

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	4690.00	现货	36770	-17.86	4672.14	37185	-415	-1.12%	/	7.87	7.81	7.96
到岸升水	100	2016年09月	36640	-12.36	4677.64	37228	-588	-1.58%	0.35%	7.83	7.80	7.96
汇率	6.642	2016年10月	36650	-6.86	4683.14	37270	-620	-1.68%	-0.03%	7.83	7.80	7.96
增值税	17%	2016年11月	36690	-1.11	4688.89	37315	-625	-1.68%	-0.11%	7.82	7.80	7.96
进口关税	0%	2016年12月	36760	-4.64	4694.64	37360	-600	-1.61%	-0.19%	7.83	7.80	7.96
杂费	100	2017年01月	36810	8.14	4698.14	37387	-577	-1.54%	-0.14%	7.84	7.81	7.96

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	1666.00	现货	12640	-12.32	1654	15749	-3109	-19.74%	/	7.64	7.58	9.52
到岸升水	360	2016年09月	12535	-8.57	1657	15778	-3243	-20.55%	0.83%	7.56	7.54	9.52
汇率	6.642	2016年10月	12420	-4.32	1662	15811	-3391	-21.45%	0.92%	7.47	7.47	9.51
增值税	17%	2016年11月	12350	-0.07	1666	15844	-3494	-22.05%	0.56%	7.41	7.40	9.51
进口关税	0%	2016年12月	12285	4.18	1670	15877	-3592	-22.62%	0.53%	7.36	7.34	9.51
杂费	100	2017年01月	12225	4.93	1671	15883	-3658	-23.03%	0.49%	7.32	7.30	9.51

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	2292.00	现货	17650	3.00	2295	19044	-1394	-7.32%	/	7.69	7.64	8.30
到岸升水	125	2016年09月	17555	-3.00	2289	18997	-1442	-7.59%	0.54%	7.67	7.65	8.30
汇率	6.642	2016年10月	17595	-0.75	2291	19015	-1420	-7.47%	-0.23%	7.68	7.66	8.30
增值税	17%	2016年11月	17610	1.75	2294	19034	-1424	-7.48%	-0.69%	7.68	7.66	8.30
进口关税	1%	2016年12月	17615	3.25	2295	19046	-1431	-7.51%	-0.03%	7.67	7.66	8.30
杂费	50	2017年01月	17615	3.75	2296	19050	-1435	-7.53%	0.00%	7.67	7.67	8.30

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	1858.00	现货	13930	-11.70	1646	15599	-1669	-10.70%	/	7.54	7.52	8.45
到岸升水	90	2016年09月	13930	-7.45	1651	15633	-1703	-10.89%	0.00%	7.53	7.50	8.45
汇率	6.642	2016年10月	13965	-3.70	1654	15663	-1698	-10.84%	-0.25%	7.53	7.50	8.45
增值税	17%	2016年11月	13980	-0.70	1657	15687	-1707	-10.88%	-0.11%	7.53	7.49	8.45
进口关税	3%	2016年12月	14030	2.55	1661	15713	-1683	-10.71%	-0.36%	7.54	7.48	8.45
杂费	100	2017年01月	14030	4.80	1663	15731	-1701	-10.81%	0.00%	7.53	7.49	8.44

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	10230	现货	79500	-52.25	10178	80897	-1397	-1.73%	/	7.81	7.83	7.95
到岸升水	110	2016年09月	79370	-34.75	10195	81034	-1664	-2.03%	-0.17%	7.78	7.77	7.95
汇率	6.642	2016年10月	79680	-19.75	10210	81152	-1472	-1.81%	-0.15%	7.80	7.81	7.95
增值税	17%	2016年11月	80500	-4.00	10226	81276	-776	-0.95%	-0.15%	7.87	7.86	7.95
进口关税	1%	2016年12月	80440	13.00	10243	81409	-869	-1.19%	-0.17%	7.85	7.80	7.95
杂费	150	2017年01月	80980	27.00	10257	81519	-539	-0.66%	-0.14%	7.90	7.90	7.95

