

# 商品期货波动率跟踪

2021年11月08日

20日历史波动率百分位高于90%:

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

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、焦炭、硅铁、锰硅

20日历史波动率绝对值后五:

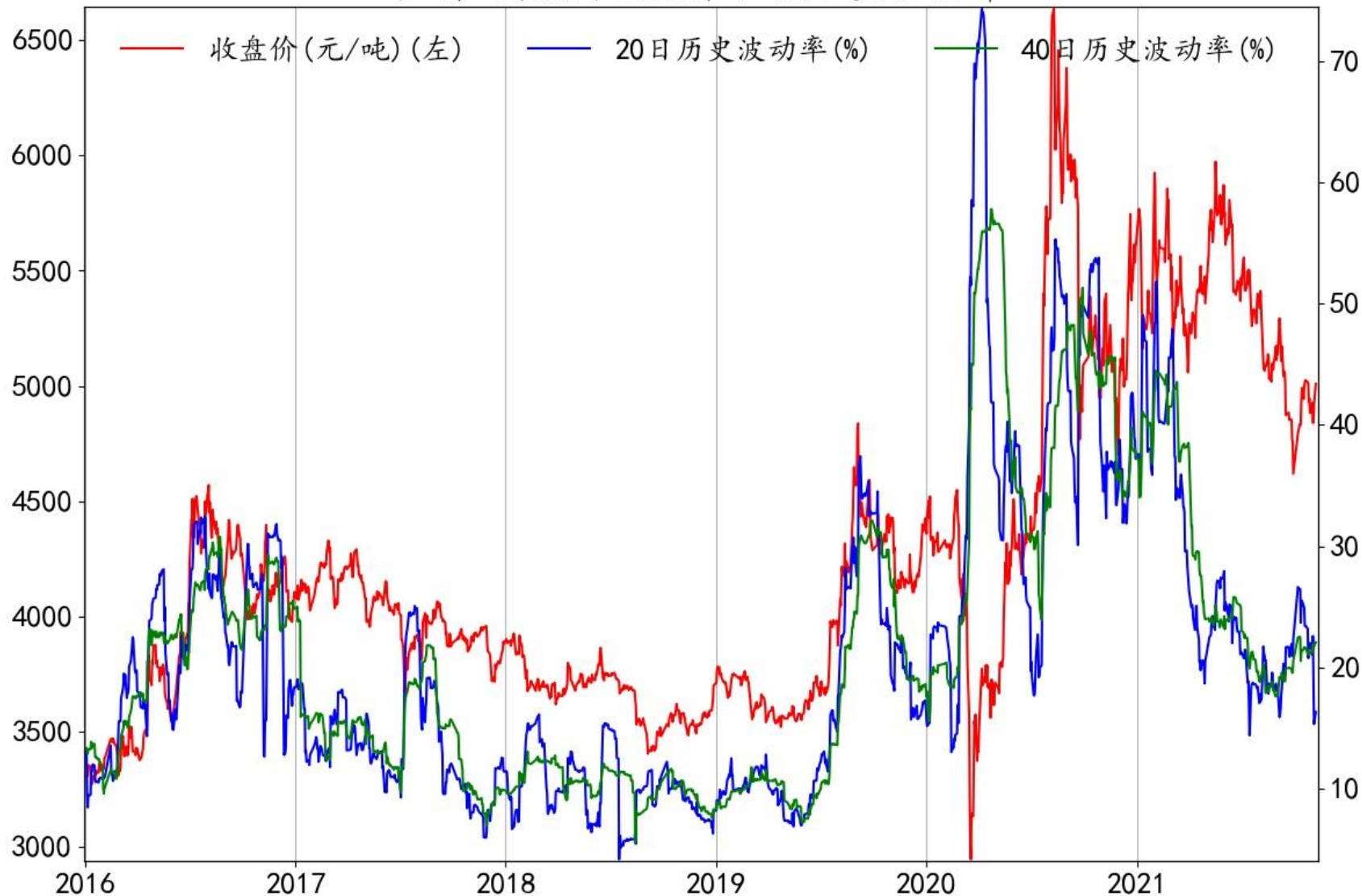
沪金、玉米、豆粕、沪银、郑糖

|    | 时间百分位  | 绝对值    |
|----|--------|--------|
| 沪银 | 45.50% | 16.30% |
| 沪金 | 58.93% | 11.96% |
| 沪铝 | 99.93% | 44.46% |
| 沪铜 | 93.53% | 26.15% |
| 沪镍 | 78.34% | 28.19% |
| 沪铅 | 69.55% | 19.35% |
| 沪锡 | 96.62% | 38.40% |
| 沪锌 | 99.93% | 51.28% |
| 热卷 | 87.20% | 38.62% |
| 铁矿 | 96.27% | 61.13% |
| 焦炭 | 99.51% | 83.59% |
| 焦煤 | 99.58% | 88.89% |
| 螺纹 | 96.41% | 46.43% |

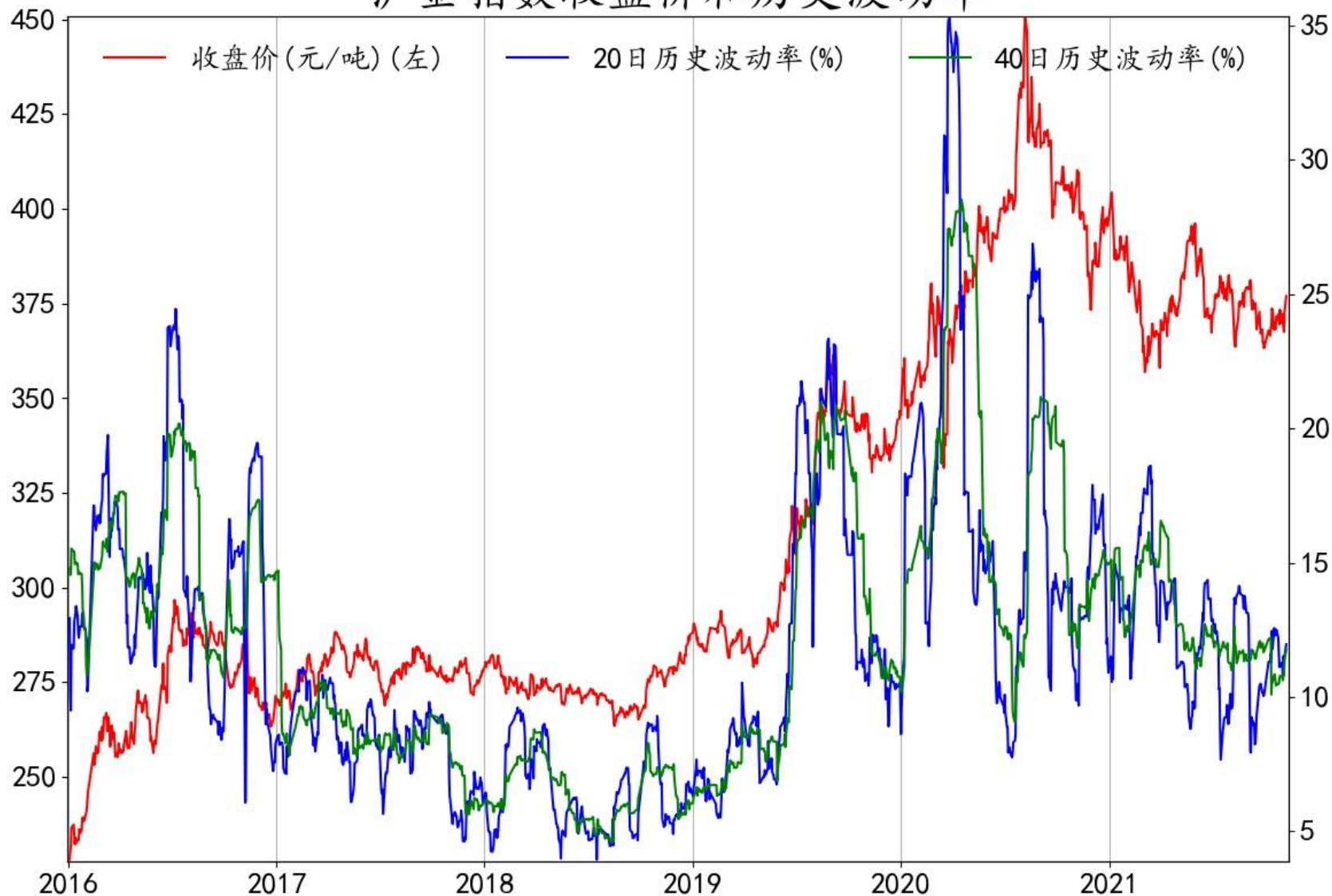
|      | 时间百分位  | 绝对值     |
|------|--------|---------|
| 硅铁   | 99.09% | 82.38%  |
| 锰硅   | 98.38% | 70.53%  |
| 不锈钢  | 72.80% | 24.91%  |
| 玻璃   | 99.79% | 52.77%  |
| PVC  | 99.09% | 60.45%  |
| 燃油   | 80.39% | 38.64%  |
| 低硫燃油 | 5.56%  | 20.35%  |
| LPG  | 89.17% | 40.48%  |
| 原油   | 38.54% | 25.35%  |
| 动煤   | 99.23% | 100.12% |
| 沥青   | 78.62% | 33.57%  |
| 苯乙烯  | 63.14% | 31.28%  |
| 乙二醇  | 98.30% | 64.80%  |

|      | 时间百分位  | 绝对值    |    | 时间百分位  | 绝对值    |
|------|--------|--------|----|--------|--------|
| 塑料   | 87.20% | 25.83% | 菜油 | 81.79% | 20.77% |
| 甲醇   | 99.09% | 55.13% | 棕榈 | 92.97% | 34.18% |
| 20号胶 | 66.36% | 29.06% | 花生 | 44.26% | 18.18% |
| 短纤   | 78.23% | 30.19% | 菜粕 | 70.11% | 21.38% |
| PP   | 86.29% | 26.95% | 豆油 | 94.23% | 28.51% |
| 沪胶   | 69.83% | 30.99% | 郑棉 | 94.59% | 34.40% |
| 纯碱   | 98.92% | 62.57% | 郑糖 | 85.94% | 16.57% |
| 纸浆   | 86.10% | 24.63% | 苹果 | 99.47% | 47.97% |
| TA   | 80.10% | 26.02% | 红枣 | 99.18% | 62.81% |
| 尿素   | 97.62% | 63.45% | 淀粉 | 97.05% | 25.64% |
| 玉米   | 74.26% | 13.80% | 鸡蛋 | 70.96% | 22.44% |
| 豆一   | 66.03% | 17.80% | 生猪 | 72.82% | 36.91% |
| 豆粕   | 31.29% | 13.88% |    |        |        |

