

外汇期权点击成交配置及交易指引

一、机构管理员设置

（一）权限检查与设置

1. 查看机构权限

机构管理员在设置→权限设置→外汇协商交易权限设置，点击机构权限 Tab 页，可查看本机构权限。机构权限由交易中心根据参与机构的会员权限范围统一设置。



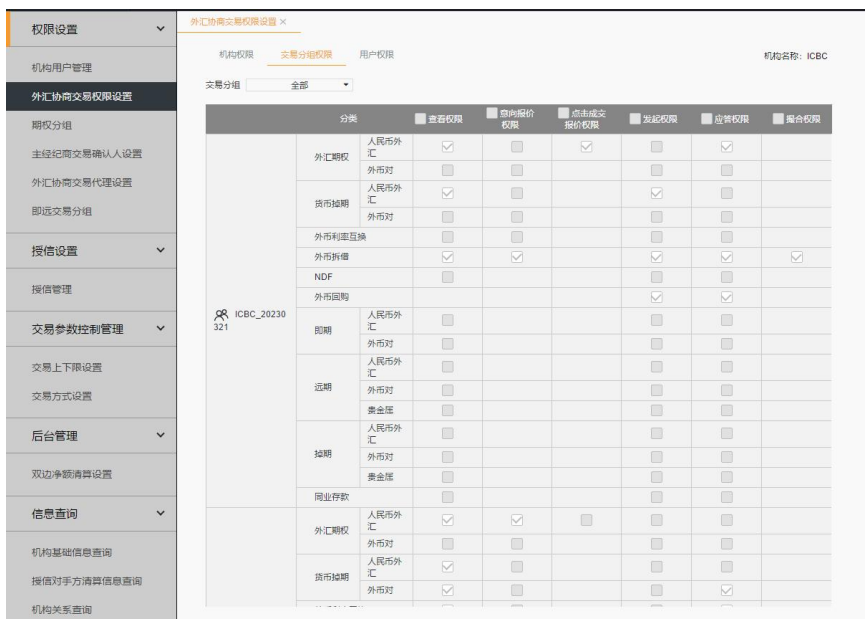
分类		查看权限	报价权限	交易权限
外汇期权		<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>
货币掉期	人民币外汇	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>
	外币对	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>
外币利率互换		<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>
外币拆借		<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>
NDF		<input checked="" type="checkbox"/>		<input checked="" type="checkbox"/>
有抵押品的外币拆借				<input checked="" type="checkbox"/>
外汇远期	人民币外汇	<input checked="" type="checkbox"/>		<input checked="" type="checkbox"/>
	外币对	<input checked="" type="checkbox"/>		<input checked="" type="checkbox"/>
外汇掉期	人民币外汇	<input checked="" type="checkbox"/>		<input checked="" type="checkbox"/>
	外币对	<input checked="" type="checkbox"/>		<input checked="" type="checkbox"/>

2. 查看及维护交易分组权限

机构管理员点击交易分组权限 Tab 页，可查看交易分组权限。交易分组权限由交易中心根据参与机构的会员权限范围统一设置。

（1）如需作为交易发起方（以下简称 Taker）参与期权点击成交交易，则需具备“发起权限”

（2）如需作为报价方（以下简称 Maker）参与期权点击成交交易，则需具备“点击成交报价权限”



3. 将用户关联至各交易分组下

点击交易分组前的图标，打开交易分组关联用户设置界面。在界面中点击【修改】后，通过勾选将相关用户关联至该分组，点击【确认】保存操作。



4. 用户权限设置

机构管理员点击进入用户权限 Tab 页，可对交易分组权限进

行查看及维护。

（1）如需作为 Taker 参与期权点击成交交易，则需勾选“发起权限”

（2）如需作为 Maker 参与期权点击成交交易，则需勾选“点击成交报价权限”

