

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	5801.50	现货	46280	-25.75	5776	46533	-253	-0.54%	/	8.01	7.80	8.06
	到岸升水	65	2017年07月	46260	-14.25	5767	46625	-365	-0.78%	0.04%	7.99	7.98	8.06
	汇率	6.7948	2017年08月	46370	6.00	5786	46690	-320	-0.59%	-0.24%	8.00	7.99	8.06
	增值税	17%	2017年09月	46470	2.50	5804	46758	-288	-0.62%	-0.22%	8.01	8.00	8.06
	进口关税	0%	2017年10月	46560	8.50	5810	46806	-246	-0.53%	-0.19%	8.01	8.00	8.06
	杂费	100	2017年11月	46740	13.69	5815	46847	-107	-0.23%	-0.39%	8.04	8.01	8.06

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	1898.00	现货	13600	-6.33	1892	16013	-2413	-15.07%	/	7.19	7.19	8.47
	到岸升水	110	2017年07月	13670	-6.33	1892	16013	-2343	-14.63%	-0.51%	7.23	7.20	8.47
	汇率	6.7948	2017年08月	13745	-2.58	1895	16043	-2298	-14.32%	-0.55%	7.25	7.22	8.46
	增值税	17%	2017年09月	13805	1.17	1899	16073	-2268	-14.11%	-0.44%	7.27	7.25	8.46
	进口关税	0%	2017年10月	13875	3.92	1902	16095	-2220	-13.79%	-0.51%	7.30	7.27	8.46
	杂费	100	2017年11月	13925	6.52	1905	16115	-2190	-13.59%	-0.36%	7.31	7.29	8.46

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	2531.00	现货	23510	-18.08	2513	21231	2279	10.73%	/	9.36	8.81	8.45
	到岸升水	125	2017年07月	22145	-9.33	2522	21301	844	3.96%	5.81%	8.78	9.35	8.45
	汇率	6.7948	2017年08月	21405	-4.83	2526	21337	68	0.32%	3.34%	8.47	8.78	8.45
	增值税	17%	2017年09月	21045	0.17	2531	21377	-332	-1.56%	1.68%	8.31	8.48	8.45
	进口关税	1%	2017年10月	20800	2.67	2534	21398	-698	-2.79%	1.16%	8.21	8.31	8.45
	杂费	50	2017年11月	20700	5.15	2536	21417	-717	-3.38%	0.48%	8.16	8.21	8.44

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	2100.50	现货	16890	-22.25	2078	17773	-883	-4.97%	/	8.13	7.89	8.55
	到岸升水	80	2017年07月	17070	-8.50	2092	17885	-815	-4.56%	-1.07%	8.16	8.18	8.55
	汇率	6.7948	2017年08月	17080	-3.00	2098	17930	-850	-4.74%	-0.06%	8.14	8.16	8.55
	增值税	17%	2017年09月	17065	1.00	2102	17963	-898	-5.00%	0.09%	8.12	8.15	8.55
	进口关税	3%	2017年10月	17035	4.00	2105	17988	-953	-5.30%	0.18%	8.09	8.12	8.55
	杂费	100	2017年11月	16930	6.12	2107	18005	-1075	-5.97%	0.62%	8.04	8.09	8.55

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	8985	现货	73400	-58.34	8927	73151	249	0.34%	/	8.22	8.13	8.19
	到岸升水	165	2017年07月	71500	-33.84	8951	73347	-1847	-2.52%	-0.27%	7.99	8.00	8.19
	汇率	6.7948	2017年08月	73680	-15.84	8969	73492	189	0.26%	-0.20%	8.21	8.23	8.19
	增值税	17%	2017年09月	73700	4.66	8990	73657	43	0.06%	-0.23%	8.20	8.22	8.19
	进口关税	1%	2017年10月	73880	22.66	9008	73801	79	0.11%	-0.20%	8.20	8.22	8.19
	杂费	150	2017年11月	74200	40.58	9026	73945	255	0.34%	-0.20%	8.22	8.23	8.19

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	18850	现货	139500	136.00	18986	160528	-21028	-13.10%	/	7.35	7.38	8.46
	到岸升水	600	2017年07月	141300	76.00	18926	160037	-18737	-11.71%	0.32%	7.47	7.46	8.46
	汇率	6.7948	2017年08月	142480	26.00	18876	159628	-17148	-10.74%	0.26%	7.55	#VALUE!	8.46
	增值税	17%	2017年09月	144160	-14.00	18836	159300	-15140	-9.50%	0.21%	7.65	7.64	8.46
	进口关税	3%	2017年10月	142190	-49.00	18801	159013	-16823	-10.58%	0.19%	7.56	7.55	8.46
	杂费	150	2017年11月	141240	-62.50	18788	158903	-17663	-11.12%	0.07%	7.52	7.51	8.46

品种	参数	合约月份	沪镍价格	美镍价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	美镍安全边际	实际比值		进口比值	
									今日	昨日		
美镍进口套利	到岸升水	70	2017年07月	46260	263.40	46779	-519	-1.11%	/	175.63	#DIV/0!	177.60
	汇率	6.7948	2017年08月	46370	263.80	46849	-479	-1.02%	-0.15%	175.78	175.36	177.59
	增值税	0.17	2017年09月	46470	264.60	46989	-519	-1.11%	-0.30%	175.62	175.25	177.59
	进口关税	0%	2017年10月	46560	264.75	47016	-456	-0.97%	-0.06%	175.86	175.52	177.58
	杂费	150	2017年11月	46740	266.05	47243	-503	-1.06%	-0.49%	175.68	#DIV/0!	177.57

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
2017/6/12	281.05	1266.5	276.6768927	679.48	4.373107251	(-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)
2017/6/12	4062	17.11	3737.814161	679.48	324.185839

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	6647	2017年07月	14.31	4258.836667	2388.16
2018年01月	6785	2017年10月	14.48	4297.105141	2487.89

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	9.4175	2017年09月	2677	2017年09月	5856	
进口大豆压榨利润	2017年11月	9.475	2018年01月	2713	2018年01月	6010	汇率
							6.7948
南美豆 (17年7月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	4.00	国际运费 (美元)	41.87	毛利 (元/吨)	703.56	净利率 (元/吨)
							(168.28)
美湾豆 (17年11月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	78.00	国际运费 (美元)	46.26	毛利 (元/吨)	715.96	净利率 (元/吨)
							(42.27)

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09月	15310	2017年07月	75.57	13120	2190	16.69%	203	203	173.81
汇率	6.7948	2018年01月	15380	2017年12月	72.47	12590	2790	22.16%	212	212	173.73
增值税	13%										
进口关税	1%										
杂费	200										

日期	ICE主力合约棉15:00价	ZCE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2017/6/12	75.57	15380	15.28889922



每日LME库存:

品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	279,575	2,700	126,775
铝	1,450,875	-5,675	419,025
镍	375,870	-1,044	105,664
锌	321,575	-1,450	145,450
铅	176,875	-425	63,175
锡	1,910	0	240

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。