

商品期货波动率跟踪

2021年11月01日

20日历史波动率百分位高于90%:

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

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:

动煤、硅铁、焦煤、焦炭、锰硅

20日历史波动率绝对值后五:

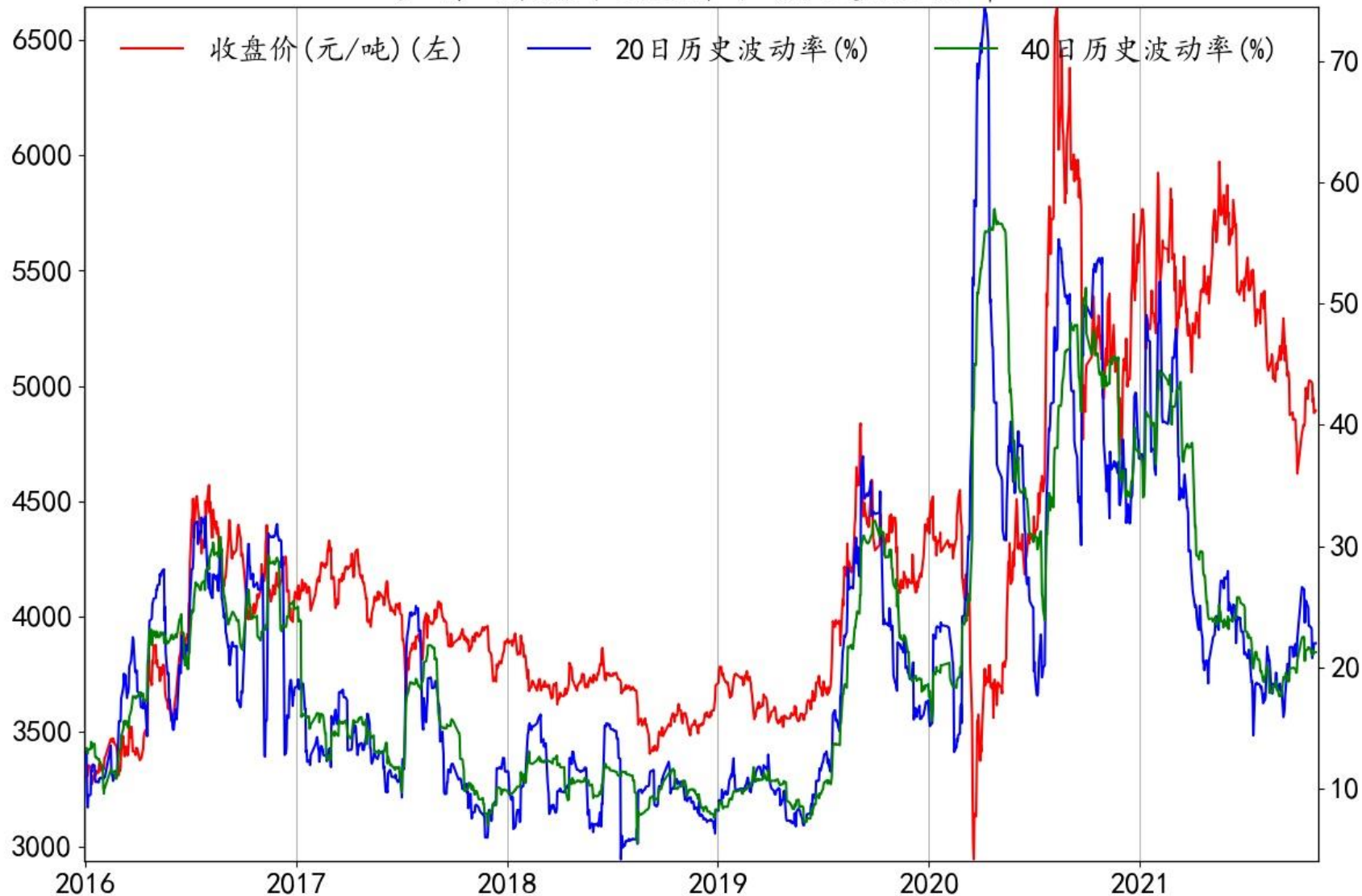
沪金、豆粕、玉米、郑糖、豆一

	时间百分位	绝对值
沪银	63.16%	21.98%
沪金	55.19%	11.27%
沪铝	99.93%	39.90%
沪铜	93.44%	25.52%
沪镍	86.87%	30.71%
沪铅	70.08%	19.42%
沪锡	97.53%	40.86%
沪锌	100.00%	49.90%
热卷	81.58%	33.31%
铁矿	96.75%	62.43%
焦炭	99.93%	86.69%
焦煤	100.00%	90.48%
螺纹	89.56%	40.02%

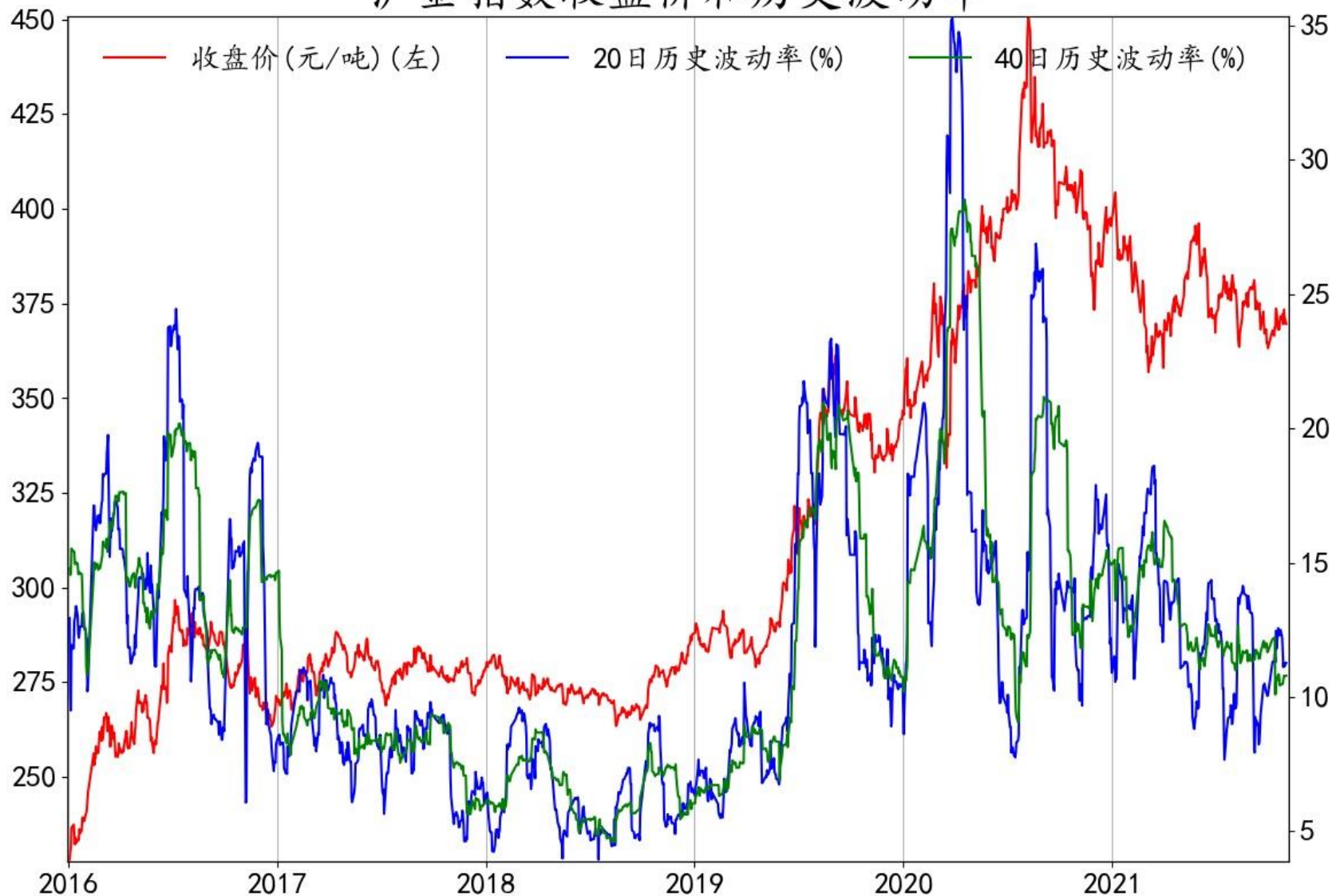
	时间百分位	绝对值
硅铁	99.65%	96.76%
锰硅	99.08%	80.37%
不锈钢	87.75%	29.72%
玻璃	100.00%	48.16%
PVC	99.51%	64.22%
燃油	86.45%	43.48%
低硫燃油	45.77%	28.50%
LPG	99.13%	50.98%
原油	56.54%	30.80%
动煤	99.86%	114.70%
沥青	51.38%	27.63%
苯乙烯	84.55%	41.44%
乙二醇	99.86%	76.37%

	时间百分位	绝对值		时间百分位	绝对值
塑料	96.82%	33.25%	菜油	93.37%	25.30%
甲醇	99.79%	69.39%	棕榈	93.93%	34.78%
20号胶	63.98%	28.27%	花生	67.42%	20.69%
短纤	93.00%	41.79%	菜粕	68.31%	21.12%
PP	94.92%	33.11%	豆油	92.31%	26.49%
沪胶	61.54%	28.57%	郑棉	98.94%	42.37%
纯碱	97.39%	52.03%	郑糖	86.17%	16.59%
纸浆	82.38%	23.70%	苹果	99.46%	46.84%
TA	94.92%	34.63%	红枣	99.34%	62.36%
尿素	99.40%	68.62%	淀粉	97.67%	26.60%
玉米	90.33%	16.53%	鸡蛋	70.71%	22.34%
豆一	71.56%	18.69%	生猪	90.53%	44.83%
豆粕	40.01%	14.84%			

