

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	现货	45600	-24.75	5632	45424	176	-0.39%	/	8.10	8.08	8.06
	到岸升水	2017年07月	45440	-16.75	5640	45488	-48	-0.10%	0.35%	8.06	8.08	8.06
	汇率	2017年08月	45490	-8.25	5649	45555	-65	-0.14%	-0.11%	8.05	8.07	8.06
	增值税	2017年09月	45570	1.75	5659	45635	-65	-0.14%	-0.18%	8.05	8.08	8.06
	进口关税	2017年10月	45660	9.25	5666	45694	-34	-0.08%	-0.20%	8.06	8.08	8.06
	杂费	2017年11月	45830	16.25	5673	45750	80	0.17%	-0.37%	8.08	8.10	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	现货	13450	-10.75	1863	15798	-2348	-14.86%	/	7.22	7.16	8.48
	到岸升水	2017年07月	13530	-8.25	1866	15818	-2288	-14.46%	-0.59%	7.25	7.22	8.48
	汇率	2017年08月	13595	-4.25	1870	15850	-2255	-14.23%	-0.48%	7.27	7.25	8.48
	增值税	2017年09月	13670	0.25	1874	15886	-2216	-13.95%	-0.55%	7.29	7.27	8.48
	进口关税	2017年10月	13740	2.75	1877	15905	-2165	-13.61%	-0.51%	7.32	7.31	8.47
	杂费	2017年11月	13795	5.50	1880	15927	-2132	-13.39%	-0.40%	7.34	7.32	8.47

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	现货	22370	-15.75	2509	21216	1154	5.44%	/	8.92	8.89	8.46
	到岸升水	2017年07月	21615	-9.00	2516	21270	345	1.62%	3.38%	8.59	8.59	8.45
	汇率	2017年08月	21140	-5.00	2520	21302	-162	-0.76%	2.20%	8.39	8.39	8.45
	增值税	2017年09月	20895	-0.50	2525	21339	-394	-1.80%	0.88%	8.30	8.30	8.45
	进口关税	2017年10月	20815	2.00	2527	21359	-644	-2.55%	0.67%	8.24	8.23	8.45
	杂费	2017年11月	20710	4.50	2530	21379	-669	-3.13%	0.50%	8.19	8.19	8.45

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	现货	17200	-20.75	2088	17867	-667	-3.73%	/	8.24	8.14	8.56
	到岸升水	2017年07月	17295	-10.00	2099	17955	-660	-3.68%	-0.55%	8.24	8.15	8.55
	汇率	2017年08月	17185	-4.00	2105	18004	-819	-4.55%	0.64%	8.16	8.03	8.55
	增值税	2017年09月	17055	0.50	2110	18041	-986	-5.46%	0.76%	8.08	7.91	8.55
	进口关税	2017年10月	16925	3.50	2113	18066	-1141	-6.31%	0.76%	8.01	7.86	8.55
	杂费	2017年11月	16845	7.00	2116	18094	-1249	-6.90%	0.47%	7.96	7.84	8.55

品种	参数	合约月份	沪锡价格	LME升贴水	伦锡价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	伦锡安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
锡进口套利	伦锡3月价	现货	74000	-60.00	8860	72666	1334	1.84%	/	8.35	8.27	8.20
	到岸升水	2017年07月	71300	-37.00	8863	72860	-1550	-2.13%	-0.26%	8.03	8.03	8.20
	汇率	2017年08月	72850	-20.00	8900	72867	-337	-0.46%	-0.19%	8.16	8.16	8.20
	增值税	2017年09月	73020	2.00	8922	73164	-144	-0.20%	-0.25%	8.18	8.18	8.20
	进口关税	2017年10月	73600	19.00	8939	73300	300	0.41%	-0.19%	8.23	8.20	8.20
	杂费	2017年11月	73870	36.00	8956	73437	433	0.59%	-0.19%	8.25	8.09	8.20

品种	参数	合约月份	沪铅价格	LME升贴水	伦铅价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	伦铅安全边际	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	123.00	19568	165408	-22908	-13.85%	/	7.28	7.28	8.45
	到岸升水	2017年07月	141300	70.00	19515	164974	-23674	-14.35%	0.27%	7.24	7.24	8.45
	汇率	2017年08月	141540	35.00	19480	164687	-23147	-14.06%	0.18%	7.27	7.27	8.45
	增值税	2017年09月	145230	-5.00	19440	164359	-19129	-11.64%	0.21%	7.47	7.47	8.45
	进口关税	2017年10月	145600	-45.00	19400	164032	-18432	-11.24%	0.21%	7.51	7.46	8.46
	杂费	2017年11月	141240	-80.00	19365	163745	-22505	-13.74%	0.18%	7.29	7.29	8.46

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	2017年07月	45440	256.60	45620	-180	-0.39%	/	177.08	177.34	177.79
	汇率	2017年08月	45490	255.70	45462	28	0.06%	0.35%	177.90	177.16	177.79
	增值税	2017年09月	45570	256.60	45620	-50	-0.11%	-0.35%	177.59	176.62	177.79
	进口关税	2017年10月	45660	257.20	45725	-65	-0.14%	-0.23%	177.53	176.86	177.78
	杂费	2017年11月	45830	259.20	46075	-245	-0.53%	-0.78%	176.81	176.91	177.76

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
2017/6/16	279.35	1253.5	274.0263549	679.95	5.323645071	(-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)
2017/6/16	4038	16.74	3659.514305	679.95	378.4856948

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	6574	2017年07月	13.50	4078.947631	2495.05
2018年01月	6663	2017年10月	13.69	4121.747866	2541.25

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		大连豆粕价格		大豆油价格		参数
	2017年07月	9.3725	2017年09月	2687	2017年09月	5884	
进口大豆压榨利润	2017年11月	9.455	2018年01月	2722	2018年01月	6050	汇率 6.7995
	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%
9.3725	4.00	41.87	726.21	(144.31)	进口菜豆出油率	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)	关税	3%
9.4550	78.00	46.26	763.78	(24.05)	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	2017年09月	15135	2017年07月	72.47	12598	2537	20.13%	209	173.84
汇率	2018年01月	15155	2017年12月	69.76	12135	3020	24.89%	217	173.95
增值税									
进口关税									
杂费									

日期	ICE主力期棉15:00价	ZCE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2017/6/16	72.47	15155	16.99790369



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	268,450	-50	106,100
铝	1,492,825	-3,300	401,225
镍	376,850	-36	115,620
锌	314,050	-2,125	144,600
铅	175,575	-725	64,700
锡	1,890	-25	405

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。