

商品期货波动率跟踪

2021年11月02日

20日历史波动率百分位高于90%:

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

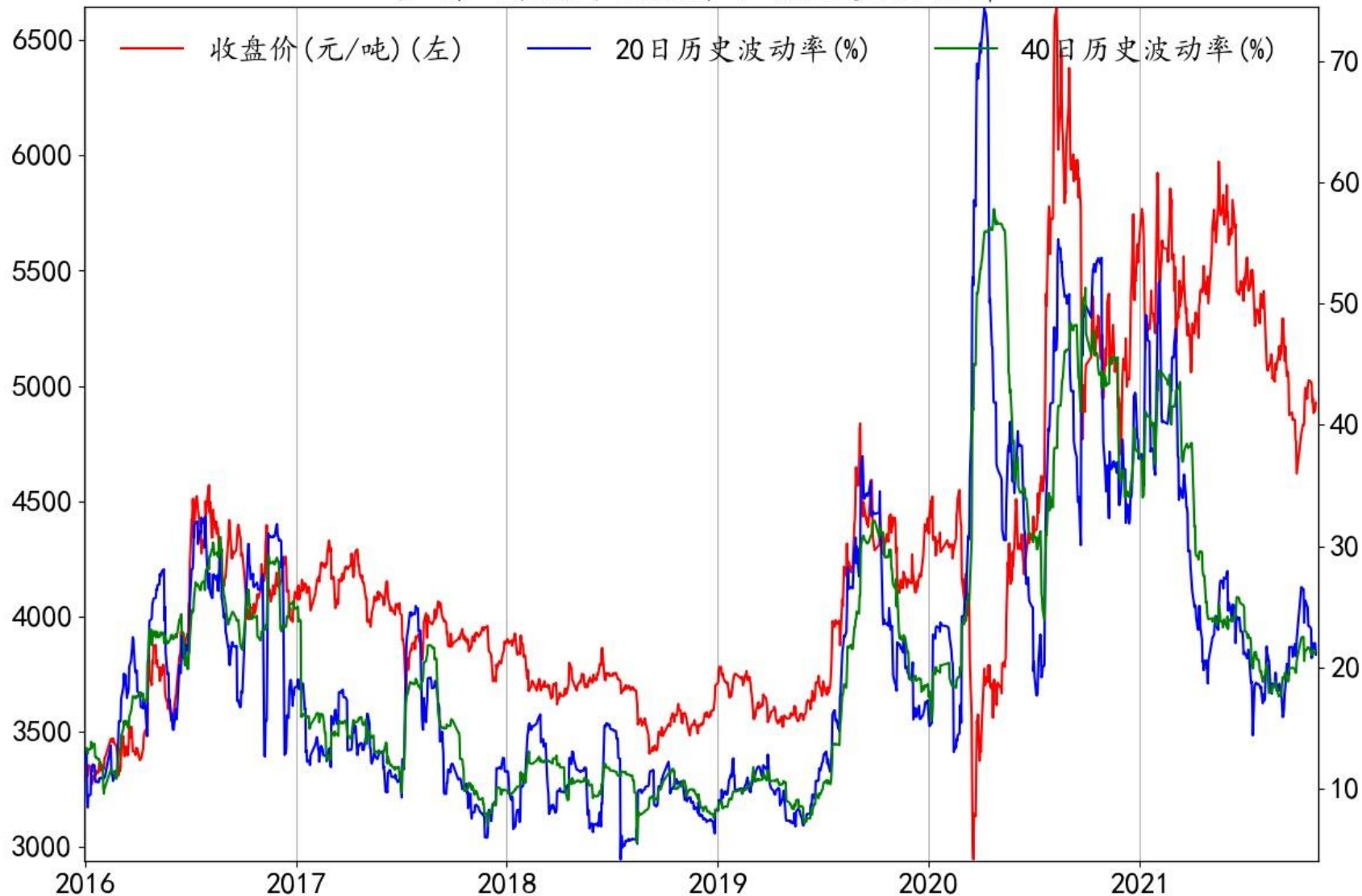
沪金、豆粕、郑糖、玉米、豆一

	时间百分位	绝对值
沪银	60.58%	21.06%
沪金	52.26%	10.86%
沪铝	99.93%	39.96%
沪铜	93.44%	25.65%
沪镍	84.63%	30.07%
沪铅	68.97%	19.31%
沪锡	97.53%	40.99%
沪锌	100.00%	50.12%
热卷	83.57%	35.06%
铁矿	98.87%	68.42%
焦炭	99.72%	83.22%
焦煤	99.86%	89.06%
螺纹	92.60%	42.48%

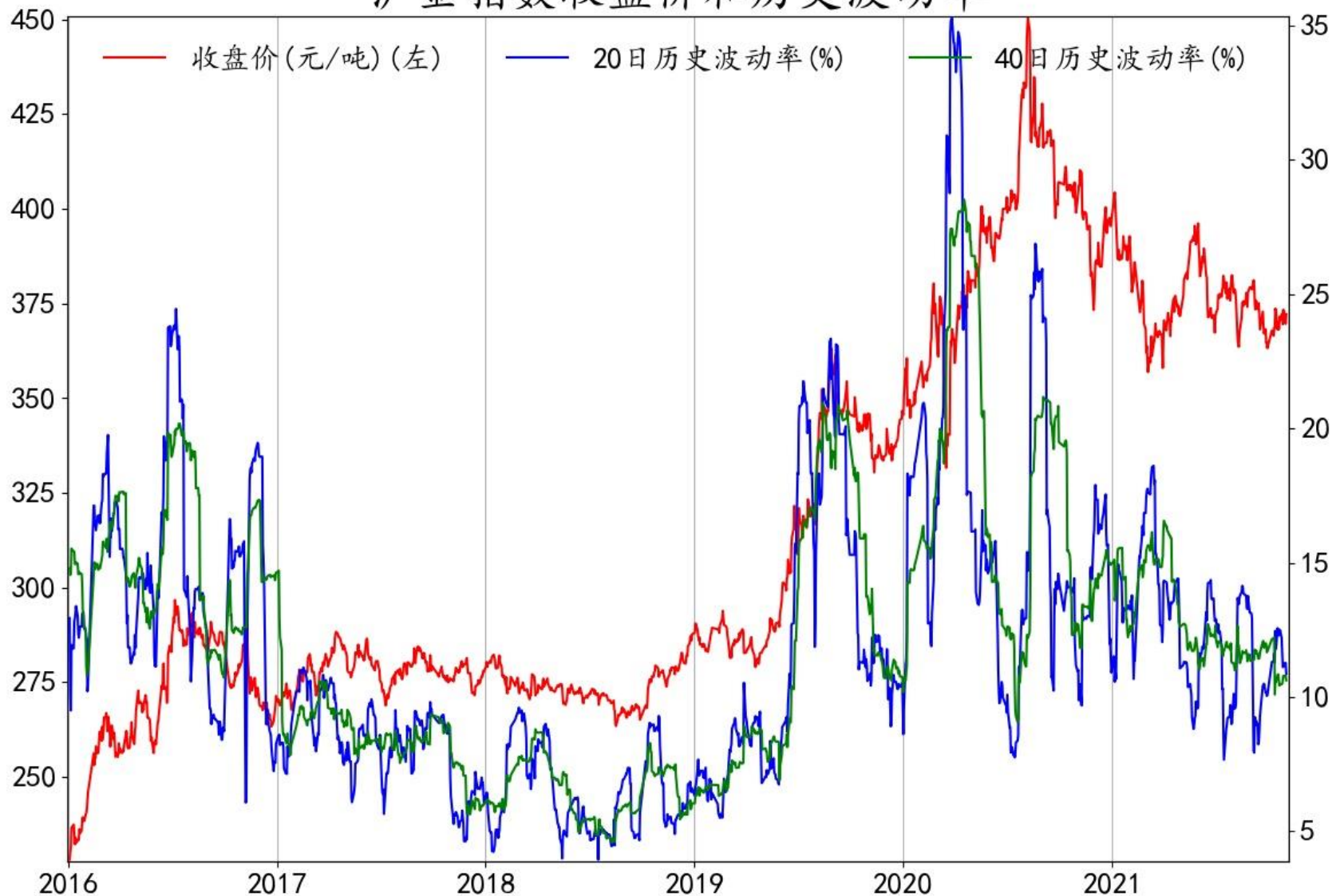
	时间百分位	绝对值
硅铁	99.44%	94.40%
锰硅	98.94%	76.26%
不锈钢	87.57%	29.64%
玻璃	100.00%	51.30%
PVC	99.44%	63.46%
燃油	85.68%	42.75%
低硫燃油	39.38%	27.64%
LPG	95.97%	45.65%
原油	56.82%	30.85%
动煤	99.58%	111.71%
沥青	58.82%	29.05%
苯乙烯	81.23%	39.01%
乙二醇	99.57%	74.70%

	时间百分位	绝对值		时间百分位	绝对值
塑料	94.78%	31.71%	菜油	92.88%	25.24%
甲醇	99.72%	67.05%	棕榈	93.94%	34.82%
20号胶	64.79%	28.49%	花生	64.25%	20.38%
短纤	91.80%	40.87%	菜粕	64.25%	20.45%
PP	91.18%	30.02%	豆油	92.31%	26.55%
沪胶	62.83%	29.06%	郑棉	98.87%	42.35%
纯碱	97.61%	52.08%	郑糖	85.33%	16.49%
纸浆	81.95%	23.62%	苹果	99.46%	47.42%
TA	94.92%	34.63%	红枣	99.18%	61.73%
尿素	99.20%	68.18%	淀粉	97.95%	26.78%
玉米	90.27%	16.53%	鸡蛋	74.40%	23.32%
豆一	71.79%	18.73%	生猪	85.34%	44.01%
豆粕	38.22%	14.64%			

