

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	5662.50	现货	45410	-26.73	5636	45584	-174	-0.38%	/	8.06	8.03	8.09
	到岸升水	65	2017年07月	45460	-18.23	5644	45652	-192	-0.42%	-0.11%	8.05	8.04	8.09
	汇率	6.8193	2017年08月	45520	-10.48	5652	45714	-194	-0.42%	-0.13%	8.05	8.04	8.09
	增值税	17%	2017年09月	45610	-9.23	5662	45795	-185	-0.41%	-0.20%	8.06	8.04	8.09
	进口关税	0%	2017年10月	45750	6.27	5669	45847	-97	-0.21%	-0.31%	8.07	8.06	8.09
	杂费	100	2017年11月	45900	13.27	5676	45903	-3	-0.01%	-0.33%	8.09	8.07	8.09

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	1880.50	现货	13780	-10.10	1870	15901	-2121	-13.34%	/	7.37	7.25	8.50
	到岸升水	110	2017年07月	13835	-8.85	1872	15911	-2076	-13.05%	-0.40%	7.39	7.36	8.50
	汇率	6.8193	2017年08月	13905	-5.10	1875	15941	-2036	-12.77%	-0.51%	7.41	7.38	8.50
	增值税	17%	2017年09月	13975	-0.10	1880	15981	-2006	-12.55%	-0.50%	7.43	7.41	8.50
	进口关税	0%	2017年10月	14035	2.65	1883	16003	-1968	-12.30%	-0.43%	7.45	7.43	8.50
	杂费	100	2017年11月	14100	5.40	1886	16024	-1924	-12.01%	-0.46%	7.48	7.45	8.50

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	2566.50	现货	22620	-9.98	2557	21659	961	4.44%	/	8.85	8.83	8.47
	到岸升水	125	2017年07月	21985	-4.54	2562	21703	282	1.30%	2.81%	8.58	8.65	8.47
	汇率	6.8193	2017年08月	21450	-1.98	2565	21723	-273	-1.26%	2.43%	8.36	8.38	8.47
	增值税	17%	2017年09月	21195	0.02	2567	21739	-544	-2.50%	1.19%	8.26	8.28	8.47
	进口关税	1%	2017年10月	21050	-0.48	2566	21735	-685	-3.15%	0.68%	8.20	8.22	8.47
	杂费	50	2017年11月	20980	-0.98	2566	21731	-751	-3.48%	0.33%	8.18	8.19	8.47

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	2131.50	现货	17720	-22.59	2109	18088	-368	-2.04%	/	8.40	8.27	8.58
	到岸升水	80	2017年07月	17600	-10.07	2121	18191	-591	-3.25%	0.68%	8.30	8.30	8.57
	汇率	6.8193	2017年08月	17385	-3.34	2128	18247	-862	-4.72%	1.22%	8.17	8.22	8.57
	增值税	17%	2017年09月	17235	-0.09	2131	18273	-1038	-5.68%	0.86%	8.09	8.18	8.57
	进口关税	3%	2017年10月	17100	2.41	2134	18294	-1194	-6.53%	0.78%	8.01	8.12	8.57
	杂费	100	2017年11月	17065	5.66	2137	18320	-1255	-6.85%	0.20%	7.98	8.06	8.57

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	8940	现货	73600	-52.07	8888	73102	488	0.68%	/	8.28	8.31	8.22
	到岸升水	165	2017年07月	71300	-40.51	8890	73195	-1895	-2.59%	-0.13%	8.01	7.92	8.22
	汇率	6.8193	2017年08月	71500	-22.57	8917	73340	160	0.22%	-0.20%	8.24	8.19	8.22
	增值税	17%	2017年09月	73620	-0.57	8939	73517	103	0.14%	-0.25%	8.24	8.26	8.22
	进口关税	1%	2017年10月	74120	15.43	8955	73646	474	0.64%	-0.18%	8.28	8.25	8.22
	杂费	150	2017年11月	73960	33.43	8973	73791	169	0.23%	-0.20%	8.24	8.30	8.22

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	19615	现货	141500	121.69	19737	167276	-25776	-15.41%	/	7.17	7.24	8.48
	到岸升水	600	2017年07月	144440	79.19	19694	166926	-22486	-13.47%	0.22%	7.33	7.36	8.48
	汇率	6.8193	2017年08月	141540	41.69	19657	166618	-25078	-15.05%	0.19%	7.20	7.22	8.48
	增值税	17%	2017年09月	145230	1.69	19617	166290	-21060	-12.66%	0.20%	7.40	7.43	8.48
	进口关税	3%	2017年10月	142950	-43.31	19572	165920	-22970	-13.84%	0.23%	7.30	7.34	8.48
	杂费	150	2017年11月	145730	-78.31	19537	165632	-19902	-12.02%	0.18%	7.46	7.49	8.48

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	45460	256.05	45666	-196	-0.43%	/	177.54	177.78	178.31
	汇率	6.8193	2017年08月	45520	255.30	45524	-4	-0.01%	0.29%	178.30	177.54	178.32
	增值税	0.17	2017年09月	45610	256.55	45744	-134	-0.29%	-0.49%	177.78	177.58	178.30
	进口关税	0%	2017年10月	45750	257.10	45840	-90	-0.20%	-0.21%	177.95	177.26	178.30
	杂费	150	2017年11月	45900	258.05	46007	-107	-0.23%	-0.37%	177.87	176.54	178.29

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
2017/6/21	278.15	1245	272.9607266	681.93	5.189273419	(-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)
2017/6/21	4008	16.445	3605.493292	681.93	402.5067079

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	6545	2017年09月	13.61	4114.115883	2430.88
2018年01月	6615	2017年10月	13.83	4163.818358	2451.18

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	
	日期	价格	日期	价格	日期	价格		
进口大豆压榨利润	2017年07月	9.2975	2017年09月	2696	2017年09月	5814	1罐=60磅=27.2154kg	
	2017年11月	9.405	2018年01月	2724	2018年01月	5960	汇率	6.8193
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)	732.30	净利率 (元/吨)	130
	9.2975		进口南美大豆 国内压榨 (17年7月到港)				(137.33)	加工费 (元/吨)
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)	754.35	净利率 (元/吨)	120
	9.4050		进口美湾大豆 国内压榨 (17年11月到港)				(33.21)	港杂费 (元/吨)

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	15215	2017年07月	71.47	12483	2752	22.08%	213	212	174.38
汇率	6.8193	2018年01月	15135	2017年12月	68.99	12037	3098	25.73%	219	220	174.48
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
2017/6/21	71.47	15135	17.62030427



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	259,300	-2,775	114,475
铝	1,440,875	21,550	382,250
镍	377,094	-378	117,240
锌	304,975	-1,600	160,450
铅	173,525	-525	66,000
锡	1,730	10	250

声明：
1. 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。
2. 本文件仅供客户参考，并不构成任何对客户之建议。
3. 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。