

グローバル外為行動規範

流動性提供者ディスクロージャーカバーシート

A. 記入上の注意事項：

全ての流動性提供者が、自己の外国為替マーケットメイキング活動に関して、このカバーシートに記入することが望ましい。流動性提供者は、このカバーシートの記入を円滑に行うために、GFXCのウェブサイト ([Disclosure Cover Sheets \(globalfx.org\)](https://www.globalfx.org)) に掲載されている

「FAQ」と「流動性提供者ディスクロージャーカバーシート記入の手引き」を参考にすることができる。別段の記載がない限り、このカバーシートで使用される用語は、グローバル外為行動規範で定義された通りである (https://www.globalfx.org/docs/fx_global.pdf)。

B. 適用対象：

流動性提供者／法人名：株式会社愛知銀行

最終更新日：2022/8/3

流動性提供者は、このカバーシートが適用される法人／事業分野を下記の通り確認した。

本カバーシートは、株式会社愛知銀行が本支店においてお客さまに提供する外国為替取引について適用されます。

C. 主な開示事項：

1. 役割（原則 8）

I. 流動性提供者の役割（いずれかを選択）

- エージェント
- プリンシパル
- 両方

II. 「両方」の場合は流動性提供者がいつそれぞれの役割で取引するのかを簡潔に説明すること。

III. 役割に関する流動性提供者の開示文書は以下に掲載する。

「外国為替取引に関するお取り扱い方針」のうち「1.お客さまとの外国為替取引における当行の役割」に記載しております。

https://www.aichibank.co.jp/corporate/international_support/foreign_country/policy/

2. プリヘッジ（原則 11）

- I. 流動性提供者はプリヘッジを行う（いずれかを選択）。
- はい
 いいえ
- II. 「はい」の場合、流動性提供者は要請があれば、個別のオーダーに「プリヘッジなし」を適用する選択肢を顧客に与えている（いずれかを選択）。
- はい
 いいえ
- III. プリヘッジに関する流動性提供者の開示文書は以下に掲載する。

3. ラストルック（原則 17）

- I. 流動性提供者はラストルック（グローバル外為行動規範で定義）を適用する（いずれかを選択）。
- はい
 いいえ
- II. 流動性提供者のラストルック適用方法（あてはまるもの全てを選択）
- 対称的
 非対称的

非対称的に適用する場合は状況を簡潔に説明する。

ラストルック提示時間内の判定において、市場レートが当行にとって有利に変動していた場合は取引を締結しますが、当行にとって不利に変動していた場合は取引を締結しません。

- III. 流動性提供者のラストルックウィンドウの最長時間と最短時間（ミリ秒（m/s）で記載）

ラストルックウィンドウの最長時間は 20,000m/s、ラストルックウィンドウの最短時間は 0 m/s

流動性提供者は、ラストルックウィンドウの時間が変動するような状況について簡潔に説明することができる。

相場急変時等で、価格変動幅が拡大し、顧客との約定が成立しづらくなった場合には、提示時間を延長する場合があります。

- IV. 流動性提供者はラストルックウィンドウ中に取引を行う。

いいえ

グローバル外為行動規範の原則 17 に記載される特徴をすべて満たす「カバー&ディール」のもとで流動性を確保する場合

V. ラストブックに関する流動性提供者の開示文書は以下に掲載する。

「外国為替取引に関するお取り扱い方針」のうち「4.電子取引の2」に記載しております。

https://www.aichibank.co.jp/corporate/international_support/foreign_country/policy/

VI. 添付の開示文書の本文で言及されている事柄を強調したい場合、流動性提供者は上記のラストブックの重要テーマのいずれについても自由形式の説明文を加えることができる。

D. ディスクロージャーインデックス：

オーダーの取り扱い

オーダーアグリゲーション（合算ベース管理）（原則9）

I. オーダーアグリゲーション（合算ベース管理）に関する流動性提供者の開示文書は以下に掲載する。

裁量（原則9）

I. 裁量の行使に関する流動性提供者の開示文書は以下に掲載する。

タイムスタンプ（原則9）

I. タイムスタンプに関する流動性提供者の開示文書は以下に掲載する。

ストップロスオーダー（原則 10）

- I. ストップロスオーダーに関する流動性提供者の開示文書は以下に掲載する。

部分執行（原則 10）

- I. 部分執行の適用に関する流動性提供者の開示文書は以下に掲載する。

その他の開示

参照価格（Reference Price）の使用（原則 13）

- I. 参照価格（reference price）の使用に関する流動性提供者の開示文書は以下に掲載する。

「外国為替取引に関するお取り扱い方針」のうち「3.取引執行の 8」に記載しております。

https://www.aichibank.co.jp/corporate/international_support/foreign_country/policy/

マークアップ及び公正なプライシングに関する基準（原則 14）

- I. マークアップの適用に関する流動性提供者の開示文書は以下に掲載する。

「外国為替取引に関するお取り扱い方針」のうち「3.取引執行の 4,5,6」に記載しております。

https://www.aichibank.co.jp/corporate/international_support/foreign_country/policy/

アグリゲーションサービス（原則 18）

- I. 流動性提供者はアグリゲーションサービスを提供している。

はい

いいえ

- II. 「はい」の場合は、アグリゲーションサービスに関する流動性提供者の開示文書は以下に掲載する。

III. 流動性ソースの利用に関する流動性提供者の開示文書は以下に掲載する。

外国為替機密取引情報の内部共有（原則 19）

I. 外国為替機密取引情報の内部共有に関する流動性提供者のハイレベルの開示文書は以下に掲載する。

「外国為替取引に関するお取り扱い方針」のうち「5.情報の取扱い 1」に記載しております。

https://www.aichibank.co.jp/corporate/international_support/foreign_country/policy/

マーケットカラー（原則 20）

I. マーケットカラーの適用に関する流動性提供者の開示文書は以下に掲載する。

「外国為替取引に関するお取り扱い方針」のうち「5.情報の取扱い 2」に記載しております。

https://www.aichibank.co.jp/corporate/international_support/foreign_country/policy/