

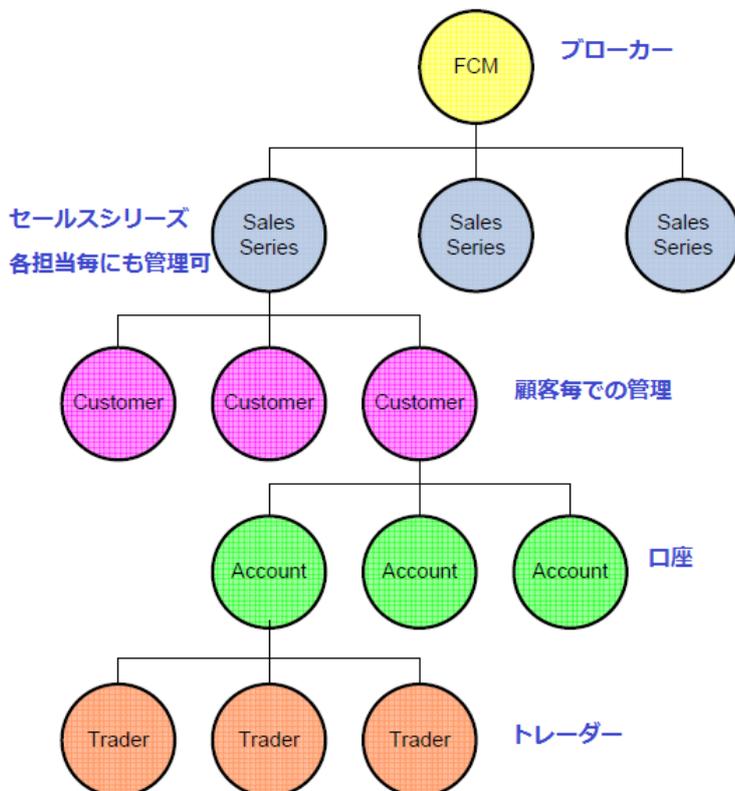
管理者用アプリケーション CAST について

業界をリードするリスク管理

取引前のリスク管理には最悪ケースのシナリオを評価するために、証拠金制御システムで口座ごとの設定が含まれます。口座のリスク設定を次のようにカスタマイズできます：

- ・ リアルタイムの証拠金の評価
- ・ 個別商品のトレード実施
- ・ ポジションサイズの制限をコントロール
- ・ 外部ポジションの新規追加
- ・ シングルトレードの証拠金制限
- ・ ドル建ての日ごとの損切り額設定
- ・ 許容可能な証拠金クレジットの設定
- ・ 取引証拠金または FCM パラメーターに基づき利用可能な必要証拠金を比較
- ・ 証拠金が不十分のときに注文をブロック
- ・ 先物やオプショントレードを許容
- ・ 注文量のコントロール
- ・ 外部ポジションの新規追加
- ・ 手仕舞いのみのモード設定
- ・ 日ごとの損切り率の設定
- ・ 取引証拠金の複数設定
- ・ 常に注文決済を承諾
- ・ 証拠金を確認するために逆指値注文を分析

階層的な管理



ブラウザからアクセス (Internet Explorer を使用)



複数言語による対応 (他英語、ロシア語に対応)

CQG

検索
 検索対象: 承認: in:

取引参加者アカウントの番号	発注番号	ティックャー番号	売買区分	サイズ	発注種別	価格	取引所	コントラクト	送信時刻
PSCQGJapan1	240661393		Buy	1	NONE LMT	4252	TOCOM	TGDQ12	2/1/2012 3:
PSCQGJapan1	240651505		Buy	1	NONE LMT	4254	TOCOM	TGDQ12	2/1/2012 3:
PSCQGJapan1	240651500		Sell	1	NONE LMT	4270	TOCOM	TGDQ12	2/1/2012 3:

注文 #240651505 Delayed (単一注文)

