

泰国证券交易所 (SET)

MTS-SET ©MetaTrader 5 网关

介绍

泰国证券交易所 (SET) 使用一种称为 SET_CONNECT 的交易系统。

©MetaTrader 5 SET 网关 扮演了 SET_CONNECT 交易系统和 ©MetaTrader 5 平台 之间桥梁的角色，使交易员使用 ©MetaTrader 5 终端 能够访问 SET 股票产品。

SET ©MetaTrader 5 网关 作为 ©MetaTrader 5 平台 的一部分使得经纪商能够提供给他们的客户访问 SET 股票产品。

下表为当前可用的基础资产：

股票	股票指数和个股
----	---------

更多关于使用 SET 网关可以交易的当前可用产品的详细列表以及 SET [官方网站](#) 关于更多合同规格的详细信息：

网络连接

通过基于 IPSec 标准的站点到站点 VPN 网络来访问 SET_CONNECT 已经完成，它提供了数据加密的最标准的安全方法。

另一个访问 SET_CONNECT 的方法是通过 SETNET3。交易所提供给会员经纪商所有相关信息。

您是交易所会员的话可以访问所有可用运行环境（测试，产品等等。）

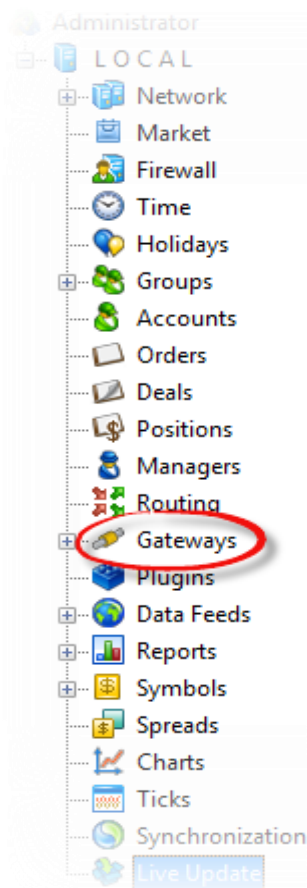
经纪商可以使用交易所提供的测试环境来进行验收测试。本文档提供关于如何配置网关连接到各个运行环境的详细信息。

每个注册经纪商都有一个四位数字的会员 ID (比如. 0123) 这是作为如下描述的身份验证凭据的基础：

- D0123_FIX_MD1 是市场数据的固定用户
- D0123_FIX_CU1 是交易的固定用户等等

通过指定的会员 ID, 订单输入和市场数据协议（两方的 FIX 协议）以及交易类型（普通订单，程序交易，做市），每个经纪商都可以请求 SET 创建新的测试账户。

Gateway Installation



1) 请创建名为 MTS-SET 的文件夹在

MT5_DIRECTORY\History\Gatewa, **MT5_DIRECTORY** 是 ©MetaTrader5 平台的安装文件夹。

2) 复制 **MTS-SET.exe** 模块到

MT5_DIRECTORY\History\Gateway\MTS-SET

3) 请使用 ©MetaTrader 5

Administrator 创建新的 **Symbols**，命名为“SET”。



4) 请使用 ©MetaTrader 5 Administrator 创建新的组（例如 demo\demoSET）用于股票交易。

注意： 为了保证正确的股票产品的保证金计算，设置 **Risk Management** 成 “for Stock Exchange”。



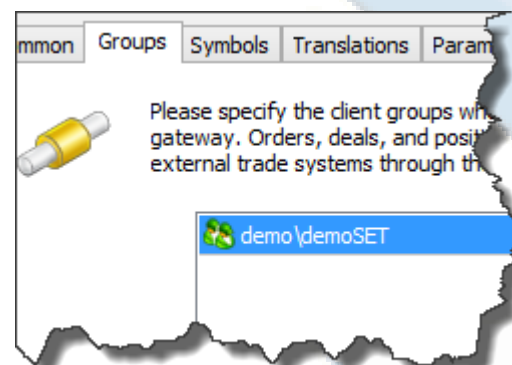
5) 在 **Gateways** 添加新的 **MTS-SET** 配置并且在出现提示时选择默认参数。

