

商品期货波动率跟踪

2021年11月05日

20日历史波动率百分位高于90%:

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

20日历史波动率百分位低于10%:

低硫燃油

20日历史波动率绝对值前五:

动煤、焦煤、硅铁、焦炭、锰硅

20日历史波动率绝对值后五:

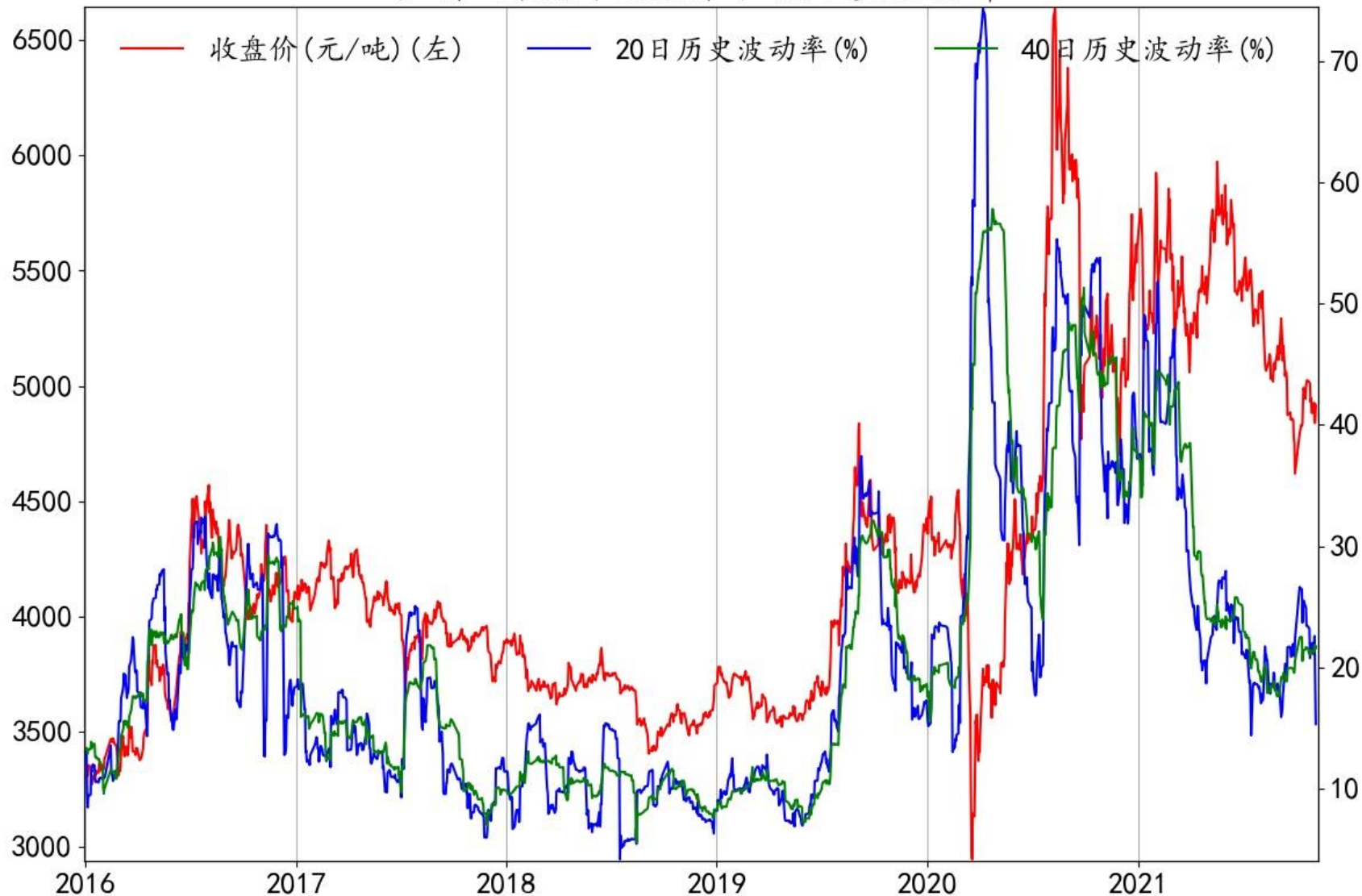
沪金、豆粕、玉米、沪银、豆一

	时间百分位	绝对值
沪银	41.94%	15.33%
沪金	56.79%	11.49%
沪铝	99.93%	44.42%
沪铜	94.23%	27.01%
沪镍	83.81%	29.72%
沪铅	63.62%	18.58%
沪锡	97.04%	38.88%
沪锌	100.00%	51.48%
热卷	87.54%	38.83%
铁矿	97.47%	64.09%
焦炭	99.79%	86.50%
焦煤	99.86%	94.10%
螺纹	96.06%	46.00%

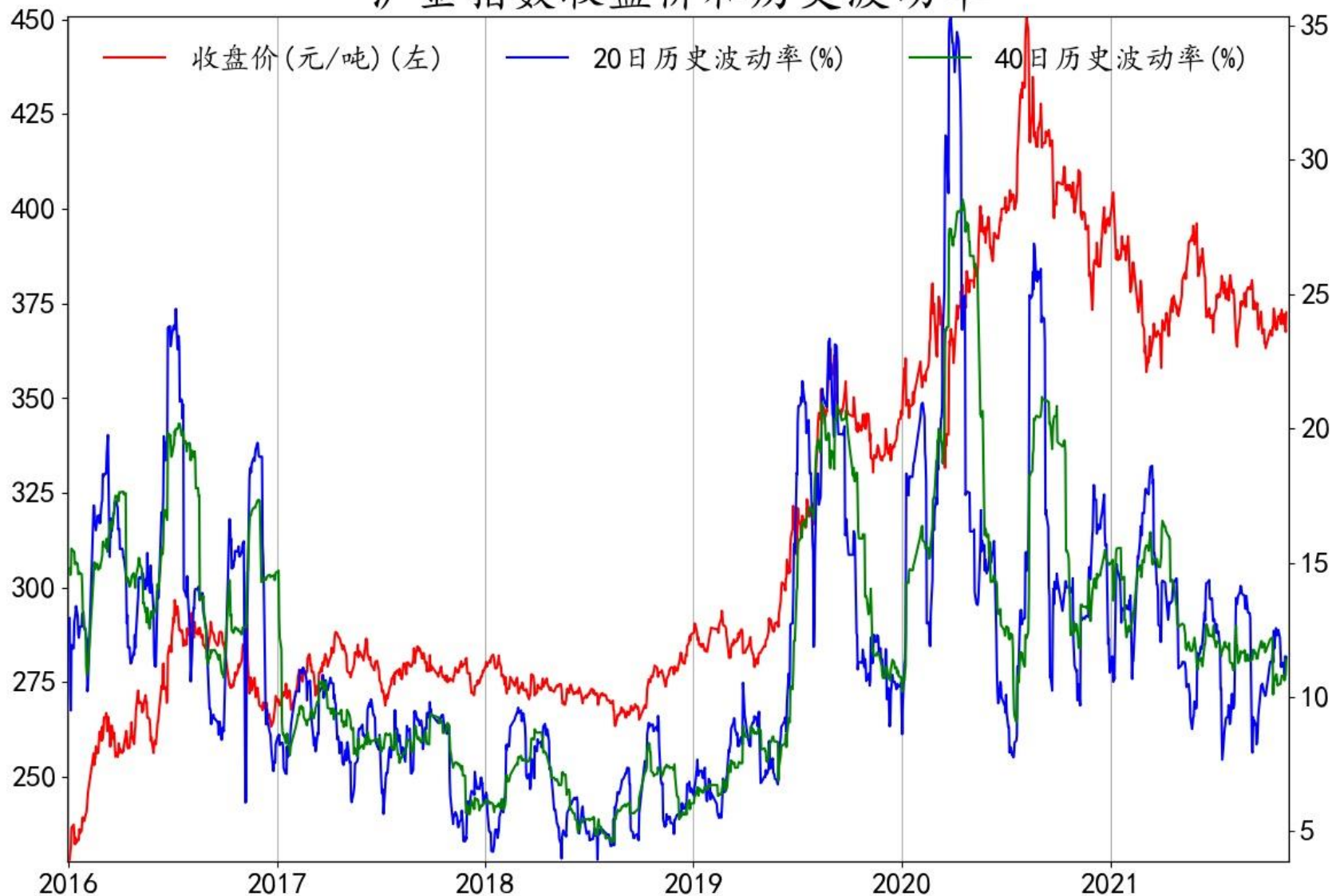
	时间百分位	绝对值
硅铁	99.16%	91.38%
锰硅	98.52%	72.35%
不锈钢	75.49%	25.65%
玻璃	99.86%	56.70%
PVC	99.79%	67.21%
燃油	57.59%	33.16%
低硫燃油	2.17%	17.85%
LPG	91.14%	43.52%
原油	23.63%	21.62%
动煤	99.30%	110.37%
沥青	76.64%	32.87%
苯乙烯	70.53%	33.62%
乙二醇	99.15%	70.98%

	时间百分位	绝对值		时间百分位	绝对值
塑料	90.01%	27.31%	菜油	81.35%	20.61%
甲醇	99.23%	62.27%	棕榈	90.43%	33.02%
20号胶	72.07%	31.06%	花生	71.98%	21.10%
短纤	83.81%	35.02%	菜粕	64.32%	20.47%
PP	89.73%	29.18%	豆油	93.38%	27.52%
沪胶	75.16%	32.56%	郑棉	94.65%	34.41%
纯碱	99.78%	65.56%	郑糖	85.36%	16.50%
纸浆	84.58%	24.19%	苹果	99.89%	53.16%
TA	79.87%	25.79%	红枣	98.69%	56.58%
尿素	98.81%	68.60%	淀粉	96.97%	25.47%
玉米	83.11%	15.27%	鸡蛋	78.33%	24.96%
豆一	52.78%	15.40%	生猪	82.47%	43.77%
豆粕	26.46%	13.06%			

