

商品期货波动率跟踪

2021年8月2日

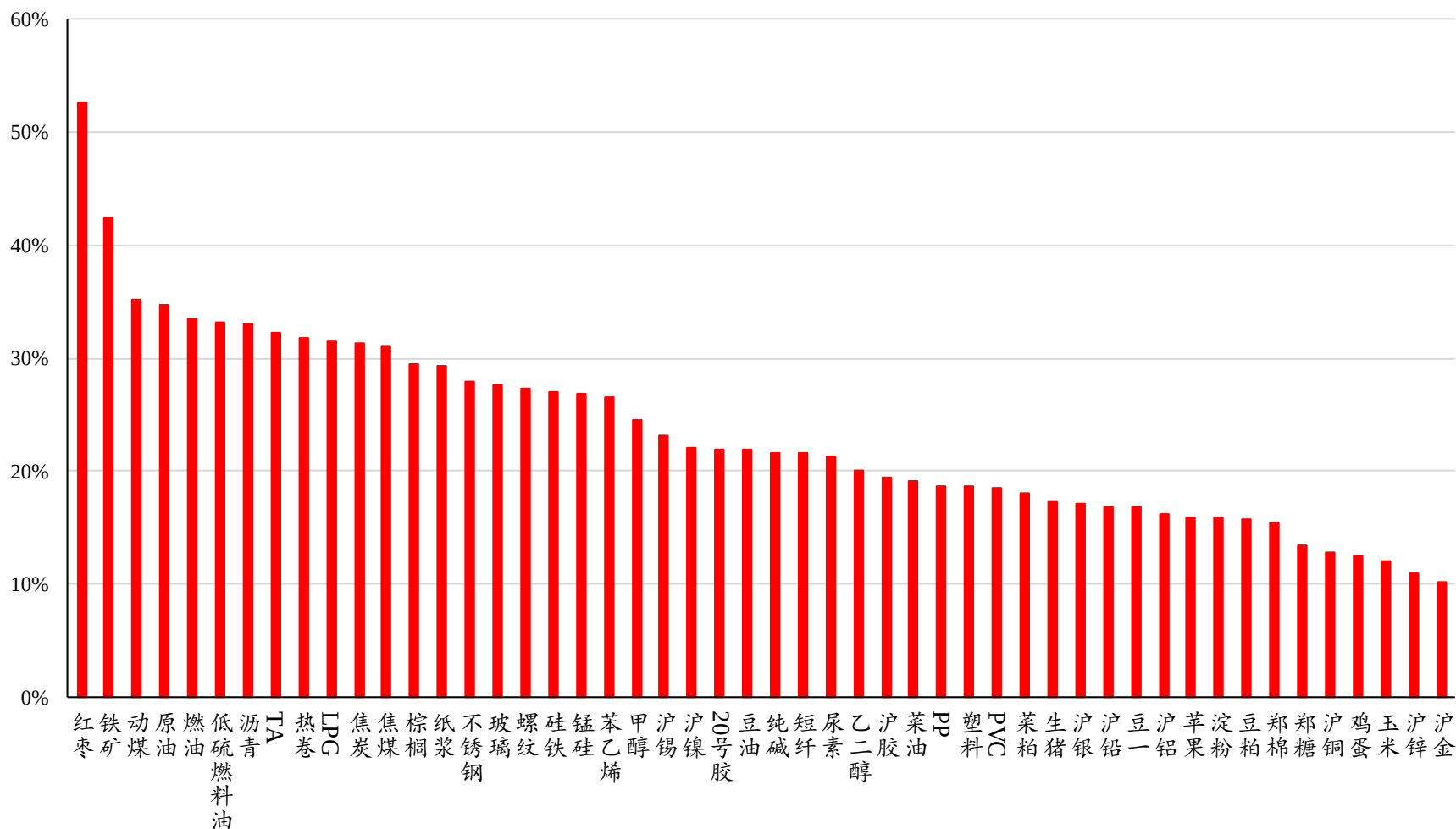
20日历史波动率绝对值前五：红枣、铁矿、动煤、原油、燃油

20日历史波动率绝对值后五：沪金、沪锌、玉米、鸡蛋、沪铜

20日历史波动率百分位高于90%：红枣、动煤、TA、纸浆

20日历史波动率百分位低于10%：沪锌、生猪

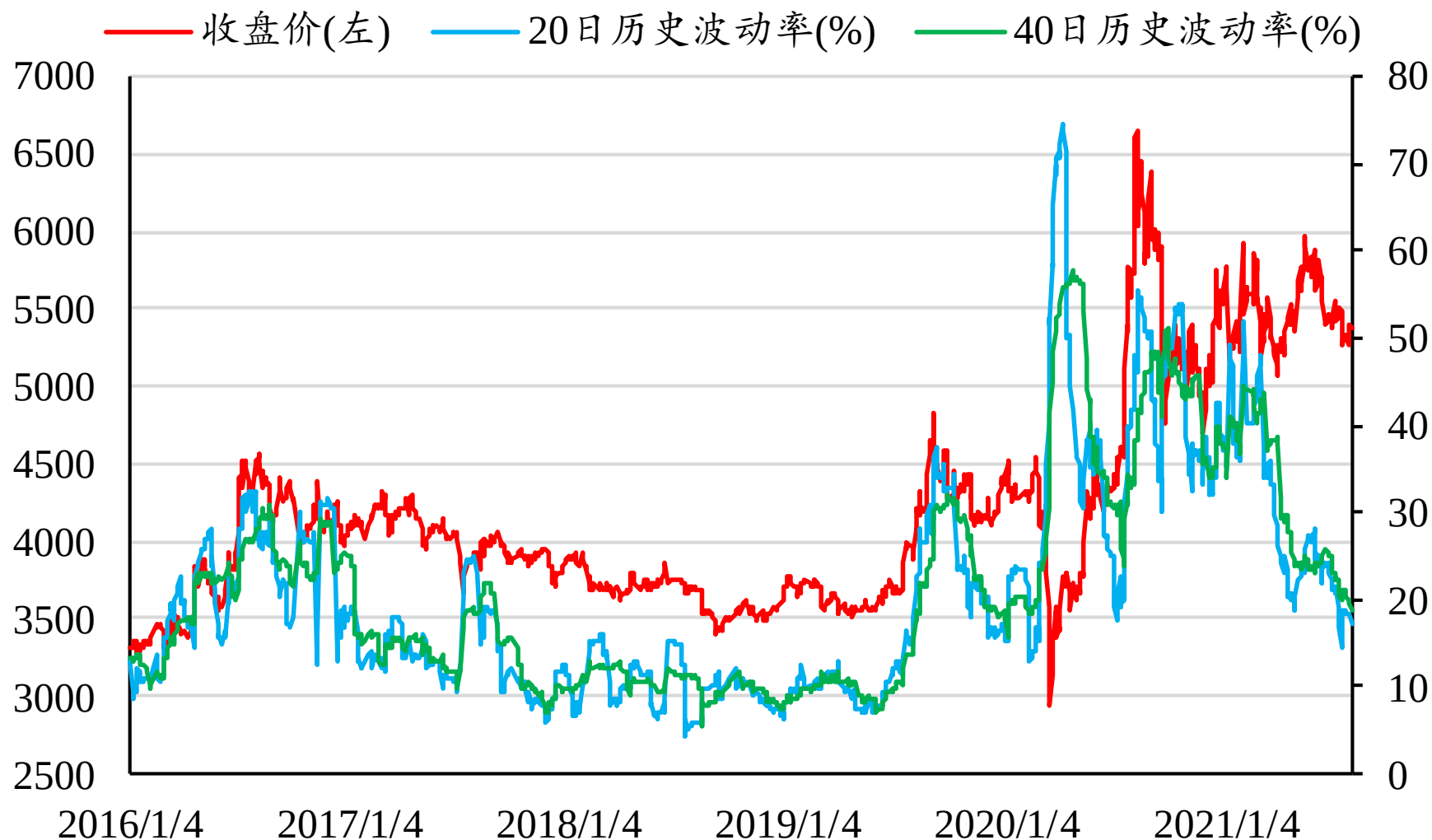
商品期货指数20日历史波动率



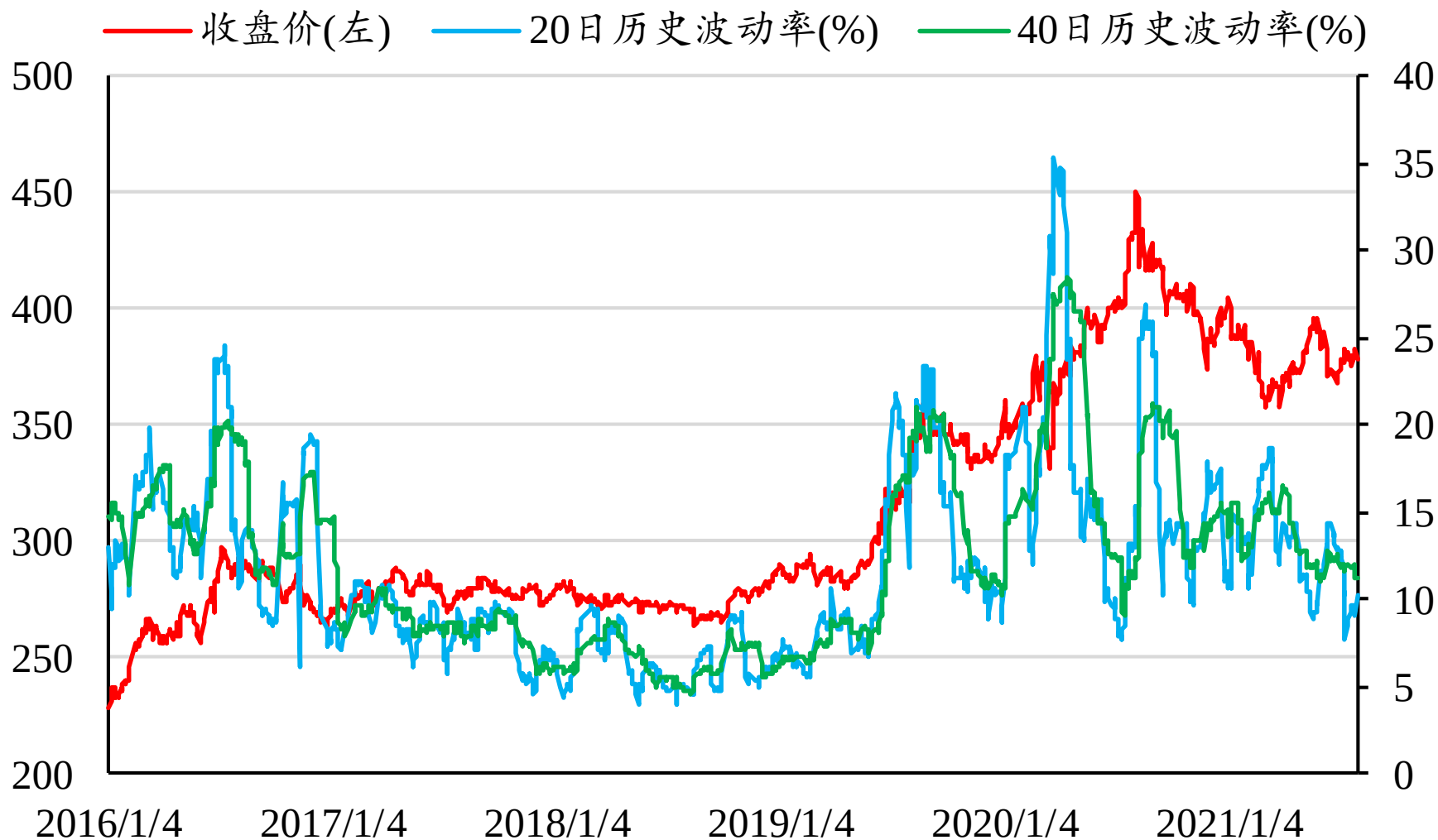
百分比一览

沪银指数	沪金指数	沪铝指数	沪铜指数	沪镍指数	沪铅指数
49.60%	47.61%	68.06%	34.51%	46.06%	50.18%
沪锡指数	沪锌指数	热卷指数	铁矿指数	焦炭指数	焦煤指数
79.84%	4.05%	78.73%	78.07%	55.41%	61.88%
螺纹指数	硅铁指数	锰硅指数	不锈钢指数	玻璃指数	PVC指数
67.99%	76.38%	71.74%	89.53%	87.49%	55.33%
燃油指数	低硫燃料油	LPG指数	原油指数	动煤指数	沥青指数
73.29%	65.81%	77.13%	68.05%	91.91%	76.53%
苯乙烯指数	乙二醇指数	塑料指数	甲醇指数	20号胶指数	短纤指数
46.21%	46.81%	59.23%	58.65%	28.75%	31.00%
PP指数	沪胶指数	纯碱指数	纸浆指数	TA指数	尿素指数
50.33%	24.14%	36.82%	91.87%	91.91%	58.63%
玉米指数	豆一指数	豆粕指数	菜油指数	棕榈指数	菜粕指数
65.93%	62.62%	47.83%	76.16%	87.42%	45.55%
豆油指数	郑棉指数	郑糖指数	苹果指数	红枣指数	淀粉指数
82.86%	44.44%	61.44%	13.83%	96.00%	74.54%
鸡蛋指数	生猪指数				
11.70%	7.30%				

