

# 商品期货波动率跟踪

2021年8月3日

# 主要观点

20日历史波动率绝对值前五：红枣、铁矿、动煤、原油、燃油

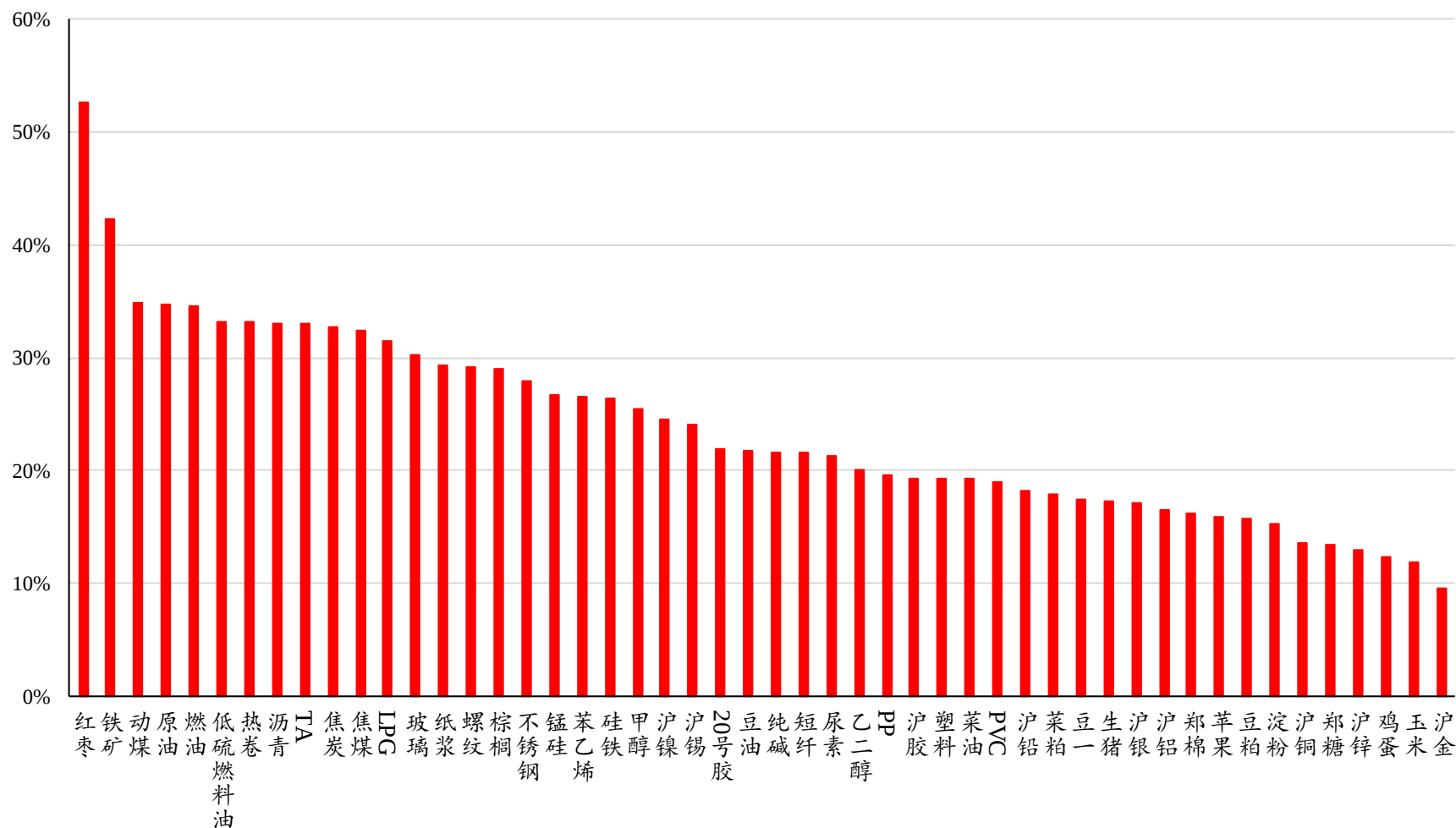
20日历史波动率绝对值后五：沪金、玉米、鸡蛋、沪锌、郑糖

20日历史波动率百分位高于90%：

红枣、不锈钢、TA、纸浆、动煤、玻璃

20日历史波动率百分位低于10%：生猪

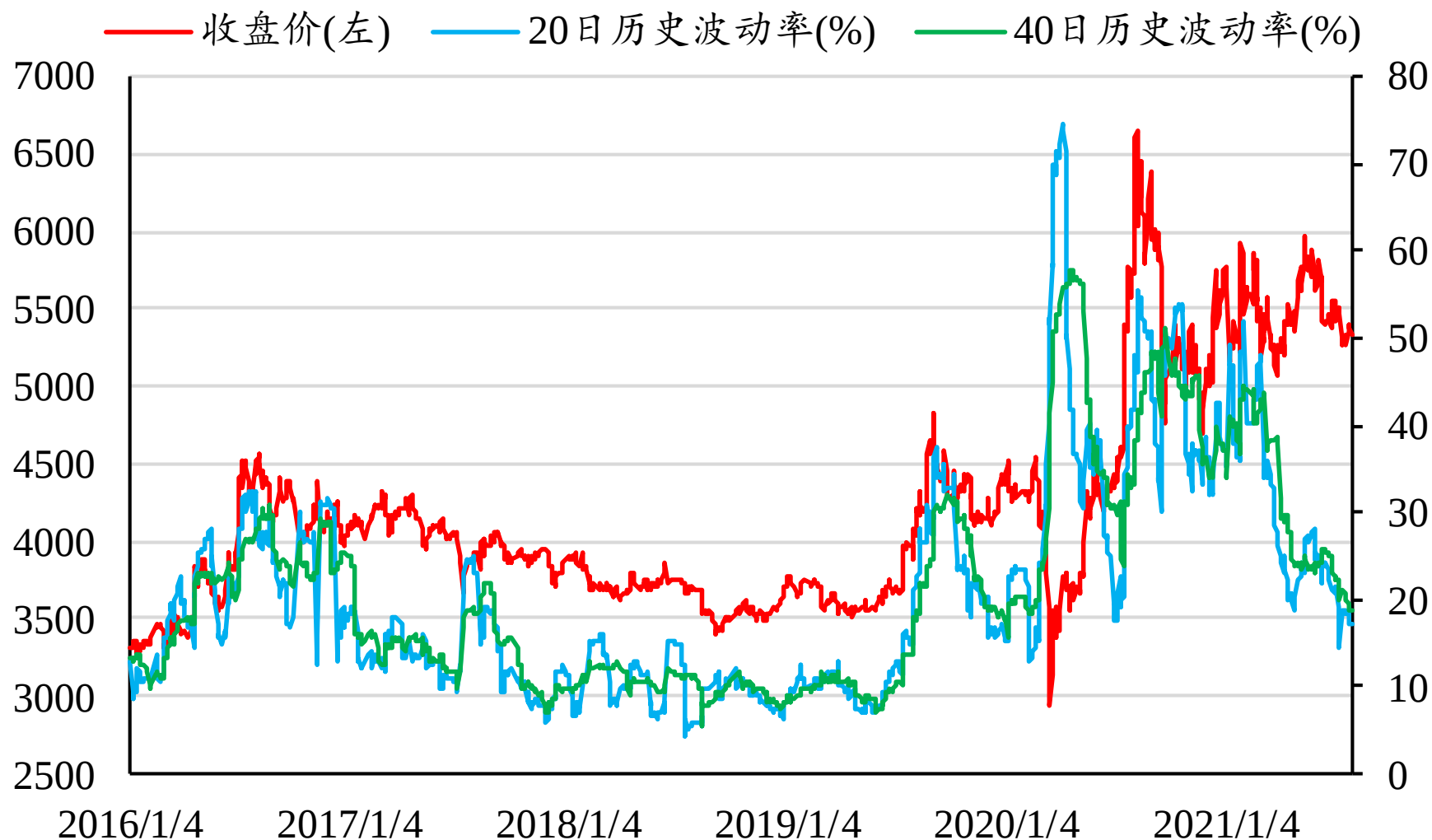
商品期货指数20日历史波动率



# 百分比一览

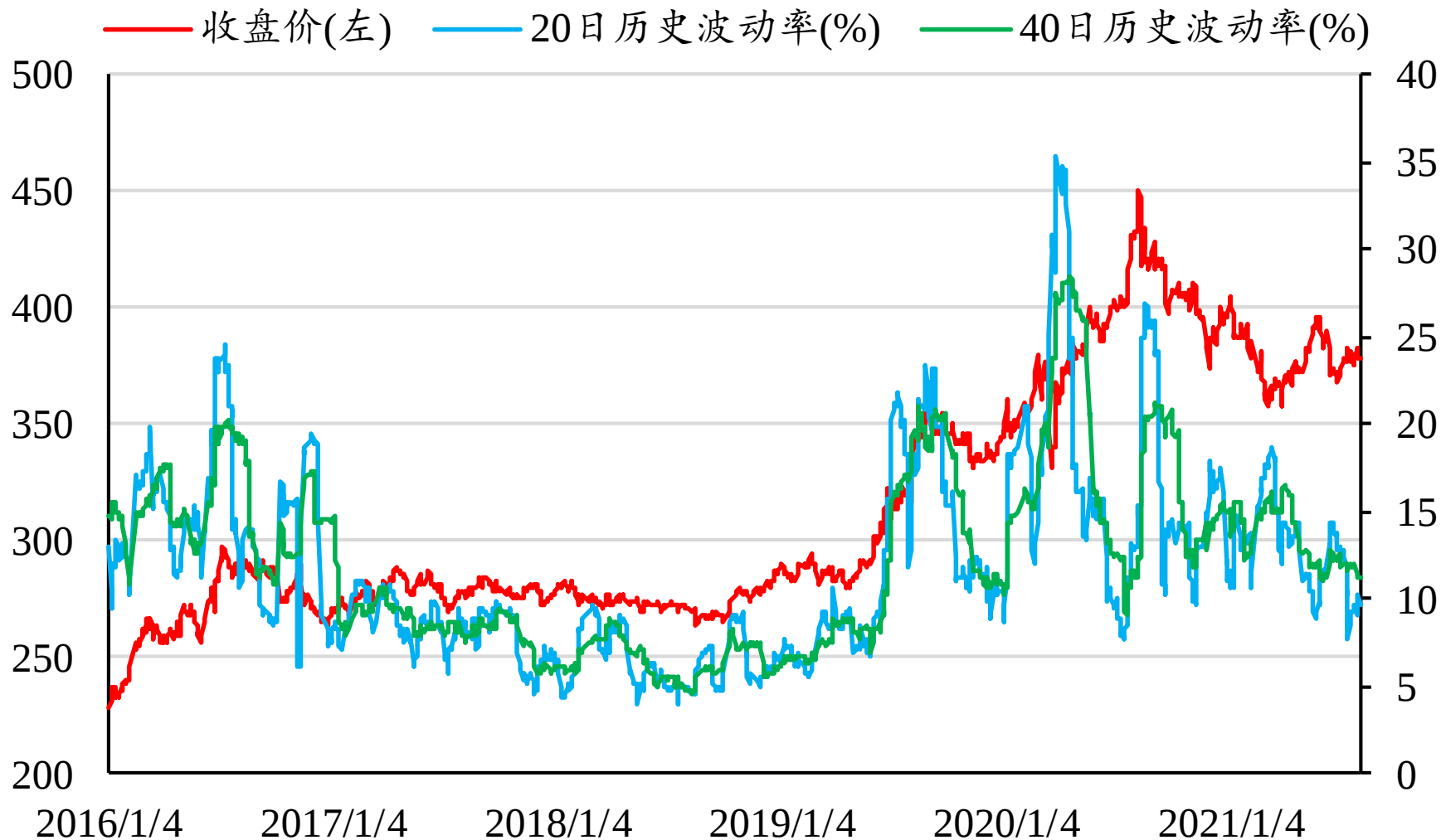
|        |        |        |        |        |        |
|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 沪银指数   | 沪金指数   | 沪铝指数   | 沪铜指数   | 沪镍指数   | 沪铅指数   |
| 49.78% | 44.93% | 69.71% | 39.34% | 61.69% | 60.37% |
| 沪锡指数   | 沪锌指数   | 热卷指数   | 铁矿指数   | 焦炭指数   | 焦煤指数   |
| 84.71% | 11.10% | 81.84% | 77.21% | 59.49% | 64.78% |
| 螺纹指数   | 硅铁指数   | 锰硅指数   | 不锈钢指数  | 玻璃指数   | PVC指数  |
| 70.74% | 74.71% | 71.18% | 93.54% | 91.47% | 58.90% |
| 燃油指数   | 低硫燃料油  | LPG指数  | 原油指数   | 动煤指数   | 沥青指数   |
| 76.91% | 65.81% | 77.44% | 68.05% | 91.76% | 76.40% |
| 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   |
| 50.22% | 46.81% | 63.90% | 63.38% | 28.75% | 31.50% |
| PP指数   | 沪胶指数   | 纯碱指数   | 纸浆指数   | TA指数   | 尿素指数   |
| 55.96% | 23.97% | 39.05% | 91.87% | 92.57% | 58.84% |
| 玉米指数   | 豆一指数   | 豆粕指数   | 菜油指数   | 棕榈指数   | 菜粕指数   |
| 64.63% | 66.32% | 47.21% | 77.06% | 86.32% | 45.00% |
| 豆油指数   | 郑棉指数   | 郑糖指数   | 苹果指数   | 红枣指数   | 淀粉指数   |
| 81.84% | 50.07% | 61.25% | 15.89% | 99.27% | 70.00% |
| 鸡蛋指数   | 生猪指数   |        |        |        |        |
| 10.96% | 8.03%  |        |        |        |        |

