

商品期货波动率跟踪

2022年01月20日

20日历史波动率百分位高于90%:

红枣、沪镍

20日历史波动率百分位低于10%:

白糖、鸡蛋、生猪

20日历史波动率绝对值前五:

红枣、焦炭、焦煤、动力煤、LPG

20日历史波动率绝对值后五:

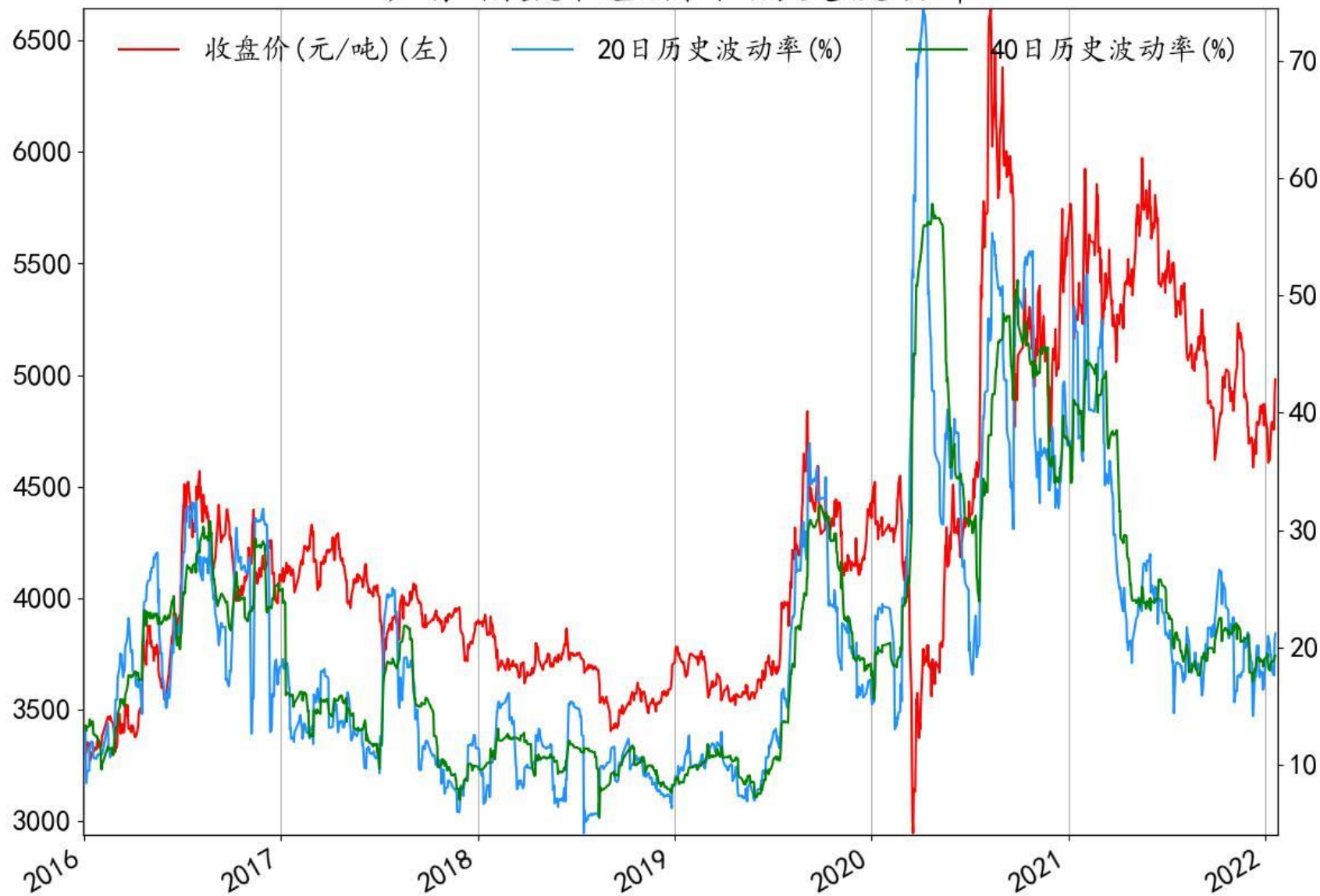
白糖、玉米、鸡蛋、沪金、棉花

	时间百分位 绝对值			时间百分位 绝对值	
沪银	62.08%	21.18%	螺纹	58.96%	25.04%
沪金	45.25%	9.86%	硅铁	73.88%	27.96%
沪铝	73.20%	18.85%	锰硅	79.17%	30.33%
沪铜	40.03%	13.90%	燃油	11.26%	22.45%
沪镍	90.57%	31.96%	低硫燃油	18.88%	24.07%
沪铅	49.53%	16.82%	LPG	78.91%	34.05%
沪锡	74.29%	22.11%	原油	29.82%	23.53%
沪锌	32.36%	16.83%	动力煤	88.67%	36.87%
不锈钢	88.99%	30.26%	玻璃	88.67%	33.24%
热卷	56.51%	23.95%	PVC	88.94%	29.13%
铁矿石	44.57%	32.57%	沥青	15.13%	18.74%
焦炭	82.77%	42.71%	苯乙烯	52.85%	28.64%
焦煤	77.07%	40.07%	乙二醇	48.48%	21.60%

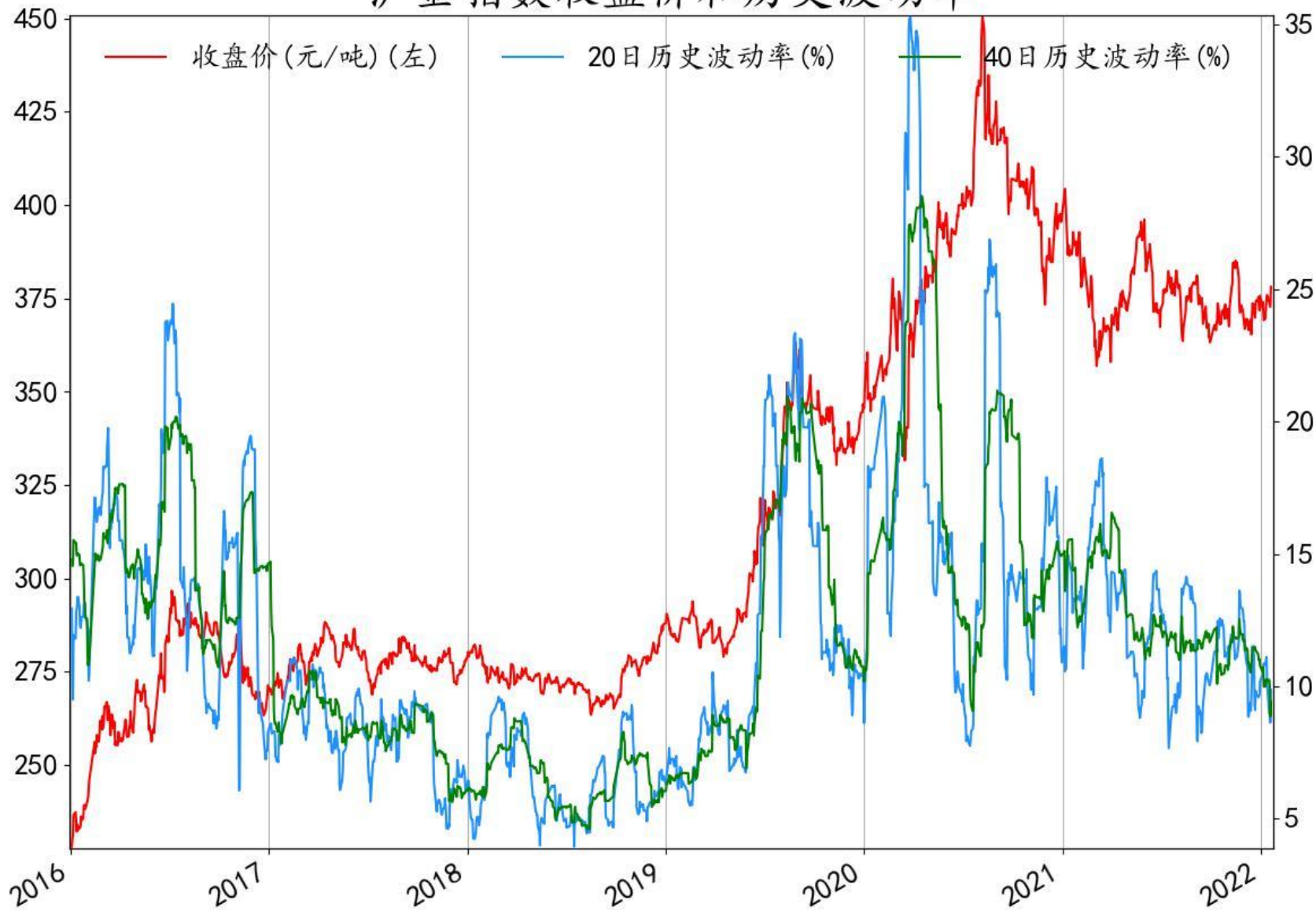
	时间百分位	绝对值
聚乙烯	60.99%	19.28%
甲醇	77.95%	28.61%
20号胶	23.39%	21.14%
短纤	13.67%	16.79%
聚丙烯	57.39%	20.03%
橡胶	15.26%	17.63%
纯碱	71.32%	29.80%
纸浆	83.50%	25.78%
PTA	53.93%	19.68%
尿素	70.32%	27.05%
玉米	42.06%	9.20%
豆一	48.24%	14.46%
豆粕	73.00%	18.91%

	时间百分位	绝对值
菜油	71.91%	18.95%
棕榈油	31.82%	15.50%
花生	45.96%	16.62%
菜粕	65.88%	20.90%
豆油	55.09%	15.38%
棉花	14.65%	10.75%
白糖	2.65%	6.75%
苹果	68.96%	27.57%
红枣	91.42%	44.13%
玉米淀粉	65.67%	14.83%
鸡蛋	2.92%	9.69%
生猪	9.72%	16.15%

