

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	4775.60	现货	37360	-23.25	4752.35	37989	-629	-1.66%	/	7.86	7.86	7.99
	到岸升水	100	2016年10月	37320	-12.75	4762.85	38071	-751	-1.97%	0.11%	7.84	7.83	7.99
	汇率	6.6738	2016年11月	37300	-5.50	4770.1	38127	-827	-2.17%	0.05%	7.82	7.83	7.99
	增值税	17%	2016年12月	37340	0.00	4775.6	38170	-830	-2.18%	-0.11%	7.82	7.82	7.99
	进口关税	0%	2017年01月	37360	3.50	4779.1	38198	-838	-2.19%	-0.05%	7.82	7.82	7.99
	杂费	100	2017年02月	37390	7.50	4783.10	38229	-839	-2.19%	-0.06%	7.82	7.82	7.99

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	1580.30	现货	12700	-12.75	1568	15151	-2451	-16.18%	/	8.10	7.93	9.67
	到岸升水	360	2016年10月	12360	-8.75	1572	15182	-2822	-18.59%	2.68%	7.86	7.79	9.66
	汇率	6.6738	2016年11月	12145	-4.75	1576	15213	-3068	-20.17%	1.74%	7.71	7.63	9.66
	增值税	17%	2016年12月	11965	0.00	1580	15251	-3286	-21.54%	1.48%	7.57	7.50	9.65
	进口关税	0%	2017年01月	11860	2.75	1583	15272	-3412	-22.34%	0.88%	7.49	7.44	9.65
	杂费	100	2017年02月	11815	6.75	1587	15303	-3488	-22.79%	0.38%	7.44	7.40	9.64

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	2291.50	现货	18020	-12.00	2280	19013	-993	-5.22%	/	7.91	7.98	8.34
	到岸升水	125	2016年10月	17955	-7.25	2284	19050	-1095	-5.75%	0.36%	7.86	7.94	8.34
	汇率	6.6738	2016年11月	17935	-3.75	2288	19078	-1143	-5.99%	0.11%	7.84	7.92	8.34
	增值税	17%	2016年12月	17905	0.00	2292	19108	-1203	-6.29%	0.17%	7.81	7.89	8.34
	进口关税	1%	2017年01月	17890	2.00	2294	19123	-1233	-6.45%	0.08%	7.80	7.88	8.34
	杂费	50	2017年02月	17885	3.50	2295	19135	-1250	-6.53%	0.03%	7.79	7.86	8.34

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	1977.40	现货	14500	-7.25	1970	16669	-2169	-13.01%	/	7.36	7.32	8.46
	到岸升水	90	2016年10月	14550	-5.75	1972	16681	-2131	-12.78%	-0.34%	7.38	7.37	8.46
	汇率	6.6738	2016年11月	14620	-2.75	1975	16705	-2085	-12.48%	-0.48%	7.40	7.39	8.46
	增值税	17%	2016年12月	14610	0.00	1977	16727	-2117	-12.66%	0.07%	7.39	7.38	8.46
	进口关税	3%	2017年01月	14675	2.00	1979	16743	-2068	-12.35%	-0.44%	7.41	7.39	8.46
	杂费	100	2017年02月	14740	3.25	1981	16753	-2013	-12.02%	-0.44%	7.44	7.37	8.46

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	10253	现货	79200	-49.00	10204	81491	-2291	-2.81%	/	7.76	7.76	7.99
	到岸升水	110	2016年10月	79240	-33.50	10220	81613	-2373	-2.91%	-0.15%	7.75	7.80	7.99
	汇率	6.6738	2016年11月	79540	-18.00	10235	81735	-2195	-2.89%	-0.15%	7.77	7.72	7.99
	增值税	17%	2016年12月	78950	0.00	10253	81877	-2927	-3.57%	-0.18%	7.70	7.73	7.99
	进口关税	1%	2017年01月	80510	15.50	10269	81999	-1489	-1.82%	-0.15%	7.84	7.88	7.99
	杂费	150	2017年02月	80580	31.00	10284	82122	-1542	-1.88%	-0.15%	7.84	7.81	7.99

