

# 商品期货指数波动率跟踪

2022年04月11日

20日历史波动率百分位高于90%:

沪镍、纸浆、棕榈油、豆粕、低硫燃油、不锈钢、  
菜油、菜粕、沥青、原油、PTA、苹果、沪锡

20日历史波动率百分位低于10%:

沪铅、沪锌、20号胶、棉花、橡胶

20日历史波动率绝对值前五:

沪镍、低硫燃油、原油、燃油、铁矿石

20日历史波动率绝对值后五:

棉花、玉米、沪铅、白糖、沪铜

|     | 百分位    | 绝对值     |
|-----|--------|---------|
| 沪银  | 56.30% | 20.04%  |
| 沪金  | 58.86% | 12.05%  |
| 沪铝  | 83.79% | 23.38%  |
| 沪铜  | 14.76% | 10.09%  |
| 沪镍  | 99.41% | 117.97% |
| 沪铅  | 2.62%  | 9.69%   |
| 沪锡  | 91.01% | 29.96%  |
| 沪锌  | 4.07%  | 11.30%  |
| 不锈钢 | 95.27% | 44.61%  |
| 热卷  | 53.87% | 23.24%  |
| 铁矿石 | 84.97% | 51.42%  |
| 焦炭  | 76.18% | 40.56%  |
| 焦煤  | 84.51% | 46.74%  |

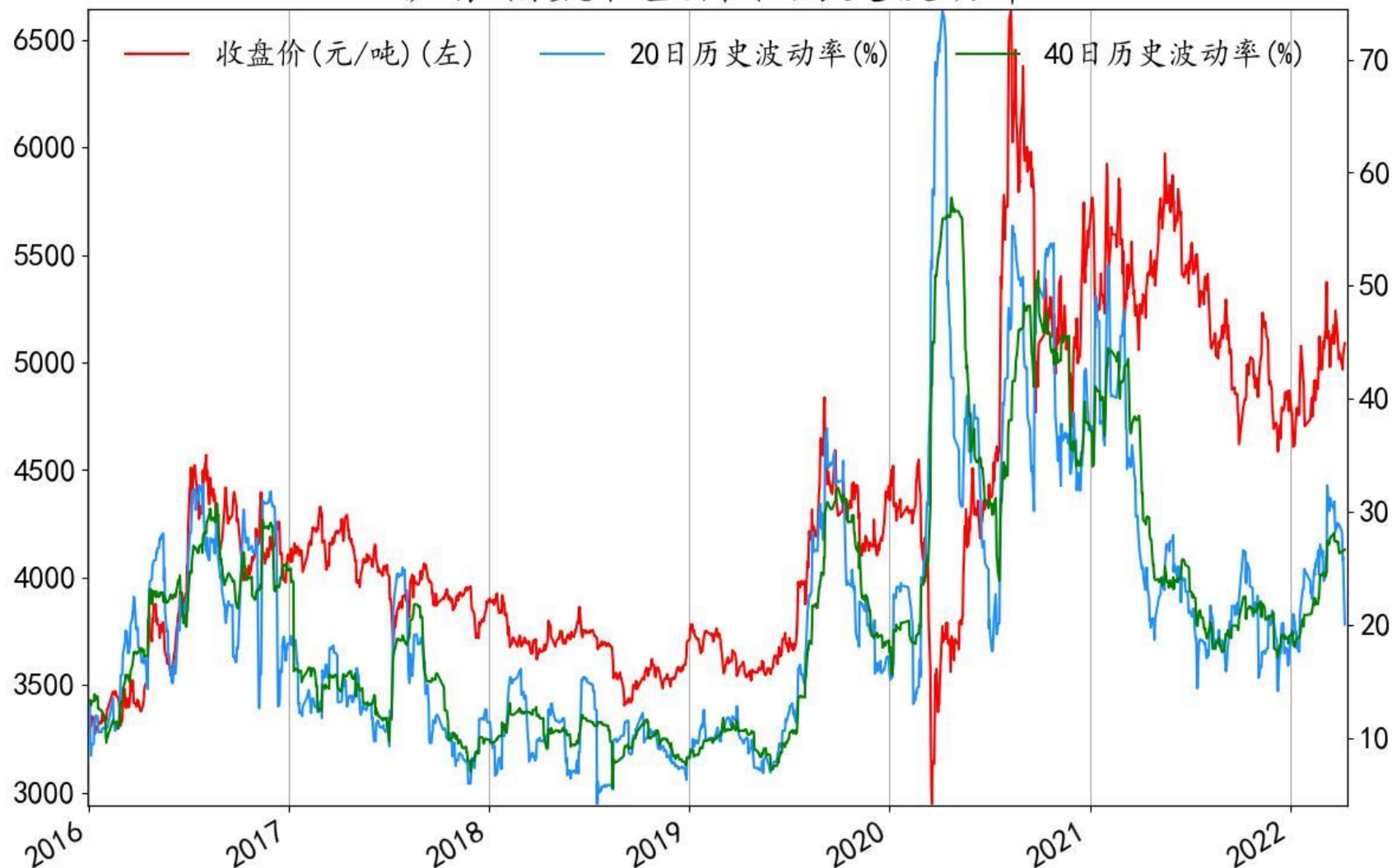
|      | 百分位    | 绝对值    |
|------|--------|--------|
| 螺纹   | 59.51% | 25.35% |
| 硅铁   | 81.63% | 34.68% |
| 锰硅   | 56.63% | 23.60% |
| 玻璃   | 89.30% | 35.36% |
| 纯碱   | 80.21% | 37.57% |
| 燃油   | 89.62% | 54.28% |
| 低硫燃油 | 95.31% | 59.91% |
| LPG  | 80.35% | 42.99% |
| 原油   | 93.97% | 59.45% |
| 动力煤  | 51.57% | 20.05% |
| PVC  | 66.01% | 21.25% |
| 沥青   | 94.82% | 46.89% |
| 苯乙烯  | 28.59% | 22.13% |

|      | 百分位    | 绝对值    |
|------|--------|--------|
| 乙二醇  | 78.19% | 31.56% |
| 聚乙烯  | 58.46% | 19.12% |
| 甲醇   | 81.56% | 30.12% |
| 20号胶 | 7.50%  | 16.66% |
| 短纤   | 65.14% | 26.17% |
| 聚丙烯  | 56.50% | 20.13% |
| 橡胶   | 8.40%  | 16.03% |
| 纸浆   | 98.96% | 36.48% |
| PTA  | 93.44% | 34.83% |
| 尿素   | 61.39% | 25.91% |
| 玉米   | 45.41% | 9.45%  |
| 豆一   | 44.82% | 14.15% |
| 豆粕   | 96.19% | 30.91% |

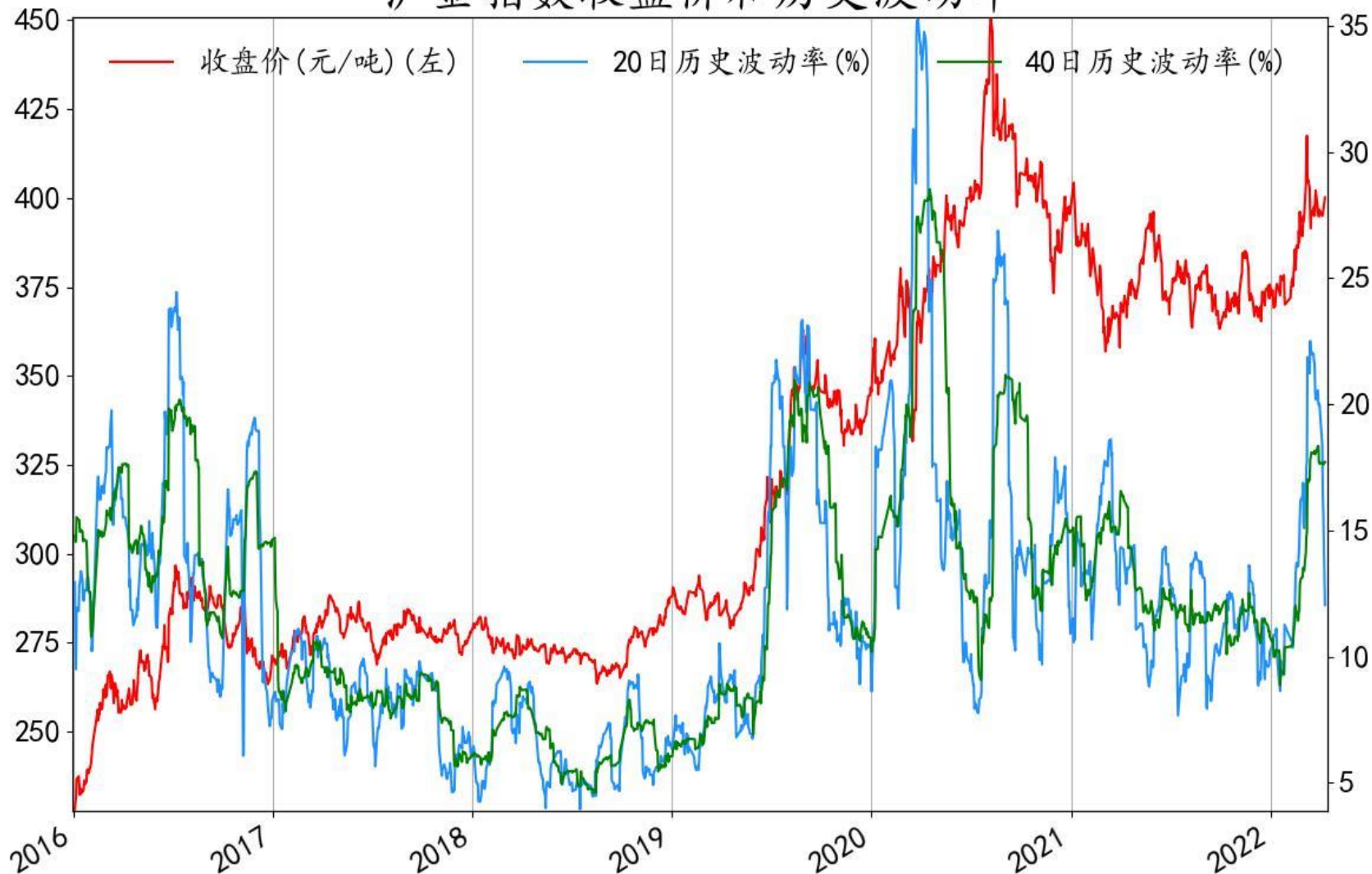
|      | 百分位    | 绝对值    |
|------|--------|--------|
| 菜油   | 95.14% | 26.94% |
| 棕榈油  | 98.82% | 46.98% |
| 花生   | 50.88% | 17.79% |
| 菜粕   | 95.08% | 35.92% |
| 豆油   | 87.80% | 25.33% |
| 棉花   | 7.94%  | 9.35%  |
| 白糖   | 23.03% | 10.00% |
| 苹果   | 92.11% | 37.05% |
| 红枣   | 65.97% | 26.61% |
| 玉米淀粉 | 74.54% | 16.05% |
| 鸡蛋   | 47.31% | 17.52% |
| 生猪   | 48.82% | 23.51% |



