

商品期货波动率跟踪

2021年10月28日

20日历史波动率百分位高于90%:

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

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:

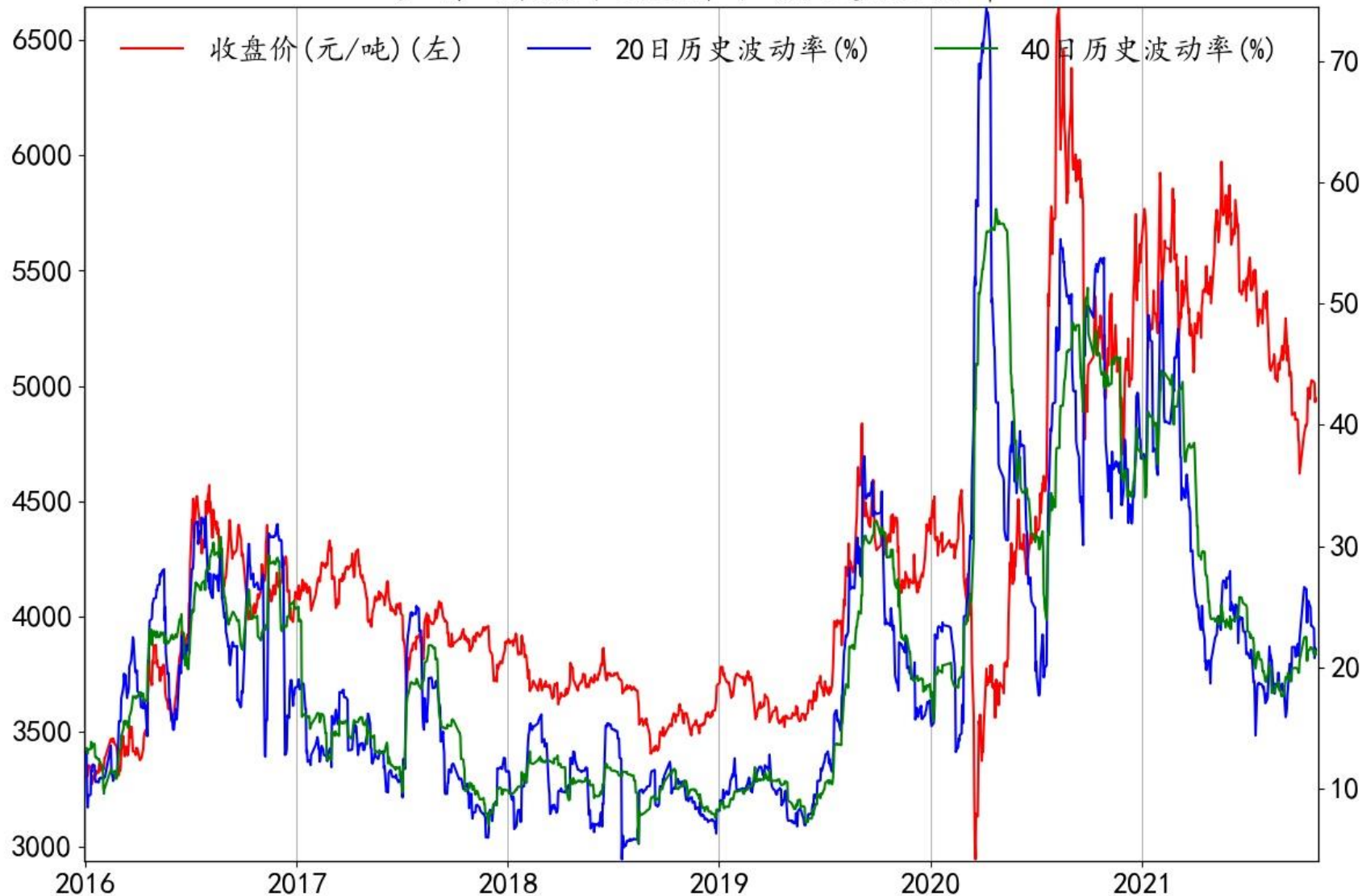
沪金、豆粕、玉米、郑糖、菜粕

	时间百分位	绝对值
沪银	61.63%	21.45%
沪金	55.05%	11.27%
沪铝	99.93%	39.72%
沪铜	93.43%	25.31%
沪镍	89.47%	31.66%
沪铅	68.98%	19.30%
沪锡	98.02%	42.13%
沪锌	99.93%	48.90%
热卷	79.65%	32.41%
铁矿	96.18%	59.32%
焦炭	100.00%	87.71%
焦煤	100.00%	87.04%
螺纹	89.96%	40.32%

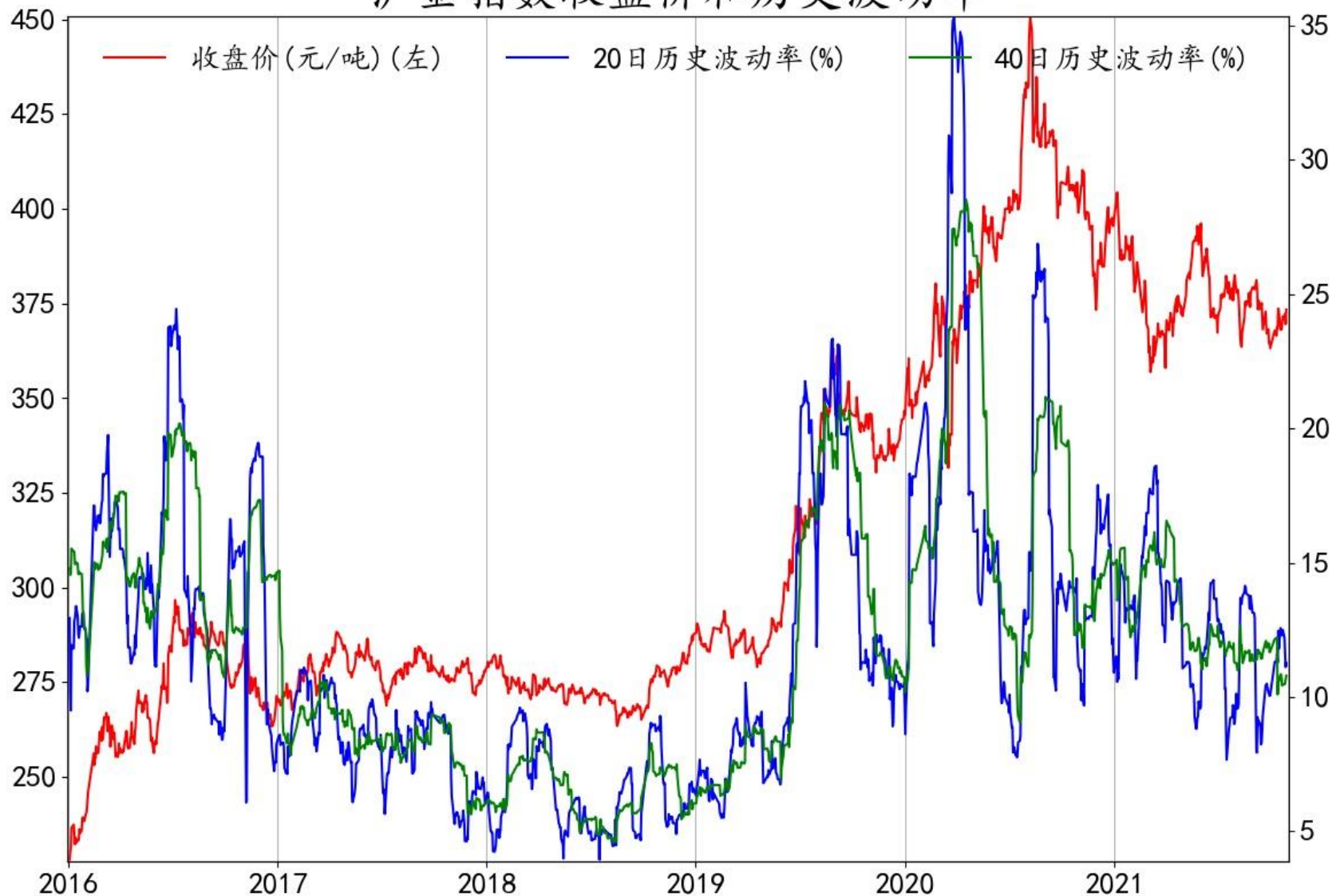
	时间百分位	绝对值
硅铁	99.79%	98.99%
锰硅	99.58%	94.20%
不锈钢	93.65%	34.96%
玻璃	100.00%	47.65%
PVC	100.00%	68.56%
燃油	86.28%	42.82%
低硫燃油	41.96%	28.02%
LPG	100.00%	51.88%
原油	56.55%	30.83%
动煤	99.86%	114.27%
沥青	69.12%	31.03%
苯乙烯	84.10%	40.87%
乙二醇	100.00%	75.09%

	时间百分位	绝对值		时间百分位	绝对值
塑料	97.24%	34.56%	菜油	89.54%	23.55%
甲醇	99.93%	71.47%	棕榈	89.96%	32.53%
20号胶	62.52%	28.12%	花生	68.75%	20.84%
短纤	94.19%	42.33%	菜粕	51.59%	18.82%
PP	95.76%	34.38%	豆油	89.47%	24.67%
沪胶	54.98%	27.00%	郑棉	99.51%	45.39%
纯碱	98.69%	57.37%	郑糖	85.37%	16.48%
纸浆	76.13%	21.11%	苹果	100.00%	51.67%
TA	96.47%	36.20%	红枣	100.00%	65.53%
尿素	99.80%	69.42%	淀粉	97.74%	26.36%
玉米	87.63%	15.82%	鸡蛋	73.99%	23.18%
豆一	80.42%	20.58%	生猪	81.38%	42.43%
豆粕	38.87%	14.71%			