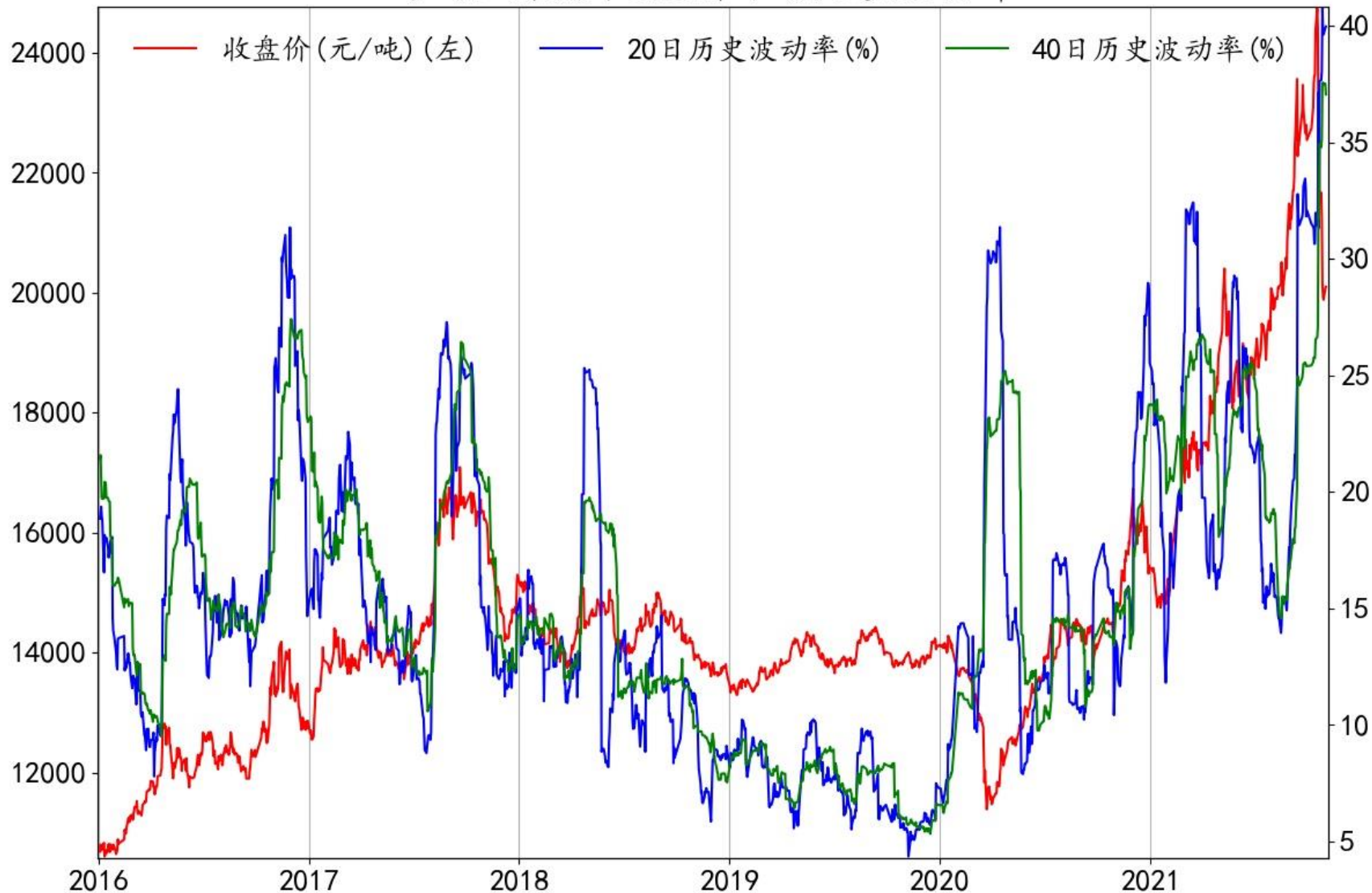
沪银指数收盘价和历史波动率



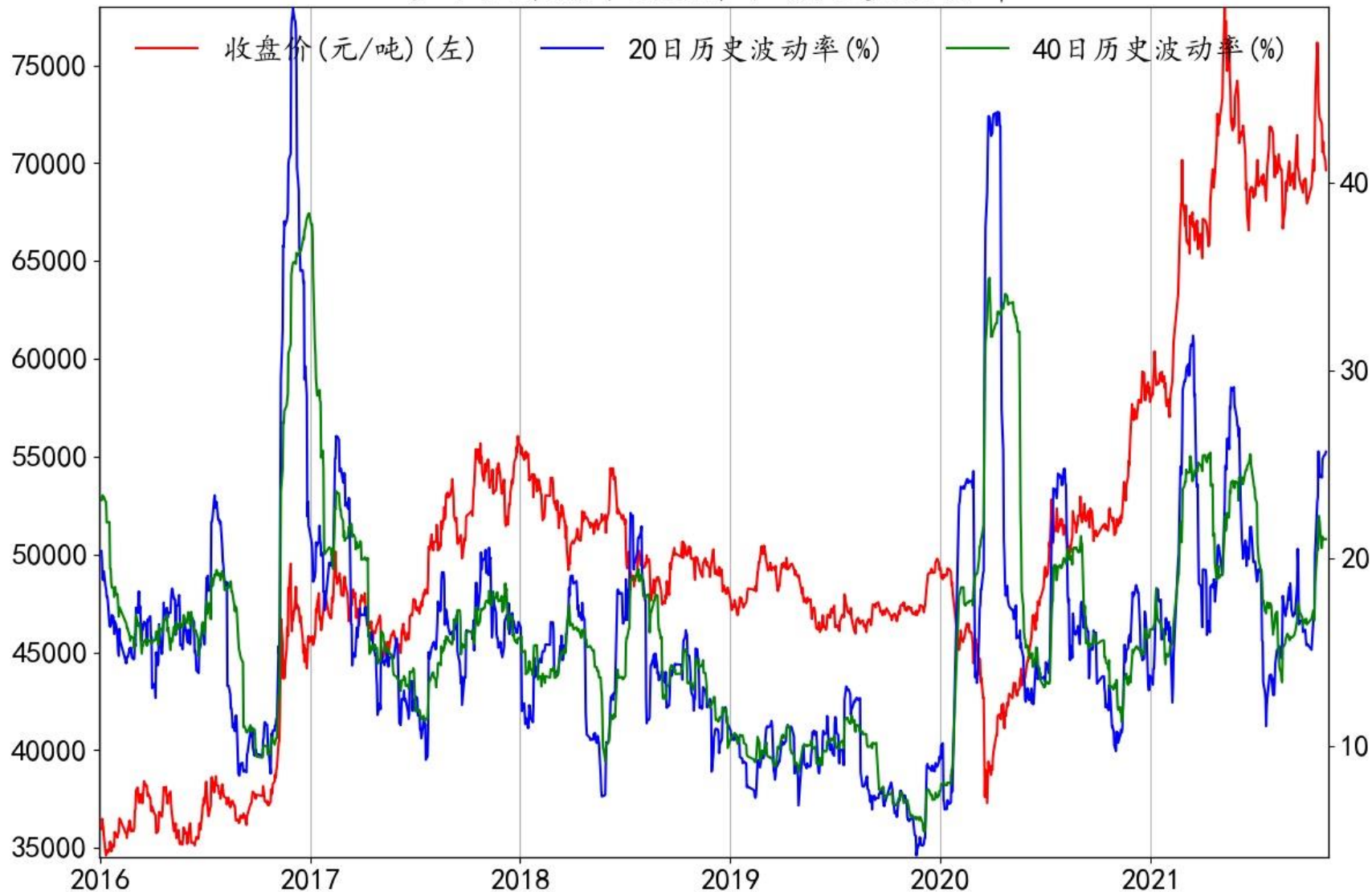
沪金指数收盘价和历史波动率



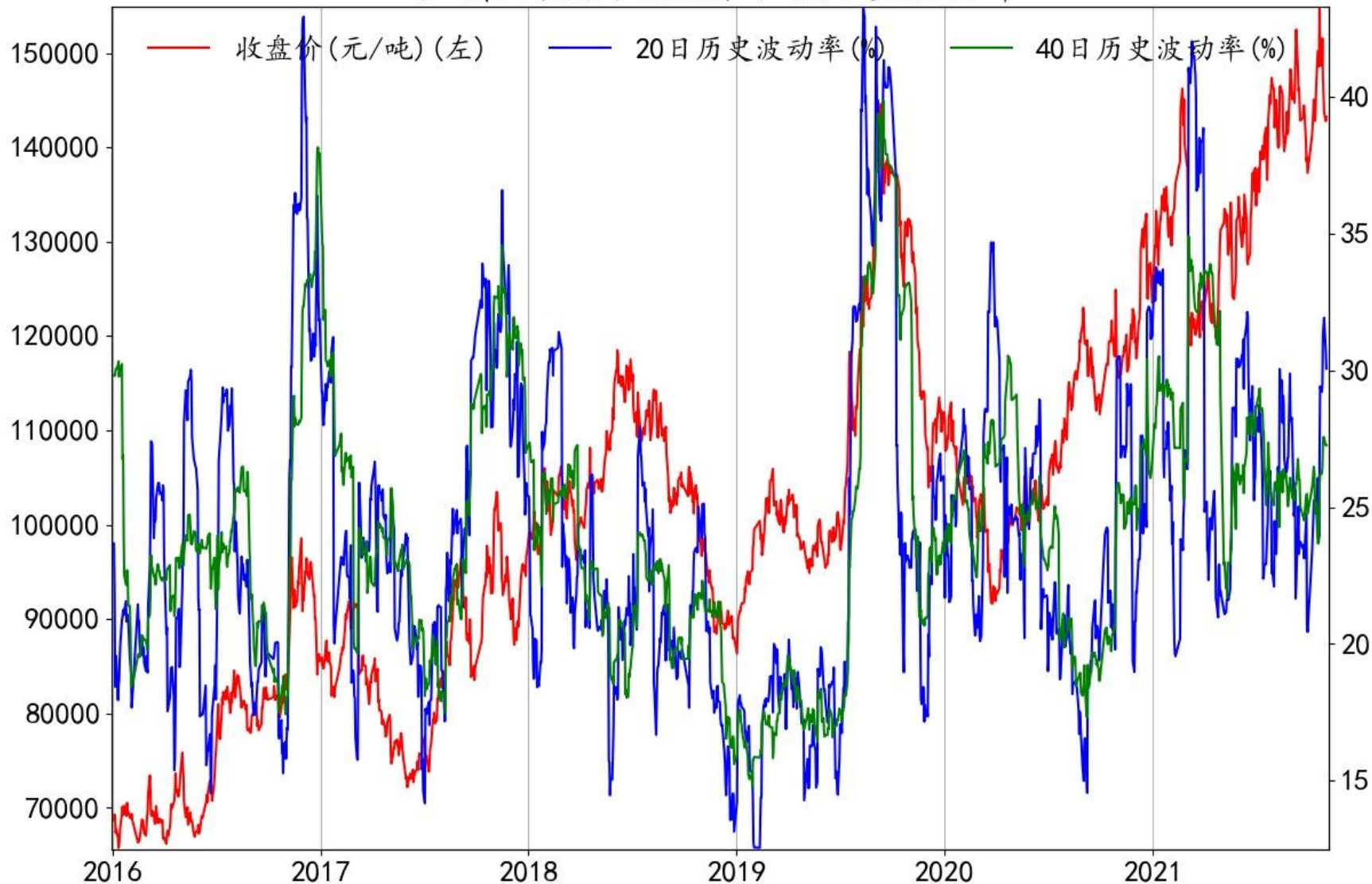
沪铝指数收盘价和历史波动率



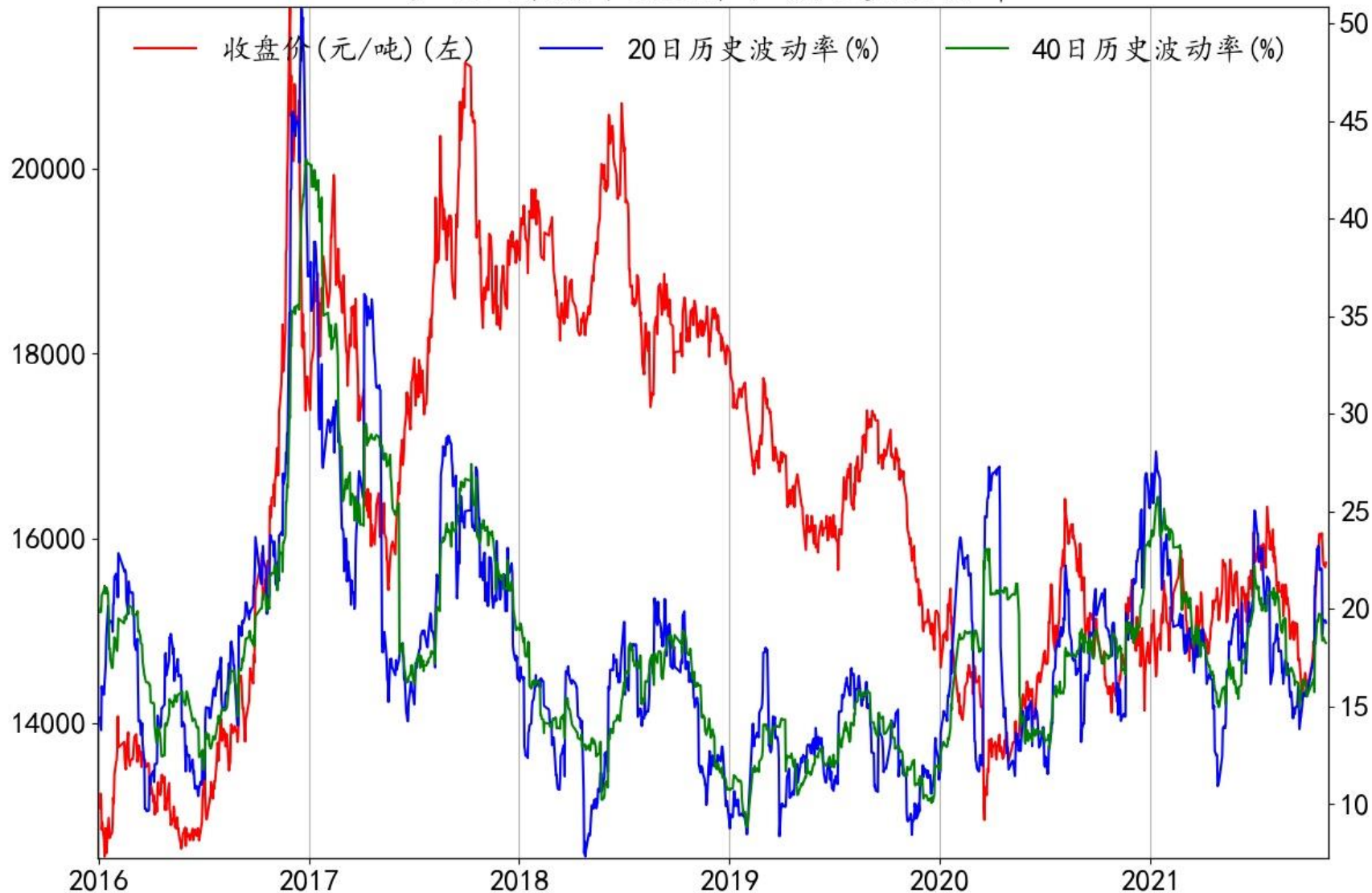
沪铜指数收盘价和历史波动率



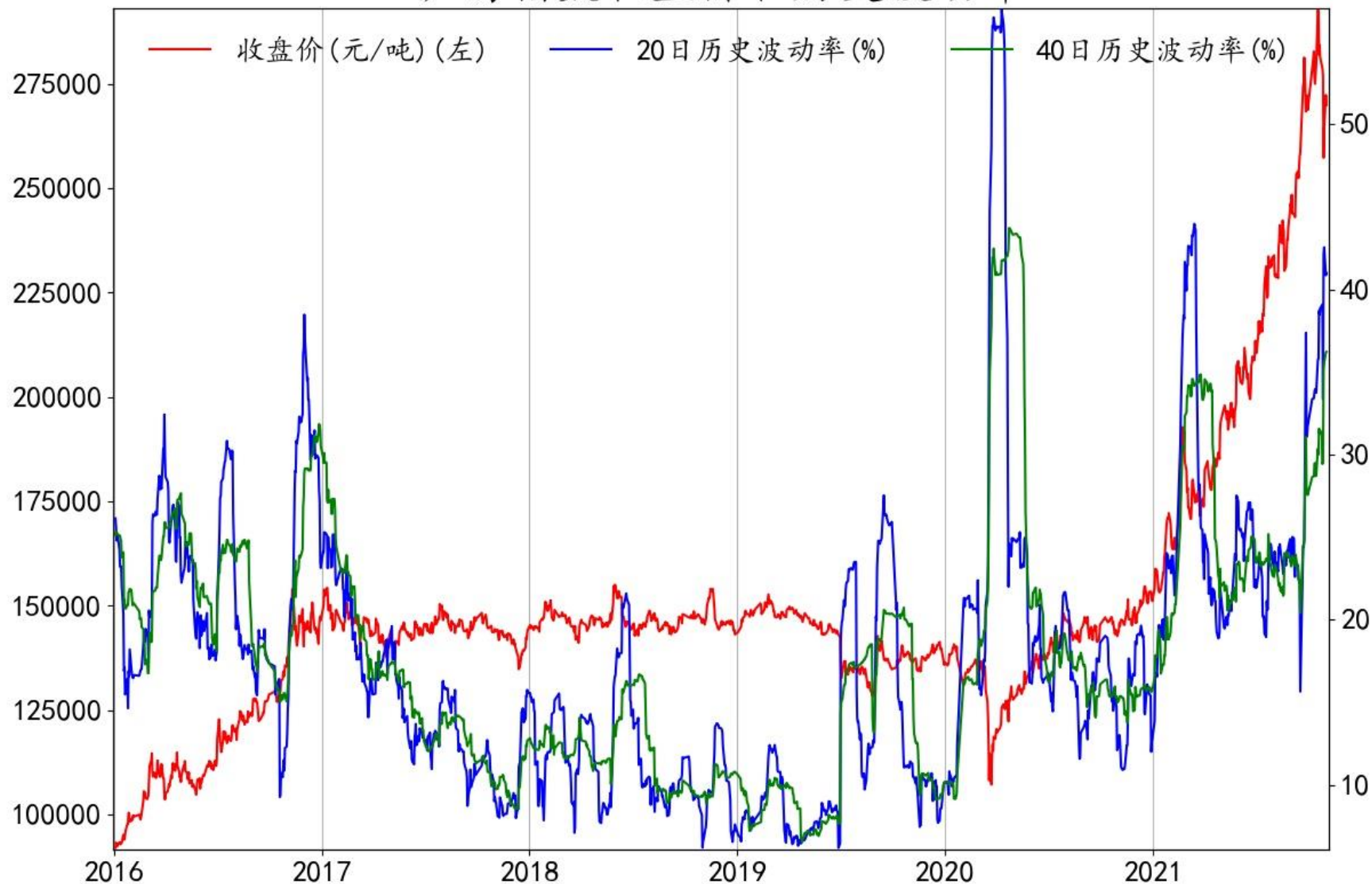
沪镍指数收盘价和历史波动率



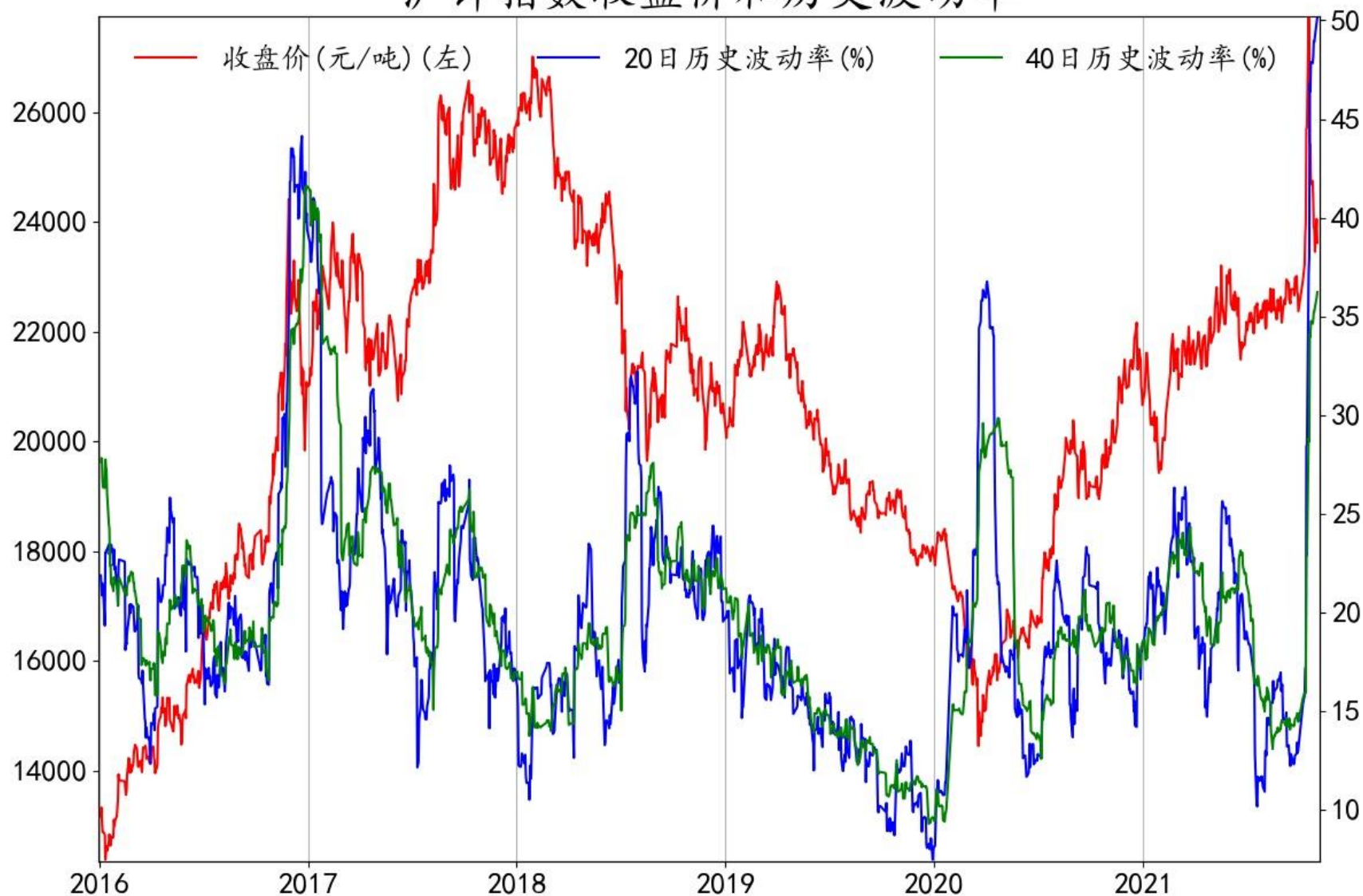
沪铅指数收盘价和历史波动率



沪锡指数收盘价和历史波动率



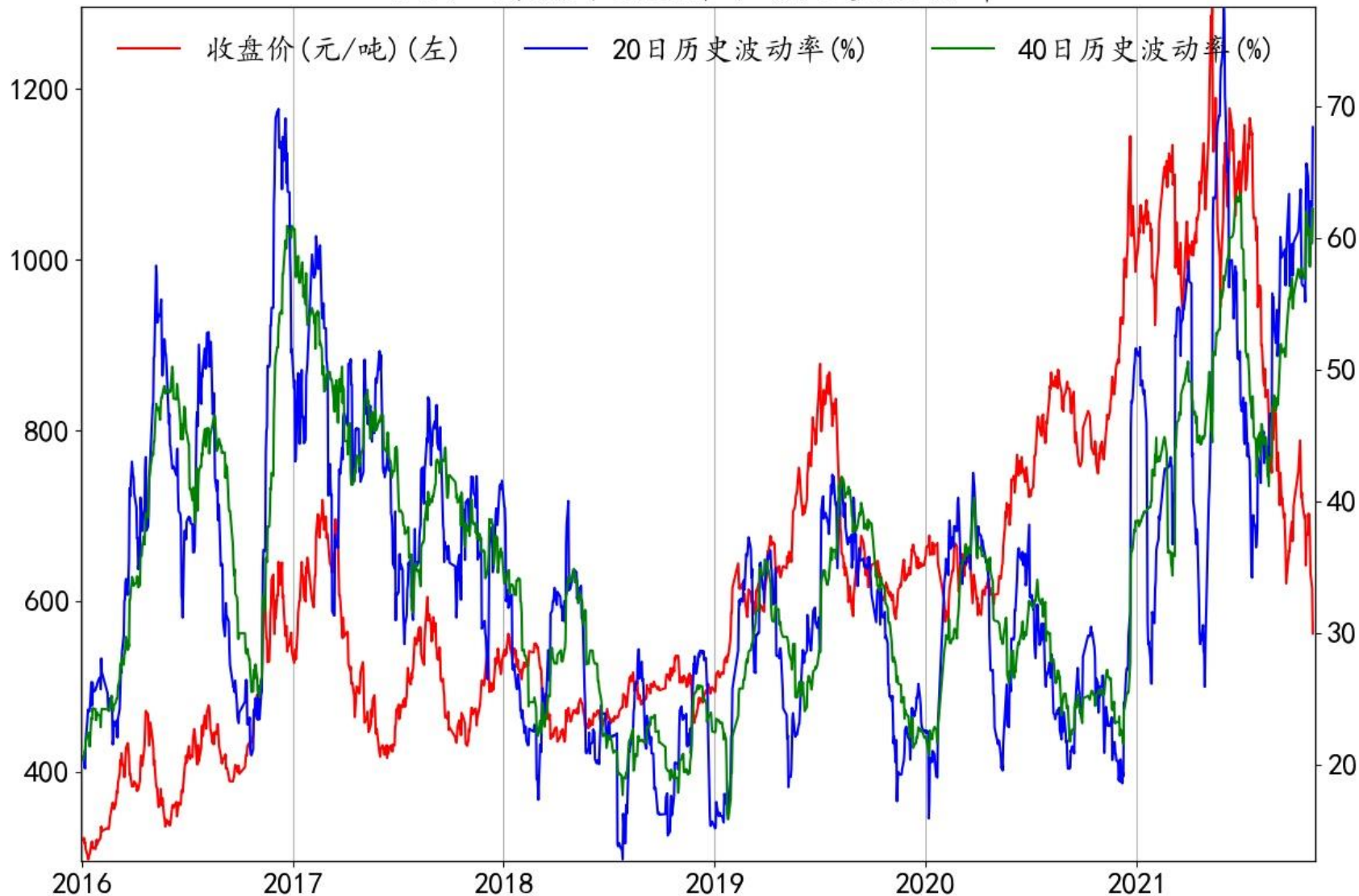
沪锌指数收盘价和历史波动率



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



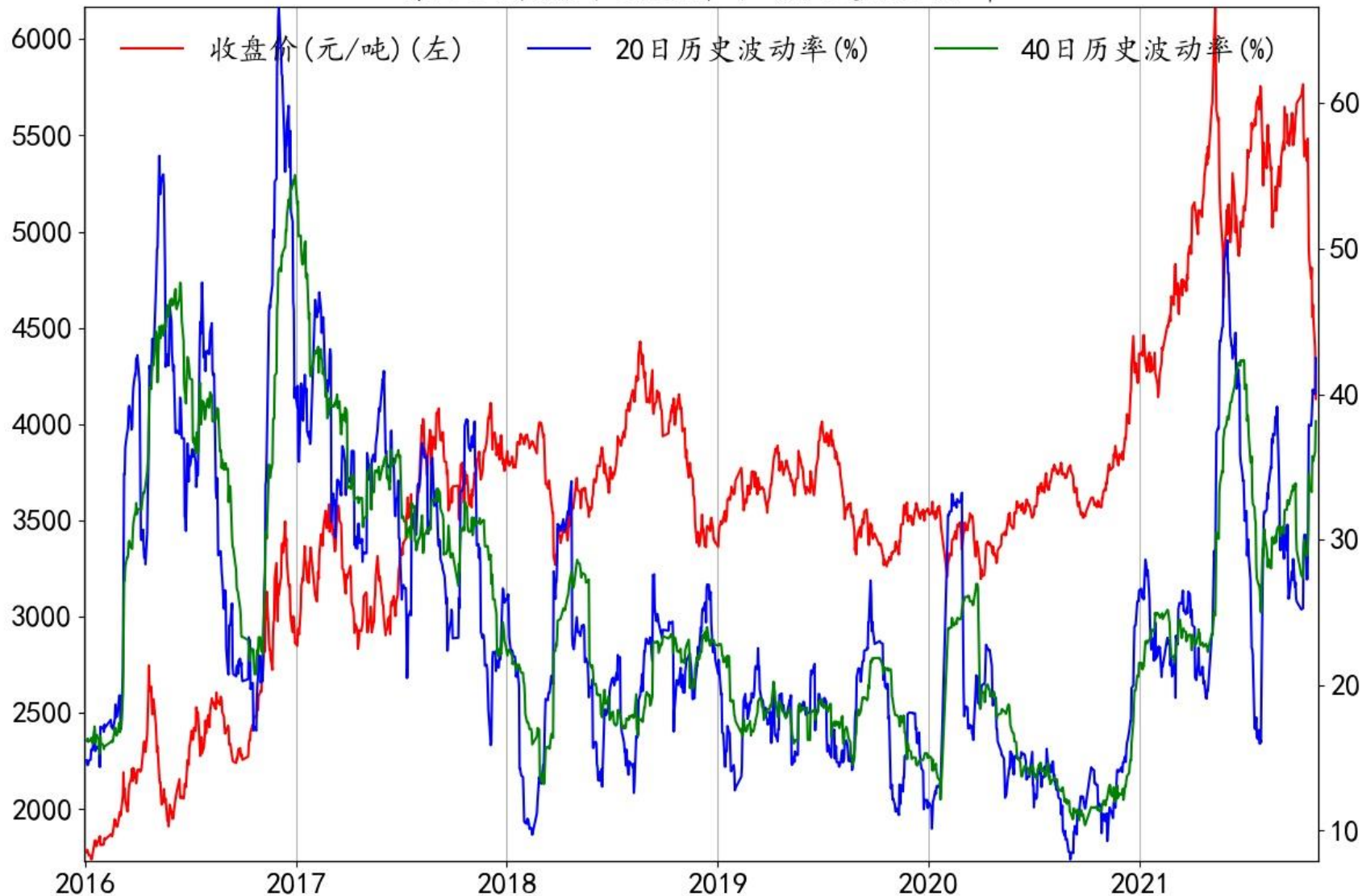
焦炭指数收盘价和历史波动率



