

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	现货	37580	-21.48	4625	37232	348	-0.94%	/	8.12	8.06	8.04
	到岸升水	2016年11月	37360	-12.23	4638	37305	55	0.15%	0.59%	8.06	8.00	8.04
	汇率	2016年12月	37350	-5.48	4645	37359	-9	-0.02%	0.03%	8.04	7.99	8.04
	增值税	2017年01月	37350	-0.23	4650	37400	-50	-0.13%	0.00%	8.03	7.99	8.04
	进口关税	2017年02月	37380	4.02	4654	37434	-54	-0.14%	-0.08%	8.03	7.99	8.04
	杂费	2017年03月	37370	8.77	4659	37471	-101	-0.27%	0.03%	8.02	7.99	8.04

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	13540	-5.96	1630	13797	-257	-1.87%	/	8.31	8.21	8.47
	到岸升水	2016年11月	13215	-5.71	1630	13799	-584	-4.24%	2.40%	8.11	7.96	8.47
	汇率	2016年12月	12930	-2.96	1633	13821	-891	-6.45%	2.16%	7.92	7.77	8.47
	增值税	2017年01月	12710	-0.21	1635	13843	-1133	-8.18%	1.70%	7.77	7.62	8.47
	进口关税	2017年02月	12520	2.54	1638	13865	-1345	-9.70%	1.49%	7.64	7.53	8.46
	杂费	2017年03月	12400	5.54	1641	13889	-1489	-10.72%	0.96%	7.56	7.47	8.46

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	现货	18260	-14.29	2261	19053	-793	-4.16%	/	8.08	8.00	8.43
	到岸升水	2016年11月	18210	-10.29	2265	19085	-875	-4.59%	0.27%	8.04	7.96	8.43
	汇率	2016年12月	18175	-4.29	2271	19133	-958	-5.01%	0.19%	8.00	7.93	8.43
	增值税	2017年01月	18145	-0.04	2275	19167	-1022	-5.33%	0.17%	7.98	7.91	8.43
	进口关税	2017年02月	18145	2.96	2278	19194	-1046	-5.45%	0.00%	7.97	7.99	8.42
	杂费	2017年03月	18150	5.71	2281	19213	-1063	-5.53%	-0.03%	7.96	7.89	8.42

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	现货	15740	-13.62	1984	16936	-1196	-7.06%	/	7.93	7.82	8.54
	到岸升水	2016年11月	15795	-8.62	1989	16977	-1182	-6.96%	-0.35%	7.94	7.77	8.54
	汇率	2016年12月	15755	-4.37	1993	17011	-1256	-7.38%	0.25%	7.90	7.73	8.53
	增值税	2017年01月	15675	-0.37	1997	17044	-1369	-8.03%	0.51%	7.85	7.66	8.53
	进口关税	2017年02月	15590	3.38	2001	17074	-1484	-8.69%	0.54%	7.79	7.71	8.53
	杂费	2017年03月	15555	6.63	2004	17101	-1546	-9.04%	0.22%	7.76	7.68	8.53

品种	参数	合约月份	沪锡价格	LME升贴水	伦锡价格	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	现货	79700	-44.08	10046	81626	-1826	-2.36%	/	7.93	7.85	8.13
	到岸升水	2016年11月	79660	-37.08	10053	81682	-2022	-2.48%	-0.07%	7.92	7.79	8.13
	汇率	2016年12月	80280	-19.08	10071	81826	-1546	-1.89%	-0.18%	7.97	7.83	8.13
	增值税	2017年01月	80410	-2.58	10087	81958	-1549	-1.89%	-0.16%	7.97	7.85	8.12
	进口关税	2017年02月	80780	11.42	10101	82070	-1290	-1.57%	-0.14%	8.00	7.88	8.12
	杂费	2017年03月	80500	25.42	10115	82182	-1682	-2.08%	-0.14%	7.96	7.88	8.12