沪银指数收盘价和历史波动率



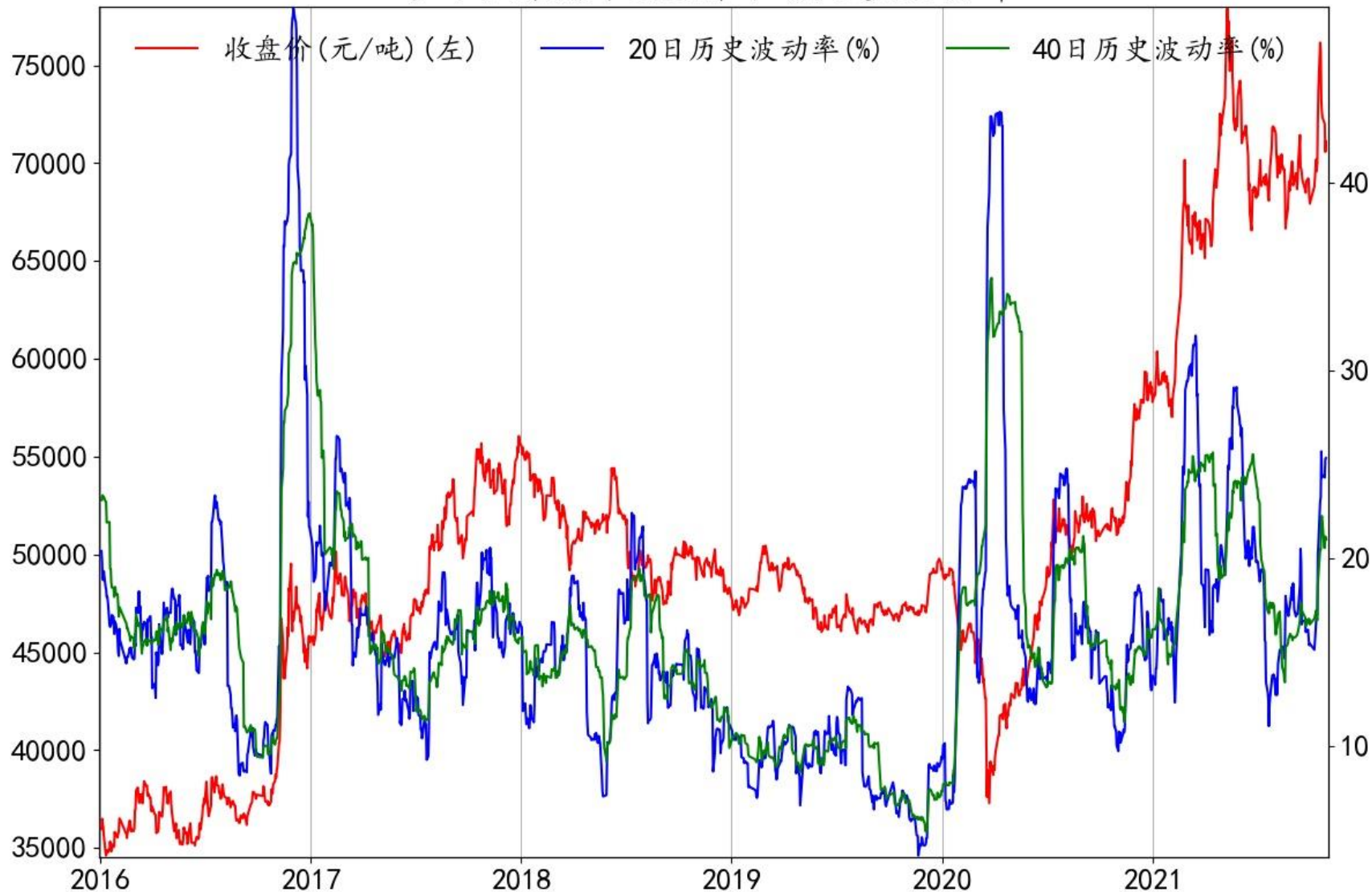
沪金指数收盘价和历史波动率



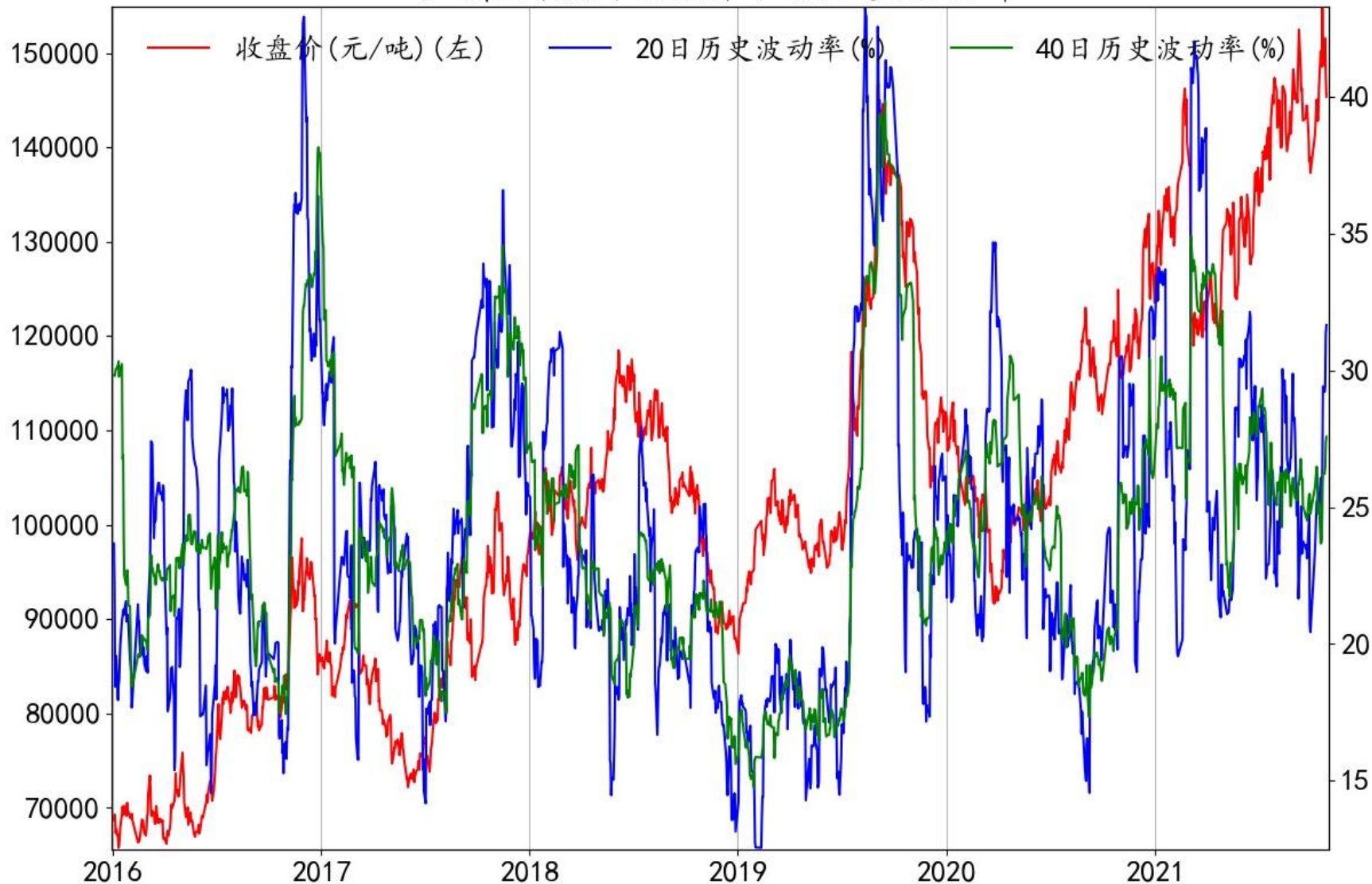
沪铝指数收盘价和历史波动率



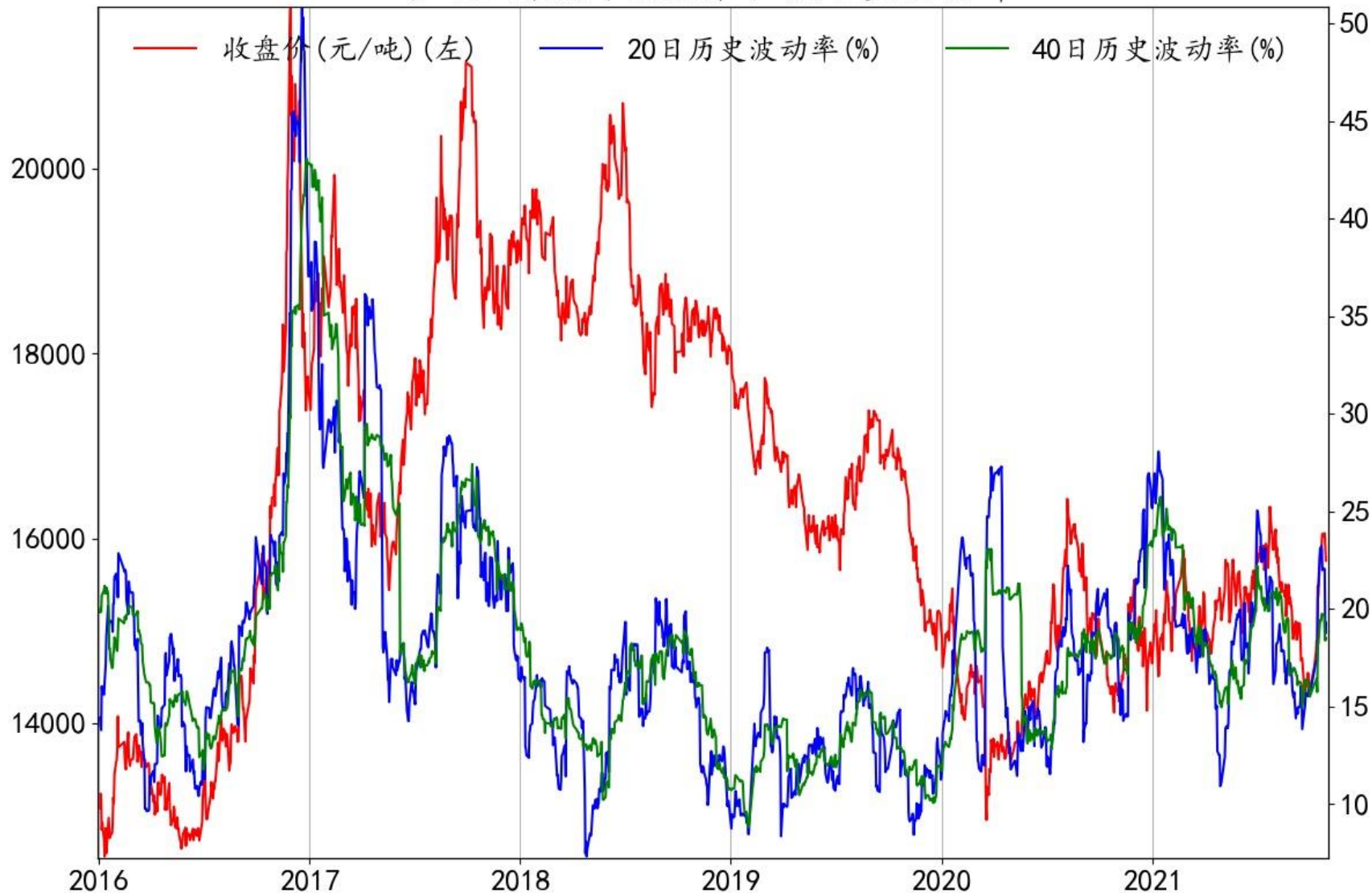
沪铜指数收盘价和历史波动率



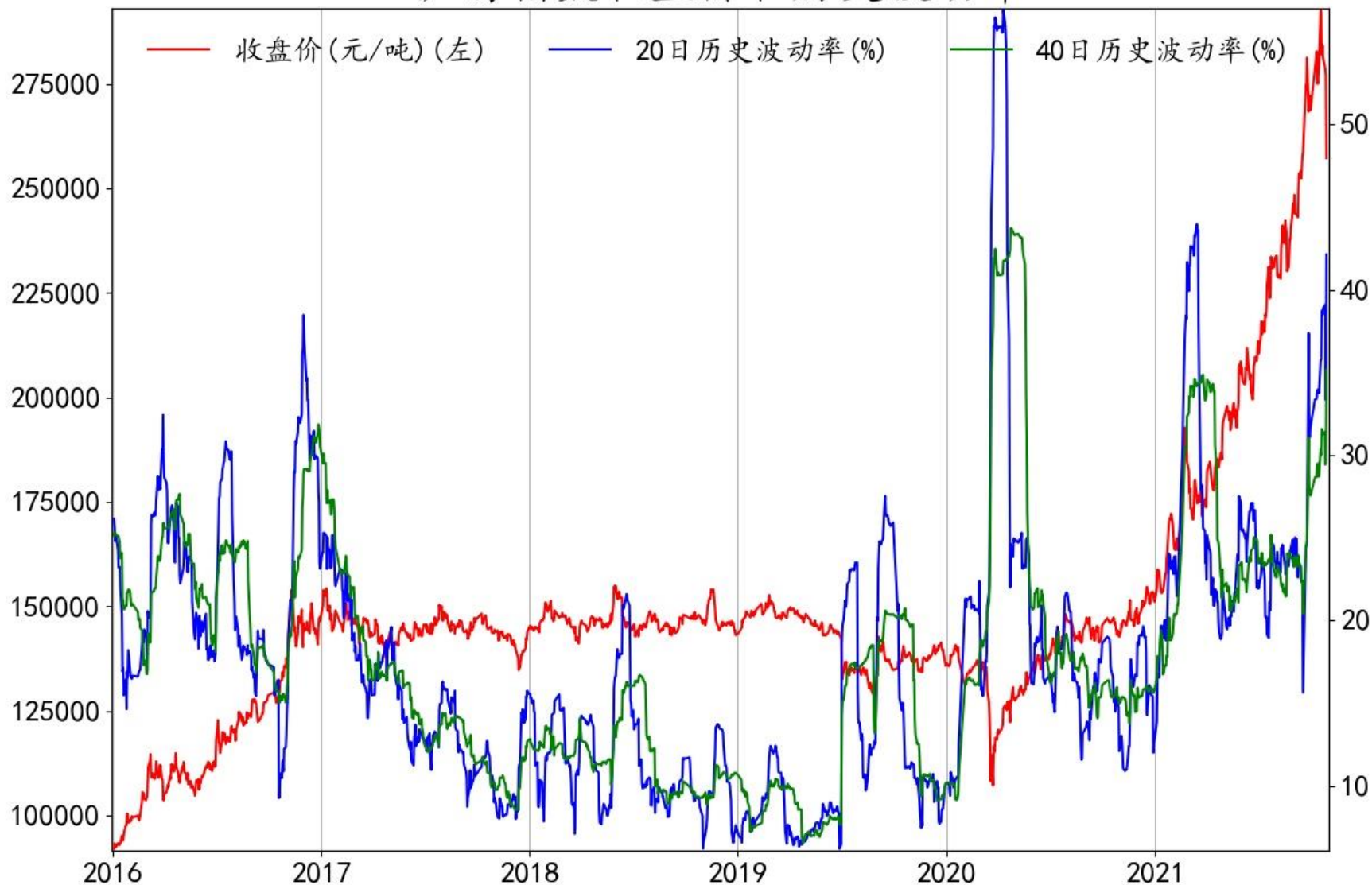
沪镍指数收盘价和历史波动率



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



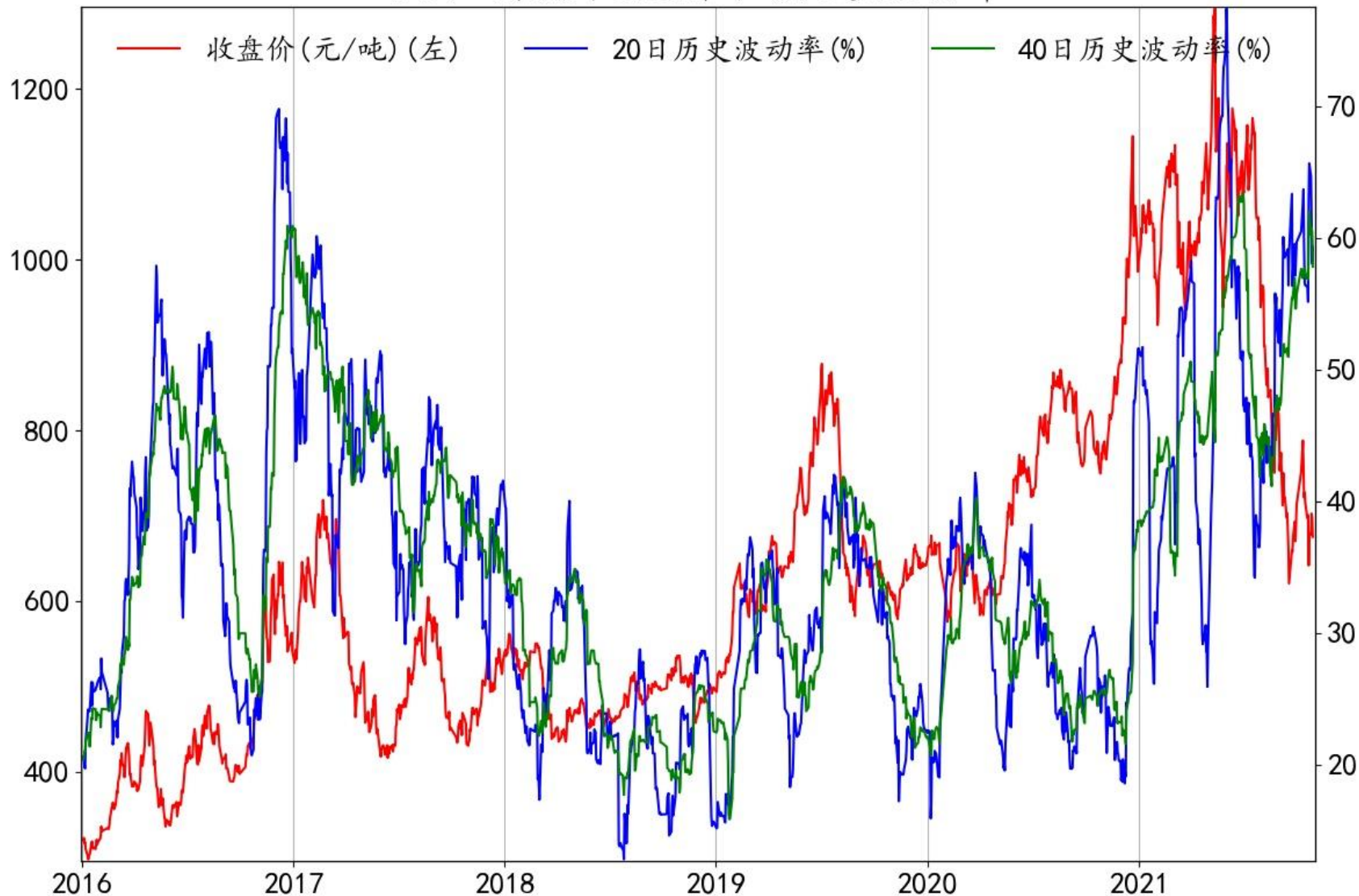
沪锌指数收盘价和历史波动率



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



