



ICE

軟性商品報告

2024年8月1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)	-0.69%	-0.84%	+1.44%	+15.18%	+17.18%
咖啡(Robusta)	-0.12%	-6.80%	-1.59%	+19.09%	+28.19%
可可	-0.54%	-1.64%	+3.60%	-15.65%	+38.09%
棉花	-0.81%	+1.45%	-1.02%	-11.71%	-24.91%
11號糖	-0.94%	+5.75%	-7.74%	-5.06%	-19.61%

重點新聞

咖啡：

9月份阿拉比卡咖啡價格小跌-0.69%，達到每磅229.2美分，而9月份羅布斯塔咖啡價格小跌-0.12%，達到每公噸4261美元。

可可：

9月份的紐約可可價格小跌-0.54%，達到每公噸8092美元。

糖：

10月份的11號糖價格小跌-0.94%，達到每磅18.94美分。

棉花：

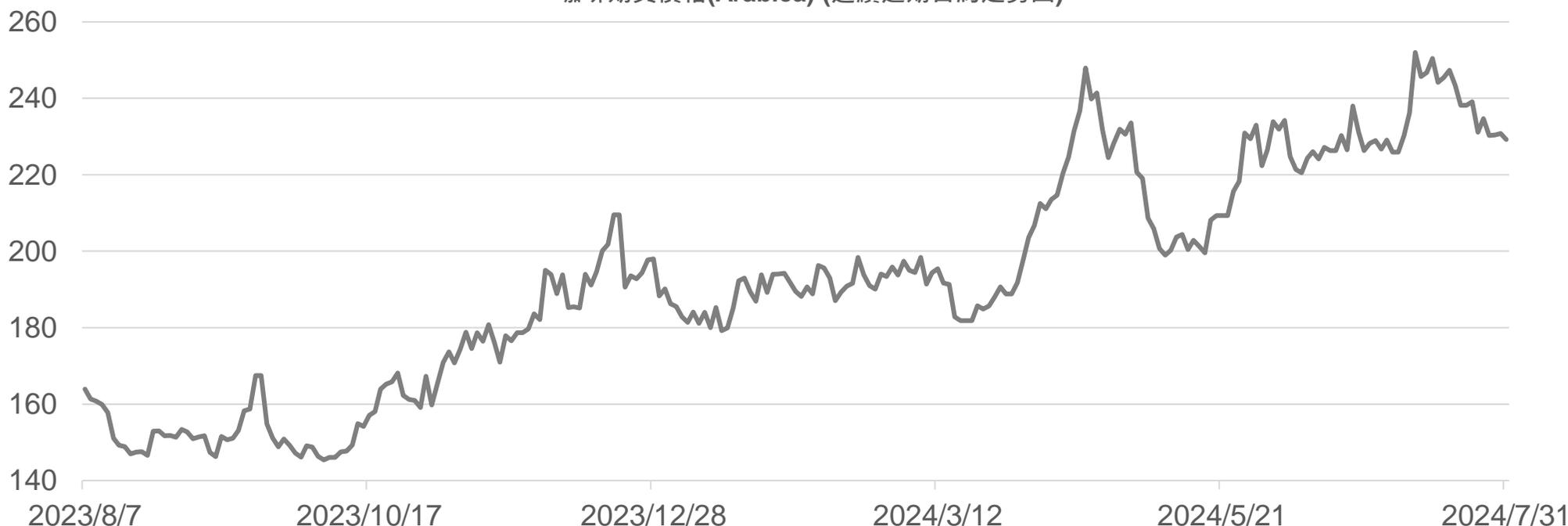
12月份的棉花價格小跌-0.81%，達到每磅68.99美分。

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Sep24價格為229.2美分/磅，或2.292美元/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Sep24	229.20	-1.60	▼ 0.69%	16265	107820	-2149	Sep24 / Dec24	-1.0
Dec24	228.15	-1.45	▼ 0.63%	10820	76335	+811	Dec24 / Mar25	-1.3
Mar25	226.90	-1.40	▼ 0.61%	5128	41240	-674	Mar25 / May25	-2.1
May25	224.80	-1.40	▼ 0.62%	2402	8980	-113	May25 / Jul25	-2.0
Jul25	222.80	-1.45	▼ 0.65%	1006	5616	+131	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Sep24價格為4261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
Sep24	4261	-5	▼ 0.12%	9327	45711	-1573	Sep24 / Nov24	-145.0
Nov24	4116	-2	▼ 0.05%	7160	24981	+553	Nov24 / Jan25	-146.0
Jan25	3970	+1	▲ 0.03%	1701	10130	+597	Jan25 / Mar25	-131.0
Mar25	3839	-4	▼ 0.10%	648	3489	+248	Mar25 / May25	-100.0
May25	3739	-5	▼ 0.13%	282	1056	+80	跨月價差 = 遠期 - 近期 (咖啡期貨的合約有 1、3、5、7、9、11)	