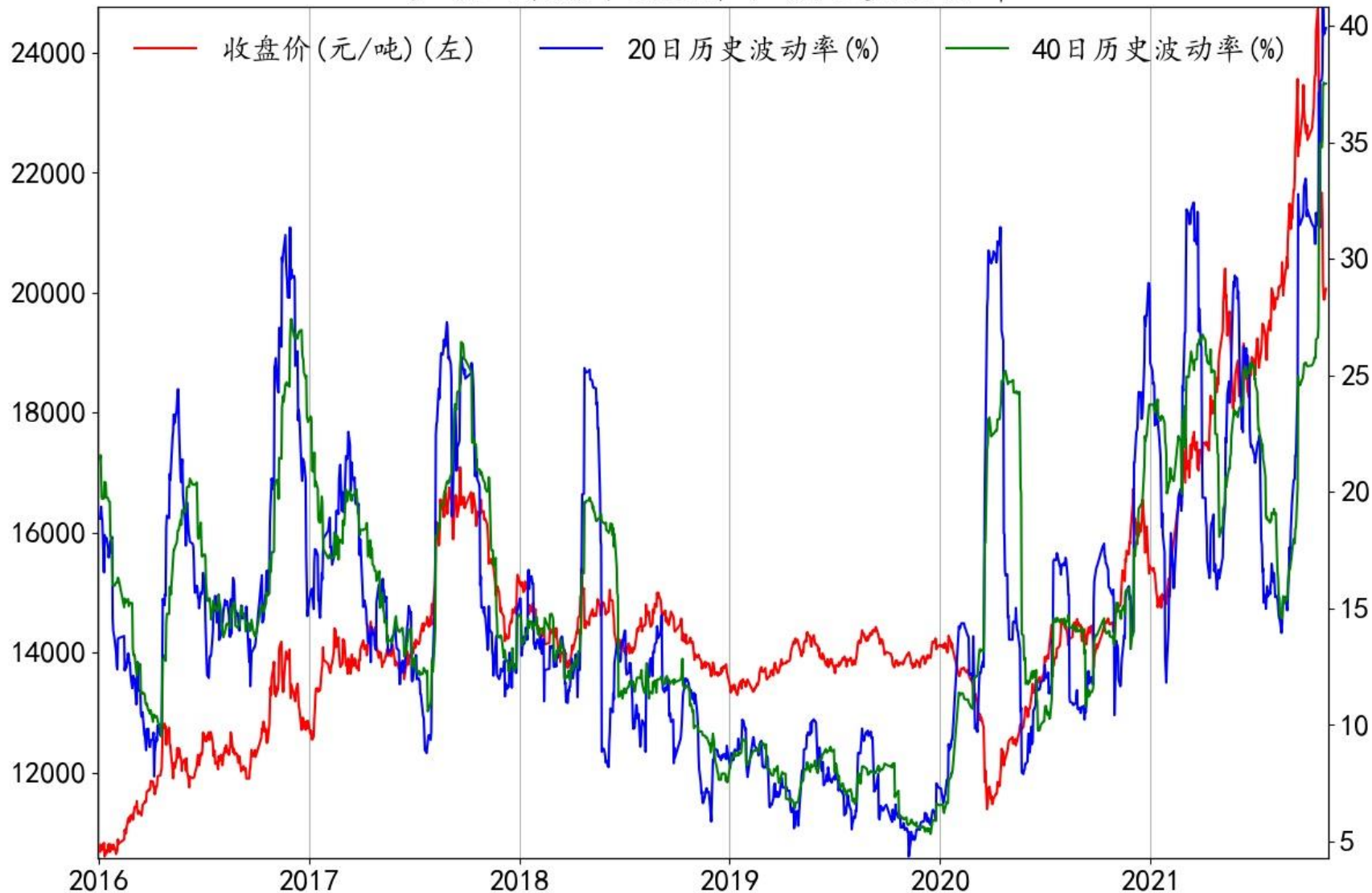
沪银指数收盘价和历史波动率



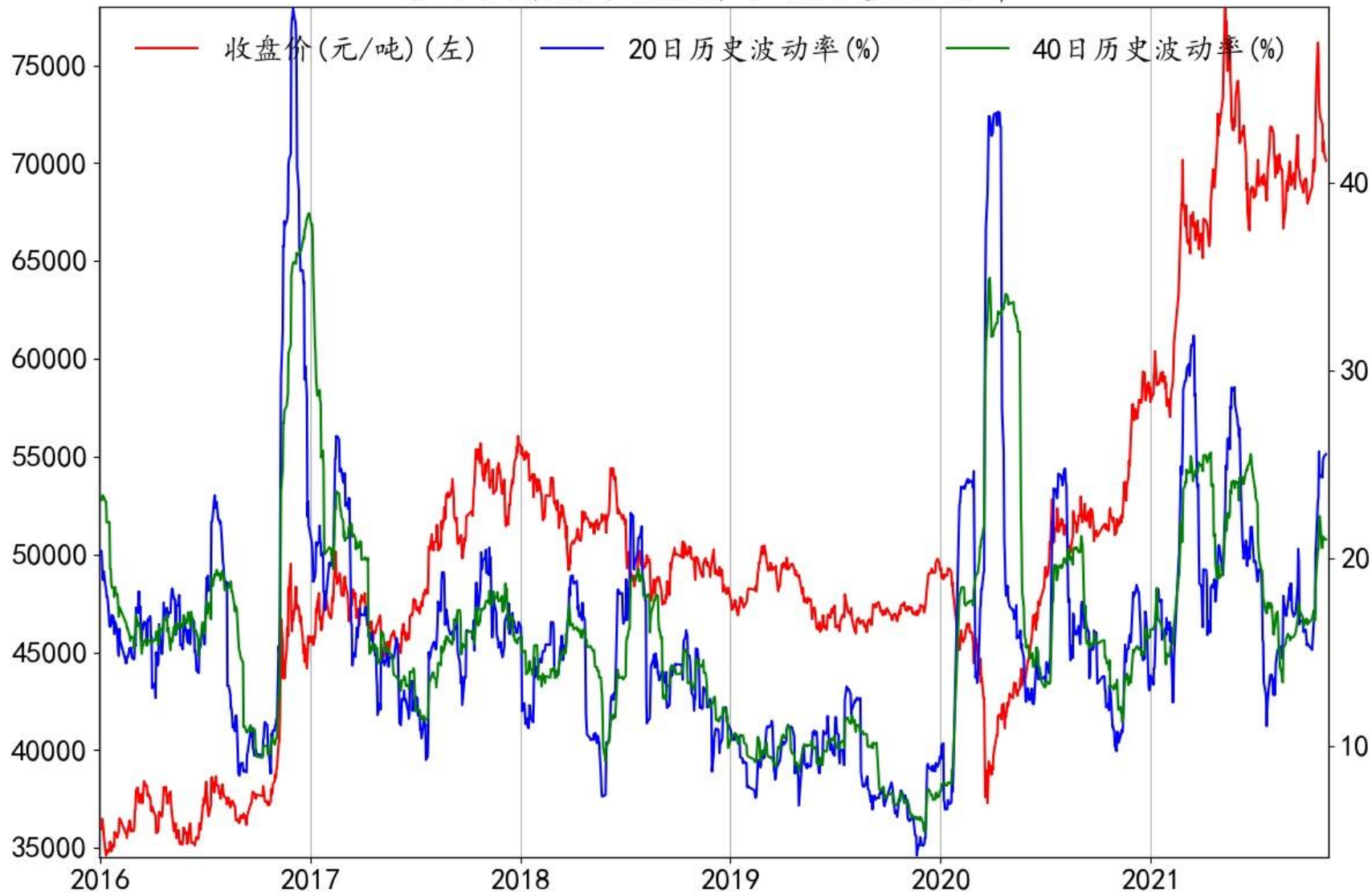
沪金指数收盘价和历史波动率



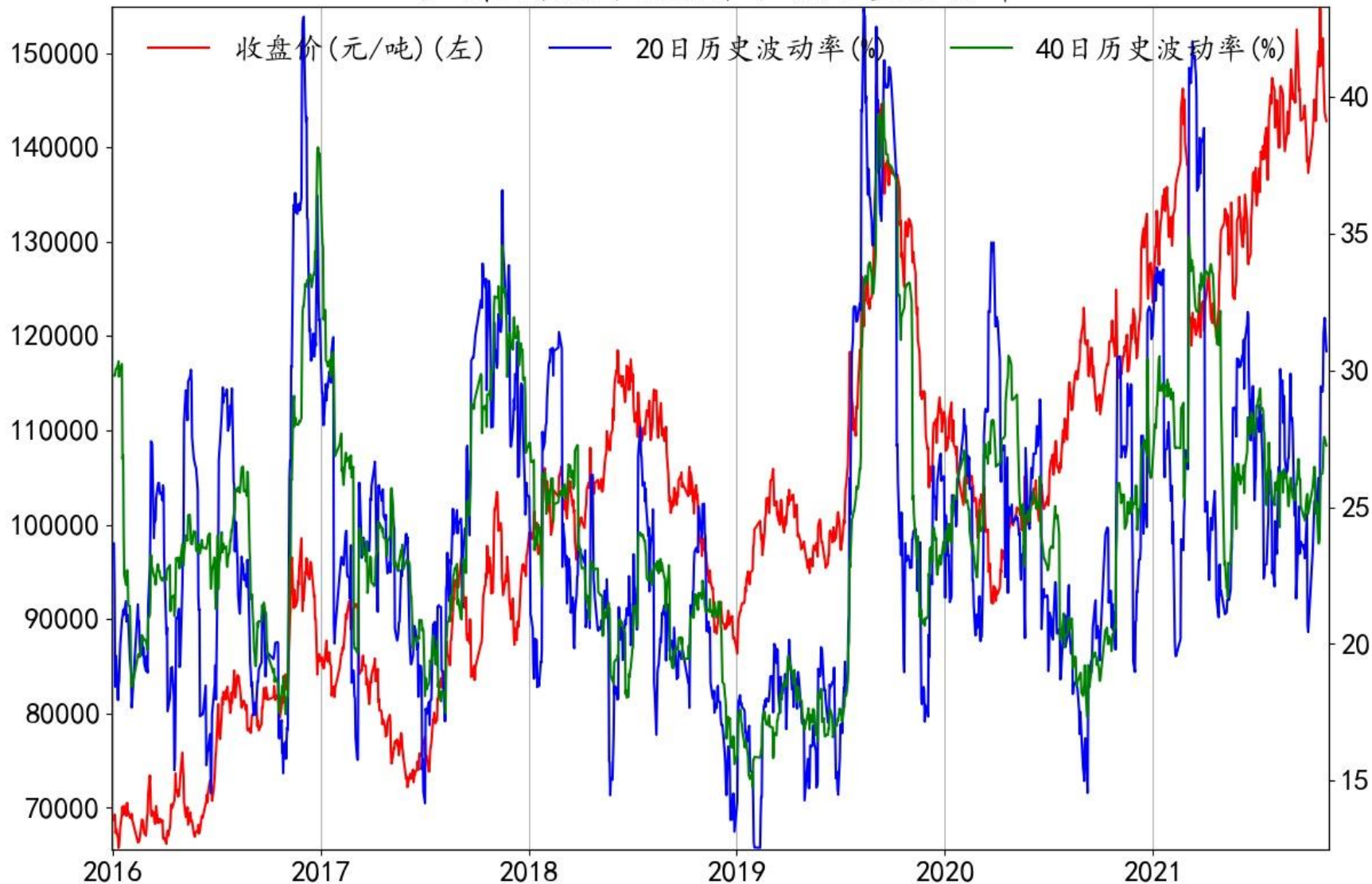
沪铝指数收盘价和历史波动率



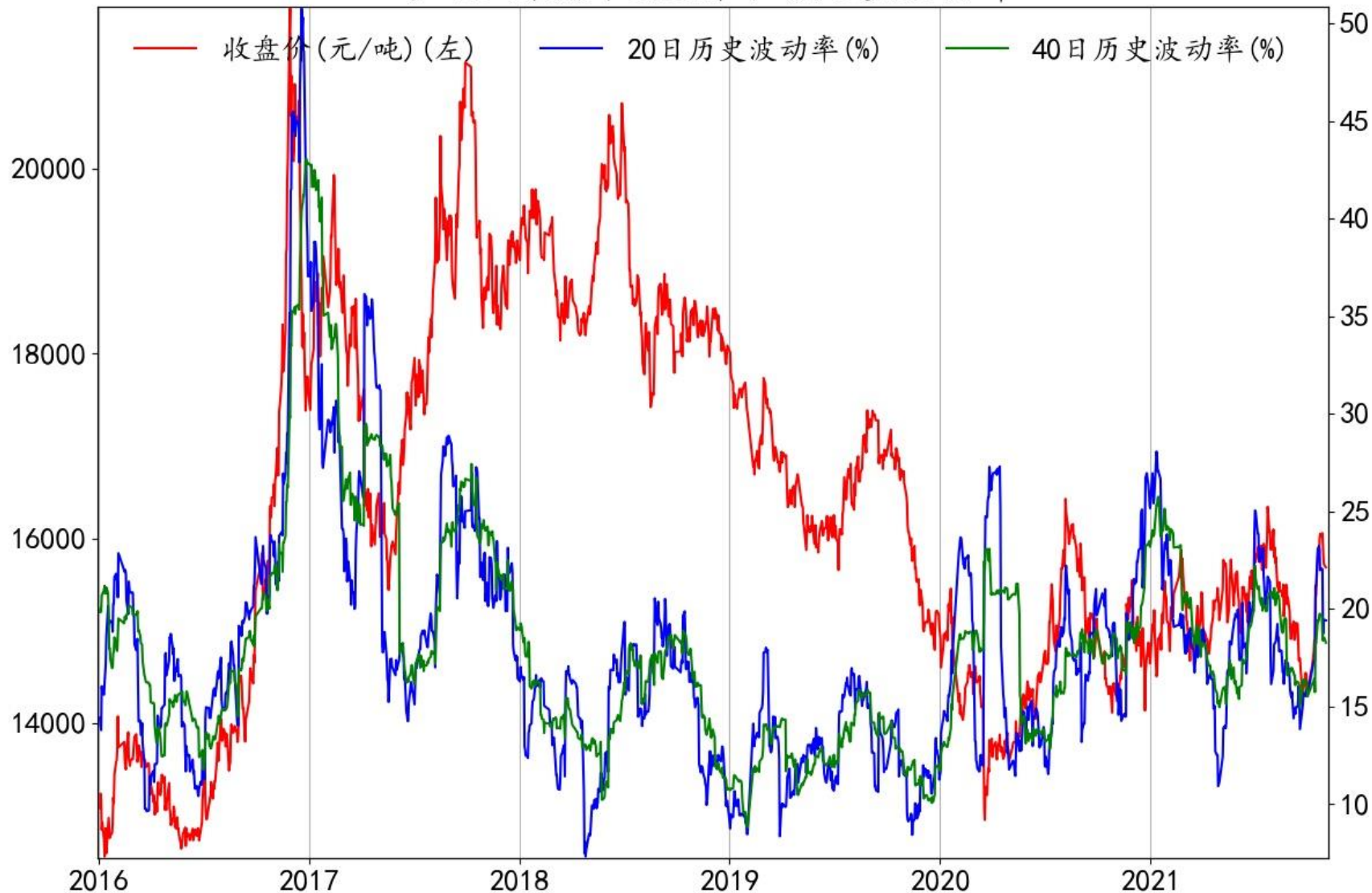
沪铜指数收盘价和历史波动率



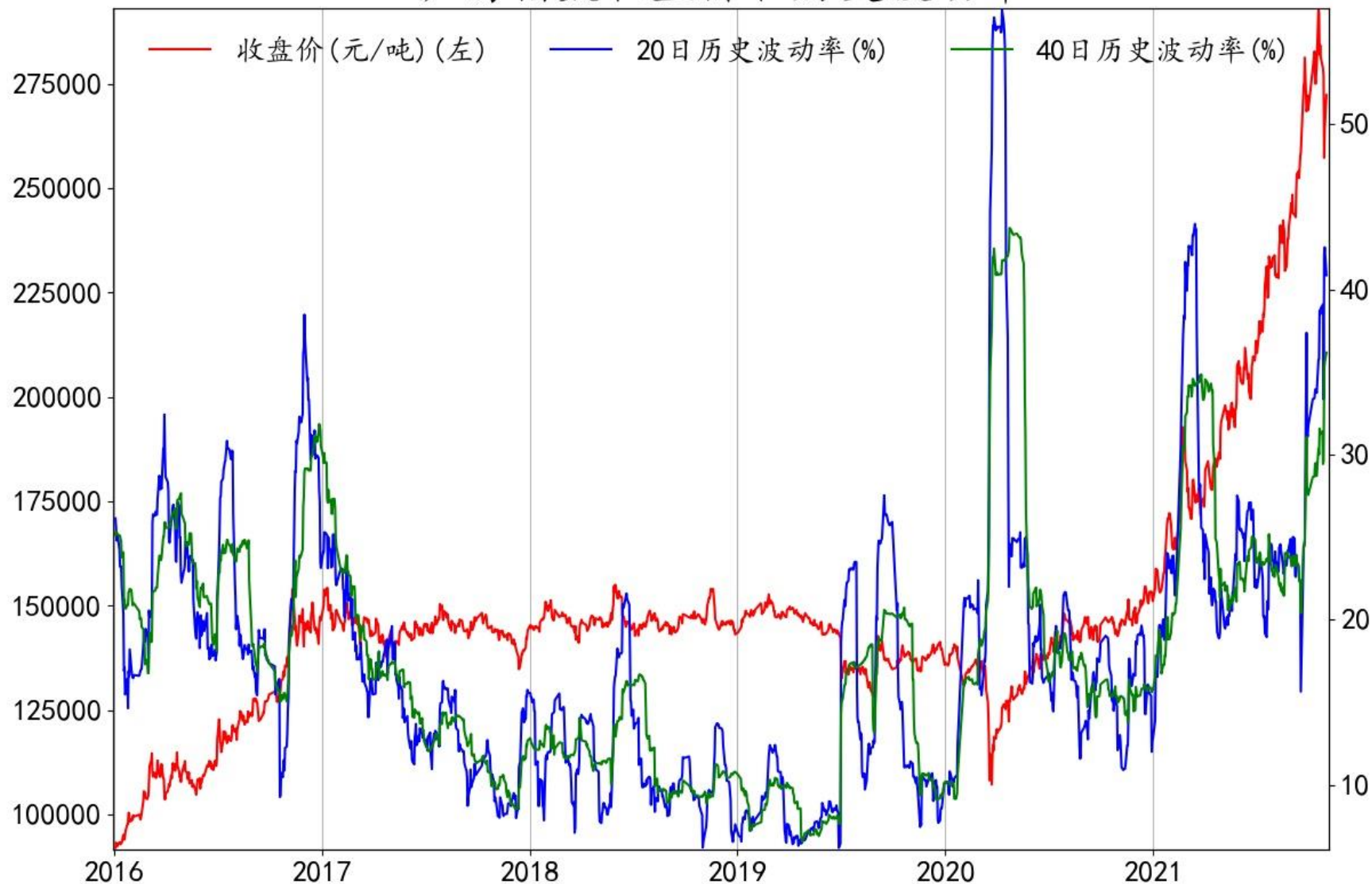
沪镍指数收盘价和历史波动率



沪铅指数收盘价和历史波动率



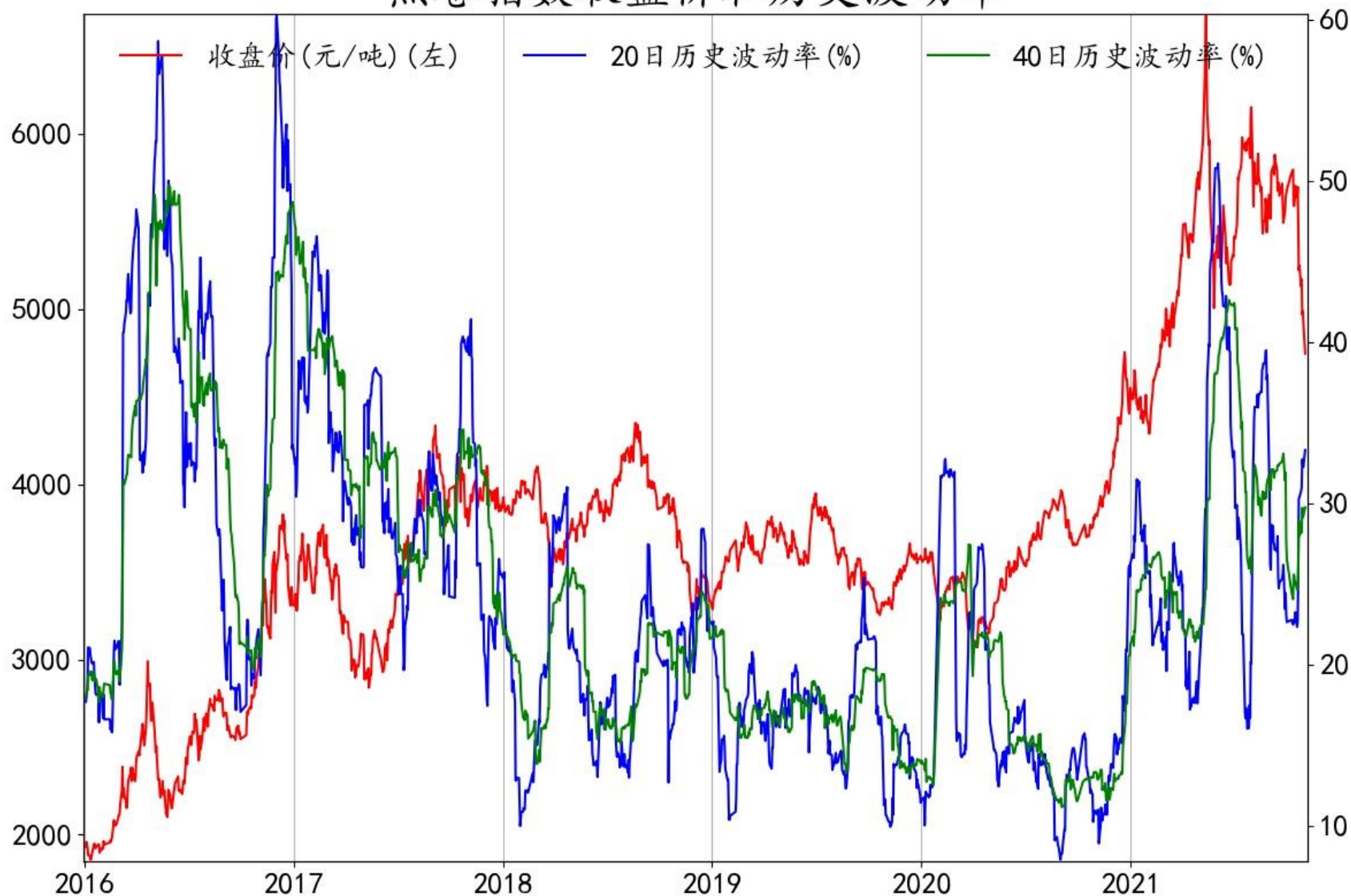
沪锡指数收盘价和历史波动率



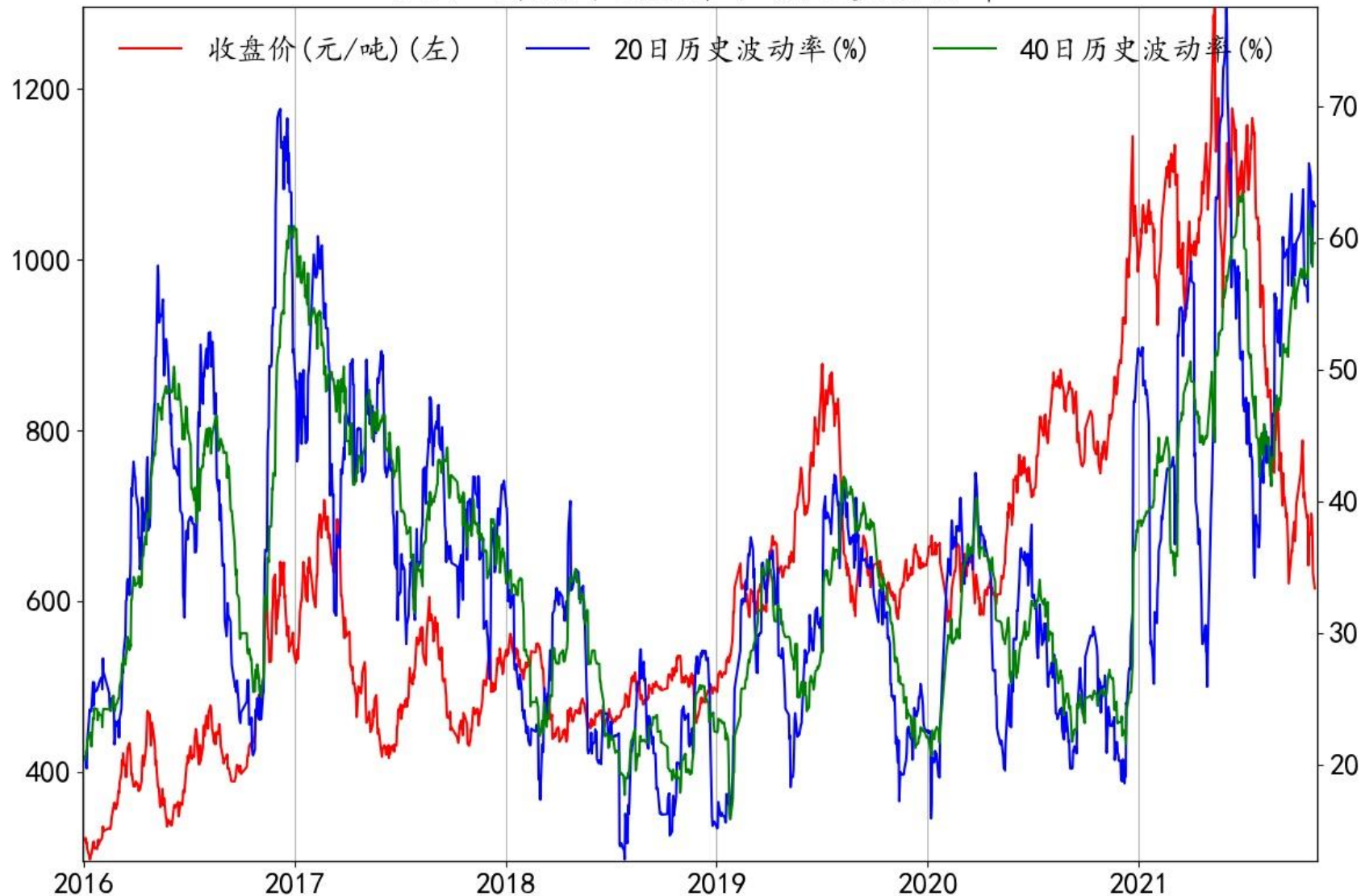
沪锌指数收盘价和历史波动率



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



