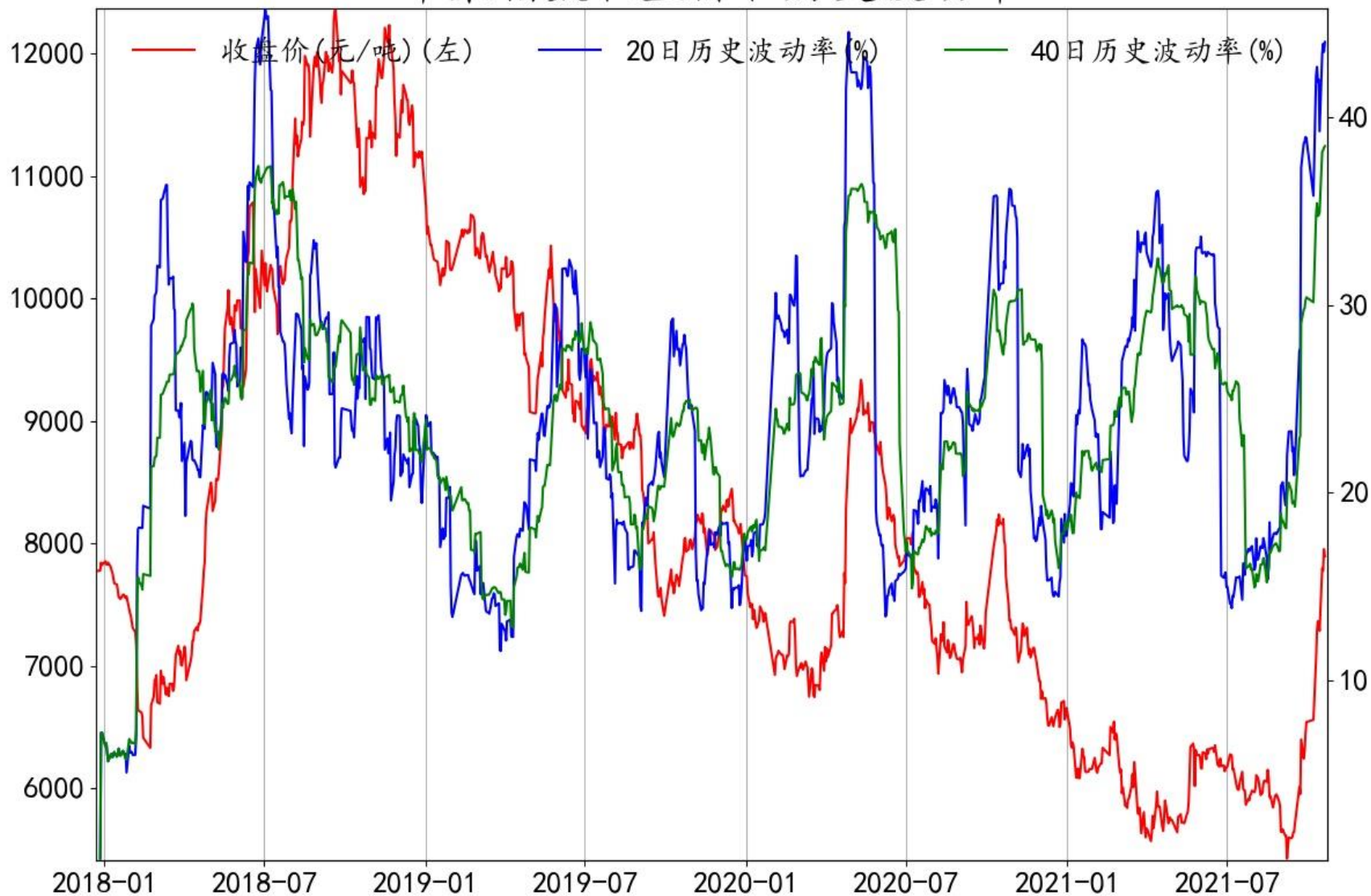
郑棉指数收盘价和历史波动率



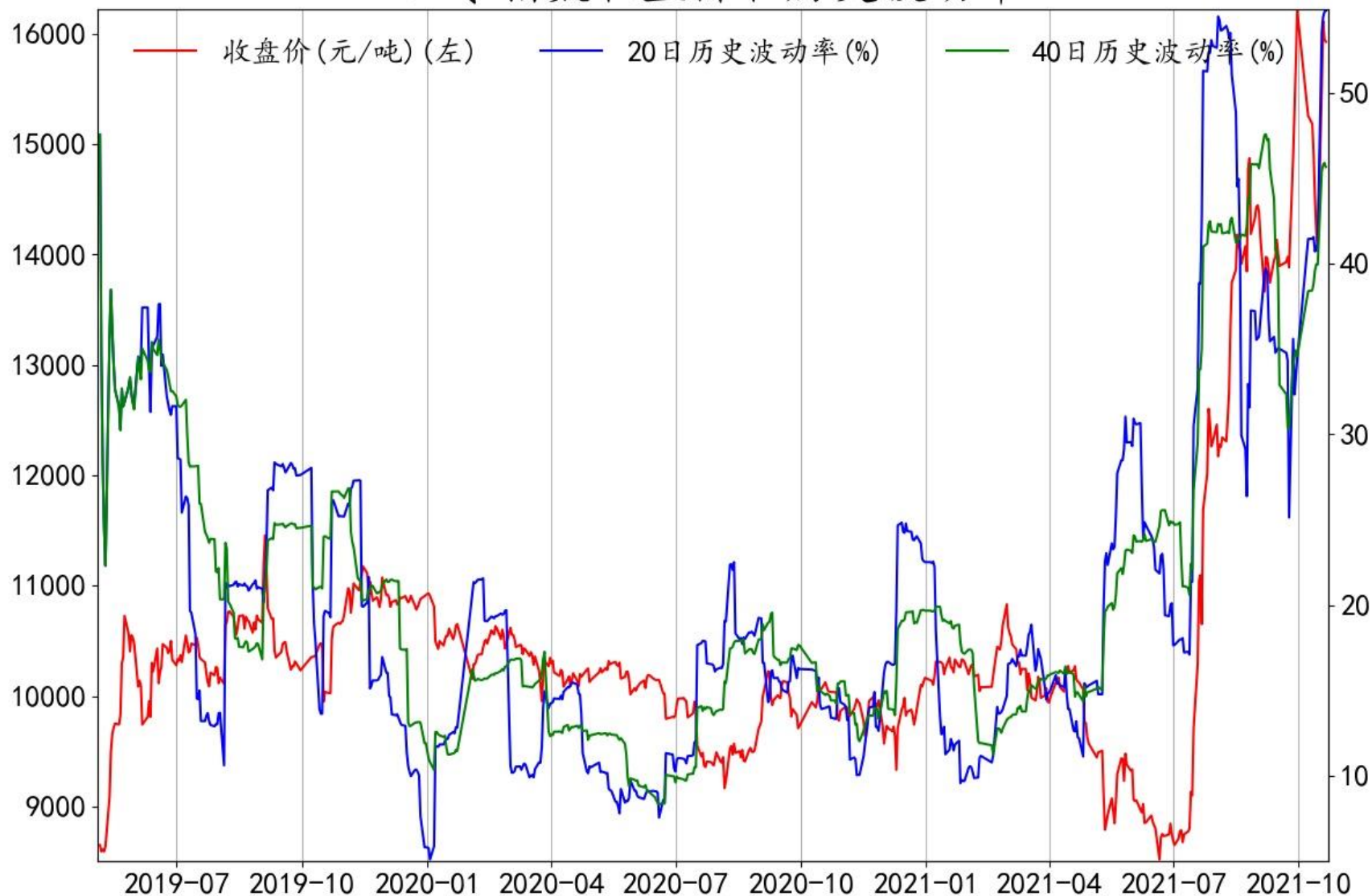