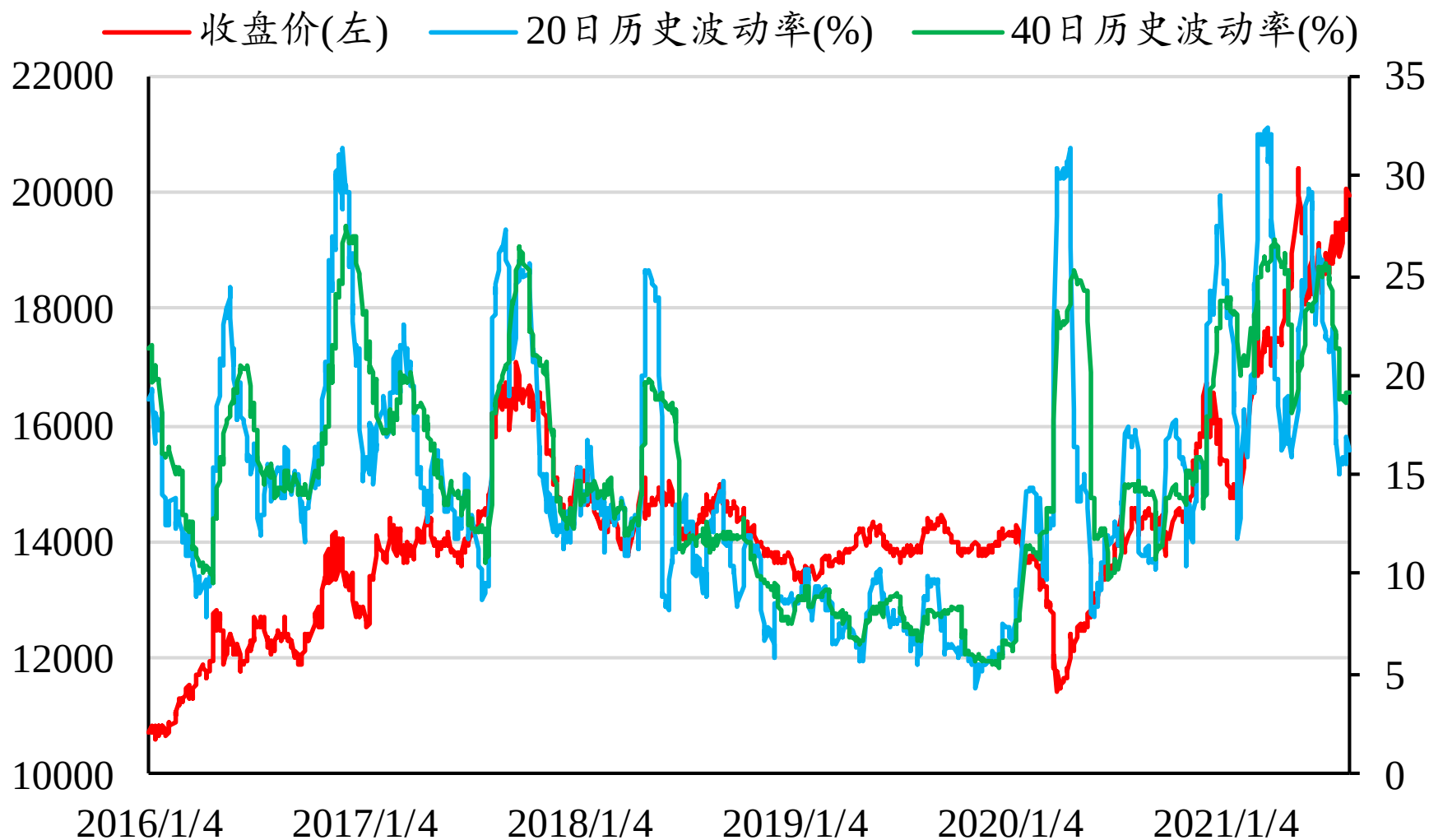
沪银指数收盘价和历史波动率走势



沪金指数收盘价和历史波动率

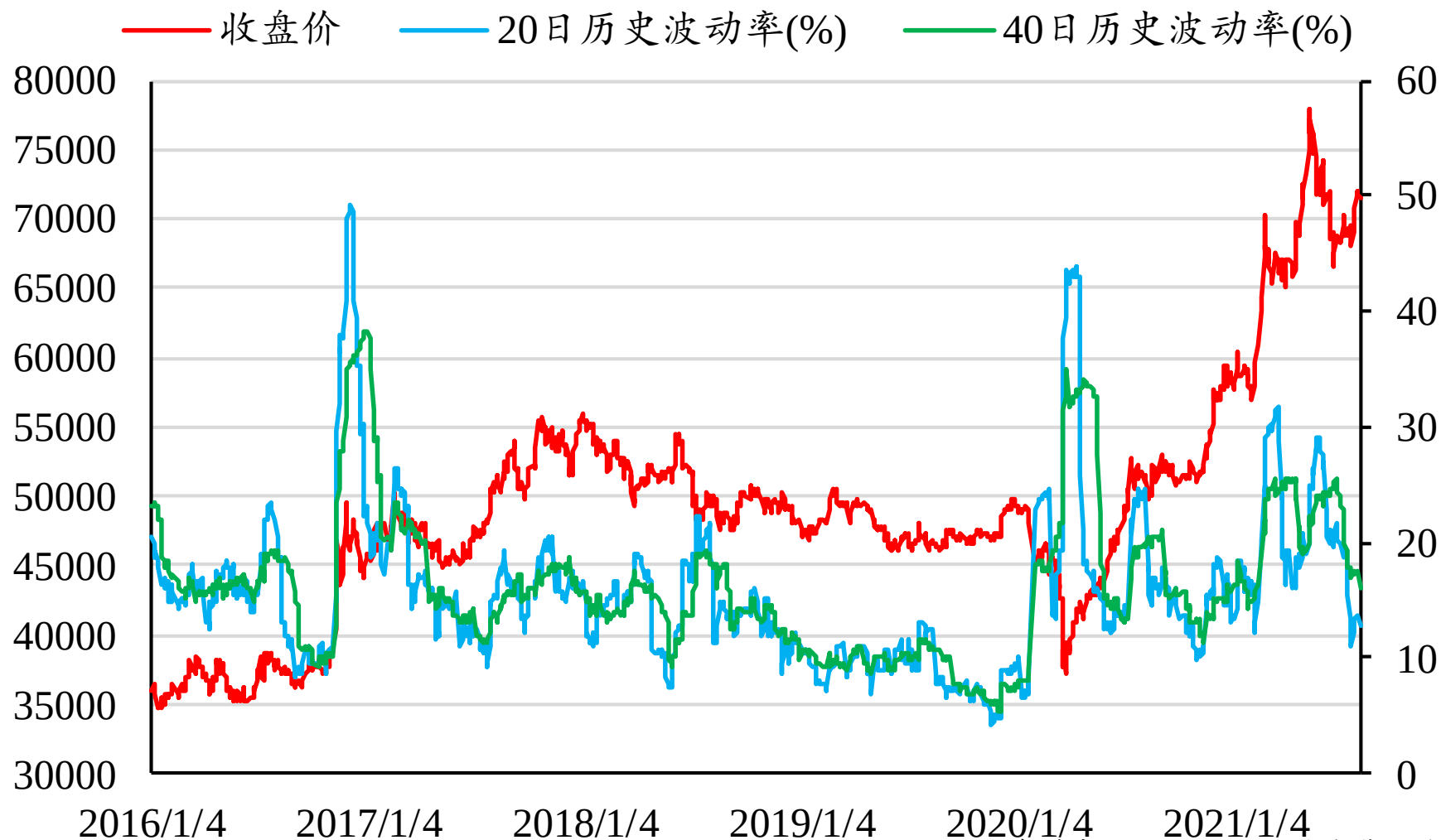


沪铝指数收盘价和历史波动率

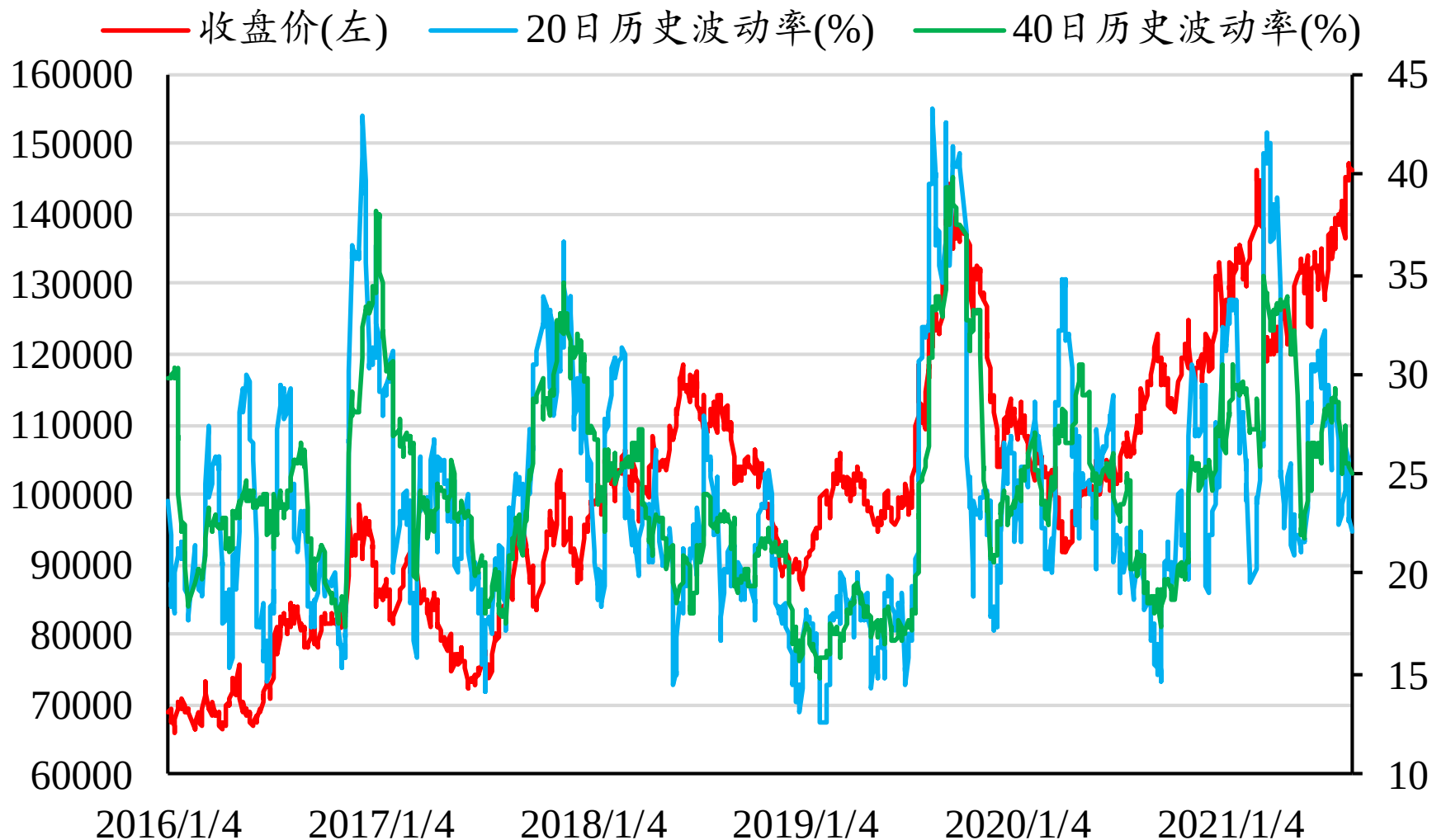


资料来源：Wind、信达期货研发中心

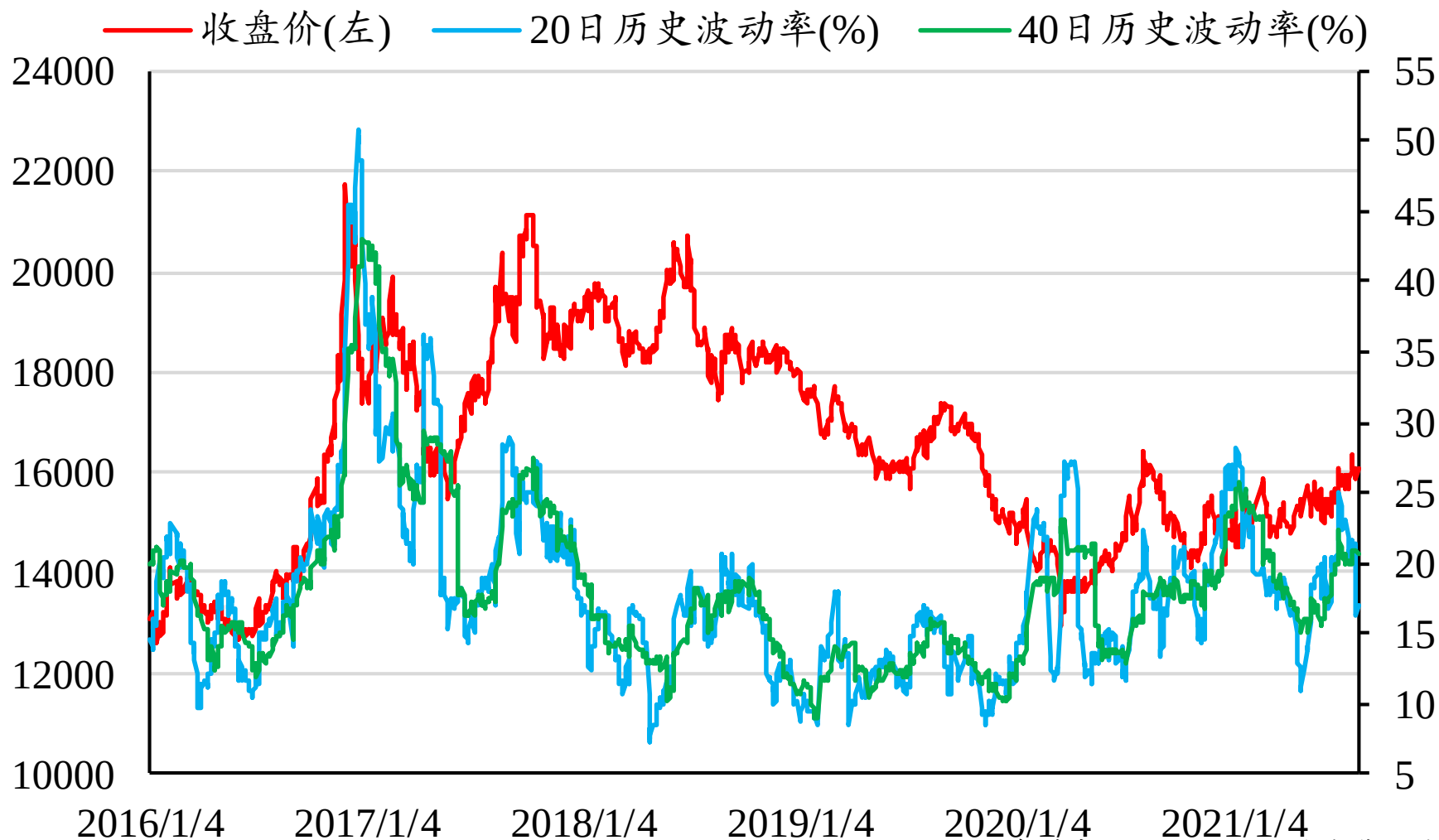
沪铜指数收盘价和历史波动率



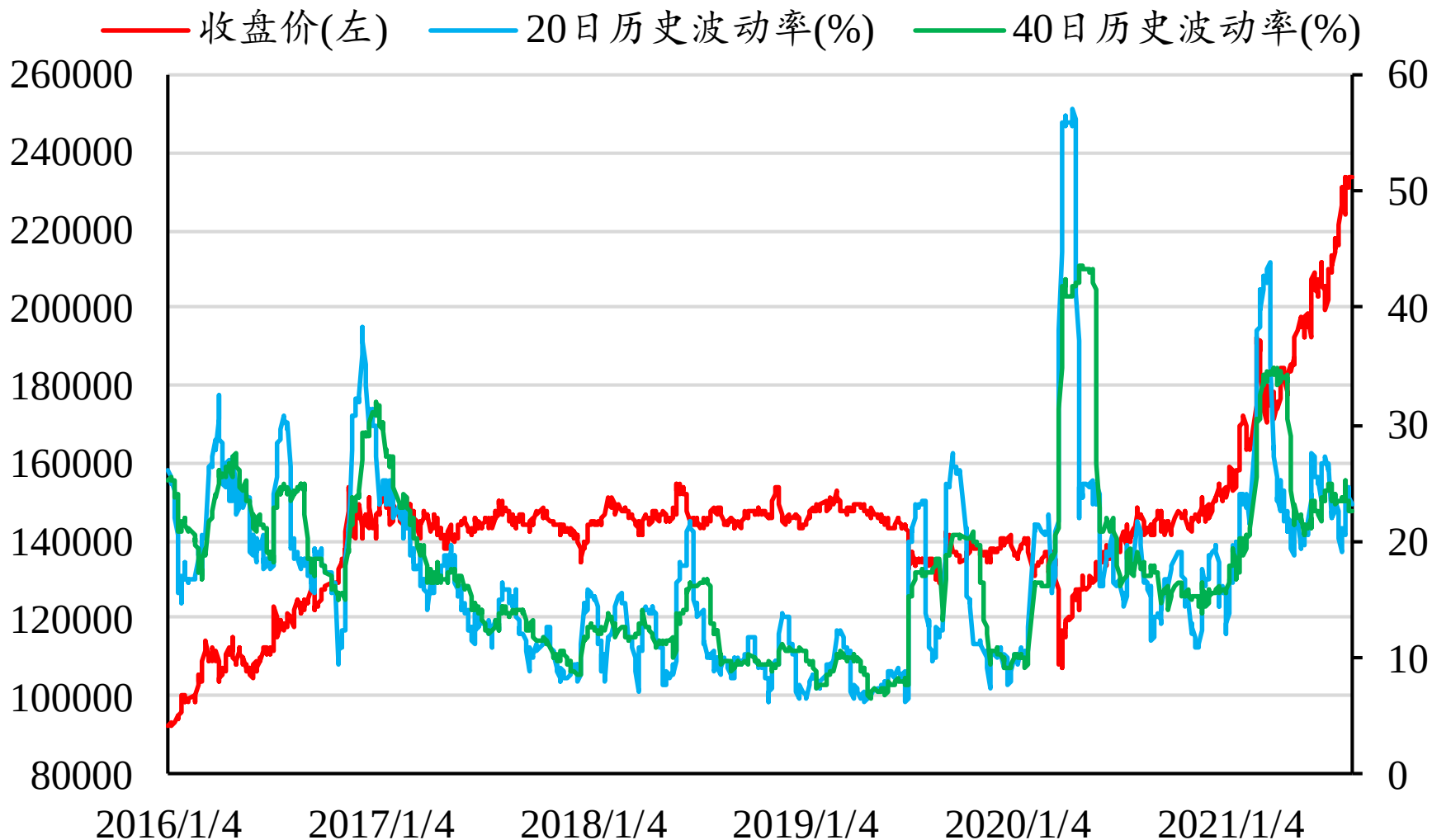
沪镍指数收盘价和历史波动率



沪铅指数收盘价和历史波动率

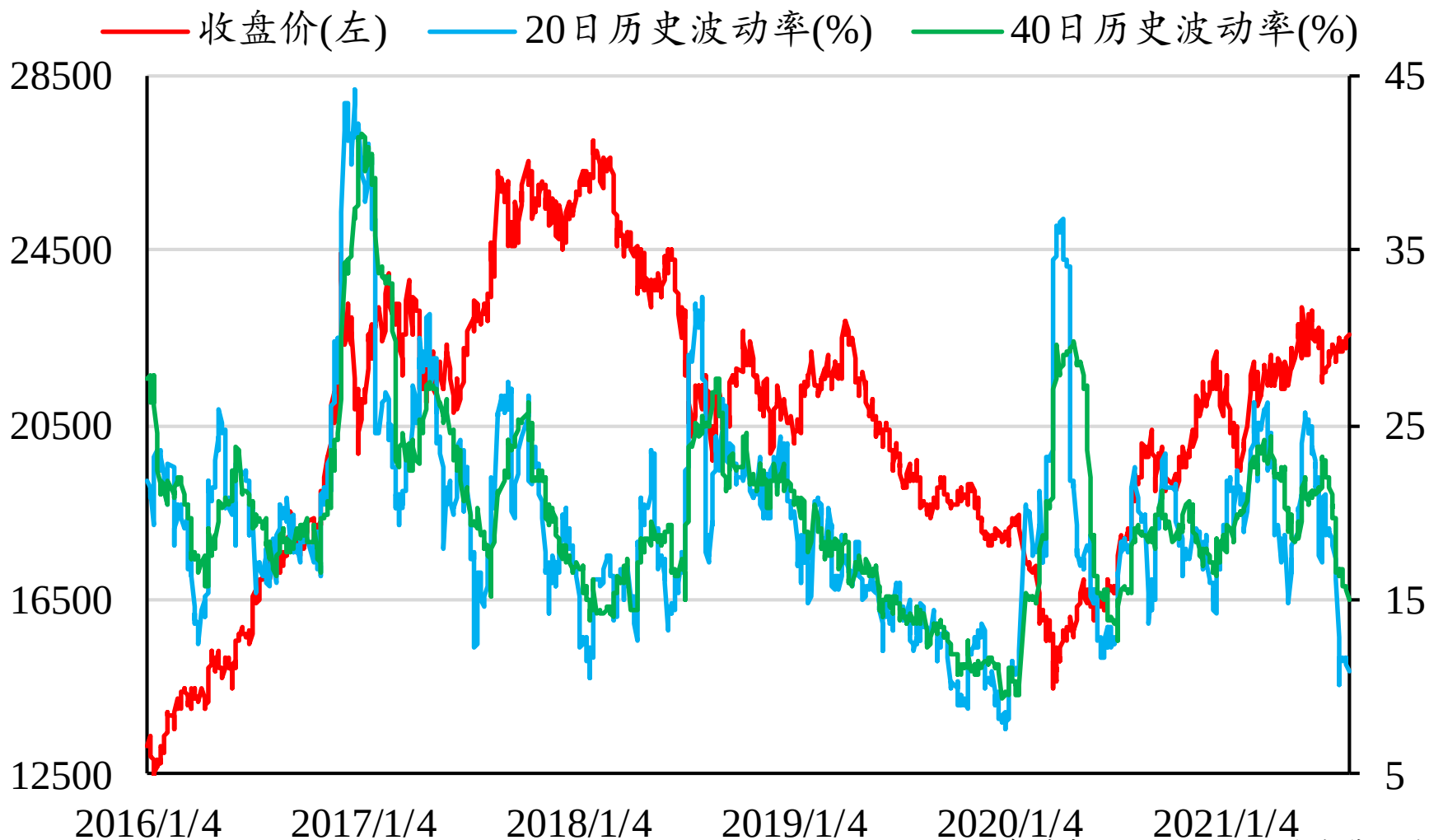


沪锡指数收盘价和历史波动率

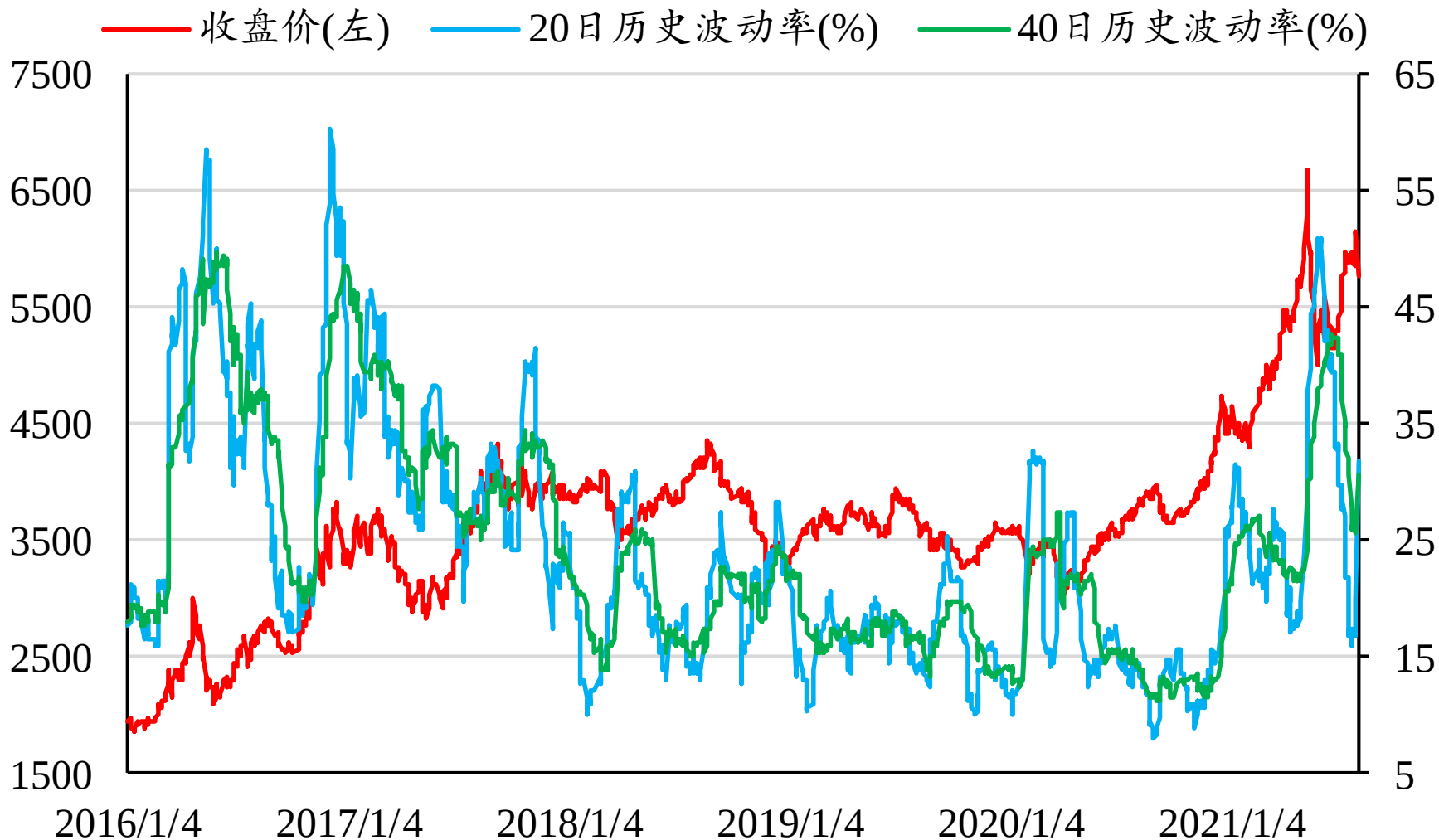


资料来源: Wind、信达期货研发中心

