

# 商品期货指数波动率跟踪

2022年03月09日

20日历史波动率百分位高于90%:

PTA、沪镍、不锈钢、棕榈油、菜油、低硫燃油、  
沪锡、铁矿石、沪铝、甲醇、玻璃、动力煤、沪锌、  
菜粕、LPG沥青、纯碱、原油、豆粕、尿素、硅铁、  
花生、豆油、燃油

20日历史波动率百分位低于10%:

鸡蛋

20日历史波动率绝对值前五:

沪镍、铁矿石、动力煤、原油、不锈钢

20日历史波动率绝对值后五:

鸡蛋、玉米、白糖、玉米淀粉、棉花

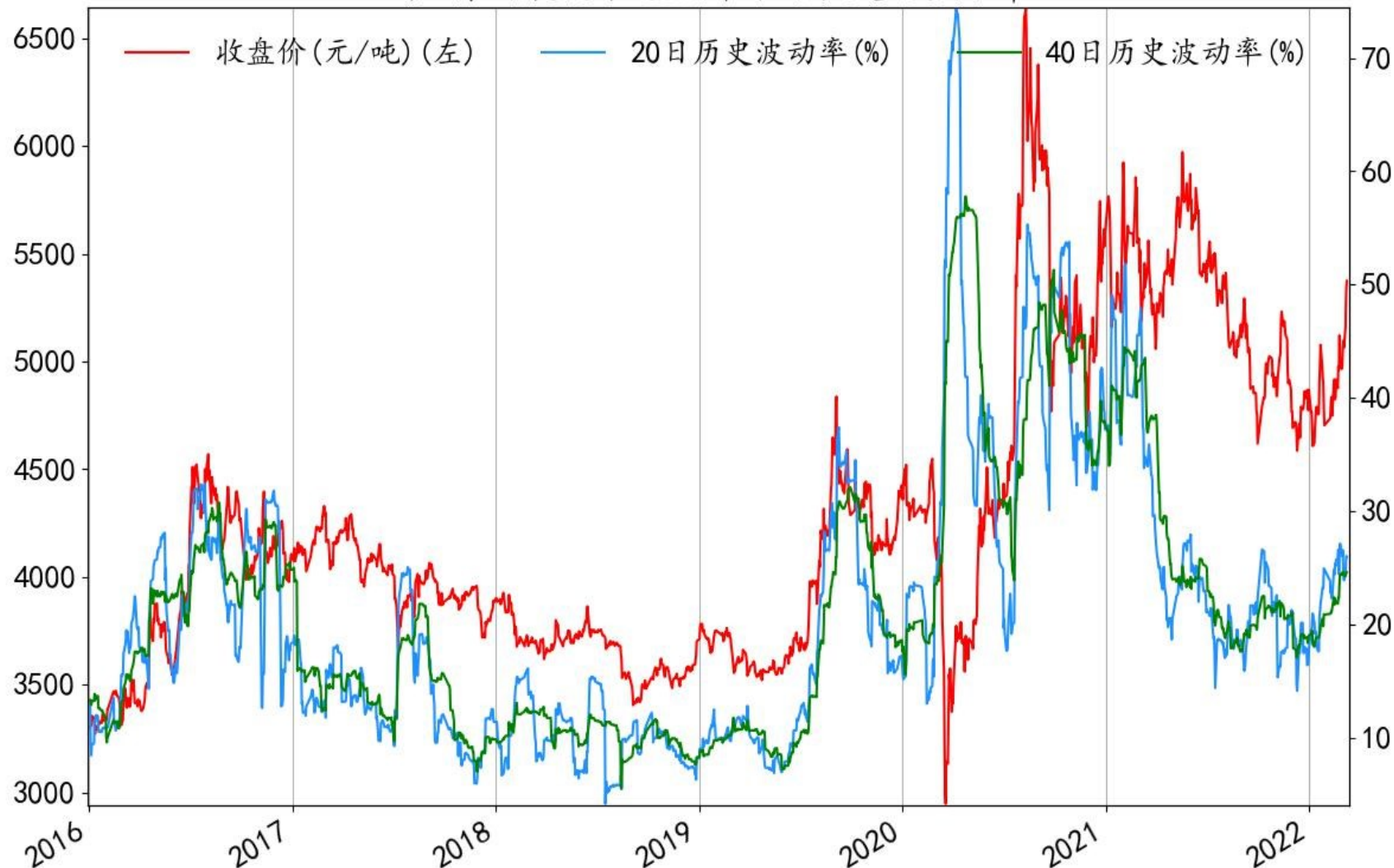
|     | 百分位     | 绝对值    |
|-----|---------|--------|
| 沪银  | 74.25%  | 26.00% |
| 沪金  | 87.82%  | 17.70% |
| 沪铝  | 97.94%  | 32.86% |
| 沪铜  | 86.96%  | 21.81% |
| 沪镍  | 100.00% | 73.20% |
| 沪铅  | 51.76%  | 17.01% |
| 沪锡  | 98.87%  | 49.44% |
| 沪锌  | 97.01%  | 39.73% |
| 不锈钢 | 100.00% | 53.32% |
| 热卷  | 78.44%  | 32.23% |
| 铁矿石 | 98.47%  | 67.84% |
| 焦炭  | 84.83%  | 44.06% |
| 焦煤  | 87.69%  | 48.54% |

|      | 百分位    | 绝对值    |
|------|--------|--------|
| 螺纹   | 75.38% | 32.58% |
| 硅铁   | 91.35% | 43.69% |
| 锰硅   | 62.48% | 25.79% |
| 玻璃   | 97.07% | 45.50% |
| 纯碱   | 94.50% | 52.70% |
| 燃油   | 90.43% | 49.96% |
| 低硫燃油 | 99.51% | 49.80% |
| LPG  | 95.37% | 47.77% |
| 原油   | 93.95% | 53.89% |
| 动力煤  | 97.07% | 64.22% |
| PVC  | 82.24% | 27.43% |
| 沥青   | 95.21% | 45.24% |
| 苯乙烯  | 46.53% | 27.40% |

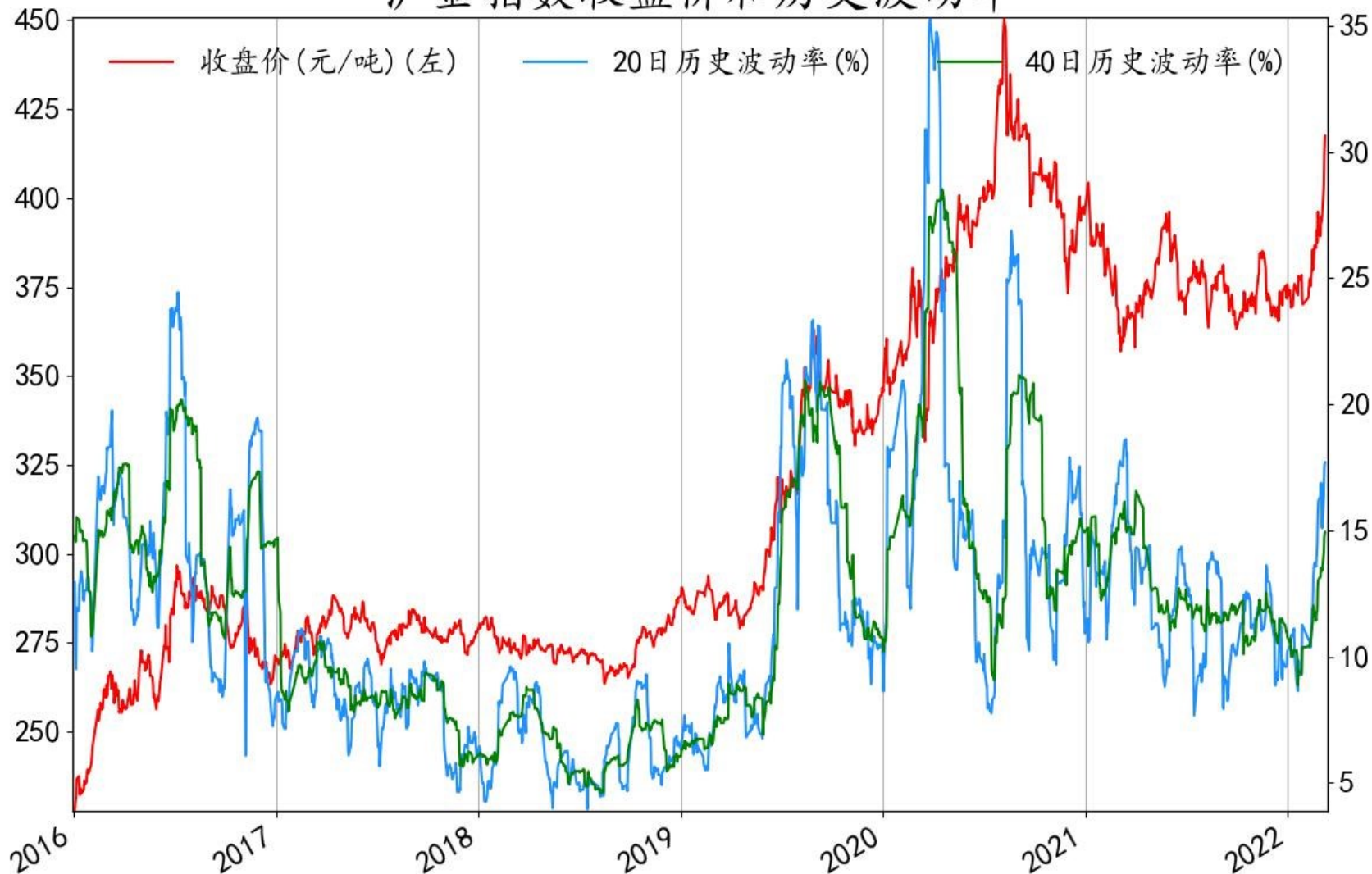
|      | 百分位     | 绝对值    |
|------|---------|--------|
| 乙二醇  | 88.30%  | 40.01% |
| 聚乙烯  | 77.38%  | 22.23% |
| 甲醇   | 97.34%  | 41.04% |
| 20号胶 | 52.50%  | 26.28% |
| 短纤   | 89.06%  | 38.73% |
| 聚丙烯  | 85.16%  | 26.69% |
| 橡胶   | 42.25%  | 23.44% |
| 纸浆   | 68.93%  | 21.23% |
| PTA  | 100.00% | 50.09% |
| 尿素   | 93.33%  | 40.43% |
| 玉米   | 37.72%  | 8.93%  |
| 豆一   | 76.98%  | 19.34% |
| 豆粕   | 93.41%  | 26.91% |

|      | 百分位    | 绝对值    |
|------|--------|--------|
| 菜油   | 99.60% | 30.85% |
| 棕榈油  | 99.93% | 42.73% |
| 花生   | 91.29% | 24.89% |
| 菜粕   | 96.41% | 36.35% |
| 豆油   | 90.62% | 26.36% |
| 棉花   | 43.18% | 15.33% |
| 白糖   | 53.43% | 12.58% |
| 苹果   | 79.27% | 29.49% |
| 红枣   | 74.31% | 28.89% |
| 玉米淀粉 | 68.66% | 15.17% |
| 鸡蛋   | 1.20%  | 7.88%  |
| 生猪   | 27.90% | 19.19% |

