

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	45420	-20.90	5592	45999	-479	-1.04%	/	8.12	8.13	8.21
	到岸升水	2017年01月	45420	-15.40	5597	45943	-523	-1.14%	0.00%	8.11	8.09	8.21
	汇率	2017年02月	45960	-8.90	5604	45996	-406	-0.88%	-0.37%	8.14	8.10	8.21
	增值税	2017年03月	45730	-3.40	5609	46040	-310	-0.67%	-0.31%	8.15	8.12	8.21
	进口关税	2017年04月	45840	0.35	5613	46071	-231	-0.50%	-0.24%	8.17	8.14	8.21
	杂费	2017年05月	45960	3.60	5616	46097	-137	-0.30%	-0.26%	8.18	8.15	8.21

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	12630	7.92	1720	14852	-2222	-14.96%	/	7.34	7.92	8.63
	到岸升水	2017年01月	12550	1.92	1714	14803	-2253	-15.22%	0.63%	7.32	7.86	8.63
	汇率	2017年02月	12525	-3.58	1709	14759	-2234	-15.14%	0.20%	7.33	7.87	8.64
	增值税	2017年03月	12580	-1.33	1711	14777	-2197	-14.87%	-0.44%	7.35	7.86	8.64
	进口关税	2017年04月	12625	0.17	1713	14789	-2164	-14.63%	-0.36%	7.37	7.88	8.64
	杂费	2017年05月	12695	2.17	1715	14805	-2110	-14.25%	-0.55%	7.40	7.91	8.63

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	21730	-18.96	2620	22435	-705	-3.14%	/	8.29	8.42	8.56
	到岸升水	2017年01月	21600	-14.96	2624	22468	-668	-3.86%	0.60%	8.23	8.18	8.56
	汇率	2017年02月	21725	-9.46	2630	22513	-788	-3.50%	-0.58%	8.26	8.21	8.56
	增值税	2017年03月	21775	-2.96	2636	22566	-791	-3.51%	-0.23%	8.26	8.20	8.56
	进口关税	2017年04月	21740	1.04	2640	22589	-859	-3.80%	0.16%	8.23	8.18	8.56
	杂费	2017年05月	21730	4.04	2643	22624	-894	-3.98%	0.05%	8.22	8.16	8.56

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	17970	-16.23	2065	18002	-32	-0.18%	/	8.70	8.81	8.72
	到岸升水	2017年01月	18060	-12.48	2069	18033	27	0.15%	-0.50%	8.73	8.90	8.72
	汇率	2017年02月	18090	-8.48	2073	18067	23	0.13%	-0.17%	8.73	8.82	8.72
	增值税	2017年03月	18020	-3.73	2077	18106	-86	-0.48%	0.39%	8.67	8.75	8.72
	进口关税	2017年04月	18010	0.52	2082	18142	-132	-0.73%	0.06%	8.65	8.71	8.72
	杂费	2017年05月	18015	3.02	2084	18163	-148	-0.81%	-0.03%	8.64	8.69	8.72

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	伦锡安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
锡进口套利	伦锡3月价	现货	85350	-55.60	10304	85634	-284	-0.33%	/	8.28	8.39	8.31
	到岸升水	2017年01月	84660	-49.60	10310	85683	-1033	-1.21%	-0.06%	8.21	8.20	8.31
	汇率	2017年02月	85190	-31.85	10328	85829	-639	-0.74%	-0.17%	8.25	8.28	8.31
	增值税	2017年03月	85430	-13.85	10346	85976	-546	-0.63%	-0.17%	8.26	8.32	8.31
	进口关税	2017年04月	85810	4.15	10364	86123	-313	-0.36%	-0.17%	8.28	8.28	8.31
	杂费	2017年05月	86370	19.65	10380	86250	120	0.14%	-0.15%	8.32	8.31	8.31

