

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	5776.50	现货	46790	-22.03	5754	47200	-410	-0.87%	/	8.13	8.11	8.20
到岸升水	60	2017年01月	46880	-18.03	5758	47232	-352	-0.75%	-0.19%	8.14	8.33	8.20
汇率	6.9235	2017年02月	46960	-10.28	5766	47295	-335	-0.71%	-0.17%	8.14	8.33	8.20
增值税	17%	2017年03月	47160	-3.78	5773	47348	-188	-0.40%	-0.43%	8.17	8.36	8.20
进口关税	0%	2017年04月	47270	0.22	5777	47380	-110	-0.23%	-0.23%	8.18	8.37	8.20
杂费	100	2017年05月	47450	3.22	5780	47405	45	0.10%	-0.38%	8.21	8.40	8.20

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	1751.50	现货	12790	8.47	1760	15167	-2377	-15.67%	/	7.27	7.22	8.62
到岸升水	100	2017年01月	12875	2.47	1754	15118	-2243	-14.84%	-0.66%	7.34	7.44	8.62
汇率	6.9235	2017年02月	12985	-3.28	1748	15071	-2086	-13.84%	-0.85%	7.43	7.53	8.62
增值税	17%	2017年03月	13040	-1.03	1750	15090	-2050	-13.58%	-0.42%	7.45	7.56	8.62
进口关税	0%	2017年04月	13105	0.22	1752	15100	-1995	-13.21%	-0.50%	7.48	7.59	8.62
杂费	100	2017年05月	13150	2.22	1754	15116	-1966	-13.01%	-0.34%	7.50	7.60	8.62

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	2717.50	现货	22550	-19.34	2698	23066	-516	-2.24%	/	8.36	8.19	8.55
到岸升水	115	2017年01月	22460	-15.34	2702	23099	-639	-2.76%	0.40%	8.31	8.26	8.55
汇率	6.9235	2017年02月	22450	-9.09	2708	23150	-700	-3.02%	-0.04%	8.29	8.24	8.55
增值税	17%	2017年03月	22465	-2.84	2715	23201	-716	-3.09%	-0.16%	8.28	8.23	8.55
进口关税	1%	2017年04月	22465	0.66	2718	23229	-764	-3.29%	0.09%	8.26	8.22	8.55
杂费	50	2017年05月	22450	3.41	2721	23252	-802	-3.45%	0.07%	8.25	8.20	8.55

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	2180.50	现货	18550	-16.34	2164	18824	-274	-1.46%	/	8.57	8.59	8.70
到岸升水	80	2017年01月	18550	-12.84	2168	18853	-303	-1.61%	0.00%	8.56	8.70	8.70
汇率	6.9235	2017年02月	18780	-8.84	2172	18887	-107	-0.57%	-1.24%	8.65	8.79	8.70
增值税	17%	2017年03月	18820	-3.84	2177	18928	-108	-0.57%	-0.21%	8.65	8.79	8.70
进口关税	3%	2017年04月	18810	0.66	2181	18966	-156	-0.82%	0.05%	8.62	8.76	8.70
杂费	100	2017年05月	18855	3.16	2184	18987	-132	-0.69%	-0.24%	8.63	8.77	8.69

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	10530	现货	87050	-53.44	10477	87009	-41	0.05%	/	8.31	8.26	8.31
到岸升水	140	2017年01月	86930	-50.44	10480	87034	-1004	-1.15%	-0.03%	8.21	8.29	8.31
汇率	6.9235	2017年02月	86270	-32.44	10498	87181	-911	-1.03%	-0.17%	8.22	8.30	8.30
增值税	17%	2017年03月	86520	-14.44	10516	87328	-808	-0.93%	-0.17%	8.23	8.31	8.30
进口关税	1%	2017年04月	85850	3.56	10534	87476	-1628	-1.88%	-0.17%	8.15	8.23	8.30
杂费	150	2017年05月	87750	19.56	10550	87607	143	0.16%	-0.15%	8.32	8.40	8.30