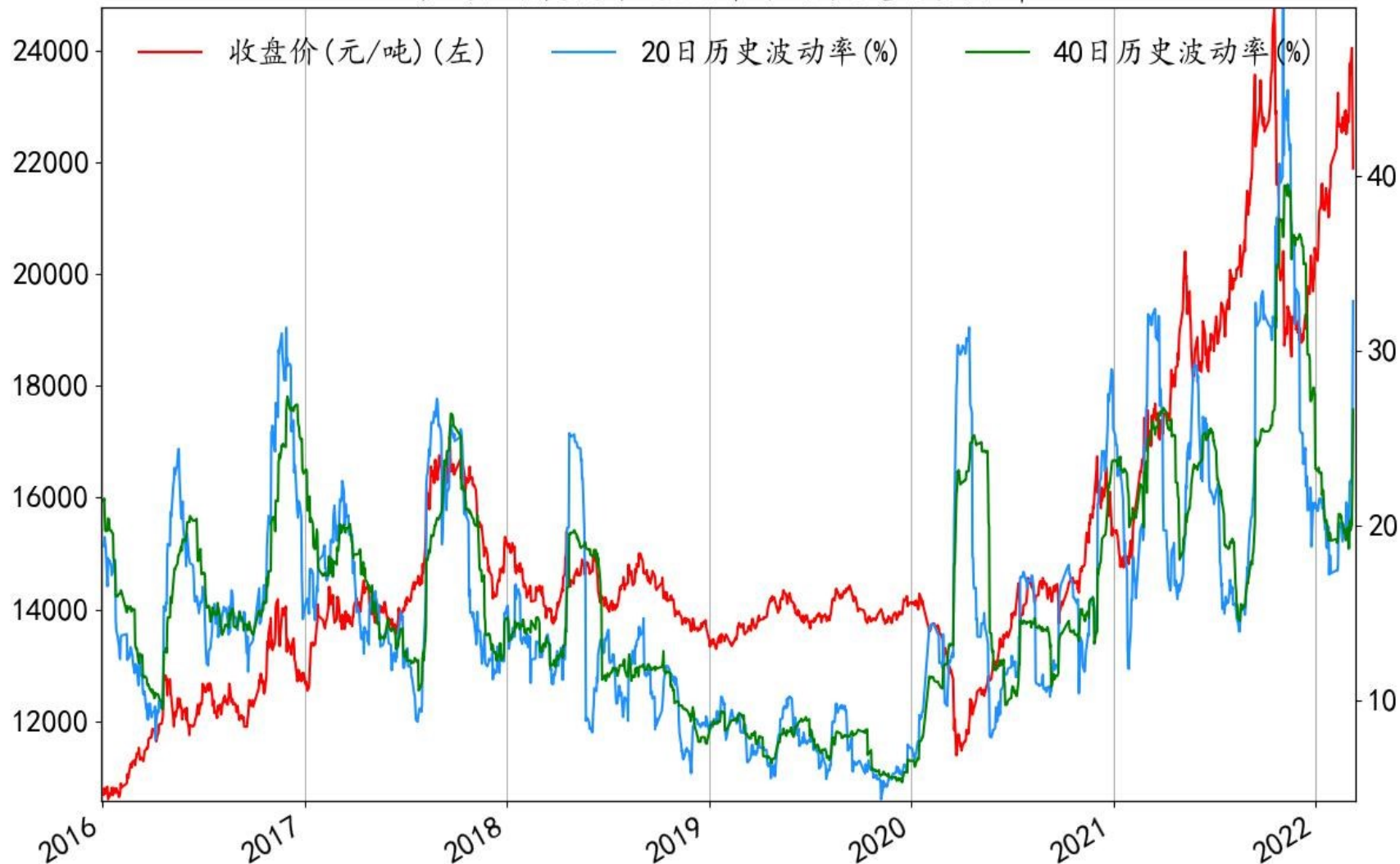
## 沪银指数收盘价和历史波动率



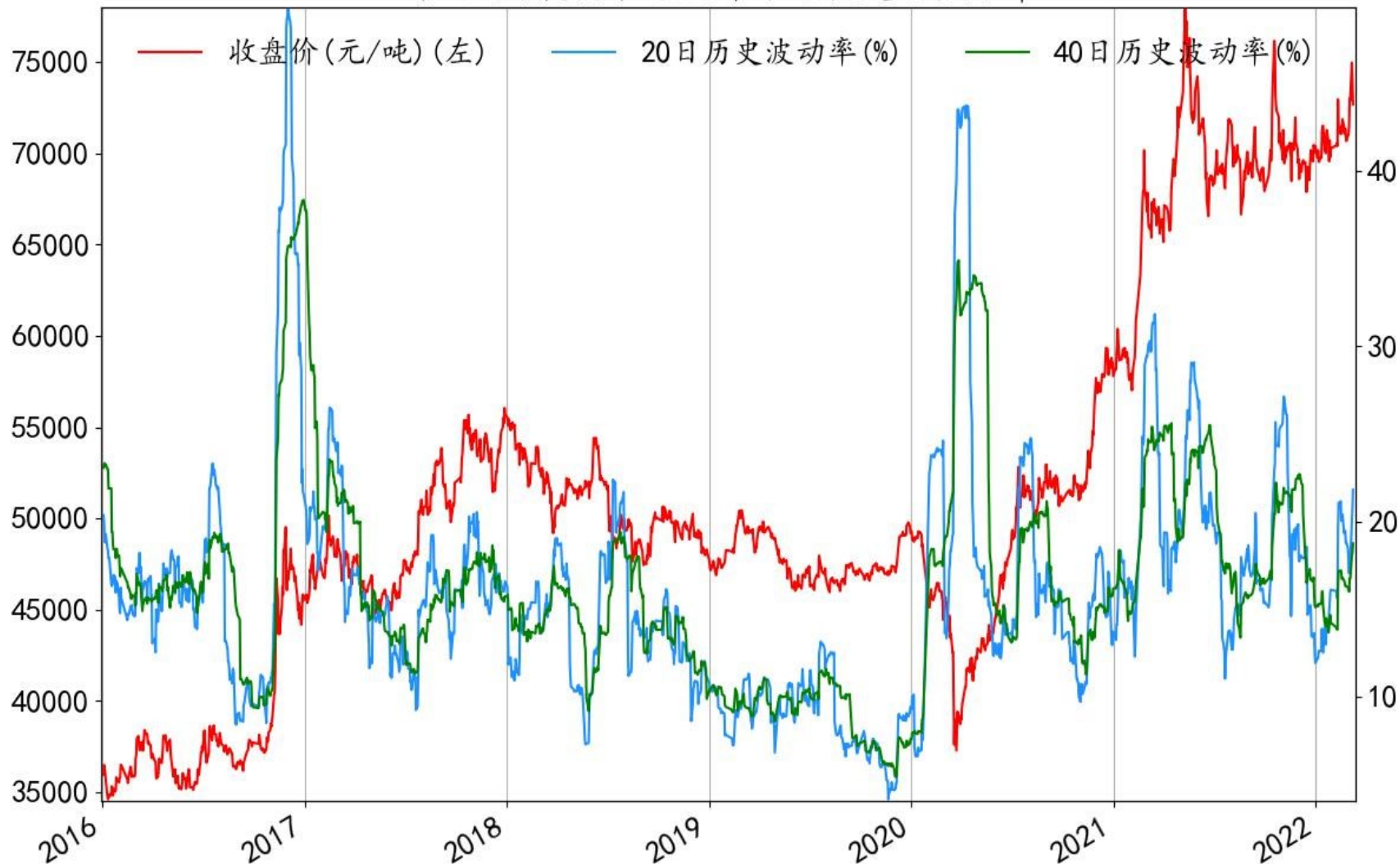
## 沪金指数收盘价和历史波动率



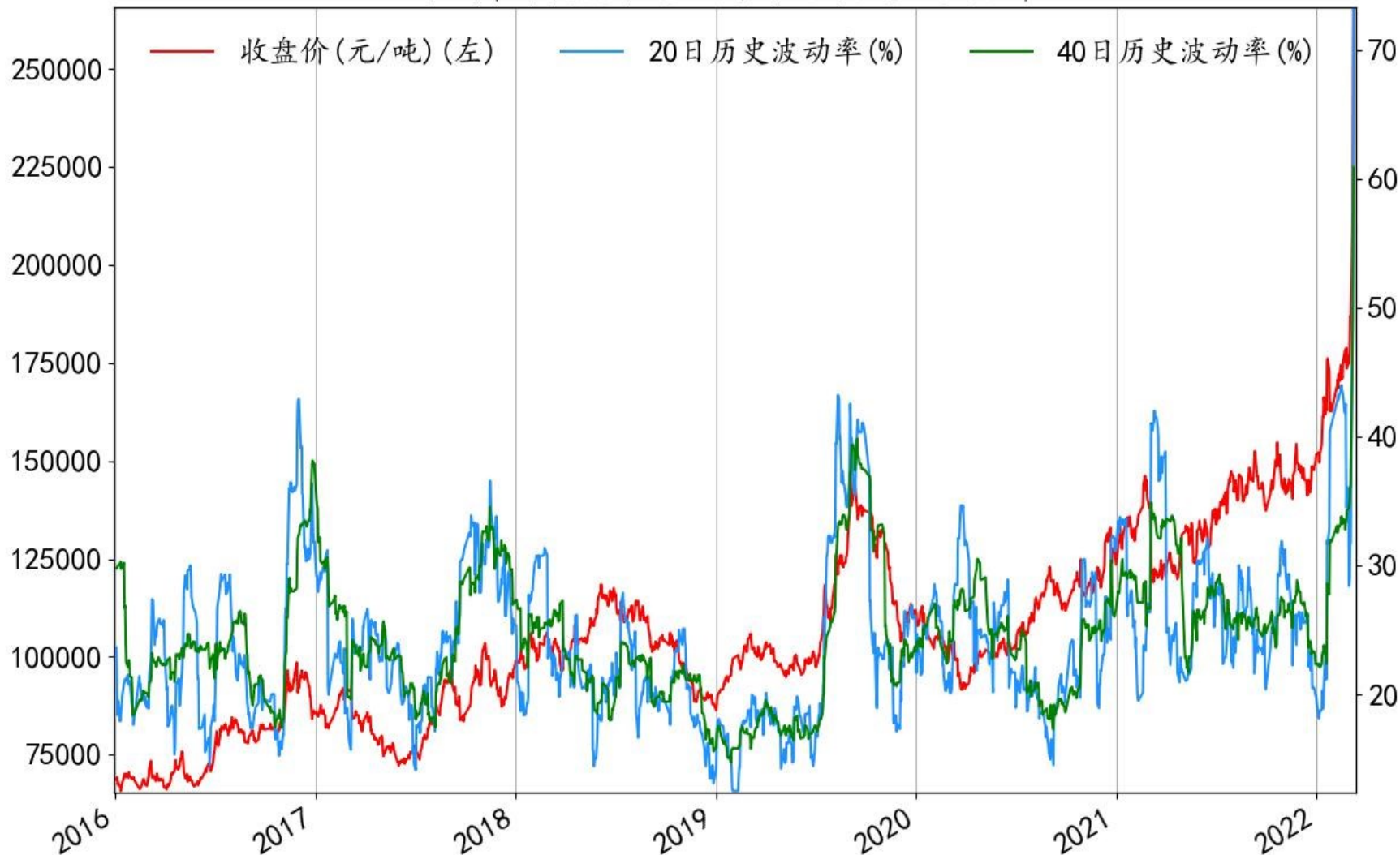
## 沪铝指数收盘价和历史波动率



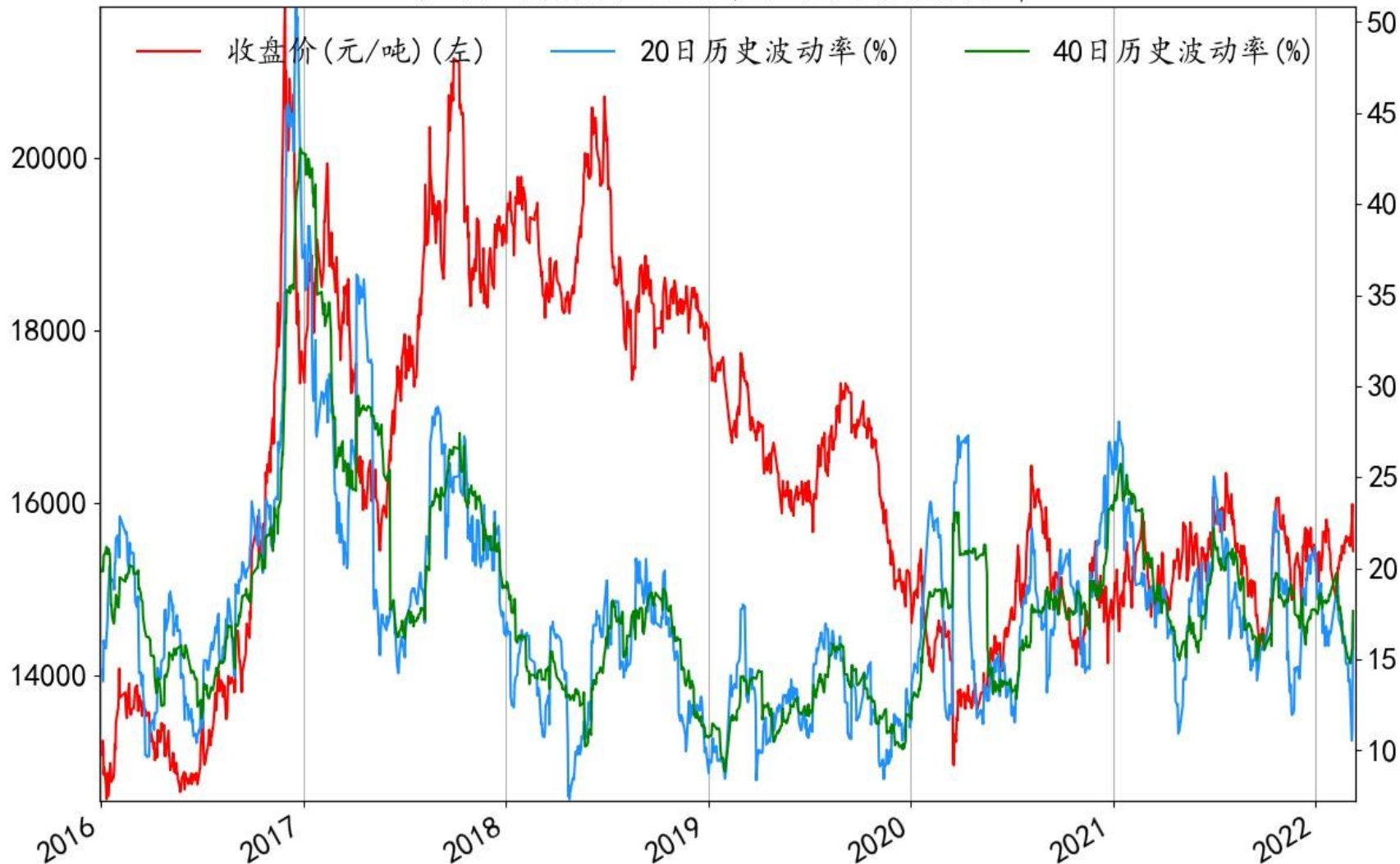
## 沪铜指数收盘价和历史波动率



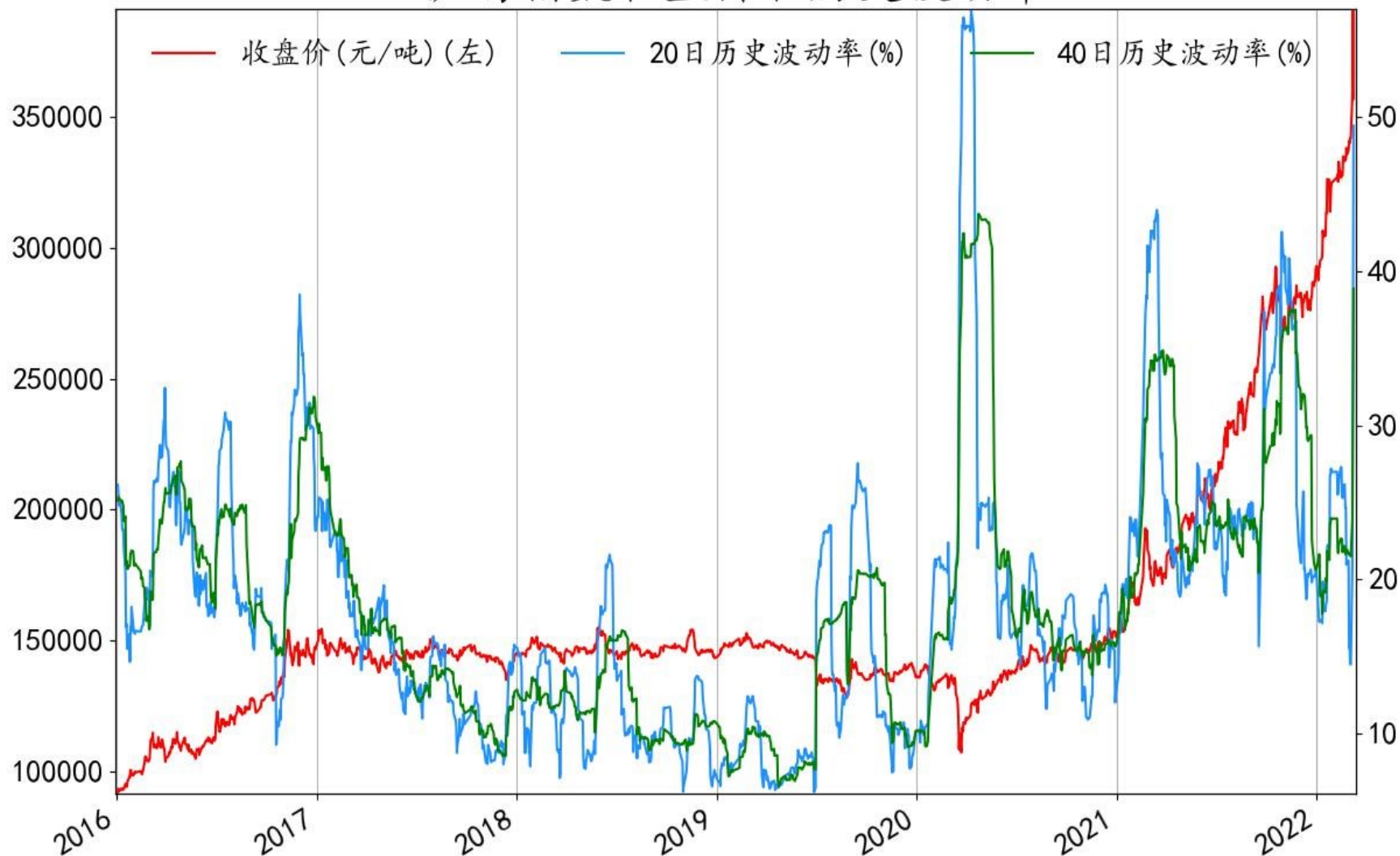
## 沪镍指数收盘价和历史波动率



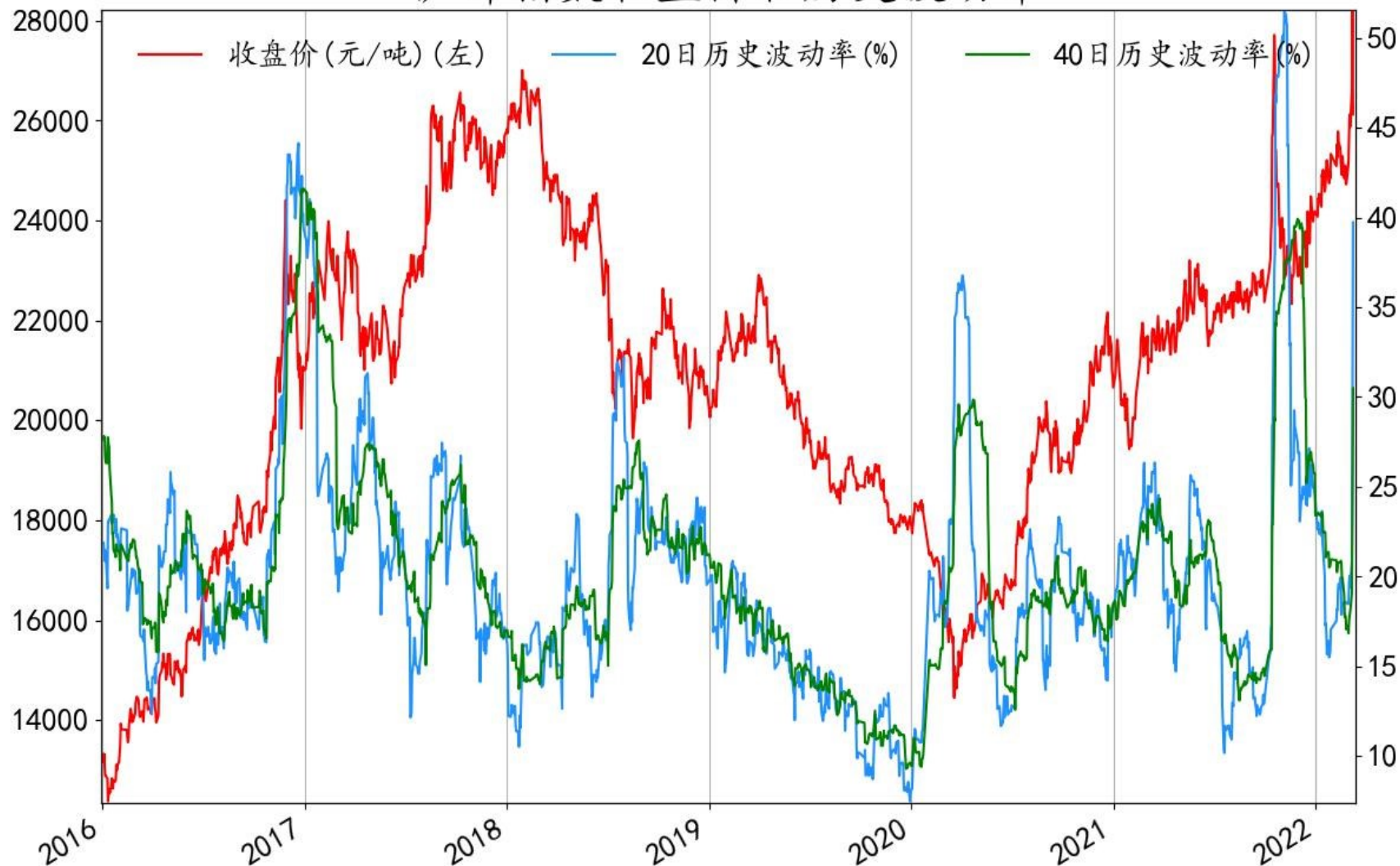
## 沪铅指数收盘价和历史波动率



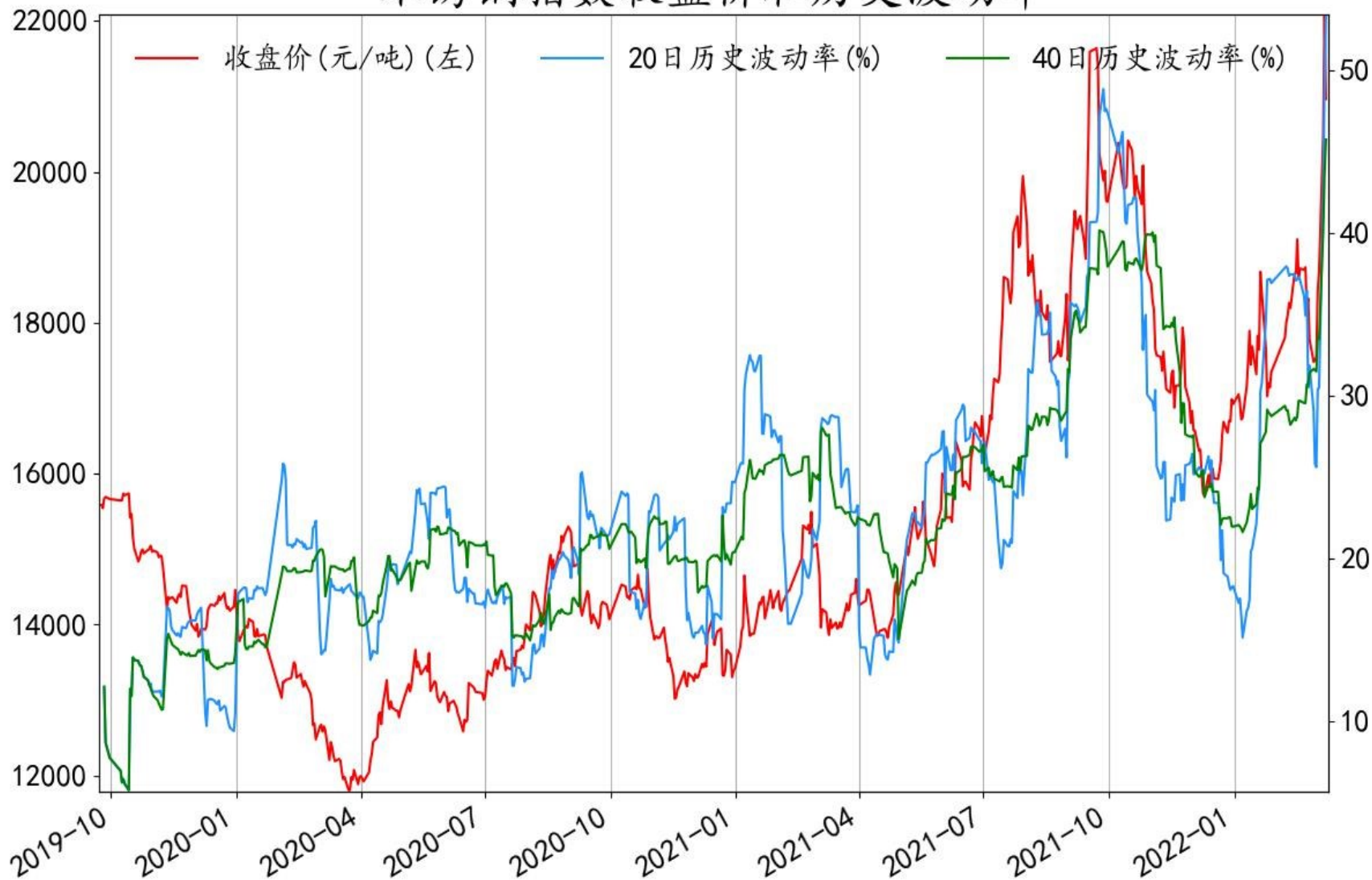
## 沪锡指数收盘价和历史波动率



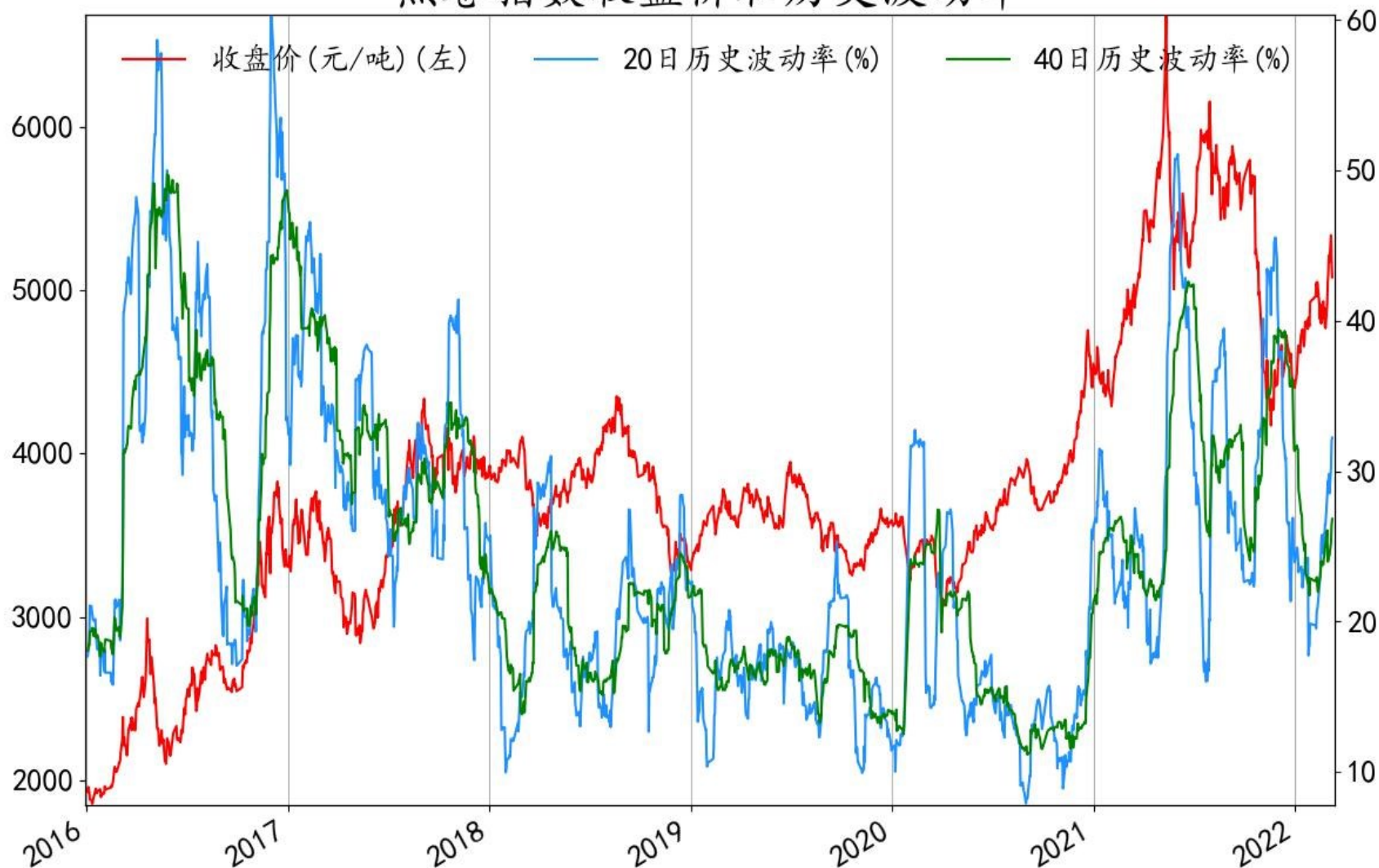
