



ICE

軟性商品報告

2024年5月8日 永豐期貨顧問事業部編制

軟性商品表現速覽

商品\期間	日(%)	週(%)	月(%)	季(%)	半年(%)
咖啡(Arabica)	+0.74%	-9.81%	-6.81%	+1.74%	+12.78%
咖啡(Robusta)	-4.60%	-15.63%	-4.02%	+7.64%	+34.11%
可可	+13.47%	-5.33%	-5.99%	+63.70%	+143.11%
棉花	+0.57%	-1.18%	-10.51%	-14.95%	-2.14%
11號糖	+2.41%	+1.22%	-7.17%	-15.32%	-26.60%

重點新聞

- 咖啡：**
7月份阿拉比卡咖啡價格小漲0.74%，達到每磅196.65美分，而7月份羅布斯塔咖啡價格大跌-4.60%，達到每公噸3378美元。
- 可可：**
7月份的紐約可可價格大漲13.47%，達到每公噸8610美元，價格再度站回季線之上。
- 糖：**
7月份的11號糖價格大漲2.41%，達到每磅19.95美分，突破了盤整約三週的整理區間上緣，也突破月線反壓。
- 棉花：**
7月份的棉花價格小漲0.57%，達到每磅77.5美分。

咖啡期貨(KC, Arabica)表現狀況

此報價為美分/磅，以今天為例：
ICE咖啡期貨May24價格為199美分/磅，或1.99美元/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
May24	199.00	-1.70 ▼	0.85%	72	324	-15	May24 / Jul24	-2.3
Jul24	196.65	+1.45 ▲	0.74%	27318	109172	-5441	Jul24 / Sep24	-1.3
Sep24	195.40	+1.25 ▲	0.64%	13932	59846	-6	Sep24 / Dec24	-1.2
Dec24	194.25	+1.40 ▲	0.73%	6331	34574	+405	Dec24 / Mar25	-0.6
Mar25	193.70	+1.30 ▲	0.68%	2473	12699	-205	跨月價差 = 遠期 - 近期 (咖啡期貨的合約有 3、5、7、9、12)	

咖啡期貨價格(Arabica) (連續近期合約走勢圖)

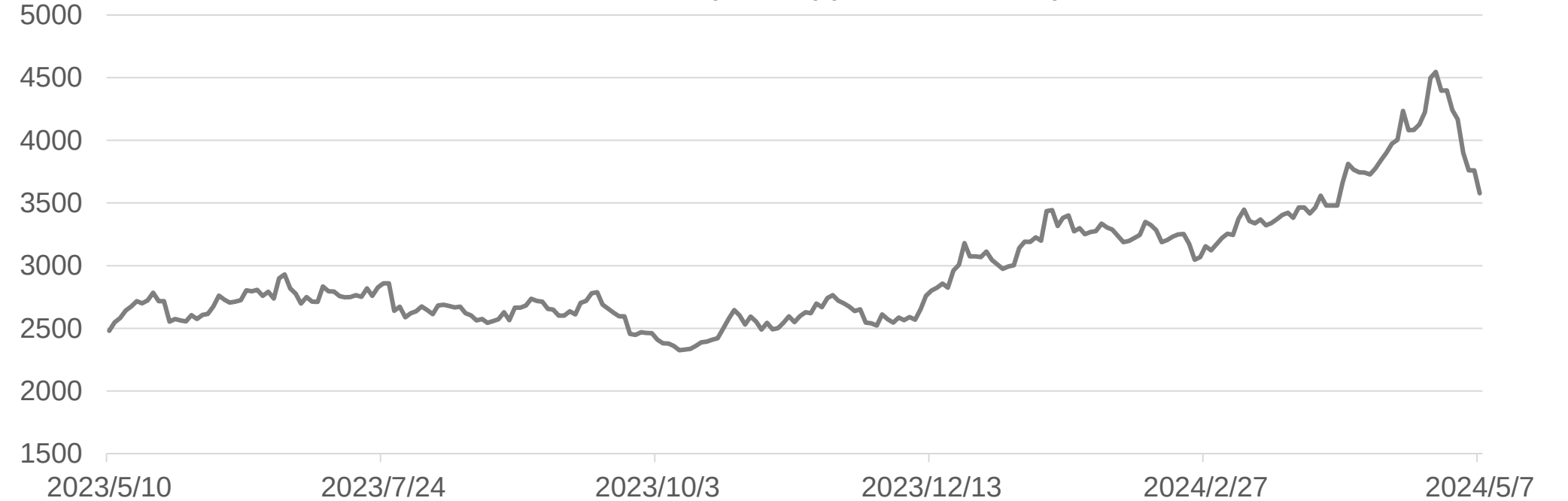


咖啡期貨(RC, Robusta)表現狀況

此報價為美元/公噸，以今天為例：Robusta期貨May24價格為3578美元/公噸
* 由於資訊取得問題，此OI為前一交易日之OI，與其他品項不同

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
May24	3578	-183	▼ 4.87%	3	1072	0	May24 / Jul24	-200.0
Jul24	3378	-163	▼ 4.60%	22578	48081	-298	Jul24 / Sep24	-73.0
Sep24	3305	-165	▼ 4.76%	11670	20368	-21	Sep24 / Nov24	-79.0
Nov24	3226	-159	▼ 4.70%	1991	4898	0	Nov24 / Jan25	-98.0
Jan25	3128	-152	▼ 4.63%	408	2911	0	跨月價差 = 遠期 - 近期 (咖啡期貨的合約有 1、3、5、7、9、11)	

