

公告

主旨：國外盤新增商品通知

說明：

2023 年 9 月 8 日起國外盤新增商品通知

澳洲交易所(ASX):

澳洲十年期公債期貨：ASX 10 Year Treasury Bond Futures (XT)

澳洲三年期公債期貨：ASX 3 Year Treasury Bond Futures (YT)

期貨 商品名稱	代號	合約 規格	最小 跳動值	交易 月份	交割 方式	台北 交易時間
						電子盤
澳洲十年期 公債期貨	XT	100,000 澳幣	0.005%=約 44 澳幣 交割月當月 8 日 T+1 起 0.001%=約 8.8 澳幣	2 個 季月	現金 結算	期間 1：3 月第 2 個周日起 5:32-13:30 / 14:12-04:00(T+1) 期間 2：4 月第 1 周日起 6:32-14:30 / 15:12-05:00(T+1) 期間 3：10 月第 1 周日起 5:32-13:30 / 14:12-04:00(T+1) (期間 1、3, 凱基委託 06:00 始有效) 期間 4：11 月第 1 個周日起 5:32-13:30 / 14:12-04:30(T+1) (期間 4, 凱基委託 07:00 始有效) LTD~9:00 (期間 2:LTD~10:00)
澳洲三年期 公債期貨	YT	100,000 澳幣	0.01%=約 29 澳幣 交割月當月 8 日 T+1 起 0.002%=約 5.8 澳幣	2 個 季月	現金 結算	期間 1：3 月第 2 個周日起 5:30-13:30 / 14:10-04:00(T+1) 期間 2：4 月第 1 周日起 6:30-14:30 / 15:10-05:00(T+1) 期間 3：10 月第 1 周日起 5:30-13:30 / 14:10-04:00(T+1) (期間 1、3, 凱基委託 06:00 始有效) 期間 4：11 月第 1 個周日起 5:30-13:30 / 14:10-04:30(T+1) (期間 4, 凱基委託 07:00 始有效) LTD~9:00 (期間 2:LTD~10:00)

附註：

1. 澳債損益以公式計算，請參考『[ASX 網頁](#)』說明

$$P = 1000 * [c (1 - v^n) / i + 100 v^n]$$

$i = \text{yield \% pa divided by } 200$

$v = 1/(1+i)$

$n = XT \text{ 為 } 20, YT \text{ 為 } 6$

$c = \text{coupon rate}/2$

2. 現階段交易澳債商品採特殊申請制，詳情請洽業管部

凱基期貨交易結算部