



ICE

軟性商品報告

2024年9月2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)	-1.43%	-1.19%	+7.68%	+10.41%	+29.71%
咖啡(Robusta)	+0.96%	+4.29%	+26.52%	+25.10%	+60.17%
可可	+0.76%	-1.58%	+28.54%	-2.69%	+20.31%
棉花	+0.10%	-2.10%	+3.89%	-5.48%	-25.34%
11號糖	-2.56%	+5.38%	+7.07%	+2.00%	-10.98%

重點新聞

- 咖啡：

12月份阿拉比卡咖啡價格下跌-1.43%，達到每磅244.05美分，而11月份羅布斯塔咖啡價格小漲0.96%，達到每公噸4948美元。
- 可可：

12月份的紐約可可價格小漲0.76%，達到每公噸7671美元。
- 糖：

10月份的11號糖價格大跌-2.56%，達到每磅19.38美分。
- 棉花：

12月份的棉花價格小漲0.10%，達到每磅69.99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248.2美分/磅，或2.482美元/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Sep24	248.20	-3.60 ▼	1.43%	12	393	-157	Sep24 / Dec24	-4.1
Dec24	244.05	-3.55 ▼	1.43%	16685	103943	-45	Dec24 / Mar25	-2.0
Mar25	242.10	-3.10 ▼	1.26%	7987	53534	+553	Mar25 / May25	-2.3
May25	239.85	-2.95 ▼	1.21%	3426	16542	+349	May25 / Jul25	-2.8
Jul25	237.00	-3.00 ▼	1.25%	1427	5716	-123	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5348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	5348	+44▲	0.83%	484	3345	-163	Sep24 / Nov24	-400.0
Nov24	4948	+47▲	0.96%	15770	53639	-349	Nov24 / Jan25	-219.0
Jan25	4729	+37▲	0.79%	6894	18367	+263	Jan25 / Mar25	-199.0
Mar25	4530	+27▲	0.60%	2446	7085	+278	Mar25 / May25	-118.0
May25	4412	+29▲	0.66%	716	1814	+72	跨月價差 = 遠期 - 近期 (咖啡期貨的合約有 1、3、5、7、9、11)	

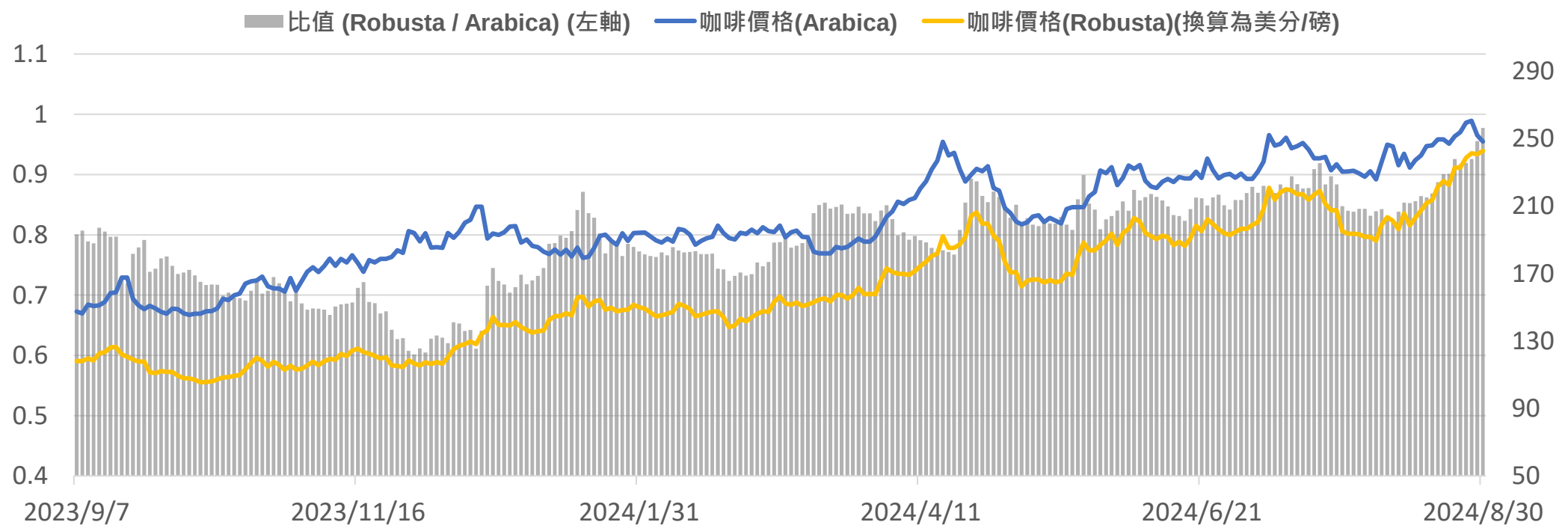
咖啡期貨價格(Robusta) (連續近期合約走勢圖)