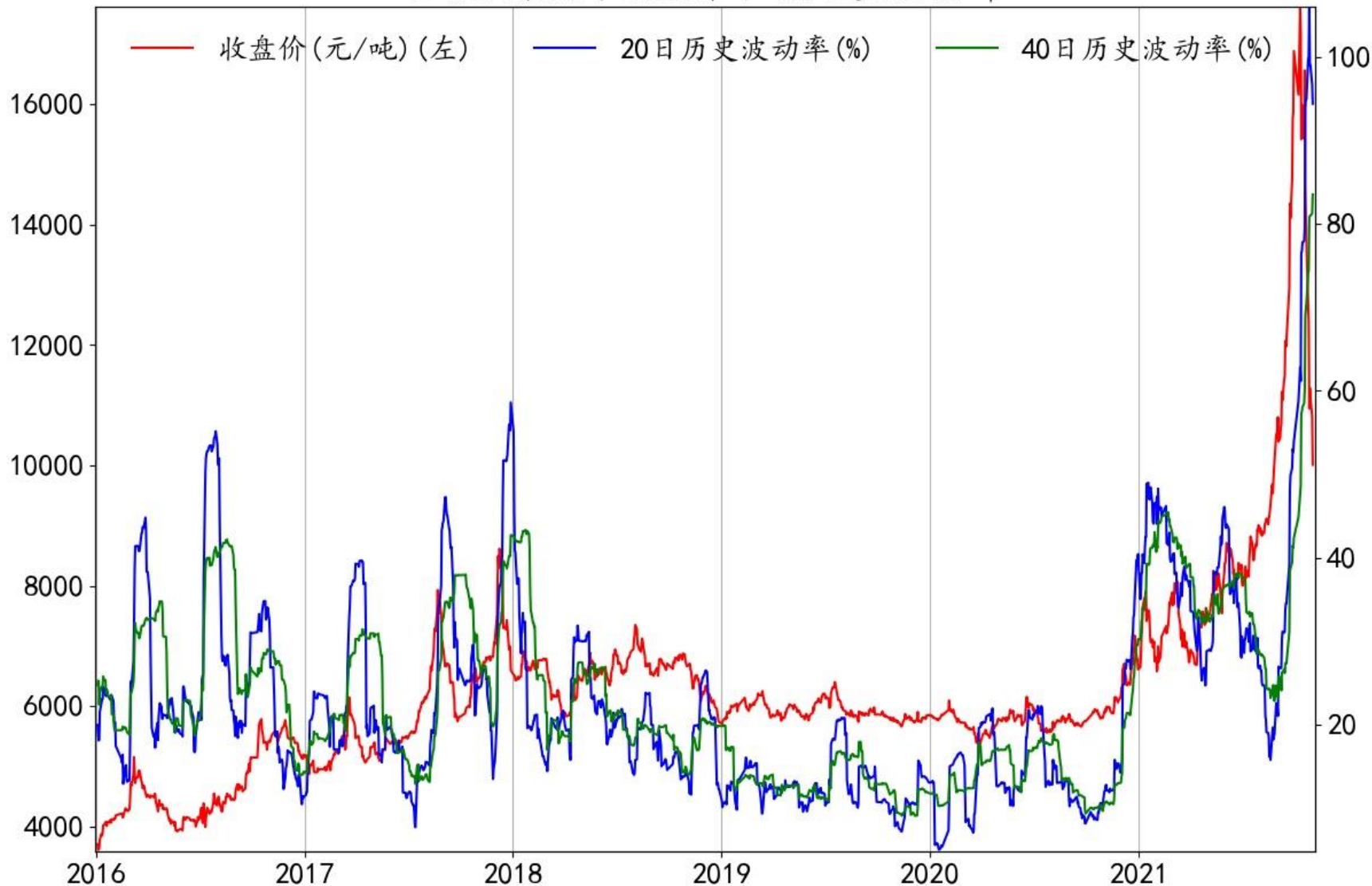
焦煤指数收盘价和历史波动率



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

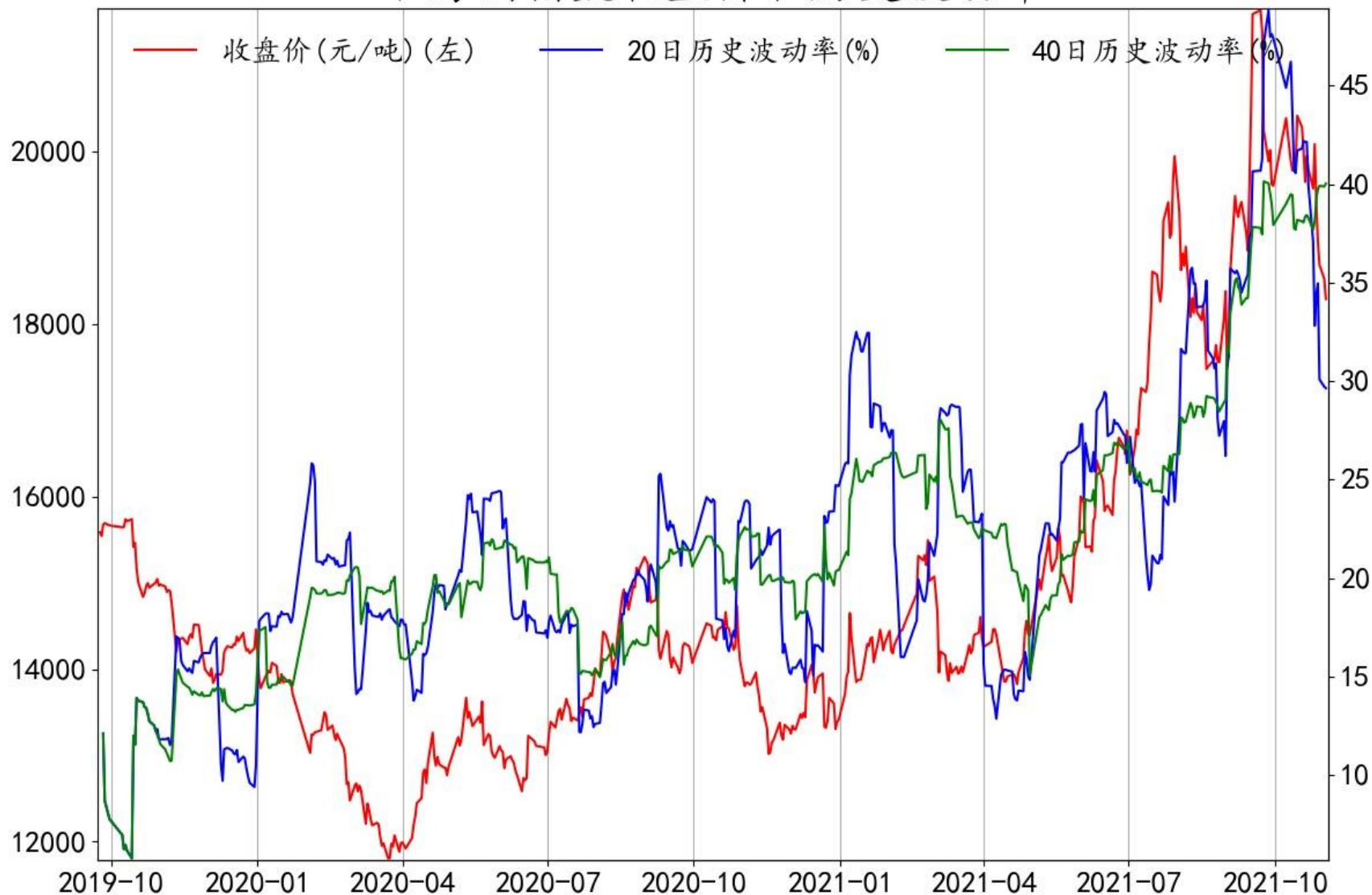


数据来源: Wind、信达期货研发中心

锰硅指数收盘价和历史波动率

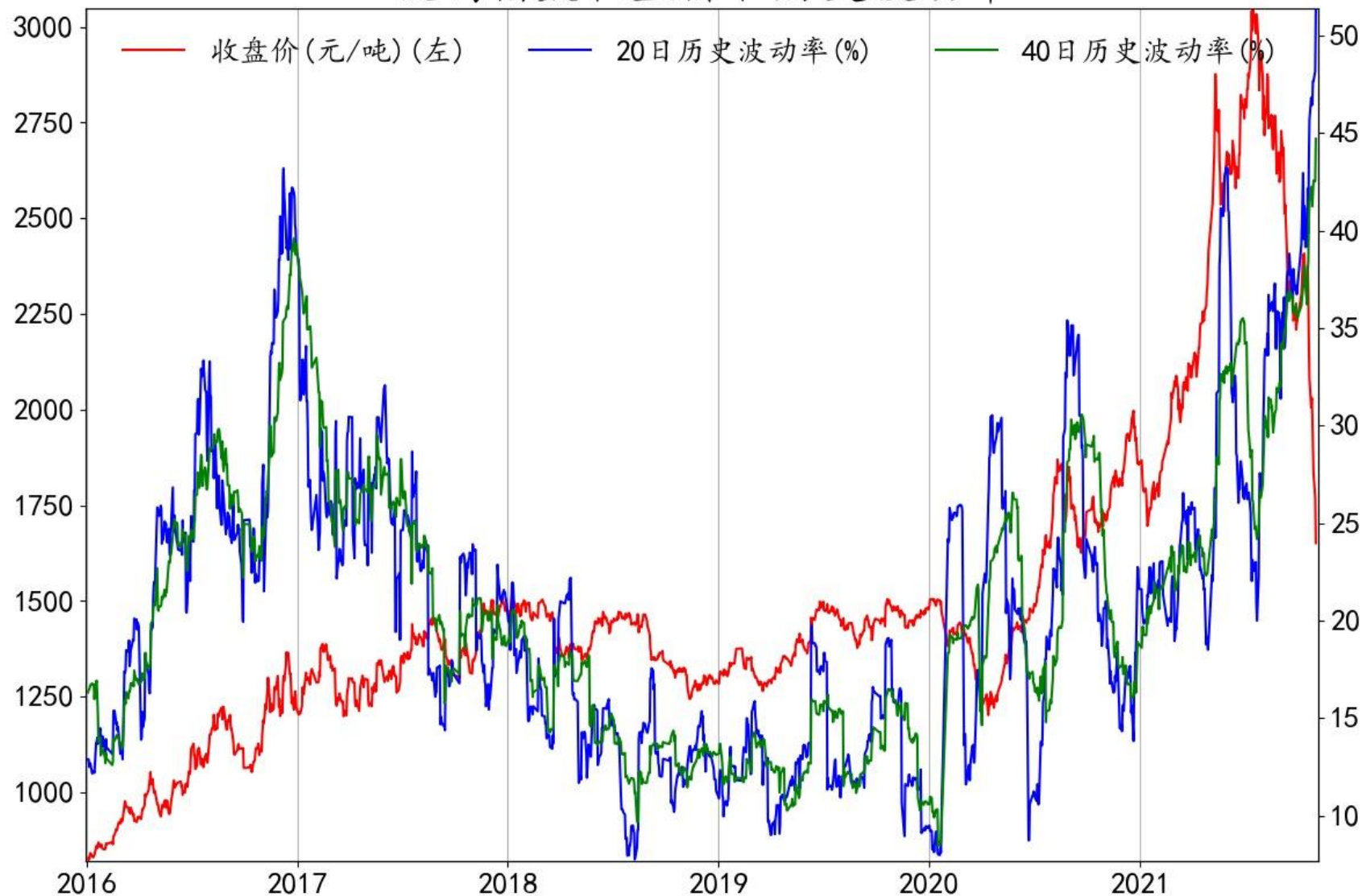


不锈钢指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

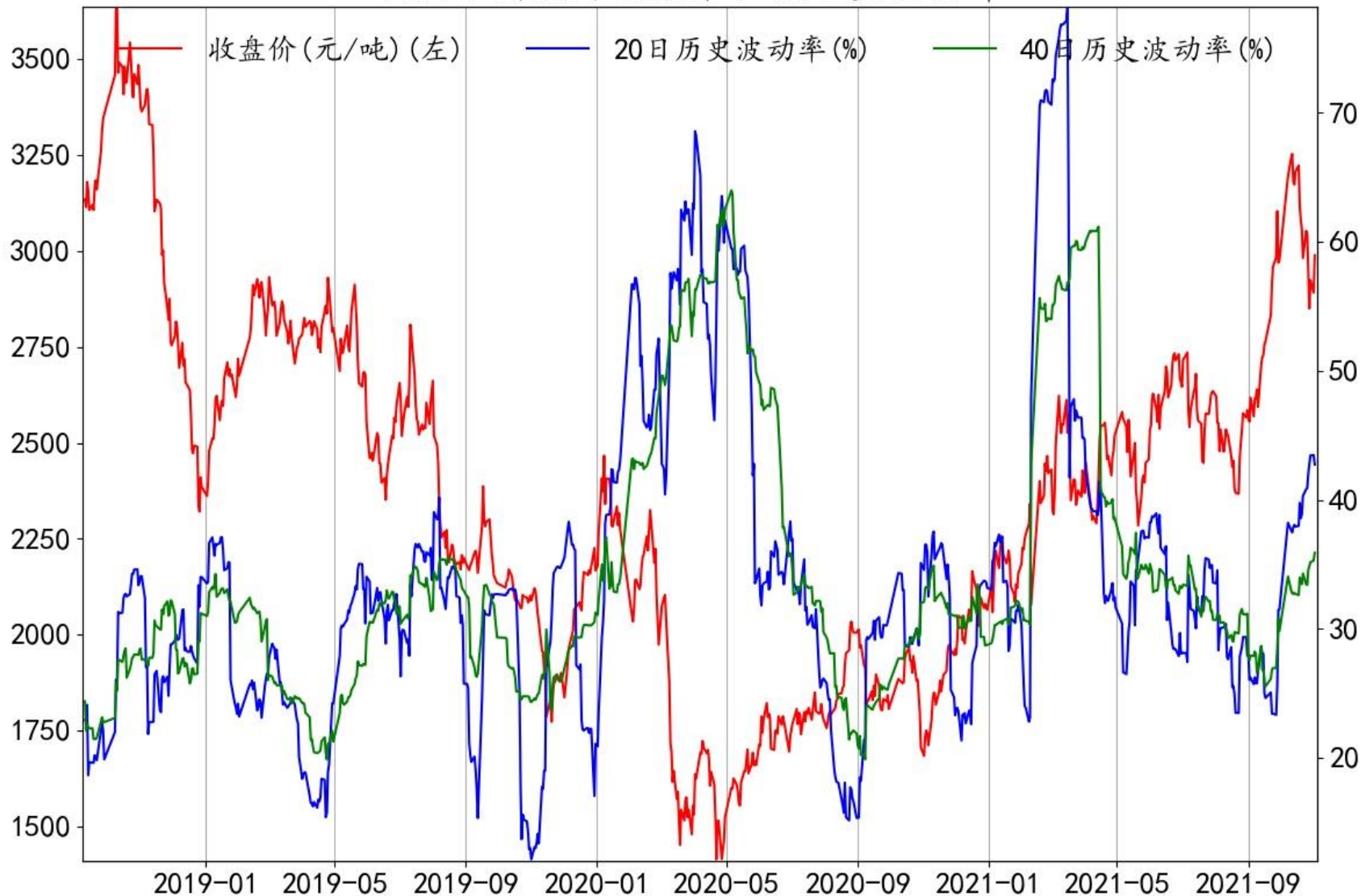
玻璃指数收盘价和历史波动率



PVC指数收盘价和历史波动率



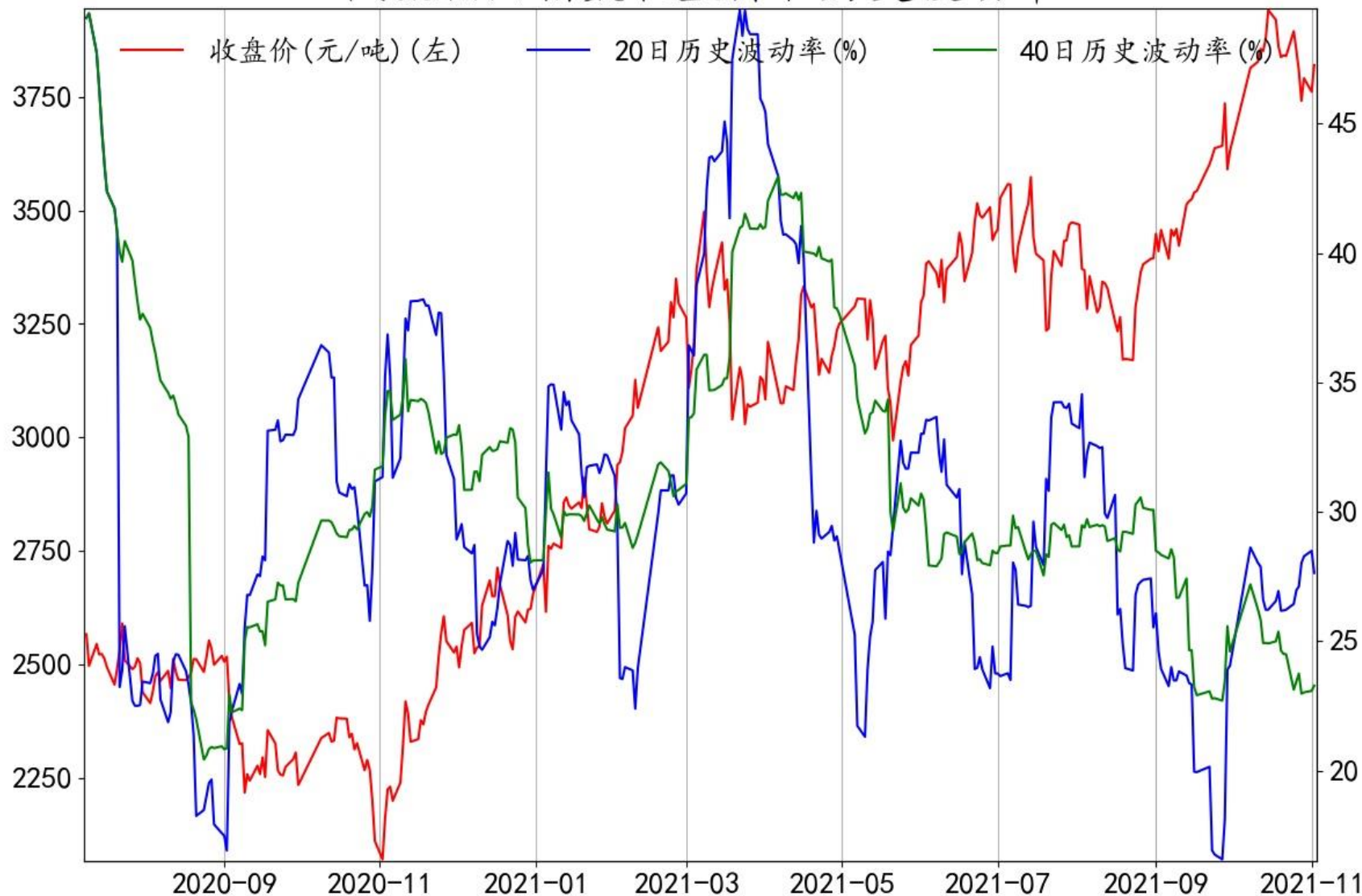
燃油指数收盘价和历史波动率



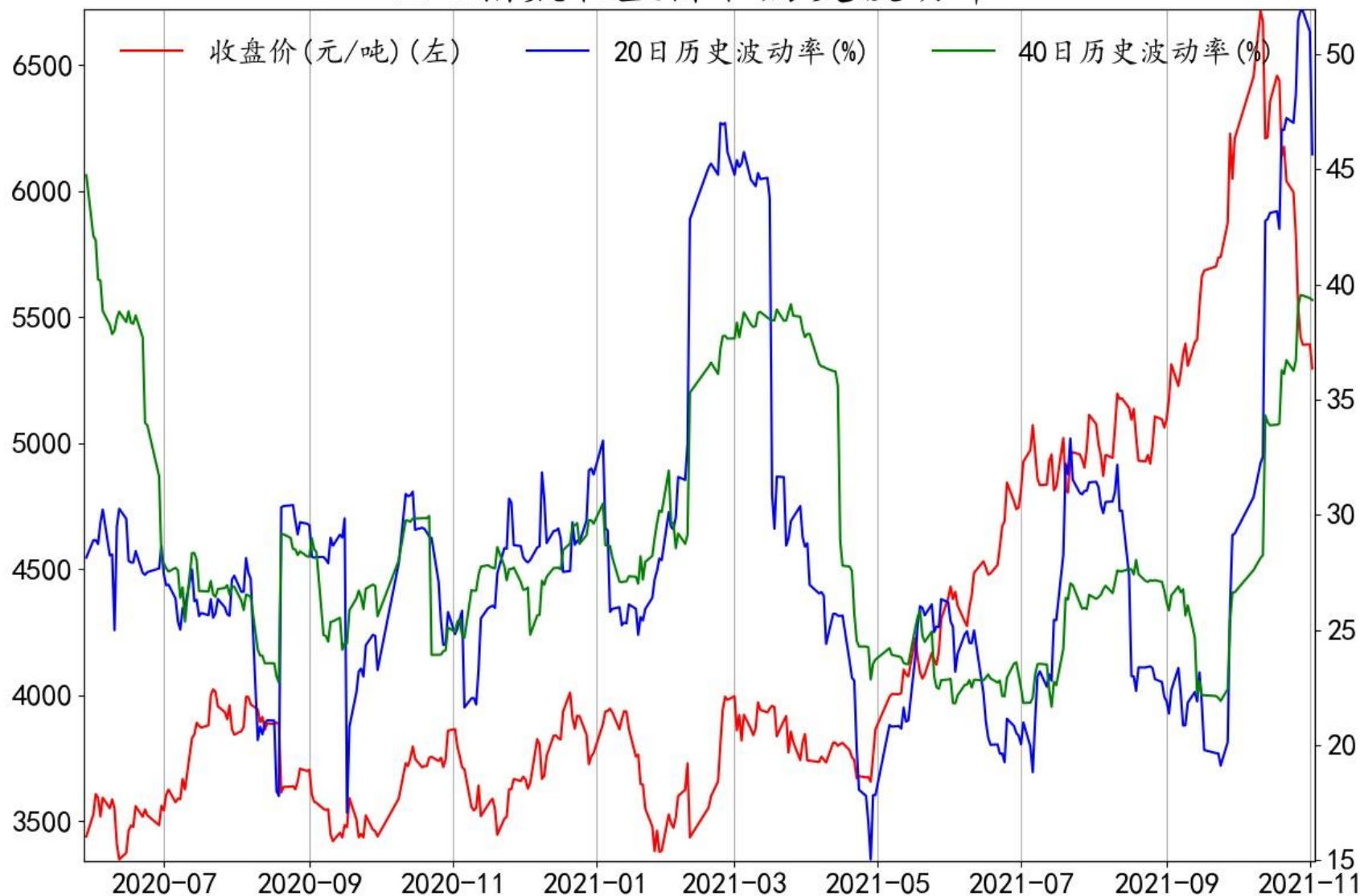
数据来源: Wind、信达期货研发中心

低硫燃油指数

低硫燃油指数收盘价和历史波动率

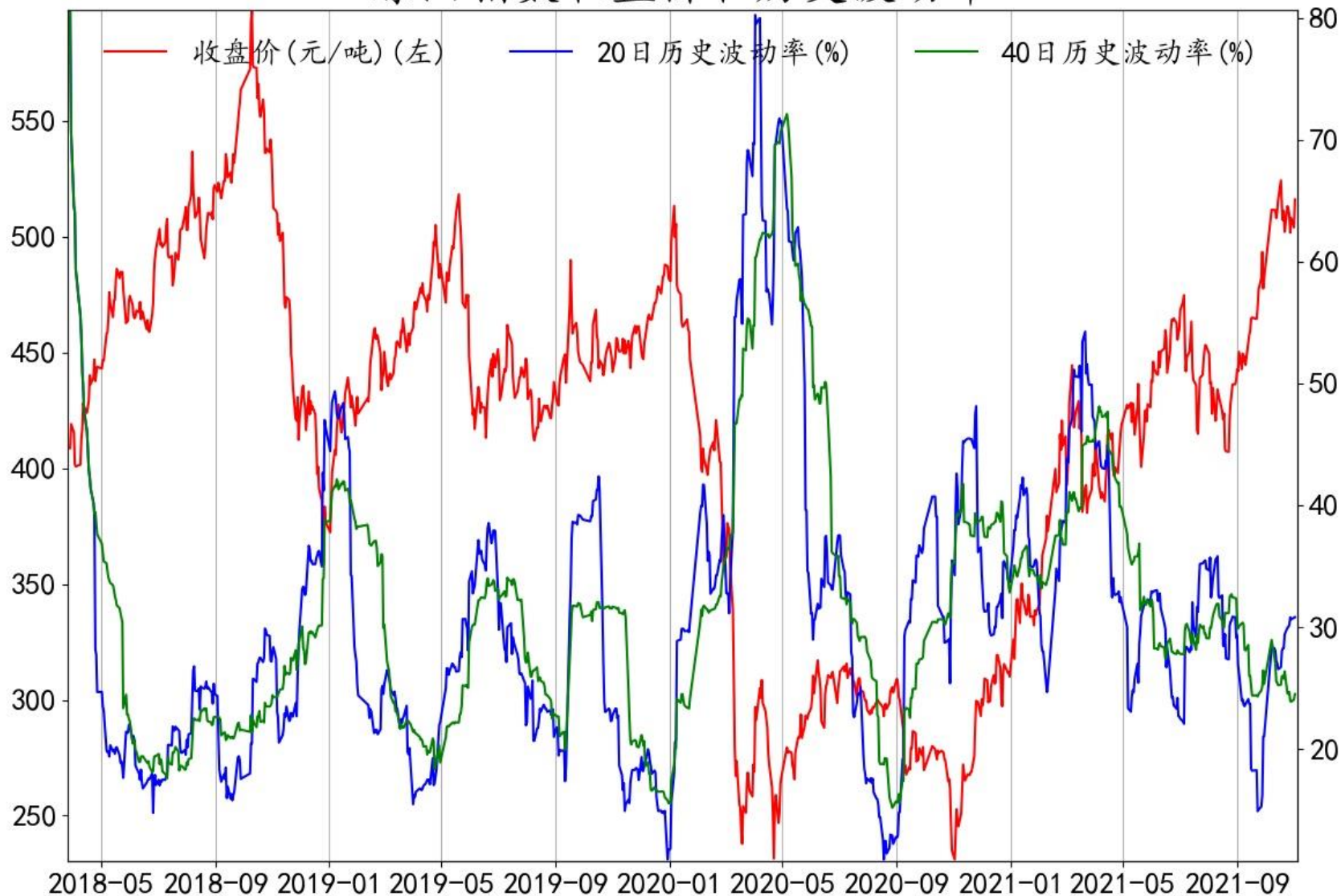


