

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	7108.00	现货	52780	-43.75	7064	52501	279	-0.53%	/	7.47	7.47	7.43
	到岸升水	65	2018年02月	51610	35.00	7073	52566	496	-1.82%	2.22%	7.30	7.41	7.43
	汇率	6.2822	2018年03月	51920	24.50	7084	52643	-723	-1.37%	-0.60%	7.33	7.44	7.43
	增值税	17%	2018年04月	52120	-9.50	7099	52753	-633	-1.20%	-0.39%	7.34	7.45	7.43
	进口关税	0%	2018年05月	52290	4.00	7112	52852	-562	-1.08%	-0.33%	7.35	7.46	7.43
	杂费	100	2018年06月	52460	19.00	7127	52962	-502	-0.96%	-0.33%	7.36	7.47	7.43

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	2190.50	现货	14070	3.50	2194	17035	-2965	-17.40%	/	6.41	6.42	7.76
	到岸升水	110	2018年02月	14130	7.00	2198	17061	-2931	-17.18%	-0.43%	6.43	6.43	7.76
	汇率	6.2822	2018年03月	14215	-5.50	2185	16969	-2754	-16.23%	-0.60%	6.51	6.51	7.77
	增值税	17%	2018年04月	14290	-2.00	2189	16994	-2704	-15.91%	-0.53%	6.53	6.53	7.77
	进口关税	0%	2018年05月	14380	1.50	2192	17020	-2640	-15.51%	-0.63%	6.56	6.56	7.76
	杂费	100	2018年06月	14445	6.75	2197	17059	-2614	-15.32%	-0.45%	6.57	6.57	7.76

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	3480.00	现货	26560	49.00	3529	27176	-616	-2.27%	/	7.53	7.52	7.70
	到岸升水	125	2018年02月	26150	26.00	3506	27005	-855	-3.17%	1.54%	7.46	7.52	7.70
	汇率	6.2822	2018年03月	26255	4.00	3484	26842	-587	-2.19%	-0.40%	7.54	7.60	7.70
	增值税	17%	2018年04月	26270	1.75	3482	26825	-555	-2.07%	-0.06%	7.55	7.60	7.70
	进口关税	1%	2018年05月	26195	-2.00	3478	26798	-603	-2.23%	0.29%	7.53	7.59	7.70
	杂费	50	2018年06月	26075	-6.25	3474	26766	-691	-2.58%	0.46%	7.51	7.57	7.71

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	2600.00	现货	19320	5.00	2605	20427	-1107	-5.42%	/	7.42	7.42	7.84
	到岸升水	80	2018年02月	19040	10.50	2611	20469	-1429	-6.98%	1.45%	7.29	7.32	7.84
	汇率	6.2822	2018年03月	19080	1.50	2602	20401	-1321	-6.47%	-0.21%	7.33	7.38	7.84
	增值税	17%	2018年04月	19045	0.00	2600	20389	-1344	-6.59%	0.18%	7.33	7.39	7.84
	进口关税	3%	2018年05月	19060	1.75	2602	20403	-1343	-6.58%	-0.08%	7.33	7.37	7.84
	杂费	100	2018年06月	19060	-0.25	2600	20388	-1328	-6.51%	0.00%	7.33	7.36	7.84

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	13545	现货	102100	-41.00	13504	101624	476	0.47%	/	7.56	7.56	7.53
	到岸升水	165	2018年02月	101640	-42.00	13503	101617	23	0.02%	0.01%	7.53	7.53	7.53
	汇率	6.2822	2018年03月	100130	-29.00	13516	101713	-1583	-1.58%	-0.10%	7.41	7.54	7.53
	增值税	17%	2018年04月	100310	-12.00	13533	101840	-1530	-1.50%	-0.13%	7.41	7.56	7.53
	进口关税	1%	2018年05月	100470	5.00	13550	101966	-1496	-1.47%	-0.13%	7.41	7.55	7.53
	杂费	150	2018年06月	101350	26.50	13572	102125	-775	-0.76%	-0.16%	7.47	7.49	7.52

