

「證券投資信託事業申報上櫃雙幣 ETF 淨值檔」申報媒體格式

一、申報時限及內容：

(一)上櫃雙幣ETF淨值檔：證券投資信託事業應於每營業日(包含停止轉換日)上午8時50分前，透過本中心衍生性金融商品交易資訊儲存庫系統(以下簡稱TR系統)，申報前一營業日之指數股票型基金及其加掛ETF之每受益權單位淨值(T-1日；小數點第10位)及申報當日之每受益權單位實際配發金額(T日；小數點第4位)、外幣(櫃檯買賣幣別)兌新臺幣匯率(T-1日；小數點第4位)，以及1交易單位指數股票型基金可換得加掛ETF之受益權單位數量(T-1日；四捨五入至小數點第2位)等資料，供計算委託人當日(T日)每筆指數股票型基金及其加掛ETF互相轉換可轉換得之受益權數量。

(二)停止轉換日期檔：證券投資信託事業辦理上櫃雙幣ETF之收益分配作業、分割及反分割作業，應於停止轉換日起算，至少五個營業日前(於確定停止轉換日時，即可進行申報作業)，透過本中心TR系統，申報停止轉換之指數股票型基金及其加掛ETF之證券代號、停止轉換日期及停止轉換理由。每1停止轉換日期為1筆申報資料，可同時申報多筆。

二、檢核淨值：經本中心檢核上櫃雙幣ETF淨值檔之淨值較前一營業日申報之淨值(T-2日)變動於正負3%以內者，以及可換得加掛ETF之受益權數量無誤後，即開放該檔ETF得申請互相轉換；如達正負3%以上者或可換得加掛ETF之受益權單位數量不符，即暫停該檔ETF申請互相轉換，直至證券投資信託事業確定資料無誤或重新申報直至正確為止，方得開放該檔ETF申請互相轉換。

三、開放申請互相轉換後更新申報內容：證券投資信託事業如欲於開放申請互相轉換後更新申報內容，應先行通知本中心(債券ETF：債券部；股票ETF：交易部)。

四、格式內容：

(一)上櫃雙幣ETF淨值檔：

	序號	欄位	格式	內容	說明
日期資訊	1	申報日期	年	9(4)	西元年
			月	9(2)	月
			日	9(2)	日
	2	申報機構代號	X(7)		格式說明(八)
異動資訊	3	<u>指數股票型基金</u> 證券代號	X(6)		
	4	<u>指數股票型基金</u> 每受益權單位淨值(T-1)	9(5)V9(10)		

5	<u>指數股票型基金</u> 每 受益權單位實際配 發金額(T)	9(5)V9(4)		無配發金額者，輸入 0
6	加掛 ETF 證券代號	X(6)		
7	加掛 ETF 每受益權 單位淨值(T-1)	9(5)V9(10)		
8	加掛 ETF 每受益權 單位實際配發金額 (T)	9(5)V9(4)		無配發金額者，輸入 0
9	加掛 ETF 幣別	X(3)		USD 或 CNY
10	加掛 ETF 幣別兌新 臺幣匯率(T-1)	9(3)V9(4)		格式說明(九)
11	1 交易單位 <u>指數股 票型基金</u> 轉換為加 掛 ETF 之轉換比率	9(5)V9(2)		格式說明(十)
12	換行識別碼	X(2)		換行識別用 CRLF(Carriage Return、 Line Feed)

1、格式說明：

(1)txt 格式

(A)9(a)表數字格式，其中a為欄位長度，長度不足時，採右靠左補0。

(B)X(a)表文字格式，其中a為欄位長度，長度不足時，採左靠右補空白。

(2)txt資料內容：固定長度，94位元組，編碼格式為ANSI。

(3)csv格式

(A)9(a)表數字格式，其中a為欄位長度，長度不足時，毋須補 0。

(B)X(a)表文字格式，其中a為欄位長度，長度不足時，毋須補空白。

(C)編碼格式為ANSI。

(4)csv資料內容

(A)各欄位資料以逗號結尾區隔下一欄位。

(B)若該欄位無資料則填一逗號。

(C)每筆資料最後一欄無論有無資料均不加逗號。

(5)檔案結構：傳輸必須為 LINE SEQUENTIAL FILE (必須含 CRLF)。

(6)傳輸時間：營業日 7:20 ~ 08:50。

(7)檔案名稱：資料檔名為FUNDPRIC。

(8)申報機構代號：詳本中心櫃買市場業務宣導網站>電腦資訊>衍

生性商品交易資訊儲存庫>肆、媒體傳檔格式>附表>(表A)金融機構代號一覽表
(https://dsp. tpex. org. tw/web/system/tr. php)

(9)加掛ETF幣別兌新臺幣匯率:用以換算為指數股票型基金淨值之匯率。

(10)1交易單位指數股票型基金轉換為加掛ETF之轉換比率，公式=指數股票型基金受益權(固定為1000) * T-1日指數股票型基金每受益權單位淨值/匯率/T-1日加掛ETF每受益權單位淨值。(四捨五入至小數點第2位)

(11)申報資料以當日最後一次申報成功為主。

(二)停止轉換日期檔：

	<u>序號</u>	<u>欄位</u>	<u>格式</u>	<u>內 容</u>	<u>說明</u>
<u>異動資訊</u>	<u>1</u>	<u>指數股票型基金證券代號</u>	<u>X(6)</u>	—	
	<u>2</u>	<u>加掛ETF證券代號</u>	<u>X(6)</u>		
	<u>3</u>	<u>停止轉換日期</u>	<u>9(8)</u>	<u>西元年月日(yyyymmdd)</u>	<u>填寫日期須大於等於當日</u>
	<u>4</u>	<u>原因說明</u>	<u>X(1)</u>	<u>0：辦理收益分配作業</u> <u>1：辦理分割或反分割作業</u>	
	<u>5</u>	<u>換行識別碼</u>	<u>X(2)</u>		<u>換行識別用</u> <u>CRLF(Carriage</u> <u>Return、Line Feed)</u>

1、格式說明：

(1)csv格式

(A)9(a)表數字格式，其中a為欄位長度，長度不足時，毋須補 0。

(B)X(a)表文字格式，其中a為欄位長度，長度不足時，毋須補空白。

(C)編碼格式為ANSI。

(2)csv資料內容

(A)各欄位資料以逗號結尾區隔下一欄位。

(B)若該欄位無資料則填一逗號。

(C)每筆資料最後一欄無論有無資料均不加逗號。

(3)檔案結構：傳輸必須為 LINE SEQUENTIAL FILE (必須含 CRLF)。

(4)傳輸時間：營業日 7:20 ~ 14:30。