

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	
铜进口套利	伦铜3月价	现货	37460	-21.41	4648	37174	286	-0.77%	/	8.06	8.06	8.00
	到岸升水	2016年11月	37210	-11.91	4658	37248	-38	-0.10%	0.67%	7.99	8.03	8.00
	汇率	2016年12月	37190	-4.91	4665	37304	-114	-3.30%	0.05%	7.97	8.02	8.00
	增值税	2017年01月	37220	-0.16	4669	37341	-121	-0.32%	-0.06%	7.97	8.01	8.00
	进口关税	2017年02月	37220	4.34	4674	37376	-156	-0.42%	0.00%	7.96	8.00	8.00
	杂费	2017年03月	37240	8.84	4678	37412	-172	-0.46%	-0.05%	7.96	8.00	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	
铝进口套利	伦铝3月价	现货	13220	-10.36	1623	13669	-449	-3.26%	/	8.14	8.14	8.42
	到岸升水	2016年11月	12865	-8.36	1625	13685	-820	-5.99%	2.69%	7.92	8.01	8.42
	汇率	2016年12月	12590	-3.86	1630	13720	-1130	-8.24%	2.14%	7.73	7.85	8.42
	增值税	2017年01月	12370	-0.11	1633	13749	-1379	-10.03%	1.75%	7.57	7.71	8.42
	进口关税	2017年02月	12225	2.89	1636	13773	-1548	-11.24%	1.17%	7.47	7.62	8.42
	杂费	2017年03月	12170	6.14	1640	13799	-1629	-11.80%	0.45%	7.42	7.57	8.42

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	
锌进口套利	伦锌3月价	现货	18260	-14.09	2270	19018	-758	-3.98%	/	8.04	8.04	8.38
	到岸升水	2016年11月	18175	-9.34	2275	19055	-880	-4.62%	0.47%	7.99	8.01	8.38
	汇率	2016年12月	18160	-4.09	2280	19097	-937	-4.91%	0.08%	7.97	7.99	8.38
	增值税	2017年01月	18135	-0.09	2284	19129	-994	-5.20%	0.14%	7.94	7.97	8.38
	进口关税	2017年02月	18115	2.41	2285	19149	-1034	-5.40%	0.11%	7.92	7.96	8.38
	杂费	2017年03月	18125	4.66	2289	19167	-1042	-5.44%	-0.06%	7.92	7.95	8.37

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	
镍进口套利	伦镍3月价	现货	15530	-13.63	1959	16641	-1111	-6.67%	/	7.93	7.93	8.49
	到岸升水	2016年11月	15445	-8.63	1964	16681	-1236	-7.41%	0.55%	7.86	7.95	8.49
	汇率	2016年12月	15360	-3.63	1969	16722	-1362	-8.14%	0.55%	7.80	7.89	8.49
	增值税	2017年01月	15275	-0.13	1973	16750	-1475	-8.81%	0.55%	7.74	7.85	8.49
	进口关税	2017年02月	15280	3.37	1976	16779	-1499	-8.93%	-0.03%	7.73	7.83	8.49
	杂费	2017年03月	15220	6.87	1980	16807	-1587	-9.44%	0.39%	7.69	7.76	8.49

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	伦铝安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
伦铝升贴水	伦铝3月价	现货	81200	-43.75	10241	82714	-1514	-1.83%	/	7.93	7.93	8.08
	到岸升水	2016年11月	79960	-34.75	10260	82786	-2926	-3.41%	-0.08%	7.80	7.96	8.08
	汇率	2016年12月	81050	-17.00	10268	82827	-1877	-2.28%	-0.17%	7.89	7.89	8.08
	增值税	2017年01月	80700	-0.50	10285	83058	-2358	-2.84%	-0.16%	7.85	7.94	8.08
	进口关税	2017年02月	81170	13.50	10299	83169	-1999	-2.40%	-0.14%	7.88	7.94	8.08
	杂费	2017年03月	82660	27.50	10313	83281	-621	-0.75%	-0.14%	8.02	8.00	8.08