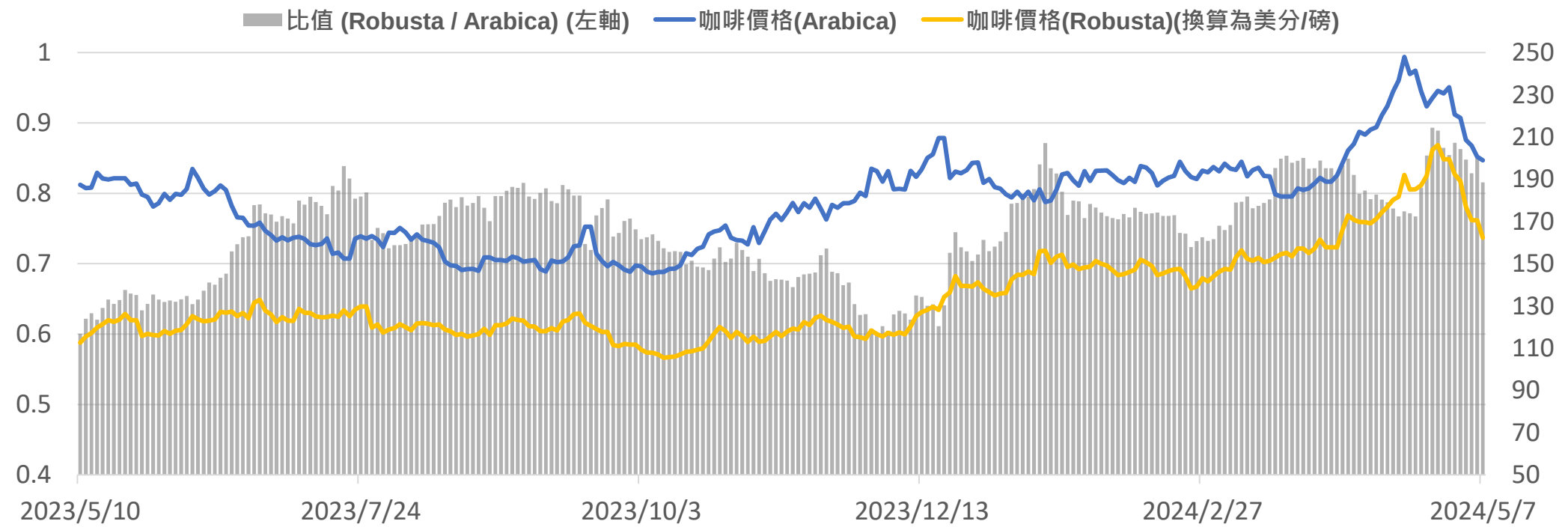
咖啡期貨價格(Robusta) (連續近期合約走勢圖)



