

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	6383.00	现货	49950	-35.00	6346	50206	-259	-0.51%	/	7.87	7.84	7.91
到岸升水	65	2017年09月	50660	-20.00	6363	50323	-343	-0.52%	-0.22%	7.87	7.84	7.91
汇率	6.6779	2017年10月	50170	-9.00	6374	50409	-239	-0.47%	-0.22%	7.87	7.85	7.91
增值税	17%	2017年11月	50330	0.00	6383	50479	-149	-0.30%	-0.32%	7.89	7.87	7.91
进口关税	0%	2017年12月	50520	11.00	6394	50565	-45	-0.09%	-0.38%	7.90	7.89	7.91
杂费	100	2018年01月	50710	18.50	6402	50624	86	0.17%	-0.38%	7.92	7.91	7.91

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	2063.00	现货	15780	5.11	2068	17118	-1338	-7.82%	/	7.63	7.60	8.28
到岸升水	110	2017年09月	16000	-10.89	2052	16993	-993	-5.84%	-1.39%	7.80	7.75	8.28
汇率	6.6779	2017年10月	16100	-4.89	2058	17040	-940	-5.52%	-0.63%	7.82	7.78	8.28
增值税	17%	2017年11月	16185	-0.14	2063	17077	-892	-5.22%	-0.53%	7.85	7.80	8.28
进口关税	0%	2017年12月	16265	4.86	2068	17116	-851	-4.97%	-0.49%	7.87	7.83	8.28
杂费	100	2018年01月	16350	7.11	2070	17134	-784	-4.57%	-0.52%	7.90	7.86	8.28

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	2989.00	现货	24890	-13.58	2975	24516	374	1.52%	/	8.37	8.39	8.24
到岸升水	125	2017年09月	24885	-4.08	2965	24591	294	1.19%	0.02%	8.34	8.31	8.24
汇率	6.6779	2017年10月	24745	-2.08	2967	24607	138	0.56%	0.56%	8.28	8.26	8.24
增值税	17%	2017年11月	24565	-0.08	2969	24623	-58	-0.23%	0.73%	8.22	8.21	8.24
进口关税	1%	2017年12月	24380	2.67	2992	24644	-264	-1.07%	0.75%	8.15	8.13	8.24
杂费	50	2018年01月	24275	1.67	2991	24637	-362	-1.47%	0.43%	8.12	8.10	8.24

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	2396.50	现货	19330	-19.60	2377	19872	-542	-2.73%	/	8.13	8.17	8.36
到岸升水	80	2017年09月	19430	-11.60	2385	19936	-506	-2.54%	-0.52%	8.15	8.17	8.36
汇率	6.6779	2017年10月	19440	-4.10	2392	19997	-557	-2.78%	-0.05%	8.13	8.15	8.36
增值税	17%	2017年11月	19415	-0.10	2396	20029	-614	-3.07%	0.13%	8.10	8.12	8.36
进口关税	3%	2017年12月	19305	3.40	2400	20057	-752	-3.75%	0.57%	8.04	8.07	8.36
杂费	100	2018年01月	19200	7.15	2404	20087	-887	-4.42%	0.54%	7.99	8.02	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	10450	现货	83800	-52.09	10398	83505	295	0.35%	/	8.06	8.04	8.03
到岸升水	165	2017年09月	83960	-38.09	10412	83615	345	0.41%	-0.13%	8.06	8.05	8.03
汇率	6.6779	2017年10月	84410	-18.09	10432	83773	637	0.76%	-0.19%	8.09	8.08	8.03
增值税	17%	2017年11月	84550	-0.59	10449	83911	639	0.76%	-0.17%	8.09	8.09	8.03
进口关税	1%	2017年12月	85140	19.91	10470	84073	1067	1.27%	-0.20%	8.13	8.11	8.03
杂费	150	2018年01月	85380	35.91	10486	84199	1181	1.40%	-0.15%	8.14	8.13	8.03

