



ICE

軟性商品報告

2024年6月13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)	+1.72%	-3.28%	+10.60%	+23.37%	+17.71%
咖啡(Robusta)	+1.05%	-5.17%	+15.75%	+23.94%	+41.00%
可可	+6.35%	+12.02%	+20.43%	+31.29%	+144.58%
棉花	-1.36%	-3.63%	-3.87%	-23.14%	-9.43%
11號糖	+1.65%	-0.16%	+1.22%	-11.74%	-8.70%

重點新聞

- 咖啡：

7月份阿拉比卡咖啡價格上漲1.72%，達到每磅224.35美分，而7月份羅布斯塔咖啡價格上漲1.05%，達到每公噸4240美元。
- 可可：

7月份的紐約可可價格大漲6.35%，達到每公噸10539美元。
- 糖：

7月份的11號糖價格上漲1.65%，達到每磅19.1美分。
- 棉花：

7月份的棉花價格下跌-1.36%，達到每磅71.74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Jul24價格為224.35美分/磅，或2.2435美元/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Jul24	224.35	+3.80▲	1.72%	33334	56919	-10845	Jul24 / Sep24	+0.5
Sep24	224.85	+3.40▲	1.54%	36981	101252	+5073	Sep24 / Dec24	-1.3
Dec24	223.60	+3.20▲	1.45%	12627	48713	+812	Dec24 / Mar25	-1.3
Mar25	222.35	+3.05▲	1.39%	6096	25474	+1791	Mar25 / May25	-1.4
May25	220.90	+2.90▲	1.33%	554	5918	+78	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Jul24價格為4240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
Jul24	4240	+44▲	1.05%	5420	27421	-1949	Jul24 / Sep24	-154.0
Sep24	4086	+33▲	0.81%	10405	51621	+1979	Sep24 / Nov24	-168.0
Nov24	3918	+16▲	0.41%	2569	11885	+7	Nov24 / Jan25	-184.0
Jan25	3734	-1▼	0.03%	1485	3778	+52	Jan25 / Mar25	-134.0
Mar25	3600	-5▼	0.14%	171	749	+8	跨月價差 = 遠期 - 近期 (咖啡期貨的合約有 1、3、5、7、9、11)	

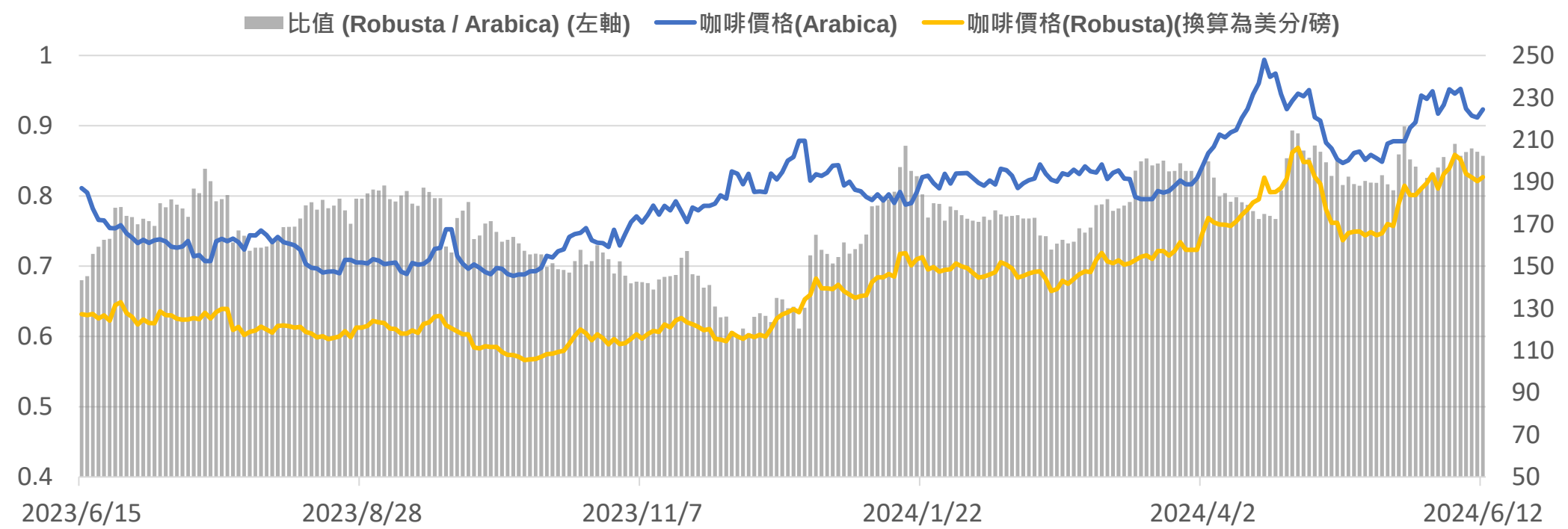
咖啡期貨價格(Robusta) (連續近期合約走勢圖)



