

品种	参数	合约月份	沪期价格	LMB升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪期安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
铜进口套利	伦铜3月价	现货	54025	-23.80	7054	54937	-912	-1.66%	/	7.66	7.84	7.79
	到岸升水	2017年11月	55060	-18.80	7050	54975	85	0.16%	-1.92%	7.80	8.02	7.79
	汇率	2017年12月	55090	-5.80	7072	55075	15	0.03%	-0.05%	7.79	8.01	7.79
	增值税	2018年01月	55210	0.20	7078	55121	89	0.16%	-0.22%	7.80	8.02	7.79
	进口关税	2018年02月	55370	8.70	7086	55187	183	0.33%	-0.29%	7.81	8.03	7.79
	杂费	2018年03月	55520	18.70	7096	55264	256	0.46%	-0.27%	7.82	8.04	7.79

品种	参数	合约月份	沪期价格	LMB升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪期安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
铝进口套利	伦铝3月价	现货	16260	-25.55	2122	17293	-1033	-5.97%	/	7.66	7.62	8.15
	到岸升水	2017年11月	16370	-15.55	2132	17370	-1000	-5.76%	-0.68%	7.68	7.63	8.15
	汇率	2017年12月	16470	-4.80	2143	17453	-983	-5.63%	-0.61%	7.69	7.64	8.15
	增值税	2018年01月	16555	0.45	2148	17493	-938	-5.36%	-0.52%	7.71	7.67	8.14
	进口关税	2018年02月	16615	6.20	2154	17538	-923	-5.26%	-0.36%	7.71	7.67	8.14
	杂费	2018年03月	16670	11.70	2159	17580	-910	-5.18%	-0.33%	7.72	7.68	8.14

品种	参数	合约月份	沪期价格	LMB升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪期安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
锌进口套利	伦锌3月价	现货	26490	60.60	2432	19945	6545	32.82%	/	10.89	7.94	8.20
	到岸升水	2017年11月	26480	22.60	2394	19649	6831	34.76%	0.04%	11.06	8.04	8.21
	汇率	2017年12月	26285	9.60	2381	19548	6737	34.46%	0.74%	11.04	8.03	8.21
	增值税	2018年01月	26060	-0.40	2371	19470	6590	33.85%	0.86%	10.99	8.00	8.21
	进口关税	2018年02月	25900	-12.40	2359	19377	6523	33.67%	0.61%	10.98	7.99	8.21
	杂费	2018年03月	25750	-24.40	2347	19283	6467	33.53%	0.58%	10.97	7.98	8.22

品种	参数	合约月份	沪期价格	LMB升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪期安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
镍进口套利	伦镍3月价	现货	21030	-12.35	2558	21032	-2	-0.01%	/	8.22	8.35	8.22
	到岸升水	2017年11月	20600	-7.85	2563	21067	-467	-2.22%	2.04%	8.04	8.09	8.22
	汇率	2017年12月	20435	-2.85	2568	21107	-672	-3.18%	0.80%	7.96	8.01	8.22
	增值税	2018年01月	20235	0.15	2571	21131	-896	-4.24%	0.98%	7.87	7.93	8.22
	进口关税	2018年02月	20180	2.65	2573	21151	-971	-4.59%	0.27%	7.84	7.90	8.22
	杂费	2018年03月	19965	5.15	2576	21171	-1206	-5.69%	1.07%	7.75	7.80	8.22

品种	参数	合约月份	沪期价格	LMB升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	伦期安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
钴进口套利	伦钴3月价	现货	92700	-68.10	11647	92049	651	0.71%	/	7.96	7.99	7.90
	到岸升水	2017年11月	93200	-45.10	11670	92228	972	1.05%	-0.20%	7.99	8.14	7.90
	汇率	2017年12月	92880	-21.10	11694	92415	465	0.50%	-0.21%	7.94	8.09	7.90
	增值税	2018年01月	93430	0.90	11716	92586	844	0.91%	-0.19%	7.97	8.13	7.90
	进口关税	2018年02月	93790	24.80	11740	92772	1018	1.10%	-0.20%	7.99	8.14	7.90
	杂费	2018年03月	93580	48.90	11764	92959	621	0.67%	-0.20%	7.95	8.11	7.90

