

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	6397.00	现货	50045	-29.60	6367	50223	-179	-0.36%	/	7.88	7.83	7.89
到岸升水	65	2017年09月	49820	-18.10	6370	50313	-393	-0.78%	0.25%	7.83	7.81	7.89
汇率	6.6601	2017年10月	50060	-7.60	6389	50395	-335	-0.58%	-0.28%	7.83	7.82	7.89
增值税	17%	2017年11月	50250	0.40	6397	50457	-207	-0.41%	-0.38%	7.85	7.83	7.89
进口关税	0%	2017年12月	50430	10.90	6408	50539	-109	-0.22%	-0.36%	7.87	7.85	7.89
杂费	100	2018年01月	50520	17.65	6415	50591	-71	-0.14%	-0.19%	7.88	7.87	7.89

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	2025.50	现货	15550	-5.95	2020	16694	-1144	-6.85%	/	7.70	7.81	8.27
到岸升水	110	2017年09月	15700	-9.95	2016	16663	-963	-5.78%	-0.96%	7.79	7.94	8.27
汇率	6.6601	2017年10月	15780	-3.70	2022	16712	-932	-5.57%	-0.51%	7.80	7.96	8.27
增值税	17%	2017年11月	15880	0.30	2026	16743	-863	-5.15%	-0.63%	7.84	7.98	8.26
进口关税	0%	2017年12月	15960	5.05	2031	16780	-820	-4.89%	-0.50%	7.86	8.00	8.26
杂费	100	2018年01月	16040	7.30	2033	16797	-757	-4.51%	-0.50%	7.89	8.03	8.26

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	2907.50	现货	24280	-13.95	2894	23807	473	1.99%	/	8.39	8.37	8.23
到岸升水	125	2017年09月	24235	-5.95	2902	23870	365	1.53%	0.19%	8.35	8.30	8.23
汇率	6.6601	2017年10月	24065	-2.45	2905	23897	188	0.70%	0.70%	8.28	8.25	8.23
增值税	17%	2017年11月	23900	0.05	2908	23917	-17	-0.07%	0.69%	8.22	8.19	8.23
进口关税	1%	2017年12月	23715	3.55	2911	23944	-229	-0.98%	0.77%	8.15	8.11	8.23
杂费	50	2018年01月	23580	3.55	2911	23944	-364	-1.52%	0.57%	8.10	8.08	8.23

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	19000	-20.35	2321	19368	-368	-1.90%	/	8.19	8.23	8.35
到岸升水	80	2017年09月	19050	-13.35	2328	19424	-374	-1.93%	-0.26%	8.18	8.17	8.34
汇率	6.6601	2017年10月	19030	-5.10	2336	19490	-460	-2.36%	0.10%	8.15	8.13	8.34
增值税	17%	2017年11月	19010	-0.10	2341	19530	-520	-2.66%	0.11%	8.12	8.07	8.34
进口关税	3%	2017年12月	18940	3.65	2345	19560	-620	-3.17%	0.37%	8.08	8.08	8.34
杂费	100	2018年01月	18925	7.40	2348	19591	-666	-3.40%	0.08%	8.06	8.01	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		
伦铝3月价	10655	现货	85200	-47.70	10607	84931	269	0.32%	/	8.03	8.19	8.01
到岸升水	165	2017年09月	84720	-37.20	10618	85013	-293	-0.34%	-0.10%	7.98	8.02	8.01
汇率	6.6601	2017年10月	85500	-17.20	10638	85171	329	0.39%	-0.19%	8.04	8.04	8.01
增值税	17%	2017年11月	85380	0.80	10656	85312	68	0.08%	-0.17%	8.01	8.08	8.01
进口关税	1%	2017年12月	85630	21.80	10677	85478	152	0.18%	-0.20%	8.02	8.02	8.01
杂费	150	2018年01月	86190	37.80	10693	85603	587	0.69%	-0.15%	8.06	8.10	8.01

