



ICE

軟性商品報告

2024年8月22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)	+0.30%	+5.25%	+7.92%	+8.72%	+27.92%
咖啡(Robusta)	+0.28%	+10.78%	+8.36%	+18.60%	+52.67%
可可	+0.75%	+8.48%	+16.47%	+2.93%	+37.47%
棉花	+1.46%	+5.33%	+4.03%	-14.04%	-28.94%
11號糖	+0.46%	-1.78%	-1.45%	-3.81%	-15.43%

重點新聞

- 咖啡：
12月份阿拉比卡咖啡價格小漲0.30%，達到每磅249.25美分，而11月份羅布斯塔咖啡價格小漲0.28%，達到每公噸4632美元。
- 可可：
12月份的紐約可可價格小漲0.75%，達到每公噸7697美元。
- 糖：
10月份的11號糖價格小漲0.46%，達到每磅17.65美分。
- 棉花：
12月份的棉花價格上漲1.46%，達到每磅70.35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Sep24價格為249.45美分/磅，或2.4945美元/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Sep24	249.45	unch	unch	5273	5541	-2734	Sep24 / Dec24	-0.2
Dec24	249.25	+0.75 ▲	0.30%	18995	100140	+2165	Dec24 / Mar25	-2.2
Mar25	247.05	+1.15 ▲	0.47%	6386	51532	+1300	Mar25 / May25	-2.1
May25	244.95	+1.30 ▲	0.53%	3128	15996	+730	May25 / Jul25	-2.3
Jul25	242.60	+1.40 ▲	0.58%	1054	6241	+48	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4954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	4954	+75	▲ 1.54%	6179	19803	-2635	Sep24 / Nov24	-322.0
Nov24	4632	+13	▲ 0.28%	14628	53170	+2886	Nov24 / Jan25	-192.0
Jan25	4440	+13	▲ 0.29%	5070	17131	+392	Jan25 / Mar25	-161.0
Mar25	4279	+15	▲ 0.35%	871	6131	+204	Mar25 / May25	-117.0
May25	4162	+22	▲ 0.53%	60	1683	-3	跨月價差 = 遠期 - 近期 (咖啡期貨的合約有 1、3、5、7、9、11)	

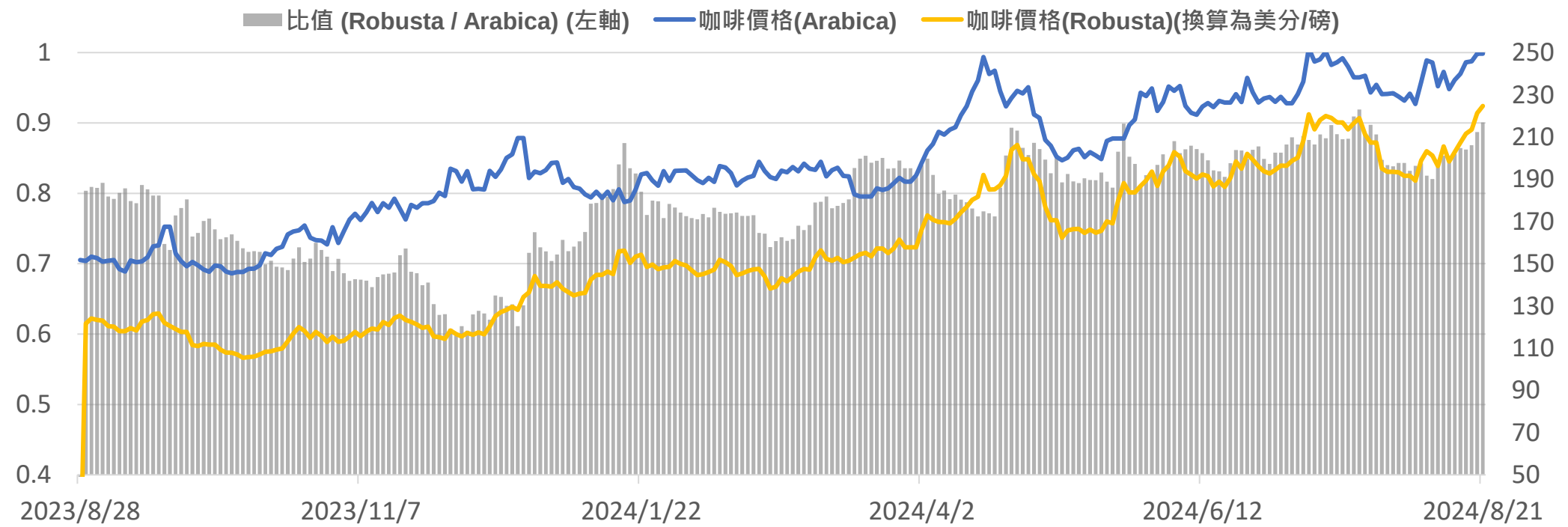
咖啡期貨價格(Robusta) (連續近期合約走勢圖)



