

商品期货波动率跟踪

2021年11月10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、PVC、甲醇、
苹果、硅铁、纯碱、红枣、豆油、锰硅、乙二醇、尿素、
棕榈、淀粉、沪锡、铁矿、螺纹、菜油、沪铜、郑棉

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、焦煤、焦炭、硅铁、锰硅

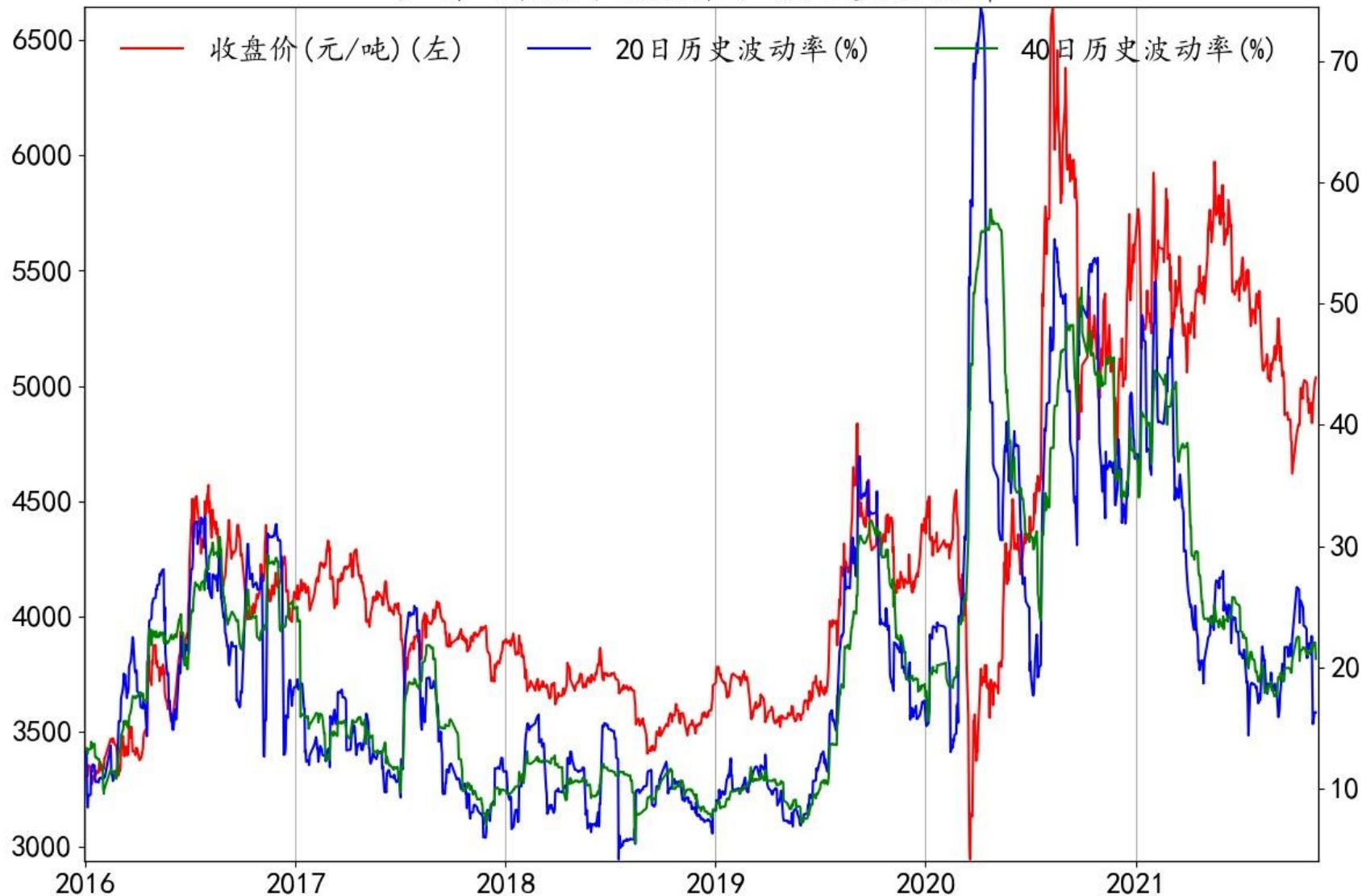
20日历史波动率绝对值后五:

沪金、豆粕、玉米、郑糖、沪银

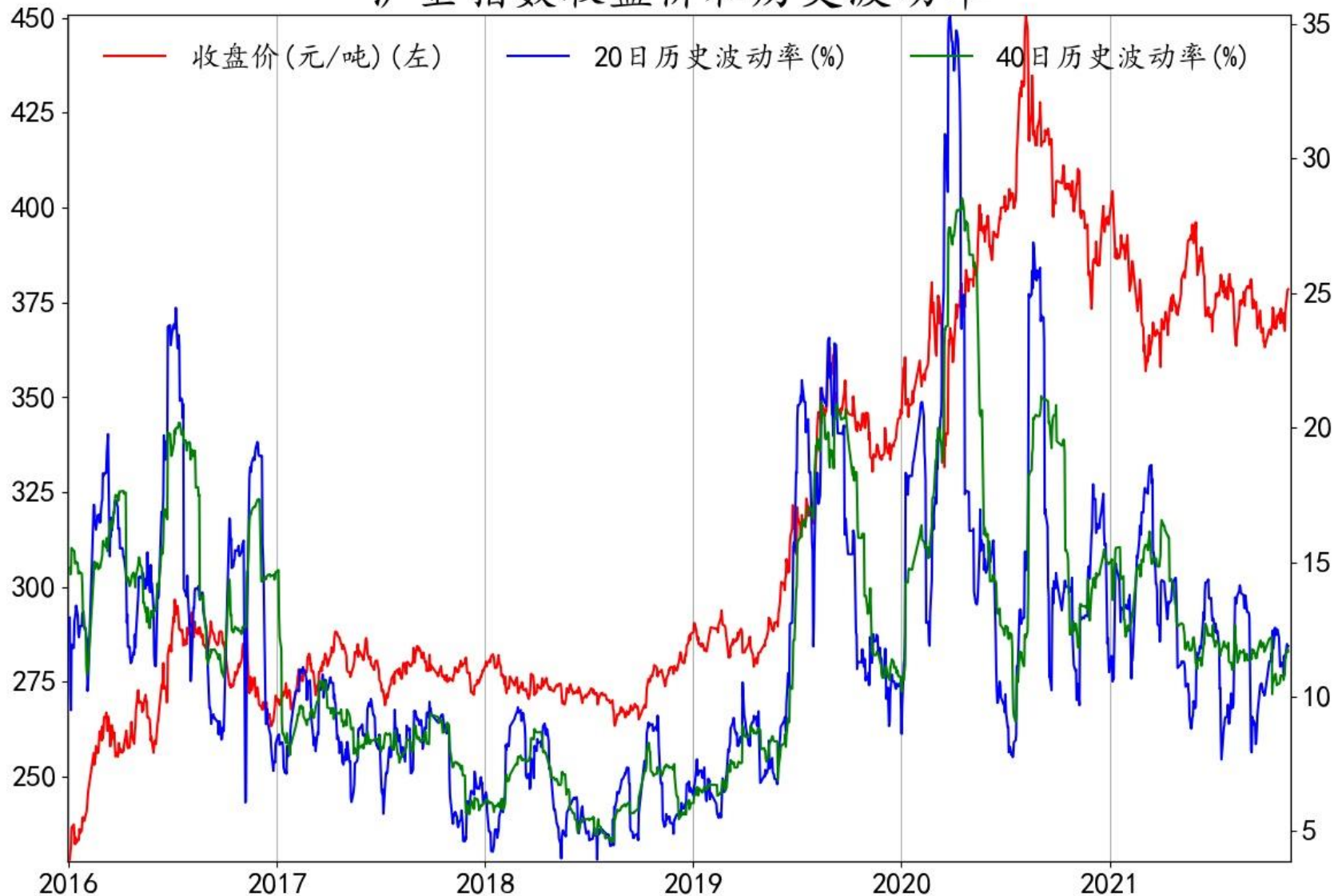
时间百分位 绝对值			时间百分位 绝对值		
沪银	45.44%	16.28%	硅铁	98.88%	78.35%
沪金	58.71%	11.87%	锰硅	98.10%	64.43%
沪铝	99.72%	43.23%	不锈钢	77.19%	25.92%
沪铜	93.40%	26.07%	玻璃	99.65%	51.78%
沪镍	79.56%	28.61%	PVC	98.95%	58.70%
沪铅	67.63%	19.17%	燃油	79.92%	38.48%
沪锡	96.21%	37.82%	低硫燃油	23.93%	24.56%
沪锌	99.79%	50.72%	LPG	88.67%	34.95%
热卷	85.74%	37.58%	原油	58.70%	31.35%
铁矿	96.07%	60.18%	动煤	99.09%	93.88%
焦炭	99.30%	82.29%	沥青	79.07%	33.80%
焦煤	99.44%	87.65%	苯乙烯	63.87%	31.83%
螺纹	95.29%	45.30%	乙二醇	97.74%	61.34%

	时间百分位 绝对值			时间百分位 绝对值	
塑料	85.46%	24.48%	菜油	94.10%	25.53%
甲醇	98.95%	52.78%	棕榈	96.77%	37.83%
20号胶	58.89%	27.69%	花生	43.78%	17.93%
短纤	77.20%	29.88%	菜粕	69.66%	21.31%
PP	83.92%	25.98%	豆油	98.17%	32.34%
沪胶	68.19%	30.35%	郑棉	91.64%	31.86%
纯碱	98.71%	61.96%	郑糖	80.13%	15.65%
纸浆	84.05%	24.04%	苹果	98.94%	47.34%
TA	80.06%	25.93%	红枣	98.53%	61.38%
尿素	97.04%	57.75%	淀粉	96.70%	25.36%
玉米	74.30%	13.81%	鸡蛋	70.72%	22.40%
豆一	67.77%	18.15%	生猪	72.59%	37.12%
豆粕	27.81%	13.40%			

