

MC 中国版串接盈透 IB

MC 中国版串接盈透 IB.....	1
1 申请使用.....	2
2 下载与安装.....	2
2.1 IB TWS 或 Gateway **.....	2
2.2 MC.....	3
3 MC 串接 IB 的 TWS 软件.....	3
3.1 登入 TWS 用户.....	3
3.2 设置 TWS API **.....	5
3.3 登入 MC.....	8
3.4 MC 连线 TWS 交易.....	8
3.5 MC 连线 TWS 行情.....	10
4 MC 串接 IB 的 Gateway.....	13
4.1 登入 IB Gateway 用户.....	13
4.2 设置 GW API **.....	15
4.3 登入 MC.....	18
4.4 MC 连线 GW 交易.....	19
4.5 MC 连线 GW 行情.....	21
5 重要事项**.....	24
5.1 交易 API 端口.....	24
5.2 直连行情选择.....	24
5.3 TWS 自动退出软件设置**.....	25
5.4 常规交易时间之外触发委托设置.....	26

1 申请使用

MC 中国版可支持盈透用户做量化交易之使用。

1. **IB 账号**：用户需要自行跟盈透证券申请得到 **IB** 的交易账号和购买行情权限，才可接入 MC。
2. **MC 账号**：用户需跟艾扬软件（以下称“本公司”）购买 MC 中国版账号，方可进行量化交易。
3. 若您已有 **IB 账号** 和 **MC 账号**，请提供 **IB 用户名与对应的交易账号（Uxxx）**，跟本公司申请在 MC 上使用 **IB 交易权限**。

P.S:

TWS 或 Gateway 软件，登入使用的是 **IB** 的用户名，如：icehihi123

MC 软件，登入交易时，使用的是 **IB** 的交易账号，如：U8811111

MC 是以 **API 方式**接入 **IB** 的 TWS 软件或 **IB Gateway** 软件，因此，有一些串接步骤，希望您能仔细阅读下文。

2 下载与安装

2.1 IB TWS 或 **Gateway** **

IB TWS 软件或 **IB Gateway** 软件下载请到盈透证券官网下载：

<https://www.ibkr.com.cn/cn/index.php?f=14490#tws-software>

TWS 安装后，桌面图标：Trader Workstation

Gateway 安装后，桌面图标：IB Gateway 963



MC 需隔夜自动交易用户，建议选用 **IB Gateway 软件，因 TWS 软件有每日强制登出限制。**
详细说明可参考：[5.3 TWS 自动退出软件设置**](#)

2.2 MC

MC 中国版，您在跟本公司购买后，相关人员会提供安装包和账号。

MC 安装后，桌面图标如下：



3MC 串接 IB 的 TWS 软件

IB 支持模拟与实盘两种交易模式：

如果是实盘账号，交易模式请选择：实时交易；

如果是模拟账号，交易模式请选择：模拟交易。

实盘与模拟交易区别是：

1. 实盘交易

- a) 若交易下单，请不点选“输入只读”，并且需要通过安全密码卡片验证（密码卡片由 IB 提供）
- b) 若只看行情不下单，可点选“输入只读”，不需要通过安全密码卡片验证（密码卡片由 IB 提供）