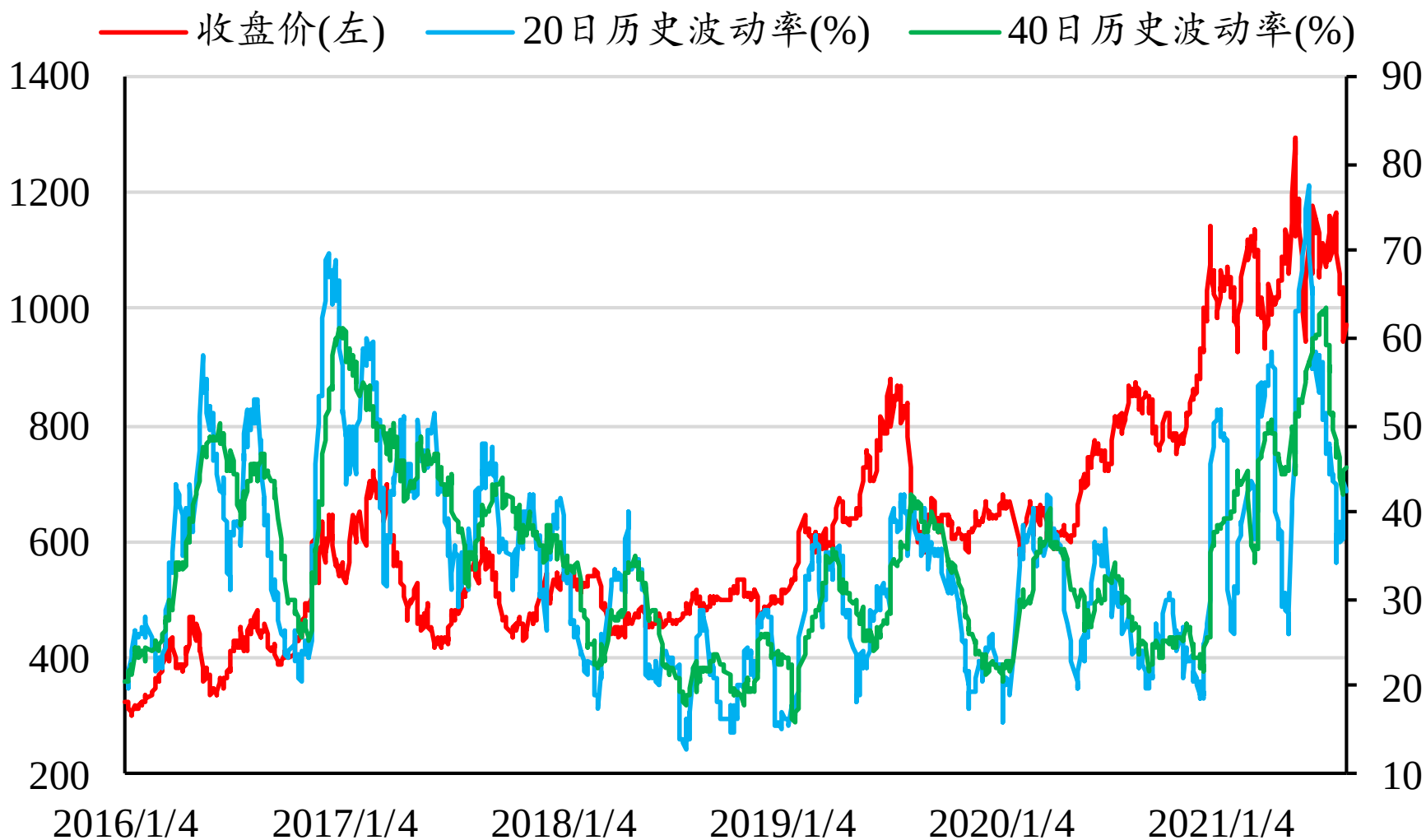
沪锌指数收盘价和历史波动率



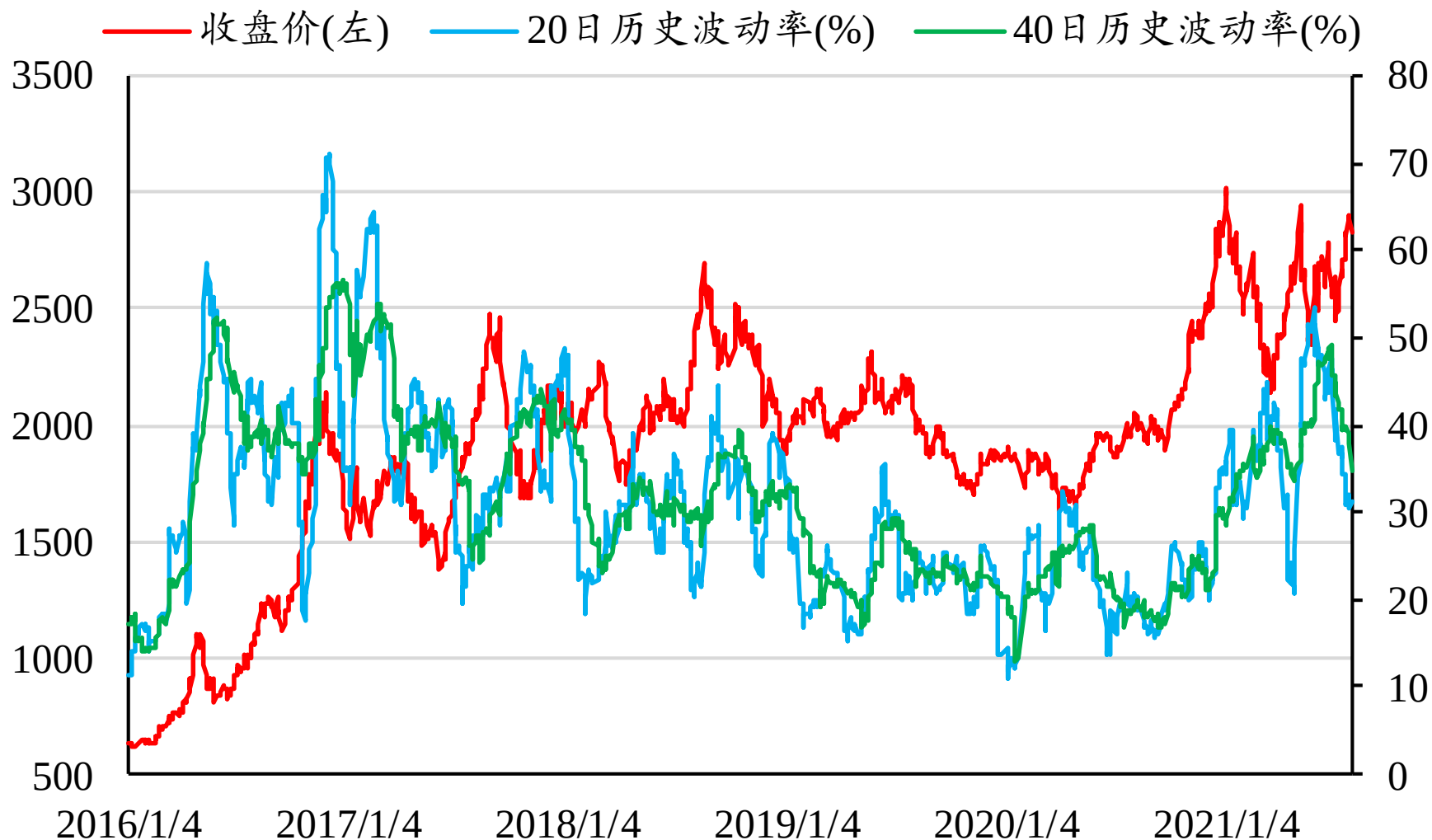
热卷指数收盘价和历史波动率



铁矿指数收盘价和历史波动率

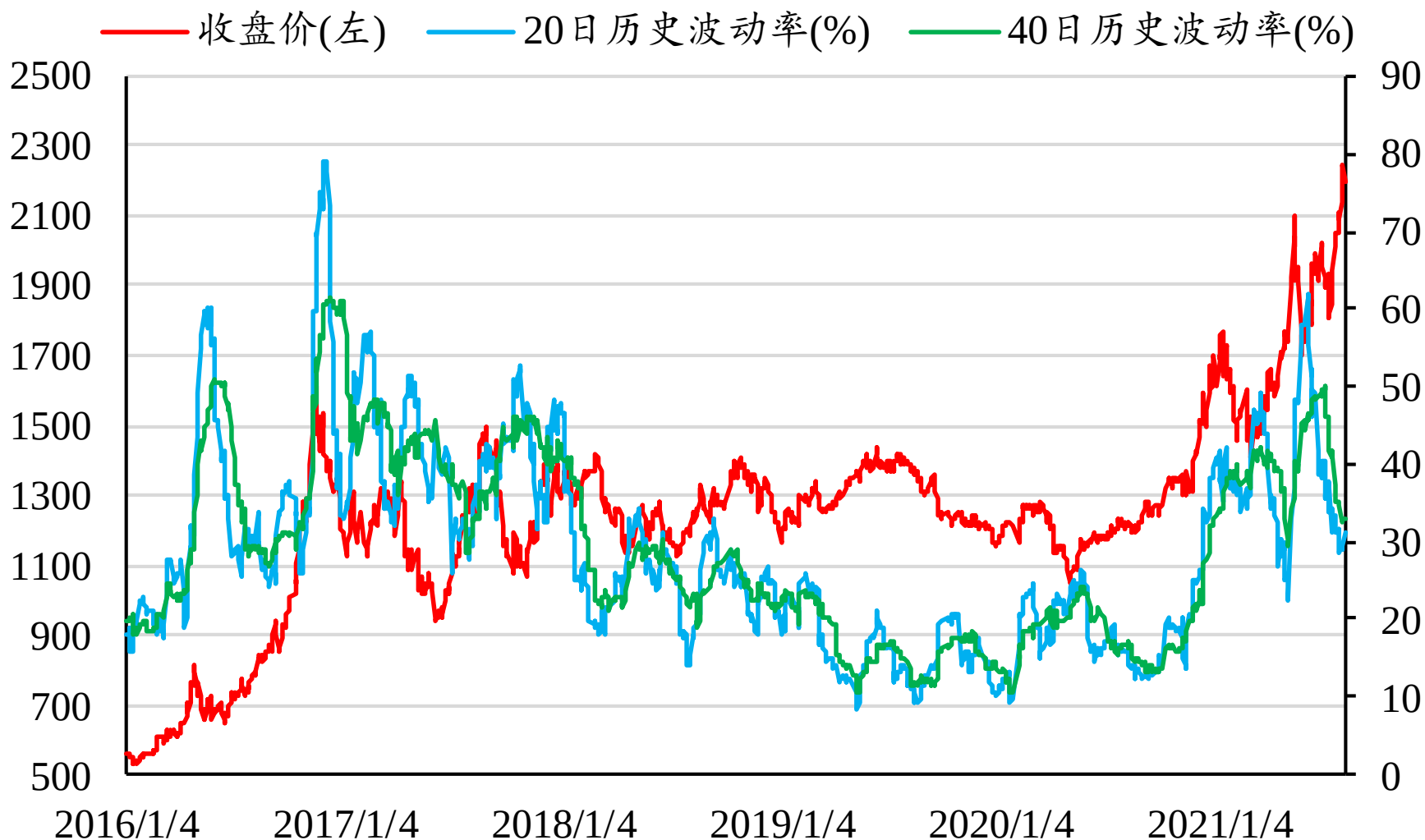


焦炭指数收盘价和历史波动率

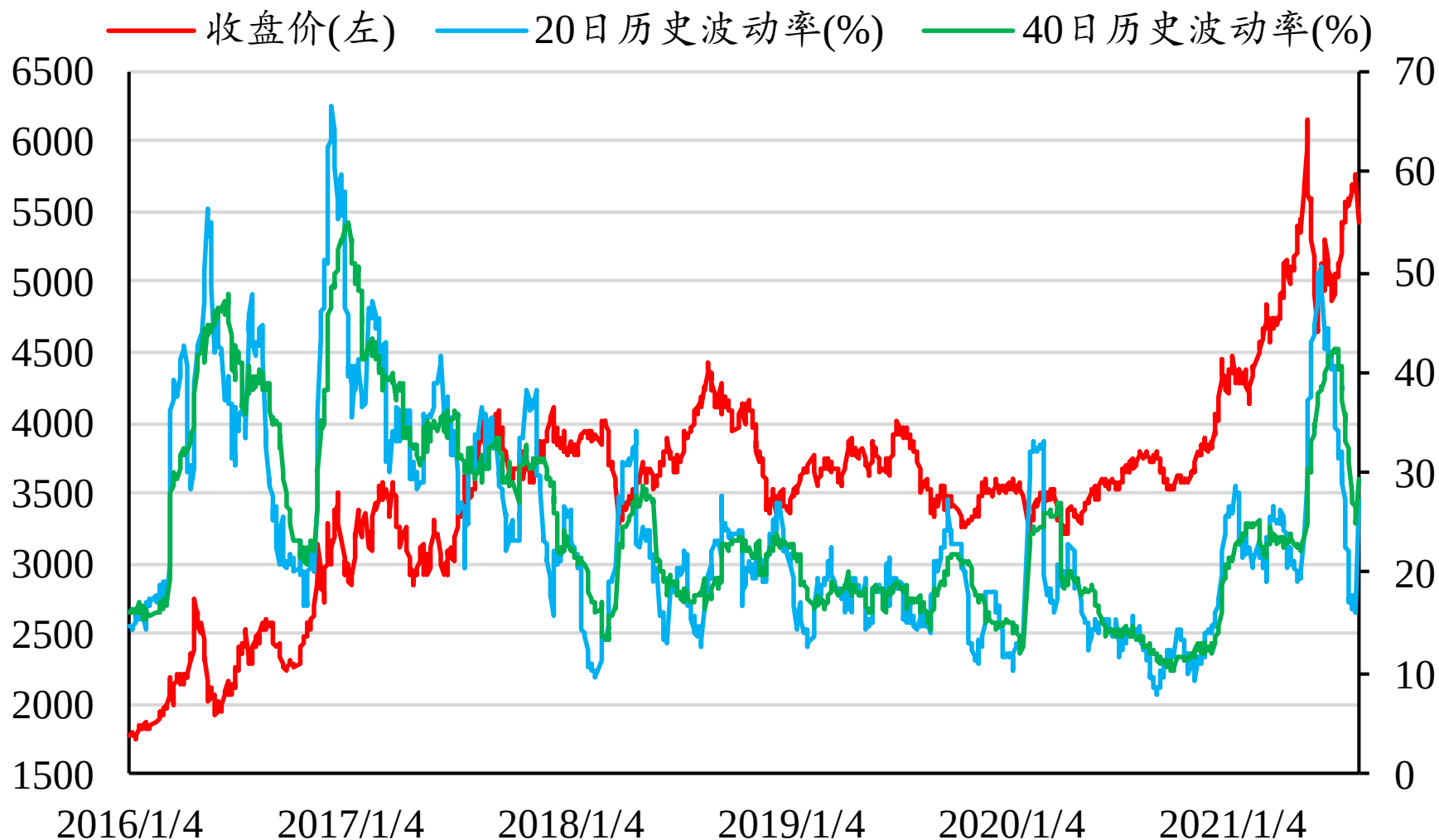


资料来源：Wind、信达期货研发中心

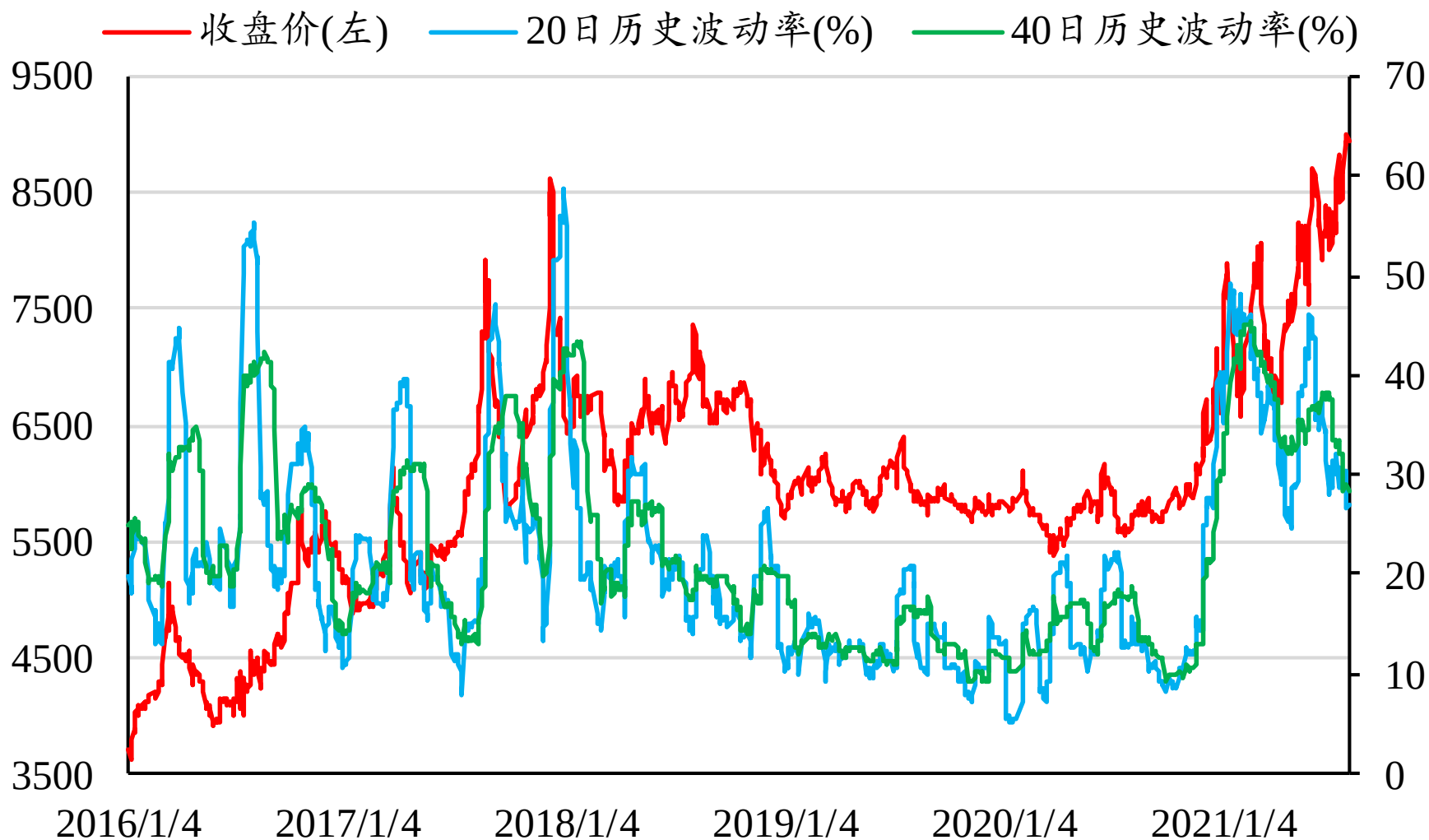
焦煤指数收盘价和历史波动率



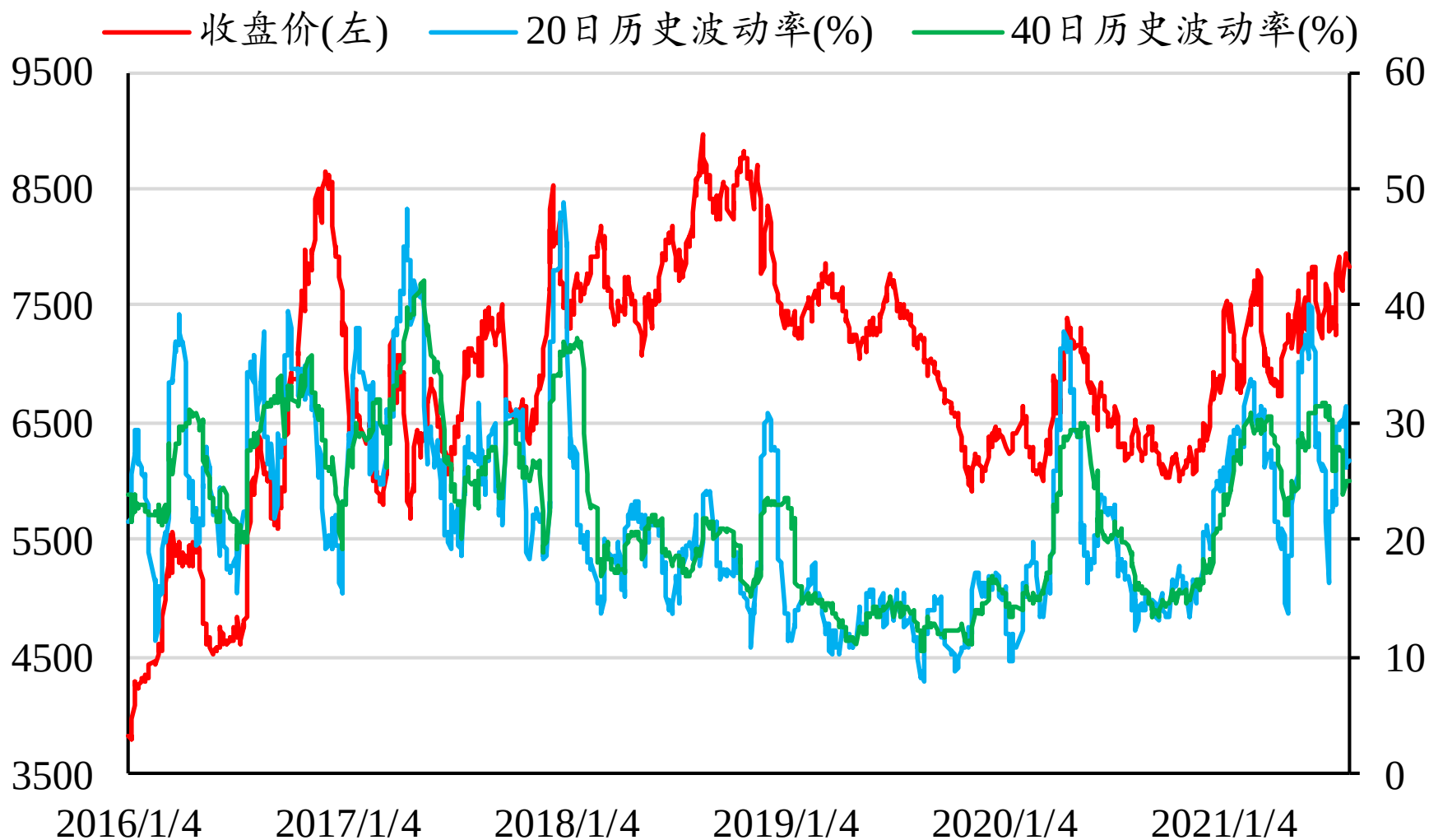
螺纹指数收盘价和历史波动率



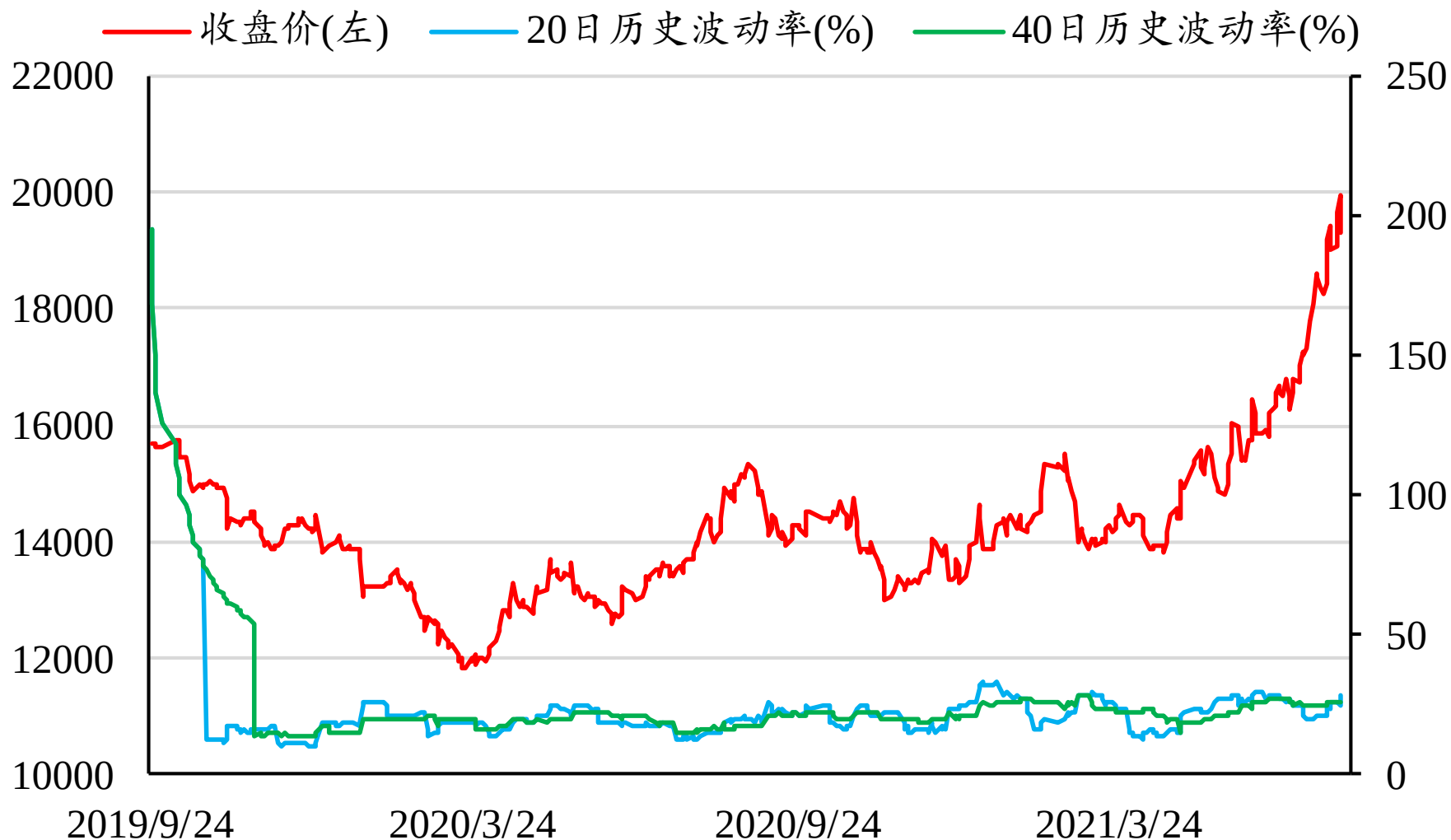
硅铁指数收盘价和历史波动率



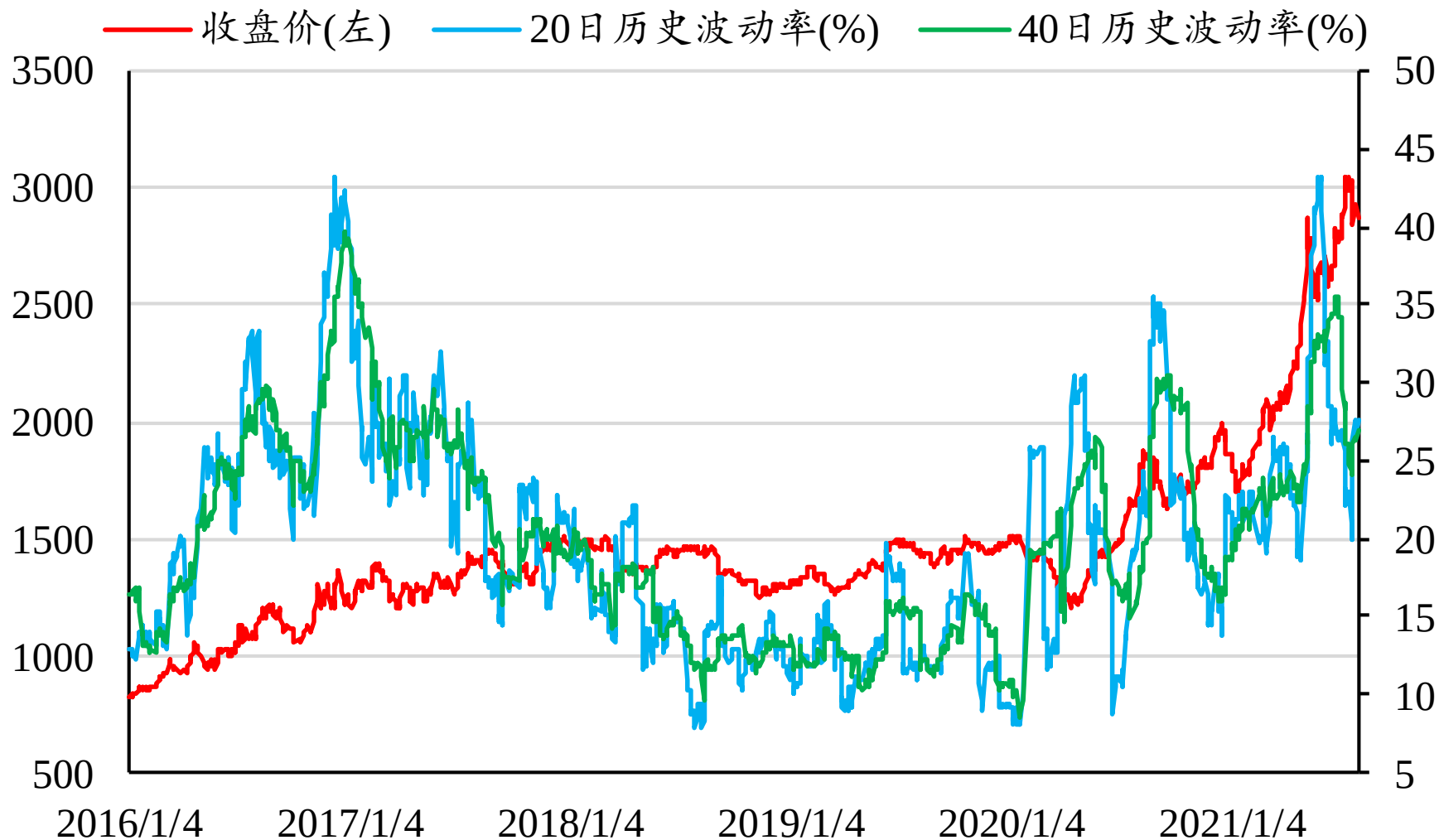
