

指數股票型基金雙幣交易機制 電腦規格說明

臺灣證券交易所
105年07月電腦規劃部



交易機制

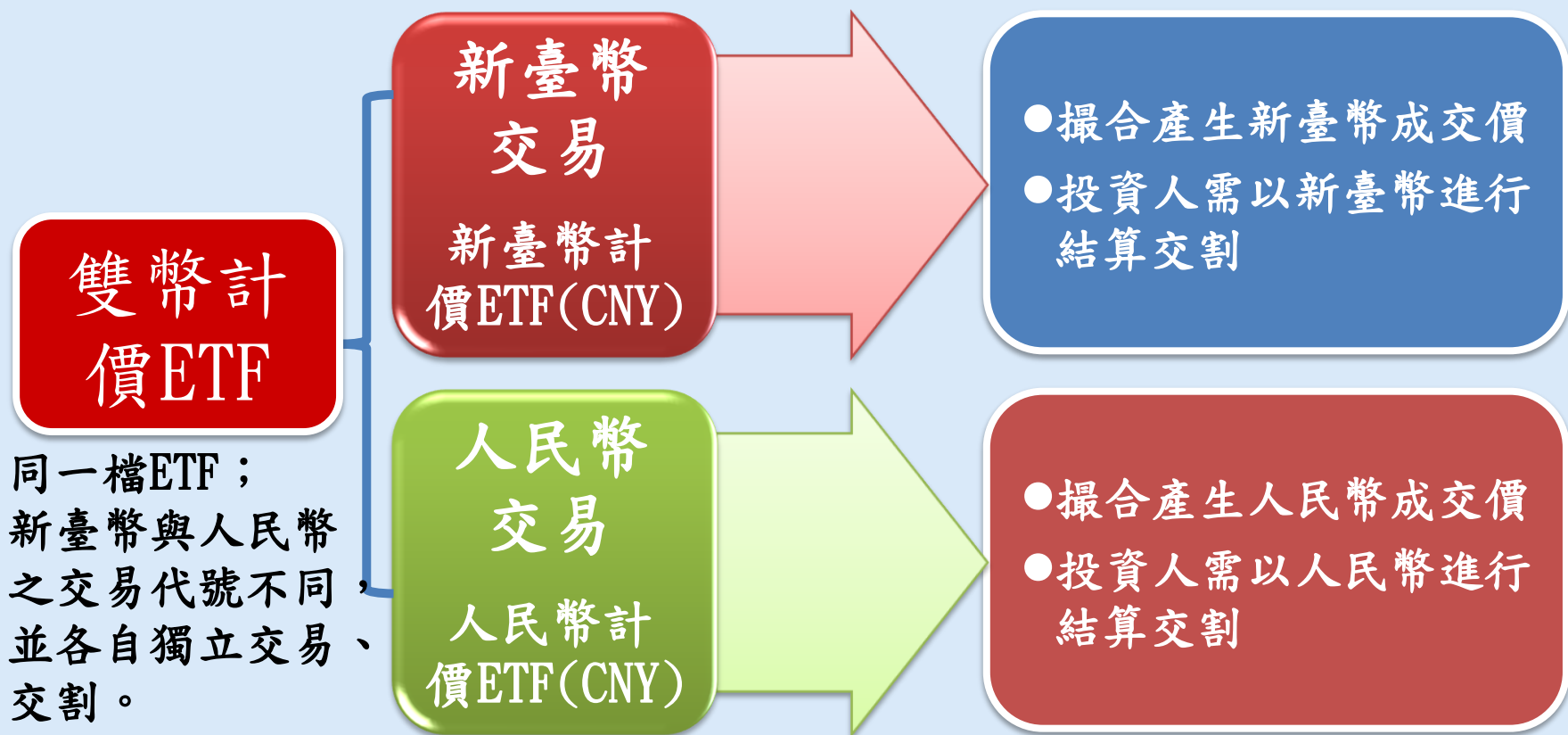
結算交割

電腦作業注意事項

重要時程

交易機制

- 次級市場提供人民幣及新臺幣之交易幣別，各自進行集中撮合，不同幣別之ETF係有**兩個不同的證券代號及獨立委託簿**。



交易機制-1

一般交易

- 普通交易、盤後定價交易，零股、鉅額交易所有現行與證券商間之申報作業格式及交易介面欄位格式均不變動。
- 除信用交易及借券交易外，人民幣計價ETF可進行之交易方式比照現行ETF。

