

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦铜价格	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		
伦铜3月价	5887.50	现货	47110	-24.06	5863	47961	-751	-1.57%	/	8.03	8.08	8.16
到岸升水	60	2017年04月	47300	-12.91	5875	47951	-851	-1.36%	-0.40%	8.05	8.07	8.16
汇率	6.8915	2017年05月	47530	-4.31	5883	48020	-490	-1.02%	-0.49%	8.08	8.09	8.16
增值税	17%	2017年06月	47700	1.94	5889	48071	-371	-0.77%	-0.36%	8.10	8.10	8.16
进口关税	0%	2017年07月	47840	6.19	5894	48105	-265	-0.55%	-0.29%	8.12	8.12	8.16
杂费	100	2017年08月	47920	11.64	5899	48149	-229	-0.48%	-0.17%	8.12	8.14	8.16

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦铜价格	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		
伦铜3月价	1947.00	现货	13530	-8.68	1938	16535	-3005	-18.17%	/	6.98	7.02	8.53
到岸升水	100	2017年04月	13730	-6.08	1941	16556	-2826	-17.07%	-1.48%	7.07	7.07	8.53
汇率	6.8915	2017年05月	13835	-3.18	1944	16579	-2744	-16.55%	-0.76%	7.12	7.11	8.53
增值税	17%	2017年06月	13910	1.07	1948	16614	-2704	-16.27%	-0.54%	7.14	7.14	8.53
进口关税	0%	2017年07月	13970	3.57	1951	16634	-2664	-16.01%	-0.43%	7.16	7.16	8.53
杂费	100	2017年08月	14025	5.57	1953	16650	-2625	-15.77%	-0.39%	7.18	7.19	8.53

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦铜价格	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		
伦铜3月价	2846.00	现货	23000	-18.93	2827	24009	-1009	-4.20%	/	8.14	8.25	8.49
到岸升水	115	2017年04月	23380	-10.13	2836	24081	-701	-2.91%	-1.65%	8.24	8.22	8.49
汇率	6.8915	2017年05月	23380	-3.68	2842	24133	-753	-3.12%	0.00%	8.23	8.19	8.49
增值税	17%	2017年06月	23385	0.57	2847	24168	-783	-3.24%	-0.02%	8.22	8.16	8.49
进口关税	1%	2017年07月	23345	3.57	2850	24193	-848	-3.50%	0.17%	8.19	8.14	8.49
杂费	50	2017年08月	23325	5.97	2852	24212	-887	-3.66%	0.09%	8.18	8.14	8.49

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦铜价格	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		
伦铜3月价	2333.50	现货	17570	-10.60	2323	20056	-2486	-12.40%	/	7.56	7.74	8.63
到岸升水	80	2017年04月	17480	-3.96	2330	20111	-2631	-13.08%	0.51%	7.50	7.53	8.63
汇率	6.8915	2017年05月	17525	-2.10	2331	20127	-2602	-12.93%	-0.26%	7.52	7.58	8.63
增值税	17%	2017年06月	17635	-0.10	2333	20143	-2508	-12.45%	-0.63%	7.56	7.60	8.63
进口关税	3%	2017年07月	17640	1.90	2335	20160	-2520	-12.50%	-0.03%	7.55	7.62	8.63
杂费	100	2017年08月	17580	3.35	2337	20172	-2592	-12.85%	0.34%	7.52	7.67	8.63

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦铜价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	伦铜安全边际	实际比值		进口比值	
									今日	昨日		
伦铜3月价	10005	现货	82500	-67.64	9937	82217	283	0.34%	/	8.30	8.39	8.27
到岸升水	140	2017年04月	80810	-45.28	9960	82389	-1789	-2.17%	-0.23%	8.09	8.33	8.27
汇率	6.8915	2017年05月	82550	-27.64	9977	82543	7	0.01%	-0.18%	8.27	8.27	8.27
增值税	17%	2017年06月	83000	-6.14	9999	82718	282	0.34%	-0.22%	8.30	8.35	8.27
进口关税	1%	2017年07月	83600	12.86	10018	82872	728	0.88%	-0.19%	8.35	8.27	8.27
杂费	150	2017年08月	83650	34.76	10040	83051	599	0.72%	-0.22%	8.33	8.27	8.27