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	伦镍安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
镍进口套利	伦镍3月价	现货	153000	69.41	21049	190853	-27553	-15.40%	/	7.27	7.22	8.59
	到岸升水	2017年01月	151830	66.91	21047	180832	-29002	-16.04%	0.01%	7.21	7.14	8.59
	汇率	2017年02月	152650	51.91	21032	180706	-28056	-15.53%	0.07%	7.26	7.21	8.59
	增值税	2017年03月	155710	31.91	21012	180540	-24830	-13.75%	0.10%	7.41	7.37	8.59
	进口关税	2017年04月	156410	-3.09	20977	180247	-23837	-13.22%	0.17%	7.46	7.25	8.59
	杂费	2017年05月	153260	-23.09	20957	180080	-26820	-14.89%	0.10%	7.31	7.25	8.59

品种	参数	合约月份	沪铜价格	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	2017年01月	45420	254.20	46040	-620	-1.35%	/	178.68	178.26	181.12
	汇率	2017年02月	45590	254.15	46031	-441	-0.96%	0.02%	179.38	177.80	181.12
	增值税	2017年03月	45730	254.80	46147	-417	-0.90%	-0.26%	179.47	179.00	181.11
	进口关税	2017年04月	45840	255.00	46182	-342	-0.74%	-0.08%	179.76	179.60	181.11
	杂费	2017年05月	45960	254.90	46165	-205	-0.44%	0.04%	180.31	179.33	181.11

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
2017/1/9	269.75	1174.1	261.4514974	692.62	8.298502611	(-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)
2017/1/9	4109	16.5	3674.260887	692.62	434.7391134

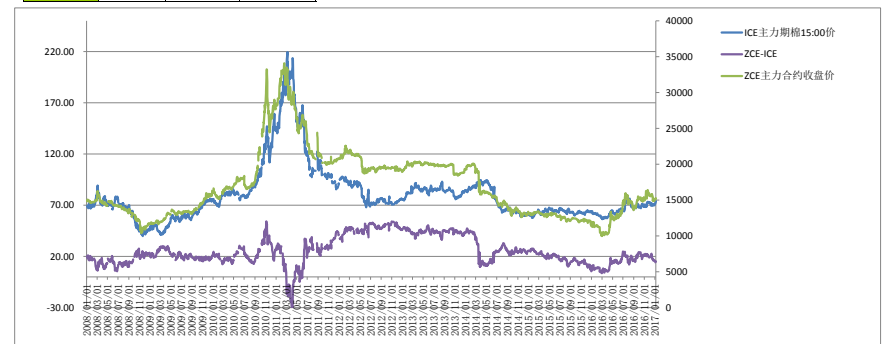
日期	郑州白糖主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年01月	7002	20.74	5806.270171	6.9262	1195.73
2017年05月	6836	20.40	5728.253128		1107.75

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
	2017年01月	986	2017年01月	3000	2017年01月	6866	
进口大豆压榨利润	2017年03月	995.75	2017年03月	2775	2017年05月	6824	汇率
							6.9262
南美豆 (16年9月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	4.00	国际运费 (美元)	41.87	毛利 (元/吨)	(217437.47)	净利率 (元/吨)
	986.0000					(289058.90)	加工费 (元/吨)
美湾豆 (17年1月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	78.00	国际运费 (美元)	46.26	毛利 (元/吨)	(250103.20)	净利率 (元/吨)
	995.7500					(292012.64)	港杂费 (元/吨)
							13%
							3%

品种	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	
铜进口套利	到岸升水	2017年01月	15100	73.74	13051	2049	15.70%	205	204	176.98
	汇率	2017年05月	15370	74.03	13101	2269	17.32%	208	206	176.97
	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
2017/1/9	73.74	15370	15.33721965



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	294,900	-225	92,050
铝	2,215,925	-1,100	859,925
镍	372,012	1,092	128,062
锌	427,225	-375	114,875
铅	193,300	-400	42,525
锡	3,885	5	650

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。