



ICE

軟性商品報告

2024年6月14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)	+0.76%	-3.48%	+12.32%	+24.31%	+16.76%
咖啡(Robusta)	-0.45%	-4.61%	+16.22%	+24.81%	+32.78%
可可	+2.57%	+9.50%	+19.24%	+29.87%	+152.10%
棉花	-0.54%	-5.42%	-5.38%	-22.60%	-9.83%
11號糖	+2.57%	+1.93%	+5.04%	-10.01%	-3.21%

重點新聞

咖啡：

7月份阿拉比卡咖啡價格小漲0.76%，達到每磅226.05美分，而7月份羅布斯塔咖啡價格小跌-0.45%，達到每公噸4221美元。

可可：

7月份的紐約可可價格大漲2.57%，達到每公噸10810美元。

糖：

7月份的11號糖價格大漲2.57%，達到每磅19.59美分。

棉花：

7月份的棉花價格小跌-0.54%，達到每磅71.35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226.05美分/磅，或2.2605美元/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Jul24	226.05	+1.70 ▲	0.76%	30585	47373	-9546	Jul24 / Sep24	+0.2
Sep24	226.25	+1.40 ▲	0.62%	34221	105662	+4410	Sep24 / Dec24	-1.3
Dec24	225.00	+1.40 ▲	0.63%	12952	48336	-377	Dec24 / Mar25	-1.4
Mar25	223.55	+1.20 ▲	0.54%	3819	26380	+906	Mar25 / May25	-1.8
May25	221.80	+0.90 ▲	0.41%	523	5911	-7	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4221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	4221	-19	▼ 0.45%	7369	25661	-1760	Jul24 / Sep24	-128.0
Sep24	4093	+7	▲ 0.17%	11735	53978	+2357	Sep24 / Nov24	-159.0
Nov24	3934	+16	▲ 0.41%	2905	11910	+25	Nov24 / Jan25	-174.0
Jan25	3760	+26	▲ 0.70%	897	4393	+615	Jan25 / Mar25	-118.0
Mar25	3642	+42	▲ 1.17%	130	782	+33	跨月價差 = 遠期 - 近期 (咖啡期貨的合約有 1、3、5、7、9、11)	

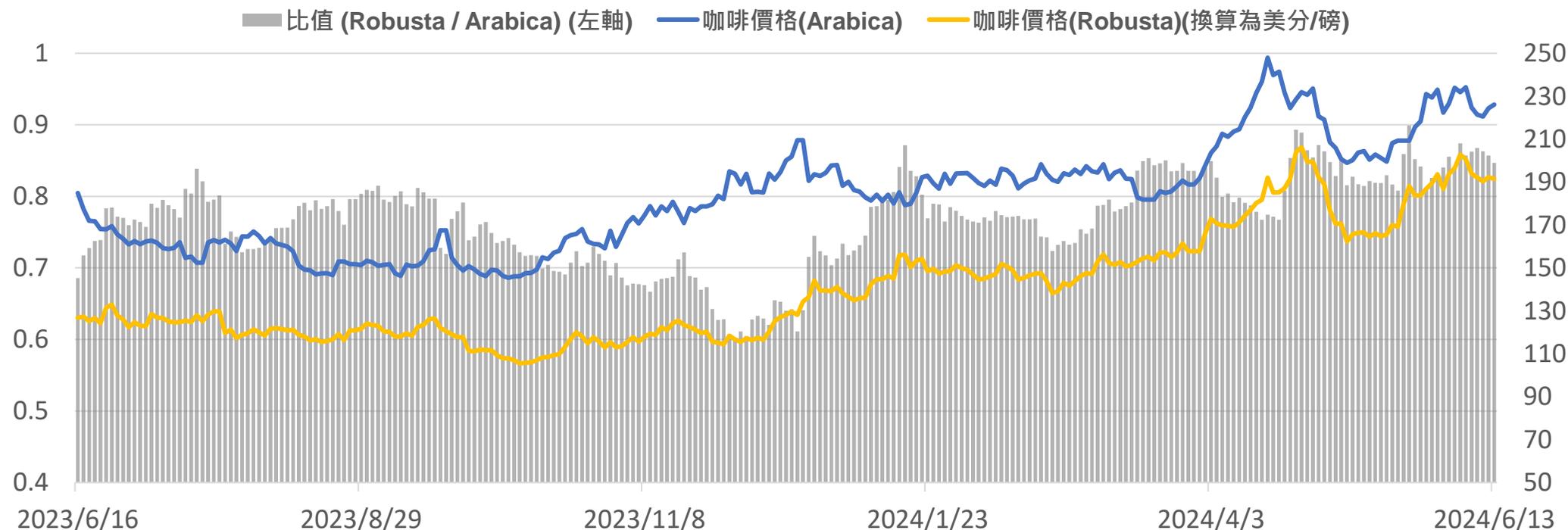
咖啡期貨價格(Robusta) (連續近期合約走勢圖)