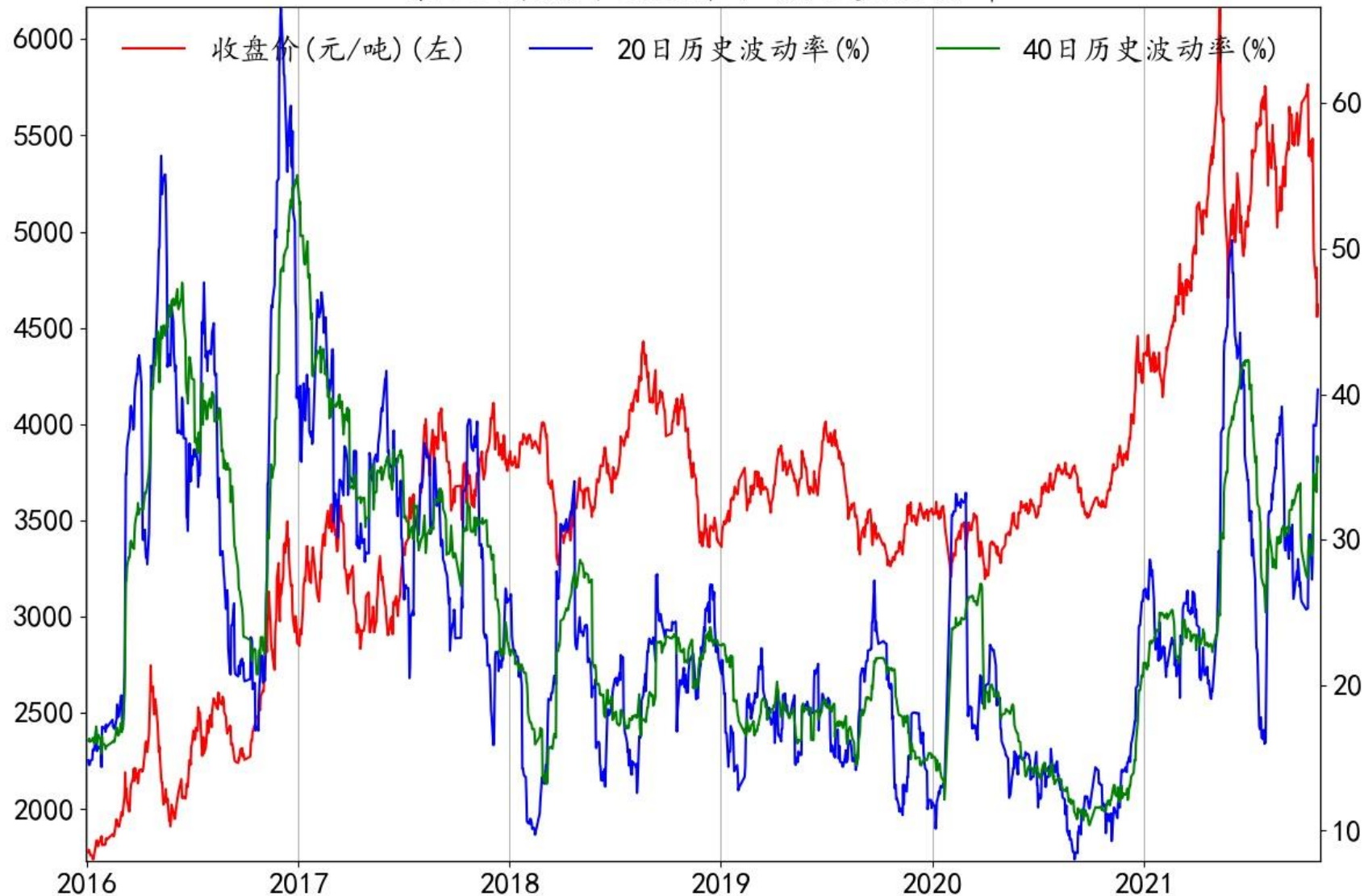
焦炭指数收盘价和历史波动率



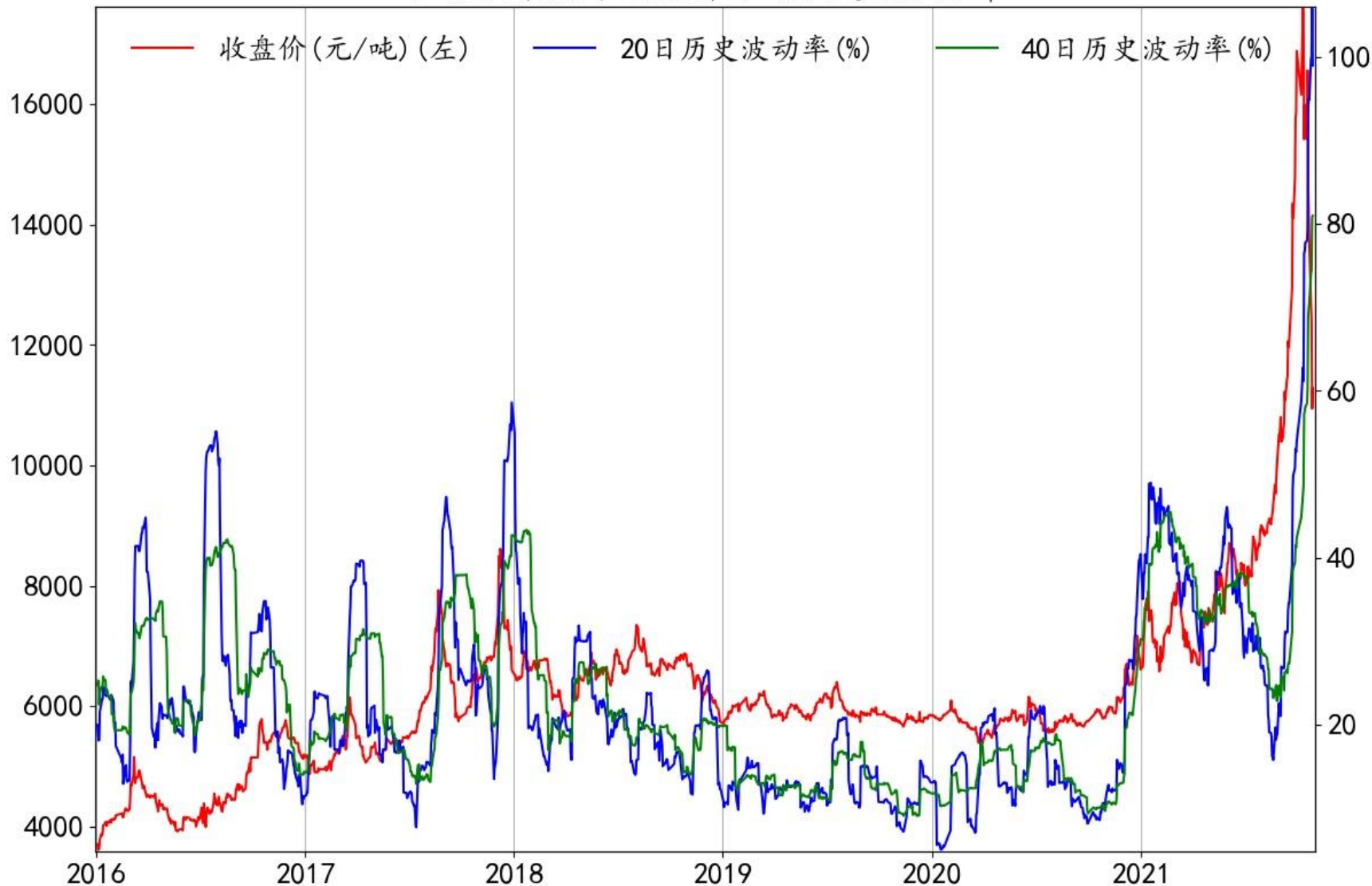
焦煤指数收盘价和历史波动率



螺纹指数收盘价和历史波动率



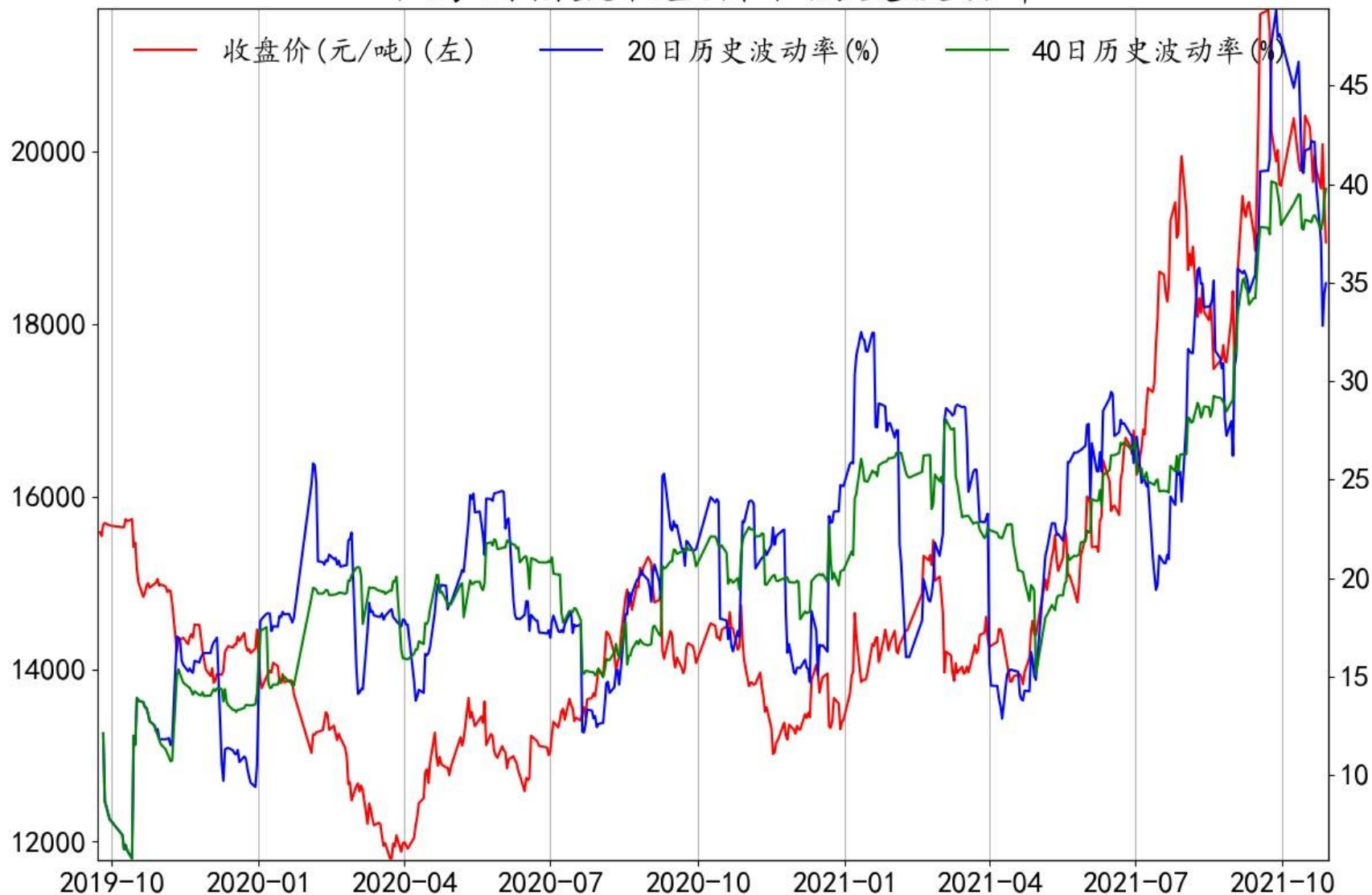
硅铁指数收盘价和历史波动率



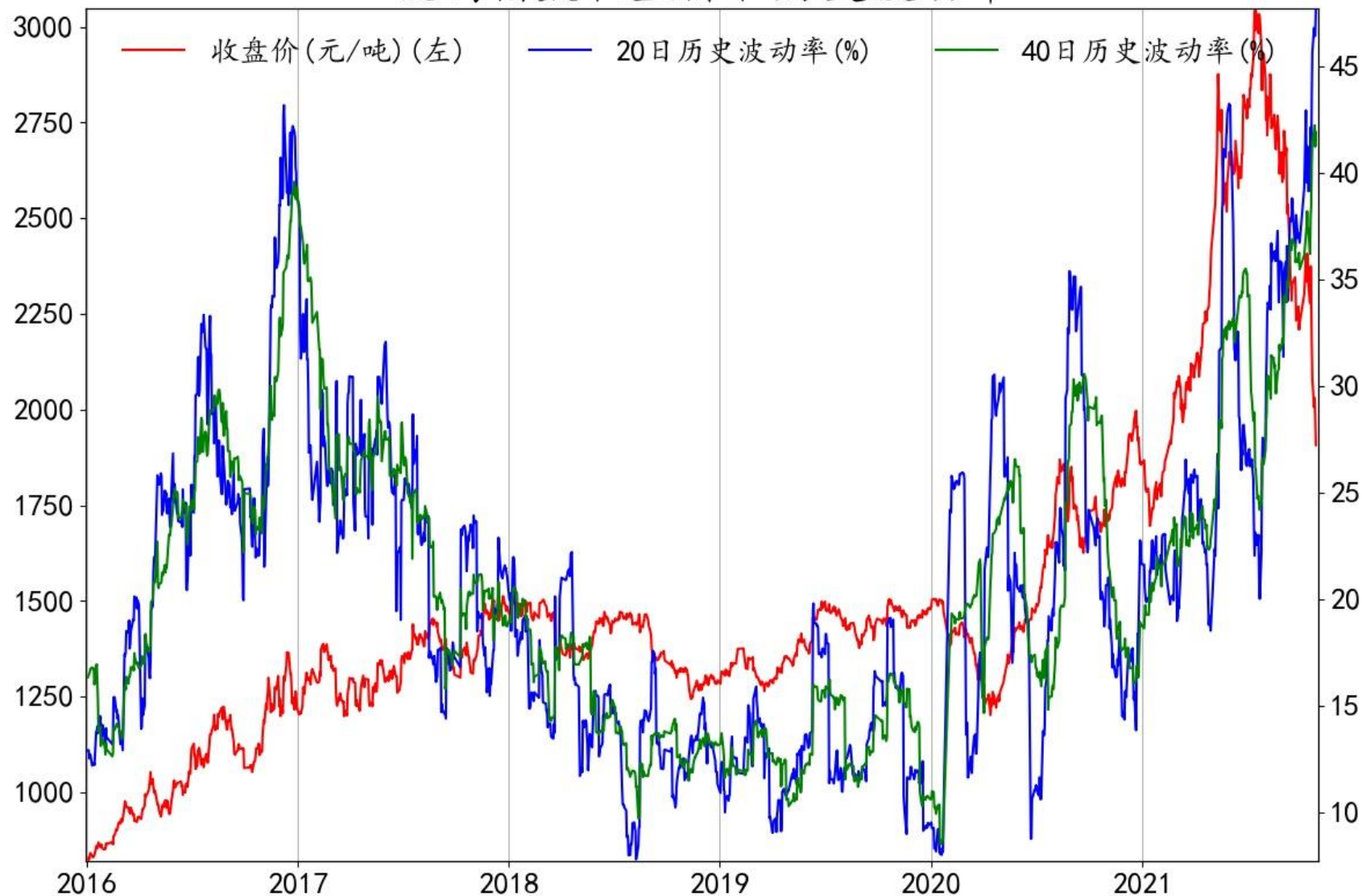
锰硅指数收盘价和历史波动率



不锈钢指数收盘价和历史波动率



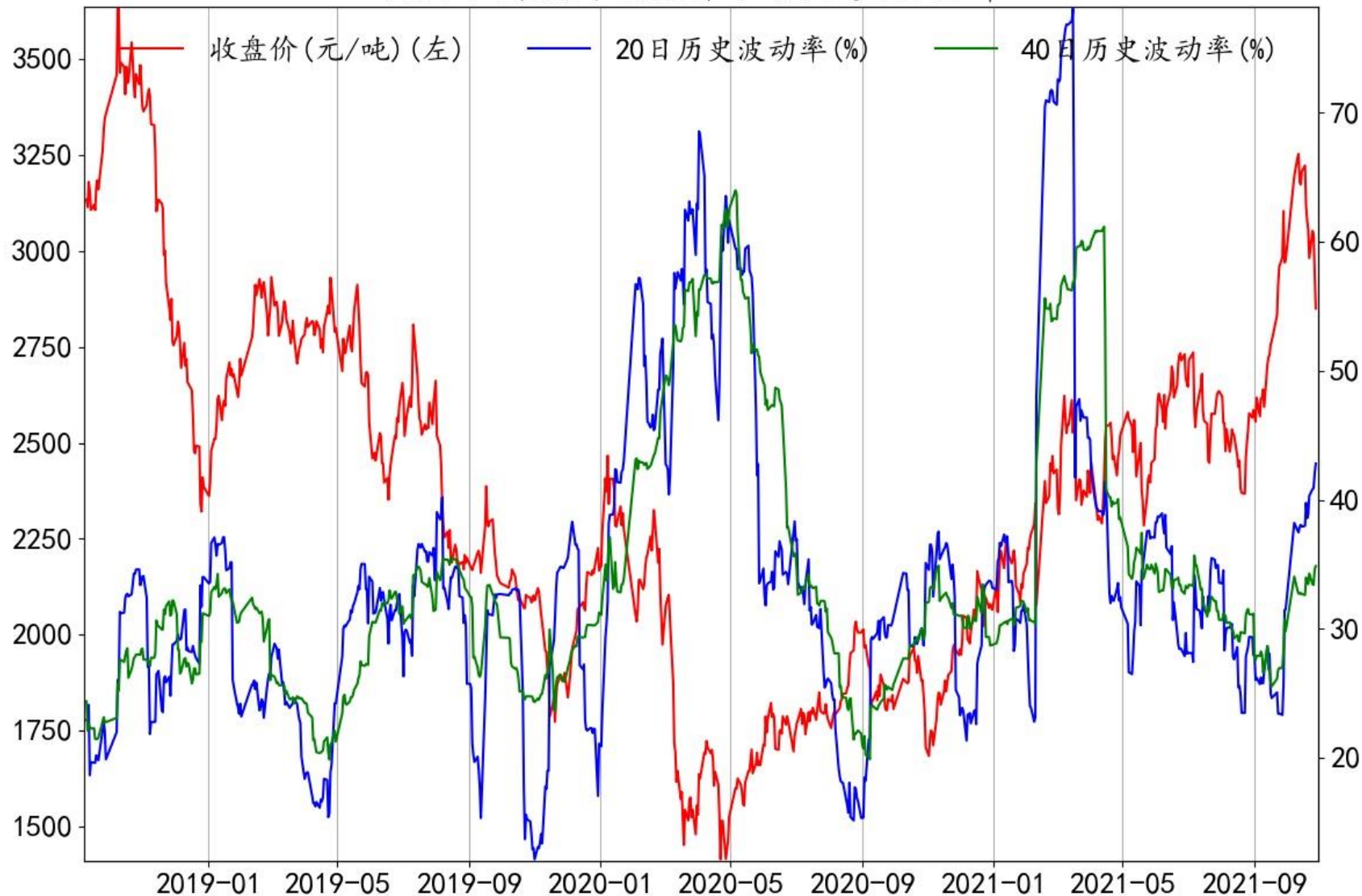
玻璃指数收盘价和历史波动率



PVC指数收盘价和历史波动率



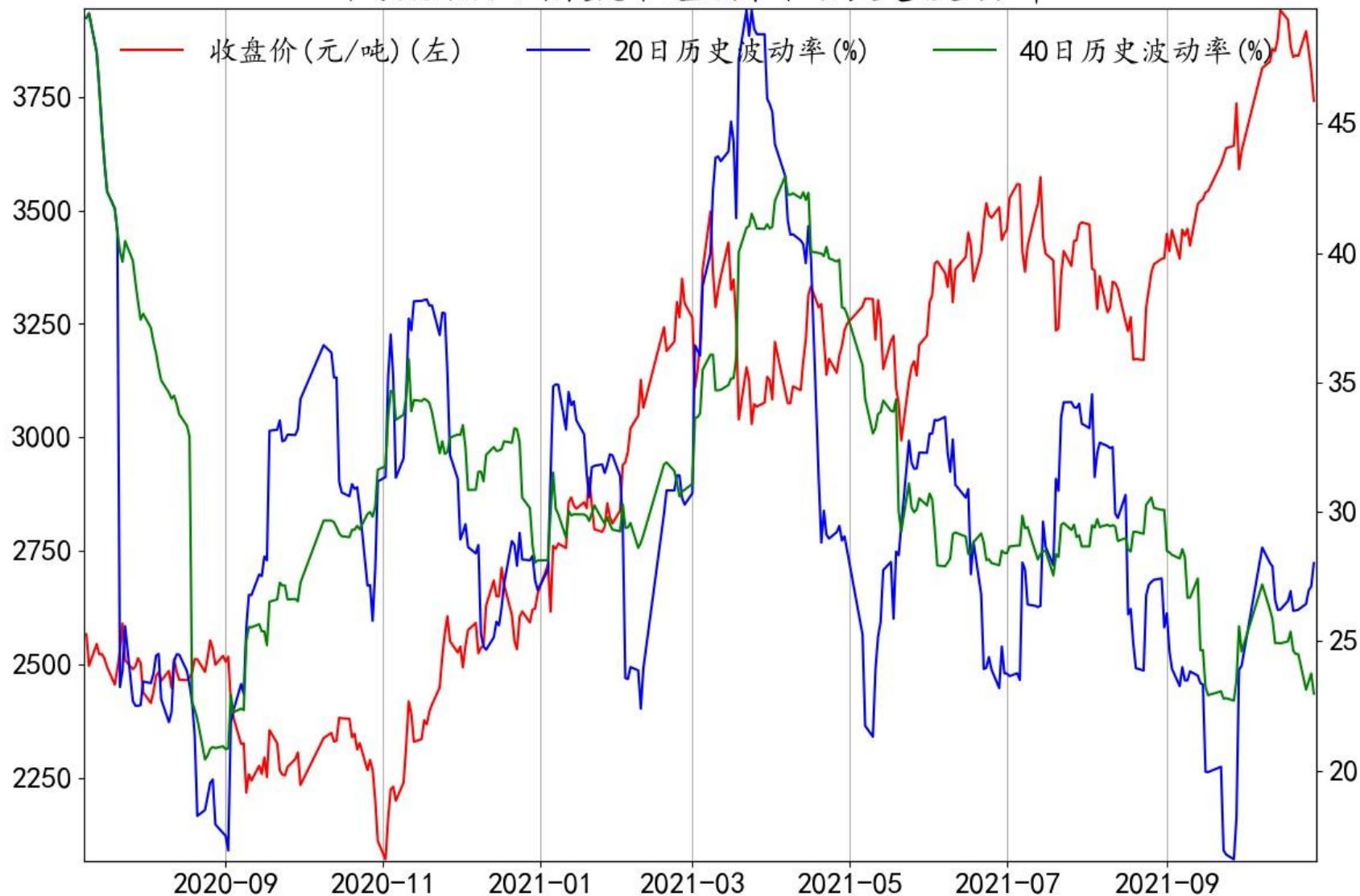
燃油指数收盘价和历史波动率