## 沪银指数收盘价和历史波动率走势

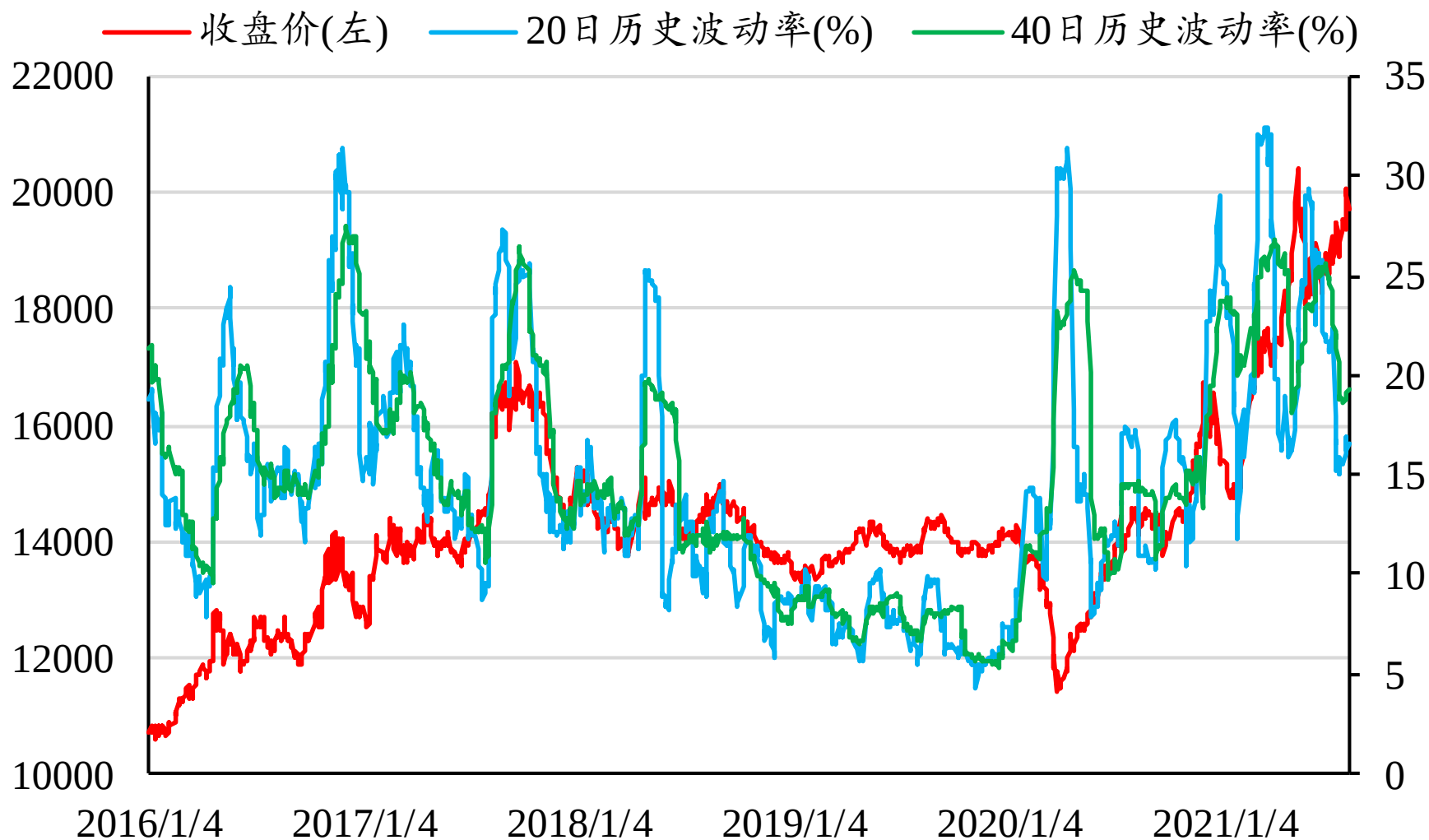


资料来源: Wind、信达期货研发中心

## 沪金指数收盘价和历史波动率

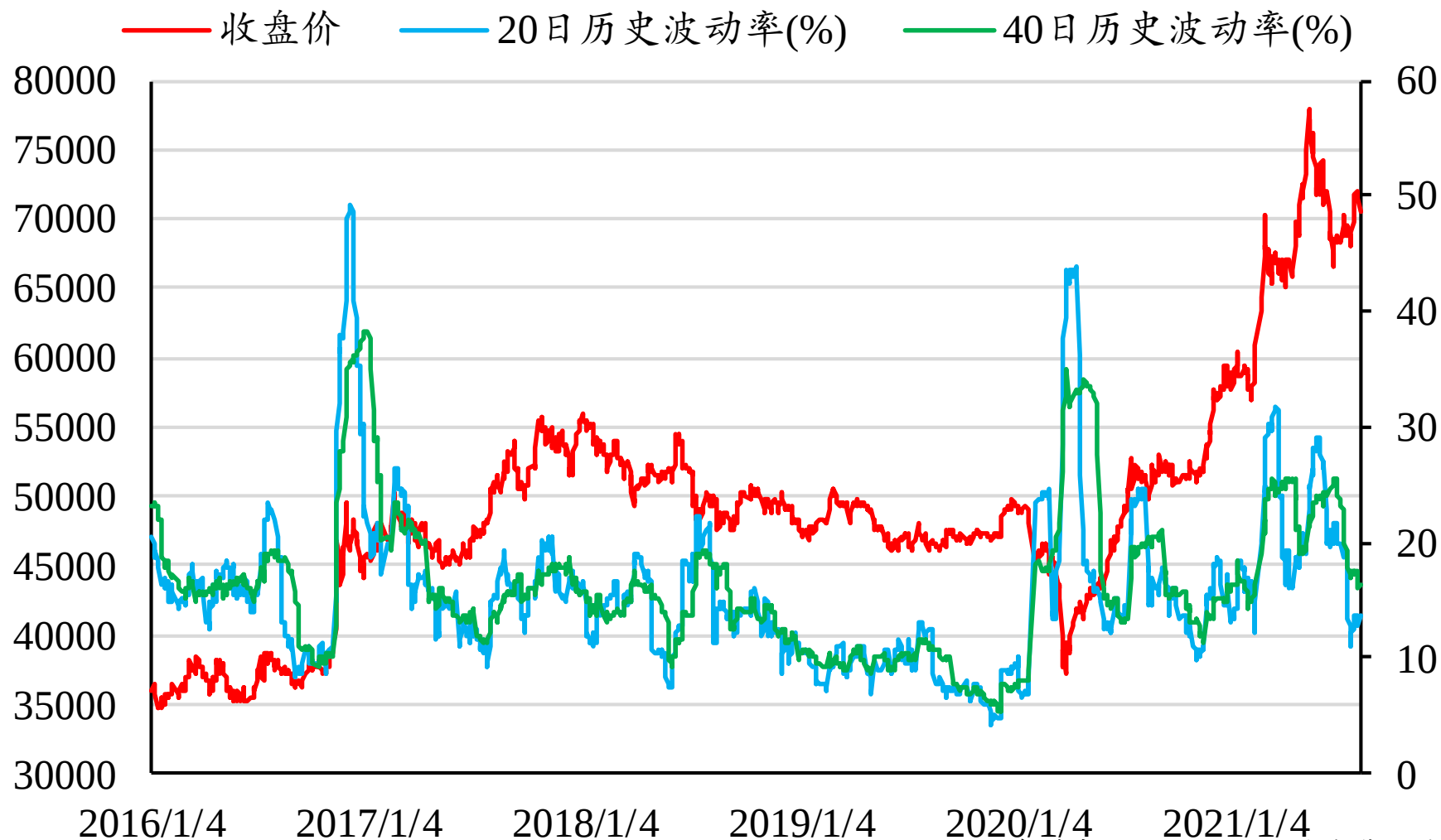


## 沪铝指数收盘价和历史波动率

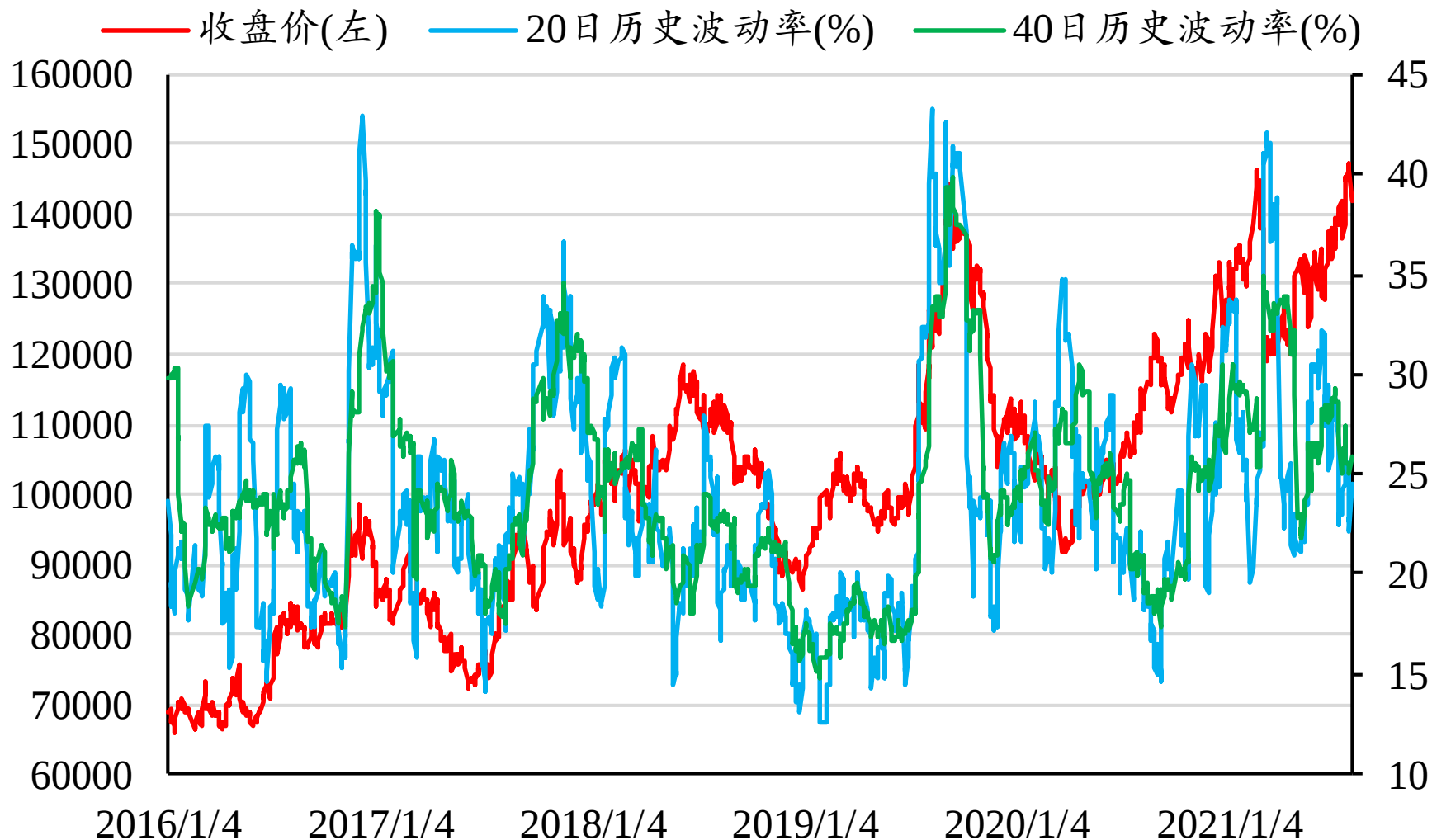


资料来源: Wind、信达期货研发中心

## 沪铜指数收盘价和历史波动率

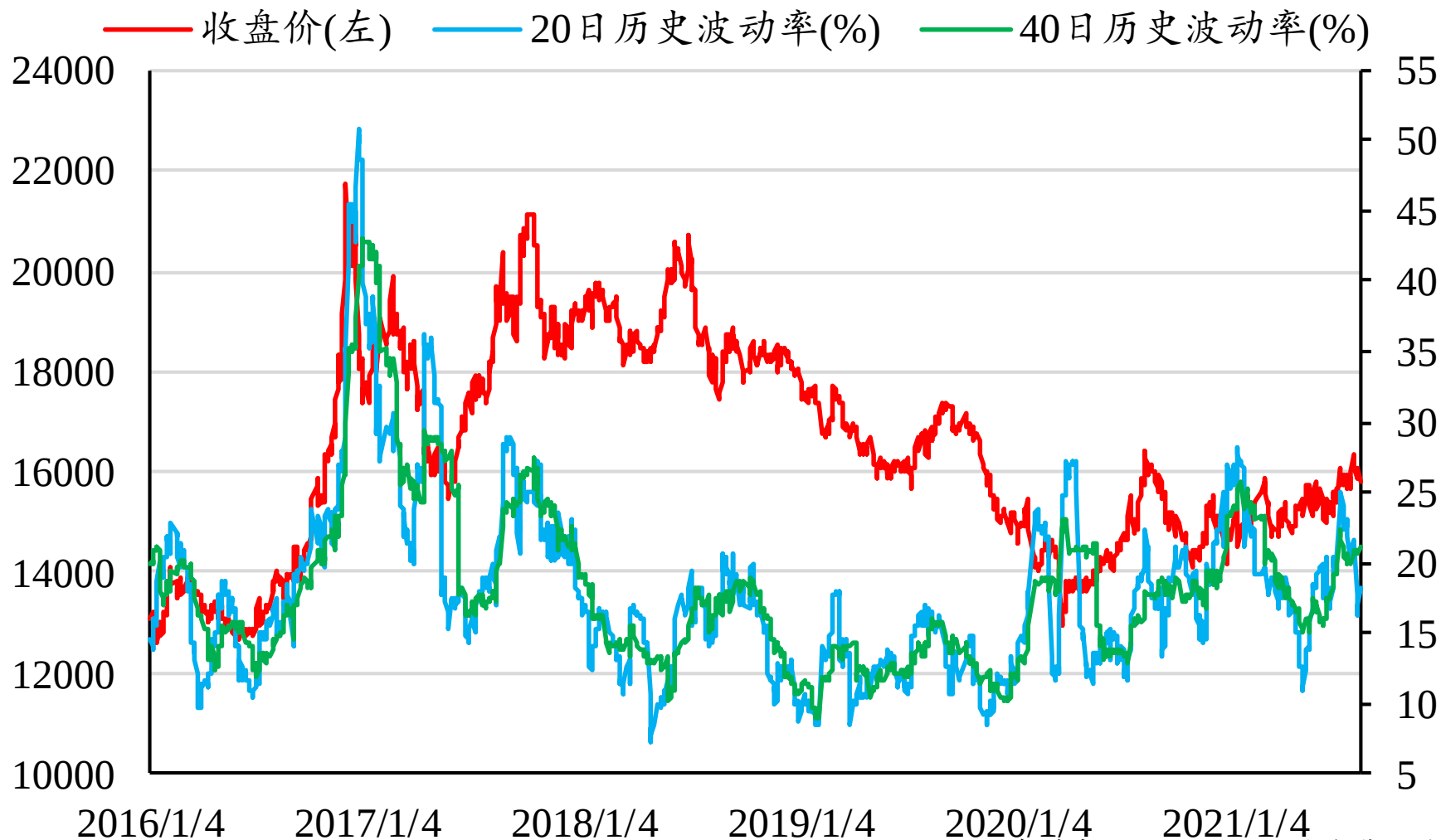


## 沪镍指数收盘价和历史波动率

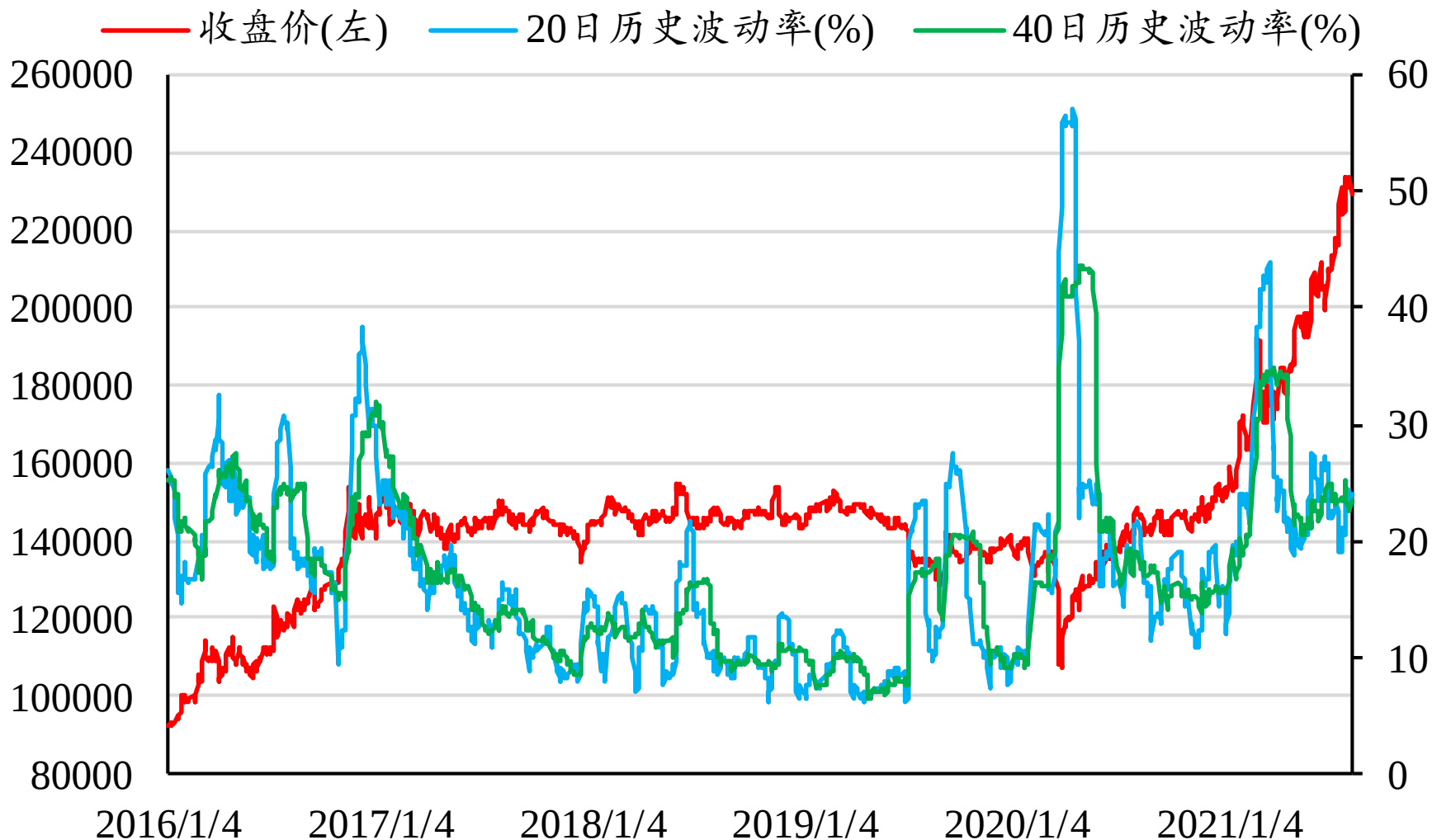


资料来源: Wind、信达期货研发中心

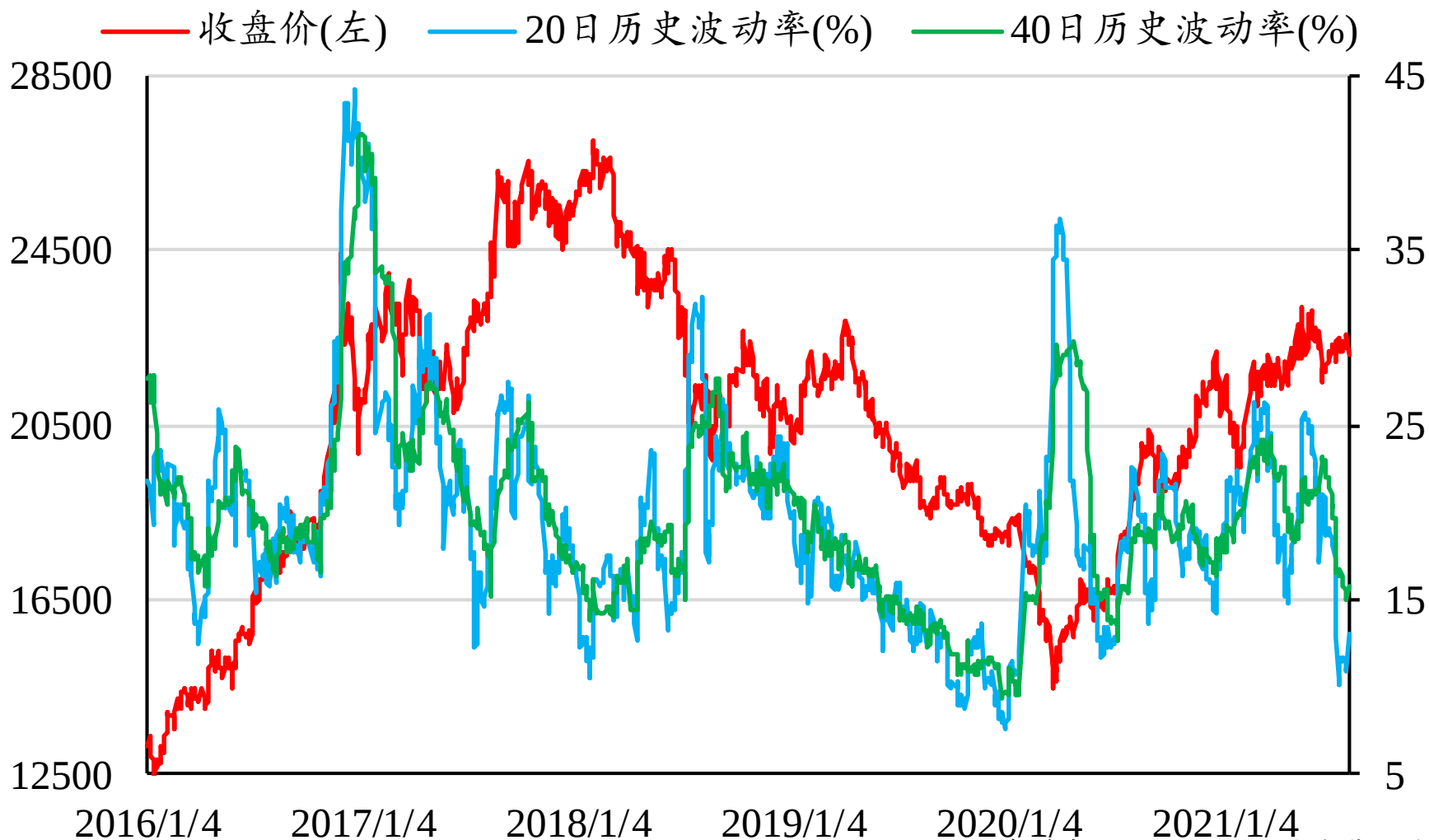
## 沪铅指数收盘价和历史波动率



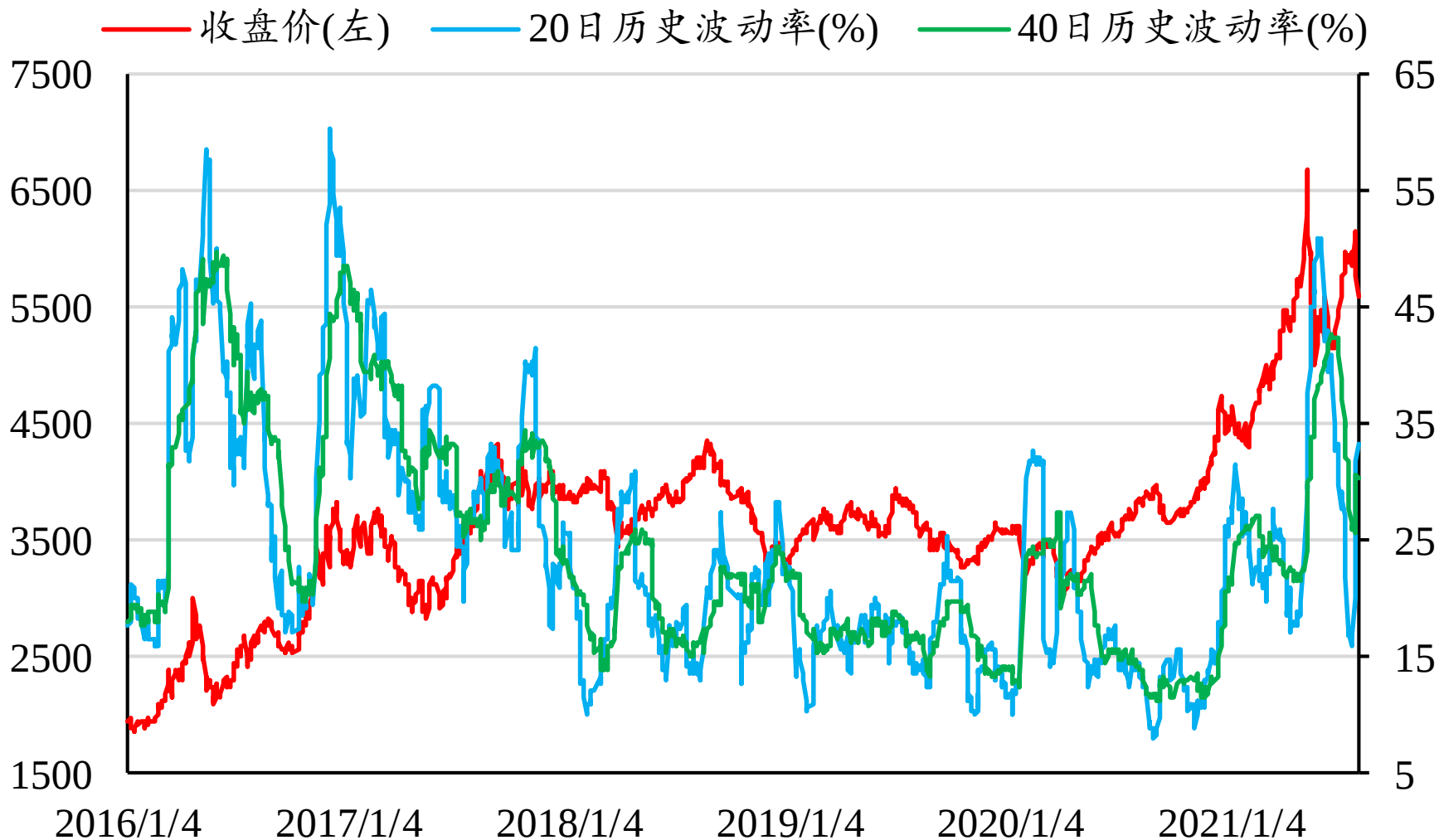