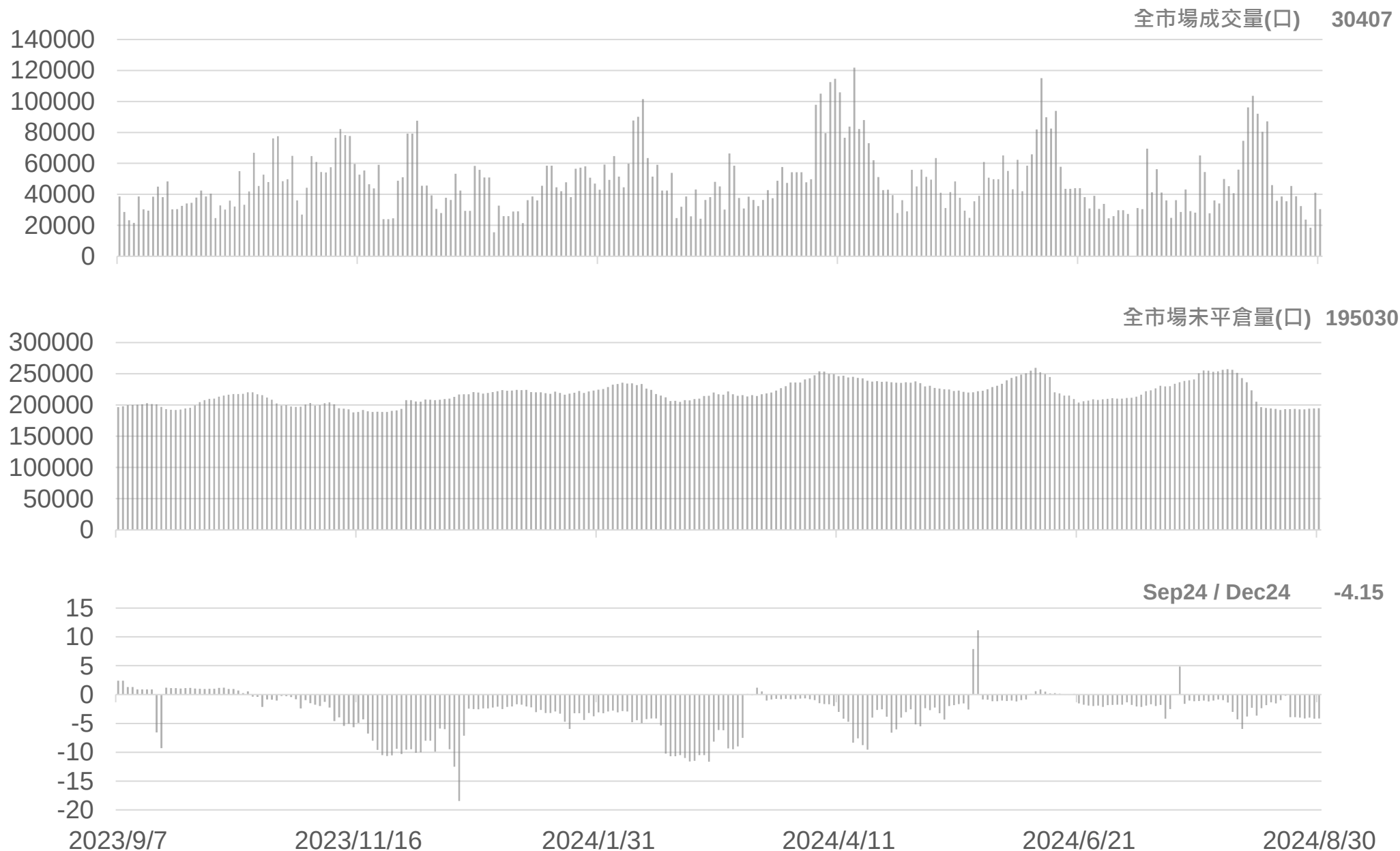
兩品種咖啡價差狀況

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	248.20	5348	242.58	0.977
Sep24	248.2	5348	242.58	0.977
Dec24	244.05	-	-	-
Mar25	242.1	4530	205.48	0.849
May25	239.85	4412	200.13	0.834