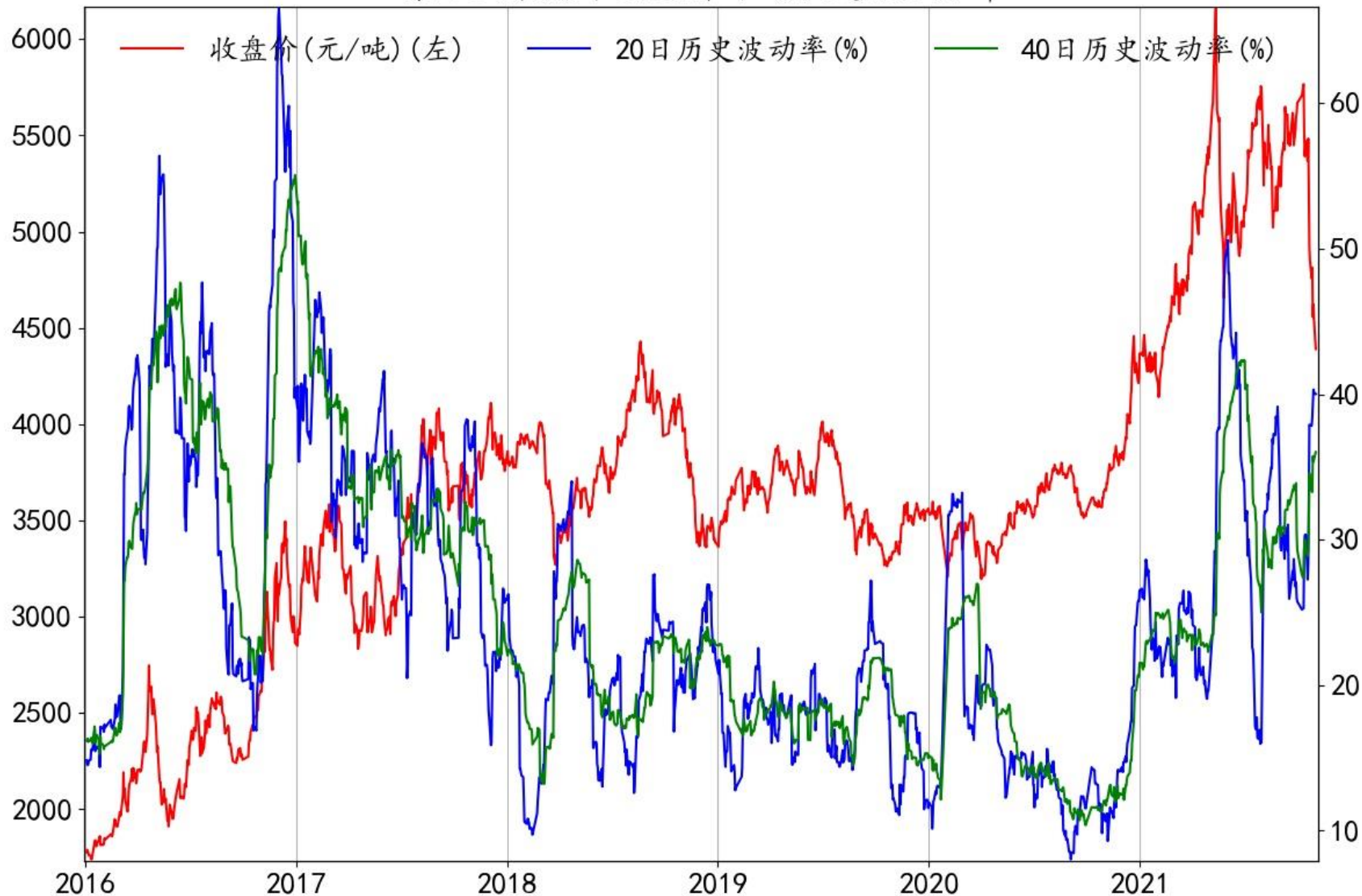
焦炭指数收盘价和历史波动率



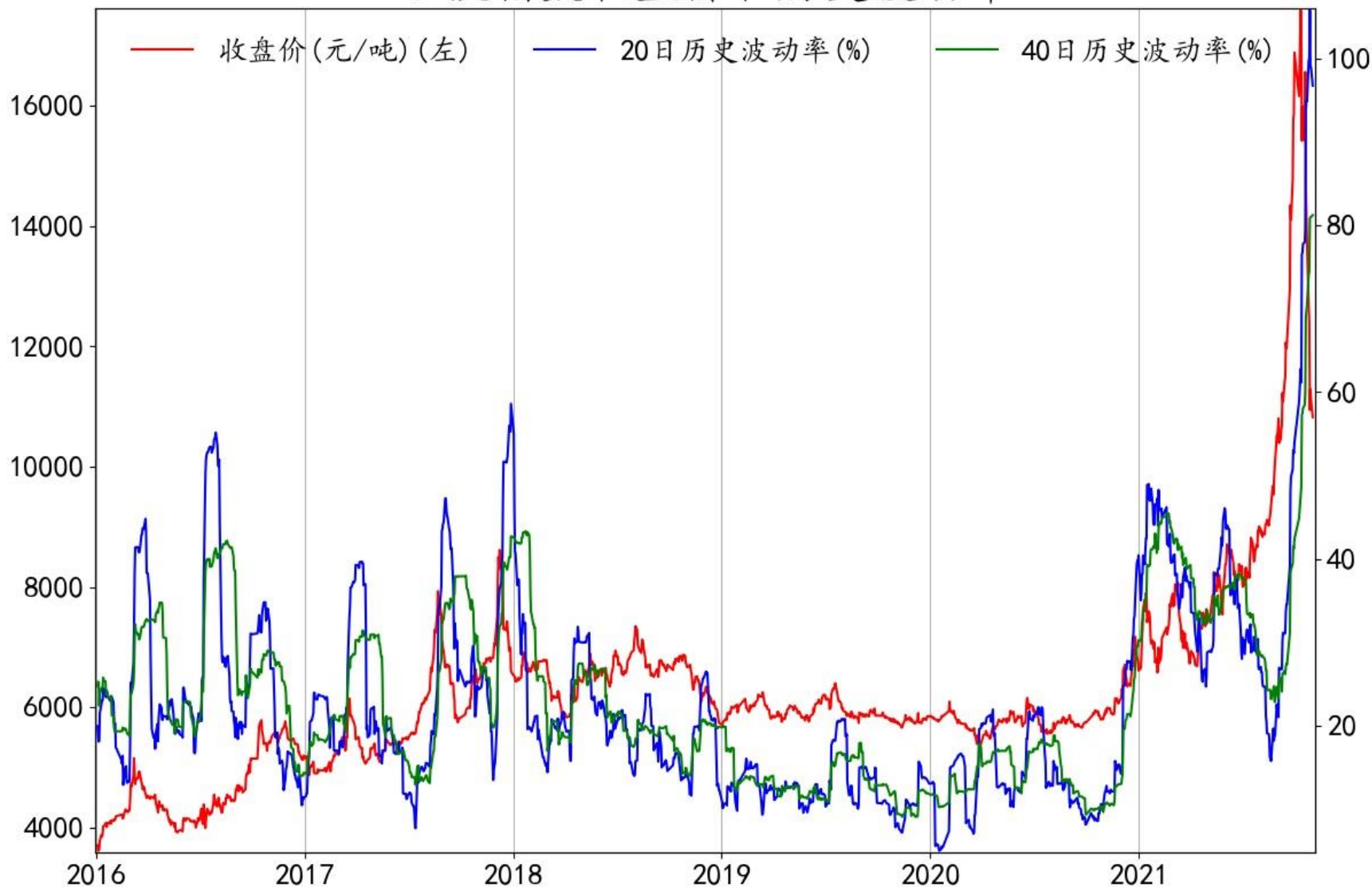
焦煤指数收盘价和历史波动率



螺纹指数收盘价和历史波动率



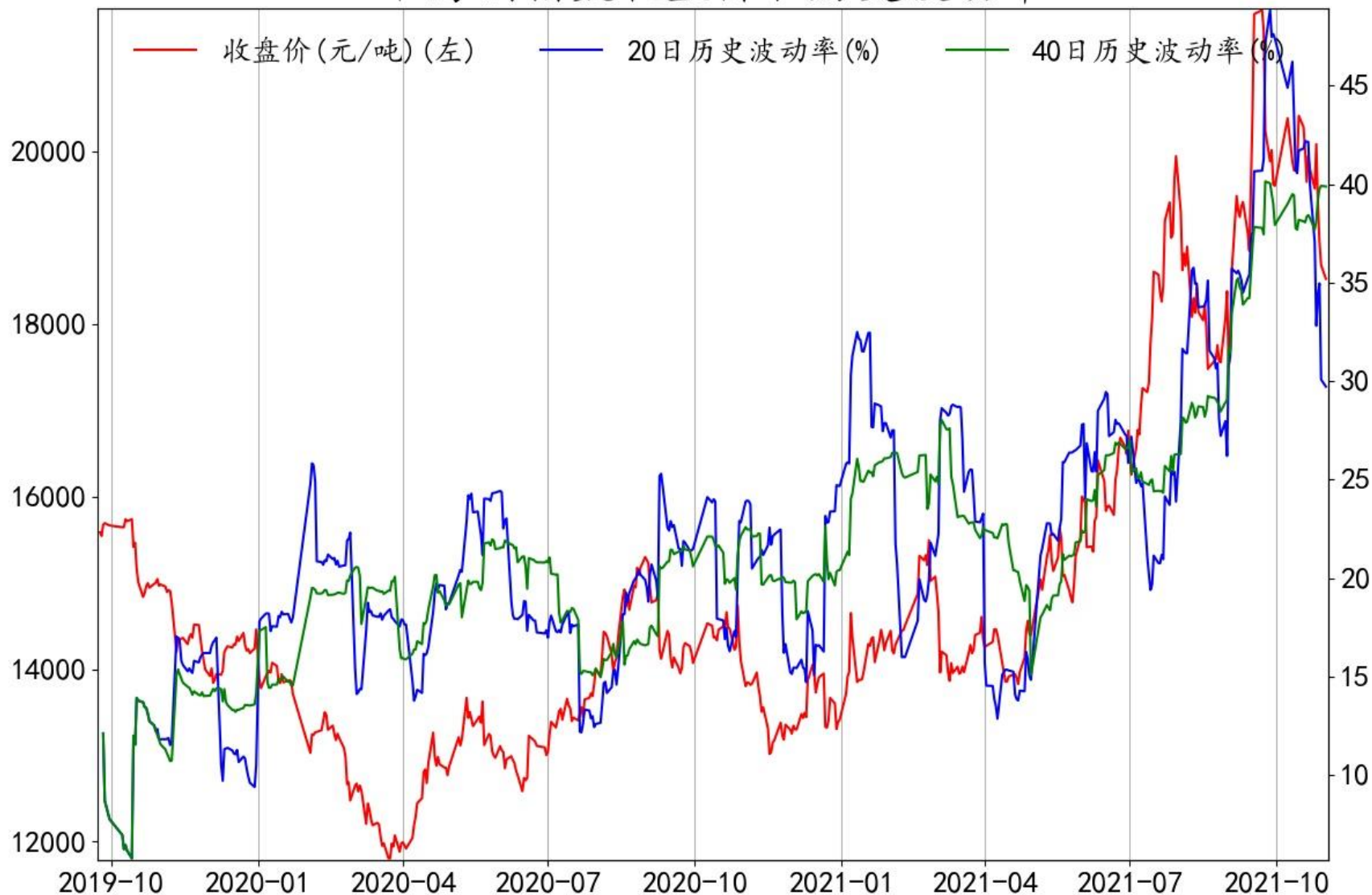
硅铁指数收盘价和历史波动率



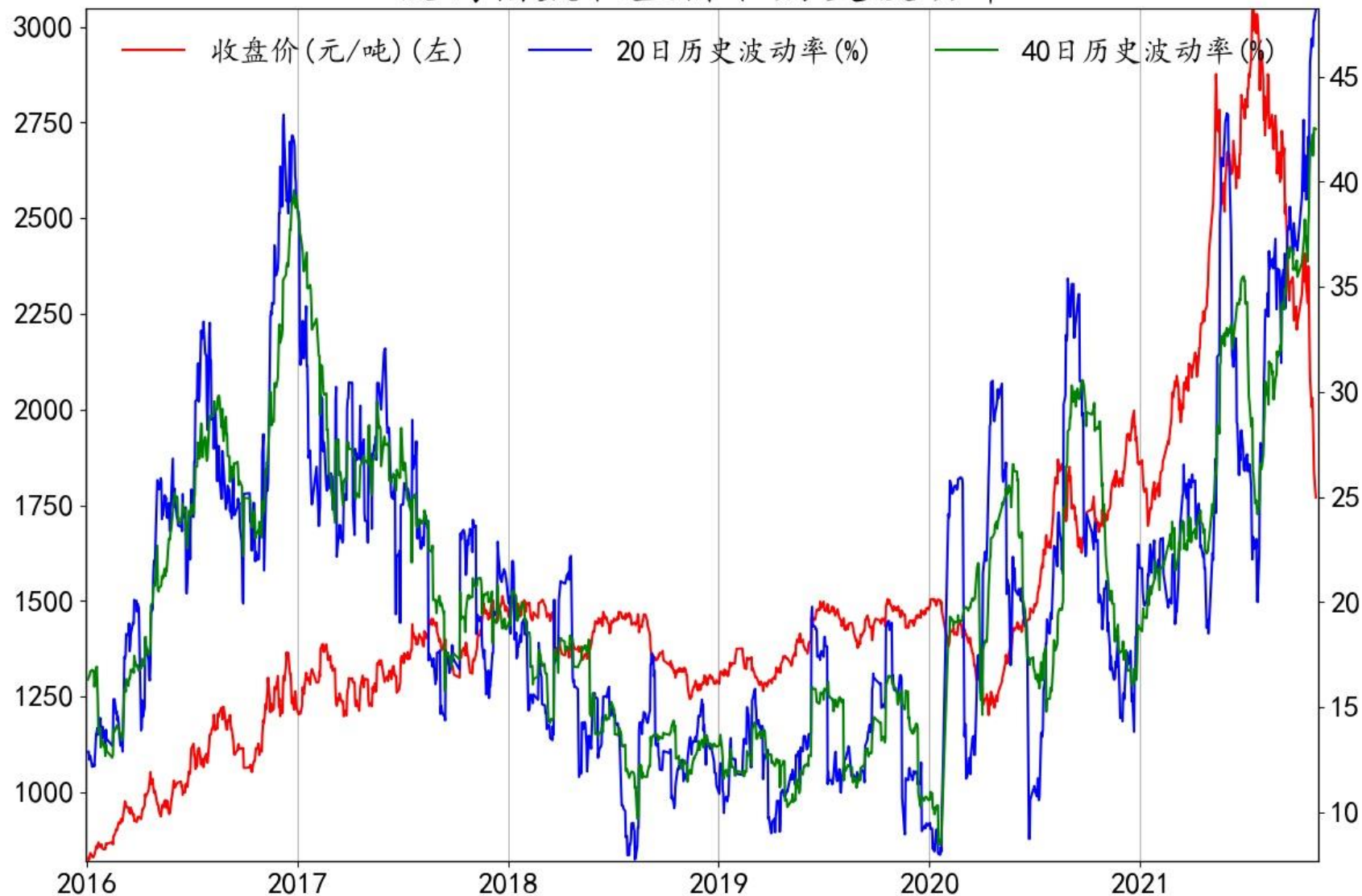
锰硅指数收盘价和历史波动率



不锈钢指数收盘价和历史波动率



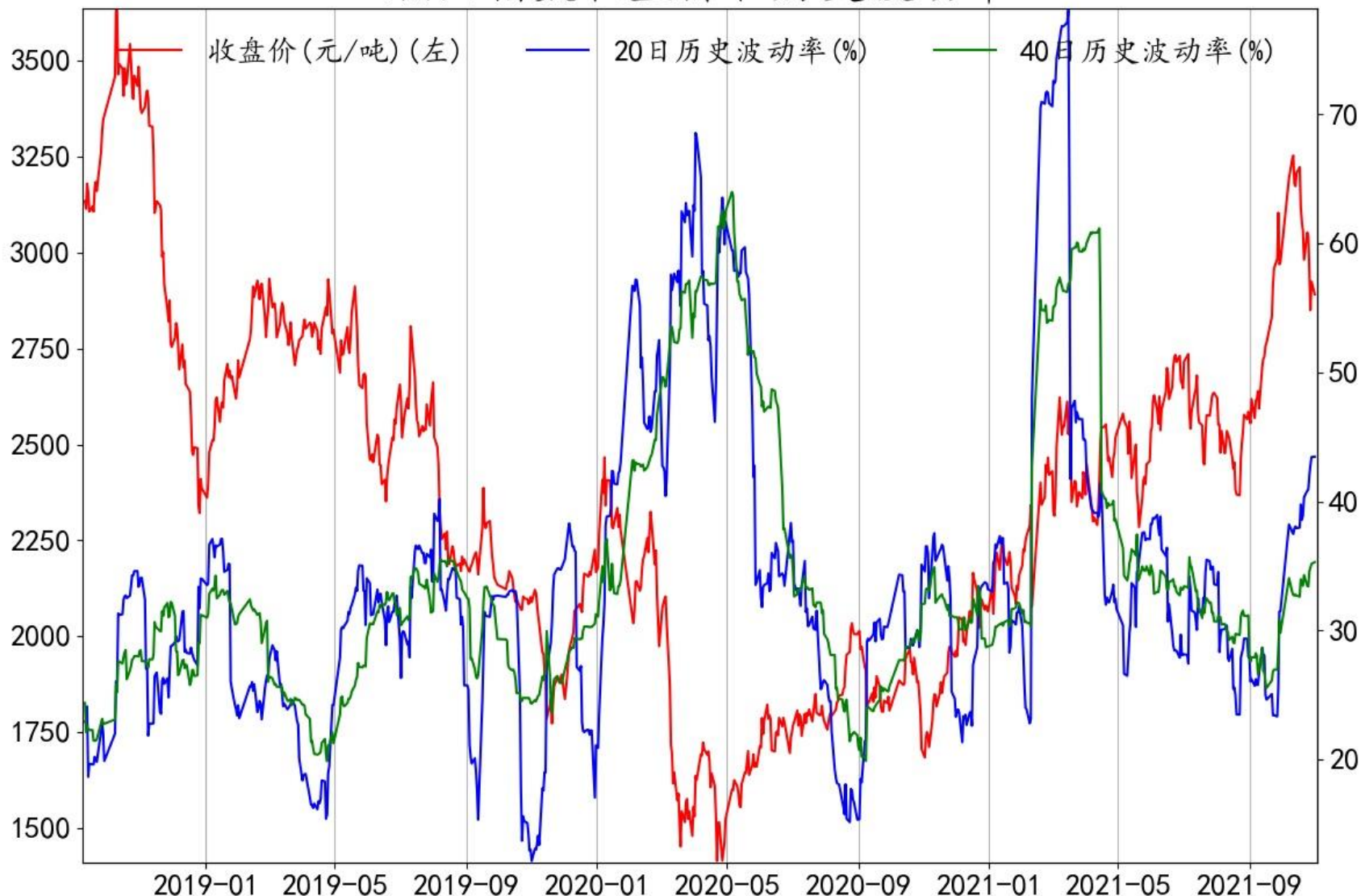
玻璃指数收盘价和历史波动率



PVC指数收盘价和历史波动率



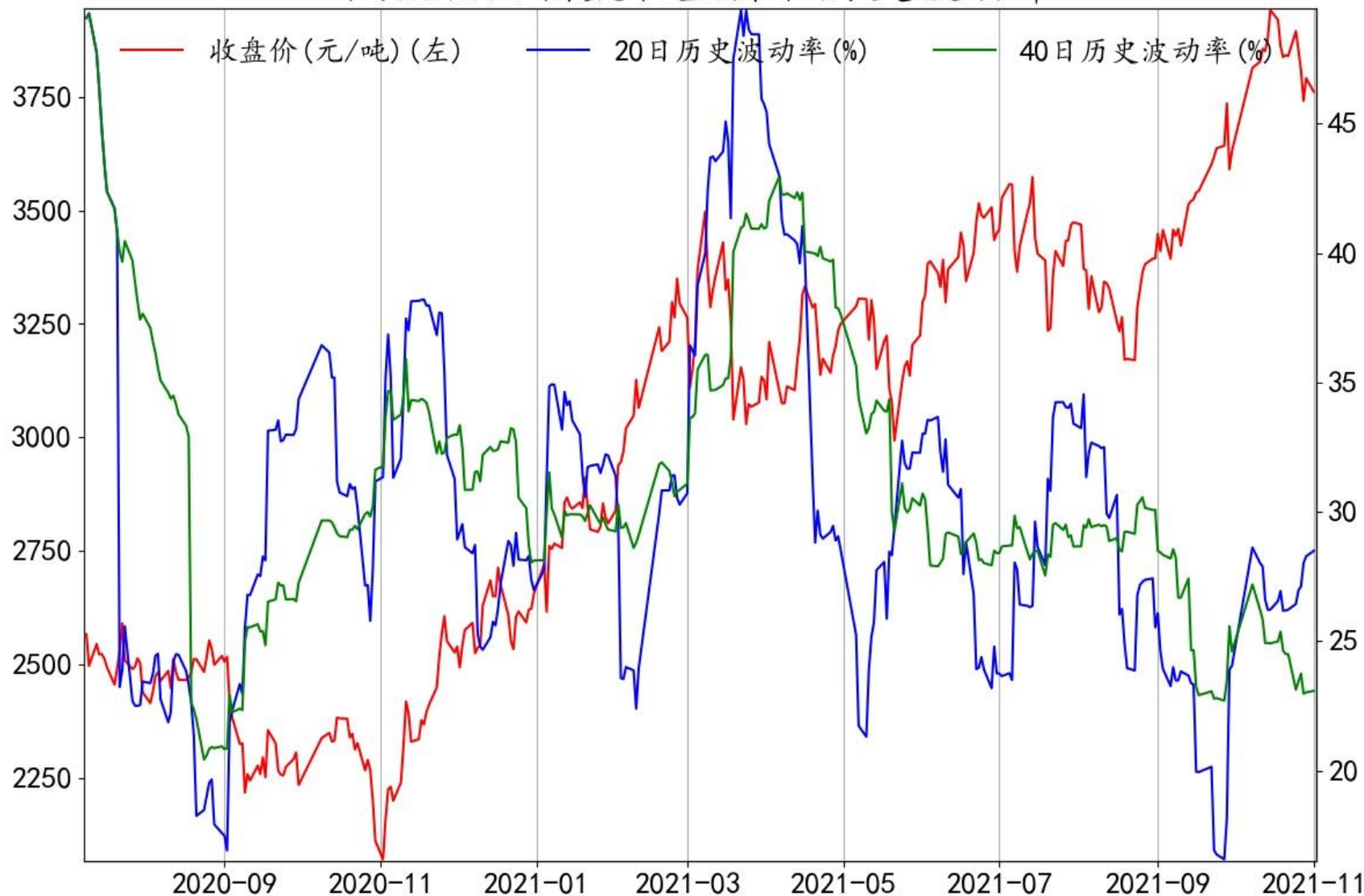
燃油指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

