

商品期货波动率跟踪

2021年10月27日

20日历史波动率百分位高于90%:

沪铝、锰硅、红枣、尿素、甲醇、动煤、LPG、PVC、
乙二醇、硅铁、焦煤、焦炭、沪锌、玻璃、苹果、
郑棉、纯碱、淀粉、塑料、PP、TA、沪锡、铁矿、
短纤、沪铜、不锈钢、棕榈、菜油、豆油

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、硅铁、锰硅、焦炭、焦煤

20日历史波动率绝对值后五:

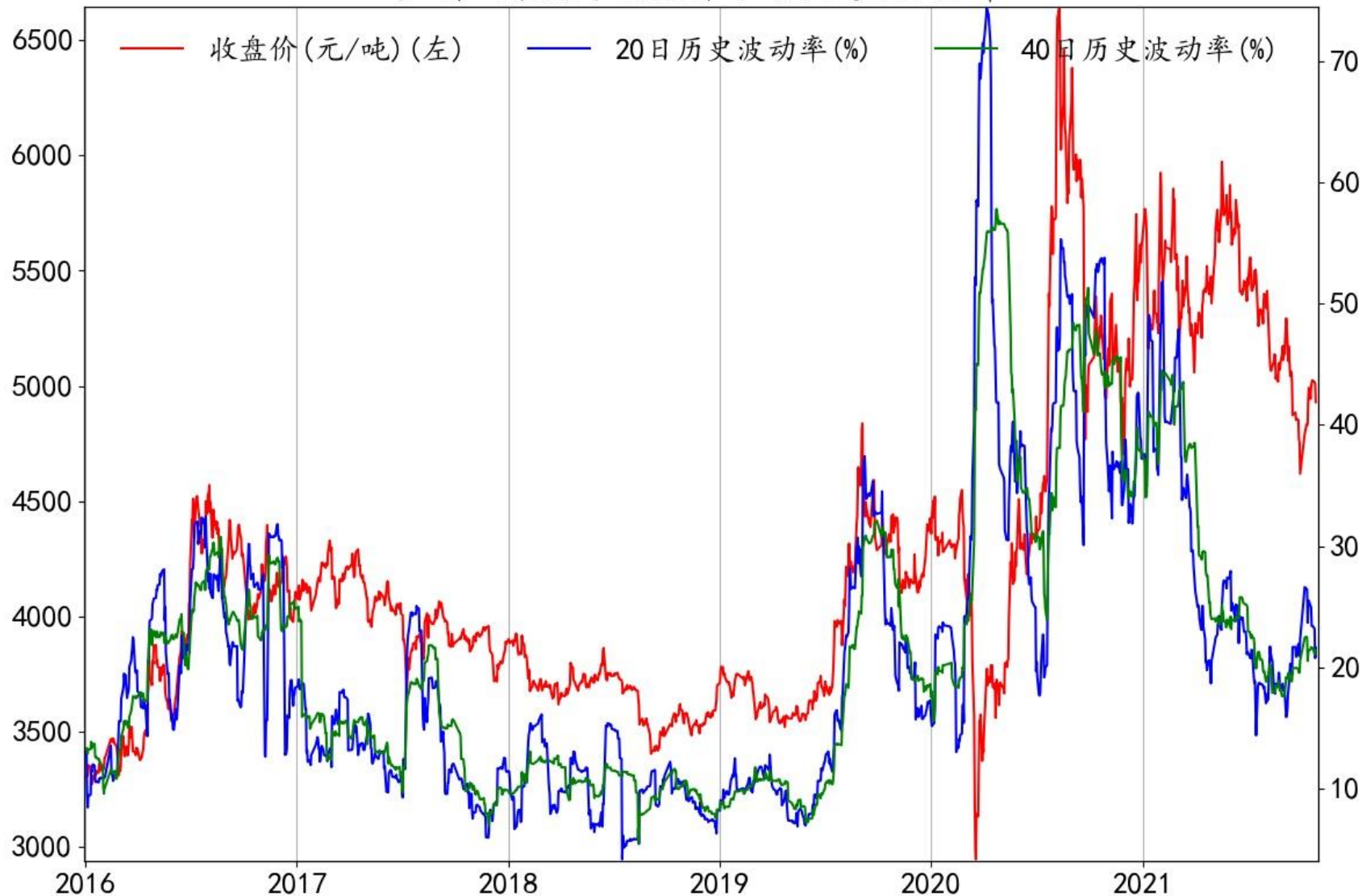
沪金、郑糖、豆粕、玉米、菜粕

	时间百分位	绝对值
沪银	61.81%	21.59%
沪金	53.96%	11.12%
沪铝	100.00%	40.74%
沪铜	93.28%	25.26%
沪镍	88.76%	31.35%
沪铅	64.78%	18.72%
沪锡	95.54%	33.35%
沪锌	100.00%	48.96%
热卷	80.34%	32.73%
铁矿	95.05%	58.06%
焦炭	100.00%	84.72%
焦煤	100.00%	84.09%
螺纹	89.32%	39.42%

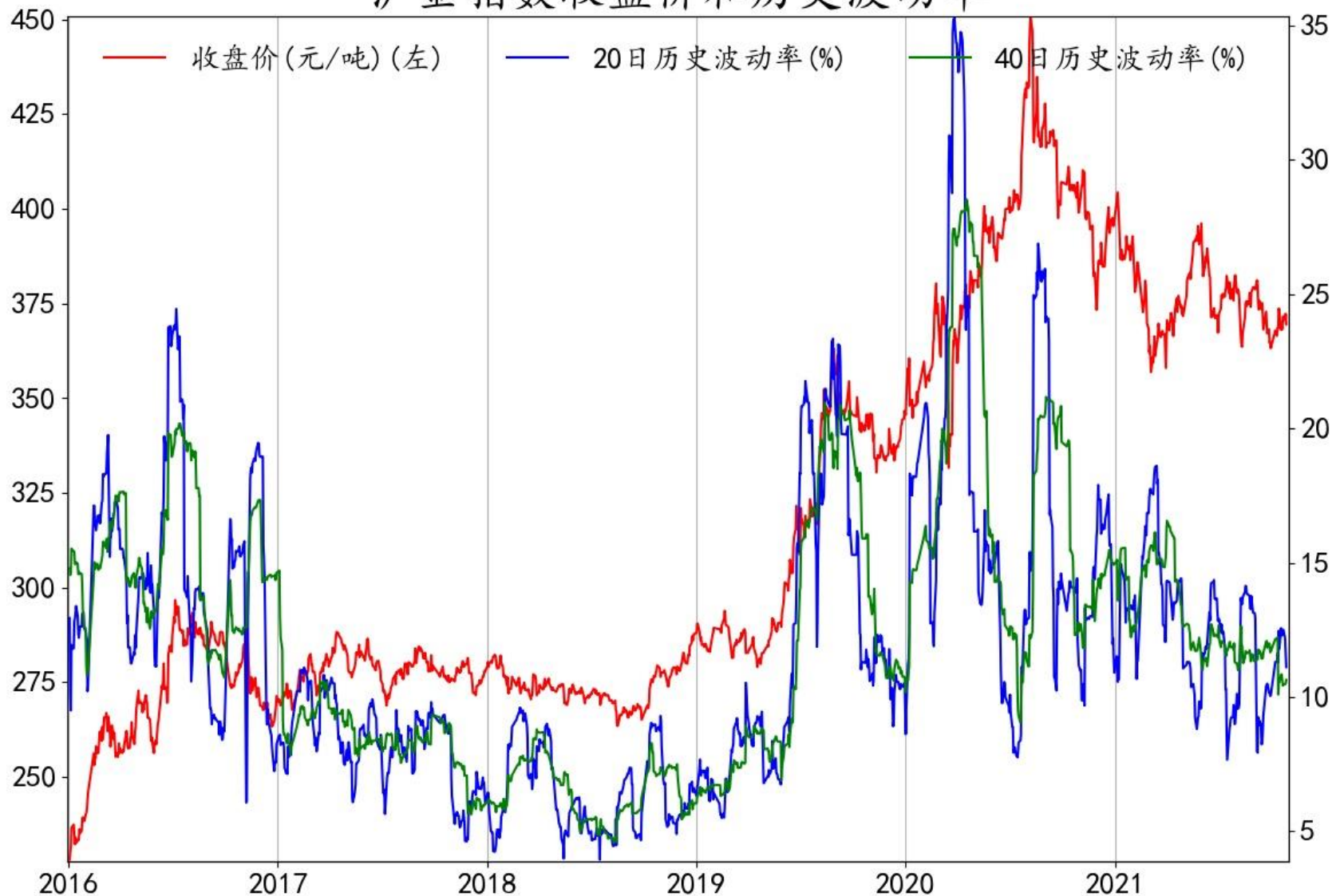
	时间百分位	绝对值
硅铁	100.00%	105.83%
锰硅	100.00%	99.75%
不锈钢	93.04%	34.40%
玻璃	99.93%	46.45%
PVC	100.00%	67.47%
燃油	85.07%	42.04%
低硫燃油	36.08%	27.12%
LPG	100.00%	51.47%
原油	55.01%	30.21%
动煤	100.00%	115.47%
沥青	69.52%	31.08%
苯乙烯	83.67%	40.82%
乙二醇	100.00%	74.45%

	时间百分位	绝对值		时间百分位	绝对值
塑料	97.31%	34.57%	菜油	90.88%	24.12%
甲醇	100.00%	72.24%	棕榈	91.09%	33.33%
20号胶	61.70%	27.96%	花生	67.43%	20.65%
短纤	93.33%	41.54%	菜粕	47.03%	18.22%
PP	96.75%	35.38%	豆油	90.45%	25.07%
沪胶	53.25%	26.59%	郑棉	99.65%	45.60%
纯碱	98.90%	57.74%	郑糖	70.72%	14.47%
纸浆	75.04%	20.60%	苹果	99.89%	48.54%
TA	96.68%	36.40%	红枣	100.00%	64.92%
尿素	100.00%	69.70%	淀粉	97.45%	25.64%
玉米	85.36%	15.48%	鸡蛋	73.69%	23.10%
豆一	81.75%	20.78%	生猪	81.82%	42.47%
豆粕	38.54%	14.67%			

