

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		
伦铜3月价	7141.00	现货	54350	-44.89	7096	54419	-69	-0.13%	/	7.68	7.68	7.67
到岸升水	65	2018年02月	54530	-21.64	7119	54596	-66	-0.12%	-0.33%	7.66	7.65	7.67
汇率	6.4832	2018年03月	54690	-7.14	7134	54706	-16	-0.03%	-0.29%	7.67	7.66	7.67
增值税	17%	2018年04月	54850	5.36	7146	54901	-49	0.09%	-0.29%	7.68	7.68	7.67
进口关税	0%	2018年05月	54990	16.36	7157	54984	106	0.19%	-0.26%	7.68	7.67	7.67
杂费	100	2018年06月	55120	26.36	7167	54960	160	0.29%	-0.24%	7.69	7.71	7.67

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		
伦铜3月价	2203.50	现货	14720	-15.02	2188	17535	-2815	-16.05%	/	6.73	6.72	8.01
到岸升水	110	2018年02月	14935	-6.02	2197	17603	-2668	-15.16%	-1.46%	6.80	6.74	8.01
汇率	6.4832	2018年03月	15040	-1.52	2202	17637	-2597	-14.73%	-0.70%	6.83	6.77	8.01
增值税	17%	2018年04月	15135	1.73	2205	17662	-2527	-14.31%	-0.63%	6.86	6.80	8.01
进口关税	0%	2018年05月	15220	6.48	2210	17698	-2478	-14.00%	-0.56%	6.89	6.83	8.01
杂费	100	2018年06月	15300	11.48	2215	17736	-2436	-13.73%	-0.53%	6.91	6.88	8.01

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		
伦铜3月价	3360.00	现货	26010	26.29	3386	26951	-941	-3.49%	/	7.68	7.69	7.96
到岸升水	125	2018年02月	26040	13.29	3373	26851	-811	-3.02%	-0.12%	7.72	7.73	7.96
汇率	6.4832	2018年03月	26060	7.29	3367	26905	-745	-2.78%	-0.08%	7.74	7.75	7.96
增值税	17%	2018年04月	26030	-0.71	3359	26744	-714	-2.67%	0.12%	7.75	7.75	7.96
进口关税	1%	2018年05月	25995	-9.71	3350	26675	-680	-2.55%	0.13%	7.76	7.75	7.96
杂费	50	2018年06月	25955	-16.71	3343	26621	-666	-2.50%	0.15%	7.76	7.73	7.96

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		
伦铜3月价	2567.00	现货	19330	6.36	2573	20830	-1500	-7.20%	/	7.51	7.46	8.09
到岸升水	80	2018年02月	19405	-0.64	2566	20776	-1371	-6.60%	-0.39%	7.56	7.54	8.10
汇率	6.4832	2018年03月	19405	-0.14	2567	20780	-1375	-6.62%	0.00%	7.56	7.53	8.10
增值税	17%	2018年04月	19420	0.86	2568	20787	-1367	-6.58%	-0.08%	7.56	7.47	8.10
进口关税	3%	2018年05月	19370	2.11	2569	20797	-1427	-6.86%	0.26%	7.54	7.54	8.10
杂费	100	2018年06月	19390	3.36	2570	20807	-1417	-6.81%	-0.10%	7.54	7.52	8.09

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	伦铜安全边际	实际比值		进口比值	
									今日	昨日		
伦铜3月价	12500	现货	97200	-40.64	12459	96868	332	0.34%	/	7.80	7.84	7.77
到岸升水	165	2018年02月	97300	-30.39	12470	96946	354	0.36%	-0.08%	7.80	7.86	7.77
汇率	6.4832	2018年03月	97900	-9.39	12491	97107	793	0.82%	-0.17%	7.84	7.82	7.77
增值税	17%	2018年04月	97150	7.61	12508	97237	-87	-0.09%	-0.14%	7.77	7.86	7.77
进口关税	1%	2018年05月	96490	26.61	12527	97383	1107	1.14%	-0.15%	7.86	7.84	7.77
杂费	150	2018年06月	96290	48.11	12548	97548	742	0.76%	-0.17%	7.83	7.86	7.77