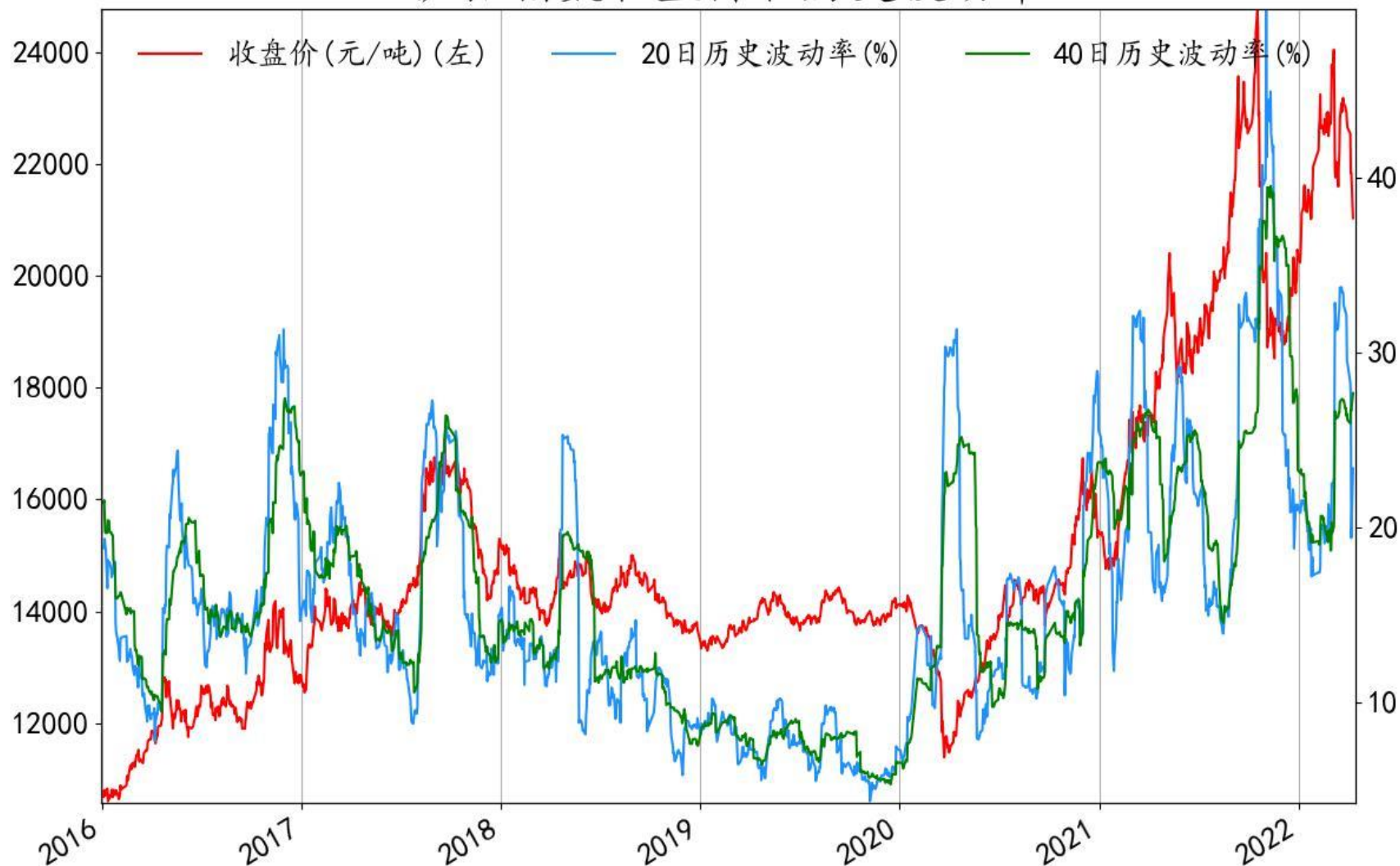
## 沪银指数收盘价和历史波动率



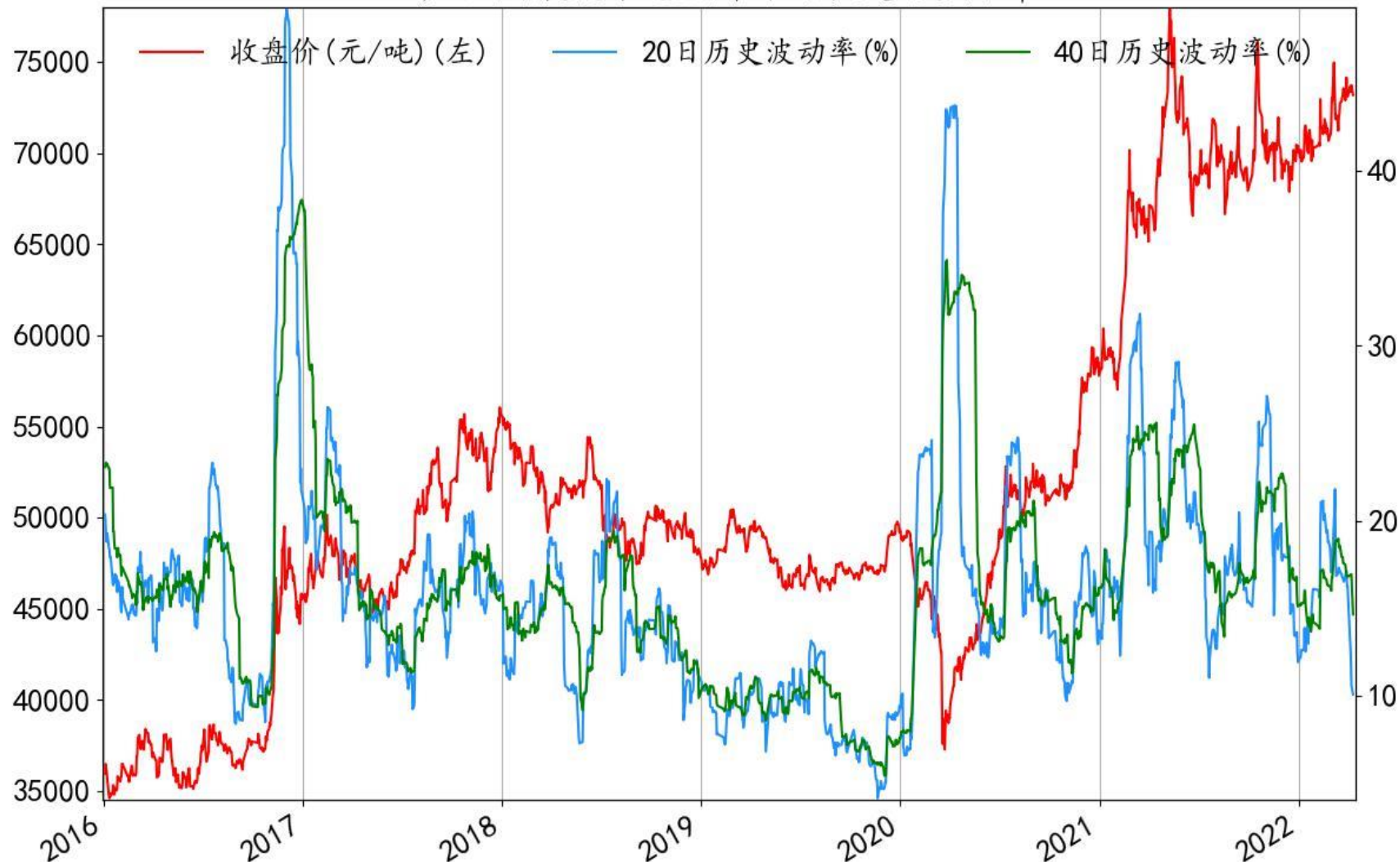
## 沪金指数收盘价和历史波动率



## 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

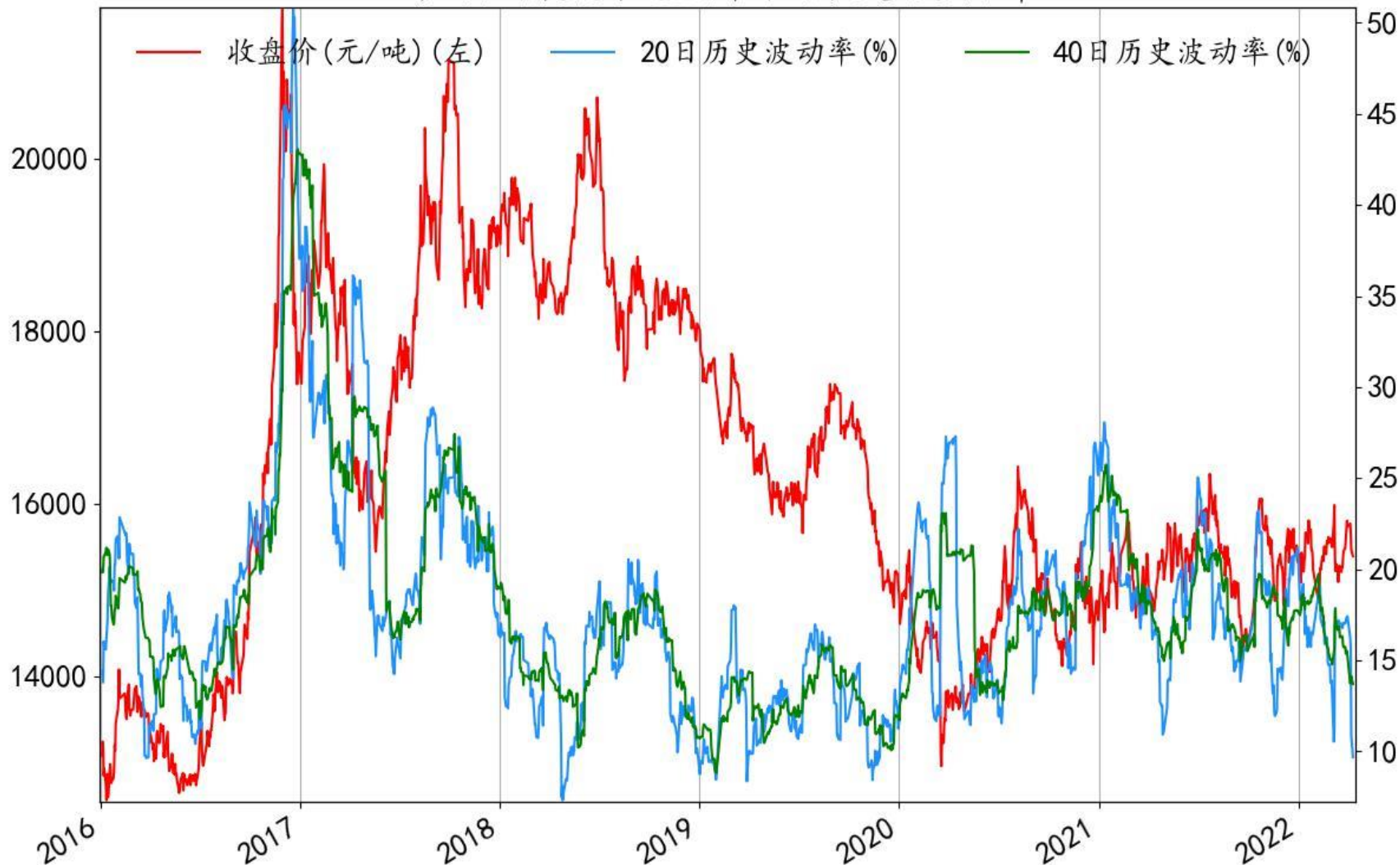




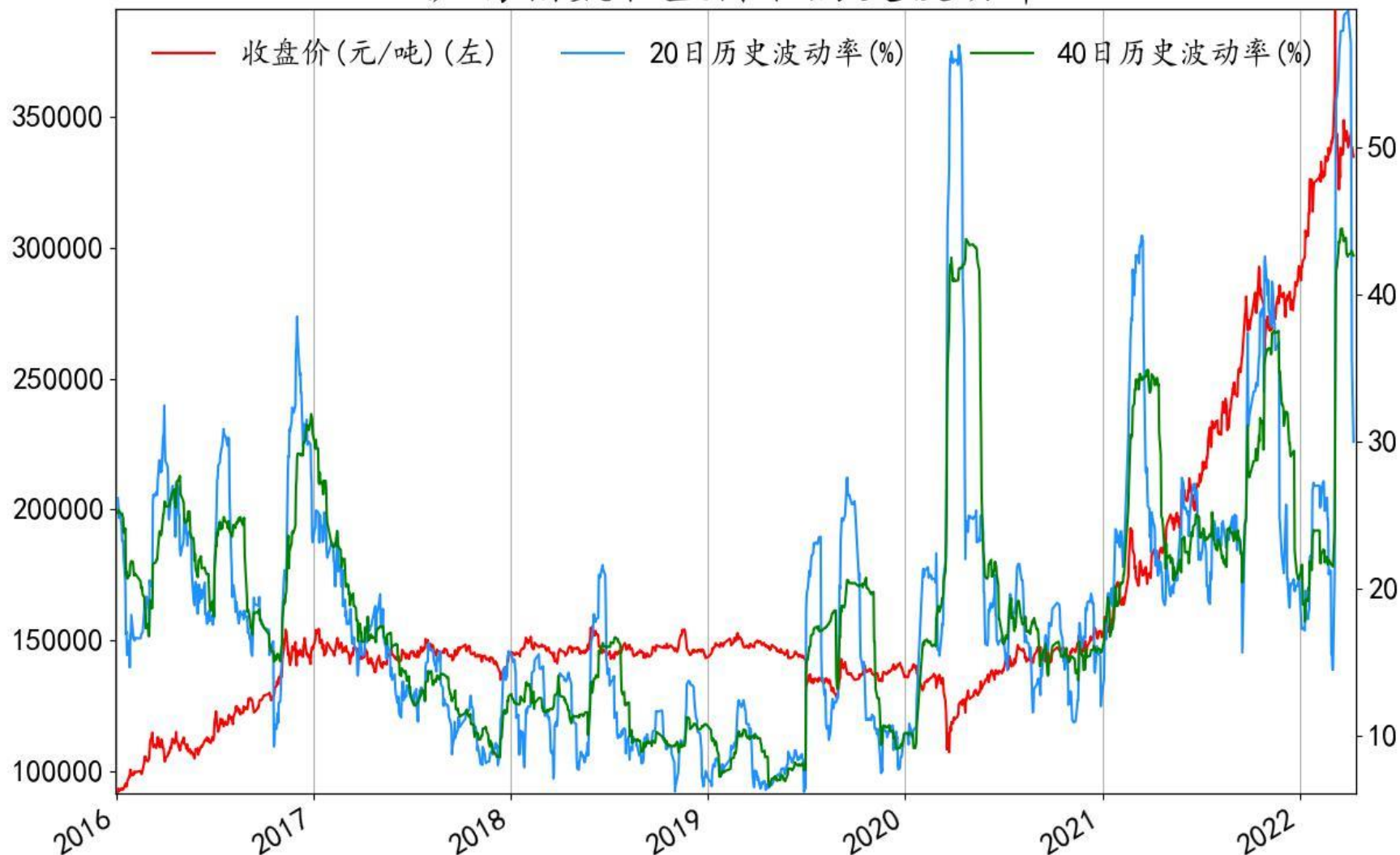
## 沪镍指数收盘价和历史波动率



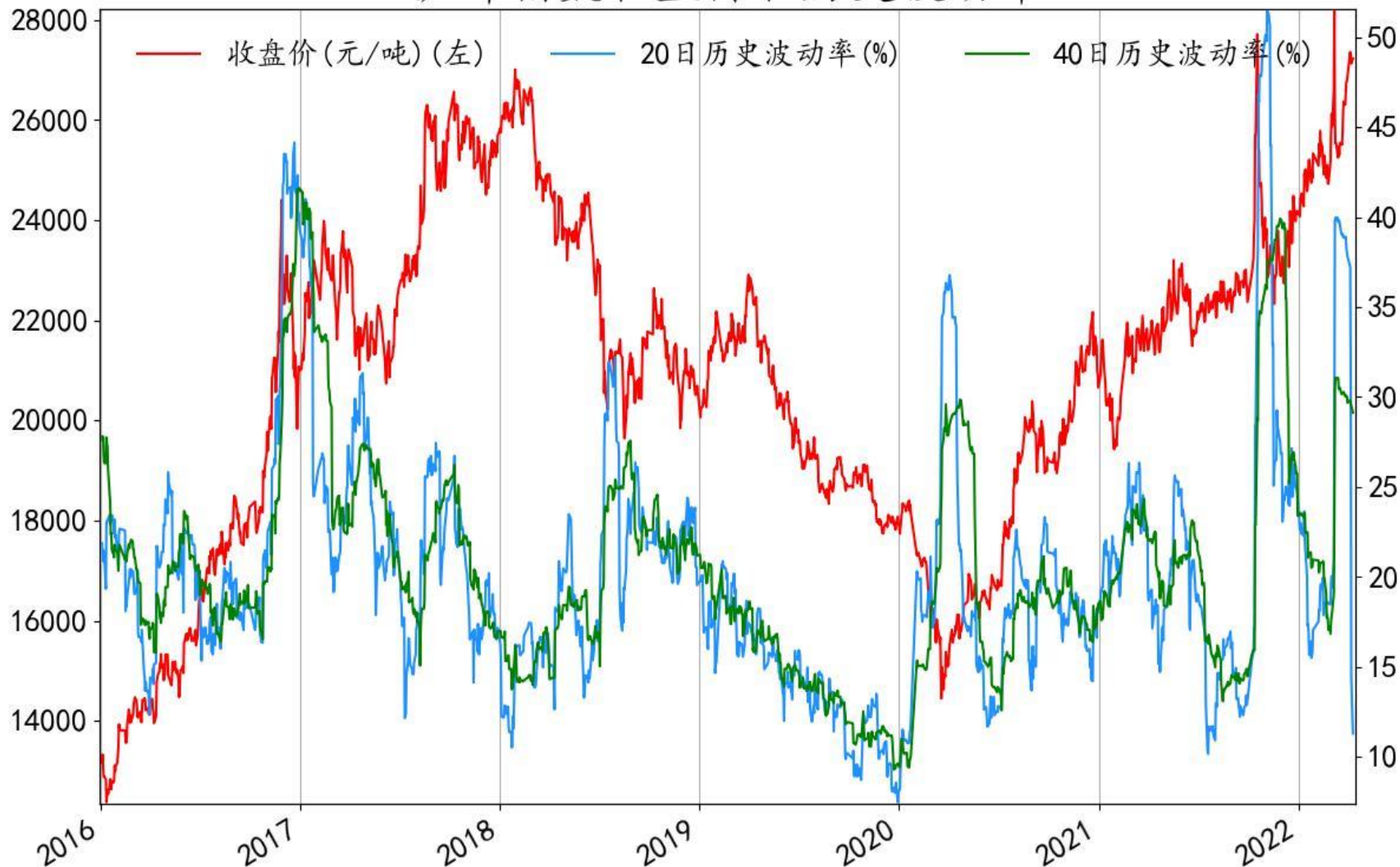
## 沪铅指数收盘价和历史波动率



## 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

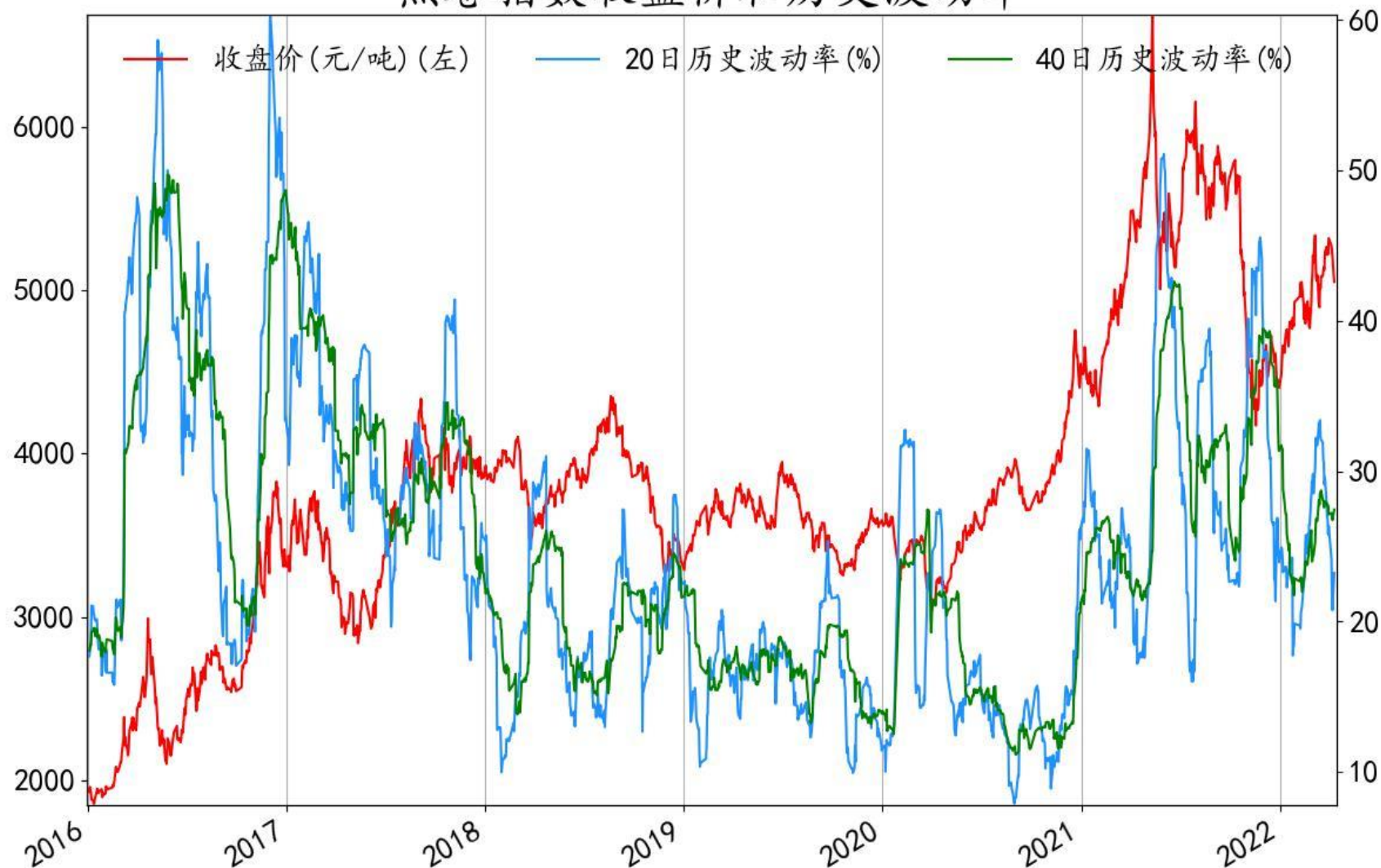




