



ICE

軟性商品報告

2024年8月19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)	+2.31%	+4.87%	+3.04%	+13.82%	+25.33%
咖啡(Robusta)	+2.06%	+7.84%	-2.30%	+15.16%	+47.02%
可可	+1.79%	-5.07%	+12.33%	+6.51%	+32.67%
棉花	+0.13%	-0.94%	-5.03%	-18.67%	-34.56%
11號糖	+0.84%	-2.44%	-3.38%	-1.26%	-20.15%

重點新聞

- 咖啡：

9月份阿拉比卡咖啡價格大漲2.31%，達到每磅245.45美分，而9月份羅布斯塔咖啡價格大漲2.06%，達到每公噸4665美元。
- 可可：

9月份的紐約可可價格上漲1.79%，達到每公噸8637美元。
- 糖：

10月份的11號糖價格小漲0.84%，達到每磅18.03美分。
- 棉花：

12月份的棉花價格小漲0.13%，達到每磅67.24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245.45美分/磅，或2.4545美元/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Sep24	245.45	+5.55	▲ 2.31%	10297	17981	-4413	Sep24 / Dec24	-1.3
Dec24	244.10	+6.05	▲ 2.54%	21319	95026	+1669	Dec24 / Mar25	-2.5
Mar25	241.60	+5.90	▲ 2.50%	8816	48696	+1256	Mar25 / May25	-2.4
May25	239.15	+5.70	▲ 2.44%	3397	13103	+84	May25 / Jul25	-2.5
Jul25	236.70	+5.65	▲ 2.45%	1453	6080	+418	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4665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	4665	+94	▲ 2.06%	4994	25187	-752	Sep24 / Nov24	-213.0
Nov24	4452	+74	▲ 1.69%	12724	43414	+2897	Nov24 / Jan25	-174.0
Jan25	4278	+74	▲ 1.76%	2336	16006	-69	Jan25 / Mar25	-163.0
Mar25	4115	+73	▲ 1.81%	424	5868	+100	Mar25 / May25	-120.0
May25	3995	+66	▲ 1.68%	52	1702	+38	跨月價差 = 遠期 - 近期 (咖啡期貨的合約有 1、3、5、7、9、11)	

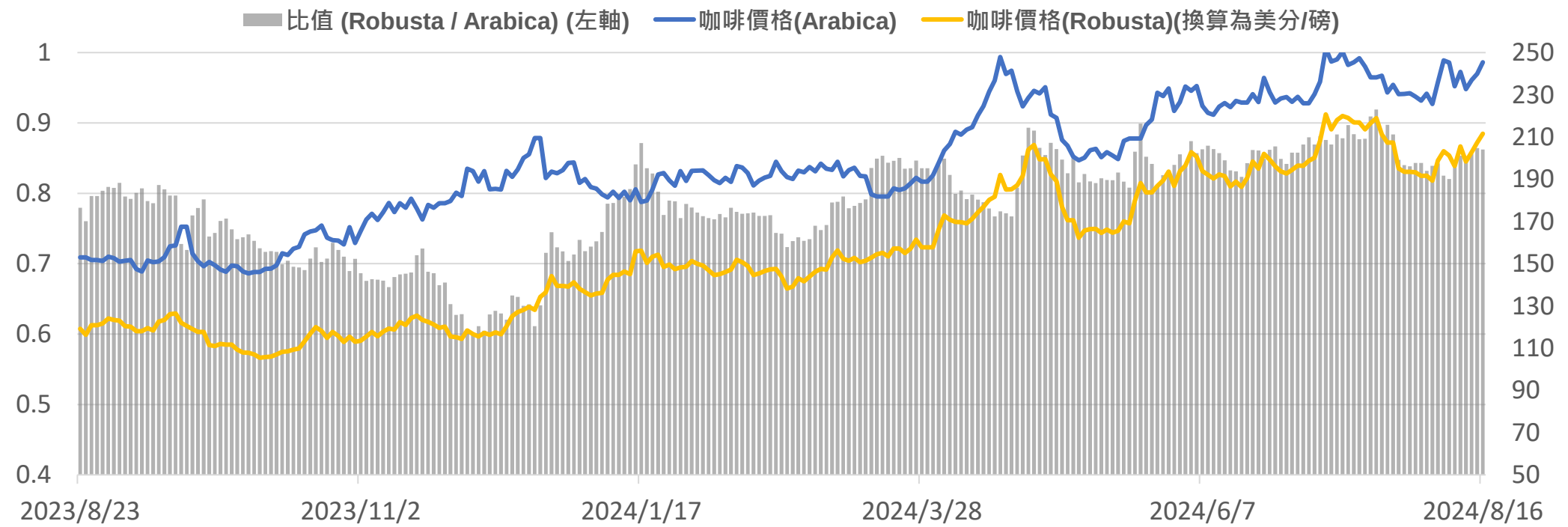
咖啡期貨價格(Robusta) (連續近期合約走勢圖)