交易機制-2

ETF編碼原則

項目名稱	流水編號			證券代號
ETF	00	NNN		0050、006208
ETF以外幣計價	00	NNN	K	00500K、00628K
槓桿型ETF	00	NNN	L	00631L
槓桿型ETF以外幣計價	00	NNN	M	00631M
反向型ETF	00	NNN	R	00656R
反向型ETF以外幣計價	00	NNN	S	00656S
期信託ETF	00	NNN	U	00635U
期信託ETF以外幣計價	00	NNN	V	00635V

交易機制-3

申購/買回

- 人民幣計價ETF不得辦理申購/買回作業



交易機制-4

交易方式(一)

- 除信用交易及借券交易外，人民幣計價ETF可進行之交易方式比照現行ETF（可進行普通交易、鉅額交易、零股交易、盤後定價交易、拍賣、標購等）。
- 人民幣計價商品之買賣依現行辦理，交易單位為仟股，交易方式比照現行ETF。

交易機制-5

交易方式(二)

- 人民幣計價商品之買賣申報價格(計算至百分位)及交割款處理依現行規定及作業辦理。
- 買賣報價計算至百分位，交割清單編製依現行作業辦理。



交易機制-6

外資額度控管

- 外資持股統計將依不同幣別、不同證券代號分開計算持股並對外揭露。



交易機制-7

資訊面

- 投信公司以即時匯率提供盤中預估淨值。
- 行情單(17時前)含外幣買賣商品成交資料，成交金額採原幣揭露。彙整全市場或全類別之交易資訊，股數、交易筆數等不涉及金額者可彙整加計外幣交易之證券資訊，但金額不加計。
- 行情單(17時後)含外幣買賣商品成交資料，成交金額採新臺幣揭露。

