

# 商品期货波动跟踪

## Commodity Futures Volatility Tracking

2023年11月10日

始于信 达于行

诚信 融合 创新 卓越

Integrity Integration Innovation Excellence

量化研究员 陈蔚文

投资咨询证号: Z0019441

联系电话: 0571-28132535

邮箱: [chenweiw@cindasc.com](mailto:chenweiw@cindasc.com)



20日历史波动率百分位高于90%:

无

20日历史波动率百分位低于10%:

生猪、锰硅、短纤、乙二醇、聚丙烯、橡胶、LPG、聚乙烯、热卷、鸡蛋

花生、沥青、螺纹、沪镍、PVC、动力煤、工业硅、沪铅

20日历史波动率绝对值前五:

纯碱、焦炭、焦煤、红枣、尿素

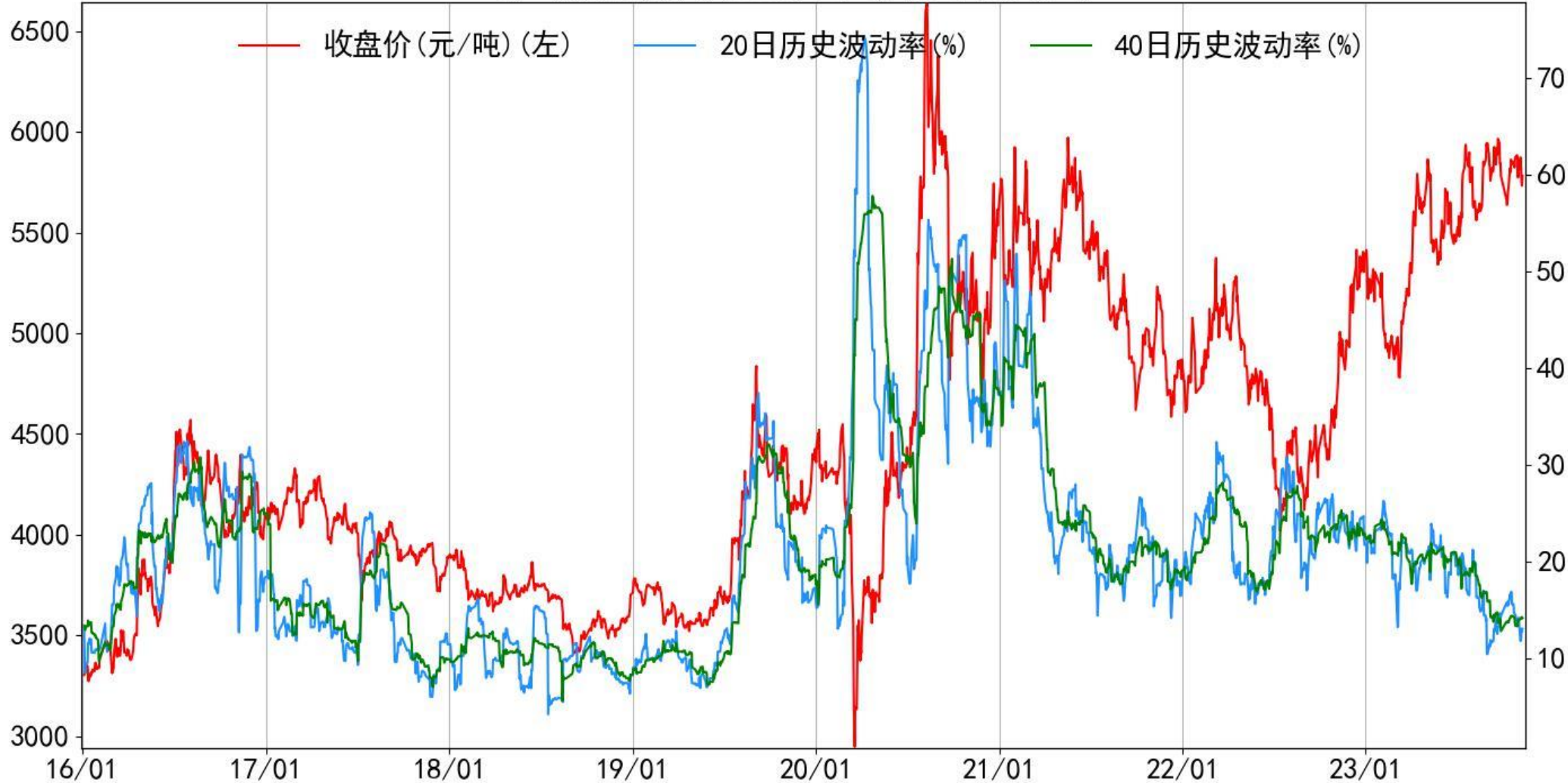
20日历史波动率绝对值后五:

动力煤、短纤、沪铅、鸡蛋、聚乙烯

# 数据概览

| 品种  | 百分位    | 绝对值    | 品种  | 百分位    | 绝对值    | 品种   | 百分位    | 绝对值    | 品种  | 百分位    | 绝对值    |
|-----|--------|--------|-----|--------|--------|------|--------|--------|-----|--------|--------|
| 沪银  | 27.12% | 13.00% | 焦煤  | 46.18% | 29.82% | 苯乙烯  | 12.12% | 15.36% | 豆粕  | 49.74% | 16.80% |
| 沪金  | 35.76% | 8.91%  | 螺纹  | 4.55%  | 12.13% | 乙二醇  | 0.50%  | 9.28%  | 菜油  | 50.26% | 16.79% |
| 沪铝  | 16.65% | 9.22%  | 硅铁  | 13.66% | 12.39% | 聚乙烯  | 2.67%  | 8.21%  | 棕榈油 | 46.39% | 20.25% |
| 沪铜  | 12.20% | 9.44%  | 锰硅  | 0.26%  | 8.56%  | 甲醇   | 12.98% | 17.98% | 花生  | 3.58%  | 9.95%  |
| 沪镍  | 5.39%  | 16.94% | 玻璃  | 44.55% | 21.01% | 20号胶 | 13.45% | 14.84% | 菜粕  | 67.02% | 22.98% |
| 沪铅  | 7.96%  | 8.12%  | 纯碱  | 68.07% | 32.93% | 短纤   | 0.27%  | 7.23%  | 豆油  | 47.43% | 16.13% |
| 沪锡  | 48.38% | 18.63% | 燃油  | 17.16% | 24.88% | 聚丙烯  | 1.47%  | 8.69%  | 棉花  | 42.93% | 15.67% |
| 沪锌  | 29.48% | 16.62% | 低燃油 | 13.55% | 23.89% | 橡胶   | 1.52%  | 12.14% | 白糖  | 30.99% | 10.54% |
| 不锈钢 | 13.61% | 13.45% | LPG | 1.67%  | 17.78% | 纸浆   | 70.87% | 21.48% | 苹果  | 67.09% | 25.56% |
| 工业硅 | 7.51%  | 14.64% | 原油  | 33.63% | 26.38% | PTA  | 10.68% | 11.90% | 红枣  | 75.45% | 29.09% |
| 热卷  | 2.98%  | 11.16% | 动力煤 | 6.68%  | 0.00%  | 尿素   | 67.64% | 29.03% | 淀粉  | 33.30% | 10.51% |
| 铁矿石 | 16.86% | 23.72% | PVC | 5.60%  | 10.26% | 玉米   | 30.31% | 8.66%  | 鸡蛋  | 3.19%  | 8.19%  |
| 焦炭  | 45.03% | 30.41% | 沥青  | 4.19%  | 15.29% | 豆一   | 28.85% | 10.96% | 生猪  | 0.15%  | 11.51% |

