

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	4768.70	现货	37300	-22.75	4745.95	37858	-559	-1.47%	/	7.86	7.86	7.98
到岸升水	100	2016年10月	37240	-11.75	4756.95	37943	-703	-1.85%	0.16%	7.83	7.85	7.98
汇率	6.6595	2016年11月	37280	-4.75	4763.95	37998	-718	-1.89%	-0.11%	7.83	7.84	7.98
增值税	17%	2016年12月	37300	0.00	4768.7	38035	-735	-1.93%	-0.05%	7.82	7.84	7.98
进口关税	0%	2017年01月	37310	2.25	4770.95	38053	-743	-1.95%	-0.03%	7.82	7.84	7.98
杂费	100	2017年02月	37340	5.75	4774.45	38080	-740	-1.94%	-0.06%	7.82	7.84	7.98

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	1586.80	现货	12480	-14.00	1573	15160	-2680	-17.68%	/	7.93	7.94	9.64
到岸升水	360	2016年10月	12290	-9.25	1578	15197	-2907	-19.13%	1.52%	7.79	7.80	9.63
汇率	6.6595	2016年11月	12065	-5.25	1582	15228	-3163	-20.77%	1.83%	7.63	7.59	9.63
增值税	17%	2016年12月	11905	-0.50	1586	15265	-3360	-22.01%	1.33%	7.50	7.47	9.62
进口关税	0%	2017年01月	11830	2.50	1589	15288	-3458	-22.62%	0.63%	7.44	7.38	9.62
杂费	100	2017年02月	11785	6.50	1593	15319	-3534	-23.07%	0.38%	7.40	7.34	9.61

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	2266.40	现货	17980	-14.25	2252	16757	-777	-4.14%	/	7.98	8.01	8.33
到岸升水	125	2016年10月	17940	-7.75	2259	16806	-868	-4.62%	0.22%	7.94	7.94	8.33
汇率	6.6595	2016年11月	17915	-3.75	2263	16840	-925	-4.91%	0.14%	7.92	7.92	8.33
增值税	17%	2016年12月	17890	0.00	2266	16869	-979	-5.19%	0.14%	7.89	7.89	8.33
进口关税	1%	2017年01月	17865	1.75	2268	16883	-1019	-5.39%	0.14%	7.88	7.87	8.33
杂费	50	2017年02月	17840	3.50	2270	16897	-1057	-5.59%	0.14%	7.86	7.86	8.32

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	1962.10	现货	14350	-2.75	1959	16547	-2197	-13.28%	/	7.32	7.34	8.45
到岸升水	90	2016年10月	14420	-5.25	1957	16527	-2107	-12.75%	-0.49%	7.37	7.37	8.45
汇率	6.6595	2016年11月	14475	-2.50	1960	16549	-2074	-12.53%	-0.38%	7.39	7.38	8.44
增值税	17%	2016年12月	14490	0.25	1962	16571	-2081	-12.56%	-0.10%	7.38	7.37	8.44
进口关税	3%	2017年01月	14510	2.25	1964	16587	-2077	-12.52%	-0.14%	7.39	7.37	8.44
杂费	100	2017年02月	14490	3.50	1966	16597	-2107	-12.69%	0.14%	7.37	7.50	8.44

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	10207	现货	78800	-49.25	10158	80952	-2152	-2.66%	/	7.76	7.87	7.97
到岸升水	110	2016年10月	79400	-33.25	10174	81078	-1878	-2.07%	-0.16%	7.80	7.89	7.97
汇率	6.6595	2016年11月	78680	-17.75	10189	81200	-2520	-3.10%	-0.15%	7.72	7.89	7.97
增值税	17%	2016年12月	78950	0.75	10208	81346	-2396	-2.95%	-0.18%	7.73	7.91	7.97
进口关税	1%	2017年01月	80810	16.25	10223	81468	-858	-1.05%	-0.15%	7.88	7.94	7.97
杂费	150	2017年02月	79980	31.75	10239	81590	-1610	-1.97%	-0.15%	7.81	7.97	7.97

