

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	伦铜3月价	7001.50	现货	51670	-28.25	6973	52932	-1062	-2.01%	/	7.44	7.55
	到岸升水	65	2018年06月	52290	-21.25	6980	52884	-694	-1.31%	-0.81%	7.49	7.53
	汇率	6.4157	2018年07月	52650	-10.00	6992	53069	-419	-0.79%	-0.69%	7.53	7.54
	增值税	17%	2018年08月	52660	0.00	7002	53144	-484	-0.91%	-0.02%	7.52	7.55
	进口关税	0%	2018年09月	52810	13.50	7015	53245	-435	-0.82%	-0.28%	7.53	7.56
	杂费	100	2018年10月	53000	24.00	7026	53324	-324	-0.61%	-0.36%	7.54	7.58
	实际比值										7.44	7.55

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	伦铜3月价	2322.00	现货	14530	-1.50	2321	18344	-3814	-20.79%	/	6.26	6.34
	到岸升水	110	2018年07月	14645	12.50	2335	18449	-3804	-20.62%	-0.79%	6.27	6.34
	汇率	6.4157	2018年08月	14730	18.00	2340	18491	-3761	-20.34%	-0.58%	6.29	6.36
	增值税	17%	2018年09月	14800	0.00	2322	18355	-3555	-19.37%	-0.48%	6.37	6.44
	进口关税	0%	2018年10月	14885	-1.00	2321	18348	-3463	-18.87%	-0.57%	6.41	6.47
	杂费	100	2018年11月	14965	-6.50	2316	18307	-3342	-18.25%	-0.54%	6.46	6.51
	实际比值										6.26	6.34

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	伦铜3月价	3130.00	现货	24420	-19.25	3111	24582	-162	-0.66%	/	7.85	7.96
	到岸升水	125	2018年07月	24285	-5.75	3124	24684	-399	-1.62%	0.55%	7.77	7.83
	汇率	6.4157	2018年08月	24055	-3.50	3127	24701	-646	-2.62%	0.95%	7.69	7.76
	增值税	17%	2018年09月	23910	0.00	3130	24728	-818	-3.31%	0.60%	7.64	7.71
	进口关税	1%	2018年10月	23840	3.00	3133	24750	-910	-3.68%	0.29%	7.61	7.67
	杂费	50	2018年11月	23720	4.00	3134	24758	-1038	-4.19%	0.50%	7.57	7.64
	实际比值										7.85	7.96

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	伦铜3月价	2513.00	现货	20550	-10.50	2503	20067	483	2.41%	/	8.21	8.31
	到岸升水	80	2018年07月	20600	0.50	2514	20152	448	2.22%	-0.24%	8.20	8.14
	汇率	6.4157	2018年08月	20250	0.50	2514	20152	98	0.49%	1.70%	8.06	8.02
	增值税	17%	2018年09月	19910	0.00	2513	20148	-238	-1.18%	1.68%	7.92	7.93
	进口关税	3%	2018年10月	19750	-0.25	2513	20146	-396	-1.97%	0.80%	7.86	7.87
	杂费	100	2018年11月	19680	0.25	2513	20150	-470	-2.33%	0.35%	7.83	7.80
	实际比值										8.21	8.31

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	伦铜3月价	15460	现货	116200	-70.00	15390	118079	-1879	-1.59%	/	7.55	7.65
	到岸升水	165	2018年07月	116360	-43.00	15417	118284	-1684	-1.42%	-0.18%	7.56	7.62
	汇率	6.4157	2018年08月	116360	-22.00	15438	118443	-2083	-1.76%	-0.14%	7.54	7.59
	增值税	17%	2018年09月	116360	0.00	15460	118610	-2530	-2.13%	-0.14%	7.51	7.55
	进口关税	1%	2018年10月	114930	25.00	15485	118799	-3869	-3.26%	-0.16%	7.42	7.48
	杂费	150	2018年11月	115590	46.00	15506	118959	-3369	-2.83%	-0.14%	7.45	7.50
	实际比值										7.55	7.65

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	伦铜3月价	20675	现货	150000	70.00	20745	311577	-161577	-51.86%	/	7.23	7.31
	到岸升水	19535	2018年07月	150800	35.00	20710	311307	-160507	-51.56%	0.17%	7.28	7.29
	汇率	6.4157	2018年08月	155570	15.00	20690	311152	-155582	-50.00%	0.10%	7.52	7.53
	增值税	17%	2018年09月	151710	0.00	20675	311036	-159326	-51.22%	0.07%	7.34	7.35
	进口关税	3%	2018年10月	154000	-30.00	20645	310804	-156804	-50.45%	0.15%	7.46	7.40
	杂费	150	2018年11月	157760	-50.00	20625	310649	-152889	-49.22%	0.10%	7.65	7.64
	实际比值										7.23	7.31

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	到岸升水	70	2018年07月	52950	314.60	52640	310	0.59%	/	168.31	170.97	
	汇率	6.4157	2018年08月	52650	315.50	52789	-139	-0.26%	-0.29%	166.88	166.83	
	增值税	0.17	2018年09月	52660	316.55	52962	-302	-0.57%	-0.33%	166.36	167.21	
	进口关税	0%	2018年10月	52810	316.40	52938	-128	-0.24%	0.05%	166.91	167.08	
	杂费	150	2018年11月	53000	317.25	53078	-78	-0.15%	-0.27%	167.06	167.26	
	实际比值										168.31	170.97
	进口比值										166.88	166.83

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
2018/6/5	271.9	1297	267.531572	641.57	4.36842797	(-5, +5)

日期	沪铜主力合约	纽约铜主力合约	纽约铜主力合约 (RMB)	人民币汇率	价差 (沪-美)
2018/6/5	3730	16.43	3389.008272	641.57	340.9917283

品种	参数	合约月份	郑州原糖主力合约	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)
白糖	2018年09月	5453	2018年07月	11.93	3545.262023	6.4157	1907.71
	2019年01月	5526	2018年10月	12.25	3613.277784		1912.72
	注: 郑州ICE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考						

品种	参数	大豆压榨价格			大豆油价格			参数
		2018年07月	2018年09月	2019年01月	2018年09月	2019年01月	汇率	
进口大豆压榨利润	2018年07月	10.04	2018年09月	3011	2018年09月	5832	1磅=60磅=27.2154kg	
	2018年11月	10.2175	2019年01月	3090	2019年01月	5990		6.4157
	南美豆 (18年7月到期)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	国际运费 (美元)	毛利 (元/吨)	净利 (元/吨)	进口菜油出油率		79.50%
10.0400	4.00	141.87	945.75	91.80	进口菜油出油率		18.50%	
美国豆 (18年11月到期)	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)		3%	
10.2175	78.00	46.26	955.15	212.52	杂质费 (元/吨)		120	

品种	参数	合约月份	郑糖价格	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		
白糖	到岸升水	70	2018年09月	17160	2018年07月	90.83	14862	2298	15.46%	189	188
	汇率	6.4157	2019年01月	17980	2018年12月	89.17	14594	3386	23.20%	202	199
	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
2018/6/5	89.17	17160	18.19458483



品种	单位	持仓数量 (吨)	盈亏	持仓数量
铜		309,300	-6,050	79,075
铝		1,192,100	-7,050	287,775
镍		281,214	-5,530	71,840
锌		244,675	-275	33,800
铅		133,975	-225	59,125
锡		2,575	65	85

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所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。