

《全球外汇市场准则》 流动性提供商信息披露要点

第一部分：填写说明

所有填写该信息披露要点的流动性提供商应针对其外汇批发市场的做市活动填写。流动性提供商可参考 GFXC 网站的常见问题解答和“流动性提供商信息披露要点填写说明”来辅助填写该模板（[Disclosure Cover Sheets \(globalfx.org\)](http://globalfx.org)）。除非另有说明，该要点模板中术语的定义参照《全球外汇市场准则》（“全球准则”）。

第二部分：范围

流动性提供商/机构名称： 中国银行股份有限公司

填写时间： 2021 年 12 月 31 日

流动性提供商在此确认该要点适用的机构/业务领域/服务范围：

本信息披露适用于中国银行股份有限公司作为流动性提供商，在境内、外外汇批发市场履行的做市活动，即在外汇批发市场持续提供买、卖双向的外汇报价，并在规定范围内承诺按所报价格成交的行为。但相关主管机构、交易场所对做市活动及其披露另有特殊规定、协议约定、或遵循其它惯例的除外。

第三部分：主要披露信息

（一）交易角色（原则 8）

1. 流动性提供商的交易角色是（单选）：

代理（Agent）

以对手方身份与客户交易（Principal）

两者均是

2. 若选择“两者均是”，请简要描述流动性提供商在何种情况下采用各交易角色：

N/A

3. 流动性提供商关于交易角色的详细信息披露文件请见：

请见《中国银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》“交易角色”章节：

<https://pic.bankofchina.com/bocappd/appform 1/202112/P020211231259614913427. pdf>

（二）预先对冲（原则 11）

1. 流动性提供商是否开展预先对冲（单选）：

是

否

2. 若选择“是”，流动性提供商是否可应要求供客户选择单笔订单不开展预先对冲（单选）：

是

否

3. 流动性提供商关于预先对冲的详细信息披露文件请见：

请见《中国银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》“预先对冲”章节：

https://pic.bankofchina.com/bocappd/appform_1/202112/P020211231259614913427.pdf

(三) Last Look (原则 17)

1. 流动性提供商是否使用 Last Look (定义参见全球准则) (单选)：

是

否

2. 流动性提供商使用 Last Look 是 (可多选)：

对称的

非对称的

若采用非对称 Last Look, 请简要描述相关情景：

N/A

3. 流动性提供商的 Last Look 窗口时长上限和下限是 (单位：毫秒)：

中国外汇交易中心电子交易平台上，我们将遵循外汇交易中心的有关规则，设定 Last Look 的有关方式和窗口时长上、下限 (0-2500ms)。在通常情况下，您在包括中国外汇交易中心平台在内的各类电子交易平台上点击成交后，会及时得到交易是否已成交的确认。

流动性提供商可简要描述 Last Look 窗口时间可能变化的情景：

当有组织交易平台（如中国外汇交易中心）提供的基础设施功能发生变化、市场流动性出现极端情况等情景下，Last Look 窗口时间可能发生变化。

4. 流动性提供商是否在 Last Look 窗口期间内开展交易：

否

在满足全球准则原则 17 所有特征的“Cover and Deal”安排下获取流动性时，会在 Last Look 窗口期间内开展交易。

5. 流动性提供商关于 Last Look 的详细信息披露文件请见：

请见《中国银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》“交易再确认”章节：

https://pic.bankofchina.com/bocappd/appform_1/202112/P020211231259614913427.pdf

6. 针对上述 Last Look 关键问题，若流动性提供商希望强调其所附信息披露文件中的任何内容，可在此处以自由格式文本进一步说明。

N/A

第四部分：信息披露文件索引

（一）订单处理

1. 订单加总（原则 9）

流动性提供商关于订单加总的详细信息披露文件请见：

请见《中国银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》“订单处理”章节“订单加总”部分：

<https://pic.bankofchina.com/bocappd/appform 1/202112/P020211231259614913427.pdf>

2. 酌情决定权（原则 9）

流动性提供商关于酌情决定权使用的详细信息披露文件请见：

请见《中国银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》“订单处理”章节“酌情决定权”部分：

<https://pic.bankofchina.com/bocappd/appform 1/202112/P020211231259614913427.pdf>

3. 时间戳（原则 9）

流动性提供商关于时间戳的详细信息披露文件请见：

请见《中国银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》“订单处理”章节“时间戳”部分：

<https://pic.bankofchina.com/bocappd/appform 1/202112/P020211231259614913427.pdf>

4. 止损订单（原则 10）

流动性提供商关于止损订单的详细信息披露文件请见：

请见《中国银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》“订单处理”章节“止损订单”部分：

https://pic.bankofchina.com/bocappd/appform_1/202112/P020211231259614913427.pdf

5. 部分执行订单（原则 10）

流动性提供商关于部分执行订单的详细信息披露文件请见：

请见《中国银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》“订单处理”章节“部分执行订单”部分：

https://pic.bankofchina.com/bocappd/appform_1/202112/P020211231259614913427.pdf

（二）其他信息披露文件

1. 参考价格的使用（原则 13）

流动性提供商关于参考价格使用的详细信息披露文件请见：

请见《中国银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》“参考价格”章节：

https://pic.bankofchina.com/bocappd/appform_1/202112/P020211231259614913427.pdf

2. 加价/公平定价标准（原则 14）

流动性提供商关于加价的详细信息披露文件请见：

请见《中国银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》“加价/公平定价标准”章节：

https://pic.bankofchina.com/bocappd/appform_1/202112/P020211231259614913427.pdf

3. 聚合服务（原则 18）

（1）流动性提供商是否使用聚合服务：

是

否

（2）若选择“是”，流动性提供商描述其聚合服务的详细信息披露文件请见：

N/A

（3）流动性提供商关于流动性来源使用的详细信息披露文件请见：

N/A

4. 在内部共享外汇交易相关保密信息（原则 19）

流动性提供商关于如何在内部共享外汇交易相关保密信息的概括性披露文件请见：

请见《中国银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》“客户信息保护”章节：

https://pic.bankofchina.com/bocappd/appform_1/202112/P020211231259614913427.pdf

5. 市场行情（原则 20）

流动性提供商关于使用市场行情的详细信息披露文件
请见：

请见《中国银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》“客户信息保护”章节：

<https://pic.bankofchina.com/bocappd/appform 1/202112/P020211231259614913427.pdf>