## 沪锡指数收盘价和历史波动率



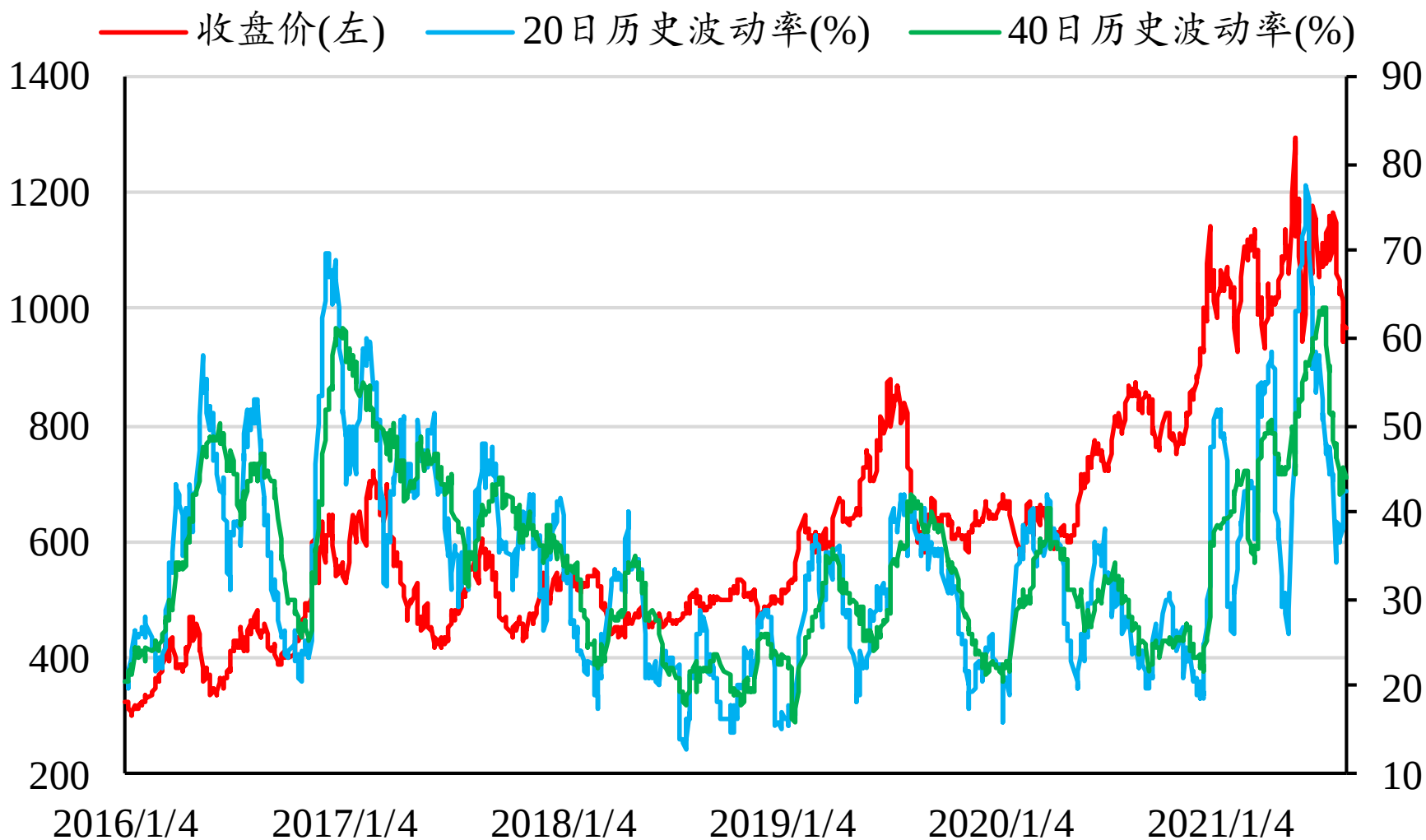
## 沪锌指数收盘价和历史波动率



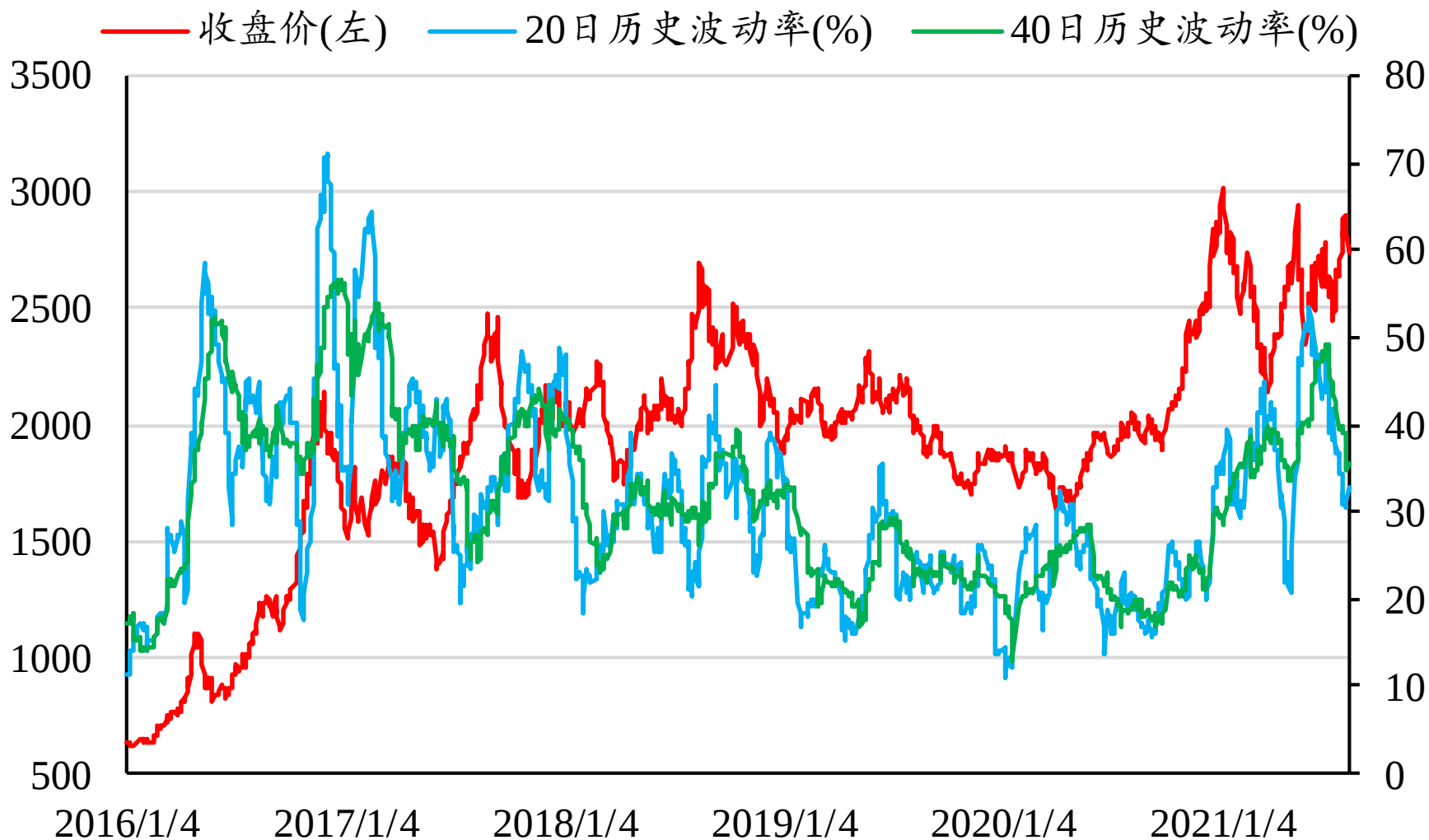
## 热卷指数收盘价和历史波动率



## 铁矿指数收盘价和历史波动率

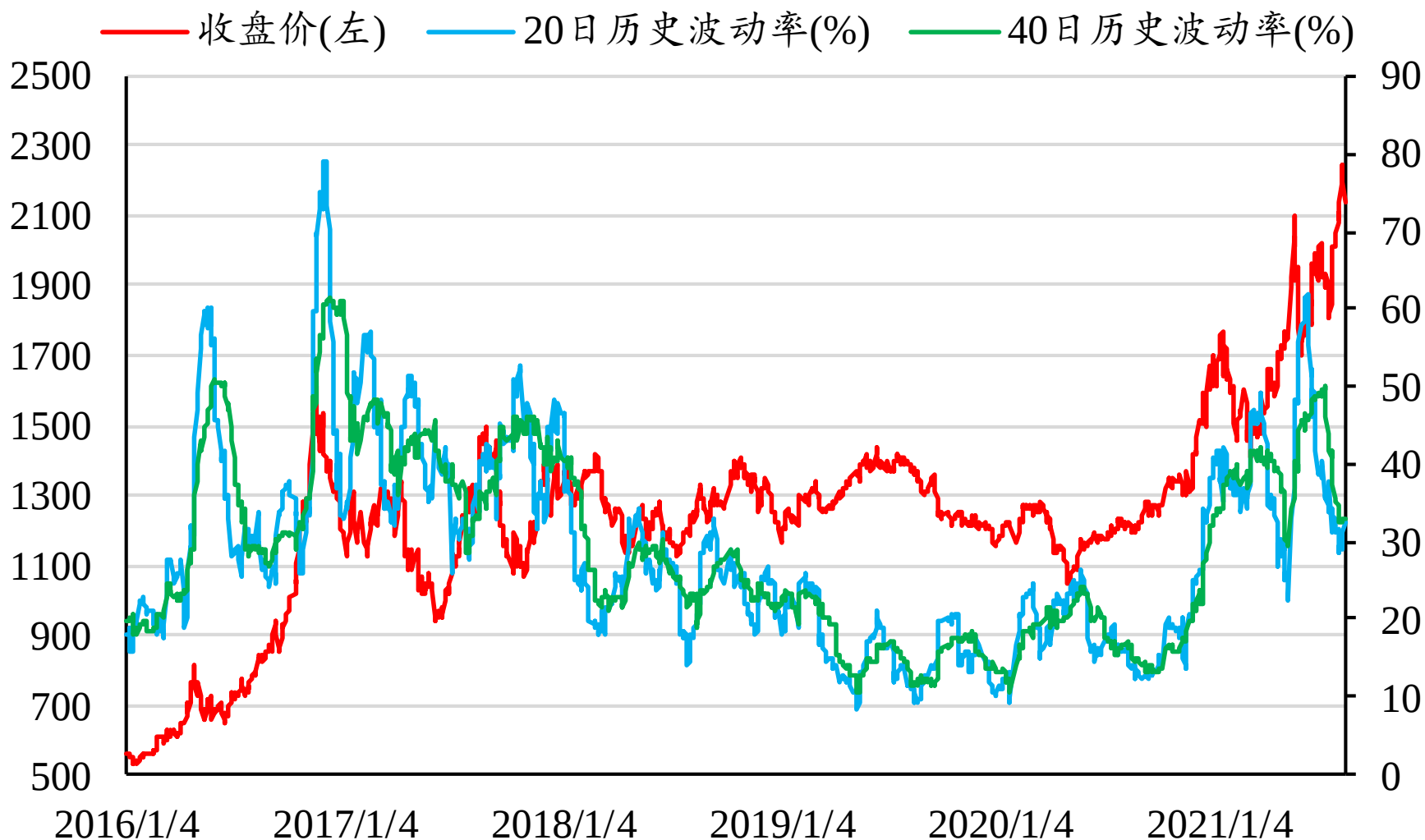


## 焦炭指数收盘价和历史波动率

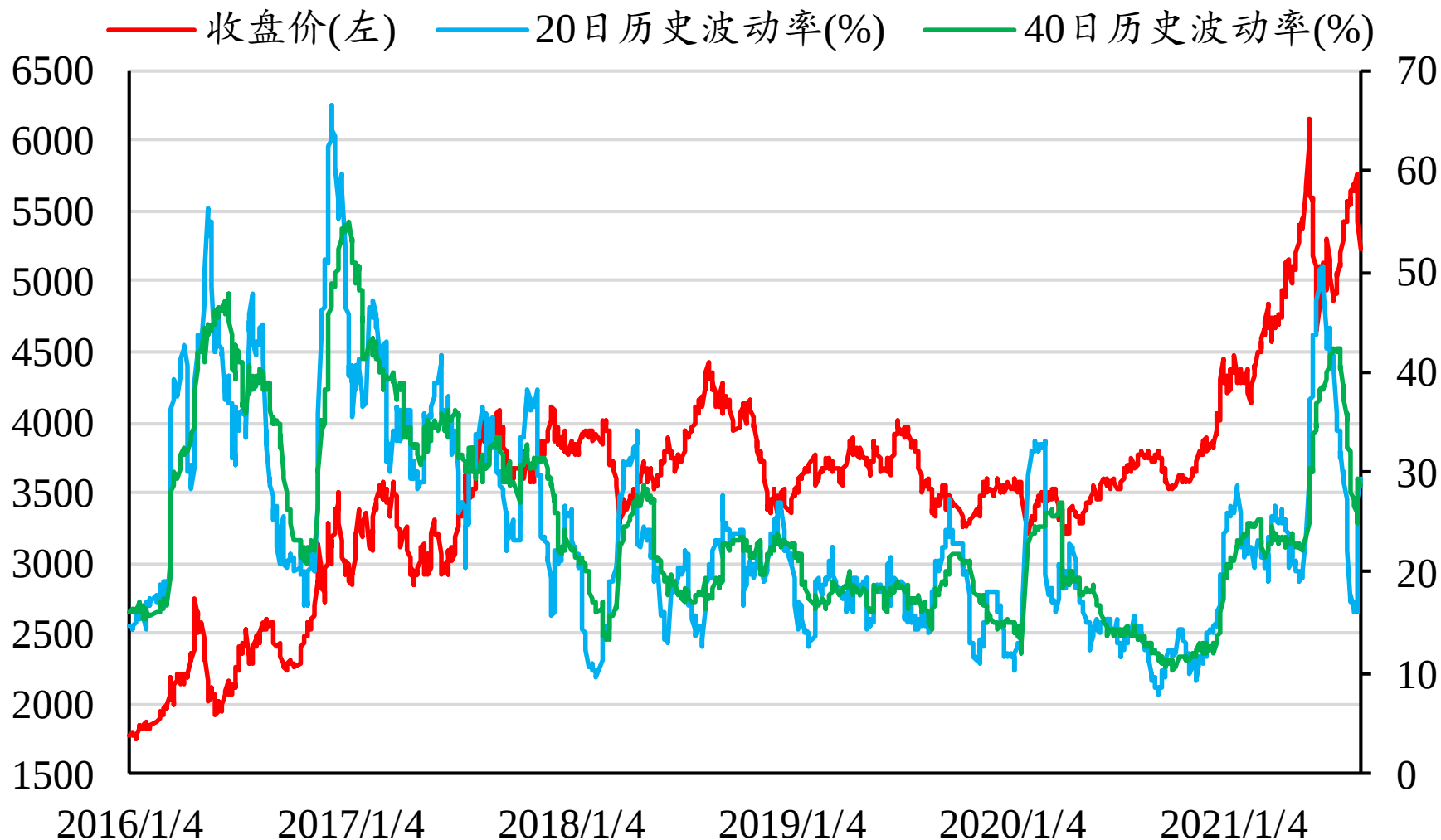


资料来源: Wind、信达期货研发中心

## 焦煤指数收盘价和历史波动率

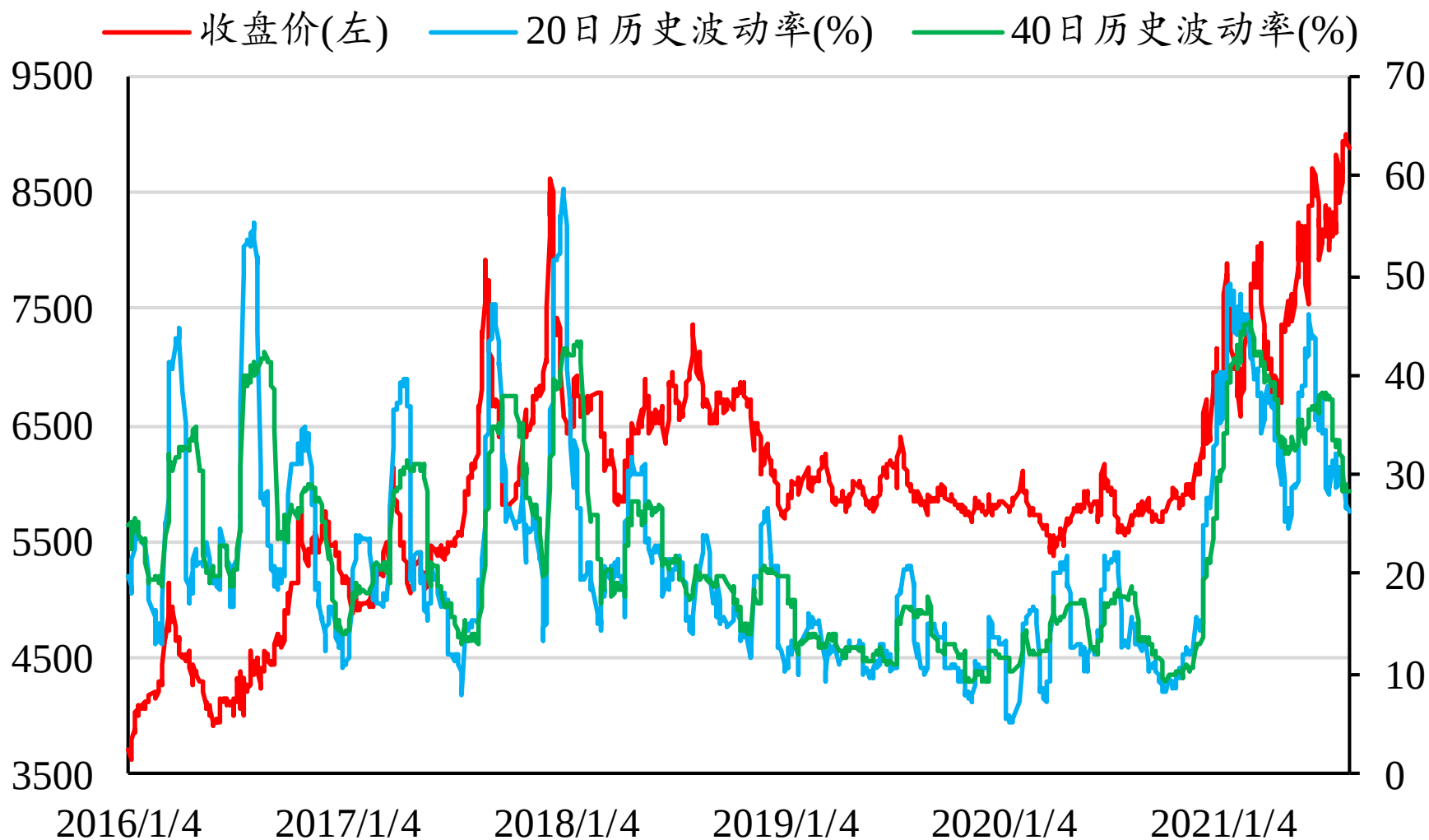


## 螺纹指数收盘价和历史波动率

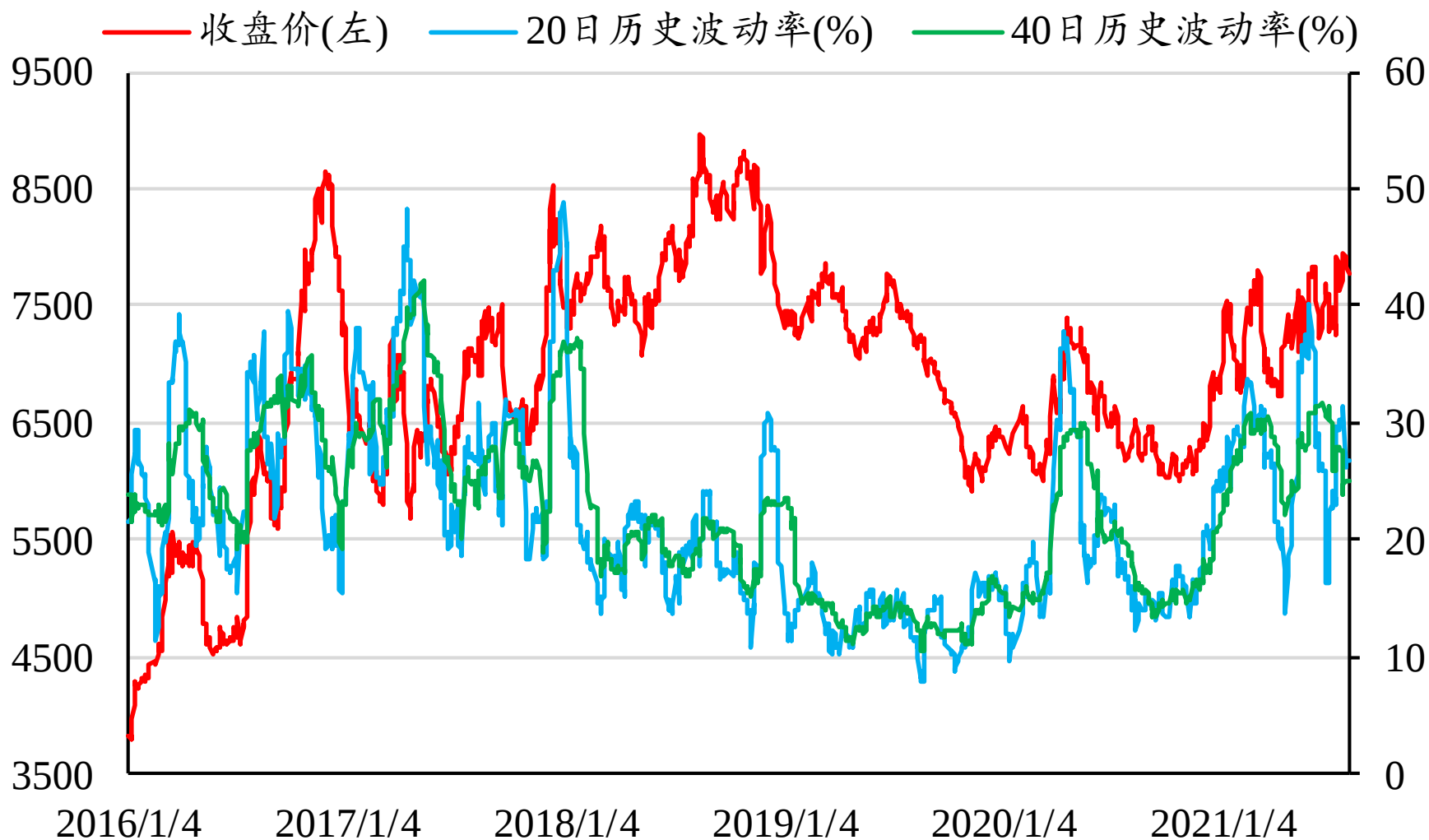


资料来源: Wind、信达期货研发中心

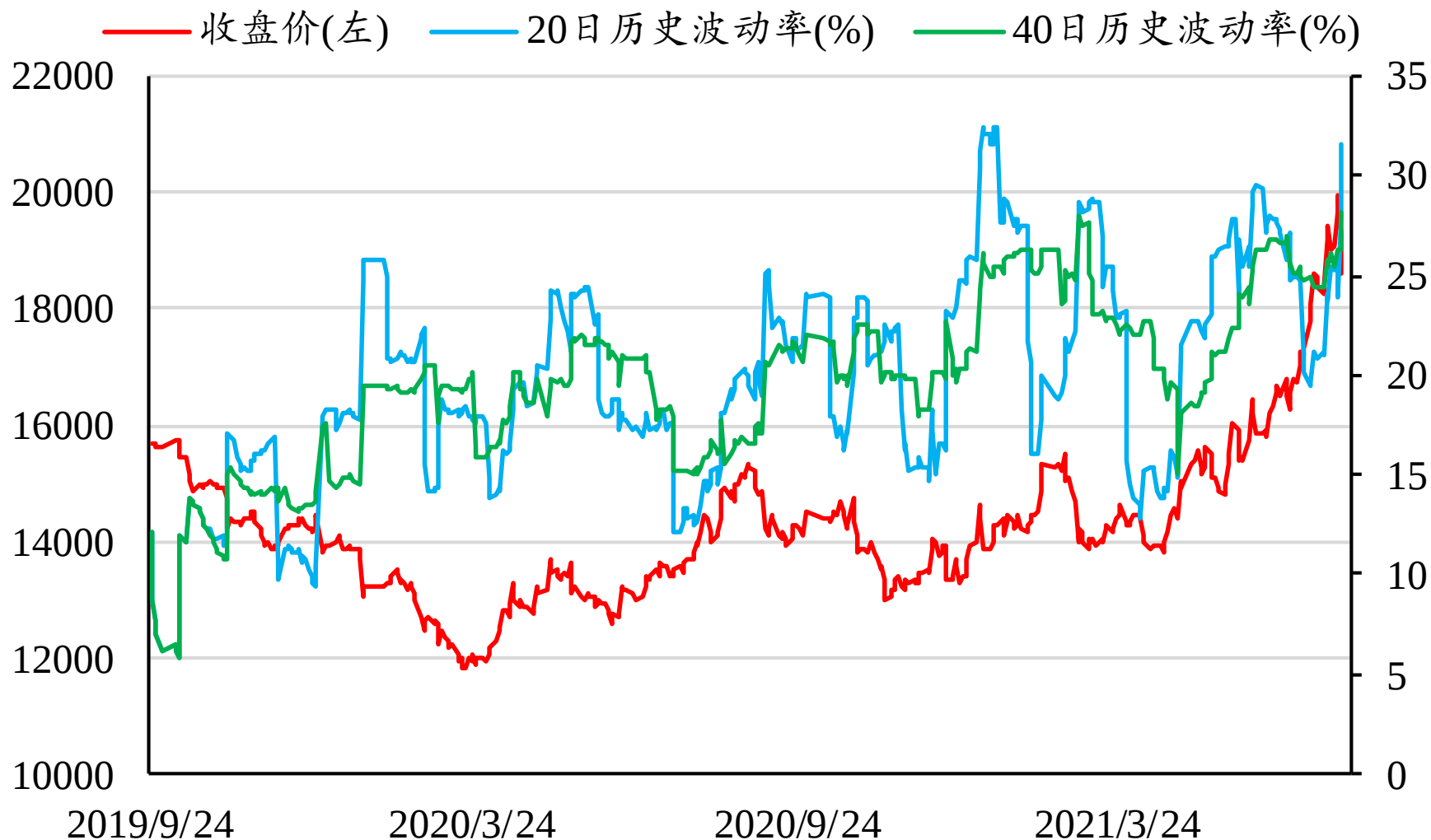
