

# 南京银行股份有限公司

## 外汇流动性提供商信息披露

### 第一部分：说明

本披露文件适用于南京银行股份有限公司（以下简称“本机构”）作为流动性提供商，在中国境内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、卖双边的外汇报价，并在规定范围内承诺按照所报价格成交的行为，旨在根据《全球外汇市场准则》、《中国外汇市场准则》的要求，为本机构的客户/交易对手提供外汇交易活动的若干信息。但相关主管机构、交易场所对做事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。

除非另有说明，本文件中术语的定义参照《全球外汇市场准则》（FX Global Code，即“全球准则”）。

### 第二部分：主要披露信息

#### （一）交易角色

本机构有序开展市场交易，持续提供有竞争力的市场报价。在与客户/交易对手的交易中，本机构通过回应报价请求、提供价格、执行客户、交易对手方订单或其他方式开展交易，并承担交易风险。在外汇业务中，本机构不是客户/交易对手的代理人或受托人，本机构不承担任何与此相关的

责任。在执行交易前，客户/交易对手应对自身交易情况进行独立评估。

## **(二) 预先对冲**

预先对冲是对一个或多个预期客户订单相关的风险进行管理的交易行为。出于维护客户利益目的，本机构可能会结合市场条件（如流动性）、预期交易的交易量和性质、头寸规模、风险管理需要等因素采取预先或同时对冲或其他方式管理头寸。

预先对冲交易的价格可能和本机构与客户的成交价不一致，也可能影响市场价格或流动性。在开展预先对冲时，本机构可继续正在进行的业务，包括风险管理、做市及执行其他客户的订单等。

## **(三) 交易再确认 (Last Look)**

当客户/交易对手通过电子交易平台接受本机构提供的报价之后，本机构将开展核查，以决定是否接受客户/交易对手的交易请求。相关核查包括：

(1) 有效性检查。确认交易请求中涉及的要素和信用限额，本机构系统内交易对手信息是否设置完备，以及必要协议的签署情况。

(2) 价格检查。当客户/交易对手向本机构发出交易请求时，报价可能已经更新，该更新动作可能独立于客户/交易对手方交易请求或在收到交易请求之前。价格检查将确定客户/交易对手方的交易请求是否在本机构的可容忍范围

内。若交易请求超出可容忍范围（无论偏离方向是否对本机构有利），交易请求将不被执行。

有效性和价格检查将同时进行，两者任意一个检查不通过将导致交易请求被拒绝。通过有效性和价格检查的交易将自动达成。

在中国境内银行间外汇市场，本机构的 Last Look 时间窗长度以中国外汇交易中心参数设置为准（0-2500 毫秒）<sup>1</sup>。在通常情况下，客户/交易对手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。

本机构不会在 Last Look 窗口期间内利用客户交易请求中的信息开展交易。

### **第三部分：订单处理政策和其他信息披露**

#### **（一）订单处理**

客户/交易对手可以使用预先约定的渠道向本机构发出交易请求或订单，只会在本机构确认时才被视为已经收到。当收到交易请求或订单时，本机构会向客户/交易对手提供报价。若客户/交易对手接受该报价，本机构会执行订单。若对

---

<sup>1</sup>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，Last Look 窗口时间可能发生变化。另外，Last Look 窗口时间也取决于网络通讯时间。

方未能及时接受报价，可能会导致该报价不再适用。在这种情况下，客户/交易对手将需再次向本机构请求报价。

### **1. 订单加总**

本机构将公平一致地处理不同客户的订单。若订单加总将带来可能有利于一个或多个客户和（或）有利于风险管理的结果，且不损害客户/交易对手的利益，本机构可能会加总不同客户的订单。

### **2. 酌情决定权**

如下因素可能影响本机构对客户订单的执行情况：客户订单头寸，流动性状况和市场条件，其他客户订单以及本机构的交易策略等。因此，当面对来自各方（包括本机构自身）的交易意向时，本机构有权行使酌情决定权，即在其认为适当的基础上满足上述交易意向，包括订单执行、成交量、时间和定价等。本机构将公平、合理地行使用酌情决定权。

