

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	37540	-7.75	4852.25	38522	-982	-2.55%	/	7.74	7.75	7.94
	到岸升水	2016年07月	37530	-3.75	4856.25	38553	-1023	-2.65%	0.03%	7.73	7.73	7.94
	汇率	2016年08月	37500	1.75	4861.75	38596	-1098	-2.84%	0.08%	7.71	7.73	7.94
	增值税	2016年09月	37530	2.50	4862.5	38602	-1072	-2.78%	-0.08%	7.72	7.74	7.94
	进口关税	2016年10月	37550	2.75	4862.75	38604	-1054	-2.73%	-0.05%	7.72	7.74	7.94
	杂费	2016年11月	37550	4.00	4864	38613	-1063	-2.76%	0.00%	7.72	7.73	7.94

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	12740	-8.75	1626	15510	-2770	-17.86%	/	7.83	7.79	9.54
	到岸升水	2016年07月	12720	-4.75	1630	15541	-2821	-18.15%	0.16%	7.80	7.75	9.53
	汇率	2016年08月	12530	-1.75	1633	15565	-3035	-19.50%	1.49%	7.67	7.62	9.53
	增值税	2016年09月	12335	1.75	1637	15592	-3257	-20.89%	1.56%	7.54	7.51	9.53
	进口关税	2016年10月	12200	1.75	1637	15592	-3392	-21.75%	1.09%	7.45	7.43	9.53
	杂费	2016年11月	12130	3.75	1639	15607	-3477	-22.28%	0.57%	7.40	7.38	9.52

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	16330	-2.25	2108	17550	-1220	-6.95%	/	7.75	7.72	8.32
	到岸升水	2016年07月	16370	-2.00	2109	17562	-1162	-6.73%	-0.24%	7.76	7.76	8.32
	汇率	2016年08月	16410	0.25	2111	17570	-1160	-6.60%	-0.24%	7.77	7.78	8.32
	增值税	2016年09月	16450	2.00	2113	17583	-1133	-6.45%	-0.24%	7.79	7.79	8.32
	进口关税	2016年10月	16470	3.00	2114	17594	-1121	-6.37%	-0.12%	7.79	7.80	8.32
	杂费	2016年11月	16500	4.75	2115	17605	-1105	-6.28%	-0.18%	7.80	7.80	8.32

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	12790	-2.25	1785	15086	-2296	-15.22%	/	7.16	7.36	8.45
	到岸升水	2016年07月	13110	-2.25	1785	15086	-1976	-13.10%	-2.50%	7.34	7.40	8.45
	汇率	2016年08月	13175	-0.50	1787	15100	-1925	-12.75%	-0.50%	7.37	7.45	8.45
	增值税	2016年09月	13210	0.50	1788	15108	-1898	-12.56%	-0.27%	7.39	7.46	8.45
	进口关税	2016年10月	13285	2.00	1790	15120	-1835	-12.13%	-0.57%	7.42	7.48	8.45
	杂费	2016年11月	13180	3.50	1791	15132	-1952	-12.90%	0.79%	7.36	7.44	8.45

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	73200	-45.50	9470	75216	-2016	-2.68%	/	7.73	7.73	7.94
	到岸升水	2016年07月	74200	-35.00	9480	75288	-1988	-1.46%	-0.11%	7.83	7.82	7.94
	汇率	2016年08月	74490	-20.00	9495	75416	-928	-1.23%	-0.16%	7.85	7.84	7.94
	增值税	2016年09月	74890	-4.00	9511	75541	-651	-0.86%	-0.17%	7.87	7.88	7.94
	进口关税	2016年10月	74860	10.50	9526	75655	-795	-1.05%	-0.15%	7.86	7.85	7.94
	杂费	2016年11月	75640	23.50	9539	75757	-117	-0.16%	-0.14%	7.93	7.86	7.94