郑糖指数收盘价和历史波动率



苹果指数收盘价和历史波动率

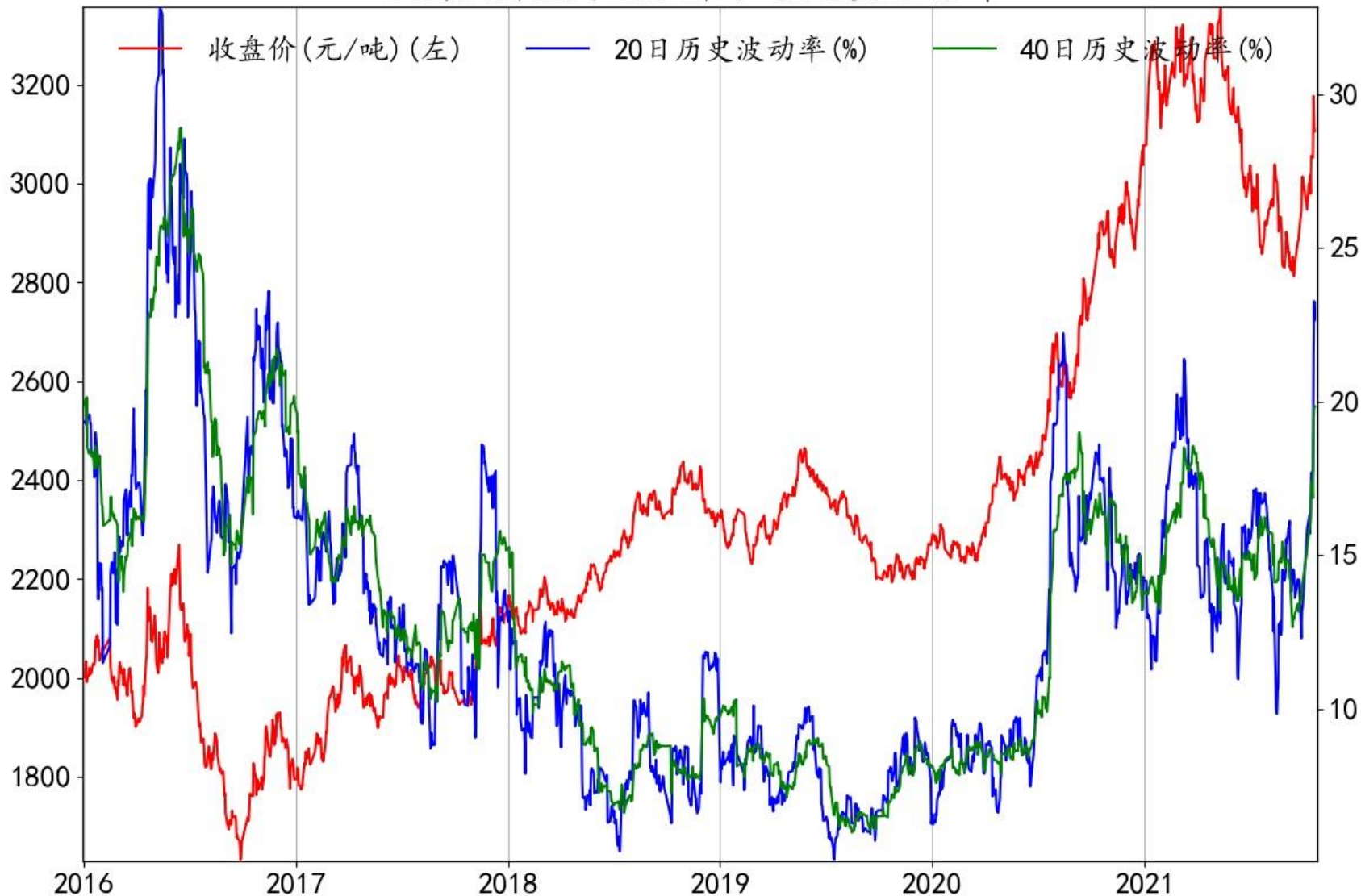