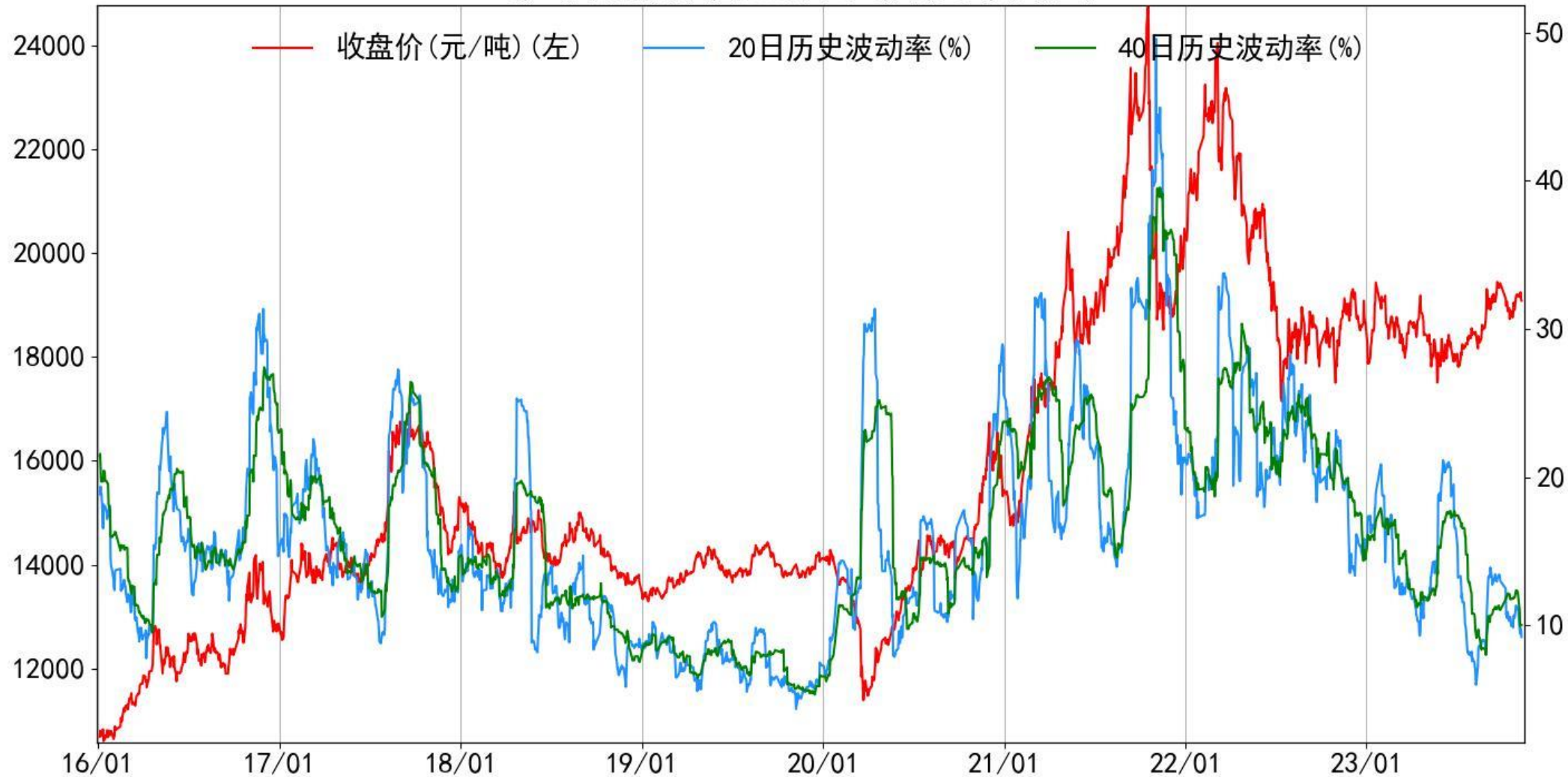
## 沪银指数收盘价和历史波动率



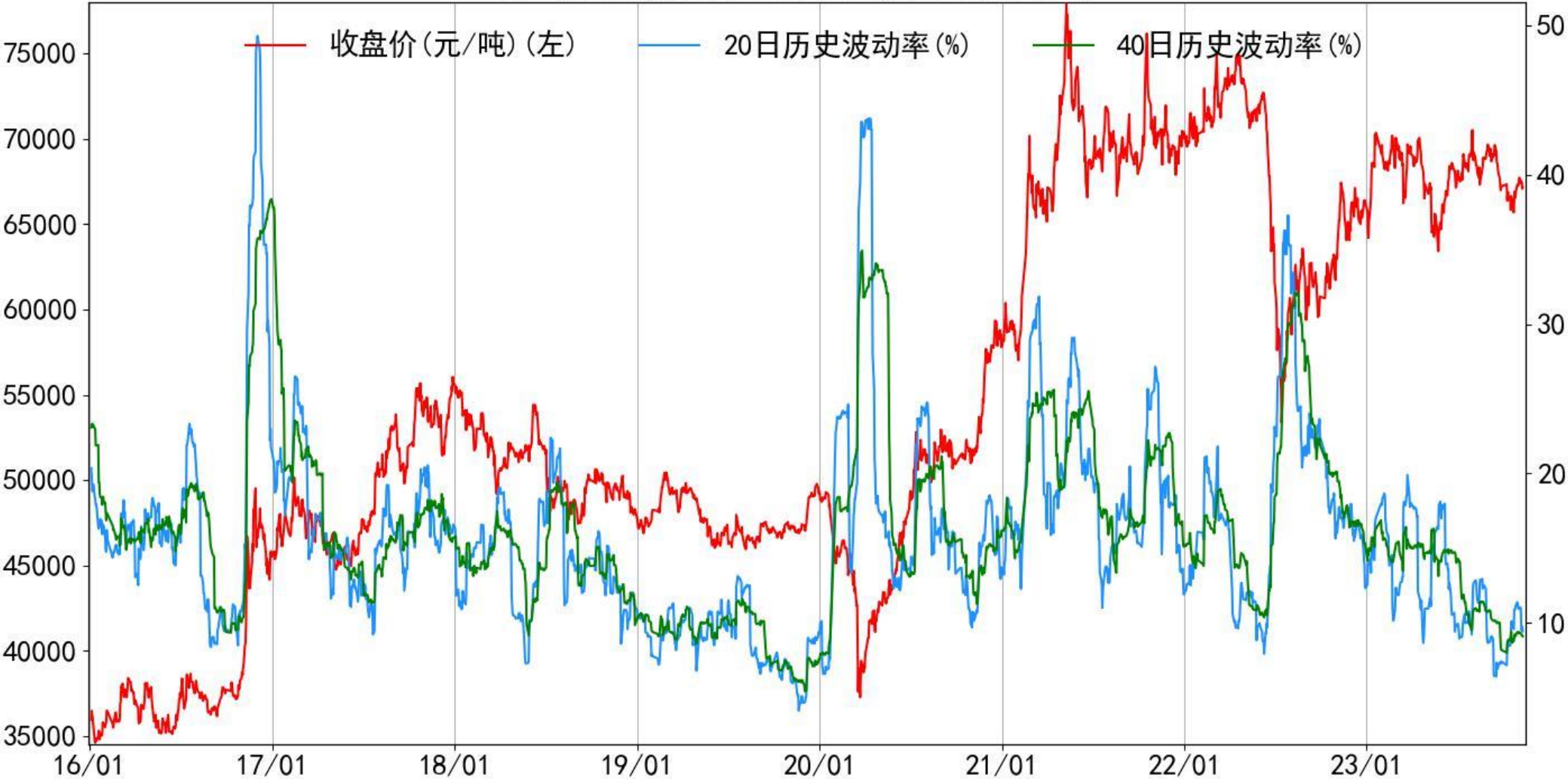
## 沪金指数收盘价和历史波动率



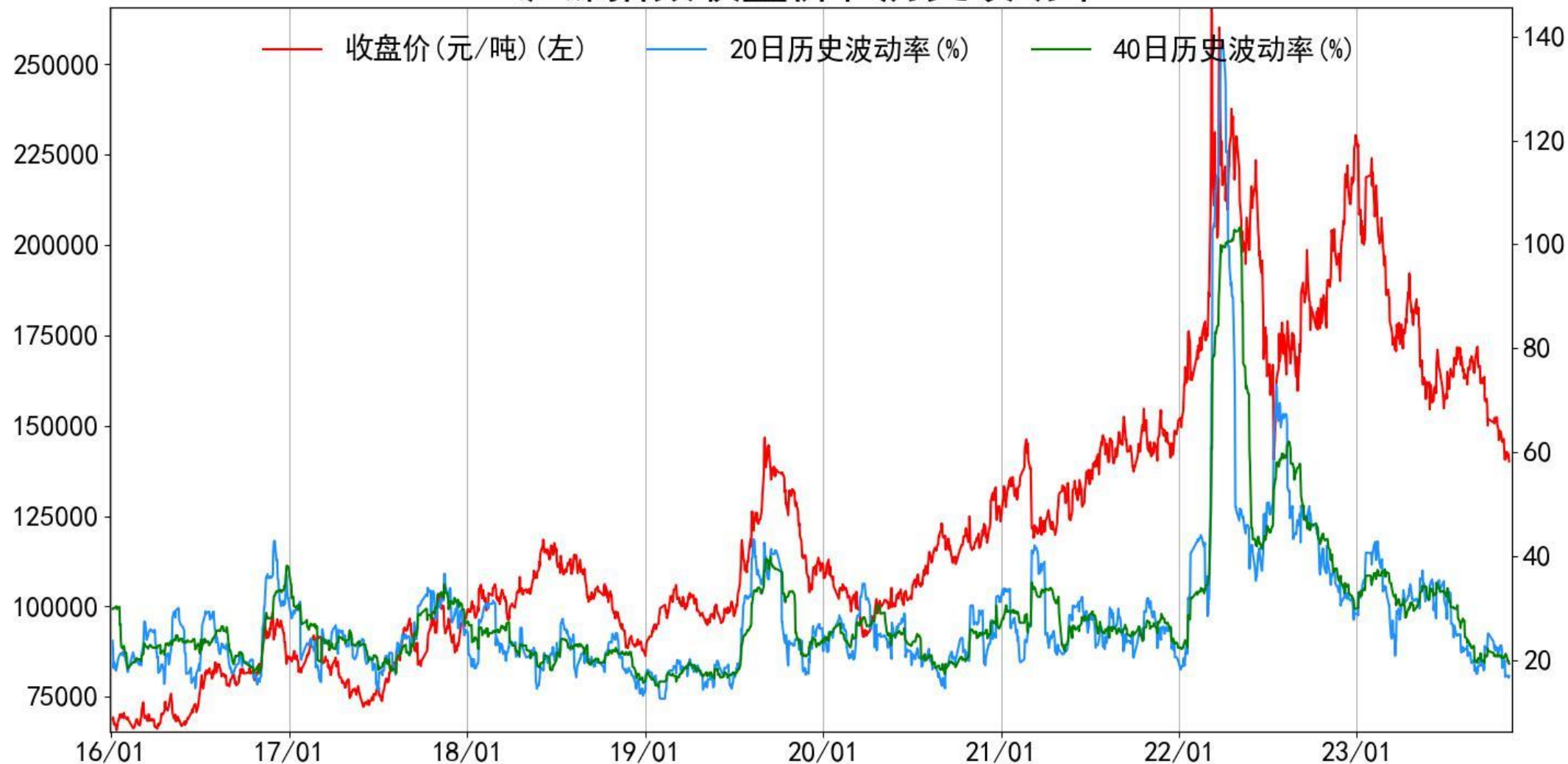
## 沪铝指数收盘价和历史波动率



## 沪铜指数收盘价和历史波动率



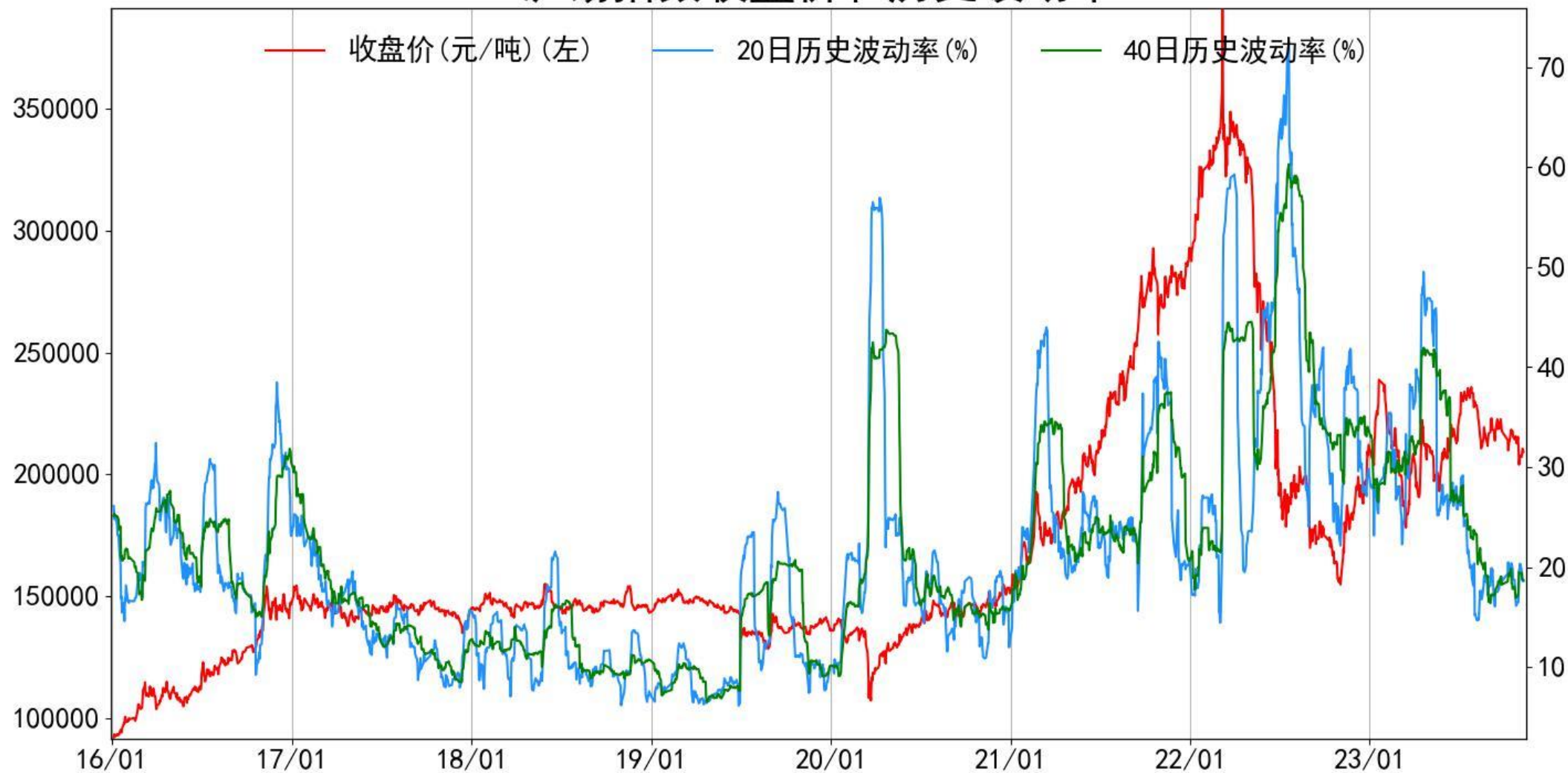
## 沪镍指数收盘价和历史波动率



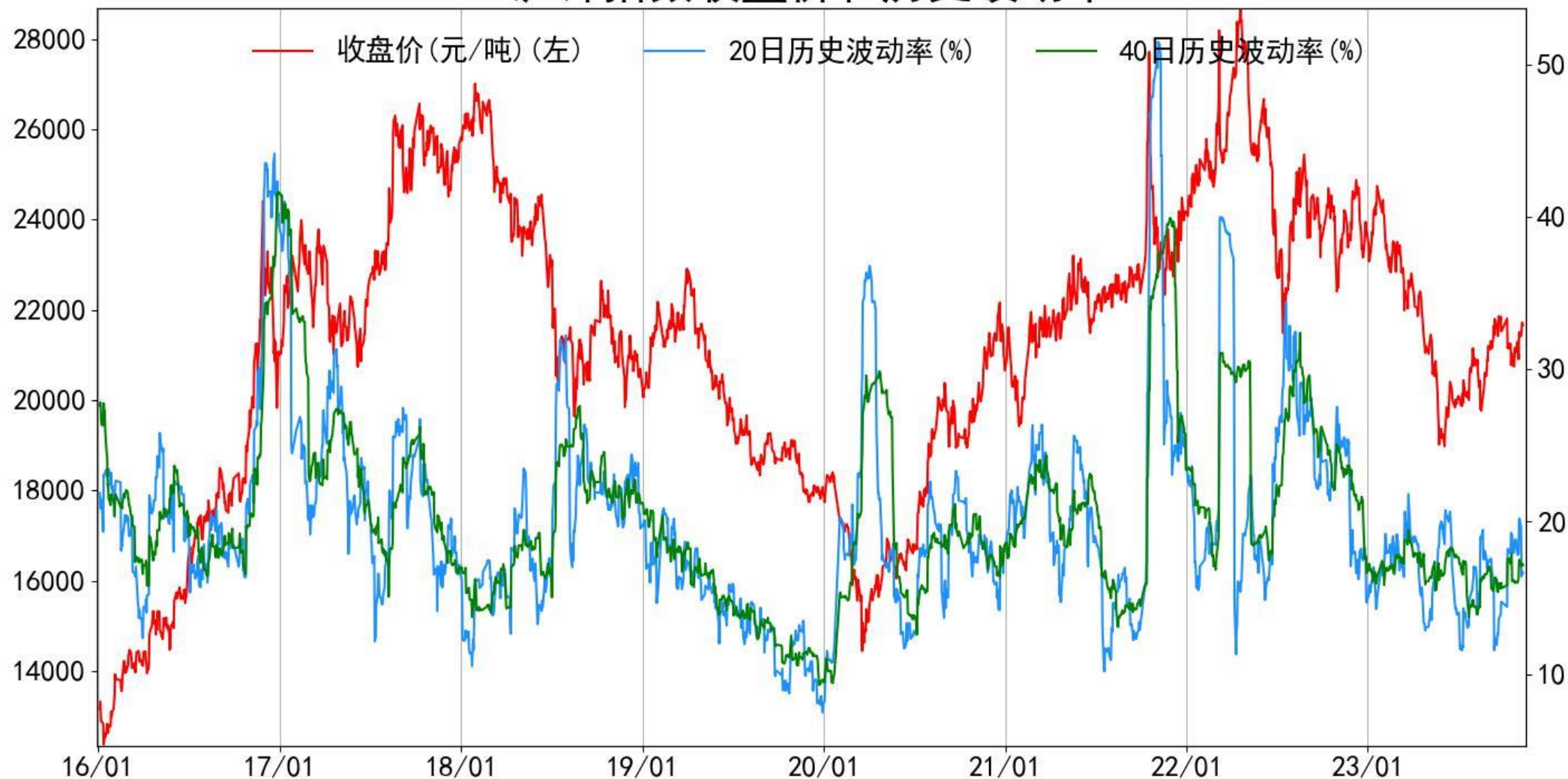
## 沪铅指数收盘价和历史波动率



## 沪锡指数收盘价和历史波动率



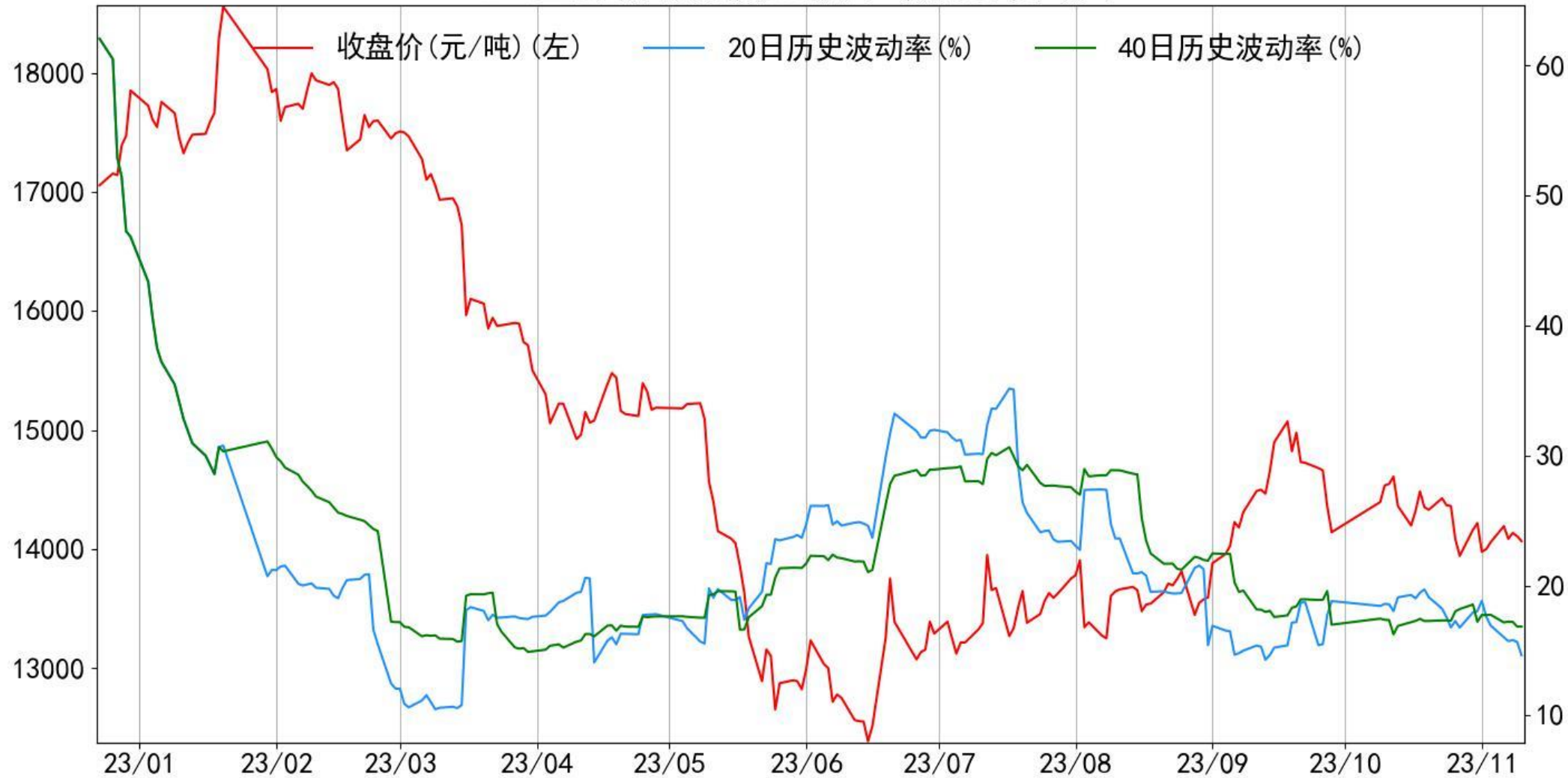
## 沪锌指数收盘价和历史波动率



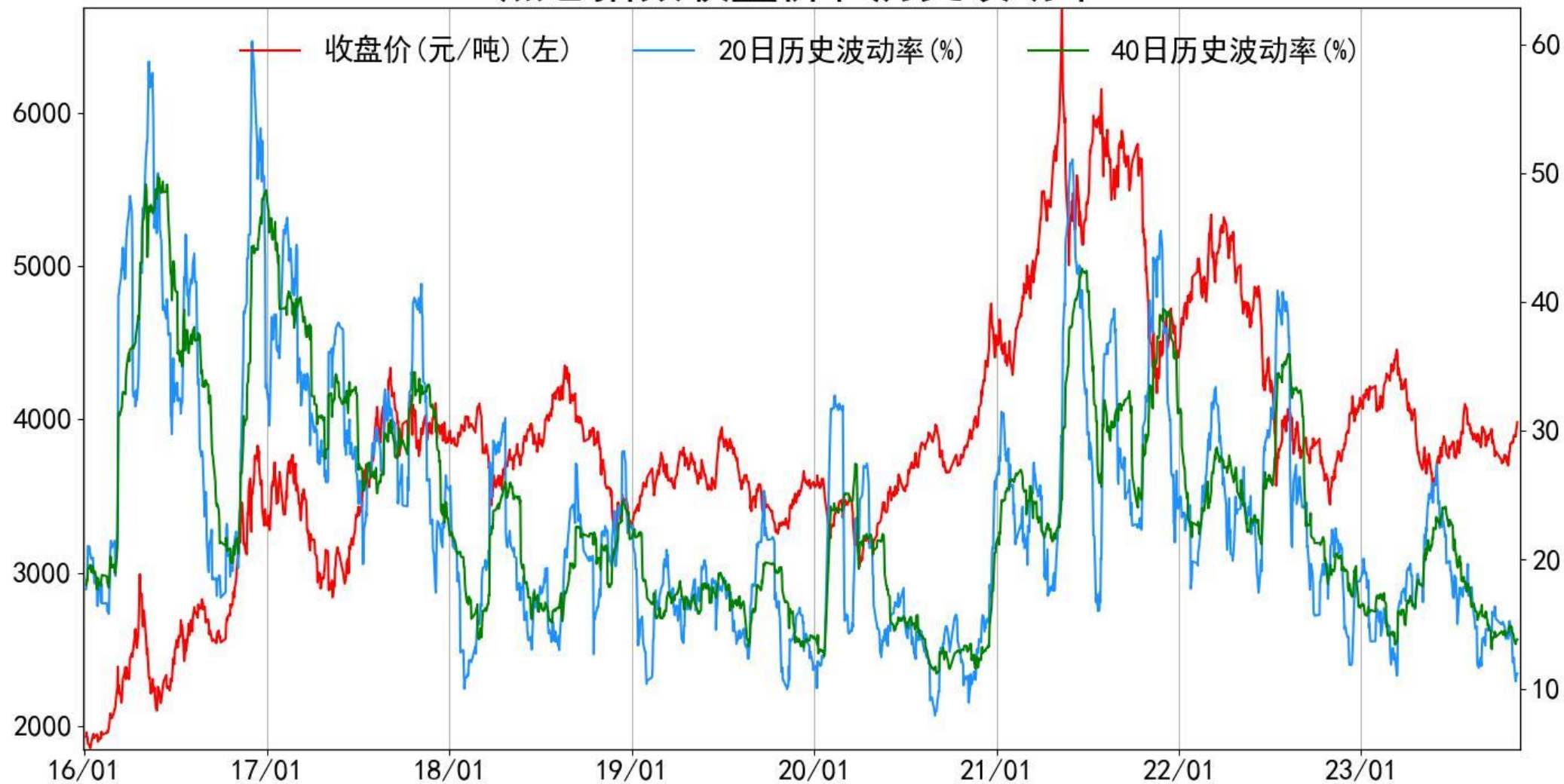