## 硅铁指数收盘价和历史波动率



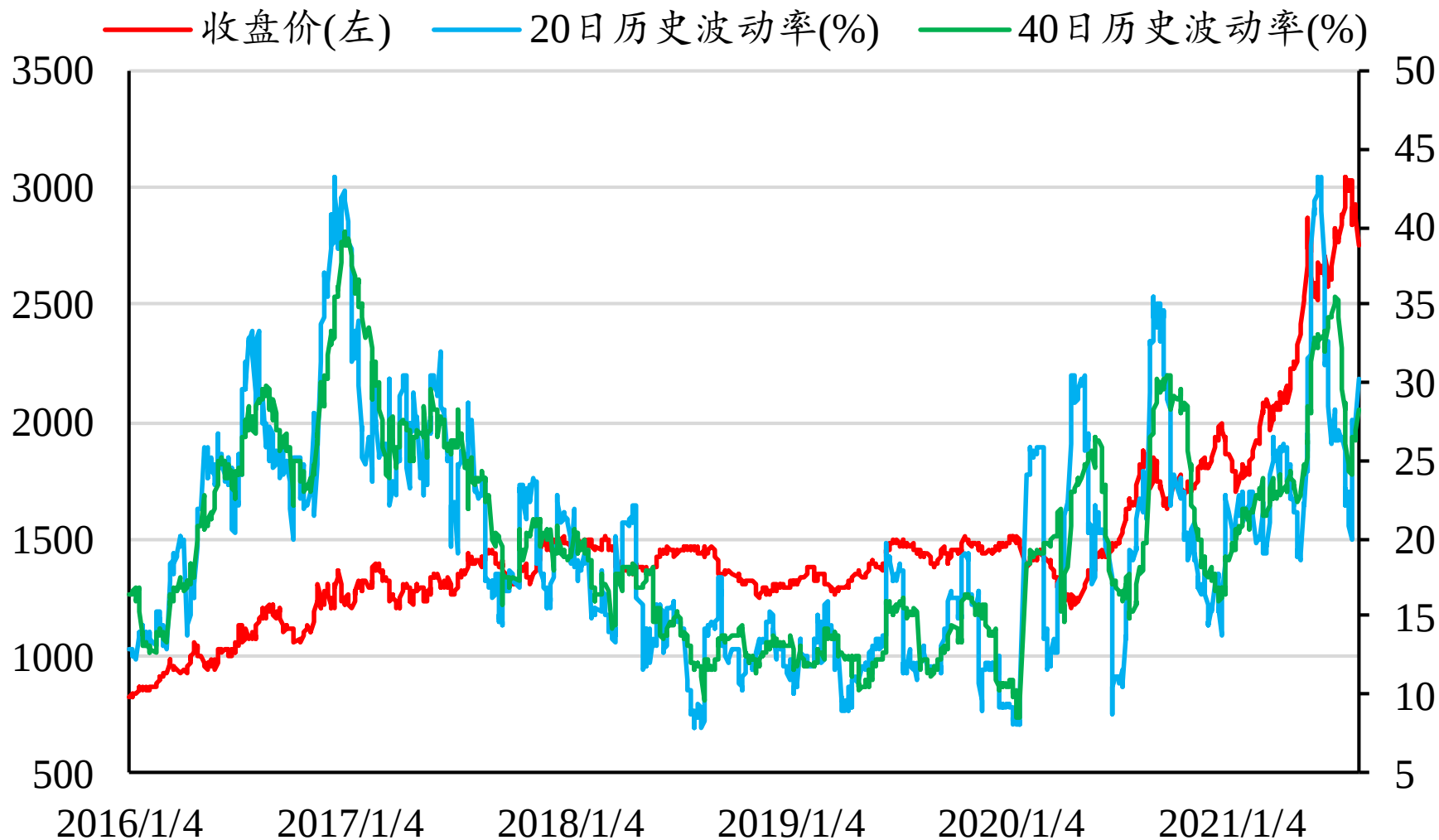
## 锰硅指数收盘价和历史波动率



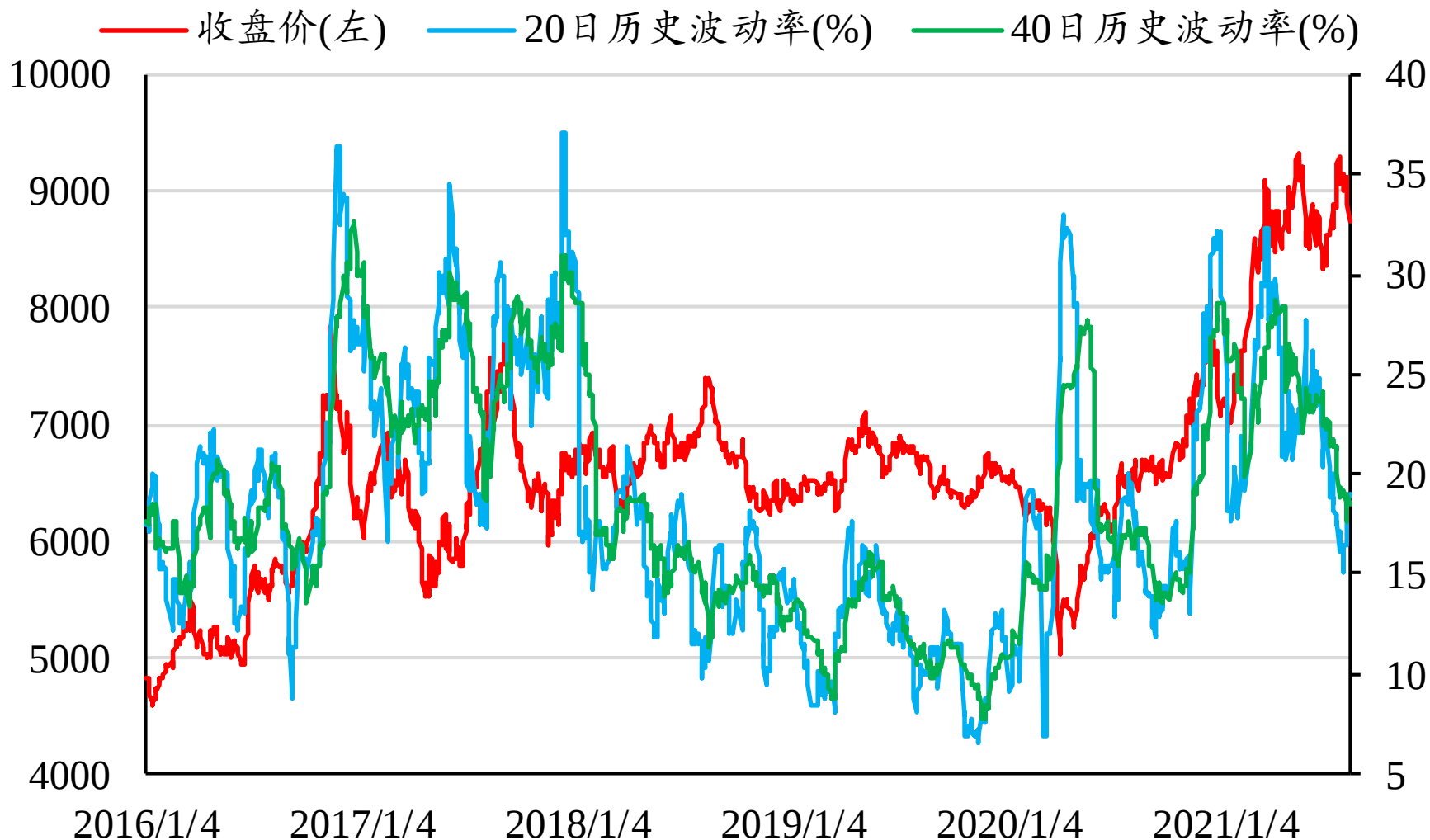
## 不锈钢指数收盘价和历史波动率



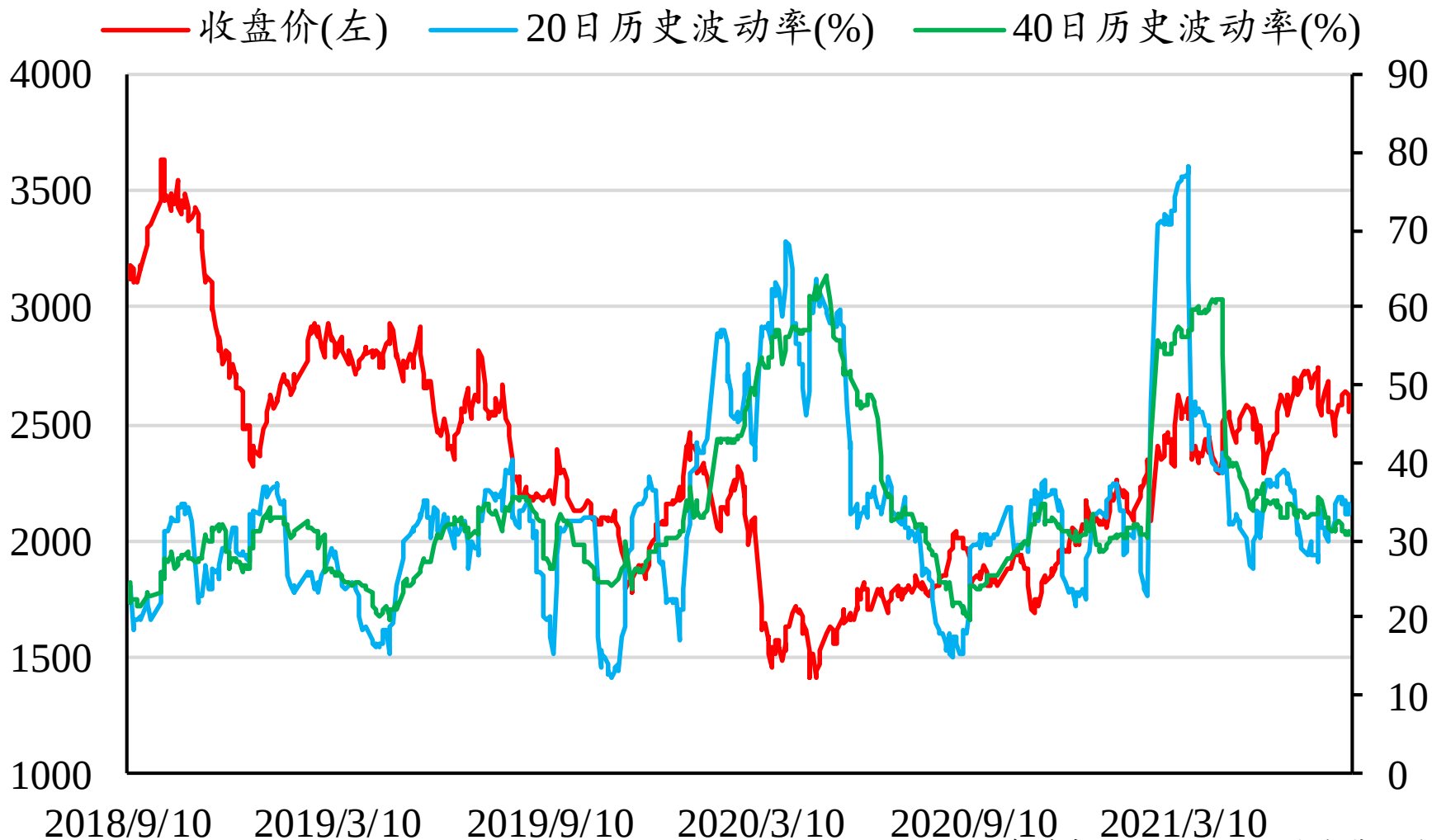
## 玻璃指数收盘价和历史波动率



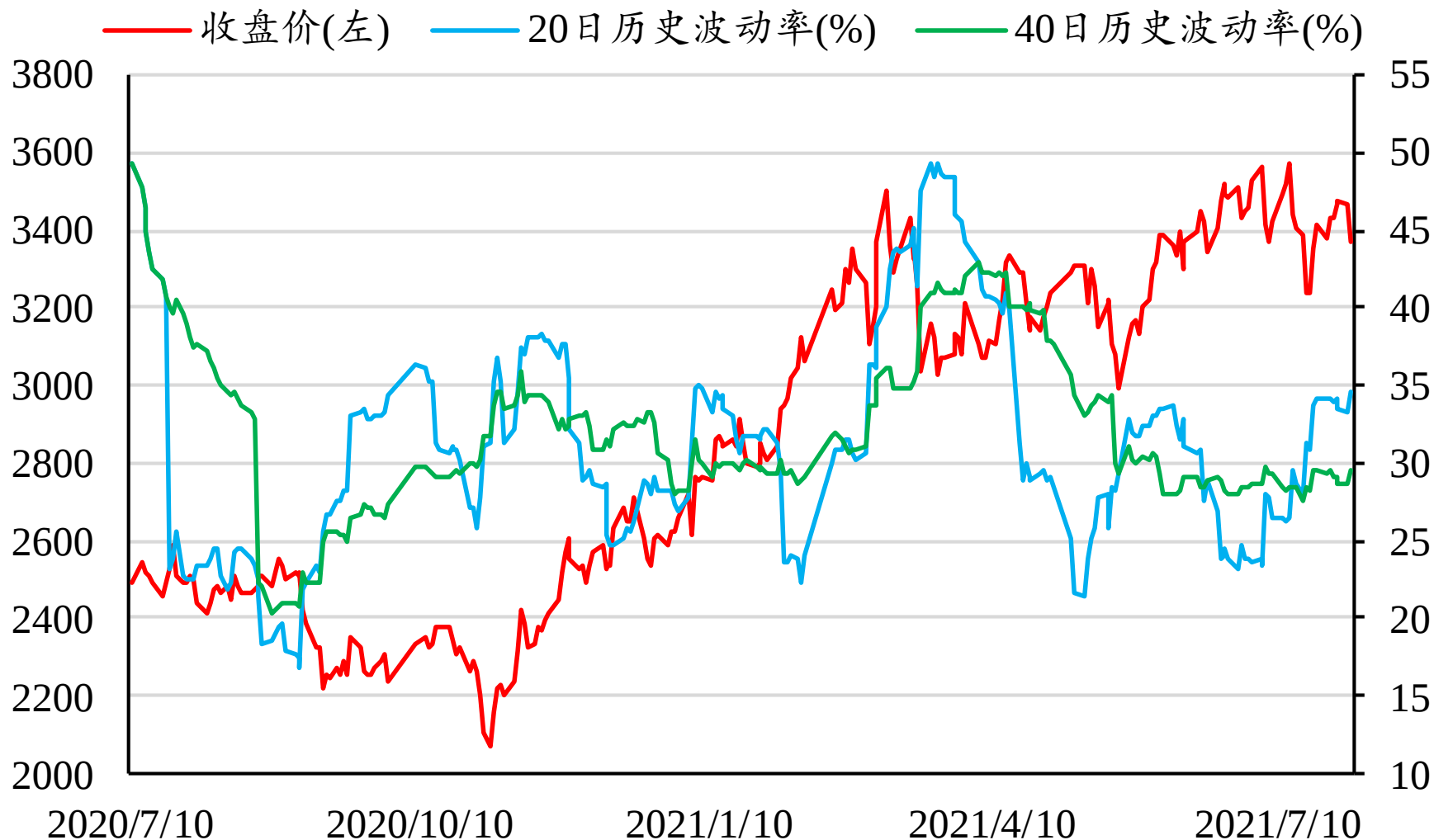
## PVC指数收盘价和历史波动率



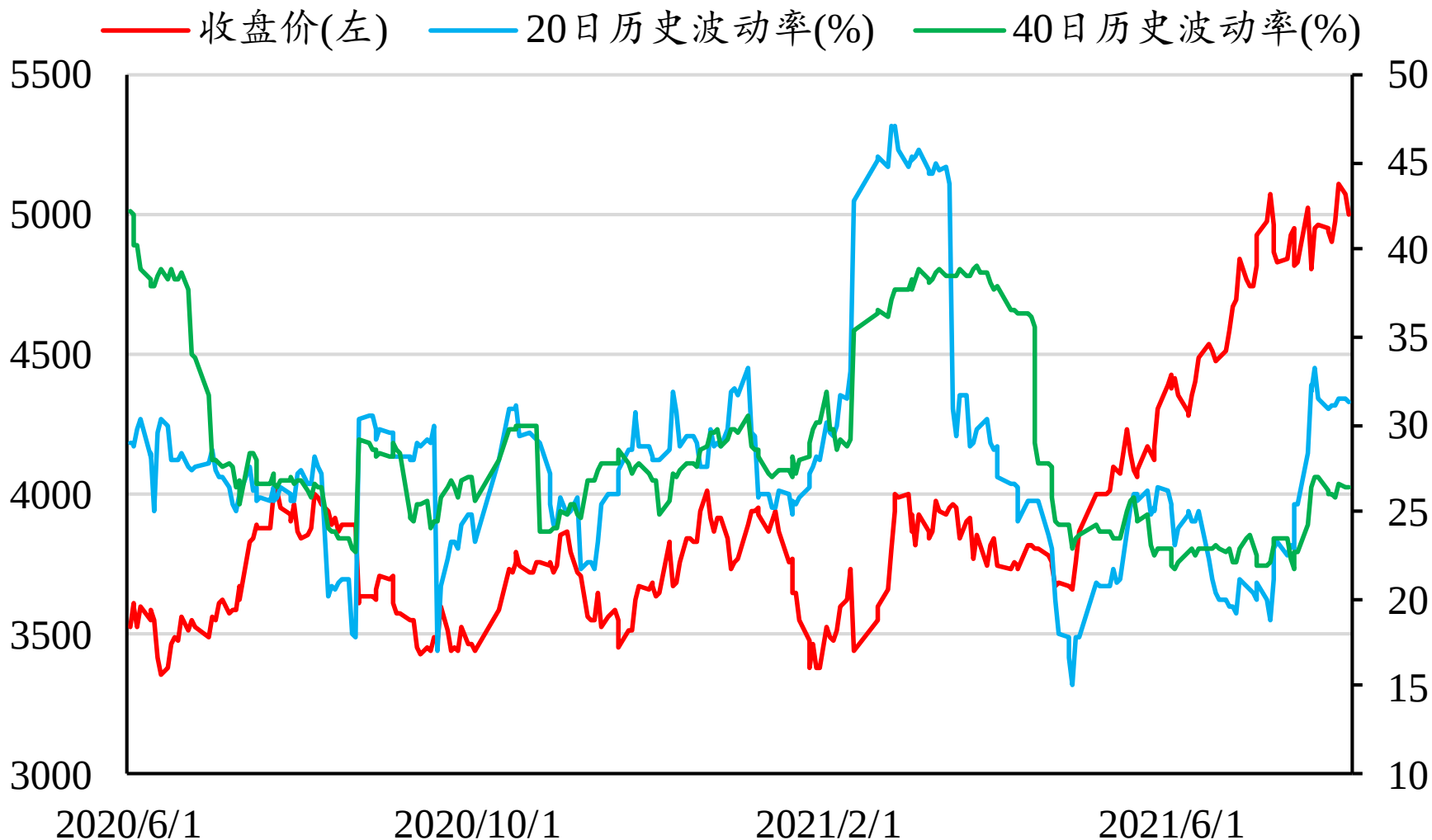
## 燃油指数收盘价和历史波动率



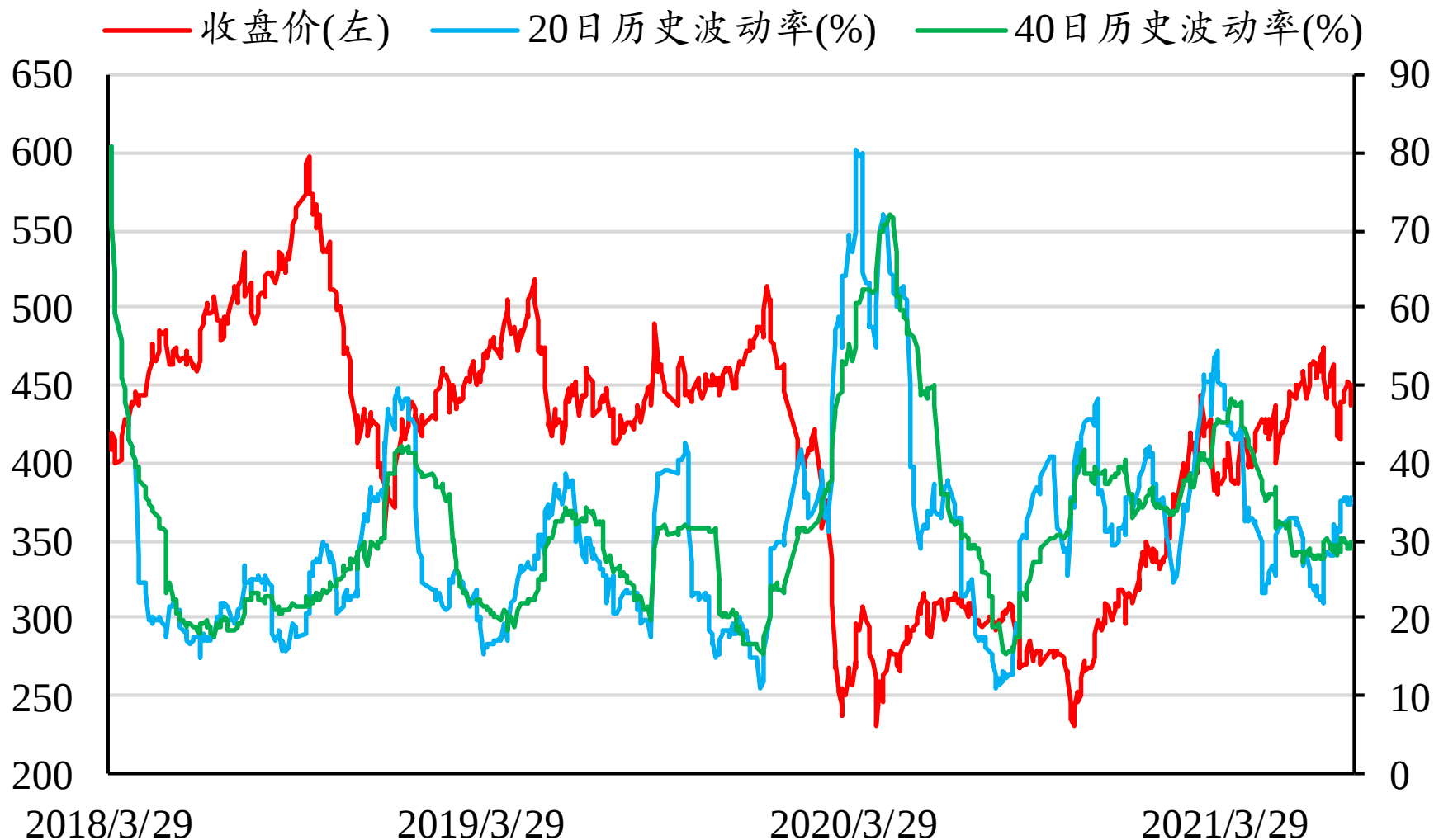
## 低硫燃料油指数收盘价和历史波动率



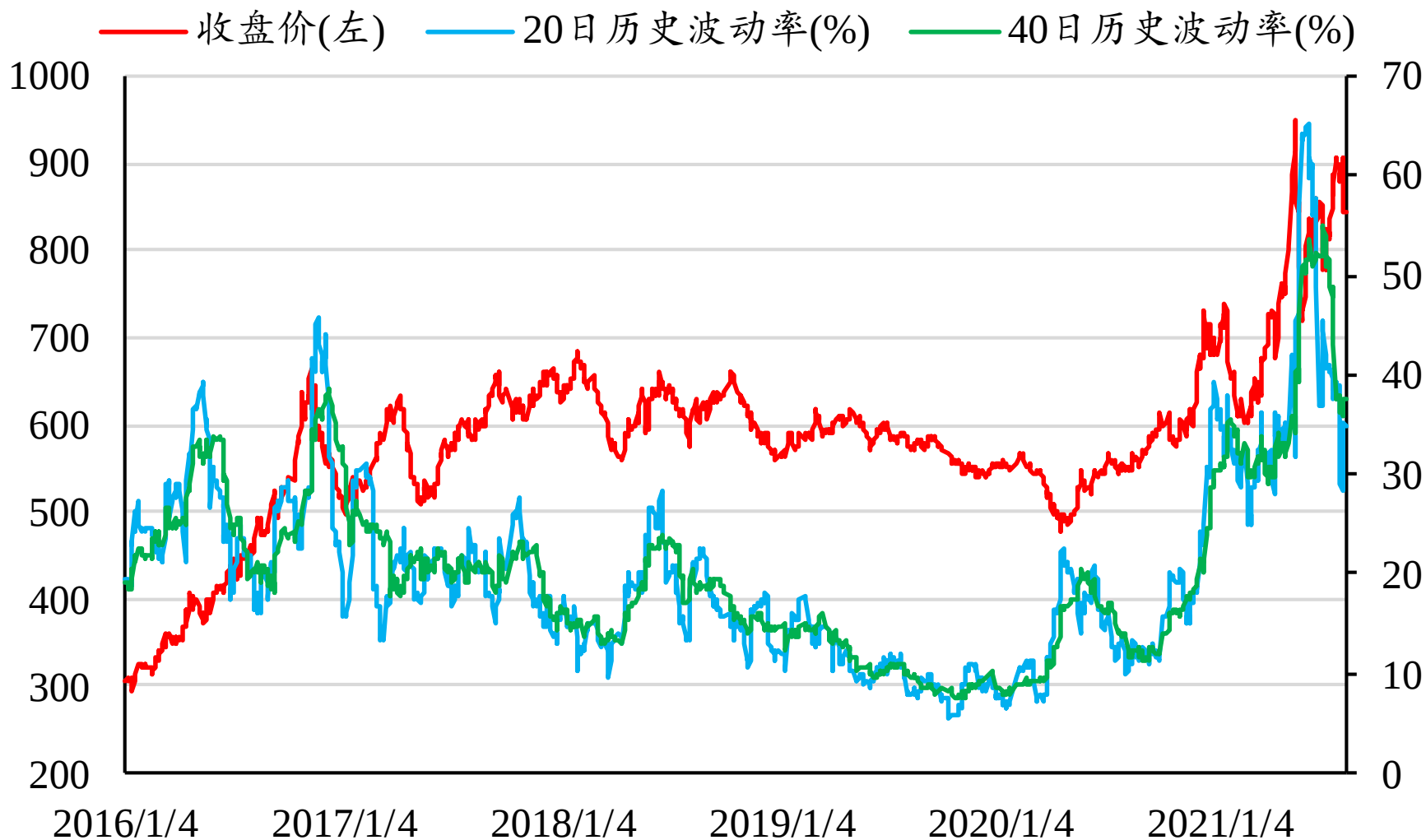