沪银指数收盘价和历史波动率



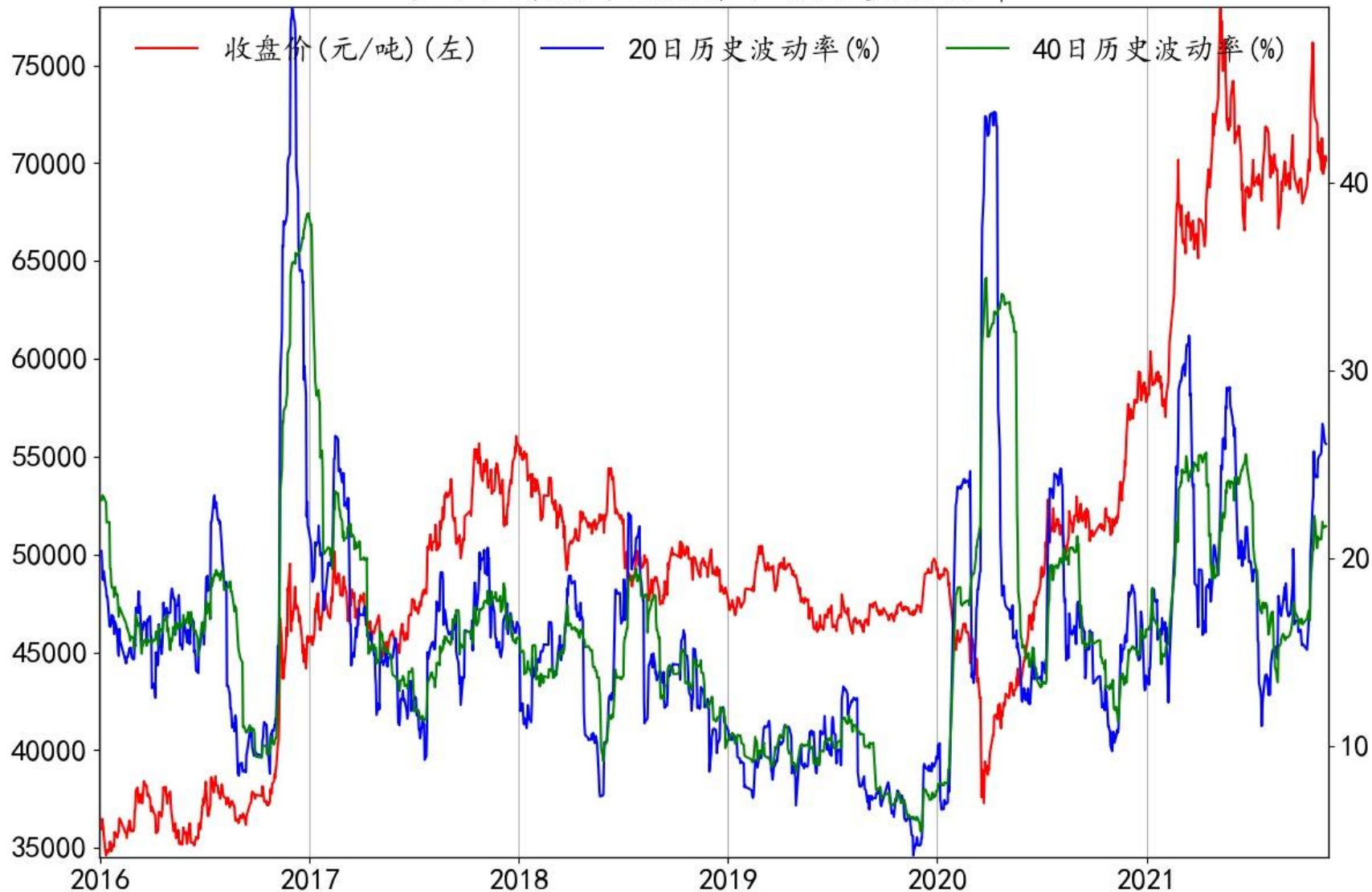
沪金指数收盘价和历史波动率



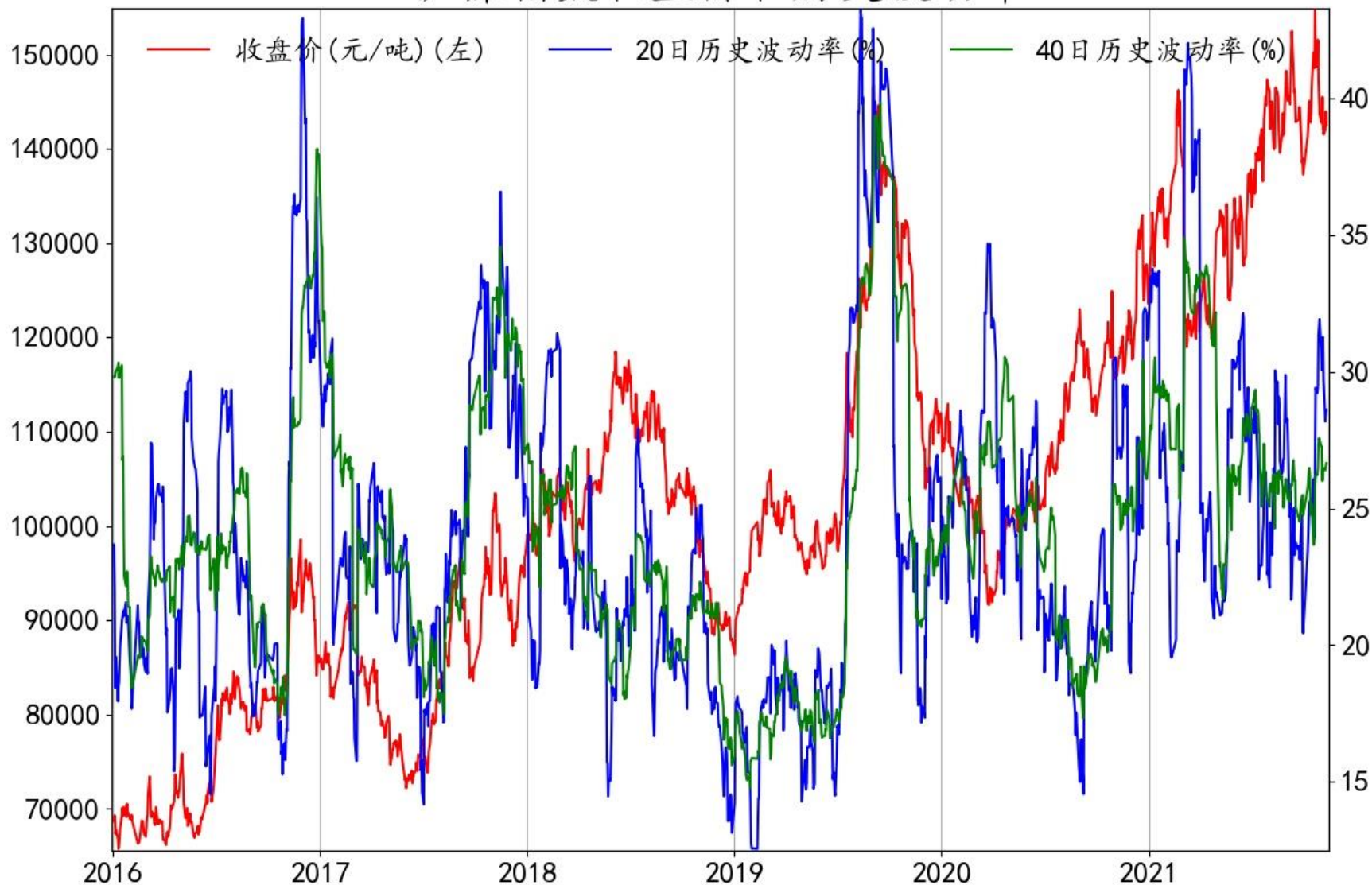
沪铝指数收盘价和历史波动率



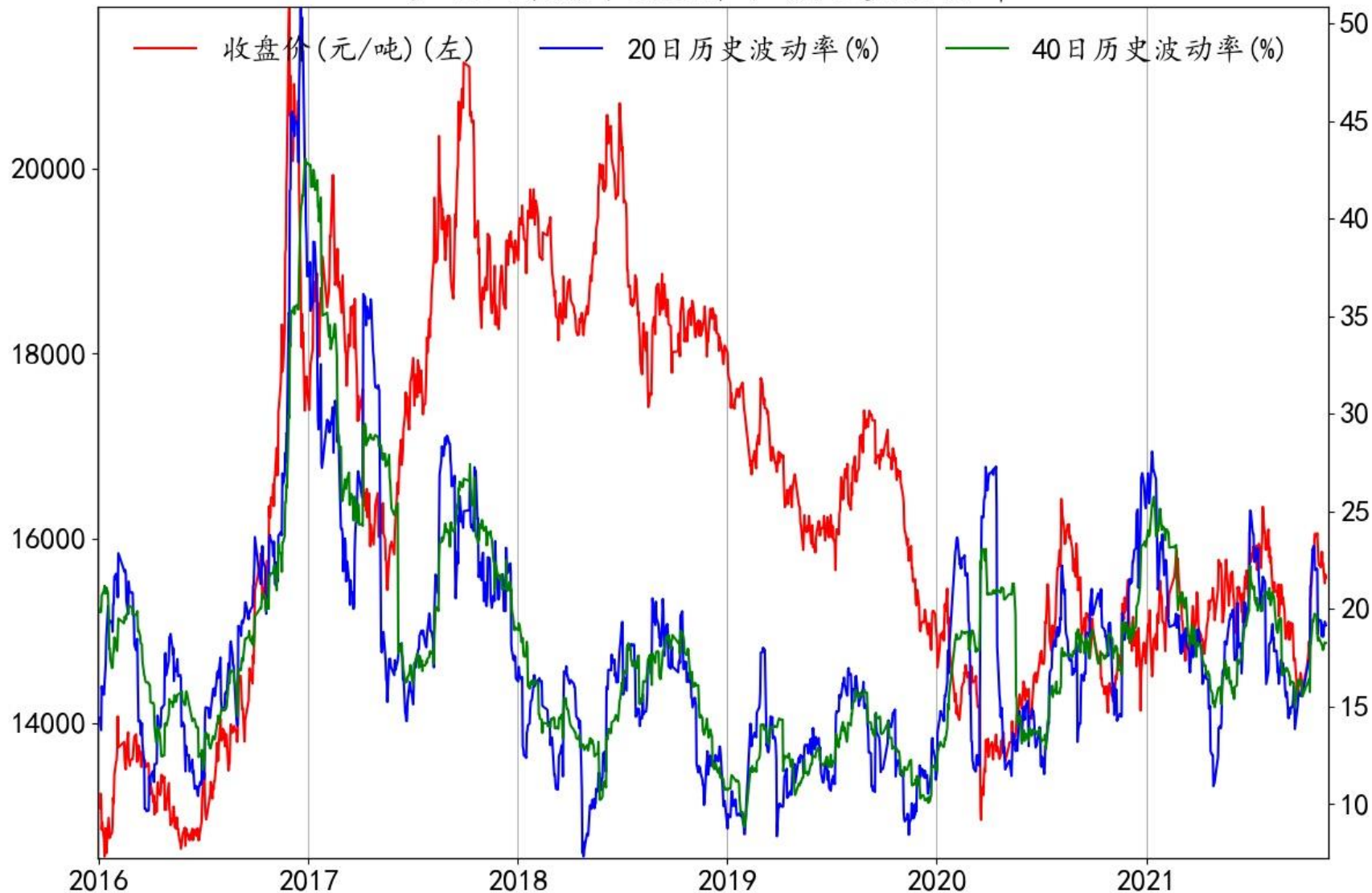
沪铜指数收盘价和历史波动率



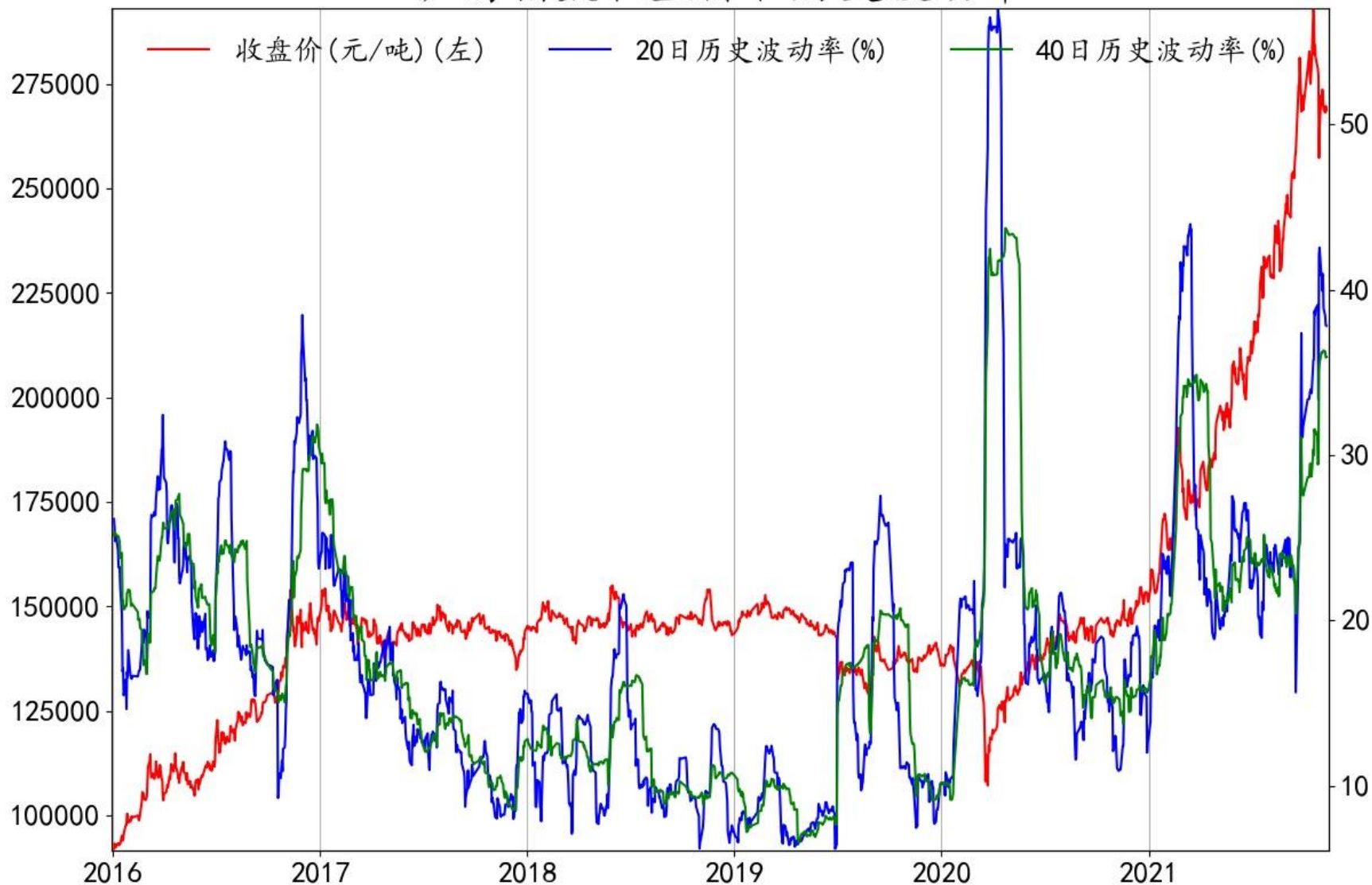
沪镍指数收盘价和历史波动率



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



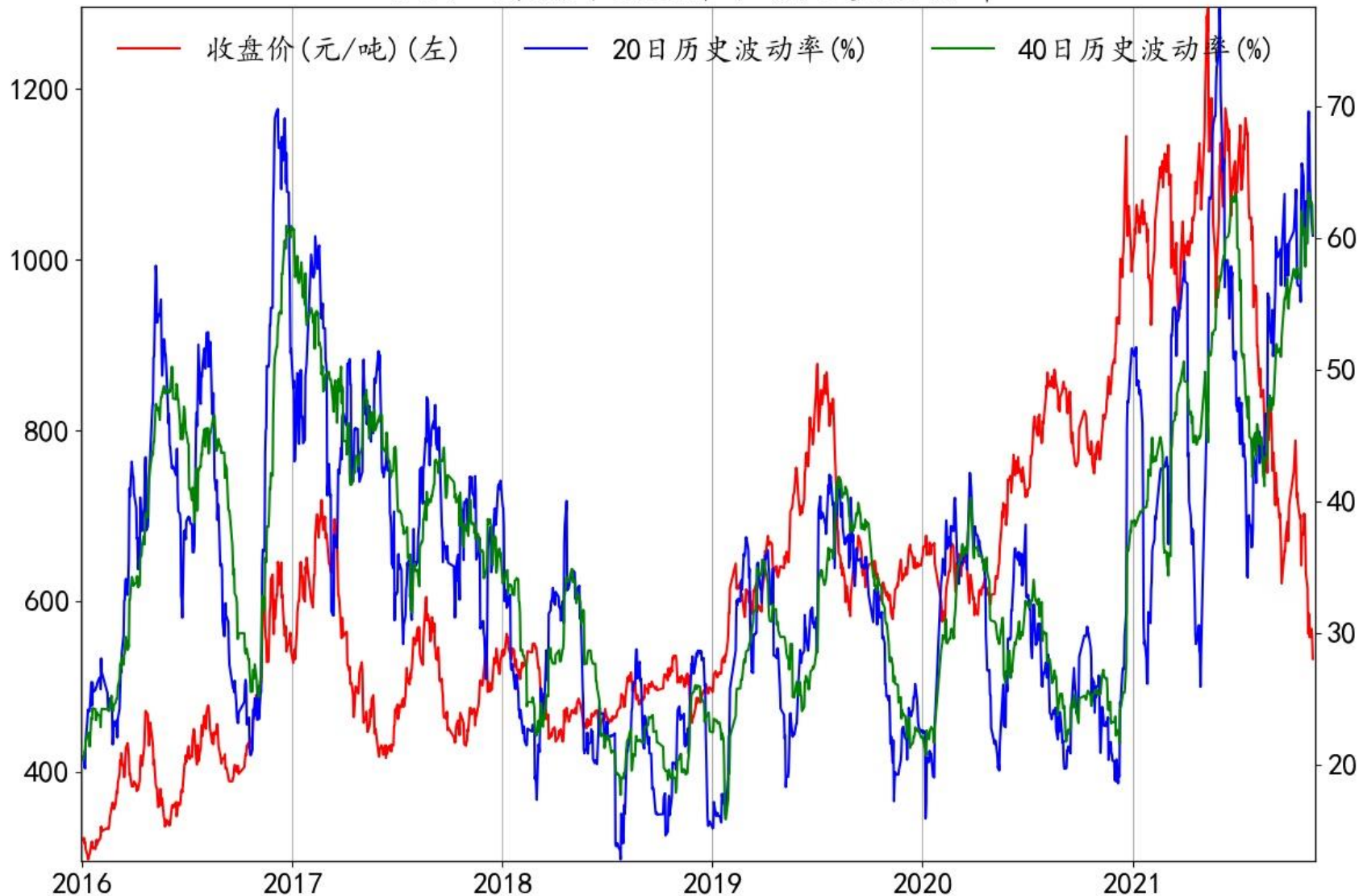
沪锌指数收盘价和历史波动率



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

