

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 \(globalfxc.org\)](https://www.globalfxc.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.globalfxc.org/docs/fx_global.pdf)。

B. 適用対象：

流動性提供者／法人名：株式会社三菱 UFJ 銀行

最終更新日：2022年3月21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。

このカバーシートは株式会社三菱UFJ銀行（支店、海外支店、及び海外現地法人を通じて取引を行う場合を含み、以下「当行」といいます。）に適用されます。

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。

三菱UFJ銀行外国為替取引に関する基本方針 セクション1・2

(日本語版) <https://www.bk.mufg.jp/kiyou/policy/gaikokukawase.html>

(英語版) https://www.bk.mufg.jp/global/aboutus/foreign_exchange.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。

三菱UFJ銀行外国為替取引に関する基本方針 セクション4

(日本語版) <https://www.bk.mufg.jp/kiyou/policy/gaikokukawase.html>

(英語版) https://www.bk.mufg.jp/global/aboutus/foreign_exchange.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。

当行はカウンターパーティから特段の要請がある場合又は技術的な制約によりシメトリック・ラストルックを適用できない場合を除き、「シメトリック（対称的）・ラストルック」を適用します。カウンターパーティからの要請に基づき又は技術的な制約により「アシメトリック（非対称的）・ラストルック」が適用される場合には、チェックした結果、価格が当行に不利に動いた場合のみ、取引依頼を受諾いたしません。

三菱UFJ銀行外国為替取引に関する基本方針 セクション10 もご参照下さい。

(日本語版) <https://www.bk.mufg.jp/kiyou/policy/gaikokukawase.html>

(英語版) https://www.bk.mufg.jp/global/aboutus/foreign_exchange.html

III. 流動性提供者のラストブ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）

ラストブックウィンドウの最長時間は25 m/s（ただし、国・地域により異なる場合があります。）、ラストブックウィンドウの最短時間は0 m/sです。

流動性提供者は、ラストブ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。

当行のラストブックウィンドウの最長時間は、システム処理間の地理的距離、予期せぬ技術的事象の発生、及び技術的な制約などの要因により変動することがあります。

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&ディーリング」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。

三菱UFJ銀行外国為替取引に関する基本方針 セクション 8・10

(日本語版) <https://www.bk.mufg.jp/kigyuu/policy/gaikokukawase.html>

(英語版) https://www.bk.mufg.jp/global/aboutus/foreign_exchange.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。

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（原則 9）

- I. オーダーアグリゲーションに関する流動性提供者の開示文書は以下に掲載する。

三菱UFJ銀行外国為替取引に関する基本方針 セクション6・15・
16・17・18

(日本語版) <https://www.bk.mufg.jp/kiyou/policy/gaikokukawase.html>

(英語版) https://www.bk.mufg.jp/global/aboutus/foreign_exchange.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。

三菱UFJ銀行外国為替取引に関する基本方針 セクション6・7・8・
10・12・14・16・18

(日本語版) <https://www.bk.mufg.jp/kiyou/policy/gaikokukawase.html>

(英語版) https://www.bk.mufg.jp/global/aboutus/foreign_exchange.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。

三菱UFJ銀行外国為替取引に関する基本方針 セクション15

(日本語版) <https://www.bk.mufg.jp/kiyou/policy/gaikokukawase.html>

(英語版) https://www.bk.mufg.jp/global/aboutus/foreign_exchange.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。

三菱UFJ銀行外国為替取引に関する基本方針 セクション3・6

(日本語版) <https://www.bk.mufg.jp/kiyou/policy/gaikokukawase.html>

(英語版) https://www.bk.mufg.jp/global/aboutus/foreign_exchange.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。

三菱UFJ銀行外国為替取引に関する基本方針 セクション17

(日本語版) <https://www.bk.mufg.jp/kiyou/policy/gaikokukawase.html>

(英語版) https://www.bk.mufg.jp/global/aboutus/foreign_exchange.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。

三菱UFJ銀行外国為替取引に関する基本方針 セクション6

(日本語版) <https://www.bk.mufg.jp/kiyou/policy/gaikokukawase.html>

(英語版) https://www.bk.mufg.jp/global/aboutus/foreign_exchange.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。

三菱UFJ銀行外国為替取引に関する基本方針 セクション12

(日本語版) <https://www.bk.mufg.jp/kiyou/policy/gaikokukawase.html>

(英語版) https://www.bk.mufg.jp/global/aboutus/foreign_exchange.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。

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。

当行はアグリゲーションサービスを提供していないため該当なし

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。

三菱UFJ銀行外国為替取引に関する基本方針 セクション23

(日本語版) <https://www.bk.mufg.jp/kiyou/policy/gaikokukawase.html>

(英語版) https://www.bk.mufg.jp/global/aboutus/foreign_exchange.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。

三菱UFJ銀行外国為替取引に関する基本方針 セクション 24

(日本語版) <https://www.bk.mufg.jp/kigyou/policy/gaikokukawase.html>

(英語版) https://www.bk.mufg.jp/global/aboutus/foreign_exchange.html