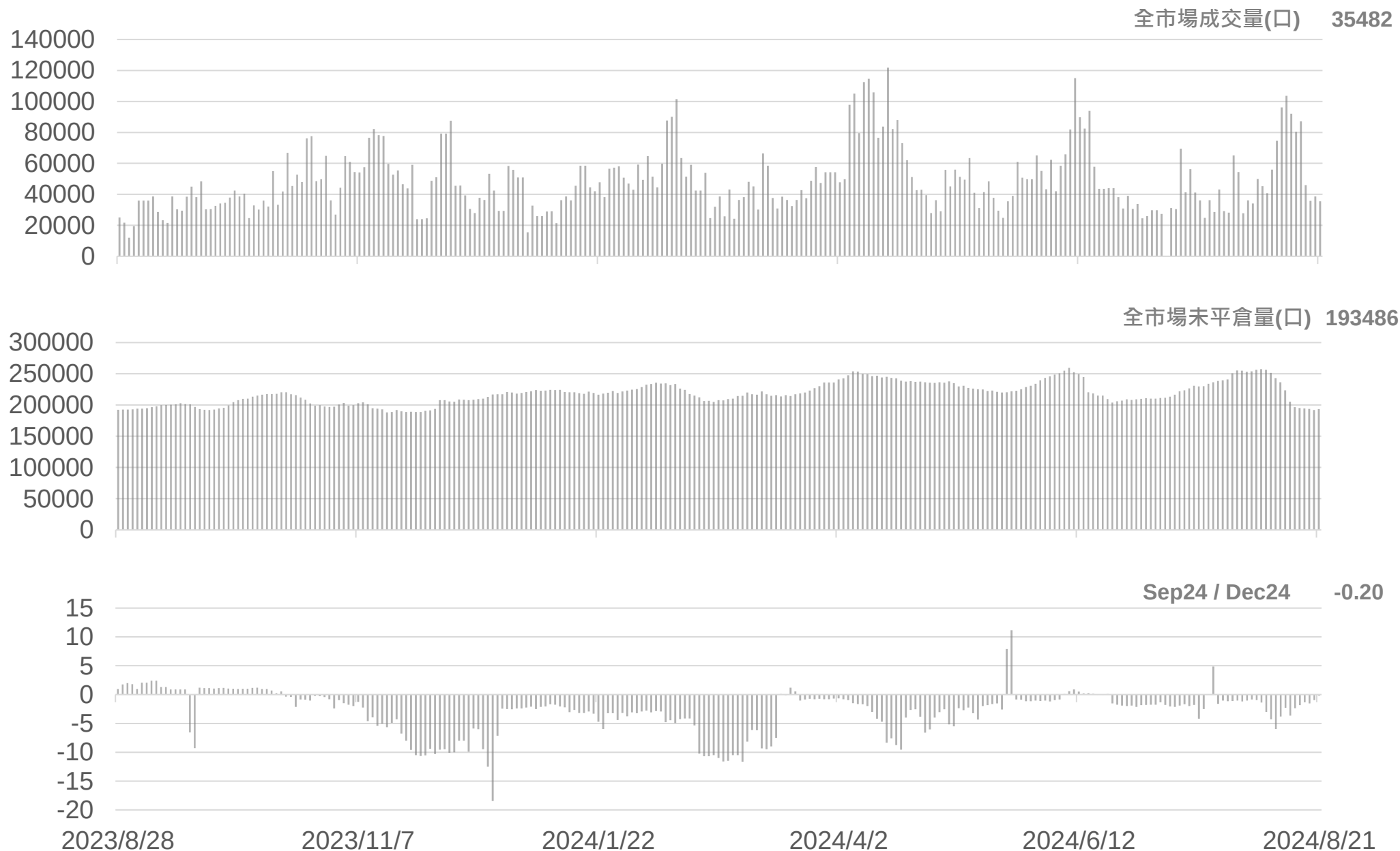
兩品種咖啡價差狀況

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

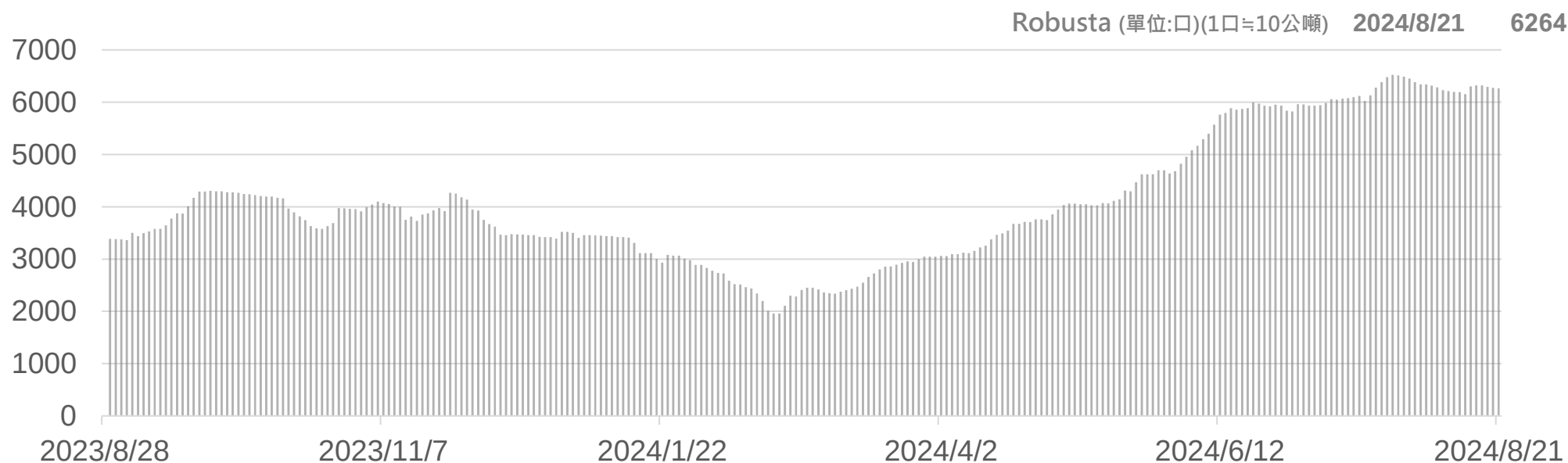
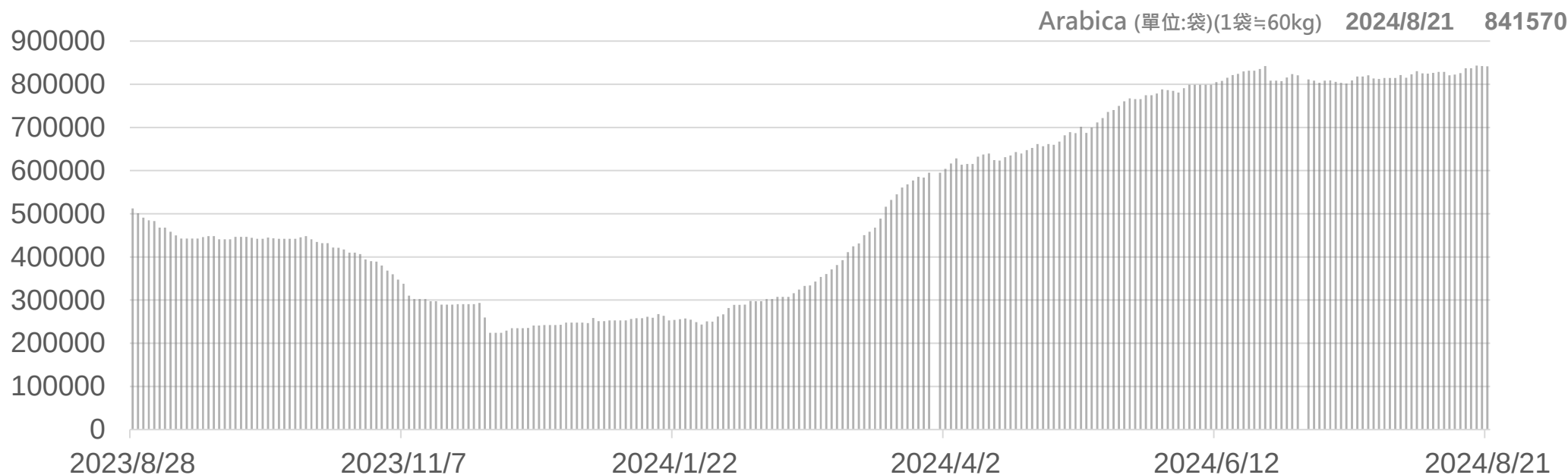
合約	Arabica (美分/磅)	Robusta (美元/公噸)	Robusta (美分/磅)	比值 (Robusta / Arabica)
近月: Sep24/Sep24	249.45	4954	224.71	0.901
Sep24	249.45	4954	224.71	0.901
Dec24	249.25	-	-	-
Mar25	247.05	4279	194.09	0.786
May25	244.95	4162	188.79	0.771



