



ICE

軟性商品報告

2024年8月28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)	+2.24%	+3.99%	+12.39%	+10.90%	+33.47%
咖啡(Robusta)	+2.78%	+7.79%	+23.28%	+21.40%	+57.60%
可可	-2.31%	+3.15%	+20.27%	+2.39%	+33.51%
棉花	-0.40%	+1.77%	+2.74%	-4.71%	-26.34%
11號糖	+2.94%	+11.55%	+2.51%	+3.92%	-10.71%

重點新聞

- 咖啡：
12月份阿拉比卡咖啡價格大漲2.24%，達到每磅255.25美分，而11月份羅布斯塔咖啡價格大漲2.78%，達到每公噸4846美元。
- 可可：
12月份的紐約可可價格大跌-2.31%，達到每公噸7825美元。
- 糖：
10月份的11號糖價格大漲2.94%，達到每磅19.6美分。
- 棉花：
12月份的棉花價格小跌-0.40%，達到每磅69.98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259.4美分/磅，或2.594美元/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Sep24	259.40	+5.75 ▲	2.27%	46	622	-33	Sep24 / Dec24	-4.1
Dec24	255.25	+5.60 ▲	2.24%	12535	101577	+422	Dec24 / Mar25	-2.1
Mar25	253.15	+6.00 ▲	2.43%	5420	53647	-145	Mar25 / May25	-2.3
May25	250.80	+6.00 ▲	2.45%	3002	16293	-356	May25 / Jul25	-2.6
Jul25	248.20	+6.05 ▲	2.50%	1468	6358	-96	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5259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	5259	+131 ▲	2.55%	477	5947	0	Sep24 / Nov24	-413.0
Nov24	4846	+131 ▲	2.78%	11669	54996	-5	Nov24 / Jan25	-198.0
Jan25	4648	+135 ▲	2.99%	4486	17807	0	Jan25 / Mar25	-179.0
Mar25	4469	+129 ▲	2.97%	1529	6598	0	Mar25 / May25	-119.0
May25	4350	+130 ▲	3.08%	249	1667	0	跨月價差 = 遠期 - 近期 (咖啡期貨的合約有 1、3、5、7、9、11)	

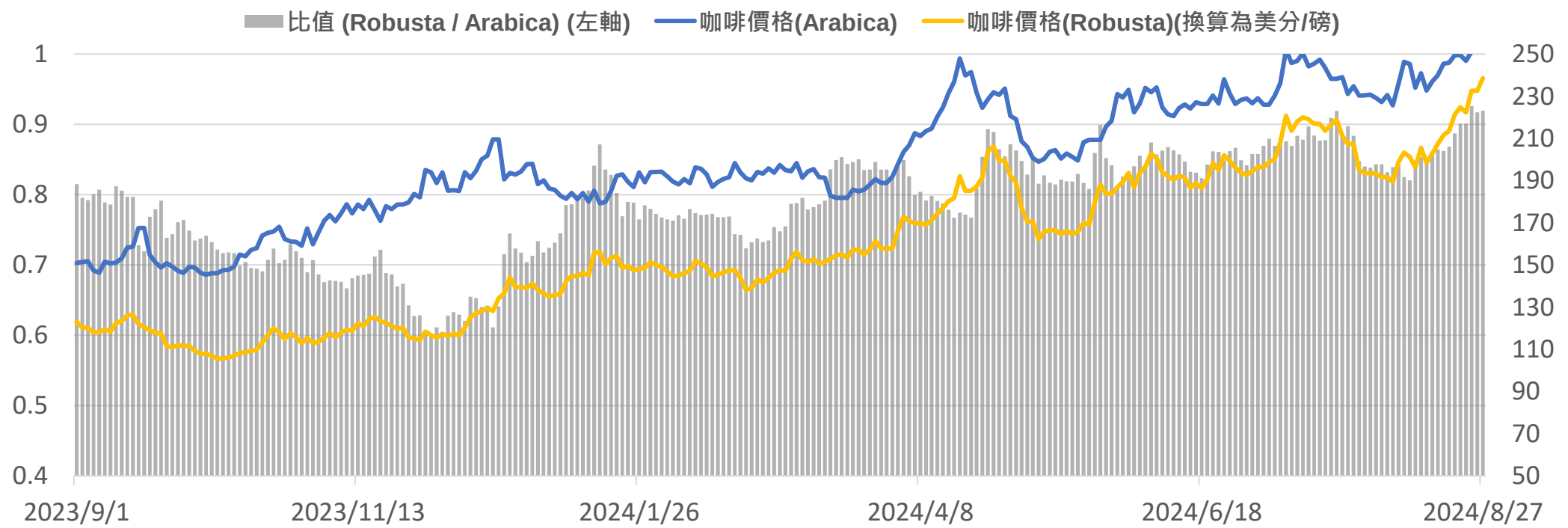
咖啡期貨價格(Robusta) (連續近期合約走勢圖)