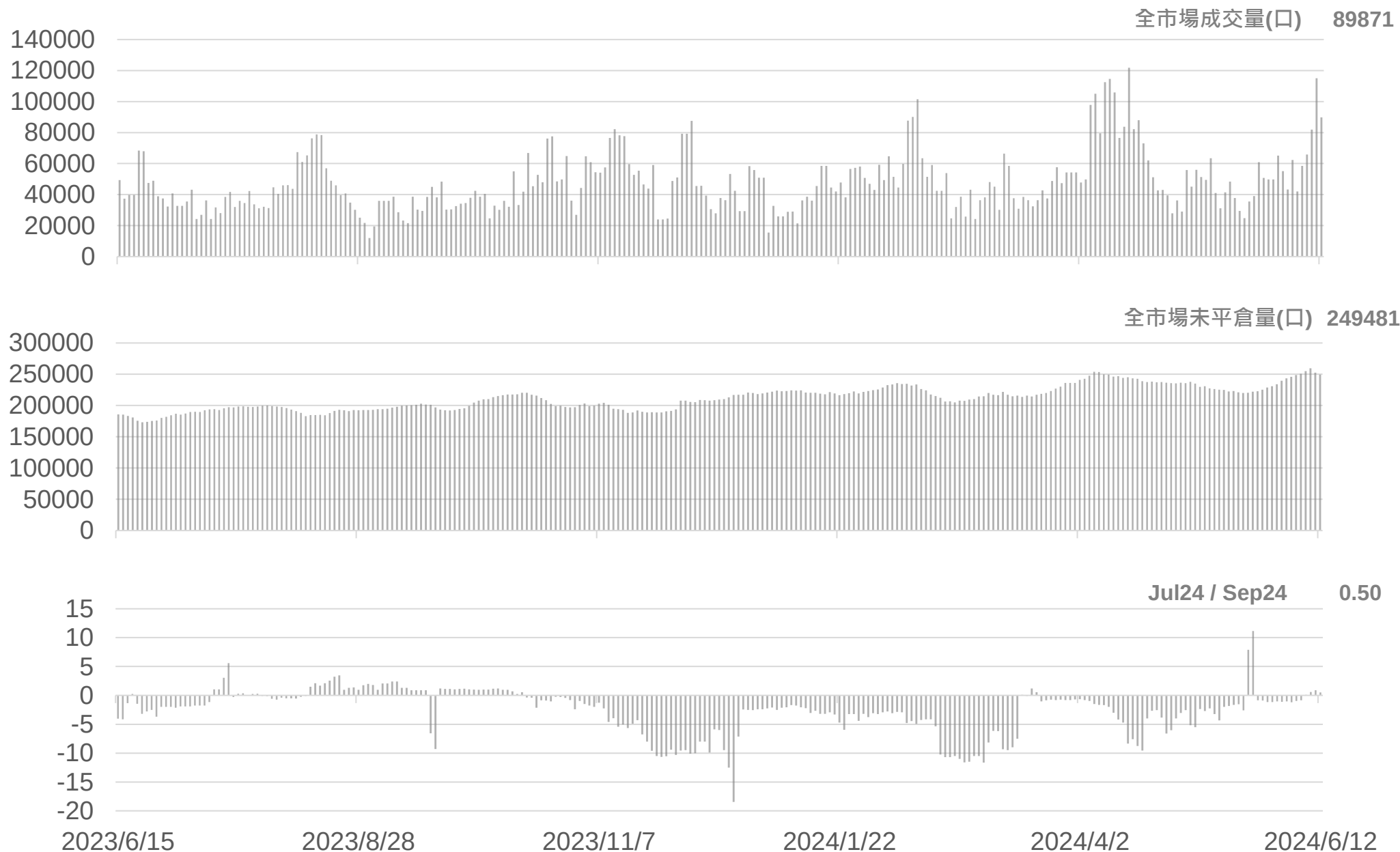
兩品種咖啡價差狀況

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

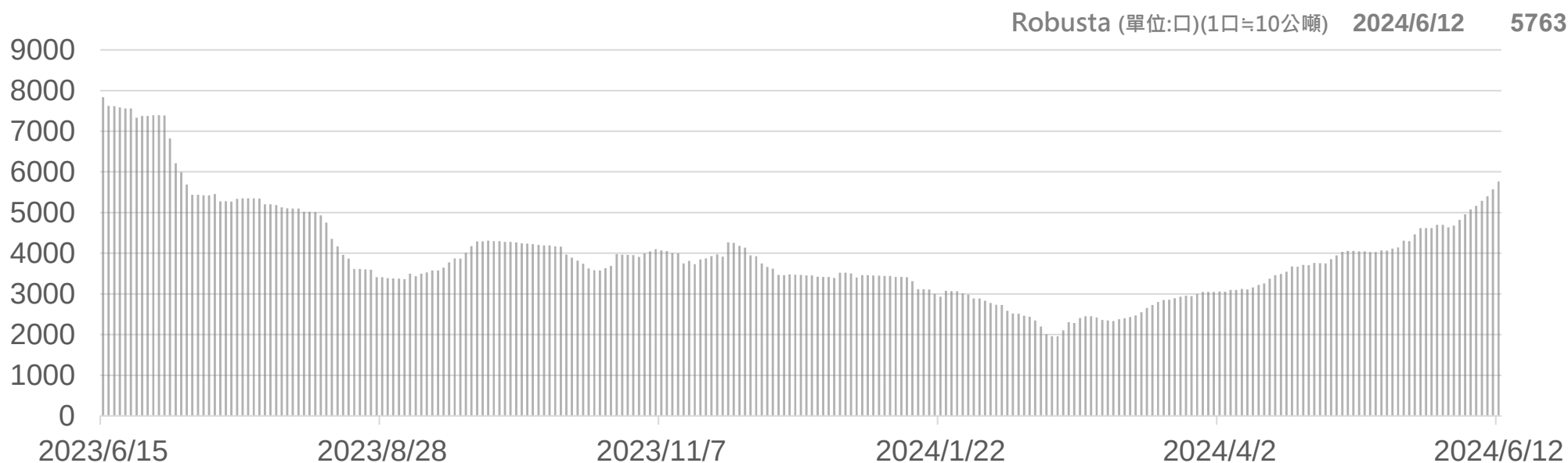
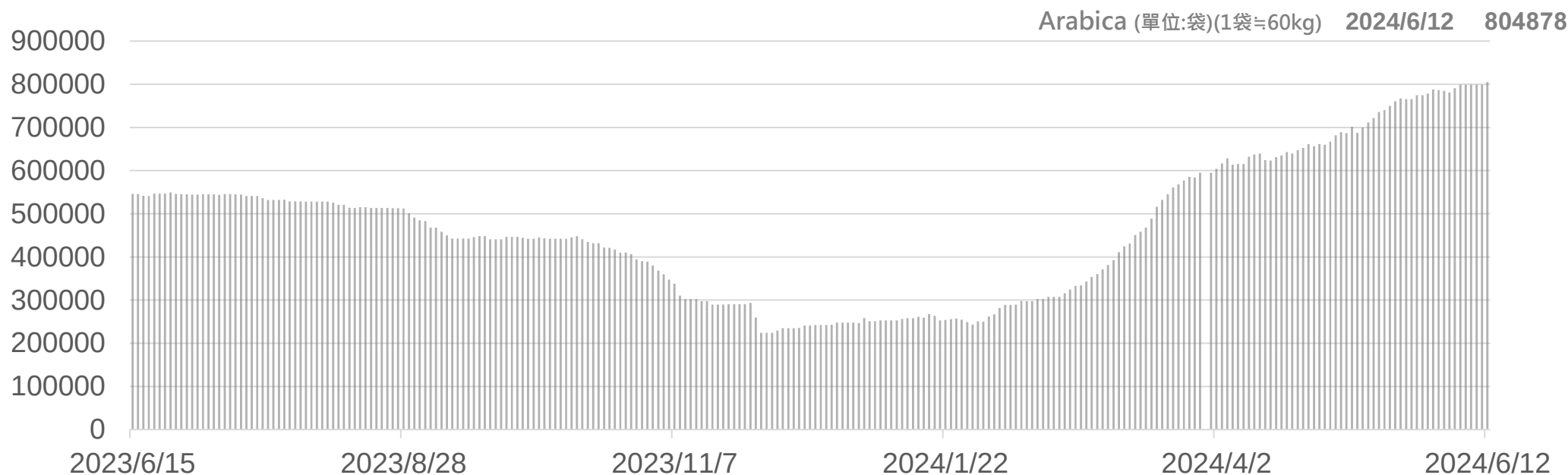
合約	Arabica (美分/磅)	Robusta (美元/公噸)	Robusta (美分/磅)	比值 (Robusta / Arabica)
近月: Jul24/Jul24	224.35	4240	192.32	0.857
Jul24	224.35	4240	192.32	0.857
Sep24	224.85	4086	185.34	0.824
Dec24	223.6	-	-	-
Mar25	222.35	3600	163.29	0.734



