

คู่มือการใช้งาน ฟังก์ชัน Auto Position

ฟังก์ชัน Auto Position เป็นฟังก์ชันที่เพิ่มความสะดวกรวดเร็วในการส่งคำสั่งซื้อขายโดย user ไม้ไม่จำเป็นต้องระบุ Position เป็น Open หรือ Close และทำให้ท่านสามารถส่งคำสั่งซื้อขาย Combination Order เพื่อทำการ Rollover ได้ด้วย โดยมีรายละเอียดและวิธีการใช้งาน ดังนี้

1. การใช้งานฟังก์ชัน Auto Position

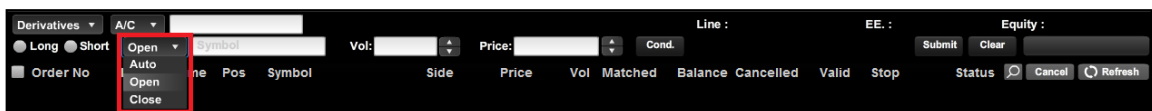
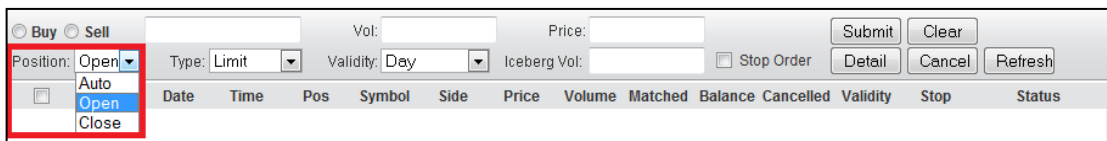
1.1 การเข้าใช้งานครั้งแรกหลังจากได้ Permission

User ที่ได้รับ Permission ในการใช้งานฟังก์ชัน Auto Position จาก Broker เมื่อกดใช้งาน หน้าจอส่งคำสั่งซื้อขาย Place Order หรือ Streaming เป็นครั้งแรกหลังจากที่ได้รับ Permission จะแสดง pop-up หน้าจอ Disclaimer ขึ้นมาให้ทำการยืนยันการใช้งาน โดยผู้ใช้งานต้องระบุความต้องการในการใช้งาน ดังนี้

- **Accept:** ผู้ใช้งานตกลงที่จะใช้งานฟังก์ชัน "Auto Position" โดยจะสามารถใช้งานฟังก์ชัน Auto Position ได้เมื่อเลือก Accept Disclaimer
- **Ask Me Later:** ผู้ใช้งานยังไม่มั่นใจ หรือไม่พร้อมที่จะใช้งานฟังก์ชัน "Auto Position" โดยจะยังไม่สามารถใช้งานฟังก์ชัน Auto Position ได้ แต่เมื่อมีการกดใช้งาน หน้าจอส่งคำสั่งซื้อขาย Place Order หรือ Streaming ในครั้งต่อไป จะแสดง pop-up หน้าจอ Disclaimer นี้ขึ้นมาให้ทำการยืนยันการใช้งานอีกครั้ง
- **Deny:** ผู้ใช้งานไม่ต้องการใช้งานฟังก์ชัน "Auto Position" โดยระบบจะทำการ disable permission การใช้งาน Auto Position ให้ทันที และเมื่อต้องการจะขอใช้งานอีกครั้ง ต้อง ขอให้ทาง Broker ทำการเพิ่ม permission ให้ใหม่

1.2 การใช้งาน Auto Position

User ที่สามารถใช้งานฟังก์ชัน Auto Position ได้ หน้าจอส่งคำสั่งซื้อขายจะแสดง Position ให้เลือกส่งคำสั่งได้ 3 รูปแบบ (ในรูปแบบของ Drop Down List) ได้แก่ Auto, Open และ Close ดังนี้



สำหรับ User ที่ตกลงใช้งานฟังก์ชัน Auto Position แล้ว จะมี Default ของ Drop Down list เป็น Auto

หมายเหตุ:

- สำหรับ User ที่ยังไม่ตกลง หรือ ยังไม่ได้รับ Permission ในการใช้งานฟังก์ชัน Auto Position จะมี Default ของ Drop Down list เป็น Open และจะยังไม่เห็น Auto ใน drop down list
- Default ของ Drop Down list สามารถเปลี่ยนได้จากเมนู Setting ในหน้าจอส่งคำสั่งซื้อขาย

2. การทำงานของฟังก์ชัน Auto Position

2.1 การส่งคำสั่งซื้อขายด้วย Auto Position (Place Order)

