

品种	参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦铜价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪铜安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
铜进口套利	伦铜3月价	6857.00	现货	53405	-26.25	6831	53434	-29	-0.05%	/	7.82	7.82
	到岸升水	65	2017年12月	53480	-23.00	6834	53459	21	0.04%	-0.14%	7.83	7.82
	汇率	6.6105	2018年01月	53550	-13.88	6843	53529	21	0.04%	-0.13%	7.83	7.82
	增值税	17%	2018年02月	53650	-3.00	6854	53614	36	0.07%	-0.19%	7.83	7.82
	进口关税	0%	2018年03月	53730	7.00	6864	53691	39	0.07%	-0.15%	7.83	7.82
	杂费	100	2018年04月	53850	14.25	6871	53747	103	0.19%	-0.22%	7.84	7.83

品种	参数	合约月份	沪铝价格	LME升贴水	伦铝价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪铝安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
铝进口套利	伦铝3月价	2067.00	现货	14220	-17.05	2050	16906	-2586	-15.39%	/	6.94	7.02
	到岸升水	110	2017年12月	14420	-16.05	2051	16813	-2393	-14.24%	-1.41%	7.03	7.08
	汇率	6.6105	2018年01月	14540	-9.80	2057	16862	-2322	-13.77%	-0.83%	7.07	7.11
	增值税	17%	2018年02月	14645	-2.80	2064	16916	-2271	-13.42%	-0.72%	7.09	7.14
	进口关税	0%	2018年03月	14745	4.20	2071	16970	-2225	-13.11%	-0.68%	7.12	7.16
	杂费	100	2018年04月	14835	10.20	2077	17016	-2181	-12.82%	-0.61%	7.14	7.19

品种	参数	合约月份	沪锌价格	LME升贴水	伦锌价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪锌安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
锌进口套利	伦锌3月价	3219.50	现货	25790	17.50	3237	26313	-523	-1.99%	/	7.97	7.94
	到岸升水	125	2017年12月	25680	7.00	3227	26231	-551	-2.10%	0.43%	7.96	8.09
	汇率	6.6105	2018年01月	25555	0.00	3220	26176	-621	-2.37%	0.49%	7.94	8.07
	增值税	17%	2018年02月	25495	1.50	3221	26188	-693	-2.65%	0.23%	7.92	8.05
	进口关税	1%	2018年03月	25460	0.00	3220	26176	-716	-2.74%	0.14%	7.91	8.04
	杂费	50	2018年04月	25405	-3.50	3216	26149	-744	-2.84%	0.22%	7.90	8.03

品种	参数	合约月份	沪铅价格	LME升贴水	伦铅价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪铅安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
铅进口套利	伦铅3月价	2531.50	现货	18980	2.00	2534	20920	-1940	-9.27%	/	7.49	7.43
	到岸升水	80	2017年12月	18960	5.50	2537	20948	-1988	-9.49%	0.11%	7.47	7.62
	汇率	6.6105	2018年01月	18950	2.50	2534	20924	-1974	-9.43%	0.05%	7.48	7.63
	增值税	17%	2018年02月	18950	2.50	2534	20924	-1974	-9.43%	0.00%	7.48	7.63
	进口关税	3%	2018年03月	18930	0.00	2532	20904	-1974	-9.44%	0.11%	7.48	7.63
	杂费	100	2018年04月	19000	-2.50	2529	20884	-1884	-9.02%	-0.37%	7.51	7.66

品种	参数	合约月份	沪锡价格	LME升贴水	伦锡价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	伦锡安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
锡进口套利	伦锡3月价	11420	现货	90950	-63.60	11356	90151	799	0.89%	/	8.01	8.09
	到岸升水	165	2017年12月	91460	-57.60	11362	90188	1262	1.40%	-0.05%	8.05	8.23
	汇率	6.6105	2018年01月	91370	-35.50	11384	90370	1000	1.11%	-0.19%	8.03	8.21
	增值税	17%	2018年02月	91500	-11.10	11409	90561	939	1.04%	-0.22%	8.02	8.20
	进口关税	1%	2018年03月	91880	12.40	11432	90745	1235	1.36%	-0.21%	8.05	8.23
	杂费	150	2018年04月	91010	34.40	11454	90916	84	0.10%	-0.19%	7.95	8.12