参数	合约月份	沪铜价格	LME升贴水	伦铜价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	伦铜安全边际	实际比值		进口比值	
									今日	昨日		
伦铜3月价	20075	现货	143000	21.82	20097	172036	-29036	-16.88%	/	7.12	7.22	8.56
到岸升水	600	2017年04月	160080	34.77	20110	172144	-12064	-7.01%	-0.06%	7.96	8.08	8.56
汇率	6.8915	2017年05月	143660	25.82	20101	172069	-28409	-16.51%	0.04%	7.15	7.20	8.56
增值税	17%	2017年06月	141560	5.82	20081	171903	-30343	-17.65%	0.10%	7.05	7.28	8.56
进口关税	3%	2017年07月	140230	-19.18	20056	171695	-31465	-18.33%	0.12%	6.99	7.16	8.56
杂费	150	2017年08月	140140	-43.53	20031	171493	-31353	-18.28%	0.12%	7.00	7.16	8.56

参数	合约月份	沪铜价格	美铜价格	进口成本	进口盈亏	进口收益率	美铜安全边际	实际比值		进口比值	
								今日	昨日		
到岸升水	70	2017年04月	47300	265.85	47879	-579	-1.21%	/	177.92	177.85	180.10
汇率	6.8915	2017年05月	47530	267.00	48083	-553	-1.15%	-0.43%	178.01	178.33	180.09
增值税	0.17	2017年06月	47700	266.70	48029	-329	-0.69%	0.11%	178.85	178.42	180.09
进口关税	0%	2017年07月	47840	268.45	48340	-500	-1.03%	-0.66%	178.21	178.45	180.07
杂费	150	2017年08月	47920	269.75	48571	-651	-1.34%	-0.48%	177.65	177.66	180.06

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
2017/3/29	280.6	1249.9	276.9364023	689.15	3.663597707	(-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)
2017/3/29	4201	18.09	4008.144266	689.15	192.8557345

日期	郑州砂磷主力合约	纽约原糖主力合约	纽约原糖加工成砂磷成本 (RMB)	RMB汇率	价差 (郑-美)
2017年05月	6609	2017年05月	17.58	5058.399426	1550.60
2017年09月	6697	2017年07月	17.62	5067.531917	1629.47

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		大豆压榨价格		大豆油价格		参数	
	2017年05月	974.75	2017年05月	2801	2017年05月	6070		1罐=60磅=27.2154kg
进口大豆	2017年07月	985.25	2017年09月	2816	2017年09月	6206	汇率	6.8915
南美豆 (16年9月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	4.00	国际运费 (美元)	41.87	毛利 (元/吨)	(213635.05)	净利率 (元/吨)	(284581.65)
974.7500							加工费 (元/吨)	130
美国豆 (17年1月到港)	FOB升贴水 (美分/蒲式耳)	78.00	国际运费 (美元)	46.26	毛利 (元/吨)	(216256.93)	净利率 (元/吨)	(287551.35)
985.2500							增值税	3%
							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05月	15000	2017年05月	76.88	13531	1469	10.86%	195	195	176.00
汇率	6.8915	2017年09月	15555	2017年07月	78.22	13783	1792	13.02%	199	199	175.96
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
2017/3/29	76.88	15555	13.72331094



品种	库存数量 (吨)	变动	注册仓单
铜	304,275	-4,950	132,175
铝	1,912,075	-11,225	900,800
镍	379,866	-1,314	93,444
锌	373,800	-350	187,200
铅	190,150	-50	112,225
锡	3,565	-150	425

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。