

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	4812.00	现货	37230	-16.00	4796.00	38028	-798	-2.10%	/	7.76	7.76	7.93
到岸升水	100	2016年09月	37530	-10.00	4802	38074	-744	-1.95%	-0.27%	7.77	7.77	7.93
汇率	6.6211	2016年10月	37390	-5.00	4807	38113	-723	-1.90%	-0.16%	7.78	7.78	7.93
增值税	17%	2016年11月	37430	0.50	4812.5	38156	-726	-1.90%	-0.11%	7.78	7.78	7.93
进口关税	0%	2016年12月	37500	6.00	4818	38198	-698	-1.83%	-0.19%	7.78	7.78	7.93
杂费	100	2017年01月	37550	9.50	4821.50	38225	-675	-1.77%	-0.13%	7.79	7.80	7.93

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		
伦铝3月价	1682.90	现货	12800	-13.00	1670	15825	-3025	-19.12%	/	7.67	7.54	9.48
到岸升水	360	2016年09月	12740	-7.50	1675	15868	-3128	-19.71%	0.47%	7.60	7.52	9.47
汇率	6.6211	2016年10月	12685	-3.50	1679	15899	-3214	-20.21%	0.43%	7.55	7.53	9.47
增值税	17%	2016年11月	12560	0.50	1683	15930	-3370	-21.15%	0.99%	7.46	7.41	9.46
进口关税	0%	2016年12月	12475	4.25	1687	15959	-3484	-21.83%	0.68%	7.39	7.33	9.46
杂费	100	2017年01月	12390	5.00	1688	15964	-3574	-22.39%	0.68%	7.34	7.27	9.46

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		
伦镍3月价	2289.00	现货	17460	-2.00	2287	18922	-1462	-7.73%	/	7.63	7.66	8.27
到岸升水	125	2016年09月	17450	-4.00	2285	18906	-1456	-7.70%	0.06%	7.64	7.64	8.27
汇率	6.6211	2016年10月	17505	-1.50	2288	18926	-1421	-7.51%	-0.32%	7.65	7.66	8.27
增值税	17%	2016年11月	17530	1.50	2291	18949	-1419	-7.49%	-0.14%	7.65	7.66	8.27
进口关税	1%	2016年12月	17550	3.25	2292	18963	-1415	-7.45%	-0.11%	7.66	7.67	8.27
杂费	50	2017年01月	17560	4.00	2293	18969	-1409	-7.43%	-0.06%	7.66	7.67	8.27

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		
伦锌3月价	1890.50	现货	13870	-10.25	1880	15821	-1951	-12.33%	/	7.38	7.31	8.41
到岸升水	90	2016年09月	13990	-6.25	1884	15853	-1863	-11.75%	-0.87%	7.42	7.31	8.41
汇率	6.6211	2016年10月	13985	-2.50	1888	15883	-1898	-11.95%	0.04%	7.41	7.32	8.41
增值税	17%	2016年11月	13995	0.50	1891	15907	-1912	-12.02%	-0.07%	7.40	7.31	8.41
进口关税	3%	2016年12月	14050	3.50	1894	15931	-1881	-11.80%	-0.39%	7.42	7.30	8.41
杂费	100	2017年01月	14050	5.50	1896	15946	-1896	-11.89%	0.00%	7.41	7.31	8.41

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		
伦锡3月价	10312	现货	79600	-49.50	10263	81306	-1706	-2.10%	/	7.76	7.76	7.92
到岸升水	110	2016年09月	79890	-31.50	10281	81447	-1557	-1.91%	-0.18%	7.77	7.75	7.92
汇率	6.6211	2016年10月	80300	-16.50	10286	81564	-1264	-1.55%	-0.15%	7.80	7.75	7.92
增值税	17%	2016年11月	80340	-1.00	10311	81686	-1346	-1.65%	-0.15%	7.79	7.74	7.92
进口关税	1%	2016年12月	80820	16.00	10328	81819	-999	-1.22%	-0.16%	7.83	7.81	7.92
杂费	150	2017年01月	81540	30.00	10342	81928	-388	-0.47%	-0.14%	7.88	7.86	7.92