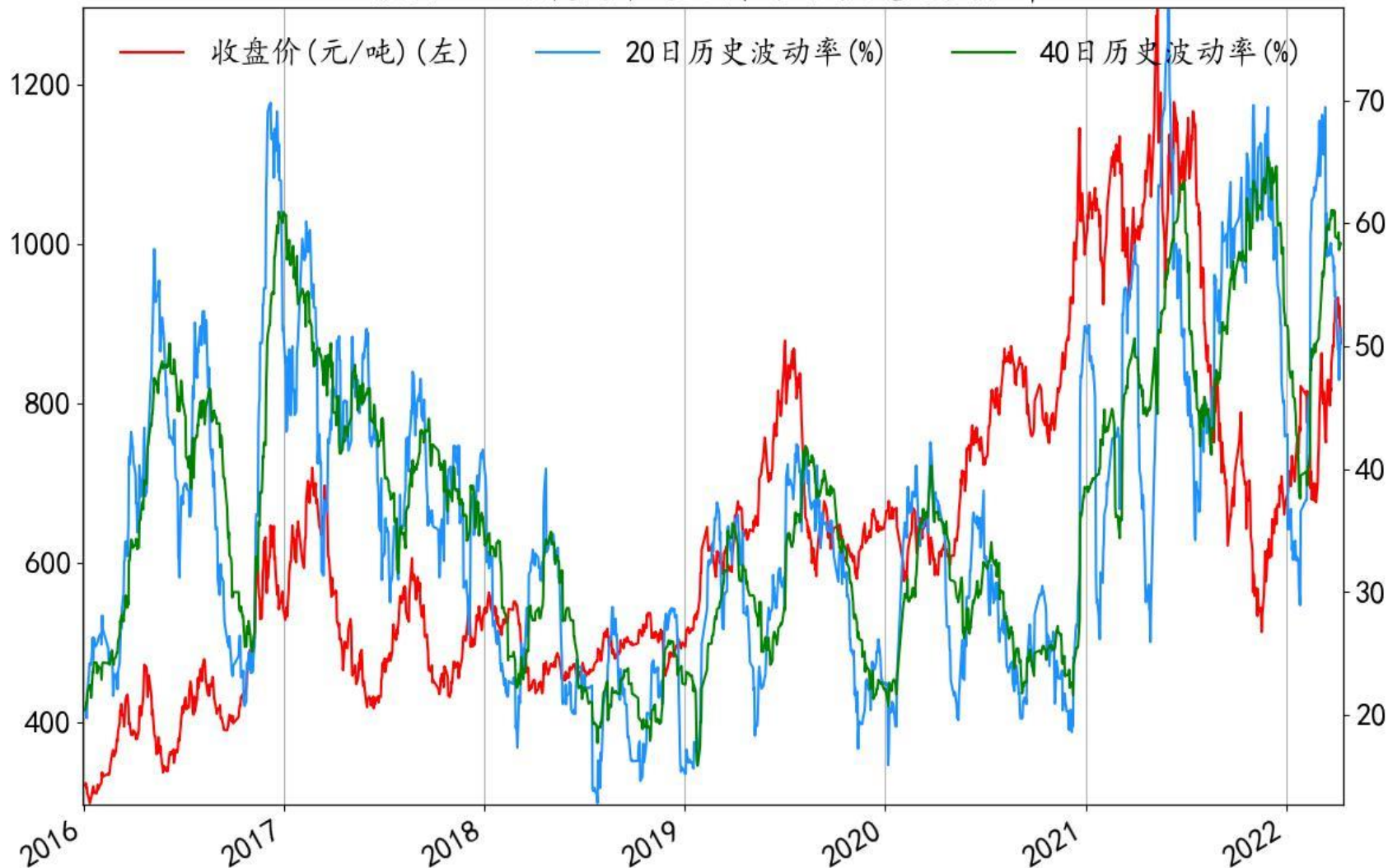
## 不锈钢指数收盘价和历史波动率



## 热卷指数收盘价和历史波动率

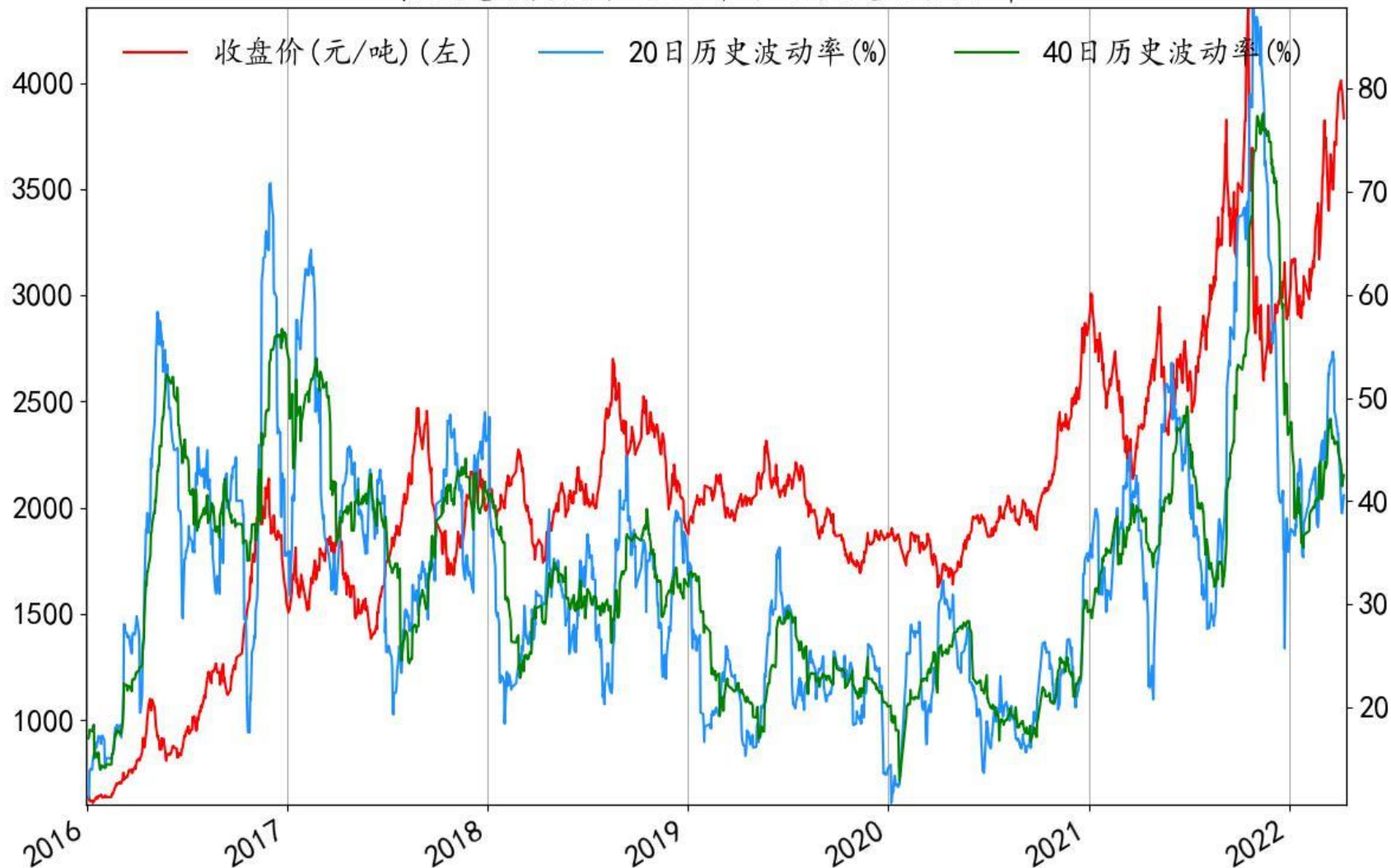


## 铁矿石指数收盘价和历史波动率



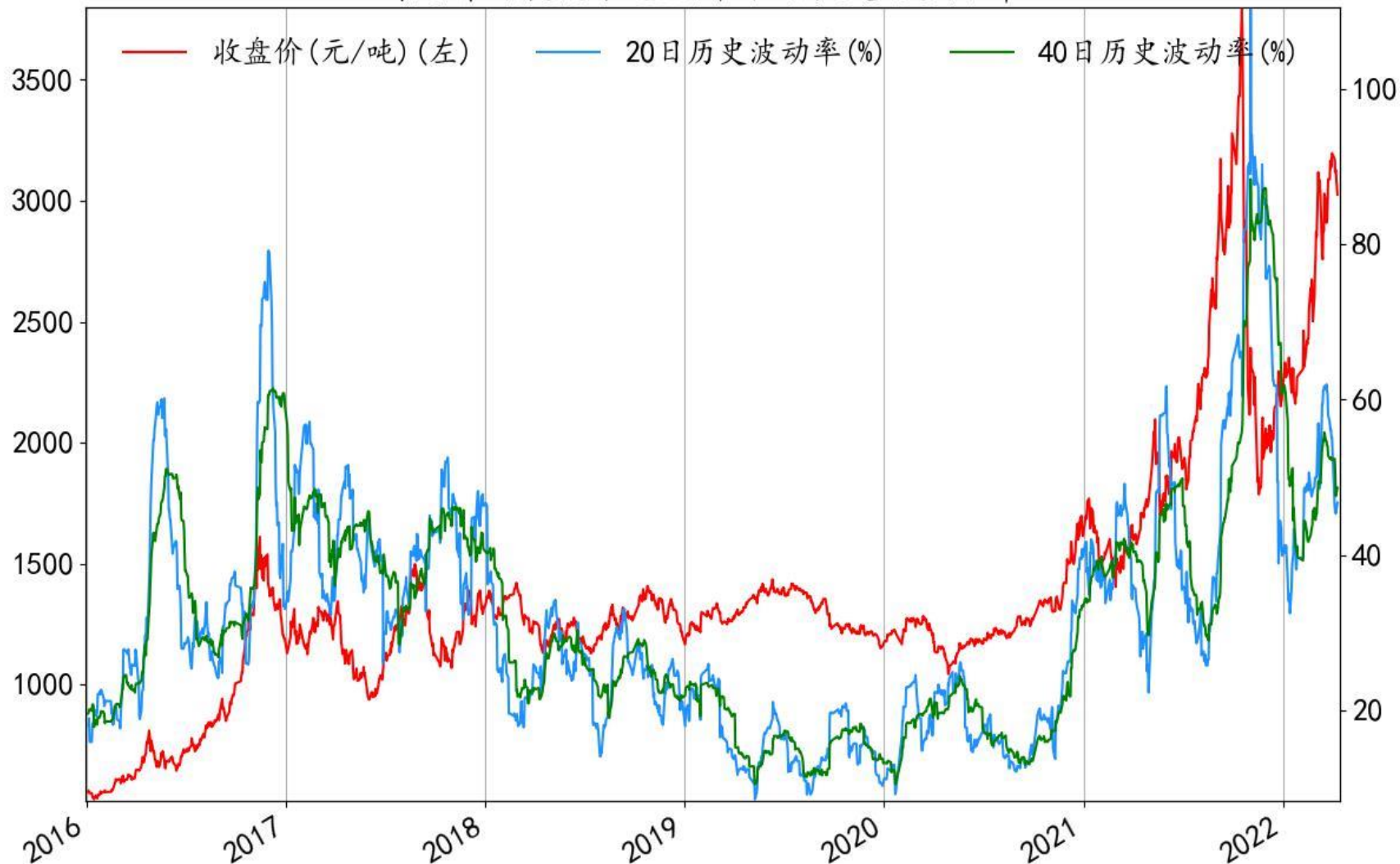


## 焦炭指数收盘价和历史波动率

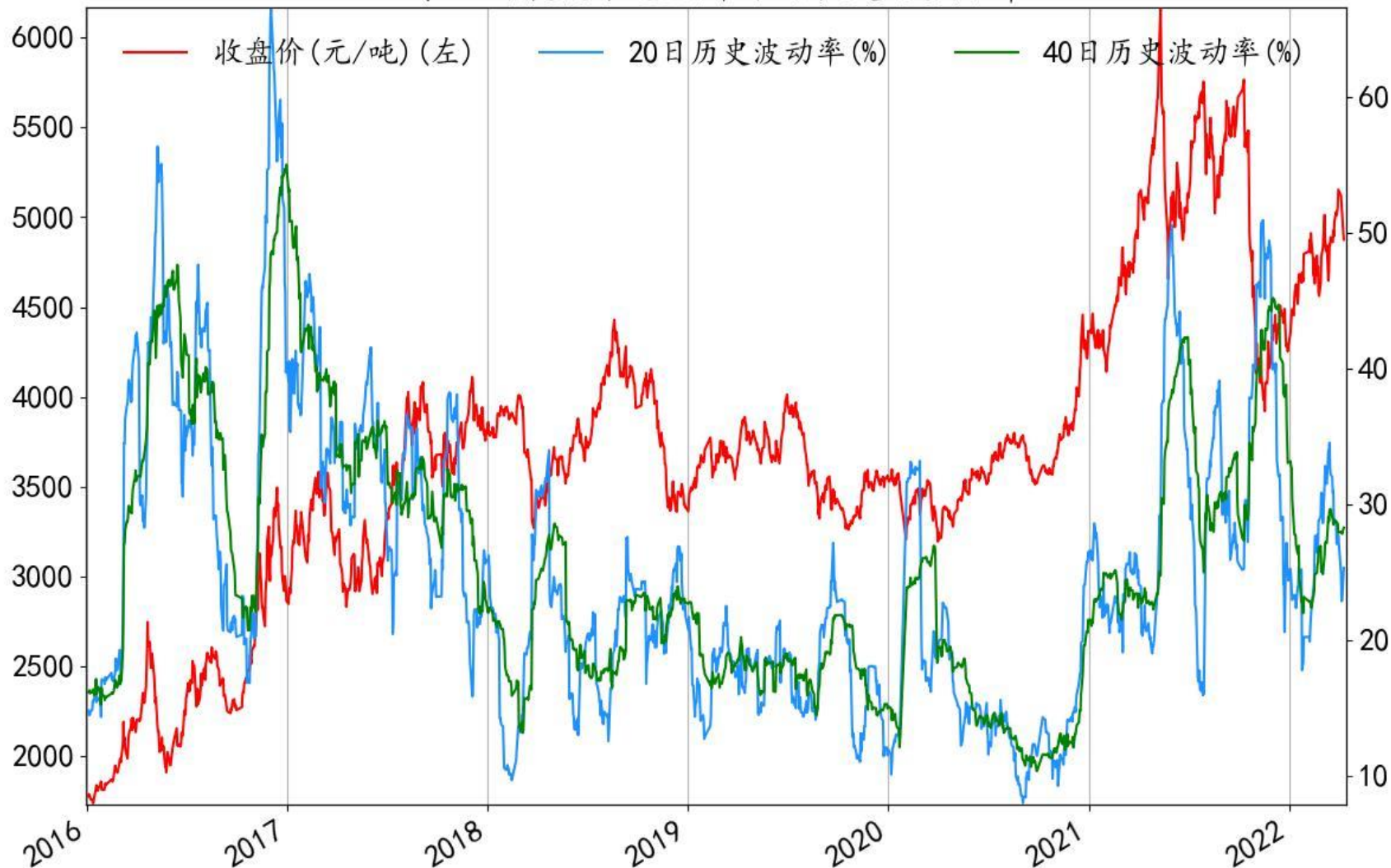




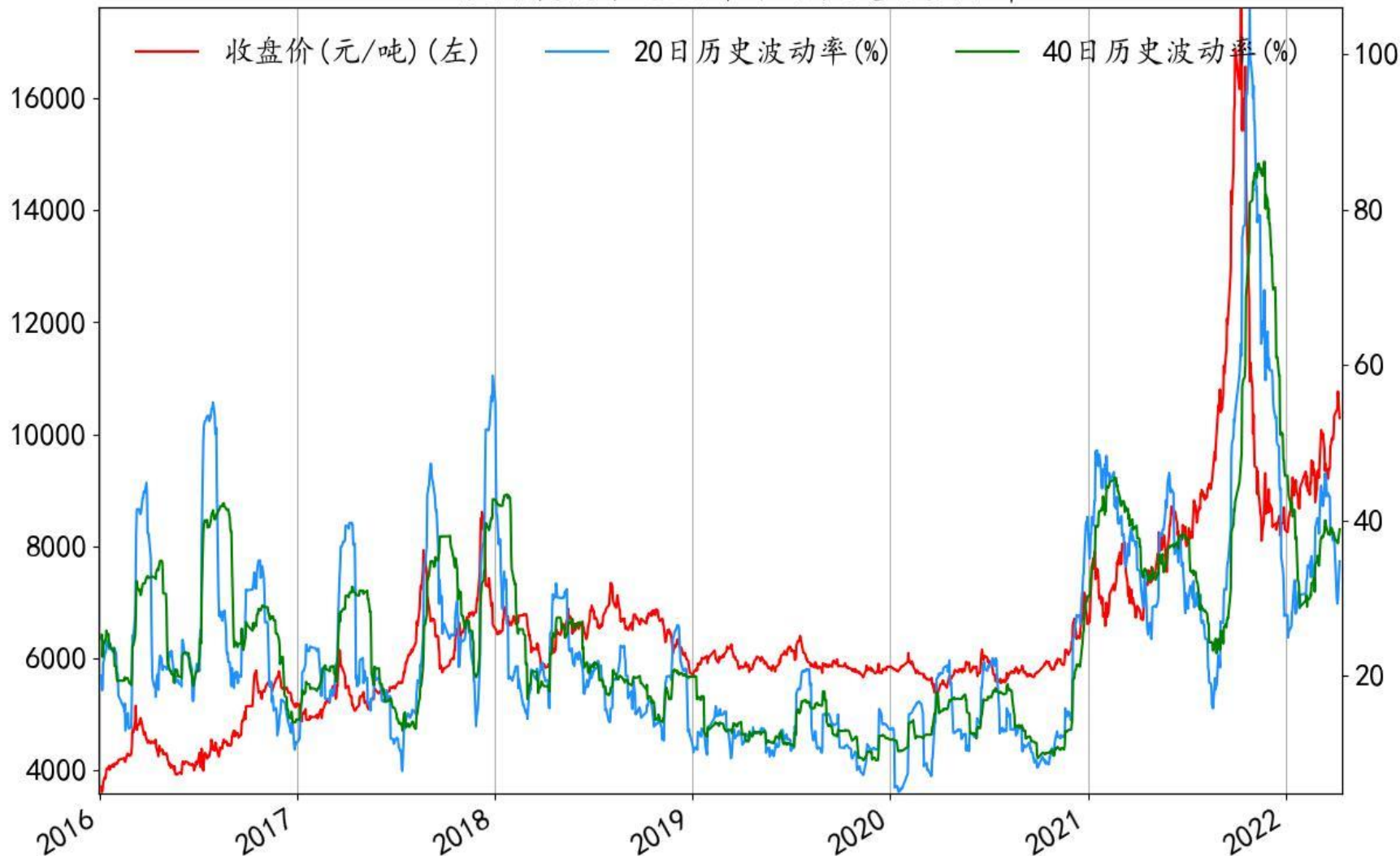
## 焦煤指数收盘价和历史波动率



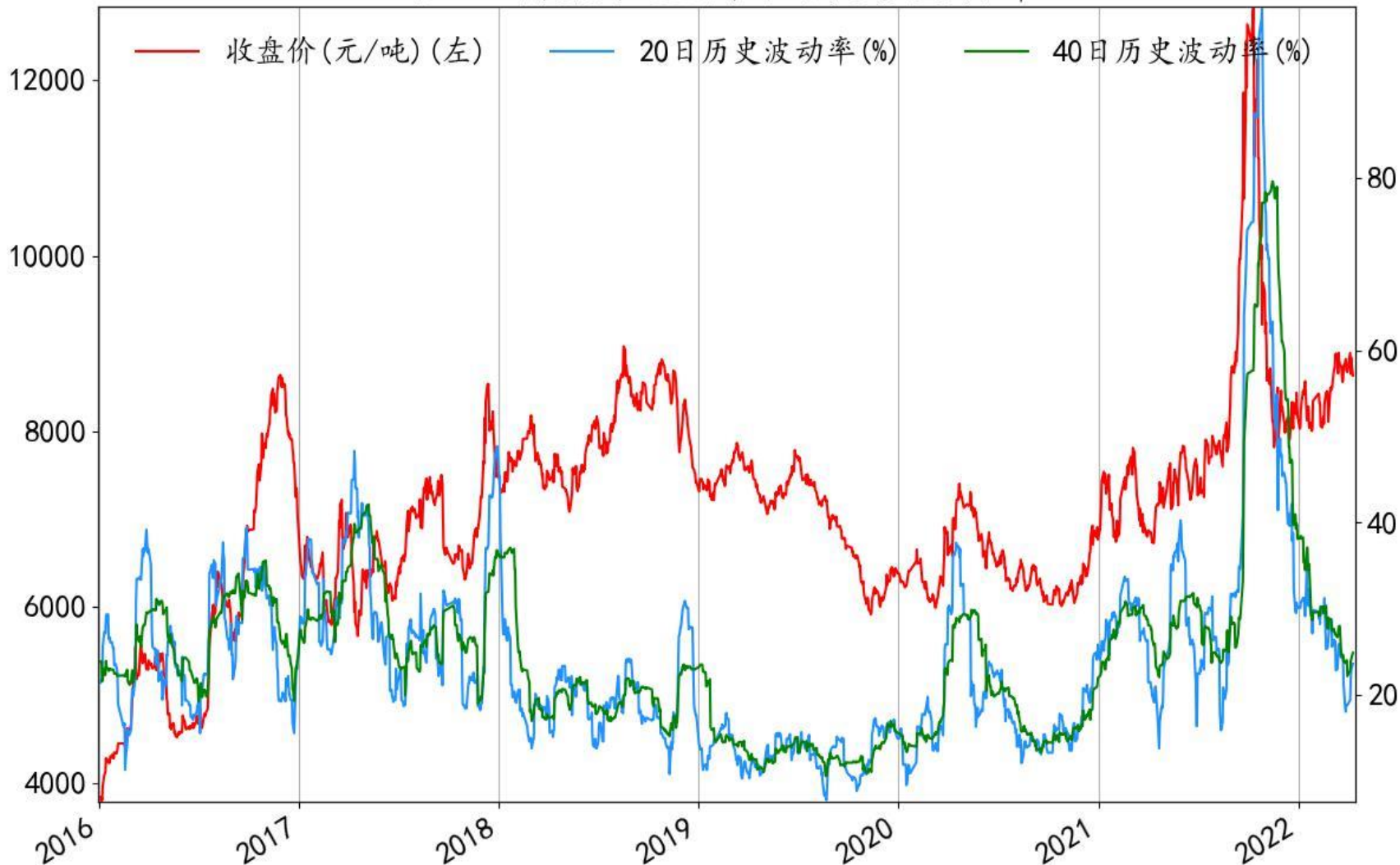
## 螺纹指数收盘价和历史波动率



## 硅铁指数收盘价和历史波动率

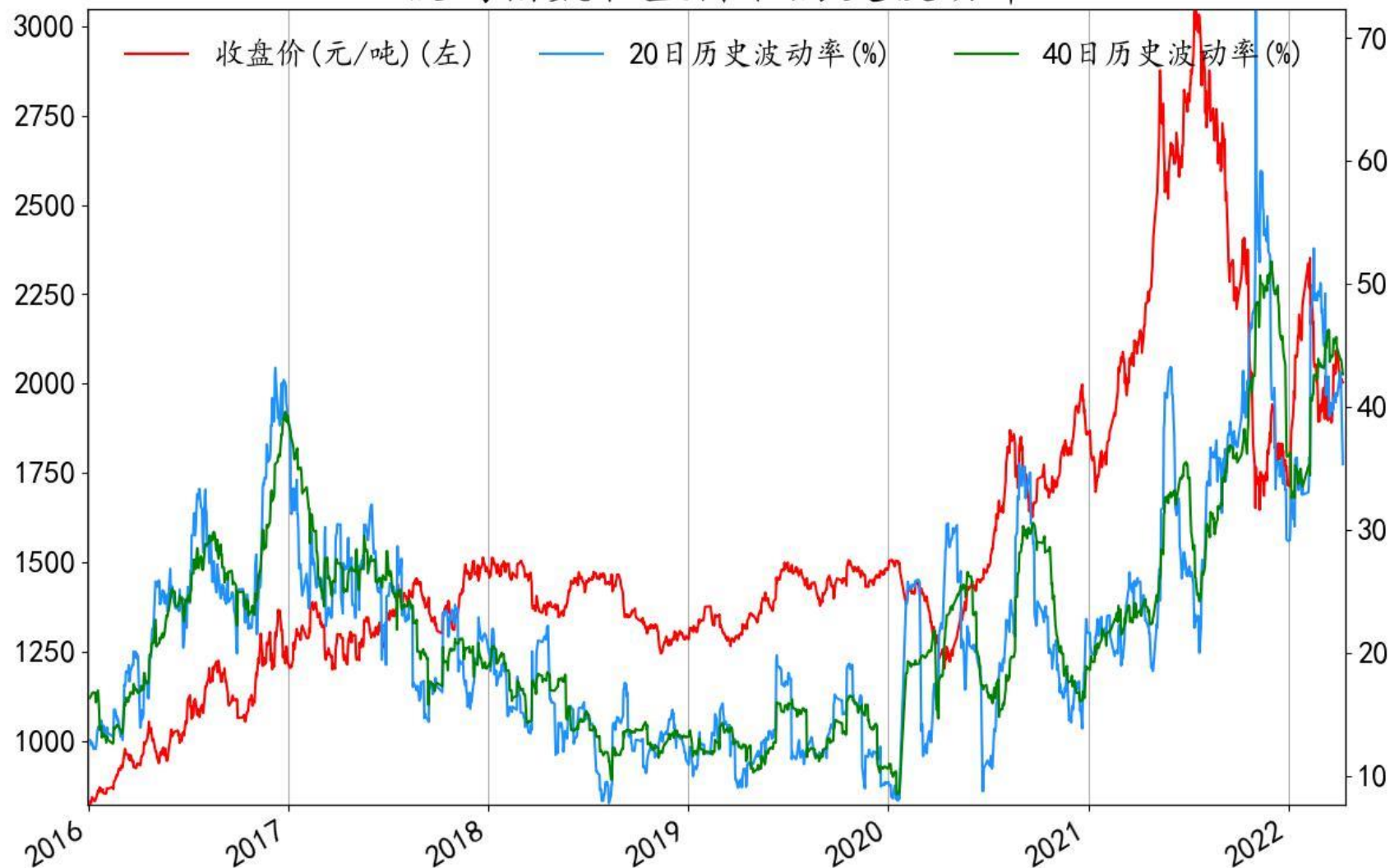