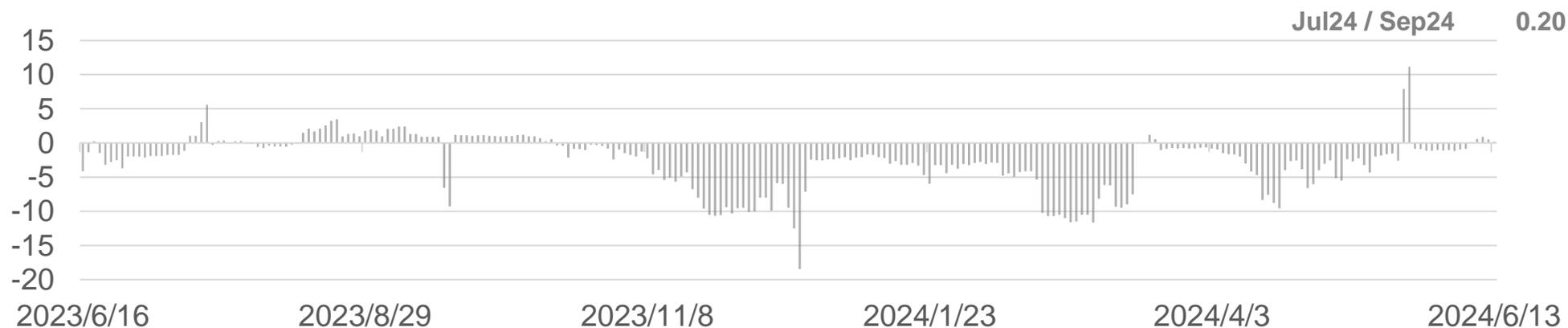
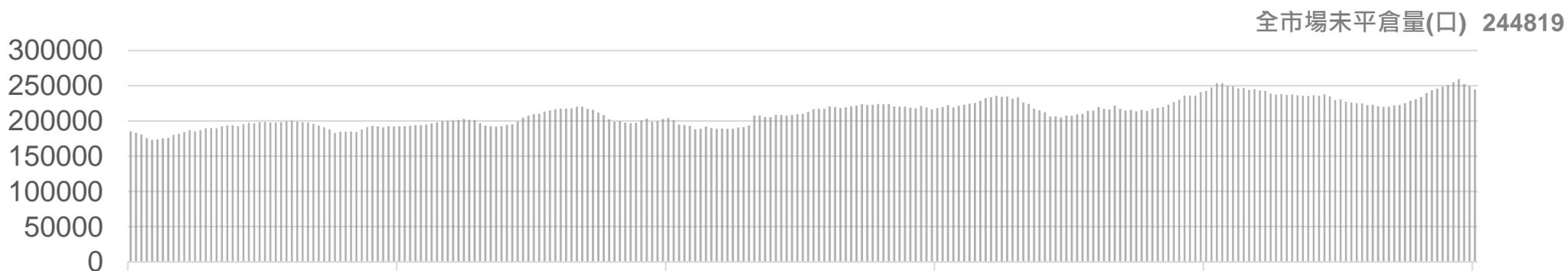
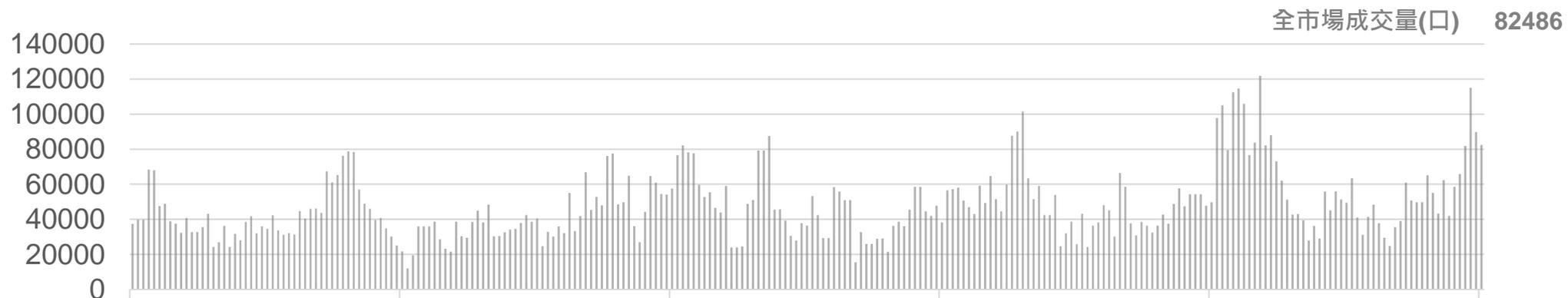
兩品種咖啡價差狀況