## LPG指数收盘价和历史波动率



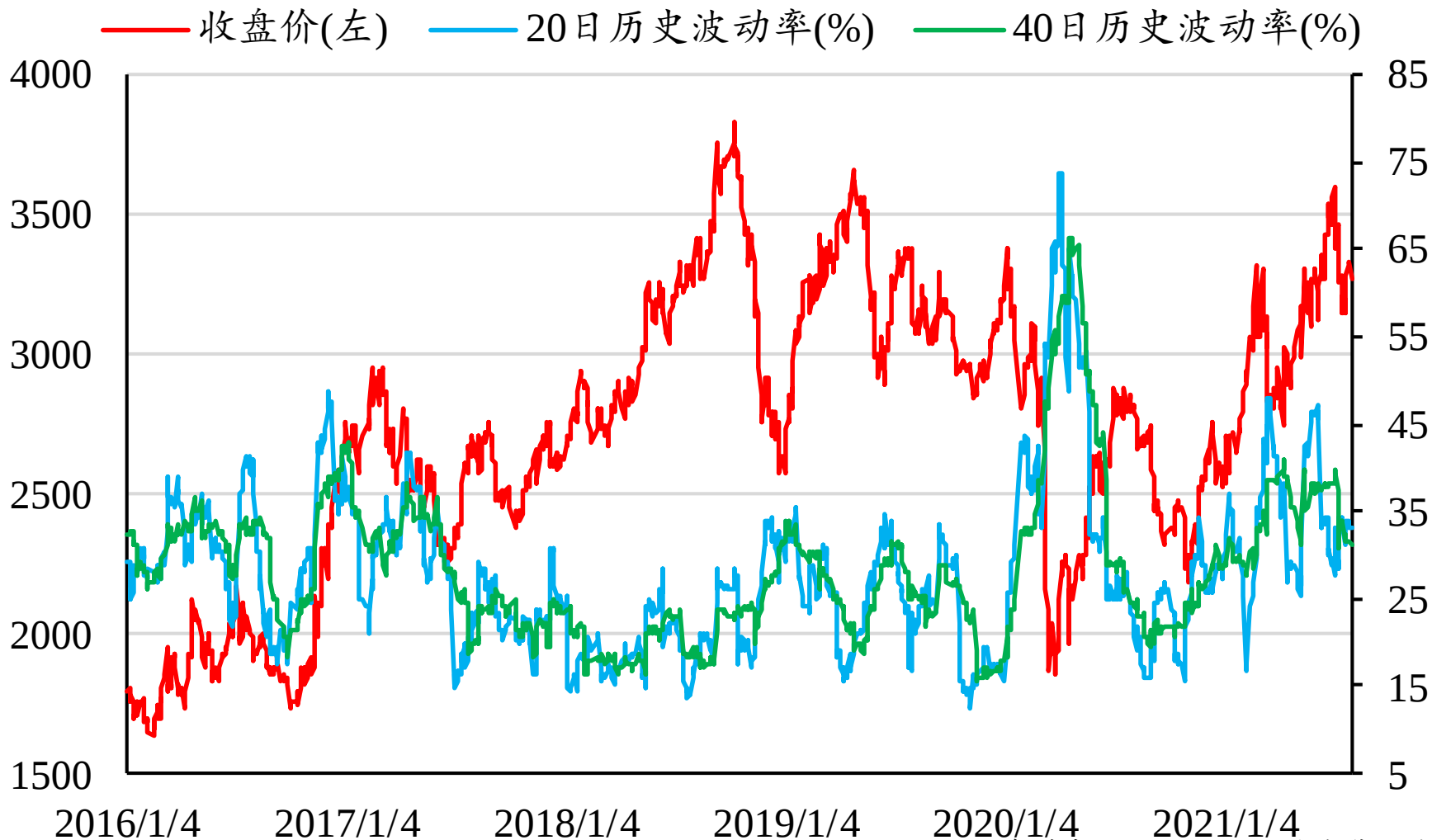
## 原油指数收盘价和历史波动率



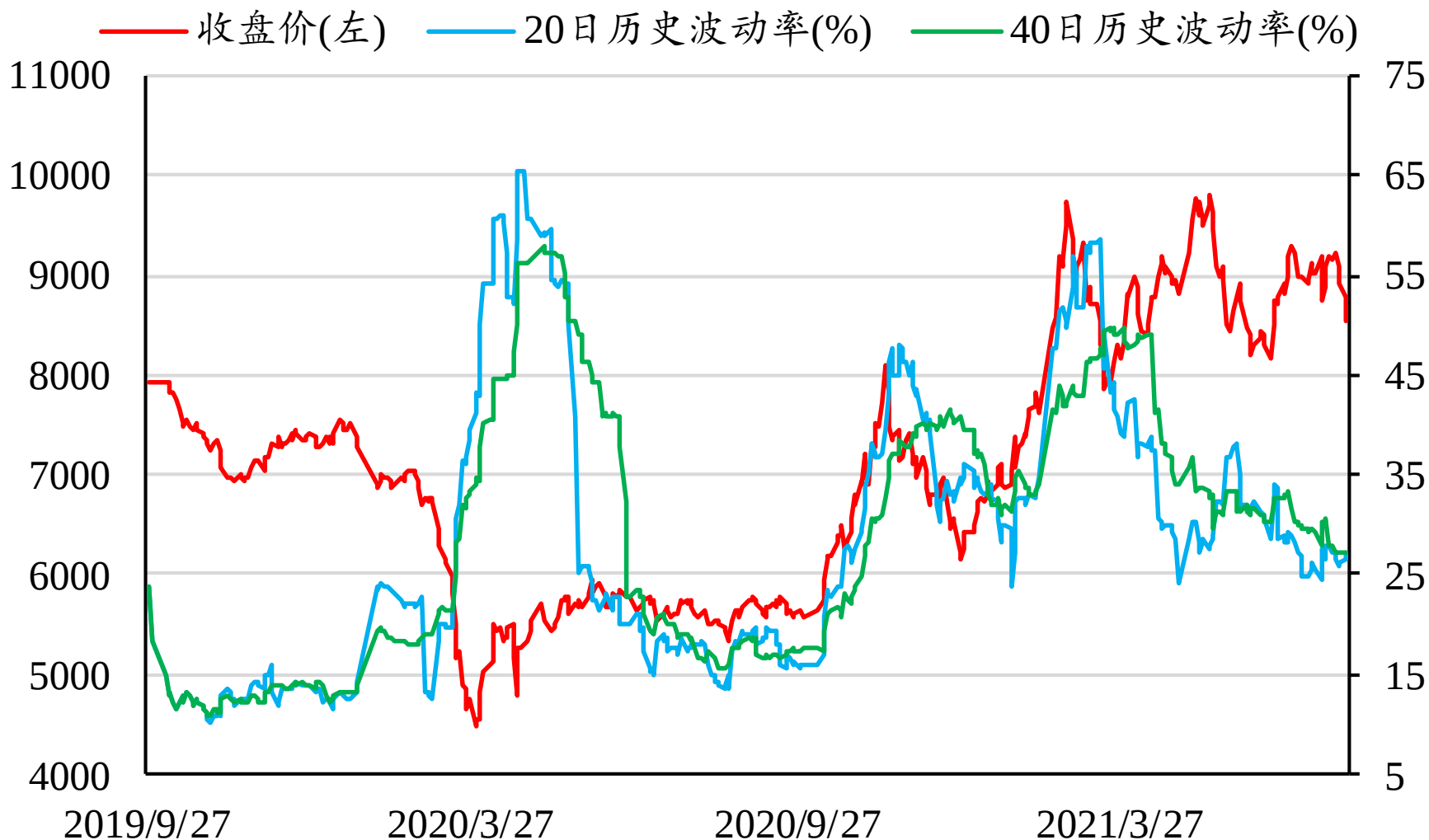
## 动煤指数收盘价和历史波动率



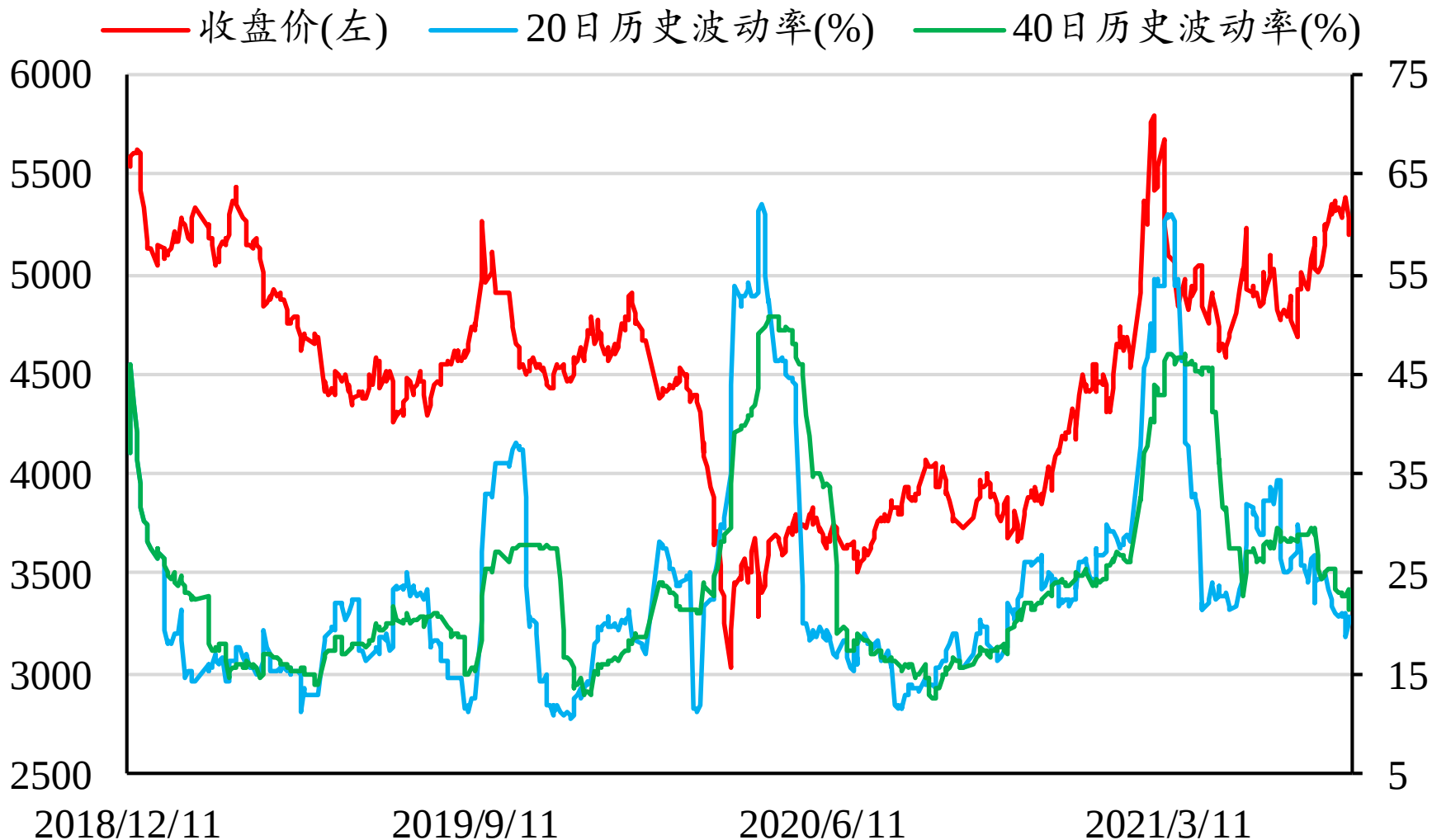
## 沥青指数收盘价和历史波动率



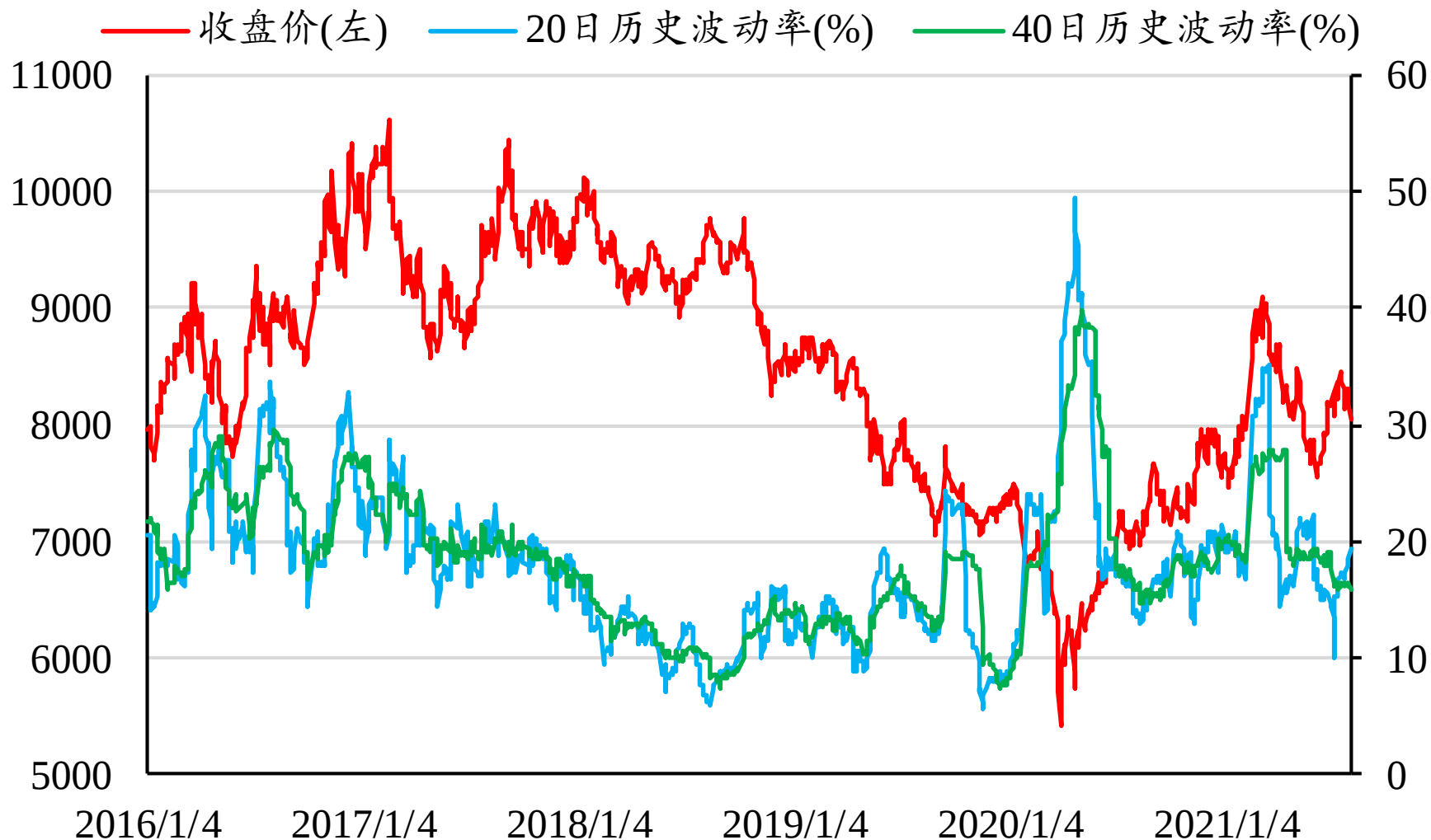
## 苯乙烯指数收盘价和历史波动率



## 乙二醇指数收盘价和历史波动率

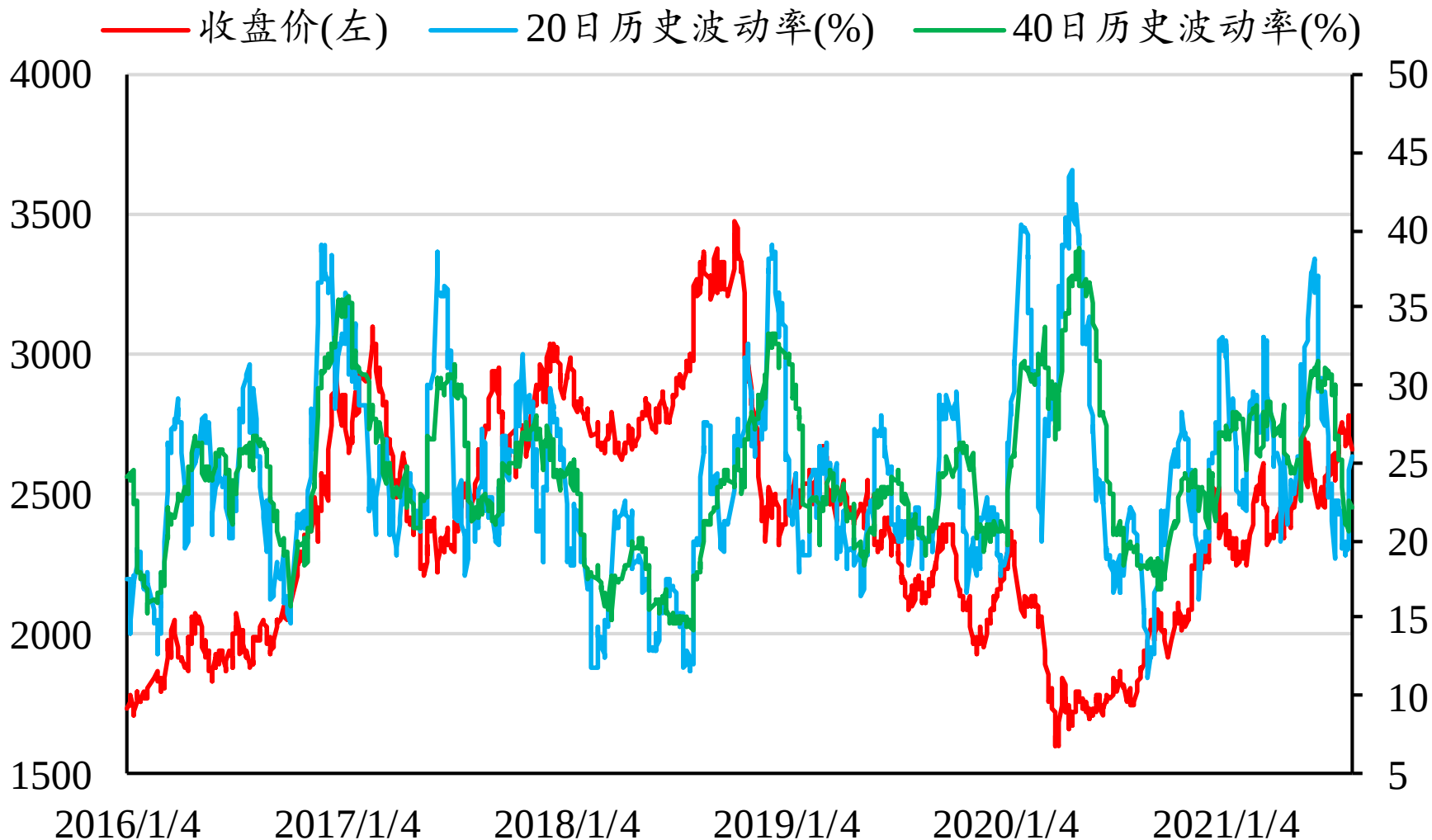


## 塑料指数收盘价和历史波动率

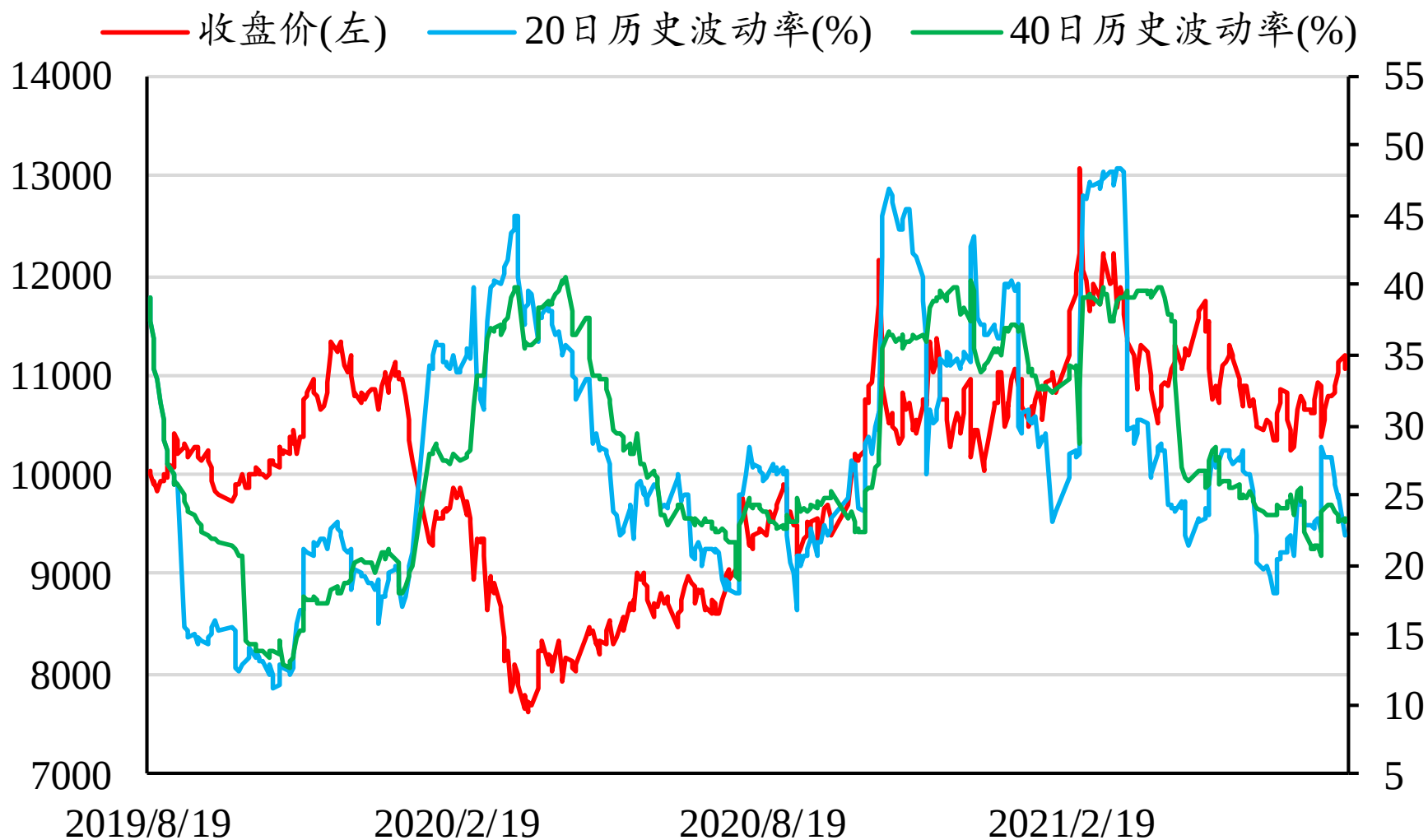


资料来源: Wind、信达期货研发中心

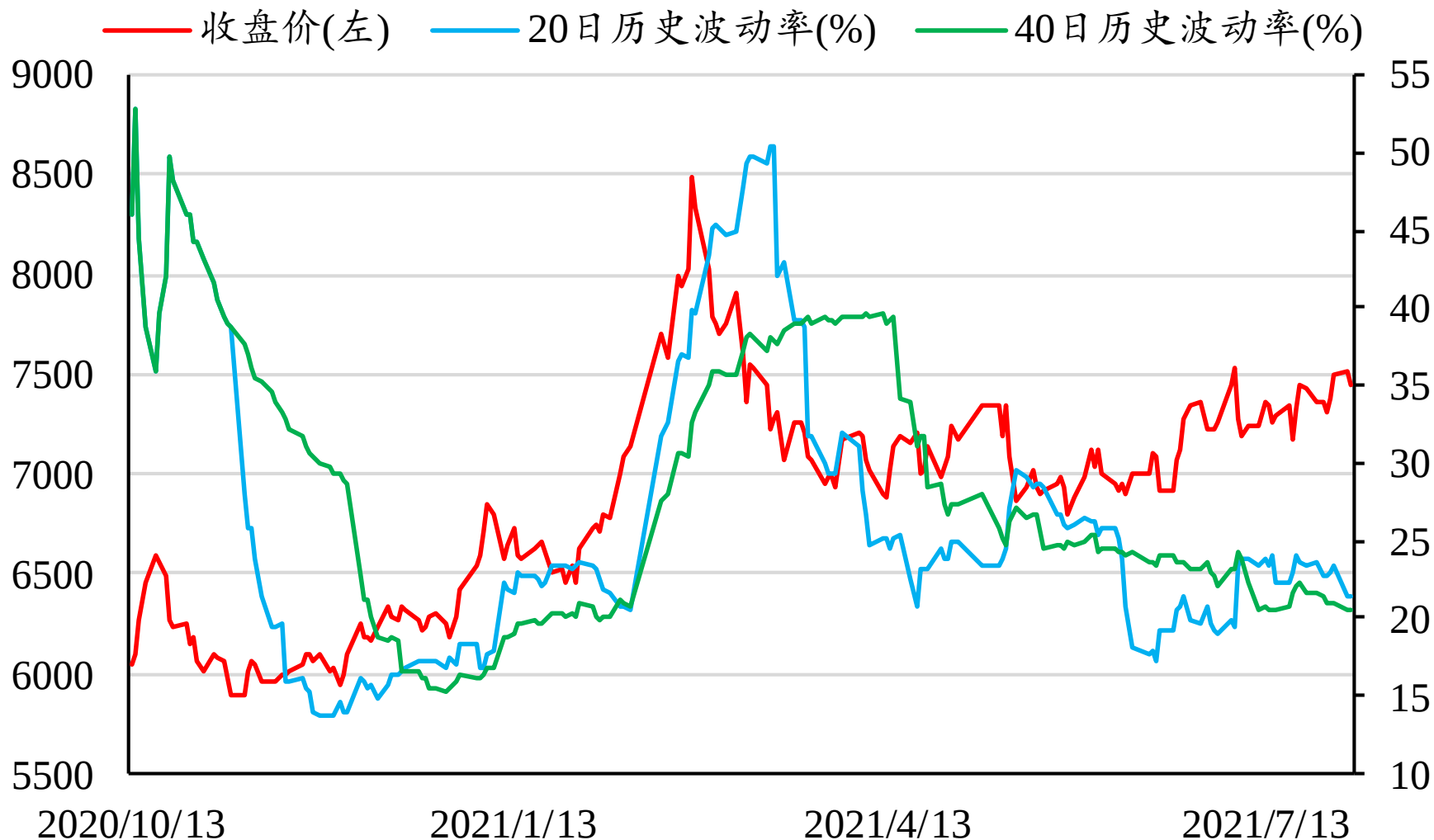