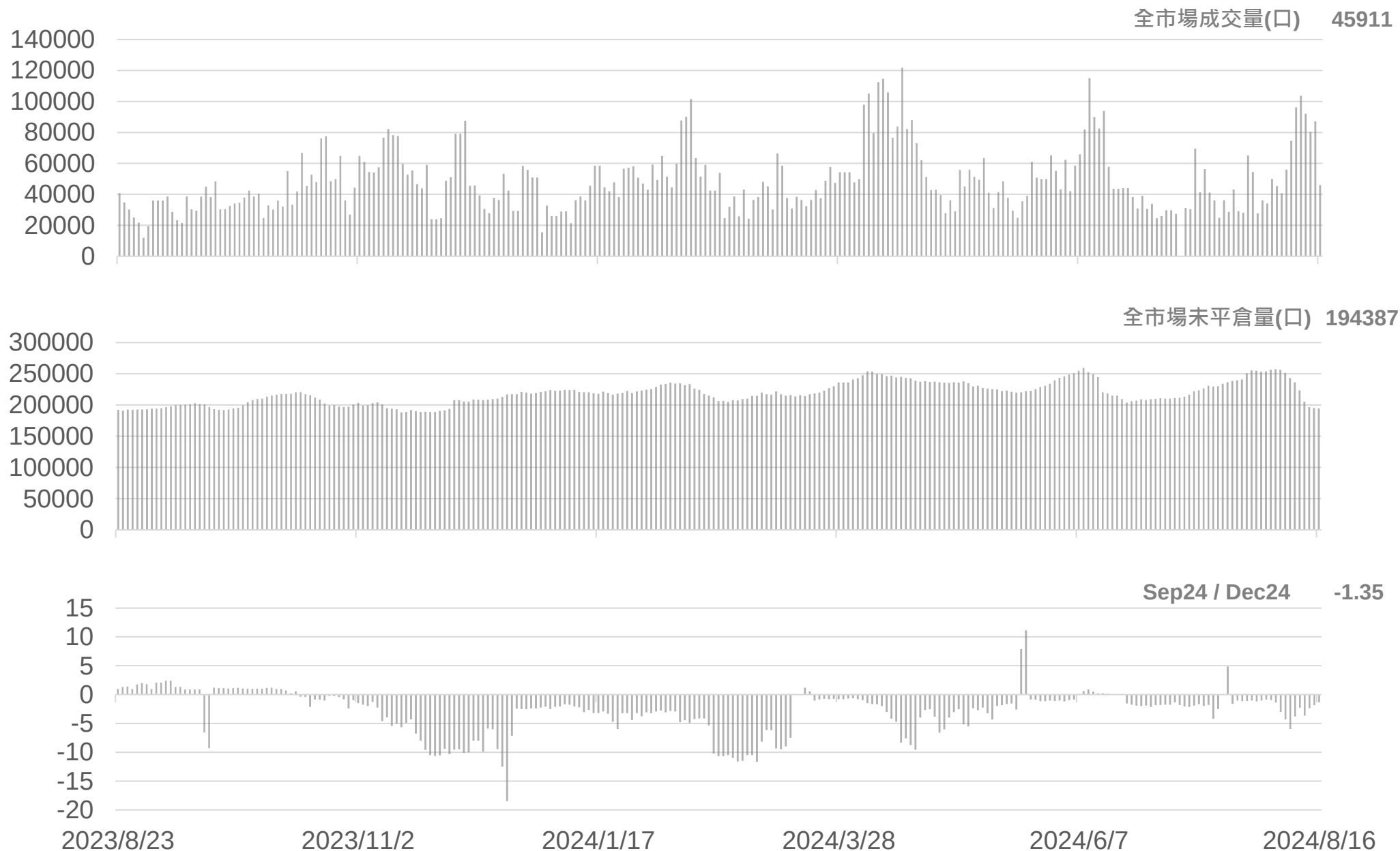
兩品種咖啡價差狀況

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

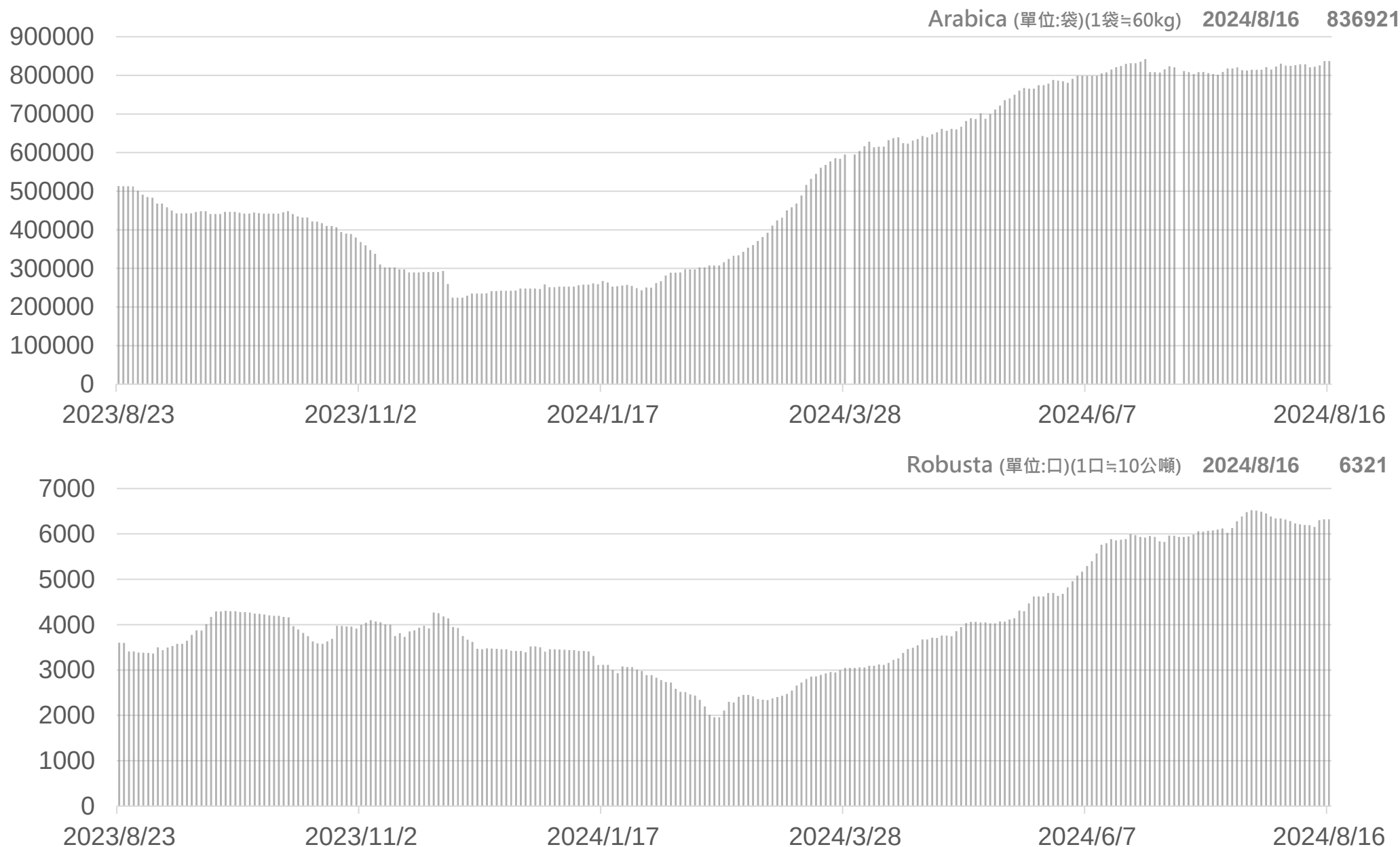
合約	Arabica (美分/磅)	Robusta (美元/公噸)	Robusta (美分/磅)	比值 (Robusta / Arabica)
近月: Sep24/Sep24	245.45	4665	211.60	0.862
Sep24	245.45	4665	211.60	0.862
Dec24	244.1	-	-	-
Mar25	241.6	4115	186.65	0.773
May25	239.15	3995	181.21	0.758



