

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪期安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
铜	伦铜3月价	4707.50	现货	37410	-19.75	4688	37486	-76	-0.20%	/	7.98	8.00	8.00
	到岸升水	80	2016年11月	37410	-10.00	4688	37563	-153	-0.41%	0.00%	7.96	7.97	8.00
	汇率	6.7303	2016年12月	37400	-3.50	4704	37614	-214	-0.57%	0.03%	7.95	7.95	8.00
	增值税	17%	2017年01月	37410	0.00	4708	37641	-231	-0.61%	-0.03%	7.95	7.94	8.00
	进口关税	0%	2017年02月	37400	4.25	4712	37675	-275	-0.73%	0.03%	7.94	7.94	8.00
	杂费	100	2017年03月	37430	8.50	4716	37708	-278	-0.74%	-0.06%	7.94	7.94	8.00

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪期安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
铝	伦铝3月价	1677.00	现货	13220	-3.50	1674	14065	-845	-6.01%	/	7.90	7.97	8.40
	到岸升水	100	2016年11月	13010	-7.00	1670	14038	-1028	-7.32%	1.59%	7.79	7.82	8.41
	汇率	6.7303	2016年12月	12785	-3.00	1674	14069	-1284	-9.13%	1.73%	7.64	7.64	8.40
	增值税	17%	2017年01月	12600	0.00	1677	14093	-1493	-10.59%	1.45%	7.51	7.51	8.40
	进口关税	0%	2017年02月	12470	2.75	1680	14115	-1645	-11.65%	1.03%	7.42	7.41	8.40
	杂费	100	2017年03月	12405	5.75	1683	14138	-1733	-12.26%	0.52%	7.37	7.37	8.40

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪期安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
锌	伦锌3月价	2299.00	现货	18150	-12.85	2286	19147	-997	-5.21%	/	7.94	8.01	8.38
	到岸升水	115	2016年11月	18230	-9.10	2290	19177	-947	-4.94%	-0.44%	7.96	7.96	8.37
	汇率	6.7303	2016年12月	18210	-3.85	2295	19218	-1008	-5.25%	0.11%	7.93	7.96	8.37
	增值税	17%	2017年01月	18200	0.15	2299	19250	-1050	-5.46%	0.05%	7.92	7.93	8.37
	进口关税	1%	2017年02月	18185	2.90	2302	19272	-1077	-5.59%	0.03%	7.90	7.92	8.37
	杂费	50	2017年03月	18200	5.15	2304	19290	-1090	-5.68%	-0.03%	7.90	7.93	8.37

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪期安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
镍	伦镍3月价	2007.50	现货	15530	-14.70	1993	16912	-1382	-8.17%	/	7.79	7.82	8.49
	到岸升水	80	2016年11月	15610	-9.45	1998	16954	-1344	-7.93%	-0.52%	7.81	7.79	8.49
	汇率	6.7303	2016年12月	15545	-4.20	2003	16997	-1452	-8.54%	0.42%	7.76	7.73	8.48
	增值税	17%	2017年01月	15480	0.05	2008	17031	-1551	-9.11%	0.42%	7.71	7.69	8.48
	进口关税	3%	2017年02月	15475	3.05	2011	17056	-1581	-9.27%	0.03%	7.70	7.66	8.48
	杂费	100	2017年03月	15360	6.55	2014	17084	-1724	-10.09%	0.74%	7.63	7.60	8.48

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	伦期安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
钴	伦钴3月价	10375	现货	80800	-40.00	10335	83460	-2660	-3.19%	/	7.82	7.84	8.08
	到岸升水	140	2016年11月	81600	-31.00	10344	83531	-1931	-2.31%	-0.09%	7.89	7.85	8.08
	汇率	6.7303	2016年12月	80980	-14.50	10361	83683	-2683	-3.21%	-0.16%	7.82	7.82	8.08
	增值税	17%	2017年01月	81680	0.50	10376	83782	-2102	-2.51%	-0.14%	7.87	7.84	8.07
	进口关税	1%	2017年02月	81800	15.00	10390	83897	-2097	-2.50%	-0.14%	7.87	7.86	8.07
	杂费	150	2017年03月	82490	29.50	10405	84012	-1522	-1.81%	-0.14%	7.93	7.93	8.07