锰硅指数收盘价和历史波动率



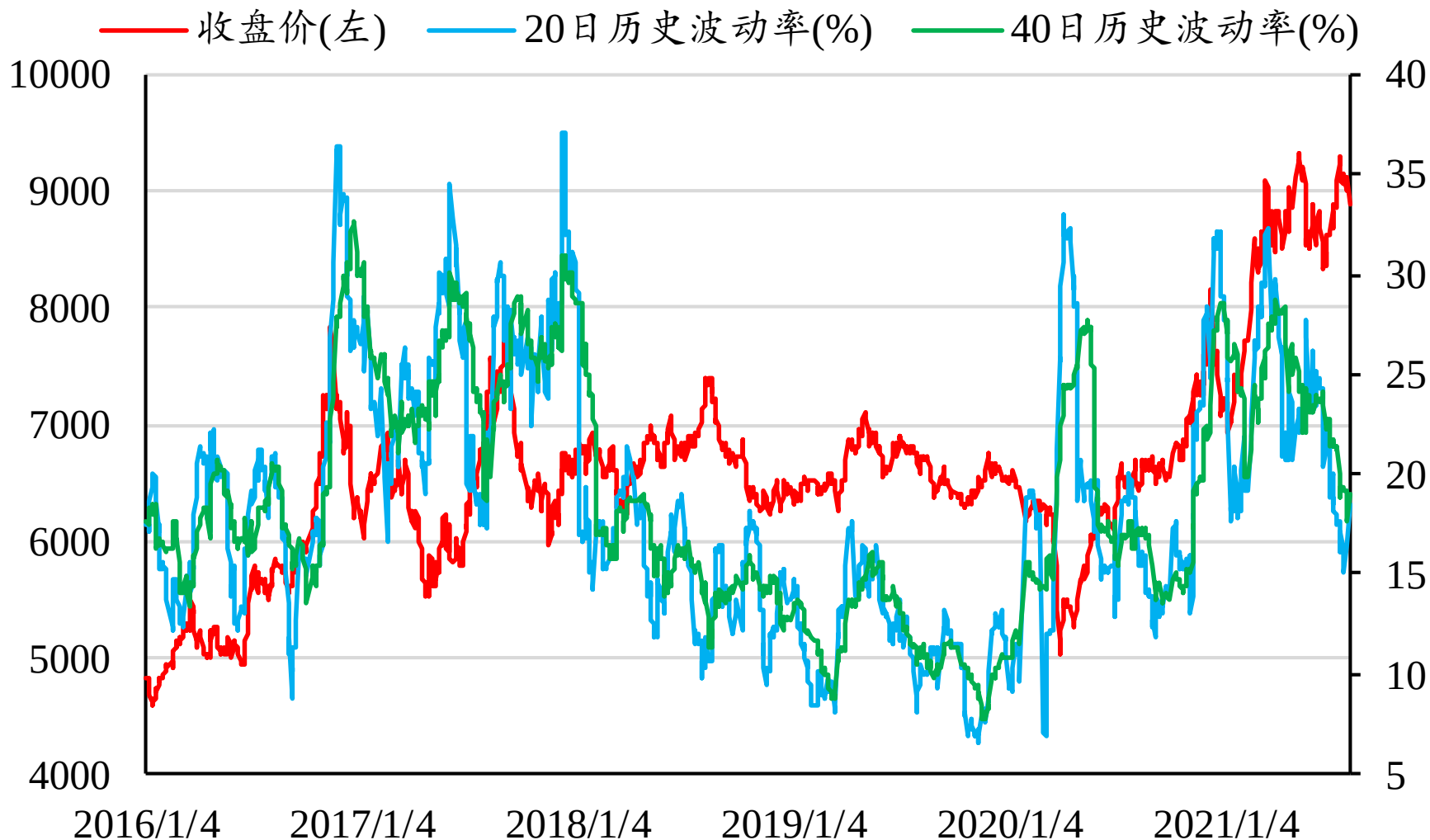
不锈钢指数收盘价和历史波动率



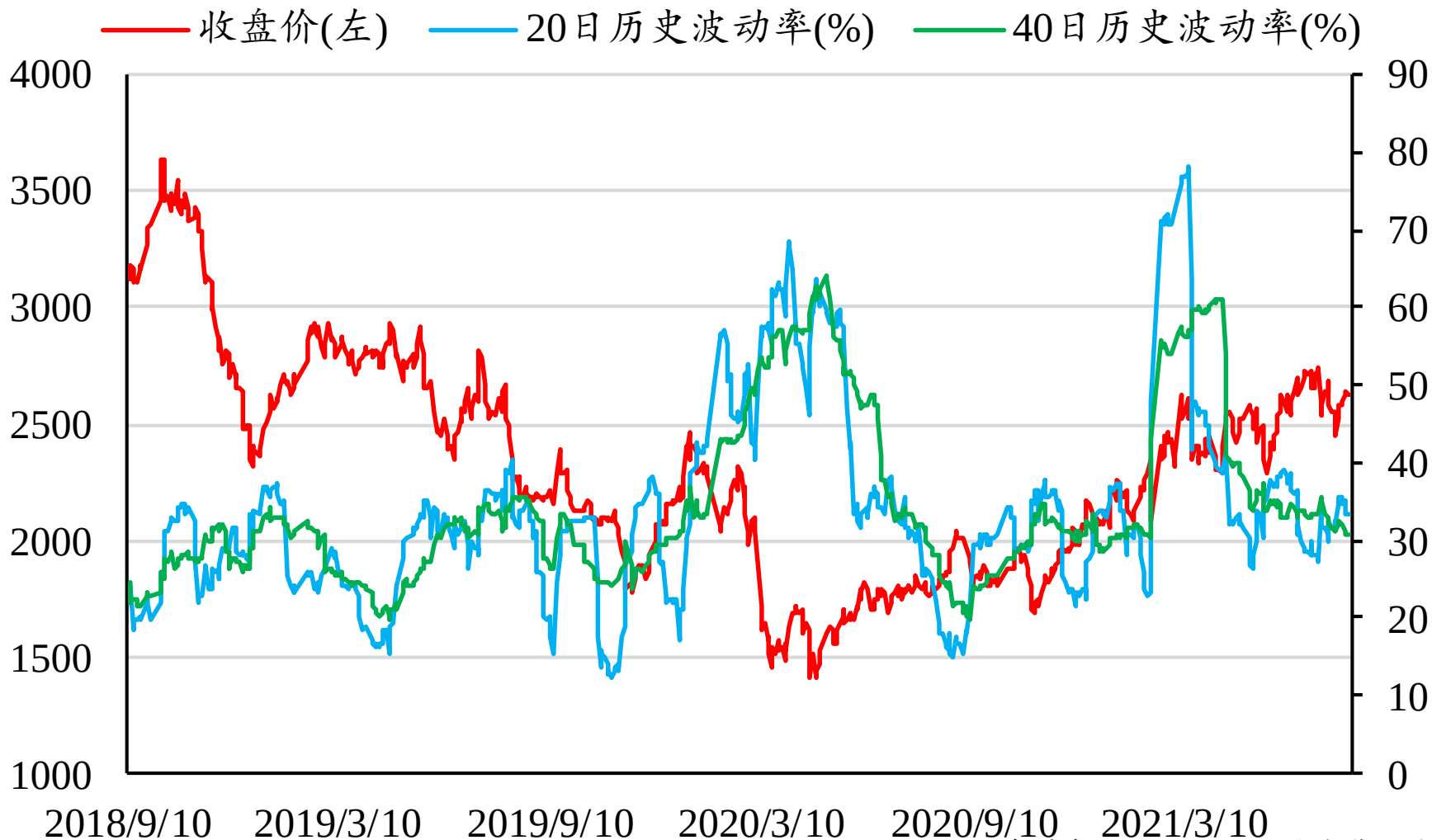
玻璃指数收盘价和历史波动率



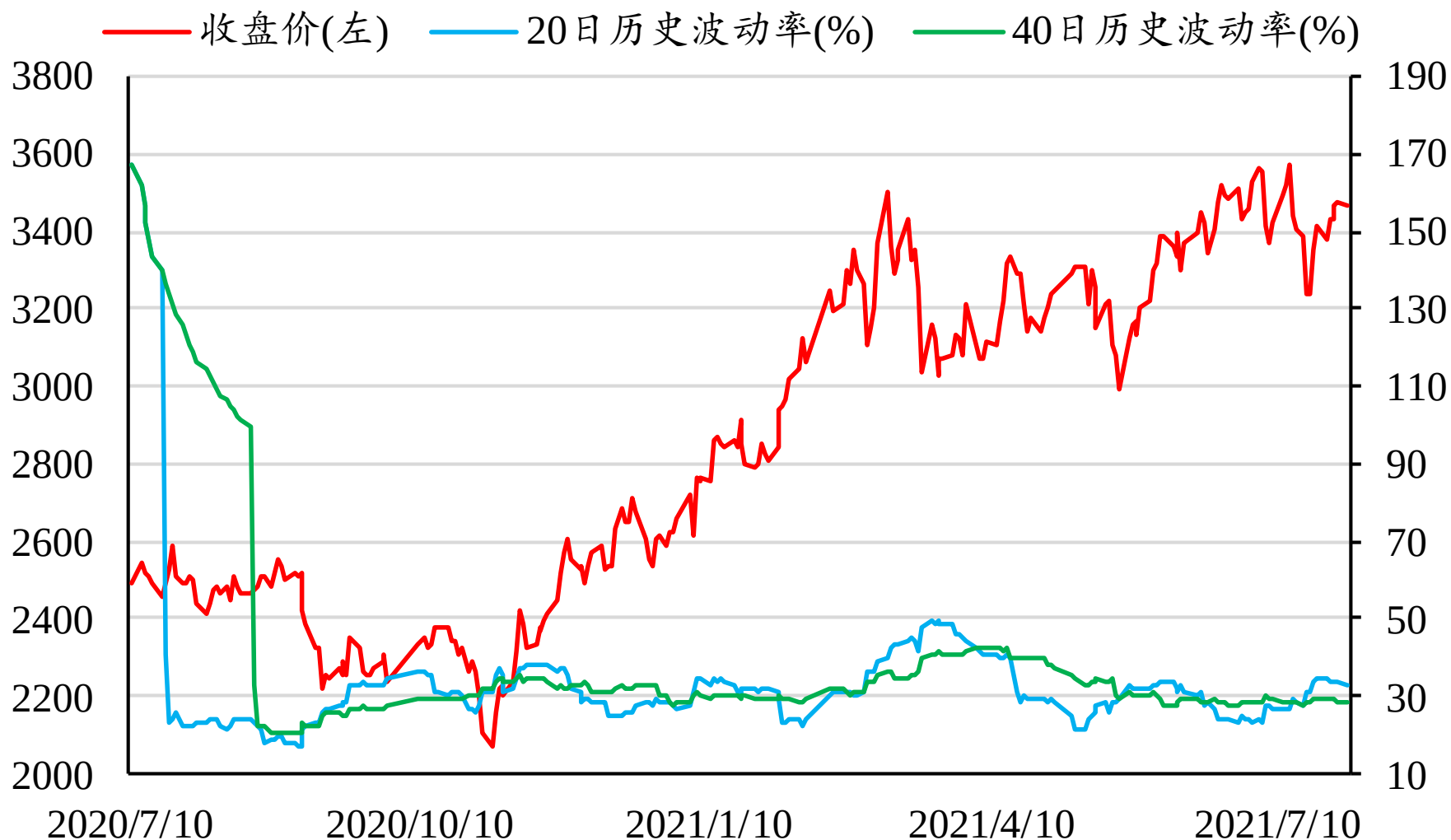
PVC指数收盘价和历史波动率



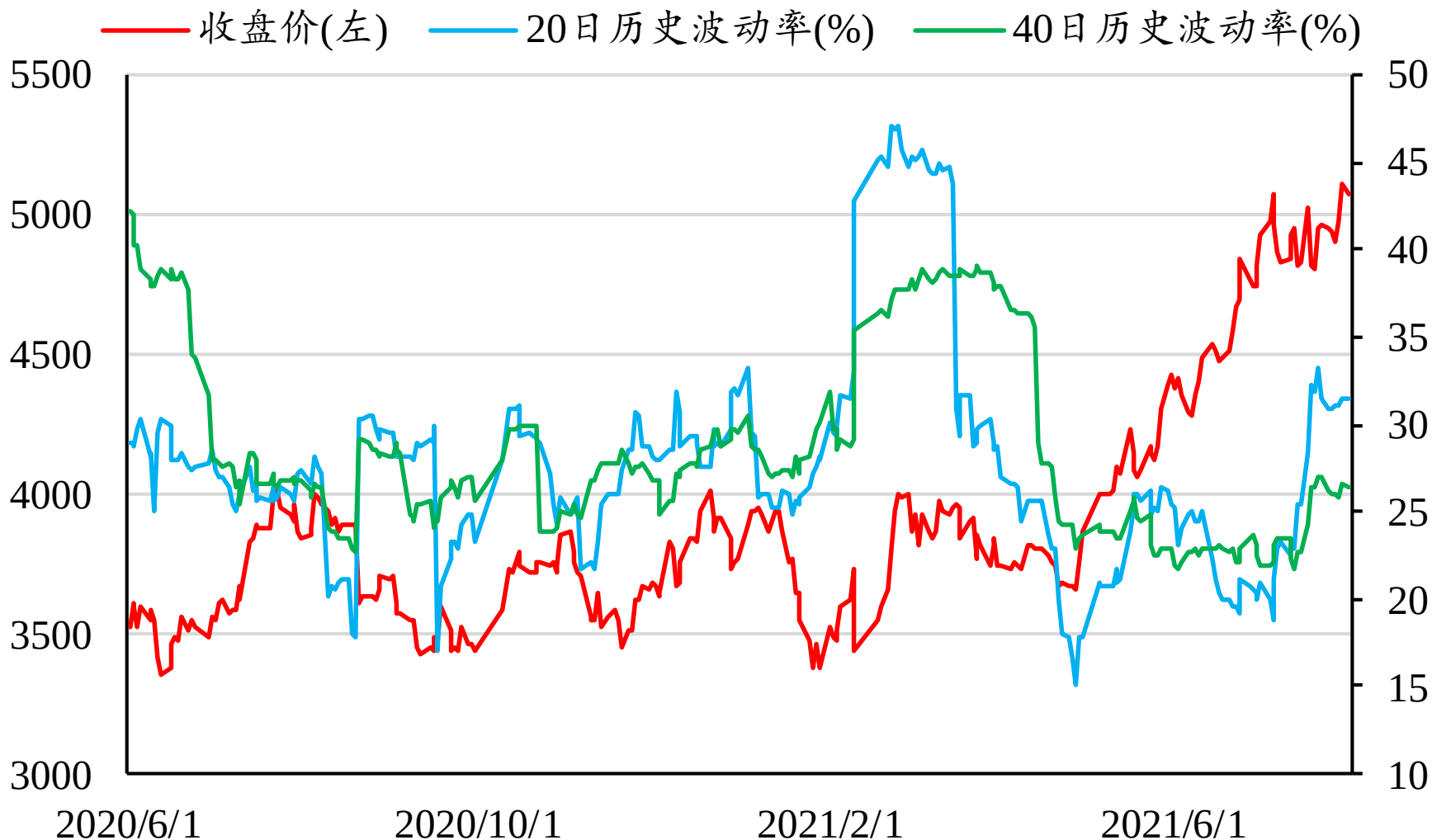
燃油指数收盘价和历史波动率



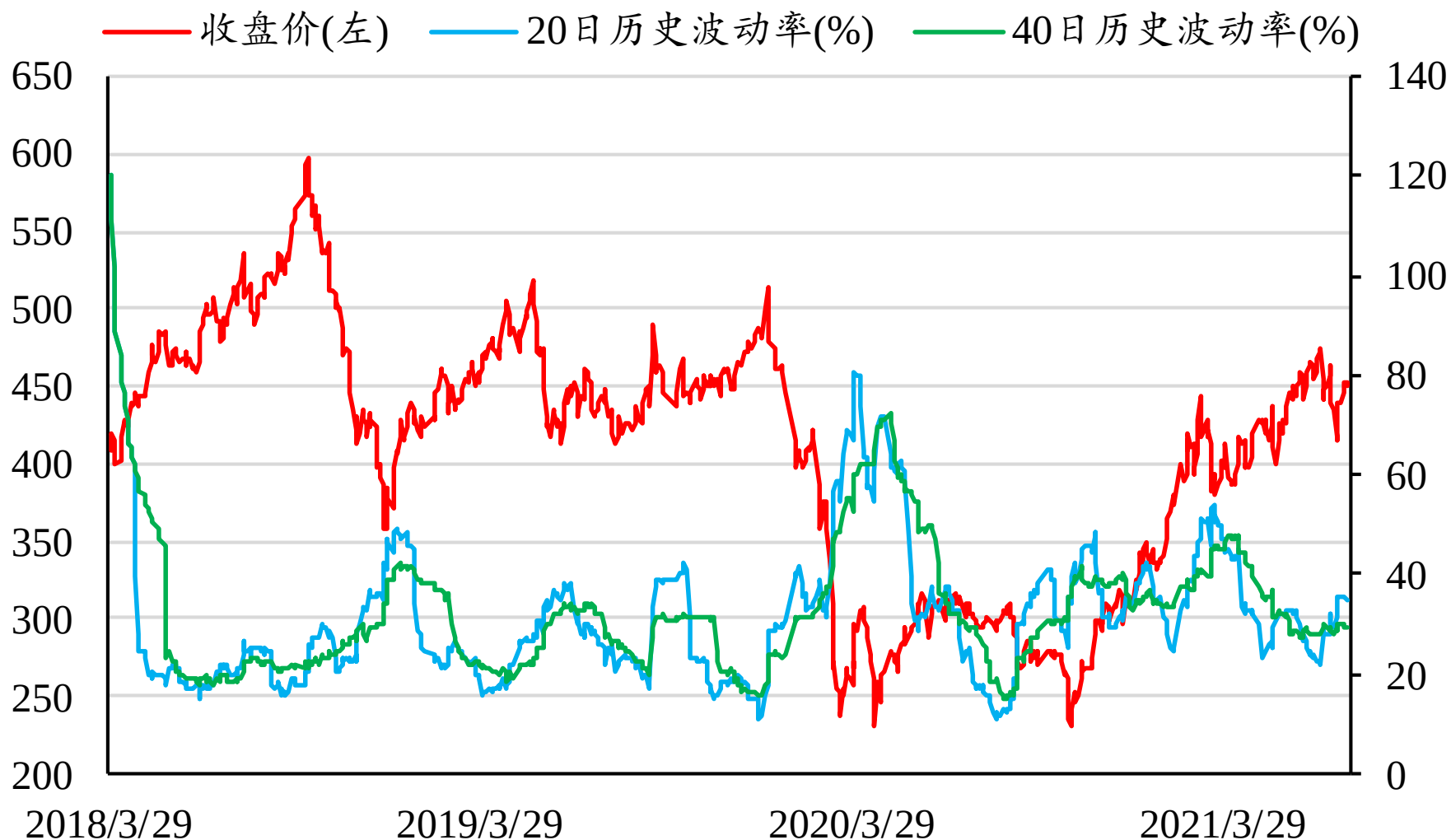
低硫燃料油指数收盘价和历史波动率



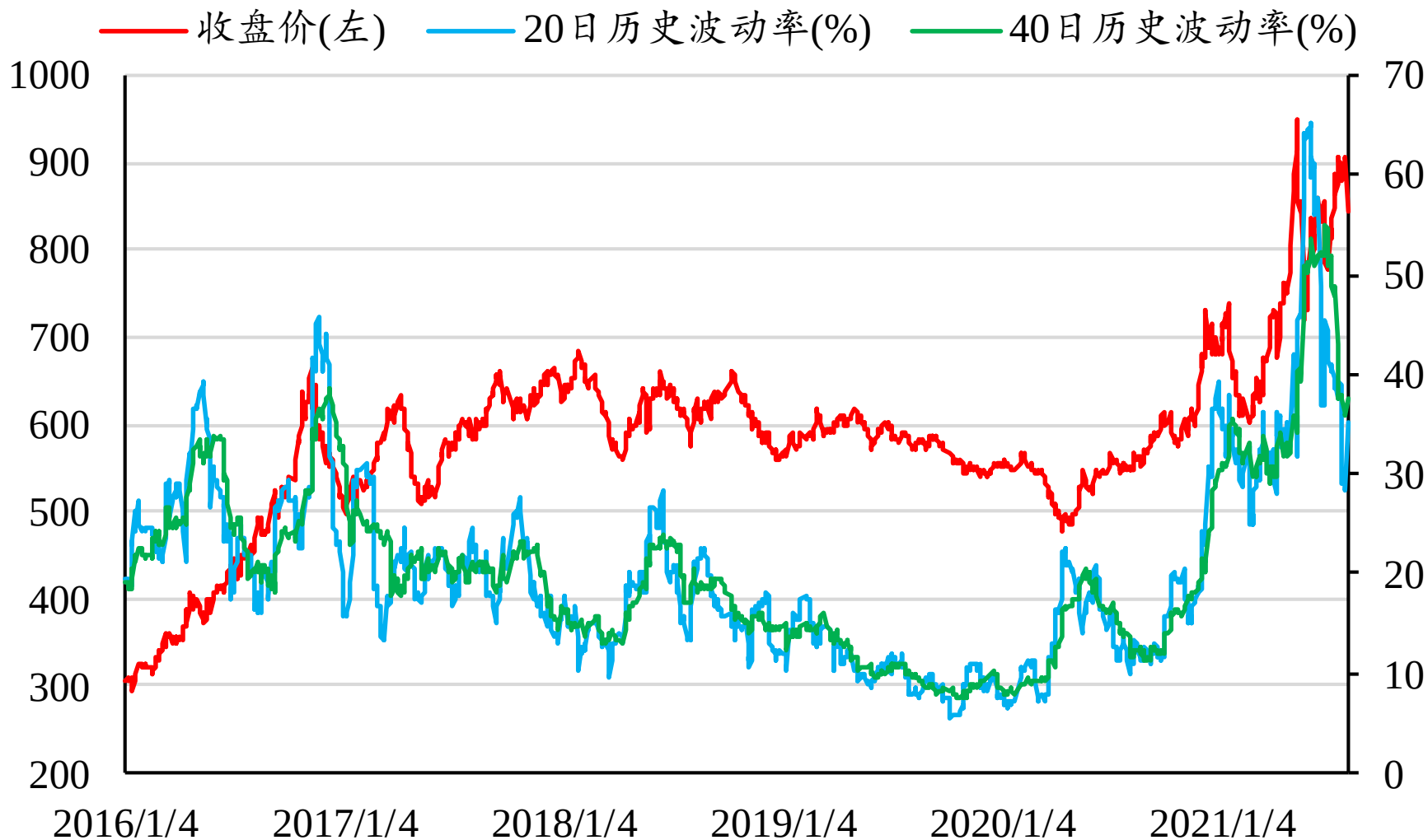
LPG指数收盘价和历史波动率



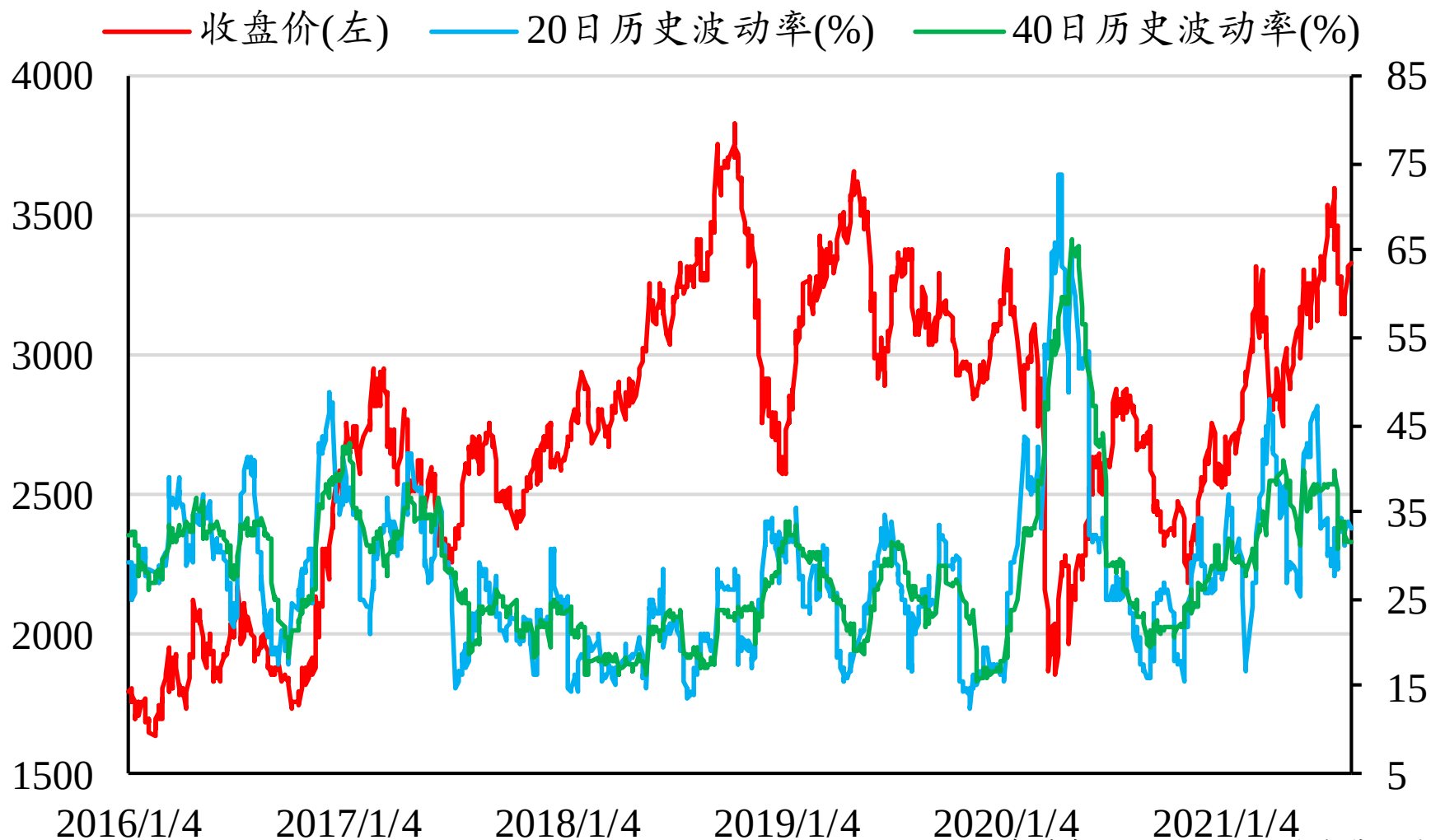
原油指数收盘价和历史波动率