咖啡(Arabica)期貨全市場成交量&OI

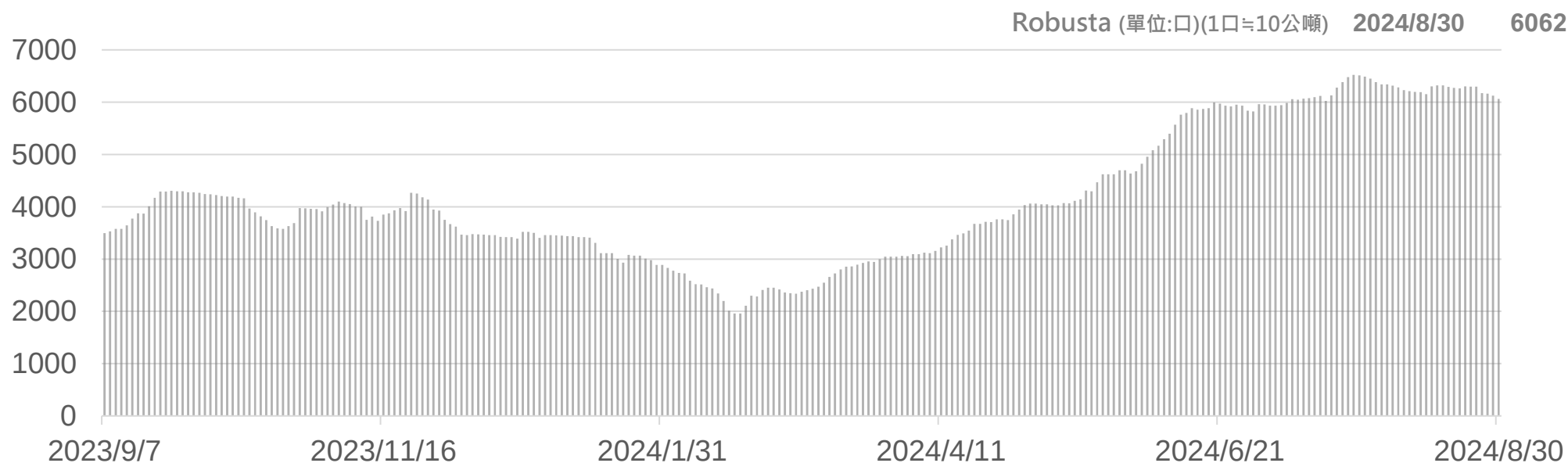
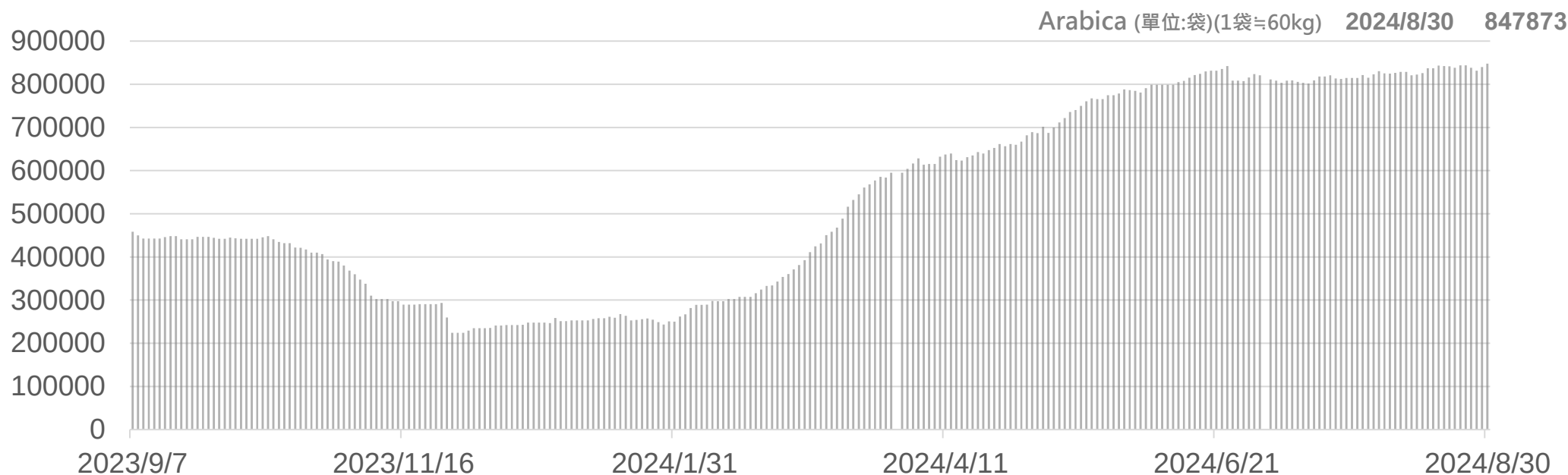


