

品种	参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	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	6993.50	现货	51925	-41.38	6952	54363	-2438	-4.48%	/	7.47	7.90
	到岸升水	65	2017年11月	54700	-25.88	6989	54482	219	-0.40%	-5.34%	7.85	7.81
	汇率	6.6093	2017年12月	54620	-10.38	6983	54602	18	0.03%	0.15%	7.82	7.78
	增值税	17%	2018年01月	54720	1.12	6995	54691	29	0.05%	-0.18%	7.82	7.78
	进口关税	0%	2018年02月	54860	12.62	7006	54780	80	0.15%	-0.26%	7.83	7.79
	杂费	100	2018年03月	54990	23.62	7017	54865	125	0.23%	-0.24%	7.84	7.80

品种	参数	合约月份	沪铝价格	LME升贴水	伦敦价格	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	2131.00	现货	15960	-19.68	2111	17277	-1317	-7.62%	/	7.56	7.62
	到岸升水	110	2017年11月	16060	-14.68	2116	17316	-1256	-7.25%	-0.63%	7.59	7.61
	汇率	6.6093	2017年12月	16150	-5.68	2125	17385	-1235	-7.11%	-0.56%	7.60	7.61
	增值税	17%	2018年01月	16225	0.32	2131	17432	-1207	-6.92%	-0.46%	7.61	7.63
	进口关税	0%	2018年02月	16290	6.07	2137	17476	-1186	-6.79%	-0.40%	7.62	7.64
	杂费	100	2018年03月	16345	11.32	2142	17517	-1172	-6.69%	-0.34%	7.63	7.64

品种	参数	合约月份	沪镍价格	LME升贴水	伦敦价格	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	3093.00	现货	26030	58.09	3151	25637	393	1.53%	/	8.26	8.31
	到岸升水	125	2017年11月	25565	28.09	3121	25403	162	0.64%	1.79%	8.19	8.25
	汇率	6.6093	2017年12月	25195	14.59	3108	25297	-102	-0.40%	1.45%	8.11	8.14
	增值税	17%	2018年01月	24940	5.09	3098	25223	-283	-1.12%	1.01%	8.05	8.07
	进口关税	1%	2018年02月	24785	-2.91	3090	25161	-376	-1.49%	0.62%	8.02	8.03
	杂费	50	2018年03月	24680	-10.41	3083	25102	-422	-1.68%	0.42%	8.01	8.01

品种	参数	合约月份	沪锌价格	LME升贴水	伦敦价格	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	2485.50	现货	20160	-15.33	2470	20412	-252	-1.23%	/	8.16	8.29
	到岸升水	80	2017年11月	19350	-6.33	2479	20483	-1133	-5.53%	4.02%	7.81	7.82
	汇率	6.6093	2017年12月	19200	-2.33	2483	20515	-1315	-6.41%	0.78%	7.73	7.74
	增值税	17%	2018年01月	19105	1.42	2487	20545	-1440	-7.01%	0.49%	7.68	7.69
	进口关税	3%	2018年02月	19125	2.67	2488	20555	-1430	-6.96%	-0.10%	7.69	7.69
	杂费	100	2018年03月	19130	4.67	2490	20571	-1441	-7.01%	-0.03%	7.68	7.69

品种	参数	合约月份	沪锡价格	LME升贴水	伦敦价格	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	11740	现货	93850	-64.66	11675	92626	1224	1.32%	/	8.04	8.05
	到岸升水	165	2017年11月	93200	-45.66	11694	92774	426	0.46%	-0.16%	7.97	7.93
	汇率	6.6093	2017年12月	94060	-22.66	11717	92954	1106	1.19%	-0.20%	8.03	7.99
	增值税	17%	2018年01月	94290	-0.66	11739	93125	1165	1.25%	-0.19%	8.03	7.99
	进口关税	1%	2018年02月	94190	21.84	11762	93301	889	0.95%	-0.19%	8.01	7.97
	杂费	150	2018年03月	94470	42.84	11783	93465	1005	1.08%	-0.18%	8.02	7.98

