

## 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](https://www.globalfx.org/docs/fx_global.pdf))。

#### B. 適用対象：

流動性提供者／法人名：株式会社伊予銀行

最終更新日： 2022年6月29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、株式会社伊予銀行が本支店（海外支店を含む）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。

###### 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

1. お客さまとの取引における当行の役割 (1)

[https://www.iyobank.co.jp/forex\\_basic\\_policy.html](https://www.iyobank.co.jp/forex_basic_policy.html)

## 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

3.取引執行（8） [https://www.iyobank.co.jp/forex\\_basic\\_policy.html](https://www.iyobank.co.jp/forex_basic_policy.html)

## 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。

顧客が取引の締結依頼をしたタイミングで、市場レートが当行有利に変動していた場合は取引締結するが、一定以上当行不利に変動していた場合は、顧客に最初に提示したレートとの差異をチェックした結果、当該取引が受諾されないことがある。

- 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 200,000m/s、最短時間は 0m/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。

相場提供ベンダー側でチェックした後、いよぎん外為インターネットサービス側で締結依頼の結果待ちの時間が変動する可能性がある。

- IV. 流動性提供者はラストブ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基本方針

3.取引執行 (3) [https://www.iyobank.co.jp/forex\\_basic\\_policy.html](https://www.iyobank.co.jp/forex_basic_policy.html)

- 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。

外国為替取引に関する基本方針

3.取引執行 (5) [https://www.iyobank.co.jp/forex\\_basic\\_policy.html](https://www.iyobank.co.jp/forex_basic_policy.html)

#### 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

3.取引執行 (5) [https://www.iyobank.co.jp/forex\\_basic\\_policy.html](https://www.iyobank.co.jp/forex_basic_policy.html)

#### 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。

外国為替取引に関する基本方針

3.取引執行 (7) [https://www.iyobank.co.jp/forex\\_basic\\_policy.html](https://www.iyobank.co.jp/forex_basic_policy.html)

## 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。

外国為替取引に関する基本方針

3.取引執行（9） [https://www.iyobank.co.jp/forex\\_basic\\_policy.html](https://www.iyobank.co.jp/forex_basic_policy.html)

## 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

3.取引執行（5） [https://www.iyobank.co.jp/forex\\_basic\\_policy.html](https://www.iyobank.co.jp/forex_basic_policy.html)

## 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基本方針

3.取引執行（6） [https://www.iyobank.co.jp/forex\\_basic\\_policy.html](https://www.iyobank.co.jp/forex_basic_policy.html)

### 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

4.お客さまとの取引価格（1）

[https://www.iyobank.co.jp/forex\\_basic\\_policy.html](https://www.iyobank.co.jp/forex_basic_policy.html)

### 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基本方針

5.情報の取扱い（1） [https://www.iyobank.co.jp/forex\\_basic\\_policy.html](https://www.iyobank.co.jp/forex_basic_policy.html)

## 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基本方針

5.情報の取扱い（3） [https://www.iyobank.co.jp/forex\\_basic\\_policy.html](https://www.iyobank.co.jp/forex_basic_policy.html)