

商品期货波动率跟踪

2021年11月09日

20日历史波动率百分位高于90%:

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

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

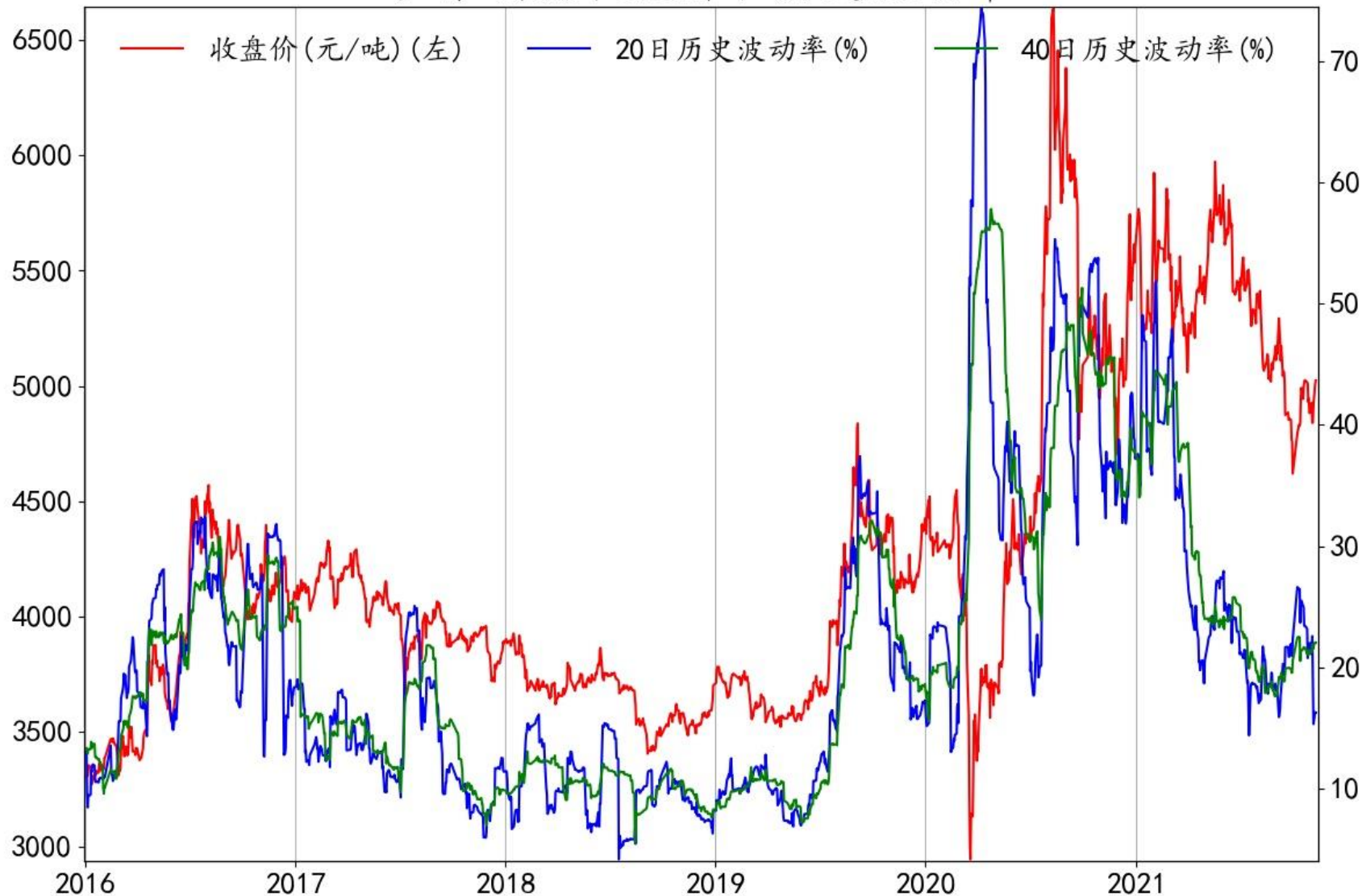
20日历史波动率绝对值后五:

沪金、玉米、豆粕、郑糖、沪银

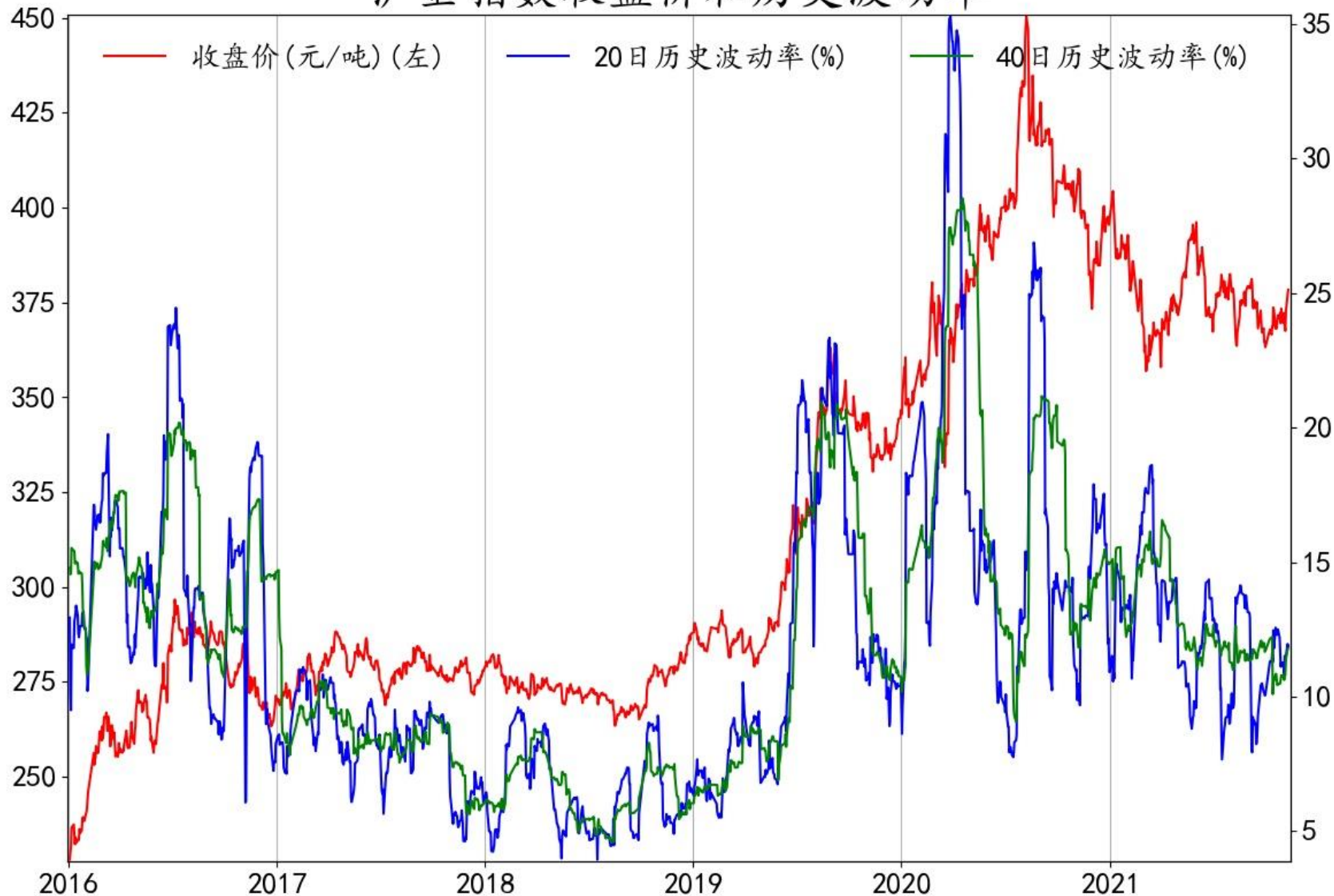
时间百分位 绝对值			时间百分位 绝对值		
沪银	45.40%	16.28%	硅铁	99.09%	82.92%
沪金	58.75%	11.88%	锰硅	98.38%	70.73%
沪铝	99.79%	43.57%	不锈钢	72.85%	24.95%
沪铜	93.46%	26.11%	玻璃	99.79%	53.00%
沪镍	78.92%	28.46%	PVC	99.09%	60.70%
沪铅	68.80%	19.30%	燃油	80.29%	38.59%
沪锡	96.28%	37.84%	低硫燃油	5.54%	20.16%
沪锌	99.86%	50.84%	LPG	88.92%	40.35%
热卷	86.09%	37.79%	原油	39.64%	25.59%
铁矿	96.21%	60.75%	动煤	99.16%	95.19%
焦炭	99.37%	83.06%	沥青	78.57%	33.57%
焦煤	99.51%	88.02%	苯乙烯	68.10%	32.66%
螺纹	95.36%	45.43%	乙二醇	98.16%	64.72%

	时间百分位	绝对值		时间百分位	绝对值
塑料	86.93%	25.77%	菜油	88.48%	23.17%
甲醇	99.02%	53.93%	棕榈	94.94%	35.78%
20号胶	66.42%	29.06%	花生	45.65%	18.31%
短纤	77.91%	30.12%	菜粕	74.21%	22.11%
PP	85.95%	26.80%	豆油	95.78%	30.19%
沪胶	69.78%	30.98%	郑棉	94.38%	34.37%
纯碱	98.71%	61.96%	郑糖	83.20%	16.07%
纸浆	79.40%	23.04%	苹果	98.93%	47.04%
TA	78.36%	24.86%	红枣	98.86%	62.35%
尿素	97.43%	62.55%	淀粉	96.84%	25.45%
玉米	74.35%	13.86%	鸡蛋	70.77%	22.41%
豆一	66.06%	17.81%	生猪	72.96%	37.13%
豆粕	31.27%	13.88%			