LPG指数收盘价和历史波动率



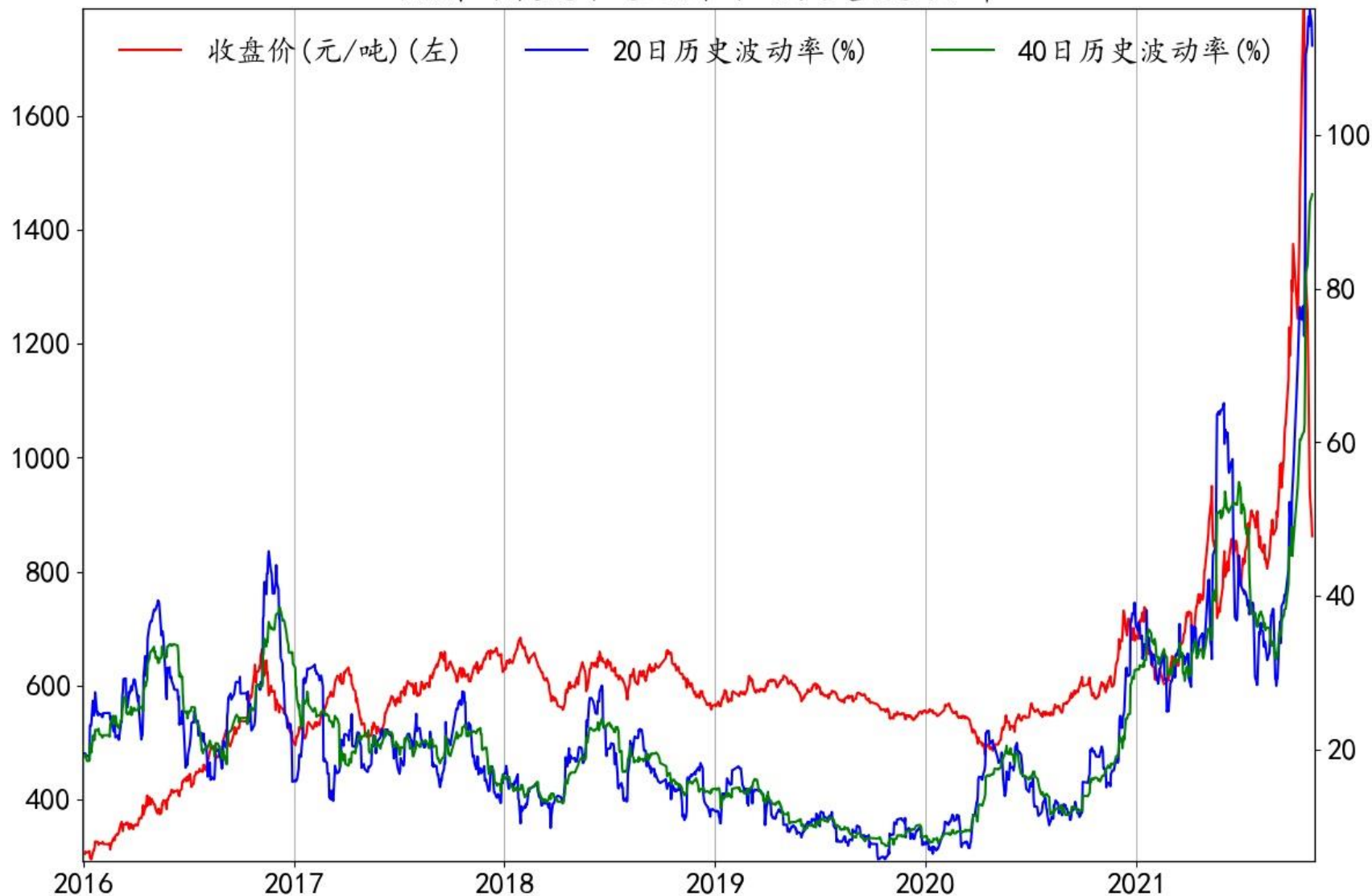
数据来源: Wind、信达期货研发中心

原油指数收盘价和历史波动率

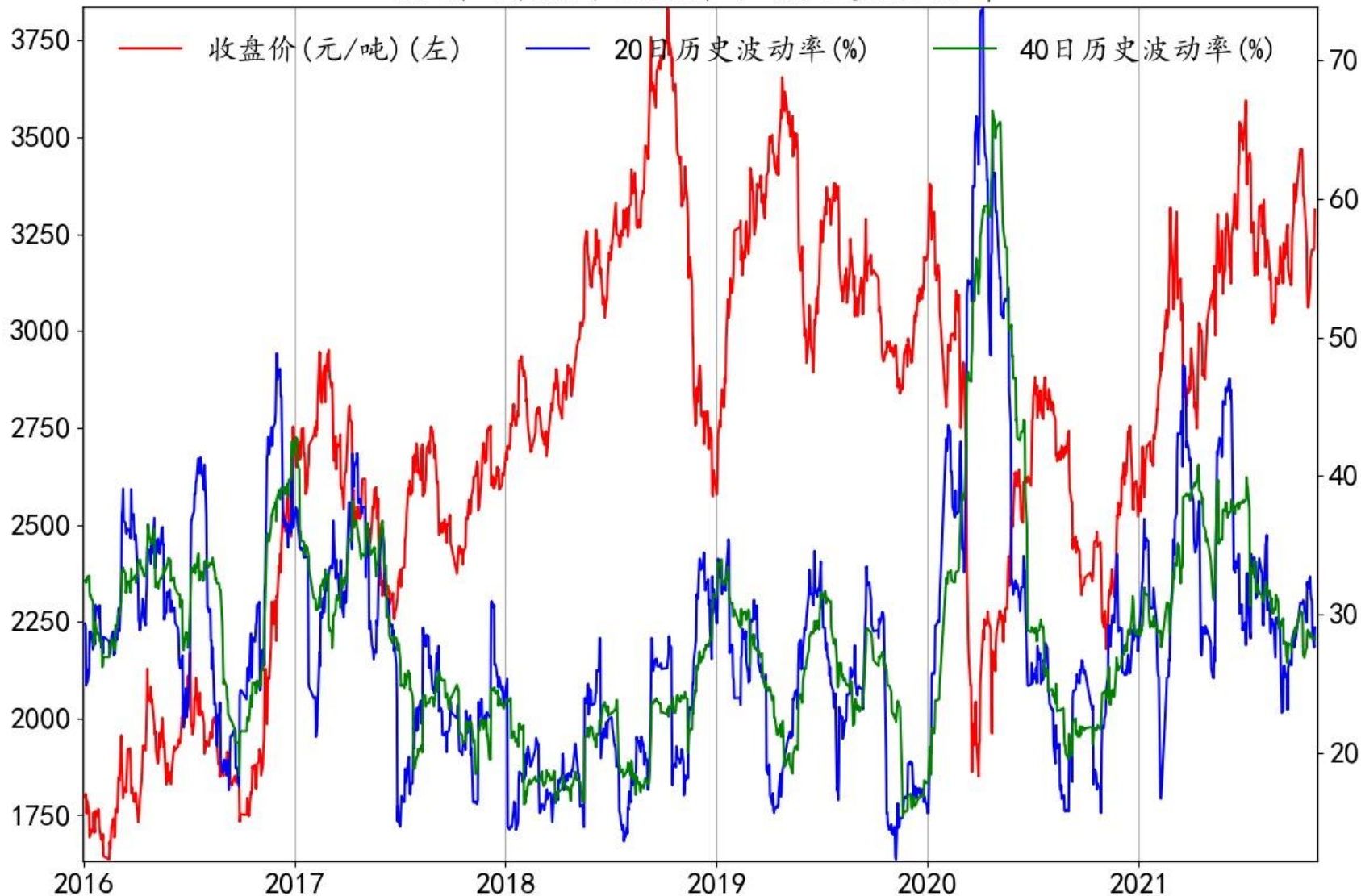


数据来源: Wind、信达期货研发中心

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

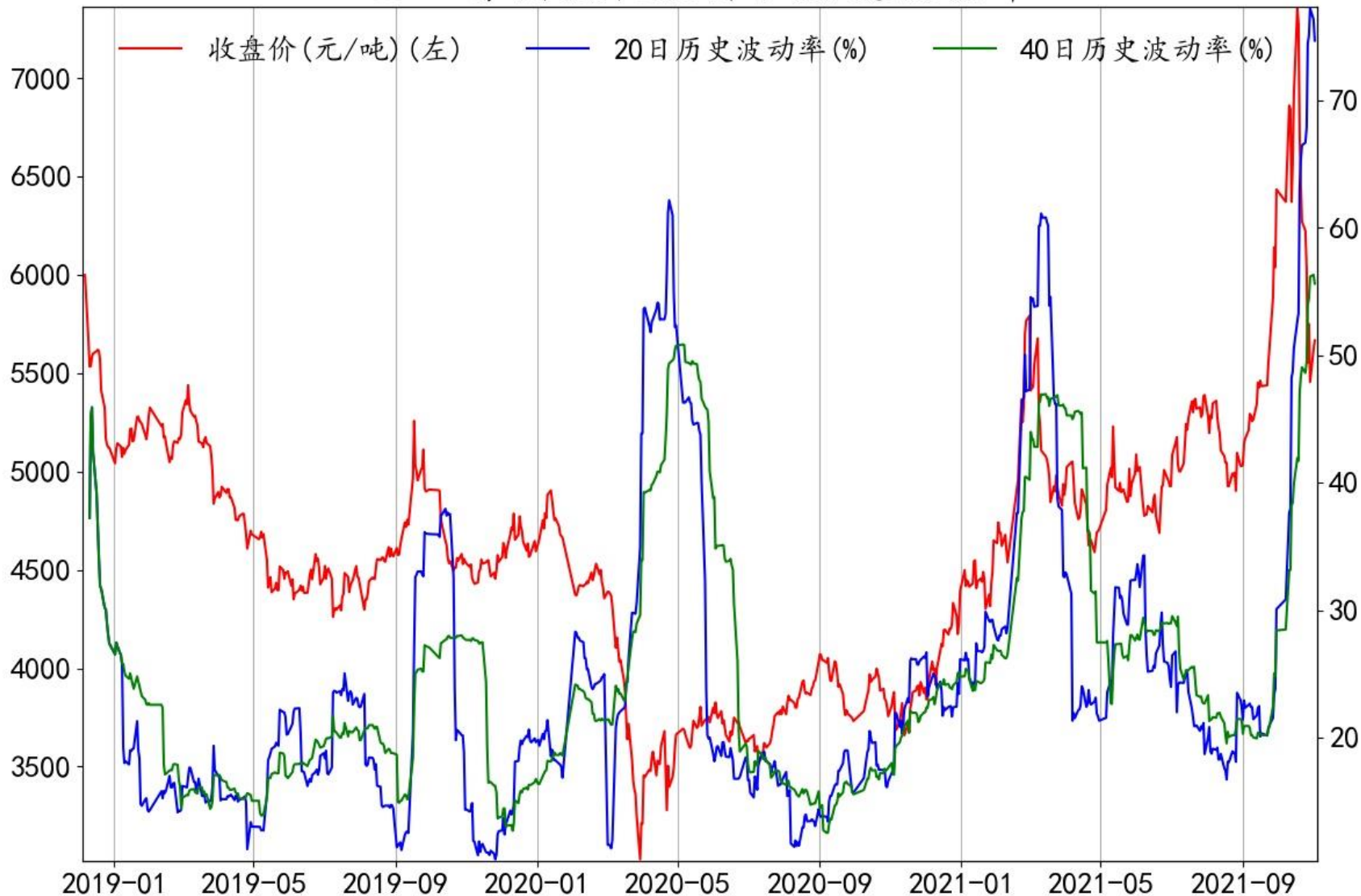


苯乙烯指数收盘价和历史波动率



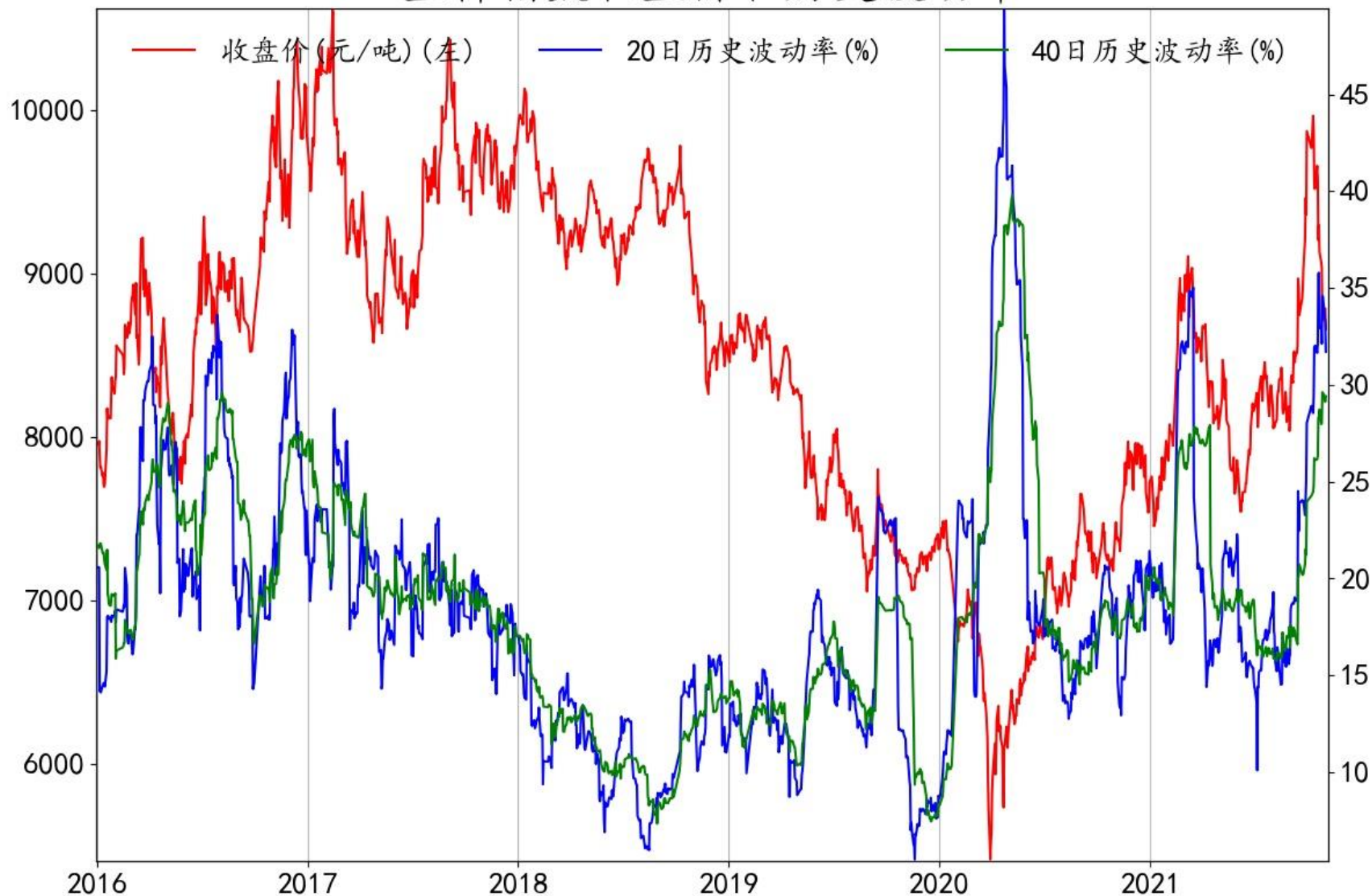
数据来源: Wind、信达期货研发中心

乙二醇指数收盘价和历史波动率

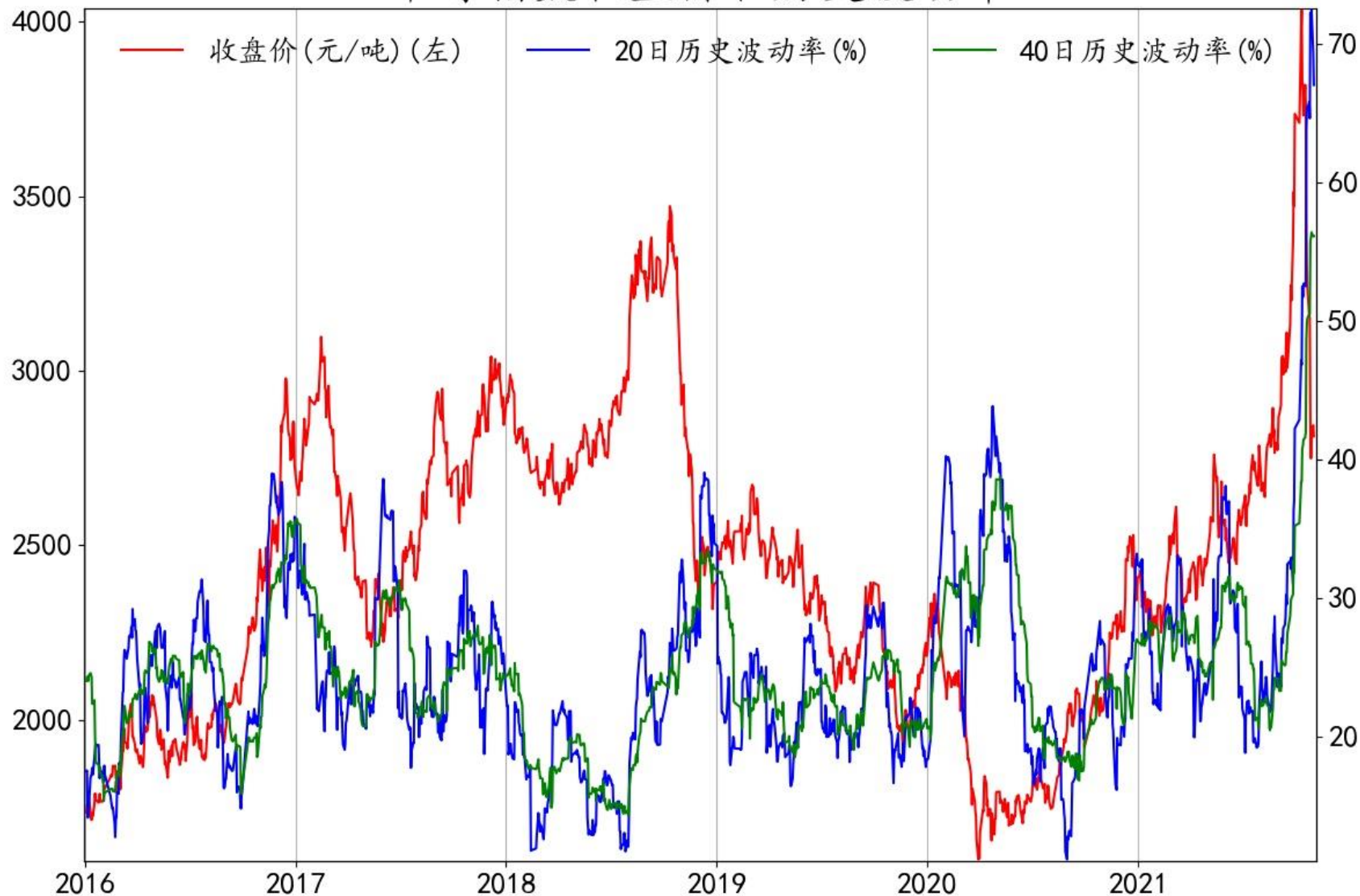


数据来源: Wind、信达期货研发中心

塑料指数收盘价和历史波动率



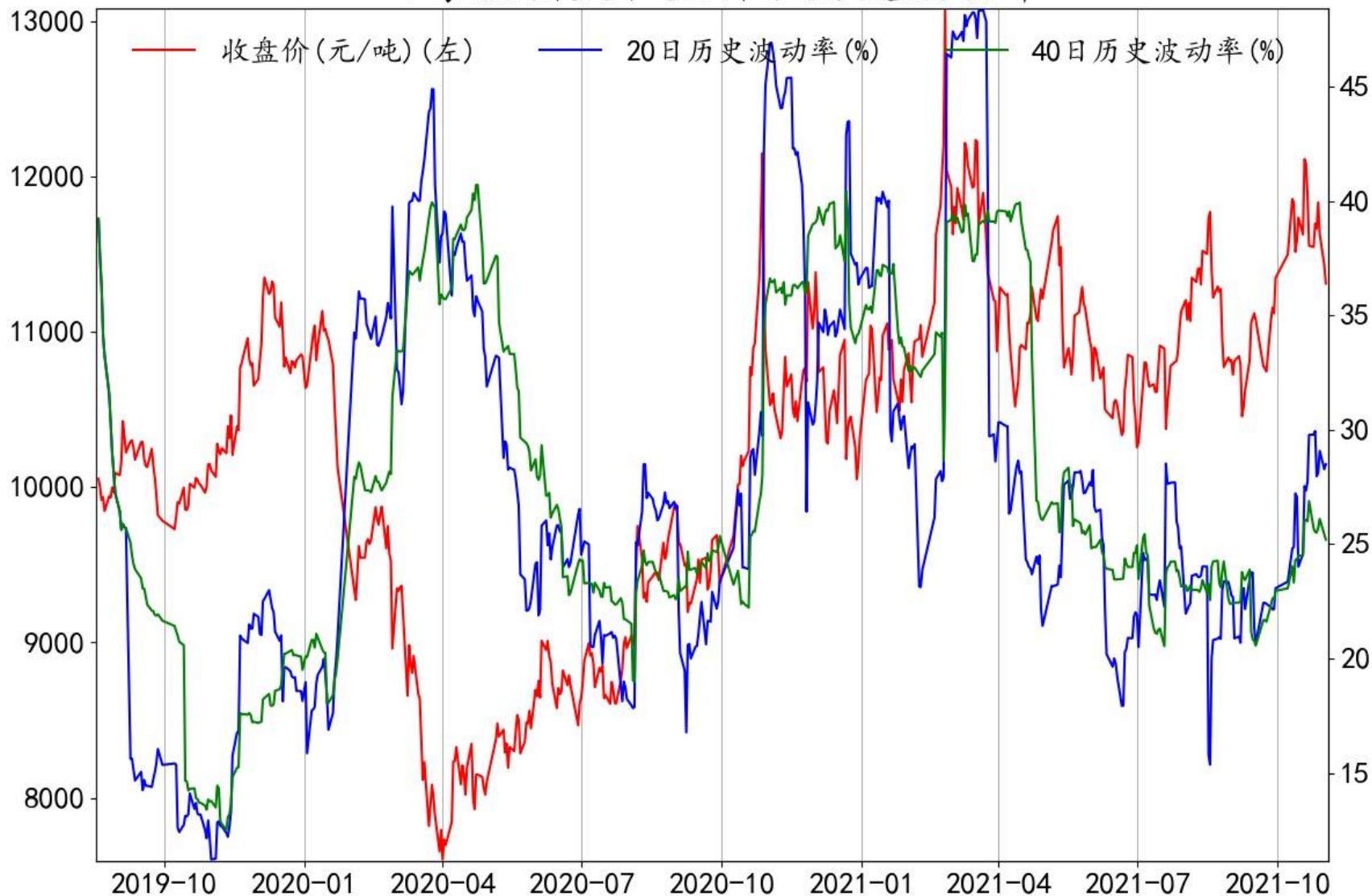
甲醇指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

