

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	7221.00	现货	54615	-46.65	7174	55192	-577	-1.04%	/	7.61	7.62	7.69
	到岸升水	65	2018年01月	55000	-35.15	7186	65279	-279	-0.51%	-0.70%	7.65	7.66	7.69
	汇率	6.5043	2018年02月	55180	-19.65	7201	55397	-217	-0.39%	-0.33%	7.66	7.66	7.69
	增值税	17%	2018年03月	55320	-4.90	7216	55509	-189	-0.34%	-0.25%	7.67	7.67	7.69
	进口关税	0%	2018年04月	55470	9.10	7230	55616	-146	-0.26%	-0.27%	7.67	7.67	7.69
	杂费	100	2018年05月	55630	19.60	7241	55696	-66	-0.12%	-0.29%	7.68	7.68	7.69

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	2228.00	现货	14600	-15.73	2212	17773	-3173	-17.85%	/	6.60	6.58	8.03
	到岸升水	110	2018年01月	14940	-12.98	2215	17793	-2853	-16.04%	-2.33%	6.74	6.70	8.03
	汇率	6.5043	2018年02月	15050	-4.73	2223	17856	-2806	-15.72%	-0.74%	6.77	6.72	8.03
	增值税	17%	2018年03月	15140	0.27	2228	17894	-2754	-15.39%	-0.60%	6.79	6.75	8.03
	进口关税	0%	2018年04月	15235	3.27	2231	17917	-2682	-14.97%	-0.63%	6.83	6.79	8.03
	杂费	100	2018年05月	15325	8.27	2236	17955	-2630	-14.65%	-0.59%	6.85	6.82	8.03

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	沪镍安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
镍进口套利	伦镍3月价	3333.00	现货	25790	19.55	3353	26779	-699	-3.69%	/	7.69	7.75	7.99
	到岸升水	125	2018年01月	25955	16.55	3350	26756	-801	-2.99%	-0.64%	7.75	7.72	7.99
	汇率	6.5043	2018年02月	25980	9.55	3343	26702	-722	-2.70%	-0.10%	7.77	7.73	7.99
	增值税	17%	2018年03月	25990	5.55	3339	26671	-681	-2.55%	-0.04%	7.78	7.74	7.99
	进口关税	1%	2018年04月	25950	-0.45	3333	26625	-675	-2.54%	0.15%	7.79	7.75	7.99
	杂费	50	2018年05月	25900	-4.45	3329	26594	-694	-2.61%	0.19%	7.78	7.75	7.99

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	2569.00	现货	19220	7.45	2576	20922	-1702	-8.14%	/	7.46	7.52	8.12
	到岸升水	80	2018年01月	19320	-0.55	2568	20859	-1539	-7.38%	-0.52%	7.52	7.52	8.12
	汇率	6.5043	2018年02月	19405	-0.55	2568	20859	-1454	-6.97%	-0.44%	7.56	7.56	8.12
	增值税	17%	2018年03月	19415	-0.05	2569	20863	-1448	-6.94%	-0.05%	7.56	7.56	8.12
	进口关税	3%	2018年04月	19445	0.70	2570	20869	-1424	-6.82%	-0.15%	7.57	7.56	8.12
	杂费	100	2018年05月	19455	2.20	2571	20881	-1426	-6.83%	-0.05%	7.57	7.57	8.12

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	沪锡安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
锡进口套利	伦锡3月价	12565	现货	96850	-55.08	12510	97571	-721	-0.74%	/	7.74	7.86	7.80
	到岸升水	165	2018年01月	98110	-54.08	12511	97579	-531	0.54%	-0.01%	7.84	7.83	7.80
	汇率	6.5043	2018年02月	97000	-30.08	12535	97763	-763	-0.78%	-0.19%	7.74	7.86	7.80
	增值税	17%	2018年03月	96790	-6.63	12558	97942	-849	-0.87%	-0.19%	7.87	7.85	7.80
	进口关税	1%	2018年04月	97510	11.67	12577	98084	-574	-0.59%	-0.15%	7.75	7.73	7.80
	杂费	150	2018年05月	99180	31.17	12596	98234	-946	0.96%	-0.16%	7.67	7.86	7.80

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	19950	现货	142750	63.45	20013	310144	-167394	-53.97%	/	7.13	7.19	15.50
	到岸升水	19535	2018年01月	143200	70.45	20020	310199	-166999	-53.84%	-0.03%	7.15	7.16	15.49
	汇率	6.5043	2018年02月	143320	40.45	19990	309964	-166644	-53.76%	0.15%	7.17	6.94	15.51
	增值税	17%	2018年03月	139790	15.45	19965	309768	-169978	-54.87%	0.13%	7.00	7.09	15.52
	进口关税	3%	2018年04月	139440	-4.55	19945	309611	-170171	-54.96%	0.10%	6.99	7.08	15.52
	杂费	150	2018年05月	145310	-19.55	19930	309493	-164183	-53.05%	0.08%	7.29	7.31	15.53

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	2018年01月	52950	323.70	54891	-1941	-3.54%	/	163.58	#DIV/0!	169.57
	汇率	6.5043	2018年02月	55180	324.05	54949	231	0.42%	-0.11%	170.28	169.26	169.57
	增值税	0.17	2018年03月	55320	327.80	55578	-258	-0.46%	-1.16%	168.76	167.69	169.55
	进口关税	0%	2018年04月	55470	327.20	55477	-7	-0.01%	0.18%	169.53	168.37	169.55
	杂费	150	2018年05月	55630	329.30	55829	-199	-0.36%	-0.64%	168.93	167.75	169.54

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
2018/1/4	279	1311.3	274.2165375	650.43	4.783162491	(-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)
2018/1/4	3885	17.1	3575.919158	650.43	309.0808424

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	5858	2018年03月	15.27	4306.537997	1551.46
2018年05月	5858	2018年05月	15.18	4287.144389	1570.86

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	
	日期	价格	日期	价格	日期	价格		
进口大豆压榨利润	2018年01月	9.58	2018年01月	2820	2018年01月	5136	1罐=60磅=27.2154kg	
	2018年03月	9.675	2018年03月	2770	2018年05月	5824	汇率	6.5043
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)	41.67	毛利 (元/吨)	799.80	净利率 (元/吨)	(46.26)
	5.9800		进口美豆大豆, 国内压榨 (17年11月到期)				加工费 (元/吨)	130
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)	809.63	净利率 (元/吨)	39.84
	9.6750		进口美湾大豆, 国内压榨 (17年11月到期)				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		进口比值	
								今日	昨日		
到岸升水	70	2018年01月	14680	2018年03月	78.49	13045	1635	12.53%	187	187	166.20
汇率	6.5043	2018年05月	15010	2018年05月	78.53	13052	1958	15.00%	191	191	166.20
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
2018/1/4	78.49	15010	14.14347189



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	200,150	-75	44,900
铝	1,101,325	-475	250,000
镍	365,934	-138	112,026
锌	180,575	-250	16,250
铅	142,075	0	47,125
锡	2,330	45	475

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。