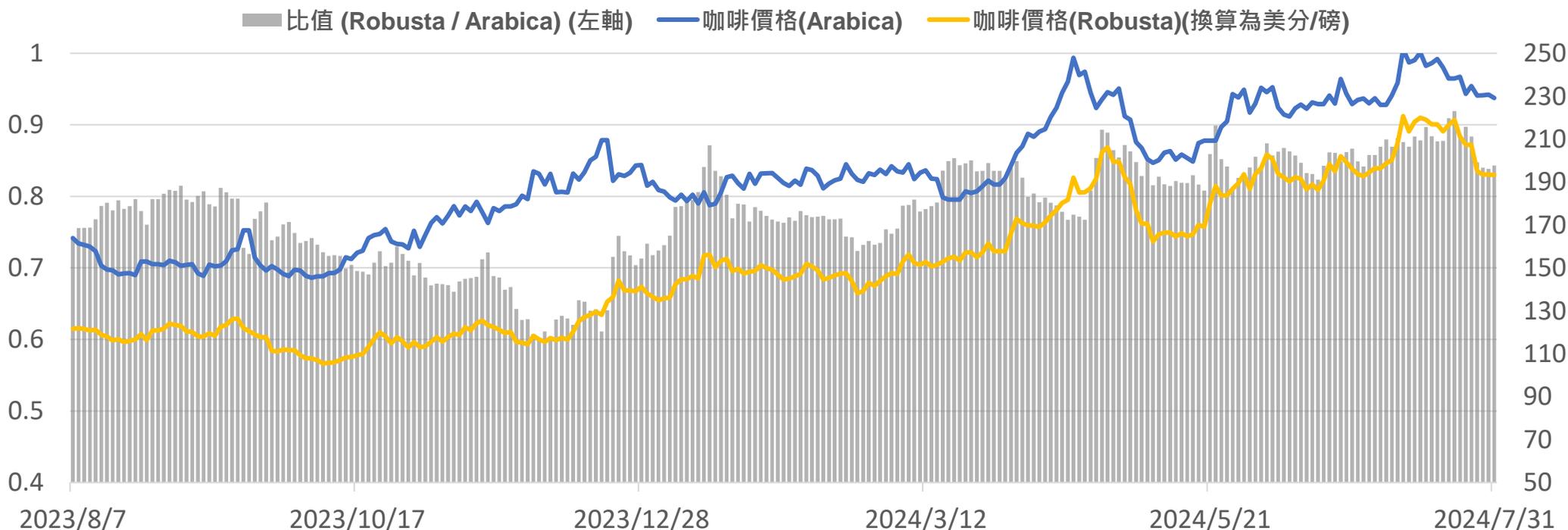
咖啡期貨價格(Robusta) (連續近期合約走勢圖)



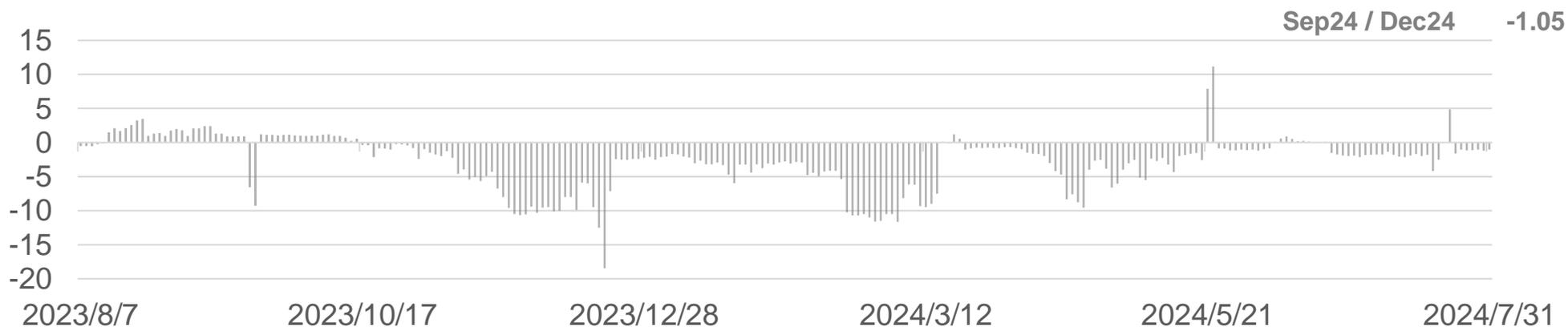
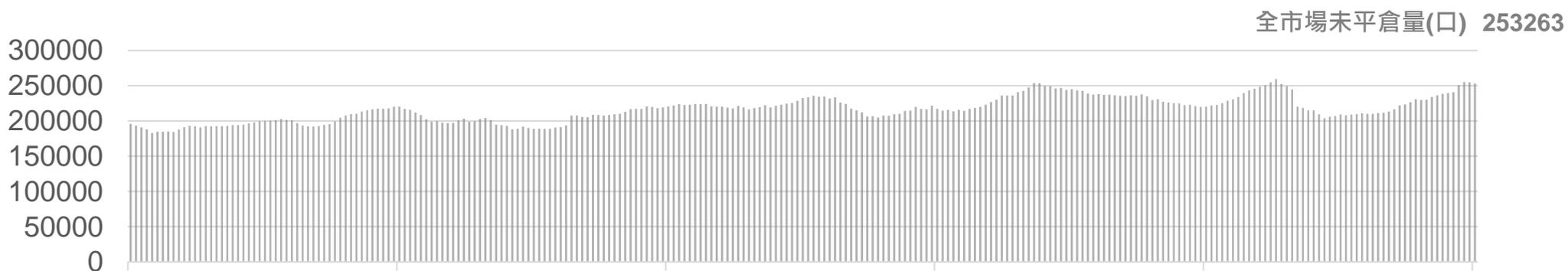
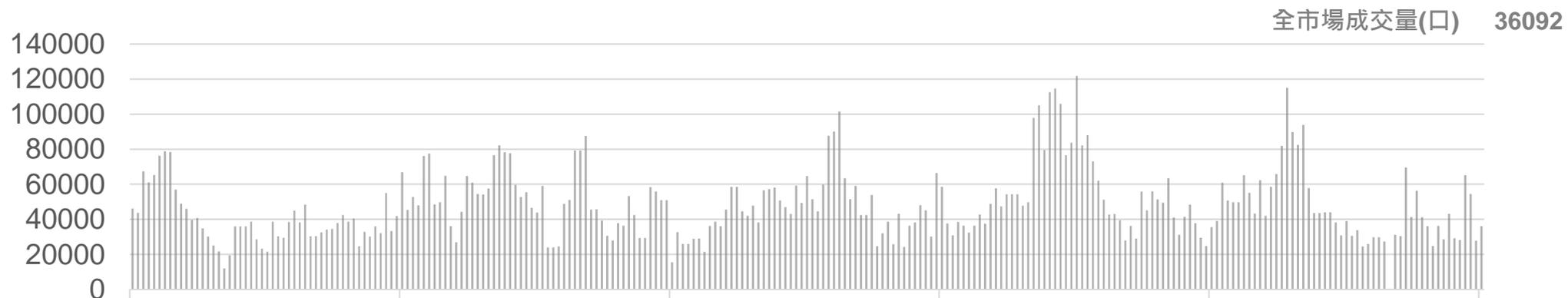
兩品種咖啡價差狀況