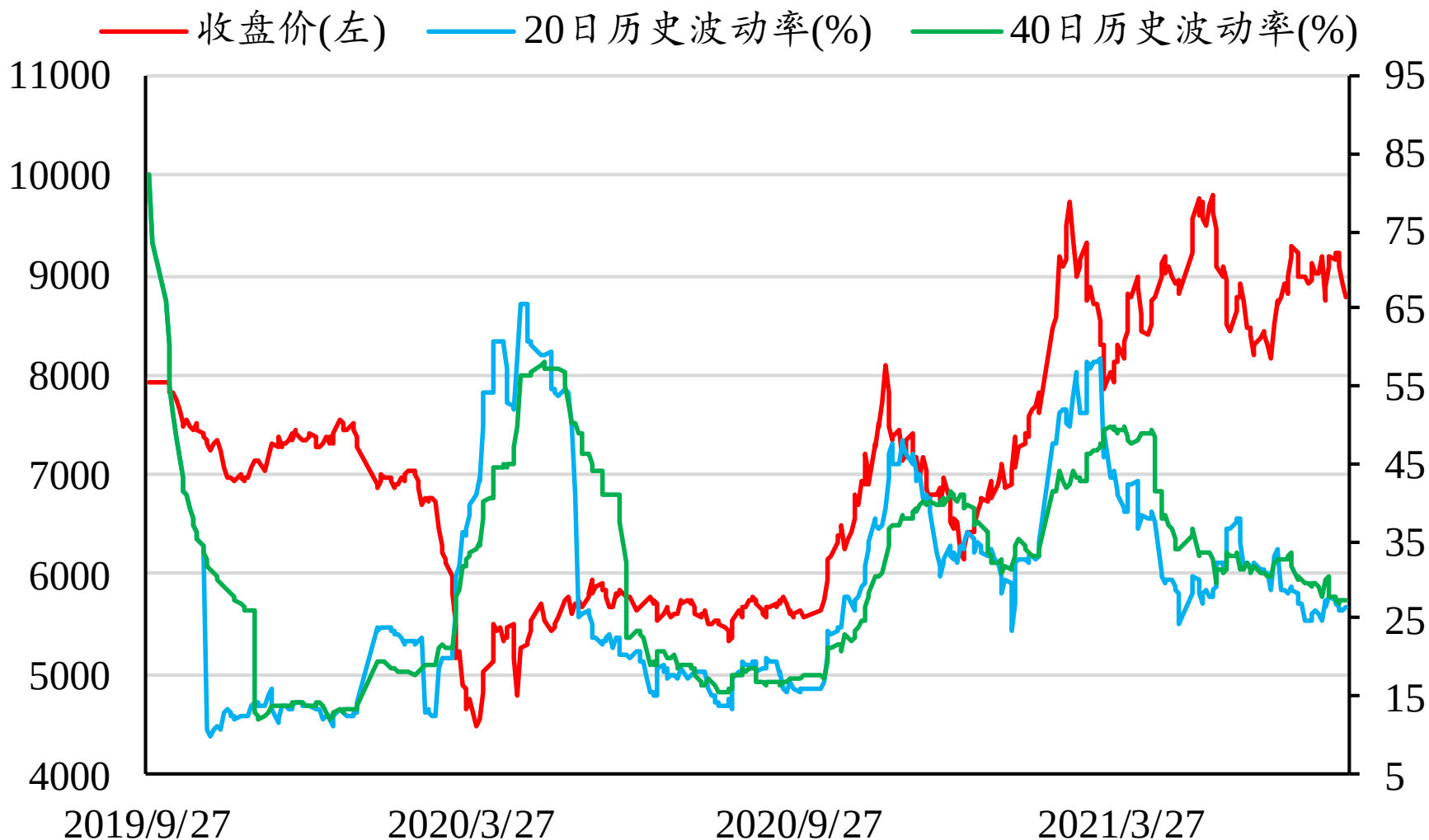
动煤指数收盘价和历史波动率



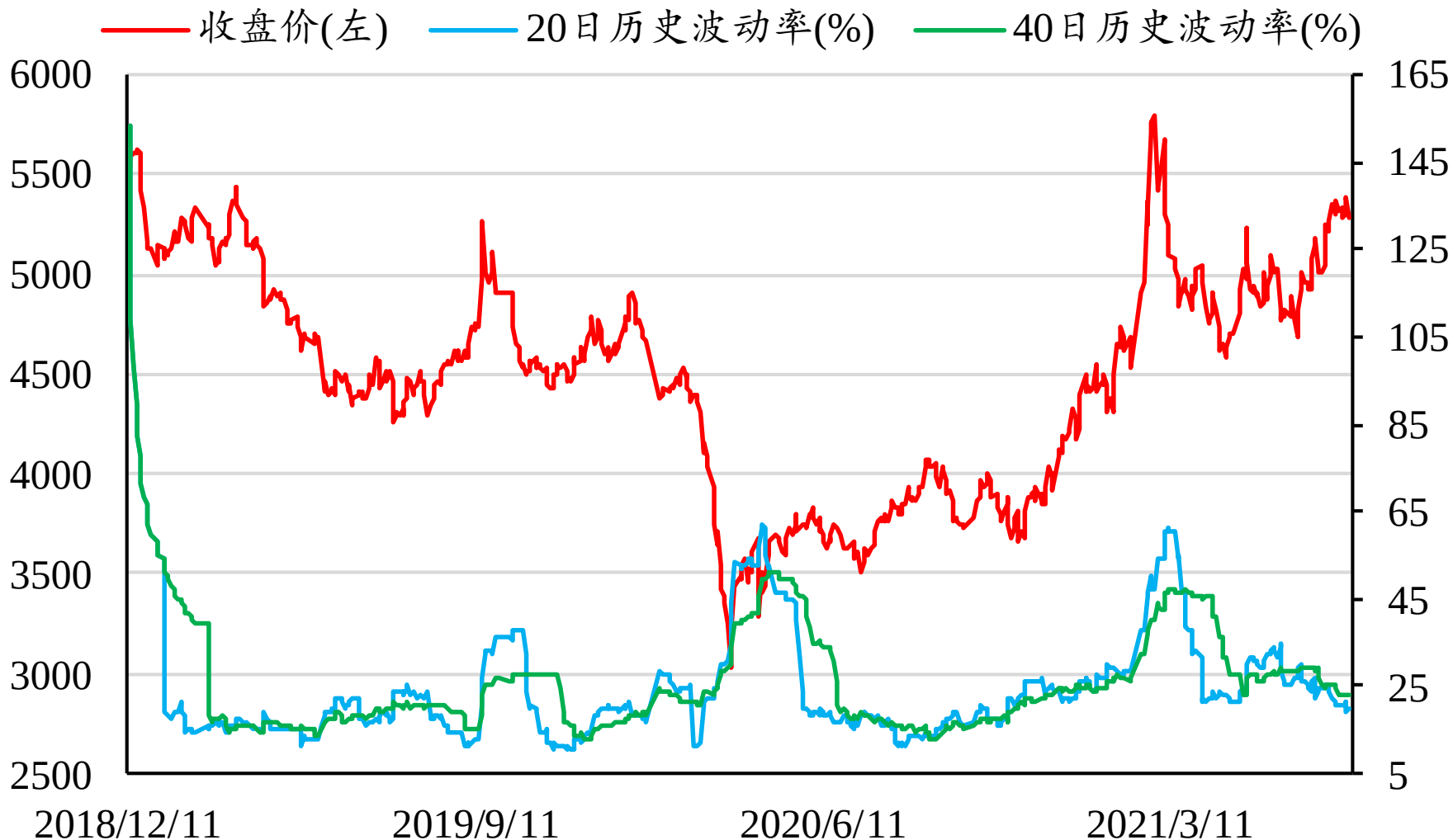
沥青指数收盘价和历史波动率



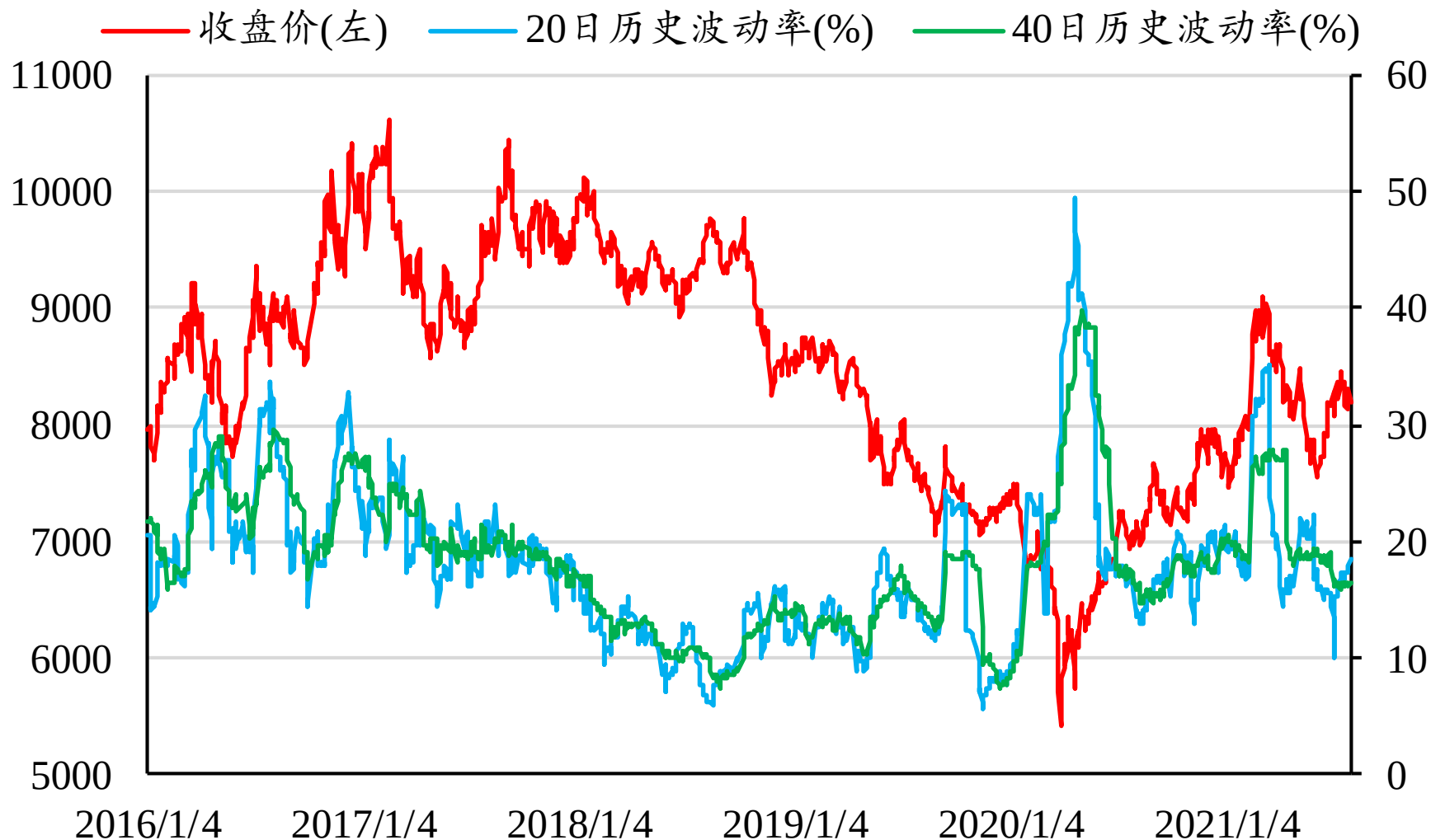
苯乙烯指数收盘价和历史波动率



乙二醇指数收盘价和历史波动率

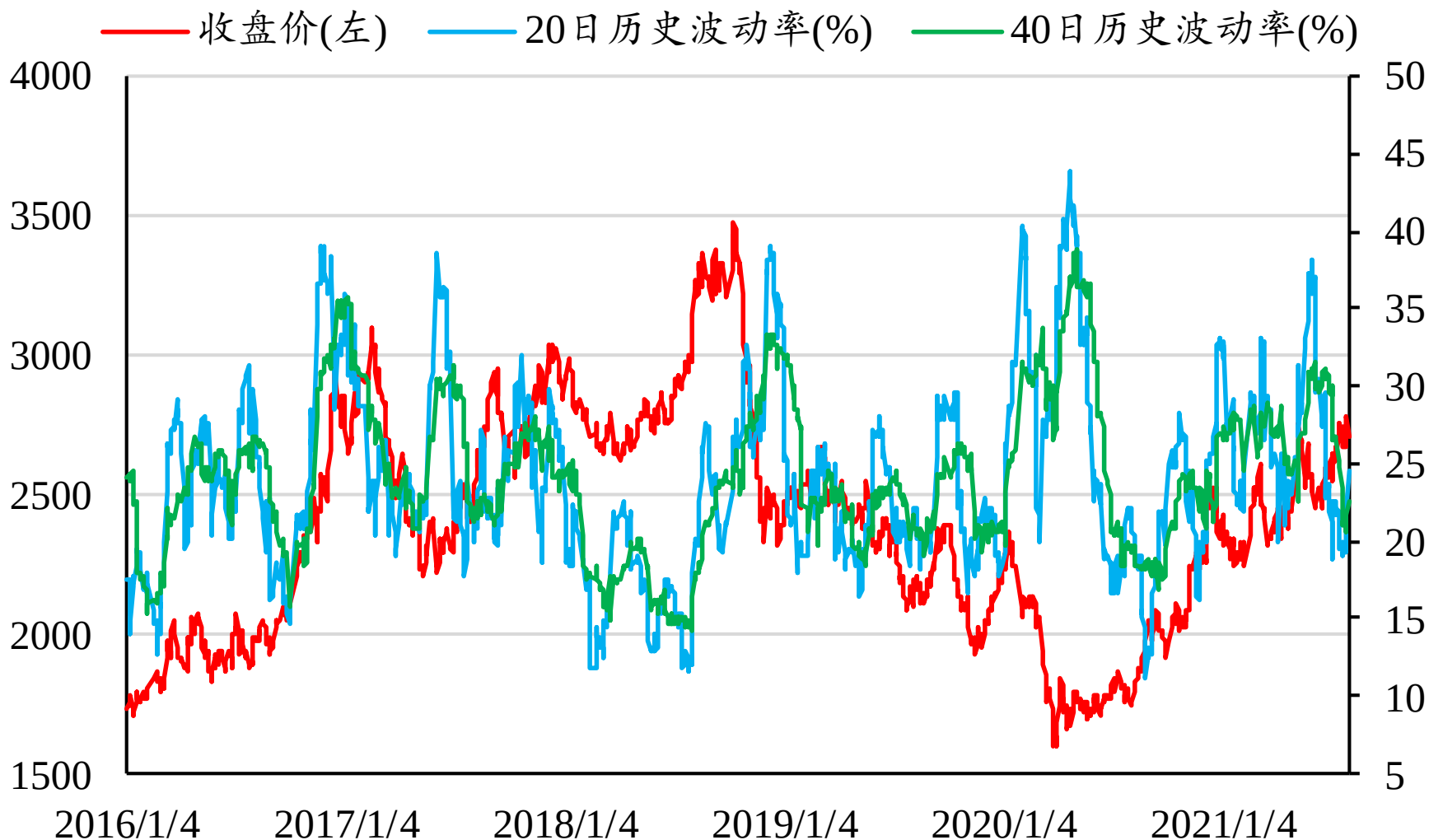


塑料指数收盘价和历史波动率



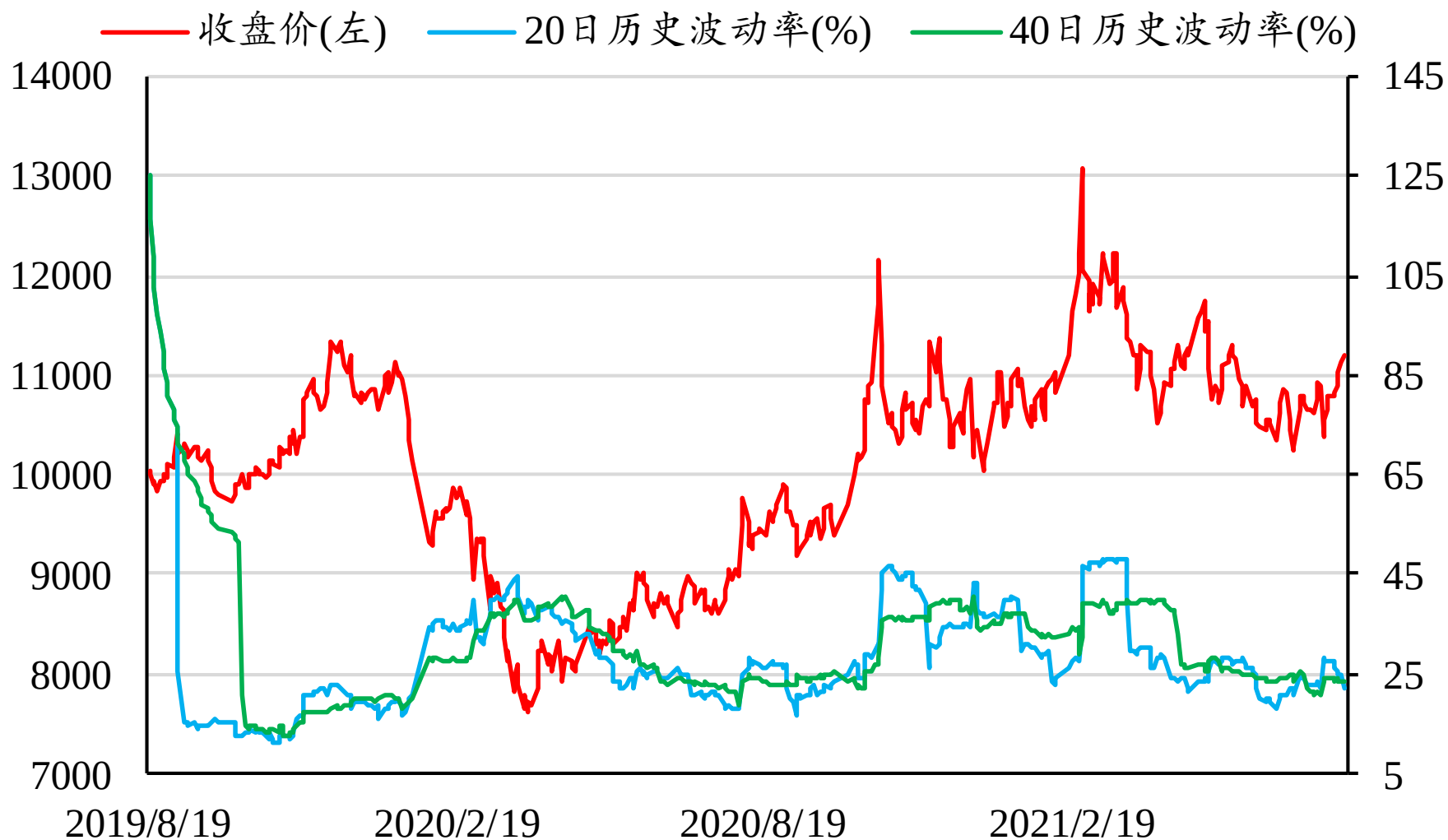
资料来源: Wind、信达期货研发中心

甲醇指数收盘价和历史波动率

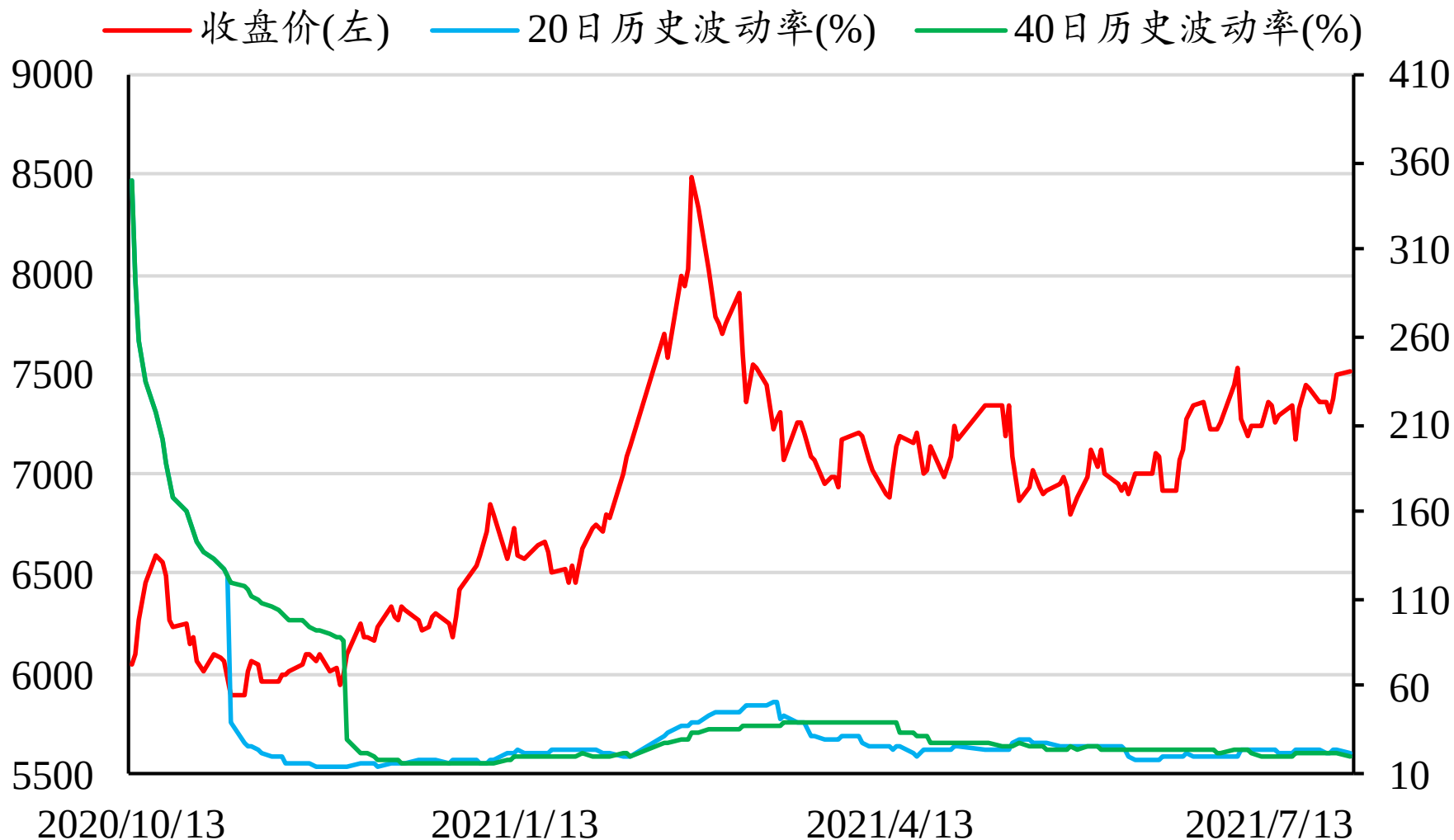


资料来源：Wind、信达期货研发中心

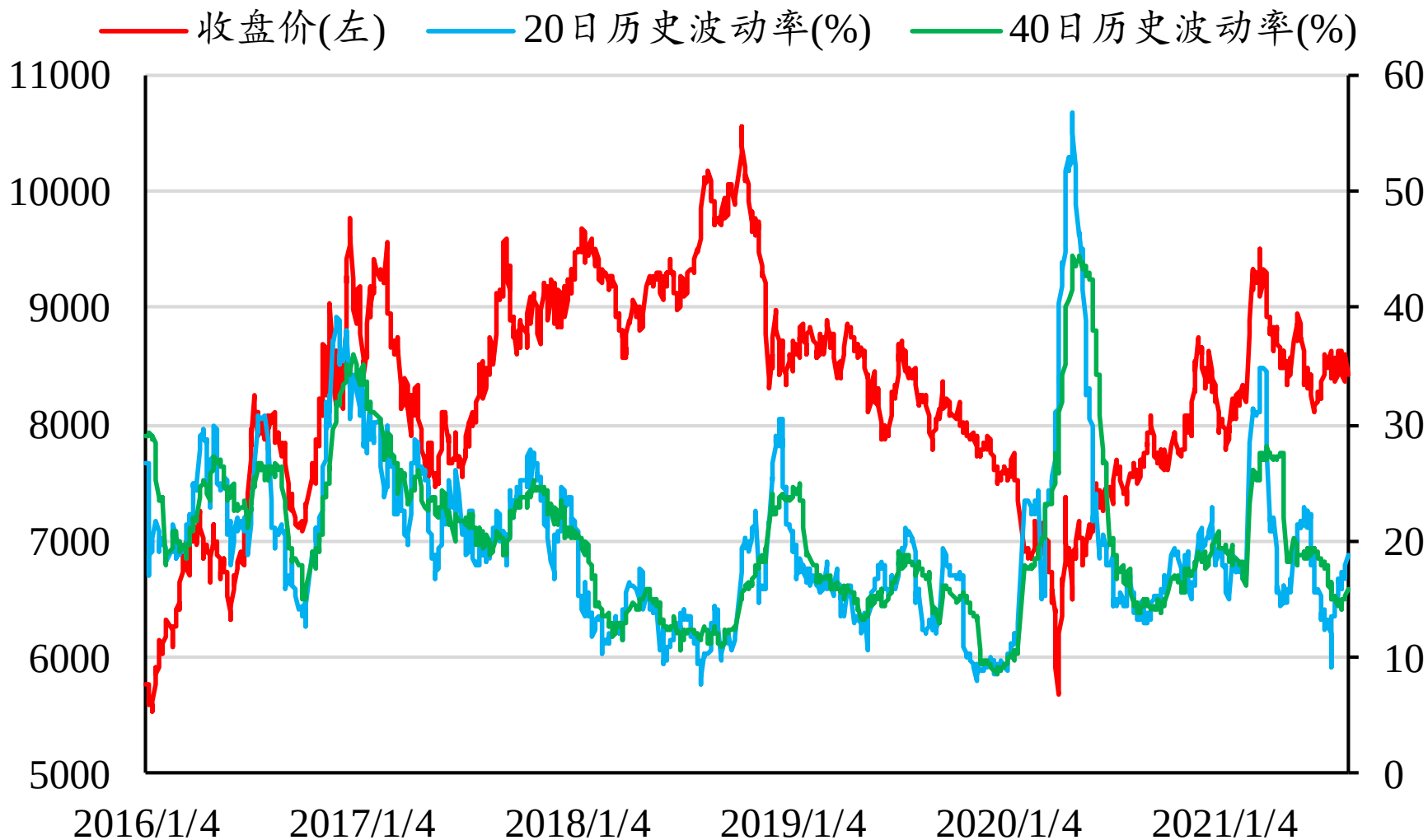
20号胶指数收盘价和历史波动率