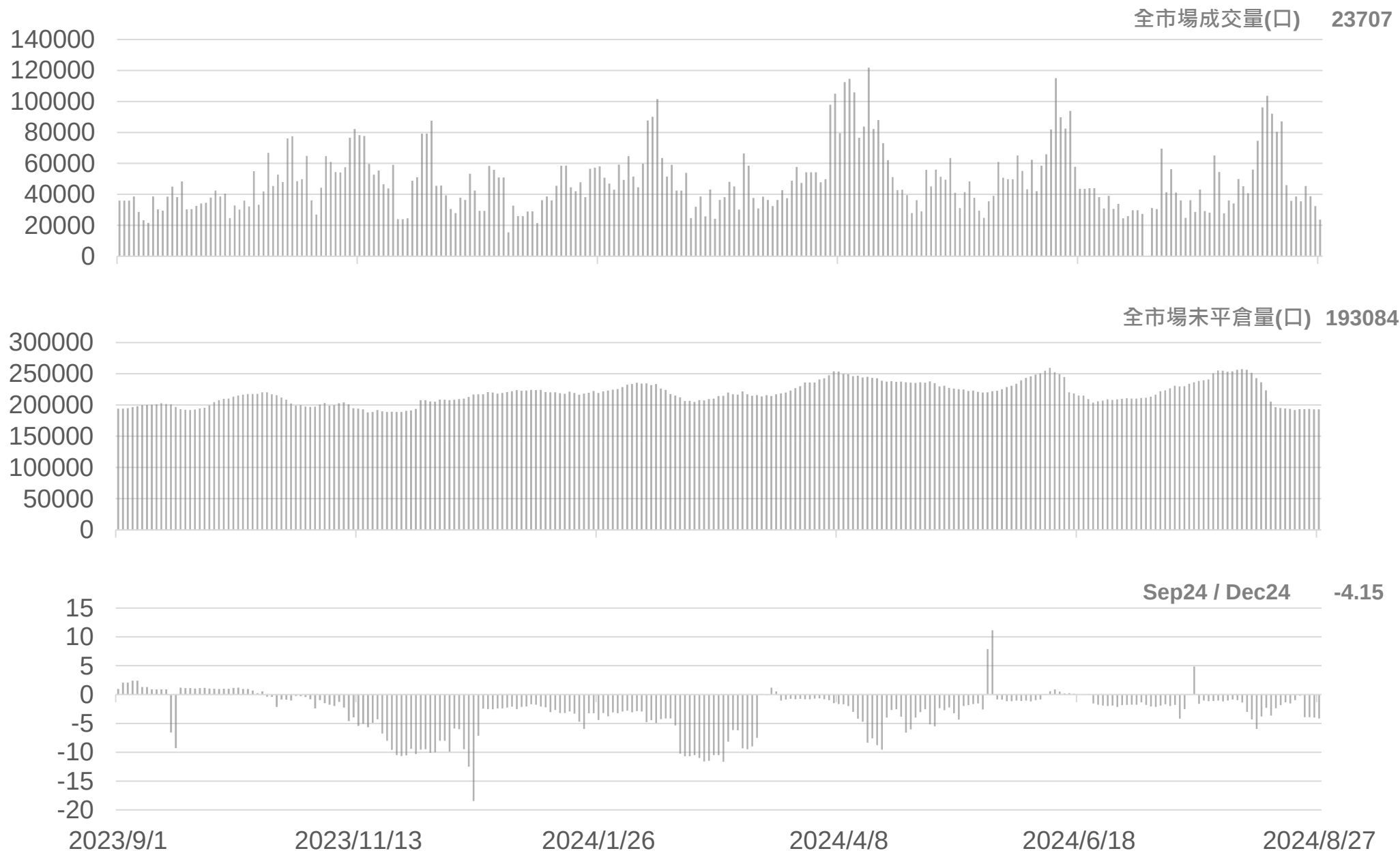
兩品種咖啡價差狀況

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

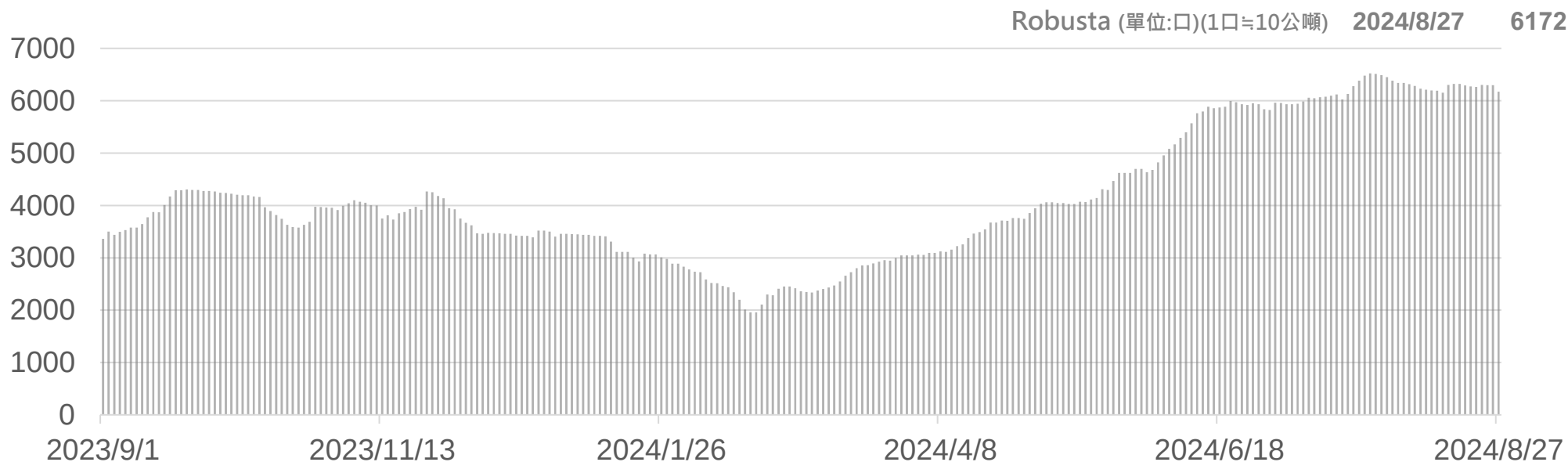
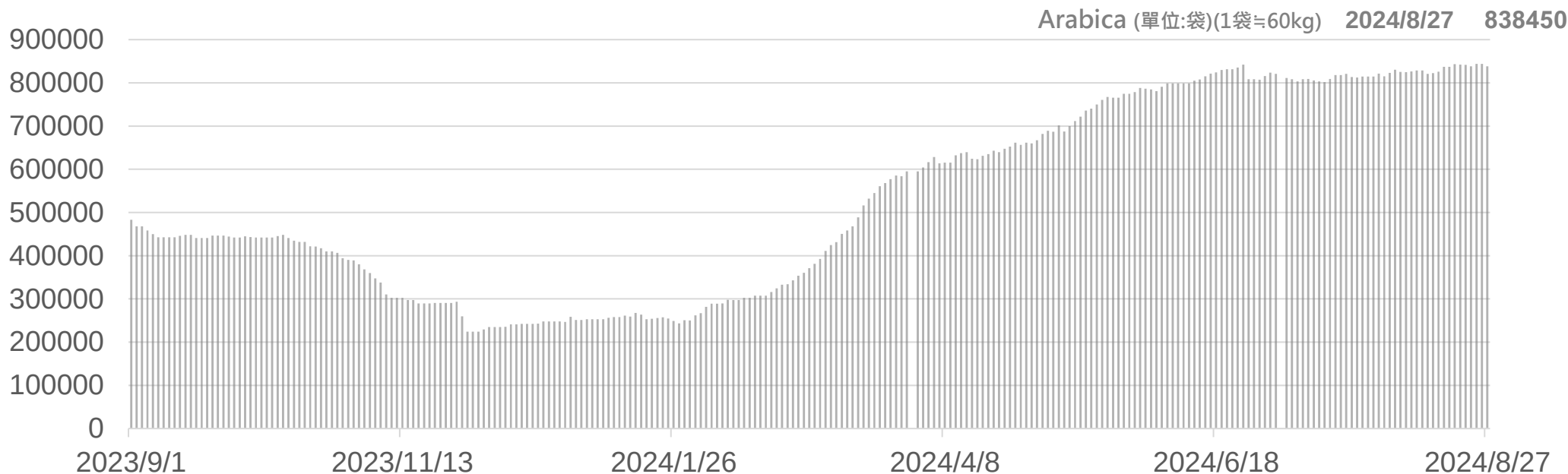
合約	Arabica (美分/磅)	Robusta (美元/公噸)	Robusta (美分/磅)	比值 (Robusta / Arabica)
近月: Sep24/Sep24	259.40	5259	238.54	0.920
Sep24	259.4	5259	238.54	0.920
Dec24	255.25	-	-	-
Mar25	253.15	4469	202.71	0.801
May25	250.8	4350	197.31	0.787