大綱

交易機制



結算交割

電腦作業注意事項

重要時程

結算交割

交割面

- 證交稅以外幣計收轉換新臺幣轉交國稅局。
- 交割銀行-國泰世華（現階段）。
- 手續費及經手費以外幣計收。
- 借券擔保金以新臺幣計收。



大綱

交易機制

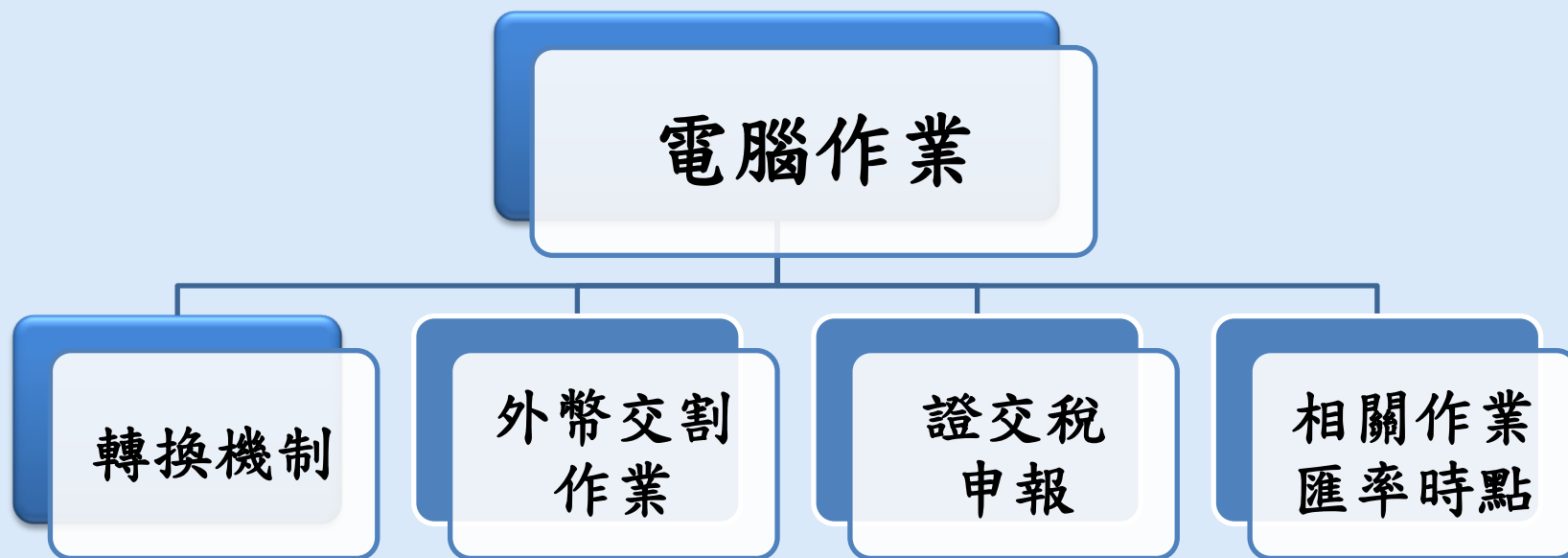
結算交割



電腦作業注意事項

重要時程

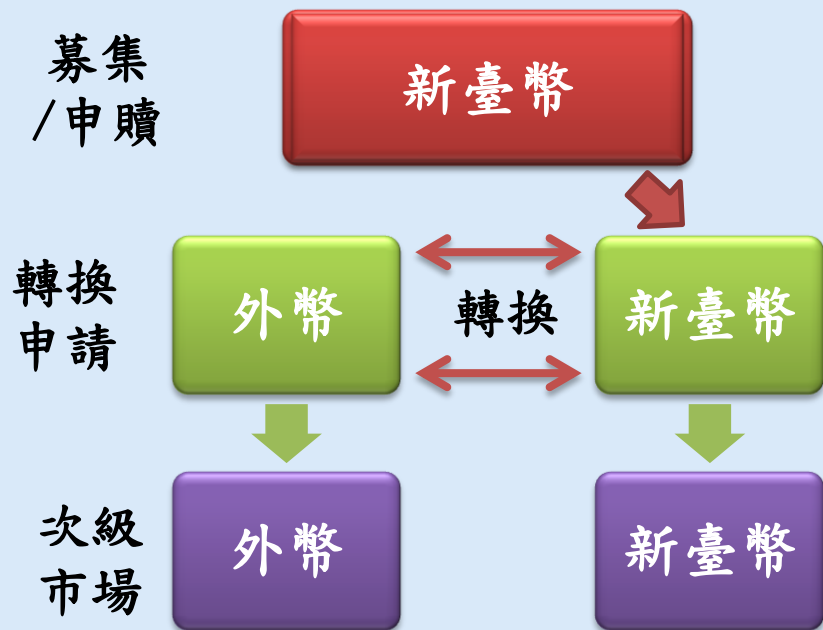
電腦作業注意事項



轉換機制

庫存部位轉換

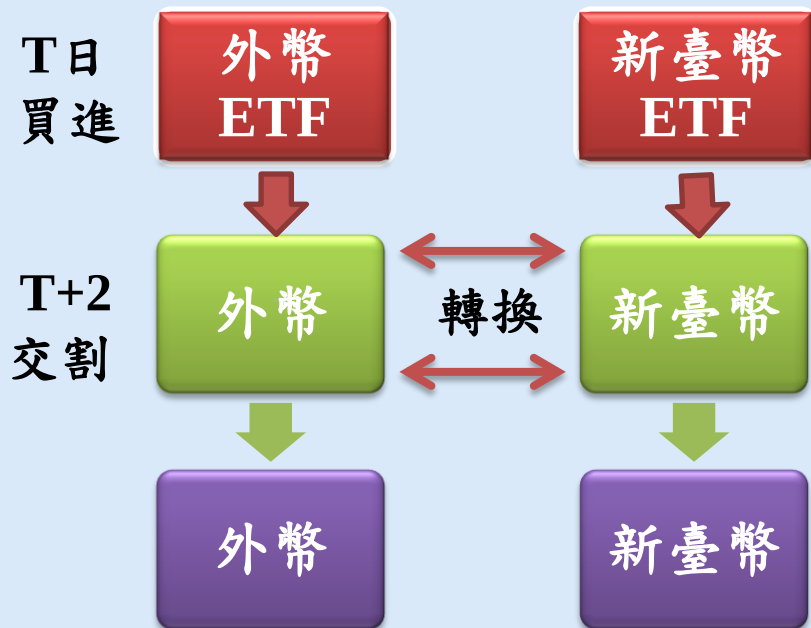
初級市場以新臺幣募集、申贖、配息



融資買進及借入部位不得申請轉換

雙幣交易

指證券在次級市場以外幣及新臺幣交易



轉換時間：上午8時30分到下午5時

轉換機制-1

電腦申報格式(CA7)

階層碼 / 項目名稱	屬性	項目說明
02 CA7-EX-DATE	9(08)	轉換日期(YYYYMMDD)
02 CA7-BRKID	X(04)	證券商代號
02 CA7-IVACNO	9(07)	投資人帳號
02 CA7-STKNO	X(06)	證券代號
02 CA7-EX-SHR	9(12)	轉換股數
02 CA7-AF-EX-CODE	X(03)	轉換後部位代號(幣別)
02 FILLER	X(80)	空白

轉換機制-2

申報注意事項(CA7)

- 同日內申請次數不限。