权限设置

机构用户管理

外汇协商交易权限设置

期权分组

主经纪商交易确认人设置

外汇协商交易代理设置

即远交易分组

授信设置

授信管理

交易参数控制管理

交易上下限设置

交易方式设置

后台管理

双边净额清算设置

信息查询

机构基础信息查询

授信对手方清算信息查询

机构关系查询

节假日查询

外汇协商交易权限设置

机构名称: ICBC

修改

机构权限

交易分组权限

用户权限

用户

全部

用户名	交易员ID	管理权限	分类	查看权限	意向报价权限	点击成交报价权限	发起权限	持仓权限	平仓权限
1.dealer@ICBC	000	<input checked="" type="checkbox"/>	外币利率互换		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
			外币折现		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
			NDF		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
			外币回购		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
			即期	人民币外币	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
				外币对	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
			远期	人民币外币	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
				外币对	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
			掉期	黄金库	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
				人民币外币	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
			同业存款	外币对	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
				黄金库	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
111111@ICBC	000	<input checked="" type="checkbox"/>	外汇期权		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
			外币对		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
			人民币外币		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
			货币掉期		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
			外币对		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
			外币利率互换		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
			外币折现		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
			NDF		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
			外币回购		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
			人民币外币		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
			黄金库		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

1 / 35

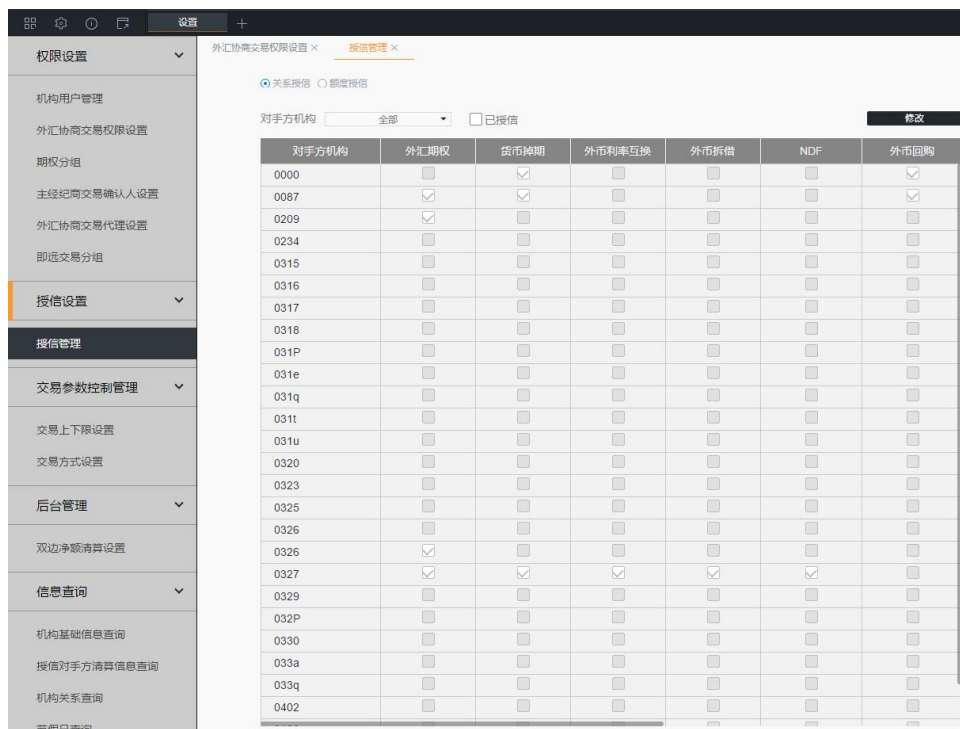
共3404条

（二）授信设置

1. Taker 方

Taker 方如需进行期权点击成交交易，需将 Maker 方在外汇报期权市场设置为已授信，操作步骤如下：

机构管理员在设置→授信设置→授信管理→关系授信，进行授信关系的设置。点击【修改】，可设置对各个对手方在外汇报期权产品上的授信，勾选为授信、取消勾选为不授信，点击【确认】后保存设置。

