

商品期货波动率跟踪

2021年10月29日

20日历史波动率百分位高于90%:

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

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、焦煤、锰硅、焦炭

20日历史波动率绝对值后五:

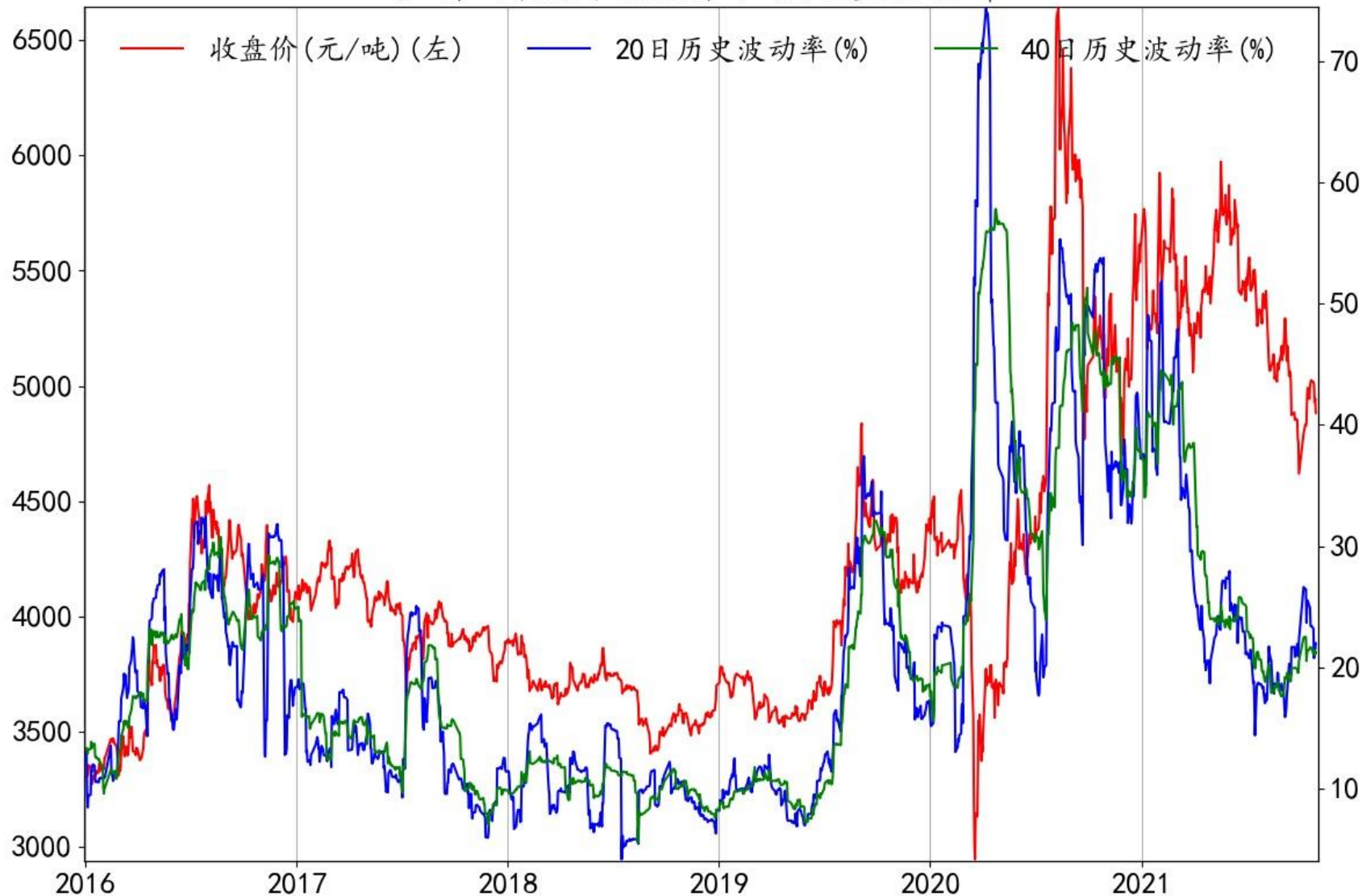
沪金、豆粕、郑糖、玉米、菜粕

	时间百分位	绝对值
沪银	63.14%	21.97%
沪金	54.17%	11.15%
沪铝	99.86%	39.63%
沪铜	93.43%	25.41%
沪镍	90.18%	31.93%
沪铅	70.13%	19.44%
沪锡	98.09%	42.55%
沪锌	100.00%	49.19%
热卷	79.31%	32.27%
铁矿	96.96%	62.78%
焦炭	99.93%	86.30%
焦煤	100.00%	89.99%
螺纹	89.69%	40.13%

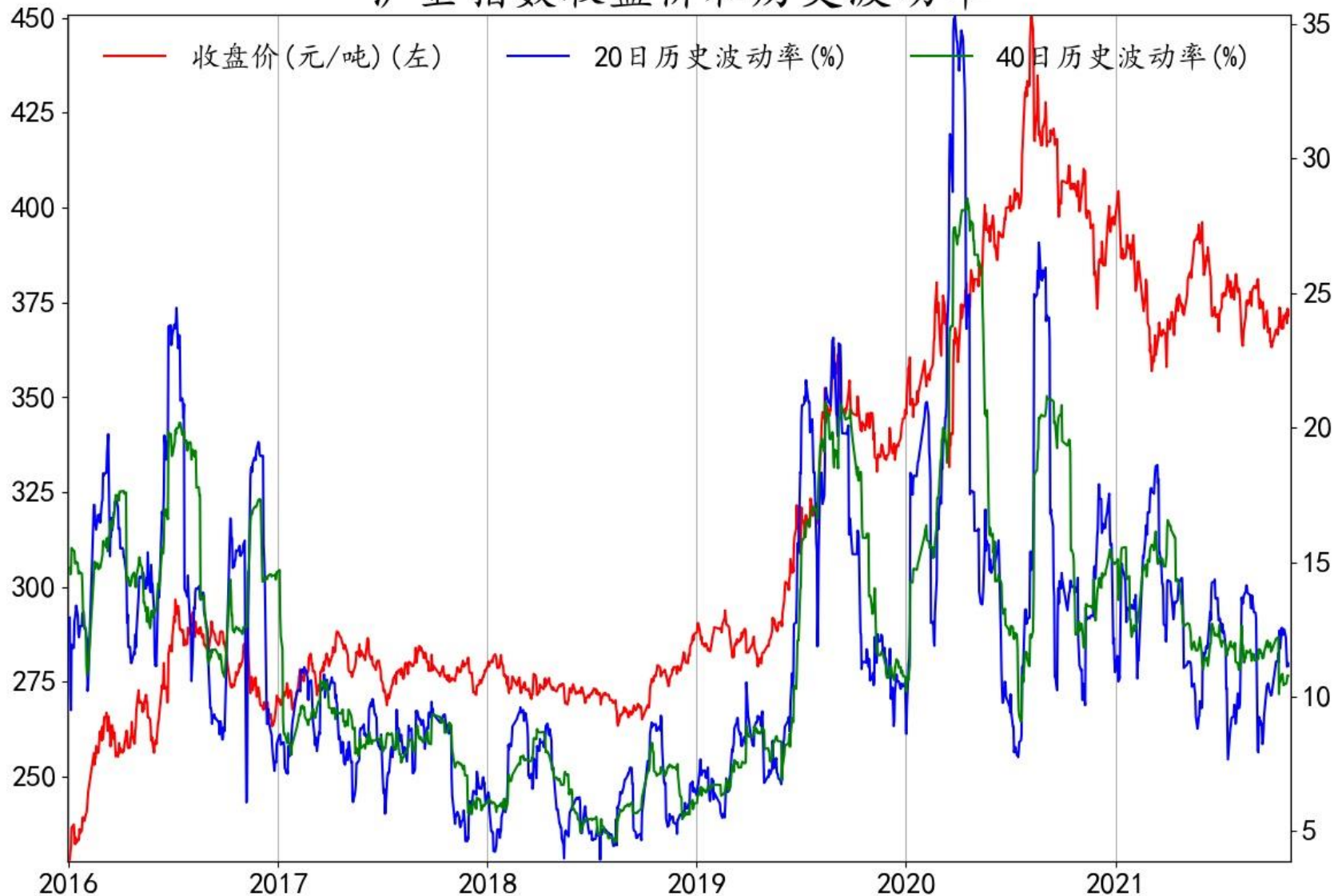
	时间百分位	绝对值
硅铁	99.72%	98.98%
锰硅	99.29%	87.24%
不锈钢	87.92%	30.08%
玻璃	100.00%	47.65%
PVC	100.00%	69.73%
燃油	86.43%	43.45%
低硫燃油	44.34%	28.29%
LPG	99.71%	51.87%
原油	56.03%	30.67%
动煤	100.00%	116.33%
沥青	56.14%	28.63%
苯乙烯	84.52%	41.37%
乙二醇	100.00%	77.22%

	时间百分位	绝对值		时间百分位	绝对值
塑料	97.03%	34.18%	菜油	91.38%	24.33%
甲醇	100.00%	72.47%	棕榈	93.29%	34.23%
20号胶	66.54%	29.07%	花生	67.80%	20.75%
短纤	93.39%	41.81%	菜粕	50.92%	18.76%
PP	95.90%	34.44%	豆油	91.10%	25.51%
沪胶	61.09%	28.36%	郑棉	99.51%	45.46%
纯碱	98.47%	56.96%	郑糖	84.53%	16.26%
纸浆	83.11%	23.82%	苹果	99.57%	47.68%
TA	95.13%	34.75%	红枣	100.00%	66.05%
尿素	99.60%	68.77%	淀粉	97.95%	26.65%
玉米	89.97%	16.41%	鸡蛋	75.71%	23.68%
豆一	83.26%	21.09%	生猪	87.30%	44.37%
豆粕	38.70%	14.69%			