## 沪锌指数收盘价和历史波动率



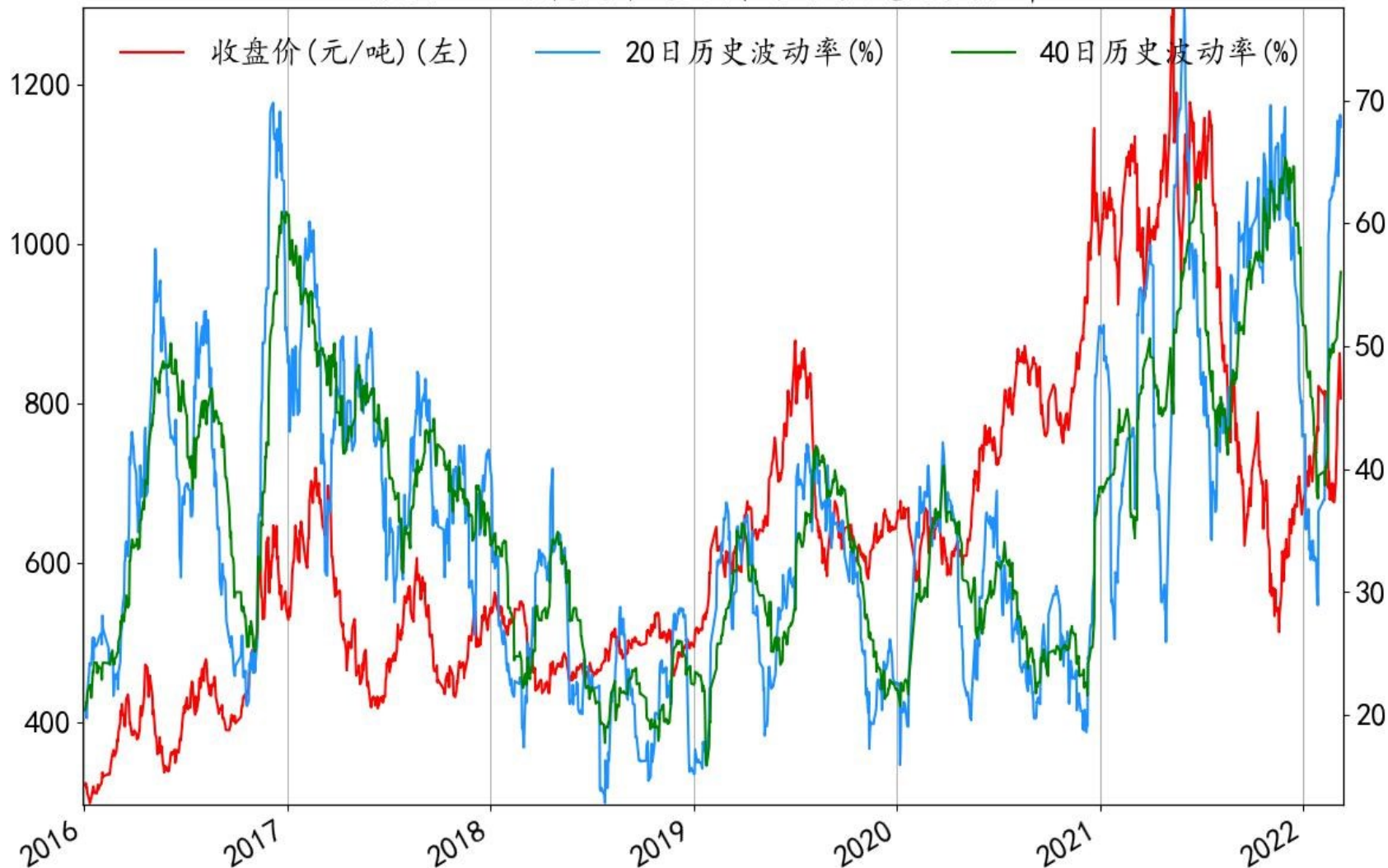
## 不锈钢指数收盘价和历史波动率



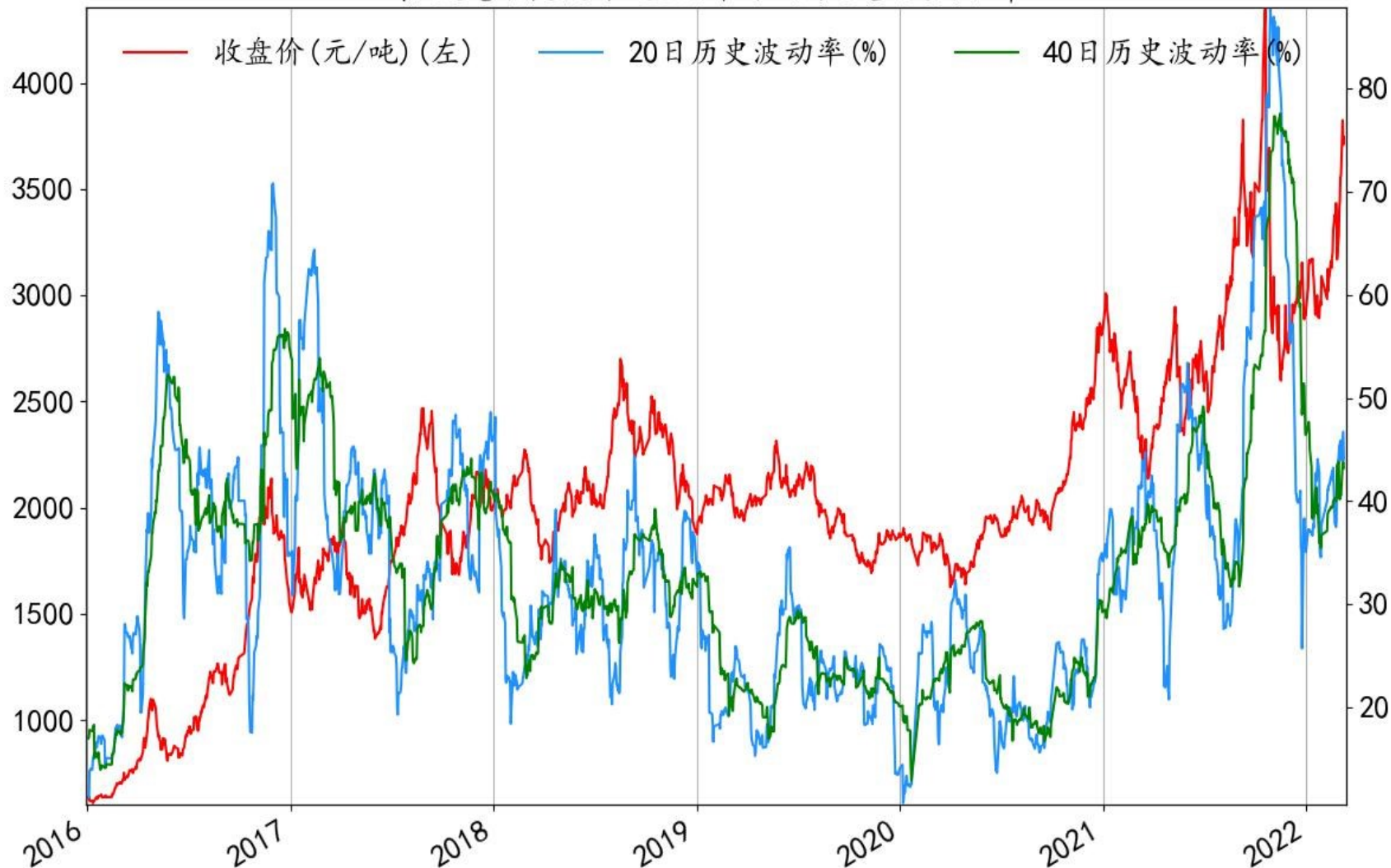
## 热卷指数收盘价和历史波动率



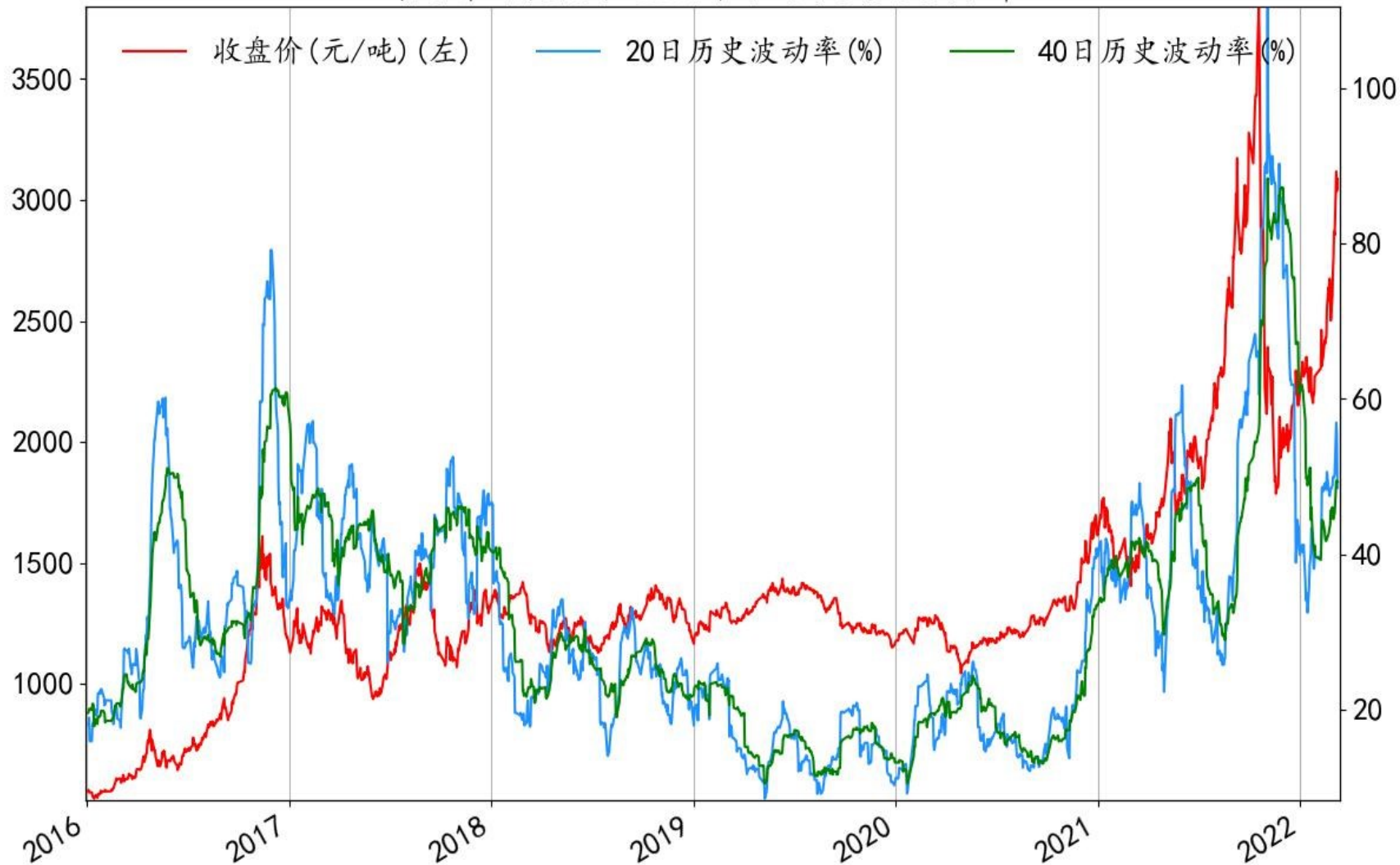
## 铁矿石指数收盘价和历史波动率



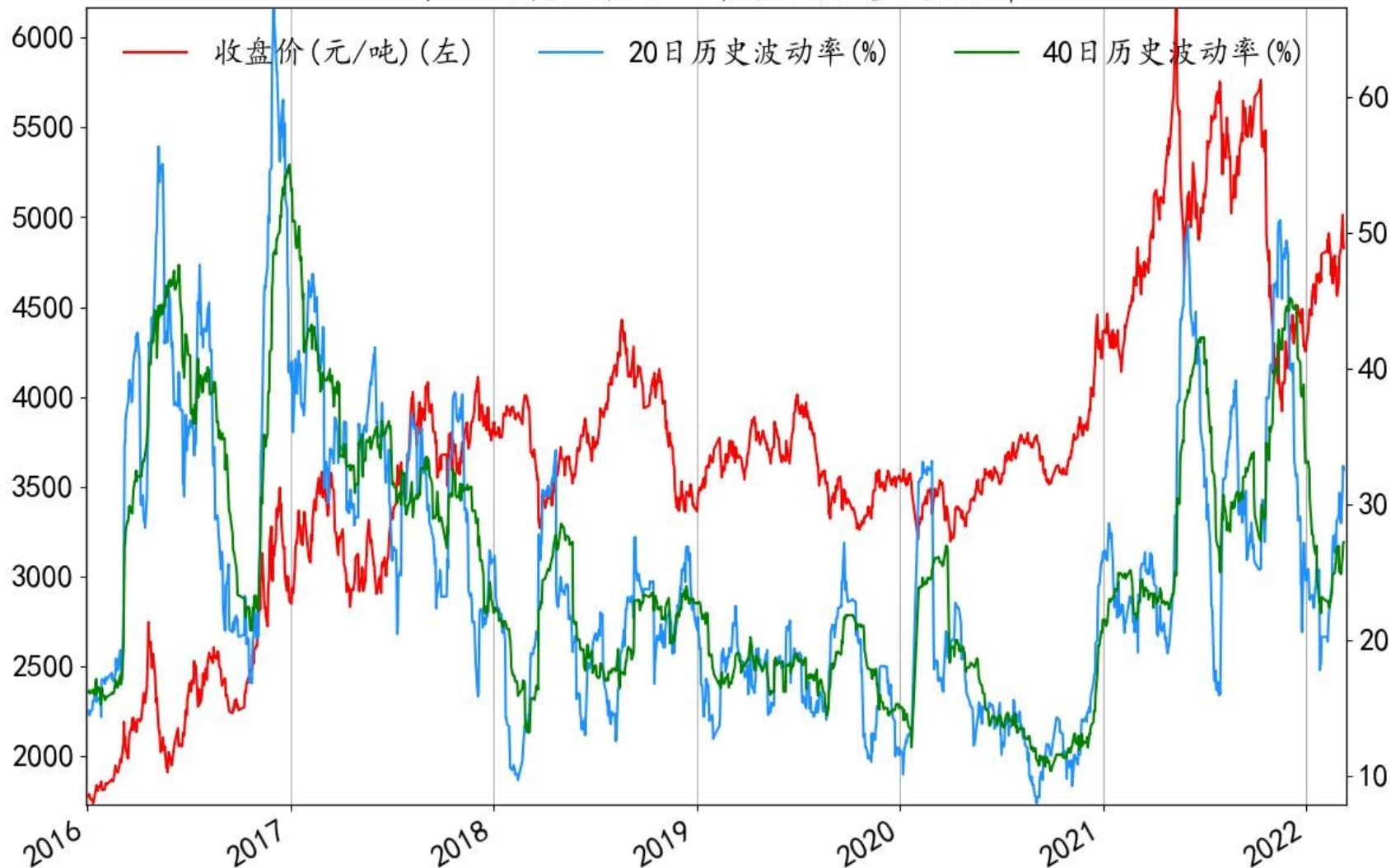
## 焦炭指数收盘价和历史波动率



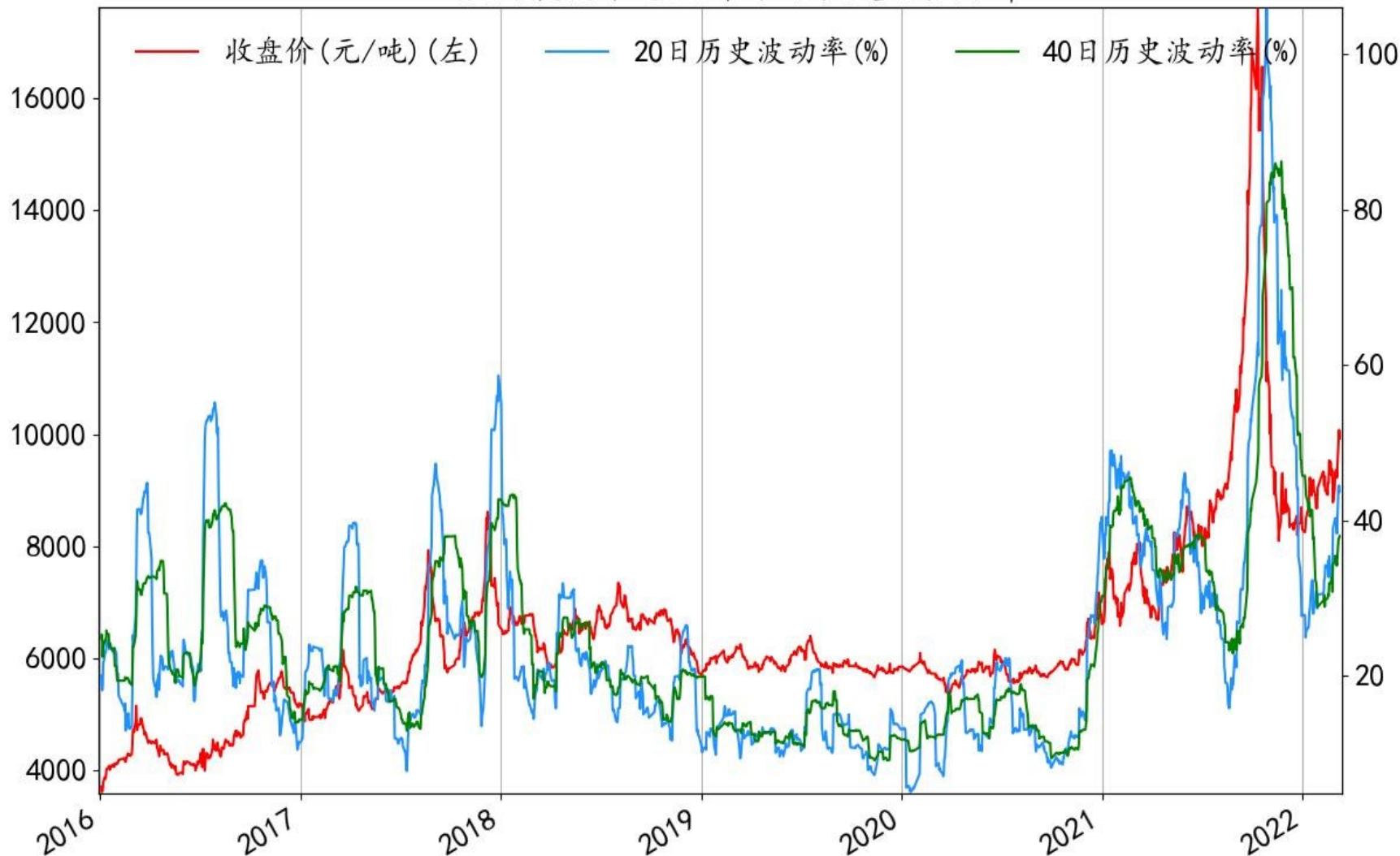
## 焦煤指数收盘价和历史波动率



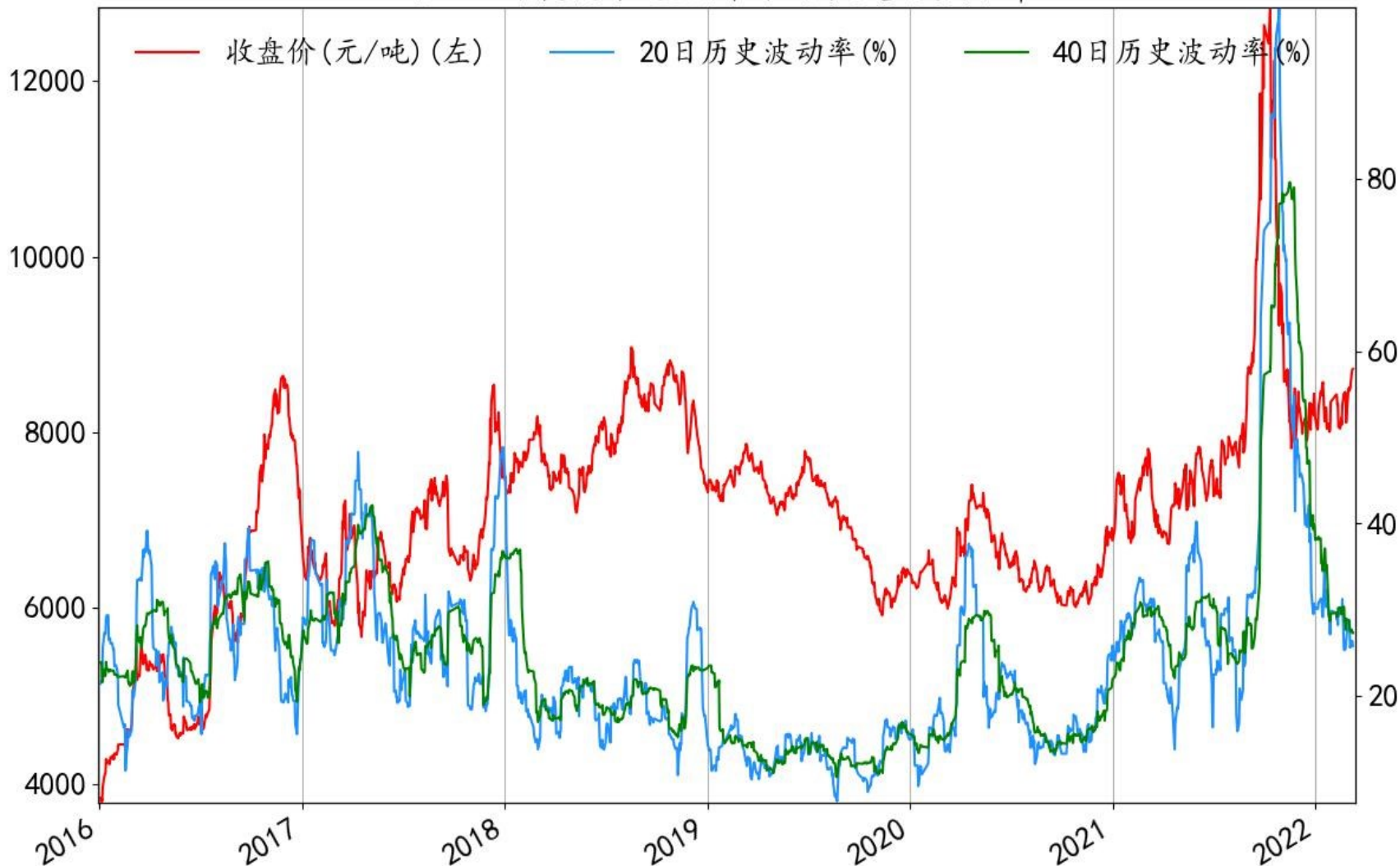
## 螺纹指数收盘价和历史波动率



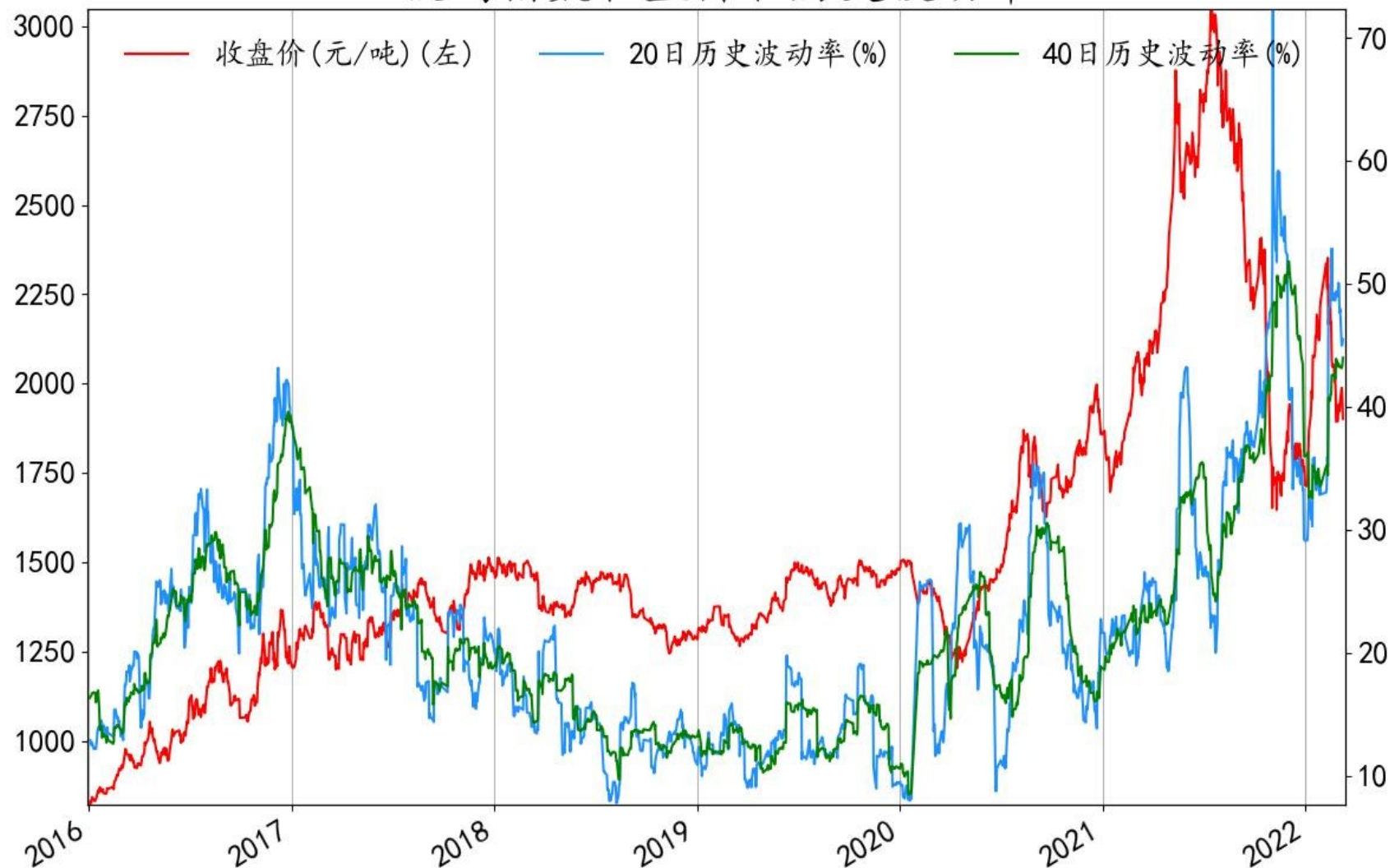