品种	参数	合约月份	沪钨价格	LME升贴水	伦钨价格	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	现货	13150	171.00	20121	169178	-156028	-92.23%	/	0.65	6.44	8.41
	到岸升水	2016年11月	124010	111.00	20061	168688	-44678	-26.49%	0.30%	6.18	6.19	8.41
	汇率	2016年12月	132160	61.00	20011	168281	-36121	-21.46%	0.25%	6.60	6.37	8.41
	增值税	2017年01月	132350	11.00	19961	167873	-35523	-21.16%	0.25%	6.63	6.49	8.41
	进口关税	2017年02月	129450	-26.00	19924	167571	-38121	-22.75%	0.19%	6.50	6.47	8.41
	杂费	2017年03月	130660	-66.00	19884	167245	-36585	-21.87%	0.20%	6.57	6.46	8.41

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	2016年11月	36950	209.60	32717	-267	-0.72%	/	176.29	175.95	177.56
	汇率	2016年12月	37350	209.50	32700	150	0.40%	0.05%	178.28	177.29	177.56
	增值税	2017年01月	37350	210.40	32757	-7	-0.02%	-0.43%	177.52	176.64	177.55
	进口关税	2017年02月	37380	209.75	32743	137	0.37%	0.31%	178.21	176.86	177.56
	杂费	2017年03月	37370	210.60	32791	-21	-0.06%	-0.41%	177.45	176.71	177.55

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
2016/10/24	277.05	1266.8	275.6916332	676.9	1.358366781	(-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)
2016/10/24	4030	17.625	3835.700217	676.9	194.2997825

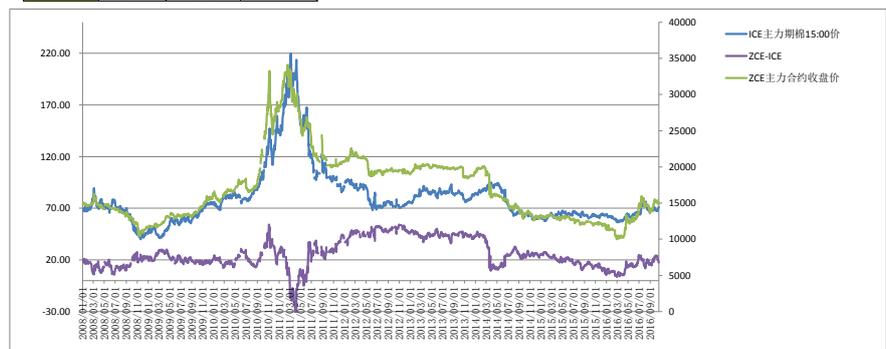
日期	郑州砂磷主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂磷成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年01月	6877	22.75	6137.404073	6.769	739.60
2017年05月	6915	22.13	5998.36664		916.63

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	2016年11月	2017年01月	2017年01月	2017年05月	
进口大豆压榨利润	991.75	1001.25	41.87	41.87	(213274.24)	(284188.13)	1罐=60磅=27.2154kg
	991.7500	4.00	国际运费 (美元)	毛利 (元/吨)	净利率 (元/吨)	汇率	79.50%
	南美白 (16年9月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	国内运费 (16年9月到港)	毛利 (元/吨)	净利率 (元/吨)	加工费 (元/吨)	18.50%
	991.7500	4.00	进口美国大豆 国内运费 (17年1月到港)	毛利 (元/吨)	净利率 (元/吨)	美国	13%
	南美白 (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)	美国	3%
	1001.2500	78.00	46.26	(215712.95)	(286928.67)	港杂费 (元/吨)	12%

参数 (不含增值税)	合约月份	郑糖价格	美糖价格	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	2017年01月	14780	68.07	11984	2816	23.54%	214	210	173.21	
汇率	2017年05月	14680	68.72	11904	2776	23.32%	214	210	173.23	
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
2016/10/24	69.07	14780	18.57713682



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	339,950	-6,825	102,425
铝	2,182,275	16,575	812,500
镍	363,288	+120	126,316
锌	454,100	-825	64,575
铅	188,925	-800	33,275
锡	2,960	0	1,350

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。