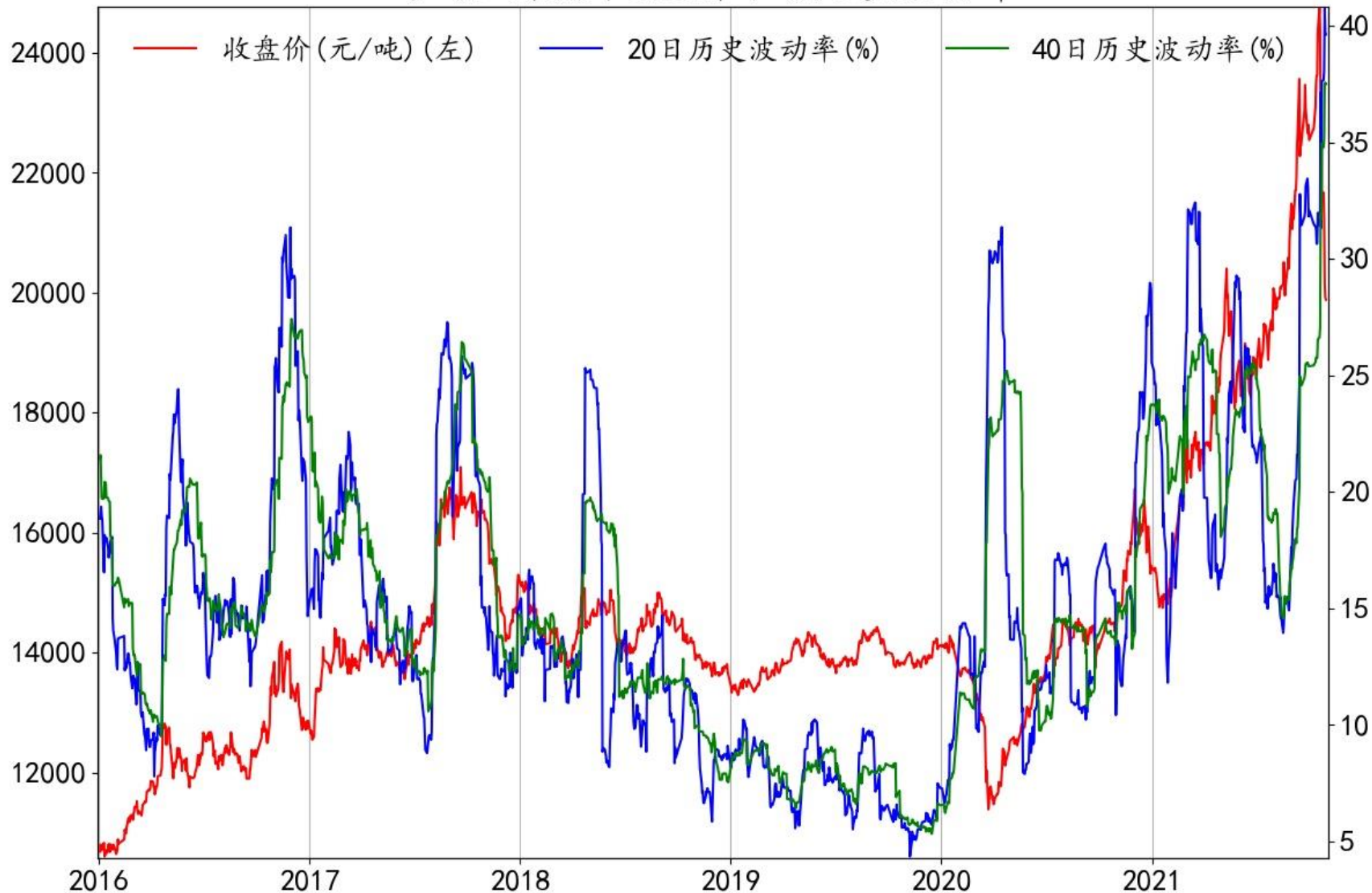
沪银指数收盘价和历史波动率



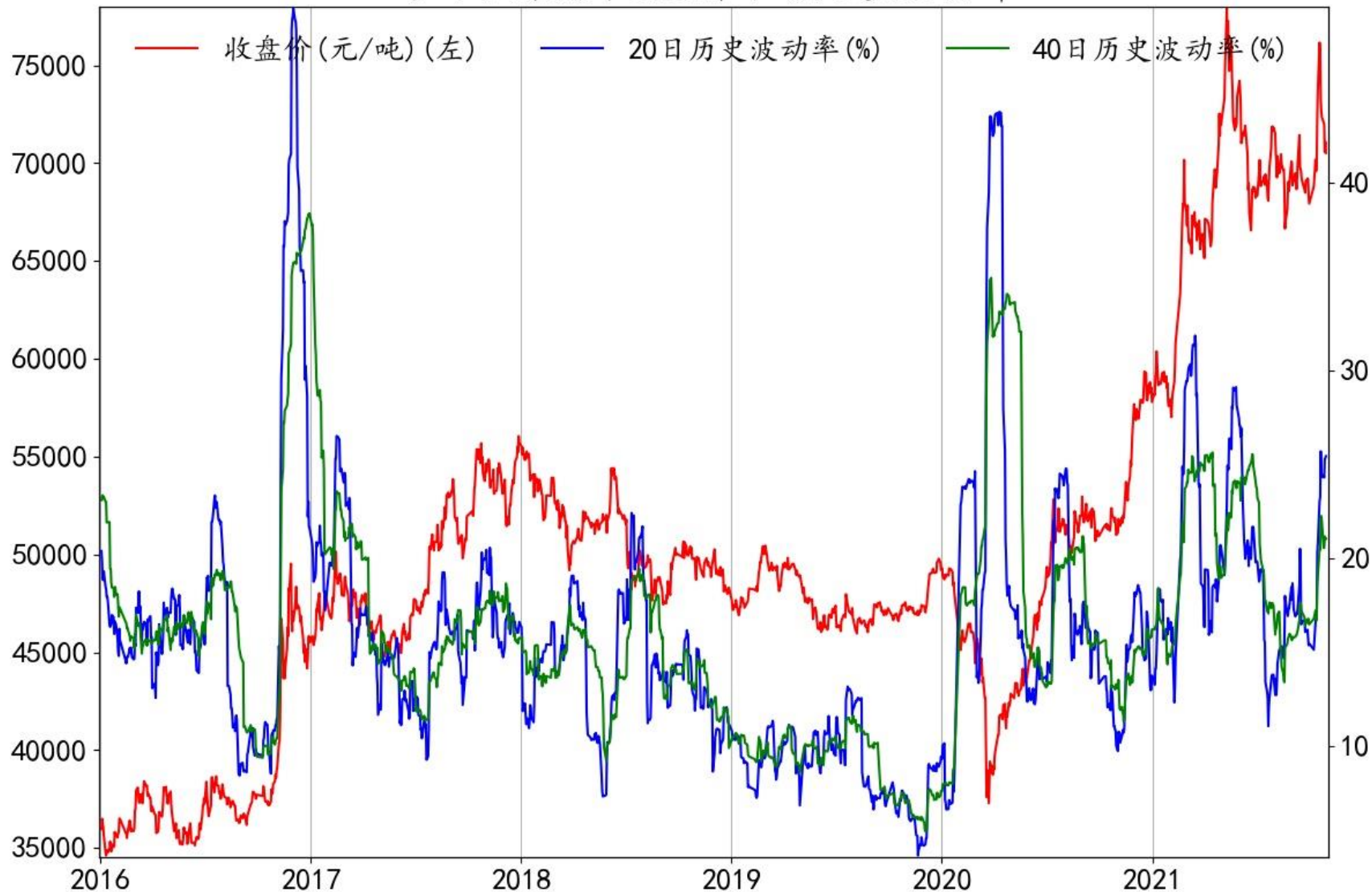
沪金指数收盘价和历史波动率



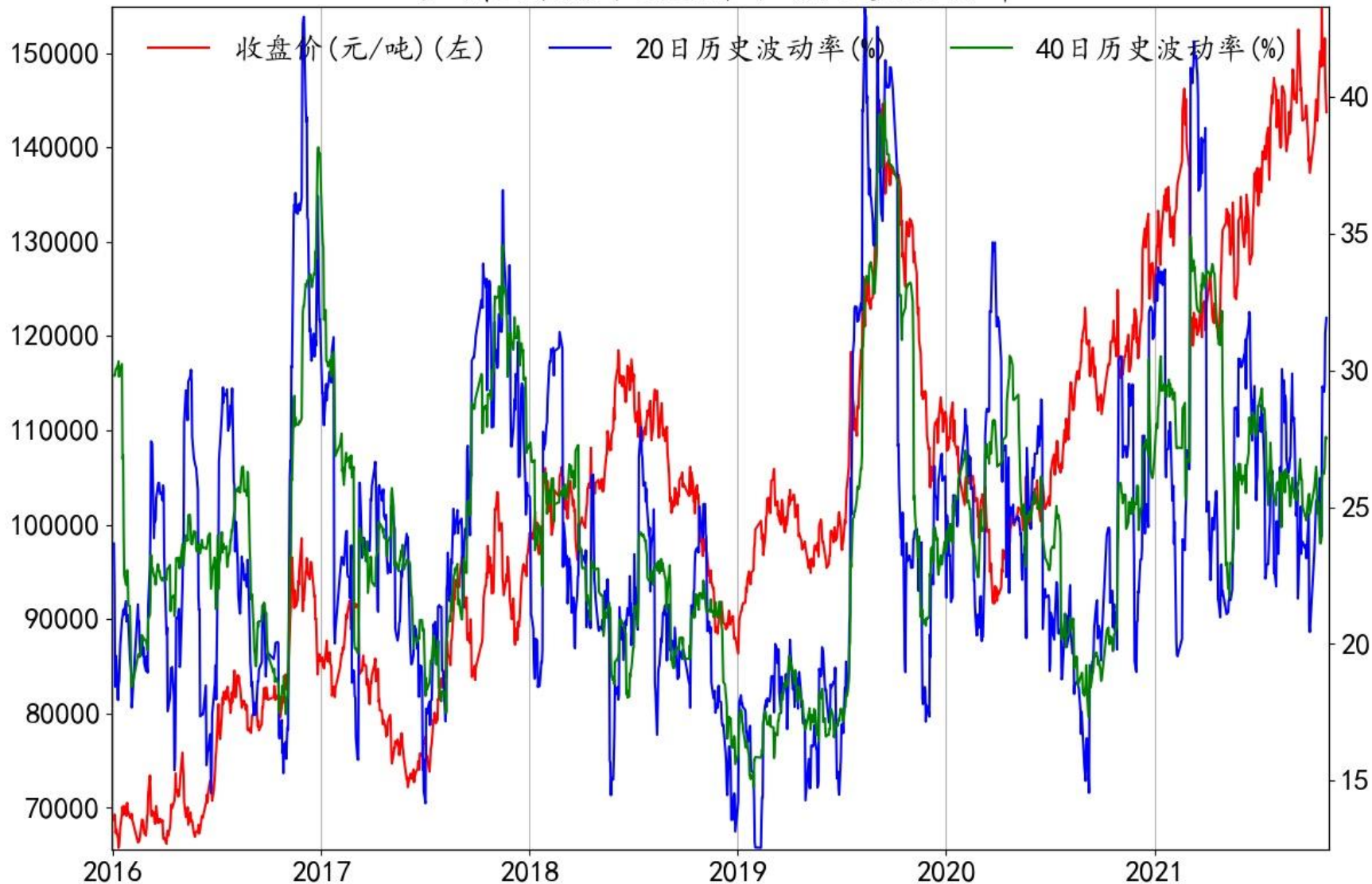
沪铝指数收盘价和历史波动率



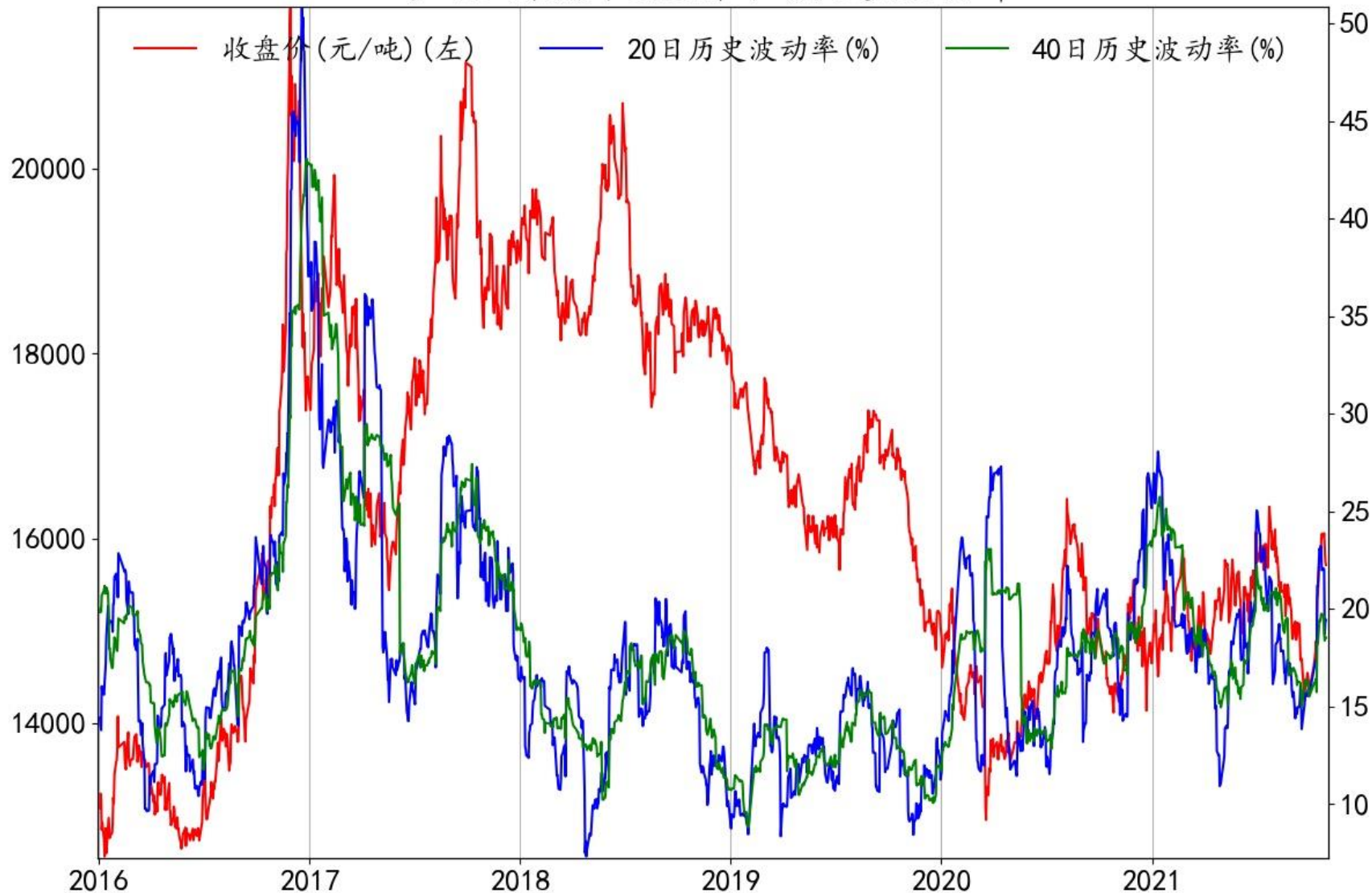
沪铜指数收盘价和历史波动率



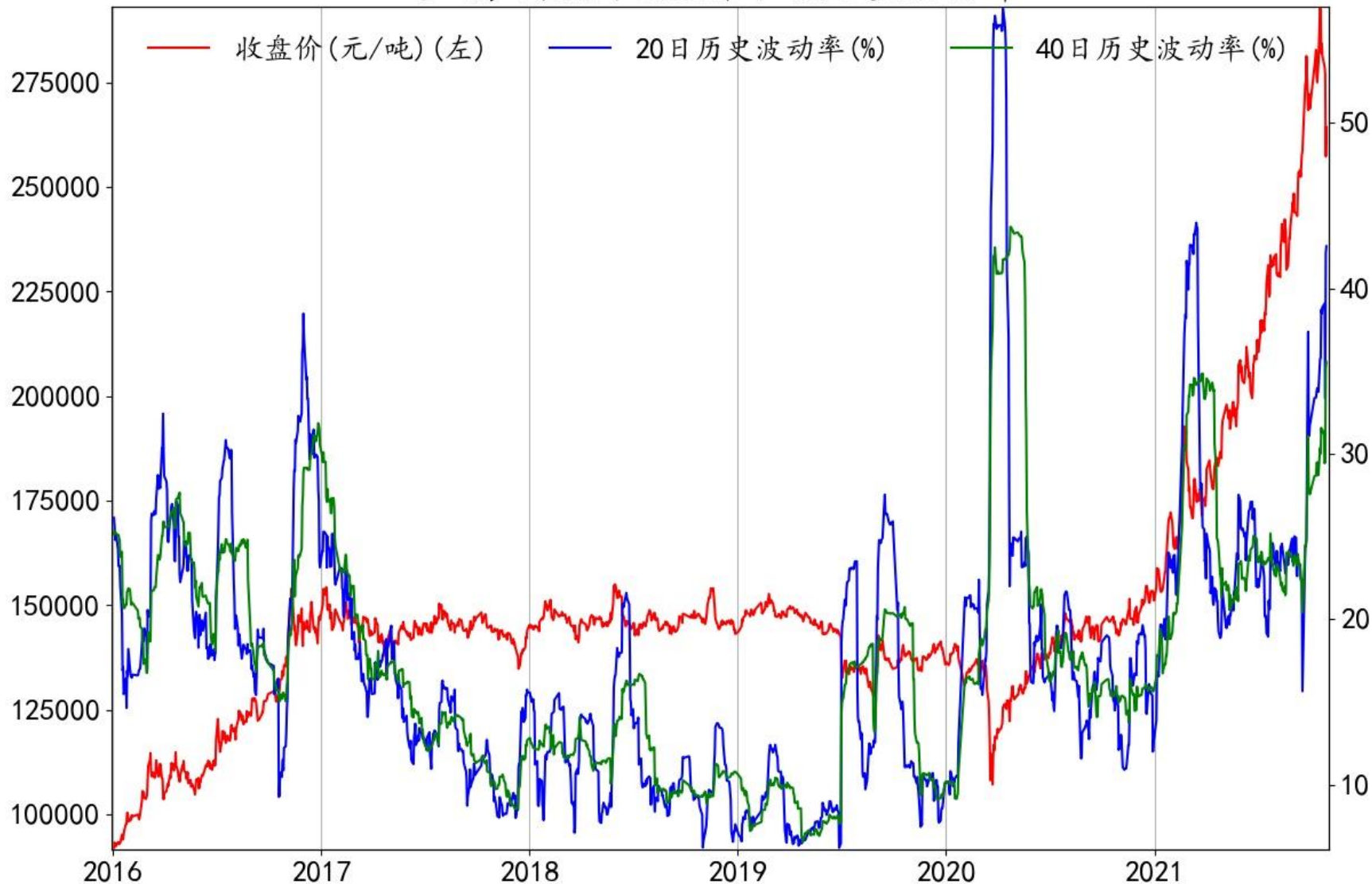
沪镍指数收盘价和历史波动率



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



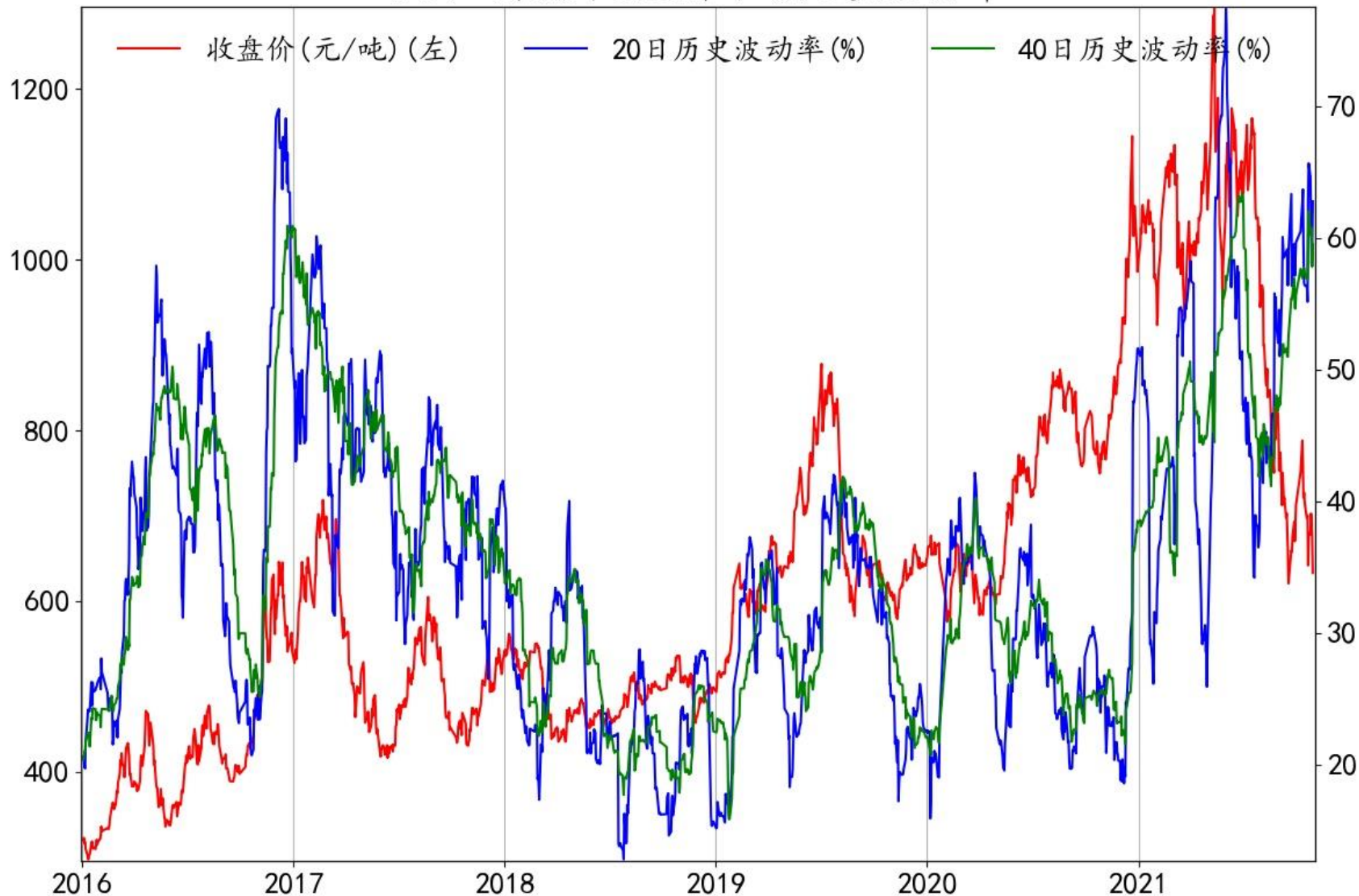
沪锌指数收盘价和历史波动率



