

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	6021.00	现货	48550	-14.50	6007	48954	-404	-0.83%	/	8.08	8.11	8.15
到岸升水	60	2017年03月	48470	-8.50	6013	49003	-533	-1.09%	0.16%	8.06	8.06	8.15
汇率	6.883	2017年04月	48660	-2.50	6019	49051	-391	-0.80%	-0.39%	8.09	8.09	8.15
增值税	17%	2017年05月	48840	1.50	6023	49083	-243	-0.50%	-0.37%	8.11	8.12	8.15
进口关税	0%	2017年06月	49010	1.87	6023	49086	-76	-0.15%	-0.35%	8.14	8.15	8.15
杂费	100	2017年07月	49150	4.50	6026	49107	-43	0.09%	-0.29%	8.16	8.16	8.15

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	1871.00	现货	13780	-10.75	1860	15886	-2106	-13.26%	/	7.41	7.40	8.54
到岸升水	100	2017年03月	13860	-7.87	1863	15909	-2049	-12.88%	-0.58%	7.44	7.51	8.54
汇率	6.883	2017年04月	13955	-3.50	1868	15944	-1989	-12.48%	-0.69%	7.47	7.54	8.54
增值税	17%	2017年05月	14040	0.50	1872	15977	-1937	-12.12%	-0.61%	7.50	7.57	8.54
进口关税	0%	2017年06月	14110	2.13	1873	15990	-1880	-11.76%	-0.50%	7.53	7.59	8.54
杂费	100	2017年07月	14190	5.50	1877	16017	-1827	-11.41%	-0.57%	7.56	7.61	8.54

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	2842.00	现货	23270	-1.75	2840	24087	-817	-3.39%	/	8.19	8.18	8.48
到岸升水	115	2017年03月	23120	-1.62	2840	24088	-968	-4.02%	0.64%	8.14	8.17	8.48
汇率	6.883	2017年04月	23170	0.25	2842	24103	-933	-3.87%	-0.22%	8.15	8.18	8.48
增值税	17%	2017年05月	23190	1.00	2843	24109	-919	-3.81%	-0.69%	8.16	8.17	8.48
进口关税	1%	2017年06月	23185	0.80	2843	24108	-923	-3.83%	0.02%	8.16	8.16	8.48
杂费	50	2017年07月	23205	1.26	2843	24111	-906	-3.78%	-0.09%	8.16	8.15	8.48

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	2254.50	现货	18950	-9.50	2245	19385	-435	-2.24%	/	8.44	8.32	8.63
到岸升水	80	2017年03月	18730	-4.12	2250	19430	-700	-3.60%	1.16%	8.32	8.29	8.63
汇率	6.883	2017年04月	18825	-2.50	2252	19443	-618	-3.18%	-0.51%	8.36	8.32	8.63
增值税	17%	2017年05月	18860	0.00	2255	19464	-604	-3.10%	-0.19%	8.37	8.33	8.63
进口关税	3%	2017年06月	18945	1.07	2256	19473	-528	-2.71%	-0.45%	8.40	8.35	8.63
杂费	100	2017年07月	18885	3.00	2258	19489	-604	-3.10%	0.32%	8.37	8.35	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	10790	现货	89100	-56.50	10734	88591	509	0.57%	/	8.30	8.24	8.25
到岸升水	140	2017年03月	88590	-39.20	10751	88732	-142	-0.17%	-0.16%	8.24	8.25	8.25
汇率	6.883	2017年04月	91160	-20.00	10770	88888	2727	2.59%	-0.18%	8.46	8.25	8.25
增值税	17%	2017年05月	89740	-2.00	10788	89034	706	0.79%	-0.17%	8.32	8.27	8.25
进口关税	1%	2017年06月	90750	8.80	10799	89122	1628	1.83%	-0.10%	8.40	8.28	8.25
杂费	150	2017年07月	91240	24.75	10815	89252	1988	2.23%	-0.15%	8.44	8.33	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	19843	现货	148500	-44.00	19799	169354	-20854	-12.31%	/	7.50	7.50	8.55
到岸升水	600	2017年03月	145330	-29.14	19814	169477	-24147	-14.25%	-0.08%	7.33	7.31	8.55
汇率	6.883	2017年04月	150390	-15.00	19828	169594	-19204	-11.32%	-0.07%	7.58	7.58	8.55
增值税	17%	2017年05月	148150	0.00	19843	169719	-21569	-12.71%	-0.08%	7.47	7.51	8.55
进口关税	3%	2017年06月	148010	7.47	19850	169781	-21771	-12.82%	-0.04%	7.46	7.45	8.55
杂费	150	2017年07月	148040	19.00	19862	169876	-21836	-12.85%	-0.06%	7.45	7.36	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	2017年03月	48470	272.60	49017	-547	-1.12%	/	177.81	177.93	179.81
汇率	6.883	2017年04月	48660	273.40	49159	-499	-1.01%	-0.29%	177.98	178.09	179.81
增值税	0.17	2017年05月	48840	273.90	49247	-407	-0.83%	-0.18%	178.31	178.35	179.80
进口关税	0%	2017年06月	49010	275.10	49460	-450	-0.91%	-0.44%	178.15	177.71	179.79
杂费	150	2017年07月	49150	275.15	49469	-319	-0.65%	-0.02%	178.63	178.68	179.79

