

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	7083.00	现货	55600	-23.80	7050	55016	584	1.06%	/	7.68	7.66	7.79
到岸升水	65	2017年11月	55160	-18.80	7064	55054	106	0.19%	0.79%	7.61	7.60	7.79
汇率	6.5883	2017年12月	55120	-5.80	7077	55154	-34	-0.06%	0.07%	7.79	7.79	7.79
增值税	17%	2018年01月	55210	0.20	7083	55201	9	0.02%	-0.16%	7.79	7.80	7.79
进口关税	0%	2018年02月	55390	8.70	7092	55266	124	0.22%	-0.33%	7.61	7.61	7.79
杂费	100	2018年03月	55550	18.70	7102	55343	207	0.37%	-0.29%	7.62	7.62	7.79

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	2140.00	现货	16050	-26.00	2114	17243	-1193	-6.92%	/	7.59	7.66	8.16
到岸升水	110	2017年11月	16265	-16.50	2124	17317	-1052	-6.07%	-1.34%	7.66	7.68	8.15
汇率	6.5883	2017年12月	16350	-5.75	2134	17399	-1049	-6.03%	-0.52%	7.66	7.69	8.15
增值税	17%	2018年01月	16430	0.00	2140	17444	-1014	-5.81%	-0.49%	7.68	7.71	8.15
进口关税	0%	2018年02月	16490	5.75	2146	17488	-998	-5.71%	-0.37%	7.68	7.71	8.15
杂费	100	2018年03月	16560	11.00	2151	17528	-968	-5.53%	-0.42%	7.70	7.72	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	3159.50	现货	26320	35.00	3195	25894	426	1.65%	/	8.24	10.89	8.11
到岸升水	125	2017年11月	25925	9.00	3169	25691	234	0.91%	1.50%	8.18	11.06	8.11
汇率	6.5883	2017年12月	25560	4.00	3164	25652	-92	-0.36%	1.41%	8.08	11.04	8.11
增值税	17%	2018年01月	25285	0.00	3160	25621	-336	-1.31%	1.08%	8.00	10.99	8.11
进口关税	1%	2018年02月	25105	-5.00	3155	25582	-477	-1.87%	0.71%	7.96	10.98	8.11
杂费	50	2018年03月	25230	-11.00	3149	25535	-305	-1.20%	-0.50%	8.01	10.97	8.11

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	2525.00	现货	20900	-13.25	2512	20677	223	1.08%	/	8.32	8.22	8.23
到岸升水	80	2017年11月	20265	-6.25	2519	20733	-468	-2.26%	3.04%	8.05	8.04	8.23
汇率	6.5883	2017年12月	20090	-3.25	2522	20757	-667	-3.21%	0.86%	7.97	7.96	8.23
增值税	17%	2018年01月	19970	0.00	2525	20783	-813	-3.91%	0.60%	7.91	7.87	8.23
进口关税	3%	2018年02月	19845	2.50	2528	20802	-957	-4.60%	0.63%	7.85	7.84	8.23
杂费	100	2018年03月	19910	5.25	2530	20824	-914	-4.39%	-0.33%	7.87	7.75	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	11695	现货	94500	-60.50	11635	92014	2480	2.70%	/	8.12	7.96	7.91
到岸升水	165	2017年11月	93200	-41.50	11654	92162	1038	1.13%	-0.16%	8.00	7.99	7.91
汇率	6.5883	2017年12月	92730	-20.00	11675	92329	401	0.43%	-0.18%	7.94	7.94	7.91
增值税	17%	2018年01月	93400	0.00	11695	92485	915	0.99%	-0.17%	7.99	7.87	7.91
进口关税	1%	2018年02月	93840	22.00	11717	92556	1184	1.28%	-0.19%	8.01	7.89	7.91
杂费	150	2018年03月	93660	45.00	11740	92835	825	0.89%	-0.20%	7.98	7.95	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	20655	现货	144250	76.00	20731	169509	-25259	-14.90%	/	6.96	6.90	8.18
到岸升水	600	2017年11月	145330	56.00	20711	169350	-24020	-14.18%	0.10%	7.02	6.98	8.18
汇率	6.5883	2017年12月	147040	26.00	20681	169112	-22072	-13.05%	0.14%	7.11	7.07	8.18
增值税	17%	2018年01月	147090	0.00	20655	168905	-21815	-12.92%	0.13%	7.12	7.12	8.18
进口关税	3%	2018年02月	143300	-40.00	20615	168588	-25288	-15.00%	0.19%	6.95	6.87	8.18
杂费	150	2018年03月	149180	-79.00	20576	168278	-19098	-11.35%	0.19%	7.25	7.17	8.18

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	55160	321.30	55191	-31	-0.06%	/	171.68	172.60	171.77
汇率	6.5883	2018年01月	55120	321.35	55199	-79	-0.14%	-0.02%	171.53	171.19	171.77
增值税	0.17	2018年02月	55210	323.95	55641	-431	-0.77%	-0.81%	170.43	172.34	171.76
进口关税	0%	2018年03月	55390	322.55	55403	-13	-0.02%	0.43%	171.73	170.95	171.77
杂费	150	2018年04月	55550	323.25	55522	28	0.05%	-0.22%	171.85	171.62	171.76

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
2017/10/17	277.25	1291.7	273.6062688	658.83	3.643731184	(-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)
2017/10/17	3910	17.155	3633.750516	658.83	276.249484

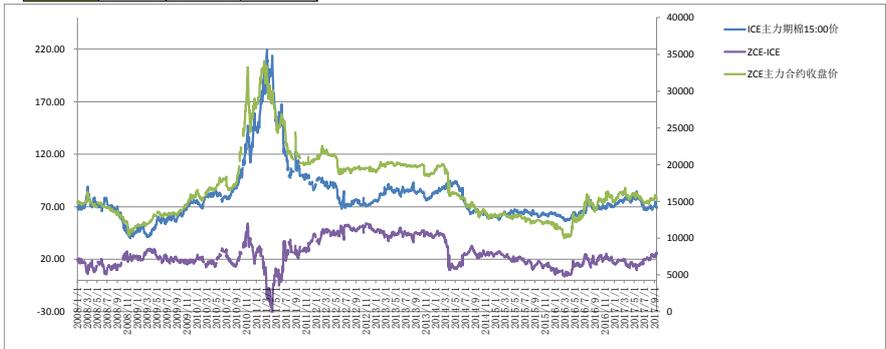
日期	郑州白糖主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2018年01月	6267	14.11	4102.042636	6.5883	2164.96
2018年05月	5946	14.22	4126.052052		1819.95

注: 郑州CICE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	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	国际运费 (美元)	毛利 (元/吨)	净利 (元/吨)	参数
南美豆 (17年11月到期)	9.9925	4.00	41.87	810.12	(61.69)	130	18.50%
美国豆 (17年11月到期)	10.0550	78.00	46.26	762.09	(31.66)	120	13%

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	15185	67.86	11449	3736	32.63%	224	222	168.72
汇率	6.5883	2018年05月	15190	67.65	11414	3776	33.08%	225	223	168.73
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
2017/10/17	67.86	15190	24.68910447



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	291,325	6,300	79,050
铝	1,212,225	-6,725	242,825
镍	385,656	-132	140,034
锌	271,850	-50	128,475
铅	152,150	175	51,550
锡	2,040	-50	110

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。