

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	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	46330	-15.00	5674	46296	234	-0.51%	/	8.20	8.35	8.16
到岸升水	2016年12月	45700	-13.00	5676	46312	-812	-1.32%	1.78%	8.05	8.12	8.16
汇率	2017年01月	45980	-6.75	5682	46362	-382	-0.82%	-0.61%	8.09	8.11	8.16
增值税	2017年02月	46100	-2.00	5687	46401	-301	-0.65%	-0.26%	8.11	8.12	8.16
进口关税	2017年03月	46160	2.25	5691	46435	-275	-0.59%	-0.13%	8.11	8.14	8.16
杂费	2017年04月	46200	4.25	5693	46451	-251	-0.54%	-0.09%	8.12	8.16	8.16

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	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	13970	-2.25	1709	14677	-707	-4.82%	/	8.17	8.27	8.59
到岸升水	2016年12月	13680	1.25	1713	14706	-1026	-6.97%	2.08%	7.99	8.07	8.59
汇率	2017年01月	13270	-3.00	1709	14671	-1401	-9.55%	3.00%	7.77	7.84	8.59
增值税	2017年02月	13145	-1.00	1711	14688	-1543	-10.50%	0.94%	7.68	7.75	8.59
进口关税	2017年03月	13175	0.50	1712	14700	-1525	-10.37%	-0.23%	7.70	7.74	8.59
杂费	2017年04月	13215	1.50	1713	14708	-1493	-10.15%	-0.30%	7.71	7.77	8.59

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	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	22520	-14.00	2701	22966	-446	-1.94%	/	8.34	8.42	8.50
到岸升水	2016年12月	22460	-10.50	2705	22994	-534	-2.32%	0.27%	8.30	8.34	8.50
汇率	2017年01月	22545	-8.00	2710	23039	-494	-2.15%	-0.38%	8.32	8.34	8.50
增值税	2017年02月	22590	0.25	2715	23082	-492	-2.13%	-0.20%	8.32	8.33	8.50
进口关税	2017年03月	22585	3.50	2719	23106	-523	-2.28%	0.02%	8.31	8.31	8.50
杂费	2017年04月	22495	5.50	2721	23125	-630	-2.72%	0.40%	8.27	8.33	8.50

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	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	21400	-14.00	2338	20167	1233	6.12%	/	9.15	8.94	8.63
到岸升水	2016年12月	21450	-10.00	2342	20200	1250	6.19%	-0.23%	9.16	8.97	8.63
汇率	2017年01月	20670	-6.50	2346	20229	441	2.18%	3.64%	8.81	8.90	8.62
增值税	2017年02月	20445	-2.50	2350	20262	183	0.90%	1.09%	8.70	8.78	8.62
进口关税	2017年03月	20315	1.00	2353	20291	24	0.12%	0.64%	8.63	8.72	8.62
杂费	2017年04月	20330	2.00	2354	20300	30	0.15%	-0.07%	8.64	8.70	8.62

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	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	91250	-52.25	10938	90298	952	1.05%	/	8.34	8.34	8.26
到岸升水	2016年12月	91580	-39.25	10951	90404	1176	1.30%	-0.12%	8.36	8.20	8.26
汇率	2017年01月	89870	-24.50	10966	90524	454	-0.72%	-0.13%	8.20	8.22	8.26
增值税	2017年02月	90520	-9.00	10981	90650	-130	-0.14%	-0.14%	8.24	8.23	8.26
进口关税	2017年03月	90160	6.75	10997	90778	-618	-0.68%	-0.14%	8.20	8.30	8.26
杂费	2017年04月	93320	24.75	11015	90925	2395	2.63%	-0.16%	8.47	8.29	8.25

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	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	144500	205.00	20595	176046	-31546	-17.92%	/	7.02	7.05	8.55
到岸升水	2016年12月	142060	130.00	20520	175423	-33363	-19.02%	0.36%	6.92	6.79	8.55
汇率	2017年01月	140110	70.00	20460	174925	-34815	-19.90%	0.29%	6.85	6.84	8.55
增值税	2017年02月	143640	30.00	20420	174593	-30953	-17.73%	0.20%	7.03	6.90	8.55
进口关税	2017年03月	148070	-10.00	20380	174261	-26191	-15.03%	0.20%	7.27	7.12	8.55
杂费	2017年04月	148040	-60.00	20330	173846	-25806	-14.84%	0.25%	7.28	6.80	8.55

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12月	45700	257.55	46371	-671	-1.45%	/	177.44	179.63	180.05
汇率	2017年01月	45980	258.50	46539	-559	-1.20%	-0.37%	177.87	178.93	180.04
增值税	2017年02月	46100	257.15	46300	-200	-0.43%	0.52%	179.27	179.15	180.05
进口关税	2017年03月	46160	259.10	46646	-486	-1.04%	-0.76%	178.16	179.72	180.03
杂费	2017年04月	46200	26140.00	463677	-4593477	-99.00%	-998.77%	1.77	175.88	177.49

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
2016/11/30	268.2	1186.9	262.7868923	688.65	5.413107665	(-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)
2016/11/30	4023	16.68	3693.053639	688.65	329.946361

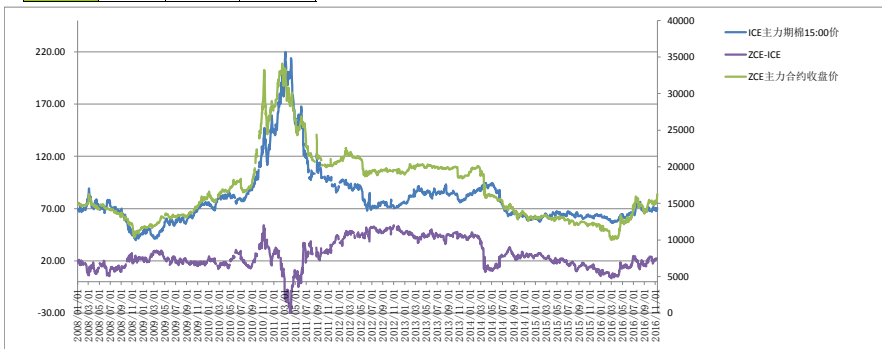
日期	郑州砂磷主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂磷成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年01月	7180	2017年03月	19.66	5529.663303	1650.34
2017年05月	7245	2017年05月	19.12	5406.464113	1838.54

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
	2017年01月	1043.5	2017年01月	3100	2017年01月	6992	1罐=60磅=27.2154kg			
2017年03月	1052	2017年03月	2936	2017年05月	7154	汇率	6.8865			
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	79.50%				
1043.5000	4.00	41.87	(260446.97)	(304215.20)	进口大豆出油率	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)	加工费 (元/吨)	130				
1052.0000	78.00	46.26	(262696.55)	(306729.44)	关税	3%				
					增值税	13%				
					港杂费 (元/吨)	120				

参数 (不含港杂费)	合约月份	磅磅价格	美棉月份	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	15650	2016年12月	72.50	12762	2888	22.63%	216	216	176.03
汇率	2017年05月	15840	2017年03月	72.5	12762	3078	24.12%	218	219	176.03
增值税										
进口关税										
杂费										

日期	ICE主力期货15:00价	ICE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2016/11/30	72.50	15650	18.72284311



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	234,825	-650	90,600
铝	2,149,150	-5,300	760,925
镍	366,834	-216	125,670
锌	442,400	-250	74,550
铅	187,725	-100	45,075
锡	3,105	-25	1,305

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。