## 硅铁指数收盘价和历史波动率



## 锰硅指数收盘价和历史波动率



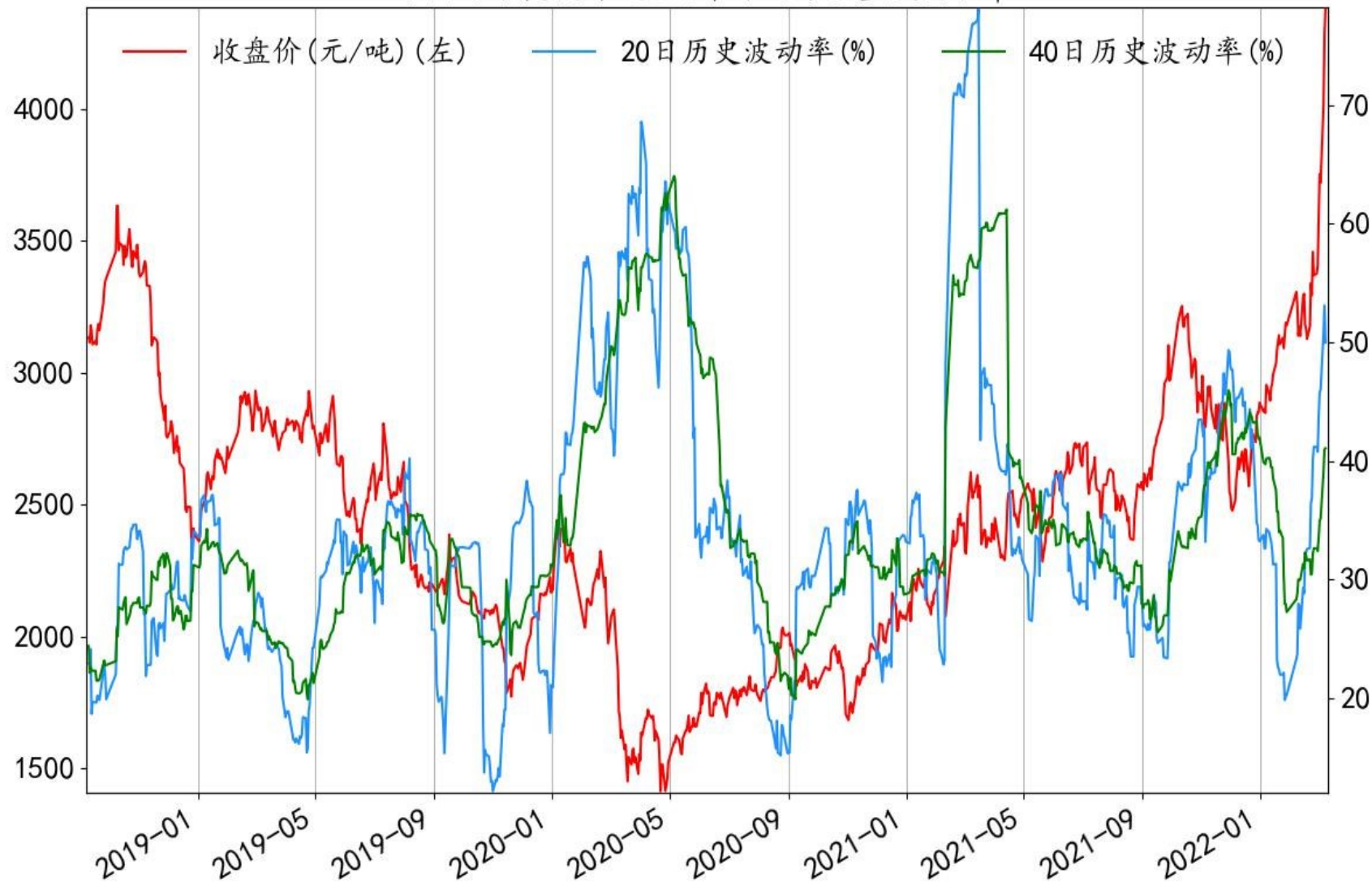
## 玻璃指数收盘价和历史波动率



## 纯碱指数收盘价和历史波动率

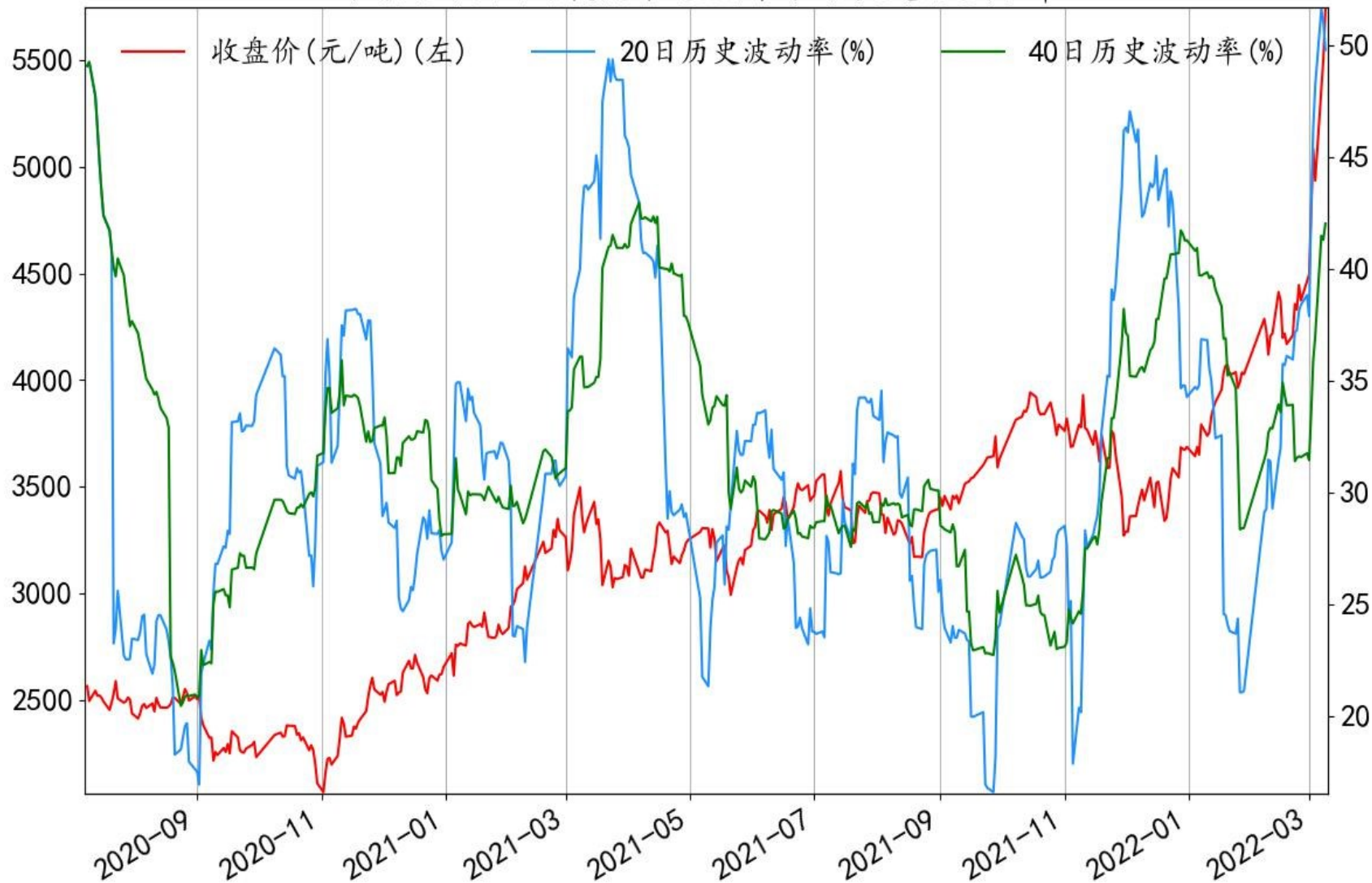


## 燃油指数收盘价和历史波动率

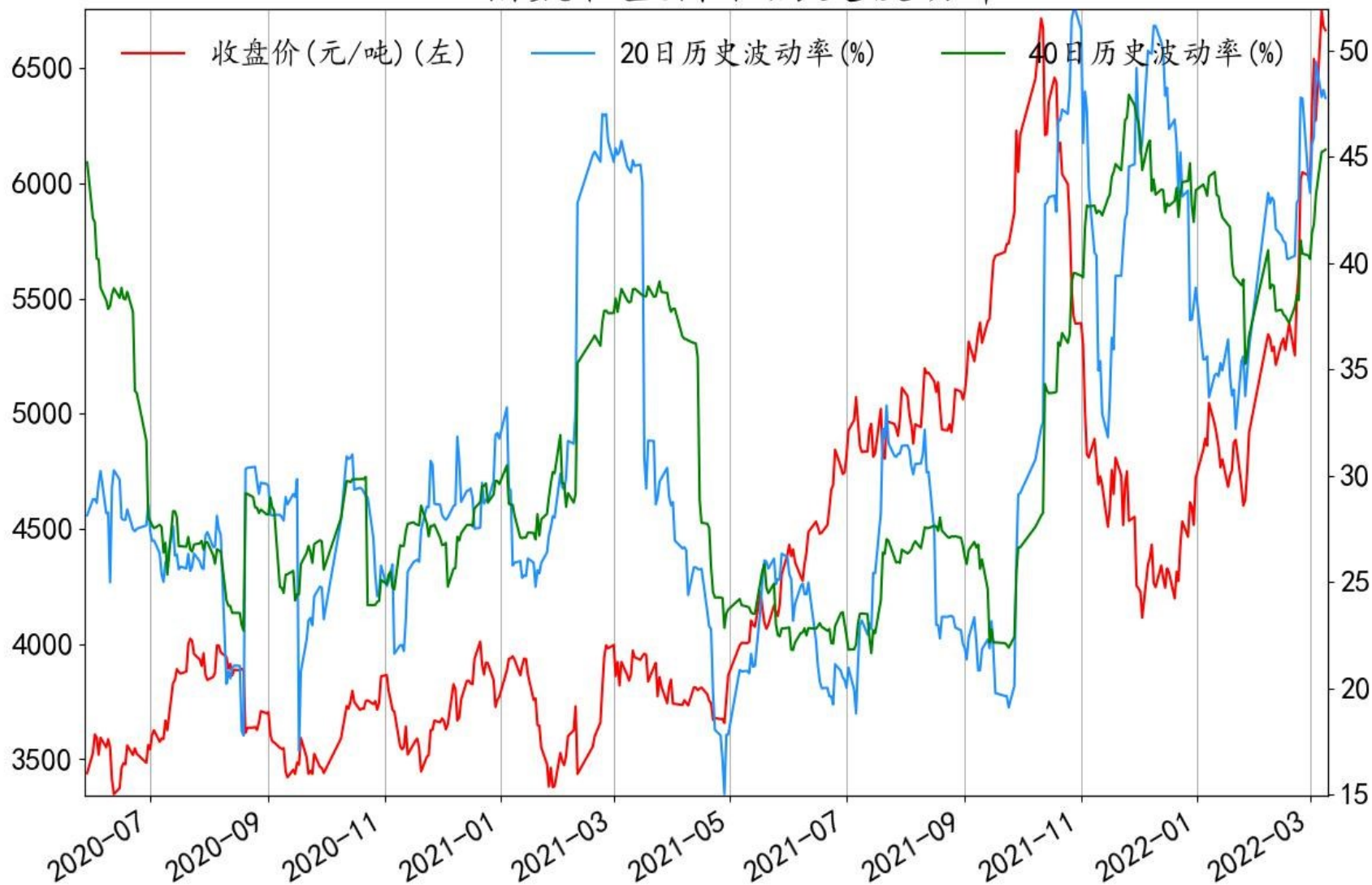


# 低硫燃油指数

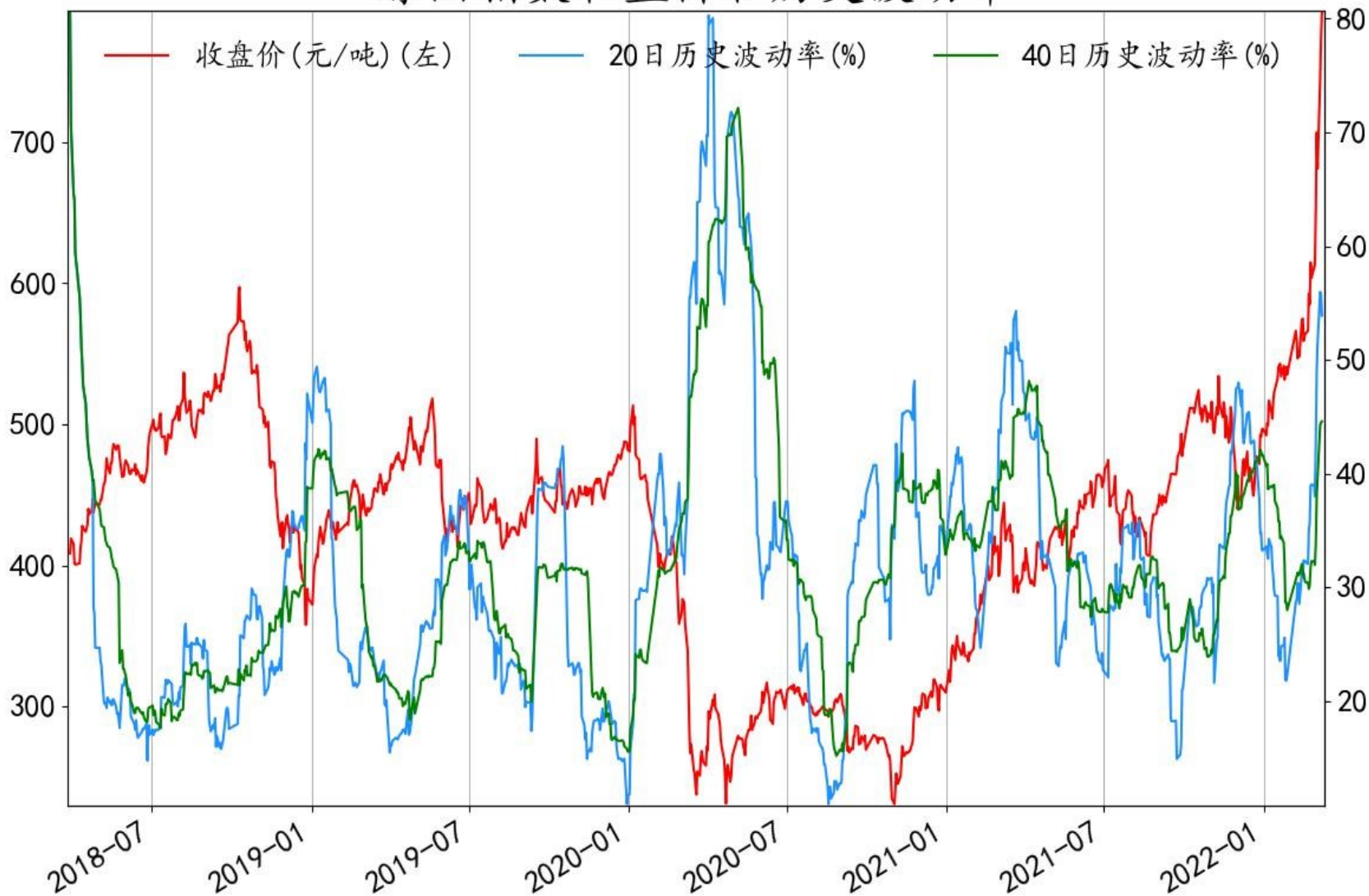
## 低硫燃油指数收盘价和历史波动率



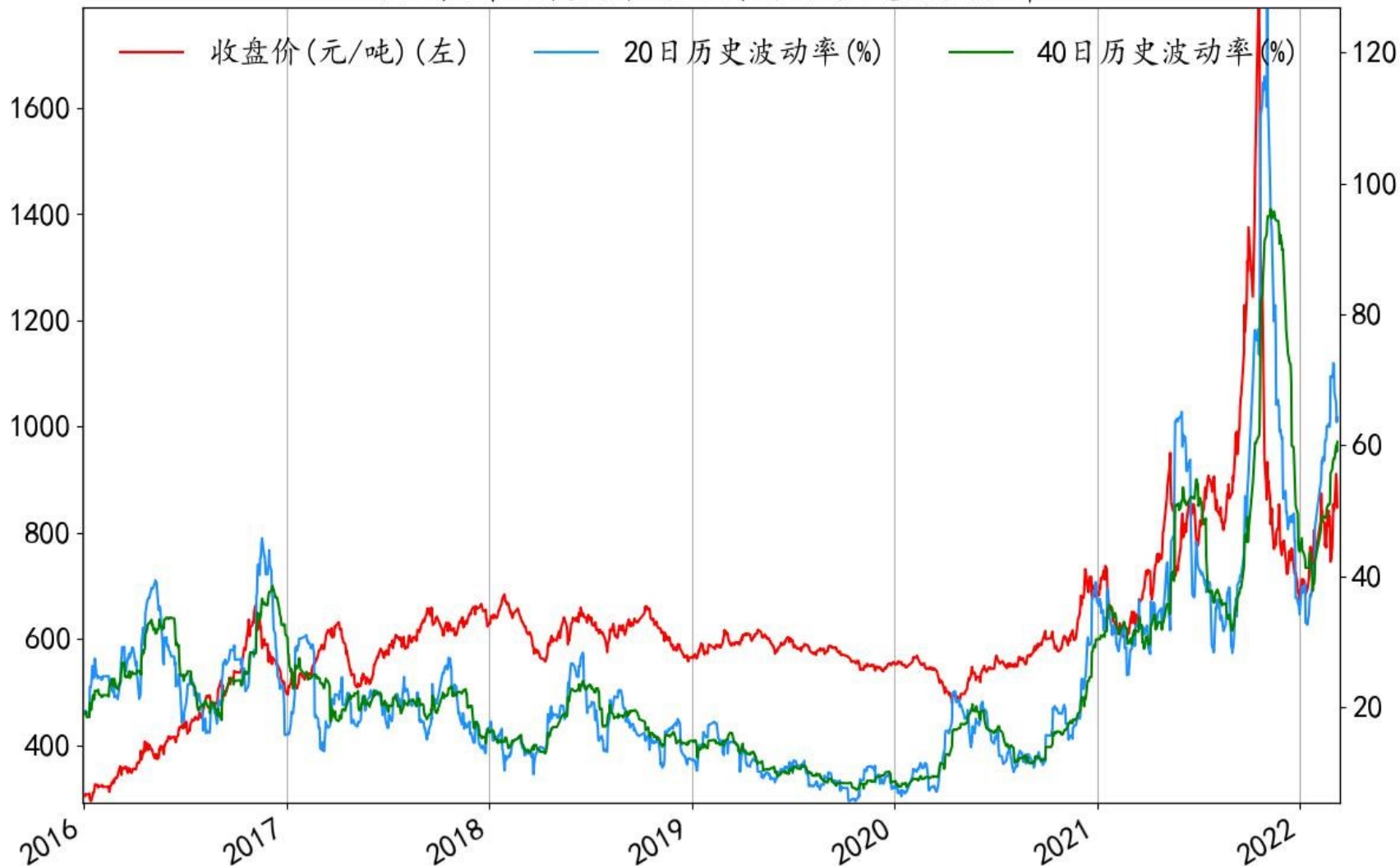
## LPG指数收盘价和历史波动率



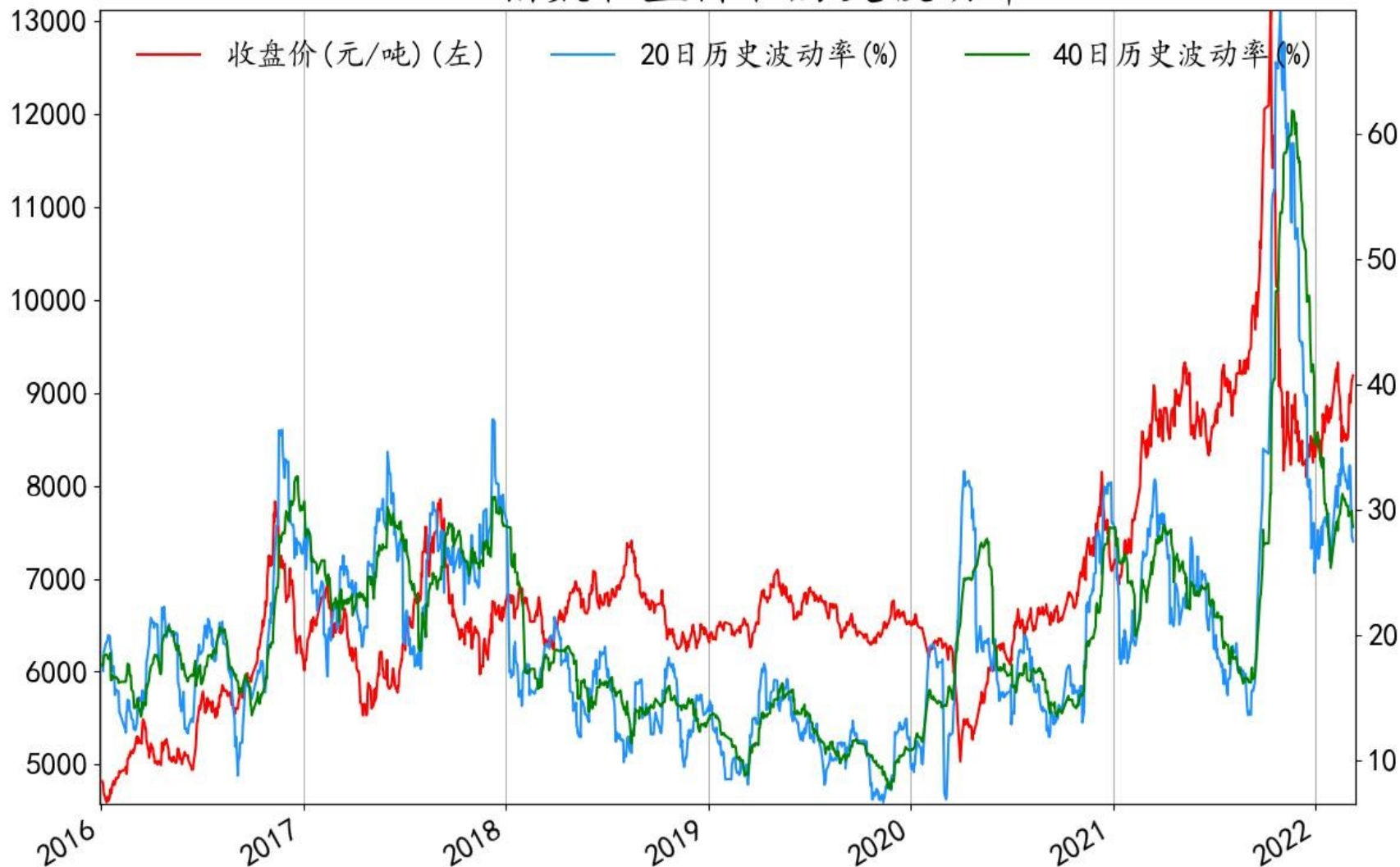
## 原油指数收盘价和历史波动率



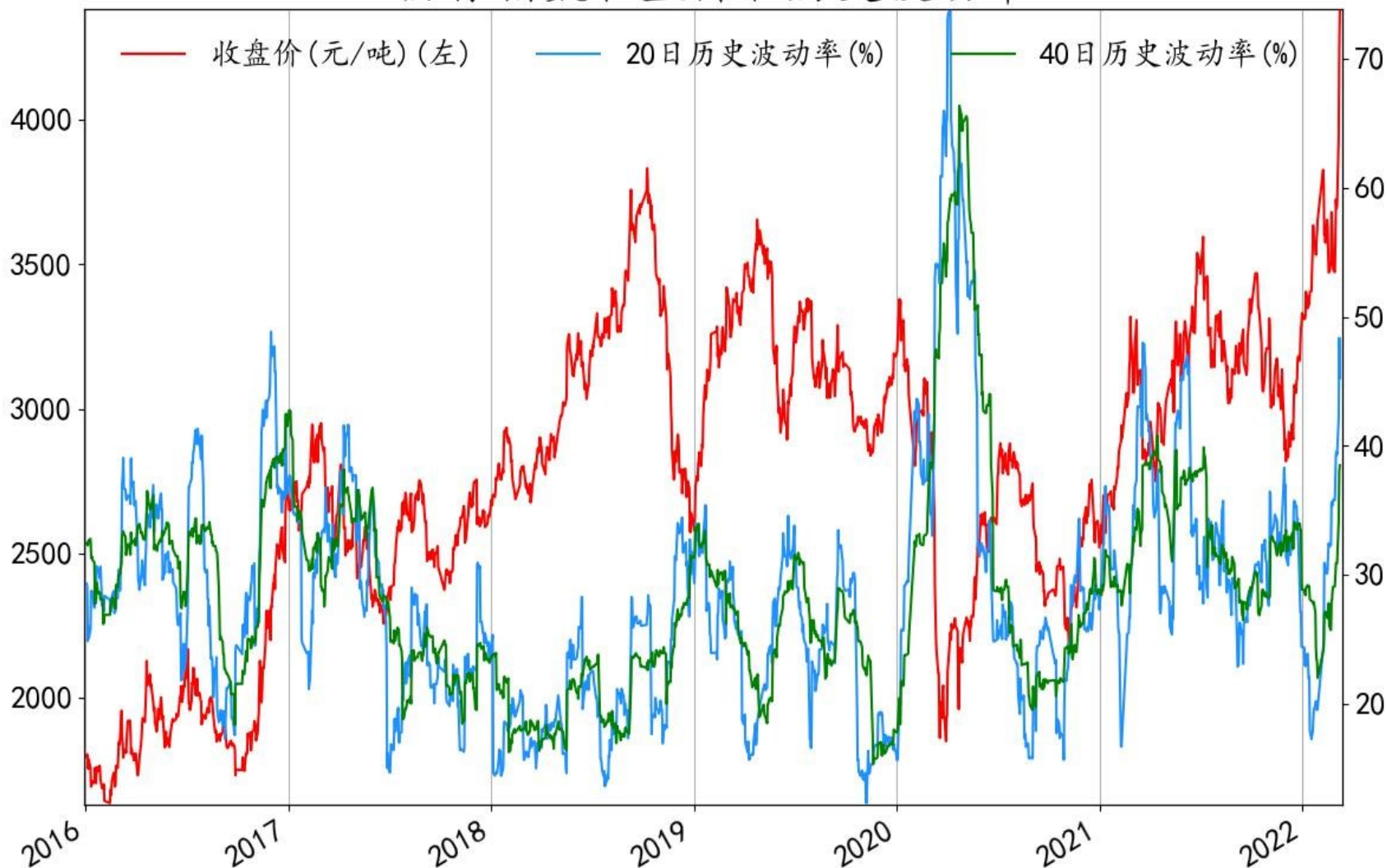