## 锰硅指数收盘价和历史波动率

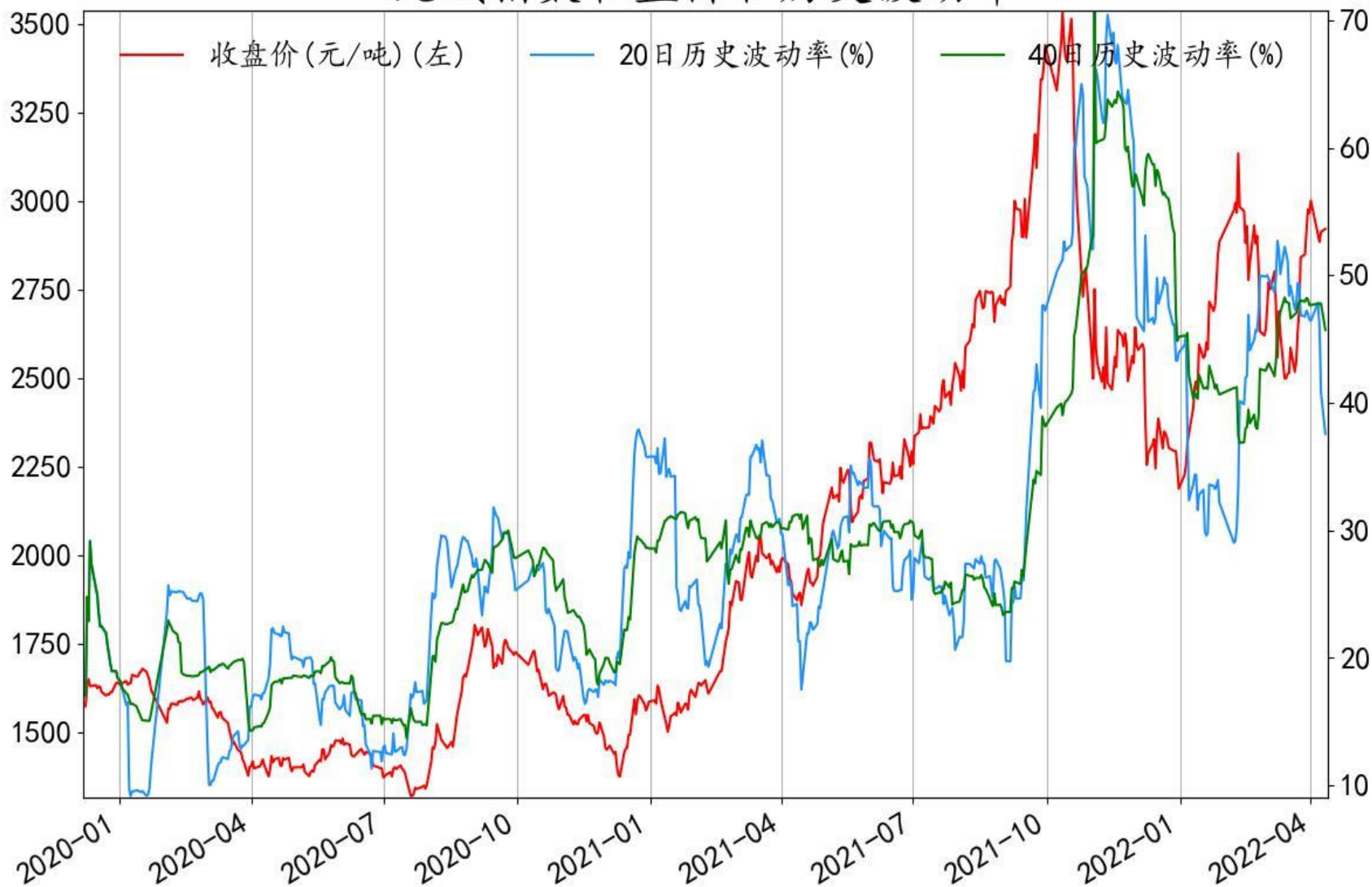




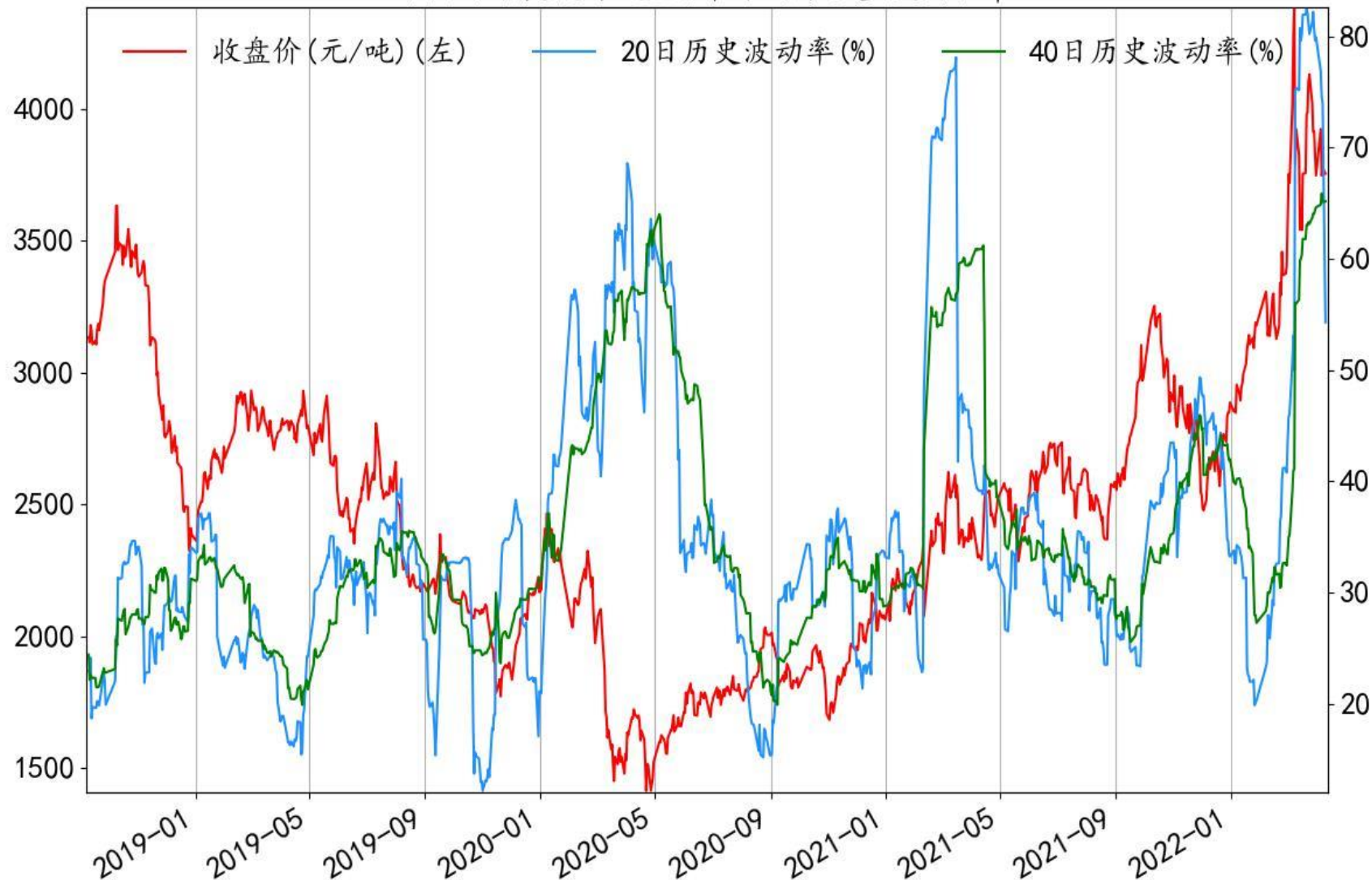
## 玻璃指数收盘价和历史波动率



## 纯碱指数收盘价和历史波动率

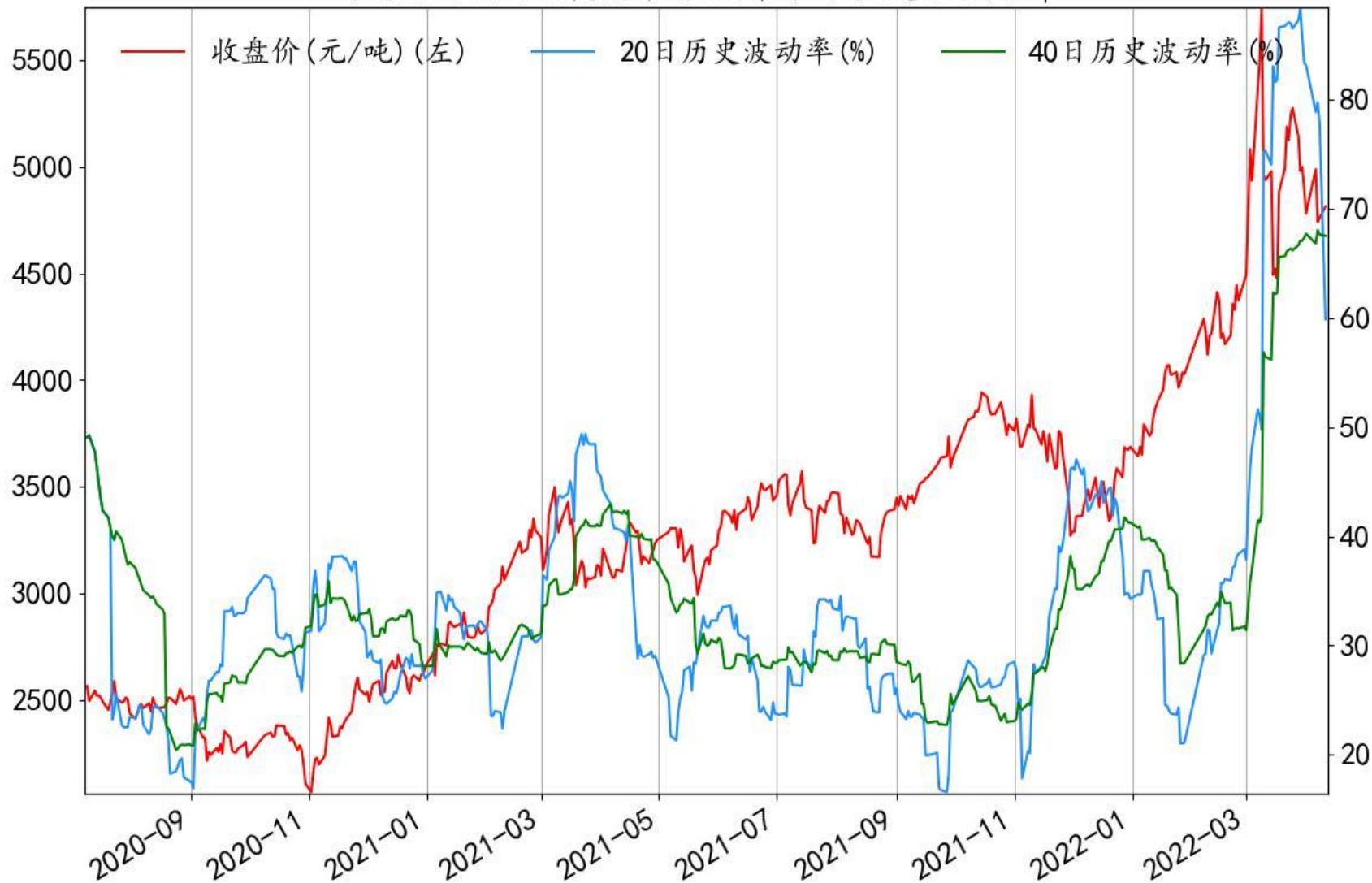


## 燃油指数收盘价和历史波动率



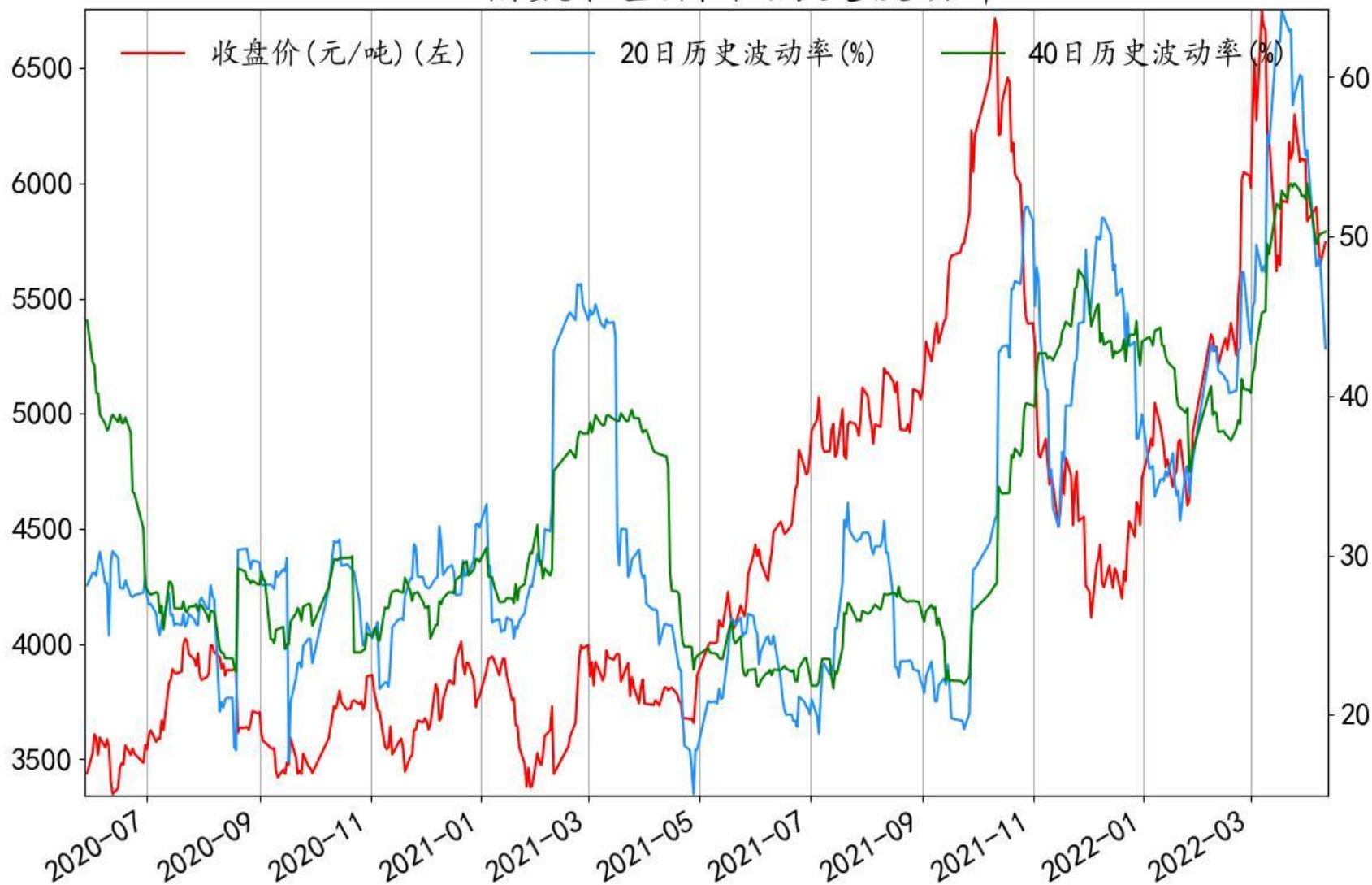
# 低硫燃油指数

## 低硫燃油指数收盘价和历史波动率

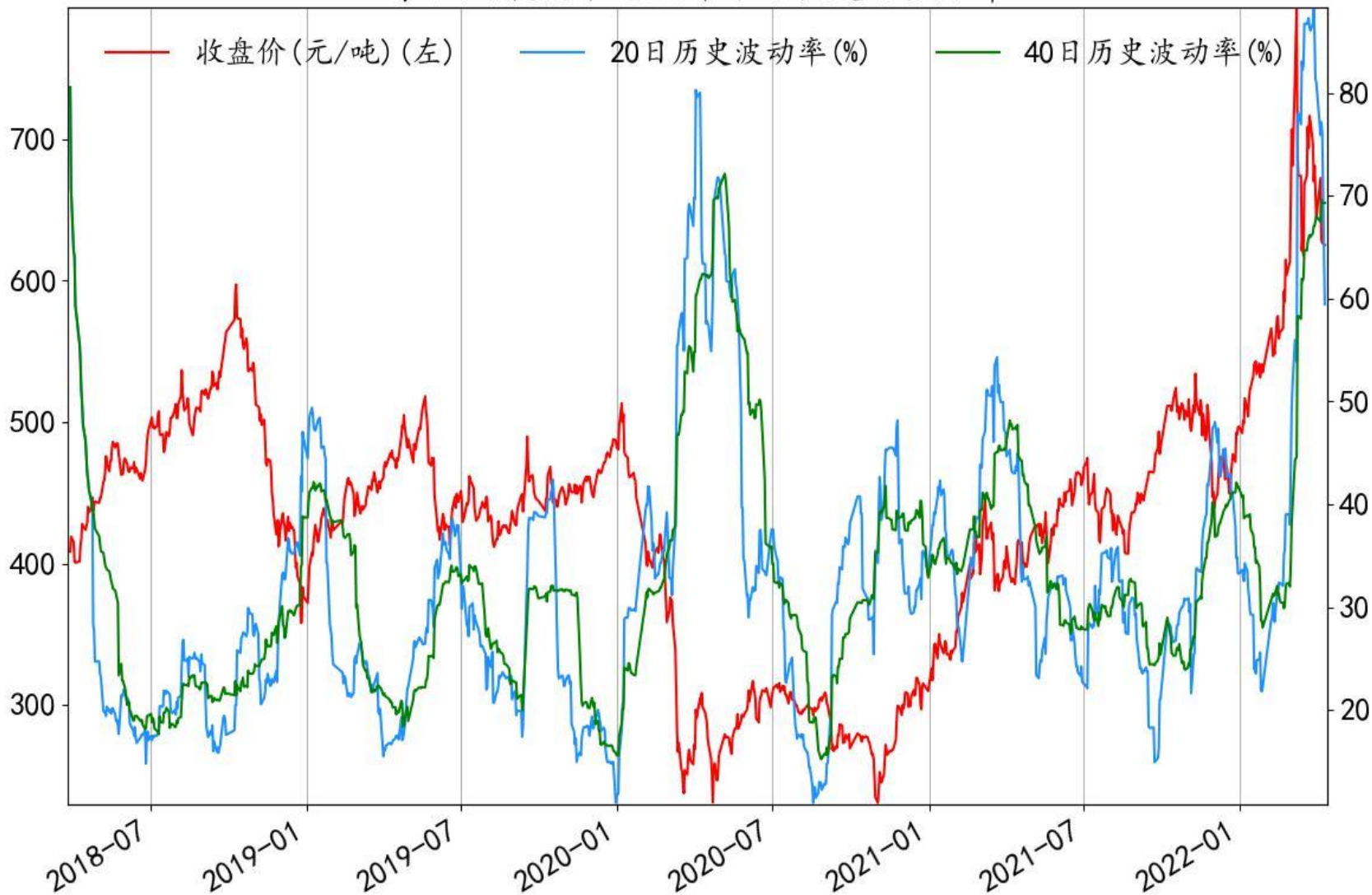




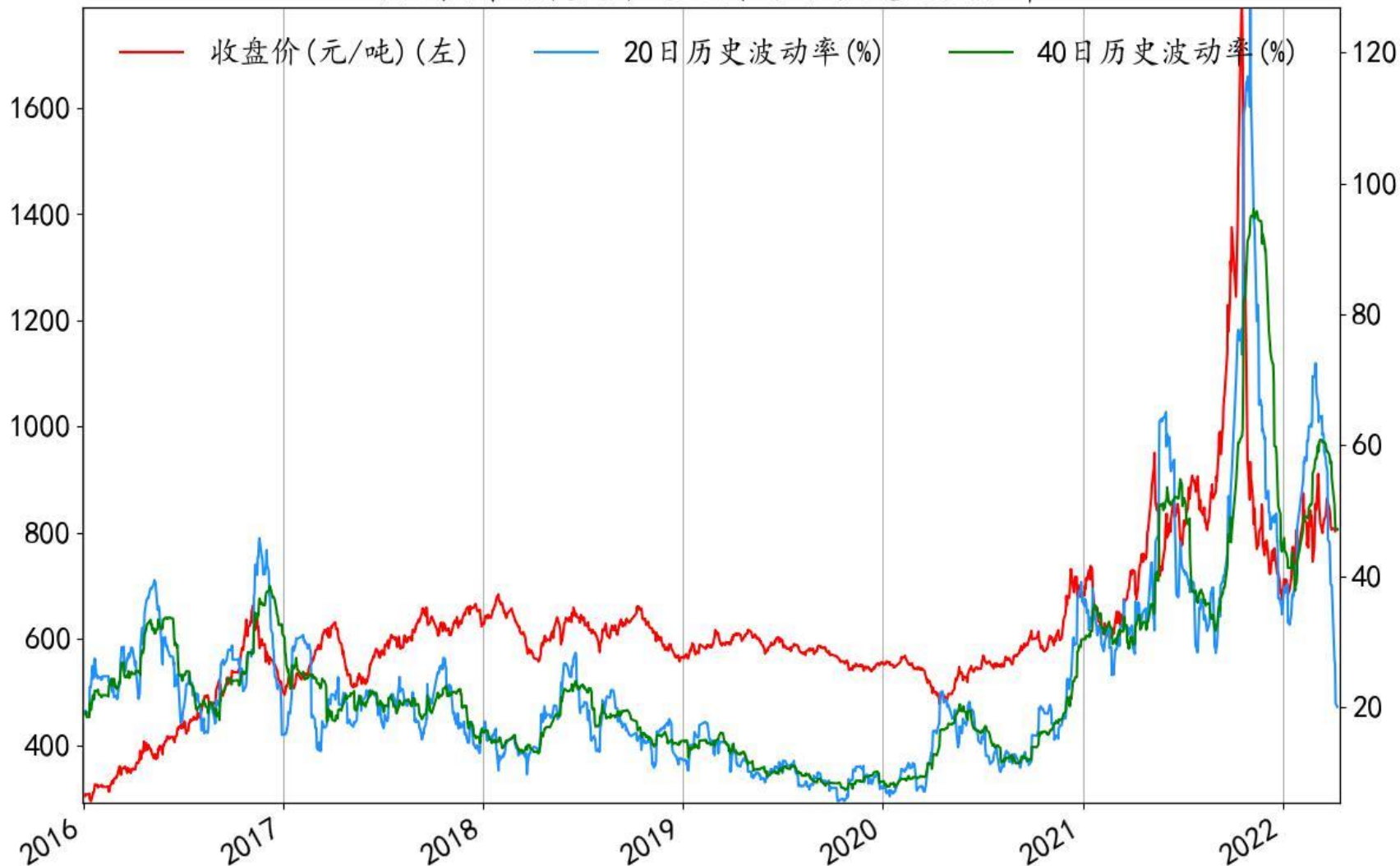
## LPG指数收盘价和历史波动率



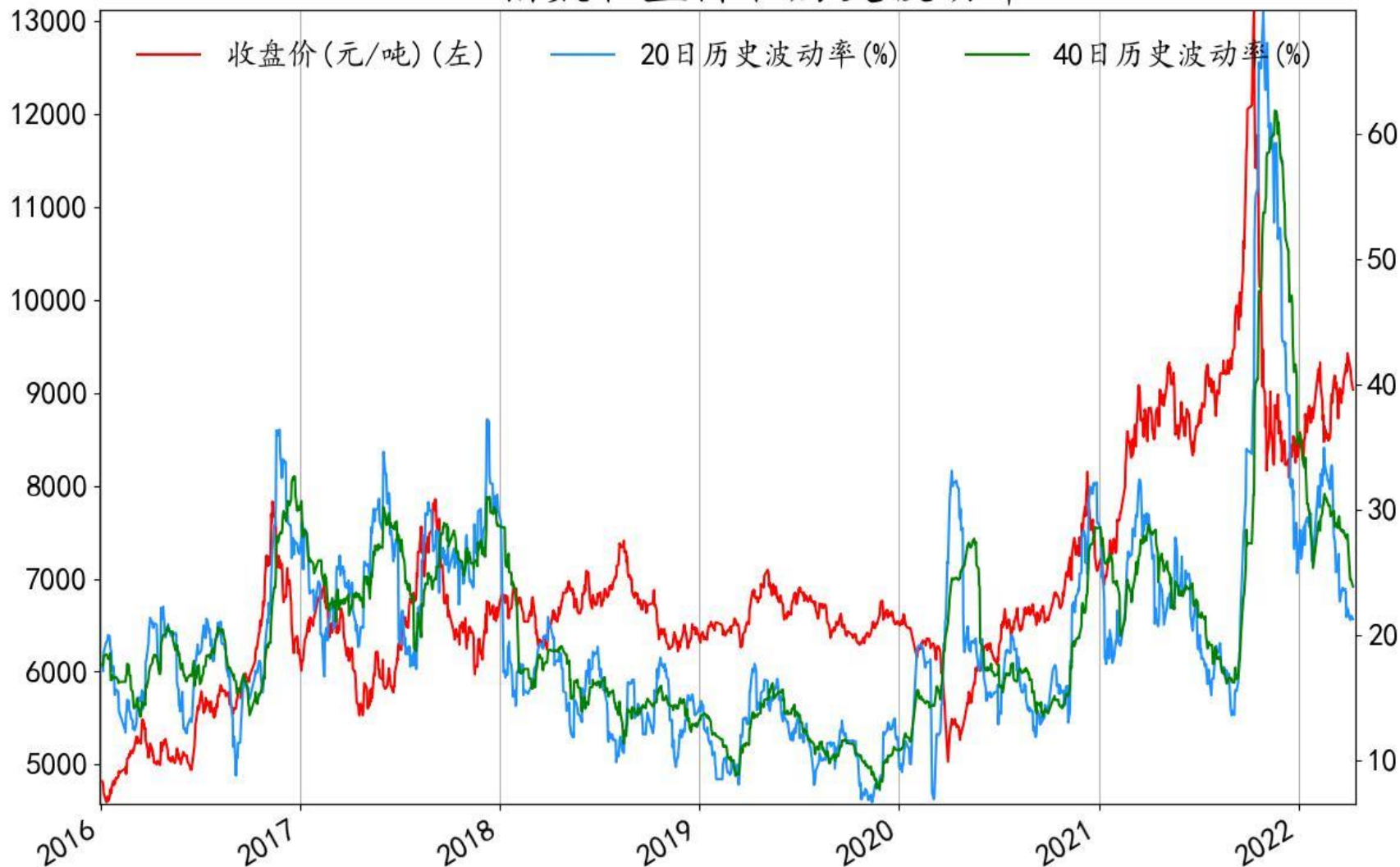
## 原油指数收盘价和历史波动率



## 动力煤指数收盘价和历史波动率

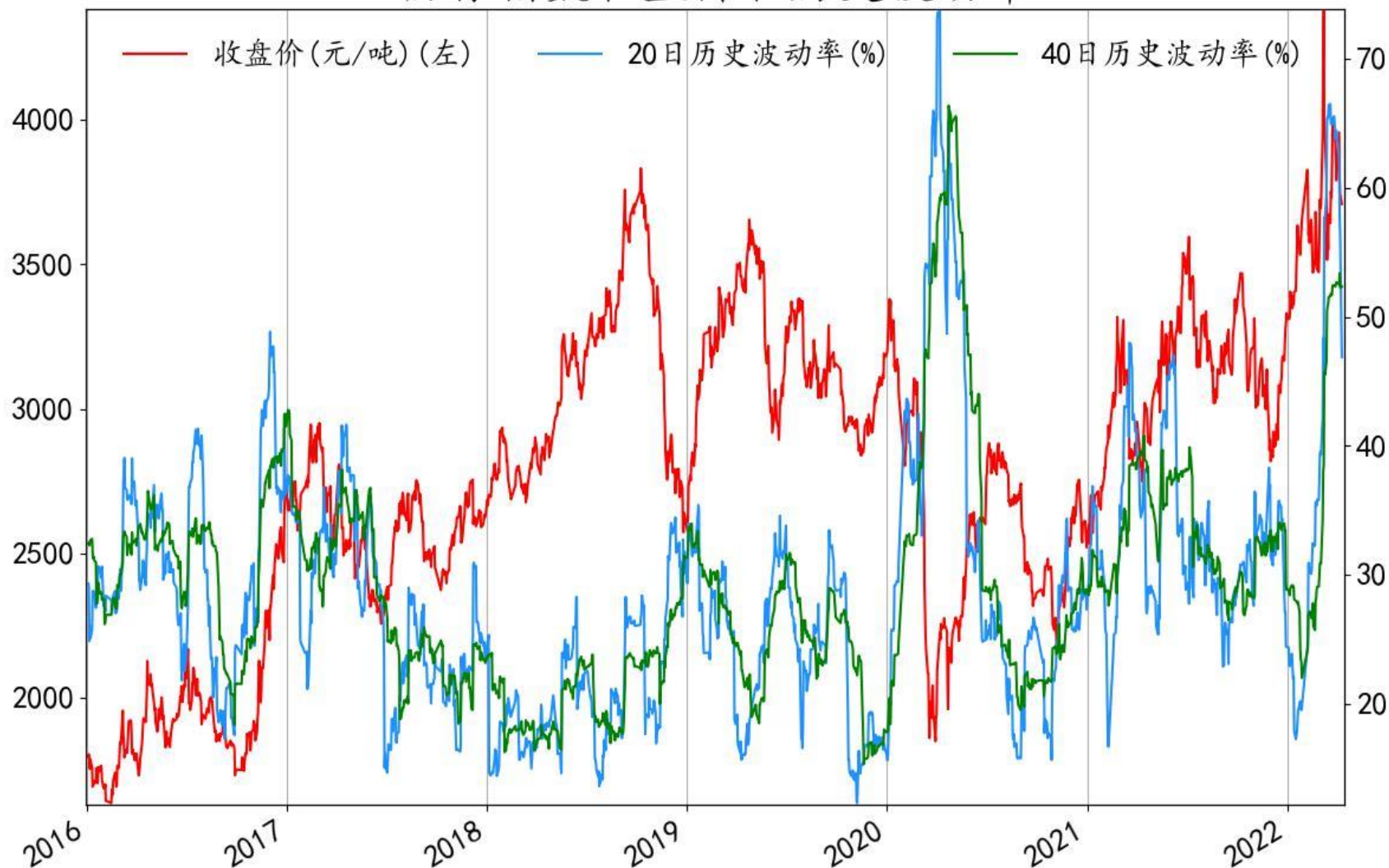