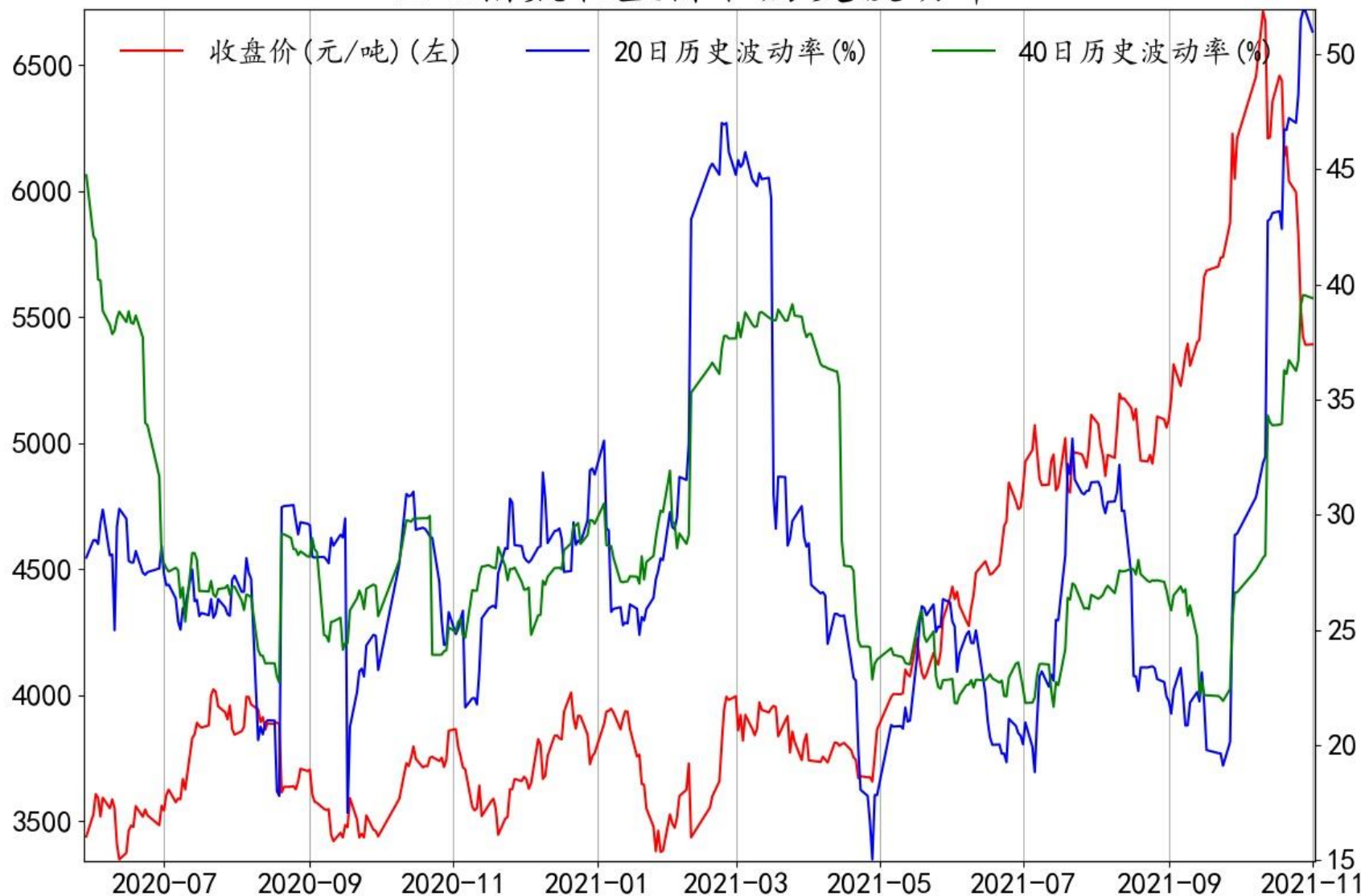
低硫燃油指数

低硫燃油指数收盘价和历史波动率



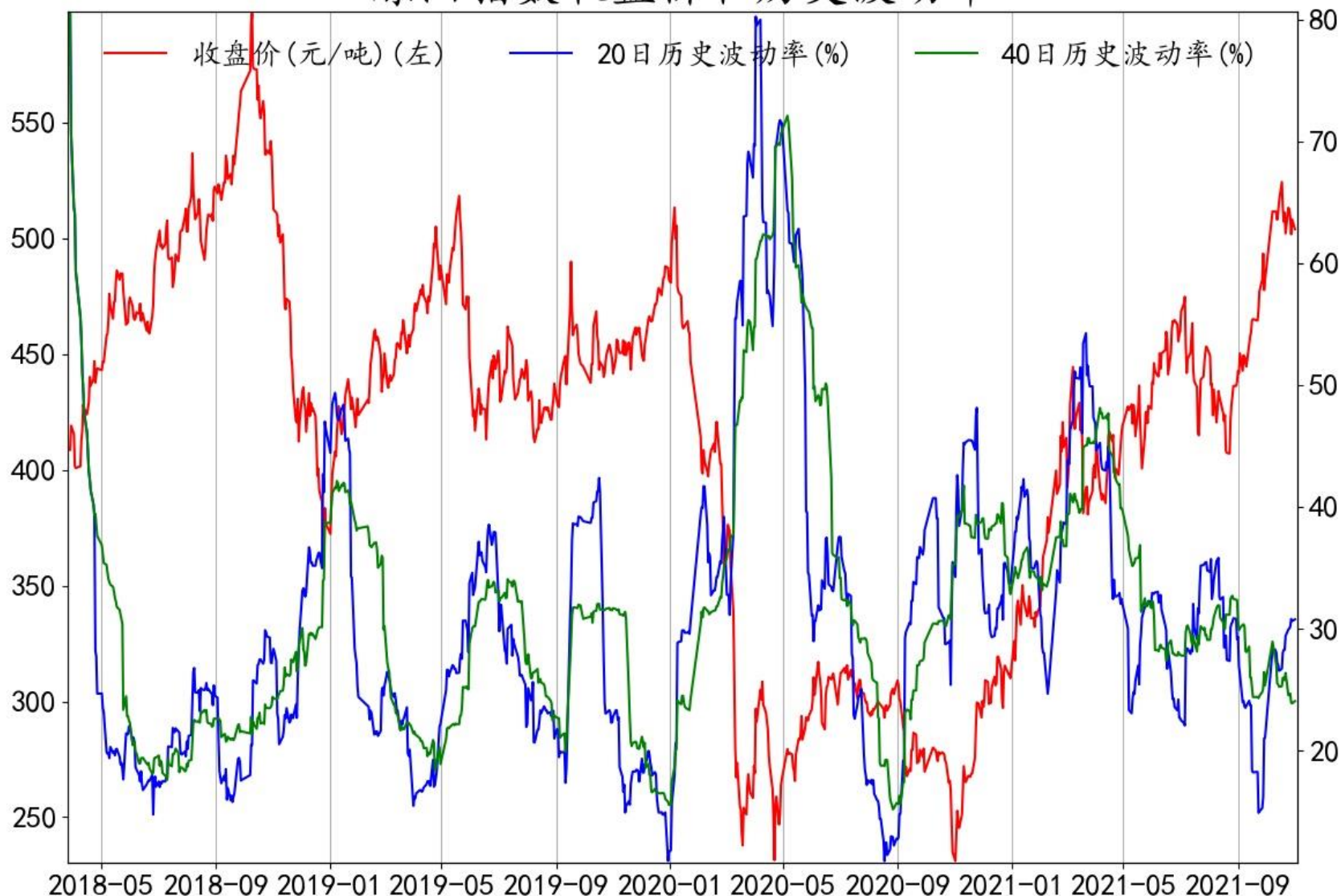
数据来源: Wind、信达期货研发中心

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



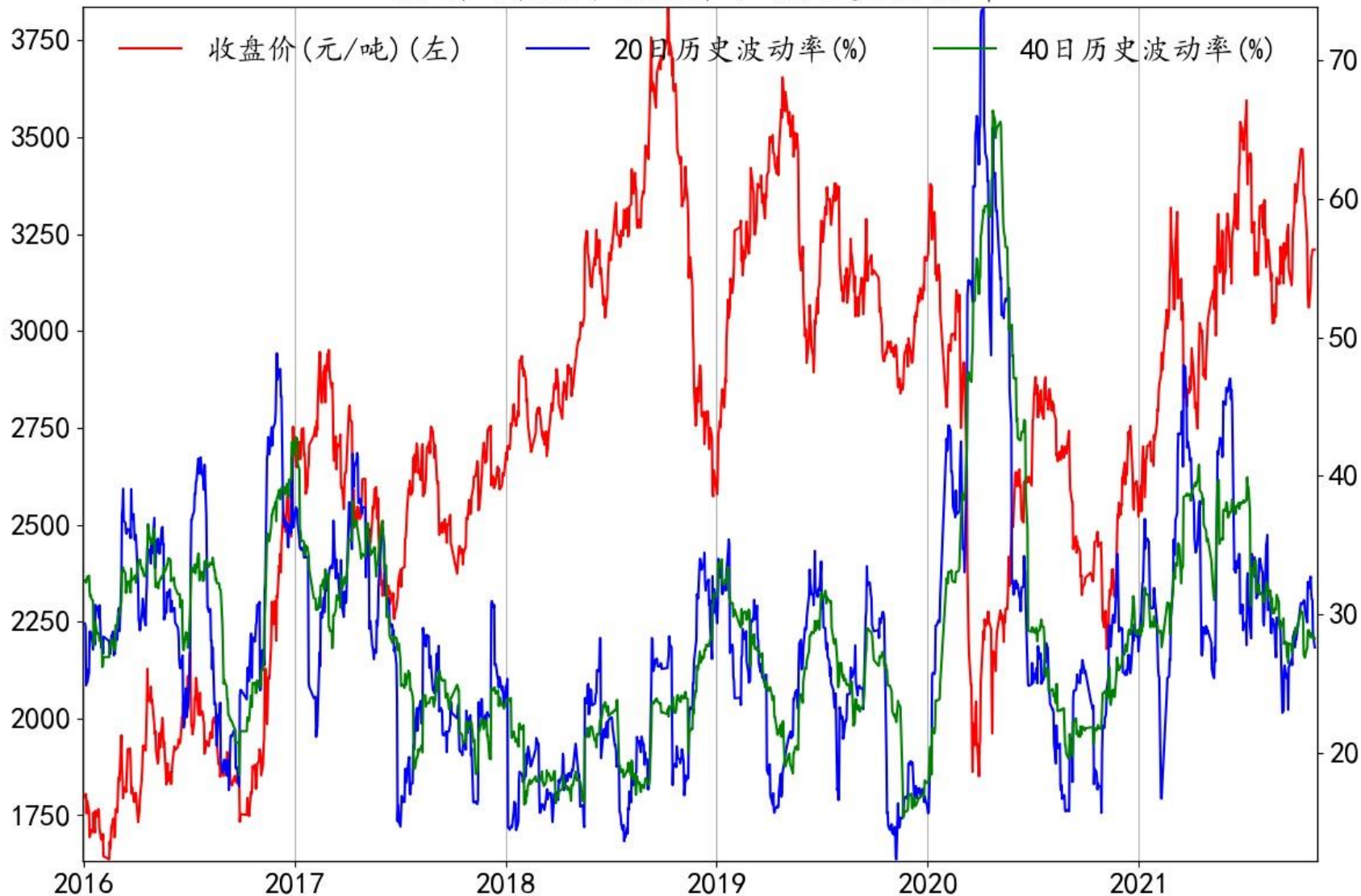
数据来源: Wind、信达期货研发中心

动煤指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

沥青指数收盘价和历史波动率

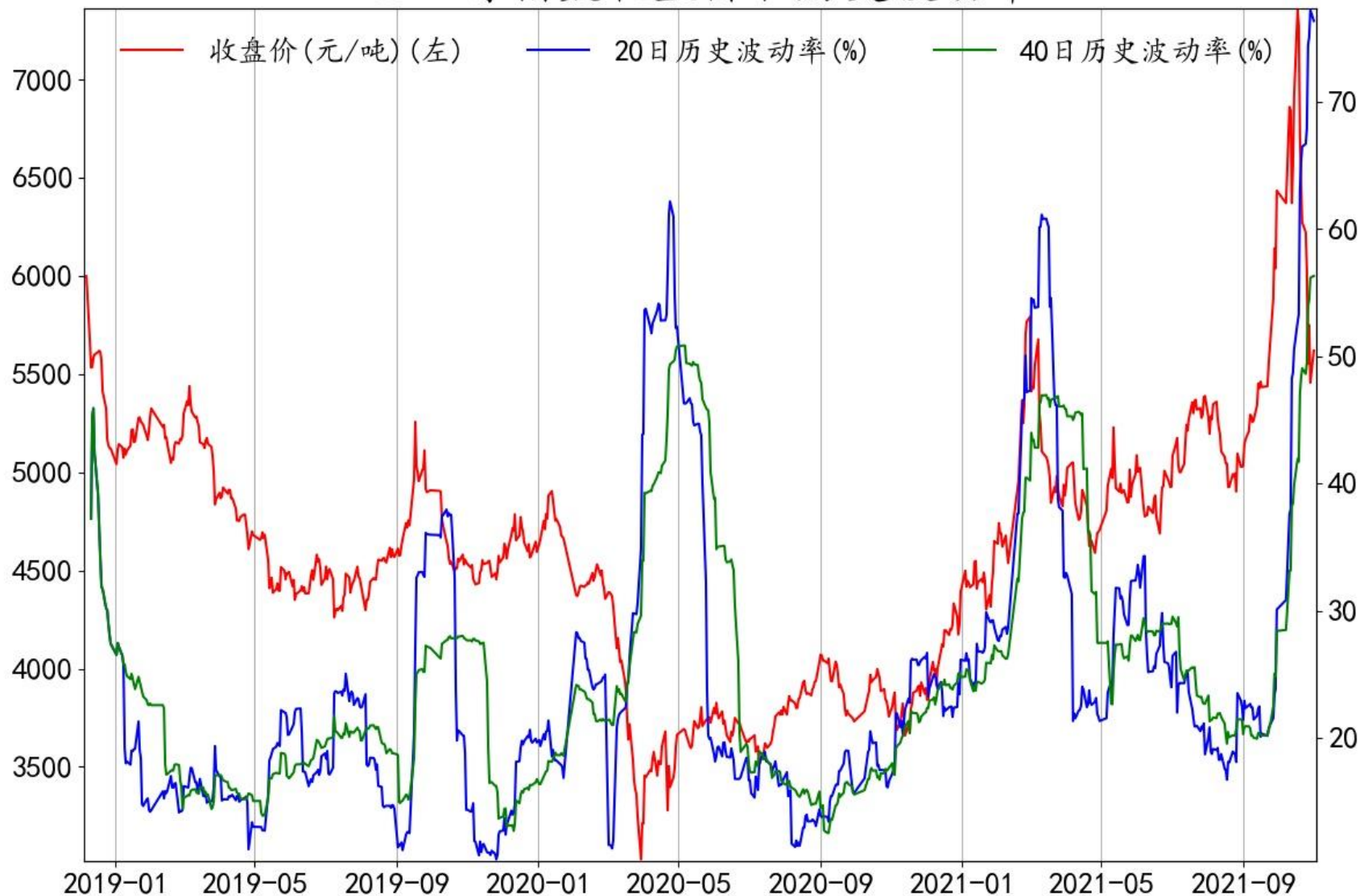


苯乙烯指数收盘价和历史波动率



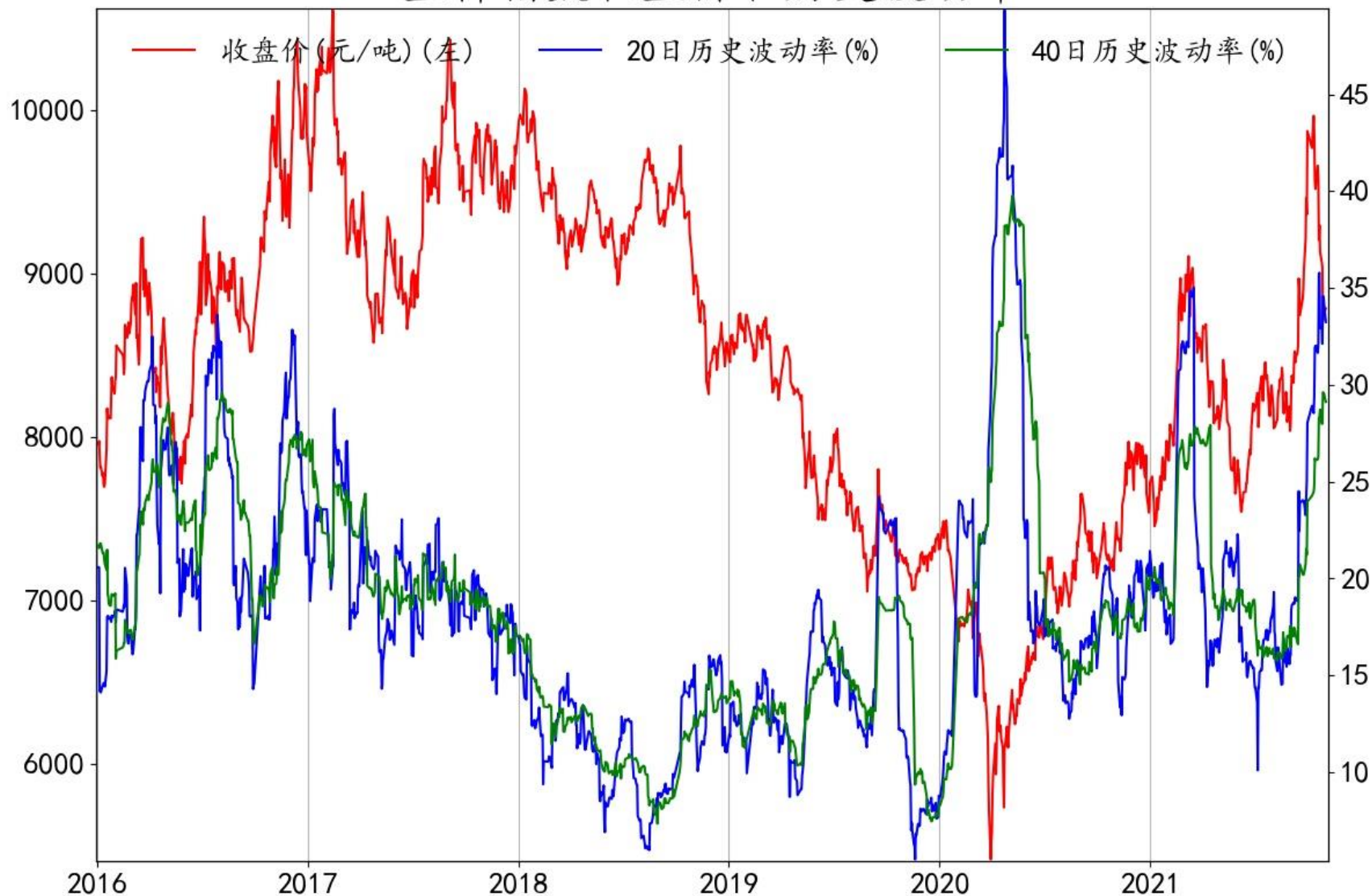
