

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
										今日	昨日	
铜进口套利	伦铜3月价	6628.00	现货	51255	-41.34	6588	50991	264	-0.52%	/	7.78	1102.55
	到岸升水	65	2017年10月	50970	-25.84	6603	51109	-139	-0.27%	0.56%	7.72	1197.94
	汇率	6.5382	2017年11月	51000	-11.34	6618	51220	-220	-0.43%	-0.06%	7.71	994.10
	增值税	17%	2017年12月	51080	4.16	6633	51339	-259	-0.50%	-0.16%	7.70	722.90
	进口关税	0%	2018年01月	51240	12.91	6642	51406	-166	-0.32%	-0.31%	7.71	653.40
	杂费	100	2018年02月	51450	24.16	6653	51492	-42	-0.08%	-0.41%	7.73	588.54

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
										今日	昨日	
铝进口套利	伦铝3月价	2133.00	现货	16320	-33.25	2100	17004	-684	-4.02%	/	7.77	7.73
	到岸升水	110	2017年10月	16470	-17.75	2115	17122	-652	-3.81%	-0.92%	7.79	7.80
	汇率	6.5382	2017年11月	16560	-6.75	2126	17207	-647	-3.76%	-0.55%	7.79	7.81
	增值税	17%	2017年12月	16670	1.75	2135	17272	-602	-3.48%	-0.66%	7.81	7.84
	进口关税	0%	2018年01月	16745	6.25	2139	17306	-561	-3.24%	-0.45%	7.83	7.86
	杂费	100	2018年02月	16785	12.75	2146	17356	-571	-3.29%	-0.24%	7.82	7.85

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
										今日	昨日	
镍进口套利	伦镍3月价	3060.00	现货	25450	-4.92	3055	24620	830	-3.37%	/	8.33	8.25
	到岸升水	125	2017年10月	24985	-5.17	3055	24618	367	1.49%	1.83%	8.18	8.09
	汇率	6.5382	2017年11月	24825	-3.42	3057	24631	194	0.79%	0.64%	8.12	8.04
	增值税	17%	2017年12月	24705	-0.42	3060	24655	50	0.20%	0.48%	8.07	8.00
	进口关税	1%	2018年01月	24630	-1.42	3059	24647	-17	-0.07%	0.30%	8.05	7.98
	杂费	50	2018年02月	24490	-3.92	3056	24628	-138	-0.58%	0.57%	8.01	7.94

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
										今日	昨日	
锌进口套利	伦锌3月价	2289.50	现货	19760	-33.03	2256	18509	1251	6.76%	/	8.76	8.53
	到岸升水	80	2017年10月	19515	-19.78	2270	18614	901	4.84%	1.24%	8.60	8.62
	汇率	6.5382	2017年11月	18880	-8.28	2281	18704	176	0.94%	3.25%	8.28	8.30
	增值税	17%	2017年12月	18490	1.97	2291	18785	-295	-1.57%	2.07%	8.07	8.09
	进口关税	3%	2018年01月	18245	6.47	2296	18821	-576	-3.06%	1.33%	7.95	7.97
	杂费	100	2018年02月	18110	10.97	2300	18856	-746	-3.96%	0.74%	7.87	7.89

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
										今日	昨日	
锡进口套利	伦锡3月价	11765	现货	92700	-86.38	11679	91856	1044	1.14%	/	7.94	7.83
	到岸升水	165	2017年10月	91840	-50.88	11714	91930	-90	-0.10%	-0.30%	7.84	7.88
	汇率	6.5382	2017年11月	91640	-22.98	11742	92147	-507	-0.55%	-0.24%	7.80	7.85
	增值税	17%	2017年12月	92050	6.12	11771	92371	-321	-0.35%	-0.25%	7.82	7.87
	进口关税	1%	2018年01月	92370	12.12	11797	92572	-202	-0.22%	-0.22%	7.83	7.88
	杂费	150	2018年02月	92800	59.12	11824	92780	20	0.02%	-0.23%	7.85	7.90

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
										今日	昨日	
铅进口套利	伦铅3月价	20705	现货	143500	130.67	20836	169046	-25546	-15.11%	/	6.89	6.87
	到岸升水	600	2017年10月	142400	76.67	20782	168620	-26220	-15.55%	0.26%	6.85	6.86
	汇率	6.5382	2017年11月	142820	41.67	20747	168344	-25524	-15.16%	0.17%	6.88	6.89
	增值税	17%	2017年12月	144130	-8.33	20697	167950	-23820	-14.18%	0.24%	6.96	6.96
	进口关税	3%	2018年01月	145150	-38.33	20667	167714	-22564	-13.45%	0.14%	7.02	7.02
	杂费	150	2018年02月	144170	-63.33	20642	167517	-23347	-13.94%	0.12%	6.98	#VALUE!

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
									今日	昨日	
美铜进口套利	到岸升水	70	2017年10月	50970	300.95	51343	-373	-0.73%	/	169.36	169.36
	汇率	6.5382	2017年11月	51000	299.40	51082	-82	-0.16%	0.52%	170.34	#DIV/0!
	增值税	0.17	2017年12月	51080	301.65	51461	-381	-0.74%	-0.75%	169.34	169.34
	进口关税	0%	2018年01月	51240	304.30	51908	-668	-1.29%	-0.88%	168.39	#DIV/0!
	杂费	150	2018年02月	51450	305.00	52026	-576	-1.11%	-0.23%	168.69	#DIV/0!

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
2017/9/13	281.5	1334.2	280.4594997	653.82	1.040500291	(-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)
2017/9/13	3987	17.92	3766.927173	653.82	220.0728266

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	2018年03月	2018年01月	2018年03月			
2018年01月	6140			14.02	4055.430312	6.5382	2084.57
2018年05月	6019			14.55	4170.232353		1848.77

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		大豆压榨成本		参数
	2017年11月	2018年01月	2018年01月	2018年01月	2018年01月	2018年01月	
进口大豆压榨利润	9.525	2690	2690	2690	6332	6332	1蒲=60磅=27.2154kg
	9.625	2648	2648	2648	6402	6402	汇率
南美豆 (17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)			进口大豆出油率
	4.00	41.87	864.79	17.11			79.50%
美湾豆 (17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)			进口大豆出油率
	78.00	46.26	820.75	49.82			18.50%

参数 (不含增值税)	合约月份	美棉价格	美棉价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	实际比值		进口比	
							今日	昨日		
到岸升水	70	2018年01月	15500	2017年12月	69.06	11581	3939	34.07%	224	224
汇率	6.5382	2018年05月	15550	2018年03月	68.52	11472	4078	35.54%	227	227
增值税	13%									
进口关税	1%									
杂费	200									

日期	ICE主力合约棉15:00价	ICE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2017/9/13	69.06	15550	26.40847948



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	246,575	27,850	86,450
铝	1,317,025	-1,925	164,775
镍	383,256	365	138,294
锌	267,050	13,075	125,880
铅	163,550	-225	50,950
锡	2,015	70	255

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。
- 本文件仅供参考, 并不构成任何对客户之建议。
- 本文件的内容并非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。