## 不锈钢指数收盘价和历史波动率



## 工业硅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



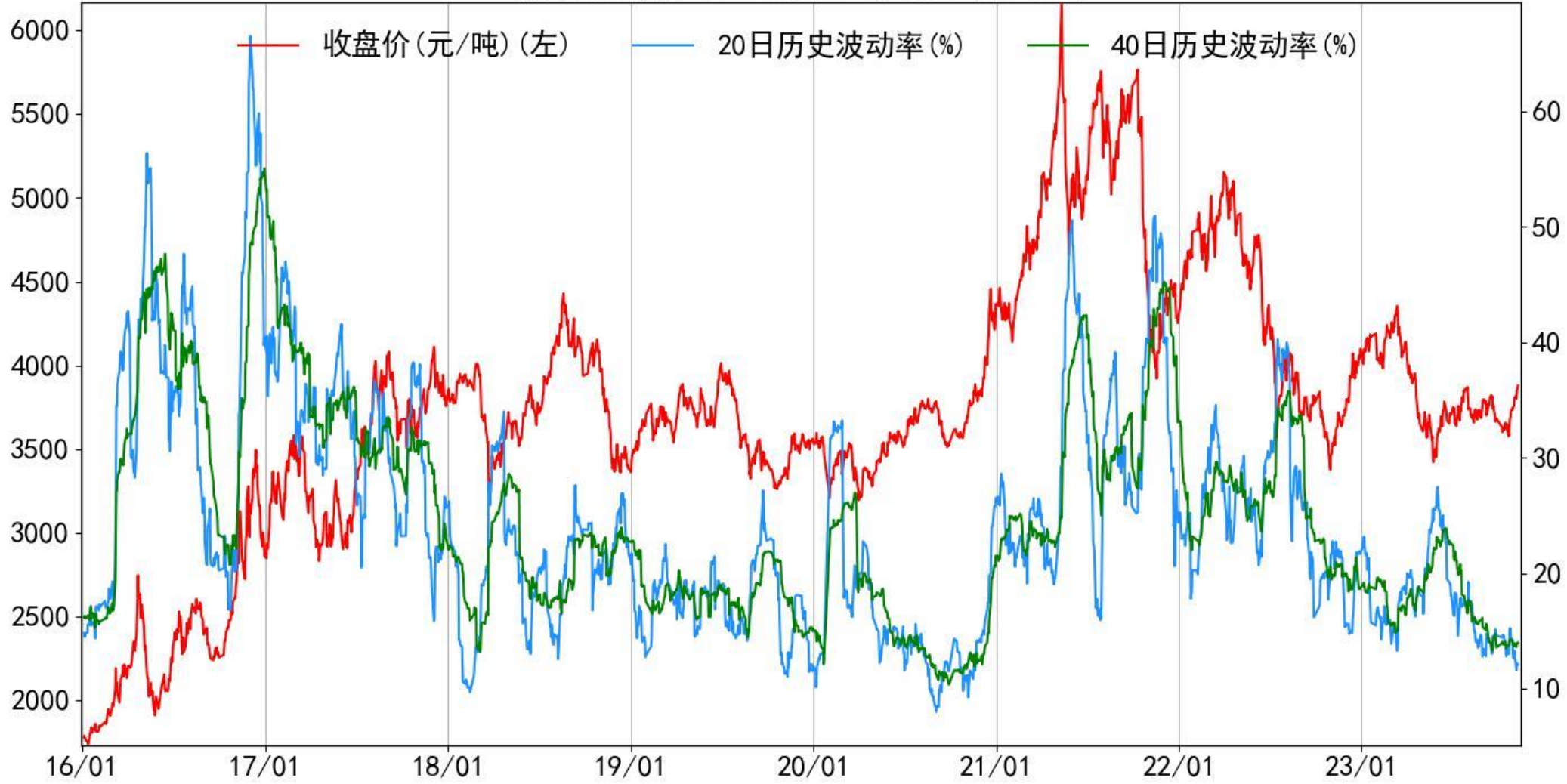
焦炭指数收盘价和历史波动率



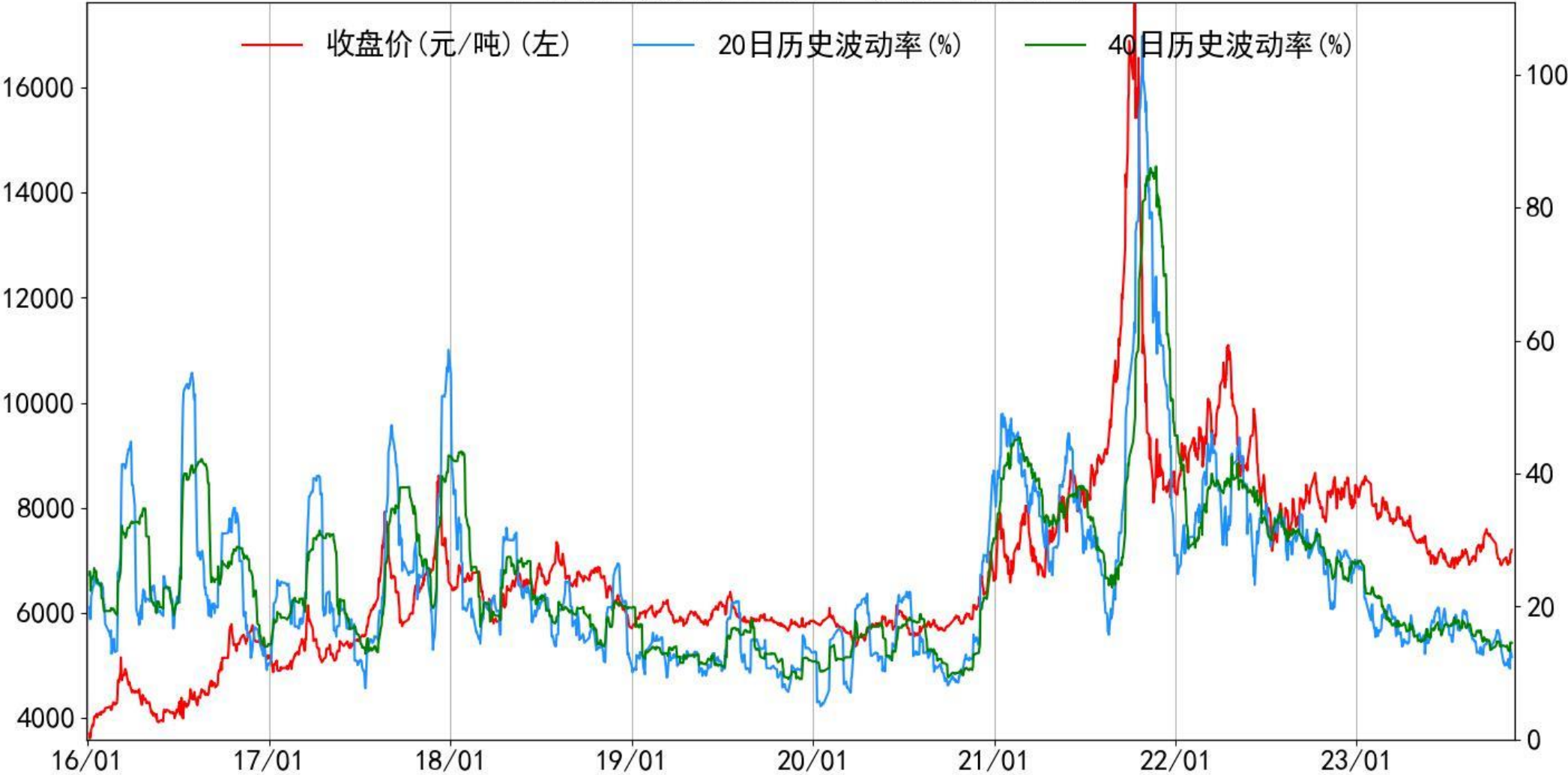
## 焦煤指数收盘价和历史波动率



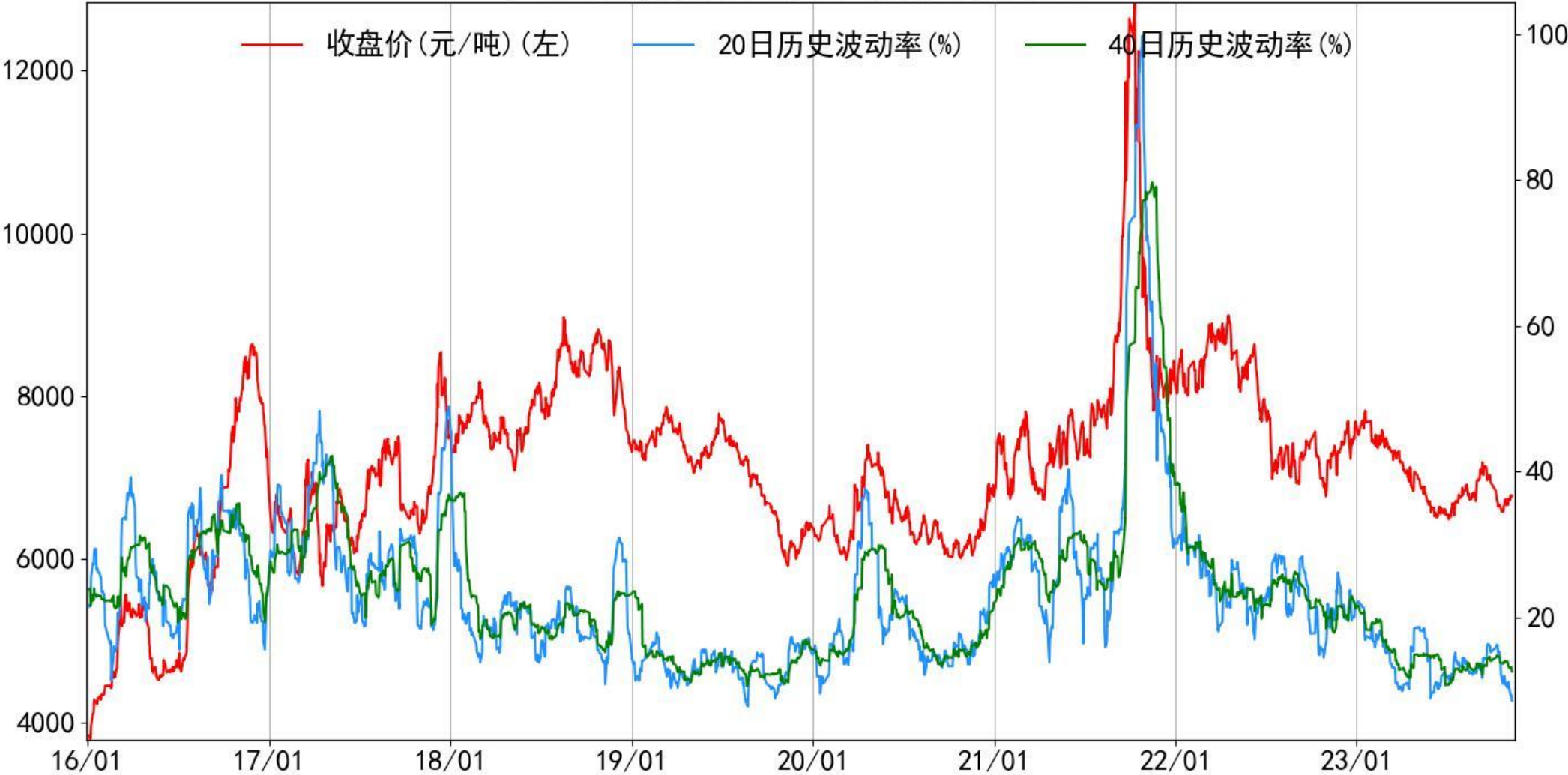
## 螺纹指数收盘价和历史波动率



## 硅铁指数收盘价和历史波动率



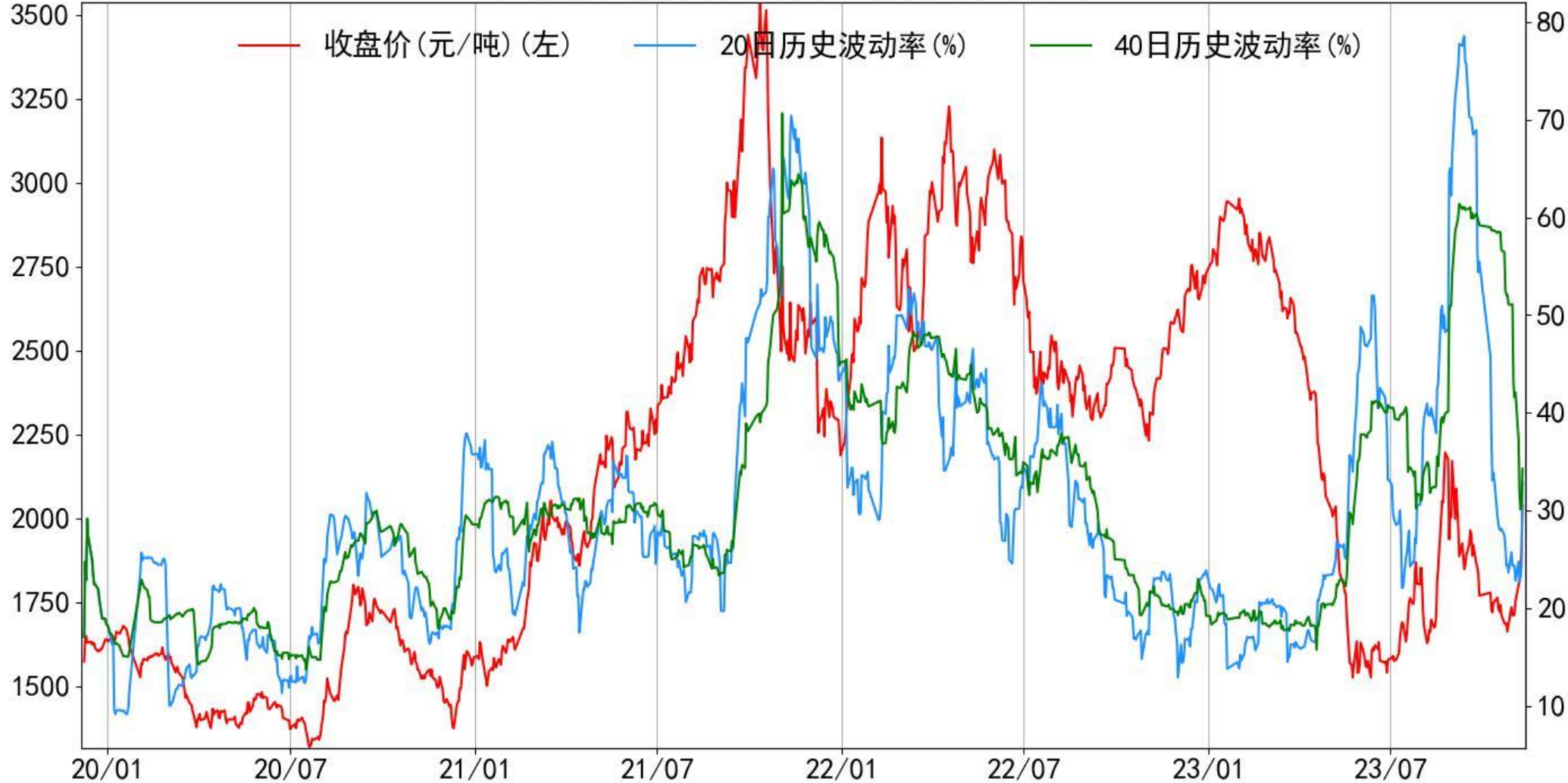
锰硅指数收盘价和历史波动率



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



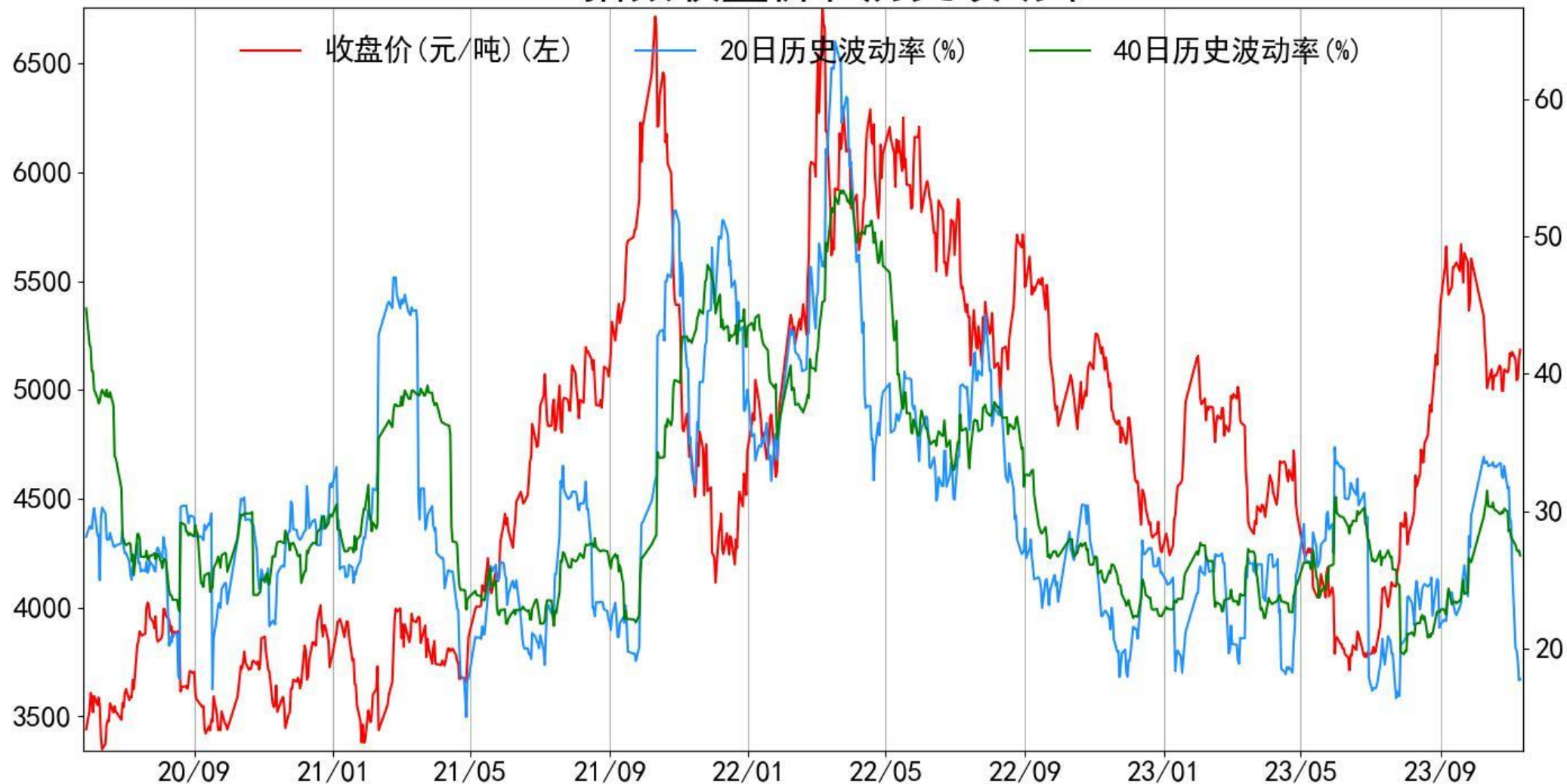
## 燃油指数收盘价和历史波动率



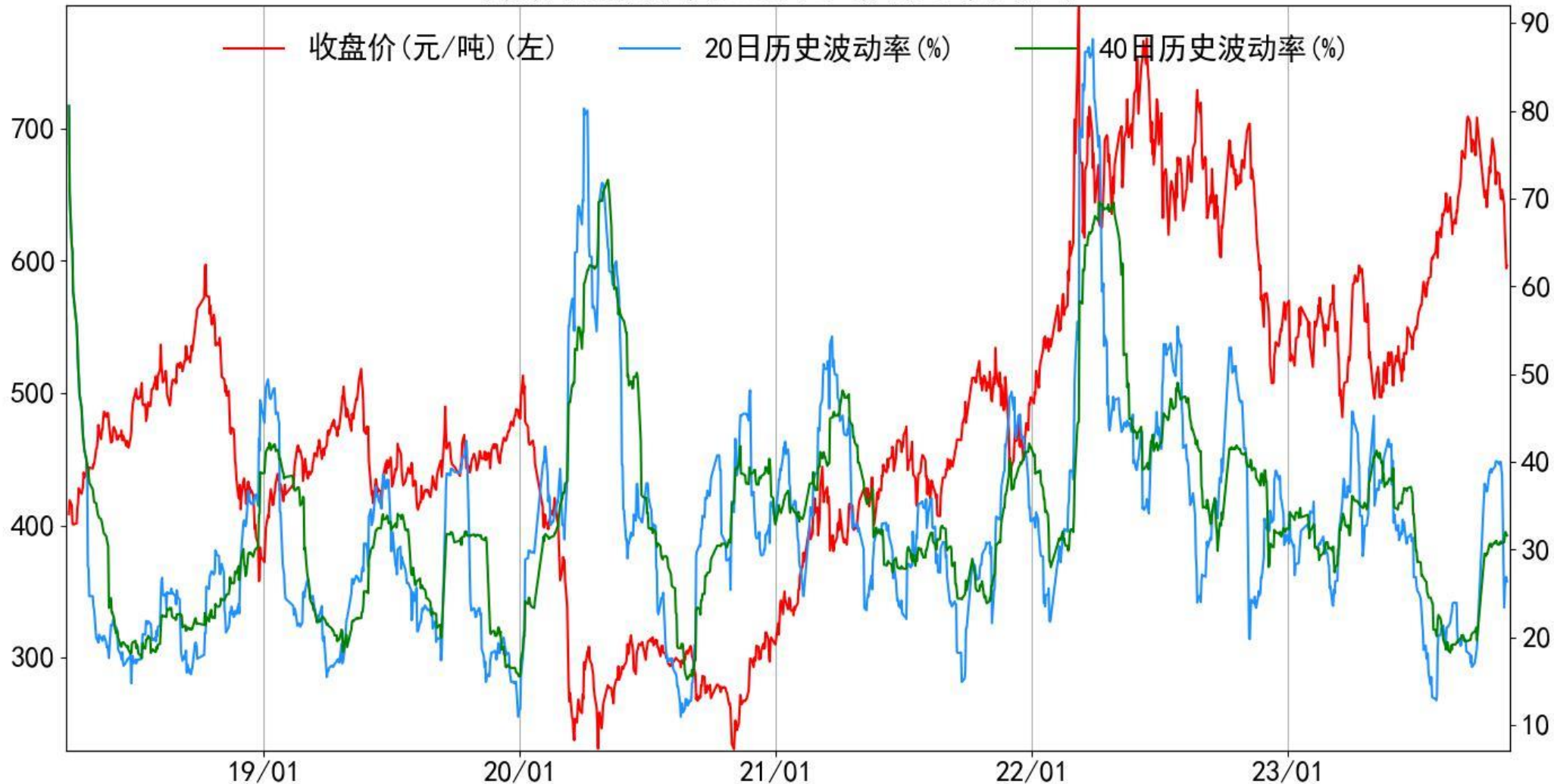