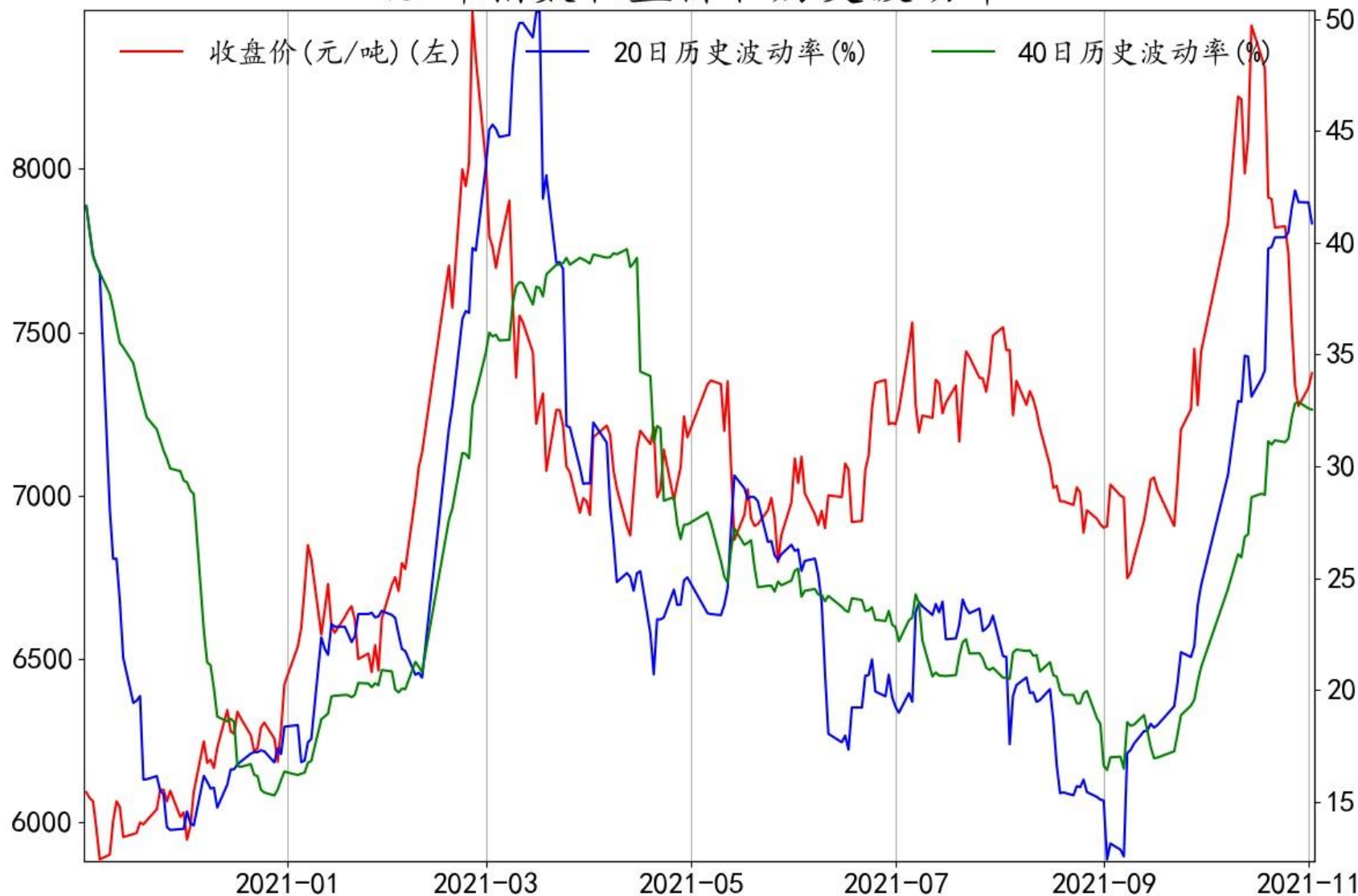
20号胶指数

20号胶指数收盘价和历史波动率



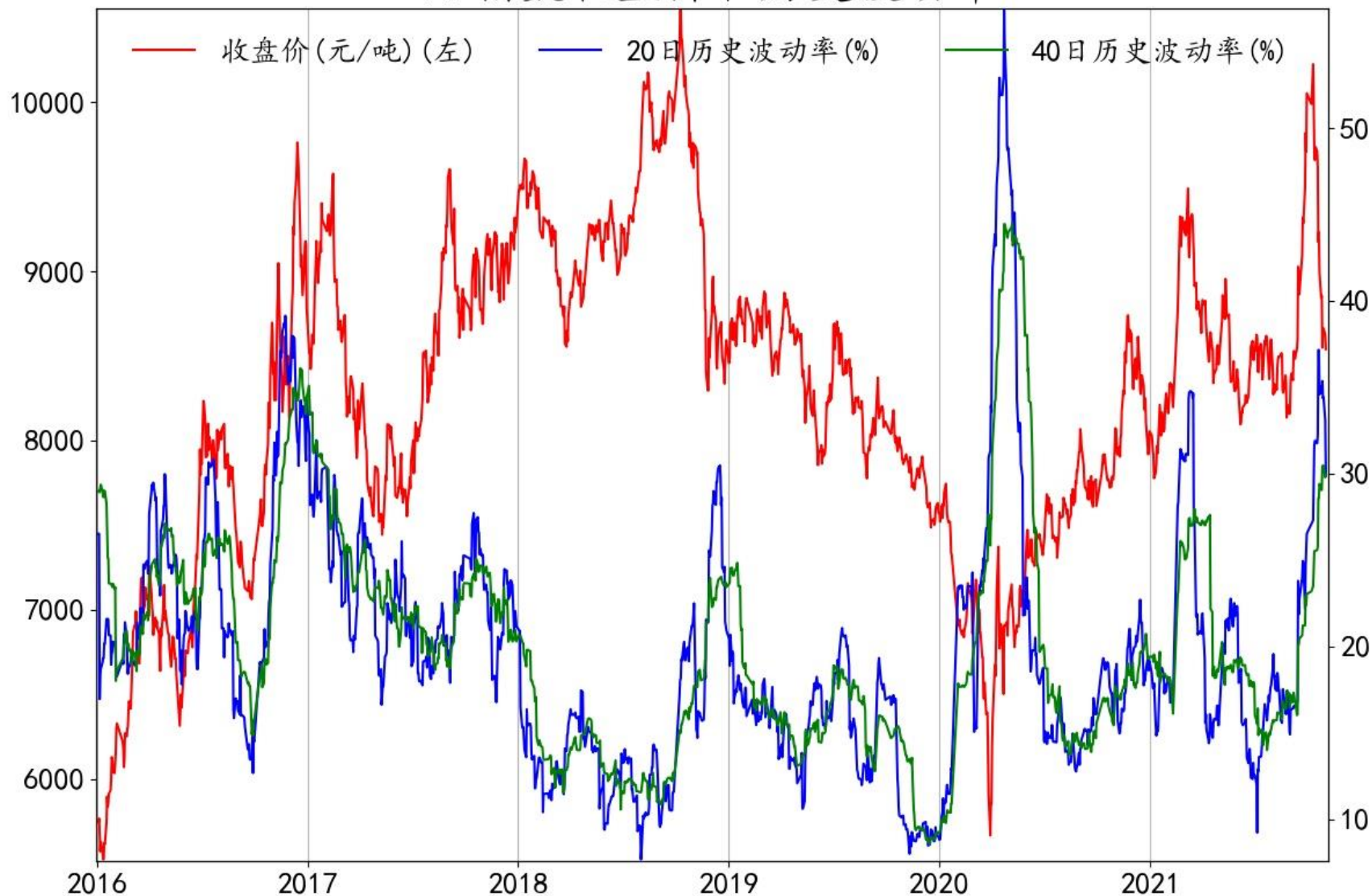
数据来源: Wind、信达期货研发中心

短纤指数收盘价和历史波动率



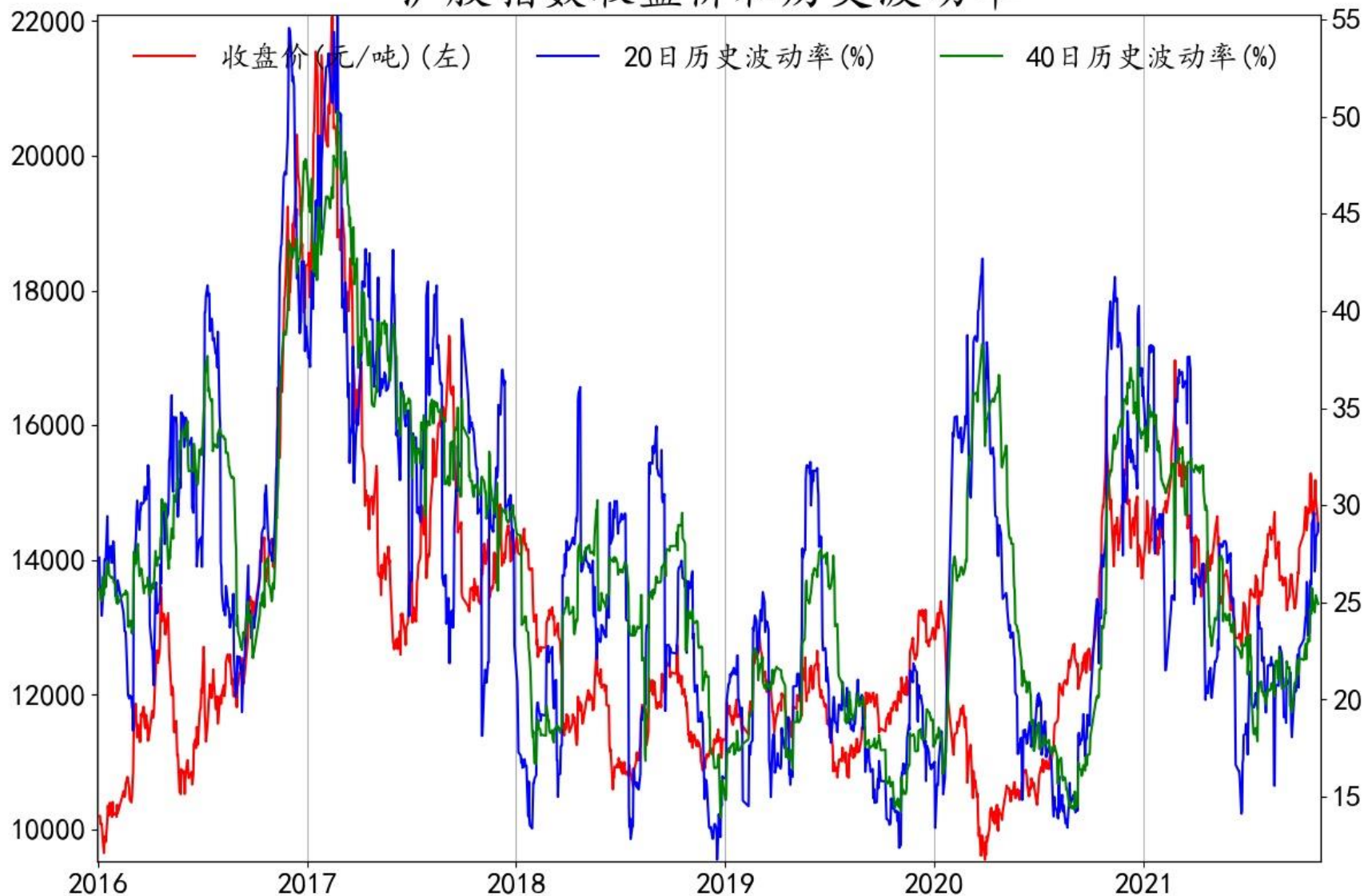
数据来源: Wind、信达期货研发中心

PP指数收盘价和历史波动率

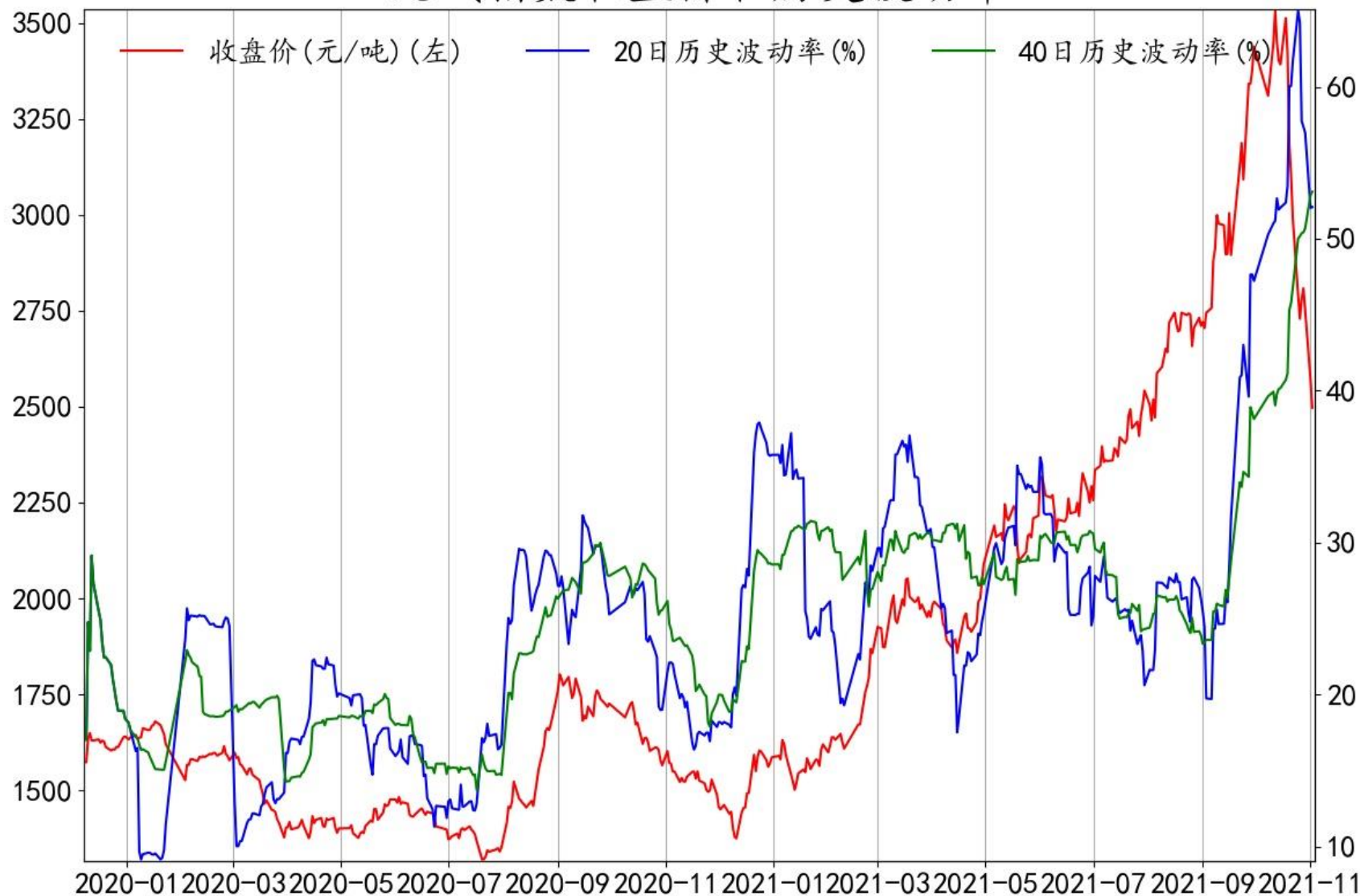


数据来源: Wind、信达期货研发中心

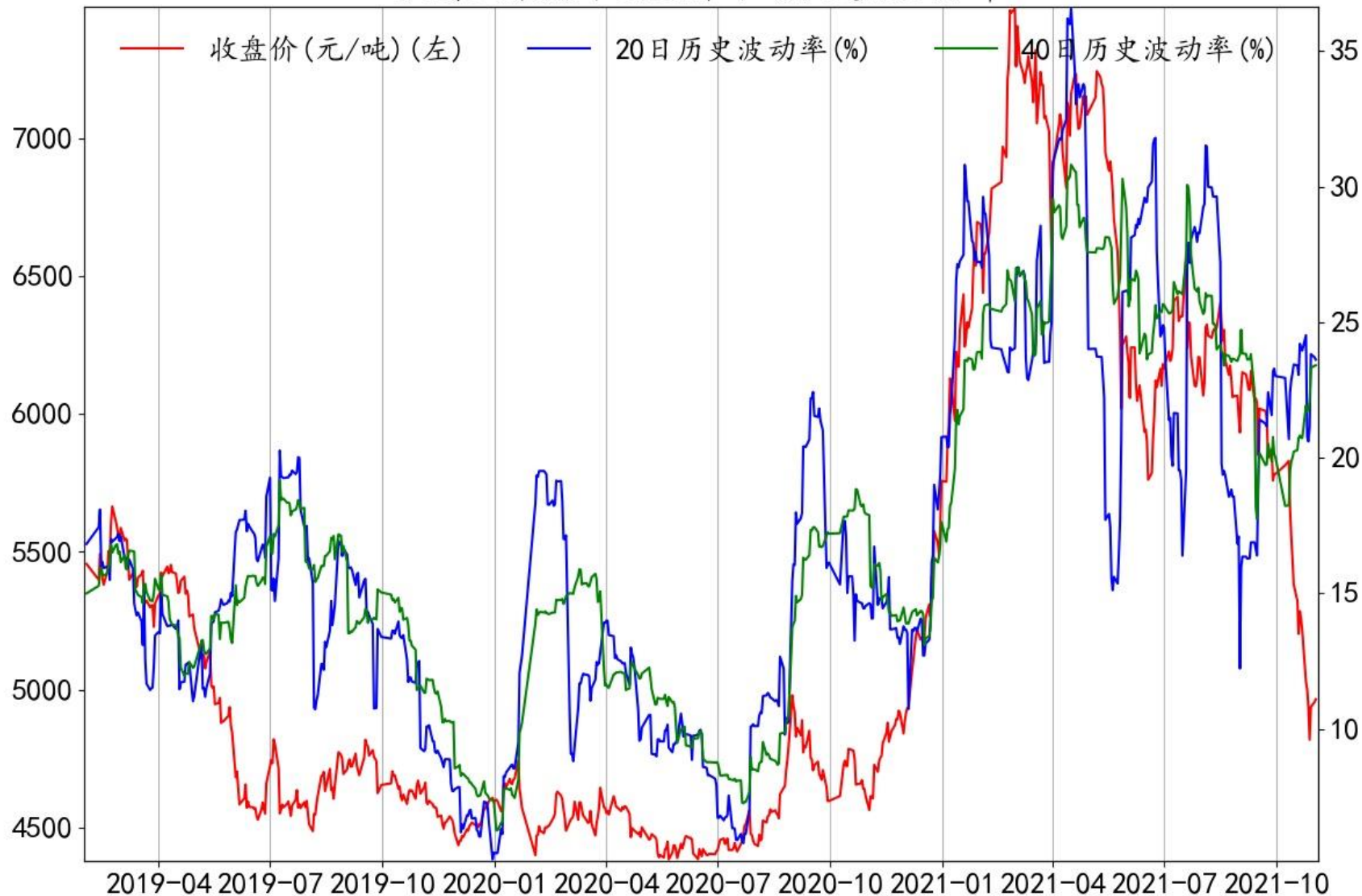
沪胶指数收盘价和历史波动率



纯碱指数收盘价和历史波动率

