

交易結算部 通知

日期：109年10月6日

主旨：CME及CBOT部分商品漲跌停及冷卻時間異動公告

說明：

2020年10月12日起CME及CBOT下列商品之期貨及選擇權，隔夜交易時段(OTH)

漲跌停，以及一般交易時段冷卻交易時間變更如下：

小S&P指數(ES)、微型S&P指數(MES)、S&P500指數(SP)

小那斯達克(NQ)、微型那斯達克(MNQ)

小道瓊(YM)、微型小道瓊(MYM)

小羅素2000指數(RTY)、微型羅素2000指數(M2K)

1. 隔夜交易時段漲跌停幅度

(OTH：台灣夏令交易時間06:00-21:30及04:00-05:00)

由原來的5%放寬為**7%**，並適用3.5%的動態熔斷機制。

補充說明：動態熔斷機制上下限3.5%係指以60分鐘前之參考價計算上下限3.5%，當到達3.5%市場將暫停2分鐘，之後重新計算參考價。

2. 一般交易時段冷卻時間

(RTH：台灣夏令交易時間21:30-04:00)

現貨指數達到第一級(7%)或第二級(13%)時，所屬期貨及選擇權暫停交易之後放大至下一級，到達20%當天暫停交易。

暫停時間由原來的15分鐘變更為**10分鐘**。