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

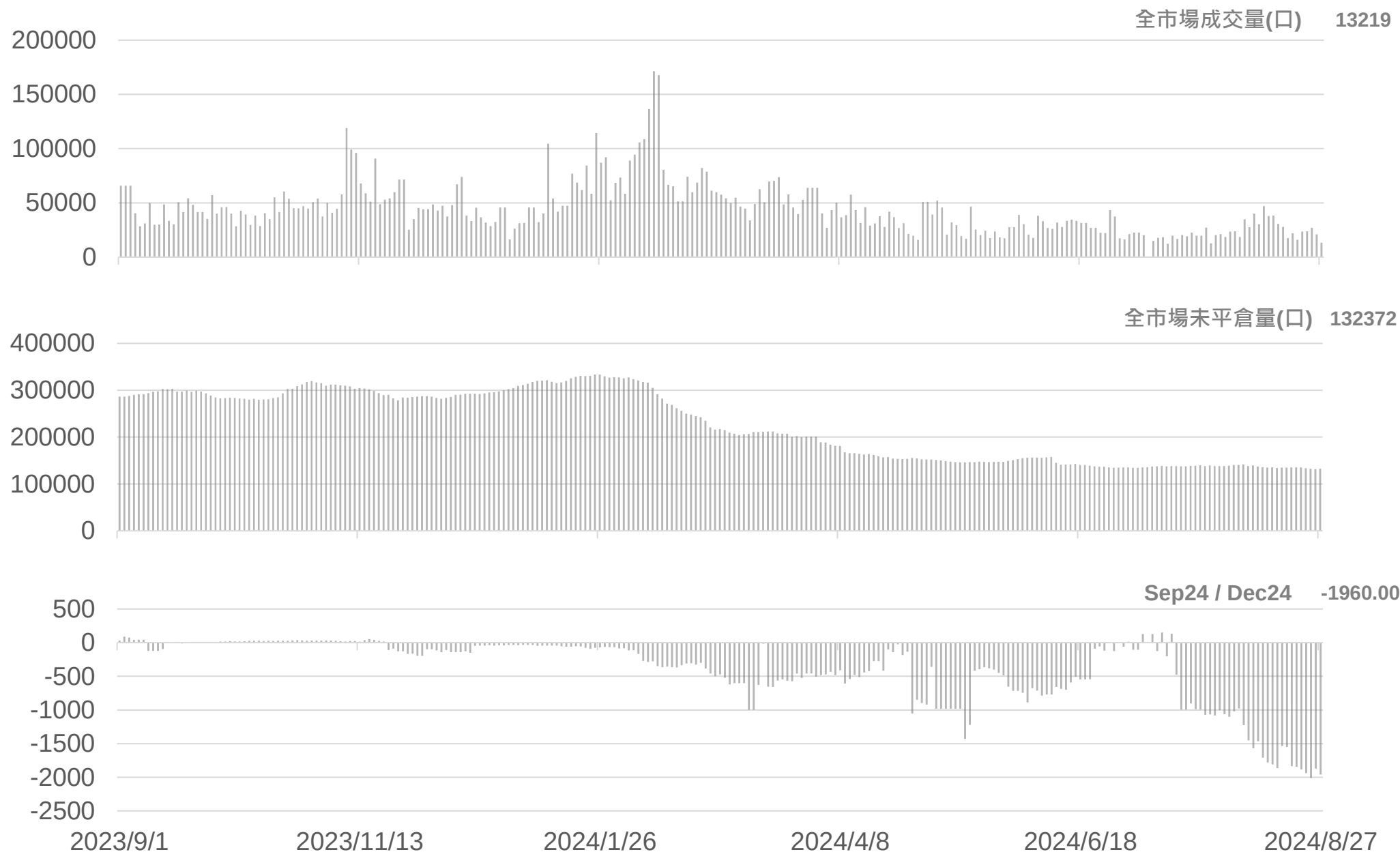
此報價為美元/公噸，以今天為例：可可期貨Sep24價格為9785美元/公噸

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Sep24	9785	-95	▼ 0.96%	999	336	-738	Sep24 / Dec24	-1960.0
Dec24	7825	-185	▼ 2.31%	7278	69947	+683	Dec24 / Mar25	-1327.0
Mar25	6498	-289	▼ 4.26%	2945	34624	+567	Mar25 / May25	-340.0
May25	6158	-303	▼ 4.69%	882	11177	+72	May25 / Jul25	-230.0
Jul25	5928	-317	▼ 5.08%	480	9125	+5	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