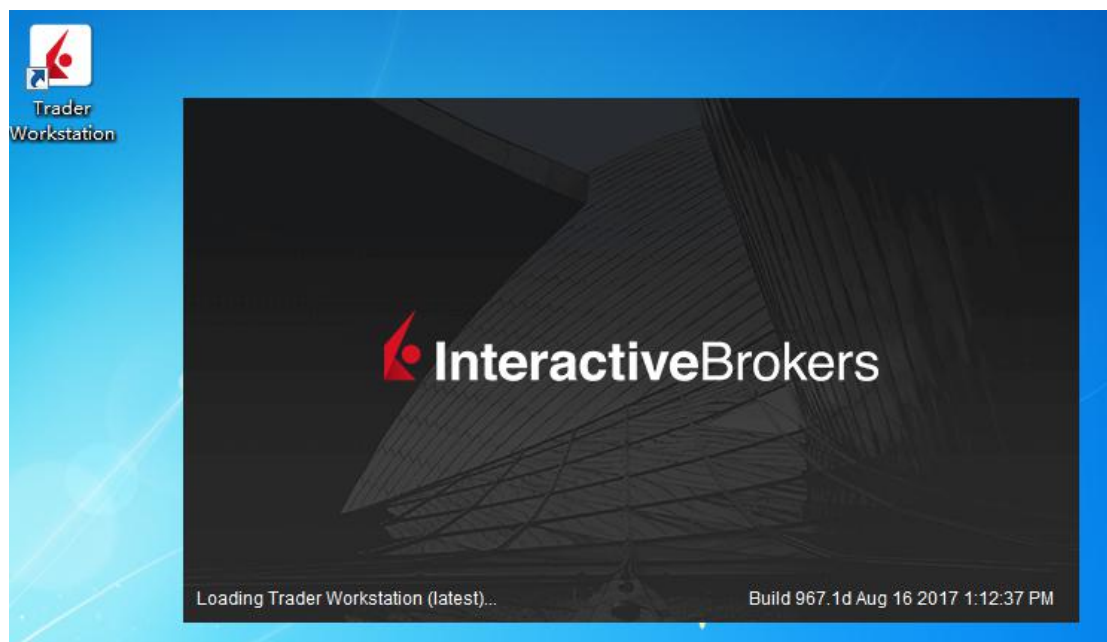
2. 模拟交易

- a) 无论是否交易下单，都不需要通过安全密码卡片验证
- b) 行情是仿真行情

3.1 登入 TWS 用户

以实盘交易为例：

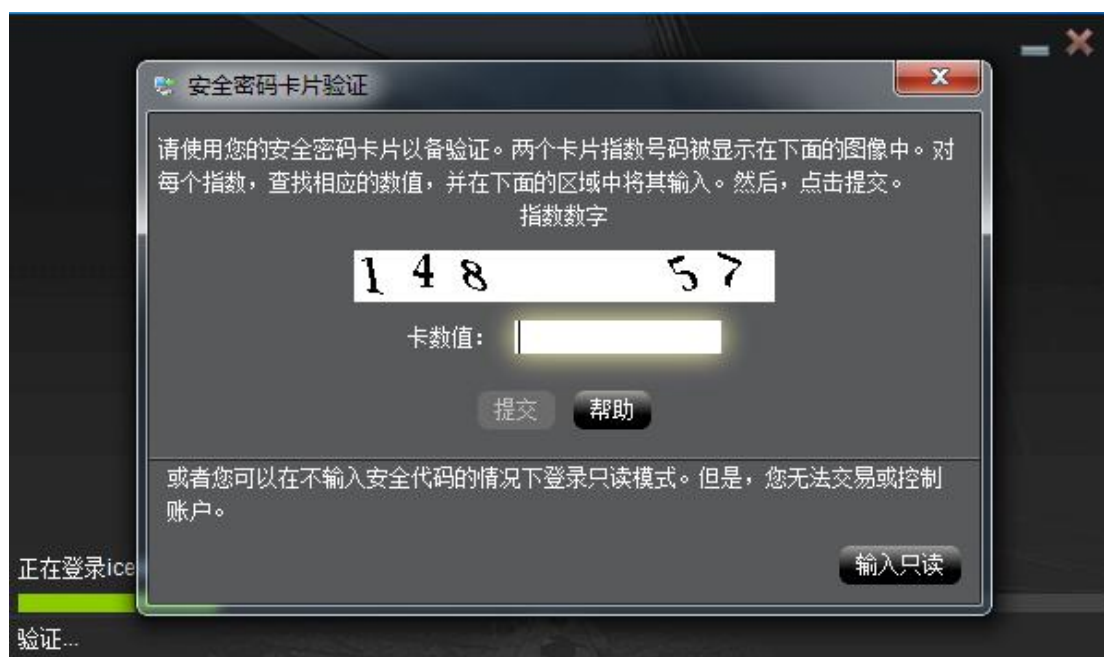
双击打开 Trader Workstation：



1. 选择交易模式：实时交易。
2. 输入用户名



3. 对比密码卡片，输入卡数值提交验证



4. 登入成功后的画面:

!!! 所在位置 U8811XXX 是将要在 MC 里面使用的交易账号。



3.2 设置 TWS API **

1. 点开 TWS 的文件 ->程序设置 ->全局配置...



2. 点开 API 的设置

- a) 勾选 启用 ActiveX 和套接客户端
- b) 不勾选 只读 API (若勾选了, 只能看行情不能下单)
- c) **套接端口** **7496** (仅限 TWS 实盘使用该端口, 其他端口请参考 [5.1 交易 API 端口](#))
- d) 可信任 IP 127.0.0.1



3. 点开 API 的“预防”

勾选全部预防设置，以保证使用 MC 自动交易时，不需要手动确认委托单。



3.3 登入 MC

使用本公司提供的 MC 会员账号登入软件：



使用本公司提供的 MC 授权账号，注册 MC：

3.4 MC 连线 TWS 交易

1. MC 和 TWS 登入成功后，请打开 MCTrader ->交易连线



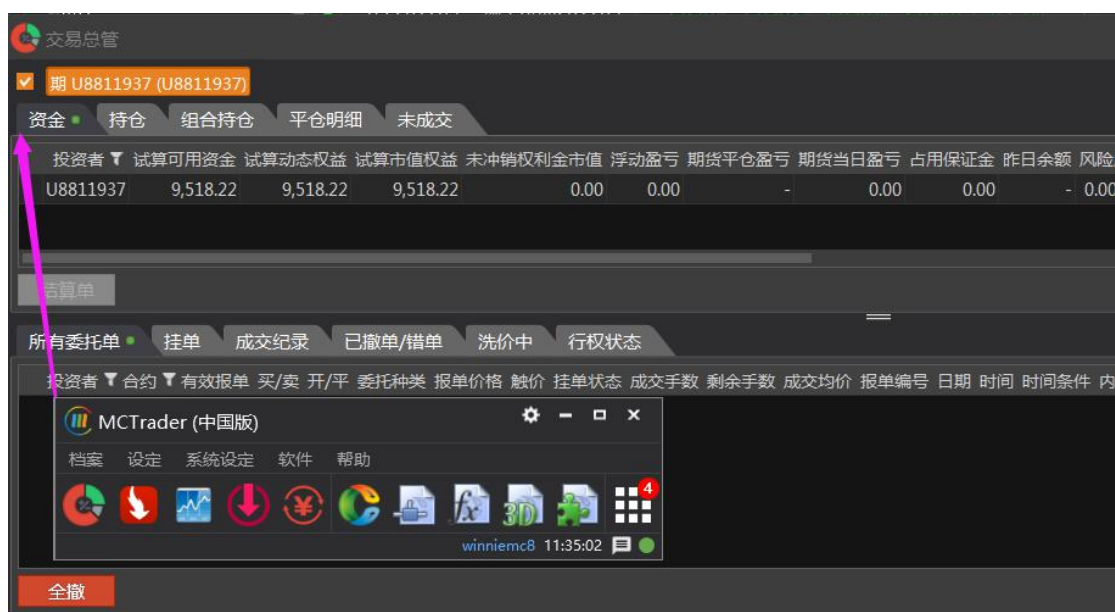
2. 选择刚刚 TWS 用户名所对应的交易账户 U8811XXX

- a) 勾选“自动登入”
- b) 点击“连线”
- c) 选择“IB_TWS”