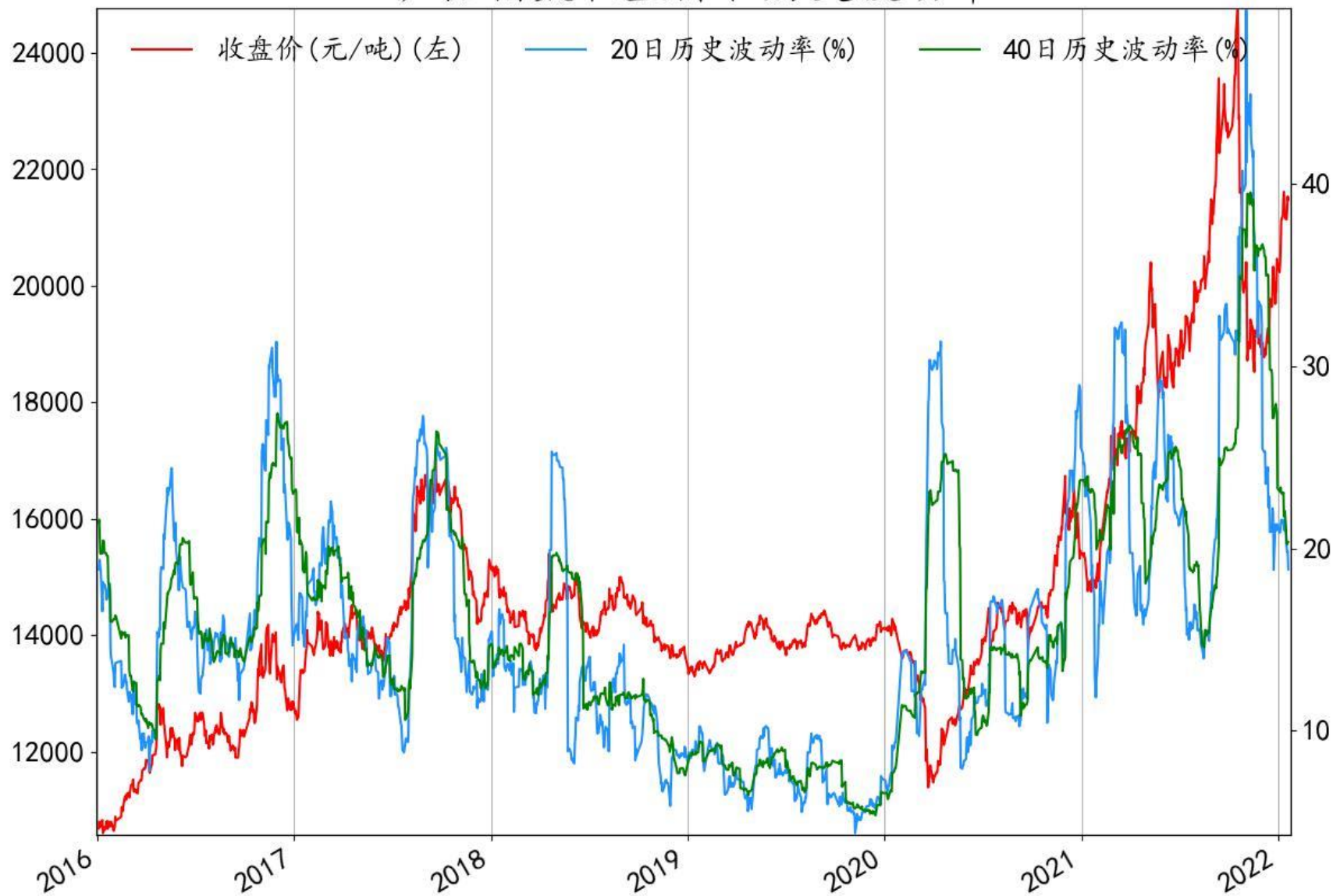
沪银指数收盘价和历史波动率



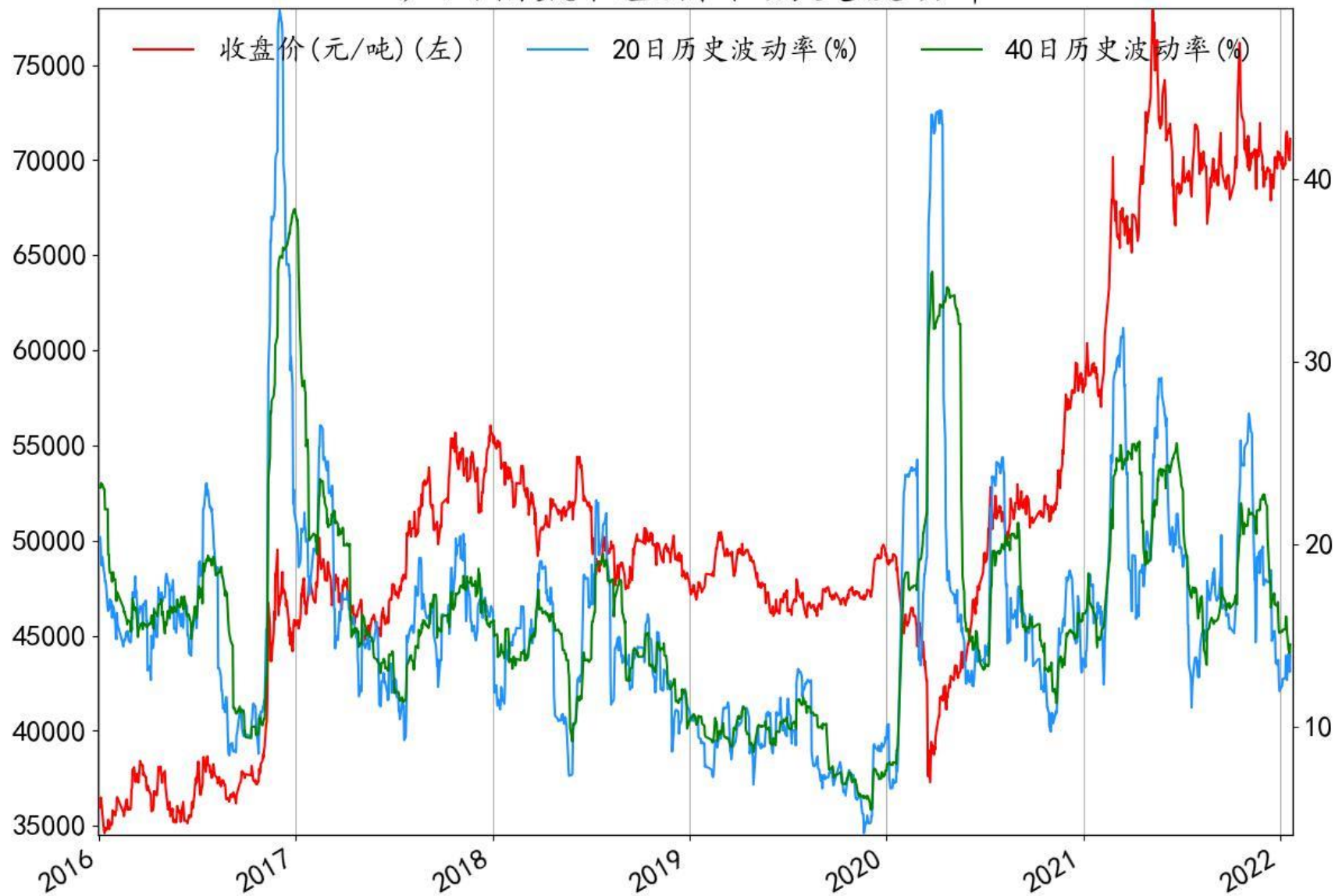
沪金指数收盘价和历史波动率



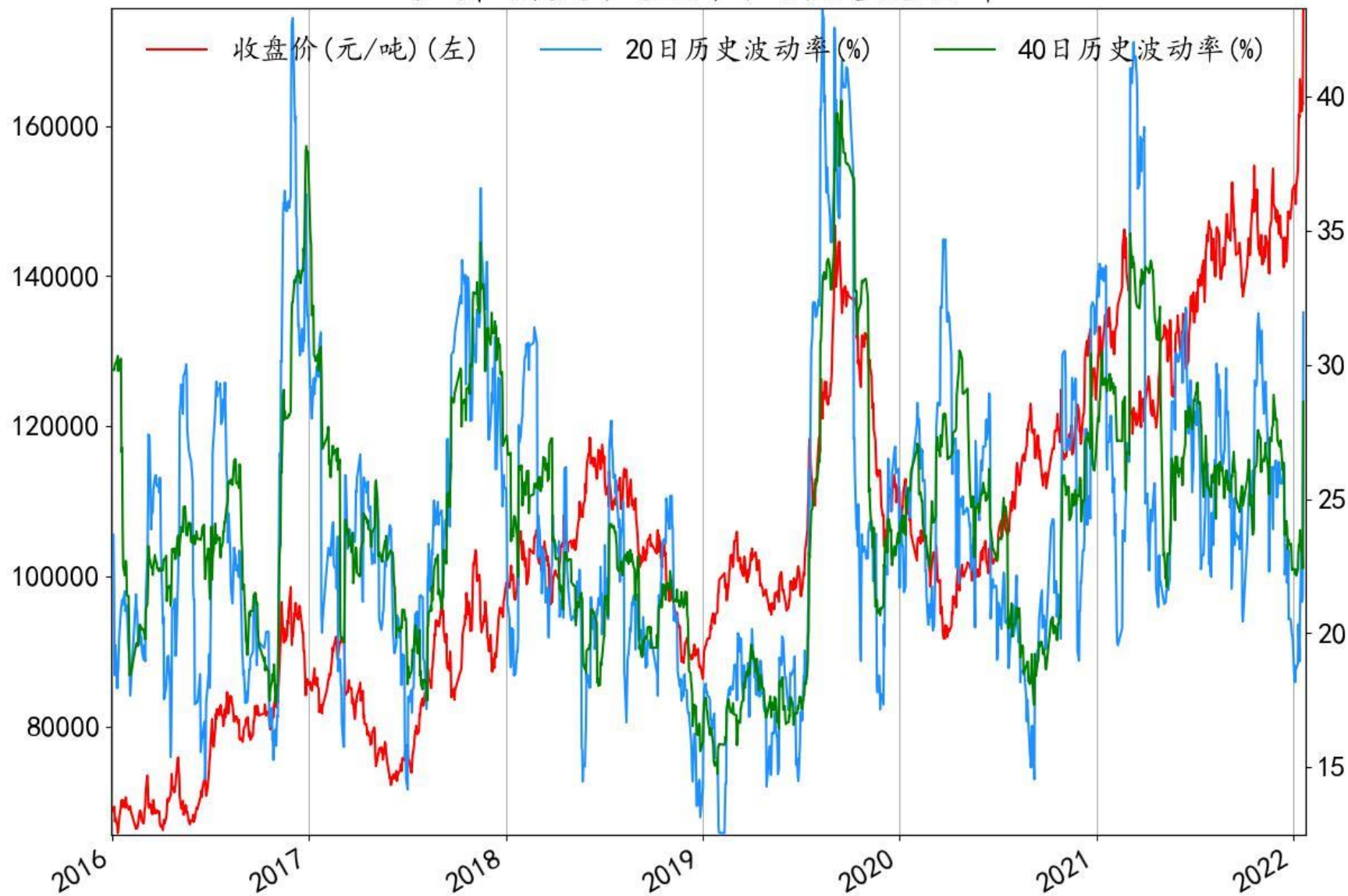
沪铝指数收盘价和历史波动率



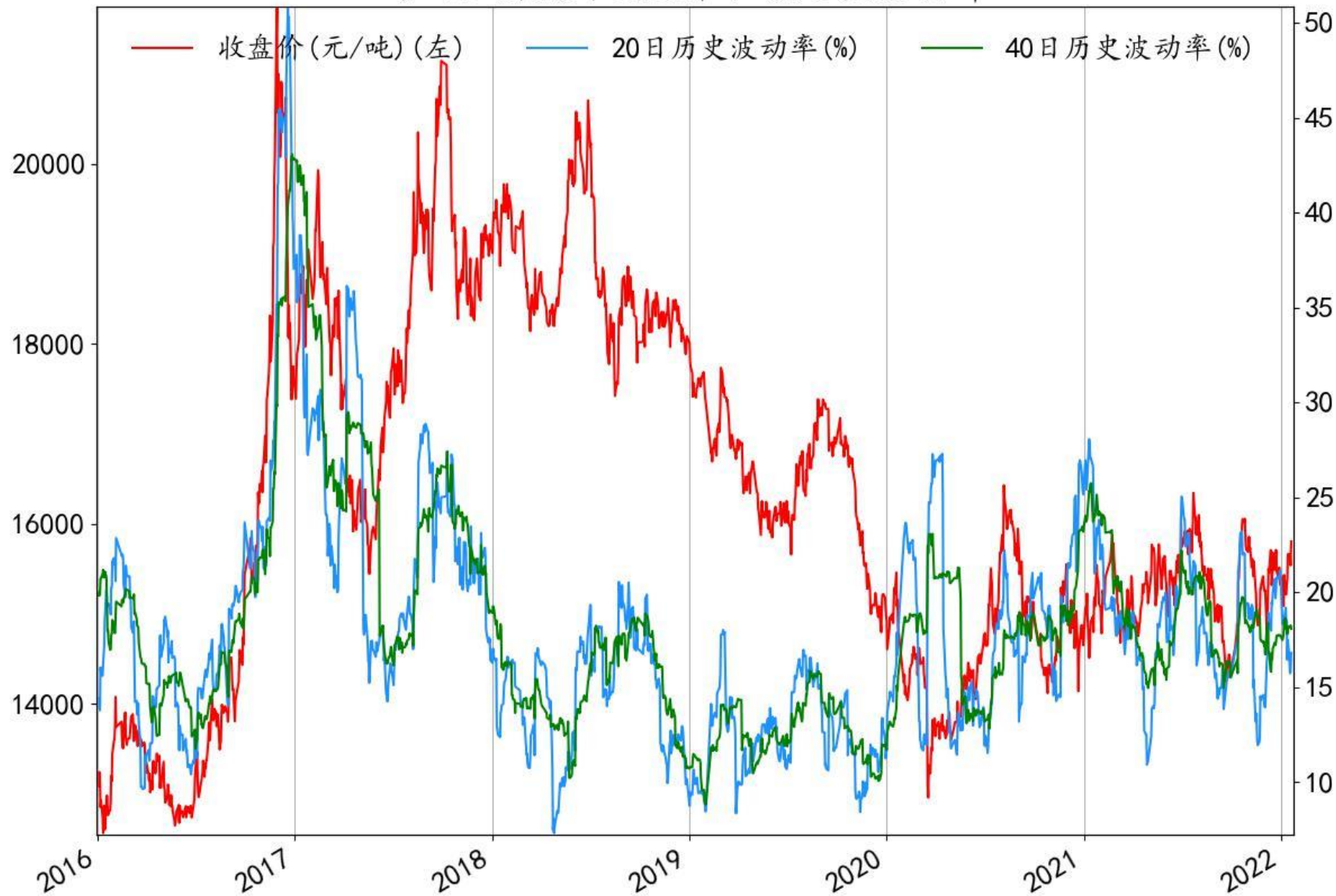
沪铜指数收盘价和历史波动率



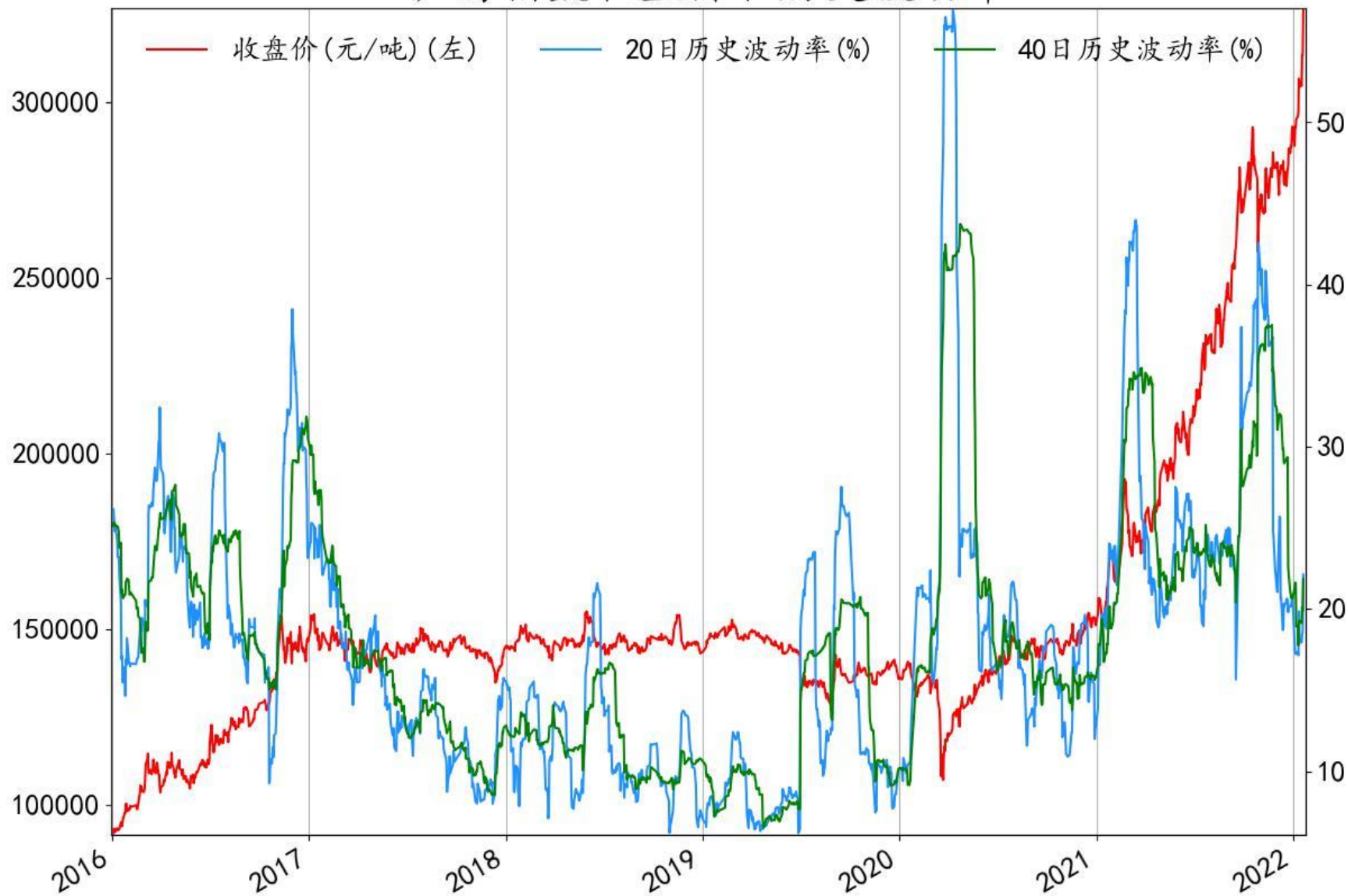
沪镍指数收盘价和历史波动率



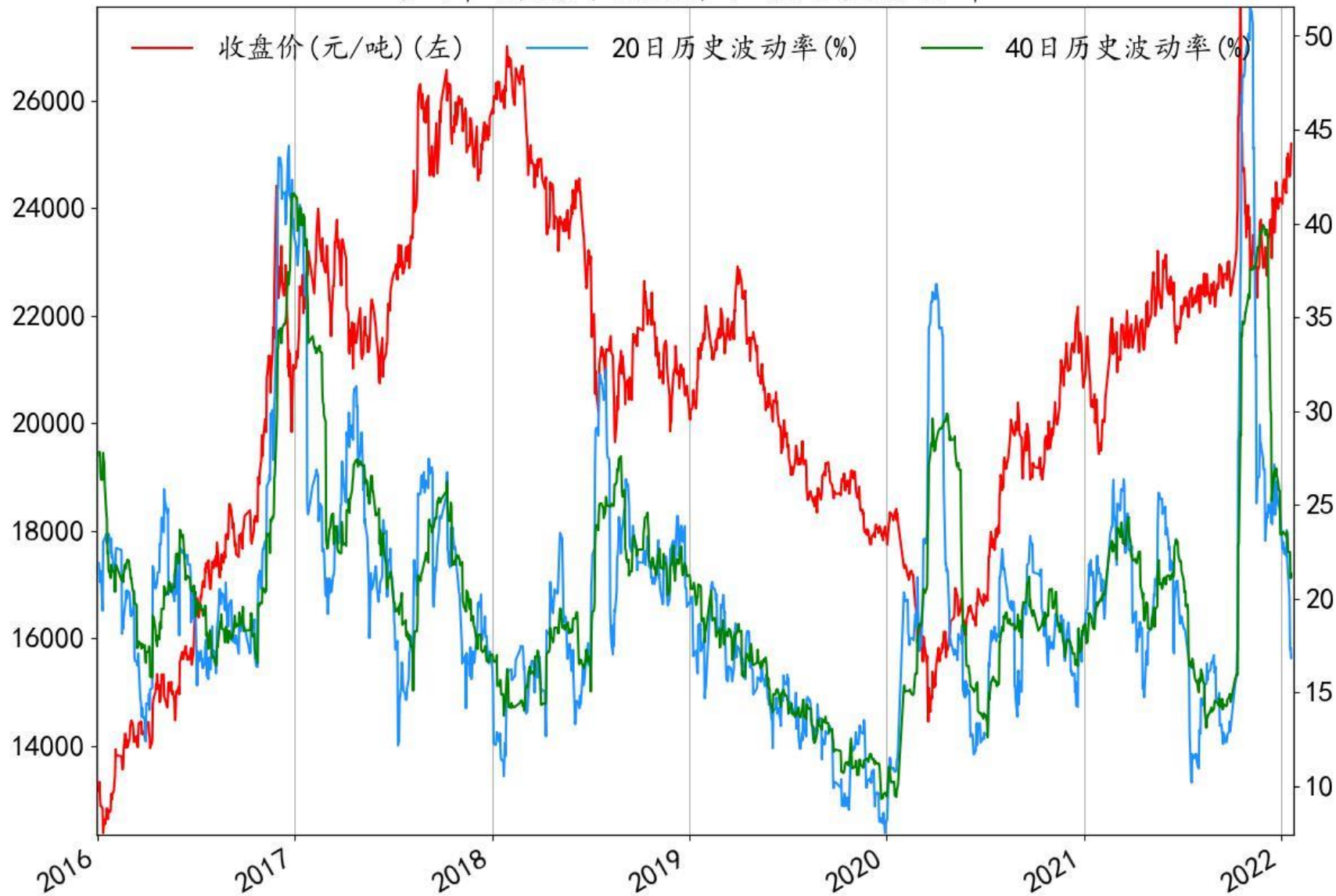
沪铅指数收盘价和历史波动率



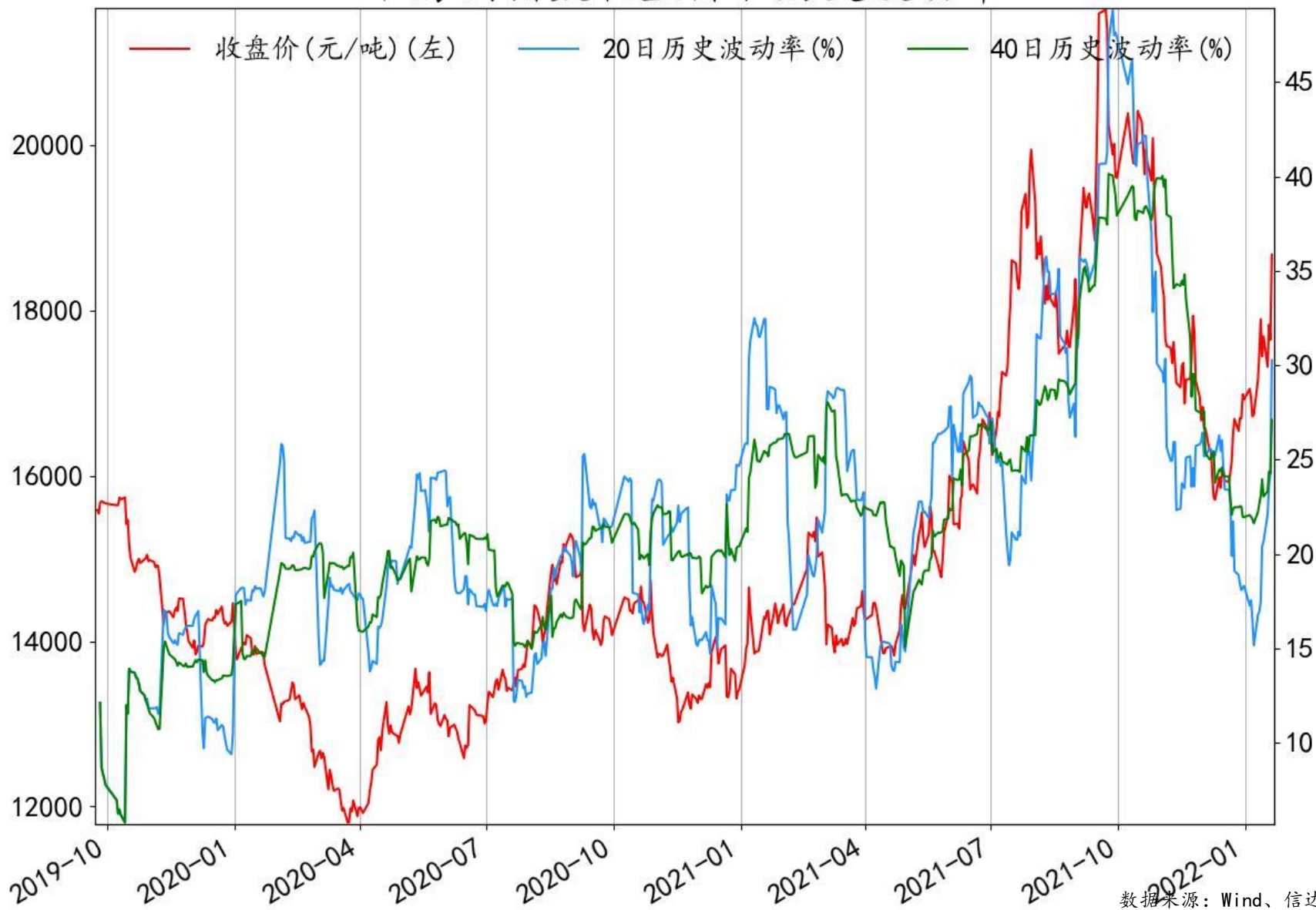
沪锡指数收盘价和历史波动率