数据来源: Wind、信达期货研发中心

乙二醇指数收盘价和历史波动率

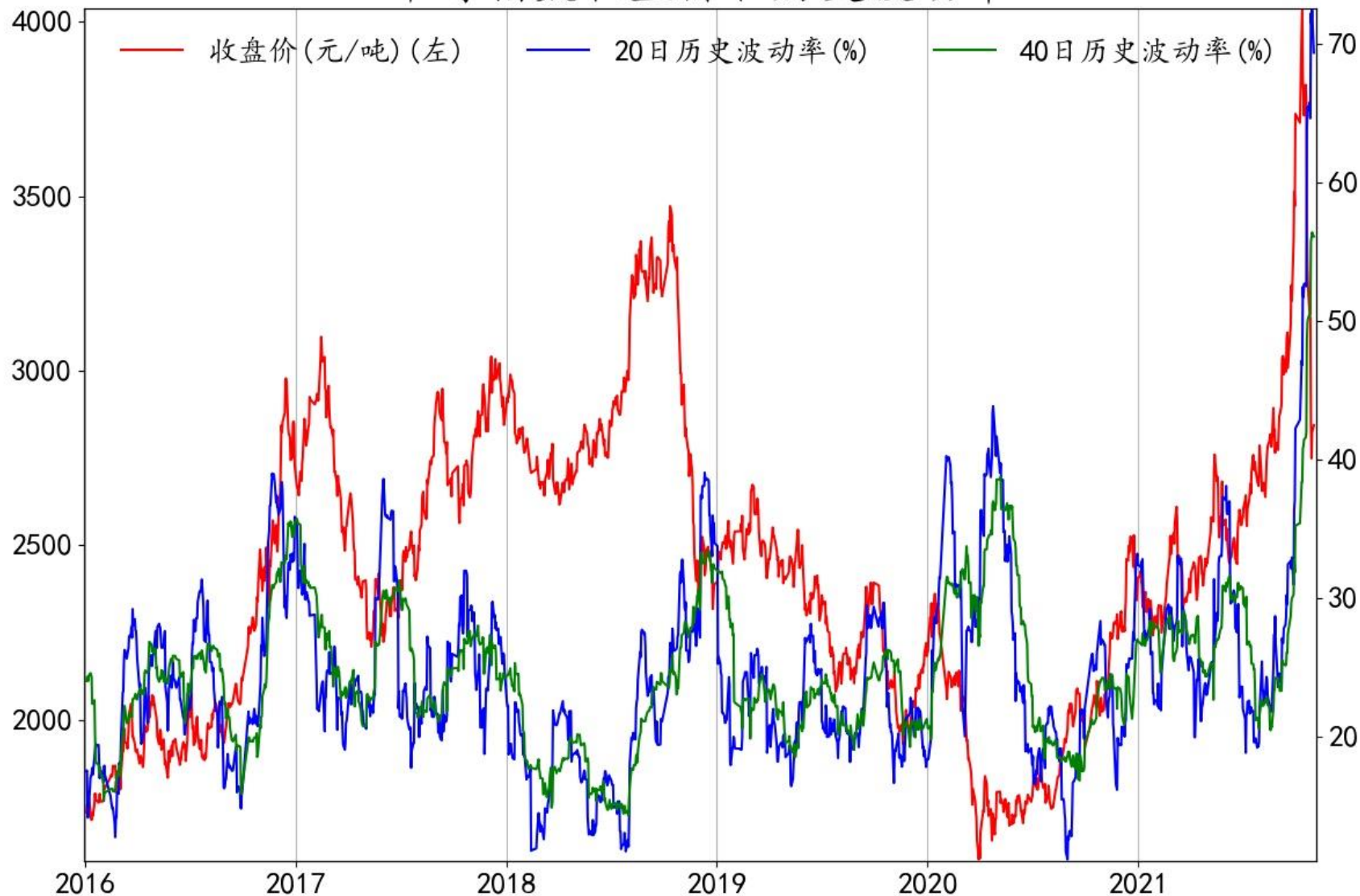


数据来源: Wind、信达期货研发中心

塑料指数收盘价和历史波动率

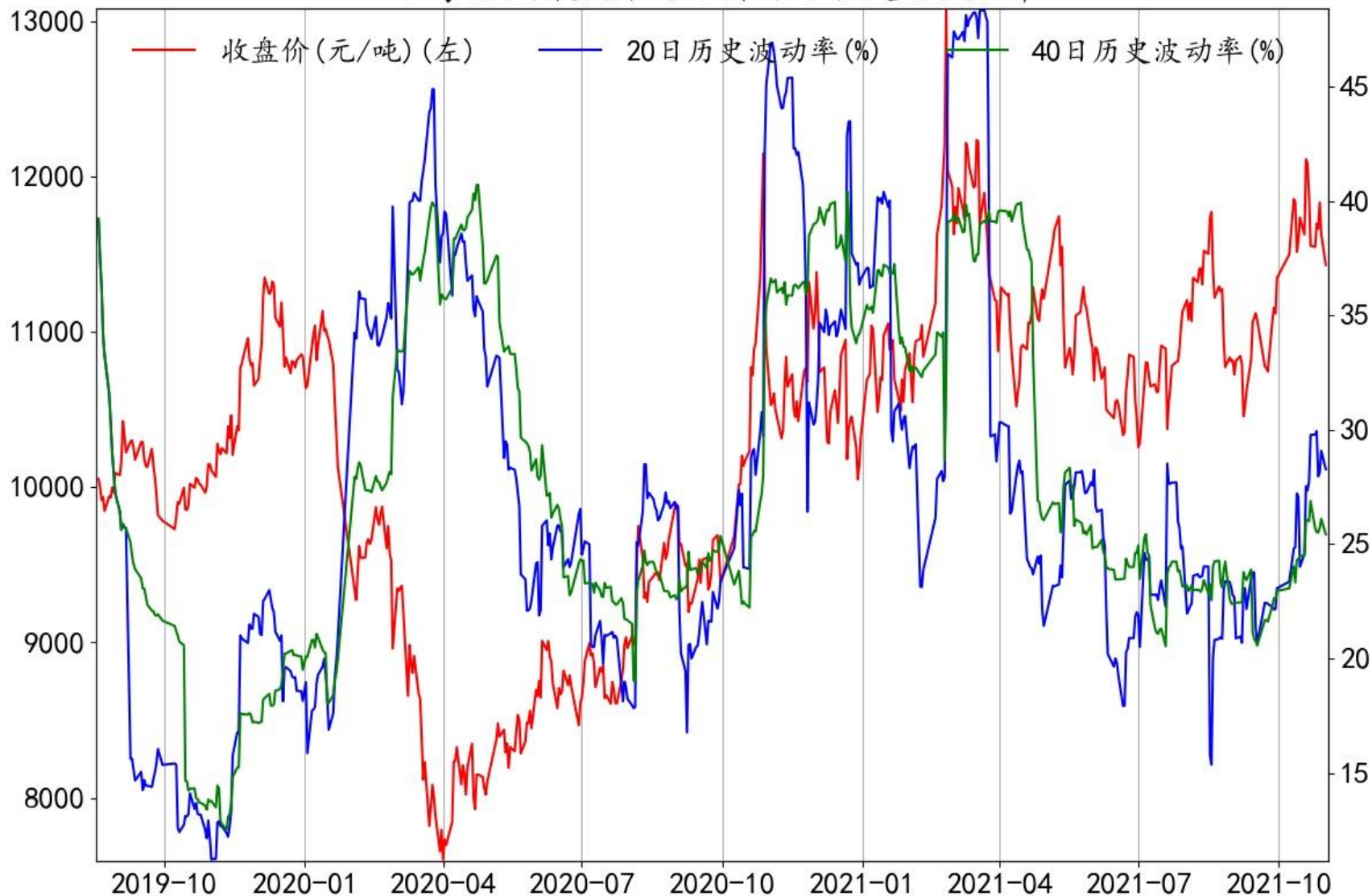


甲醇指数收盘价和历史波动率



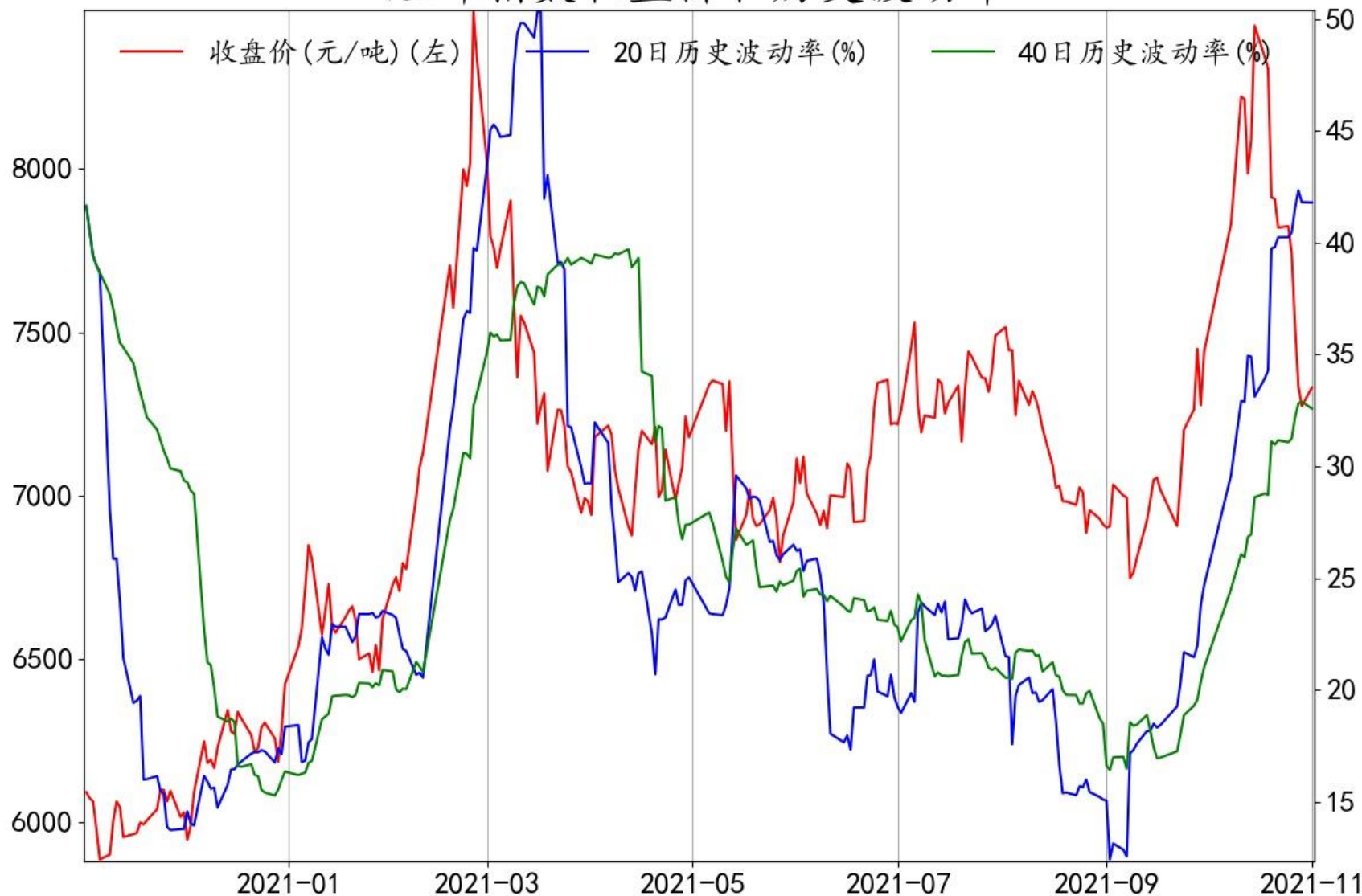
20号胶指数

20号胶指数收盘价和历史波动率

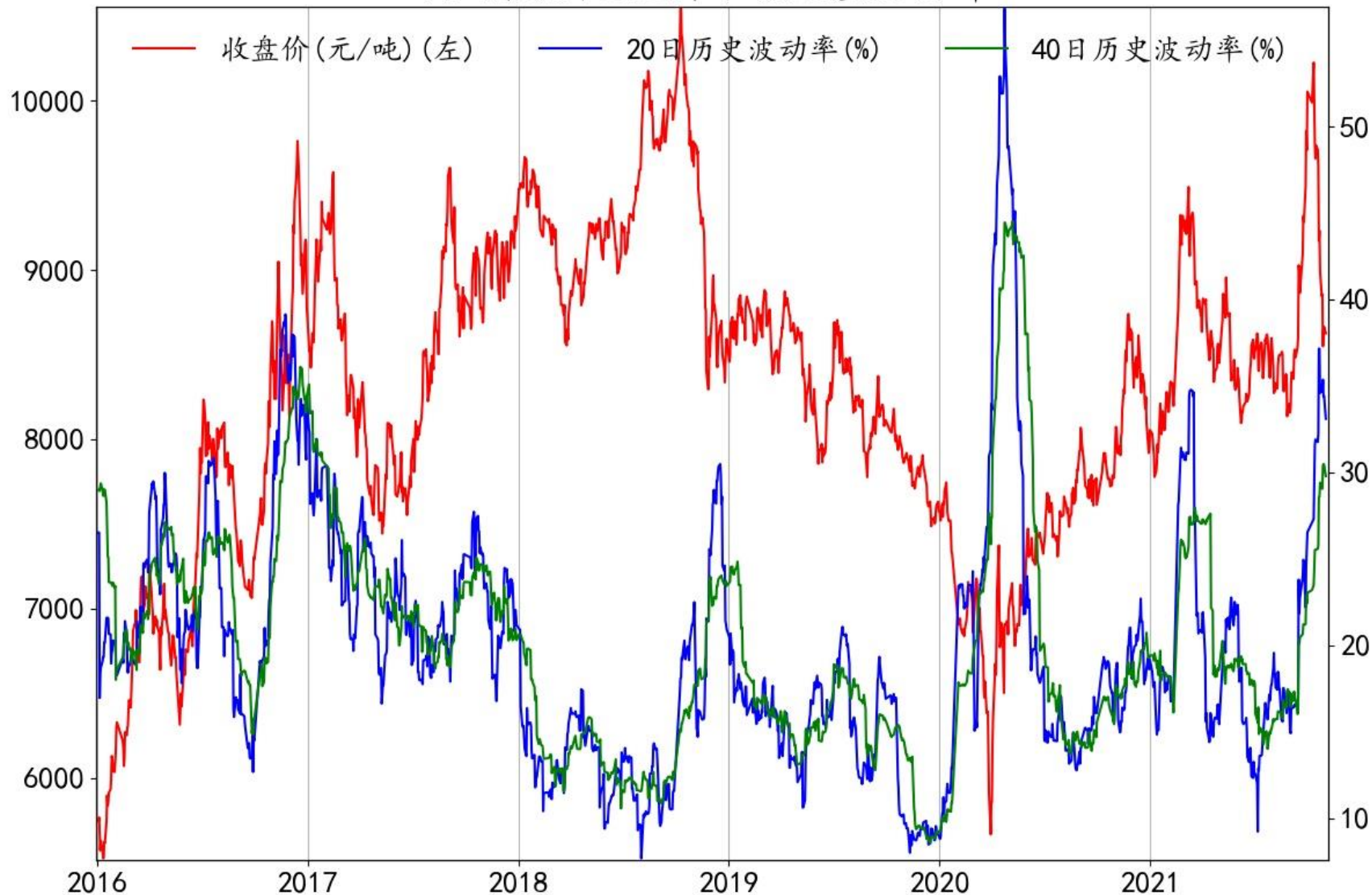


数据来源: Wind、信达期货研发中心

短纤指数收盘价和历史波动率

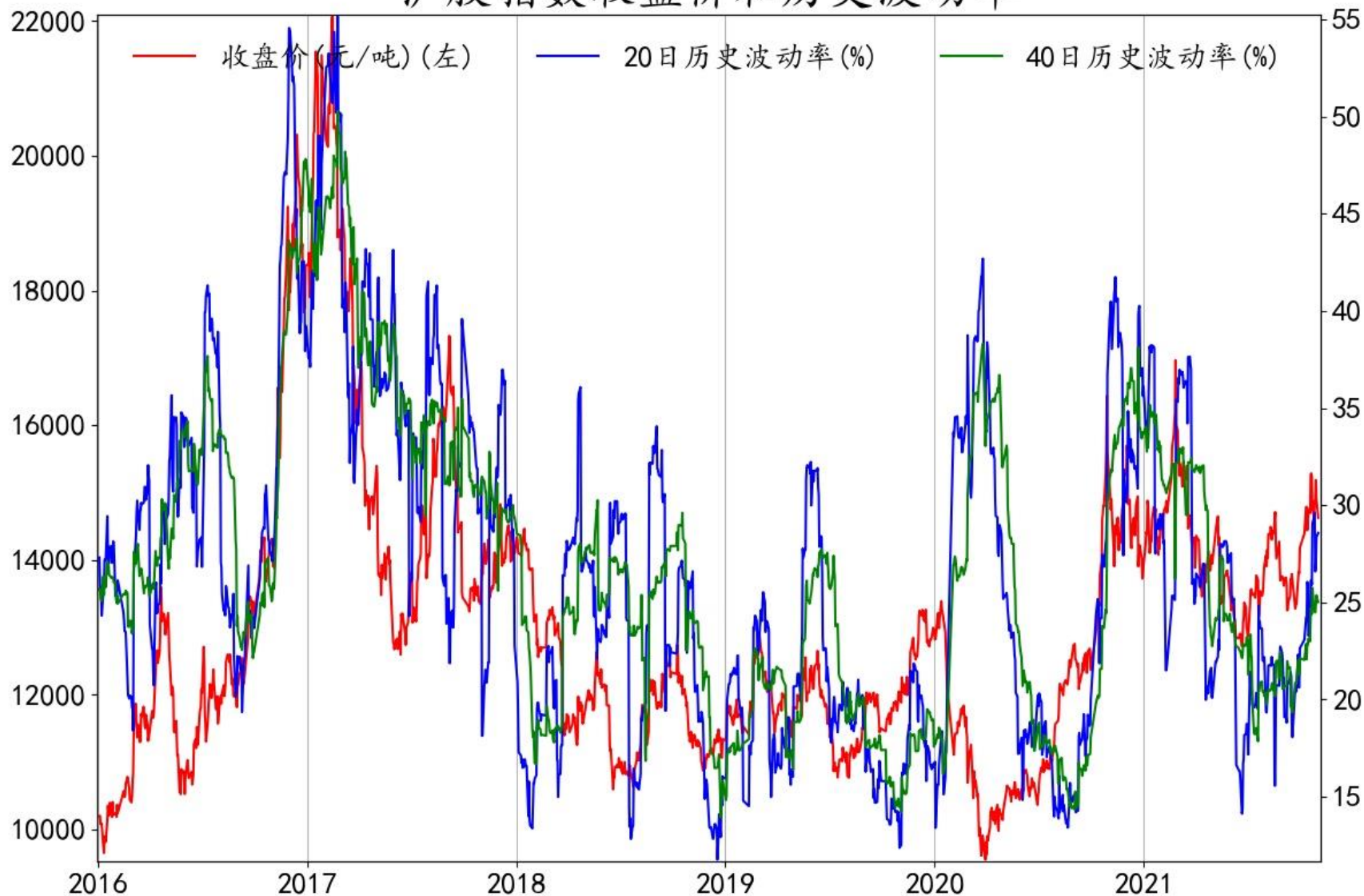


PP指数收盘价和历史波动率

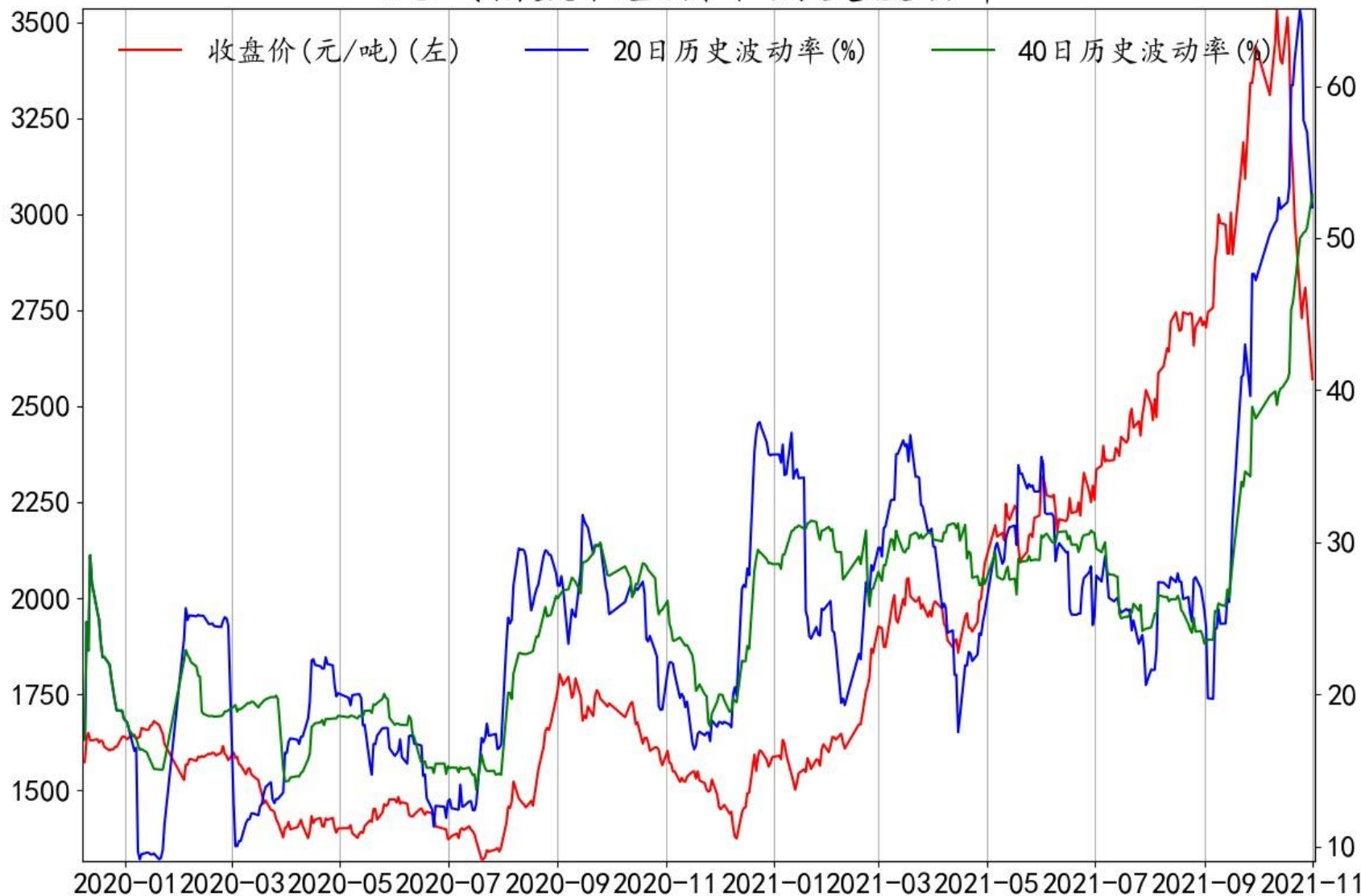