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



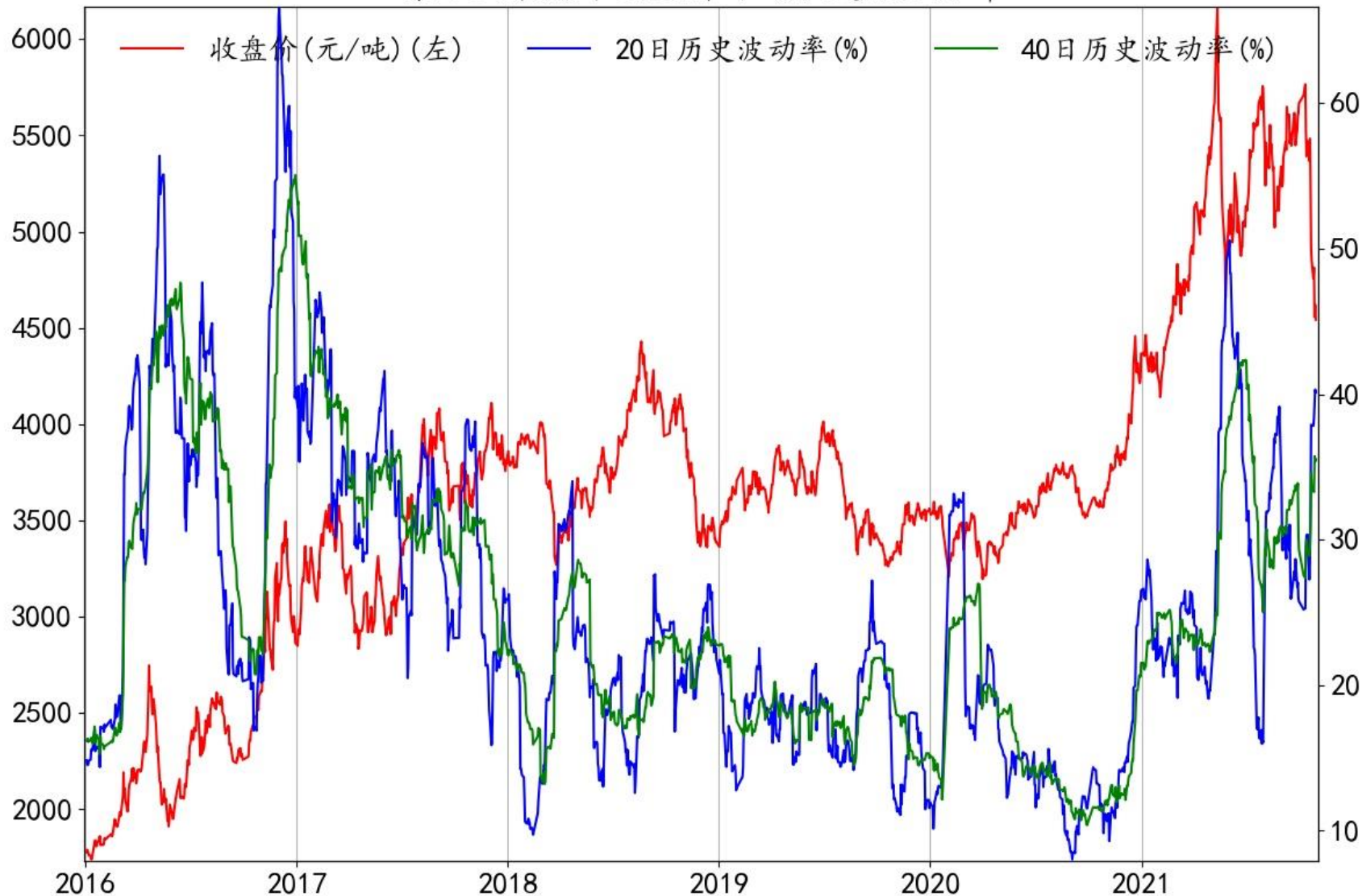
焦炭指数收盘价和历史波动率



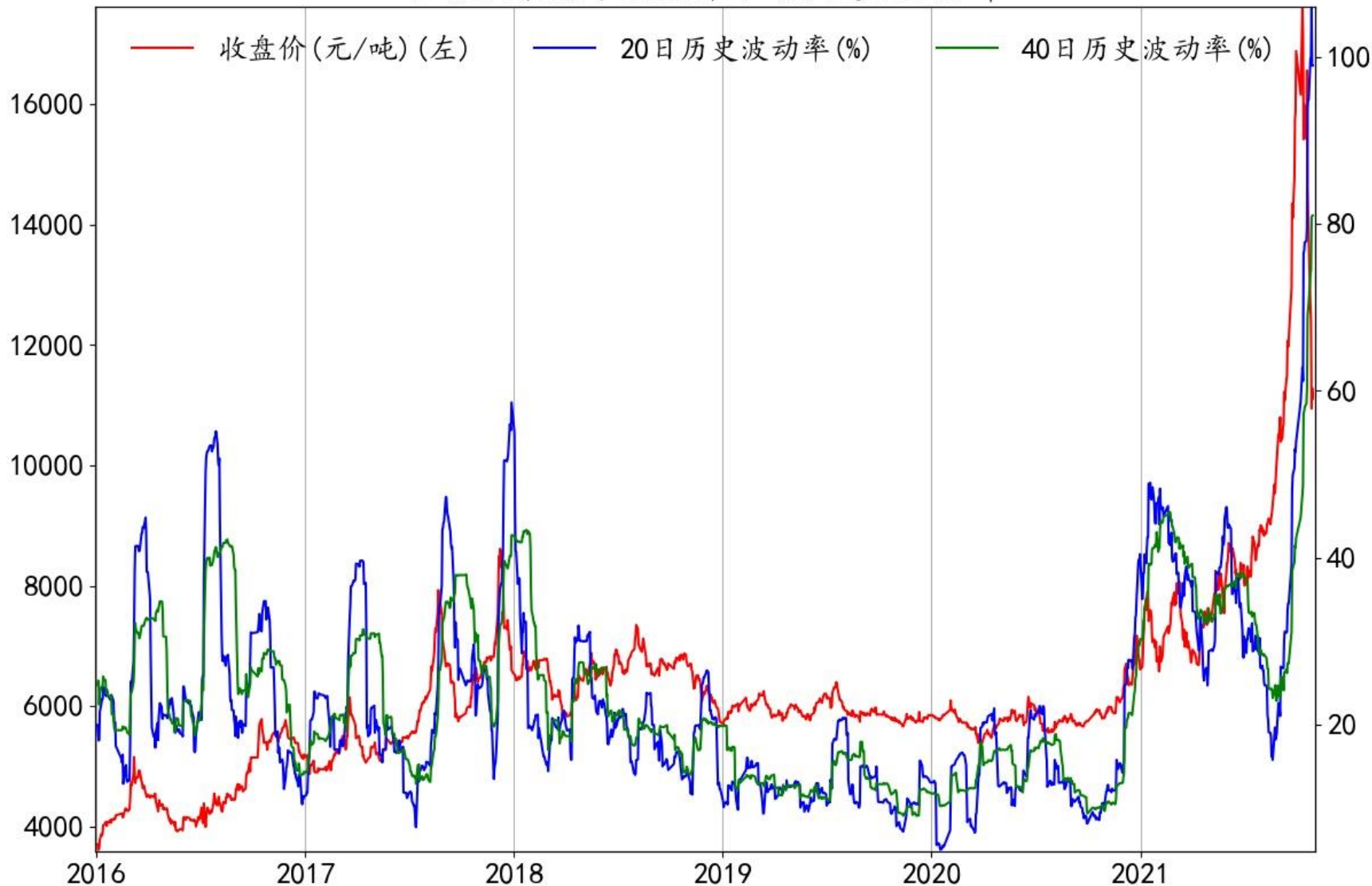
焦煤指数收盘价和历史波动率



螺纹指数收盘价和历史波动率



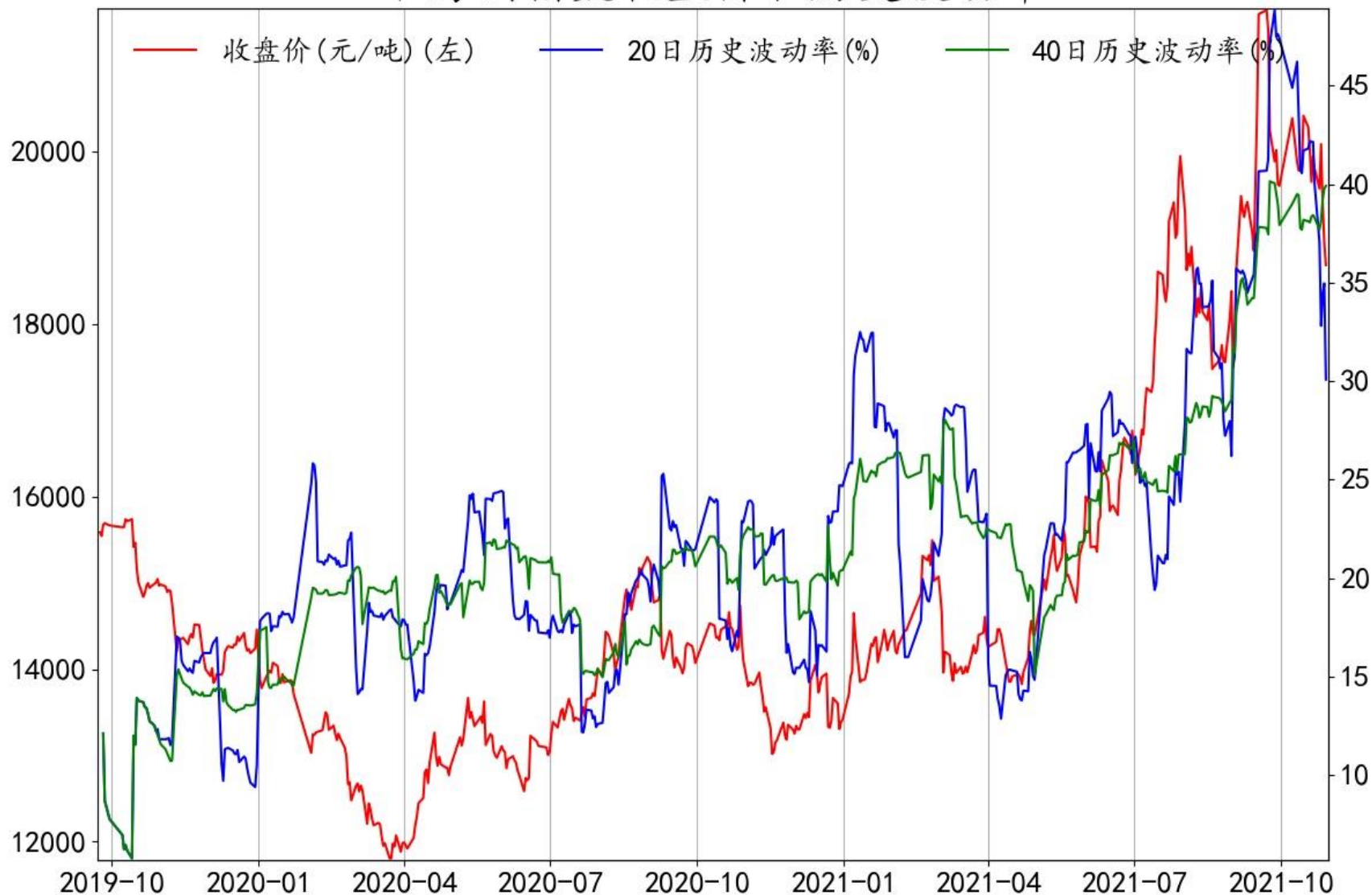
硅铁指数收盘价和历史波动率



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

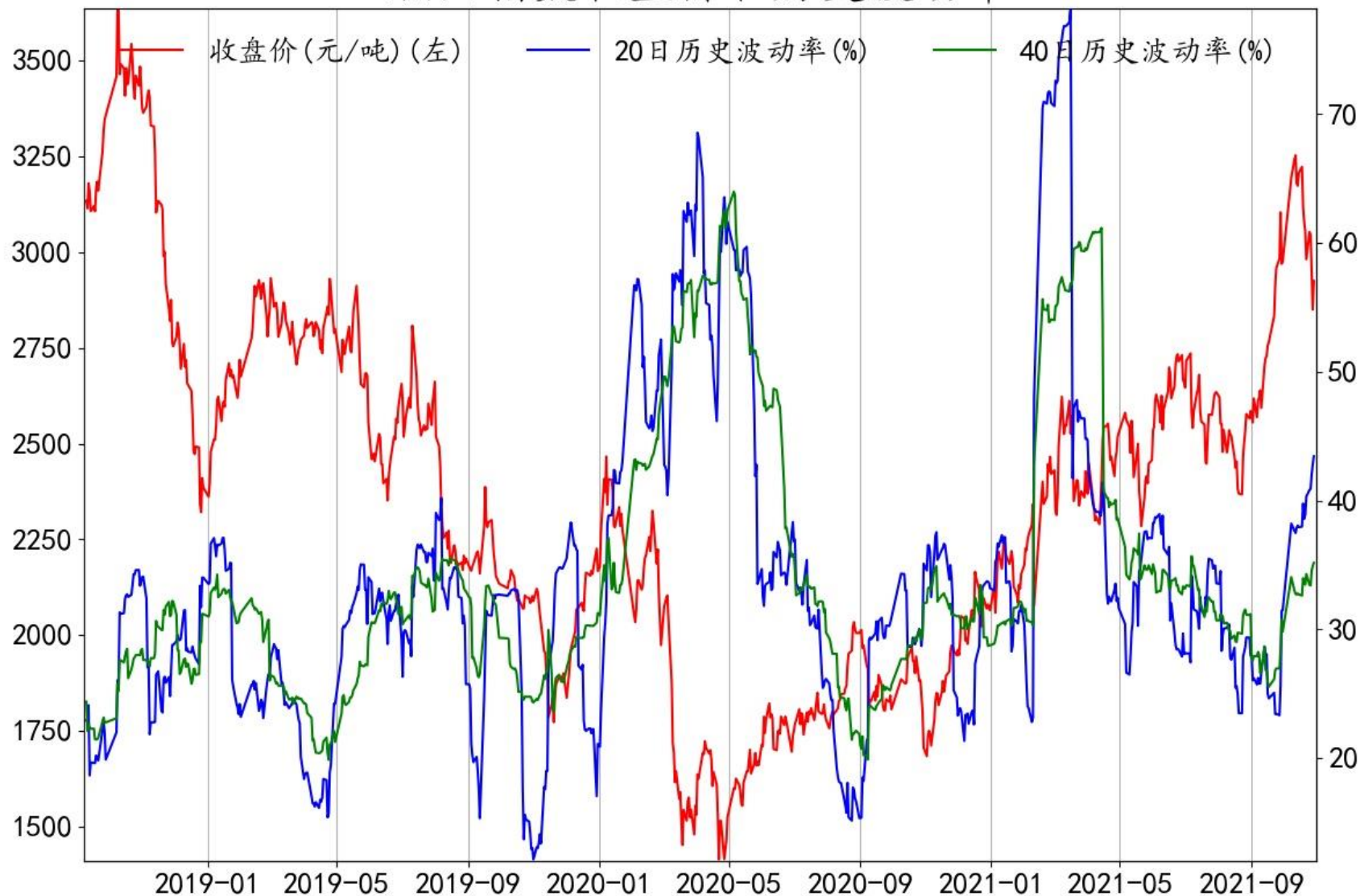


PVC指数收盘价和历史波动率



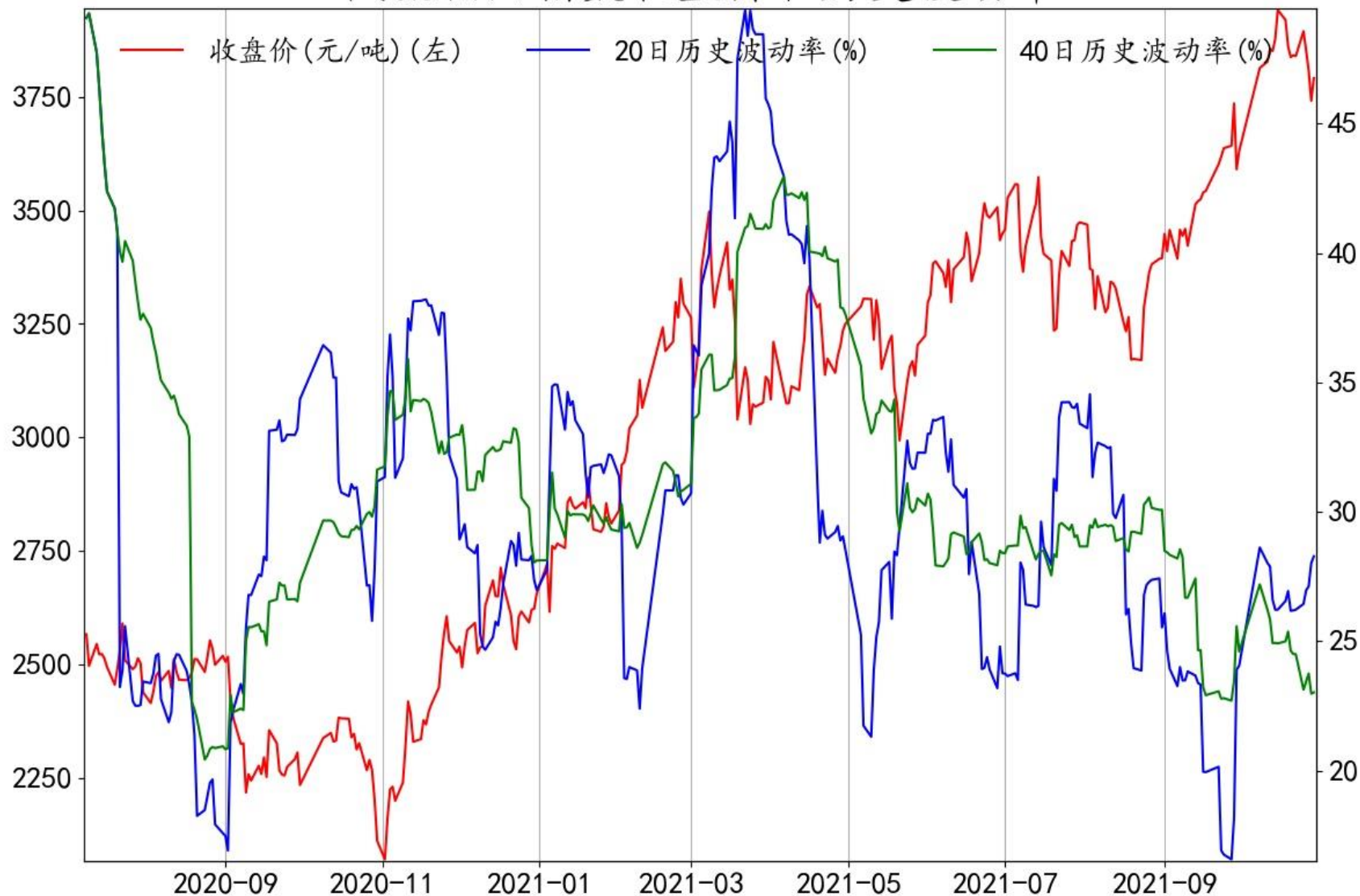
