

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	47820	-5.00	5894	47867	-47	-0.10%	/	8.11	8.05	8.12
到岸升水	2016年12月	47370	-5.00	5894	47867	-497	-1.04%	0.94%	8.04	8.06	8.12
汇率	2017年01月	47500	-6.50	5882	47855	-355	-0.74%	-0.27%	8.06	8.08	8.12
增值税	2017年02月	47690	-2.75	5886	47885	-195	-0.41%	-0.40%	8.09	8.11	8.12
进口关税	2017年03月	47760	0.50	5899	47911	-151	-0.31%	-0.15%	8.10	8.12	8.12
杂费	2017年04月	47830	1.50	5900	47919	-89	-0.19%	-0.15%	8.11	8.12	8.12

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	13750	1.75	1720	14700	-950	-6.46%	/	8.00	8.10	8.55
到岸升水	2016年12月	13730	2.75	1721	14708	-978	-6.65%	0.15%	7.98	8.05	8.55
汇率	2017年01月	13340	-3.75	1714	14656	-1316	-8.99%	2.84%	7.78	7.82	8.55
增值税	2017年02月	13165	-1.50	1717	14674	-1509	-10.29%	1.31%	7.67	7.68	8.55
进口关税	2017年03月	13195	0.25	1718	14688	-1493	-10.17%	-0.23%	7.68	7.69	8.55
杂费	2017年04月	13250	1.25	1719	14696	-1446	-9.84%	-0.42%	7.71	7.70	8.55

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	23090	-17.75	2737	23159	-69	-0.30%	/	8.44	8.30	8.46
到岸升水	2016年12月	22680	-14.75	2740	23163	-503	-2.17%	1.76%	8.28	8.31	8.46
汇率	2017年01月	22810	-8.50	2746	23234	-424	-1.83%	-0.57%	8.31	8.31	8.46
增值税	2017年02月	22905	-3.50	2751	23275	-370	-1.59%	-0.42%	8.33	8.32	8.46
进口关税	2017年03月	22900	1.25	2755	23313	-413	-1.77%	0.02%	8.31	8.29	8.46
杂费	2017年04月	22905	3.00	2758	23327	-422	-1.81%	-0.02%	8.31	8.31	8.46

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	20480	-15.25	2292	19704	776	3.94%	/	8.93	8.96	8.60
到岸升水	2016年12月	20700	-12.75	2295	19725	975	4.94%	-1.07%	9.02	8.95	8.60
汇率	2017年01月	20350	-7.75	2300	19766	584	2.95%	1.69%	8.85	8.82	8.59
增值税	2017年02月	20095	-3.50	2304	19801	294	1.48%	1.25%	8.72	8.70	8.59
进口关税	2017年03月	19950	0.00	2308	19830	120	0.60%	0.72%	8.65	8.65	8.59
杂费	2017年04月	19920	2.50	2310	19851	69	0.35%	0.15%	8.62	8.67	8.59

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	93300	-50.50	11525	94673	-1373	-1.45%	/	8.10	8.14	8.21
到岸升水	2016年12月	93200	-41.50	11534	94746	-1546	-1.63%	-0.08%	8.08	8.08	8.21
汇率	2017年01月	93680	-26.50	11549	94858	-1189	-1.25%	-0.13%	8.11	8.12	8.21
增值税	2017年02月	93670	-10.50	11565	94998	-1129	-1.19%	-0.14%	8.12	8.17	8.21
进口关税	2017年03月	96950	4.25	11579	95117	833	0.89%	-0.13%	8.29	8.01	8.21
杂费	2017年04月	95300	20.75	11596	95251	49	0.05%	-0.14%	8.22	8.22	8.21

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	145500	215.00	21365	181668	-36168	-19.91%	/	6.81	6.77	8.50
到岸升水	2016年12月	142060	175.00	21325	181338	-39278	-21.66%	0.19%	6.66	6.66	8.50
汇率	2017年01月	145000	100.00	21250	180718	-35718	-19.76%	0.35%	6.82	6.78	8.50
增值税	2017年02月	144920	40.00	21190	180222	-35302	-19.59%	0.28%	6.84	6.83	8.51
进口关税	2017年03月	144840	-4.00	21146	179558	-35018	-19.47%	0.21%	6.85	6.84	8.51
杂费	2017年04月	144750	-59.00	21091	179404	-34654	-19.32%	0.26%	6.86	6.07	8.51

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	47370	266.65	47784	-414	-0.87%	/	177.65	177.59	179.20
汇率	2017年01月	47500	267.50	47934	-434	-0.91%	-0.32%	177.57	178.20	179.19
增值税	2017年02月	47690	268.80	48164	-474	-0.98%	-0.49%	177.42	178.72	179.18
进口关税	2017年03月	47760	267.65	47961	-201	-0.42%	0.43%	178.44	178.72	179.19
杂费	2017年04月	47830	270.15	48403	-573	-1.18%	-0.93%	177.05	180.52	179.17

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
2016/12/6	265.15	1170.8	258.1306336	685.75	7.019366386	(-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)
2016/12/6	4028	16.84	3712.777477	685.75	315.222523

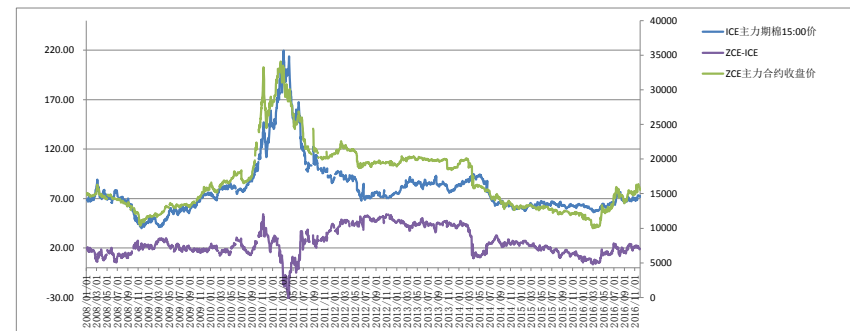
日期	郑州砂磷主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂磷成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年01月	7005	2017年03月	19.00	5358.691578	1646.31
2017年05月	7070	2017年05月	18.56	5258.729786	1811.27

注: 郑州CICE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

进口大豆压榨利润	美豆价格		大连豆粕价格		大豆油价格		参数
	2017年01月	1045	2017年01月	3093	2017年01月	6970	
	2017年03月	1055	2017年03月	2928	2017年05月	7160	汇率
			进口南美大豆 国内压榨 (16年9月到港)				进口大豆出油率
			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)
			4.00	41.87	(259722.56)	(303368.93)	关税
			美湾豆 (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)
			1055.0000	78.00	46.26	(262336.65)	(306308.74)

参数 (不含增值税)	合约月份	铜价	美铜月份	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	15640	2016年12月	72.47	12704	2936	23.11%	216	217	175.30
汇率	2017年05月	15800	2017年03月	72.47	12704	3096	24.37%	218	220	175.30
增值税										
进口关税										
杂费										

日期	ICE主力期棉15:00价	ICE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2016/12/6	72.47	15640	19.08008377



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	229,500	-3,525	101,025
铝	2,116,325	-10,875	733,460
镍	368,910	186	126,114
锌	439,800	-1,575	89,075
铅	187,675	0	44,575
锡	3,185	0	1,120

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。