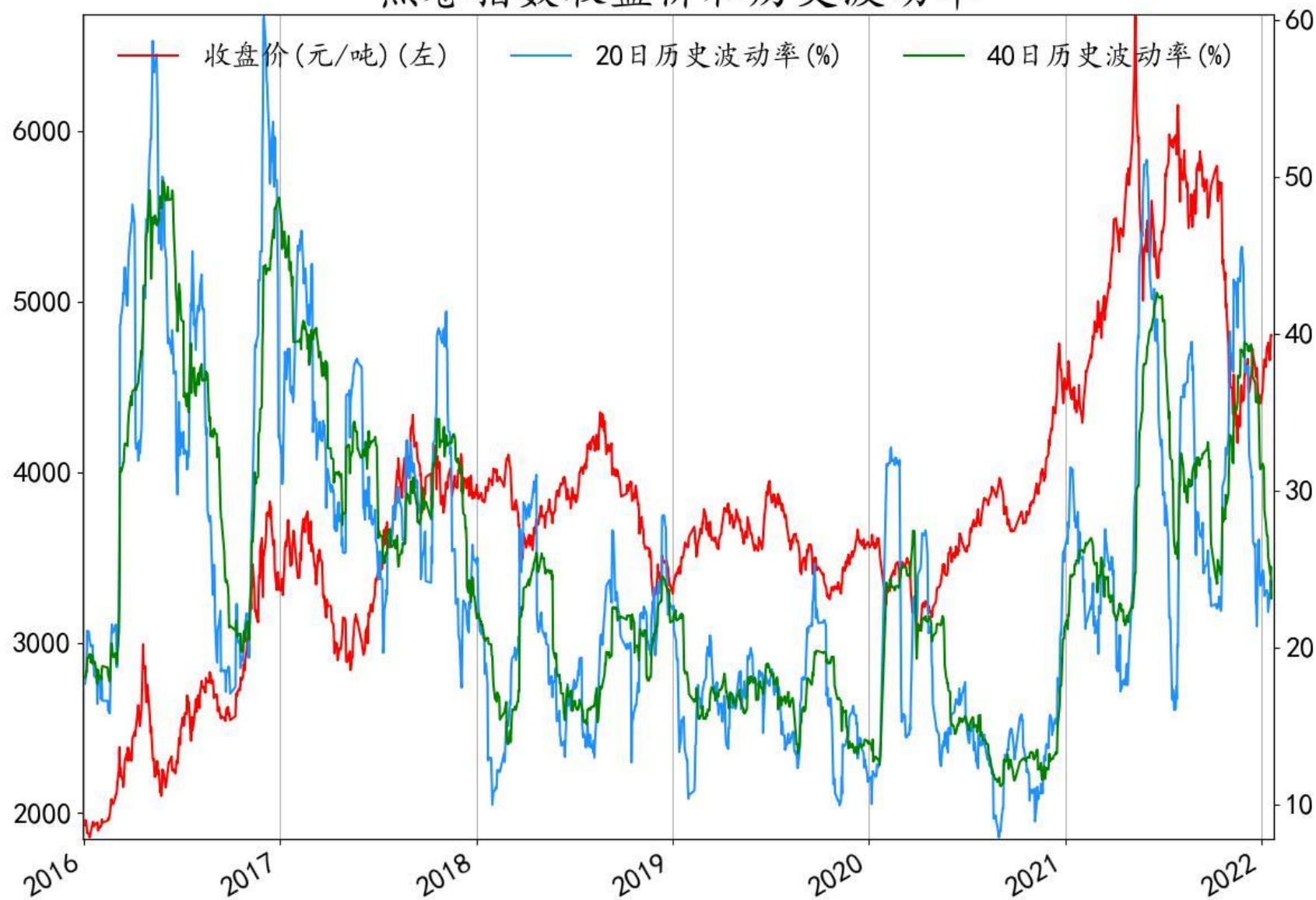
沪锌指数收盘价和历史波动率



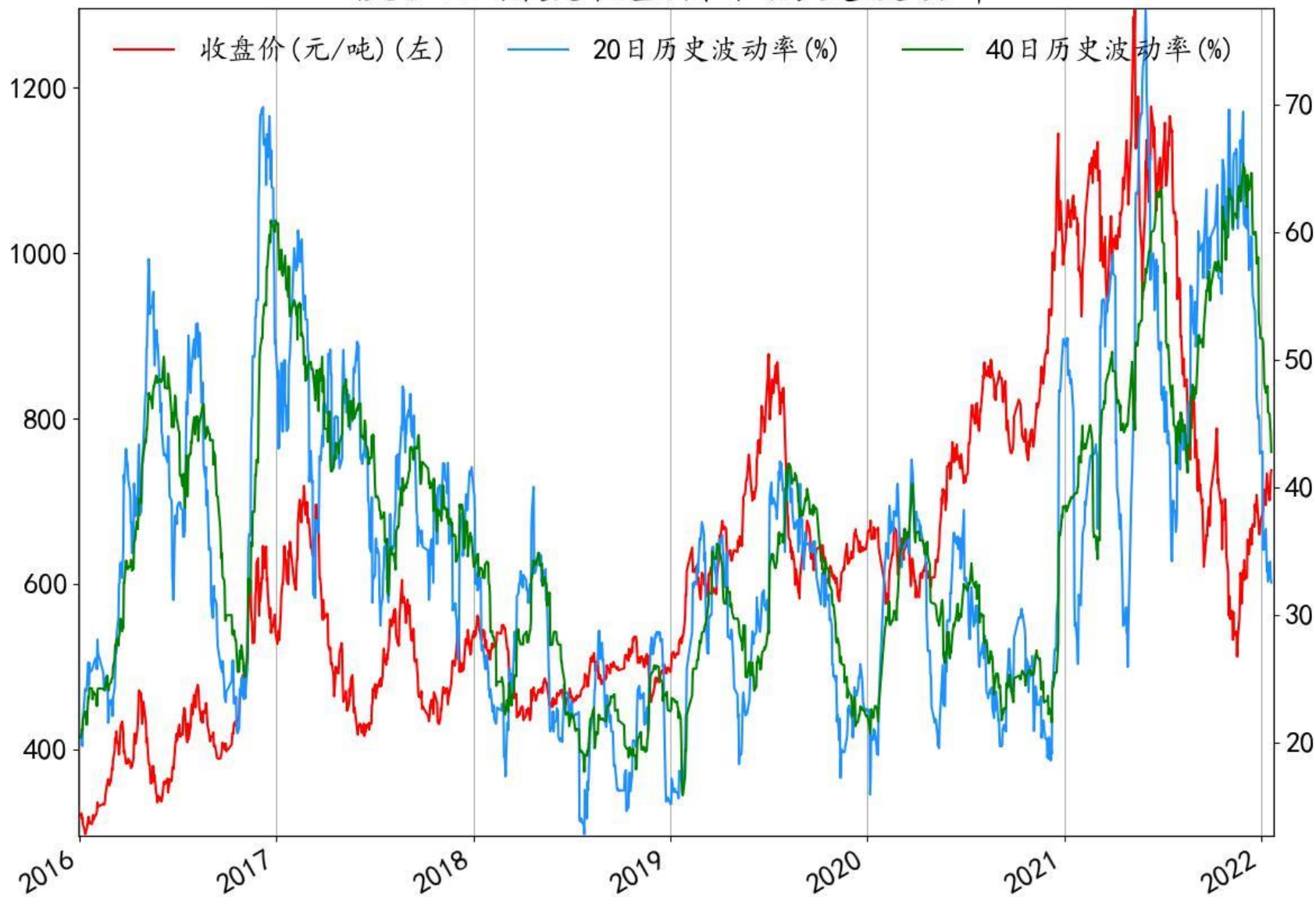
不锈钢指数收盘价和历史波动率



热卷指数收盘价和历史波动率



铁矿石指数收盘价和历史波动率



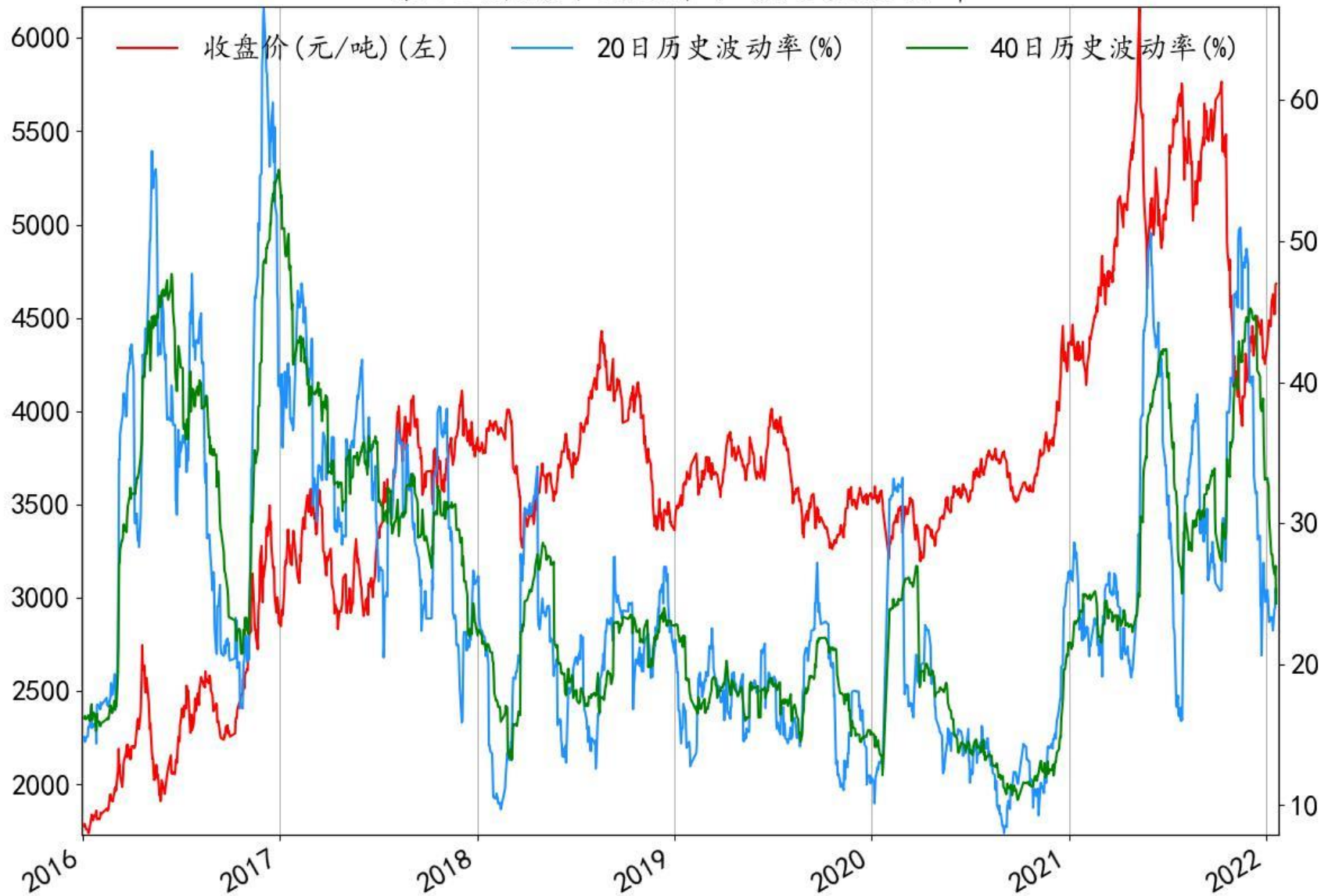
焦炭指数收盘价和历史波动率



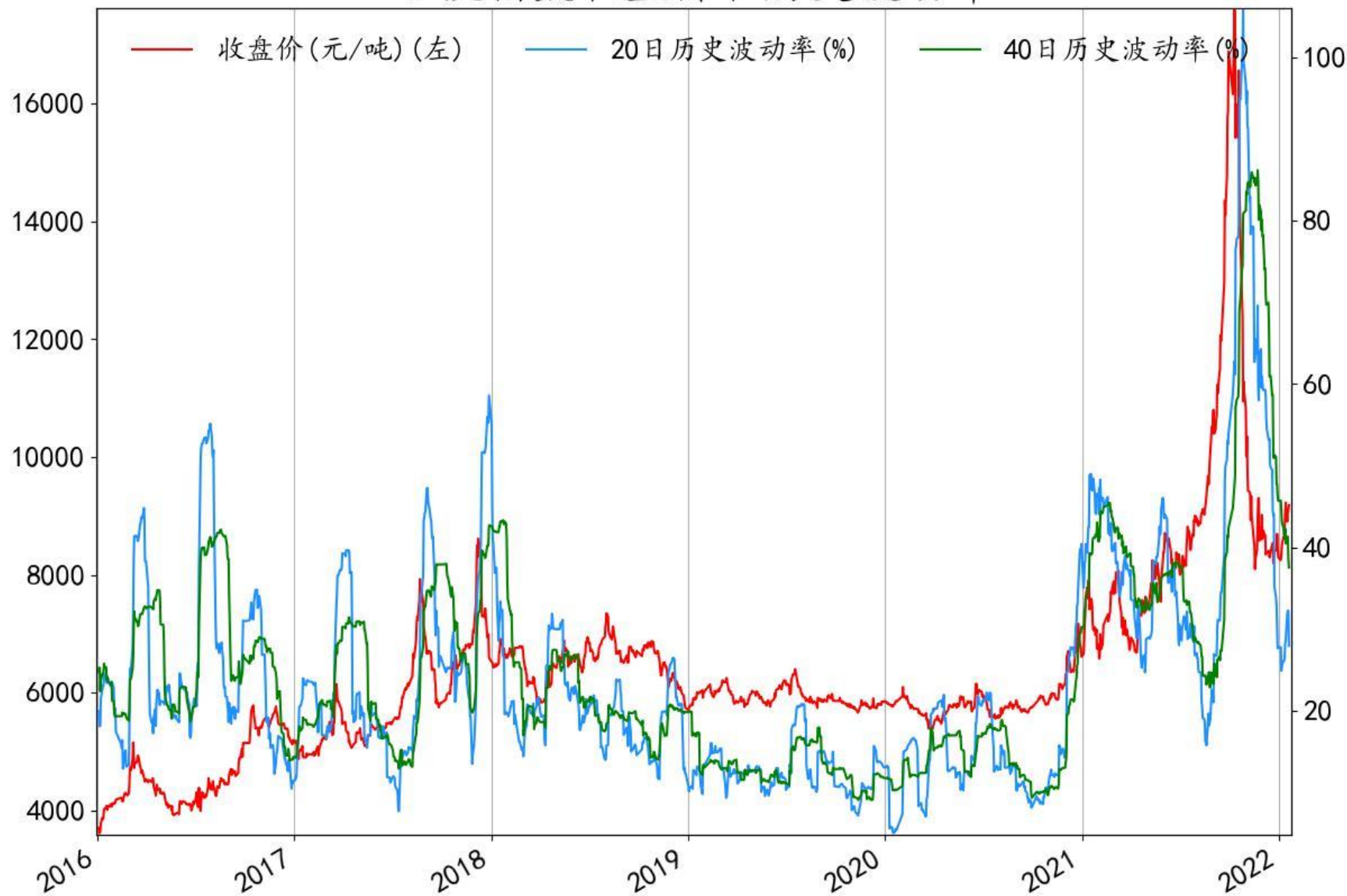
焦煤指数收盘价和历史波动率



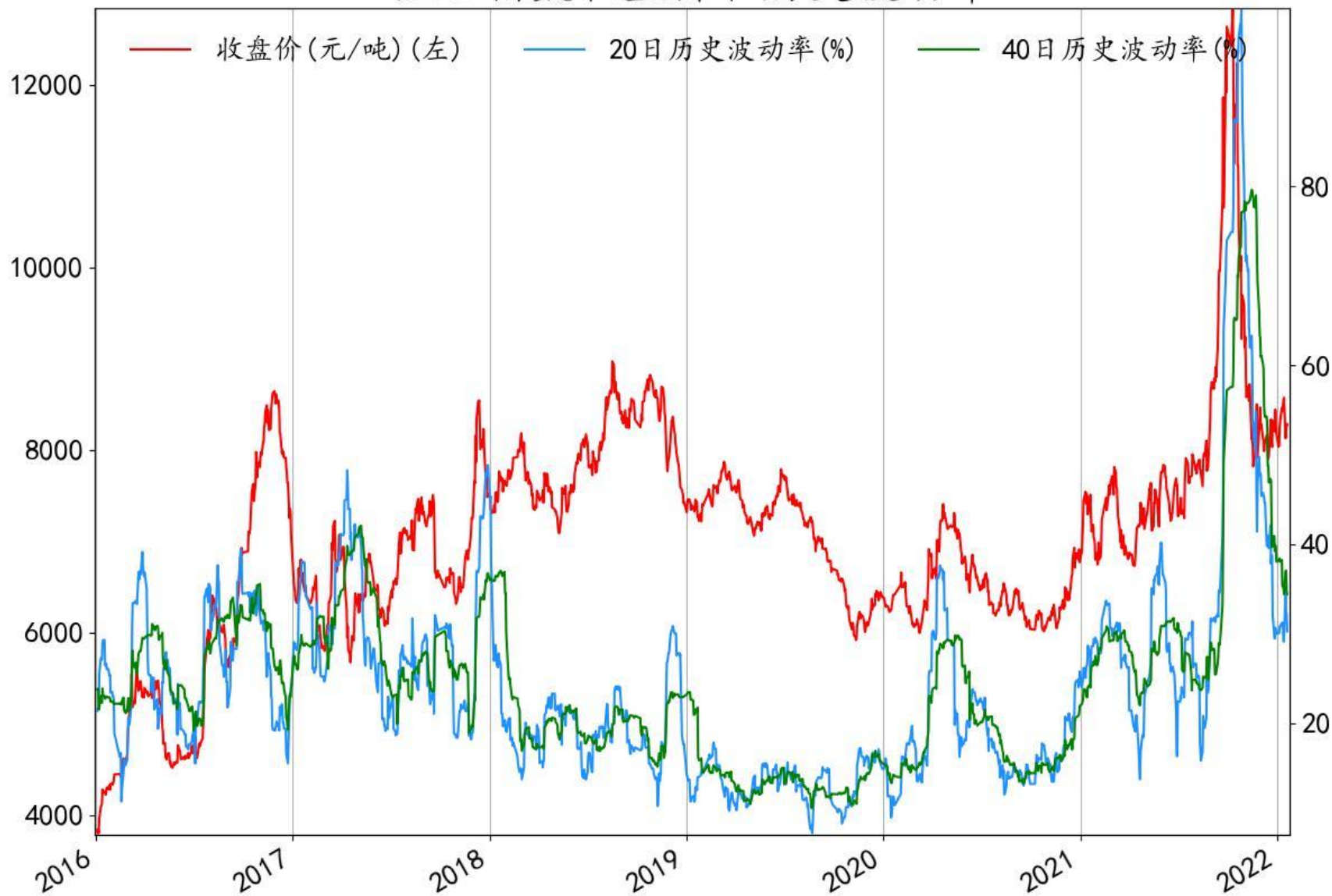
螺纹指数收盘价和历史波动率



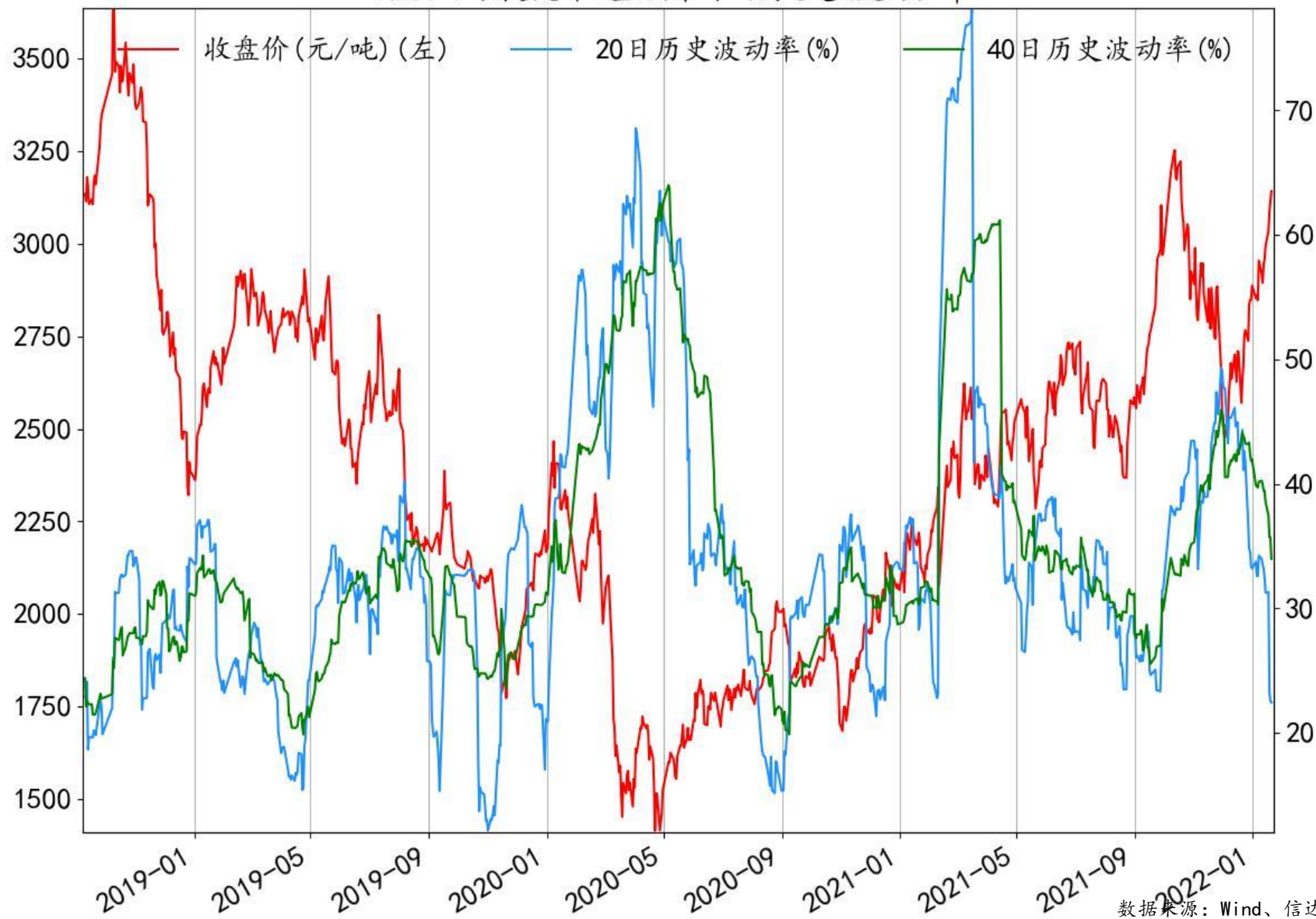
硅铁指数收盘价和历史波动率



锰硅指数收盘价和历史波动率