数据来源: Wind、信达期货研发中心

燃油指数收盘价和历史波动率

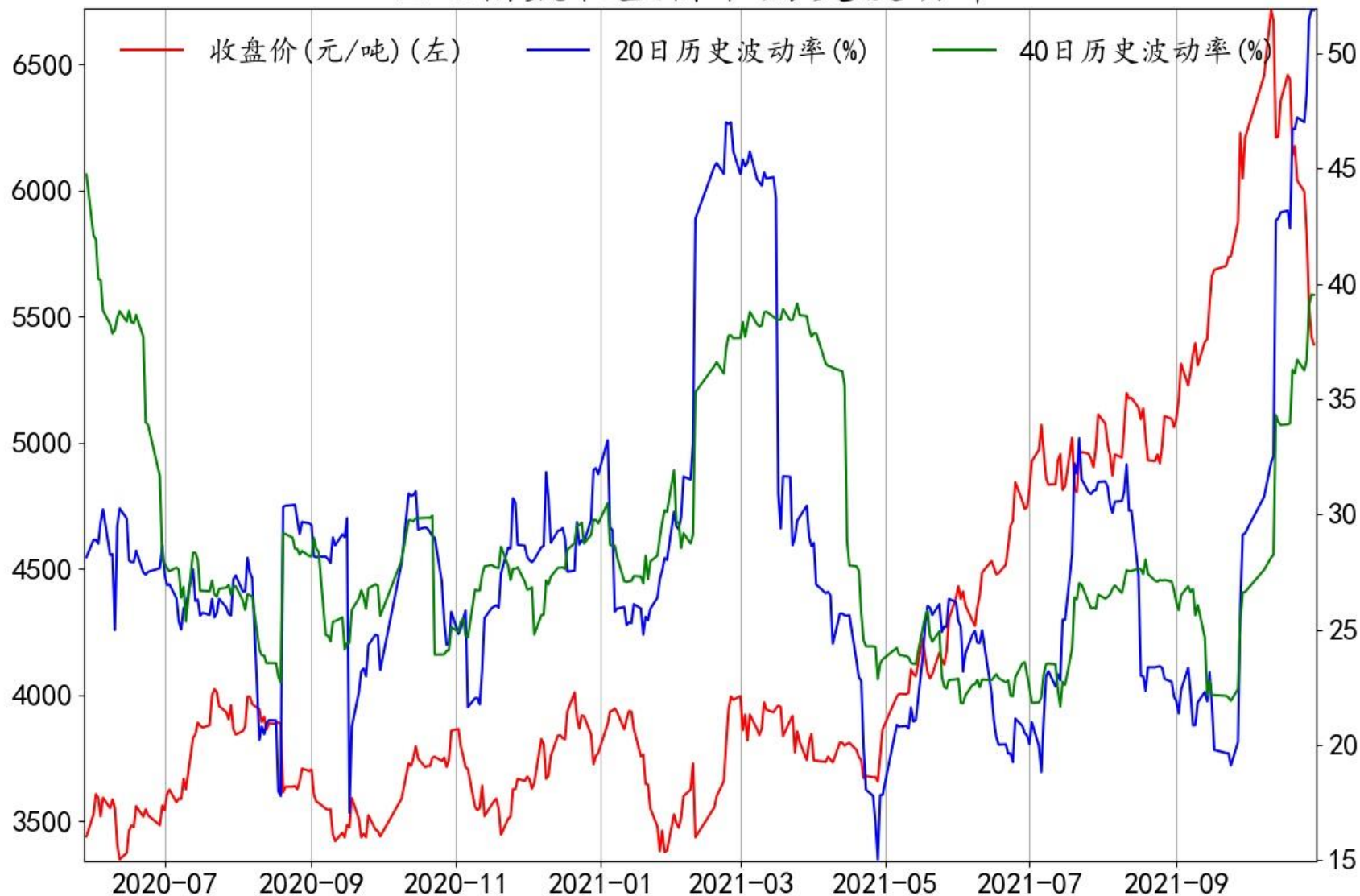


低硫燃油指数

低硫燃油指数收盘价和历史波动率

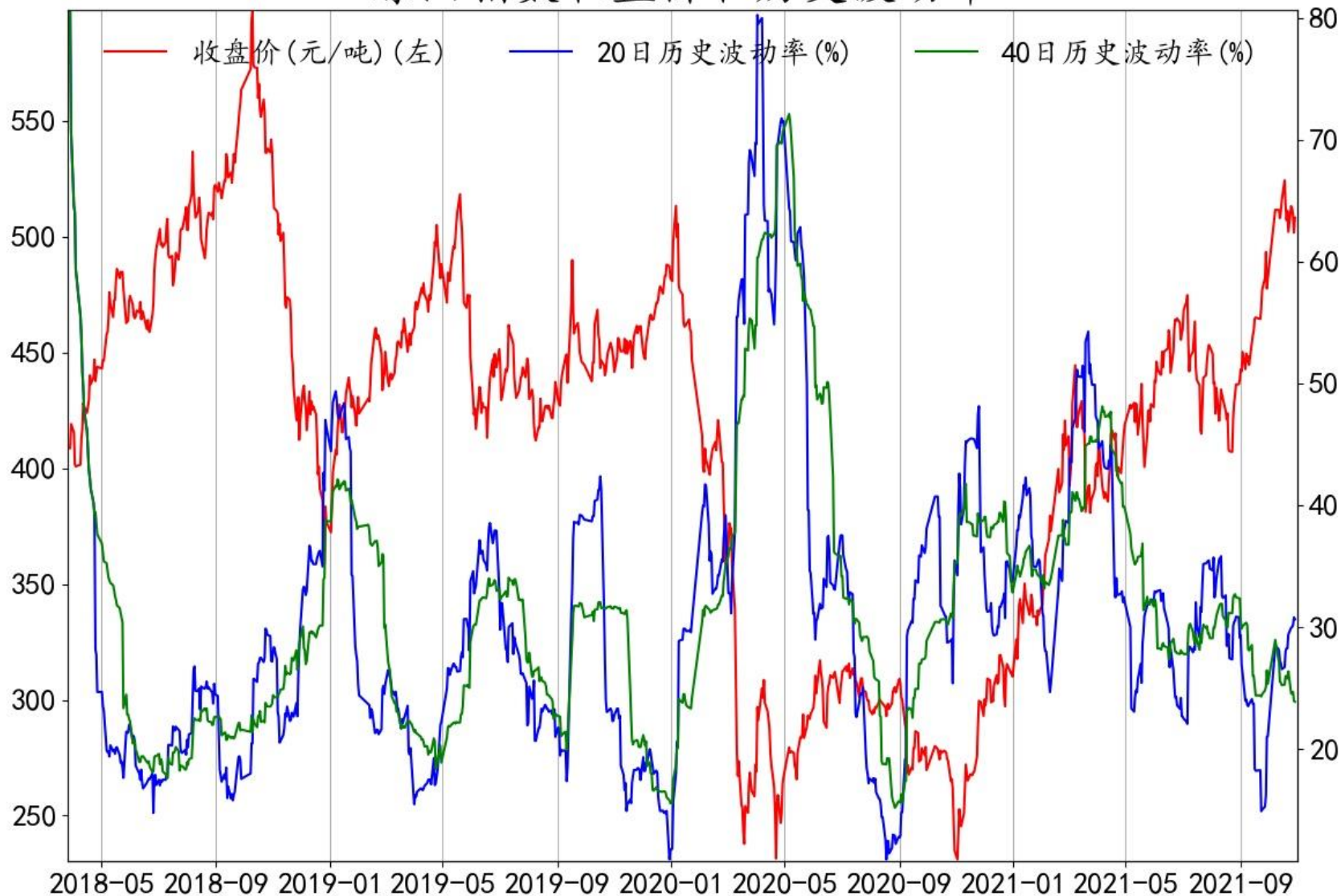


LPG指数收盘价和历史波动率



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

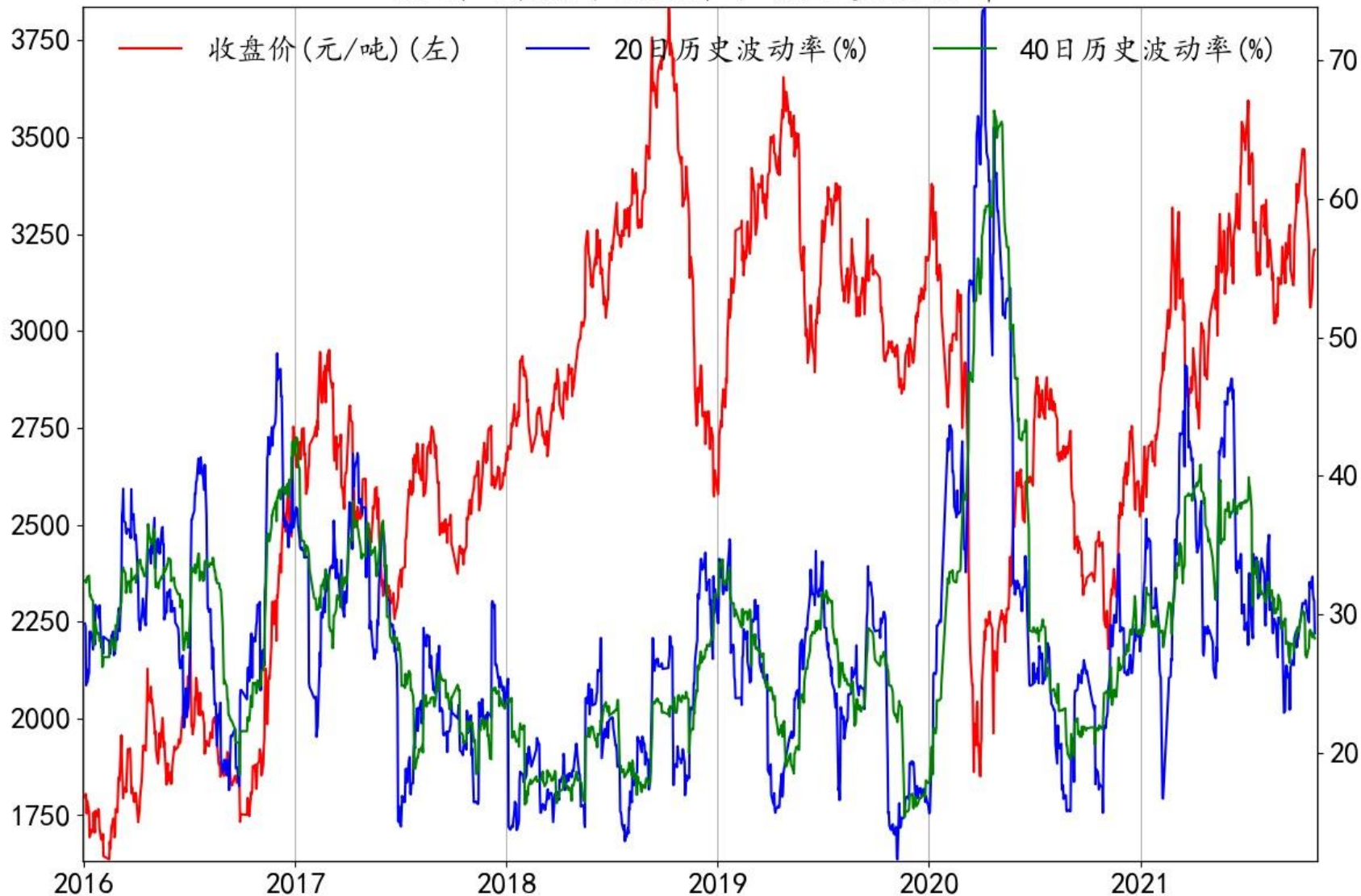


数据来源: Wind、信达期货研发中心

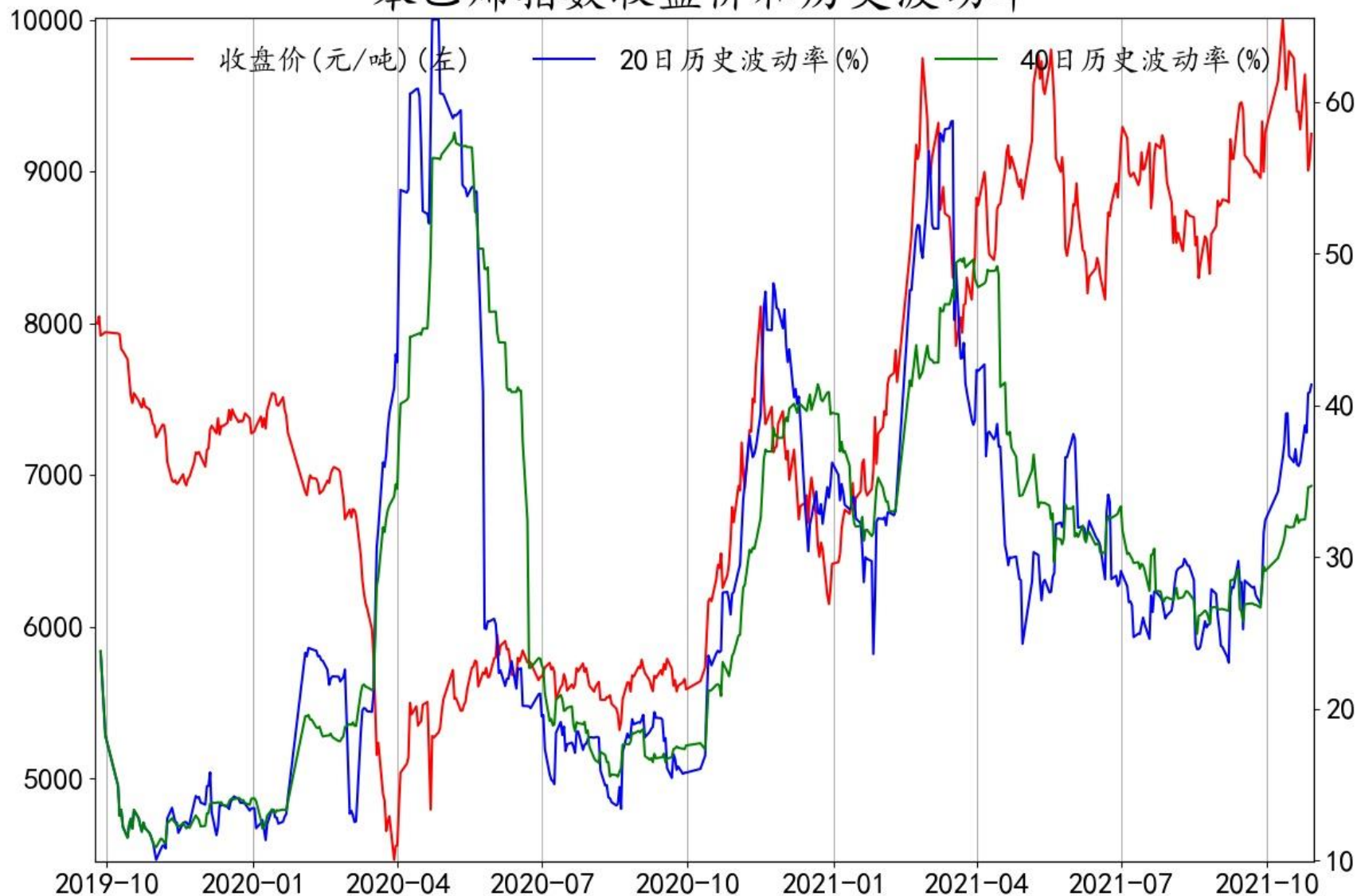
动煤指数收盘价和历史波动率



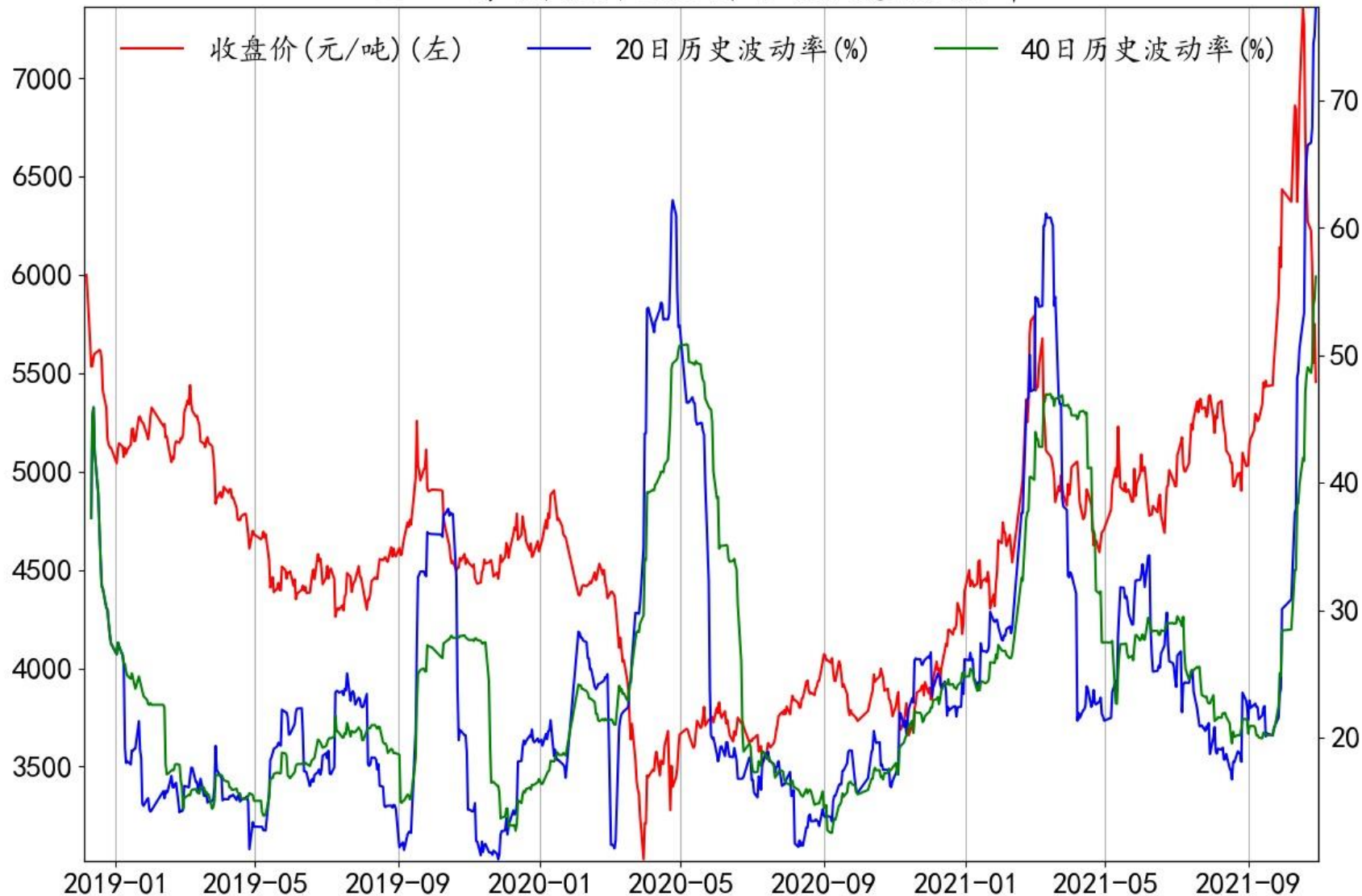
