

CME Group 指數期貨價格限制與市場暫停規則變更公告

致: 各位尊貴的客戶,

自 2020 年 10 月 12 日 (週一) 起, 以下指數期貨價格限制及市場暫停規則變更如下。

時段		新規則	舊規則
電子盤	0600 -- 2130	價格限制: 0400(+1)產生之參考價 $\pm 7\%$ 。 新增動態價格穩定機制: $\pm 3.5\%$ ((60 分鐘觸發動態上下價格限制, 即暫停交易 2 分鐘)	價格限制: 0400(T+1)產生之參考價 $\pm 5\%$
一般時段	2130 – 0325(+1)	無漲停限制, 跌停為 0400 產生之參考價 7%、13%、20%。非 S&P 相關商品主要期貨觸及跌停後開始監控 2 分鐘, 期間交易正常。若 2 分鐘監控期間仍為跌停價, 暫停交易 2 分鐘後開放下一階段。 #S&P 現貨指數跌停熔斷時, <u>下面商品暫停交易 10 分鐘</u>	無漲停限制, 跌停為 0400 產生之參考價 7%、13%、20%。非 S&P 相關商品主要期貨觸及跌停後開始監控 2 分鐘, 期間交易正常。若 2 分鐘監控期間仍為跌停價, 暫停交易 2 分鐘後開放下一階段。 #S&P 現貨指數跌停熔斷時, 指數期貨暫停交易 15 分鐘
	0325 – 0400(+1)	不變	跌停為 20%若期貨主要合約觸及跌停維持交易不再放寬; 若現貨觸及跌停, 則期貨同步暫停交易至收盤。
電子盤	0400 – 0415 (+1) 0430 – 0500 (+1)	價格限制: 0400 產生之參考價 $\pm 7\%$ (跌停為 0400 參考價 -7% 與前一天參考價 -20% 二者取其高)	價格限制: 0400 產生之參考價 $\pm 5\%$ (跌停為 0400 參考價 -5% 與前一天參考價 -20% 二者取其高)

#一般時段 S&P 現貨觸及跌停時, 僅下面商品暫停 10 分鐘, 其他商品維持 15 分鐘不變。

道瓊相關: YM、MYM; 納斯達克相關: NQ、MNQ; 標普 500 相關: SP、ES、MES; 羅素相關: RTY、M2K

注: 1) 所有時間以香港時間表示

2) 以上時間為美國夏令時

資料來源：CME GROUP

此公告僅供客戶參考，具體時間以交易所通知為準。本公司不對其準確性，及時性或完整性作任何陳述，擔保或保證。如有任何查詢，請致電(852) 2293-9688 與我們的交易部聯絡。

感謝您的關注!

元大期貨(香港)有限公司

2020年10月07日