## 低燃油指数收盘价和历史波动率



## LPG指数收盘价和历史波动率



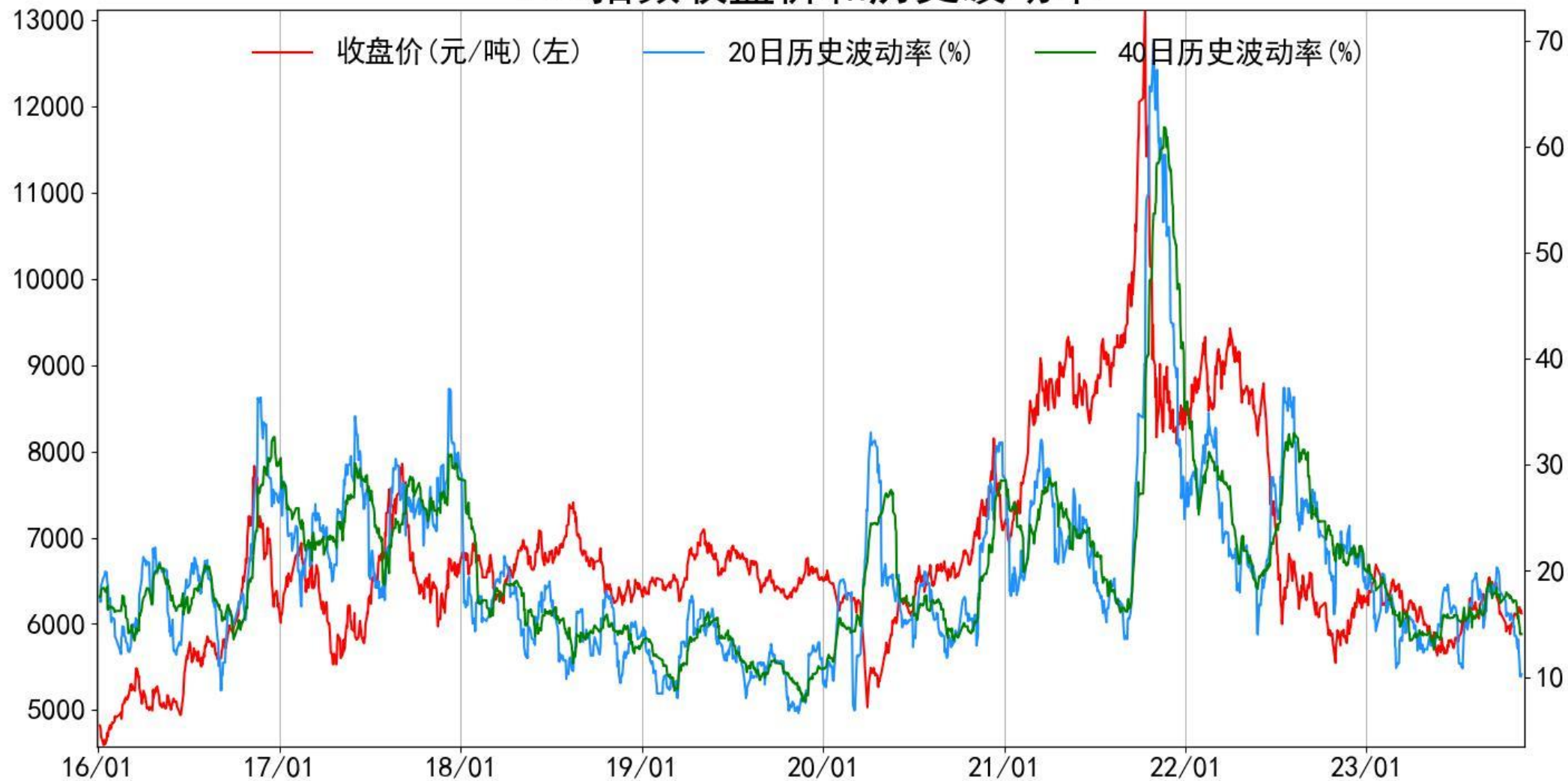
## 原油指数收盘价和历史波动率



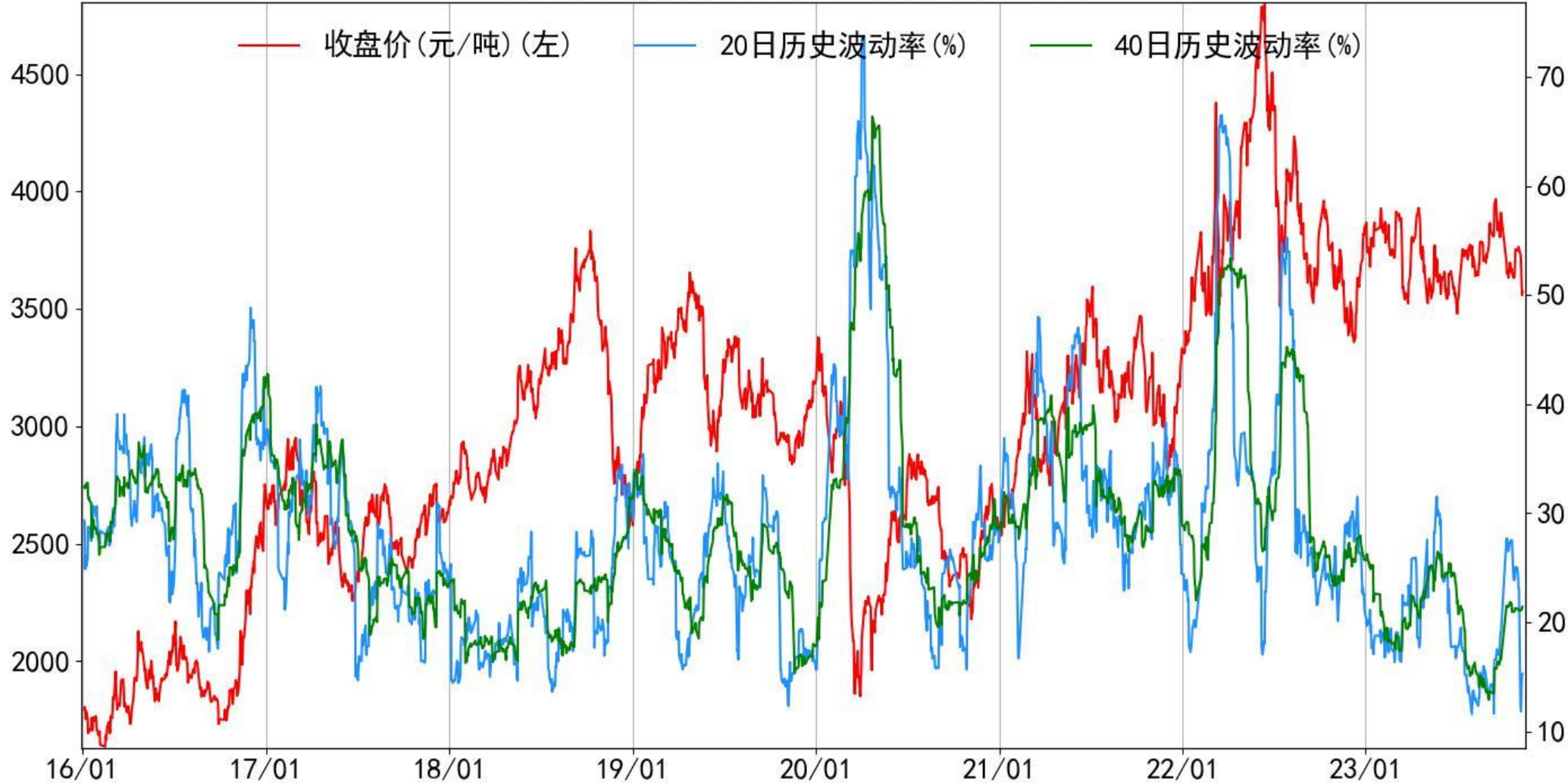
## 动力煤指数收盘价和历史波动率



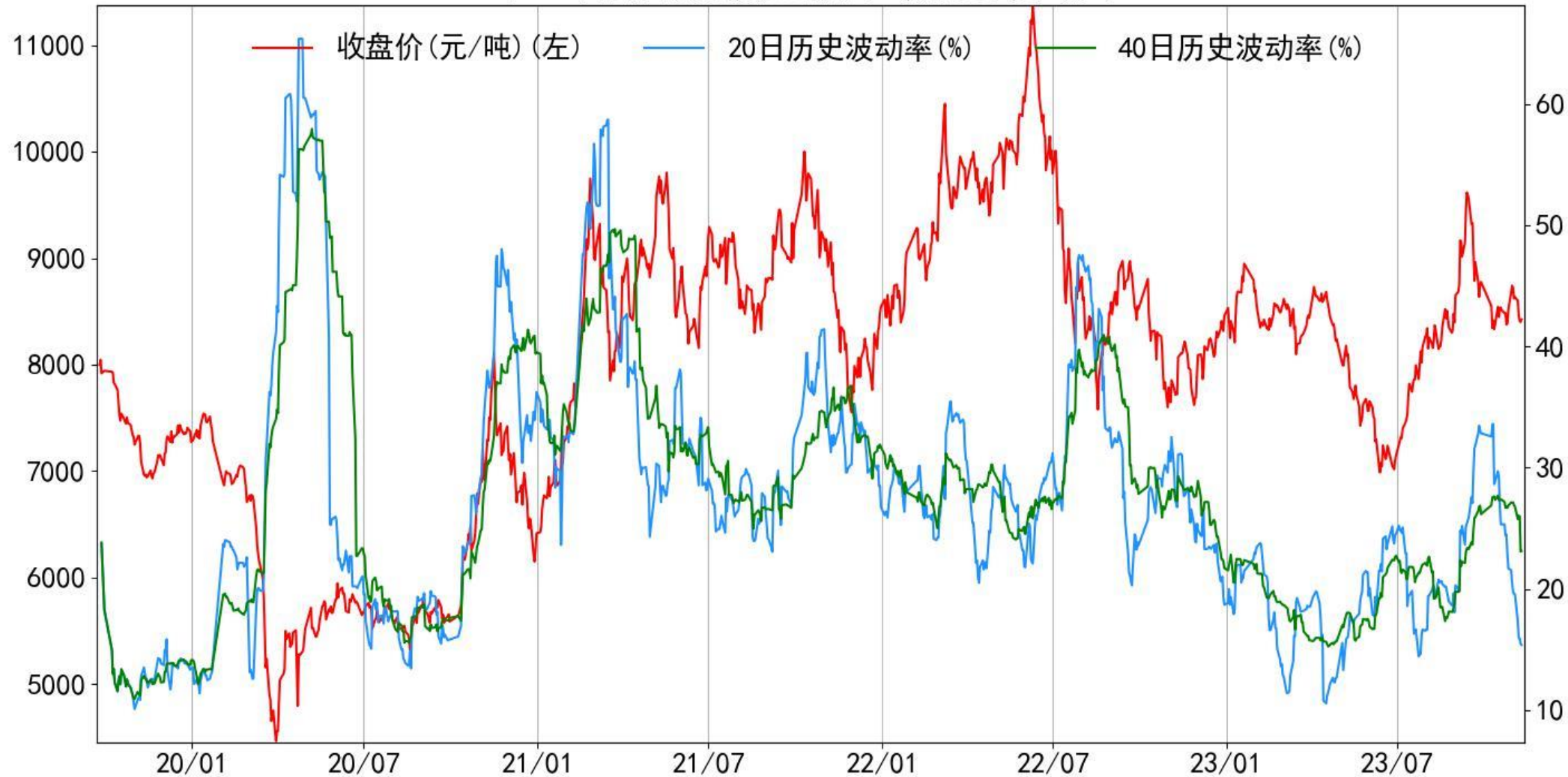
## PVC指数收盘价和历史波动率



## 沥青指数收盘价和历史波动率



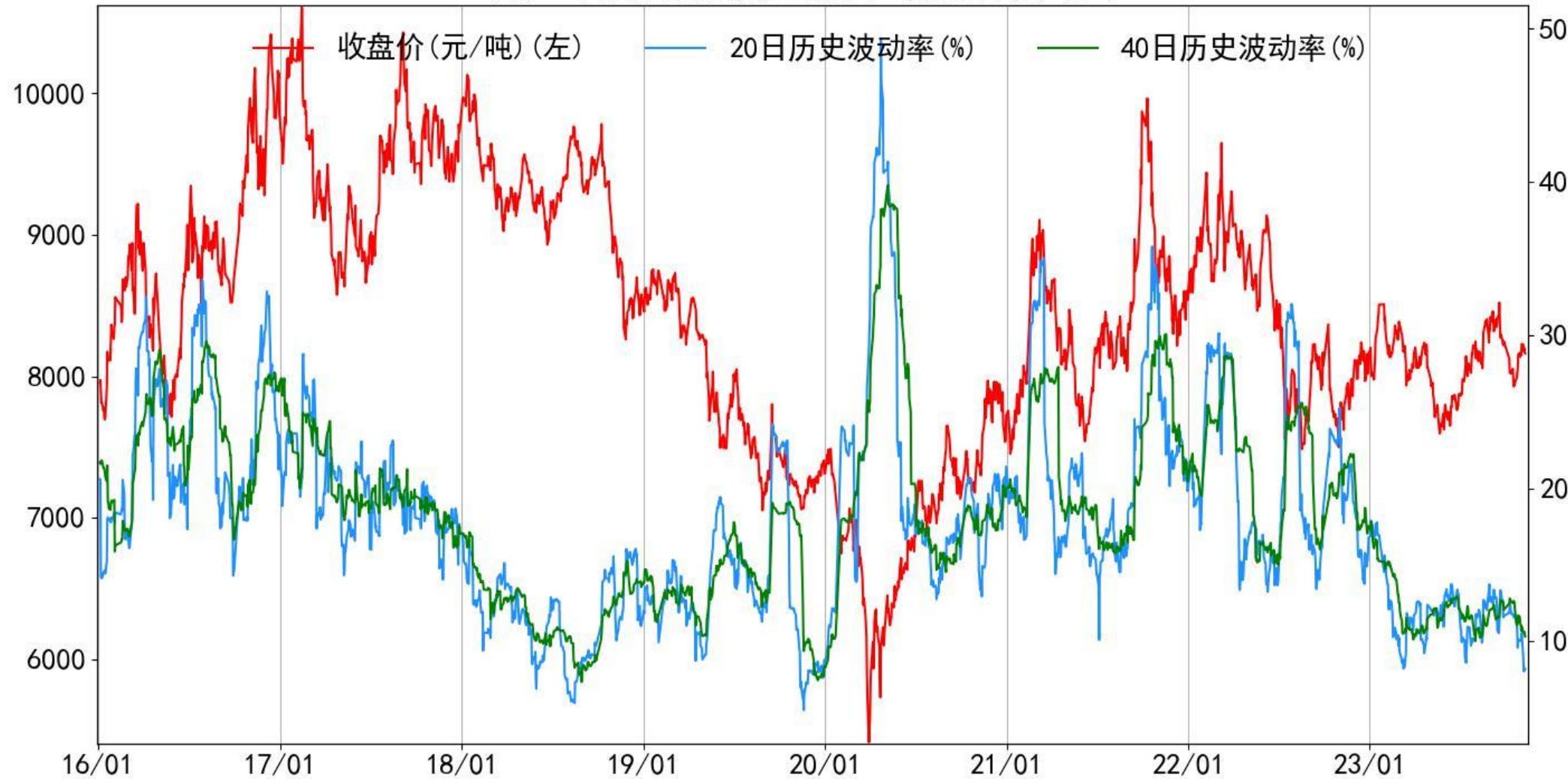
## 苯乙烯指数收盘价和历史波动率



## 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



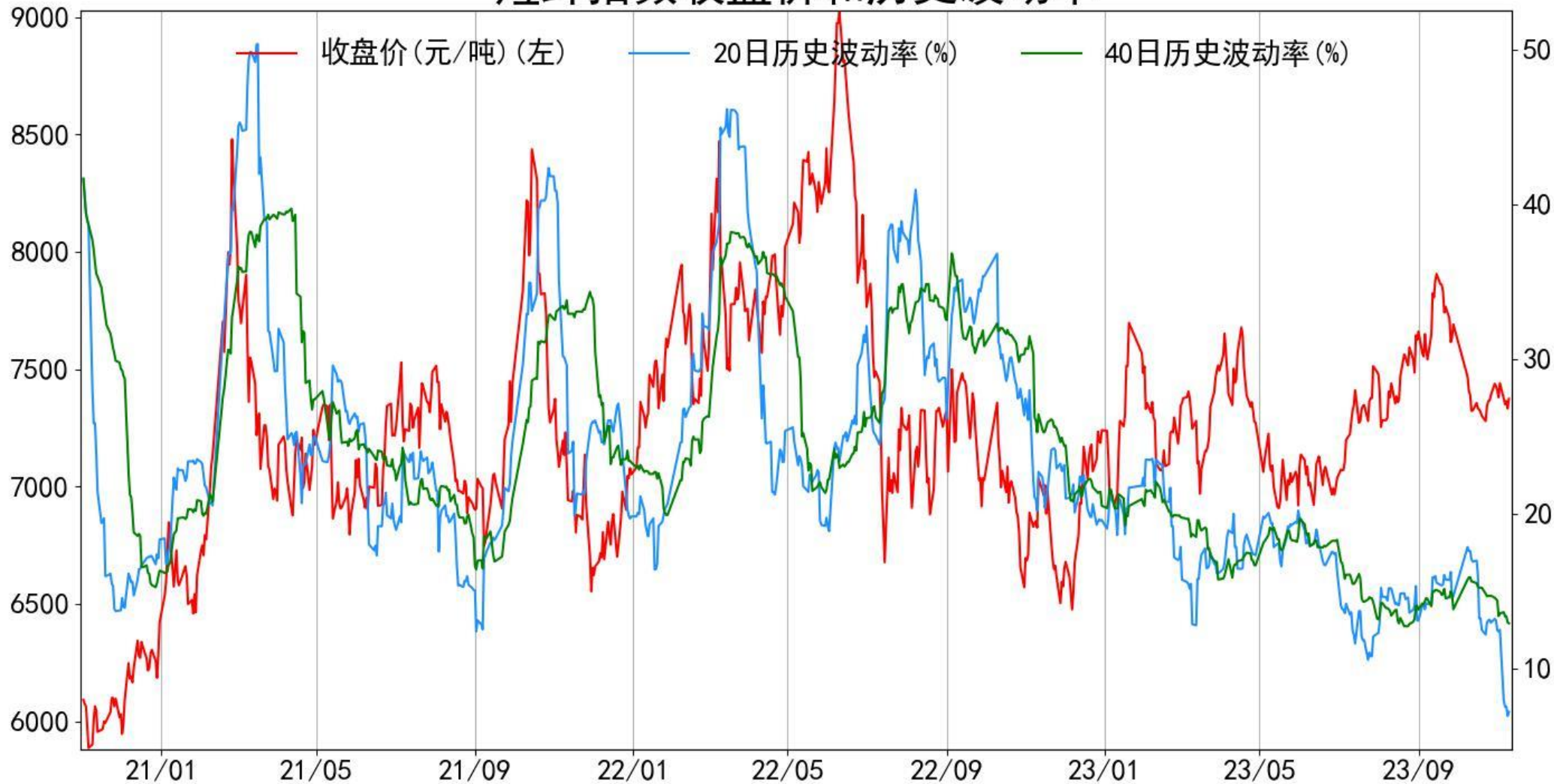
## 甲醇指数收盘价和历史波动率



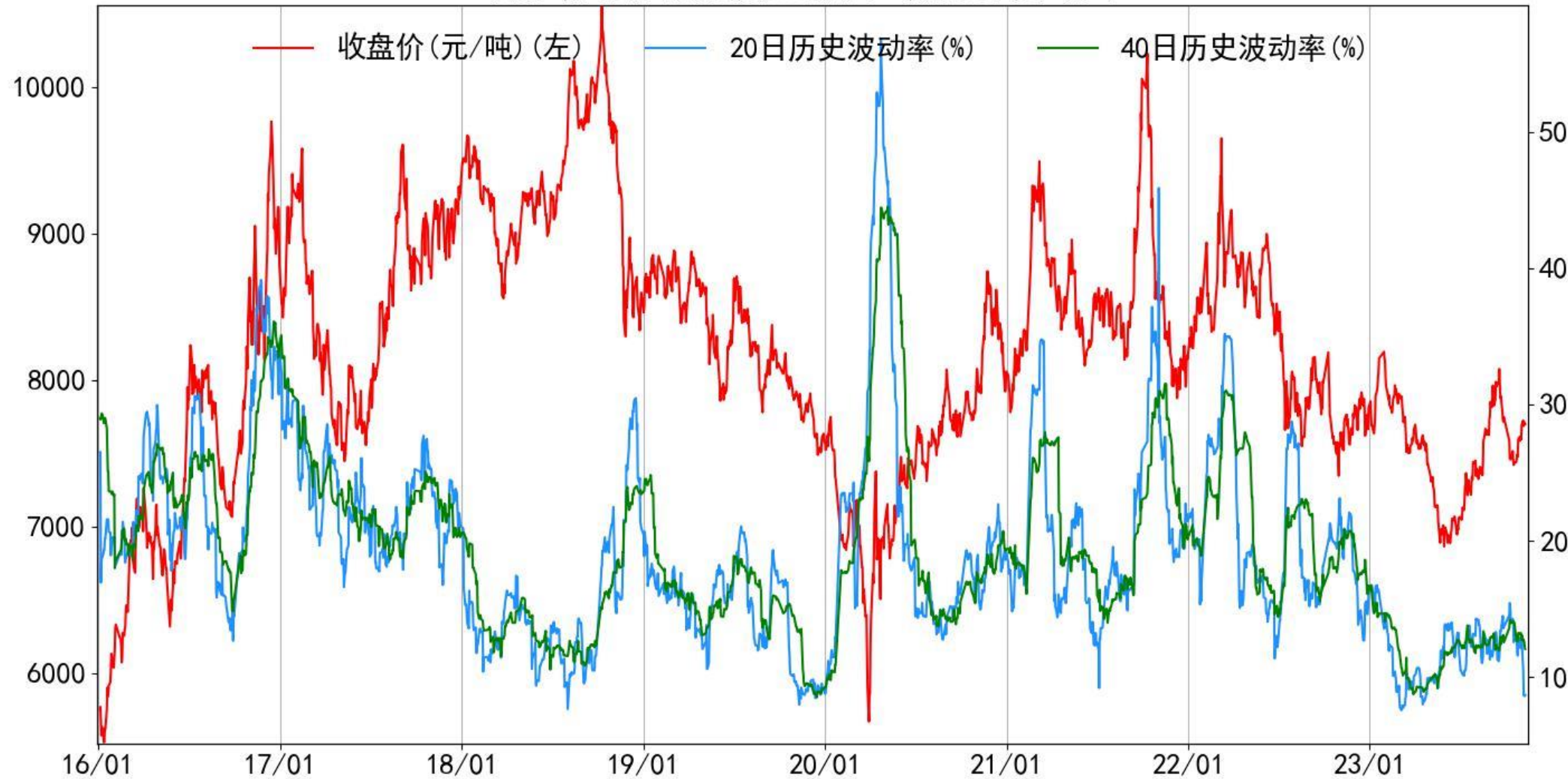