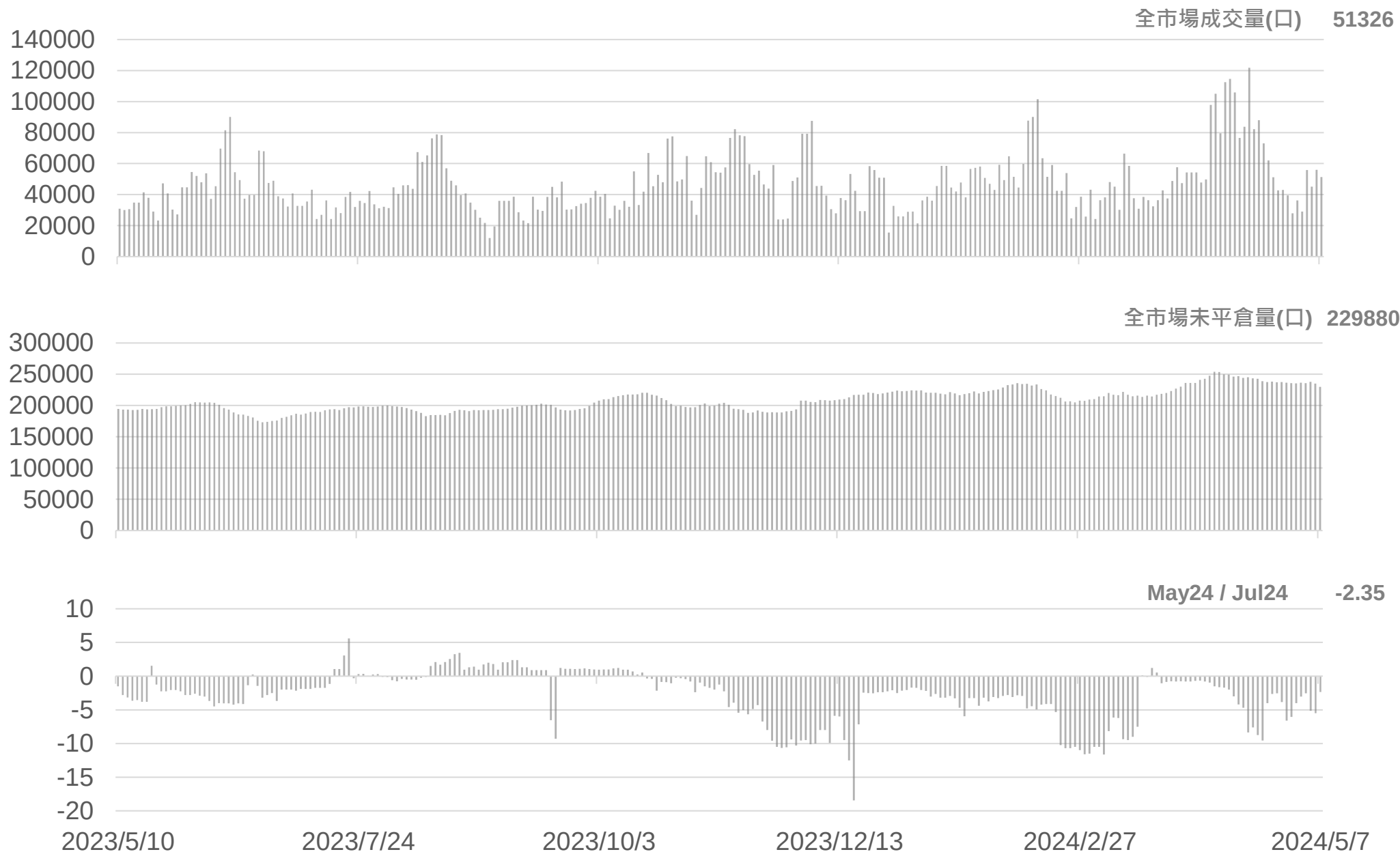
兩品種咖啡價差狀況

由於Arabica與Robusta的報價不同
因此將Robusta的報價統一轉換為 美分/磅後，即可比較兩品種價格上的強弱關係

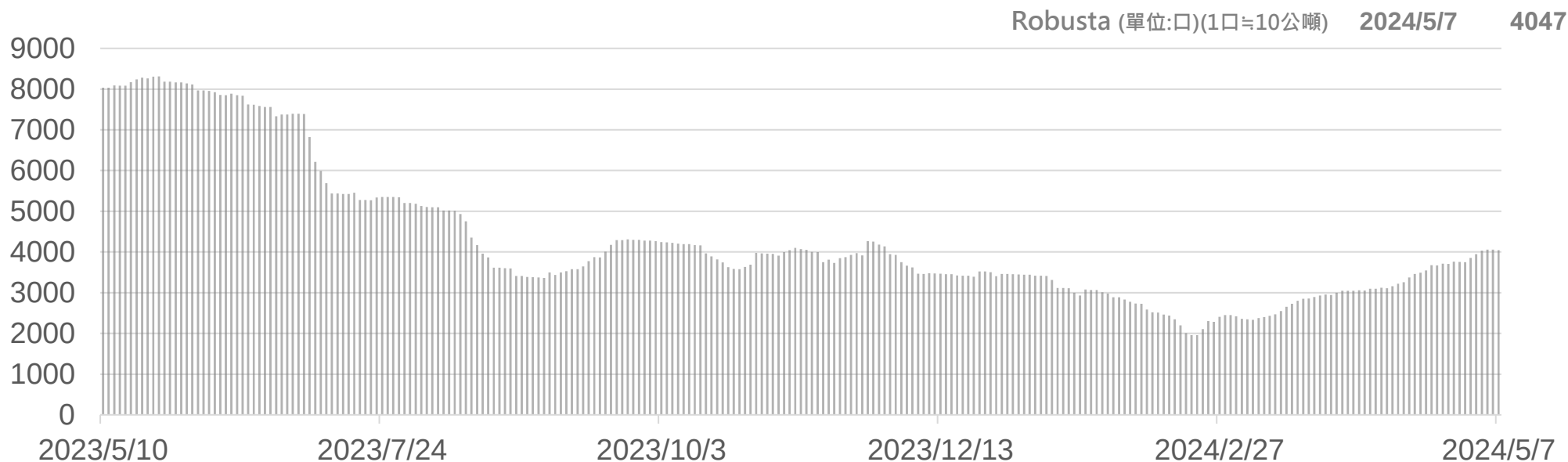
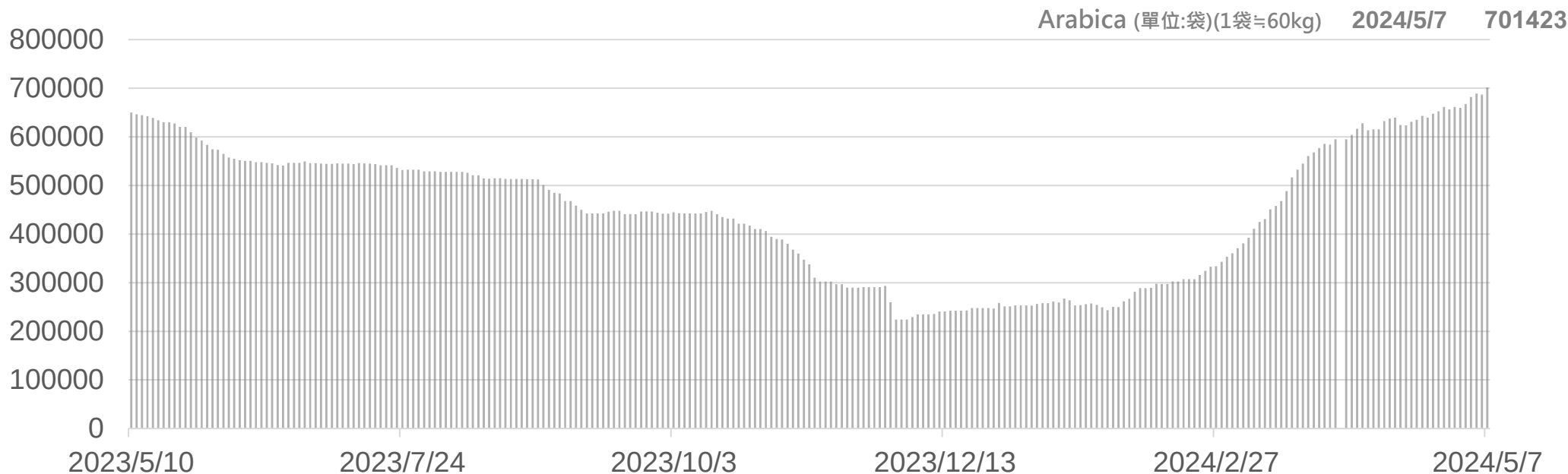
合約	Arabica (美分/磅)	Robusta (美元/公噸)	Robusta (美分/磅)	比值 (Robusta / Arabica)
近月: May24/May24	199.00	3578	162.30	0.816
May24	199	3578	162.30	0.816
Jul24	196.65	3378	153.22	0.779
Sep24	195.4	3305	149.91	0.767
Dec24	194.25	-	-	-