## PVC指数收盘价和历史波动率



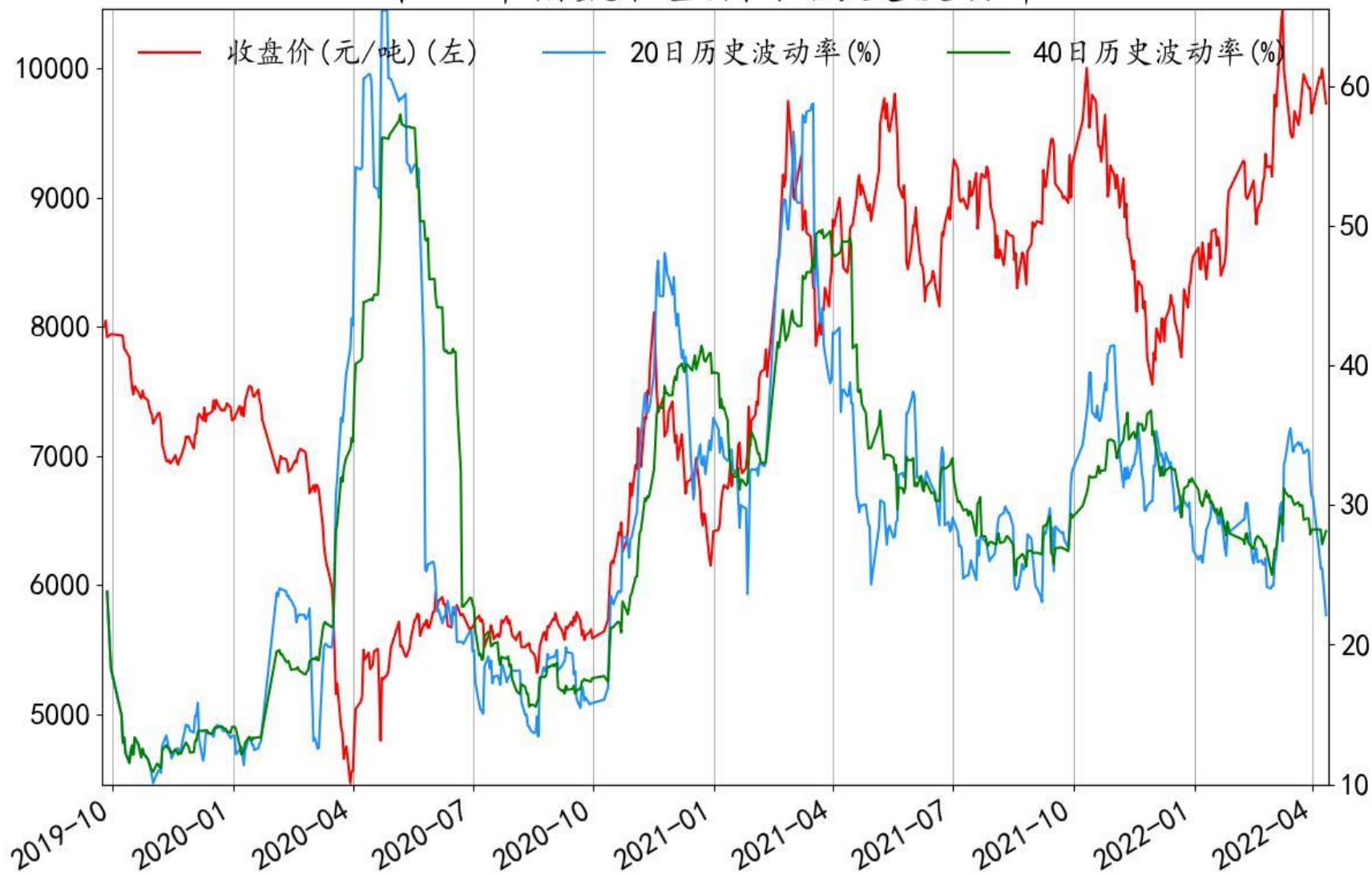


## 沥青指数收盘价和历史波动率



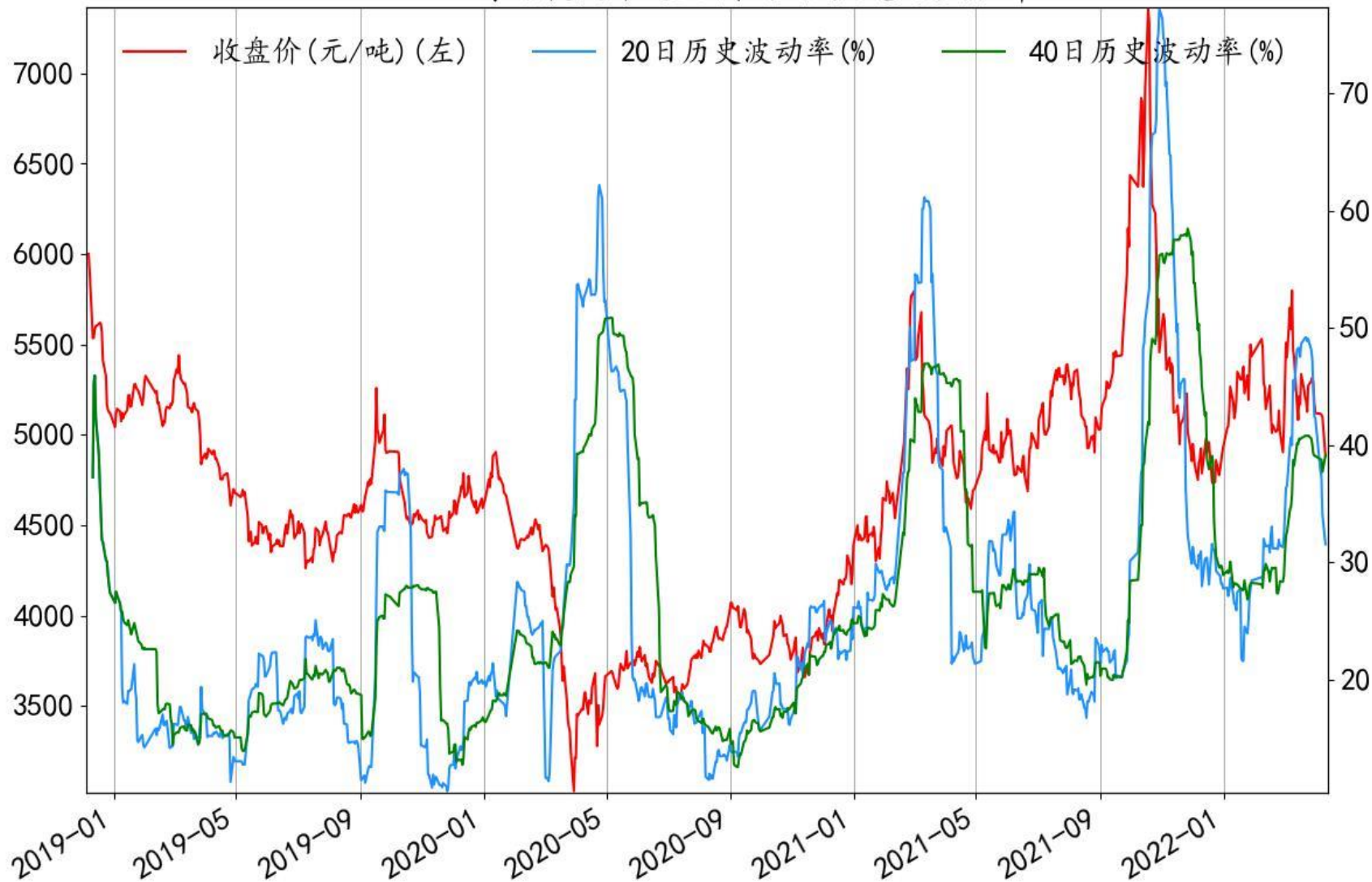
# 苯乙烯指数

## 苯乙烯指数收盘价和历史波动率



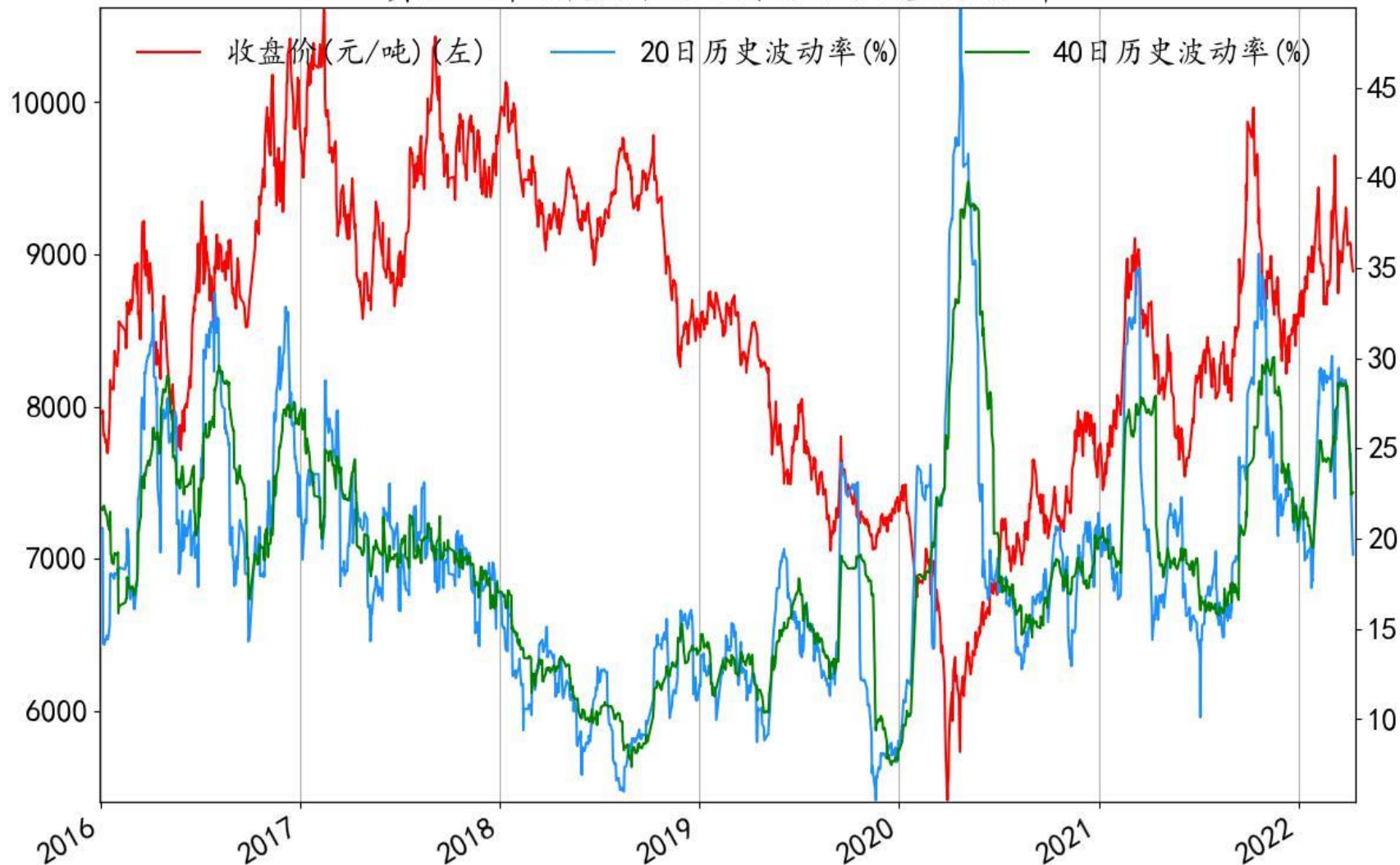
# 乙二醇指数

## 乙二醇指数收盘价和历史波动率



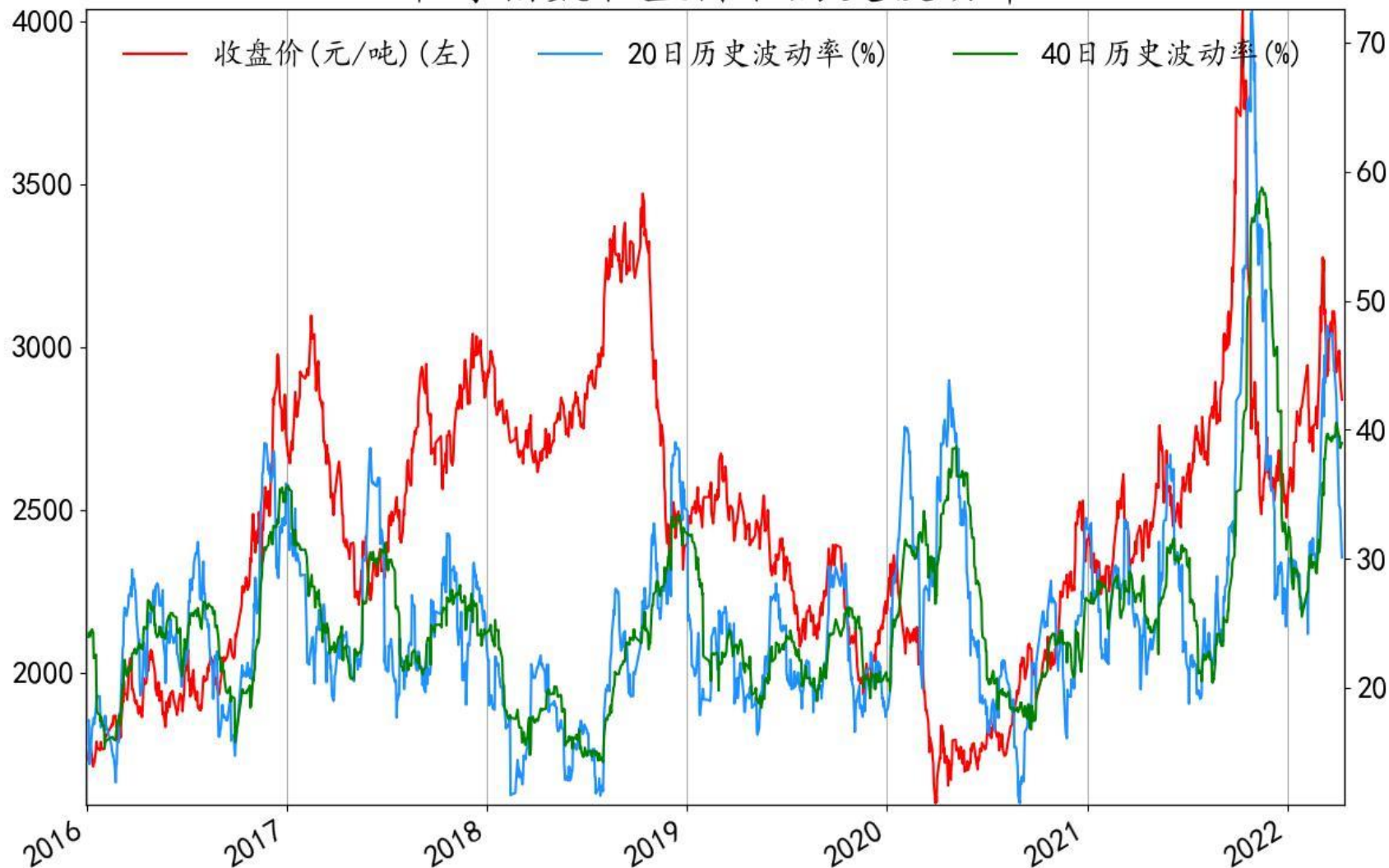


## 聚乙烯指数收盘价和历史波动率



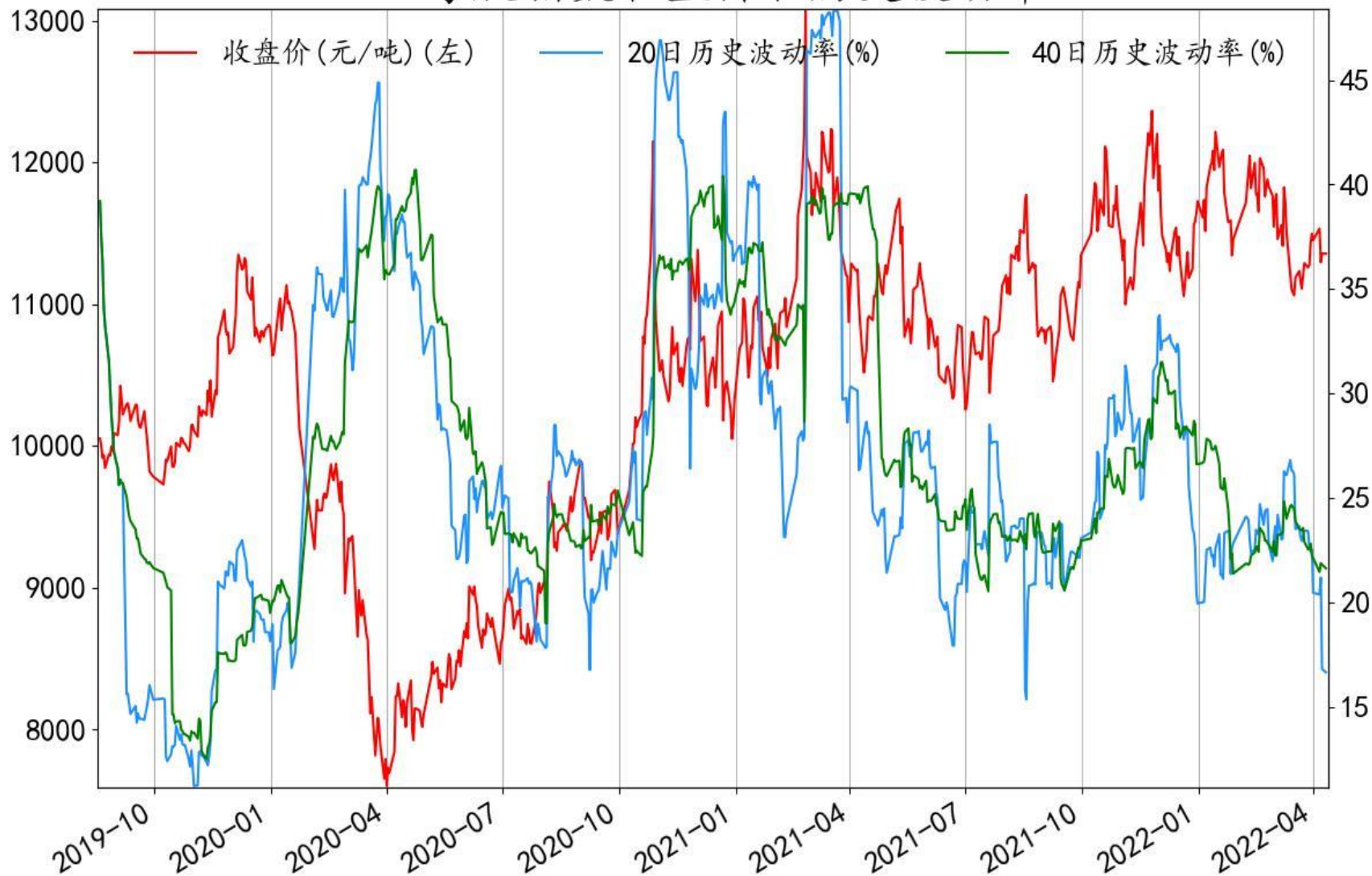


## 甲醇指数收盘价和历史波动率

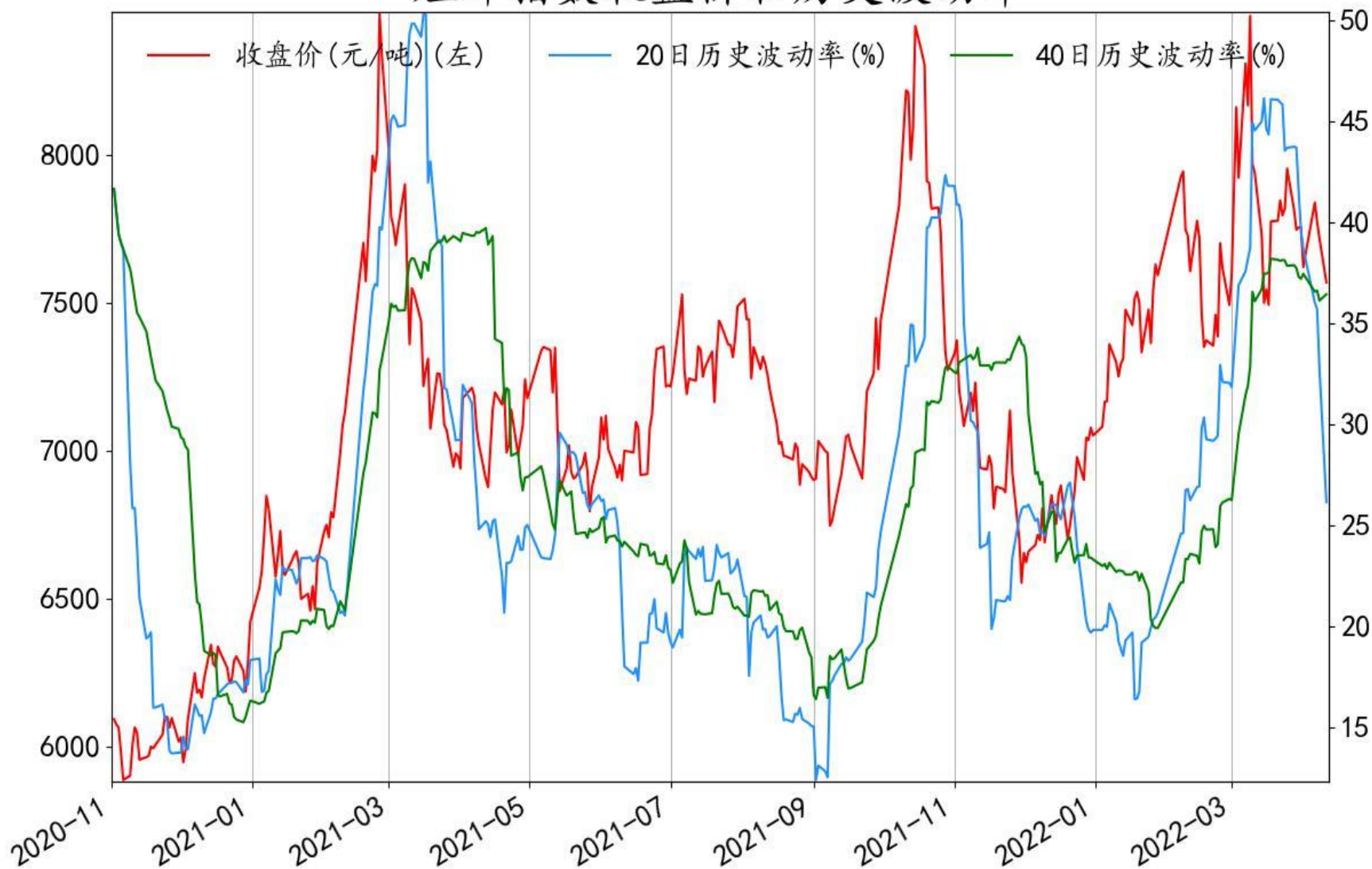