沪银指数收盘价和历史波动率



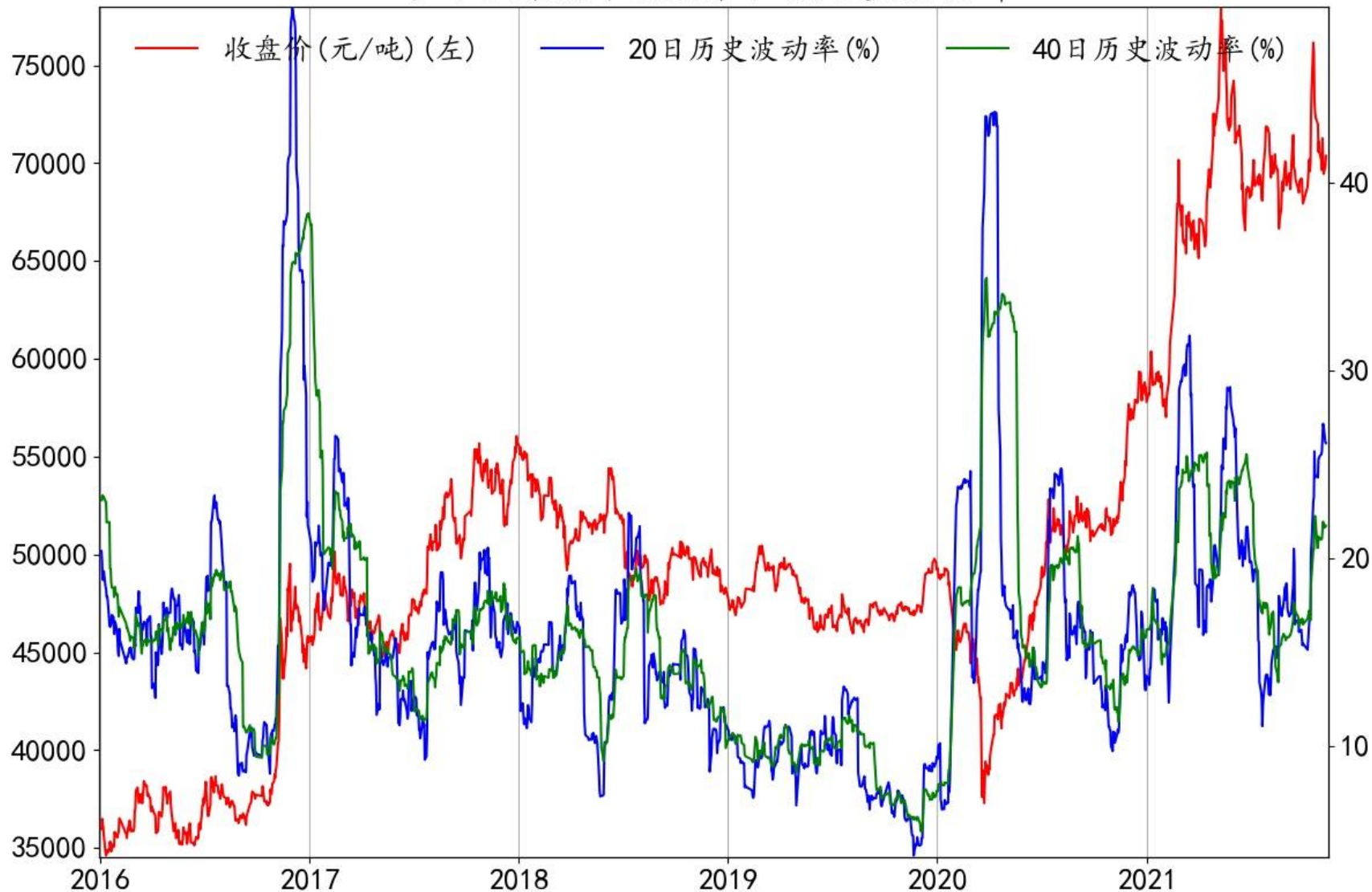
沪金指数收盘价和历史波动率



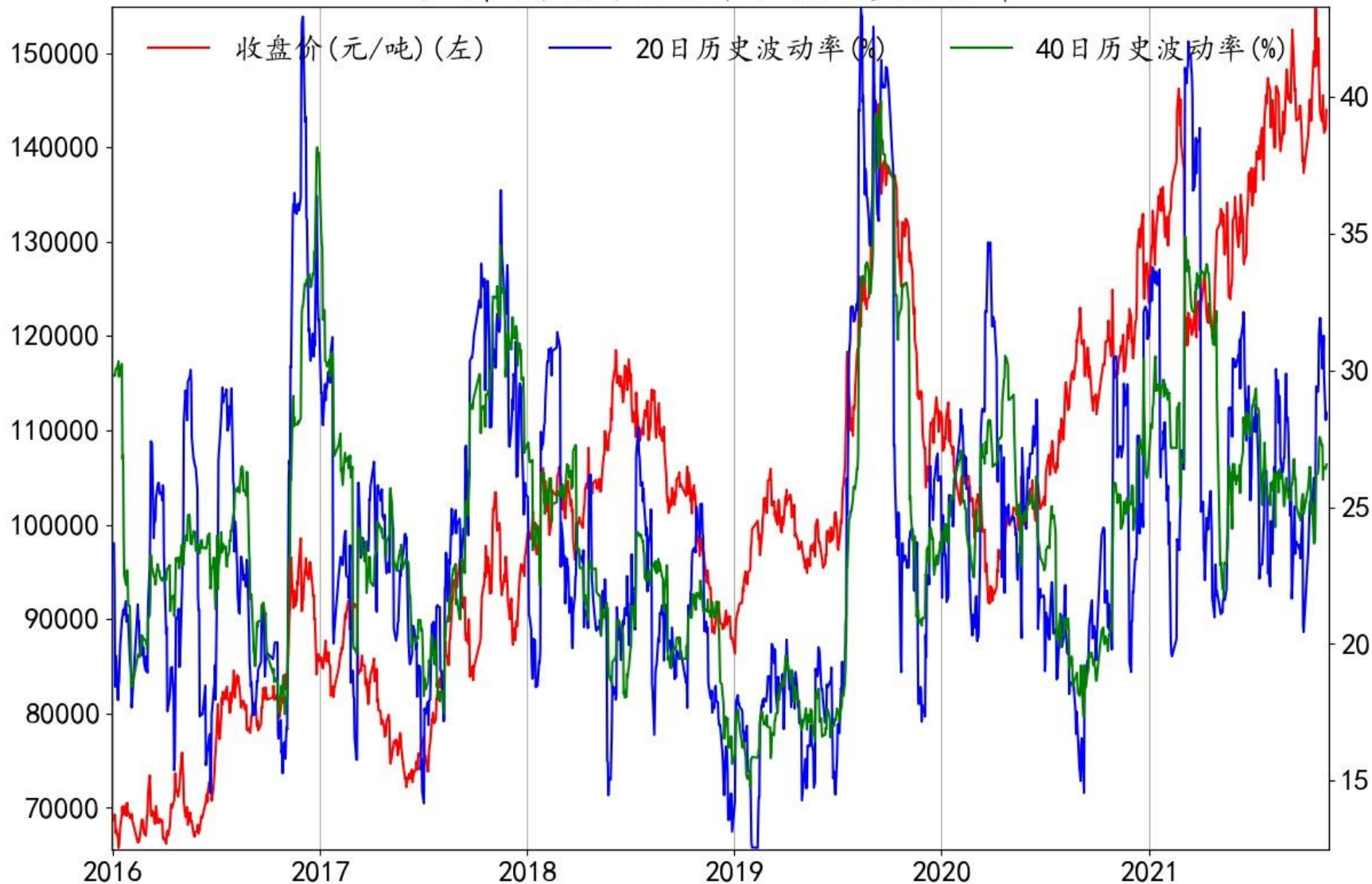
沪铝指数收盘价和历史波动率



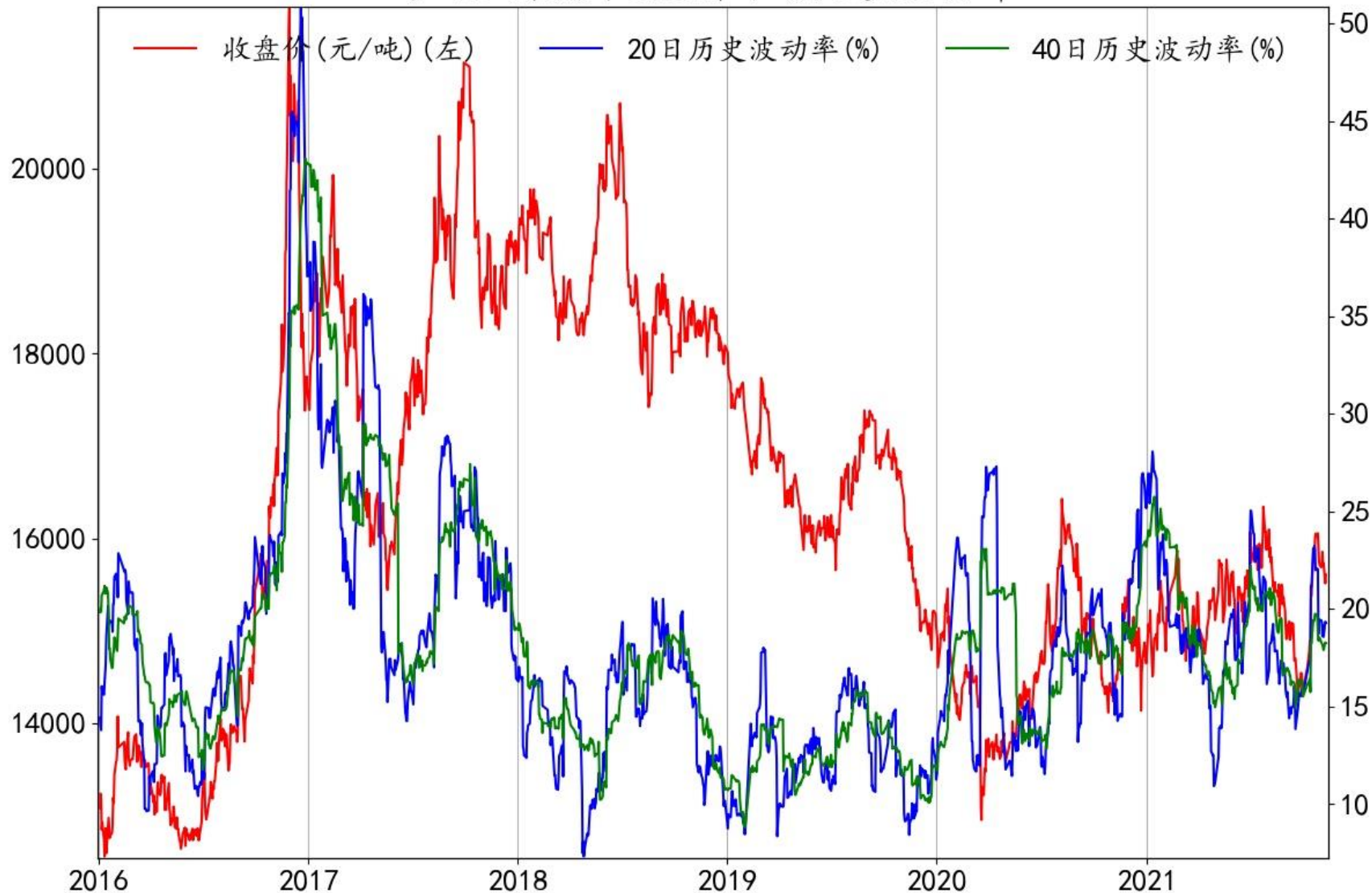
沪铜指数收盘价和历史波动率



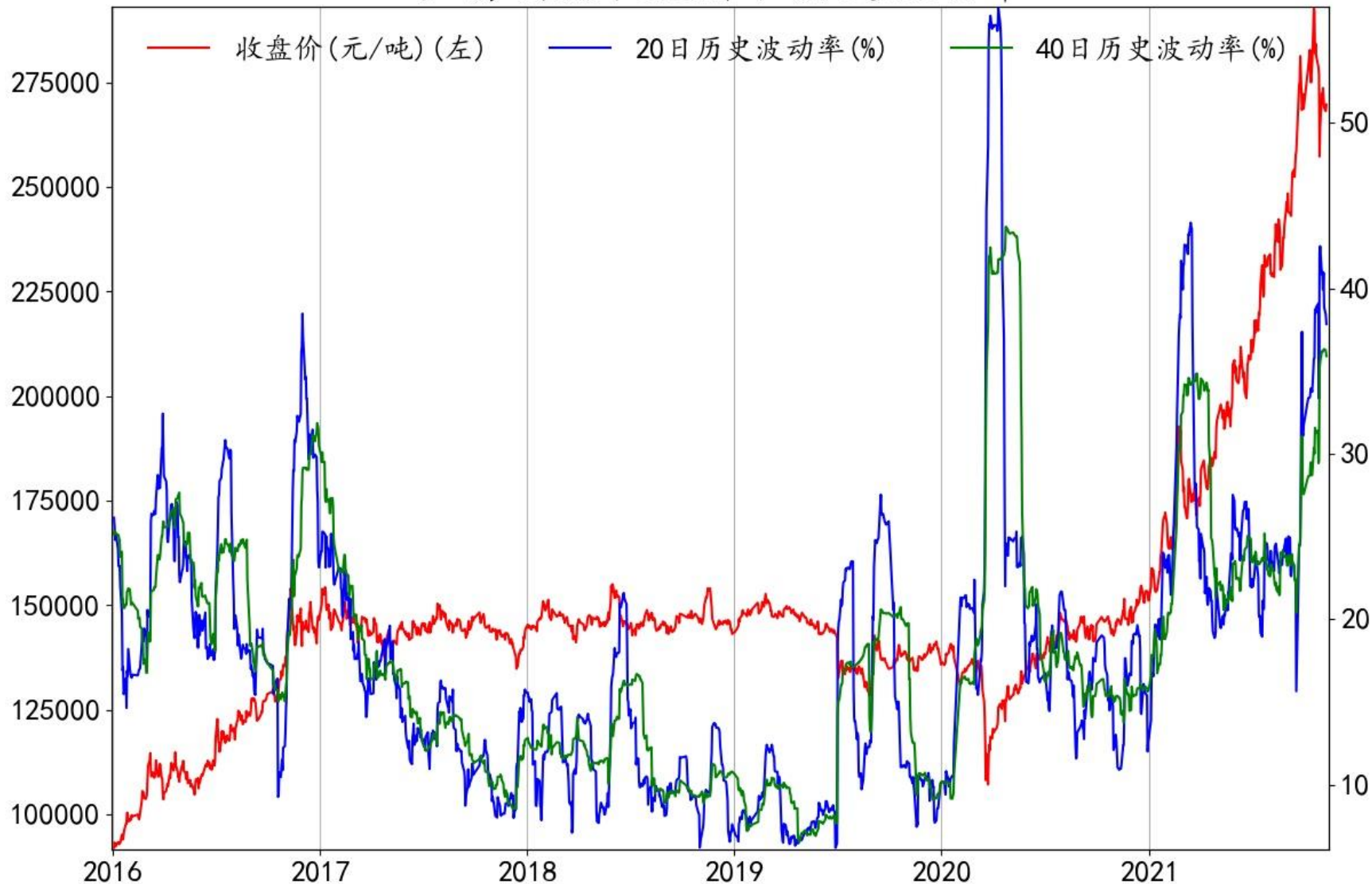
沪镍指数收盘价和历史波动率



沪铅指数收盘价和历史波动率



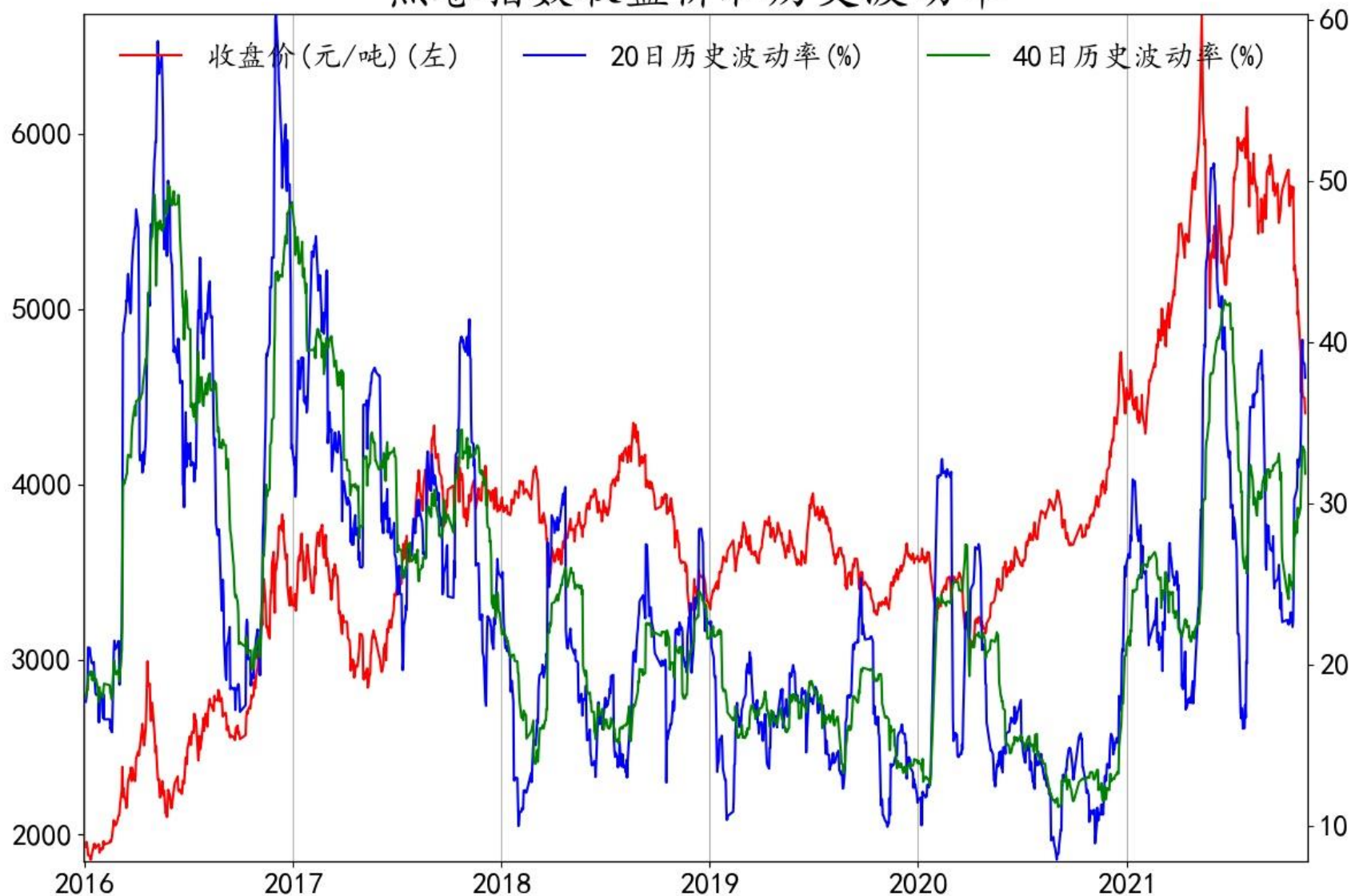
沪锡指数收盘价和历史波动率



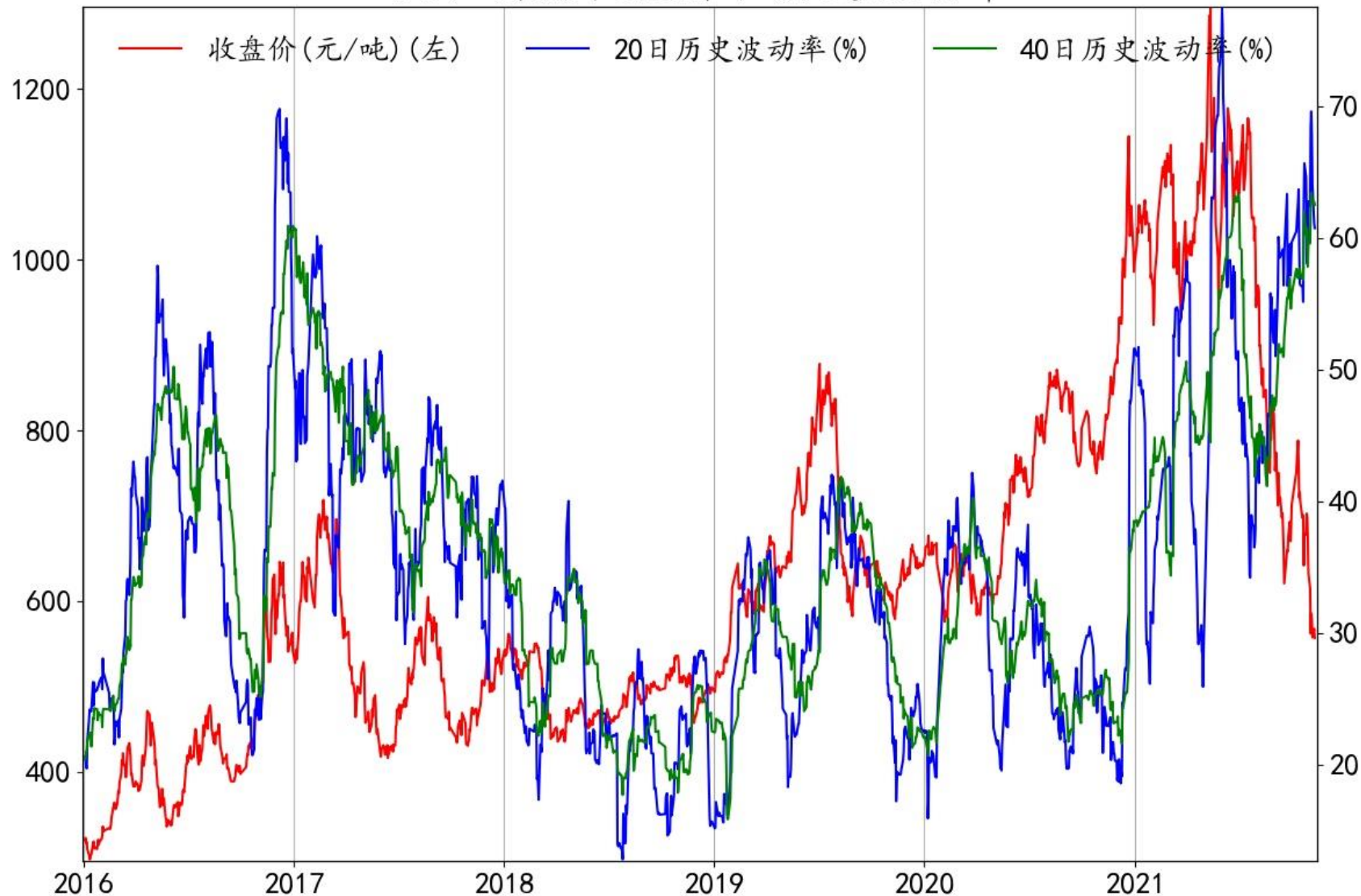
沪锌指数收盘价和历史波动率



