

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	37850	-22.00	4817	38181	-331	-0.87%	/	7.68	7.63	7.93
到岸升水	2016年10月	37720	-13.00	4826	38251	-531	-1.39%	0.34%	7.82	7.81	7.93
汇率	2016年11月	37760	-5.50	4833	38310	-550	-1.43%	-0.11%	7.81	7.81	7.93
增值税	2016年12月	37780	1.06	4840	38361	-581	-1.51%	-0.05%	7.81	7.81	7.93
进口关税	2017年01月	37820	5.50	4844	38396	-576	-1.50%	-0.11%	7.81	7.81	7.93
杂费	2017年02月	37860	9.75	4848	38429	-569	-1.48%	-0.11%	7.81	7.81	7.93

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	13220	-7.75	1624	13565	-345	-2.54%	/	8.14	8.12	8.35
到岸升水	2016年10月	12680	-6.75	1625	13573	-893	-6.58%	4.08%	7.80	7.77	8.35
汇率	2016年11月	12420	-3.25	1629	13600	-1180	-8.68%	2.05%	7.63	7.60	8.35
增值税	2016年12月	12190	0.87	1633	13632	-1442	-10.58%	1.85%	7.47	7.45	8.35
进口关税	2017年01月	12025	4.50	1637	13660	-1635	-11.97%	1.35%	7.35	7.33	8.35
杂费	2017年02月	11930	8.00	1640	13688	-1758	-12.84%	0.79%	7.27	7.28	8.35

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	17750	-9.25	2250	16705	-955	-5.11%	/	7.89	7.90	8.31
到岸升水	2016年10月	17655	-6.00	2254	16731	-1076	-5.74%	0.54%	7.83	7.85	8.31
汇率	2016年11月	17660	-2.50	2257	16758	-1098	-5.85%	-0.03%	7.82	7.84	8.31
增值税	2016年12月	17665	0.72	2260	16784	-1119	-5.98%	-0.03%	7.82	7.83	8.31
进口关税	2017年01月	17670	3.75	2263	16808	-1138	-6.05%	-0.03%	7.81	7.82	8.31
杂费	2017年02月	17660	5.50	2265	16821	-1161	-6.17%	0.06%	7.80	7.82	8.31

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	14430	-10.25	1903	16052	-1622	-10.10%	/	7.58	7.50	8.43
到岸升水	2016年10月	14420	-7.75	1906	16072	-1652	-10.28%	0.07%	7.57	7.47	8.43
汇率	2016年11月	14440	-4.00	1910	16102	-1662	-10.32%	-0.14%	7.56	7.49	8.43
增值税	2016年12月	14410	0.67	1914	16140	-1730	-10.72%	0.21%	7.53	7.46	8.43
进口关税	2017年01月	14440	3.50	1917	16163	-1723	-10.66%	-0.21%	7.53	7.47	8.43
杂费	2017年02月	14520	5.00	1919	16175	-1655	-10.23%	-0.55%	7.57	7.46	8.43

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	伦铜安全边际	实际比值		进口比值
									今日	昨日	
伦铜3月价	现货	81050	-44.50	10421	83442	-2392	-2.87%	/	7.78	7.65	8.01
到岸升水	2016年10月	80300	-32.50	10433	83537	-3237	-3.87%	-0.12%	7.70	7.68	8.01
汇率	2016年11月	80380	-17.50	10448	83655	-3275	-3.91%	-0.14%	7.69	7.65	8.01
增值税	2016年12月	81300	3.17	10468	83818	-2518	-3.00%	-0.20%	7.77	7.68	8.01
进口关税	2017年01月	81480	16.50	10482	83823	-2443	-2.91%	-0.13%	7.77	7.77	8.01
杂费	2017年02月	82710	28.50	10494	84018	-1308	-1.56%	-0.11%	7.68	7.76	8.01

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	伦铜安全边际	实际比值		进口比值
									今日	昨日	
伦铜3月价	现货	128250	50.00	19650	163027	-34777	-21.33%	/	6.53	6.47	8.30
到岸升水	2016年10月	122010	40.00	19640	162947	-40937	-25.12%	0.05%	6.21	6.26	8.30
汇率	2016年11月	122720	20.00	19620	162786	-40066	-24.61%	0.10%	6.25	6.29	8.30
增值税	2016年12月	116520	-1.00	19599	162617	-46097	-28.35%	0.11%	5.95	5.98	8.30
进口关税	2017年01月	127010	-14.00	19586	162512	-35502	-21.85%	0.07%	6.48	6.52	8.30
杂费	2017年02月	126780	-37.00	19563	162327	-35547	-21.90%	0.12%	6.48	6.52	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	2016年10月	36950	218.65	38255	-1305	-3.41%	/	168.99	169.42	174.96
汇率	2016年11月	37760	218.90	38298	-538	-1.40%	-0.11%	172.50	173.27	174.96
增值税	2016年12月	37780	219.35	38375	-595	-1.55%	-0.21%	172.24	172.51	174.95
进口关税	2017年01月	37820	220.55	38582	-762	-1.97%	-0.55%	171.48	172.48	174.93
杂费	2017年02月	37860	220.80	38625	-765	-1.98%	-0.11%	171.47	172.42	174.93

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
2016/9/26	288.1	1339.1	287.3533457	667.44	0.746654329	(-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)
2016/9/26	4342	19.635	4213.41419	667.44	128.5858097

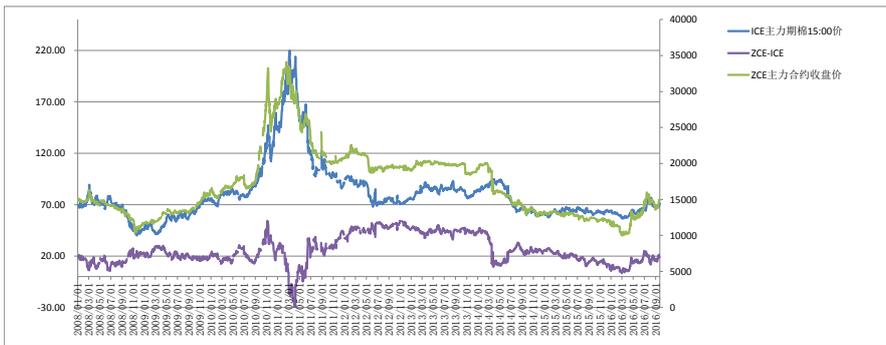
日期	郑州砂糖主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年01月	6610	22.10	5915.393757	6.6744	694.61
2017年05月	6648	22.60	6025.953692		622.05

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11月	2017年01月	2016年11月	2017年01月	2017年01月	2017年05月		
进口大豆	956.5	2866	2718		6458	1罐=60磅=27.2154kg	汇率	6.6744
2017年01月	963	2718			6490		净利率	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)	净利率 (元/吨)			进口大豆出油率	18.50%
956.5000	4.00	41.87	(231260.87)	(270187.76)			加工费 (元/吨)	130
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)	净利率 (元/吨)			关税	3%
963.0000	78.00	46.26	(232965.21)	(272069.88)			港杂费 (元/吨)	120

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	2017年01月	15495	70.68	12070	3425	28.38%	219	211	170.77
汇率	2017年05月	15520	70.94	12113	3407	28.12%	219	211	170.76
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
2016/9/26	70.68	15495	22.50953905



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	364,125	7,250	57,050
铝	2,136,025	-10,700	881,360
镍	362,364	-852	112,512
铅	191,250	250	66,150
锌	442,000	-650	22,675
锡	3,715	0	1,955

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来源均属准确,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而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。