## 动力煤指数收盘价和历史波动率



## PVC指数收盘价和历史波动率

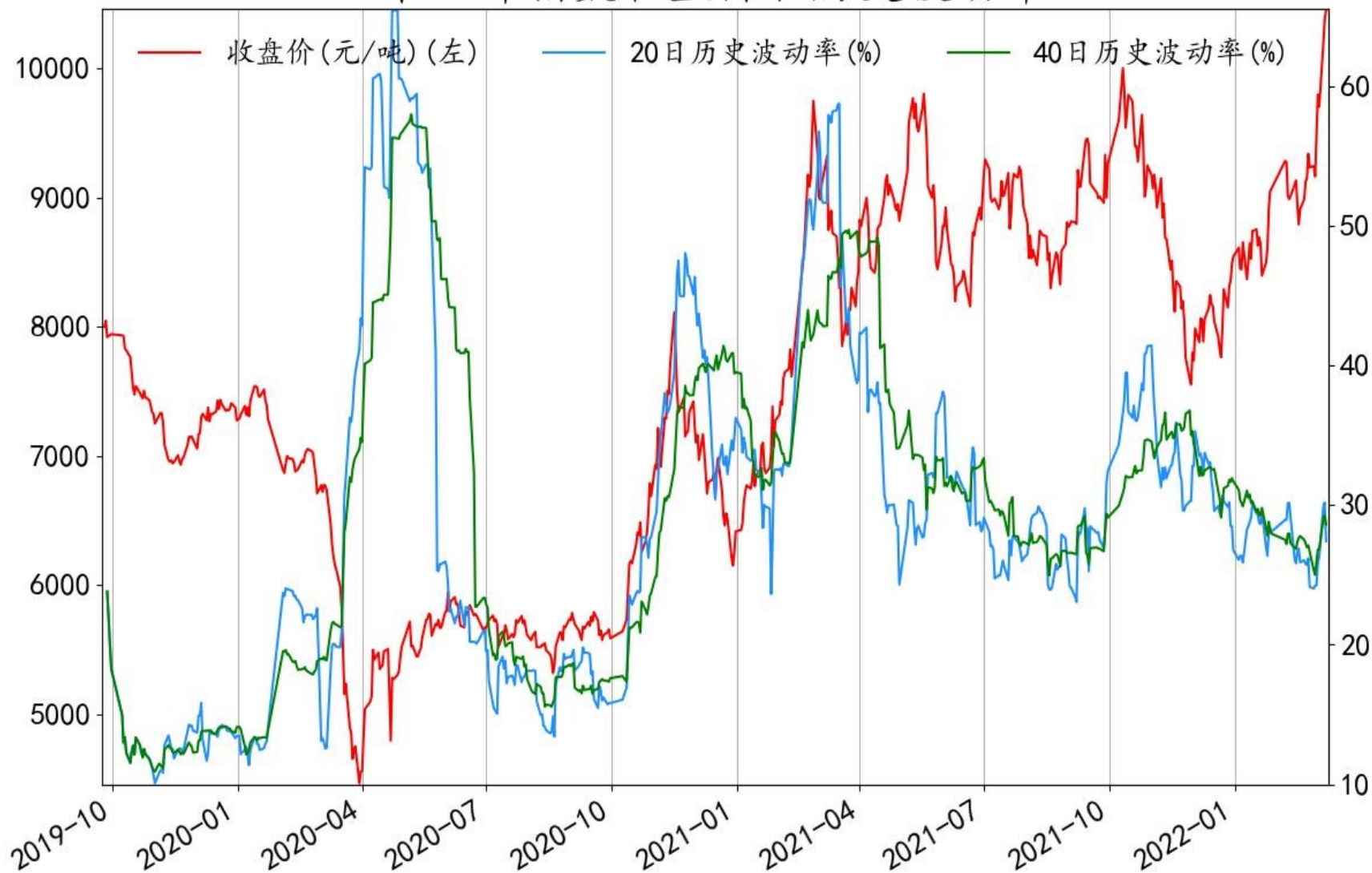


## 沥青指数收盘价和历史波动率



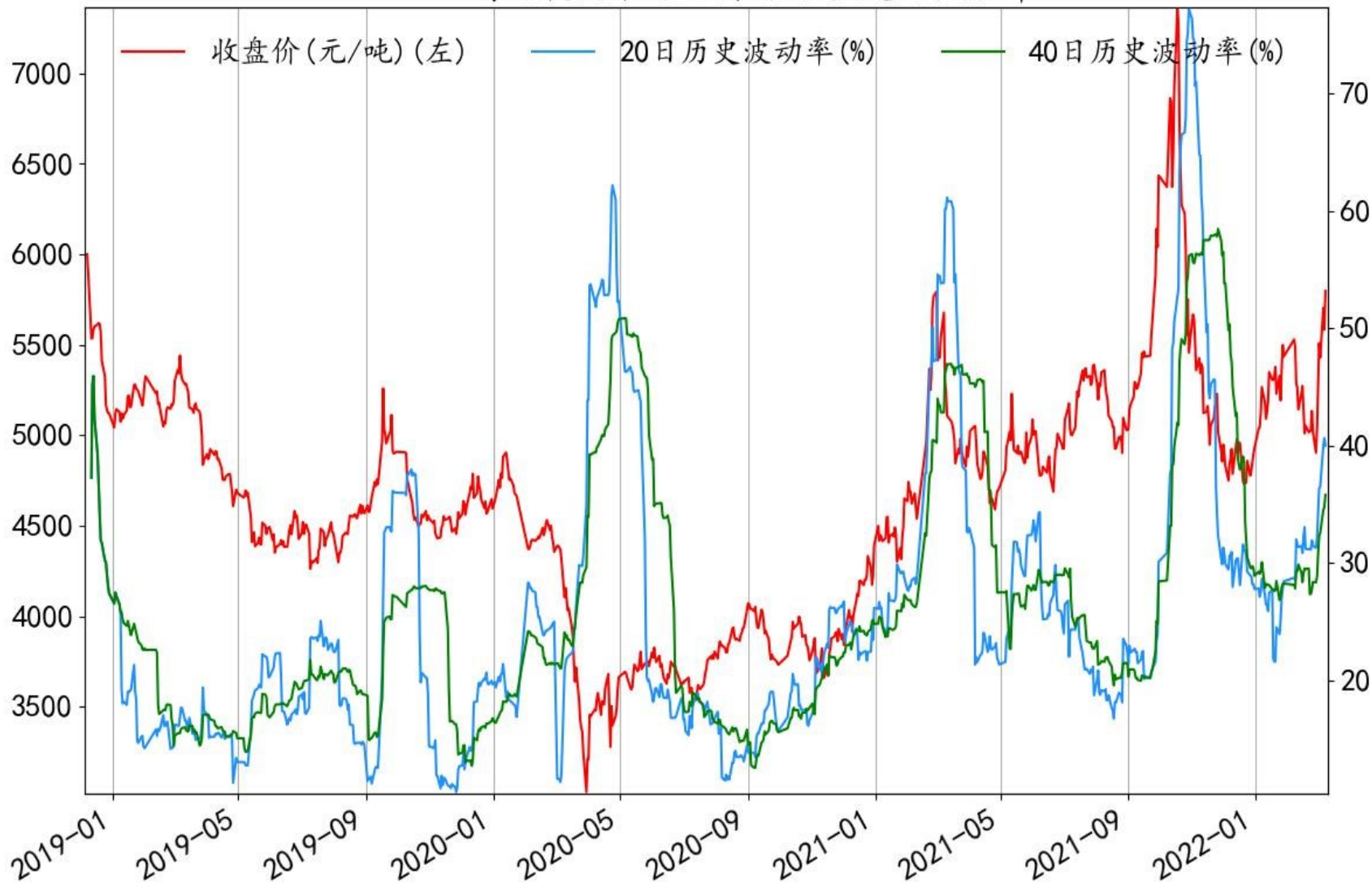
# 苯乙烯指数

## 苯乙烯指数收盘价和历史波动率

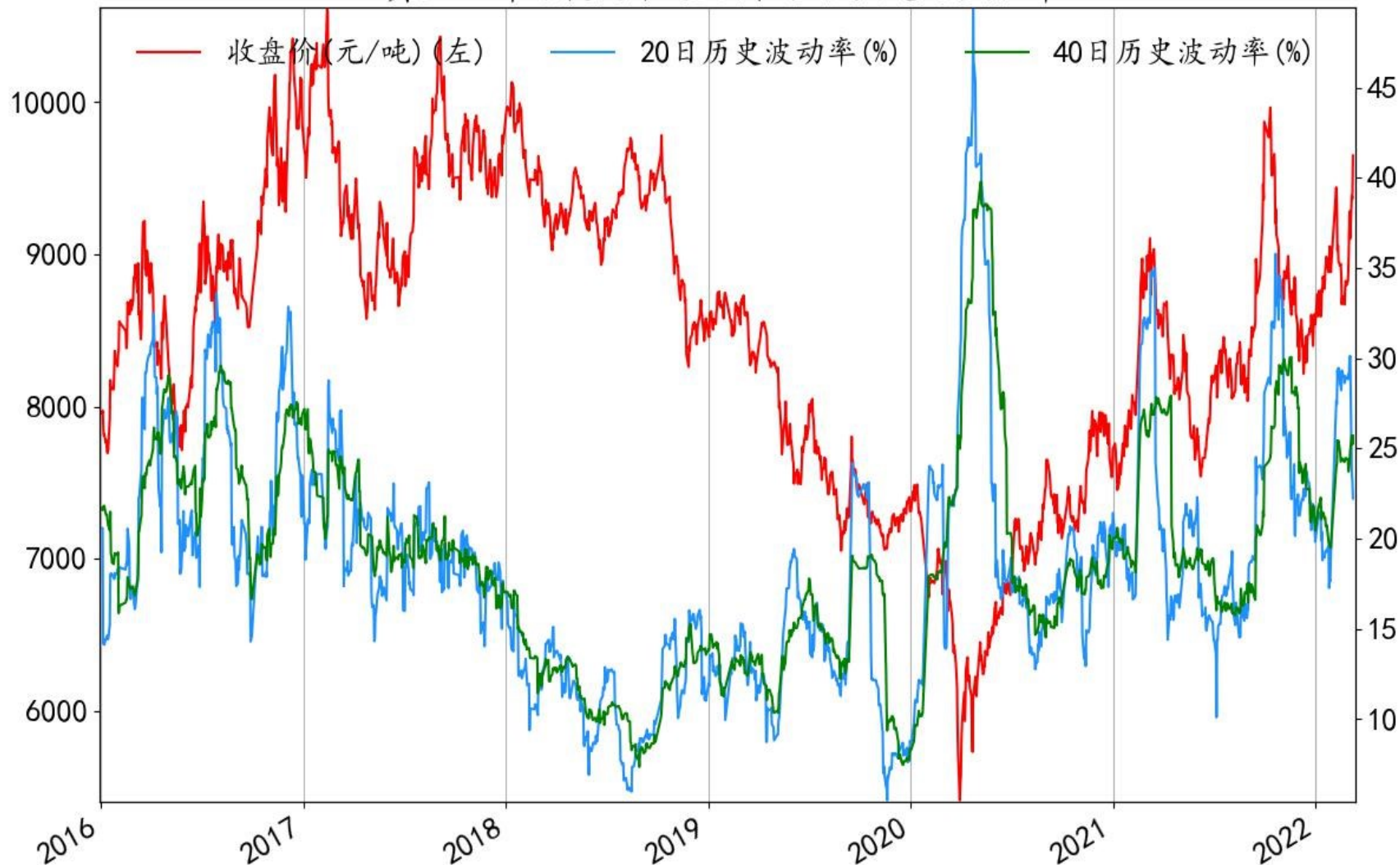


# 乙二醇指数

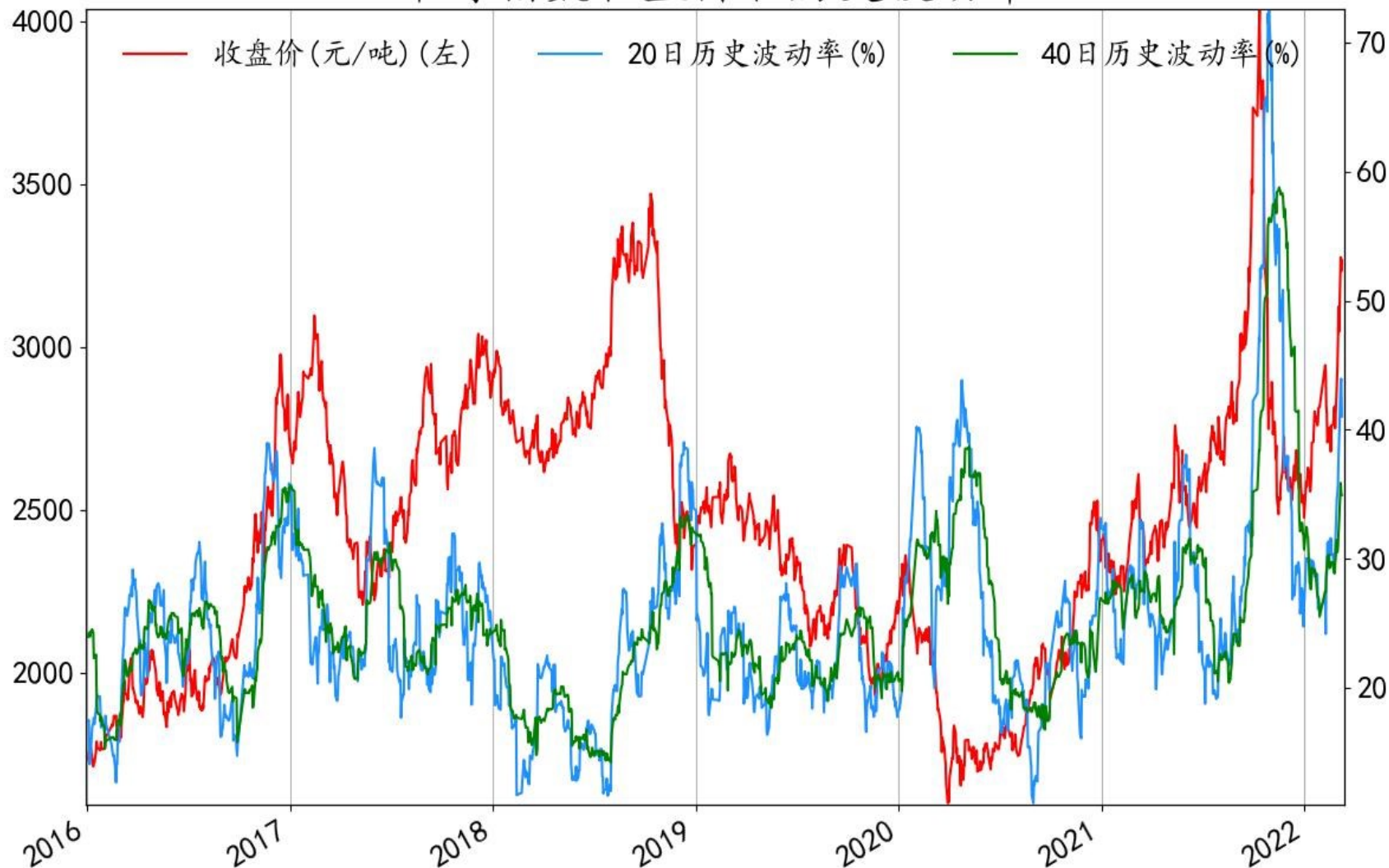
## 乙二醇指数收盘价和历史波动率



## 聚乙烯指数收盘价和历史波动率

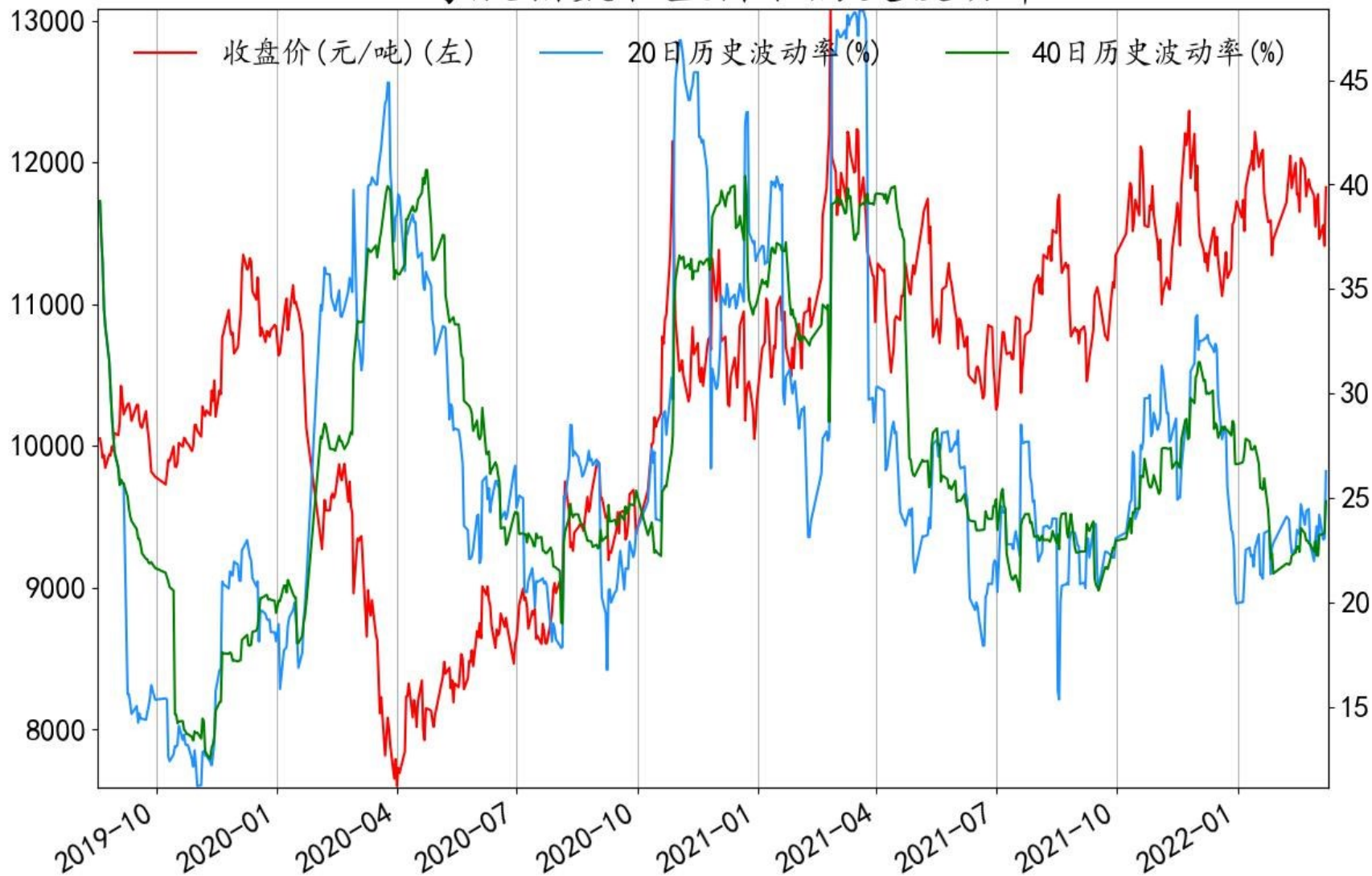


## 甲醇指数收盘价和历史波动率

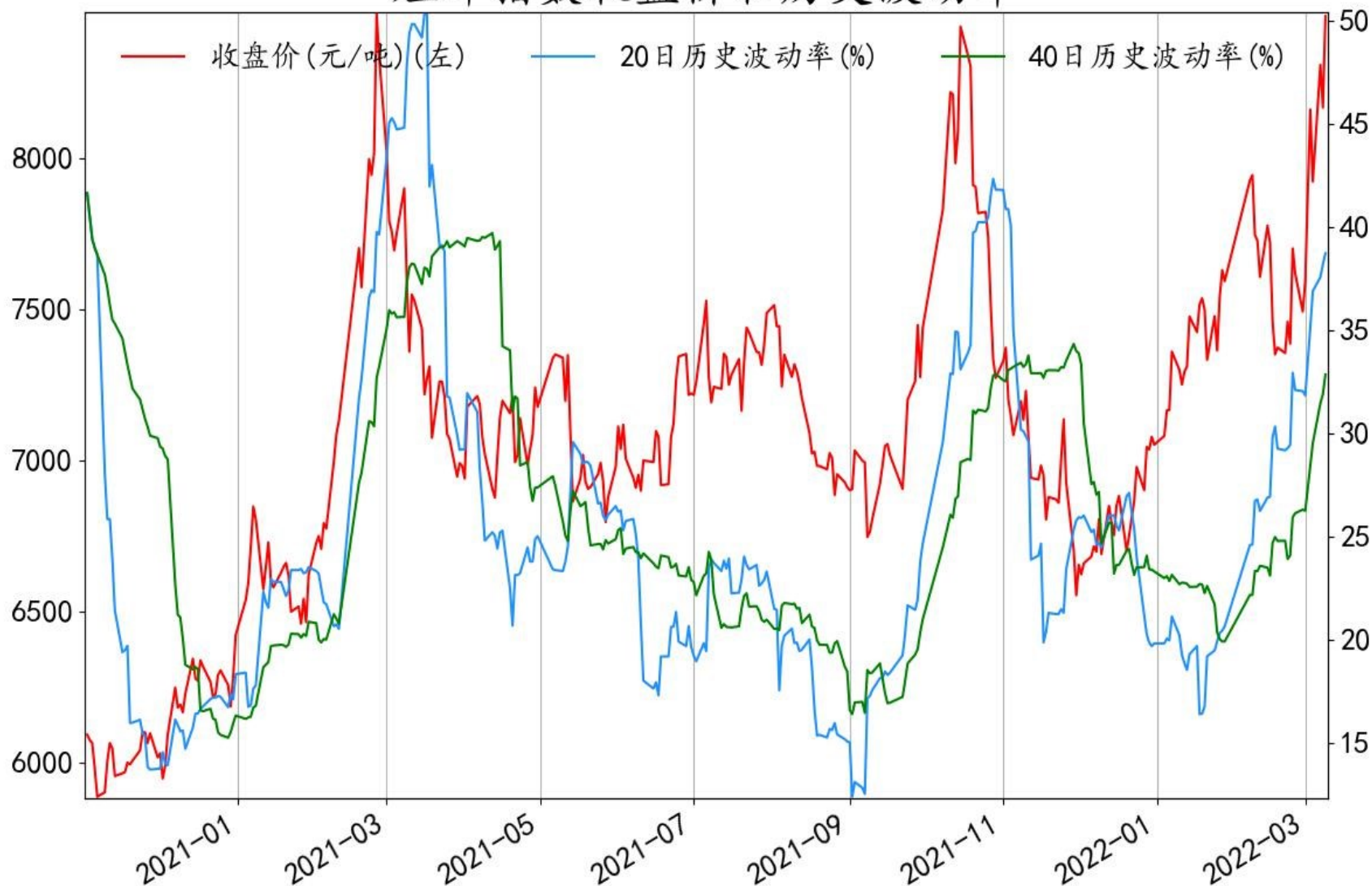


# 20号胶指数

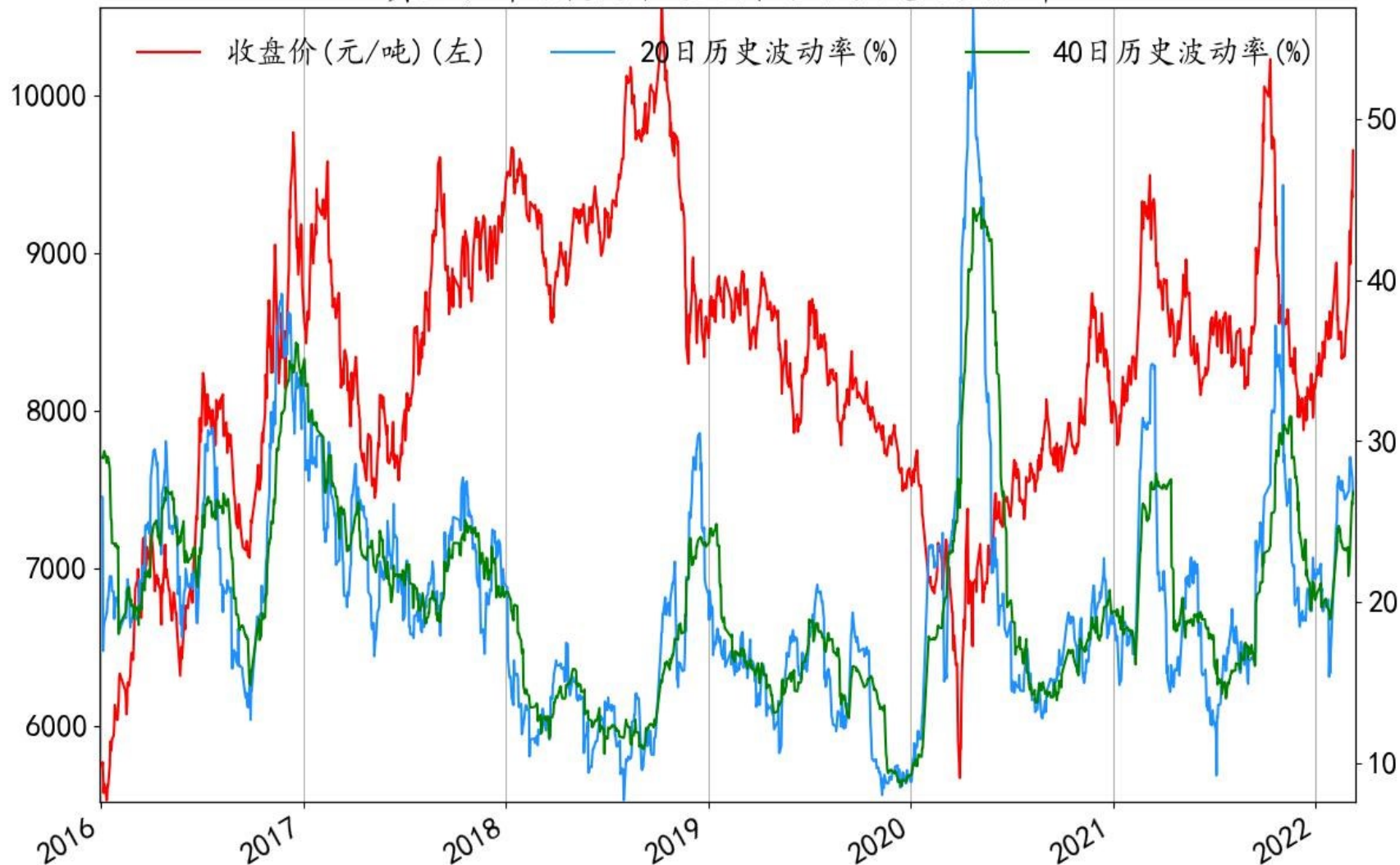