红枣指数收盘价和历史波动率

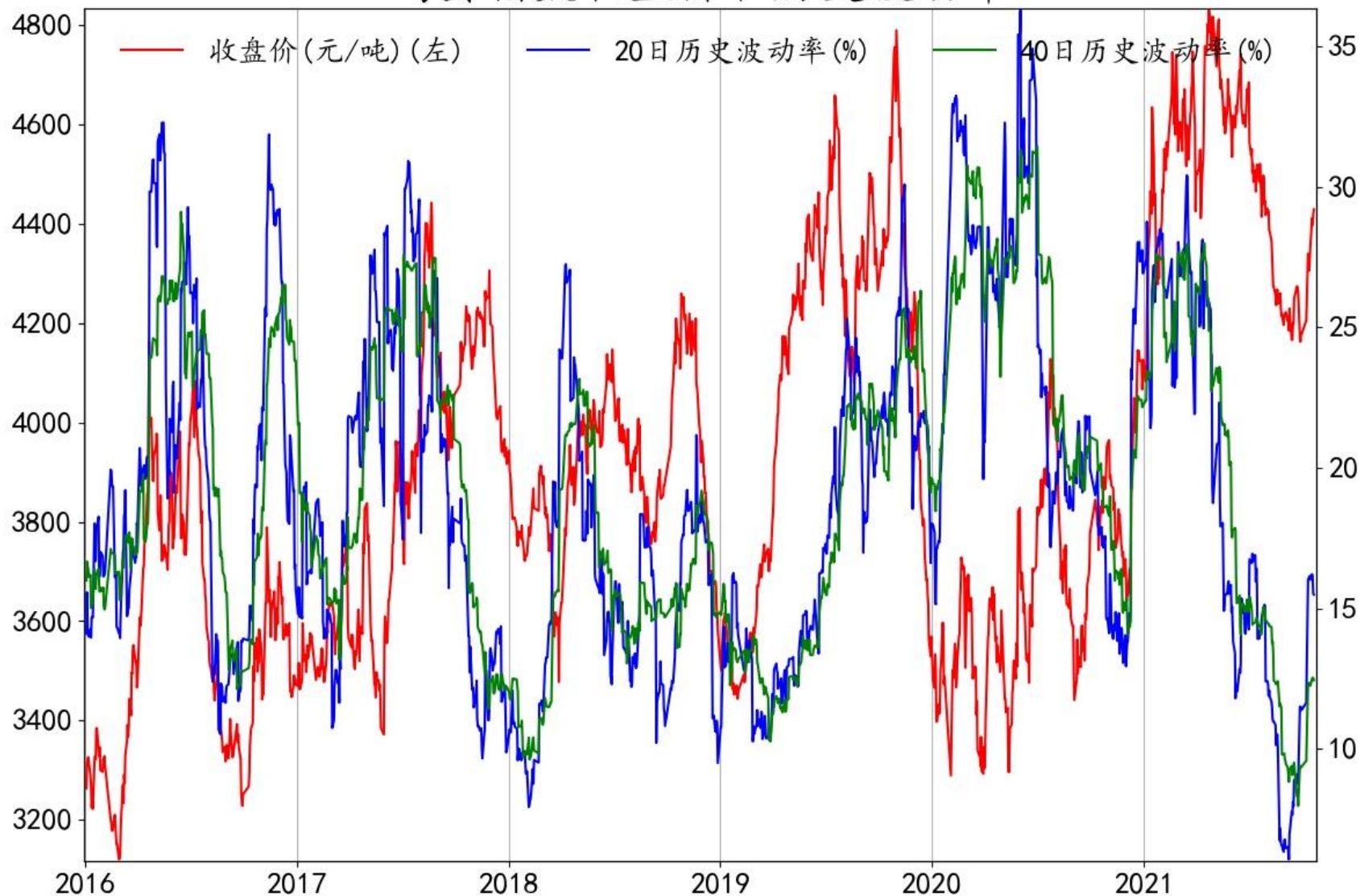


数据来源: Wind、信达期货研发中心

