

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	5757.00	现货	47920	-15.25	5742	46962	1059	2.28%	/	8.35	8.10	8.16
到岸升水	60	2016年12月	46640	-12.75	5744	46882	-242	-0.52%	2.67%	8.12	8.18	8.16
汇率	6.8889	2017年01月	46610	-6.75	5750	46931	-321	-0.68%	0.06%	8.11	8.21	8.16
增值税	17%	2017年02月	46750	-2.50	5755	46965	-215	-0.48%	-0.30%	8.12	8.24	8.16
进口关税	0%	2017年03月	46890	2.00	5759	47001	-111	-0.24%	-0.30%	8.14	8.25	8.16
杂费	100	2017年04月	47030	3.00	5760	47009	21	0.04%	-0.30%	8.16	8.26	8.16

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	1733.00	现货	14310	-2.00	1731	14858	-548	-3.69%	/	8.27	8.21	8.58
到岸升水	100	2016年12月	13990	0.75	1734	14880	-890	-5.98%	2.24%	8.07	8.09	8.58
汇率	6.8889	2017年01月	13570	-3.00	1730	14850	-1280	-8.62%	3.00%	7.84	7.93	8.58
增值税	17%	2017年02月	13420	-1.50	1732	14862	-1442	-9.70%	1.11%	7.75	7.86	8.58
进口关税	0%	2017年03月	13425	0.75	1734	14880	-1455	-9.78%	-0.04%	7.74	7.85	8.58
杂费	100	2017年04月	13475	1.75	1735	14888	-1413	-9.49%	-0.37%	7.77	7.86	8.58

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	2855.00	现货	23930	-13.75	2841	24116	-186	-0.77%	/	8.42	8.26	8.49
到岸升水	115	2016年12月	23735	-8.75	2846	24156	-421	-1.74%	0.81%	8.34	8.27	8.49
汇率	6.8889	2017年01月	23780	-3.50	2852	24199	-419	-1.73%	-0.19%	8.34	8.26	8.49
增值税	17%	2017年02月	23785	0.79	2856	24234	-449	-1.85%	-0.02%	8.33	8.26	8.49
进口关税	1%	2017年03月	23765	3.75	2859	24258	-493	-2.03%	0.08%	8.31	8.23	8.49
杂费	50	2017年04月	23830	5.25	2860	24270	-440	-1.81%	-0.27%	8.33	8.23	8.49

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	2460.00	现货	21900	-9.00	2451	21112	788	3.73%	/	8.94	8.48	8.61
到岸升水	80	2016年12月	22030	-5.00	2455	21145	885	4.18%	-0.59%	8.97	8.92	8.61
汇率	6.8889	2017年01月	21865	-3.00	2457	21162	703	3.32%	0.75%	8.90	8.64	8.61
增值税	17%	2017年02月	21605	-0.46	2460	21183	422	1.99%	1.19%	8.78	8.44	8.61
进口关税	3%	2017年03月	21455	1.50	2462	21199	256	1.21%	0.69%	8.72	8.38	8.61
杂费	100	2017年04月	21420	1.00	2461	21195	225	1.06%	0.16%	8.70	8.35	8.61

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	11360	现货	94300	-47.50	11313	93380	920	0.98%	/	8.34	8.10	8.25
到岸升水	140	2016年12月	92900	-36.50	11324	93470	-670	-0.72%	-0.10%	8.20	8.19	8.25
汇率	6.8889	2017年01月	93210	-22.00	11338	93588	-378	-0.40%	-0.13%	8.22	8.24	8.25
增值税	17%	2017年02月	93400	-6.00	11354	93718	-318	-0.34%	-0.14%	8.23	8.25	8.25
进口关税	1%	2017年03月	94420	9.50	11370	93844	576	0.61%	-0.14%	8.30	8.08	8.25
杂费	150	2017年04月	94340	26.50	11387	93983	357	0.38%	-0.15%	8.29	8.12	8.25