沥青指数收盘价和历史波动率



苯乙烯指数收盘价和历史波动率

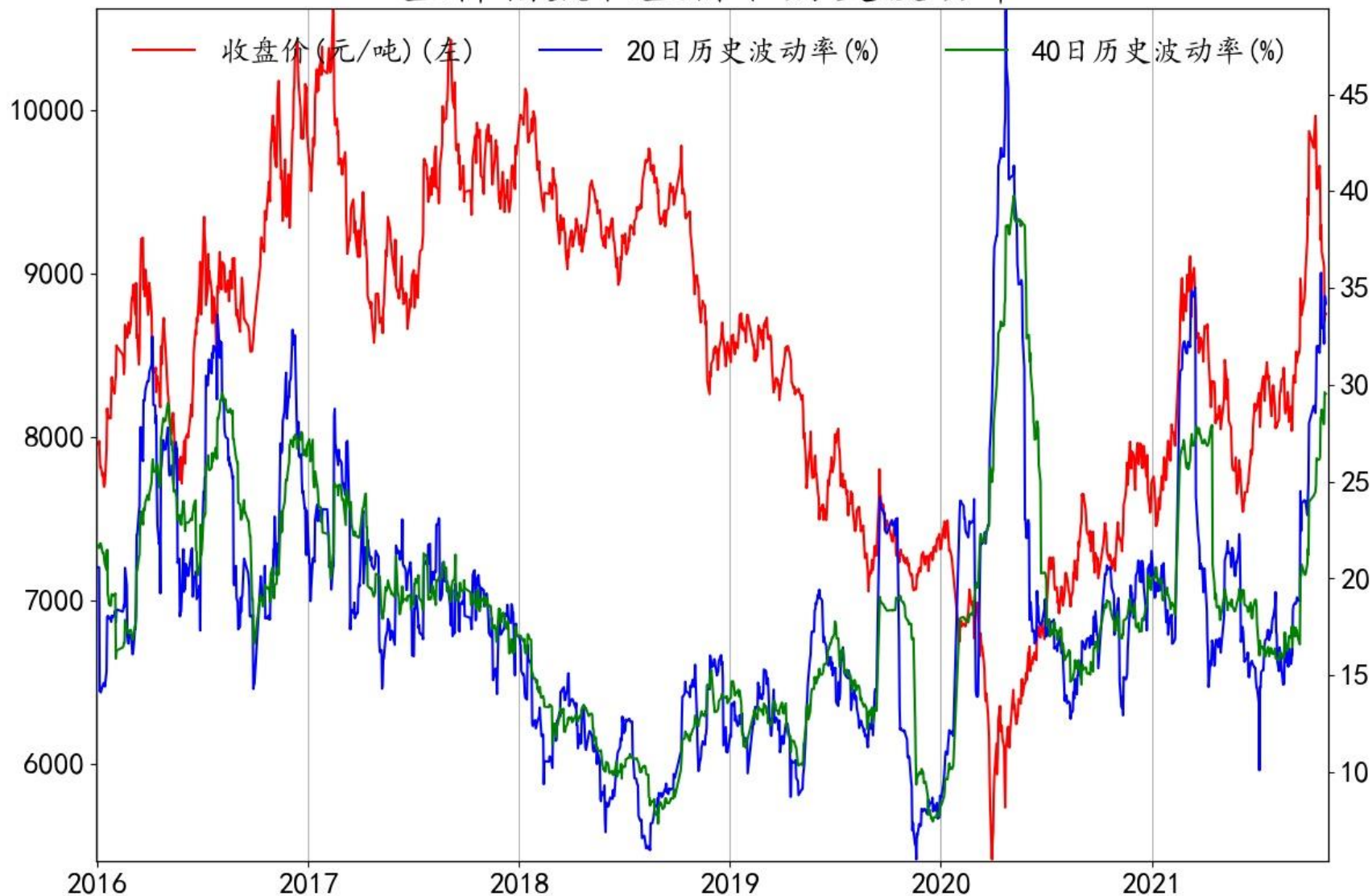


乙二醇指数收盘价和历史波动率

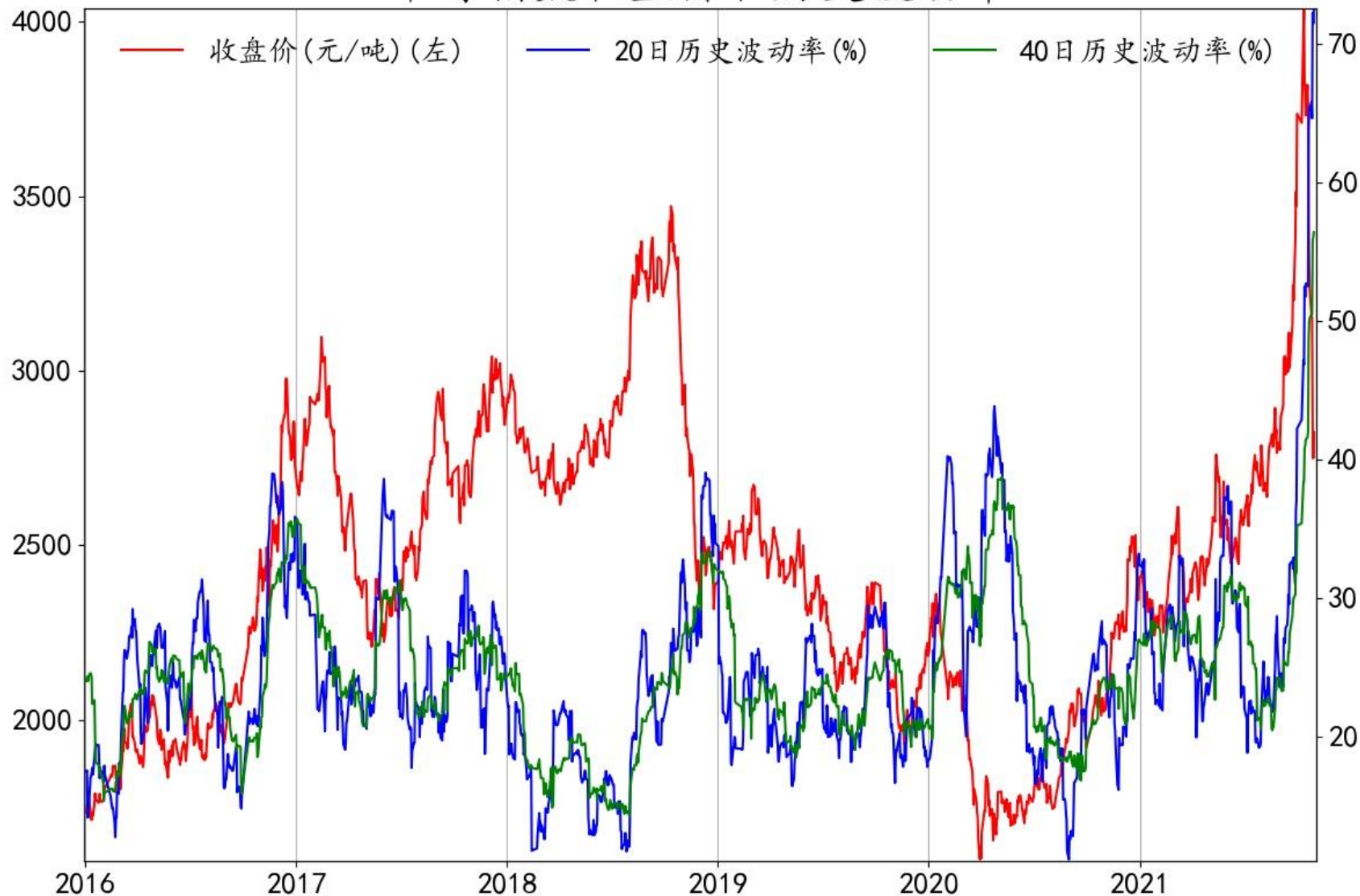


数据来源: Wind、信达期货研发中心

塑料指数收盘价和历史波动率

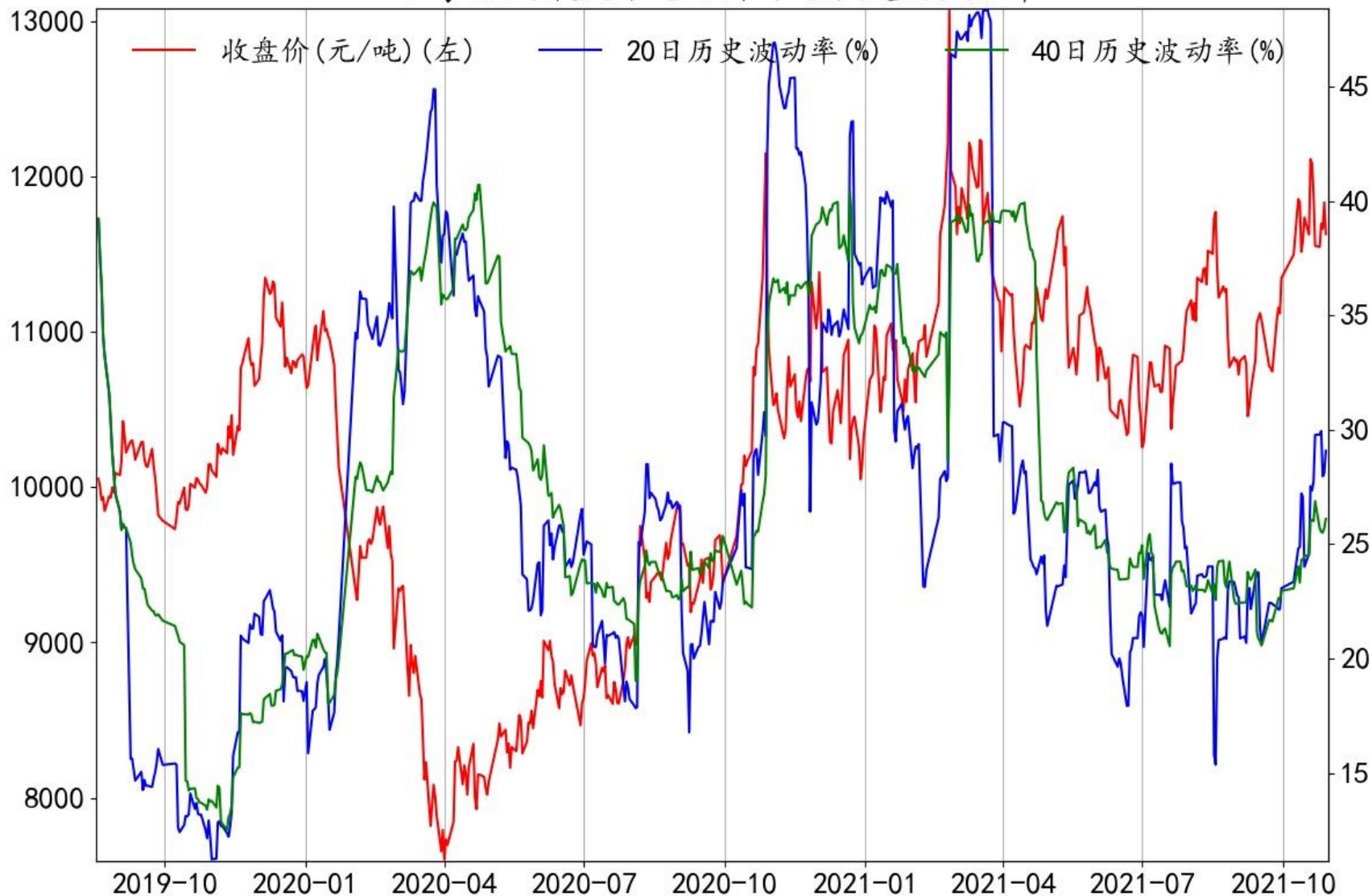


甲醇指数收盘价和历史波动率



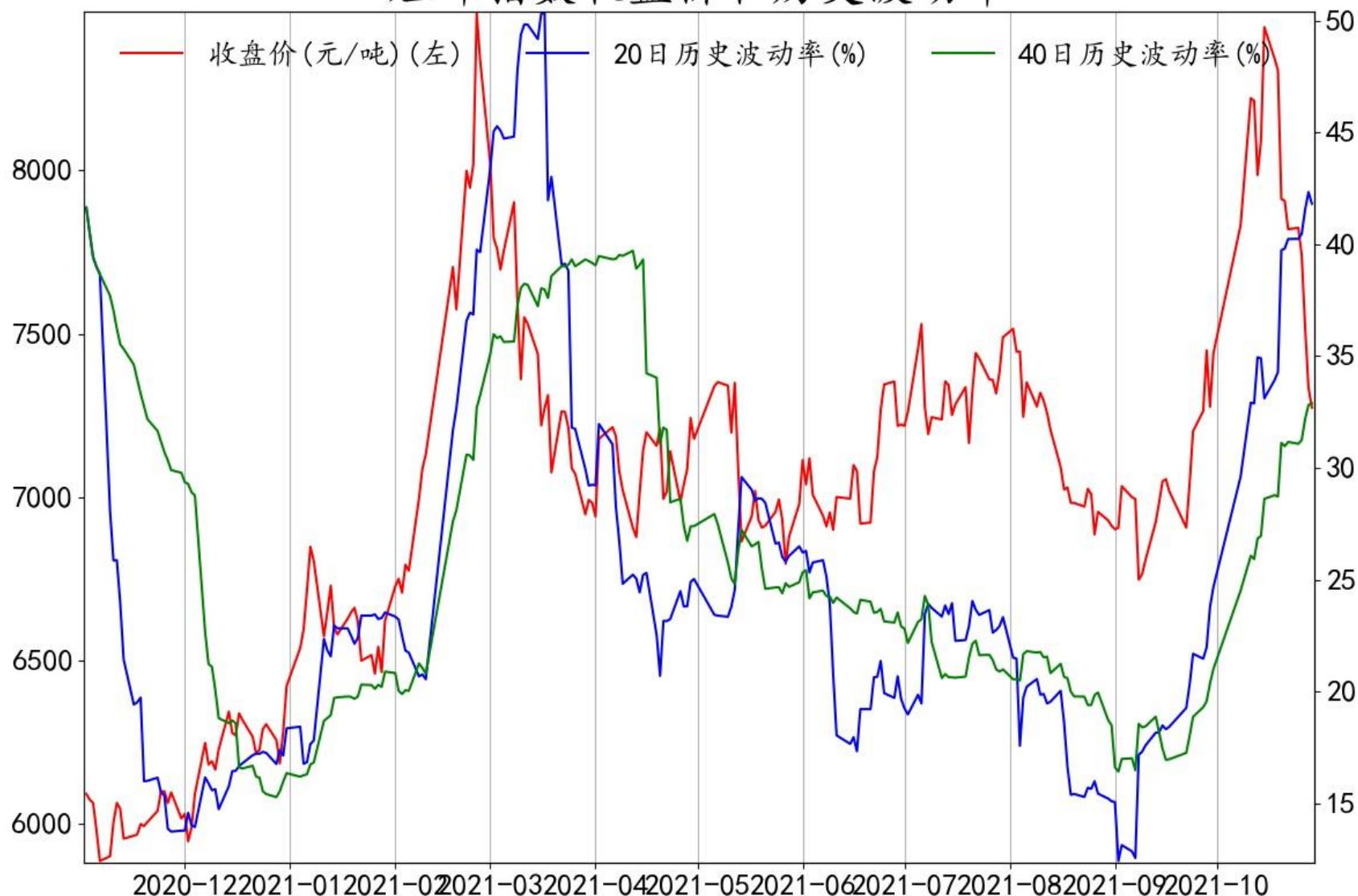
20号胶指数

20号胶指数收盘价和历史波动率

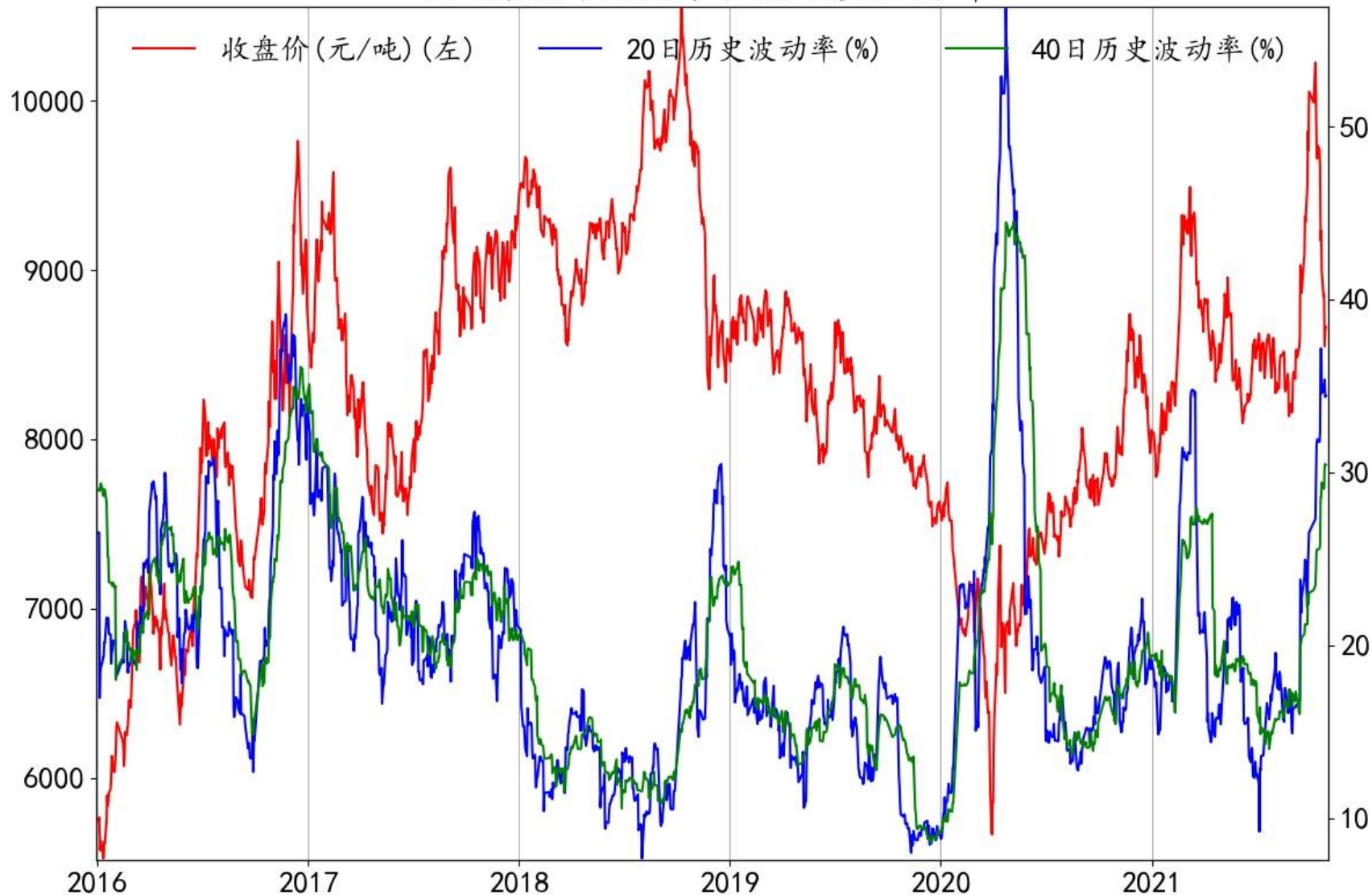


数据来源: Wind、信达期货研发中心

短纤指数收盘价和历史波动率

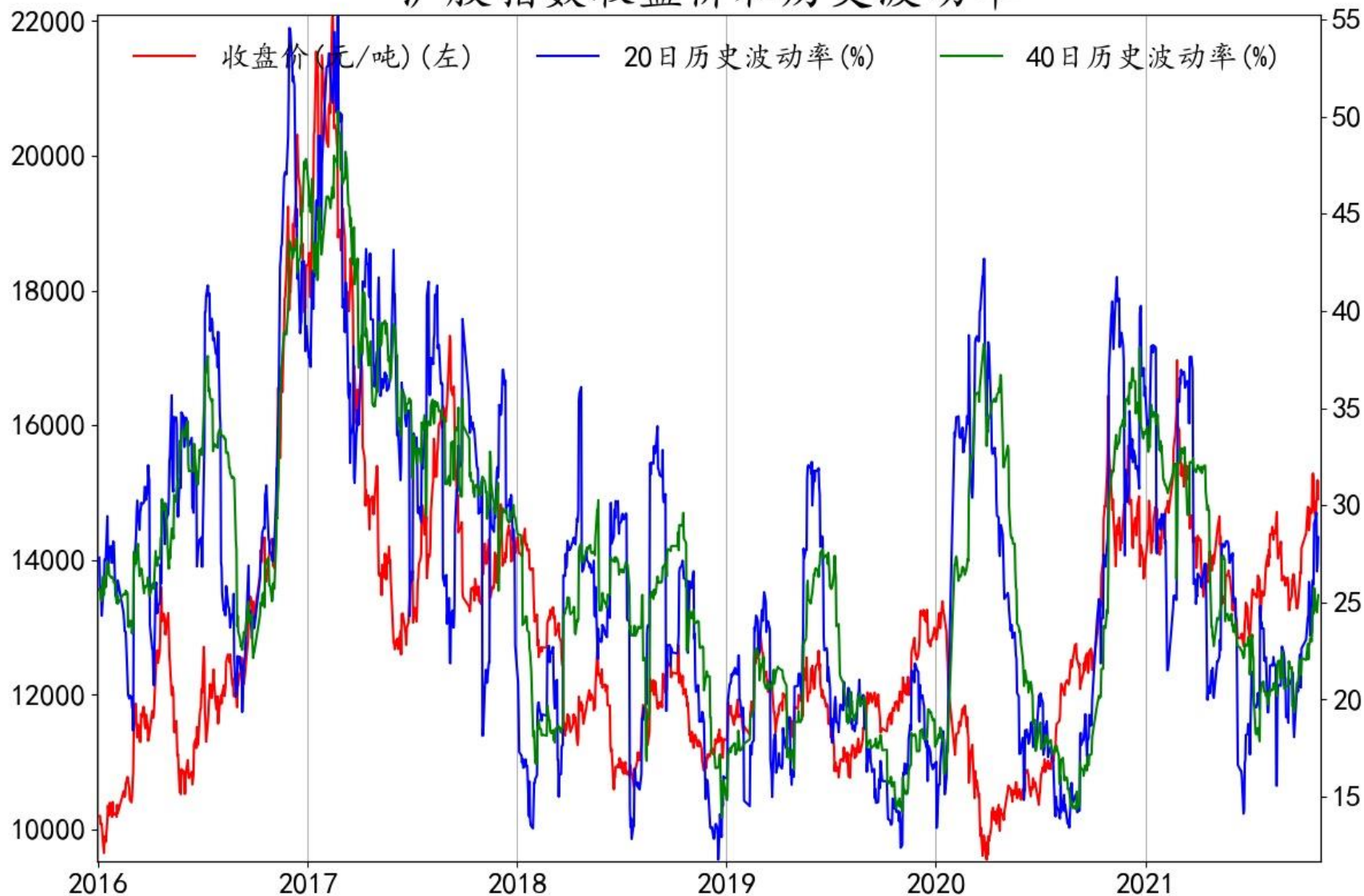


