

「盈透– 外掛程式套件」安裝說明

連接IB Gateway版本

請您先瞭解以下訊息

- 1.此說明因為有一定技術含量(socket , IP , Port...等[若看不懂需請您自行google])，使用前請務必詳閱。
- 2.因為IB的Gateway並不是下單大師開發的。若您在使用或設定Gateway途中發生錯誤，或是您不瞭解，看不懂，或是Gateway盤中斷線.....等。需請用戶自行上網爬文解決，或詢問盈透。因為客服量頗大，因此下單大師無法做Gateway線上教學及諮詢服務
3. IB Gateway就是沒有介面的TWS，只接受程式的方式呼叫使用，無法直接使用IB Gateway 的介面下單。

盈透客服（提供電話，線上聊天，e-mail.....等）

<https://www.interactivebrokers.com.hk/cn/index.php?f=customerService&p=contact>

「盈透- 外掛程式套件」安裝說明

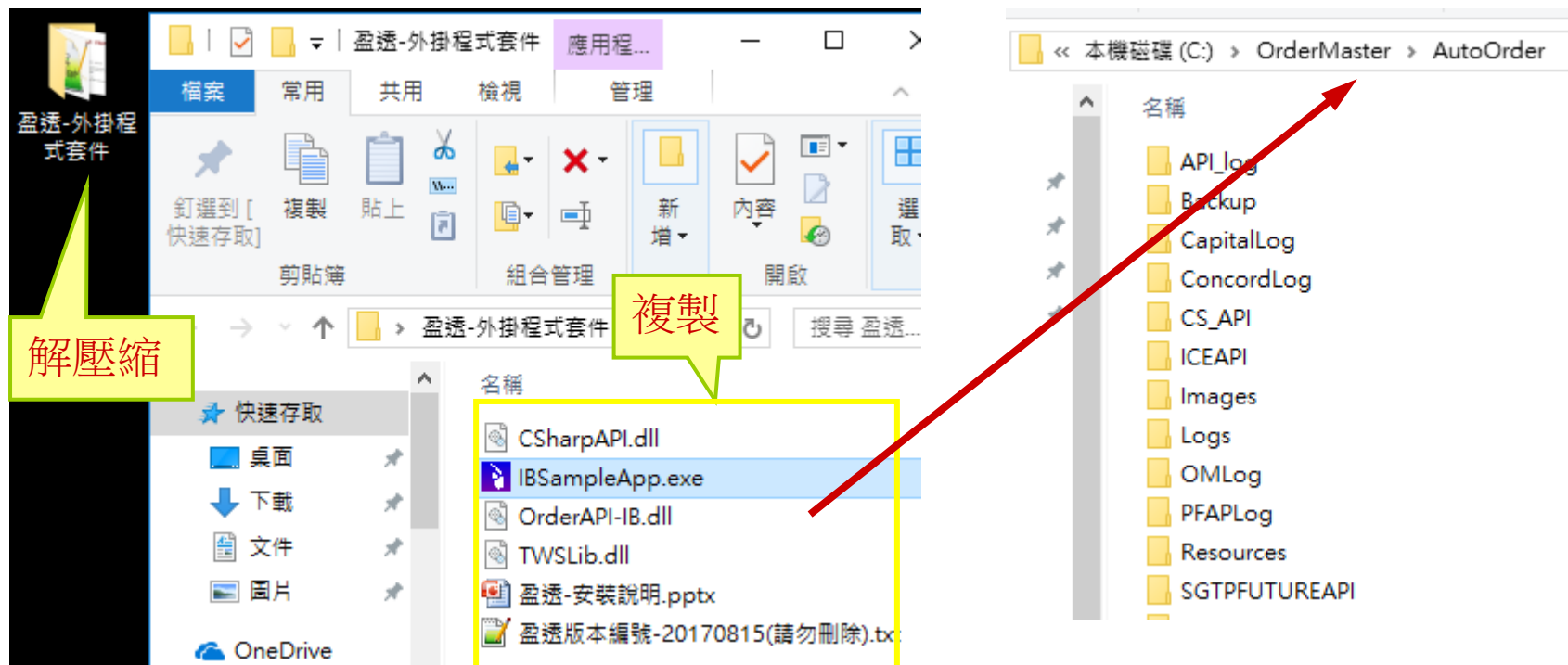
- 1.盈透 API 是通用元件，每個人用的元件都一樣。
- 2.開啟下單大師前必需先開啟**IB Gateway**
- 下載**IB Gateway**
<https://www.interactivebrokers.com/en/index.php?f=5041>
- 3.無法登入或下單，請用「IBSampleApp.exe」測看看。
- 4.目前能交易國外期貨，不能交易國外選擇權，也不能交易台指相關商品
- 5.要使用IB API交易，不需向IB申請，只需要到開啟**Gateway**即可(詳情請參考本文件 六.執行 **IB Gateway**)
- 6.每個下單大師只能對應一套**Gateway**，若要對應多個**Gateway**，需開啟多個下單大師，並設定不同的port。
- 7. 可開啟多個下單大師連線同一個**Gateway**。下單大師也可以和MC下單機同時連接**Gateway**，只需將client id欄位輸入不同的數字即可。
- 當沖保證金減半，是由IB端控制。並非由程式電文判斷。

注意：本外掛程式套件已包含官方的 API 元件，無需另外去IB 下載安裝任何API程式。

一、安裝「盈透-外掛程式套件」

- 將本套件解壓縮後，選取資料夾裡面所有檔案，複製到下單大師安裝目錄下。

請注意：若使用「一鍵搞定」功能安裝，請跳過此步驟。



二、開啟下單大師之「帳戶管理」

盈透外掛程式套件，**安裝成功**，就會出現盈透選項

只允許一個帳號，不能新增其他帳號。若要下單到多個**Gateway**，需開啟多個下單大師

若**Gateway**與下單大師同一台，可輸入**127.0.0.1** 或是 本機IP
* 請注意若是**DHCP**浮動IP，每次重開機IP可能會不同，請設定固定IP

API 下單帳號設定

帳號: 盈透

API	分公司	帳號	主登入
盈透	127.0.0.1		<input type="checkbox"/>
統一	8000		<input type="checkbox"/>
統一外期	8000		<input checked="" type="checkbox"/>
永豐	F002000		<input checked="" type="checkbox"/>
群益	F020000		<input type="checkbox"/>
群益	F020000		<input type="checkbox"/>
大昌	F039000		<input type="checkbox"/>
元大	P00		<input checked="" type="checkbox"/>

刪除 存檔

☐ 主帳號 (登入) ☒ 子帳號 (群組帳號)

IP: 127.0.0.1 PORT: 7496

Client ID: 1 憑證密碼:

憑證位置

請輸入帳號(例: **U8873968**)，按新增(帳號要輸入正確)

要按存檔才算數

若同一台機器要開多個**Gateway**搭配下單大師，因IP相同，需藉由不同的**port**來達成
* 請注意有些**port** 如 **443, 80, 21** ...是特定用途的**port**，使用會有問題，請避開。