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



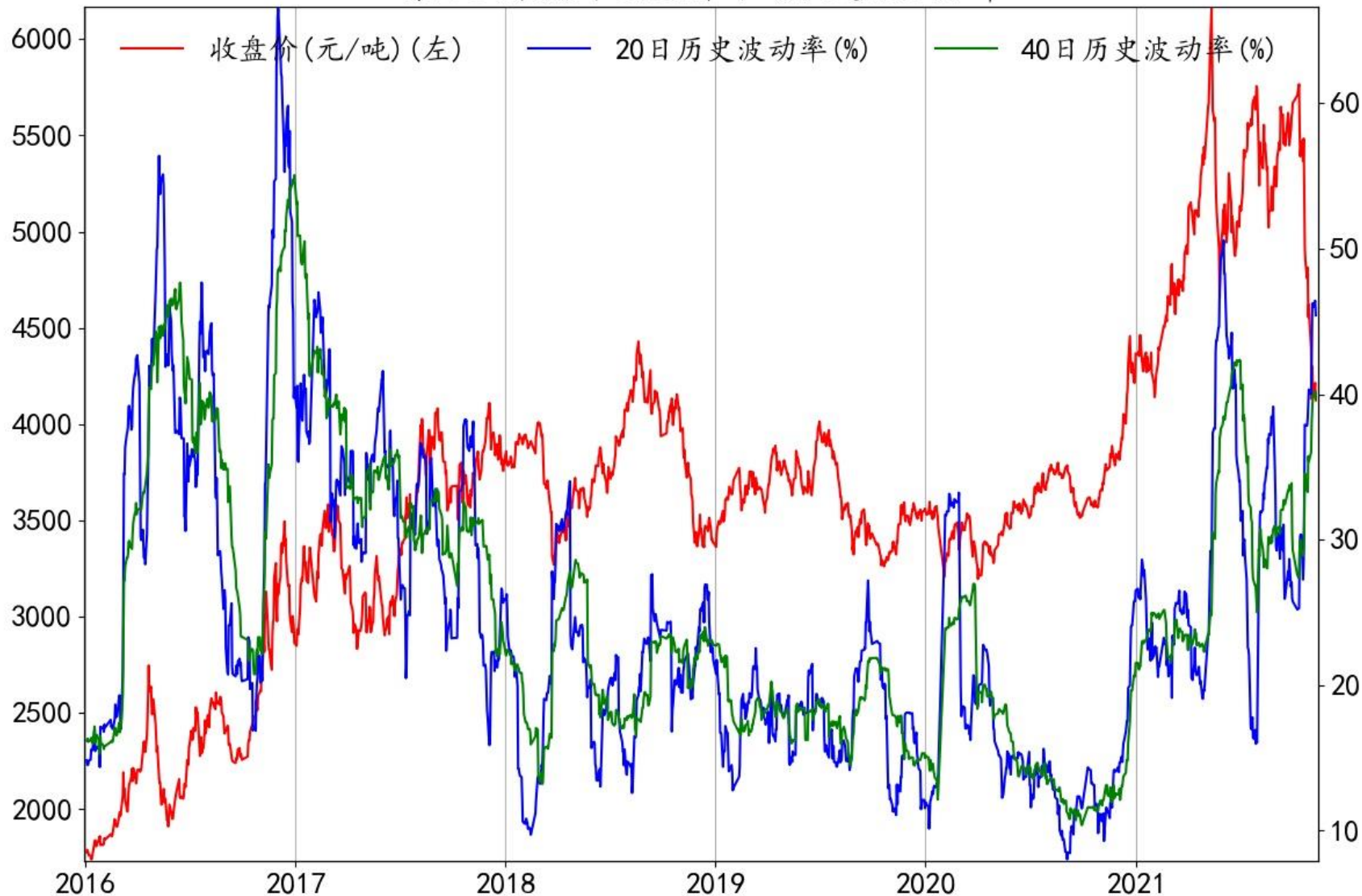
焦炭指数收盘价和历史波动率



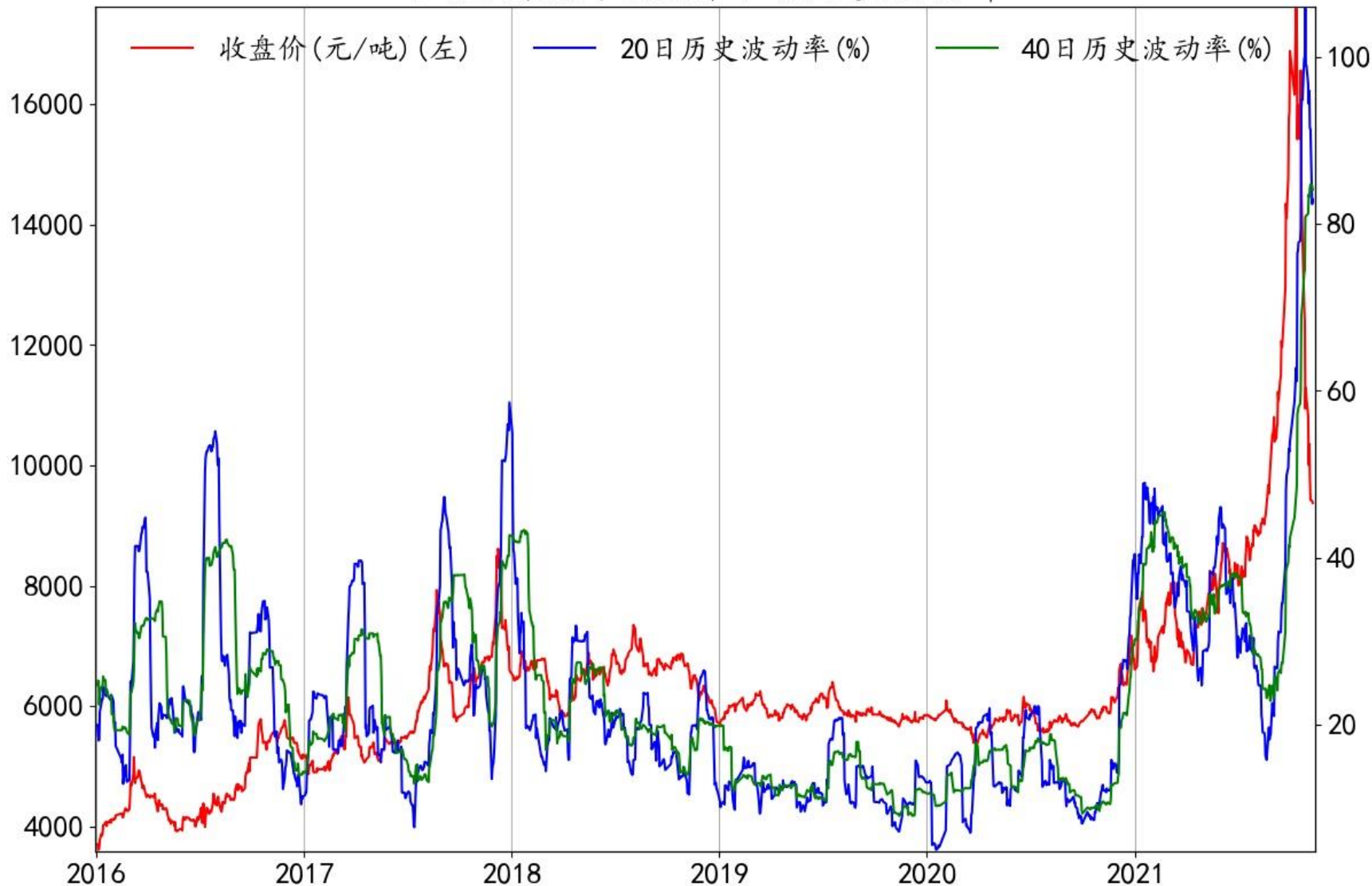
焦煤指数收盘价和历史波动率



螺纹指数收盘价和历史波动率



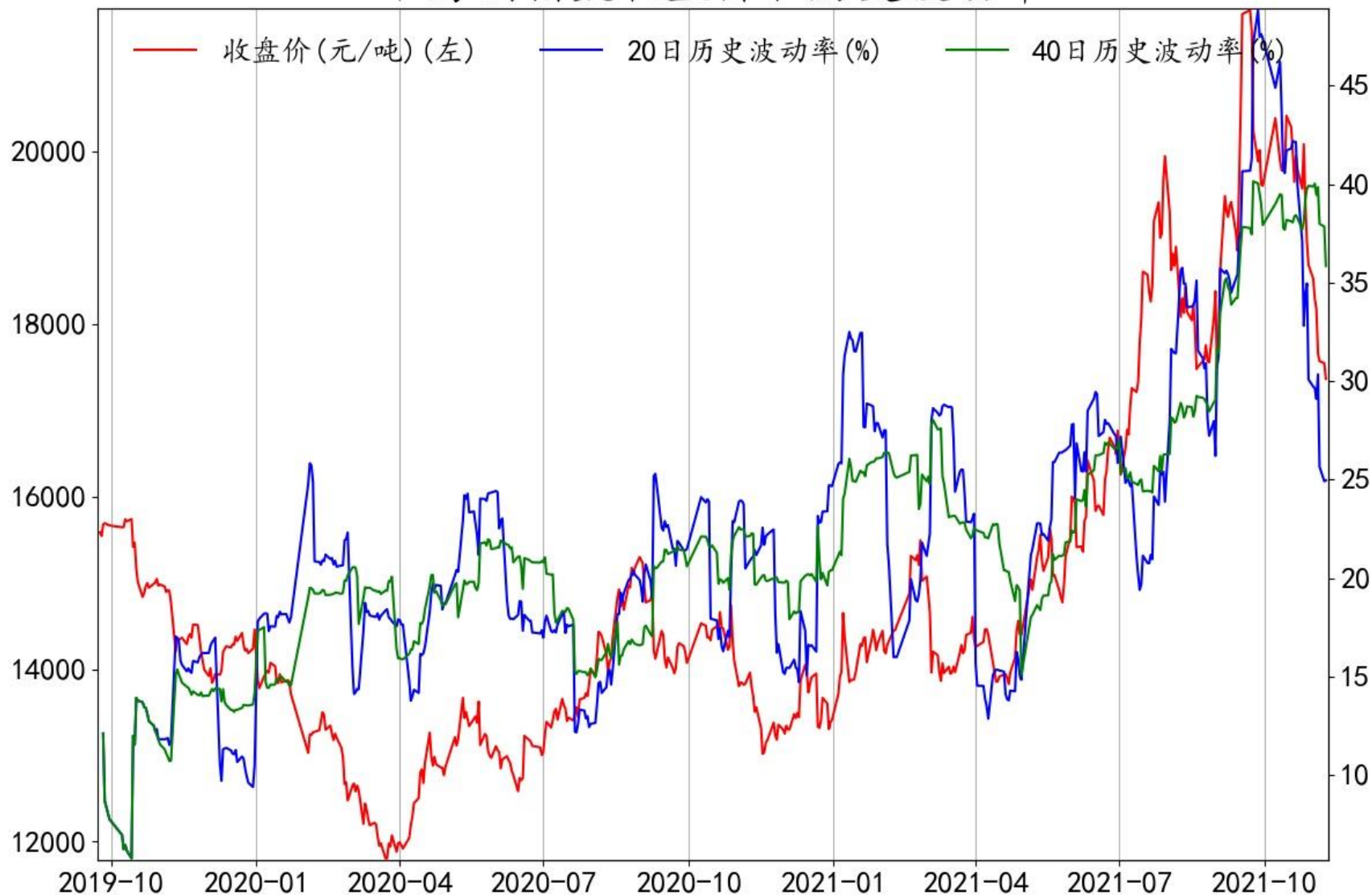
硅铁指数收盘价和历史波动率



锰硅指数收盘价和历史波动率

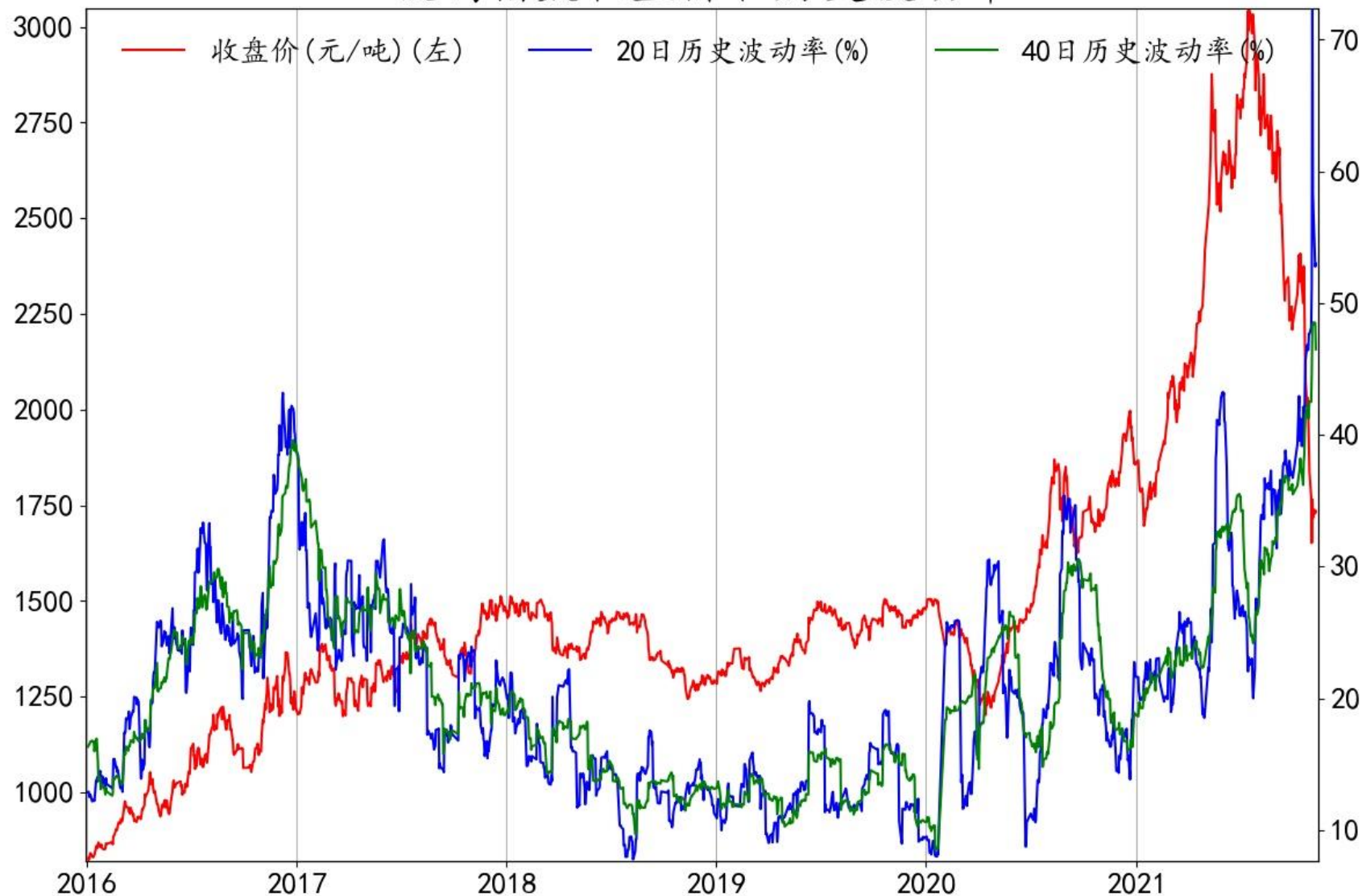


不锈钢指数收盘价和历史波动率

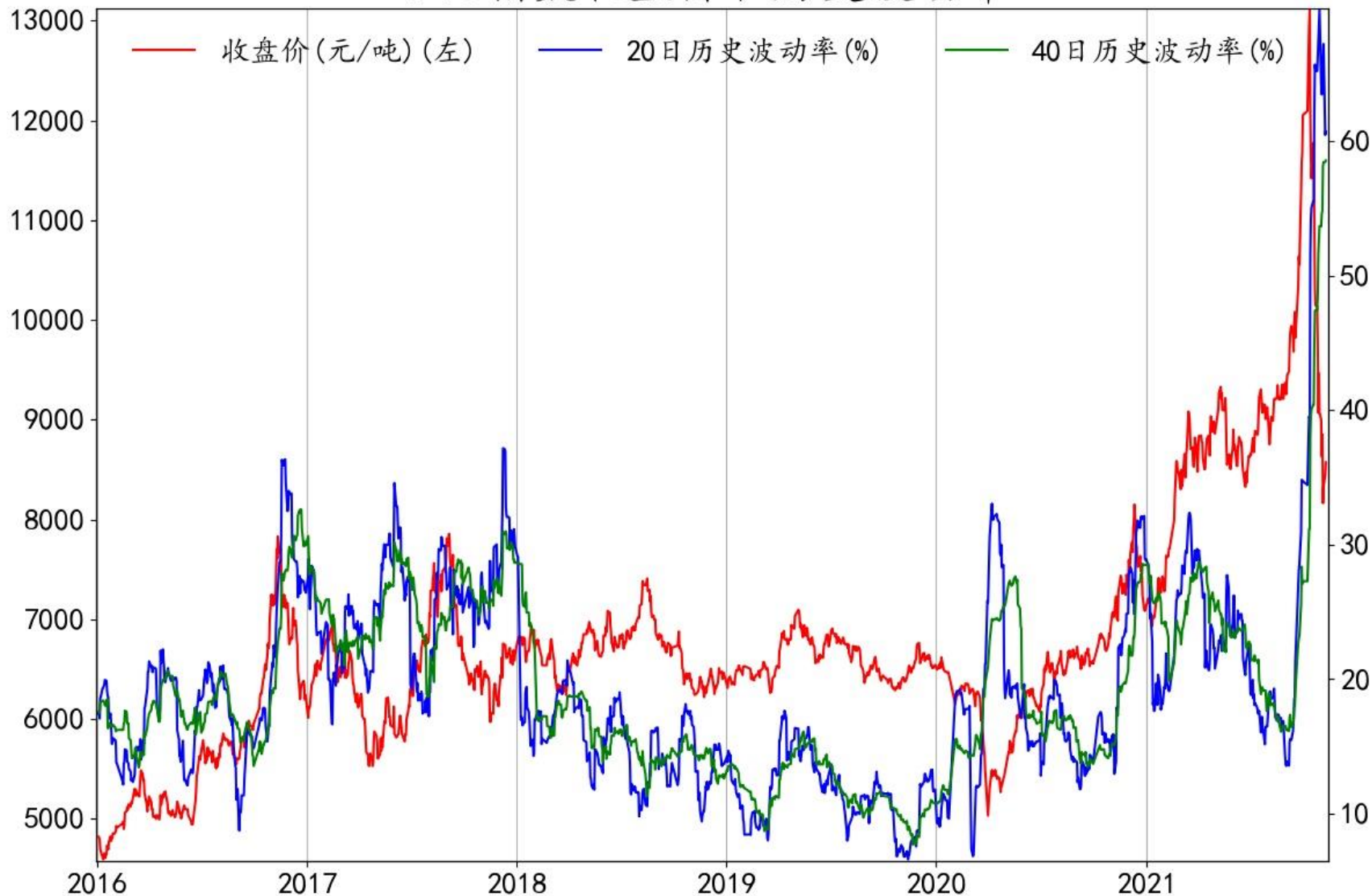


数据来源: Wind、信达期货研发中心

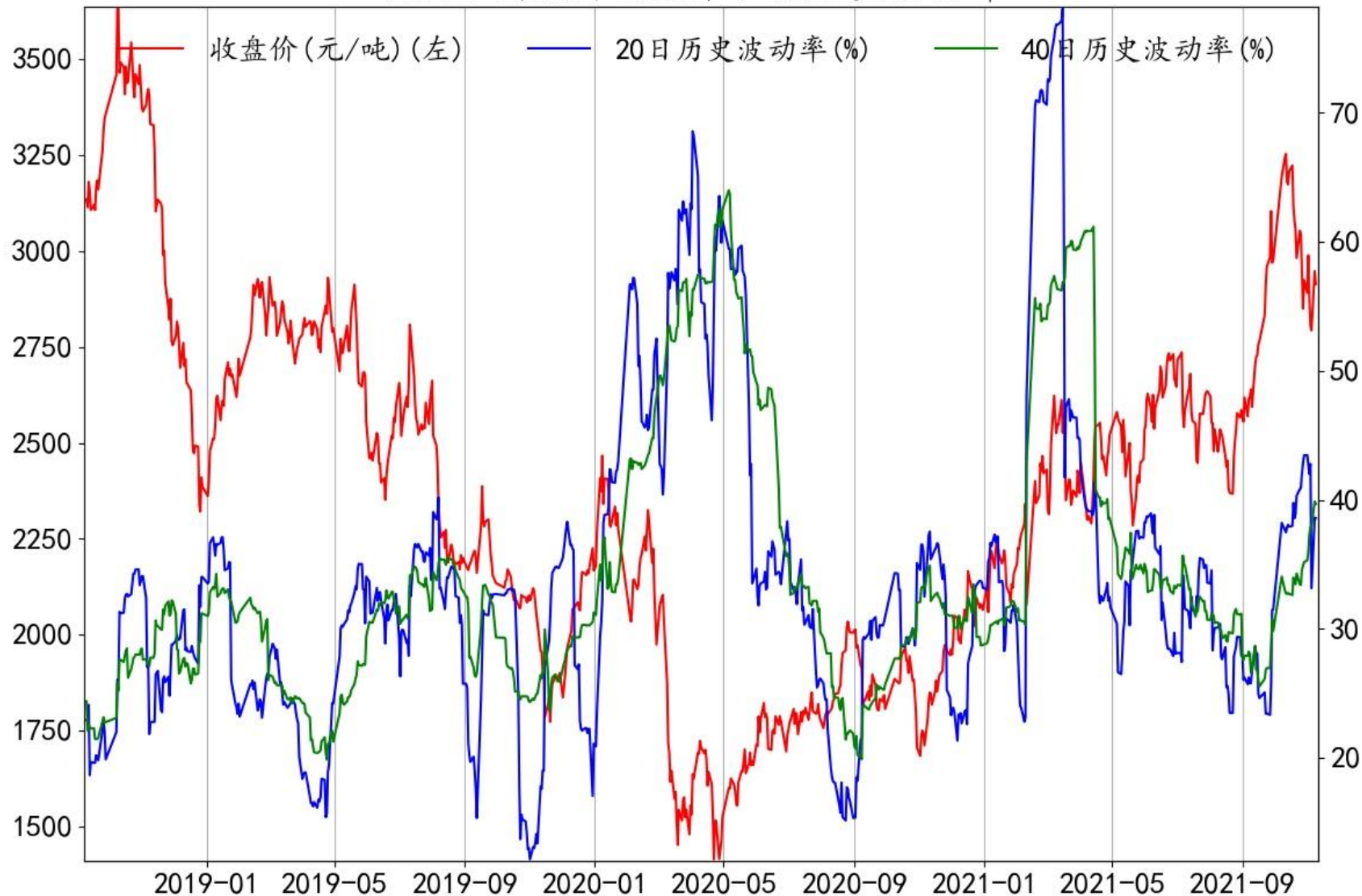