## 沪银指数收盘价和历史波动率



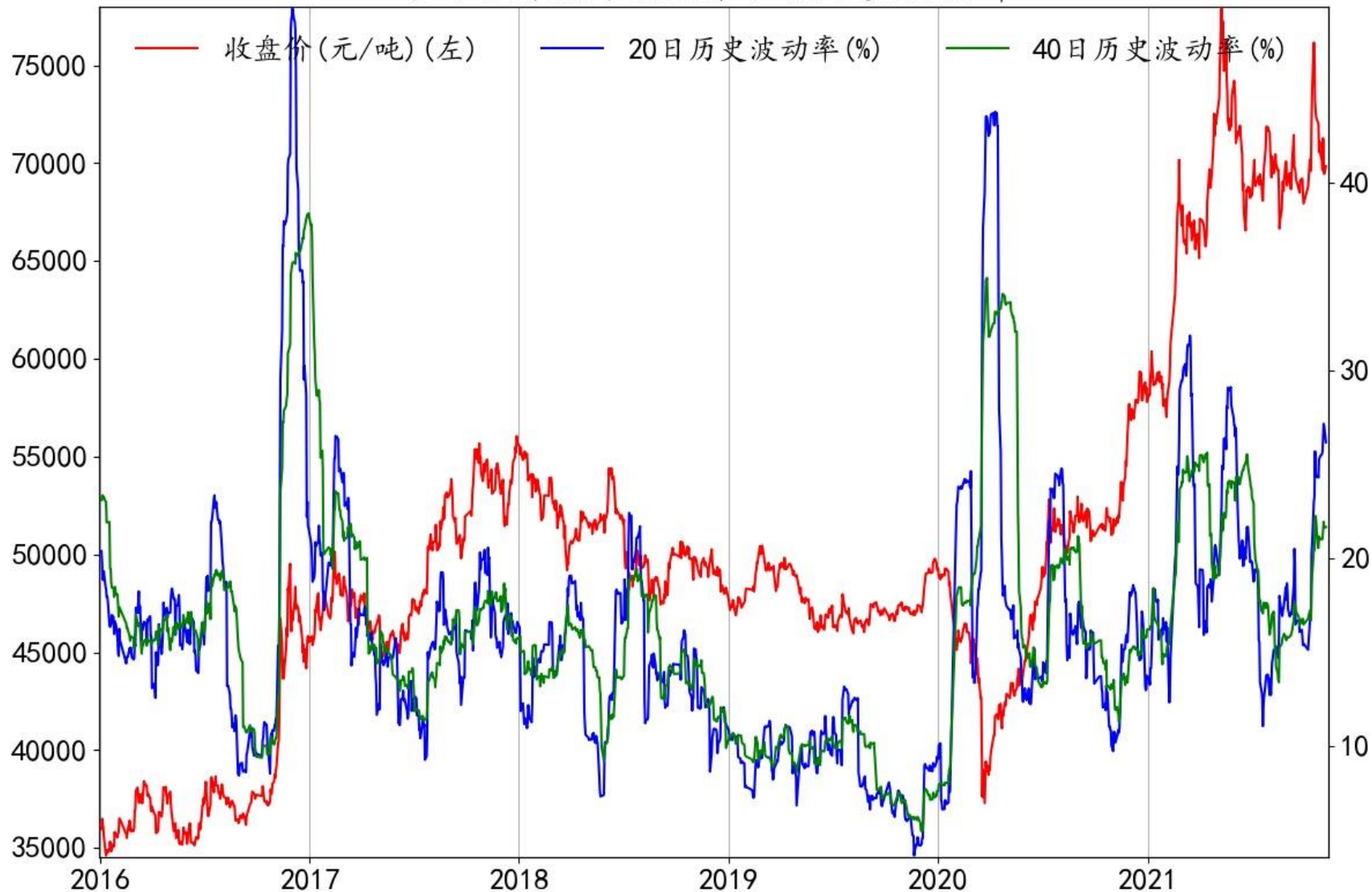
## 沪金指数收盘价和历史波动率



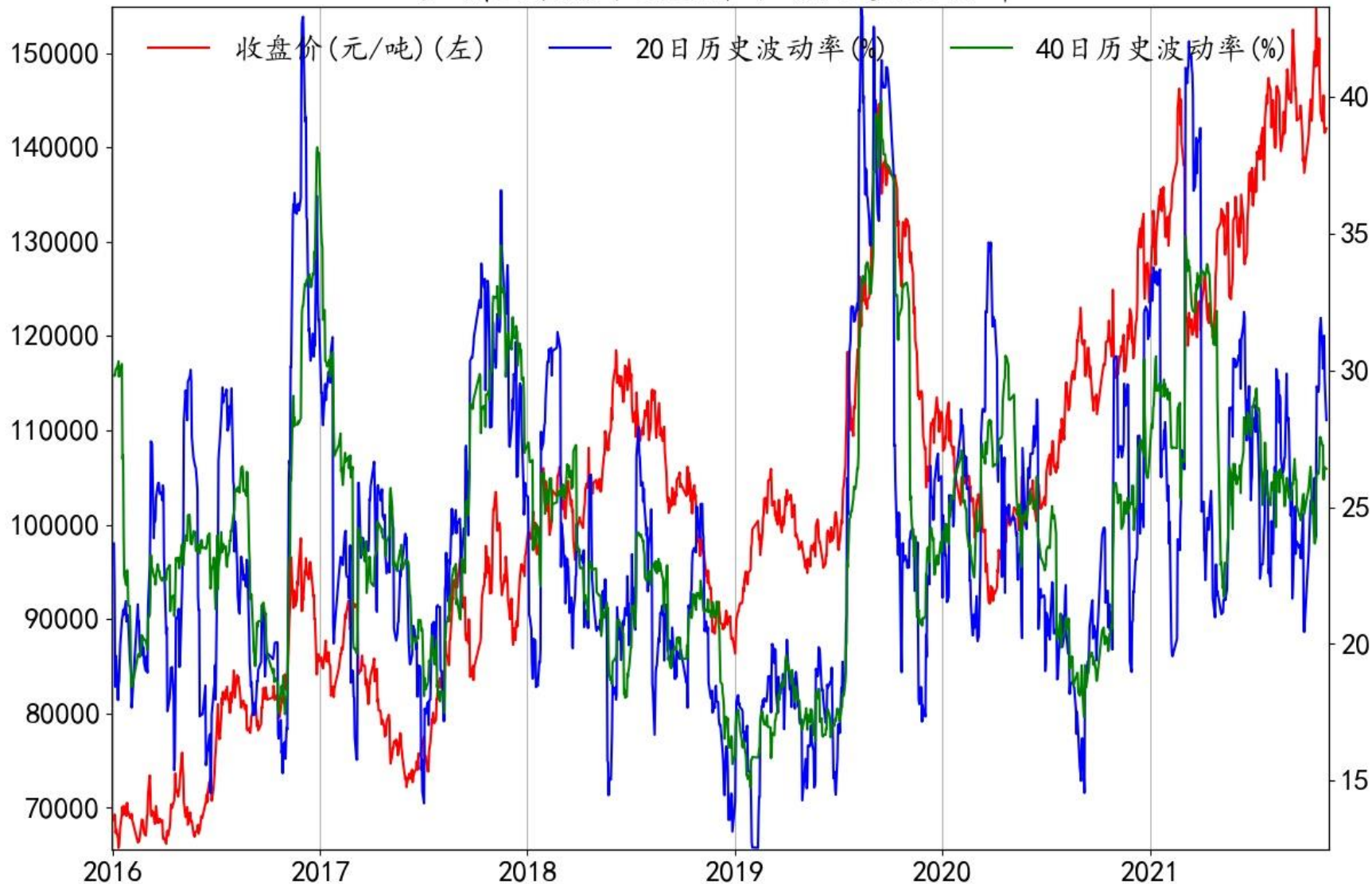
## 沪铝指数收盘价和历史波动率



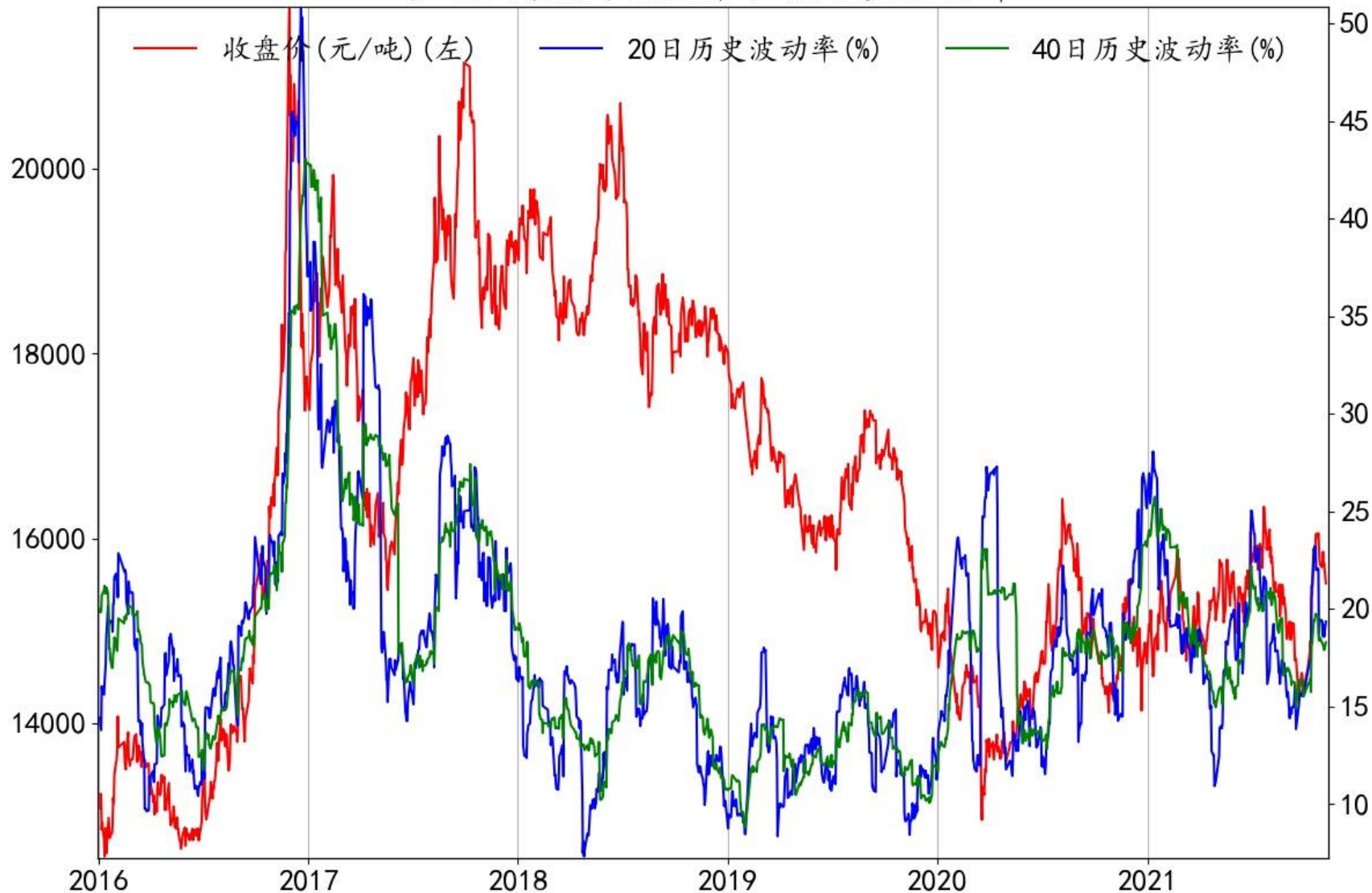
## 沪铜指数收盘价和历史波动率



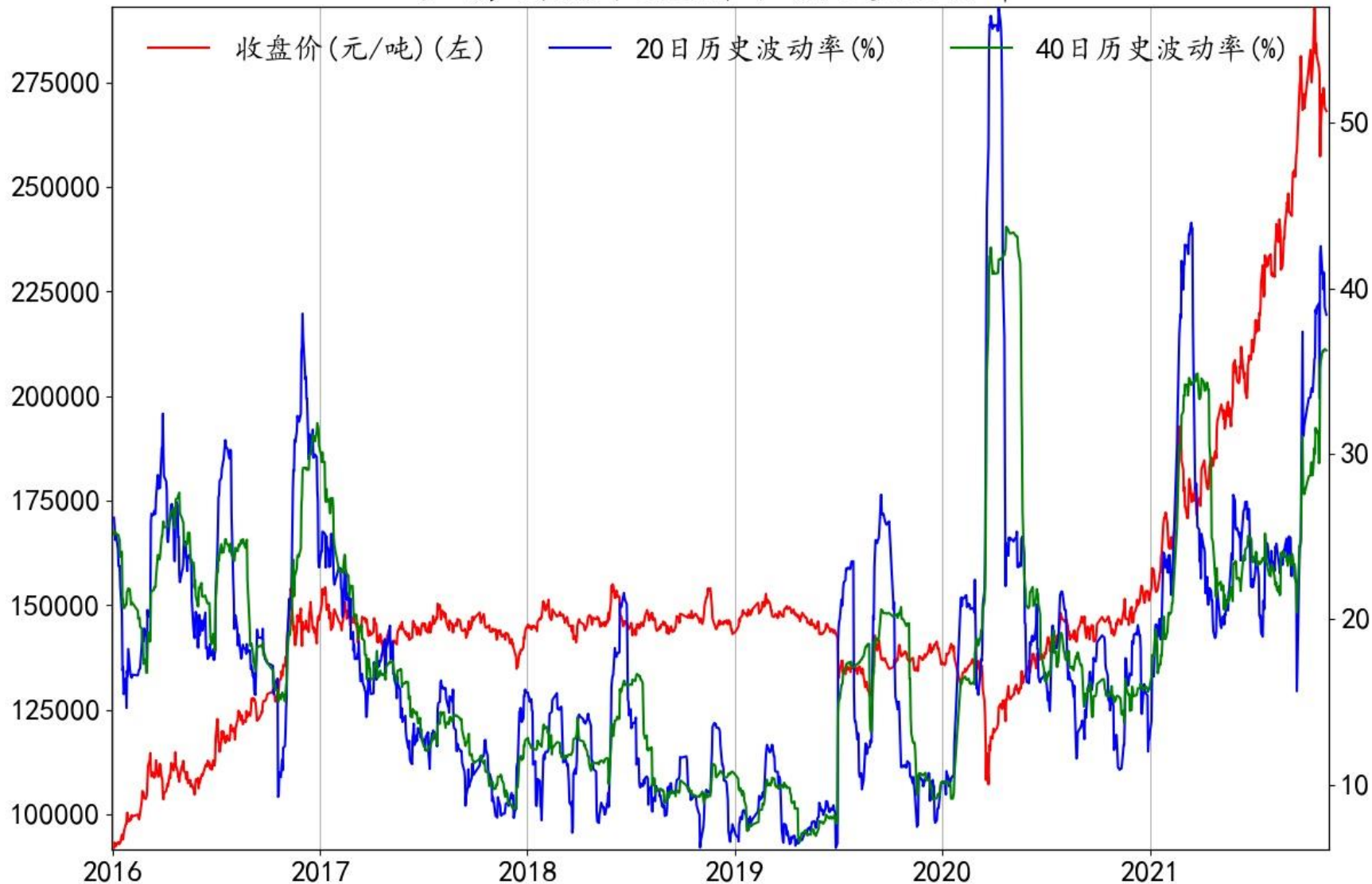
## 沪镍指数收盘价和历史波动率



## 沪铅指数收盘价和历史波动率



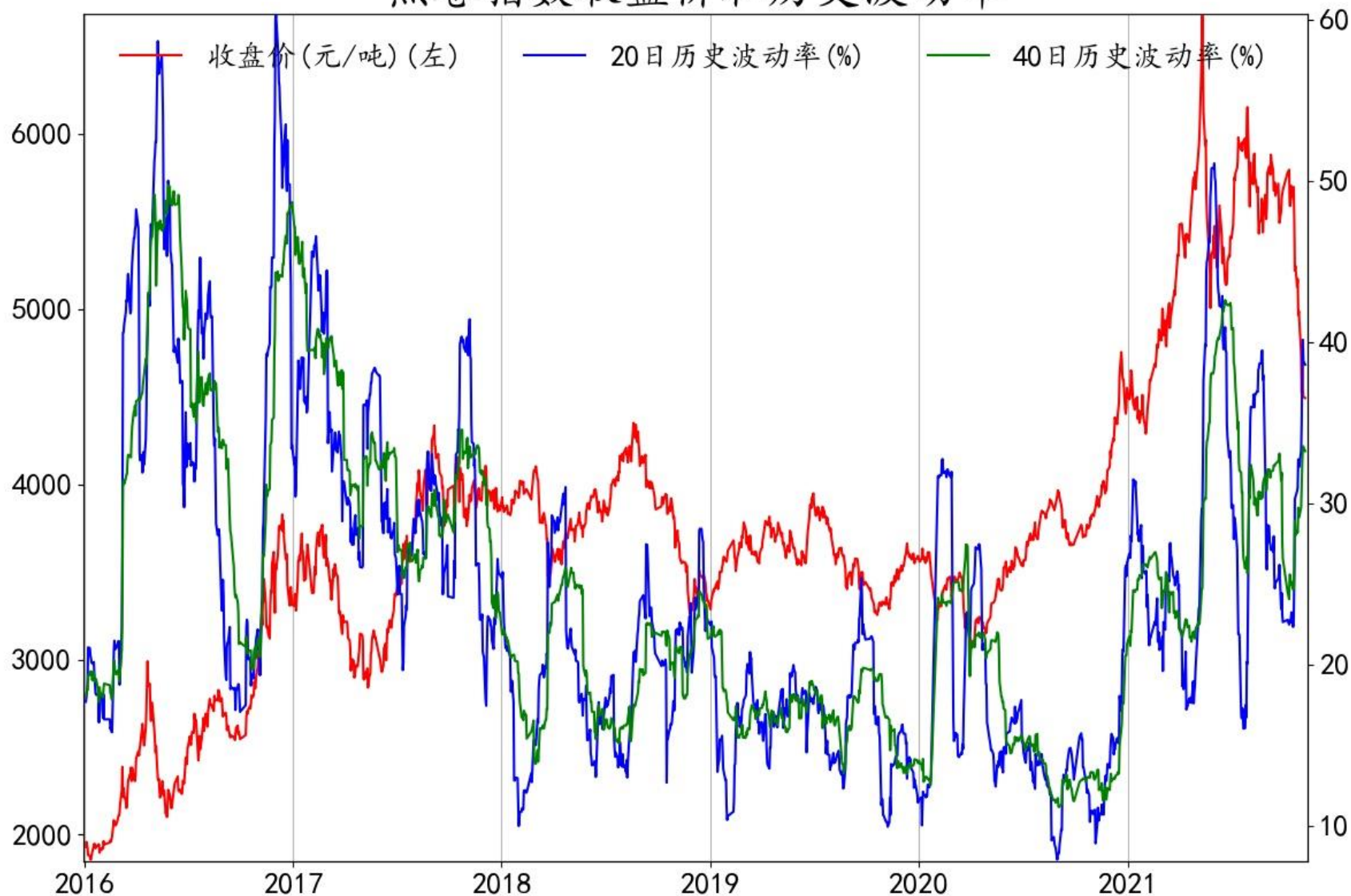
## 沪锡指数收盘价和历史波动率



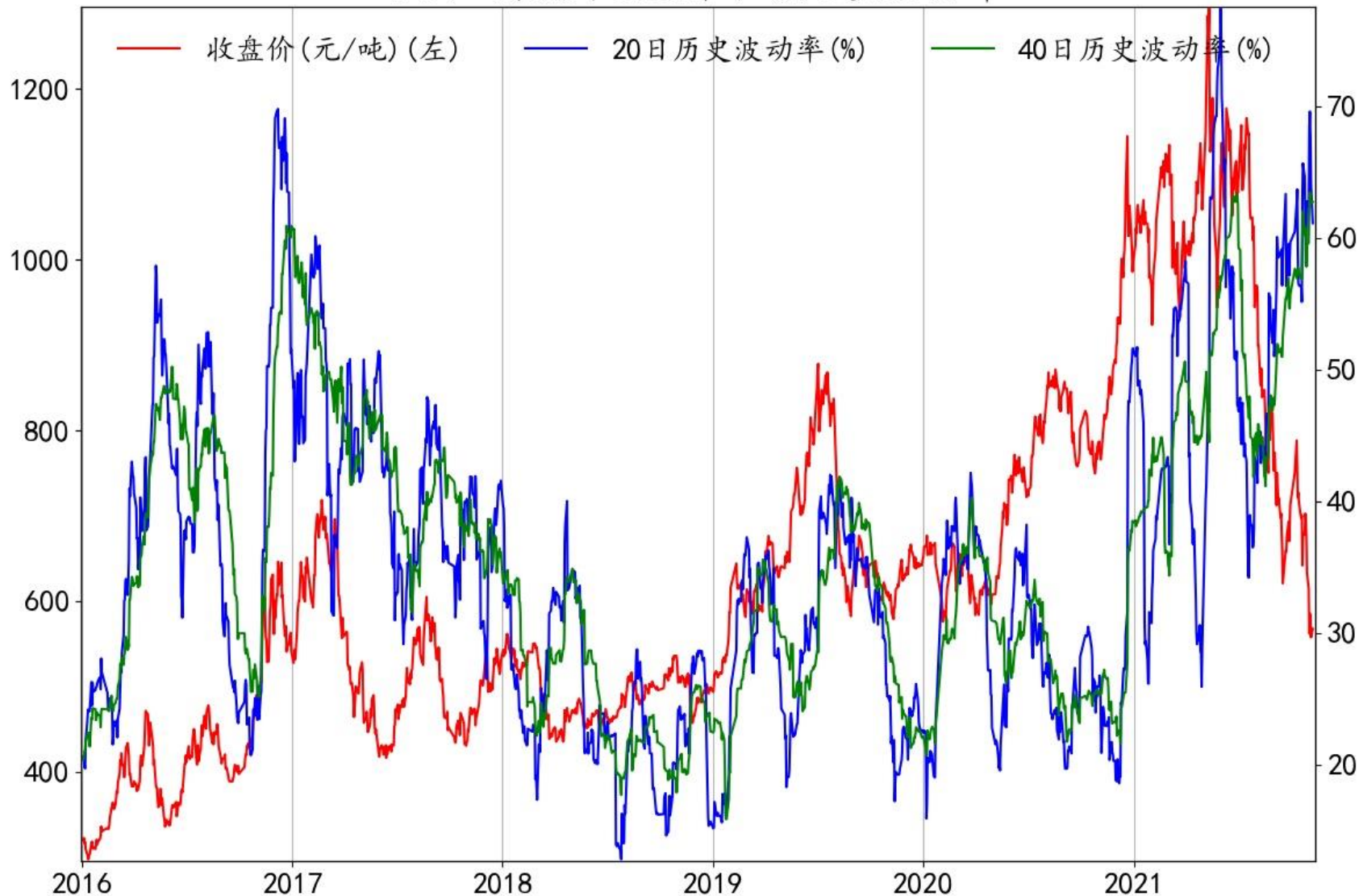
