

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	伦铜3月价	现货	37200	-16.65	4734.15	37974	-674	-1.78%	/	7.86	7.91	8.00
	到岸升水	2016年10月	37200	-9.40	4741.4	37931	-731	-1.93%	0.00%	7.85	7.87	8.00
	汇率	2016年11月	37230	-3.90	4746.9	37973	-743	-1.98%	-0.06%	7.84	7.87	8.00
	增值税	2016年12月	37250	0.10	4750.9	38005	-755	-1.99%	-0.05%	7.84	7.86	8.00
	进口关税	2017年01月	37250	1.10	4751.9	38013	-763	-2.01%	0.00%	7.84	7.87	8.00
	杂费	2017年02月	37280	4.10	4754.90	38036	-756	-1.99%	-0.06%	7.84	7.86	8.00

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	伦铝3月价	现货	12400	-12.05	1561	15114	-2714	-17.96%	/	7.94	8.12	9.68
	到岸升水	2016年10月	12200	-8.55	1565	15141	-2941	-19.43%	1.61%	7.80	7.83	9.68
	汇率	2016年11月	11915	-4.55	1569	15173	-3258	-21.47%	2.34%	7.59	7.61	9.67
	增值税	2016年12月	11745	-0.30	1573	15206	-3461	-22.76%	1.43%	7.47	7.49	9.67
	进口关税	2017年01月	11630	2.45	1576	15227	-3597	-23.62%	0.98%	7.38	7.43	9.66
	杂费	2017年02月	11600	6.45	1580	15259	-3659	-23.98%	0.26%	7.34	7.39	9.66

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	沪铝安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
锌	伦锌3月价	现货	17640	-14.80	2202	18412	-772	-4.19%	/	8.01	7.98	8.36
	到岸升水	2016年10月	17535	-8.05	2208	18465	-930	-5.04%	0.60%	7.94	7.88	8.36
	汇率	2016年11月	17525	-3.80	2213	18499	-974	-5.26%	0.06%	7.92	7.86	8.36
	增值税	2016年12月	17480	0.20	2217	18530	-1050	-5.67%	0.26%	7.89	7.83	8.36
	进口关税	2017年01月	17470	2.20	2219	18546	-1076	-5.80%	0.06%	7.87	7.83	8.36
	杂费	2017年02月	17445	3.70	2220	18558	-1113	-6.00%	0.14%	7.86	7.81	8.36

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	伦镍3月价	现货	14190	-0.80	1933	16385	-2195	-13.40%	/	7.34	7.48	8.47
	到岸升水	2016年10月	14220	-4.80	1929	16353	-2133	-13.04%	-0.21%	7.37	7.45	8.48
	汇率	2016年11月	14250	-2.05	1932	16375	-2125	-12.98%	-0.21%	7.38	7.44	8.48
	增值税	2016年12月	14260	0.20	1934	16393	-2133	-13.01%	-0.07%	7.37	7.44	8.47
	进口关税	2017年01月	14265	2.20	1936	16409	-2144	-13.07%	-0.04%	7.37	7.44	8.47
	杂费	2017年02月	14535	3.20	1937	16417	-1882	-11.47%	-1.89%	7.50	7.66	8.47

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	
锡	伦锡3月价	现货	77700	-52.05	9874	78944	-1244	-1.58%	/	7.87	7.83	8.00
	到岸升水	2016年10月	78000	-34.80	9891	79209	-1080	-1.37%	-0.17%	7.89	7.89	8.00
	汇率	2016年11月	78160	-18.55	9907	79209	-1049	-1.32%	-0.16%	7.89	7.83	7.99
	增值税	2016年12月	78550	0.70	9927	79361	-811	-1.02%	-0.19%	7.91	7.87	7.99
	进口关税	2017年01月	78960	15.70	9942	79479	-619	-0.65%	-0.15%	7.94	7.87	7.99
	杂费	2017年02月	79340	30.70	9957	79597	-257	-0.32%	-0.15%	7.97	7.97	7.99