沪银指数收盘价和历史波动率



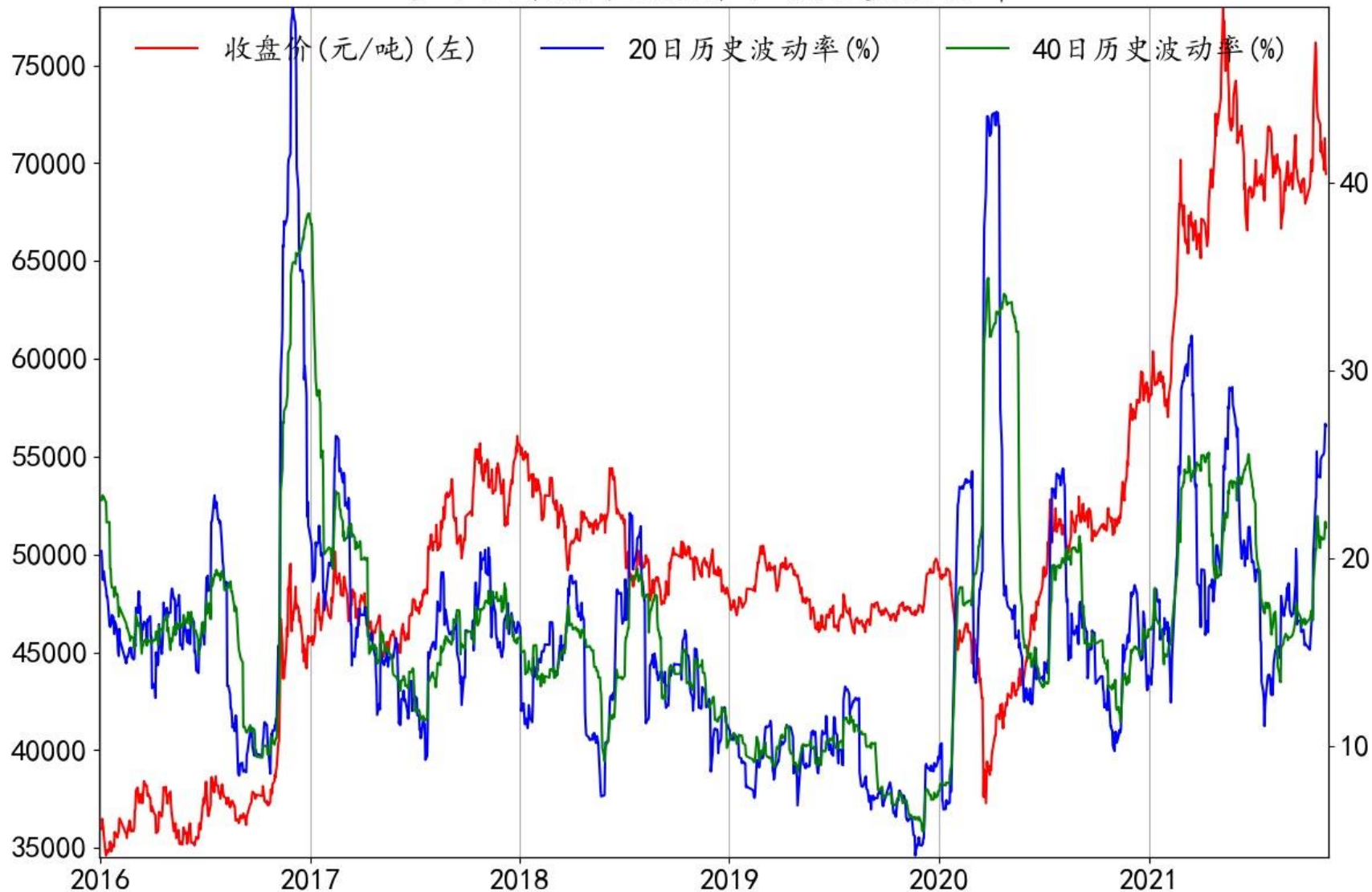
沪金指数收盘价和历史波动率



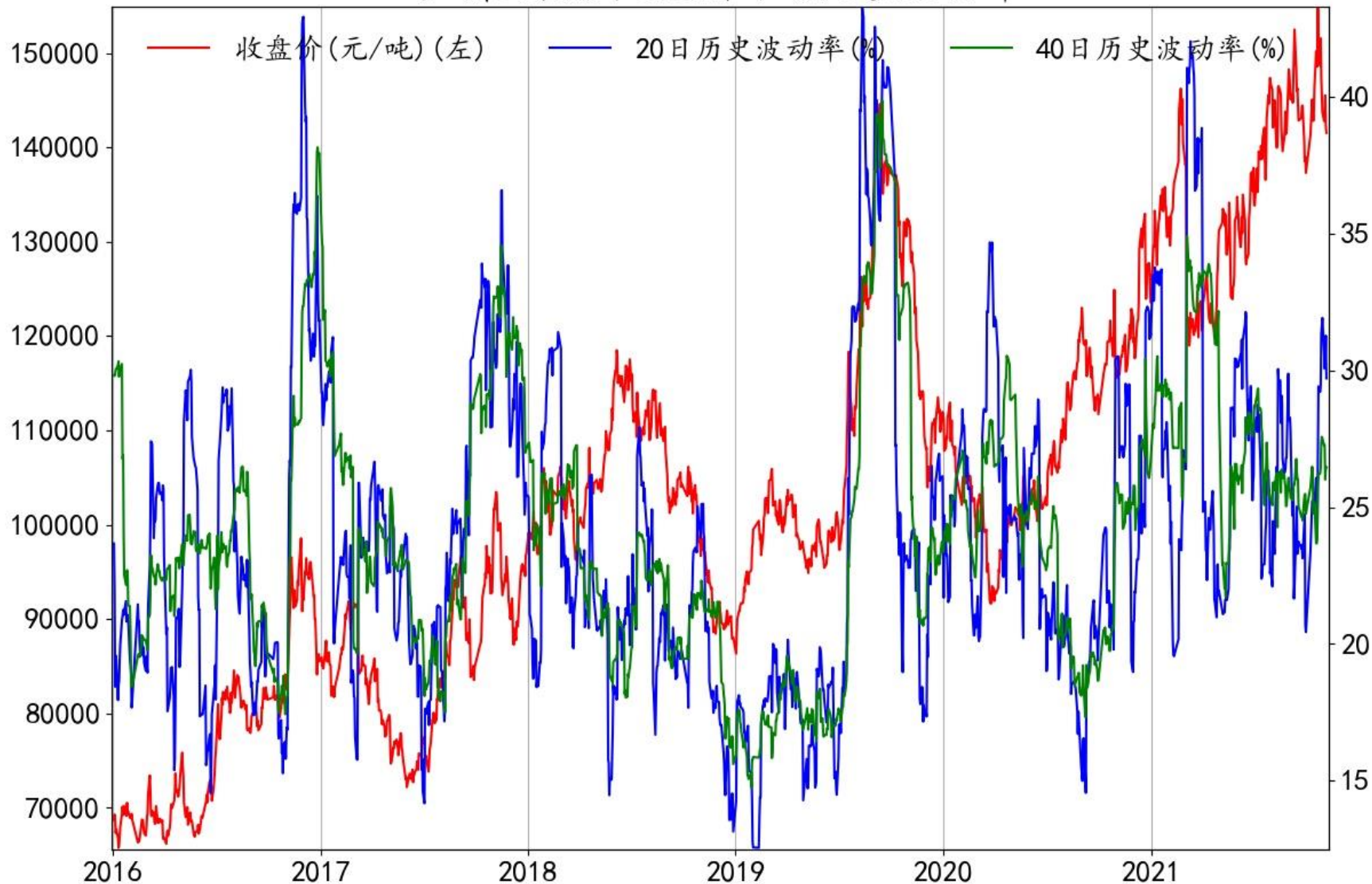
沪铝指数收盘价和历史波动率



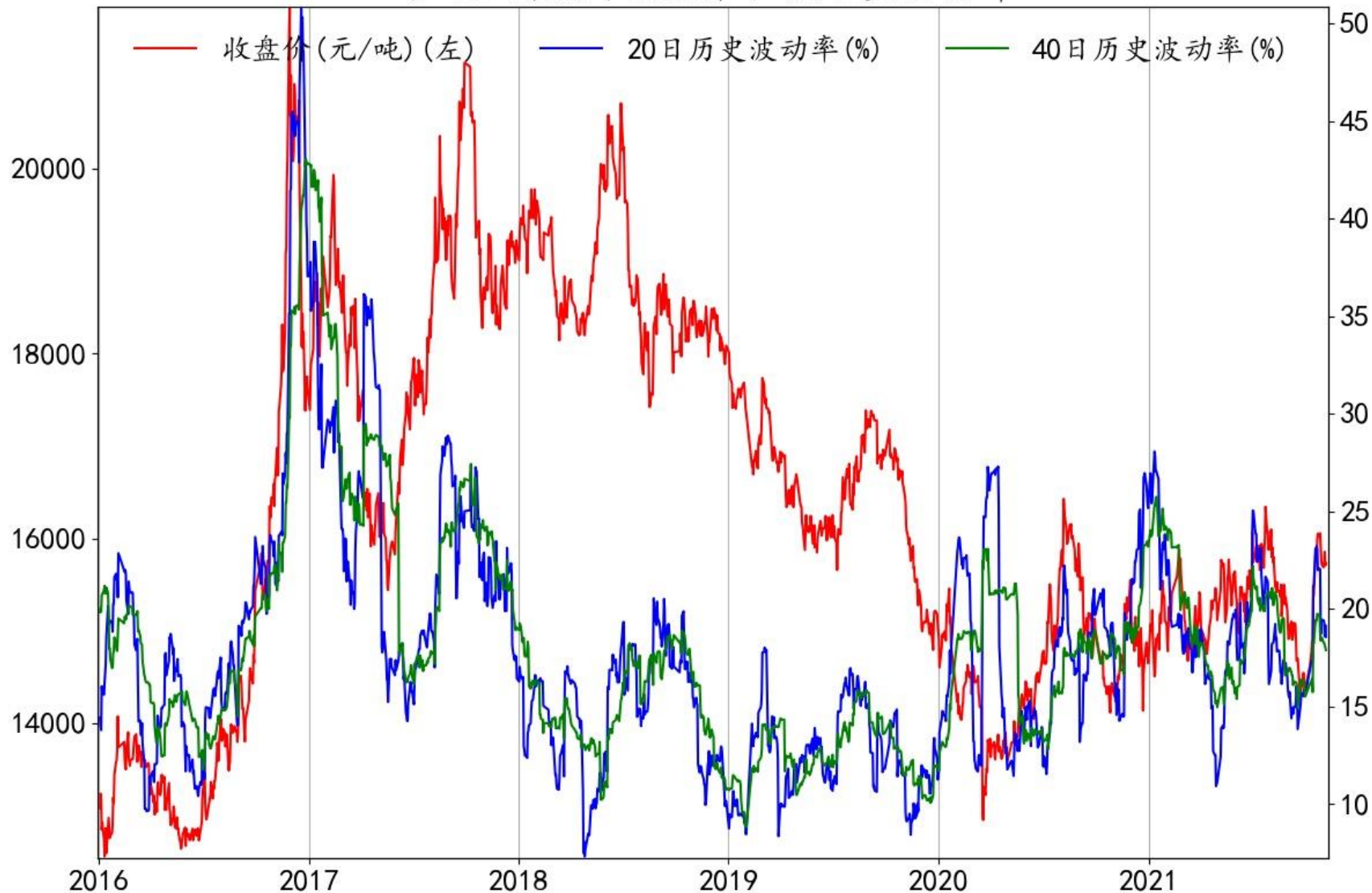
沪铜指数收盘价和历史波动率



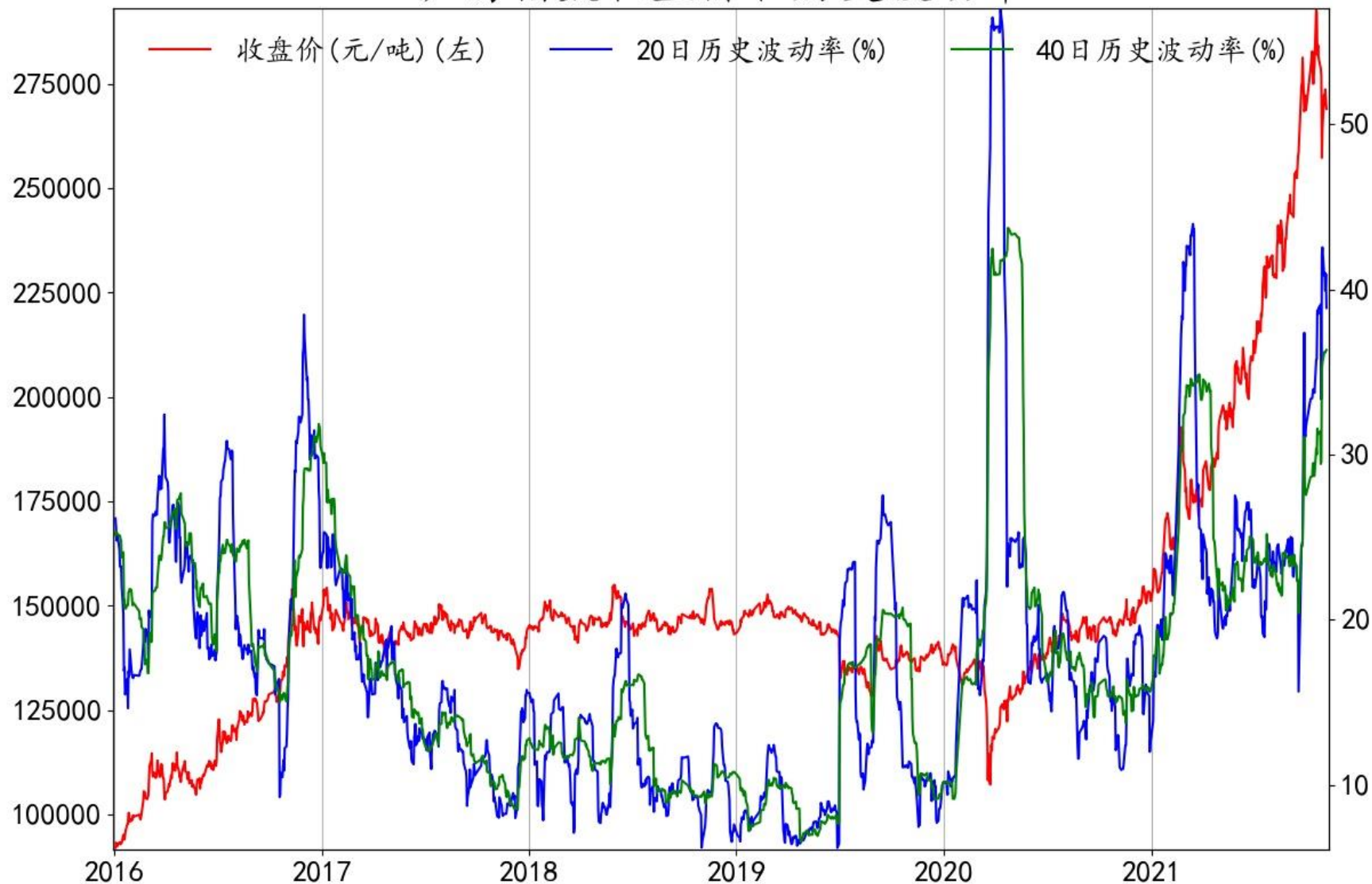
沪镍指数收盘价和历史波动率



沪铅指数收盘价和历史波动率



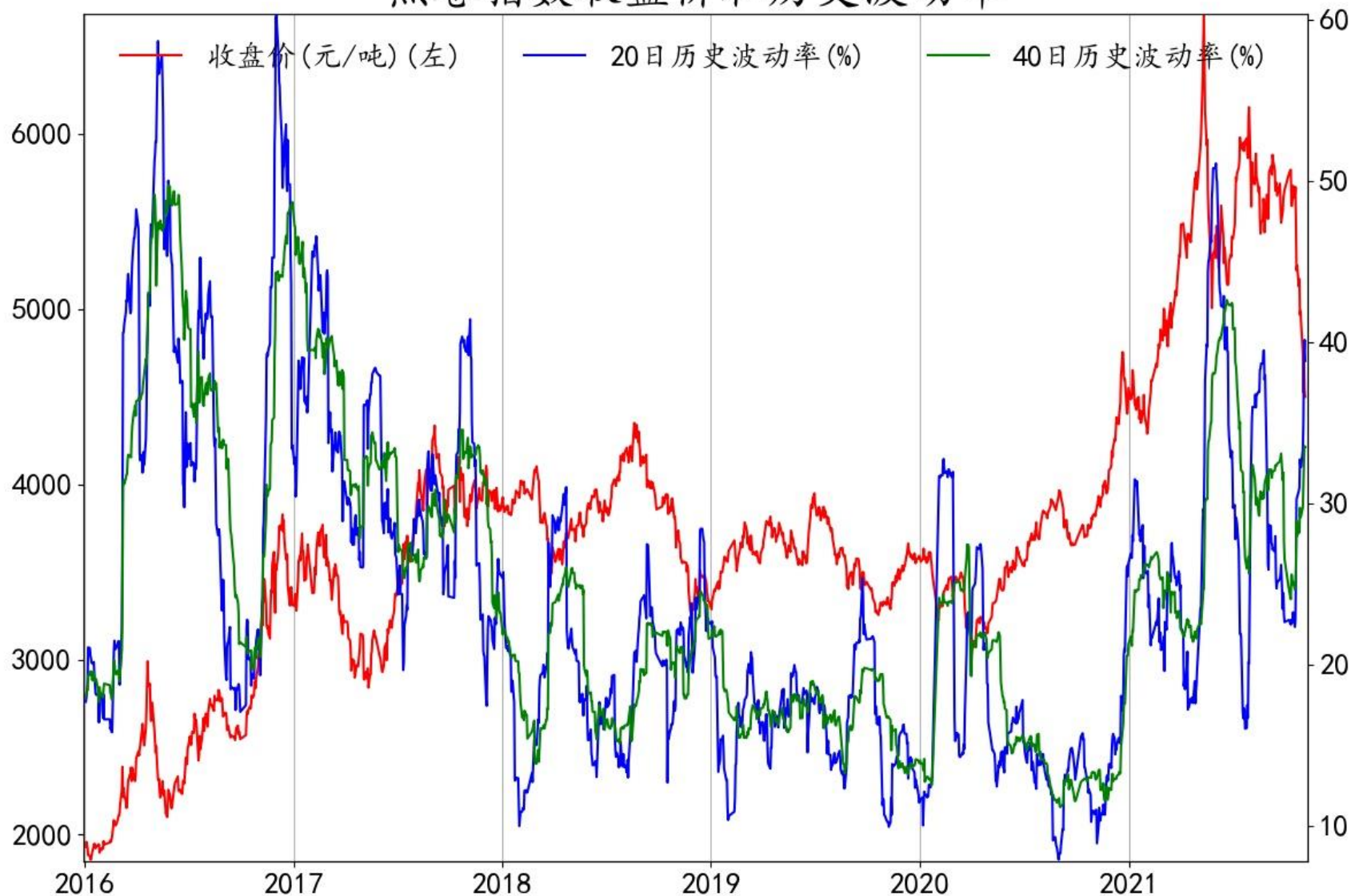
沪锡指数收盘价和历史波动率



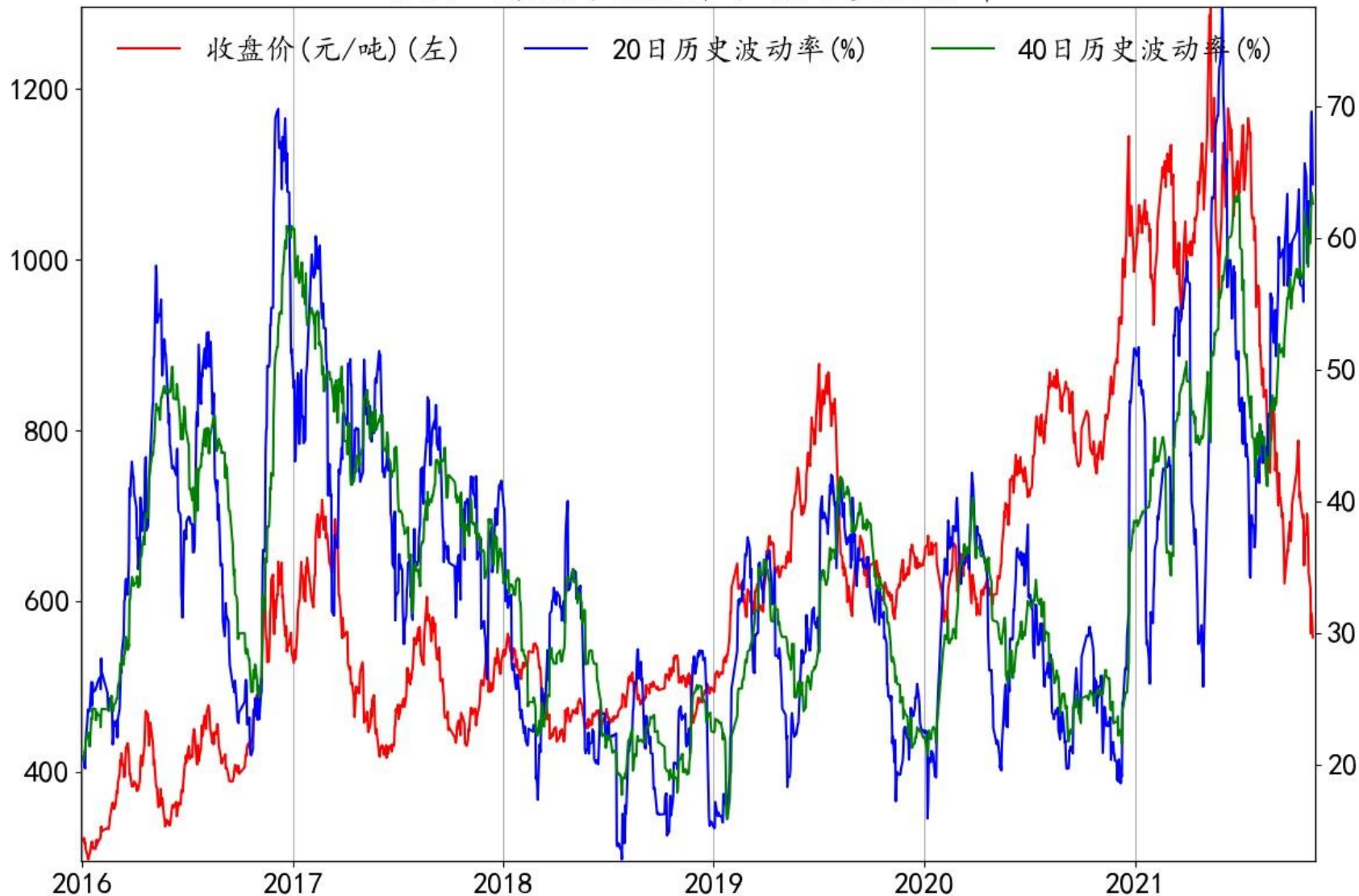
沪锌指数收盘价和历史波动率



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



