

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	37200	-12.95	4747.05	37899	-699	-1.84%	/	7.84	7.76	7.98	
到岸升水	100	2016年09月	37070	-9.45	4750.55	37926	-856	-2.28%	0.35%	7.80	7.77	7.98
汇率	6.6652	2016年10月	37140	-4.95	4755.05	37961	-821	-2.16%	-0.19%	7.81	7.78	7.98
增值税	17%	2016年11月	37160	0.05	4760.05	38000	-840	-2.21%	-0.05%	7.81	7.78	7.98
进口关税	0%	2016年12月	37250	5.05	4765.05	38039	-789	-2.07%	-0.24%	7.82	7.78	7.98
杂费	100	2017年01月	37270	8.55	4768.55	38066	-796	-2.09%	-0.05%	7.82	7.79	7.98

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	现货	12630	-12.76	1644	15730	-3100	-19.71%	/	7.68	7.67	9.57	
到岸升水	360	2016年09月	12470	-8.26	1649	15765	-3295	-20.90%	1.27%	7.56	7.60	9.56
汇率	6.6652	2016年10月	12375	-4.26	1653	15796	-3421	-21.66%	0.76%	7.49	7.55	9.56
增值税	17%	2016年11月	12300	-0.26	1657	15827	-3527	-22.29%	0.61%	7.42	7.46	9.55
进口关税	0%	2016年12月	12225	3.74	1661	15858	-3633	-22.91%	0.61%	7.36	7.39	9.55
杂费	100	2017年01月	12155	4.49	1661	15864	-3709	-23.38%	0.57%	7.32	7.34	9.55

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	现货	17600	0.36	2270	18913	-1313	-6.94%	/	7.75	7.63	8.33	
到岸升水	125	2016年09月	17365	-4.14	2265	18877	-1512	-8.01%	1.34%	7.67	7.64	8.33
汇率	6.6652	2016年10月	17385	-1.89	2268	18895	-1510	-7.99%	-0.12%	7.67	7.65	8.33
增值税	17%	2016年11月	17415	0.86	2270	18916	-1501	-7.94%	-0.17%	7.67	7.65	8.33
进口关税	1%	2016年12月	17435	2.86	2272	18932	-1497	-7.91%	-0.11%	7.67	7.66	8.33
杂费	50	2017年01月	17450	3.61	2273	18938	-1488	-7.88%	-0.09%	7.68	7.66	8.33

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	现货	13900	-12.67	1861	15770	-1870	-11.86%	/	7.47	7.38	8.47	
到岸升水	90	2016年09月	13890	-7.17	1866	15814	-1924	-12.16%	0.07%	7.44	7.42	8.47
汇率	6.6652	2016年10月	13900	-3.42	1870	15844	-1944	-12.27%	-0.07%	7.43	7.41	8.47
增值税	17%	2016年11月	13910	-0.42	1873	15868	-1958	-12.34%	-0.07%	7.43	7.40	8.47
进口关税	3%	2016年12月	14050	3.08	1877	15896	-1846	-11.61%	-1.01%	7.49	7.42	8.47
杂费	100	2017年01月	14010	5.58	1879	15916	-1906	-11.98%	0.28%	7.46	7.41	8.47

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	现货	79600	-49.94	10150	80961	-1361	-1.68%	/	7.84	7.76	7.98	
到岸升水	110	2016年09月	79000	-32.44	10168	81099	-2099	-2.59%	-0.17%	7.77	7.77	7.98
汇率	6.6652	2016年10月	79440	-17.94	10182	81213	-1773	-2.18%	-0.14%	7.80	7.80	7.98
增值税	17%	2016年11月	80340	-2.94	10197	81331	-991	-1.22%	-0.15%	7.88	7.79	7.98
进口关税	1%	2016年12月	79970	14.06	10214	81465	-1845	-1.84%	-0.17%	7.83	7.83	7.98
杂费	150	2017年01月	80590	28.06	10228	81575	-985	-1.21%	-0.14%	7.88	7.88	7.98