类型	名称	账户	状态	自动登入	自动结算	
IB_TWS,IB_GW	VC	U8811937	未登入	<input checked="" type="checkbox"/>		连线
IB_TWS_Sim,IB_GW_Sim	Jingang	DU773493	未登入	<input type="checkbox"/>		连线
IB_TWS_Sim,IB_GW_Sim	qianchen	DU774283	未登入	<input type="checkbox"/>		连线
IB_TWS_Sim,IB_GW_Sim	stars	DU774270	未登入	<input type="checkbox"/>		连线
IB_TWS_Sim,IB_GW_Sim	VCDEMO	DU565811	未登入	<input checked="" type="checkbox"/>		连线
IB_TWS_Sim,IB_GW_Sim	winnie_SIM	DU773190	未登入	<input type="checkbox"/>		连线



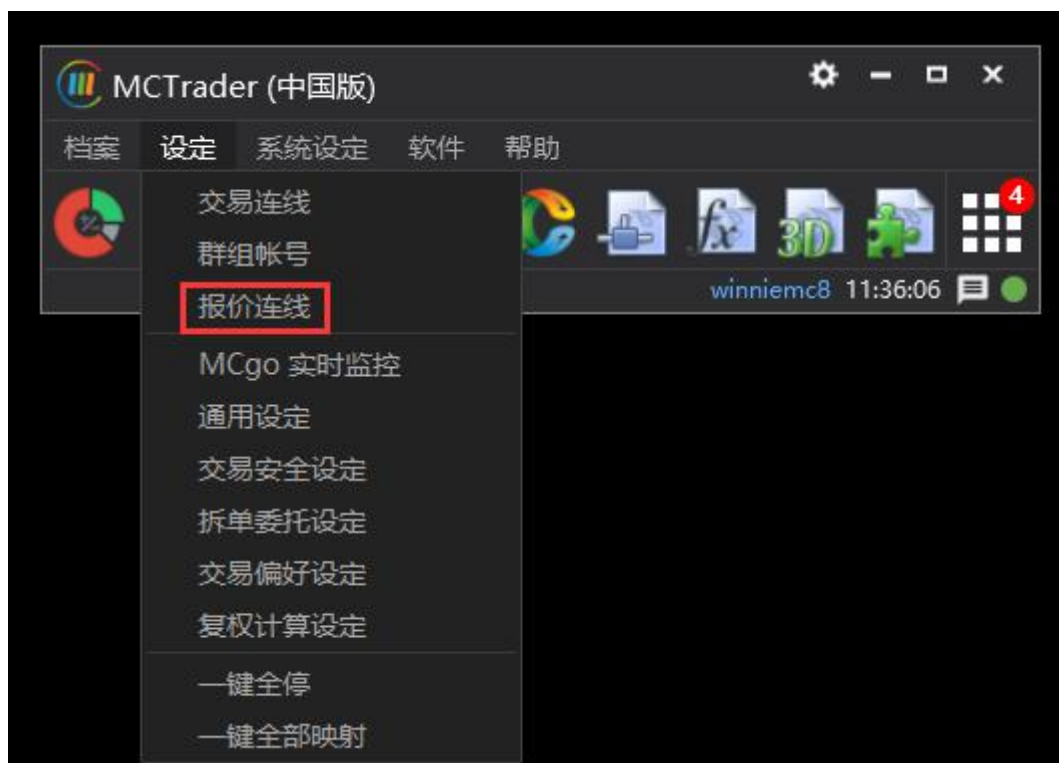
3. 打开交易总管，可查看资金、持仓、回报情况



3.5 MC 连线 TWS 行情

MC 的外盘行情报价，预设是本公司合作的非 IB 的外盘交易商授权提供，预设报价只有 28 天试用期。IB 用户，请在使用时，将预设报价切为 IB 直连报价。

1. MC 和 TWS 登入成功后，请打开 MCTrader ->报价连线



2. 外盘行情：点击“交易商授权外盘报价”



