CQG プラグインによる アイスバーグ注文

アルゴオーダー機能について

こちらのプラグインにつきましては、サンプルという位置づけであるため、弊社サ ポート対象外のツールとなります。詳細はこちらに記載しております。 これにより、予期せぬ動作などによる機会損失などにつきまして弊社は責任を負い かねます。

Daichi Sase 6/16/2017

Contents

アイスバーグ注文の設定について	3
起動方法	3
起動後の最初の設定	3
アイスバーグアイコン	4
アイスバーグメニュー	4
About	4
Help	4
Show Log	4
Configuration Manager	5
Profile Manager	6
Monitor	9
注意点	10



アイスバーグ注文の設定について

起動方法

AlgoOrder ICBG を起動します。



起動後の最初の設定

CQG IC/Classic より Setting → Trading Preference →Smart Order → Enable Iceberg にチェックを入れ ます。また Notifications のボックスにもチェックを入れてください。一度設定をすれば次回からの設定は 必要ございません。

👪 Trading Prefere	ences - DOMTrader	×
Display	Smart Orders	
Price Display	Symbol settings for trading account: Default for all accounts	
Notifications		
Risk	DOM-Triggered Stops Iceburg	
Limits & Stops	Iceberg Strategies Iceburg algorithmic order	
Smart Orders	Trailing OCO	_
Strategy Orders	OCO Strategies Iceburg Size 5 Contract(s)	
Keyboard Keys	Market If Touched Vise fixed price	
	Market limit Respect price changes	
	Notifications	
	Enable confirmations for Iceburg	
	* No order parameters have	
	been set for this instrument	
	Add symbol	
	OK Cancel App	oly

板画面の OCO ボタンよりアイスバーグが選択可能になります。





アイスバーグアイコン

Windows のツールバーにアイコンが表示されます。



右クリックをすると以下の画面が表示されます。

Algorithmic Order ICBG	
About	Ctrl+A
Help	Ctrl+H
Show Logs	Ctrl+L
Configuration Manager	Ctrl+G
Profile Manager	Ctrl+F
Monitor	Ctrl+M
Restart	Ctrl+R
Close	Ctrl+X

アイスバーグメニュー

Aboutバージョン情報を表示します。HelpCQG API の Web ページが表示され、API のご紹介をご確認いただけます。Show Logログファイルのフォルダが開きます。

Configuration Manager

下図のスクリーンが起動します。

Algorithmic Order Setting	(S				
Long Name : Icebergs					
Short Name : ICBG					
Balloon Tip Settings					
Balloon Tip Level : In	fo	+]		
ogger Settings					
Log Level :	Info		•		
Log File Max Size :	1024	÷ 1	Œ		
Log Files Max Count :	50				
6	vill tako o	ffort afte	r applicat	ion met	art

Long Name 注文名の正式名称を変えることができます。**Trading Preference**・板画面の表示等に反映 されます。

Short Name 注文名の略称を変更できます。下図は名前を Long Name を Icbrgs Batch、Short Name を ICBB と変更。



Balloon Tip Level

ツールバーアイコンから表示される情報レベルを指定します。

- Info 情報レベル
- Error エラー
- Warning 警告
- None なし

Logger Settings

ログレベルを設定します。

Log Level

- Info 情報レベル
- Error エラー
- Warning 警告
- None なし

Log file Max Size 1 ログファイルの最大のサイズ

Log file Max Count ログファイルの最大カウント数

Profile Manager

以下画面より各アイスバーグの注文のデフォルトの設定ができます。

🏟 ICBG Profile Manager	—
Algo order application in	nstance : 0
Iceberg Mode :	Smart Iceberg 👻
Iceberg Min Size :	5 🚔 in % 🔲
Iceberg Max Size :	5 📩 in %
Distance from Market :	2 🔶 tick(s)
Release Time :	5 second(s)
Payup Time :	2 second(s)
Payup Distance :	1 🕂 tick(s)
Percentage :	10 🔹 %
Use fixed price :	
Respect price changes :	
	OK Cancel

- Iceberg Mode 次ページ参照
- Iceberg Min Size ワンショット時の最小の枚数
- Iceberg Max Size ワンショット時の最大の枚数

• Distance From Market

最初にワンショットがおかれる注文の直近約定値までの幅です。例)10 Ticks と指定し、銘柄 TOCOM ゴム 直近約定値 297.0 の場合最初の指値が 298.0 に発注がされます。

• Release Time

指定時刻(秒)毎に発注枚数がワンショットの注文へ追加されていきます。追加される枚数は 最小~最大枚数からランダムにて追加されます。

• Payup Time & Payup Distance

指定時刻(秒)毎に Payup Distance にて設定されたチック数が動きます。買の場合は指値値 段が自動的に上がり、売りの場合は指値が下がります。

• Percentage

ここで指定された%のワンショットの枚数が Payup Time 内に約定しなかった場合には、指値が移動します。

Iceberg Mode について

以下3つより Iceberg の種類を選ぶことができます。

Mode :	Smart Random Iceberg	-
	Smart Iceberg Random Iceberg	
	Smart Random Iceberg	

Smart Iceberg:通常のアイスバーグ注文です。板画面から指値及び発注枚数を指定し(下記注:参照)、合計発注枚数(Max Quantity)及びワンショットの枚数(Iceberg Size)を確認画面から指定します。ワンショットが全て約定すると、次のワンショットの注文が発注されます。