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	111000	19.00	17069	141348	-30348	-21.47%	/	6.50	6.56	8.28
	到岸升水	2016年07月	#N/A	6.00	17056	141244	#VALUE!	#VALUE!	0.08%	#VALUE!	#VALUE!	8.28
	汇率	2016年08月	110630	6.00	17056	141244	-30614	-21.67%	0.00%	6.49	6.54	8.28
	增值税	2016年09月	112770	1.00	17051	141204	-28434	-20.14%	0.03%	6.61	6.60	8.28
	进口关税	2016年10月	#N/A	-5.00	17045	141156	#VALUE!	#VALUE!	0.04%	#VALUE!	#VALUE!	8.28
	杂费	2016年11月	#N/A	-20.00	17030	141036	#VALUE!	#VALUE!	0.09%	#VALUE!	#VALUE!	8.28

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	2016年07月	37530	219.55	38162	-632	-1.66%	/	170.94	171.06	173.82
	汇率	2016年08月	37500	219.25	38110	-610	-1.60%	0.14%	171.04	171.36	173.82
	增值税	2016年09月	37530	219.80	38204	-674	-1.77%	-0.25%	170.75	171.28	173.81
	进口关税	2016年10月	37550		643	36907	5738.95%	100.00%	#DIV/0!	#DIV/0!	#DIV/0!
	杂费	2016年11月	37550		643	36907	5738.95%	#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
2016/6/30	283	1317.9	280.9736557	663.12	2.026344319	(-5, +5)

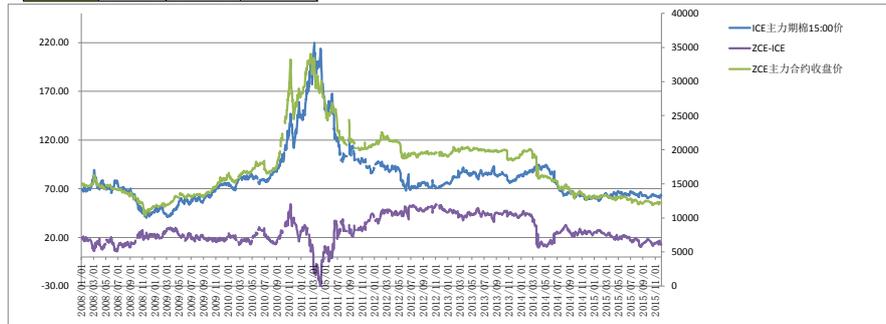
日期	沪银主力合约	纽约银主力合约	纽约银主力合约 (RMB)	人民币汇率	价差 (沪-美)
2016/6/30	4064	18.43	3929.239301	663.12	134.7606994

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	6090	20.92	5621.34299	6.6312	468.66
2017年01月	6377	21.01	5641.11497		735.89

品种	参数	合约月份	美豆价格	大豆压榨价格		美豆油价格	参数
				进口成本	进口盈亏		
进口大豆压榨利润	2016年07月	1153.5	2016年09月	3394	2016年09月	6162	汇率
	2016年11月	1121.75	2017年01月	3309	2017年01月	6304	汇率
	南美洲 (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)	净利率 (元/吨)	进口大豆出油率	79.50%
	1153.5000	4.00	41.87	(277383.13)	(323926.09)	进口大豆出油率	18.50%
			进口美豆大豆 国内压榨 (17年1月到港)	毛利 (元/吨)	净利率 (元/吨)	加工费 (元/吨)	130
			46.26	(269687.50)	(314879.90)	美国	3%
		78.00			净利率 (元/吨)	13%	
					港杂费 (元/吨)	120	

参数 (不含港杂费)	合约月份	美棉价格	美棉价格	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	14385	200	14185	7082.50%	#DIV/0!	#DIV/0!	#DIV/0!	
汇率	2017年01月	14725	66.20	11245	3480	30.94%	222	222	
增值税									
进口关税									
杂费									

日期	ICE主力期货棉15:00价	ZCE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2016/6/30	66.20	14725	22.93555858



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	191,525	-2,675	54,825
铝	2,287,850	-5,750	1,018,750
镍	379,338	-948	115,536
锡	185,225	-1,025	71,925
锌	443,175	16,950	16,625
铅	5,985	-75	1,345

声明:

1. 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。
2. 本文件仅供客户参考, 并不构成任何对客户之建议。
3. 本文件的内容并非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。