玻璃指数收盘价和历史波动率



PVC指数收盘价和历史波动率



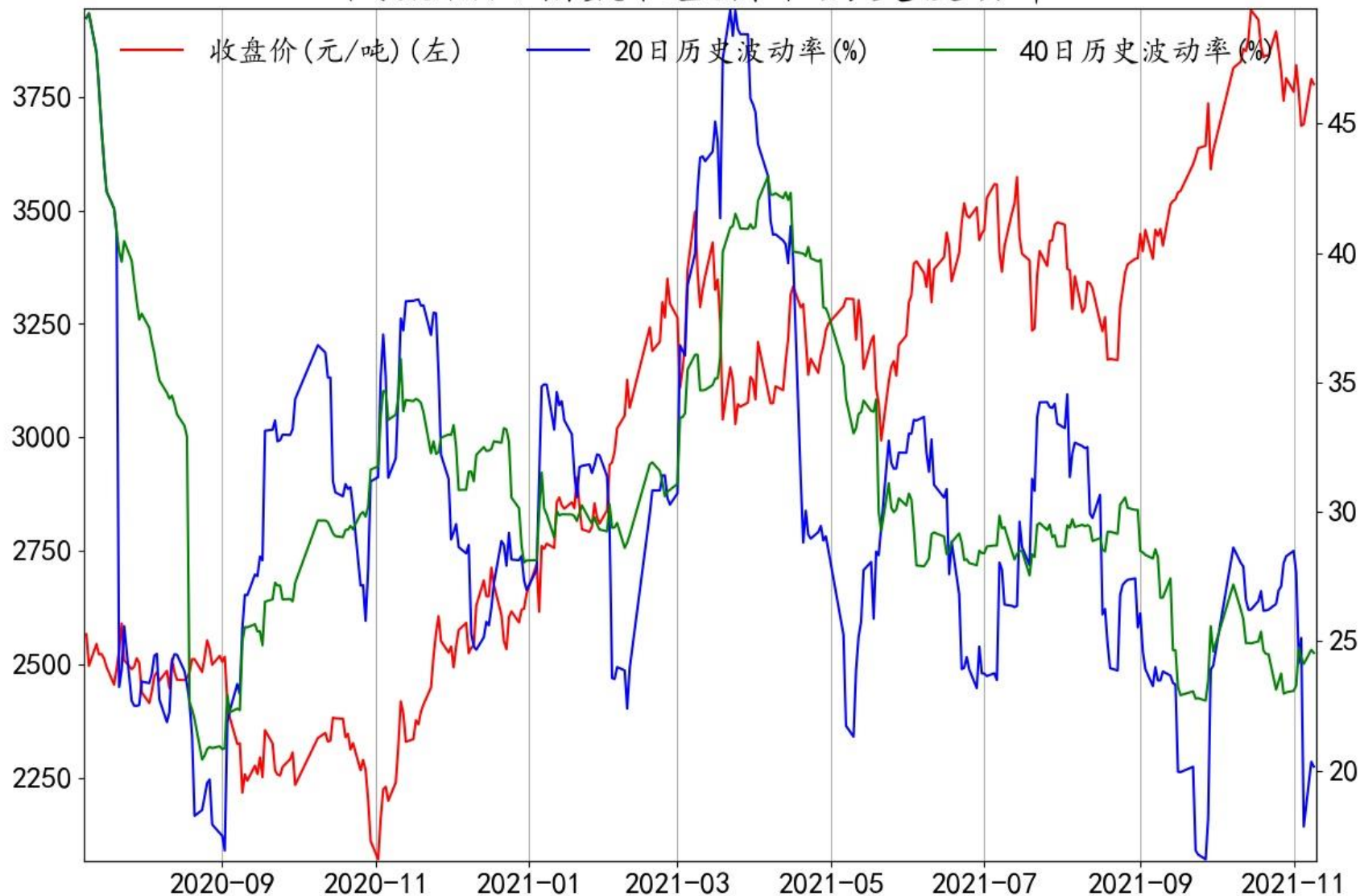
燃油指数收盘价和历史波动率



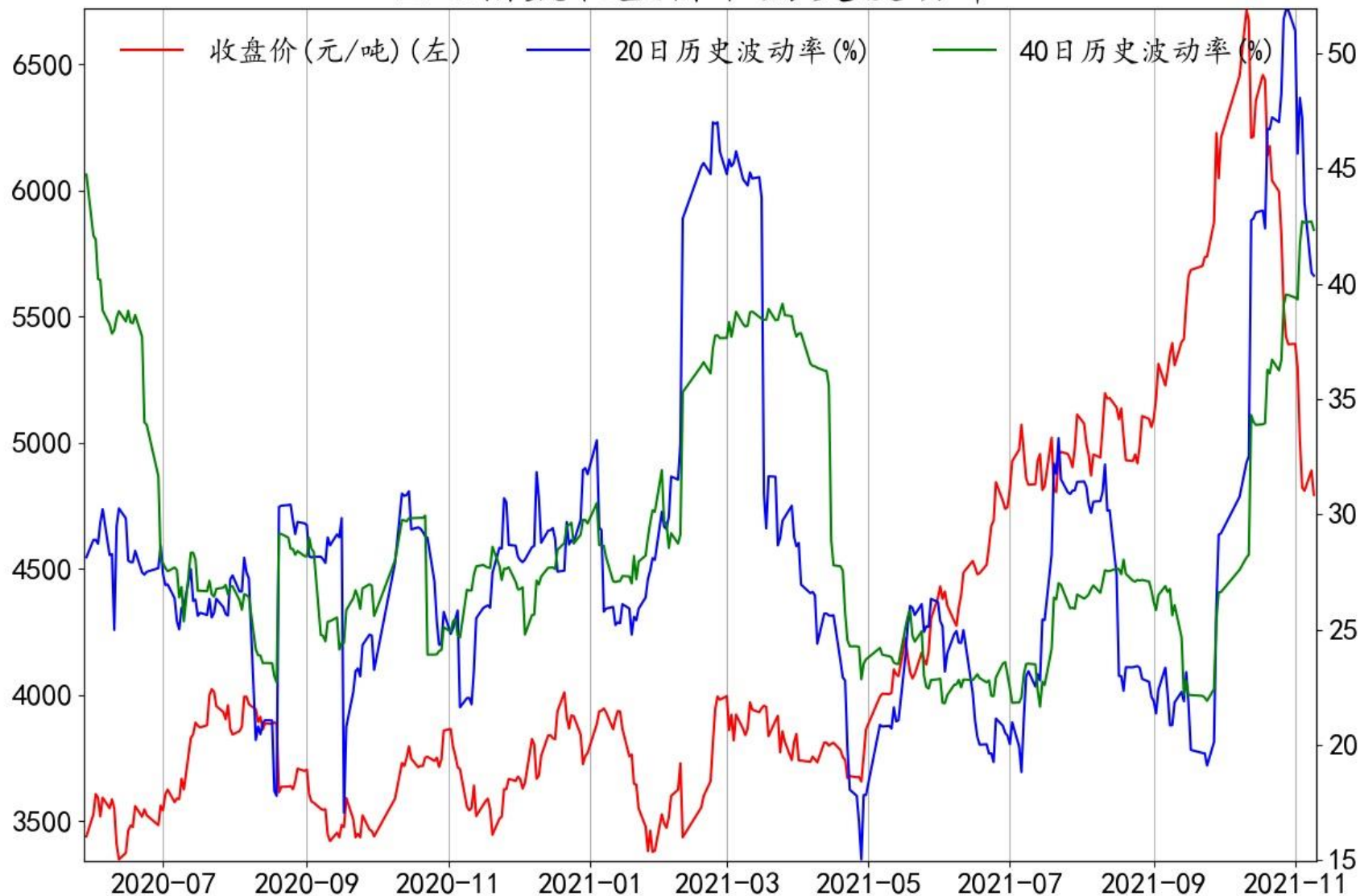
数据来源: Wind、信达期货研发中心

低硫燃油指数

低硫燃油指数收盘价和历史波动率

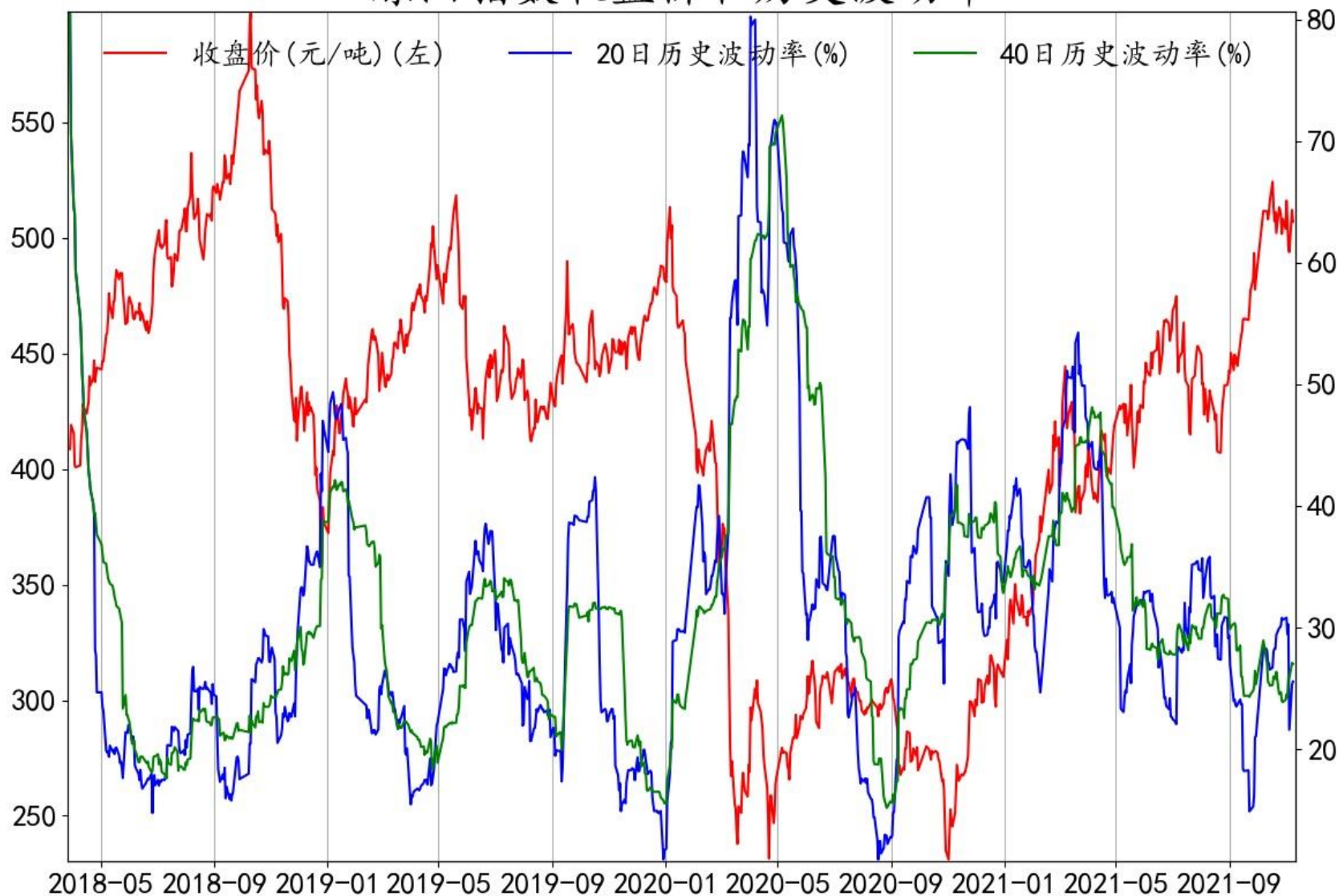


LPG指数收盘价和历史波动率



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

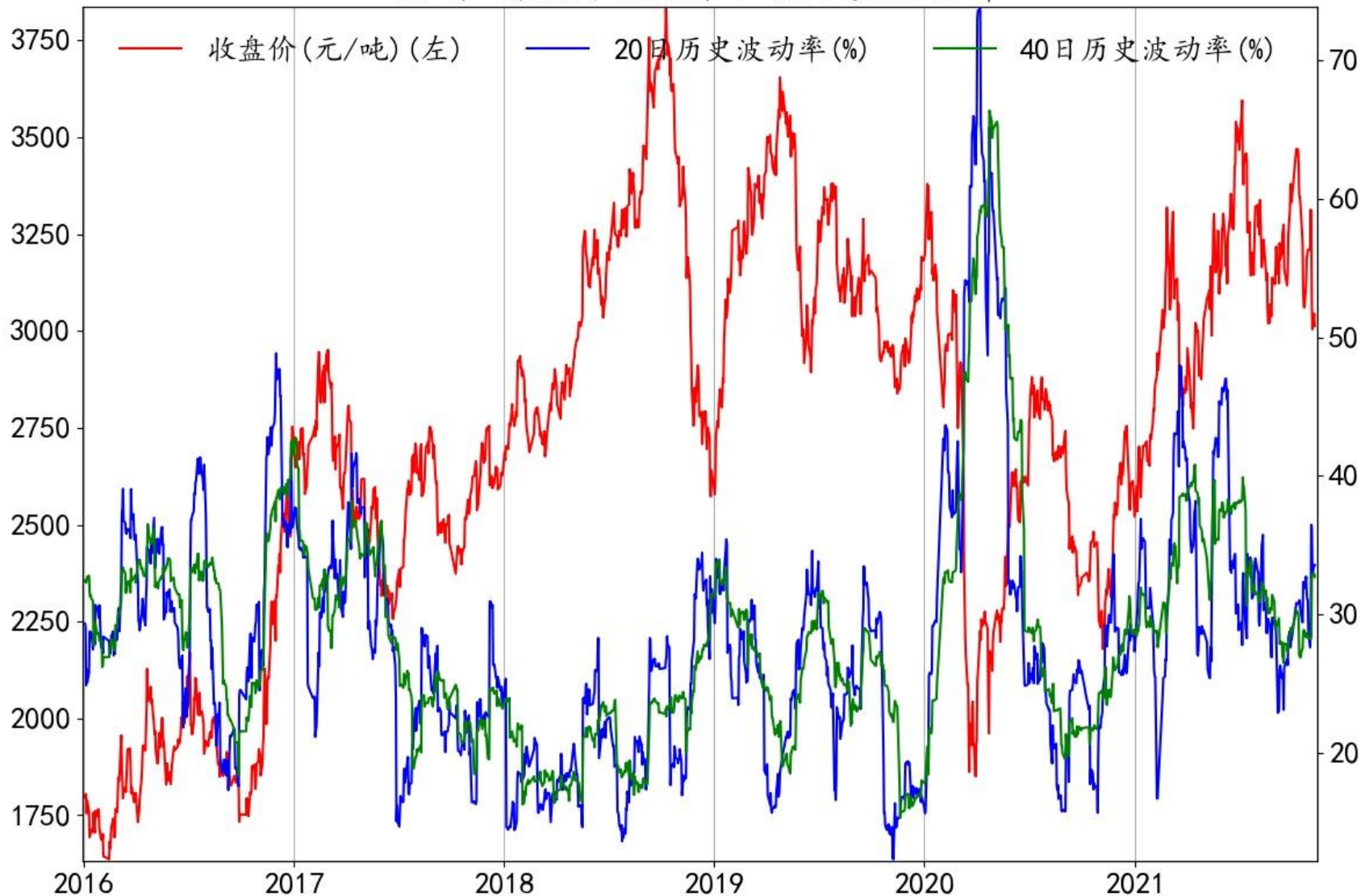


数据来源: Wind、信达期货研发中心

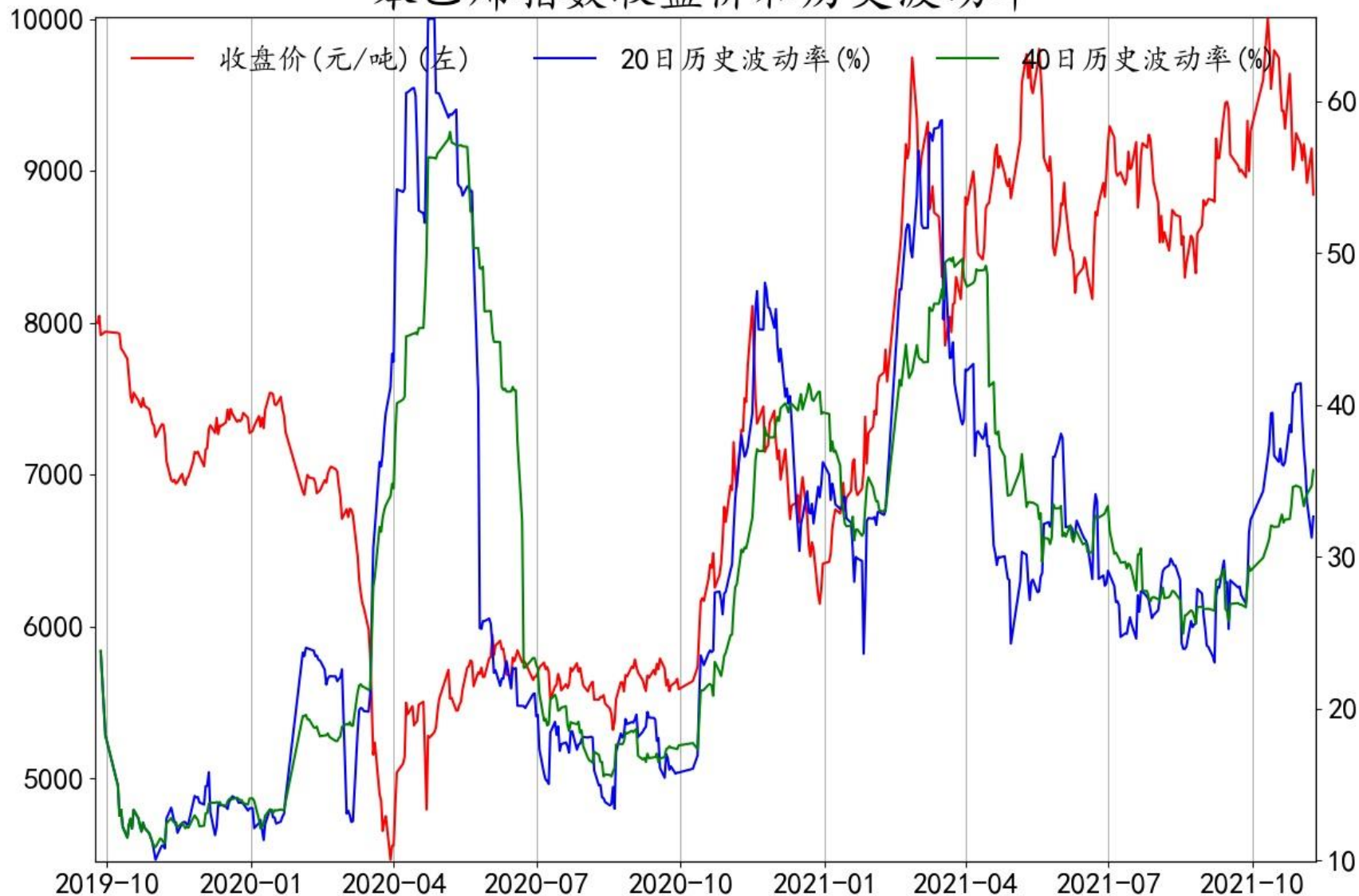