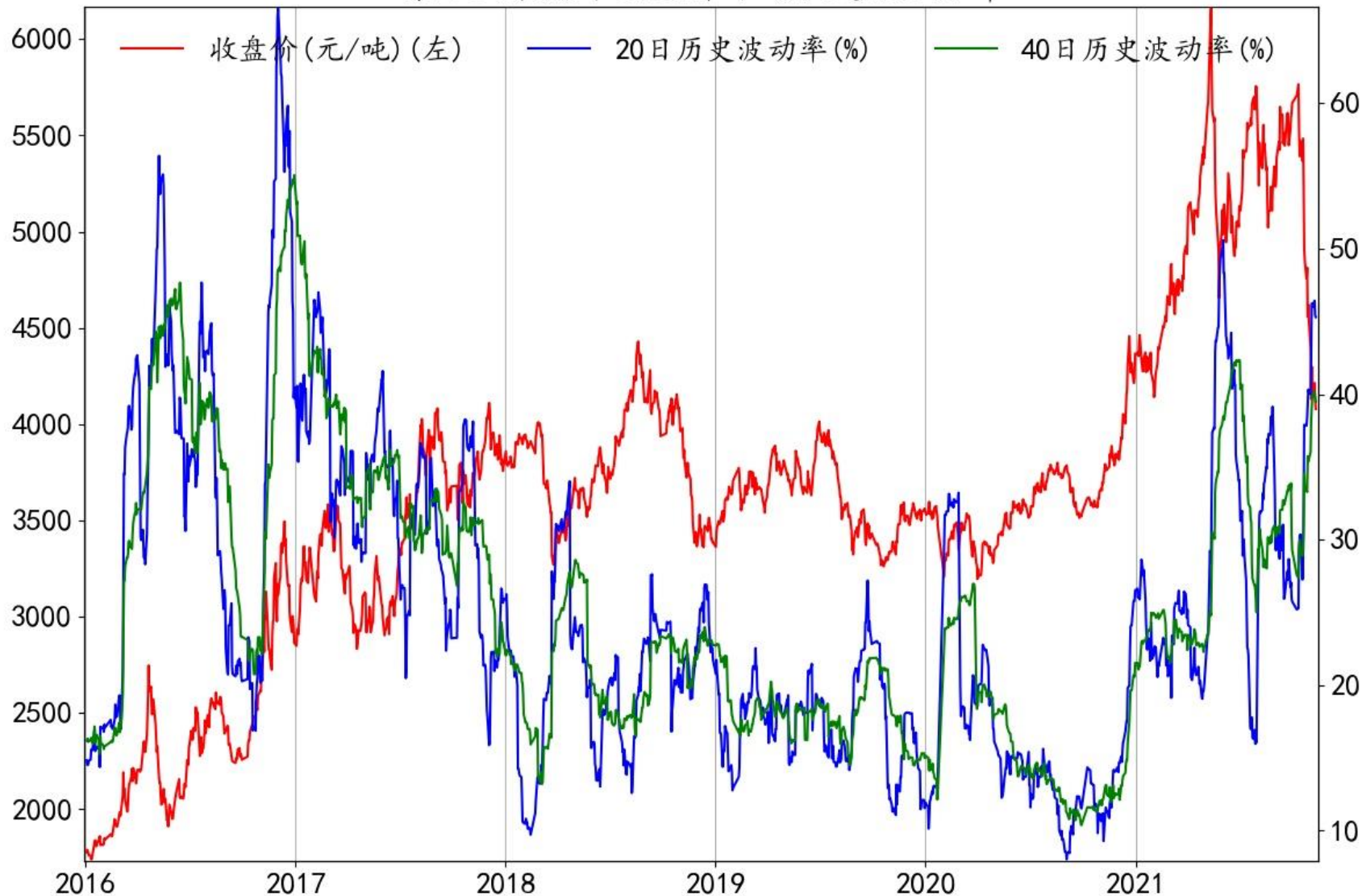


焦煤指数收盘价和历史波动率

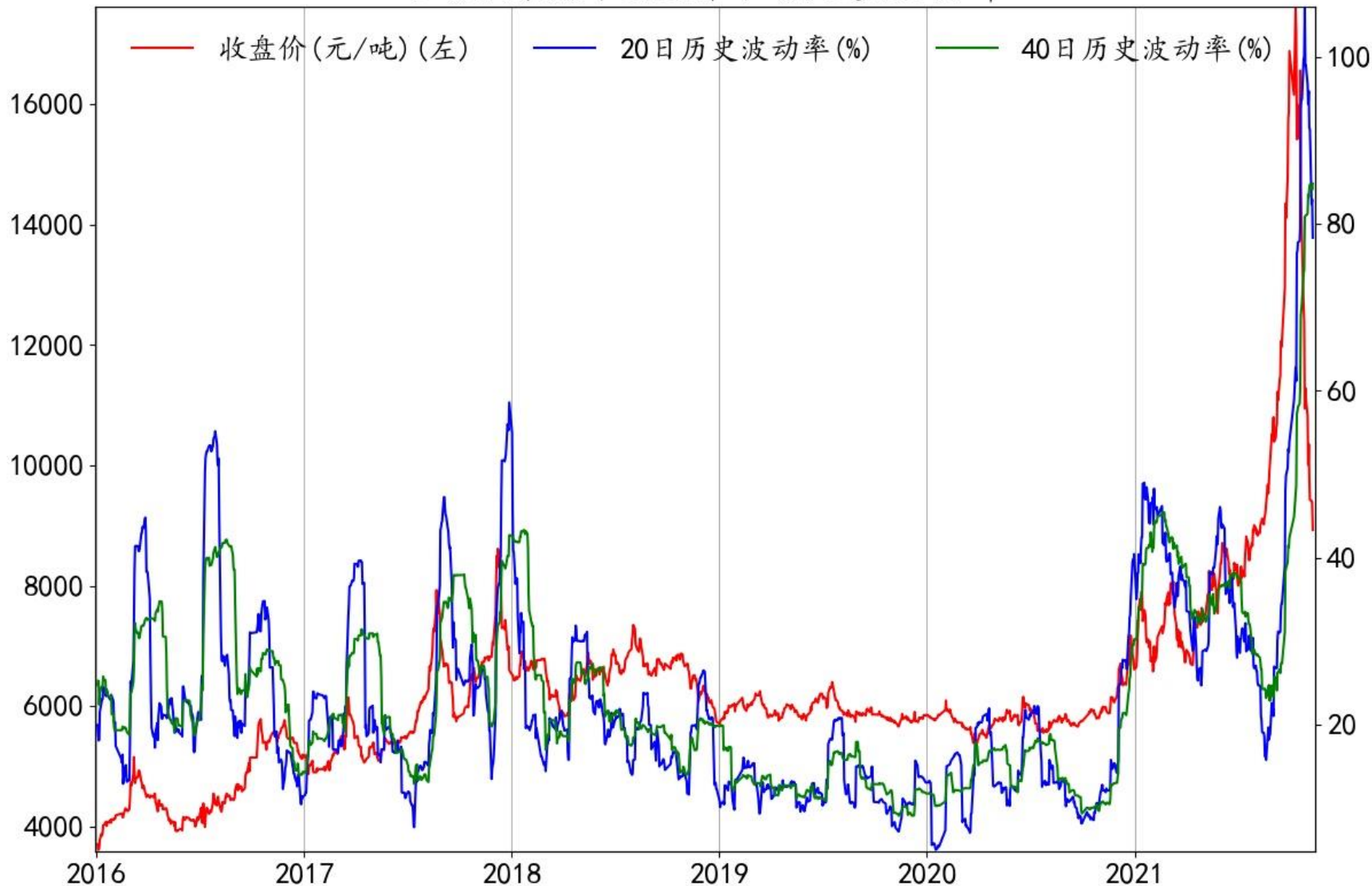


数据来源：Wind、信达期货研发中心

螺纹指数收盘价和历史波动率



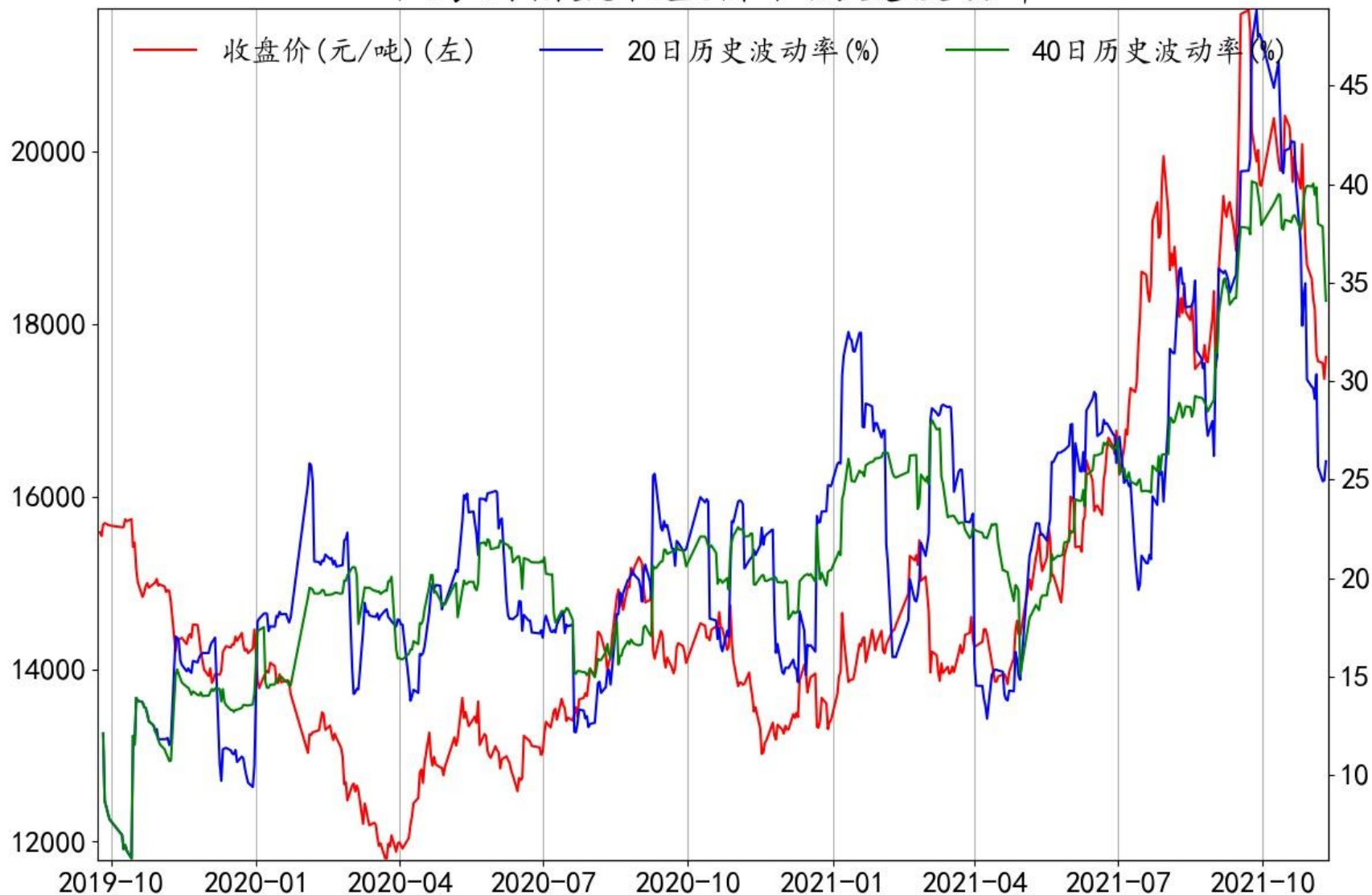
硅铁指数收盘价和历史波动率



锰硅指数收盘价和历史波动率

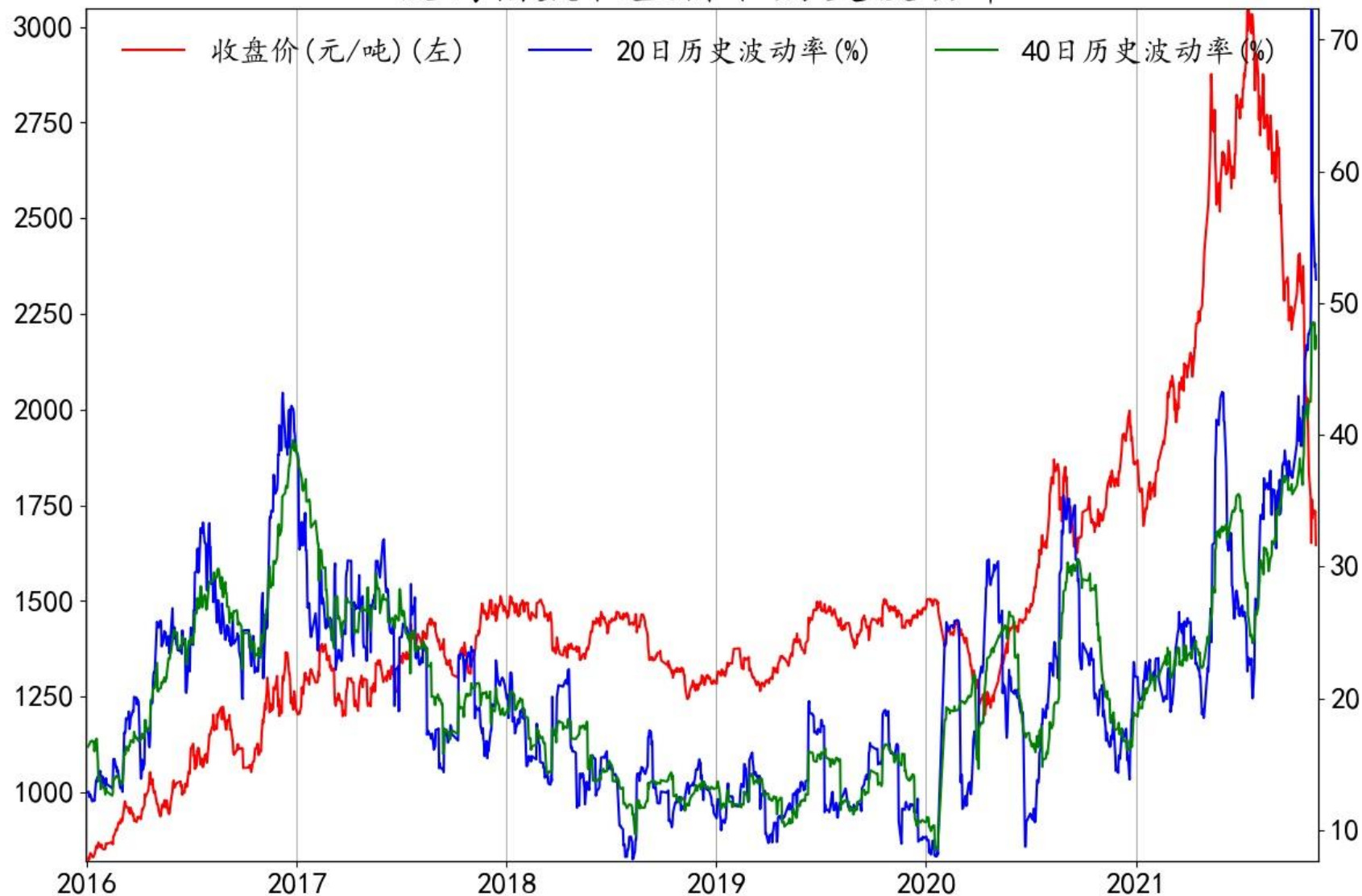


不锈钢指数收盘价和历史波动率

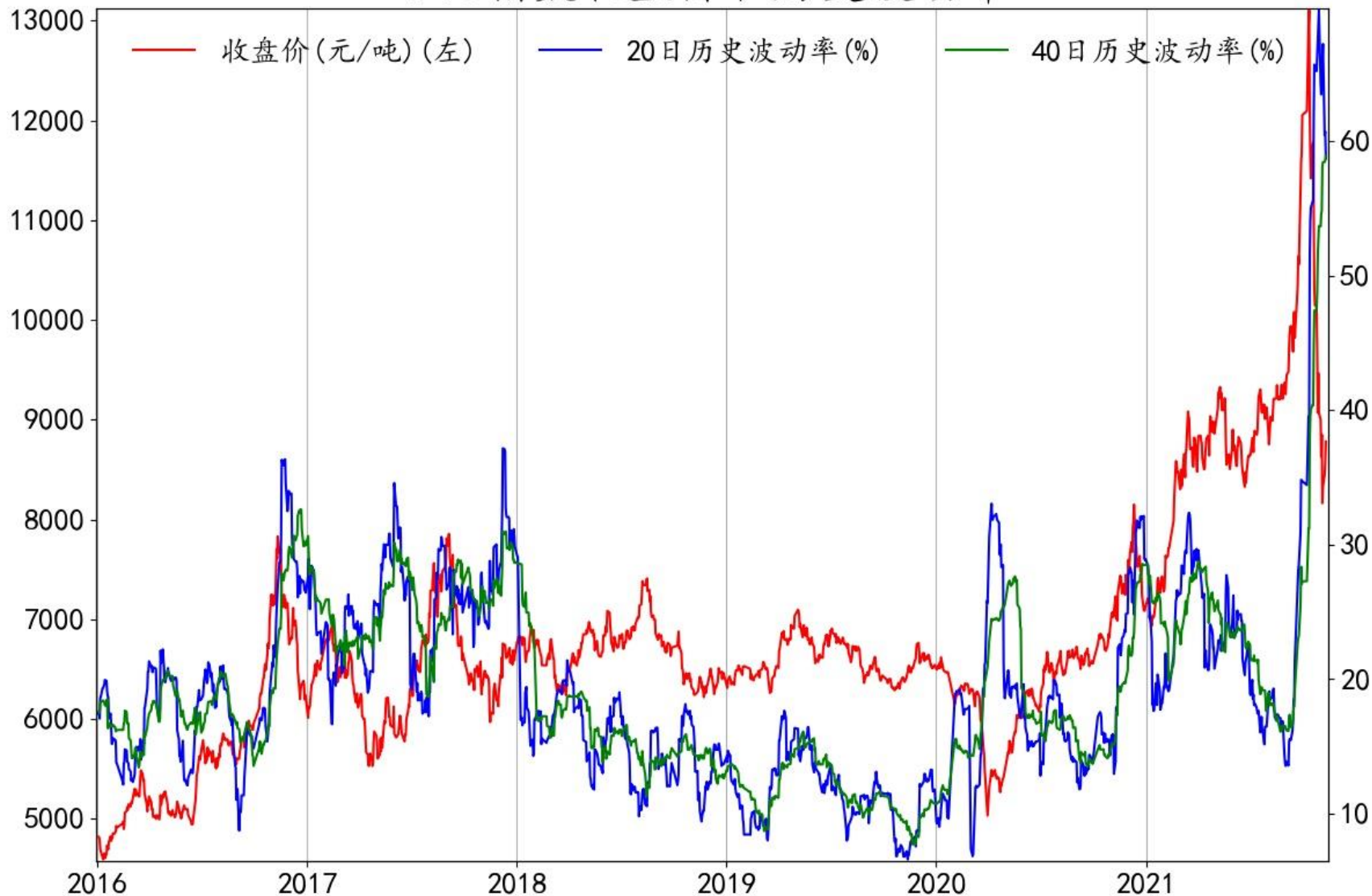


数据来源: Wind、信达期货研发中心

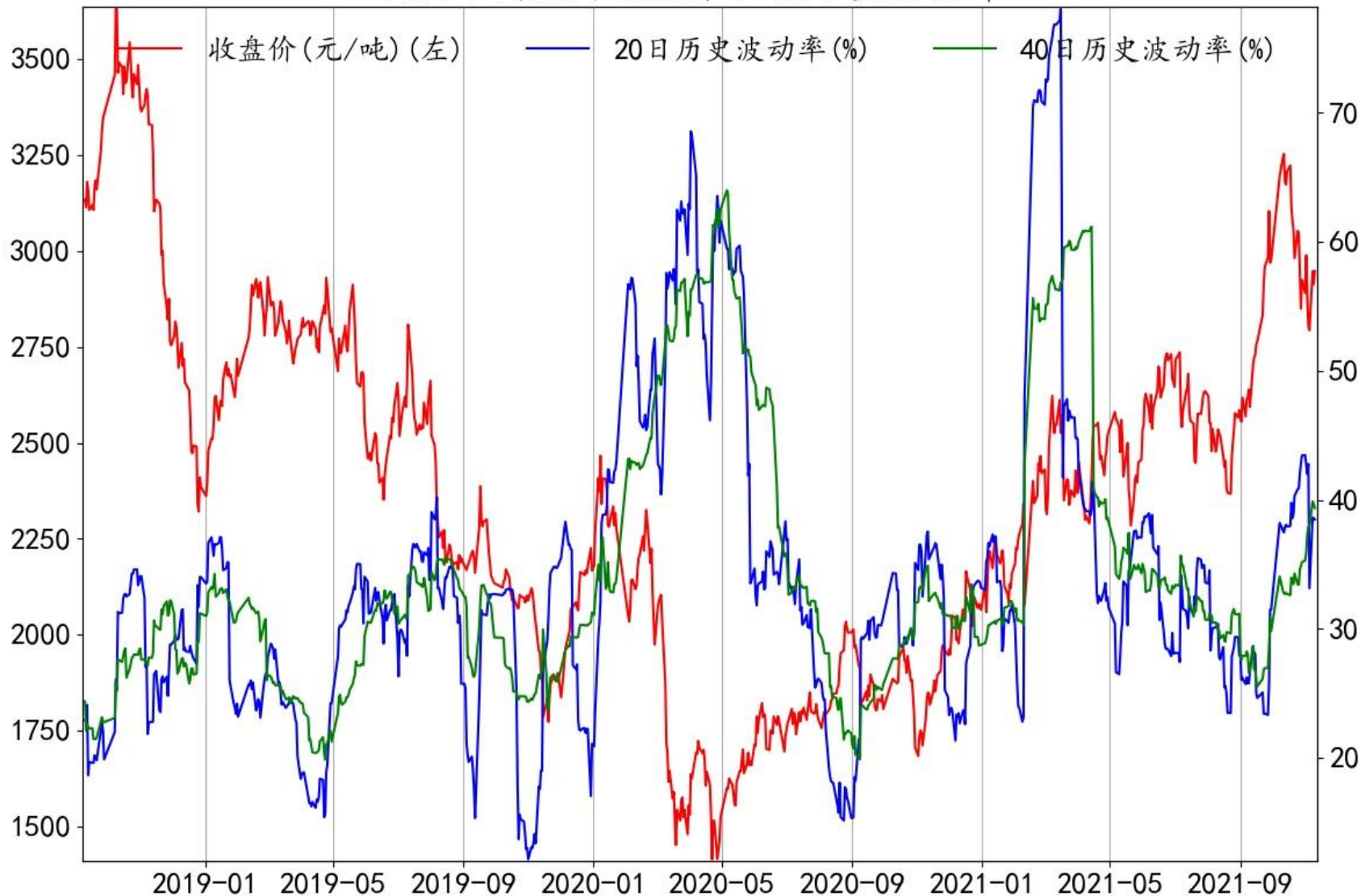
玻璃指数收盘价和历史波动率