全ての時刻は、ローカル時刻で表示されます。
(最後: 2012/02/01 15:39) @ 4261

注文詳細

商品:	Gold -- TOCOM
説明:	買い 1 TGDQ12 @ 4254 LMT
トレーディングの表示:	
レッグ:	1 - 買い 1 TGDQ12
時間:	DAY : 計算された有効期限 2012/08/28 15:31:00
執行システム注文ID:	
注文ルート:	Delayed
ルートコード:	100
ルート上のGW(ゲートウェイ)オーダー ID:	
トレーダー:	cqgjapan1 cqgjapan1
アカウント:	SIMCOGJapan1 (PSCOGJapan1)
アクション:	<input type="button" value="キャンセルの確認"/>
現在の注文:	240651505 - Delayed order.

▶操作詳細

注文状態の変更

様々な口座の設定

・ シングル口座 ・ ギブアップ口座 ・ 共有の購買力を持つグループ口座 ・ オムニバス口座 ・ 商業口座

アカウント情報

取引参加者

カスタマー

現在のロケーション

取引参加者アカウントの番号 PS

アカウント名 SIM

セールスシリーズ

モードアカウントグループ

アカウントタイプ 清算機関用ハウスアカウント用

アカウント設定

アカウントステートメント: 口座のステートメントの設定

- 取引参加者からステートメントを受け取ったらすぐに処理します。
- 完全なデイリーステートメントを作成する (?)
- 1日の終わりにポジションをゼロにする (?)

ギブアップアカウント 取引参加者 (?) ギブアップのブローカー指定も可能

ブロックアカウント Size

アカウントの取引時間帯 開始時刻 終了時刻 タイムゾーン

このアカウントの照会を実行しますか? はい いいえ 取引参加者の設定を使用 取引時間の制限も可能

グループ口座設定によるリスク管理

アカウント () をマスターグループアカウントに設定する

マスターアカウントにする

グループのリレーションタイプ: 3つのオプションがあります

- 個別証拠金(サブアカウントはマスターアカウントから設定した割合まで購買余力を借りることができます)
- 個別に証拠金を算出し、必要証拠金と購買余力を合算します。
- マスターアカウントとサブアカウントの証拠金を合算する(証拠金の計算において資金、注文、ポジションを組み合わせます)

[マスターアカウントから借入]を設定すると、各サブアカウントは全の資金を使用でき、さらにマスターアカウントの購買余力(余力がある場合)から定義された割合の資金を借り入れて必要証拠金をカバーできます。例えば、マスターアカウントの購買余力が100,000ドルで、サブアカウントの '%Purchasing Power' パラメーターが50%に設定されている場合、自身の購買余力に加えてマスターアカウントから50,000ドルまで使用できます。購買余力は、マスターアカウントまたは他のサブアカウントが必要証拠金をカバーするために既に使用されている場合があるので、全ての資金が利用可能ではない場合があります。

[マスターアカウントから借入]を設定しなければ、'%Purchasing Power' パラメーターは使用されません。代わりに、マスターアカウントと全てのサブアカウントの購買余力は合算され、マスターアカウント全てのサブアカウントに必要証拠金の合計をカバーするために使用されます。結合された必要証拠金が結合された購買余力を超えると、グループの全てのアカウントでトレードを開くことができなくなります。

オムニバスアカウントの設定

新しいオムニバスアカウントを作成する カスタマー用 **Kentro-Securities (16787564)**

アカウント情報

取引参加者: CQG Demo
 カスタマー: 16787564 - Kentro-Securities
 現在のロケーション: Chicago
 取引参加者アカウントの番号: TS
 アカウント名: DEMO
 セールスシリーズ: 007 - CQGDemo
 アカウントタイプ: Customer Account 他のカスタマーアカウント

アカウント設定

アカウントステートメント:
 取引参加者からステートメントを受け取ったらすぐに処理します。
 完全なデイリーステートメントを作成する (?)
 1日の終わりにポジションをゼロにする (?)