預設為**0**，可自行修改為其他數字。若有多個下單大師要連到同一個**Gateway**需輸入不同數字

下單帳號

×

目前一套下單大師只能連到一套TWS
請刪除其中一組盈透下單帳號

檢核

確定

Gateway設定好port後，再填入下單大師的port欄位。

多個Gateway需設定多個不同的port，否則會發生錯誤

API 下單帳號設定

帳號：盈透

新增

API	分公司	帳號	登入
康和	000		<input type="checkbox"/>
(模擬)	000		<input type="checkbox"/>
國泰	000		<input checked="" type="checkbox"/>
日盛	000		<input checked="" type="checkbox"/>
盈透	127.0.0.1		<input type="checkbox"/>
統一	8000		<input type="checkbox"/>
統一外期	8000		<input checked="" type="checkbox"/>
永豐	F002000		<input checked="" type="checkbox"/>
群益	F020000		<input type="checkbox"/>

刪除

存檔

☐ 主帳號 (登入)

☒ 子帳號 (群組帳號)

IP：

127.0.0.1

PORT：

4002

Client ID：

1

憑證密碼：

憑證位置：

D0574725 Trader Workstation Configuration (Simulated Trading)

設置

訊息

應用程序界面

設定

預設

新聞設定

智能傳遞

應用程序界面 - 設定

一般

☐ 啟用DDE客戶

☐ 只讀API

☒ 連接時下載未結定單

☒ 發送投資組合時包括外匯持倉合約

☒ PrepareDailyPnL when downloading positions

☒ 以「不斷更新」標誌，發送EFP及波動盤的狀態更新。

☒ 以英文發送應用程序界面(API)訊息

通訊端埠

4002

☒ 使用外匯數據自動計算

☒ 建立API信息日誌文檔

☐ 在API記錄檔中包含市場數據

☒ Expose entire trading schedule to API

用戶設置的級別

Error

主要應用程序界面(API)客戶的辨認號碼

至API的批量數據發送超時

30

秒鐘

組成交易所分隔符

☒ 顯示 1/10基點的外匯數據

☒ 允許以 1/10的基點進行外匯交易

定息產品定價

☒ 顯示淨價 (包括交易所費用) ☐ 顯示初始價格 (不包括交易所費)

本地計算的指數價格

☐ 選擇本地指數價格

股票設定範例

- 請由IB的Contract & Securities Search網頁搜尋想要下單的股票代號及交易所
- https://pennies.interactivebrokers.com/cstools/contract_info/v3.9/index.php

The screenshot shows the InteractiveBrokers Contract & Securities Search interface. The 'Simple' tab is selected. A search bar contains 'apple'. The search results show 'Apple Inc (AAPL@NASDAQ)' as the top result. A table of results is displayed below, with the first row highlighted. Annotations in red text and boxes indicate the steps: 1. 輸入關鍵字 (Enter keyword), 2. 找到正確的股票 (Find the correct stock), 3. 點選 Stock (Click Stock), and 4. 找到正確的 Symbol 及 Exchange (Find the correct Symbol and Exchange).

1. 輸入關鍵字

2. 找到正確的股票

3. 點選 Stock

4. 找到正確的 Symbol 及 Exchange

Description/Name	Type	Symbol	Exchange	Stock Type	ClsPrc	Currency
Details APPLE INC	Stock	AAPL	EBS	Common	172.32	CHF
Details APPLE INC	Stock	AAPLUSD	EBS	Common	171.00	USD
Details APPLE INC	Stock	APC	IBIS	Common	151.59	EUR
Details APPLE INC	Stock	AAPL	MEXI	Common	3,303.9	MXN
Details APPLE INC	Stock	AAPL	NASDAQ	Common	170.18	USD

美股IBM範例



International Business Machines Corp (IBM@NYSE)		Contract for Difference (CFD)(1), Futures(13), Option(860), Stock(4), Warrants(1857), Structured Product(1422)					
	Description/Name	Type	Symbol	Exchange	Stock Type	ClsPrs	Currency
Details	INTL BUSINESS MACHINES CORP	Stock	IBMUSD	EBS	Common	134.89	USD
Details	INTL BUSINESS MACHINES CORP	Stock	IBM	IBIS	Common	121.28	EUR
Details	INTL BUSINESS MACHINES CORP	Stock	IBM	MEXI	Common	2,663.2	MXN
Details	INTL BUSINESS MACHINES CORP	Stock	IBM	NYSE	Common	137.52	USD

下單商品: ☐ 期貨 ☐ 選擇權 ☒ 股票 ☐ 國外期貨 ☐ 訊號決定

商品名稱: INTL BUSINESS MA 交易所代號: NYSE

商品代號: IBM 展約價格: 0

跳動單位: 1

☐ 買權 ☐ 賣權

轉合下單開區 帳戶總倉位

☐ 每次下單最大口數為 10

☐ 帳戶總倉位最大口數 25

(請注意：免費版與標準版會自動限制)

☐ 帳戶總交易次數限制 50 次

API						
無標題	xAPI	等待處理中 (全部)				
金融產品	買價尺寸	買價	賣價	賣價尺寸	最後價	更改
	行動	數量	有效期	種類	限價	目的地
IBM @NYSE	7	• 136.89	136.93 •	4	• 136.91	-0.61
	買	0 DAY	MKT	MARKET	NYSE	

美股AAPL範例

InteractiveBrokers Contract Search

Apple Inc (AAPL@NASDAQ)

Contract for Difference (CFD)(1),
Futures(13), Option(1456), Stock(5),
Warrants(7241), Structured Product(4711)

Description/Name	Type	Symbol	Exchange	Stock Type	ClsPrc	Currency
Details APPLE INC	Stock	AAPL	EBS	Common	172.32	CHF
Details APPLE INC	Stock	AAPLUSD	EBS	Common	171.00	USD
Details APPLE INC	Stock	APC	IBIS	Common	151.59	EUR
Details APPLE INC	Stock	AAPL	MEXI	Common	3,303.9	MXN
Details APPLE INC	Stock	AAPL	NASDAQ	Common	170.18	USD

下單商品：☐期貨 ☐選擇權 ☒股票 ☐國外期貨 ☐訊號決定

商品名稱：APPLE INC 交易所代號：NASDAQ

商品代號：AAPL 展約價格：0

跳動單位：1

股票類別：現股 ☒上市股票

轉倉下單間隔：5 秒 帳戶總倉位：1

☐每次下單最大口數為 10

☐帳戶總倉位最大口數 25

☐帳戶總交易次數限制 50 次

此範例雖然查出來的Exchange為NASDAQ，但是若輸入NASDAQ交易會發生以下錯誤

盈透 下單失敗,帳號 DU574725 - 盈透 下單失敗,帳號 DU574725

2019/02/14 22:57:05
ID:224 200No security definition has been found for the request

下午 10:57

下單商品：☐期貨 ☐選擇權 ☒股票 ☐國外期貨 ☐訊號決定

商品名稱：APPLE INC 交易所代號：ISLAND

商品代號：AAPL 展約價格：0

跳動單位：1

☒買權 ☐賣權

依照IB API的規則(In the API side, NASDAQ is always defined as ISLAND in the exchange field) 若查出來的Exchange為NASDAQ 請一律改為ISLAND

日股SHARP範例

InteractiveBrokers Contract Securities Search

Sharp Corp-Japan (6753@TSEJ) Contract for Difference (CFD)(1), Option(96), Stock(3)