PP指数收盘价和历史波动率

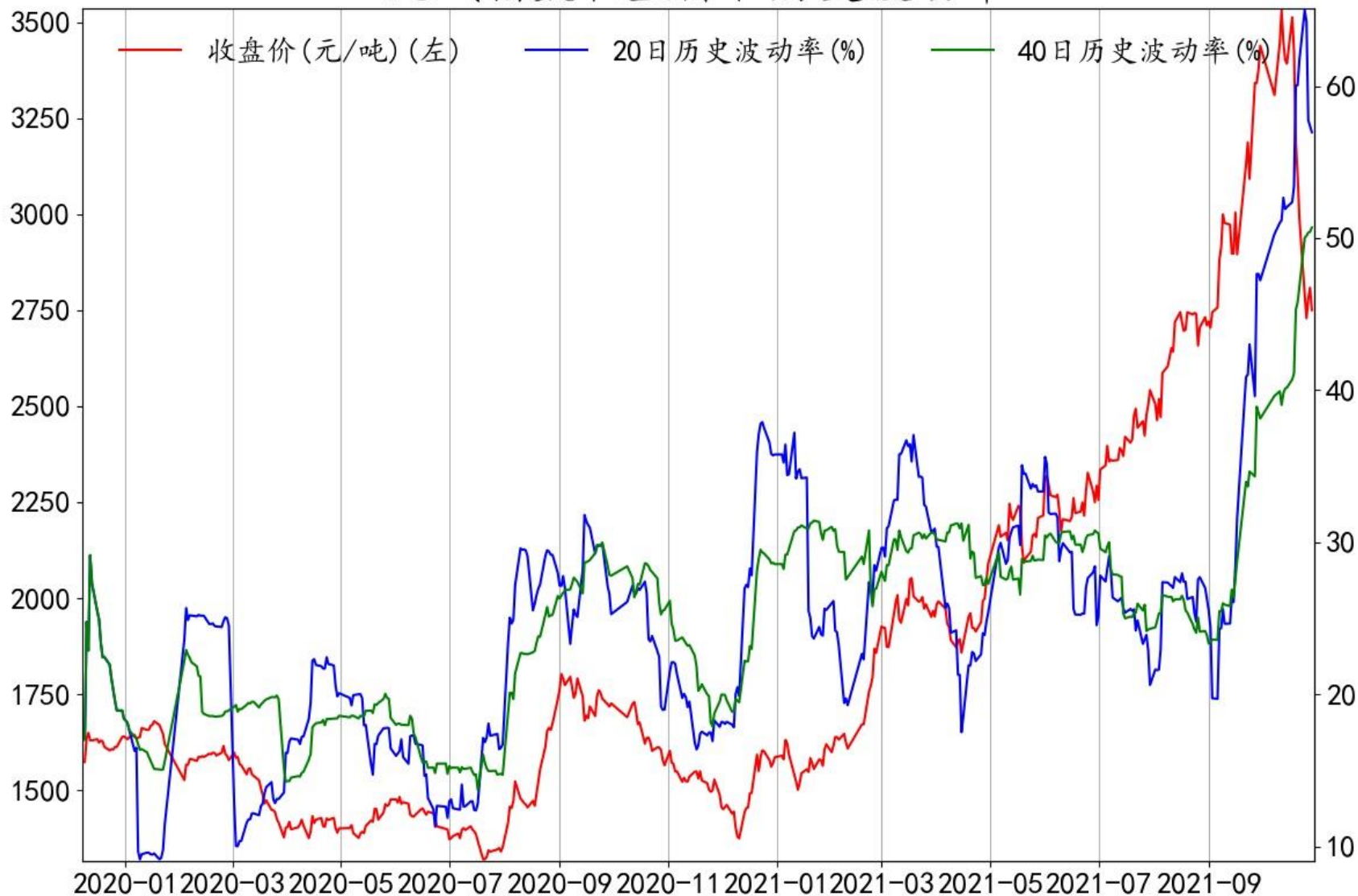


数据来源: Wind、信达期货研发中心

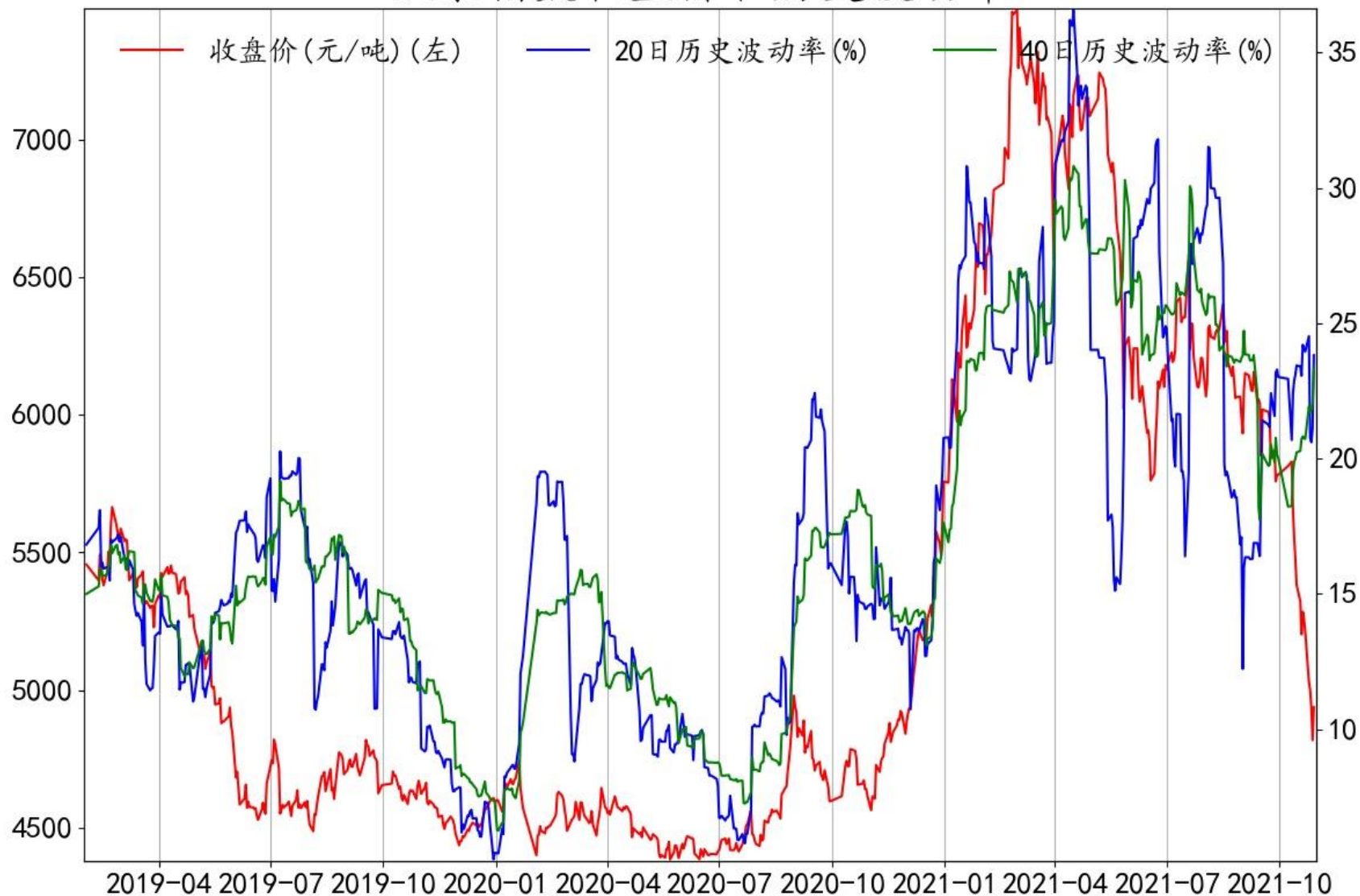
沪胶指数收盘价和历史波动率



纯碱指数收盘价和历史波动率

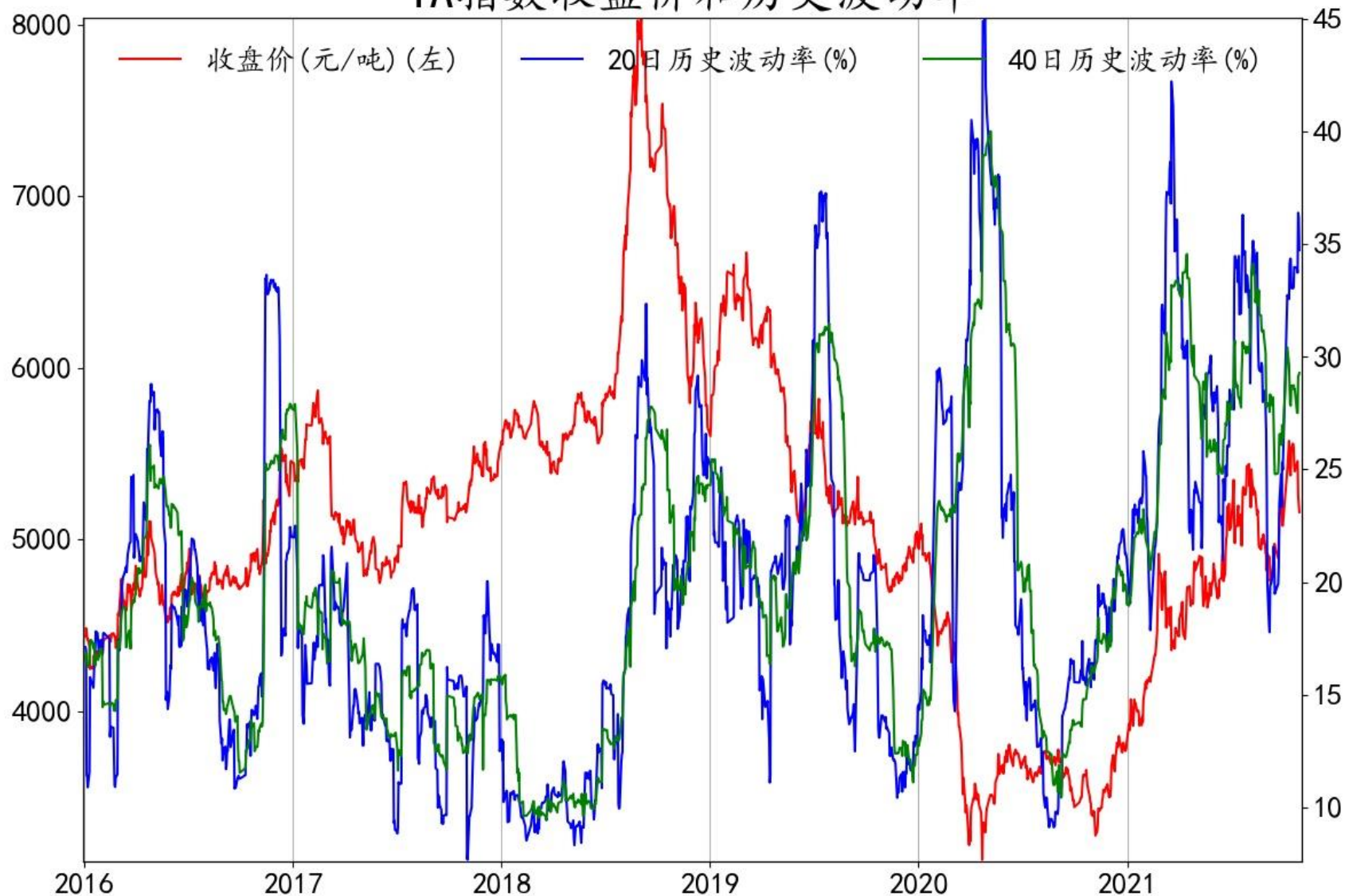


纸浆指数收盘价和历史波动率

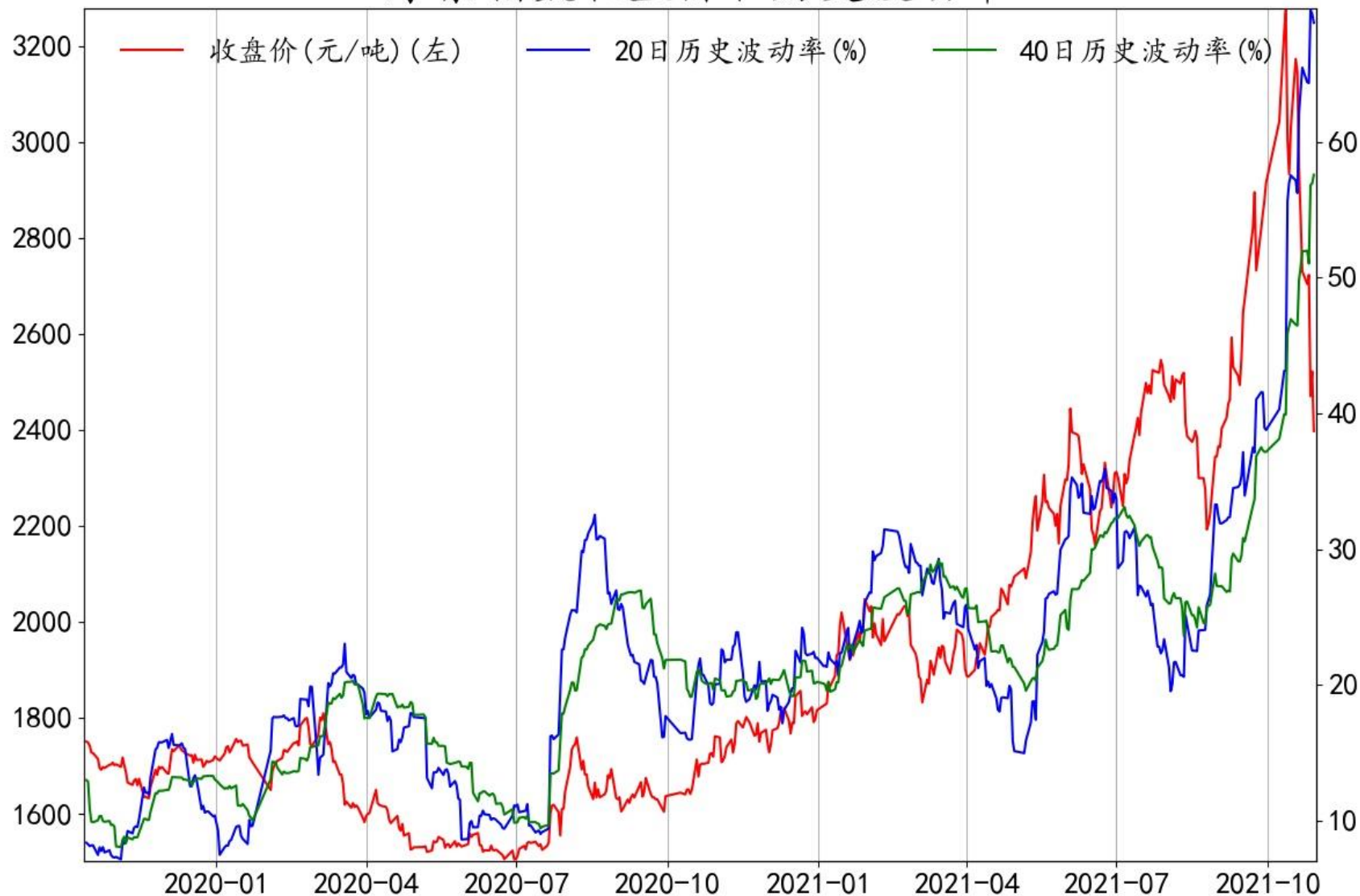


数据来源: Wind、信达期货研发中心

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

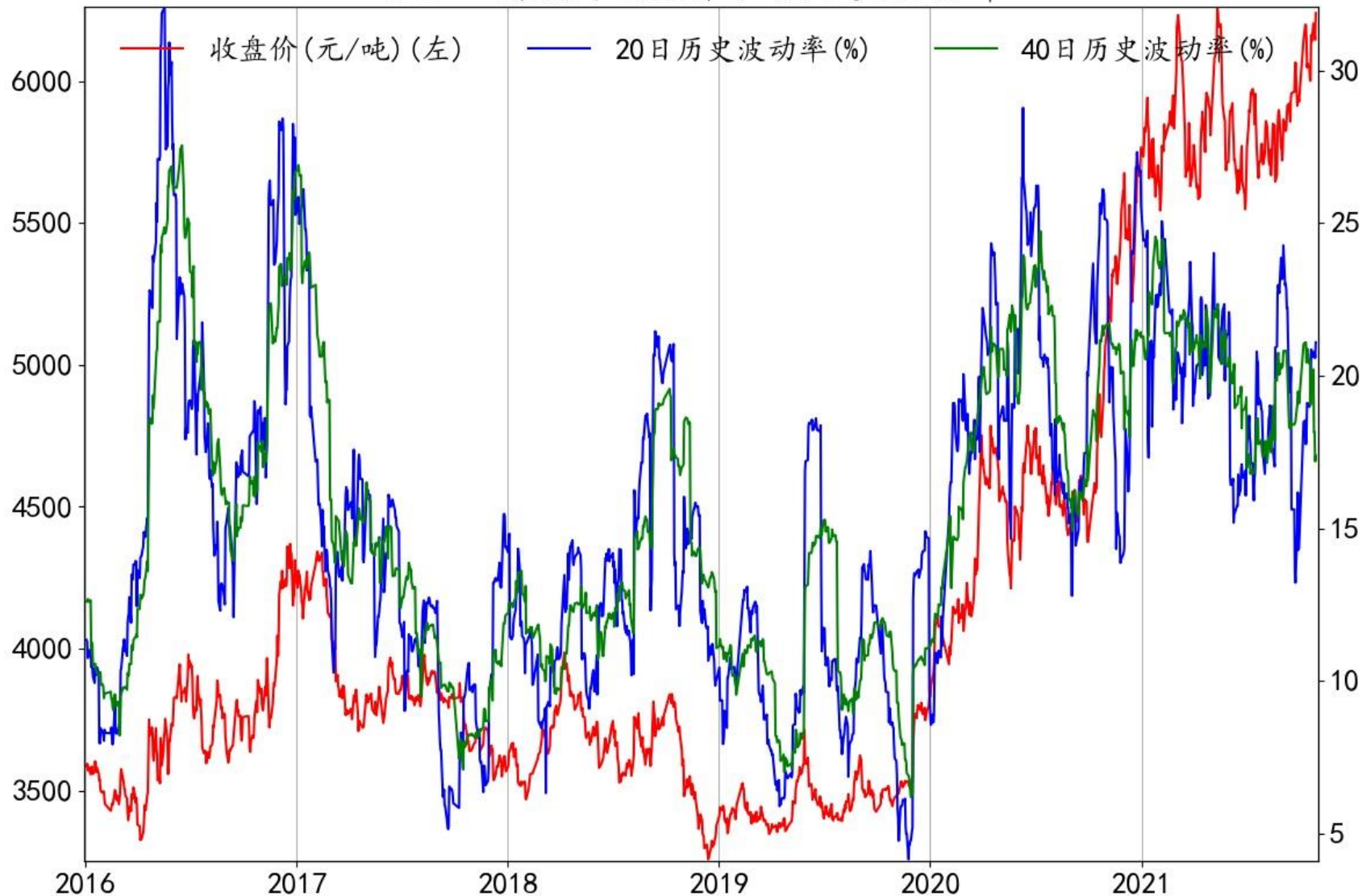