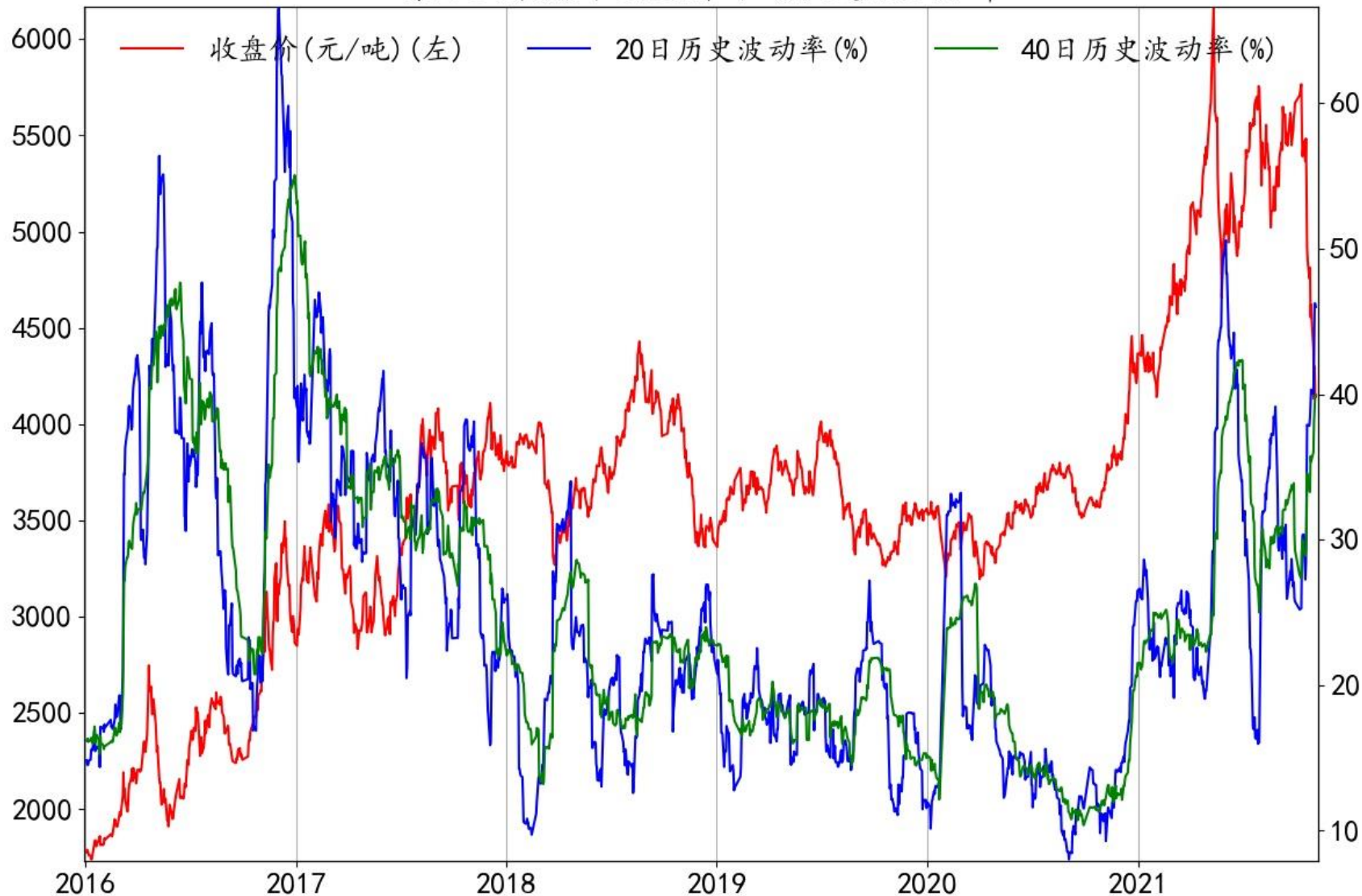
焦炭指数收盘价和历史波动率



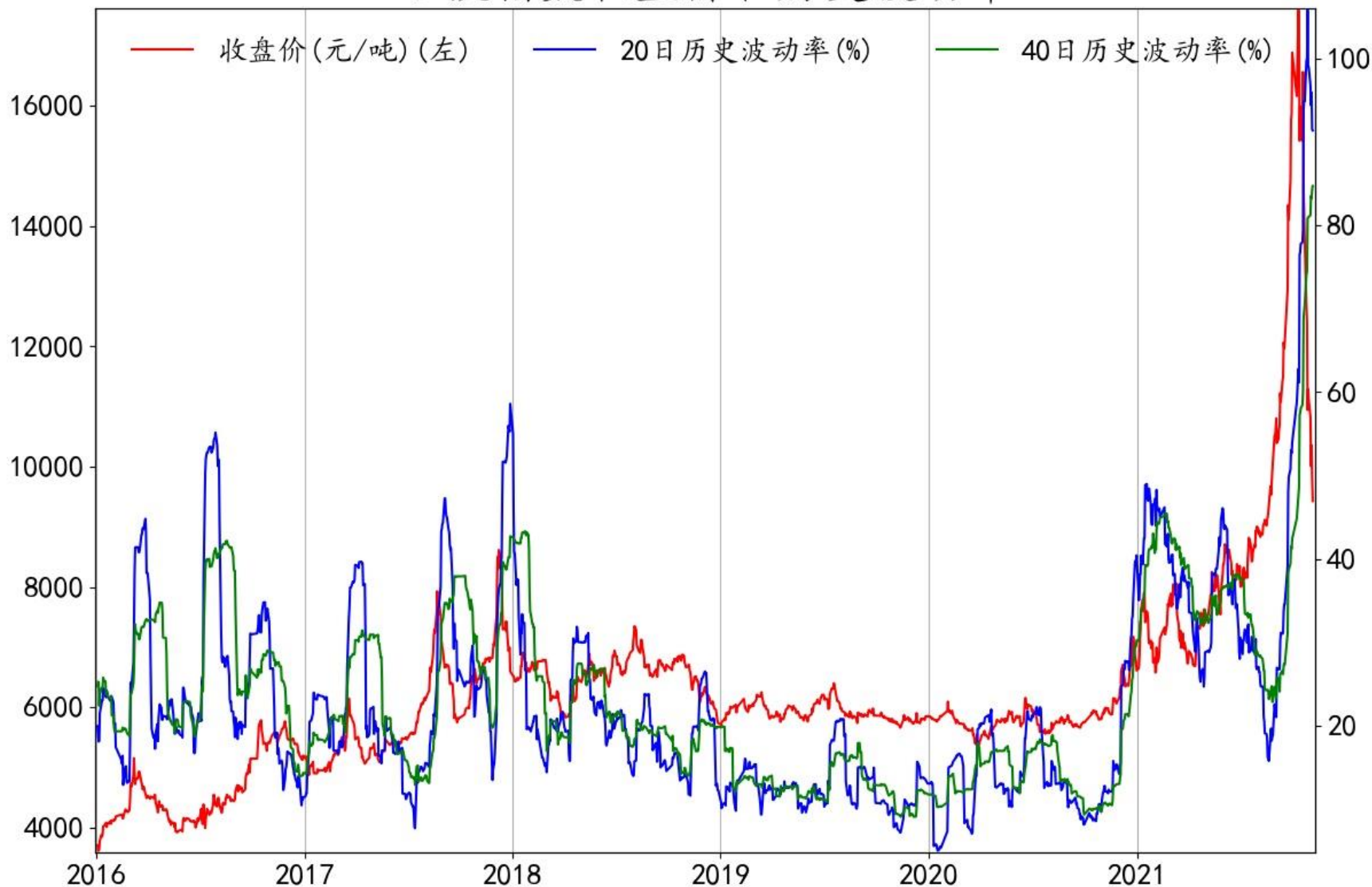
焦煤指数收盘价和历史波动率



螺纹指数收盘价和历史波动率



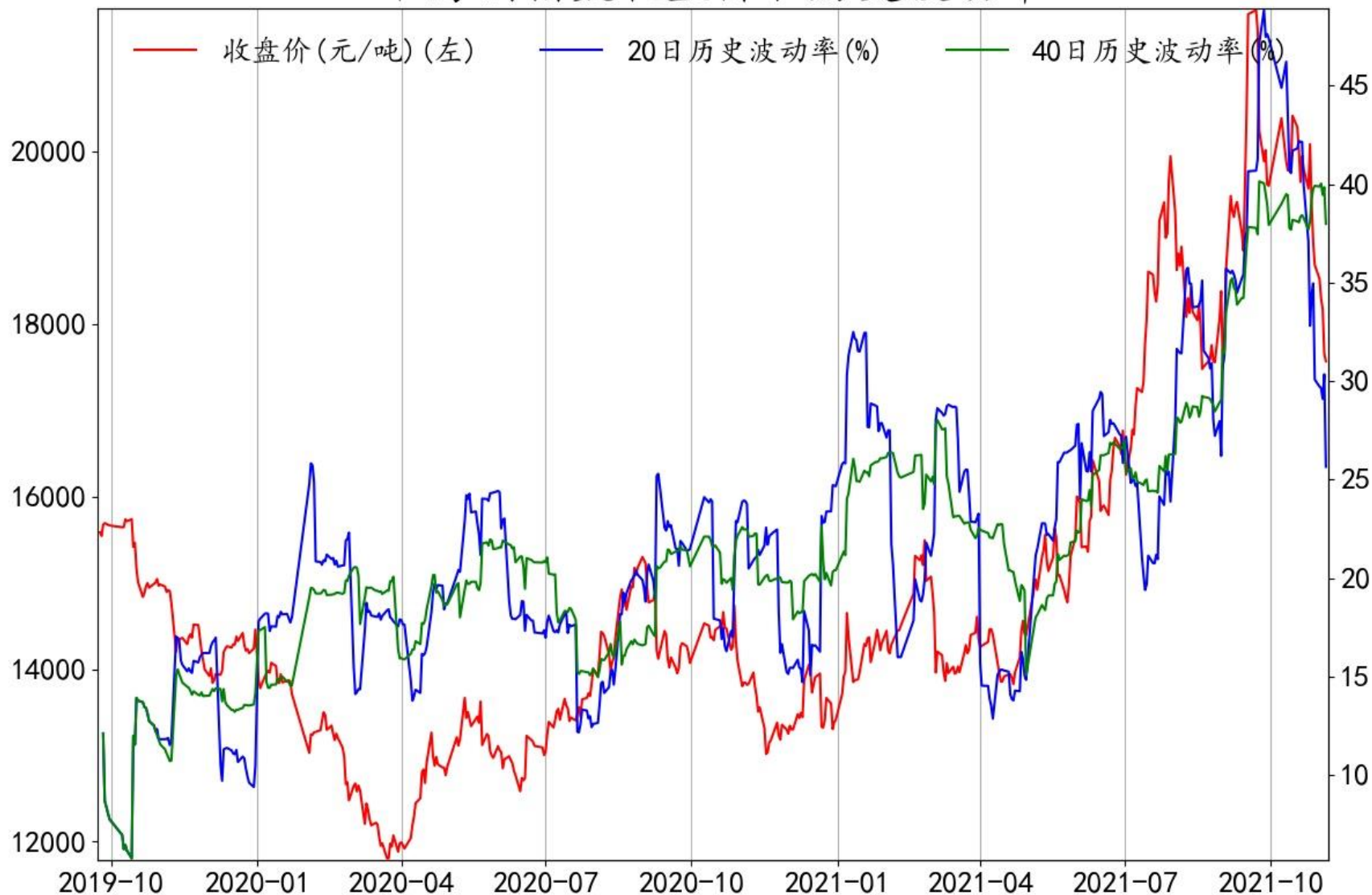
硅铁指数收盘价和历史波动率



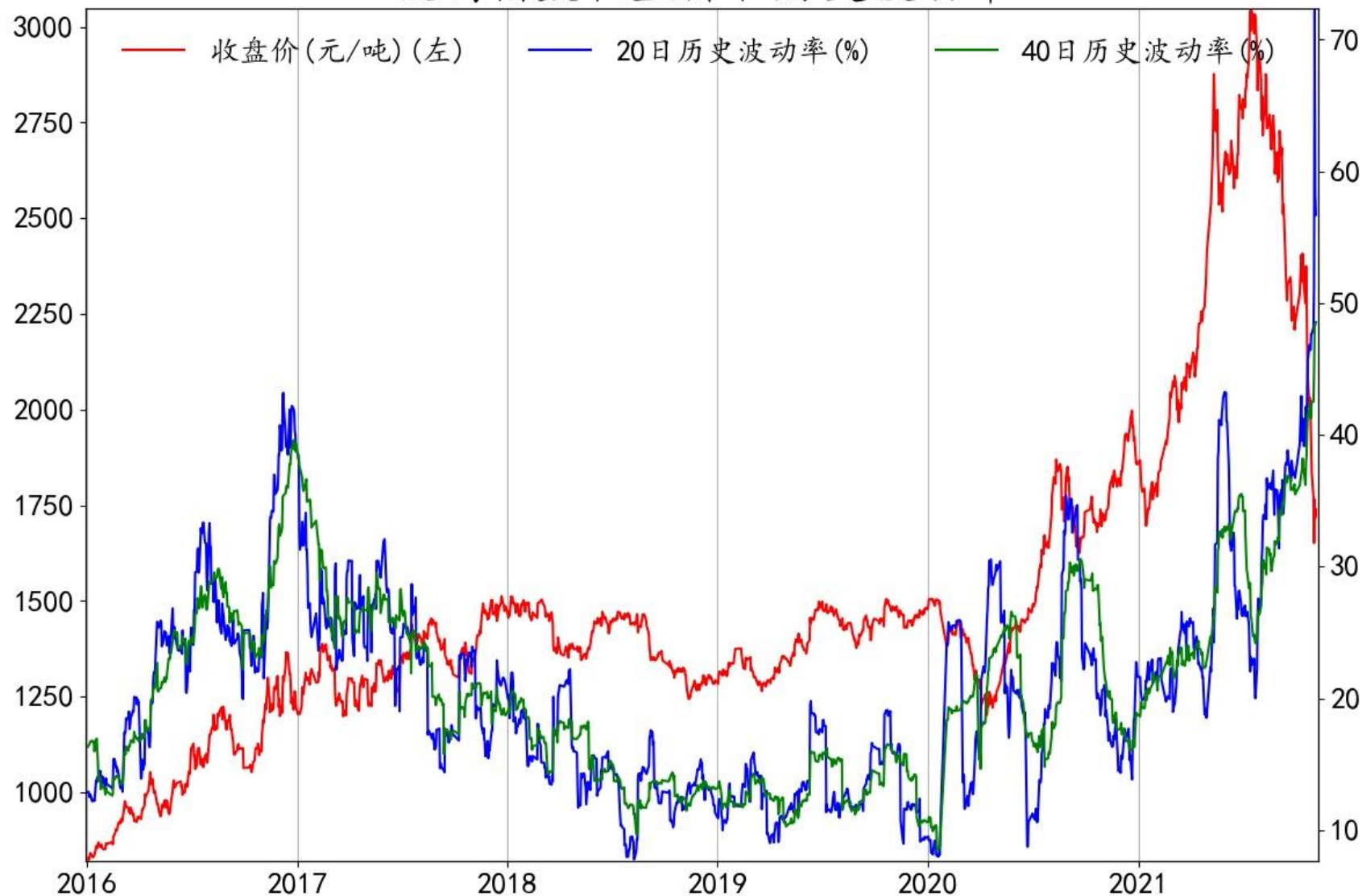
锰硅指数收盘价和历史波动率



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

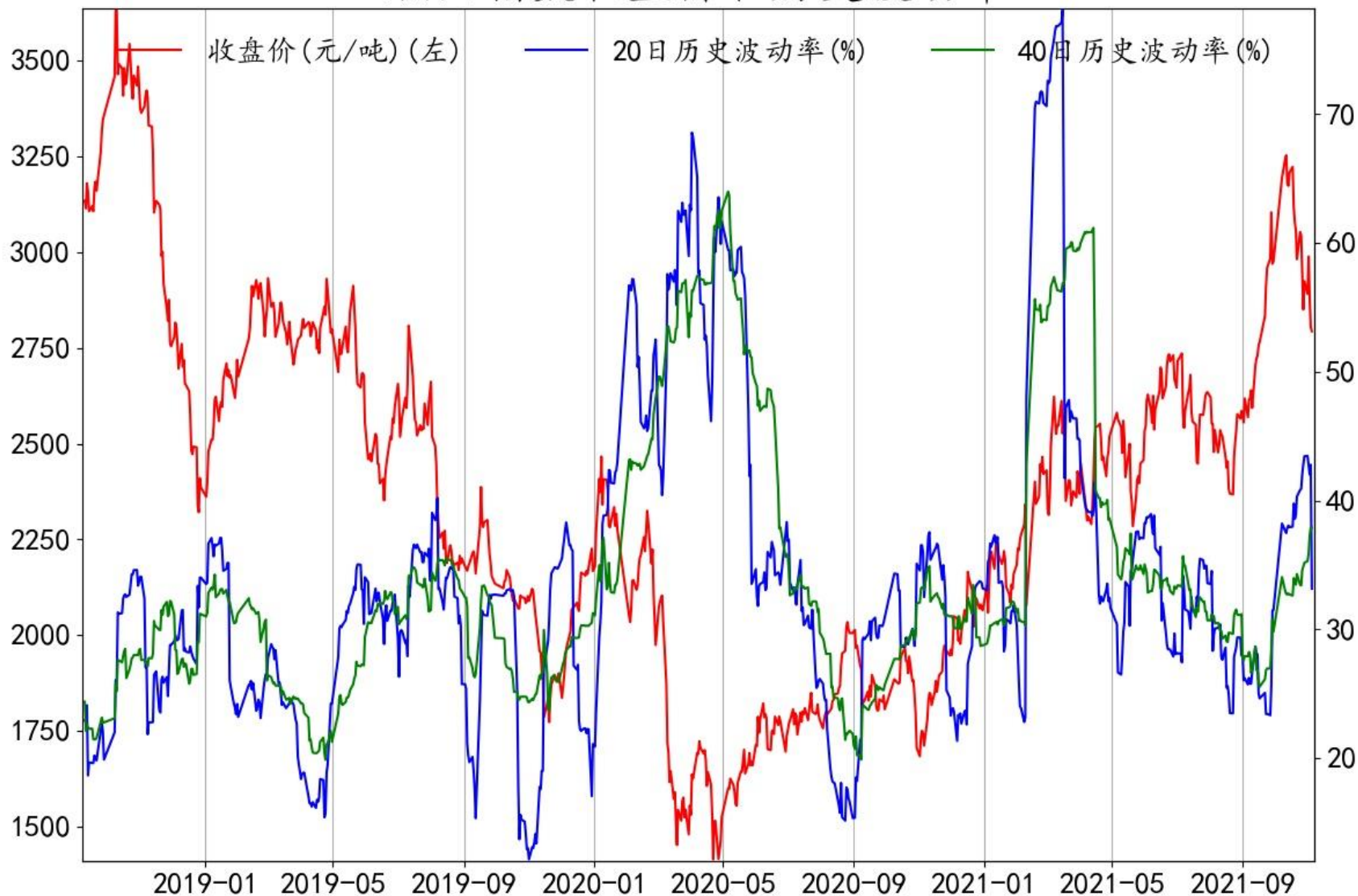


数据来源: Wind、信达期货研发中心

PVC指数收盘价和历史波动率



