

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	5706.00	现货	45890	-24.81	5681	45949	-69	-0.13%	/	8.08	8.06	8.09
到岸升水	65	2017年07月	45720	-17.81	5688	46005	-285	-0.62%	0.37%	8.04	8.05	8.09
汇率	6.8197	2017年08月	45810	-8.31	5698	46081	-271	-0.59%	-0.20%	8.04	8.05	8.09
增值税	17%	2017年09月	45890	2.19	5708	46165	-275	-0.59%	-0.17%	8.04	8.06	8.09
进口关税	0%	2017年10月	46000	7.94	5714	46210	-210	-0.46%	-0.24%	8.05	8.07	8.09
杂费	100	2017年11月	46170	14.94	5721	46266	-96	-0.21%	-0.37%	8.07	8.09	8.09

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	1869.00	现货	13740	-9.37	1860	15816	-2076	-13.12%	/	7.39	7.37	8.50
到岸升水	110	2017年07月	13700	-8.87	1860	15820	-2120	-13.40%	0.29%	7.37	7.39	8.50
汇率	6.8197	2017年08月	13765	-4.87	1864	15852	-2087	-13.16%	-0.47%	7.38	7.41	8.50
增值税	17%	2017年09月	13830	0.13	1869	15892	-2062	-12.97%	-0.47%	7.40	7.43	8.50
进口关税	0%	2017年10月	13910	3.13	1872	15916	-2006	-12.60%	-0.58%	7.43	7.45	8.50
杂费	100	2017年11月	13955	5.63	1875	15935	-1980	-12.43%	-0.32%	7.44	7.48	8.50

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	2637.00	现货	22970	-8.57	2628	22239	731	3.28%	/	8.74	8.85	8.46
到岸升水	125	2017年07月	22420	-3.07	2634	22284	136	0.61%	2.39%	8.51	8.58	8.46
汇率	6.8197	2017年08月	21990	-0.32	2637	22306	-316	-1.42%	1.82%	8.34	8.36	8.46
增值税	17%	2017年09月	21720	2.43	2639	22328	-608	-2.72%	1.23%	8.23	8.26	8.46
进口关税	1%	2017年10月	21560	1.93	2639	22324	-764	-3.42%	0.74%	8.17	8.20	8.46
杂费	50	2017年11月	21470	1.93	2639	22324	-854	-3.83%	0.42%	8.14	8.18	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	2185.50	现货	17850	-21.62	2164	18541	-691	-3.73%	/	8.25	8.40	8.57
到岸升水	80	2017年07月	17660	-9.12	2176	18644	-984	-5.28%	1.06%	8.11	8.30	8.57
汇率	6.8197	2017年08月	17535	-2.37	2183	18699	-1164	-6.23%	0.71%	8.03	8.17	8.57
增值税	17%	2017年09月	17410	1.13	2187	18728	-1318	-7.04%	0.71%	7.96	8.09	8.56
进口关税	3%	2017年10月	17215	3.13	2189	18745	-1530	-8.16%	1.12%	7.87	8.01	8.56
杂费	100	2017年11月	17175	6.38	2192	18771	-1596	-8.50%	0.23%	7.84	7.98	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	8915	现货	74500	-53.09	8862	72896	1604	2.20%	/	8.41	8.28	8.23
到岸升水	165	2017年07月	71300	-39.59	8875	73005	-1705	-2.34%	-0.15%	8.03	8.01	8.23
汇率	6.8197	2017年08月	73350	-22.59	8892	73142	208	0.29%	-0.19%	8.25	8.24	8.23
增值税	17%	2017年09月	73930	-0.59	8914	73320	610	0.83%	-0.25%	8.29	8.24	8.23
进口关税	1%	2017年10月	73840	15.41	8930	73448	392	0.53%	-0.18%	8.27	8.28	8.22
杂费	150	2017年11月	74190	33.41	8948	73594	596	0.81%	-0.20%	8.29	8.24	8.22

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	19580	现货	142000	126.11	19706	167034	-25034	-14.99%	/	7.21	7.17	8.48
到岸升水	600	2017年07月	144440	81.11	19661	166664	-22224	-13.33%	0.23%	7.35	7.33	8.48
汇率	6.8197	2017年08月	141540	46.11	19626	166377	-24837	-14.93%	0.18%	7.21	7.20	8.48
增值税	17%	2017年09月	145230	6.11	19586	166048	-20818	-12.54%	0.20%	7.41	7.40	8.48
进口关税	3%	2017年10月	144700	-28.89	19551	165760	-21060	-12.71%	0.18%	7.40	7.30	8.48
杂费	150	2017年11月	145730	-58.89	19521	165514	-19784	-11.95%	0.15%	7.47	7.46	8.48

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	45720	260.65	46467	-747	-1.61%	/	175.41	177.54	178.27
汇率	6.8197	2017年08月	45810	258.20	46036	-226	-0.49%	0.94%	177.42	178.30	178.30
增值税	0.17	2017年09月	45890	258.60	46107	-217	-0.47%	-0.15%	177.46	177.78	178.29
进口关税	0%	2017年10月	46000	259.60	46282	-282	-0.61%	-0.39%	177.20	177.95	178.28
杂费	150	2017年11月	46170	263.00	46880	-710	-1.51%	-1.31%	175.55	177.87	178.25

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
2017/6/22	279.9	1251	274.2922882	681.97	5.607711806	(-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)
2017/6/22	4043	16.6	3639.689835	681.97	403.3101647

日期	郑州郑糖主力合约		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	6470	2017年09月	13.12	4003.618305	6.8197		
2018年01月	6505		2017年10月	13.34	4053.323695		2466.38	2451.68

注: 郑州CZCE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	9.185	2017年09月	2658	2017年09月	5778		1罐=60磅=27.2154kg
	2017年11月	9.2775	2018年01月	2687	2018年01月	5918	汇率	6.8197
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)	723.86	净利 (元/吨)	(141.19)	进口大豆出油率	79.50%
9.1850	4.00	进口美南大豆, 国内压榨 (17年7月到港)					进口美豆出油率	18.50%
美南豆 (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
9.2775	78.00	进口美南大豆, 国内压榨 (17年11月到港)					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	15130	2017年07月	70.91	12388	2762	22.34%	213	213	174.41
汇率	6.8197	2018年01月	15045	2017年12月	67.83	11839	3206	27.08%	222	219	174.54
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
2017/6/22	70.91	15045	17.64533601



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	256,700	-2,600	111,875
铝	1,432,750	-8,125	365,700
镍	376,644	-450	118,186
锌	304,000	-975	200,275
铅	172,825	-700	65,300
锡	1,780	50	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。