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

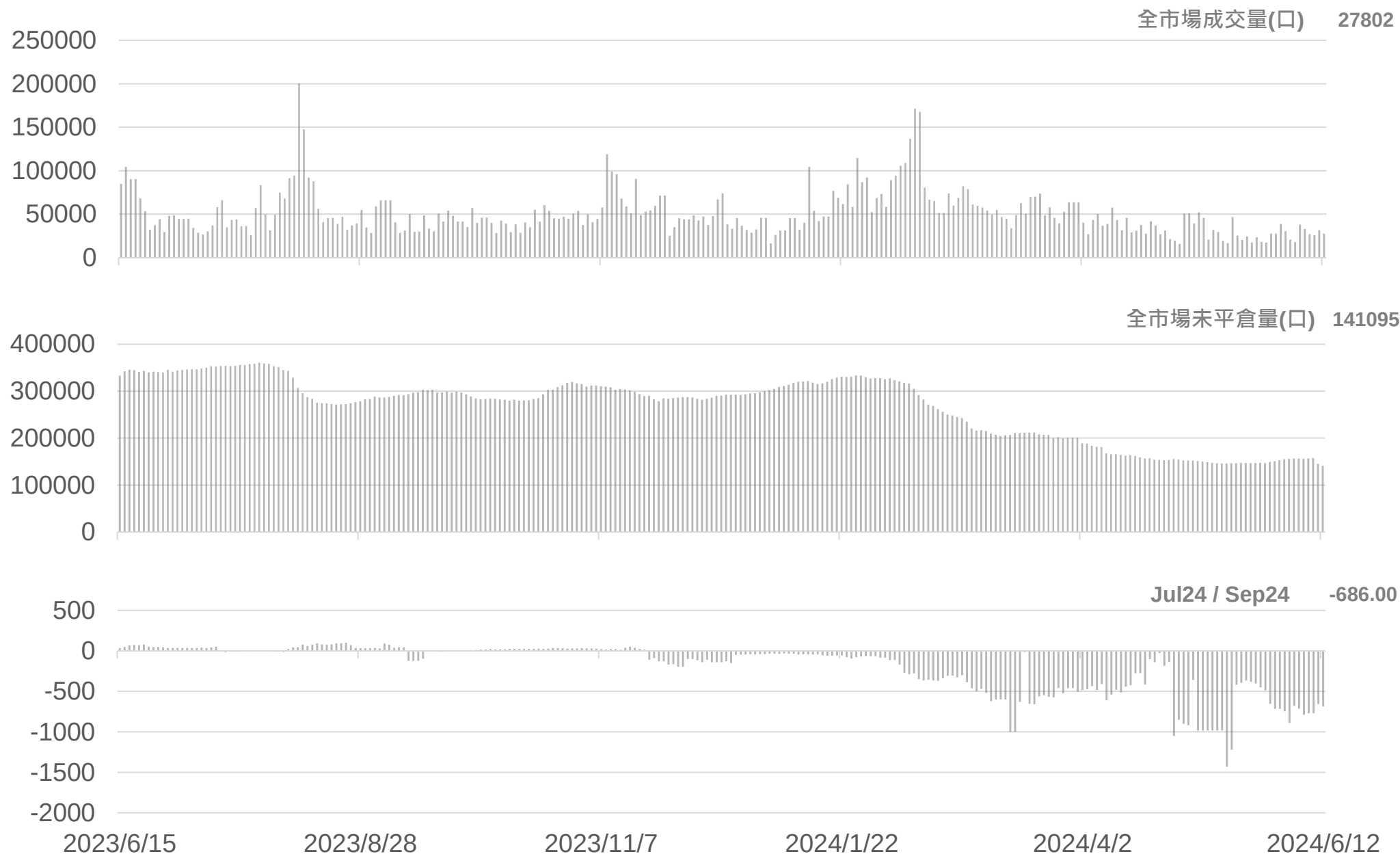
此報價為美元/公噸，以今天為例：可可期貨Jul24價格為10539美元/公噸

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Jul24	10539	+629 ▲	6.35%	9152	19534	-3607	Jul24 / Sep24	-686.0
Sep24	9853	+599 ▲	6.47%	10892	43347	-184	Sep24 / Dec24	-1203.0
Dec24	8650	+433 ▲	5.27%	4241	41656	-257	Dec24 / Mar25	-1041.0
Mar25	7609	+328 ▲	4.50%	2182	19434	-93	Mar25 / May25	-543.0
May25	7066	+262 ▲	3.85%	737	8178	+40	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



