

《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 \(globalfx.org\)](https://www.globalfx.com/disclosure-cover-sheets))。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： 上海浦东发展银行股份有限公司

填写时间： 2022 年 4 月 27 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：

浦发银行股份有限公司作为流动性提供商，在境内外汇批发市场开展的外汇做市交易。

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：

无

3.流动性提供商关于交易角色的详细信息披露文件请见：

《上海浦东发展银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》“一、外汇交易服务”

(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：

无

(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：

无

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

0—2500 毫秒（以中国外汇交易中心参数设置为准）。

流动性提供商可简要描述 Last Look 窗口时间可能变化的情景：

根据市场流动性情况、风险管理需要酌情进行调整。

4.流动性提供商是否在 Last Look 窗口期间内利用客户交易请求中的信息开展交易：

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：

《上海浦东发展银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》“五、交易再确认机制”

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。

无

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：

《上海浦东发展银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》 “四、
订单管理”

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：

《上海浦东发展银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》 “四、
订单管理”

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：

《上海浦东发展银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》 “四、
订单管理”

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：

《上海浦东发展银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》 “四、
订单管理”

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：

《上海浦东发展银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》 “四、
订单管理”

（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：

《上海浦东发展银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》 “三、
报价规则”

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：

《上海浦东发展银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》 “三、
报价规则”

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：

无

(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：

无

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：

《上海浦东发展银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》 “二、
保护客户/交易对手方信息”

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：

《上海浦东发展银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》 “六、
市场行情使用”