

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	6674.00	现货	52400	-52.14	6622	52122	278	-0.53%	/	7.91	7.90	7.87
到岸升水	65	2017年10月	52110	-43.83	6630	52186	-76	-0.15%	0.55%	7.86	7.99	7.87
汇率	6.6493	2017年11月	52130	-26.83	6647	52319	-189	-0.38%	-0.04%	7.84	7.87	7.87
增值税	17%	2017年12月	52180	-7.33	6667	52470	-290	-0.55%	-0.10%	7.83	7.85	7.87
进口关税	0%	2018年01月	52250	-4.67	6679	52564	-314	-0.60%	-0.13%	7.82	7.94	7.87
杂费	100	2018年02月	52410	18.17	6692	52669	-259	-0.49%	-0.31%	7.83	7.93	7.87

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	2154.50	现货	16220	-23.16	2131	17537	-1317	-7.51%	/	7.61	7.64	8.23
到岸升水	110	2017年10月	16465	-20.10	2134	17561	-1096	-6.24%	-1.51%	7.71	7.77	8.23
汇率	6.6493	2017年11月	16580	-13.10	2141	17615	-1035	-5.88%	-0.70%	7.74	7.80	8.23
增值税	17%	2017年12月	16685	-3.35	2151	17691	-1006	-5.69%	-0.63%	7.76	7.82	8.22
进口关税	0%	2018年01月	16755	1.90	2156	17732	-977	-5.51%	-0.42%	7.77	7.83	8.22
杂费	100	2018年02月	16810	7.65	2162	17777	-967	-5.44%	-0.33%	7.77	7.83	8.22

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	3264.00	现货	27110	59.10	3323	27143	-33	-0.12%	/	8.16	8.18	8.17
到岸升水	125	2017年10月	27200	39.93	3304	26993	207	0.77%	-0.33%	8.23	8.50	8.17
汇率	6.6493	2017年11月	26735	9.93	3274	26757	-22	-0.08%	1.71%	8.17	8.43	8.17
增值税	17%	2017年12月	26440	4.93	3269	26716	-278	-1.04%	1.10%	8.09	8.35	8.17
进口关税	1%	2018年01月	26250	-0.57	3263	26675	-425	-1.59%	0.72%	8.04	8.04	8.17
杂费	50	2018年02月	26140	-6.57	3257	26627	-487	-1.83%	0.42%	8.02	8.29	8.17

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	2529.00	现货	21860	-17.47	2512	20866	994	4.76%	/	8.70	8.68	8.31
到岸升水	80	2017年10月	21865	-14.85	2514	20887	978	4.68%	-0.02%	8.70	8.79	8.31
汇率	6.6493	2017年11月	21150	-9.10	2520	20933	217	1.04%	3.27%	8.39	8.49	8.31
增值税	17%	2017年12月	20755	-1.60	2527	20993	-238	-1.14%	1.87%	8.21	8.30	8.31
进口关税	3%	2018年01月	20455	1.90	2531	21021	-566	-2.69%	1.45%	8.08	8.17	8.31
杂费	100	2018年02月	20355	4.40	2533	21041	-686	-3.26%	0.49%	8.03	8.12	8.31

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	10780	现货	87400	-88.04	10692	85458	1942	2.27%	/	8.17	8.26	7.99
到岸升水	165	2017年10月	84210	-80.17	10700	85520	-1310	-1.53%	-0.07%	7.87	8.11	7.99
汇率	6.6493	2017年11月	87370	-50.67	10729	85752	1618	1.89%	-0.28%	8.14	8.39	7.99
增值税	17%	2017年12月	86330	-19.17	10761	85999	331	0.38%	-0.29%	8.02	8.27	7.99
进口关税	1%	2018年01月	87290	5.83	10786	86196	1094	1.27%	-0.23%	8.09	8.34	7.99
杂费	150	2018年02月	84700	30.83	10811	86392	-1692	-1.96%	-0.23%	7.83	8.07	7.99