咖啡(Arabica)期貨全市場成交量&OI



咖啡庫存走勢圖

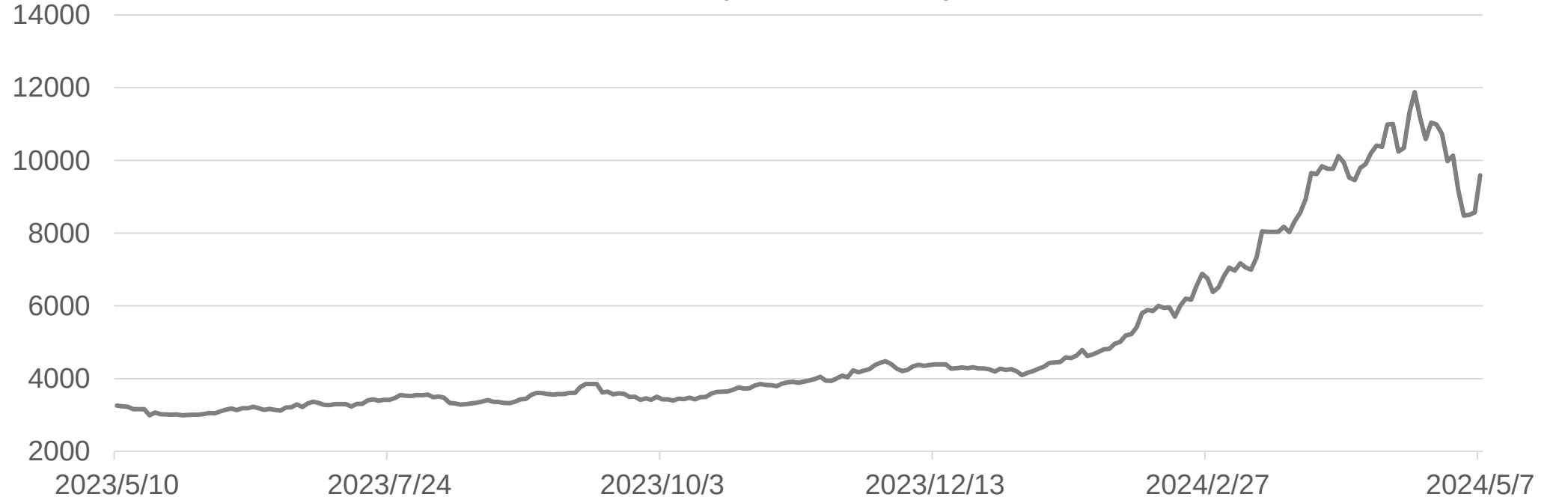


可可期貨表現狀況

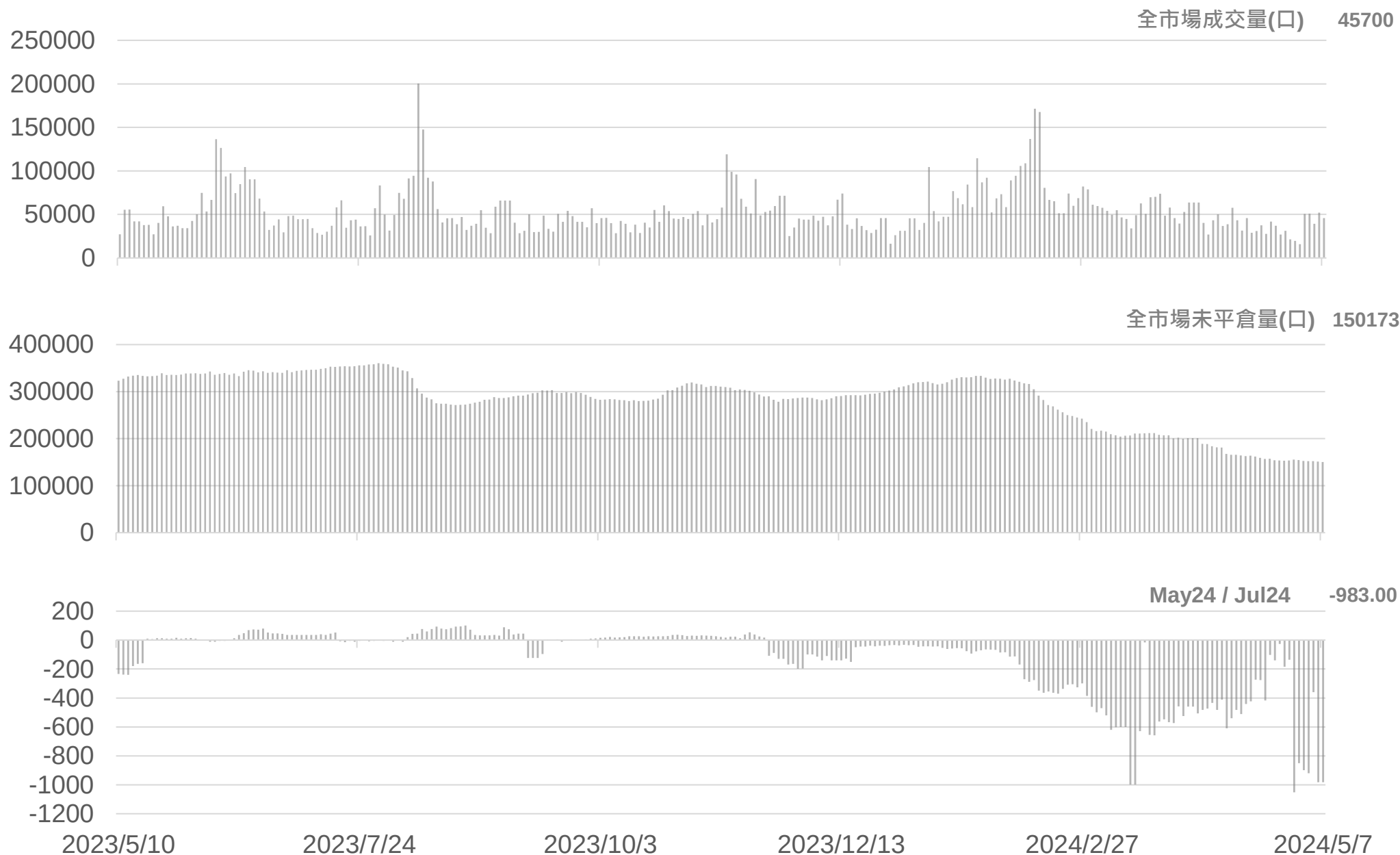
此報價為美元/公噸，以今天為例：可可期貨May24價格為9593美元/公噸

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
May24	9593	+1022 ▲	11.92%	10	5	-10	May24 / Jul24	-983.0
Jul24	8610	+1022 ▲	13.47%	21439	49899	-1778	Jul24 / Sep24	-477.0
Sep24	8133	+967 ▲	13.49%	10689	33310	+644	Sep24 / Dec24	-704.0
Dec24	7429	+813 ▲	12.29%	7096	37201	-90	Dec24 / Mar25	-740.0
Mar25	6689	+653 ▲	10.82%	3902	15345	+168	跨月價差 = 遠期 - 近期 (可可期貨的合約有 3、5、7、9、12)	

可可期貨價格 (連續近期合約走勢圖)