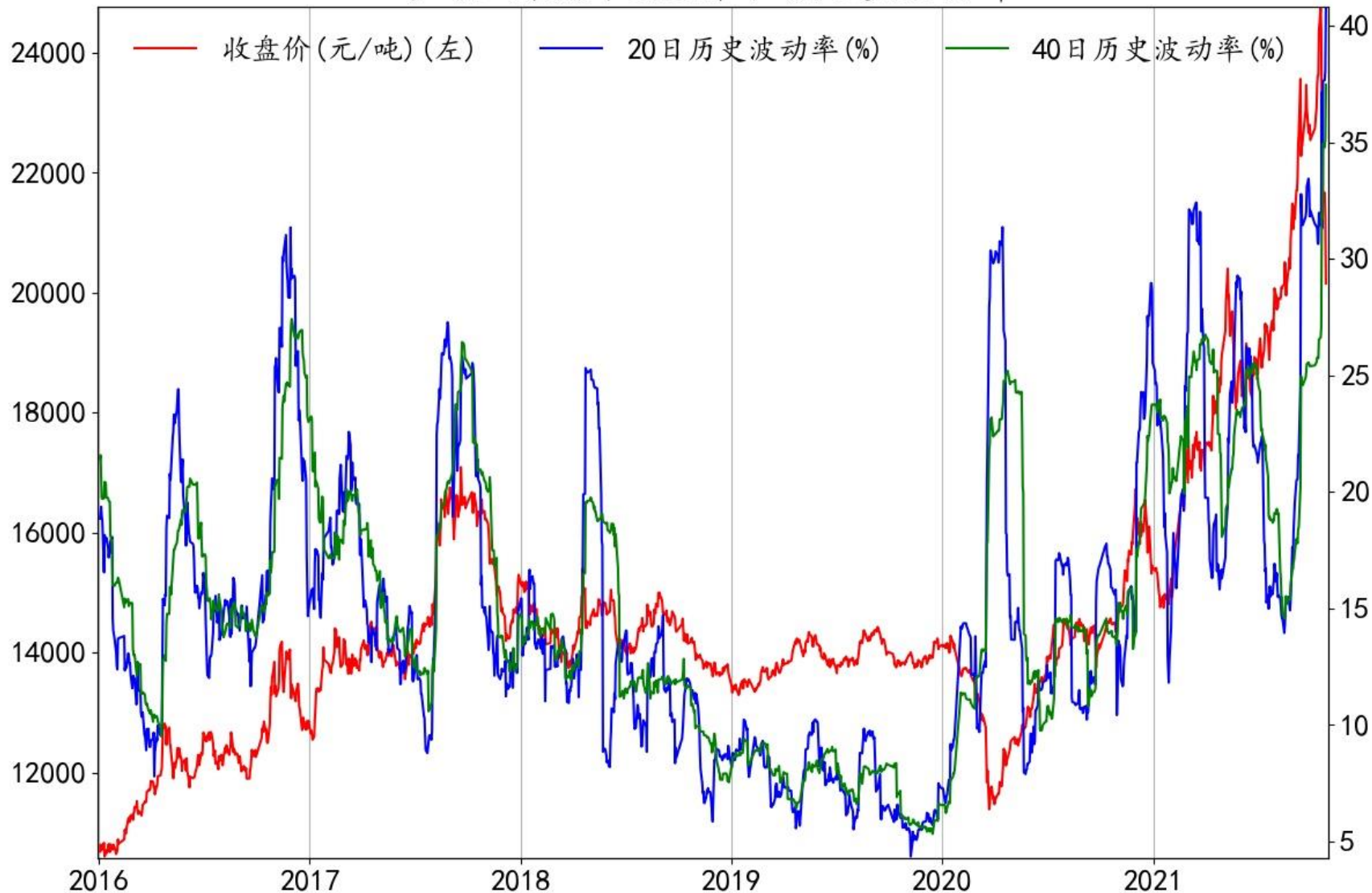
沪银指数收盘价和历史波动率



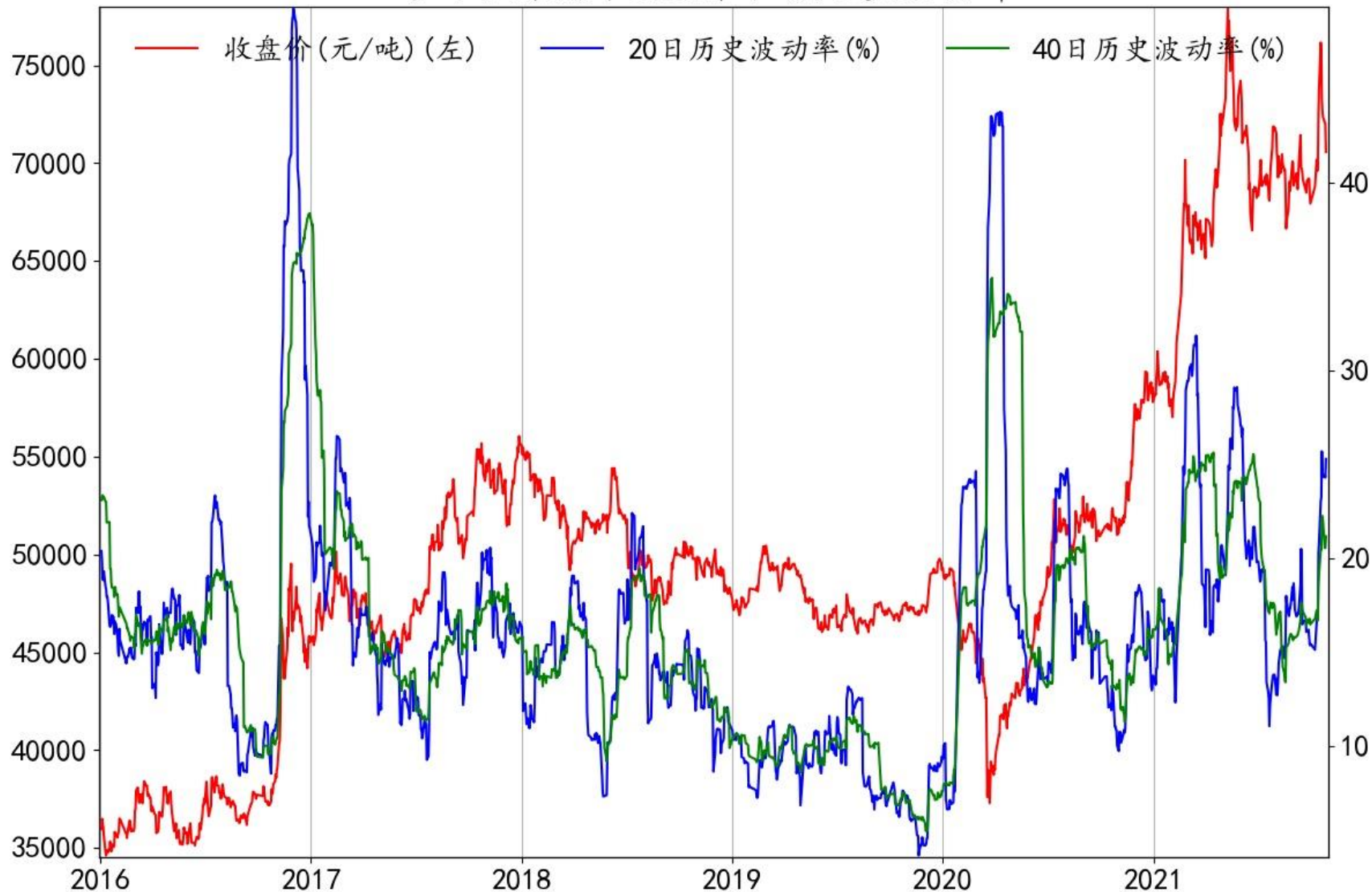
沪金指数收盘价和历史波动率



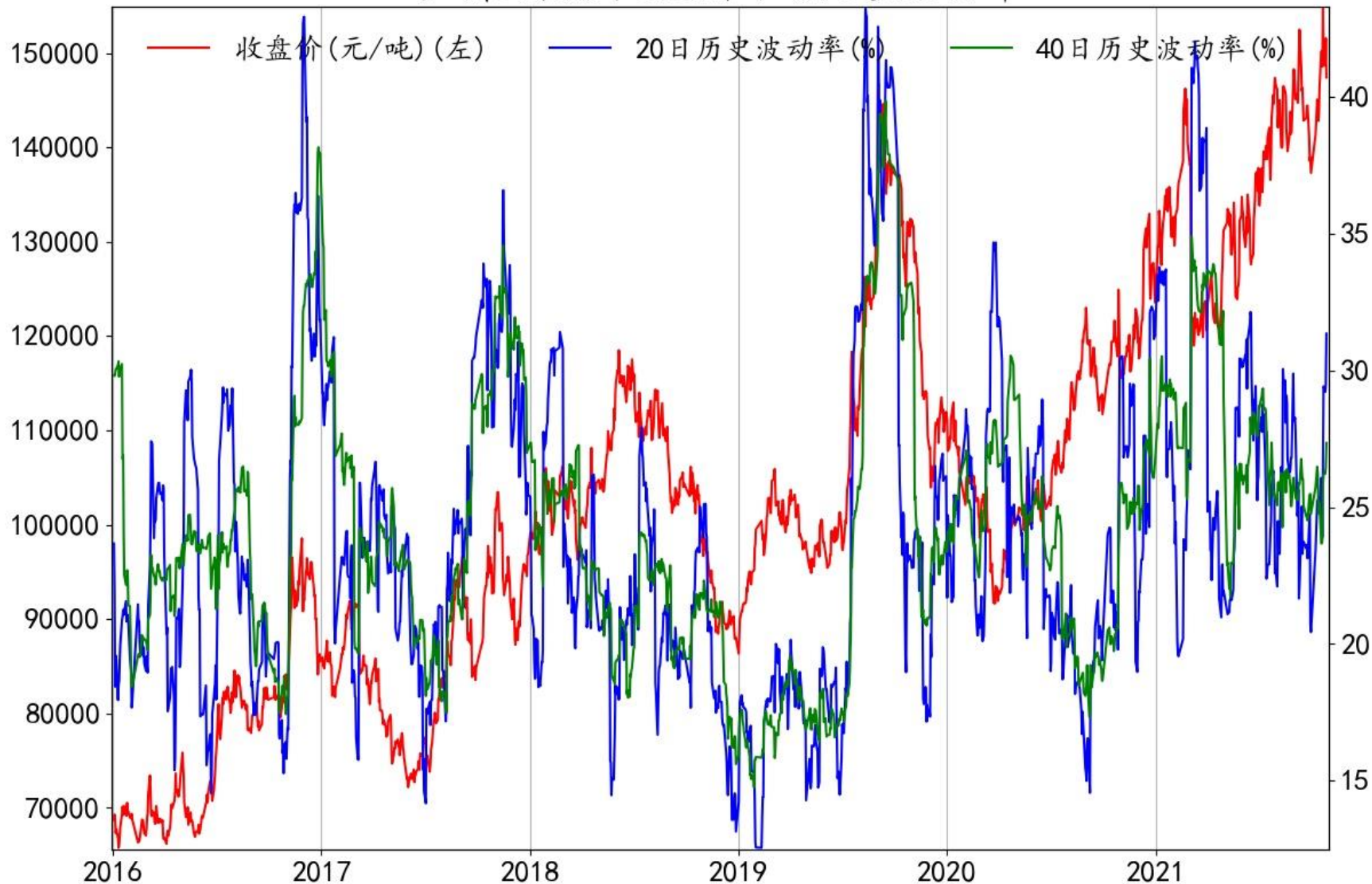
沪铝指数收盘价和历史波动率



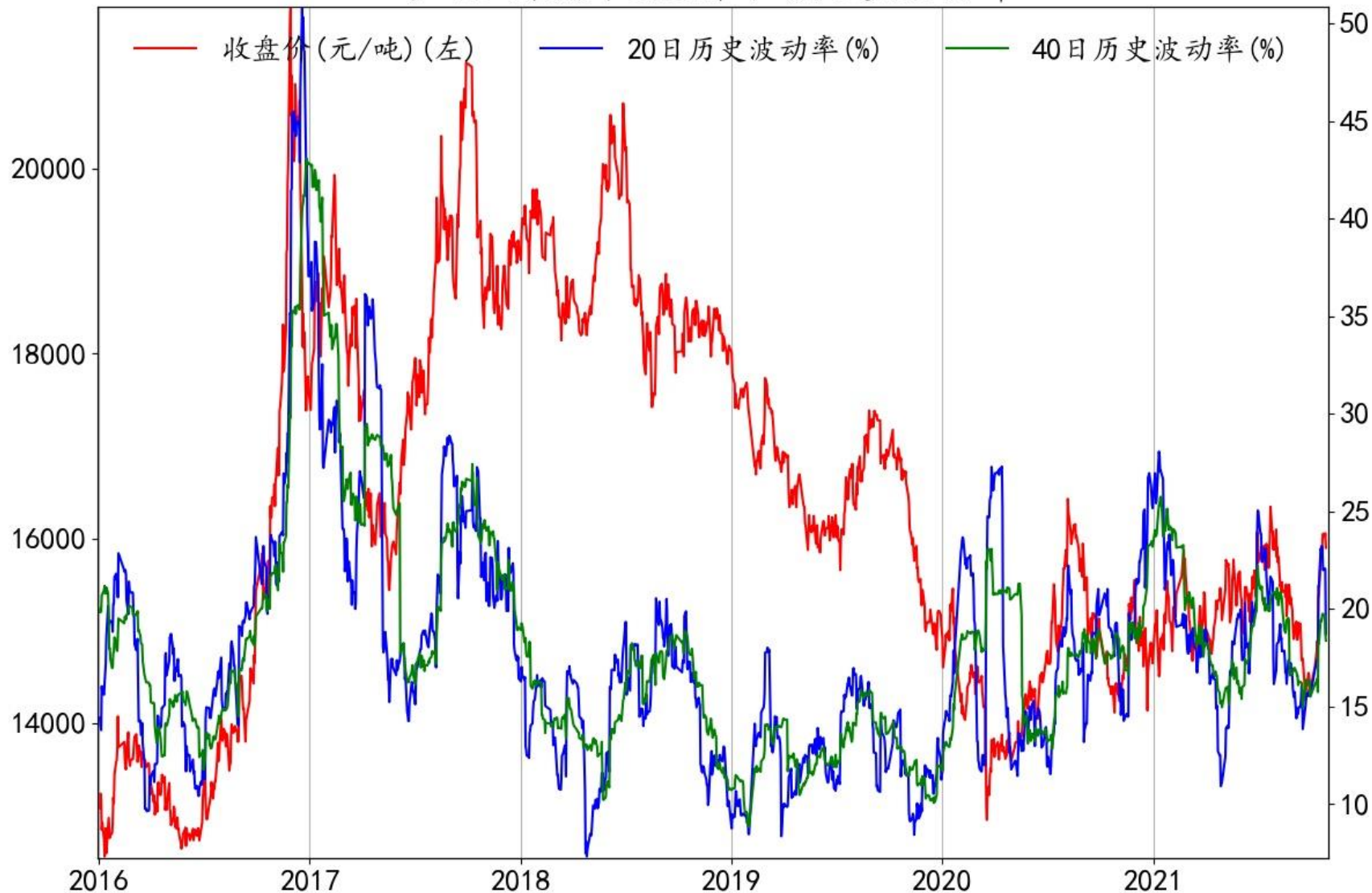
沪铜指数收盘价和历史波动率



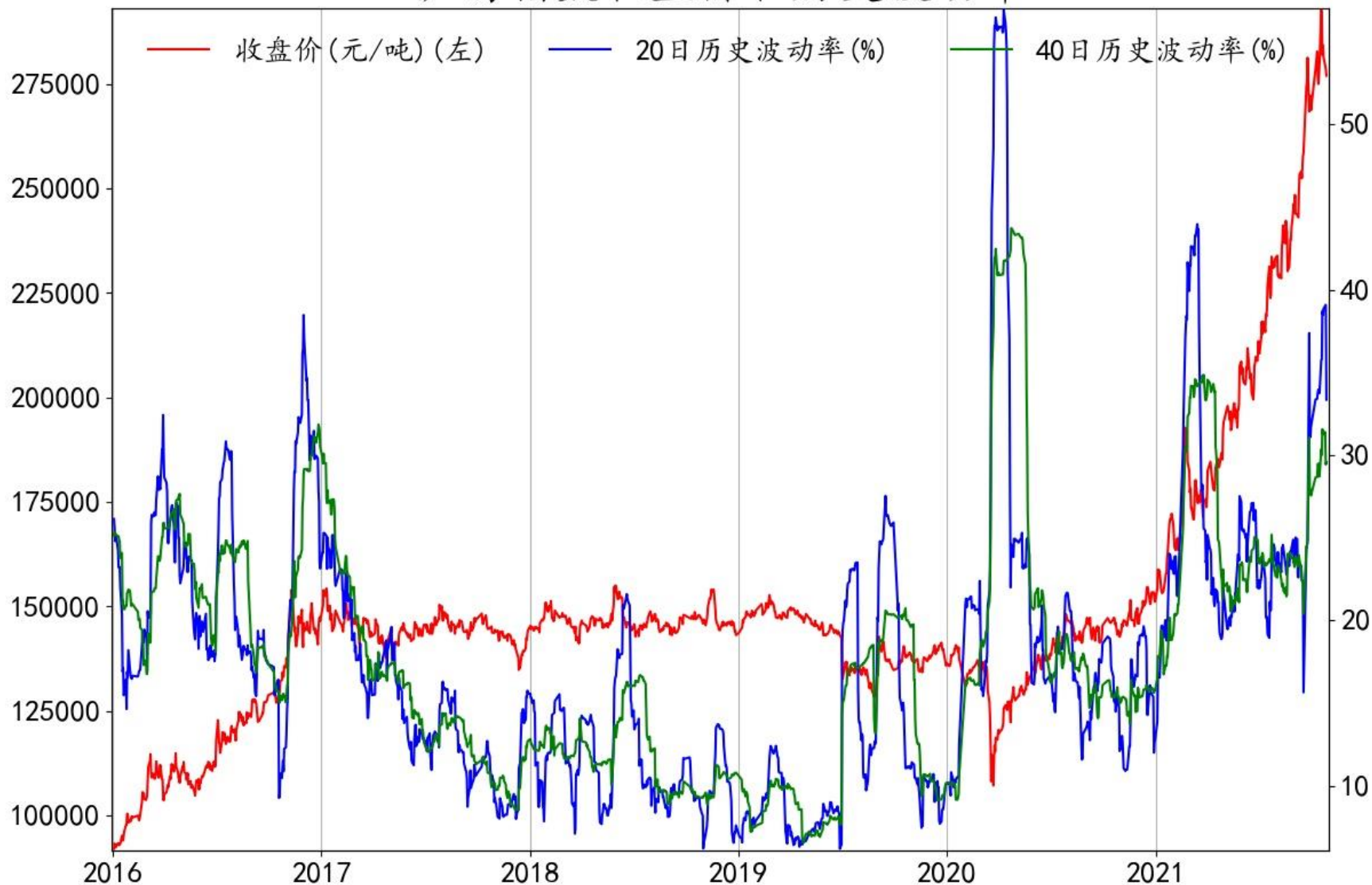
沪镍指数收盘价和历史波动率



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



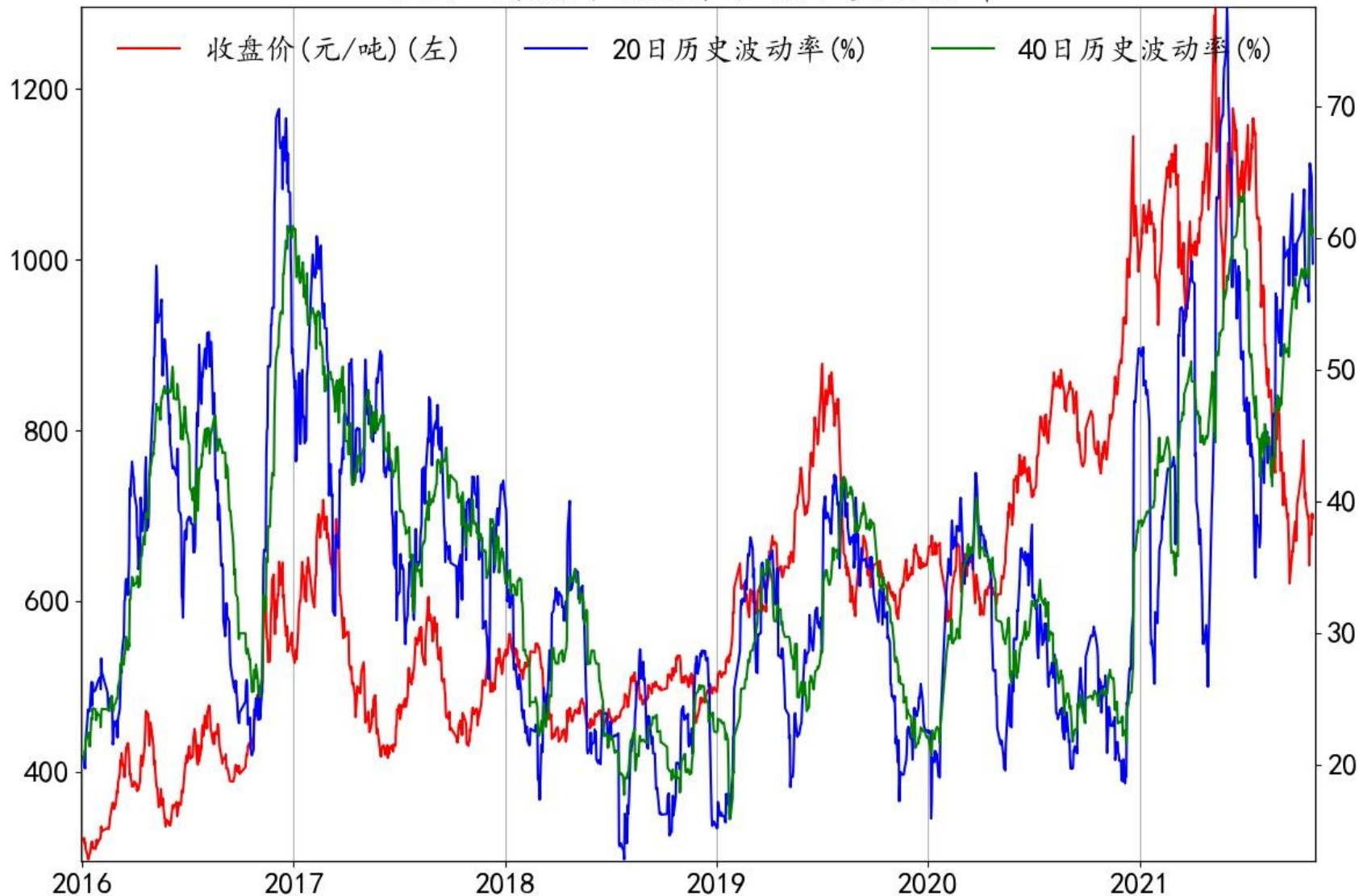
沪锌指数收盘价和历史波动率



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



