

品种	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	
铜进口套利	伦铜3月价	现货	45240	-19.52	5566	45300	-60	-0.13%	/	8.13	8.06	8.14
	到岸升水	2017年01月	45090	-14.52	5571	45340	-250	-0.55%	0.33%	8.09	8.04	8.14
	汇率	2017年02月	45180	-9.02	5576	45384	-204	-0.45%	-0.20%	8.10	8.05	8.14
	增值税	2017年03月	45350	-3.52	5582	45429	-79	-0.17%	-0.38%	8.12	8.08	8.14
	进口关税	2017年04月	45440	0.23	5586	45459	-19	-0.04%	-0.20%	8.14	8.10	8.14
	杂费	2017年05月	45550	4.23	5590	45491	59	0.13%	-0.24%	8.15	8.12	8.14

品种	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	
铝进口套利	伦铝3月价	现货	12680	7.23	1601	13768	-1088	-7.90%	/	7.92	7.44	8.60
	到岸升水	2017年01月	12535	1.23	1595	13720	-1185	-8.64%	1.14%	7.86	7.42	8.60
	汇率	2017年02月	12505	-4.27	1590	13676	-1171	-8.56%	0.24%	7.87	7.43	8.60
	增值税	2017年03月	12510	-1.52	1592	13698	-1188	-8.67%	-0.04%	7.86	7.43	8.60
	进口关税	2017年04月	12570	0.23	1594	13712	-1142	-8.33%	-0.48%	7.88	7.45	8.60
	杂费	2017年05月	12620	2.23	1596	13728	-1108	-8.07%	-0.40%	7.91	7.48	8.60

品种	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	
锌进口套利	伦锌3月价	现货	21660	-17.11	2573	21865	-205	-0.94%	/	8.42	8.31	8.50
	到岸升水	2017年01月	21095	-13.11	2577	21897	-802	-3.66%	2.61%	8.18	8.15	8.50
	汇率	2017年02月	21190	-8.36	2582	21936	-746	-3.40%	-0.45%	8.21	8.14	8.50
	增值税	2017年03月	21215	-2.61	2588	21983	-768	-3.49%	-0.12%	8.20	8.14	8.49
	进口关税	2017年04月	21195	1.39	2592	22015	-820	-3.72%	0.09%	8.18	8.12	8.49
	杂费	2017年05月	21180	4.14	2595	22037	-857	-3.89%	0.07%	8.16	8.10	8.49

品种	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	
镍进口套利	伦镍3月价	现货	17860	-17.30	2028	17542	318	1.82%	/	8.81	8.64	8.65
	到岸升水	2017年01月	18090	-13.05	2032	17577	513	2.92%	-1.29%	8.90	8.71	8.65
	汇率	2017年02月	17960	-8.55	2036	17614	346	1.96%	0.72%	8.82	8.62	8.65
	增值税	2017年03月	17865	-3.55	2041	17655	210	1.19%	0.53%	8.75	8.57	8.65
	进口关税	2017年04月	17810	0.70	2046	17691	119	0.68%	0.31%	8.71	8.54	8.65
	杂费	2017年05月	17790	3.20	2048	17711	79	0.44%	0.11%	8.69	8.54	8.65

品种	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	伦铝安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
伦铝升贴水	伦铝3月价	现货	85000	-54.43	10131	83491	1509	1.81%	/	8.39	8.31	8.24
	到岸升水	2017年01月	83150	-47.83	10137	83543	-393	-0.47%	-0.06%	8.20	8.18	8.24
	汇率	2017年02月	84080	-30.18	10155	83697	383	0.47%	-0.18%	8.28	8.23	8.24
	增值税	2017年03月	84640	-11.83	10173	83835	805	0.96%	-0.18%	8.32	8.23	8.24
	进口关税	2017年04月	84390	5.57	10191	83977	413	0.49%	-0.17%	8.28	8.20	8.24
	杂费	2017年05月	84810	20.57	10206	84099	711	0.85%	-0.15%	8.31	8.27	8.24