数据来源: Wind、信达期货研发中心

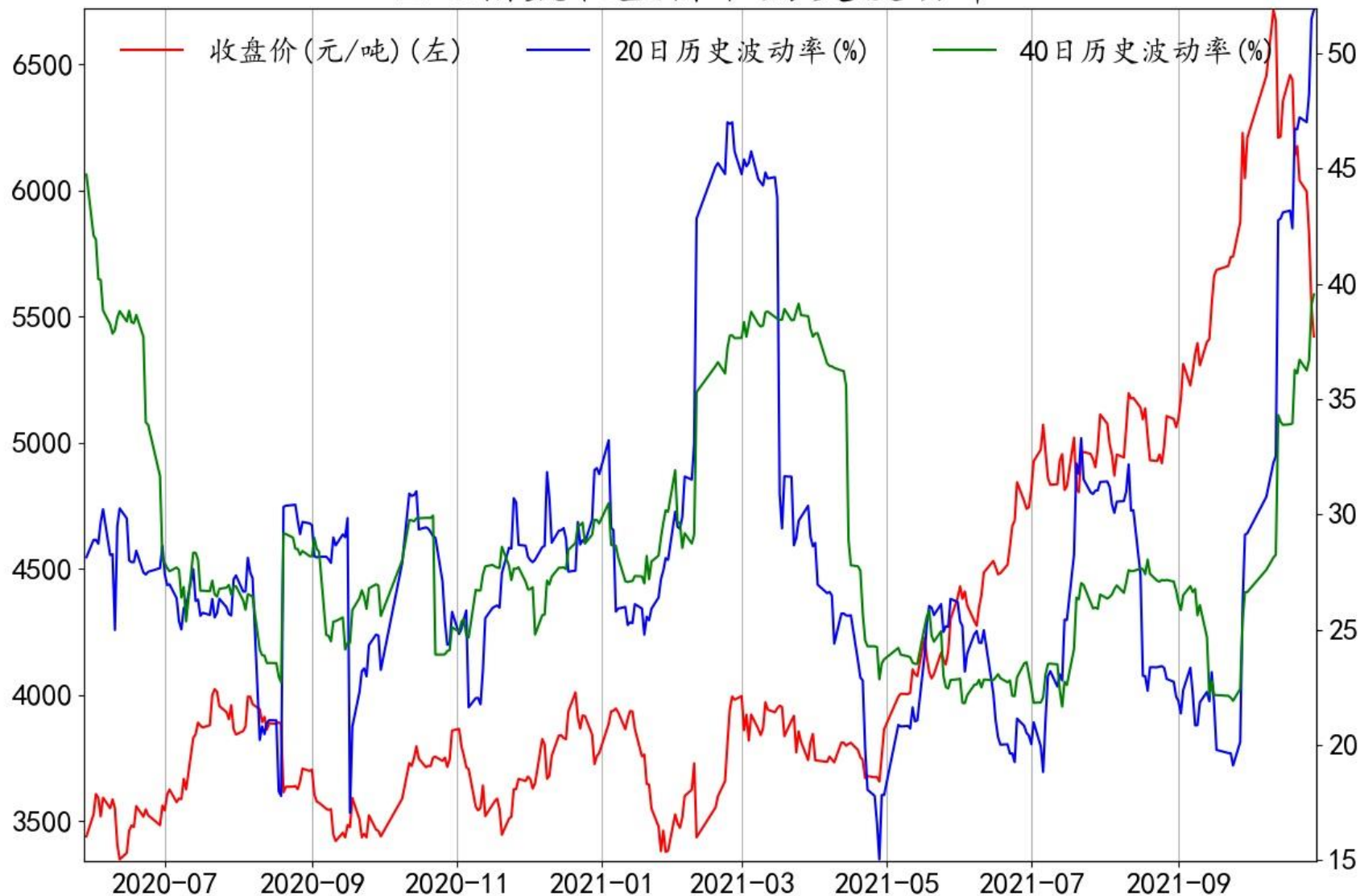
低硫燃油指数

低硫燃油指数收盘价和历史波动率



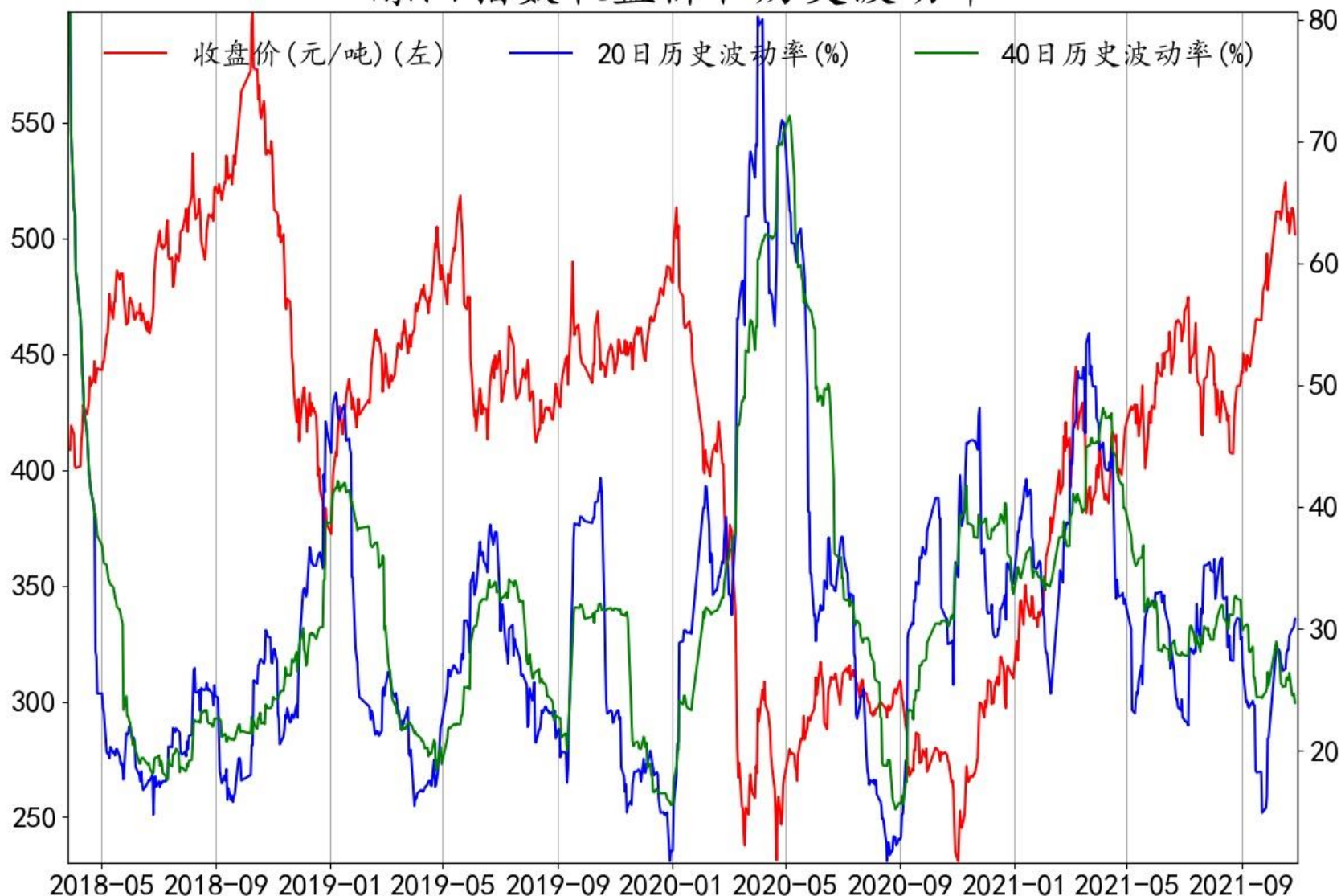
数据来源: Wind、信达期货研发中心

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



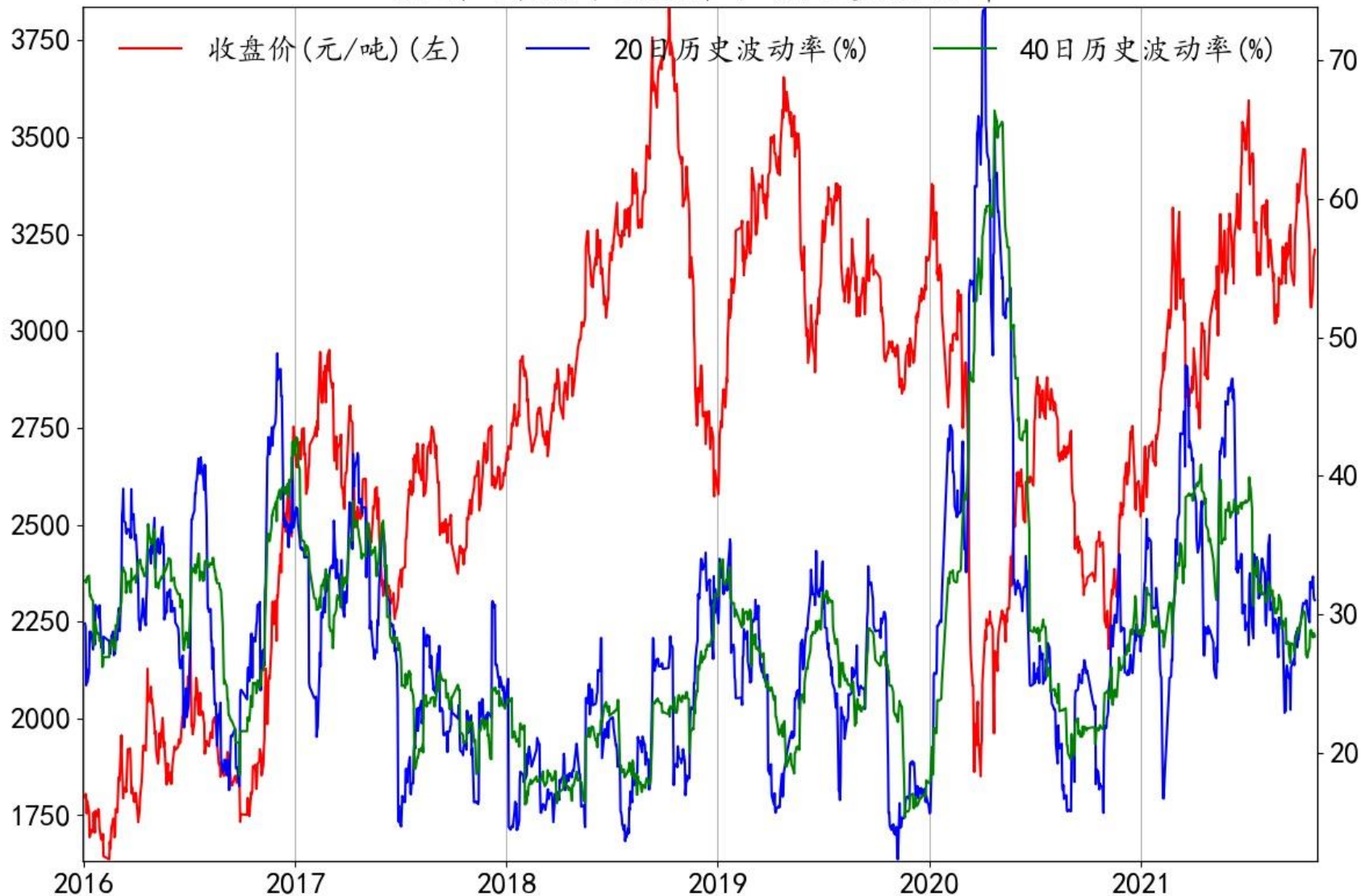
数据来源: Wind、信达期货研发中心

动煤指数收盘价和历史波动率

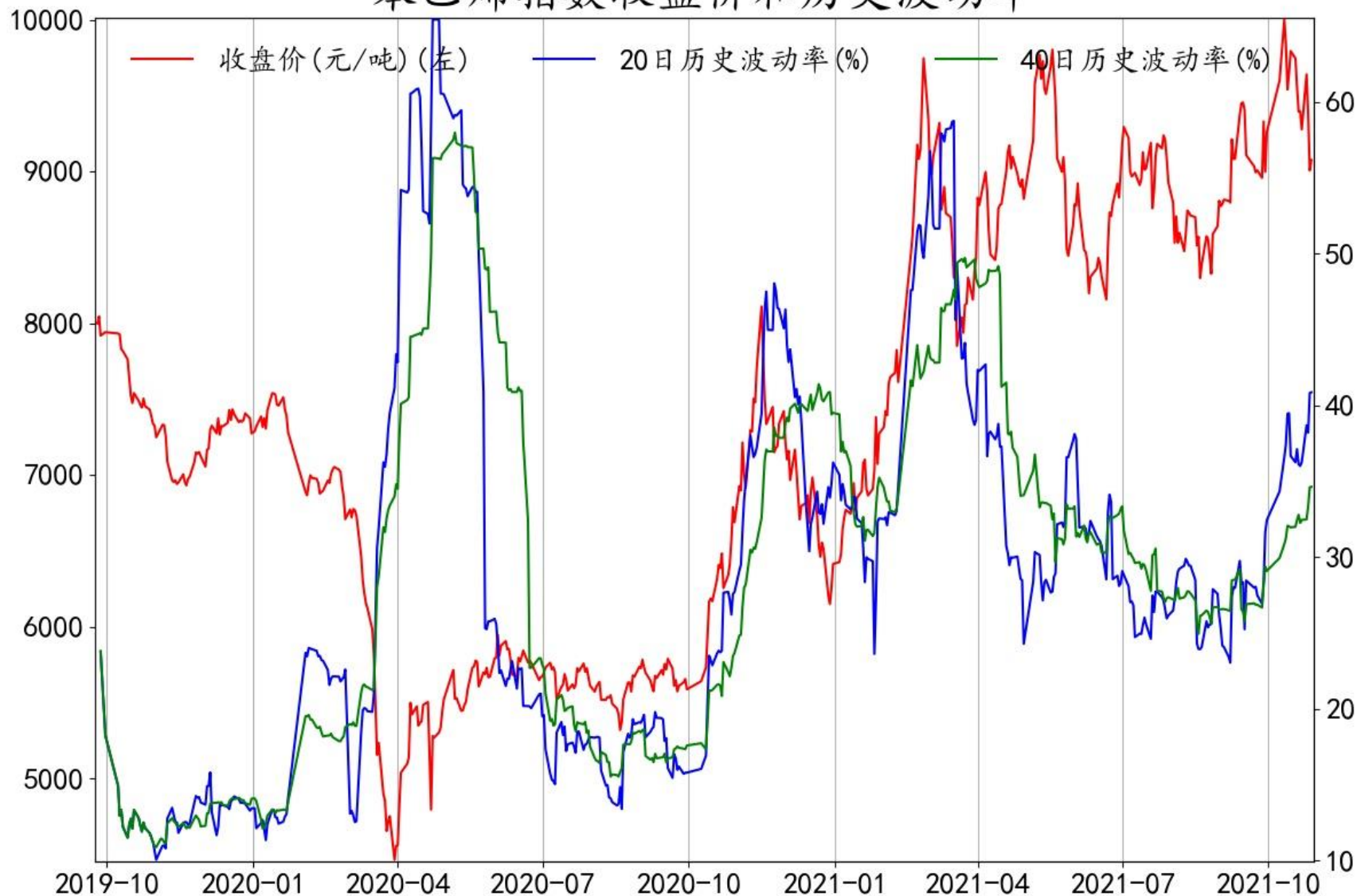


数据来源: Wind、信达期货研发中心

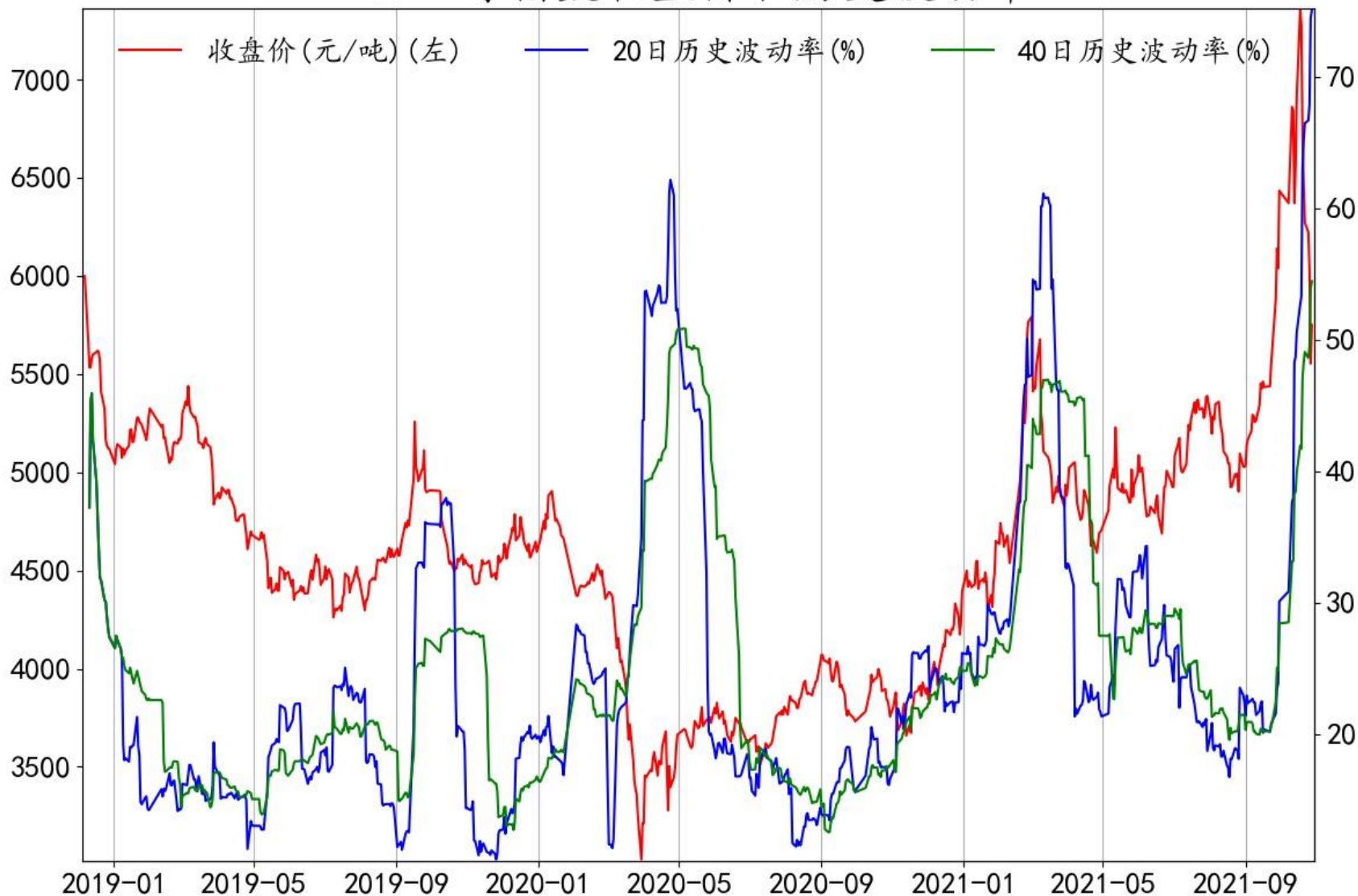
沥青指数收盘价和历史波动率