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	18735	现货	124250	28.12	18763	155138	-30888	-19.91%	/	6.62	6.67	8.27
到岸升水	600	2016年09月	124120	33.12	18768	155178	-31058	-20.01%	-0.03%	6.61	6.58	8.27
汇率	6.642	2016年10月	125000	21.12	18756	155082	-30082	-19.40%	0.06%	6.66	6.72	8.27
增值税	17%	2016年11月	123990	8.12	18743	154978	-30988	-19.99%	0.07%	6.62	6.75	8.27
进口关税	3%	2016年12月	122000	-1.88	18733	154898	-32988	-21.24%	0.05%	6.51	6.61	8.27
杂费	150	2017年01月	125410	-11.88	18723	154818	-29408	-18.99%	0.05%	6.70	6.65	8.27

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	210.75	36717	233	0.63%	/	175.33	172.34	174.22
汇率	6.642	2016年10月	36650	211.65	36872	-222	-0.60%	-0.43%	173.16	172.57	174.21
增值税	0.17	2016年11月	36690	211.50	36846	-156	-0.42%	0.07%	173.48	172.96	174.21
进口关税	0%	2016年12月	36760	211.95	36923	-163	-0.44%	-0.21%	173.44	172.59	174.21
杂费	150	2017年01月	36810	212.95	37094	-284	-0.77%	-0.47%	172.86	172.47	174.19

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
2016/8/24	287.4	1341.4	286.4495806	664.2	0.950119439	(-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)
2016/8/24	4209	18.845	4024.259986	664.2	184.7400137

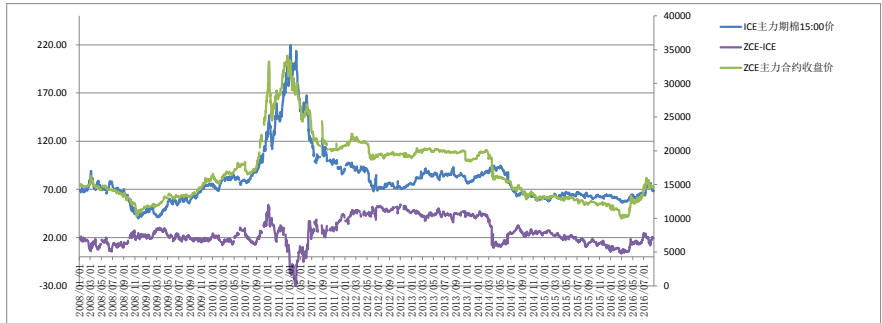
日期	郑州砂磷主力合约		纽约原糖主力合约		纽约原糖加工成砂磷成本 (RMB)		RMB汇率	价差 (郑-美)
	2017年01月	2017年05月	2016年09月	2017年01月	2016年09月	2017年01月		
2017年01月	6276	6316	20.71	21.17	5583.415561	5684.636938	6.642	692.58
2017年05月								631.36

注: 郑州CZCE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

参数	大豆价格		大豆压榨价格		大豆油价格		参数			
	2016年08月	2016年09月	2016年09月	2017年01月	2016年09月	2017年01月				
进口大豆	1030	1007.5	3068	2981	6264	6418	汇率	6.642		
大豆(16年9月到期)	FOB升贴水(美分/蒲式耳)	41.87	国际运费(美元)	41.87	毛利(元/吨)	(217937.37)	净利率(元/吨)	(289615.90)	进口大豆出油率	79.50%
1030.0000	4.00	进口美国大豆 国内压榨(16年9月到期)							进口大豆出油率	18.50%
美湾豆(17年1月到期)	FOB升贴水(美分/蒲式耳)	46.26	国际运费(美元)	46.26	毛利(元/吨)	(21485.98)	净利率(元/吨)	(283181.67)	加工费(元/吨)	130
1007.5000	78.00	进口美国大豆 国内压榨(17年1月到期)							关税	3%
									港杂费(元/吨)	120

参数(不含增值税)	合约月份	郑棉价格	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	14575	68.55	11656	2919	25.04%	213	213	170.04
汇率	6.642	2017年05月	14585	68.41	11633	2952	25.38%	213	212	170.05
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
2016/8/24	68.55	14575	19.53409684



品种	库存数量(吨)	变动	注册仓单
铜	254,700	14,625	52,650
铝	2,259,100	24,575	822,100
镍	373,206	-342	113,436
铅	187,650	0	68,200
锌	455,275	175	23,800
锡	4,570	-60	1,595

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。