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	20015	现货	144500	151.04	20166	167265	-22765	-13.61%	/	7.17	7.09	8.29
到岸升水	600	2017年09月	143410	81.04	20096	166702	-23292	-13.97%	0.35%	7.14	7.09	8.30
汇率	6.6779	2017年10月	144350	31.04	20046	166300	-21950	-13.20%	0.25%	7.20	7.30	8.30
增值税	17%	2017年11月	150780	1.04	20016	166058	-15278	-9.20%	0.15%	7.53	7.43	8.30
进口关税	3%	2017年12月	145940	-33.96	19981	165777	-19837	-11.97%	0.17%	7.30	7.24	8.30
杂费	150	2018年01月	146070	-53.96	19961	165616	-19546	-11.80%	0.10%	7.32	7.28	8.30

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	50660	288.90	50364	-304	-0.60%	/	173.28	172.72	174.33
汇率	6.6779	2017年10月	50170	289.95	50545	-375	-0.74%	-0.36%	173.03	172.78	174.32
增值税	0.17	2017年11月	50330	289.95	50545	-215	-0.43%	0.00%	173.58	172.95	174.32
进口关税	0%	2017年12月	50520	291.10	50743	-223	-0.44%	-0.40%	173.55	173.03	174.31
杂费	150	2018年01月	50710	291.30	50777	-67	-0.13%	-0.07%	174.08	173.39	174.31

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
2017/8/16	276.95	1275.3	273.8062066	667.79	3.143793428	(-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)
2017/8/16	3906	16.625	3569.37833	667.79	336.62167

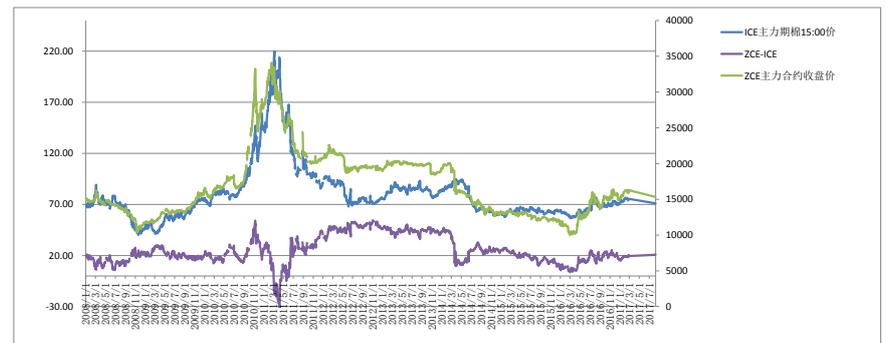
日期	郑州砂糖主力合约	6174	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年09月	6249	2017年10月	13.20	3949.215848	6.6779	2299.78
2018年01月	6300	2018年03月	14.00	4126.204506		2173.80

注: 郑州CICE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
	日期	合约月份	价格	日期	合约月份	价格	日期	合约月份	价格	
进口大豆压榨利润	2017年11月	9.245	2017年09月	2757	2017年09月	6066	15#-60磅=27.2154kg	汇率	6.6779	
	2018年01月	9.325	2018年01月	2716	2018年01月	6184	进口大豆出油率	79.50%		
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)	887.99	净利率 (元/吨)	36.02	进口大豆出油率	18.50%
	9.2450								加工费 (元/吨)	130
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)	658.01	净利率 (元/吨)	86.39	关税	3%
	9.3250								港杂费 (元/吨)	120

参数 (不含港杂费)	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	15210	2017年12月	67.27	11503	3707	32.23%	226	226	171.00
汇率	6.6779	2018年01月	15145	2018年03月	67.08	11471	3674	32.03%	226	226	171.01
增值税	13%										
进口关税	1%										
杂费	200										

日期	ICE主力合约棉15:00价	ZCE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2017/8/16	67.27	151.45	23.76684115



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	279,000	-1,975	150,025
铝	1,286,350	-2,675	236,280
镍	385,560	1,302	120,912
锌	250,700	-2,200	101,000
铅	149,225	0	61,300
锡	1,760	10	150

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。