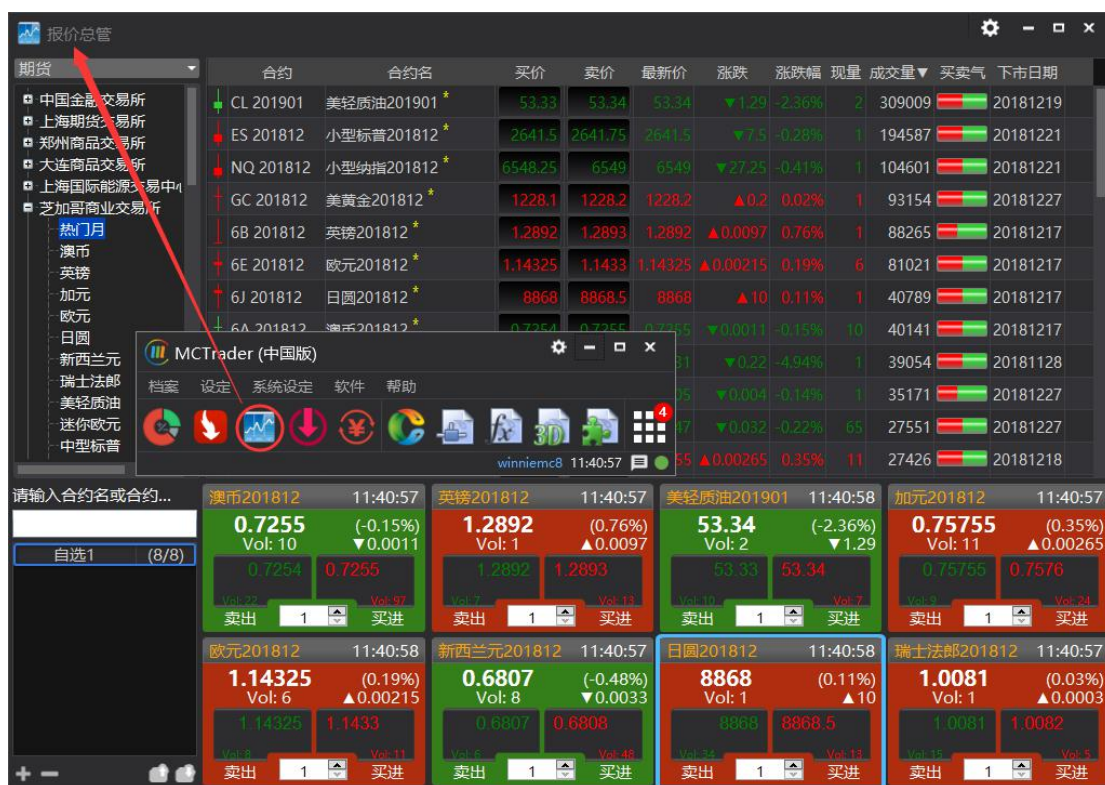
3. 外盘行情：选择“IB_TWS Quote”，并“连线”



4. 设定报价服务，勾选“设为预设连线”