动煤指数收盘价和历史波动率



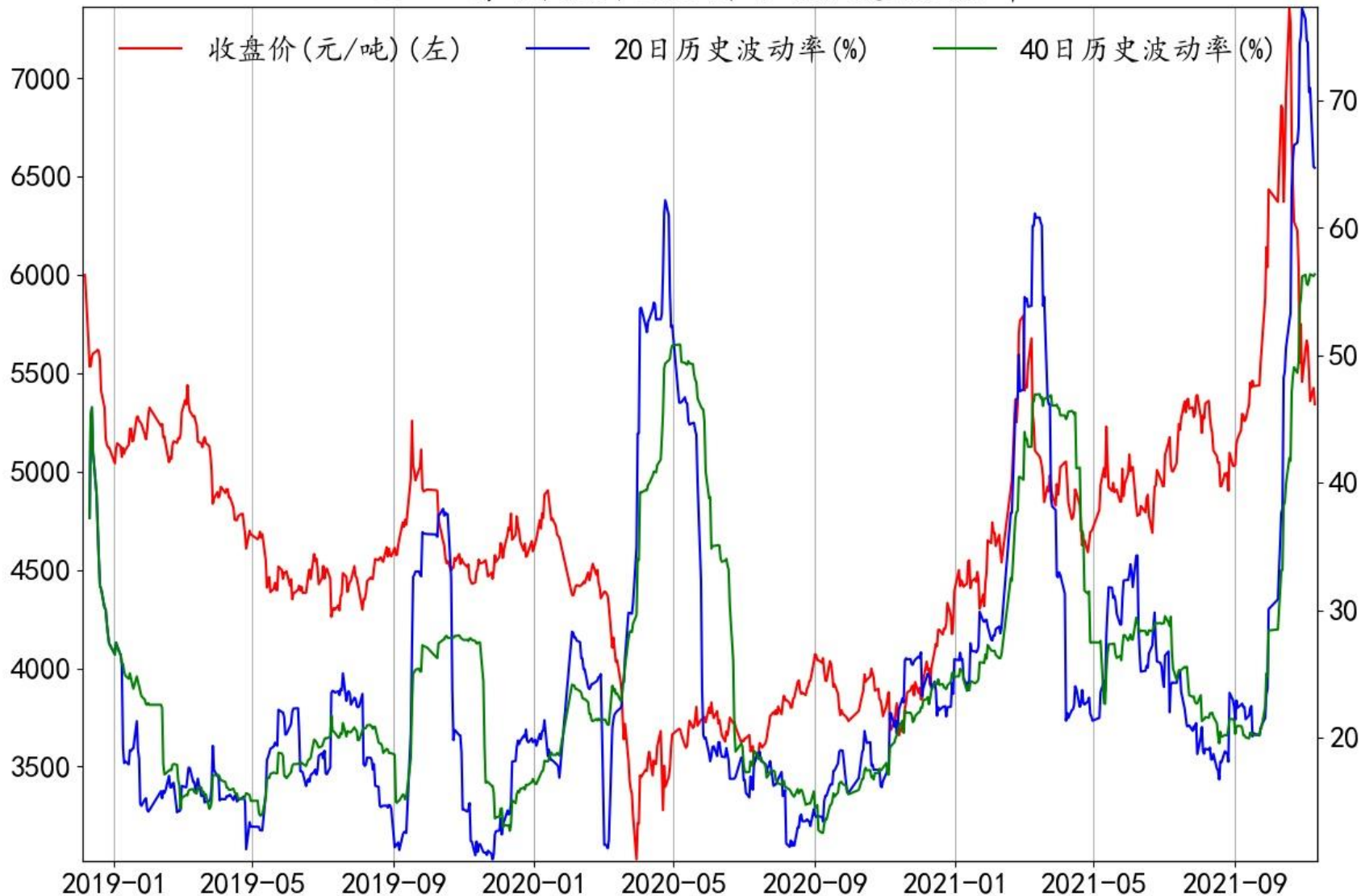
沥青指数收盘价和历史波动率



苯乙烯指数收盘价和历史波动率

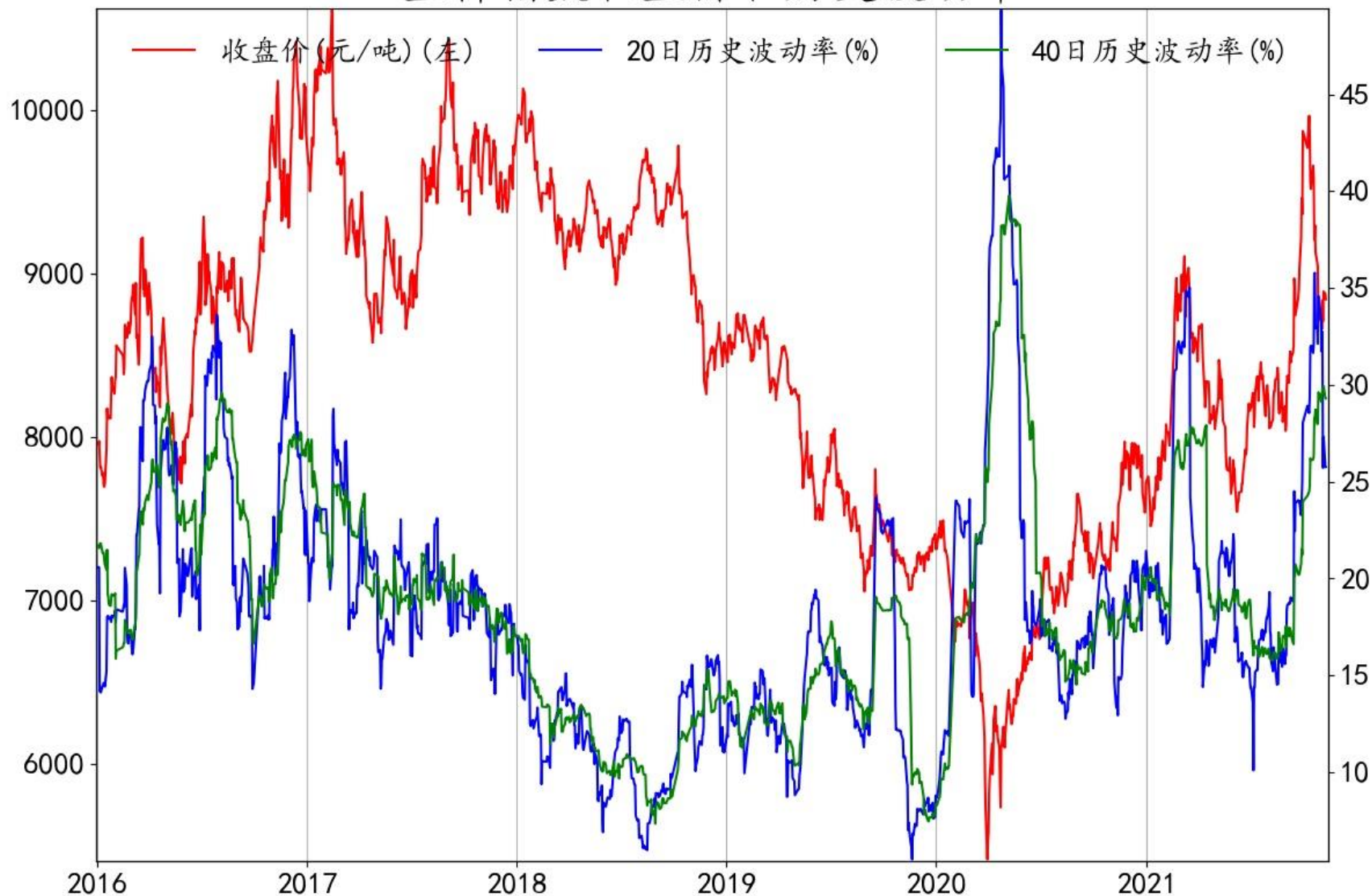


乙二醇指数收盘价和历史波动率

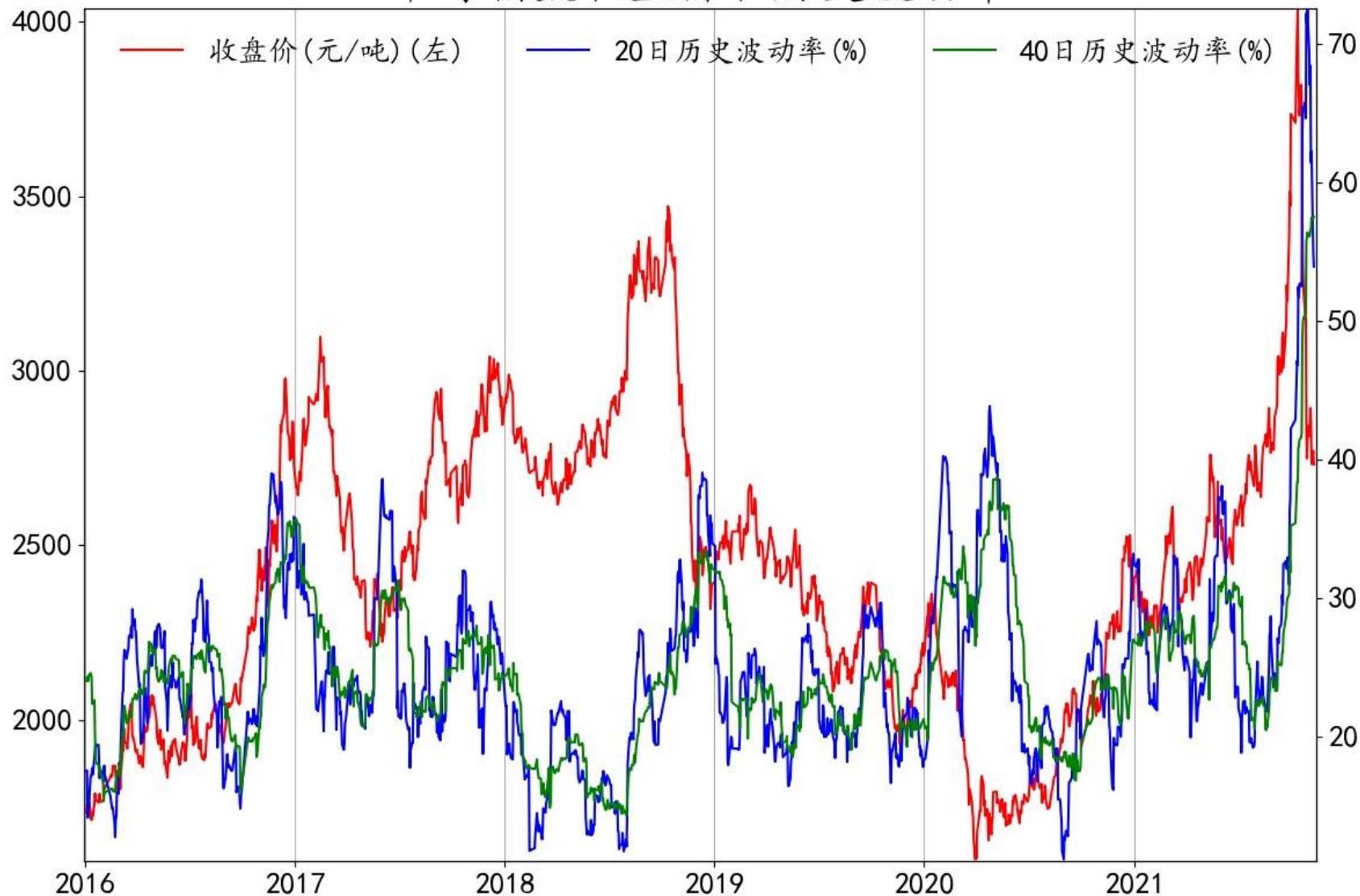


数据来源: Wind、信达期货研发中心

塑料指数收盘价和历史波动率

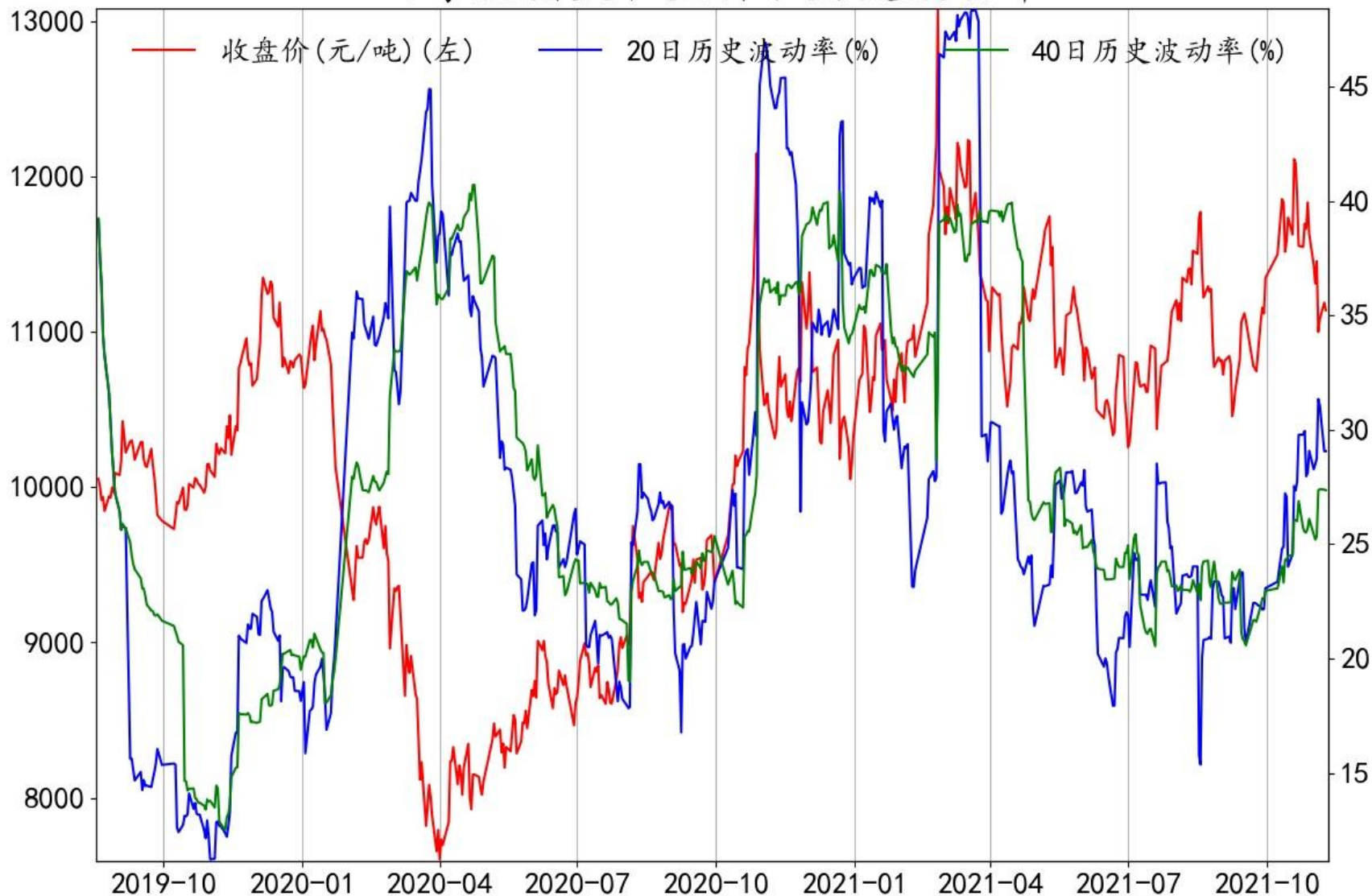


甲醇指数收盘价和历史波动率



20号胶指数

20号胶指数收盘价和历史波动率

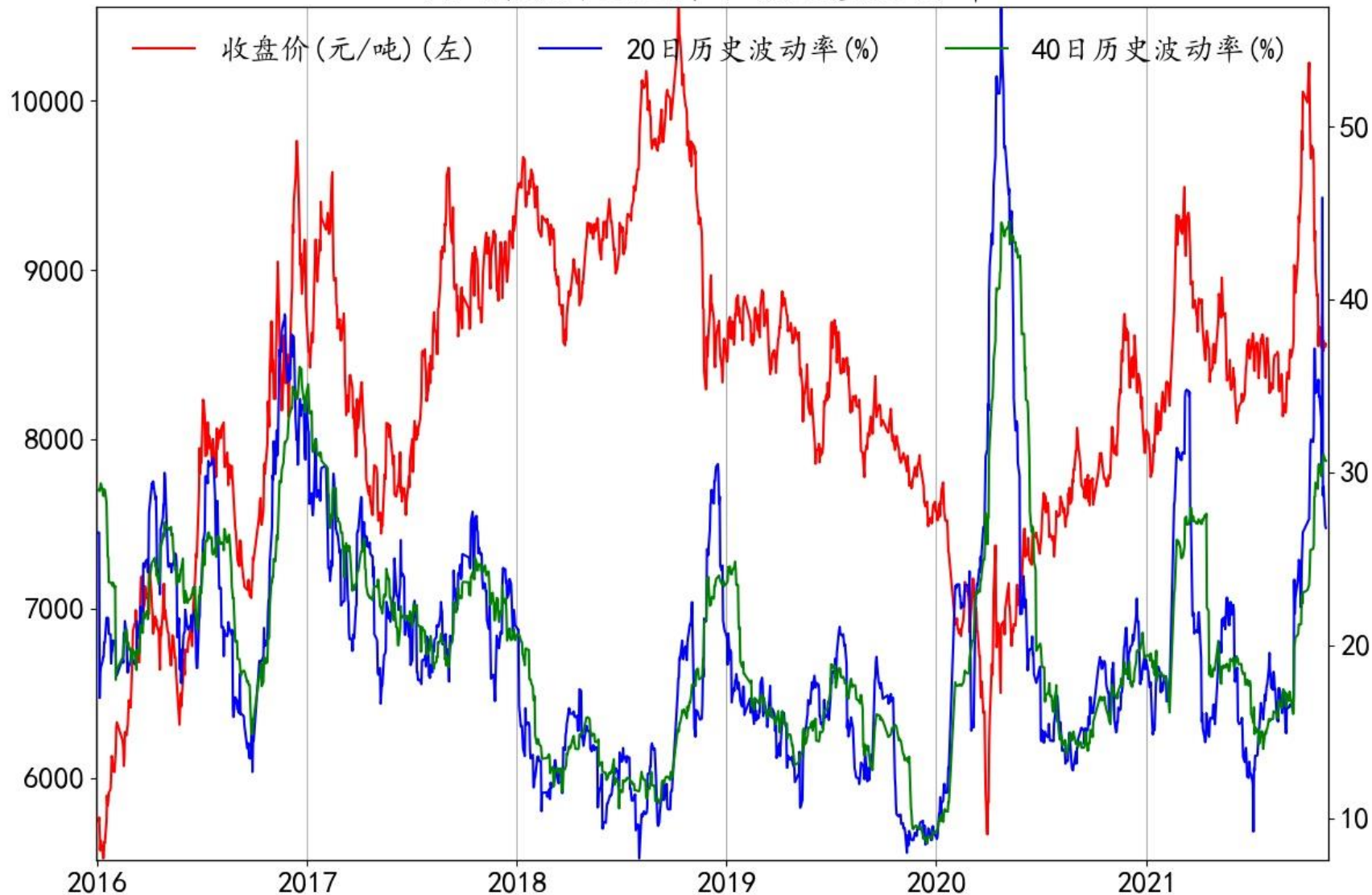


数据来源: Wind、信达期货研发中心