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

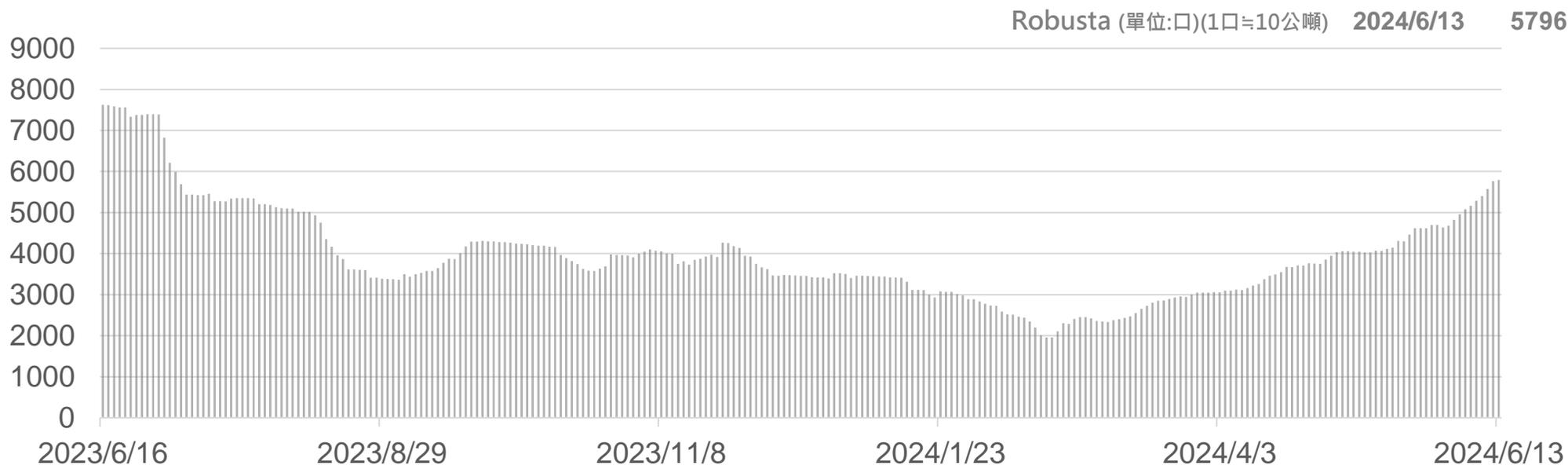
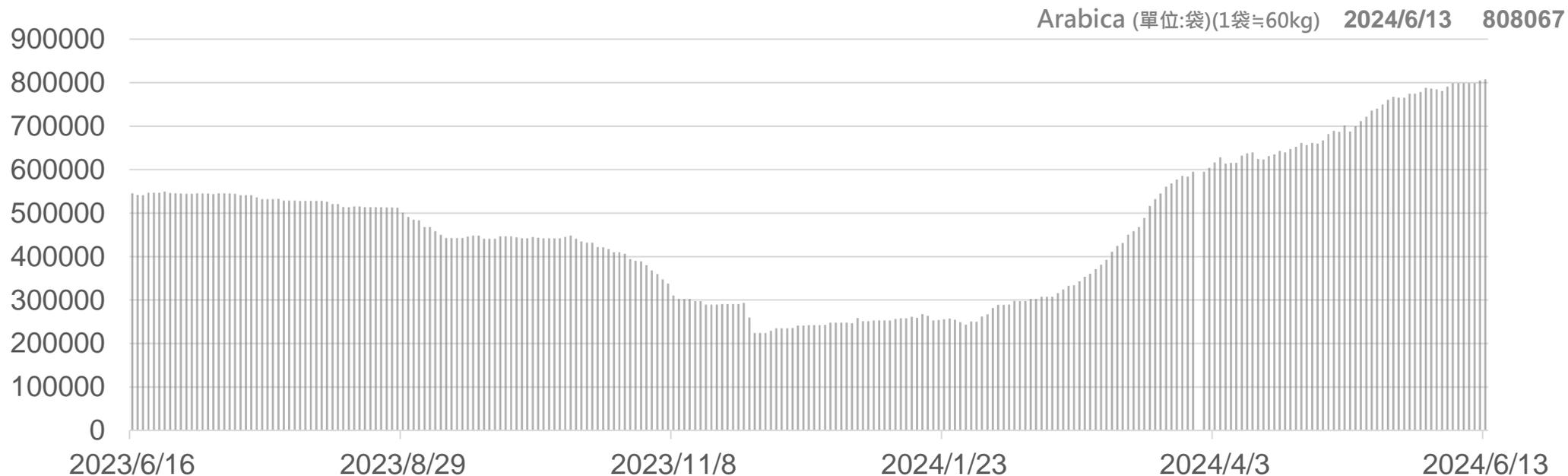
合約	Arabica (美分/磅)	Robusta (美元/公噸)	Robusta (美分/磅)	比值 (Robusta / Arabica)
近月: Jul24/Jul24	226.05	4221	191.46	0.847
Jul24	226.05	4221	191.46	0.847
Sep24	226.25	4093	185.66	0.821
Dec24	225	-	-	-
Mar25	223.55	3642	165.20	0.739



