

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	6827.00	现货	52590	-25.36	6802	52347	243	-0.47%	/	7.73	12.14	7.70
到岸升水	65	2017年09月	51620	-28.36	6799	52324	-704	-1.34%	1.84%	7.59	7.69	7.70
汇率	6.5032	2017年10月	51730	-18.36	6809	52400	-670	-1.28%	-0.21%	7.60	7.70	7.70
增值税	17%	2017年11月	51740	-6.11	6821	52493	-753	-1.43%	-0.02%	7.59	7.69	7.70
进口关税	0%	2017年12月	51880	7.39	6834	52596	-716	-1.36%	-0.27%	7.59	7.69	7.70
杂费	100	2018年01月	52050	14.89	6842	52653	-603	-1.14%	-0.33%	7.61	7.71	7.70

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	2089.00	现货	15950	-24.77	2064	16643	-693	-4.16%	/	7.73	2.35	8.06
到岸升水	110	2017年09月	15780	-18.77	2070	16689	-909	-5.45%	1.07%	7.62	2.33	8.06
汇率	6.5032	2017年10月	15815	-11.27	2078	16746	-931	-5.56%	-0.22%	7.61	2.34	8.06
增值税	17%	2017年11月	15870	-4.02	2085	16801	-931	-5.54%	-0.35%	7.61	2.35	8.06
进口关税	0%	2017年12月	15950	3.23	2092	16856	-906	-5.36%	-0.50%	7.62	2.36	8.06
杂费	100	2018年01月	16000	7.23	2096	16887	-887	-5.25%	-0.31%	7.63	2.37	8.06

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	3089.00	现货	25610	-3.54	3085	24722	888	-3.59%	/	8.30	8.32	8.01
到岸升水	125	2017年09月	25010	-1.54	3087	24737	273	1.10%	2.34%	8.10	8.20	8.01
汇率	6.5032	2017年10月	24790	-3.04	3086	24726	64	0.26%	0.88%	8.03	8.14	8.01
增值税	17%	2017年11月	24575	-1.79	3087	24735	-160	-0.65%	0.87%	7.96	8.07	8.01
进口关税	1%	2017年12月	24400	0.46	3089	24753	-353	-1.42%	0.71%	7.90	8.02	8.01
杂费	50	2018年01月	24310	-1.04	3088	24741	-431	-1.74%	0.37%	7.87	7.99	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	2323.50	现货	19480	-29.15	2294	18708	772	4.13%	/	8.49	8.45	8.15
到岸升水	80	2017年09月	19100	-26.15	2297	18731	369	1.97%	1.95%	8.31	8.35	8.15
汇率	6.5032	2017年10月	18900	-16.15	2307	18810	90	0.48%	1.05%	8.19	8.16	8.15
增值税	17%	2017年11月	18535	-6.15	2317	18888	-353	-1.87%	1.93%	8.00	8.01	8.15
进口关税	3%	2017年12月	18295	1.85	2325	18951	-656	-3.46%	1.29%	7.87	7.88	8.15
杂费	100	2018年01月	18000	5.60	2329	18980	-980	-5.16%	1.61%	7.73	7.81	8.15

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	11940	现货	95350	-63.89	11976	92684	2666	2.88%	/	8.03	7.98	7.80
到岸升水	165	2017年09月	91810	-52.89	11987	92798	-958	-1.03%	-0.09%	7.72	7.85	7.80
汇率	6.5032	2017年10月	92200	-34.39	11996	92911	-711	-0.76%	-0.16%	7.74	7.87	7.80
增值税	17%	2017年11月	91600	-11.89	11928	93084	-1484	-1.59%	-0.19%	7.68	7.78	7.80
进口关税	1%	2017年12月	92840	11.61	11952	93264	-424	-0.45%	-0.20%	7.77	7.89	7.80
杂费	150	2018年01月	92750	31.61	11972	93418	-668	-0.71%	-0.17%	7.75	7.88	7.80