เนื่องจากการส่งคำสั่งซื้อขาย สำหรับ Order หนึ่งๆ จะสามารถส่ง Position เข้าไปยัง ดลท. ได้เพียง 1 Position เท่านั้น (Open หรือ Close) ดังนั้น เมื่อ User เลือกที่จะส่งคำสั่งซื้อขายด้วยฟังก์ชัน Auto Position การระบุ Position ก่อนส่งคำสั่งไปยัง ดลท. จะเป็นไปตามกระบวนการ ดังนี้

- 1) กรณีที่ จำนวนสัญญาที่ส่ง \leq จำนวน Available Position ของ Series ผั่งตรงข้ามที่มีใน Portfolio
 - a) Closing Method = Auto Net
 - ระบบจะส่งคำสั่งไปที่ TFEX โดยกำหนดให้มี Position เป็น "Close"
 - เมื่อคำสั่งที่ส่งถูกจับคู่ ระบบจะทำการตรวจสอบ position ใน portfolio เพื่อทำการ auto-net position ให้อีกครั้ง

- b) Closing Method = Manual
- ระบบจะส่งคำสั่งไปที่ TFEX โดยกำหนดให้มี Position เป็น "Close"
- 2) กรณีที่ จำนวนสัญญาที่ส่ง > จำนวน Available Position ของ Series ผั่งตรงข้ามที่มีใน Portfolio
- a) Closing Method = Auto Net
- ระบบจะส่งคำสั่งไปที่ TFEX โดยกำหนดให้มี Position เป็น "Open"
 - เมื่อคำสั่งที่ส่งถูกจับคู่ ระบบจะทำการตรวจสอบ position ใน portfolio เพื่อทำการ auto-net position ให้อีกครั้ง
 - กรณีนี้จะทำให้สามารถ open สัญญาข้ามฝั่งได้ (ต่างจากกรณีที่ระบุ position เป็น Open จะไม่สามารถเปิดสัญญาข้ามฝั่งได้ เนื่องจากระบบจะไม่อนุญาตให้ open position พร้อมกันทั้งขา long และ short)
- b) Closing Method = Manual
- ระบบจะส่งคำสั่งไปที่ TFEX โดยกำหนดให้มี Position เป็น "Open"

หมายเหตุ:

การส่งคำสั่งแบบ Open และ Close ยังคงทำงานตามเดิม คือ

- Position = Open: ระบบจะส่งคำสั่งเป็น Open Position ตามปกติ
- Position = Close: ระบบจะตรวจสอบ Available Position ตามปกติว่าสามารถปิดสถานะได้หรือไม่ และแจ้ง Error หากมีจำนวนสัญญาไม่เพียงพอที่จะปิดสถานะ

2.2 การเปลี่ยนแปลงคำสั่งซื้อขาย (Change Order)

การ Change Order ใดๆ จะไม่สามารถ Change Position มาเป็น Auto ได้ แต่สำหรับ Order ที่มี Position เป็น Auto อยู่แล้วนั้น เมื่อทำการ Change Order ระบบจะทำการเปลี่ยน Position ของ Order นั้น มาเป็น Position ตามที่ส่งเข้าตลาดจริง ดังนี้

- 1) Auto Position ที่ส่ง Position เป็น "Open" เข้าตลาด
 - ระบบจะมอง Order ดังกล่าวเป็นเหมือน Order ที่ส่งแบบ Open ทั่วไป
 - หน้าจอจะเปลี่ยนการแสดงผล Position จาก "Auto(Open)" เป็น "Open"
 - การตรวจสอบ Position ในการ Change Order จะเป็นดังนี้
 - Closing Method = Auto Net: หากการ Change Order ทำให้เกิดการ Open Series เดียวกันทั้งฝั่ง Long และ Short จะไม่สามารถ Charge Order ได้
 - Closing Method = Manual: สามารถ Change Order ได้โดยไม่ตรวจสอบ Available Position
- 2) Auto Position ที่ส่ง Position เป็น "Close" เข้าตลาด
 - ระบบจะมอง Order ดังกล่าวเป็นเหมือน Order ที่ส่งแบบ Close ทั่วไป
 - หน้าจอจะเปลี่ยนการแสดงผล Position จาก "Auto(Close)" เป็น "Close"
 - การตรวจสอบ Position ในการ Change Order จะเป็นดังนี้
 - หาก Available Position ใน Portfolio มีไม่เพียงพอกับการ Close Position จะไม่สามารถ Change Order ได้