PVC指数收盘价和历史波动率



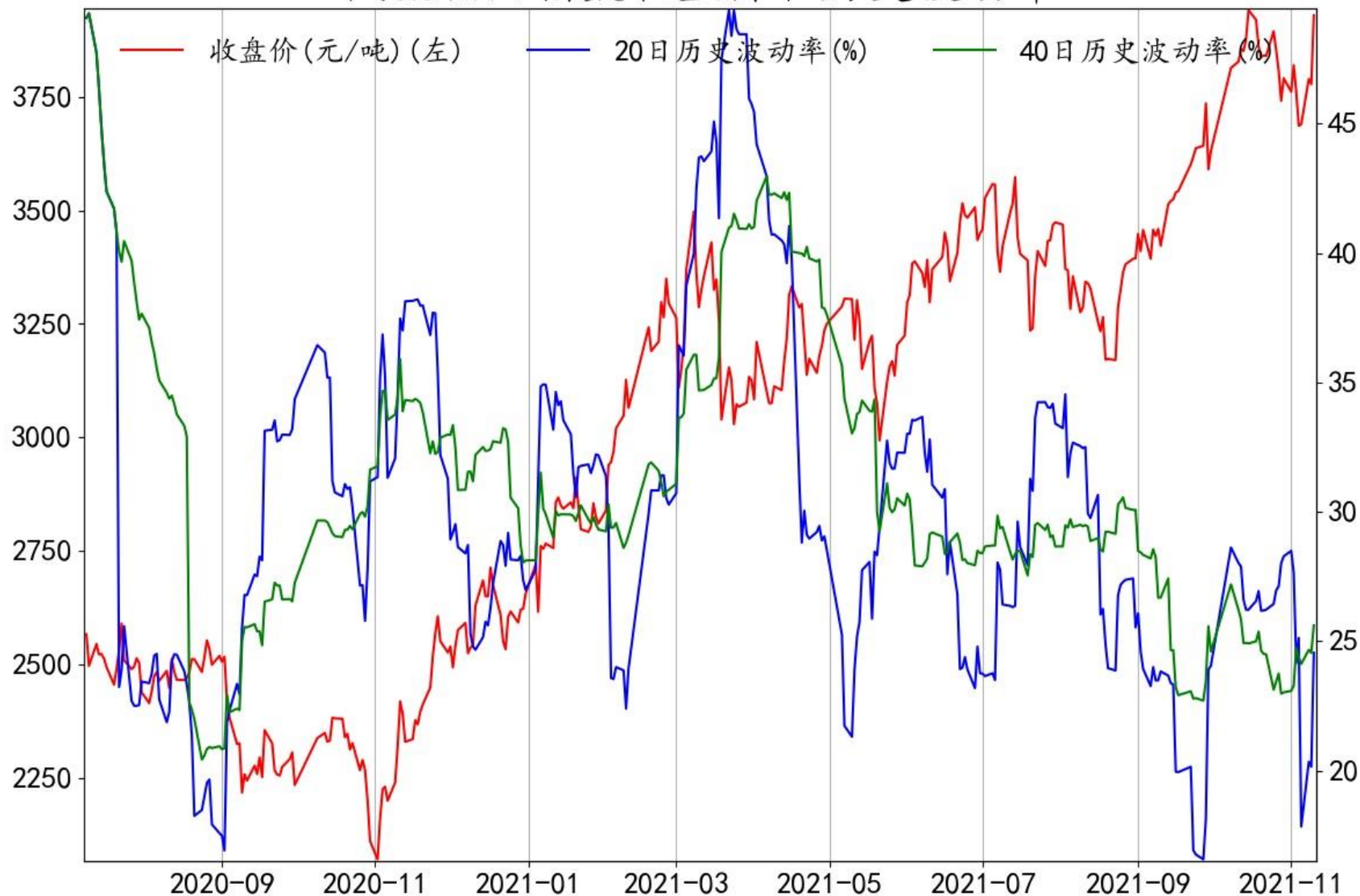
燃油指数收盘价和历史波动率



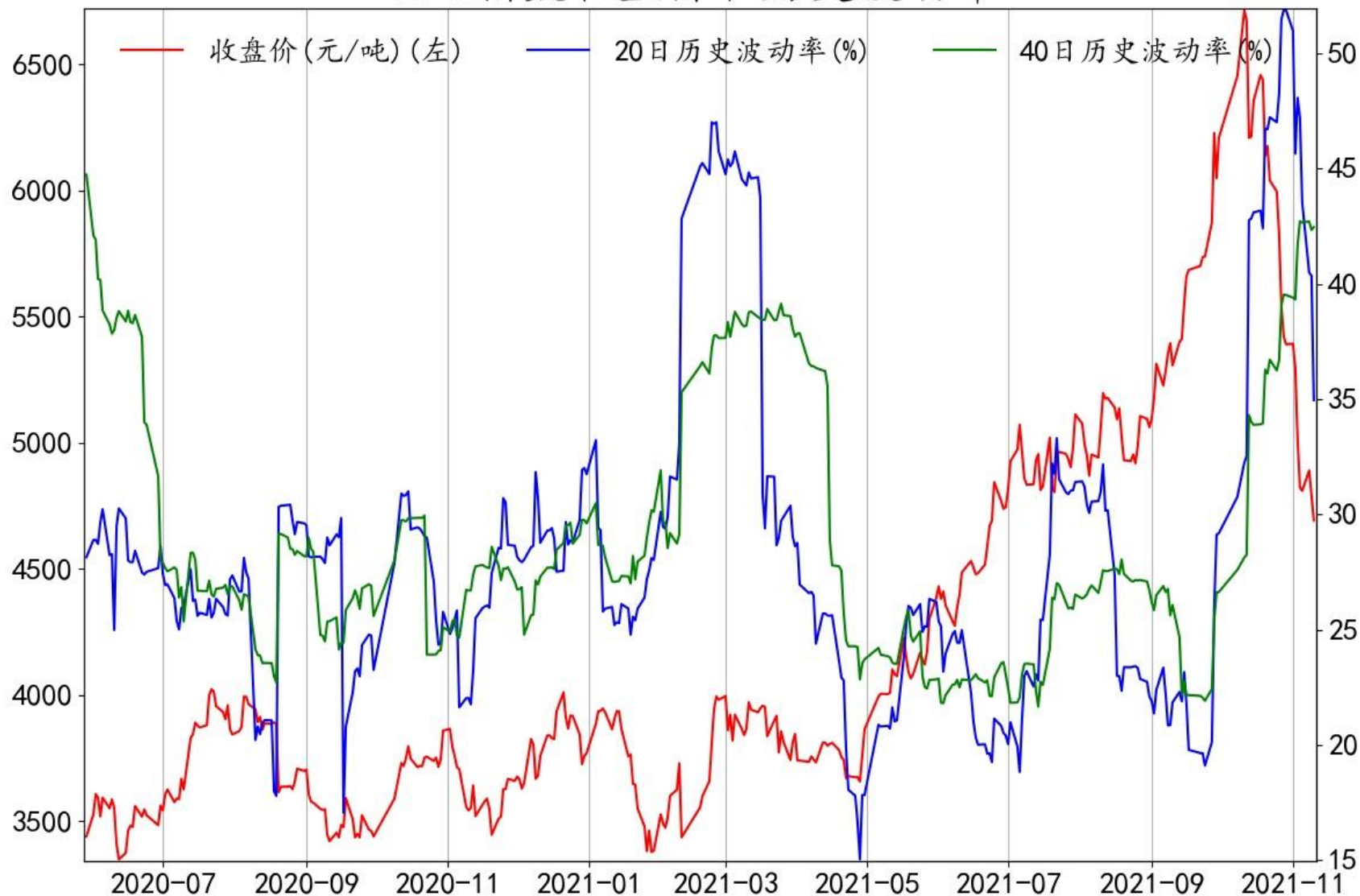
数据来源: Wind、信达期货研发中心

低硫燃油指数

低硫燃油指数收盘价和历史波动率

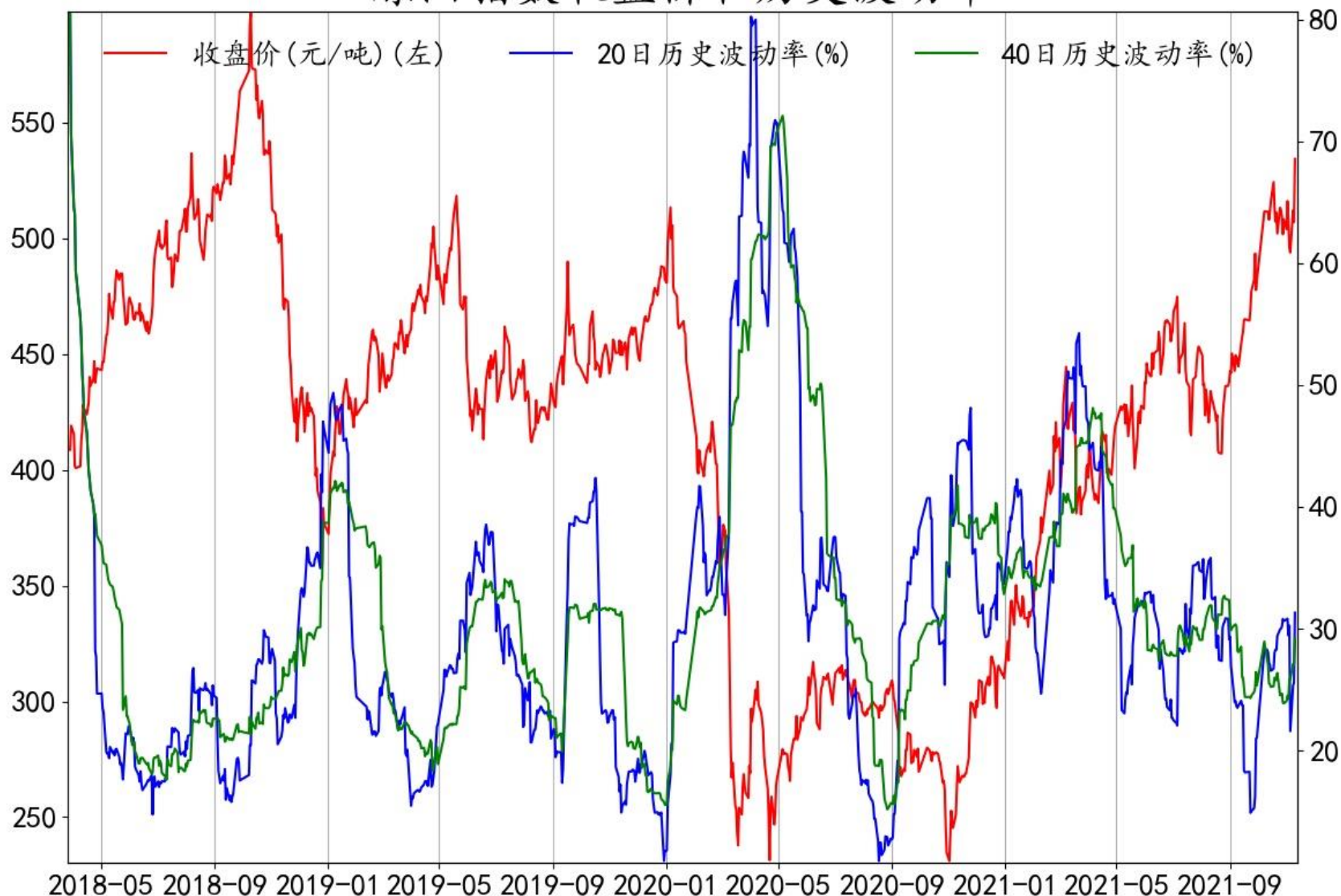


LPG指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

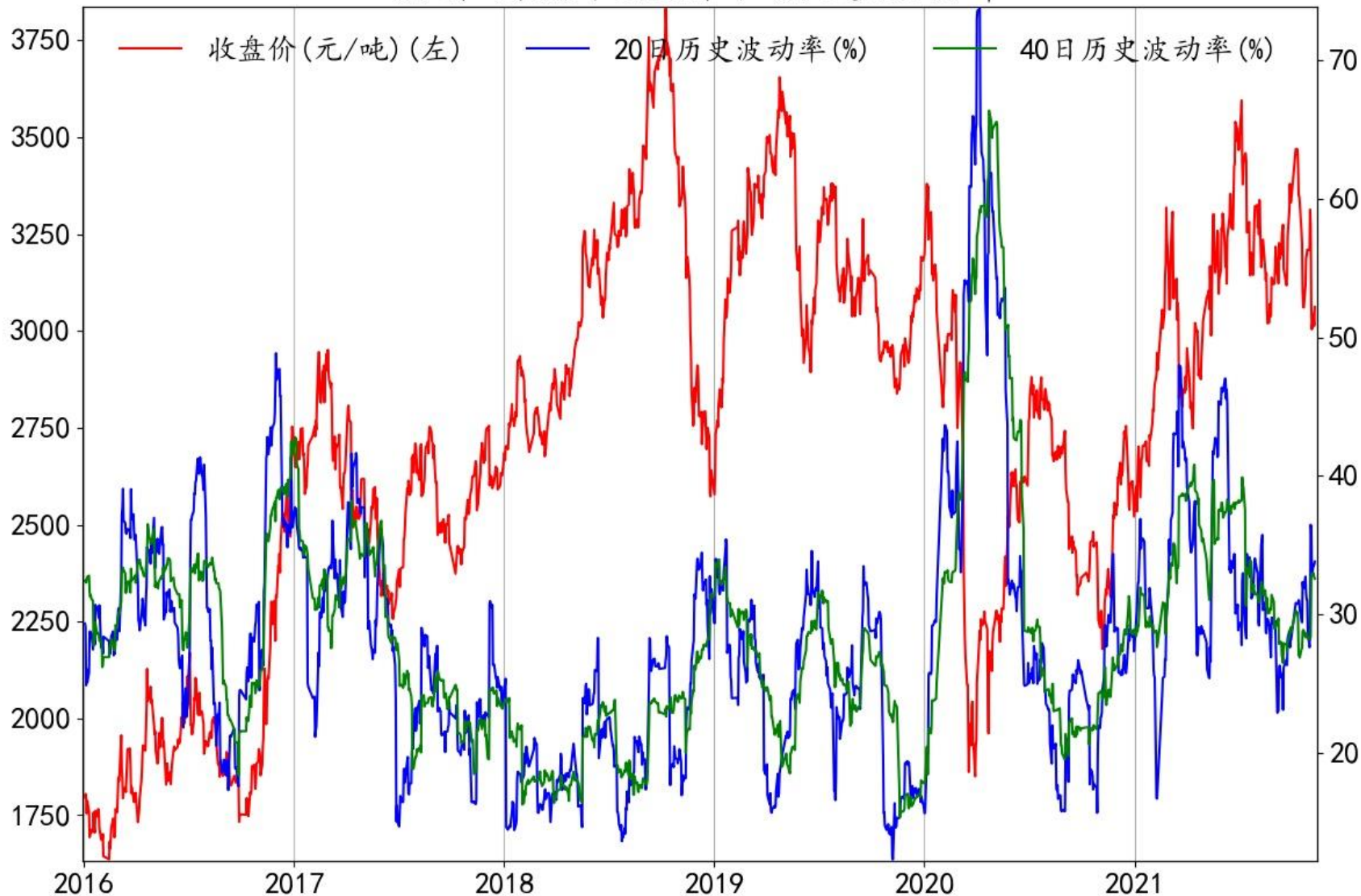
原油指数收盘价和历史波动率



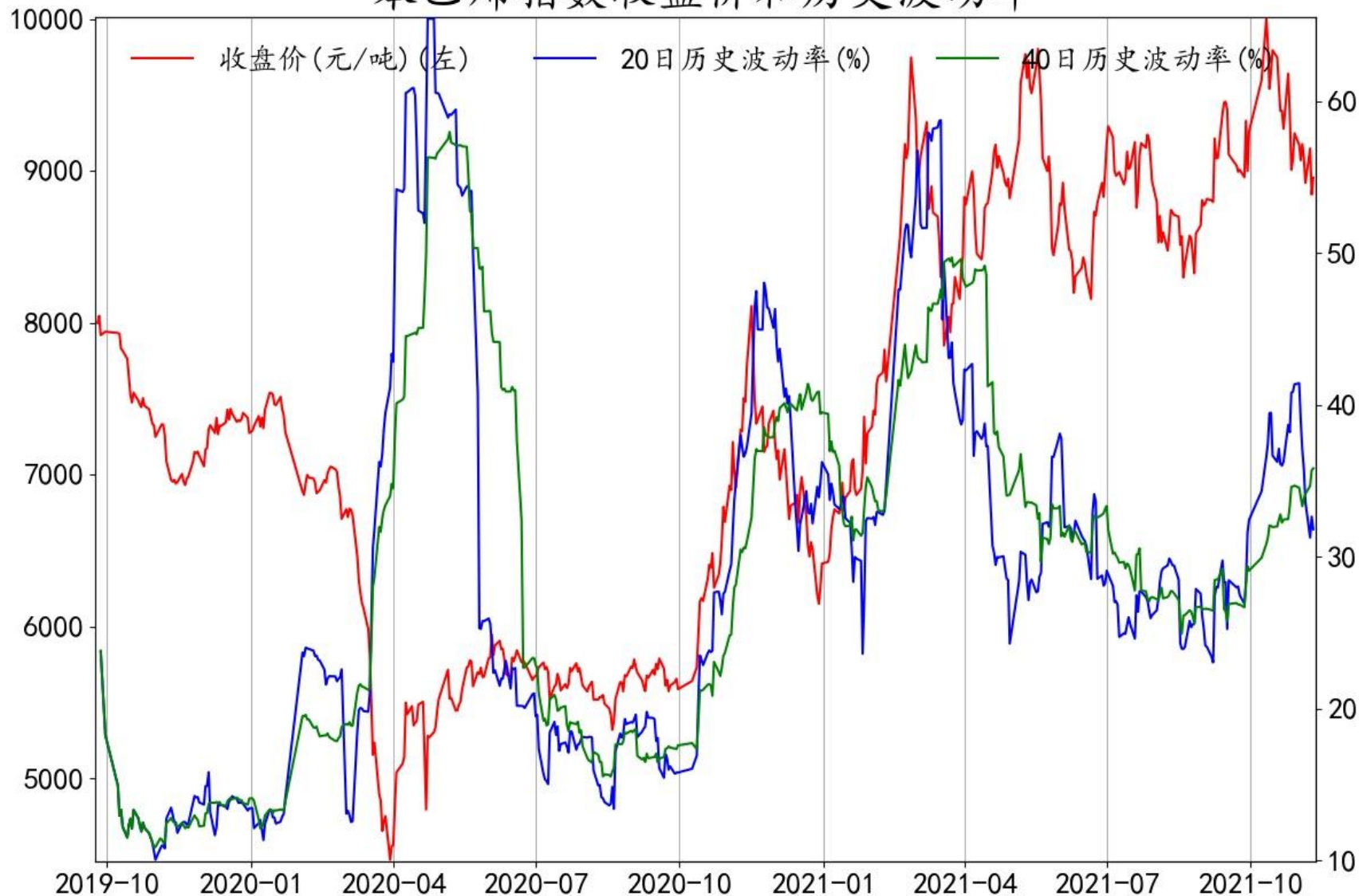
动煤指数收盘价和历史波动率



沥青指数收盘价和历史波动率