苯乙烯指数收盘价和历史波动率

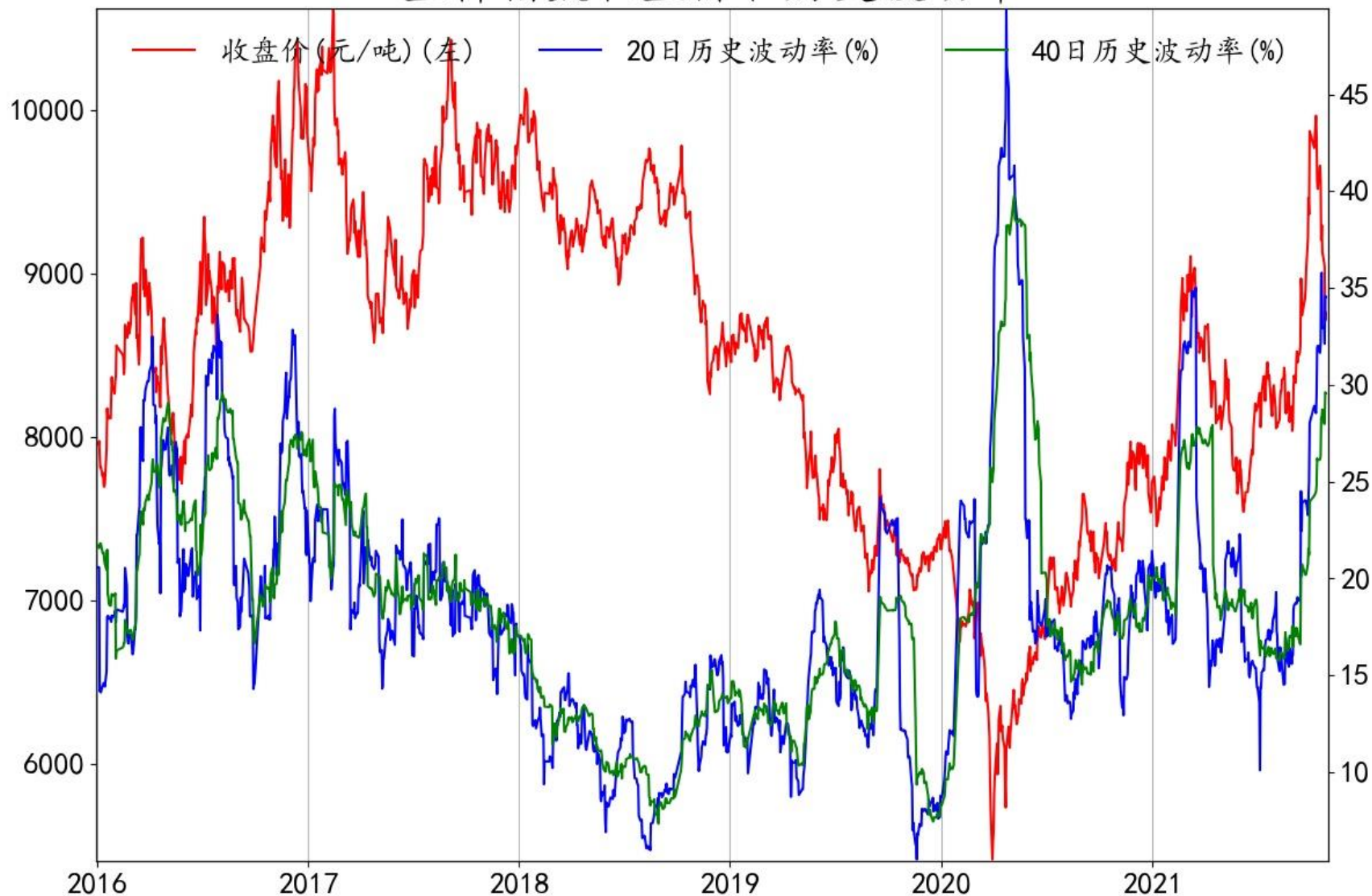


乙二醇指数收盘价和历史波动率

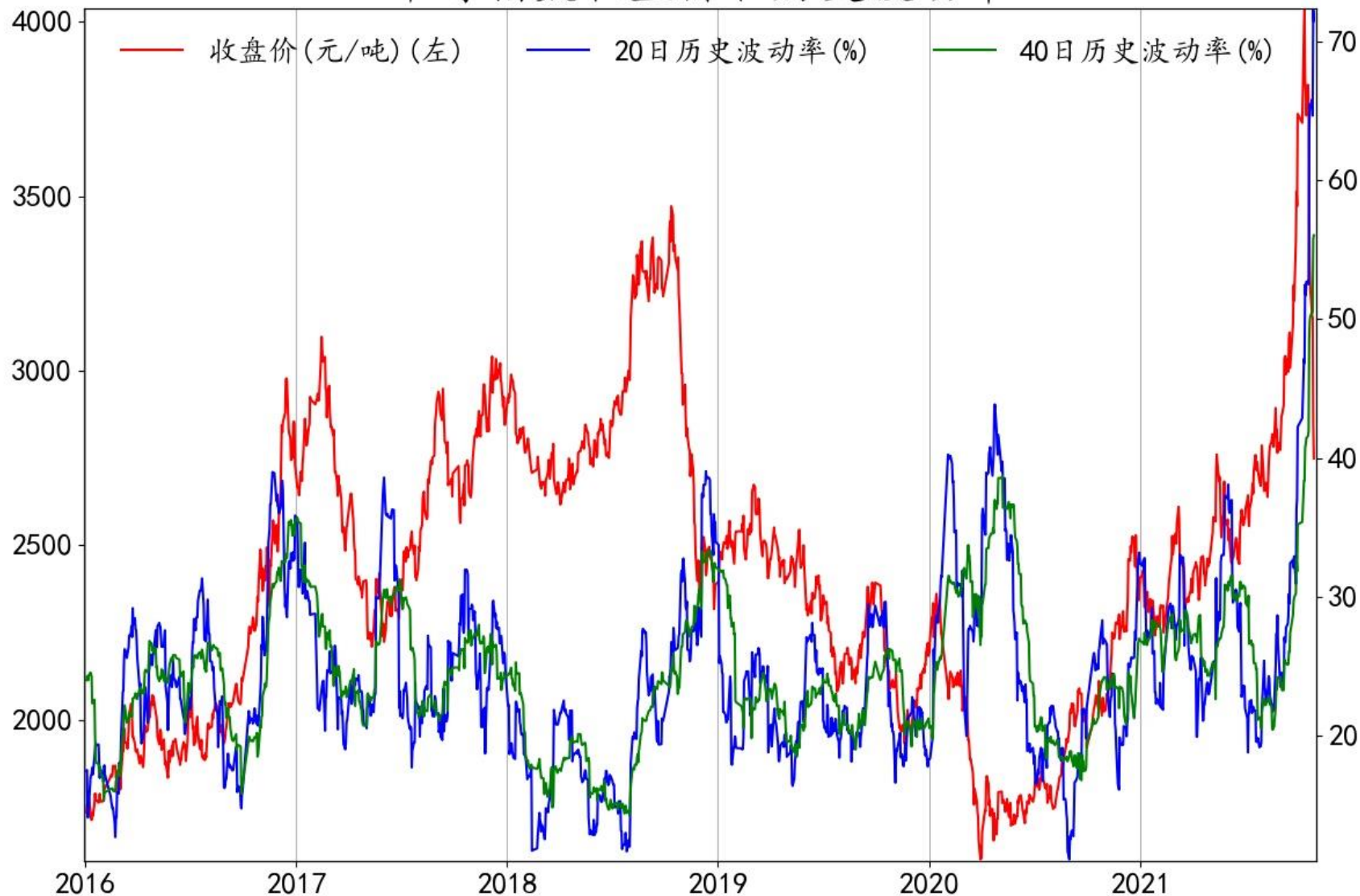


数据来源: Wind、信达期货研发中心

塑料指数收盘价和历史波动率

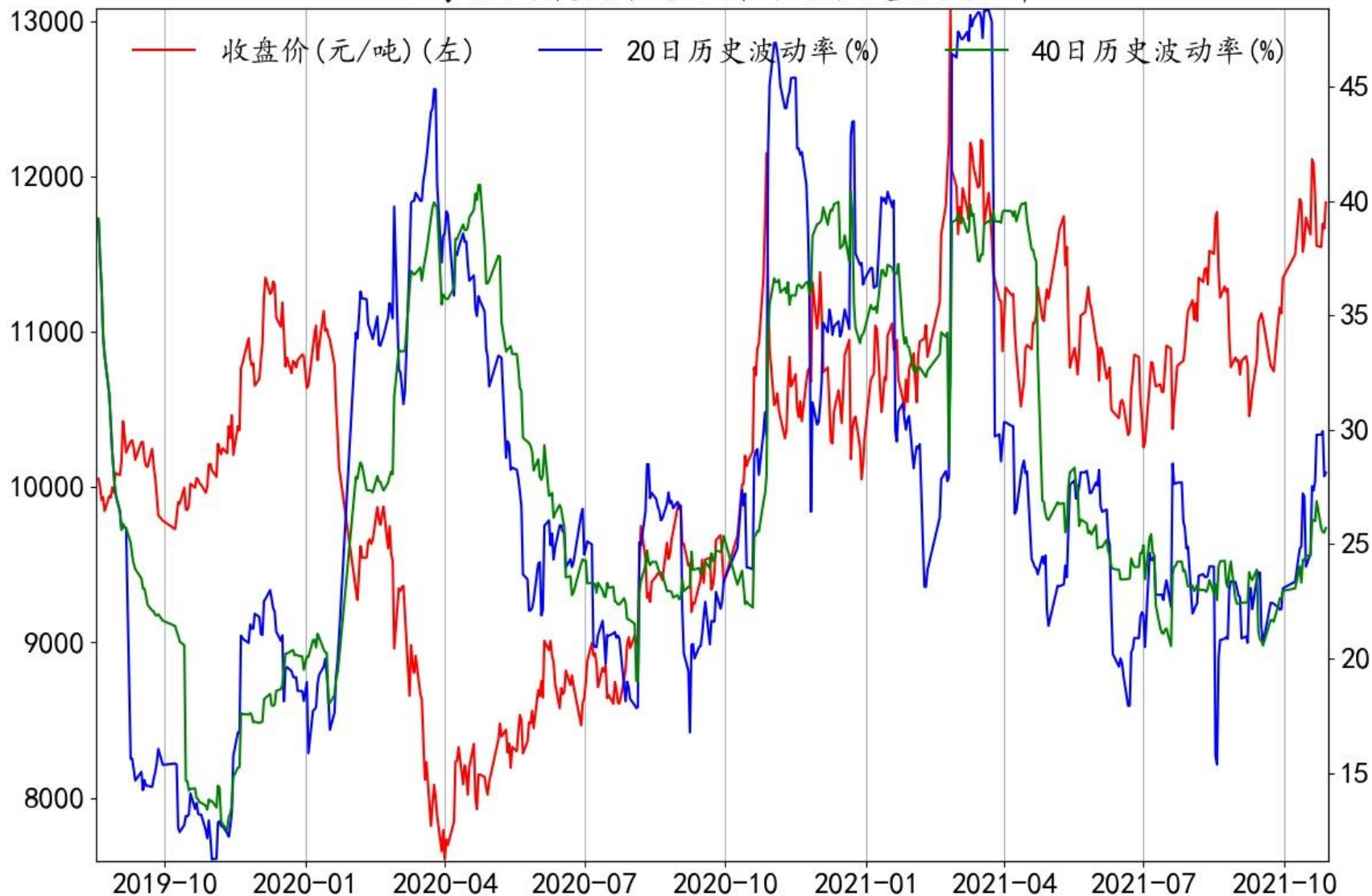


甲醇指数收盘价和历史波动率



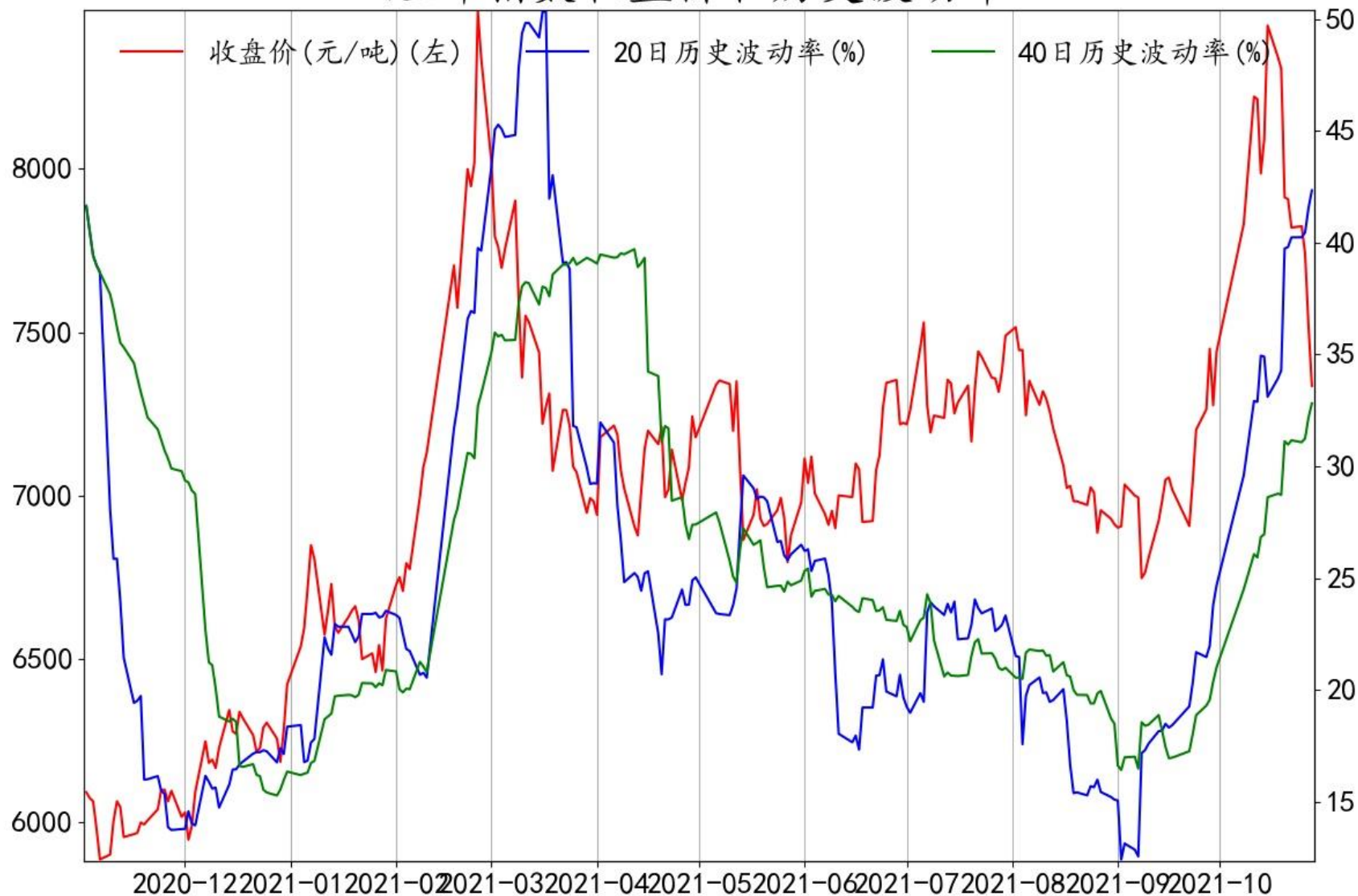
20号胶指数

20号胶指数收盘价和历史波动率

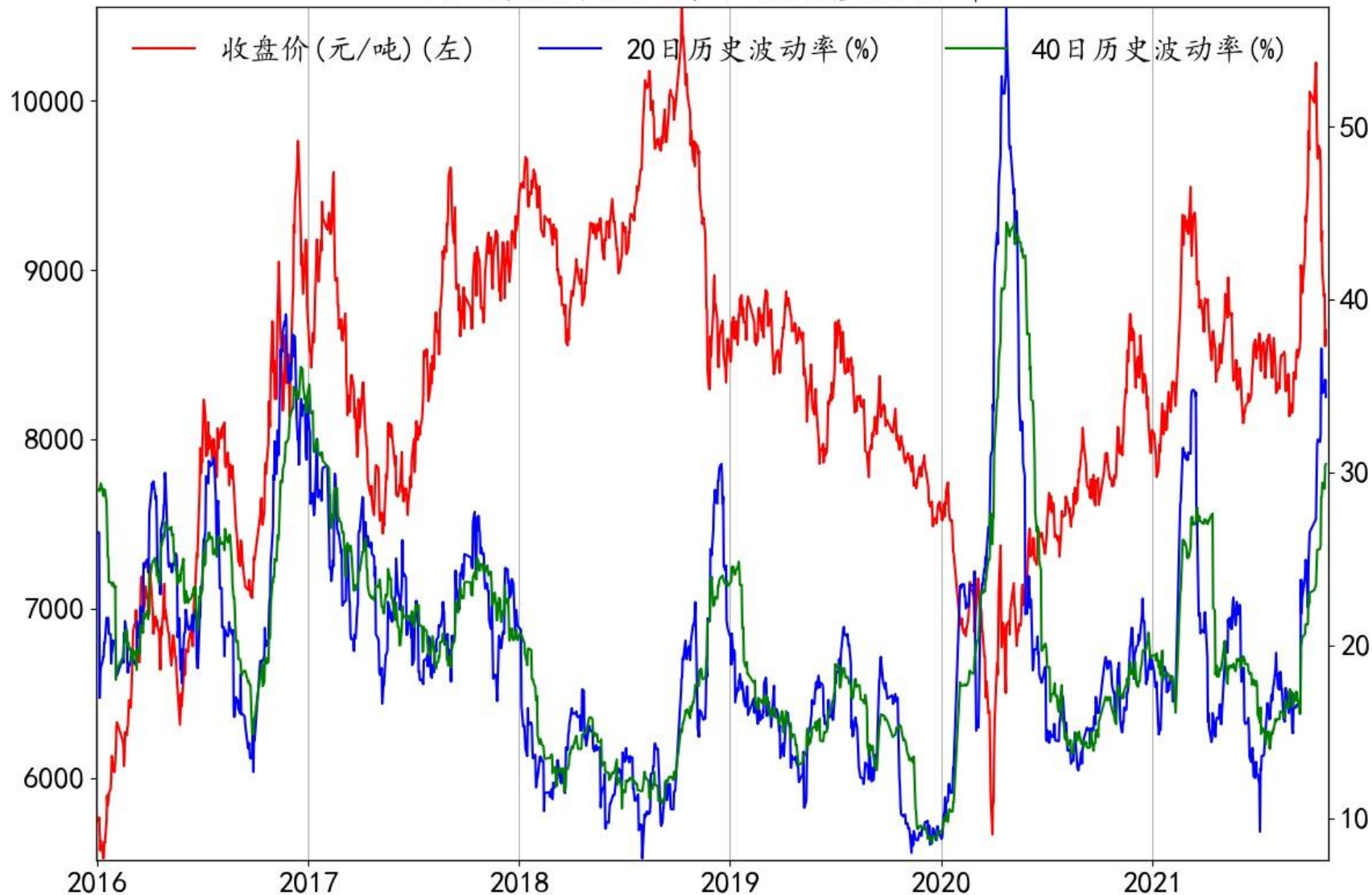


数据来源: Wind、信达期货研发中心

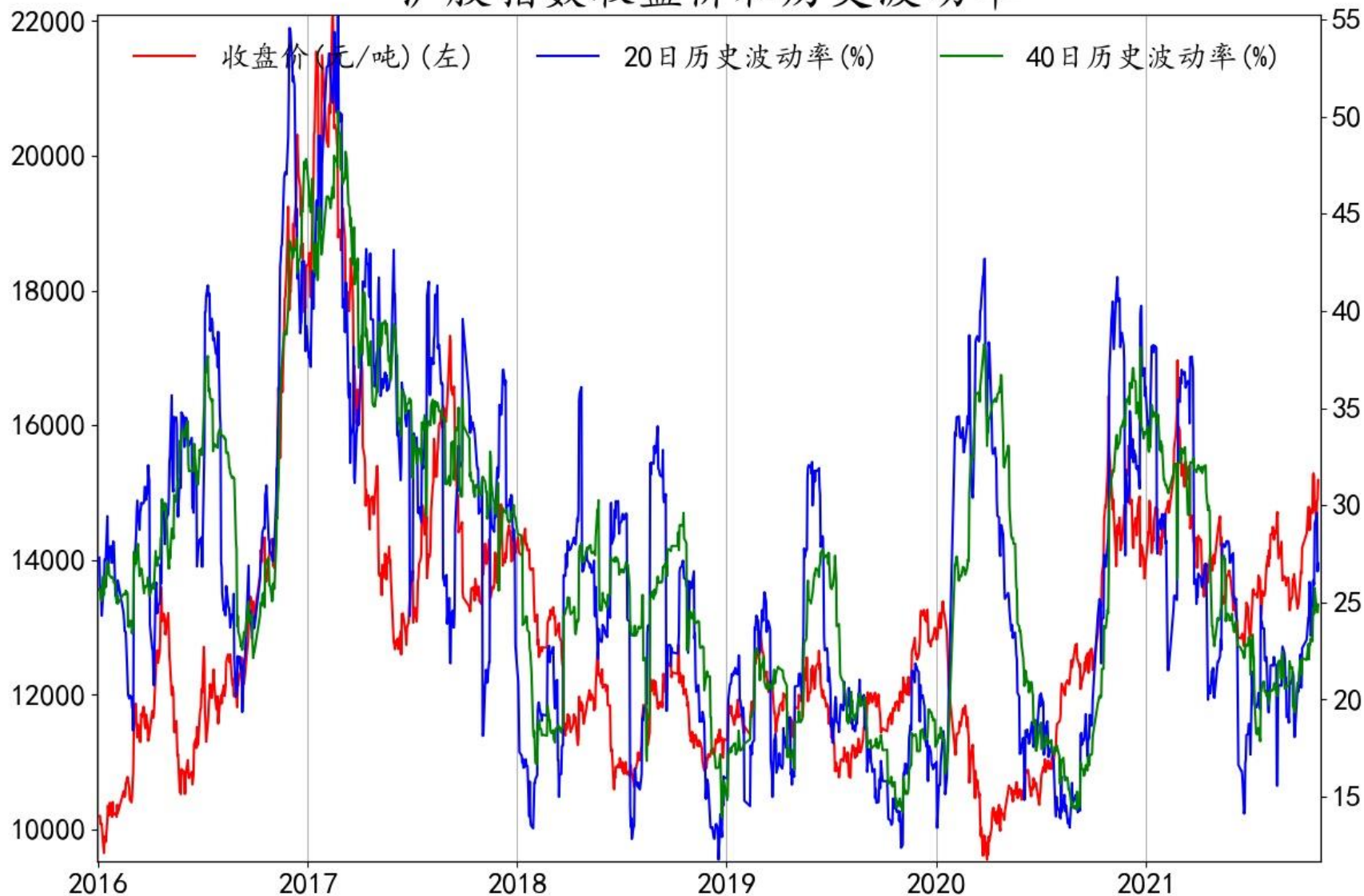
短纤指数收盘价和历史波动率