## 20号胶指数收盘价和历史波动率



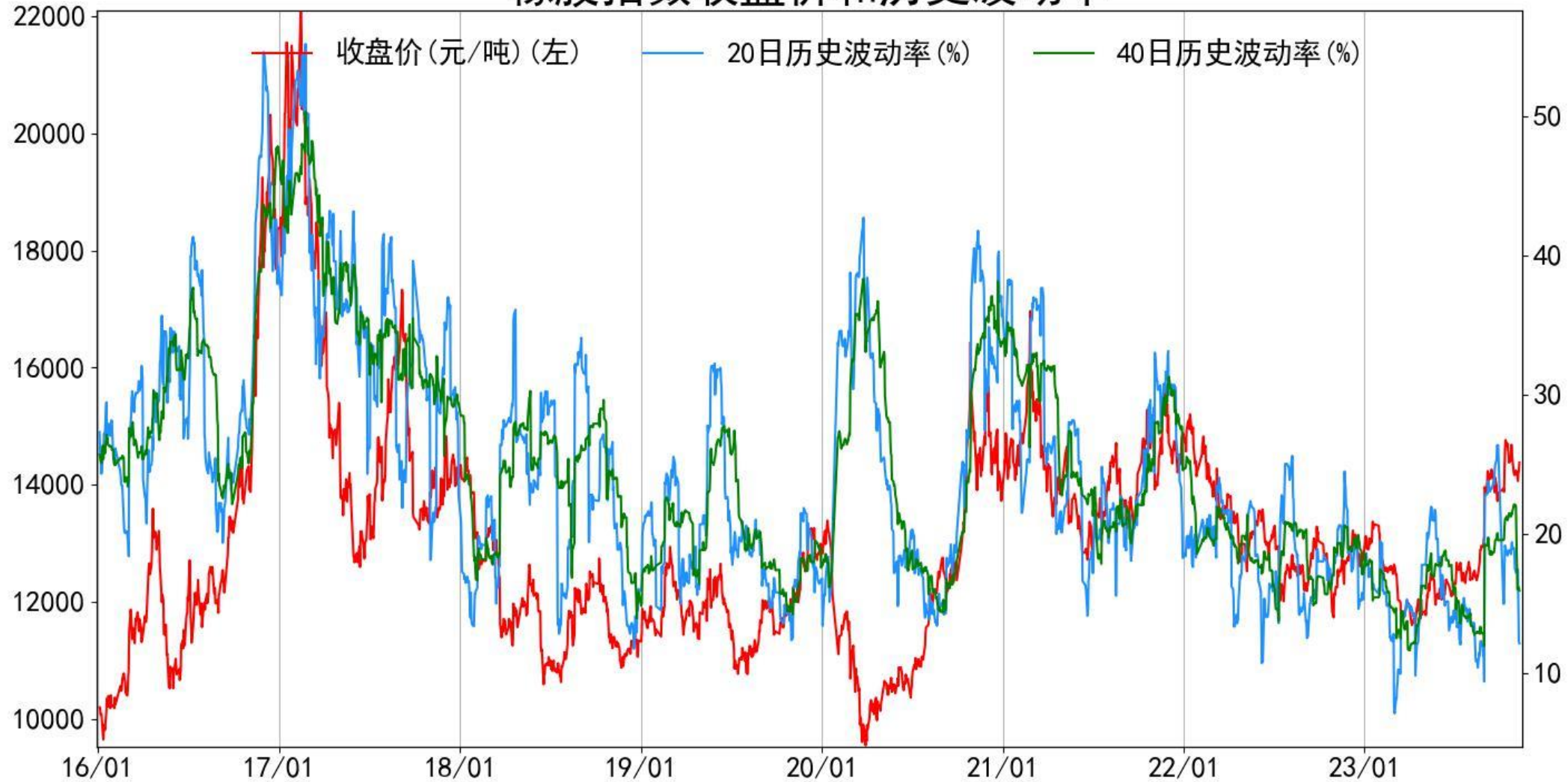
## 短纤指数收盘价和历史波动率



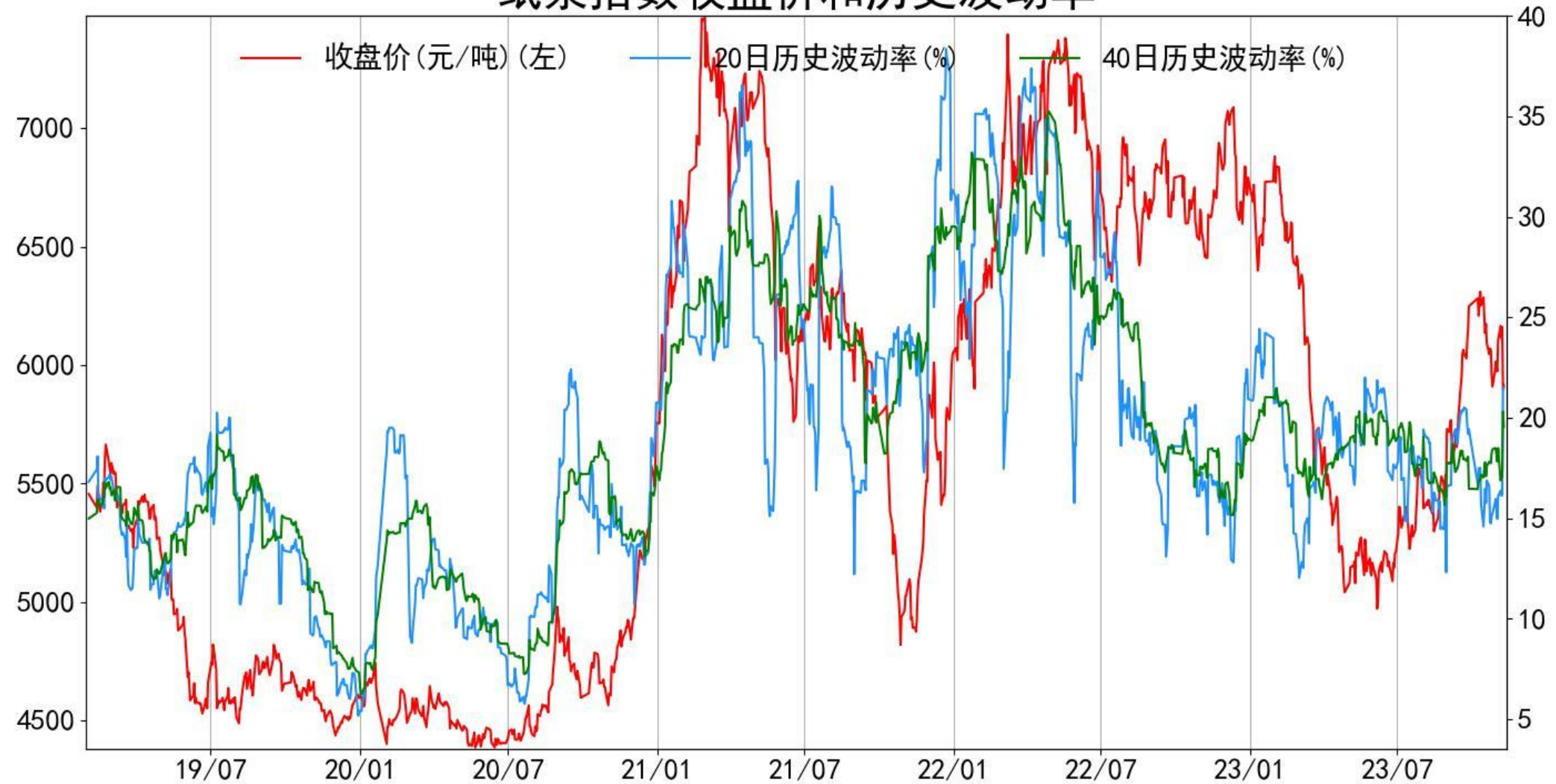
## 聚丙烯指数收盘价和历史波动率



## 橡胶指数收盘价和历史波动率



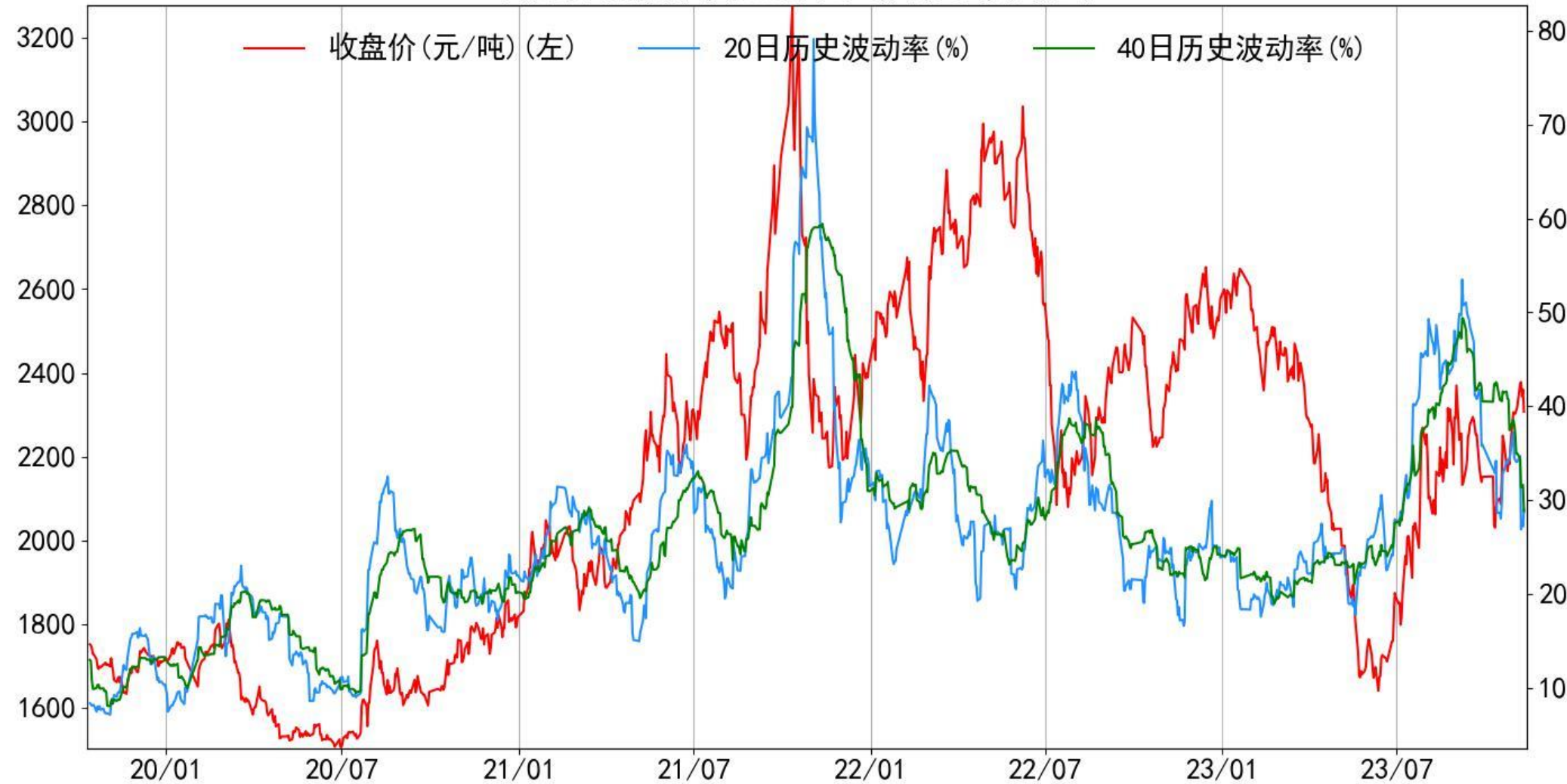
## 纸浆指数收盘价和历史波动率



## PTA指数收盘价和历史波动率



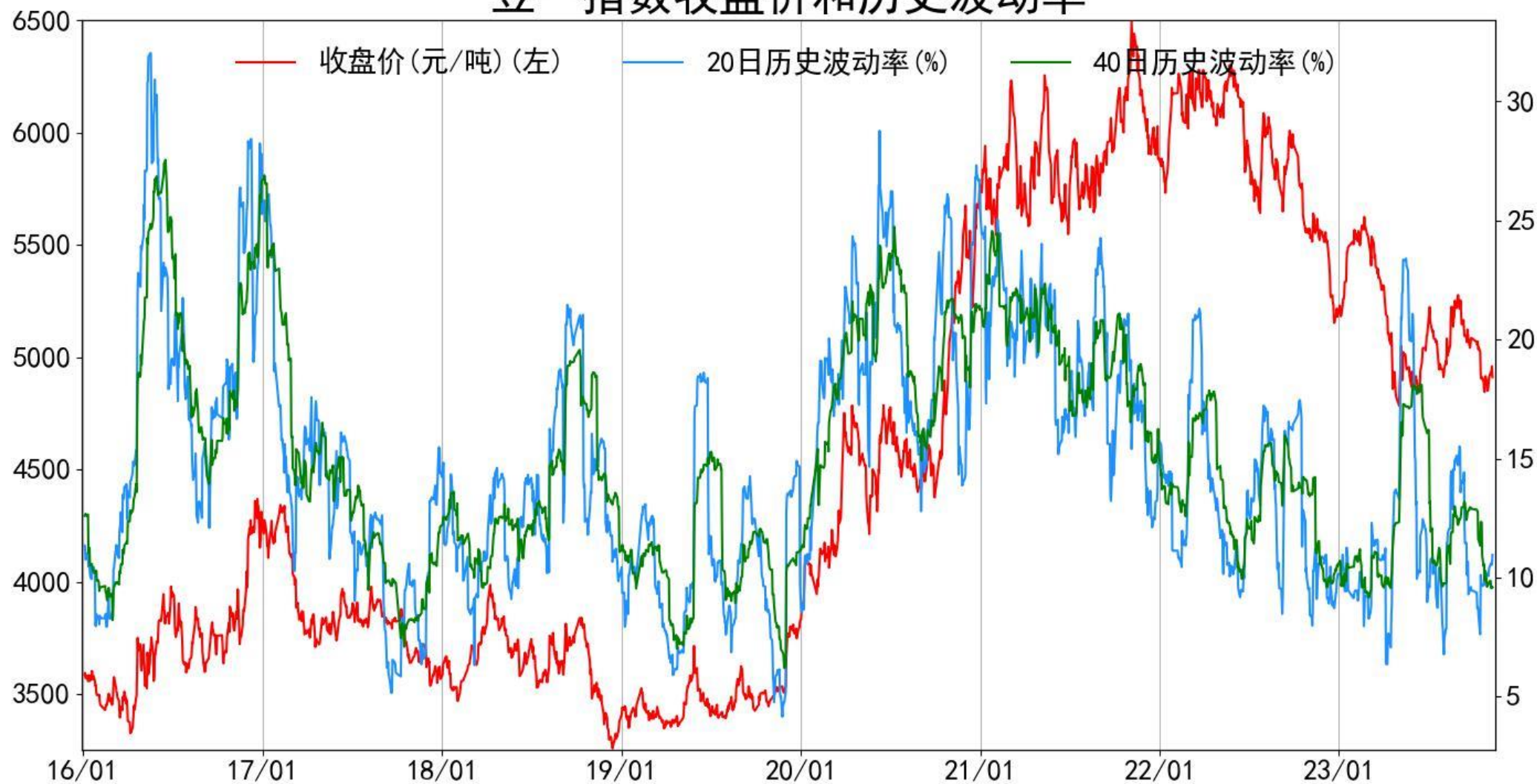
## 尿素指数收盘价和历史波动率



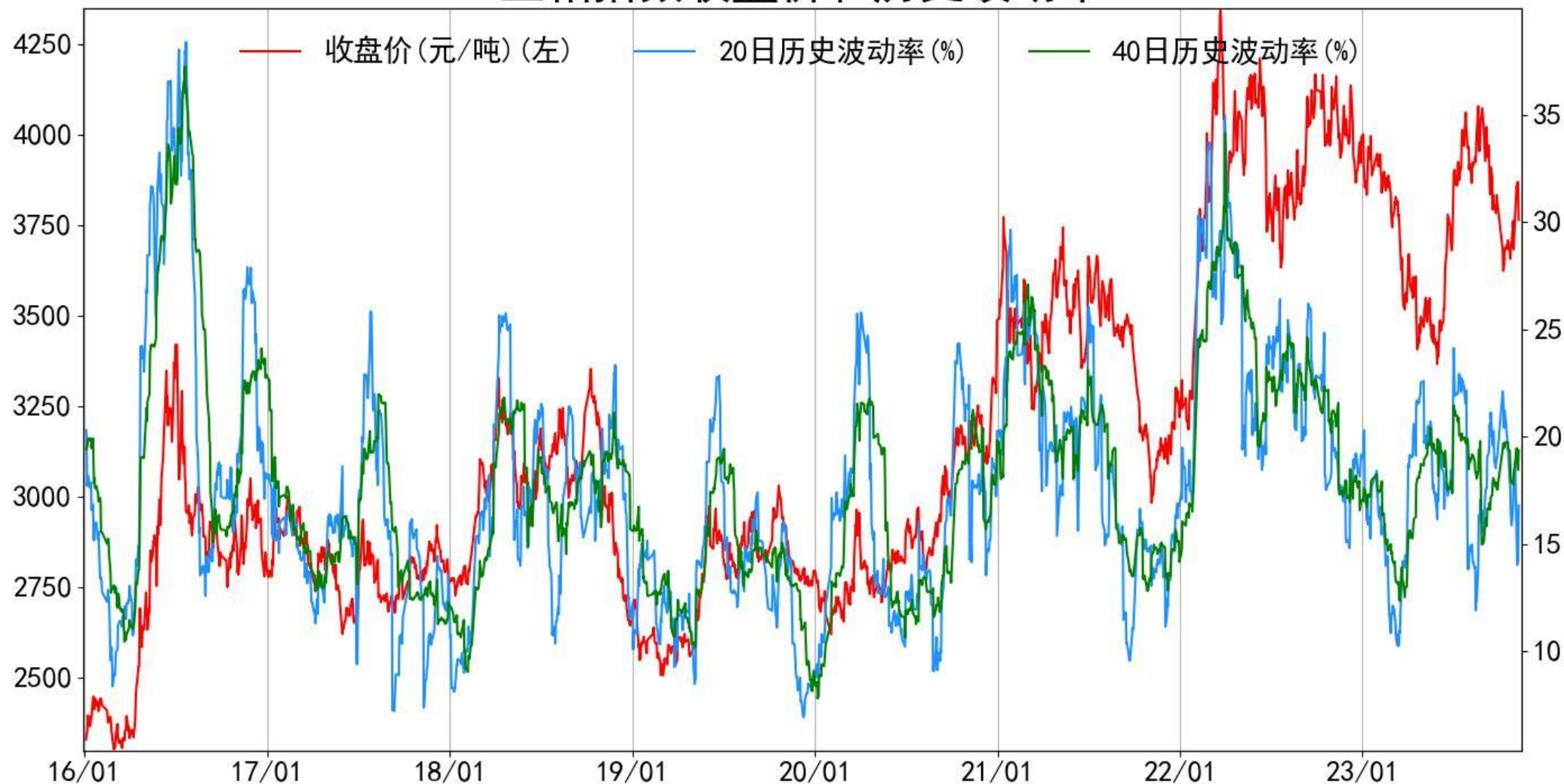
## 玉米指数收盘价和历史波动率



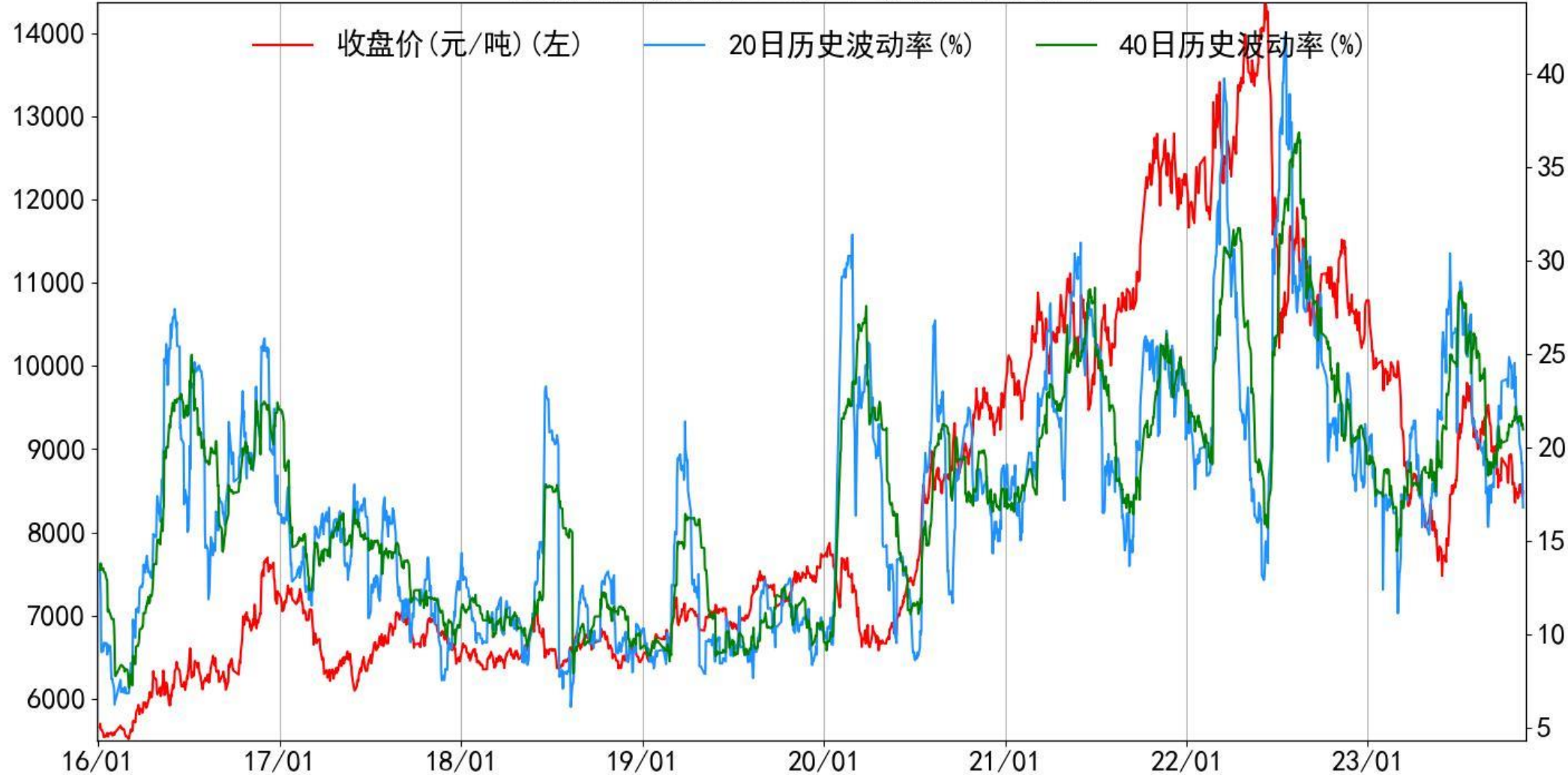
## 豆一指数收盘价和历史波动率



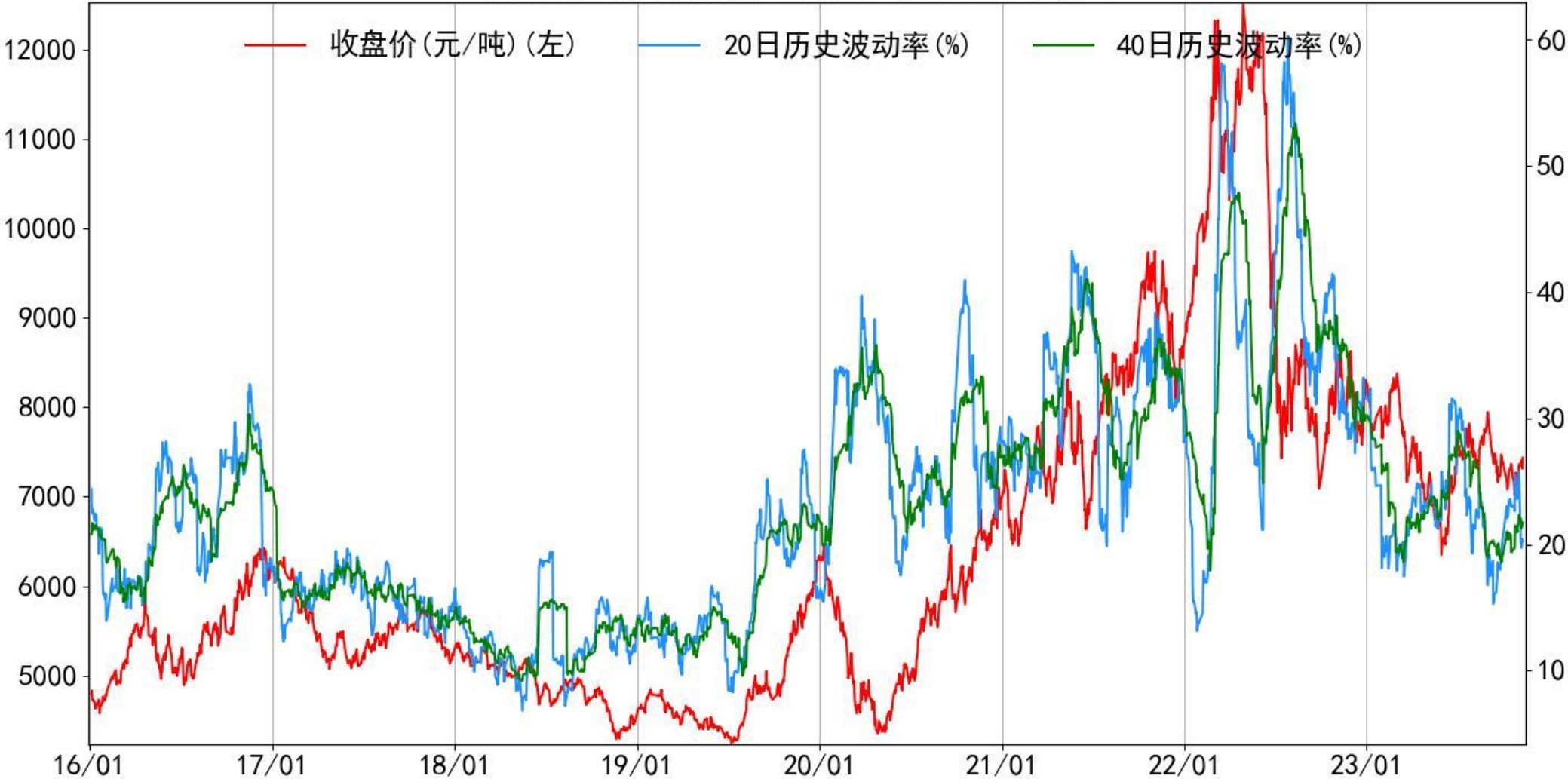