	Description/Name	Type	Symbol	Exchange	Stock Type	ClsPrc	Currency
Details	SHARP CORP	Stock	SRP	FWB2	Common	10.09	EUR
Details	SHARP CORP	Stock	6753	TSEJ	Common	1,278.0	JPY
Details	SHARP CORP UNSPONSORED ADR	Stock	SHACAY	PINK	American Depositary Receipt (ADR)	2.835	USD

下單商品: ☐ 期貨 ☐ 選擇權 ☒ 股票 ☐ 國外期貨 ☐ 訊號決定

商品名稱: SHARP CORP 交易所代號: TSEJ

商品代號: 6753 展約價格: 0

跳動單位: 1 ☒ 買權 ☐ 賣權

股票類別: 現股 ☒ 上市股票 轉倉下單間隔: 5 秒

帳戶總倉位: 0

☐ 每次下單最大口數為 10

☐ 帳戶總倉位最大口數 25

(請注意: 免費版與標準版會自動限制)

☐ 帳戶總交易次數限制 50 次

API						
無標題		xAPI		等待處理中 (全部)		
金融產品		買價尺寸	買價	賣價	賣價尺寸	最後價
		行動	數量	有效期	種類	限價
6753 TSEJ @TSEJ		100	1016	1490	100	
		買	100 DAY	MKT	MARKET	TSEJ

港股XIAOMI小米範例



Contract &
Securities Search

Xiaomi Corp (1810@SEHK)		Contract for Difference (CFD)(1), Futures(5), Option(462), Stock(3), Warrants(283), Structured Product(62)					
	Description/Name	Type	Symbol	Exchange	Stock Type	ClsPrc	Currency
Details	XIAOMI CORP - UNSP ADR	Stock	XIACY	PINK	American Depository Receipt (ADR)	7.23	USD
Details	XIAOMI CORP-CLASS B	Stock	1810	SEHK	Common	11.38	HKD
Details	XIAOMI CORP-CLASS B	Stock	BCP	SWB	Common	1.300	EUR

下單商品： ☐ 期貨 ☐ 選擇權 ☒ 股票 ☐ 國外期貨 ☐ 訊號決定

商品名稱： XIAOMI CORP 交易所代號： SEHK

商品代號： 1810 履約價格： 0

跳動單位： 1 ☐ 買權 ☐ 賣權

轉倉下單間隔 帳戶總倉位

☐ 每次下單最大口數為 10

☐ 帳戶總倉位最大口數 25

(請注意：免費版與標準版會自動限制)

☐ 帳戶總交易次數限制 50 次

API						
無標題	XAPI	等待處理中 (全部)				
金融產品	買價尺寸	買價	賣價	賣價尺寸	最後價	更改
行動	數量	有效期	種類	限價	目的地	
1810 SEHK					• 11.52	0.00
買	200 DAY	MKT	MARKET	SEHK		

由訊號決定(股票)

國外股票: SymName, SymID, StockType, IsMarketStock#DateTime, Current, Price
名稱 代號 A: 現股 Y: 上市

SymID格式為Exchange_Symbol 例: NYSE_WMT

StockType一律放A

IsMarketStock一律放Y

範例如右



Walmart Inc (WMT@NYSE)							Contract for Difference (CFD)(1), Futures(13), Option(774), Stock(4), Warrants(783), Structured Product(582)	
	Description/Name	Type	Symbol	Exchange	Stock Type	ClsPrc	Currency	
Details	WALMART INC	Stock	WMTUSD	EBS	Common	96.38	USD	
Details	WALMART INC	Stock	WMT	IBIS	Common	86.46	EUR	
Details	WALMART INC	Stock	WMT	MEXI	Common	1,904.0	MXN	
Details	WALMART INC	Stock	WMT	NYSE	Common	97.94	USD	

訊號決定股票.t 記事本
檔案(F) 編輯(E) 格式(O) 檢視(V) 說明(H)
WALMART INC,NYSE_WMT,A,Y#2019/2/14 16:08:00,10,98

API						
無標題 X API 等待處理中 (全部) +						
金融產品	買價尺寸	買價	賣價	賣價尺寸	最後價	更
行動	數量	有效期	種類	限價	目前	
WMT @NYSE	9	• 98.71	98.72 •	13	• 98.71	
買	0	DAY	MKT	MARKET	NYSE	

中間補上底線

由訊號決定(股票)

相關詳細設定請參考下單
大師使用手冊

下單帳號：盈透-DU574725 ☐ 當沖-保證金減半 ☒ 股票

下單商品：☐ 期貨 ☐ 選擇權 ☐ 股票 ☐ 國外期貨 ☒ 訊號決定

商品名稱：股票 交易所代號：
商品代號：
跳動單位：1 買權 賣權
股票類別：現股 ☒ 上市股票
轉倉下單間隔：5 秒 帳戶總倉位：0

【專業版】下單大師 v2.5.3014-(停止下單)

主畫面 送單紀錄 帳戶管理 策略管理 使用策略 公告設定

策略設定 更名 策略名稱：股票訊號 新增

策略名稱	單邊	當沖	倉位	訊號來源	訊號格式
印鈔機2		<input type="checkbox"/>	0	R:\印鈔機2.txt	Date Time,Current,Price
印鈔機3		<input type="checkbox"/>	0	R:\印鈔機3.txt	Date Time,Current,Price
股票訊號		<input type="checkbox"/>	0	R:\訊號決定股票.txt	SymName,SymID,StockType,IsMarketStock
期貨訊號		<input type="checkbox"/>	0	C:\Users\STEVE\Desktop\訊號決定期貨.txt	SymName,SymID,Month,NewClose#Date
萬用API		<input type="checkbox"/>	0	訊號識別碼：FTX	SymName,SymID,Month,StrPrice,CallPut
選擇權訊號		<input type="checkbox"/>	0	C:\Users\STEVE\Desktop\訊號決定選擇權.txt	SymName,SymID,Month,StrPrice,CallPut

策略種類：HTS ☐ 連續下單模式 目前倉位：0 同步 多空都做 刪除

當沖策略：☐ 於 13 40 30 換倉日增加 -15 分鐘 全部同步 全部歸0 手動下單

訊號來源：到此時間時，若有倉位將自動平倉並且不再進場

☒ 文字檔：訊號決定股票.txt RA 格式：☐ 印鈔機1 ☐ 印鈔機2 ☐ 自訂
☐ 萬用API：識別碼 ☒ 股票 ☐ 期貨 ☐ 選擇權 ☐ 國外期貨
☐ TS 2000i：Symbol ☒ 總倉位下單(建議) ☒ 總倉位下單(避免加碼單) SymName,SymID,StockType,IsMarketStock

Strategy 倉位變動等待時間 0.30 秒 每隔 0.050 秒偵測，每秒 20 次
資料夾 小數位數 0 每隔 0.0 分鐘價格未跳動異常通知
☐ 手動下單 ☐ 遠端訊號：Port 16888 音效 預設