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	20700	现货	143500	130.00	20830	168097	-24597	-14.63%	/	6.89	6.89	8.07
到岸升水	600	2017年10月	141840	105.00	20805	167901	-26061	-15.52%	0.12%	6.82	6.83	8.07
汇率	6.5032	2017年11月	142400	55.00	20755	167509	-25109	-14.99%	0.24%	6.86	6.86	8.07
增值税	17%	2017年12月	141490	30.00	20730	167313	-25823	-15.43%	0.12%	6.83	6.82	8.07
进口关税	3%	2018年01月	147090	0.00	20700	167078	-19988	-11.96%	0.14%	7.11	7.10	8.07
杂费	150	2018年02月	144700	-30.00	20670	166843	-22143	-13.27%	0.14%	7.00	7.01	8.07

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10月	51620	309.90	52569	-949	-1.80%	/	166.57	168.54	169.63
汇率	6.5032	2017年11月	51730	309.80	52552	-822	-1.56%	0.03%	166.98	168.97	169.63
增值税	0.17	2017年12月	51740	310.45	52661	-921	-1.75%	-0.21%	166.66	168.85	169.63
进口关税	0%	2018年01月	51880	314.00	53256	-1376	-2.58%	-1.14%	165.22	167.39	169.60
杂费	150	2018年02月	52050	315.70	53541	-1481	-2.78%	-0.54%	164.87	167.65	169.59

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
2017/9/8	283.7	1359.8	284.3106739	650.32	-0.610673918	(-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)
2017/9/8	4053	18.11	3786.487943	650.32	266.5120572

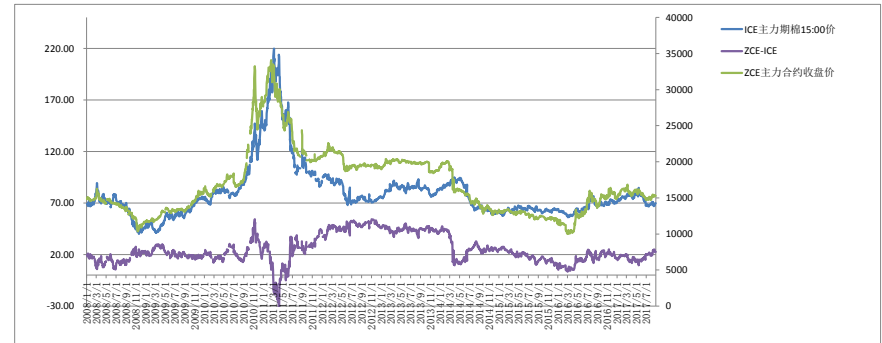
日期	郑州白糖主力合约		纽约原糖主力合约		纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
	2017年09月	6365	2017年10月	14.08			
2018年01月	6148		2018年03月	14.67	4019.517099	6.5032	2315.48
					4176.631472		1971.37

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			大连豆油价格			参数
	2017年11月	9.7125	2017年09月	2750	2017年09月	6166	1罐=60磅=27.2154kg	汇率	6.5032	
进口大豆压榨压榨率	2018年01月	9.8075	2018年01月	2717	2018年01月	6320				
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)	818.63	净利 (元/吨)	(2.50)	进口大豆出油率	79.50%
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)	828.51	净利 (元/吨)	53.64	进口菜豆出油率	18.50%
									加工费 (元/吨)	130
									关税	3%
									增值税	13%
									港杂费 (元/吨)	120

参数 (不含港杂费)	合约月份	美棉价格	美棉月份	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	15490	2017年12月	74.20	12341	3149	25.51%	209	213	166.32
汇率	6.5032	2018年01月	15560	2018年03月	72.55	12071	3489	28.90%	214	218	166.39
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
2017/9/8	74.20	15560	21.84401252



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	213,175	2,450	96,800
铝	1,321,500	125	167,275
镍	384,978	828	143,256
锌	241,800	-875	129,325
铅	164,375	-75	61,475
锡	1,915	-25	250

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所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.