ギブアップアカウント 取引参加者: --なし-- (?)
 ブロックアカウント Size: 1
 アカウントの取引時間帯 開始時刻: 終了時刻: タイムゾーン: -----選択-----

このアカウントの照会を実行しますか? はい いいえ 取引参加者の設定を使用

オムニバスアカウントのスタイル:
 通常オムニバスアカウント
 バーチャルオムニバスアカウント

**バーチャルのオプションより各オムニバス下にある
各口座の情報を取引所サイドに送信することができます**

様々なパラメータでのリスク管理

リスク管理モジュールは次のものを利用してマージン分析を実施します:(擬似 SPAN を使用)

- ・ 口座バランスと正味資産
- ・ 未決済ポジション
- ・ 評価損金
- ・ 先物ポジション未実現損益
- ・ 預託担保
- ・ 正味流動価格
- ・ オプションの市場価格
- ・ 正確なヒストリカルデータ
- ・ 相場が発表するリスクアレイ

適用	名前	パラメーター	算出基準::
<input type="checkbox"/>	商品ポジション上限	<input checked="" type="radio"/> 0 <input type="radio"/> 無制限	<input type="checkbox"/> デルタ1日あたりの損失上限 0.00 (0.00 - 1.00) 0.00 金額(ドル)
<input type="checkbox"/>	限月ポジション上限	<input checked="" type="radio"/> 0 <input type="radio"/> 無制限	
<input checked="" type="checkbox"/>	証拠金サブシステム		
	許容される証拠金与信	0.00	証拠金乗数 SPAN証拠金のパーセンテージ 1.00
	クロスマージンを有効にする	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> 購買余力(PP)にOTE(評価損益)を含める <input type="checkbox"/> 購買余力(PP)にネットオプション価値(NOV)を含める <input type="checkbox"/> DLL/DDLL (1日あたりの損失上限およびデルタ1日あたりの損失上限)にUPL (未実現のP/L)を含める <input type="checkbox"/> DLL/DDLL (1日あたりの損失上限およびデルタ1日あたりの損失上限)にOTE (評価損益)を含める <input type="checkbox"/> 算出基準:: 負の残高の存在チェック 1.00 (0.00) 1.00 0.00 金額
<input type="checkbox"/>	1日あたりの損失上限		<input type="checkbox"/> OTEで買値/売値の使用を無効にする <input type="checkbox"/> NOV/UPLで買値/売値の使用を無効にする

簡易な注文の管理

検索対象: 240661397 承認: 発注番号 in: Stage_CentralDB 検索 Excelにエクスポ

注文 #2406

全ての時刻は、ローカ (最後: 2012/02/02 07:16:00)

注文詳細

商品: OMEX/GLOBEX
 説明: EM12 @ 17411 LMT
 トレーディングの

レグ: 1 - 売り 1 GCEM12
 時間: DAY : 計算された有効期限 2012/02/02 07:16:00
 執行システム注文ID: 896D-40E3FD892468ACF1
 注文ルート: CQG - Simulator SSP
 ルートコード: 77
 ルート上のGW(ゲートウェイ)オーダー ID: ORDERID240661397
 トレーダー: [cqgjapan1 cqgjapan1](#)
 アカウント: [SIMCOGJapan1 \(PSCOGJapan1\)](#)
 現在の注文: 240661397 - Filled.

操作詳細

注文状態の変更

時刻	GW状態	GW状態詳細	クライアントステータス	クライアントトランザクション	コメント
2012/02/01 15:51:25	Transmitting	Pending New, not sent.	In Transit	In Transit	
2012/02/01 15:51:25	Transmitting	Broker pending.	No Change	Not sent	
2012/02/01 15:51:25	Working	Working.	Working	Acknowledged	
2012/02/01 16:41:19	Filled	Filled.	Filled	Fill	

検索の条件は様々設定できます

その他 API によるカスタマイズ可能なリスク画面

Risk Console

DATA Connection is Up GW Connection is Up 2012/02/02 23:45:27 Log Off kentaroj

Accounts Last Update: 2012/02/02 23:44:38 Update Positions, Orders & Manual Fills Last Update: 2012/02/02 23:45:09 Update Update Frequency: 1 minute

