

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/docs/disclosure-cover-sheets)) 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：株式会社池田泉州銀行

最終更新日：2022 年 9 月 30 日

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、株式会社池田泉州銀行の本支店においてお客様に提供される外国為替取引について適用される。

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。

該当なし

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基本方針』のうち「当行の立場」において記載しております。

<https://www.sihd-bk.jp/aboutus/policy/currencyexchange/>

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。

『外国為替取引に関する基本方針』のうち「オーダーの取扱い」において記載しております。

<https://www.sihd-bk.jp/aboutus/policy/currencyexchange/>

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。

対象サービス：Web 外国為替サービス

⇒顧客が取引の締結依頼をしたタイミングで、市場レートが金融機関有利に変動していた場合は取引締結するが、一定以上金融機関不利に変動していた場合は取引を受諾致しません。

- 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・最短時間は定めておりませんが、速やかに行われます。

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。

該当なし

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. ラストル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基本方針』のうち「オーダーの取扱い」において記載しております。

<https://www.sihd-bk.jp/aboutus/policy/currencyexchange/>

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ル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。

該当なし

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。

『外国為替取引に関する基本方針』のうち「オーダーの取扱い」において記載しております。

<https://www.sihd-bk.jp/aboutus/policy/currencyexchange/>

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。

『外国為替取引に関する基本方針』のうち「オーダーの取扱い」において記載しております。

<https://www.sihd-bk.jp/aboutus/policy/currencyexchange/>

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。

該当なし

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。

該当なし

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。

『外国為替取引に関する基本方針』のうち「オーダーの取扱い」において記載しております。

<https://www.sihd-bk.jp/aboutus/policy/currencyexchange/>

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。

該当なし

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基本方針』のうち「適用レート」において記載しております。

<https://www.sihd-bk.jp/aboutus/policy/currencyexchange/>

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。

該当なし

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。

該当なし

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基本方針』のうち「取引情報管理」において記載しております。

<https://www.sihd-bk.jp/aboutus/policy/currencyexchange/>

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。

該当なし