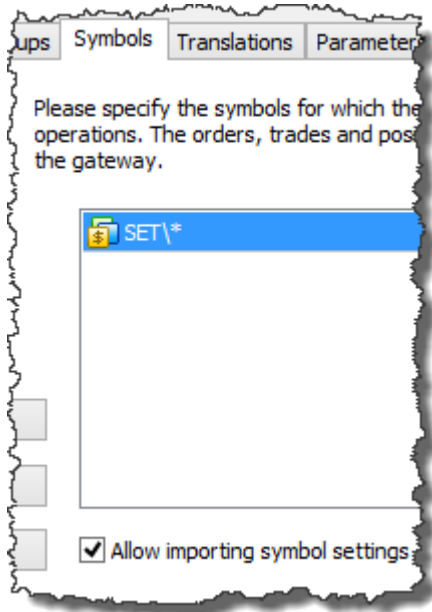
注意： 如果 **MTS-SET** 没有出现在下拉列表 请回到 “**Step 1**” 并检查 “MTS-SET.exe” 文件是否正确放在专用文件夹中。



6) 添加在

“**Step 4**” 创建的新组到网关属性下面的 **Groups** 选项卡中。





7) 添加“SET*”到 **Symbols** 选项卡并且确保检查“Allow importing symbol settings”设置。

它会自动从交易所导入产品信息。

网关参数

Parameters 选项卡包含了设置可以启用网关技术各方面的微调。下面将会详细介绍它们的目的和有效值。

➤ **ENV - 工作环境。**

一个工作环境名确定了为市场数据和交易提供市场数据服务，订单输入服务和灾难恢复服务的相互关联的网络。

有两种主要类别的环境：测试和生产。

测试环境

- **NEXT-C**
- **NEXT-A**
- **NEXT-B**
- **STAGE**

生产环境

- **PROD1** (SETNET3 link group 1)
- **PROD2** (SETNET3 link group 2)

Parameter	Value
ab ENV	STAGE
ab MD_USER	0123_FIX_MD1
ab TR_USER	0123_FIX_CU1
ab MD_PASS	****
ab TR_PASS	****
ab ENTERING_TRADER	0123_FIX_CU1_TR
ab CLEARING_FIRM	C123
ab TR_ACCOUNT	*
ab TR_ACCOUNT_TYPE	*

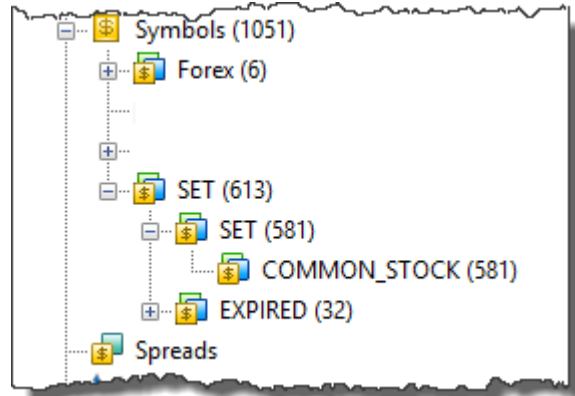
- **MD_USER** - 市场数据用户。
- **TR_USER** - 交易用户/中央用户/活跃用户。
- **MD_PASS / TR_PASS** - 市场数据和交易用户密码。
- **ENTERING_TRADER** - 交易组用户。
- **CLEARING_FIRM** - **SET** 提供的结算 ID。
- **TR_ACCOUNT / TR_ACCOUNT_TYPE** - **SET** 提供的交易账户详细信息。

SET 符号

网关会自动从交易所导入可交易产品或者在在线时更新现有产品。根据市场 ID 和部门 ID，产品会被导入到一个树形结构中去。

注意： 只有在重启 ©MetaTrader 5 主交易服务器和 ©MetaTrader 5 历史服务器后才可以交易新的 SET 产品。可以在交易日安全重启服务器。重启只需要几秒时间。