## 20号胶指数收盘价和历史波动率



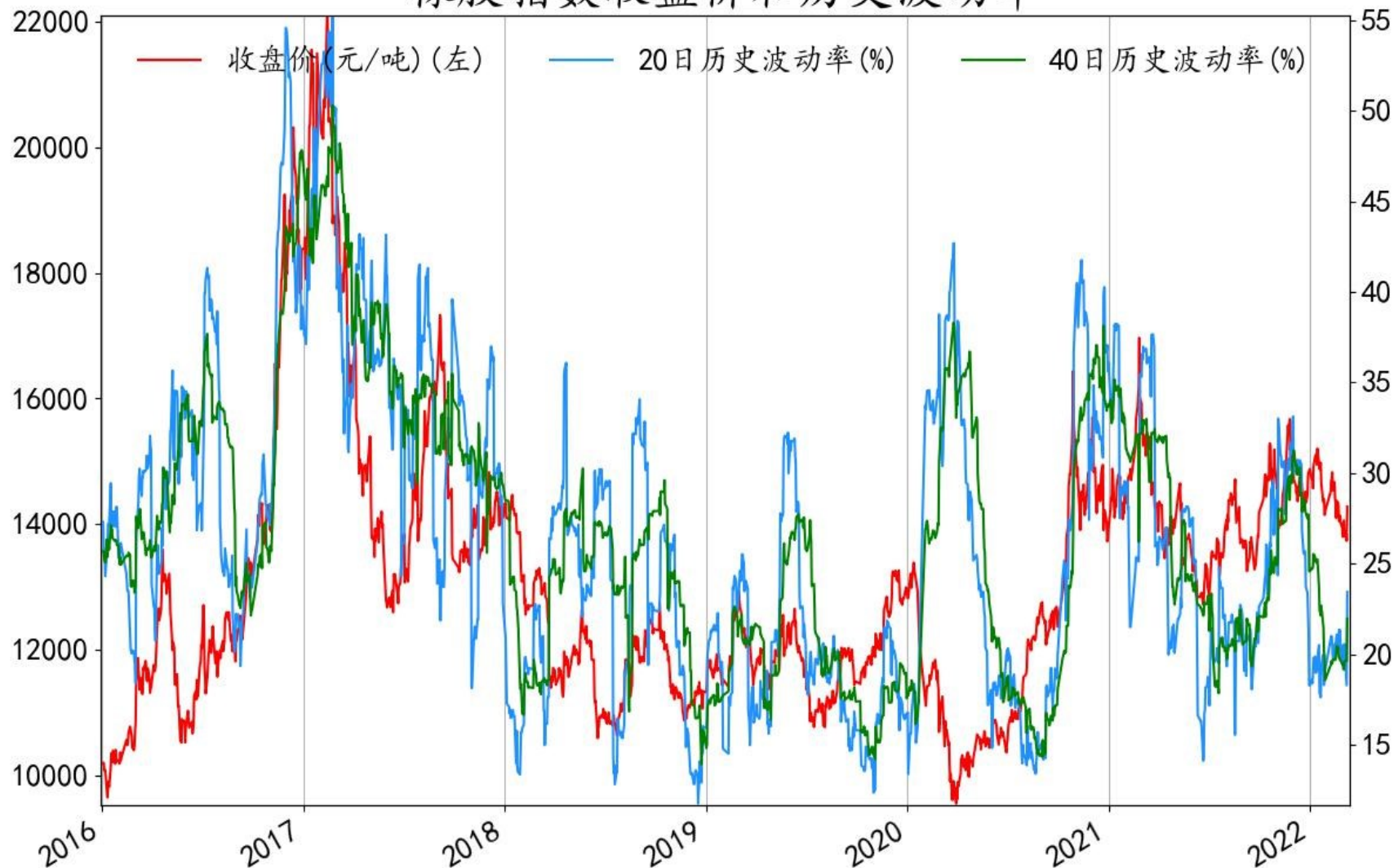
## 短纤指数收盘价和历史波动率



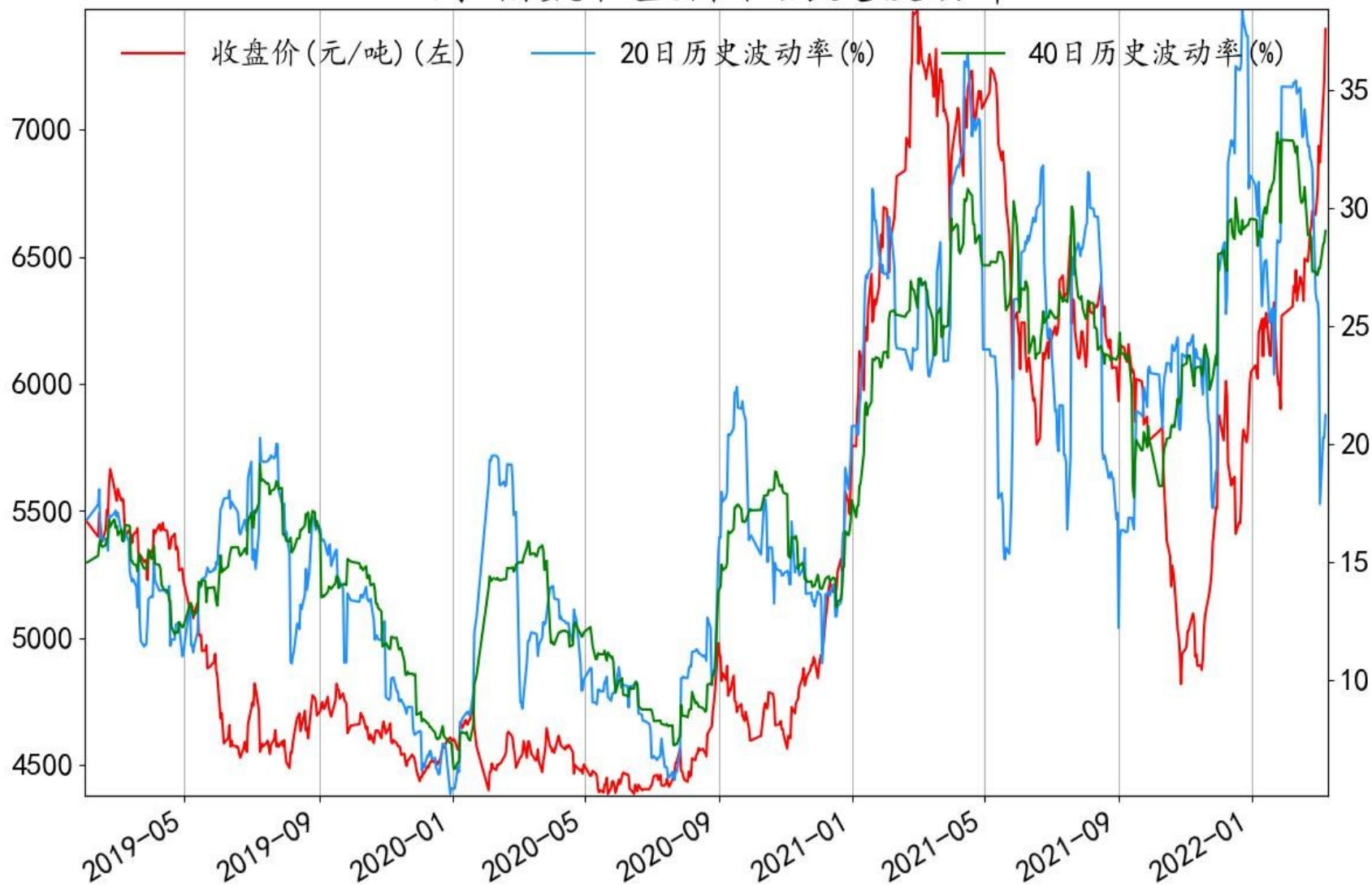
## 聚丙烯指数收盘价和历史波动率



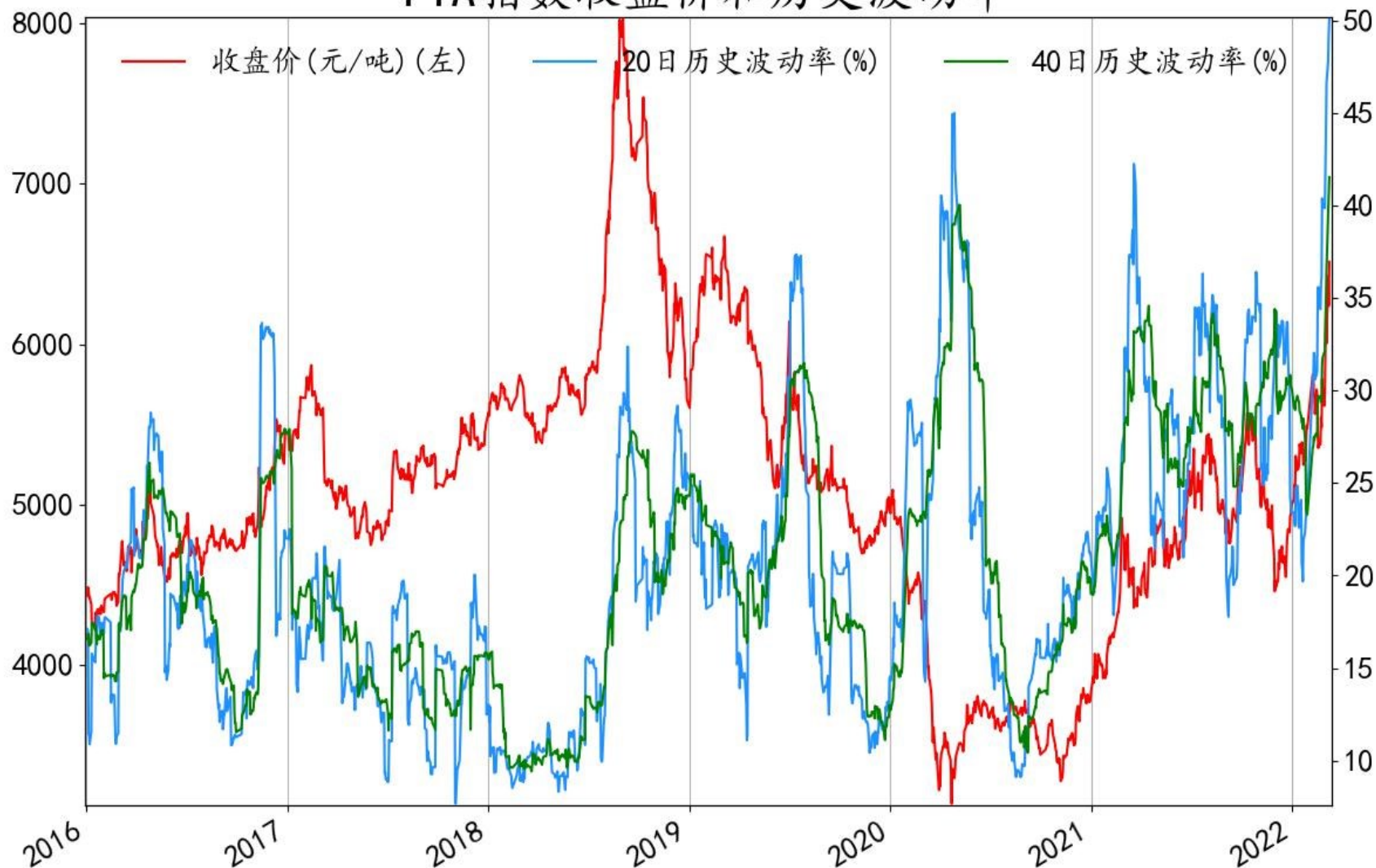
## 橡胶指数收盘价和历史波动率



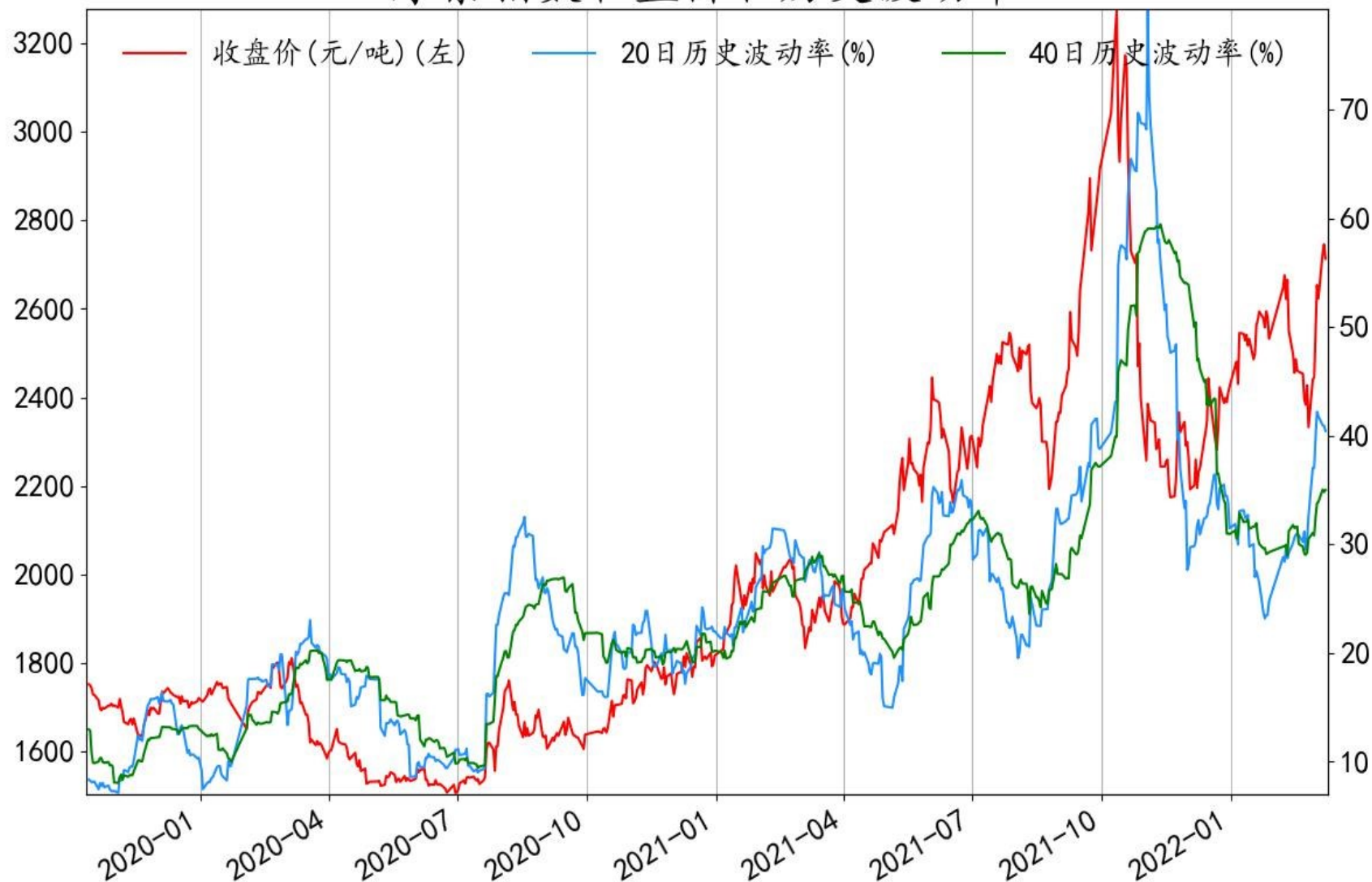
## 纸浆指数收盘价和历史波动率



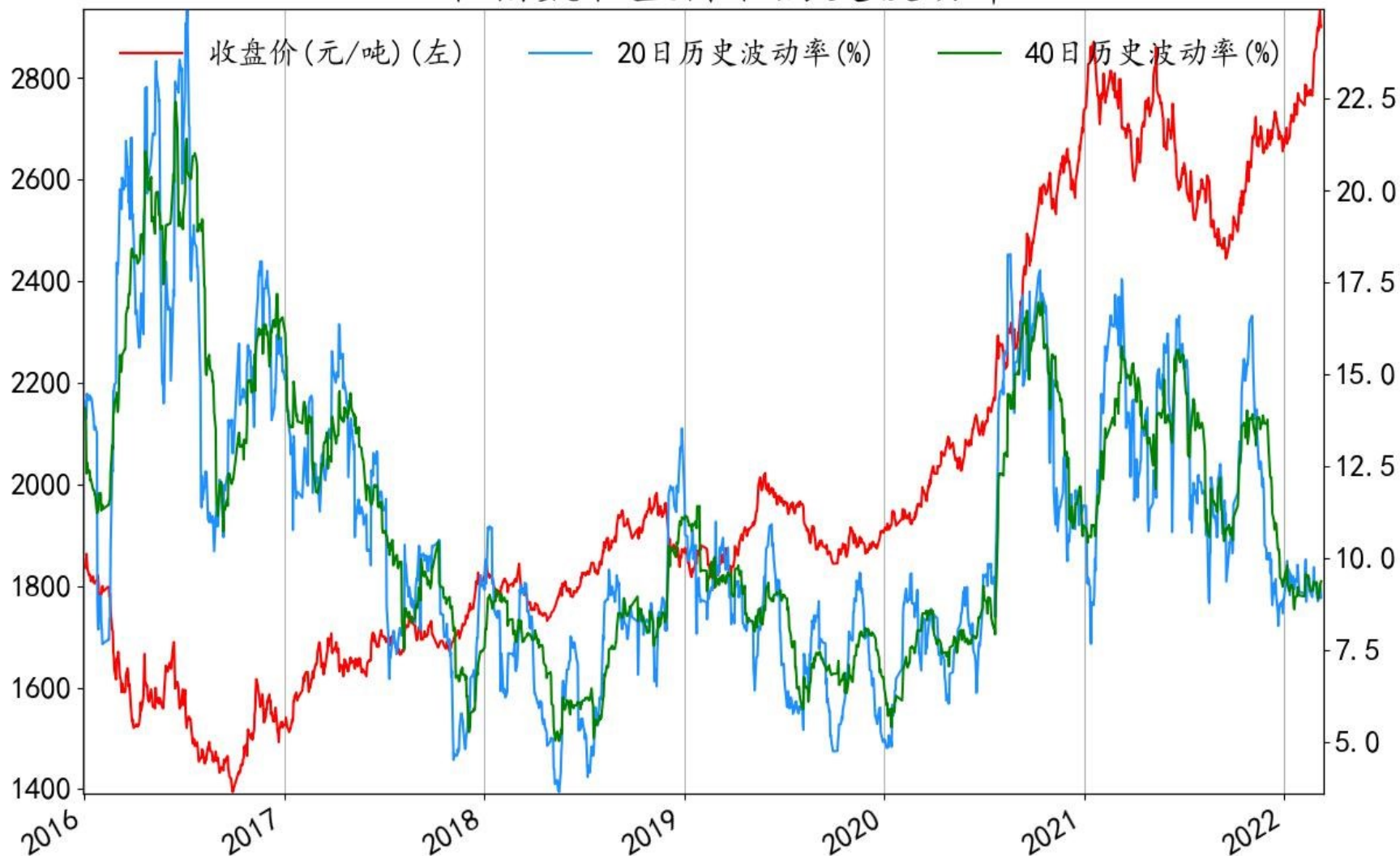
## PTA指数收盘价和历史波动率



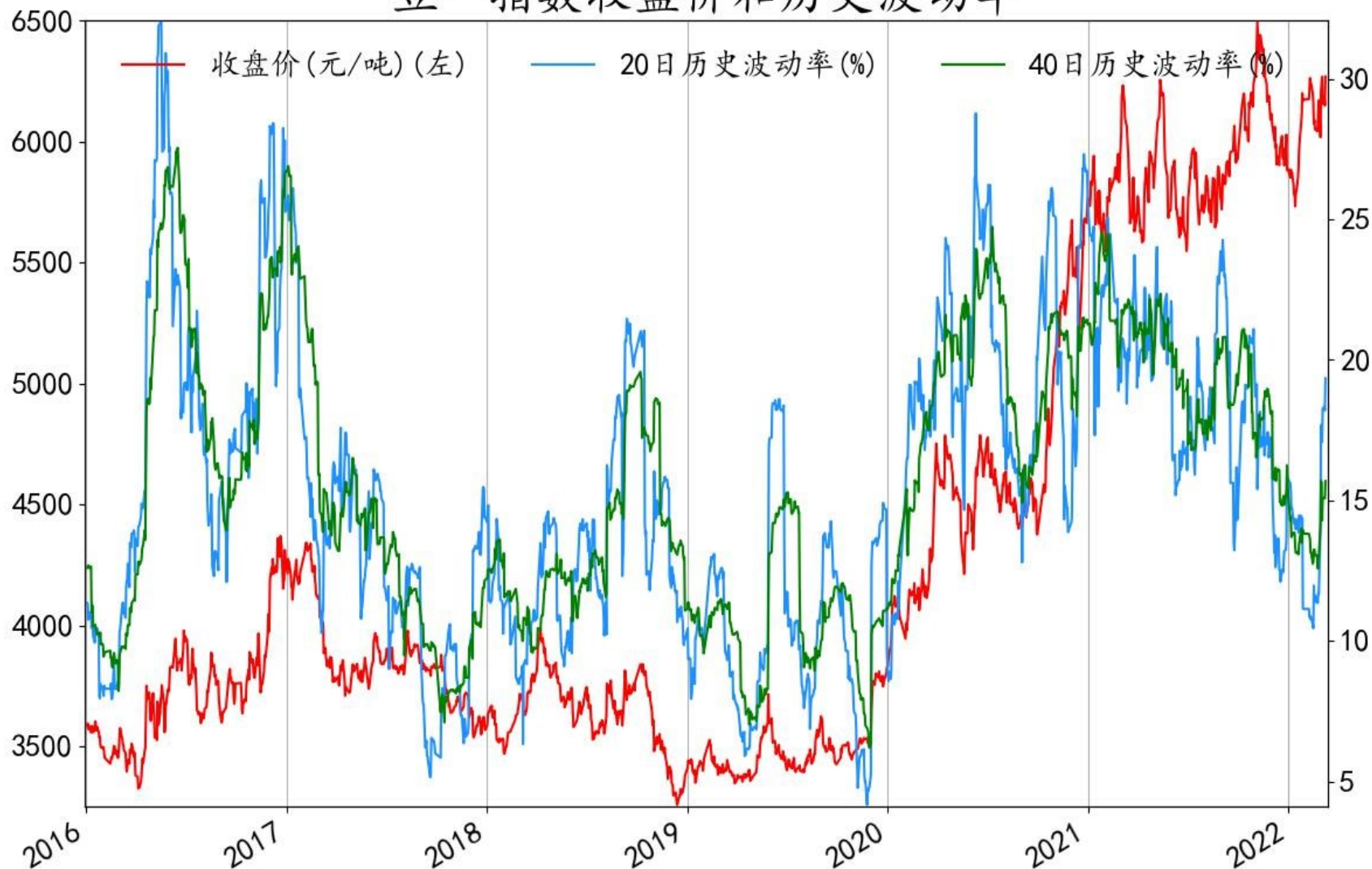
## 尿素指数收盘价和历史波动率



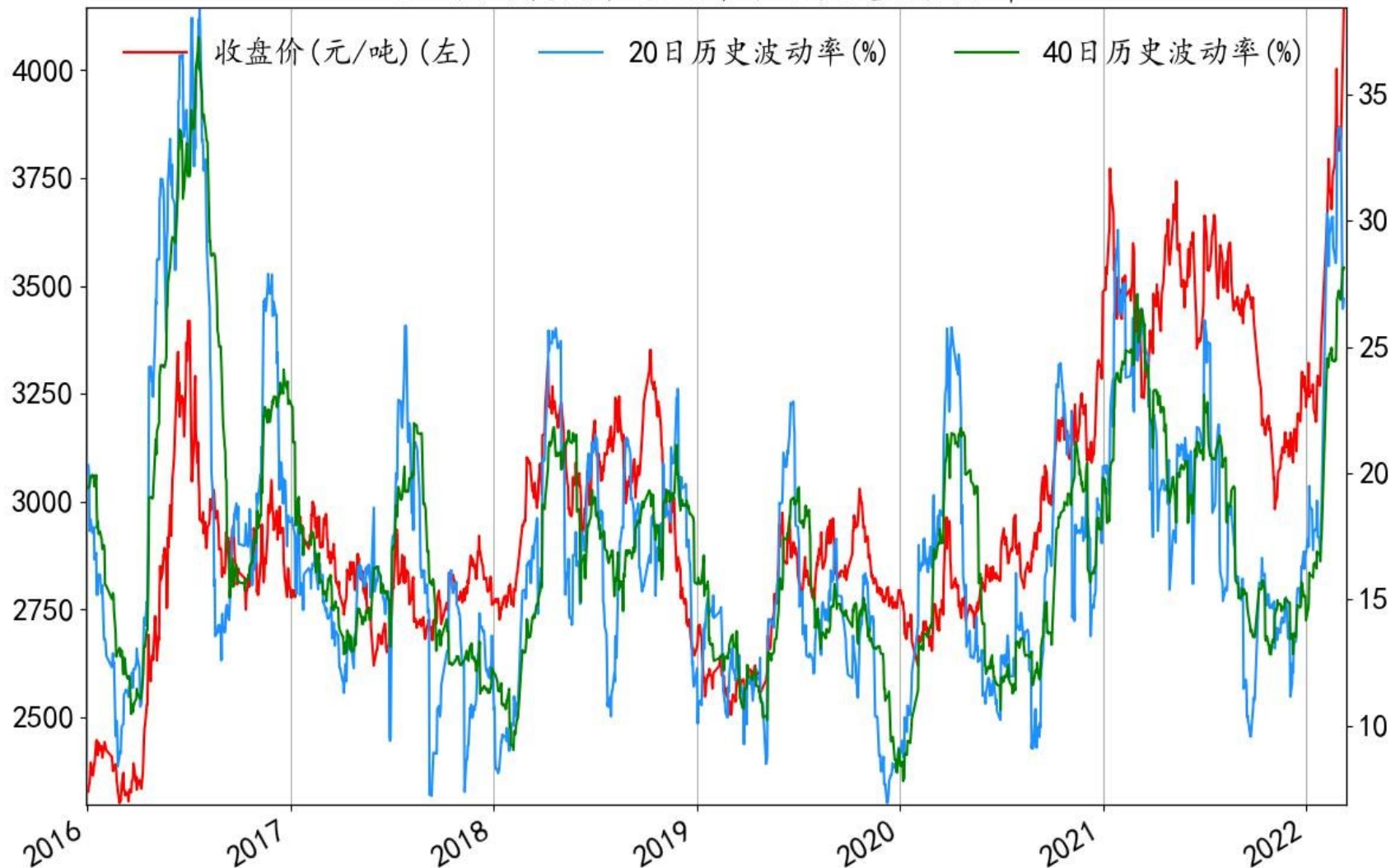
