

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	6330.00	现货	49550	-32.21	6298	50131	-181	-0.36%	/	7.93	7.93	7.96
到岸升水	65	2017年08月	49800	-24.71	6305	50189	-289	-0.58%	0.10%	7.91	7.91	7.96
汇率	6.7205	2017年09月	50030	-12.71	6317	50284	-254	-0.50%	-0.26%	7.92	7.91	7.96
增值税	17%	2017年10月	50170	-3.46	6327	50367	-187	-0.37%	-0.28%	7.93	7.93	7.96
进口关税	0%	2017年11月	50330	6.04	6336	50431	-101	-0.20%	-0.32%	7.94	7.94	7.96
杂费	100	2017年12月	50550	15.24	6345	50504	-46	0.09%	-0.44%	7.97	7.96	7.96

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	1926.00	现货	14210	-23.16	1903	1927	-1717	-10.78%	/	7.47	7.50	8.37
到岸升水	110	2017年08月	14655	-18.91	1907	1960	-1305	-8.18%	-3.13%	7.68	7.57	8.37
汇率	6.7205	2017年09月	14765	-9.91	1916	16031	-1266	-7.90%	-0.75%	7.71	7.59	8.37
增值税	17%	2017年10月	14850	-3.41	1923	16082	-1232	-7.66%	-0.58%	7.72	7.62	8.36
进口关税	0%	2017年11月	14940	2.09	1928	16125	-1185	-7.35%	-0.61%	7.75	7.63	8.36
杂费	100	2017年12月	15025	6.29	1932	16158	-1133	-7.01%	-0.57%	7.78	7.66	8.36

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	2770.50	现货	23060	-11.93	2759	22950	110	0.48%	/	8.36	8.39	8.32
到岸升水	125	2017年08月	23125	-10.43	2760	22962	163	0.71%	-0.28%	8.38	8.35	8.32
汇率	6.7205	2017年09月	23055	-6.43	2764	22994	61	0.27%	0.30%	8.34	8.31	8.32
增值税	17%	2017年10月	22940	-1.93	2769	23030	-90	-0.39%	0.50%	8.29	8.26	8.32
进口关税	1%	2017年11月	22790	2.32	2773	23063	-273	-1.19%	0.65%	8.22	8.20	8.32
杂费	50	2017年12月	22660	4.72	2775	23082	-422	-1.83%	0.57%	8.17	8.16	8.32

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	2341.00	现货	18190	-24.86	2316	19506	-1316	-6.75%	/	7.85	7.96	8.42
到岸升水	80	2017年08月	18350	-17.36	2324	19567	-1217	-6.22%	-0.88%	7.90	7.95	8.42
汇率	6.7205	2017年09月	18440	-7.36	2334	19648	-1208	-6.15%	-0.49%	7.90	7.92	8.42
增值税	17%	2017年10月	18400	-2.11	2339	19690	-1290	-6.55%	0.22%	7.87	7.90	8.42
进口关税	3%	2017年11月	18355	1.39	2342	19719	-1364	-6.92%	0.24%	7.84	7.85	8.42
杂费	100	2017年12月	18210	5.59	2347	19753	-1543	-7.81%	0.79%	7.76	7.83	8.42

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	10185	现货	83050	-49.82	10135	81950	1100	1.34%	/	8.19	8.22	8.09
到岸升水	165	2017年08月	83300	-42.82	10142	82006	994	1.21%	-0.07%	8.18	8.23	8.09
汇率	6.7205	2017年09月	82120	-26.32	10160	82145	-25	-0.03%	-0.17%	8.08	8.11	8.09
增值税	17%	2017年10月	82850	-6.32	10179	82296	554	0.67%	-0.19%	8.14	8.15	8.09
进口关税	1%	2017年11月	82550	10.68	10196	82431	119	0.14%	-0.17%	8.10	8.22	8.08
杂费	150	2017年12月	83120	27.88	10213	82567	553	0.67%	-0.17%	8.14	8.17	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	20495	现货	147000	125.50	20621	172012	-25012	-14.54%	/	7.13	7.17	8.34
到岸升水	600	2017年08月	144990	90.50	20586	171729	-26739	-15.57%	0.17%	7.04	7.02	8.34
汇率	6.7205	2017年09月	146300	45.50	20541	171364	-25064	-14.63%	0.22%	7.12	7.14	8.34
增值税	17%	2017年10月	148880	25.50	20521	171202	-22322	-13.04%	0.10%	7.26	7.23	8.34
进口关税	3%	2017年11月	149580	-4.50	20491	170959	-21379	-12.51%	0.15%	7.30	7.26	8.34
杂费	150	2017年12月	147930	-24.29	20471	170799	-22869	-13.39%	0.10%	7.23	7.19	8.34