可可期貨全市場成交量&OI



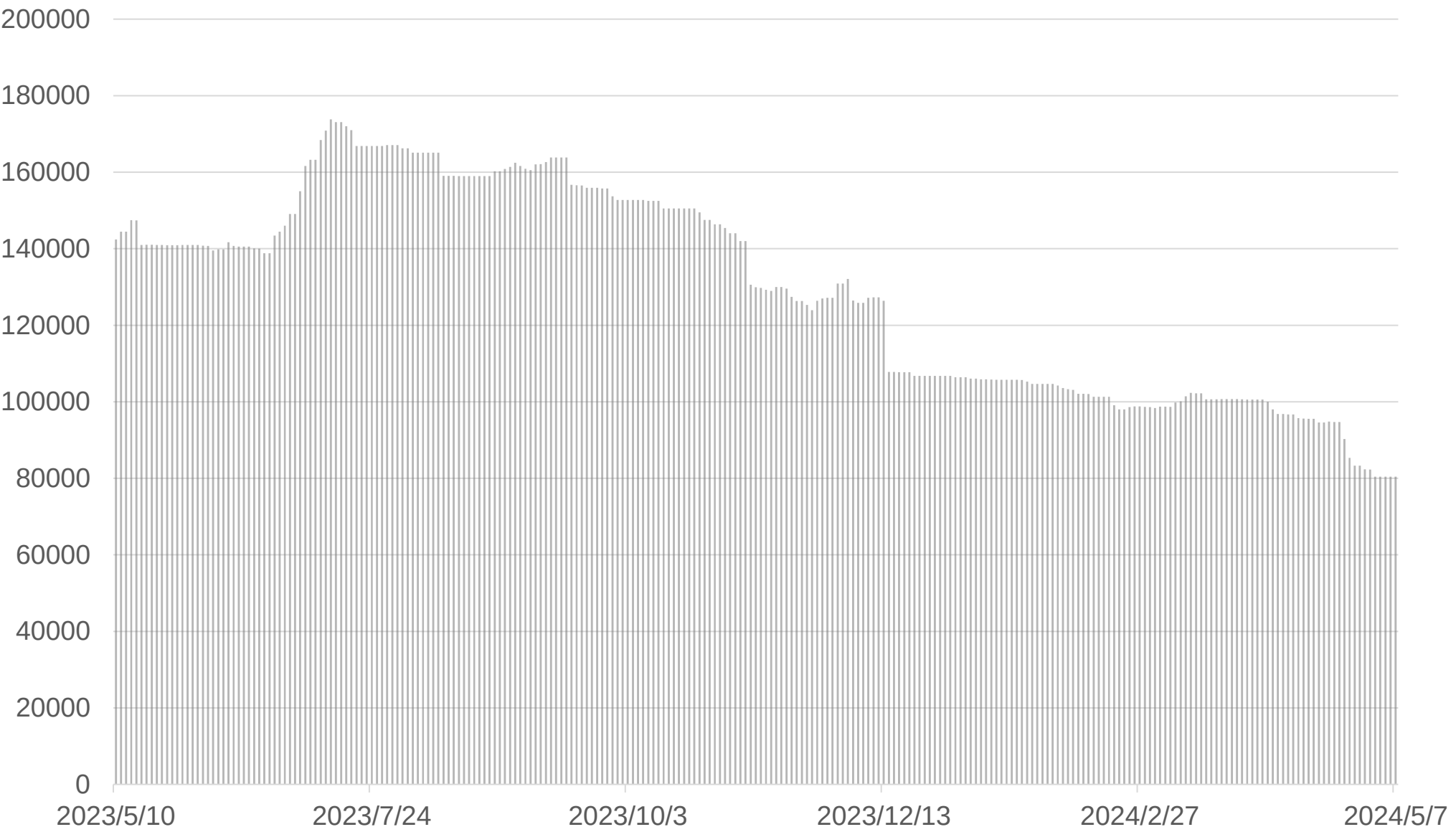
永豐期貨
SinoPac Futures

永豐期貨股份有限公司 | 台北市重慶南路一段2號8樓 | 02-2381-1799 | 111年金管期總字第007號 | 顧問事業部
本研究報告純屬研究性質僅供參考，不保證其完整性及精確性，報告內容具時效性，適後若有變更，本公司將不做預告或主動更新。交易人決策時應衡量自身需求與交易風險，並就交易結果自行負責，本公司恕不負任何法律責任，亦不作任何保證。未經授權，禁止任何形式抄襲、引用或轉載。

數據日期 2024年5月7日

可可庫存走勢圖

可可庫存 (單位:公噸) 2024/5/3 80450



棉花期貨表現狀況

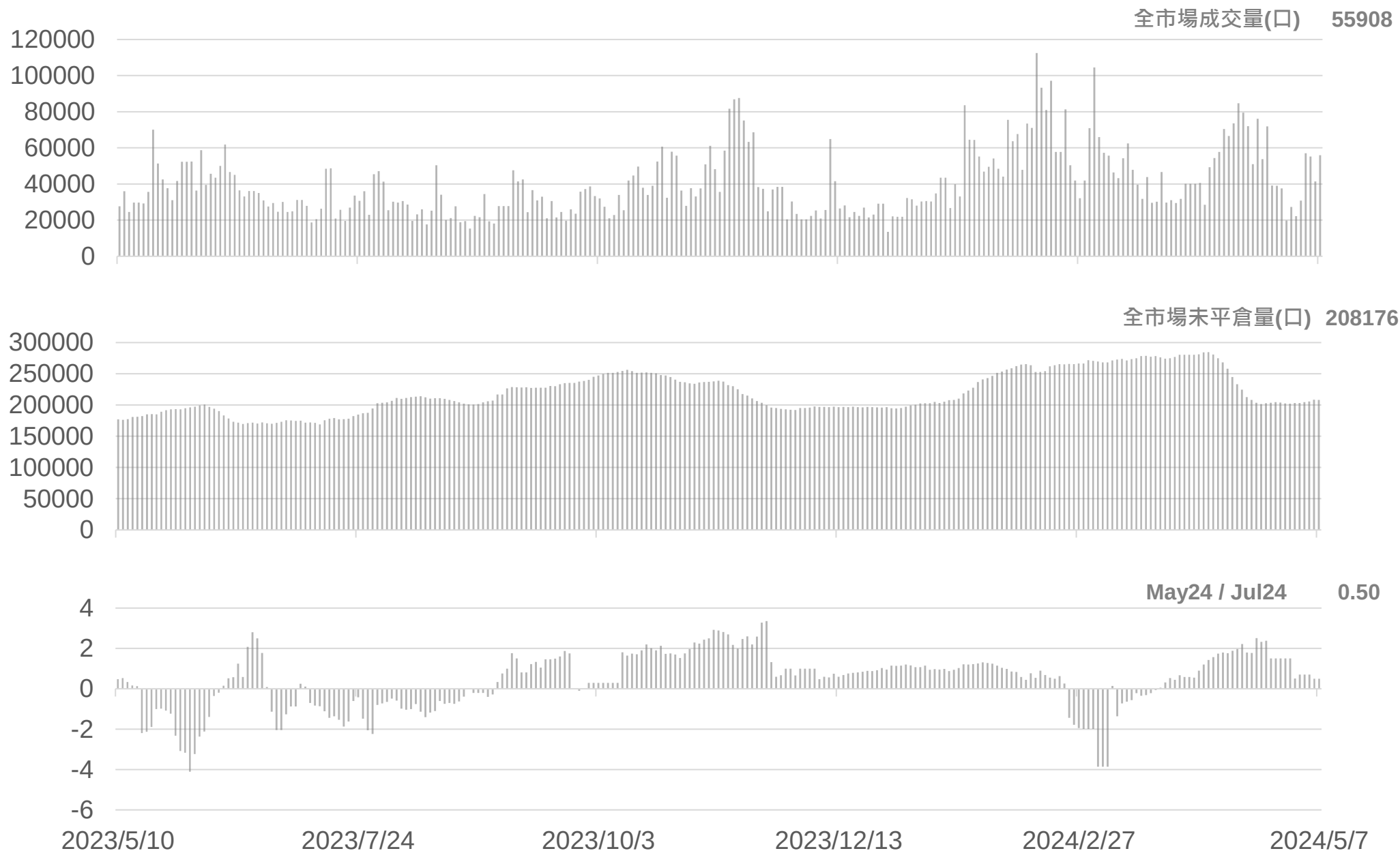
此報價為美分/磅，以今天為例：棉花期貨May24價格為77美分/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
May24	77.00	+0.44▲	0.57%	0	2	0	May24 / Jul24	+0.5
Jul24	77.50	+0.44▲	0.57%	31803	103572	-1051	Jul24 / Oct24	-0.8
Oct24	76.65	+0.49▲	0.64%	12	200	+1	Oct24 / Dec24	-0.9
Dec24	75.75	+0.44▲	0.58%	17905	81379	-617	Dec24 / Mar25	+1.5
Mar25	77.26	+0.43▲	0.56%	4049	14800	+778	跨月價差 = 遠期 - 近期 (棉花期貨的合約有 3、5、7、10、12)	