品种	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	伦铝安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
伦铝升贴水	伦铝3月价	现货	153000	78.45	21178	180371	-27371	-15.17%	/	7.22	7.05	8.52
	到岸升水	2017年01月	151130	75.45	21175	180346	-29216	-16.20%	0.01%	7.14	7.12	8.52
	汇率	2017年02月	152650	60.45	21160	180222	-27572	-15.30%	0.07%	7.21	7.02	8.52
	增值税	2017年03月	155710	35.45	21135	180015	-24305	-13.50%	0.12%	7.37	7.02	8.52
	进口关税	2017年04月	152950	-4.55	21095	179684	-26734	-14.88%	0.19%	7.25	7.17	8.52
	杂费	2017年05月	152900	-24.55	21075	179518	-26618	-14.83%	0.09%	7.25	7.33	8.52

品种	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	
美铝进口套利	到岸升水	2017年01月	45090	252.95	45425	-335	-0.74%	/	178.26	176.79	179.58
	汇率	2017年02月	45180	254.10	45628	-448	-0.98%	-0.45%	177.80	176.68	179.57
	增值税	2017年03月	45350	253.35	45495	-145	-0.32%	0.30%	179.00	177.71	179.57
	进口关税	2017年04月	45440	253.00	45433	7	0.01%	0.14%	179.60	178.01	179.58
	杂费	2017年05月	45550	254.00	45610	-60	-0.13%	-0.40%	179.33	178.35	179.57

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
2017/1/6	268.85	1174.8	259.3637959	686.68	9.486204052	(-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)
2017/1/6	4075	16.4	3620.672671	686.68	454.3273293

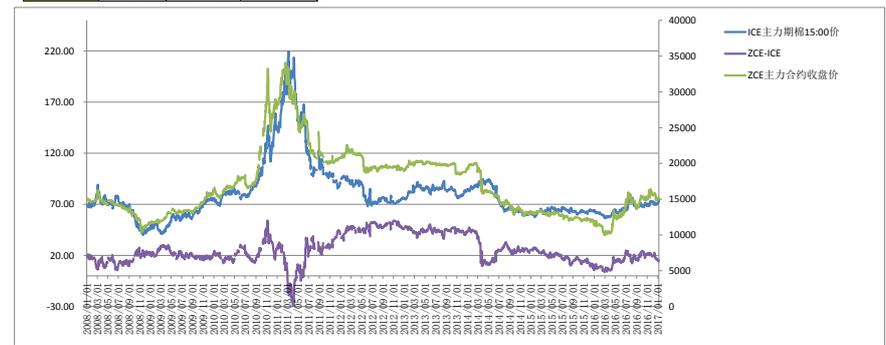
日期	郑州砂磷主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂磷成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年01月	6970	20.66	5742.872055	6.8668	1227.13
2017年05月	6791	20.40	5683.723616		1107.28

注: 郑州CZCE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

品种	大豆价格		大豆压榨价格		大豆油价格		参数
	2017年01月	2017年03月	2017年01月	2017年03月	2017年01月	2017年03月	
进口大豆压榨利润	999.5	1007.5	41.87	41.87	(218668.90)	(290492.69)	汇率
	进口美国大豆 国内压榨 (16年9月到港)						净利率 (%)
	净利率 (16年9月到港)						79.50%
	净利率 (17年1月到港)						18.50%
	净利率 (17年1月到港)						3%
	净利率 (17年1月到港)						13%

品种	参数	合约月份	期货价格	美糖月份	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		
糖进口套利	到岸升水	2017年01月	15015	2017年03月	73.63	12922	2093	16.20%	204	203	175.49	
	汇率	2017年02月	15185	2017年05月	73.75	12942	2243	17.33%	206	206	175.49	
	增值税											
	进口关税											
	杂费											

日期	ICE主力期棉15:00价	ZCE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2017/1/6	73.63	15185	15.13631912



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。