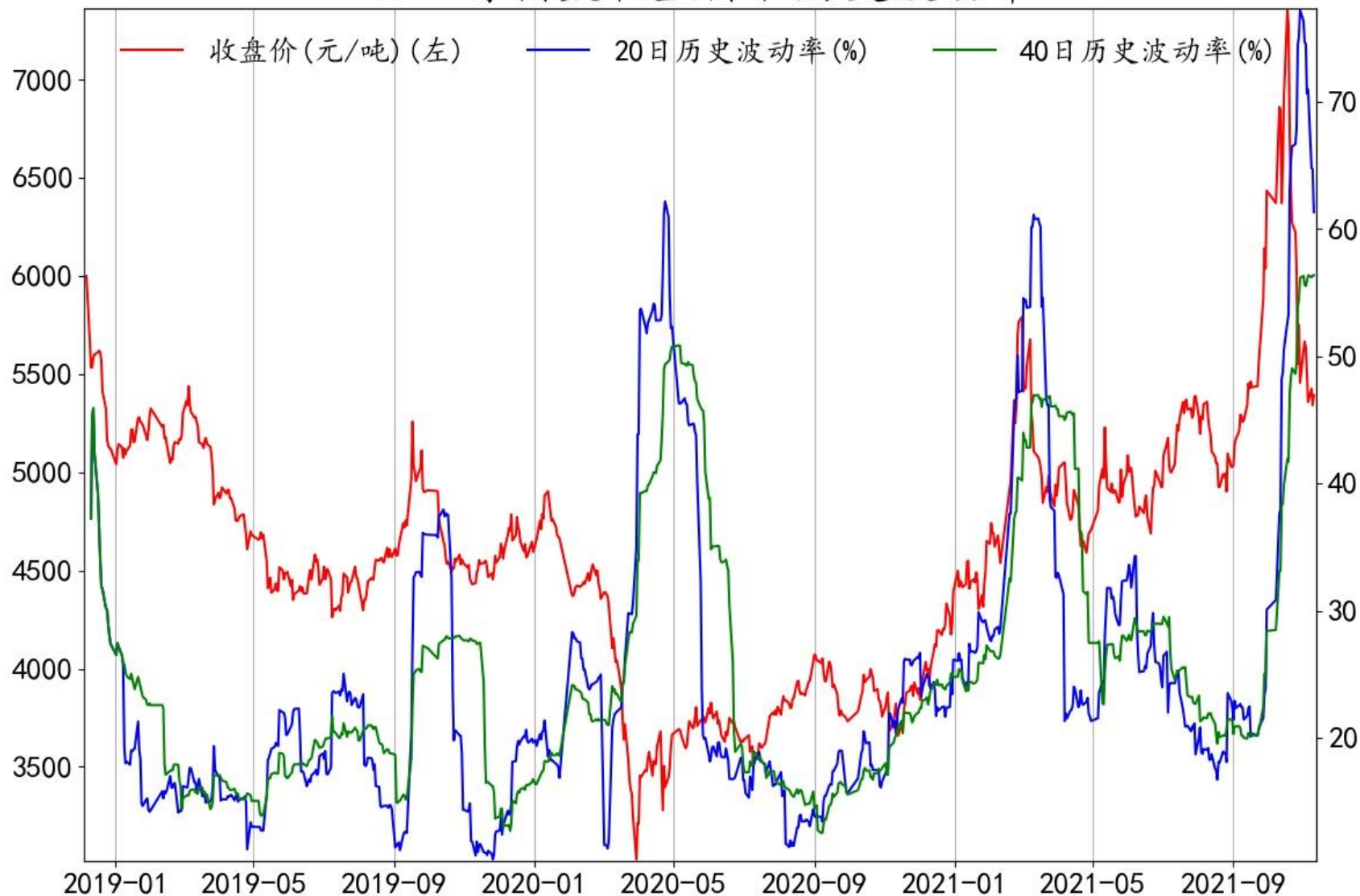


苯乙烯指数收盘价和历史波动率



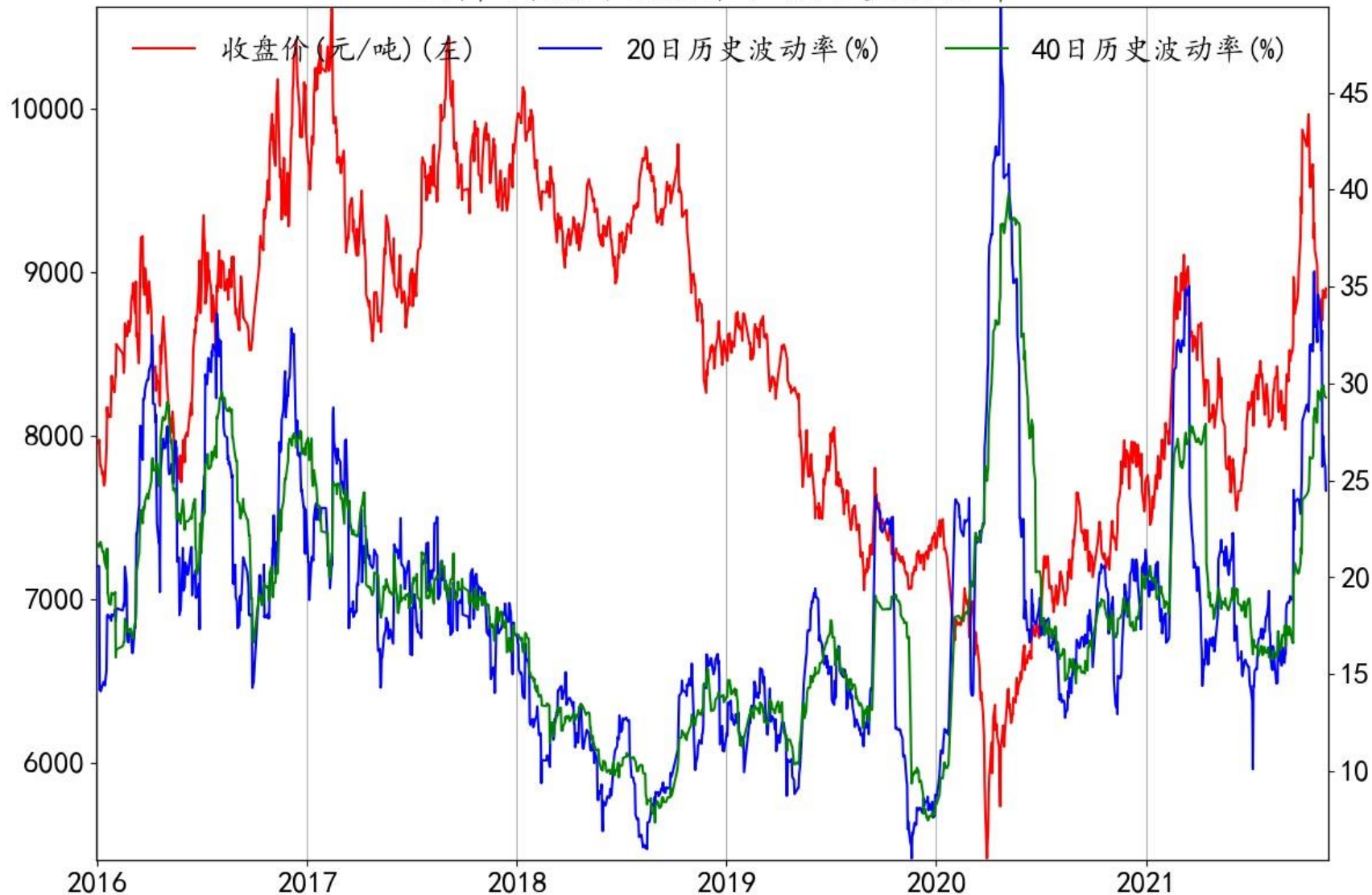
数据来源: Wind、信达期货研发中心

乙二醇指数收盘价和历史波动率

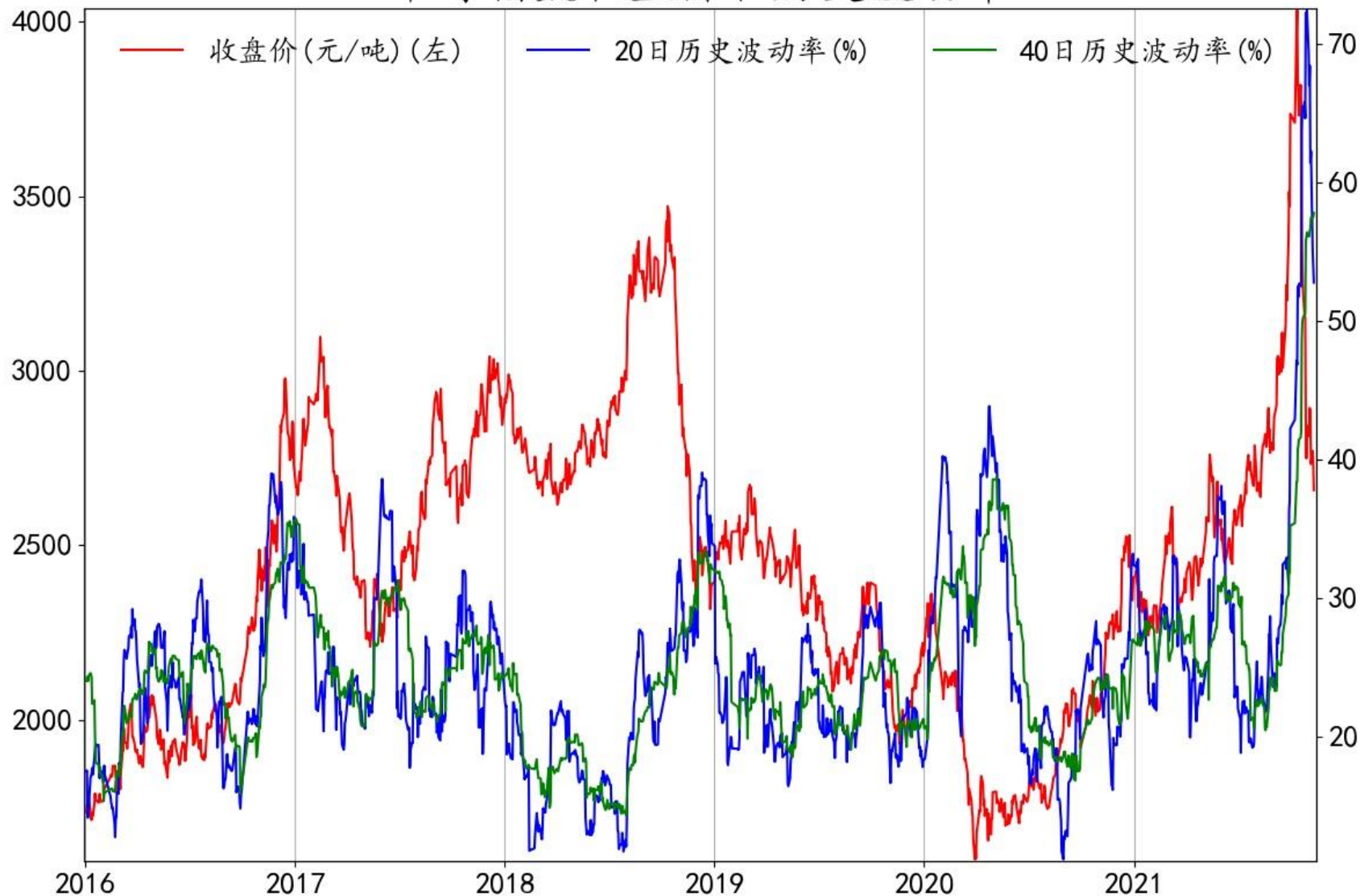


数据来源: Wind、信达期货研发中心

塑料指数收盘价和历史波动率

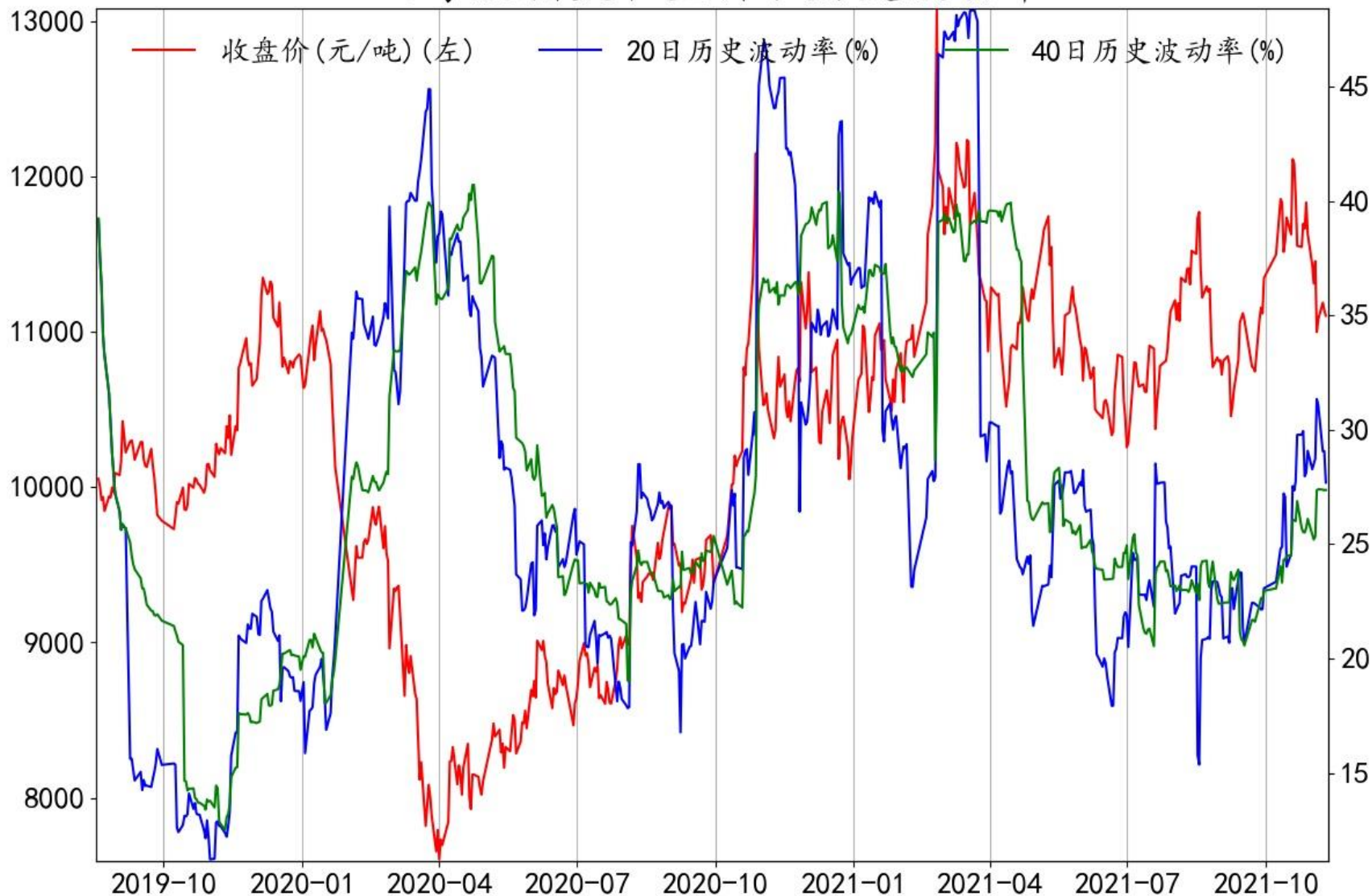


甲醇指数收盘价和历史波动率



20号胶指数

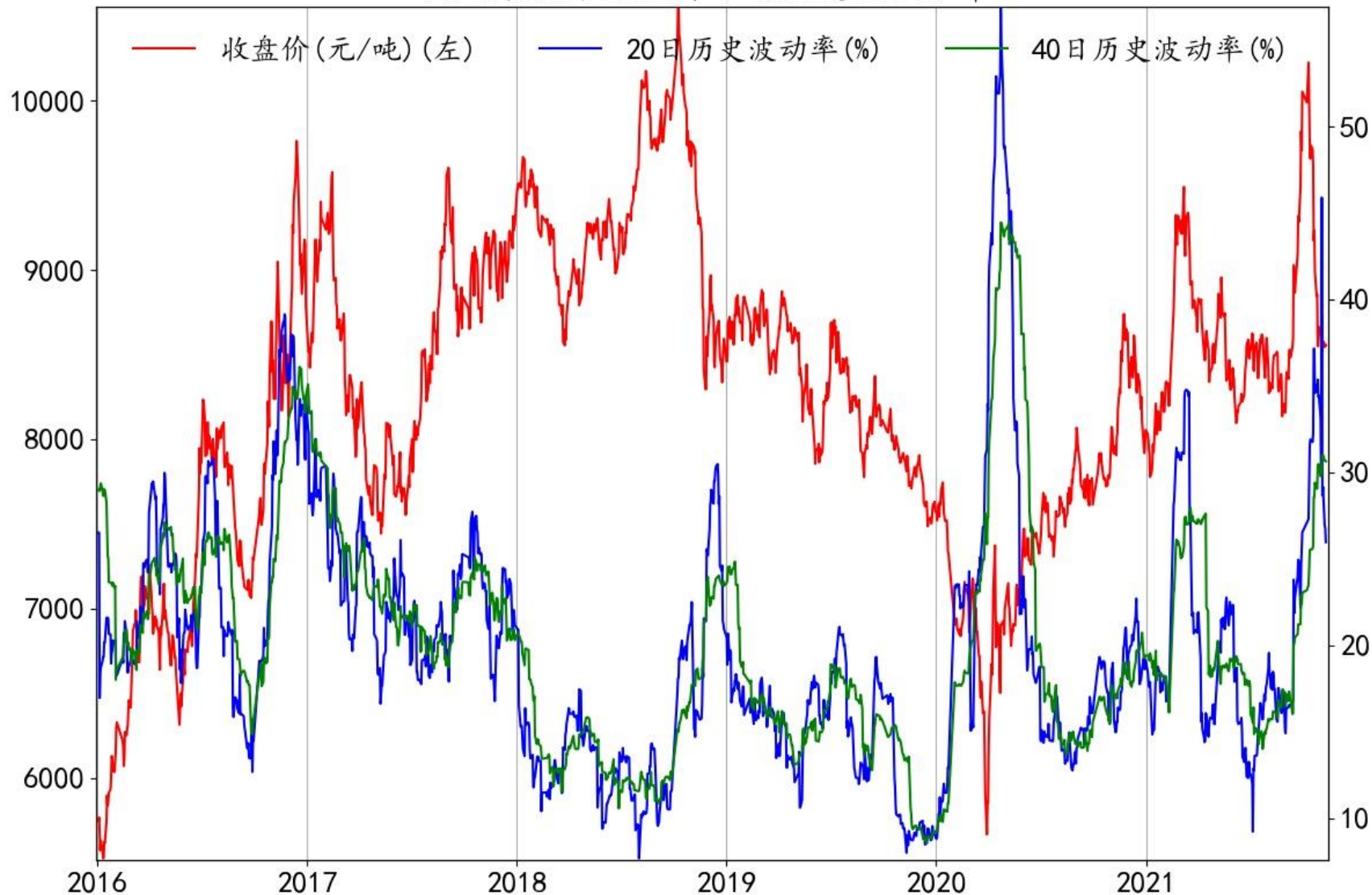
20号胶指数收盘价和历史波动率



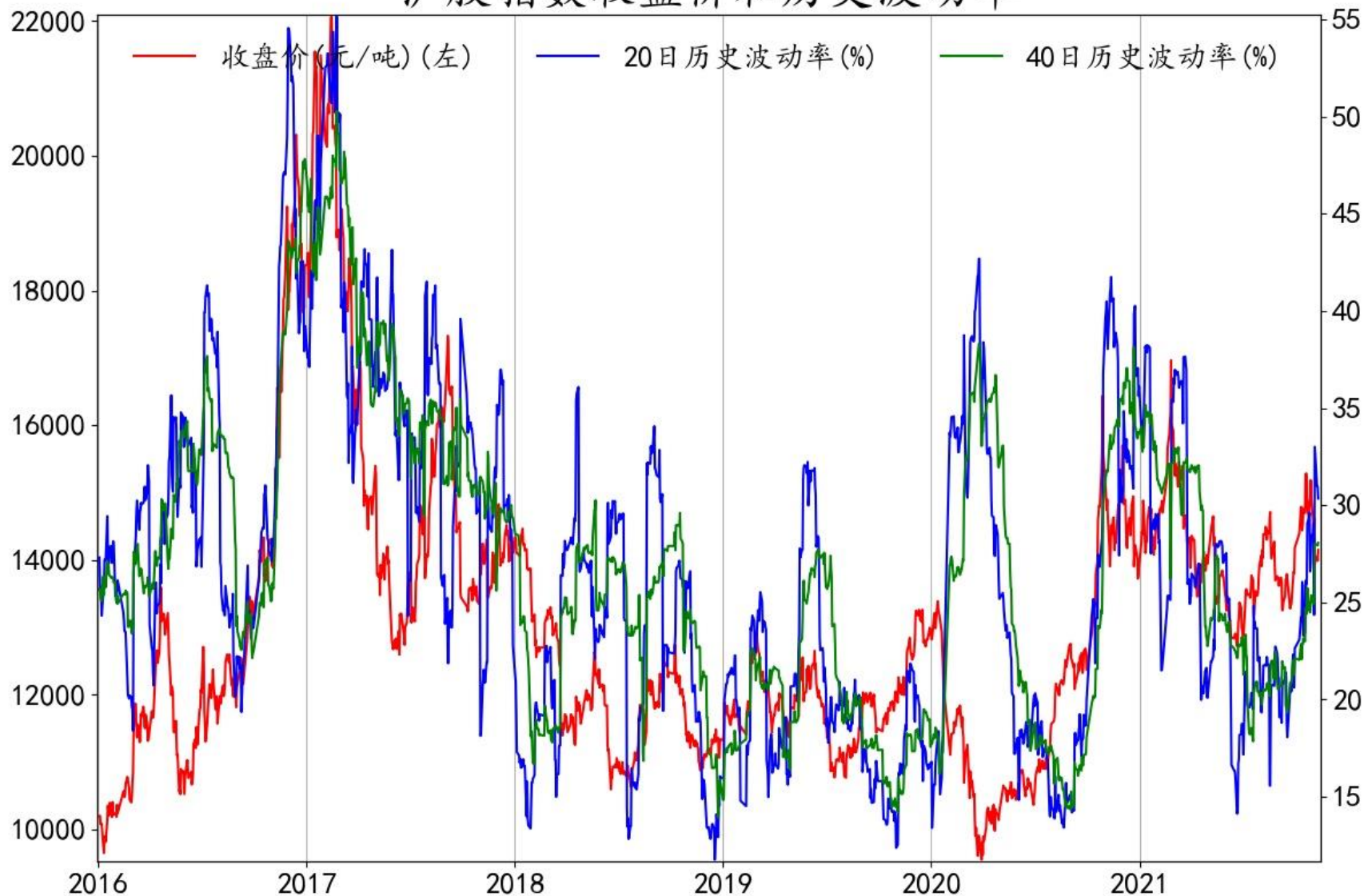
短纤指数收盘价和历史波动率