可設定同時下單多個期貨與多個股票

帳戶設定：API 下單帳號與商品的配對組合

更名 帳戶名稱：IBTSEJ8030 新增

帳戶名稱	下單帳號	商品	月份	交易所	履約價	買賣權	當沖	總倉位
IB1SEHK8030	盈透-DU574725	FLYINGFINANCIALSERVICEHOL	2019/02	SEHK			<input type="checkbox"/>	0
IBTSEJ8030	盈透-DU574725	CHUOGYORUICOLT	2019/02	TSEJ			<input type="checkbox"/>	0
IBSEHK543	盈透-DU574725	PACIFCONLINE	2019/02	SEHK			<input type="checkbox"/>	0
IBSGX543	盈透-DU574725	NOELGIFTSINTERNATIONALL...	2019/02	SGX			<input type="checkbox"/>	0
IBStockBySign	盈透-DU574725	WALMART INC					<input type="checkbox"/>	1
IBSGXSTW	盈透-DU574725	MSCI:Taiwan	2019/02	SGX			<input type="checkbox"/>	0
IBHKMHI	盈透-DU574725	MiniHangSeng	2019/02	HKFE			<input type="checkbox"/>	0
IBOSEN225	盈透-DU574725	FTSE100	2019/02	ICEEU			<input type="checkbox"/>	0
IBIBM	盈透-DU574725	XIAOMI CORP	2019/02	SEHK			<input type="checkbox"/>	0

全部清倉 登入測試 實單測試 刪除 存檔

下單帳號：盈透-DU574725 ☐ 當沖-保證金減半

下單商品：☐ 期貨 ☐ 選擇權 ☒ 股票 ☐ 國外期貨 ☐ 訊號決定

商品名稱：CHUOGYORUICOL' 交易所代號：TSEJ

商品代號：8030 履約價格：0

跳動單位：1 ☐ 買權 ☐ 賣權

股票類別：現股 ☒ 上市股票 轉倉下單間隔 5 秒 帳戶總倉位 0

下單次數口數限制 換倉日 自動轉倉

(這裡是以帳戶為單位設定)

☐ 每次下單最大口數為 10

☐ 帳戶總倉位最大口數 25

(請注意：免費版與標準版會自動限制)

☐ 帳戶總交易次數限制 50 次

三、Log 檔位置

- Log 檔的位置在：安裝目錄下的「IBLog」資料夾，如：
「C:\OrderMaster\AutoOrder\IBLog」
- 此Log是下單大師記錄
- 另一個Log檔是IB記錄，位置在C:\Jts\
- 請注意：當下單大師送單完畢之後發生的問題(例如委託單沒有送到 Server、或是委託單較慢收到)，要查此 Log 才能找到原因。

IB Gateway與下單大師的架構

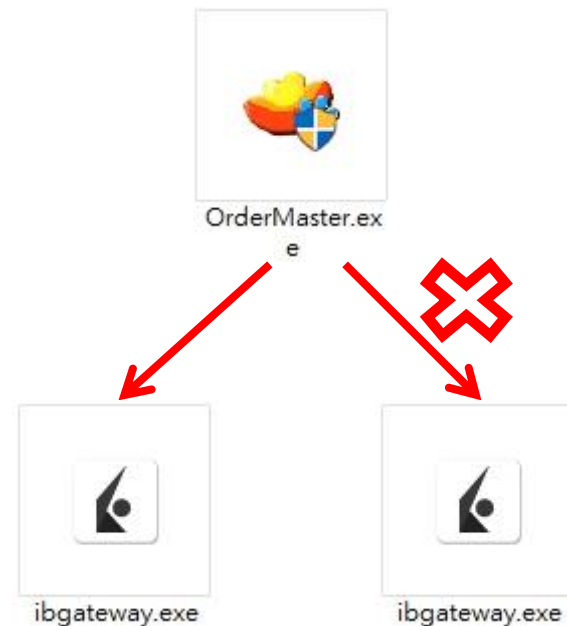


Clientid 1 Clientid 2 Clientid 3

可開啟多個下單大師連線同一個IBG。
下單大師也可以和MC下單機同時連接IBG，只需將client ID欄位輸入不同的數字即可。

The screenshot shows the configuration window for OrderMaster.ex. It has two tabs: '主帳號 (登入)' (Main Account (Login)) and '子帳號 (群組帳號)' (Sub-account (Group Account)). The '子帳號 (群組帳號)' tab is selected. The fields are as follows:

Field	Value
IP :	127.0.0.1
PORT :	7496
Client ID :	1
憑證密碼 :	
憑證位置 :	



每個下單大師只能對應一個IBG，若要對應多個IBG，需開啟多個下單大師，並設定不同的port。

使用盈透API前,最好先使用模擬帳戶
先行試驗.確定沒問題後.再使用真實
帳戶做交易

申請IB模擬帳戶(如右圖)
[請看美股隊長教學文](#)

The sequence of screenshots illustrates the process of opening a Paper Trading Account on the Interactive Brokers website:

- Step 1:** The user is on the Interactive Brokers homepage. In the top navigation bar, the 'Account Management' link is highlighted with a blue arrow.
- Step 2:** The 'Account Management' page is shown. In the left sidebar, the 'Settings' link is highlighted with a blue arrow.
- Step 3:** The 'Paper Trading' section is displayed. The 'Continue' button is highlighted with a blue arrow.
- Step 4:** The 'Paper Trading' account creation form is shown. The 'Continue' button is highlighted with a blue arrow.
- Step 5:** The 'Paper Trading' confirmation page is shown. The 'Continue' button is highlighted with a blue arrow.

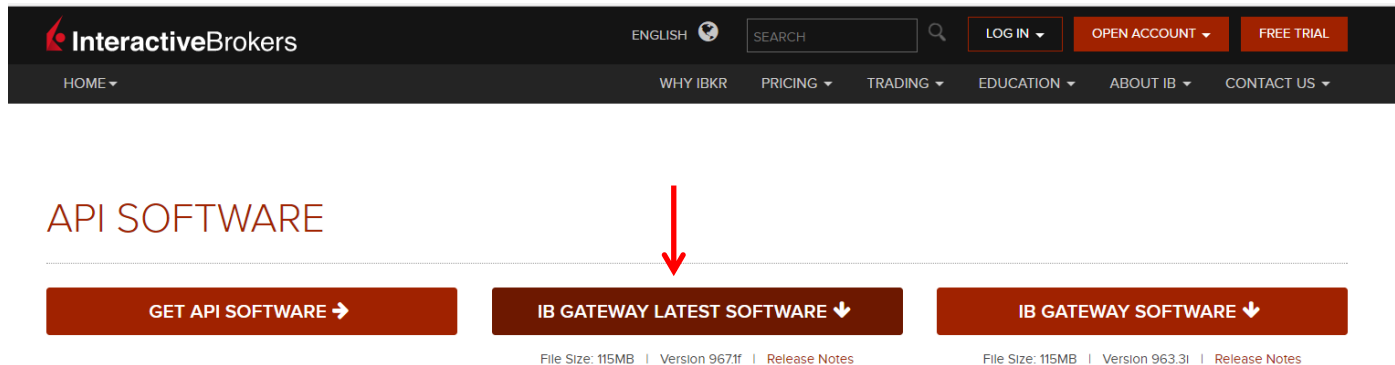
The final screenshot shows the 'SIMULATED TRADING' interface, indicating that the Paper Trading Account has been successfully opened.