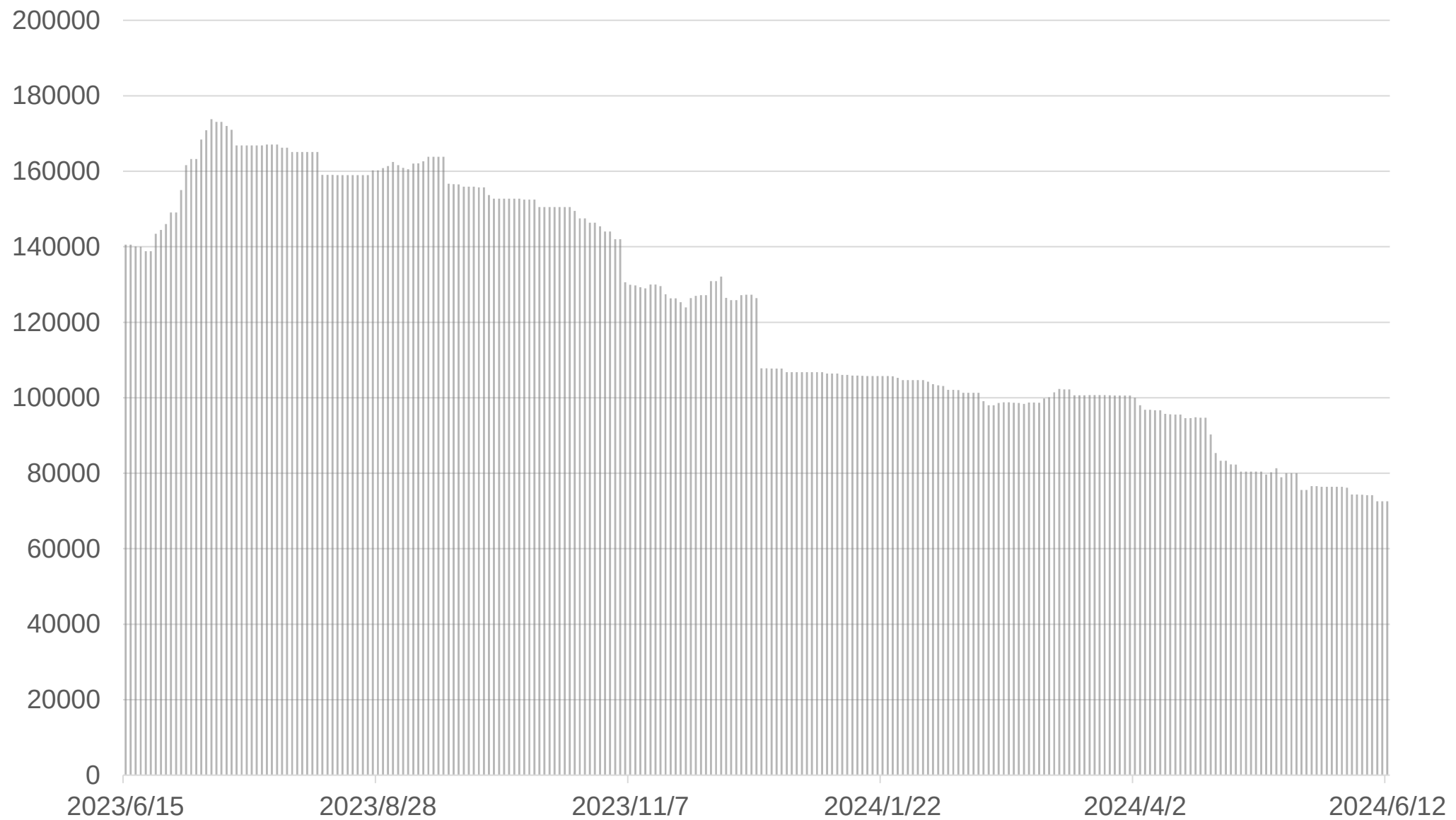
永豐期貨
SinoPac Futures

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6月12日

可可庫存走勢圖

可可庫存 (單位:公噸) 2024/6/11 72570



棉花期貨表現狀況

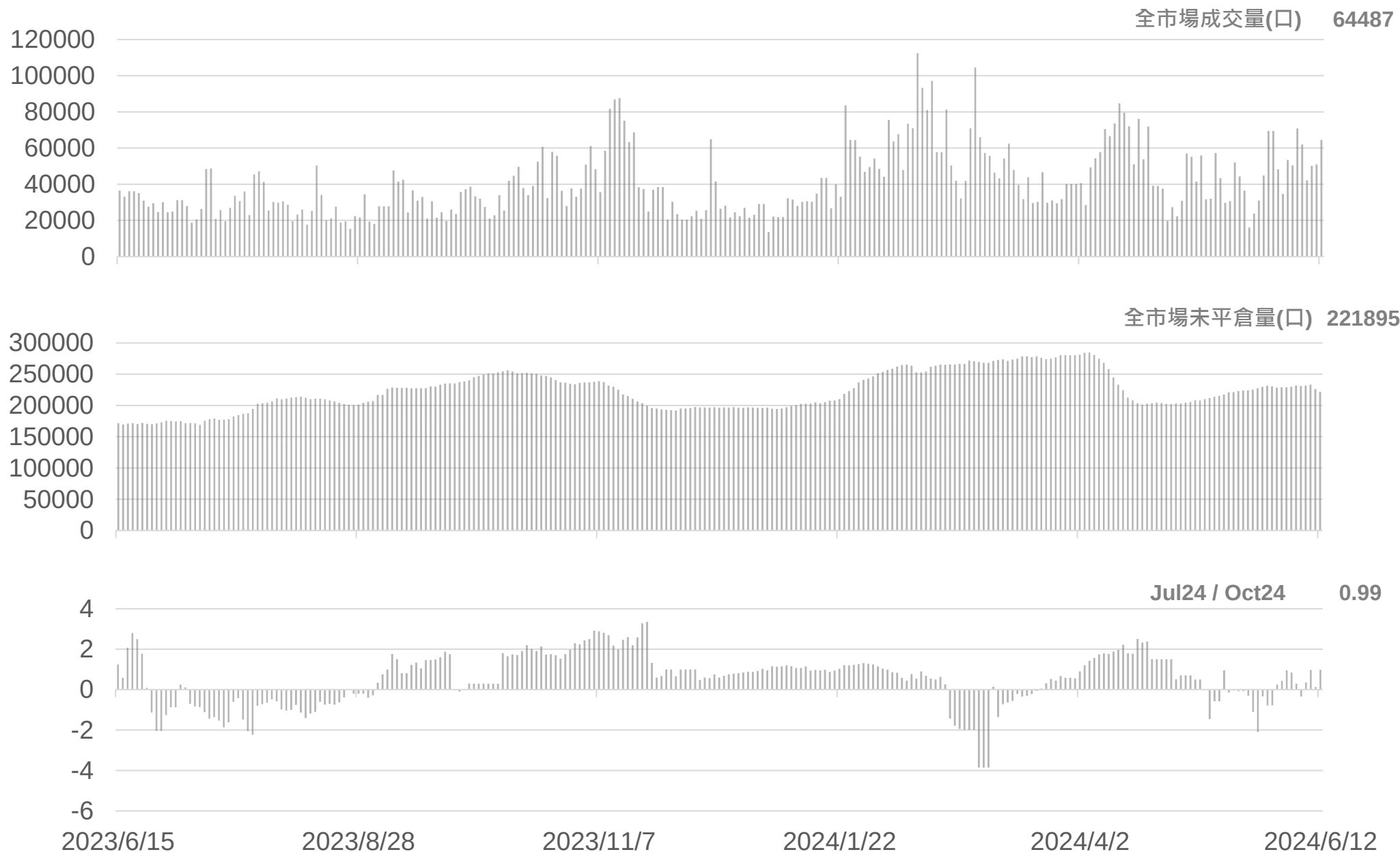
此報價為美分/磅，以今天為例：棉花期貨Jul24價格為71.74美分/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Jul24	71.74	-0.99 ▼	1.36%	24595	53635	-10317	Jul24 / Oct24	+1.0
Oct24	72.73	-0.13 ▼	0.18%	36	273	+10	Oct24 / Dec24	-1.1
Dec24	71.65	-0.78 ▼	1.08%	29011	127274	+4480	Dec24 / Mar25	+1.5
Mar25	73.16	-0.72 ▼	0.97%	7215	24100	+568	Mar25 / May25	+1.5
May25	74.63	-0.72 ▼	0.96%	2590	5921	+753	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)