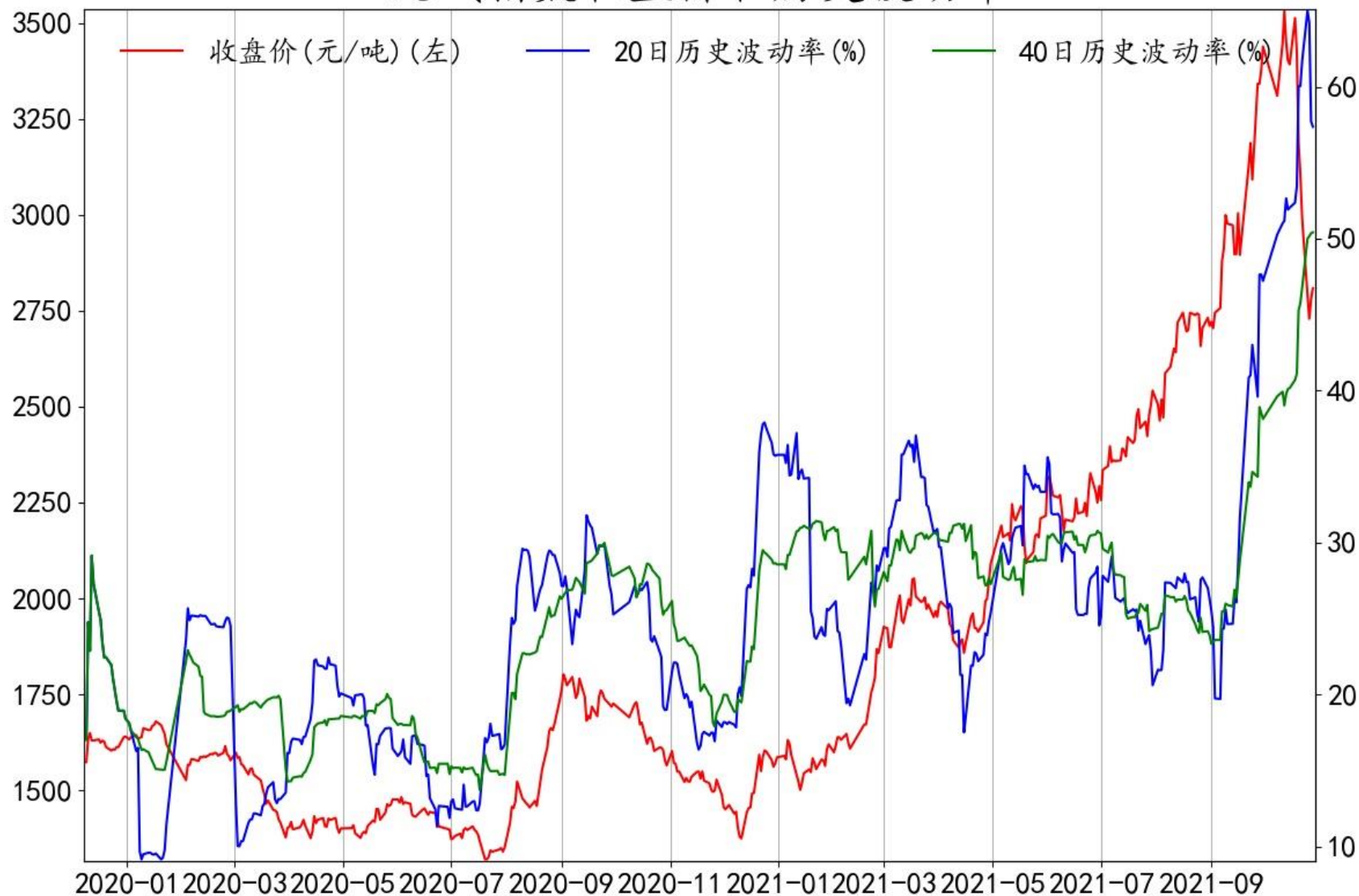
PP指数收盘价和历史波动率



沪胶指数收盘价和历史波动率

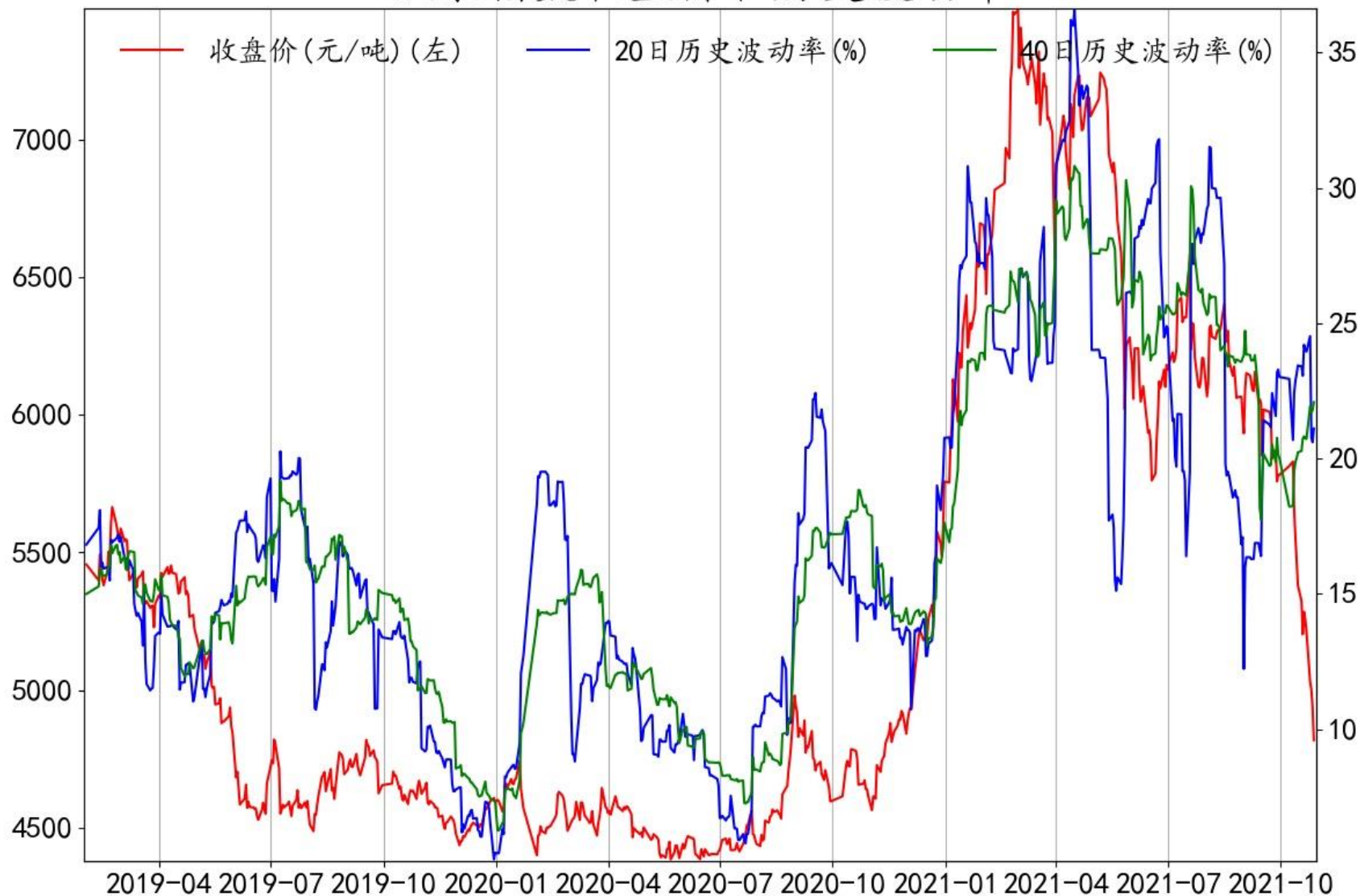


纯碱指数收盘价和历史波动率



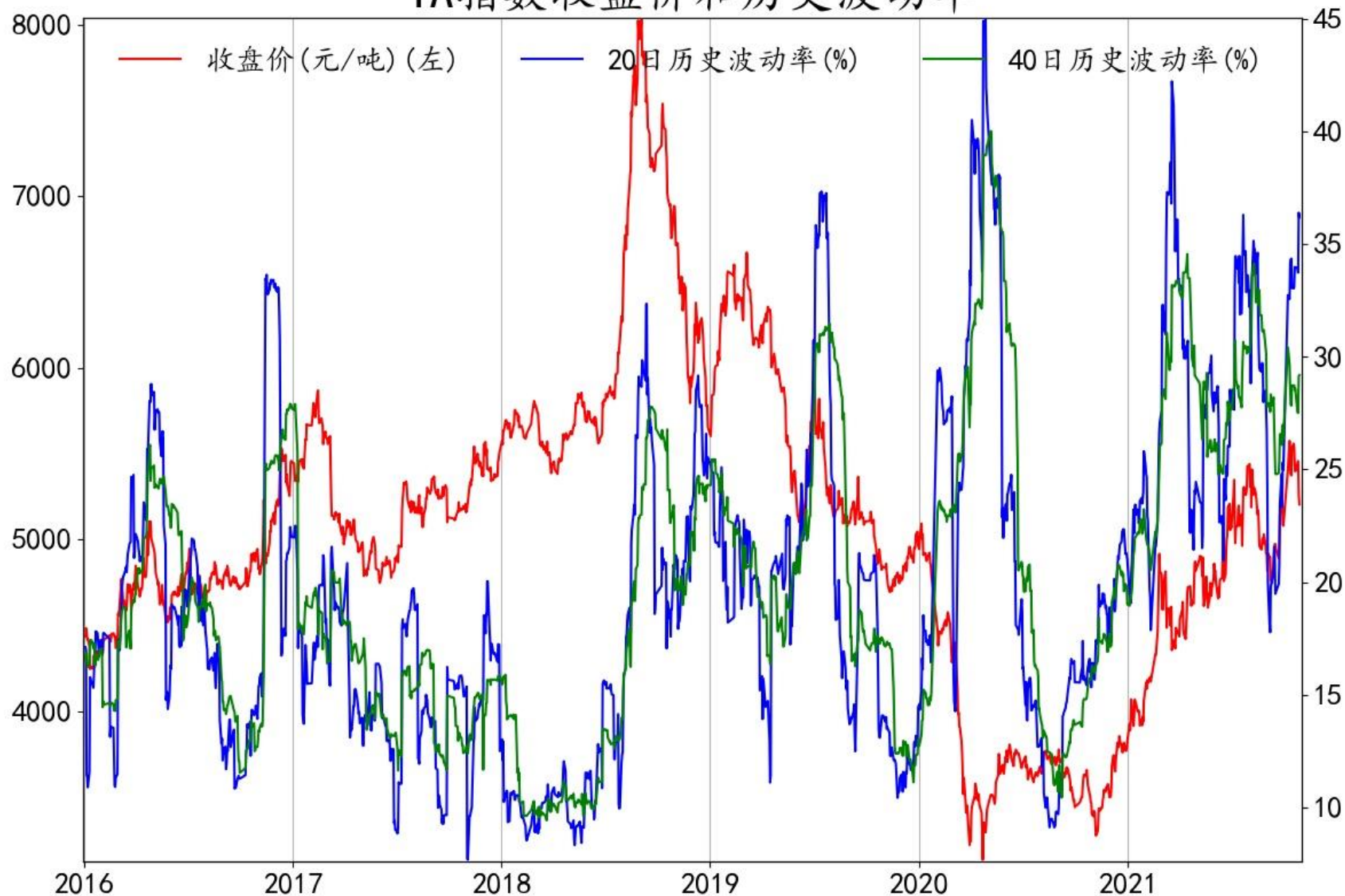
数据来源: Wind、信达期货研发中心

纸浆指数收盘价和历史波动率

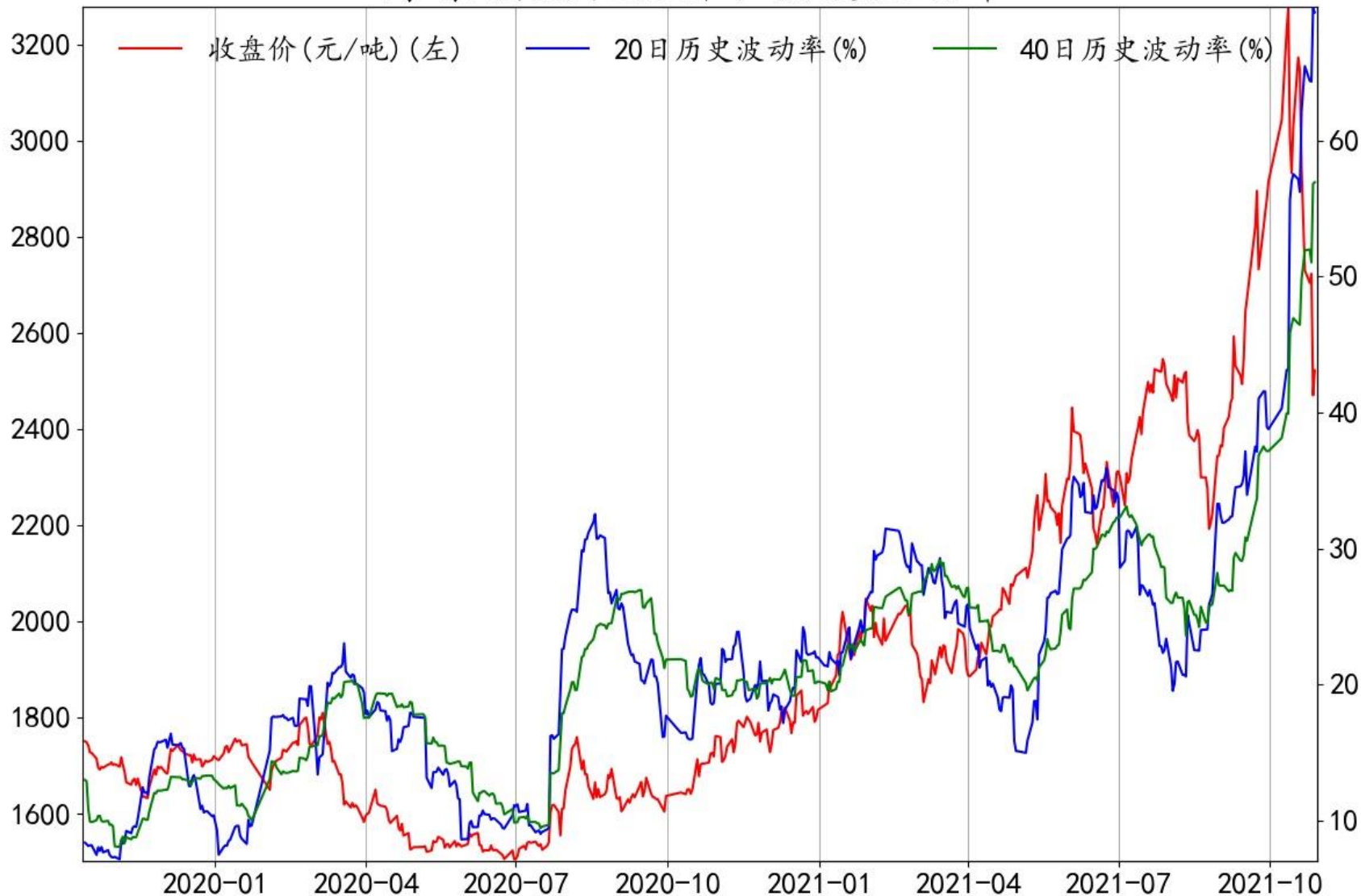


数据来源: Wind、信达期货研发中心

TA指数收盘价和历史波动率



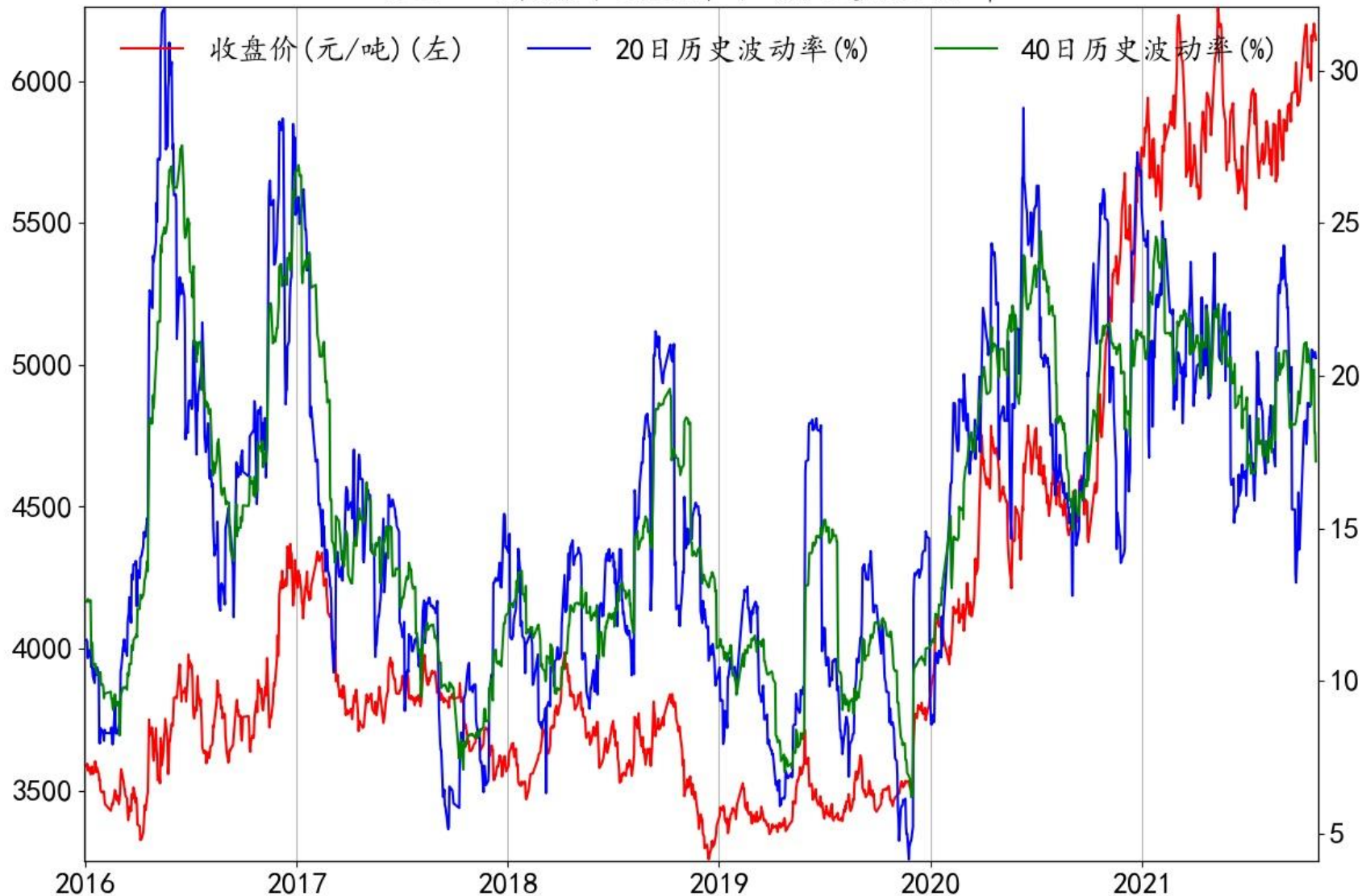
尿素指数收盘价和历史波动率



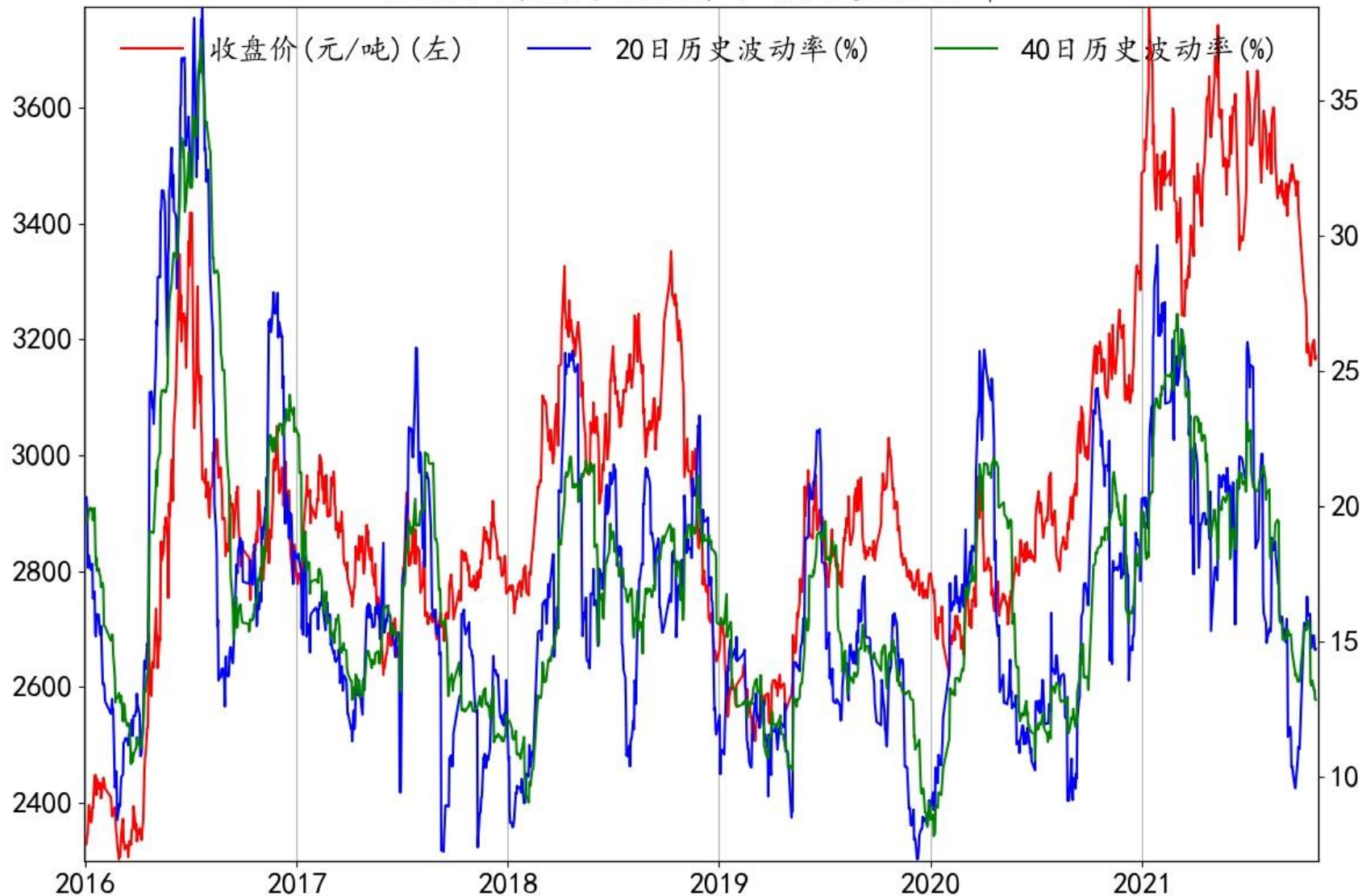
玉米指数收盘价和历史波动率



