

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		
铜进口套利	伦铜3月价	6165.00	现货	49400	-2.80	6162	50191	-791	-1.58%	/	8.02	8.06	8.14
	到岸升水	60	2017年03月	49890	-8.80	6156	50142	-252	-0.50%	-0.99%	8.10	8.10	8.14
	汇率	6.8806	2017年04月	50110	-3.30	6162	50187	-77	-0.15%	-0.44%	8.13	8.13	8.14
	增值税	17%	2017年05月	50220	-7.80	6157	50150	70	0.14%	-0.22%	8.16	8.16	8.14
	进口关税	0%	2017年06月	50330	2.45	6167	50233	97	0.19%	-0.22%	8.16	8.19	8.14
	杂费	100	2017年07月	50510	4.70	6170	50251	259	0.52%	-0.36%	8.19	8.20	8.14

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		进口比值	
										今日	昨日		
铝进口套利	伦铝3月价	1894.50	现货	13790	-3.00	1892	16132	-2342	-14.52%	/	7.29	7.29	8.53
	到岸升水	100	2017年03月	14325	-7.00	1888	16100	-1775	-11.02%	-3.88%	7.59	7.45	8.53
	汇率	6.8806	2017年04月	14415	-3.50	1891	16128	-1713	-10.62%	-0.63%	7.62	7.48	8.53
	增值税	17%	2017年05月	14485	-7.93	1887	16092	-1607	-9.99%	-0.49%	7.68	7.50	8.53
	进口关税	0%	2017年06月	14540	3.75	1898	16187	-1647	-10.17%	-0.38%	7.66	7.51	8.53
	杂费	100	2017年07月	14580	7.50	1902	16217	-1637	-10.09%	-0.28%	7.67	7.53	8.53

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		进口比值	
										今日	昨日		
锌进口套利	伦锌3月价	2941.00	现货	23650	6.90	2948	24954	-1304	-5.23%	/	8.02	8.15	8.46
	到岸升水	115	2017年03月	23655	-1.10	2940	24889	-1034	-4.15%	-0.87%	8.11	8.12	8.47
	汇率	6.8806	2017年04月	23890	-0.60	2940	24893	-1003	-4.03%	-0.15%	8.12	8.14	8.47
	增值税	17%	2017年05月	23930	-3.43	2938	24870	-940	-3.78%	-0.17%	8.15	8.14	8.47
	进口关税	1%	2017年06月	23950	0.90	2942	24905	-855	-3.83%	-0.08%	8.14	8.13	8.47
	杂费	50	2017年07月	23925	1.40	2942	24909	-884	-3.98%	0.10%	8.13	8.13	8.47

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		进口比值	
										今日	昨日		
镍进口套利	伦镍3月价	2433.00	现货	19370	-2.80	2430	20914	-1544	-7.38%	/	7.97	7.93	8.61
	到岸升水	80	2017年03月	19830	-2.80	2430	20914	-1084	-5.18%	-2.37%	8.16	8.16	8.61
	汇率	6.8806	2017年04月	19915	-0.80	2432	20931	-1016	-4.85%	-0.43%	8.19	8.19	8.61
	增值税	17%	2017年05月	19930	-2.80	2430	20914	-984	-4.71%	-0.08%	8.20	8.19	8.61
	进口关税	3%	2017年06月	19920	1.70	2435	20951	-1031	-4.92%	0.05%	8.18	8.20	8.61
	杂费	100	2017年07月	19880	2.20	2435	20956	-1076	-5.13%	0.20%	8.16	8.20	8.61

品种	参数	合约月份	沪钴价格	LME升贴水	伦钴价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	伦钴安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
钴进口套利	伦钴3月价	10820	现货	87750	-51.50	10769	88845	-1095	-1.23%	/	8.15	8.24	8.25
	到岸升水	140	2017年03月	88900	-36.90	10764	88971	-29	0.03%	-0.14%	8.25	8.27	8.25
	汇率	6.8806	2017年04月	89560	-16.75	10803	89127	433	0.49%	-0.18%	8.29	8.28	8.25
	增值税	17%	2017年05月	90260	-47.62	10772	88876	1384	1.58%	0.29%	8.38	8.33	8.25
	进口关税	1%	2017年06月	90500	18.50	10839	89414	1086	1.21%	-0.61%	8.35	8.37	8.25
	杂费	150	2017年07月	87680	36.00	10856	89556	-1876	-2.10%	-0.16%	8.08	8.17	8.25