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

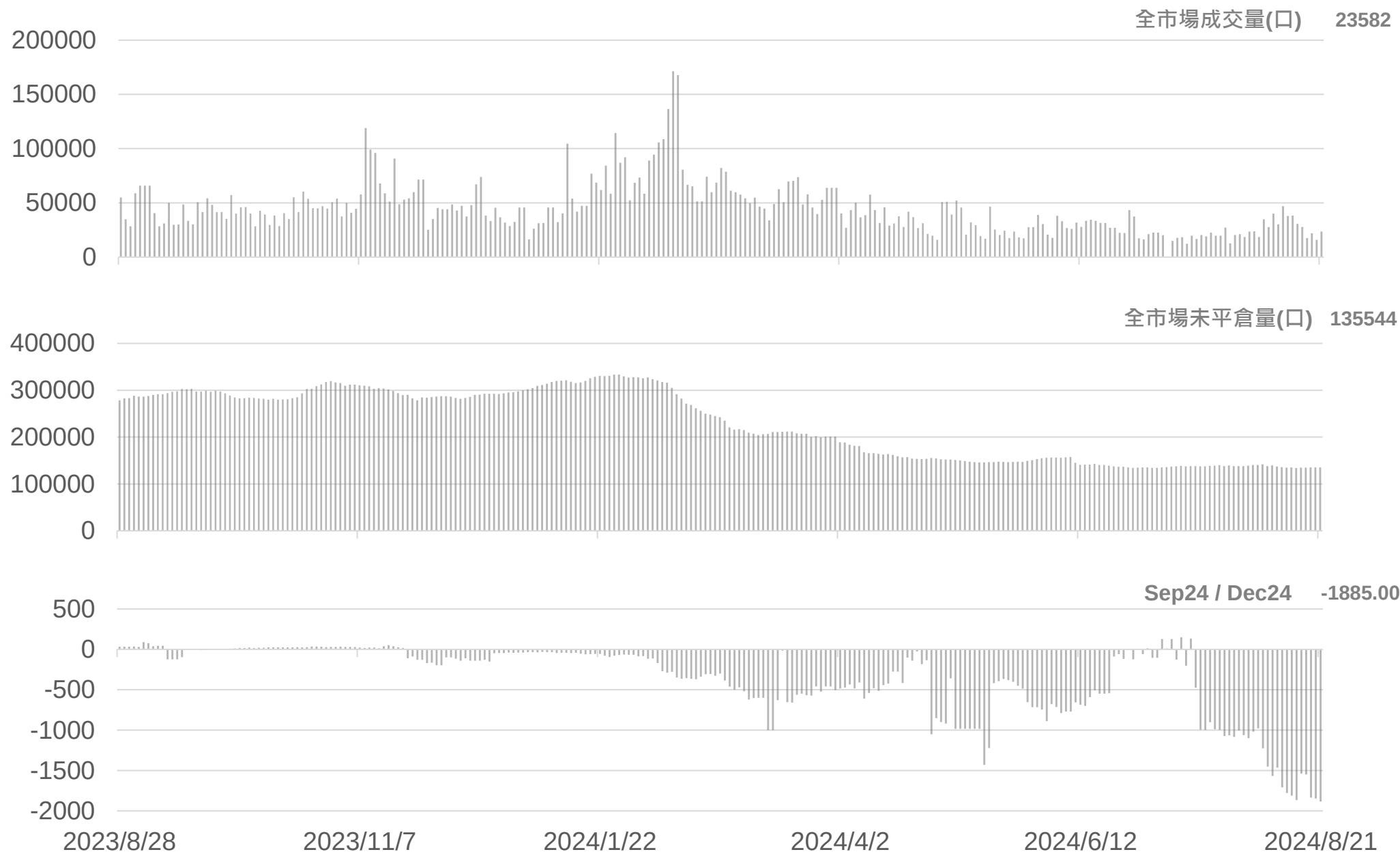
此報價為美元/公噸，以今天為例：可可期貨Sep24價格為9582美元/公噸

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Sep24	9582	+96▲	1.01%	3597	5497	-1389	Sep24 / Dec24	-1885.0
Dec24	7697	+57▲	0.75%	12922	69312	+1122	Dec24 / Mar25	-1256.0
Mar25	6441	+15▲	0.23%	3659	33997	-59	Mar25 / May25	-331.0
May25	6110	-1▼	0.02%	1697	10678	+120	May25 / Jul25	-214.0
Jul25	5896	-20▼	0.34%	1010	8994	+146	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