数据来源: Wind、信达期货研发中心

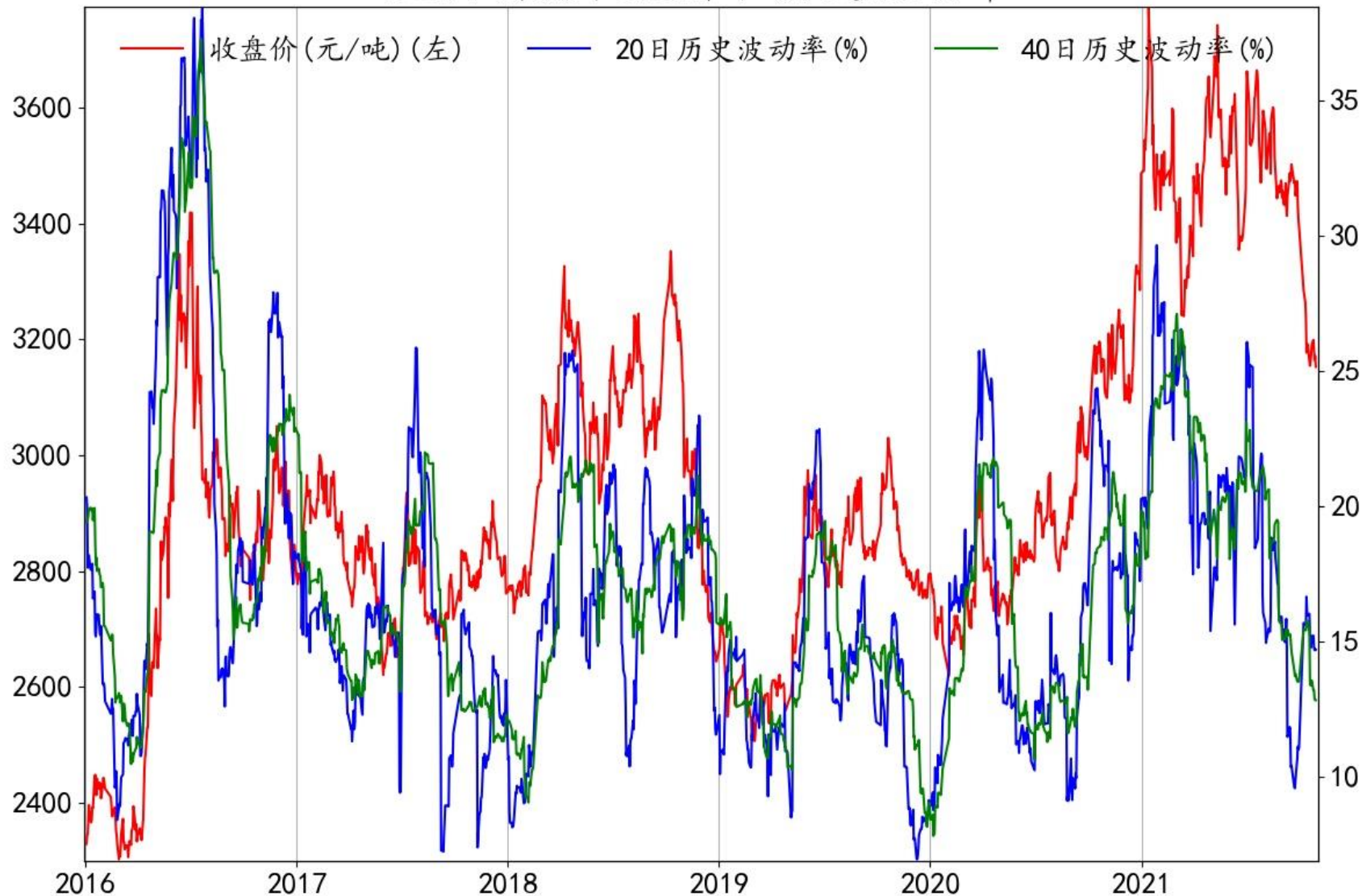
玉米指数收盘价和历史波动率



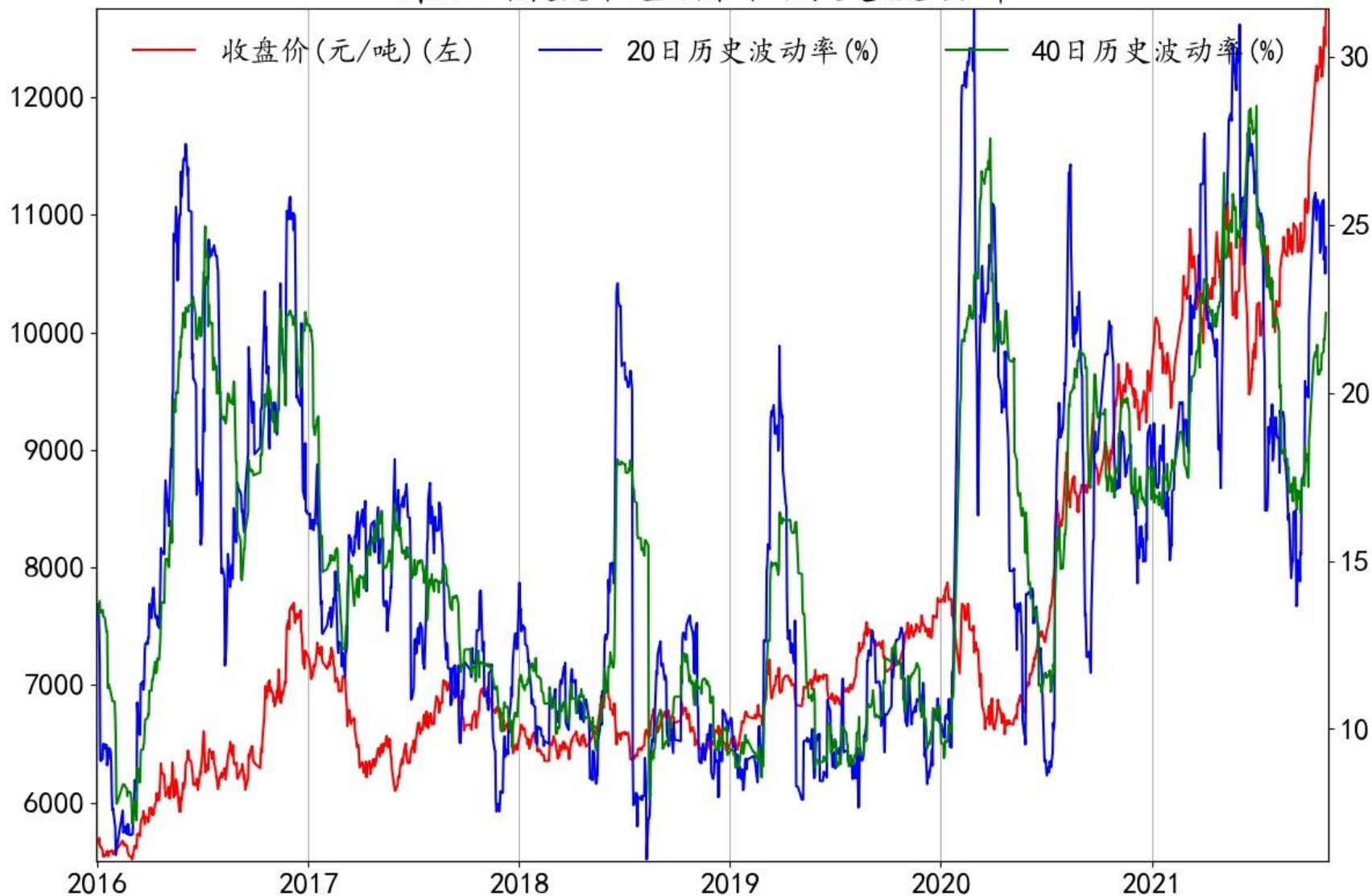
豆一指数收盘价和历史波动率



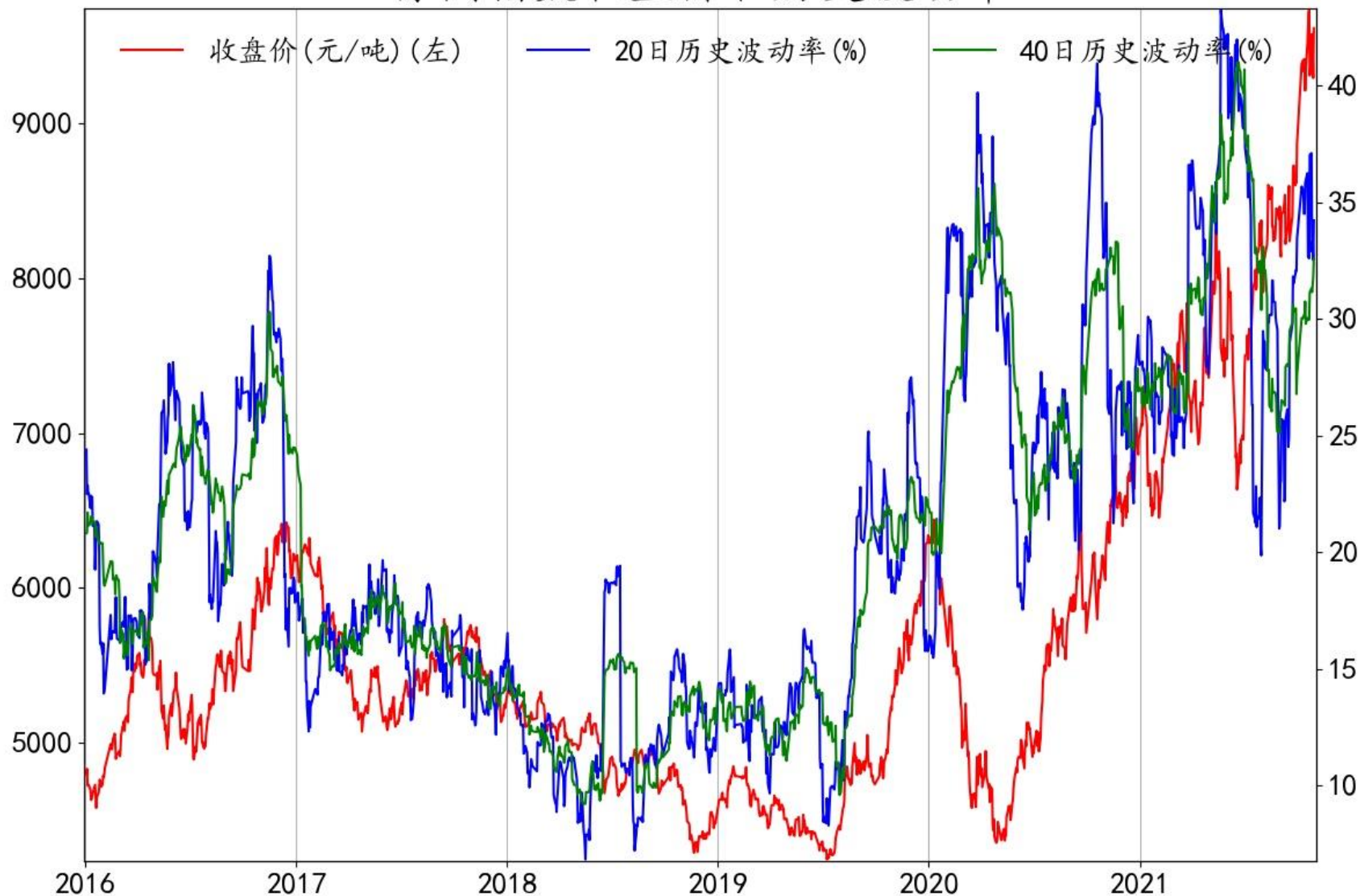
豆粕指数收盘价和历史波动率



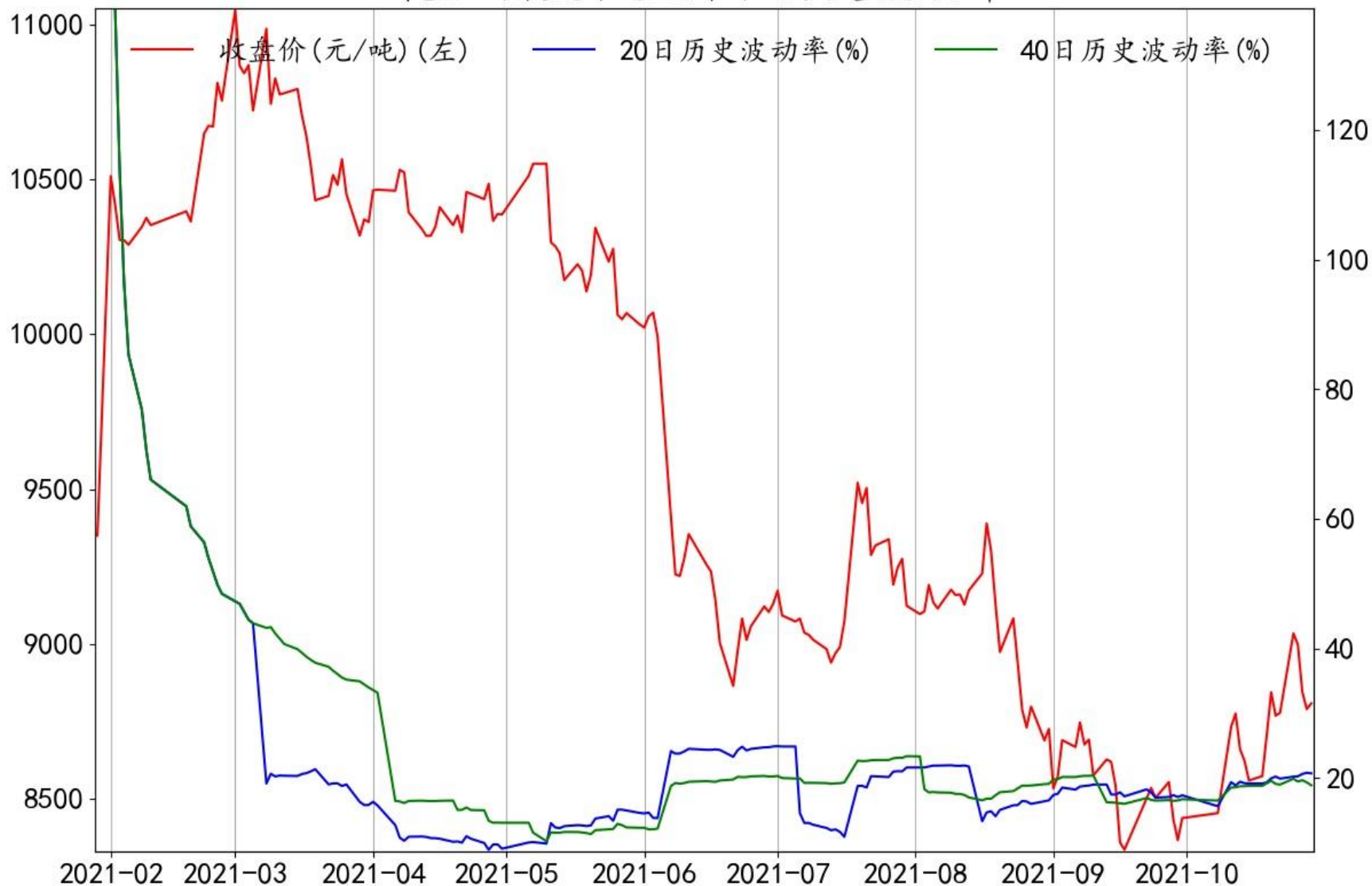
菜油指数收盘价和历史波动率



棕榈指数收盘价和历史波动率

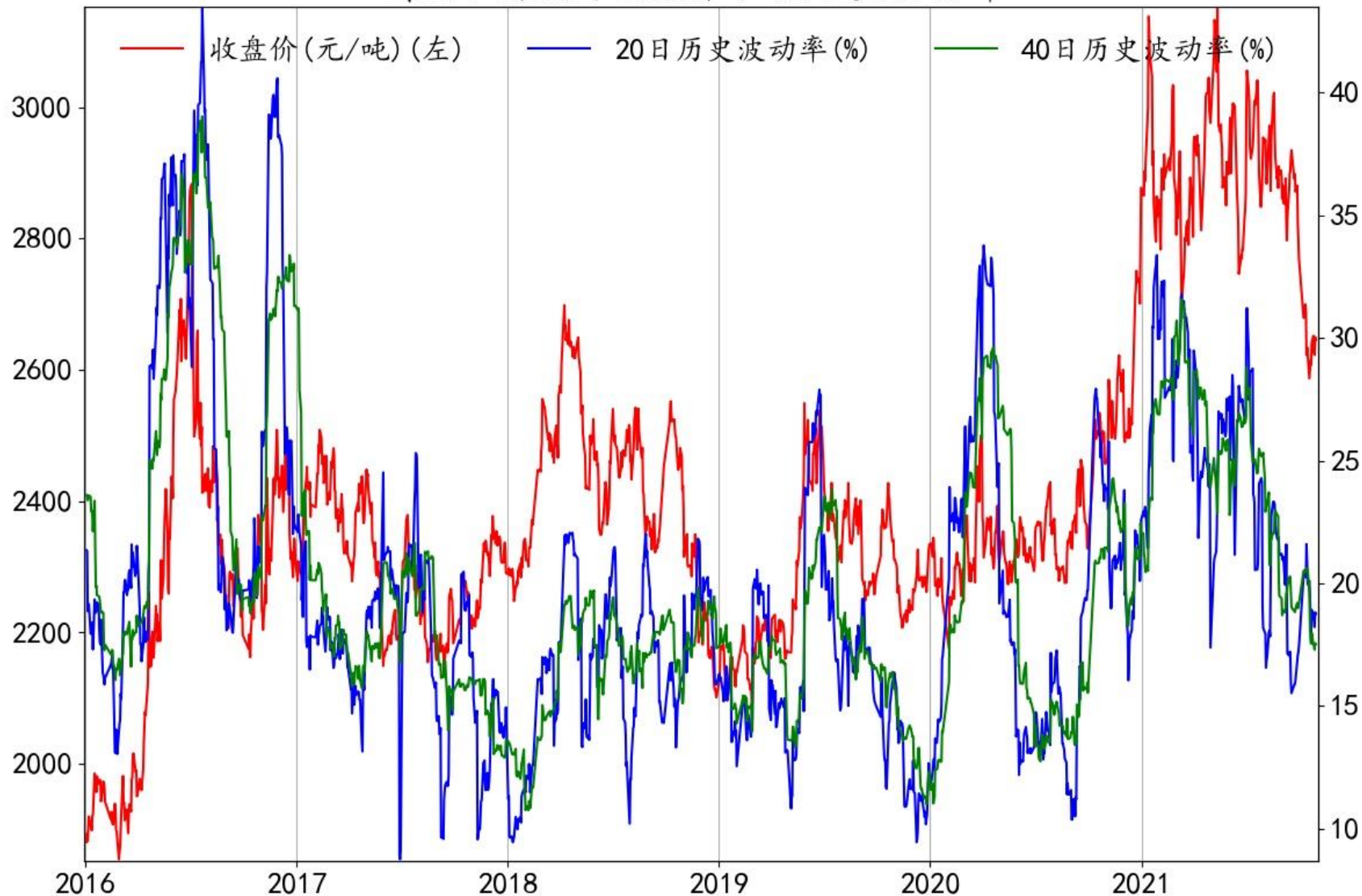


花生指数收盘价和历史波动率

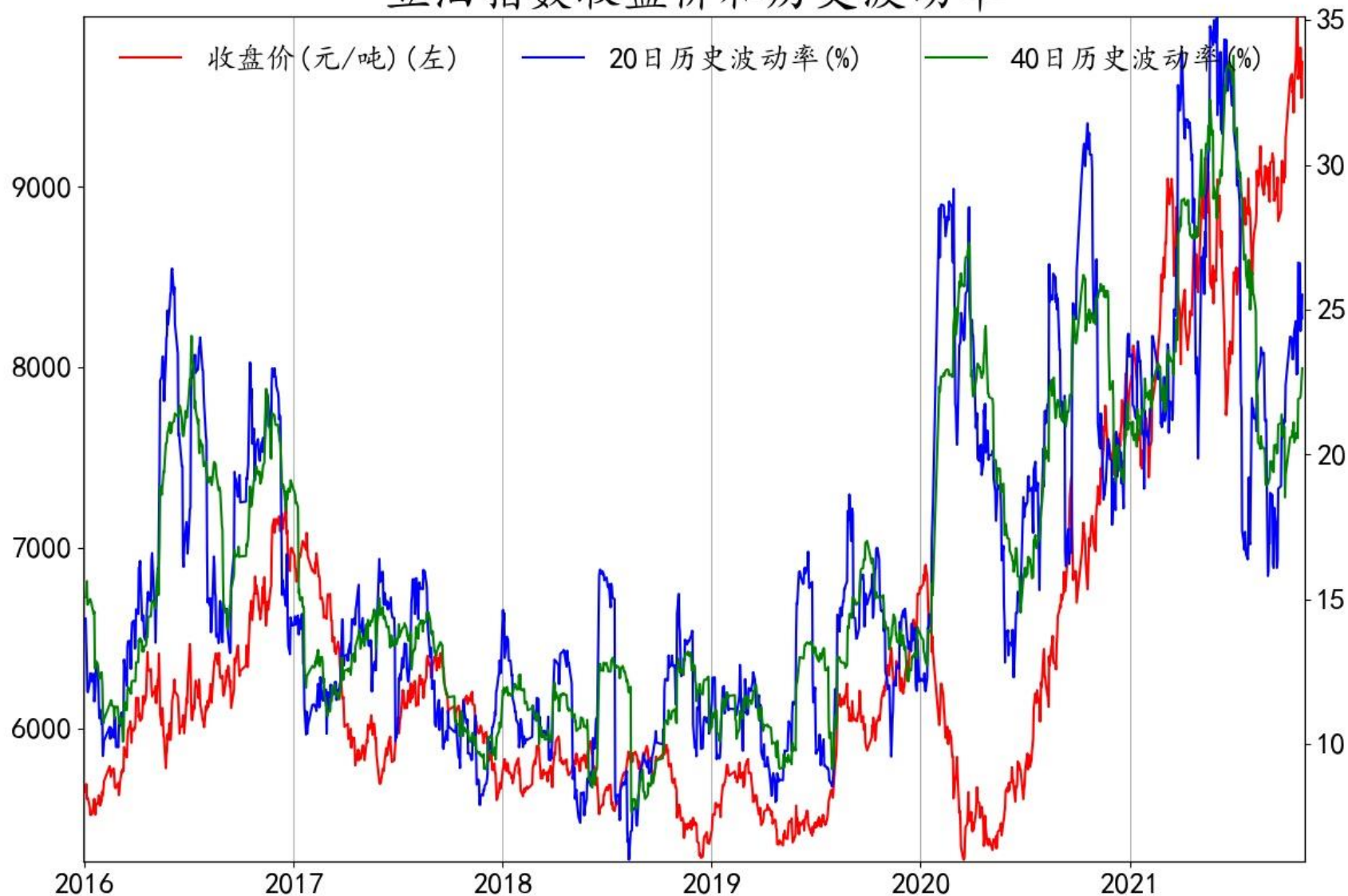


数据来源: Wind、信达期货研发中心