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

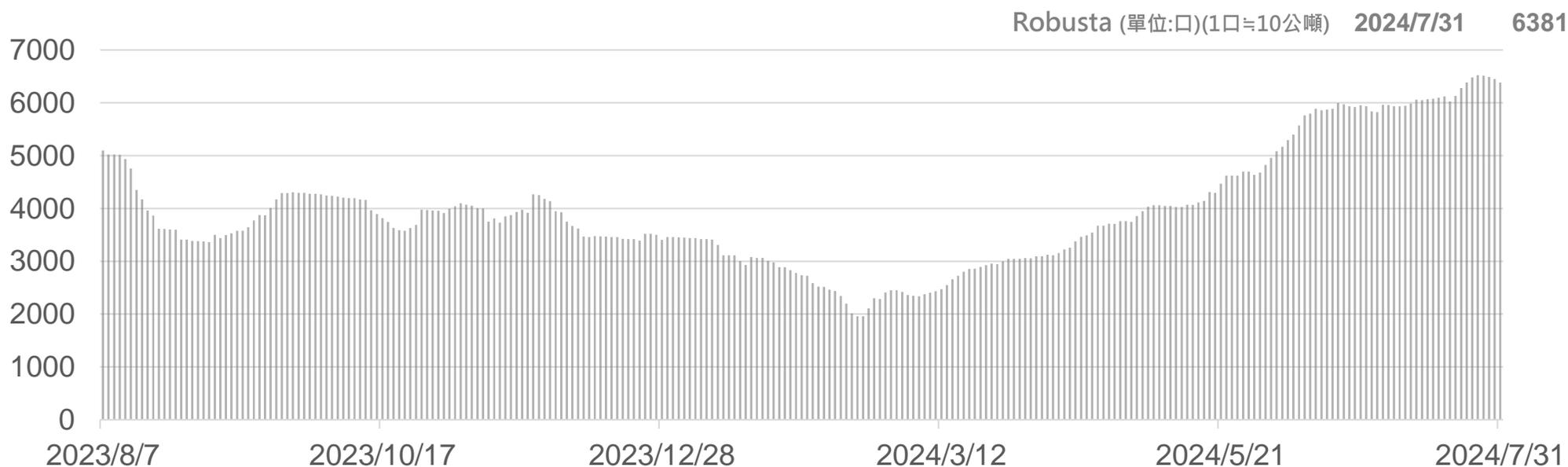
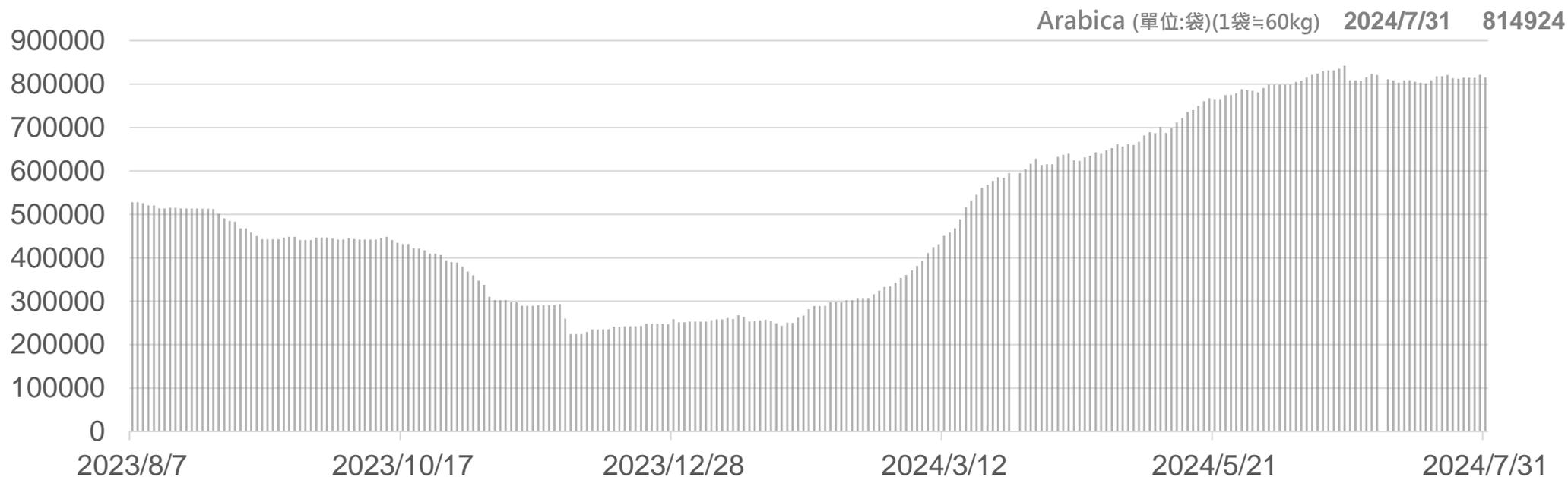
合約	Arabica (美分/磅)	Robusta (美元/公噸)	Robusta (美分/磅)	比值 (Robusta / Arabica)
近月: Sep24/Sep24	229.20	4261	193.28	0.843
Sep24	229.2	4261	193.28	0.843
Dec24	228.15	-	-	-
Mar25	226.9	3839	174.13	0.767
May25	224.8	3739	169.60	0.754