# 20号胶指数

## 20号胶指数收盘价和历史波动率

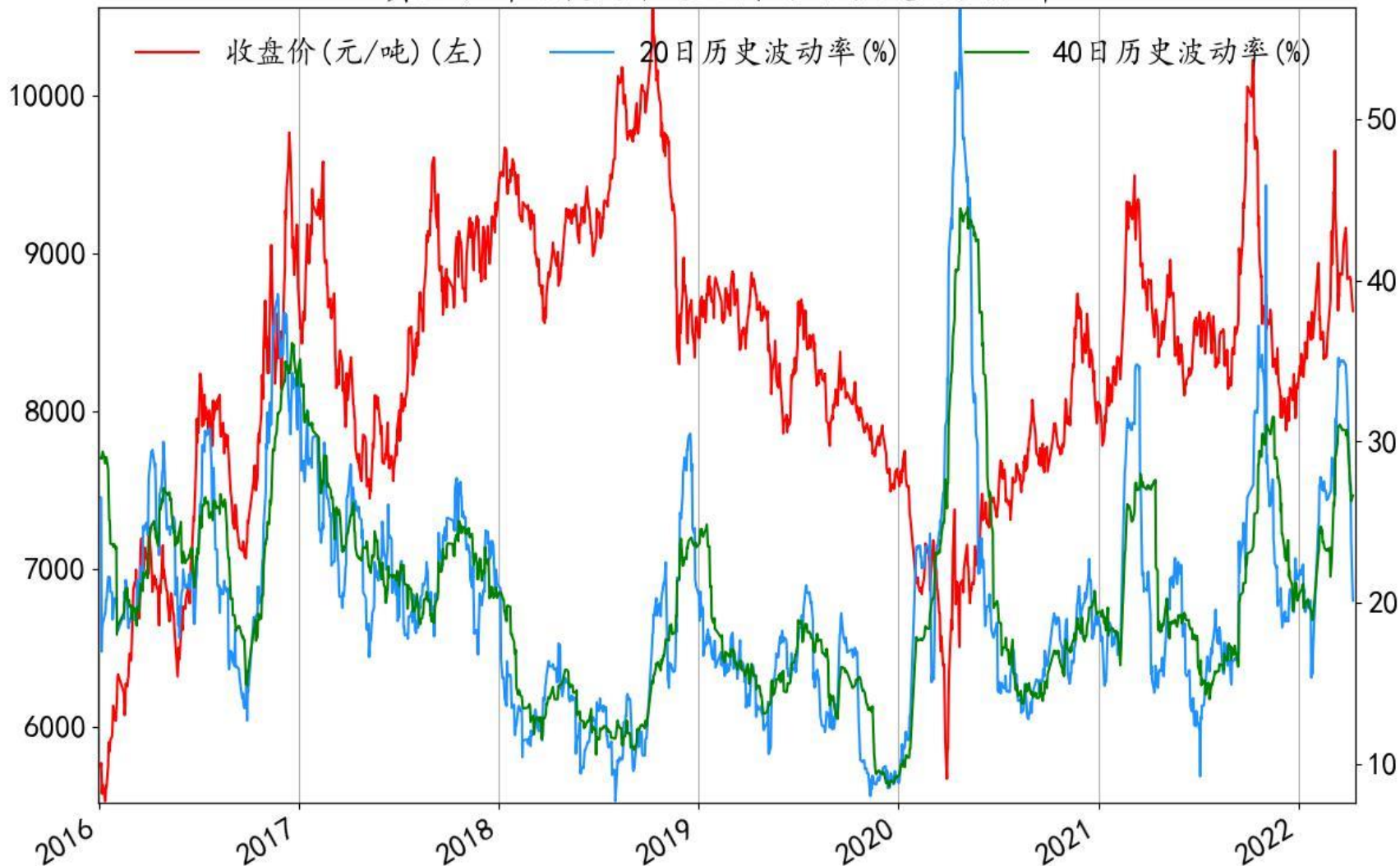


## 短纤指数收盘价和历史波动率



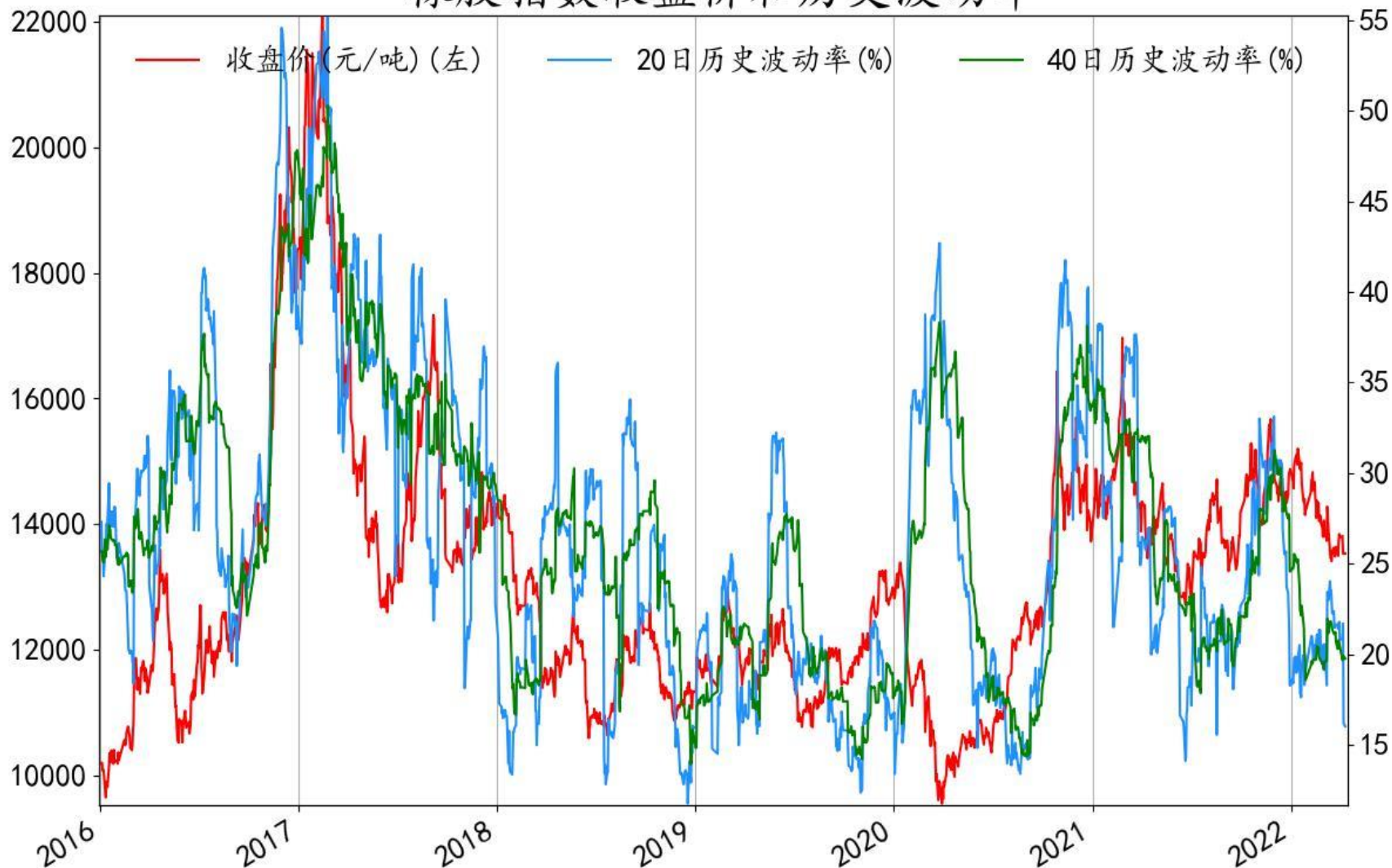


## 聚丙烯指数收盘价和历史波动率





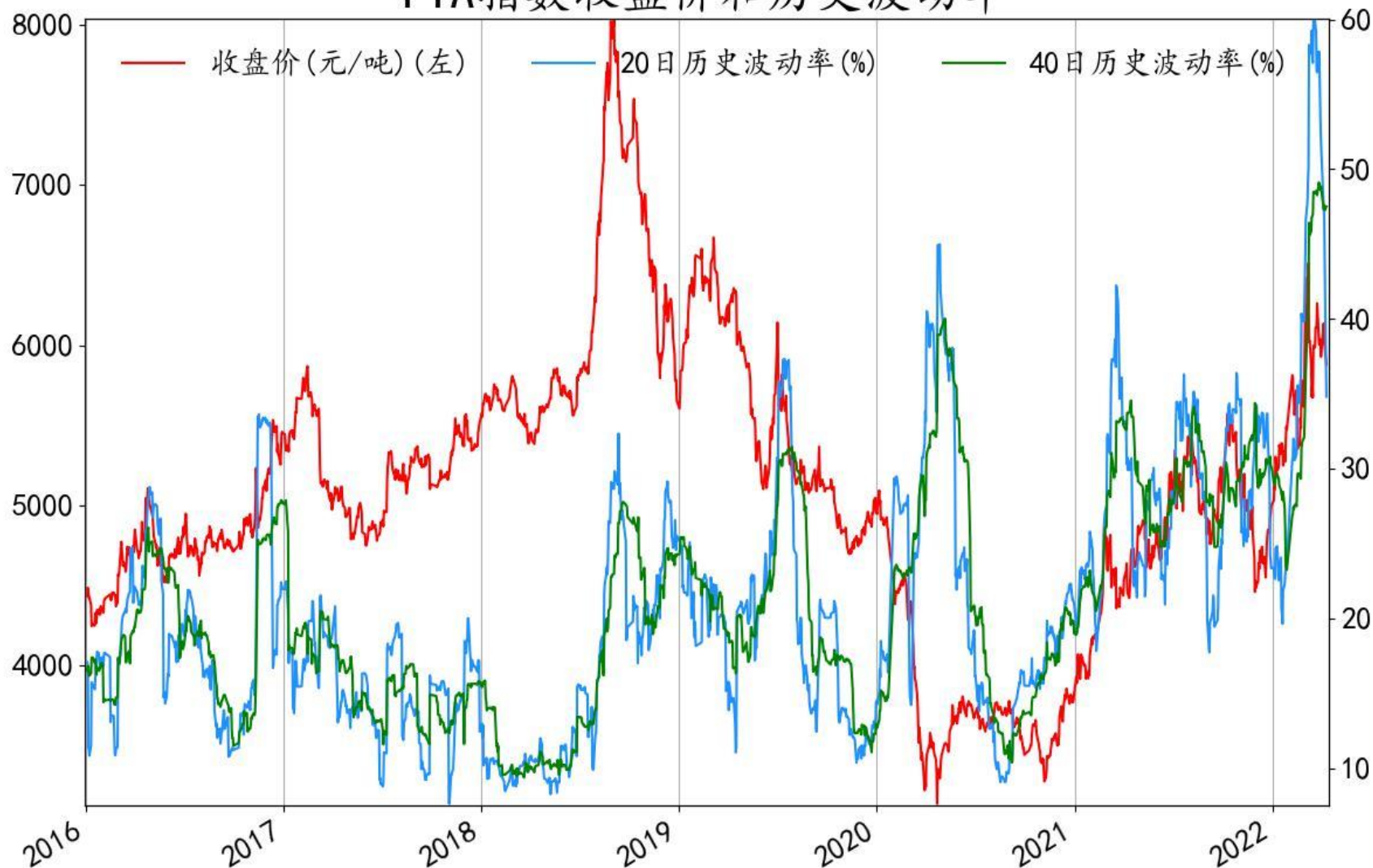
## 橡胶指数收盘价和历史波动率



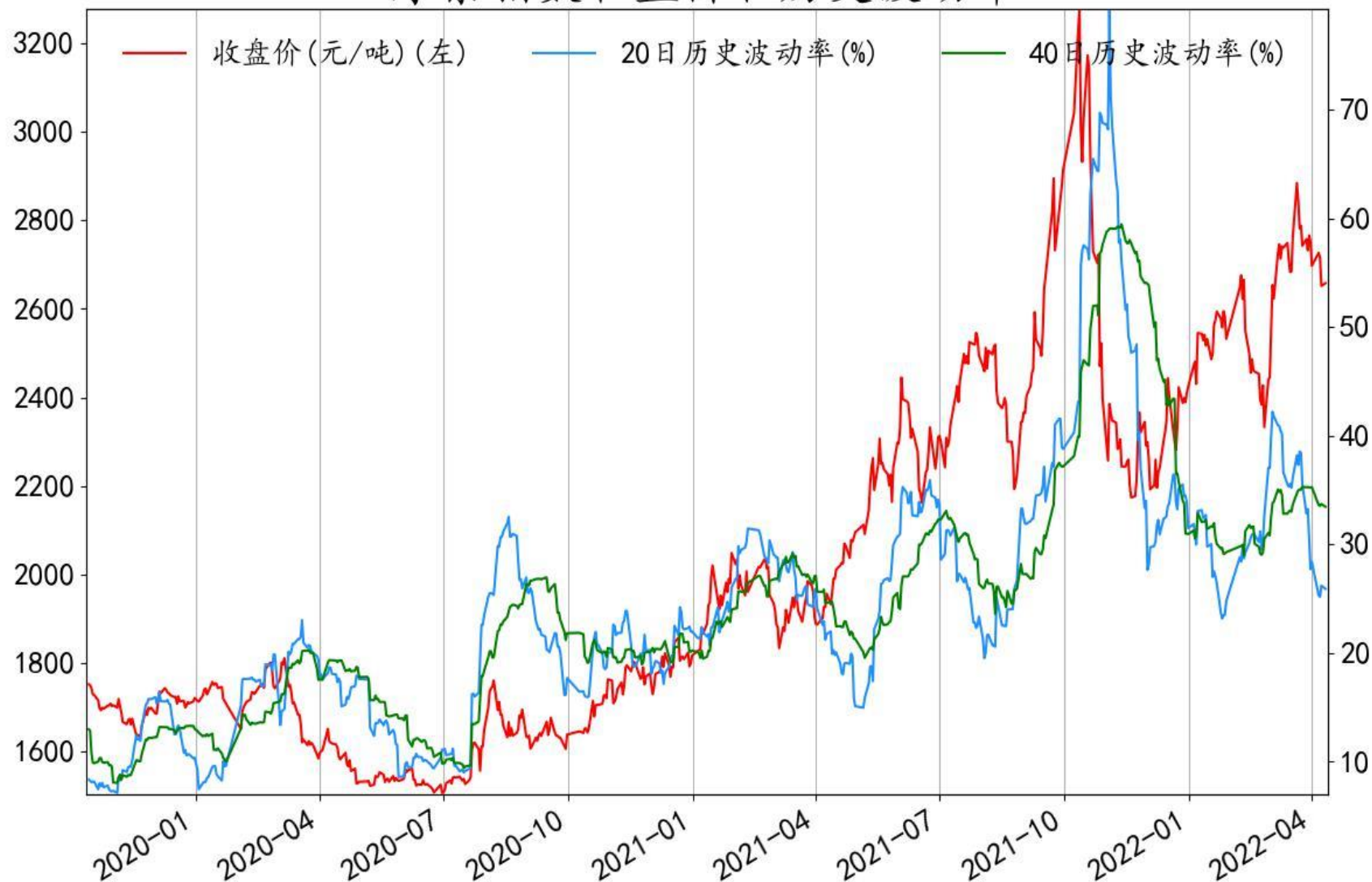
## 纸浆指数收盘价和历史波动率



## PTA指数收盘价和历史波动率

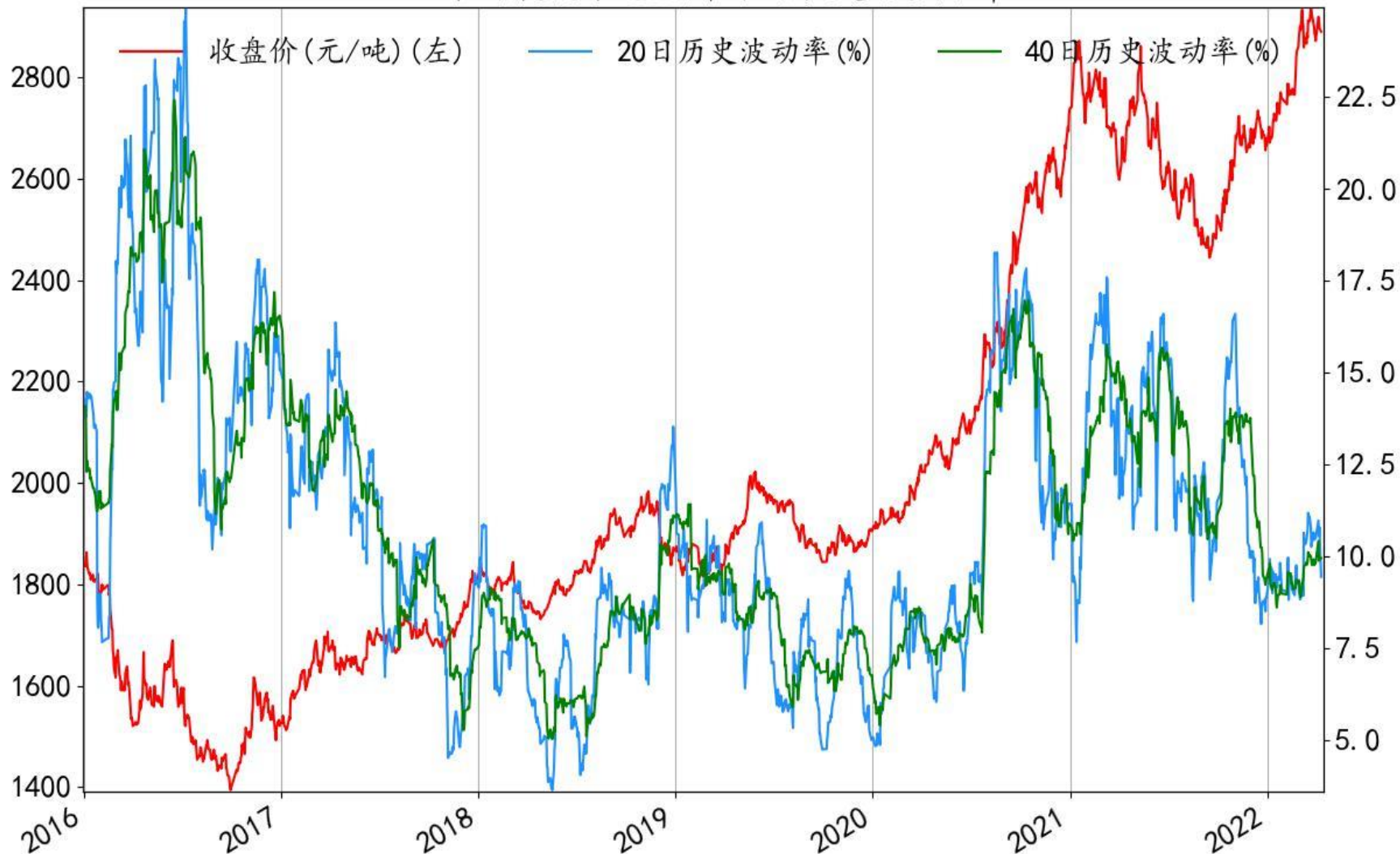


## 尿素指数收盘价和历史波动率

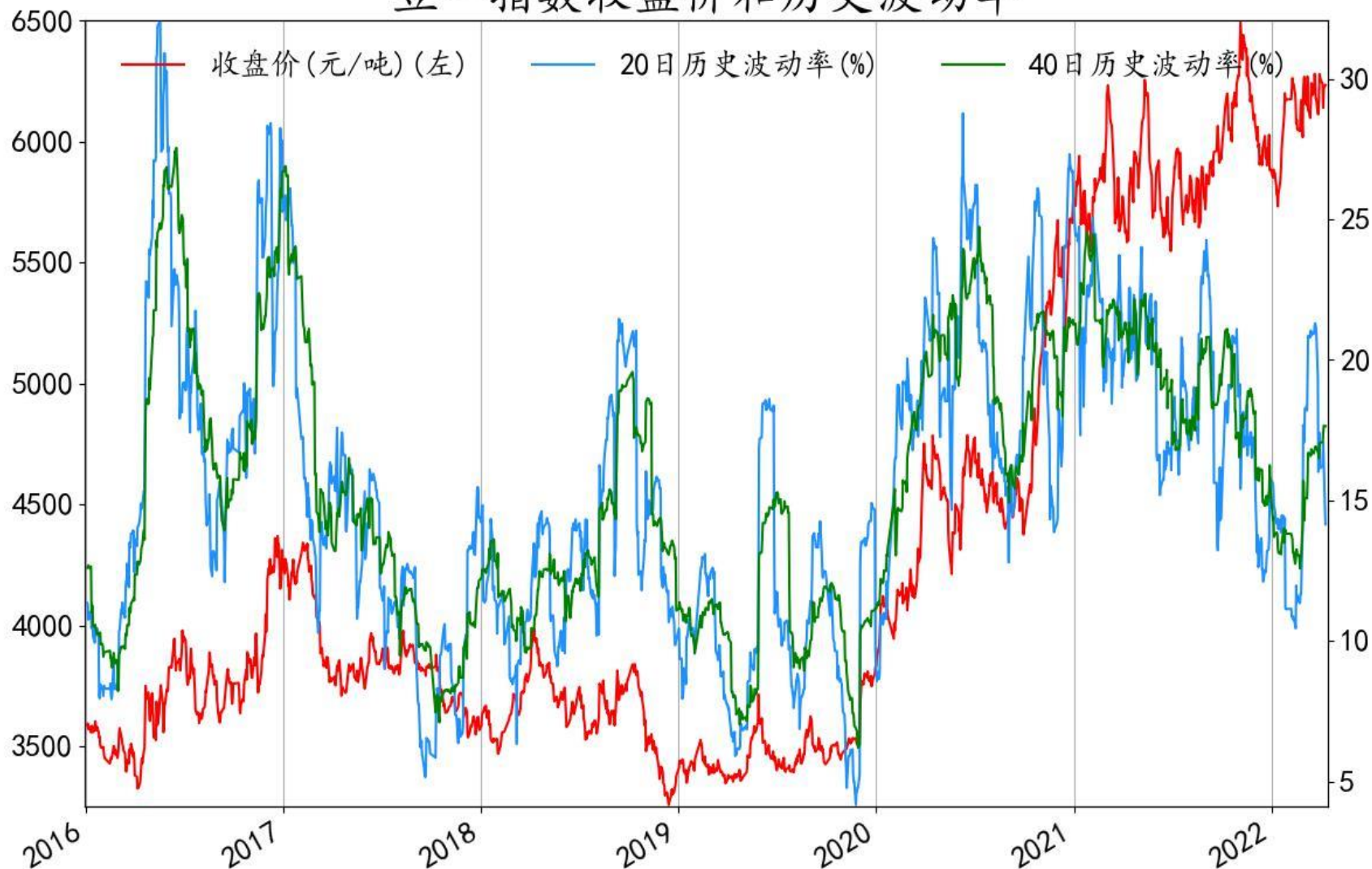




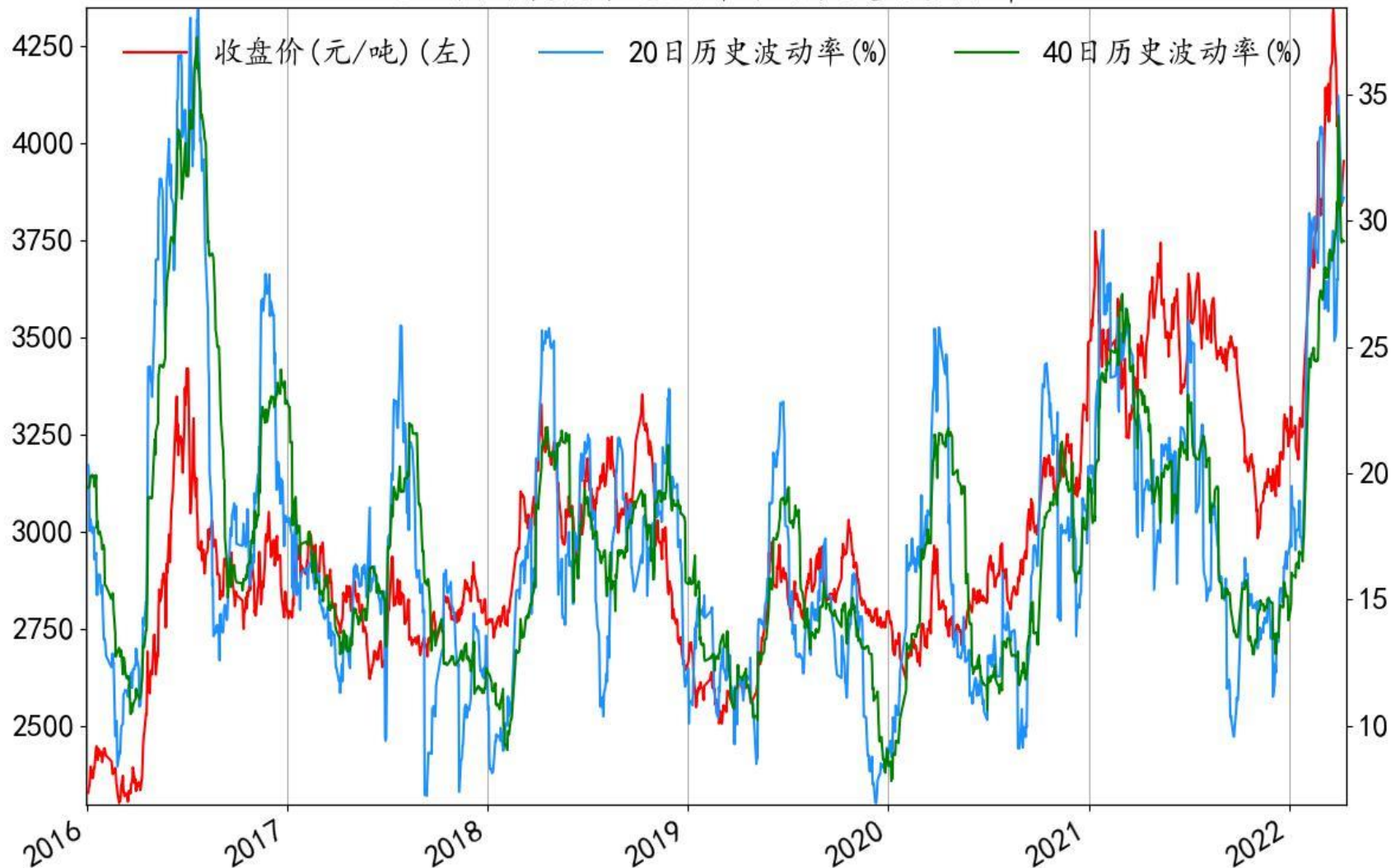
## 玉米指数收盘价和历史波动率



## 豆一指数收盘价和历史波动率

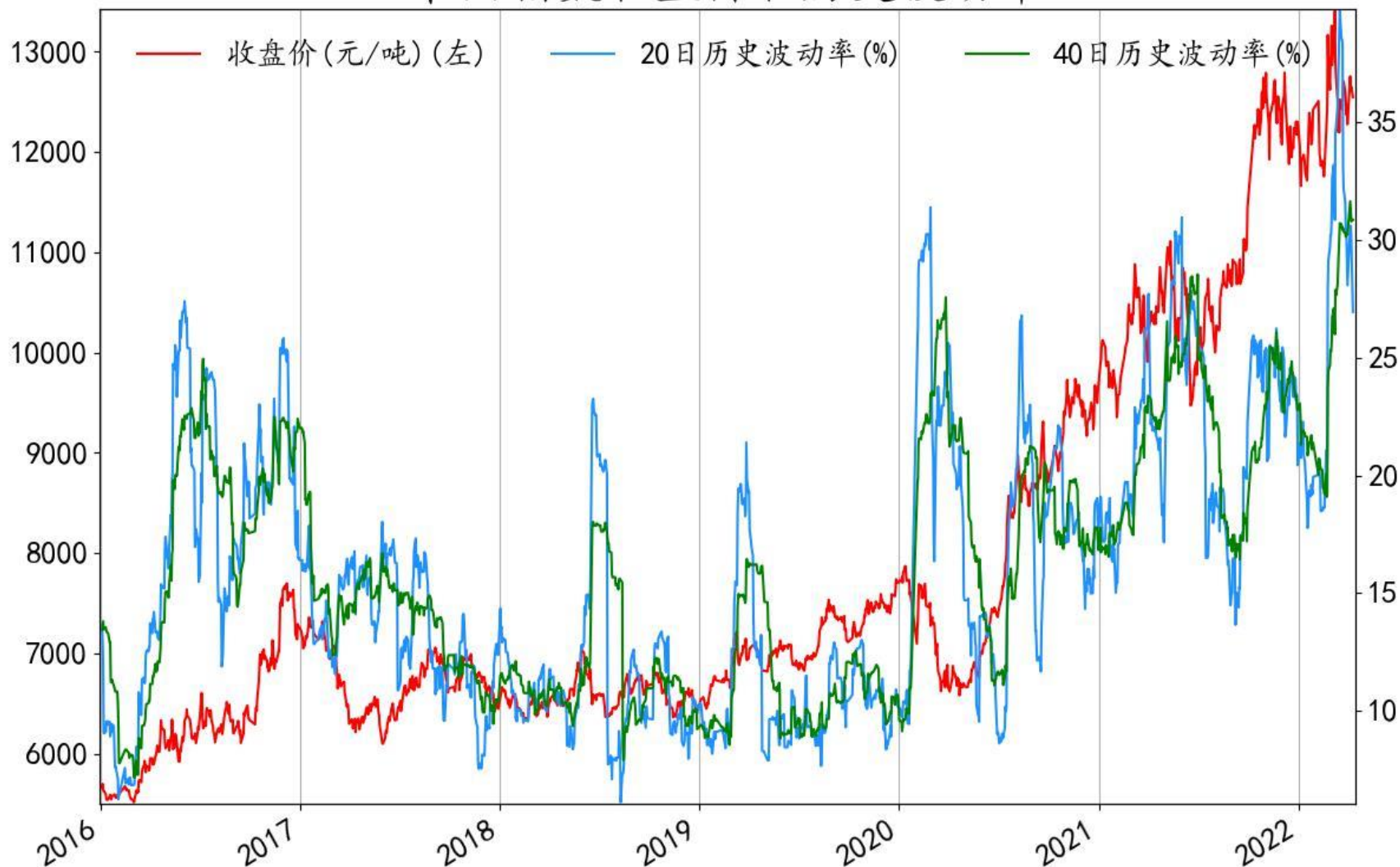


