

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：株式会社新生銀行

最終更新日：2022年7月15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。

新生銀行の日本国内本支店

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取組方針」

2. お客さまとの外国為替取引における当行の役割

<https://www.shinseibank.com/corporate/fx/>

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取組方針」

4. オーダーの取扱い 第4項

<https://www.shinseibank.com/corporate/fx/>

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。

該当なし

- 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）

該当なし

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。

該当なし

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取組方針」

4. オーダーの取扱い 第 6 項

<https://www.shinseibank.com/corporate/fx/>

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取組方針」

4. オーダーの取扱い 第 2 項

<https://www.shinseibank.com/corporate/fx/>

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。

「外国為替取引に関する取組方針」

4. オーダーの取扱い 第5項

<https://www.shinseibank.com/corporate/fx/>

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取組方針」

4. オーダーの取扱い 第1項

<https://www.shinseibank.com/corporate/fx/>

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取組方針」

5. 約定価格

<https://www.shinseibank.com/corporate/fx/>

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取組方針」

5. 約定価格

<https://www.shinseibank.com/corporate/fx/>

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取組方針」

6. お客様の情報の取扱い

<https://www.shinseibank.com/corporate/fx/>

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取組方針」

7. マーケットカラー

<https://www.shinseibank.com/corporate/fx/>

FX Global Code

Liquidity Provider Disclosure Cover Sheet

A. INSTRUCTIONS:

All Liquidity Providers should complete this Cover Sheet in relation to their wholesale foreign exchange market making activities. Liquidity Providers can make use of the FAQs and the “Liquidity Provider Disclosure Cover Sheet Instructions” available on the GFXC website to facilitate the completion of this Cover Sheet ([Disclosure Cover Sheets \(globalfx.org\)](https://www.globalfx.org/docs/disclosure-cover-sheets)). All terms used in this Cover Sheet are as defined in the FX Global Code unless otherwise stated (https://www.globalfx.org/docs/fx_global.pdf).

B. SCOPE:

Liquidity Provider / Entity Name: Shinsei Bank, Limited
Most Recent Date Completed: July 15, 2022

Liquidity Provider to confirm the entity / business area(s) to which this Cover Sheet applies:

The Head Office and domestic branches of Shinsei Bank

C. KEY DISCLOSURES:

1. Capacity (Principle 8)

I. Liquidity Provider acts as (check one):

- Agent
- Principal
- Both

II. If ‘Both’, briefly describe when Liquidity Provider acts in each capacity:

N.A.

III. Liquidity Provider’s disclosure regarding capacity is located here:

Foreign Exchange Transaction Policy

2. The Bank’s roles in foreign exchange transactions with its customers

<https://www.shinseibank.com/corporate/en/fx/>

2. Pre-Hedging (Principle 11)

I. Liquidity Provider ever pre-hedges (check one):

- Yes
- No

II. If yes, Liquidity Provider ever offers clients, upon request, the option of placing an individual order specifying no pre-hedging (check one):

Yes

No

III. Liquidity Provider's disclosure regarding pre-hedging is located here:

Foreign Exchange Transaction Policy

Paragraph 4 of 4. Order handling

<https://www.shinseibank.com/corporate/en/fx/>

3. Last Look (Principle 17)

I. Liquidity Provider ever employs Last Look (as defined in the FX Global Code) (check one):

Yes

No

II. Liquidity Provider's use of Last Look is (check all that apply):

Symmetrical

Asymmetrical

If Asymmetrical is used, briefly describe the circumstances:

N.A.

III. Liquidity Provider's Last Look window maximum and minimum length (in m/s)

N.A.

Liquidity Provider may briefly describe the circumstances under which Last Look window times may change

N.A.

IV. Liquidity Provider ever trades during the Last Look window:

No

When sourcing liquidity under a "Cover and Deal" arrangement that meets all of the characteristics set out in Principle 17 of the Code.

- V. Liquidity Provider's disclosure regarding Last Look is located here:

N.A.

- VI. Liquidity Provider may include free form text regarding any of the above Last Look key topics, if it would like to highlight anything referenced in the main body of its disclosure attached

N.A.

D. DISCLOSURES INDEX:

Order Handling

Order Aggregation (Principle 9)

- I. Liquidity Provider's disclosure regarding order aggregation is located here:

Foreign Exchange Transaction Policy
Paragraph 6 of 4. Order handling
<https://www.shinseibank.com/corporate/en/fx/>

Discretion (Principle 9)

- I. Liquidity Provider's disclosure regarding use of discretion is located here:

Foreign Exchange Transaction Policy
Paragraph 2 of 4. Order handling
<https://www.shinseibank.com/corporate/en/fx/>

Time-Stamping (Principle 9)

- I. Liquidity Provider's disclosure regarding time-stamping is located here:

N.A.

Stop-Loss Orders (Principle 10)

- I. Liquidity Provider's disclosure regarding stop-loss orders is located here:

Foreign Exchange Transaction Policy
Paragraph 5 of 4. Order handling
<https://www.shinseibank.com/corporate/en/fx/>

Partial Fills (Principle 10)

- I. Liquidity Provider's disclosure regarding use of partial fills is located here:

Foreign Exchange Transaction Policy

Paragraph 1 of 4. Order handling

<https://www.shinseibank.com/corporate/en/fx/>

Additional Disclosures

Use of Reference Prices (Principle 13)

- I. Liquidity Provider's disclosure regarding use of reference prices is located here:

Foreign Exchange Transaction Policy

5. Execution prices

<https://www.shinseibank.com/corporate/en/fx/>

Markup / Fair Pricing Standards (Principle 14)

- I. Liquidity Provider's disclosure regarding use of mark-up is located here:

Foreign Exchange Transaction Policy

5. Execution prices

<https://www.shinseibank.com/corporate/en/fx/>

Aggregation Services (Principle 18)

- I. Liquidity Provider uses aggregation services:

Yes

No

- II. If 'Yes', Liquidity Provider's disclosure describing its aggregation services is located here:

N.A.

- III. Liquidity Provider's disclosure regarding use of liquidity sources is located here:

N.A.

Internal sharing of Confidential FX Trading Information (Principle 19)

- I. Liquidity Provider's high level disclosure regarding internal sharing of confidential FX Trading Information is located here:

Foreign Exchange Transaction Policy

6. Handling of customer information

<https://www.shinseibank.com/corporate/en/fx/>

Market Colour (Principles 20 and 22)

- I. Liquidity Provider's disclosure regarding use of Market Colour is located here:

Foreign Exchange Transaction Policy

7. Market color

<https://www.shinseibank.com/corporate/en/fx/>