## 豆粕指数收盘价和历史波动率



## 菜油指数收盘价和历史波动率



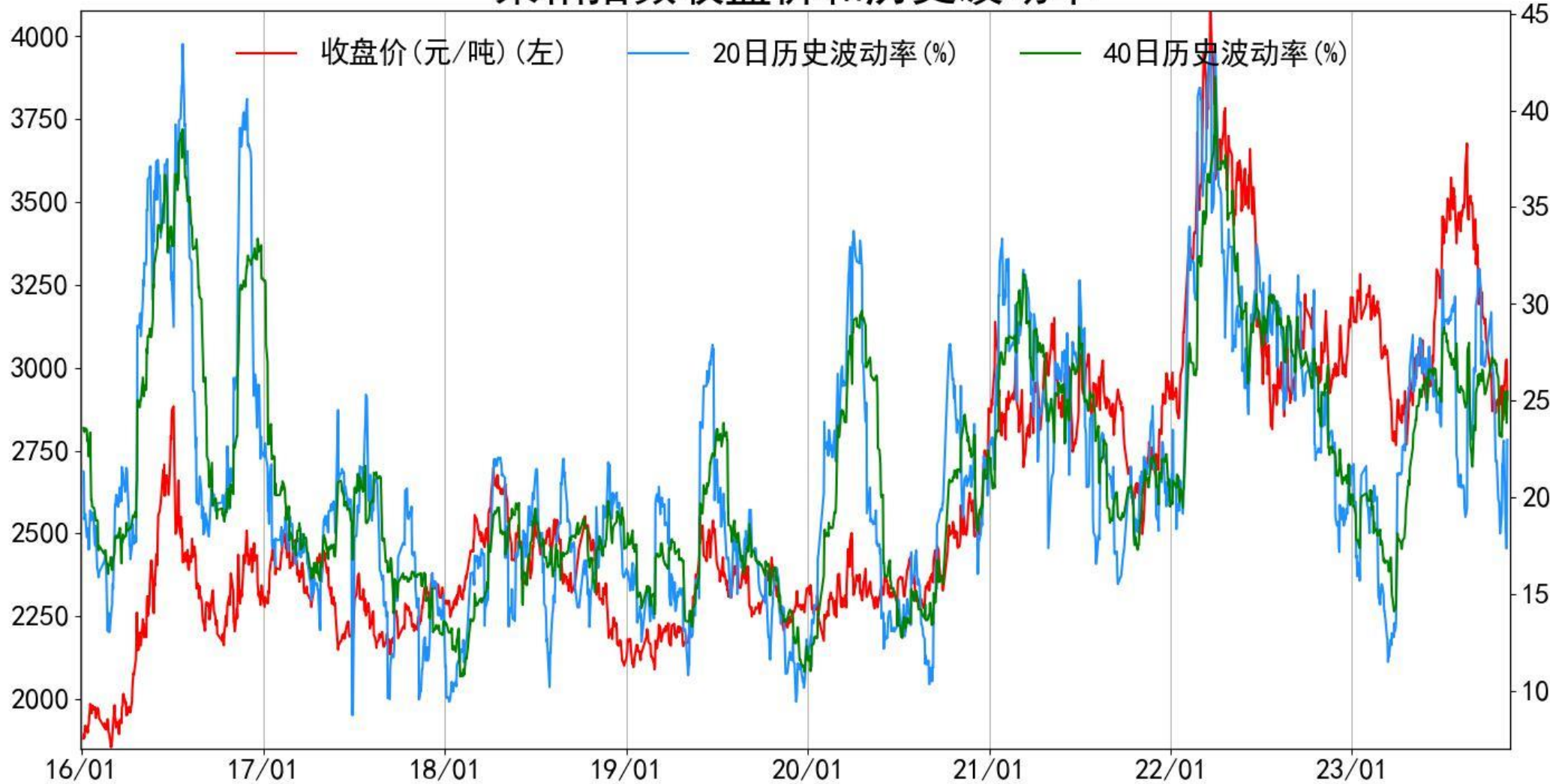
## 棕榈油指数收盘价和历史波动率



## 花生指数收盘价和历史波动率



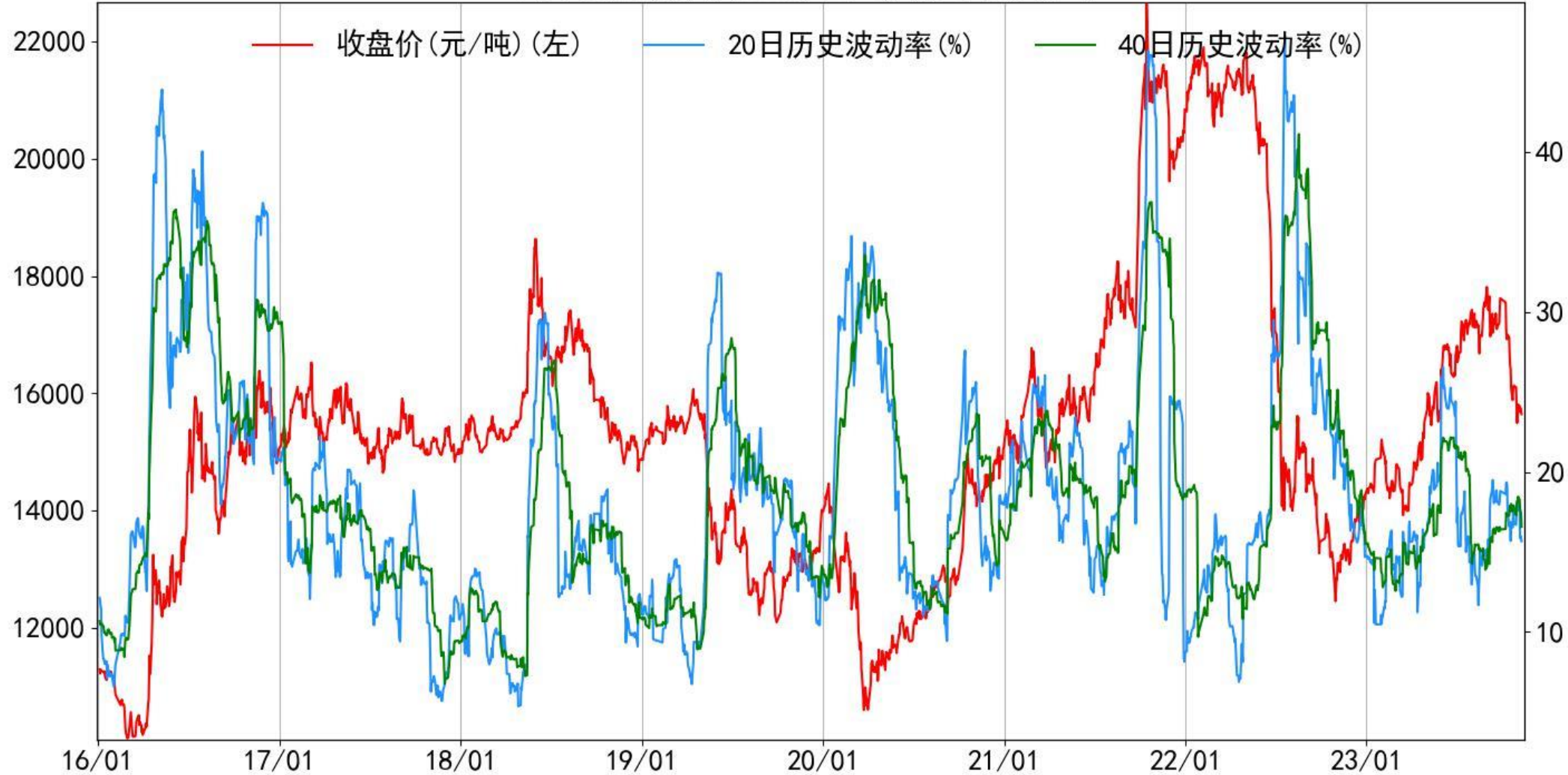
## 菜粕指数收盘价和历史波动率



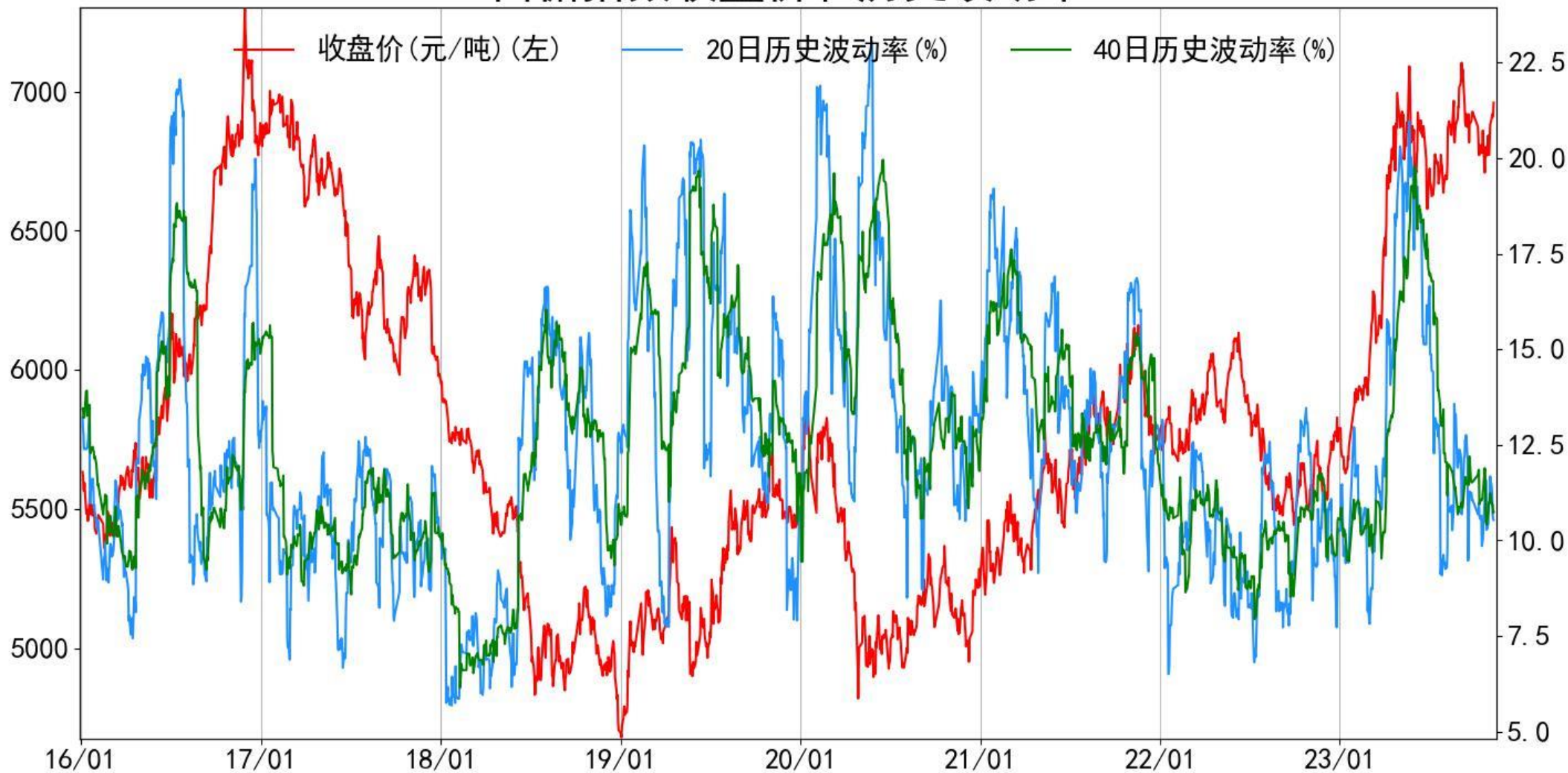
## 豆油指数收盘价和历史波动率



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



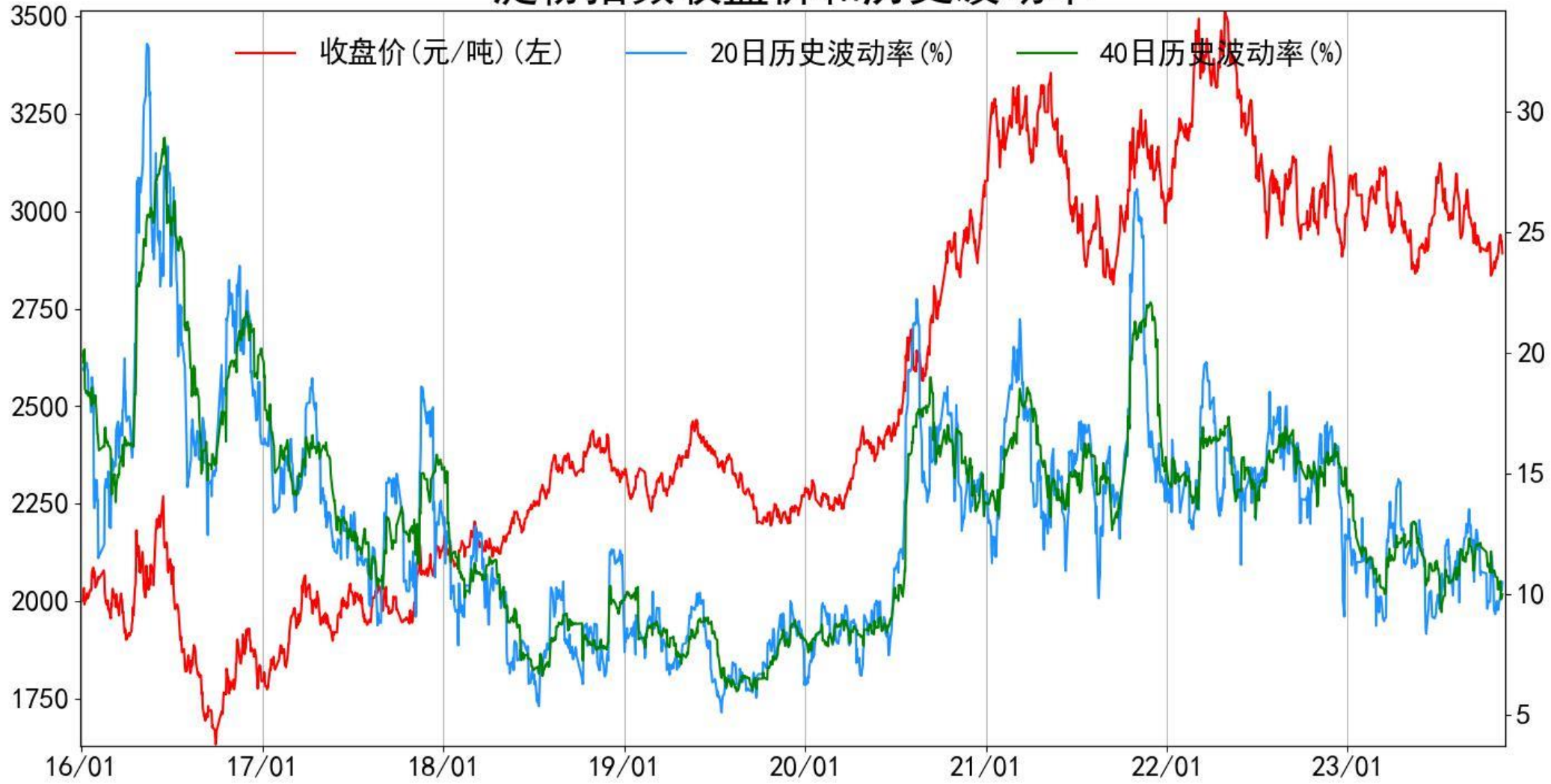
## 苹果指数收盘价和历史波动率



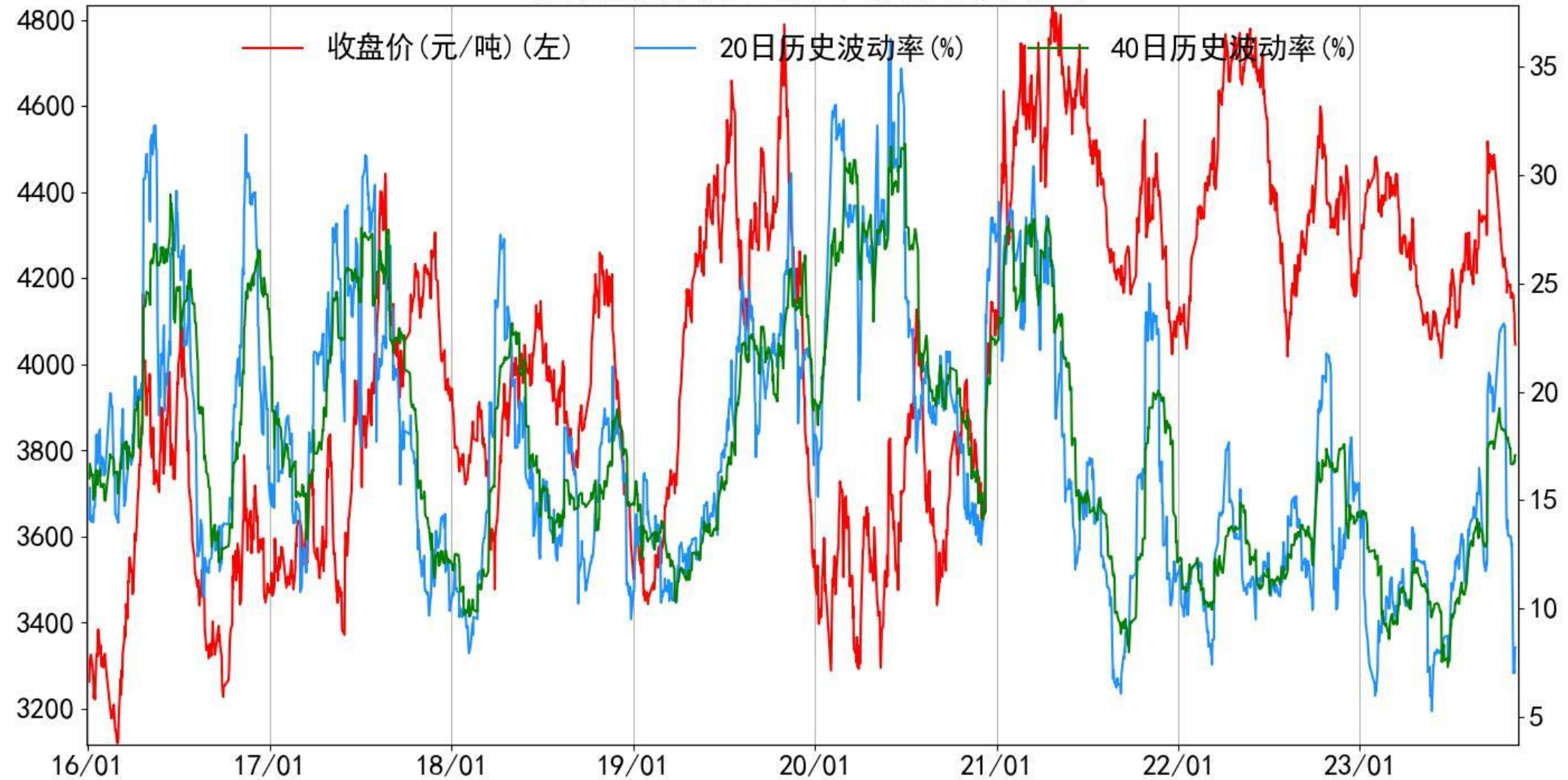
## 红枣指数收盘价和历史波动率



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