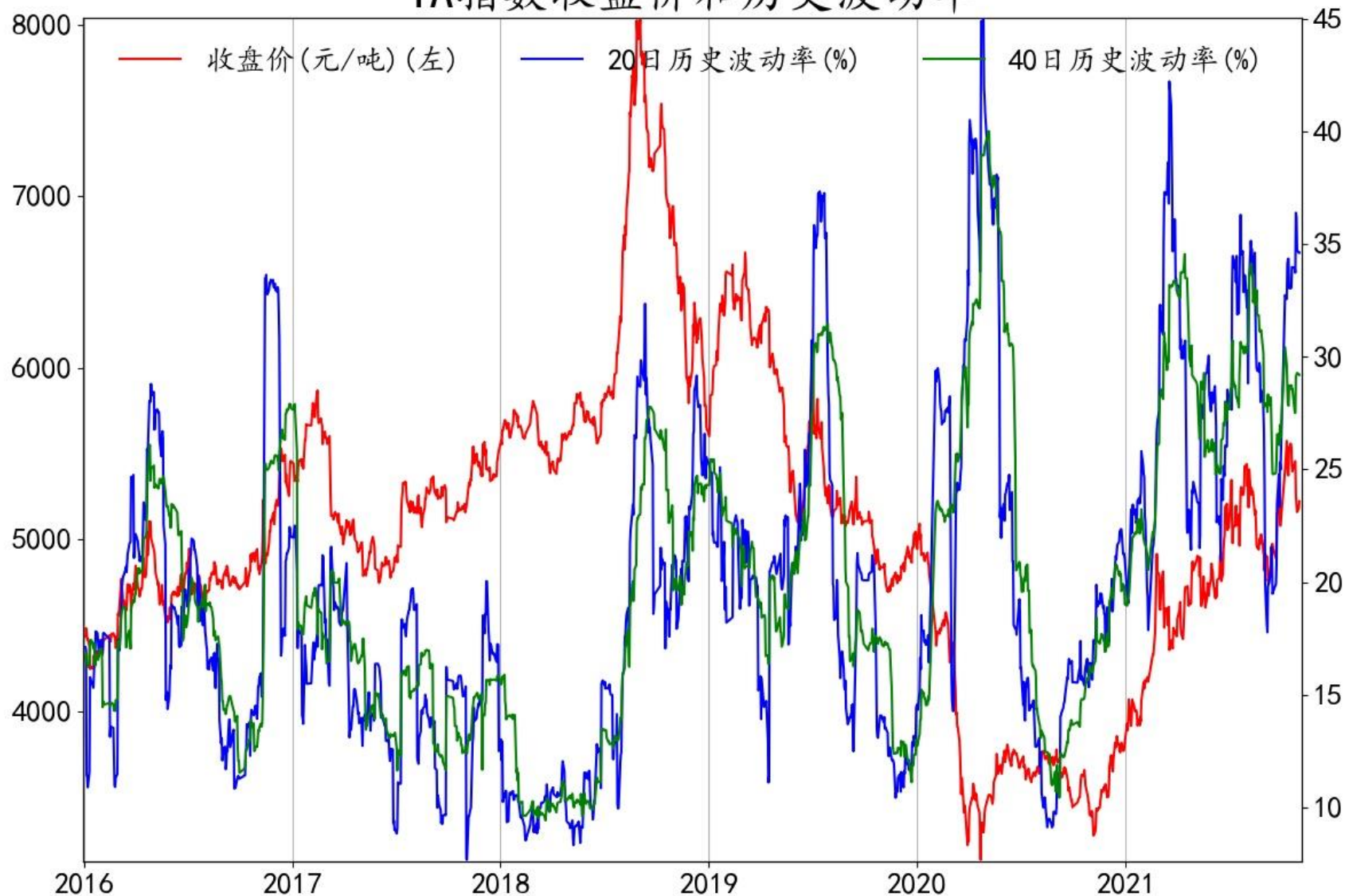


纸浆指数收盘价和历史波动率



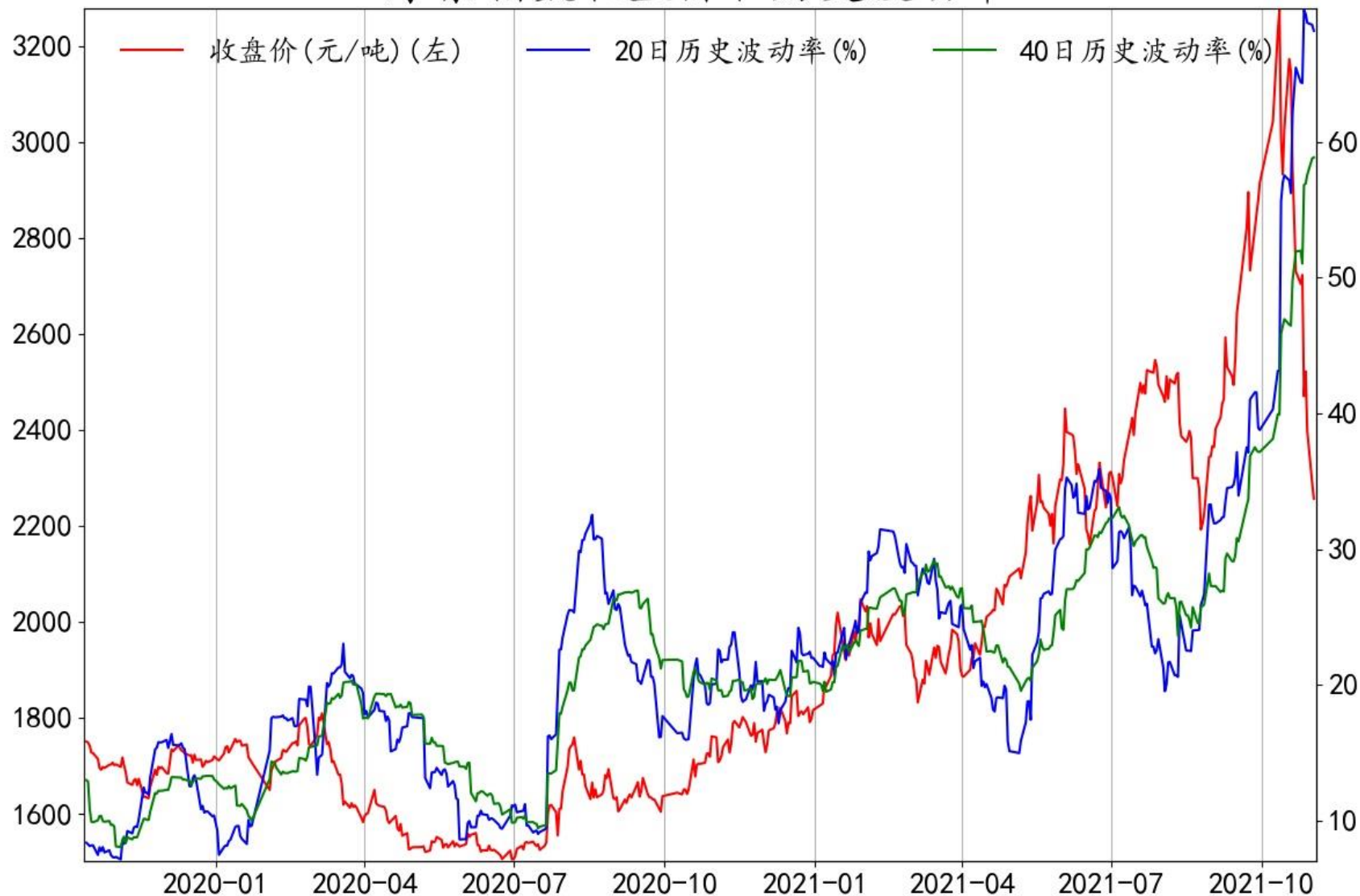
数据来源: Wind、信达期货研发中心

TA指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

尿素指数收盘价和历史波动率

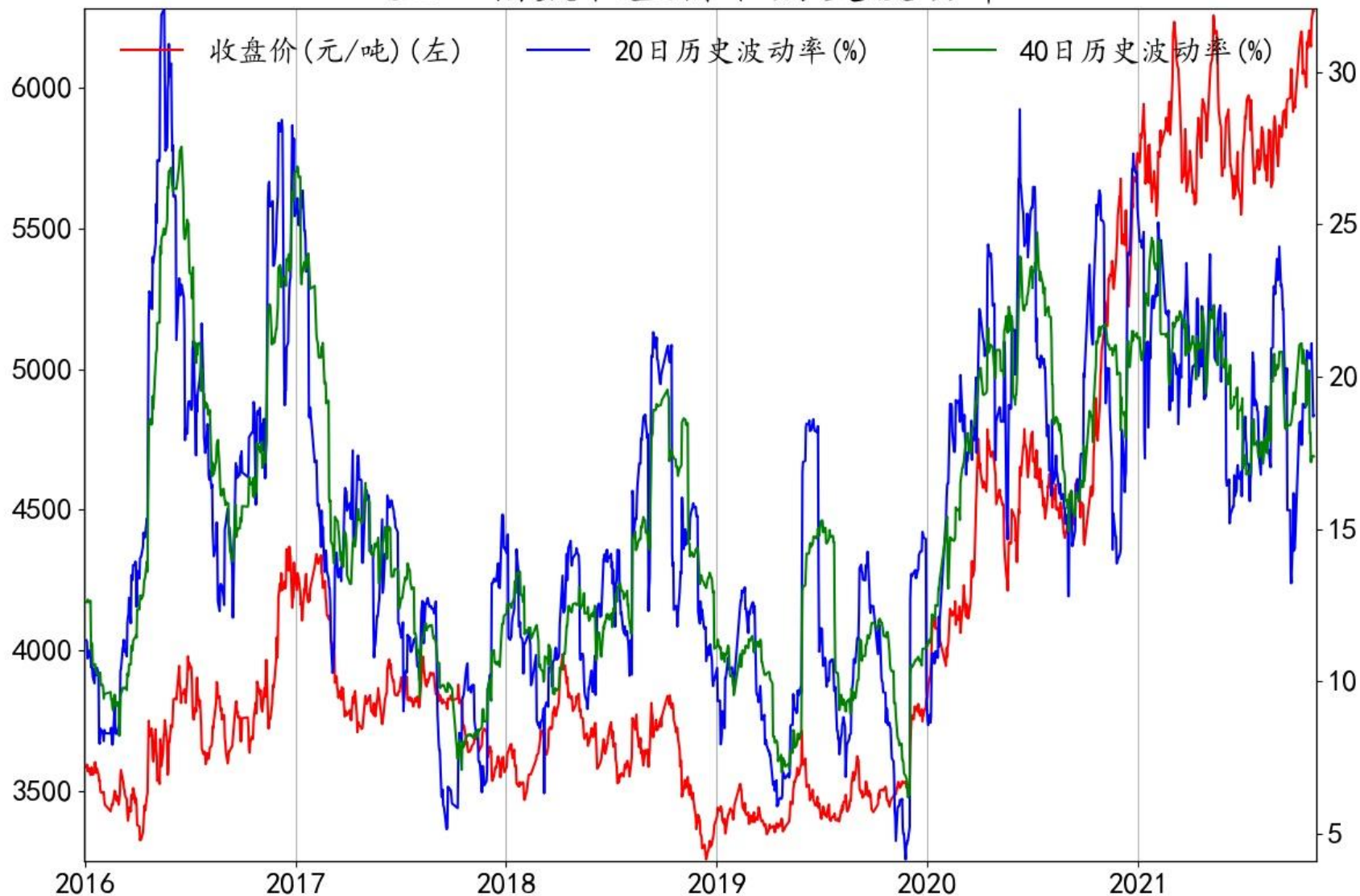


数据来源: Wind、信达期货研发中心

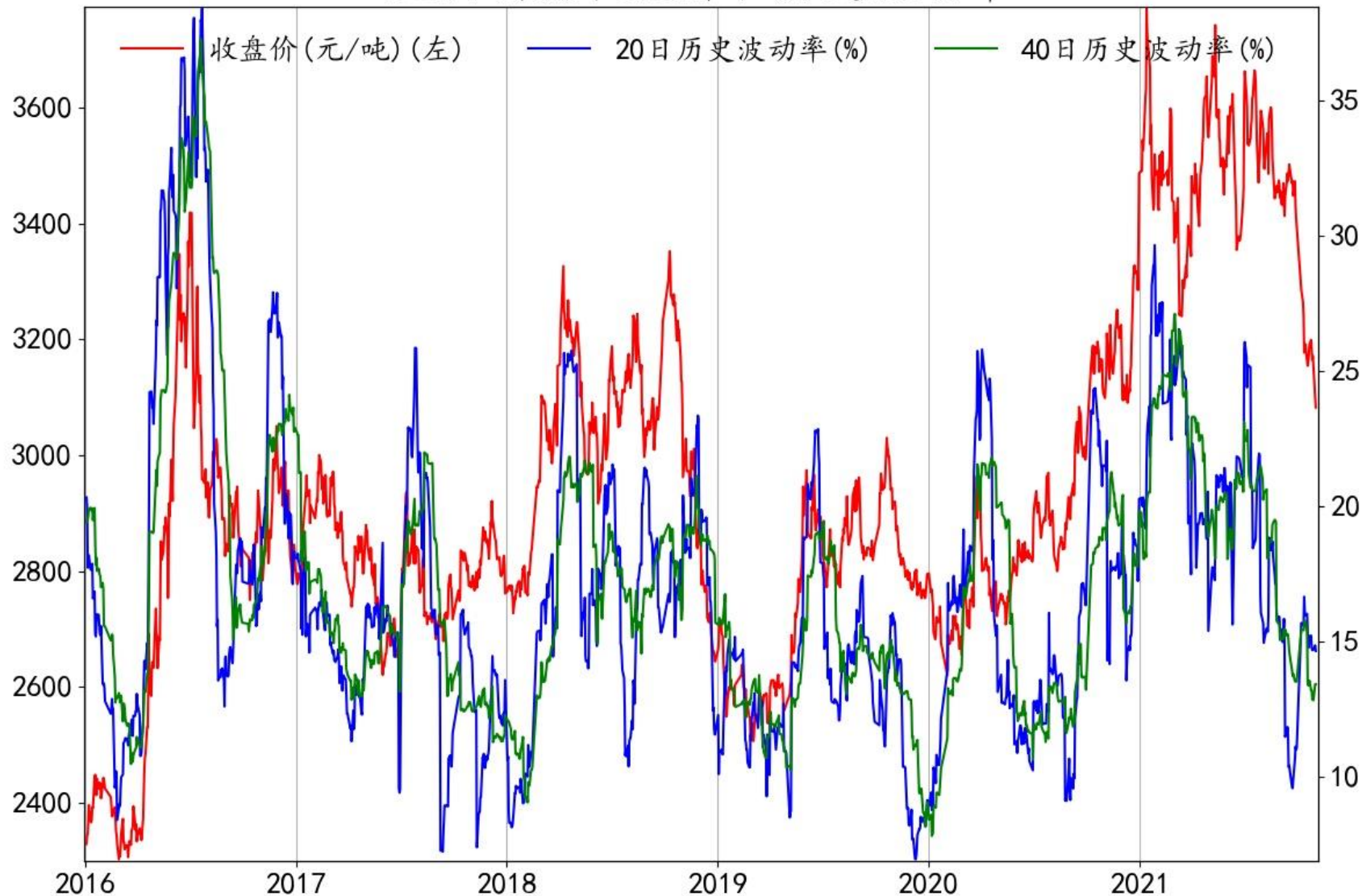
玉米指数收盘价和历史波动率



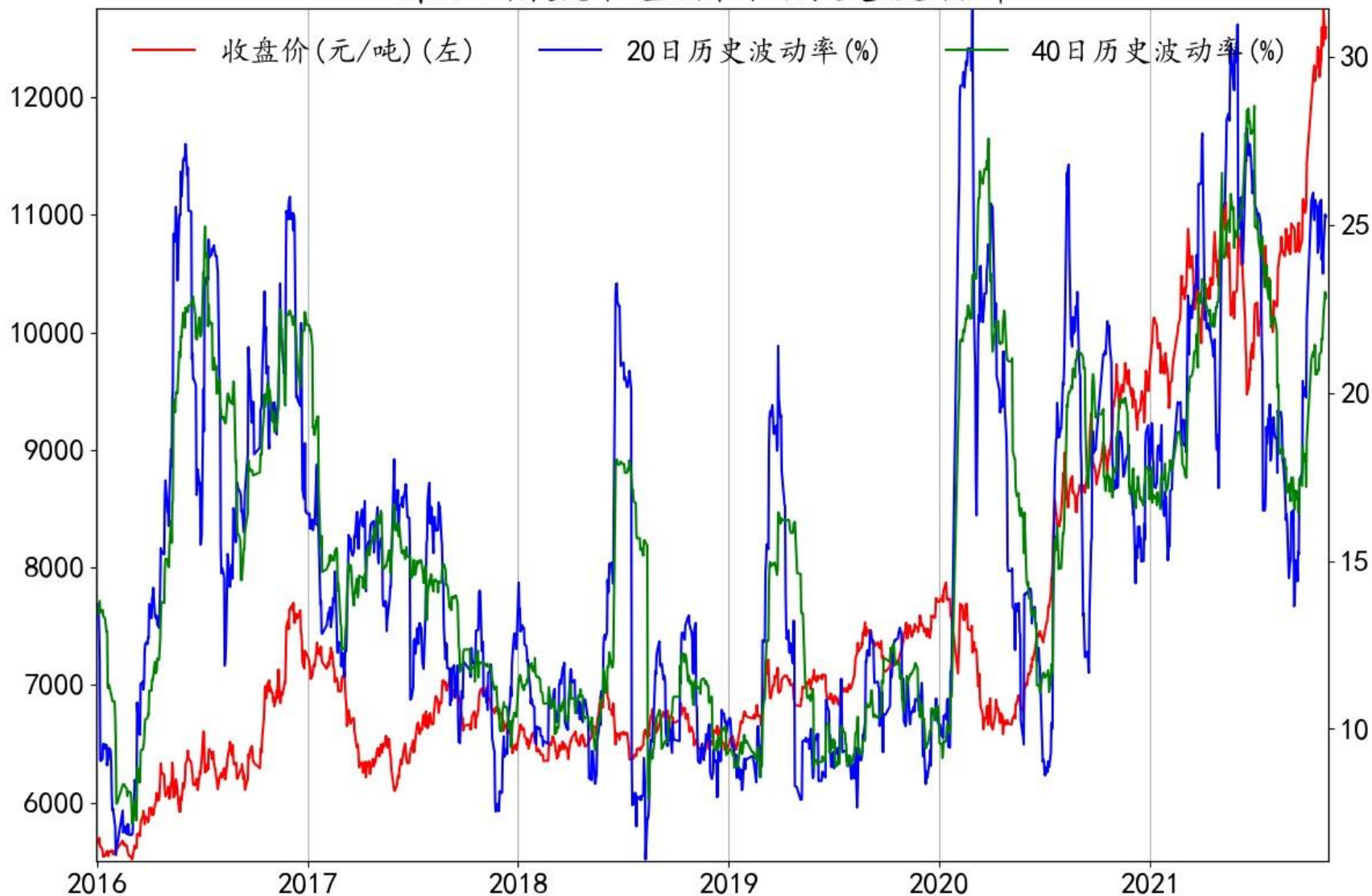
豆一指数收盘价和历史波动率