## 甲醇指数收盘价和历史波动率



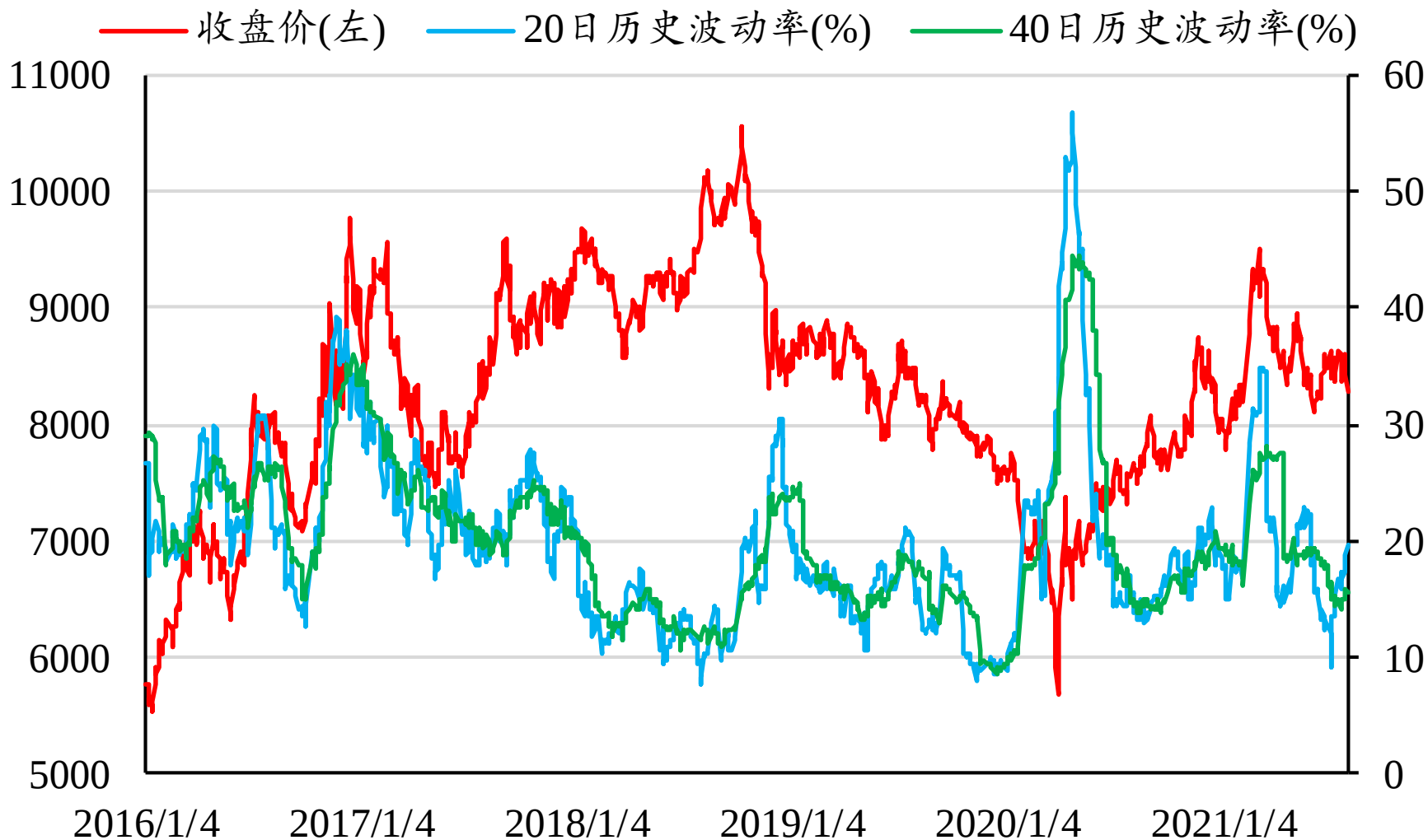
## 20号胶指数收盘价和历史波动率



## 短纤指数收盘价和历史波动率

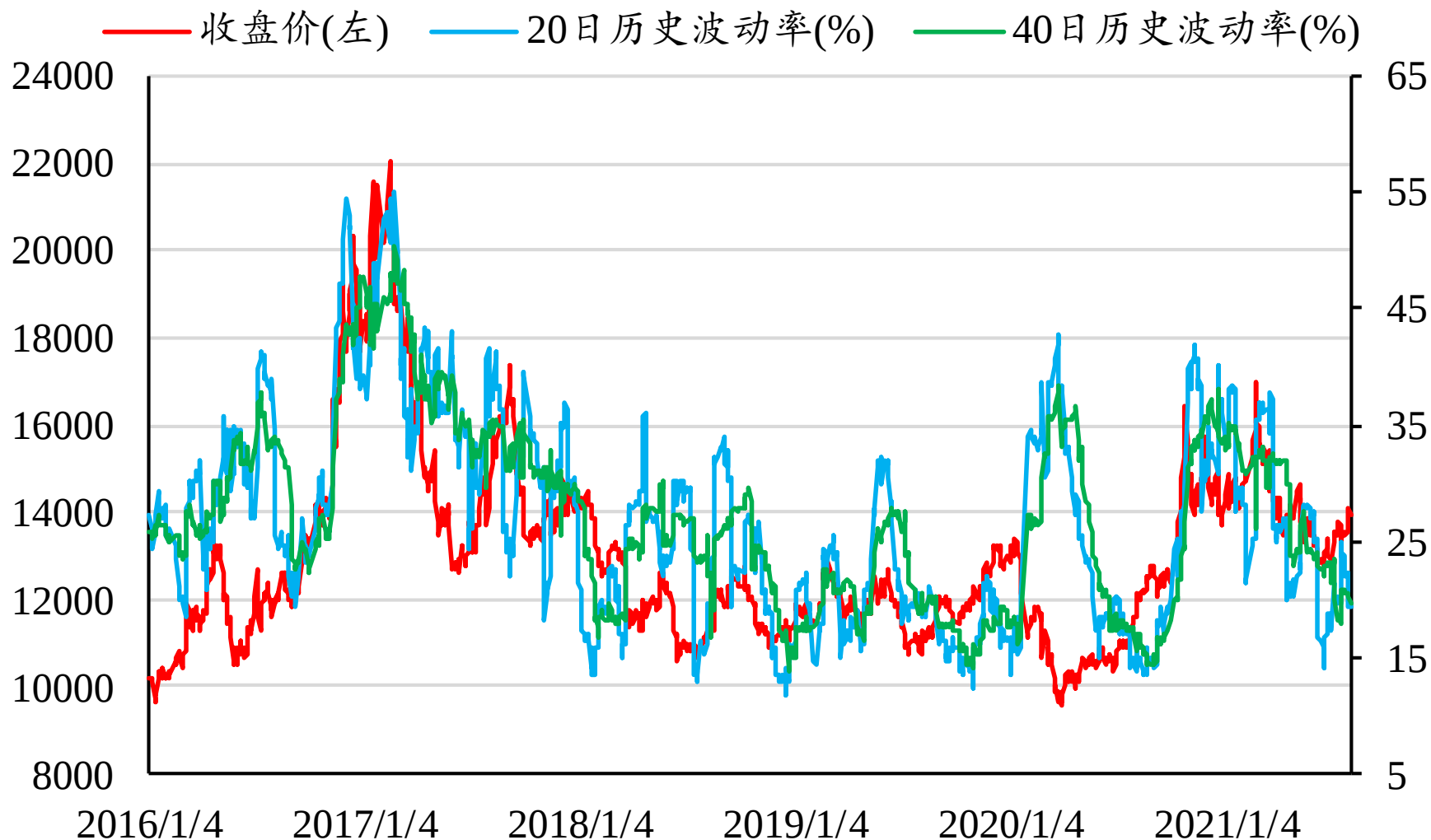


## PP指数收盘价和历史波动率

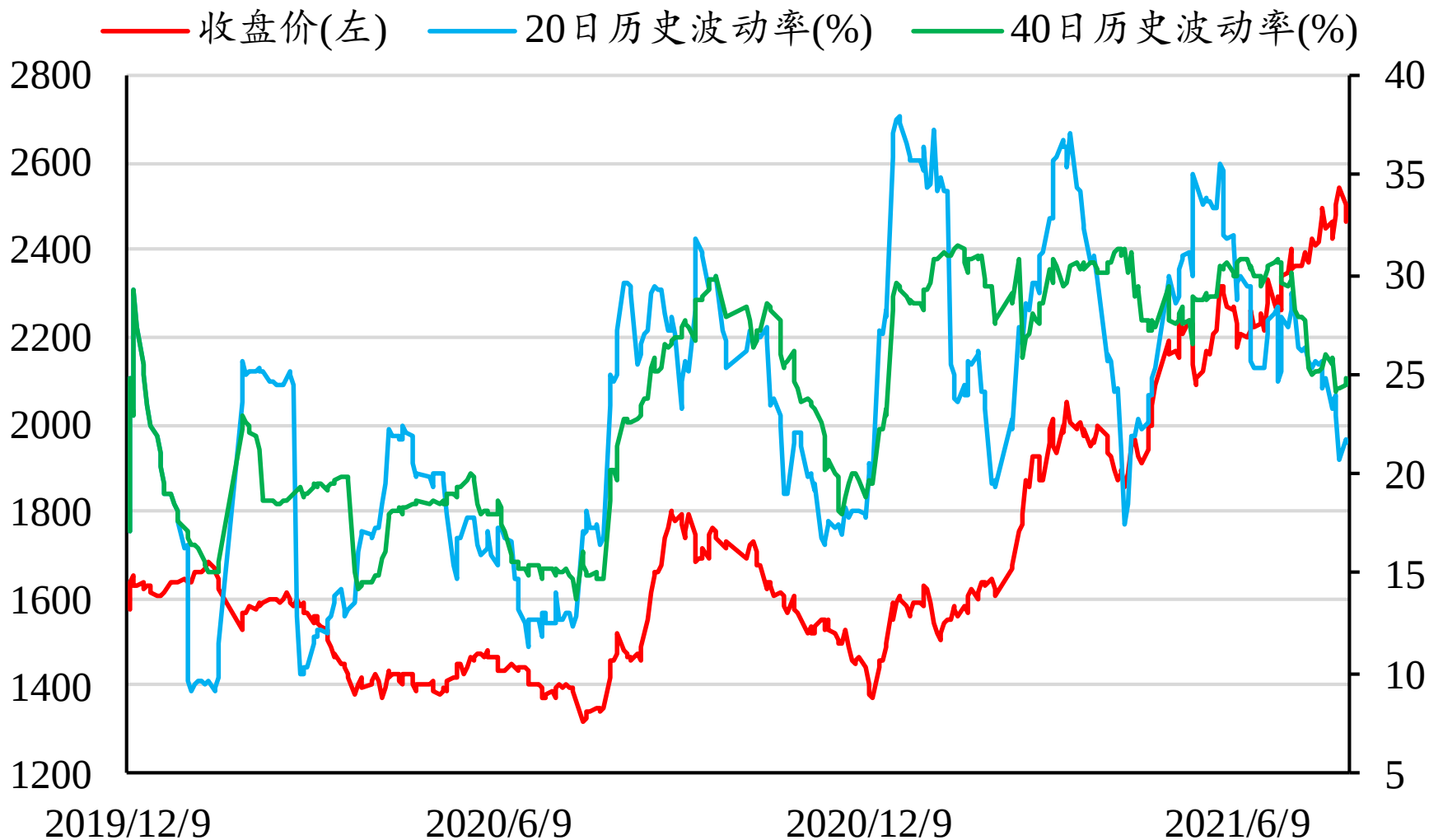


资料来源: Wind、信达期货研发中心

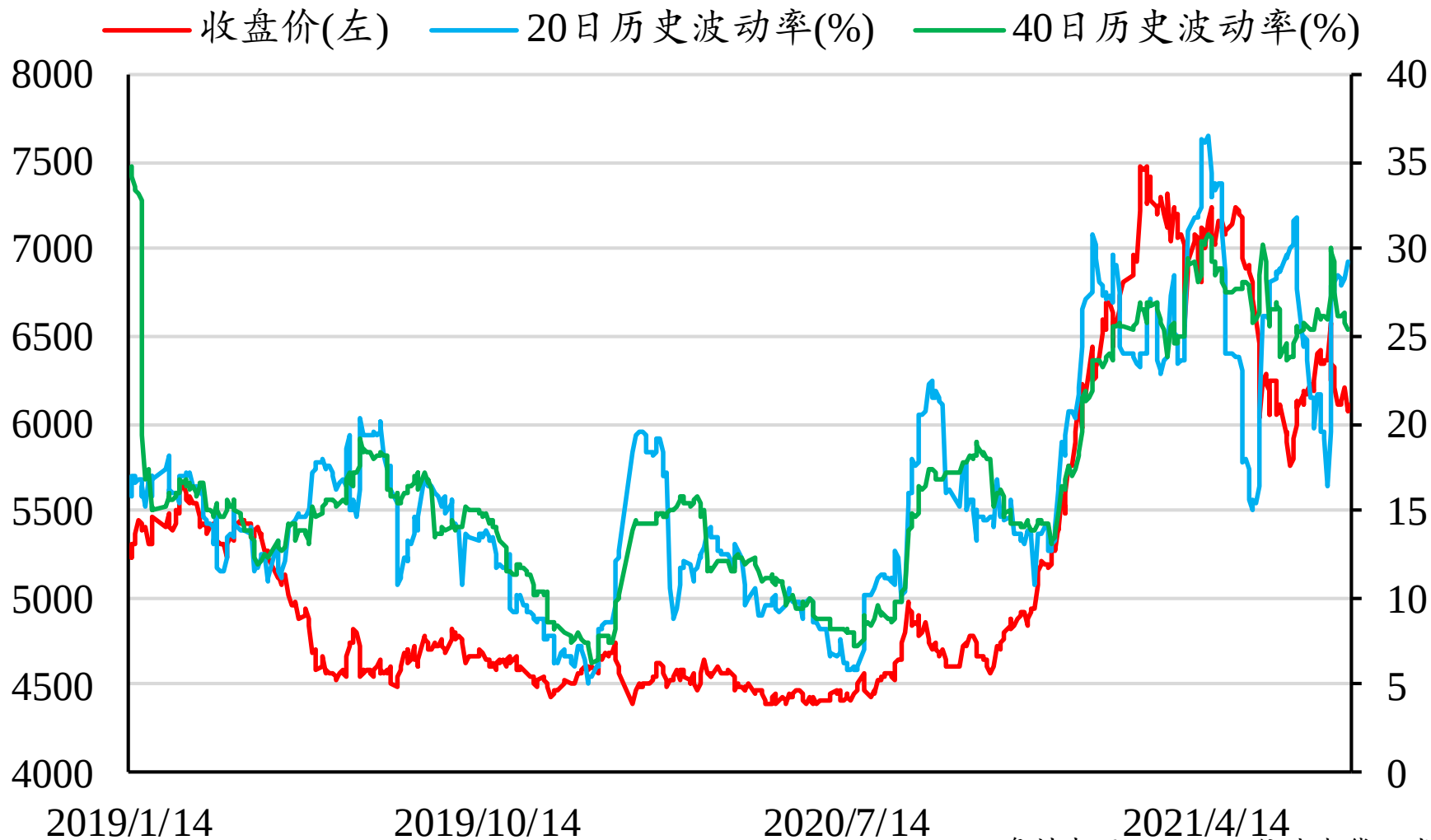
## 沪胶指数收盘价和历史波动率



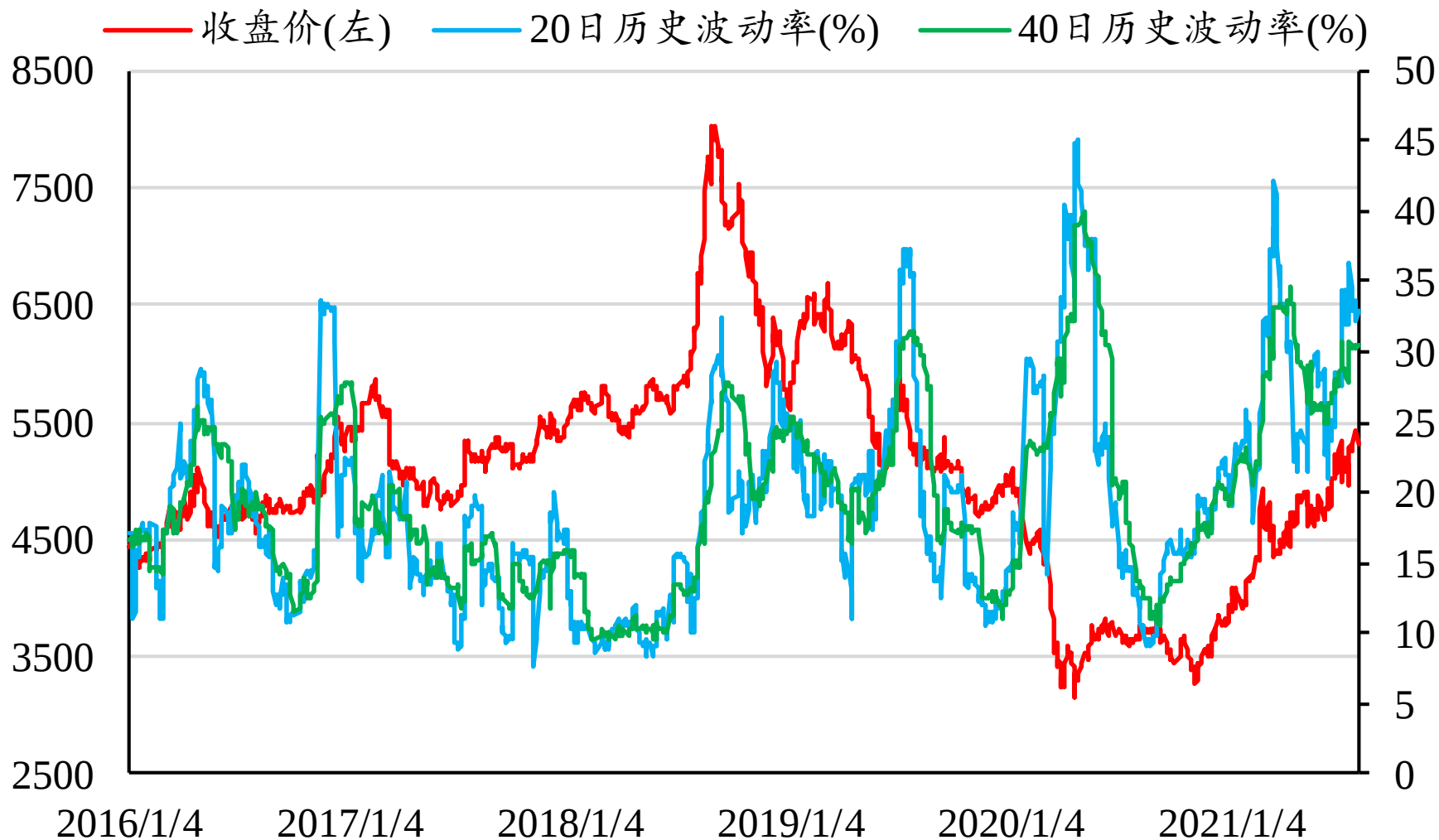
## 纯碱指数收盘价和历史波动率



## 纸浆指数收盘价和历史波动率

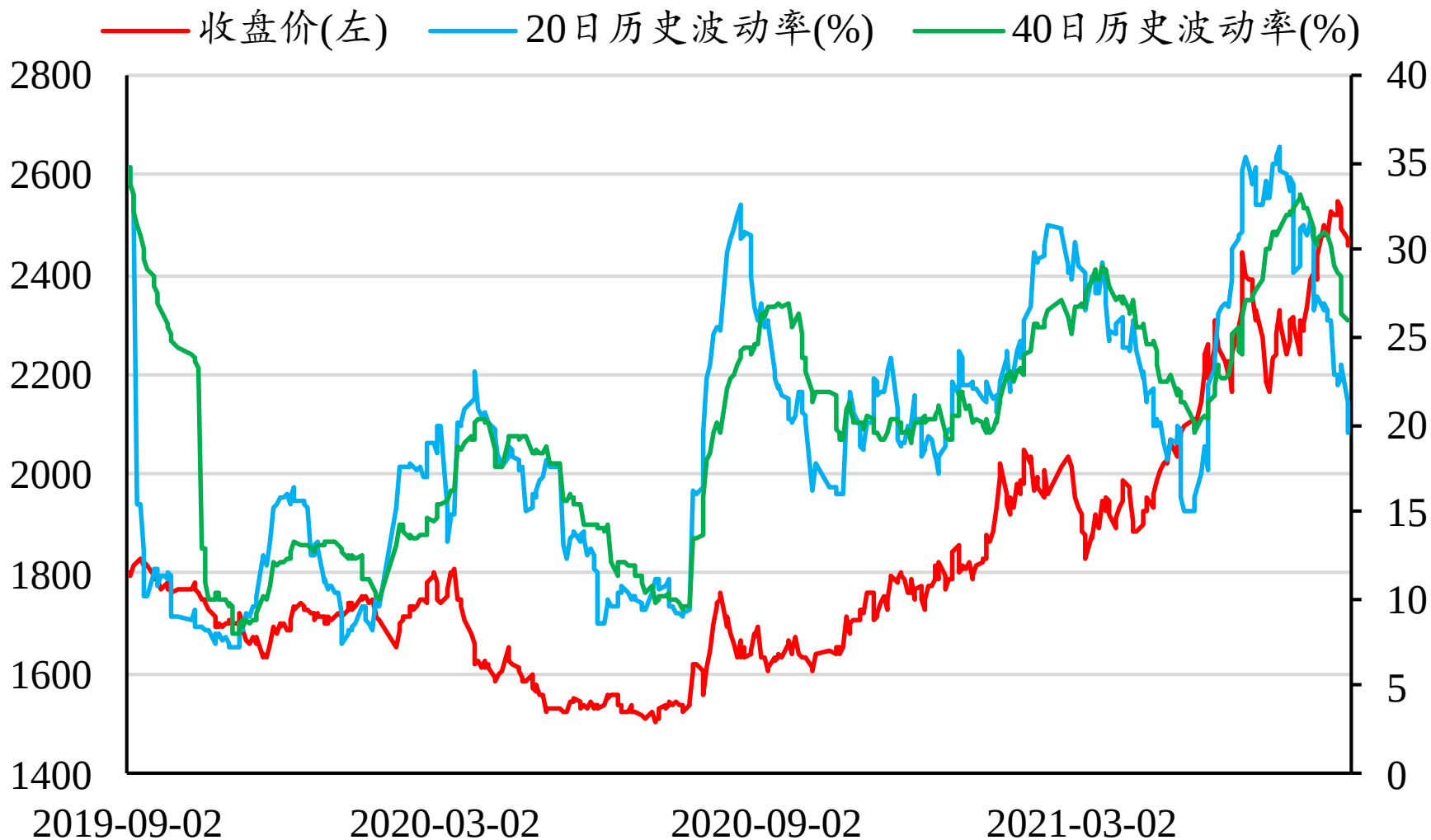


## TA指数收盘价和历史波动率

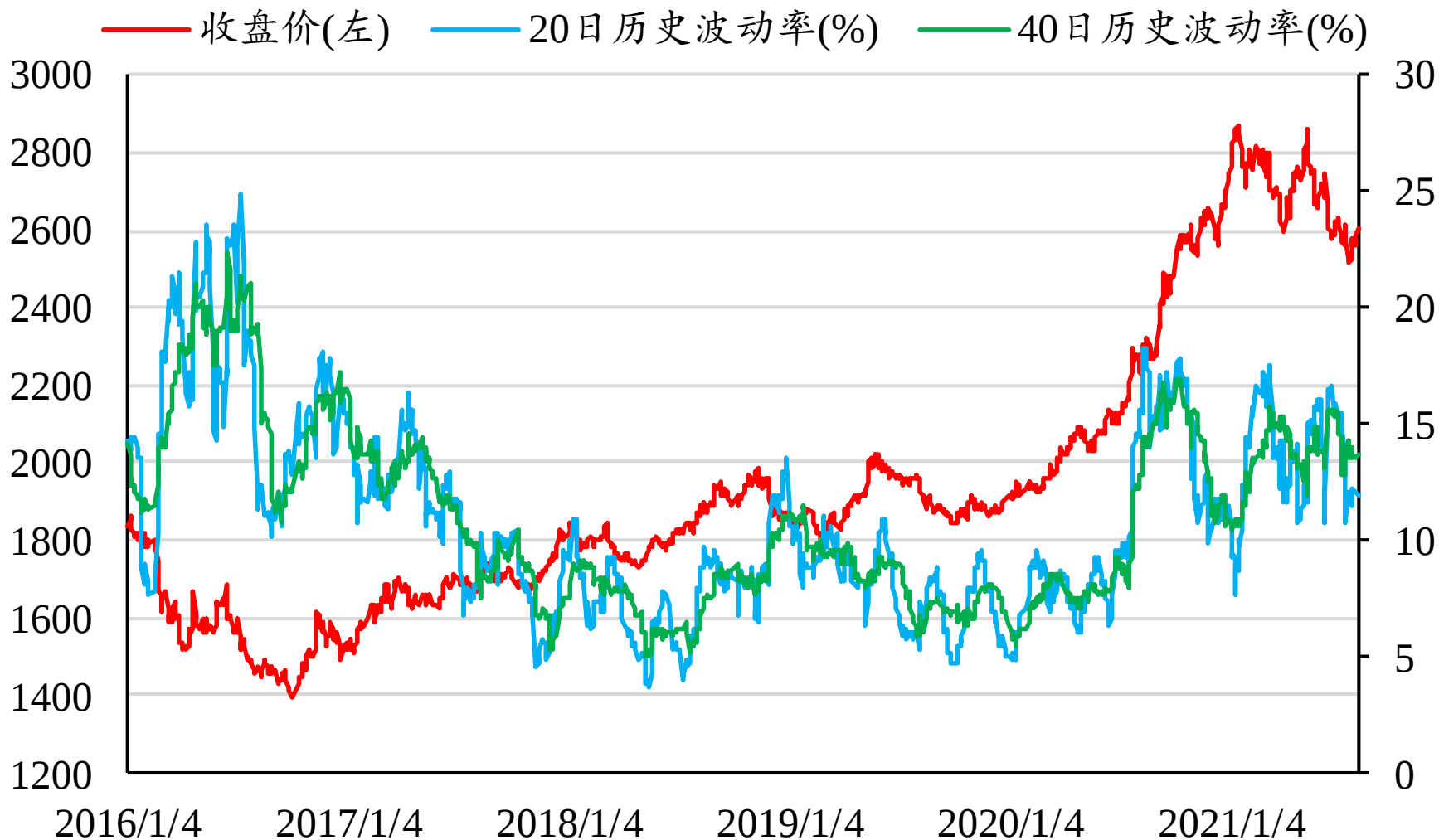


资料来源: Wind、信达期货研发中心