- 投資人自有庫存部位即可申請轉換。
- 投資人於標的上市當日即可申請轉換。



轉換機制-3

申報注意事項(CA7)

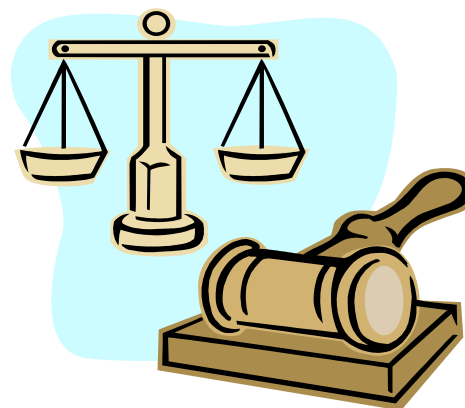
- 轉換股數僅限仟股。
- 外幣計價ETF部位，不得為借券交易標的。
- 投資人借入、融資買進、融券賣出之臺幣部位ETF後，不得轉換為人民幣部位ETF，臺幣計價ETF部位亦不得申請轉換為外幣部位。



轉換機制-4

申報注意事項(CA7)

- 因應人民幣標的不得進行信用交易及提供擔保。
- 特定專戶不得申請轉換(包含88999999、885555-X、995555-X、99999999、錯帳專戶、違約專戶、借券專戶、、等)。



轉換機制-5

外幣證券轉換對照檔(T86)

階層碼/項目名稱	屬性	項目說明
01 T86-DATA-1		
02 T86-DATE	9(08)	首筆日期
02 T86-DATA-CNT	9(05)	資料筆數(含首筆)
02 FILLER	X(37)	空白
01 T86-DATA-2		
02 T86-STKID-0	X(06)	原證券代號
02 T86-STKID-F	X(06)	轉換對應加掛外幣證券代號
02 T86-CURRENCY-0	X(03)	原證券幣別
02 T86-CURRENCY-F	X(03)	轉換對應加掛證券幣別
02 T86-LIST-DATE-F	9(08)	轉換對應加掛上市日期
02 FILLER	X(24)	空白