品种	参数	合约月份	沪期价格	LMB升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	伦期安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
钨进口套利	伦钨3月价	现货	144250	135.00	20905	170776	-28526	-15.53%	/	6.90	6.87	8.17
	到岸升水	2017年11月	145600	85.00	20855	170380	-24780	-14.54%	0.24%	6.98	#VALUE!	8.17
	汇率	2017年12月	147040	40.00	20810	170022	-22982	-13.52%	0.22%	7.07	7.05	8.17
	增值税	2018年01月	147880	0.00	20770	169705	-21825	-12.86%	0.19%	7.12	7.10	8.17
	进口关税	2018年02月	142550	-35.00	20735	169427	-26877	-15.86%	0.17%	6.87	#VALUE!	8.17
	杂费	2018年03月	148400	-70.00	20700	169150	-20750	-12.27%	0.17%	7.17	#VALUE!	8.17

品种	参数	合约月份	沪期价格	美期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	美期安全边际	实际比值		进口比值
									今日	昨日	
美糖进口套利	到岸升水	2017年12月	55060	319.00	54764	296	0.54%	/	172.60	172.60	171.67
	汇率	2018年01月	55090	321.80	55239	-149	-0.27%	-0.88%	171.19	171.19	171.66
	增值税	2018年02月	55210	320.35	54993	217	0.39%	0.45%	172.34	172.34	171.67
	进口关税	2018年03月	55370	323.90	55595	-225	-0.41%	-1.11%	170.95	#DIV/0!	171.64
	杂费	2018年04月	55520	323.50	55527	-7	-0.01%	0.12%	171.62	171.62	171.65

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
2017/10/16	278.7	1306	276.4508258	658.39	2.249474207	(-5, +5)

日期	沪镍主力合约	纽约镍主力合约	纽约镍主力合约 (RMB)	人民币汇率	价差 (沪-美)
2017/10/16	3935	17.415	3686.359806	658.39	248.640194

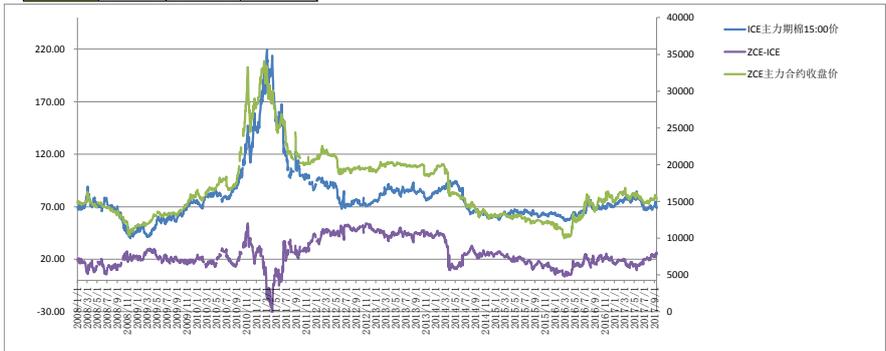
日期	郑州白糖主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2018年01月	6271	2018年03月	14.42	4167.278757	2103.72
2018年05月	5968	2018年05月	14.48	4180.366056	1787.63

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		大连豆粕价格		大连豆油价格		参数
	日期	价格	日期	价格	日期	价格	
进口大豆压榨利润	2017年11月	10.07	2018年01月	2852	2018年01月	6104	1罐=60磅=27.2154kg
	2018年01月	10.1825	2018年03月	2787	2018年05月	6248	汇率
南美豆 (17年11月到期)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	41.87	国际运费 (美元)	801.91	净利 (元/吨)	(72.44)	进口大豆出油率
	4.00	41.87	801.91	801.91	(72.44)	79.50%	
美湾豆 (17年11月到期)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	78.00	国际运费 (美元)	46.26	净利 (元/吨)	(41.23)	进口美豆出油率
	78.00	46.26	46.26	755.18	(41.23)	18.50%	
						加工费 (元/吨)	
						130	
						关税	
						3%	
						增值税	
						13%	
						港杂费 (元/吨)	
						120	

参数 (不含增值税)	合约月份	美糖价格	美糖月份	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	
到岸升水	2018年01月	15220	2017年12月	68.70	11581	3639	31.42%	222	222	168.57
汇率	2018年05月	15235	2018年03月	68.25	11506	3729	32.41%	223	223	168.59
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
2017/10/16	68.70	15235	24.18531242



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	285,025	1,225	74,550
铝	1,218,950	-10,800	249,250
镍	385,788	216	137,664
锌	271,900	975	146,375
铅	151,975	-100	51,675
锡	2,090	0	160

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。