

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	7022.00	现货	52070	-43.25	6979	52372	-302	-0.58%	/	7.46	7.50	7.50
到岸升水	65	2018年03月	52620	-25.25	6997	52506	114	0.22%	-1.06%	7.52	7.53	7.50
汇率	6.3428	2018年04月	52790	-11.50	7011	52608	182	0.33%	-0.32%	7.53	7.55	7.50
增值税	17%	2018年05月	52990	0.00	7022	52693	297	0.56%	-0.38%	7.55	7.56	7.50
进口关税	0%	2018年06月	53100	13.00	7035	52790	310	0.59%	-0.21%	7.55	7.57	7.50
杂费	100	2018年07月	53330	22.50	7045	52860	470	0.89%	-0.43%	7.57	7.59	7.50

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	2129.40	现货	14020	-7.25	2122	16665	-2645	-15.87%	/	6.61	6.54	7.85
到岸升水	110	2018年03月	14020	-7.75	2122	16661	-2641	-15.85%	0.00%	6.61	6.68	7.85
汇率	6.3428	2018年04月	14105	-3.00	2126	16696	-2591	-15.52%	-0.61%	6.63	6.70	7.85
增值税	17%	2018年05月	14205	0.50	2130	16722	-2517	-15.05%	-0.71%	6.67	6.74	7.85
进口关税	0%	2018年06月	14305	5.25	2135	16758	-2453	-14.64%	-0.70%	6.70	6.76	7.85
杂费	100	2018年07月	14390	9.00	2138	16786	-2396	-14.27%	-0.59%	6.73	6.80	7.85

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	3465.10	现货	26345	22.50	3488	27127	-782	-2.68%	/	7.55	7.54	7.78
到岸升水	125	2018年03月	26635	6.50	3472	27009	-373	-1.38%	-1.10%	7.67	7.64	7.78
汇率	6.3428	2018年04月	26650	2.00	3467	26974	-324	-1.20%	-0.08%	7.69	7.66	7.78
增值税	17%	2018年05月	26855	-2.00	3463	26944	-359	-1.33%	0.24%	7.68	7.66	7.78
进口关税	1%	2018年06月	26970	-6.00	3459	26914	-444	-1.63%	0.43%	7.65	7.66	7.78
杂费	50	2018年07月	26400	-10.00	3455	26884	-484	-1.80%	0.26%	7.64	7.64	7.78

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	2556.70	现货	19230	3.50	2560	20281	-1051	-5.18%	/	7.51	7.53	7.92
到岸升水	80	2018年03月	19320	3.00	2560	20277	-957	-4.72%	-0.47%	7.55	7.52	7.92
汇率	6.3428	2018年04月	19315	-1.00	2556	20247	-932	-4.60%	0.03%	7.56	7.53	7.92
增值税	17%	2018年05月	19290	0.00	2557	20254	-964	-4.76%	0.13%	7.54	7.53	7.92
进口关税	3%	2018年06月	19275	0.50	2557	20258	-983	-4.85%	0.08%	7.54	7.52	7.92
杂费	100	2018年07月	19270	1.50	2558	20266	-996	-4.91%	0.03%	7.53	7.49	7.92

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	13560	现货	102000	-42.00	13518	102708	-708	-0.69%	/	7.55	7.61	7.60
到岸升水	165	2018年03月	102180	-31.00	13529	102790	-610	-0.59%	-0.08%	7.55	7.62	7.60
汇率	6.3428	2018年04月	103360	-16.50	13544	102899	-461	0.45%	-0.11%	7.63	7.67	7.60
增值税	17%	2018年05月	103490	0.50	13561	103027	-463	0.45%	-0.13%	7.63	7.63	7.60
进口关税	1%	2018年06月	103830	21.50	13582	103184	-646	0.63%	-0.15%	7.64	7.68	7.60
杂费	150	2018年07月	104000	39.50	13600	103319	-681	0.66%	-0.13%	7.65	7.64	7.60