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	20800	现货	148000	205.00	21005	179511	-31511	-17.55%	/	7.05	6.90	8.55
到岸升水	600	2016年12月	142060	130.00	20930	178888	-36828	-20.59%	0.36%	6.79	0.00	8.55
汇率	6.8889	2017年01月	142650	70.00	20870	178390	-35740	-20.03%	0.29%	6.84	0.00	8.55
增值税	17%	2017年02月	143640	26.25	20826	178027	-34387	-19.32%	0.21%	6.90	0.00	8.55
进口关税	3%	2017年03月	148070	-10.00	20790	177726	-29656	-16.69%	0.17%	7.12	0.00	8.55
杂费	150	2017年04月	141100	-60.00	20740	177311	-36211	-20.42%	0.24%	6.80	0.00	8.55

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12月	46640	259.65	46760	-120	-0.26%	/	179.63	180.30	180.09
汇率	6.8889	2017年01月	46610	260.50	46911	-301	-0.64%	-0.33%	178.93	180.95	180.08
增值税	0.17	2017年02月	46750	260.95	46991	-241	-0.51%	-0.17%	179.15	181.68	180.08
进口关税	0%	2017年03月	46890	260.90	46982	-92	-0.20%	0.02%	179.72	181.31	180.08
杂费	150	2017年04月	47030	267.40	48136	-1106	-2.30%	-2.49%	175.88	185.18	180.01

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
2016/11/29	269.8	1190.9	263.7644087	688.89	6.035591323	(-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)
2016/11/29	4046	16.59	3674.407205	688.89	371.5927954

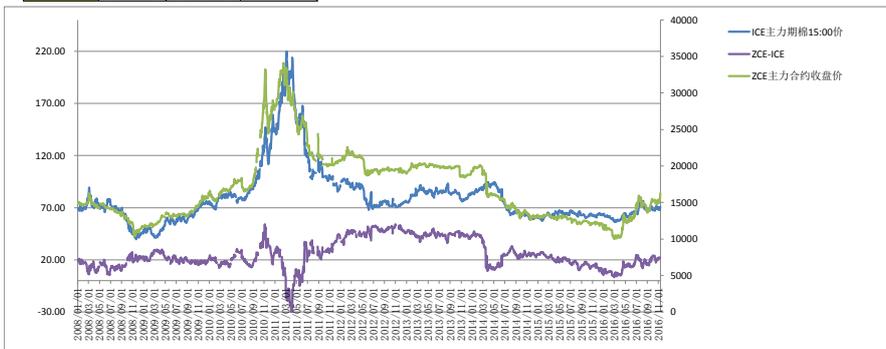
日期	郑州白糖主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年01月	7270	20.15	5643.234454	6.8889	1626.77
2017年05月	7320	19.58	5513.145544		1806.85

注: 郑州CICE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

参数	美豆价格		大豆压榨价格		大豆油价格		参数	
	2017年01月	1051.75	2017年01月	3126	2017年01月	6948		1罐=60磅=27.2154kg
进口大豆压榨压榨率	2017年03月	1060.5	2017年03月	2975	2017年05月	7120	汇率	6.8889
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%
1051.7500	4.00	41.87	(262615.00)	(306740.71)	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 (元/吨)	加工费 (元/吨)			130
1060.5000	78.00	46.26	(261916.56)	(309317.37)	关税			3%
					增值税			13%
					港杂费 (元/吨)			120

参数 (不含增值税)	合约月份	郑糖价格	美糖价格	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	15755	2016年12月	72.79	12817	2938	22.92%	216	220	176.08
汇率	6.8889	2017年05月	16000	2017年03月	73.03	12859	3141	24.43%	219	228	176.07
增值税	13%										
进口关税	1%										
杂费	200										

日期	ICE主力期棉15-00价	ICE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2016/11/29	72.79	15755	19.01288732



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	235,475	1,225	82,825
铝	2,155,050	-3,225	766,925
镍	367,050	-42	126,904
锌	442,850	-175	74,325
铅	187,825	0	45,175
锡	3,130	60	1,315

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。