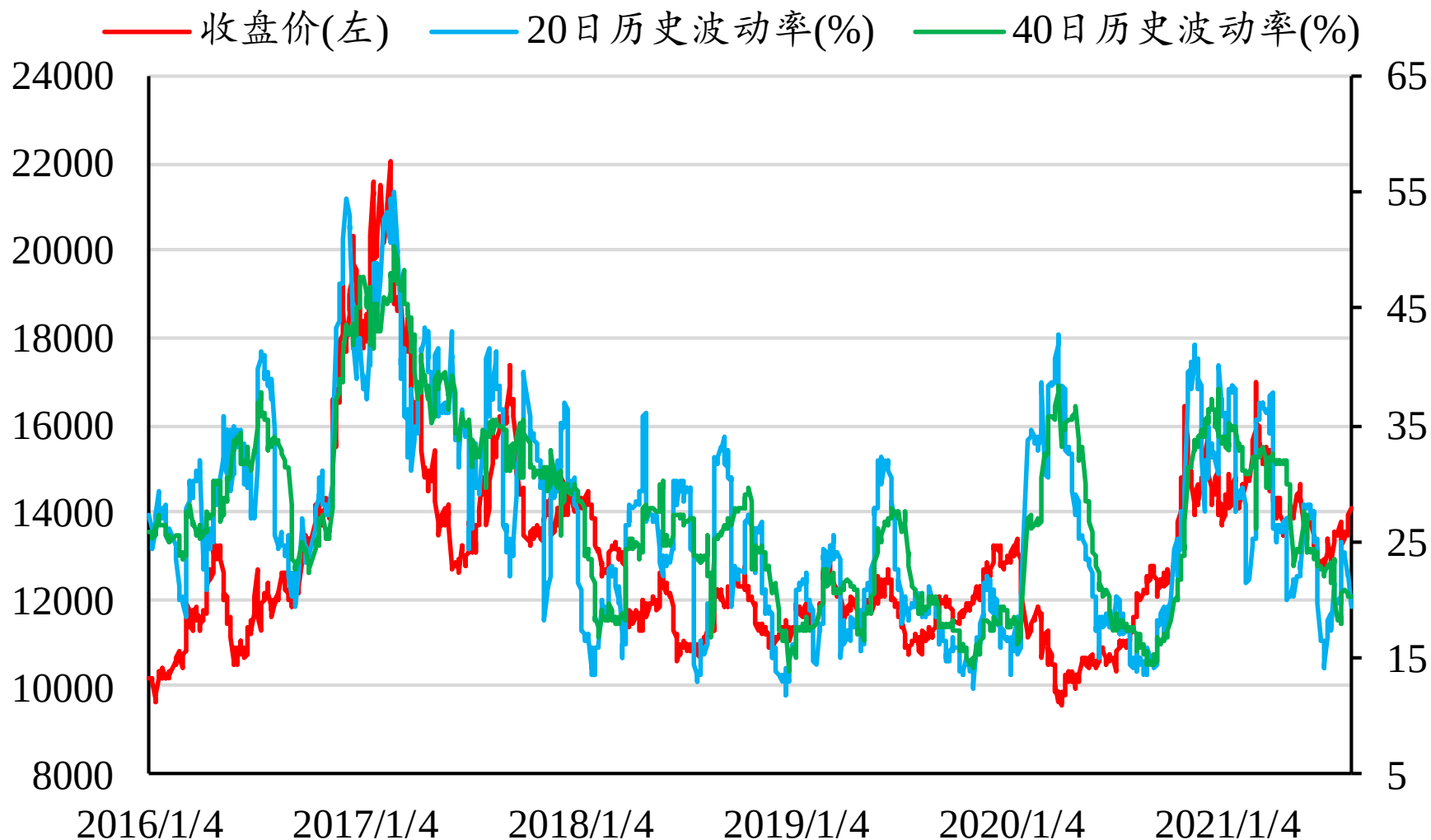
短纤指数收盘价和历史波动率



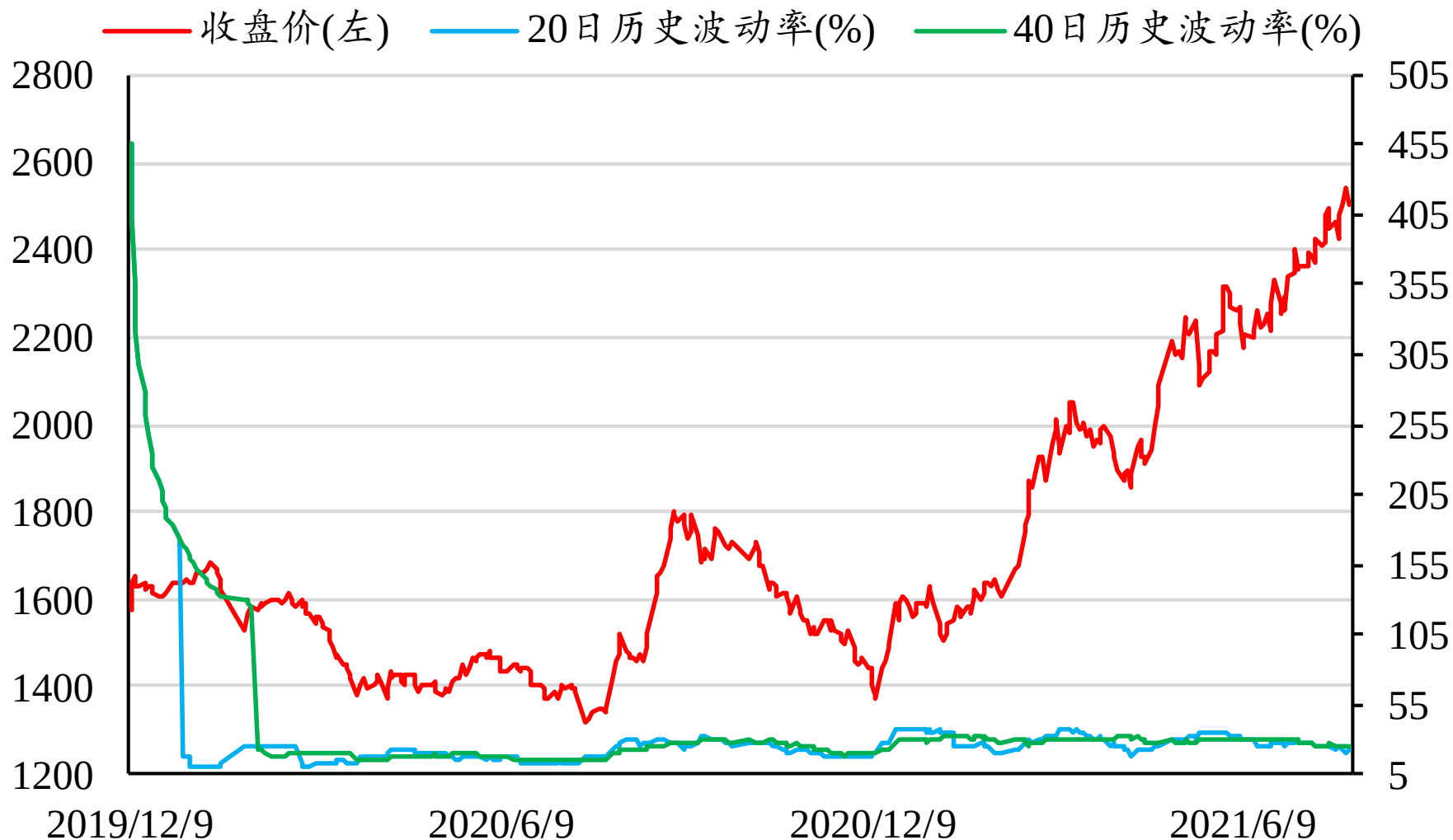
PP指数收盘价和历史波动率



沪胶指数收盘价和历史波动率

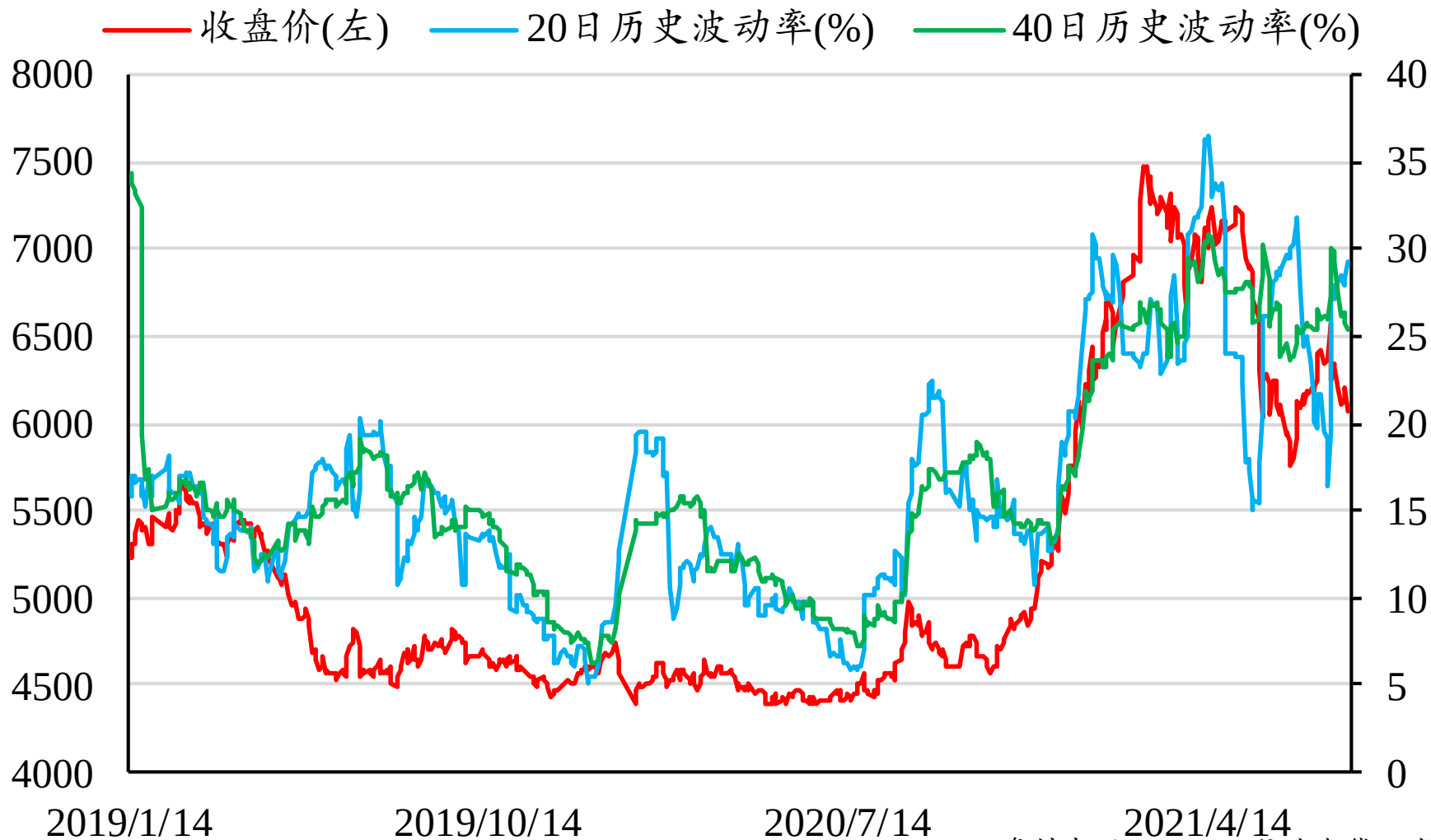


纯碱指数收盘价和历史波动率

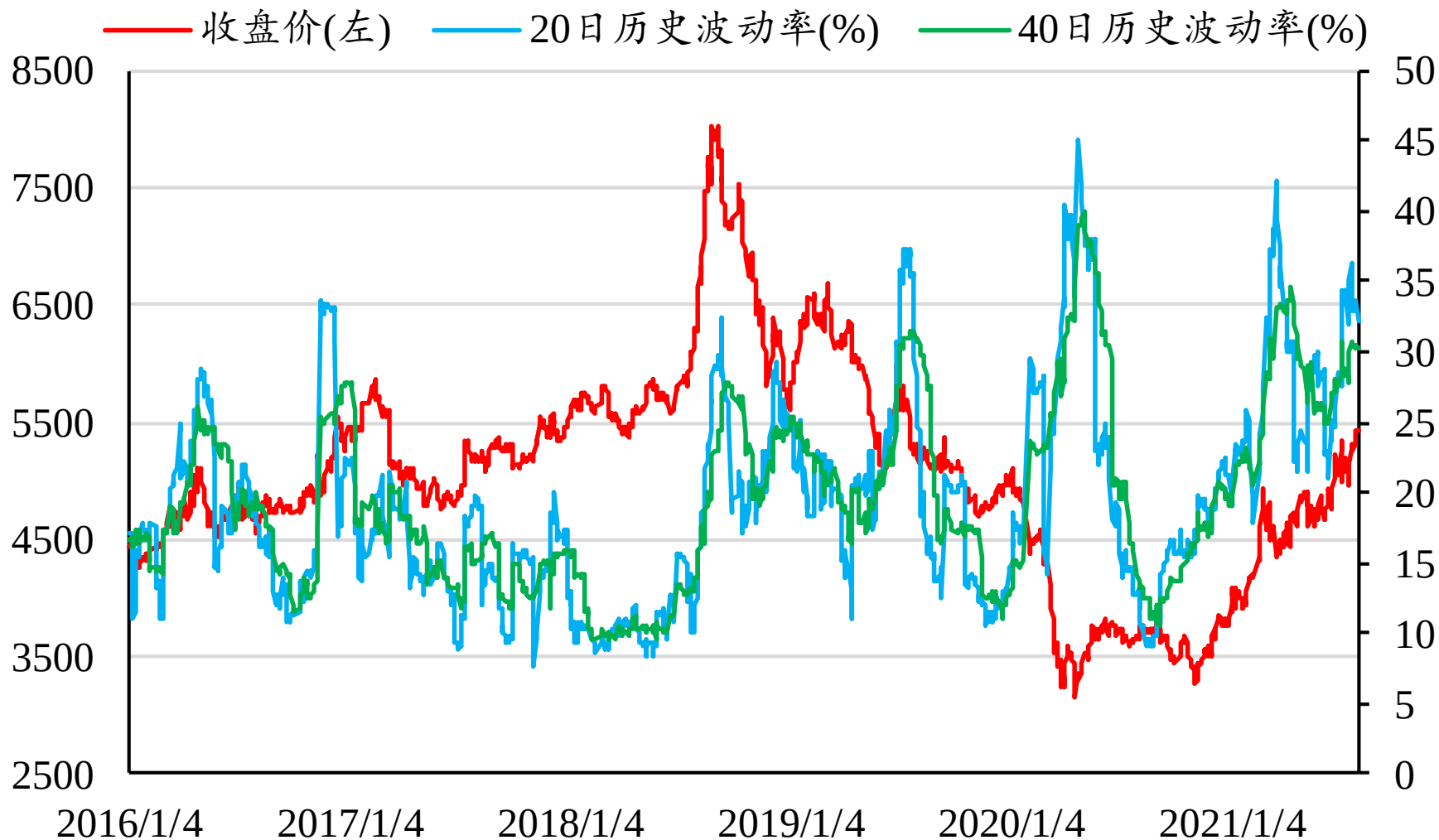


资料来源: Wind、信达期货研发中心

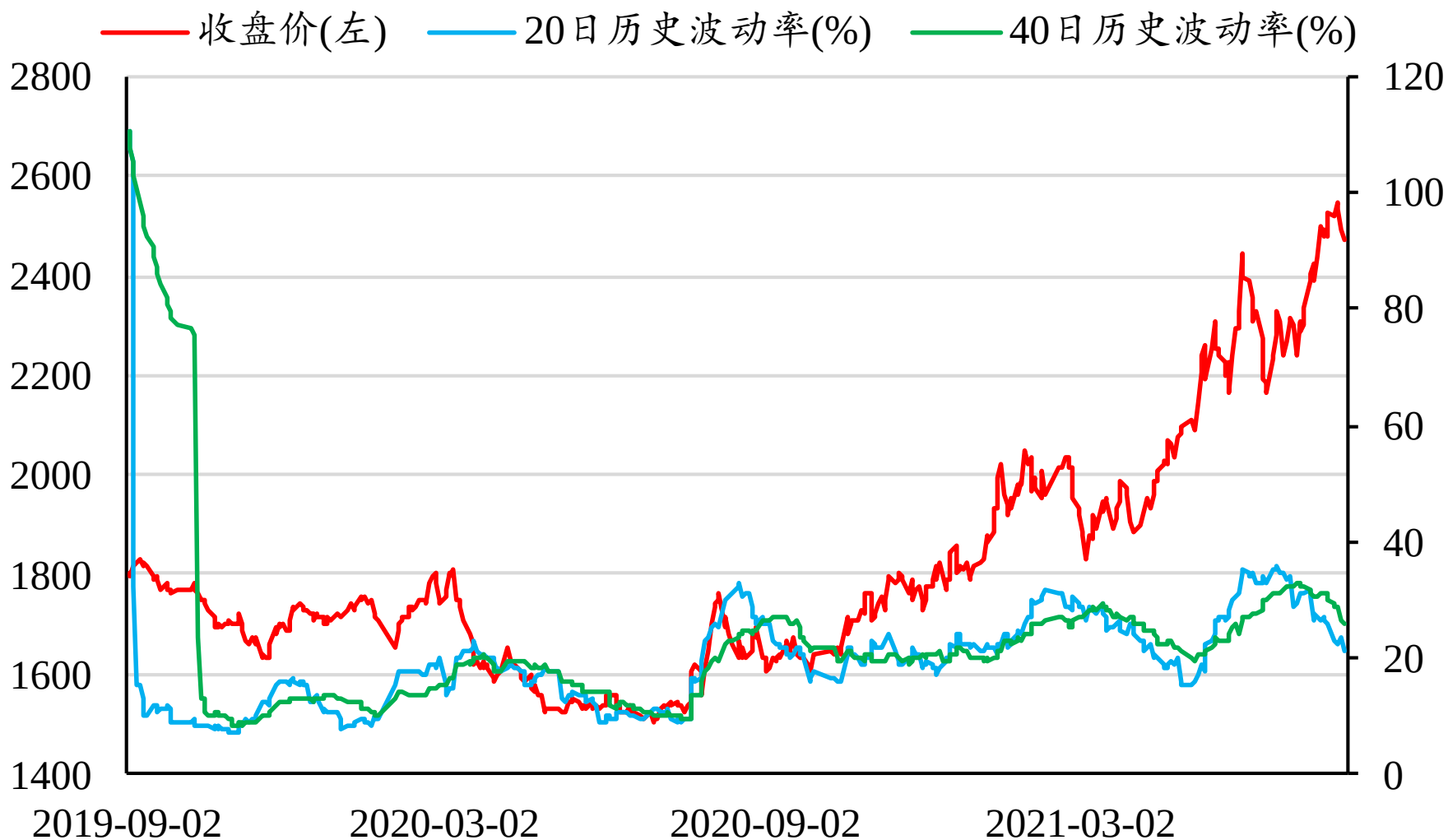
纸浆指数收盘价和历史波动率



TA指数收盘价和历史波动率

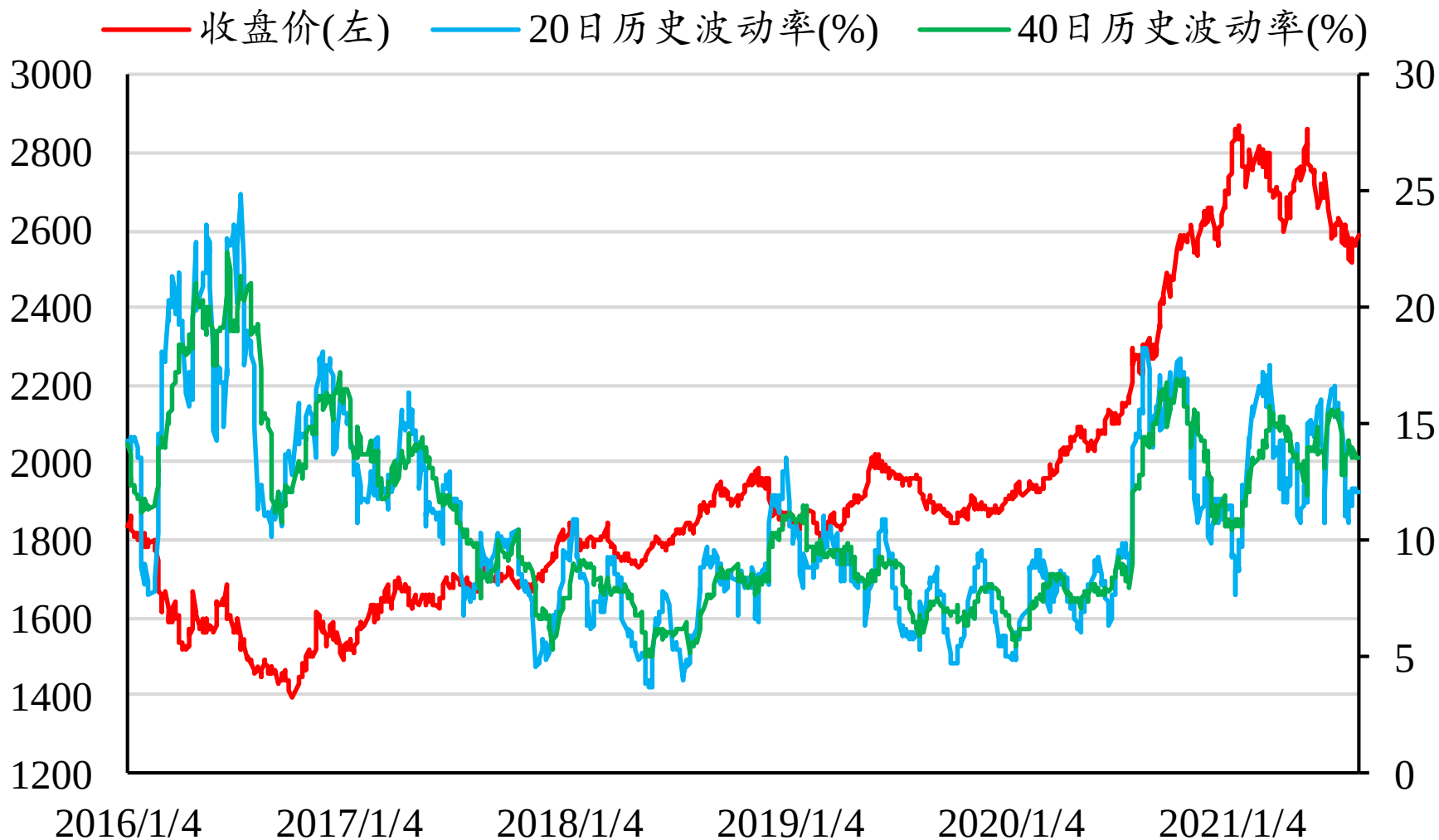


尿素指数收盘价和历史波动率

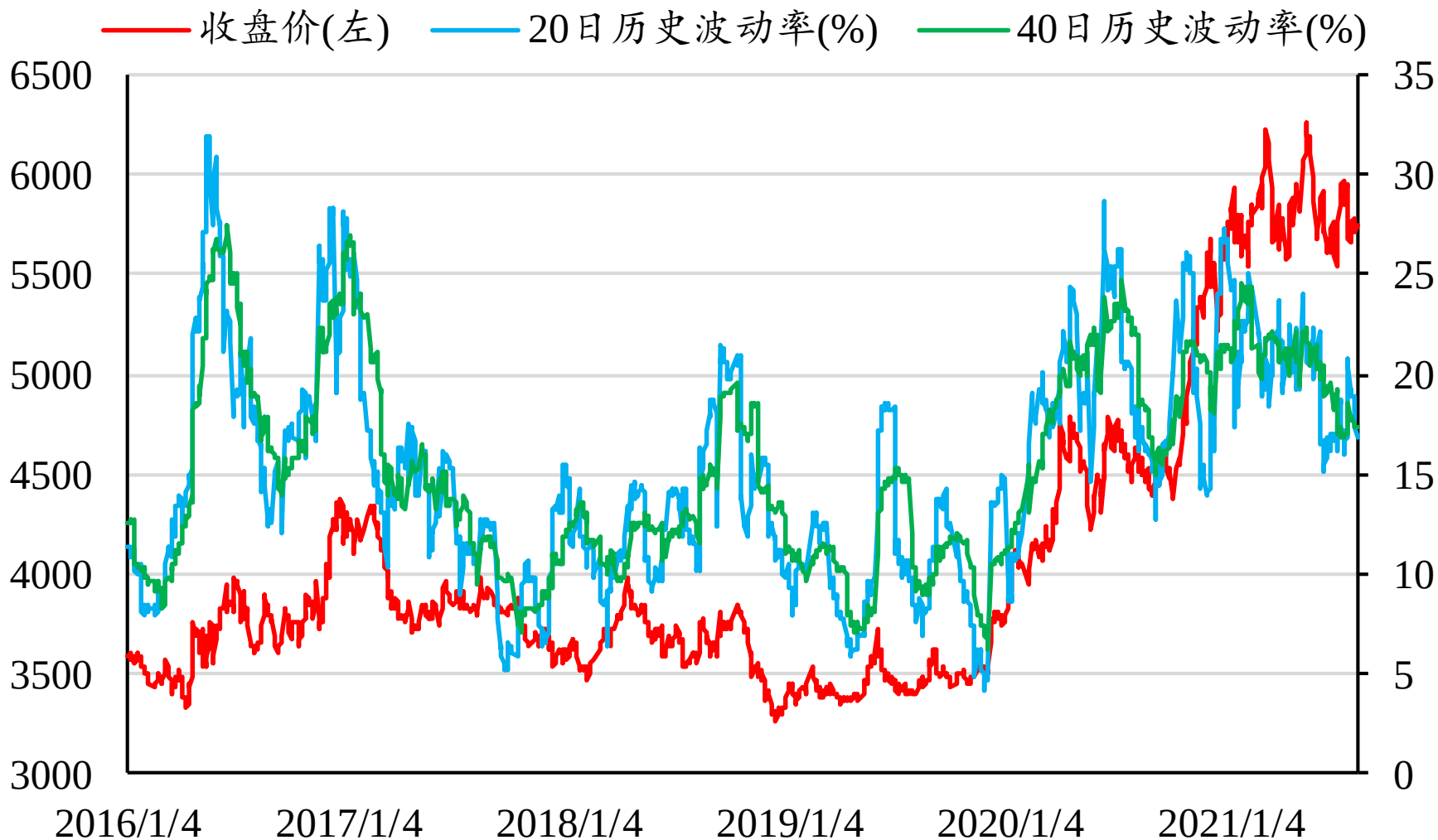


资料来源：Wind、信达期货研发中心

