

檔 號：

保存年限：

財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心 函

地址：台北市中正區羅斯福路二段100號
15樓

承辦人：黃鎮傑

電話：02-23666130

電子信箱：jack@tpex.org.tw

受文者：如正副本

發文日期：中華民國114年6月13日

發文字號：證櫃債字第1140400417號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：如主旨

主旨：修正本中心「證券投資信託事業申報上櫃雙幣ETF淨值檔」申報媒體格式及TR系統操作手冊如附件，並自即日起施行，請查照。

說明：

- 一、為辦理本中心指數股票型基金及其加掛ETF互相轉換作業，證券投資信託事業應於每營業日上午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(TR系統)申報旨揭檔案資料，供本中心計算委託人當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，以及辦理停止轉換作業。
- 二、另為使證券投資信託事業順利辦理上櫃雙幣ETF之收益分配作業，以保障投資人參與收益分配權利，本中心「指數股票型基金及主動式交易所交易基金受益憑證買賣辦法」(下稱買賣辦法)第22條第9項規定，指數股票型基金或其加掛ETF於辦理收益分配時，應自停止過戶日前兩個營業日起停止轉換至停止過戶日前一個營業日。
- 三、配合前開停止轉換作業，修正旨揭申報媒體格式內容及調整相關申報規定，內容如下：
 - (一)新增停止轉換日期檔：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，應依本中心買賣辦法第22條第8項及第9項規定停止轉換。證券投資信託事業應於停止轉換日起算，至少五個營業日前，透過本中心TR系統申報停止轉換日期檔。每1停止轉換日期為1筆申報資料，可同時申報多筆。
 - (二)變更證券投資信託事業辦理分割及反分割作業之旨揭檔案申報方式：配合申報停止轉換日期檔作業，刪除原指數股票型基金及其加掛ETF於分割及反分割作業期間，

不得申報旨揭淨值檔之規定，即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分前申報旨揭淨值檔。

(三)配合相關日期停止轉換，修正雙幣ETF淨值檔格式說明(10)之「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(刪除T日每受益權單位實際配發金額項目)。

四、旨揭申報媒體格式可至本中心網站下載，路徑：本中心網站>櫃買市場業務宣導網站>證券商/金融機構/投信專區>衍生性商品交易資訊儲存庫專區>文件下載(網址：<https://dsp.tpex.org.tw/web/tr/download.php>)。

五、各證券投資信託事業如需進行申報作業測試，本中心之聯絡窗口如下：

(一)業務問題(債券部)：黃先生(02)2366-6130。

(二)電腦問題(資訊部)：吳先生(02)2366-6153。

六、本中心113年12月30日證櫃債字第1130400917號函自即日起廢止。

正本：各證券投資信託公司

副本：本中心資訊部