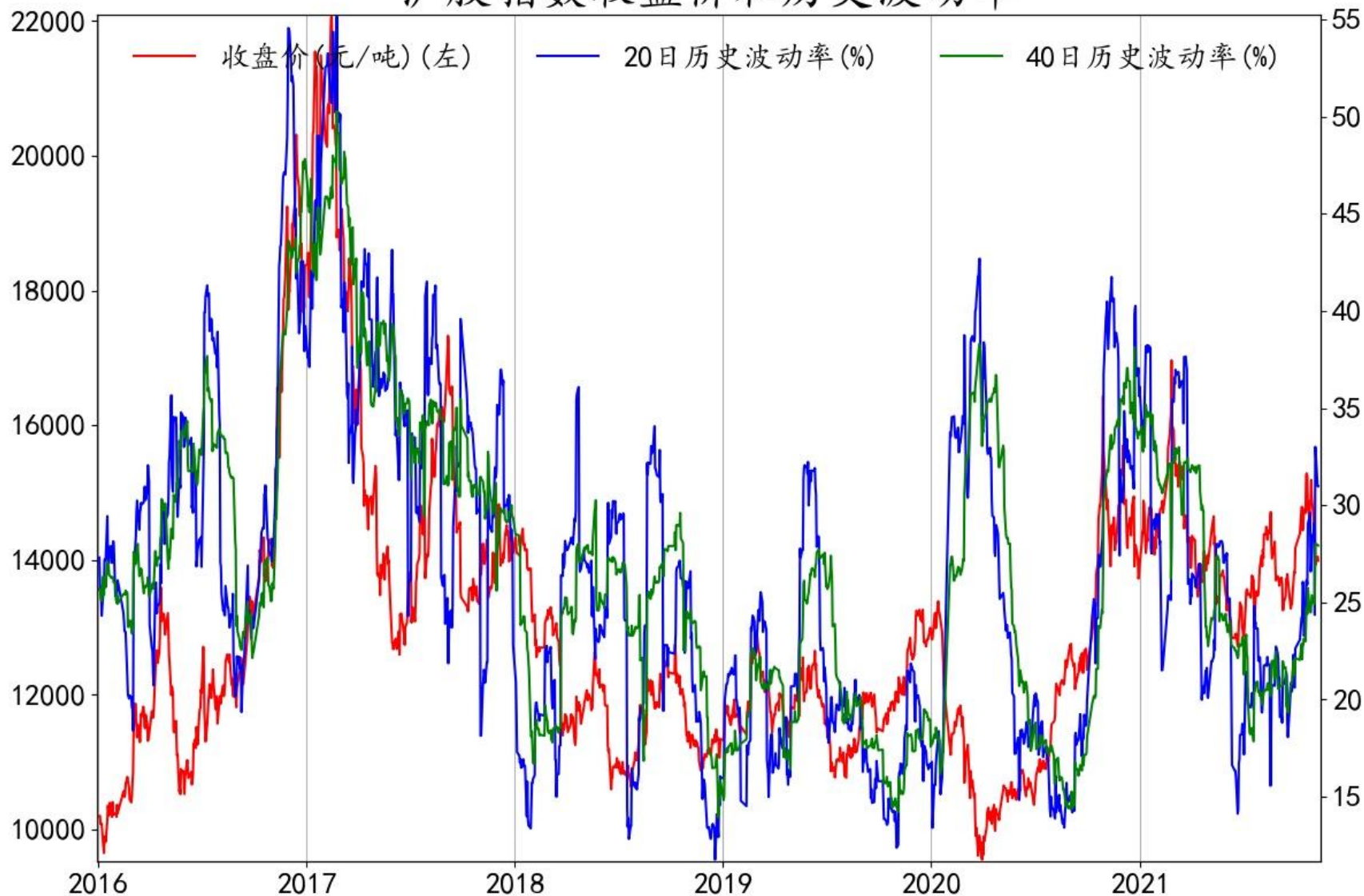
短纤指数收盘价和历史波动率



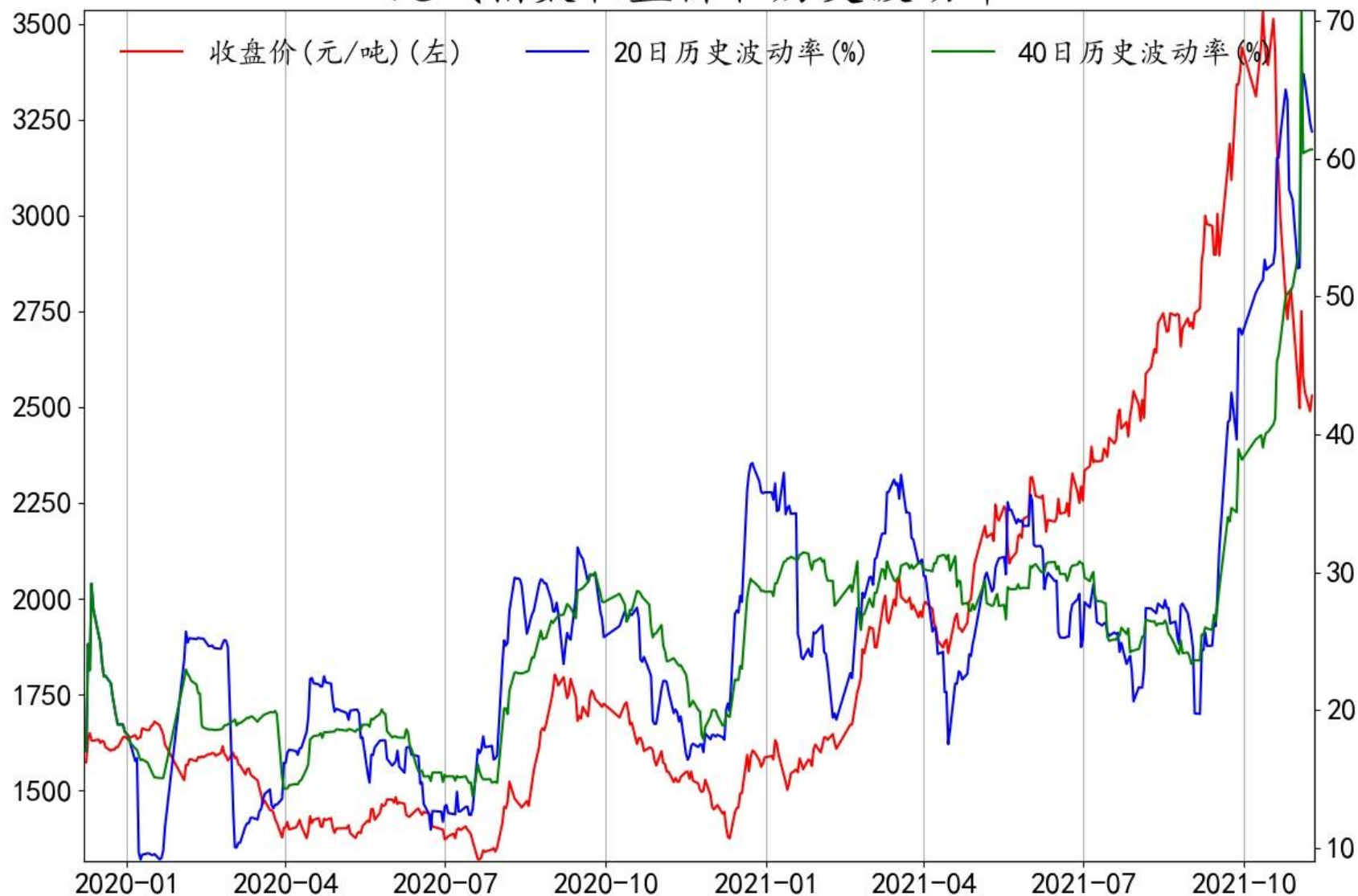
PP指数收盘价和历史波动率



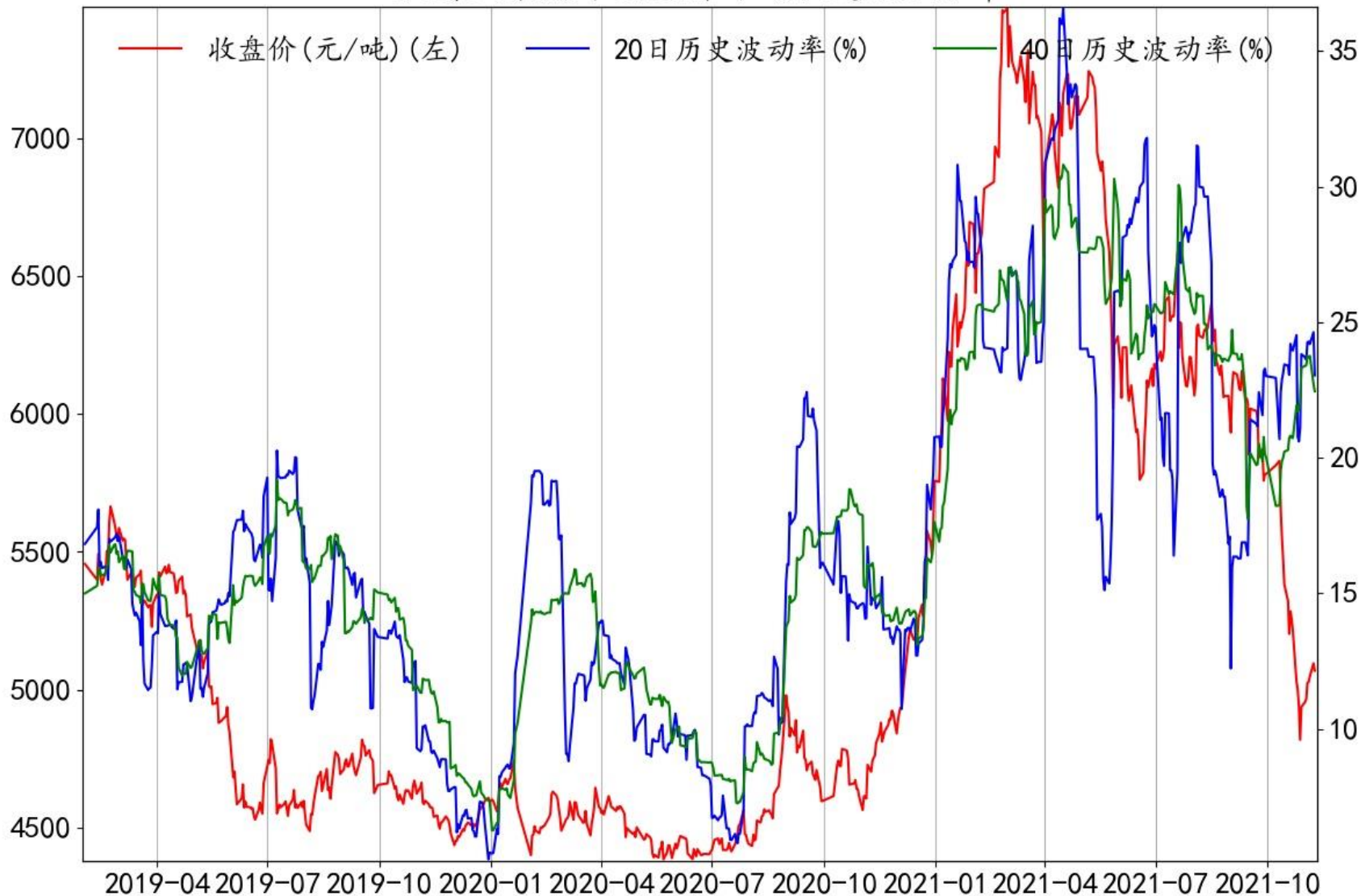
沪胶指数收盘价和历史波动率



纯碱指数收盘价和历史波动率

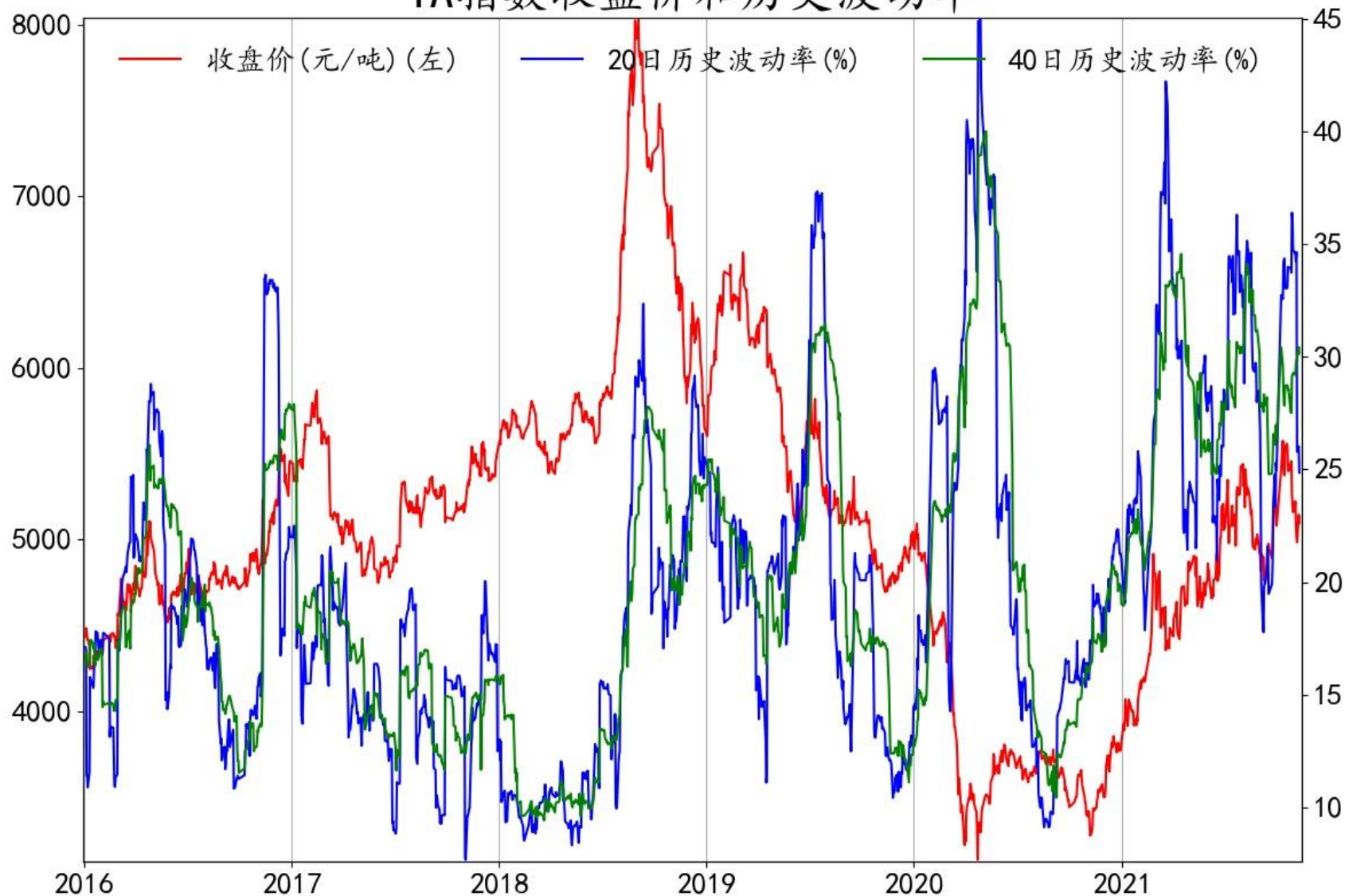


纸浆指数收盘价和历史波动率



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

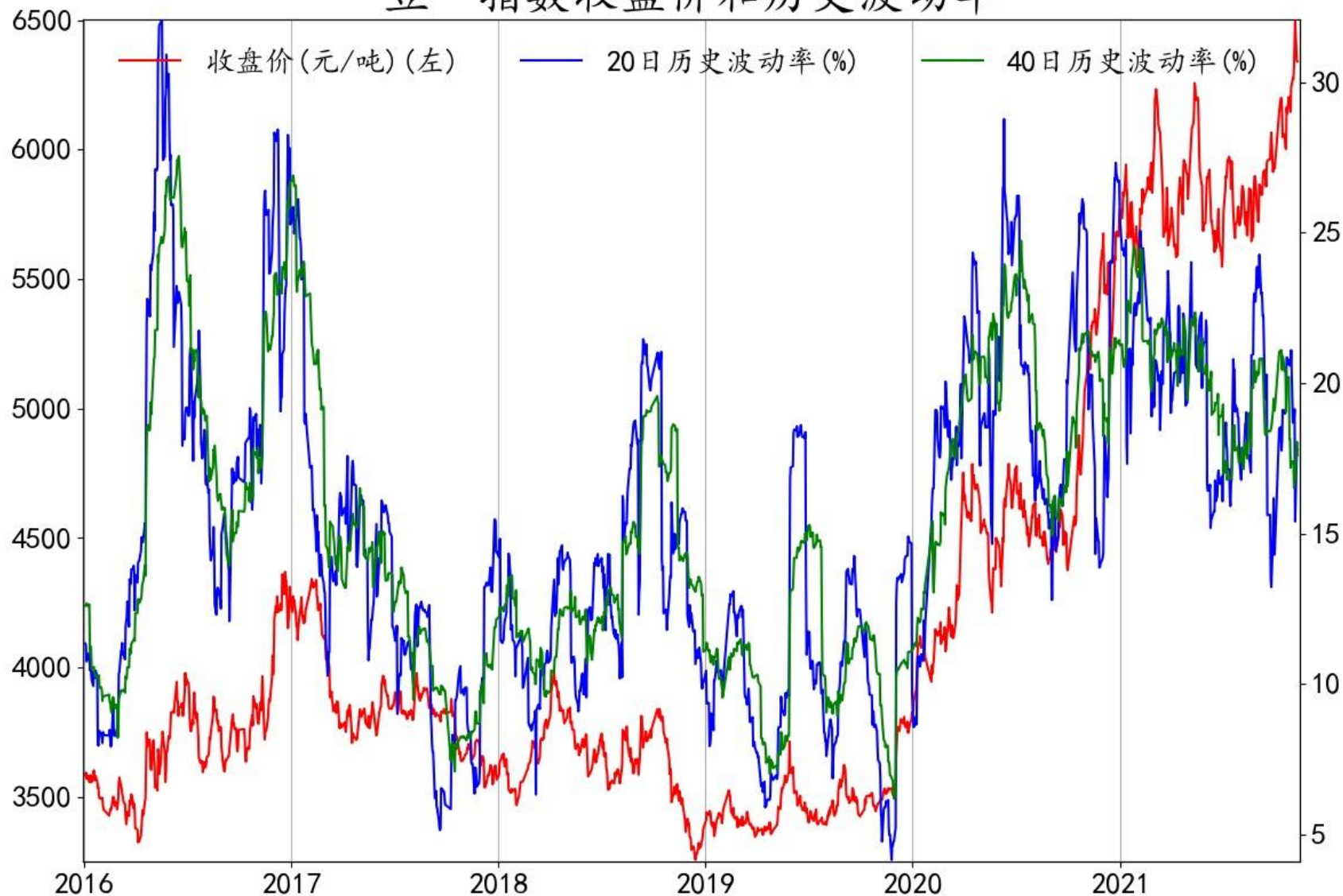


数据来源: Wind、信达期货研发中心

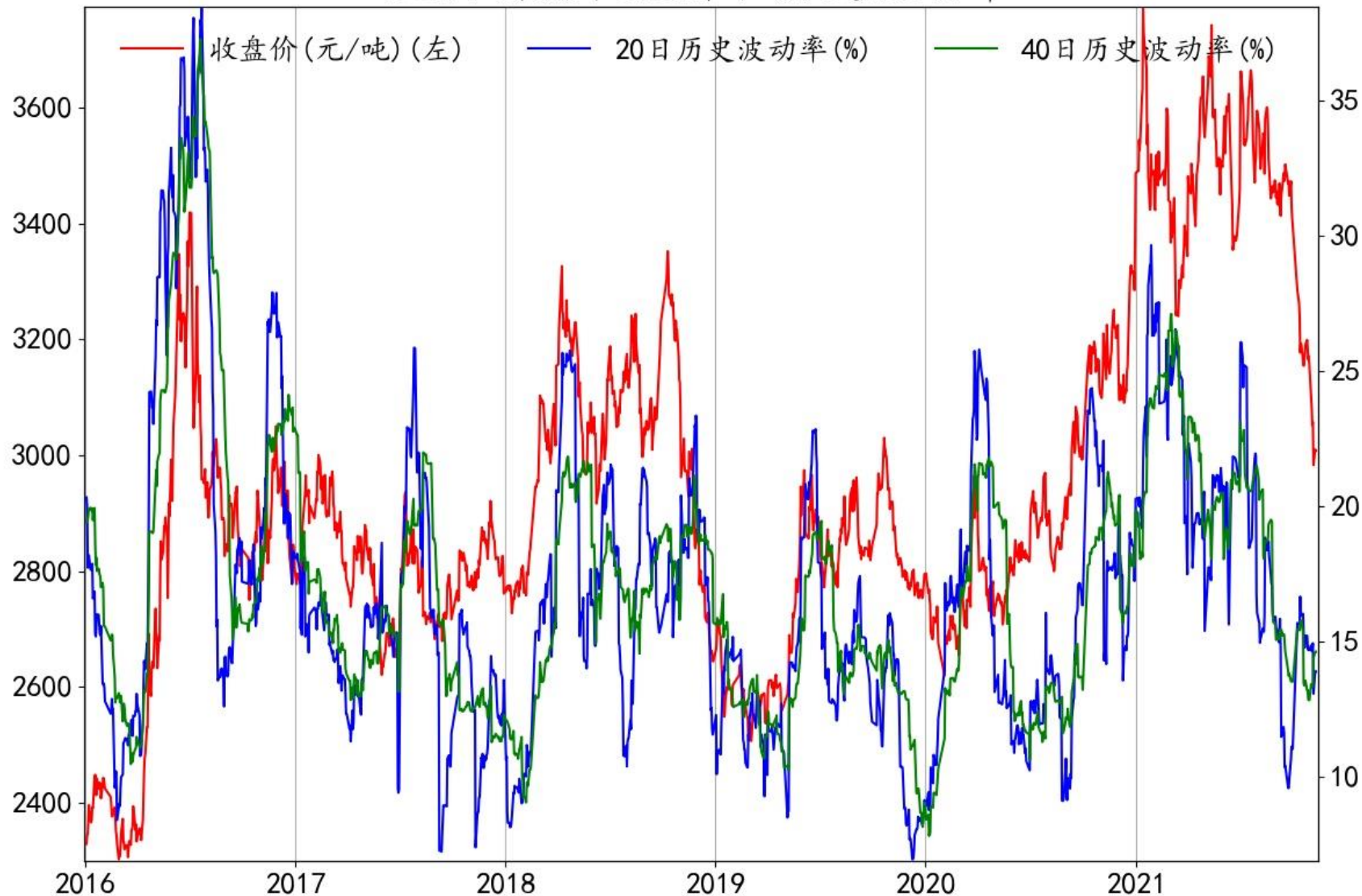