数据来源: Wind、信达期货研发中心

沪胶指数收盘价和历史波动率

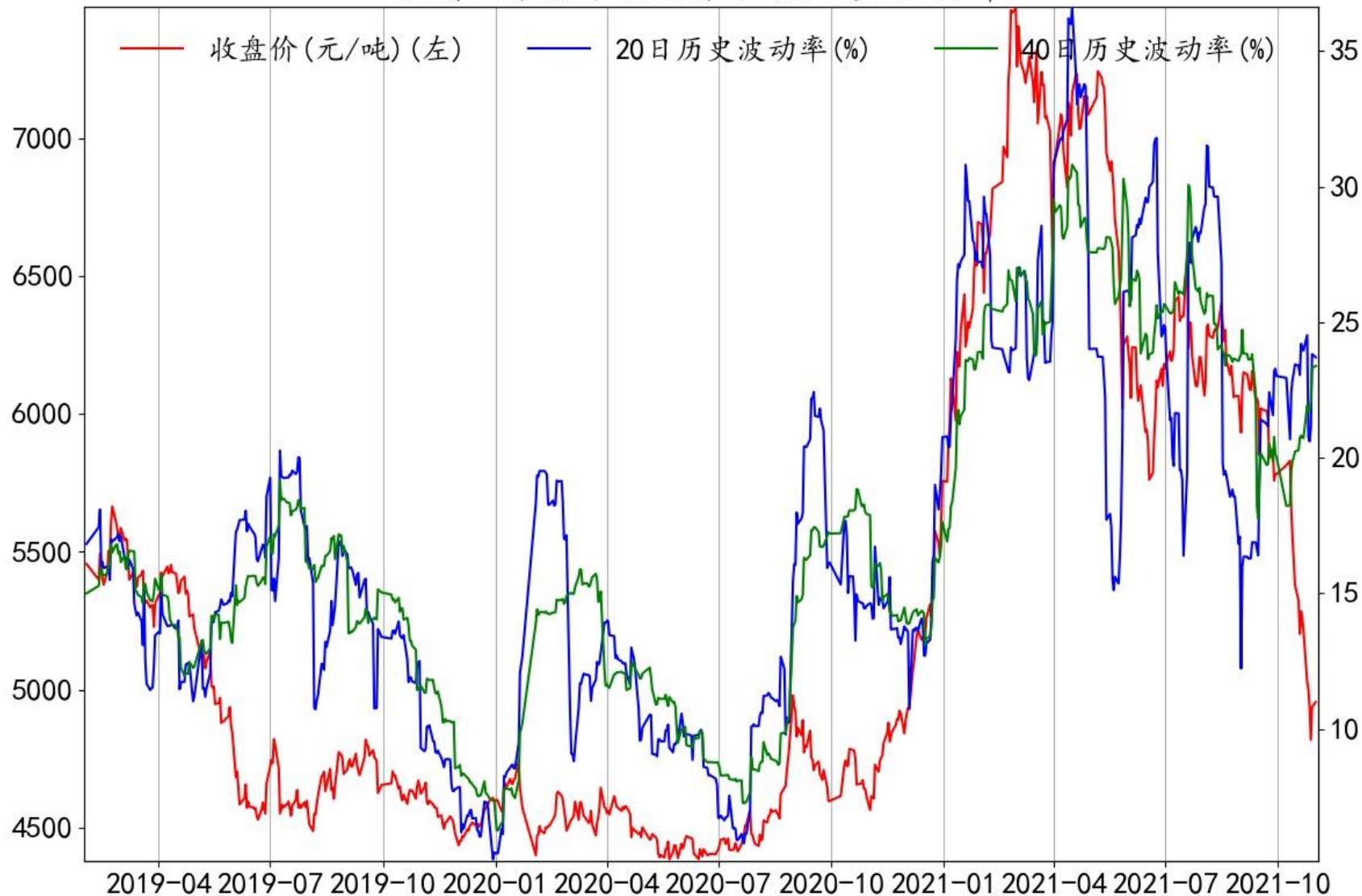


纯碱指数收盘价和历史波动率

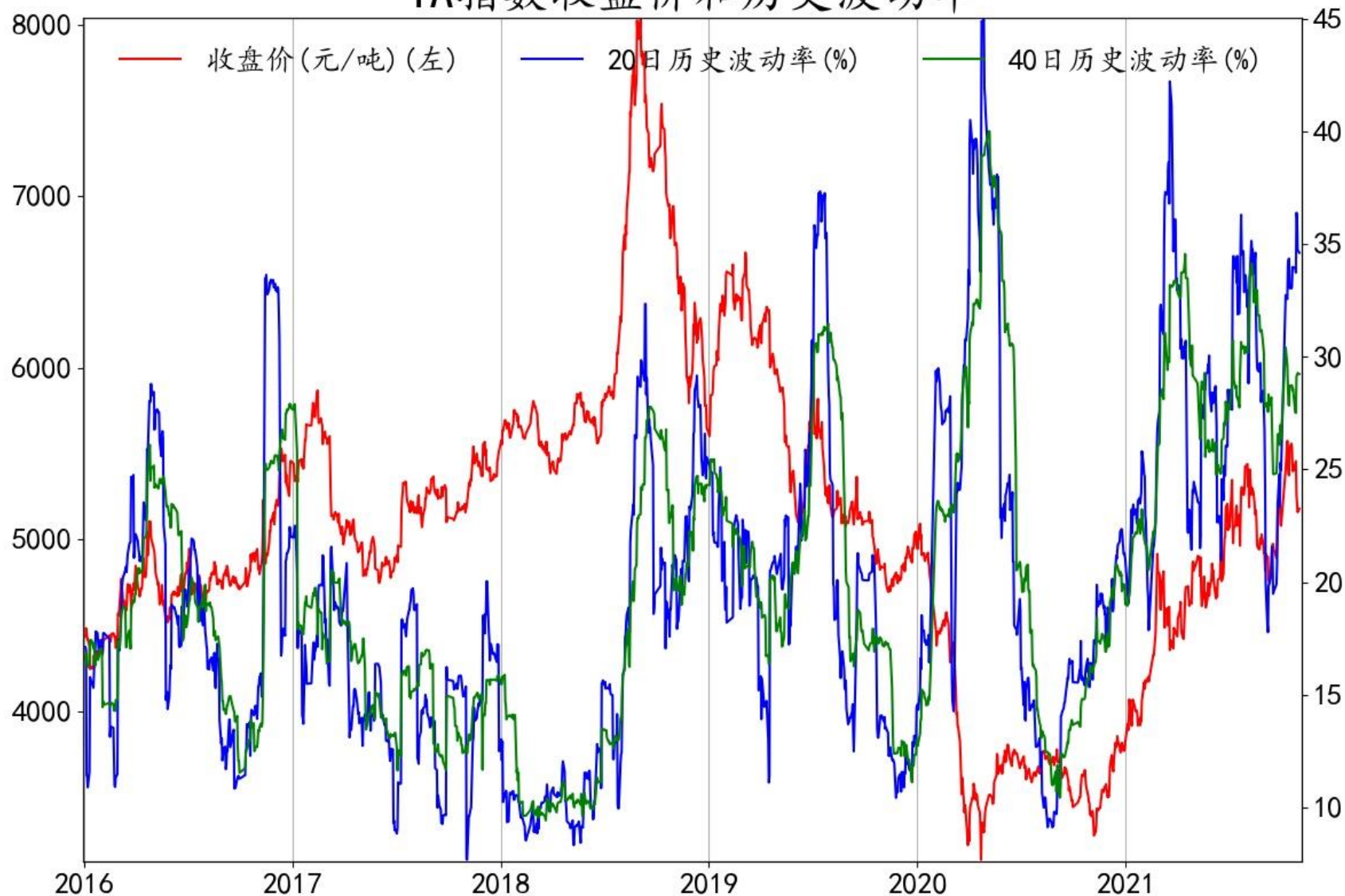


数据来源: Wind、信达期货研发中心

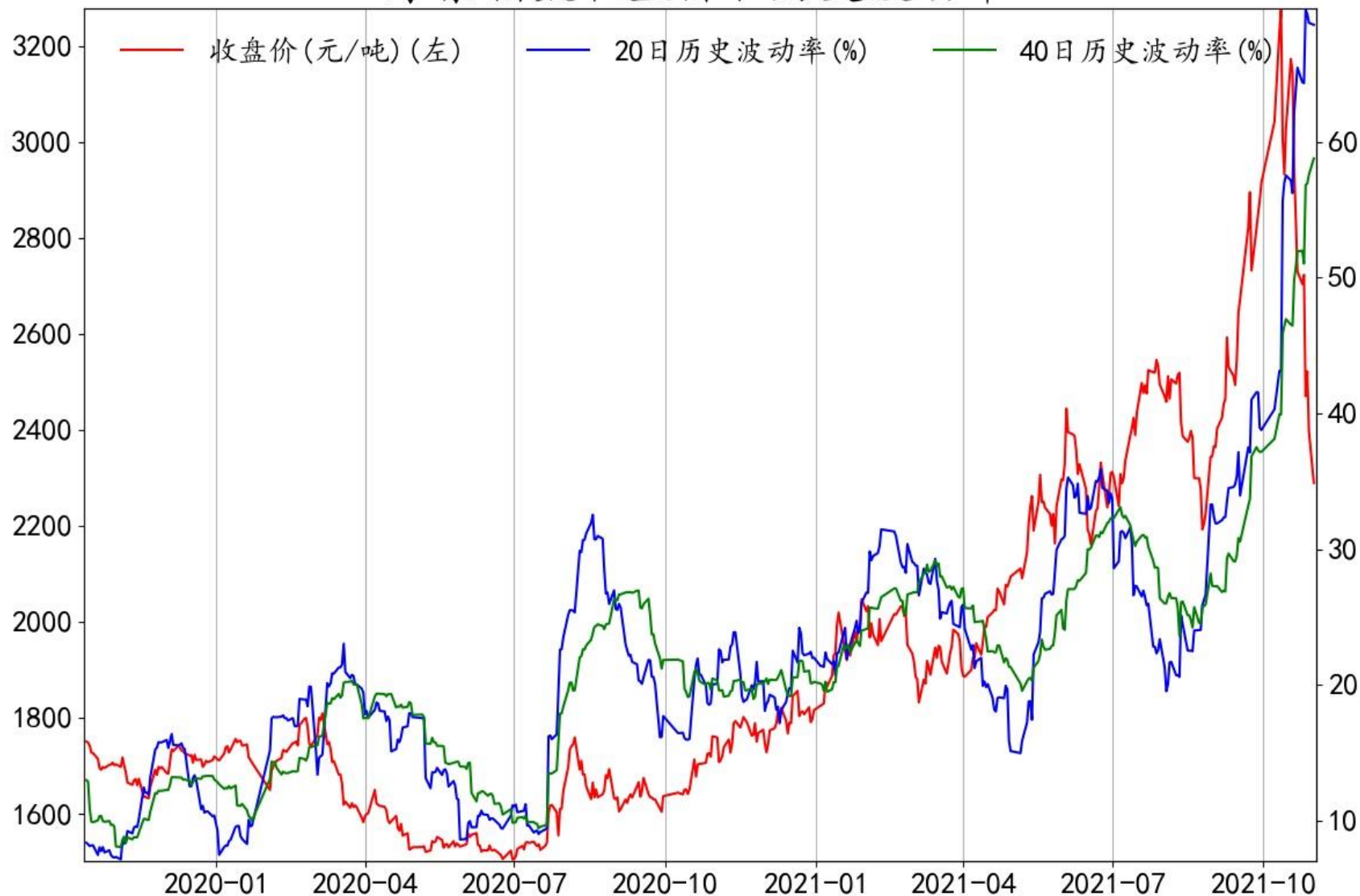
纸浆指数收盘价和历史波动率



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

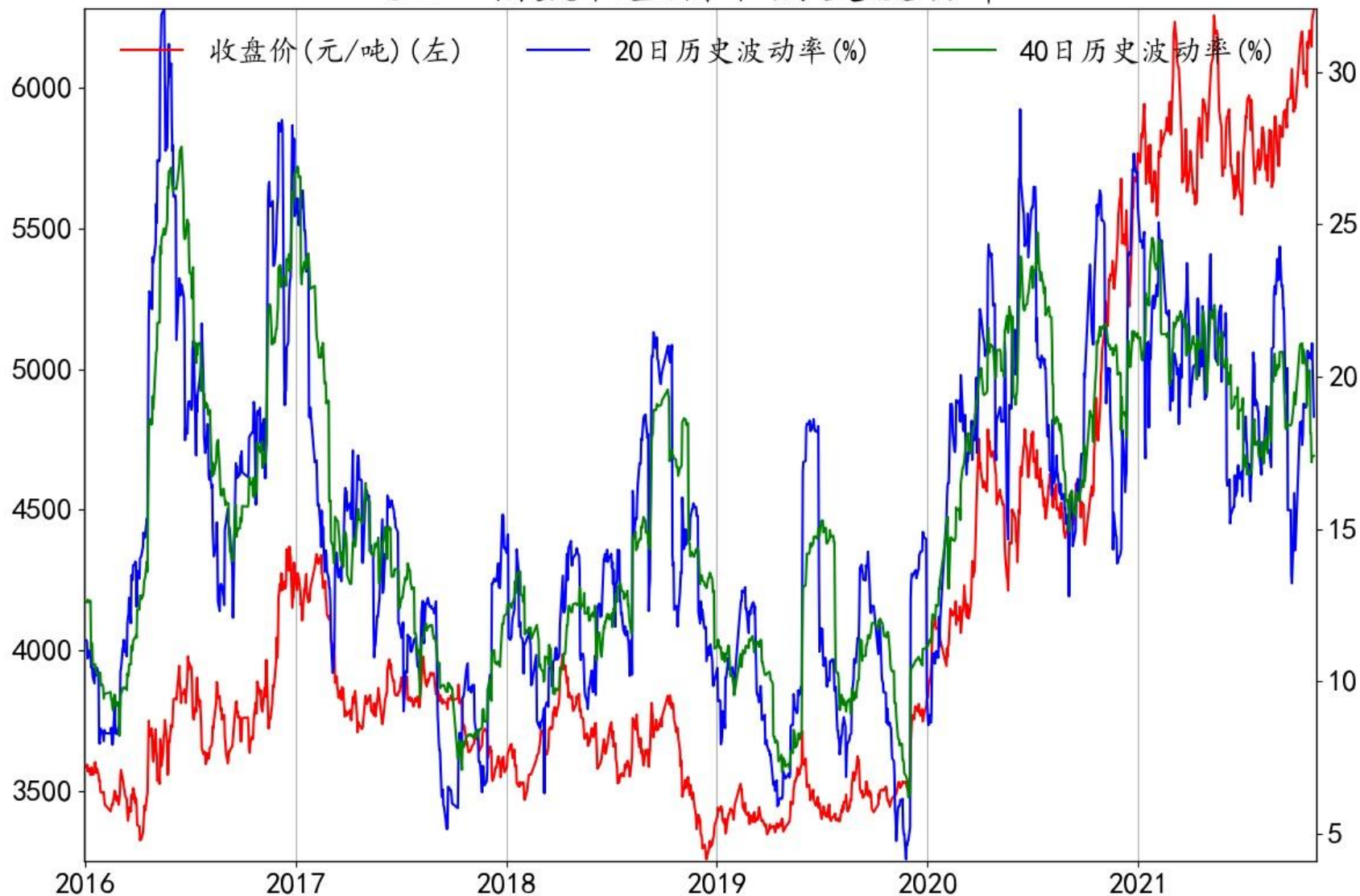


数据来源: Wind、信达期货研发中心

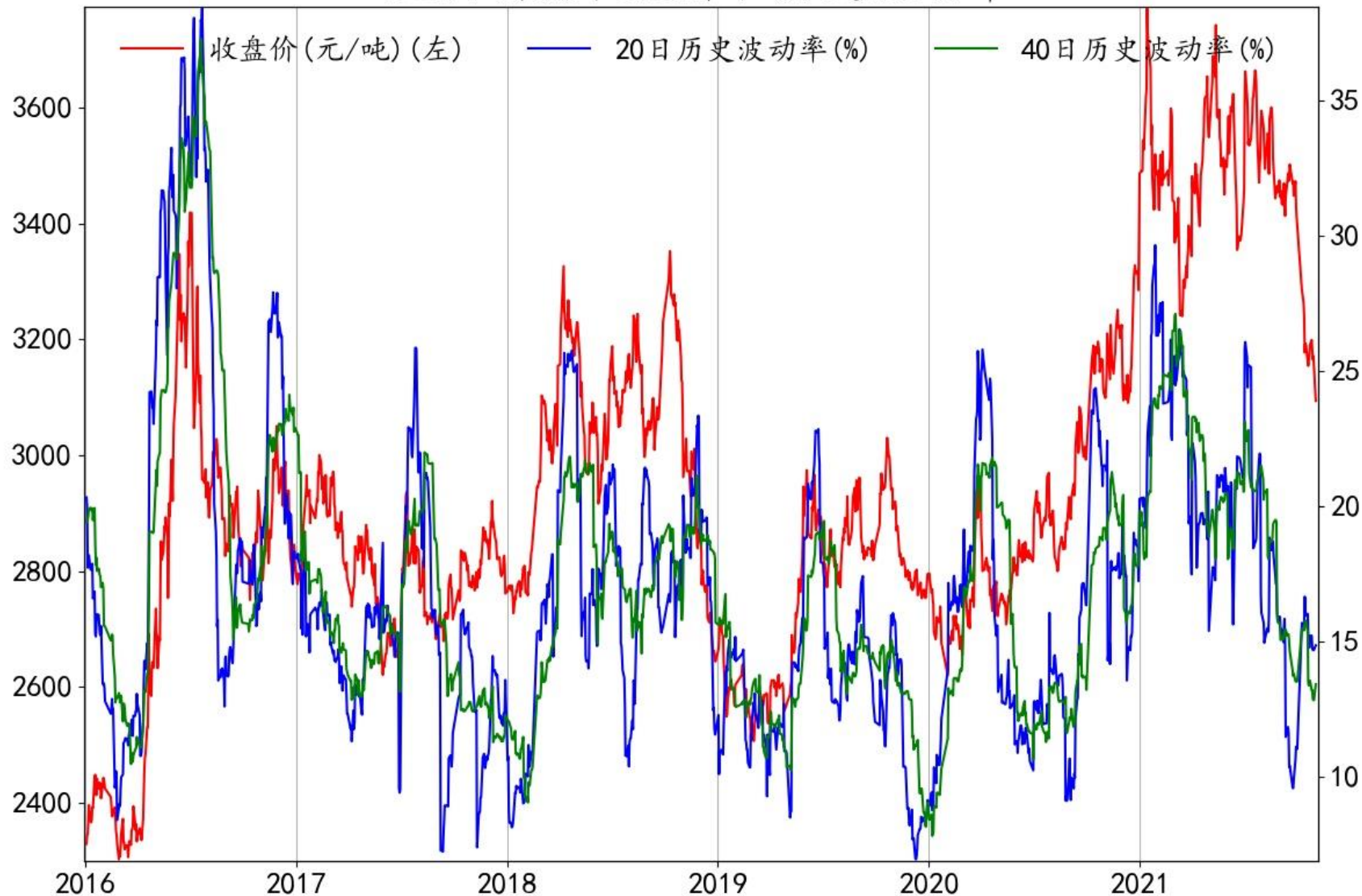
玉米指数收盘价和历史波动率