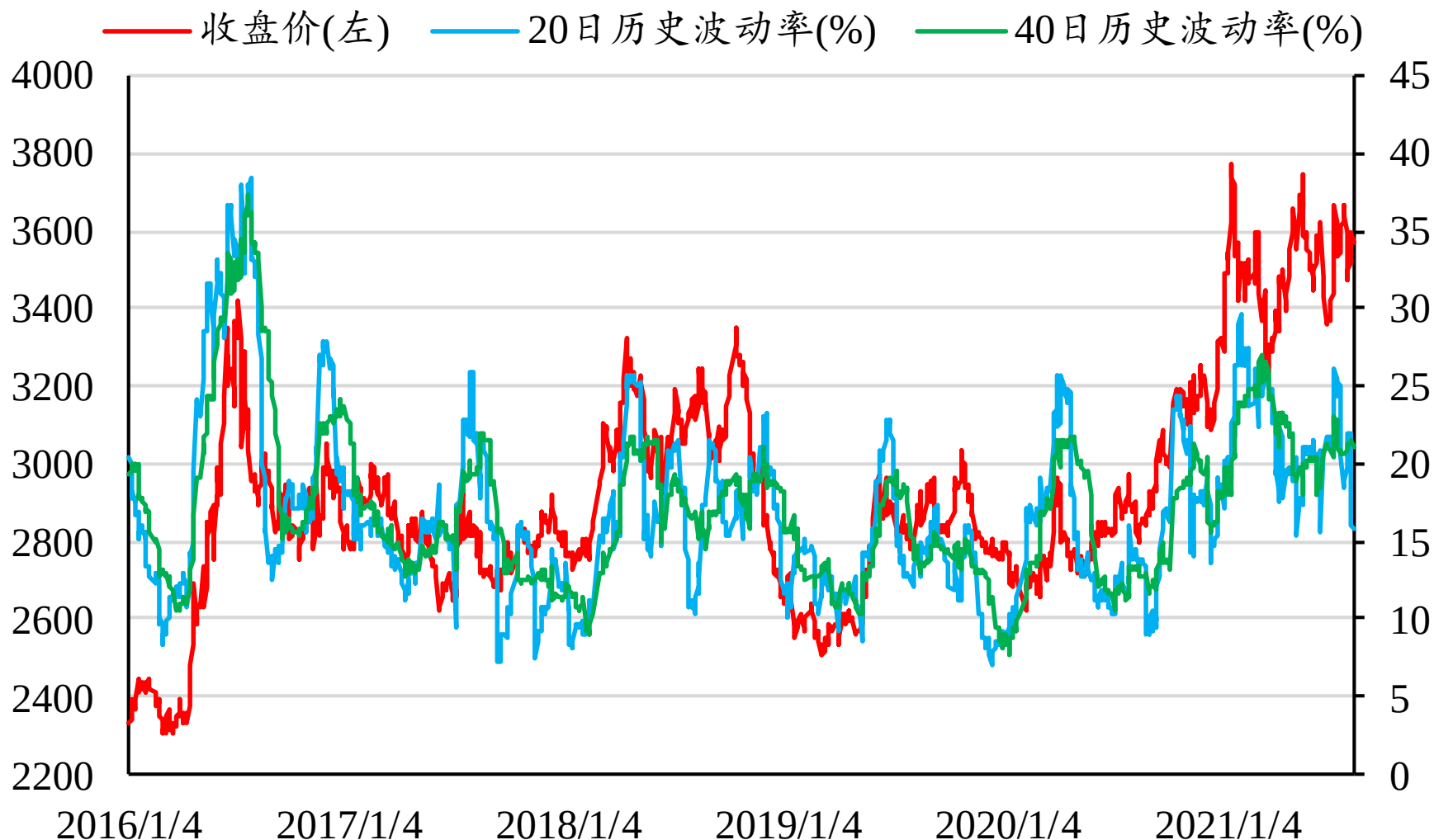
玉米指数收盘价和历史波动率



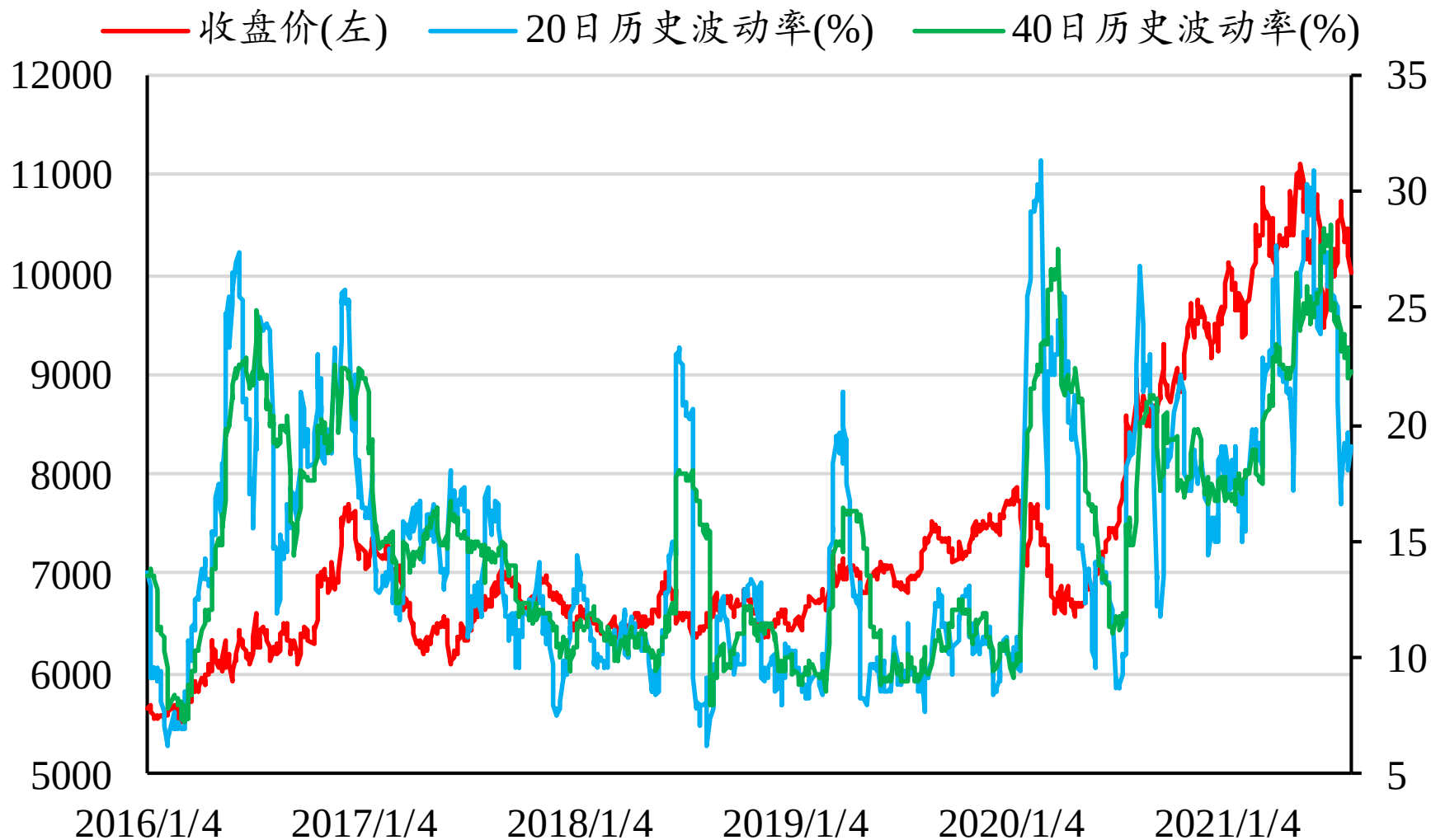
豆一指数收盘价和历史波动率



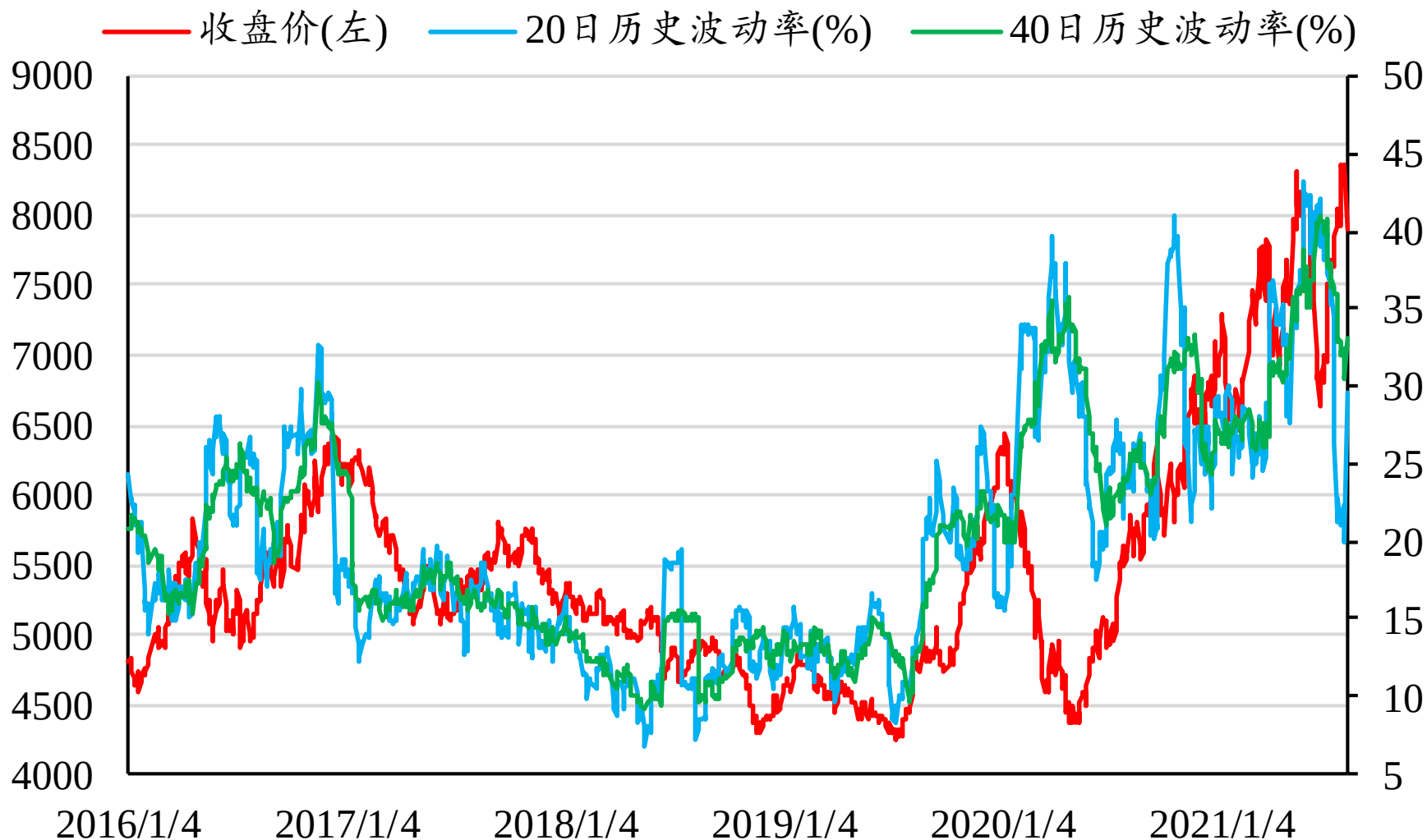
豆粕指数收盘价和历史波动率



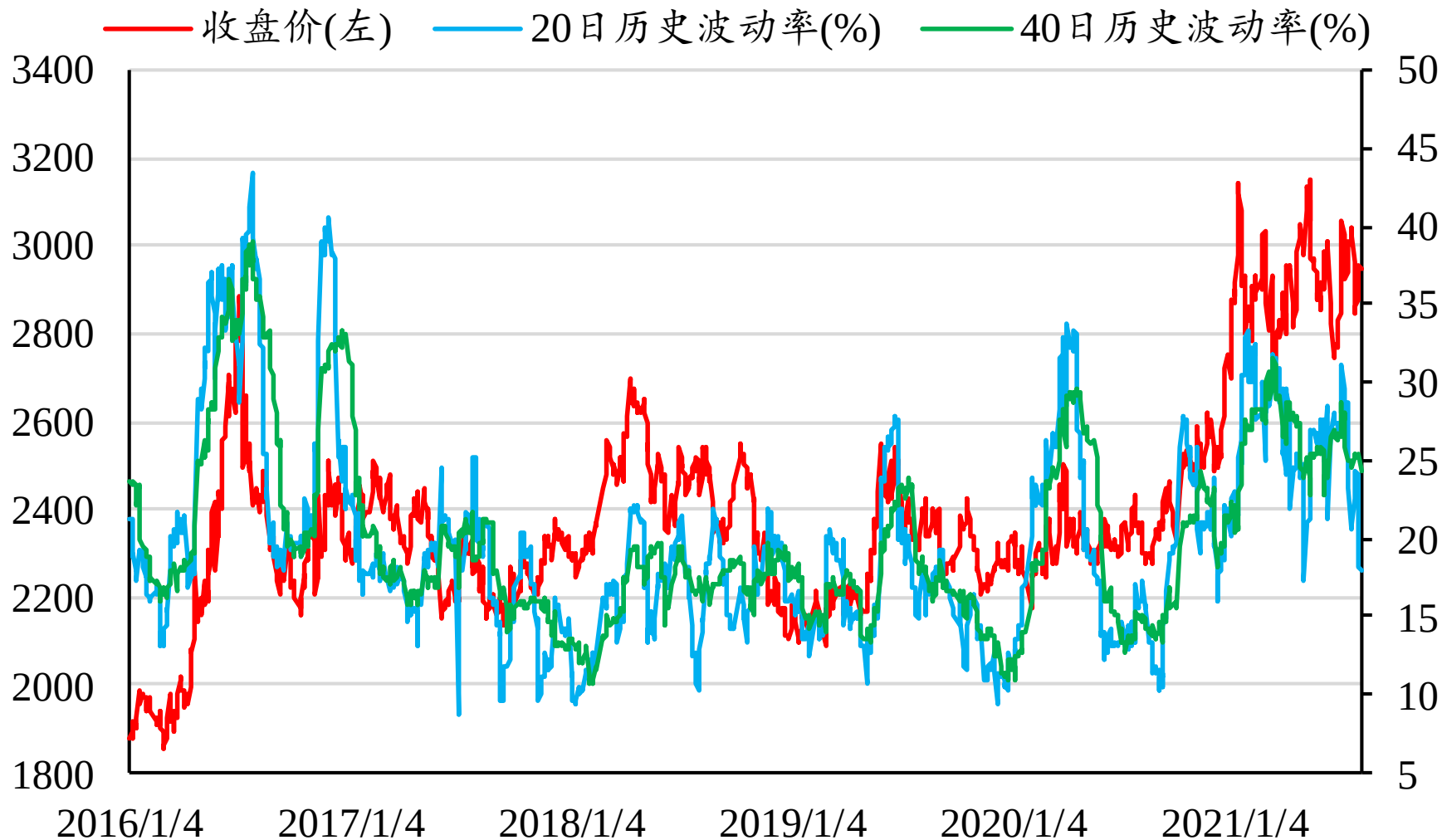
菜油指数收盘价和历史波动率



棕榈指数收盘价和历史波动率

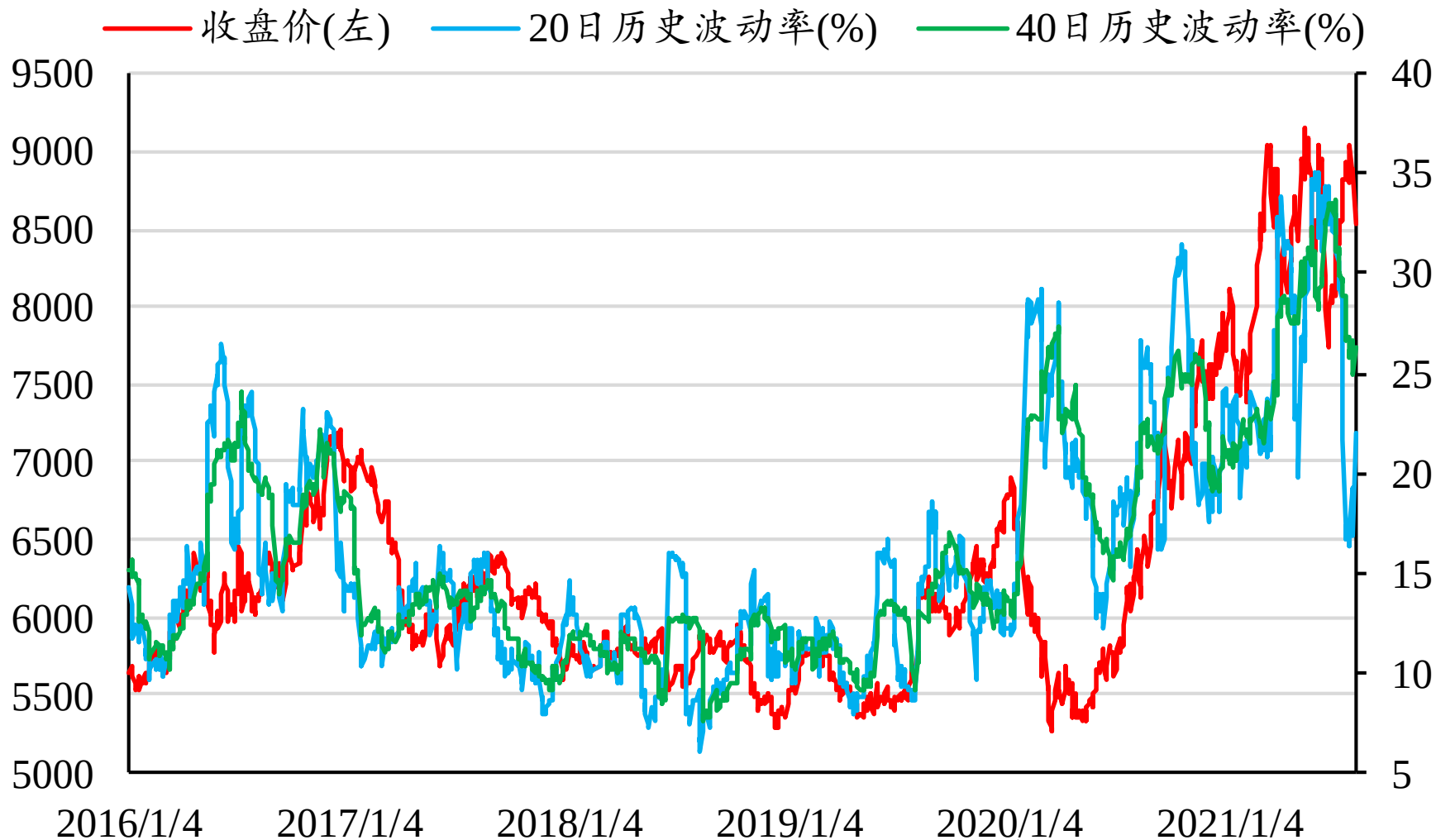


菜粕指数收盘价和历史波动率

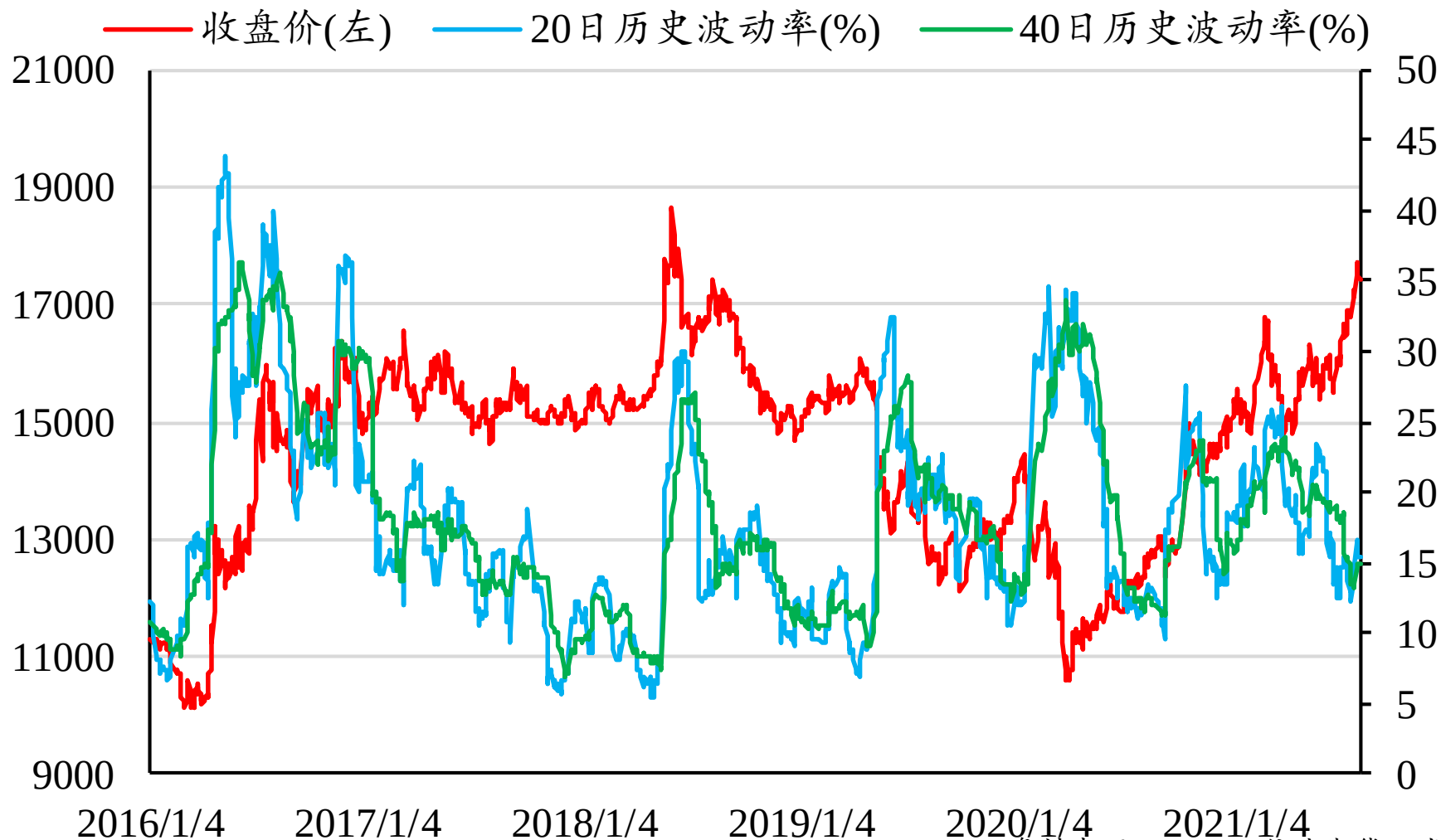


资料来源：Wind、信达期货研发中心

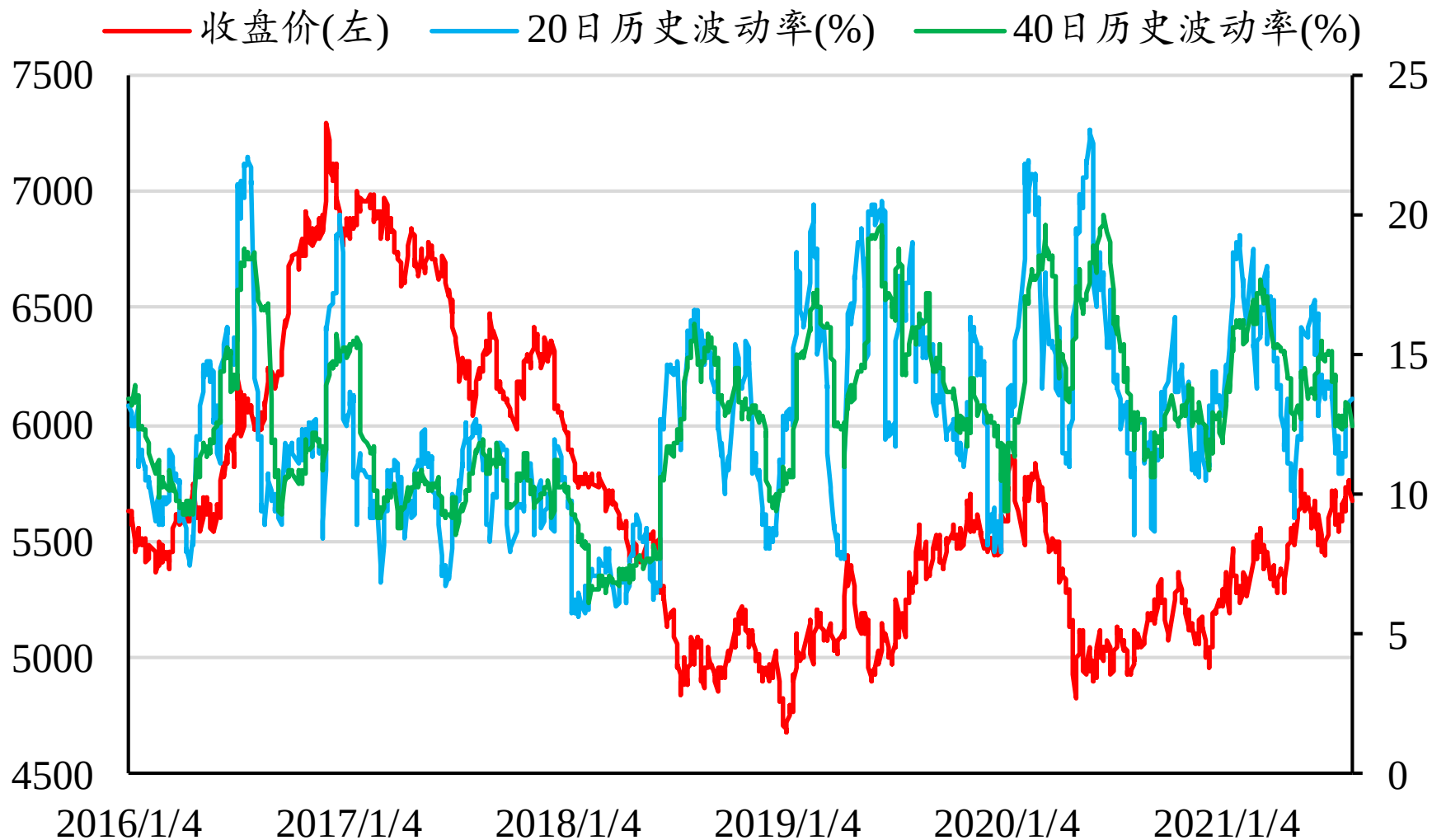
豆油指数指数收盘价和历史波动率



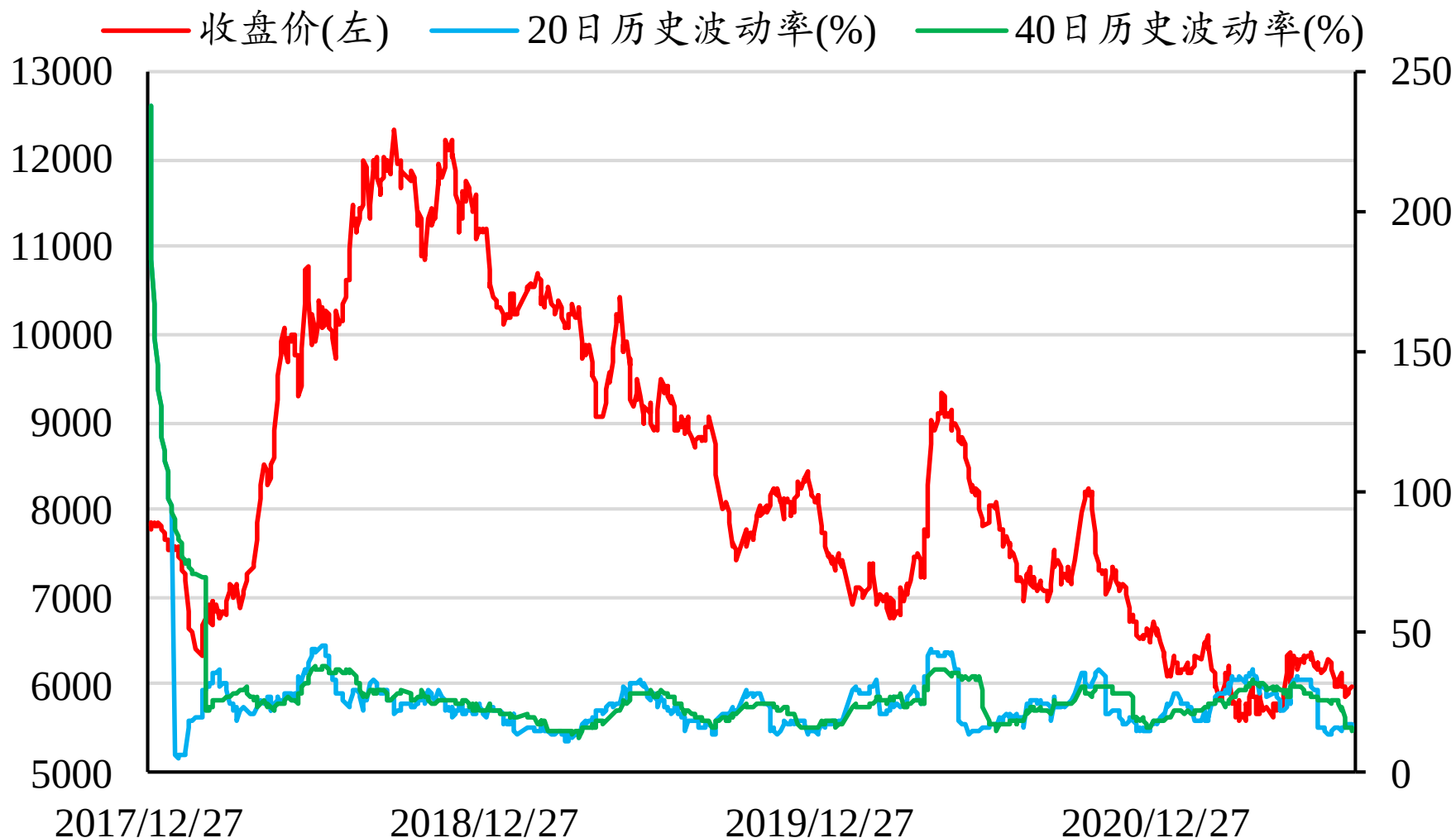
