

トレードの価格制限機能拡充による変更点

<リスクパラメーターページ>

アカウント情報→リスクパラメーターページに“トレードの価格制限 (%)”を追加しました。

<旧>

リスクパラメーター 対象 |

1回のトレードの上限

これらのチェックは、アカウントの残高、ポジション、または未処理注文に関係なく、その

適用	名前	パラメーター
<input checked="" type="checkbox"/>	トレードサイズ上限	100
<input type="checkbox"/>	トレード証拠金上限	0.00
<input type="checkbox"/>	トレードの価格制限	Enforce for: パッシブ + アグレッシブ、LMT + STP 0 チェック



<新>

リスクパラメーター 対象 **SIMCentr11 (PSCentr11)**

<input type="checkbox"/>	トレードの価格制限(チェック)	Enforce for: パッシブ + アグレッシブ、LMT + STP <input type="radio"/> チェック <input type="radio"/> 無制限 <input checked="" type="radio"/> FCM デフォルト値 (50)
<input checked="" type="checkbox"/>	トレードの価格制限 (%)	Enforce for: パッシブ + アグレッシブ、LMT + STP <input checked="" type="radio"/> 0.0100 (0.01 = 1%) <input type="radio"/> 無制限 <input type="radio"/> FCM デフォルト値 (60)

ここでの設定値は全商品に適用されるデフォルト値です。マーケットリミットページにて取引所別、商品別での設定値変更が可能です。

パーセントでの設定方法につき、例えば、上図のとおりモードを‘パッシブ+アグレッシブ、LMT+STP’とし、設定値を1% (0.01) とした場合、ベストビッドが100円の場合は「102円以上の売り指値注文」および「98円以下の売り指値注文もしくは売り逆指値注文」はリジェクトされます。

また、FCMs→ミニマム FCM リスクパラメーターページおよびデフォルト アカウント リスクパラメーターページにもトレードの価格制限 (%) が追加されました。

<マーケットリミットページ>

アカウント情報→マーケットリミットページの設定画面が以下のとおり変更となりました。

<旧>

マーケットリミット

クイック検索... ノンデフォルトのみ 取引が許可されている商品のみ

代替可能商品	取引が許可されている	商品ポジション上限	銘柄ポジション上限	限月ポジション上限	トレードサイズ上限	トレードの価格制限	証拠金乗数
全ての商品	<input type="checkbox"/>	無制限	無制限	無制限	100	無制限	1,000
全ての米国商品	<input type="checkbox"/>	デフォルト	デフォルト	デフォルト	デフォルト	デフォルト	デフォルト
全ての米国以外の商品	<input type="checkbox"/>	デフォルト	デフォルト	デフォルト	デフォルト	デフォルト	デフォルト
+ TOCOM	<input checked="" type="checkbox"/>	デフォルト	デフォルト	デフォルト	デフォルト	デフォルト	デフォルト



<新>

SIMCentr11 (PSCentr11)のマーケットリミット

クイック検索... ノンデフォルトのみ 取引が許可されている商品のみ

① 全ての商品

全ての米国商品

全ての米国以外の商品

APEX

Borsa Istanbul Exchange

Brazil/Globex

BTEC UST

Bursa Malaysia/Globex

CBOT/Globex

CFE

Citadel

CME/Globex

COMEX/Globex

DGX

Direct FX

② 全ての商品

- UUX UX Index -- RTU
- TSL Silver -- TOCOM
- TRU Rubber RSS3 -- TOCOM
- TPM Mini Platinum -- TOCOM
- TPL Platinum -- TOCOM
- TPA Palladium -- TOCOM
- TMG Mini Gold -- TOCOM
- TLKE Lorry Kerosene -- TOCOM
- TLGO Lorry Gas Oil -- TOCOM
- TLGA Lorry Gasoline -- TOCOM

③ 全ての商品のマーケットリミット

パラメーター トレードの価格制限(チェック) トレードの価格制限(%)

設定	値
商品ポジション上限	無制限
銘柄ポジション上限	無制限
限月ポジション上限	無制限
トレードサイズ上限	無制限
証拠金乗数	1,000

パラ④ トレードの価格制限(チェック) トレードの価格制限(%)

現在の市場価格(リスクパラメーターベースのトレードの価格制限参照)

	設定値
デフォルト	⑤ デフォルト (50)
立会い中	
ビットアスク	⑥ 5
直近値	⑦ 7
始値	⑧ 10
前日清算値	⑨ 12
板合わせ	
ビットアスク	⑥ 5
均衡価格	⑦ 7
前日清算値	⑨ 12

① 全ての商品、全ての米国商品、全ての米国以外の商品および取引所単位で取引許可を設定する場合はここにチェックを入れてください。

② 商品ごとに個別の取引許可を設定する場合はここにチェックを入れてください。米国商品は青色に、米国以外の商品は緑色にハイライトされます。

③ パラメータータブ

商品ポジション、銘柄ポジション、限月ポジション、トレードサイズ上限および証拠金乗数の設定はここで行ってください。上図のとおり全ての商品を選択した上でこの設定を行うと、設定値が全商品に適用されます。商品ごとに個別の設定を行う場合は対象商品を選択し行ってください。

④ 取引の価格制限タブ

価格制限における“現在の市場価格”は、ベストビッド/アスクが最優先で適用され、市場にビッド/アスクがない場合には直近値→始値→前日清算値の順で適用される定義となっています。旧 CAST は全ての値段に対し単一の値のみの設定となっていました。新 CAST はそれぞれの値段に別々の値を設定することができます。しかしながら、ビッド/アスク→直近値→始値→前日清算値の順で適用される定義には変わりがないため、必然的に優先順位の高い値段により小さい値を設定し且つ全ての値段に何らかの値を設定する必要があります。例えば、下表例 1 のようにビッド/アスクを無制限に、直近値、始値、前日清算値を 5 ティックに設定した場合、市場にビッド/アスクがある限り価格制限は無制限となり、実質価格制限によるリミット設定はなされていないことになります。

	ビッド/アスク	直近値	始値	前日清算値	結果
例 1	無制限	5	5	5	市場にビッド/アスクがある限りビッド/アスクの無制限が有効となる。
例 2	5	無制限	無制限	無制限	市場にビッド/アスクがある限りビッド/アスクの 5 ティックが有効となる。
例 3	5	7	10	12	5→7→10→12 の順で有効になる。

また、立会い中と板合わせで別々の値段設定が可能です。

設定値につき、FCM デフォルト値を設定し複数のアカウントに対し共通の値を適用させることもできます。詳細情報をご希望の場合は弊社にご連絡ください。

なお、今回の変更による Reporting Tool への影響はございません。