

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	6040.00	现货	4820	-16.75	6023	48948	-128	-0.26%	/	8.11	8.02	8.13
	到岸升水	60	2017年03月	48560	-11.75	6023	48988	-428	-0.87%	0.53%	8.06	8.10	8.13
	汇率	6.8632	2017年04月	48740	-4.75	6035	49945	-305	-0.62%	-0.37%	8.08	8.13	8.13
	增值税	17%	2017年05月	48910	-0.25	6040	49081	-171	-0.35%	-0.35%	8.10	8.16	8.13
	进口关税	0%	2017年06月	49080	2.75	6043	49105	-25	-0.05%	-0.35%	8.12	8.16	8.13
	杂费	100	2017年07月	49210	6.00	6046	49131	79	0.16%	-0.26%	8.14	8.19	8.13

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	1894.00	现货	14130	-12.00	1882	16015	-1885	-11.77%	/	7.51	7.29	8.51
	到岸升水	100	2017年03月	14245	-8.00	1886	16047	-1802	-11.23%	-0.81%	7.55	7.59	8.51
	汇率	6.8632	2017年04月	14345	-4.00	1890	16080	-1735	-10.79%	-0.70%	7.59	7.62	8.51
	增值税	17%	2017年05月	14410	0.00	1894	16112	-1702	-10.56%	-0.45%	7.61	7.68	8.51
	进口关税	0%	2017年06月	14445	3.75	1898	16142	-1697	-10.51%	-0.24%	7.61	7.66	8.51
	杂费	100	2017年07月	14420	7.00	1901	16168	-1748	-10.81%	0.17%	7.59	7.67	8.50

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	2906.50	现货	23600	1.25	2908	24565	-965	-3.93%	/	8.12	8.02	8.45
	到岸升水	115	2017年03月	23655	-2.75	2904	24533	-928	-3.78%	-0.02%	8.13	8.11	8.45
	汇率	6.8632	2017年04月	23655	-1.25	2905	24545	-890	-3.63%	-0.21%	8.14	8.12	8.45
	增值税	17%	2017年05月	23680	0.25	2907	24557	-877	-3.57%	-0.11%	8.15	8.15	8.45
	进口关税	1%	2017年06月	23685	1.75	2908	24569	-874	-3.58%	-0.08%	8.15	8.14	8.45
	杂费	50	2017年07月	23685	3.25	2910	24581	-896	-3.65%	0.04%	8.14	8.13	8.45

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	2367.50	现货	19270	-7.00	2361	20285	-1015	-5.00%	/	8.16	7.97	8.59
	到岸升水	80	2017年03月	19335	-5.00	2363	20302	-967	-4.76%	-0.34%	8.18	8.16	8.59
	汇率	6.8632	2017年04月	19400	-2.00	2366	20326	-926	-4.56%	-0.34%	8.20	8.19	8.59
	增值税	17%	2017年05月	19450	-0.50	2367	20339	-889	-4.37%	-0.26%	8.22	8.20	8.59
	进口关税	3%	2017年06月	19510	2.00	2370	20359	-849	-4.17%	-0.31%	8.23	8.18	8.59
	杂费	100	2017年07月	19540	3.00	2371	20368	-828	-4.06%	-0.15%	8.24	8.16	8.59

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	10805	现货	88400	-55.00	10750	88471	-71	-0.08%	/	8.22	8.15	8.23
	到岸升水	140	2017年03月	88960	-38.00	10767	88608	452	0.51%	-0.16%	8.27	8.25	8.23
	汇率	6.8632	2017年04月	88940	-18.00	10767	88771	169	0.19%	-0.19%	8.25	8.29	8.23
	增值税	17%	2017年05月	89810	1.00	10806	88925	885	1.00%	-0.18%	8.31	8.38	8.23
	进口关税	1%	2017年06月	89800	18.00	10823	89663	737	0.83%	-0.16%	8.30	8.35	8.23
	杂费	150	2017年07月	89830	35.00	10840	89200	630	0.71%	-0.16%	8.29	8.08	8.23

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	19925	现货	149000	-24.00	19901	169711	-20711	-12.20%	/	7.49	7.53	8.53
	到岸升水	600	2017年03月	143350	-5.00	19920	169668	-26518	-15.81%	-0.10%	7.20	7.19	8.53
	汇率	6.8632	2017年04月	150390	-5.00	19920	169668	-19478	-11.47%	0.00%	7.55	7.21	8.53
	增值税	17%	2017年05月	148500	0.00	19925	169909	-21409	-12.60%	-0.03%	7.45	7.57	8.53
	进口关税	3%	2017年06月	144650	5.00	19930	169950	-25300	-14.89%	-0.03%	7.26	7.26	8.53
	杂费	150	2017年07月	146270	0.00	19925	169909	-23639	-13.91%	0.03%	7.34	7.27	8.53

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	48560	273.90	49106	-546	-1.11%	/	177.29	177.83	179.28
	汇率	6.8632	2017年04月	48740	274.95	49292	-552	-1.12%	-0.38%	177.27	178.45	179.28
	增值税	0.17	2017年05月	48910	275.50	49389	-479	-0.97%	-0.20%	177.53	178.12	179.27
	进口关税	0%	2017年06月	49080	276.15	49504	-424	-0.86%	-0.24%	177.73	179.56	179.27
	杂费	150	2017年07月	49210	276.80	49619	-409	-0.82%	-0.24%	177.78	178.51	179.26

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
2017/2/15	274.95	1227.1	270.7681816	6.8632	4.181818433	(-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)
2017/2/15	4220	17.92	3954.173102	6.8632	265.8268978

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	6837	20.50	5703.762331	6.8632	1133.24
2017年09月	6916	20.37	5674.203616		1241.80

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03月	1043.75	2017年05月	2937	2017年05月	6830		
进口大豆压榨利润	2017年05月	1054.25	2017年09月	2951	2017年09月	6874	汇率	6.8632
	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%
	1043.7500	4.00	41.87	(259774.56)	(303405.45)		进口菜豆出油率	18.50%
							加工费 (元/吨)	130
	美湾豆 (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%
	1054.2500	78.00	46.26	(262403.33)	(306380.82)		港杂费 (元/吨)	120

参数 (不含增值税)	合约月份	郑棉价格	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	
到岸升水	70	2017年05月	15845	76.30	13376	2469	18.46%	208	175.31
汇率	6.8632	2017年09月	16220	77.95	13661	2559	18.73%	208	175.25
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
2017/2/15	76.30	16220	18.56631009



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	235,825	-7,525	107,050
铝	2,212,000	-8,775	589,275
镍	380,610	-936	104,880
锌	395,725	14,425	105,125
铅	189,150	-25	70,450
锡	5,930	50	855

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。