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	21586	现货	148000	88.00	21674	315140	-167140	-53.04%	/	6.83	6.88	14.54
到岸升水	19535	2018年03月	149690	50.00	21636	314849	-165159	-52.46%	0.18%	6.92	7.05	14.55
汇率	6.3428	2018年04月	147740	25.00	21611	314658	-166918	-53.05%	0.12%	6.84	6.83	14.56
增值税	17%	2018年05月	148880	0.00	21586	314467	-165587	-52.66%	0.12%	6.90	6.92	14.57
进口关税	3%	2018年06月	149920	-25.00	21561	314276	-164356	-52.30%	0.12%	6.95	7.08	14.58
杂费	150	2018年07月	143990	-45.00	21541	314123	-170133	-54.16%	0.09%	6.68	6.79	14.58

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	2018年03月	52950	316.60	52370	560	1.11%	/	167.25	169.93	165.41
汇率	6.3428	2018年04月	52790	317.80	52566	224	0.43%	-0.38%	166.11	167.28	165.41
增值税	0.17	2018年05月	52990	318.45	52672	318	0.60%	-0.20%	166.40	166.95	165.40
进口关税	0%	2018年06月	53100	319.00	52762	338	0.64%	-0.17%	166.46	168.57	165.40
杂费	150	2018年07月	53330	319.75	52885	445	0.84%	-0.24%	166.79	166.78	165.39

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
2018/2/14	276.1	1336.7	272.5875291	634.28	3.512470888	(-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)
2018/2/14	3718	16.605	3386.186819	634.28	331.813181

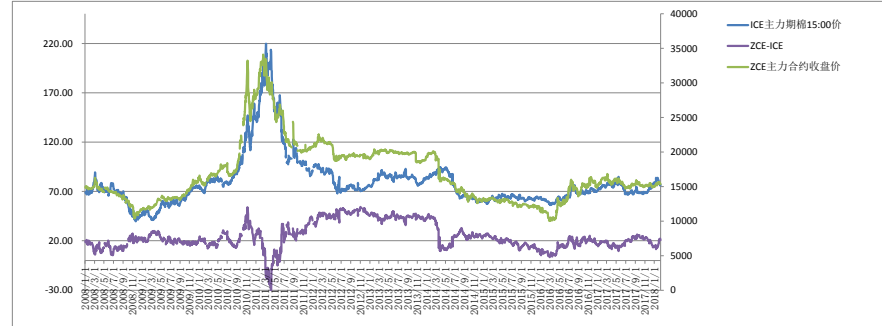
日期	郑州白糖主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂糖成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2018年05月	5759	13.65	3872.499109	6.3428	1886.50
2018年09月	5742	13.53	3847.283016		1894.72

注: 郑州CZCE与纽约原糖交易时间不一致, 仅供参考

进口大豆压榨利润	美豆价格		大豆压榨价格		大豆油价格		参数
	2018年03月	10.0925	2018年05月	2857	2018年05月	5634	
	2018年05月	10.1975	2018年09月	2837	2018年09月	5780	汇率
			进口南美大豆 国内压榨 (18年3月到港)				进口大豆出油率
			FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	国际运费 (美元)	毛利 (元/吨)	净利 (元/吨)	进口大豆出油率
			4.00	41.87	802.88	(44.73)	加工费 (元/吨)
			美国豆 (18年5月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	国际运费 (美元)	毛利 (元/吨)	净利 (元/吨)
			10.1975	78.00	46.26	789.72	14.77
							港杂费 (元/吨)
							120

参数 (不含增值税)	合约月份	郑糖价格	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	2018年05月	14900	2018年03月	75.97	12324	2576	20.50%	196	195	162.23
汇率	6.3428	2018年09月	15370	2018年05月	77.10	12505	2865	22.91%	199	198	162.19
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
2018/2/14	77.10	14900	17.19595526



品种	库存数量 (吨)	变动	注销比率
铜	333,625	600	50.525
铝	1,272,550	-2,860	200.825
镍	338,850	-354	89.052
锌	154,350	-1,775	70.650
铅	121,075	-1,625	43.350
锡	1,910	-15	645

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。