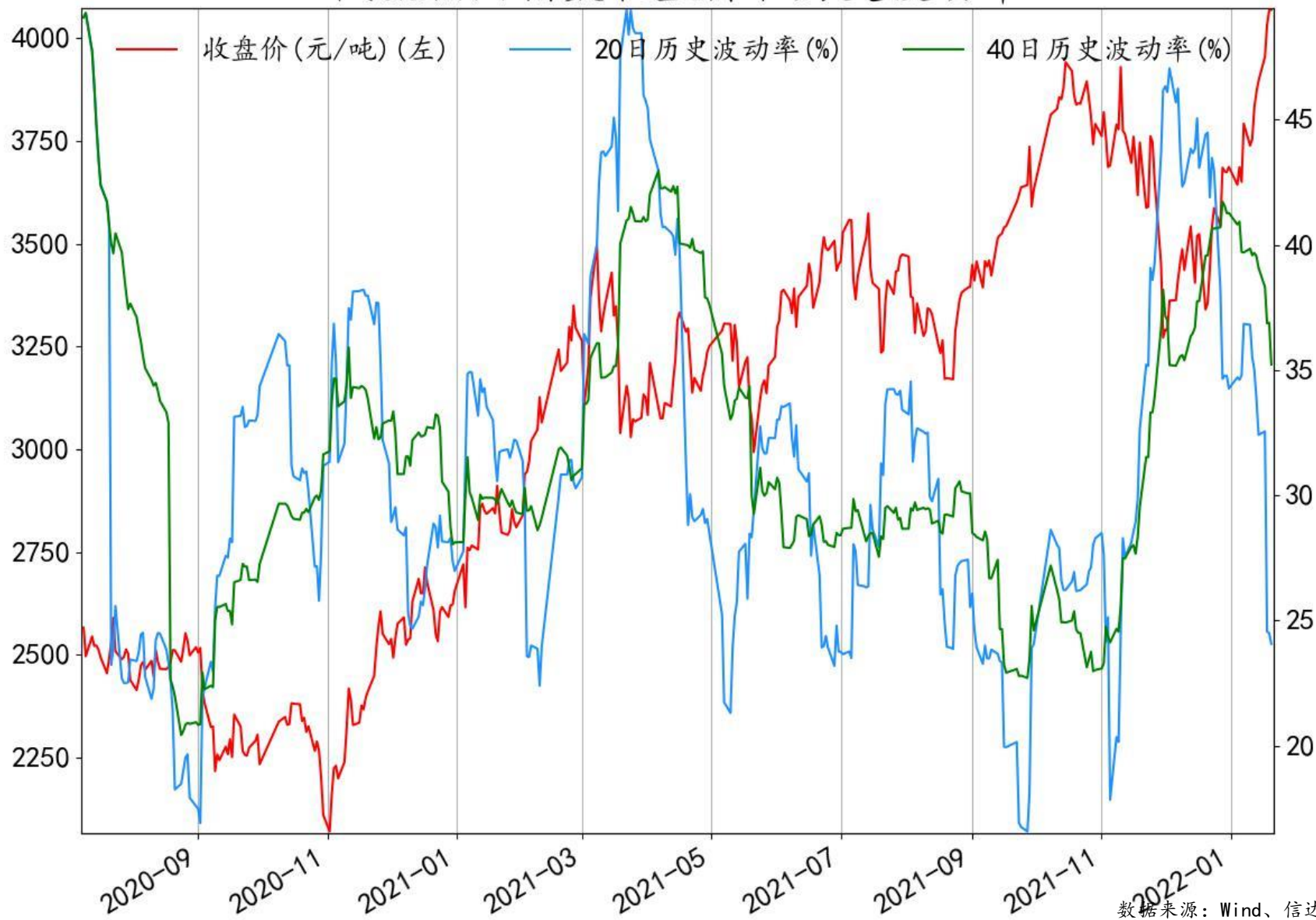


燃油指数收盘价和历史波动率

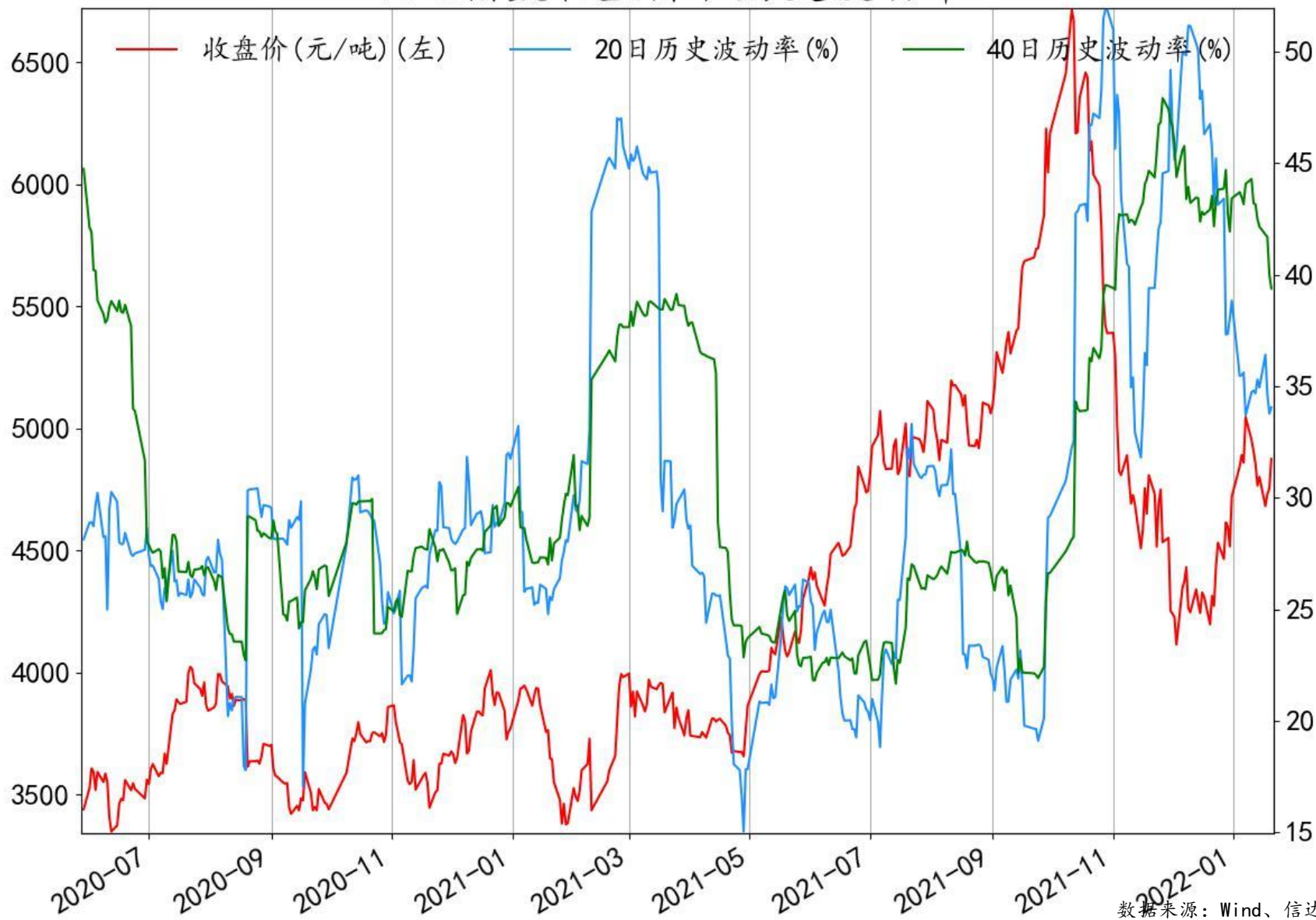


低硫燃油指数

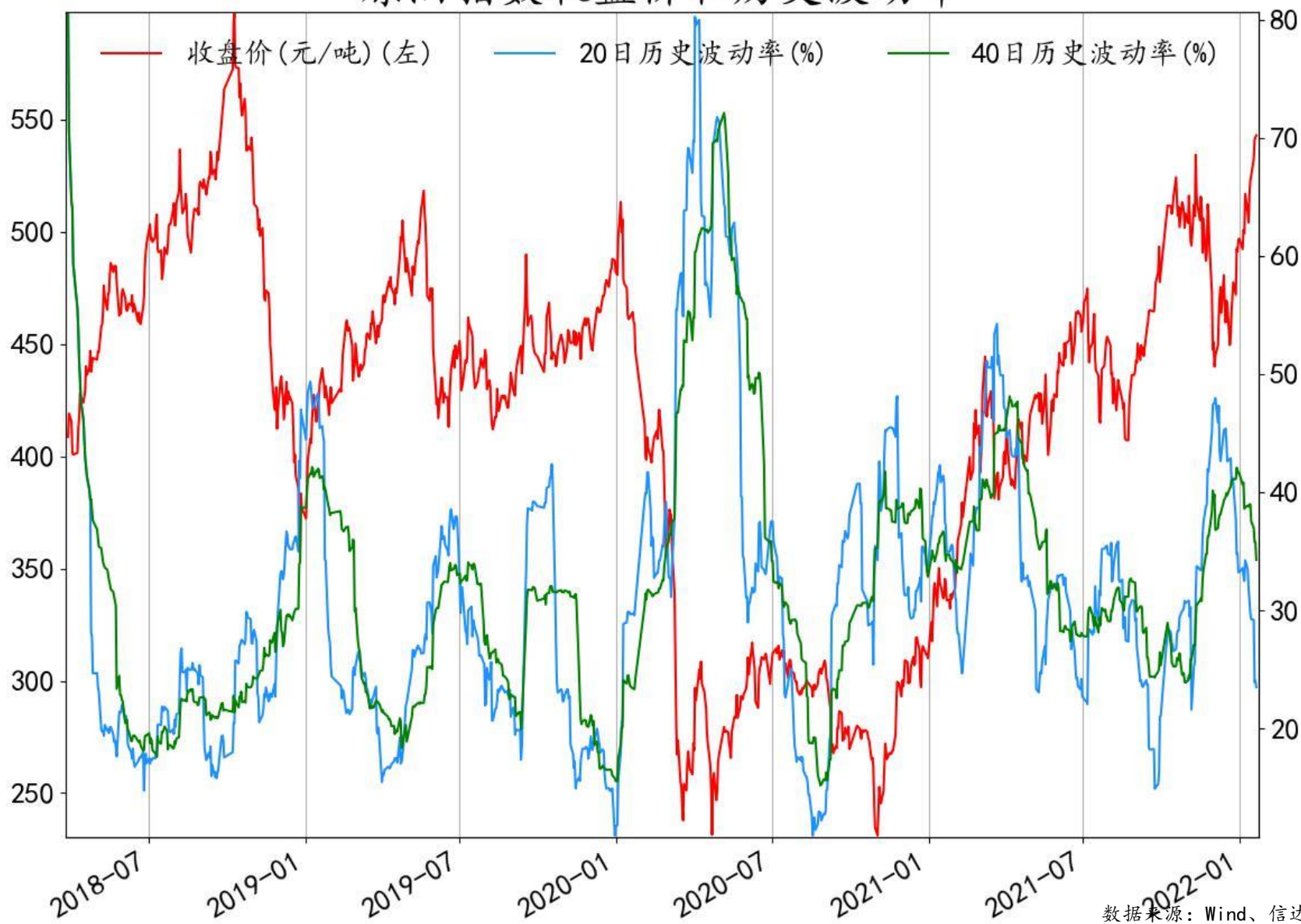
低硫燃油指数收盘价和历史波动率



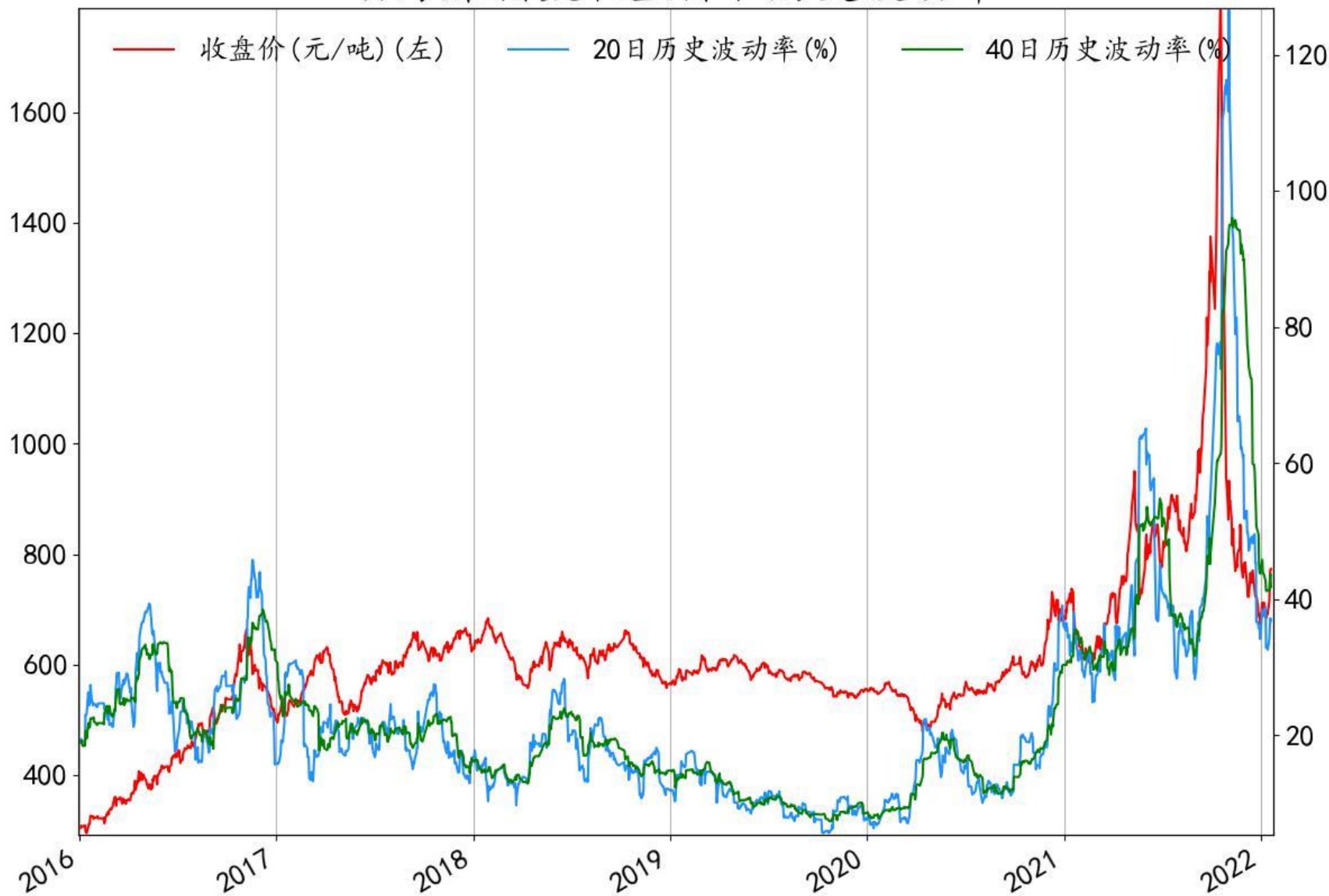
LPG指数收盘价和历史波动率



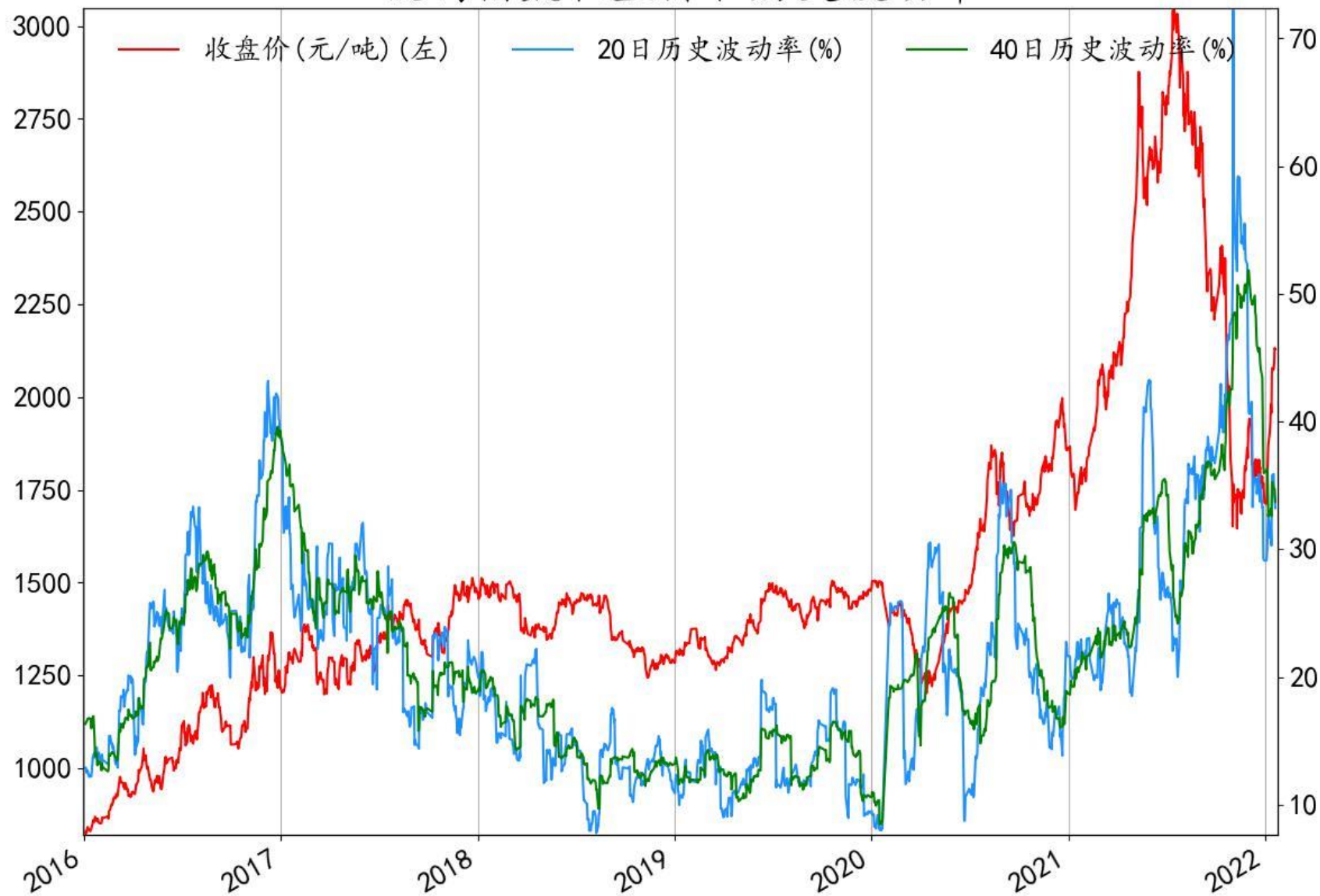
原油指数收盘价和历史波动率



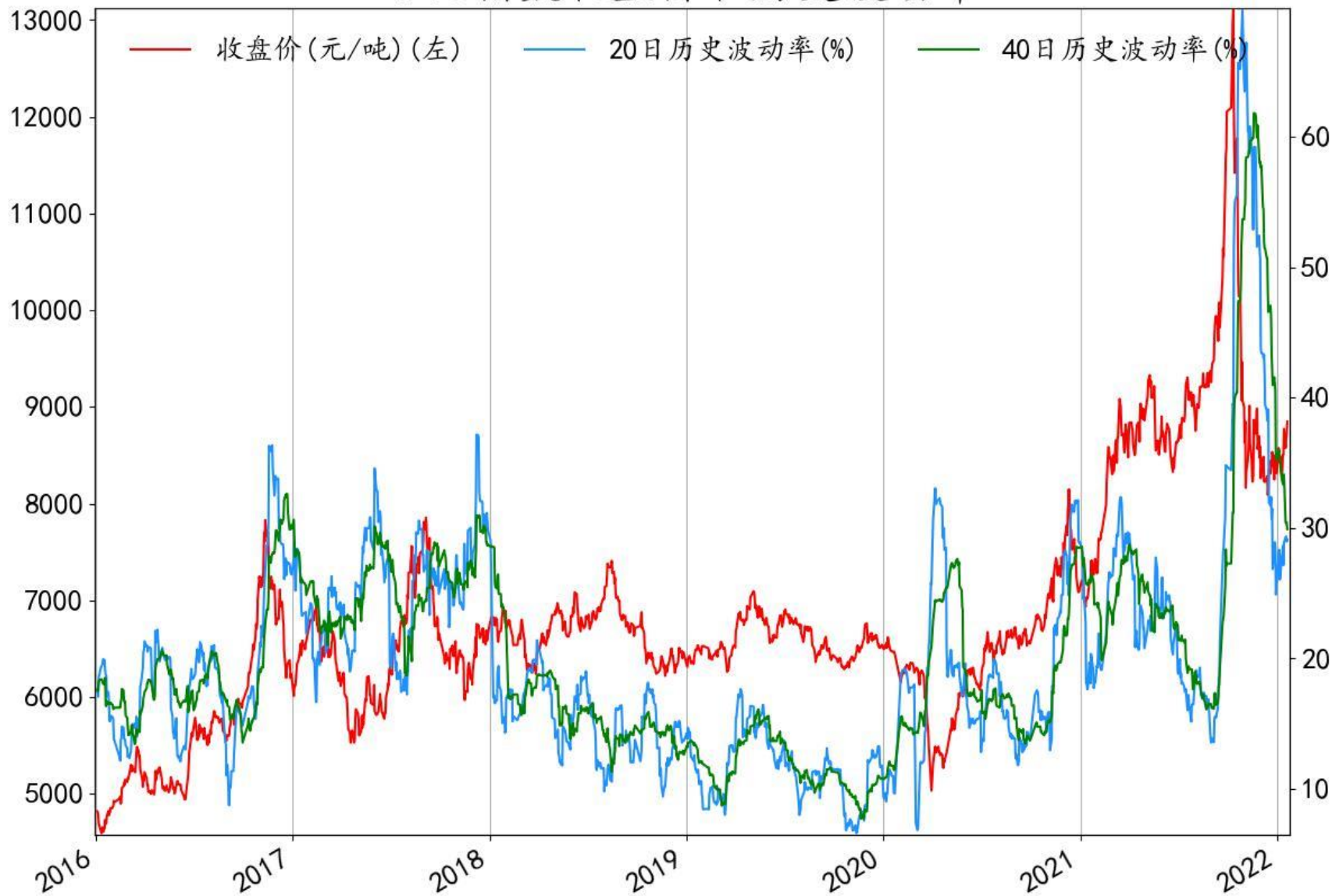
动力煤指数收盘价和历史波动率



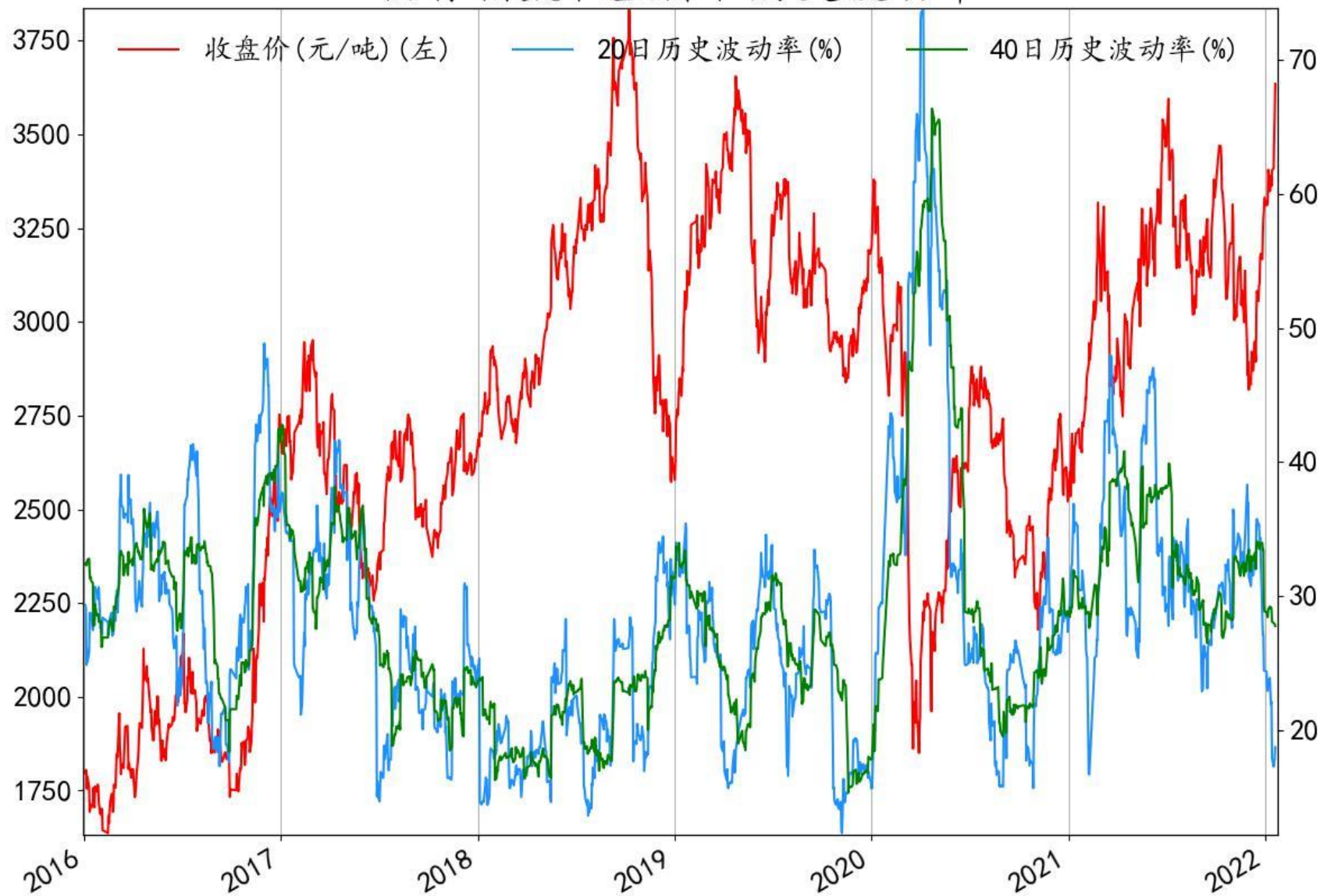
玻璃指数收盘价和历史波动率



PVC指数收盘价和历史波动率