永豐期貨
SinoPac Futures

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30日

咖啡庫存走勢圖



可可期貨表現狀況

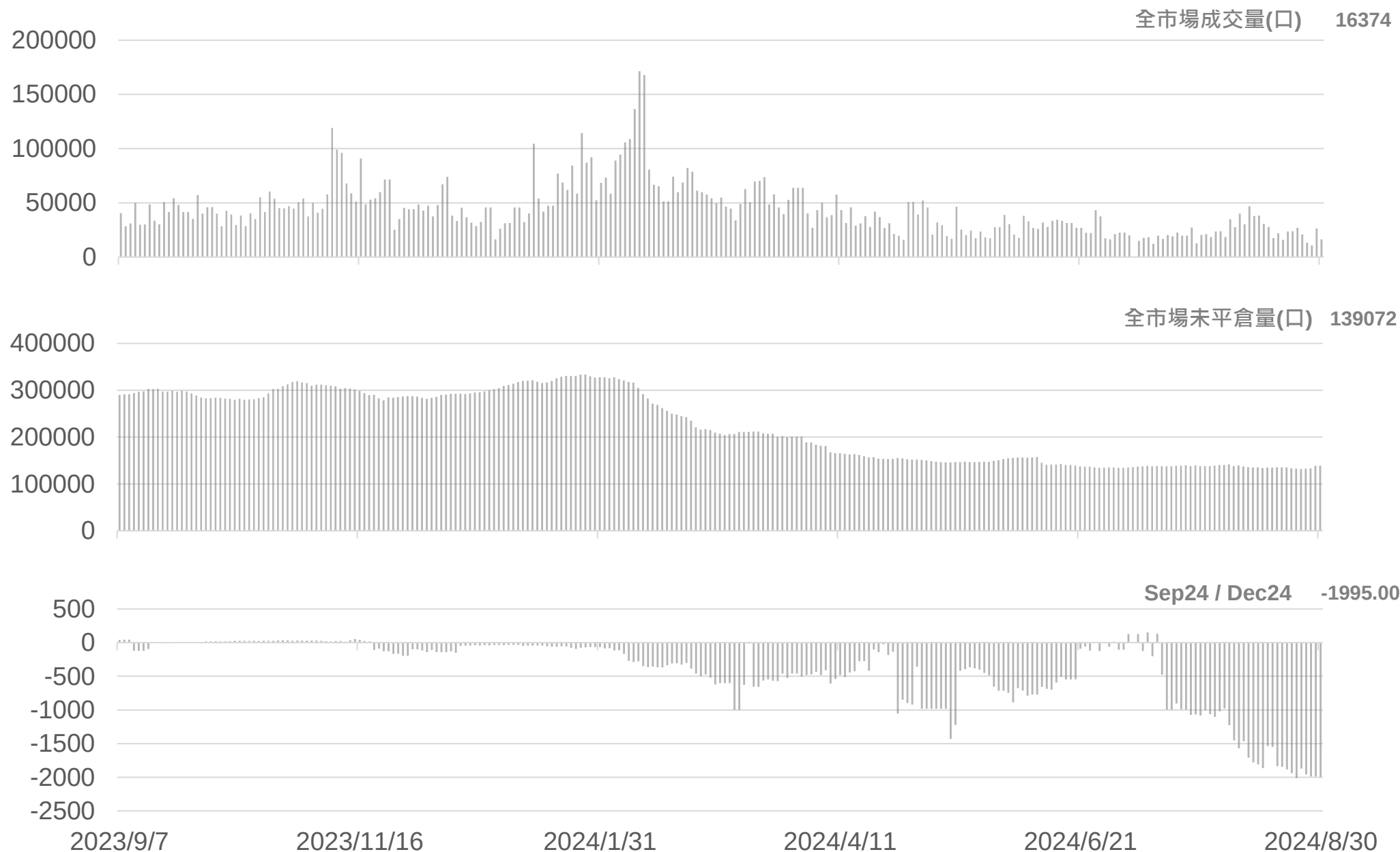
此報價為美元/公噸，以今天為例：可可期貨Sep24價格為9666美元/公噸

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Sep24	9666	+66▲	0.69%	11	115	-53	Sep24 / Dec24	-1995.0
Dec24	7671	+58▲	0.76%	7995	70790	+149	Dec24 / Mar25	-1222.0
Mar25	6449	+8▲	0.12%	5034	35335	-20	Mar25 / May25	-377.0
May25	6072	-11▼	0.18%	1395	16029	+71	May25 / Jul25	-257.0
Jul25	5815	-22▼	0.38%	977	9234	+42	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