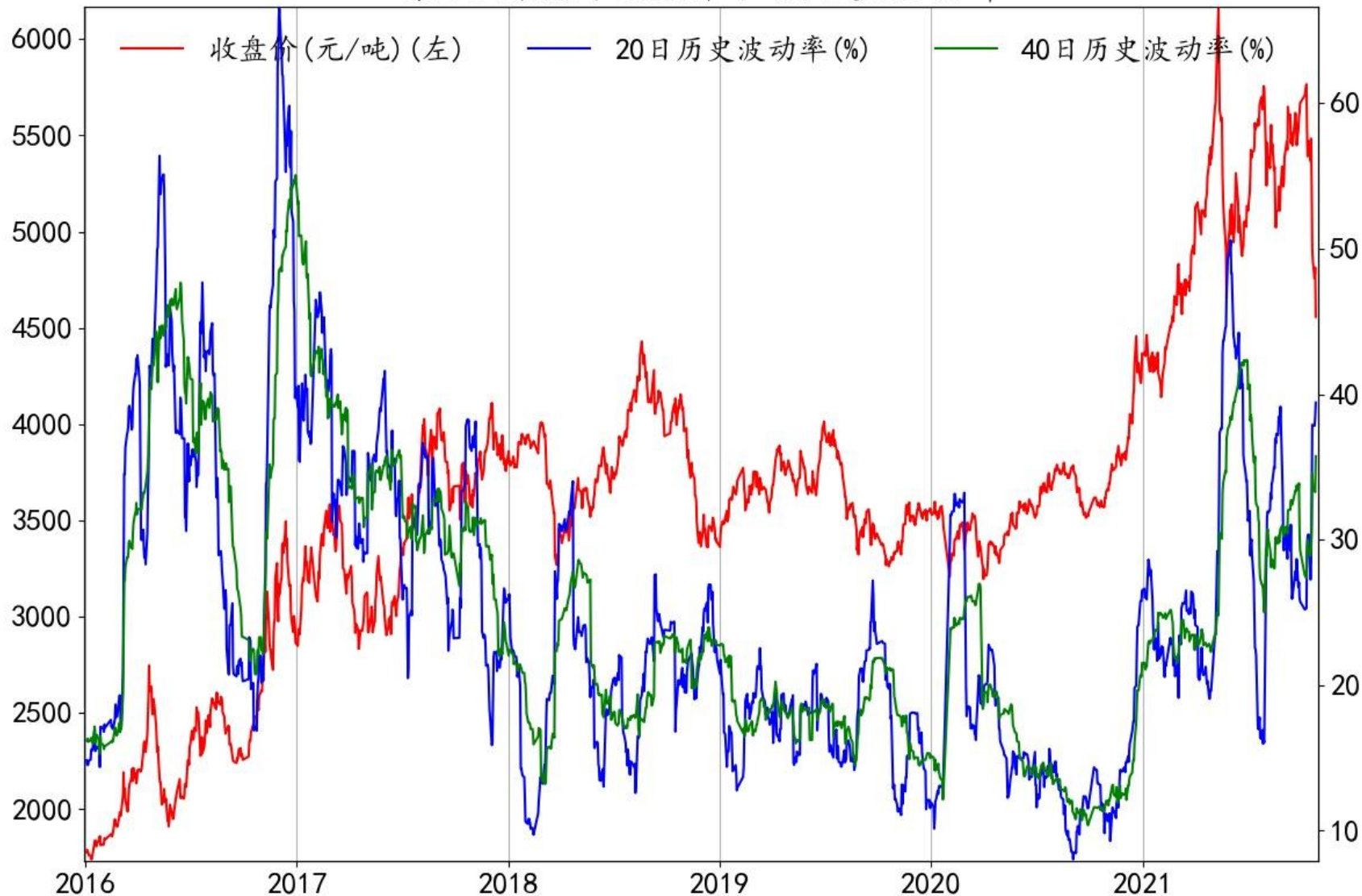
焦炭指数收盘价和历史波动率



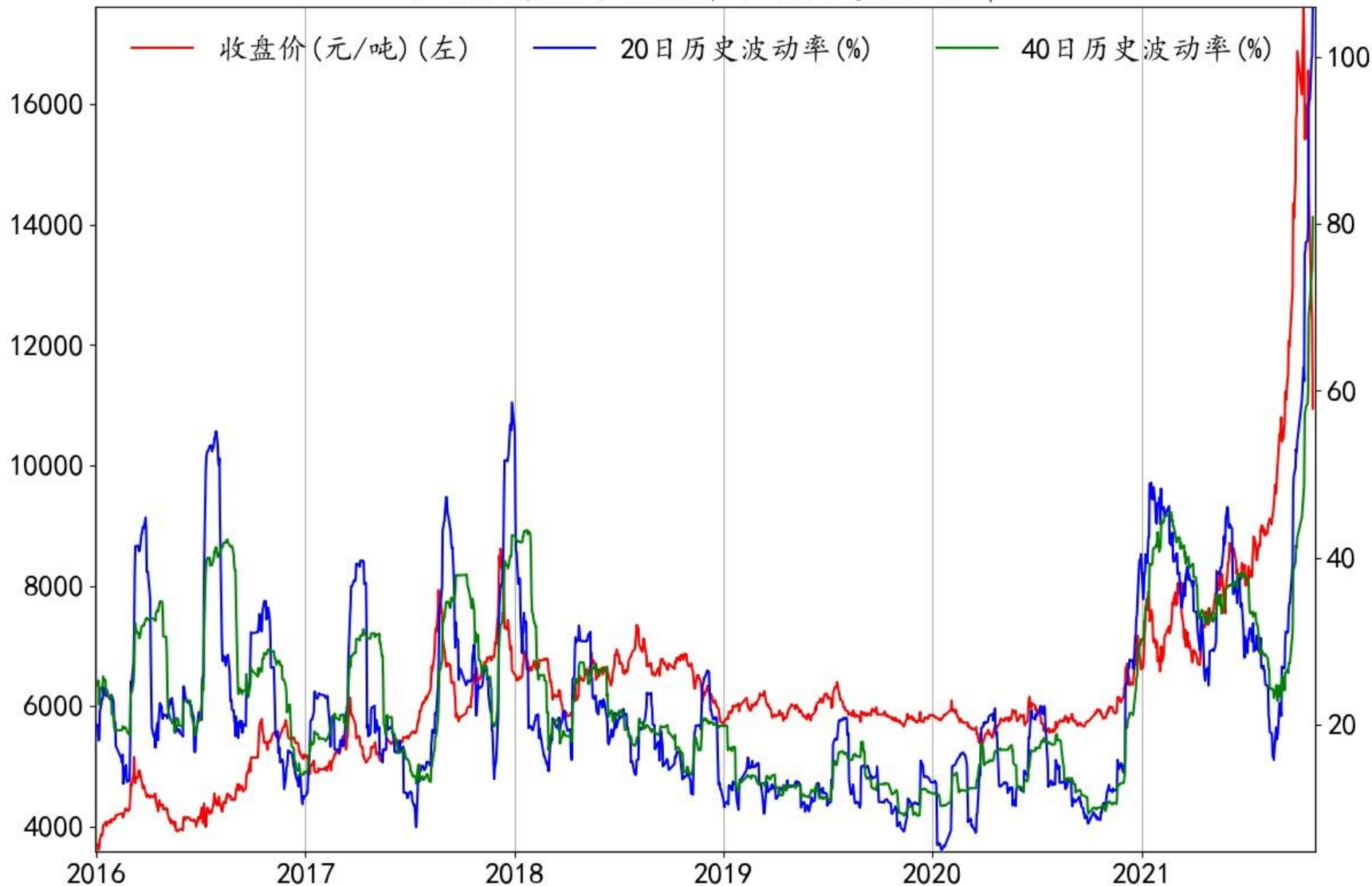
焦煤指数收盘价和历史波动率



螺纹指数收盘价和历史波动率



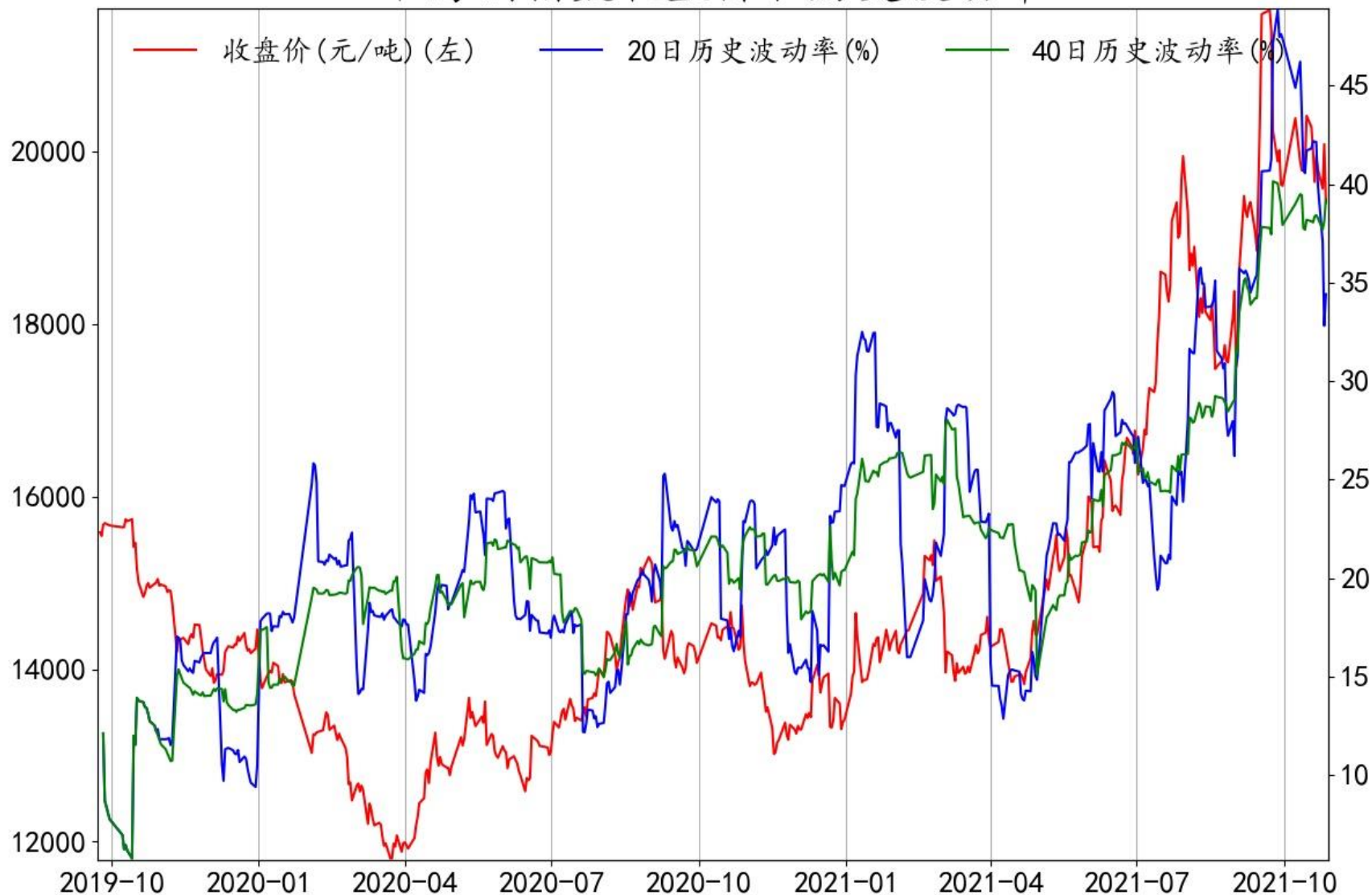
硅铁指数收盘价和历史波动率



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

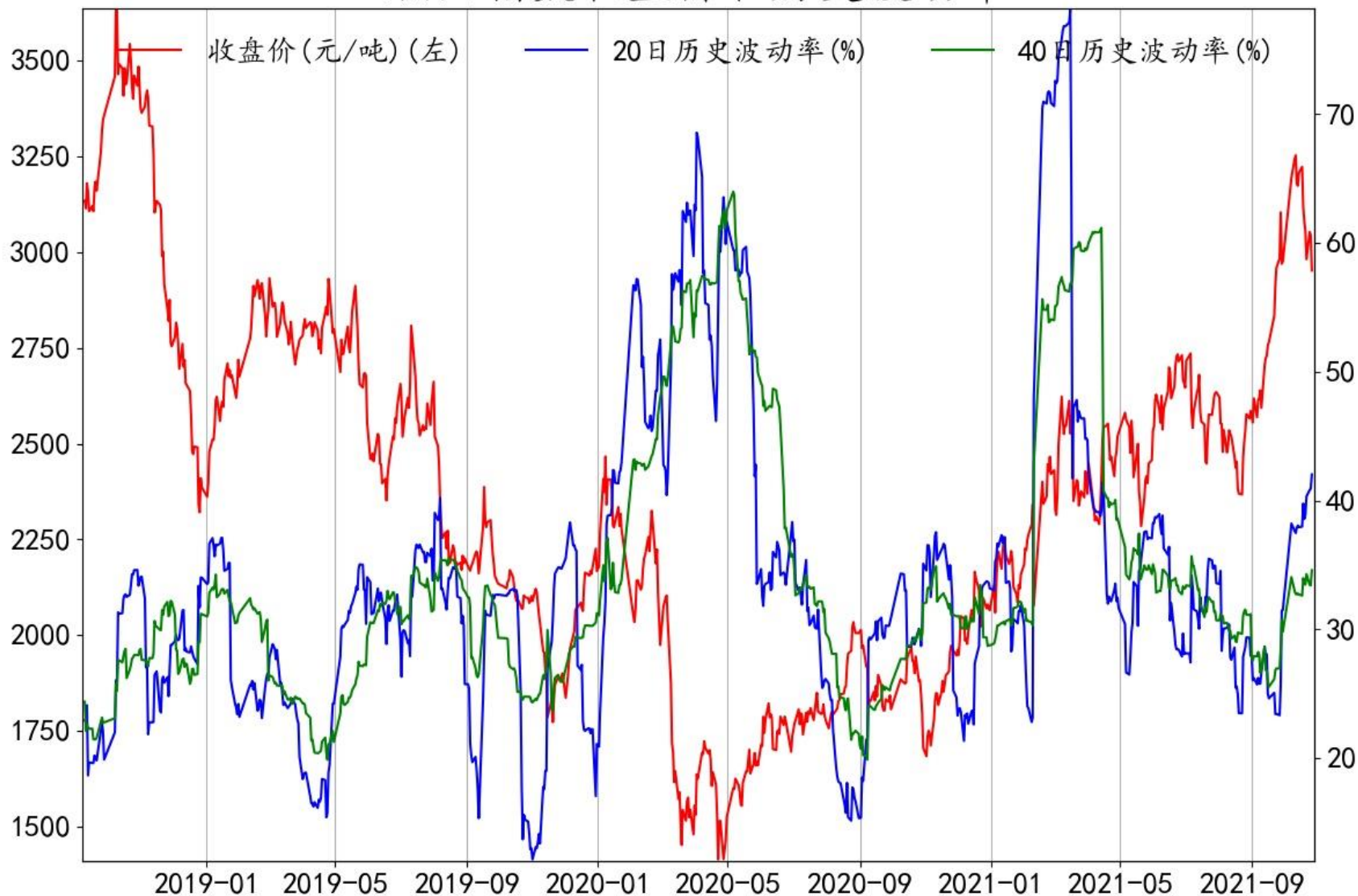


PVC指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

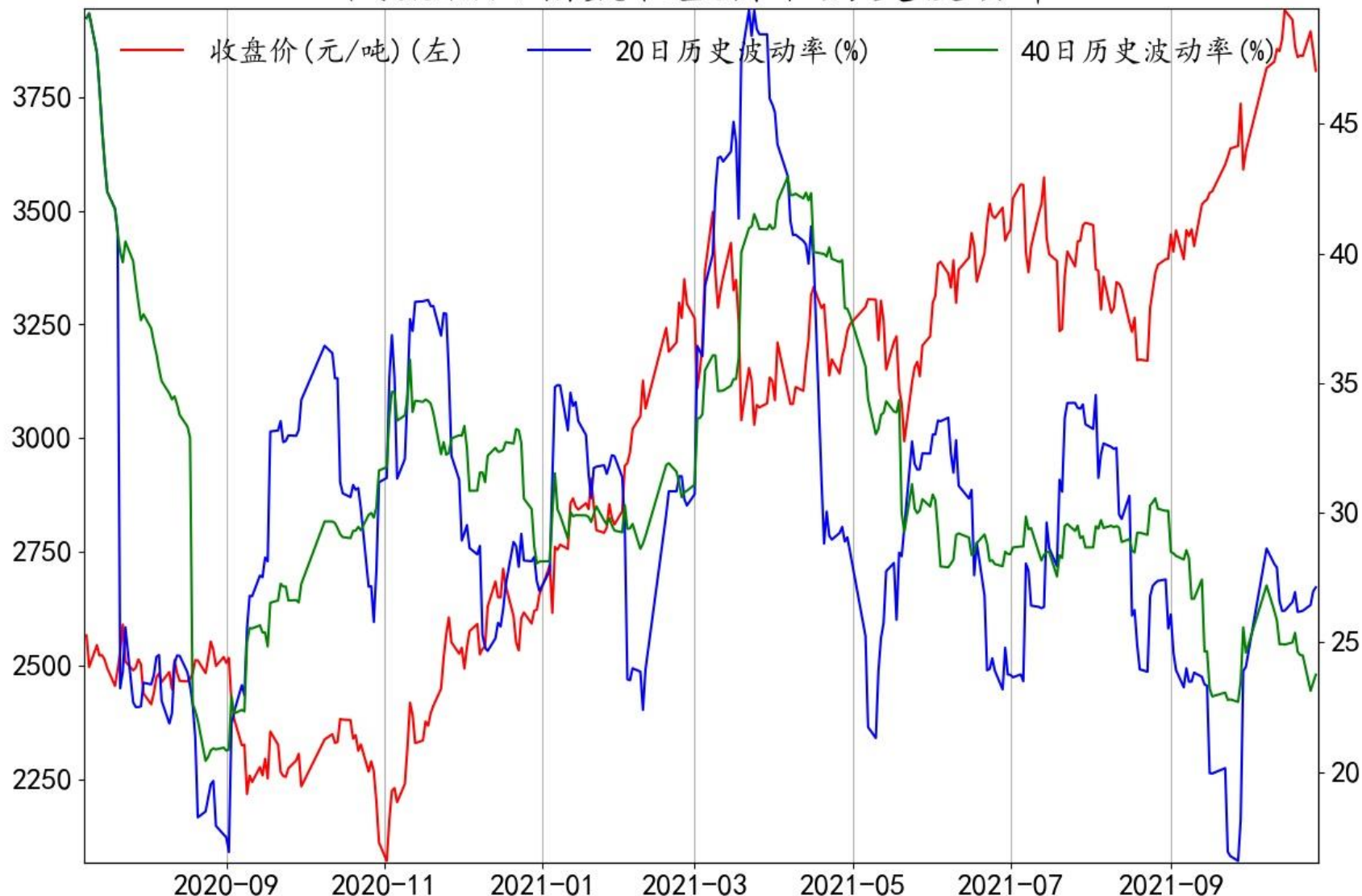
燃油指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