3. การแสดงรายการ Auto Position ในหน้าจอ

3.1 การแสดงหน้าจอ Order Status

<input type="checkbox"/>	Enter ID	Account No	Order No	Date	Time	Pos.	Series ID	Side	Price	Volume	Matched	Balance	Cancelled	Valid	Stop	Status	Approve	Detail
	I1111	0100003	1588	26/03/14	10:14:53	Auto	S50Z14	Long	800.0	1	0	0	1	Day		Expired (E)		>>
	I1111	0100003	1587	26/03/14	10:14:02	Auto	S50Z14	Long	800.0	7	0	0	7	Day		Cancelled (CX)		>>
	I1111	0100003	1586	26/03/14	10:13:52	Auto	S50Z14	Short	800.0	1	1	0	0	Day		Matched (M)		>>
	I1111	0100003	1585	26/03/14	10:13:21	Auto	S50Z14	Long	800.0	1	0	0	1	Day		Cancelled (CX)		>>
	I1111	0100003	1300	25/03/14	10:27:53	Open	S50U14	Short	800.0	1	1	0	0	Day		Matched (M)		>>

Order No	Date	Time	Pos	Symbol	Side	Price	Volume	Matched	Balance	Cancelled	Valid	Stop	Status	Cancel	Refresh
2593	03/04	18:40:05	A	S50U14	Long	750.0	2	0	2	0	Day		Pending(OF)	Change	Detail
1873	26/03	18:00:52	O	S50Z14C875	Long	145.9	1	0	0	0	1 Day		Expired(E)	Detail	
1729	26/03	17:54:38	O	AMATAM14	Long	17.50	1	0	0	0	1 Day		Rejected(-1)	Detail	
1588	26/03	10:14:53	A	S50Z14	Long	800.0	1	0	0	0	1 Day		Expired(E)	Detail	

Order no	Date	Time	Pos	Symbol	Side	Price	Volume	Matched	Balance	Cancelled	Validity	Stop	Status
2593	03/04	18:40:09	Auto	S50U14	Long	750.0	2	0	2	0	Day		Pending(OF)
1873	26/03	18:00:52	Open	S50Z14C875	Long	145.9	1	0	0	0	1 Day		Expired(E)
1729	26/03	17:54:38	Open	AMATAM14	Long	17.50	1	0	0	0	1 Day		Rejected(-1)
1588	26/03	10:14:53	Auto	S50Z14	Long	800.0	1	0	0	0	1 Day		Expired(E)

3.2 การแสดงหน้าจอ Order Details

a) Auto Position ที่ส่ง Position เป็น "Open" เข้าตลาด

Order No	Time	Position	Series ID	Side	Price	Volume	Matched	Balance	Cancelled	Stop Status	Status
1586	10:13:52	Auto (Open)	S50Z14	Short	800.0	1	1	0	0		Matched
TFEX Order No	Type	Validity	Valid Until	Iceberg Vol	Stop ID	Stop Cond	Stop Price	Status Meaning			
ON-2-1404789228247-1	Limit	Day						Matched order			
Trade Date	Trade Time	Entry Trader	Entry Date	Cancel Trader	Cancel Date	Cancel Time	Reject Code	Reject Meaning			
26/03/2014	10:13:52	I1111	26/03/2014								
Deal No.	Trade No	Ledger Seq.	Date	Time	Position	Series ID	Side	Price	Volume	Active Volume	Deal Status
DN-2-1404789228247-1	TN-2-1404789228247-1	0	26/03/2014	10:13:48	Open	S50Z14	Short	800.0	1	1	Unregistration
Change History											
Time	Change Trader	Action	Deal Detail				Order Detail				

b) Auto Position ที่ส่ง Position เป็น "Close" เข้าตลาด

Order No	Time	Position	Series ID	Side	Price	Volume	Matched	Balance	Cancelled	Stop Status	Status
1299	10:03:09	Auto (Close)	S50U14	Short	850.0	1	1	0	0		Matched
TFEX Order No	Type	Validity	Valid Until	Iceberg Vol	Stop ID	Stop Cond	Stop Price	Status Meaning			
ON-2-1404702187652-1	Limit	Day						Matched order			
Trade Date	Trade Time	Entry Trader	Entry Date	Cancel Trader	Cancel Date	Cancel Time	Reject Code	Reject Meaning			
25/03/2014	10:03:09	I1111	25/03/2014								
Deal No.	Trade No	Ledger Seq.	Date	Time	Position	Series ID	Side	Price	Volume	Active Volume	Deal Status
DN-2-1404702187652-1	TN-2-1404702187652-1	0	25/03/2014	10:03:07	Close	S50U14	Short	850.0	1	1	Unregistration
Change History											
Time	Change Trader	Action	Deal Detail				Order Detail				