## 玉米指数收盘价和历史波动率



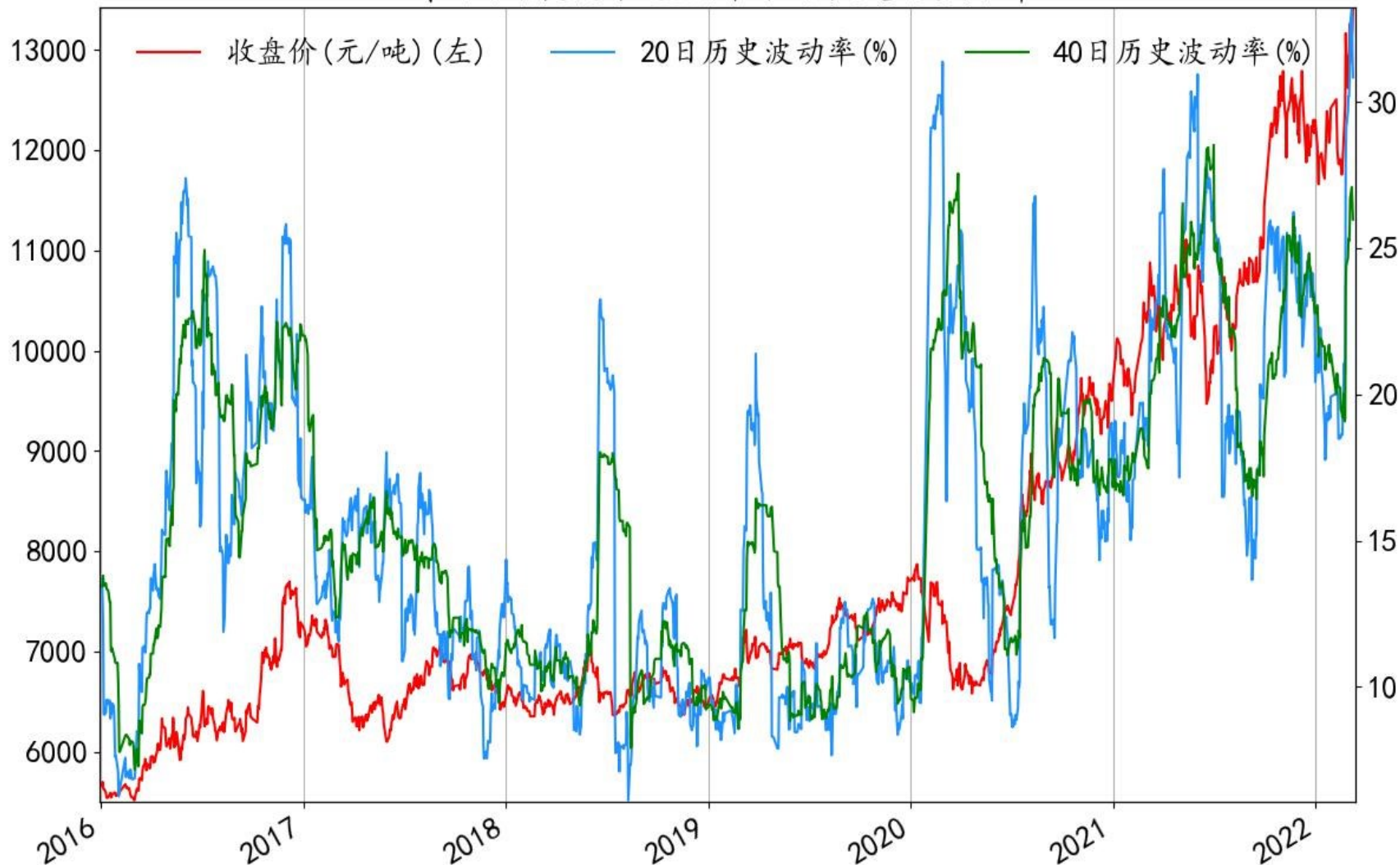
## 豆一指数收盘价和历史波动率



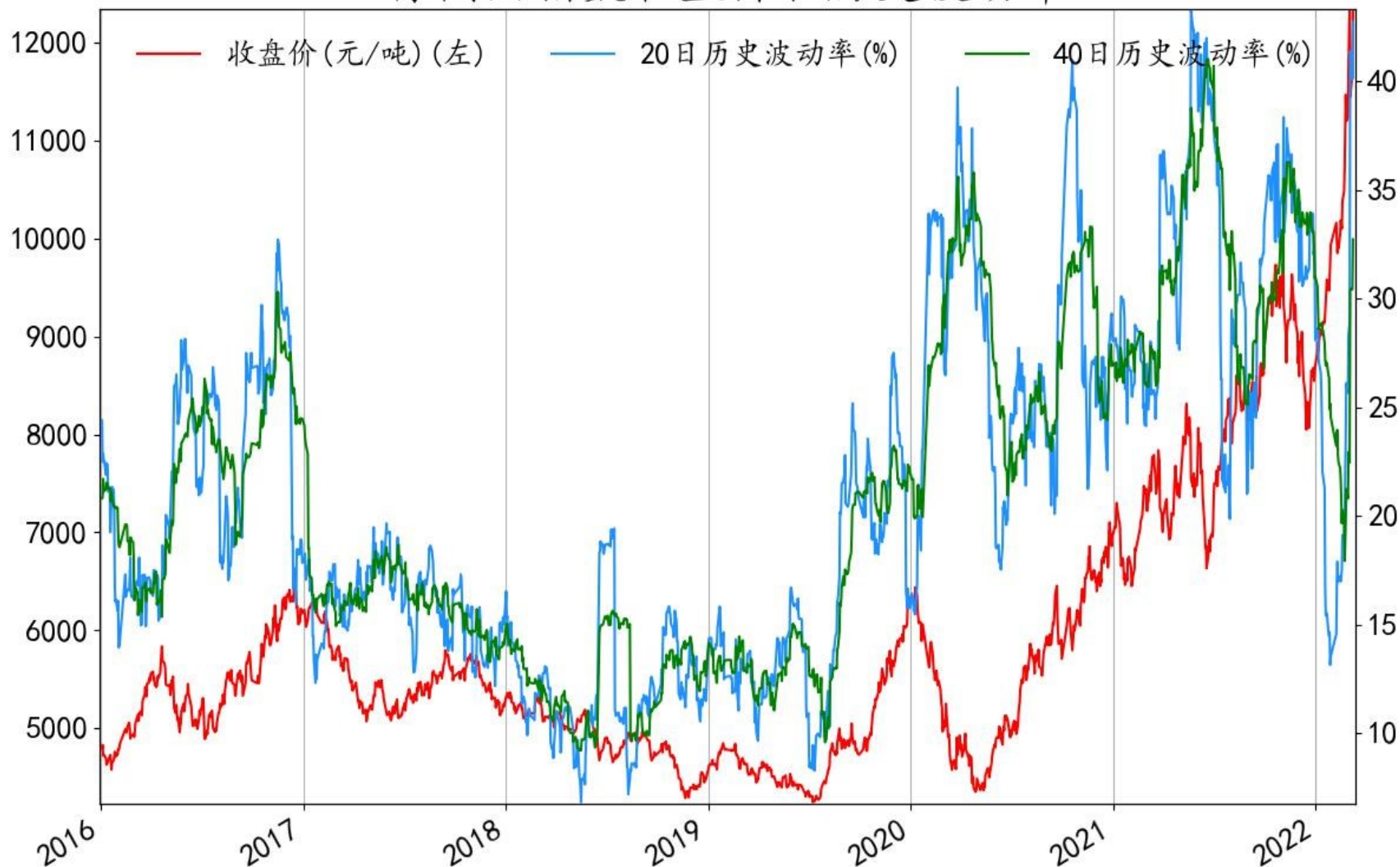
## 豆粕指数收盘价和历史波动率



## 菜油指数收盘价和历史波动率



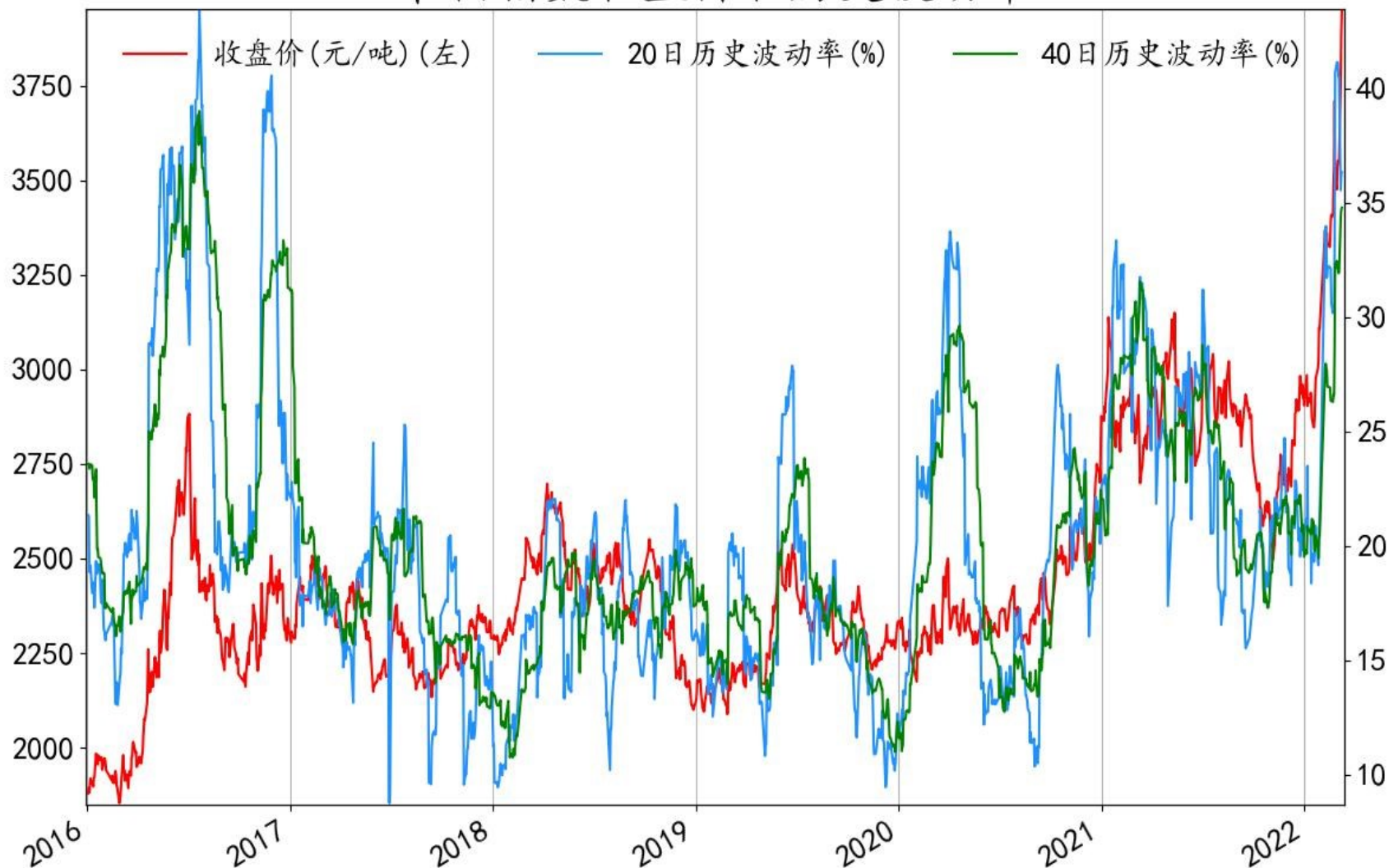
## 棕榈油指数收盘价和历史波动率



## 花生指数收盘价和历史波动率

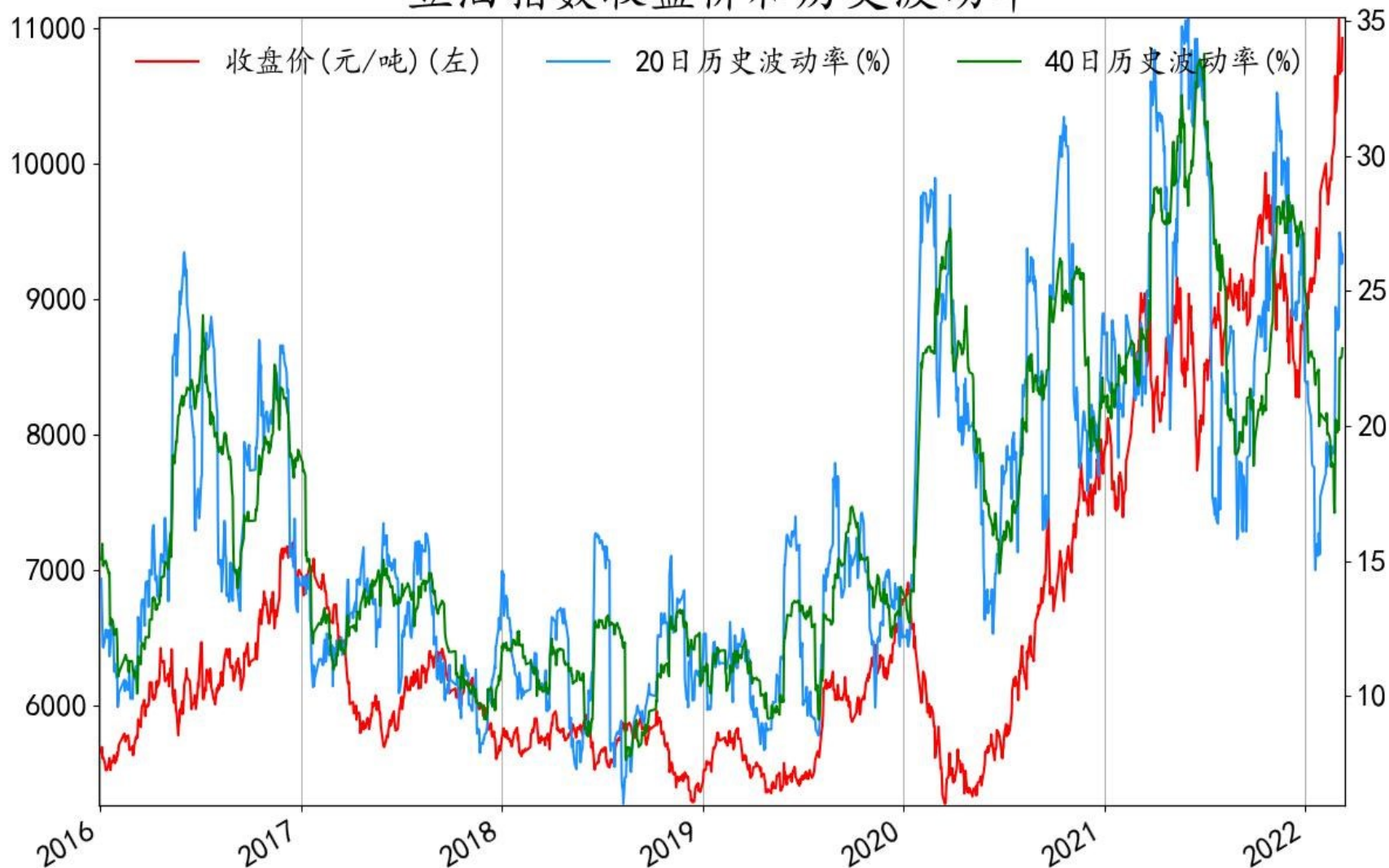


## 菜粕指数收盘价和历史波动率

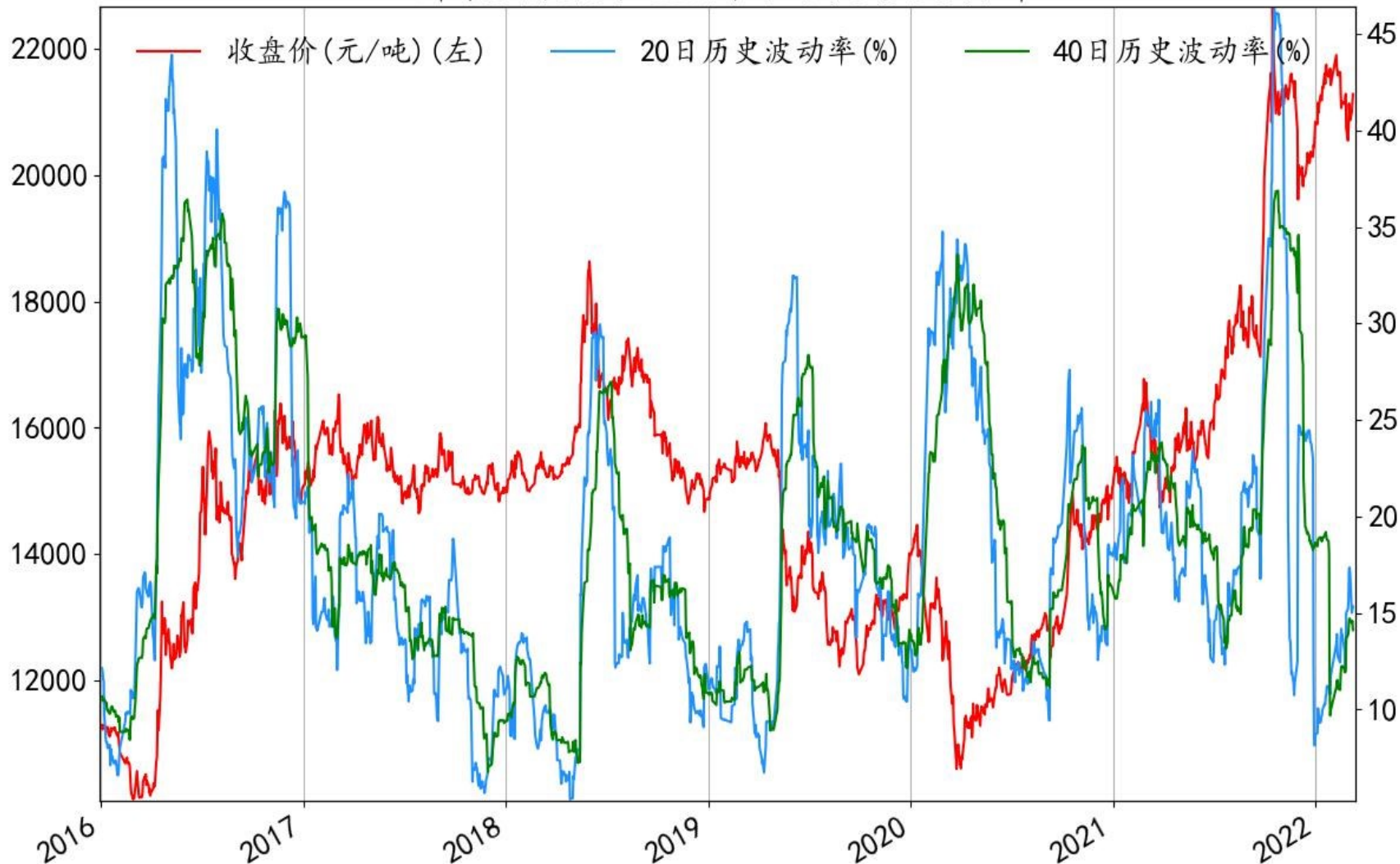


# 豆油指数

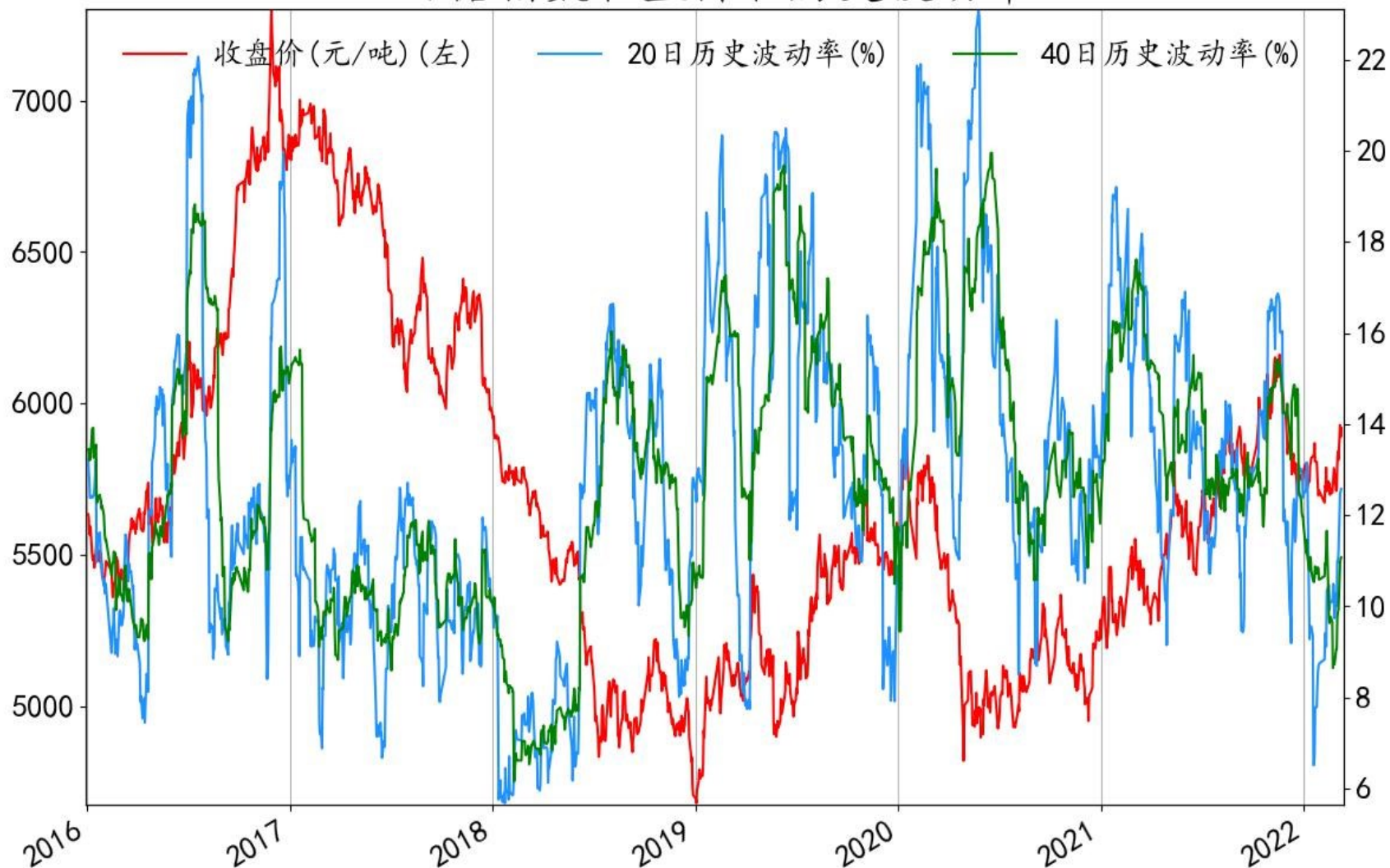
## 豆油指数收盘价和历史波动率



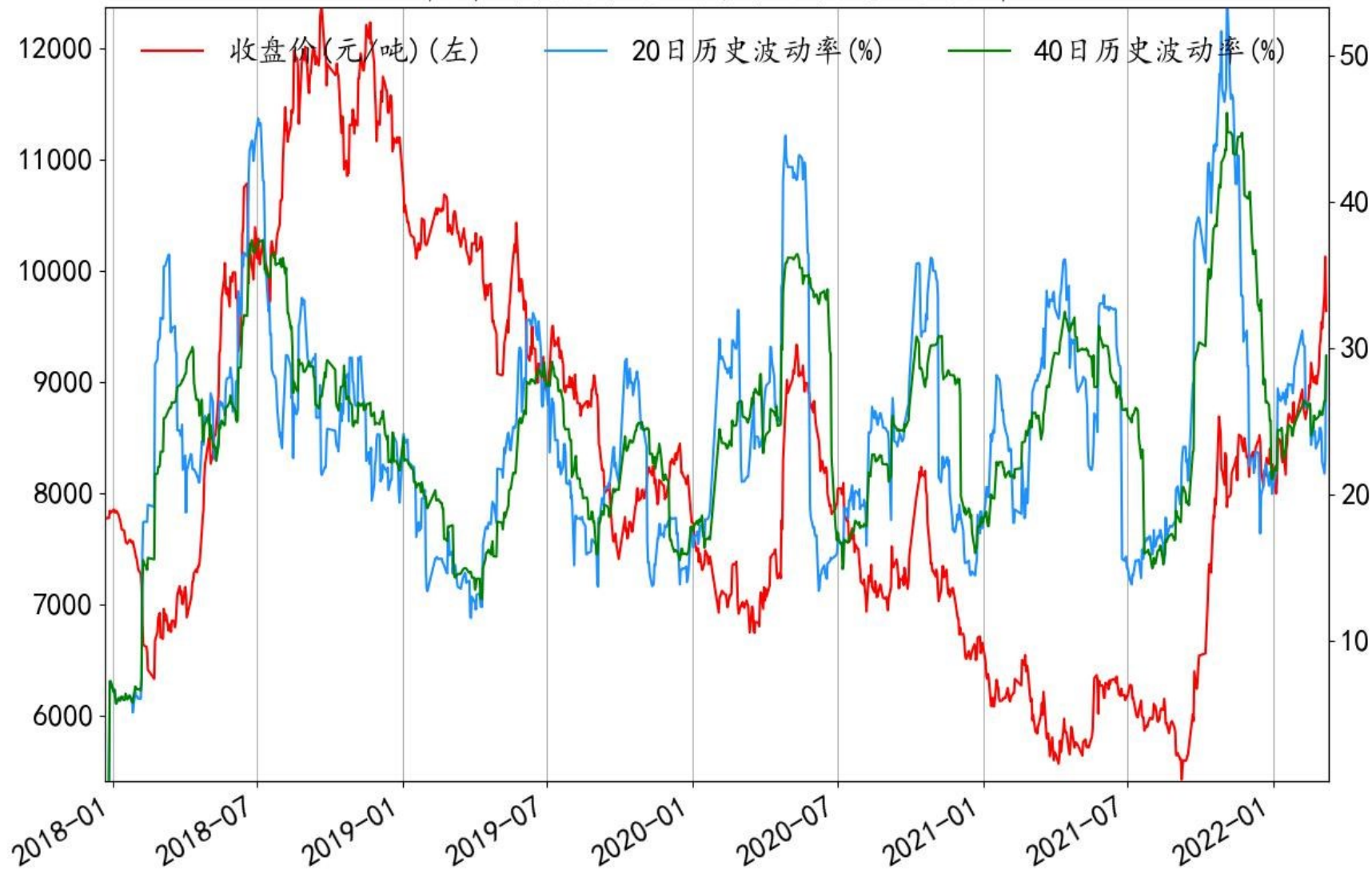