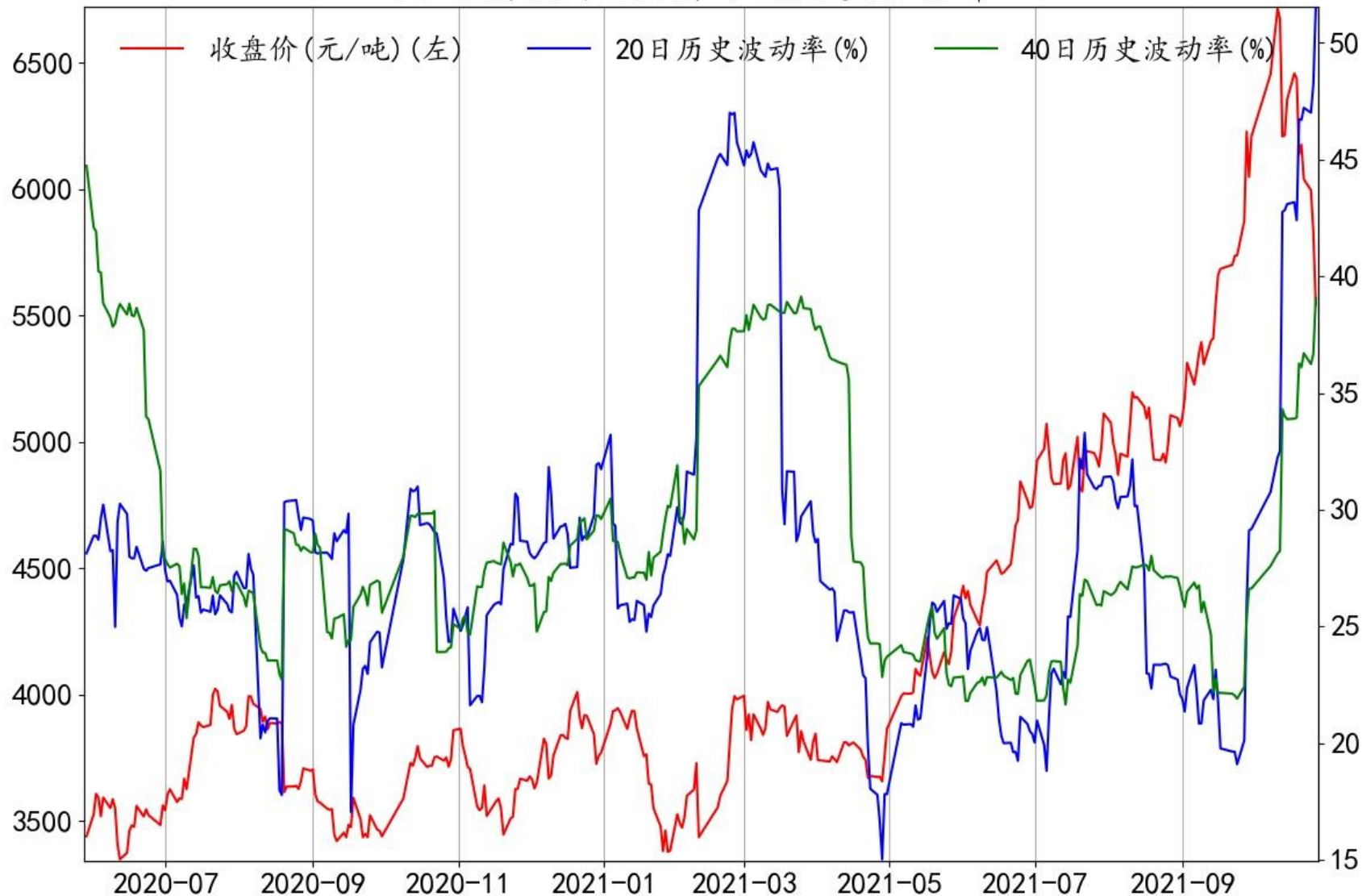
低硫燃油指数

低硫燃油指数收盘价和历史波动率



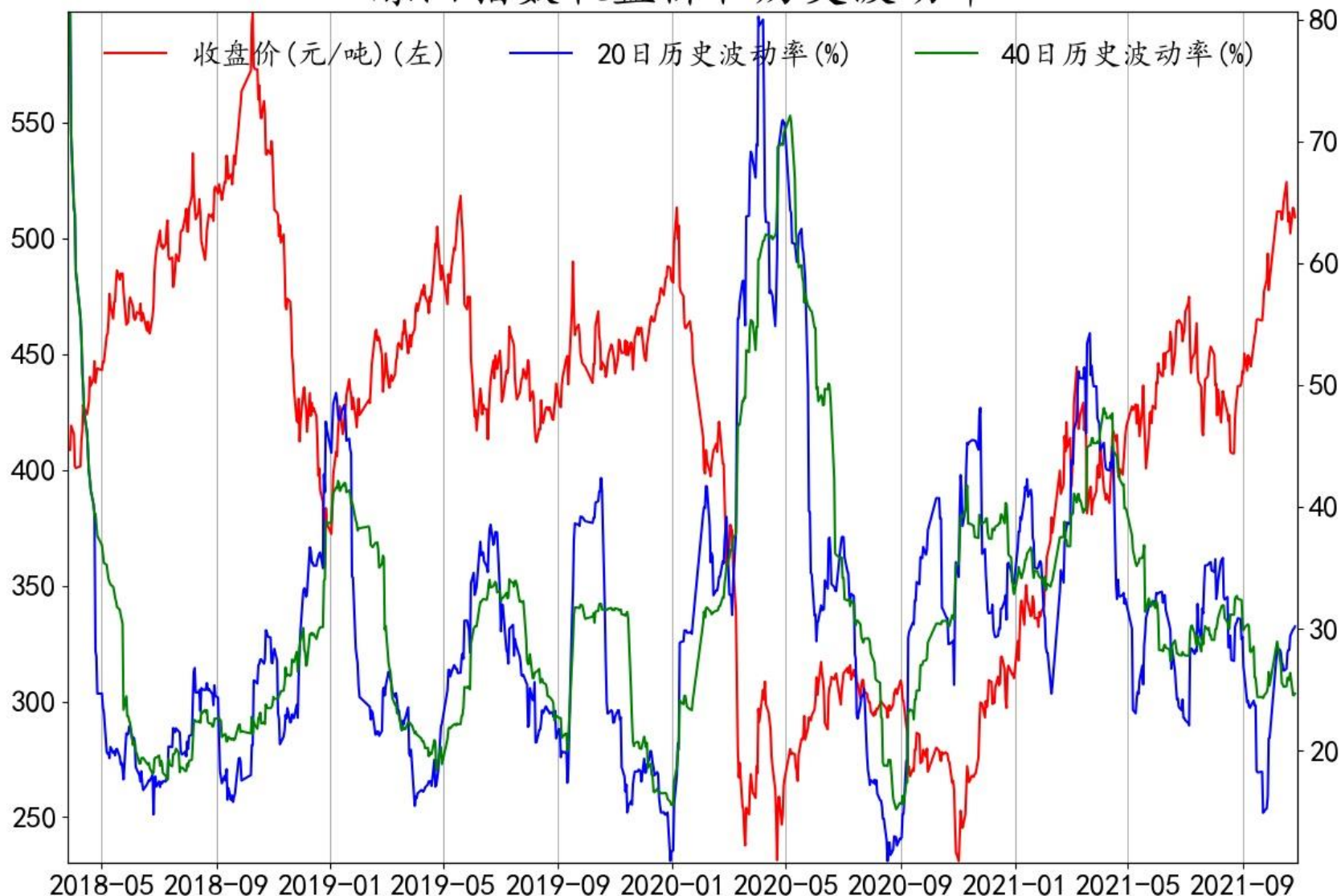
数据来源: Wind、信达期货研发中心

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

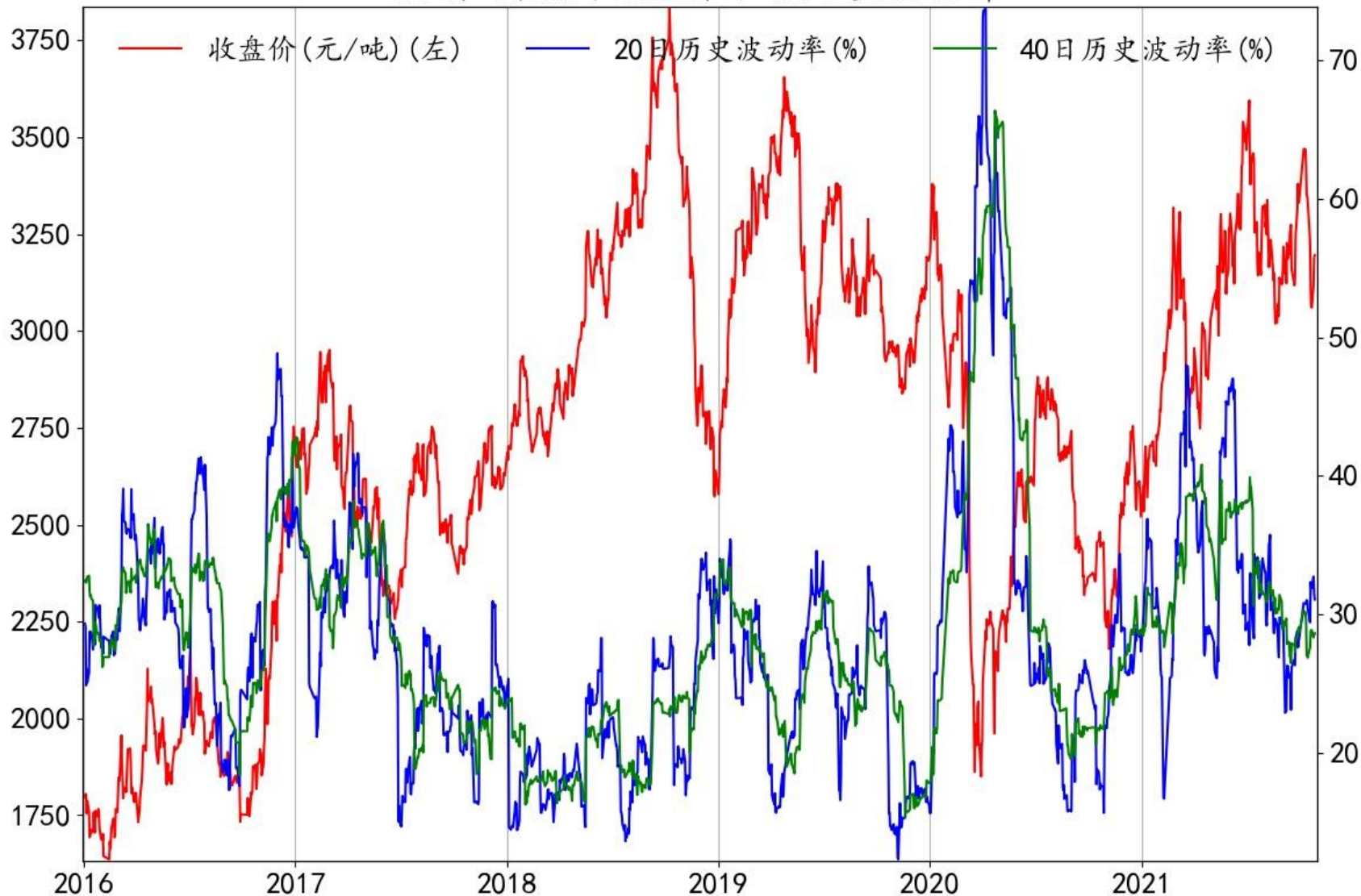


数据来源: Wind、信达期货研发中心

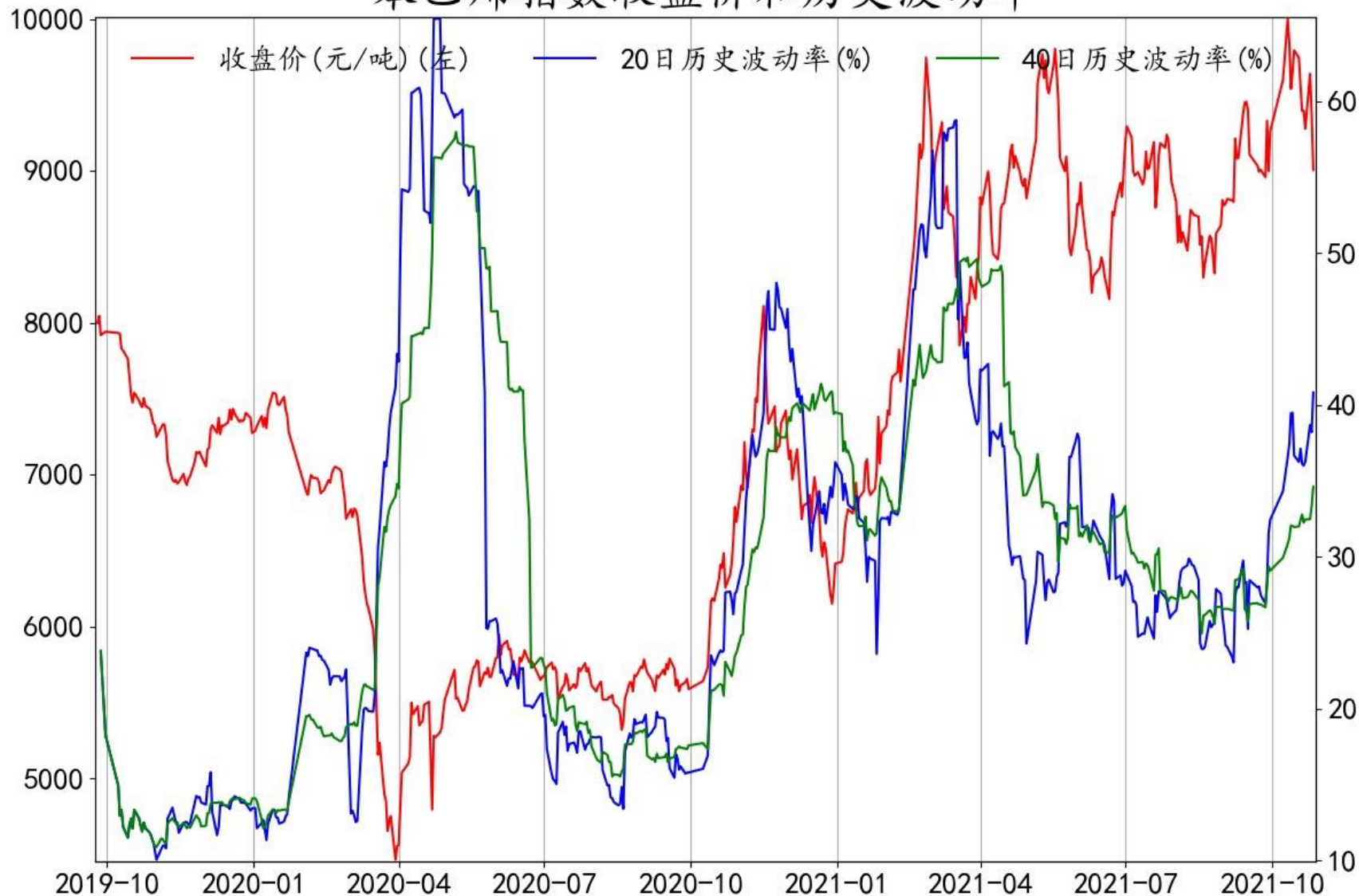
动煤指数收盘价和历史波动率



沥青指数收盘价和历史波动率

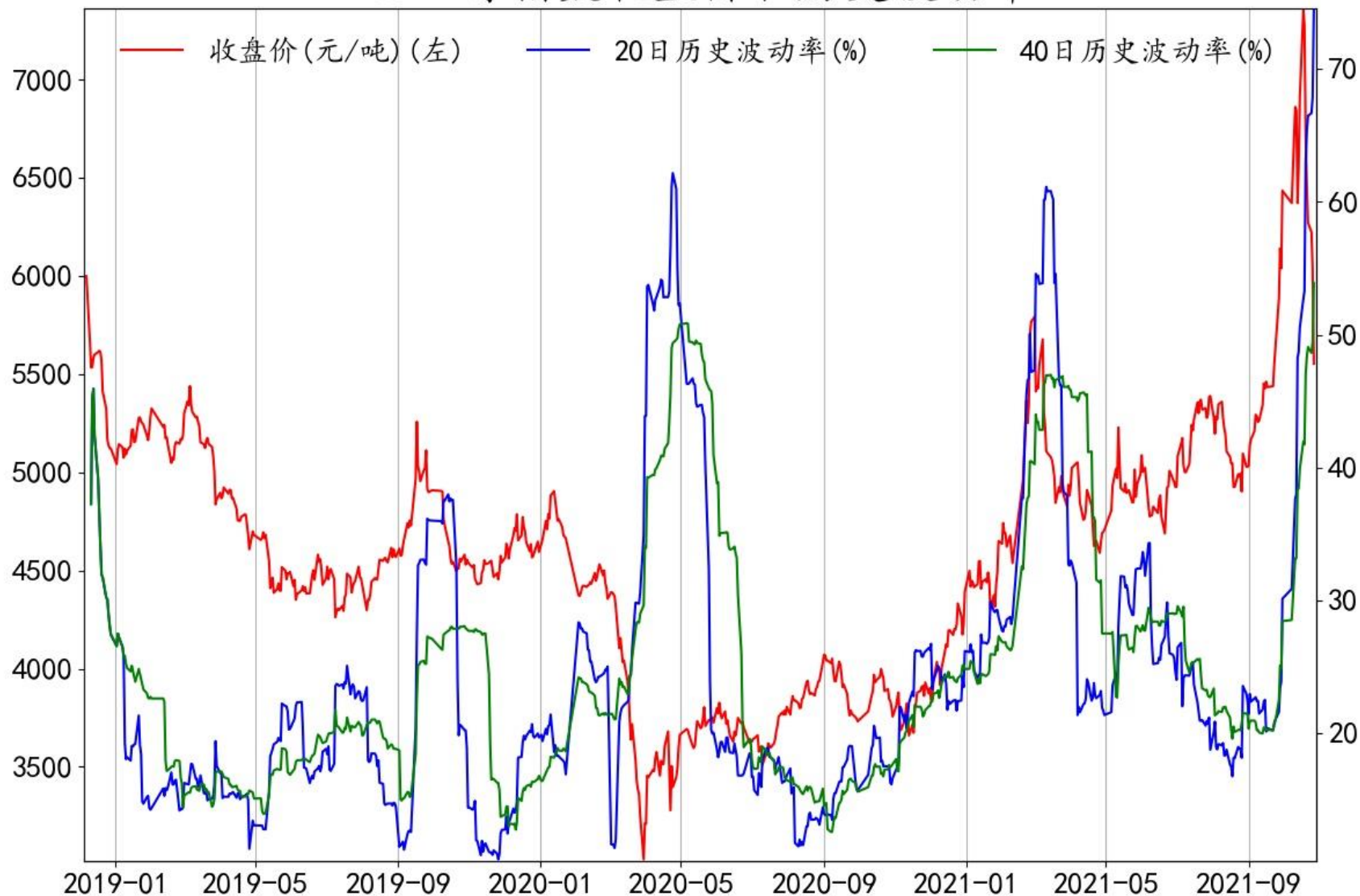


苯乙烯指数收盘价和历史波动率



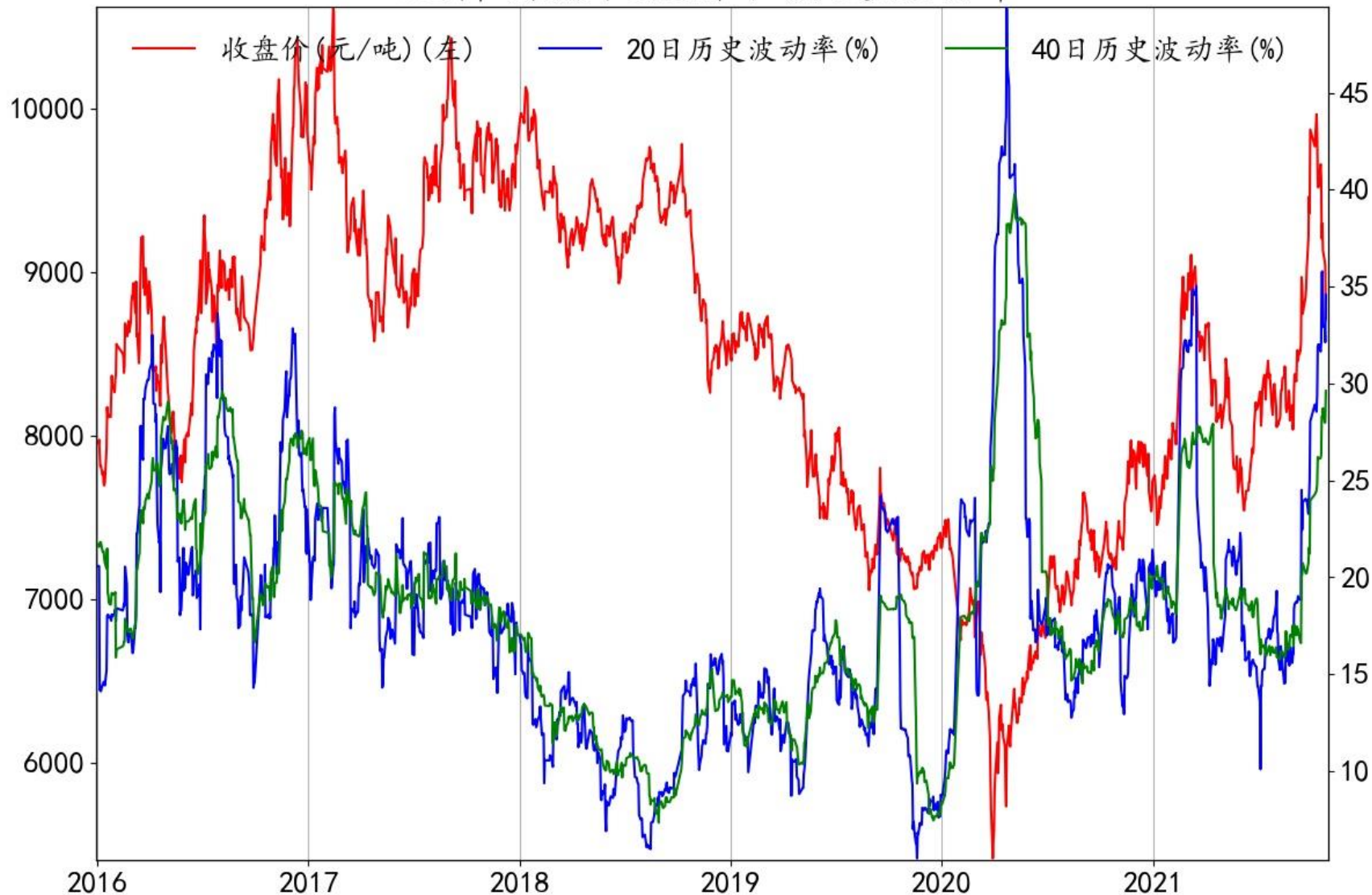