品种	参数	合约月份	沪钨价格	LME升贴水	伦敦价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪钨安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
钨进口套利	伦钨3月价	19449	现货	125250	5.50	19455	161440	-36190	-22.42%	/	6.44	6.46	8.30
	到岸升水	600	2016年10月	122010	7.50	19457	161456	-39446	-24.43%	-0.01%	6.27	6.29	8.30
	汇率	6.6738	2016年11月	122720	2.50	19452	161416	-38966	-23.97%	0.03%	6.31	6.32	8.30
	增值税	17%	2016年12月	118520	0.00	19449	161396	-44876	-27.80%	0.01%	5.99	6.01	8.30
	进口关税	3%	2017年01月	124380	-13.00	19436	161291	-36911	-22.88%	0.07%	6.40	6.42	8.30
	杂费	150	2017年02月	127760	-29.00	19420	161163	-33403	-20.73%	0.08%	6.58	6.60	8.30

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	2016年10月	36950	215.35	37684	-734	-1.95%	/	171.58	172.10	174.99
	汇率	6.6738	2016年11月	37300	216.15	37821	-521	-1.36%	-0.37%	172.57	172.55	174.98
	增值税	0.17	2016年12月	37340	215.75	37753	-413	-1.09%	0.19%	173.07	172.97	174.98
	进口关税	0%	2017年01月	37360	216.95	37959	-599	-1.58%	-0.56%	172.21	172.97	174.97
	杂费	150	2017年02月	37390	217.20	38002	-612	-1.61%	-0.12%	172.15	172.63	174.96

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
2016/9/21	285.35	1322.1	283.6798641	667.38	1.670135882	(-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)
2016/9/21	4345	19.46	4175.486087	667.38	169.5139129

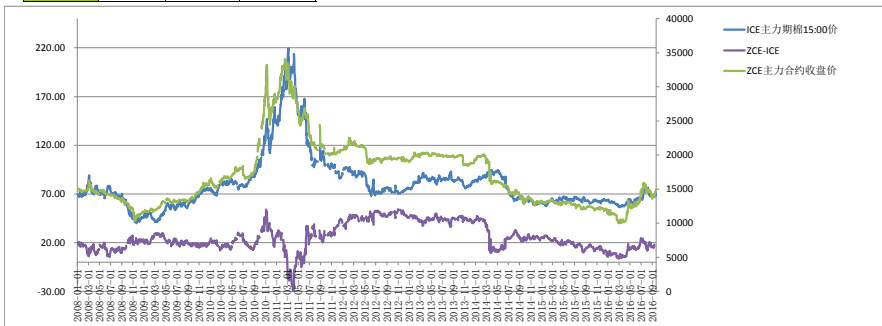
日期	郑州砂糖主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年01月	6412	2016年01月	22.25	5948.075171	463.92
2017年05月	6451	2017年03月	22.75	6058.625167	392.37

注: 郑州CICE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	
	2016年11月	985	2017年01月	2990	2017年01月	6354		
进口大豆压榨利润	2017年01月	989.75	2017年05月	2779	2017年05月	6412	汇率	6.6738
	南美白 (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 (元/吨)	加工费 (元/吨)	进口大豆出油率
	985.0000	4.00	41.87	(238150.49)	(278219.36)	130	进口大豆出油率	18.50%
	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 (元/吨)		美国	3%
	989.7500	78.00	46.26	(239470.20)	(279646.50)		港杂费 (元/吨)	120

参数 (不含增值税)	合约月份	美糖价格	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01月	14985	2016年12月	70.60	12055	2910	24.14%	212	170.75
汇率	6.6738	2017年05月	15040	2017年03月	70.45	12030	3010	25.02%	213	170.76
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
2016-9-21	70.60	14965	19.41012133



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	347,800	-150	51,225
铝	2,161,575	-6,600	862,150
镍	364,782	+1,002	114,942
锡	191,225	+2,200	66,375
锌	444,150	-250	23,350
铅	3,745	-5	815

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。