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	19401	现货	125250	1.50	19403	160677	-35427	-22.05%	/	6.46	6.48	8.28
到岸升水	600	2016年10月	122010	6.50	19408	160717	-38707	-24.08%	-0.03%	6.29	6.52	8.28
汇率	6.6595	2016年11月	122720	1.50	19403	160677	-37957	-23.62%	0.03%	6.32	6.38	8.28
增值税	17%	2016年12月	116520	-0.50	19401	160661	-44141	-27.47%	0.01%	6.01	6.22	8.28
进口关税	3%	2017年01月	124530	-13.50	19388	160557	-36027	-22.44%	0.07%	6.42	6.44	8.28
杂费	150	2017年02月	127760	-33.50	19368	160396	-32636	-20.35%	0.10%	6.60	6.65	8.28

参数	合约月份	沪铝价格	美铝价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	美铝安全边际	实际比值		进口比值	
								今日	昨日		
到岸升水	70	2016年10月	36950	214.70	37492	-542	-1.45%	/	172.10	172.42	174.62
汇率	6.6595	2016年11月	37280	216.05	37724	-444	-1.18%	-0.63%	172.55	172.60	174.61
增值税	0.17	2016年12月	37300	215.65	37655	-355	-0.94%	0.19%	172.97	173.22	174.61
进口关税	0%	2017年01月	37310	215.70	37663	-353	-0.94%	-0.02%	172.97	173.26	174.61
杂费	150	2017年02月	37340	216.30	37766	-426	-1.13%	-0.28%	172.63	172.11	174.60

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
2016/9/20	284.85	1320.4	282.7080378	665.95	2.141962186	(-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)
2016/9/20	4302	19.31	4134.423061	665.95	167.5769387

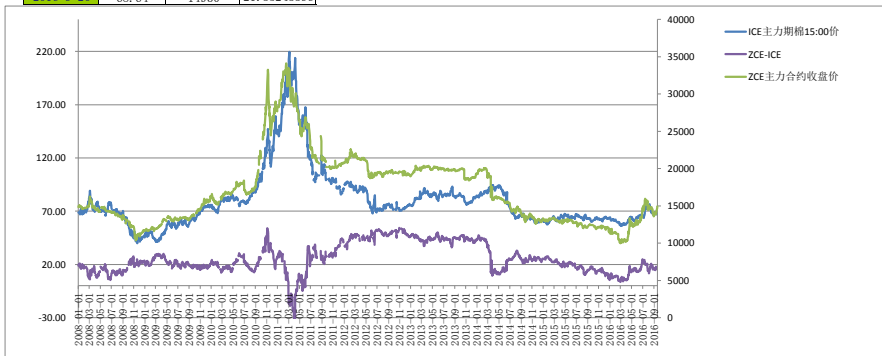
日期	郑州砂磷主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂磷成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年01月	6432	22.07	5896.765938	6.6595	535.23
2017年05月	6476	22.74	6044.585518		431.41

注: 郑州CICE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

参数	合约月份	美豆价格	国内压榨 (16年9月到港)	国际运费 (美元)	毛利 (元/吨)	净利 (元/吨)	美豆 (元/吨)	国内压榨 (17年1月到港)	国际运费 (美元)	毛利 (元/吨)	净利 (元/吨)	美豆 (元/吨)	国内压榨 (元/吨)	美豆 (元/吨)
2016年11月	980.25	2017年01月	2977	2017年01月	6380	1罐=60磅=27.2154kg	参数							
2017年01月	986	2017年05月	2767	2017年05月	6440	汇率	6.6595							
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)	进口美豆出油率	79.50%								
980.2500	4.00	41.87	(238476.03)	(276268.80)	进口美豆出油率	18.50%								
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)	加工费 (元/吨)	130								
986.0000	78.00	46.26	(238036.78)	(277976.96)	关税	3%								
					港杂费 (元/吨)	120								

参数 (不含港杂费)	合约月份	美棉价格	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	70	2017年01月	14830	2016年12月	68.64	11701	3229	27.59%	218	214	170.48	
汇率	6.6595	2017年05月	15030	2017年03月	68.58	11691	3339	28.56%	219	217	170.48	
增值税	13%											
进口关税	1%											
杂费	200											

日期	ICE主力期货15:00价	ICE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2016-9-20	68.64	14930	21.35243396



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	347,950	-1,675	54,500
铝	2,168,175	6,700	861,700
镍	365,784	-1,074	114,648
锡	189,025	875	66,375
锌	444,400	0	23,600
铅	3,750	-75	765

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。