数据来源: Wind、信达期货研发中心

乙二醇指数收盘价和历史波动率

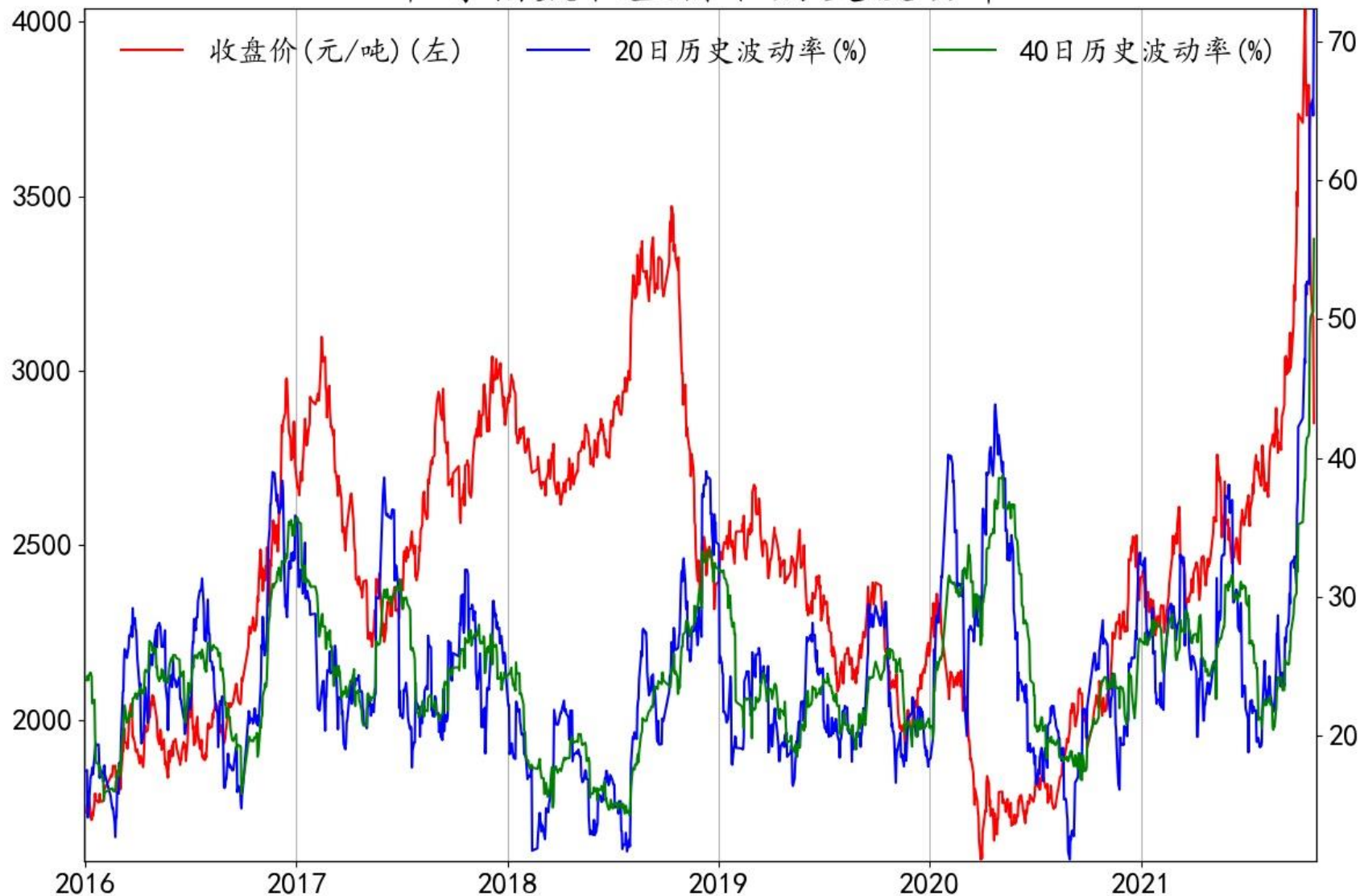


数据来源: Wind、信达期货研发中心

塑料指数收盘价和历史波动率

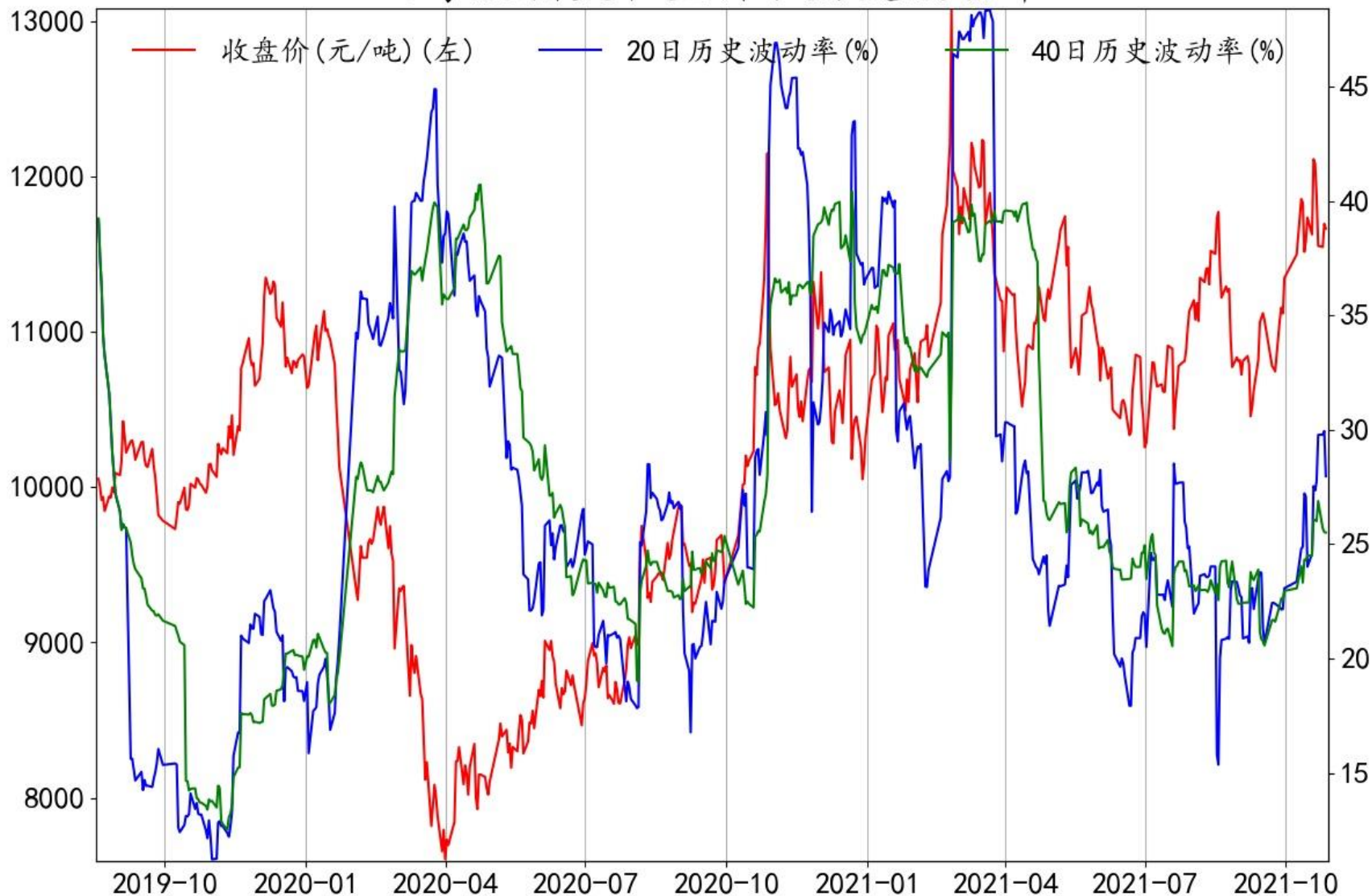


甲醇指数收盘价和历史波动率



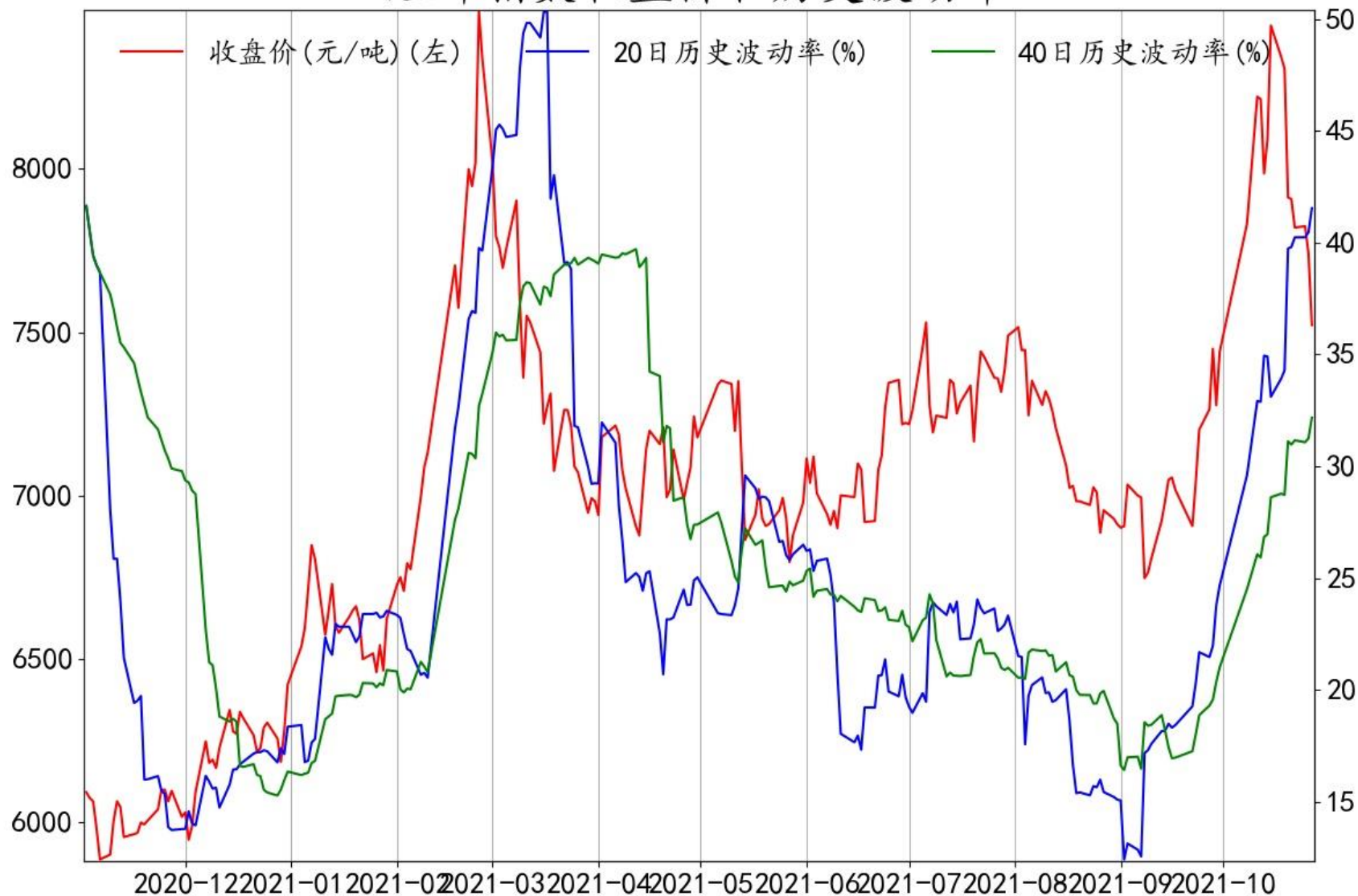
20号胶指数

20号胶指数收盘价和历史波动率



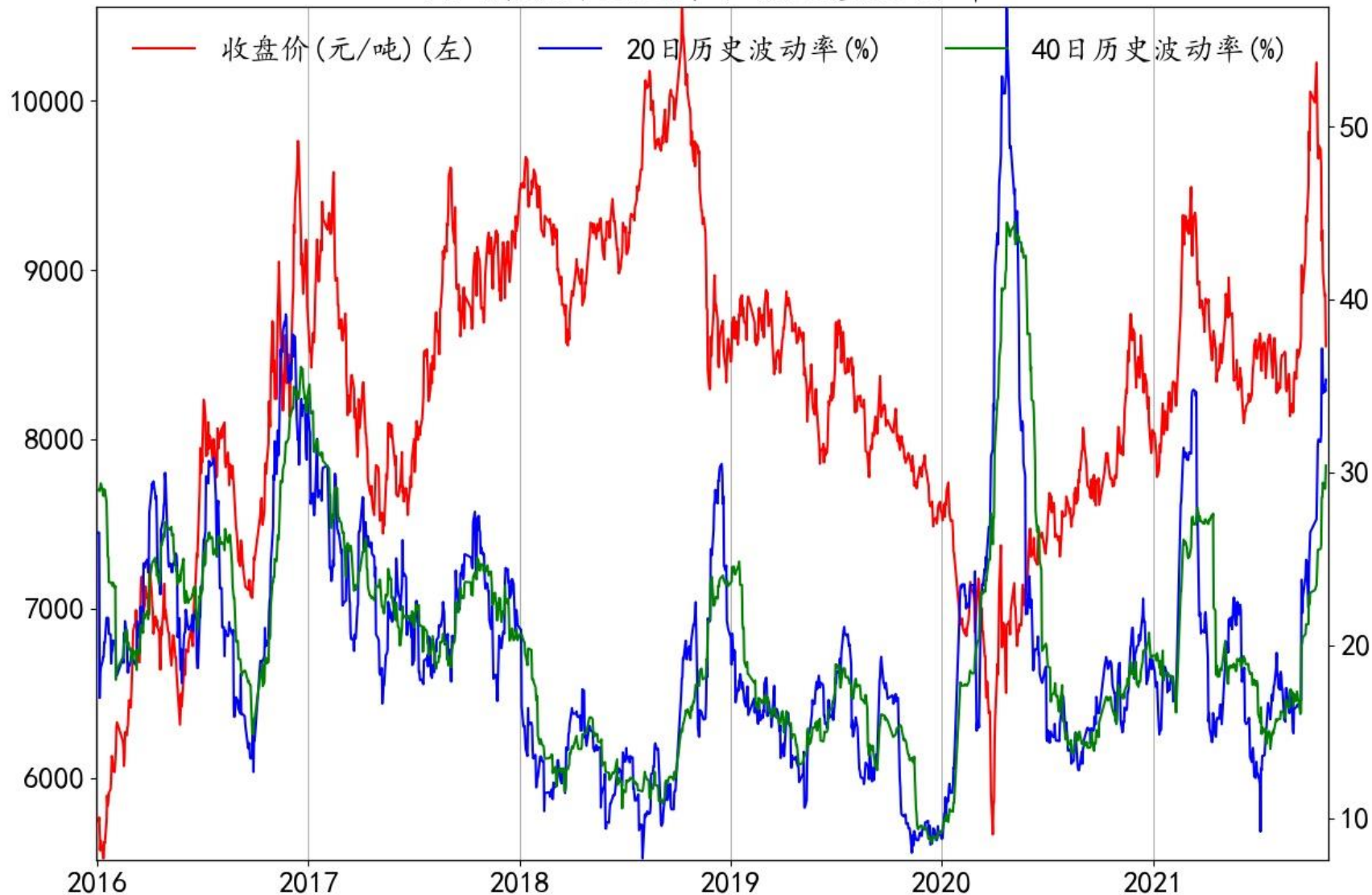
数据来源: Wind、信达期货研发中心

短纤指数收盘价和历史波动率



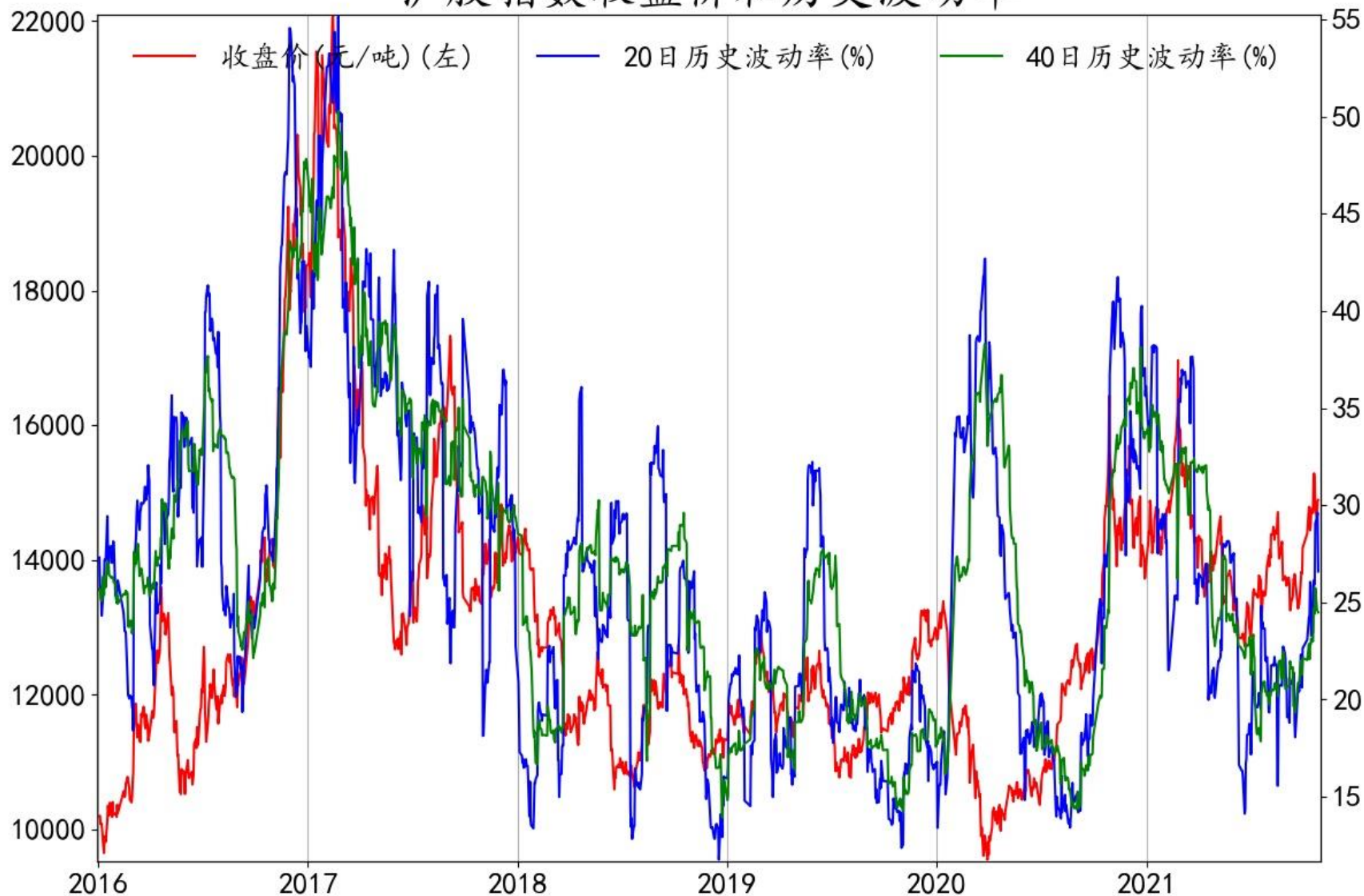
数据来源: Wind、信达期货研发中心

PP指数收盘价和历史波动率