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	20840	现货	145500	111.29	20951	172842	-27342	-15.82%	/	6.94	6.95	8.25
到岸升水	600	2017年10月	144500	111.29	20951	172842	-28342	-16.40%	0.00%	6.90	6.95	8.25
汇率	6.6493	2017年11月	145320	61.29	20901	172441	-27121	-15.73%	0.24%	6.95	7.00	8.25
增值税	17%	2017年12月	146400	31.29	20871	172201	-25801	-14.98%	0.14%	7.01	7.07	8.25
进口关税	3%	2018年01月	148300	-1.71	20838	171937	-23637	-13.75%	0.16%	7.12	7.17	8.25
杂费	150	2018年02月	143350	-36.71	20803	171656	-28306	-16.49%	0.17%	6.89	#VALUE!	8.25

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12月	52110	302.35	52420	-310	-0.59%	/	172.46	#DIV/0!	173.49
汇率	6.6493	2018年01月	52130	303.35	52591	-461	-0.88%	-0.33%	171.96	171.90	173.48
增值税	0.17	2018年02月	52180	302.90	52548	-368	-0.70%	0.08%	172.27	172.10	173.48
进口关税	0%	2018年03月	52250	304.30	52788	-538	-1.02%	-0.46%	171.71	#DIV/0!	173.47
杂费	150	2018年04月	52410	305.05	52916	-506	-0.96%	-0.25%	171.81	171.28	173.47

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
2017/10/9	276.75	1284	274.4934393	664.93	2.256560681	(-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)
2017/10/9	3895	16.95	3623.569935	664.93	271.4300651

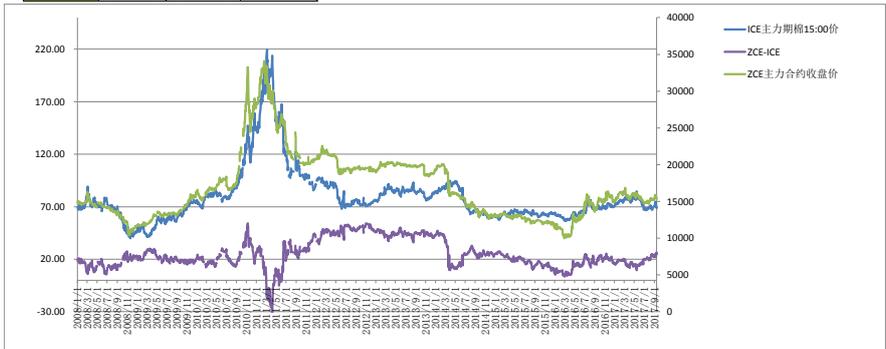
日期	郑商砂糖主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2018年01月	6034	14.09	4130.654352	6.6493	1903.35
2018年05月	5827	14.19	4152.683184		1674.32

注: 郑商CZCE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

参数	合约月份	到岸升水	大豆压榨价格			净利率 (元/吨)	净利率 (元/吨)	净利率 (元/吨)	净利率 (元/吨)		
			进口成本	进口盈亏	进口收益率					美铝安全边际	
到岸升水	70	2017年12月	52110	302.35	52420	-310	-0.59%	/	172.46	#DIV/0!	173.49
汇率	6.6493	2018年01月	52130	303.35	52591	-461	-0.88%	-0.33%	171.96	171.90	173.48
增值税	0.17	2018年02月	52180	302.90	52548	-368	-0.70%	0.08%	172.27	172.10	173.48
进口关税	0%	2018年03月	52250	304.30	52788	-538	-1.02%	-0.46%	171.71	#DIV/0!	173.47
杂费	150	2018年04月	52410	305.05	52916	-506	-0.96%	-0.25%	171.81	171.28	173.47

参数 (不含增值税)	合约月份	到岸升水	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	2018年01月	15980	2017年12月	68.74	11701	3379	28.88%	219	219	170.21
汇率	6.6493	2018年05月	15130	2018年03月	68.00	11577	3653	30.69%	223	223	170.25
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
2017/10/9	68.74	15130	22.59785617



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	291,000	-2,450	67,800
铝	1,242,450	-4,425	239,550
镍	384,864	-1,638	135,528
锌	258,575	7,875	135,850
铅	154,875	-250	54,375
锡	1,970	0	195

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。