品种	参数	合约月份	沪铅价格	LME升贴水	伦敦价格	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	20075	现货	143750	81.10	20156	165470	-21720	-13.13%	/	7.13	7.07
	到岸升水	600	2017年11月	144550	76.10	20151	165430	-20880	-12.62%	0.02%	7.17	#VALUE!
	汇率	6.6093	2017年12月	145390	31.10	20106	165071	-19681	-11.92%	0.22%	7.23	7.14
	增值税	17%	2018年01月	144740	6.10	20081	164872	-20132	-12.21%	0.12%	7.21	7.12
	进口关税	3%	2018年02月	143300	-36.90	20038	164530	-21230	-12.90%	0.21%	7.15	#VALUE!
	杂费	150	2018年03月	147930	-73.90	20001	164235	-16305	-9.93%	0.18%	7.40	#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		进口比值
									今日	昨日	
美铜进口套利	到岸升水	70	2017年12月	54700	316.30	54515	185	0.34%	/	172.94	172.94
	汇率	6.6093	2018年01月	54620	317.60	54736	-116	-0.21%	-0.41%	171.98	171.98
	增值税	0.17	2018年02月	54720	319.10	54992	-272	-0.49%	-0.47%	171.48	171.48
	进口关税	0%	2018年03月	54860	317.55	54728	132	0.24%	0.49%	172.76	#DIV/0!
	杂费	150	2018年04月	54990	319.65	55086	-96	-0.17%	-0.66%	172.03	172.03

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
2017/10/19	275.7	1282.5	272.5234363	660.93	3.176563716	(-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)
2017/10/19	3888	17	3612.396426	660.93	275.6035736

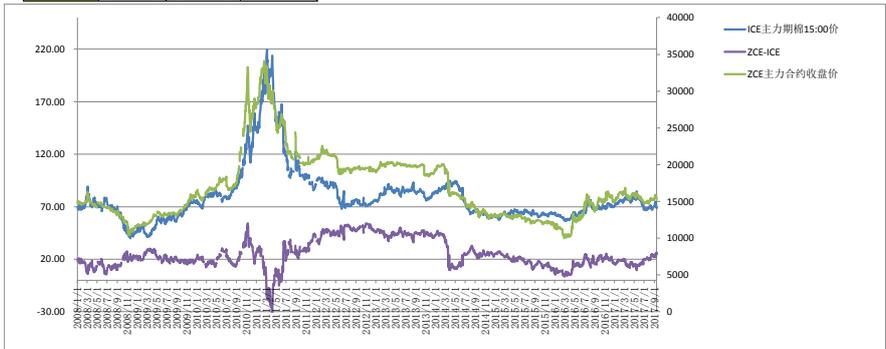
品种	合约月份	纽约原糖主力合约		纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)		RMB汇率	价差 (郑-美)
		2018年03月	2018年05月	14.05	4100.271522		
白糖	2018年01月	6220	14.05	4100.271522	6.6093	2119.73	
	2018年05月	5903	14.13	4117.788573		1785.21	

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
	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	9.955	10.05	2851	2782	5974	6126	1罐=60磅=27.2154kg
							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)	进口美豆出油率	进口美豆出油率	79.50%
	9.9550	41.87	795.61	(77.08)	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)	关税	3%
	10.0500	46.26	716.52	(47.81)	加工费 (元/吨)	增值税	13%
					港杂费 (元/吨)		120

品种	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		进口比值	
								今日	昨日		
棉花进口套利	到岸升水	70	2018年01月	15030	2017年12月	67.70	11458	3572	31.17%	222	222
	汇率	6.6093	2018年05月	15055	2018年03月	67.27	11387	3668	32.21%	224	224
	增值税	13%									
	进口关税	1%									
杂费	200										

日期	ICE主力期货15:00价	ZCE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2017/10/19	67.70	15055	23.73513453



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	291,250	-975	69,375
铝	1,207,800	-2,525	238,325
镍	386,418	1,200	141,234
锌	269,725	-1,525	64,375
铅	151,850	-75	51,250
锡	2,110	0	125

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。