

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	4809.80	现货	37640	-23.37	4786	37915	-175	-0.46%	/	7.86	7.86	7.90
到岸升水	60	2016年10月	37600	-13.37	4786	37893	-293	-0.77%	0.11%	7.84	7.84	7.90
汇率	6.6513	2016年11月	37650	-6.37	4803	37947	-297	-0.78%	-0.13%	7.84	7.82	7.90
增值税	17%	2016年12月	37690	-0.12	4810	37996	-306	-0.81%	-0.11%	7.84	7.82	7.90
进口关税	0%	2017年01月	37720	3.13	4813	38021	-301	-0.79%	-0.08%	7.84	7.82	7.90
杂费	100	2017年02月	37770	7.38	4817	38054	-284	-0.75%	-0.13%	7.84	7.82	7.90

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	1603.00	现货	13200	-10.10	1593	15298	-2098	-13.71%	/	8.29	8.10	9.60
到岸升水	360	2016年10月	12555	-8.35	1595	15311	-2756	-18.00%	4.89%	7.87	7.86	9.60
汇率	6.6513	2016年11月	12310	-4.85	1598	15338	-3028	-19.74%	1.95%	7.70	7.71	9.60
增值税	17%	2016年12月	12120	-0.10	1603	15375	-3255	-21.17%	1.54%	7.56	7.57	9.59
进口关税	0%	2017年01月	11980	2.65	1606	15397	-3417	-22.19%	1.16%	7.46	7.49	9.59
杂费	100	2017年02月	11915	6.65	1610	15428	-3513	-22.77%	0.54%	7.40	7.44	9.58

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	2292.50	现货	18080	-12.86	2280	18950	-870	-4.59%	/	7.93	7.91	8.31
到岸升水	125	2016年10月	17910	-7.86	2285	18989	-1079	-5.68%	0.94%	7.84	7.86	8.31
汇率	6.6513	2016年11月	17910	-4.11	2288	19019	-1109	-5.83%	0.00%	7.83	7.84	8.31
增值税	17%	2016年12月	17915	-0.11	2292	19050	-1135	-5.98%	-0.03%	7.81	7.81	8.31
进口关税	1%	2017年01月	17910	2.89	2295	19074	-1164	-6.10%	0.03%	7.80	7.80	8.31
杂费	50	2017年02月	17900	4.39	2297	19086	-1186	-6.21%	0.06%	7.79	7.79	8.31

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	1954.70	现货	14500	-8.60	1946	16420	-1920	-11.69%	/	7.45	7.36	8.44
到岸升水	90	2016年10月	14520	-6.60	1948	16436	-1916	-11.66%	-0.14%	7.45	7.38	8.44
汇率	6.6513	2016年11月	14550	-3.35	1951	16462	-1912	-11.62%	-0.21%	7.46	7.40	8.44
增值税	17%	2016年12月	14560	-0.10	1955	16488	-1928	-11.70%	-0.07%	7.45	7.39	8.44
进口关税	3%	2017年01月	14585	2.65	1957	16511	-1926	-11.66%	-0.17%	7.45	7.41	8.44
杂费	100	2017年02月	14570	4.15	1959	16523	-1953	-11.82%	0.10%	7.44	7.44	8.43

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	10462	现货	81150	-49.55	10412	82855	-1705	-2.06%	/	7.79	7.76	7.96
到岸升水	110	2016年10月	81110	-34.55	10427	82973	-1863	-2.24%	-0.14%	7.78	7.75	7.96
汇率	6.6513	2016年11月	80630	-19.05	10443	83094	-2464	-3.07%	-0.15%	7.72	7.77	7.96
增值税	17%	2016年12月	80930	-0.55	10461	83240	-2310	-2.77%	-0.18%	7.74	7.70	7.96
进口关税	1%	2017年01月	81700	14.95	10477	83362	-1662	-1.99%	-0.15%	7.80	7.84	7.96
杂费	150	2017年02月	82390	29.45	10491	83476	-1086	-1.30%	-0.14%	7.85	7.84	7.96