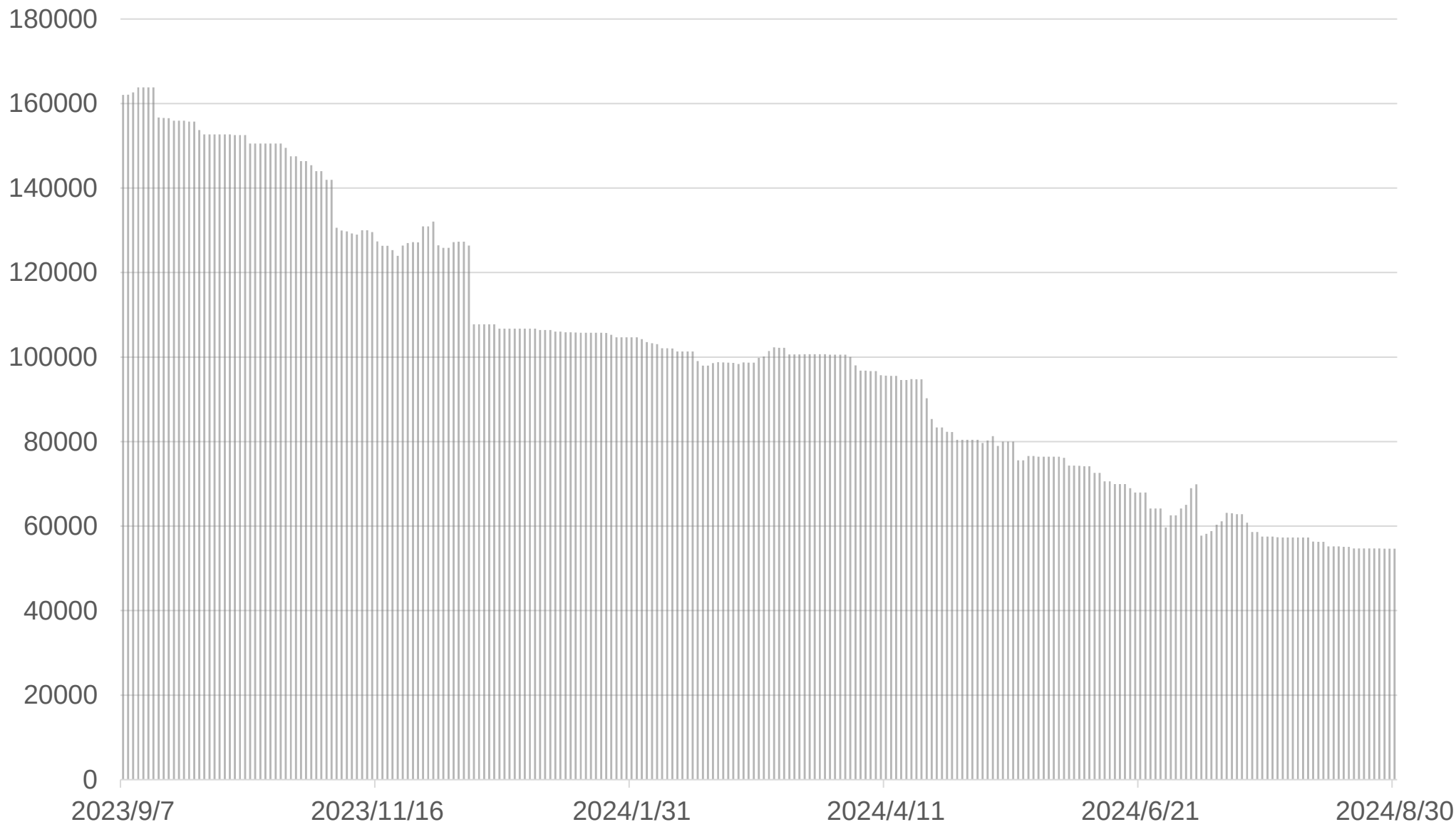
永豐期貨
SinoPac Futures

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30日

可可庫存走勢圖

可可庫存 (單位:公噸) 2024/8/29 54650



棉花期貨表現狀況

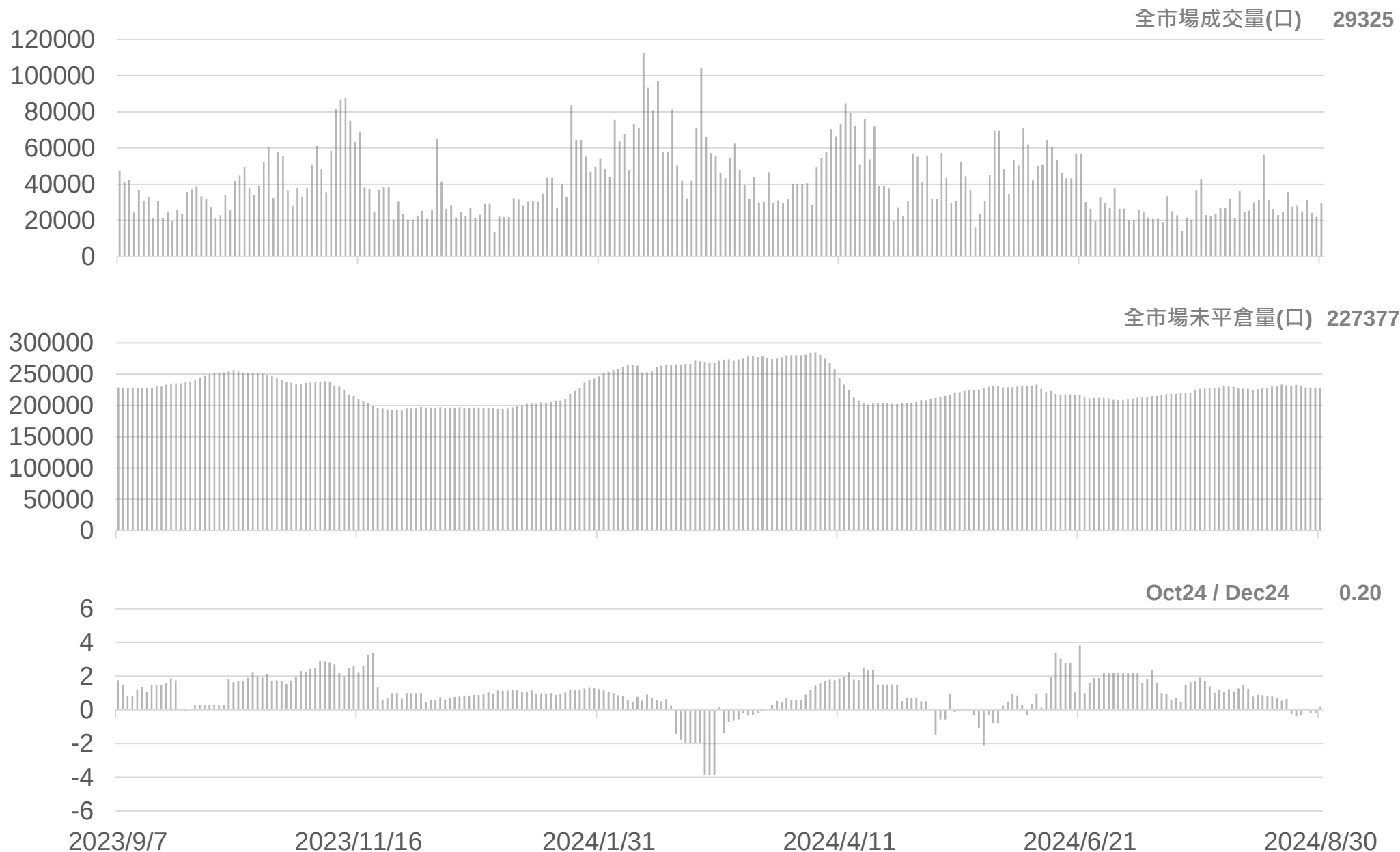
此報價為美分/磅 · 以今天為例：棉花期貨Oct24價格為69.79美分/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Oct24	69.79	-0.34 ▼	0.48%	9	280	-40	Oct24 / Dec24	+0.2
Dec24	69.99	+0.07 ▲	0.10%	18814	142081	-1049	Dec24 / Mar25	+1.7
Mar25	71.65	+0.13 ▲	0.18%	4793	43513	+1115	Mar25 / May25	+1.2
May25	72.87	+0.17 ▲	0.23%	3355	17090	+55	May25 / Jul25	+0.7
Jul25	73.55	+0.18 ▲	0.25%	1424	10421	+188	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)