- 本报告由信达期货有限公司（以下简称“信达期货”）制作及发布。
- 本公司已取得期货交易咨询业务资格，交易咨询业务资格：证监许可【2011】1445号。
- 本研究报告是基于本公司认为可靠的且目前已公开的信息撰写，本公司力求但不保证该信息的准确性和完整性，因此任何人不得对本报告所载的信息、观点以及数据的准确性、可靠性、时效性及完整性产生任何依赖，且信达期货不对因使用此报告及所载材料而造成的损失承担任何责任。本报告不应取代个人的独立判断。本报告仅反映编写人的不同设想、见解及分析方法。同时，本公司不保证文中观点或陈述不会发生任何变更，在不同时期，本公司可发出与本报告所载资料、意见及推测不一致的报告。
- 此报告所载的全部内容仅作参考之用。此报告的内容不构成对任何人的投资建议，且信达期货不会因接收人收到此报告而视其为客户。
- 如果在任何国家或地区管辖范围内，本报告内容或其适用与任何政府机构、监管机构、自律组织或者清算机构的法律、规则或规定内容相抵触，或者信达期货未被授权在当地提供这种信息或服务，那么本报告的内容并不意图提供给这些地区的个人或组织，任何个人或组织也不得在当地查看或使用本报告。本报告所载的内容并非适用于所有国家或地区或者适用于所有人。
- 除非另有说明，信达期货拥有本报告的版权和/或其他相关知识产权。未经信达期货有限公司事先书面许可，任何单位或个人不得以任何方式复制、转载、引用、刊登、发表、发行、修改、翻译此报告的全部或部分材料、内容。除非另有说明，本报告中使用的所有商标、服务标记及标记均为信达期货所有或经合法授权被许可使用的商标、服务标记及标记。未经信达期货或商标所有权人的书面许可，任何单位或个人不得使用该商标、服务标记及标记。

<http://www.cindaqh.com/>

信达期货有限公司

电 话：4006-728-728

地 址：浙江省杭州市萧山区宁围街道利一路188号天人大厦19-20层

**专业**经营、**效率**至上、**创造**价值

Professional management, efficiency  
first, value creation

