

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	5842.00	现货	47000	-2.31	5840	47638	-638	-1.34%	/	8.05	8.04	8.16
到岸升水	60	2016年12月	47070	-4.31	5838	47622	-652	-1.18%	-0.15%	8.06	8.05	8.16
汇率	6.887	2017年01月	47170	-5.31	5837	47614	-444	-0.93%	-0.21%	8.08	8.06	8.16
增值税	17%	2017年02月	47369	-2.31	5840	47638	-278	-0.58%	-0.40%	8.11	8.08	8.16
进口关税	0%	2017年03月	47450	0.69	5843	47663	-213	-0.45%	-0.19%	8.12	8.09	8.16
杂费	100	2017年04月	47450	0.94	5843	47665	-215	-0.46%	0.00%	8.12	8.09	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	1718.00	现货	13920	0.50	1719	14753	-833	-5.65%	/	8.10	8.16	8.58
到岸升水	100	2016年12月	13840	2.00	1720	14765	-925	-6.27%	0.57%	8.05	8.11	8.58
汇率	6.887	2017年01月	13405	-4.00	1714	14717	-1312	-8.91%	3.14%	7.82	7.89	8.59
增值税	17%	2017年02月	13185	-1.75	1716	14735	-1550	-10.52%	1.64%	7.68	7.77	8.59
进口关税	0%	2017年03月	13205	0.00	1718	14749	-1544	-10.47%	-0.15%	7.69	7.75	8.59
杂费	100	2017年04月	13240	1.25	1719	14759	-1519	-10.29%	-0.27%	7.70	7.76	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	2732.00	现货	22520	-17.86	2714	23075	-555	-2.40%	/	8.30	8.22	8.50
到岸升水	115	2016年12月	22570	-14.61	2717	23101	-531	-2.30%	-0.22%	8.31	8.25	8.50
汇率	6.887	2017年01月	22620	-8.36	2724	23152	-532	-2.30%	-0.22%	8.31	8.25	8.50
增值税	17%	2017年02月	22710	-3.11	2729	23195	-485	-2.09%	-0.40%	8.32	8.26	8.50
进口关税	1%	2017年03月	22660	-1.39	2733	23231	-671	-2.46%	0.22%	8.29	8.25	8.50
杂费	50	2017年04月	22720	3.39	2735	23248	-628	-2.27%	-0.26%	8.31	8.22	8.50

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	2300.50	现货	20480	-15.90	2285	19725	755	3.83%	/	8.96	9.07	8.63
到岸升水	80	2016年12月	20470	-13.15	2287	19748	722	3.66%	0.05%	8.95	8.88	8.63
汇率	6.887	2017年01月	20210	-8.40	2292	19787	423	2.14%	1.27%	8.82	8.79	8.63
增值税	17%	2017年02月	19985	-3.90	2297	19825	160	0.81%	1.11%	8.70	8.67	8.63
进口关税	3%	2017年03月	19895	0.35	2301	19860	35	0.18%	0.45%	8.65	8.60	8.63
杂费	100	2017年04月	19960	2.85	2303	19881	79	0.40%	-0.33%	8.67	8.57	8.63

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	11570	现货	93800	-51.94	11518	95028	-1228	-1.29%	/	8.14	8.17	8.25
到岸升水	140	2016年12月	93760	-41.94	11528	95109	-1969	-2.06%	-0.09%	8.08	8.07	8.25
汇率	6.887	2017年01月	93760	-26.44	11544	95235	-1475	-1.53%	-0.13%	8.12	8.14	8.25
增值税	17%	2017年02月	94470	-10.69	11559	95363	-893	-0.94%	-0.14%	8.17	8.14	8.25
进口关税	1%	2017年03月	92740	3.81	11574	95481	-2741	-2.87%	-0.13%	8.01	8.29	8.25
杂费	150	2017年04月	95300	20.31	11590	95616	-316	-0.33%	-0.14%	8.22	8.17	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	21175	现货	145000	231.48	21406	182793	-37793	-20.68%	/	6.77	6.80	8.54
到岸升水	600	2016年12月	142060	166.48	21341	182254	-40194	-22.06%	0.30%	6.66	6.69	8.54
汇率	6.887	2017年01月	144160	91.48	21266	181631	-37471	-20.63%	0.35%	6.78	6.81	8.54
增值税	17%	2017年02月	144920	31.48	21206	181133	-36213	-19.99%	0.28%	6.83	6.87	8.54
进口关税	3%	2017年03月	144840	-3.52	21171	180843	-36003	-19.91%	0.17%	6.84	7.03	8.54
杂费	150	2017年04月	149350	-58.52	21116	180386	-31036	-17.21%	0.26%	7.07	6.90	8.54

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	47070	265.05	47705	-635	-1.33%	/	177.59	178.57	179.99
汇率	6.887	2017年01月	47170	264.70	47643	-473	-0.99%	0.13%	178.20	177.62	179.99
增值税	0.17	2017年02月	47360	265.00	47696	-336	-0.71%	-0.11%	178.72	179.31	179.99
进口关税	0%	2017年03月	47450	265.50	47785	-335	-0.70%	-0.19%	178.72	177.97	179.99
杂费	150	2017年04月	47450	262.85	47315	135	0.29%	1.00%	180.52	176.57	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
2016/12/5	265.7	1174	259.9496262	688.7	5.750373785	(-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)
2016/12/5	4030	16.685	3694.428887	688.7	335.5711129

日期	郑州砂糖主力合约	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	7037	2017年03月	19.19	5422.789163	1614.21
2017年05月	7082	2017年05月	18.77	5326.960614	1755.04

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		大连豆油价格		参数		
	2017年01月	1038	2017年01月	3082	2017年01月	6992		1罐=60磅=27.2154kg	
	2017年03月	1048	2017年05月	2916	2017年05月	7184	汇率	6.887	
	南美豆 (16年9月到港)		进口南美大豆 国内压榨 (16年9月到港)				进口美豆出油率	79.50%	
	1038.0000	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	41.87	毛利 (元/吨)	(259088.47)	净利 (元/吨)	(302631.75)	进口美豆出油率	18.50%
		4.00	进口美豆大豆 国内压榨 (17年1月到港)				加工费 (元/吨)	130	
	美湾豆 (17年1月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	46.26	毛利 (元/吨)	(261713.81)	净利 (元/吨)	(305383.98)	美国	3%
	1048.0000	78.00					港杂费 (元/吨)	120	

参数 (不含增值税)	合约月份	美棉价格	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	15630	71.98	12673	2957	23.33%	217	176.06
汇率	6.887	2017年05月	15730	71.35	12564	3166	25.20%	220	219
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
2016/12/5	71.98	15630	19.11965003



每日LME库存:

品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	233,025	-1,000	96,350
铝	2,128,200	-10,075	744,325
镍	368,724	1,896	126,432
锌	441,375	-125	90,450
铅	187,175	-50	44,575
锡	3,185	-25	1,095

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。