

公告

主旨：CME Group 調整外匯類及利率類商品價格波動限制公告

說明：

2021 年 7 月 12 日(一)起 CME Group 調整部份外匯商品價格波動限制

商品如下：

商品	原規定	新規定
歐元系列 (EC,E7,M6E) 英鎊系列 (BP,M6B) 日幣系列 (JY,MJY) 澳幣系列(AD,M6A) 加幣 (CD) 紐幣 (NE) 瑞朗 (SF)	Circuit Breaker 400,800,1200,1600,無	動態熔斷機制(DCB) 以 4%計算。

註：相關變動公告內容請詳-CME 交易所資訊

(https://www.cmegroup.com/market-regulation/rule-filings/2021/6/21-204_APPB.xlsx)

2021 年 7 月 26 日(一)起 CME Group 調整部份利率商品價格波動限制

商品如下：

商品	原規定	新規定
三月期歐洲美元 (ED) 一個月期擔保隔夜融資利率 期貨 (SR1) 三個月期擔保隔夜融資利率 期貨 (SR3)	Circuit Breaker ETH: 0.5, 1.0, 1.5, 2.0, 無 RTH: 1.5, 2.0, 2.5, 3.0, 無	動態熔斷機制 (DCB) 以 50 個跳動點數計算。
30 天聯邦基金利率 (FF)	Circuit Breaker ETH: 0.5, 1, 1.5, 2 RTH: 1.5, 2, 2.5, 3,無	動態熔斷機制 (DCB) 以 50 個跳動點數計算。

註：相關變動公告內容請詳-CME 交易所資訊

(https://www.cmegroup.com/market-regulation/rule-filings/2021/6/21-204_APPD.xlsx)

凱基期貨交易結算部