

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	现货	46770	-11.67	5802	47398	-628	-1.32%	/	8.06	8.20	8.17
	到岸升水	2016年12月	46820	-10.87	5803	47406	-486	-1.02%	-0.32%	8.09	8.05	8.17
	汇率	2017年01月	46820	-5.87	5808	47446	-626	-1.11%	0.00%	8.08	8.09	8.17
	增值税	2017年02月	47060	-1.87	5812	47478	-418	-0.88%	-0.30%	8.10	8.11	8.17
	进口关税	2017年03月	47130	1.63	5816	47507	-377	-0.79%	-0.15%	8.10	8.11	8.17
	杂费	2017年04月	47180	3.13	5817	47519	-339	-0.71%	-0.11%	8.11	8.12	8.17

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	现货	13940	-0.80	1737	14923	-983	-6.59%	/	8.02	8.17	8.59
	到岸升水	2016年12月	13935	1.20	1739	14940	-1005	-6.72%	0.04%	8.01	7.99	8.59
	汇率	2017年01月	13520	-3.05	1735	14905	-1385	-9.29%	2.98%	7.79	7.77	8.59
	增值税	2017年02月	13355	-1.05	1737	14921	-1566	-10.50%	1.22%	7.69	7.68	8.59
	进口关税	2017年03月	13355	0.70	1739	14936	-1581	-10.58%	0.00%	7.68	7.70	8.59
	杂费	2017年04月	13415	1.70	1740	14944	-1529	-10.23%	-0.45%	7.71	7.71	8.59

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	现货	22760	-14.27	2735	23271	-511	-2.20%	/	8.32	8.34	8.51
	到岸升水	2016年12月	22795	-11.27	2738	23295	-500	-2.15%	-0.15%	8.33	8.30	8.51
	汇率	2017年01月	22895	-8.27	2744	23344	-449	-1.92%	-0.44%	8.34	8.32	8.51
	增值税	2017年02月	22940	-0.02	2749	23387	-447	-1.91%	-0.20%	8.35	8.32	8.51
	进口关税	2017年03月	22930	3.73	2753	23416	-488	-2.08%	0.04%	8.33	8.31	8.51
	杂费	2017年04月	22905	5.73	2755	23434	-529	-2.28%	0.11%	8.32	8.27	8.51

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	现货	21080	-14.55	2374	20497	583	2.85%	/	8.88	9.15	8.63
	到岸升水	2016年12月	21400	-10.55	2378	20530	870	4.24%	-1.52%	9.00	9.16	8.63
	汇率	2017年01月	21140	-6.55	2382	20563	577	2.80%	1.21%	8.87	8.81	8.63
	增值税	2017年02月	20915	-2.55	2386	20597	318	1.55%	1.06%	8.76	8.70	8.63
	进口关税	2017年03月	20805	0.70	2390	20624	181	0.88%	0.53%	8.71	8.63	8.63
	杂费	2017年04月	20720	2.45	2391	20638	82	0.40%	0.41%	8.66	8.64	8.63

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	现货	91100	-54.85	11194	92511	-1411	-1.53%	/	8.14	8.34	8.26
	到岸升水	2016年12月	90000	-40.15	11209	92629	-2629	-2.84%	-0.13%	8.03	8.36	8.26
	汇率	2017年01月	91470	-24.65	11224	92755	-1285	-1.39%	-0.14%	8.15	8.20	8.26
	增值税	2017年02月	92350	-8.90	11240	92894	-534	-0.57%	-0.14%	8.22	8.24	8.26
	进口关税	2017年03月	92740	1.60	11255	93002	-262	-0.28%	-0.13%	8.24	8.20	8.26
	杂费	2017年04月	91460	22.85	11272	93143	-1683	-1.81%	-0.15%	8.11	8.47	8.26