5. 报价总管，可查看已成功接入的 IB 报价



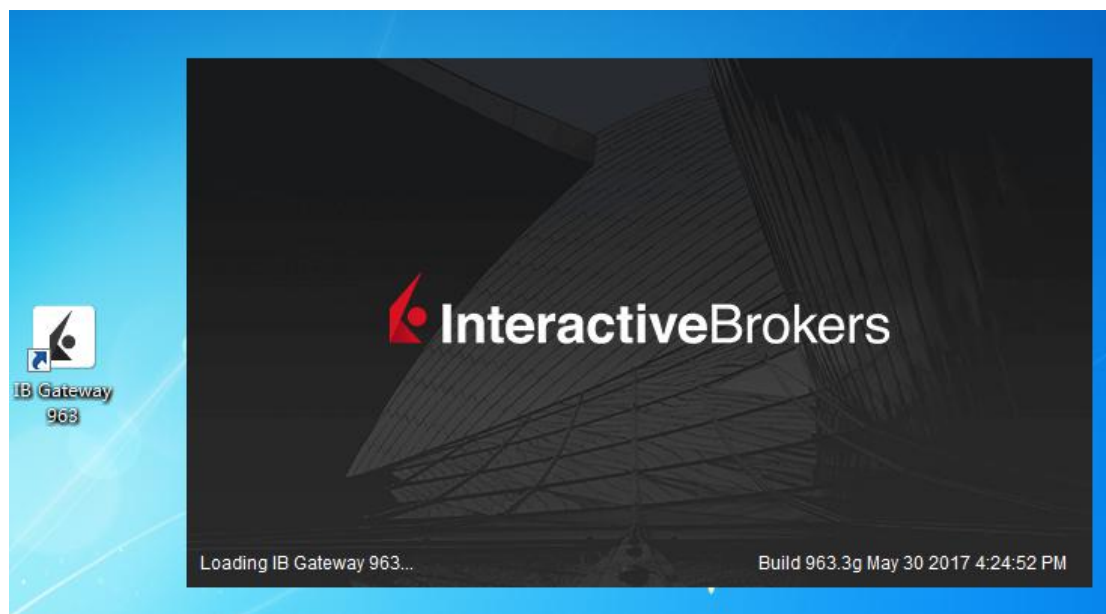
对于没有报价的商品，买卖价会揭露 -100

4 MC 串接 IB 的 Gateway

4.1 登入 IB Gateway 用户

以实盘交易为例：

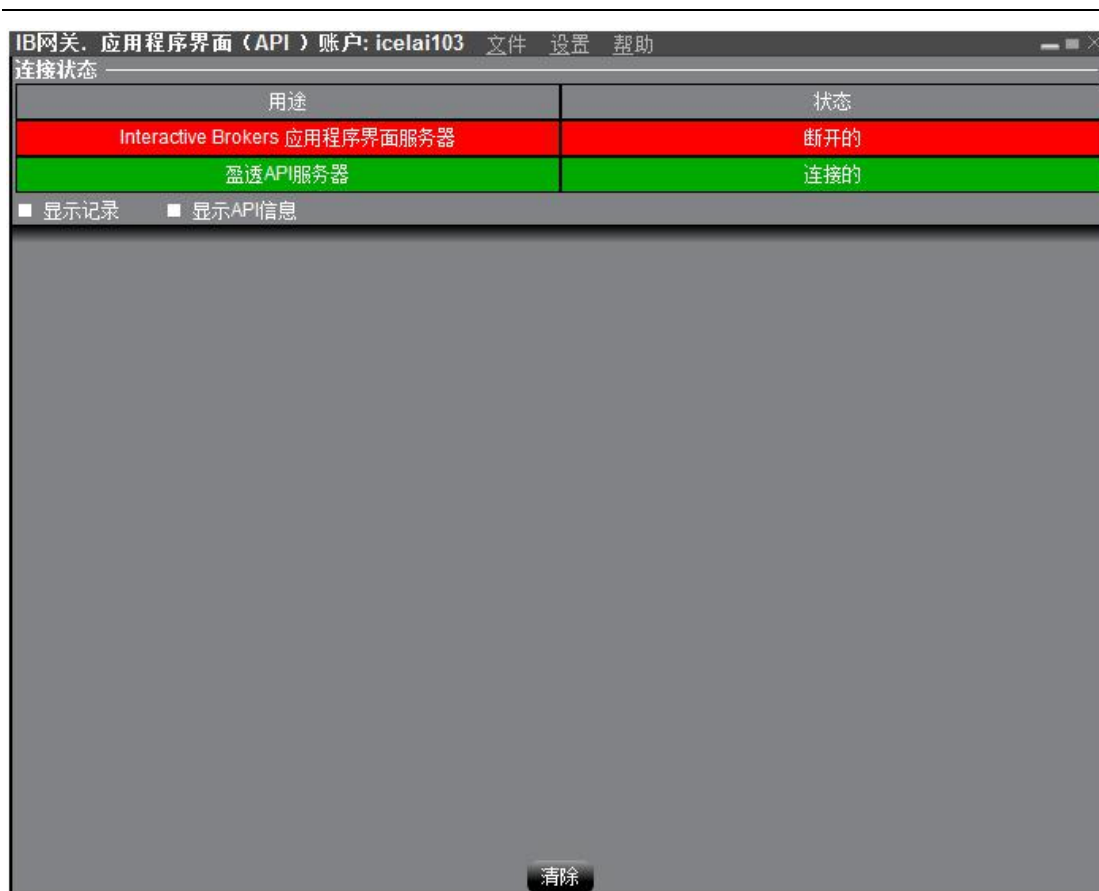
双击打开 IB Gateway 963：



1. 选择 API 类型： IB API
2. 交易模式：实时交易
3. 输入用户名、密码

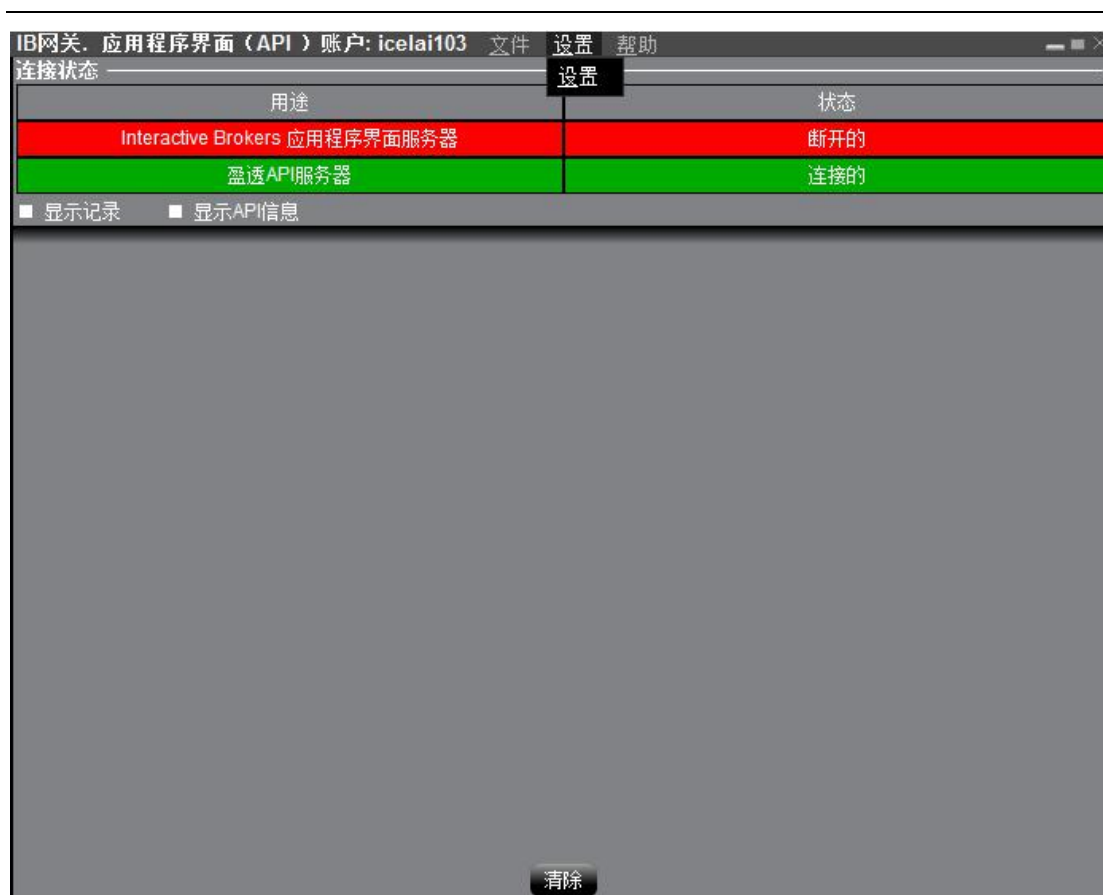


4. 对比密码卡片，输入卡数值提交验证