3.3 การแสดงหน้าจอ Deal Details

- a) กรณีที่ได้รับ Confirm รายการจับคู่ จากระบบ Trading แต่ยังไม่ได้รับ Confirm จากระบบ Clearing
- Deal Status แสดงเป็น "Unregistration"
 - Position ของ Deal แสดงเป็น Open หรือ Close ตามที่ได้รับ Confirm มาจากระบบ Trading

Enter ID	Account No	Order No	Trade No	Ledger Seq	Ledger Date	Time	Pos.	Series ID	Side	Deal Price	Deal Volume	Active Volume	Deal Status	Detail
590794-0	13537	TN-2-1397203989961-3	84	11/04/14	15:13:10	Open	S50H15	Long	1,196.9	1	1	Active	>>	
590794-0	13254	TN-1-1397036057596-1	0			Open	KBANKH15	Long	230.00	1	1	Unregistration		
590794-0	13249	TN-2-1397035611903-1	0			Open	S50J14	Long	900.0	1	1	Unregistration		

Order No	Time	Position	Series ID	Side	Price	Volume	Matched	Balance	Cancelled	Stop Status	Status
13254	16:34:17	Open	KBANKH15	Long	230.00	1	1	0	0		Matched
TFEX Order No	Type	Validity	Valid Until	Iceberg Vol	Stop ID	Stop Cond	Stop Price	Status Meaning			
ON-1-1397036057596-1	Limit	Session	Settlement					Matched order			
Trade Date	Trade Time	Entry Trader	Entry Date	Cancel Trader	Cancel Date	Cancel Time	Reject Code	Reject Meaning			
09/04/2014	16:34:17		09/04/2014								
				Change	Close						
Deal No.	Trade No	Ledger Seq.	Date	Time	Position	Series ID	Side	Price	Volume	Active Volume	Deal Status
DN-1-1397036057596-1	TN-1-1397036057596-1	0	09/04/2014	16:34:17	Open	KBANKH15	Long	230.00	1	1	Unregistration
Change History											
Time	Change Trader	Action	Deal Detail				Order Detail				

- b) กรณีที่ได้รับ Confirm รายการจับคู่ จากทั้งระบบ Trading และ Clearing
- Deal Status แสดงเป็น "Active" หรือ "Rectified"
 - Position ของ Deal แสดงเป็น Open หรือ Close ตามที่ได้รับ Confirm มาจากระบบ Clearing

Enter ID	Account No	Order No	Trade No	Ledger Seq	Ledger Date	Time	Pos.	Series ID	Side	Deal Price	Deal Volume	Active Volume	Deal Status	Detail
11111	loadtest1_23	20425	TN-2-1404131400887-68	18	02/07/14	19:30:04	Open	GFZ14	Long	20,200.00	1	1	Active	>>
11111	loadtest1_23	20425	TN-2-1404131400887-69	20	02/07/14	19:30:04	Open	GFZ14	Long	20,200.00	1	1	Active	>>
11111	loadtest1_24	20424	TN-2-1404131400887-67	16	02/07/14	19:30:04	Open	GFZ14	Long	20,200.00	1	1	Active	>>
11111	loadtest1_24	20424	TN-2-1404131400887-66	14	02/07/14	19:30:04	Open	GFZ14	Long	20,200.00	1	1	Active	>>

Trading Account : loadtest1_23												
Order No	Time	Position	Series ID	Side	Price	Volume	Matched	Balance	Cancelled	Stop Status	Status	
20425	15:20:38	Open	GFZ14	Long	20,200.00	2	2	0	0		Matched	
TFEX Order No	Type	Validity	Valid Until	Iceberg Vol	Stop ID	Stop Cond	Stop Price	Status Meaning				
ON-2-1404116435935-1	Limit	Day						Matched order				
Trade Date	Trade Time	Entry Trader	Entry Date	Cancel Trader	Cancel Date	Cancel Time	Reject Code	Reject Meaning				
02/07/2014	15:21:25	I1111	27/03/2014									
Change						Close						
Deal No.	Trade No	Ledger Seq.	Date	Time	Position	Series ID	Side	Price	Volume	Active Volume	Deal Status	
DN-2-1404131400887-8	TN-2-1404131400887-68	18	02/07/2014	19:30:00	Open	GFZ14	Long	20,200.00	1	1	Active	
DN-2-1404131400887-8	TN-2-1404131400887-69	20	02/07/2014	19:30:00	Open	GFZ14	Long	20,200.00	1	1	Active	
Change History												
Time	Change Trader	Action	Deal Detail				Order Detail					
17:10:15		Continue					Order	20379	↔	20425		