注:板画面にて指定した発注枚数と合計発注枚数(Max Quantity)は同枚数に設定してください。



- Max Quantity 合計発注枚数
- Iceberg Min Size ワンショット時の最小の枚数
- Use Fixed Price

チェックを入れた場合、ワンショットの価格が約定した際に、同じ指値にて再度発注される。チェックを入れなかった場合、最初に発注時に直近約定値と離れていたチック数と同じ チック数離れた価格にて、2回目の注文が行われる。

• Respect Price Change

チェックを入れた場合、価格変更の際には変更された価格にて2回目の発注が行われる。



Random Iceberg: ワンショット時の最小の枚数(Iceberg Min Size)と最大の枚数(Iceberg Max Size)を設定し、ランダムにて発注がなされるようになります。

注:板画面にて指定した発注枚数と合計発注枚数(Max Quantity)は同枚数に設定してください。

SELL 10 T	RUX7 @ 19	9.8 LMT SIMDa CQGsim3+
	Place SELL Order	Cancel
Enter order paramete	ers	
Max Quantity	10 Con	ract(s)
Iceberg Min Size	2	Contract(s)
Iceberg Max Size	5	Contract(s)
Use fixed price		
Respect price chang	es 📃	
Use these parameters for this symbol an	eters as the default d all symbols withou	t

- Max Quantity 合計発注枚数
- Iceberg Min Size ワンショット時の最小の枚数
- Iceberg Max Size ワンショット時の最大の枚数
- Use Fixed Price

チェックを入れた場合、ワンショットの価格が約定した際に、同じ指値にて再度発注される。チェックを入れなかった場合、最初に発注時に直近約定値と離れていたチック数と同 じチック数離れた価格にて、2回目の注文が行われる。

Respect Price Change
 チェックを入れた場合、価格変更の際には変更された価格にて2回目の発注が行われる。

➤ Smart Random Iceberg 以下設定が可能です。

- Iceberg Min Size ワンショット時の最小の枚数
- Iceberg Max Size ワンショット時の最大の枚数

• Distance From Market

最初にワンショットがおかれる注文の直近約定値までの幅です。

例) 10 Ticks と指定し、銘柄 TOCOM ゴム 直近約定値 297.0 の場合、最初の指値が 298.0 に発注がされます。

- Payup Time & Payup Distance
 指定時刻(秒)毎に Payup Distance にて設定されたチック数が動きます。買の場合は指値
 値段が自動的に上がり、売りの場合は指値が下がります。
- Percentage

ここで指定された%のワンショットの枚数が Payup Time 内に約定しなかった場合には、 指値が移動します。

• Release Time

Payup が発生しなかった場合、指定時刻(秒)毎に発注枚数がワンショットの注文へ追加 されていきます。追加される枚数は最小〜最大枚数からランダムにて追加されます。



Enter order paramete	ers:	
Iceberg Min Size	1	Contract(s)
ceberg Max Size	5	Contract(s)
Distance From Marke	et 2	Tick(s)
Release Time	5	Second(s)
Payup Time	2	Second(s)
Payup Distance	1	Tick(s)
Percentage	10	%
	Place Order	Don't Place Order

Monitor

注文のモニターとキャンセルができます。

Order ID	Status	FCM Account ID	Account Name	Instrument Name	Side	Type	Limit Price	Stop Price	Tot
/ 001	Working	PSkenacct1	SIMkenacct1	F.US.TKRN13	Sell	Limit	72990	N/A	
Z (002	Working	PSkenacct1	SIMkenacct1	F.US.TKRN13	Sell	Limit	72970	N/A	
003	Working	PSkenacct1	SIMkenacct1	F.US.TKRN13	Buy	Limit	72870	N/A	
004	Working	PSkenacct1	SIMkenacct1	F.US.TKRN13	Buy	Limit	72860	N/A	

選択した注文をキャンセルするにはウィンドウ左側のボックスにチェックをいれ、Cancel Checked Orders を クリックします。全注文をキャンセルするには Cancel All Orders をクリックします。

注意点

・本アプリケーションには、多重起動制御機能が付いておりません。2 重起動したままご利用になりますと正 常な発注が出来ない場合が御座います。

🖙 🕹 🛛 🗳	🚇 Windows タスク マネージャー
🔊 🖸 🖂 🔘	ファイル(F) オプション(O) 表示(V) ヘルプ(H)
S 🖬 🖬 🧛 🦛	アプリケーション プロセス サービス パフォーマンス ネットワーク ユーザー
o 😽	イメージ名 ^ PID ユーザー名 CP メモリ (プラ 説明
カスタマイズ	Adrenalin.exe 20724 yhiyama 00 53,680 K Adrenalin AlgoOrder ICBG.exe *32 20368 yhiyama 00 17,428 K Algorithmi
👂 🕐 Сарб 🗗 💽 😽 🖿 惧 (AlgoOrder ICBG.exe *32 21184 yhiyama 00 17,792 K Algorithmi AlgoOrder ICBG.exe *32 22312 yhiyama 00 17,308 K Algorithmi

タスクマネージャーより、不必要なアプリケーションを終了してください。

- ・アルゴ注文中は、本アプリケーションを終了させないでください。アルゴ機能が停止してしまいます。
- ・アルゴ注文キャンセルは、CQGIC 上及び本アプリケーション上から行ってください。本アプリケーション 上にアルゴ注文が残っていると、トリガーされた際発注される場合がございます。
- ・アルゴ注文後、Monitor 画面内の LimitPrice が N/A の場合が御座います。価格表示に少し時間がかかる場合が御座いますが、もし N/A のままでしたら、正常に発注できておりませんので、弊社カスタマーサポート へご連絡ください。