咖啡(Arabica)期貨全市場成交量&OI



咖啡庫存走勢圖



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8月16日

可可期貨表現狀況

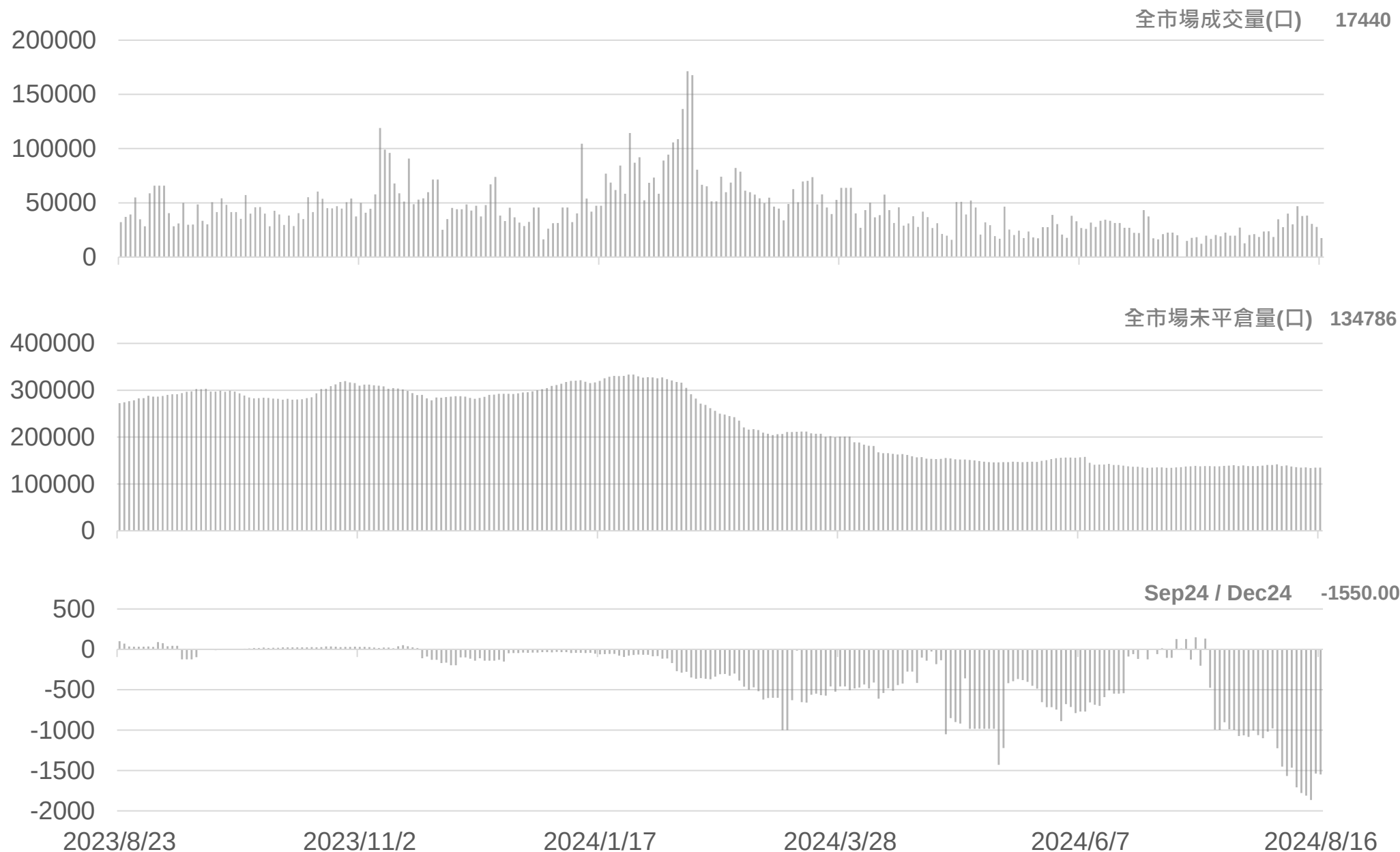
此報價為美元/公噸，以今天為例：可可期貨Sep24價格為8637美元/公噸

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Sep24	8637	+152 ▲	1.79%	4032	9726	-1290	Sep24 / Dec24	-1550.0
Dec24	7087	+139 ▲	2.00%	8139	66290	+840	Dec24 / Mar25	-912.0
Mar25	6175	+66 ▲	1.08%	3578	33049	+221	Mar25 / May25	-244.0
May25	5931	+57 ▲	0.97%	928	10445	-10	May25 / Jul25	-154.0
Jul25	5777	+52 ▲	0.91%	477	8554	+82	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)

