

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	5712.50	现货	45710	-21.00	5692	45963	-253	-0.55%	/	8.03	8.04	8.08
到岸升水	65	2017年07月	45760	-18.00	5695	45987	-227	-0.49%	-0.11%	8.04	8.08	8.08
汇率	6.8096	2017年08月	45840	-9.50	5703	46055	-215	-0.47%	-0.17%	8.04	8.08	8.08
增值税	17%	2017年09月	45950	0.00	5713	46131	-181	-0.39%	-0.24%	8.04	8.09	8.08
进口关税	0%	2017年10月	46070	6.50	5719	46182	-112	-0.24%	-0.26%	8.06	8.10	8.08
杂费	100	2017年11月	46210	13.25	5726	46236	-26	-0.06%	-0.30%	8.07	8.11	8.08

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	1900.50	现货	13690	-11.75	1889	16025	-2335	-14.57%	/	7.25	7.21	8.48
到岸升水	110	2017年07月	13920	-8.25	1892	16052	-2132	-13.28%	-1.68%	7.36	7.42	8.48
汇率	6.8096	2017年08月	13995	-4.50	1896	16082	-2087	-12.98%	-0.54%	7.38	7.44	8.48
增值税	17%	2017年09月	14080	0.00	1901	16118	-2038	-12.64%	-0.61%	7.41	7.47	8.48
进口关税	0%	2017年10月	14140	2.50	1903	16138	-1998	-12.38%	-0.43%	7.43	7.49	8.48
杂费	100	2017年11月	14190	5.00	1906	16158	-1968	-12.18%	-0.35%	7.45	7.51	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	2558.00	现货	22500	-10.50	2548	21555	945	4.38%	/	8.83	8.79	8.46
到岸升水	125	2017年07月	22085	-8.25	2553	21598	487	2.26%	1.84%	8.65	8.72	8.46
汇率	6.8096	2017年08月	21420	-2.25	2556	21622	-202	-0.93%	3.01%	8.38	8.45	8.46
增值税	17%	2017年09月	21170	0.00	2558	21640	-470	-2.17%	1.17%	8.28	8.34	8.46
进口关税	1%	2017年10月	21030	0.50	2559	21644	-614	-2.84%	0.66%	8.22	8.28	8.46
杂费	50	2017年11月	20960	2.00	2560	21656	-696	-3.21%	0.33%	8.19	8.24	8.46

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	2139.00	现货	17520	-20.75	2118	18139	-619	-3.41%	/	8.27	8.25	8.56
到岸升水	80	2017年07月	17675	-9.75	2129	18230	-555	-3.04%	-0.88%	8.30	8.31	8.56
汇率	6.8096	2017年08月	17550	-3.75	2135	18279	-729	-3.99%	0.71%	8.22	8.23	8.56
增值税	17%	2017年09月	17490	0.00	2139	18310	-820	-4.48%	0.34%	8.18	8.19	8.56
进口关税	3%	2017年10月	17390	3.00	2142	18334	-944	-5.15%	0.57%	8.12	8.13	8.56
杂费	100	2017年11月	17300	6.50	2146	18363	-1063	-5.79%	0.52%	8.06	8.07	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	9045	现货	74650	-57.00	8988	73803	847	1.15%	/	8.31	8.24	8.21
到岸升水	165	2017年07月	71300	-39.00	9006	73948	-2648	-3.58%	-0.20%	7.92	7.98	8.21
汇率	6.8096	2017年08月	73890	-21.50	9024	74089	-209	-0.28%	-0.19%	8.19	8.25	8.21
增值税	17%	2017年09月	74730	0.00	9045	74262	468	0.63%	-0.24%	8.26	8.33	8.21
进口关税	1%	2017年10月	74740	17.50	9063	74403	337	0.45%	-0.19%	8.25	8.31	8.21
杂费	150	2017年11月	75380	35.50	9081	74548	832	1.12%	-0.20%	8.30	8.37	8.21

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	19545	现货	142500	129.00	19674	166523	-24023	-14.43%	/	7.24	7.21	8.46
到岸升水	600	2017年07月	144440	89.00	19634	166195	-21755	-13.09%	0.20%	7.36	#VALUE!	8.46
汇率	6.8096	2017年08月	141540	49.00	19544	165867	-24327	-14.67%	0.20%	7.22	7.20	8.47
增值税	17%	2017年09月	145230	0.00	19545	165465	-20235	-12.23%	0.25%	7.43	7.41	8.47
进口关税	3%	2017年10月	143230	-41.00	19504	165128	-21898	-13.26%	0.21%	7.34	7.32	8.47
杂费	150	2017年11月	145730	-76.00	19469	164841	-19111	-11.59%	0.18%	7.49	7.47	8.47

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07月	45760	257.40	45828	-68	-0.15%	/	177.78	#DIV/0!	178.04
汇率	6.8096	2017年08月	45840	258.20	45968	-128	-0.28%	-0.31%	177.54	177.54	178.03
增值税	0.17	2017年09月	45950	258.75	46065	-115	-0.25%	-0.21%	177.58	177.58	178.03
进口关税	0%	2017年10月	46070	259.90	46267	-197	-0.42%	-0.44%	177.26	177.26	178.02
杂费	150	2017年11月	46210	261.75	46591	-381	-0.82%	-0.71%	176.54	#DIV/0!	178.00

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
2017/6/20	278.25	1245.1	272.5943515	680.96	5.6556485	(-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)
2017/6/20	4023	16.55	3623.352757	680.96	399.6472433

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	6537	2017年07月	13.47	4077.442383	6.8096		
2018年01月	6610		2017年10月	13.68	4124.81817		2459.56	2485.18

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		大豆油价格		参数		
	2017年07月	9.385	2017年09月	2711	2017年09月	5838		1罐=60磅=27.2154kg	
	2017年11月	9.4925	2018年01月	2744	2018年01月	6002	汇率	6.8096	
			进口南美大豆, 国内压榨 (17年7月到港)					进口大豆出油率	79.50%
	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	18.50%
	9.3850	4.00	41.87	729.93	(142.22)			加工费 (元/吨)	130
			进口美国大豆, 国内压榨 (17年11月到港)					关税	3%
	美国豆 (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)			增值税	13%
	9.4925	78.00	46.26	759.28	(31.00)			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	15180	2017年07月	71.60	12488	2712	21.75%	212	212	174.13
汇率	6.8096	2018年01月	15190	2017年12月	68.96	12016	3174	28.42%	220	220	174.24
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
2017/6/20	71.60	15190	17.94142167



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	262,075	-3,100	100,050
铝	1,418,325	-6,400	386,850
镍	377,472	0	116,802
锌	306,575	-5,350	161,600
铅	174,050	-600	62,900
锡	1,720	-45	250

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。投资涉及高风险, 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。