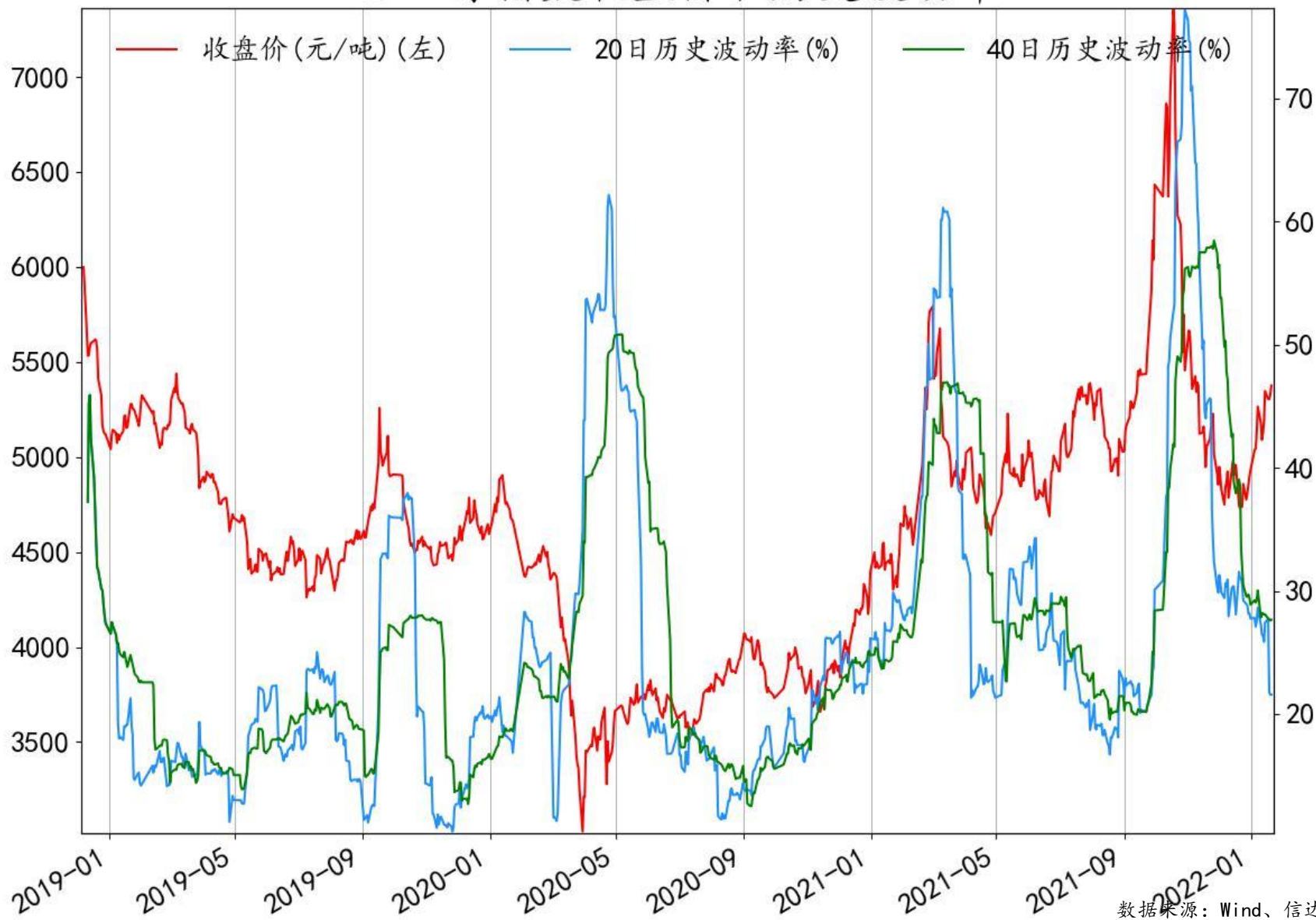
沥青指数收盘价和历史波动率



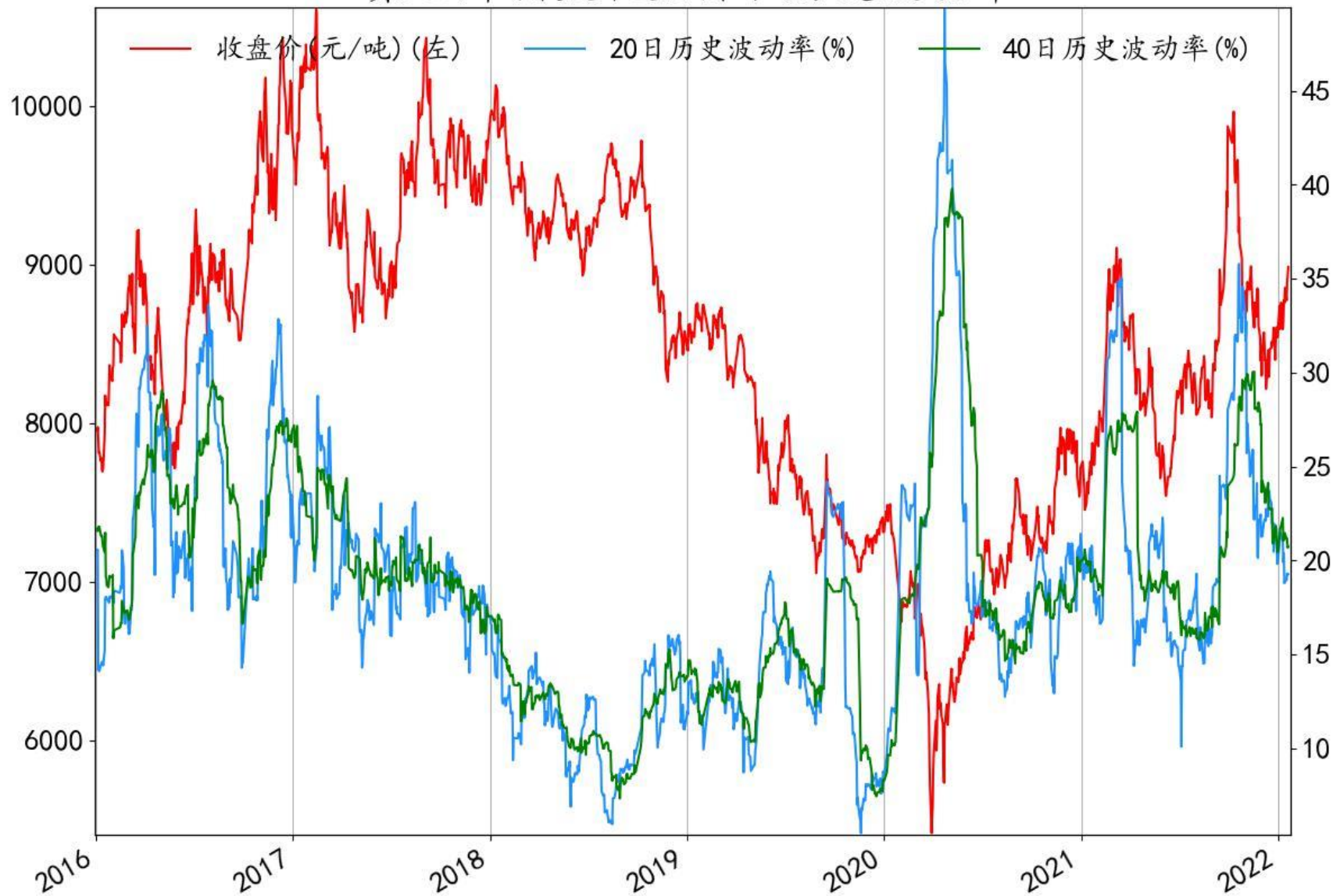
苯乙烯指数收盘价和历史波动率



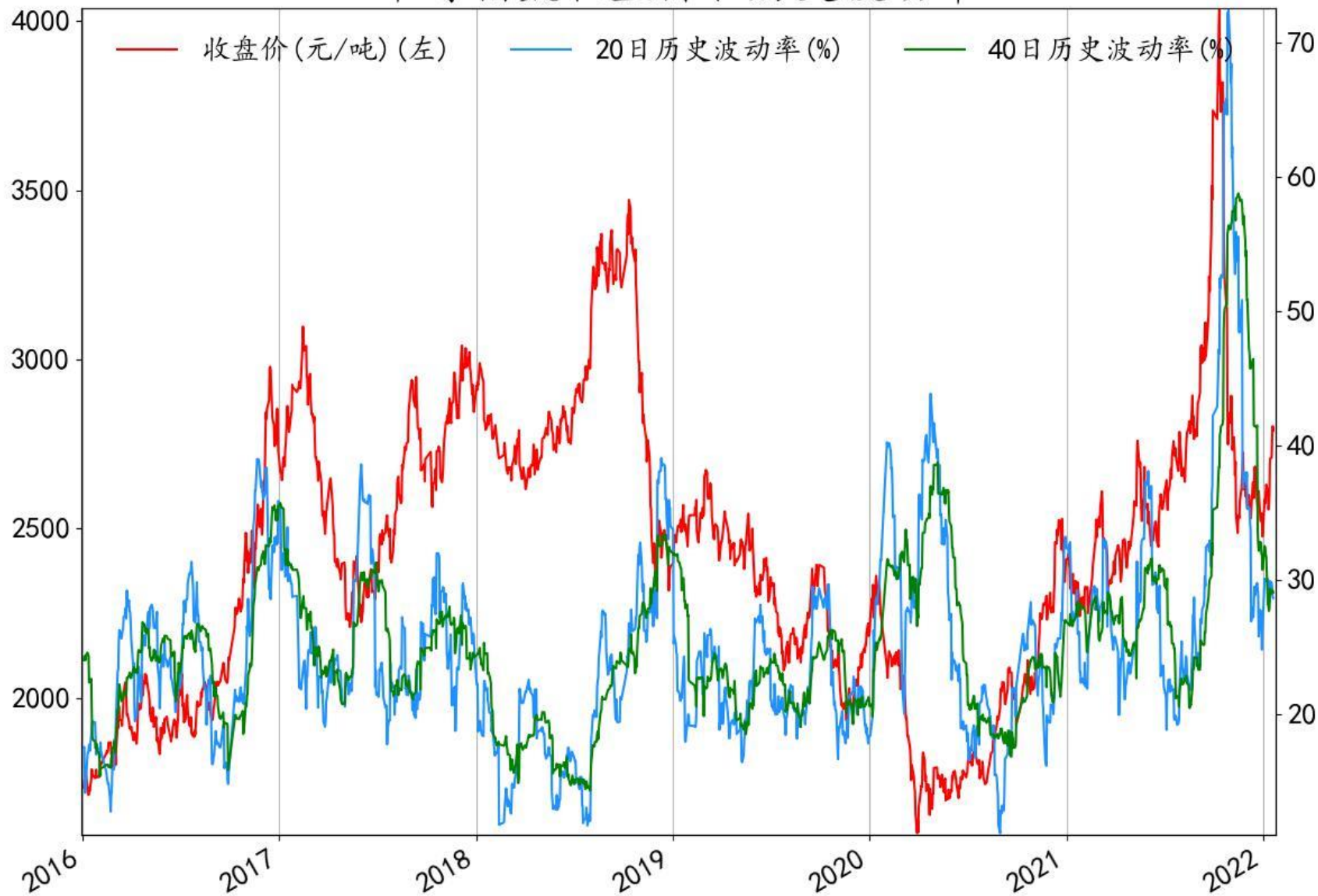
乙二醇指数收盘价和历史波动率



聚乙烯指数收盘价和历史波动率

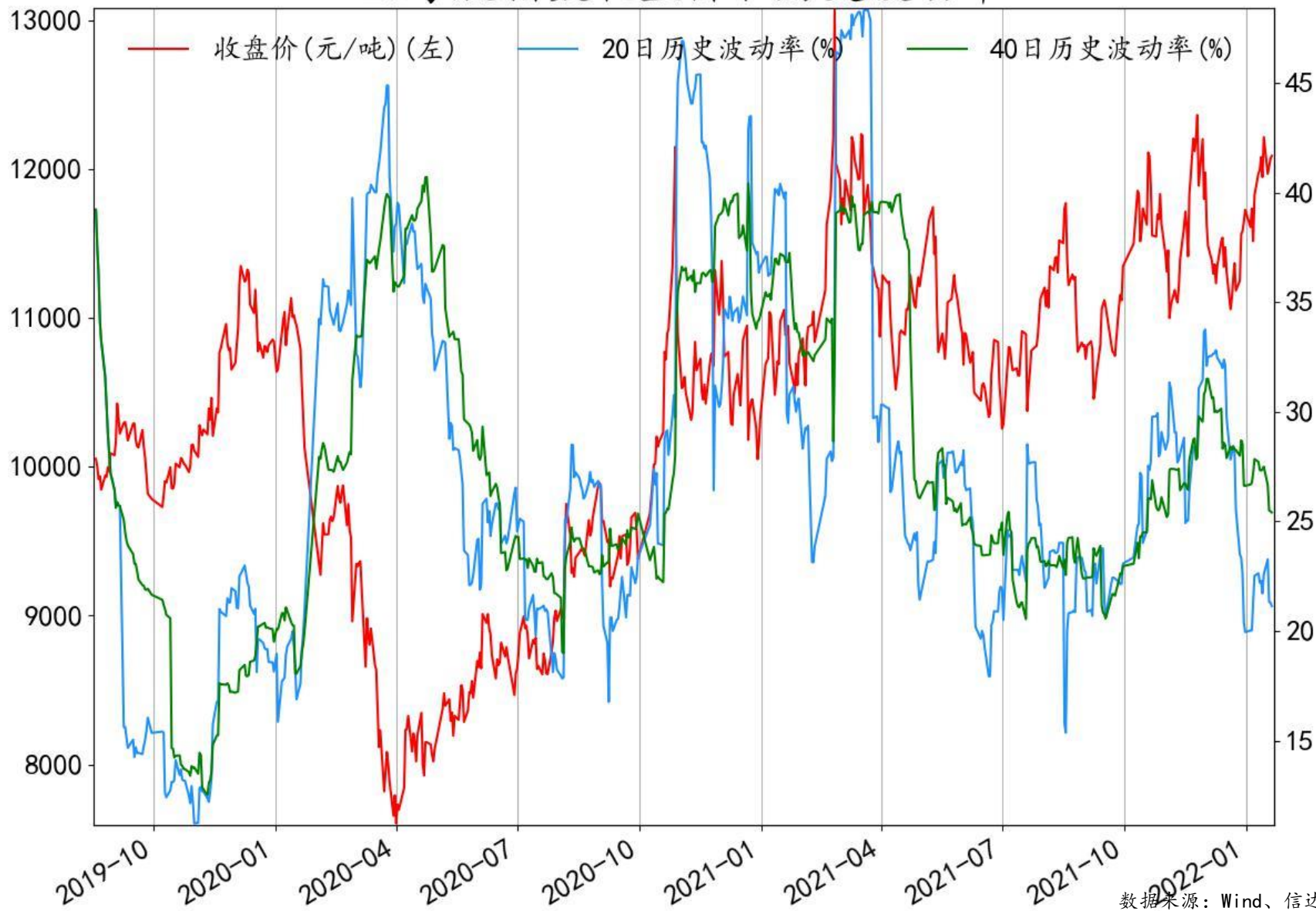


甲醇指数收盘价和历史波动率

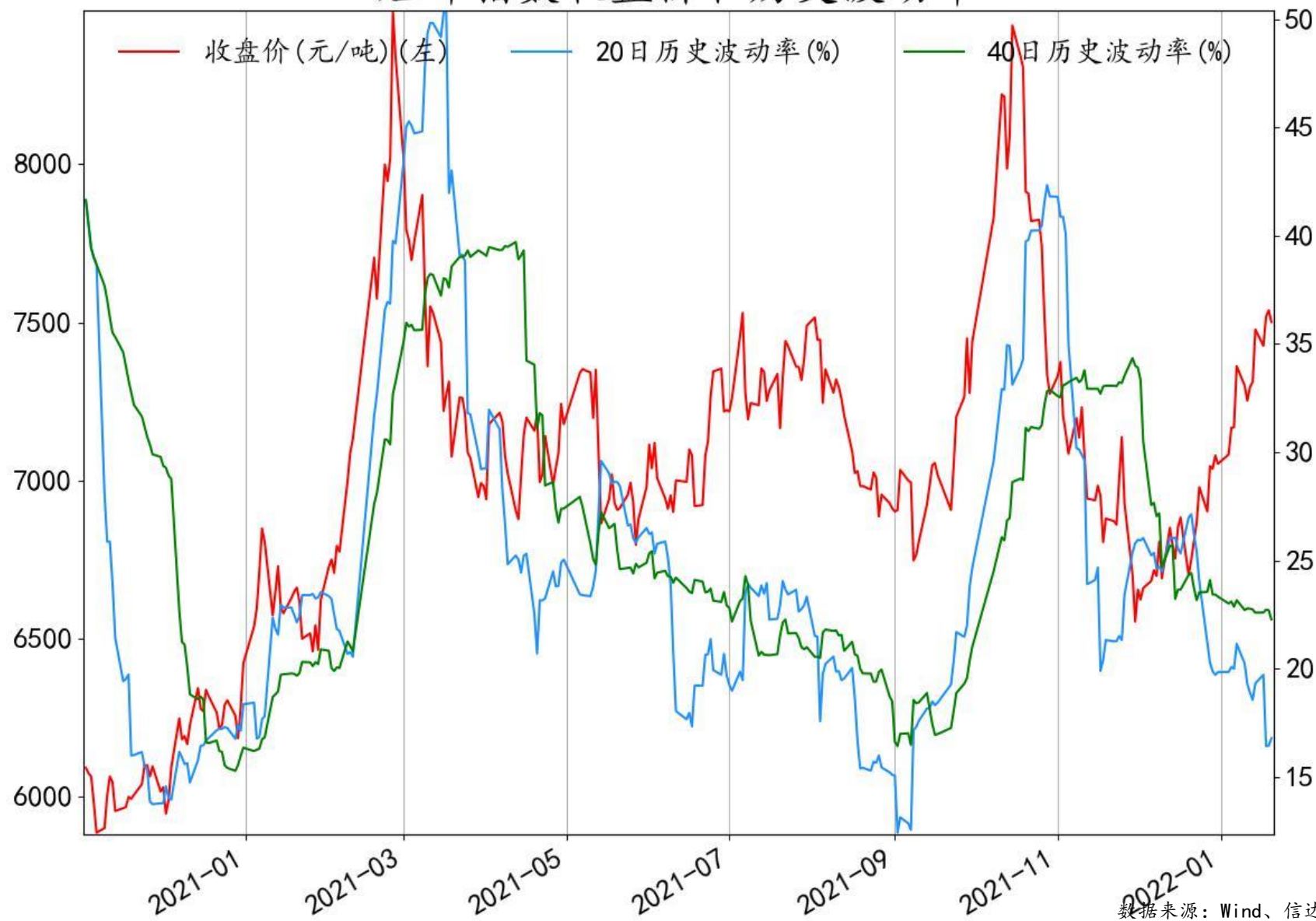


20号胶指数

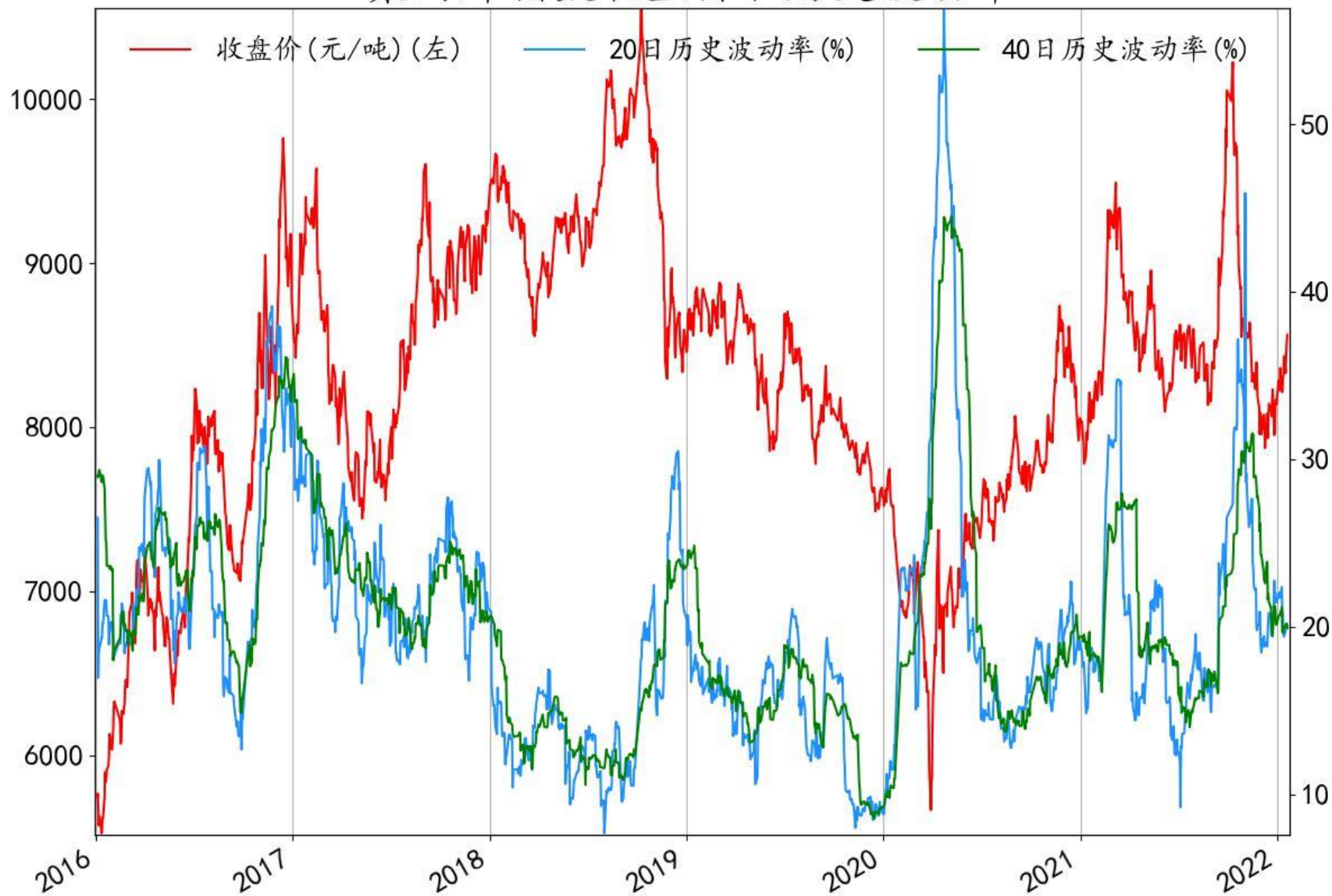
20号胶指数收盘价和历史波动率



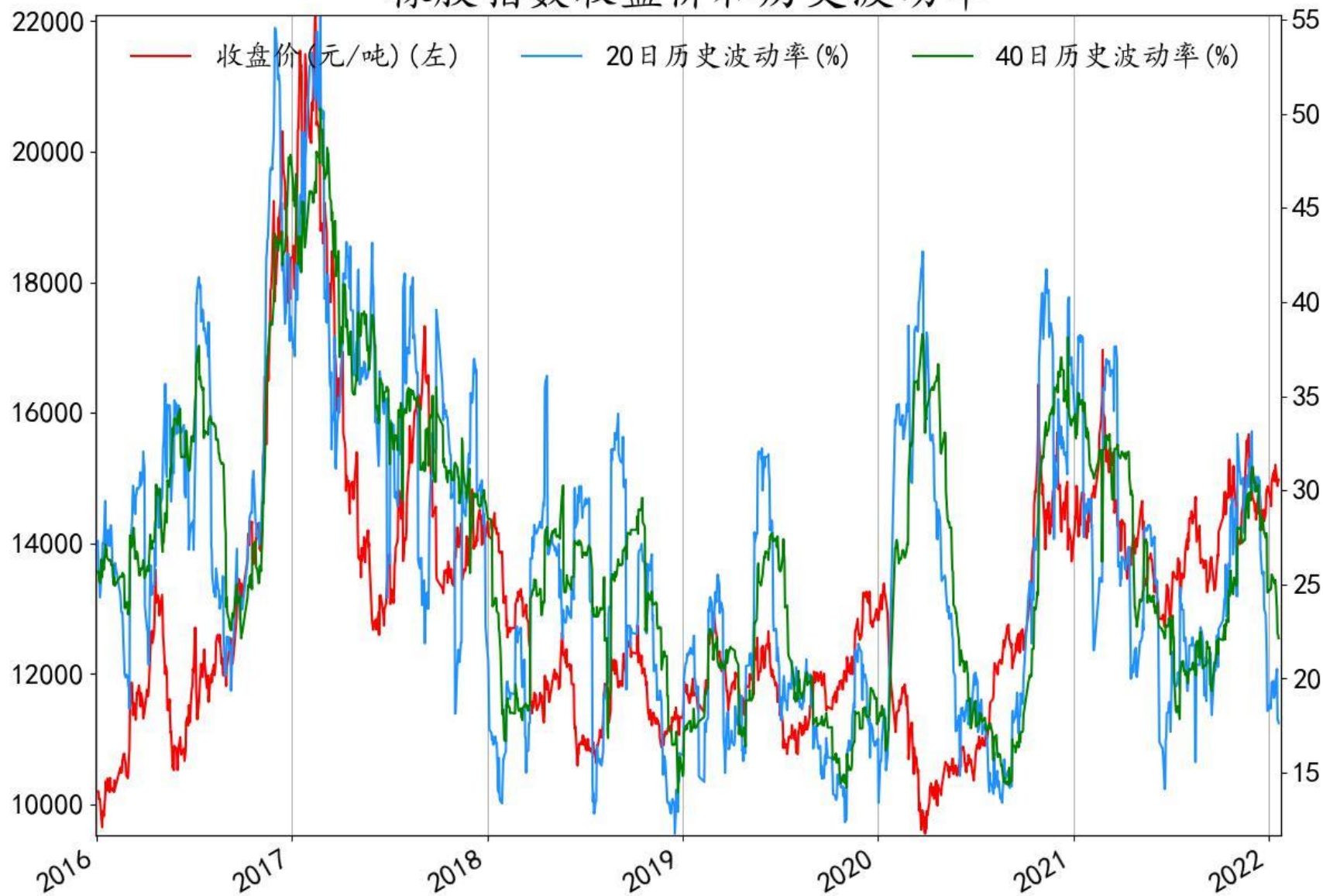
短纤指数收盘价和历史波动率