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	伦镍安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
镍进口套利	伦镍3月价	19925	现货	150000	-8.20	19917	170271	-20271	-11.91%	/	7.53	7.62	8.55
	到岸升水	600	2017年03月	143350	8.80	19934	170412	-27062	-15.88%	-0.09%	7.19	7.27	8.55
	汇率	6.8806	2017年04月	143820	8.80	19934	170412	-26992	-15.60%	0.00%	7.21	7.30	8.55
	增值税	17%	2017年05月	150750	-3.95	19921	170307	-19557	-11.48%	0.06%	7.57	7.63	8.55
	进口关税	3%	2017年06月	144650	-6.20	19919	170288	-25638	-15.06%	0.01%	7.26	7.35	8.55
	杂费	150	2017年07月	144790	-11.20	19914	170247	-25457	-14.95%	0.03%	7.27	7.23	8.55

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03月	49890	280.55	50410	-520	-1.03%	/	177.83	177.79	179.68
	汇率	6.8806	2017年04月	50110	280.80	50454	-344	-0.68%	-0.09%	178.45	178.68	179.68
	增值税	0.17	2017年05月	50220	281.95	50658	-438	-0.86%	-0.41%	178.12	178.29	179.67
	进口关税	0%	2017年06月	50330	280.30	50365	-35	-0.07%	0.59%	179.56	180.99	179.68
	杂费	150	2017年07月	50510	282.95	50835	-325	-0.64%	-0.95%	178.51	179.10	179.66

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
2017/2/14	276	1230.9	272.2952718	688.06	3.704728217	(-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)
2017/2/14	4233	17.875	3954.243223	688.06	278.7567771

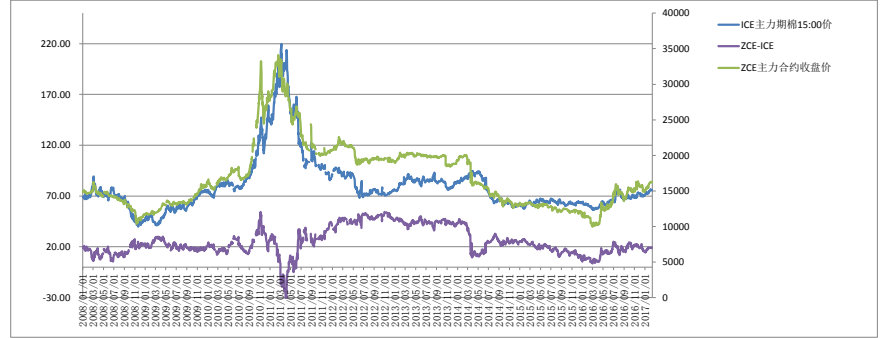
日期	郑州砂磷主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂磷成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年05月	6915	20.04	5612.006431	6.8806	1302.99
2017年09月	6981	20.00	5602.888383		1378.11

注: 郑州CZCE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

品种	大豆价格		大豆豆粕价格		大豆豆油价格		参数	
	2017年03月	1048	2017年05月	2956	2017年05月	6828		1罐=60磅=27.2154kg
进口大豆压榨利润	2017年05月	1059.25	2017年09月	2970	2017年09月	6874	汇率	6.8806
	南美豆 (16年9月到港)	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	79.50%
	1048.0000	4.00	41.87	(261501.82)	(305119.12)		进口大豆出油率	18.50%
			进口美商大豆 国内压榨 (17年1月到港)				加工费 (元/吨)	130
	美商豆 (17年1月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	国际运费 (美元)	毛利 (元/吨)	净利 (元/吨)		关税	3%
	1059.2500	78.00	46.26	(261326.55)	(308622.28)		港杂费 (元/吨)	120

参数 (不含港杂费)	合约月份	郑糖价格	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	70	2017年05月	15935	2017年03月	76.21	13394	2541	18.97%	209	210	175.75
汇率	6.8806	2017年09月	16310	2017年05月	77.91	13688	2622	19.15%	209	211	175.69
增值税	13%										
进口关税	1%										
杂费	200										

日期	ICE主力合约15:00价	ZCE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2017/2/14	76.21	16310	18.94146154



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	243,350	-4,475	105,025
铝	2,220,775	-5,075	589,825
镍	381,546	+1,494	106,416
钴	381,300	-2,350	106,500
铂	189,175	600	70,475
钯	5,880	0	605

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。