

# CQG スプレッダークイックリファレンスガイド

## スプレッドの QFormula 作成

スプレッド形式 = SPREAD(<CQG 表現>,<計算方法>,<チック>,<比率>,<BAT フィルター>,<ロールオーバー>)  
 値がない場合でもコンマが必要です。例) SPREAD (1.6\*TYA-USA,,,5:3)

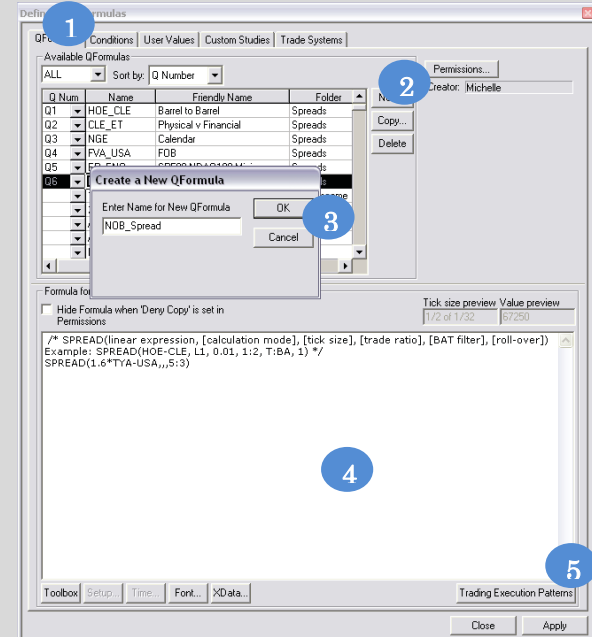
### スプレッド形式

- CQG 表現** : 銘柄シンボルと乗数 (オプション) を設定
- 計算方法** : スプレッドの計算設定 - レッグと通貨  
**Auto** : 銘柄間での価格の差を表示  
**L1, L2, L3 等** : レッグのチック値ベースの価格表示  
**CUR** : レッグの通貨ベースの価格を表示
- チック** : スプレッドのチック値を設定。バイナリ (2 乗数) ・小数点可。  
 1/2 1/4 1/8 1/16 1/32 1/64 1/128 1/256 1/512 1/1024 1/2048  
 1/2 1/64 1/8 1/32 1/4 1/32 1/2 1/32  
 CUR モード時、チック値はレッグチック値の最大分母、そうでない場合は最小値となります。
- 比率** : 各レッグの注文枚数。例) leg 1:leg 2:leg 3
- BAT フィルター** : 各レッグは BAT (Bid-買気配・Ask-売気配・Trade-直近) フィルターを持ちます。各レッグのフィルターはコロンにて分けられます。レッグが買/売気配を持たない場合、直近が使用されます。  
**BA** : シンセティック銘柄情報の計算にレッグの買/売気配を指定。  
**T** : シンセティック銘柄情報の計算に直近価格を指定。
- ロールオーバー** : オン時、ひとつのレッグが失効した際、全レッグが同じ限月にロールオーバーされます。  
**0** = 同じ限月へのロールオーバーはオフです。  
**1** = 同じ限月へのロールオーバーはオンです。

### スプレッドの QFormula 作成

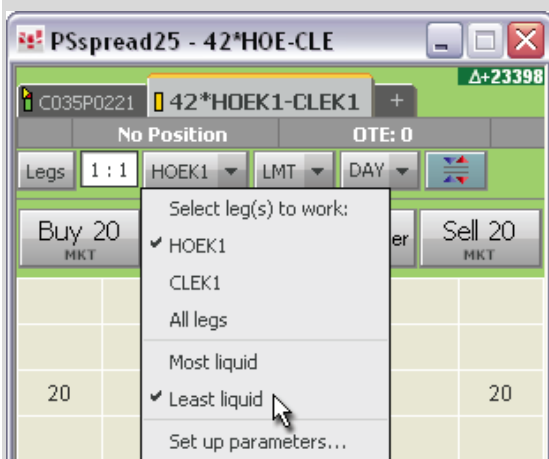
- “Define User Formulas”ウィンドウを開き、“QFormulas”タブを開きます。
- “New”ボタンをクリックします。
- QFormulas 名を入力し、OK をクリックします。
- エディター内に“SPREAD(“と入力すると、自動的にフォーミュラが表示されます。ユーザーの形式と SPREAD (@) に訂正します。
- “Trading Execution Pattern”ボタンをクリックし、スプレッド設定します。設定後、“Apply”->“Close”ボタンを押します。