## 沪锌指数收盘价和历史波动率



## 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

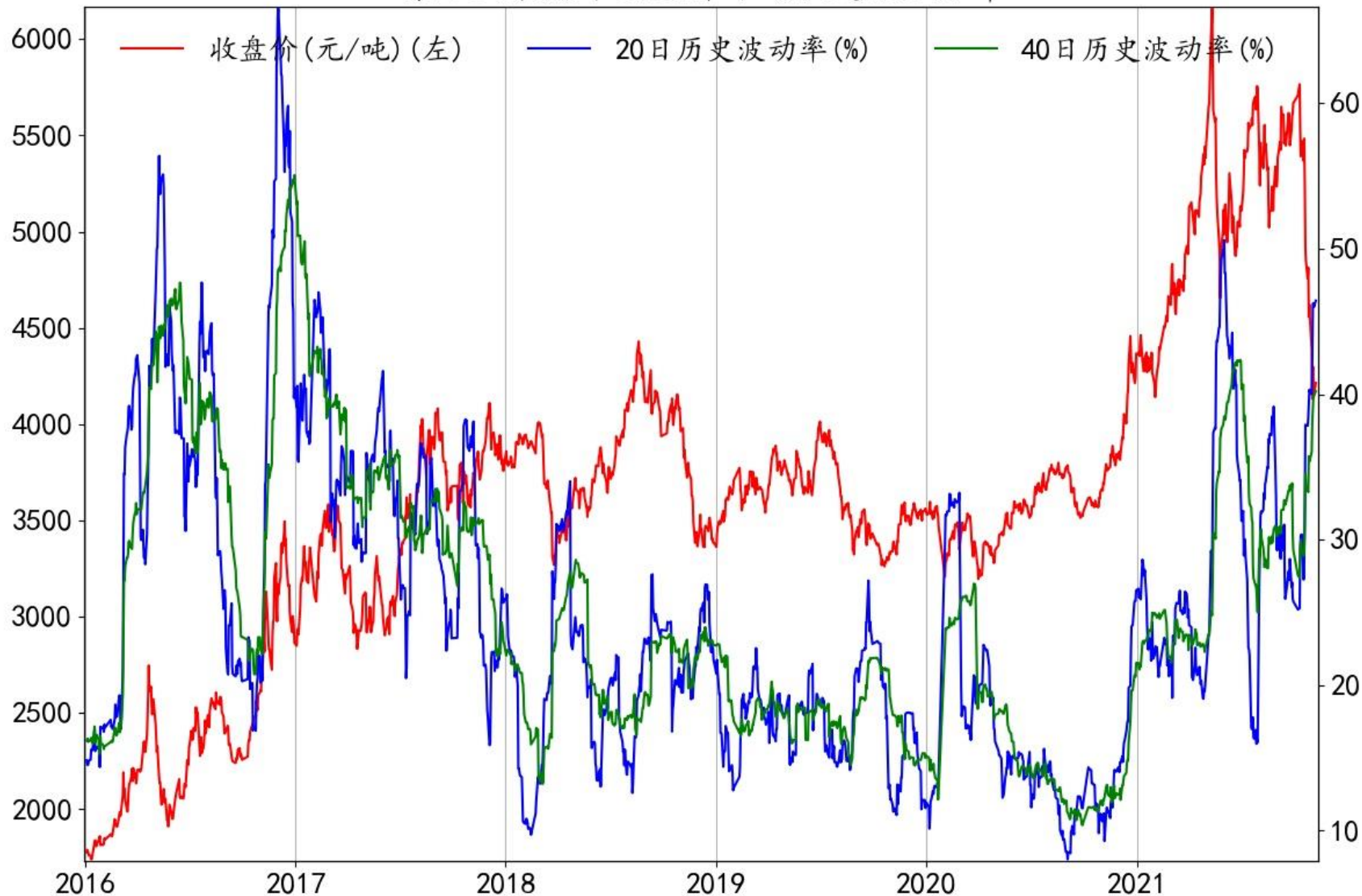


数据来源: Wind、信达期货研发中心

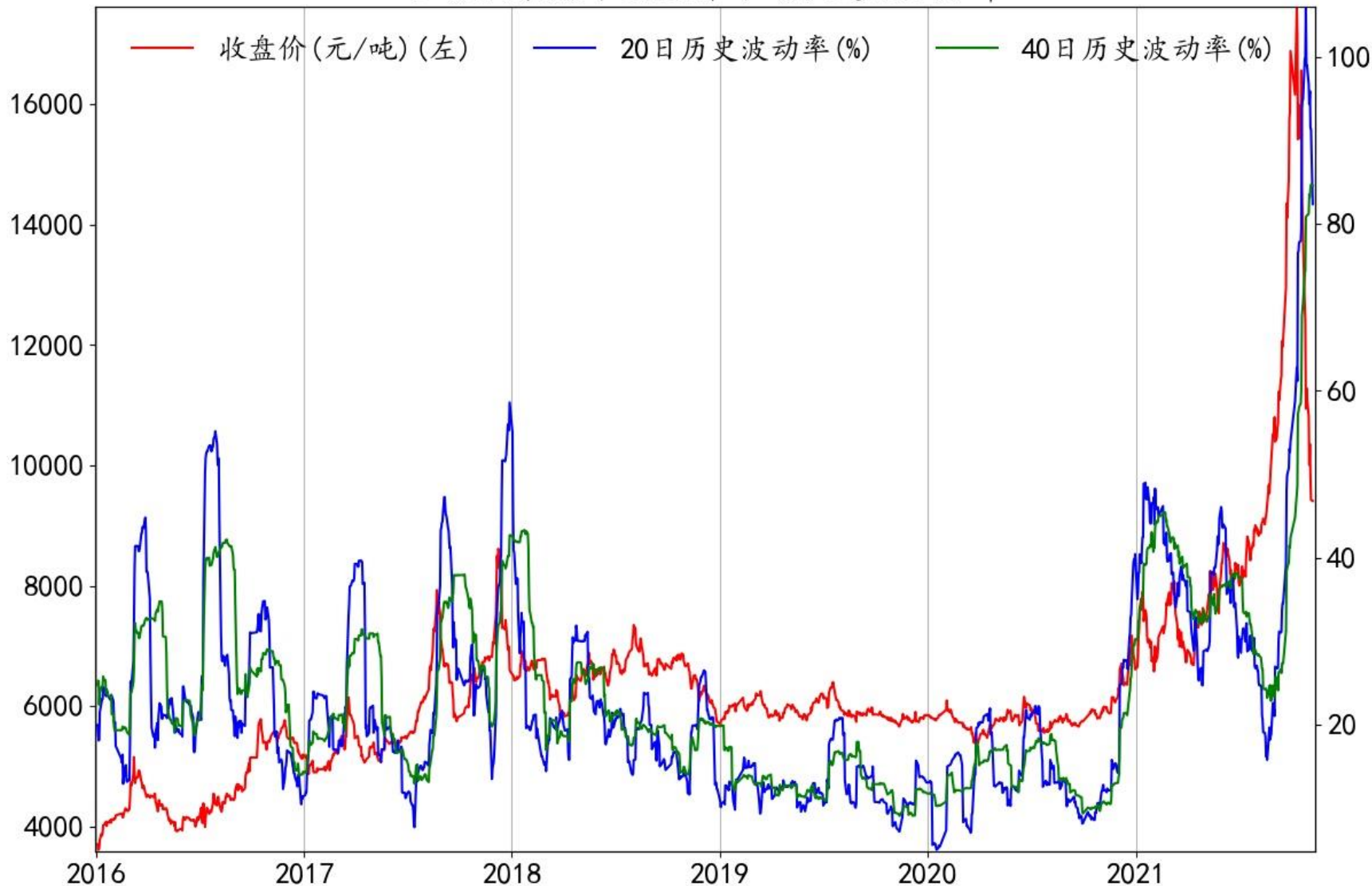
## 焦煤指数收盘价和历史波动率



## 螺纹指数收盘价和历史波动率



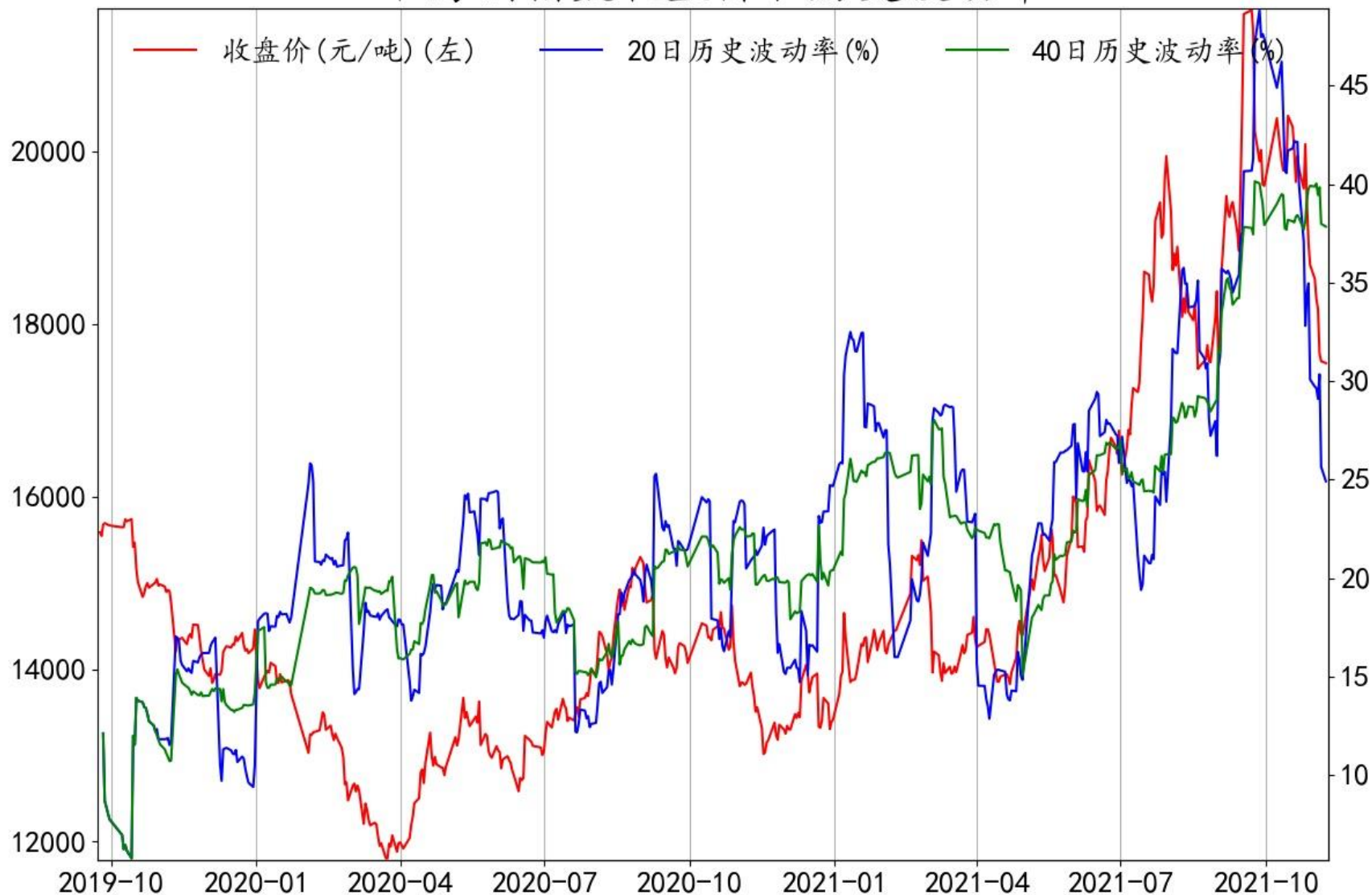
## 硅铁指数收盘价和历史波动率



## 锰硅指数收盘价和历史波动率

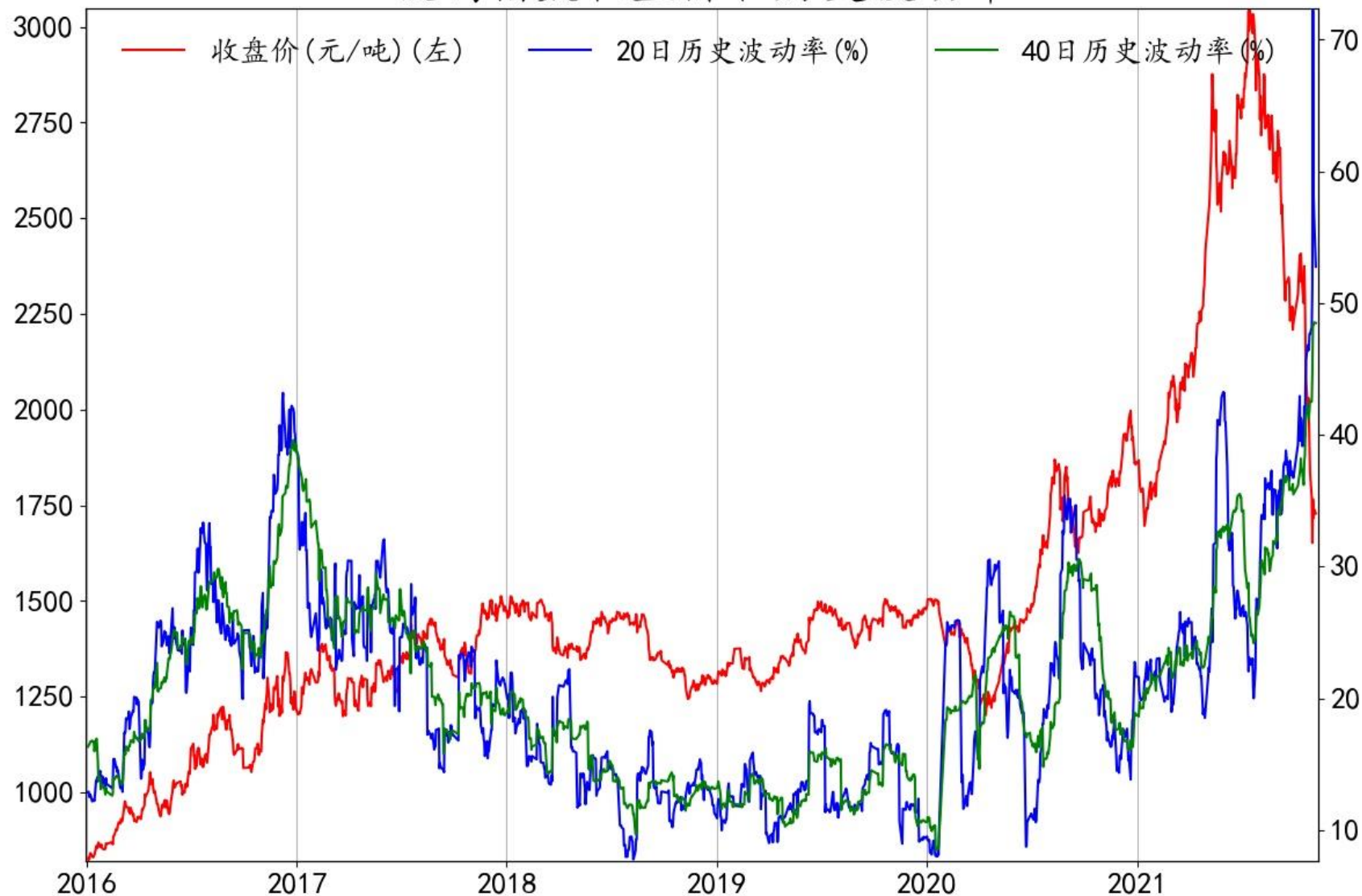


## 不锈钢指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

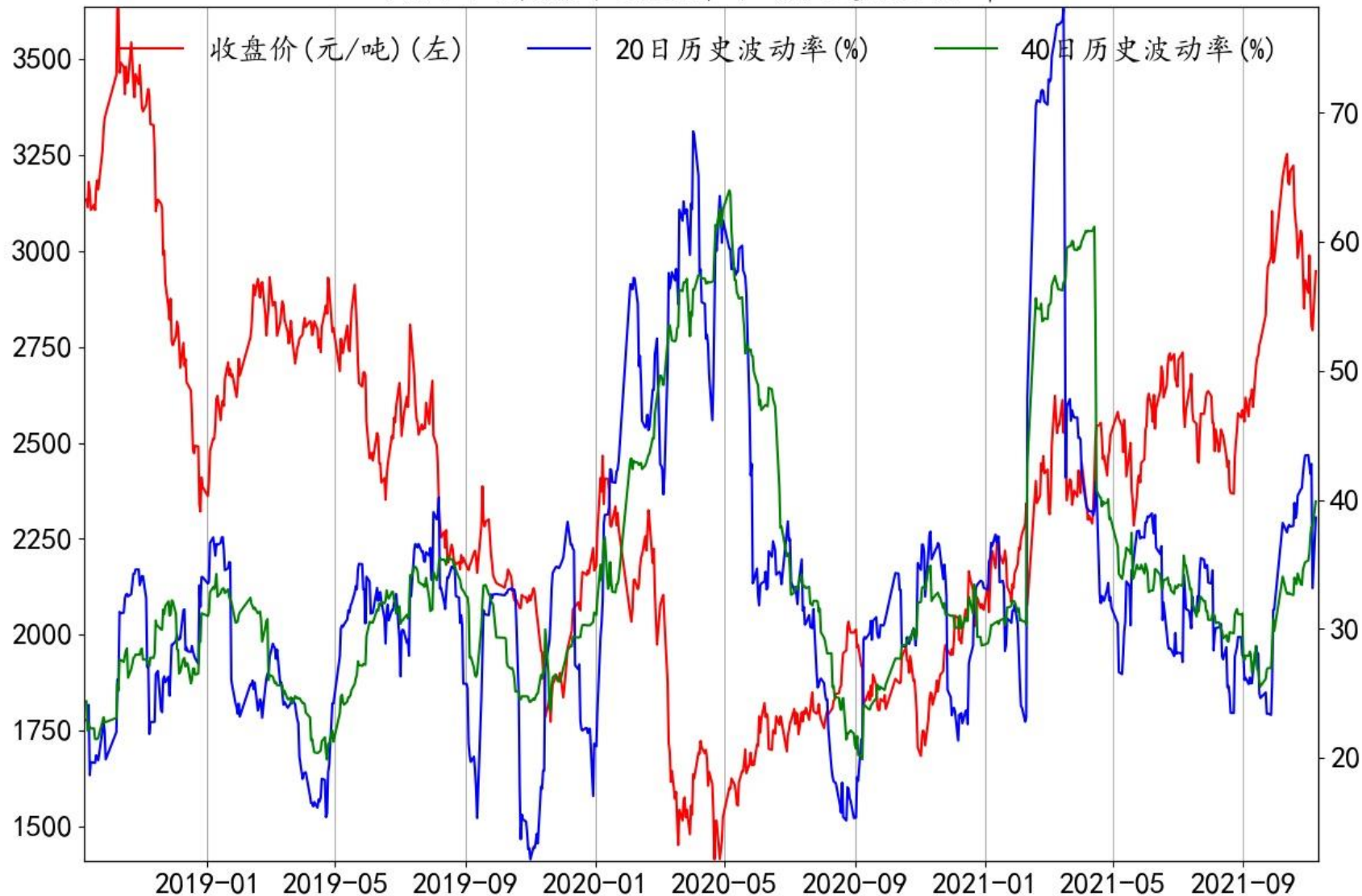