聚丙烯指数收盘价和历史波动率



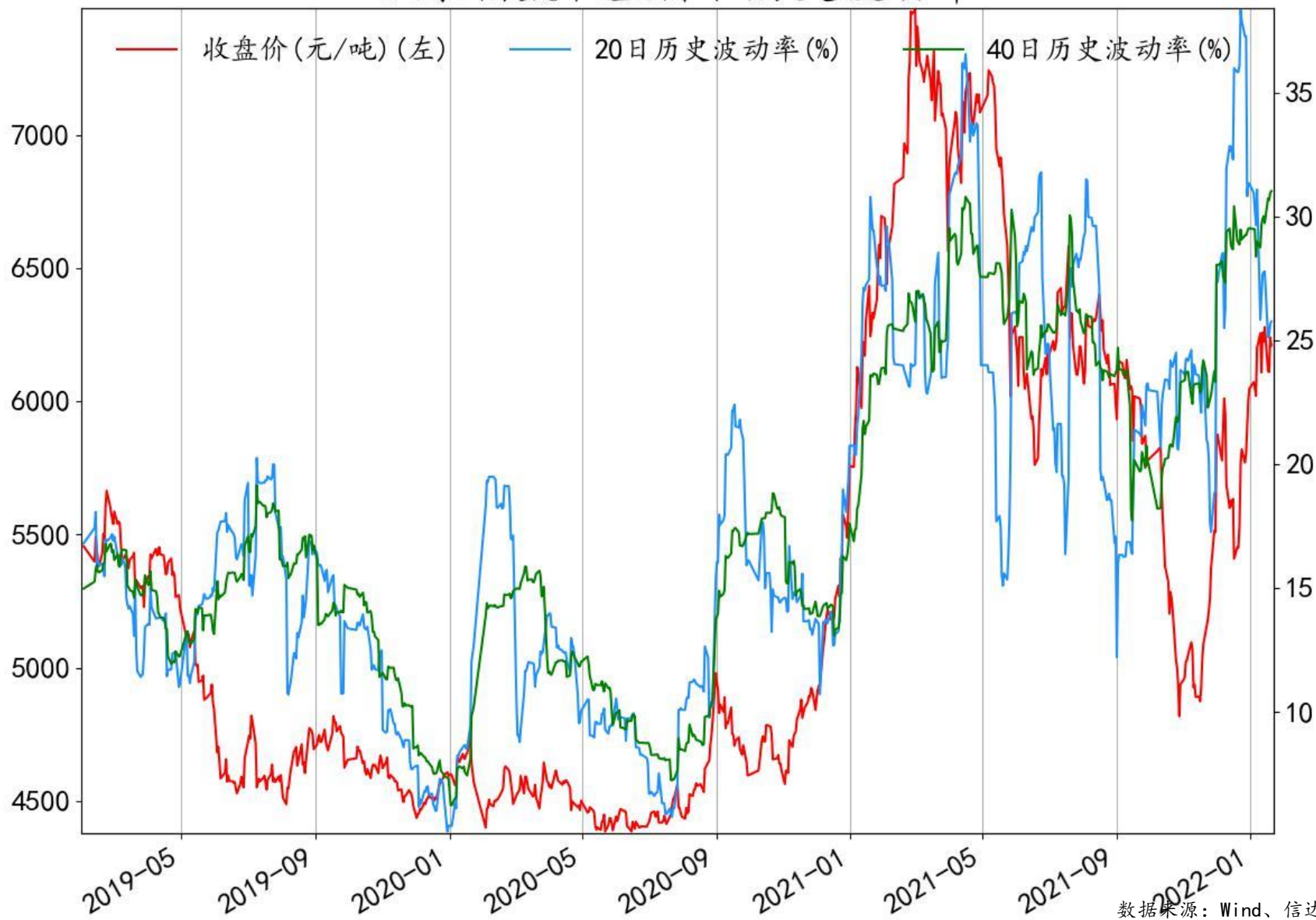
橡胶指数收盘价和历史波动率



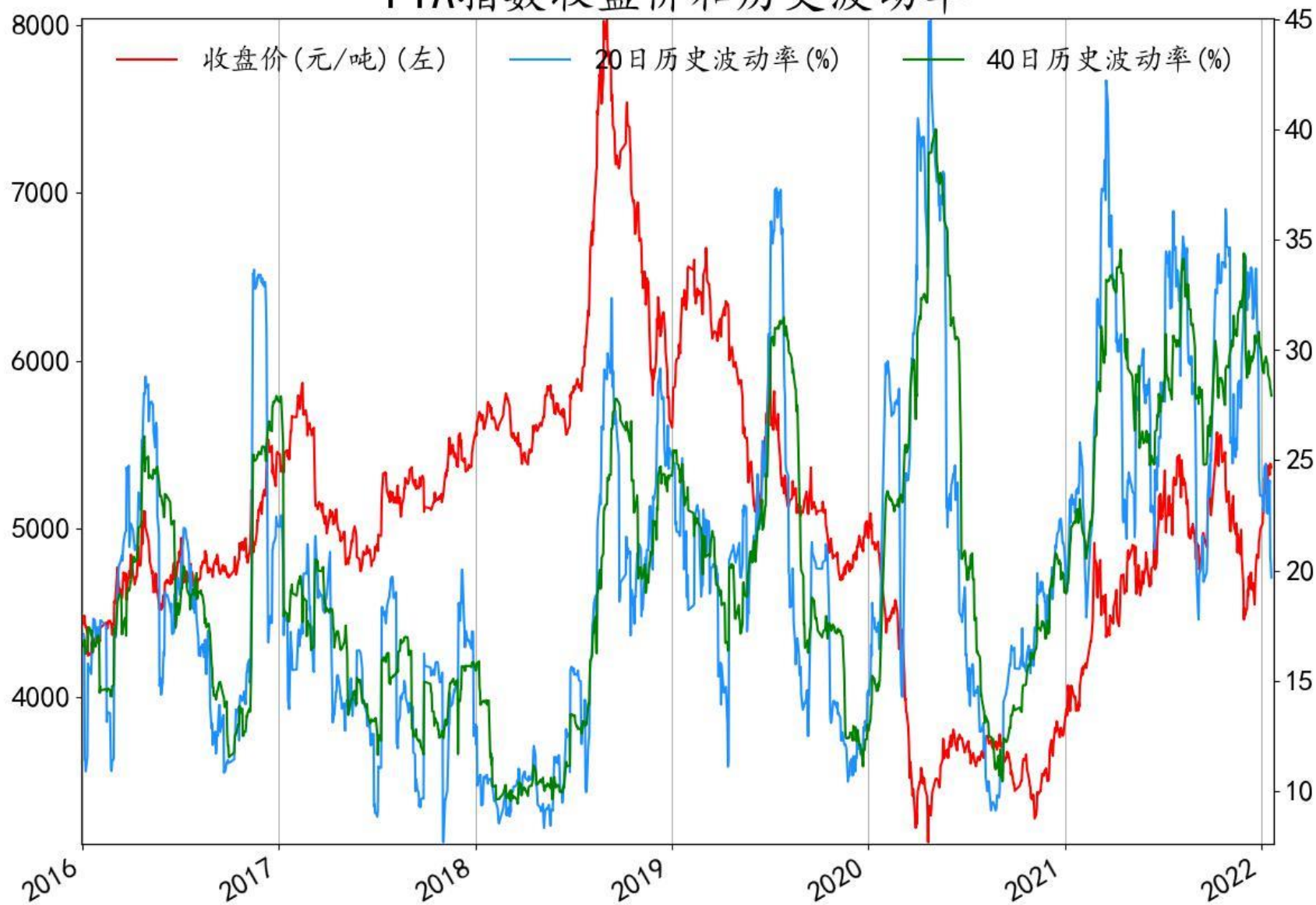
纯碱指数收盘价和历史波动率



纸浆指数收盘价和历史波动率



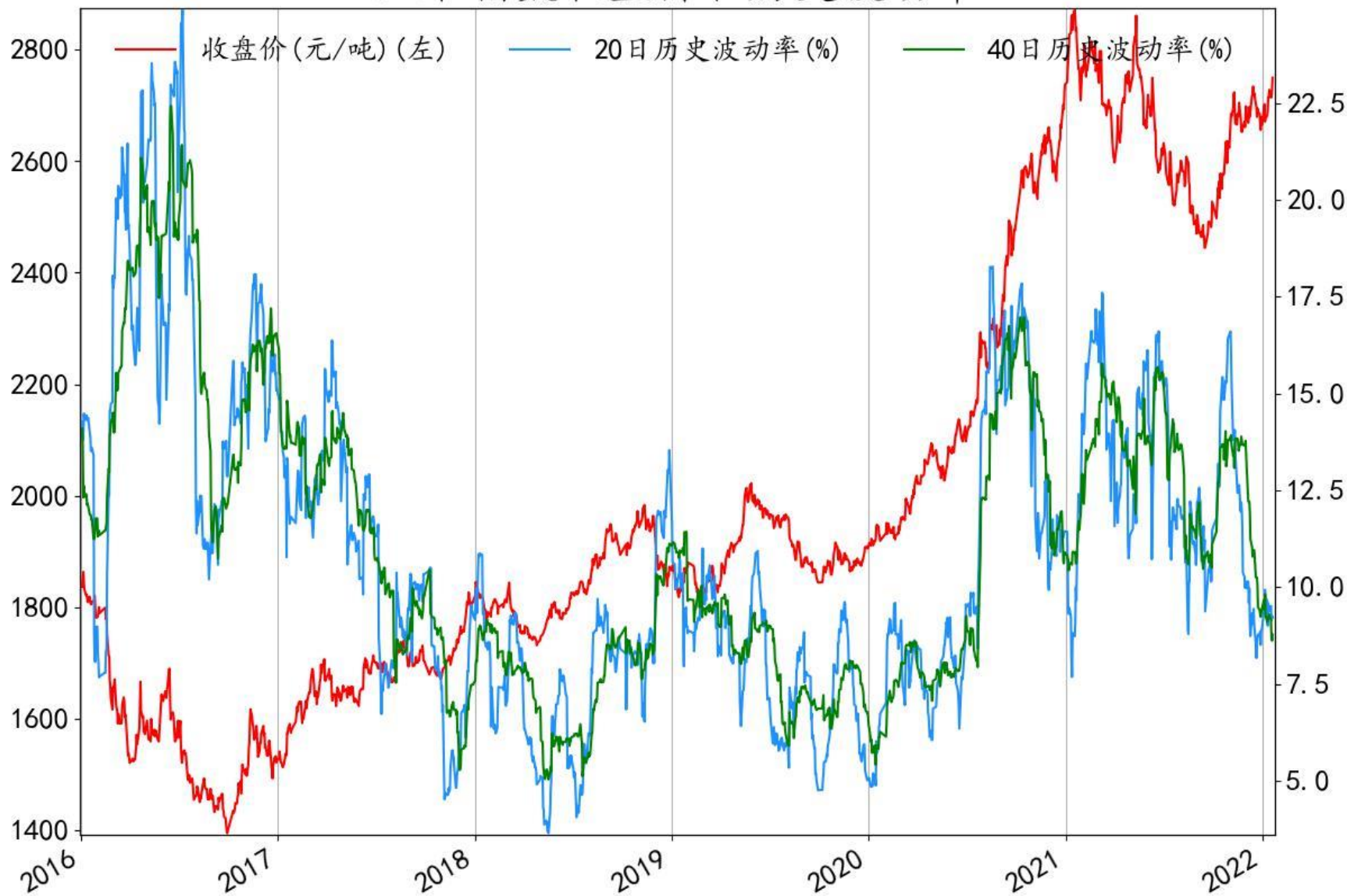
PTA指数收盘价和历史波动率



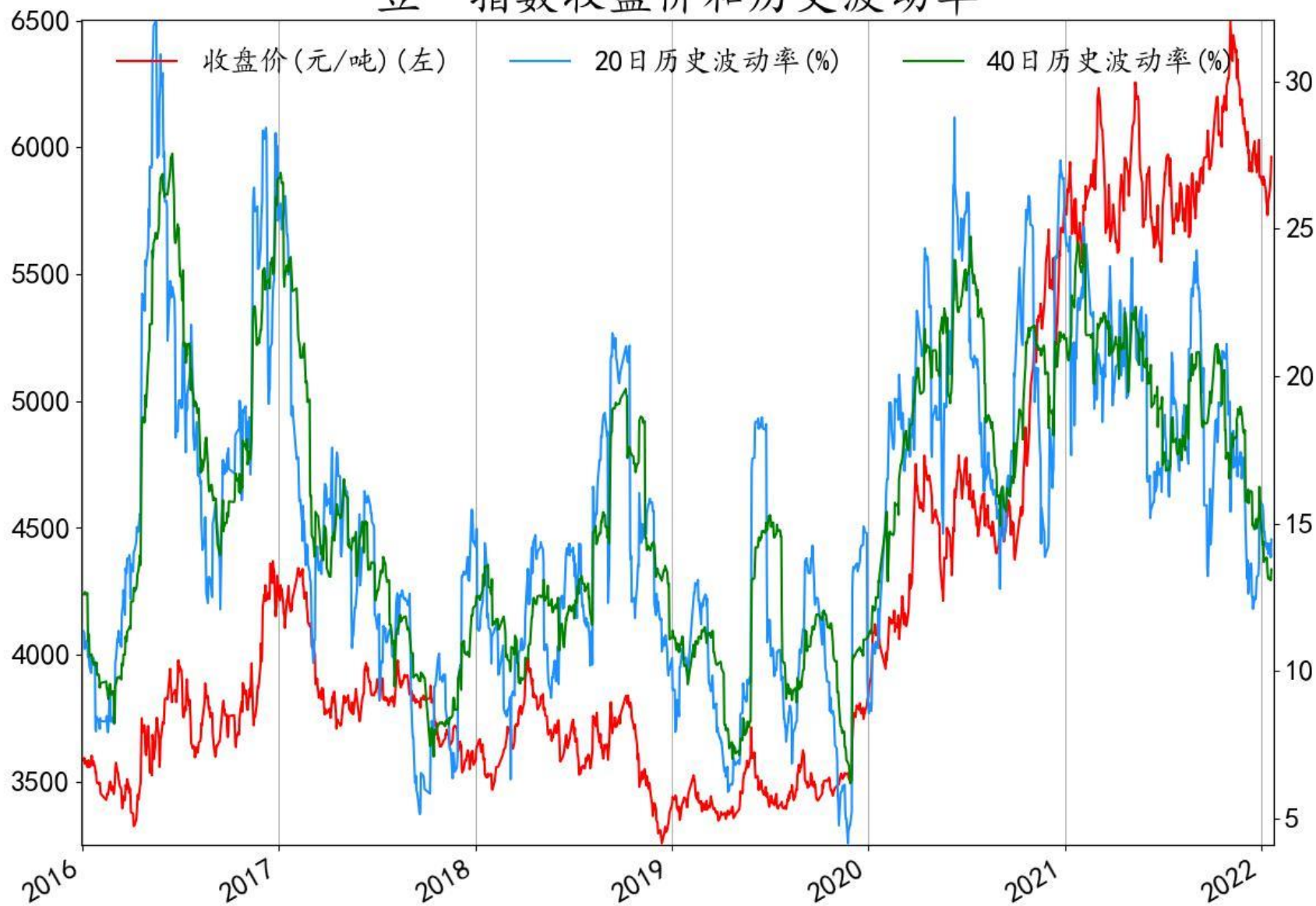
尿素指数收盘价和历史波动率



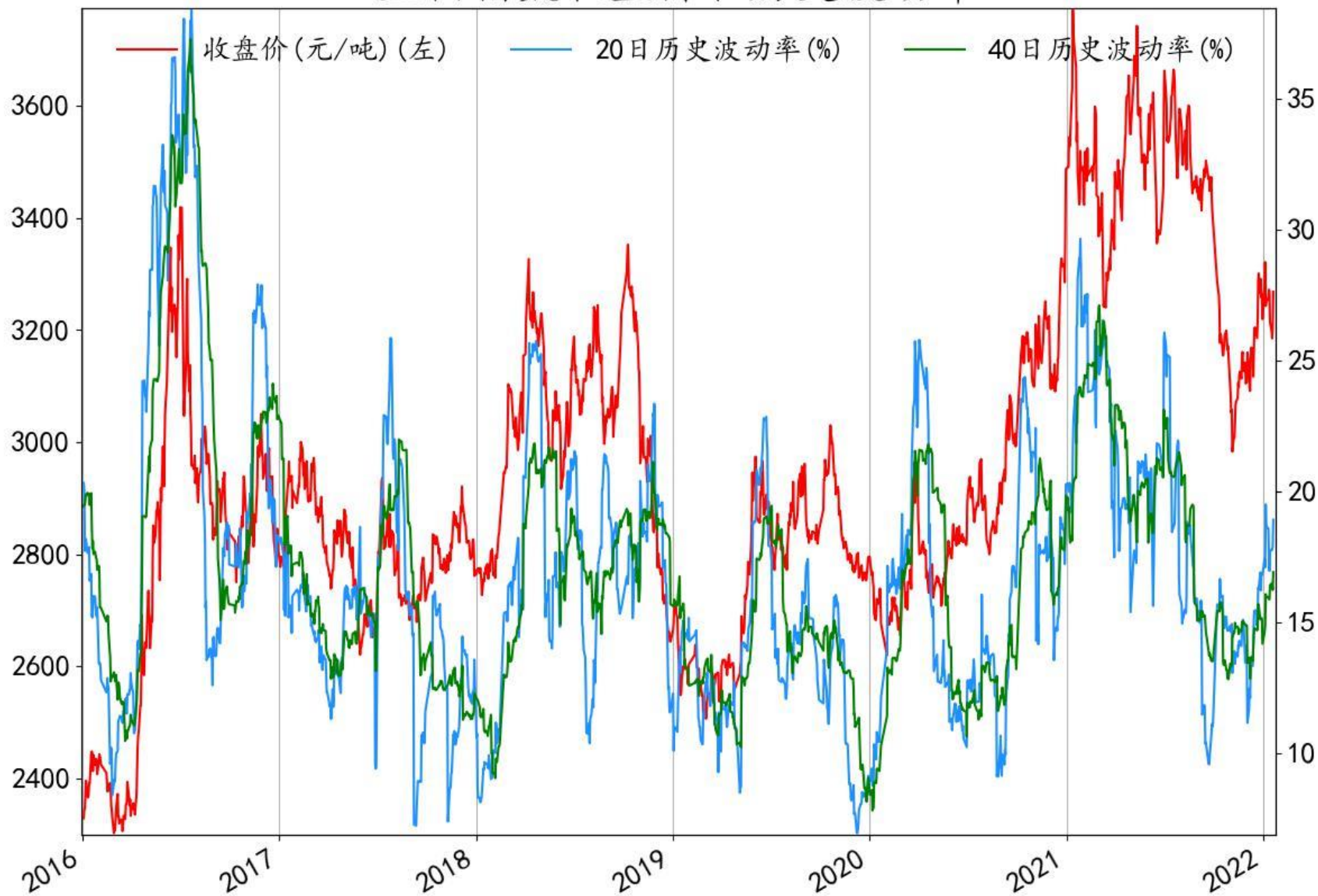
玉米指数收盘价和历史波动率



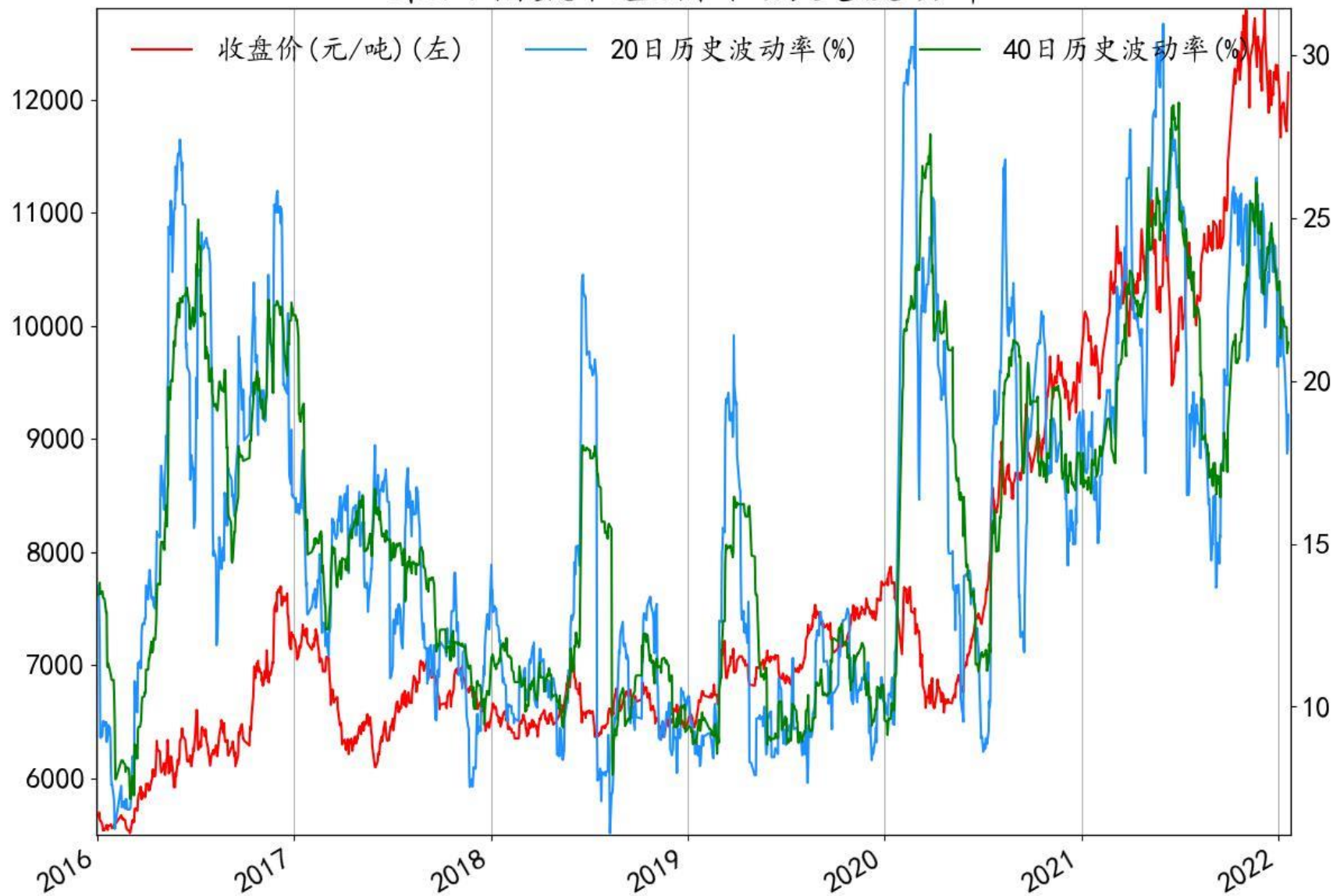
豆一指数收盘价和历史波动率



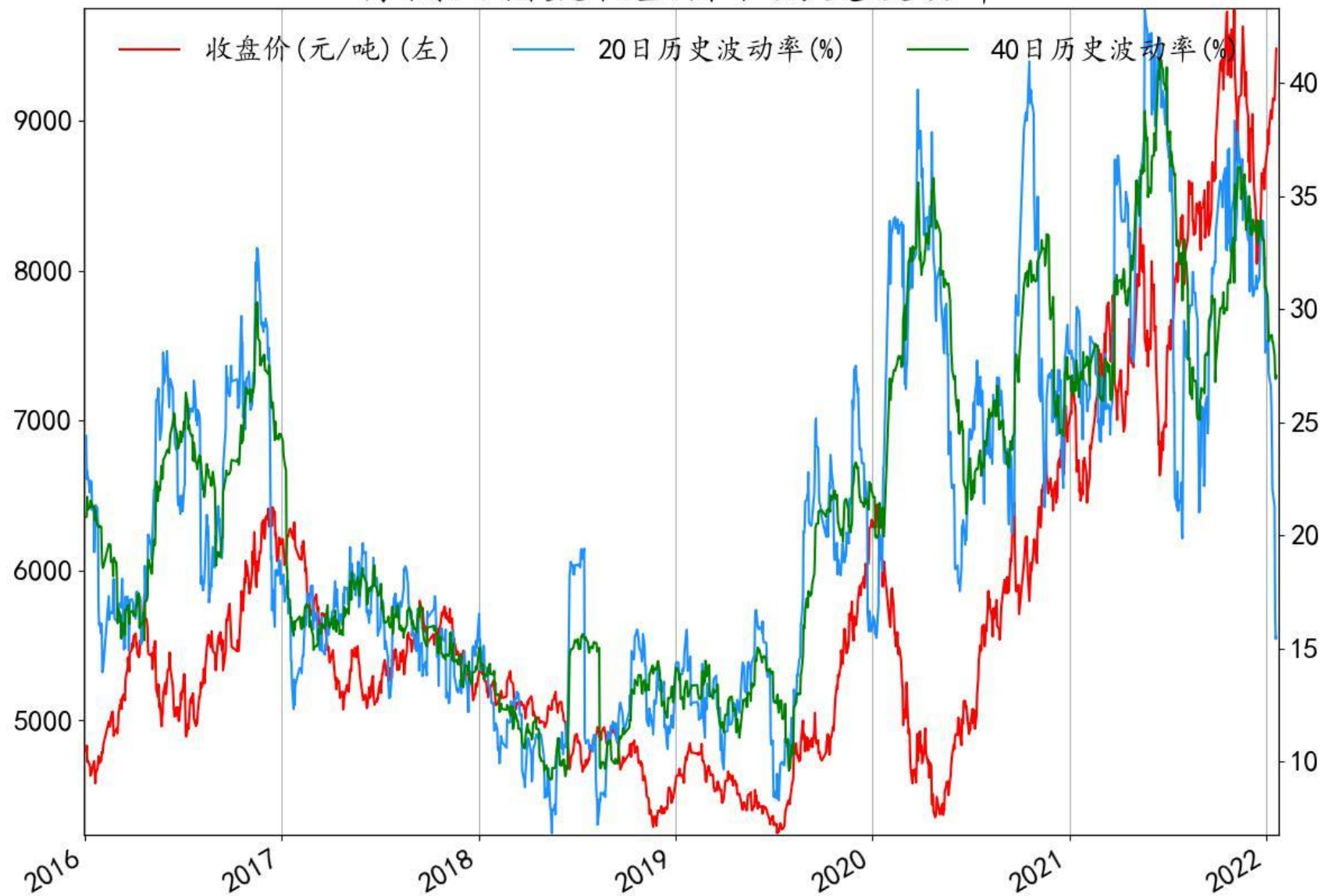