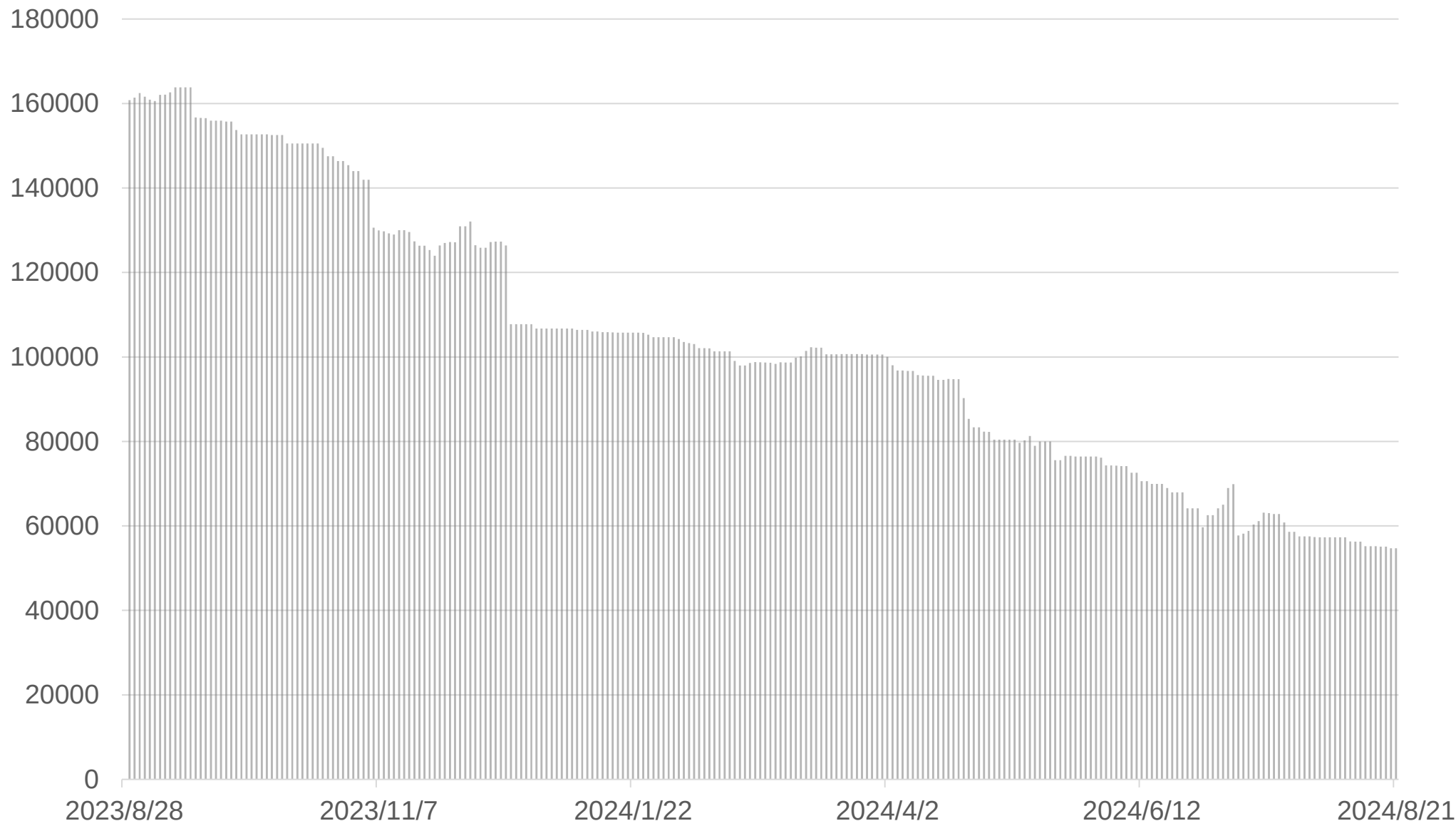
永豐期貨
SinoPac Futures

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8月21日

可可庫存走勢圖

可可庫存 (單位:公噸) 2024/8/20 54690



棉花期貨表現狀況

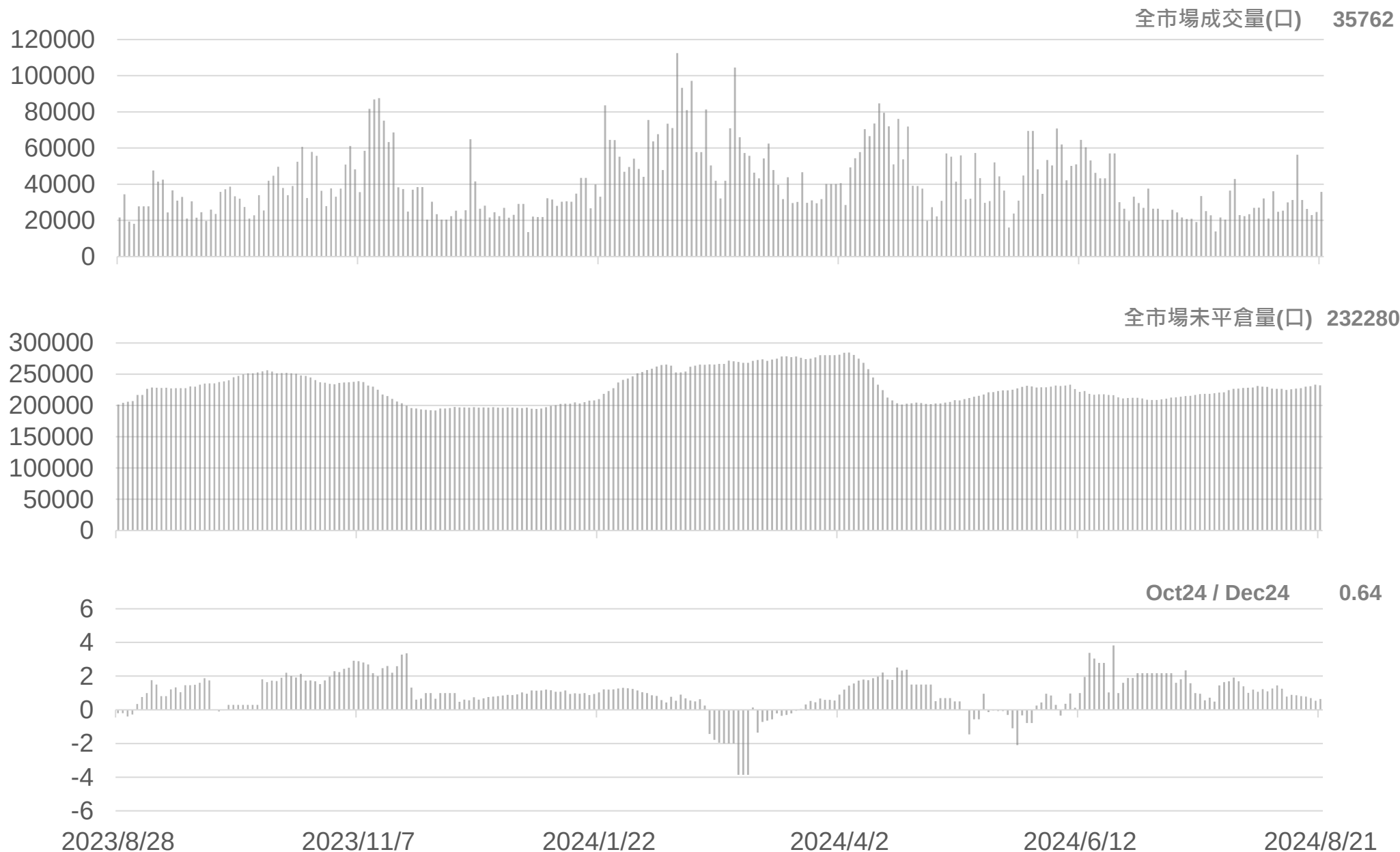
此報價為美分/磅 · 以今天為例：棉花期貨Oct24價格為69.71美分/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Oct24	69.71	+0.91 ▲	1.32%	23	351	+3	Oct24 / Dec24	+0.6
Dec24	70.35	+1.01 ▲	1.46%	23539	151785	-2107	Dec24 / Mar25	+1.3
Mar25	71.62	+0.94 ▲	1.33%	6539	41263	-84	Mar25 / May25	+1.1
May25	72.67	+0.91 ▲	1.27%	2984	16425	+455	May25 / Jul25	+0.5
Jul25	73.22	+0.82 ▲	1.13%	1717	9101	+422	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)

