

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	7030.50	现货	55300	-31.34	6999	54642	658	1.20%	/	7.90	7.88	7.81
到岸升水	65	2017年11月	56000	-26.34	7004	54681	319	0.58%	0.54%	7.85	7.79	7.81
汇率	6.5991	2017年12月	54890	-11.84	7019	54793	97	0.18%	0.20%	7.82	7.76	7.81
增值税	17%	2018年01月	55000	-0.34	7030	54881	119	0.22%	-0.20%	7.82	7.76	7.81
进口关税	0%	2018年02月	55120	11.66	7042	54974	146	0.27%	-0.22%	7.83	7.77	7.81
杂费	100	2018年03月	55300	23.16	7054	55063	237	0.43%	-0.33%	7.84	7.79	7.81

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		
伦铝3月价	2128.00	现货	16020	-24.91	2103	17187	-1167	-6.79%	/	7.62	7.59	8.17
到岸升水	110	2017年11月	15990	-16.41	2112	17253	-1263	-7.32%	0.19%	7.57	7.53	8.17
汇率	6.5991	2017年12月	16080	-6.16	2122	17332	-1252	-7.22%	-0.56%	7.58	7.53	8.17
增值税	17%	2018年01月	16170	-0.16	2128	17378	-1208	-6.95%	-0.56%	7.60	7.56	8.17
进口关税	0%	2018年02月	16220	5.59	2134	17423	-1203	-6.90%	-0.31%	7.60	7.56	8.17
杂费	100	2018年03月	16325	10.84	2139	17463	-1138	-6.52%	-0.65%	7.63	7.59	8.16

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		
伦锌3月价	3090.50	现货	25900	24.87	3115	25319	581	2.30%	/	8.31	8.24	8.13
到岸升水	125	2017年11月	25665	9.87	3100	25202	463	1.84%	0.91%	8.28	8.10	8.13
汇率	6.5991	2017年12月	25295	4.87	3095	25163	132	0.52%	1.44%	8.17	8.00	8.13
增值税	17%	2018年01月	25005	0.12	3091	25126	-121	-0.48%	1.15%	8.09	7.91	8.13
进口关税	1%	2018年02月	24815	-3.88	3087	25095	-280	-1.11%	0.76%	8.04	7.87	8.13
杂费	50	2018年03月	24730	-8.38	3082	25060	-330	-1.32%	0.34%	8.02	7.85	8.13

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		
伦镍3月价	2484.50	现货	20450	-17.08	2467	20359	91	0.45%	/	8.29	8.32	8.25
到岸升水	80	2017年11月	19745	-8.58	2476	20426	-681	-3.33%	3.45%	7.97	7.84	8.25
汇率	6.5991	2017年12月	19395	-4.83	2480	20456	-1061	-5.19%	1.77%	7.82	7.69	8.25
增值税	17%	2018年01月	19240	-0.08	2484	20494	-1254	-6.12%	0.80%	7.74	7.62	8.25
进口关税	3%	2018年02月	19100	2.67	2487	20516	-1416	-6.90%	0.73%	7.68	7.56	8.25
杂费	100	2018年03月	19350	4.67	2489	20532	-1182	-5.75%	-1.31%	7.77	7.65	8.25

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		
伦锡3月价	11795	现货	94400	-63.13	11732	92324	1476	1.59%	/	8.05	8.12	7.92
到岸升水	165	2017年11月	93200	-44.13	11751	93072	128	0.14%	-0.16%	7.93	8.00	7.92
汇率	6.5991	2017年12月	93530	-22.13	11773	93243	287	0.31%	-0.19%	7.94	8.01	7.92
增值税	17%	2018年01月	94710	-6.63	11794	93411	1299	1.39%	-0.18%	8.03	8.10	7.92
进口关税	1%	2018年02月	94240	21.37	11816	93583	657	0.70%	-0.19%	7.98	8.04	7.92
杂费	150	2018年03月	94880	44.37	11839	93762	1118	1.19%	-0.19%	8.01	8.08	7.92