## 棉花指数收盘价和历史波动率



## 白糖指数收盘价和历史波动率



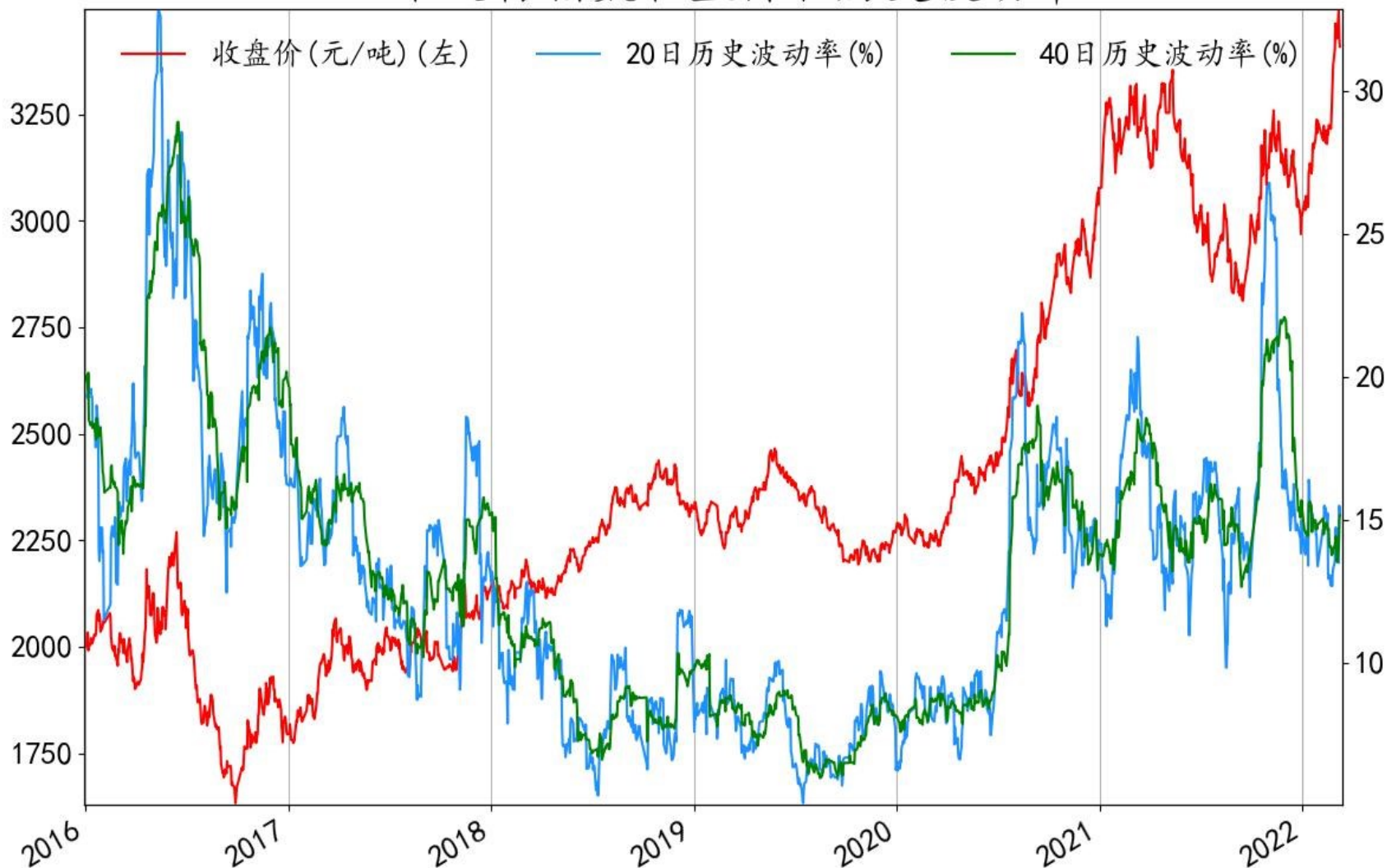
## 苹果指数收盘价和历史波动率



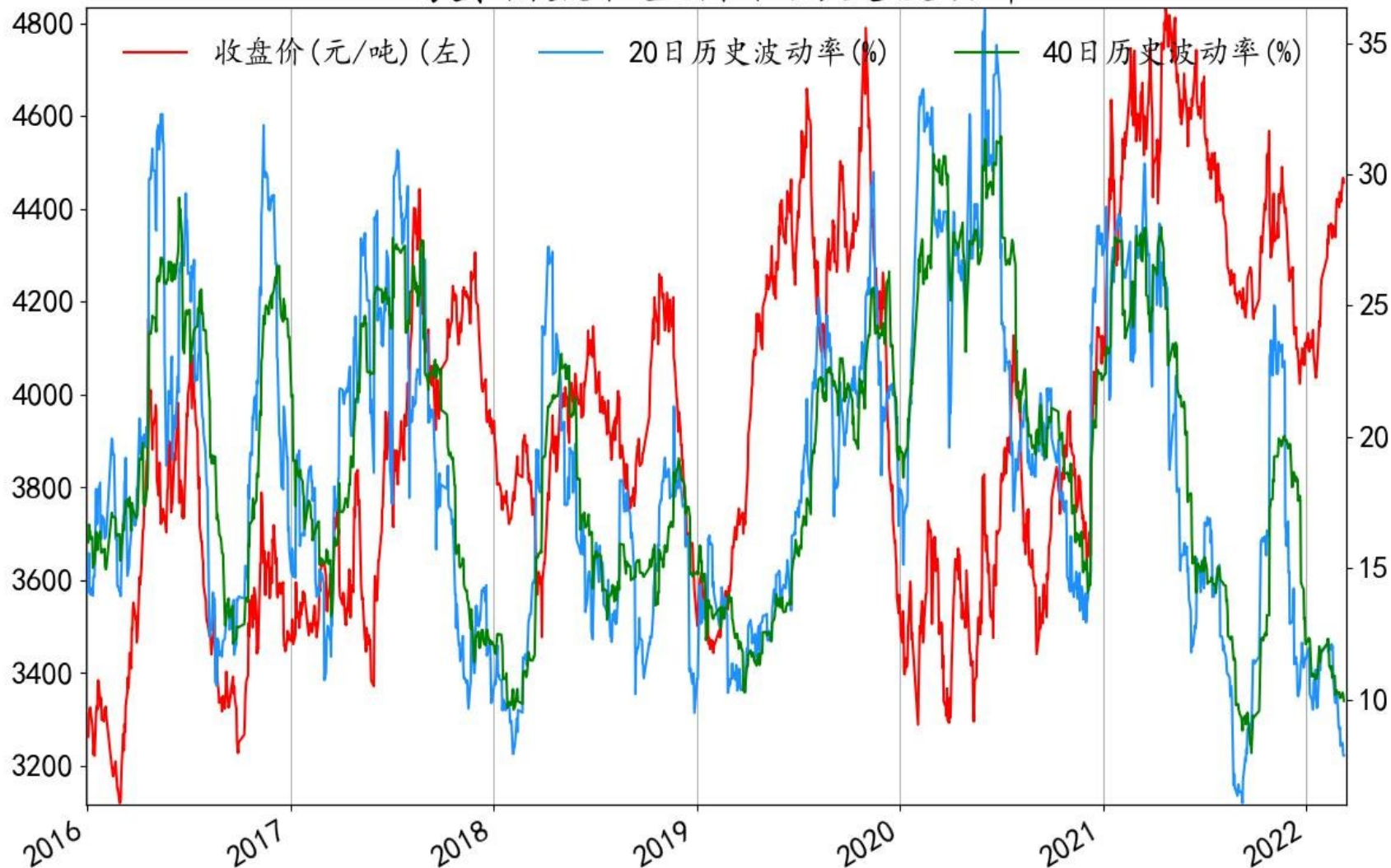
## 红枣指数收盘价和历史波动率



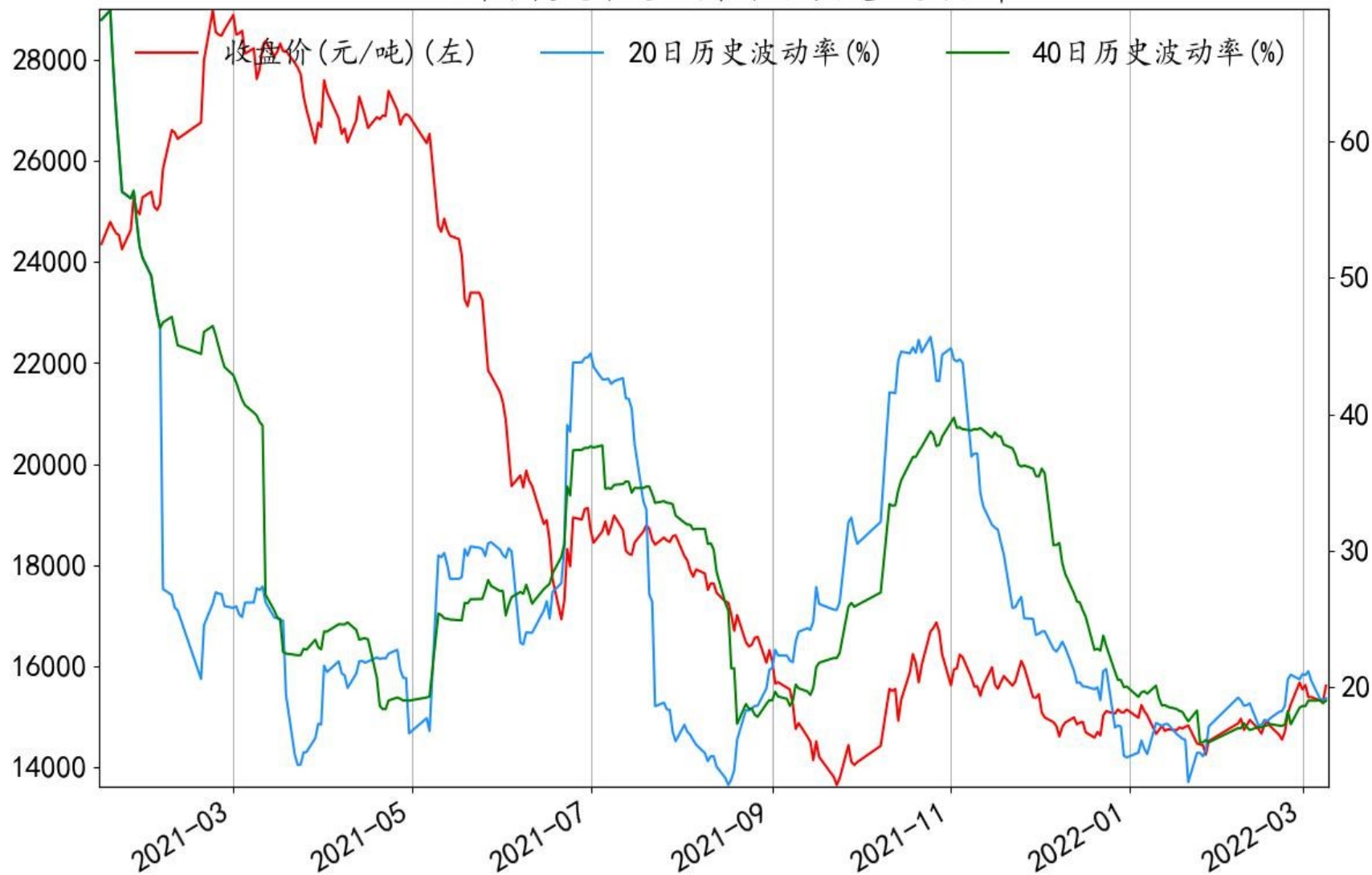
## 玉米淀粉指数收盘价和历史波动率



## 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



# 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。

信达期货研究所

电话：0571-28132535

QQ：736426384

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