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	21809	现货	149500	95.00	21904	313871	-164371	-52.37%	/	6.83	6.81	14.33
	到岸升水	19535	2018年02月	142620	80.00	21889	313758	-171138	-54.54%	0.07%	6.52	6.51	14.33
	汇率	6.2822	2018年03月	148930	50.00	21859	313531	-164601	-52.50%	0.14%	6.81	6.81	14.34
	增值税	17%	2018年04月	149600	30.00	21839	313379	-163379	-52.26%	0.09%	6.85	6.85	14.35
	进口关税	3%	2018年05月	149360	0.00	21809	313152	-163392	-52.30%	0.14%	6.85	6.94	14.36
	杂费	150	2018年06月	149940	-20.00	21789	313001	-163061	-52.10%	0.09%	6.88	6.88	14.37

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02月	52950	306.45	50227	2723	5.42%	/	172.79	#DIV/0!	163.90
	汇率	6.2822	2018年03月	51920	309.50	50721	1199	2.36%	-1.00%	167.75	170.31	163.88
	增值税	0.17	2018年04月	52120	312.00	51126	994	1.94%	-0.81%	167.05	169.52	163.86
	进口关税	0%	2018年05月	52290	311.60	51061	1229	2.41%	0.13%	167.81	170.28	163.87
	杂费	150	2018年06月	52460	310.00	50802	1658	3.26%	0.51%	169.23	#DIV/0!	163.88

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
2018/2/8	271.7	1310.8	261.751975	628.22	6.94802498	(-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)
2018/2/8	3674	16.25	3282.132739	628.22	391.8672612

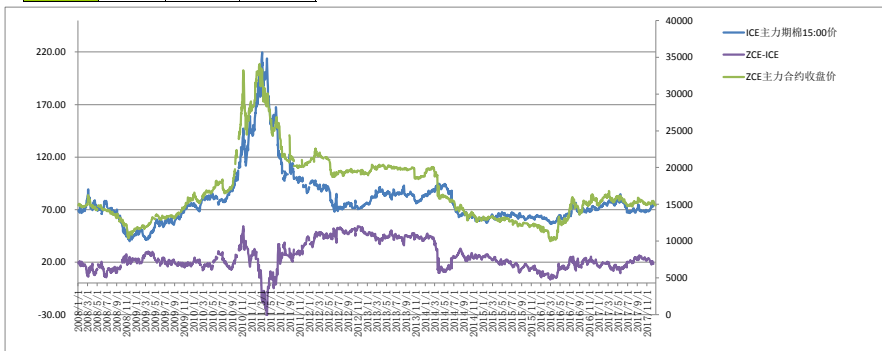
日期	郑州白糖主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2018年05月	5788	2018年03月	14.00	3913.465915	1874.53
2018年09月	5764	2018年05月	13.99	3911.38465	1852.62

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	9.825	2018年05月	2806	2018年05月	5610		
进口大豆压榨利润	2018年05月	9.9325	2018年09月	2778	2018年09月	5784	汇率	6.2822
	南美白 (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%	
	9.8250	4.00	41.87	818.18	17.64	进口大豆出油率	18.50%	
						加工费 (元/吨)	130	
	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)	关税	3%	
	9.9325	78.00	46.26	828.03	68.84	港杂费 (元/吨)	120	

参数 (不含港杂费)	合约月份	美铜价格	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	70	2018年05月	14945	2018年03月	76.18	12242	2703	22.08%	196	160.69
汇率	6.2822	2018年09月	15390	2018年05月	77.53	12455	2935	23.56%	199	160.65
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
2018/2/8	76.18	15390	22.15648373



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	316,100	21,125	50,475
铝	1,058,175	-1,700	22,125
镍	343,896	-3,252	94,044
锌	162,725	-1,625	79,025
铅	126,950	-1,850	48,750
锡	1,845	55	625

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。