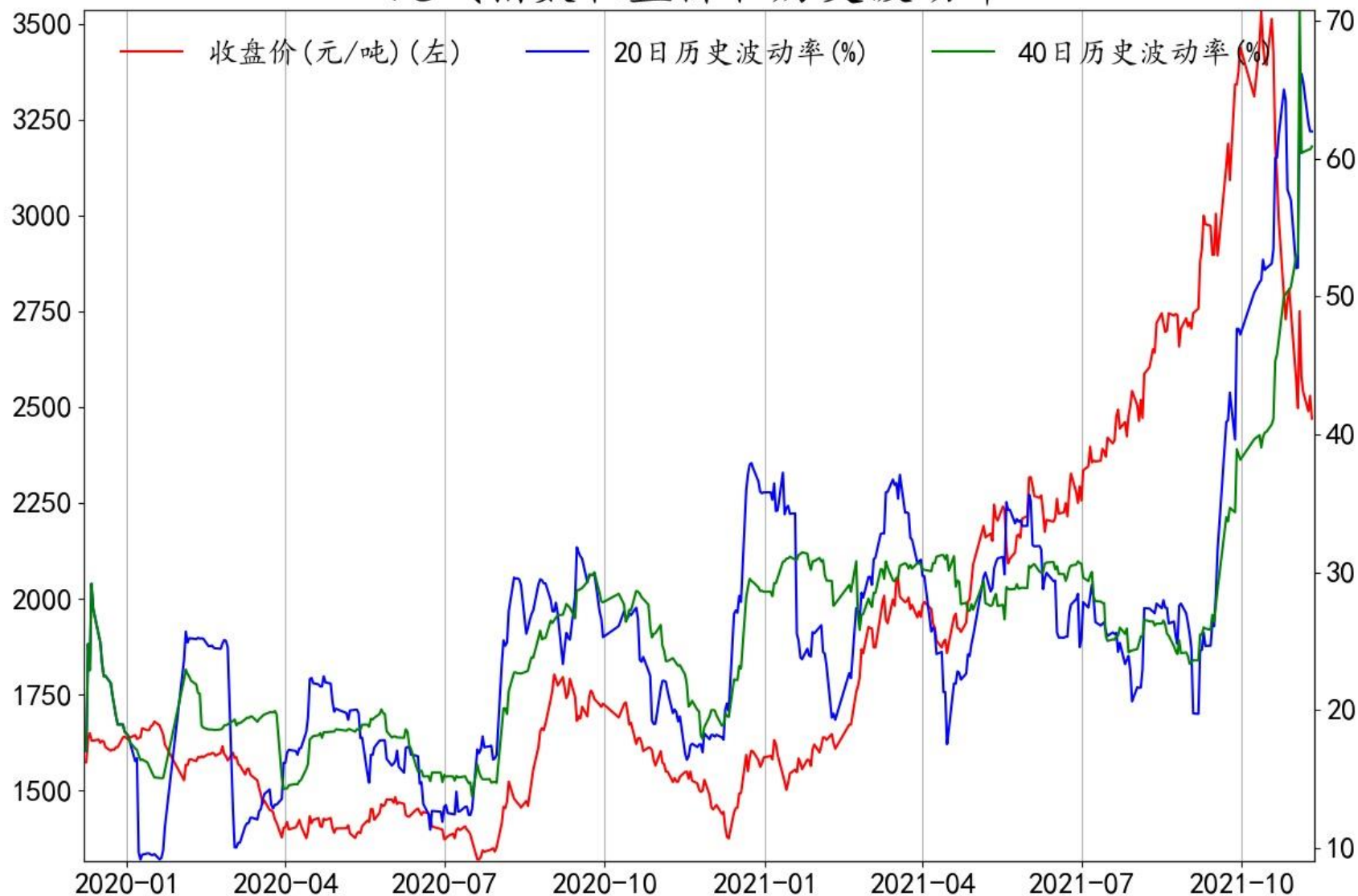
PP指数收盘价和历史波动率



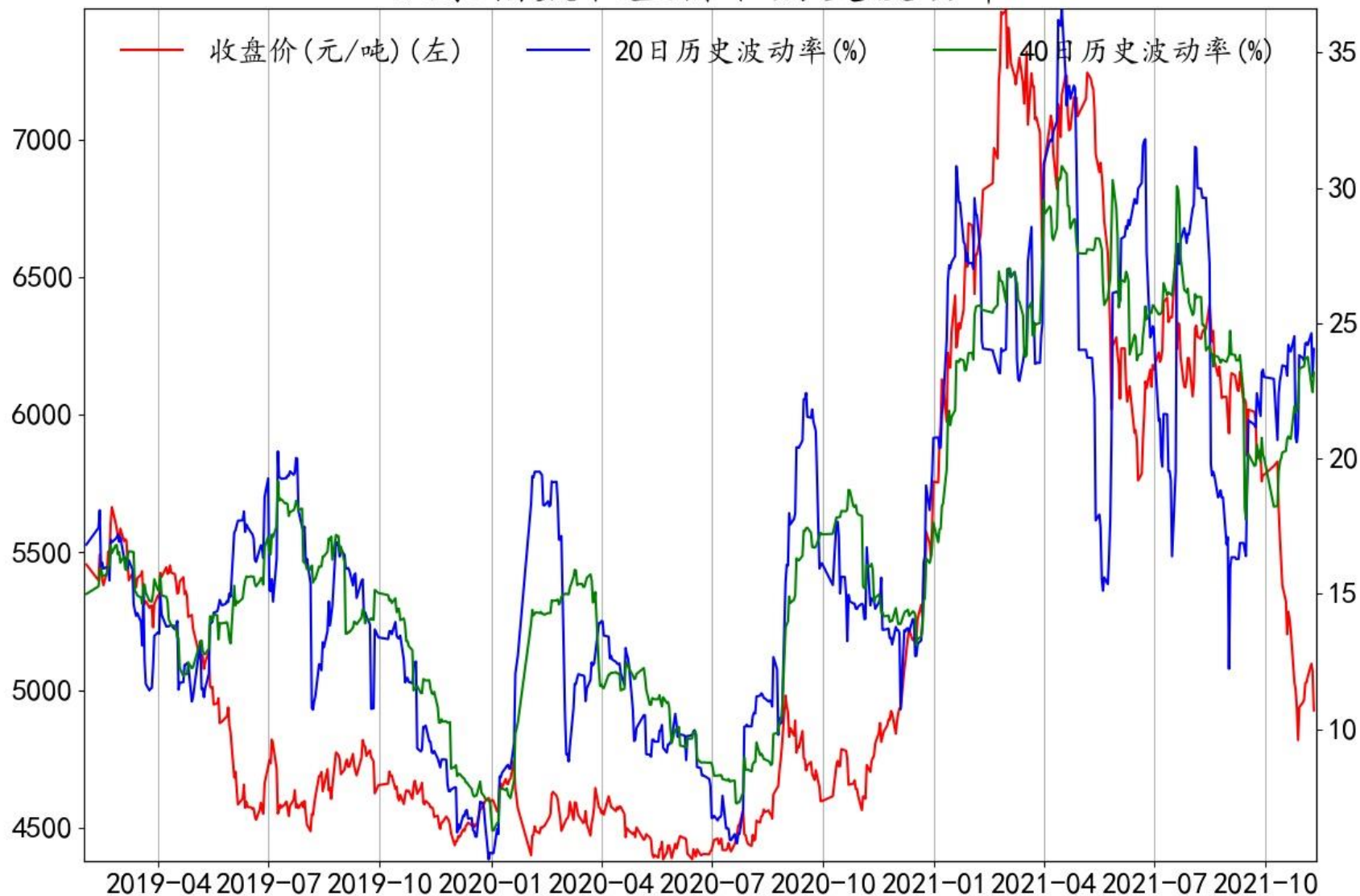
沪胶指数收盘价和历史波动率



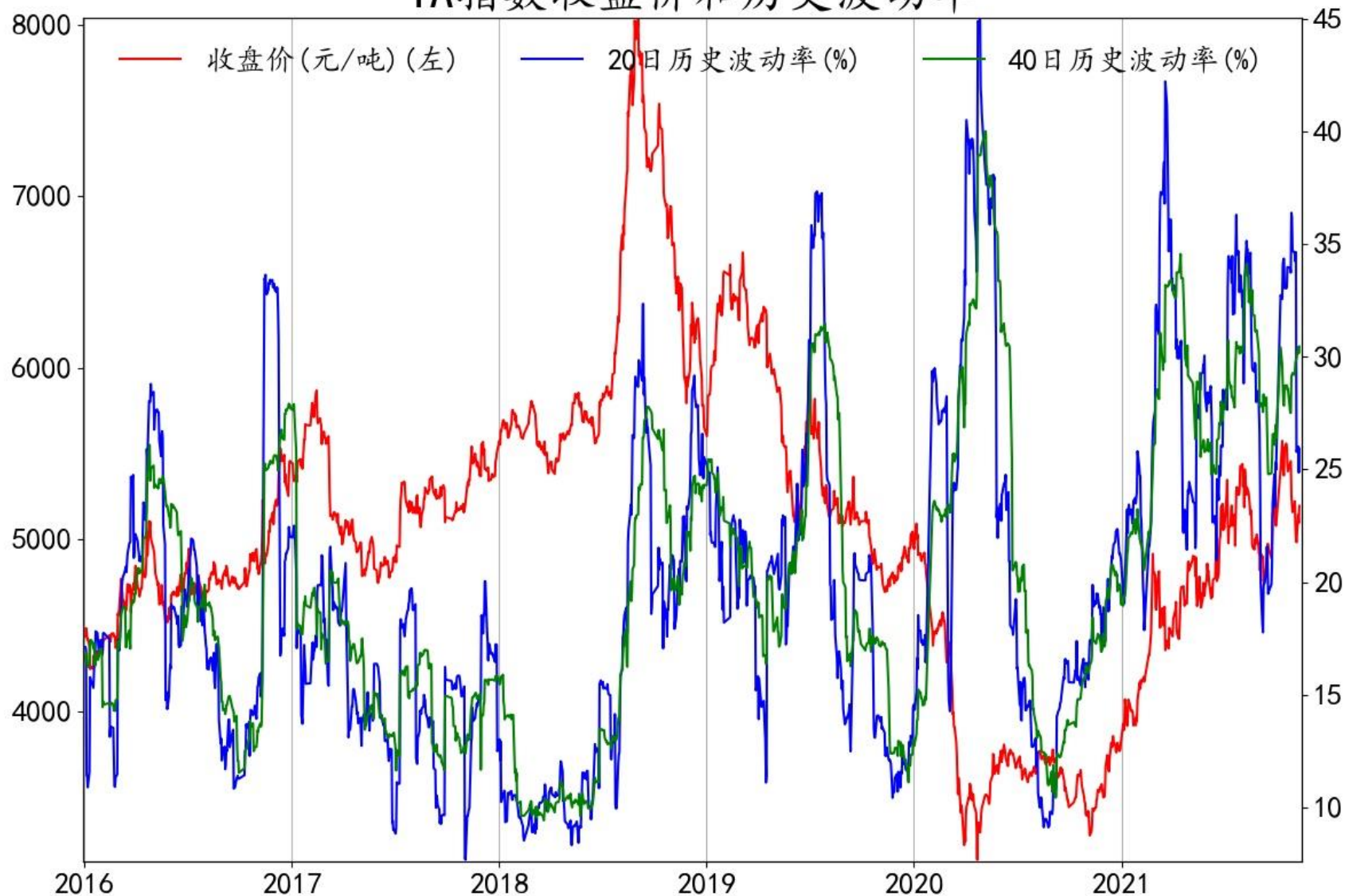
纯碱指数收盘价和历史波动率



纸浆指数收盘价和历史波动率



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

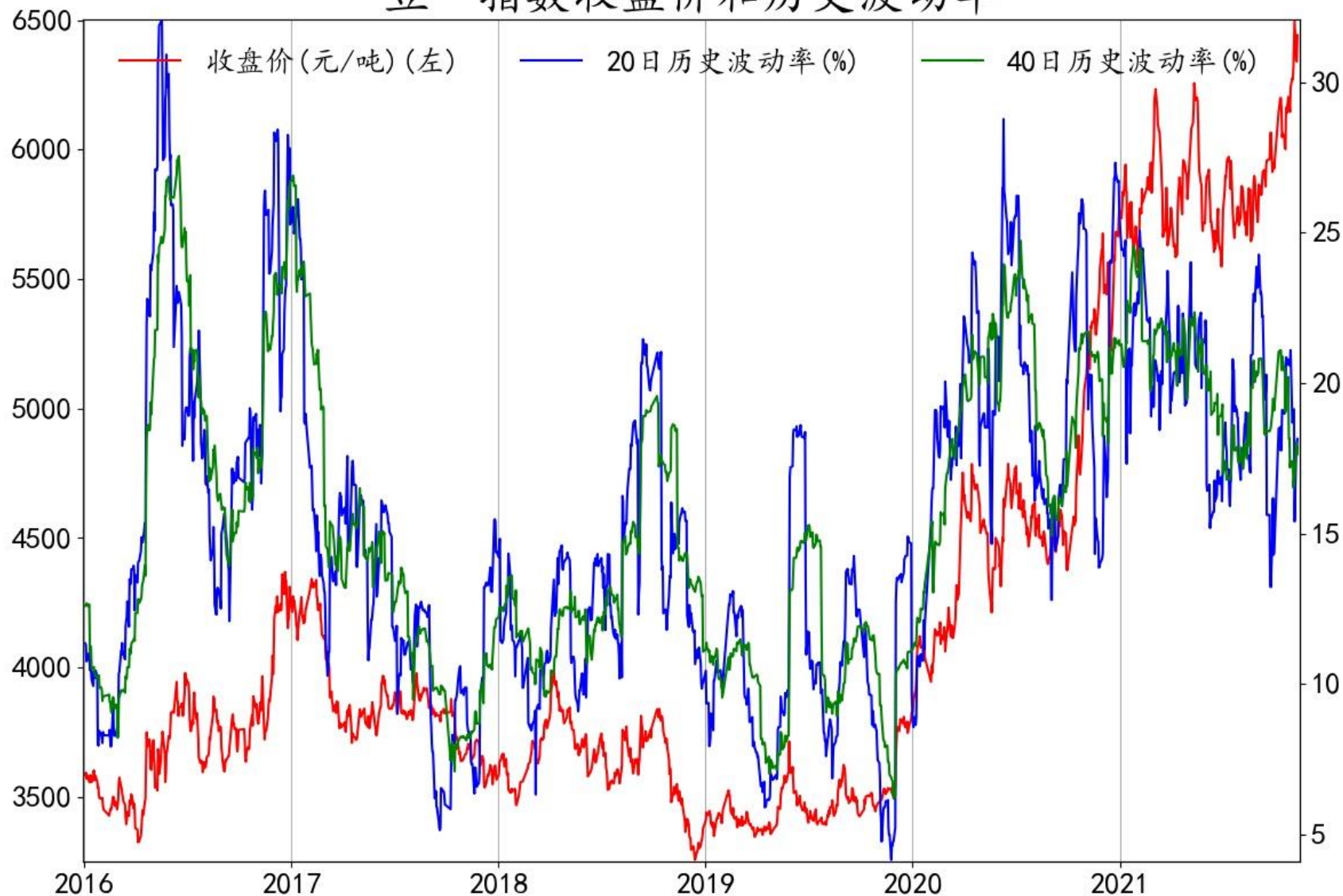


数据来源: Wind、信达期货研发中心

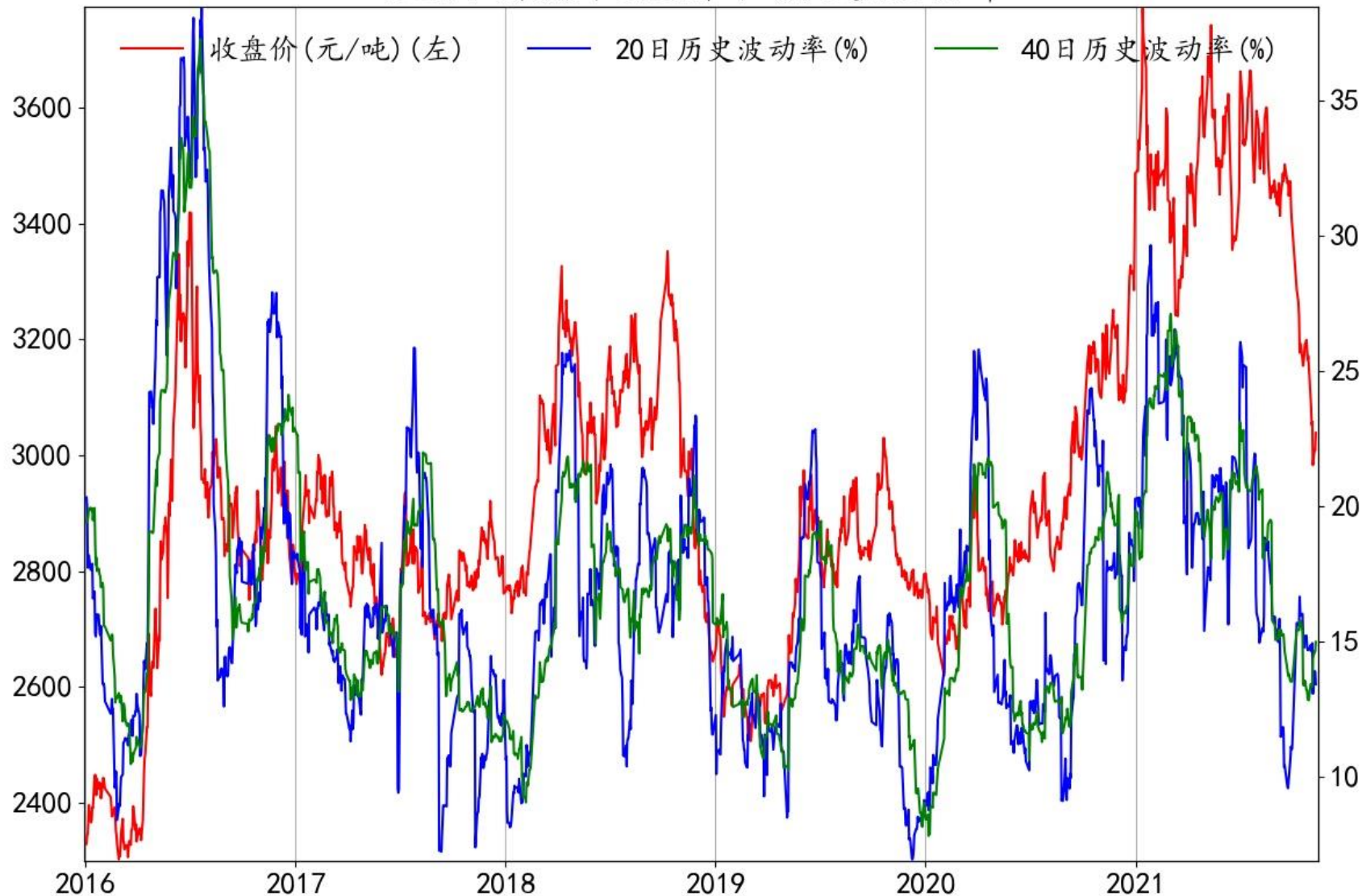
玉米指数收盘价和历史波动率



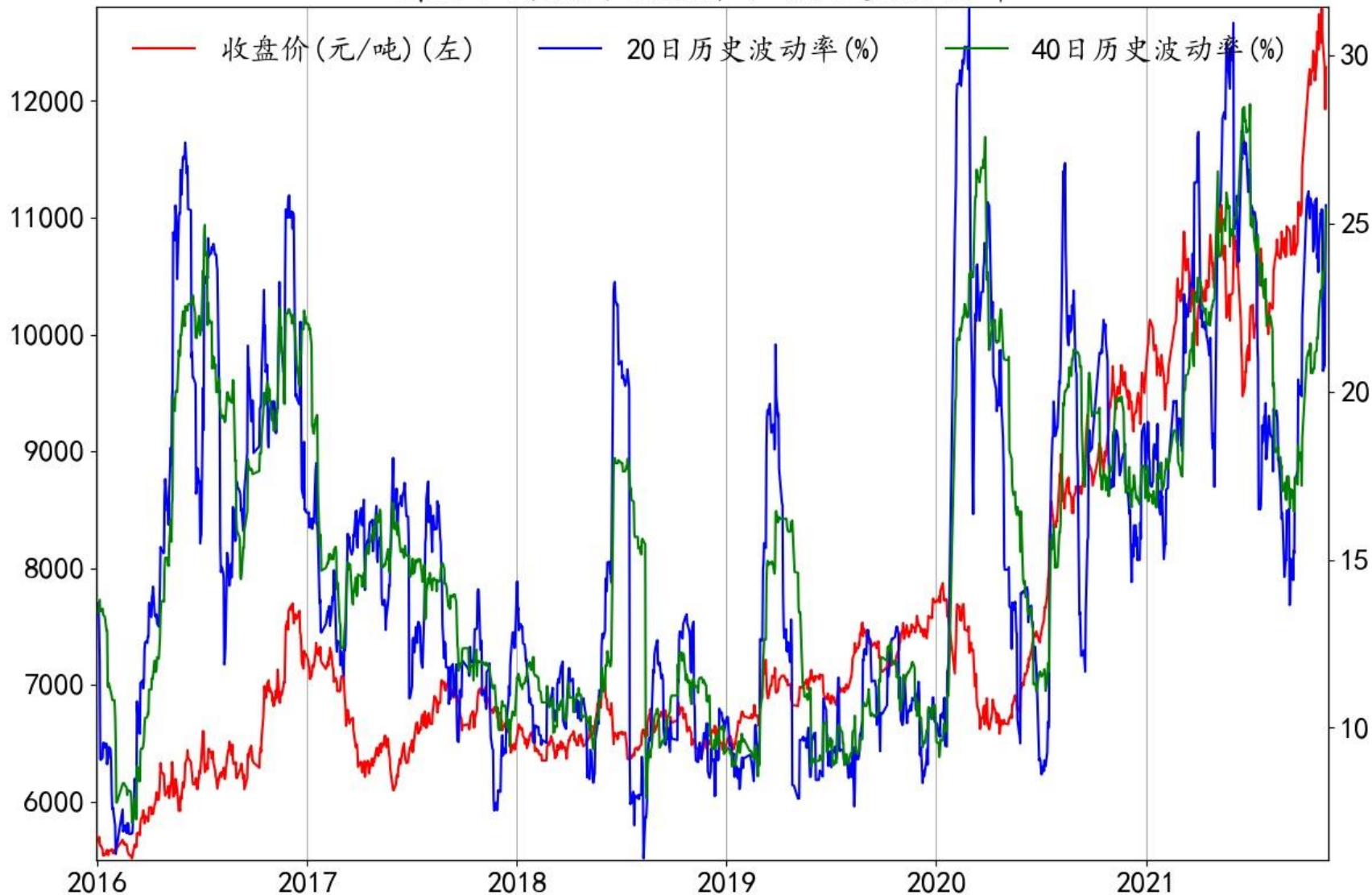
豆一指数收盘价和历史波动率