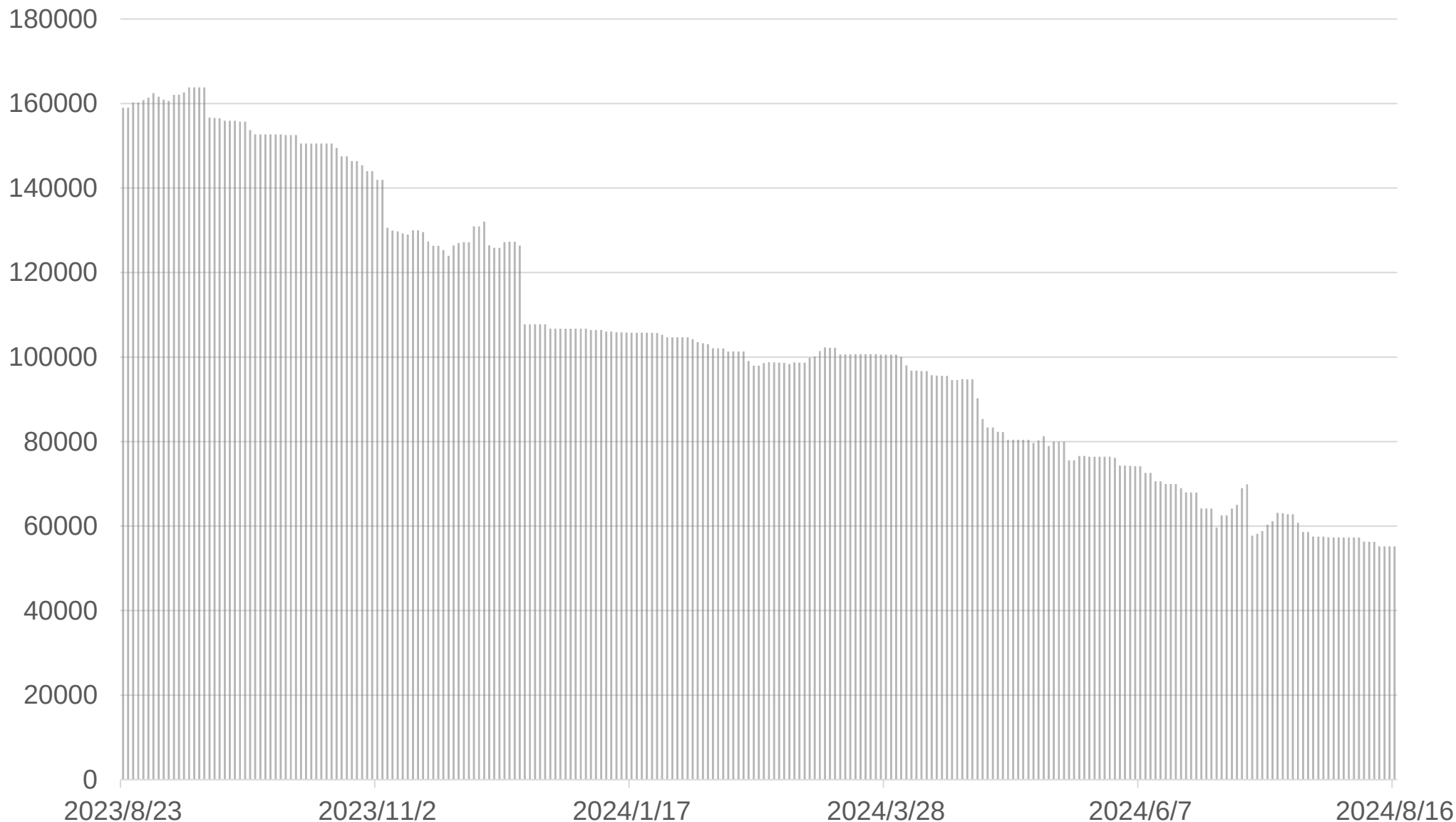


可可期貨全市場成交量&OI



可可庫存走勢圖

可可庫存 (單位:公噸) 2024/8/15 55190



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8月16日

棉花期貨表現狀況

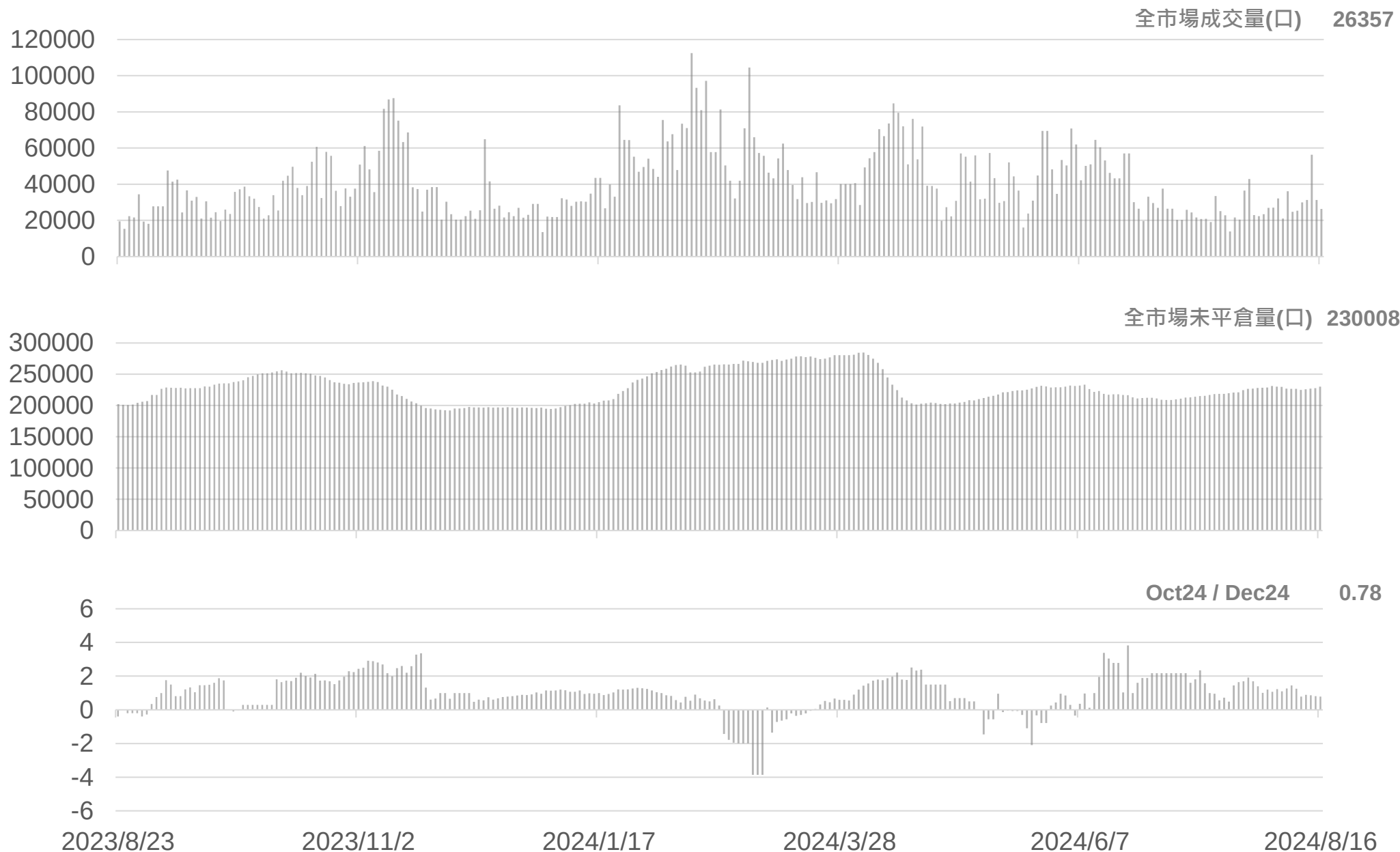
此報價為美分/磅 · 以今天為例：棉花期貨Oct24價格為66.46美分/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Oct24	66.46	+0.12 ▲	0.18%	31	348	-11	Oct24 / Dec24	+0.8
Dec24	67.24	+0.09 ▲	0.13%	16826	152493	+657	Dec24 / Mar25	+1.5
Mar25	68.74	+0.02 ▲	0.03%	5403	40829	+991	Mar25 / May25	+1.3
May25	69.99	-0.05 ▼	0.07%	2422	14978	+42	May25 / Jul25	+0.9
Jul25	70.89	-0.10 ▼	0.14%	862	8524	+273	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)

