

《全球外汇市场准则》 流动性提供商信息披露要点模板

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 - Global Foreign Exchange Committee](#)）。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： 中国农业银行

填写时间： 2026 年 8 月

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农业银行股份有限公司作为中国境内银行间外汇市场流动性提供商，持续提供买、卖双向外汇报价。

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：

[《中国农业银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》](#)

（二）客户交互数据（原则 9）

1.贵机构是否与第三方共享任何未经匿名、未经整合的客户交互数据，即基于客户交互得到的订单或交易数据（经客户同意或根据原则 20 与相关监管或政府机构等第三方共享的除外）？

☐是

☐否

该原则适用于运营外汇电子交易平台的市场参与者，我行不适用

1-1.贵机构是否与第三方实时共享客户交互数据？

☐是

☐否

该原则适用于运营外汇电子交易平台的市场参与者，我行不适用

1-2.贵机构是否将客户交互数据作为付费服务向第三方提供？

☐是

☐否

该原则适用于运营外汇电子交易平台的市场参与者，我行不适用

1-3.客户能否选择不向第三方提供其数据？

☐是

☐否

该原则适用于运营外汇电子交易平台的市场参与者，我行不适用

2.数据共享制度请见：

该原则适用于运营外汇电子交易平台的市场参与者，我行不适用

（三）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：

《中国农业银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》

(四) 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):

0-2000 毫秒

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、风险管理要求酌情进行调整

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：

[《中国农业银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》](#)

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：

[《中国农业银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》](#)

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：

[《中国农业银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》](#)

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：

[《中国农业银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》](#)

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：

[《中国农业银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》](#)

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：

[《中国农业银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》](#)

（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：

[《中国农业银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》](#)

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：

[《中国农业银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》](#)

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：

[《中国农业银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》](#)

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：

[《中国农业银行股份有限公司外汇流动性提供商信息披露》](#)