四、下載IB Gateway

請到以下網址下載

此文件使用Version 967.1f

<https://www.interactivebrokers.com/en/index.php?f=5041>



The screenshot shows the Interactive Brokers website header with the logo, language selector (English), search bar, and navigation links (Home, Why IBKR, Pricing, Trading, Education, About IB, Contact Us). Below the header, the 'API SOFTWARE' section is displayed. It contains three buttons: 'GET API SOFTWARE', 'IB GATEWAY LATEST SOFTWARE', and 'IB GATEWAY SOFTWARE'. A red arrow points to the 'IB GATEWAY LATEST SOFTWARE' button. Below the buttons, the file size (115MB) and version (967.1f) are listed for the latest software, along with a link to the release notes.

InteractiveBrokers

ENGLISH

SEARCH

LOG IN

OPEN ACCOUNT

FREE TRIAL

HOME

WHY IBKR

PRICING

TRADING

EDUCATION

ABOUT IB

CONTACT US

API SOFTWARE

GET API SOFTWARE

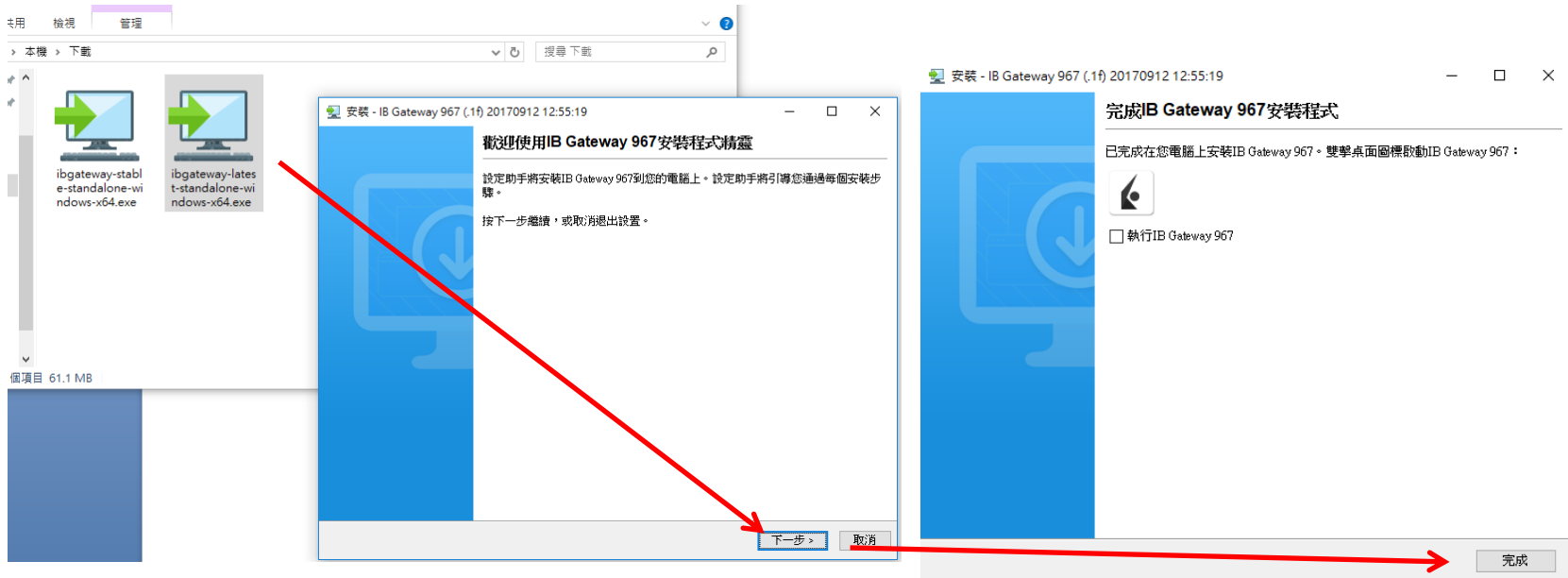
IB GATEWAY LATEST SOFTWARE

IB GATEWAY SOFTWARE

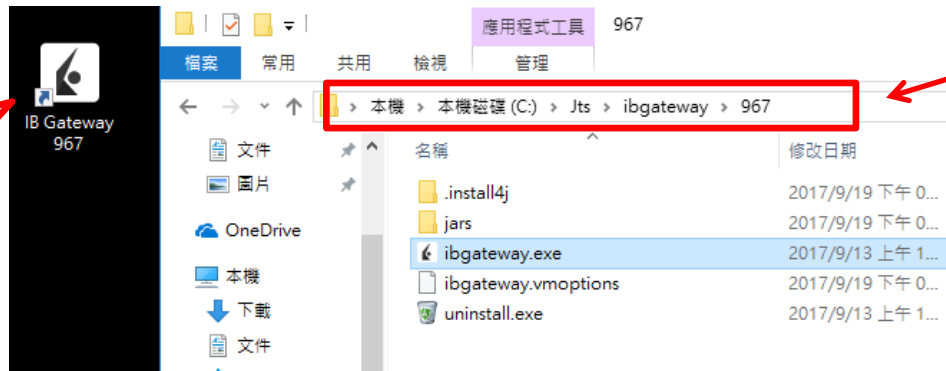
File Size: 115MB | Version 967.1f | Release Notes