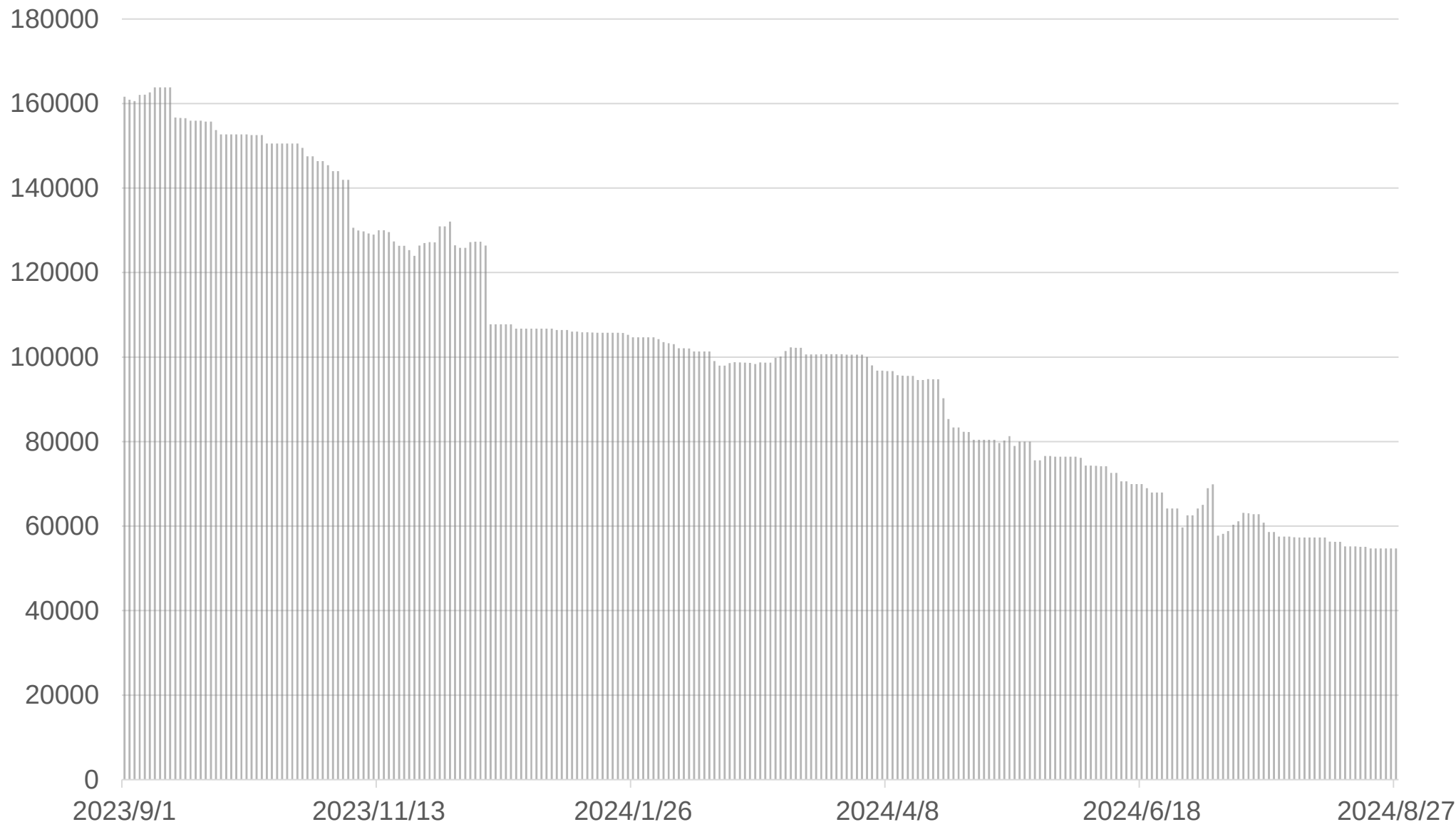
永豐期貨
SinoPac Futures

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27日

可可庫存走勢圖

可可庫存 (單位:公噸) 2024/8/23 54690



棉花期貨表現狀況

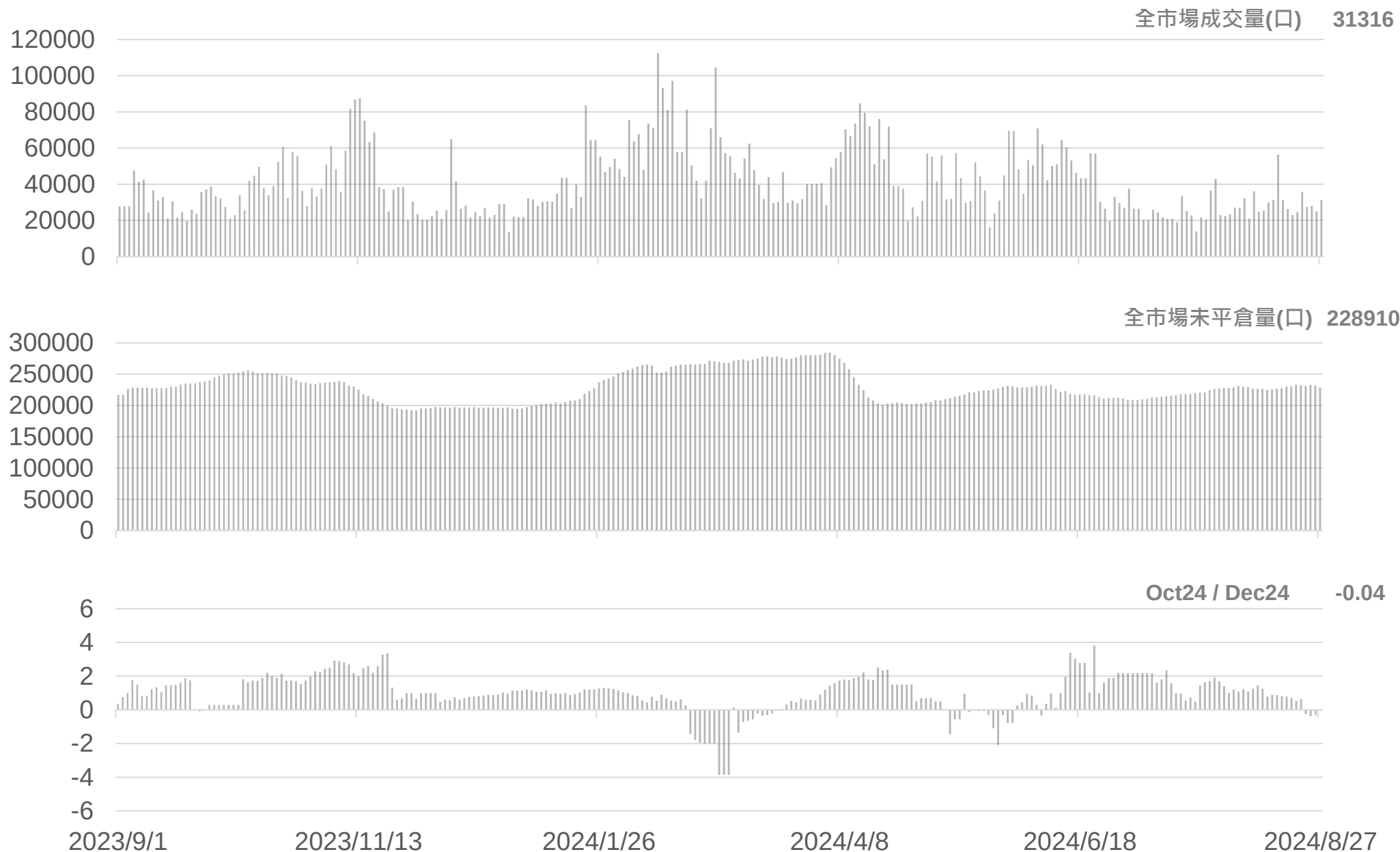
此報價為美分/磅 · 以今天為例：棉花期貨Oct24價格為70.02美分/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Oct24	70.02	-0.56 ▼	0.79%	9	319	0	Oct24 / Dec24	-0.0
Dec24	69.98	-0.28 ▼	0.40%	20605	146371	-2968	Dec24 / Mar25	+1.6
Mar25	71.58	-0.21 ▼	0.29%	5965	40971	-1004	Mar25 / May25	+1.2
May25	72.77	-0.19 ▼	0.26%	2336	17161	+318	May25 / Jul25	+0.6
Jul25	73.39	-0.17 ▼	0.23%	1358	10079	+550	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