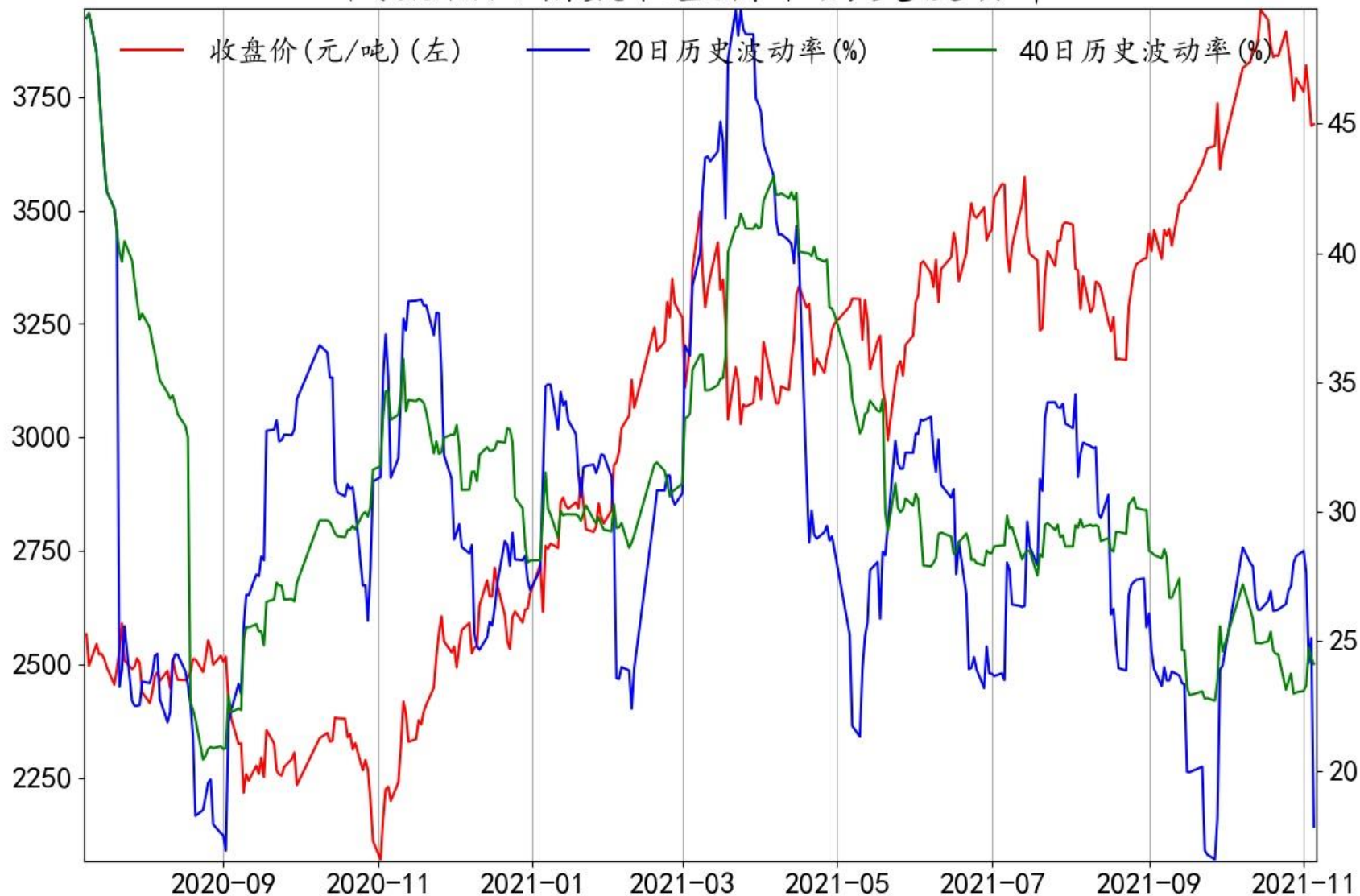
燃油指数收盘价和历史波动率



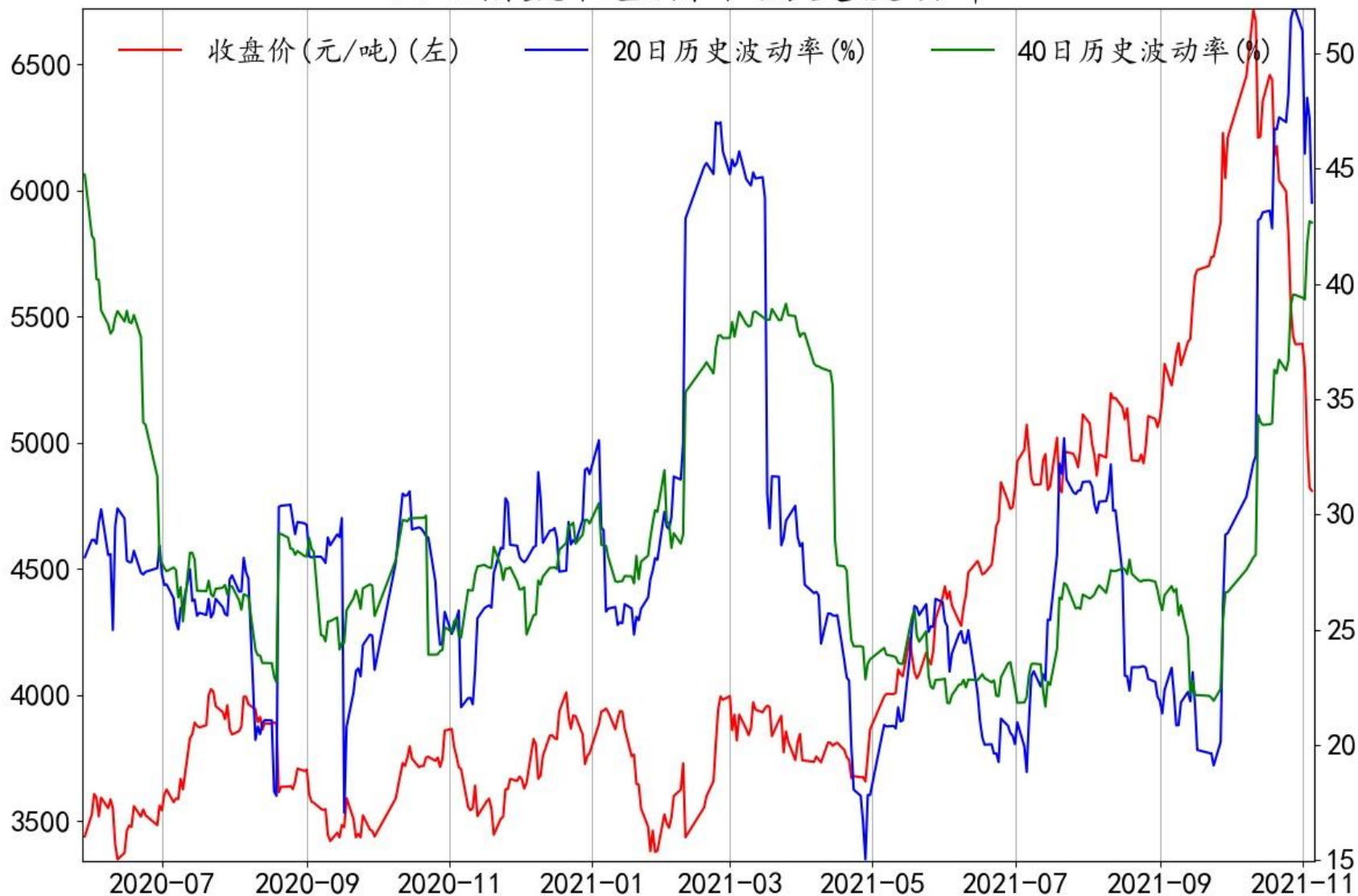
数据来源: Wind、信达期货研发中心

低硫燃油指数

低硫燃油指数收盘价和历史波动率

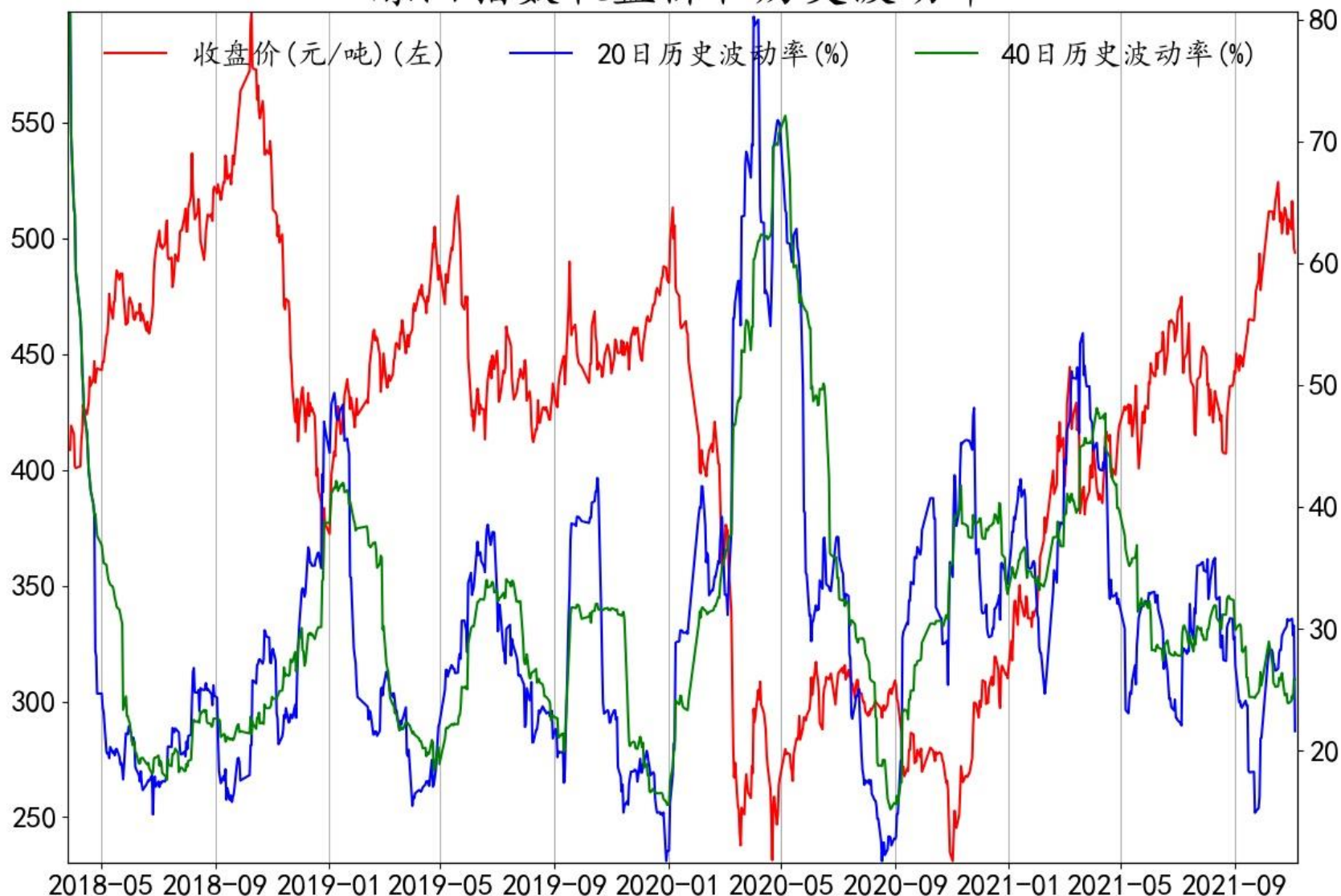


LPG指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

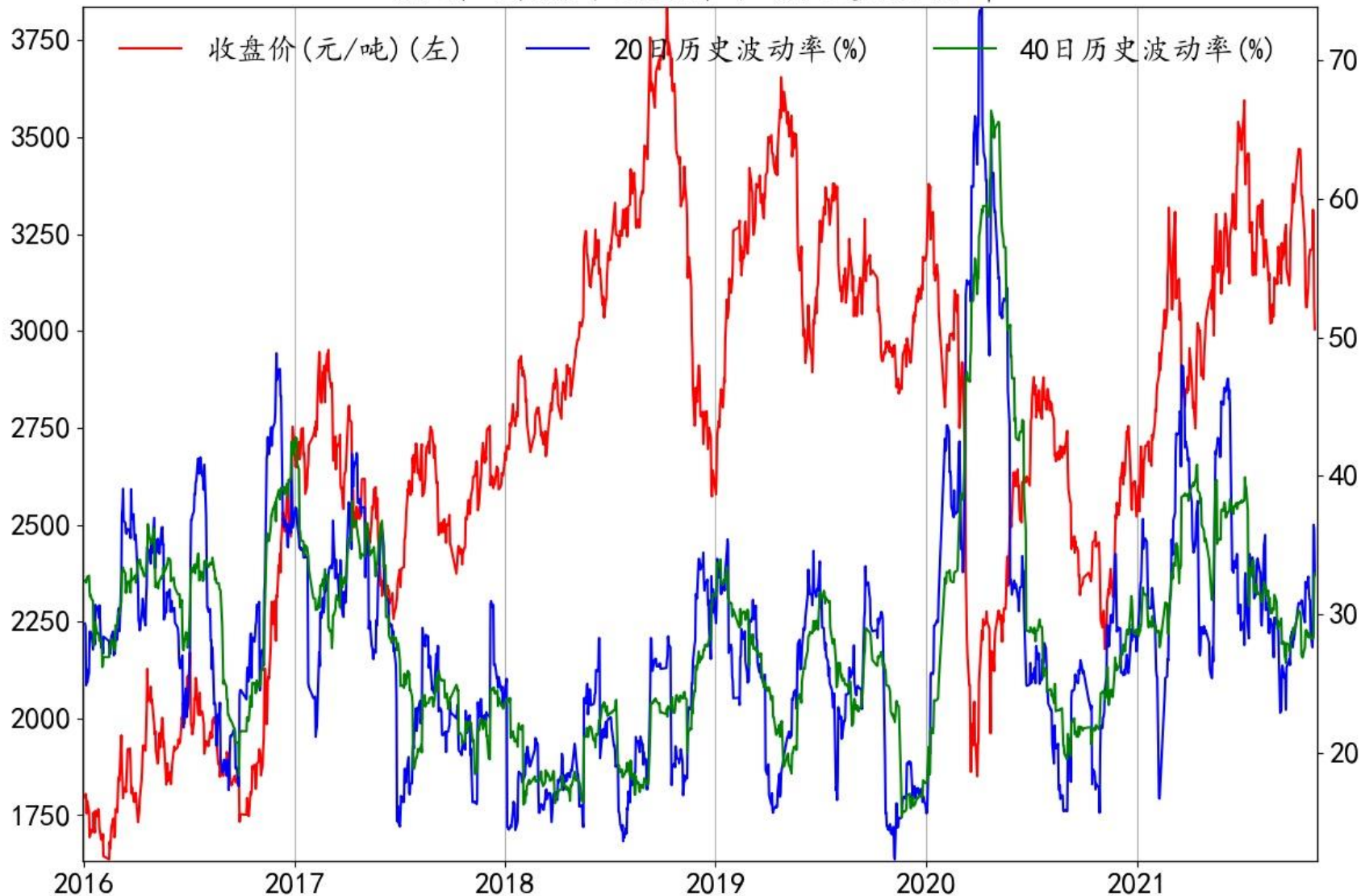
原油指数收盘价和历史波动率



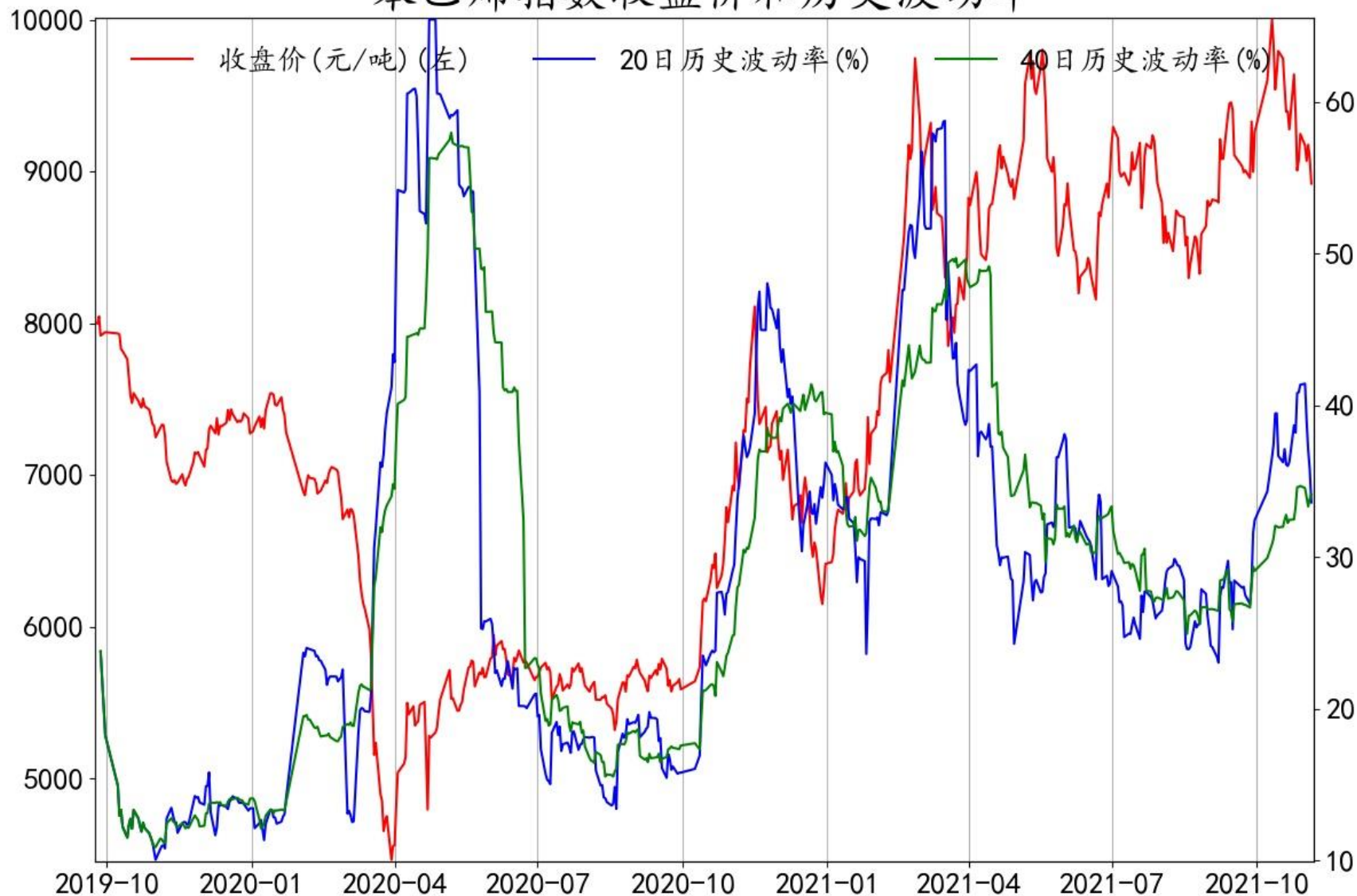
动煤指数收盘价和历史波动率



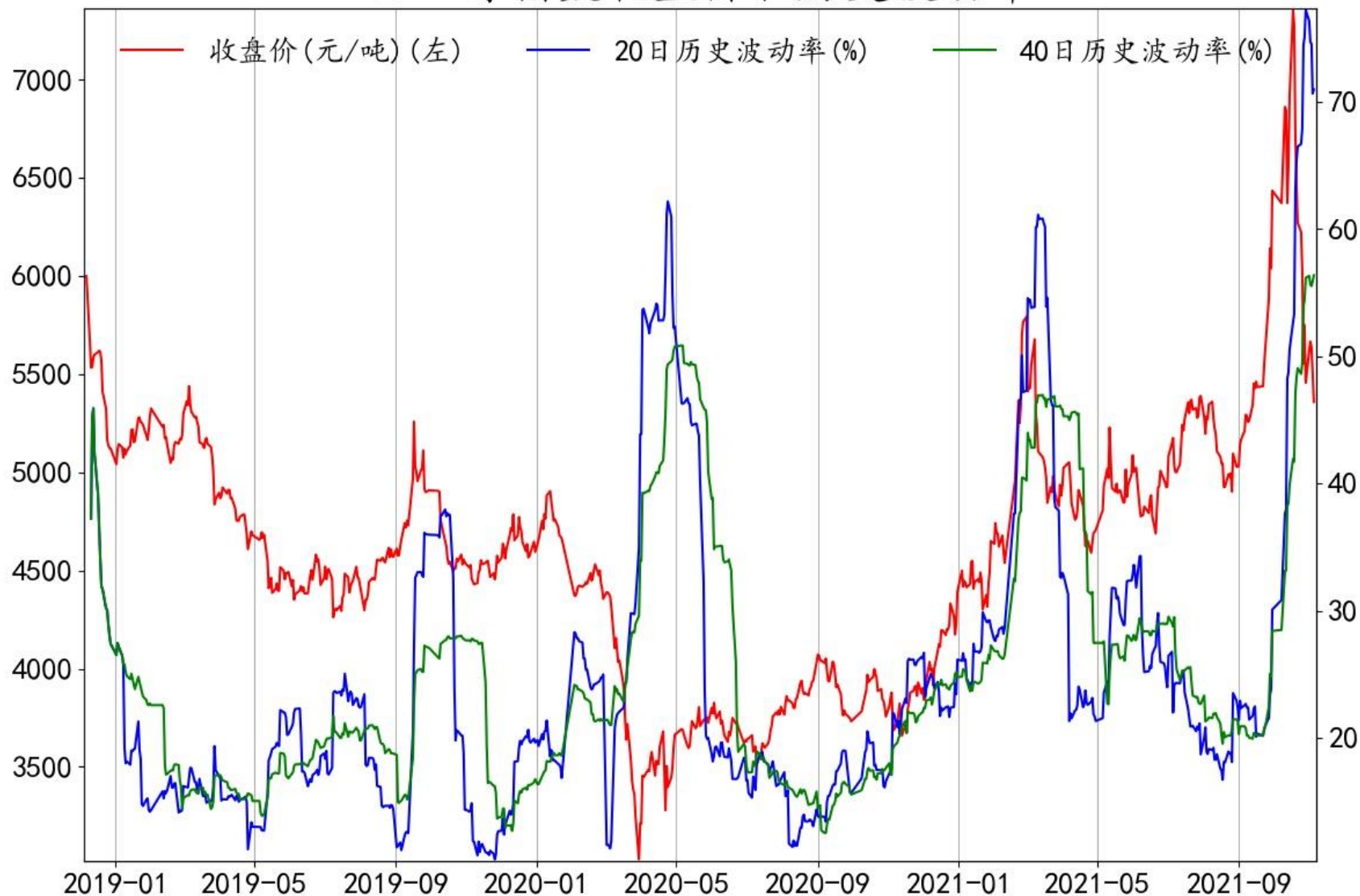
