

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪期安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
铜	伦铜3月价	6365.00	现货	50200	-26.17	6339	50470	-270	-0.54%	/	7.92	7.91	7.96
	到岸升水	65	2017年08月	50140	-21.67	6343	50506	-366	-0.72%	0.12%	7.90	7.90	7.96
	汇率	6.7228	2017年09月	50260	-13.17	6352	50573	-313	-0.52%	-0.24%	7.91	7.91	7.96
	增值税	17%	2017年10月	50440	-4.67	6360	50640	-200	-0.39%	-0.36%	7.93	7.93	7.96
	进口关税	0%	2017年11月	50620	3.83	6369	50706	-86	-0.17%	-0.36%	7.95	7.95	7.96
	杂费	100	2017年12月	50760	12.23	6377	50772	-12	-0.02%	-0.28%	7.96	7.96	7.96

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪期安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
铝	伦铝3月价	1925.00	现货	14740	-22.25	1903	15932	-1192	-7.46%	/	7.75	7.66	8.37
	到岸升水	110	2017年08月	14935	-19.25	1906	15955	-1020	-6.39%	-1.32%	7.84	7.90	8.37
	汇率	6.7228	2017年09月	15040	-11.00	1914	16020	-980	-6.12%	-0.70%	7.86	7.92	8.37
	增值税	17%	2017年10月	15140	-4.25	1921	16073	-933	-5.81%	-0.66%	7.88	7.95	8.37
	进口关税	0%	2017年11月	15230	1.50	1927	16118	-888	-5.51%	-0.59%	7.91	7.97	8.37
	杂费	100	2017年12月	15305	5.90	1931	16153	-848	-5.25%	-0.49%	7.93	7.99	8.37

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪期安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
锌	伦锌3月价	2816.00	现货	23380	-11.08	2805	23326	-54	0.23%	/	8.34	8.34	8.32
	到岸升水	125	2017年08月	23430	-10.59	2805	23300	100	0.43%	-0.21%	8.35	8.33	8.32
	汇率	6.7228	2017年09月	23490	-6.58	2809	23362	128	0.55%	-0.26%	8.36	8.34	8.32
	增值税	17%	2017年10月	23470	-2.58	2813	23394	56	0.24%	0.17%	8.34	8.31	8.32
	进口关税	1%	2017年11月	23370	1.17	2817	23424	-54	-0.23%	0.34%	8.30	8.27	8.31
	杂费	50	2017年12月	23255	3.37	2819	23441	-186	-0.79%	0.49%	8.25	8.22	8.31

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪期安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
镍	伦镍3月价	1356.50	现货	18690	-19.09	1337	11583	7107	61.35%	/	13.97	7.89	8.66
	到岸升水	80	2017年08月	18875	-15.09	1341	11616	7259	62.49%	-0.99%	14.07	8.00	8.66
	汇率	6.7228	2017年09月	18935	-6.84	1350	11683	7252	62.08%	-0.32%	14.03	8.00	8.66
	增值税	17%	2017年10月	18960	-2.84	1354	11715	7245	61.84%	-0.13%	14.01	7.99	8.65
	进口关税	3%	2017年11月	18950	0.66	1357	11743	7207	61.37%	0.05%	13.96	7.97	8.65
	杂费	100	2017年12月	18930	5.06	1362	11779	7151	60.71%	0.11%	13.90	7.95	8.65

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	伦期安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
钴	伦钴3月价	10350	现货	83300	-43.67	10306	83338	-38	-0.05%	/	8.08	8.10	8.09
	到岸升水	165	2017年08月	83300	-43.67	10306	83338	-38	-0.41%	0.00%	8.05	8.03	8.09
	汇率	6.7228	2017年09月	83320	-30.17	10320	83445	-125	-0.13%	-0.13%	8.07	8.04	8.09
	增值税	17%	2017年10月	83610	-10.17	10340	83694	8	0.01%	-0.19%	8.09	8.06	8.09
	进口关税	1%	2017年11月	84290	6.33	10356	83735	555	0.66%	-0.16%	8.14	8.11	8.09
	杂费	150	2017年12月	84450	22.73	10373	83865	585	0.70%	-0.16%	8.14	8.11	8.09

品种	参数	合约月份	沪期价格	LME升贴水	伦期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	伦期安全边际	实际比值		进口比值	
										今日	昨日		
锡	伦锡3月价	20580	现货	147500	121.50	20702	172727	-25227	-14.61%	/	7.13	7.13	8.34
	到岸升水	600	2017年08月	144990	86.50	20667	172444	-27454	-15.92%	0.17%	7.02	#VALUE!	8.34
	汇率	6.7228	2017年09月	147990	51.50	20632	172160	-24170	-14.04%	0.17%	7.17	7.15	8.34
	增值税	17%	2017年10月	148640	31.50	20612	171998	-23358	-13.58%	0.10%	7.21	7.19	8.34
	进口关税	3%	2017年11月	148530	-3.50	20577	171715	-23185	-13.50%	0.17%	7.22	#VALUE!	8.35
	杂费	150	2017年12月	146890	-19.33	20561	171586	-24696	-14.39%	0.08%	7.14	#VALUE!	8.35

品种	参数	合约月份	沪期价格	美糖期价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	美糖安全边际	实际比值		进口比值	
									今日	昨日		
美糖	到岸升水	70	2017年08月	50140	288.85	50694	-554	-1.09%	/	173.58	173.58	175.50
	汇率	6.7228	2017年09月	50260	288.65	50659	-399	-0.79%	0.07%	174.12	174.12	175.50
	增值税	0.17	2017年10月	50440	288.25	50590	-150	-0.30%	0.14%	174.99	174.99	175.51
	进口关税	0%	2017年11月	50620	289.95	50884	-264	-0.52%	-0.59%	174.58	#DIV/0!	175.49
	杂费	150	2017年12月	50760	290.70	51014	-254	-0.50%	-0.26%	174.61	174.61	175.49

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
2017/8/7	275.95	1263.1	273.0102445	672.28	2.939755487	(-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)
2017/8/7	3823	16.215	3504.759017	672.28	318.2409827

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	6245	2017年07月	14.19	4192.661346	6.7228	2052.34
2018年01月	6249	2017年10月	14.93	4357.476617		1891.52

注: 郑州CICE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

品种	美豆价格		大豆压榨价格		大豆油价格		参数
	日期	价格	日期	价格	日期	价格	
进口大豆压榨压榨	2017年11月	9.6375	2017年09月	2808	2017年09月	6030	1罐=60磅=27.2154kg
	2018年01月	9.7275	2018年01月	2775	2018年01月	6164	汇率
南美豆 (17年11月到期)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	4.00	国际运费 (美元)	41.87	毛利 (元/吨)	809.16	净利率 (元/吨)
	进口关税	0%	进口关税	0%	净利率 (元/吨)	(63.63)	加工费 (元/吨)
美湾豆 (17年11月到期)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	78.00	国际运费 (美元)	46.26	毛利 (元/吨)	785.81	净利率 (元/吨)
	进口关税	0%	进口关税	0%	净利率 (元/吨)	(6.13)	港杂费 (元/吨)

参数 (不含增值税)	合约月份	美糖价格	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	15015	2017年12月	70.81	12178	2837	23.30%	212	212	171.98
汇率	6.7228	2018年01月	15100	2018年03月	70.37	12103	2997	24.76%	215	215	172.00
增值税	13%										
进口关税	1%										
杂费	200										

日期	ICE主力期棉15:00价	ICE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2017/8/7	70.81	15100	19.35013835



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。