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	
钨	伦钨3月价	现货	124750	-8.00	19241	159838	-35088	-21.95%	/	6.48	6.48	8.31
	到岸升水	2016年10月	125420	1.00	19250	159910	-34490	-21.57%	-0.05%	6.52	6.42	8.31
	汇率	2016年11月	122720	1.00	19250	159910	-37190	-23.26%	0.00%	6.38	6.41	8.31
	增值税	2016年12月	119780	0.00	19249	159902	-40122	-25.09%	0.01%	6.22	6.22	8.31
	进口关税	2017年01月	123780	-20.00	19229	159741	-35961	-22.51%	0.10%	6.44	6.42	8.31
	杂费	2017年02月	127760	-40.00	19209	159580	-31820	-19.94%	0.10%	6.65	6.69	8.31

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	
钼	到岸升水	2016年10月	36950	214.30	37530	-580	-1.55%	/	172.42	175.45	175.13	
	汇率	2016年11月	37230	215.70	37771	-541	-1.43%	-0.65%	172.60	172.89	175.11	
	增值税	2016年12月	37250	215.05	37659	-409	-1.09%	0.30%	173.22	173.93	175.12	
	进口关税	2017年01月	37250	215.00	37651	-401	-1.06%	0.02%	173.26	174.67	175.12	
	杂费	2017年02月	37280	216.60	37926	-646	-1.70%	-0.74%	172.11	174.41	175.10	

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
2016/9/19	284.55	1319.4	283.304146	667.86	1.245853969	(-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)
2016/9/19	4284	19.17	4116.219857	667.86	167.7801429

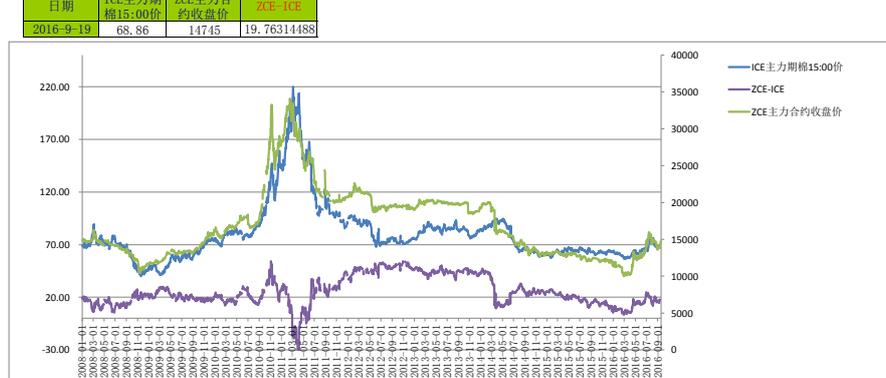
日期	郑州砂磷主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂磷成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年01月	6437	2016年10月	21.64	5816.999707	620.00
2017年05月	6478	2017年03月	22.43	5991.794328	486.21

注：郑州CICE与纽约原糖交易时间不一致，仅供参考。

品种	大豆价格		大豆粕价格		大豆油价格		参数
	2016年11月	2017年01月	2016年10月	2017年01月	2017年01月	2017年05月	
进口大豆压榨利润	977	2980	2763	6206	汇率	6.6786	175.13
	982.5	2763	2763	6270	净利率	18.50%	175.11
南美豆 (16年9月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	国际运费 (美元)	毛利 (元/吨)	净利率 (元/吨)	加工费 (元/吨)	关税	13%
	4.00	41.87	(236396.27)	(276172.10)	130	3%	
美湾豆 (17年1月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	国际运费 (美元)	毛利 (元/吨)	净利率 (元/吨)	港杂费 (元/吨)		120
	78.00	46.26	(237904.46)	(277817.93)			

参数 (不含增值税)	合约月份	合约价格	美棉月份	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01月	14745	2016年12月	68.86	11771	2974	25.28%	214	211	170.95
汇率	2017年05月	14870	2017年03月	68.41	11696	3174	27.14%	217	213	170.97
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
2016-9-19	68.86	14745	19.76314488



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	349,625	625	57,975
铝	2,161,475	-5,460	865,675
镍	366,858	-108	116,652
锡	188,150	300	66,400
锌	444,400	-50	23,550
钨	3,825	-10	840

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。