

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		
铜进口套利	伦铜3月价	5554.00	现货	44965	-25.67	5528	45298	-323	-0.71%	/	8.13	8.19	8.19
	到岸升水	65	2017年06月	45230	-13.17	5541	45389	-159	-0.35%	-0.59%	8.16	8.17	8.19
	汇率	6.9051	2017年07月	45270	-5.17	5549	45454	-184	-0.40%	-0.09%	8.16	8.16	8.19
	增值税	17%	2017年08月	45320	2.08	5556	45513	-193	-0.42%	-0.11%	8.16	8.15	8.19
	进口关税	0%	2017年09月	45400	10.58	5565	45581	-181	-0.40%	-0.18%	8.16	8.15	8.19
	杂费	100	2017年10月	45540	17.33	5571	45636	-96	-0.21%	-0.31%	8.17	8.15	8.19

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	1872.50	现货	13720	-5.67	1867	16071	-2351	-14.63%	/	7.35	7.30	8.61
	到岸升水	110	2017年06月	13795	-5.17	1867	16075	-2280	-14.18%	-0.55%	7.39	7.35	8.61
	汇率	6.9051	2017年07月	13845	-1.67	1871	16103	-2258	-14.02%	-0.36%	7.40	7.38	8.61
	增值税	17%	2017年08月	13890	0.83	1873	16123	-2233	-13.85%	-0.33%	7.41	7.40	8.61
	进口关税	0%	2017年09月	13940	4.83	1877	16156	-2216	-13.71%	-0.36%	7.43	7.42	8.61
	杂费	100	2017年10月	13970	8.08	1881	16182	-2212	-13.67%	-0.22%	7.43	7.44	8.60

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		
锌进口套利	伦锌3月价	2635.00	现货	22250	-13.92	2621	22457	-207	-0.92%	/	8.49	8.44	8.57
	到岸升水	125	2017年06月	22175	-6.42	2629	22519	-344	-1.53%	0.34%	8.44	8.49	8.57
	汇率	6.9051	2017年07月	21945	-2.17	2633	22563	-608	-2.70%	1.04%	8.34	8.40	8.57
	增值税	17%	2017年08月	21735	-0.42	2635	22568	-833	-3.69%	0.96%	8.25	8.31	8.57
	进口关税	1%	2017年09月	21575	2.33	2637	22590	-1045	-4.49%	0.74%	8.18	8.24	8.57
	杂费	50	2017年10月	21425	3.83	2639	22602	-1177	-5.21%	0.70%	8.12	8.17	8.57

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		
镍进口套利	伦镍3月价	2212.00	现货	16100	-3.71	2208	19142	-3042	-15.89%	/	7.29	7.36	8.67
	到岸升水	80	2017年06月	16340	-4.71	2207	19133	-2793	-14.60%	-1.49%	7.40	7.35	8.67
	汇率	6.9051	2017年07月	16465	-1.21	2211	19162	-2697	-14.08%	-0.76%	7.45	7.40	8.67
	增值税	17%	2017年08月	16500	1.04	2213	19181	-2681	-13.98%	-0.21%	7.46	7.43	8.67
	进口关税	3%	2017年09月	16530	3.79	2216	19204	-2674	-13.92%	-0.18%	7.46	7.46	8.67
	杂费	100	2017年10月	16355	6.54	2219	19227	-2872	-14.94%	1.06%	7.37	7.45	8.67

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		
钴进口套利	伦钴3月价	9285	现货	76200	-42.17	9223	76752	-552	-0.72%	/	8.26	8.39	8.32
	到岸升水	165	2017年06月	75900	-30.67	9234	76846	-1246	-1.62%	-0.12%	8.19	8.20	8.32
	汇率	6.9051	2017年07月	76070	-12.17	9253	76997	-927	-1.20%	-0.20%	8.22	8.22	8.32
	增值税	17%	2017年08月	75990	3.33	9268	77124	-2034	-2.64%	-0.17%	8.10	8.26	8.32
	进口关税	1%	2017年09月	77130	24.33	9289	77295	-165	-0.21%	-0.23%	8.30	8.29	8.32
	杂费	150	2017年10月	76460	42.33	9307	77442	-882	-1.27%	-0.19%	8.22	8.33	8.32

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		
钨进口套利	伦钨3月价	19800	现货	140000	63.33	19863	170432	-30432	-17.86%	/	7.05	7.03	8.58
	到岸升水	600	2017年06月	141000	47.33	19847	170299	-29299	-17.20%	0.08%	7.10	7.03	8.58
	汇率	6.9051	2017年07月	141590	22.33	19822	170091	-28501	-16.76%	0.13%	7.14	7.16	8.58
	增值税	17%	2017年08月	141050	-1.67	19798	169891	-28841	-16.98%	0.12%	7.12	6.92	8.58
	进口关税	3%	2017年09月	142250	-31.67	19768	169642	-27392	-16.15%	0.15%	7.20	7.13	8.58
	杂费	150	2017年10月	141060	-51.67	19748	169475	-28415	-16.77%	0.10%	7.14	7.18	8.58

品种	参数	合约月份	沪铝价格	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06月	45230	251.60	45437	-207	-0.46%	/	179.77	180.36	180.59
	汇率	6.9051	2017年07月	45270	252.05	45517	-247	-0.54%	-0.18%	179.61	179.86	180.59
	增值税	0.17	2017年08月	45320	251.35	45393	-73	-0.16%	0.28%	180.31	179.71	180.60
	进口关税	0%	2017年09月	45400	253.05	45695	-295	-0.65%	-0.68%	179.41	179.35	180.58
	杂费	150	2017年10月	45540	251.20	45366	174	0.38%	0.73%	181.29	179.34	180.60

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
2017/5/11	277.35	1222.1	271.3112073	690.51	6.038792701	(-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)
2017/5/11	4030	16.275	3613.116683	690.51	416.8833166

品种	参数	合约月份	沪铝价格	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 (沪-美)
白糖	郑州白糖主力合约						
	2017年09月	6667	2017年09月	15.90	4683.002551	6.9051	1994.00
	2018年01月	6759	2017年10月	16.18	4747.056151		2011.94

注：郑州CICE与纽约原糖交易时间不一致，仅供参考。

品种	参数	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	美棉安全边际	实际比值		进口比值		
									今日	昨日			
美棉进口套利	到岸升水	70	2017年09月	15495	2017年07月	76.40	13474	2021	15.00%	203	194	176.36	
	汇率	6.9051	2018年01月	15755	2017年12月	72.45	12788	2967	23.21%	217	211	176.50	
	增值税	13%											
	进口关税	1%											
	杂费	200											

日期	ICE主力期棉15:00价	ZCE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2017/5/11	76.40	15755	15.1875093



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	336,725	-2,475	101,325
铝	1,564,800	-5,775	596,325
镍	381,834	456	106,554
锌	347,200	475	115,125
铅	178,325	-650	93,475
锡	2,290	0	480

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。