轉換機制-6

幣別對應表說明

幣別代碼	幣別中文
CNY	人民幣
JPY	日圓
KRW	韓圀
USD	美元
CAD	加拿大幣
GBP	英鎊

幣別代碼	幣別中文
EUR	歐元
SEK	瑞典克朗
AUD	澳幣
HKD	港幣
SGD	新加坡幣

外幣交割作業

款項收付—交割銀行(國泰世華)

同行轉帳 (無手續費)

A證券商國泰
世華外幣交
割帳戶

TWSE國泰世
華外幣帳戶

B證券商國泰
世華外幣交
割帳戶

跨行匯款

C證券商在
其他銀行外幣
交割帳戶

D證券商在
其他銀行外幣
交割帳戶

外幣交割作業-1

經手費明細檔(C17)

階層碼 / 項目名稱	屬性	項目說明	備註
01 MFU-BRKID	X(04)	證商案代號	
01 MFU-DATE	9(08)	日期	
01 MFU-TYPE	9(01)	類別	
01 MFU-FEE	9(12)	經手費	說明一
01 MFU-MTHAMT	9(15)	成交金額	
01 MFU-CURRENCY	X(03)	交易幣別	說明二
01 FILLER	X(07)	空白	

說明一：
外幣經手費以原幣計收(無條件捨去至元)。

說明二：台幣幣別為空白，外幣請參考
(外幣證券轉換對照檔說明)。

外幣交割作業-2

外幣交割淨收付資料(CA6)

階層碼/項目名稱	屬性	項目說明
02 CA6-MTHDATE	9(08)	成交日期(YYYYMMDD)
02 CA6-BRKID	X(04)	證券商代號
02 CA6-TRADE-CURRENCY	X(03)	幣別(外幣)
02 CA6-SETDATE	9(08)	交割日期(YYYYMMDD)
02 CA6-TSEC-NETPAY	9(14)	證交所外幣淨付金額(元)
02 CA6-TSEC-NETRCV	9(14)	證交所外幣淨收金額(元)
02 CA6-OTC-NETPAY	9(14)	櫃買中心外幣淨付金額(元)
02 CA6-OTC-NETRCV	9(14)	櫃買中心外幣淨收金額(元)
02 CA6-TTL-NETPAY	9(14)	合併後外幣淨付金額(元)
02 CA6-TTL-NETRCV	9(14)	合併後外幣淨收金額(元)
02 CA6-LOG-TIME	9(06)	LOG時間

