

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	45620	-21.00	5625	46147	-527	-1.14%	/	8.11	8.12	8.20
	到岸升水	2017年01月	45910	-16.25	5629	46185	-275	-0.60%	-0.64%	8.16	8.20	8.20
	汇率	2017年02月	45980	-9.75	5636	46238	-258	-0.58%	-0.15%	8.16	8.21	8.20
	增值税	2017年03月	46110	-3.75	5642	46286	-176	-0.38%	-0.28%	8.17	8.22	8.20
	进口关税	2017年04月	46240	0.25	5646	46319	-79	-0.17%	-0.28%	8.19	8.24	8.20
	杂费	2017年05月	46330	3.75	5649	46347	-17	-0.04%	-0.19%	8.20	8.25	8.20

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	12530	9.25	1736	14974	-2444	-16.32%	/	7.22	7.34	8.62
	到岸升水	2017年01月	12760	2.75	1730	14922	-2162	-14.49%	-1.84%	7.38	7.44	8.63
	汇率	2017年02月	12815	-3.00	1724	14875	-2060	-13.85%	-0.43%	7.43	7.50	8.63
	增值税	2017年03月	12870	-1.00	1726	14891	-2021	-13.57%	-0.43%	7.46	7.52	8.63
	进口关税	2017年04月	12910	0.50	1728	14903	-1993	-13.38%	-0.31%	7.47	7.54	8.63
	杂费	2017年05月	12980	2.25	1729	14918	-1938	-12.99%	-0.54%	7.51	7.57	8.63

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	22210	-20.25	2713	23189	-979	-4.22%	/	8.19	8.29	8.55
	到岸升水	2017年01月	22510	-15.75	2718	23226	-716	-3.08%	-1.35%	8.28	8.58	8.55
	汇率	2017年02月	22515	-9.75	2724	23275	-760	-3.26%	-0.02%	8.27	8.56	8.55
	增值税	2017年03月	22555	-3.00	2731	23330	-775	-3.32%	-0.18%	8.26	8.56	8.54
	进口关税	2017年04月	22550	1.00	2735	23353	-813	-3.48%	0.02%	8.25	8.54	8.54
	杂费	2017年05月	22490	4.25	2738	23389	-899	-3.88%	0.27%	8.21	8.51	8.54

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	18300	-16.00	2130	18539	-239	-1.29%	/	8.59	8.70	8.70
	到岸升水	2017年01月	18650	-12.75	2133	18566	84	0.45%	-1.91%	8.74	9.02	8.70
	汇率	2017年02月	18755	-8.75	2137	18599	156	0.84%	-0.56%	8.78	9.05	8.70
	增值税	2017年03月	18750	-3.75	2142	18641	109	0.58%	0.03%	8.75	9.03	8.70
	进口关税	2017年04月	18780	0.75	2147	18679	101	0.54%	-0.16%	8.75	9.02	8.70
	杂费	2017年05月	18750	3.25	2149	18700	50	0.27%	0.16%	8.72	9.00	8.70

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	85750	-52.25	10378	86200	-450	-0.52%	/	8.26	8.28	8.31
	到岸升水	2017年01月	85500	-50.25	10380	86216	-716	-0.83%	-0.02%	8.24	8.29	8.31
	汇率	2017年02月	86240	-32.25	10398	86363	-123	-0.14%	-0.17%	8.29	8.35	8.31
	增值税	2017年03月	86020	-14.00	10416	86513	-493	-0.57%	-0.18%	8.26	8.31	8.31
	进口关税	2017年04月	85850	5.00	10435	86668	-818	-0.94%	-0.18%	8.23	8.28	8.31
	杂费	2017年05月	87130	21.00	10451	86799	-331	-0.38%	-0.15%	8.34	8.39	8.31

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	153000	40.00	21140	181535	-28535	-15.72%	/	7.24	7.27	8.59
	到岸升水	2017年01月	152700	40.00	21140	181535	-28835	-15.88%	0.00%	7.22	7.26	8.59
	汇率	2017年02月	152650	30.00	21130	181452	-28902	-15.87%	0.05%	7.22	7.26	8.59
	增值税	2017年03月	151050	20.00	21120	181368	-30318	-16.72%	0.05%	7.15	7.19	8.59
	进口关税	2017年04月	155860	0.00	21100	181202	-25342	-13.99%	0.09%	7.39	#VALUE!	8.59
	杂费	2017年05月	154800	-20.00	21080	181035	-26235	-14.49%	0.09%	7.34	7.39	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	45910	256.20	46378	-468	-1.01%	/	179.20	#DIV/0!	181.02
	汇率	2017年02月	45980	255.40	46235	-255	-0.55%	0.31%	180.03	180.03	181.03
	增值税	2017年03月	46110	256.30	46396	-286	-0.62%	-0.35%	179.91	179.91	181.02
	进口关税	2017年04月	46240	256.60	46449	-209	-0.45%	-0.12%	180.20	180.20	181.02
	杂费	2017年05月	46330	257.30	46574	-244	-0.52%	-0.27%	180.06	180.06	181.01

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
2017/11/10	271.5	1185.6	263.9056157	692.34	7.594384291	(-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)
2017/11/10	4126	16.655	3707.277353	692.34	418.7226471

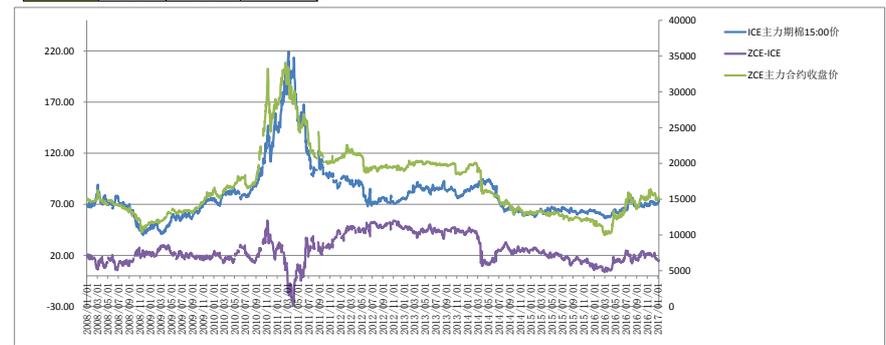
品种	参数	合约月份	沪铜价格	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
白糖	郑州白糖主力合约	2017年01月	6947	20.50	5749.091006	6.9234	1197.91
		2017年05月	6811	20.30	5703.217181		1107.78

注：郑州CICE与纽约原糖交易时间不一致，仅供参考。

品种	参数	大豆压榨价格			大豆油价格			参数
		2017年01月	2017年01月	2017年01月	2017年01月	2017年01月	2017年01月	
进口大豆压榨利润	2017年01月	990	2999	6866	1罐=60磅=27.2154kg	汇率	6.9234	
	2017年03月	1000.75	2778	6878		进口大豆出油率	79.50%	
						进口大豆出油率	18.50%	
	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)	加工费 (元/吨)	关税	3%
	990.0000	41.87	(218354.38)	(290125.81)				
		4.00						
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)	港杂费 (元/吨)			
1000.7500	78.00	46.26	(251260.37)	(293391.40)				

品种	参数	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	15165	73.17	12946	2219	17.14%	207	207	176.94	
	汇率	2017年05月	15445	73.61	13023	2422	18.60%	210	210	176.92	
	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
2017/1/10	73.17	15445	16.37808493



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	293,400	-1,500	88,275
铝	2,232,725	16,800	855,550
镍	371,964	-49	130,086
锌	426,425	-800	114,075
铅	193,300	0	42,950
锡	3,815	-70	455

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。