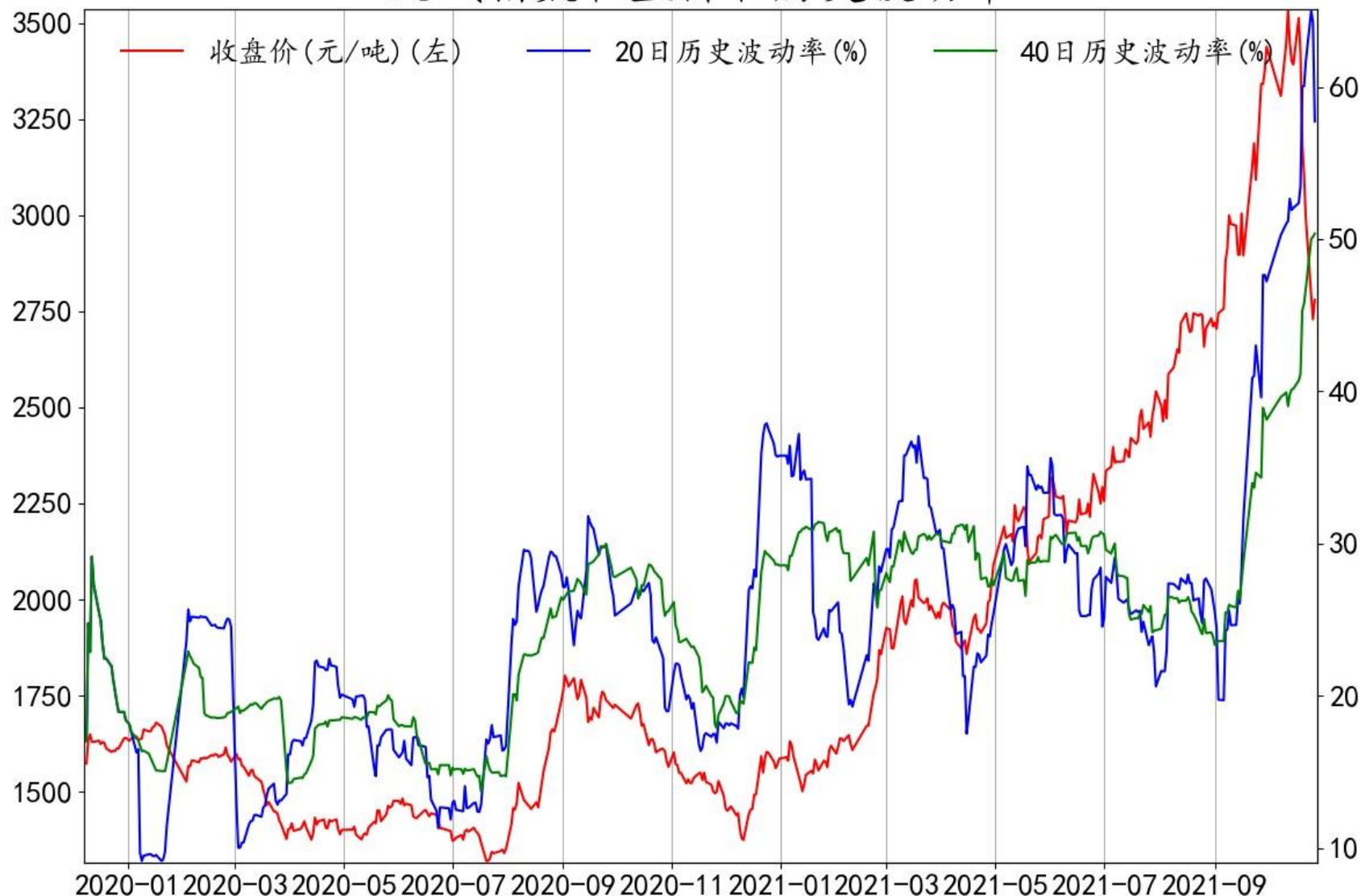


数据来源: Wind、信达期货研发中心

沪胶指数收盘价和历史波动率

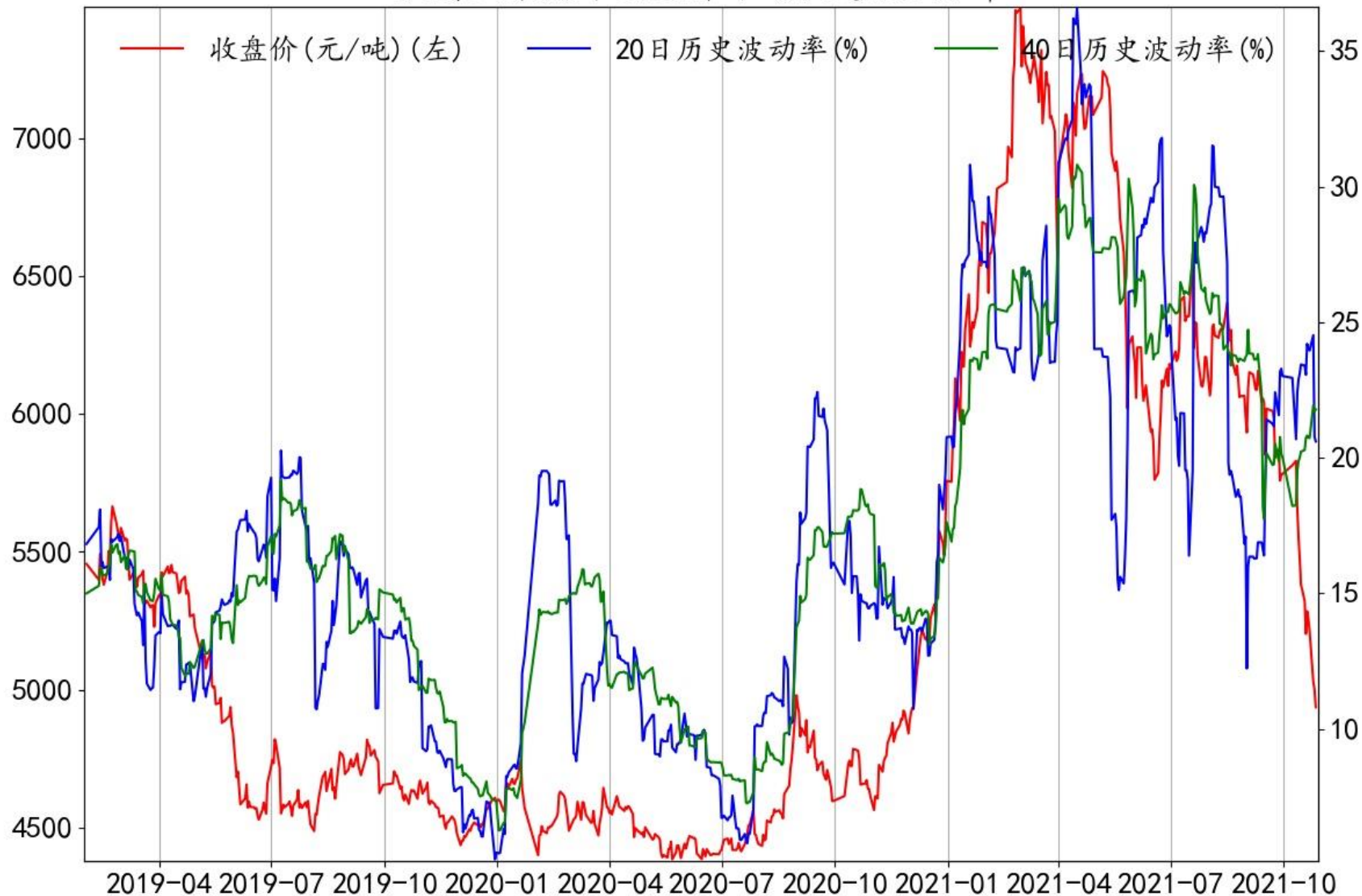


纯碱指数收盘价和历史波动率



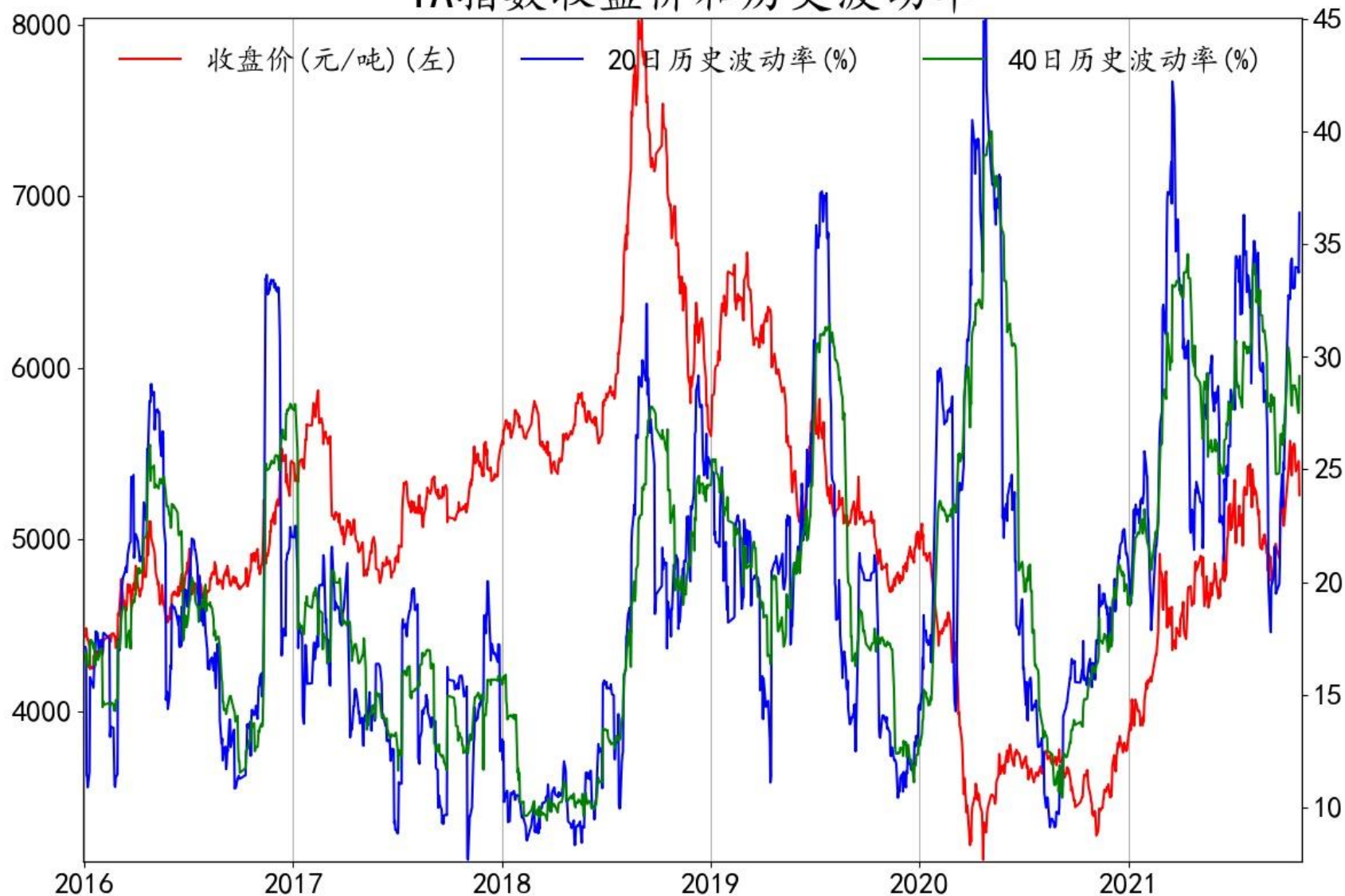
数据来源: Wind、信达期货研发中心

纸浆指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

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

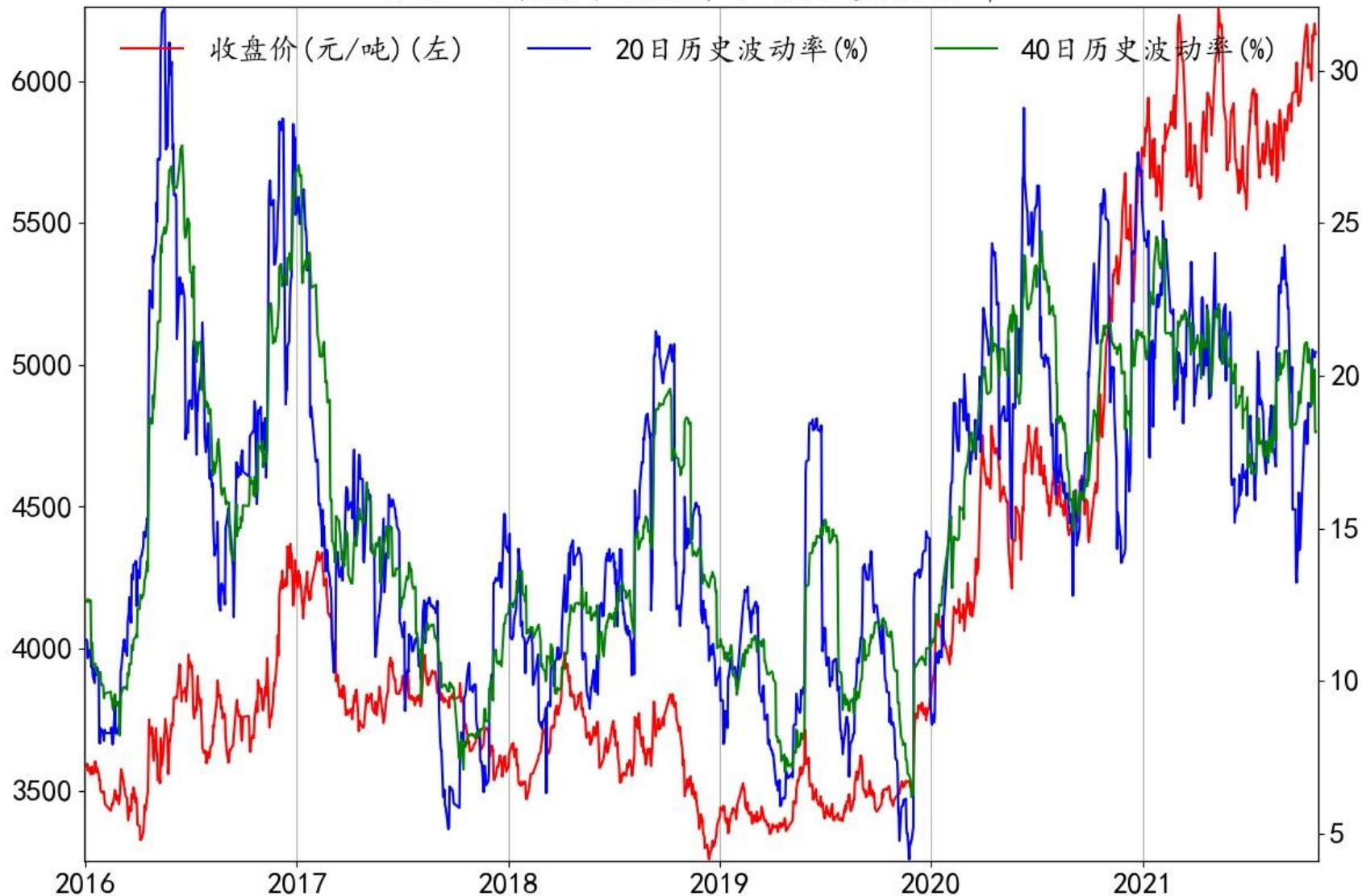


数据来源: Wind、信达期货研发中心

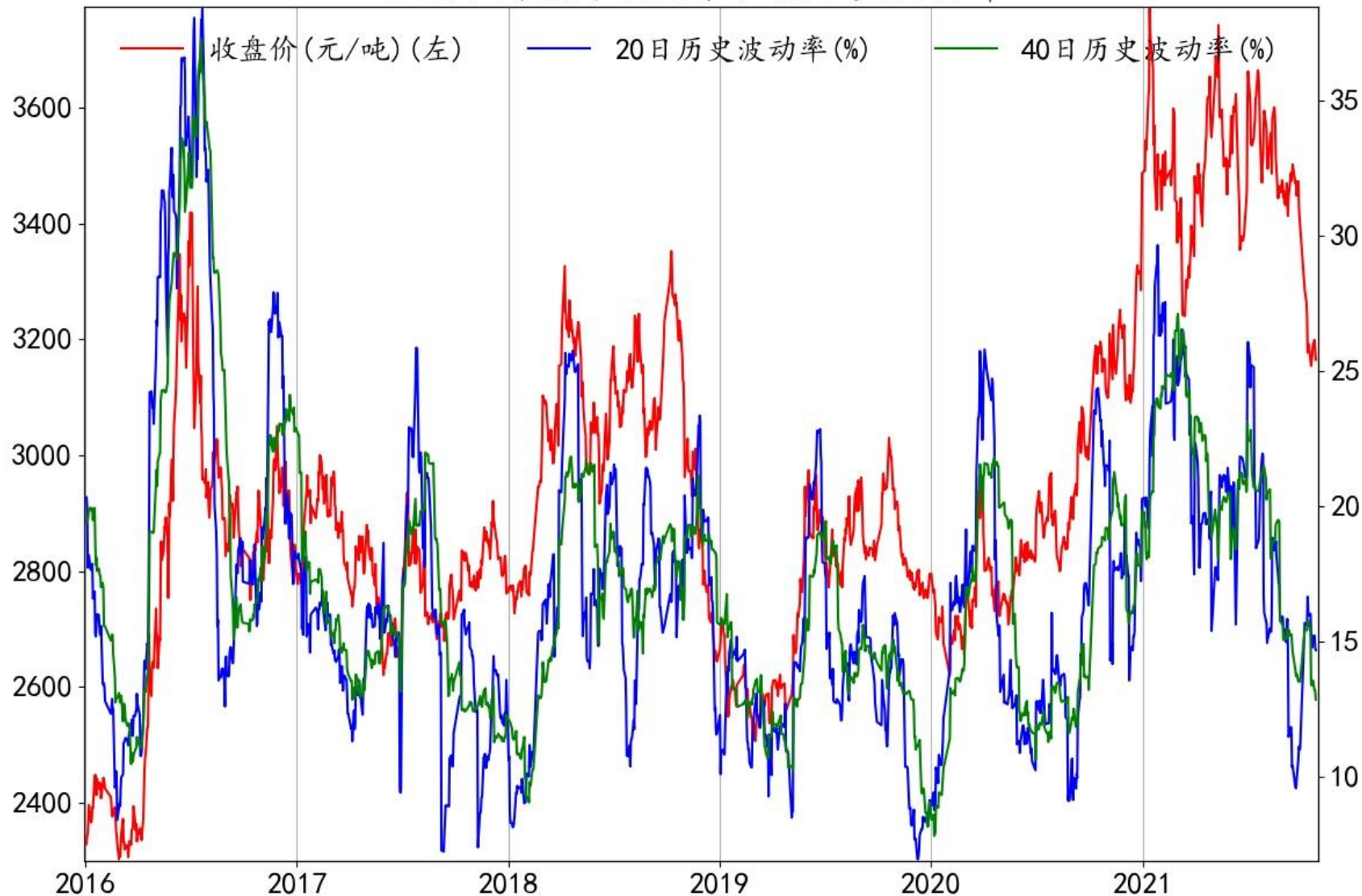