外幣交割作業-3

相關說明(CA6)之一

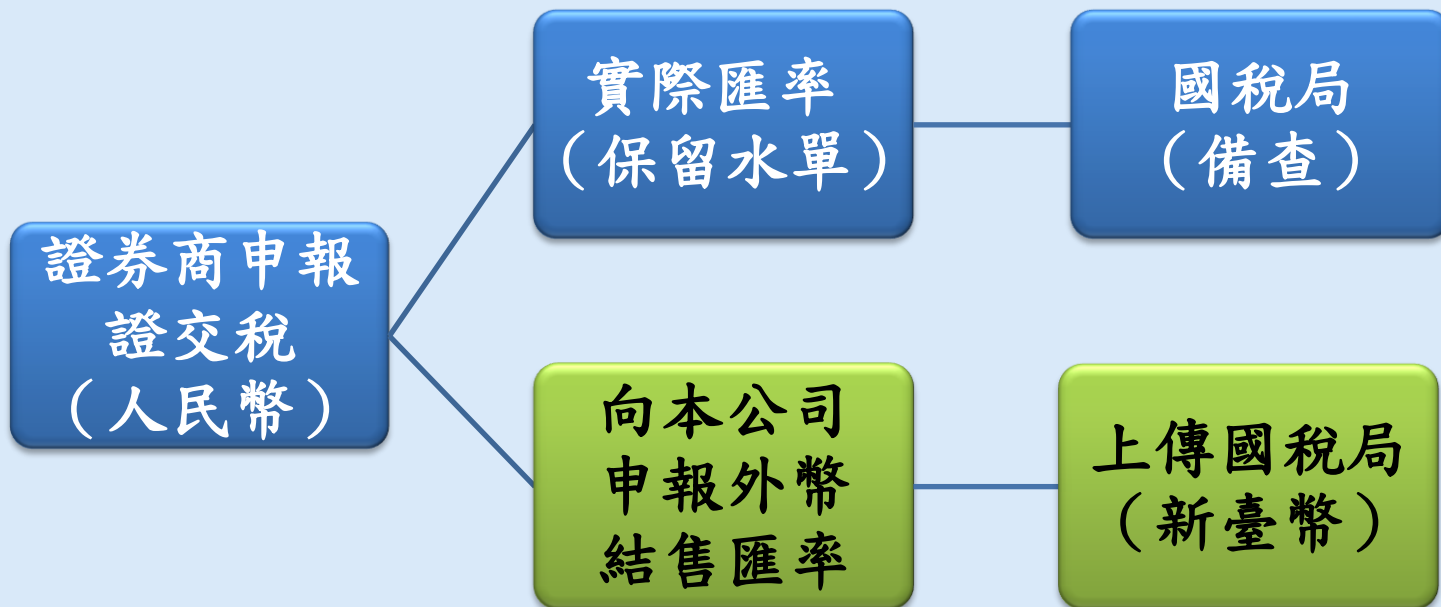
- 人民幣買賣ETF適用外幣買賣商品交易機制，作業時間為每日08:30—20:00。
- 人民幣標的與現行臺幣標的之賣出券項交割將合併辦理交割控管，不同幣別標的之賣出券項均完成交割始能操作賣出交割完成通知(A00)，不需分幣別辦理。
- 證交所分別依證券商完成臺幣及/或人民幣款項繳付後，通知集保結算所分別辦理證券商臺幣及/或人民幣之買進證券撥付(分流)。

外幣交割作業-4

相關說明(CA6)之二

- 當證券商每次與集保公司完成外幣買賣商品對帳(集中市場及櫃買市場)作業後，證交所將即時接收集保公司傳送該證券商當日兩市場之淨收付資料後，即透過主機連線檔案傳輸主動傳送(CA6)。
- 證券商可由CA6-LOG-TIME判斷該筆資料是否為最後之外幣買賣商品合併交割代價淨收付資料。
- 每家證券商(總公司或自營商)只有一筆資料。
- 計算方式請參考C50 。

證交稅申報



證交稅申報-1

證券商外幣結匯匯率檔(CAG)

階層碼/項目名稱	屬性	項目說明
02 CAG-BRKID	X(04)	證券商代號
02 CAG-MTH-DATE	9(08)	成交日期
02 CAG-CURRENCY	X(03)	幣別
02 CAG-RATE	9(04)V9(04)	結匯匯率
02 CAG-MTH-SHARE	9(12)	成交股數
02 CAG-CODE	X(01)	異動別

證交稅申報-2

相關說明(CAG)之一

- 申報時間說明：於T+2、T+3日08:30~18:00，由證券商向證交所申報。
- 由證券商總、分公司各自分別申報T日外幣證券成交之稅額結匯匯率及股數等相關資料。
- 每一證券商、交易日及單一幣別，僅申報一筆，可刪除重報。
- T+2、T+3申報之匯率以成交日公告匯率上下10%區間為有效資料。

證交稅申報-3

相關說明(CAG)之二

- 計算原則：集中市場以外國貨幣為計價單位之有價證券，證券自營商或證券交易代徵人應彙整交割當日該有價證券之外國貨幣應納稅額，按四捨五入計算至小數點後2位，並以交割日或次一營業日實際結售新臺幣金額計算至元，元四捨五入。
- 範例說明：以外國貨幣計價單位之有價證券
賣出成交共3045(股) $\times$ 成交單價15.69(人民幣)=成交金額47,776(人民幣)。
外國貨幣應納證交稅額=47,776(人民幣) $\times$ (1/1000)=47.78(人民幣)。
應納台幣證交稅=47.78(人民幣) $\times$ 結售匯率(4.96台幣) $\div$ 237台幣(元)。