File Size: 115MB | Version 963.3i | Release Notes

五、安裝IB Gateway



桌面捷徑

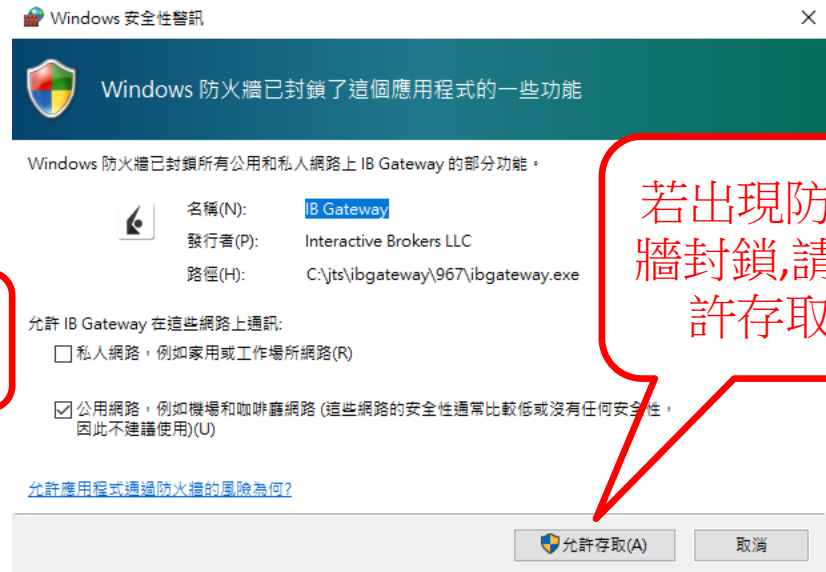


六、執行IB Gateway



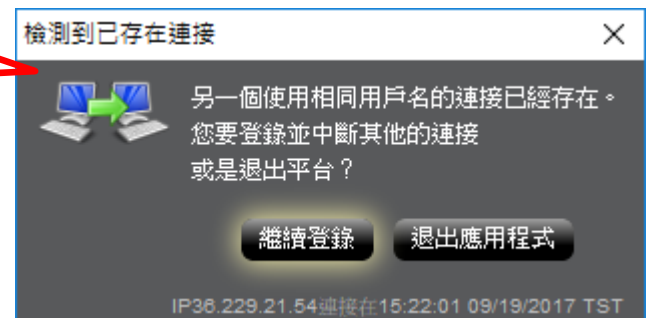
請選應用
界面

特別注意交易模式,若你在下單大師設定測試帳號,但是這裡選擇“實時交易”,則還是會下到正式環境去

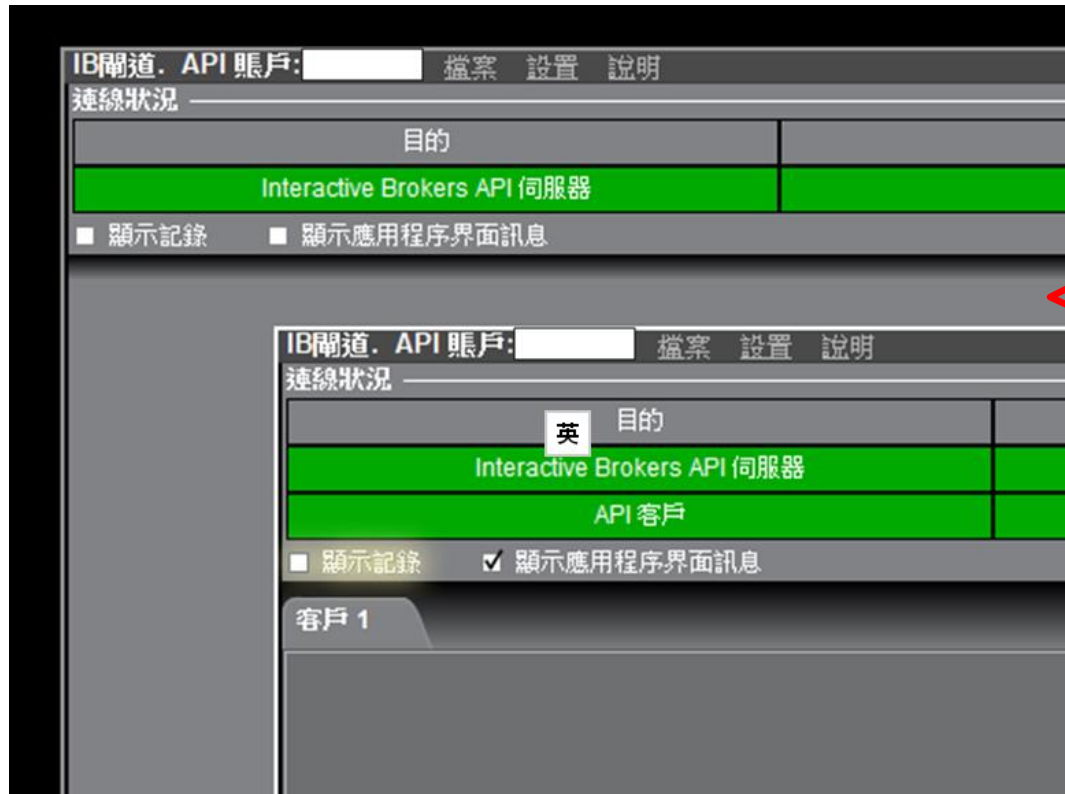


若出現防火
牆封鎖,請允
許存取

不能與TWS
同時登入，
就算不同電
腦也一樣



六、執行IB Gateway



同一台電腦可開多個
Gateway，搭配多個
下單大師可管理多個
帳號，但請注意把
port區分開

七、設定IB Gateway



七、設定IB Gateway

DU574725 Trader Workstation Configuration (Simulated Trading)

設置

- 訊息
- 应用程序界面
 - 設定
 - 預防
 - 新聞設定
- 預設
- 智能傳遞

应用程序界面 - 設定

- ☒ 使用負數來捆綁自動訂單
- ☒ 建立API信息日誌文檔
- ☐ 在API記錄檔中包含市場數據
- ☒ Expose entire trading schedule to API
- 用戶設置的級別: Error
- 主要应用程序界面(API)客戶的辨認號碼:
- 至API的批量數據發送超時: 30 秒鐘
- 組成交易所分隔符:
- ☒ 顯示1/10基點的外匯數據
- ☒ 允許以1/10的基點進行外匯交易

定息產品定價

☐ 顯示淨價 (包括交易所費用) ☐ 顯示初始價格 (不包括交易所費用)

本地/計算的指數價格

☐ 選擇本地指數價格

訂單

☐ 將所附對沖訂單的訂單參考名設置為與母單一致

期權行權請求: 截止時間之前可編輯 (因清算機構而異)

重新設定应用程序界面訂單鑑別次序

☒ 僅允許本地主機作出的連接

信任入侵防護系統

127.0.0.1

建立

七、設定IB Gateway

☒ 以英文發送應用程式界面(API)訊息

~~需勾選,否則會回傳亂碼~~
可不勾選,下單大師會顯示正確中英文



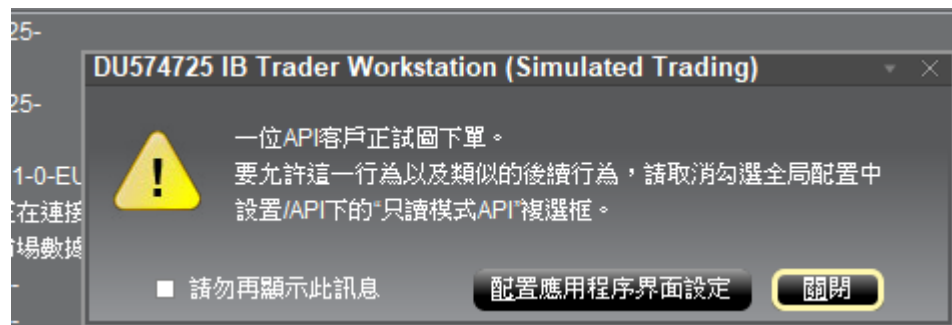
```
Request-1, Code: 2104 - 亂碼
Request-1, Code: 2104 - 亂碼
Request-1, Code: 2104 - 亂碼
Request-1, Code: 2104 - 亂碼
Request-1, Code: 2104 - 亂碼
```



```
Request-1, Code: 2104 - Market data farm connection is OK.cashfarm
Request-1, Code: 2104 - Market data farm connection is OK.cashfarm
Request-1, Code: 2104 - Market data farm connection is OK.cashfarm
```

☐ 只讀API

需清除,否則無法交易



七、設定IB Gateway



建議TWS與下單大師同一台電腦，並勾選。若不勾選，需在下面建立可連線的IP，否則會發生錯誤

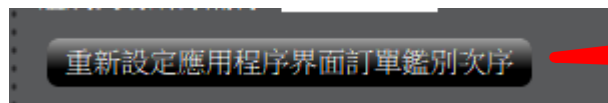


若不勾選的話，就算本地端IP也需建立資料

```
Request -1, Code: -1 - Error: System.IO.EndOfStreamException: 無法讀取資料流末端之外。  
於 System.IO.BinaryReader.ReadByte()  
於 IBApi.EReader.ReadString()  
於 IBApi.EReader.ReadInt()  
於 IBApi.EClientSocket.Connect(String host, Int32 port, Int32 clientId, Boolean extraAuth)
```