沥青指数收盘价和历史波动率



苯乙烯指数收盘价和历史波动率

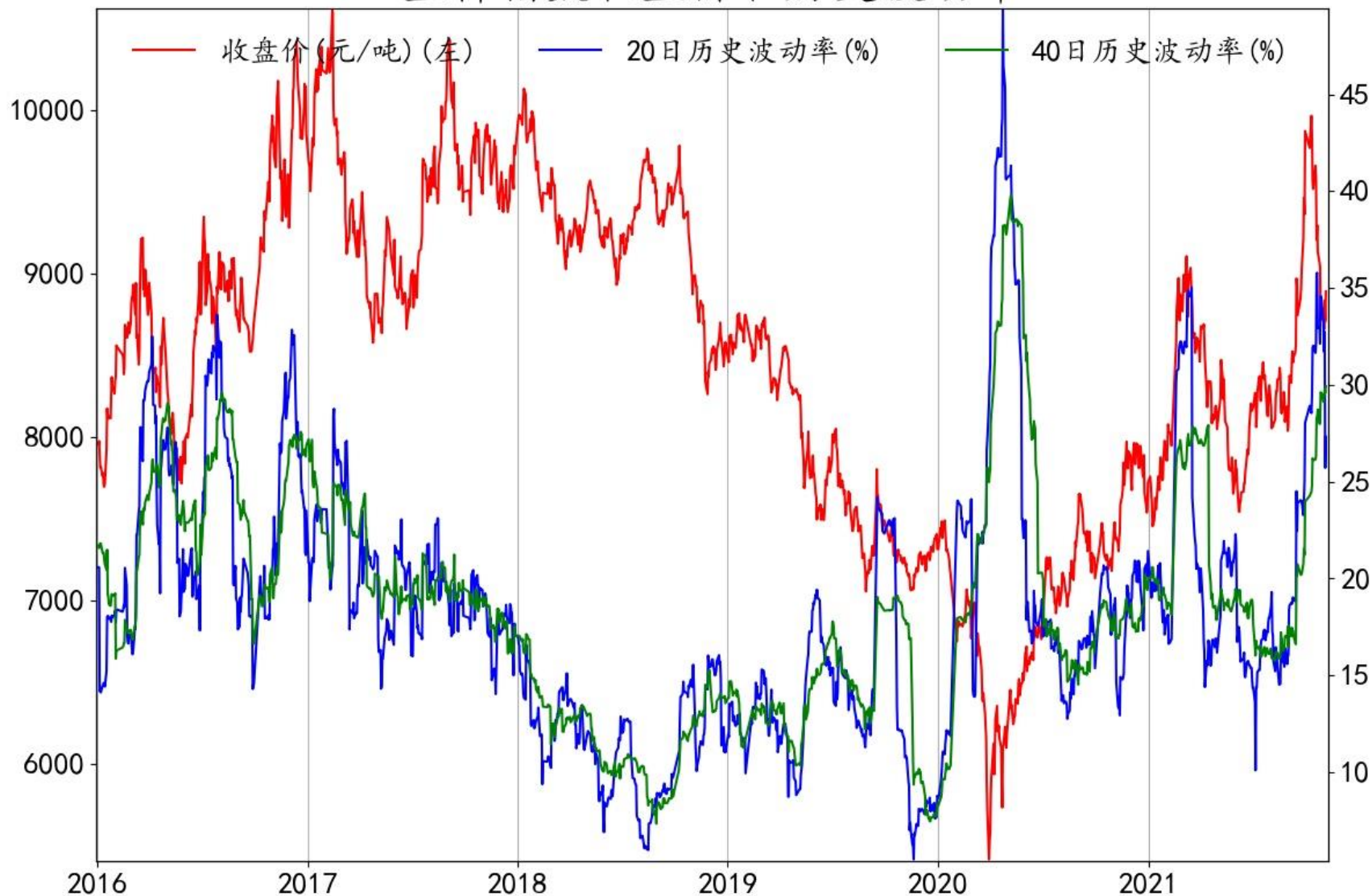


乙二醇指数收盘价和历史波动率

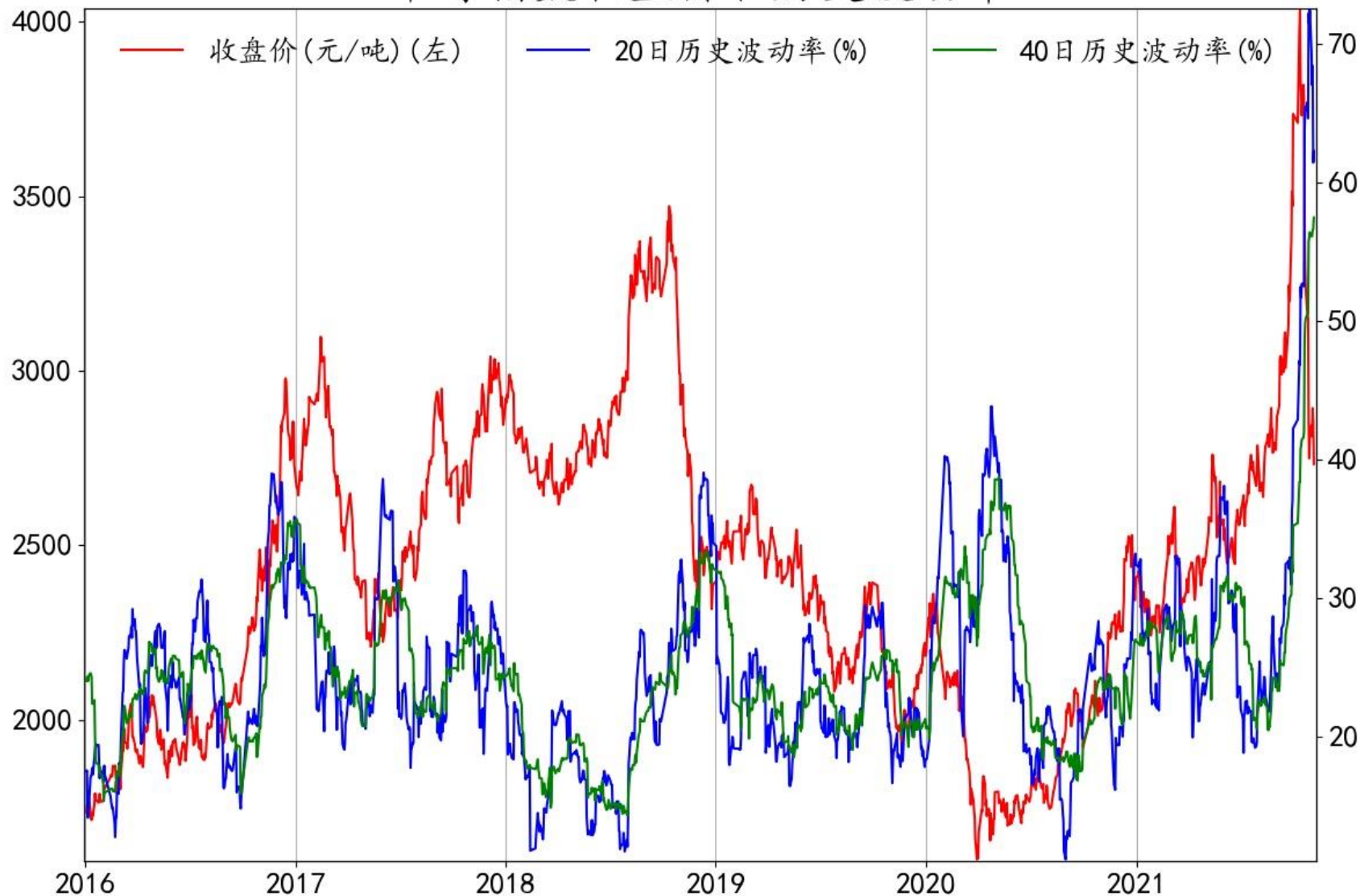


数据来源: Wind、信达期货研发中心

塑料指数收盘价和历史波动率

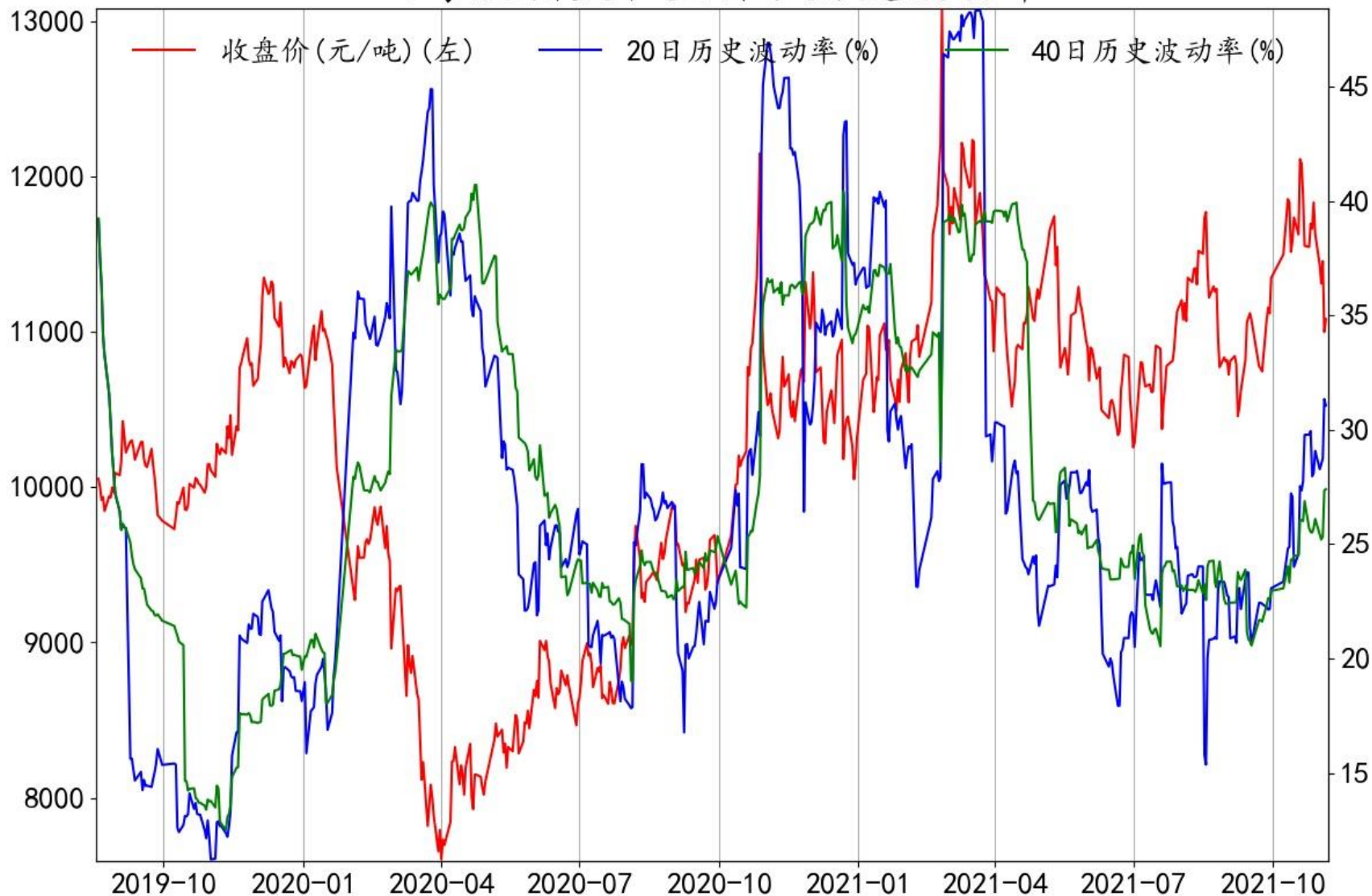


甲醇指数收盘价和历史波动率



20号胶指数

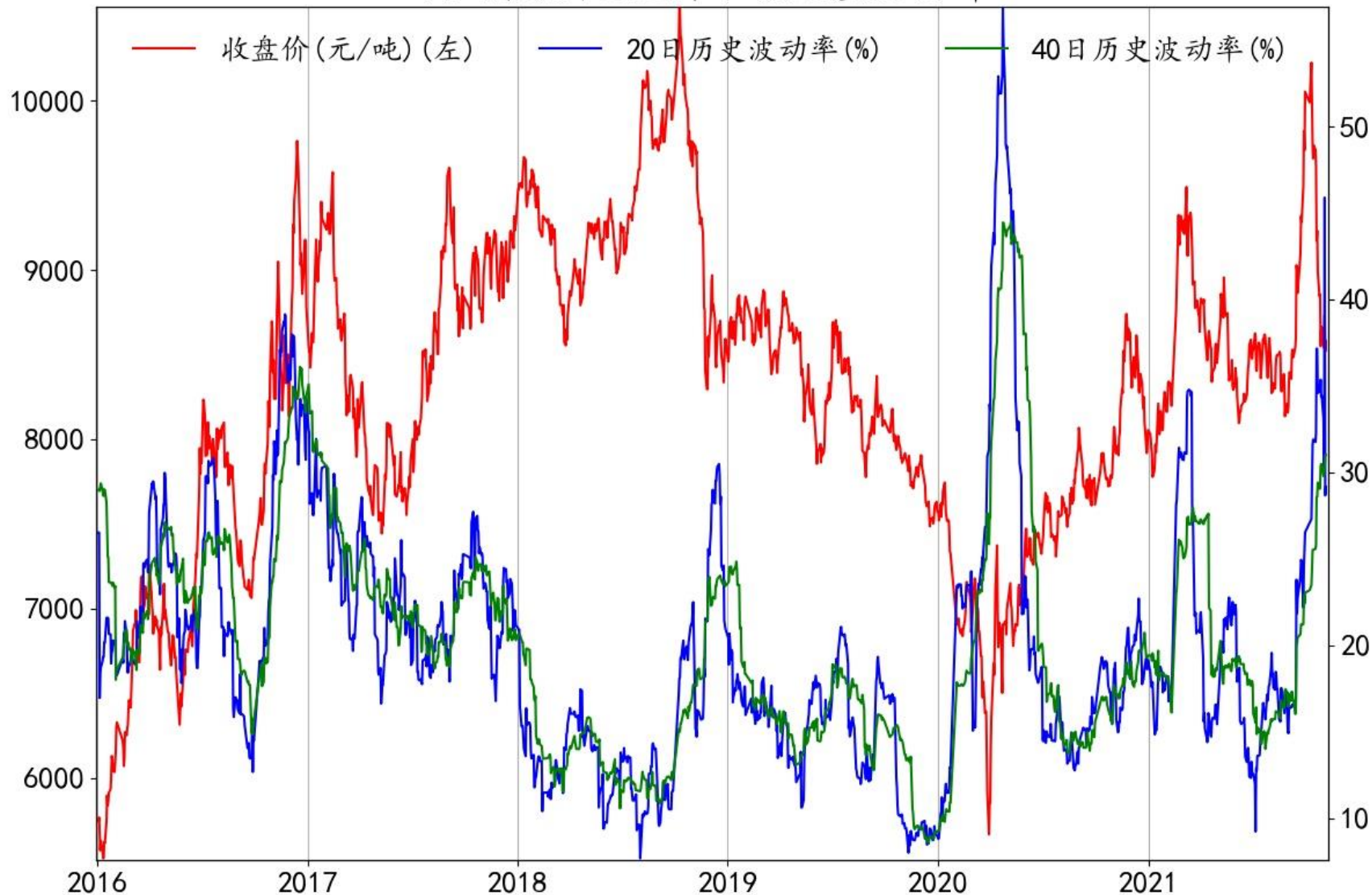
20号胶指数收盘价和历史波动率



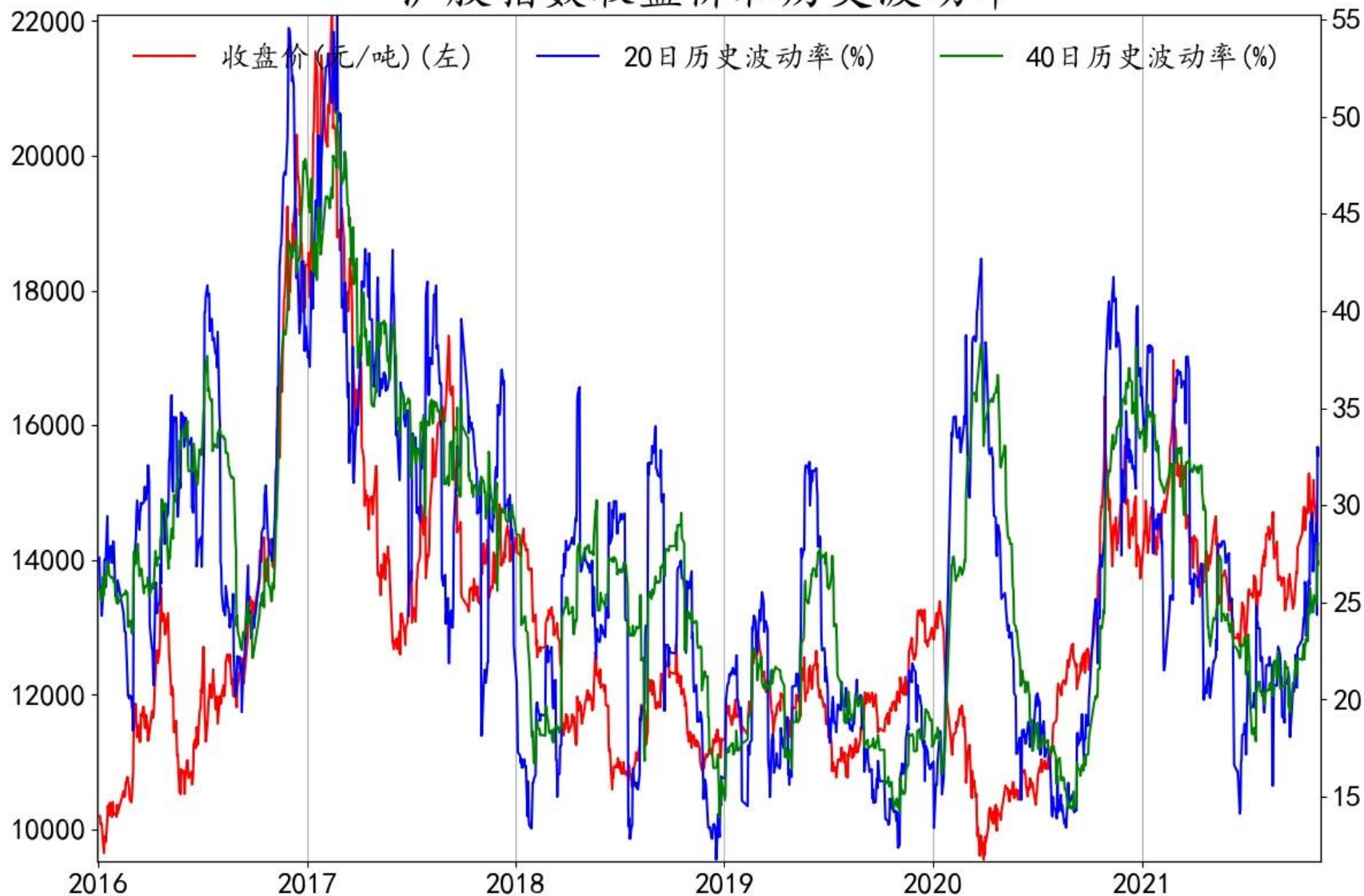
短纤指数收盘价和历史波动率



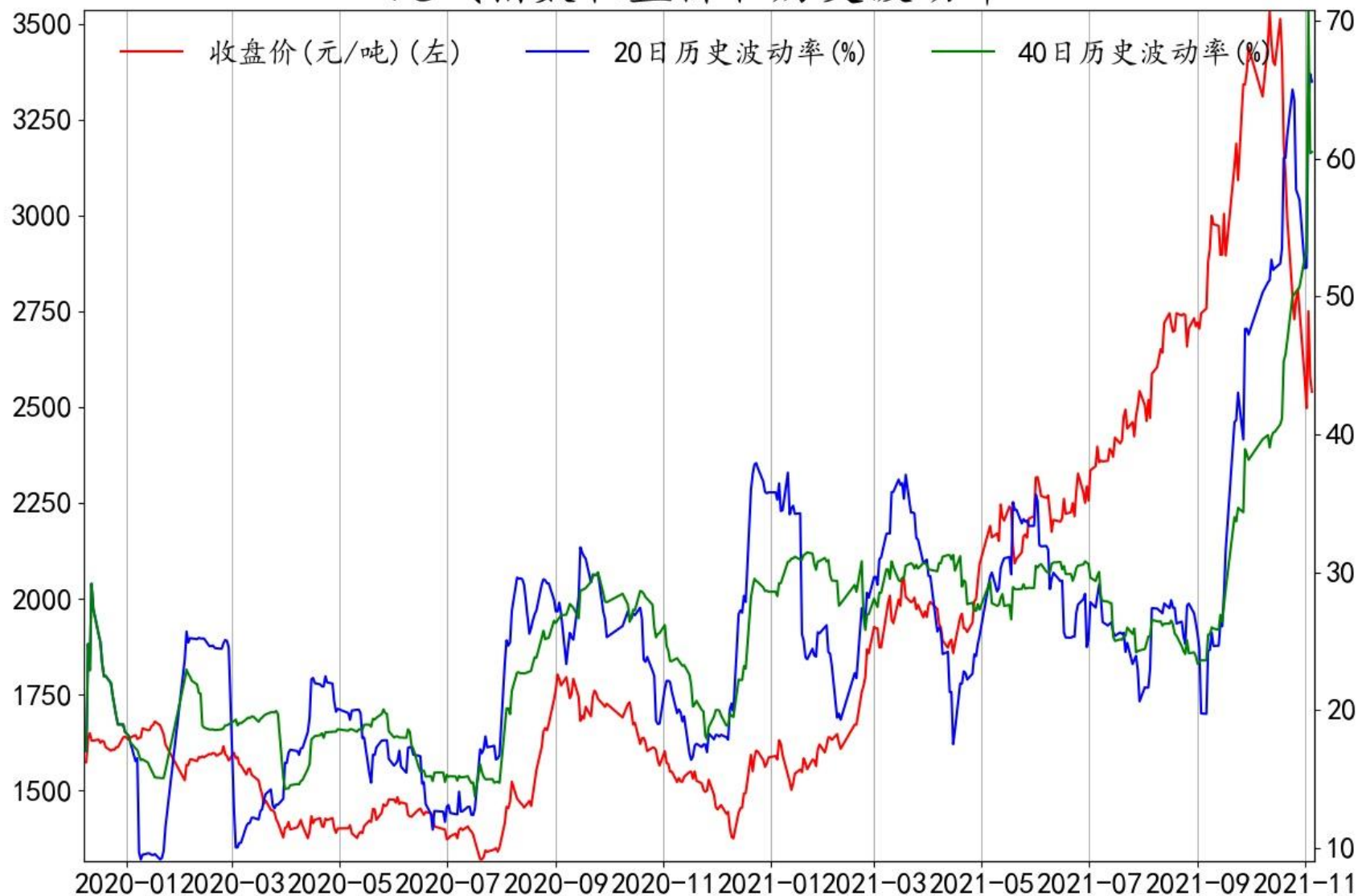
PP指数收盘价和历史波动率



