

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	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	
									今日	昨日		
伦铜3月价	6601.00	现货	51350	-34.25	6567	51480	-130	-0.25%	/	7.82	7.87	7.84
到岸升水	65	2018年01月	51670	-18.50	6583	51602	66	0.13%	-0.62%	7.85	7.90	7.84
汇率	6.6218	2018年02月	51700	-6.75	6594	51683	7	0.01%	-0.06%	7.84	7.91	7.84
增值税	17%	2018年03月	51840	3.25	6604	51770	70	0.14%	-0.27%	7.85	7.91	7.84
进口关税	0%	2018年04月	51980	12.00	6613	51838	142	0.27%	-0.27%	7.86	7.92	7.84
杂费	100	2018年05月	52170	20.25	6621	51902	268	0.52%	-0.37%	7.88	7.94	7.84

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	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	
									今日	昨日		
伦铜3月价	2018.50	现货	14050	-18.23	2000	16449	-2399	-14.59%	/	7.02	7.05	8.22
到岸升水	110	2018年01月	14225	-10.23	2008	16511	-2286	-13.85%	-1.25%	7.08	7.11	8.22
汇率	6.6218	2018年02月	14320	-2.73	2016	16569	-2249	-13.58%	-0.67%	7.10	7.13	8.22
增值税	17%	2018年03月	14420	3.02	2022	16614	-2194	-13.21%	-0.70%	7.13	7.16	8.22
进口关税	0%	2018年04月	14505	9.02	2028	16660	-2155	-12.94%	-0.59%	7.15	7.18	8.22
杂费	100	2018年05月	14595	14.77	2033	16705	-2110	-12.63%	-0.62%	7.18	7.20	8.22

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	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	
									今日	昨日		
伦铜3月价	3104.00	现货	24950	10.64	3115	25400	-450	-1.77%	/	8.01	8.04	8.16
到岸升水	125	2018年01月	24865	-2.36	3102	25298	-433	-1.71%	0.34%	8.02	8.05	8.16
汇率	6.6218	2018年02月	24705	-0.36	3104	25314	-609	-2.41%	0.64%	7.96	8.00	8.16
增值税	17%	2018年03月	24605	1.39	3105	25328	-723	-2.85%	0.40%	7.92	7.96	8.16
进口关税	1%	2018年04月	24530	0.39	3104	25320	-790	-3.12%	0.30%	7.90	7.94	8.16
杂费	50	2018年05月	24510	-1.61	3102	25304	-794	-3.14%	0.08%	7.90	7.94	8.16

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	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	
									今日	昨日		
伦铜3月价	2463.50	现货	18620	-1.75	2462	20383	-1763	-8.65%	/	7.56	7.50	8.28
到岸升水	80	2018年01月	18550	-2.50	2461	20377	-1827	-8.97%	0.38%	7.54	7.47	8.28
汇率	6.6218	2018年02月	18530	-1.00	2463	20389	-1859	-9.12%	0.11%	7.52	7.46	8.28
增值税	17%	2018年03月	18540	0.00	2464	20397	-1857	-9.10%	-0.05%	7.53	7.46	8.28
进口关税	3%	2018年04月	18630	0.50	2464	20401	-1771	-8.68%	-0.49%	7.56	7.50	8.28
杂费	100	2018年05月	18520	2.50	2466	20417	-1897	-9.29%	0.59%	7.51	7.45	8.28

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	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	
									今日	昨日		
伦铜3月价	11025	现货	87350	-54.21	10971	87287	63	0.07%	/	7.96	8.13	7.96
到岸升水	165	2018年01月	88350	-35.71	10989	87432	918	1.05%	-0.17%	8.04	8.21	7.96
汇率	6.6218	2018年02月	88310	-10.71	11014	87628	682	0.78%	-0.23%	8.02	8.19	7.96
增值税	17%	2018年03月	88790	9.29	11034	87784	1006	1.15%	-0.18%	8.05	8.22	7.96
进口关税	1%	2018年04月	88910	31.29	11056	87956	954	1.08%	-0.20%	8.04	8.21	7.96
杂费	150	2018年05月	89120	53.29	11078	88129	991	1.13%	-0.20%	8.04	8.22	7.96

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	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	
									今日	昨日		
伦铜3月价	19420	现货	140500	70.36	19490	311570	-171070	-54.91%	/	7.21	7.19	15.99
到岸升水	19535	2018年01月	139230	60.36	19480	311490	-172260	-55.30%	0.05%	7.15	7.13	15.99
汇率	6.6218	2018年02月	143050	30.36	19450	311250	-168200	-54.04%	0.15%	7.35	#VALUE!	16.00
增值税	17%	2018年03月	144080	-4.64	19415	310971	-166891	-53.67%	0.18%	7.42	7.41	16.02
进口关税	3%	2018年04月	140670	-34.64	19385	310732	-170062	-54.73%	0.15%	7.26	7.25	16.03
杂费	150	2018年05月	141570	-64.64	19355	310492	-168822	-54.40%	0.15%	7.31	7.30	16.04

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	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
									今日	昨日	
到岸升水	70	2018年01月	52950	297.05	51333	1617	3.15%	/	178.25	178.25	172.81
汇率	6.6218	2018年02月	51700	297.50	51410	290	0.56%	-0.15%	173.78	173.78	172.81
增值税	0.17	2018年03月	51840	298.35	51555	285	0.55%	-0.29%	173.76	173.76	172.80
进口关税	0%	2018年04月	51980	297.20	51358	622	1.21%	0.39%	174.90	#DIV/0!	172.81
杂费	150	2018年05月	52170	299.90	51819	351	0.68%	-0.91%	173.96	173.96	172.79

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
2017/12/8	266.4	1247.7	265.6300793	662.18	0.769920665	(-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)
2017/12/8	3603	15.675	3337.141535	662.18	265.8584647

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)
	2018年01月	6536	2018年03月	14.35	4172.825729	6.6218		
2018年05月	6179		2018年05月	14.28	4157.469321		2363.17	2021.53

注: 郑州CICE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

日期	美豆价格		大连豆粕价格		大连豆油价格		参数		
	2018年01月	9.94	2018年01月	2932	2018年01月	5686		1罐=60磅=27.2154kg	
2018年03月	10.0625		进口美湾大豆, 国内压榨 (17年11月到期)		2875	2018年05月	5872	汇率	6.6218
南美豆 (17年11月到期)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	国际运费 (美元)	毛利 (元/吨)		净利 (元/吨)		进口美豆出油率	79.50%	
9.9400	4.00	41.87	805.02		(68.52)		进口美豆出油率	18.50%	
美湾豆 (17年11月到期)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	国际运费 (美元)	毛利 (元/吨)		净利 (元/吨)		加工费 (元/吨)	130	
10.0625	78.00	46.26	764.88		(31.13)		关税	3%	
							增值税	13%	
							港杂费 (元/吨)	120	

参数 (不含增值税)	合约月份	郑糖价格	美糖月份	美糖价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	实际比值		进口比	
								今日	昨日		
到岸升水	70	2018年01月	15180	2018年03月	74.12	12549	2831	20.98%	205	205	169.31
汇率	6.6218	2018年05月	15480	2018年05月	74.60	12629	2851	22.57%	208	208	169.29
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
2017/12/8	74.12	15480	19.71885725



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	195,150	1,175	35,450
铝	1,094,525	-3,050	226,900
镍	376,938	-906	126,294
锌	201,125	-1,450	36,775
铅	145,300	200	49,275
锡	2,325	-15	315

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.