棉花期貨價格 (連續近期合約走勢圖)

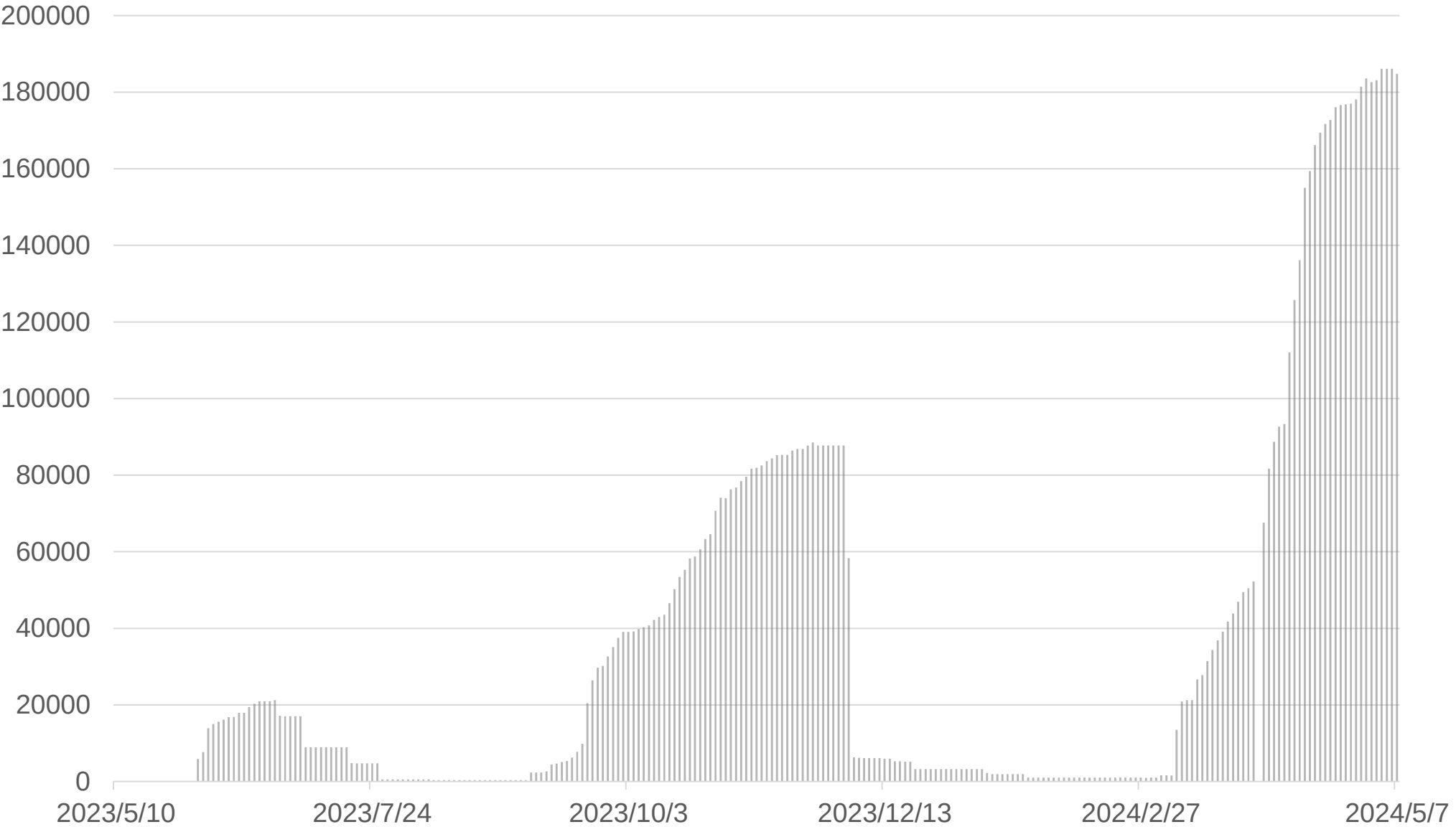


棉花期貨全市場成交量&OI



棉花庫存走勢圖

棉花庫存 (單位:包)(1包=500磅) 2024/5/7 184790



11號糖期貨表現狀況

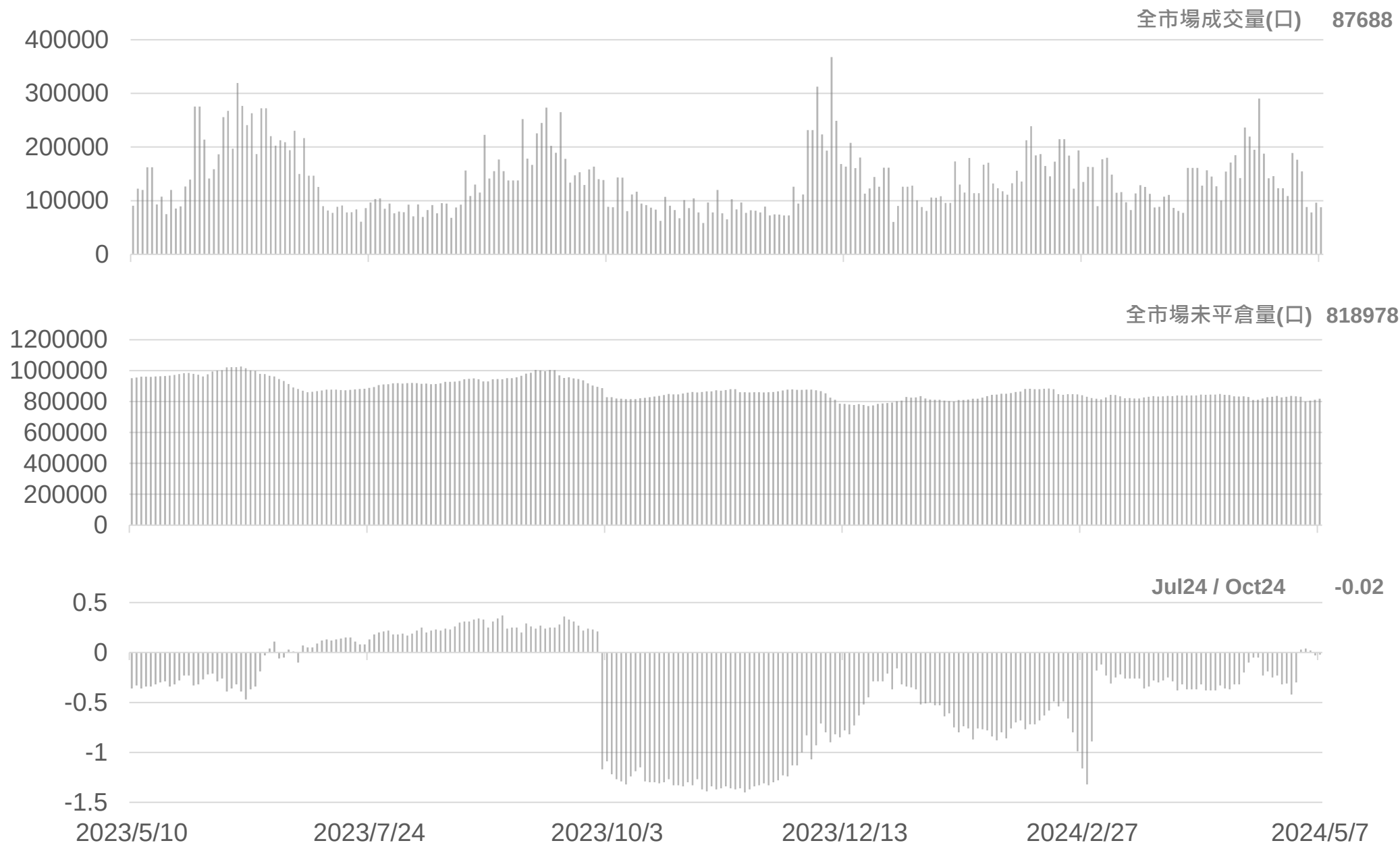
此報價為美分/磅，以今天為例：11號糖期貨Jul24價格為19.95美分/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Jul24	19.95	+0.47 ▲	2.41%	42472	366500	-253	Jul24 / Oct24	-0.0
Oct24	19.93	+0.48 ▲	2.47%	25273	189661	+4126	Oct24 / Mar25	+0.2
Mar25	20.16	+0.45 ▲	2.28%	10188	115403	+1659	Mar25 / May25	-0.6
May25	19.54	+0.36 ▲	1.88%	4321	53388	+746	May25 / Jul25	-0.3