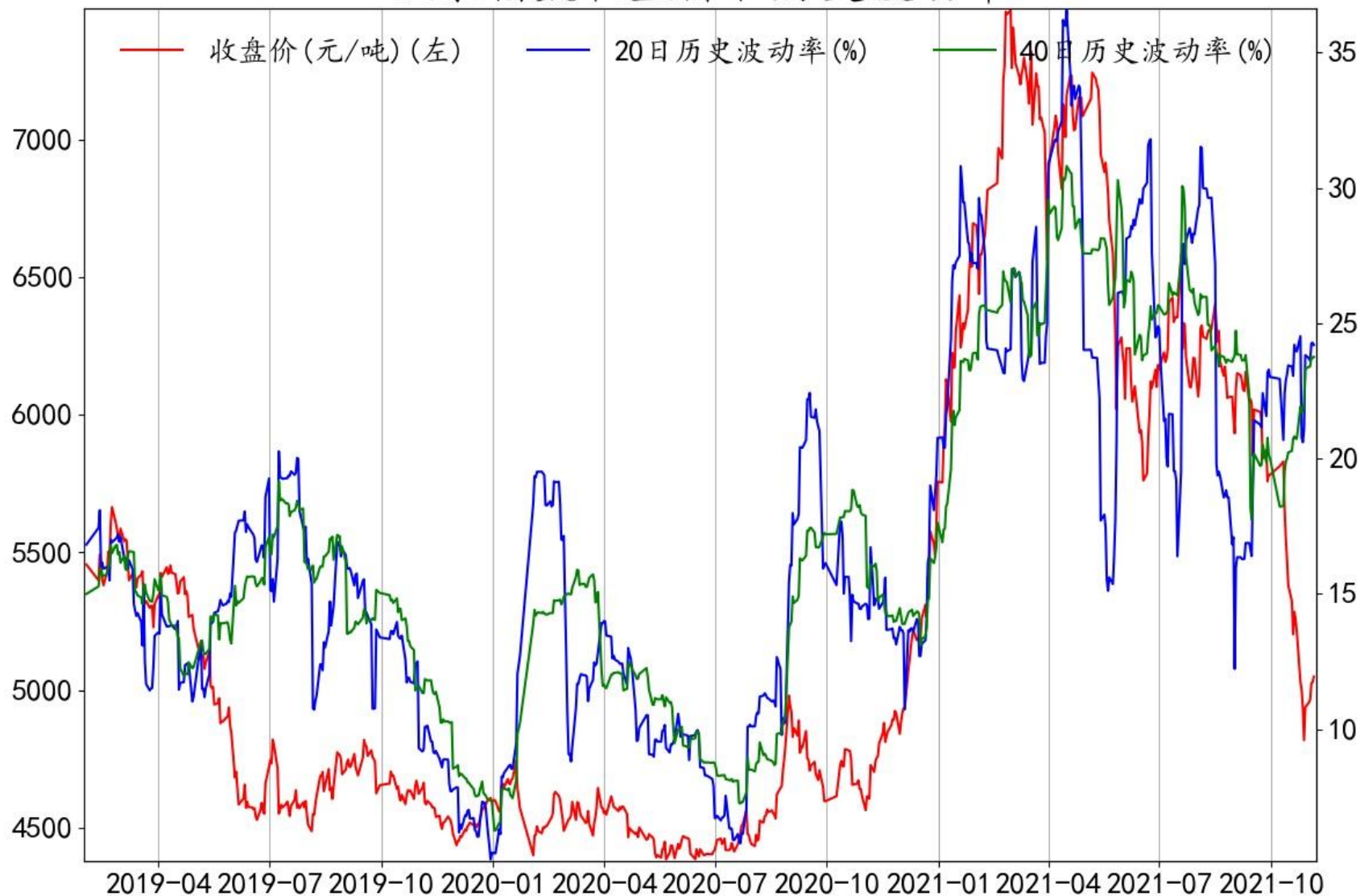
沪胶指数收盘价和历史波动率



纯碱指数收盘价和历史波动率

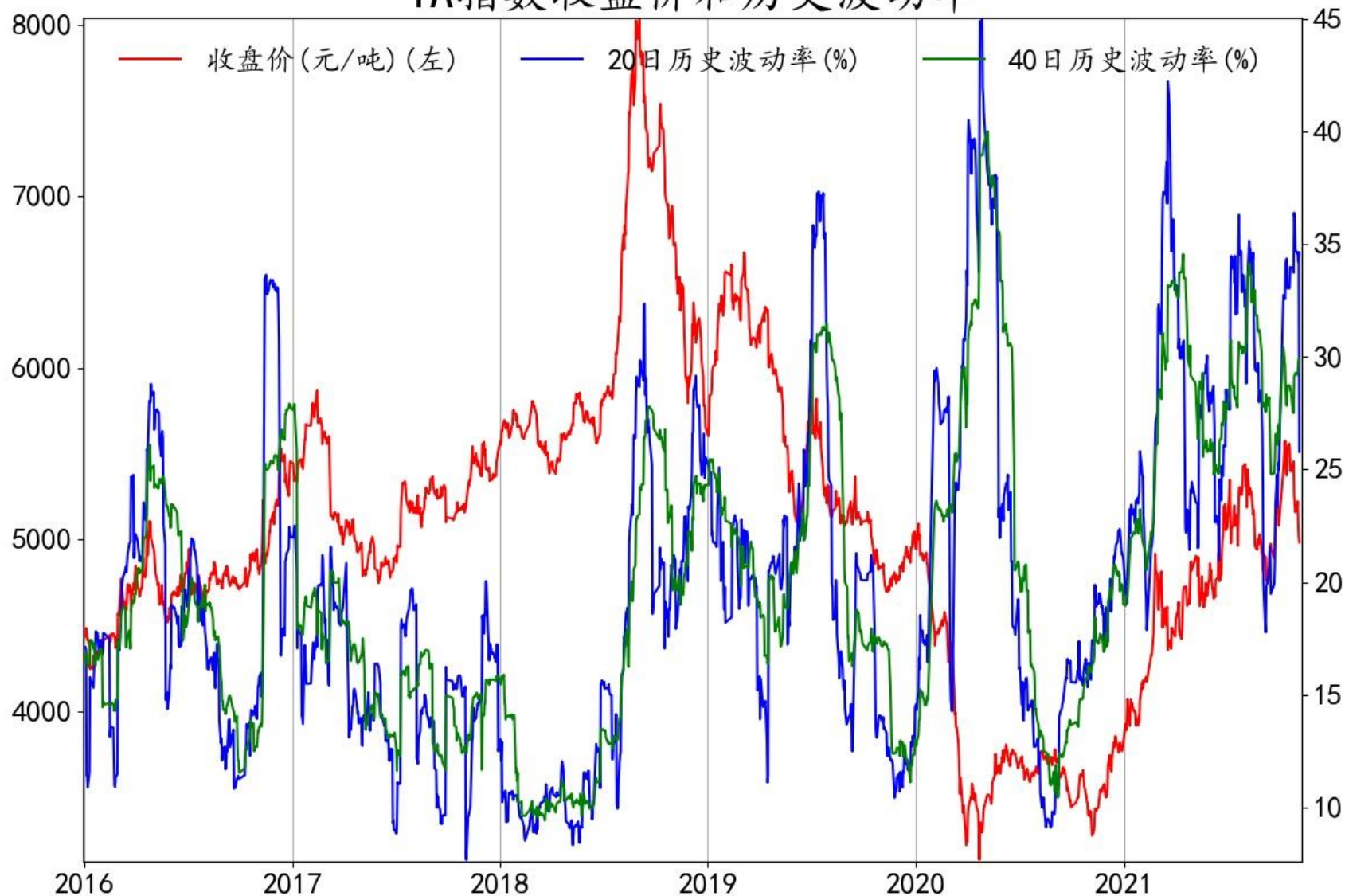


纸浆指数收盘价和历史波动率

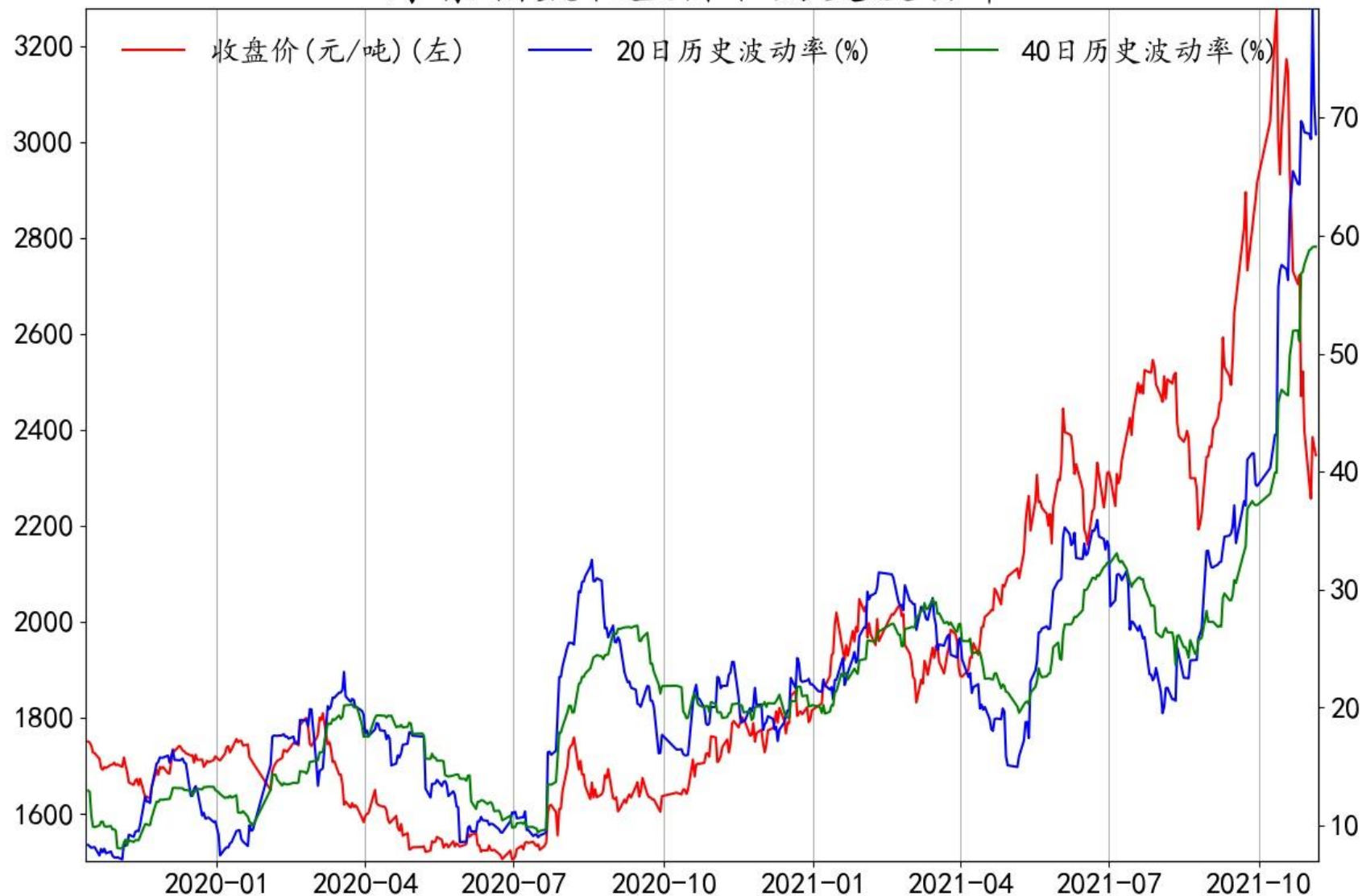


数据来源: Wind、信达期货研发中心

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

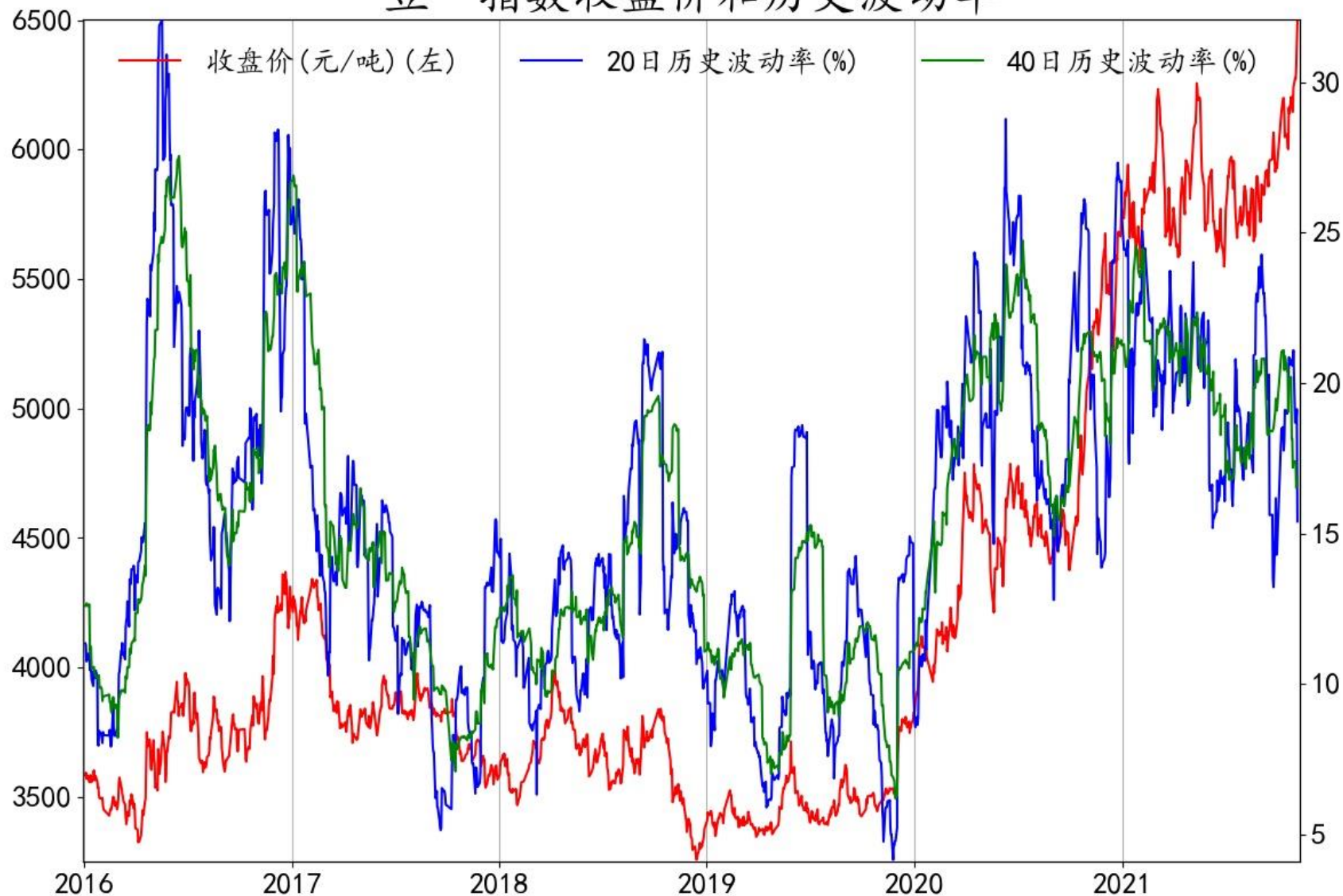


数据来源: Wind、信达期货研发中心

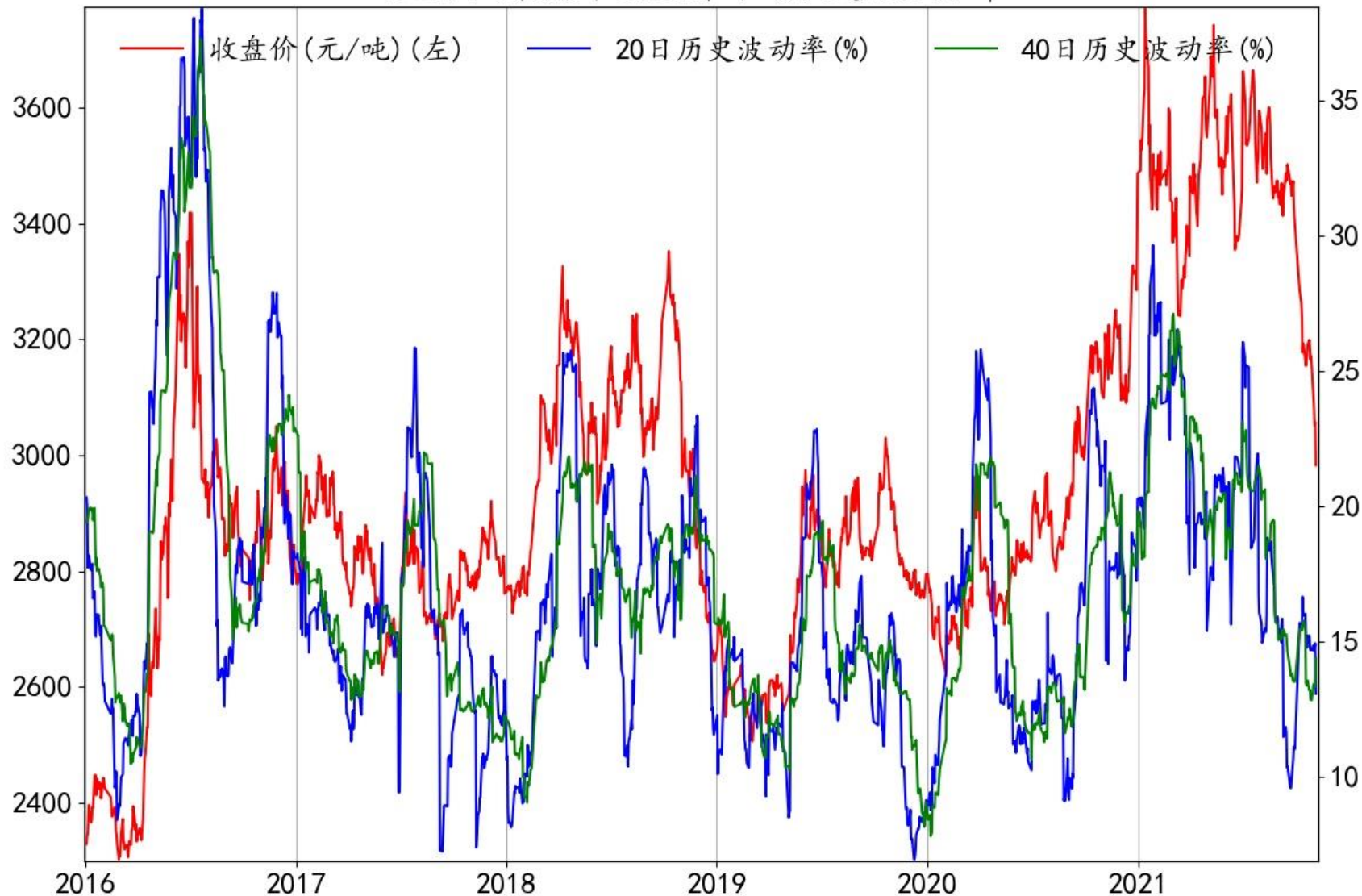
玉米指数收盘价和历史波动率



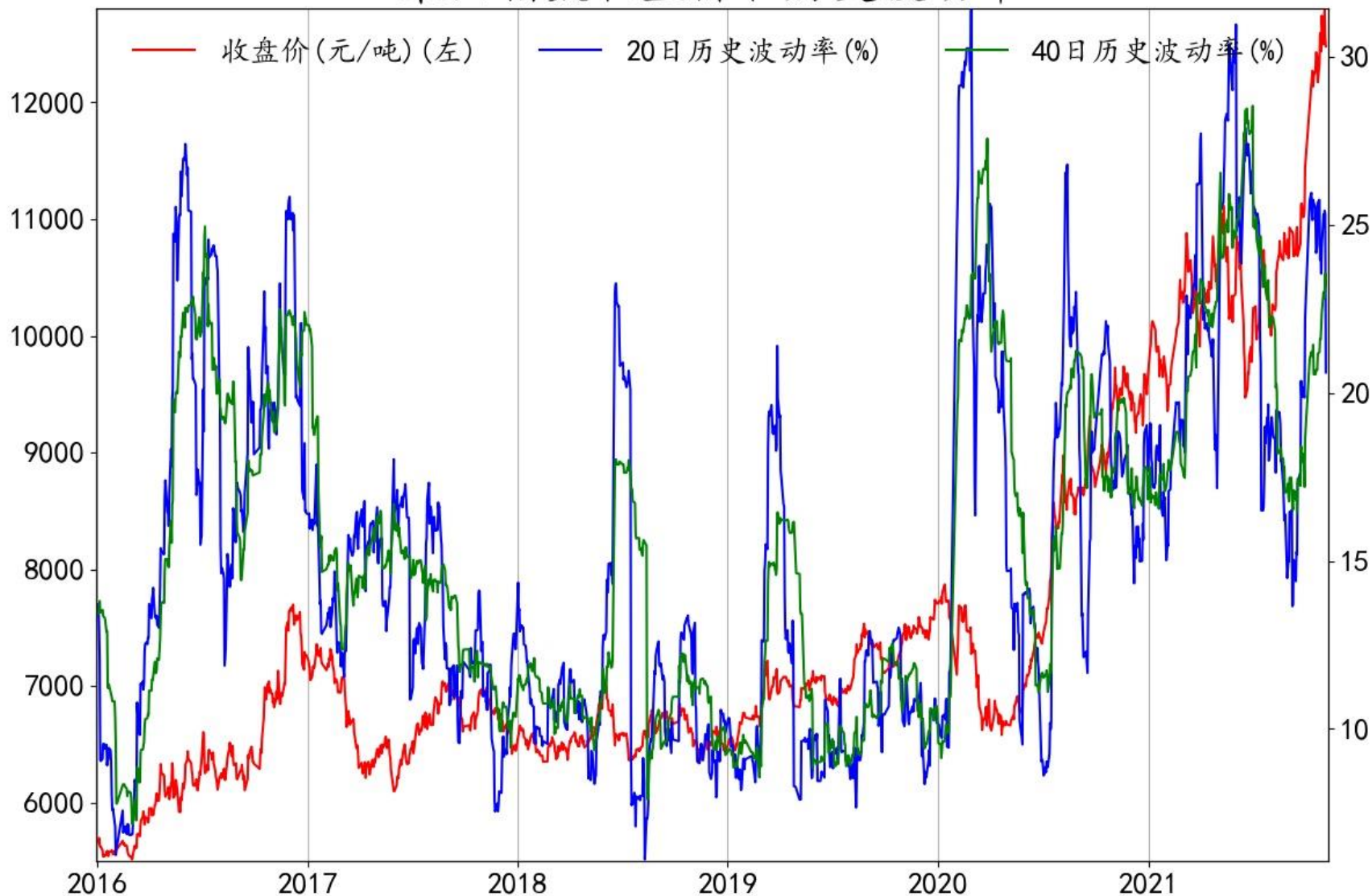