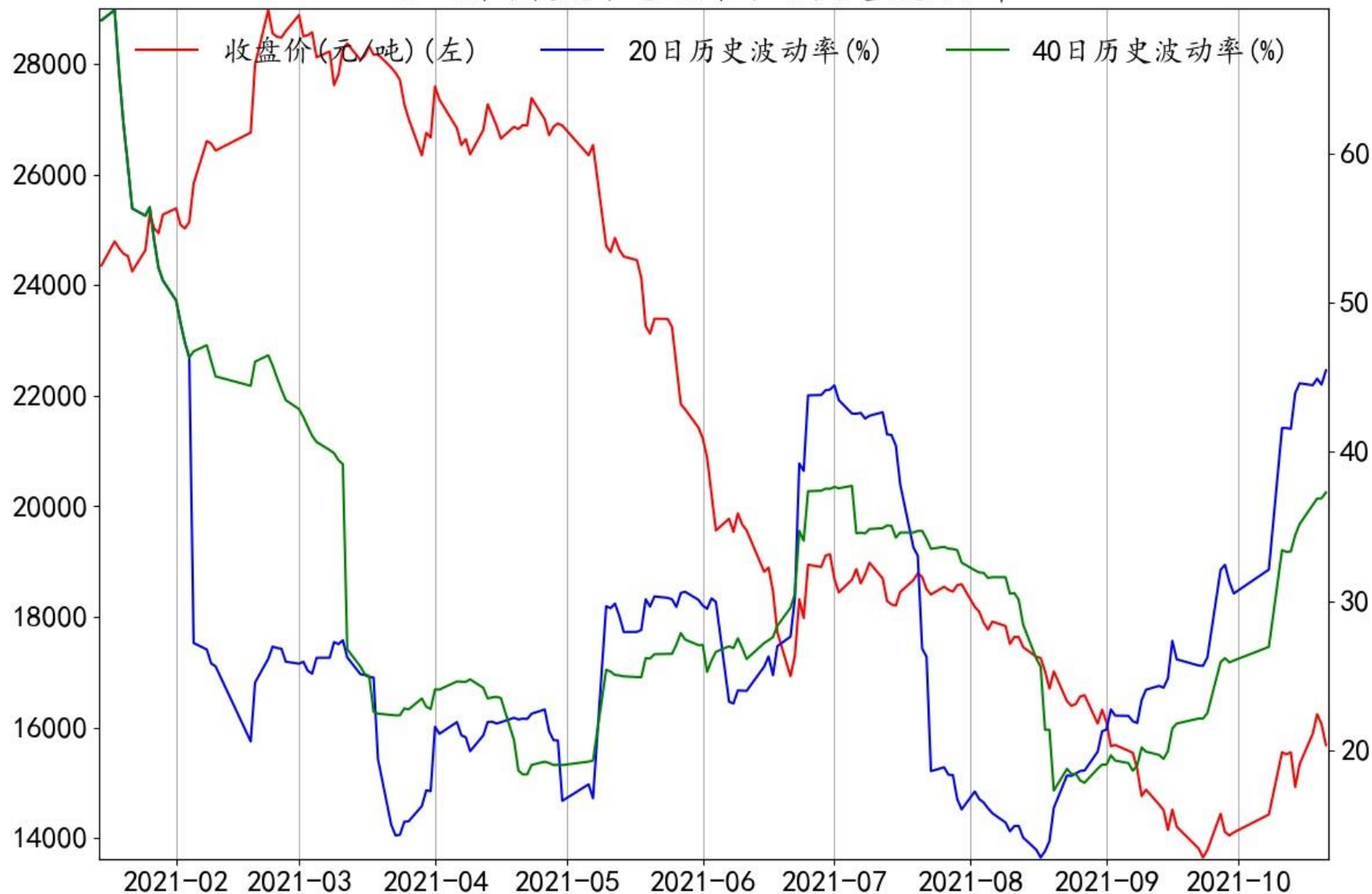
淀粉指数收盘价和历史波动率



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

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