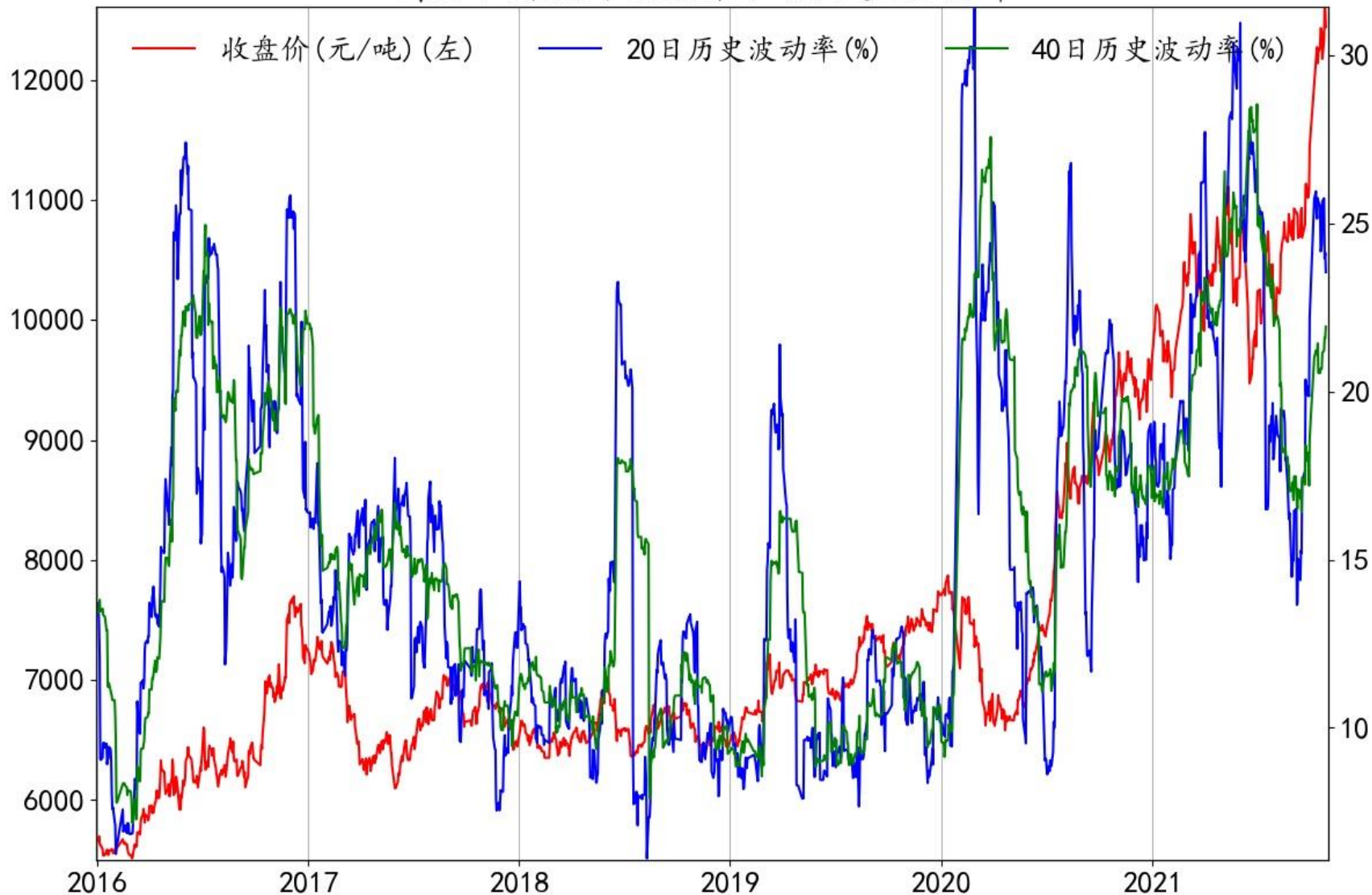
豆一指数收盘价和历史波动率



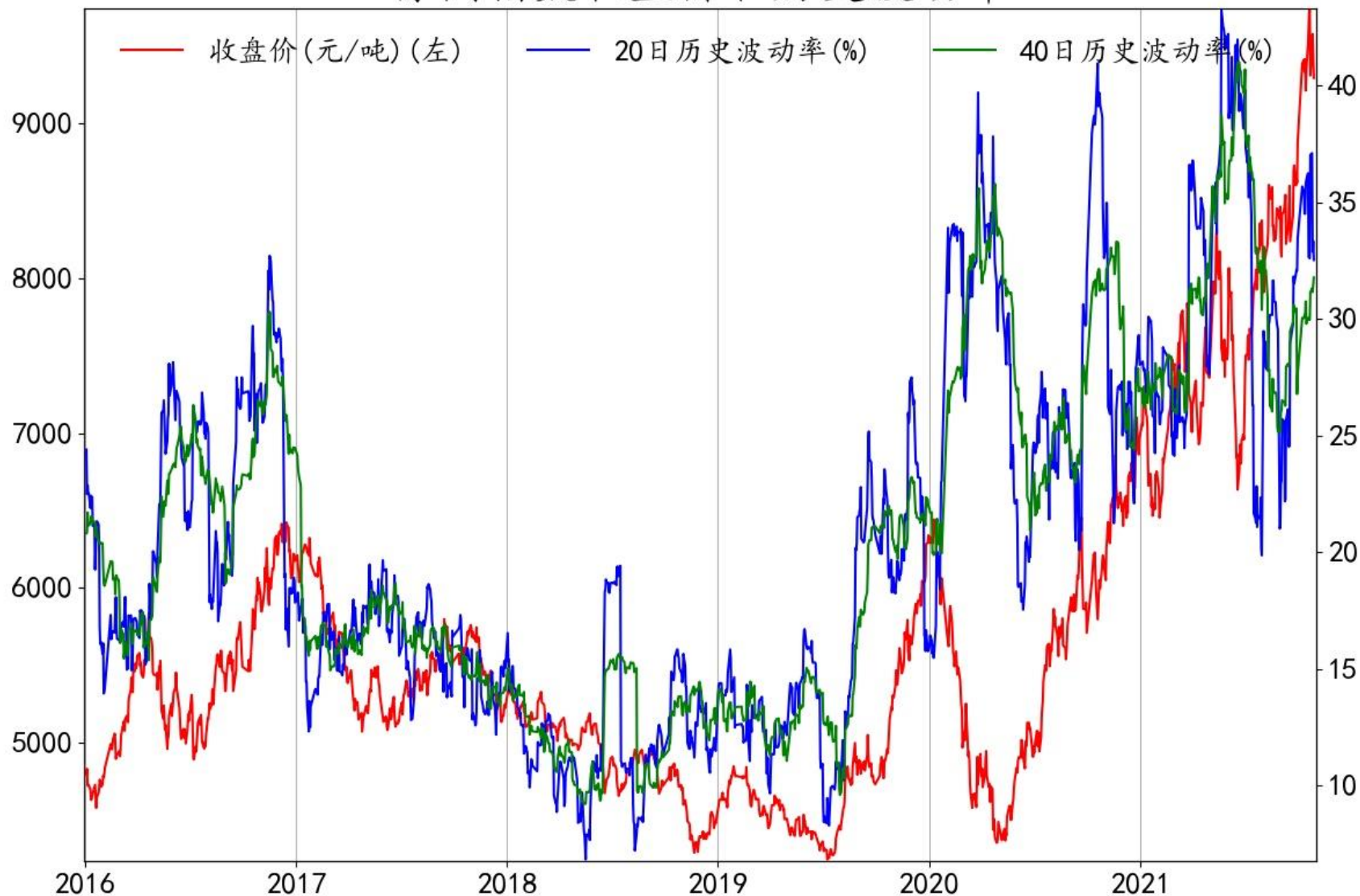
豆粕指数收盘价和历史波动率



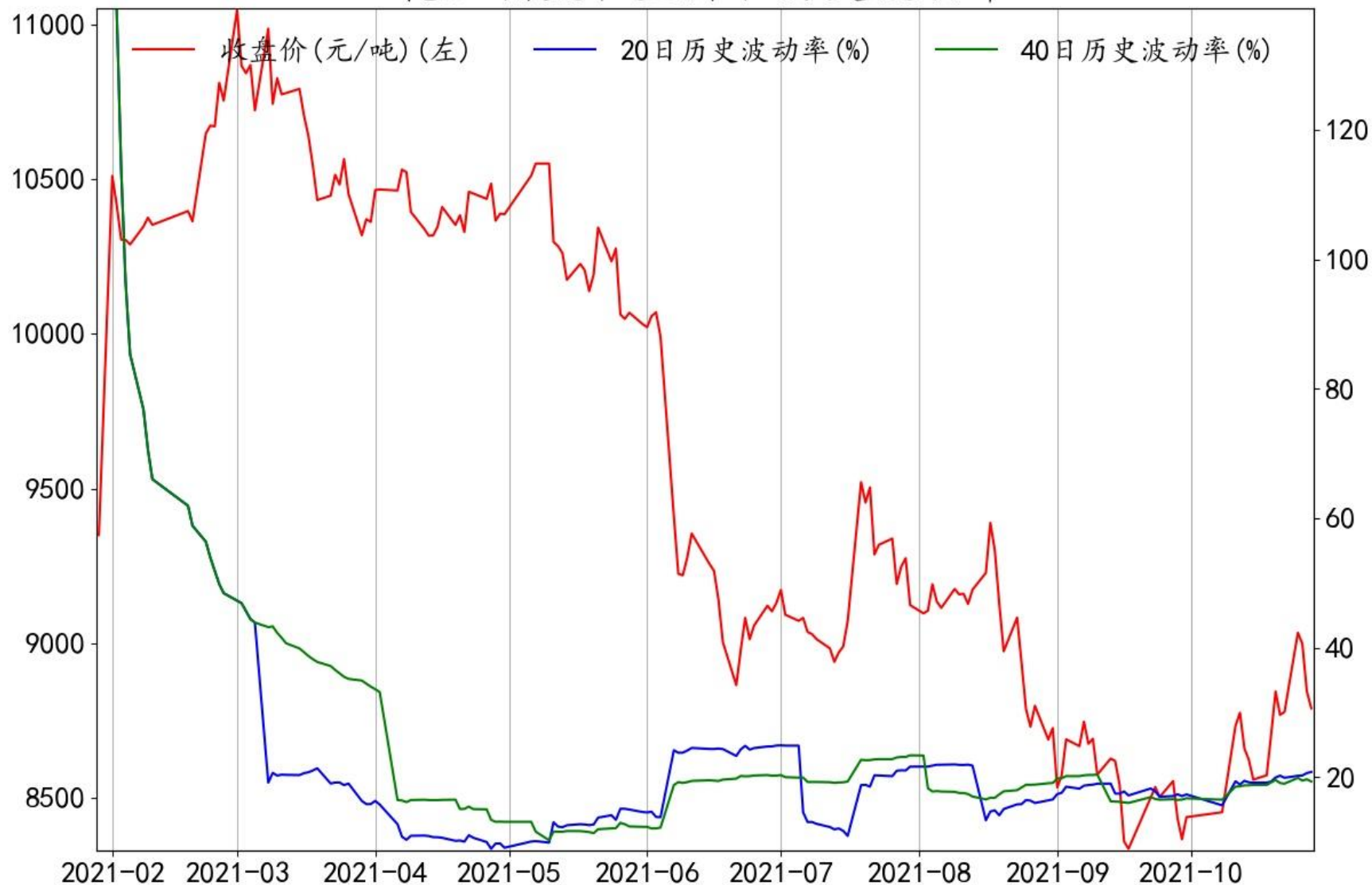
菜油指数收盘价和历史波动率



棕榈指数收盘价和历史波动率

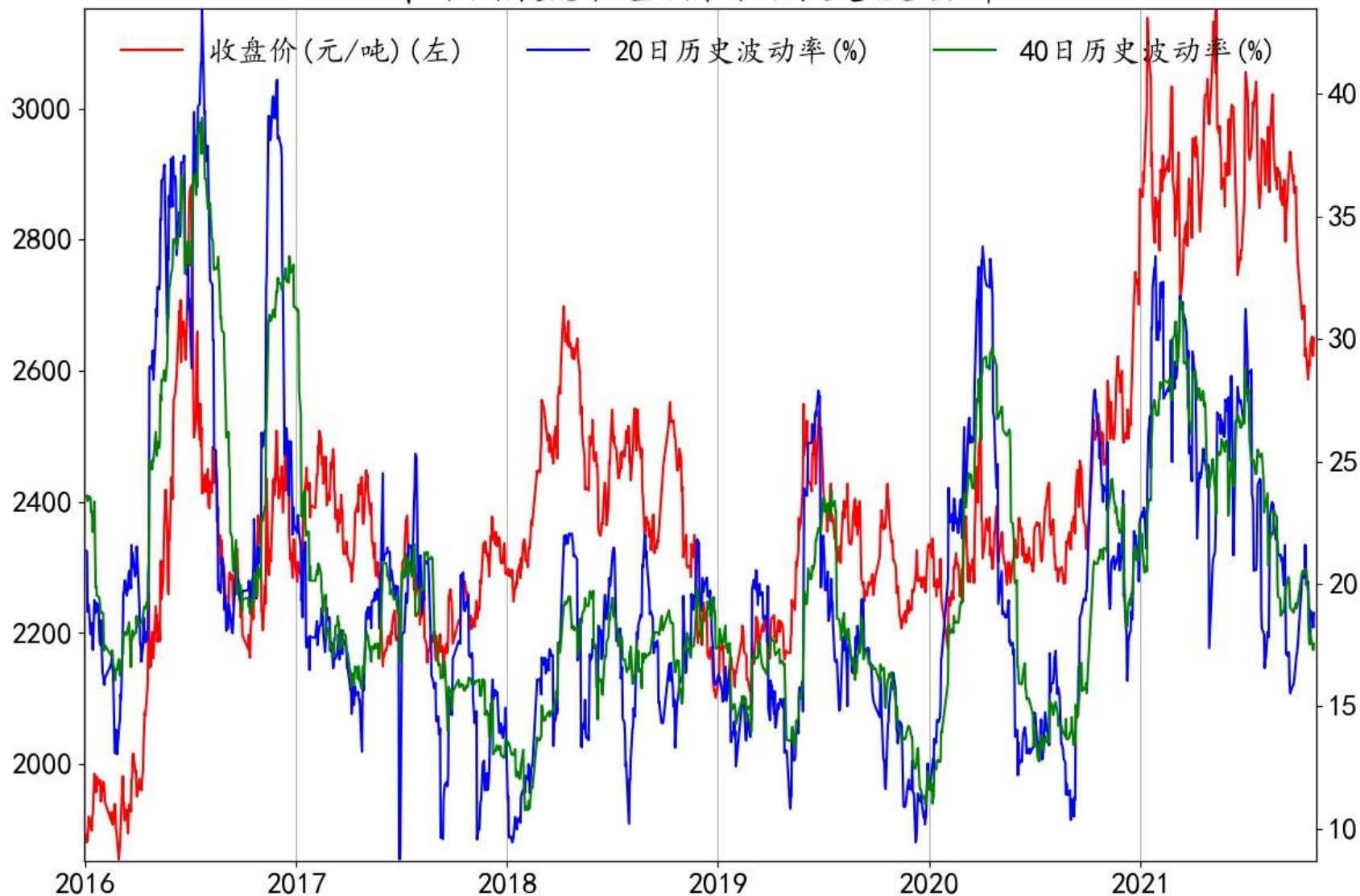


花生指数收盘价和历史波动率

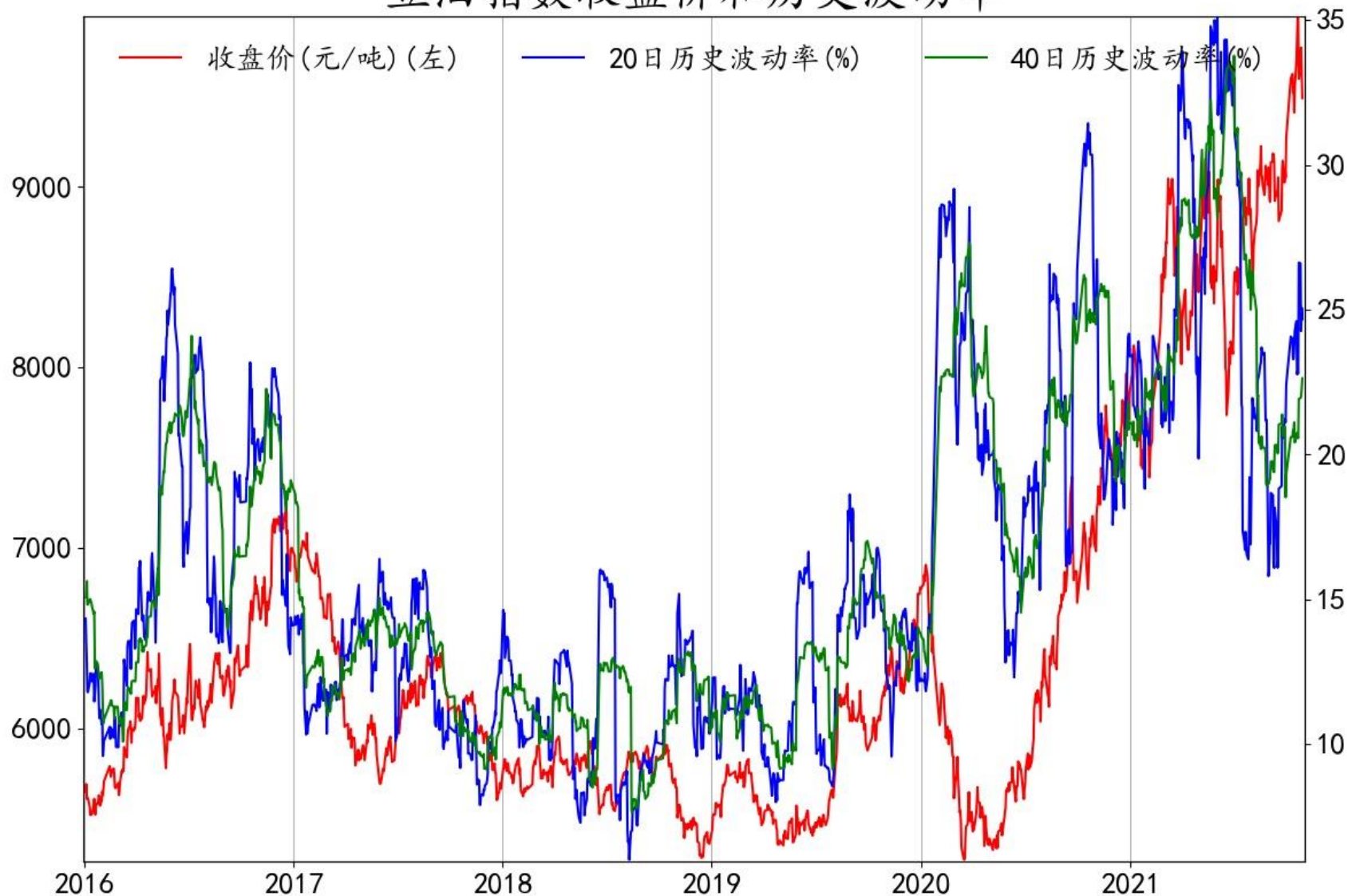


数据来源: Wind、信达期货研发中心

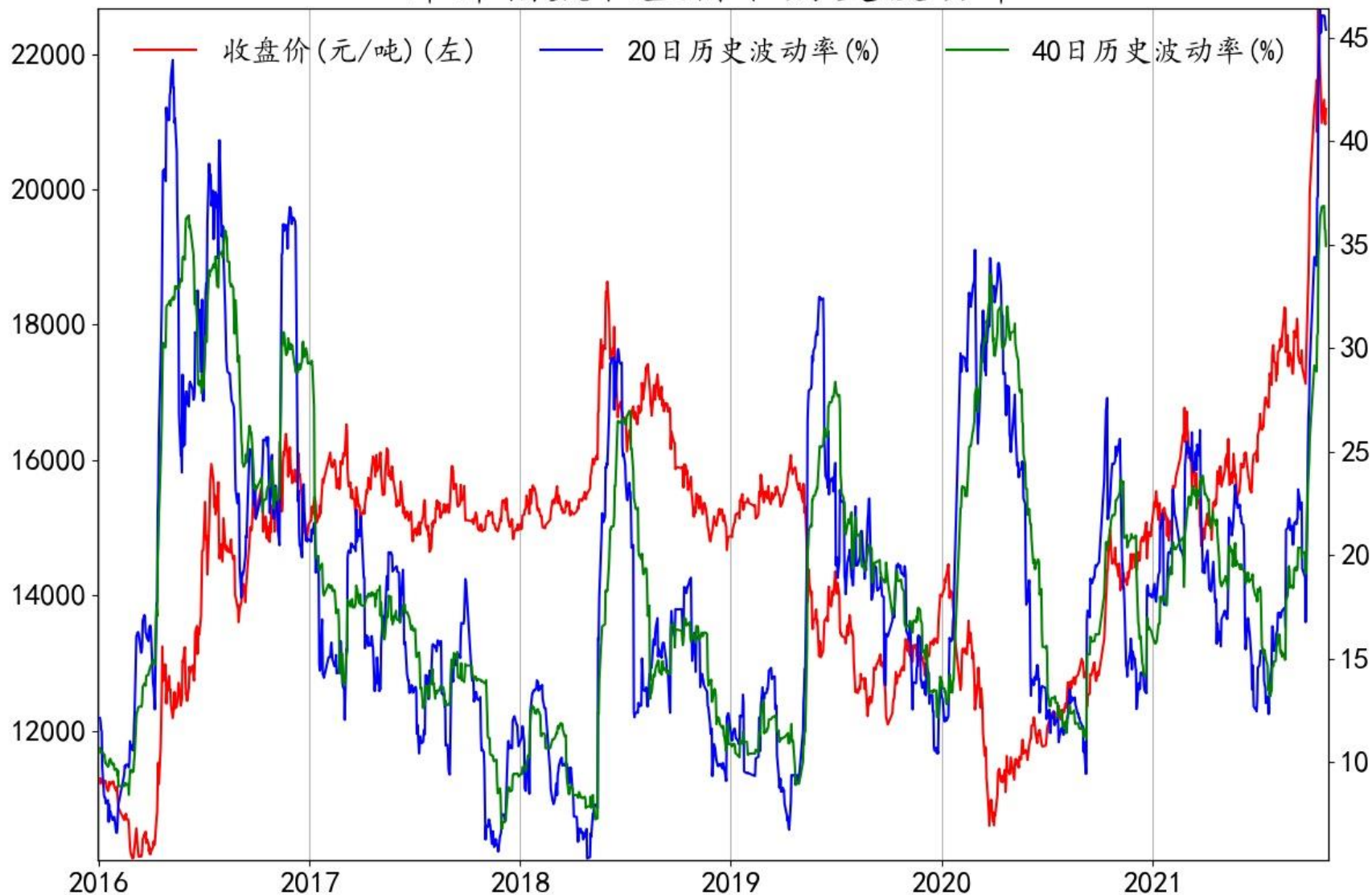
菜粕指数收盘价和历史波动率



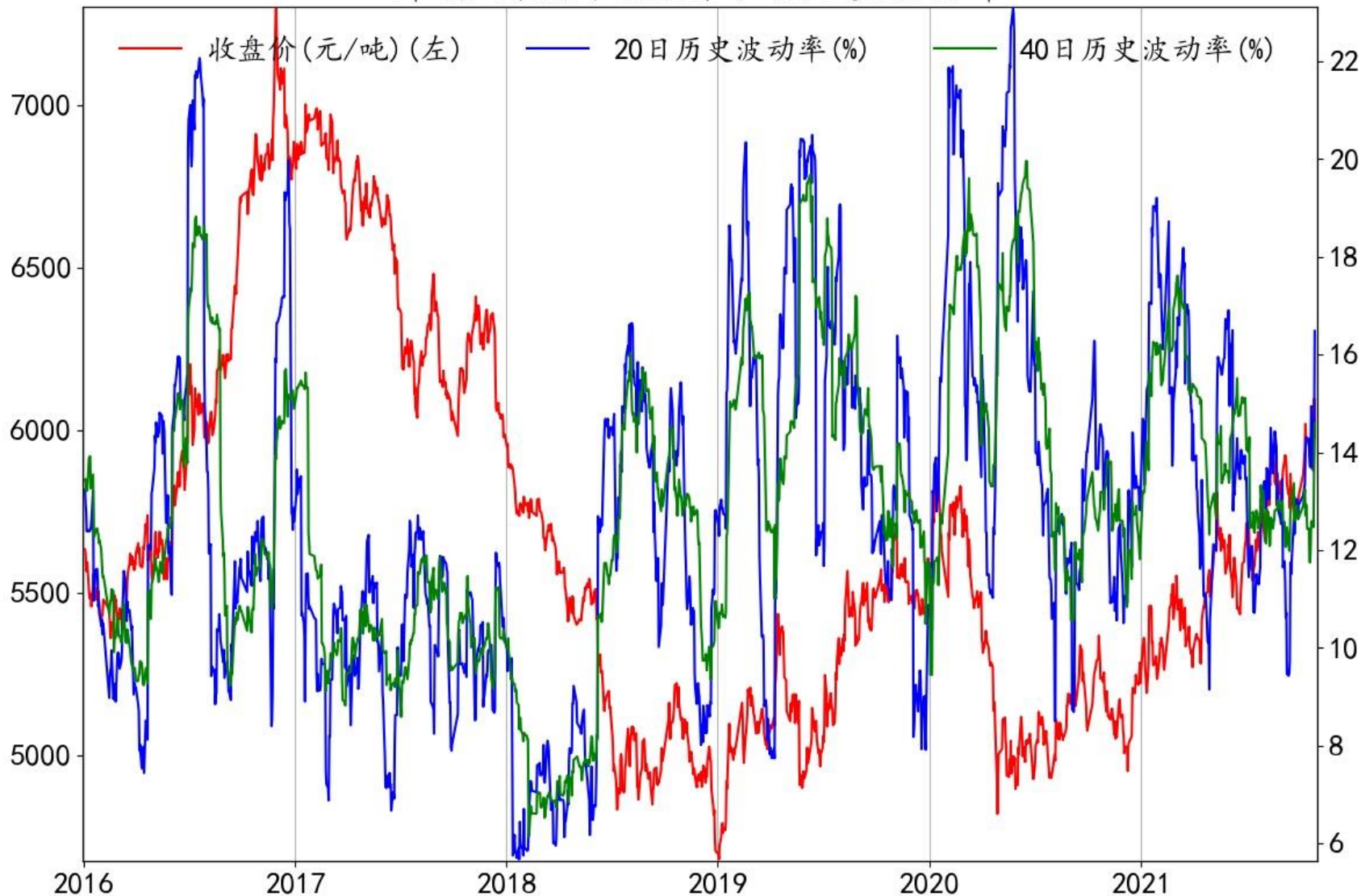
豆油指数收盘价和历史波动率