## 玻璃指数收盘价和历史波动率



## PVC指数收盘价和历史波动率

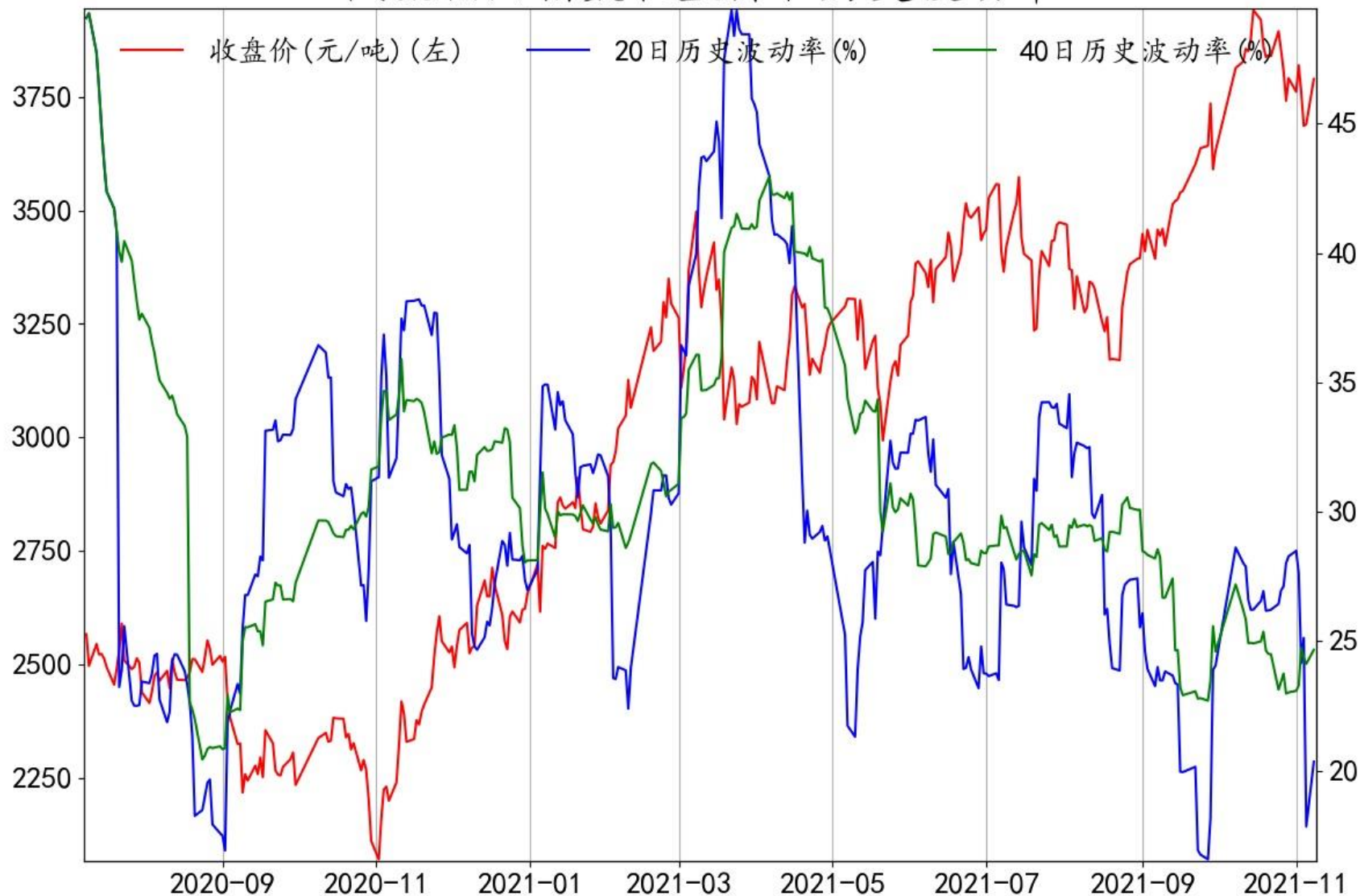


## 燃油指数收盘价和历史波动率



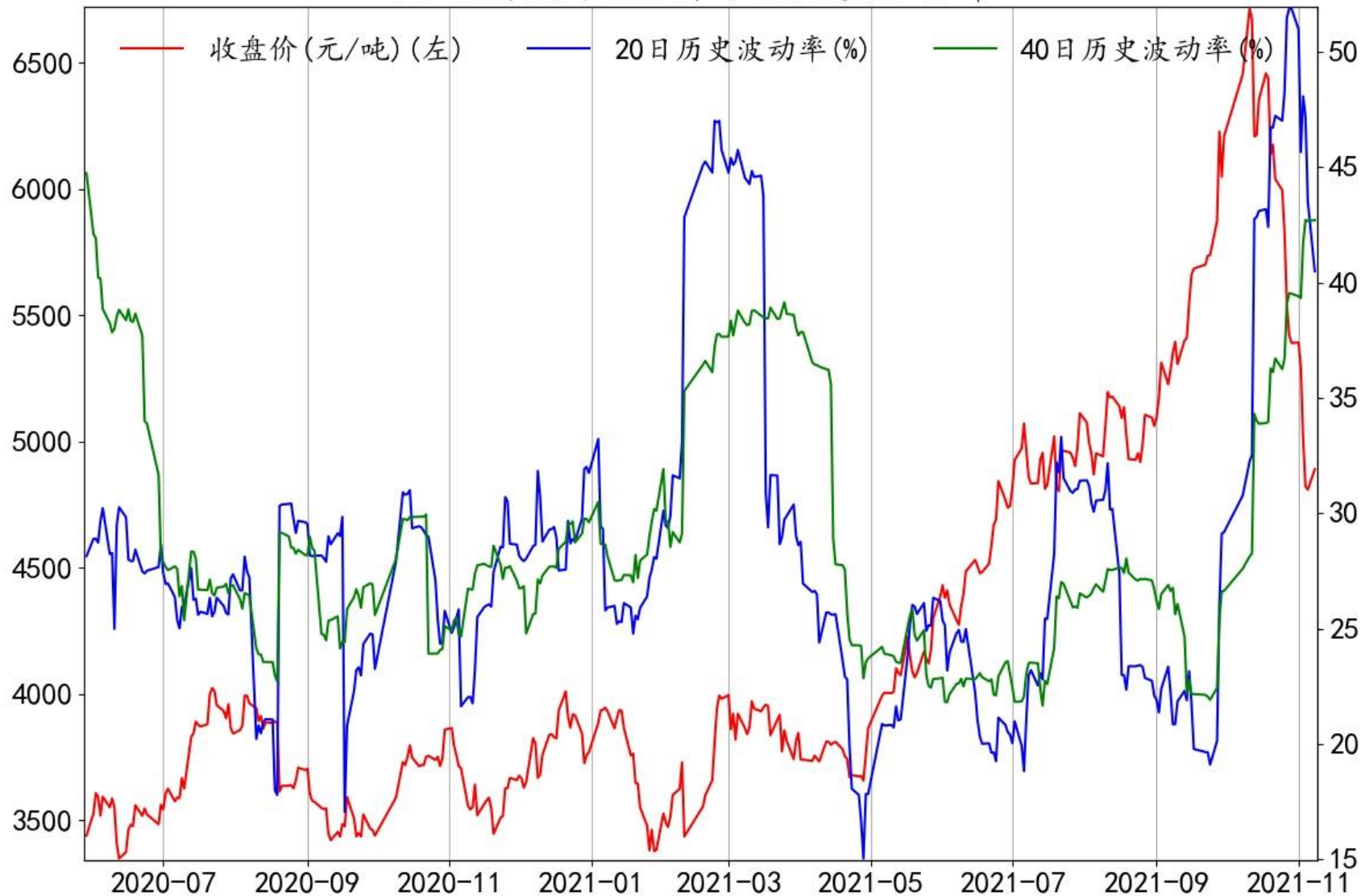
# 低硫燃油指数

## 低硫燃油指数收盘价和历史波动率



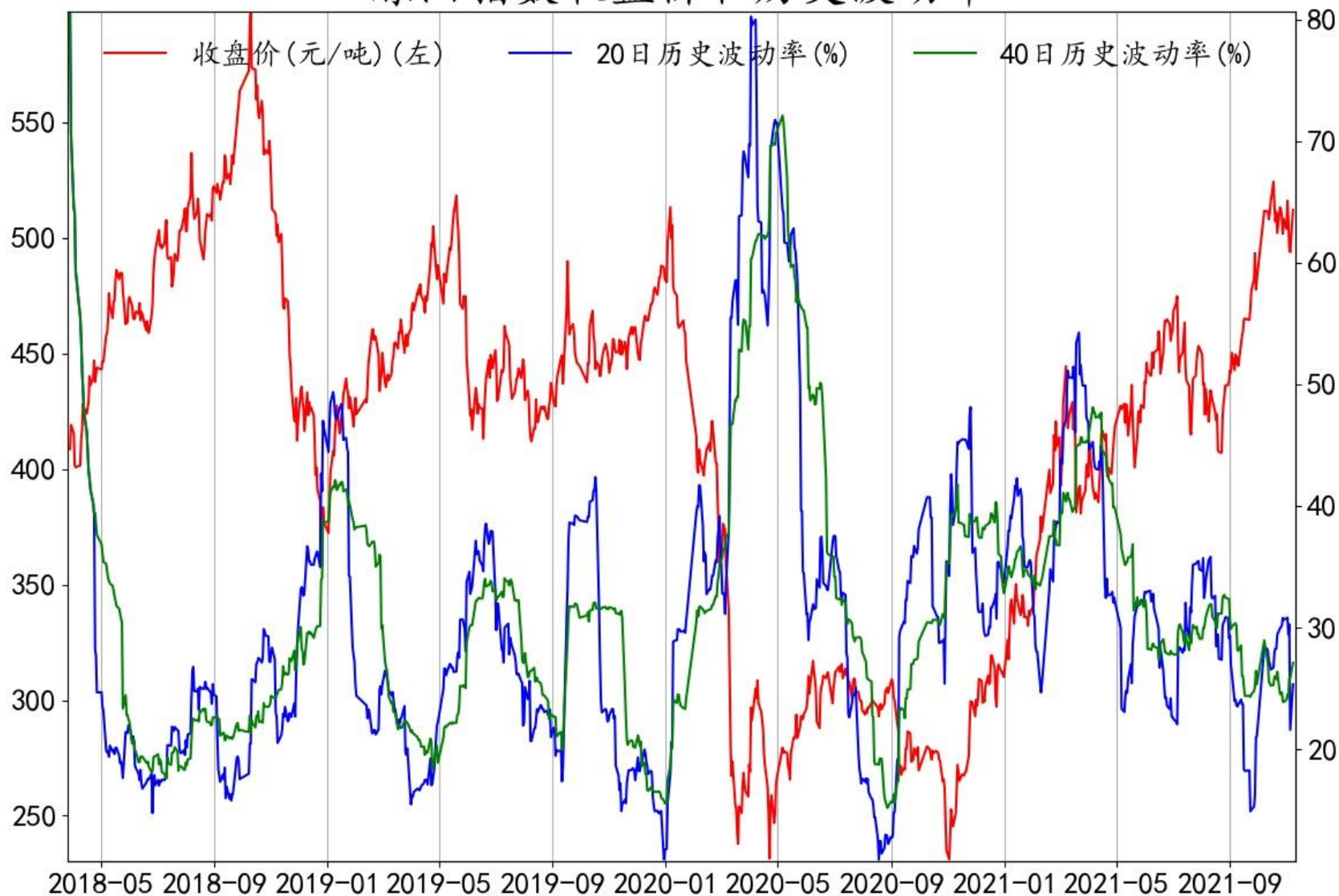
数据来源: Wind、信达期货研发中心

## 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

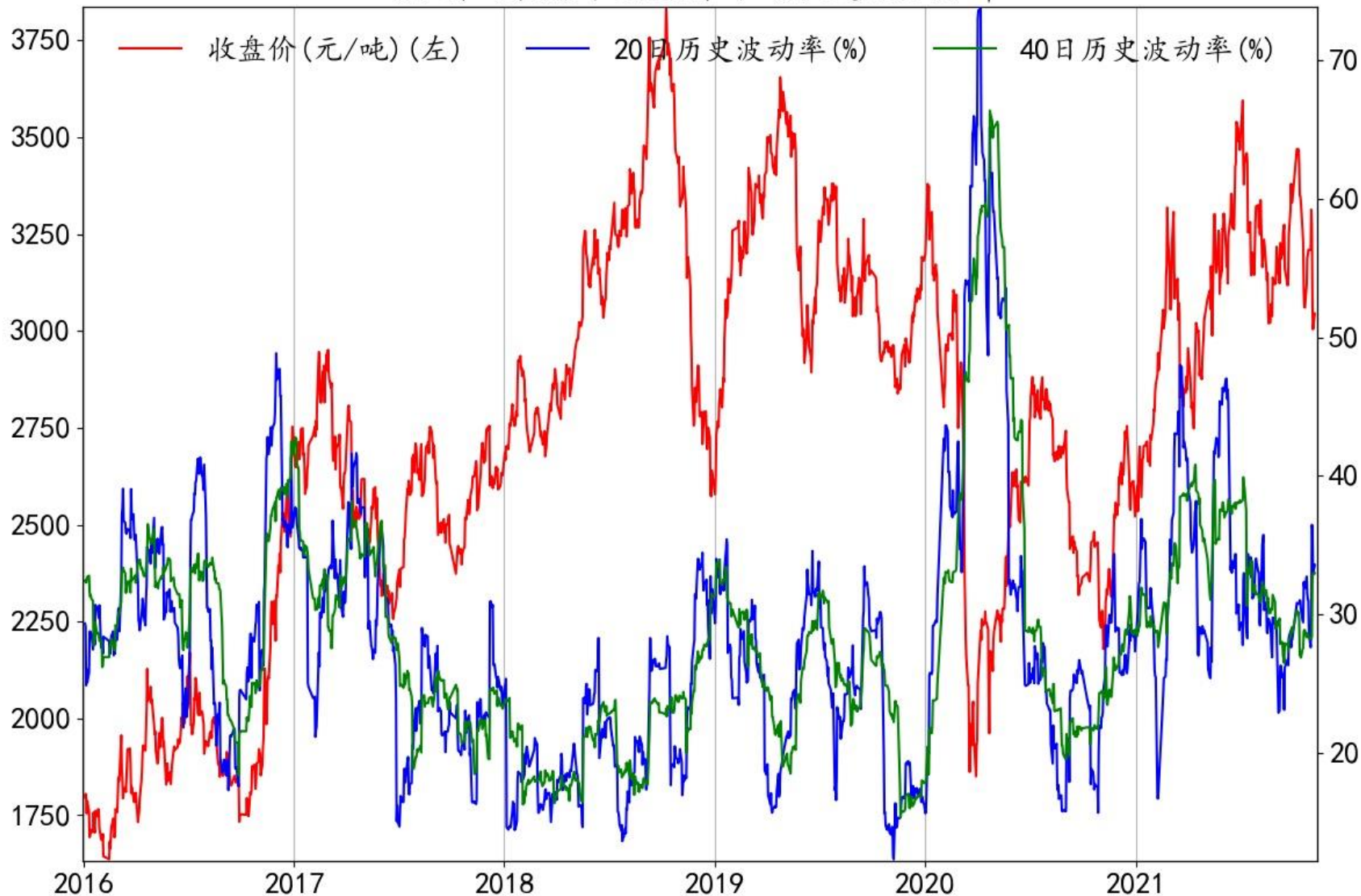
## 原油指数收盘价和历史波动率



## 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

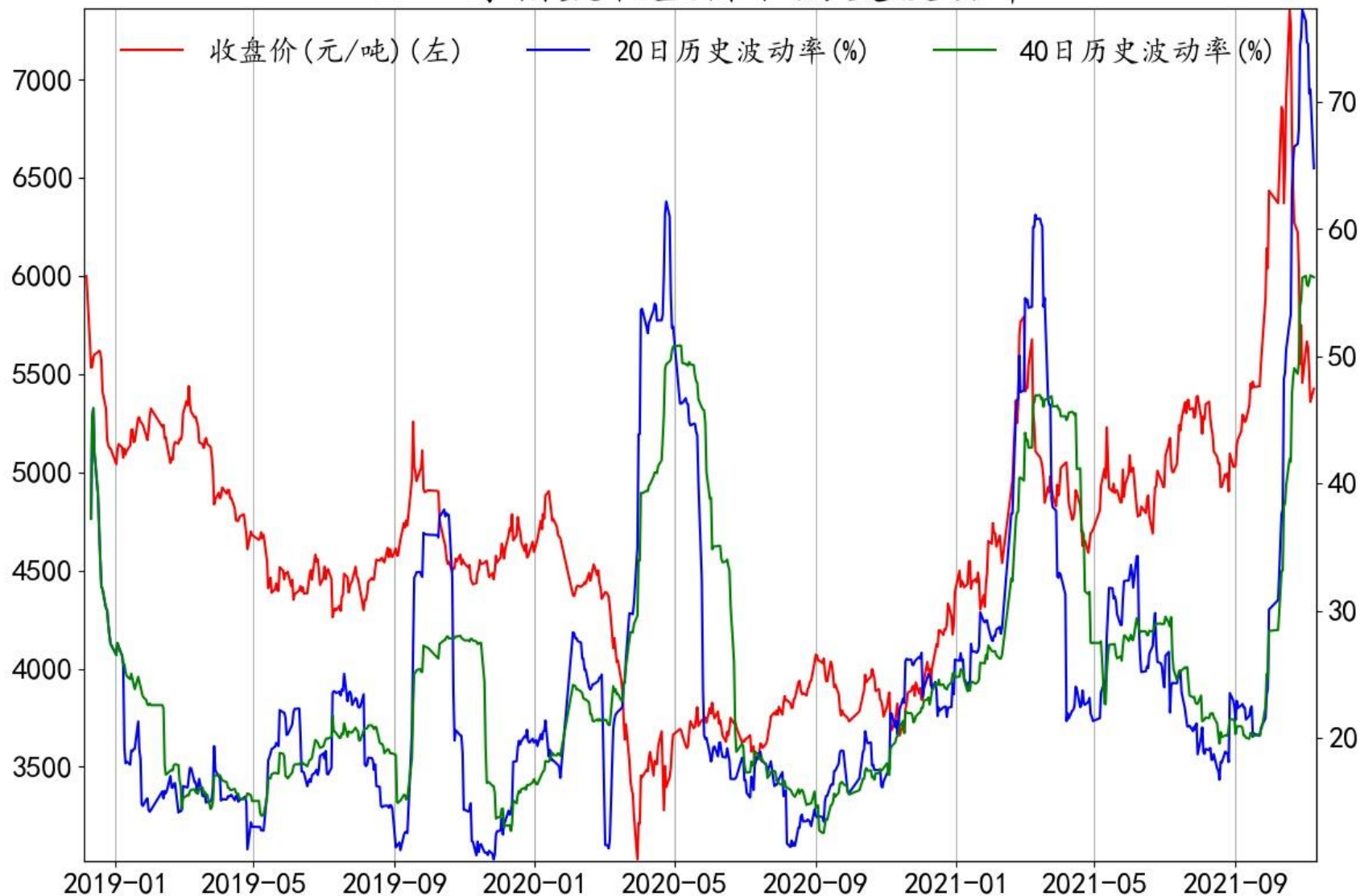