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
2017/2/22	277.2	1235.5	273.4082006	688.3	3.791799374	(-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)
2017/2/22	4224	17.97	3976.645379	688.3	247.3546214

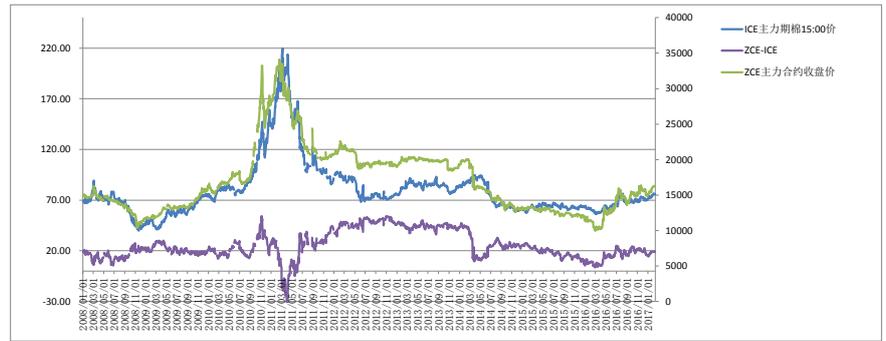
日期	郑州砂糖主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年05月	6861	2017年03月	20.85	5798.481841	1062.52
2017年09月	6938	2017年05月	20.77	5780.239385	1157.76

注: 郑州CICE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

进口大豆压榨平衡表	美豆价格		大豆压榨价格		大豆压榨油价格		参数	
	2017年03月	1027.75	2017年05月	2914	2017年05月	6654		1罐=60磅=27.2154kg
	2017年05月	1038.5	2017年09月	2953	2017年09月	6730	汇率	6.883
	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%
	1027.7500	4.00	41.87	(256638.00)	(299631.19)		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
	1038.5000	78.00	46.26	(259212.09)	(302863.09)		关税	3%
							港杂费 (元/吨)	120

参数 (不含港杂费)	合约月份	美糖价格	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05月	15485	2017年03月	74.12	13037	2448	18.78%	209	212	175.88
汇率	6.883	2017年09月	15895	2017年05月	76.05	13371	2524	18.88%	209	212	175.82
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
2017/2/22	74.12	15895	18.57804527



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	219,425	-2,000	93,225
铝	2,191,450	-3,925	783,400
镍	384,000	-900	105,000
锌	385,925	-1,125	169,550
铅	189,800	0	70,300
锡	5,820	0	1,110

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。
- 本文件的内容并非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。