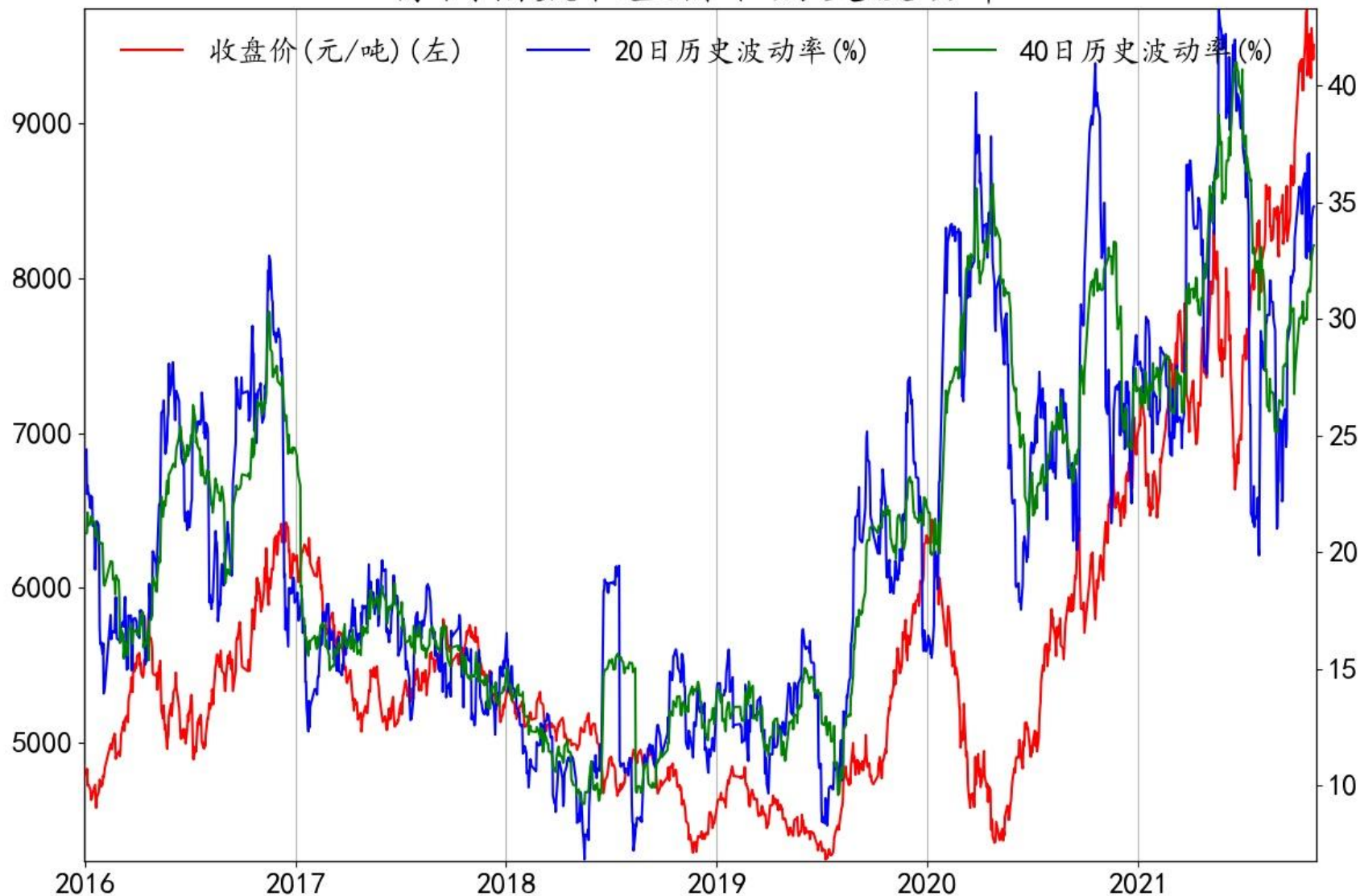
豆粕指数收盘价和历史波动率



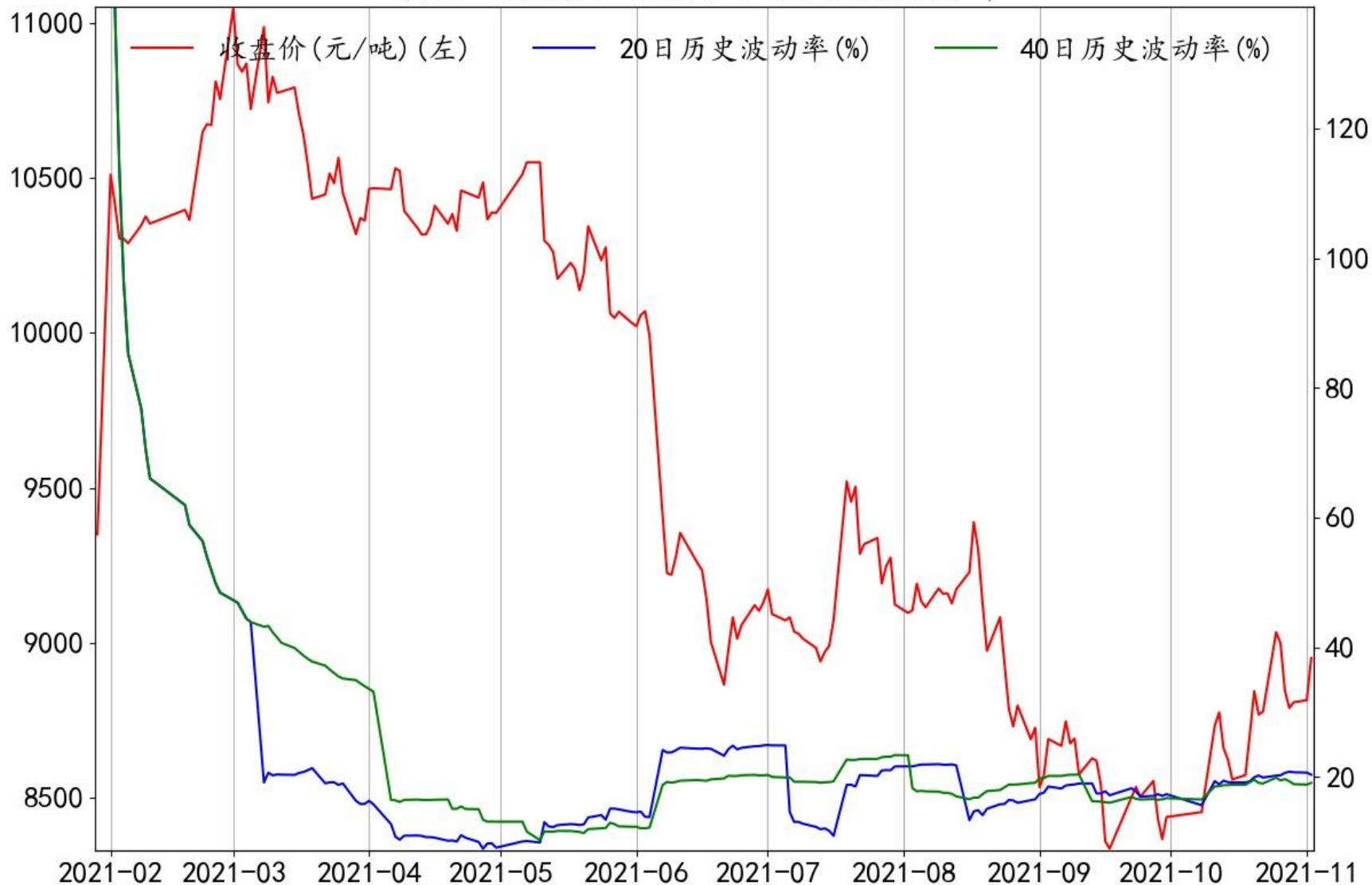
菜油指数收盘价和历史波动率



棕榈指数收盘价和历史波动率

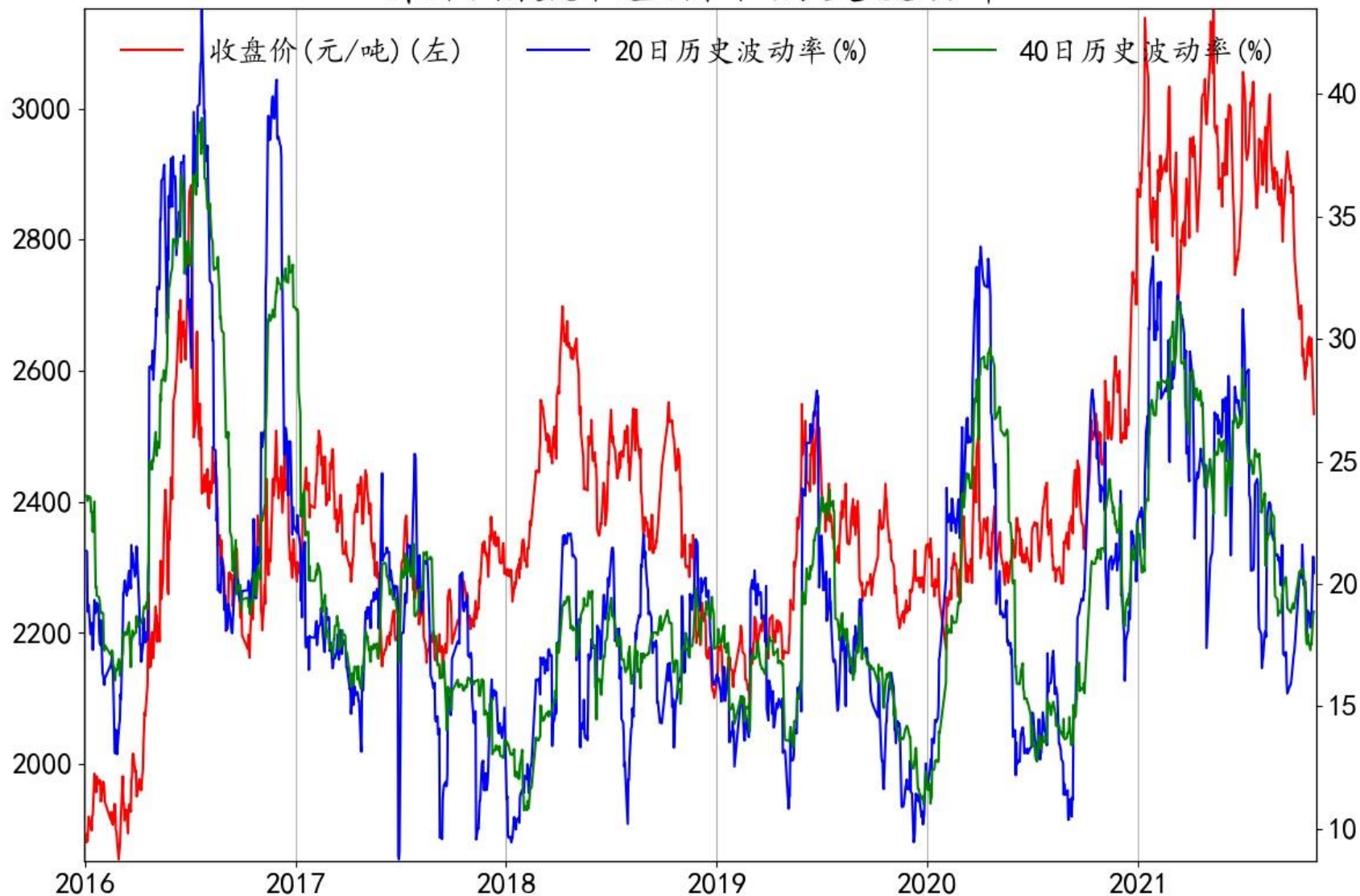


花生指数收盘价和历史波动率

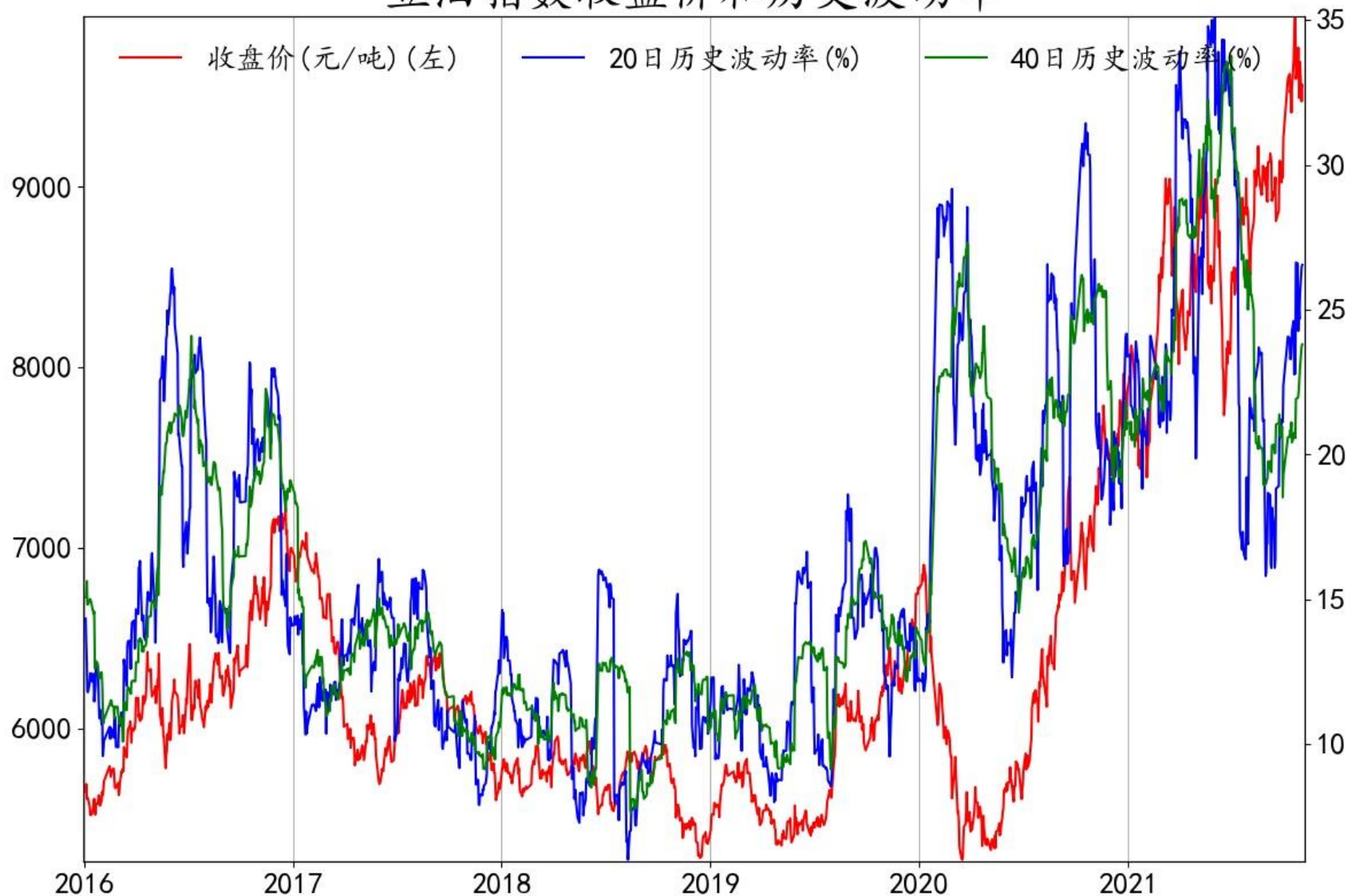


数据来源: Wind、信达期货研发中心

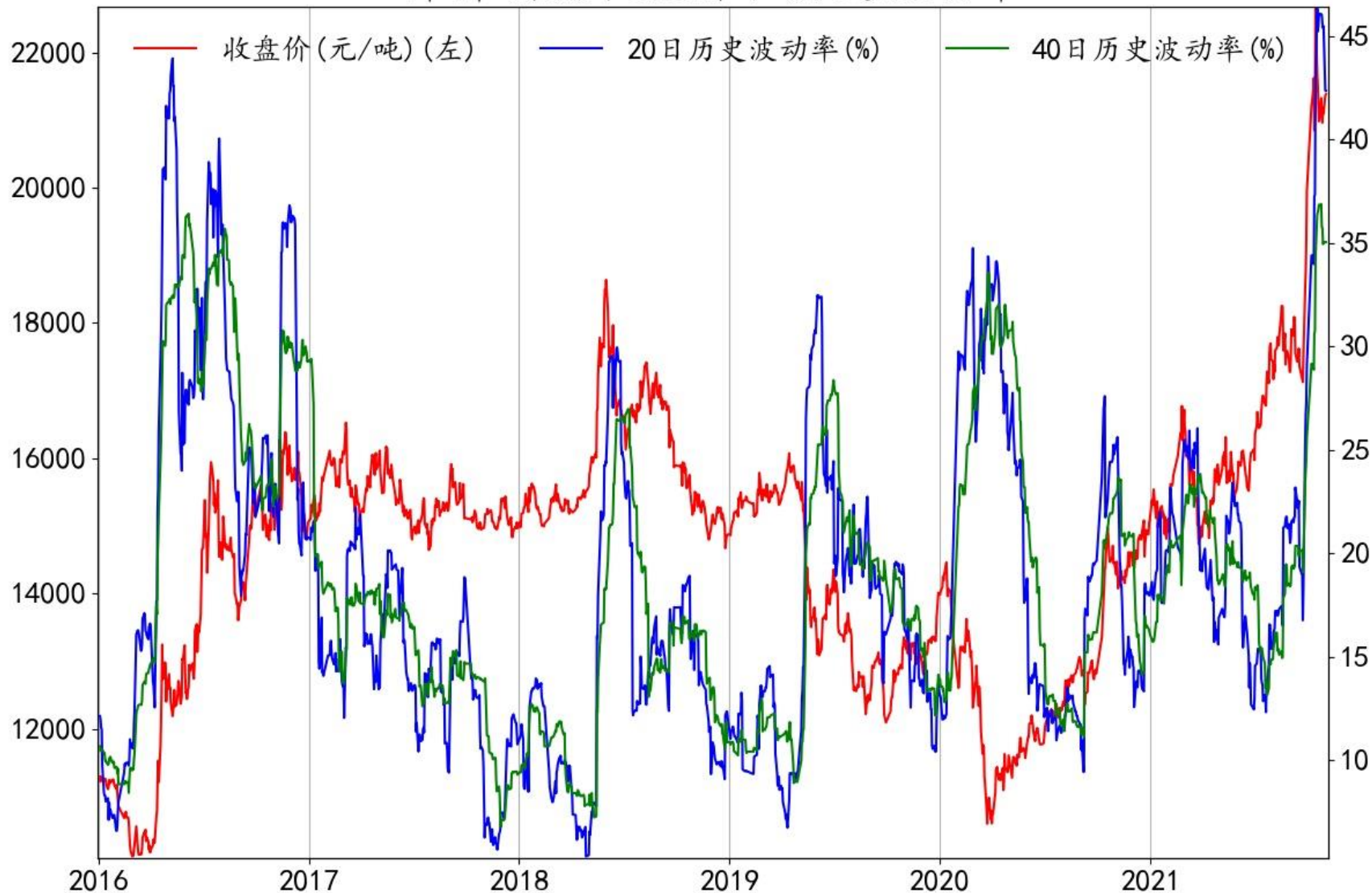
菜粕指数收盘价和历史波动率



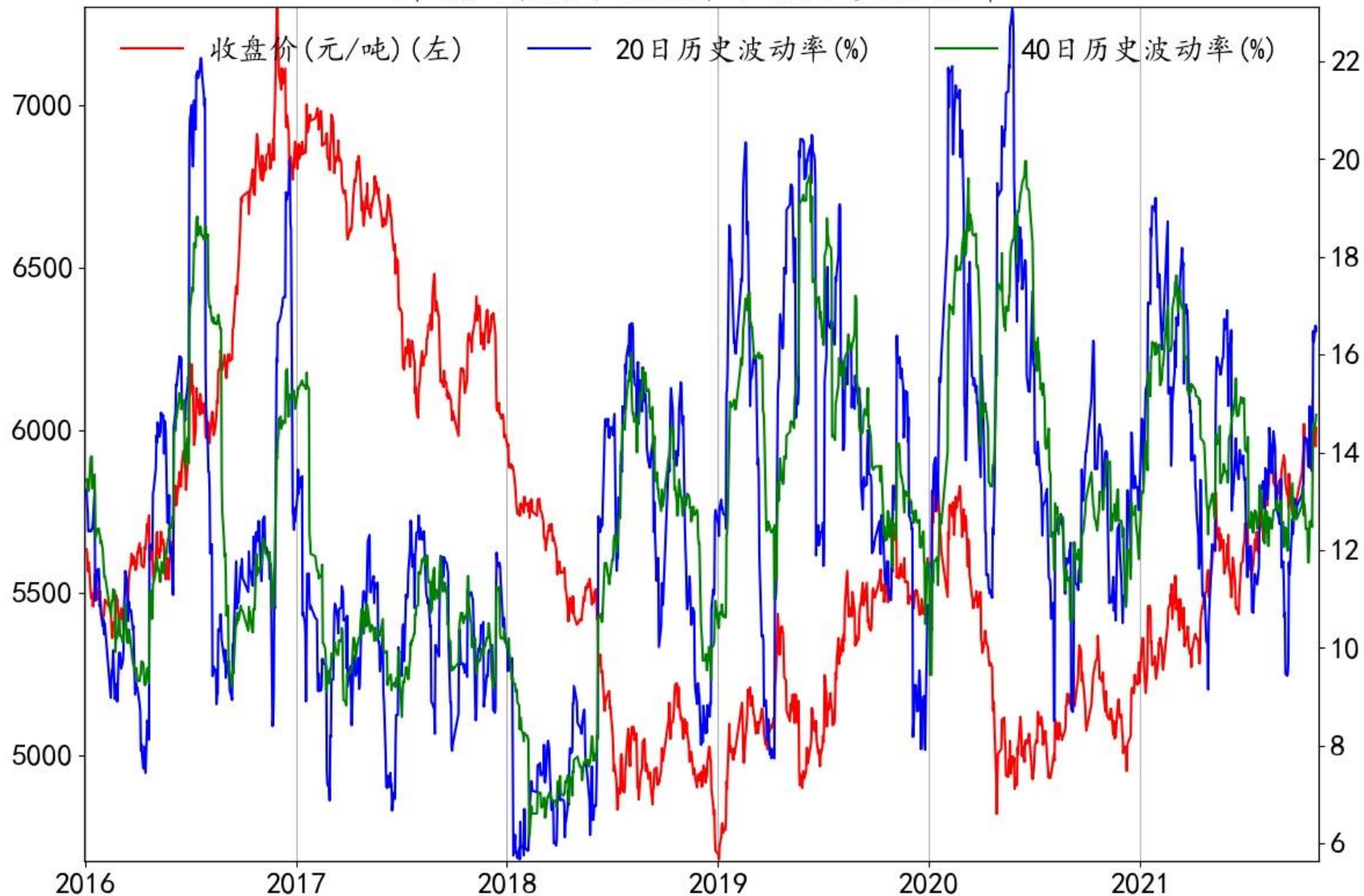
豆油指数收盘价和历史波动率



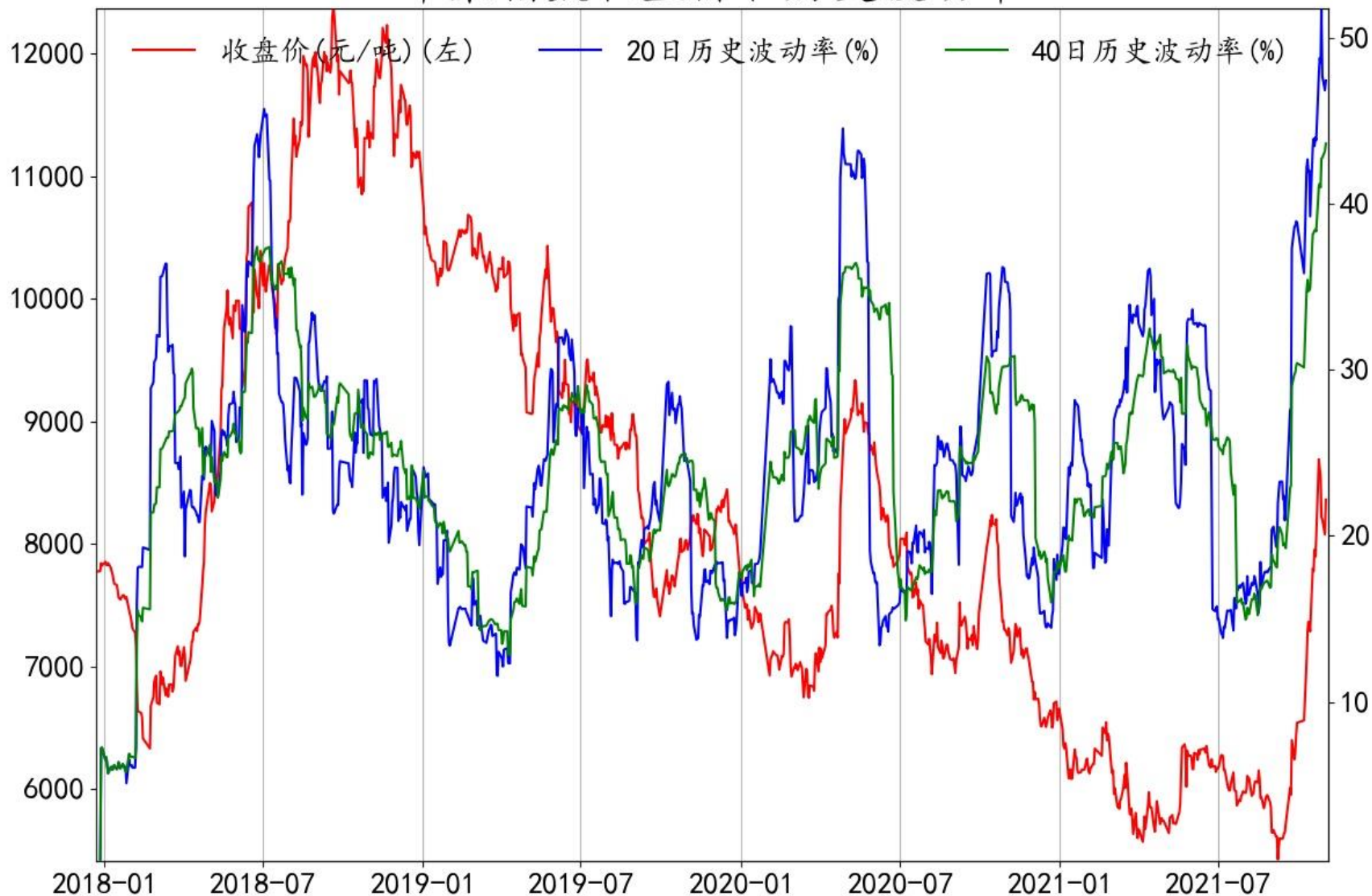