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	伦期安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
锡	伦锡3月价	19550	现货	128250	40.00	19590	163905	-36555	-21.75%	/	6.55	6.58	8.37
	到岸升水	600	2016年11月	124010	34.00	19584	163856	-39846	-24.32%	0.03%	6.33	6.36	8.37
	汇率	6.7303	2016年12月	127500	19.00	19569	163734	-36234	-22.13%	0.08%	6.52	6.55	8.37
	增值税	17%	2017年01月	128740	-1.00	19549	163572	-34832	-21.29%	0.10%	6.59	6.59	8.37
	进口关税	3%	2017年02月	128460	-16.00	19534	163451	-34991	-21.41%	0.08%	6.58	6.57	8.37
	杂费	150	2017年03月	128000	-31.00	19519	163329	-35329	-21.63%	0.08%	6.56	6.57	8.37

品种	参数	合约月份	沪期价格	美期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	美期安全边际	实际比值		进口比值	
									今日	昨日		
美糖	到岸升水	70	2016年11月	36950	210.90	37230	-280	-0.75%	/	175.20	175.37	176.53
	汇率	6.7303	2016年12月	37400	212.10	37438	-38	-0.10%	-0.57%	176.33	176.45	176.51
	增值税	0.17	2017年01月	37410	211.60	37352	58	0.16%	0.24%	176.80	176.28	176.52
	进口关税	0%	2017年02月	37400	212.40	37490	-90	-0.24%	-0.38%	176.08	176.18	176.51
	杂费	150	2017年03月	37430	213.25	37638	-208	-0.55%	-0.40%	175.52	175.74	176.50

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
2016/10/18	275.2	1263.1	273.3148165	673.03	1.885183459	(-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)
2016/10/18	4033	17.69	3827.835567	673.03	205.164433

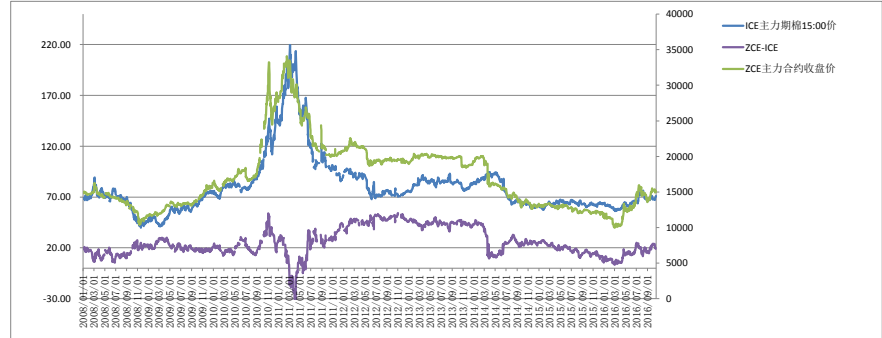
日期	郑州白糖主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB/汇率	价差 (郑-美)
2017年01月	6796	2017年03月	23.14	6192.338461	603.66
2017年05月	6830	2017年05月	22.44	6036.258193	793.74

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		大豆压榨价格		大豆油价格		参数
	2016年11月	2017年01月	2017年01月	2017年05月	2017年01月	2017年05月	
进口大豆压榨利润	982.25	2856	2766		6624	6718	1罐=60磅=27.2154kg
	990.75	2766					汇率
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 (元/吨)			进口大豆出油率
	4.00	41.87	(239570.56)	(279866.17)			19.50%
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)			进口大豆出油率
	78.00	46.26	(211725.84)	(282281.33)			18.50%
							加工程 (元/吨)
							130
							关税
							3%
							增值税
							13%
							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	15080	2016年12月	70.97	12218	2862	23.42%	212	217	172.16
汇率	6.7303	2017年05月	14970	2017年03月	70.89	12205	2765	22.66%	211	213	172.16
增值税	13%										
进口关税	1%										
杂费	200										

日期	ICE主力期棉15:00价	ICE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2016/10/18	70.97	15080	18.97038286



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	348,000	2,200	100,400
铝	2,085,800	2,550	813,100
镍	361,284	-1,164	114,364
锌	455,750	100	34,650
铅	190,400	600	31,000
锡	3,030	-220	1,630

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。