豆粕指数收盘价和历史波动率



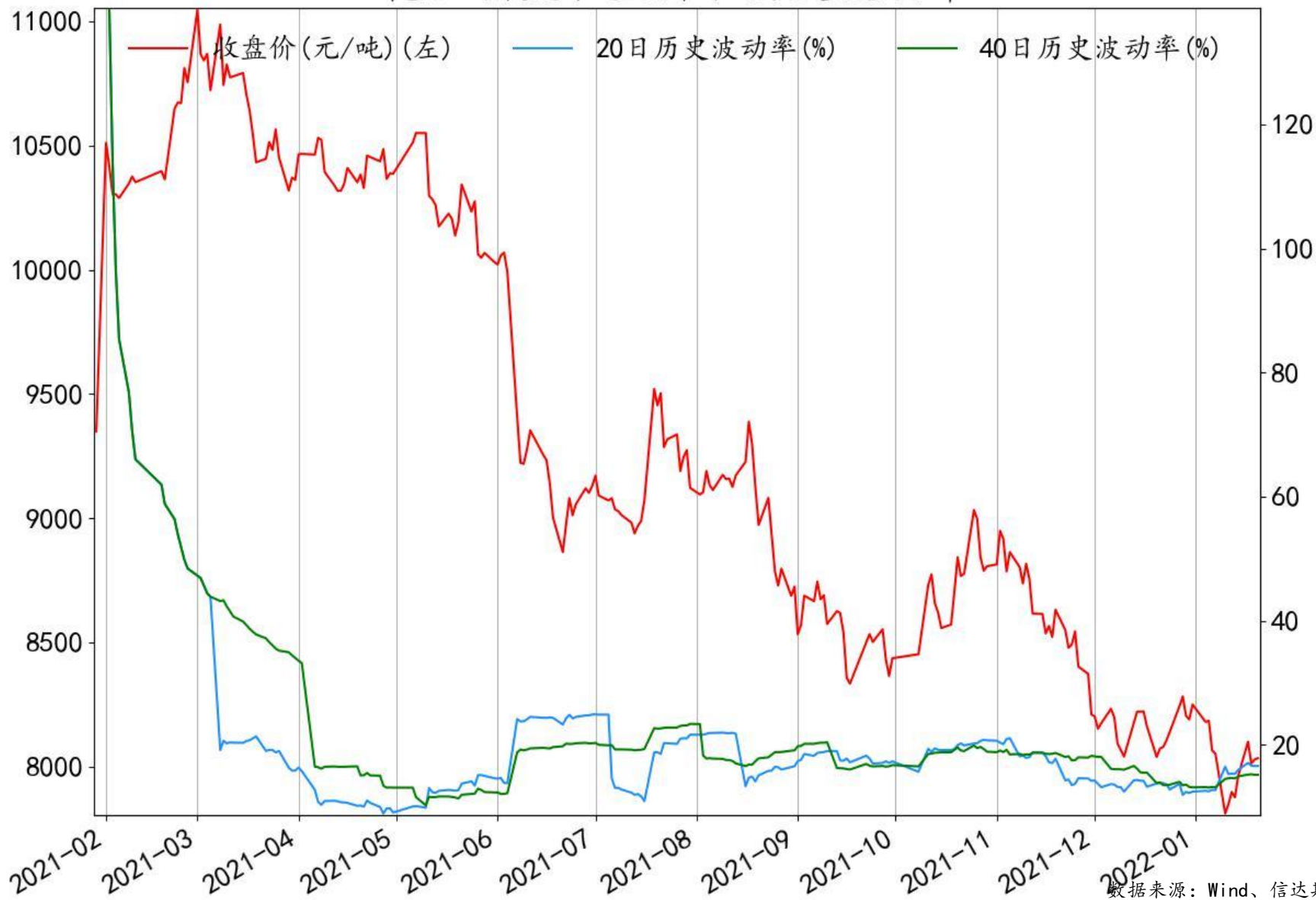
菜油指数收盘价和历史波动率



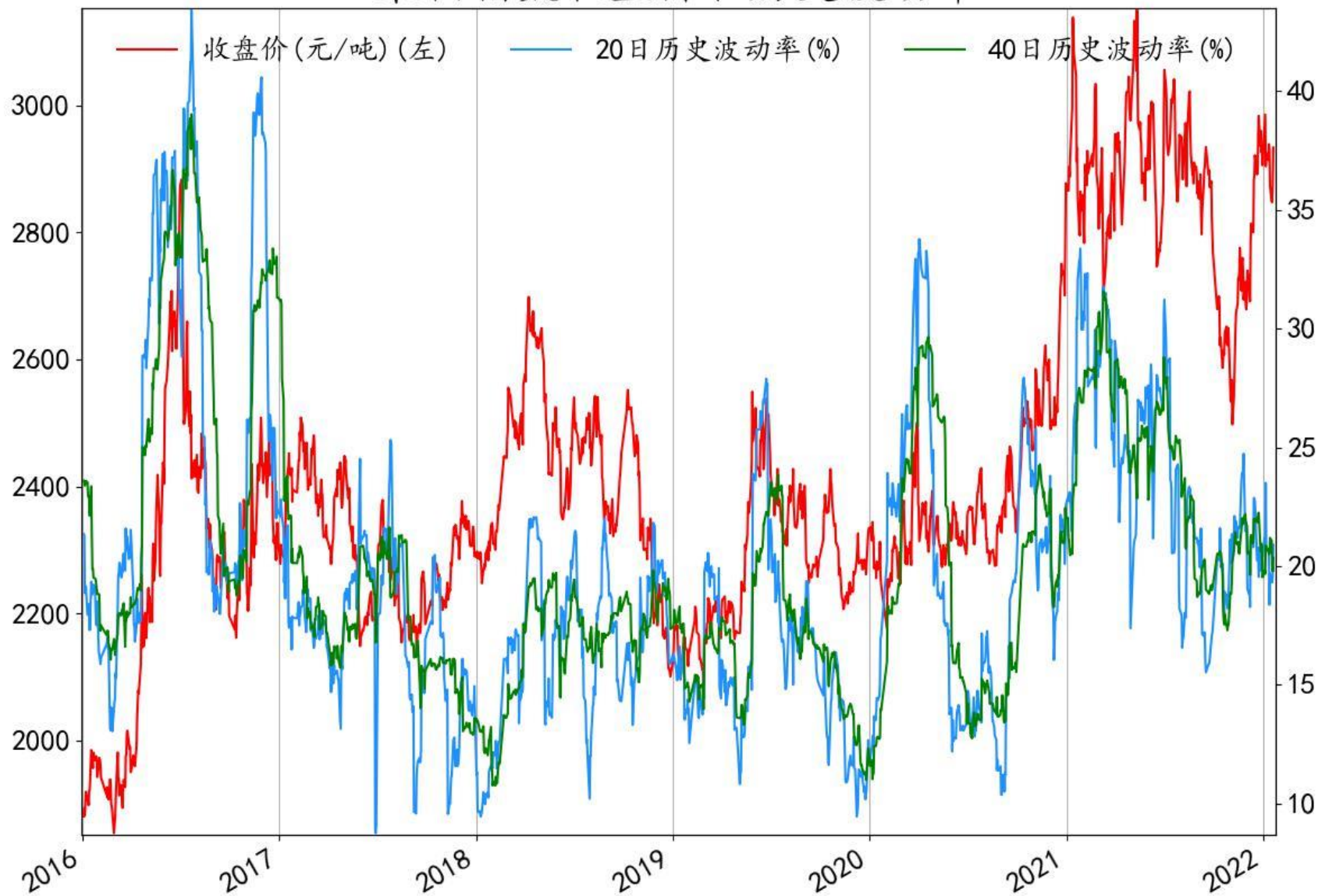
棕榈油指数收盘价和历史波动率



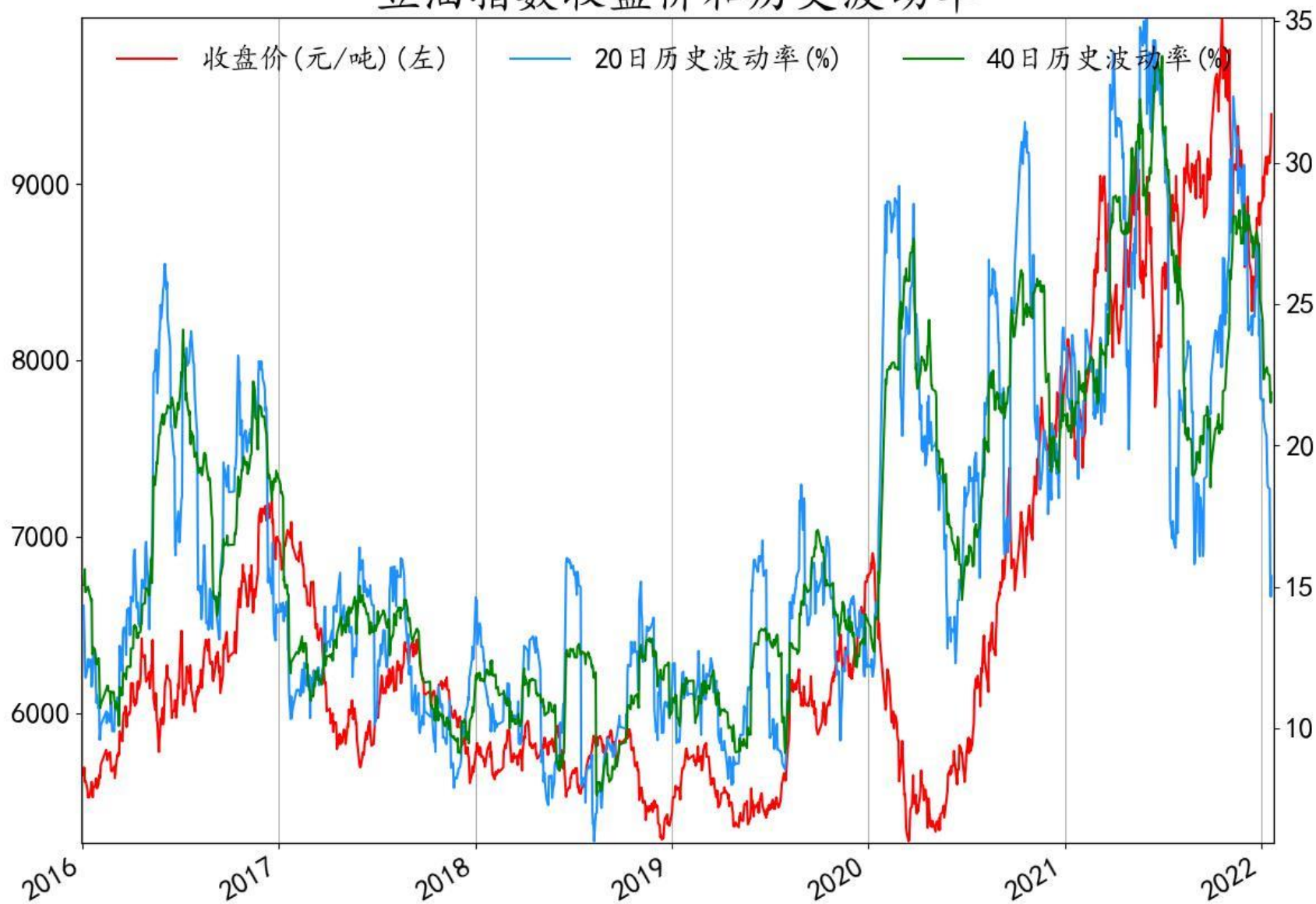
花生指数收盘价和历史波动率



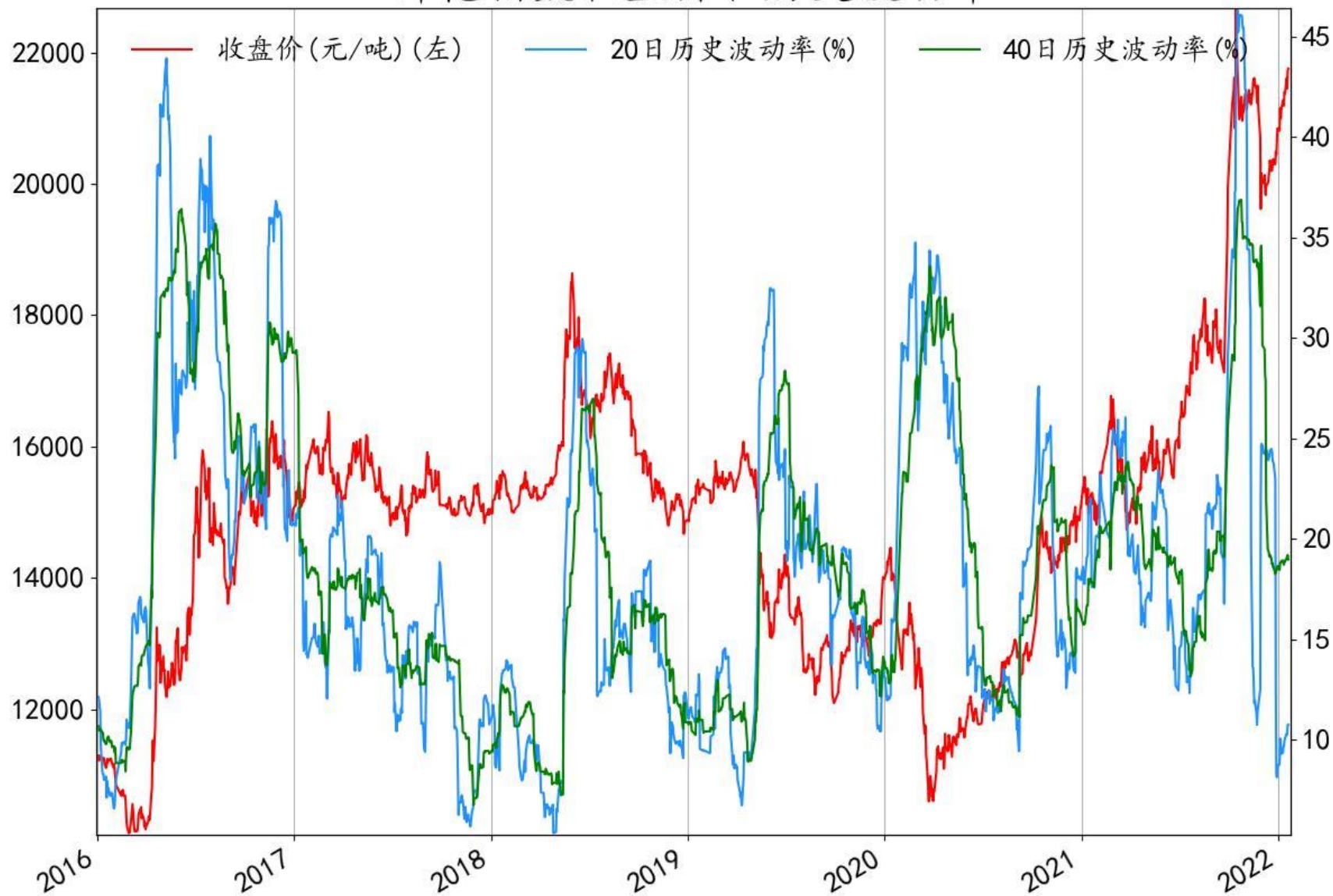
菜粕指数收盘价和历史波动率



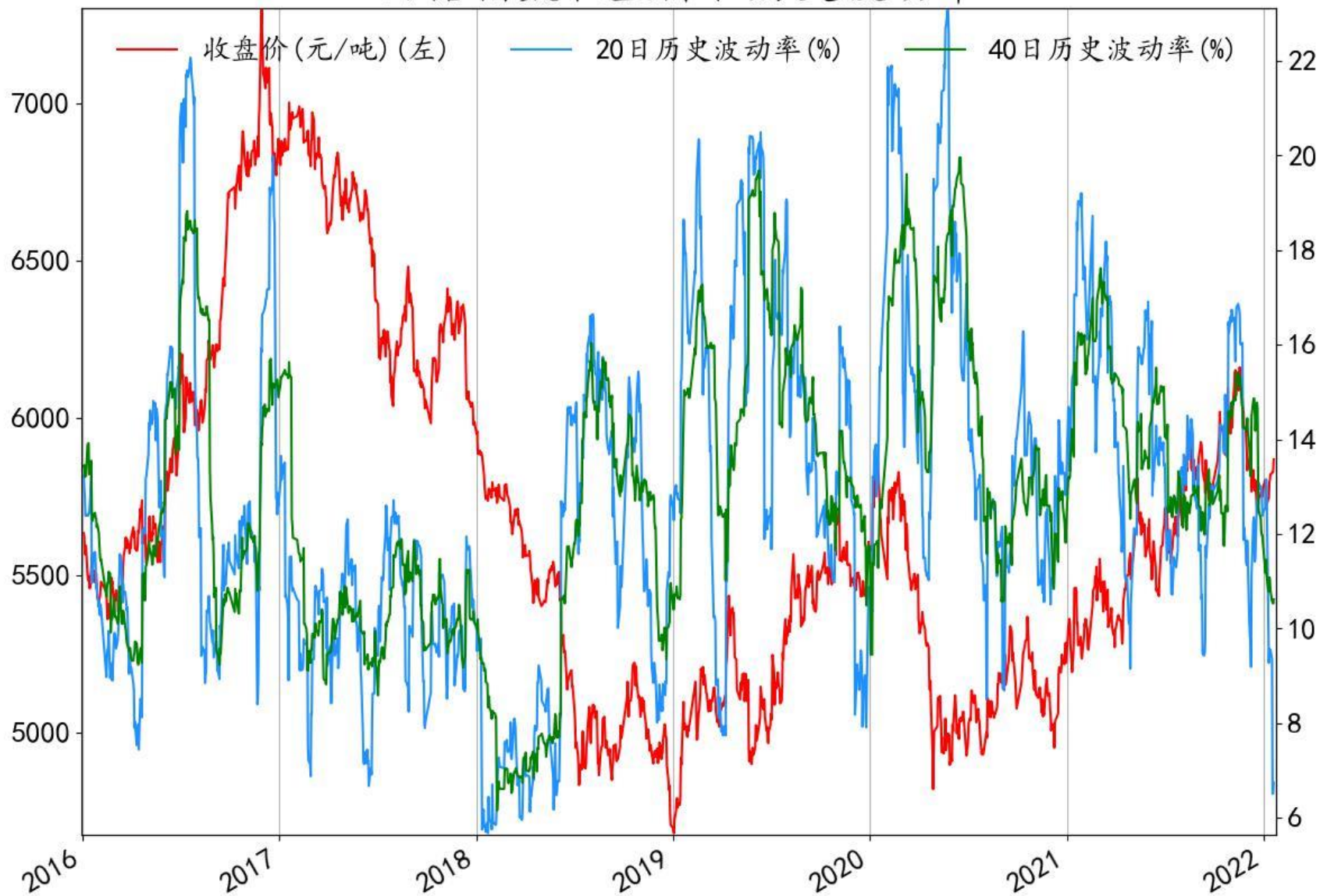
豆油指数收盘价和历史波动率



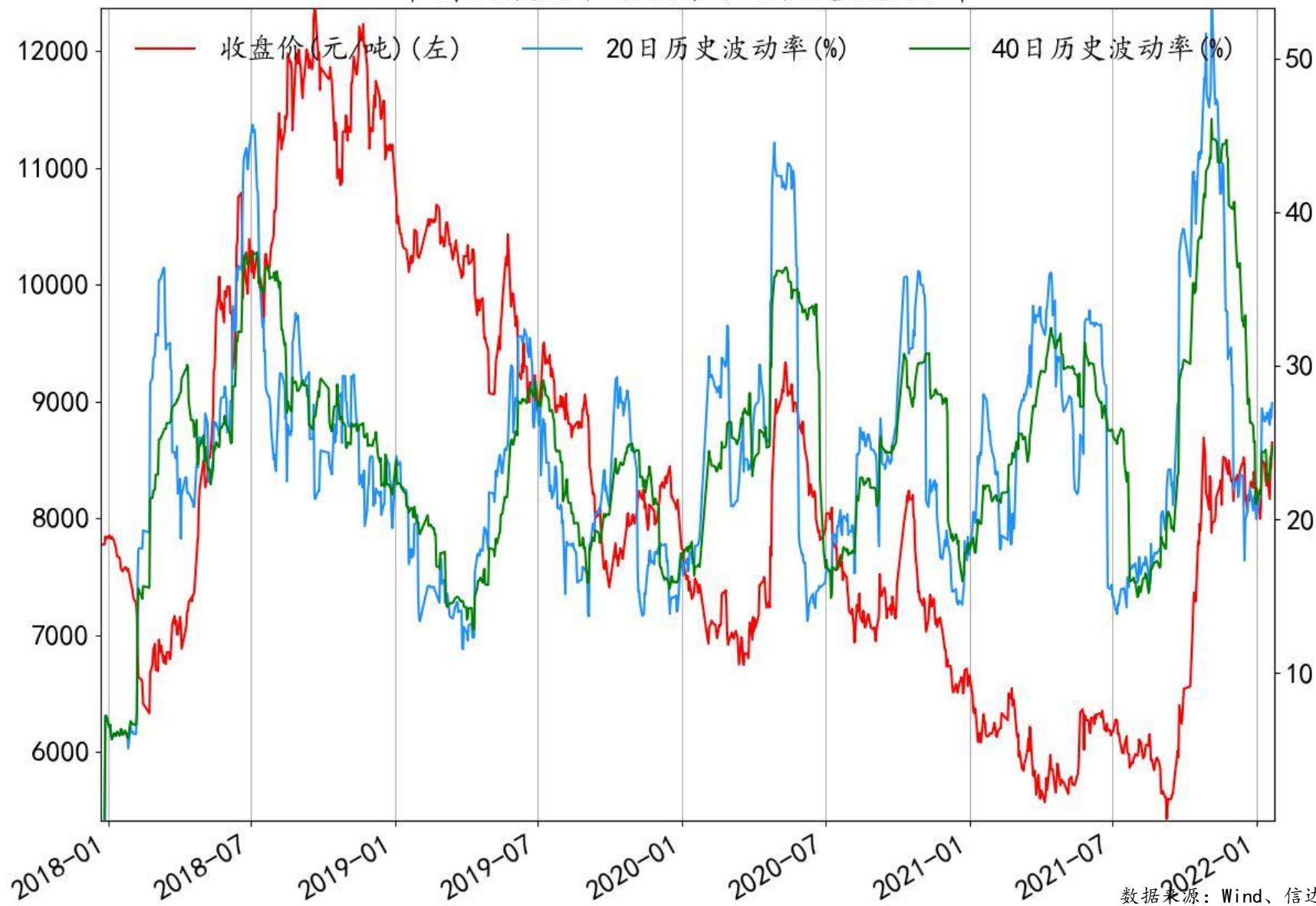
棉花指数收盘价和历史波动率



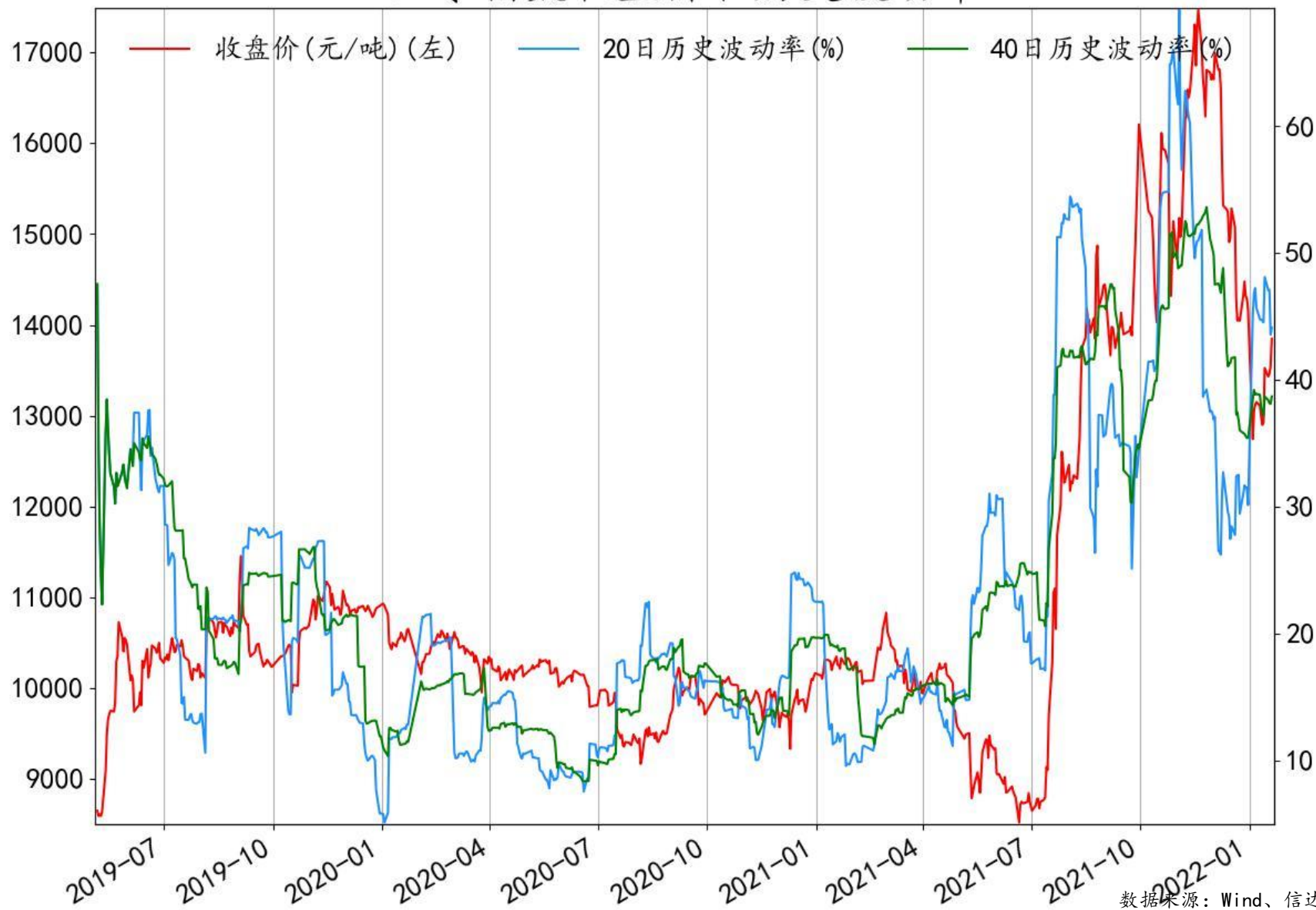