咖啡(Arabica)期貨全市場成交量&OI



咖啡庫存走勢圖

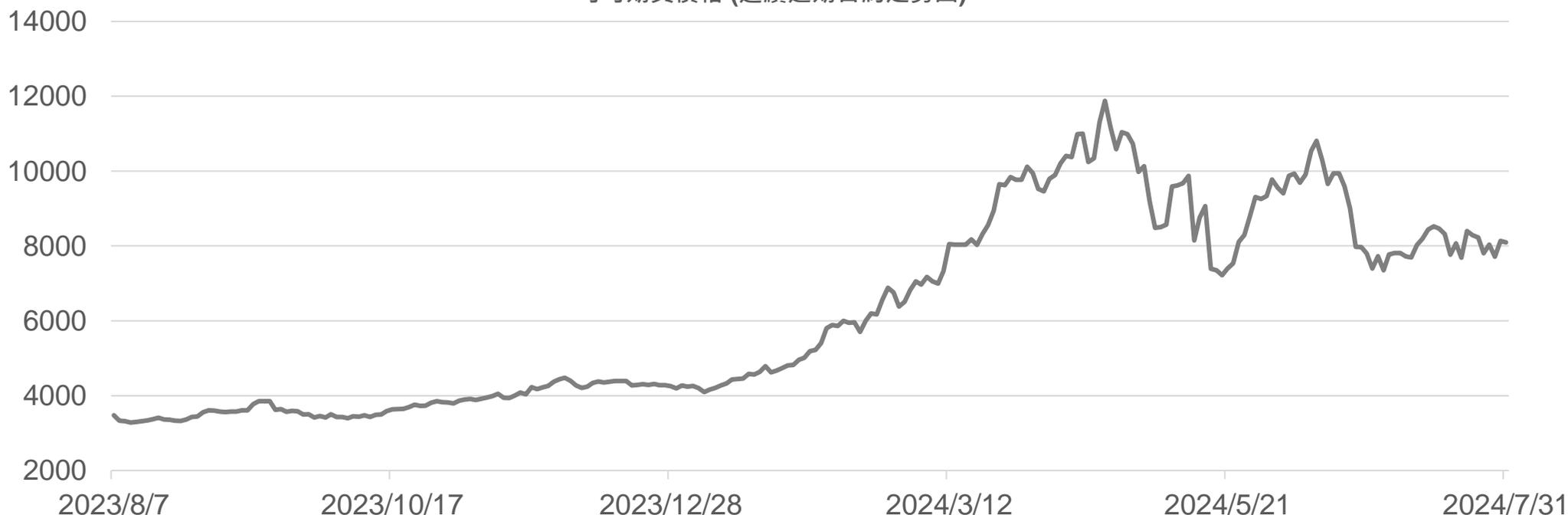


可可期貨表現狀況

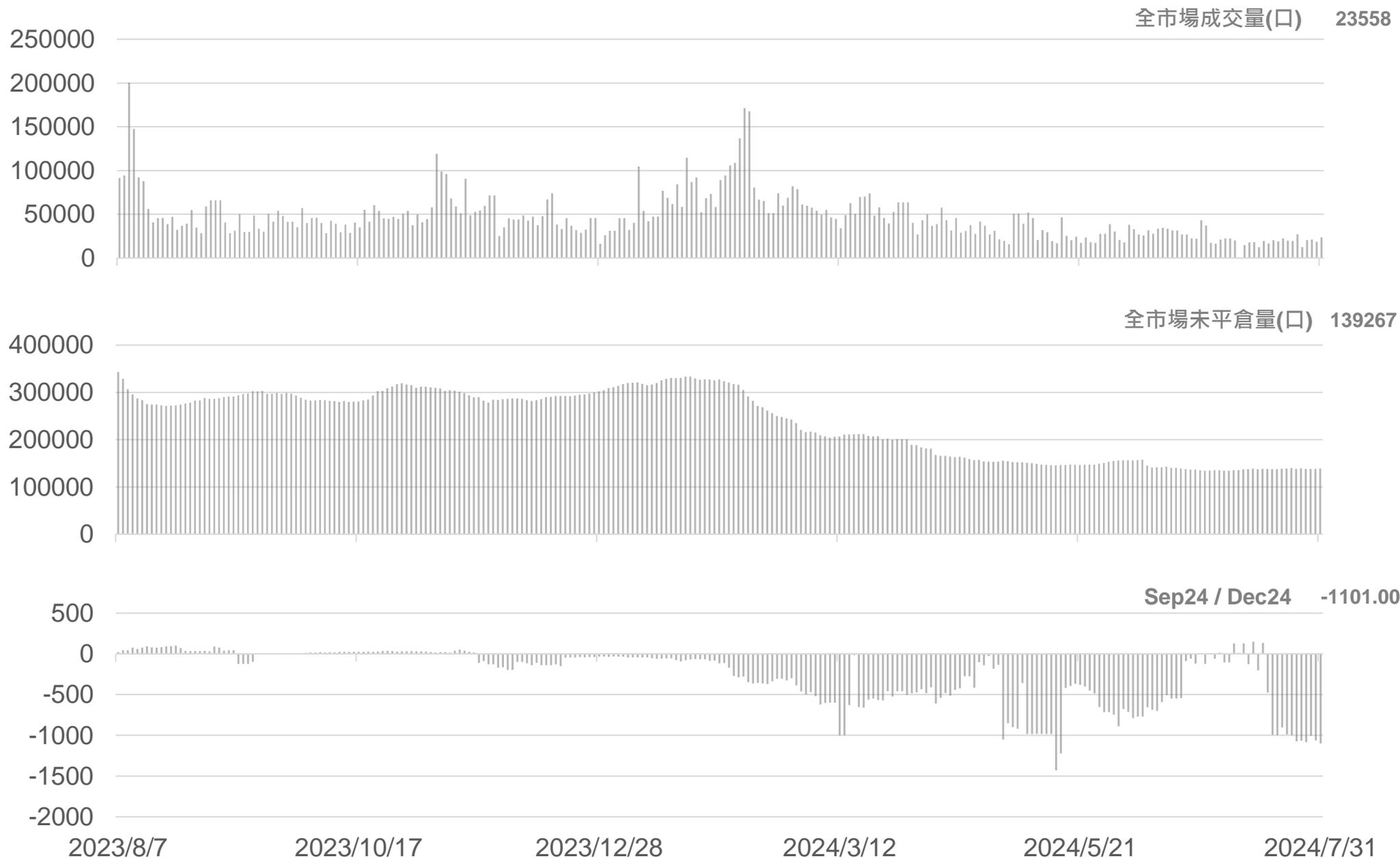
此報價為美元/公噸，以今天為例：可可期貨Sep24價格為8092美元/公噸

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Sep24	8092	-44	▼ 0.54%	11261	42358	-1020	Sep24 / Dec24	-1101.0
Dec24	6991	-83	▼ 1.17%	7444	48868	+1482	Dec24 / Mar25	-772.0
Mar25	6219	-91	▼ 1.44%	2824	26211	+338	Mar25 / May25	-253.0
May25	5966	-90	▼ 1.49%	836	8711	-165	May25 / Jul25	-154.0
Jul25	5812	-77	▼ 1.31%	733	7376	+141	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)