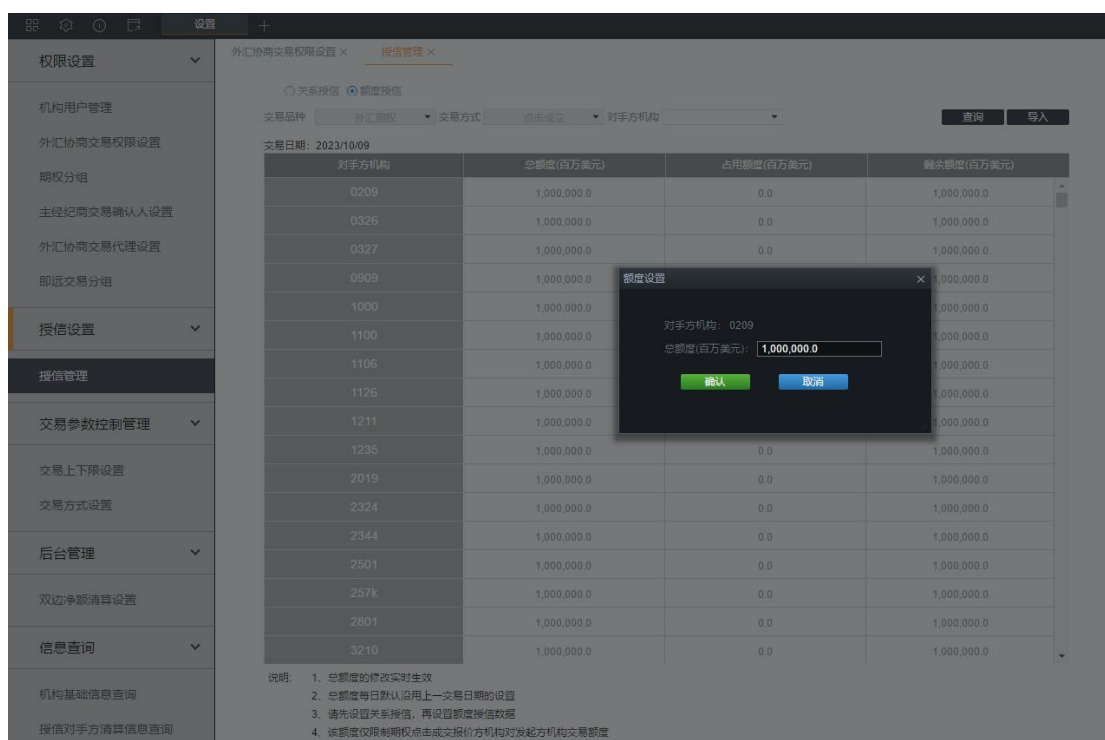


2. Maker 方

Maker 方如需进行期权点击成交交易，需设置 Maker 方在外汇期权市场关系授信和额度授信。操作步骤如下：

（1）关系授信设置：机构管理员在设置→授信设置→授信管理→关系授信，进行授信关系的设置。点击【修改】，可设置对各个对手方在外汇期权产品上的授信，勾选为授信、取消勾选为不授信，点击【确认】后保存设置。

（2）额度授信设置：机构管理员在设置→授信设置→授信管理→额度授信，进行额度授信设置。该额度仅对期权点击成交 Maker 方对 Taker 方的额度进行控制。机构管理员，可点击某个对手方的总额度，打开额度修改界面，逐个对手方修改额度，也可通过导入功能，批量设置与多个对手方之间的额度。



（三）交易方式设置

Maker 方如需进行期权点击成交交易，需设置对应的报价方式和交易所使用的交易分组。

机构管理员在设置→交易参数控制管理→交易方式设置→外汇期权版面设置 ESP 交易的报价方式和所使用的交易分组。

报价方式可选择 API 和手工，如选择手工，则仅允许通过 FX2017 客户端进行报价及点击成交交易，如选择 API，则仅允许通过 API 进行报价及点击成交交易。

需选择进行期权点击成交交易所用的报价方交易分组，仅与该分组关联的用户可参与外汇期权点击成交交易。

权限设置

机构用户管理

外汇协商交易权限设置

期权分组

主经纪商交易确认人设置

外汇协商交易代理设置

即远交易分组

授信设置

授信管理

交易参数控制管理

交易上下限设置

交易方式设置

后台管理

双边净额清算设置

信息查询

机构基础信息查询

外汇协商交易权限设置 ×

授信管理 ×

交易方式设置 ×

交易品种 外汇期权

修改

RFQ

货币对	报价方式	报价方式
EUR/CNY	手工	手工
GBP/CNY	手工	手工
HKD/CNY	手工	手工
JPY/CNY	手工	手工
USD/CNY	手工	API
AUD/USD	手工	手工
EUR/USD	手工	手工
GBP/USD	API	手工
USD/CAD	手工	手工
USD/HKD	手工	手工
USD/JPY	手工	手工