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	伦铝安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
伦铝升贴水	伦铝3月价	现货	128750	53.54	19759	165272	-38522	-22.10%	/	6.52	6.52	8.36
	到岸升水	2016年11月	124010	38.54	19744	165150	-41140	-24.91%	0.08%	6.28	6.28	8.36
	汇率	2016年12月	127500	18.54	19724	164988	-37488	-22.72%	0.10%	6.46	6.46	8.37
	增值税	2017年01月	128760	0.54	19706	164842	-36082	-21.89%	0.09%	6.53	6.53	8.37
	进口关税	2017年02月	128460	-14.46	19691	164720	-36260	-22.01%	0.08%	6.52	6.52	8.37
	杂费	2017年03月	128000	-29.46	19676	164599	-36599	-22.24%	0.08%	6.51	6.51	8.37

品种	参数	合约月份	沪铝价格	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	2016年11月	36950	210.20	37109	-159	-0.43%	/	175.78	175.20	176.54
	汇率	2016年12月	37190	210.05	37083	107	0.29%	0.07%	177.05	176.33	176.54
	增值税	2017年01月	37220	211.10	37265	-45	-0.12%	-0.50%	176.31	176.80	176.53
	进口关税	2017年02月	37220	211.50	37334	-114	-0.31%	-0.19%	175.98	176.08	176.52
	杂费	2017年03月	37240	211.15	37274	-34	-0.09%	0.17%	176.37	175.52	176.53

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
2016/10/19	275.2	1262.7	273.2282629	673.03	1.971737118	(-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)
2016/10/19	4024	17.615	3811.606756	673.03	212.3932441

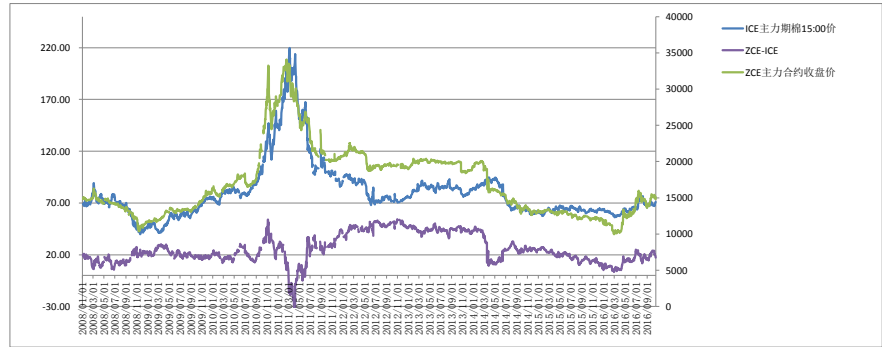
日期	郑州砂磷主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂磷成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年01月	6725	22.90	6138.825226	6.7303	586.17
2017年05月	6774	22.25	5993.893519		780.11

注: 郑州CZCE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

品种	大豆价格		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	976.75	985.5	41.87	46.26	(238220.14)	(278292.83)	1罐=60磅=27.2154kg
	976.7500	985.5000	41.87	46.26	(238220.14)	(278292.83)	汇率
							进口大豆出油率
							79.50%
							进口大豆出油率
							18.50%
							加工费 (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	铜价	美铜价格	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	14825	71.15	12249	2576	21.03%	208	212	172.15
汇率	2017年05月	14760	70.41	12123	2637	21.75%	210	211	172.18
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
2016/10/19	71.15	14825	17.26950769



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	350,625	2,625	102,000
铝	2,110,550	24,750	810,525
镍	361,278	0	115,960
锌	455,475	-275	34,375
铅	190,400	0	31,000
锡	2,955	-75	1,490

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所导致任何损失或损害负责。
- 本文件仅供参考, 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。