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	21155	现货	153500	25.00	21180	181872	-28372	-15.60%	/	7.25	7.24	8.59
到岸升水	600	2017年01月	152650	25.00	21180	181872	-29222	-16.07%	0.00%	7.21	7.22	8.59
汇率	6.9235	2017年02月	152650	25.00	21180	181872	-29222	-16.07%	0.00%	7.21	7.22	8.59
增值税	17%	2017年03月	151810	20.00	21175	181830	-30020	-16.51%	0.02%	7.17	7.19	8.59
进口关税	3%	2017年04月	151720	0.00	21155	181663	-29943	-16.48%	0.09%	7.17	#VALUE!	8.59
杂费	150	2017年05月	153180	-20.00	21135	181496	-28316	-15.60%	0.09%	7.25	7.27	8.59

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	2017年01月	46880	260.10	47074	-194	-0.41%	/	180.24	#DIV/0!	180.99
汇率	6.9235	2017年02月	46960	260.65	47173	-213	-0.45%	-0.21%	180.16	#DIV/0!	180.98
增值税	0.17	2017年03月	47160	262.70	47538	-378	-0.80%	-0.79%	179.52	179.52	180.96
进口关税	0%	2017年04月	47270	262.35	47476	-206	-0.43%	0.13%	180.18	180.18	180.96
杂费	150	2017年05月	47450	262.70	47538	-88	-0.19%	-0.13%	180.62	180.62	180.96

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
2017/11/11	271.85	1190.1	261.911108	692.35	6.938891983	(-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)
2017/11/11	4161	16.88	3757.414926	692.35	403.5850741

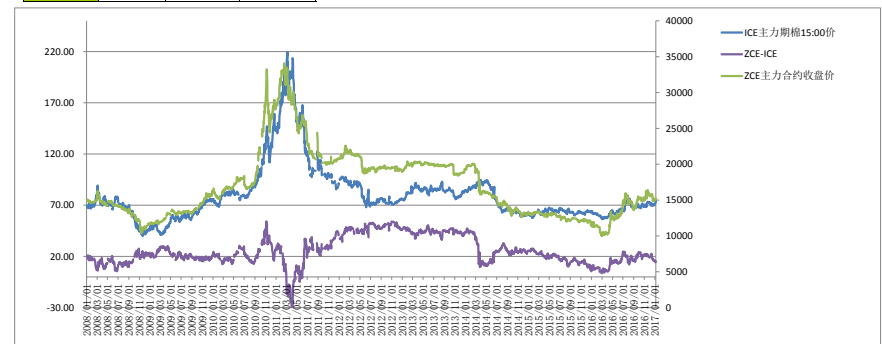
日期	郑州白糖主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年01月	6900	20.55	5760.634925	6.9235	1139.37
2017年05月	6870	20.40	5726.229059		1143.77

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	大豆价格		大连豆粕价格		大连豆油价格		参数	
	2017年01月	1002	2017年01月	2970	2017年01月	6928		1罐=60磅=27.2154kg
	2017年03月	1013.75	2017年03月	2824	2017年05月	6950	汇率	6.9235
南美豆 (16年9月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	4.00	国际运费 (美元)	41.87	毛利 (元/吨)	(251422.07)	净利 (元/吨)	(293694.45)
1002.0000								
美国豆 (17年1月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	78.00	国际运费 (美元)	46.26	毛利 (元/吨)	(251621.77)	净利 (元/吨)	(297195.45)
1013.7500								

参数 (不含增值税)	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		
到岸升水	70	2017年01月	15130	2017年03月	73.31	12971	2159	16.65%	206	206	176.93
汇率	6.9235	2017年05月	15385	2017年05月	73.71	13041	2344	17.98%	209	209	176.92
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
2017/1/11	73.31	15385	15.88892442



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	288,225	-5,175	85,000
铝	2,243,775	11,050	852,300
镍	371,828	-36	134,160
锌	425,150	-1,275	112,875
铅	193,225	-75	42,975
锡	3,815	0	625

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所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。