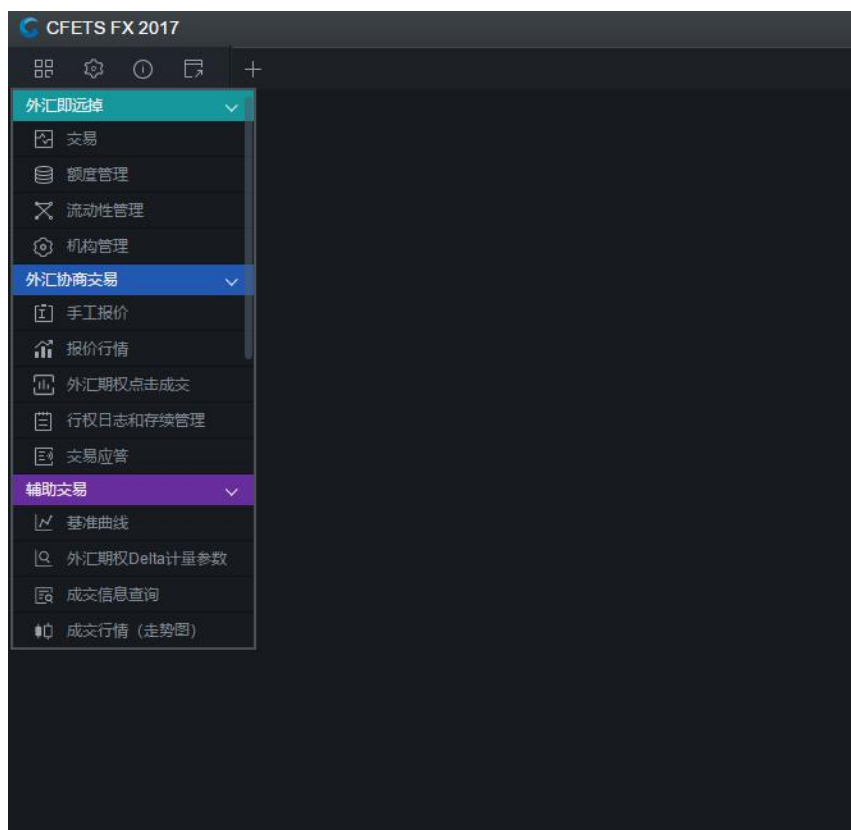
ESP

修改

货币对	报价对象	报价方式	报价方交易分组
USD/CNY	波动率(%)	手工	ICBC_FX_ZHOU
	期权套期(Pips)	手工	

二、相关交易流程

交易员可通过外汇期权点击成交菜单，打开外汇期权点击成交交易相关版面。



（一）报价对象为波动率

1. Maker 报价

Maker 方交易员可在外汇期权点击成交→手工报价版面进行报价。

点击【修改报价】按钮进入修改模式，修改报价后，点击【保存并发布】按钮发布报价。同时支持一键导入昨日报价和通过文件导入报价的便捷功能。

*通过期限选择下拉框，可选择展示/修改多期限报价

*【导入】和【一键导入昨日报价】功能导入的报价均为草稿，如核对无误后，可通过【保存并发布】按钮发布报价。

*不论本机构的报价方式为 API 和手工，交易员均可使用【撤销所有报价】功能撤销本机构所有报价。

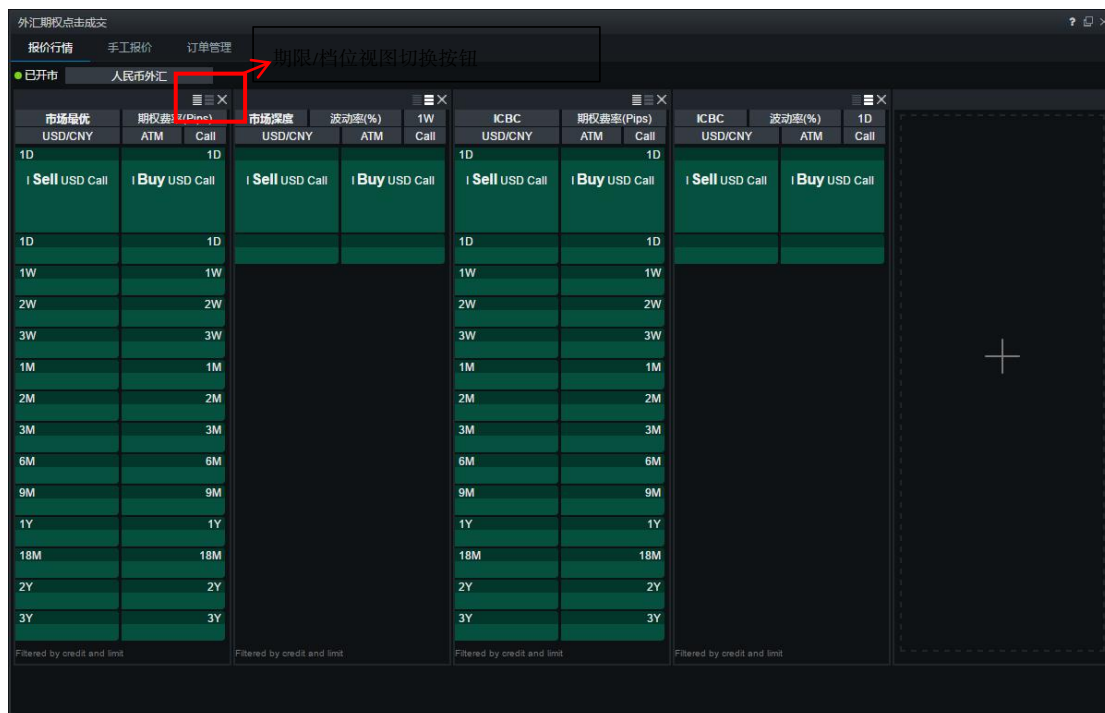
2. Taker 查看报价

Taker 方交易员可在外汇期权点击成交→报价行情版面查看报价，可在下图红框处点击切换两种展示形式：

（1）期限梯度视图：按期限展示报价，可选择市场最优，展示每个期限的市场最优价；也可选择具体机构报价，展示每个期限指定机构最优报价。

（2）档位梯度视图：按档位展示报价，可选择市场深度，展示指定期限的前 10 档报价；也可选择具体机构报价，展示指定期限指定机构全部档位报价。

（3）上述报价均经授信过滤。



3. Taker 点击报价提交订单