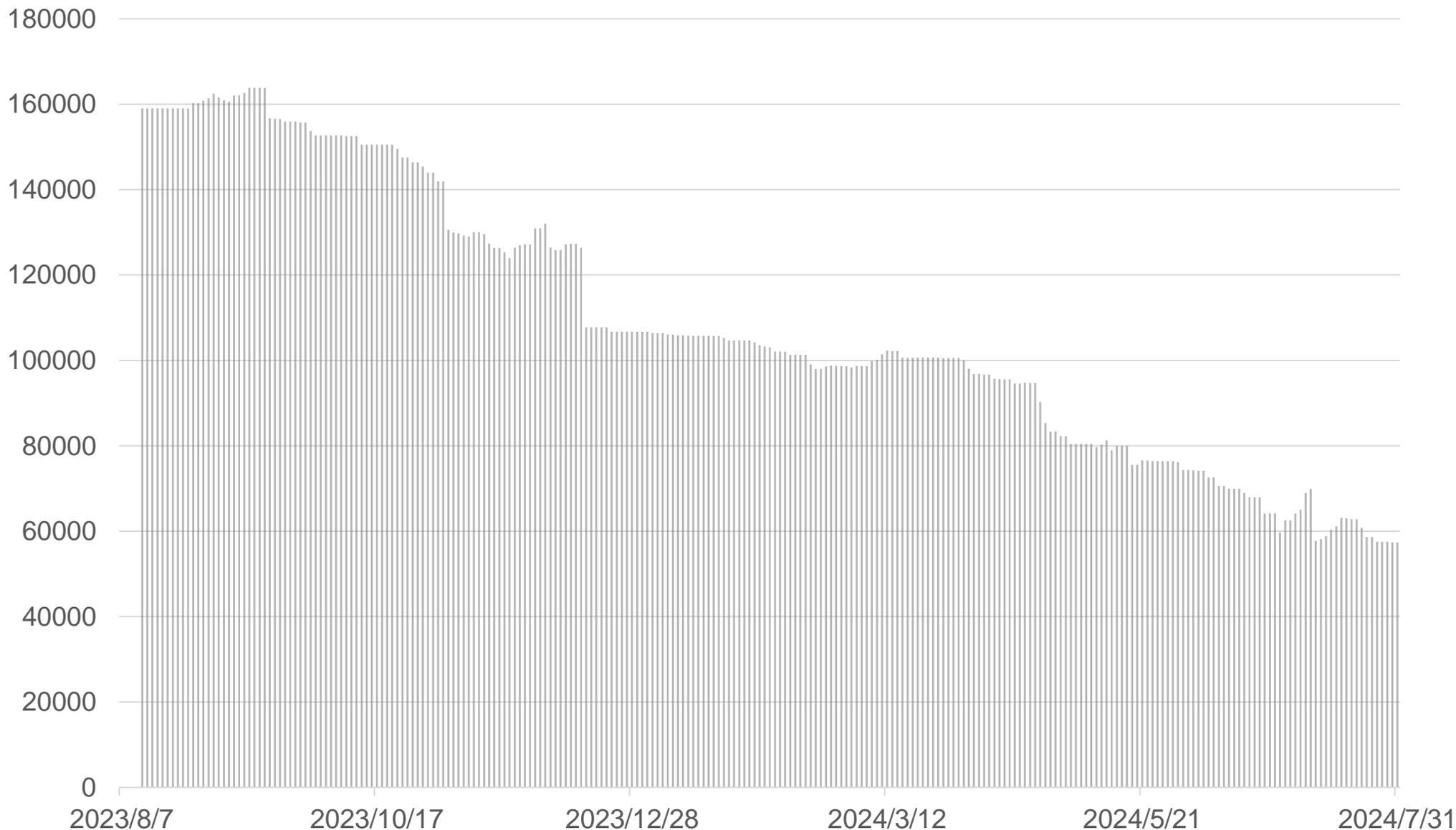


可可期貨全市場成交量&OI



可可庫存走勢圖

可可庫存 (單位:公噸) 2024/7/30 57340



棉花期貨表現狀況

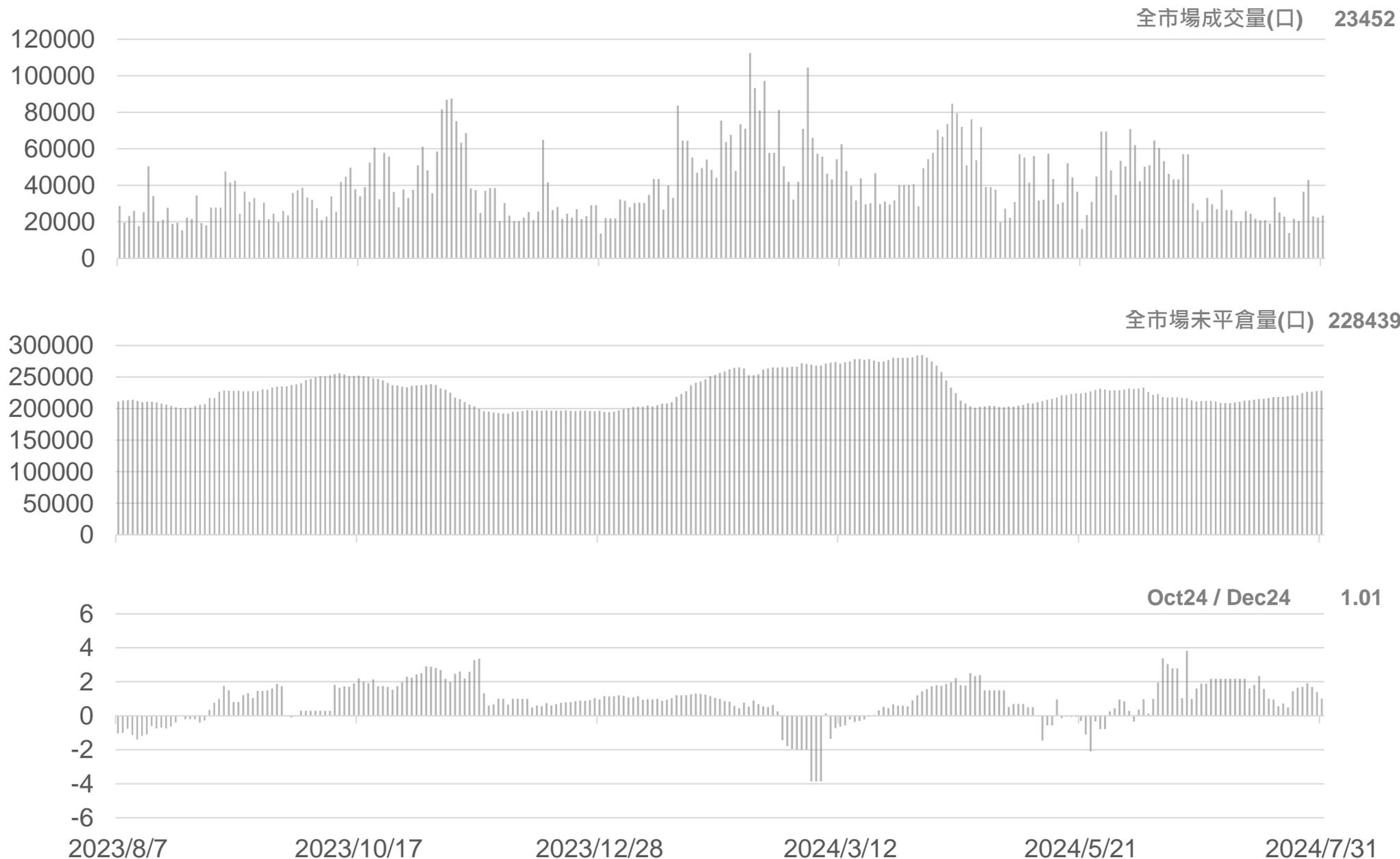
此報價為美分/磅·以今天為例：棉花期貨Oct24價格為67.98美分/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Oct24	67.98	-0.17	▼ 0.25%	23	394	-6	Oct24 / Dec24	+1.0
Dec24	68.99	-0.56	▼ 0.81%	16009	160171	-595	Dec24 / Mar25	+1.7
Mar25	70.67	-0.51	▼ 0.72%	4221	38541	+836	Mar25 / May25	+1.3
May25	71.93	-0.47	▼ 0.65%	1962	11256	+170	May25 / Jul25	+0.9
Jul25	72.88	-0.45	▼ 0.61%	797	7120	-159	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)

