

品种	参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪铜安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
铜进口套利	伦铜3月价	现货	48560	-16.00	5963	48340	220	-0.45%	/	8.14	8.15	8.11
	到岸升水	2017年03月	48220	-10.00	5969	48388	-168	-0.35%	0.70%	8.08	8.07	8.11
	汇率	2017年04月	48360	-4.00	5975	48436	-76	-0.16%	-0.25%	8.09	8.08	8.11
	增值税	2017年05月	48550	0.00	5979	48468	82	-0.17%	-0.39%	8.12	8.12	8.11
	进口关税	2017年06月	48680	2.00	5981	48484	196	-0.40%	-0.27%	8.14	8.14	8.11
	杂费	2017年07月	48860	4.00	5983	48501	359	-0.74%	-0.37%	8.17	8.16	8.11

品种	参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪铜安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
铜进口套利	伦铜3月价	现货	13990	-12.50	1869	15870	-1880	-11.85%	/	7.49	7.51	8.49
	到岸升水	2017年03月	13980	-8.50	1873	15902	-1922	-12.09%	0.07%	7.46	7.54	8.49
	汇率	2017年04月	14065	-3.75	1878	15940	-1875	-11.77%	-0.61%	7.49	7.57	8.49
	增值税	2017年05月	14140	0.00	1882	15971	-1831	-11.46%	-0.53%	7.52	7.59	8.49
	进口关税	2017年06月	14215	4.00	1886	16003	-1788	-11.17%	-0.53%	7.54	7.60	8.49
	杂费	2017年07月	14280	6.75	1888	16025	-1745	-10.89%	-0.46%	7.56	7.61	8.49

品种	参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪铜安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
铜进口套利	伦铜3月价	现货	23320	-7.00	2839	23942	-622	-2.60%	/	8.22	8.21	8.43
	到岸升水	2017年03月	23250	-5.00	2841	23958	-708	-2.96%	0.30%	8.19	8.15	8.43
	汇率	2017年04月	23280	-3.00	2843	23975	-695	-2.90%	-0.13%	8.19	8.16	8.43
	增值税	2017年05月	23310	0.00	2846	23999	-689	-2.87%	-0.13%	8.19	8.16	8.43
	进口关税	2017年06月	23310	2.00	2848	24015	-705	-2.94%	0.00%	8.19	8.16	8.43
	杂费	2017年07月	23215	3.00	2849	24023	-808	-3.38%	0.41%	8.15	8.14	8.43

品种	参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪铜安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
铜进口套利	伦铜3月价	现货	18920	-14.50	2258	19384	-464	-2.39%	/	8.38	8.35	8.59
	到岸升水	2017年03月	18895	-6.50	2266	19450	-755	-3.88%	1.19%	8.25	8.22	8.59
	汇率	2017年04月	18750	-3.25	2269	19476	-726	-3.73%	-0.29%	8.26	8.24	8.58
	增值税	2017年05月	18820	0.00	2272	19503	-683	-3.50%	-0.37%	8.28	8.25	8.58
	进口关税	2017年06月	18940	2.00	2274	19520	-580	-2.97%	-0.64%	8.33	8.24	8.58
	杂费	2017年07月	18945	4.00	2276	19536	-591	-3.03%	-0.03%	8.32	8.24	8.58

品种	参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪铜安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
铜进口套利	伦铜3月价	现货	90000	-57.25	10893	83399	601	0.67%	/	8.26	8.24	8.21
	到岸升水	2017年03月	89750	-37.25	10913	83651	189	0.21%	-0.18%	8.22	8.39	8.21
	汇率	2017年04月	90320	-16.50	10934	83728	592	0.69%	-0.19%	8.26	8.26	8.21
	增值税	2017年05月	90690	0.00	10950	83862	828	0.92%	-0.15%	8.28	8.32	8.21
	进口关税	2017年06月	90830	17.50	10968	84004	828	0.92%	-0.16%	8.28	8.36	8.21
	杂费	2017年07月	91840	33.50	10984	84133	1707	1.89%	-0.15%	8.36	8.42	8.21

品种	参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪铜安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
铜进口套利	伦铜3月价	现货	148500	-42.00	19563	166487	-17987	-10.80%	/	7.59	7.49	8.51
	到岸升水	2017年03月	143350	-25.00	19580	166628	-23278	-13.97%	-0.09%	7.32	7.20	8.51
	汇率	2017年04月	150390	-15.00	19590	166710	-18320	-9.79%	-0.05%	7.68	7.55	8.51
	增值税	2017年05月	146690	0.00	19605	166834	-20144	-12.07%	-0.08%	7.48	7.46	8.51
	进口关税	2017年06月	144650	10.00	19615	166916	-22266	-13.34%	-0.05%	7.37	7.26	8.51
	杂费	2017年07月	145260	15.00	19620	166958	-21698	-13.00%	-0.03%	7.40	7.28	8.51

品种	参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦敦价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	沪铜安全边际	实际比值		进口比值
										今日	昨日	
铜进口套利	到岸升水	2017年03月	48220	270.70	48416	-196	-0.40%	/	178.13	177.81	178.85	
	汇率	2017年04月	48360	272.80	48786	-426	-0.87%	-0.78%	177.27	177.15	178.84	
	增值税	2017年05月	48550	272.45	48725	-175	-0.36%	0.13%	178.20	177.87	178.84	
	进口关税	2017年06月	48860	274.30	49051	-371	-0.76%	-0.68%	177.47	176.49	178.82	
	杂费	2017年07月	48860	274.25	49042	-182	-0.37%	0.02%	178.16	178.36	178.82	

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
2017/2/17	277.45	1238.4	272.560853	684.56	4.889147002	(-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)
2017/2/17	4227	18.04	3970.44395	684.56	256.5560497

日期	郑州砂糖主力合约	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)
2017年05月	6840	20.39	5665.563012	6.8456	1174.44
2017年09月	6914	20.35	5656.491346		1257.51

品种	参数	合约月份	大豆价格	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)
				毛利 (元/吨)	净利率 (元/吨)				
进口大豆压榨利润	2017年03月	1035.5	2906	2906	189	(257074.66)	(300253.84)		
	2017年05月	1046.5	2934	2934					
	南美豆 (16年9月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	国际运费 (美元)	毛利 (元/吨)	净利率 (元/吨)	净利率 (元/吨)	净利率 (元/吨)	净利率 (元/吨)	净利率 (元/吨)
	1035.5000	4.00	41.87	(257074.66)	(300253.84)				
	美国豆 (17年1月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	国际运费 (美元)	毛利 (元/吨)	净利率 (元/吨)	净利率 (元/吨)	净利率 (元/吨)	净利率 (元/吨)	
	1046.5000	78.00	46.26	(259805.12)	(303350.78)				

品种	参数	合约月份	期货价格	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	
糖进口套利	到岸升水	2017年05月	15515	2017年03月	74.70	13067	2448	18.74%	208	207	174.92
	汇率	2017年09月	15910	2017年05月	76.47	13372	2538	18.98%	208	208	174.86
	增值税										
	进口关税										
	杂费										

日期	ICE主力期棉15:00价	ICE主力合约收盘价	ZCE-ICE
2017/2/17	74.70	15910	18.5924448



品种	库存数量 (吨)	变动	注销仓单
铜	229,075	-7,650	103,000
铝	2,202,350	-5,700	629,400
镍	379,494	-606	102,396
锌	390,850	-3,075	100,425
铅	189,750	625	70,400
锡	5,995	50	940

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。