5. 登入成功后画面：



4.2 设置 GW API **

1. 点开 IB 网关的设置



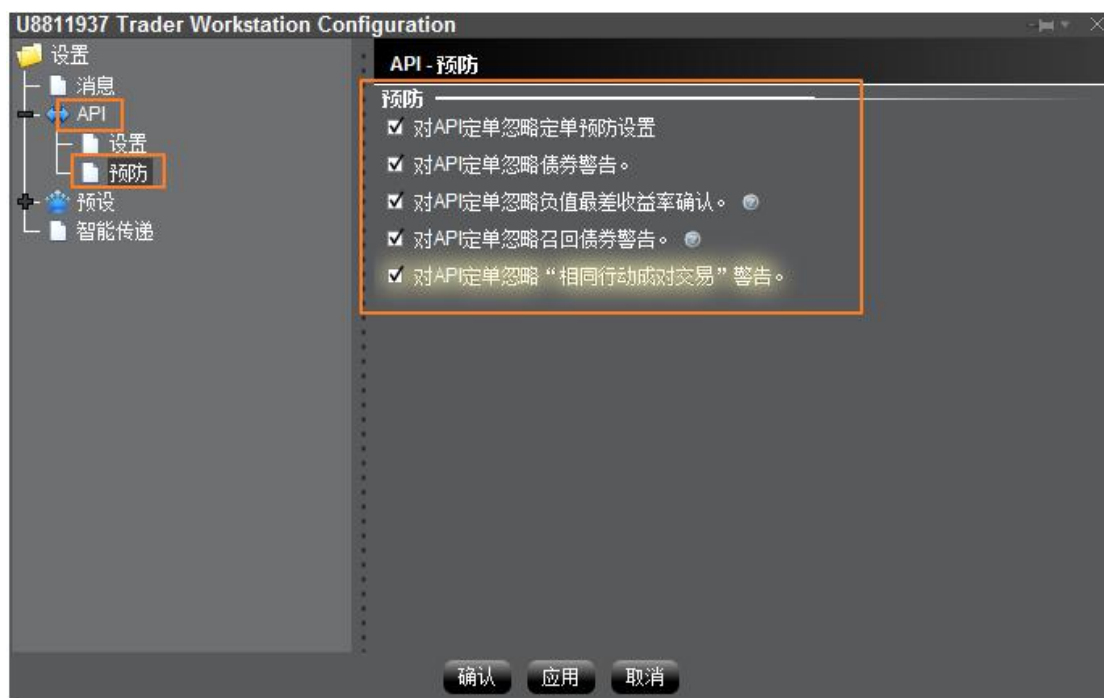
2. 点开 API 的设置

- a) 不勾选启用 DDE 客户端（需要使用 DDE 的时候勾选）
- b) 不勾选 只读 API（若勾选了，只能看行情不能下单）
- c) **套接字端口 4001**（仅限 GW 实盘使用该端口，其他端口请参考 [5.1 交易 API 端口](#)）
- d) 可信任 IP 127.0.0.1



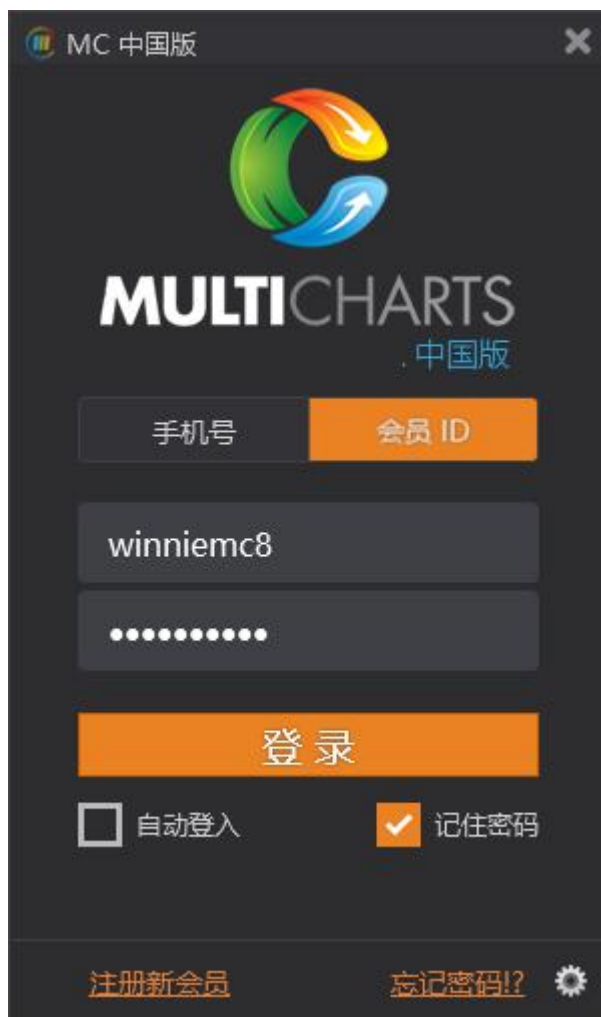
3. 点开 API 的“预防”