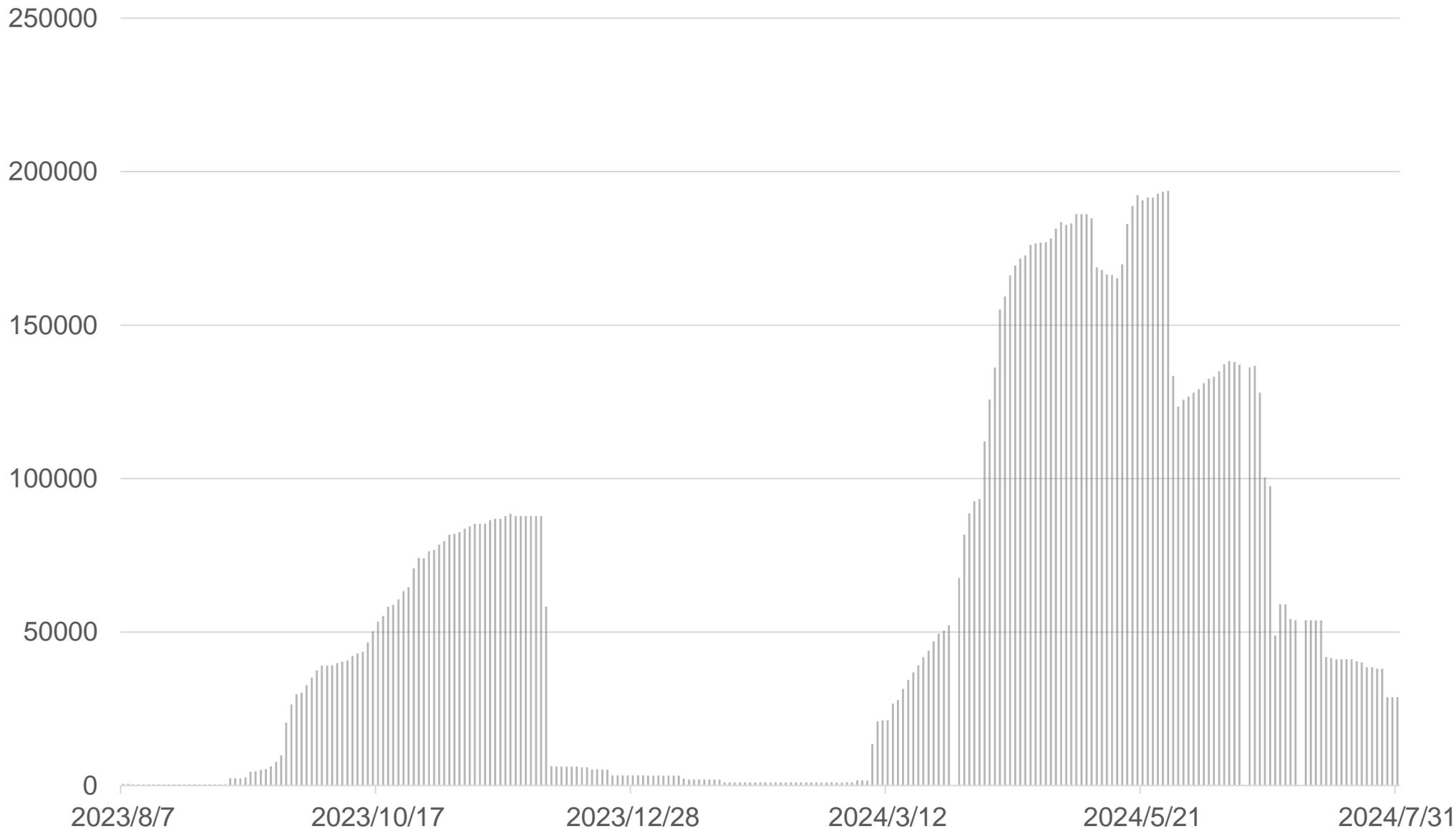


棉花期貨全市場成交量&OI



棉花庫存走勢圖

棉花庫存 (單位:包)(1包=500磅) 2024/7/31 28745



11號糖期貨表現狀況

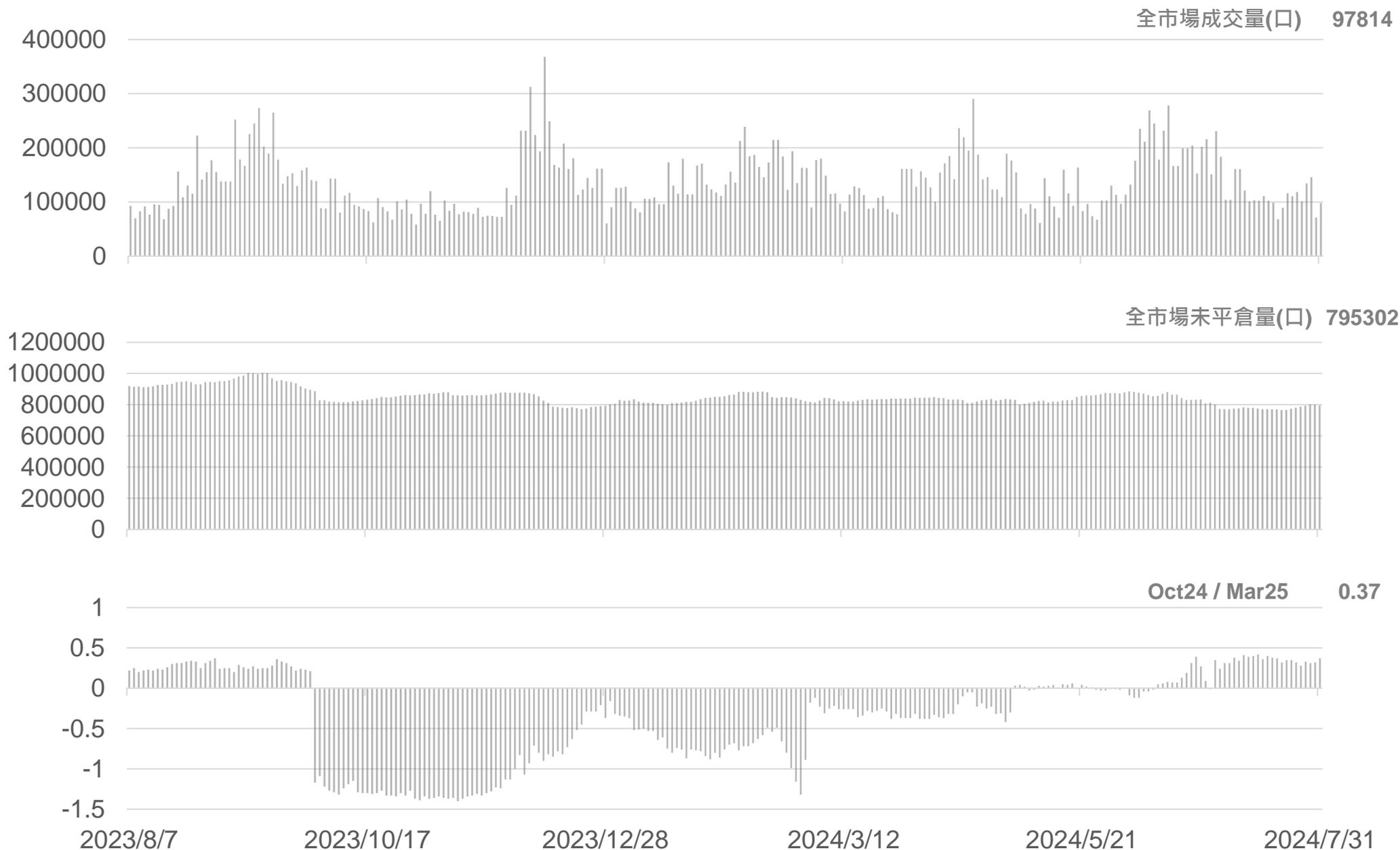
此報價為美分/磅 · 以今天為例：11號糖期貨Oct24價格為18.94美分/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Oct24	18.94	-0.18 ▼	0.94%	55993	338584	-6032	Oct24 / Mar25	+0.4
Mar25	19.31	-0.13 ▼	0.67%	17051	197789	+1039	Mar25 / May25	-0.8
May25	18.51	-0.11 ▼	0.59%	9563	86447	-633	May25 / Jul25	-0.5
Jul25	18.06	-0.07 ▼	0.39%	6727	71419	+283	Jul25 / Oct25	-0.1
Oct25	17.97	-0.04 ▼	0.22%	3877	42536	+196	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