Q 番号が割り振られますので、その数値を使用して DOMTrader やチケットに入力ができます。

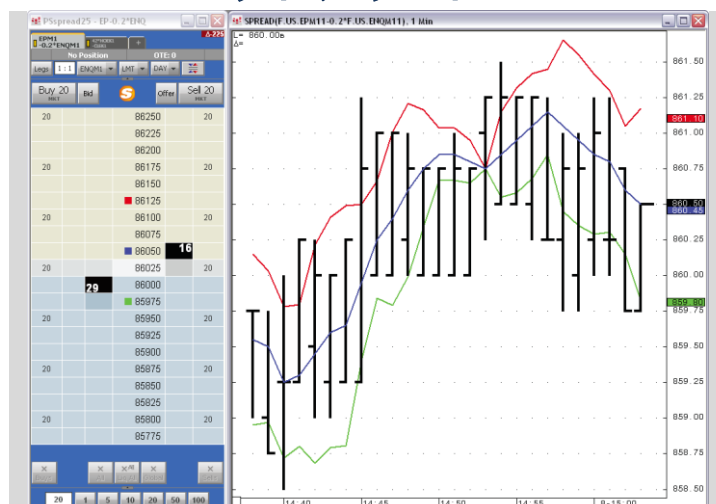


### 取引所受付済注文オプション

メニューより取引所へ発注するレッグを選びます。リクイディティがあるほうか、ないほうか、同時に両方か。



### スプレッドチャート



板とチャートで CBOT 10 年国債と 30 年における US ドル スプレッド表示です。

## 設定方法

### ▼ Spread Properties

- **Color** : 取引ウィンドウの背景の色を設定します。
- **Overfill management** : 過約定の対応を設定します。  
**No Selection**: 過約定に対してアクションを起こしません。  
**Auto Hedge Overfills** : (取引所) 受付中もしくは(サーバ) 待機中のレッグが過約定した場合、レッグの比率を維持できるように試みます。  
**Avoid Overfills** : 過約定をなるべく避けるように受付中のレッグの動きを弱め過約定を最小化します。
- **Ignore partial fills in price discovery** : メイン注文の約定価格を無視します。

### ▼ How to Work

- **Size** : レッグ比率を決め、それぞれの枚数を設定します。
- **Work** : どのレッグを取引所へ発注するか設定します。ひとつか、全てか、どちらでもないか。

### ▼ Messaging

- **Volume Multiplier** : サーバにあるレッグの残枚数の割合より取引所レッグの枚数決めます。
- **Work Threshold** : この設定値より大きい残枚数がモニターされているレッグにある場合のみCQGは注文を発注・執行させます。
- **Min Size Increment** : モニター・レッグに最低設定された枚数がない限り発注はされません。枚数訂正する場合は設定された枚数以上が必要となります。

### ▼ Proportional Execution

- **Trigger** : スプレッドを比率設定した場合使用。2番目のレッグ発注前に必要な主レッグの部分約定の数値を設定します。

### ▼ Queue Holders

- **Min and Max Number of holders** : 最小と最大の待機注文数を設定します。
- **# of levels** : 待機中の注文間においてどれだけの価格チックをスキップするか設定します。
- **Order size restore threshold** : 待機注文管理に使用され、待機注文の一部として発注される注文数が最大化する前に最良気配より離すかチック数を設定します。

### ▼ If Incomplete

- **Replace order to complete strategy by using selected method below** : カバー注文の対応をします。トレイリングリミット注文とペイアップ<sup>®</sup>を使用し未成立注文のコントロールをします。
- **Execute incomplete strategy if order is not filled in this many seconds** : カバー注文を出す前の時間を設定します。これにて若干時間を待って価格を確認できます。
- **Allow leg to slip this number of ticks** : カバー注文に対してどれだけのスリッページを許すか設定します。マイナスの数値も使用可能です。  
**Trailing Limit, same side** : 元注文と同じサイドの最良気配を追跡するトレイリングリミット注文を発注します。  
**Trailing Limit, opposite side** : 元注文の反対、つまり買の場合は最良売気配をトラックするトレイリングリミット注文を発注します。  
**Payups ペイアップ** : スリッページのチックサイズに応じて指値に注文訂正をします。
- **Monitor leaning DOM volume to determine when to replace order** : サーバーに待機中のレッグの気配枚数をモニターするか設定します。未約定注文(Payupかトレイリング)が訂正される前に状態が条件に合う必要があります。  
**DOM Volume** : 発注をトリガーする枚数設定となります。設定枚数より取引所の気配枚数が低い場合、CQGはPayups(元注文の指値をスリッページ設定の価格に訂正)かトレイリング注文を行います。  
**DOM Volume relative to order size** : ボックスには枚数比率を入力します。  
**DOM ratio between best bid/ask** : 枚数の比率を設定します。取引所での気配枚数の比率が指定の数値を下回った場合、Payupsにて設定された注文が行なわれます。