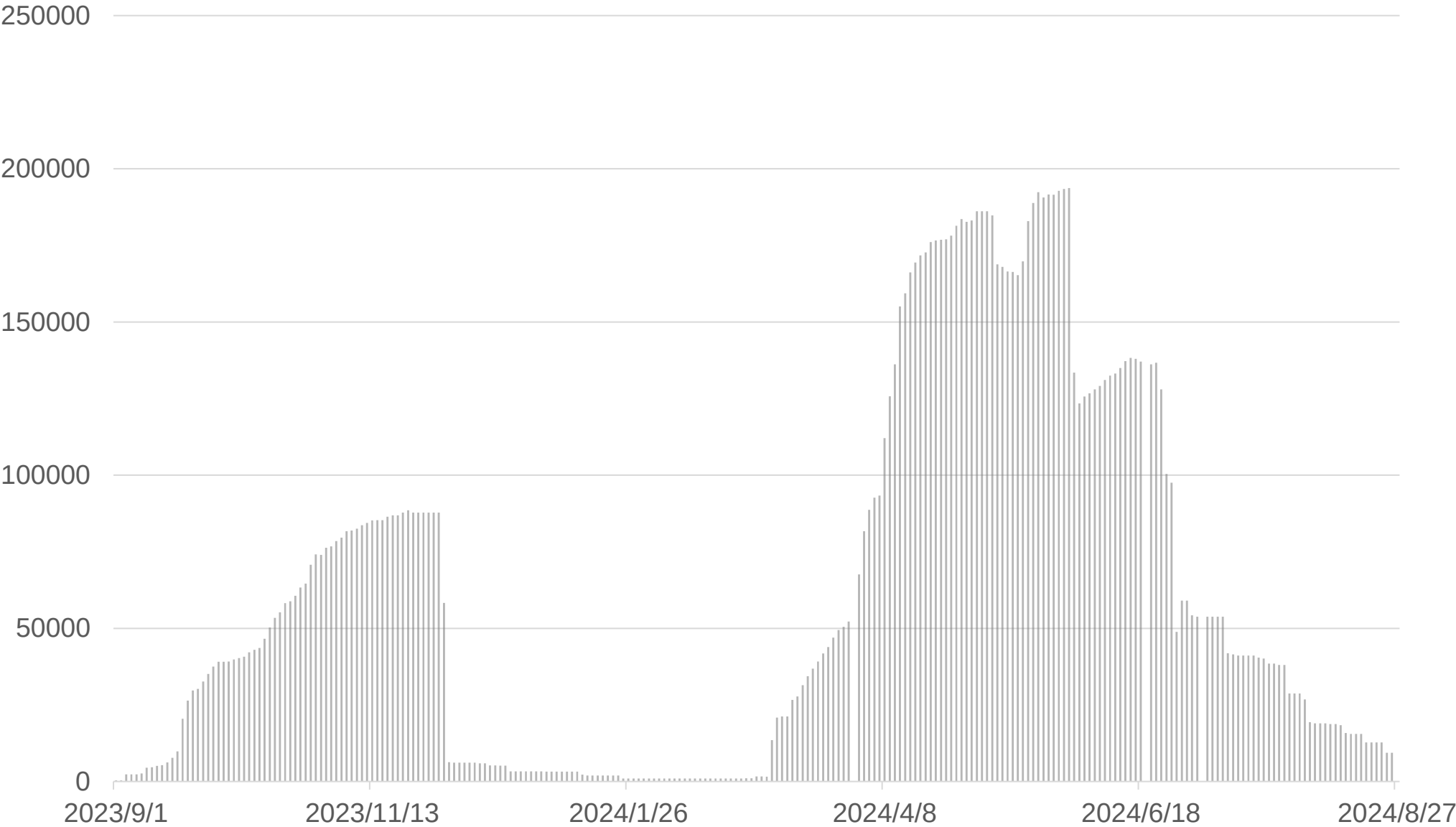
永豐期貨
SinoPac Futures

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27日

棉花庫存走勢圖

棉花庫存 (單位:包)(1包=500磅) 2024/8/26 9413



11號糖期貨表現狀況

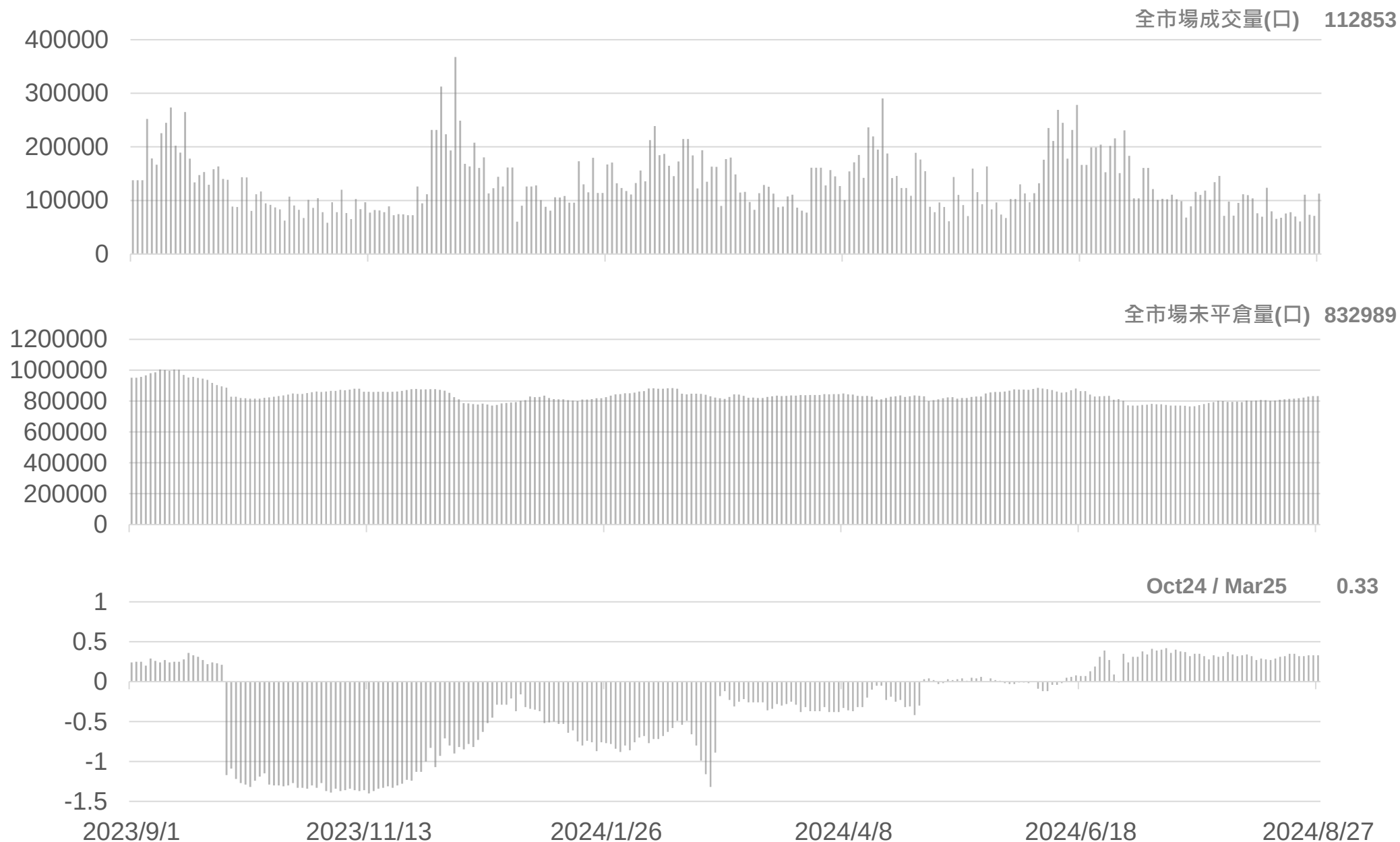
此報價為美分/磅，以今天為例：11號糖期貨Oct24價格為19.6美分/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Oct24	19.60	+0.56▲	2.94%	56095	318927	-3064	Oct24 / Mar25	+0.3
Mar25	19.93	+0.56▲	2.89%	26702	224725	+2071	Mar25 / May25	-0.8
May25	19.12	+0.49▲	2.63%	11694	103128	-298	May25 / Jul25	-0.5
Jul25	18.59	+0.43▲	2.37%	6030	74605	-185	Jul25 / Oct25	-0.2
Oct25	18.43	+0.39▲	2.16%	4849	46256	+764	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