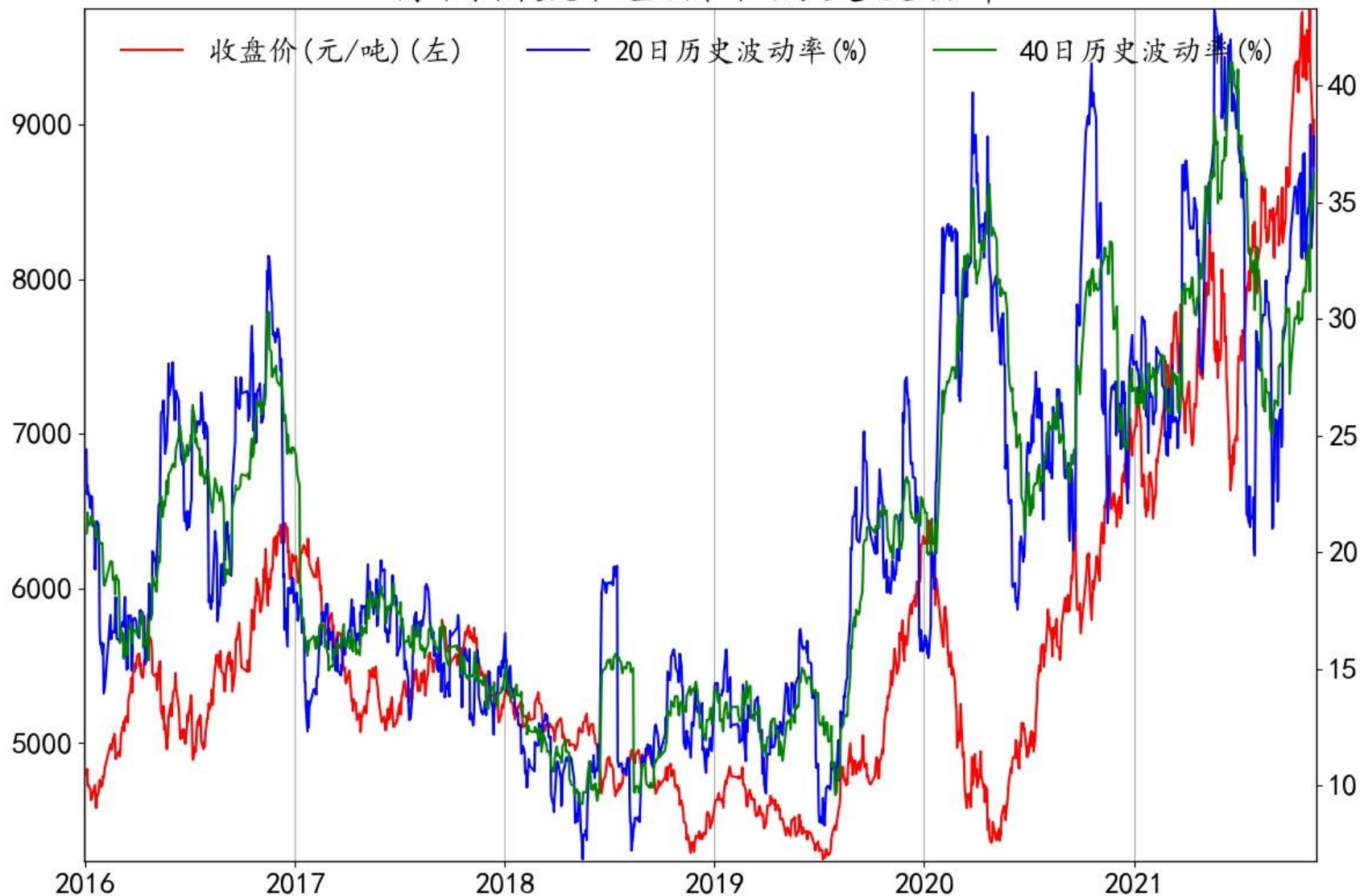
豆粕指数收盘价和历史波动率



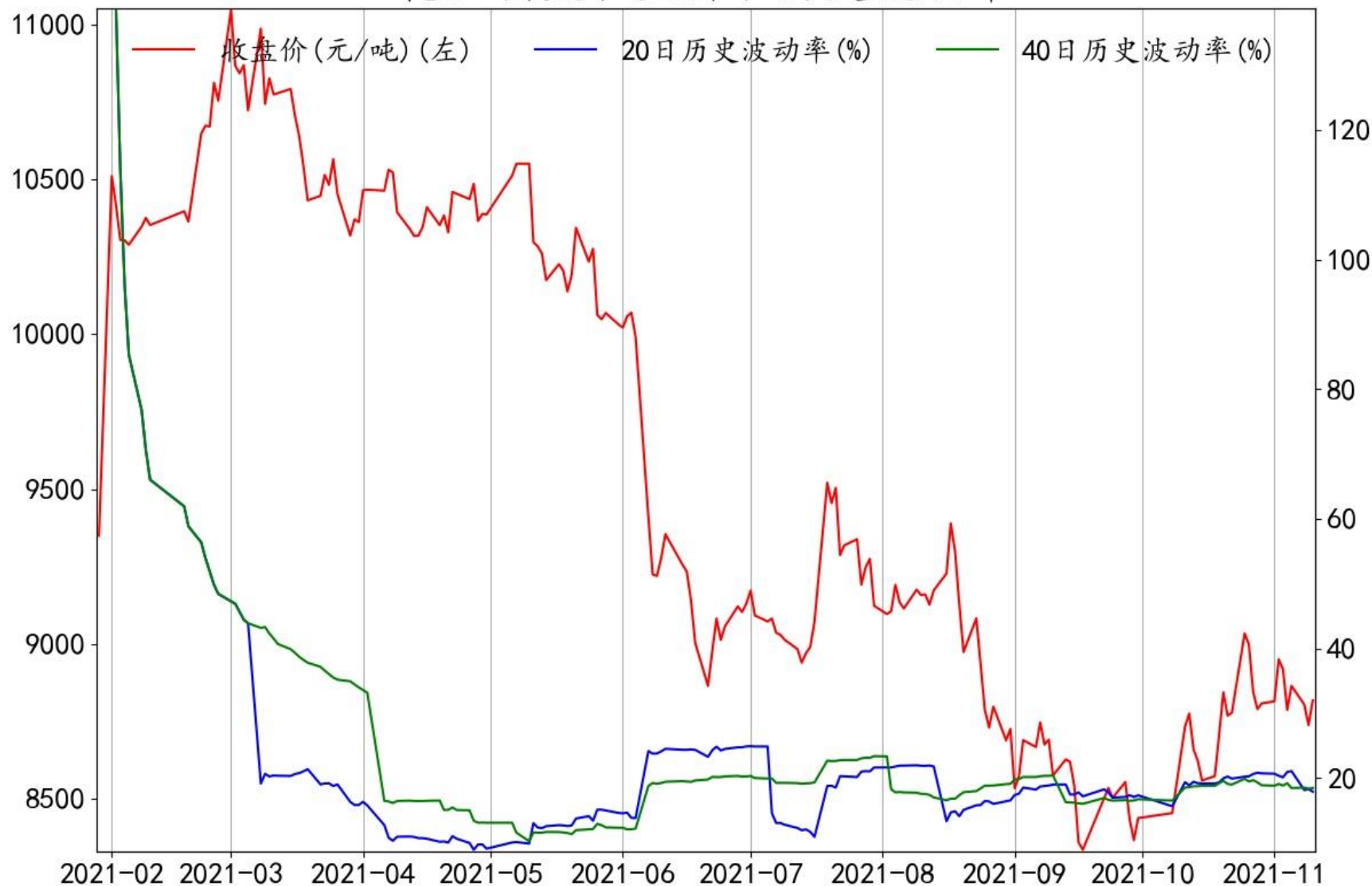
菜油指数收盘价和历史波动率



棕榈指数收盘价和历史波动率

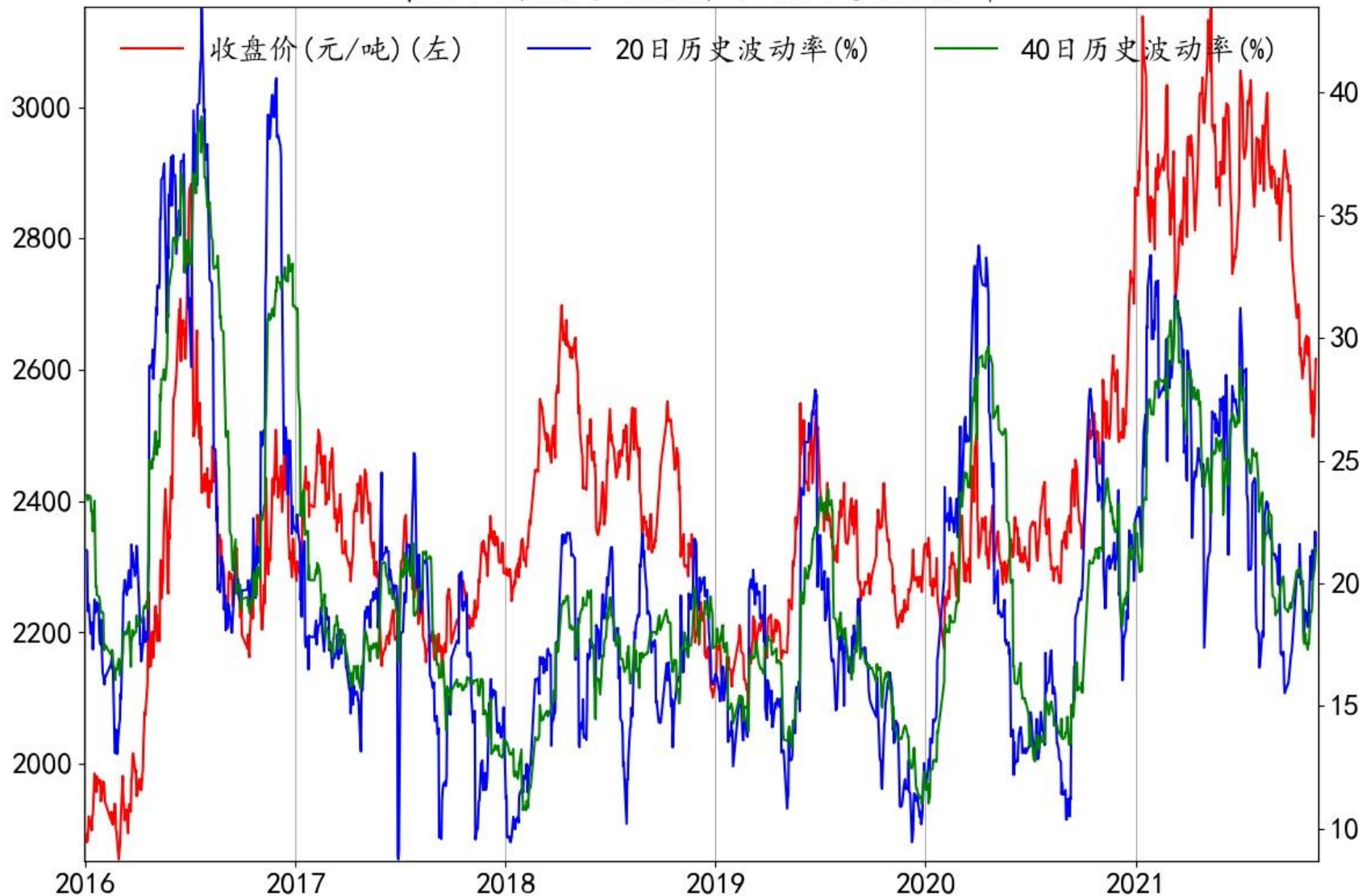


花生指数收盘价和历史波动率

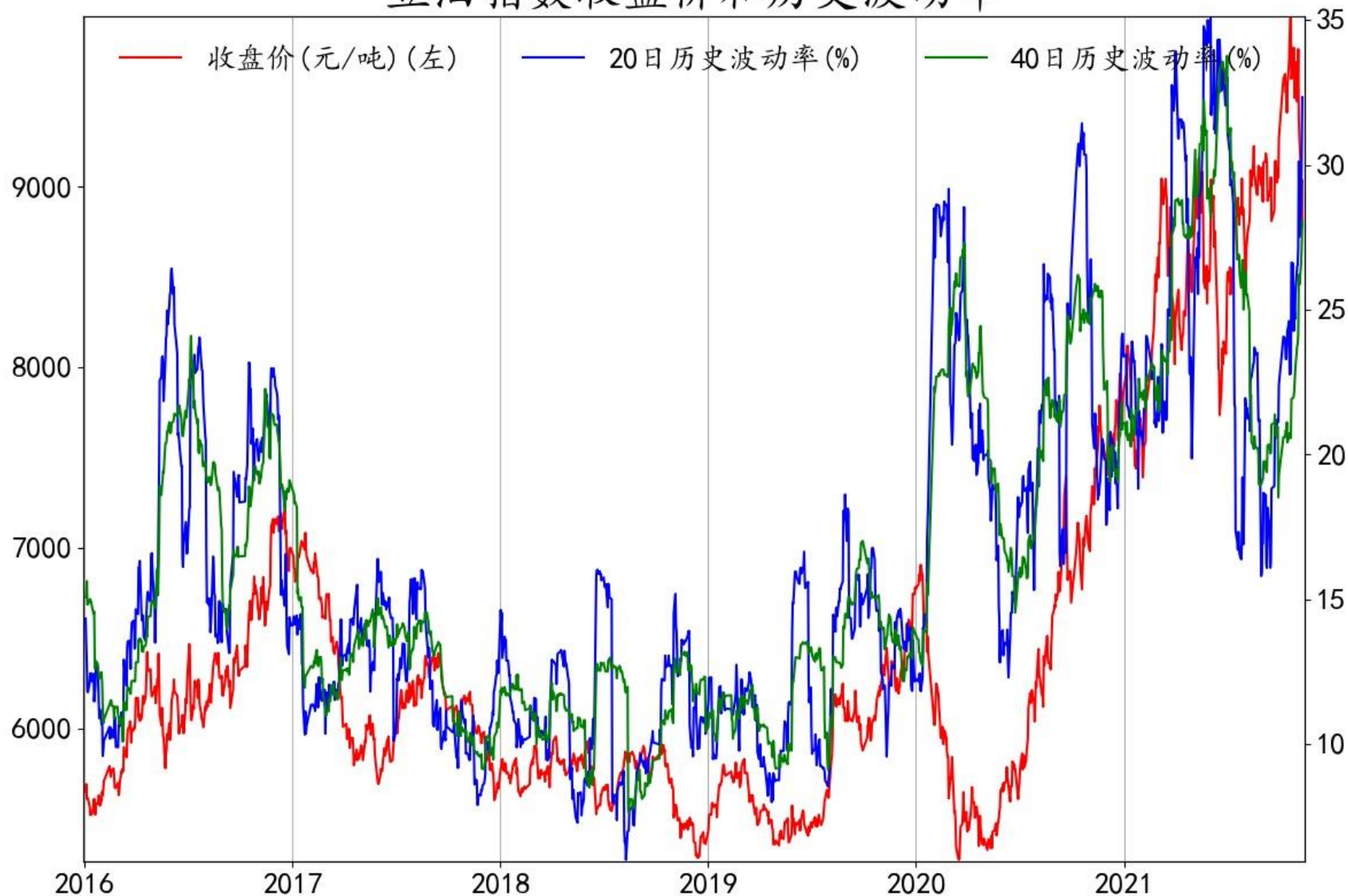


数据来源: Wind、信达期货研发中心

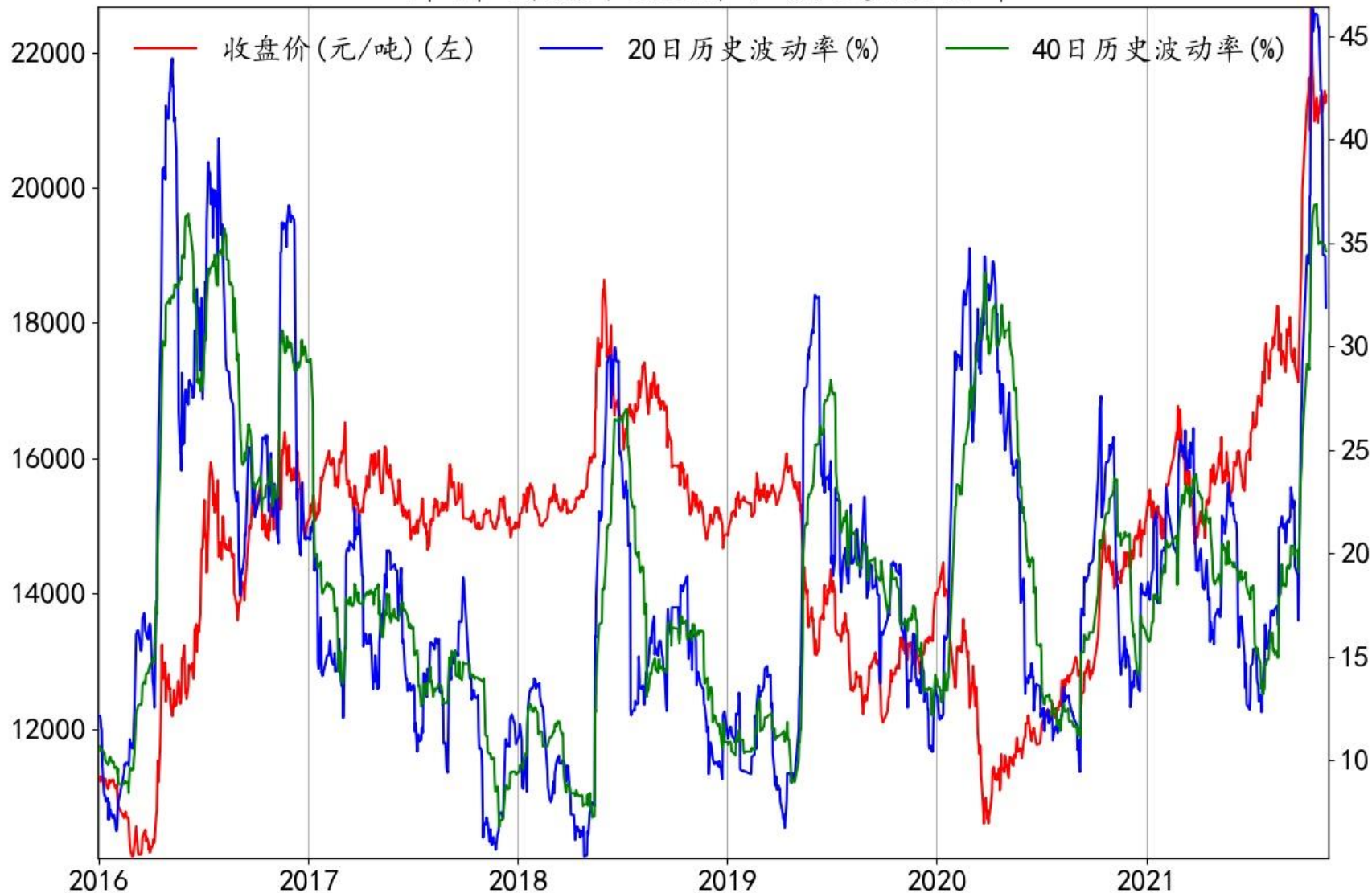
菜粕指数收盘价和历史波动率



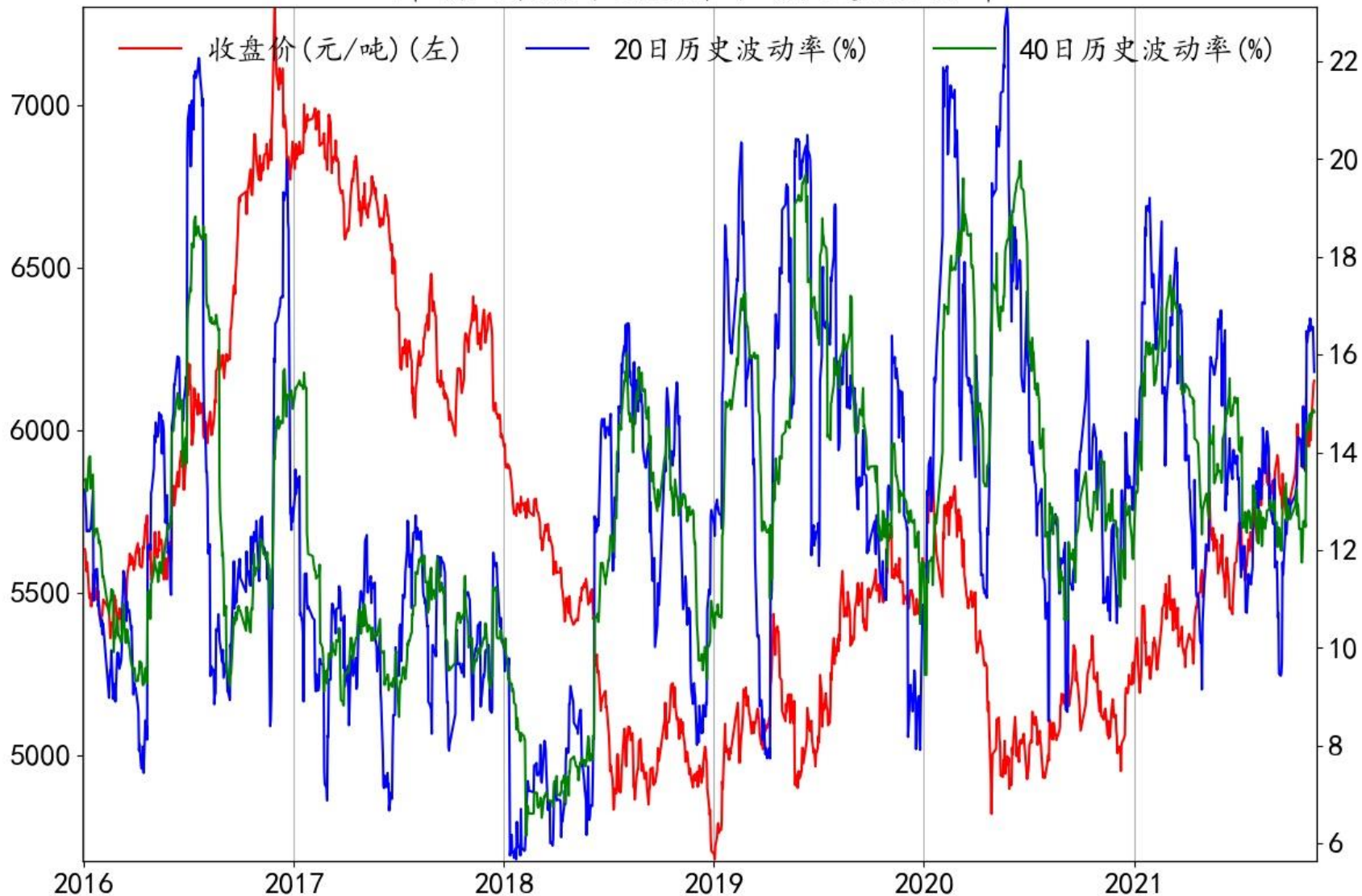
豆油指数收盘价和历史波动率



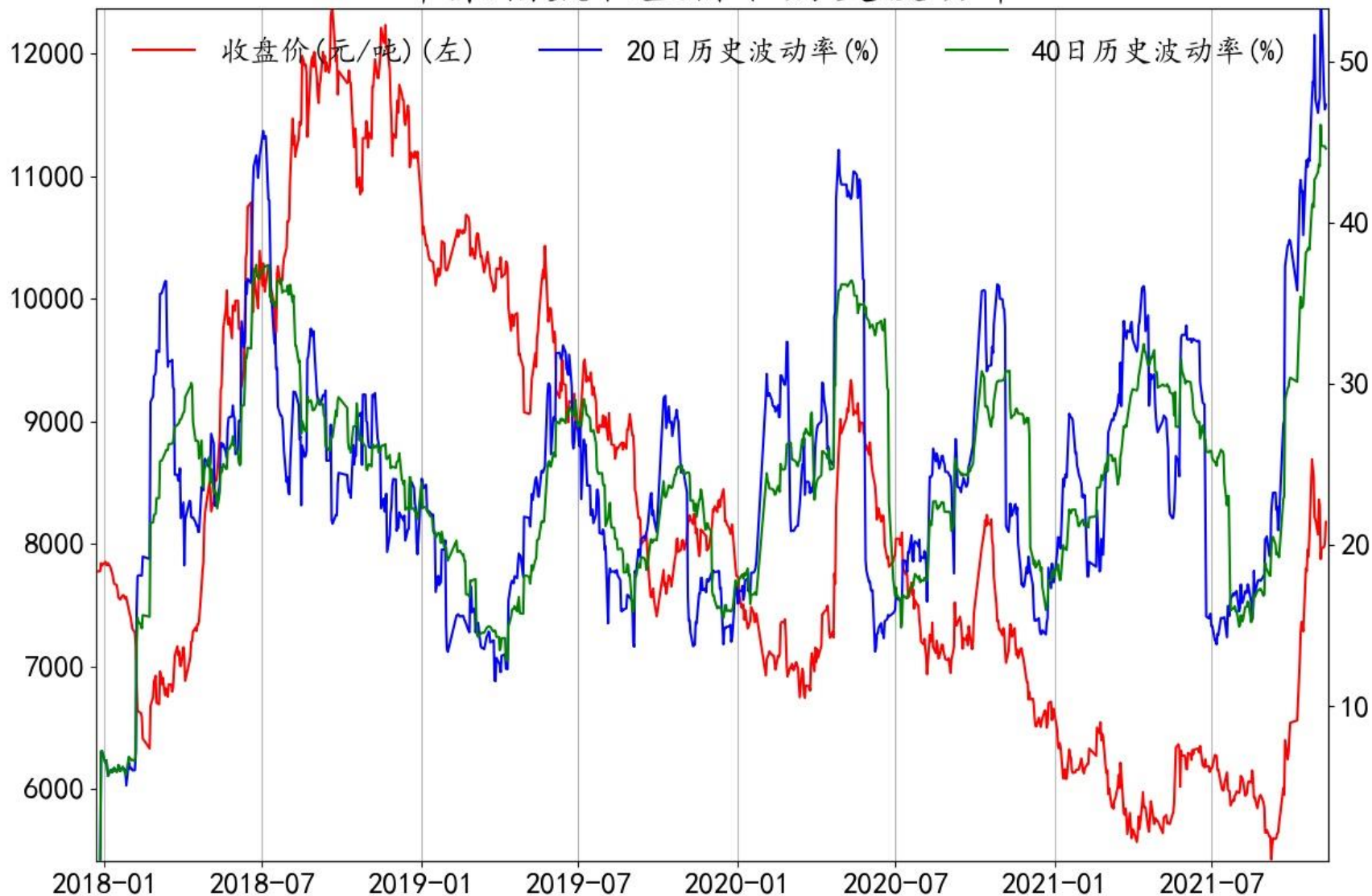