## 苯乙烯指数收盘价和历史波动率



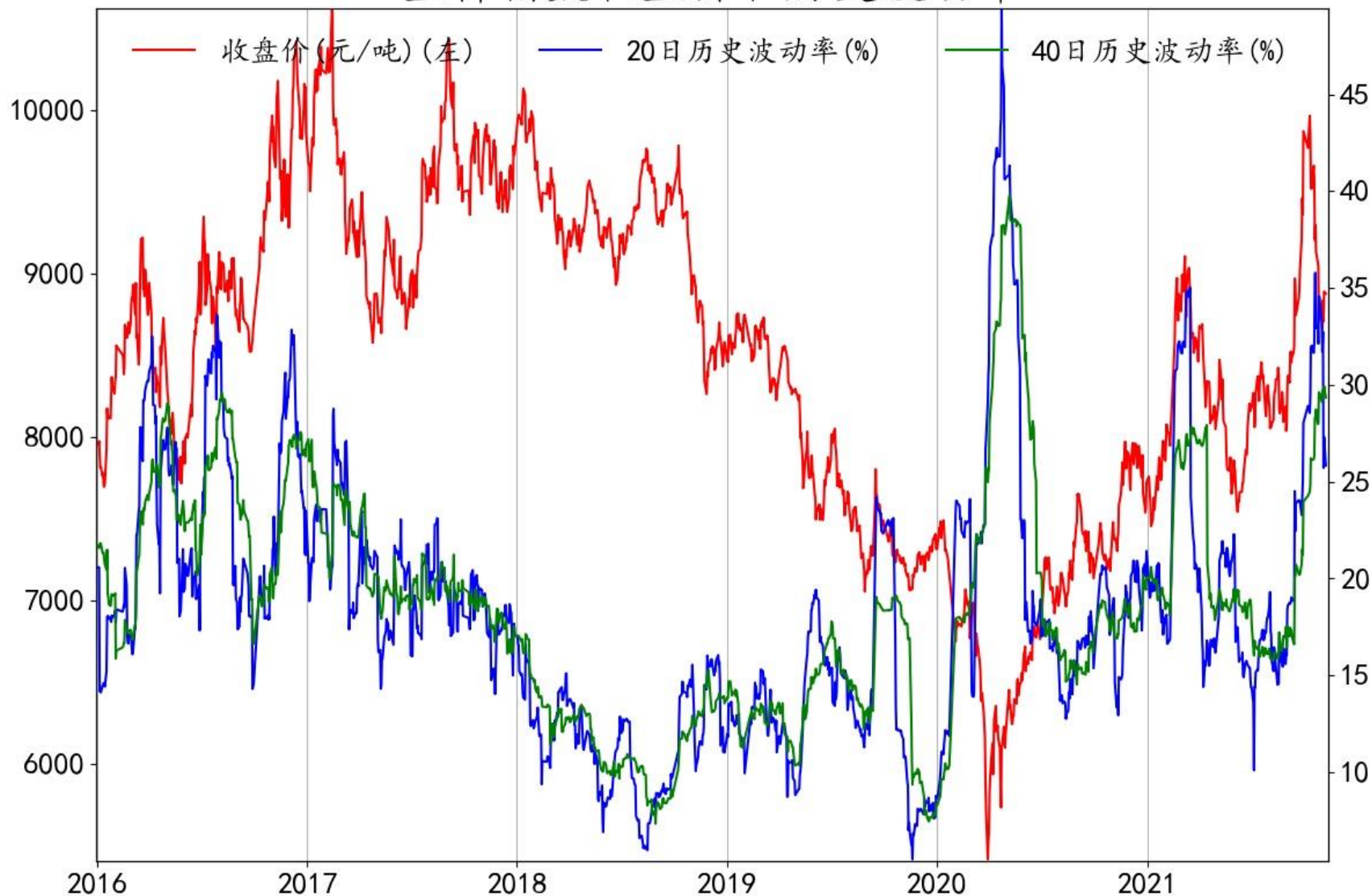
# 乙二醇指数

## 乙二醇指数收盘价和历史波动率

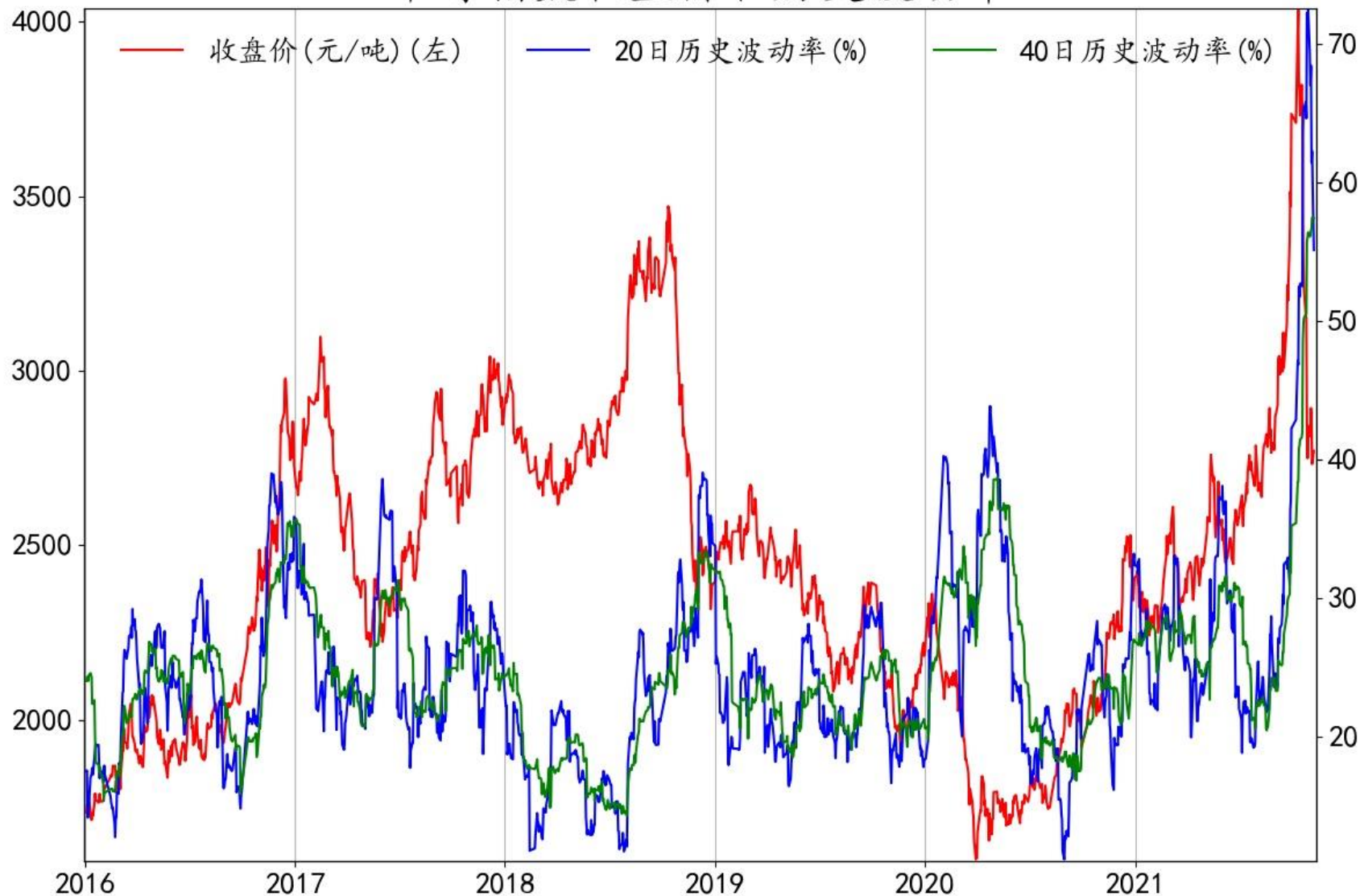


数据来源: Wind、信达期货研发中心

## 塑料指数收盘价和历史波动率

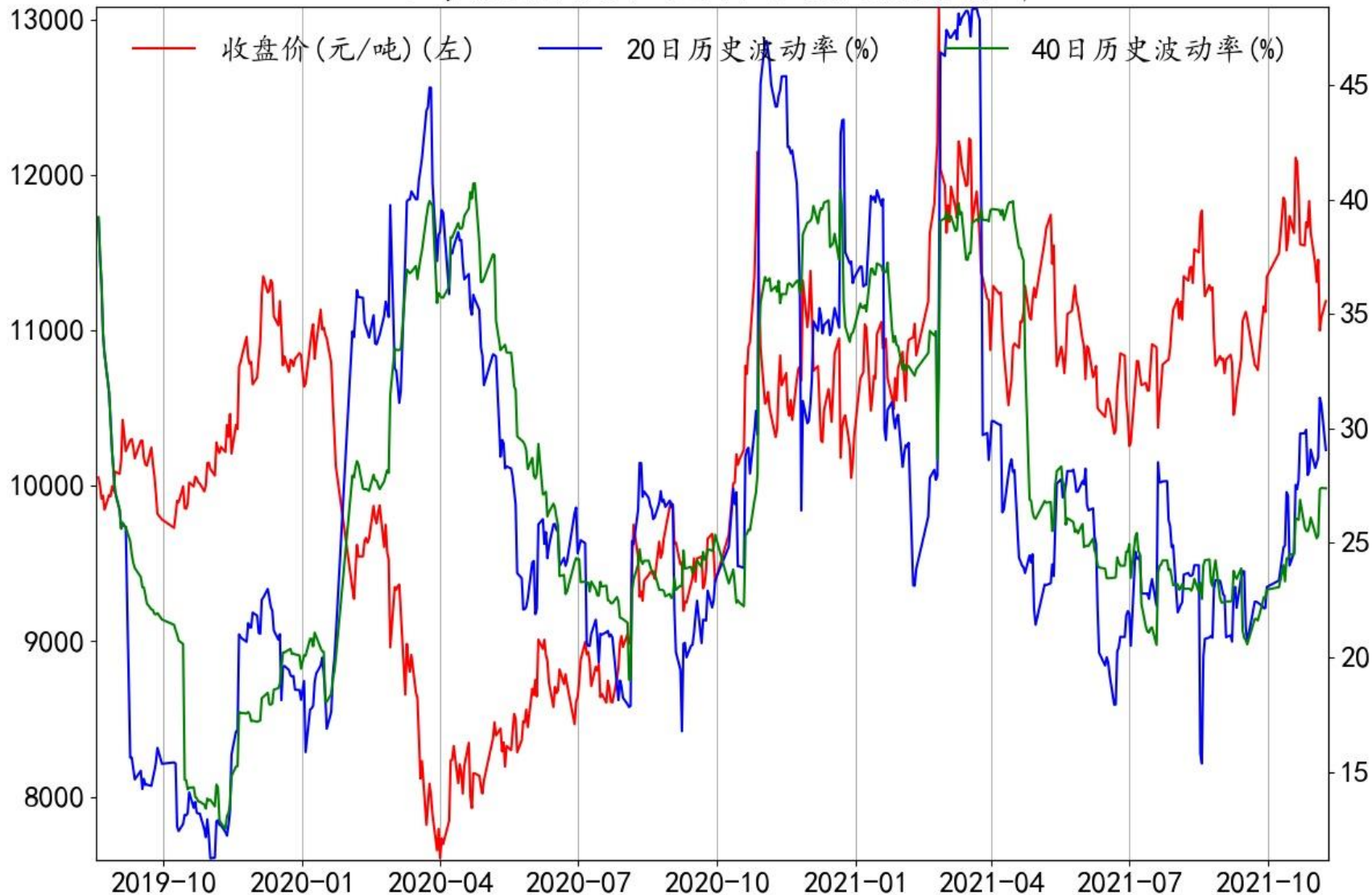


## 甲醇指数收盘价和历史波动率



# 20号胶指数

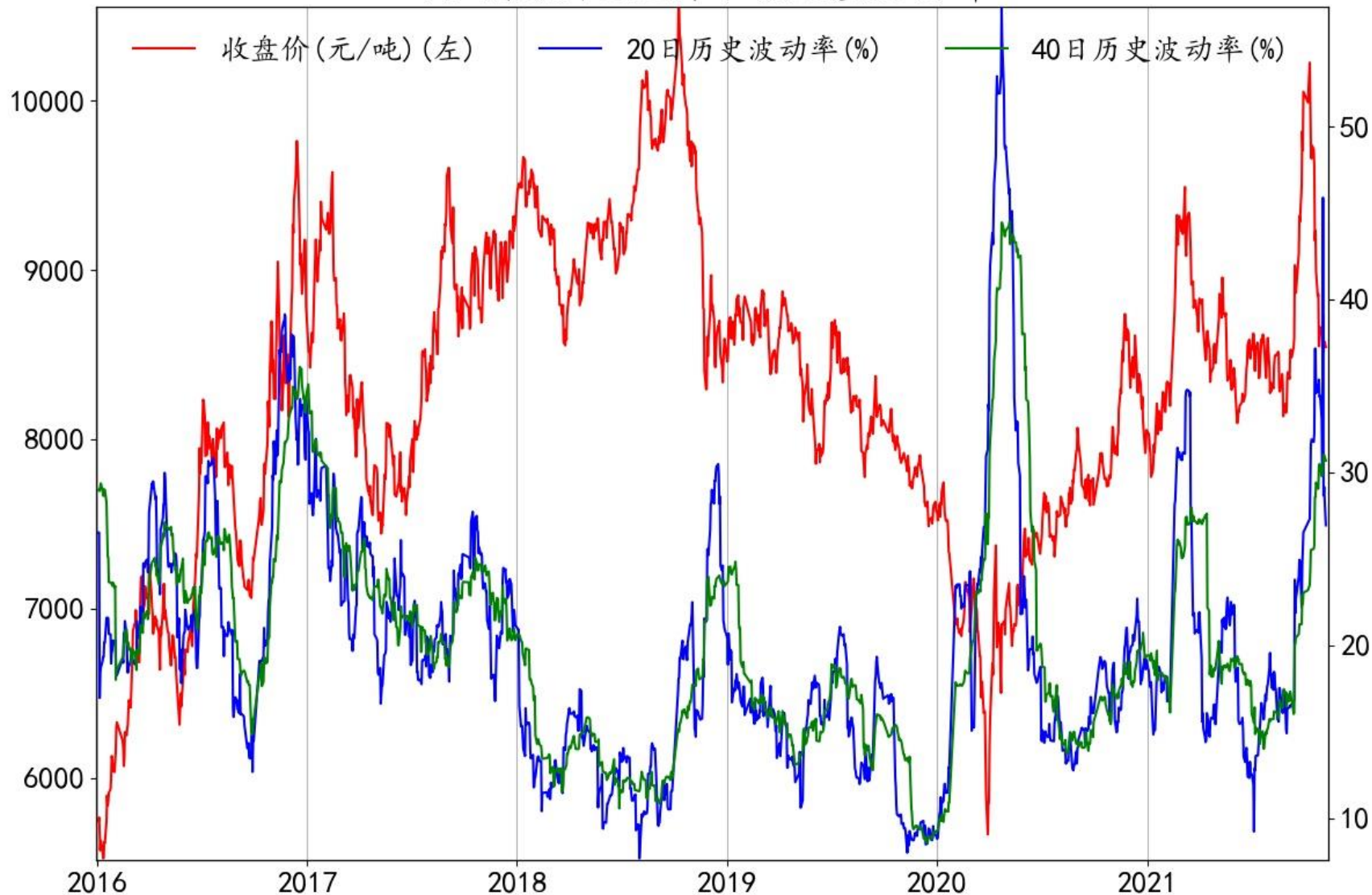
## 20号胶指数收盘价和历史波动率



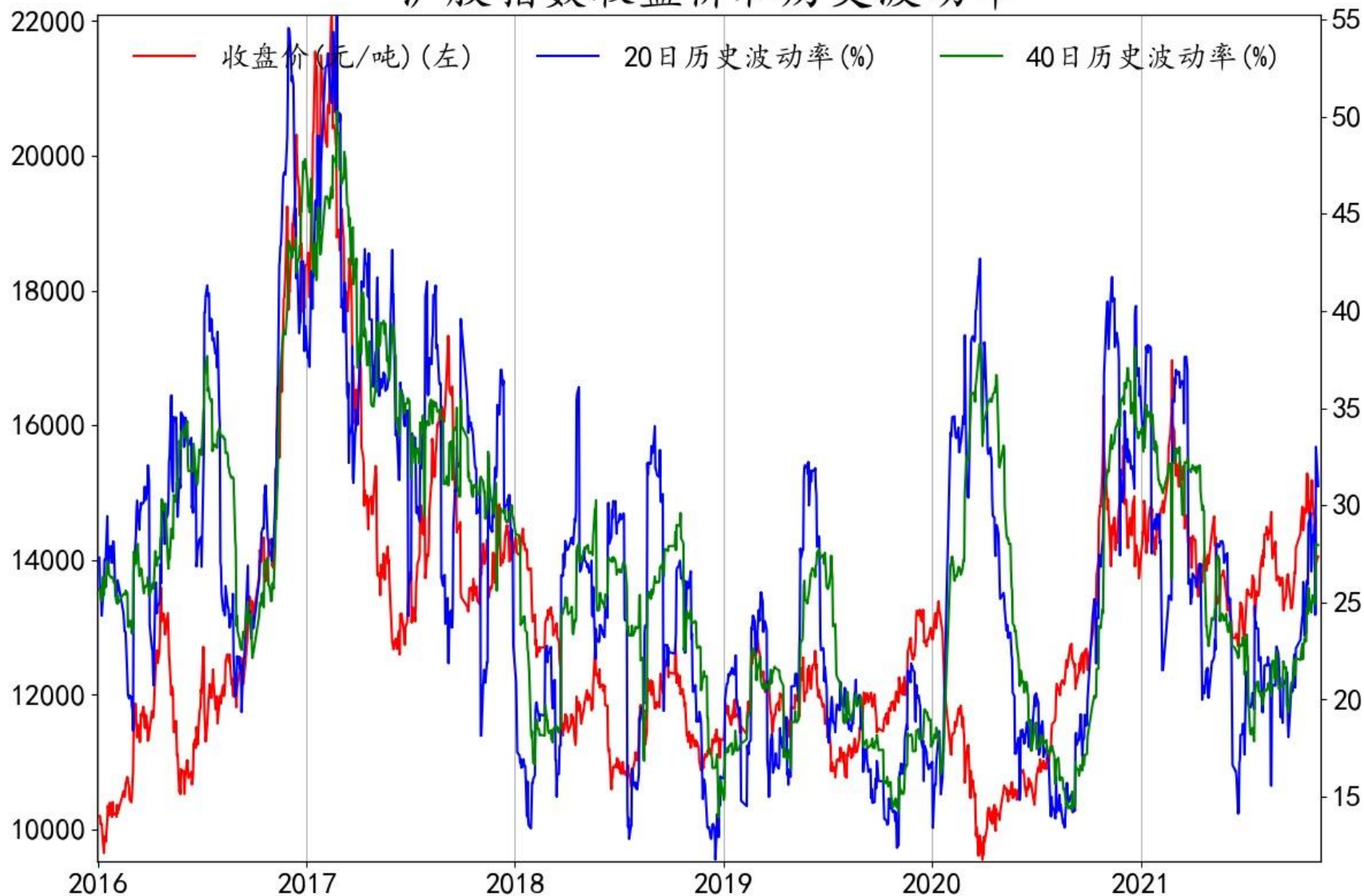
## 短纤指数收盘价和历史波动率



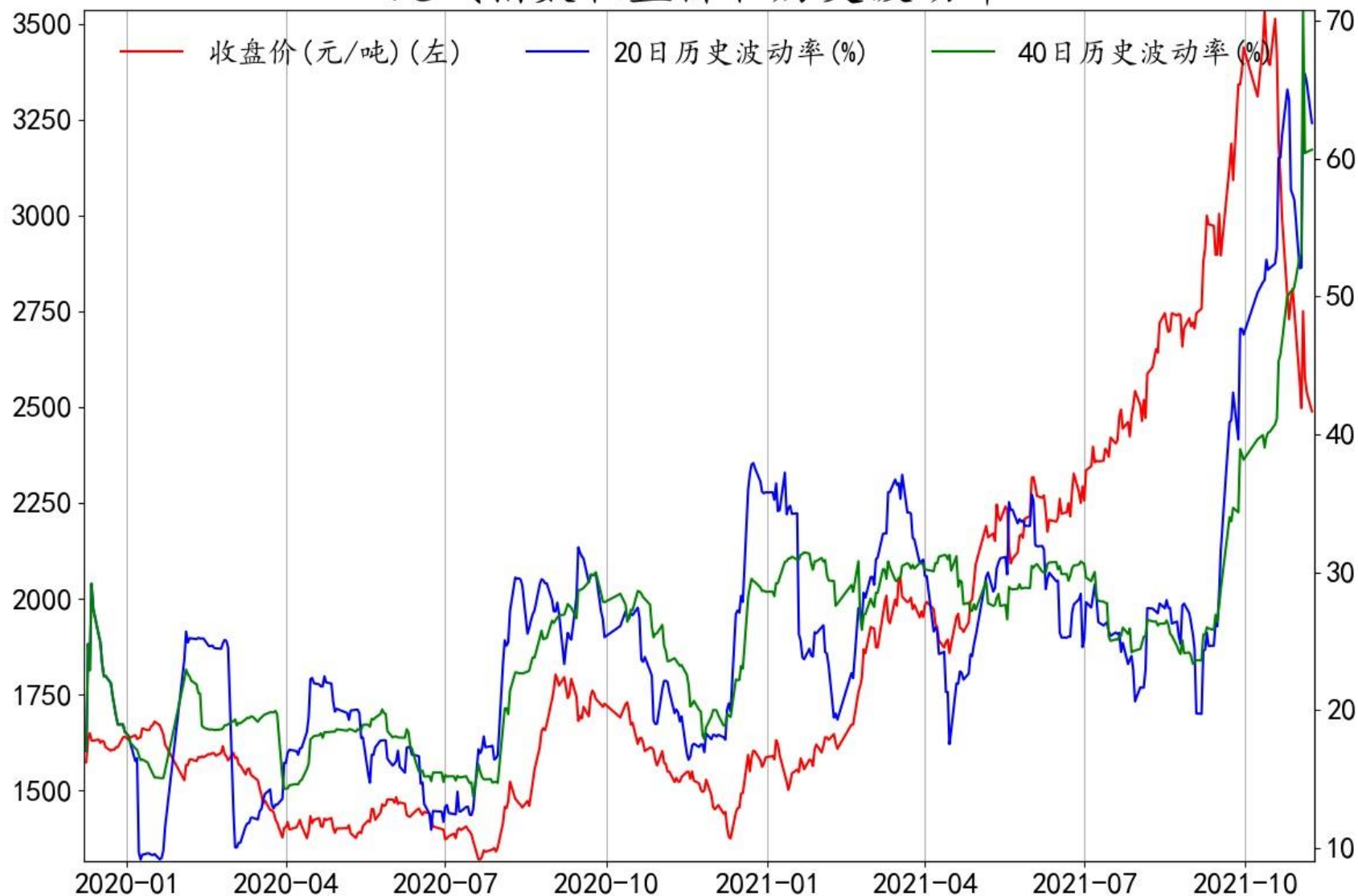