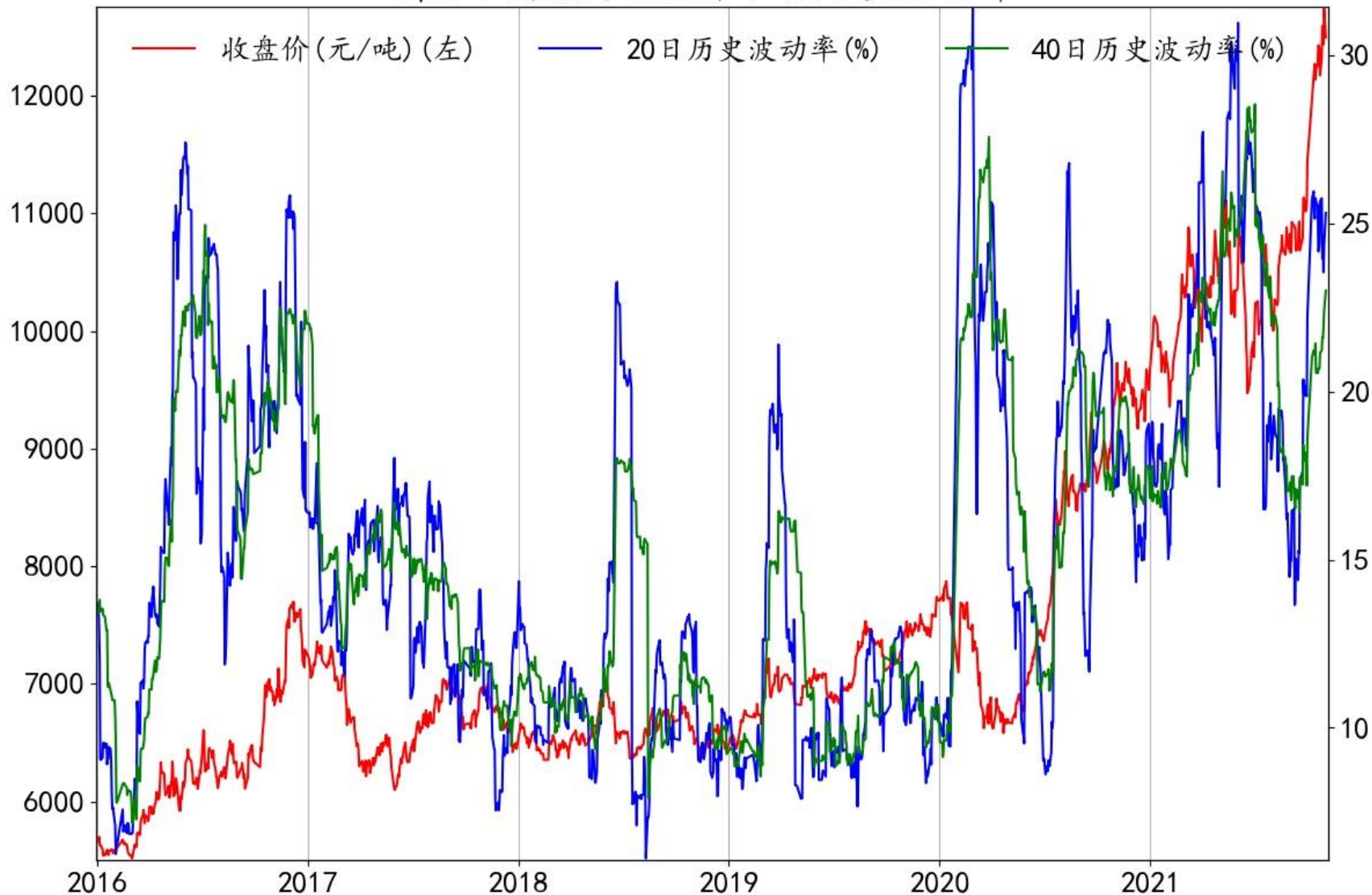
豆一指数收盘价和历史波动率



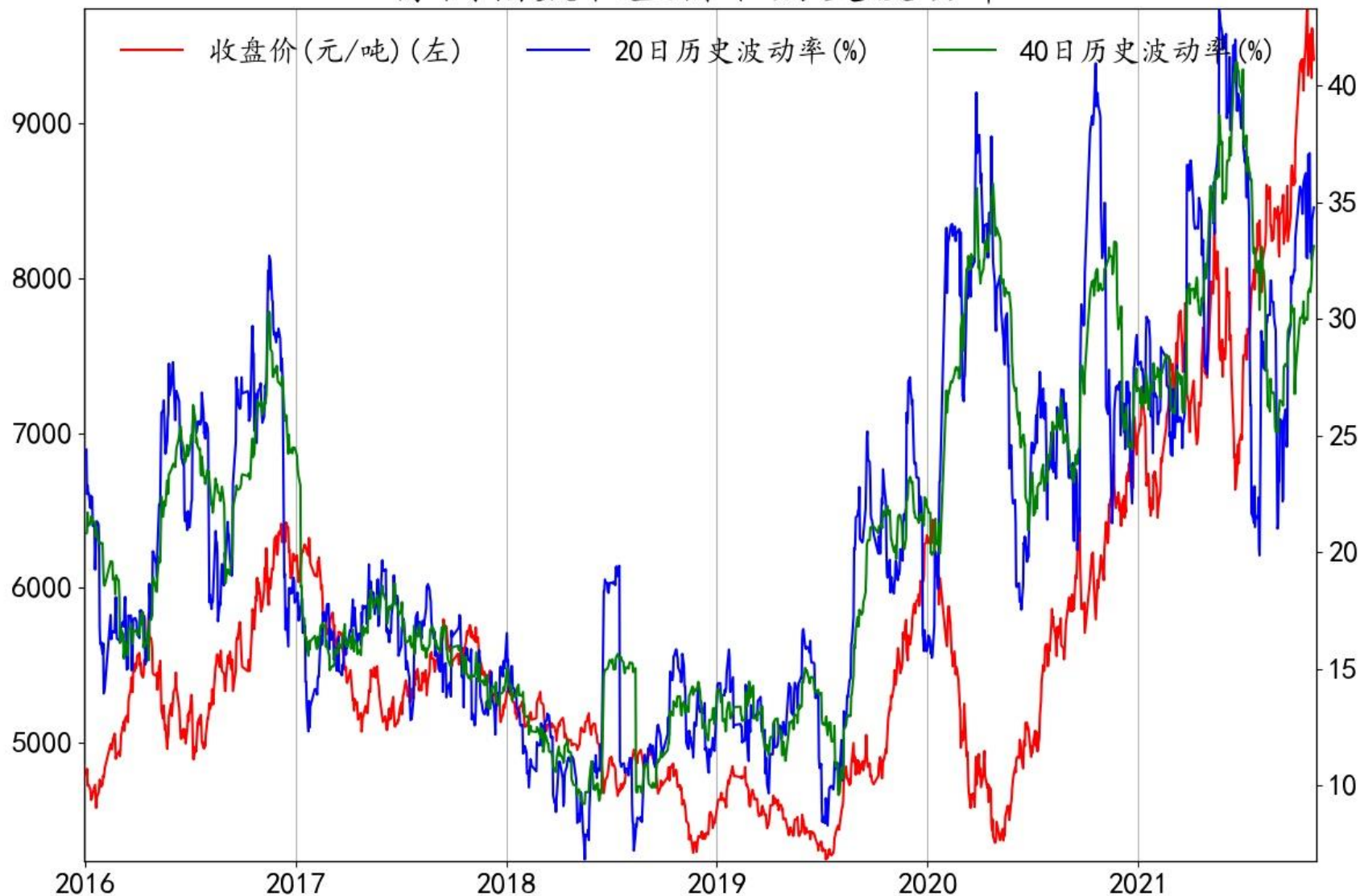
豆粕指数收盘价和历史波动率



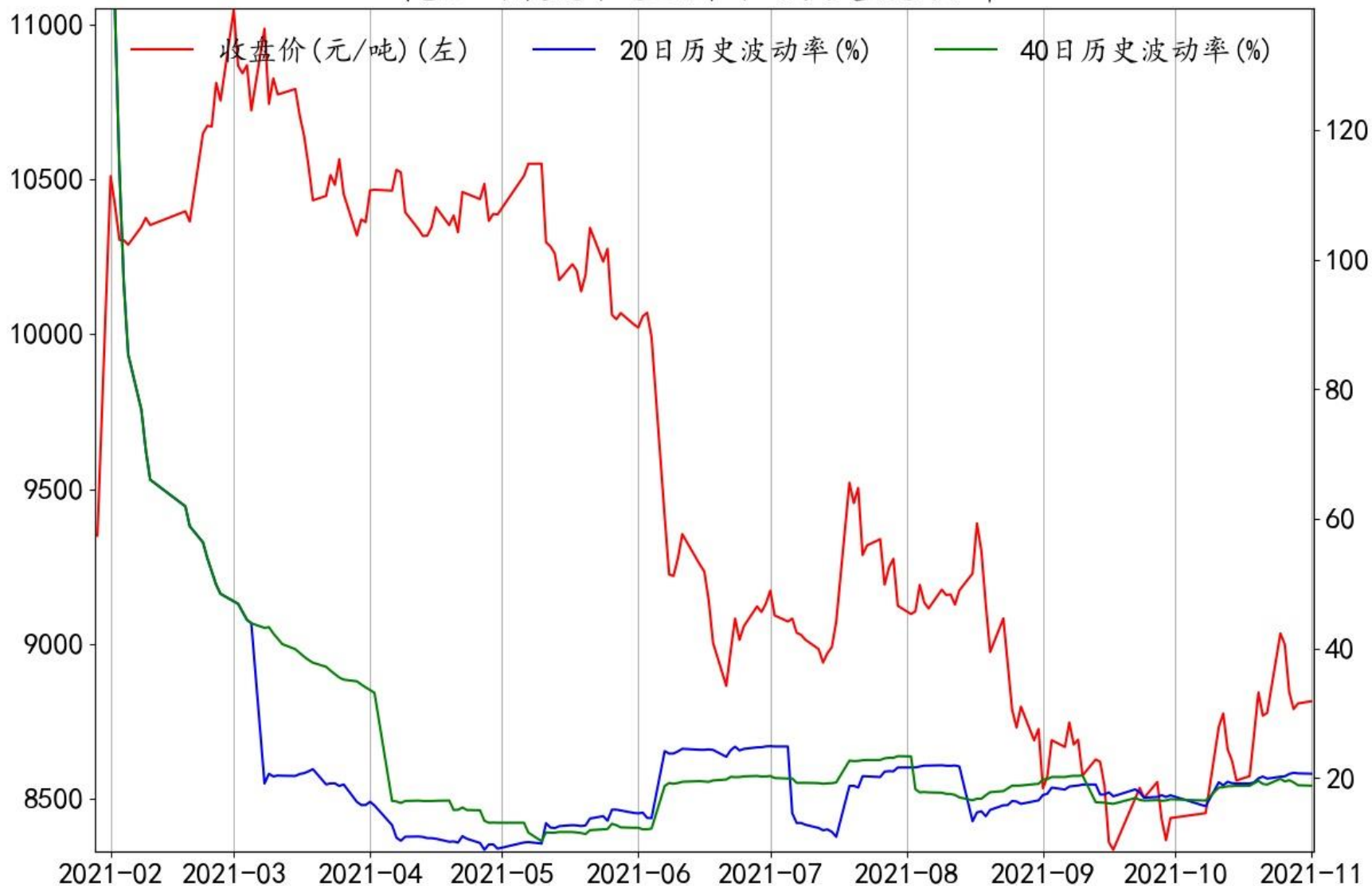
菜油指数收盘价和历史波动率



棕榈指数收盘价和历史波动率

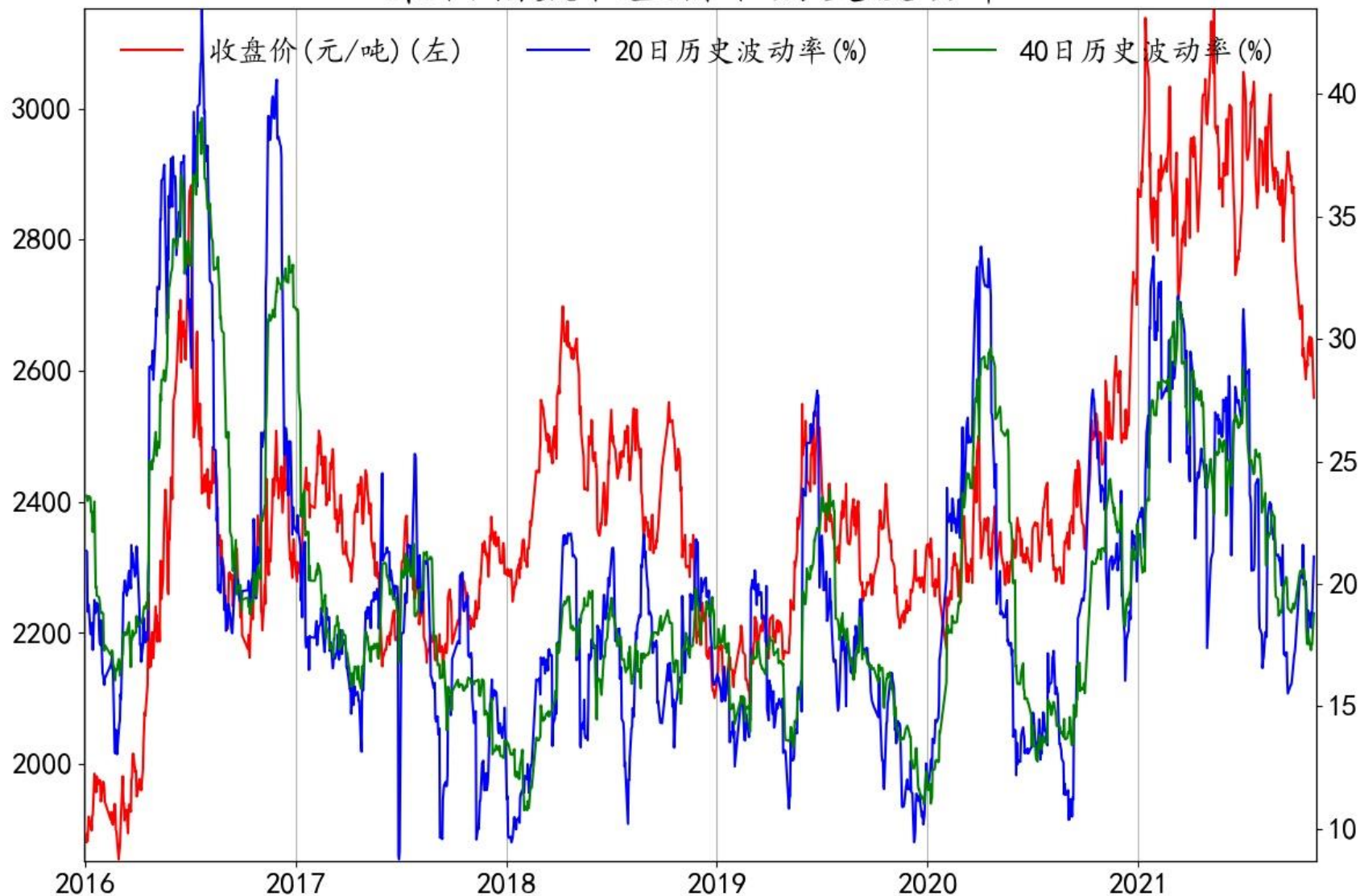


花生指数收盘价和历史波动率

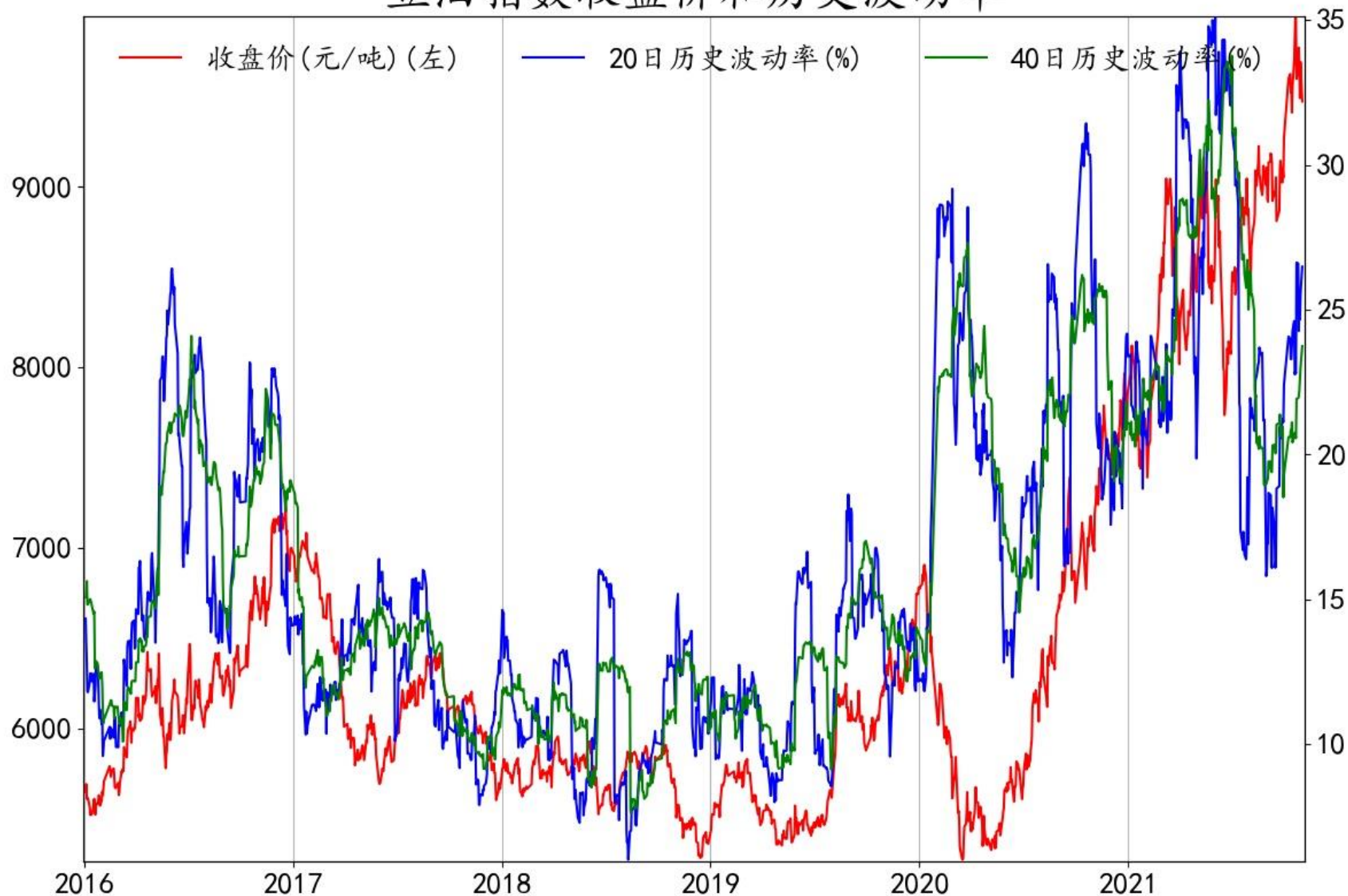


数据来源: Wind、信达期货研发中心

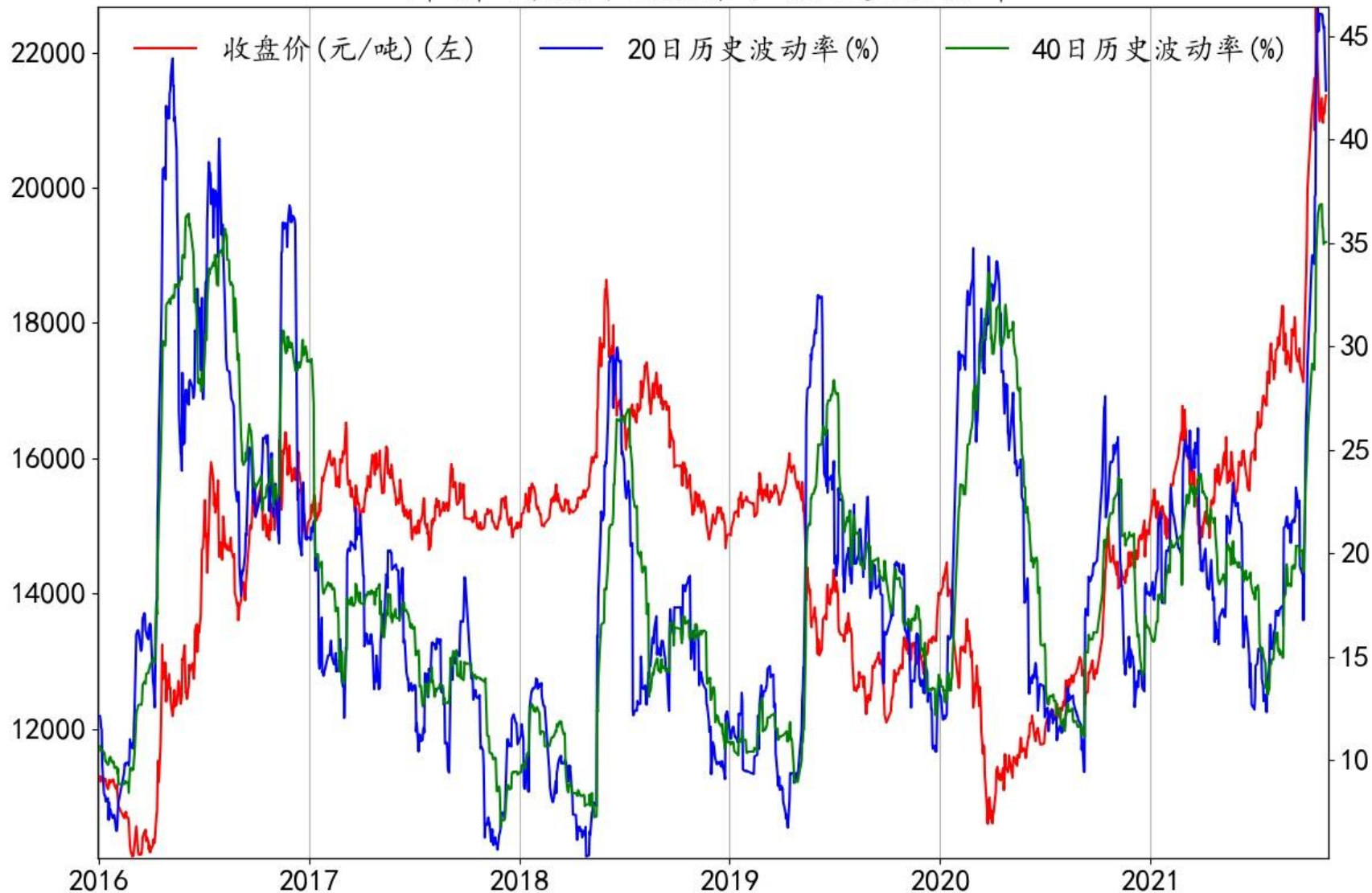
菜粕指数收盘价和历史波动率



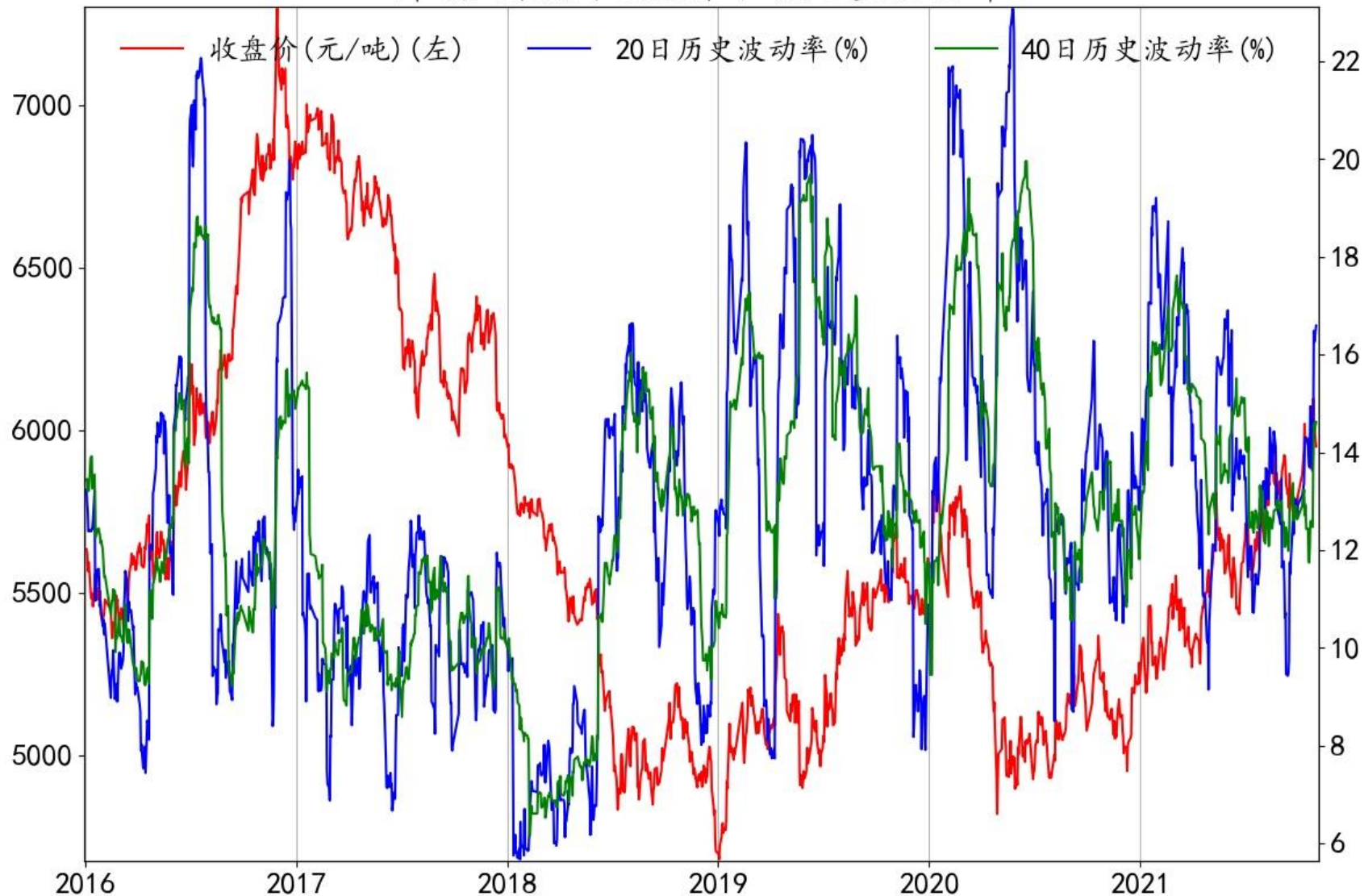
豆油指数收盘价和历史波动率