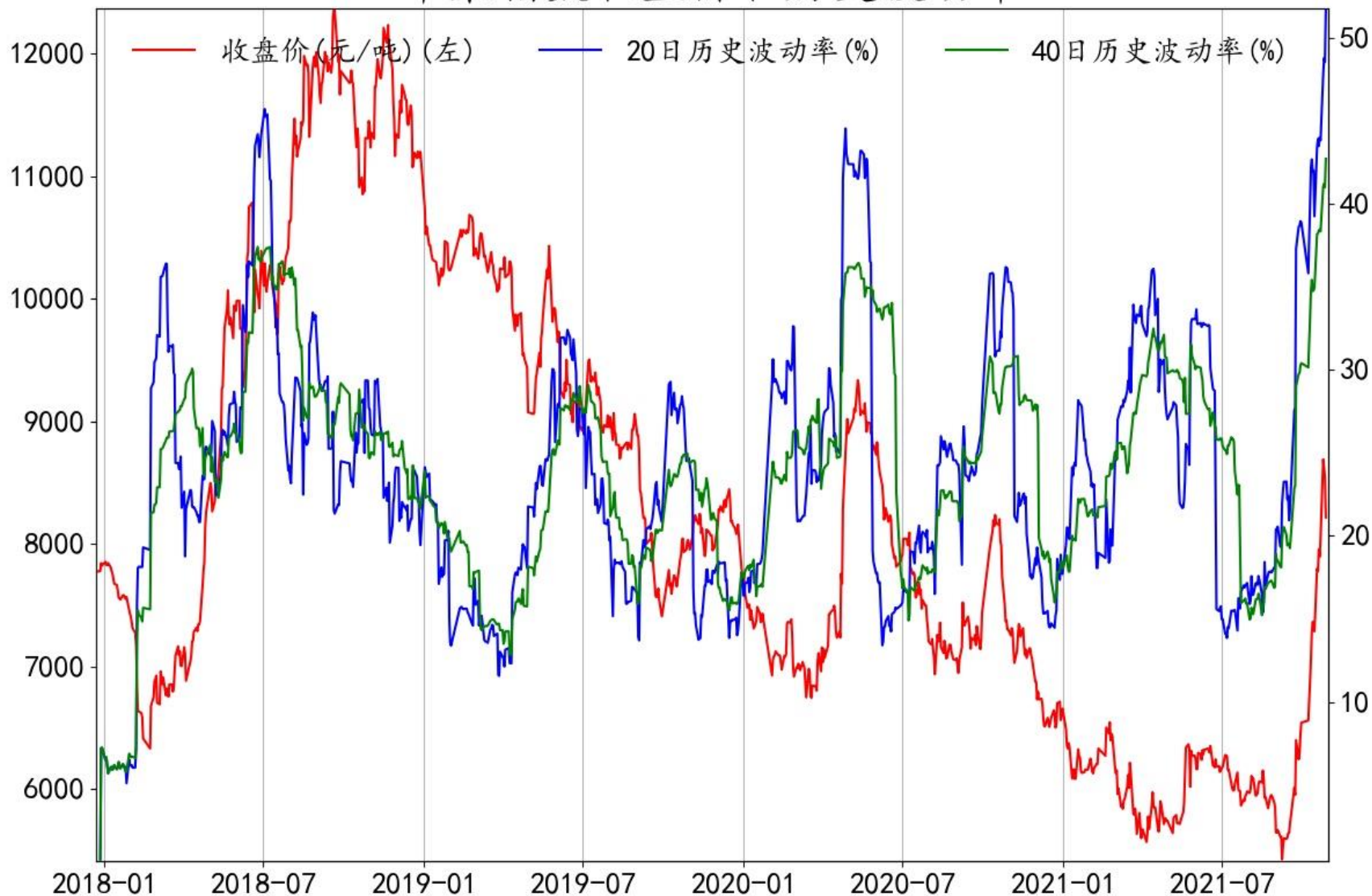
郑棉指数收盘价和历史波动率



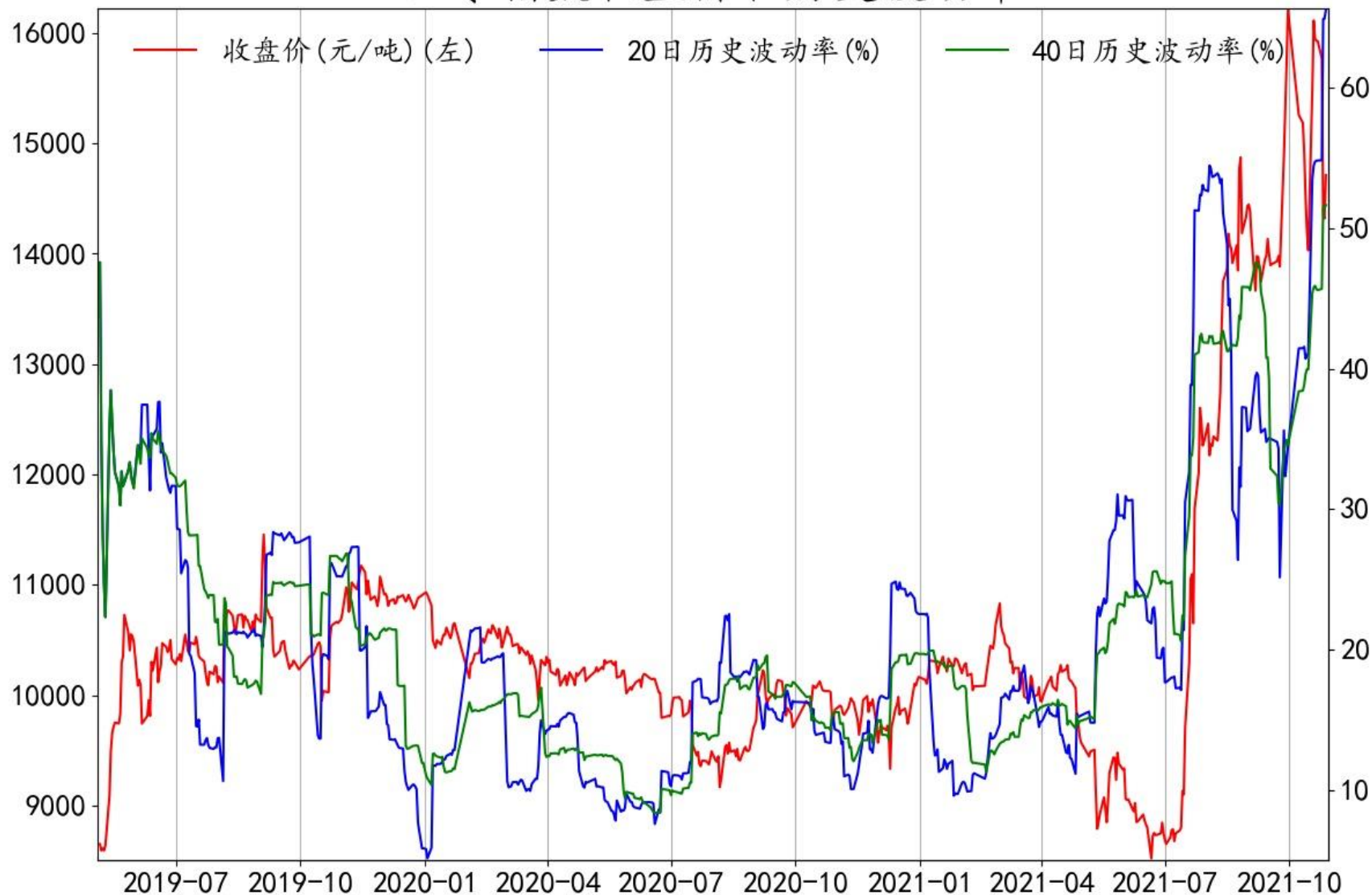
郑糖指数收盘价和历史波动率



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

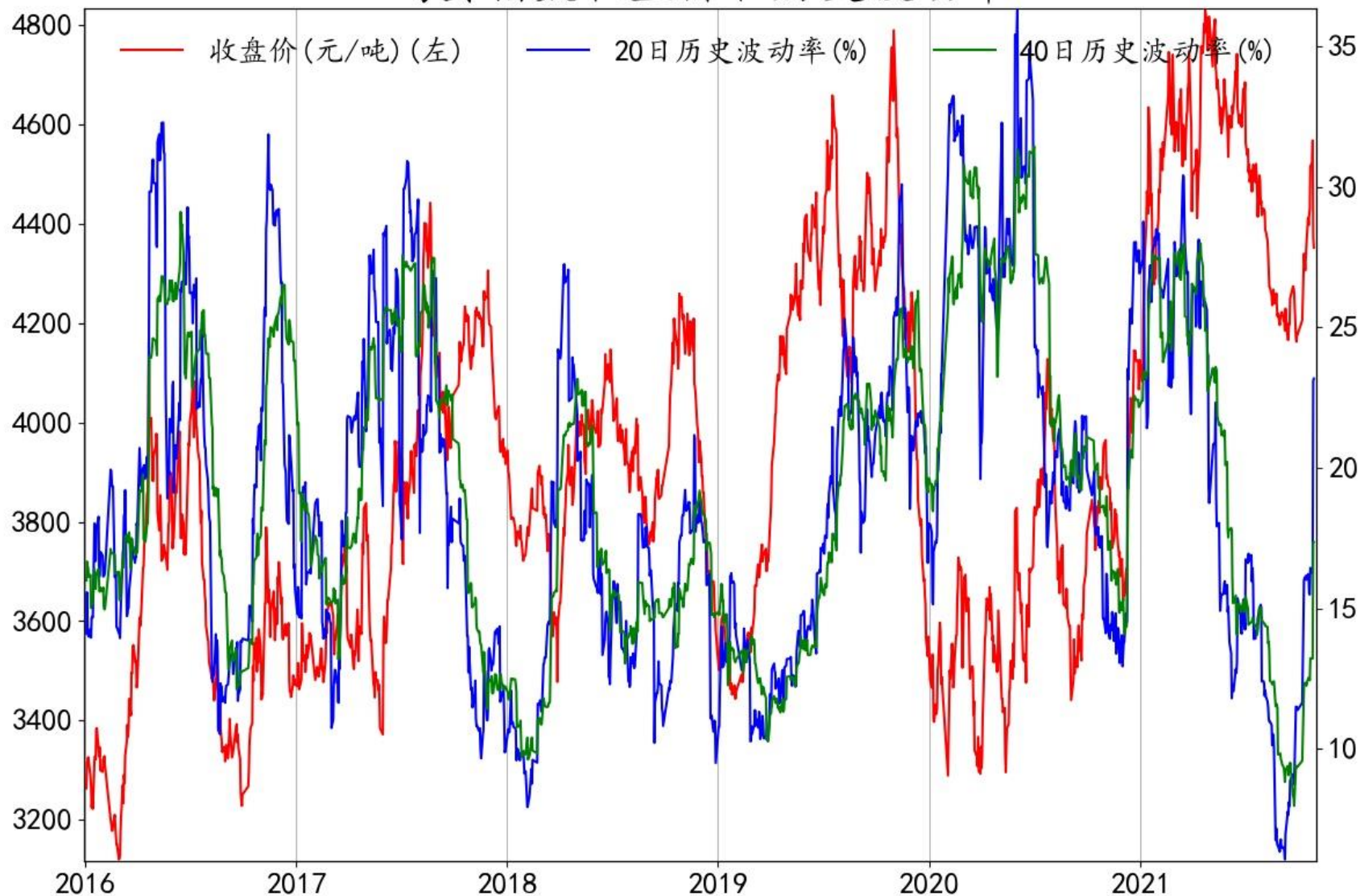


数据来源: Wind、信达期货研发中心

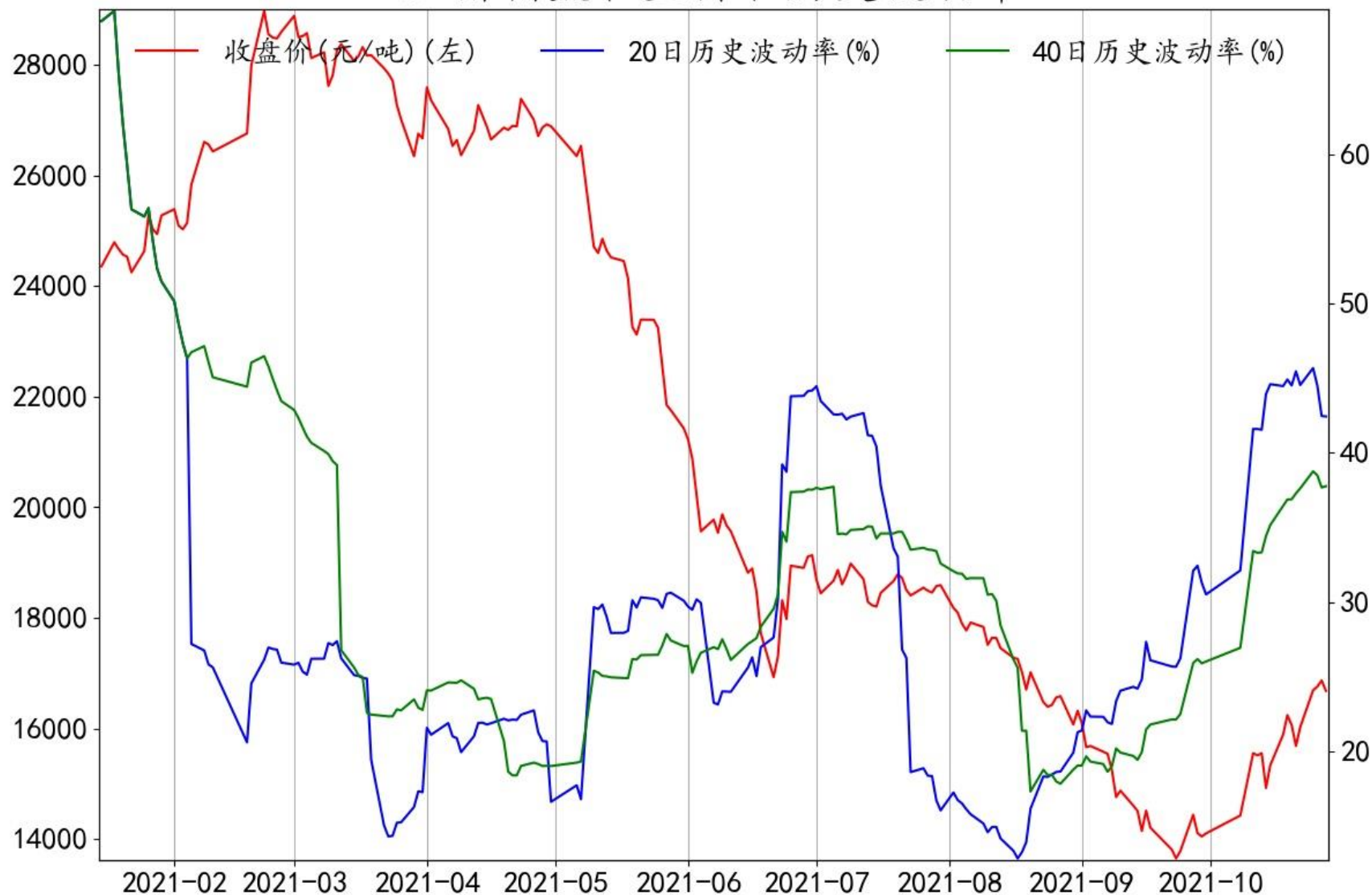
淀粉指数收盘价和历史波动率



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



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