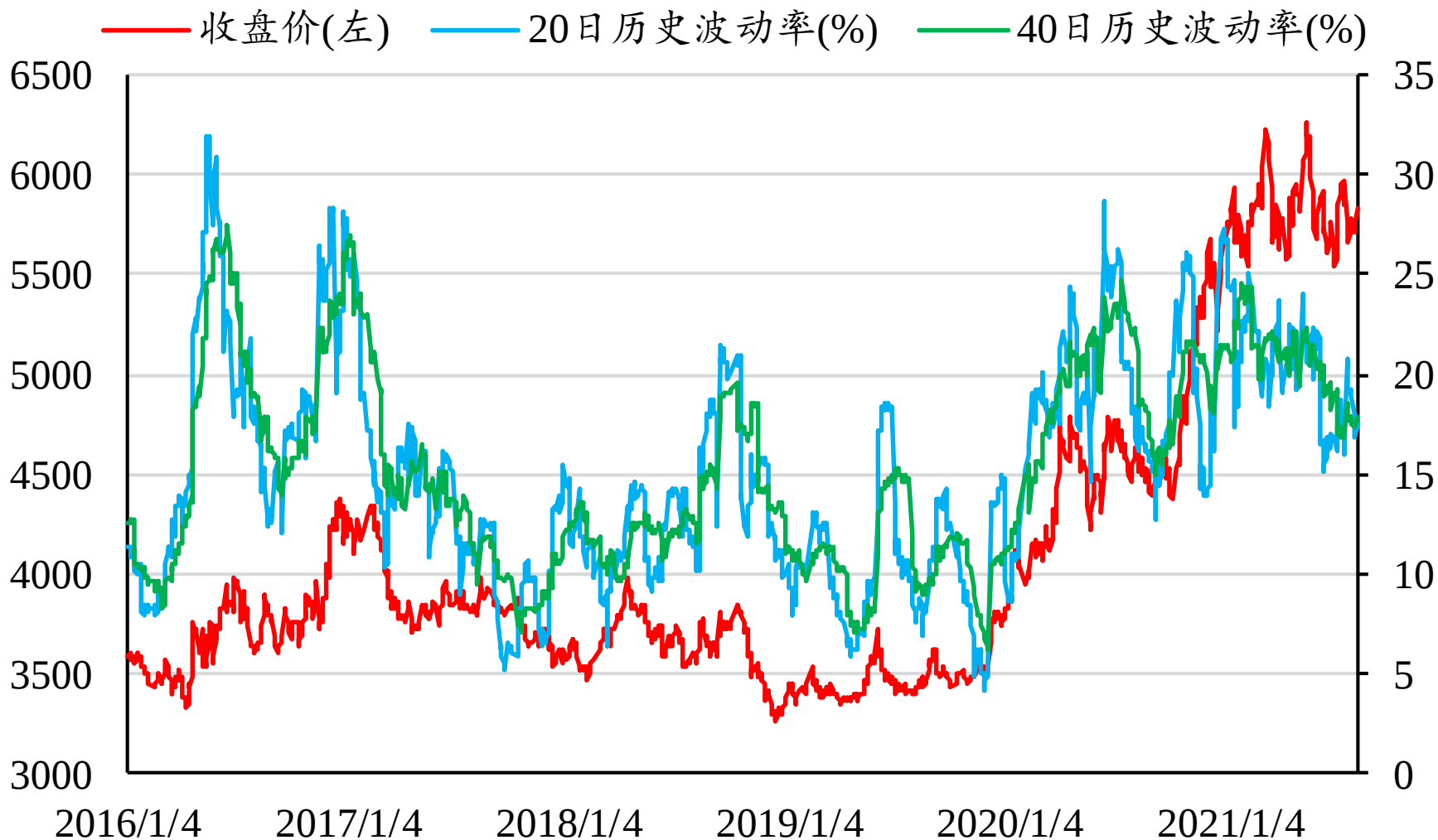
## 尿素指数收盘价和历史波动率



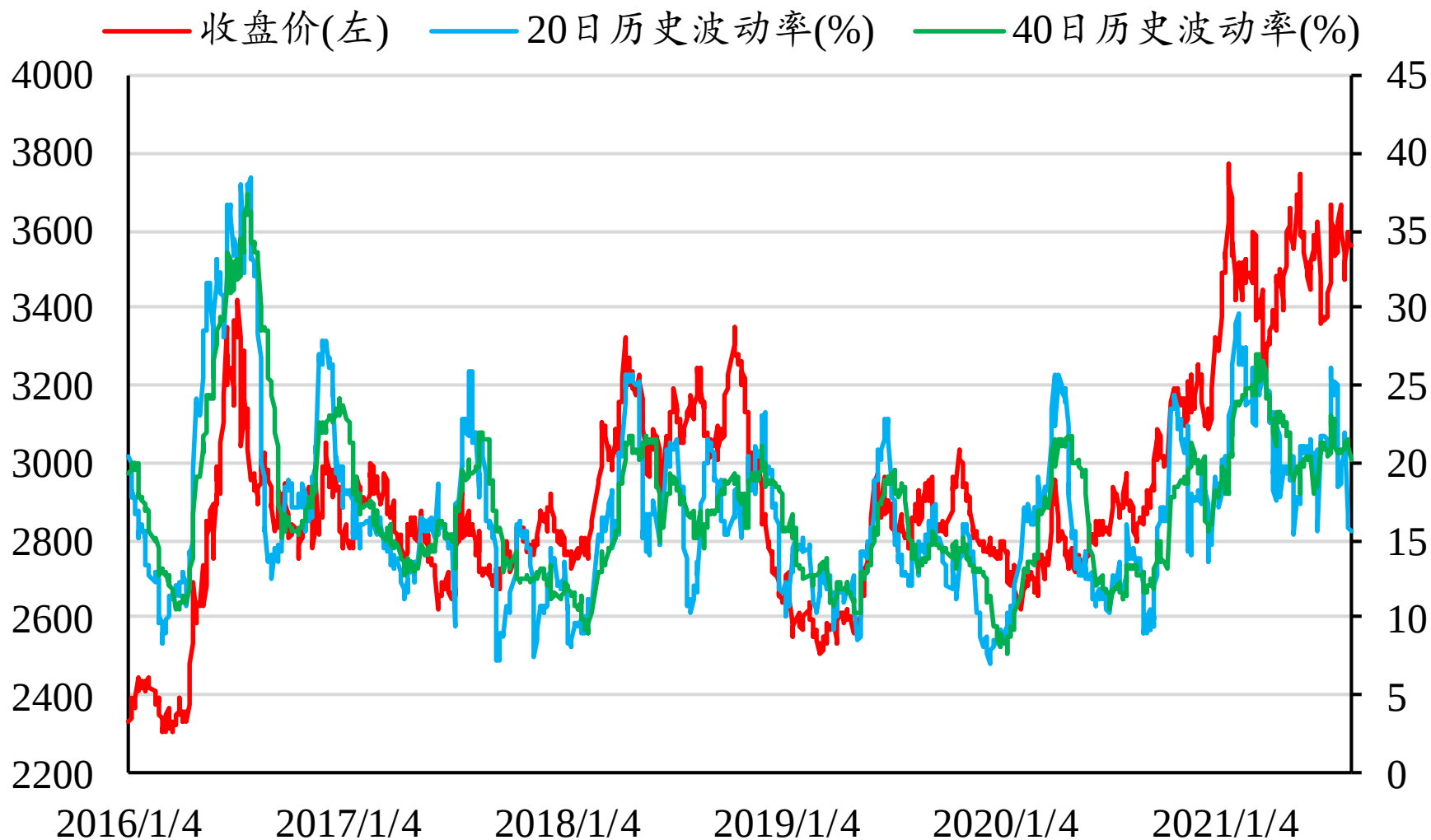
## 玉米指数收盘价和历史波动率



## 豆一指数收盘价和历史波动率

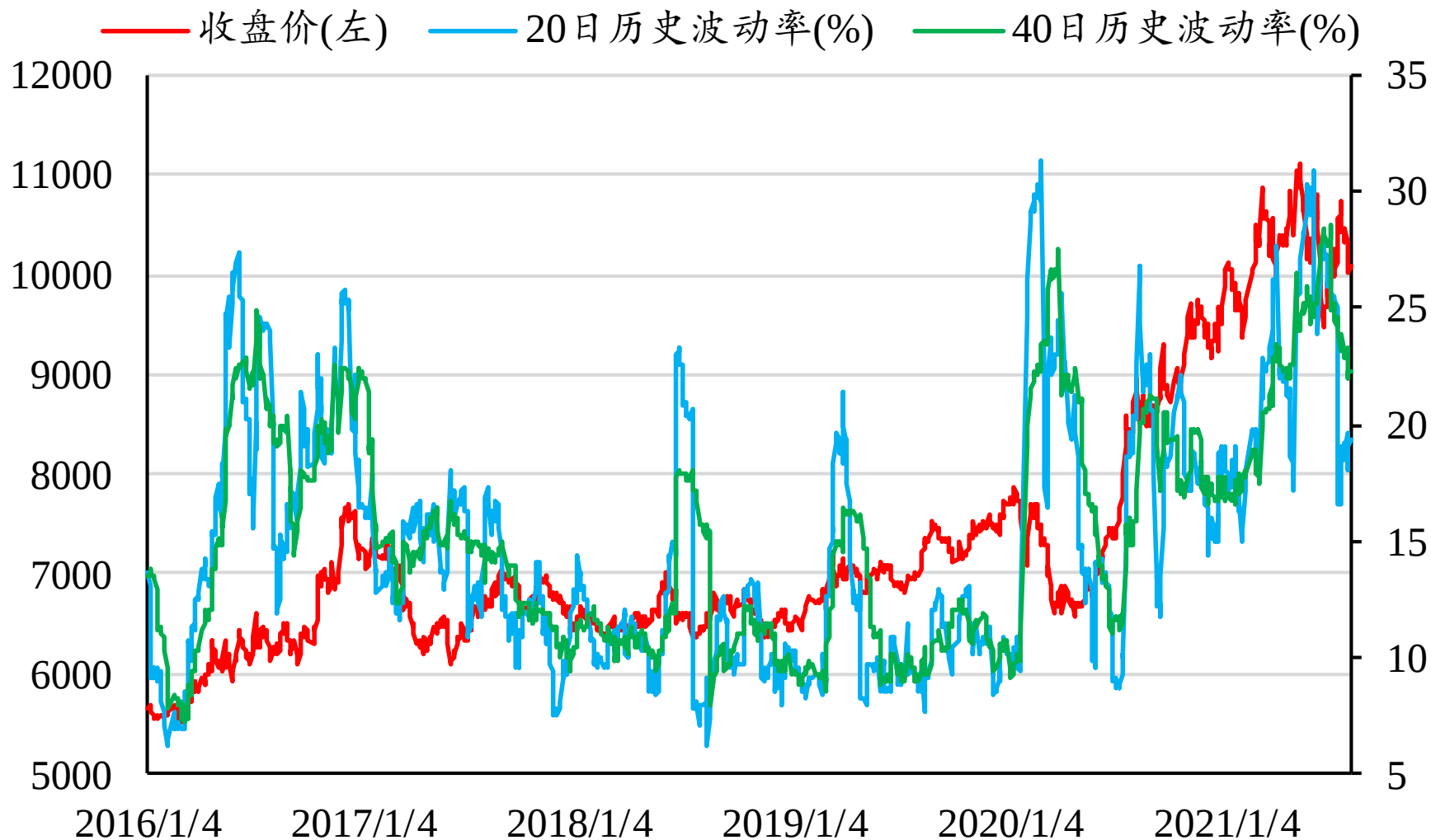


## 豆粕指数收盘价和历史波动率

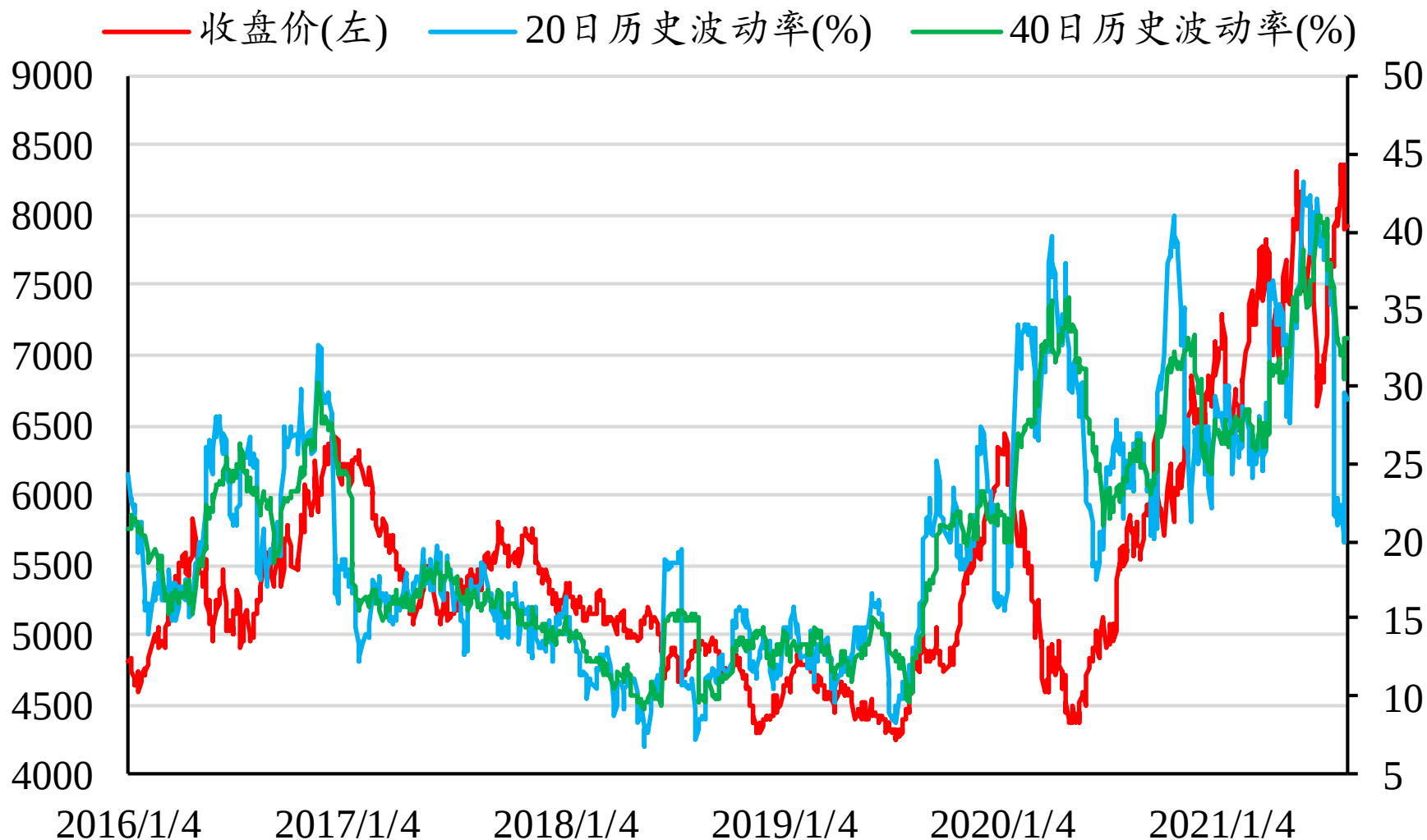


资料来源: Wind、信达期货研发中心

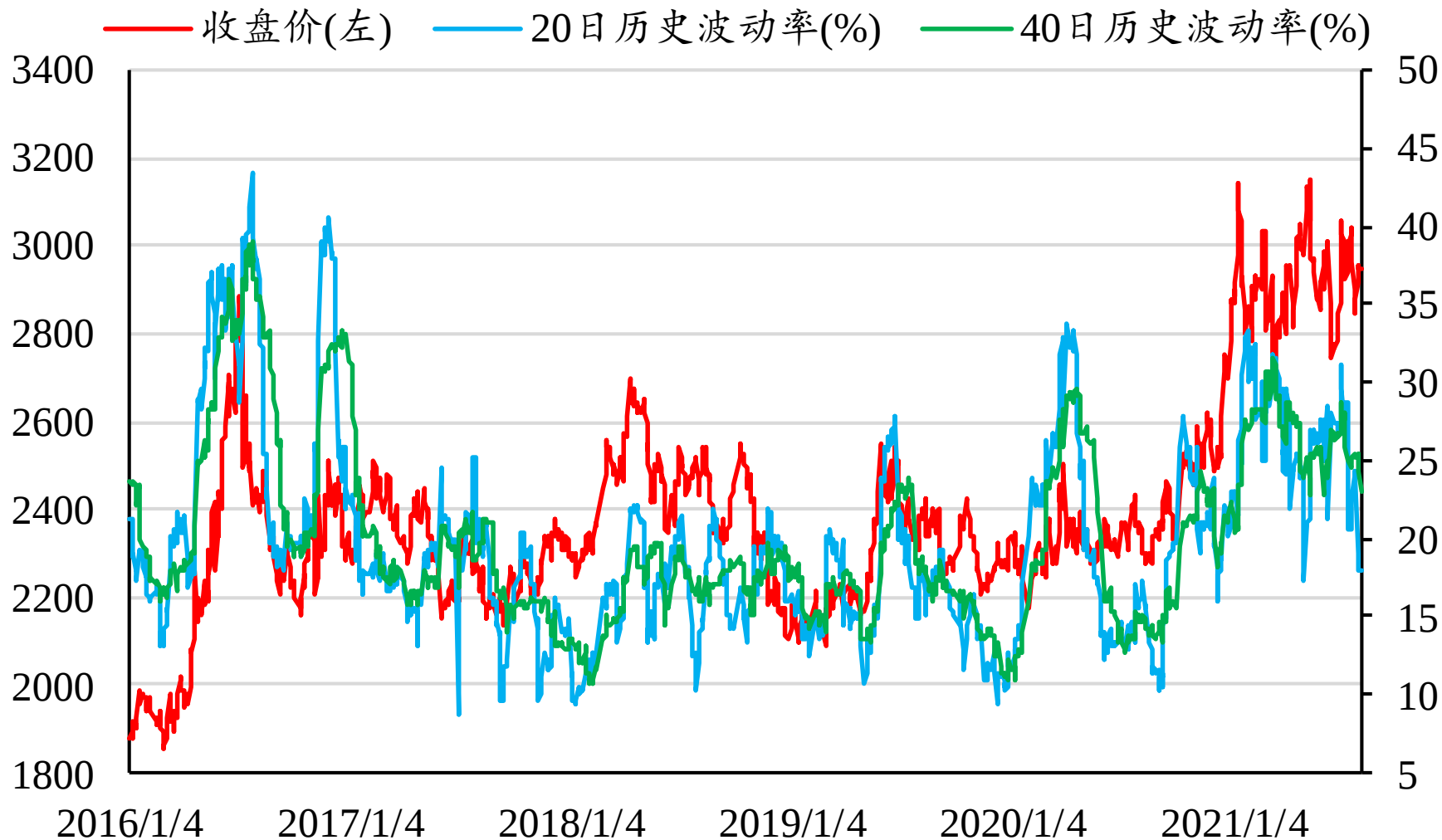
## 菜油指数收盘价和历史波动率



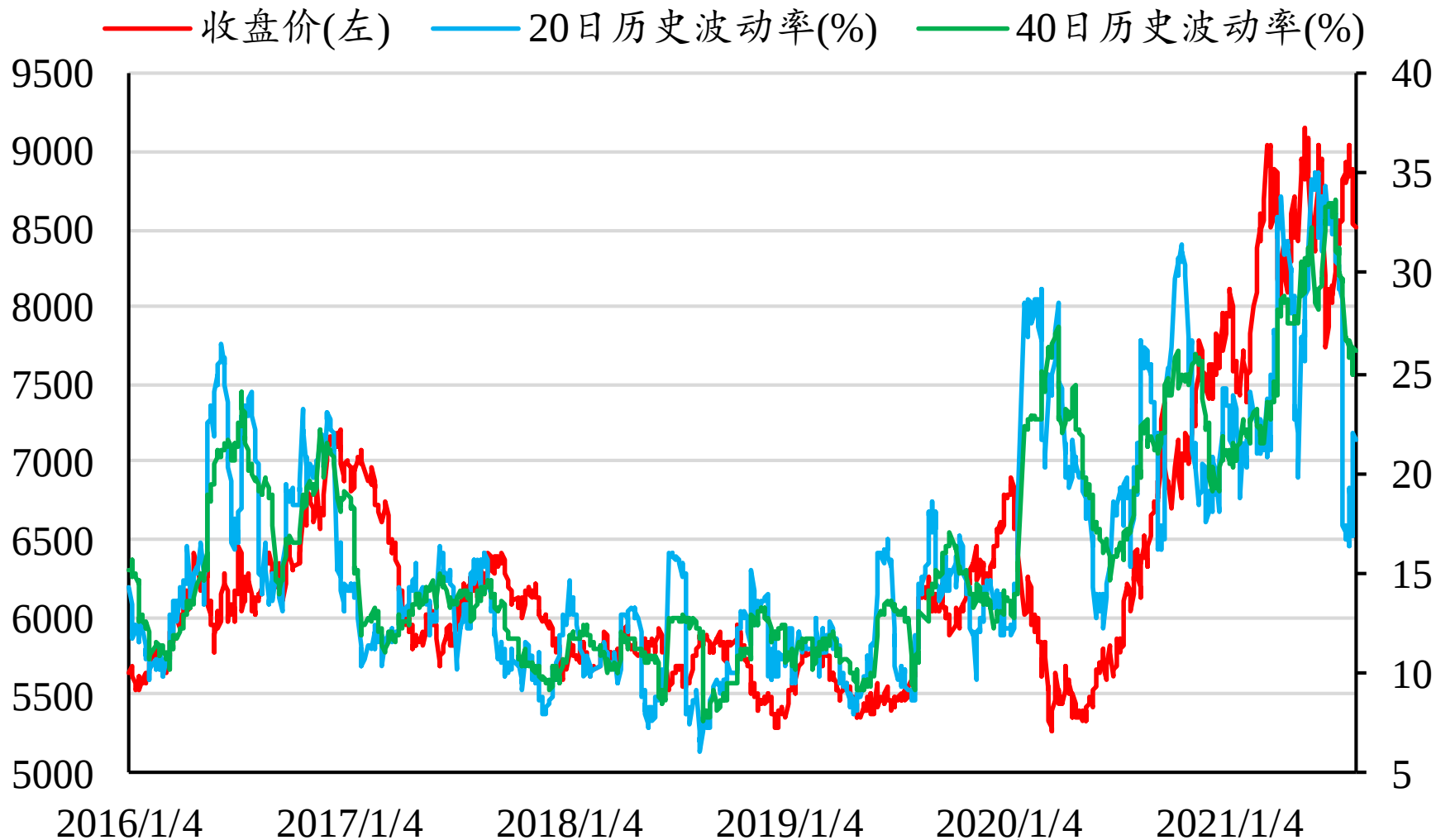
## 棕榈指数收盘价和历史波动率



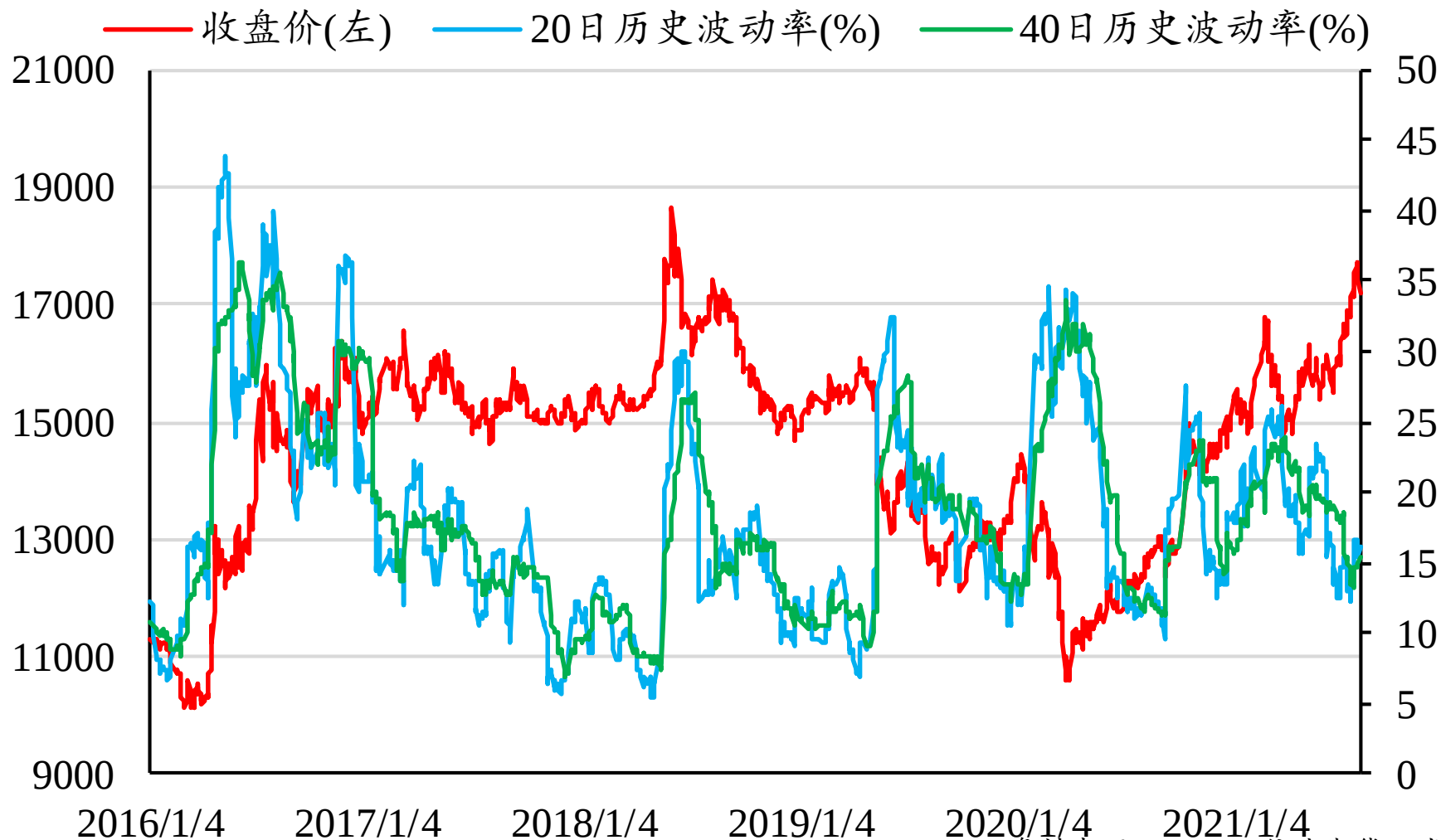
## 菜粕指数收盘价和历史波动率



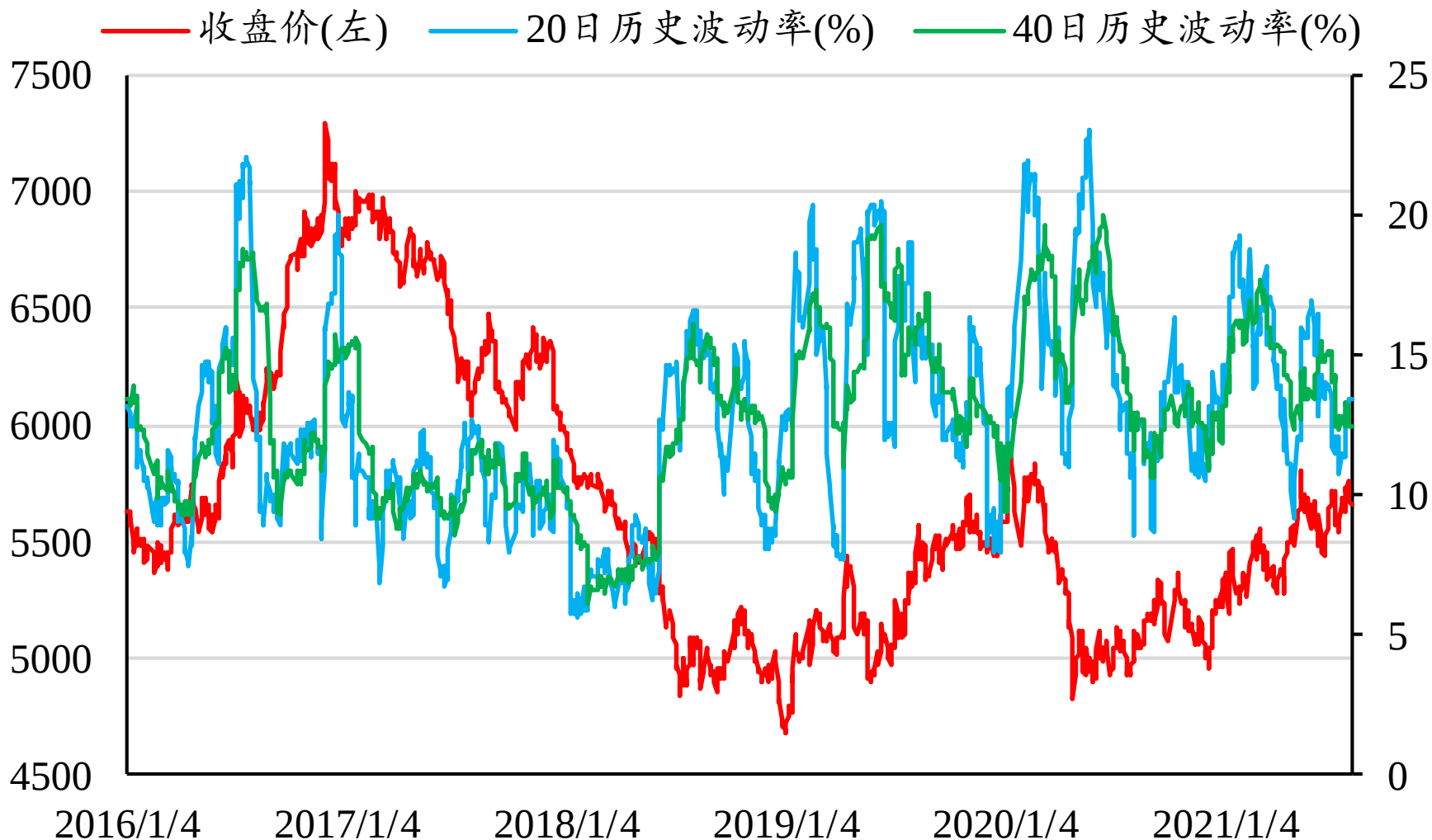