咖啡(Arabica)期貨全市場成交量&OI



咖啡庫存走勢圖

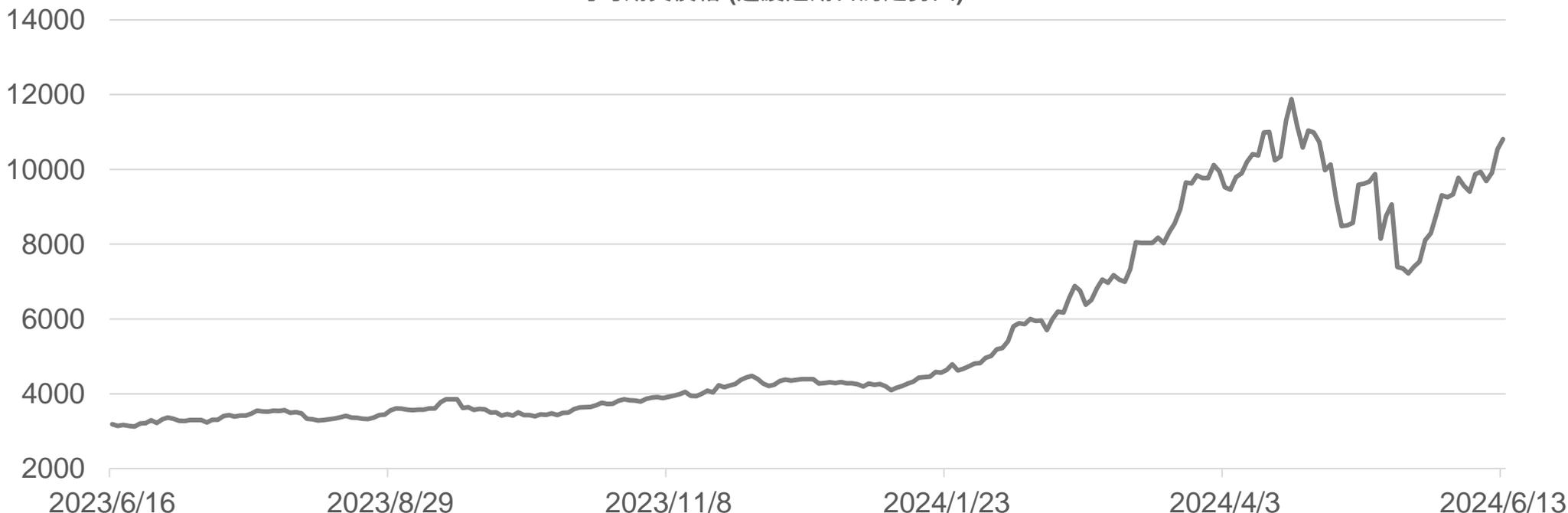


可可期貨表現狀況

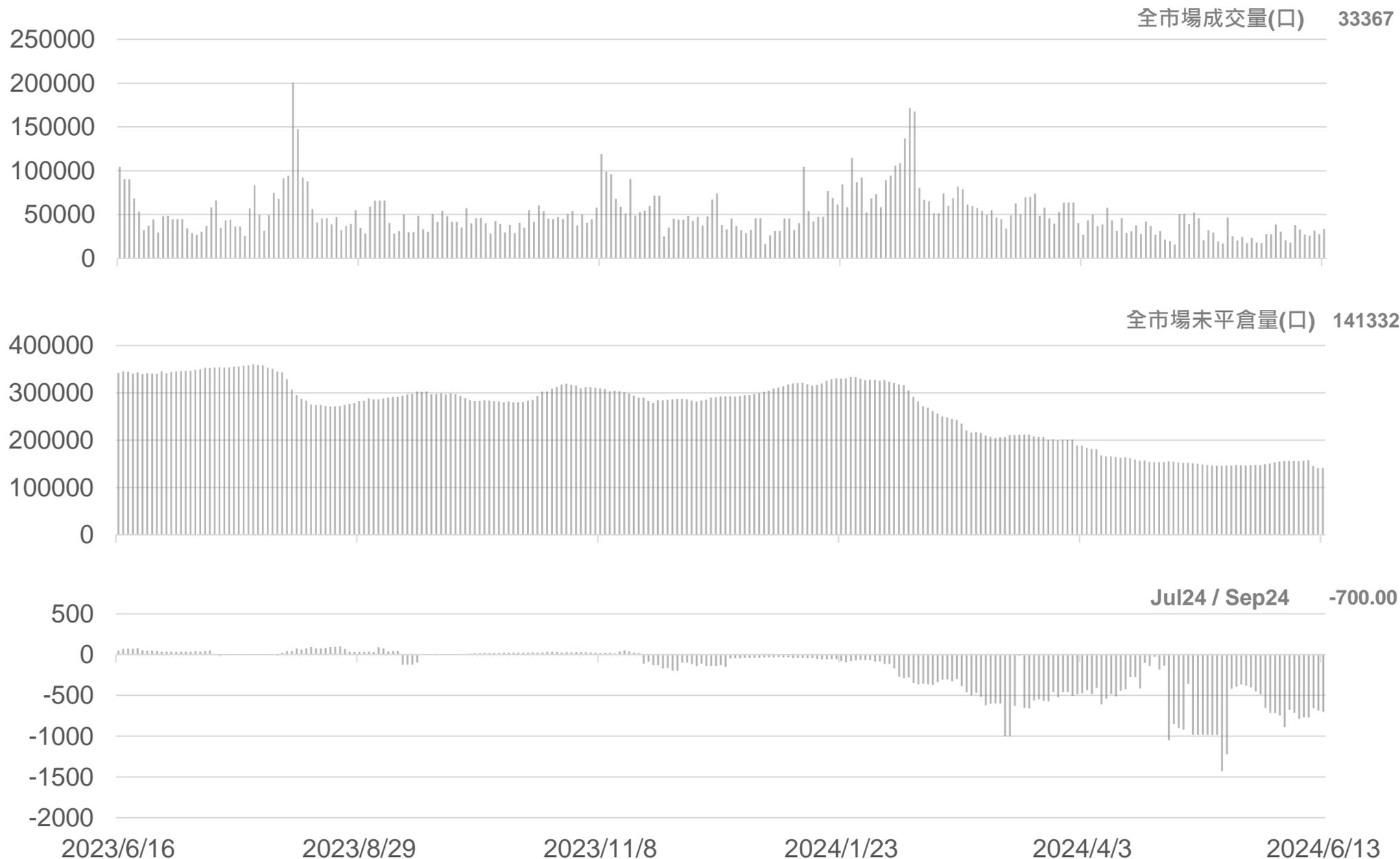
此報價為美元/公噸，以今天為例：可可期貨Jul24價格為10810美元/公噸

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Jul24	10810	+271 ▲	2.57%	9207	16489	-3045	Jul24 / Sep24	-700.0
Sep24	10110	+257 ▲	2.61%	14283	45796	+2449	Sep24 / Dec24	-1270.0
Dec24	8840	+190 ▲	2.20%	4655	41886	+230	Dec24 / Mar25	-1132.0
Mar25	7708	+99 ▲	1.30%	2470	19816	+382	Mar25 / May25	-535.0
May25	7173	+107 ▲	1.51%	1735	8269	+91	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)