## PP指数收盘价和历史波动率



## 沪胶指数收盘价和历史波动率

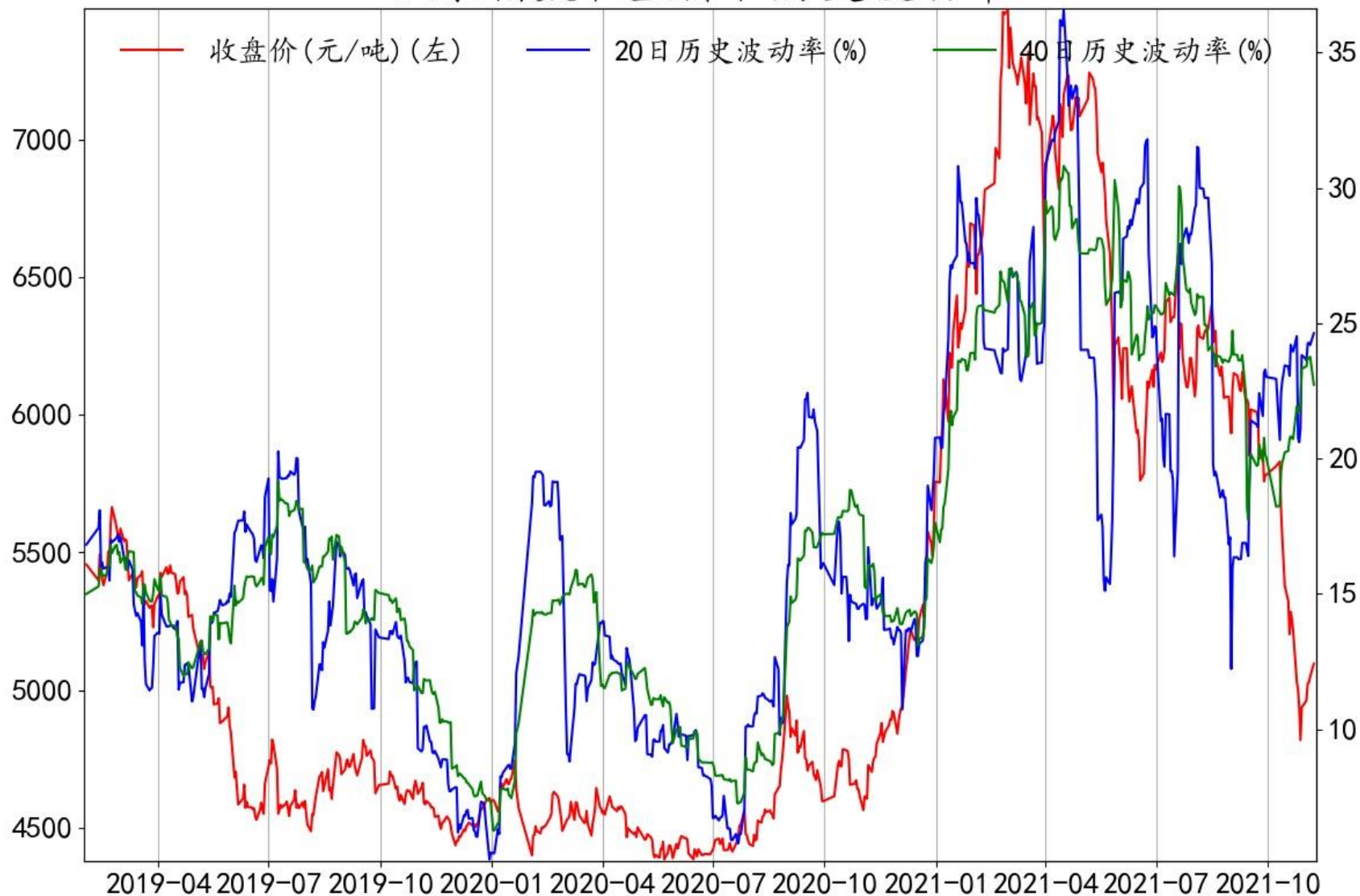


## 纯碱指数收盘价和历史波动率

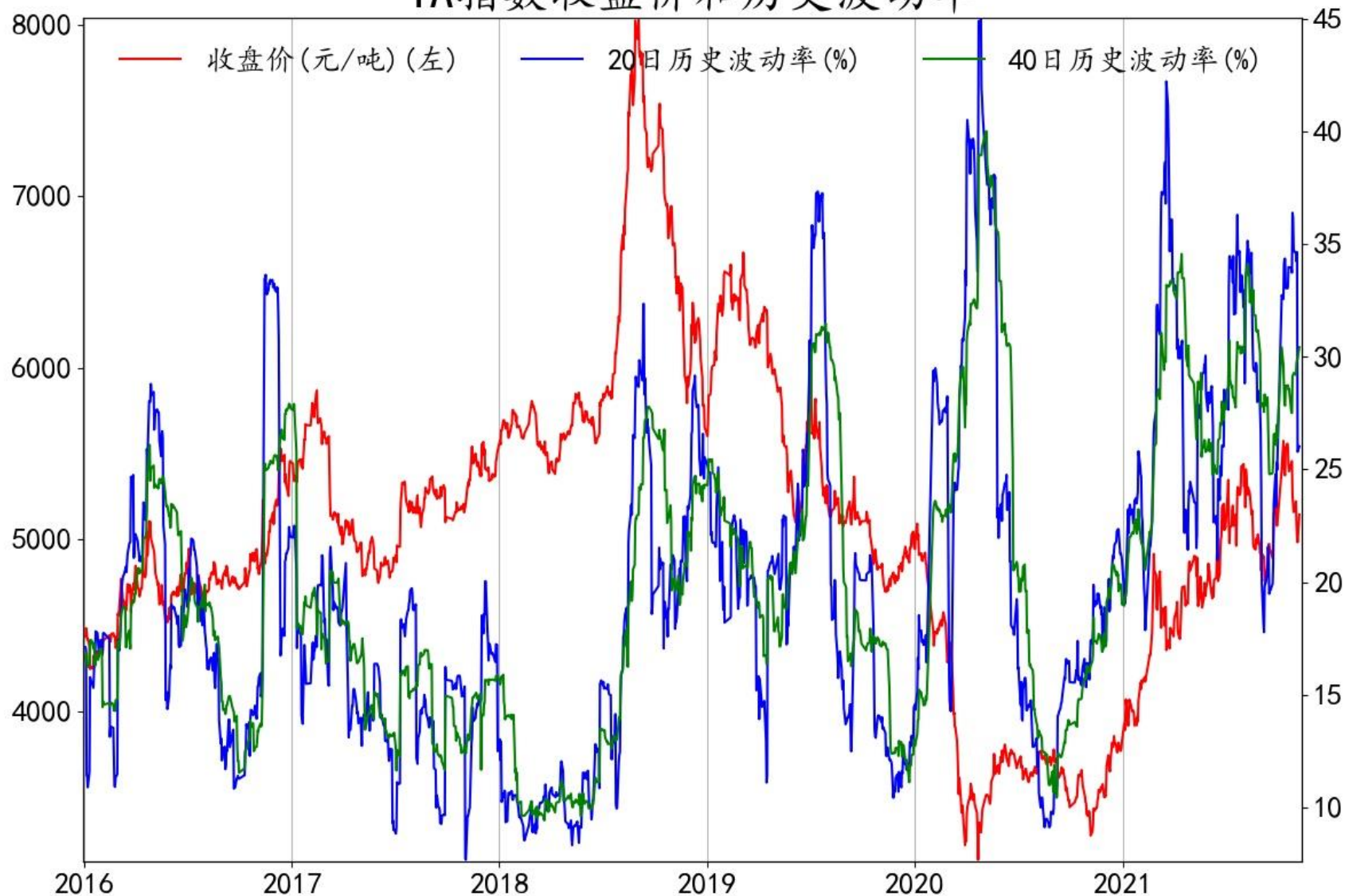


数据来源: Wind、信达期货研发中心

## 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

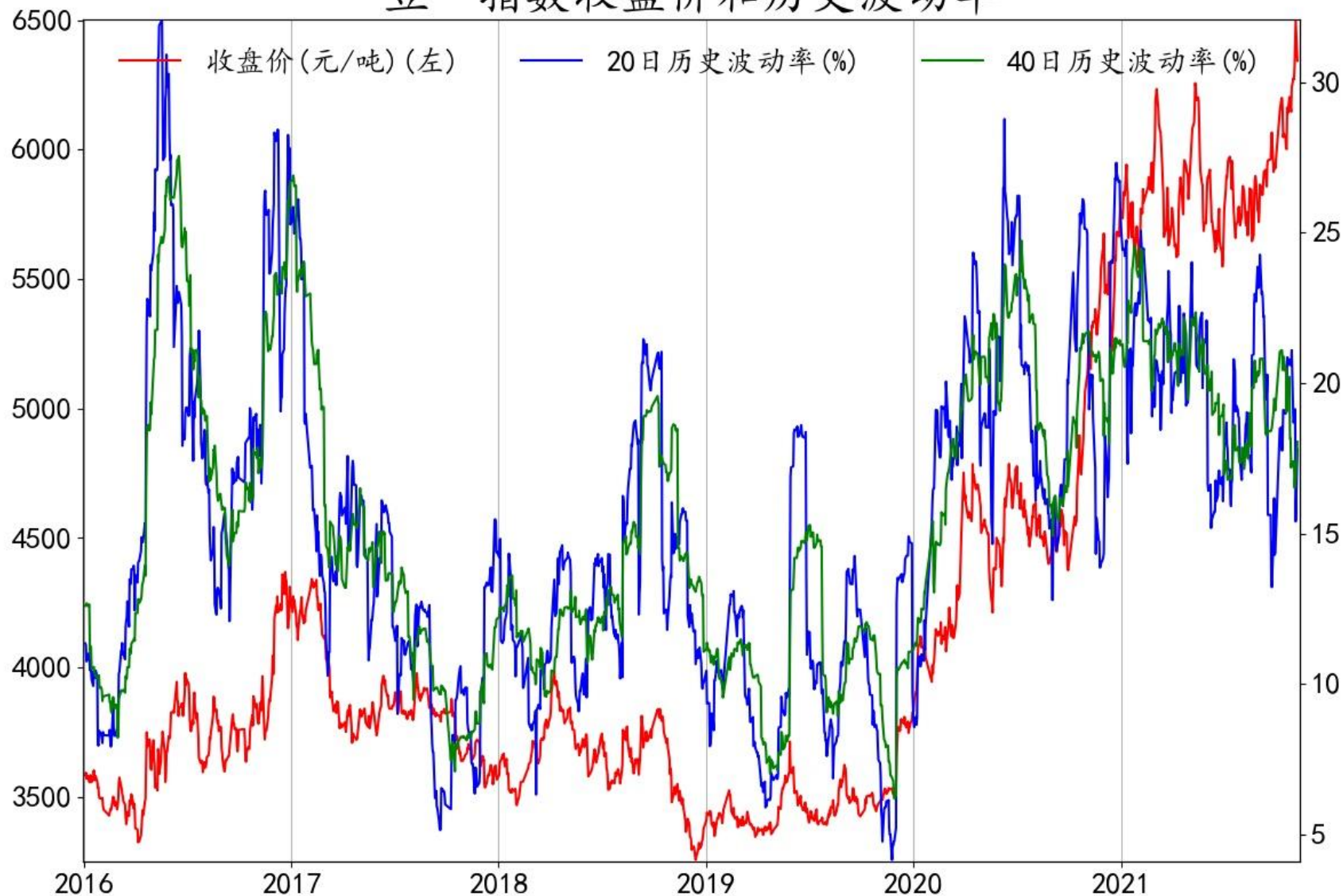


数据来源: Wind、信达期货研发中心

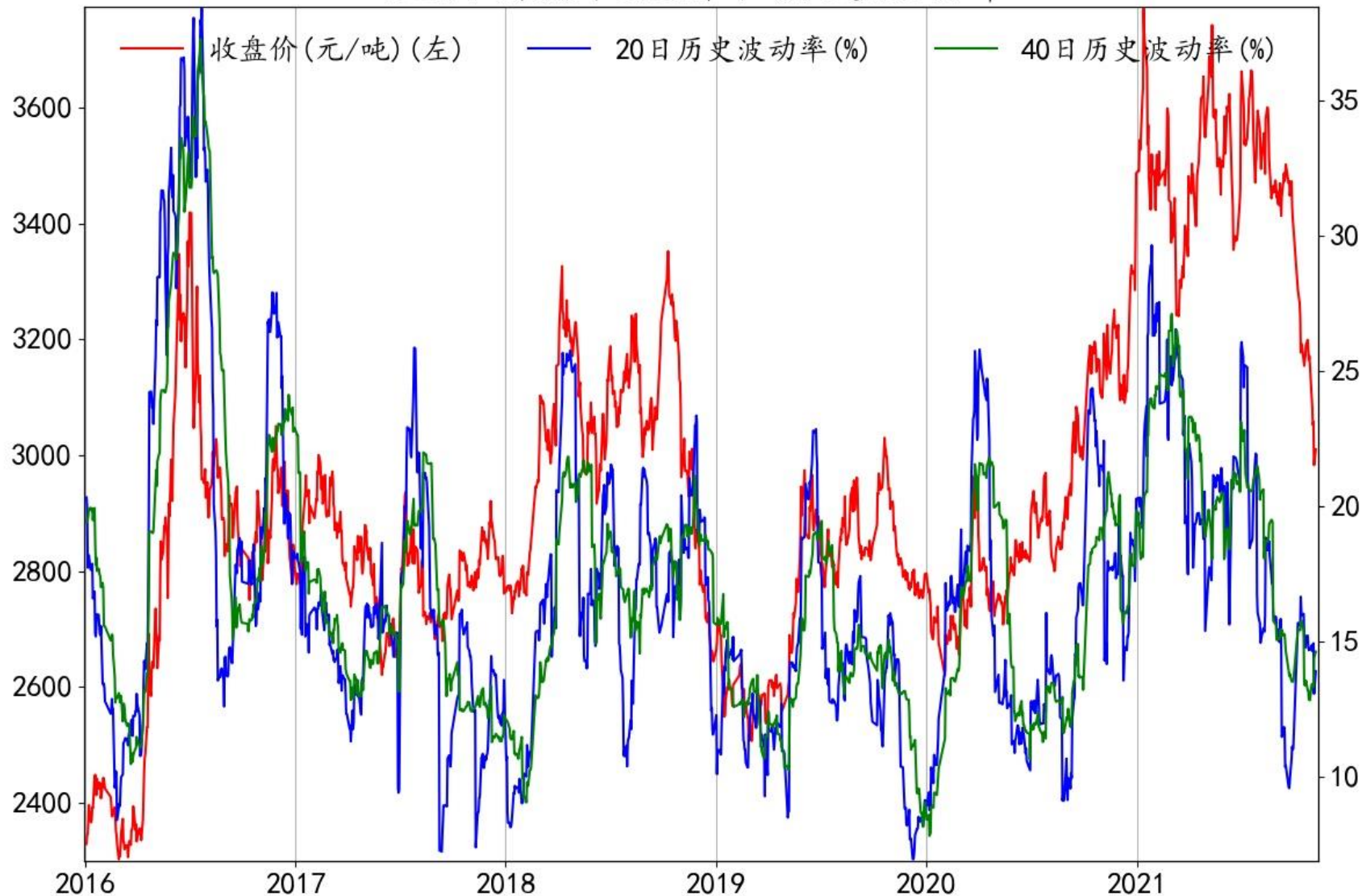
## 玉米指数收盘价和历史波动率



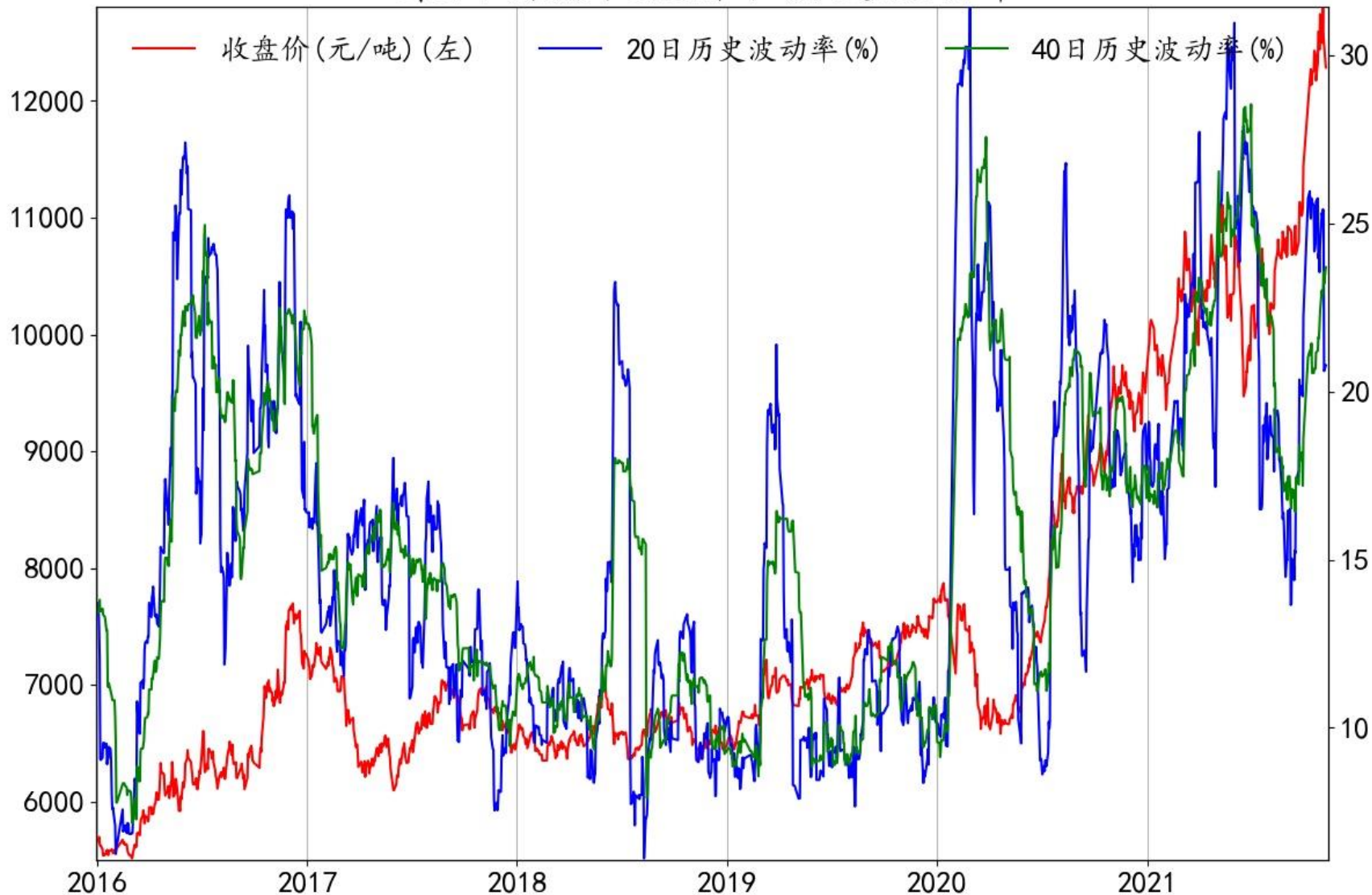
## 豆一指数收盘价和历史波动率



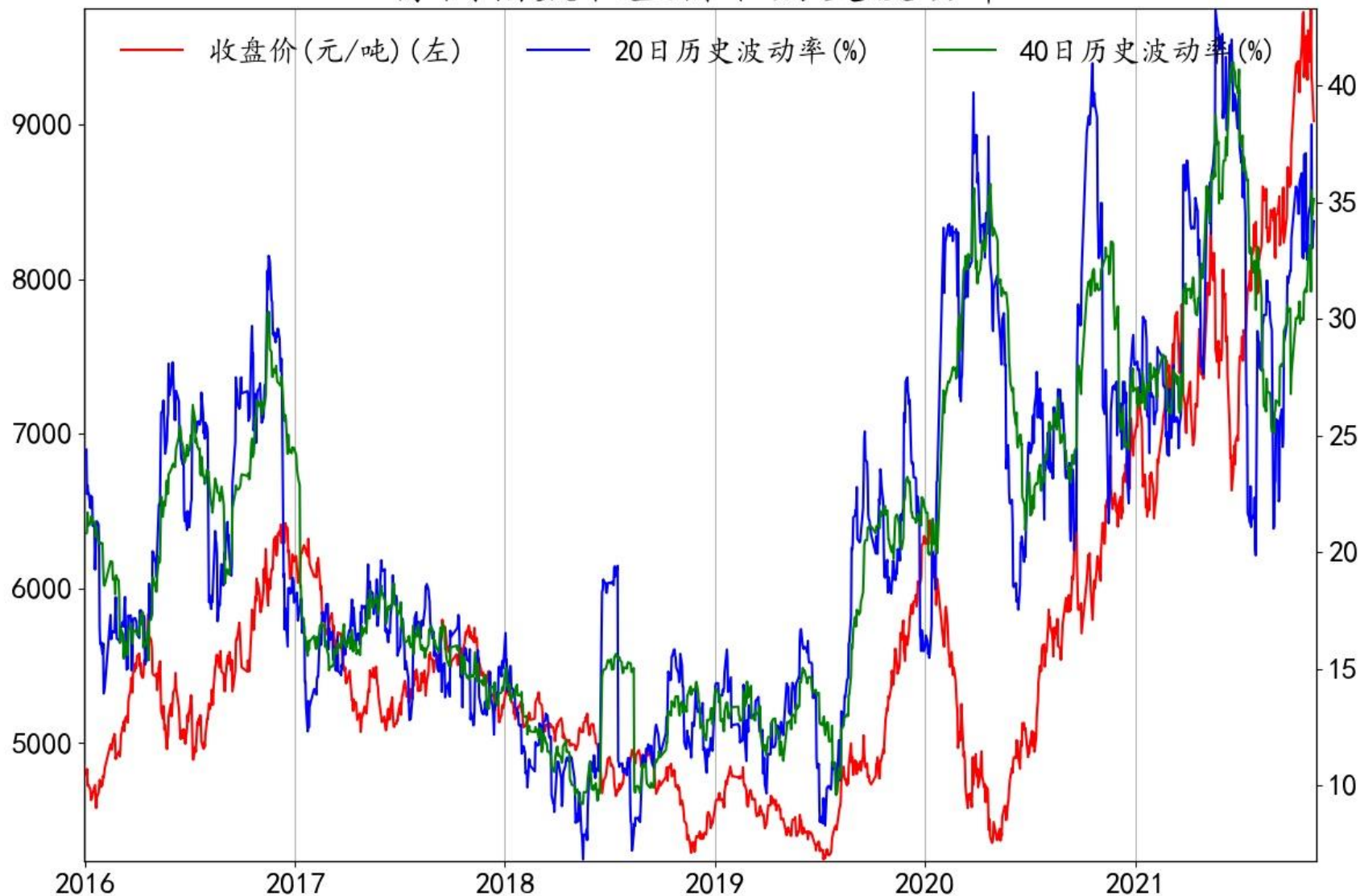