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	20220	现货	146000	115.00	20335	168176	-22176	-13.19%	/	7.18	7.22	8.27
到岸升水	600	2017年09月	144200	60.00	20280	167735	-23535	-14.03%	0.27%	7.11	7.19	8.27
汇率	6.6601	2017年10月	148420	25.00	20245	167454	-19034	-11.37%	0.17%	7.33	7.33	8.27
增值税	17%	2017年11月	150780	0.00	20220	167253	-16473	-9.85%	0.12%	7.46	7.46	8.27
进口关税	3%	2017年12月	146720	-20.00	20200	167093	-20373	-12.19%	0.10%	7.26	7.46	8.27
杂费	150	2018年01月	147050	-40.00	20180	166932	-19882	-11.91%	0.10%	7.29	7.35	8.27

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09月	49820	289.80	50385	-465	-0.92%	/	172.26	172.87	173.86
汇率	6.6601	2017年10月	50060	290.50	50505	-445	-0.88%	-0.24%	172.32	173.30	173.86
增值税	0.17	2017年11月	50250	292.80	50900	-650	-1.28%	-0.79%	171.62	171.58	173.84
进口关税	0%	2017年12月	50430	291.95	50754	-324	-0.64%	0.29%	172.74	173.21	173.84
杂费	150	2018年01月	50520	294.20	51140	-620	-1.21%	-0.77%	171.72	173.30	173.83

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
2017/8/14	279.75	1292.6	276.7807737	666.01	2.969226273	(-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)
2017/8/14	4013	17.17	3676.563426	666.01	336.4365737

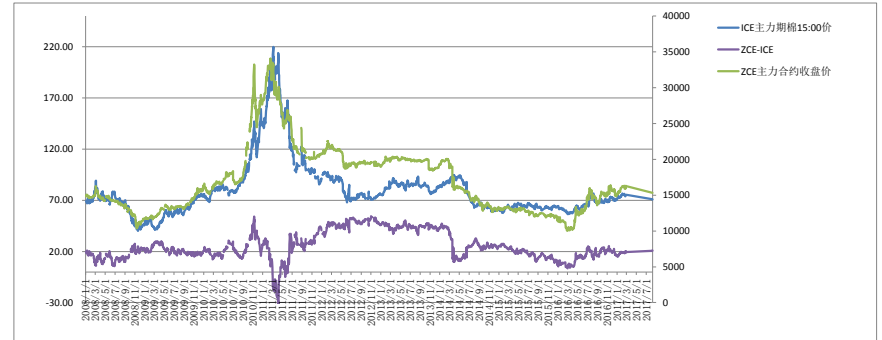
日期	郑州砂磷主力合约	6174	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂磷成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年09月	6211	2017年10月	13.30	3962.182482	6.6601	2248.82
2018年01月	6247	2018年03月	14.16	4151.938143		2095.06

注: 郑州CZCE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

参数	美豆价格		大连豆粕价格		大豆油价格		参数	
	2017年11月	9.395	2017年09月	2780	2017年09月	6166		1罐=60磅=27.2154kg
进口大豆压榨利润	2018年01月	9.4825	2018年01月	2734	2018年01月	6292	汇率	6.6601
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)	693.88	净利率 (元/吨)	37.85
美国豆 (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)	659.67	净利率 (元/吨)	83.33

参数 (不含增值税)	合约月份	郑棉价格	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	15380	2017年12月	68.23	11634	3746	32.20%	225	222	170.51
汇率	6.6601	2018年01月	15370	2018年03月	68.17	11624	3746	32.23%	225	225	170.51
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
2017/8/14	68.23	15370	24.40624251



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	283,325	-350	142,025
铝	1,291,250	7,425	250,750
镍	375,288	-400	117,858
锌	255,275	-3,025	99,975
铅	151,925	-125	64,050
锡	1,730	0	135

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。