Taker 方交易员，可点击价格卡片的报价打开订单版面，填写交易量后提交订单。

如订单与报价匹配，则将展示匹配明细，Taker 可在指定时间内逐笔或批量对交易进行确认。如交易双方均确认则成交，如交易双方任意一方未确认，则交易取消。未成交的量，可通过【RFQ】按钮打开 RFQ 交易单，快速发起 RFQ 交易。

外汇报权点击成交: 2023100990000207@ICBC

发送 普通期权: I Buy USD Call 1,101,000,000.00 vs CNY Put

交易分组: **ABCI_FX-NEW** 货币对: USD/CNY

对手方机构: ICBC 工商银行 期限: 1D

交易方向: Buy Call Delta对冲交易: Sell Spot

Delta: ATM 波动率 (%) : 7.0000

名义本金 (USD): **1,101,000,000.00**

外汇报期权点击成交: 2023100990000186@ICBC

发送 普通期权: I Sell USD Call 100,000,000.00 vs CNY Put

交易分组: ABCI_FX-NEW
对手方机构: ICBC 工商银行
交易方向: Sell Call
Delta: ATM
名义本金 (USD): 100,000,000.00

货币对: USD/CNY
期限: 1D
Delta对冲交易: Buy Spot
波动率 (%): 6.0000

Confirming

交易信息

接受 137s **拒绝**

匹配量 (合计): 100,000,000.00 USD
成交量 (合计):

