

中国期货市场波动率/手续费评估表@www.paddingtonmacro.com

2021/11/14	最新价	合约乘数	品种价值	品种日ATR(6)	品种日ATR价值	开仓手续费	平仓手续费	平今手续费	开平合计 (平今)	开平合计 (非平今)	波动/手续费比 (平今)	波动/手续费比 (平今) 排序	波动/手续费比 (非平今)	波动/手续费比 (非平今) 排序
IF.CFE	4893.8	300	1468140	67.07	20120.00	33.77	33.77	506.51	540.28	67.53	37.24	47	297.92	19
IH.CFE	3229.2	300	968760	49.80	14940.00	22.28	22.28	334.22	356.50	44.56	41.91	46	335.26	16
IC.CFE	7165	200	1433000	78.43	15686.67	32.96	32.96	494.39	527.34	65.92	29.75	48	237.97	27
TS.CFE	100.805	20,000	2016100	0.06	1133.33	3	3	0	3	6	377.78	12	188.89	37
TF.CFE	101.025	10,000	1010250	0.15	1450.00	3	3	0	3	6	483.33	10	241.67	24
T.CFE	99.785	10,000	997850	0.29	2908.33	3	3	0	3	6	969.44	1	484.72	12
AU.SHF	385.16	1,000	385160	4.81	4813.33	10	10	0	10	20	481.33	11	240.67	26
AG.SHF	5217	15	78255	112.67	1690.00	3.91	3.91	3.91	7.83	7.83	215.96	24	215.96	32
CU.SHF	71160	5	355800	1205.00	6025.00	17.79	17.79	35.58	53.37	35.58	112.89	34	169.34	38
AL.SHF	19655	5	98275	696.67	3483.33	3	3	15	18	6	193.52	27	580.56	7
ZN.SHF	23280	5	116400	598.33	2991.67	3	3	15	18	6	166.20	30	498.61	11
PB.SHF	15475	5	77375	250.83	1254.17	3.10	3.10	3.10	6.19	6.19	202.61	26	202.61	34
NI.SHF	147880	1	147880	3518.33	3518.33	3	3	45	48	6	73.30	39	586.39	6
SN.SHF	285900	1	285900	8011.67	8011.67	3	3	60	63	6	127.17	32	1335.28	1
A.DCE	6445	10	64450	119.67	1196.67	2	2	2	4	4	299.17	16	299.17	18
P.DCE	9520	10	95200	390.33	3903.33	2.5	2.5	2.5	5	5	780.67	3	780.67	4
Y.DCE	9562	10	95620	346.00	3460.00	2.5	2.5	2.5	5	5	692.00	4	692.00	5
OI.CZC	12535	10	125350	426.17	4261.67	2	2	6	8	4	532.71	8	1065.42	2
M.DCE	3133	10	31330	68.17	681.67	1.5	1.5	1.5	3	3	227.22	21	227.22	30
RM.CZC	2703	10	27030	69.00	690.00	1.5	1.5	1.5	3	3	230.00	19	230.00	28
C.DCE	2664	10	26640	45.67	456.67	1.2	1.2	1.2	2.4	2.4	190.28	28	190.28	36
CS.DCE	3192	10	31920	67.67	676.67	1.5	1.5	1.5	3	3	225.56	22	225.56	31
JD.DCE	4590	10	45900	72.50	725.00	6.89	6.89	6.89	13.77	13.77	52.65	42	52.65	47
AP.CZC	7990	10	79900	258.33	2583.33	5	5	20	25	10	103.33	36	258.33	21
CJ.CZC	15710	5	78550	646.67	3233.33	15	15	15	30	30	107.78	35	107.78	43
SR.CZC	6121	10	61210	98.67	986.67	3	3	0	3	6	328.89	13	164.44	39
CF.CZC	21425	5	107125	390.83	1954.17	10	10	10	20	20	97.71	37	97.71	44
CY.CZC	29040	5	145200	440.83	2204.17	4	4	0	4	8	551.04	6	275.52	20
SC.INE	515.7	1,000	515700	18.30	18300.00	20	20	0	20	40	915.00	2	457.50	13
BU.SHF	3124	10	31240	129.00	1290.00	3.12	3.12	3.12	6.25	6.25	206.47	25	206.47	33
FU.SHF	2850	10	28500	111.00	1110.00	1.43	1.43	21.38	22.80	2.85	48.68	44	389.47	15
RU.SHF	14575	10	145750	314.17	3141.67	3	3	15	18	6	174.54	29	523.61	10
SP.SHF	4904	10	49040	122.33	1223.33	2.45	2.45	0.00	2.45	4.90	498.91	9	249.46	23
L.DCE	9027	5	45135	228.67	1143.33	1	1	1	2	2	571.67	5	571.67	8
PP.DCE	8590	5	42950	218.83	1094.17	1	1	1	2	2	547.08	7	547.08	9
V.DCE	8714	5	43570	392.33	1961.67	1	1	5	6	2	326.94	14	980.83	3
TA.CZC	4990	5	24950	147.67	738.33	3	3	0	3	6	246.11	17	123.06	42
MA.CZC	2575	10	25750	151.50	1515.00	3	3	10	13	6	116.54	33	252.50	22
EG.DCE	5266	10	52660	240.33	2403.33	3	3	8	11	6	218.48	23	400.56	14
UR.CZC	2263	20	45260	97.50	1950.00	5	5	15	20	10	97.50	38	195.00	35
RB.SHF	4212	10	42120	192.67	1926.67	4.21	4.21	4.21	8.42	8.42	228.71	20	228.71	29
HC.SHF	4483	10	44830	215.83	2158.33	4.48	4.48	4.48	8.97	8.97	240.72	18	240.72	25
I.DCE	550.5	100	55050	33.33	3333.33	5.51	5.51	5.51	11.01	11.01	302.76	15	302.76	17
J.DCE	2898	100	289800	172.67	17266.67	173.88	173.88	173.88	347.76	347.76	49.65	43	49.65	48
JM.DCE	2130	60	127800	152.67	9160.00	76.68	76.68	76.68	153.36	153.36	59.73	41	59.73	46
ZC.CZC	883.4	100	88340	57.77	5776.67	120	120	120	240	240	24.07	49	24.07	49
FG.CZC	1743	20	34860	96.83	1936.67	6	6	6	12	12	161.39	31	161.39	40
SM.CZC	8652	5	43260	355.00	1775.00	10	10	30	40	20	44.38	45	88.75	45
SF.CZC	9052	5	45260	507.67	2538.33	9	9	30	39	18	65.09	40	141.02	41