豆一指数收盘价和历史波动率



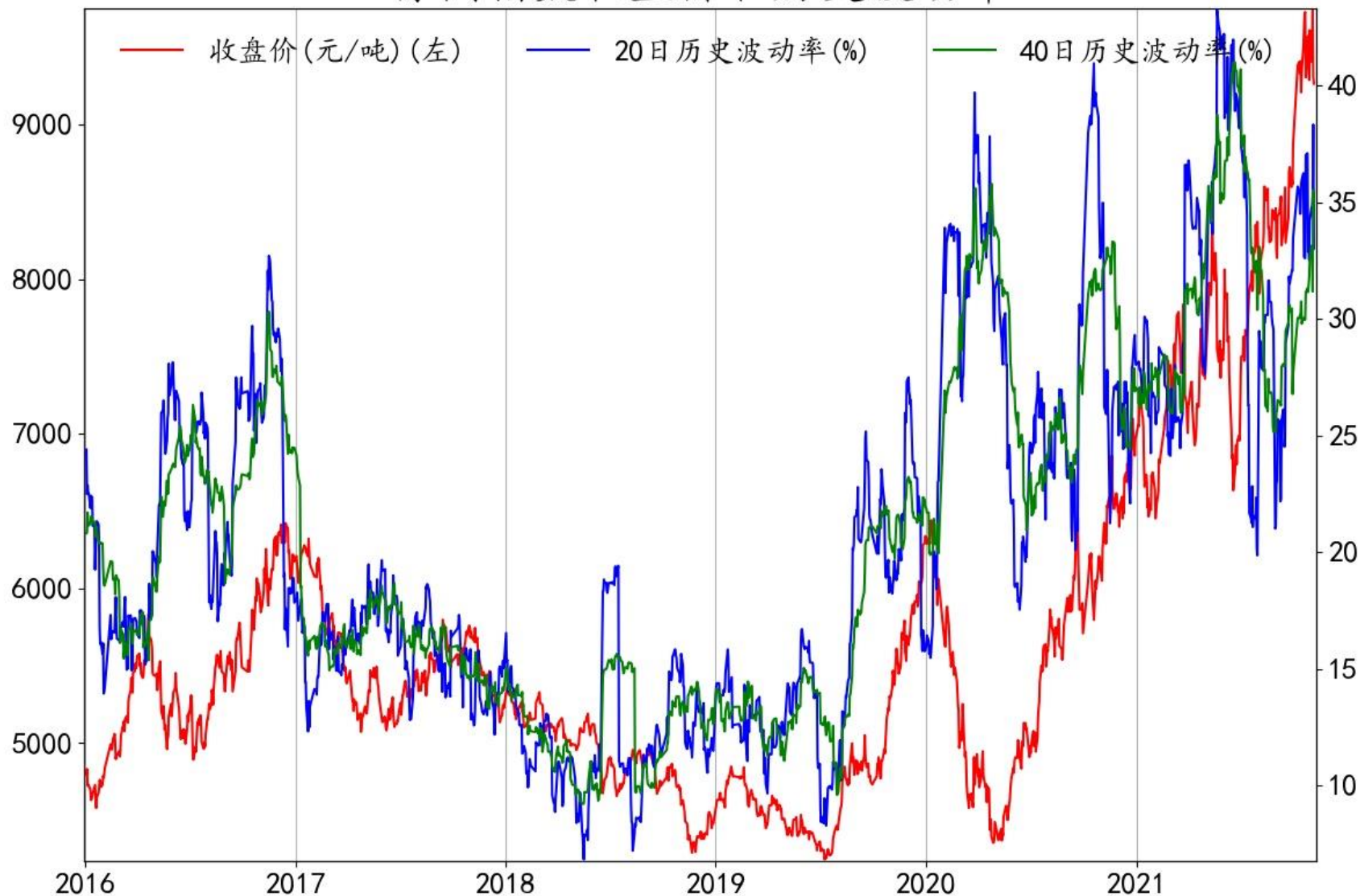
豆粕指数收盘价和历史波动率



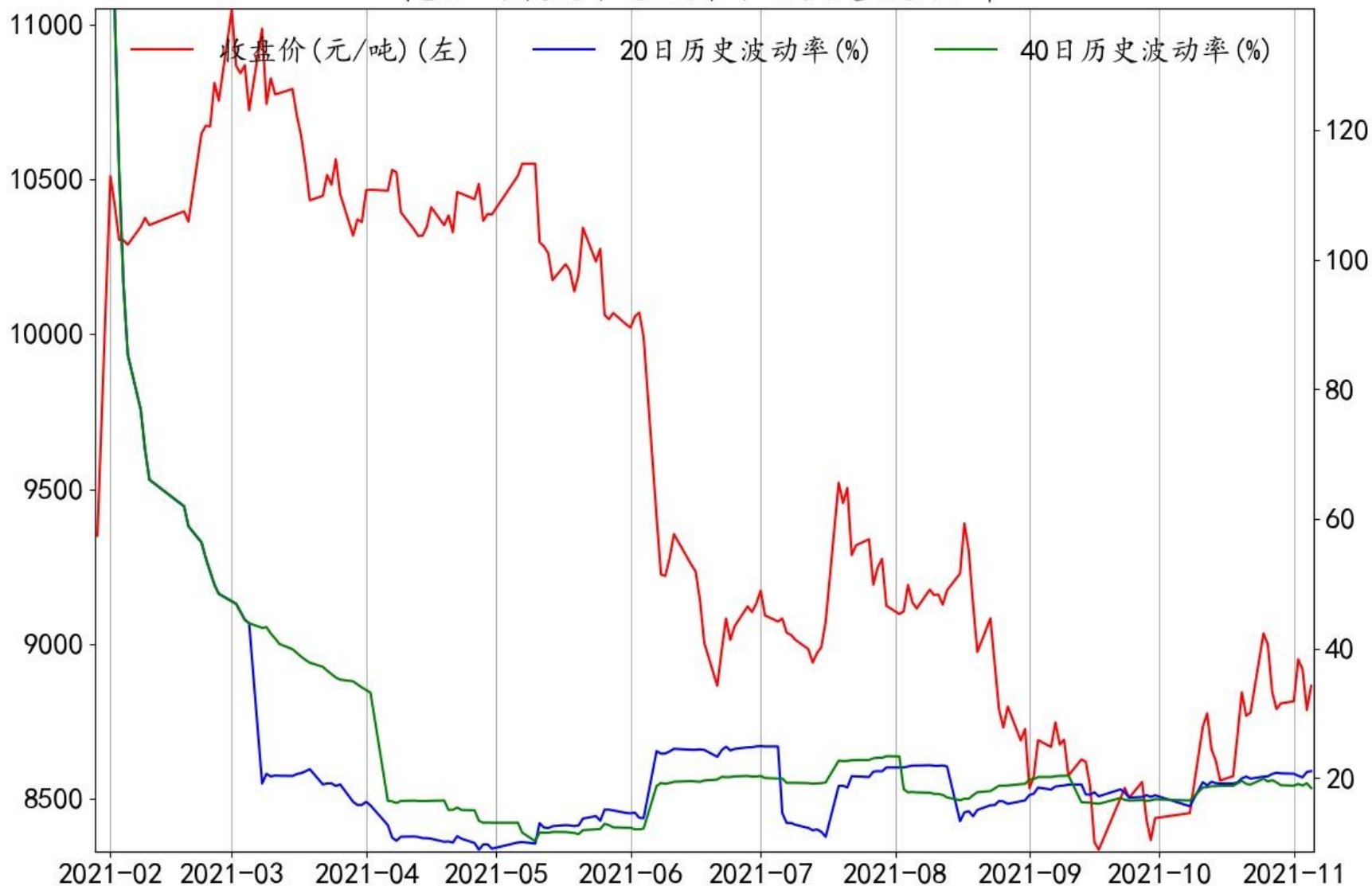
菜油指数收盘价和历史波动率



棕榈指数收盘价和历史波动率

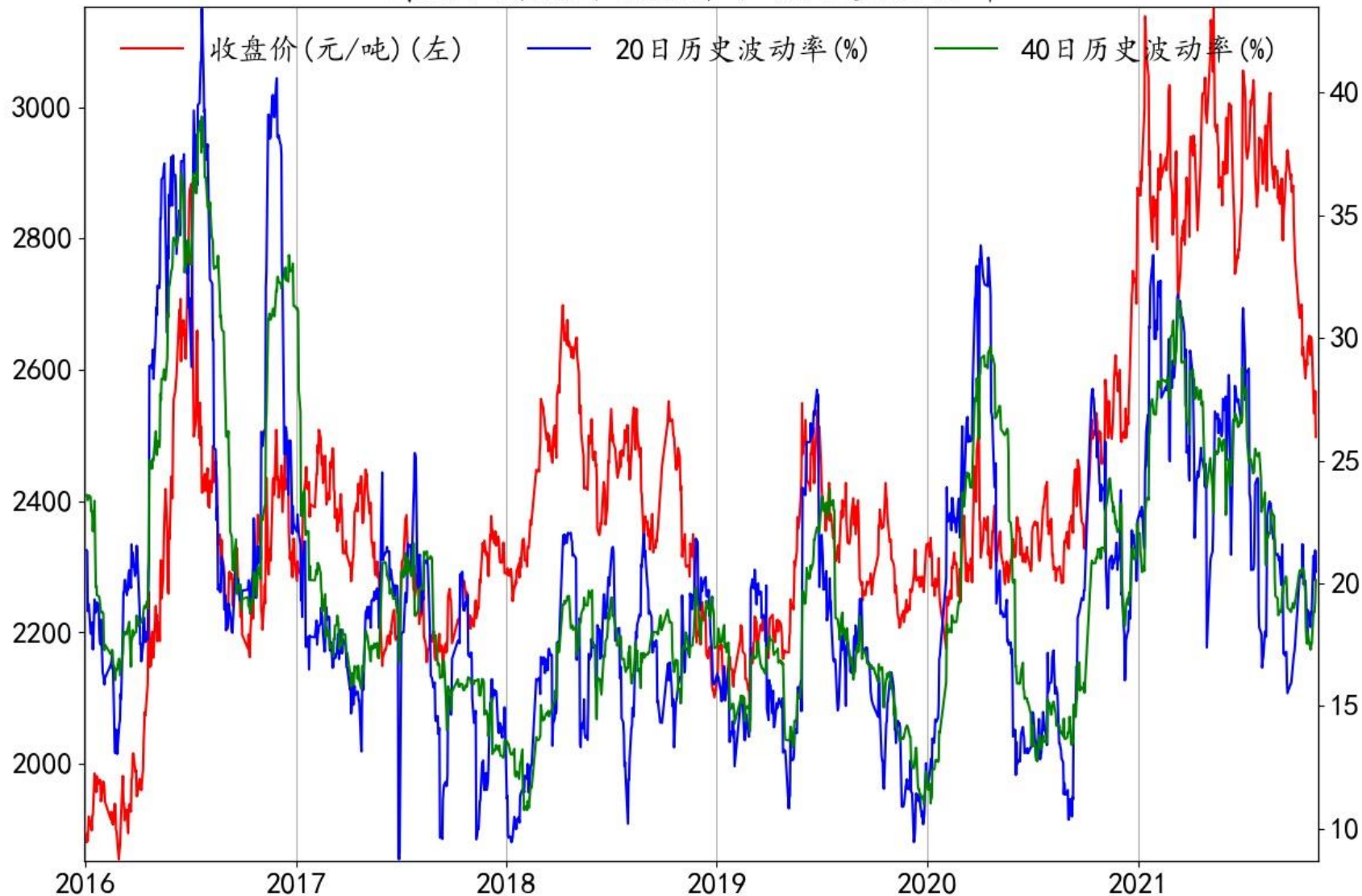


花生指数收盘价和历史波动率

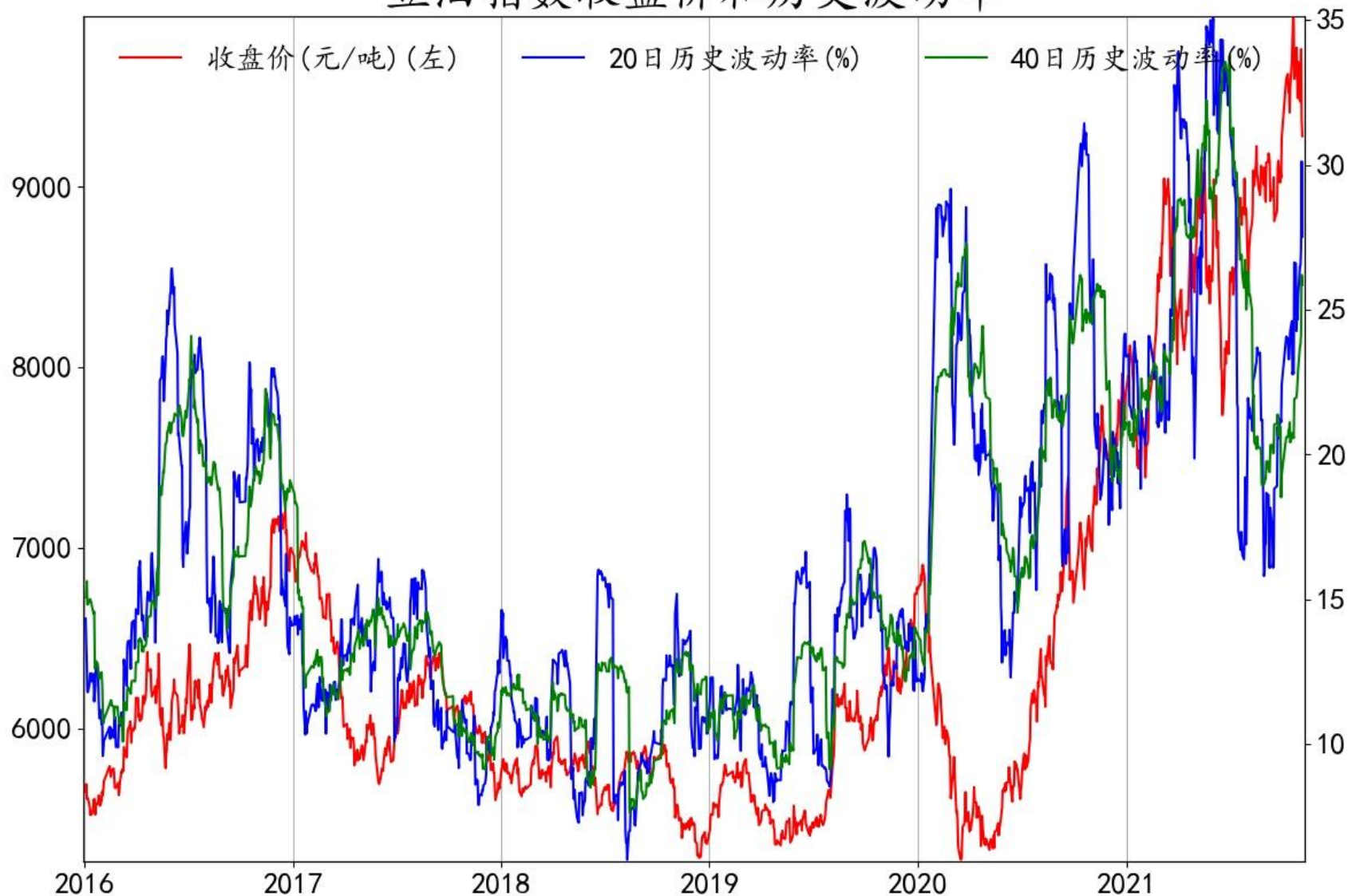


数据来源: Wind、信达期货研发中心

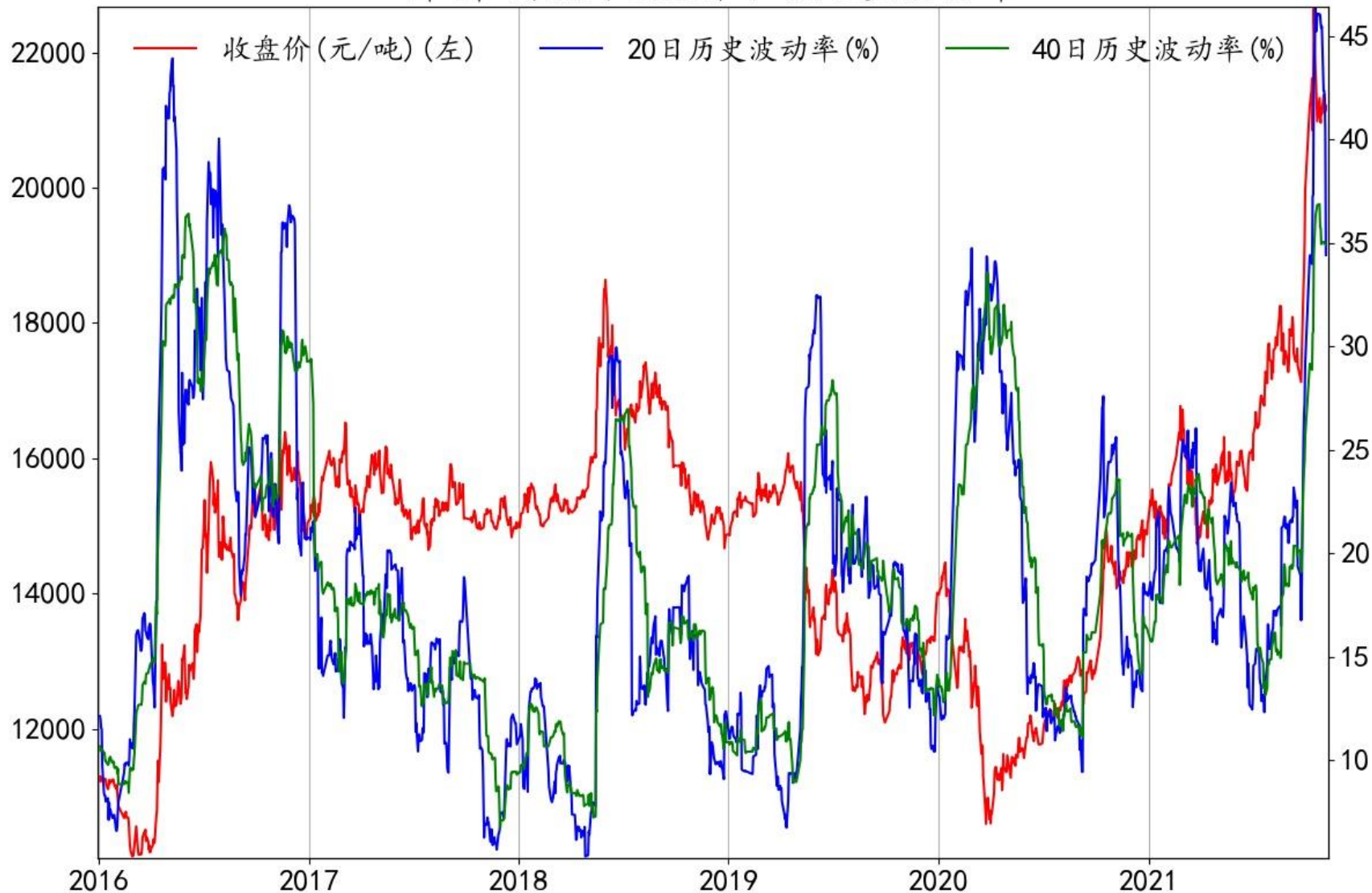
菜粕指数收盘价和历史波动率



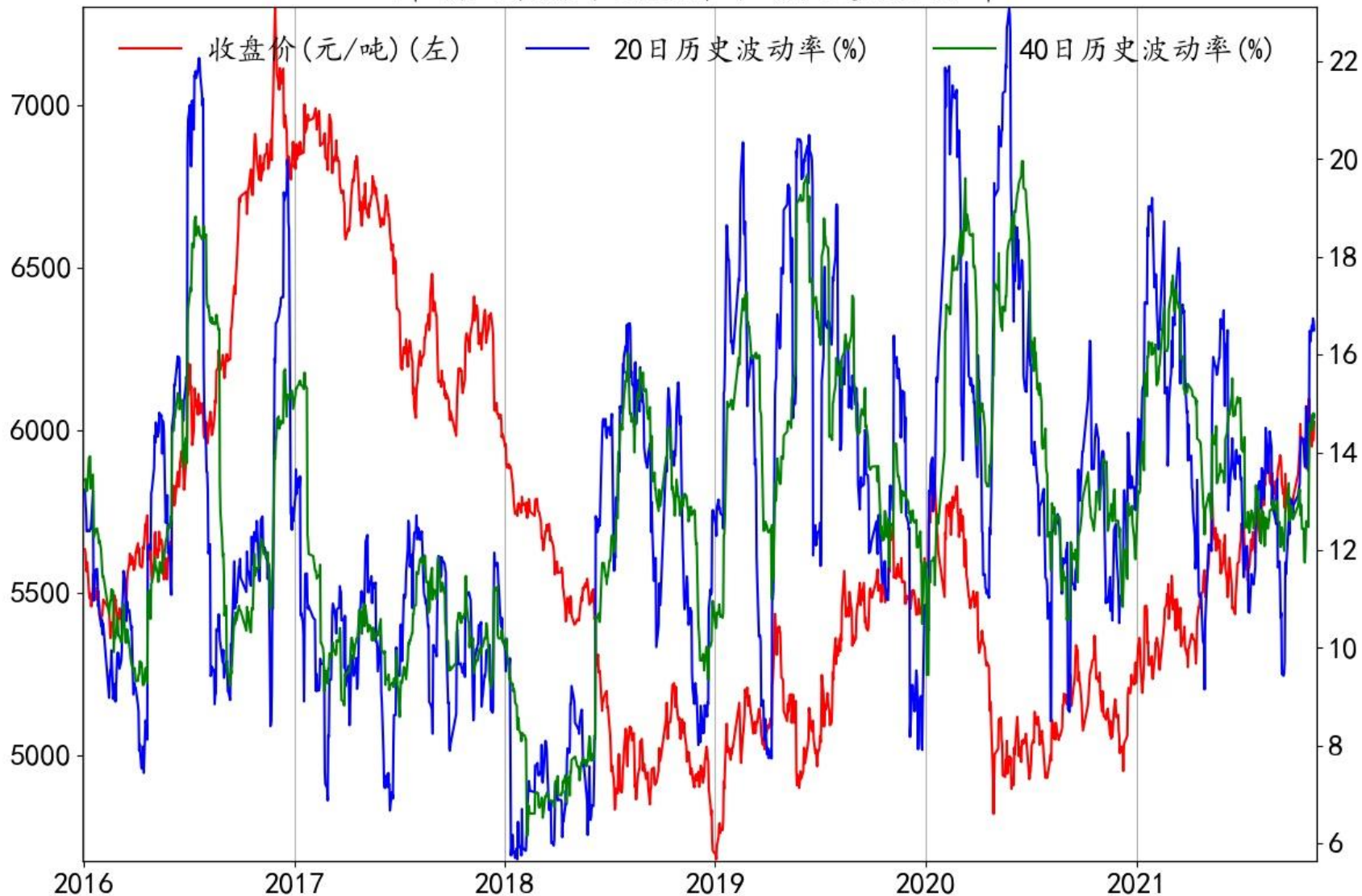
豆油指数收盘价和历史波动率



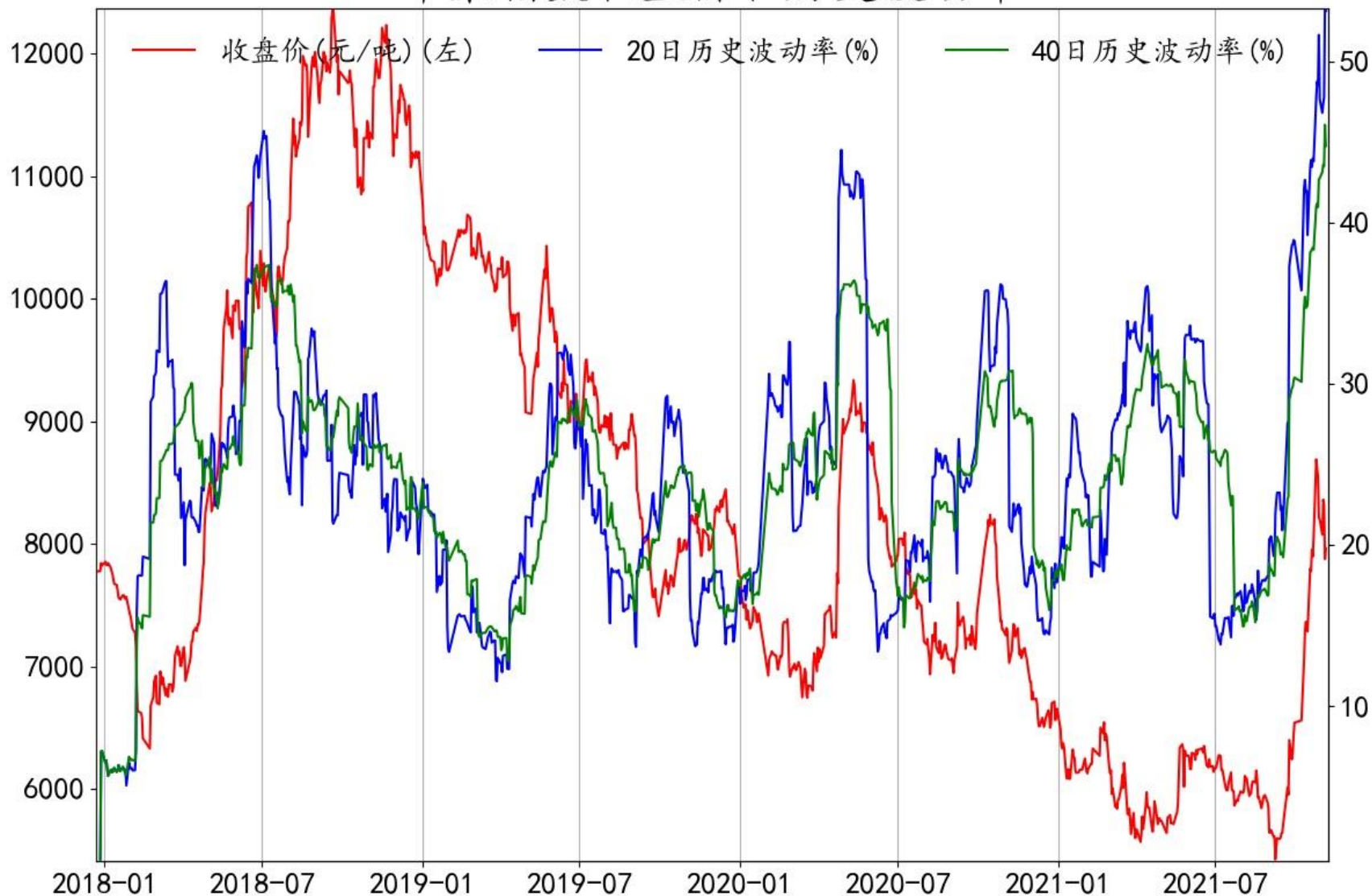