## 豆油指数指数收盘价和历史波动率



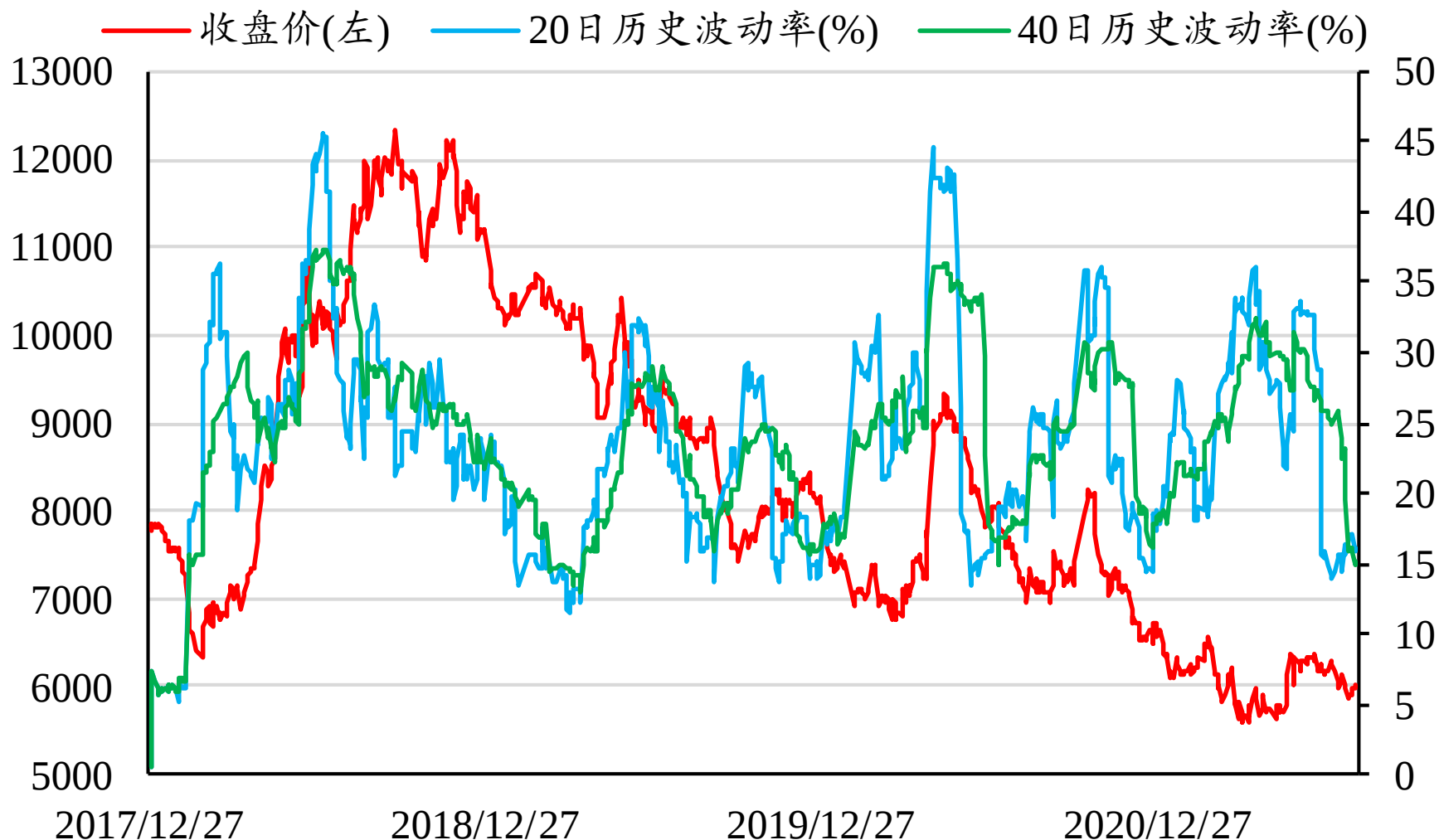
## 郑棉指数收盘价和历史波动率



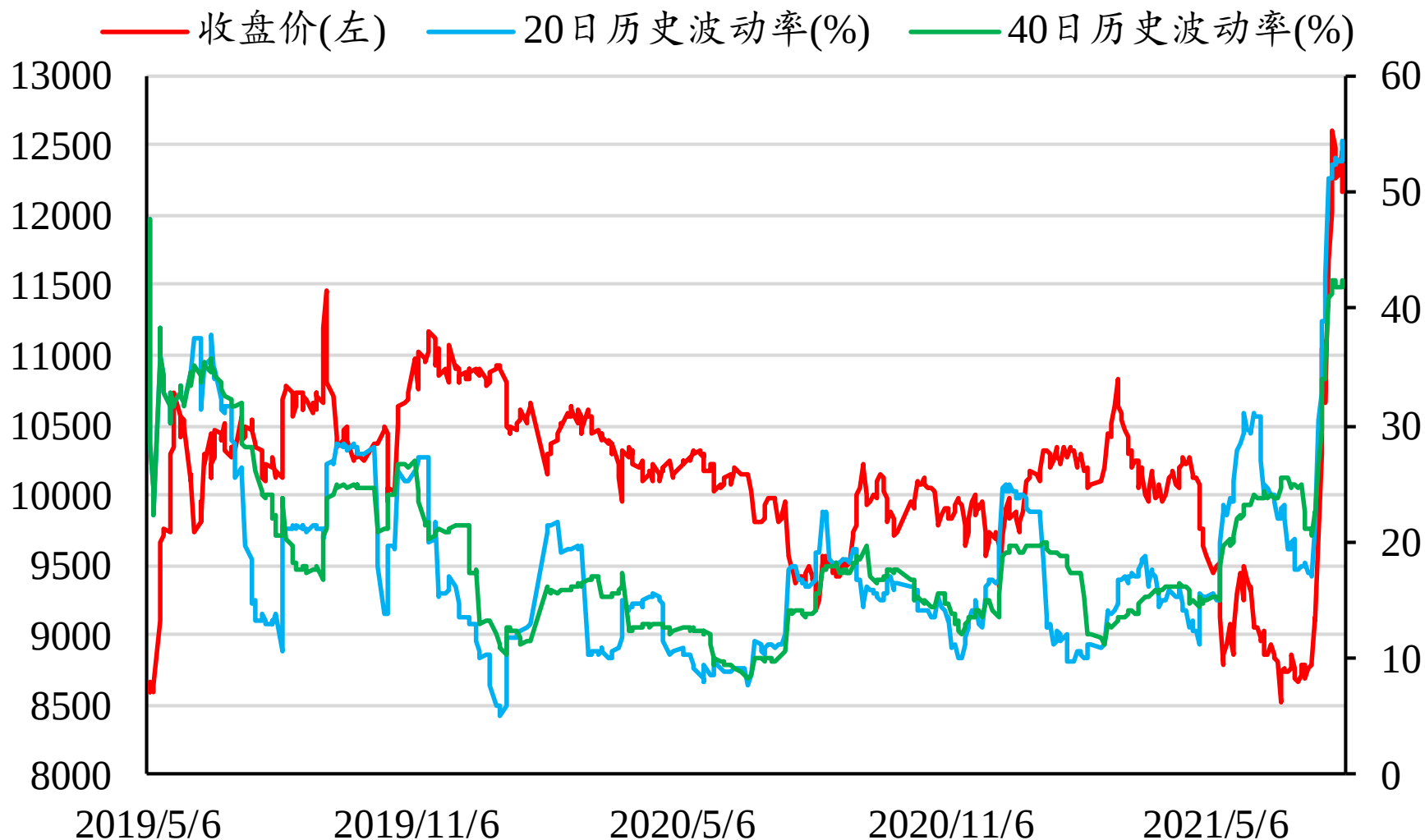
## 郑糖指数收盘价和历史波动率



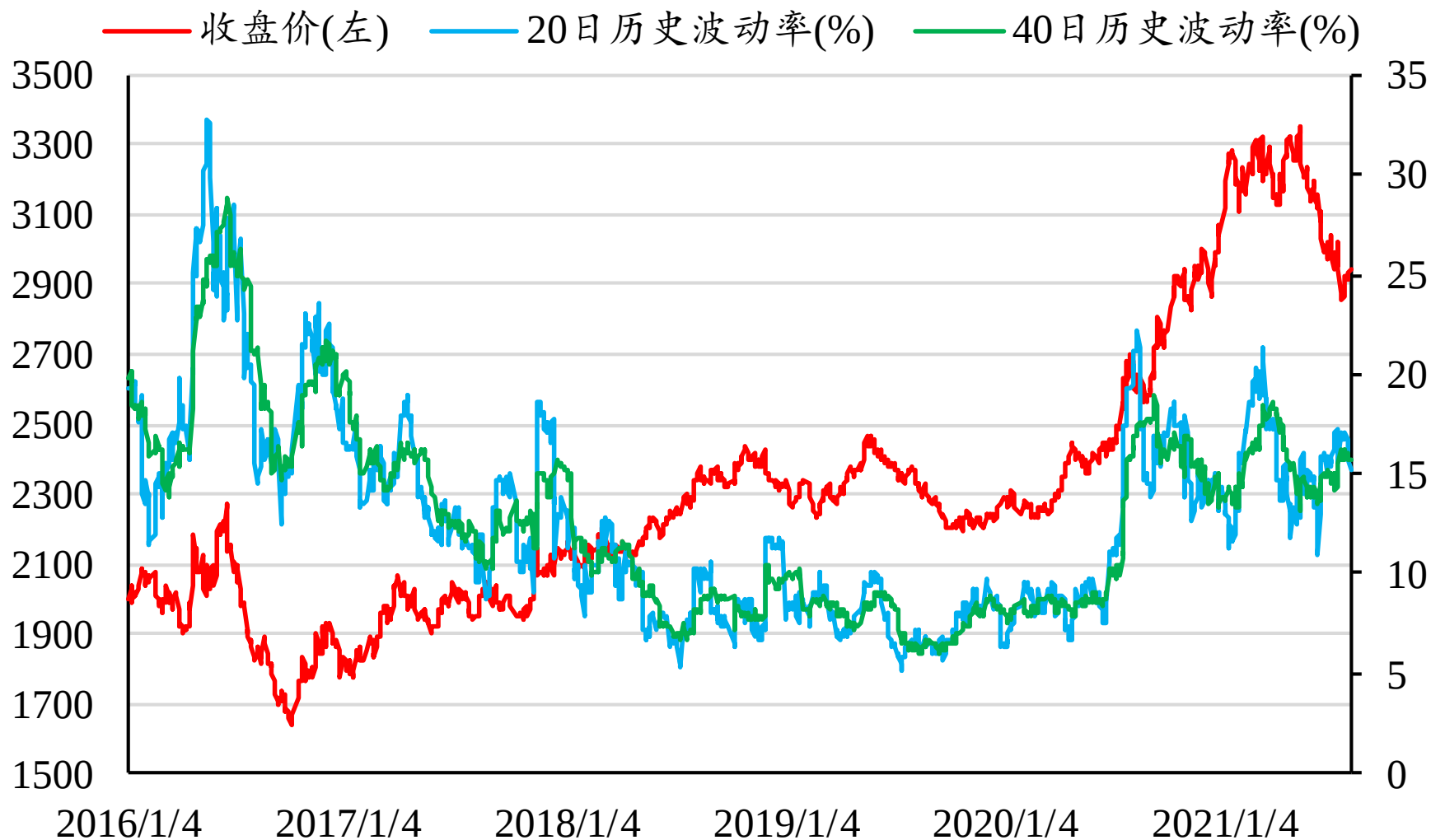
## 苹果指数收盘价和历史波动率



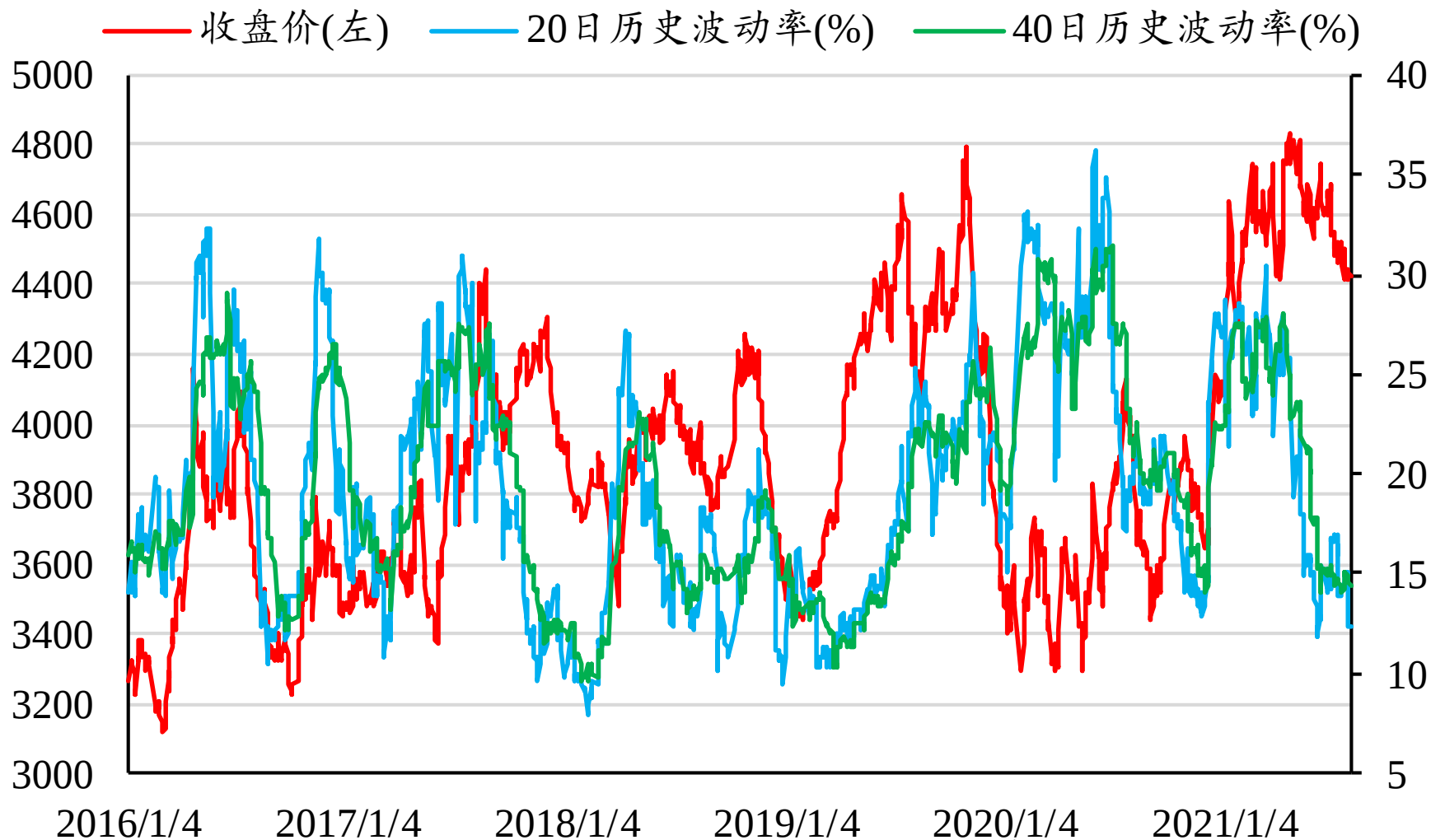
## 红枣指数收盘价和历史波动率



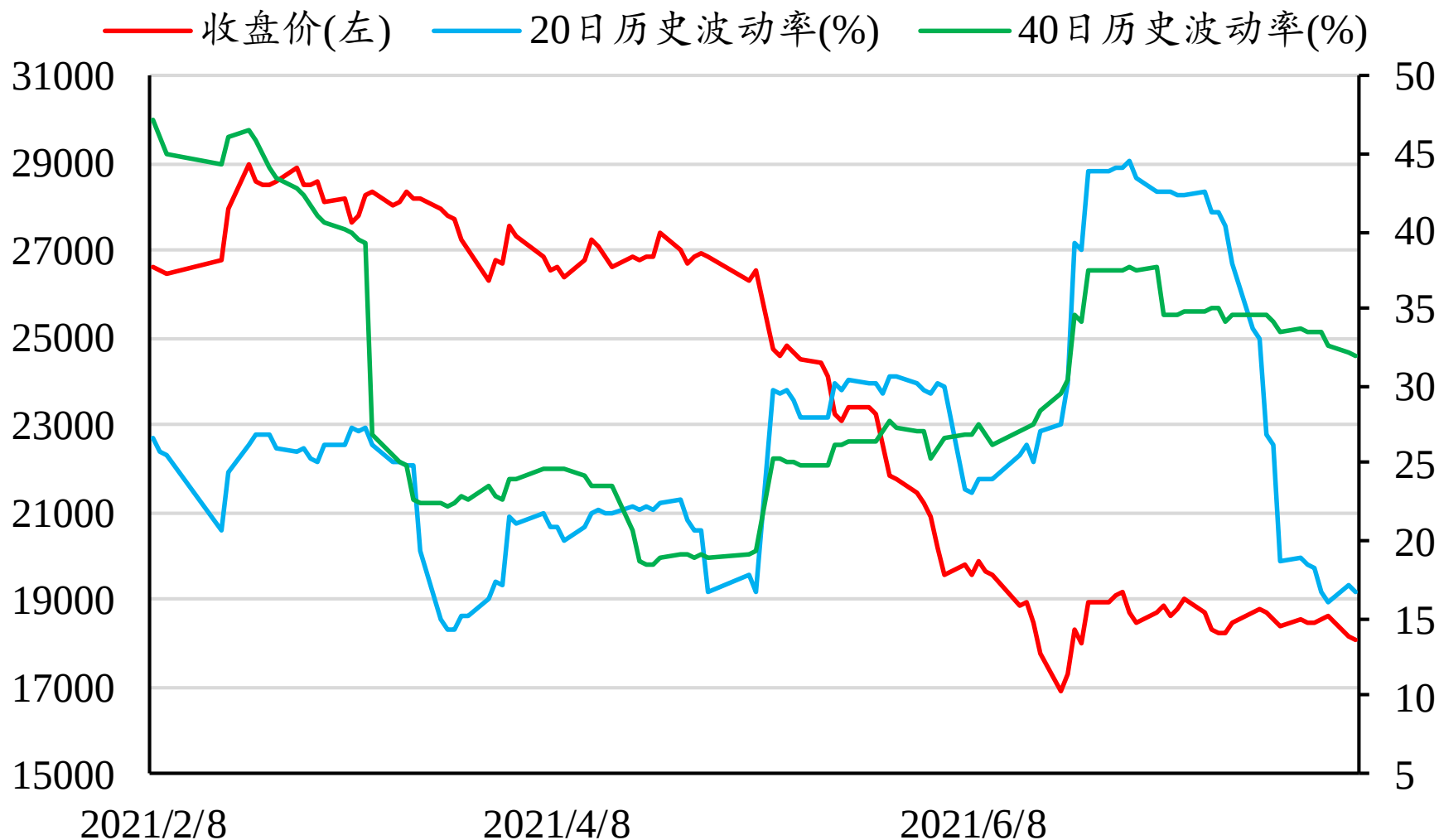
## 淀粉指数收盘价和历史波动率



## 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](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