郑棉指数收盘价和历史波动率



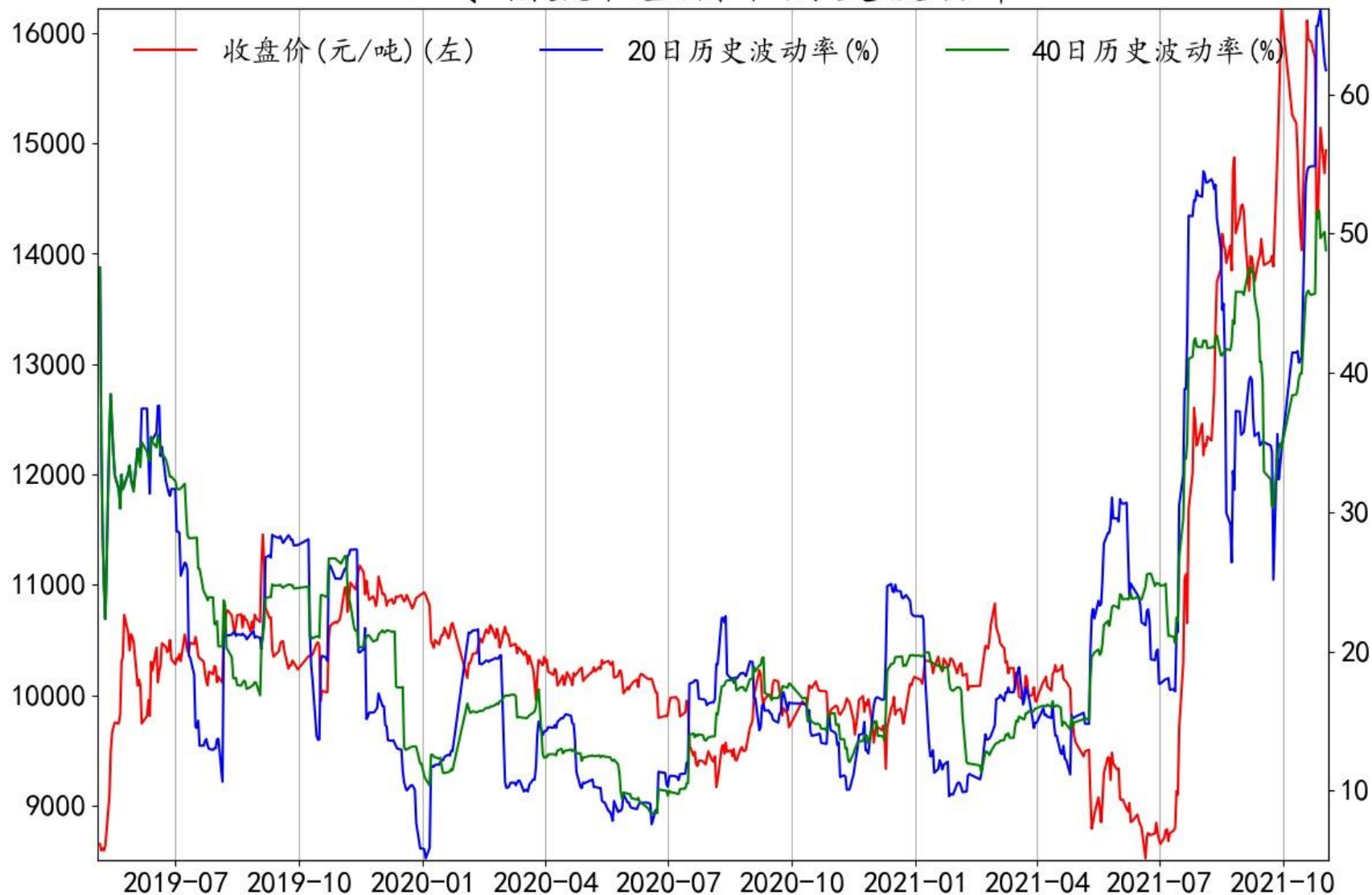
郑糖指数收盘价和历史波动率



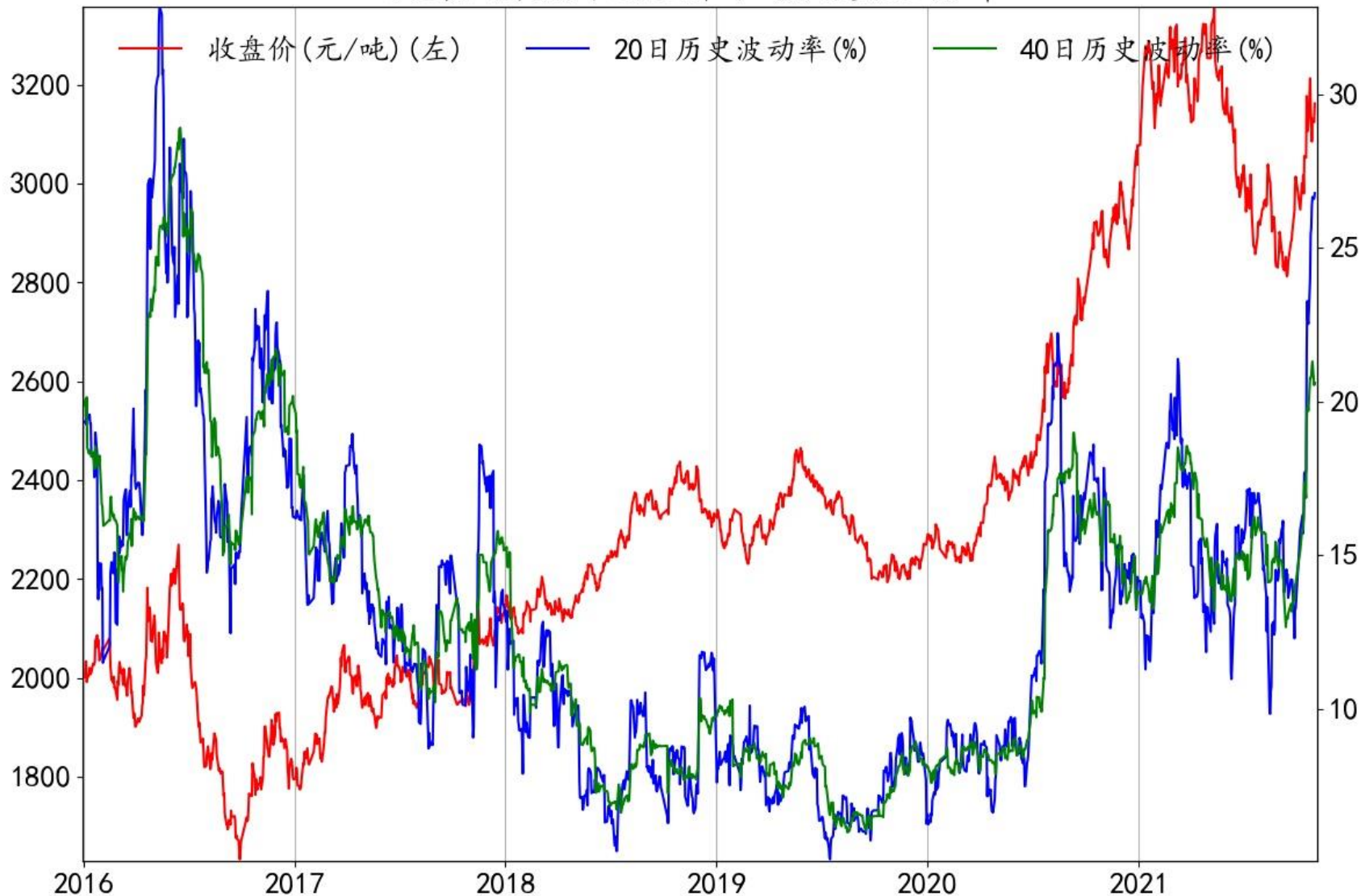
苹果指数收盘价和历史波动率



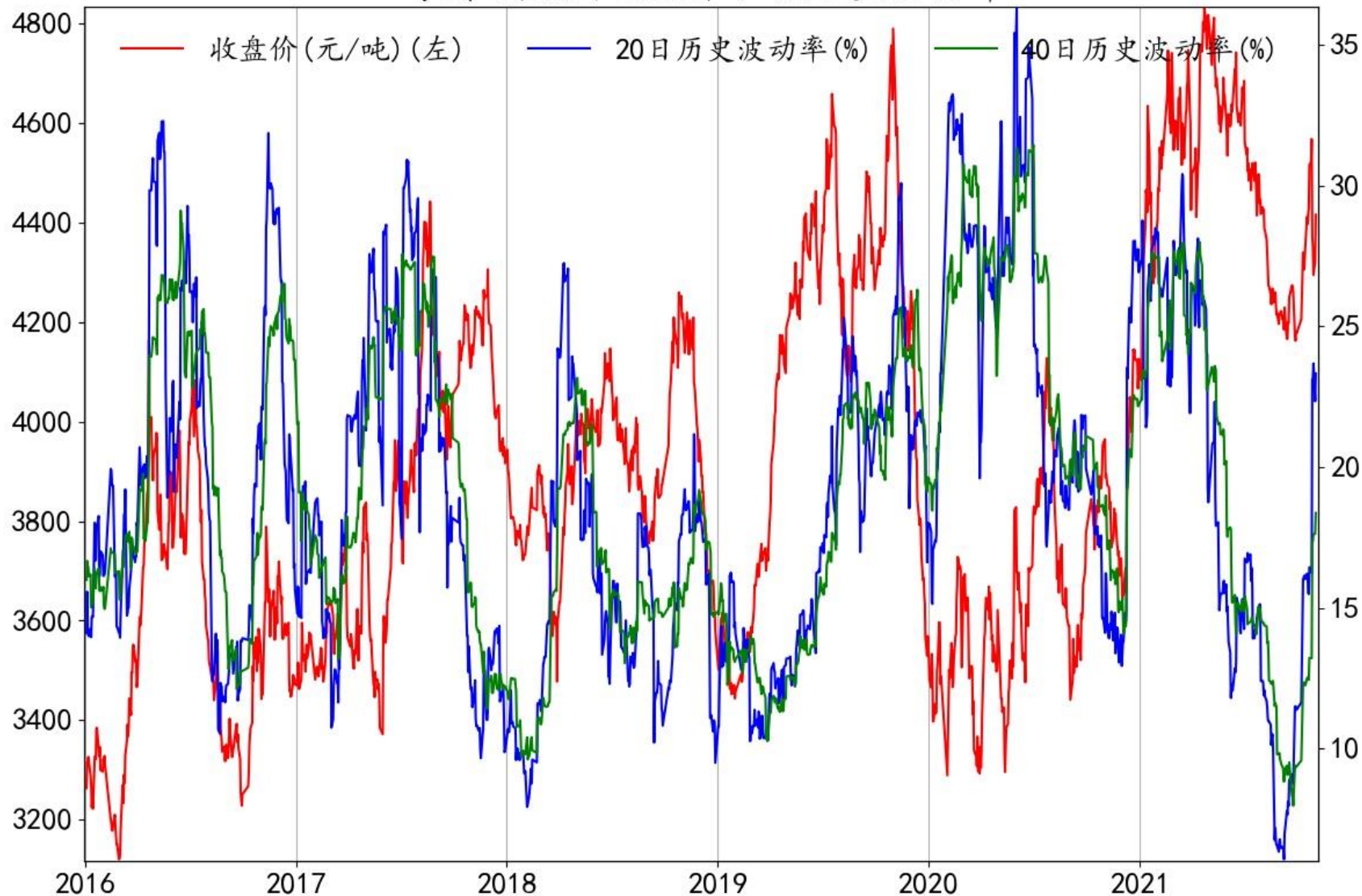
红枣指数收盘价和历史波动率



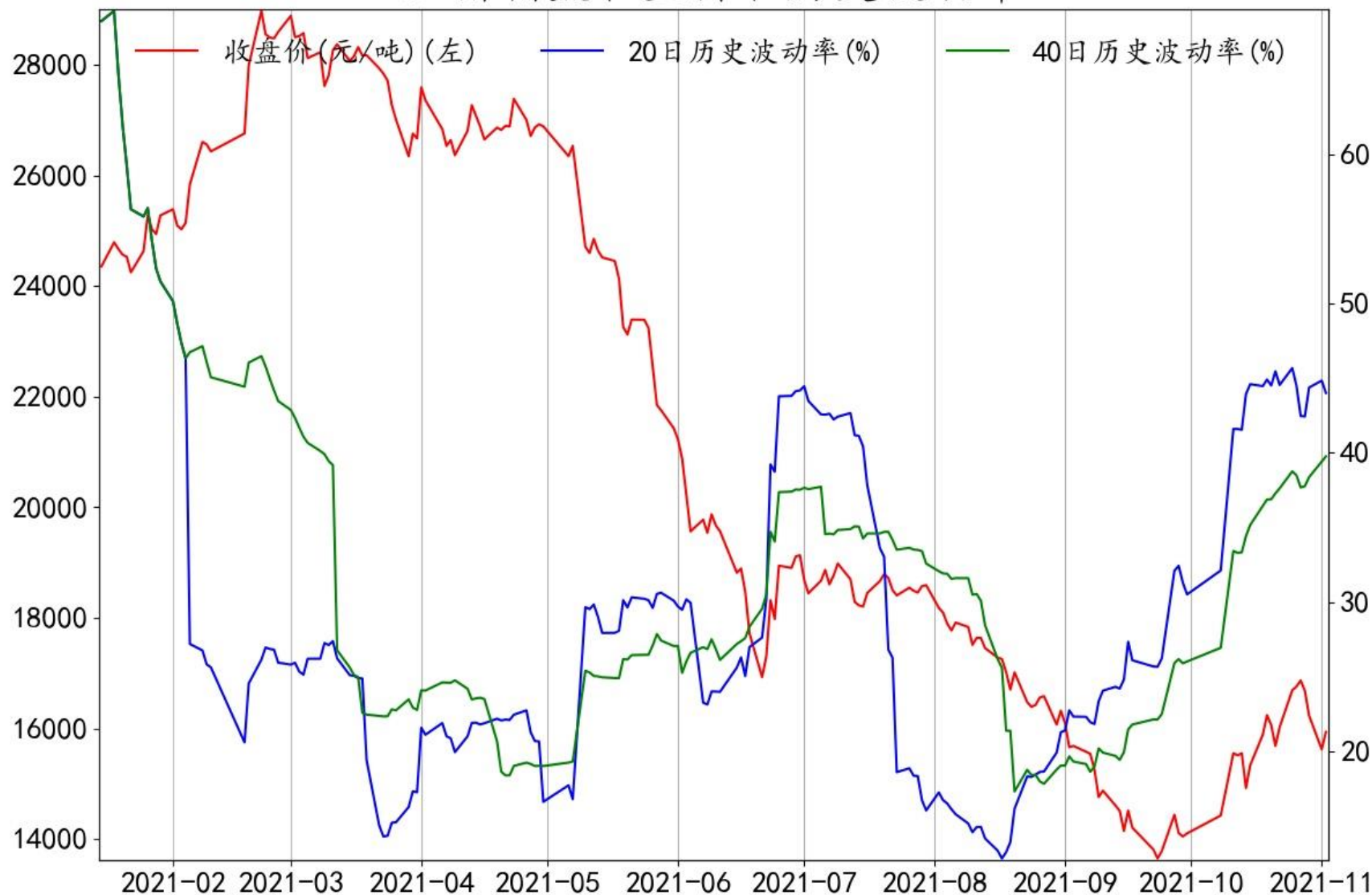
淀粉指数收盘价和历史波动率



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



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