

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	
伦铜3月价	现货	37170	-8.75	4796.75	38098	-928	-2.44%	/	7.75	7.75	7.94
到岸升水	2016年07月	37120	-3.75	4801.75	38137	-1017	-2.57%	0.13%	7.73	7.78	7.94
汇率	2016年08月	37150	1.50	4807	38178	-1028	-2.69%	-0.06%	7.73	7.78	7.94
增值税	2016年09月	37220	2.50	4808	38186	-966	-2.53%	-0.19%	7.74	7.78	7.94
进口关税	2016年10月	37210	2.50	4808	38186	-976	-2.55%	0.03%	7.74	7.76	7.94
杂费	2016年11月	37190	3.75	4809.25	38195	-1005	-2.63%	0.05%	7.73	7.77	7.94

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	
伦铜3月价	现货	12600	-10.50	1617	15437	-2837	-18.38%	/	7.79	7.87	9.55
到岸升水	2016年07月	12560	-6.25	1621	15470	-2910	-18.81%	0.32%	7.75	7.83	9.55
汇率	2016年08月	12365	-3.25	1624	15494	-3129	-20.19%	1.55%	7.62	7.71	9.54
增值税	2016年09月	12225	1.00	1628	15527	-3302	-21.26%	1.13%	7.51	7.60	9.54
进口关税	2016年10月	12110	2.50	1630	15538	-3428	-22.06%	0.94%	7.43	7.52	9.54
杂费	2016年11月	12035	4.50	1632	15554	-3519	-22.62%	0.62%	7.38	7.45	9.53

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	
伦铜3月价	现货	16060	-3.25	2080	17330	-1270	-7.33%	/	7.72	7.77	8.33
到岸升水	2016年07月	16140	-2.50	2081	17336	-1196	-6.90%	-0.50%	7.76	7.84	8.33
汇率	2016年08月	16210	-0.25	2083	17353	-1143	-6.59%	-0.43%	7.78	7.84	8.33
增值税	2016年09月	16240	1.50	2085	17367	-1127	-6.49%	-0.19%	7.79	7.85	8.33
进口关税	2016年10月	16260	2.75	2086	17377	-1117	-6.43%	-0.12%	7.80	7.87	8.33
杂费	2016年11月	16275	4.75	2088	17392	-1117	-6.42%	-0.09%	7.80	7.86	8.33

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	
伦铜3月价	现货	12760	-3.50	1734	14679	-1919	-13.07%	/	7.36	7.43	8.47
到岸升水	2016年07月	12840	-3.00	1735	14683	-1843	-12.55%	-0.63%	7.40	7.47	8.47
汇率	2016年08月	12935	-1.50	1736	14695	-1760	-11.97%	-0.74%	7.45	7.52	8.46
增值税	2016年09月	12965	-0.50	1737	14703	-1738	-11.82%	-0.23%	7.46	7.54	8.46
进口关税	2016年10月	13010	1.50	1739	14719	-1709	-11.61%	-0.35%	7.48	7.51	8.46
杂费	2016年11月	12950	3.00	1741	14731	-1781	-12.09%	0.46%	7.44	7.53	8.46

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	伦铜安全边际	实际比值		进口比值
									今日	昨日	
伦铜3月价	现货	71700	-46.50	9274	73693	-1993	-2.70%	/	7.73	7.73	7.95
到岸升水	2016年07月	72620	-34.50	9286	73787	-1167	-1.58%	-0.13%	7.82	7.87	7.95
汇率	2016年08月	72950	-18.50	9302	73913	-963	-1.30%	-0.17%	7.84	7.87	7.95
增值税	2016年09月	73450	-2.00	9318	74042	-592	-0.80%	-0.18%	7.88	7.93	7.95
进口关税	2016年10月	73260	10.50	9331	74140	-880	-1.19%	-0.13%	7.85	7.89	7.95
杂费	2016年11月	73470	23.50	9344	74242	-772	-1.04%	-0.14%	7.86	8.00	7.95

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	伦铜安全边际	实际比值		进口比值
									今日	昨日	
伦铜3月价	现货	111000	27.00	16927	140238	-29238	-20.85%	/	6.56	6.62	8.28
到岸升水	2016年07月	#N/A	12.00	16912	140118	#VALUE!	#VALUE!	0.09%	#VALUE!	#VALUE!	8.29
汇率	2016年08月	110630	10.00	16910	140102	-29472	-21.04%	0.01%	6.54	6.57	8.29
增值税	2016年09月	111630	5.00	16905	140062	-28432	-20.30%	0.03%	6.60	6.68	8.29
进口关税	2016年10月	#N/A	-5.00	16895	139982	#VALUE!	#VALUE!	0.06%	#VALUE!	#VALUE!	8.29
杂费	2016年11月	#N/A	-10.00	16890	139942	#VALUE!	#VALUE!	0.03%	#VALUE!	#VALUE!	8.29

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	
到岸升水	2016年07月	37120	217.00	37733	-613	-1.62%	/	171.06	171.94	173.88
汇率	2016年08月	37150	216.80	37699	-549	-1.46%	0.09%	171.36	172.18	173.89
增值税	2016年09月	37220	217.30	37764	-564	-1.49%	-0.23%	171.28	172.02	173.88
进口关税	2016年10月	37210		643	36567	5685.19%	100.00%	#DIV/0!	171.34	#DIV/0!
杂费	2016年11月	37190		643	36547	5682.09%	#DIV/0!	#DIV/0!	#DIV/0!	#DIV/0!

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
2016/6/29	284.3	1323.9	282.303921	663.24	1.996079024	(-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)
2016/6/29	4056	18.32	3906.494322	663.24	149.5056785

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)
2016年09月	5841	19.83	5382.759262	6.6324	458.24
2017年01月	6141	20.06	5433.2968		707.70

注: 郑州CICE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

参数	合约月份	大豆压榨价格			大豆油价格			参数
		进口大豆	国内压榨	净油 (元/吨)	毛油 (元/吨)	净油 (元/吨)	毛油 (元/吨)	
2016年07月	1148.25	2016年09月	3356	2016年09月	6072	1罐=60磅=27.2154kg		
2016年11月	1115	2017年01月	3280	2017年01月	6218	汇率	6.6324	
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)	净油 (元/吨)	进口大豆出油率		79.50%	
1148.2500	4.00	41.87	(276201.04)	(322542.70)	进口菜豆出油率		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)	净油 (元/吨)	加工费 (元/吨)		13%	
1115.0000	78.00	46.26	(268130.66)	(313061.60)	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	2016年09月	14535	2016年07月	200	14335	7167.50%	#DIV/0!	#DIV/0!	#DIV/0!	
汇率	2017年01月	14670	2016年12月	65.97	11209	3461	30.88%	222	218	169.91
增值税										
进口关税										
杂费										

日期	ICE主力期棉15-00价	ICE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2016/6/29	65.97	14670	22.81655735



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	194,200	1,250	54,875
铝	2,393,600	-6,700	1,025,000
镍	380,285	-798	116,340
铅	186,250	900	72,950
锌	426,225	-2,350	17,825
锡	6,060	-25	1,420

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, 否则不得分发给任何其他人士。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)及独立寻求专业意见。