参数	合约月份	沪铅价格	LME升贴水	伦铅价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	伦铅安全边际	实际比值		进口比值	
									今日	昨日		
伦铅3月价	18420	现货	123250	30.00	18450	152152	-28902	-19.00%	/	6.68	6.75	8.25
到岸升水	600	2016年09月	122000	25.00	18445	152112	-30112	-19.80%	0.03%	6.61	6.62	8.25
汇率	6.6211	2016年10月	124210	15.00	18435	152032	-27822	-18.30%	0.05%	6.74	6.81	8.25
增值税	17%	2016年11月	123370	6.00	18426	151960	-28590	-18.81%	0.05%	6.70	6.81	8.25
进口关税	3%	2016年12月	122000	-4.00	18416	151880	-29880	-19.67%	0.05%	6.62	6.78	8.25
杂费	150	2017年01月	123080	-14.00	18406	151801	-28721	-18.92%	0.05%	6.69	6.70	8.25

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	70	2016年09月	36950	217.15	37694	-744	-1.97%	/	170.16	170.16	173.59
汇率	6.6211	2016年10月	37390	217.80	37805	-415	-1.10%	-0.30%	171.67	172.37	173.58
增值税	0.17	2016年11月	37430	217.55	37763	-333	-0.88%	0.11%	172.05	172.69	173.58
进口关税	0%	2016年12月	37500	218.25	37882	-382	-1.01%	-0.32%	171.82	171.82	173.57
杂费	150	2017年01月	37550	218.30	37890	-340	-0.90%	-0.02%	172.01	173.42	173.57

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
2016/8/19	289.3	1353.7	288.1665675	662.11	1.133432465	(-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)
2016/8/19	4367	19.635	4179.766975	662.11	187.2330254

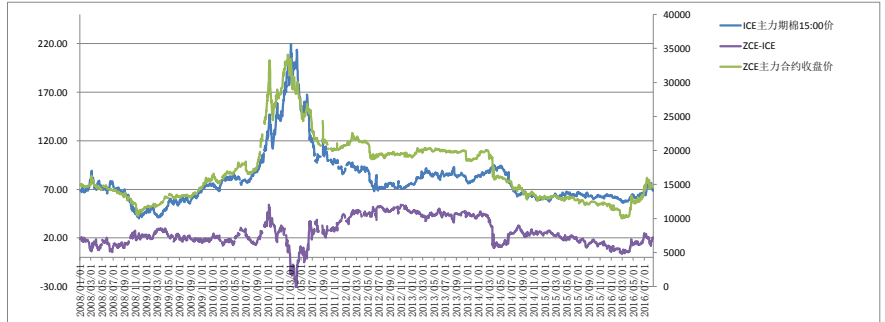
日期	郑州砂磷主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂磷成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年01月	6238	20.08	5429.340063	6.6211	808.66
2017年05月	6294	20.53	5528.049392		765.95

注: 郑州CICE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

进口大豆压榨平衡表	大豆价格			大豆压榨成本			大豆压榨利润		
	日期	价格	单位	日期	价格	单位	日期	价格	单位
2016年08月	1023.75	2016年09月	3062	2016年09月	6328	1罐=60磅=27.2154kg	汇率	6.6211	
2016年11月	1004	2017年01月	2986	2017年01月	6416		进口大豆出油率	79.50%	
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)	进口大豆出油率	18.50%	加工费 (元/吨)	130	
1023.7500	4.00	215618.72	(215618.72)	(286917.27)	美国	3%			
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)	120			
1004.0000	78.00	46.26	(210857.22)	(281285.85)					

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	70	2017年01月	14645	2016年12月	69.00	11695	2950	25.22%	212	214	169.49
汇率	6.6211	2017年05月	14650	2017年03月	69.00	11695	2955	25.27%	212	214	169.49
增值税	13%										
进口关税	1%										
杂费	200										

日期	ICE主力合约收市价	ZCE主力合约收市价	ZCE-ICE
2016/8/19	69.00	14645	19.7865217



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	210,625	-2,800	59,375
铝	2,245,050	-7,100	940,025
镍	373,512	-60	112,344
铅	187,025	-100	68,525
锌	455,875	-1,175	24,250
锡	4,725	-170	1,625

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。