若交易请求或订单被拒绝，客户/交易对手有权知晓本机构拒绝的理由。

### **3. 时间戳**

本机构使用时间戳制度，本机构与客户/交易对手达成交易的时间将被如实记录下来。

#### **4. 止损订单**

止损订单是一种或有订单，在该指令有效期内若标的的某个参考价格达到或超过一个预先设定的水平，则会触发一个买/卖指定数量标的的指令。

由于价格波动、流动性等因素的变化，最终成交的价格可能不同于触发止损指令的参考价格水平，产生的差异被称为滑点。依照市场惯例，客户/交易对手需要承担滑点的成本。

#### **5. 部分执行订单**

本机构将尽最大努力按客户/交易对手指定的数量达成交易。然而，由于价格波动、流动性等因素的变化，对限定成交价格的订单而言，在订单指令有效期内无法成交、部分成交或全部成交的结果都有可能发生，且具体的执行结果无法预先获知。除非另有说明，本机构默认客户/交易对手接受部分成交的订单执行结果。如果出现此类情况，本机构将会第一时间及时告知客户和交易对手部分成交结果。

##### **(二) 参考价格**

本机构将按照公平公正的原则使用包括第三方提供的价格在内的价源参与形成参考价格。人民币市场汇率参考价统一以中国外汇交易中心公布数据为准，其形成过程与可能包含本机构在内的市场参与者的报价和交易活动有关。

##### **(三) 报价规则**

本机构按照公平公正的原则向客户/交易对手提供合理价格，在交易报价时，本机构会考虑在交易中承担的风险、基

基础设施及其他运营成本、交易执行渠道、交易执行成本、交易对手方及资金相关成本、客户服务费用、客户关系等。

在不同的市场状况和交易下，不同因素的影响有所不同。

除非另有约定，本机构向客户/交易对手所报实价或意向性报价均为“全价”，其中包括加价。即便交易类型相同或类似，本机构也可能基于总体客户关系等因素对不同客户提供不同加价。无论通过电子方式还是声讯方式开展交易，在交易执行前，客户应确认机构报价及相关交易条款。

#### **（四）客户信息保护**

对于外汇市场交易，本机构有权在特定情况下，按照《中国外汇市场准则》“需要知晓（Need to Know）”原则传递客户敏感信息，主要包括：

（1） 仅向有正当理由获取敏感信息的内、外部机构或个人披露敏感信息，例如出于风险管理、法律和合规等需要；

（2） 在任何情形下均不向任何有证据表明可能滥用敏感信息的内、外部机构或个人披露此类信息；

（3） 除非因前述理由或经客户同意，获得的敏感信息应仅用于原定目的。

本机构同时制定客户敏感信息保护的相关制度、流程和行为准则，在交流市场信息时对客户做匿名或者泛指处理，在交易沟通时不泄露客户的委托、操作和头寸（为具体交易的执行、处理、清算进行业务处理所需的除外），控制信息被

公开交流的目的和范围，并且限定和控制本机构内部可以接触到敏感信息的人员范围，保护客户/交易对手的相关敏感信息不会被不当使用。

在不违反上述前提的原则下，本机构可能会使用由客户/交易对手提供的信息来为本机构对冲风险相关的业务决策提供信息；可能会与本机构销售和交易人员共享有关客户活动的信息；可能会以汇总和不可追溯的方式使用或披露相关信息，以表明本机构对市场的看法和/或用于面向客户的业务、产品或服务。本机构可能会根据任何适用的法律或法规与监管机构提供客户信息，以履行相关责任并遵守其必须遵守的一般和特定监管要求以及其他要求。除上述情况外，本机构不会对无关第三方公开与客户/交易对手的交易细节，除非得到客户/交易对手的同意或依据有关适用的法律和监管规定。

#### **第四部分：其他**

本机构致力于维护长期的客户关系以成就可持续的业务。本文所列信息仅供参考，不作为客户办理外汇交易业务的直接依据。如您对本文所披露内容有任何疑问，请与本机构业务人员联系。

南京银行在法律法规范围内，对上述内容进行解释。