

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	5812.50	现货	45385	-16.50	5794	46977	-1492	-3.18%	/	7.63	7.93	8.09
到岸升水	65	2017年07月	46560	-14.50	5798	46909	-349	-0.74%	-2.59%	8.03	7.89	8.09
汇率	6.8238	2017年08月	46690	6.00	5807	46977	-287	-0.61%	-0.28%	8.04	7.89	8.09
增值税	17%	2017年09月	46820	3.00	5816	47049	-229	-0.49%	-0.28%	8.05	7.89	8.09
进口关税	0%	2017年10月	46900	8.25	5821	47091	-191	-0.41%	-0.17%	8.06	7.89	8.09
杂费	100	2017年11月	47100	15.00	5828	47145	-45	-0.10%	-0.43%	8.08	7.92	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	1875.50	现货	13660	-8.75	1867	15882	-2222	-13.99%	/	7.32	7.36	8.51
到岸升水	110	2017年07月	13875	-8.50	1867	15884	-2009	-12.65%	-1.57%	7.43	7.34	8.51
汇率	6.8238	2017年08月	13935	-4.50	1871	15916	-1981	-12.45%	-0.43%	7.45	7.36	8.51
增值税	17%	2017年09月	14000	0.50	1876	15956	-1956	-12.26%	-0.47%	7.46	7.37	8.51
进口关税	0%	2017年10月	14055	3.50	1879	15980	-1925	-12.05%	-0.39%	7.48	7.40	8.50
杂费	100	2017年11月	14105	6.00	1882	16000	-1895	-11.84%	-0.36%	7.50	7.42	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	2708.00	现货	22830	-2.75	2705	22872	-42	-0.18%	/	8.44	8.51	8.45
到岸升水	125	2017年07月	22510	0.25	2708	22896	-386	-1.69%	1.40%	8.31	8.29	8.45
汇率	6.8238	2017年08月	22260	1.75	2710	22909	-649	-2.83%	1.11%	8.21	8.12	8.45
增值税	17%	2017年09月	22095	4.00	2712	22827	-832	-3.63%	0.74%	8.15	8.01	8.45
进口关税	1%	2017年10月	22000	0.50	2709	22896	-898	-3.92%	0.43%	8.12	7.96	8.45
杂费	50	2017年11月	21985	-3.00	2705	22870	-885	-3.87%	0.07%	8.13	7.92	8.45

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	2200.00	现货	17760	-19.00	2181	18693	-933	-4.99%	/	8.14	8.19	8.57
到岸升水	80	2017年07月	17460	-9.00	2191	18775	-1315	-7.01%	1.69%	7.97	8.06	8.57
汇率	6.8238	2017年08月	17375	-2.00	2198	18833	-1458	-7.74%	0.49%	7.90	7.98	8.57
增值税	17%	2017年09月	17270	1.50	2202	18862	-1592	-8.44%	0.60%	7.84	7.91	8.57
进口关税	3%	2017年10月	17140	3.50	2204	18878	-1738	-9.21%	0.75%	7.78	7.81	8.57
杂费	100	2017年11月	17135	6.50	2207	18903	-1768	-9.35%	0.03%	7.77	7.78	8.57

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	伦铝安全边际	实际比值		进口比值	
									今日	昨日		
伦铝3月价	9150	现货	74900	-52.50	9098	74940	60	0.08%	/	8.23	8.19	8.23
到岸升水	165	2017年07月	71300	-38.00	9112	74957	-3657	-4.88%	-0.16%	7.92	7.83	8.23
汇率	6.8238	2017年08月	74000	-21.00	9129	75094	-1094	-1.48%	-0.19%	8.11	8.04	8.23
增值税	17%	2017年09月	74590	1.00	9151	75271	-681	-0.91%	-0.24%	8.15	8.08	8.23
进口关税	1%	2017年10月	75570	17.00	9167	75400	170	0.23%	-0.17%	8.24	8.06	8.23
杂费	150	2017年11月	75850	35.00	9185	75545	305	0.40%	-0.20%	8.26	8.08	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	伦铝安全边际	实际比值		进口比值	
									今日	昨日		
伦铝3月价	19350	现货	141500	85.00	19435	164905	-23405	-14.19%	/	7.28	7.29	8.48
到岸升水	600	2017年07月	144440	60.00	19410	164699	-20259	-12.30%	0.13%	7.44	7.43	8.49
汇率	6.8238	2017年08月	141540	35.00	19385	164494	-22954	-13.95%	0.13%	7.30	7.30	8.49
增值税	17%	2017年09月	145230	5.00	19355	164247	-19017	-11.58%	0.15%	7.50	7.50	8.49
进口关税	3%	2017年10月	144440	-25.00	19325	164000	-19560	-11.93%	0.15%	7.47	7.49	8.49
杂费	150	2017年11月	145730	-50.00	19300	163795	-18065	-11.03%	0.13%	7.55	7.55	8.49

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	46560	263.80	47049	-489	-1.04%	/	176.50	175.41	178.35
汇率	6.8238	2017年08月	46690	263.05	46917	-227	-0.48%	0.28%	177.49	177.42	178.35
增值税	0.17	2017年09月	46820	263.60	47014	-194	-0.41%	-0.21%	177.62	177.46	178.35
进口关税	0%	2017年10月	46900	264.20	47119	-219	-0.46%	-0.23%	177.52	177.20	178.35
杂费	150	2017年11月	47100	266.10	47453	-353	-0.74%	-0.72%	177.00	175.55	178.33

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
2017/6/23	280.45	1249.8	274.1939243	682.38	6.256075719	(-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)
2017/6/23	4054	16.645	3651.750576	682.38	402.2494242

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	6532	12.84	3942.403601	6.8238	2589.60
2018年01月	6539	13.06	3992.138874		2546.86

注: 郑州CICE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

参数	合约月份	美豆价格	大豆压榨价格		净利率 (元/吨)	净利率 (元/吨)	净利率 (元/吨)	净利率 (元/吨)
			美豆价格	美豆价格				
2017年07月	9.0775	2017年09月	2645	2017年09月	5780	1500	175.41	178.35
2017年11月	9.16	2018年01月	2674	2018年01月	5922	1500	177.42	178.35
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)	净利率 (元/吨)				
9.0775	4.00	41.87	739.60	(121.49)				
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)	净利率 (元/吨)				
9.1600	78.00	46.26	767.95	(9.95)				

参数 (不含增值税)	合约月份	美棉价格	美棉月份	美棉价格	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	15250	2017年07月	71.34	12449	2801	22.50%	214	213	174.50
汇率	6.8238	2018年01月	15020	2017年12月	67.14	11728	3292	28.07%	224	222	174.67
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
2017/6/23	71.34	15020	17.01506622



每日LME库存:

品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	258,700	2,000	112,550
铝	1,428,525	-3,225	362,475
镍	375,850	-792	119,582
锌	301,900	-2,100	220,750
铅	171,350	-1,475	69,075
锡	1,790	10	235

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。