

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	5587.00	现货	45230	-18.00	5569	45442	-212	-0.47%	/	8.12	8.13	8.16
	到岸升水	65	2017年06月	45280	-8.00	5579	45523	-243	-0.53%	-0.11%	8.12	8.10	8.16
	汇率	6.8786	2017年07月	45300	-3.25	5584	45561	-261	-0.57%	-0.04%	8.11	8.09	8.16
	增值税	17%	2017年08月	45360	2.50	5590	45607	-247	-0.54%	-0.13%	8.12	8.10	8.16
	进口关税	0%	2017年09月	45420	9.25	5596	45662	-242	-0.53%	-0.13%	8.12	8.11	8.16
	杂费	100	2017年10月	45550	15.00	5602	45708	-158	-0.36%	-0.29%	8.13	8.12	8.16

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	1915.00	现货	13880	-2.00	1913	16381	-2501	-15.27%	/	7.26	7.25	8.56
	到岸升水	110	2017年06月	13965	-5.50	1910	16353	-2388	-14.60%	-0.61%	7.31	7.31	8.56
	汇率	6.8786	2017年07月	14030	-2.50	1913	16377	-2347	-14.33%	-0.47%	7.34	7.32	8.56
	增值税	17%	2017年08月	14090	0.75	1916	16403	-2313	-14.10%	-0.43%	7.35	7.33	8.56
	进口关税	0%	2017年09月	14140	4.00	1919	16429	-2289	-13.93%	-0.35%	7.37	7.34	8.56
	杂费	100	2017年10月	14180	6.50	1922	16449	-2269	-13.80%	-0.28%	7.38	7.35	8.56

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	2530.00	现货	22140	-14.75	2515	21511	629	2.92%	/	8.80	8.69	8.55
	到岸升水	125	2017年06月	21800	-7.25	2523	21572	228	1.06%	1.54%	8.64	8.55	8.55
	汇率	6.8786	2017年07月	21430	-1.75	2528	21617	-187	-0.86%	1.70%	8.48	8.39	8.55
	增值税	17%	2017年08月	21180	1.00	2531	21639	-459	-2.12%	1.17%	8.37	8.29	8.55
	进口关税	1%	2017年09月	20985	4.50	2535	21668	-683	-3.15%	0.92%	8.28	8.23	8.55
	杂费	50	2017年10月	20845	6.25	2536	21682	-837	-3.88%	0.67%	8.22	8.20	8.55

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	2068.50	现货	15550	-16.00	2053	17777	-2227	-12.53%	/	7.58	7.57	8.66
	到岸升水	80	2017年06月	15385	-6.00	2063	17860	-2475	-13.86%	1.06%	7.46	7.44	8.66
	汇率	6.8786	2017年07月	15470	-2.50	2066	17889	-2419	-13.52%	-0.55%	7.49	7.48	8.66
	增值税	17%	2017年08月	15585	0.50	2069	17914	-2329	-13.00%	-0.74%	7.53	7.48	8.66
	进口关税	3%	2017年09月	15580	5.00	2074	17951	-2371	-13.21%	0.03%	7.51	7.49	8.66
	杂费	100	2017年10月	15705	7.00	2076	17968	-2263	-12.59%	-0.80%	7.57	7.52	8.66

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	伦铝安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
伦镍进口套利	伦镍3月价	9135	现货	75700	-38.50	9097	75432	268	0.36%	/	8.32	8.32	8.29
	到岸升水	165	2017年06月	74700	-31.50	9104	75488	-788	-1.04%	-0.08%	8.21	8.21	8.29
	汇率	6.8786	2017年07月	75150	-16.00	9119	75614	-464	-0.61%	-0.17%	8.24	8.23	8.29
	增值税	17%	2017年08月	75950	1.50	9137	75757	193	0.26%	-0.19%	8.31	8.27	8.29
	进口关税	1%	2017年09月	76020	20.50	9156	75911	109	0.14%	-0.21%	8.30	8.30	8.29
	杂费	150	2017年10月	76340	38.00	9173	76053	287	0.38%	-0.19%	8.32	8.50	8.29

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	伦铝安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
伦镍进口套利	伦镍3月价	20295	现货	141750	145.00	20440	174559	-32809	-18.80%	/	6.93	6.89	8.54
	到岸升水	600	2017年06月	141000	95.00	20390	174145	-33145	-19.03%	0.24%	6.92	6.91	8.54
	汇率	6.8786	2017年07月	141770	55.00	20350	173813	-32043	-18.44%	0.20%	6.97	6.96	8.54
	增值税	17%	2017年08月	142990	20.00	20315	173523	-30533	-17.60%	0.17%	7.04	7.04	8.54
	进口关税	3%	2017年09月	144050	-20.00	20275	173191	-29141	-16.83%	0.20%	7.10	7.10	8.54
	杂费	150	2017年10月	142850	-45.00	20250	172984	-30134	-17.42%	0.12%	7.05	6.92	8.54

品种	参数	合约月份	沪铝价格	美铝价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	美铝安全边际	实际比值		进口比值	
									今日	昨日		
美铝进口套利	到岸升水	70	2017年06月	45280	253.40	45582	-302	-0.66%	/	178.69	178.57	179.88
	汇率	6.8786	2017年07月	45300	253.65	45626	-326	-0.72%	-0.10%	178.59	178.55	179.88
	增值税	0.17	2017年08月	45360	254.55	45786	-426	-0.93%	-0.35%	178.20	177.71	179.87
	进口关税	0%	2017年09月	45420	254.55	45786	-366	-0.80%	0.00%	178.43	178.46	179.87
	杂费	150	2017年10月	45550	255.00	45866	-316	-0.69%	-0.18%	178.63	181.19	179.87

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
2017/5/19	282.65	1250	276.4401282	687.86	6.209871157	(-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)
2017/5/19	4096	16.68	3688.817071	687.86	407.1829287

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09月	6734	16.00	4689.875883	6.8786	2044.12
2018年01月	6814	16.24	4744.568264		2069.43

注: 郑州CZCE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07月	9.4825	2017年09月	2737	2017年09月	5938		1罐=60磅=27.2154kg	
进口大豆压榨利润	2017年11月	9.4725	2018年01月	2768	2018年01月	6110	汇率	6.8786	
	南美豆 (17年7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%	
	9.4825	4.00	41.87	720.41	(163.41)	进口菜豆出油率		18.50%	
			进口美国大豆, 国内压榨 (17年11月到港)			加工费 (元/吨)		130	
			美国豆 (17年11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)		3%
	9.4725	78.00	46.26	779.09		(16.61)	港杂费 (元/吨)	120	

参数 (不含增值税)	合约月份	期货价格	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09月	15810	2017年07月	79.11	13892	1918	13.81%	200	175.60
汇率	6.8786	2018年01月	15945	2017年12月	73.78	12969	2976	22.94%	216	175.79
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
2017/5/19	79.11	15945	13.93912248



每日LME库存:

品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	336,650	-3,700	110,675
铝	1,506,700	-8,700	541,850
镍	378,894	-930	109,188
锌	342,675	-2,200	172,475
铅	184,425	-25	92,575
锡	2,020	-25	330

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所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。