## 豆粕指数收盘价和历史波动率



## 菜油指数收盘价和历史波动率

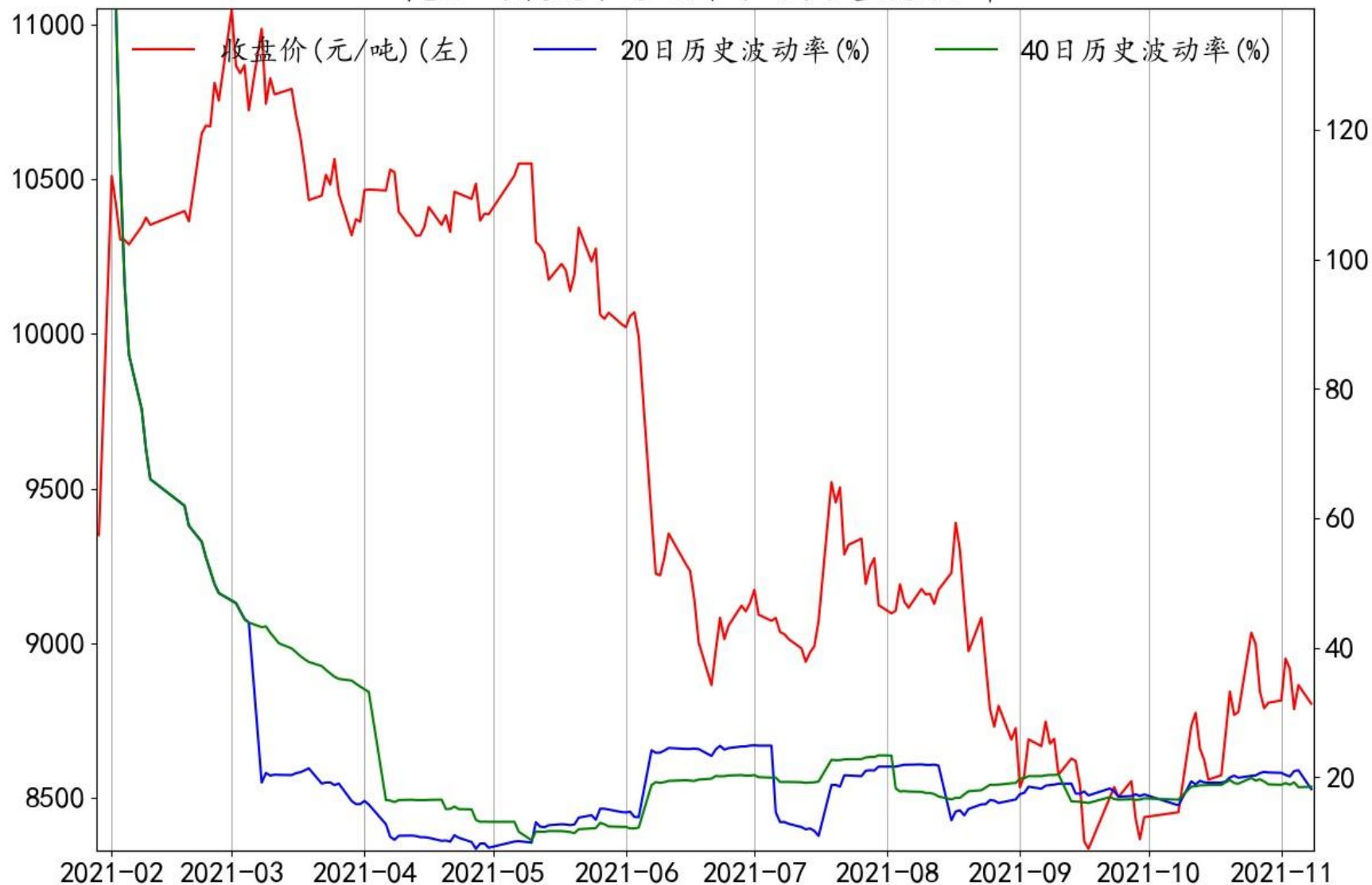


## 棕榈指数收盘价和历史波动率



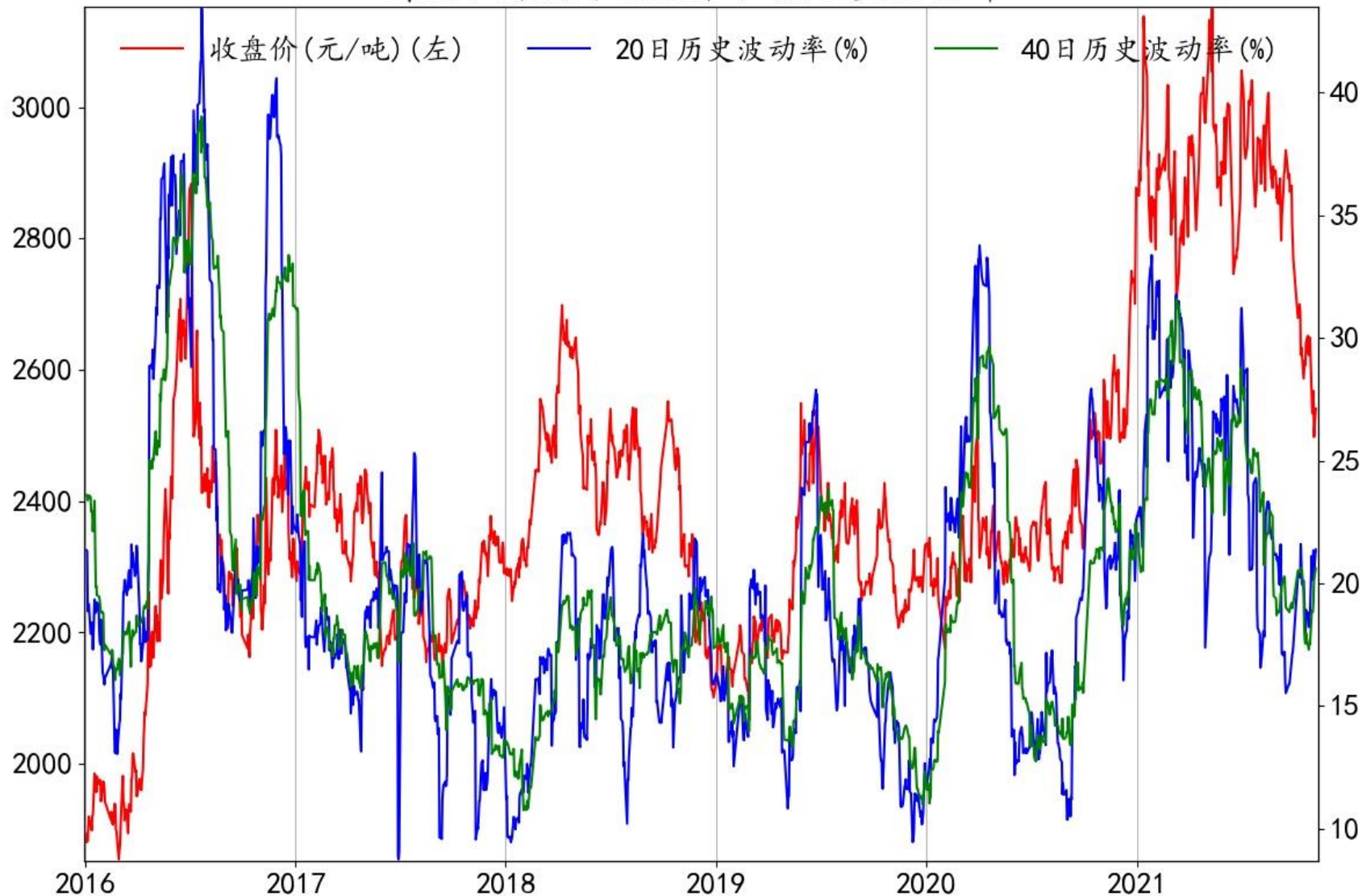
数据来源: Wind、信达期货研发中心

## 花生指数收盘价和历史波动率

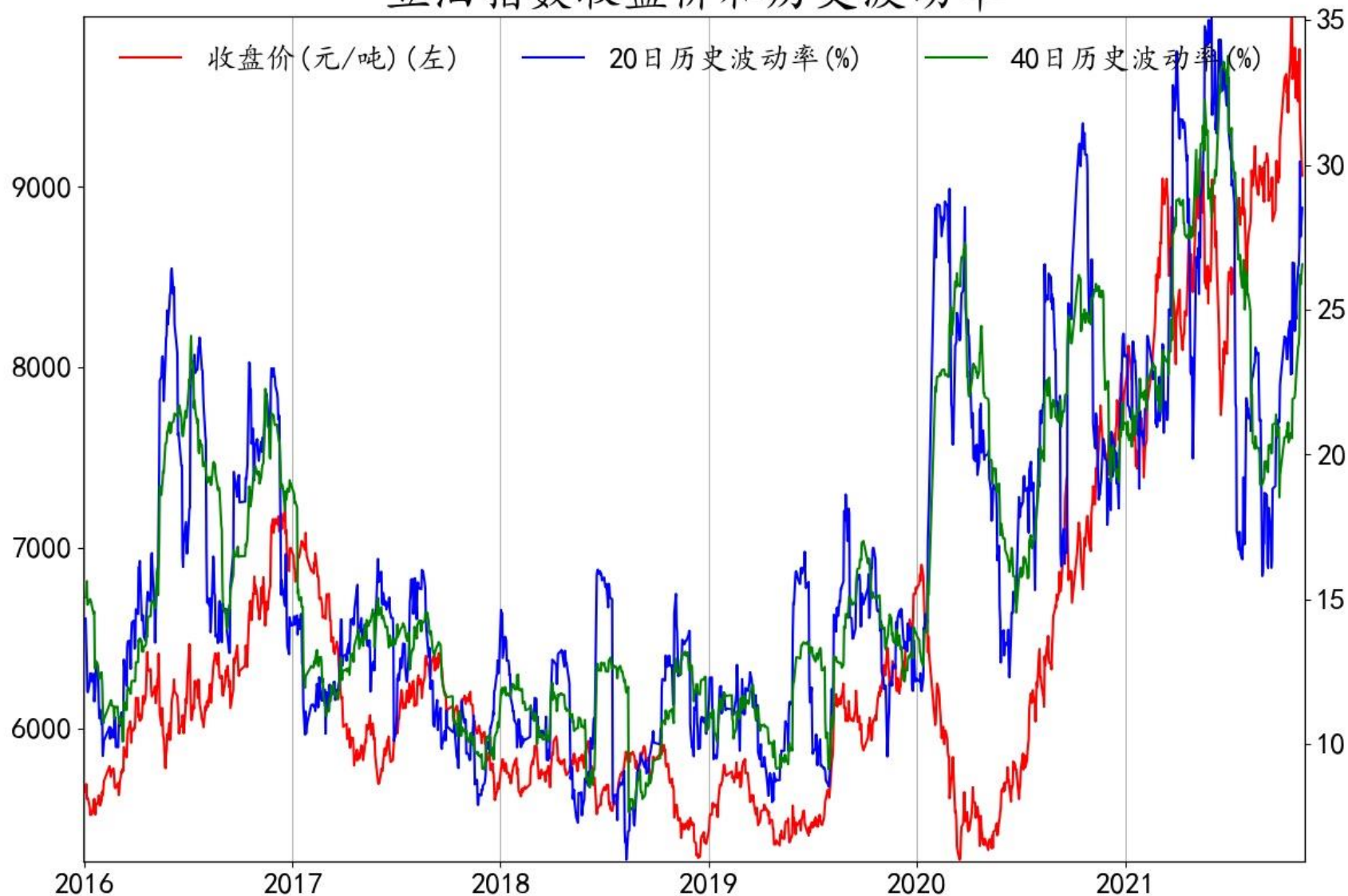


数据来源: Wind、信达期货研发中心

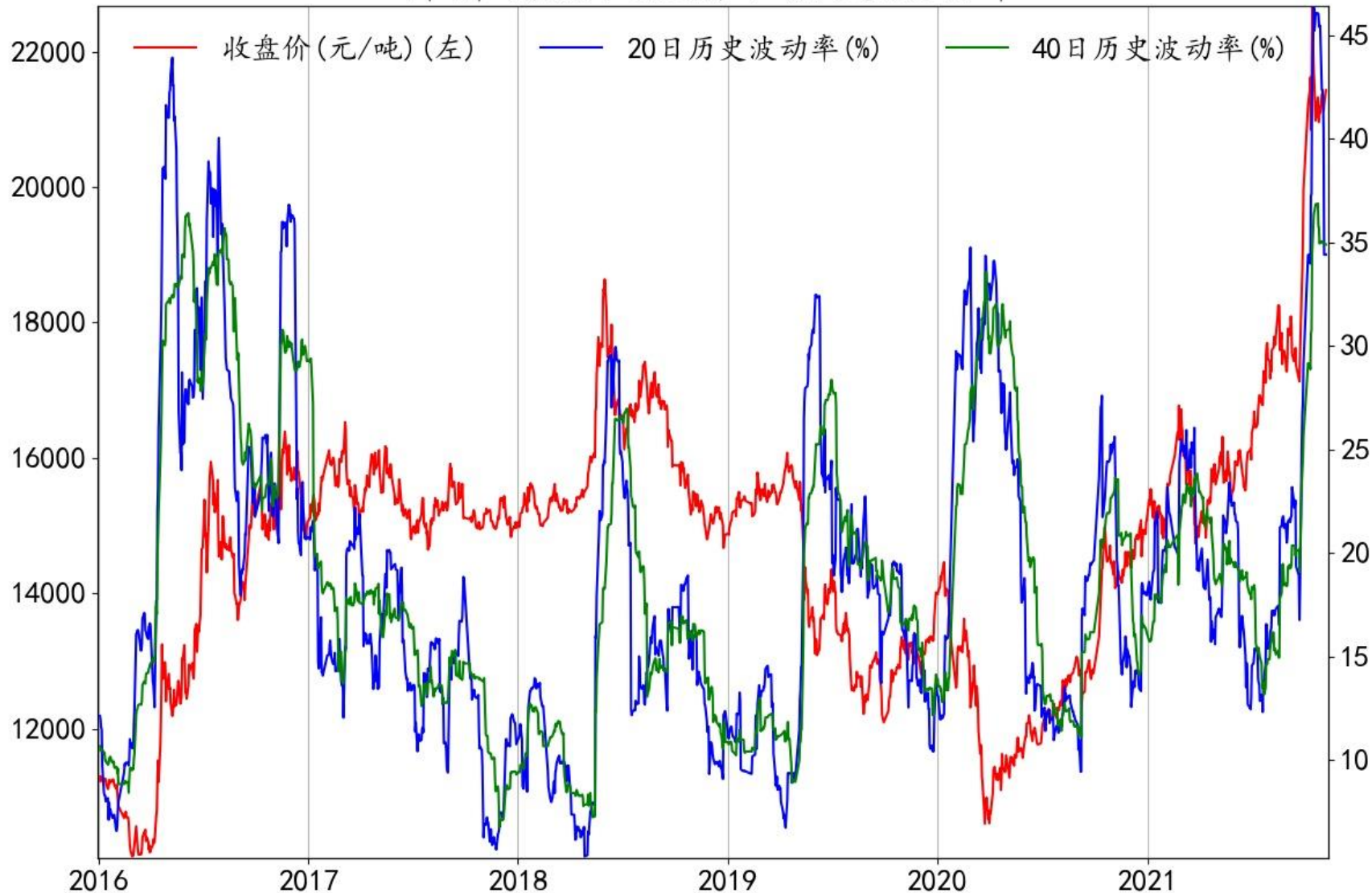
## 菜粕指数收盘价和历史波动率



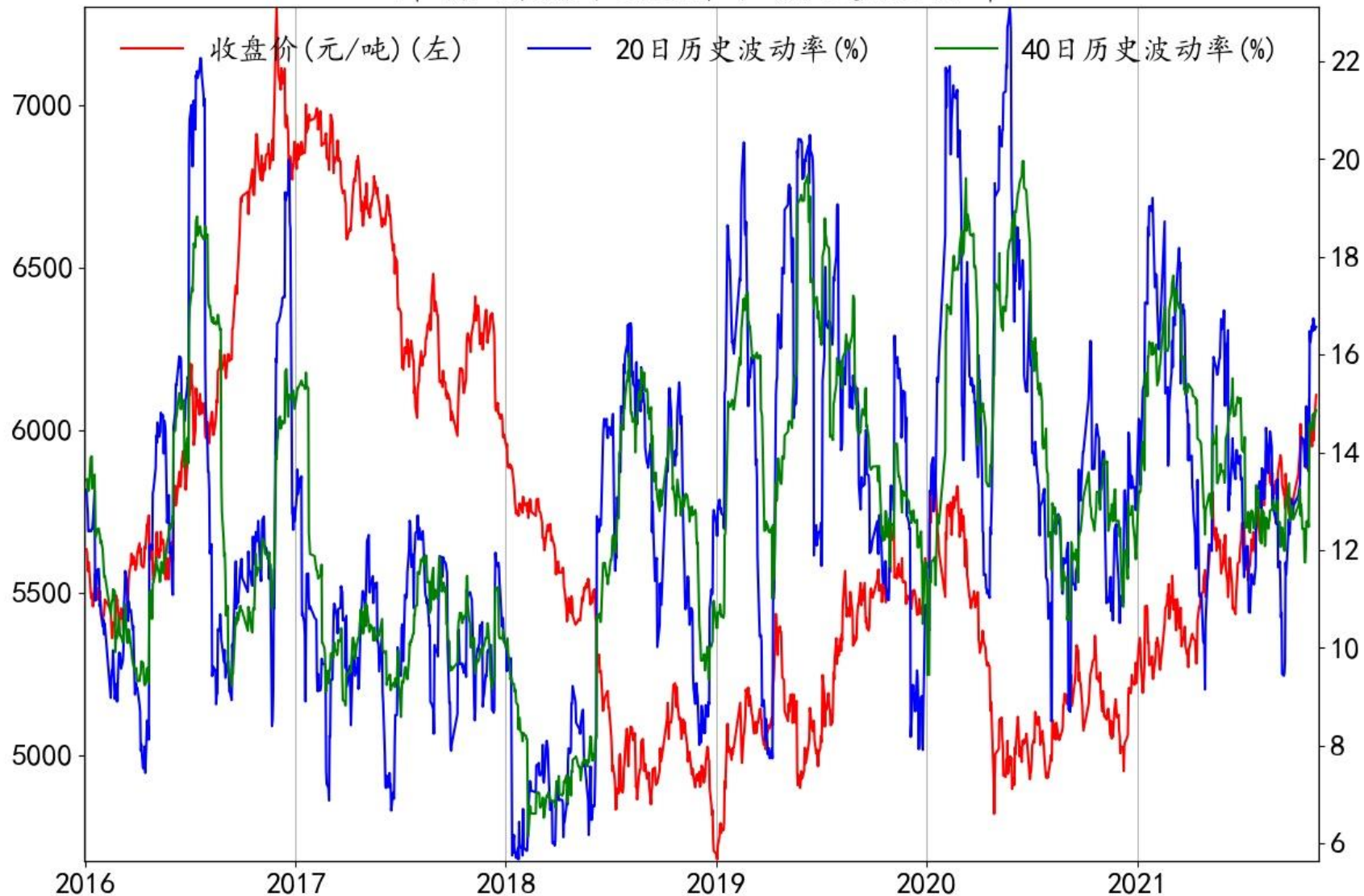
## 豆油指数收盘价和历史波动率



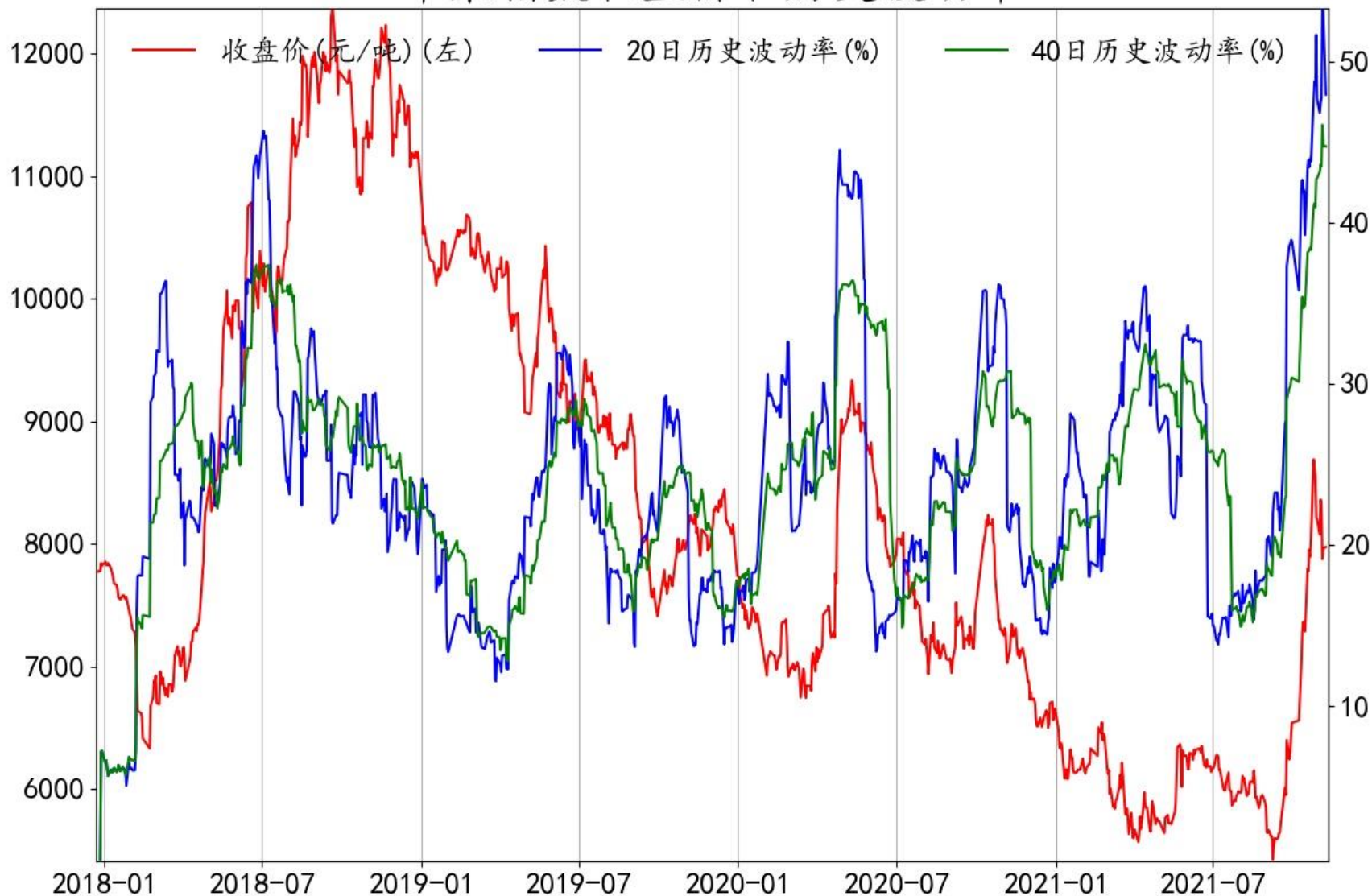