勾选全部预防设置，以保证使用 MC 自动交易时，不需要手动确认委托单。



4.3 登入 MC

使用本公司提供的 MC 会员账号登入软件：



使用本公司提供的 MC 授权账号，注册 MC

4.4 MC 连线 GW 交易

1. MC 和 IB Gateway 登入成功后，请打开 MTrader ->交易连线

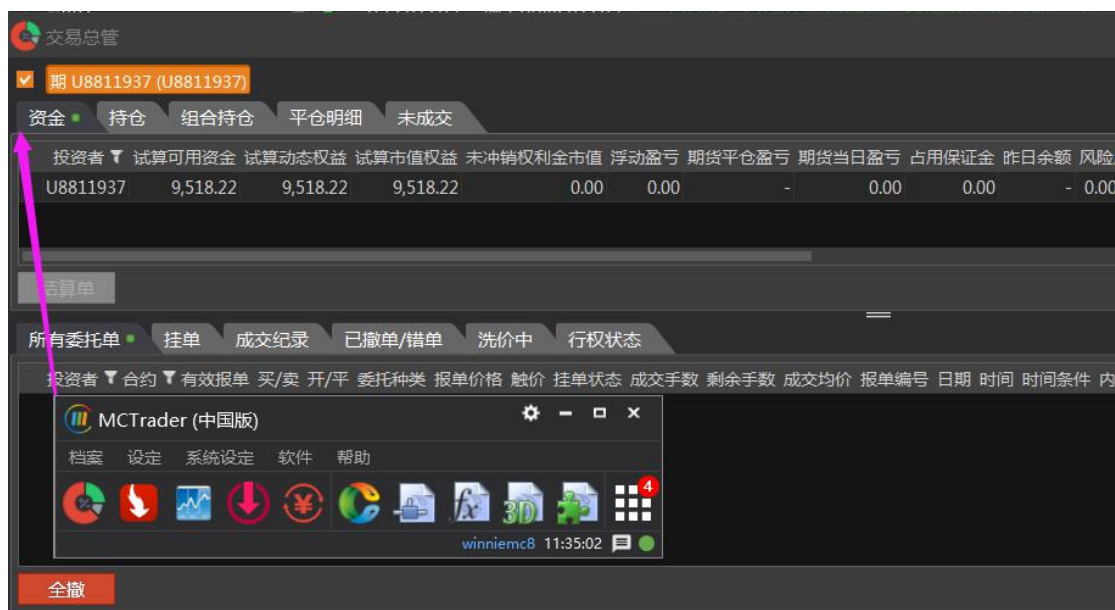


2. 选择刚刚 Gateway 用户名所对应的交易账户 U8811XXX
 - a) 勾选“自动登入”
 - b) 点击“连线”
 - c) 选择“IB_GW”

类型	名称	账户	状态	自动登入	自动结算	
IB_TWS,IB_GW	VC	U8811937	未登入	<input checked="" type="checkbox"/>		连线
IB_TWS_Sim,IB_GW_Sim	Jingang	DU773493	未登入	<input type="checkbox"/>		连线
IB_TWS_Sim,IB_GW_Sim	qianchen	DU774283	未登入	<input type="checkbox"/>		连线
IB_TWS_Sim,IB_GW_Sim	stars	DU774270	未登入	<input type="checkbox"/>		连线
IB_TWS_Sim,IB_GW_Sim	VCDEMO	DU565811	未登入	<input checked="" type="checkbox"/>		连线
IB_TWS_Sim,IB_GW_Sim	winnie_SIM	DU773190	未登入	<input type="checkbox"/>		连线



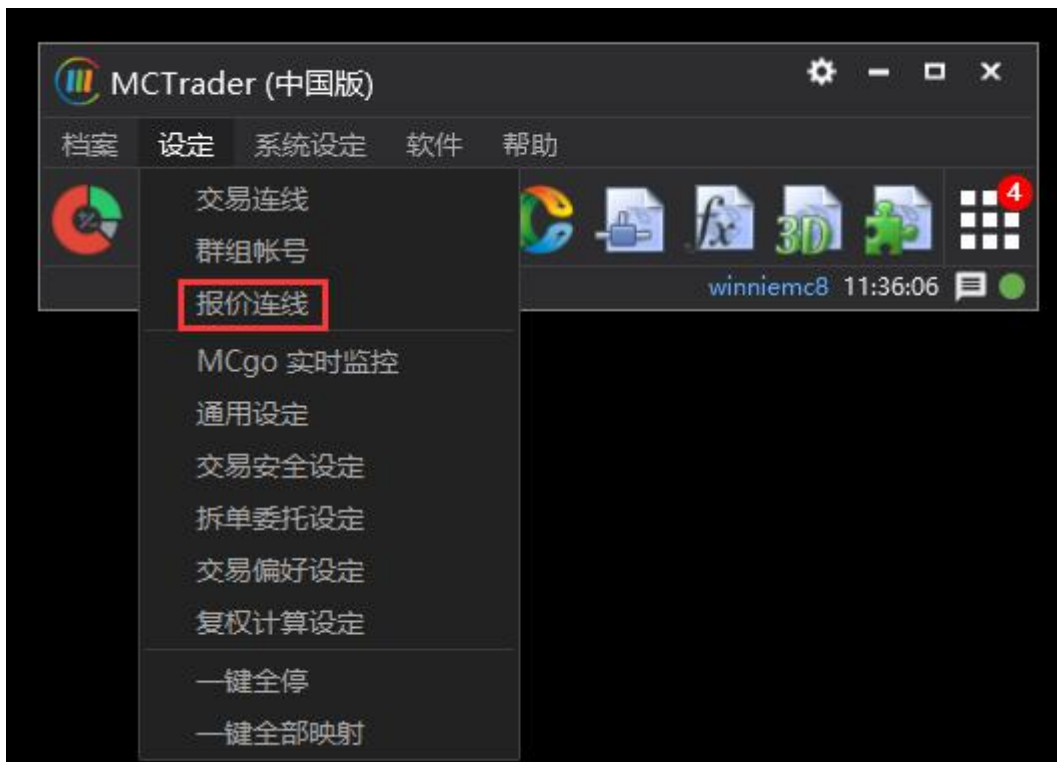
3. 打开交易总管，可查看资金、持仓、回报情况



4.5 MC 连线 GW 行情

MC 的外盘行情报价，预设是本公司合作的非 IB 的外盘交易商授权提供，预设报价只有 28 天试用期。IB 用户，请在使用时，将预设报价切为 IB 直连报价。

6. MC 和 Gateway 登入成功后，请打开 MCTrader ->报价连线



7. 外盘行情：点击“交易商授权外盘报价”