## 豆粕指数收盘价和历史波动率



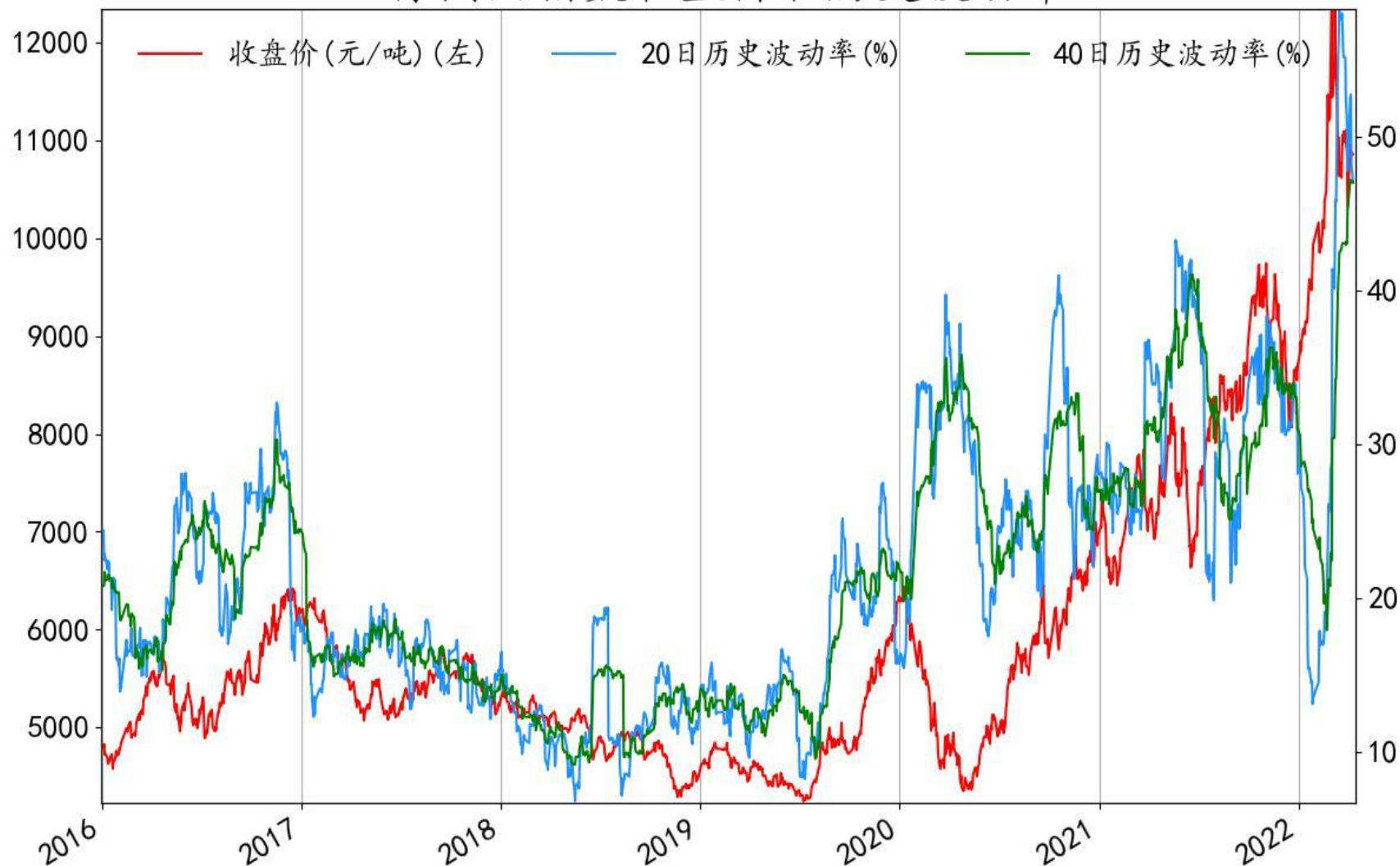


## 菜油指数收盘价和历史波动率





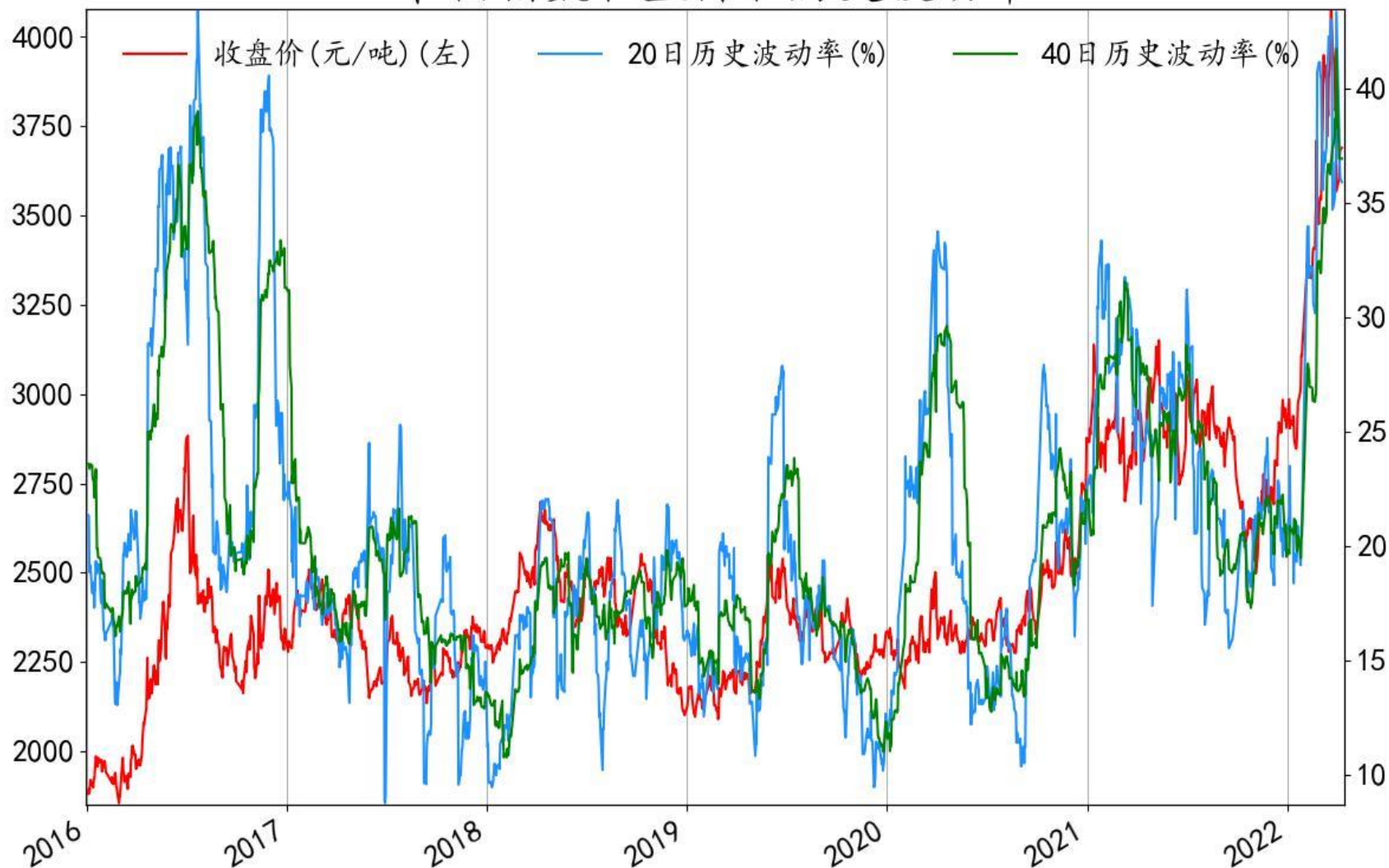
## 棕榈油指数收盘价和历史波动率



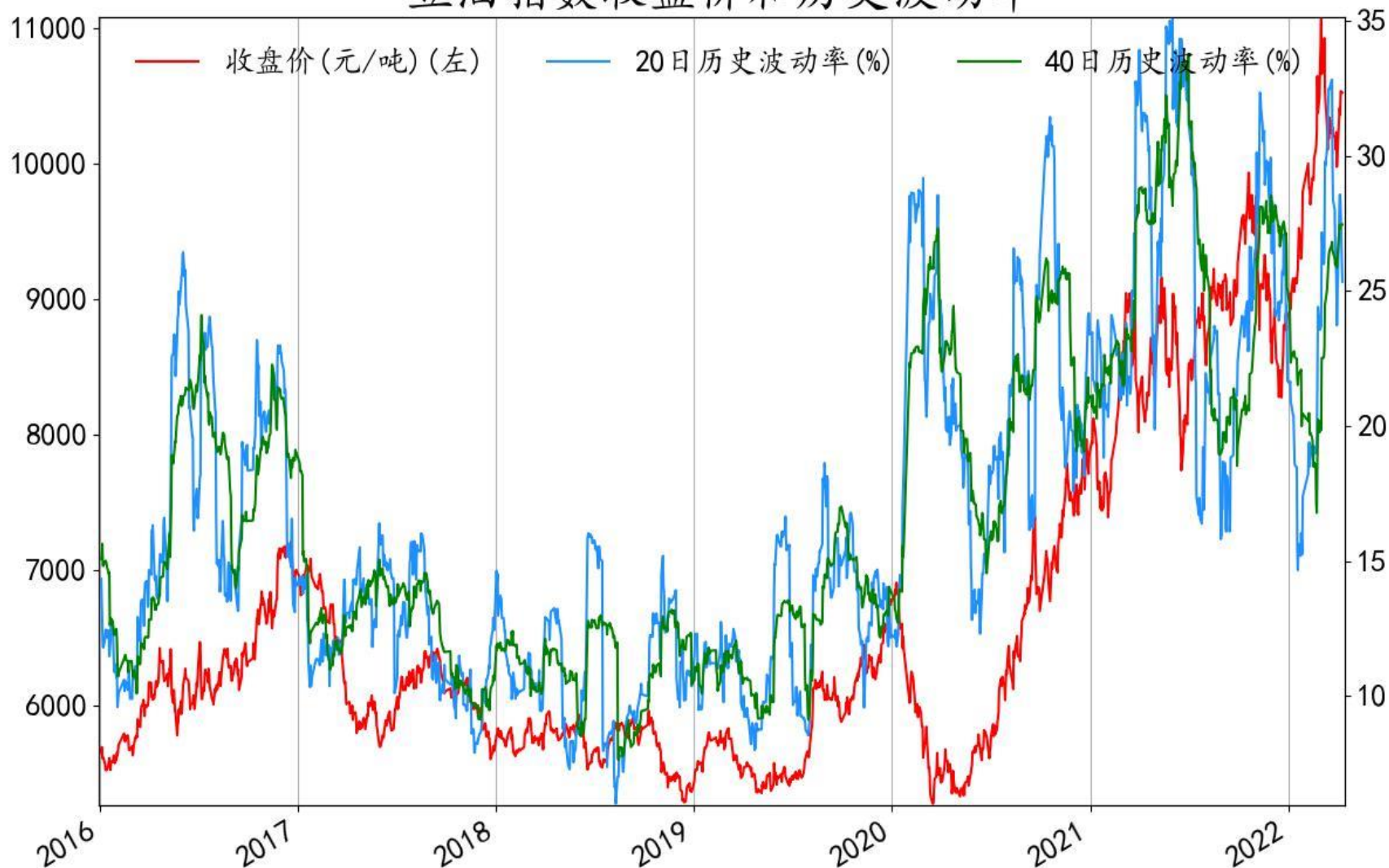
## 花生指数收盘价和历史波动率



## 菜粕指数收盘价和历史波动率

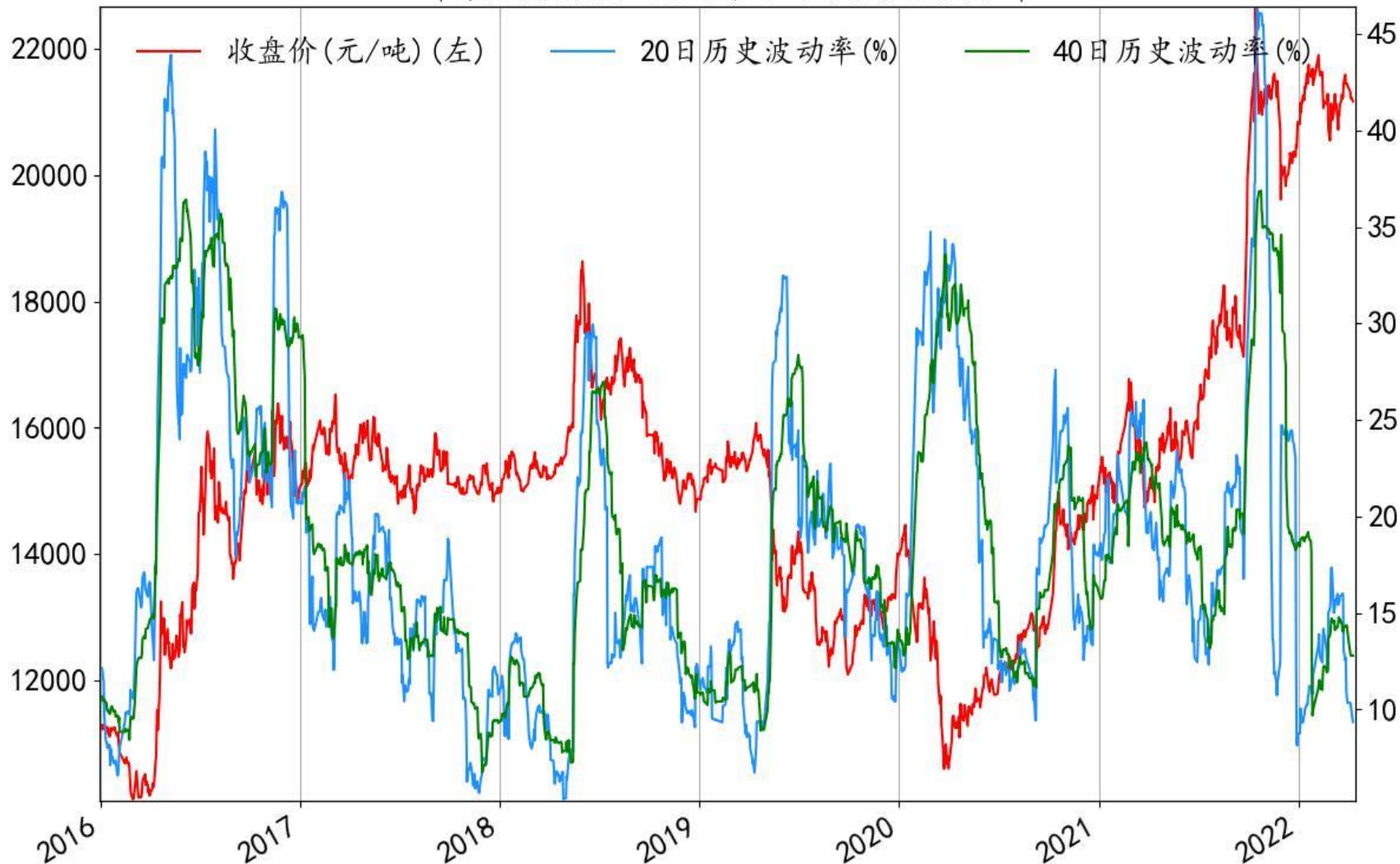


## 豆油指数收盘价和历史波动率

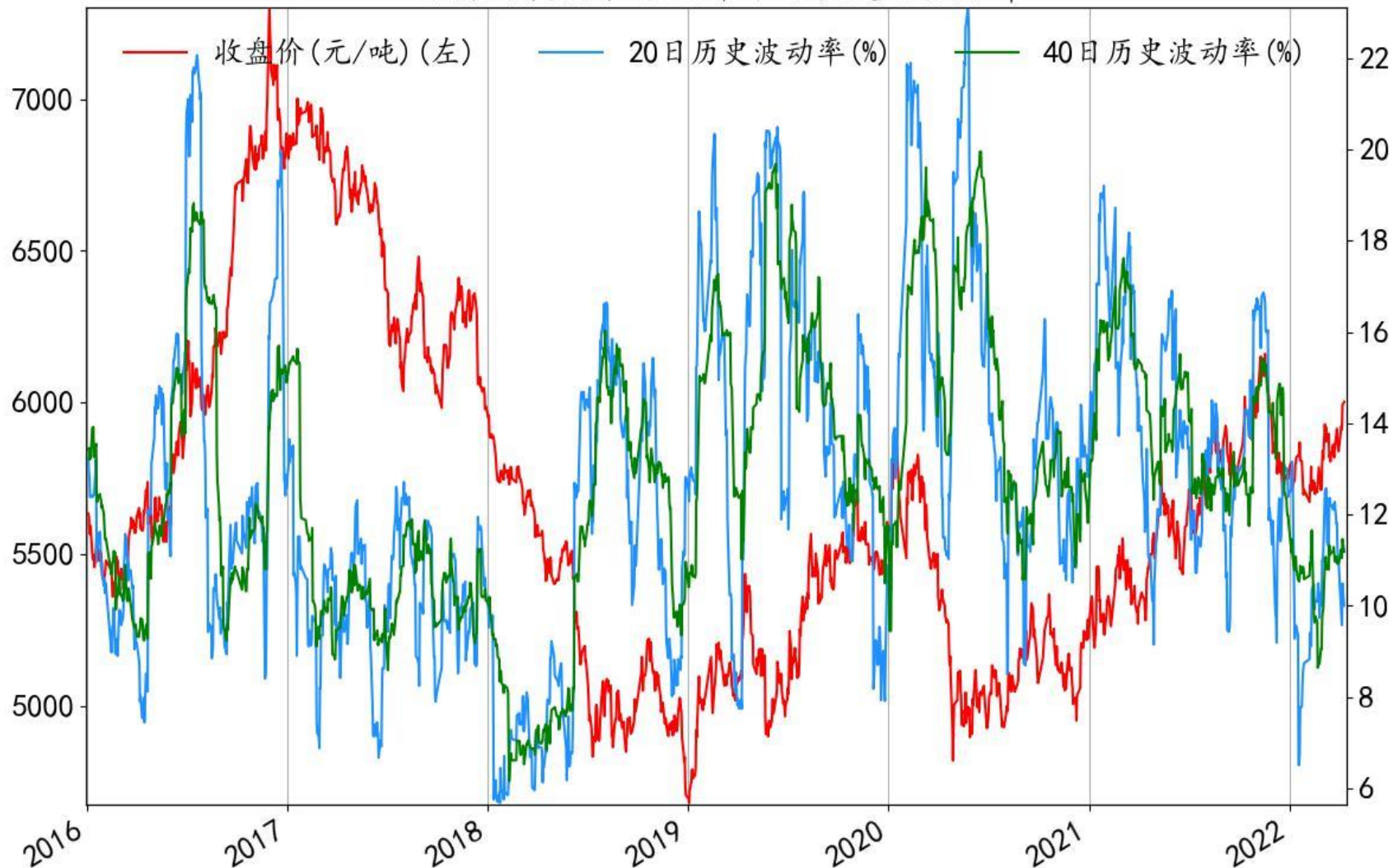




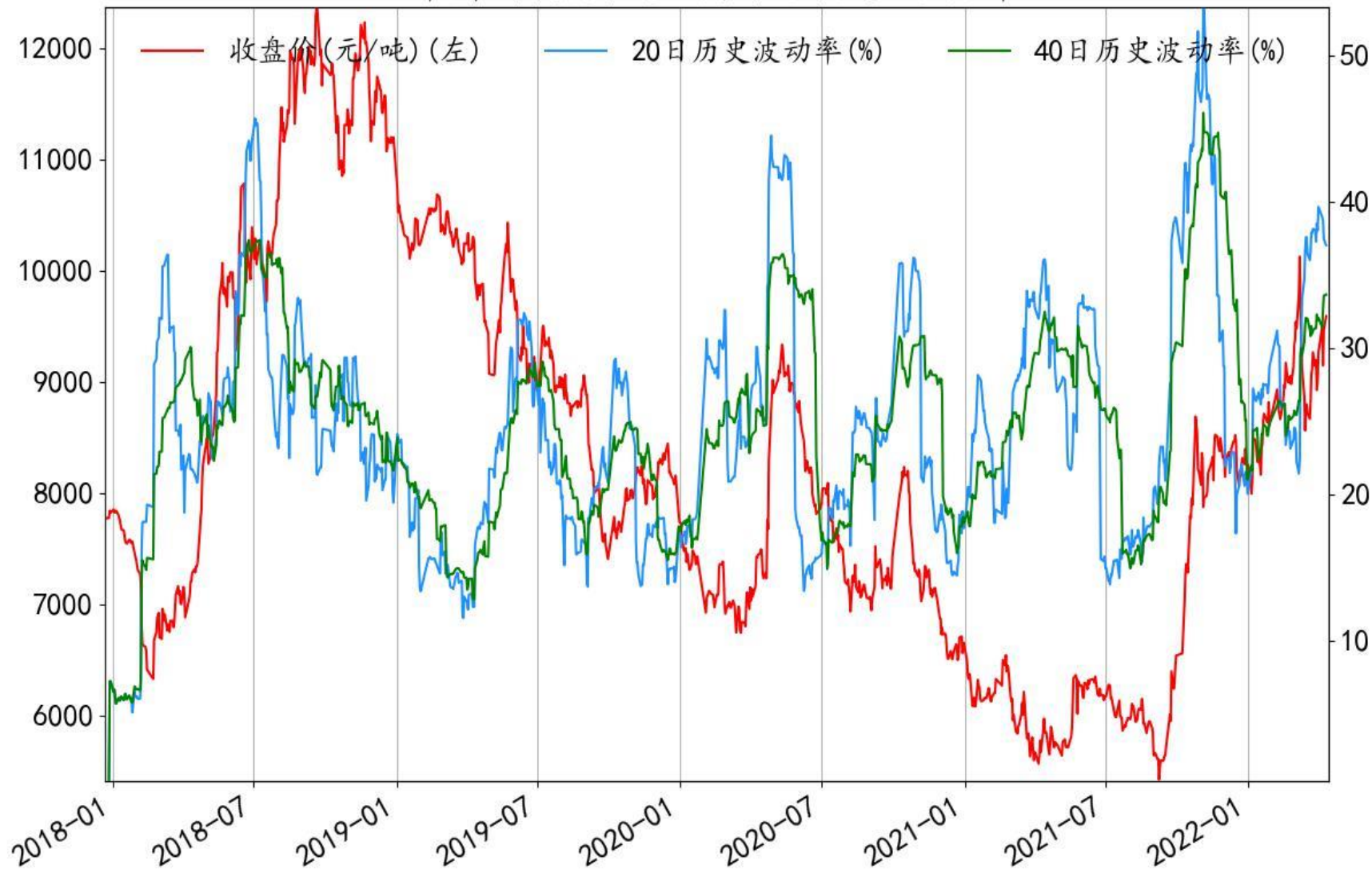
## 棉花指数收盘价和历史波动率



## 白糖指数收盘价和历史波动率

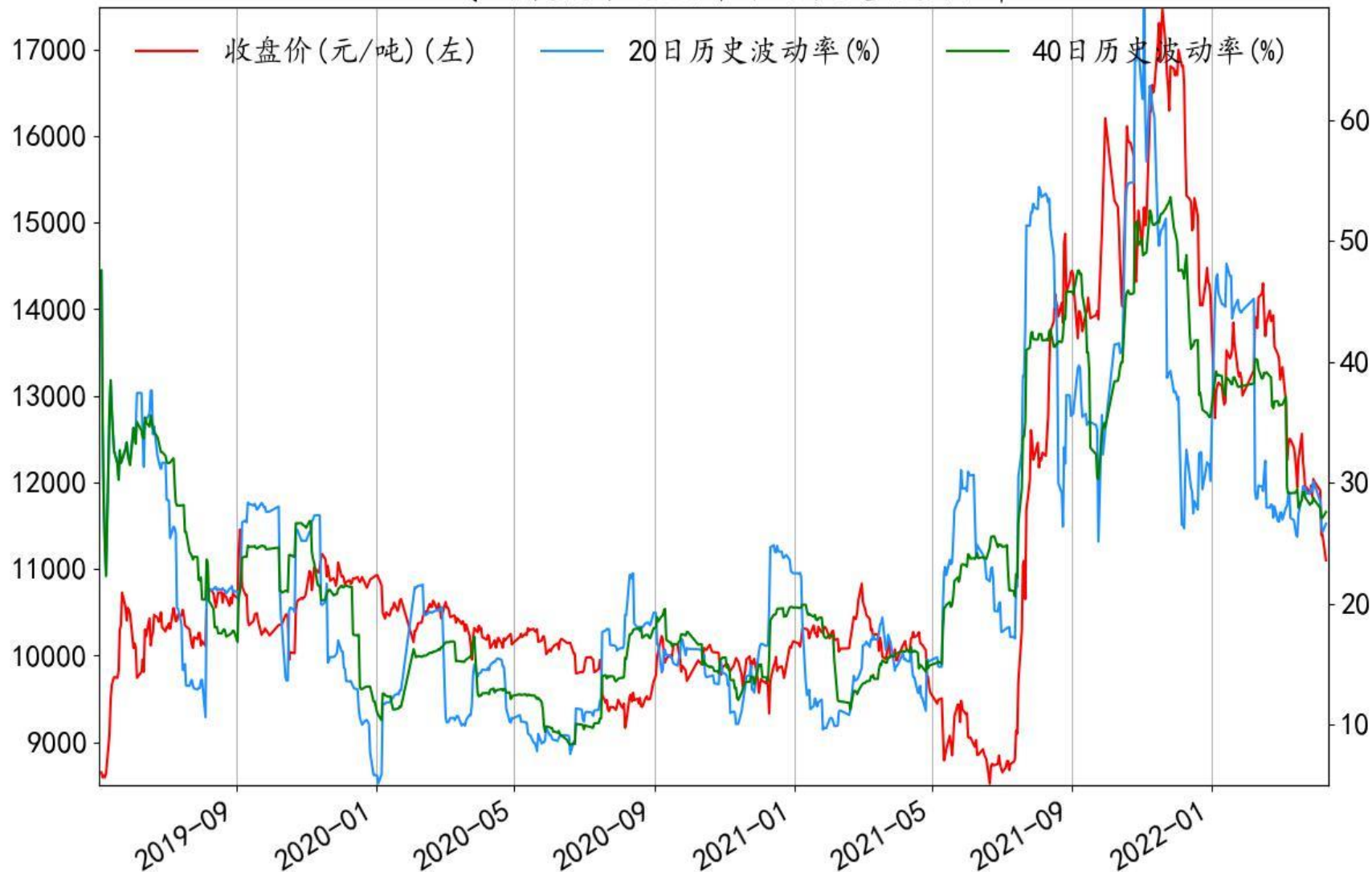