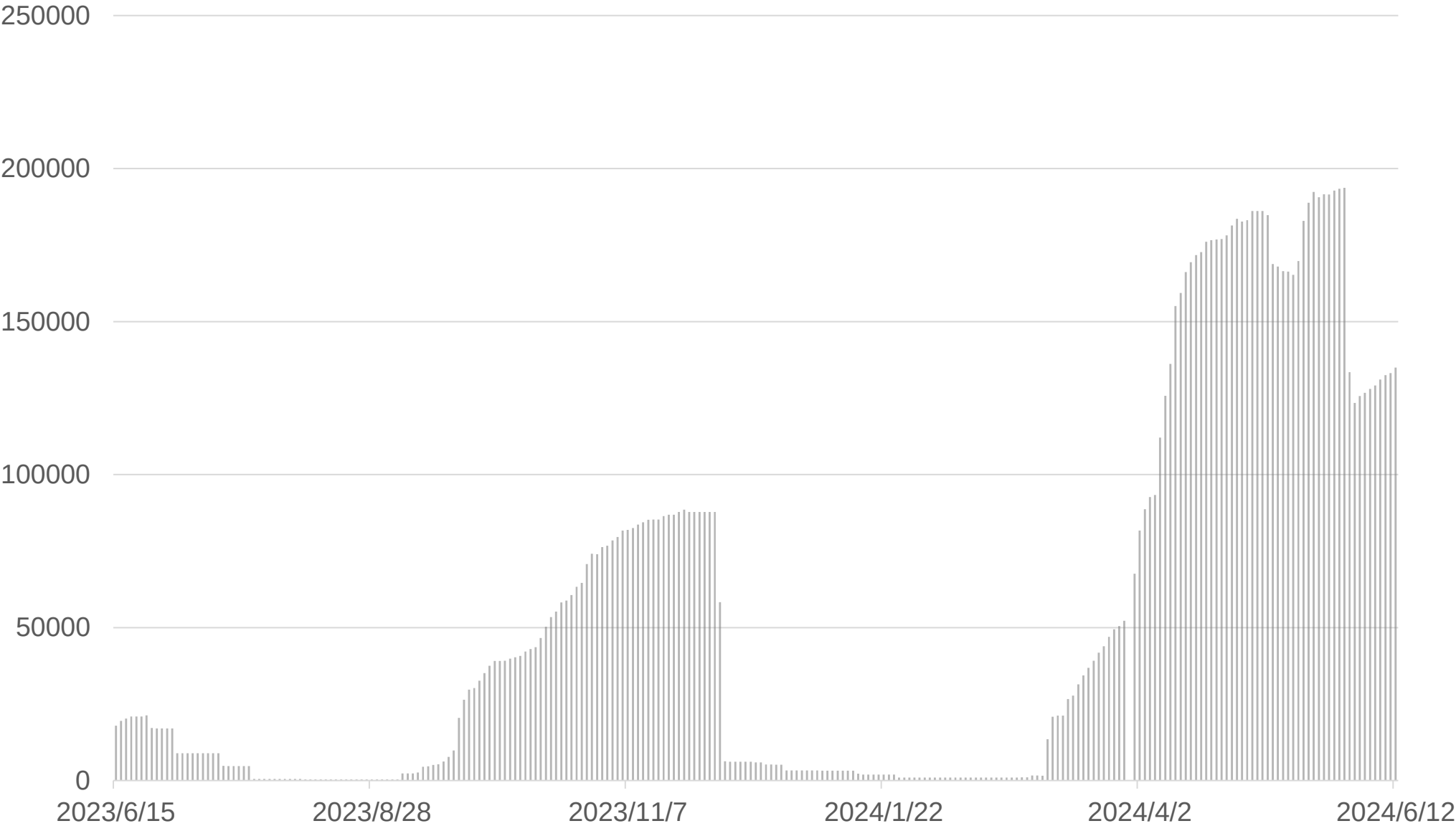


棉花期貨全市場成交量&OI



棉花庫存走勢圖

棉花庫存 (單位:包)(1包=500磅) 2024/6/12 134938



11號糖期貨表現狀況

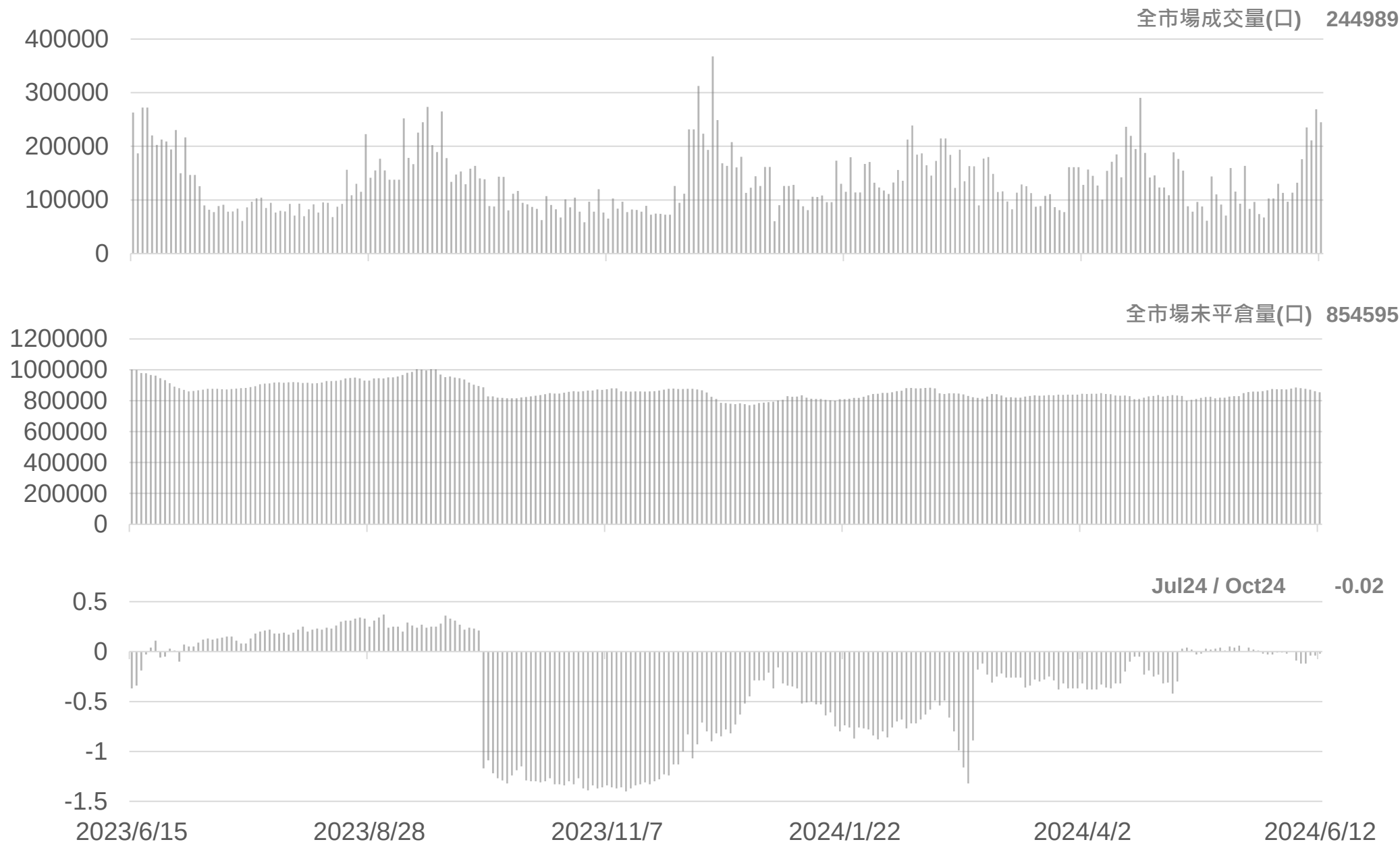
此報價為美分/磅，以今天為例：11號糖期貨Jul24價格為19.1美分/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Jul24	19.10	+0.31 ▲	1.65%	103858	226670	-28516	Jul24 / Oct24	-0.0
Oct24	19.08	+0.33 ▲	1.76%	82317	277148	+14689	Oct24 / Mar25	+0.1
Mar25	19.22	+0.27 ▲	1.42%	26108	152318	+1186	Mar25 / May25	-0.7
May25	18.54	+0.16 ▲	0.87%	13167	70889	+2333	May25 / Jul25	-0.3
Jul25	18.22	+0.09 ▲	0.50%	11915	58083	+2509	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



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