品种	参数	合约月份	沪镍价格	LME升贴水	伦镍价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	伦镍安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
镍进口套利	伦镍3月价	19520	现货	141250	73.00	19593	311856	-170606	-54.71%	/	7.21	7.22
	到岸升水	19535	2017年12月	139600	83.00	19603	311936	-172336	-55.25%	-0.05%	7.12	7.13
	汇率	6.6105	2018年01月	141700	58.00	19578	311736	-170036	-54.54%	0.13%	7.24	7.24
	增值税	17%	2018年02月	142710	23.00	19543	311458	-168748	-54.18%	0.18%	7.30	#VALUE!
	进口关税	3%	2018年03月	144080	-12.00	19508	311179	-167099	-53.70%	0.18%	7.39	7.39
	杂费	150	2018年04月	140670	-42.00	19478	310940	-170270	-54.76%	0.15%	7.22	7.23

品种	参数	合约月份	沪铜价格	美铜价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	美铜安全边际	实际比值		进口比值
									今日	昨日	
美铜进口套利	到岸升水	70	2017年12月	52950	308.40	53179	-229	-0.43%	/	171.69	171.69
	汇率	6.6105	2018年01月	53550	309.55	53375	175	0.33%	-0.37%	172.99	172.99
	增值税	0.17	2018年02月	53650	310.30	53503	147	0.28%	-0.24%	172.90	172.90
	进口关税	0%	2018年03月	53730	311.40	53690	40	0.07%	-0.35%	172.54	172.54
	杂费	150	2018年04月	53850	311.25	53665	185	0.35%	0.05%	173.01	173.01

日期	沪金主力合约	纽约金主力合约	纽约金主力合约 (RMB)	人民币汇率	价差 (沪-美)	无套利区间估值
2017/12/4	272	1273.5	270.6601239	661.05	1.339876117	(-5, +5)

日期	沪银主力合约	纽约银主力合约	纽约银主力合约 (RMB)	人民币汇率	价差 (沪-美)
2017/12/4	3731	16.31	3466.404885	661.05	264.5951154

日期	郑州白糖主力合约		纽约原糖主力合约		纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)		RMB汇率	价差 (郑-美)
	合约月份	价格	合约月份	价格	成本	成本		
2018年01月	6430		2018年03月	15.02		4313.351465	6.6105	2116.65
2018年05月	6176		2018年05月	14.99		4306.781379		1869.22

注: 郑州CZCE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

品种	美豆价格		大连豆粕价格		大连豆油价格		参数
	日期	价格	日期	价格	日期	价格	
进口大豆压榨利润	2018年01月	10.0475	2018年01月	2926	2018年01月	5864	1罐=60磅=27.2154kg
	2018年03月	10.165	2018年03月	2871	2018年05月	6056	汇率
南美豆 (17年11月到期)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	4.00	国际运费 (美元)	41.87	毛利 (元/吨)	811.26	净利 (元/吨)
							(65.28)
美湾豆 (17年11月到期)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	78.00	国际运费 (美元)	46.26	毛利 (元/吨)	775.06	净利 (元/吨)
							(23.97)

参数 (不含增值税)	合约月份	磅价	美价	美价	进口成本	进口盈亏	进口收益率	实际比值		进口比值
								今日	昨日	
到岸升水	70	2018年01月	15200	2018年03月	73.09	12357	2843	23.01%	208	#DIV/0!
汇率	6.6105	2018年05月	15455	2018年05月	73.72	12462	2993	24.02%	210	211
增值税	13%									
进口关税	1%									
杂费	200									

日期	ICE主力期棉15:00价	ICE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2017/12/4	73.09	15455	20.75745796



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	182,425	-1,100	41,625
铝	1,104,550	-4,350	232,375
镍	378,528	-1,572	126,886
锌	209,700	-1,825	45,350
铅	144,900	-100	45,400
锡	2,395	0	325

声明:

- 新永安期货有限公司(「新永安」)相信本文件所载内容之数据来源均属准确, 并未以明示或暗示方式声明、保证、确保或推断其准确性、完整性、及时性或无任何缺陷。除非经新永安同意, 否则不得分发予任何其他人士。新永安不会就因未经授权使用本文件而导致任何损失或损害负责。
- 本文件仅供客户参考, 并不构成任何对客户之建议。
- 本文件的内容并未经香港任何监管机构审阅。投资涉及风险, 建议阁下小心行事, 进行任何投资前, 请细阅相关文件(包括风险因素)及征求独立专业意见。