Jul25	19.25	+0.30 ▲	1.58%	4530	37570	+666	跨月價差 = 遠期 - 近期 (11號糖期貨的合約有 3、5、7、10)	

11號糖期貨價格 (連續近期合約走勢圖)



11號糖期貨全市場成交量&OI



永豐期貨
SinoPac Futures

永豐期貨股份有限公司 | 台北市重慶南路一段2號8樓 | 02-2381-1799 | 111年金管期總字第007號 | 顧問事業部
本研究報告純屬研究性質僅供參考，不保證其完整性及精確性，報告內容具時效性，適後若有變更，本公司將不做預告或主動更新。交易人決策時應衡量自身需求與交易風險，並就交易結果自行負責，本公司恕不負任何法律責任，亦不作任何保證。未經授權，禁止任何形式抄襲、引用或轉載。

數據日期 2024年5月7日

敬語

本研究報告純屬研究性質僅供參考，不保證其完整性及精確性，報告內容具時效性，邇後若有變更，本公司將不做預告或主動更新。交易人應審慎考量本身之需求及交易可能衍生之風險，並就交易結果自行負責，本公司恕不負任何法律責任，亦不作任何保證。未經本公司授權，禁止以任何形式複製、轉載或節錄。

永豐期貨股份有限公司 | 台北市重慶南路一段2號8樓 | 02-2381-1799 | 111年金管期總字第007號 | 顧問事業部