白糖指数收盘价和历史波动率



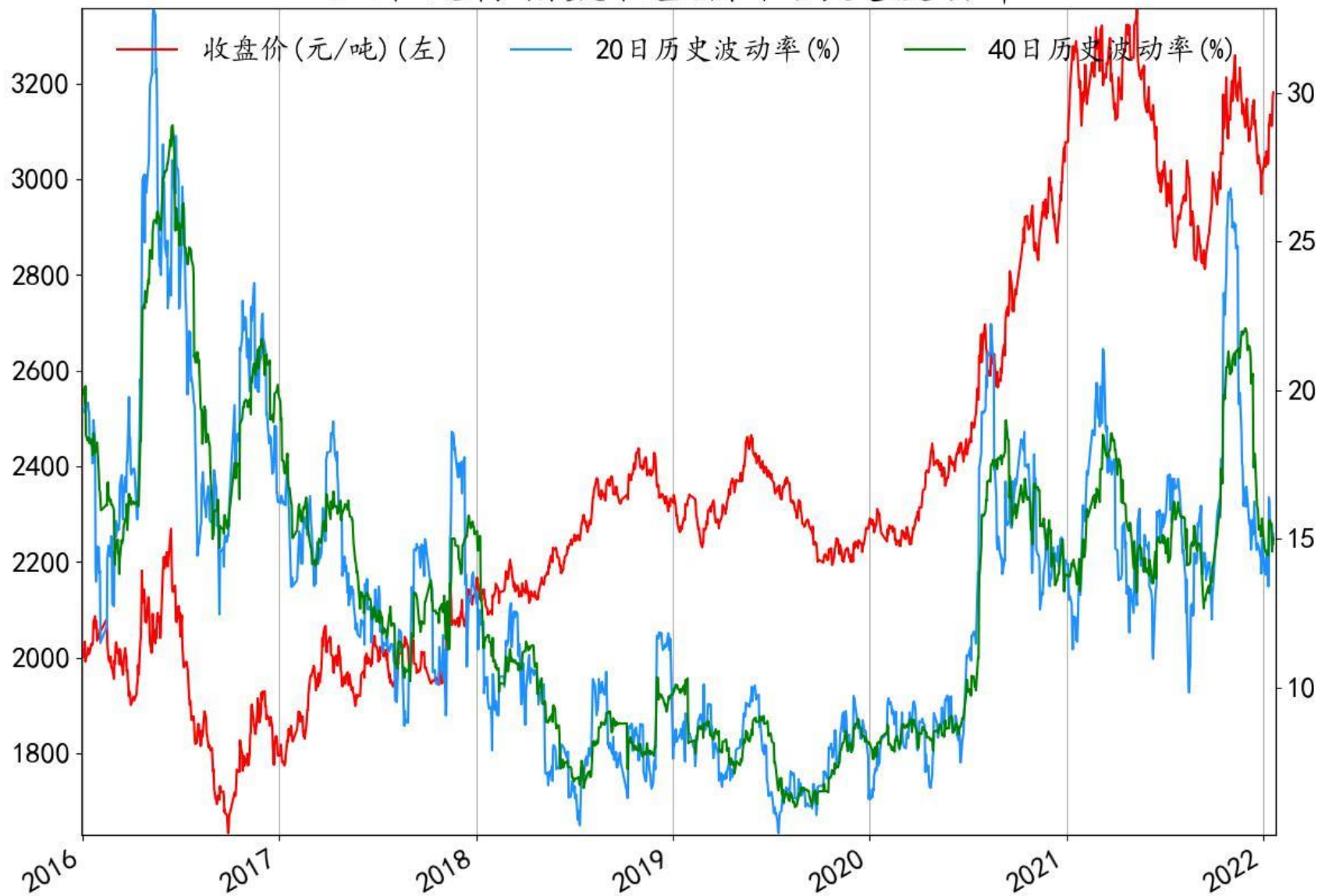
苹果指数收盘价和历史波动率



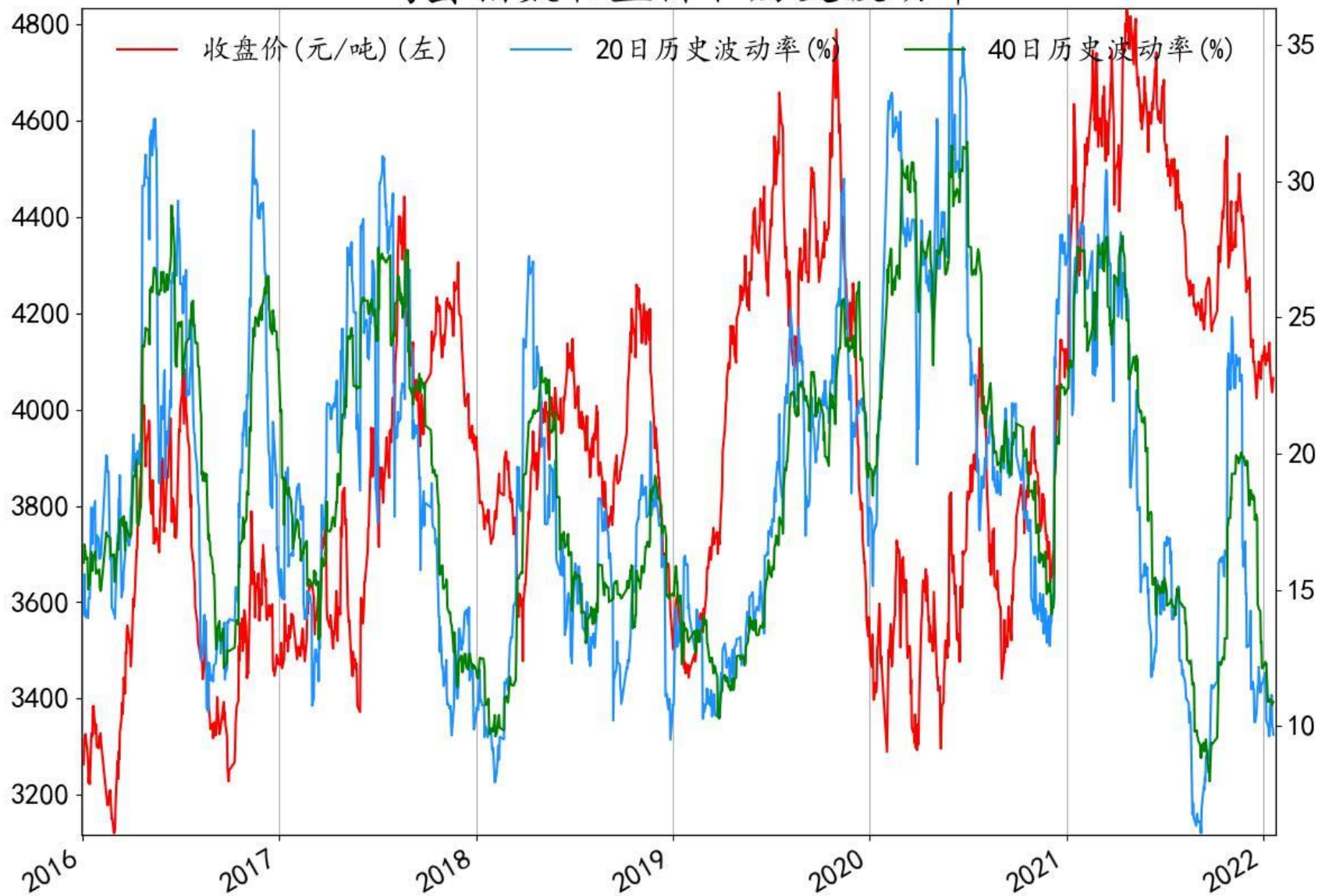
红枣指数收盘价和历史波动率



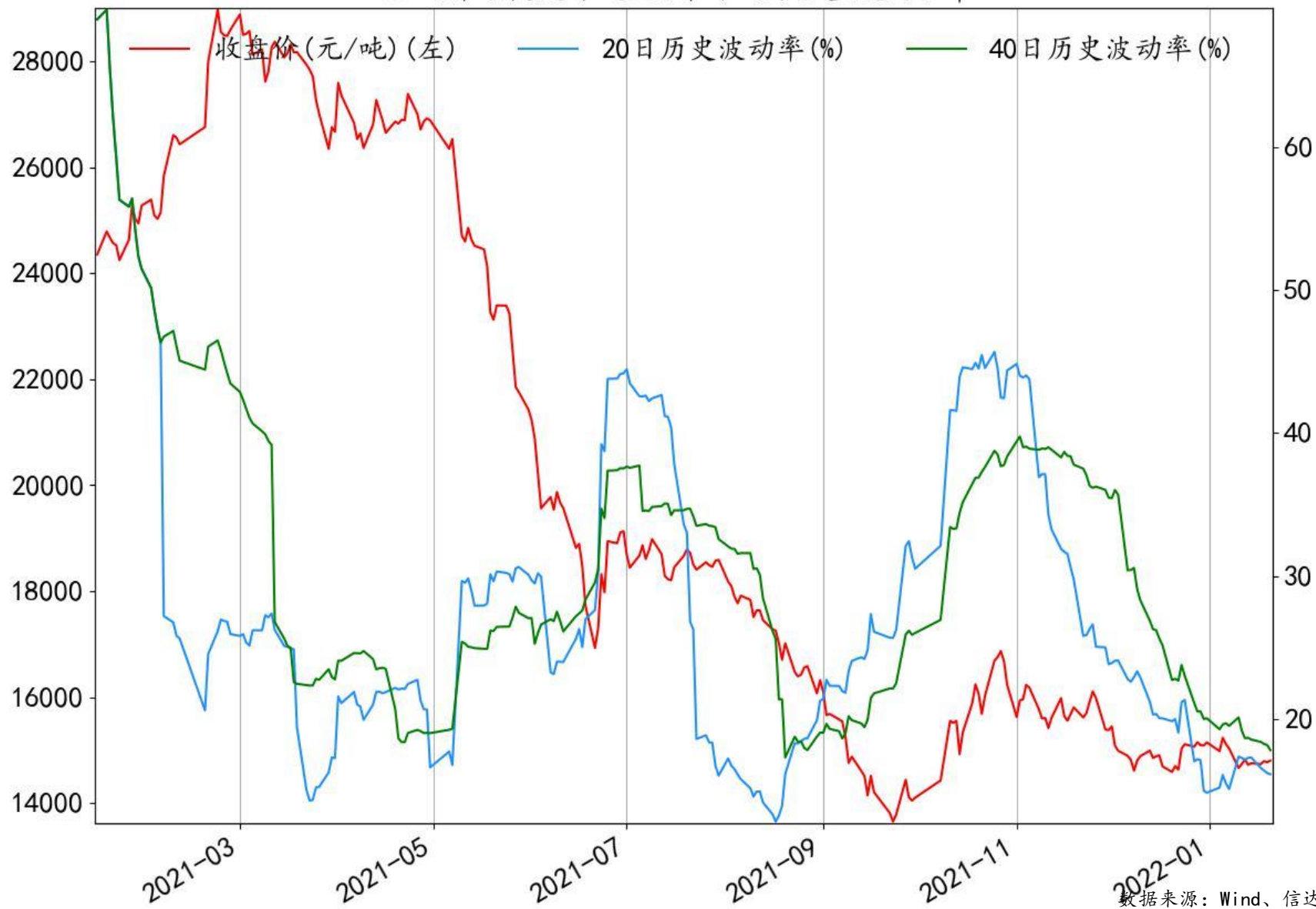
玉米淀粉指数收盘价和历史波动率



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



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。

信达期货研究所

电话：0571-28132535

微信：WilliamChen2021

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