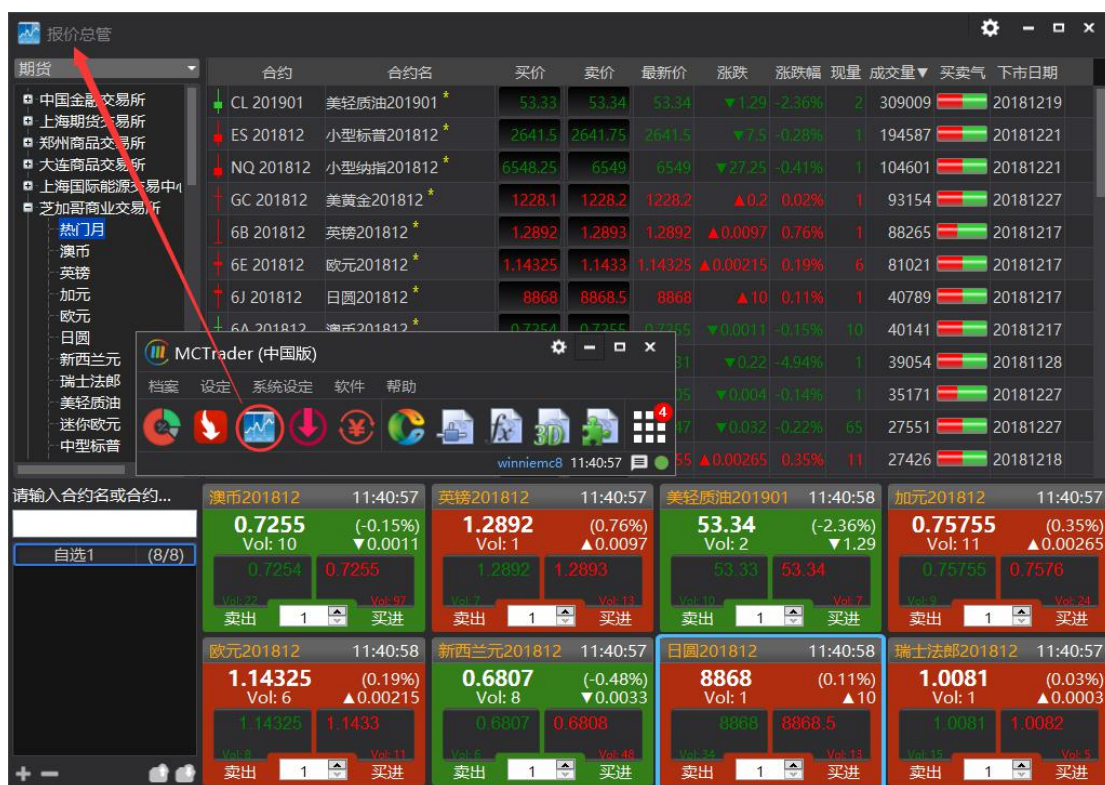
8. 外盘行情：选择“IB_GW Quote”，并“连线”



9. 设定报价服务，勾选“设为预设连线”



10. 报价总管，可查看已成功接入的 IB 报价



P.S: 对于没有报价的商品，买卖价会揭露 -100

5 重要事项**

5.1 交易 API 端口

请根据您的登入的 TWS 或 Gateway 账号，设置对于的 API 端口

API 串接	实盘 TWS	模拟 TWS	实盘 Gateway	模拟 Gateway
API 套接字端口	7496	7497	4001	4002

5.2 直连行情选择

请根据您的登入的 TWS 或 Gateway 账号选择对应的报价，设为预设：

外盘行情	实盘 TWS	模拟 TWS	实盘 Gateway	模拟 Gateway
预设	IB_TWS	IB_TWS_SIM	IB_GW	无

5.3 TWS 自动退出软件设置**

因 TWS 软件，有一个每天强制自动退出软件的设置，对于隔夜使用 MC 自动交易的用户：请自行设定一个合适的自动退出时间；并于 TWS 退出后手动再登入 TWS 即可继续使用 MC。

Gateway 软件，不会每天强制自动退出，因此对于 MC 的自动交易用户，若连续隔夜交易，可选用 Gateway 软件。

1. 点开 TWS 的文件 ->程序设置 ->全局配置...



2. 点开设置 ->锁定并退出->自动退出计时器

修改一个自己合适重新登入 TWS 软件的时间。



5.4 常规交易时间之外触发委托设置

如果用 TWS 手动交易 stop、stoplimit 单在全部交易时间都可触发成交，可以勾选“允许定单在常规交易时间以外被激活、触发或成交（如果可用）”；

而 MC 在自动交易时，下单 stop\stoplimit 已带入这个设定参数，用户可不需要额外设定。

关于本设置，可扩充阅读：

<https://www.interactivebrokers.com/en/index.php?f=22063#02>