玉米指数收盘价和历史波动率



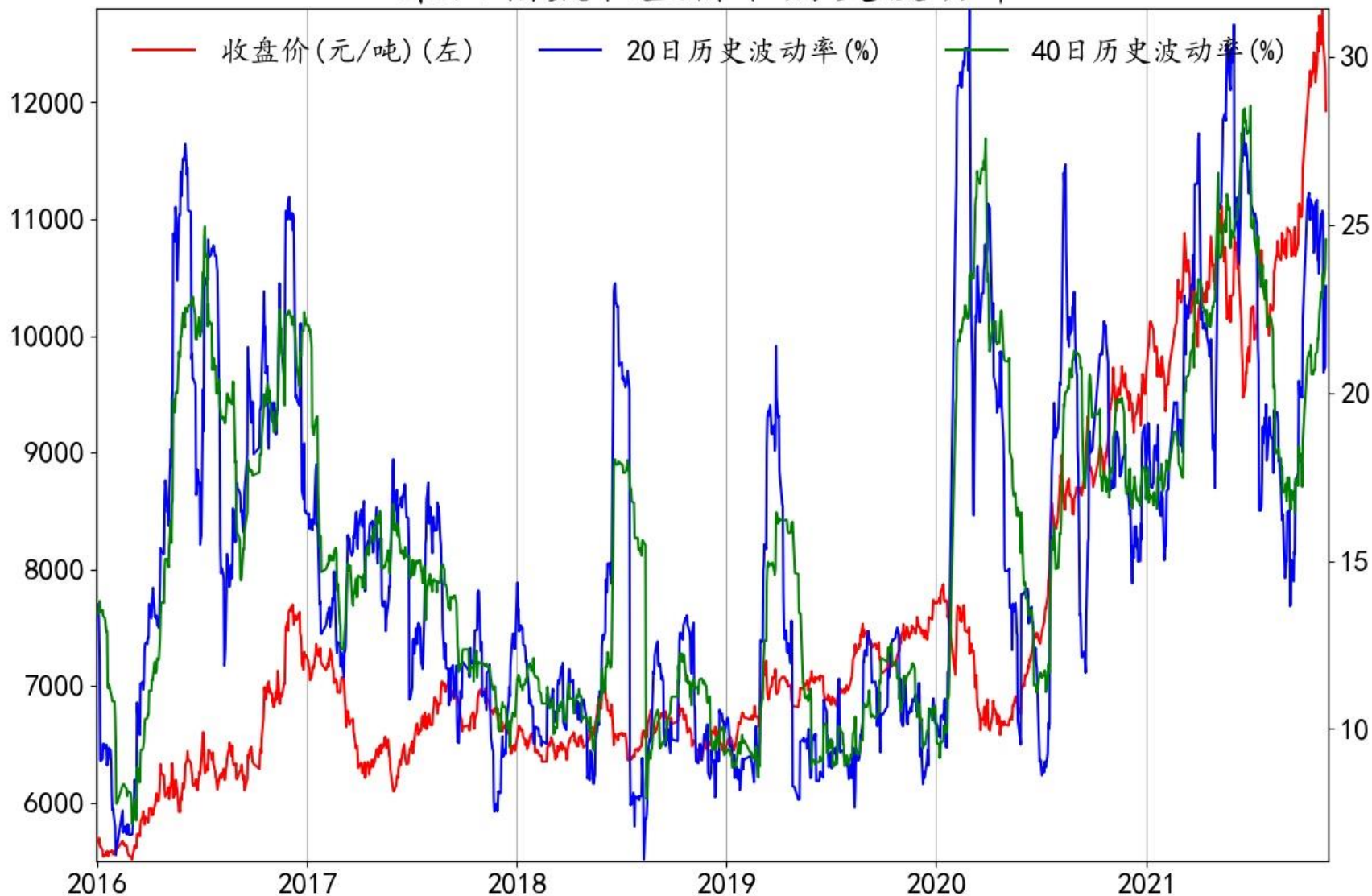
豆一指数收盘价和历史波动率



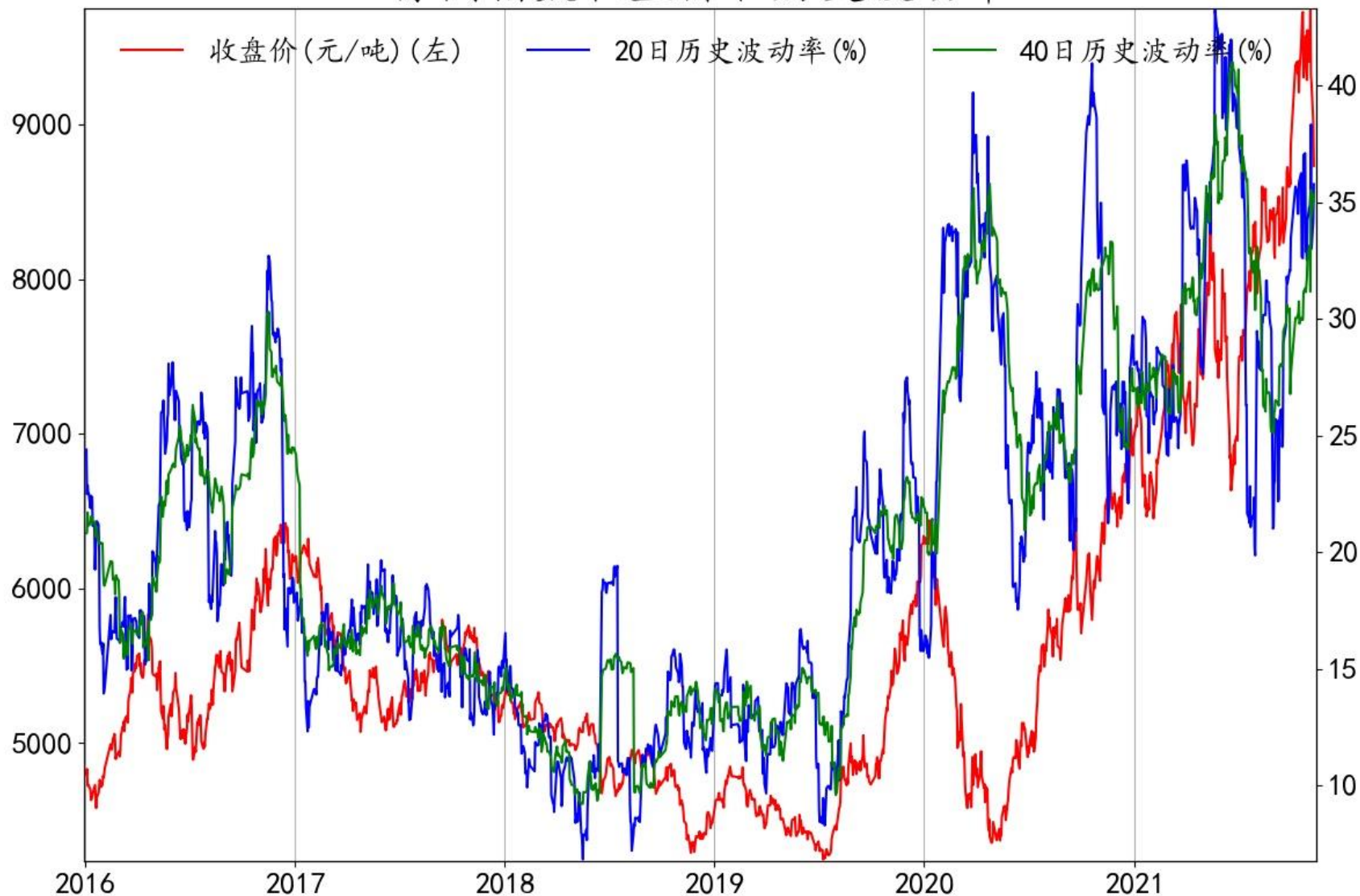
豆粕指数收盘价和历史波动率



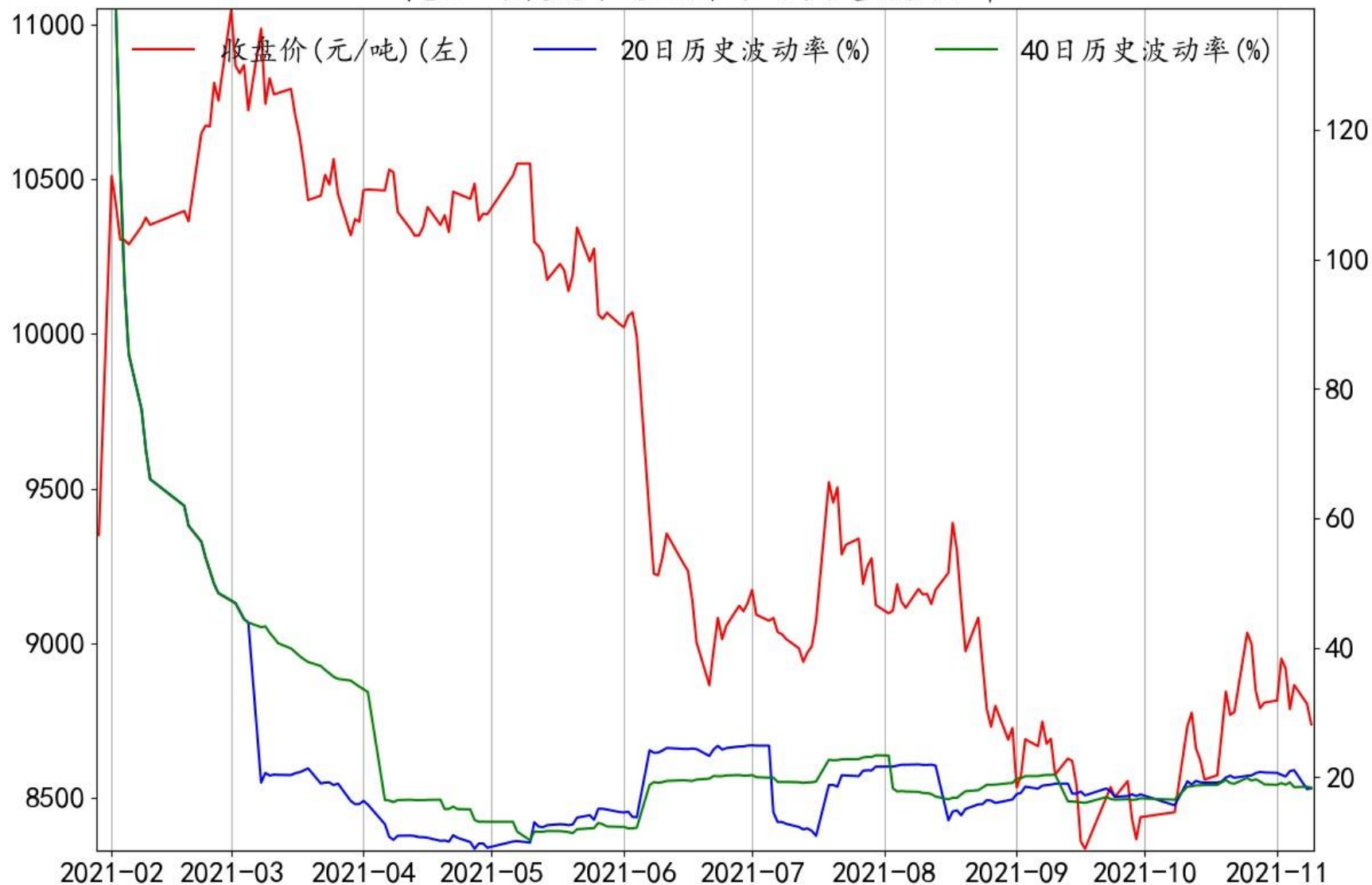
菜油指数收盘价和历史波动率



棕榈指数收盘价和历史波动率

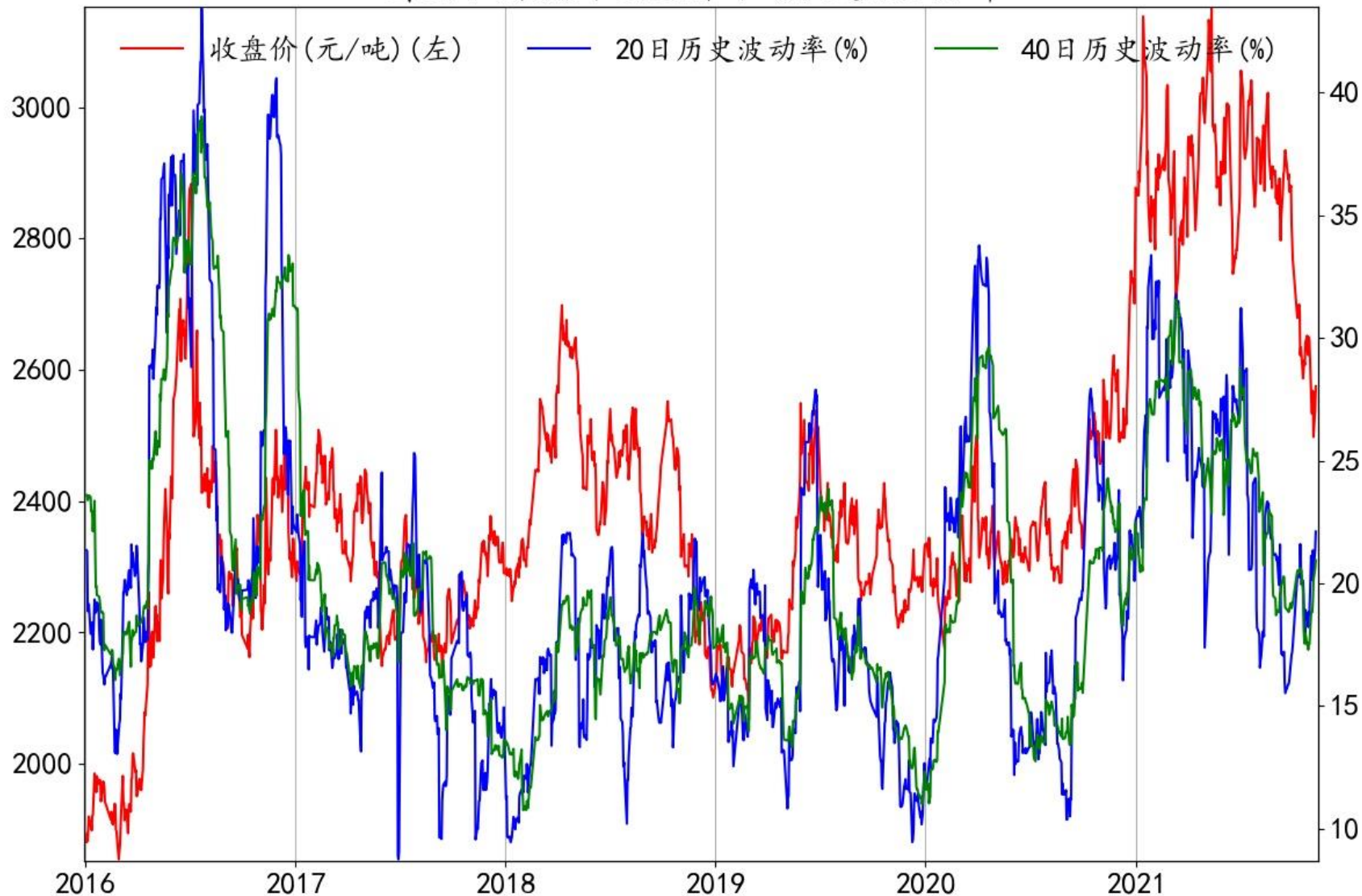


花生指数收盘价和历史波动率

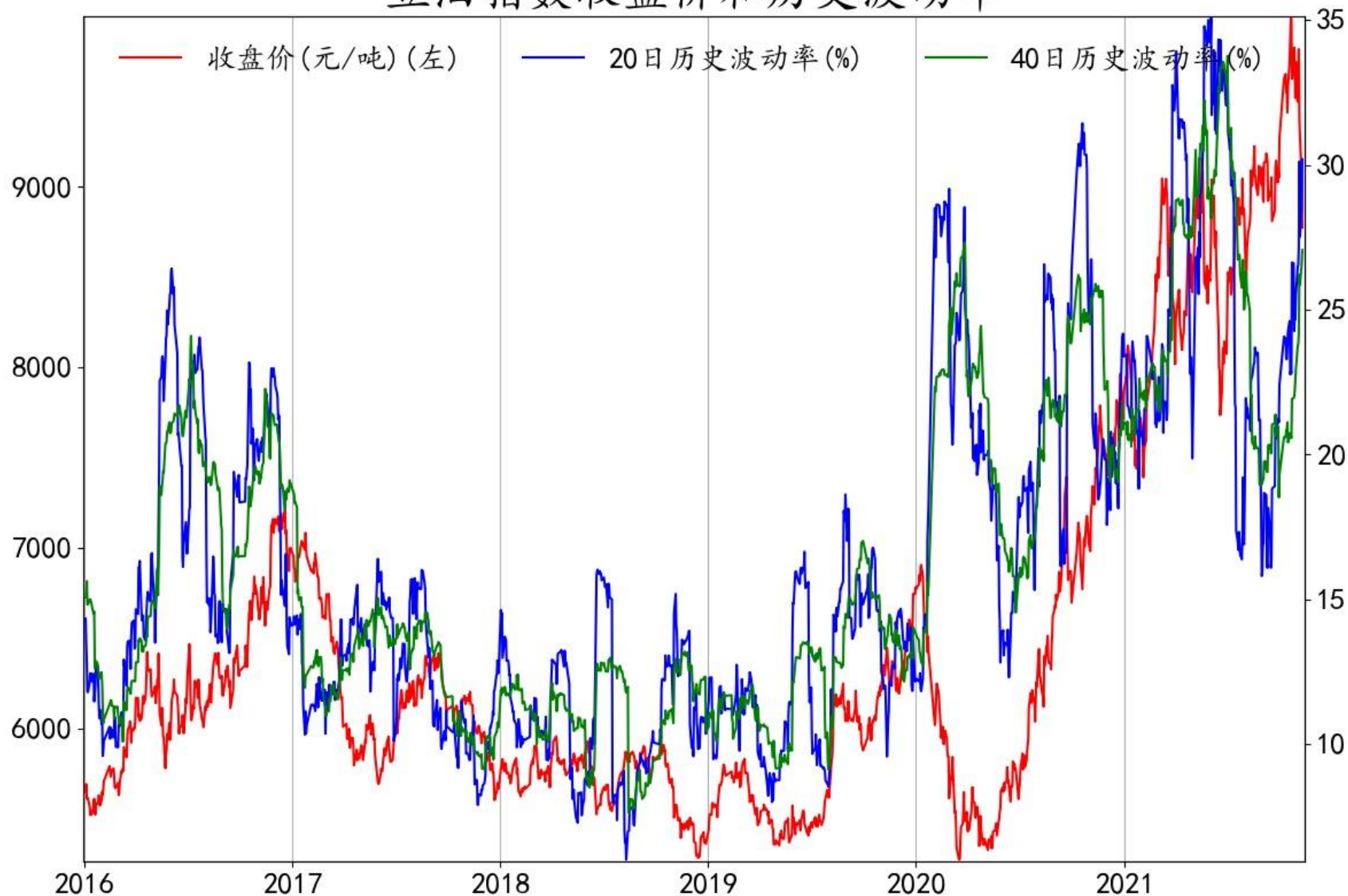


数据来源: Wind、信达期货研发中心

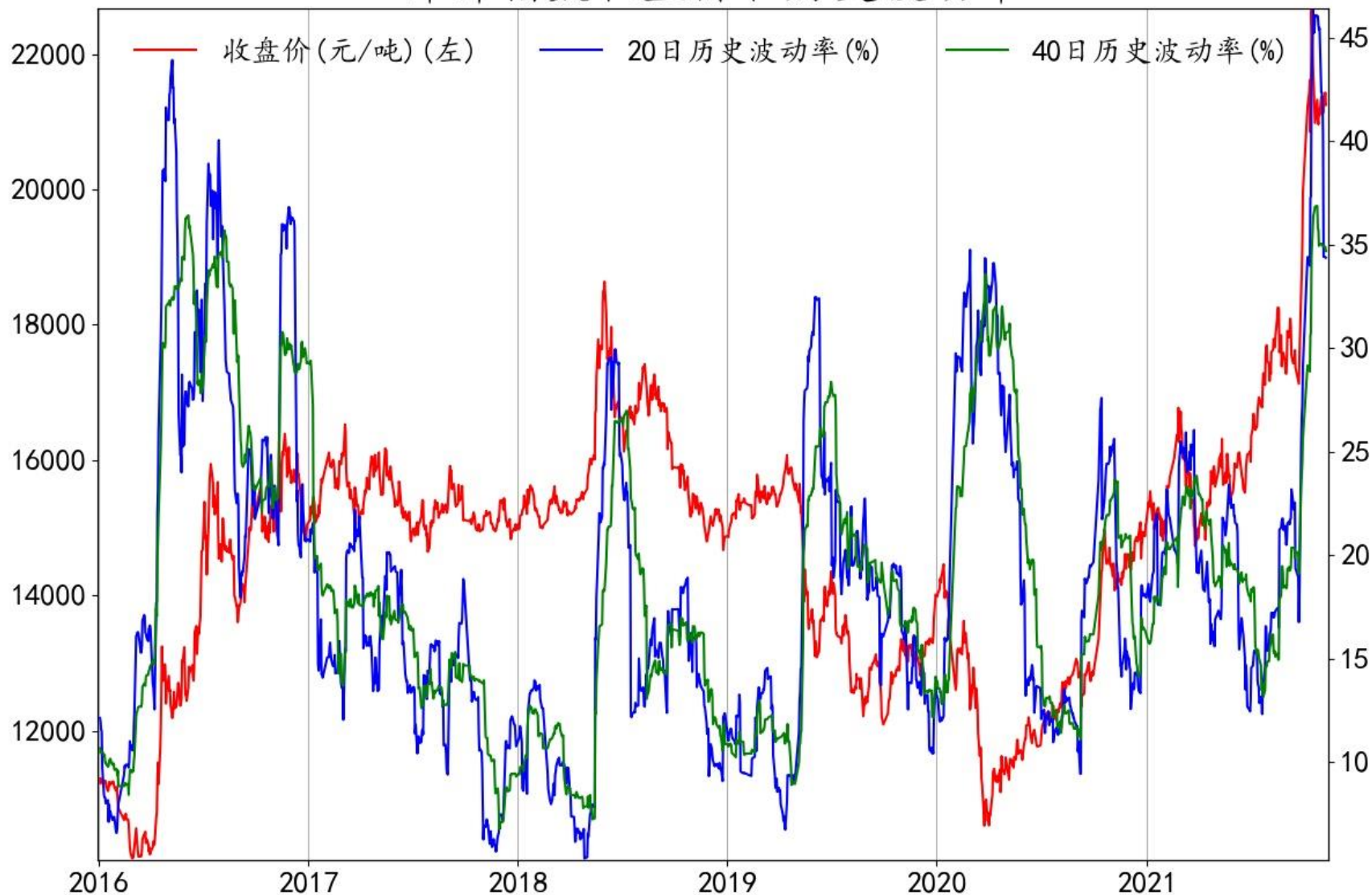
菜粕指数收盘价和历史波动率



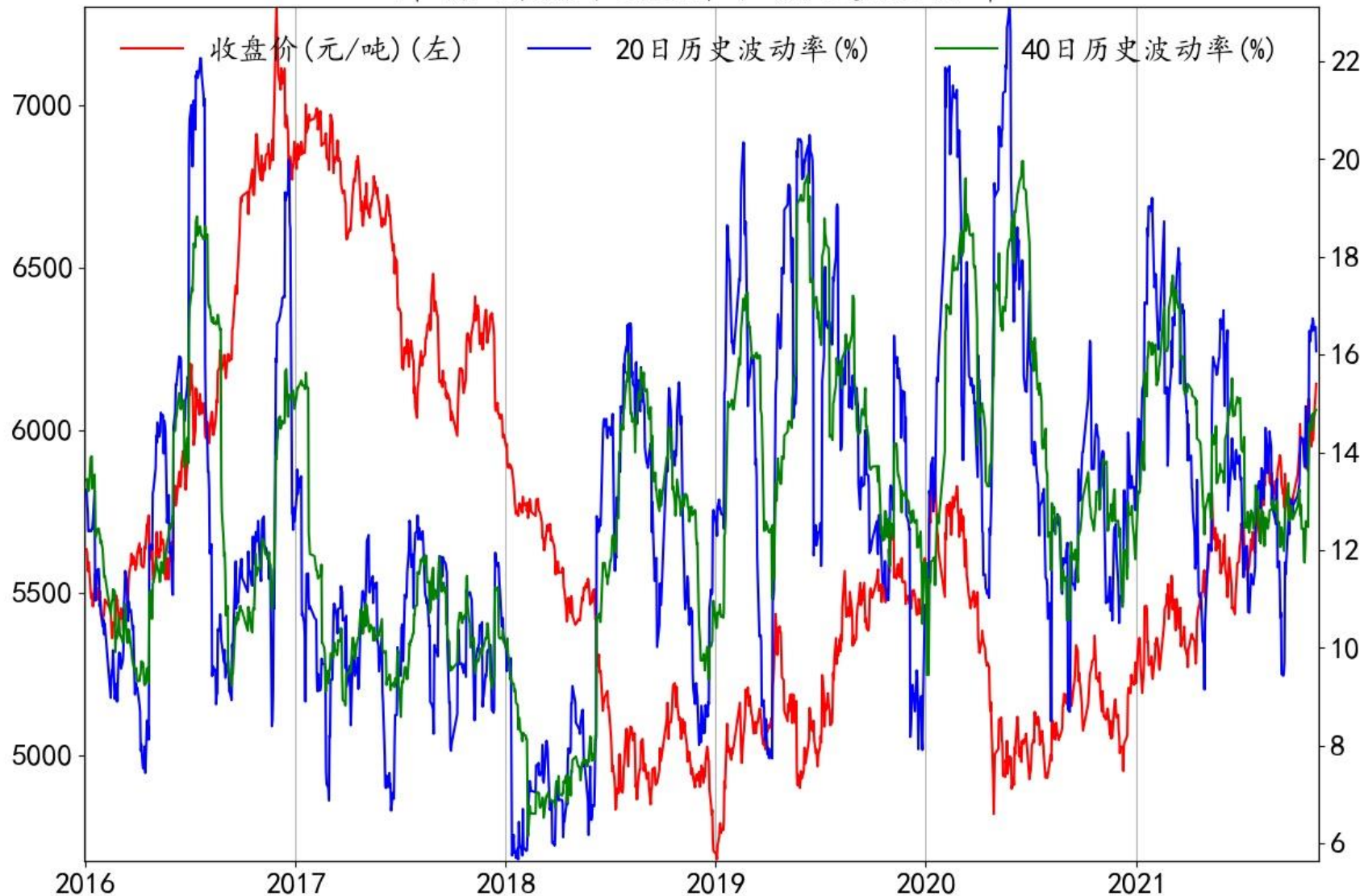
