

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	现货	45500	-30.92	5656	45514	-14	-0.03%	/	8.05	7.99	8.05
	到岸升水	2017年07月	45550	-18.67	5669	45611	-61	-0.13%	-0.11%	8.04	7.96	8.05
	汇率	2017年08月	45600	-8.92	5678	45689	-89	-0.19%	-0.11%	8.03	7.96	8.05
	增值税	2017年09月	45710	2.08	5689	45776	-66	-0.14%	-0.24%	8.04	7.96	8.05
	进口关税	2017年10月	45790	9.58	5696	45835	-45	-0.10%	-0.18%	8.04	7.96	8.05
	杂费	2017年11月	45970	16.58	5703	45891	79	0.17%	-0.39%	8.06	7.99	8.05

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	现货	13350	-10.17	1872	15833	-2483	-15.68%	/	7.13	7.22	8.46
	到岸升水	2017年07月	13480	-7.67	1874	15853	-2373	-14.97%	-0.97%	7.19	7.16	8.46
	汇率	2017年08月	13555	-3.67	1878	15885	-2330	-14.67%	-0.56%	7.22	7.18	8.46
	增值税	2017年09月	13635	0.83	1883	15920	-2285	-14.36%	-0.59%	7.24	7.21	8.46
	进口关税	2017年10月	13715	3.33	1885	15940	-2225	-13.96%	-0.59%	7.27	7.24	8.45
	杂费	2017年11月	13760	6.08	1888	15962	-2202	-13.80%	-0.33%	7.29	7.26	8.45

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	现货	22310	-17.88	2500	21098	1212	5.74%	/	8.92	9.08	8.44
	到岸升水	2017年07月	21620	-9.13	2509	21169	451	2.13%	3.09%	8.62	8.72	8.44
	汇率	2017年08月	21135	-5.13	2513	21201	-66	-0.31%	2.24%	8.41	8.51	8.44
	增值税	2017年09月	20945	-0.63	2517	21237	-292	-1.37%	0.90%	8.32	8.42	8.44
	进口关税	2017年10月	20800	1.88	2520	21267	-467	-2.15%	0.69%	8.25	8.35	8.44
	杂费	2017年11月	20720	4.38	2522	21277	-557	-2.62%	0.38%	8.21	8.31	8.44

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	现货	17000	-23.08	2068	17663	-663	-3.75%	/	8.22	7.50	8.54
	到岸升水	2017年07月	17110	-10.33	2081	17767	-657	-3.70%	-0.65%	8.22	7.58	8.54
	汇率	2017年08月	16895	-4.33	2087	17817	-922	-5.17%	1.26%	8.10	7.47	8.54
	增值税	2017年09月	16680	0.42	2091	17855	-1175	-6.58%	1.27%	7.98	7.36	8.54
	进口关税	2017年10月	16605	3.42	2094	17880	-1275	-7.13%	0.45%	7.93	7.32	8.54
	杂费	2017年11月	16600	6.92	2098	17909	-1309	-7.31%	0.03%	7.91	7.30	8.54

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	现货	73300	-62.17	8853	72456	844	1.17%	/	8.28	8.25	8.18
	到岸升水	2017年07月	71300	-37.17	8876	72656	-1356	-1.87%	-0.28%	8.03	8.08	8.18
	汇率	2017年08月	72850	-20.17	8895	72792	-142	-0.20%	-0.19%	8.17	8.21	8.18
	增值税	2017年09月	72940	0.83	8916	72961	-21	-0.03%	-0.24%	8.18	8.23	8.18
	进口关税	2017年10月	73300	17.83	8933	73097	203	0.28%	-0.19%	8.21	8.25	8.18
	杂费	2017年11月	72470	34.83	8950	73233	-763	-1.04%	-0.19%	8.10	8.14	8.18

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	现货	142500	123.67	19329	163104	-20604	-12.63%	/	7.37	7.26	8.44
	到岸升水	2017年07月	141300	71.67	19277	162678	-21378	-13.14%	0.27%	7.33	7.24	8.44
	汇率	2017年08月	141540	36.67	19242	162392	-20852	-12.84%	0.18%	7.36	7.27	8.44
	增值税	2017年09月	145230	-8.33	19197	162024	-16794	-10.37%	0.23%	7.57	7.47	8.44
	进口关税	2017年10月	144790	-43.33	19162	161738	-16948	-10.48%	0.18%	7.56	7.46	8.44
	杂费	2017年11月	141240	-73.33	19132	161493	-20253	-12.54%	0.16%	7.38	7.29	8.44

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	2017年07月	45550	256.85	45568	-18	-0.04%	/	177.34	#DIV/0!	177.41
	汇率	2017年08月	45600	257.40	45664	-64	-0.14%	-0.21%	177.16	177.16	177.40
	增值税	2017年09月	45710	258.80	45909	-199	-0.43%	-0.54%	176.62	176.62	177.39
	进口关税	2017年10月	45790	258.90	45926	-136	-0.30%	-0.04%	176.86	176.86	177.39
	杂费	2017年11月	45970	259.85	46092	-122	-0.27%	-0.37%	176.91	#DIV/0!	177.38

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
2017/6/15	279.85	1260.5	274.9770958	678.52	4.872904189	(-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)
2017/6/15	4041	16.9	3686.721872	678.52	354.2781284

品种	参数	合约月份	郑州砂糖主力合约	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 (郑-美)
白糖		2018年01月	6733	2017年10月	13.83	4145.677365	2587.32
	注: 郑州CICE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考						

品种	参数	美豆价格		大连豆粕价格		大豆油价格		参数	
		2017年07月	9.32	2017年09月	2664	2017年09月	5840		1罐=60磅=27.2154kg
进口大豆压榨利润		2017年11月	9.39	2018年01月	2701	2018年01月	6006	汇率	6.7852
	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%		
	9.3200	4.00	41.87	718.03	(148.77)	进口大豆出油率	18.50%		
	美湾豆 (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)	加工费 (元/吨)	3%		
	9.3900	78.00	46.26	760.33	(23.55)	美税	13%		
						港杂费 (元/吨)	120		

品种	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		
棉花	到岸升水	2017年09月	15160	2017年07月	73.30	12714	2446	19.24%	207	207	173.45
	汇率	2018年01月	15205	2017年12月	70.77	12282	2923	23.80%	215	215	173.55
	增值税										
	进口关税										
	杂费										

日期	ICE主力期货棉15-00价	ZCE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2017/6/15	73.30	15205	16.65215756



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	268,500	-4,125	109,200
铝	1,436,125	-1,900	404,525
镍	376,896	534	111,156
锌	316,175	-1,800	144,200
铅	176,300	-75	65,575
锡	1,915	-5	430

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。