NOTE: 到期的符号会被自动移到 SET/EXPIRED 文件夹。



符号组设置

在“组设定”中，经纪商能够管理哪些 SET 产品是面向客户的 (在 ©MetaTrader 5 客户端可看见以及可交易的产品)。

下表是交易组的符号配置示例：

Symbol	Spread	Trade
 SET\SET\COMMON_STOCK*	Default	Default

符号设置和配置

这部分将提供关于根据 SET 规格，设置以及配置符号能够正常运行的指导。

注意： 标有 SET 的领域是使用 SET 提供的数据，不能被修改。

注意： 标有 THB 的领域包含泰铢钱值。

 The setting up of main parameters of the symbol. Please specify its name, description, and other parameters.

Symbol: ADVANC	Description: ADVANCED INFO SERVICE
ISIN:	International:
Basis:	Page: http://marketdata.set.or.th/mkt/marketsummary.do
Source:	Digits: 0
Background: ☐ None	Market depth: 10
Spread: off pt	Base currency: THB
Spread balance: 0 bid / 0 ask	Profit currency: THB
	Margin currency: THB

Symbol – 股票行情自动收录器名称。 **SET**

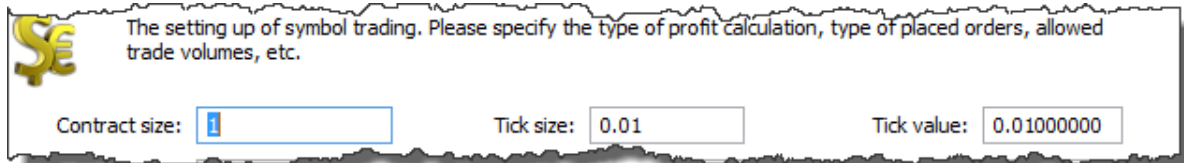
Description – 产品的简单介绍。 **SET**

Page -官方 SET 产品页面链接。

Digits - 小数点后的数字位数。 **SET**

Market depth – 指定终端显示的市场深度的级别。

All currency - 根据 SET 所有货币字段必须为泰铢。



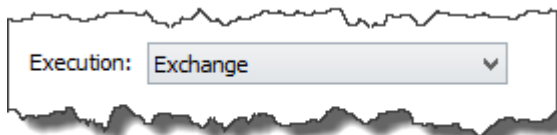
The setting up of symbol trading. Please specify the type of profit calculation, type of placed orders, allowed trade volumes, etc.

Contract size: Tick size: Tick value:

Contract size - 合约乘数。 **SET**

Tick size - 最小点数变化。 **SET**

Tick value - 一个点数价值。 **SET**



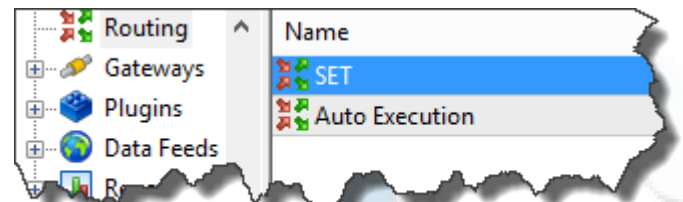
Execution:

Execution – “Exchange” 指该产品的订单由外部交易所处理而不是由 ©MetaTrader 5 平台处理。

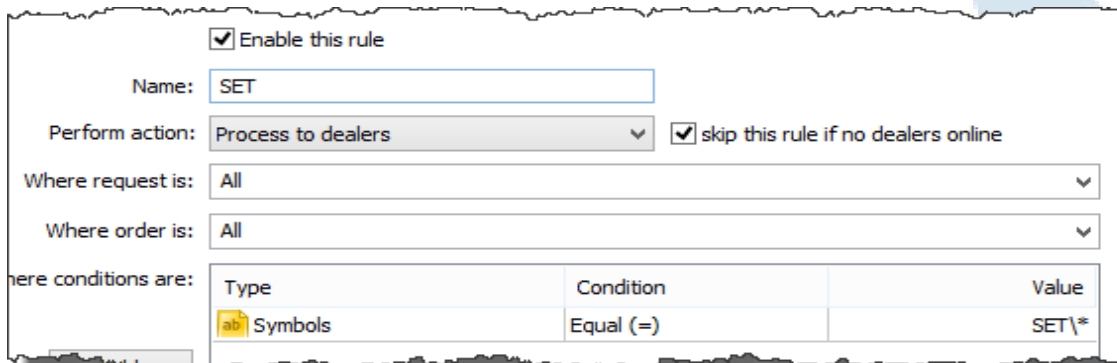
路由

新的 “Routing” 规则需要如下添加和配置。 SET 规则需在 “Auto Execution” 规则之前。

新规则指导 ©MetaTrader5 平台发送 SET 订单到网关来获得正确的处理。



关于 “Common” 的路由规则：



☒ Enable this rule

Name:

Perform action: ☒ skip this rule if no dealers online

Where request is:

Where order is:

Where conditions are:

Type	Condition	Value
ab Symbols	Equal (=)	SET*

路由规则的 “Dealers” 选项卡:

Login	Name
3	MTS-SET

NOTE: 要获得正确的 SET 股票订单处理规则定义是强制性的。

用 MetaTrader 5 终端交易股票

Market Watch: 15:20:28

Symbol	Bid	Ask	Last	Volu...	Time
ADVANC	140.0		140.0	300.00	15:20:28
AFC	0.90	1.00	1.00	200.00	15:18:58
AHC			35.5	100.00	16:04:08
AJ			5.65	100.00	16:04:08
ALUCON			216	1.00K	15:18:58
AMARIN					16:04:08
ASIA			86.8	100.00	16:04:08
ASIAN			2.12	100.00	16:04:08
ASIMAR			3.14	100.00	16:04:08
+ click to add...					9 / 585

Symbols | Details | Trading | Ticks

Market Watch (左图) 窗口显示了 SET 上市股票的列表，配有最新的买价，卖价，最后交易价格和最后交易量。

AFC, ASIA FIBER PUBLIC CO.,LTD

Volume	Price	Trade
800	1.00	
500	0.90	

sl 0 vol 1 tp 0

Sell Close Buy

Depth of Market (右图) 窗口显示了 SET 股票的一级价格书深度。

Market Watch: 15:20:28

AFC, ASIA FIBER PUBLIC CO.,LTD

Tick Size	0.05
Tick Value	0.05000
Lower Limit	5.95
Upper Limit	11.00
Bid	0.90
Ask	1.00
Last	1.00
Last High	1.10
Last Low	0.85
Price Change	17.65%
Volume	200.00
Open Price	0.85
Average Weighted Price	0.89

Details (左图) 窗口显示了交易所提供的关于 SET 股票产品的额外数据包括价格限制，开盘价，以及实时价格百分比变化。

网关日志

下一部分详细解释了当 ©SET 网关处理订单并发送到 SET_CONNECT 的时候，关于日志输入的创建。

©SET 网关日志输入作为新订单被处理。

Gateway	'0'->'1001': request #10360420 received (#2988171 exchange buy 1.00 S50H16 at market)
Gateway	'1001': request #10360420 answered - Placed (#2988171 exchange buy 1.00 S50H16 at market)
Gateway	execution send complete - added order #2988171, buy 1.00 S50H16 at market [based on order 'ON-2-1444894061851-1']

下面是详细的解释：

- #2988171: 是 ©MetaTrader 5 平台订单号。
- '0' -> '1001'
 - '0' 是交易商 ID (在此情况客户自己下单)。
如果 7832 号交易商代表 1001 号交易者下订单，值就为 '7832'。
 - 1001 是由 ©MetaTrader 5 平台分配的交易员 ID。
- 第二行表示请求已经被网关接受并发送到 SET 但还没有执行。
- 第三行表示通过网关发送的订单已经成功收到并且由 SET 执行，SET_CONNECT 订单号是 ON-2-1444894061851-1。