Risk Management Order Details

ORDERES of ALL ACCOUNTS

Order ID	Trader Name	Account	Instrument	Status	Side	Quantity	Type	Limit Pri.	Stop Price
24099274	kentaroj	PSCOG.Japan1	F.US.TGSN12		Sell	1	Limit		
241022856	kentaroj	PSCOG.Japan1	F.US.TGSN12		Sell	1	Limit		
24099275	kentaroj	PSCOG.Japan1	F.US.TGSN12		Sell	1	Limit		
24099276	kentaroj	PSCOG.Japan1	F.US.JTPXH12	InOrderBook	Buy	1	Limit	N/A	N/A
241022664	kentaroj	PSCOG.Japan1	F.US.JTPXH12	InOrderBook	Buy	1	Limit	N/A	N/A
24099277	kentaroj	PSCOG.Japan1	F.US.JTPXH12		Buy	1	Limit	N/A	N/A
241014455	kentaroj								

MANUAL FILLS of ALL ACCOUNTS

Trade ID	Account
1	PSkenact3
2	PSkenact3

OPEN POSITIONS of <ALL ACCOUNTS>

Account	Instrument	Long	Short	Average Price	OTE	MVO	Offset	Profit/Loss	Curren
PSkenact1	F.US.JNKH12	1	0						
PSkenact3	F.US.JNKH12	1	0						
PSCOG.Japan1	F.US.GCEM12	0	1						
PSkenact1	F.US.GCEM12	3m	0						
PSkenact3	F.US.JNKH12	1m	0						
PSCOG.Japan1	F.US.TGSN12	5	0						
TOTAL		11	1		-388930.00	0.00	0	-20000.00	

Accounts Count: 6
 Open Positions Count: 5
 Working Orders Count: 7
 Manual Fills Count: 2
 Total P/L+OTE: -4565514.50

ACCOUNTS OF TRADER <Undefined trader>

Account	Current Balance	Profit / Loss	Max P / L	Min P / L	OTE	MVO	NLV	Net Change	% Gain / Loss	Margin (Settle...	Cash Excess ...	Currency	FCM ID
7	100009512.17	0.00			-4571342.40	0.00	95518169.77	-4571342.40	-45754243...	0.00	0.00	USD	144
0	100000000.00	0.00			0.00	0.00	100000000.00	0.00	0.00	0.00	0.00	USD	144
0	100000193.40	-181.60		-181.60	6446.80	0.00	100000640.00	6265.20	626522349...	0.00	0.00	USD	144
5	100000104.95	0.00			0.00	0.00	100000104.00	0.00	0.00	0.00	0.00	USD	144
0	32234.00	0.00			-437.30	0.00	31796.70	-437.30	-140959.28	0.00	0.00	USD	266
0	100000000.00	0.00			0.00	0.00	100000000.00	0.00	0.00	0.00	0.00	USD	144
2	500122044.52	-181.60		-181.60	-456532.90	0.00	495556711.00	-4565514.50	-45691692...	0.00	0.00	USD	144

MODES (Middle Office Data Service)ファイルのご提供

CQG では注文・約定・トランザクションのデータをファイルにして提供しています。

ファイルの取得には CQG からのお客様の SFTP サーバへのアップロード、もしくは弊社サーバよりダウンロードが可能になります。

ファイルの送信間隔は分単位でのご指定、もしくは一日に数回の時間の指定ができます。

ファイルの種類には3種類あり、約定・注文・トランザクションのファイルをご提供しております。

ファイルのフォーマット等の詳細につきましては、仕様書をご参照ください。

リアルタイムでのデータ取得をご希望の場合は、FIX にてデータを配信しております。

この場合は弊社の FIX サーバに対しての開発が必要になります。

PARSE ファイルによる口座情報（証拠金・建玉等）のアップデート

定型のファイルを CQG の FTP サーバにアップロードすることにより、顧客・トレーダーの口座情報をアップデートすることができます。

定型のファイルには数種類のフォーマットをご用意しており、サンプルファイルのご提供もしております。

また他通貨でのお取引の際には、為替レート等の対応をしております。