CME Group 指数期货价格限制与市场暂停规则变更公告

致: 各位尊贵的客户,

自 2020 年 10 月 12 日 (周一)起,以下指数期货价格限制及市场暂停规则变更如下。

时段		新规则	旧规则
电子盘	0600 2130	价格限制: 0400(+1)产生之参考价 <u>+</u> 7%。	价格限制: 0400(T+1)产生之参考价±5%
		新增动态价格稳定机制: ±3.5% ((60 分钟触发动态上下价格限	
		制,即暂停交易2分钟)	
	2130 – 0325(+1)	无涨停限制,跌停为 0400 产生之参考价 7%、13%、	无涨停限制,跌停为 0400 产生之参考价 7%、13%、
		20%。非 S&P 相关商品主要期货触及跌停后开始监控 2	20%。非 S&P 相关商品主要期货触及跌停后开始监控 2 分
		分钟,期间交易正常。若2分钟监控期间仍为跌停价,暂	钟,期间交易正常。若2分钟监控期间仍为跌停价,暂停交
一般时段		停交易2分钟后开放下一阶段。	易2分钟后开放下一阶段。
		#S&P 现货指数跌停熔断时, 下面商品暂停交易 10 分钟	#S&P 现货指数跌停熔断时,指数期货暂停交易 15 分钟
	0325 – 0400(+1)	不变	跌停为20%若期货主要合约触及跌停维持交易不再放宽;若
			现货触及跌停,则期货同步暂停交易至收盘。
电子盘	0400 – 0415 (+1)	价格限制: 0400 产生之参考价 <u>+</u> 7% (跌停为 0400 参考价-7%与前	价格限制: 0400 产生之参考价 <u>+</u> 5% (跌停为 0400 参考价-5%与前一天
	0430 – 0500 (+1)	一天参考价-20%二者取其高)	参考价-20%二者取其高)

#一般时段 S&P 现货触及跌停时,仅下面商品暂停 10 分钟,其他商品维持 15 分钟不变。

道琼相关: YM、MYM;纳斯达克相关: NQ、MNQ;标普500相关: SP、ES、MES;罗素相关: RTY、M2K

注: 1) 所有时间以香港时间表示

2) 以上时间为美国夏令时

数据源:<u>CME GROUP</u>

此公告仅供客户参考,具体时间以交易所通知为准。本公司不对其准确性,及时性或完整性作任何陈述,担保或保证。如有任何查询,请致电(852) 2293-9688 与我们的交易部联络。

感谢您的关注! 元大期货(香港)有限公司 2020 年 10 月 07 日