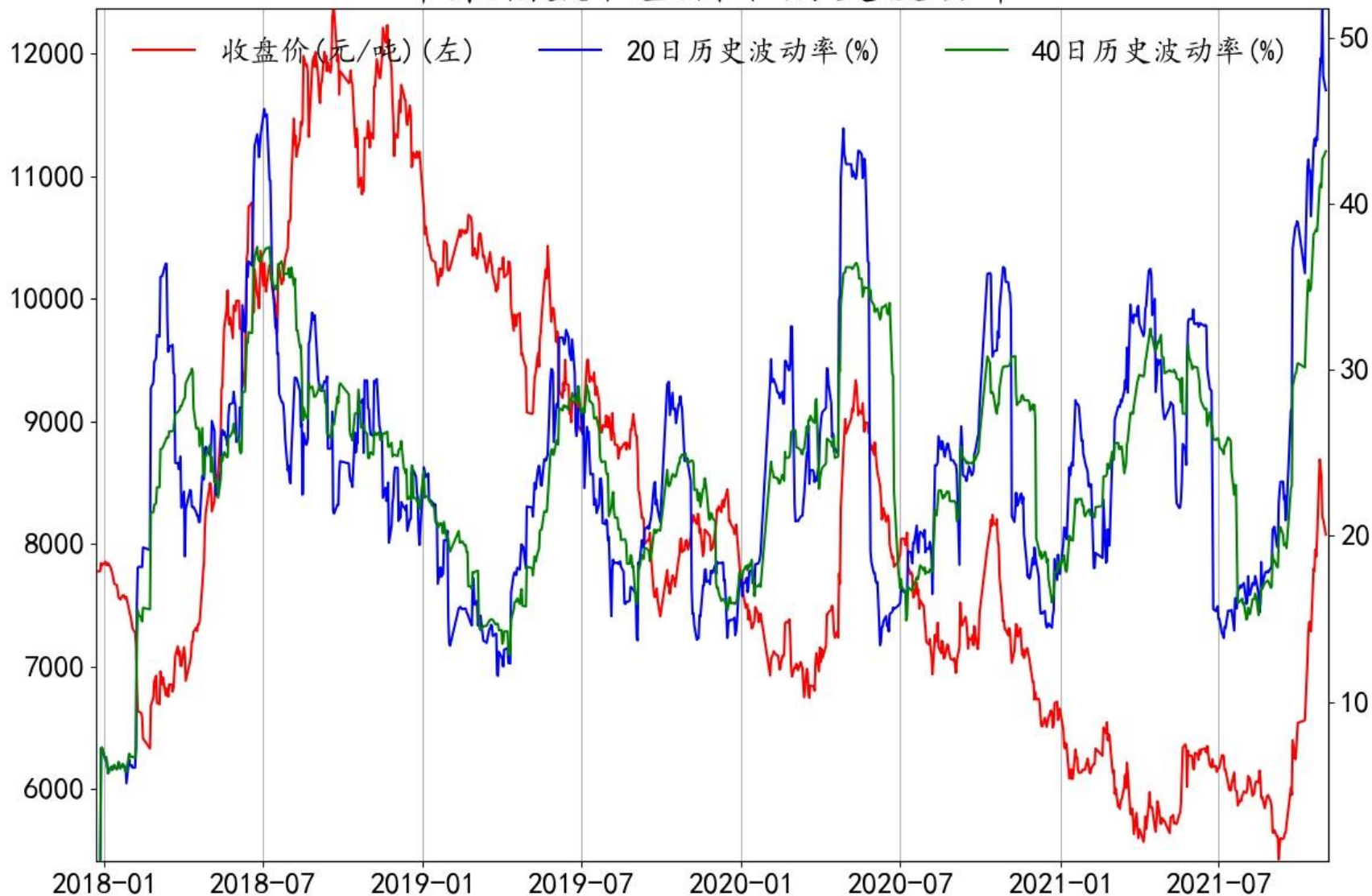
郑棉指数收盘价和历史波动率



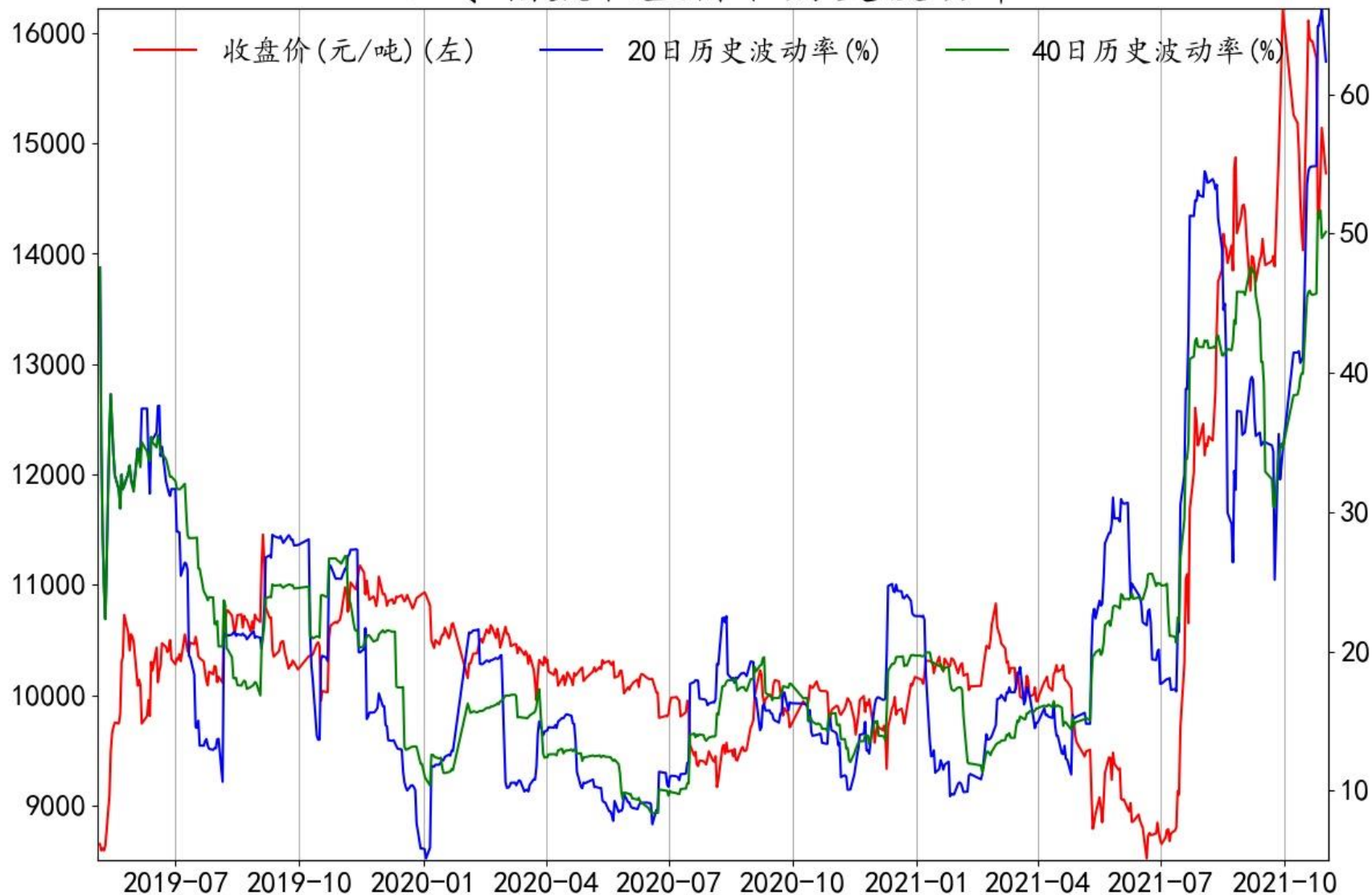
郑糖指数收盘价和历史波动率



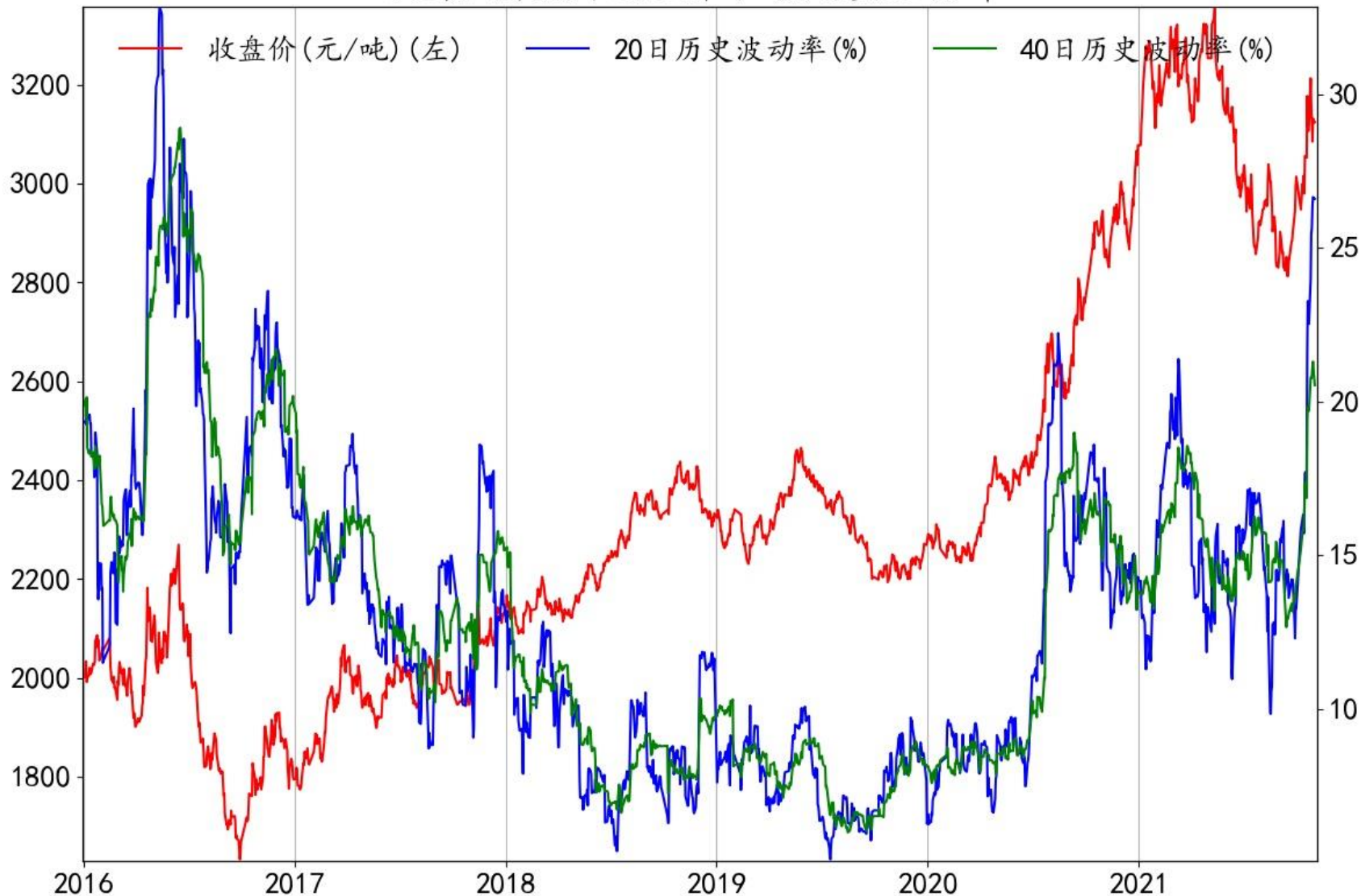
苹果指数收盘价和历史波动率



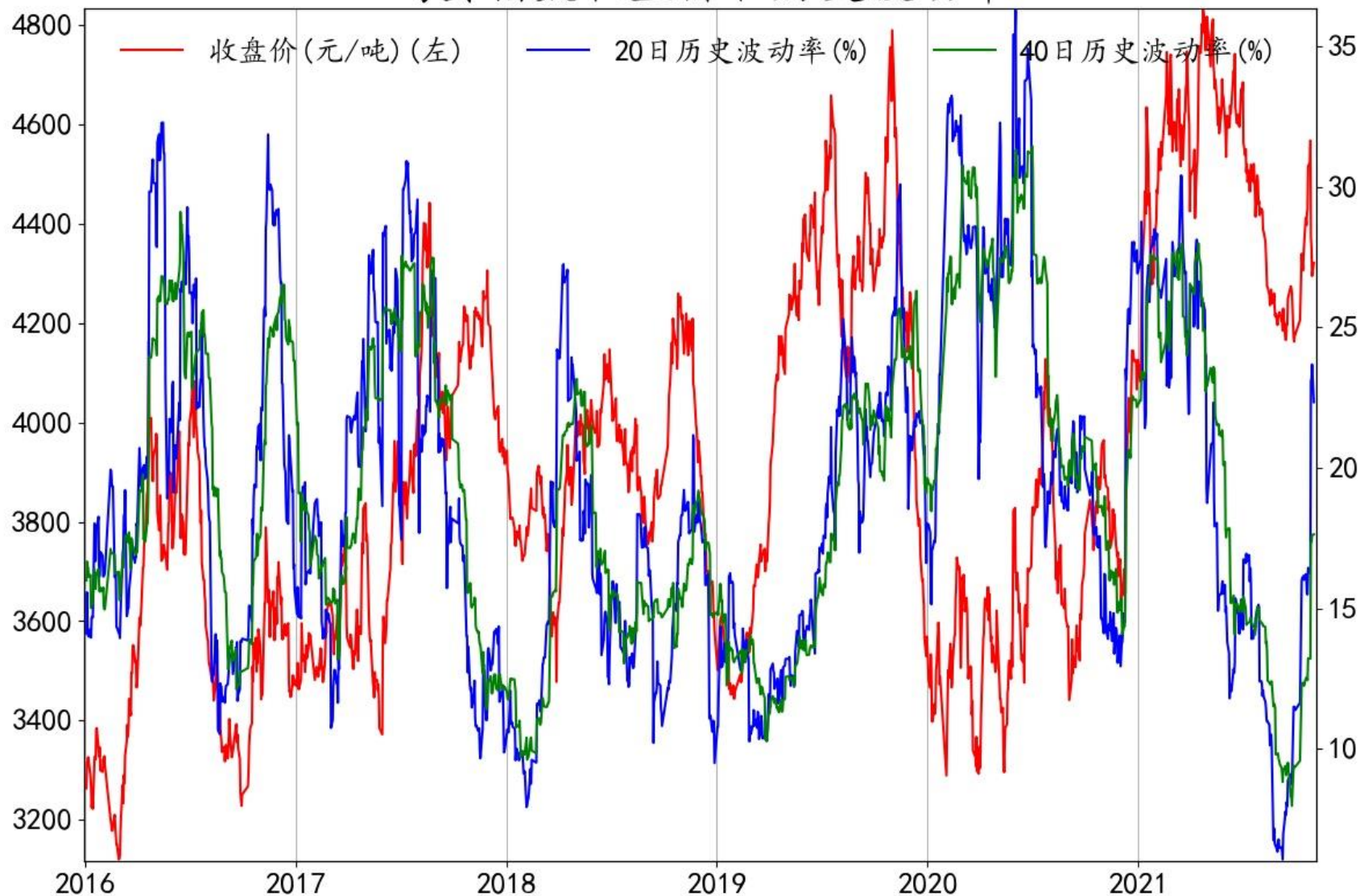
红枣指数收盘价和历史波动率



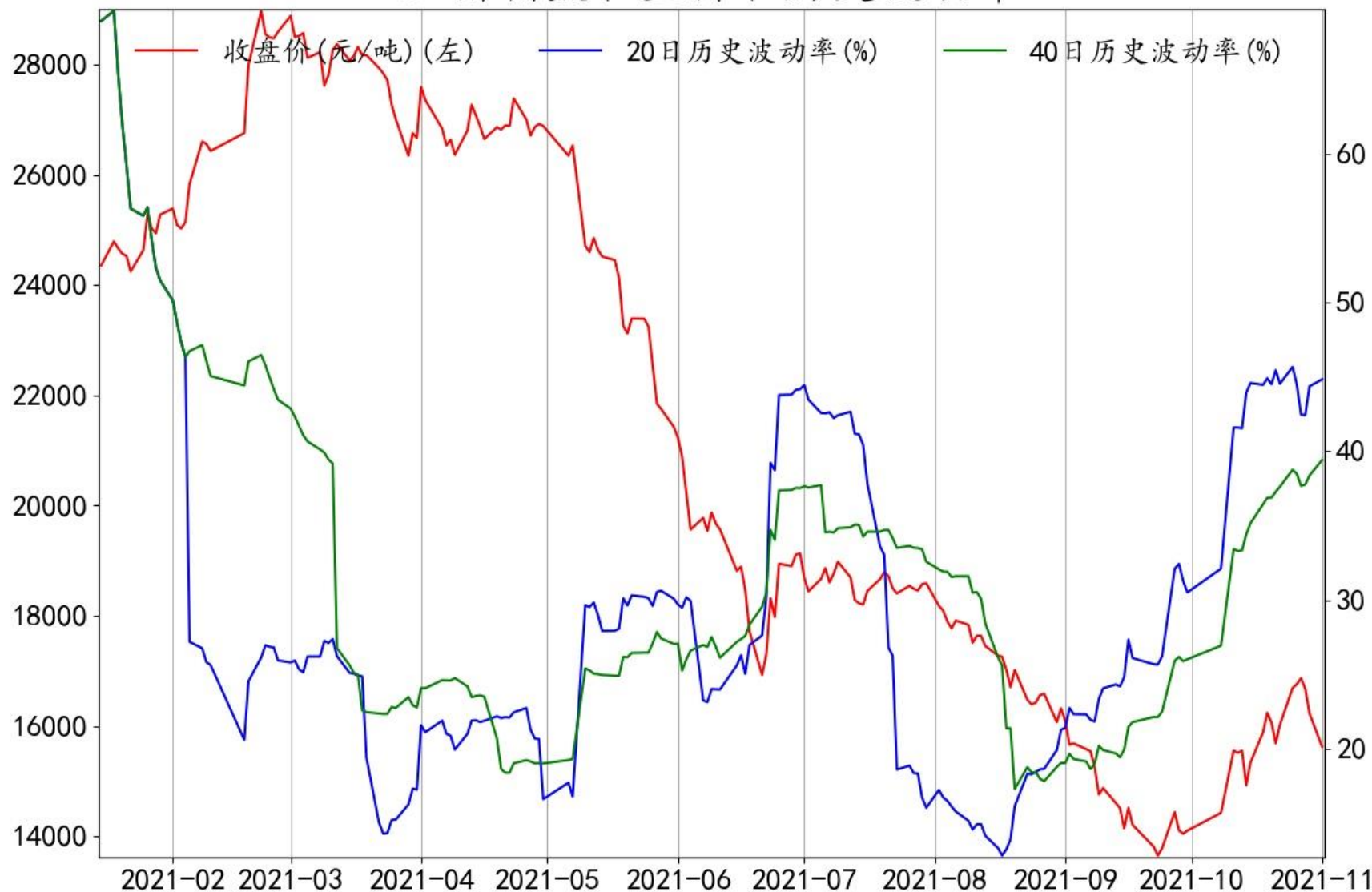
淀粉指数收盘价和历史波动率



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

微信：WilliamChen2021

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