

参数	合约月份	沪期价格	LMB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	
伦期3月价	6952.00	现货	53275	-29.82	6922	53540	-265	-0.49%	/	7.70	7.73
到岸升水	65	2017年09月	53470	-26.26	6926	53567	-397	-0.18%	-0.37%	7.72	7.72
汇率	6.537	2017年10月	53610	-16.76	6935	53640	-30	-0.08%	-0.26%	7.73	7.73
增值税	17%	2017年11月	53740	-4.26	6948	53735	5	0.01%	-0.24%	7.73	7.73
进口关税	0%	2017年12月	53820	7.74	6956	53827	-7	-0.01%	-0.15%	7.73	7.73
杂费	100	2018年01月	54000	14.99	6967	53883	117	0.22%	-0.33%	7.75	7.77

参数	合约月份	沪期价格	LMB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	
伦期3月价	2110.00	现货	16180	-21.76	2088	16913	-733	-4.33%	/	7.75	7.80
到岸升水	110	2017年09月	16360	-15.72	2094	16959	-599	-3.53%	-1.11%	7.81	7.77
汇率	6.537	2017年10月	16465	-9.22	2101	17009	-544	-3.20%	-0.64%	7.84	7.79
增值税	17%	2017年11月	16565	-2.72	2107	17058	-493	-2.89%	-0.61%	7.86	7.82
进口关税	0%	2017年12月	16630	3.28	2113	17104	-474	-2.77%	-0.39%	7.87	7.84
杂费	100	2018年01月	16675	6.28	2116	17127	-452	-2.64%	-0.27%	7.88	7.88

参数	合约月份	沪期价格	LMB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	
伦期3月价	3194.00	现货	26350	0.46	3194	25692	658	2.56%	/	8.25	8.32
到岸升水	125	2017年09月	26280	1.50	3196	25700	580	2.26%	0.27%	8.22	8.24
汇率	6.537	2017年10月	26160	-1.50	3193	25677	483	1.88%	0.46%	8.19	8.19
增值税	17%	2017年11月	26070	-1.50	3193	25677	393	1.53%	0.34%	8.17	8.17
进口关税	1%	2017年12月	25965	0.00	3194	25689	276	1.08%	0.40%	8.13	8.13
杂费	50	2018年01月	25875	-5.00	3189	25650	225	0.88%	0.35%	8.11	8.12

参数	合约月份	沪期价格	LMB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	
伦期3月价	2401.00	现货	19910	-25.53	2375	19444	466	2.40%	/	8.38	8.42
到岸升水	80	2017年09月	19900	-23.67	2377	19458	442	2.27%	0.05%	8.37	8.37
汇率	6.537	2017年10月	19515	-13.42	2388	19539	-24	-0.12%	1.93%	8.17	8.21
增值税	17%	2017年11月	19360	-4.67	2396	19608	-248	-1.26%	0.79%	8.08	8.13
进口关税	3%	2017年12月	19225	2.58	2404	19665	-440	-2.24%	0.70%	8.00	8.06
杂费	100	2018年01月	19100	5.83	2407	19691	-591	-3.00%	0.65%	7.94	7.97

参数	合约月份	沪期价格	LMB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	
伦期3月价	12230	现货	95300	-56.85	12173	95461	-161	-0.17%	/	7.83	7.91
到岸升水	165	2017年09月	95510	-49.22	12181	95518	-8	-0.01%	-0.06%	7.84	7.83
汇率	6.537	2017年10月	95410	-33.22	12197	95642	-232	-0.13%	-0.13%	7.82	7.89
增值税	17%	2017年11月	95500	-10.72	12219	95816	-316	-0.33%	-0.18%	7.82	7.89
进口关税	1%	2017年12月	96110	10.78	12241	95982	128	0.13%	-0.18%	7.85	7.90
杂费	150	2018年01月	96730	28.28	12258	96117	613	0.64%	-0.14%	7.89	7.93

参数	合约月份	沪期价格	LMB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	
伦期3月价	20700	现货	144500	191.42	20891	169454	-24954	-14.73%	/	6.92	6.94
到岸升水	600	2017年10月	143600	155.42	20855	169170	-25570	-15.12%	0.17%	6.89	6.91
汇率	6.537	2017年11月	145130	90.42	20790	168658	-23528	-13.95%	0.31%	6.98	6.93
增值税	17%	2017年12月	148220	45.42	20745	168304	-20084	-11.93%	0.22%	7.14	7.14
进口关税	3%	2018年01月	147090	-4.58	20695	167910	-20820	-12.40%	0.24%	7.11	7.11
杂费	150	2018年02月	146630	-39.58	20660	167634	-21004	-12.53%	0.17%	7.10	7.14

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	
到岸升水	70	2017年10月	53470	316.45	53945	-475	-0.88%	/	168.97	169.07
汇率	6.537	2017年11月	53610	315.95	53861	-251	-0.47%	0.16%	169.68	168.89
增值税	0.17	2017年12月	53740	317.10	54054	-314	-0.58%	-0.36%	169.47	169.29
进口关税	0%	2018年01月	53820	312.45	53271	549	1.03%	1.47%	172.25	170.72
杂费	150	2018年02月	54000	318.05	54214	-214	-0.40%	-1.79%	169.78	170.07

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
2017/9/5	283.65	1340.9	281.8161601	653.7	1.833839879	(-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)
2017/9/5	4059	17.88	3757.829027	653.7	301.1709725

日期	郑州白糖主力合约		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	6542	2017年10月	13.86	4020.133507	6.537		
2018年01月	6363	2018年03月	14.50		4158.736943			

日期	美豆价格		大连豆粕价格			大连豆油价格		参数
	2017年11月	9.575	2017年09月	2765	2017年09月	6296	1罐=60磅=27.2154kg	
2018年01月	9.67	2018年01月	2727		2018年01月	6398	汇率	
							6.537	
南美豆 (17年11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)	905.42	净利率 (元/吨)	55.90
								130
美湾豆 (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)	871.61	净利率 (元/吨)	99.05
								120

参数 (不含增值税)	合约月份	合约价格	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	15800	2017年12月	72.53	12130	3670	30.26%	216	#D/W/01
汇率	6.537	2018年01月	15910	2018年03月	71.43	11949	3961	33.15%	223	219
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
2017/9/5	72.53	15910	25.16661314



每日LME库存:

品种	库存数量 (吨)	变动	注销合约
铜	217,550	-3,325	106,100
铝	1,324,475	-150	173,275
镍	385,392	-1,854	142,740
锌	243,250	-475	130,550
铅	154,775	6,475	65,775
锡	1,910	0	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。