建議每隔幾天非交易時段（先將下單大師關閉）人工去執行一次。請勿於交易時去執行，可能導致錯誤。



八、IB相關網站說明

客戶服務

<https://www.interactivebrokers.com.hk/cn/index.php?f=2440>

官網

<https://www.interactivebrokers.com.hk/cn/home.php>

TWS下載

<https://www.interactivebrokers.com.hk/cn/index.php?f=14490#twswsoftware>

IB Gateway下載

<https://www.interactivebrokers.com/en/index.php?f=5041>

IB Contract Information Center

https://pennies.interactivebrokers.com/cstools/contract_info/v3.9/index.php

Intraday Margin Requirements(日內保證金[當沖保證金]用法)

<https://www.interactivebrokers.com.hk/cn/index.php?f=marginnew&p=fut1>

API錯誤代碼說明

https://interactivebrokers.github.io/tws-api/message_codes.html#gsc.tab=0

API Reference Guide

<http://interactivebrokers.github.io/tws-api/#gsc.tab=0>

九、附註

恆生期貨交易所(HKFE)，在夜盤時段需勾選於正常交易時段以外成交，才會即時掛單成交，否則會變成早盤預約單，並發出警告訊息(Warning: your order will not be placed at the exchange until 2019-XX-XX 09:15:00 Hongkong)。

下單大師2019/08會將HKFE的單預設勾起來。也就是說不會變成預約單，會即刻掛單。

The screenshot displays the XAPI trading platform interface. The top navigation bar includes tabs for '一般' (General), '投資組合' (Portfolio), 'xAPI', and '等待處理中 (全部)' (Waiting for processing (all)). Below this, the 'API' section is active, showing a table of orders. The table has columns for '金融產品' (Financial Product), '買價尺寸' (Buy Price/Size), '買價' (Buy Price), '賣價' (Sell Price), '賣價尺寸' (Sell Price/Size), '最後價' (Last Price), '更改' (Change), '漲跌 %' (Change %), '持倉' (Position), and '平倉' (Close). The first row shows an order for 'MHI Aug29'19 @HKFE' with a quantity of 5, a buy price of 26188, and a sell price of 26190. The 'Order Type' dropdown is open, showing options: 'DAY', 'GTC', 'IOC', and '於正常交易時段以外成交' (Trade outside normal trading hours). The '於正常交易時段以外成交' option is highlighted with a red box and a red arrow.

金融產品	買價尺寸	買價	賣價	賣價尺寸	最後價	更改	漲跌 %	持倉	平倉
行動	數量	有效期	種類	限價	傳送	狀態	交易價位	取消	一取消
MHI Aug29'19 @HKFE	5	• 26188	26190 •	3	• 26188	-26	-0.10%		
買	1	DAY	LMT	26000				取消	
		DAY							
		GTC							
		IOC							
		<input checked="" type="checkbox"/> 於正常交易時段以外成交							

十、指定IB下單帳號

創建、移動、連接或分割賬戶

U6038362

賬戶設置 / 創建、移動、連接或分割賬戶

創建、移動、連接或分割賬戶

若是有多帳戶需求
您可使用在帳戶設置處新增個人帳戶

- ☒ 創建一個新的個人、聯名或IRA賬戶，連接至我的已有賬戶并使用同一組用戶名和密碼 ?
- ☐ 創建一個新的連接賬戶，由顧問/經紀商管理 ?
- ☐ 將我的整個賬戶移至由顧問/經紀商管理的賬戶 ?
- ☐ 將我的已有賬戶連接至管理員 ?
- ☐ 將我的賬戶劃分為兩個分區，其中一個由顧問管理 ?

十、指定IB下單帳號

Your Portfolio

new Test Acct

0.00

U6038362

GET MONEY

U8873968

All Accounts

帳戶新增成功後
在IB帳戶管理主頁會看到類似左側多帳號畫面

帳號輸入錯誤下
單將會錯誤

文件 編輯 交易 賬戶 交易工具 分析工具 查看 幫助

定單 賬戶 交易記錄 新聞 基本面 在冊交易者 期權交易者 風險

一般 在TWS處可選擇下單帳號

選擇賬戶 GET MONEY

金融	全部	U8873968	買價	賣價
賬	GET MONEY		現金量	有效期
SSG Jul29	new Test Acct		• 304.75	304.85 •
MHI Jul30'			• 25942	25946 •
MCH.HK Jul30'20 ...		2	• 10675	10677 •
MNQ Sep18'20 @G...		2	• 10642.00	10642.25 •

API 下單帳號設定			
帳號：	盈透	U8873968	新增
API	分公司	帳號	主登入
盈透	127.0.0.1	U8873968	<input type="checkbox"/>
國泰	000		<input checked="" type="checkbox"/>
康和	000		<input type="checkbox"/>
康和	000		<input type="checkbox"/>
康和	000		<input type="checkbox"/>
康和	000		<input type="checkbox"/>
統一	8000		<input type="checkbox"/>

十、指定IB下單帳號

API

一般 投資組合 **xAPI** Pending (All) +

選擇帳戶 GET MONEY

金融產品	買入量	買價	賣價	賣出量	最後價	變化	變化%
帳戶	行動	數量	有效期	類型	限價	傳送	狀態
XINA50 Jul30'20 @SGX		20	16052.50	16055.00	69	16052.50	-75.00 -0.47%
GET MONEY	買	1 DAY	LMT	15000.00			

DEBUG開發【專業版】下單大師 v2.5.3055 (2020/12/31) -開始下單中 ...

主畫面 送單紀錄 帳戶管理 策略管理 使用策略 公告設定

帳號正確，下單成功

開始下單中 ... 2020/07/10 (五) 00:28:42

使用策略 (策略+帳戶): 全部清倉 全部模擬單 全部正式單 策略同步 全帳戶同步 全帳戶補單 (全部是正式單)

啟用	策略名稱	帳戶名稱	下單帳號	商品	代碼	月份	策略倉位	倍數	(實際)帳戶倉
<input checked="" type="checkbox"/>	印鈔機2	IB期貨	盈透-U8873968	FTSE:XinhuaChinaA50	XINA50	2020/07	1	1	1


重新登入 開始下單 停止下單


2020/07/10 00:27:59 【印鈔機2】
"15000" 多單進場，策略倉位 0 → 1
帳戶【IB期貨】(FTSE:XinhuaChinaA50) 帳戶倉位 0 → 1
倍數 1，本次下單 1，下單後帳戶總倉位 1
00:27:59.717 策略【印鈔機2】發現訊號，倉位 0 --> 1


若是2個帳號都要下單，需要開2個下單大師各別設定帳號


十、指定IB下單帳號


DEBUG開發【專業版】下單大師 v2.5.3055 (2020/12/31) -開始下單中 ...