豆油指数收盘价和历史波动率



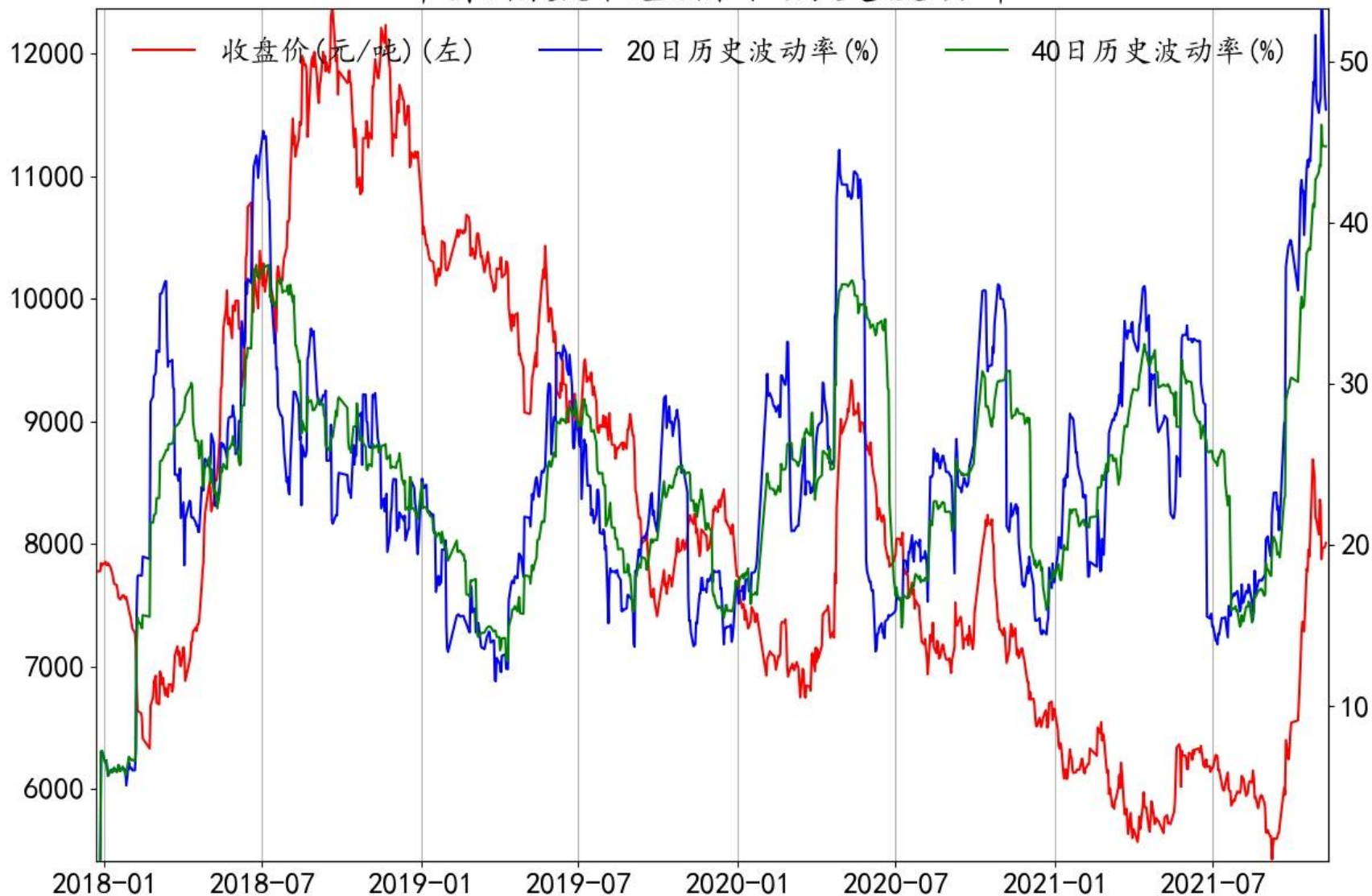
郑棉指数收盘价和历史波动率



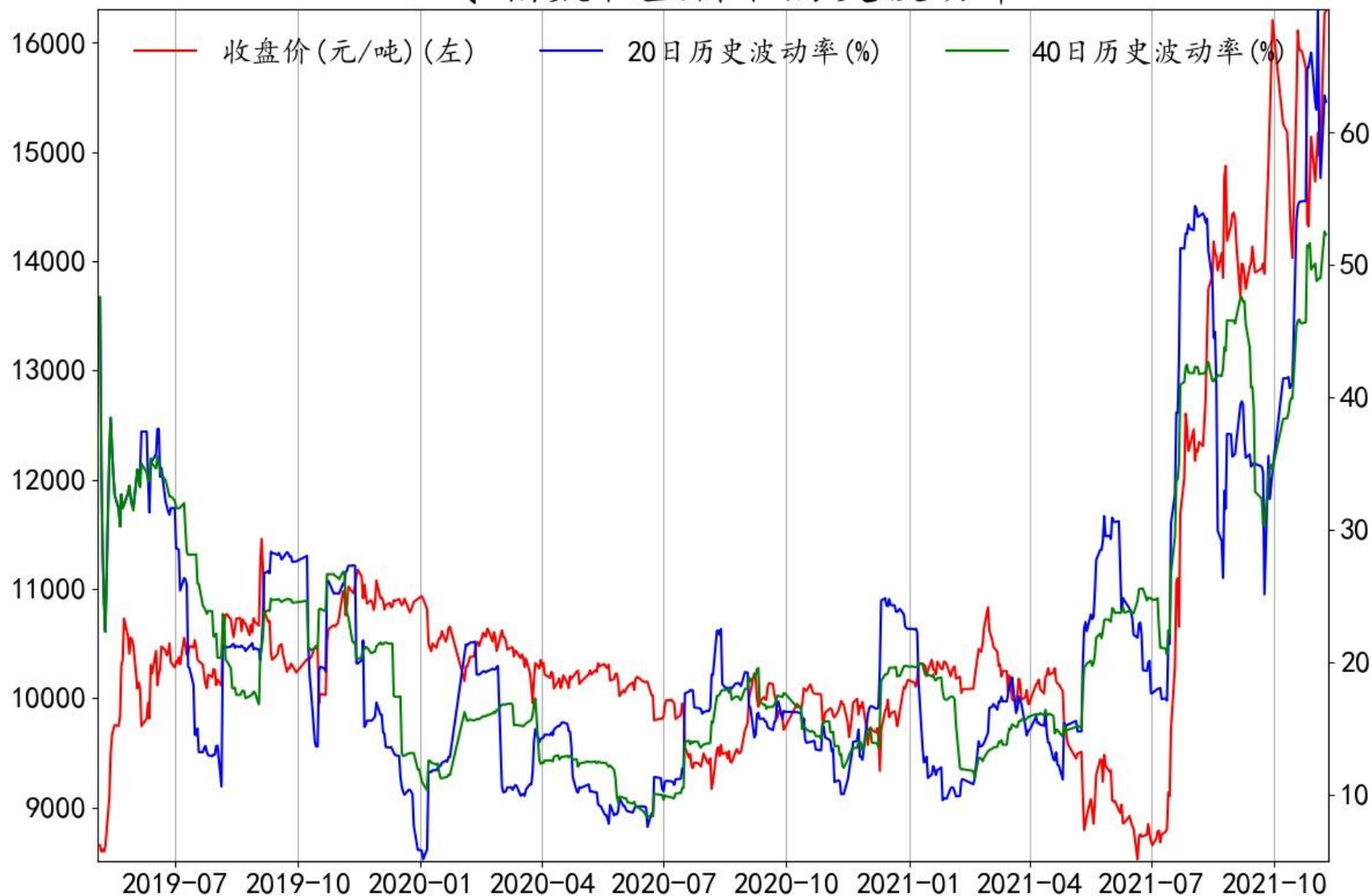
郑糖指数收盘价和历史波动率



苹果指数收盘价和历史波动率

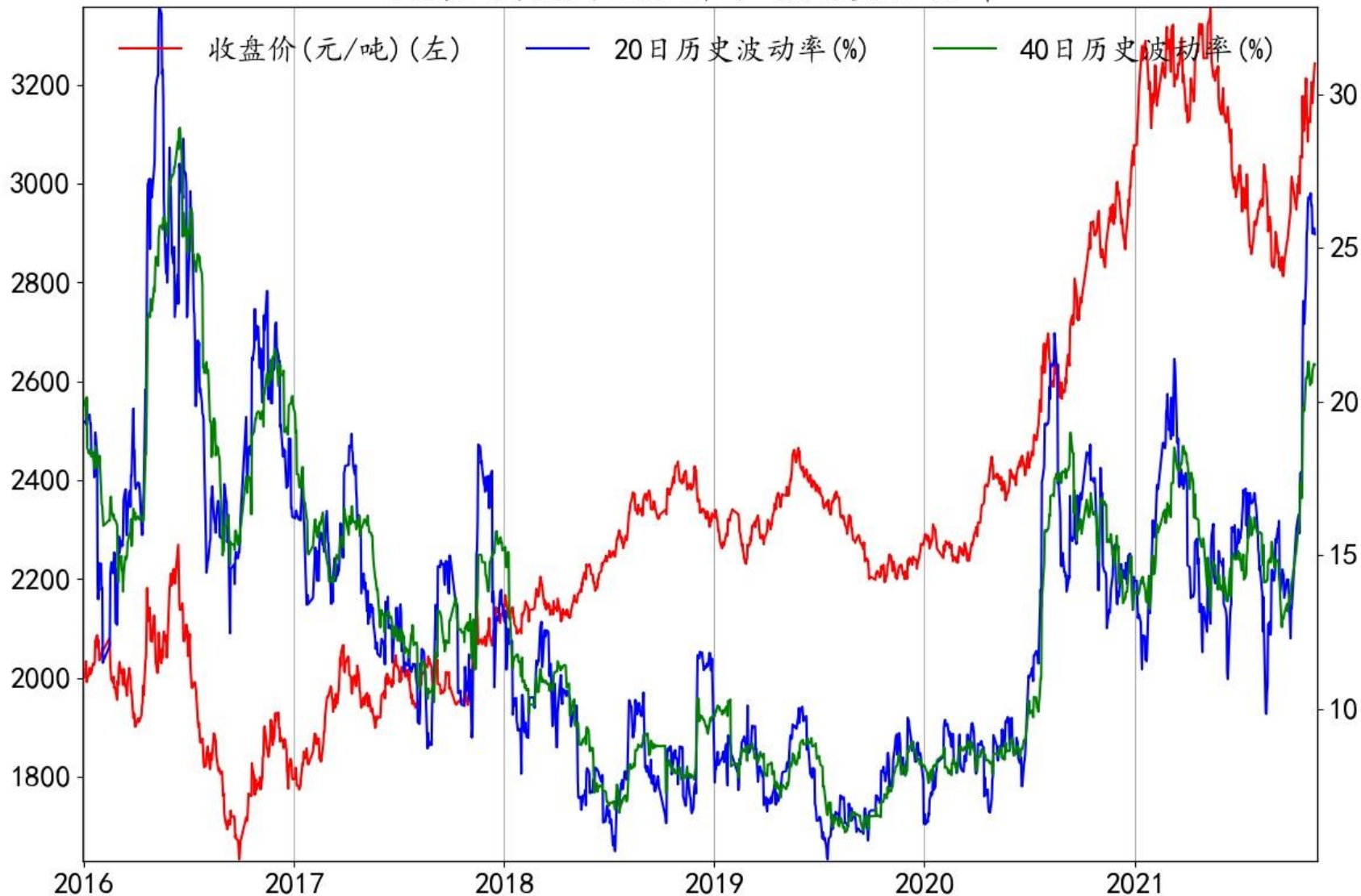


红枣指数收盘价和历史波动率

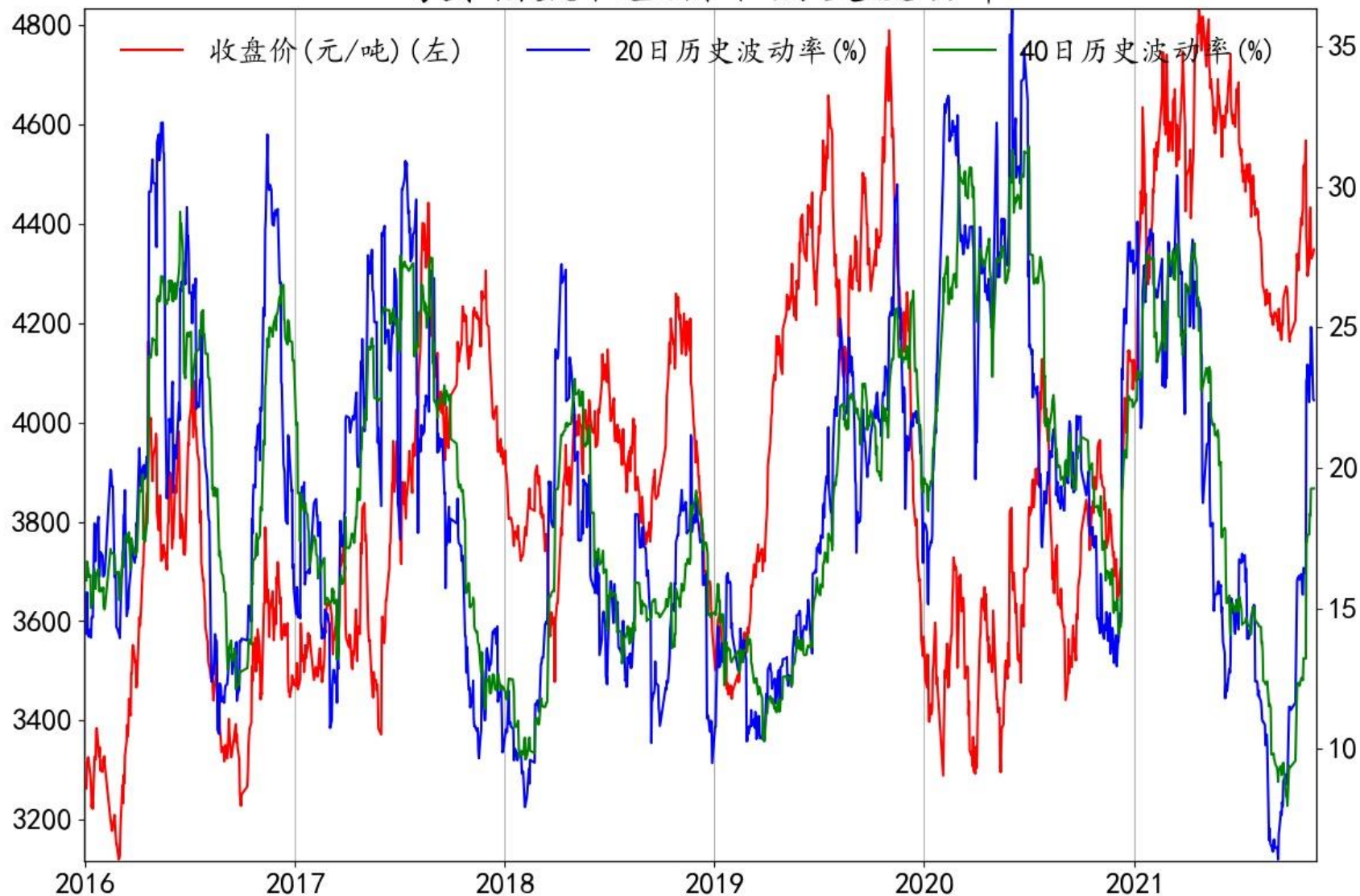


数据来源: Wind、信达期货研发中心

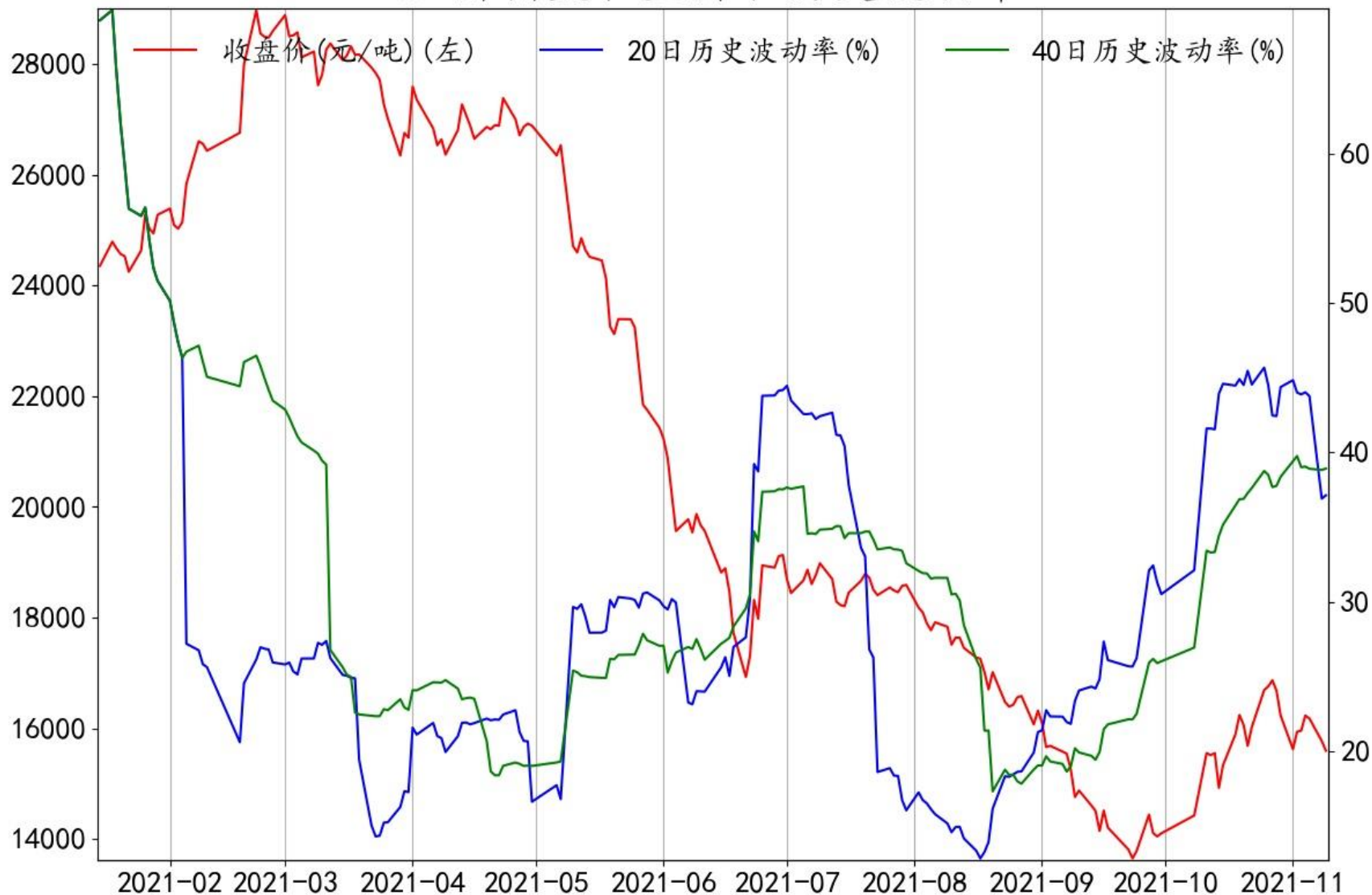
淀粉指数收盘价和历史波动率



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