郑棉指数收盘价和历史波动率



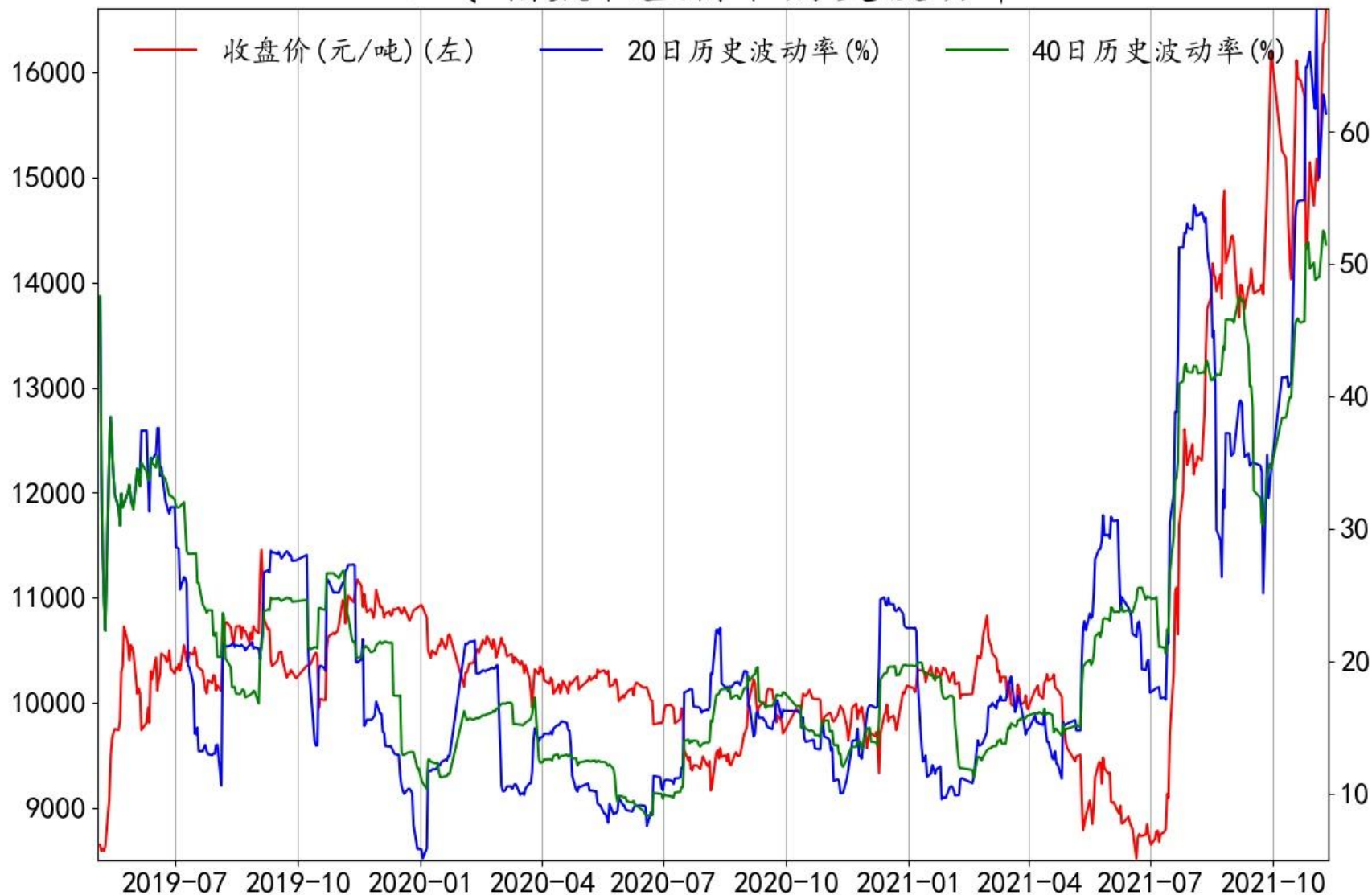
郑糖指数收盘价和历史波动率



苹果指数收盘价和历史波动率

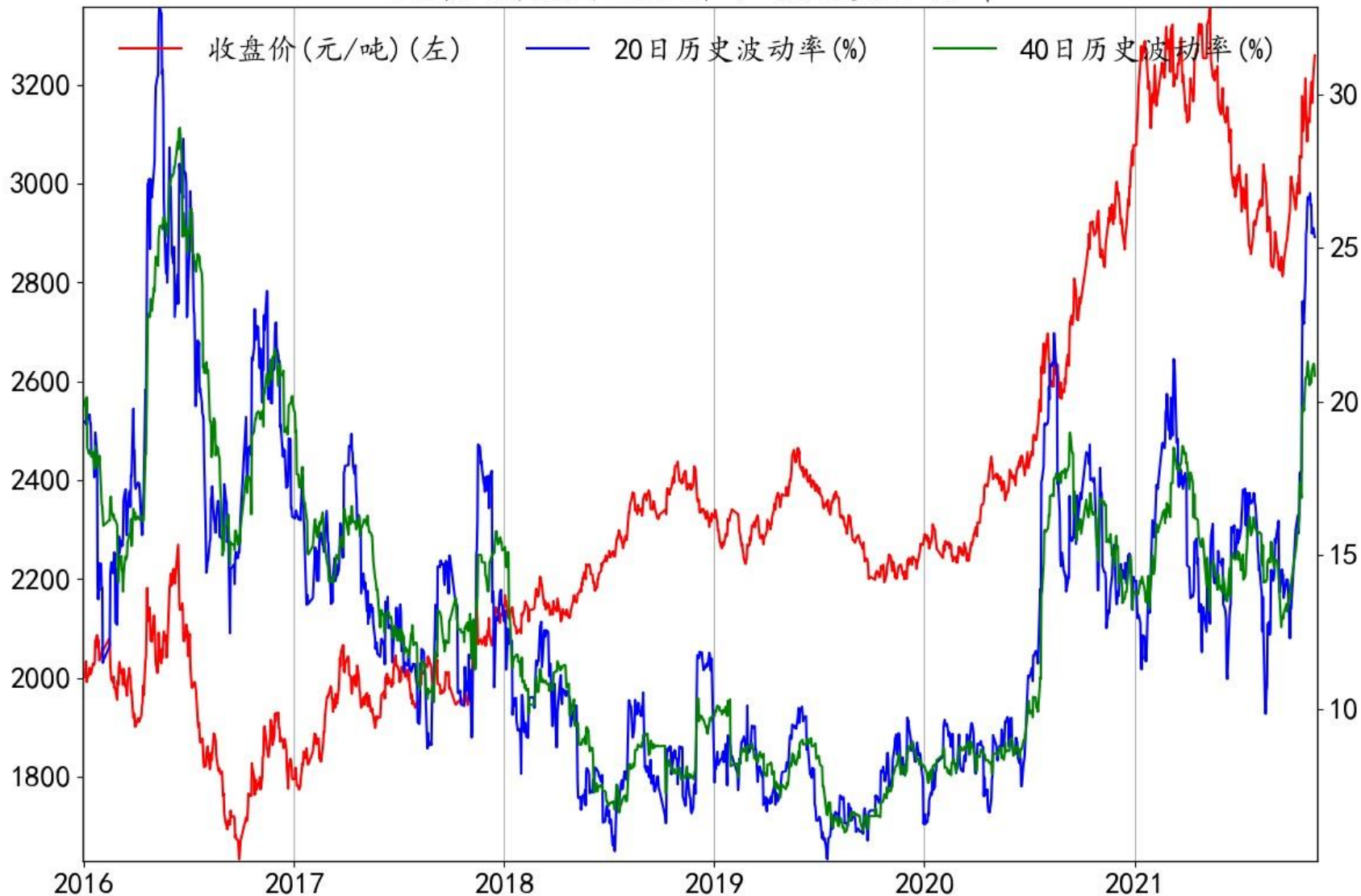


红枣指数收盘价和历史波动率

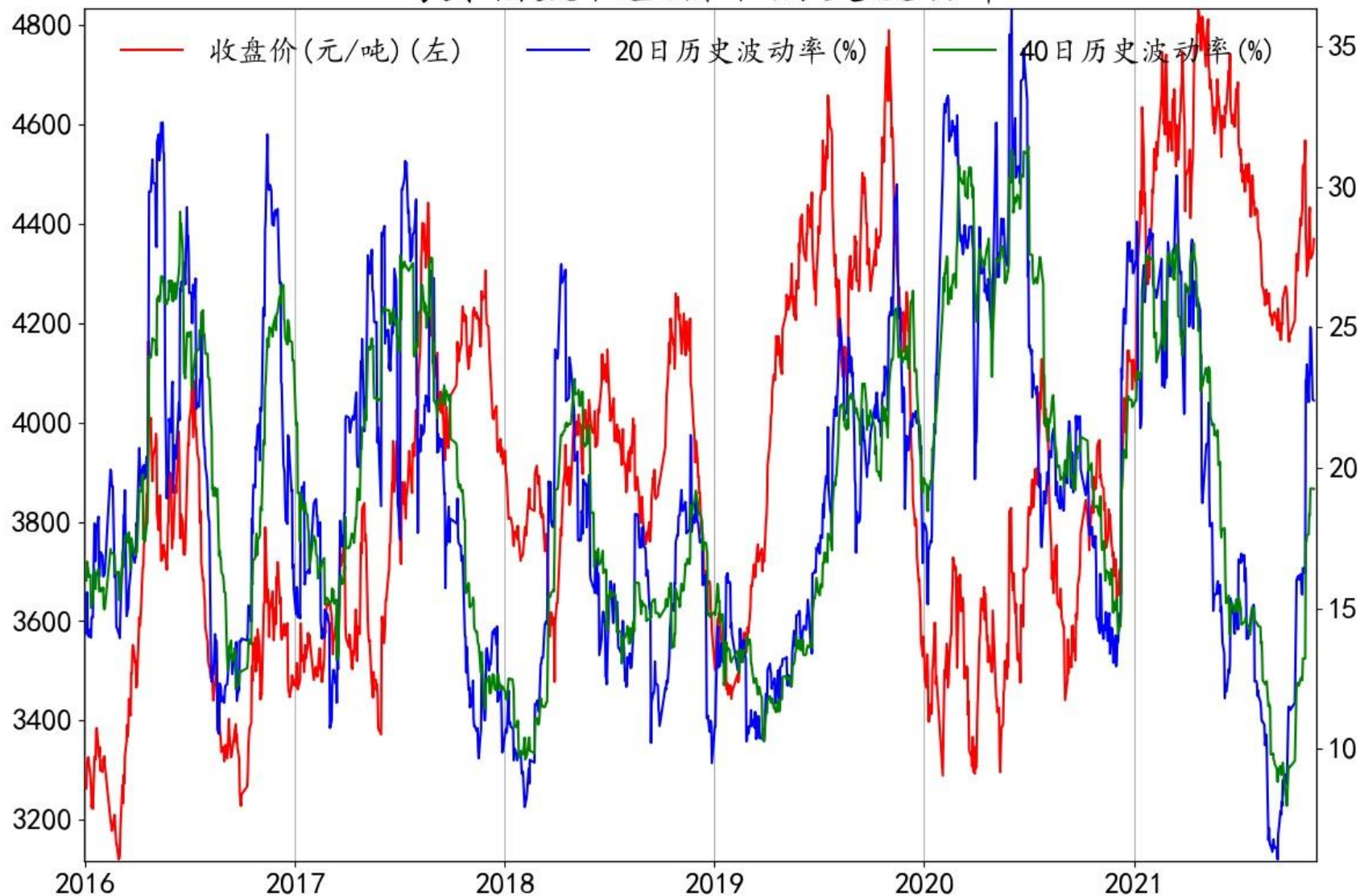


数据来源: Wind、信达期货研发中心

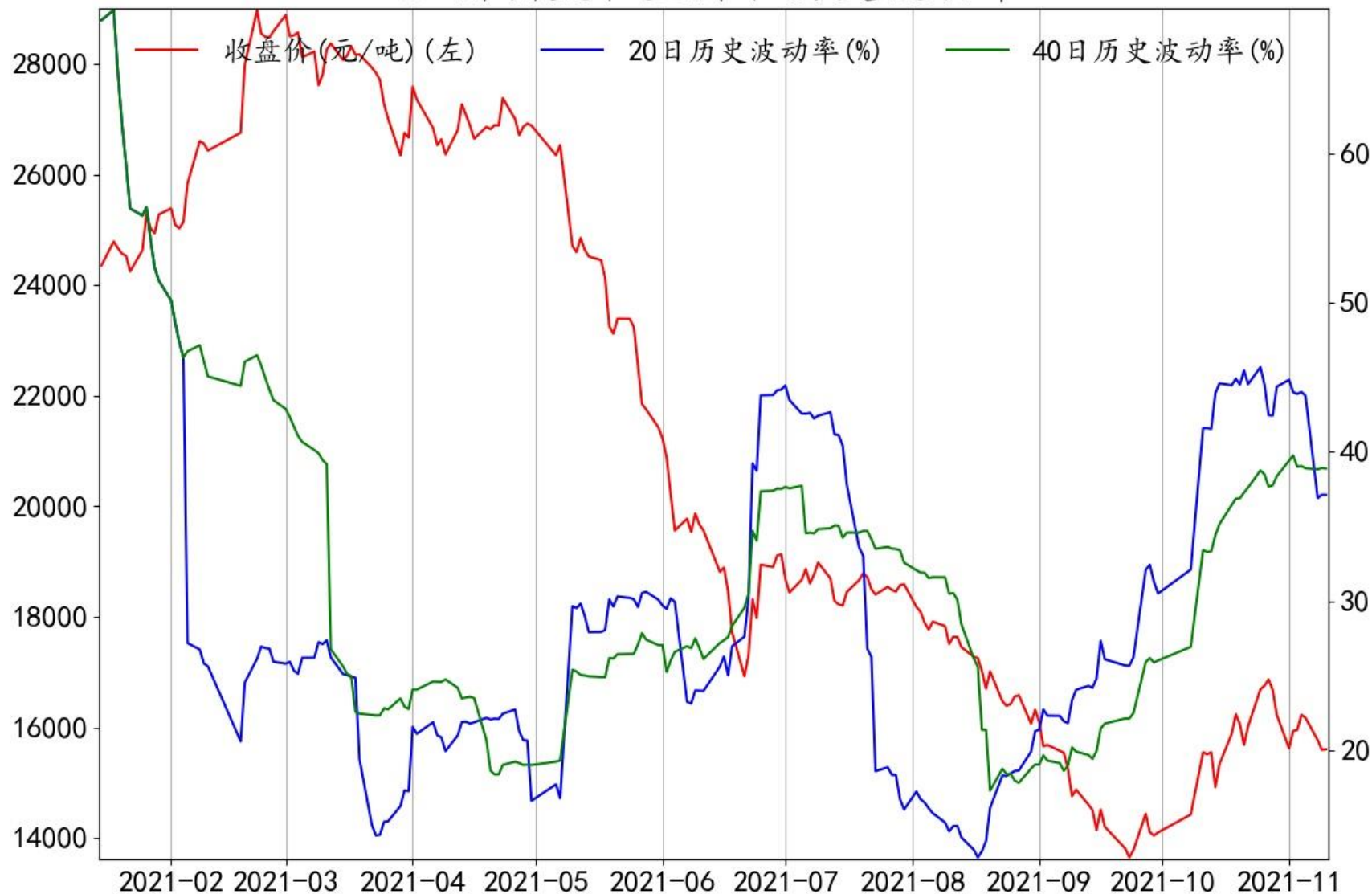
淀粉指数收盘价和历史波动率



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



信达期货
CINDA FUTURES



(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