## 苹果指数收盘价和历史波动率





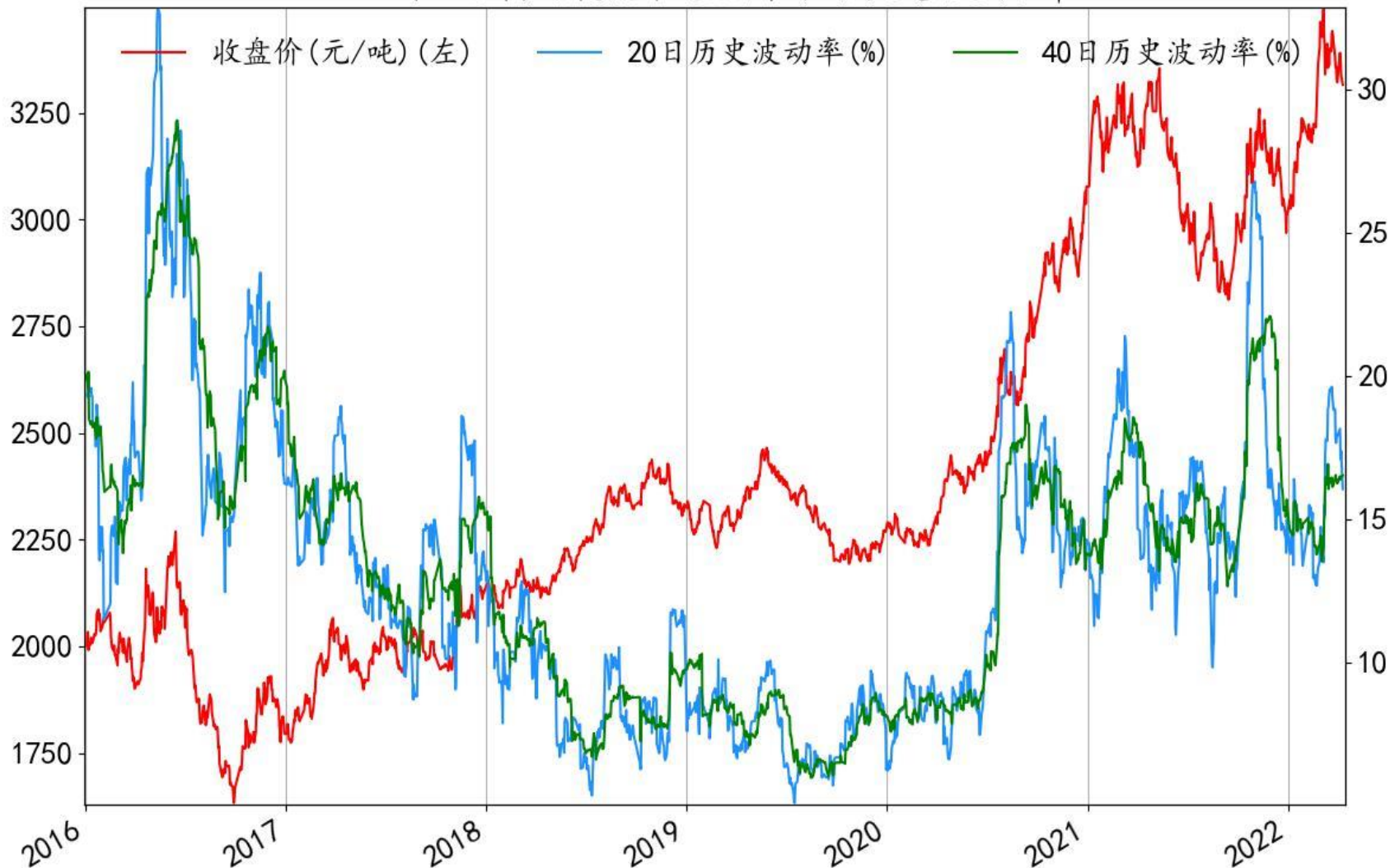
## 红枣指数收盘价和历史波动率



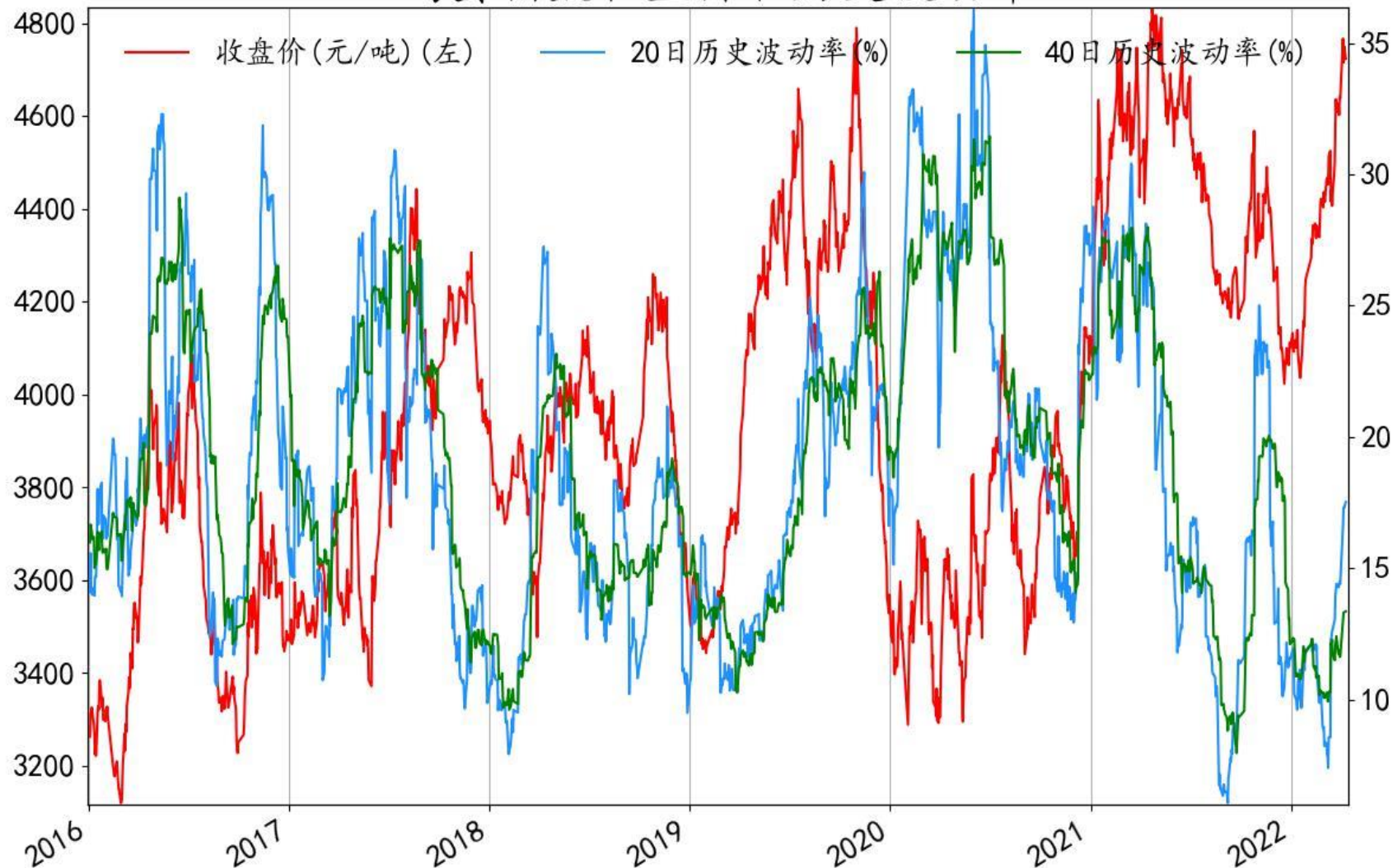


# 玉米淀粉指数

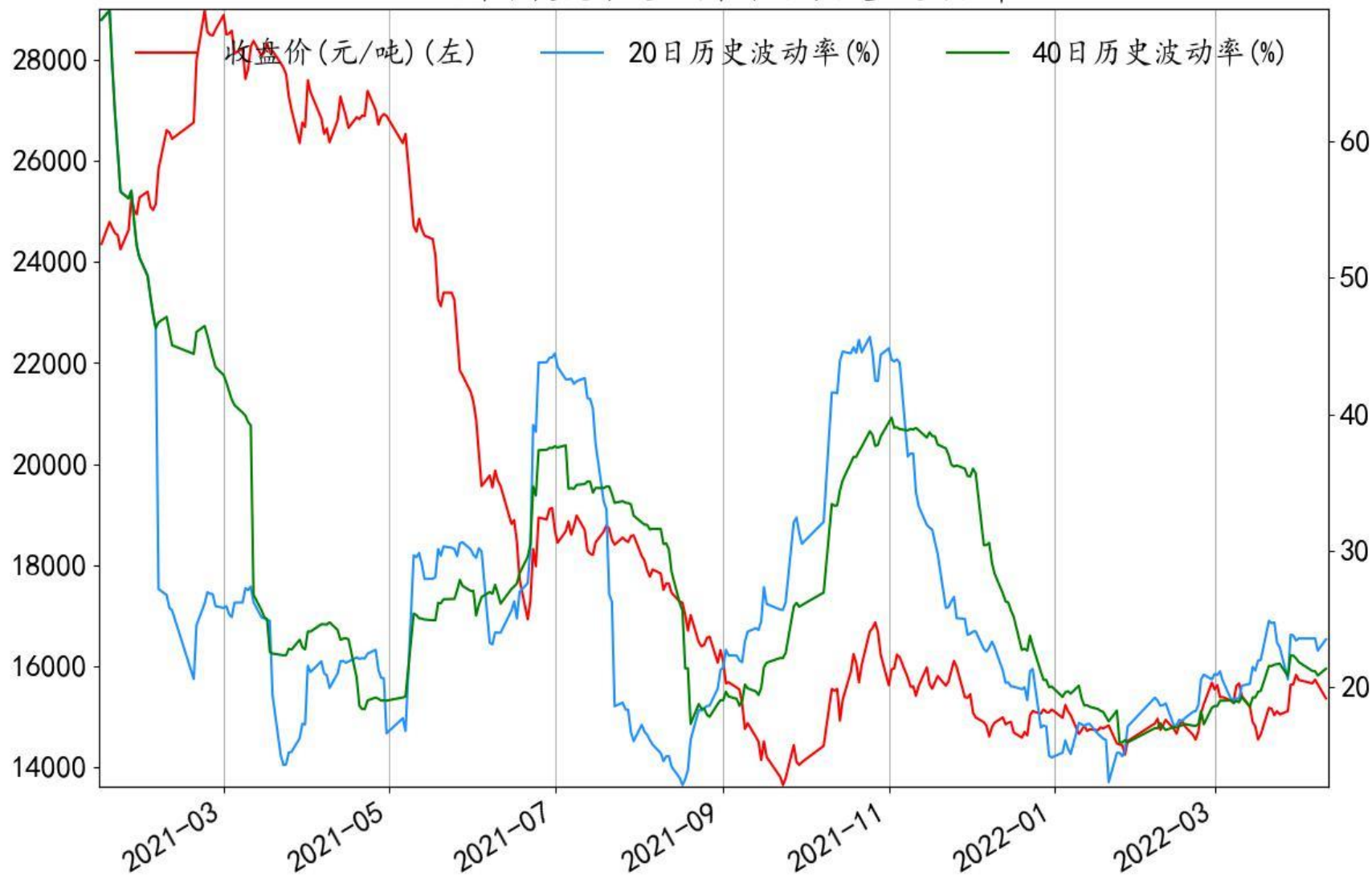
## 玉米淀粉指数收盘价和历史波动率



## 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



# 重要声明



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。

信达期货研究所

电话：0571-28132535

QQ：736426384

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