

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	现货	54740	-43.36	7145	54858	-119	-0.21%	/	7.66	7.67	7.68
	到岸升水	2018年02月	54860	-19.36	7169	55040	-180	-0.33%	-0.22%	7.65	7.67	7.68
	汇率	2018年03月	55010	-4.86	7183	55150	-140	-0.25%	-0.27%	7.66	7.67	7.68
	增值税	2018年04月	55120	7.89	7196	55247	-127	-0.23%	-0.20%	7.66	7.67	7.68
	进口关税	2018年05月	55260	18.89	7207	55330	-70	-0.13%	-0.25%	7.67	7.68	7.68
	杂费	2018年06月	55450	7.89	7196	55247	203	0.37%	-0.34%	7.71	7.69	7.68

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	现货	14780	-15.23	2232	17986	-3106	-17.36%	/	6.62	6.62	8.01
	到岸升水	2018年02月	15105	-5.23	2242	17962	-2857	-15.90%	-2.20%	6.74	6.76	8.01
	汇率	2018年03月	15210	-0.23	2247	18000	-2790	-15.50%	-0.70%	6.77	6.78	8.01
	增值税	2018年04月	15305	3.02	2250	18024	-2719	-15.09%	-0.62%	6.80	6.81	8.01
	进口关税	2018年05月	15395	8.02	2255	18062	-2667	-14.77%	-0.59%	6.83	6.84	8.01
	杂费	2018年06月	15480	3.02	2250	18024	-2544	-14.12%	-0.55%	6.88	6.86	8.01

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	现货	26030	22.54	3387	26987	-957	-3.55%	/	7.69	7.69	7.97
	到岸升水	2018年02月	26080	11.54	3376	26903	-823	-3.06%	-0.19%	7.73	7.71	7.97
	汇率	2018年03月	26105	6.54	3371	26864	-759	-2.83%	-0.10%	7.75	7.74	7.97
	增值税	2018年04月	26200	-0.46	3364	26811	-731	-2.73%	0.10%	7.75	7.74	7.97
	进口关税	2018年05月	26225	-7.86	3355	26753	-728	-2.72%	0.21%	7.75	7.74	7.97
	杂费	2018年06月	25985	-0.46	3364	26811	-826	-3.08%	0.15%	7.73	7.73	7.97

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	现货	19330	6.37	2590	20990	-1660	-7.91%	/	7.46	7.46	8.10
	到岸升水	2018年02月	19480	-0.63	2583	20935	-1455	-6.95%	-0.78%	7.54	7.54	8.10
	汇率	2018年03月	19465	-0.13	2584	20939	-1474	-7.04%	0.08%	7.53	7.53	8.10
	增值税	2018年04月	19325	1.62	2586	20953	-1628	-7.77%	0.72%	7.47	7.48	8.10
	进口关税	2018年05月	19495	2.87	2587	20963	-1468	-7.00%	-0.88%	7.54	7.54	8.10
	杂费	2018年06月	19450	1.62	2586	20953	-1503	-7.17%	0.23%	7.52	7.52	8.10

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	现货	97950	-48.36	12497	97278	672	0.69%	/	7.84	7.84	7.78
	到岸升水	2018年02月	98350	-28.86	12516	97427	923	0.95%	-0.16%	7.86	7.87	7.78
	汇率	2018年03月	98090	-6.36	12539	97600	490	0.50%	-0.18%	7.82	7.84	7.78
	增值税	2018年04月	98720	11.14	12556	97734	986	1.01%	-0.14%	7.86	7.87	7.78
	进口关税	2018年05月	98580	29.64	12575	97876	704	0.72%	-0.15%	7.84	7.85	7.78
	杂费	2018年06月	98690	11.14	12556	97734	956	0.98%	0.15%	7.86	7.85	7.78

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	伦铅安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
铅进口套利	伦铅3月价	现货	142750	60.36	19975	309236	-166496	-53.84%	/	7.15	7.15	15.48
	到岸升水	2018年02月	143320	35.36	19950	309040	-165720	-53.62%	0.13%	7.18	7.17	15.49
	汇率	2018年03月	140600	15.36	19930	308884	-168284	-54.48%	0.10%	7.05	#VALUE!	15.50
	增值税	2018年04月	140250	-4.64	19910	308727	-168477	-54.57%	0.10%	7.04	#VALUE!	15.51
	进口关税	2018年05月	145600	-19.64	19895	308610	-163010	-52.82%	0.08%	7.32	7.31	15.51
	杂费	2018年06月	142040	-4.64	19910	308727	-166687	-53.99%	-0.08%	7.13	7.14	15.51

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	2018年02月	52950	324.90	54984	-2034	-3.70%	/	162.97	162.97	169.23
	汇率	2018年03月	55010	326.05	55176	-166	-0.30%	-0.35%	168.72	168.72	169.23
	增值税	2018年04月	55120	327.15	55360	-240	-0.43%	-0.34%	168.49	#DIV/0!	169.22
	进口关税	2018年05月	55260	327.45	55410	-150	-0.27%	-0.09%	168.76	168.76	169.22
	杂费	2018年06月	55450	328.60	55603	-153	-0.27%	-0.35%	168.75	#DIV/0!	169.21

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
2018/1/5	279.85	1319.4	275.3674219	649.15	4.482578091	(-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)
2018/1/5	3890	17.2	3589.752658	649.15	300.2473421

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05月	5867	15.18	4279.762388	6.4915	1587.24
2018年09月	#N/A Inval1	15.09	4260.406945	#VALUE!	#VALUE!

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		大豆压榨价格		大豆油价格		参数	
	2018年03月	9.7075	2018年05月	2820	2018年05月	5440		1罐=60磅=27.2154kg
进口大豆压榨利润	2018年05月	9.815	2018年09月	2775	2018年09月	5824	汇率	6.4915
	南美豆 (18年3月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	国际运费 (美元)	毛利 (元/吨)	净利 (元/吨)		进口大豆出油率	79.50%
	9.7075	4.00	41.87	774.61	(71.98)		进口大豆出油率	18.50%
	美湾豆 (18年5月到港)	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
	9.8150	78.00	46.26	784.71	10.62		关税	3%
							港杂费 (元/吨)	120

参数 (不含增值税)	合约月份	铜价	美铜月份	美铜价格	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05月	14800	2018年03月	79.21	13138	1662	12.65%	187	187	165.86
汇率	2018年09月	15170	2018年05月	79.27	13148	2022	15.38%	191	191	165.86
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
2018/1/5	79.21	15170	14.59550654



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	203,850	3,700	44,900
铝	1,099,475	-1,850	249,750
镍	365,070	-864	112,524
锌	180,325	-250	41,075
铅	141,925	-150	47,075
锡	2,335	5	490

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。