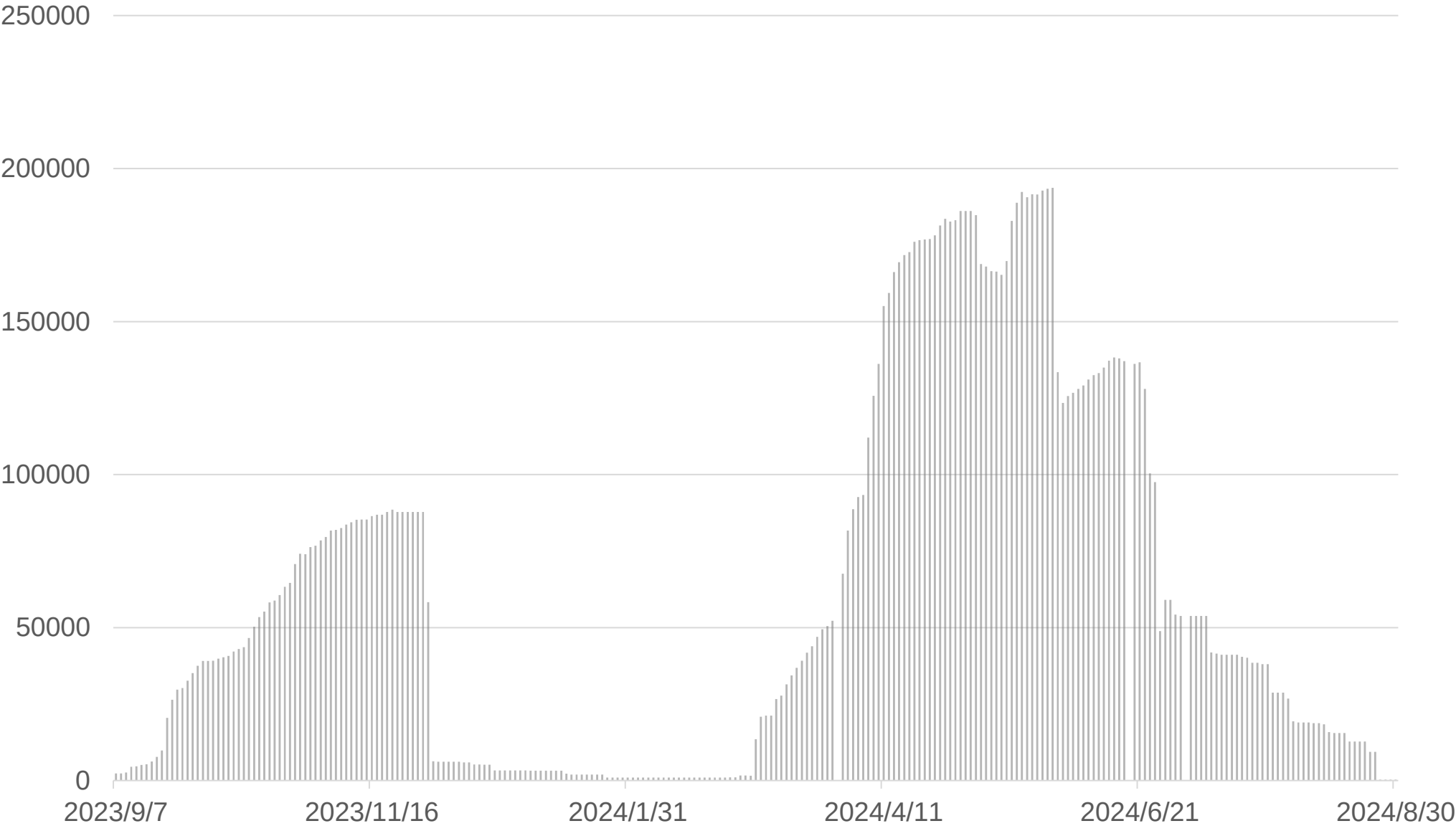


棉花期貨全市場成交量&OI



棉花庫存走勢圖

棉花庫存 (單位:包)(1包=500磅) 2024/8/30 266



11號糖期貨表現狀況

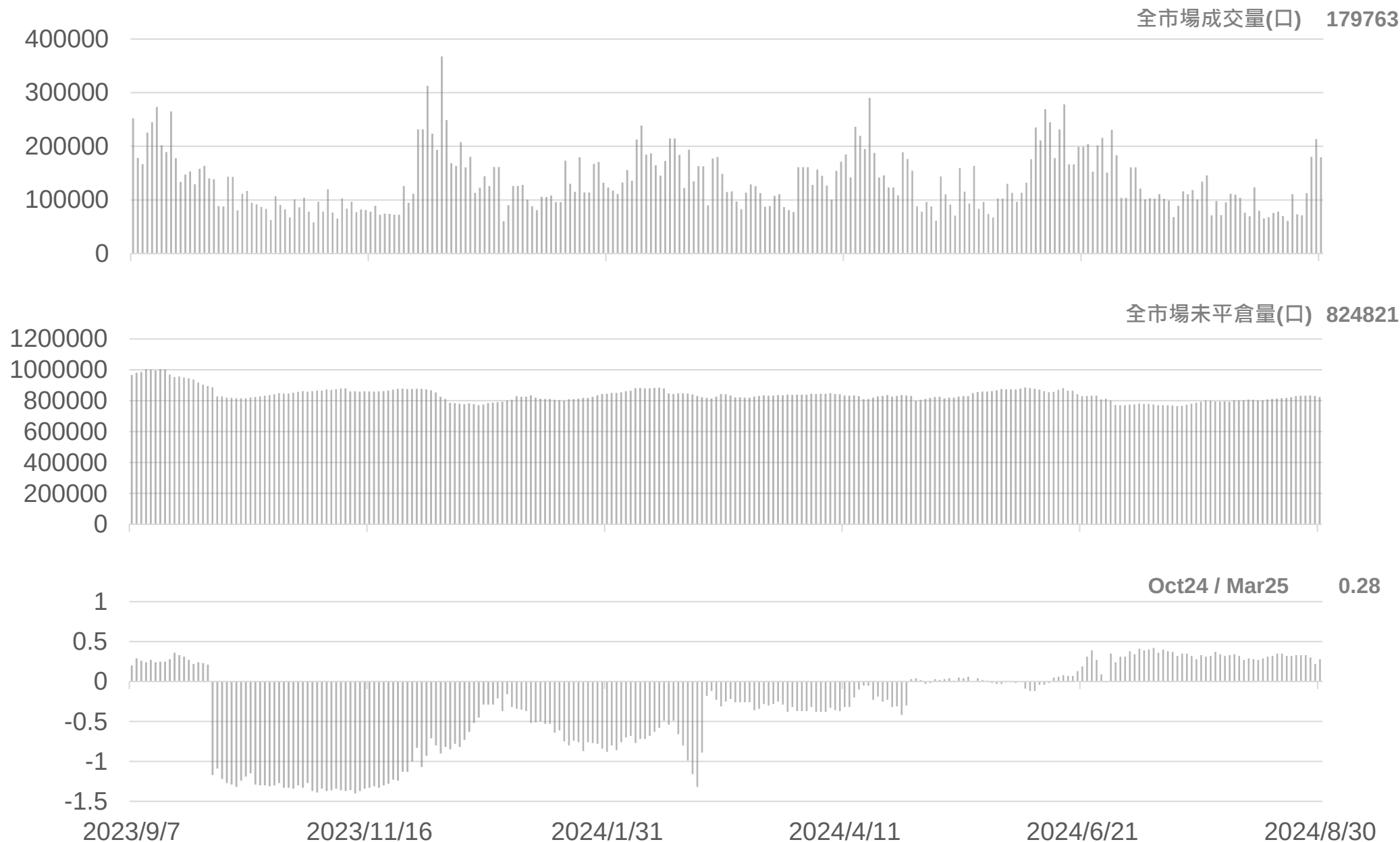
此報價為美分/磅，以今天為例：11號糖期貨Oct24價格為19.38美分/磅

月份	結算	變動	變動%	交易量	OI	OI增減	跨月	價差
Oct24	19.38	-0.51 ▼	2.56%	87729	296462	-11777	Oct24 / Mar25	+0.3
Mar25	19.66	-0.45 ▼	2.24%	50124	232058	-461	Mar25 / May25	-0.8
May25	18.86	-0.39 ▼	2.03%	18100	106091	+3304	May25 / Jul25	-0.5
Jul25	18.36	-0.33 ▼	1.77%	8986	74265	+833	Jul25 / Oct25	-0.2
Oct25	18.19	-0.30 ▼	1.62%	5924	47924	+877	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30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