玉米指数收盘价和历史波动率



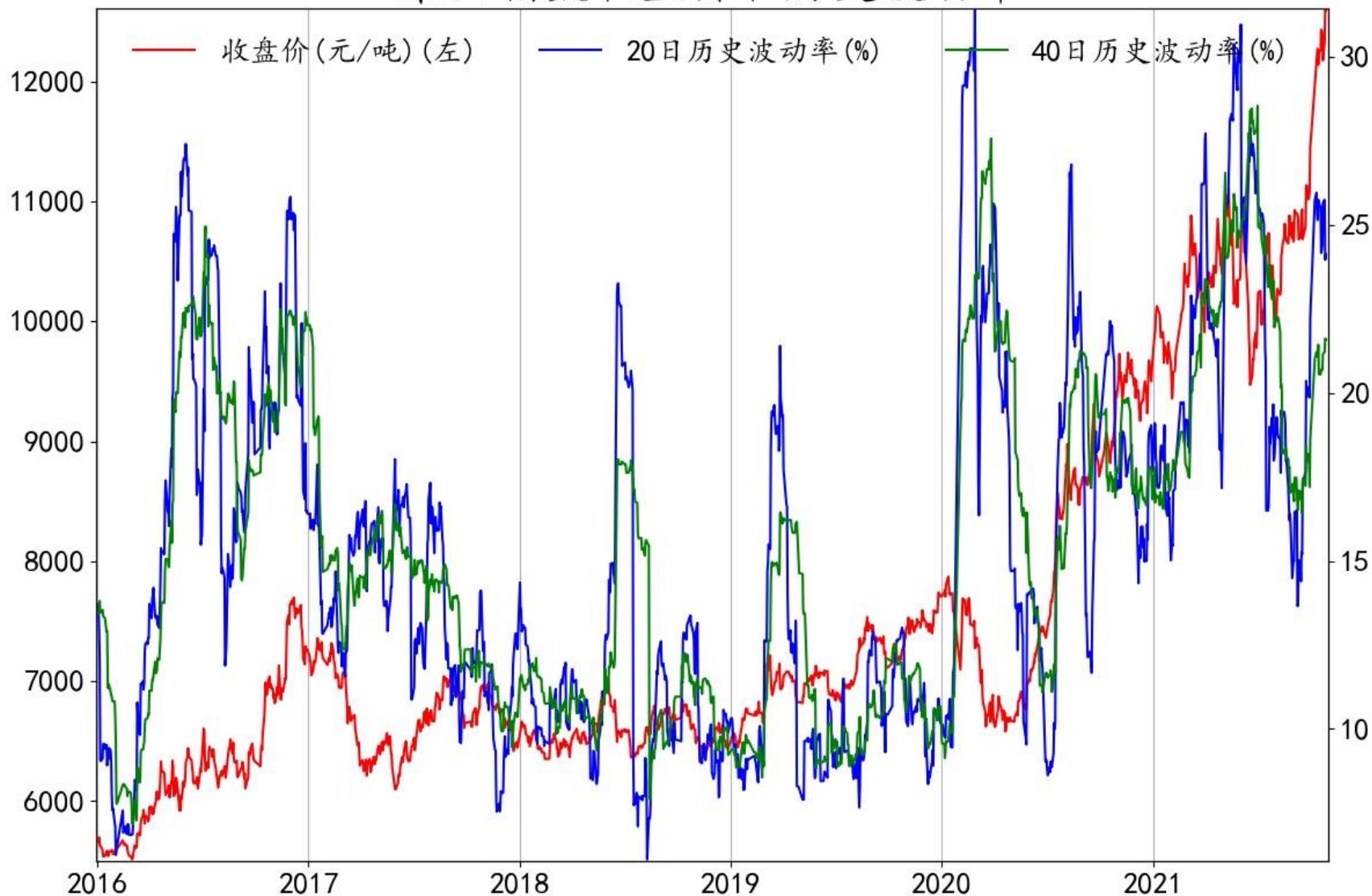
豆一指数收盘价和历史波动率



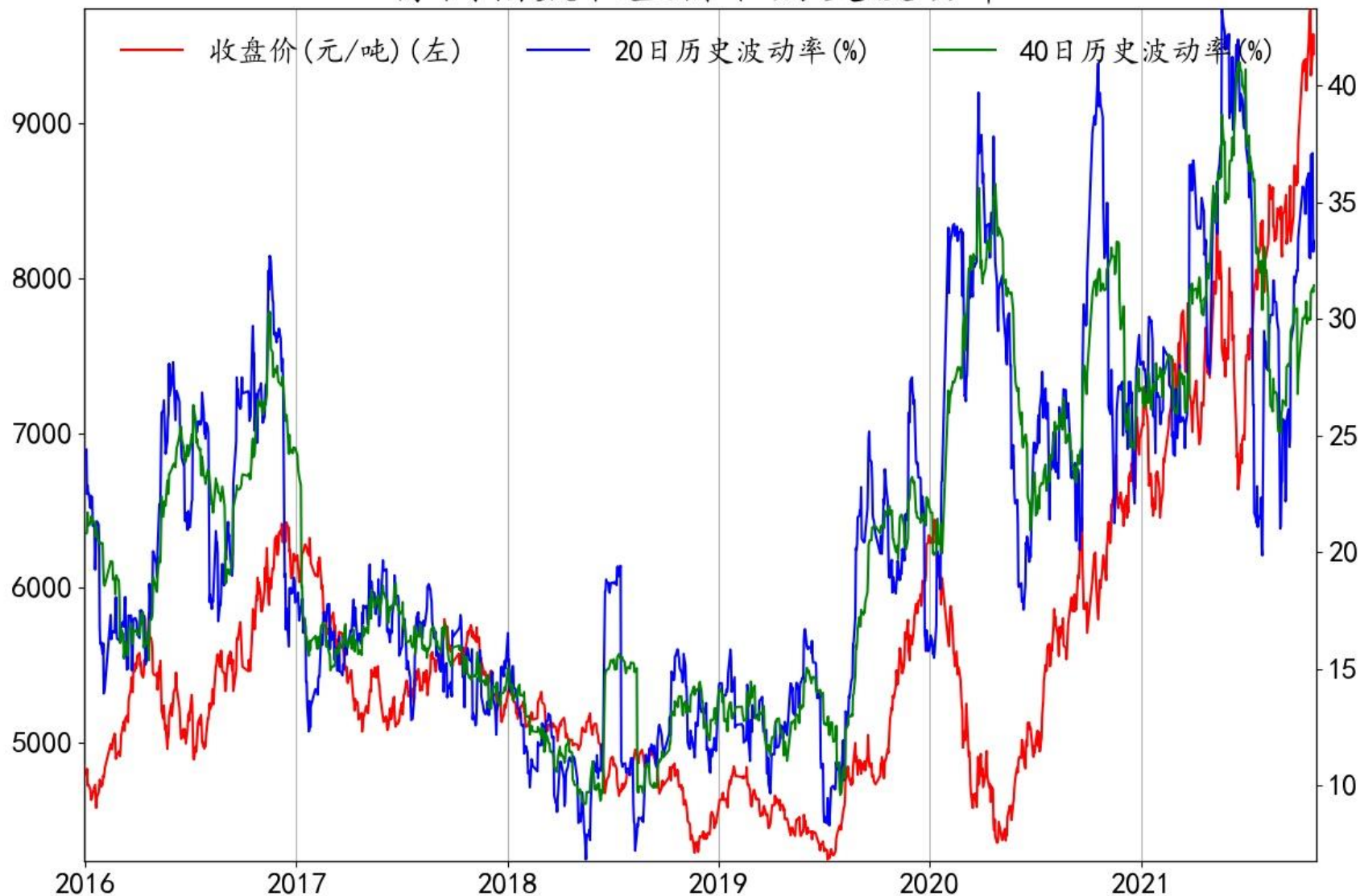
豆粕指数收盘价和历史波动率



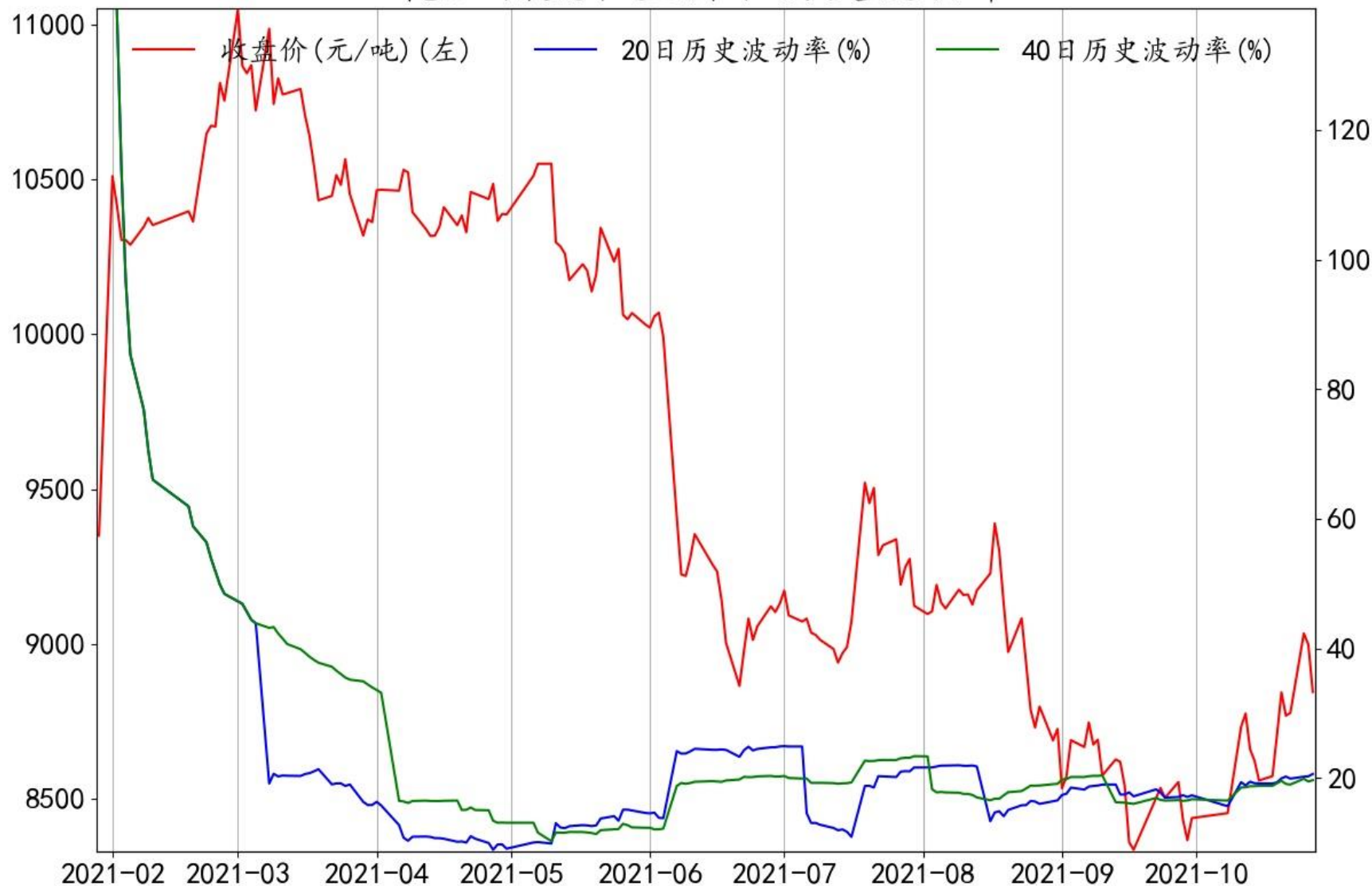
菜油指数收盘价和历史波动率



棕榈指数收盘价和历史波动率

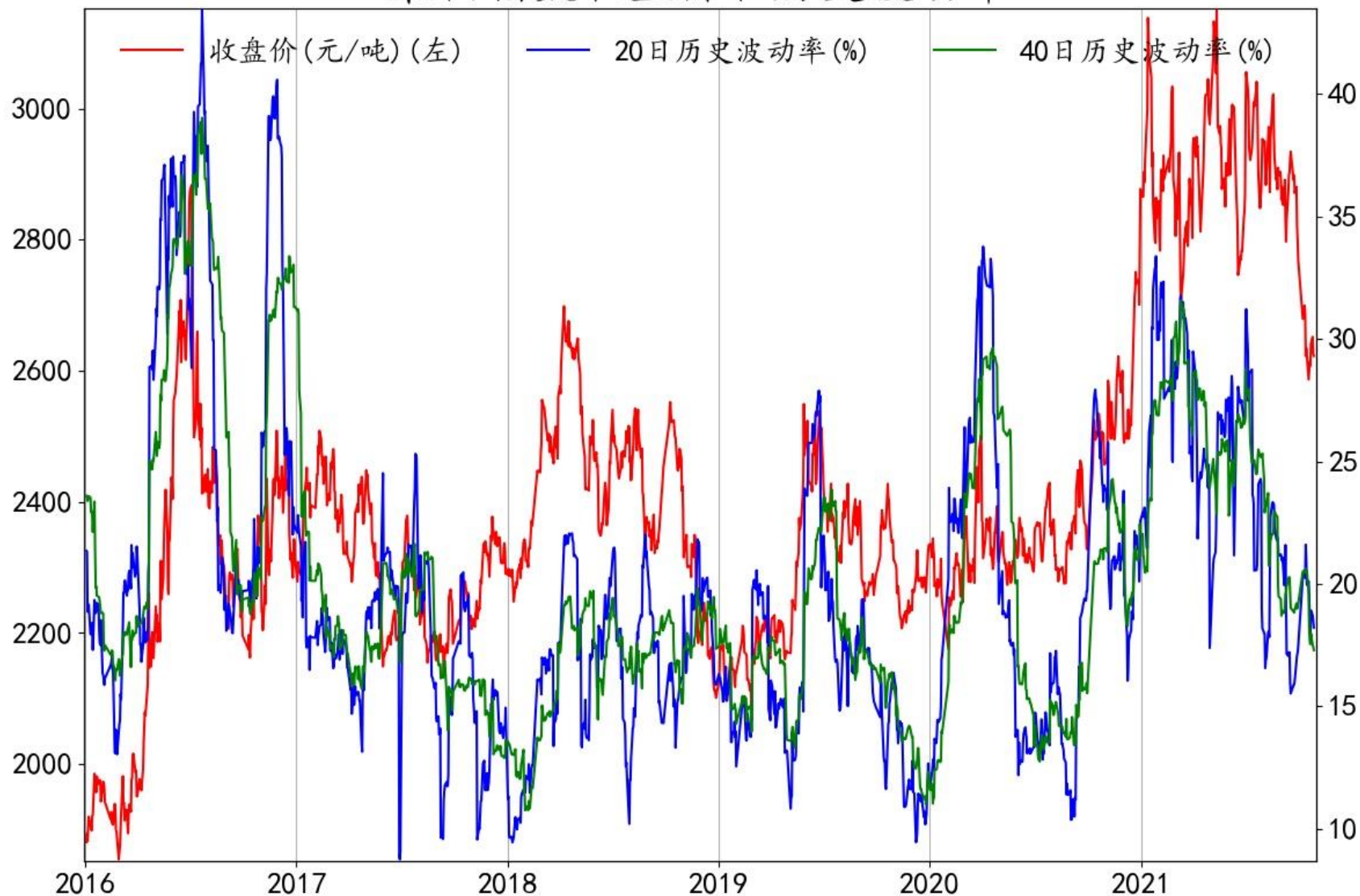


花生指数收盘价和历史波动率

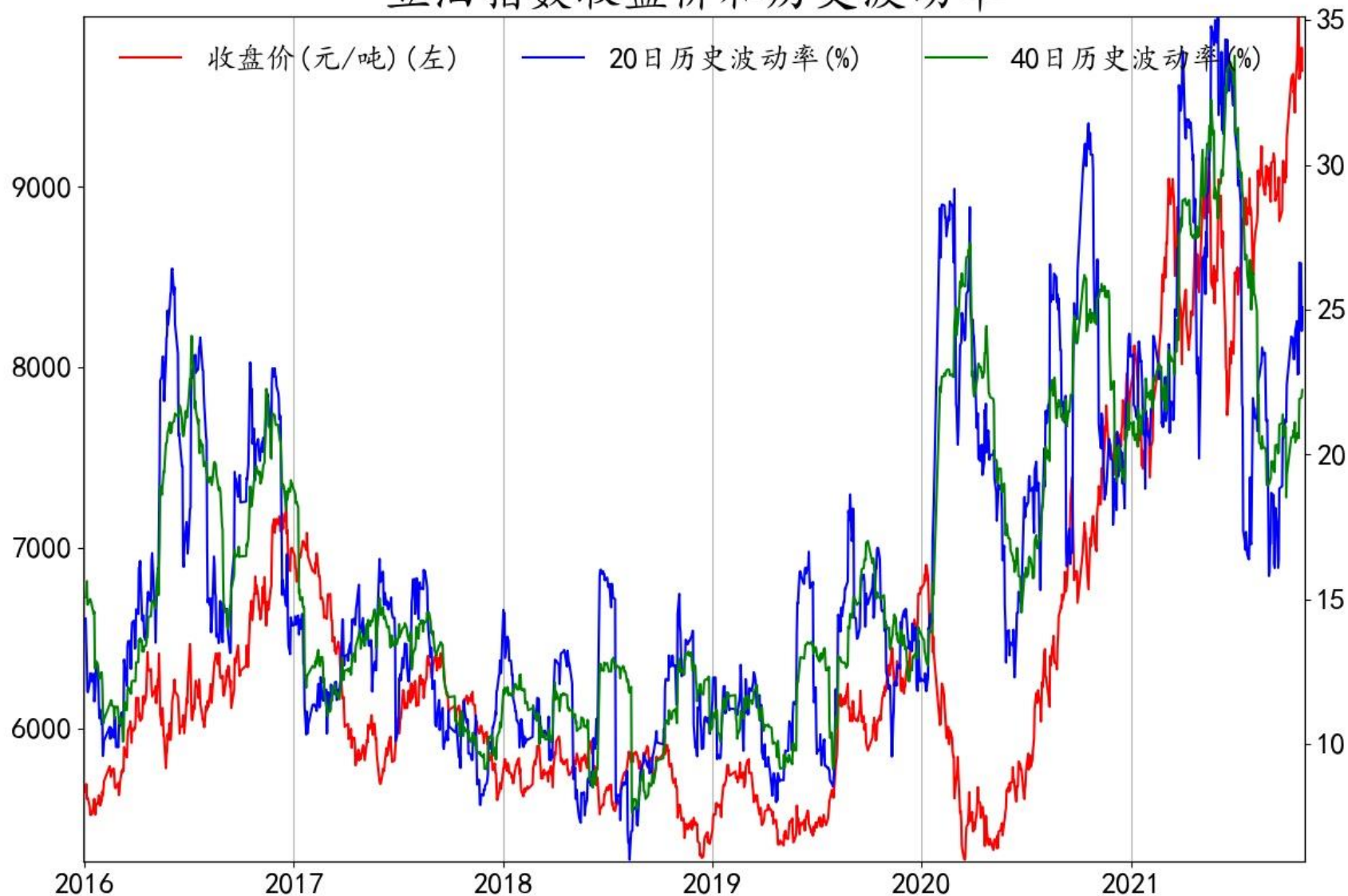


数据来源: Wind、信达期货研发中心

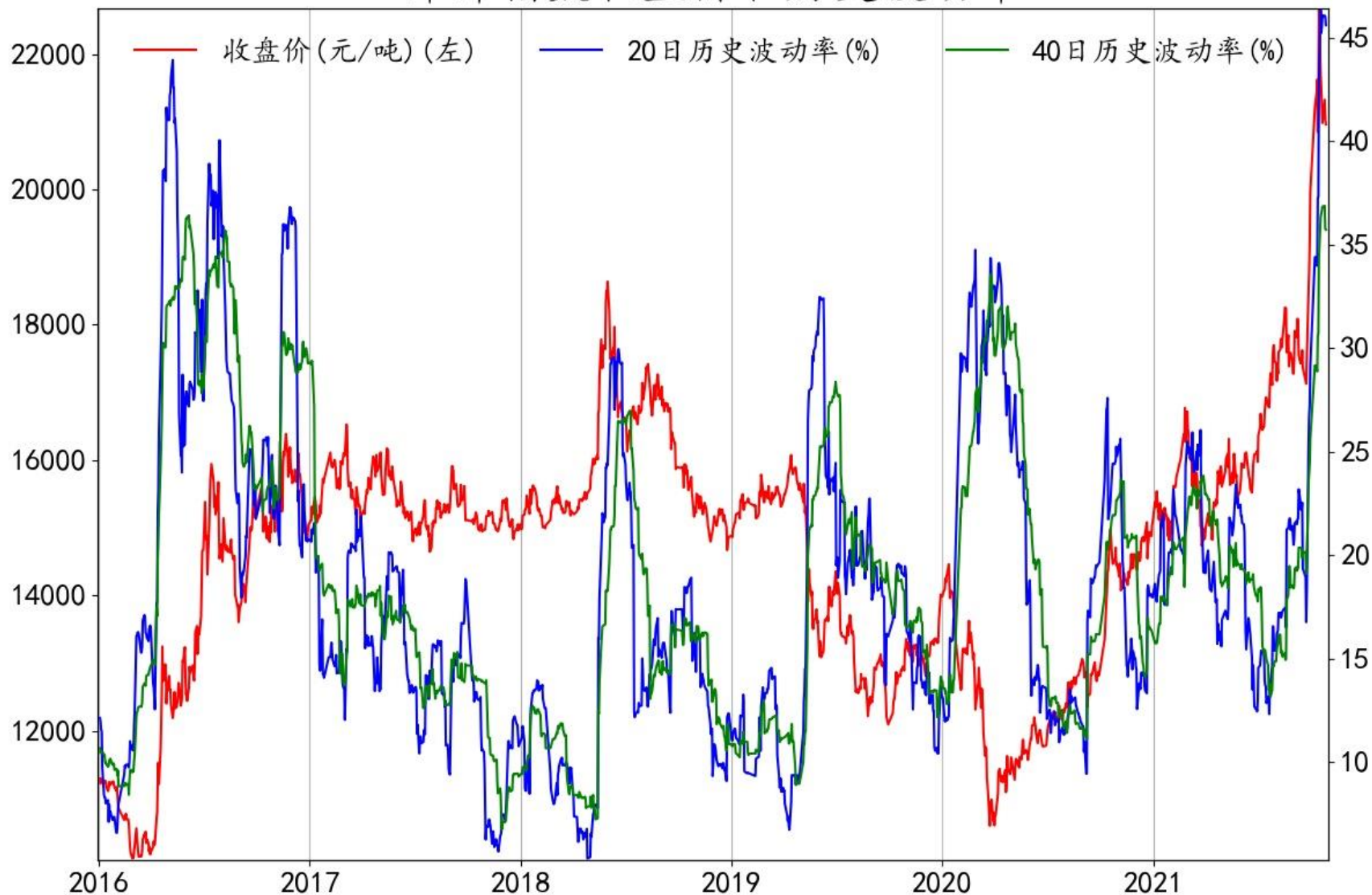
菜粕指数收盘价和历史波动率



