

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪期安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
铜	伦铜3月价	现货	51540	-34.25	6523	51088	452	0.89%	/	7.90	7.82	7.83
	到岸升水	2018年01月	51270	-18.50	6539	51210	60	0.12%	0.52%	7.84	7.79	7.83
	汇率	2018年02月	51320	-6.75	6550	51301	19	-0.04%	-0.10%	7.83	7.78	7.83
	增值税	2018年03月	51420	3.25	6560	51378	-42	0.08%	-0.19%	7.84	7.79	7.83
	进口关税	2018年04月	51540	12.00	6569	51446	94	0.18%	-0.23%	7.85	7.79	7.83
	杂费	2018年05月	51760	20.25	6577	51510	250	0.49%	-0.43%	7.87	7.82	7.83

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪期安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
铝	伦铝3月价	现货	13950	-18.23	1994	16387	-2437	-14.87%	/	7.00	7.02	8.22
	到岸升水	2018年01月	14145	-10.23	2002	16449	-2304	-14.00%	-1.40%	7.06	7.04	8.21
	汇率	2018年02月	14240	-2.73	2010	16507	-2267	-13.73%	-0.67%	7.09	7.06	8.21
	增值税	2018年03月	14345	3.02	2016	16551	-2206	-13.33%	-0.74%	7.12	7.10	8.21
	进口关税	2018年04月	14445	9.02	2022	16598	-2153	-12.97%	-0.70%	7.15	7.12	8.21
	杂费	2018年05月	14530	14.77	2027	16642	-2112	-12.69%	-0.59%	7.17	7.15	8.21

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪期安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
锌	伦锌3月价	现货	25220	10.64	3101	25269	-49	-0.20%	/	8.13	8.01	8.15
	到岸升水	2018年01月	24810	-2.36	3088	25168	-358	-1.42%	1.63%	8.03	8.00	8.15
	汇率	2018年02月	24640	-0.36	3090	25183	-543	-2.16%	0.69%	7.97	7.94	8.15
	增值税	2018年03月	24540	1.39	3092	25197	-657	-2.61%	0.41%	7.94	7.90	8.15
	进口关税	2018年04月	24475	0.39	3091	25189	-714	-2.84%	0.26%	7.92	7.88	8.15
	杂费	2018年05月	24440	-1.61	3089	25174	-734	-2.91%	0.14%	7.91	7.88	8.15

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪期安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
镍	伦镍3月价	现货	18510	-1.75	2451	20279	-1769	-8.72%	/	7.55	7.56	8.27
	到岸升水	2018年01月	18490	-2.50	2451	20273	-1783	-8.80%	0.11%	7.55	7.51	8.27
	汇率	2018年02月	18485	-1.00	2452	20285	-1800	-8.87%	0.03%	7.54	7.51	8.27
	增值税	2018年03月	18460	0.00	2453	20293	-1833	-9.03%	0.14%	7.53	7.49	8.27
	进口关税	2018年04月	18430	0.50	2454	20297	-1867	-9.20%	0.16%	7.51	7.48	8.27
	杂费	2018年05月	18485	2.50	2456	20313	-1828	-9.00%	-0.30%	7.53	7.50	8.27

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	伦期安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
钴	伦钴3月价	现货	88600	-54.21	10836	86145	2455	2.85%	/	8.18	7.96	7.95
	到岸升水	2018年01月	87210	-35.71	10854	86290	920	1.07%	-0.17%	8.03	7.84	7.95
	汇率	2018年02月	86200	-10.71	10879	86485	1715	1.98%	-0.23%	8.11	8.01	7.95
	增值税	2018年03月	87650	9.29	10899	86642	1008	1.16%	-0.18%	8.04	7.94	7.95
	进口关税	2018年04月	88910	31.29	10921	86814	2096	2.41%	-0.20%	8.14	8.04	7.95
	杂费	2018年05月	87850	53.29	10943	86986	864	0.99%	-0.20%	8.03	7.93	7.95

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	伦期安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
锡	伦锡3月价	现货	139500	70.36	19445	310901	-171401	-55.13%	/	7.17	7.21	15.99
	到岸升水	2018年01月	137600	60.36	19435	310821	-173221	-55.79%	0.05%	7.08	7.06	15.99
	汇率	2018年02月	142420	30.36	19405	310582	-168162	-54.14%	0.15%	7.34	#VALUE!	16.00
	增值税	2018年03月	144080	-4.64	19370	310303	-166223	-53.57%	0.18%	7.44	7.42	16.02
	进口关税	2018年04月	140670	-34.64	19340	310063	-169393	-54.63%	0.15%	7.27	7.26	16.03
	杂费	2018年05月	140360	-64.64	19310	309824	-169464	-54.70%	0.16%	7.27	7.25	16.04

品种	参数	合约月份	沪期价格	美期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	美期安全边际	实际比值		进口比值
									今日	昨日	
美糖	到岸升水	2018年01月	52950	294.95	50924	2026	3.98%	/	179.52	179.52	172.65
	汇率	2018年02月	51320	295.70	51052	268	0.53%	-0.25%	173.55	173.55	172.65
	增值税	2018年03月	51420	296.60	51205	215	0.42%	-0.30%	173.36	173.36	172.64
	进口关税	2018年04月	51540	298.75	51572	-32	-0.06%	-0.72%	172.52	172.52	172.62
	杂费	2018年05月	51760	297.95	51435	325	0.63%	0.27%	173.72	173.72	172.63

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
2017/12/11	272.55	1248.4	265.5142023	661.52	7.03579731	(-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)
2017/12/11	3744	15.785	3357.210576	661.52	386.7894242

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	6099	14.05	4103.453289	6.6152	1995.55
2018年05月	6099	14.00	4092.495359		2006.50

注: 郑州CICE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
	2018年01月	9.875	2018年01月	2912	2018年01月	5694	
进口大豆压榨平衡表	2018年03月	9.9925	2018年03月	2850	2018年05月	5890	汇率
							6.6152
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)	809.01	净利率 (元/吨)
							(61.19)
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)	768.01	净利率 (元/吨)
							(24.56)

参数 (不含增值税)	合约月份	美糖价格	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		进口比值
								今日	昨日	
到岸升水	2018年01月	14985	2018年03月	73.45	12426	2559	20.60%	204	204	169.17
汇率	2018年05月	15140	2018年05月	73.87	12495	2645	21.16%	205	205	169.15
增值税										
进口关税										
杂费										

日期	ICE主力期棉15:00价	ICE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2017/12/11	73.45	151.40	18.419364



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	194,600	-650	34,925
铝	1,087,425	2,900	226,090
镍	376,152	-786	128,784
钴	199,425	-1,700	35,075
铂	145,750	450	51,100
钯	2,320	-5	310

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。