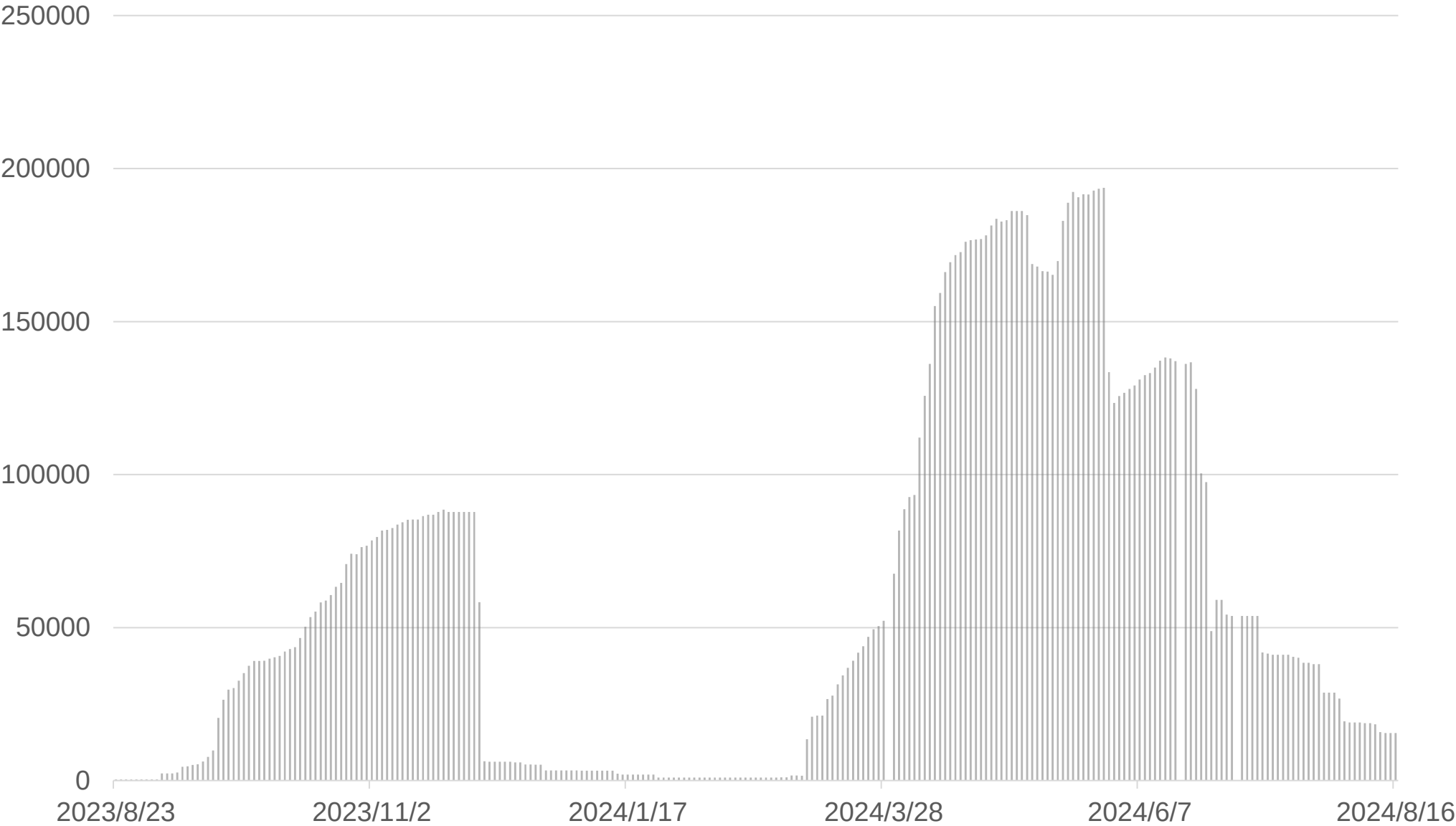


棉花期貨全市場成交量&OI



棉花庫存走勢圖

棉花庫存 (單位:包)(1包=500磅) 2024/8/16 15526



11號糖期貨表現狀況

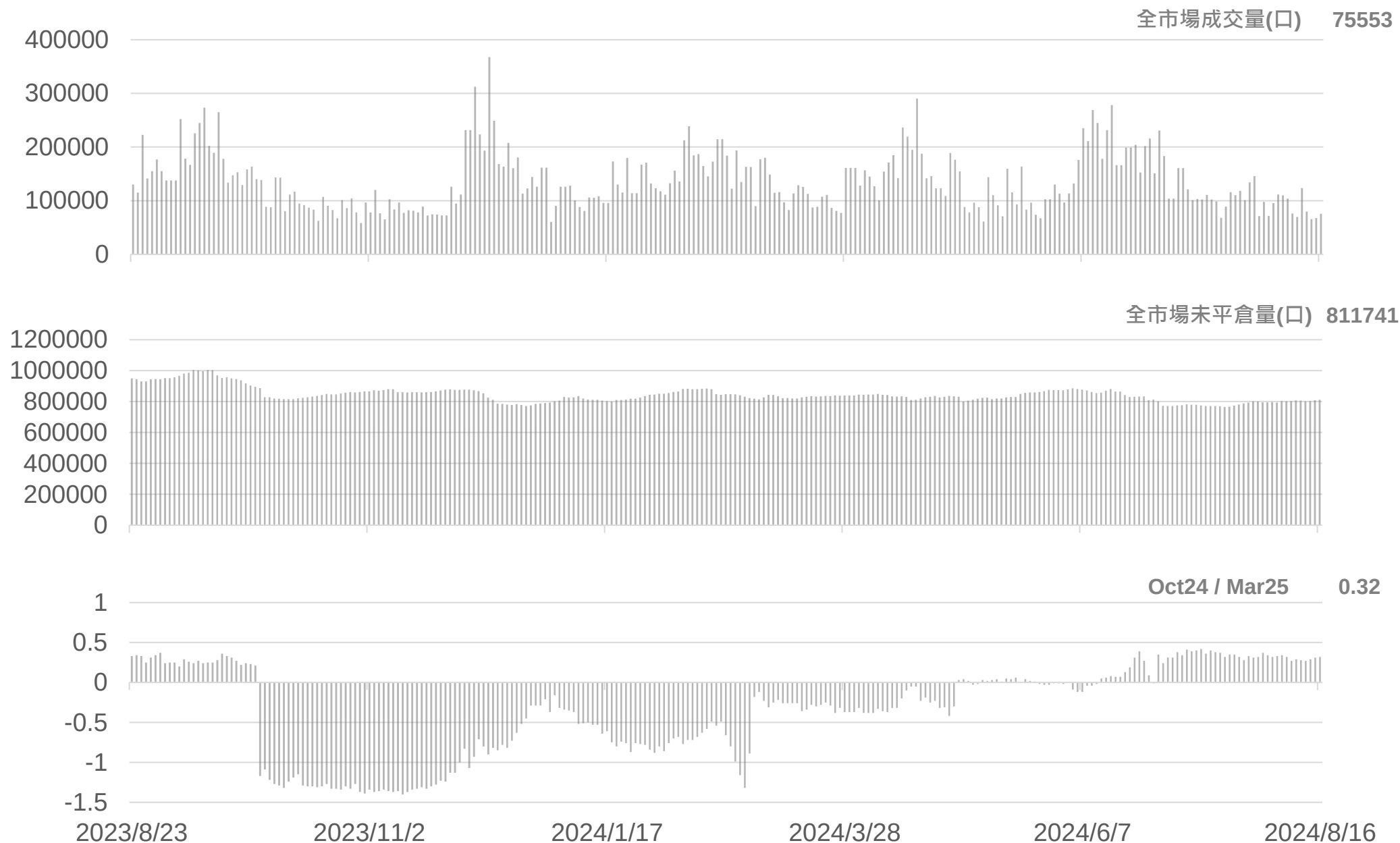
此報價為美分/磅，以今天為例：11號糖期貨Oct24價格為18.03美分/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Oct24	18.03	+0.15 ▲	0.84%	42166	324412	+659	Oct24 / Mar25	+0.3
Mar25	18.35	+0.16 ▲	0.88%	19387	211550	+676	Mar25 / May25	-0.6
May25	17.74	+0.16 ▲	0.91%	7961	96075	+1517	May25 / Jul25	-0.4
Jul25	17.36	+0.14 ▲	0.81%	2717	72913	+536	Jul25 / Oct25	+0.0
Oct25	17.38	+0.12 ▲	0.70%	1681	44630	-90	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8月16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