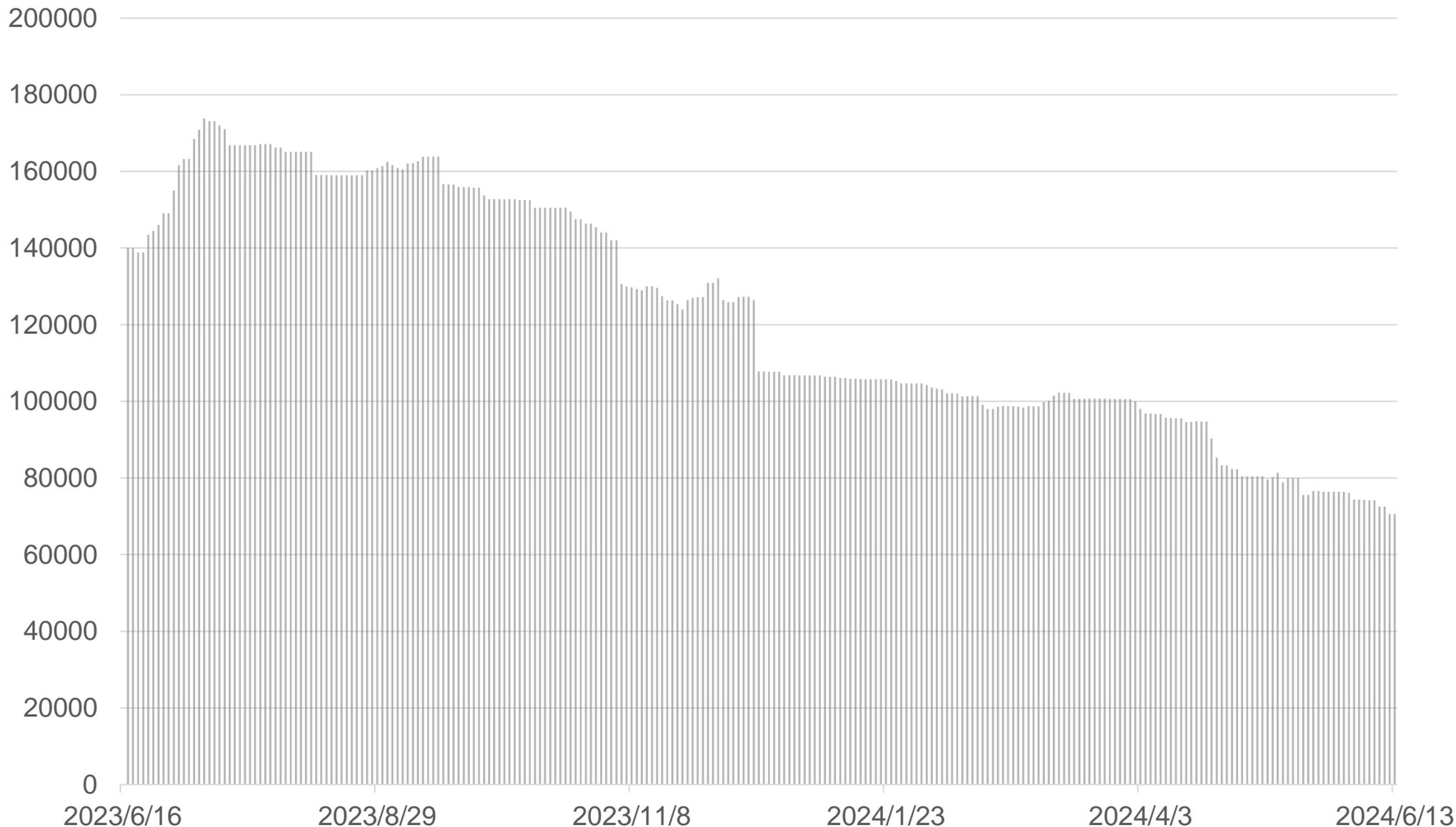


可可期貨全市場成交量&OI



可可庫存走勢圖

可可庫存 (單位:公噸) 2024/6/12 70570



棉花期貨表現狀況

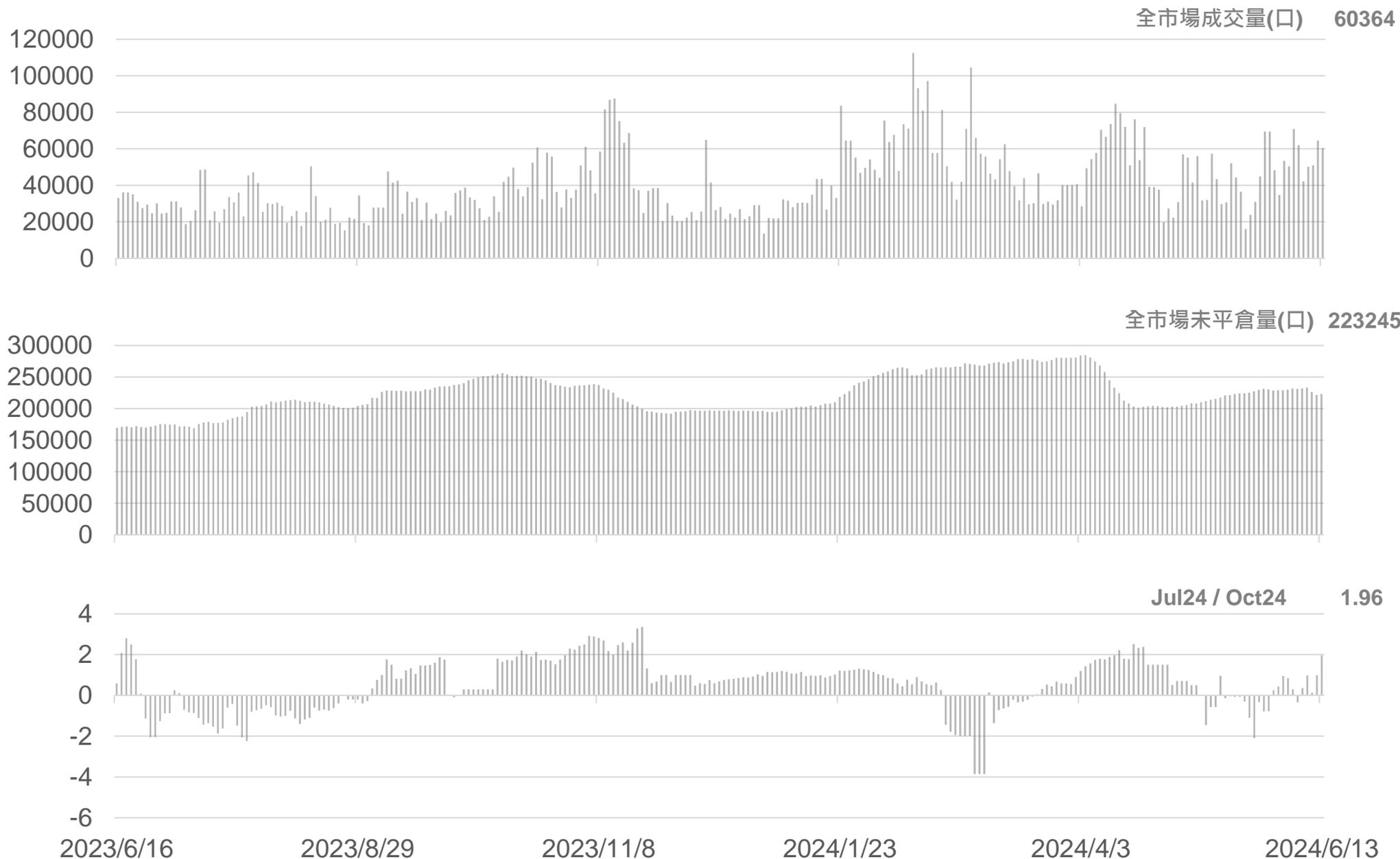
此報價為美分/磅，以今天為例：棉花期貨Jul24價格為71.35美分/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Jul24	71.35	-0.39 ▼	0.54%	19346	45344	-8291	Jul24 / Oct24	+2.0
Oct24	73.31	+0.58 ▲	0.80%	82	293	+20	Oct24 / Dec24	-1.5
Dec24	71.79	+0.14 ▲	0.20%	30713	134827	+7553	Dec24 / Mar25	+1.5
Mar25	73.31	+0.15 ▲	0.21%	7808	25411	+1311	Mar25 / May25	+1.5
May25	74.78	+0.15 ▲	0.20%	1837	6458	+537	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)