品种	参数	合约月份	沪铅价格	LME升贴水	伦敦价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪铅安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
铅进口套利	伦铅3月价	现货	143500	270.91	21320	182307	-38807	-21.29%	/	6.73	7.02	8.55
	到岸升水	2016年12月	142060	185.91	21235	181601	-39541	-21.77%	0.40%	6.69	6.92	8.55
	汇率	2017年01月	145740	100.91	21150	180895	-35155	-19.43%	0.40%	6.89	6.85	8.55
	增值税	2017年02月	143860	35.91	21085	180354	-36494	-20.23%	0.31%	6.82	7.03	8.55
	进口关税	2017年03月	148070	-9.09	21040	179980	-31910	-17.73%	0.21%	7.04	7.27	8.55
	杂费	2017年04月	142980	-59.09	20990	179565	-36585	-20.37%	0.24%	6.81	7.28	8.55

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12月	46820	265.60	47864	-944	-1.97%	/	176.66	177.44	180.21
	汇率	2017年01月	46820	263.65	47517	-597	-1.26%	0.73%	177.96	177.87	180.23
	增值税	2017年02月	47060	262.70	47349	-289	-0.61%	0.36%	179.14	179.27	180.24
	进口关税	2017年03月	47130	264.40	47651	-521	-1.09%	-0.65%	178.25	178.16	180.22
	杂费	2017年04月	47180	263.70	47526	-346	-0.73%	0.26%	178.92	177.7	180.23

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
2016/12/1	266.3	1174.5	260.3926345	689.58	5.907365478	(-5, +5)

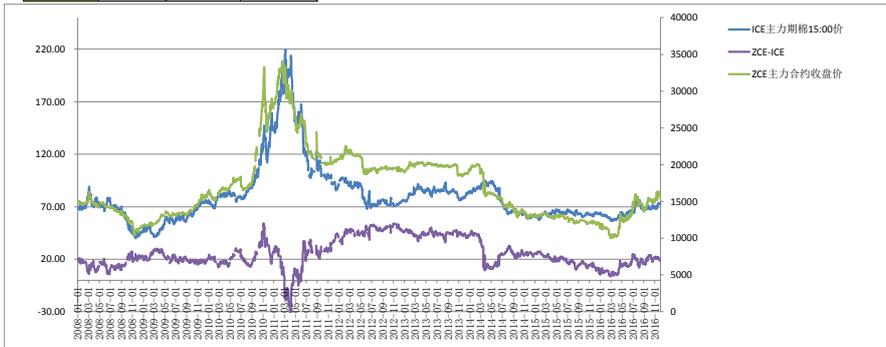
日期	沪银主力合约	纽约银主力合约	纽约银主力合约 (RMB)	人民币汇率	价差 (沪-美)
2016/12/1	4018	16.485	3654.808497	689.58	363.1915027

品种	参数	合约月份	沪铜价格	纽约铜主力合约	纽约铜主力合约 (RMB)	人民币汇率	价差 (沪-美)
白铜	郑州砂铜主力合约	2017年01月	7135	19.88	5586.667143	6.8958	1548.33
		2017年05月	7207	19.31	5456.447934		1750.55
	注: 郑州CICE与纽约原铜交易时间不一致, 仅供参考						

品种	参数	合约月份	大豆价格	大豆压榨价格		大豆油价格		参数
				国内压榨 (16年9月到港)	净利 (元/吨)	国内压榨 (17年1月到港)	净利 (元/吨)	
进口大豆压榨利润	2017年01月	1036.75	2017年01月	3093	2017年01月	6988	1罐=60磅=27.2154kg	
	2017年03月	1046.5	2017年03月	2936	2017年03月	7162	汇率	6.8958
	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	79.50%	
	1036.7500	4.00	41.87	(259099.48)	(302616.34)	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)	加工费 (元/吨)	130	
	1046.5000	78.00	46.26	(261660.98)	(305524.69)	关税	3%	
					增值税	13%		
					港杂费 (元/吨)	120		

品种	参数 (不含增值税)	合约月份	铜价	美铜月份	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		
铜	到岸升水	2017年01月	15880	2016年12月	72.46	12772	2908	22.77%	216	216	176.27	
	汇率	2017年05月	15895	2017年03月	71.58	12620	3275	25.98%	222	218	176.30	
	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
2016-12-1	72.46	15680	18.81444793



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	236,675	1,850	94,150
铝	2,144,850	-4,300	758,625
镍	367,008	174	126,606
锌	442,000	-400	78,575
铅	187,725	0	45,075
锡	3,185	80	1,305

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。