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	
到岸升水	70	2017年08月	49900	287.90	50512	-612	-1.21%	/	173.32	173.15	175.45
汇率	6.7205	2017年09月	50030	287.30	50408	-378	-0.75%	0.21%	174.14	173.99	175.45
增值税	0.17	2017年10月	50170	287.75	50486	-316	-0.63%	-0.16%	174.35	174.16	175.45
进口关税	0%	2017年11月	50330	289.55	50798	-468	-0.92%	-0.63%	173.82	173.24	175.44
杂费	150	2017年12月	50550	289.25	50746	-196	-0.39%	0.10%	174.76	174.49	175.44

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
2017/8/2	277.95	1273.4	275.1423538	672.05	2.807646151	(-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)
2017/8/2	3916	16.655	3598.630362	672.05	317.3696377

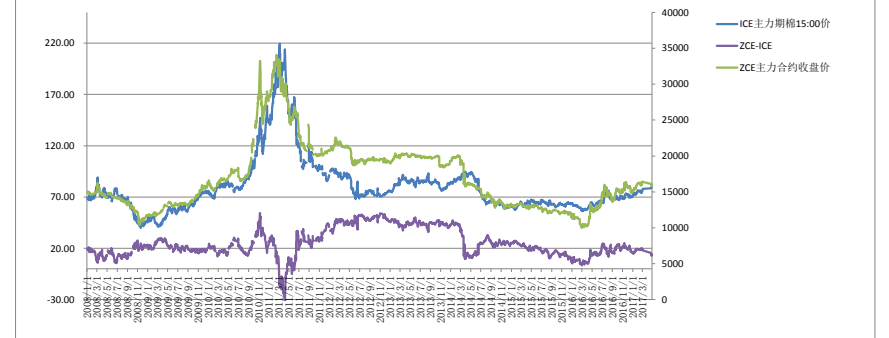
日期	郑州白糖主力合约	6174	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年09月	6122	2017年07月	14.80	4327.225085	6.7205	1794.77
2018年01月	6153	2017年10月	15.50	4483.078084		1669.92

注：郑州CICE与纽约原糖交易时间不一致，仅供参考。

参数	大豆价格		大豆压榨价格		大豆油价格		参数	
	2017年08月	9.655	2017年09月	2818	2017年09月	6120		1罐=60磅=27.2154kg
进口大豆压榨压榨	2017年11月	9.77	2018年01月	2796	2018年01月	6264	汇率	6.7205
南美豆 (17年9月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	4.00	国际运费 (美元)	41.87	毛利 (元/吨)	830.15	净利率 (元/吨)	(43.09)
9.6550			进口南美大豆, 国内压榨 (17年11月到港)				加工费 (元/吨)	130
美国豆 (17年11月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	78.00	国际运费 (美元)	46.26	毛利 (元/吨)	811.12	净利率 (元/吨)	17.68
9.7700			进口美国大豆, 国内压榨 (17年11月到港)				美国	3%
							加拿大	13%
							港澳费 (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	15020	2017年12月	69.39	11934	3086	25.86%	216	214	171.98
汇率	6.7205	2018年01月	15120	2018年03月	68.76	11827	3293	27.84%	220	218	172.01
增值税	13%										
进口关税	1%										
杂费	200										

日期	ICE主力合约15:00价	ICE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2017/8/2	69.39	15120	20.92045271



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的建议.
- 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.