

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	5538.00	现货	44980	-21.75	5517	45132	-152	-0.34%	/	8.15	8.13	8.18
到岸升水	65	2017年06月	44910	-12.25	5527	45206	-298	-0.66%	0.16%	8.13	8.16	8.18
汇率	6.8948	2017年07月	44930	-5.00	5534	45267	-337	-0.74%	-0.04%	8.12	8.16	8.18
增值税	17%	2017年08月	44990	1.50	5541	45319	-329	-0.73%	-0.13%	8.12	8.16	8.18
进口关税	0%	2017年09月	45100	9.50	5549	45384	-284	-0.62%	-0.24%	8.13	8.16	8.18
杂费	100	2017年10月	45250	15.75	5555	45434	-184	-0.41%	-0.33%	8.15	8.17	8.18

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	1880.00	现货	13700	-5.50	1875	16109	-2409	-14.95%	/	7.31	7.35	8.59
到岸升水	110	2017年06月	13815	-5.50	1875	16109	-2294	-14.24%	-0.84%	7.37	7.39	8.59
汇率	6.8948	2017年07月	13855	-1.50	1879	16141	-2286	-14.16%	-0.29%	7.38	7.40	8.59
增值税	17%	2017年08月	13905	1.00	1881	16161	-2256	-13.96%	-0.36%	7.39	7.41	8.59
进口关税	0%	2017年09月	13940	5.00	1885	16193	-2253	-13.92%	-0.25%	7.40	7.43	8.59
杂费	100	2017年10月	13980	8.75	1889	16224	-2244	-13.83%	-0.29%	7.40	7.43	8.59

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	2591.50	现货	22030	-6.00	2586	22134	-104	-0.47%	/	8.52	8.49	8.56
到岸升水	125	2017年06月	21895	-6.00	2586	22134	-239	-1.08%	0.61%	8.47	8.44	8.56
汇率	6.8948	2017年07月	21610	-2.00	2590	22167	-557	-2.51%	1.30%	8.35	8.34	8.56
增值税	17%	2017年08月	21395	-0.25	2591	22181	-786	-3.54%	0.99%	8.26	8.25	8.56
进口关税	1%	2017年09月	21220	2.50	2594	22203	-983	-4.43%	0.82%	8.18	8.18	8.56
杂费	50	2017年10月	21100	4.25	2596	22218	-1118	-5.03%	0.57%	8.13	8.12	8.56

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	2175.00	现货	16000	-7.00	2168	18778	-2778	-14.80%	/	7.38	7.29	8.66
到岸升水	80	2017年06月	16020	-6.00	2169	18787	-2767	-14.73%	-0.13%	7.39	7.40	8.66
汇率	6.8948	2017年07月	16110	-2.25	2173	18818	-2708	-14.39%	-0.56%	7.41	7.45	8.66
增值税	17%	2017年08月	16135	1.50	2177	18849	-2714	-14.40%	-0.16%	7.41	7.46	8.66
进口关税	3%	2017年09月	16170	4.50	2180	18874	-2704	-14.33%	-0.22%	7.42	7.46	8.66
杂费	100	2017年10月	16225	7.00	2182	18895	-2670	-14.13%	-0.34%	7.44	7.37	8.66

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	9275	现货	78850	-24.00	9251	78868	-18	-0.02%	/	8.31	8.26	8.31
到岸升水	165	2017年06月	78600	-29.50	9246	78823	-1223	-1.59%	0.06%	8.18	8.19	8.31
汇率	6.8948	2017年07月	78300	-11.50	9264	78970	-670	-0.87%	-0.19%	8.24	8.22	8.31
增值税	17%	2017年08月	78400	2.00	9277	79079	-679	-0.88%	-0.15%	8.24	8.10	8.31
进口关税	1%	2017年09月	78990	23.00	9298	79251	-261	-0.34%	-0.23%	8.28	8.30	8.31
杂费	150	2017年10月	78990	41.00	9316	79397	-407	-0.53%	-0.19%	8.26	8.22	8.31

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	19850	现货	140500	71.00	19921	170657	-30157	-17.67%	/	7.05	7.05	8.57
到岸升水	600	2017年06月	141000	50.00	19900	170483	-29483	-17.29%	0.11%	7.09	7.10	8.57
汇率	6.8948	2017年07月	141530	25.00	19875	170275	-29745	-16.88%	0.13%	7.12	7.14	8.57
增值税	17%	2017年08月	141050	-5.00	19845	170026	-28976	-17.04%	0.15%	7.11	7.12	8.57
进口关税	3%	2017年09月	142050	-35.00	19815	169777	-27727	-16.33%	0.15%	7.17	7.20	8.57
杂费	150	2017年10月	140370	-55.00	19795	169610	-29240	-17.24%	0.10%	7.09	7.14	8.57

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06月	44910	250.75	45218	-308	-0.68%	/	179.10	179.77	180.33
汇率	6.8948	2017年07月	44930	251.05	45272	-342	-0.75%	-0.12%	178.97	179.61	180.33
增值税	0.17	2017年08月	44990	251.35	45325	-335	-0.74%	-0.12%	178.99	180.31	180.33
进口关税	0%	2017年09月	45100	252.30	45494	-394	-0.87%	-0.38%	178.76	179.41	180.32
杂费	150	2017年10月	45250	252.60	45547	-297	-0.65%	-0.12%	179.14	181.29	180.31

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
2017/5/12	278.1	1227.5	272.1035395	689.48	5.99646046	(-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)
2017/5/12	4053	16.41	3637.653021	689.48	415.3469785

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09月	6653	15.63	4615.14282	6.8948	2037.86
2018年01月	6759	15.93	4683.669307		2075.33

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		大连豆粕价格		大连豆油价格		参数
	日期	价格	日期	价格	日期	价格	
2017年07月	9.63		2017年09月	2792	2017年09月	5976	1罐=60磅=27.2154kg
2017年11月	9.605		2018年01月	2811	2018年01月	6142	汇率
南美豆 (17年7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%
9.6300	4.00	41.87	727.60	(164.14)	进口菜豆出油率		18.50%
美湾豆 (17年11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
9.6050	78.00	46.26	779.56	(23.11)	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09月	15780	2017年07月	81.31	14306	1474	10.30%	194	203	175.94
汇率	6.8948	2018年01月	16000	2017年12月	73.00	12864	3136	24.38%	219	217	176.22
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
2017/5/12	81.31	16000	11.84070009



每日LME库存:

品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	329,375	-7,350	109,750
铝	1,556,150	-8,660	587,675
镍	380,610	+1,224	105,330
锌	345,150	-2,050	153,075
铅	183,150	4,825	93,125
锡	2,320	30	460

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。