郑棉指数收盘价和历史波动率



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

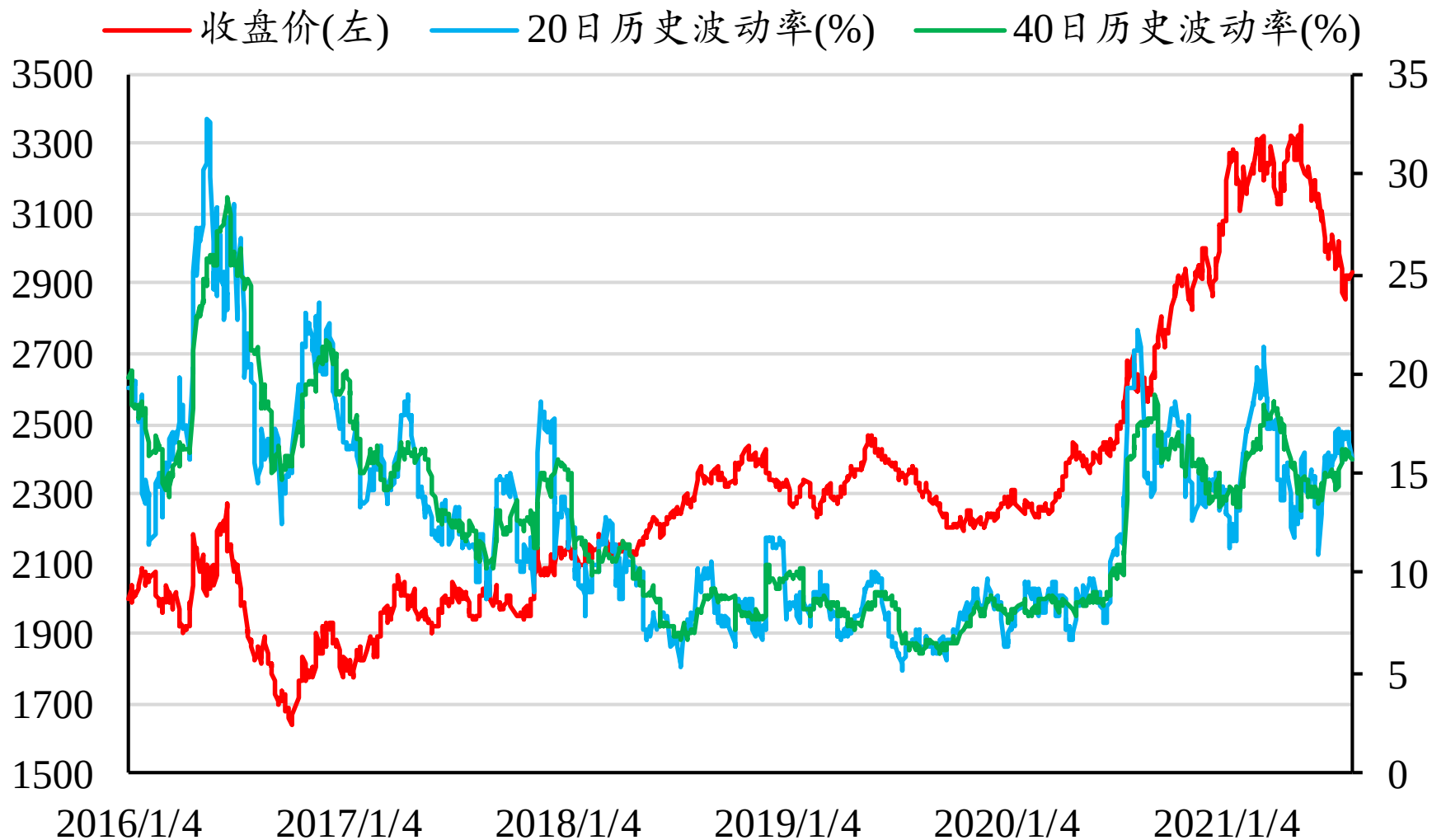


红枣指数收盘价和历史波动率

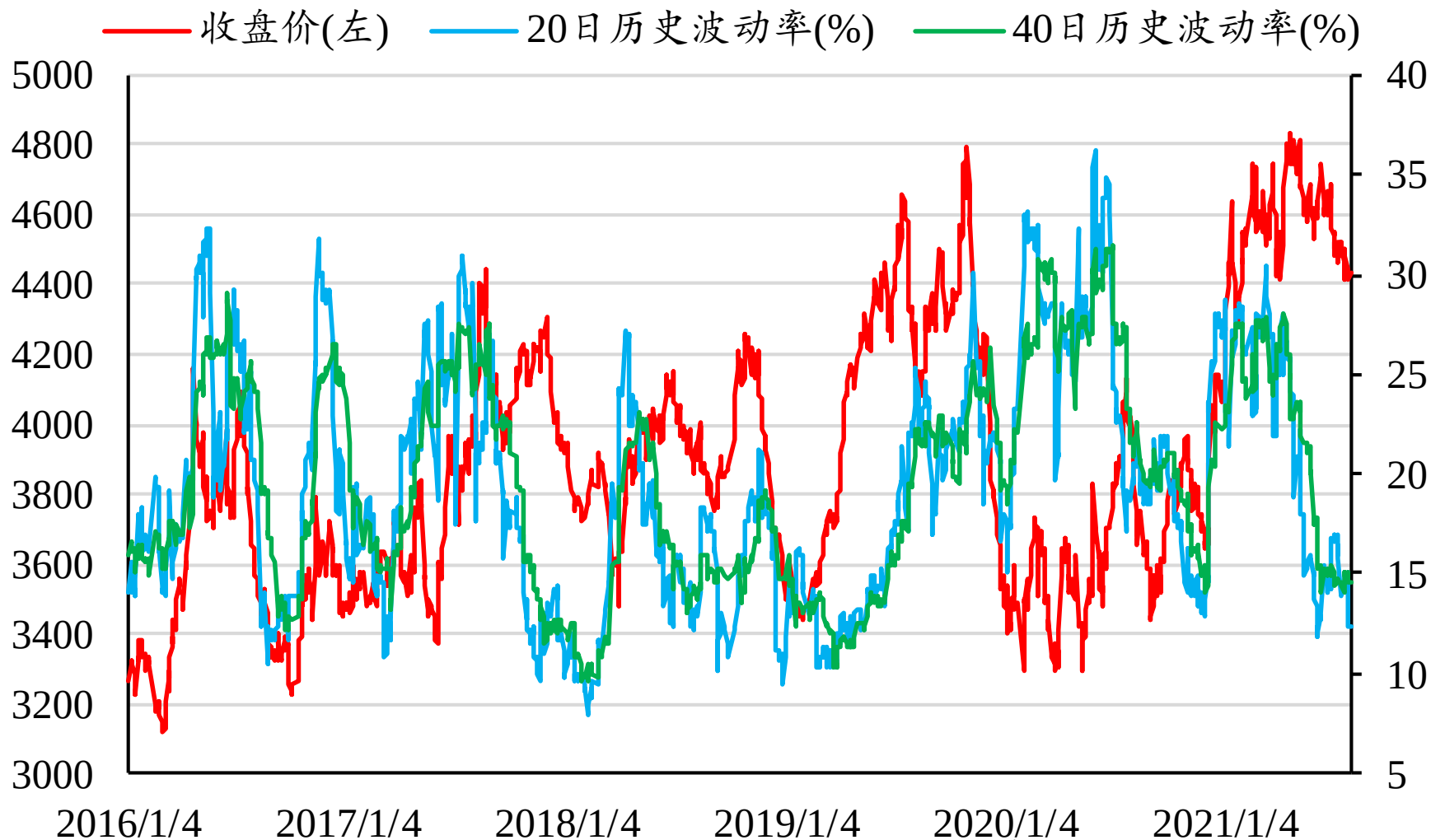


资料来源: Wind、信达期货研发中心

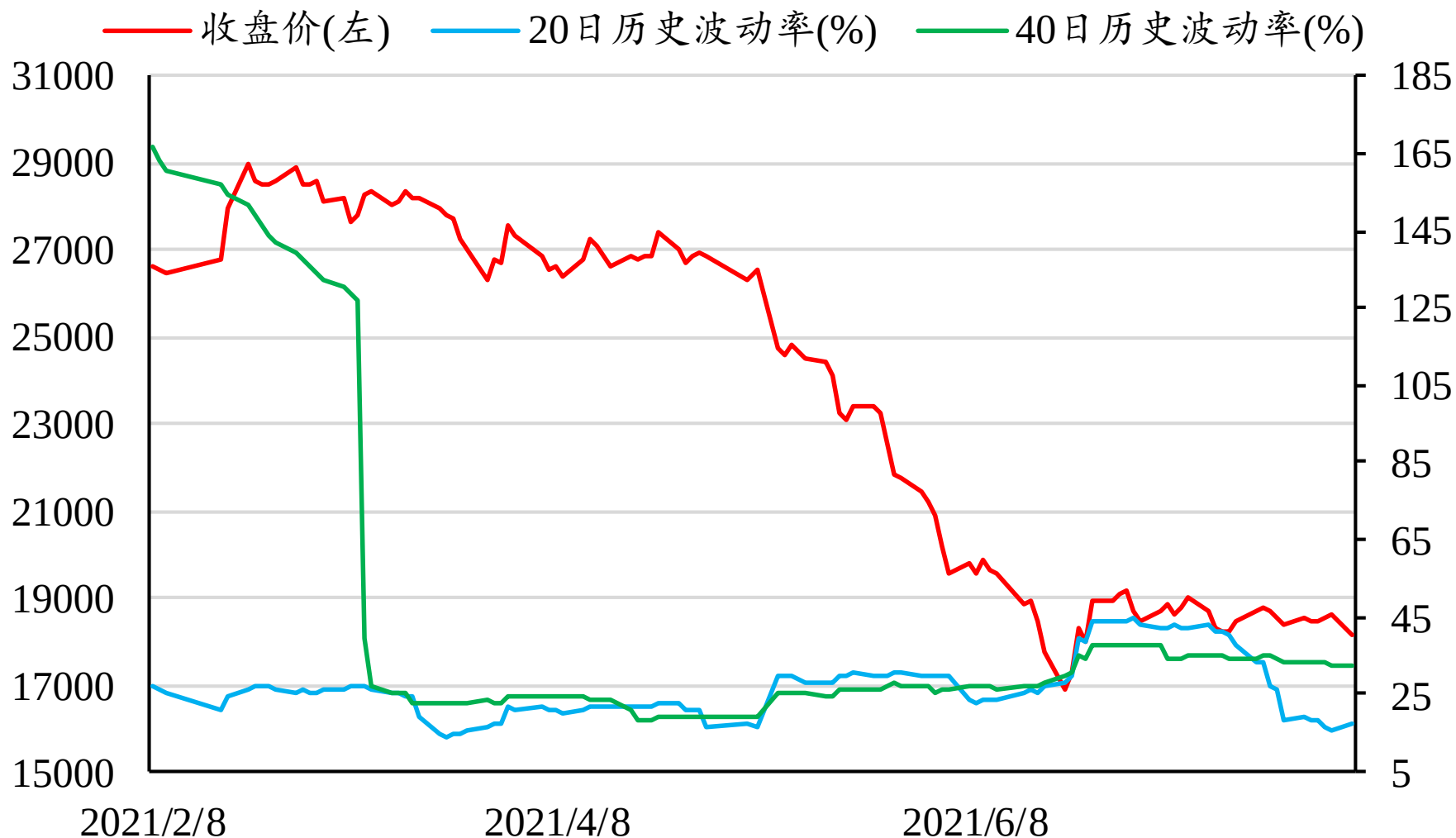
淀粉指数收盘价和历史波动率



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



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。

信达期货研发中心

电话：0571-28132535

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