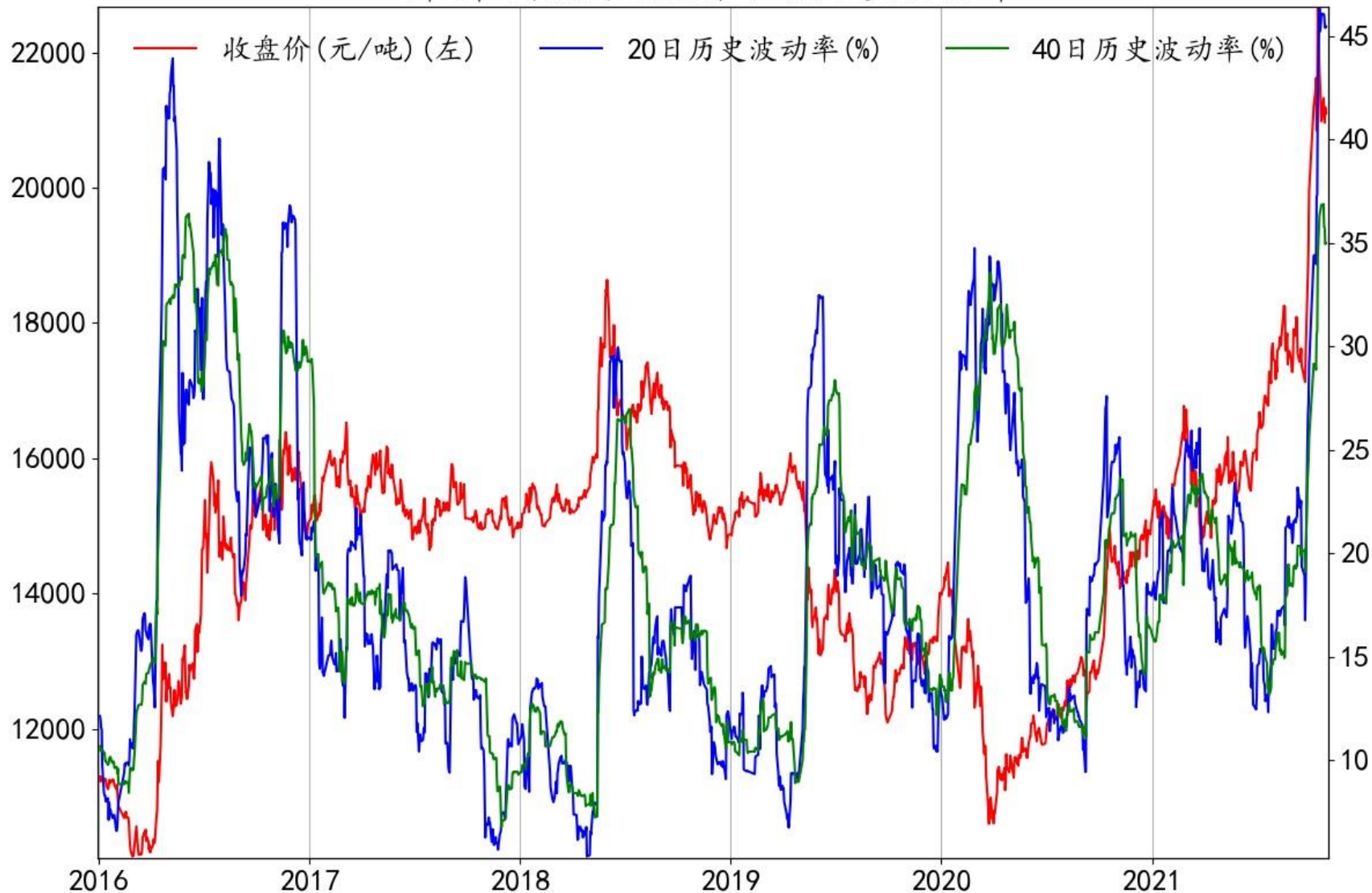
菜粕指数收盘价和历史波动率



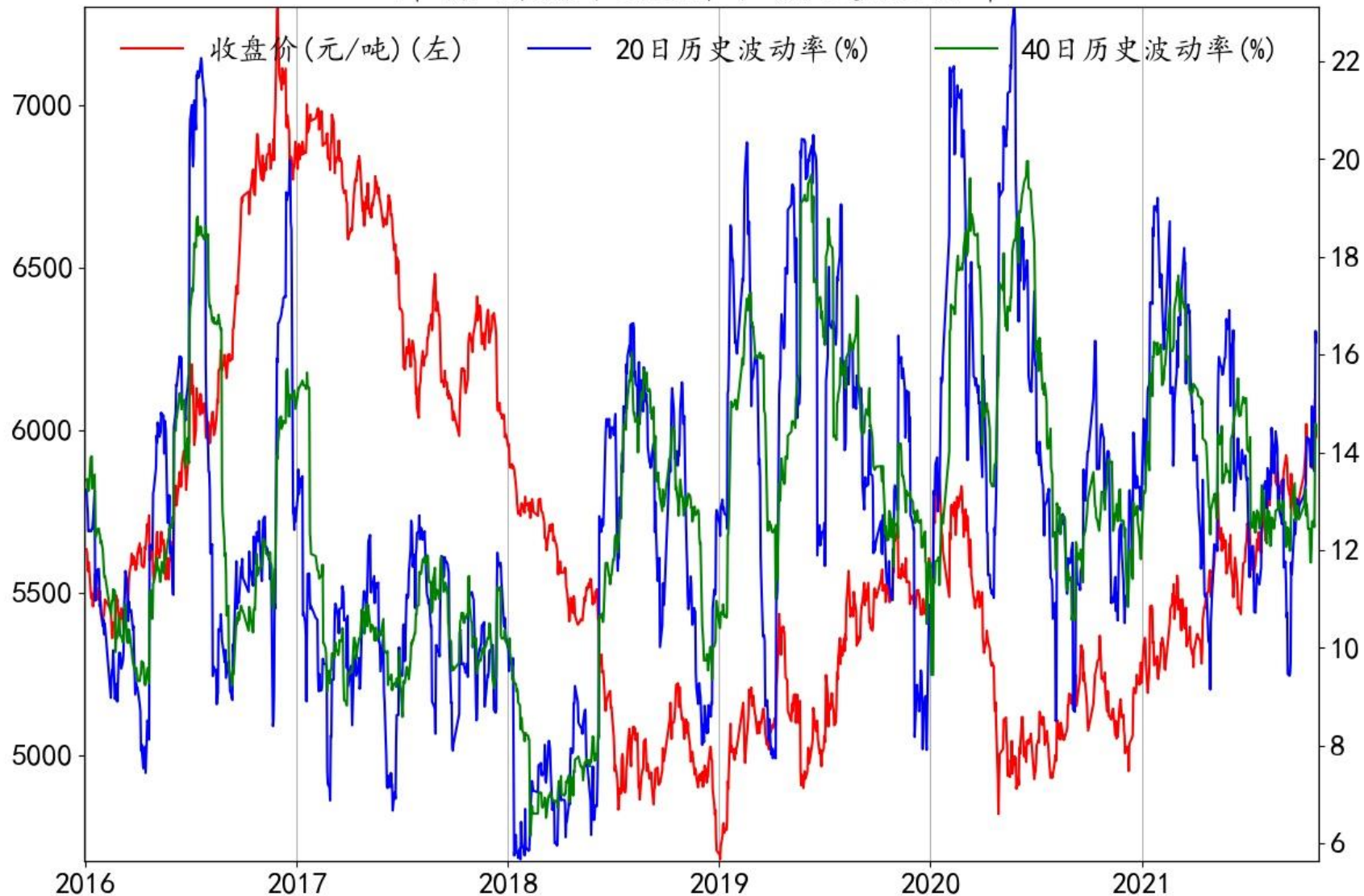
豆油指数收盘价和历史波动率



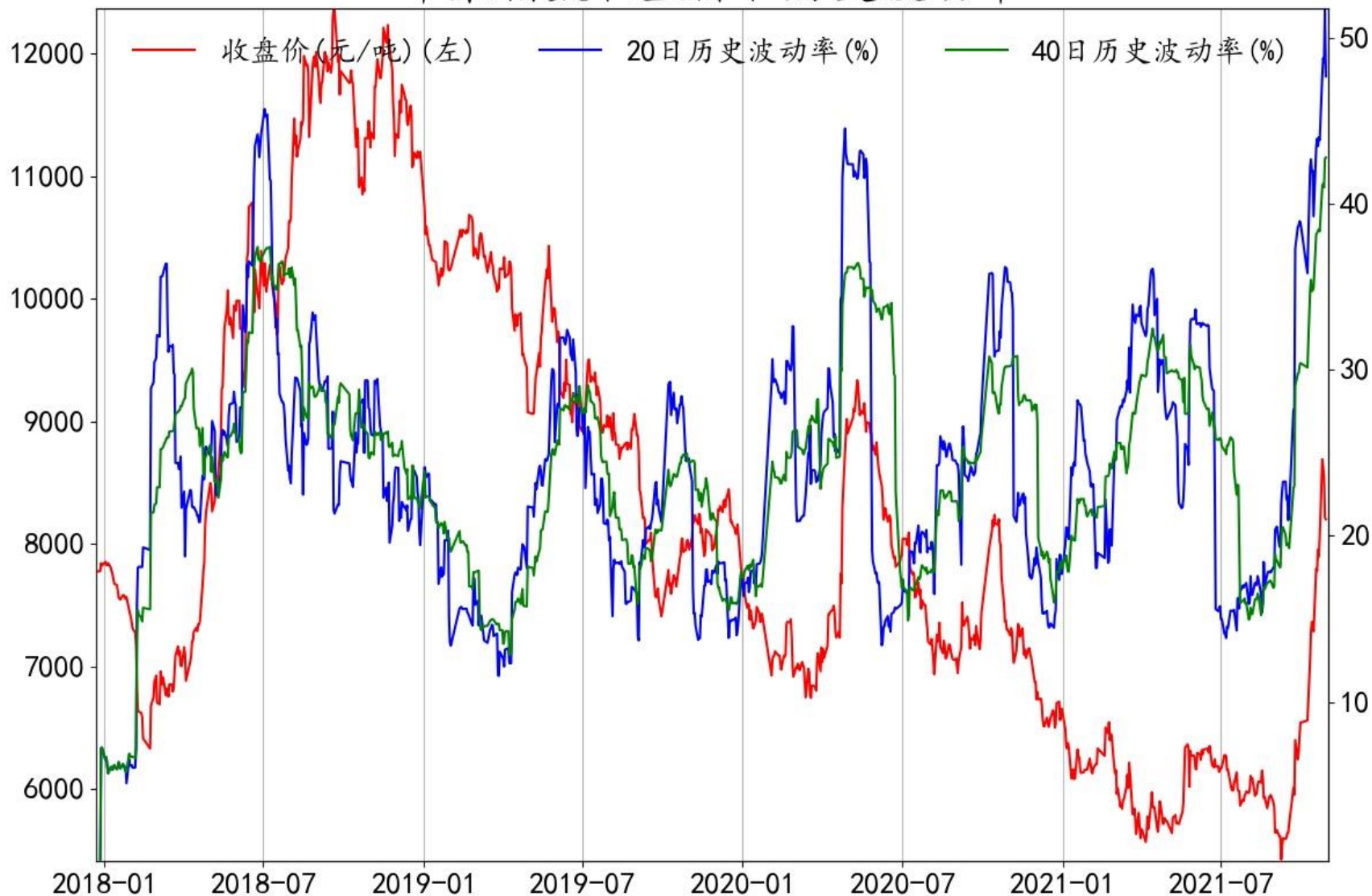
郑棉指数收盘价和历史波动率



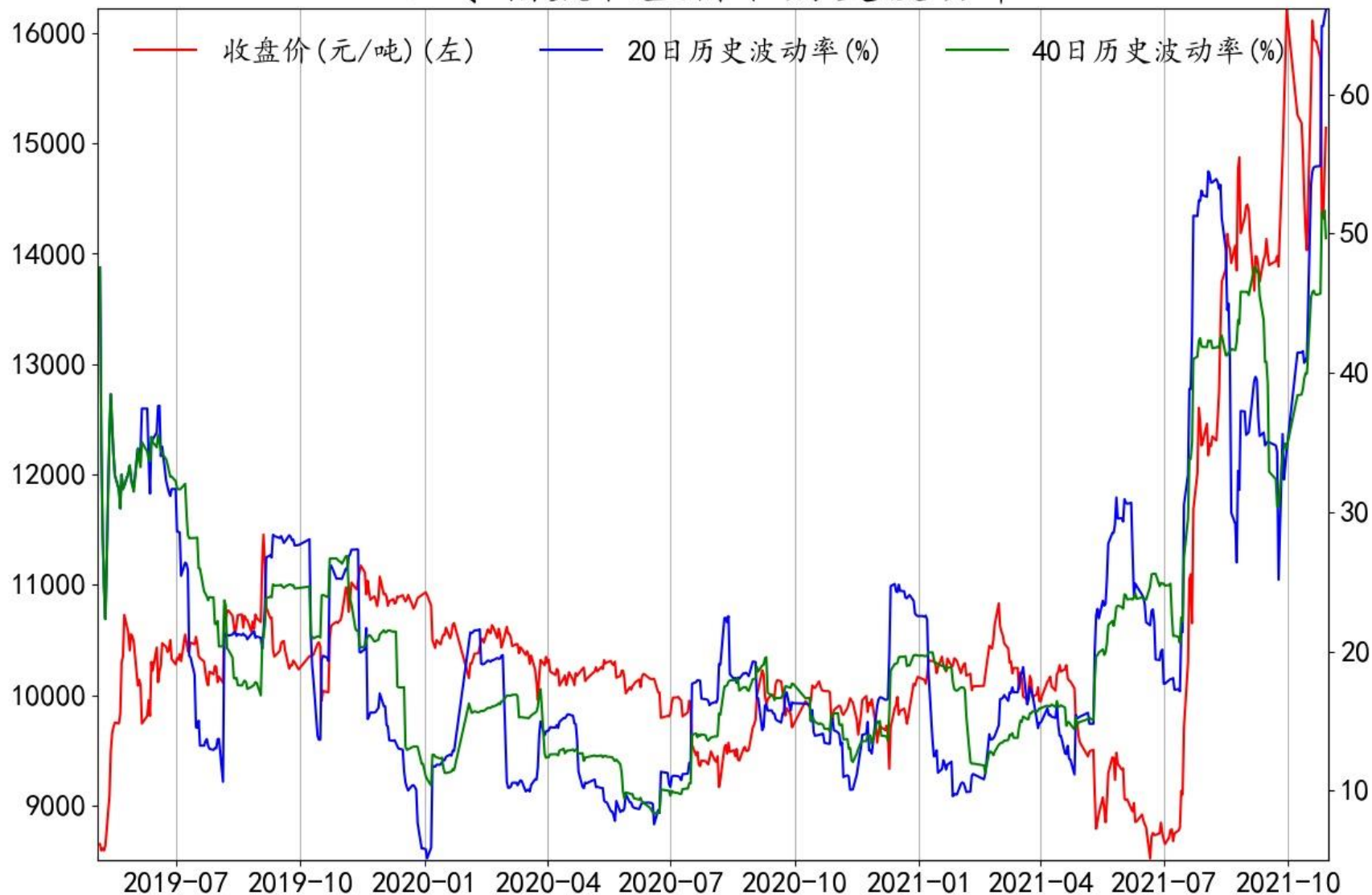
郑糖指数收盘价和历史波动率



苹果指数收盘价和历史波动率



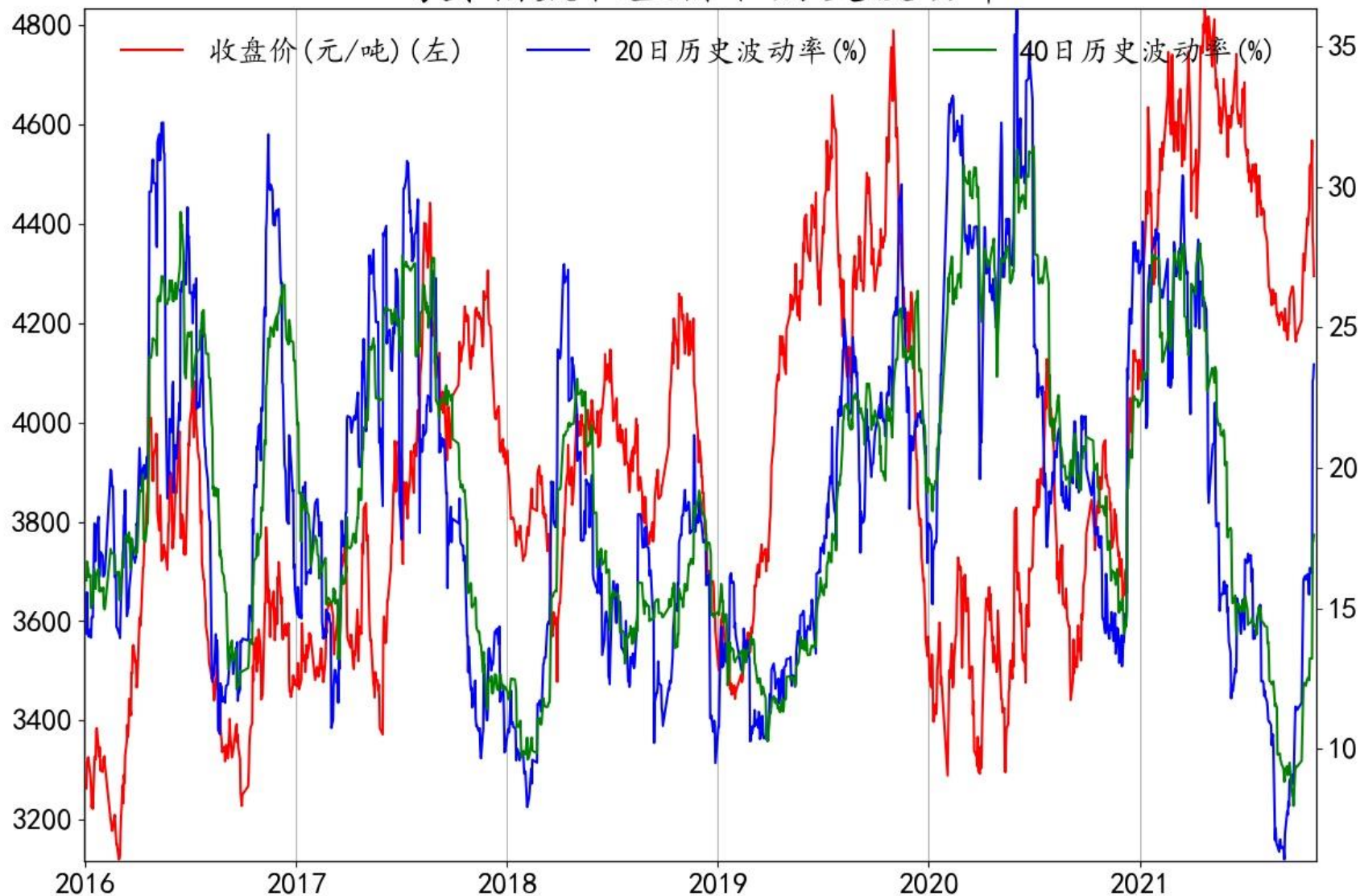
红枣指数收盘价和历史波动率



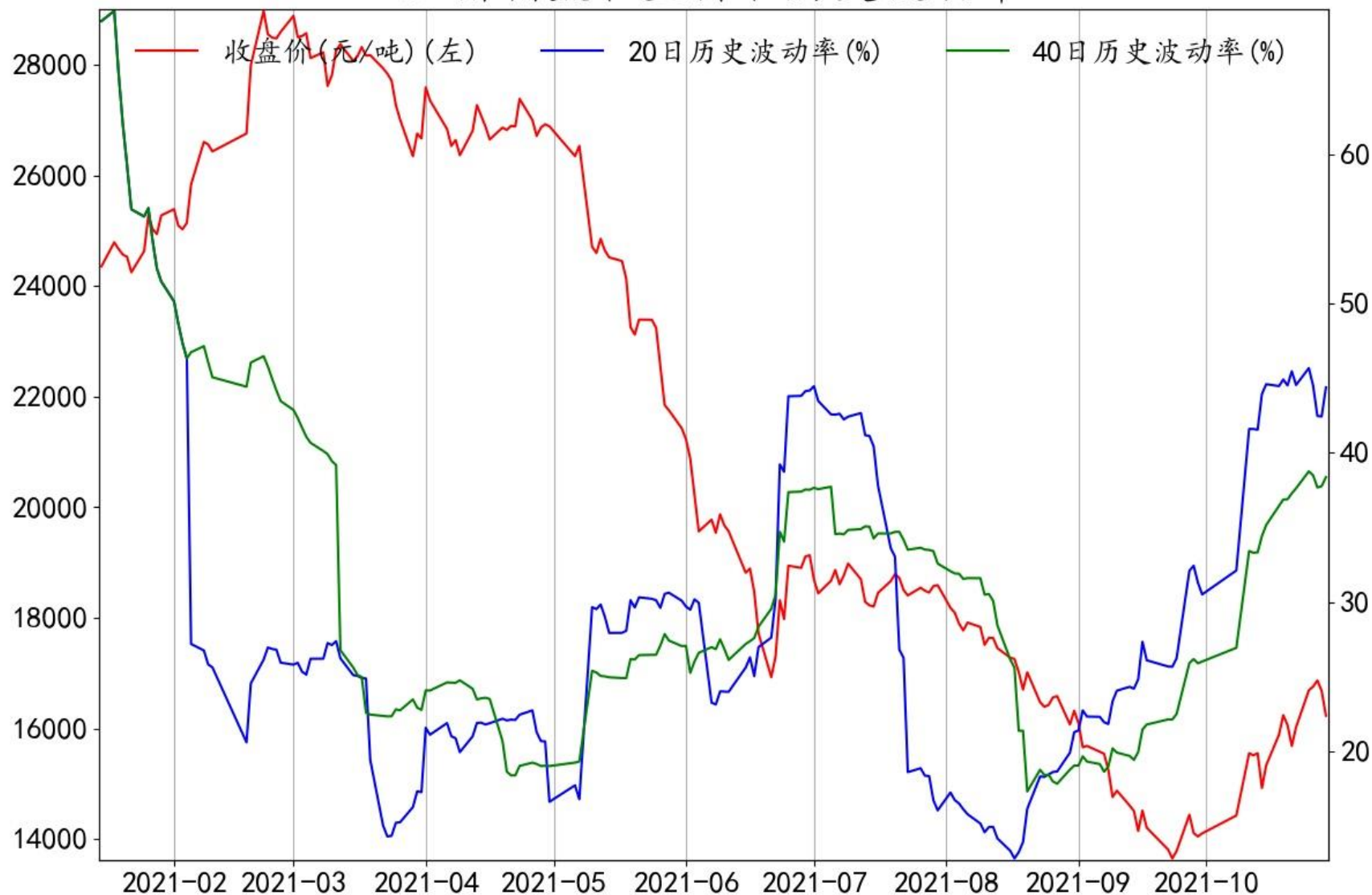
淀粉指数收盘价和历史波动率



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