<input checked="" type="checkbox"/>	成交编号	交易状态	交易金额	波动率 (%)	期权费率(Pips)	期权费	执行价格
<input checked="" type="checkbox"/>	6.2.1012710	Confirming	100,000,000.00 USD	6.0000	90.56	905,608.88 CNY	7.2285

4. Maker 进行交易确认

当 Taker 方提交订单与 Maker 方报价匹配后，Maker 方交易员将收到交易确认提醒：



点击【交易】按钮后，可打开查看详情，并逐笔或批量进行交易确认：

外汇期权点击成交: 2023100990000236@ABCI

普通期权: I Buy USD Put vs CNY Call

交易分组: ICBC_FX_ZHOU 货币对: USD/CNY
 对手方机构: ABCI 农业银行 期限: 1M
 交易方向: Buy Put Delta对冲交易: Buy
 Delta: ATM 报价对象: 波动率 (%)

Deal Done

交易信息

接受 拒绝

匹配量 (合计): 12,000,000.000 USD
 成交量 (合计): 12,000,000.000 USD

成交编号	交易状态	交易金额	波动率 (%)	期权费率(Pips)	期权费	执行价格
6.2.1012771	Completed	12,000,000.000 USD	3.3000	276.76	332,114.87 CNY	7.2296

(二) 报价对象为期权费率

1. Maker 报价

Maker 报价操作步骤与报价对象为波动率时基本一致。

2. Taker 查看报价

Taker 查看报价操作步骤与报价对象为波动率时基本一致。

3. Taker 点击报价提交订单

Taker 方交易员，可点击价格卡片的报价打开订单版面，填写交易量后提交订单。

如订单与报价匹配，则将展示匹配明细，如交易的要素计算成功，则直接成交，无需交易双方另行确认。未成交的量，可通过【RFQ】按钮打开 RFQ 交易单，快速发起 RFQ 交易。

外汇率期权点击成交: 2023100990000242@ICBC

发送

普通期权: I Sell USD Call 111,000,000.000 vs CNY Put

交易分组: ABCI_FX-NEW

货币对: USD/CNY

对手方机构: ICBC 工商银行

期限: 1D

交易方向: Sell Call

Delta: ATM

期权费率 (Pips): 6.00

名义本金 (USD): 111,000,000.000

Deal Done

交易信息

匹配量 (合计): 111,000,000.000 USD

剩余未成交量: 0.000 USD

成交量 (合计): 111,000,000.000 USD

成交编号	交易状态	交易金额	波动率 (%)	期权费率(Pips)	期权费	执行价格
6.2.1012790	Completed	111,000,000.000 USD	0.0650	6.00	66,600.00 CNY	7.2285

4. Maker 成交/交易异常通知

当 Taker 方提交订单与 Maker 方报价匹配后，Maker 方交易员将收到成交或交易异常通知。

（三）订单管理

Taker 方交易员可通过期权点击成交→订单管理→发起版面，查看本人提交的外汇期权点击成交订单及订单关联的交易。

Maker 方交易员可通过期权点击成交→订单管理→接收版面，查看与本机构报价匹配的订单及订单关联的交易。如未从交易确认通知弹框接起交易确认请求，也可通过该版面接起。

外汇报点成交

报价行情 手工报价 订单管理

发起 接收 订单状态

订单编号	订单状态	报价方交易员	报价对象	货币对	期限	基准货币交易...	交易类型	Delta	匹配量	成交量
2023112390000002	Cancelled		波动率(%)	USD/CNY	1D	Buy	Call	ATM	1,000,000.00 US\$	
成交编号	交易状态	交易金额	波动率(%)	期权费率(Pips)	期权费	执行价格	DX对冲交易类型	DX对冲交易金额	DX对冲助涨远...	时间
6.2.1020022	● Rejected	1,000,000.00 USD	4.7090	70.94	7.093.93 CNY	7.2285	即期	500,000.00 USD	7.2292	2023/11
2023112390000001	Cancelled		波动率(%)	USD/CNY	1D	Buy	Call	ATM	1,000,000.00 US\$	

10 1 / 1 共2条