郑棉指数收盘价和历史波动率



郑糖指数收盘价和历史波动率

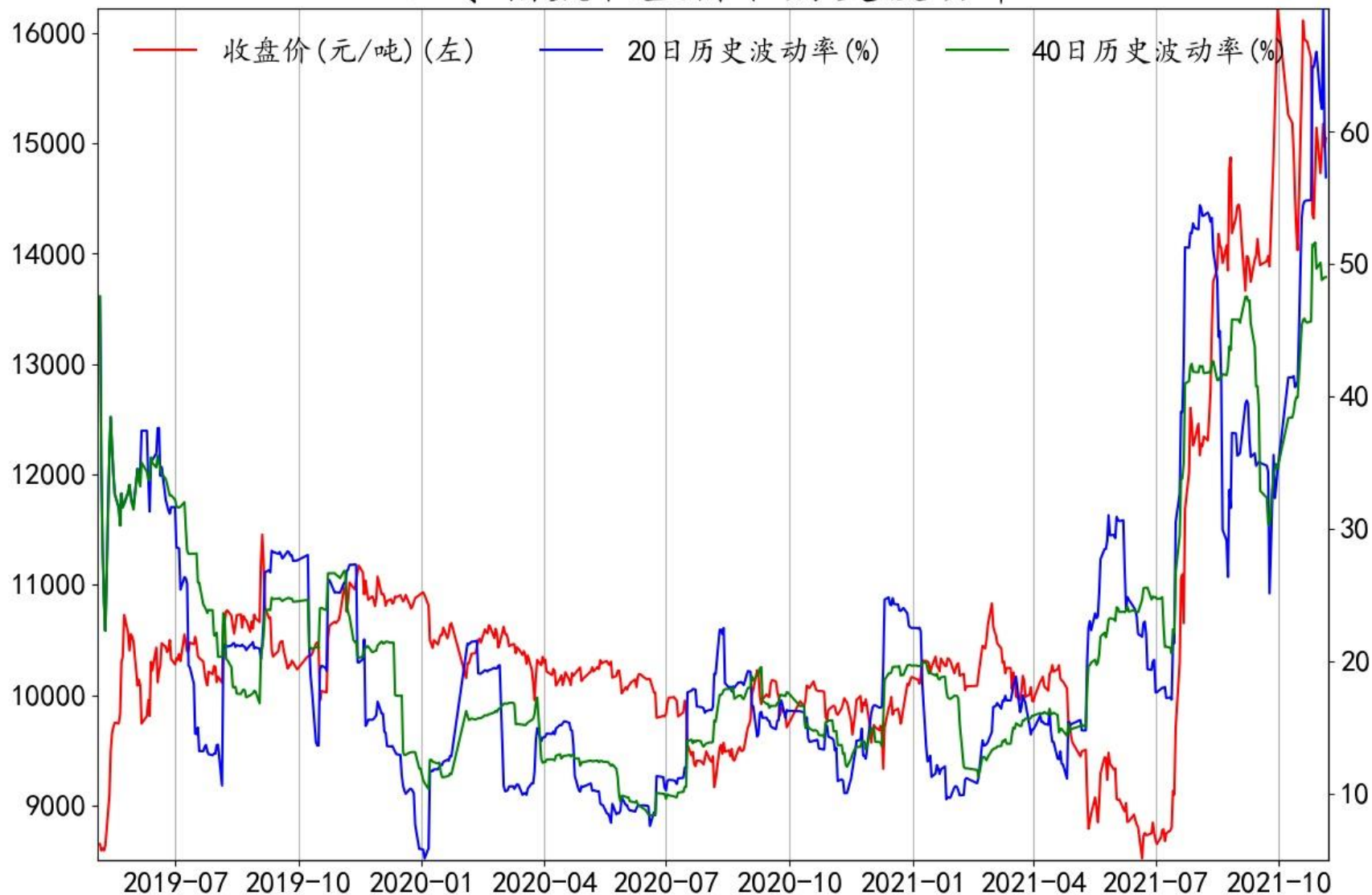


苹果指数收盘价和历史波动率



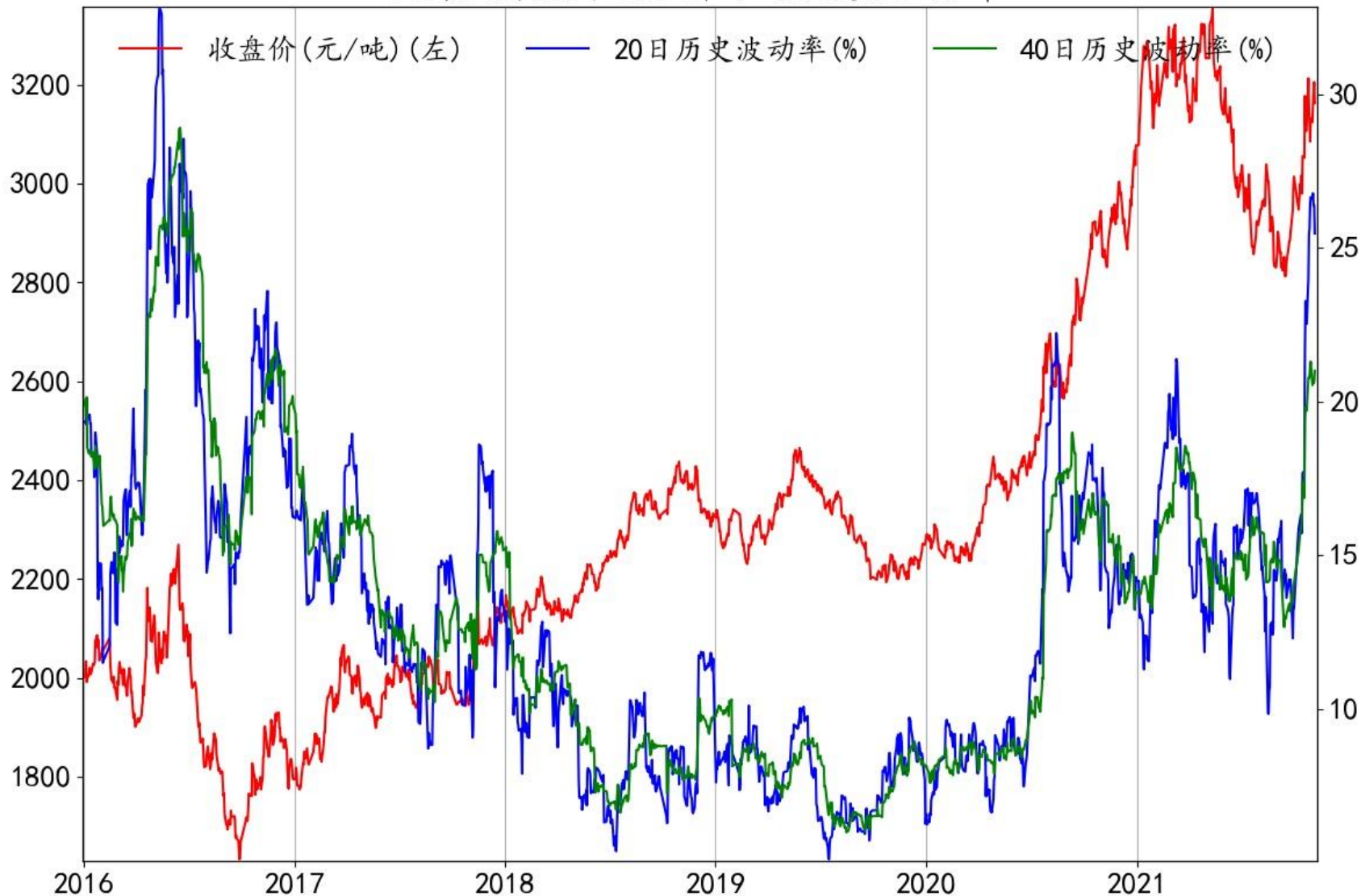
数据来源: Wind、信达期货研发中心

红枣指数收盘价和历史波动率

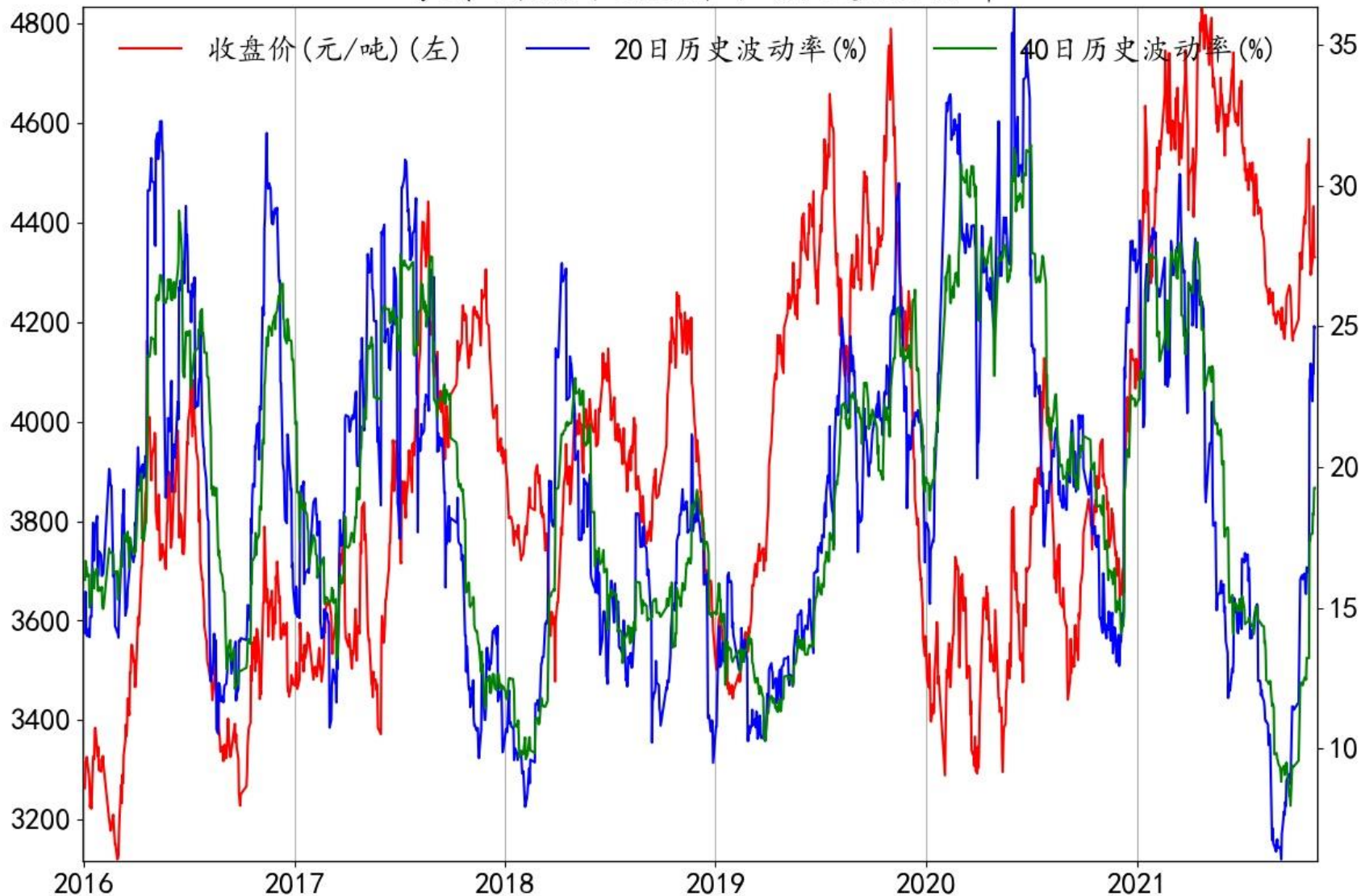


数据来源: Wind、信达期货研发中心

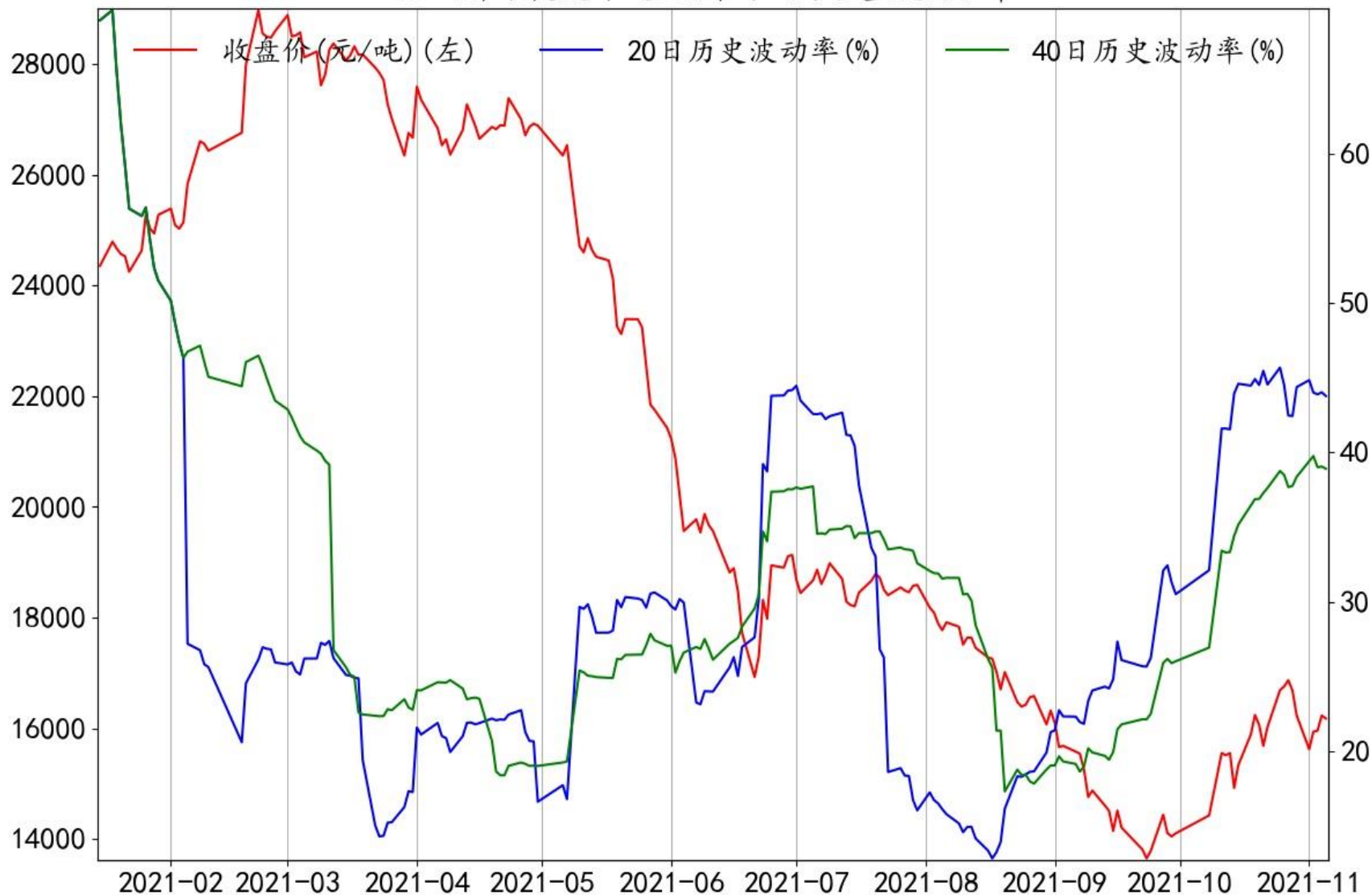
淀粉指数收盘价和历史波动率



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

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