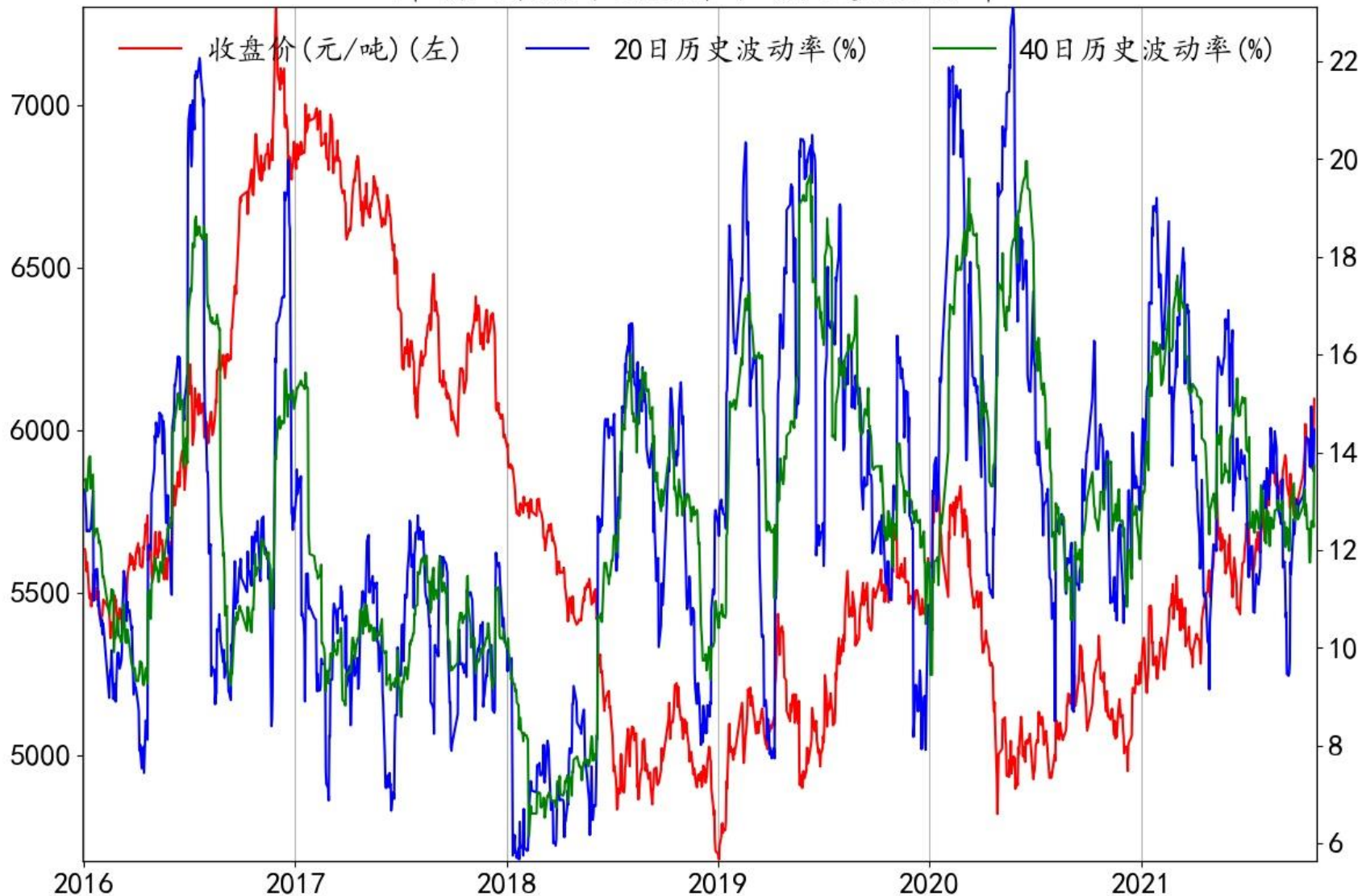
豆油指数收盘价和历史波动率



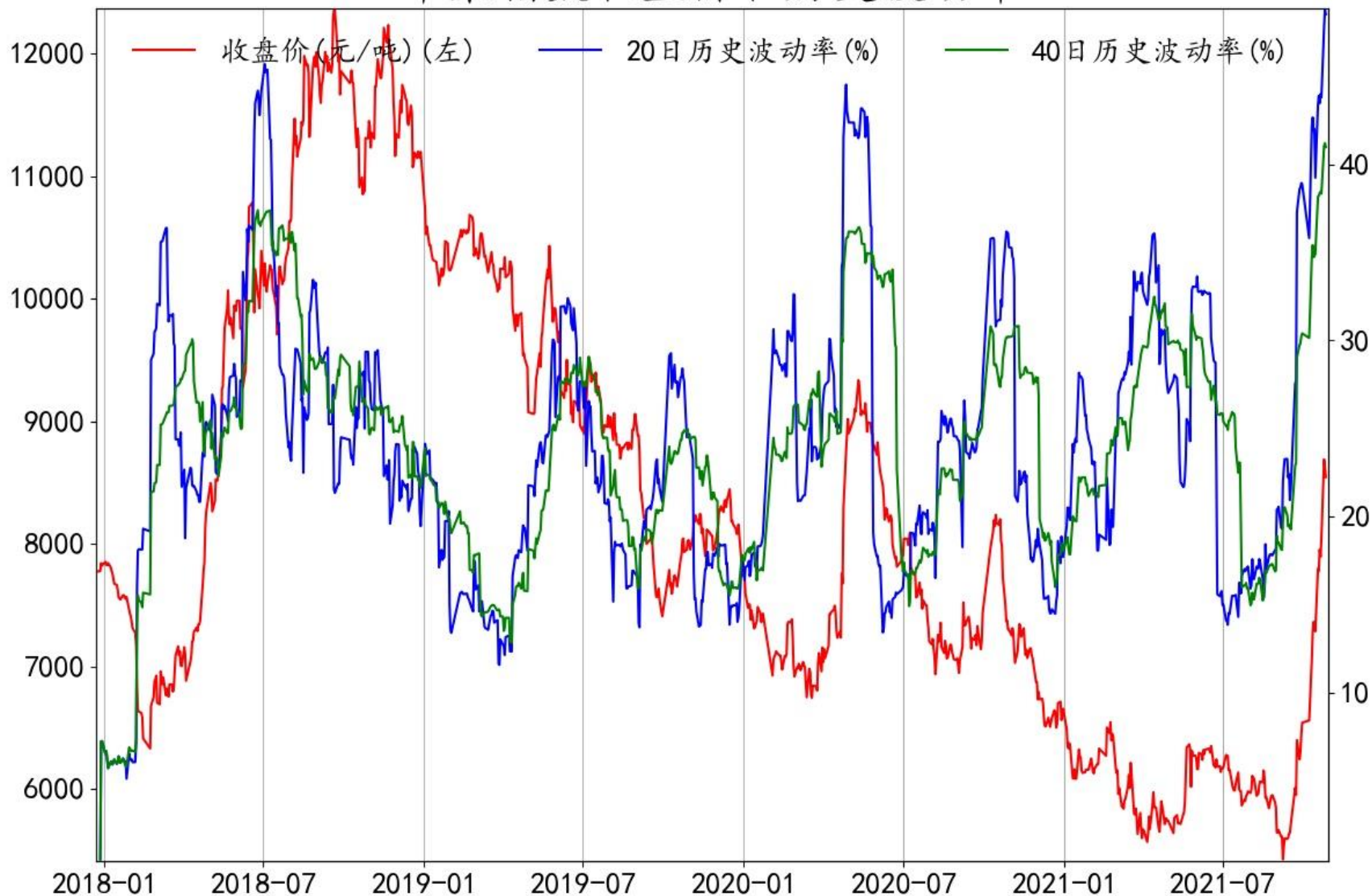
郑棉指数收盘价和历史波动率



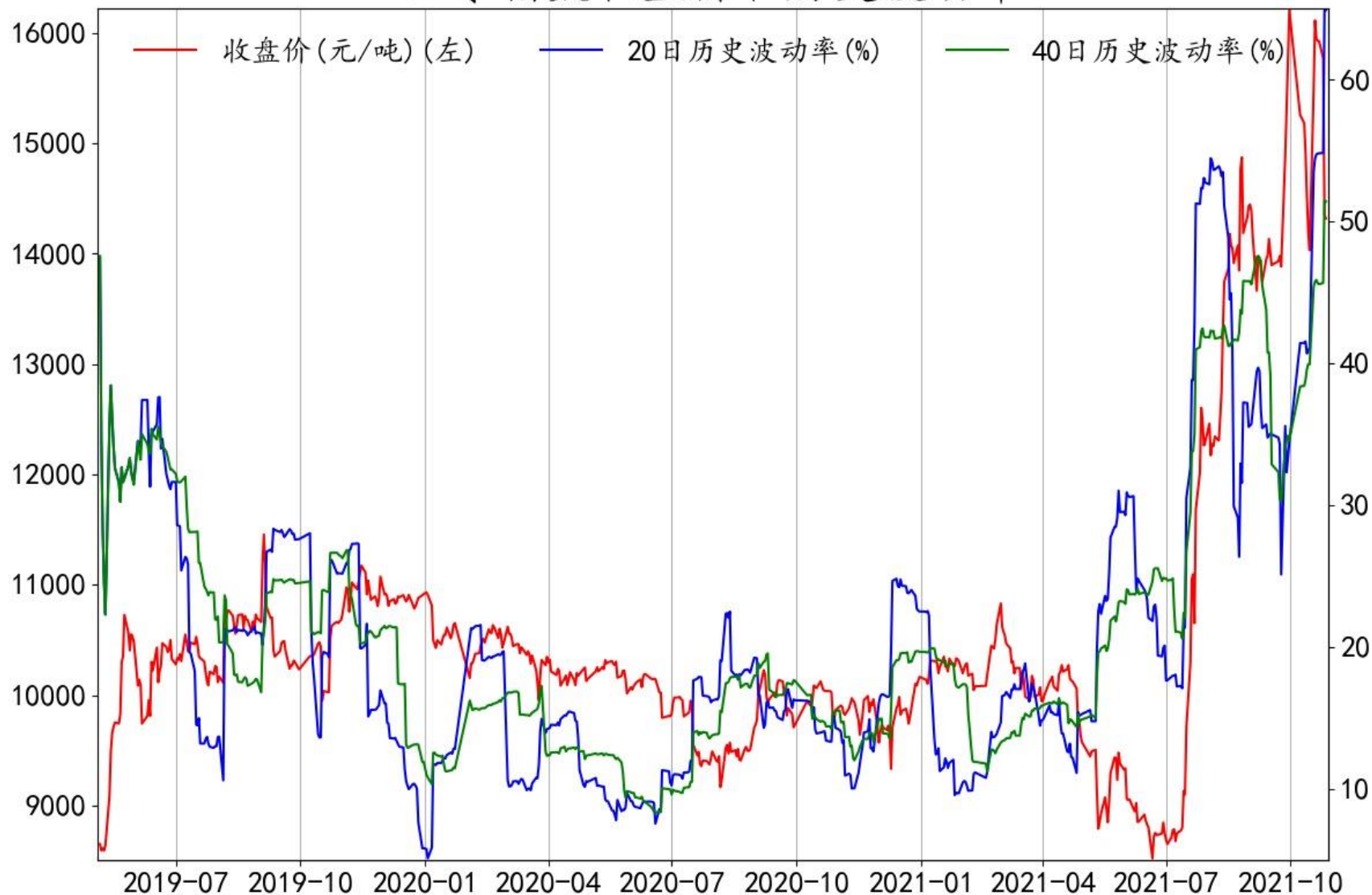
郑糖指数收盘价和历史波动率



苹果指数收盘价和历史波动率



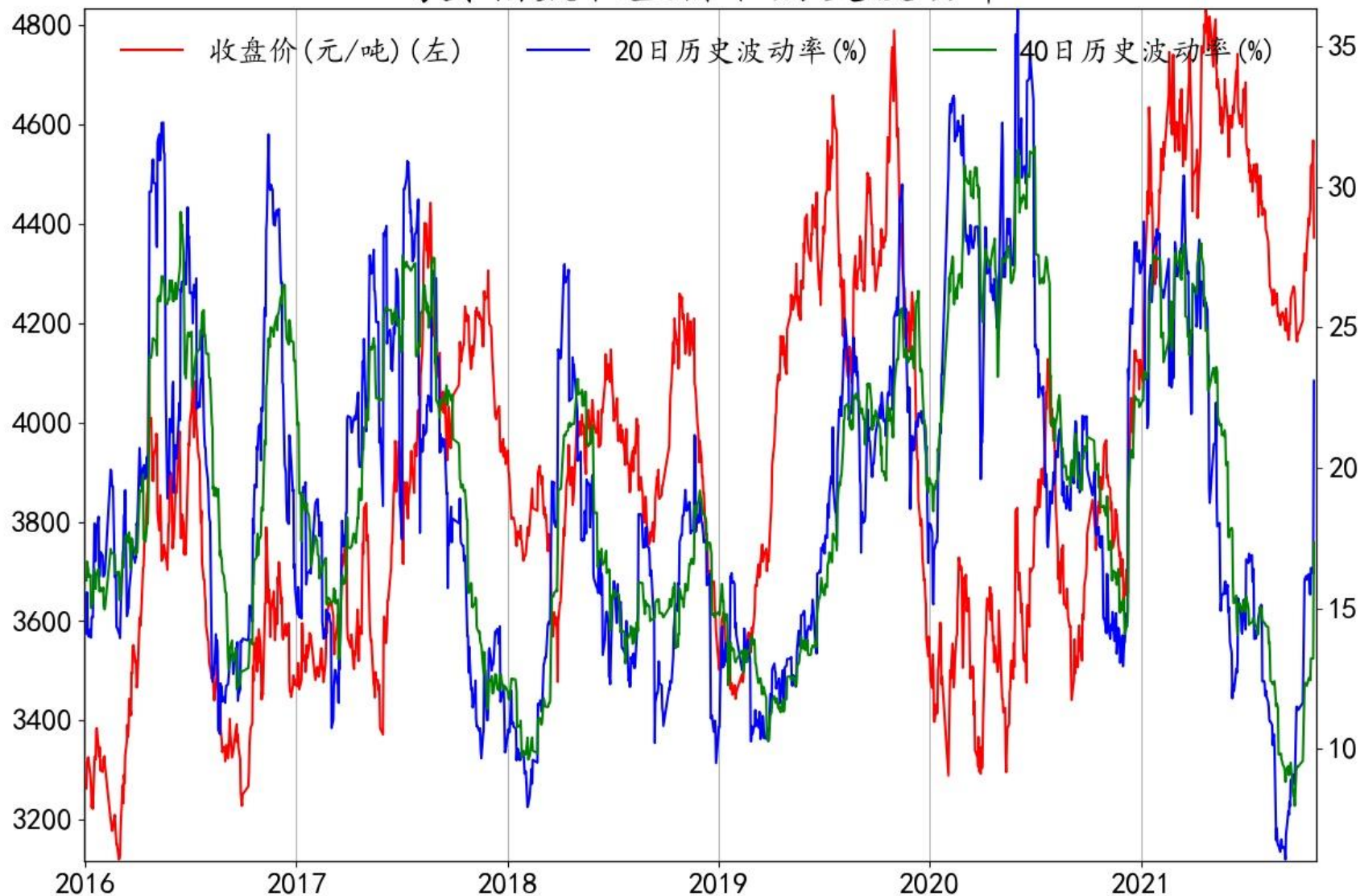
红枣指数收盘价和历史波动率



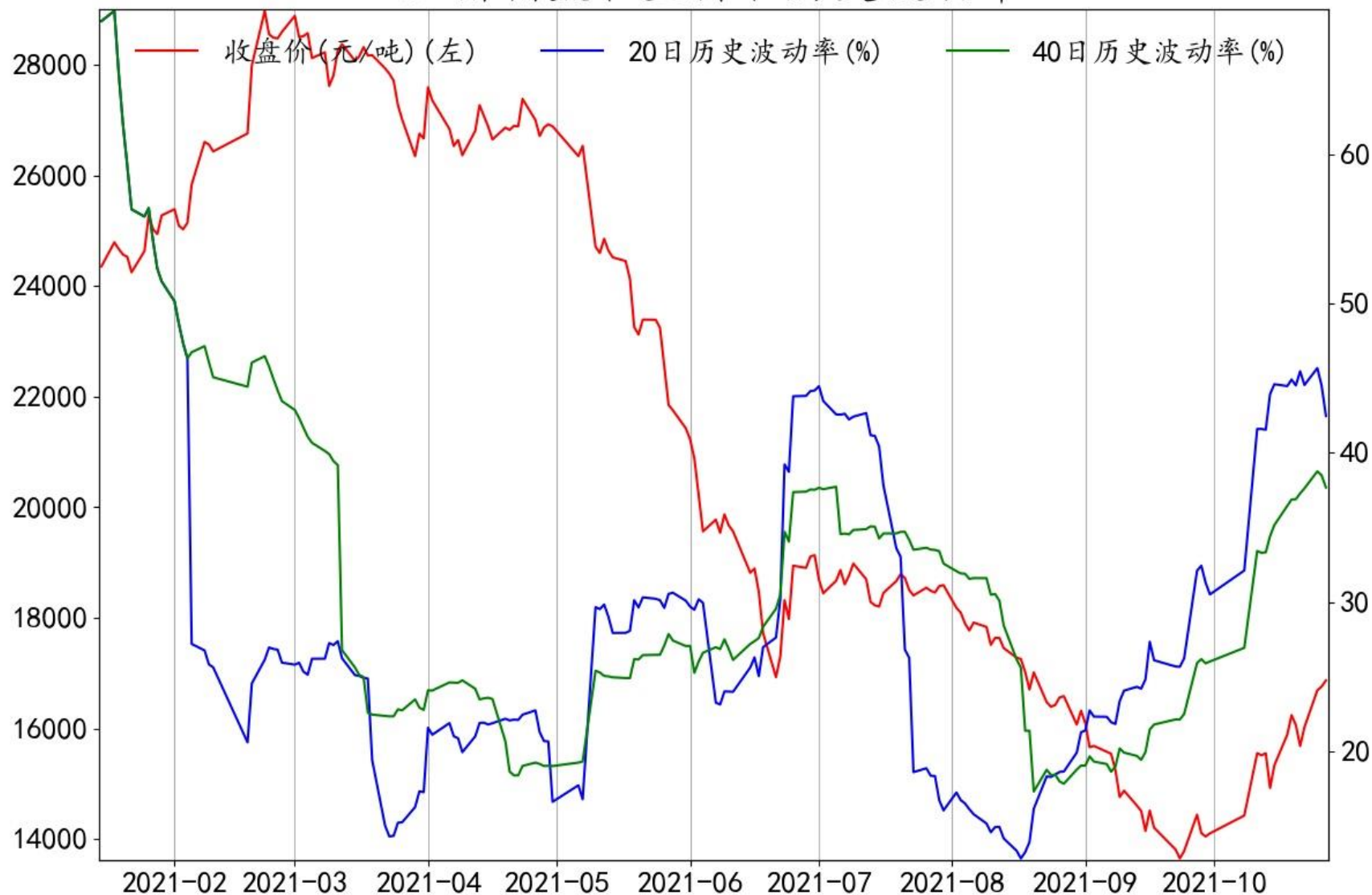
淀粉指数收盘价和历史波动率



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

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