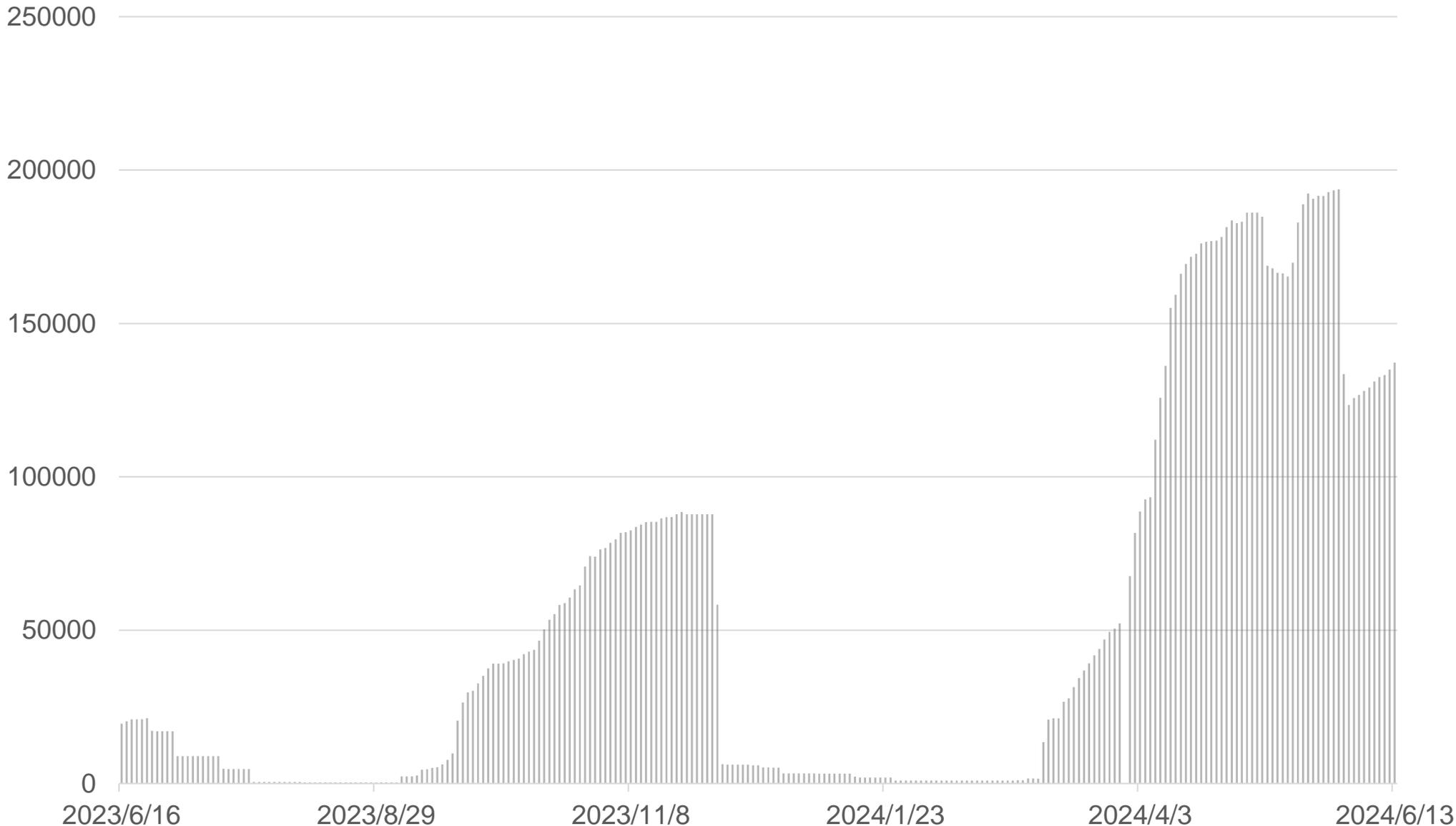


棉花期貨全市場成交量&OI



棉花庫存走勢圖

棉花庫存 (單位:包)(1包=500磅) 2024/6/13 137209



11號糖期貨表現狀況

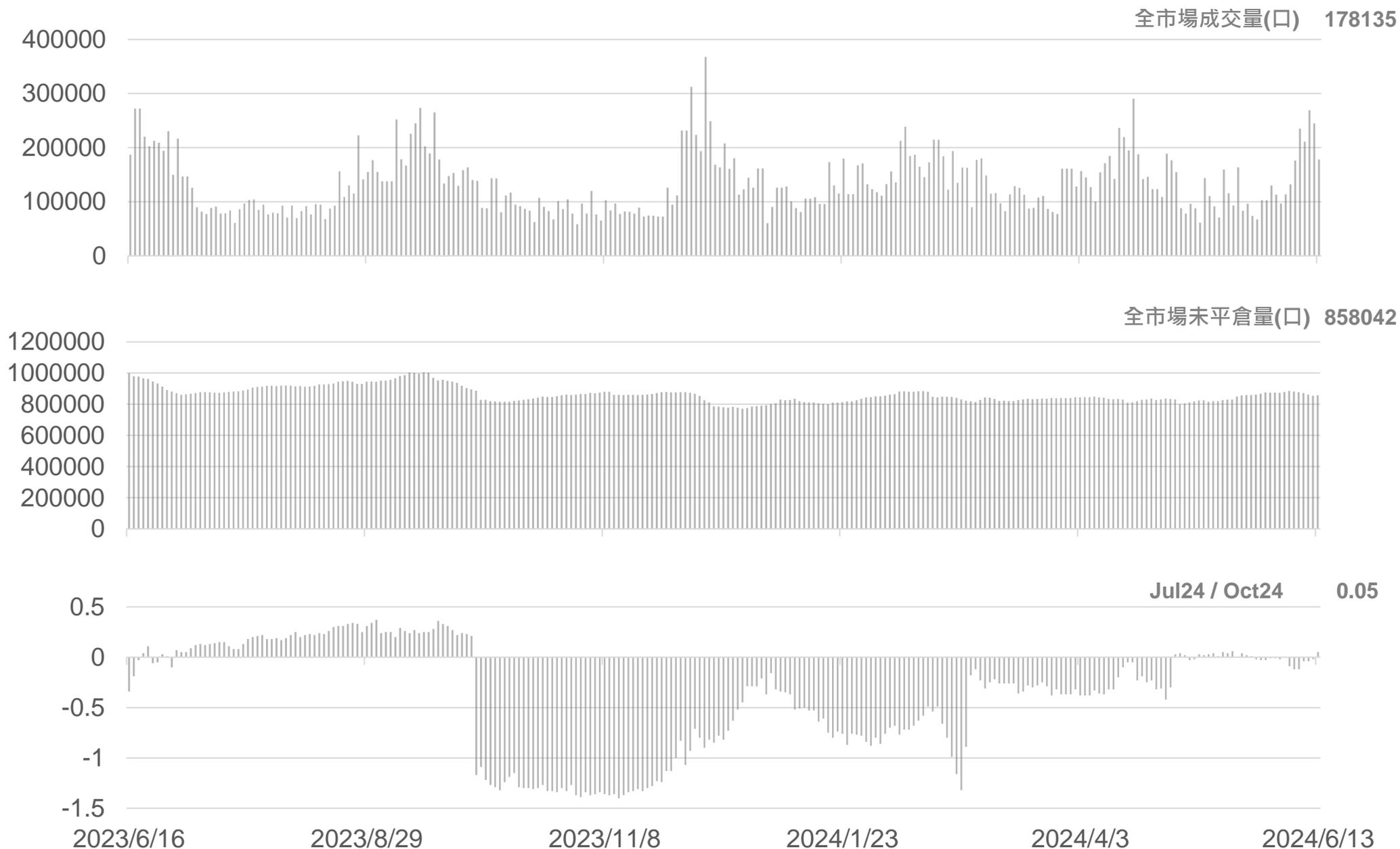
此報價為美分/磅·以今天為例：11號糖期貨Jul24價格為19.59美分/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Jul24	19.59	+0.49 ▲	2.57%	69508	204898	-21772	Jul24 / Oct24	+0.1
Oct24	19.64	+0.56 ▲	2.94%	65389	296921	+19773	Oct24 / Mar25	+0.1
Mar25	19.73	+0.51 ▲	2.65%	22874	154329	+2011	Mar25 / May25	-0.8
May25	18.91	+0.37 ▲	2.00%	11508	74009	+3120	May25 / Jul25	-0.4
Jul25	18.50	+0.28 ▲	1.54%	5328	57949	-134	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