参数	合约月份	沪钨价格	LME升贴水	伦钨价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪钨安全边际	实际比值		进口比值	
									今日	昨日		
伦钨3月价	20320	现货	144250	80.19	20400	167156	-22906	-13.70%	/	7.07	6.96	8.19
到岸升水	600	2017年11月	145330	61.19	20381	167004	-21674	-12.98%	0.09%	7.13	#VALUE!	8.19
汇率	6.5991	2017年12月	145390	31.19	20351	166766	-21376	-12.82%	0.15%	7.14	7.03	8.19
增值税	17%	2018年01月	145480	1.19	20321	166527	-21047	-12.64%	0.15%	7.16	7.04	8.19
进口关税	3%	2018年02月	143300	-38.81	20281	166209	-22909	-13.78%	0.20%	7.07	#VALUE!	8.20
杂费	150	2018年03月	149180	-77.81	20242	165899	-16719	-10.08%	0.19%	7.37	#VALUE!	8.20

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	2017年12月	56000	318.75	54848	152	0.28%	/	172.55	#DIV/0!	172.07
汇率	6.5991	2018年01月	54890	319.50	54975	-85	-0.15%	-0.24%	171.80	171.80	172.07
增值税	0.17	2018年02月	55000	320.10	55077	-77	-0.14%	-0.19%	171.82	171.82	172.06
进口关税	0%	2018年03月	55120	320.75	55188	-68	-0.12%	-0.20%	171.85	#DIV/0!	172.06
杂费	150	2018年04月	55300	321.40	55298	2	0.00%	-0.20%	172.06	172.06	172.05

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
2017/10/18	276.15	1284.7	272.5696215	659.91	3.58037853	(-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)
2017/10/18	3901	17.02	3611.064807	659.91	289.9351931

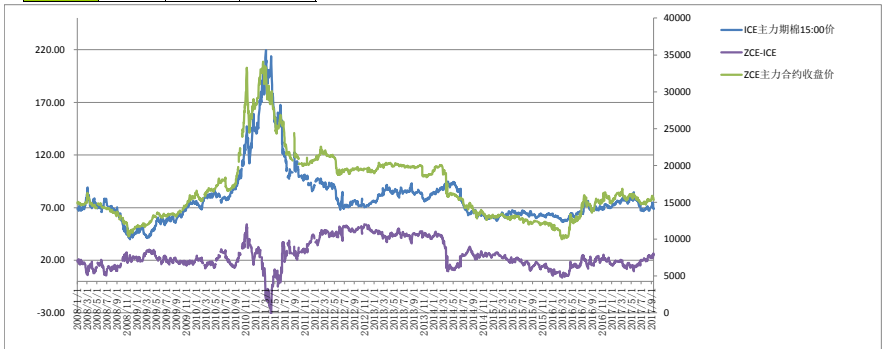
日期	郑州白糖主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2018年01月	6269	14.08	4101.329598	6.5991	2167.67
2018年05月	5944	14.16	4118.819615		1825.18

注：郑州CZCE与纽约原糖交易时间不一致，仅供参考

参数	合约月份	美豆价格	大豆压榨价格			参数	
			进口成本	进口盈亏	进口收益率		
2017年11月	9.935	2018年01月	2837	2018年01月	6064	1罐=60磅=27.2154kg	
2018年01月	10.0325	2018年03月	2775	2018年05月	6212	汇率	6.5991
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)		进口美豆出油率	79.50%
9.9350	4.00	41.87	809.88	(60.88)		进口美豆出油率	18.50%
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)		加工费 (元/吨)	130
10.0325	78.00	46.26	764.95	(27.74)		关税	3%
						增值税	13%
						港杂费 (元/吨)	120

参数 (不含增值税)	合约月份	美棉价格	美棉月份	美棉价格	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01月	15155	2017年12月	67.96	11484	3671	31.96%	223	223	168.99
汇率	6.5991	2018年05月	15150	2018年03月	67.61	11426	3724	32.59%	224	224	169.00
增值税	13%										
进口关税	1%										
杂费	200										

日期	ICE主力期棉15:00价	ICE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2017/10/18	67.96	15150	24.19432807



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	292,225	900	72,850
铝	1,210,325	-1,900	240,850
镍	385,218	-438	138,882
锌	271,250	-600	65,900
铅	151,925	-225	51,325
锡	2,110	70	125

声明：  
1. 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。  
2. 本文件仅供参考，并不构成任何对客户之建议。  
3. 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。