

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	36310	-17.00	4628.00	36943	-633	-1.71%	/	7.65	7.67	7.98
到岸升水	2016年09月	36330	-11.00	4634	36889	-659	-1.78%	-0.06%	7.84	7.83	7.98
汇率	2016年10月	36370	-5.75	4639.25	37030	-660	-1.78%	-0.11%	7.84	7.83	7.98
增值税	2016年11月	36420	-1.00	4644	37067	-647	-1.75%	-0.14%	7.84	7.82	7.98
进口关税	2016年12月	36460	4.00	4649	37106	-646	-1.74%	-0.11%	7.84	7.83	7.98
杂费	2017年01月	36510	7.75	4652.75	37135	-625	-1.68%	-0.14%	7.85	7.84	7.98

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	12570	-12.75	1637	15660	-3090	-19.73%	/	7.68	7.64	9.57
到岸升水	2016年09月	12450	-8.50	1641	15693	-3243	-20.66%	0.95%	7.59	7.56	9.56
汇率	2016年10月	12340	-4.00	1646	15728	-3388	-21.54%	0.88%	7.50	7.47	9.56
增值税	2016年11月	12260	-0.25	1649	15757	-3497	-22.19%	0.65%	7.43	7.41	9.55
进口关税	2016年12月	12205	3.50	1653	15786	-3581	-22.69%	0.45%	7.38	7.36	9.55
杂费	2017年01月	12155	4.00	1654	15790	-3635	-23.02%	0.41%	7.35	7.32	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	17460	5.75	2280	18980	-1520	-8.01%	/	7.66	7.69	8.32
到岸升水	2016年09月	17510	-3.25	2271	18909	-1399	-7.40%	-0.29%	7.71	7.67	8.33
汇率	2016年10月	17505	-0.75	2274	18929	-1424	-7.52%	0.03%	7.70	7.68	8.33
增值税	2016年11月	17495	1.75	2276	18949	-1454	-7.67%	0.06%	7.69	7.68	8.32
进口关税	2016年12月	17470	3.75	2278	18964	-1484	-7.88%	0.14%	7.67	7.67	8.32
杂费	2017年01月	17445	4.50	2279	18970	-1525	-8.04%	0.14%	7.65	7.67	8.32

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	13910	-11.75	1646	15637	-1727	-11.04%	/	7.54	7.54	8.47
到岸升水	2016年09月	13960	-7.25	1650	15673	-1713	-10.93%	-0.36%	7.54	7.53	8.47
汇率	2016年10月	13970	-4.25	1653	15697	-1727	-11.00%	-0.07%	7.54	7.53	8.47
增值税	2016年11月	13995	-0.75	1657	15725	-1730	-11.00%	-0.18%	7.54	7.53	8.47
进口关税	2016年12月	14005	2.50	1660	15751	-1746	-11.09%	-0.07%	7.53	7.54	8.47
杂费	2017年01月	14000	4.75	1662	15769	-1769	-11.22%	0.04%	7.52	7.53	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	76650	-54.50	9886	78818	-2168	-2.75%	/	7.75	7.81	7.97
到岸升水	2016年09月	77030	-35.50	9906	79068	-1938	-2.45%	-0.19%	7.78	7.78	7.97
汇率	2016年10月	77210	-20.00	9920	79090	-1880	-2.38%	-0.16%	7.78	7.80	7.97
增值税	2016年11月	77950	-4.00	9936	79216	-1266	-1.60%	-0.16%	7.85	7.87	7.97
进口关税	2016年12月	78050	13.50	9954	79353	-1303	-1.64%	-0.18%	7.84	7.85	7.97
杂费	2017年01月	78450	27.50	9968	79464	-1014	-1.28%	-0.14%	7.87	7.90	7.97

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	124250	9.00	18794	155810	-31660	-20.26%	/	6.61	6.62	8.29
到岸升水	2016年09月	122610	18.00	18803	155882	-33272	-21.34%	-0.05%	6.52	6.61	8.29
汇率	2016年10月	122690	11.00	18796	155826	-33136	-21.26%	0.04%	6.53	6.66	8.29
增值税	2016年11月	121000	3.00	18788	155762	-34762	-22.32%	0.04%	6.44	6.62	8.29
进口关税	2016年12月	122000	-2.00	18783	155722	-33722	-21.66%	0.03%	6.50	6.51	8.29
杂费	2017年01月	123900	-14.00	18771	155626	-31726	-20.39%	0.06%	6.60	6.70	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09月	36950	208.65	36457	493	1.35%	/	177.09	175.33	174.73
汇率	2016年10月	36370	209.55	36612	-242	-0.66%	-0.43%	173.56	173.16	174.72
增值税	2016年11月	36420	209.55	36612	-192	-0.52%	0.00%	173.80	173.48	174.72
进口关税	2016年12月	36460	209.65	36629	-169	-0.46%	-0.05%	173.91	173.44	174.71
杂费	2017年01月	36510	209.70	36638	-128	-0.35%	-0.02%	174.11	172.86	174.71

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
2016/8/25	284.75	1328.7	284.5150363	666.02	0.23196374	(-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)
2016/8/25	4144	18.57	3976.401162	666.02	167.5988385

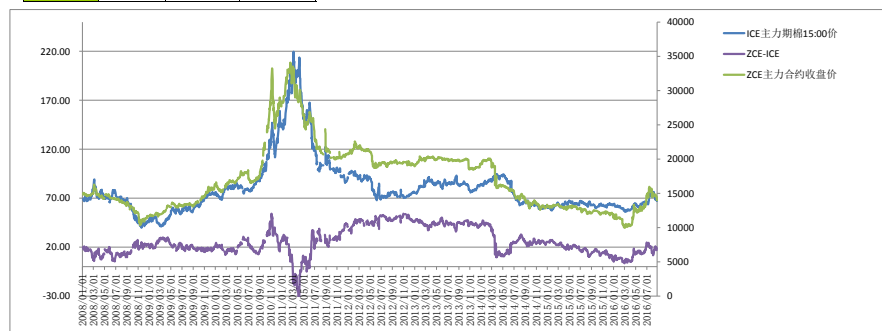
日期	郑州砂磷主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂磷成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年01月	6230	20.32	5511.192923	6.6602	718.81
2017年05月	6273	20.82	5621.517638		651.48

注: 郑州CZCE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		大连豆粕价格		大豆油价格		参数
	2016年08月	1024.75	2016年09月	3076	2016年09月	6146	
	2016年11月	1000.25	2017年01月	2968	2017年01月	6326	汇率
			进口南美大豆, 国内压榨 (16年9月到港)				6.6602
			进口美国大豆, 国内压榨 (17年1月到港)				79.50%
			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
			4.00	41.87	(217356.93)	(288938.76)	18.50%
			1024.7500				加工费 (元/吨)
							130
			美湾豆 (17年1月到港)	国际运费 (美元)	毛利 (元/吨)	净利 (元/吨)	关税
			1000.2500	46.26	(211412.73)	(281928.66)	3%
							港杂费 (元/吨)
							120

参数 (不含港杂费)	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	2017年01月	13980	67.25	11470	2510	21.89%	208	213	170.55
汇率	2017年05月	14020	67.13	11450	2570	22.45%	209	213	170.56
增值税									
进口关税									
杂费									

日期	ICE主力期棉15:00价	ZCE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2016/8/25	67.25	13980	17.00733414



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	263,875	9,175	50,425
铝	2,253,775	-5,325	916,775
镍	372,414	-792	112,884
铅	187,300	-350	67,850
锌	455,075	-200	26,150
锡	4,530	-40	1,580

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)及征求独立专业意见。