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	伦铜安全边际	实际比值		进口比值	
									今日	昨日		
伦铜3月价	19911	现货	142750	41.48	19952	308662	-165912	-53.75%	/	7.15	7.15	15.47
到岸升水	19535	2018年02月	142660	46.48	19957	308701	-166041	-53.79%	-0.03%	7.15	7.18	15.47
汇率	6.4832	2018年03月	140760	26.48	19937	308545	-167785	-54.38%	0.10%	7.06	7.05	15.48
增值税	17%	2018年04月	140410	-3.52	19907	308310	-167900	-54.46%	0.15%	7.05	7.04	15.49
进口关税	3%	2018年05月	144610	-18.52	19892	308193	-163583	-53.08%	0.08%	7.27	7.32	15.49
杂费	150	2018年06月	142040	-33.52	19877	308076	-166036	-53.89%	0.08%	7.15	7.13	15.50

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		
到岸升水	70	2018年02月	52950	321.00	54262	-1312	-2.42%	/	164.95	162.97	169.04
汇率	6.4832	2018年03月	54690	323.55	54688	2	0.00%	-0.79%	169.03	168.72	169.02
增值税	0.17	2018年04月	54850	323.85	54738	112	0.20%	-0.09%	169.37	168.49	169.02
进口关税	0%	2018年05月	54990	324.85	54905	85	0.15%	-0.31%	169.28	168.76	169.02
杂费	150	2018年06月	55120	325.30	54980	140	0.25%	-0.14%	169.44	168.75	169.01

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
2018/1/8	280.2	1319.7	275.0778701	6.48.32	5.122129614	(-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)
2018/1/8	3891	17.185	3582.036222	6.48.32	308.9637777

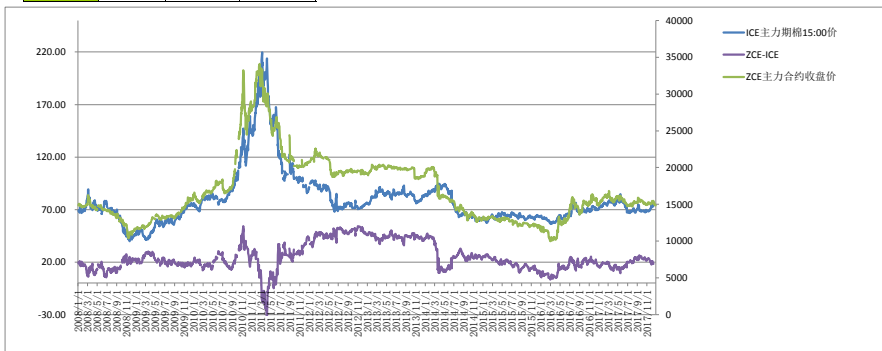
日期	郑州白糖主力合约		纽约原糖主力合约		纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)		RMB汇率	价差 (郑-美)
	2018年05月	2018年09月	2018年03月	2018年05月	2018年05月	2018年09月		
2018年05月	5874			14.99	4234.166377		6.4832	1639.83
2018年09月	5836			14.98	4232.018522			1603.98

注: 郑州CZCE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

进口大豆压榨平衡表	美豆价格		大连豆粕价格		大连豆油价格		参数	
	2018年03月	9.6575	2018年05月	2817	2018年05月	5400	1罐=60磅=27.2154kg	6.4832
2018年05月	9.7675		2018年09月	2767	2018年09月	5756	汇率	
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)	进口美豆出油率	79.50%	进口美豆出油率	18.50%
9.6575	4.00	41.87	779.75	(66.98)	加工费 (元/吨)	130	关税	3%
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)	美湾豆出油率	13%	港杂费 (元/吨)	120
9.7675	78.00	46.26	780.16	8.69				

参数 (不含港杂费)	合约月份	美铜价格	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	70	2018年05月	14830	2018年03月	78.57	13017	1813	13.93%	165.67
汇率	6.4832	2018年09月	15175	2018年05月	78.85	13062	2113	16.17%	191
增值税	13%								
进口关税	1%								
杂费	200								

日期	ICE主力期棉15:00价	ZCE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2018/1/8	78.57	15175	15.38655702



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	203,850	0	45,950
铝	1,095,875	-3,600	246,150
镍	368,430	-3,360	113,484
锌	180,325	0	41,075
铅	144,000	2,075	46,900
锡	2,335	0	500

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.