## 郑棉指数收盘价和历史波动率



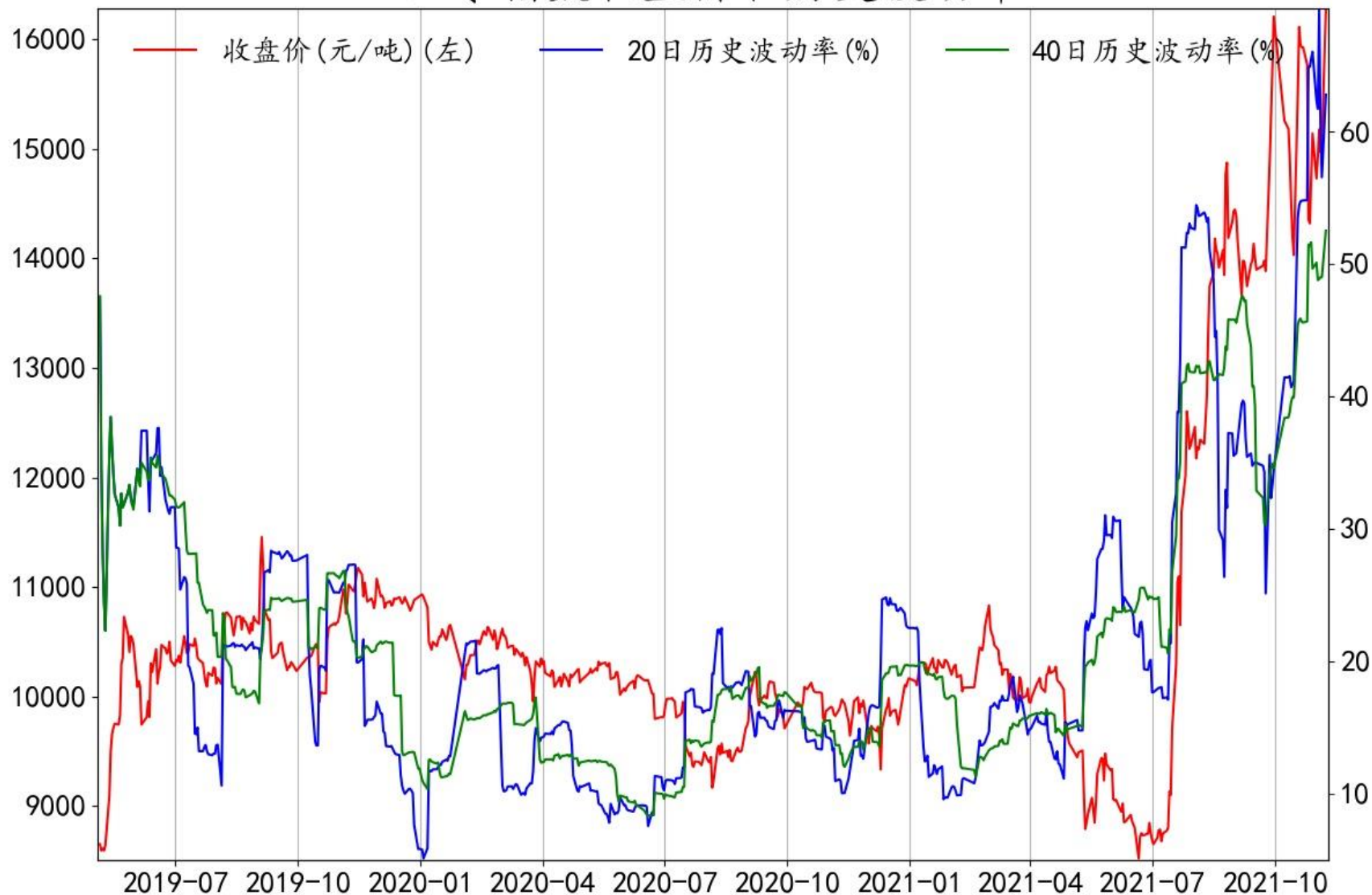
## 郑糖指数收盘价和历史波动率



## 苹果指数收盘价和历史波动率

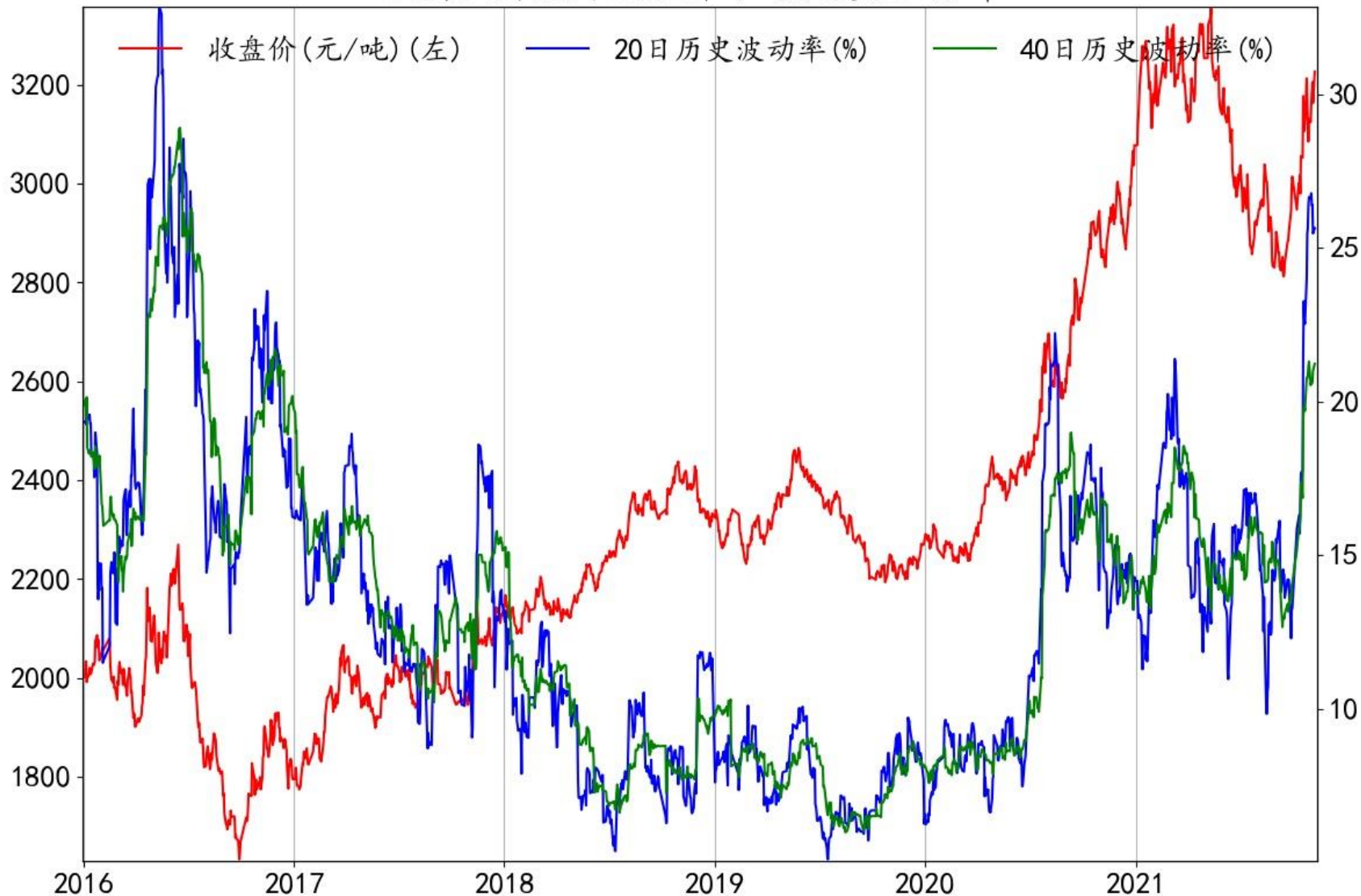


## 红枣指数收盘价和历史波动率

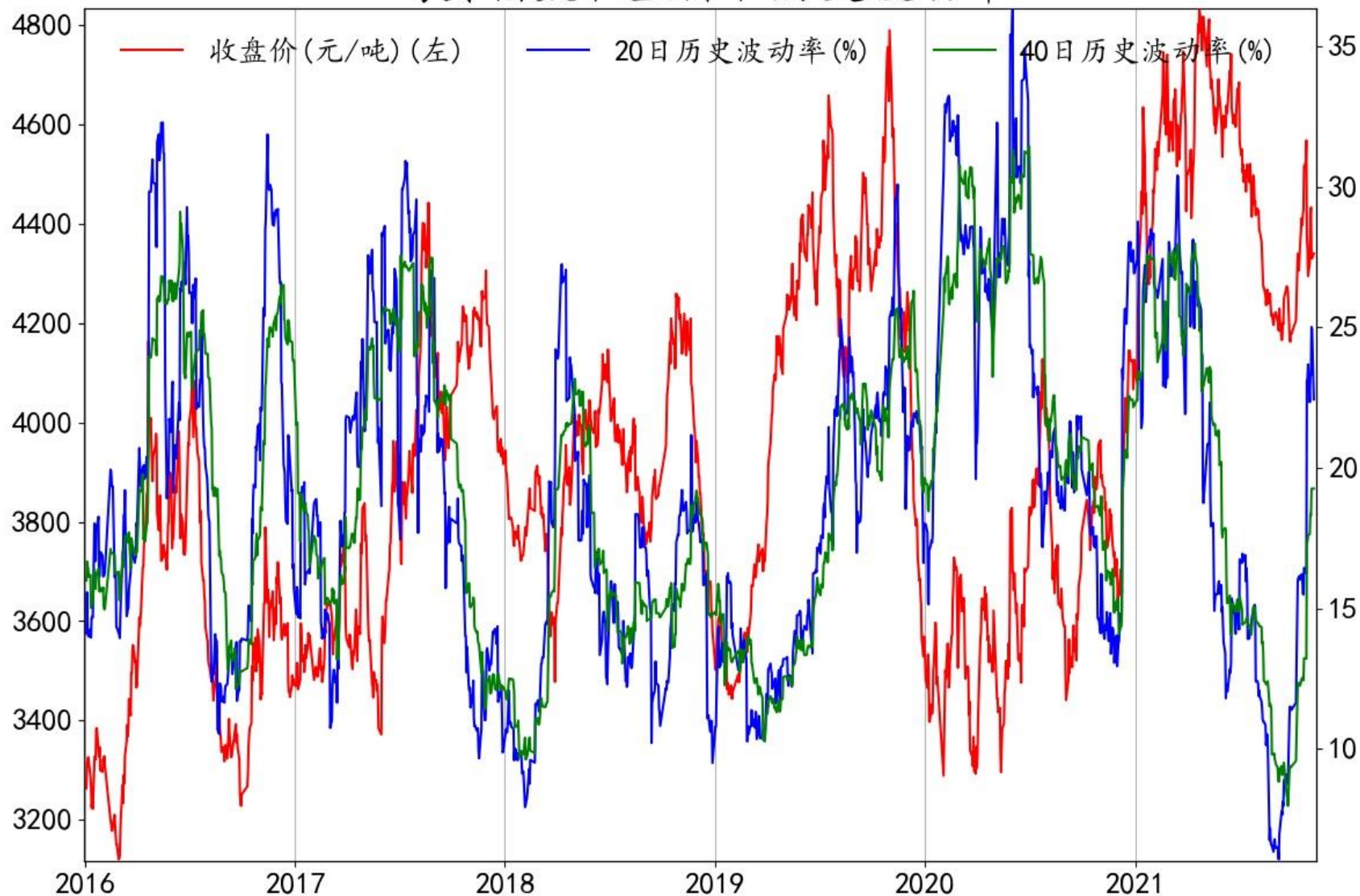


数据来源: Wind、信达期货研发中心

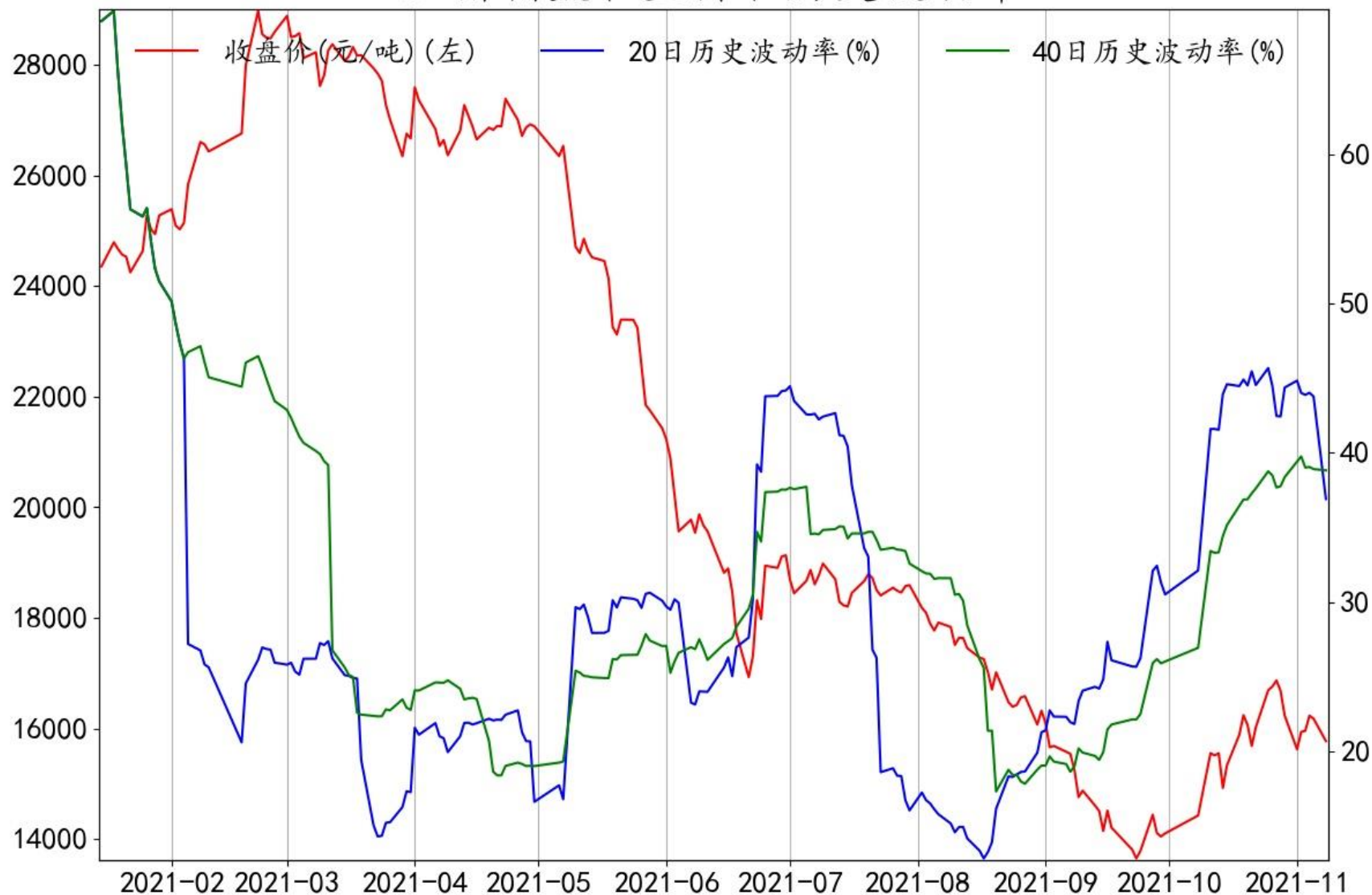
## 淀粉指数收盘价和历史波动率



## 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



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](http://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