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	19419	现货	125250	11.35	19430	160703	-35453	-22.06%	/	6.45	6.44	8.27
到岸升水	600	2016年10月	122010	13.35	19432	160719	-38709	-24.08%	-0.01%	6.28	6.27	8.27
汇率	6.6513	2016年11月	122720	3.35	19422	160639	-37919	-23.60%	0.05%	6.32	6.31	8.27
增值税	17%	2016年12月	116520	0.35	19419	160615	-44095	-27.45%	0.02%	6.00	5.99	8.27
进口关税	3%	2017年01月	126220	-12.65	19406	160511	-34291	-21.36%	0.07%	6.50	6.40	8.27
杂费	150	2017年02月	125420	-28.65	19390	160382	-34962	-21.80%	0.08%	6.47	6.58	8.27

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	216.95	37831	-881	-2.33%	/	170.32	171.58	174.38
汇率	6.6513	2016年11月	37650	217.00	37840	-190	-0.50%	-0.02%	173.50	172.57	174.38
增值税	0.17	2016年12月	37690	217.80	37977	-287	-0.76%	-0.37%	173.05	173.07	174.37
进口关税	0%	2017年01月	37720	215.95	37660	60	0.16%	0.85%	174.67	172.21	174.39
杂费	150	2017年02月	37770	216.20	37703	67	0.18%	-0.12%	174.70	172.15	174.39

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
2016/9/22	287.7	1337.5	286.016692	665.13	1.683330801	(-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)
2016/9/22	4385	19.81	4236.254368	665.13	148.7456323

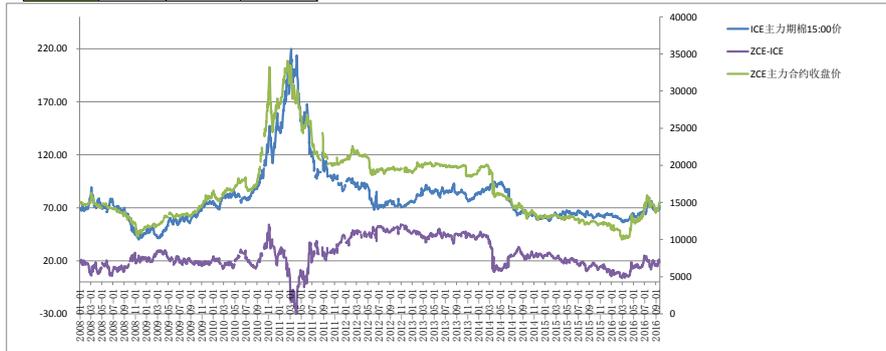
日期	郑州砂磷主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂磷成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年01月	6473	22.30	5940.846643	6.6513	532.15
2017年05月	6512	22.88	6068.652297		443.35

注: 郑州CZCE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

参数	合约月份	大豆价格	大豆压榨价格			参数	
			进口大豆	国内压榨	净利率		
2016年11月	970.5	2017年01月	2938	2017年01月	6372	1罐=60磅=27.2154kg	
2017年01月	976	2017年05月	2757	2017年05月	6416	汇率	6.6513
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	79.50%	
970.5000	4.00	41.87	(233829.92)	(273183.29)	进口大豆出油率	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)	净利率 (元/吨)	加工费 (元/吨)	130	
976.0000	78.00	46.26	(235308.04)	(274798.70)	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	14910	2016年12月	71.62	12186	2724	22.35%	208	212	170.15
汇率	6.6513	2017年05月	15000	2017年03月	71.40	12149	2851	23.47%	210	213	170.16
增值税	13%										
进口关税	1%										
杂费	200										

日期	ICE主力期棉15:00价	ZCE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2016-9-22	71.62	14910	18.36267928



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	346,050	-1,750	53,225
铝	2,153,425	-8,150	883,675
镍	364,902	120	114,824
铅	191,025	-200	66,175
锌	443,850	-300	23,050
锡	3,745	0	760

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。