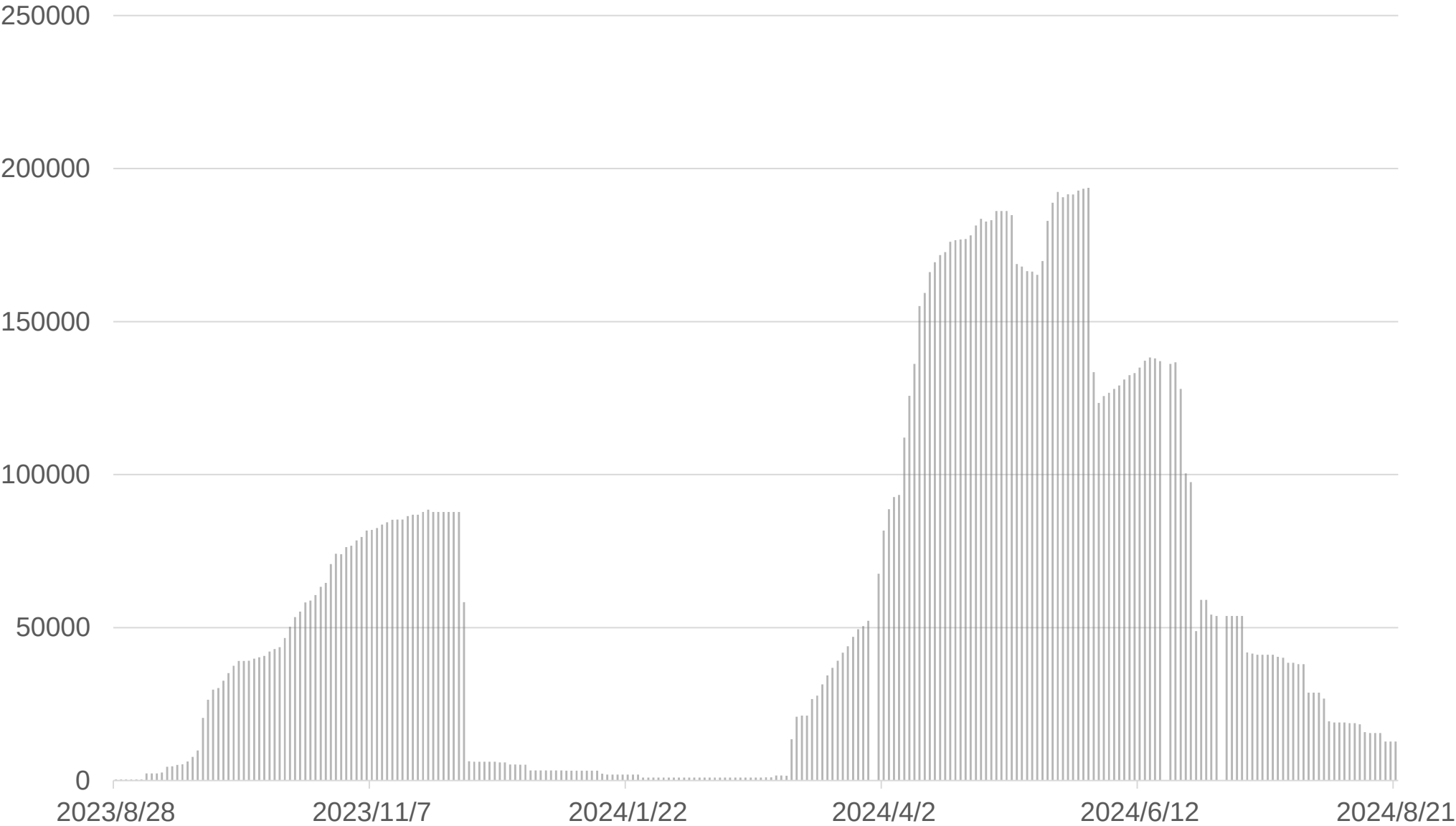


棉花期貨全市場成交量&OI



棉花庫存走勢圖

棉花庫存 (單位:包)(1包=500磅) 2024/8/21 12767



11號糖期貨表現狀況

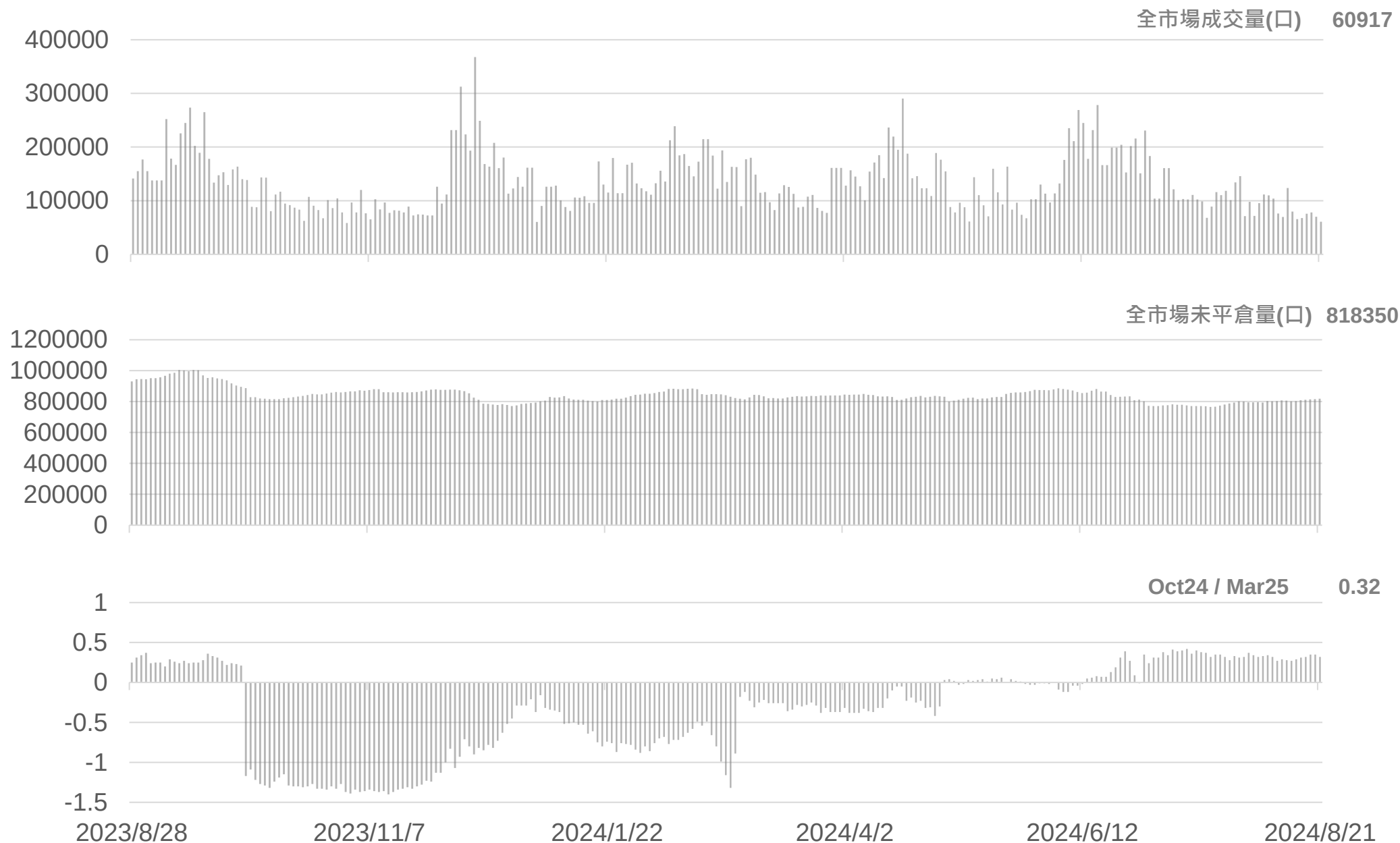
此報價為美分/磅，以今天為例：11號糖期貨Oct24價格為17.65美分/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Oct24	17.65	+0.08▲	0.46%	31101	320859	-394	Oct24 / Mar25	+0.3
Mar25	17.97	+0.05▲	0.28%	16309	215605	+1268	Mar25 / May25	-0.6
May25	17.40	+0.03▲	0.17%	6843	100459	+751	May25 / Jul25	-0.3
Jul25	17.08	+0.01▲	0.06%	3294	73107	+70	Jul25 / Oct25	+0.1
Oct25	17.15	unch	unch	1935	44798	+259	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21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