主畫面

送單紀錄

帳戶管理

策略管理

使用策略

公告設定

開始下單中 ...
2020/07/10 (五) 00:32:57

使用策略 (策略+帳戶): 全部清倉 全部模擬單 全部正式單 全策略同步 全帳戶同步 全帳戶補單 (全部是正式單)

啟用	策略名稱	帳戶名稱	下單帳號	商品	代碼	月份	策略倉位	倍數	(實際)帳戶倉
<input checked="" type="checkbox"/>	印鈔機2	IB期貨	盈透-U1111111	FTSE:XinhuaChinaA50	XINA50	2020/07	1	1	1

帳號錯誤，下單失敗

帳戶 (帳號+商品):

帳戶名稱	下單帳號	商品	月份
IB期貨	盈透-U1111111	FTSE:XinhuaChinaA50	2020

策略:

策略名稱	前	訊號時間	價格	倉位	跳動	手動	查看
印鈔機2		00:32:14	15000	1	15000	下單	文字

2020/07/10 00:32:14 【印鈔機2】
"15000" 多單進場，策略倉位 0 → 1
帳戶【IB期貨】(FTSE:XinhuaChinaA50) 帳戶倉位 0 → 1
倍數 1，本次下單 1，下單後帳戶總倉位 1
00:32:14.249 策略【印鈔機2】發現訊號，倉位 0
00:32:14.545 <盈透_下單失敗> 帳號
U6038362,U8873968, ID:26 201定單被拒絕—
原因：:無效或缺IB帳戶號碼

00:32:07.550 開始下單
00:32:07.528 所有策略倉位，同步成功！
00:31:15.360 <警告/提醒> 【印鈔機2】策略倉
戶戶和訊號同步：由【1】 ~【0】

API 元件：

期貨商	登入狀態
盈透	登入成功

十一、朋友與家庭顧問帳戶

個人、聯名或IRA帳戶

開始申請

繼續完成申請

需要提供的資料

退休帳戶信息

聯繫盈透代表

其它申請

信託帳戶

朋友與家庭顧問

機構申請

註冊投資顧問

對沖基金

資金經理

自營交易集團

介紹經紀商

十一、朋友與家庭顧問帳戶



進入財務顧問設置後，可依需求建立配置文件。共有 3 種模式

十一、朋友與家庭顧問帳戶

編輯配置文件

名稱: SHARE

使用: ☐ 百分比
☐ 比率
☒ 合約/股份

分配

帳戶	Value
DU	1
DU	2
DU	3
DU	4
DU	5
DU	0

帳號: (模擬) 新增

暱稱	API	分公司	帳號
STEVE	大昌		
STEVE	大昌		
STEVE	元大	P00	
TINO	元富II	000	
STEVE	日盛	000	
STEVE	永豐	F002000	
STEVE	永豐II	F002000	
STEVE	兆豐	F030000	
STEVE	盈透	127.0.0.1	
假的	國泰	000	

☐ (特別選項) 刪除 存檔

☐ (特別選項) 暱稱: STEVE

☐ 主帳號 (登入) ☒ 子帳號 (群組帳號)

IP: 127.0.0.1 PORT: 7497

Client ID: 0 文件配置: SHARE

憑證位置:

☒ 憑證到期提醒: 2100/12/31

若是顧問帳戶，且要依照配置下單者，請將配置文件名稱輸入到此欄位中。

以下情況需放空白

1. 非顧問帳戶
2. 顧問帳號，但暫時不使用帳戶配置下單只想單帳號下單者(帳號必需輸入正確)

此欄位若變更需重新登入或重啟下單大師

十一、朋友與家庭顧問帳戶

文件設置為合約/股份

本案例設有5個帳號設置如下圖，一共15股(1+2+3+4+5)，分別為

57 => 1股

58 => 2股

59 => 3股

60 => 4股

61 => 5股

實測下單時，不管若MC倉位輸出倉位多少，或是下單大師設定為幾倍(下單電文裡的下單口數不管數字為何)，一律都是下15口

名稱: SHARE

使用: ☒ 百分比
☐ 比率
☐ 合約/股份 ?

分配

	帳戶	Value
DU	57	1
DU	58	2
DU	59	3
DU	60	4
DU	61	5

為以下時間段顯示交易: 今日

交易	概要	帳戶	行動	數量	金融產品
...		SHARE	BOT	15	XINA50 Mar30'21 @SGX
...		SHARE	BOT	15	XINA50 Mar30'21 @SGX
...		DU 561	BOT	5	XINA50 Mar30'21 @SGX
...		DU 560	BOT	4	XINA50 Mar30'21 @SGX
...		DU 559	BOT	3	XINA50 Mar30'21 @SGX
...		DU 558	BOT	2	XINA50 Mar30'21 @SGX
...		DU 557	BOT	1	XINA50 Mar30'21 @SGX

十一、朋友與家庭顧問帳戶

文件設置為百分比

本案例設有5個帳號設置如下圖，一共100%，分別為

57 => 20%

58 => 20%

59 => 20%

60 => 10%

61 => 30%

當沖-保證金減半 手動下单
下单帳號: 盈透-DU... 策略仓位: 0 ☒ 同步 (自动)
商品名稱: FTSE:XinhuaChi 下单倍数: 10 倍
交易月份: 2021/03 (實際)帳戶仓位: 0 同步 全部

假設總數下20口時，則57會分配下4口,60為2口...依此類推

實測下单時，10口的倍數會按比例下单，MC輸出的倉位或是下单大師倍數請設定為10的倍數.不然下出的口數不會按比例(結果如何請自行測試)

名稱: percent

使用: ☐ 百分比
☐ 比率
☒ 合約/股份

分配

賬戶	Value
DU 57	20.0
DU 58	20.0
DU 59	20.0
DU 60	10.0
DU 61	30.0

percent	BOT	10	XINA50	Mar30'21	@SGX
percent	BOT	10	XINA50	Mar30'21	@SGX
DU 61	BOT	3	XINA50	Mar30'21	@SGX
DU 60	BOT	1	XINA50	Mar30'21	@SGX
DU 59	BOT	2	XINA50	Mar30'21	@SGX
DU 58	BOT	2	XINA50	Mar30'21	@SGX
DU 57	BOT	2	XINA50	Mar30'21	@SGX

十一、朋友與家庭顧問帳戶

文件設置為**比率**

本案例設有5個帳號設置如下圖，一共150(50+40+30+20+10)，分別為

57 => 50 = 5/15

58 => 40 = 4/15

59 => 30 = 3/15

60 => 20 = 2/15

61 => 10 = 1/15

下單帳號：	盈透-I	策略倉位：	0	<input checked="" type="checkbox"/> 同步 (自動)
商品名稱：	FTSE:XinhuaChi	下單倍數：	15	倍
交易月份：	2021/03	(實際)帳戶倉位：	0	同步 全部

假設總數下30口時，則57會分配下10口,58為8口...依此類推

實測下單時，15口的倍數會按比例下單，MC輸出的倉位或是下單大師倍數請設定為15的倍數.不然下出的口數不會按比例(結果如何請自行測試)

名稱: ratio

使用: ☒ 百分比 ☐ 比率 ☐ 合約/股份

分配	帳戶	Value
DU	57	50.0
DU	58	40.0
DU	59	30.0
DU	60	20.0
DU	61	10.0

ratio	BOT	15	XINA50	Mar30'21	@SGX
ratio	BOT	15	XINA50	Mar30'21	@SGX
DU	BOT	1	XINA50	Mar30'21	@SGX
DU	BOT	2	XINA50	Mar30'21	@SGX
DU	BOT	3	XINA50	Mar30'21	@SGX
DU	BOT	4	XINA50	Mar30'21	@SGX
DU	BOT	5	XINA50	Mar30'21	@SGX

~ 謝謝指教 ~

實現印鈔機的梦想，就從此刻開始！