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	现货	123250	45.44	18495	153529	-30279	-19.72%	/	6.66	6.68	8.30	
到岸升水	600	2016年09月	121840	45.44	18495	153529	-31689	-20.64%	0.00%	6.59	6.61	8.30
汇率	6.6652	2016年10月	124210	25.44	18475	153368	-29158	-19.01%	0.11%	6.72	6.74	8.30
增值税	17%	2016年11月	124390	5.44	18455	153208	-28818	-18.81%	0.11%	6.74	6.70	8.30
进口关税	3%	2016年12月	122000	-3.56	18446	153135	-31135	-20.33%	0.05%	6.61	6.62	8.30
杂费	150	2017年01月	123160	-13.56	18436	153055	-29895	-19.53%	0.05%	6.68	6.69	8.30

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	214.80	37541	-591	-1.57%	/	172.02	170.16	174.77
汇率	6.6652	2016年10月	37140	216.60	37850	-710	-1.86%	-0.84%	171.47	171.67	174.75
增值税	0.17	2016年11月	37160	217.45	37996	-836	-2.20%	-0.39%	170.89	172.05	174.74
进口关税	0%	2016年12月	37250	216.00	37747	-497	-1.32%	0.67%	172.45	171.82	174.76
杂费	150	2017年01月	37270	218.10	38108	-838	-2.20%	-0.97%	170.88	172.01	174.73

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
2016/8/22	286.7	1337.1	286.5286752	666.52	0.171324752	(-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)
2016/8/22	4204	18.845	4038.31642	666.52	165.6835801

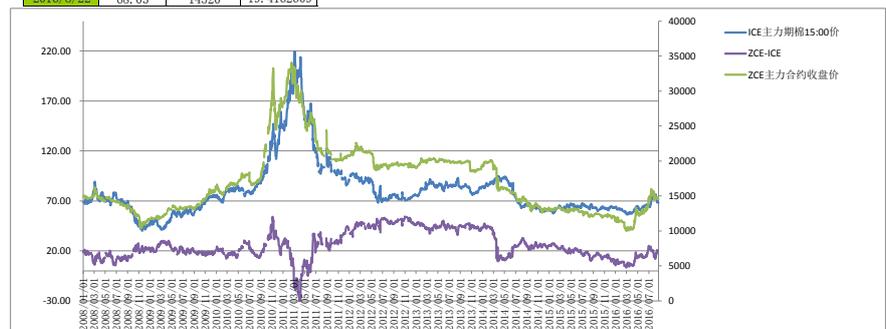
日期	郑州砂糖主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年01月	6242	2016年09月	19.79	5397.895955	844.10
2017年05月	6294	2017年03月	20.31	5512.719796	781.28

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	美豆价格		大连豆粕价格		大连豆油价格		参数
	2016年08月	1028.5	2016年09月	3080	2016年09月	6224	
2016年11月	1005.75	2017年01月	3005	2017年01月	6354	汇率	6.6652
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)	进口美豆出油率	进口美豆出油率	79.50%
1028.5000	4.00	41.87	(218446.02)	(290209.50)	进口美豆出油率	加工费 (元/吨)	18.50%
美国豆 (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)	关税	港杂费 (元/吨)	13%
1005.7500	78.00	46.26	(212909.25)	(283676.24)			

参数 (不含增值税)	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	70	2017年01月	14520	2016年12月	68.03	11609	2911	25.08%	213	212	170.65
汇率	6.6652	2017年05月	14550	2017年03月	68.50	11688	2862	24.49%	212	212	170.62
增值税	13%										
进口关税	1%										
杂费	200										

日期	ICE主力期棉15.00价	ZCE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2016/8/22	68.03	14520	19.4162609



每日LME库存:

品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	229,375	16,750	57,325
铝	2,241,550	-3,500	935,025
镍	373,692	180	111,948
铅	187,900	875	68,450
锌	455,200	-675	23,575
锡	4,630	-95	1,655

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。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。