相關作業匯率時點

內容	匯率時點
借券擔保金	借券日依本公司前一日公告匯率換算
違約金額	同一申報日依本公司當日公告匯率換算
錯帳金額	成交日依本公司當日公告匯率換算
證券商受託買賣申報總金額	依本公司前一日公告匯率換算
當日買賣處置證券累計金額	依本公司前一日公告匯率換算
上市參考價	上市前一日以新臺幣ETF每受益權單位淨值乘以投信公司提供之匯率
除息參考價	除息前一日以新臺幣ETF息值乘以投信公司提供之匯率換算成外幣之息值
鉅額	依本公司前一日公告匯率換算
盤中預估淨值	投信公司依即時匯率計算
收盤參考淨值	投信公司依當天收盤匯率換算

相關作業匯率時點-1

電腦檔案格式(CA9)

階層碼/項目名稱	屬性	項目說明
02 CA9-DATE	9(08)	日期(YYYYMMDD)
02 CA9-CURRENCY	X(03)	幣別(外幣)
02 CA9-BEFORE-RATE		前日公告匯率
03 CA9-BEFORE-RATE-BUY	9(04)V9(04)	前日公告買進匯率
03 CA9-BEFORE-RATE-SELL	9(04)V9(04)	前日公告賣出匯率
02 CA9-PM330-RATE		當日下午3:30匯率
03 CA9-PM330-RATE-BUY	9(04)V9(04)	PM 3:30買進匯率
03 CA9-PM330-RATE-SELL	9(04)V9(04)	PM 3:30賣出匯率
02 CA9-CLOSE-RATE		當日收盤匯率
03 CA9-CLOSE-RATE-BUY	9(04)V9(04)	收盤買進匯率
03 CA9-CLOSE-RATE-SELL	9(04)V9(04)	收盤賣出匯率

相關作業匯率時點-2

相關說明(CA9)之一

- 外幣/台幣兌換匯率係由國泰世華銀行每日所提供，證交所主動傳送，證券商可自行要求。此作業時間為每日上午7:30時至18時。
- CA9-BEFORE-RATE(前日公告匯率)：為前一營業日下午3:30匯率。
- 外幣買賣ETF買賣金額納入證券商受託額度控管，以前日公告(賣出)匯率換算後，計入證券商受託買賣額度。

相關作業匯率時點-3

相關說明(CA9)之二

- 外幣買賣ETF鉅額交易之最低買賣申報金額檢核（台幣1,500萬元），以前日公告(賣出)匯率換算計算。
- CA9-PM330-RATE(當日3:30匯率)：每日15:30後可查詢該項匯率，不含(當日收盤匯率)。

相關作業匯率時點-4

相關說明(CA9)之三

- CA9-CLOSE-RATE (當日收盤匯率)：每日16:00後可查詢全部匯率(含當日3:30匯率)。
- 本公司於封關日後(T+1、T+2日)，仍依作業時間提供每日公告匯率。

大綱

交易機制

結算交割

電腦作業注意事項



重要時程

重要時程

07/04 — 07/14

業務宣導

04—台北
06—台北
07—台北
12—台中
14—高雄

07/04

提供
台北
測試
環境

08/07

市場
會測

08/08

正式
上線

補充說明

-  本次說明會講義置於本公司網站，請參考：
首頁 > 關於證交所 > 新聞資訊 > 活動訊息
(http://www.twse.com.tw/ch/about/press_room/tsec_event.php)
-  電腦作業手冊 (<http://www.twse.com.tw>→產品與服務→證券商服務→電腦規劃部/作業部→作業手冊)
-  本項作業提供主機及網路連線申報與查詢作業方式。

補充說明-1

 聯絡電話(電腦規劃部)

 張婷芳專員：(02)8101-5913(1095@twse.com.tw)

 袁相葦專員：(02)8101-5904(1049@twse.com.tw)

 吳家傳專員：(02)8101-5905(0504@twse.com.tw)

畢 完 報 簡 教 指 請 敬