4. การแสดงหน้าจอ Pre-Confirm Report

4.1 Pre-Confirmation "By Order"

แสดง Position ตามที่ส่งเข้าตลาดฯ จริง เช่น Order ที่ส่งแบบ Auto แต่ระบบยังเข้าตลาดเป็น Open หน้าจอ Report จะแสดง Position เป็น "O" เป็นต้น

Order Trading Summary													
Order No	Side	Position	Series D	Order Time	Volume	Price	Status	Validity	Cancel Time	Matched	Confirm Price	Amount	Realized P/L
50301	L	O	S50N14	15:05:21	6	1,264.0	Matched	Cancel		2	1,264.0	505,600.00	
					6	1,264.0	Matched	Cancel	2	1,264.0	505,600.00		
			S50M14		6	999.0	Matched	Cancel	1	999.0	199,800.00		
					6	1,280.1	Matched	Cancel	2	1,280.1	512,040.00		
			S50N14		6	982.9	Matched	Cancel	1	982.9	196,580.00		
					6	875.0	Matched	Cancel	1	875.0	175,000.00		
			S50M14		6	858.9	Matched	Cancel	1	858.9	171,780.00		
					6	1,280.1	Matched	Cancel	2	1,280.1	512,040.00		
					Summary	Long	-	Open		6	-16.1		
50567	S	O	SVV14	10:14:00	1	700	Matched	Day		1	700	70,000.00	
					Summary	Short	-	Open		1	700		
50582	L	C	S50M14	13:43:57	10	1,200.0	Matched	Day		10	1,200.0	2,400,000.00	-369,490.00
					Summary	Long	-	Close		10	1,200.0		

4.2 Pre-Confirmation "By Matched Order"

แสดง Position ตามที่ได้รับ Confirm Deal กลับมาจากตลาดฯ

Order Trading Summary									
Order No	Side	Position	Series	Matched	Confirm Price	Avg. Price	Amount	Realized P/L	
50301	L	O	S50N14	2	1,264.0	-16.1	505,600.00		
				2	1,264.0	-16.1	505,600.00		
			S	S50M14	1	999.0	-16.1	199,800.00	
					2	1,280.1	-16.1	512,040.00	
			L	S50N14	1	982.9	-16.1	196,580.00	
					1	875.0	-16.1	175,000.00	
			L	S50N14	1	858.9	-16.1	171,780.00	
					2	1,280.1	-16.1	512,040.00	
			Summary	Short - Open	6	-16.1			
50567	S	O	SVV14	1	700	700	70,000.00		
			Summary	Short - Open	1	700			
50582	L	C	S50M14	10	1,200.0	1,200.0	2,400,000.00	-369,490.00	
			Summary	Long - Close	10	1,200.0		-369,490.00	

4.3 Pre-Confirmation "By Series"

แสดง Position ตามที่ได้รับ Confirm Deal กลับมาจากตลาดฯ

Order Trading Summary						
Side	Position	Series	Matched	Avg.Price	Amount	Realized P/L
L	O	S50M14	70	1,028.6	14,400,000.00	-338,980.00
L	C	S50M14	20	1,200.0	4,800,000.00	-738,980.00
S	O	S50M14	6	1,165.7	1,398,880.00	0.00
L	O	S50N14	6	1,149.6	1,379,560.00	0.00
S	O	SW14	1	700	70,000.00	0.00
Grand Total			103			-1,077,960.00

5. การคำนวณ Margin

การคำนวณ Margin สำหรับคำสั่งซื้อขายแบบ Auto Position จะใช้วิธีการคำนวณ Margin เหมือนกับการส่งคำสั่งซื้อขายแบบ Open/Close ตามปกติ ทั้งกรณีที่คิด Margin แบบ Gross/Net SRM และ Virtual SRM

การส่งคำสั่งซื้อขายแบบ Auto Position นี้ อาจทำให้เกิดกรณีที่หน้าจอ Order Status แสดงผลว่ามีรายการ Open Same Series ได้ แต่เมื่อมีรายการ Match กลับมา ระบบ Settrade จะทำการตรวจสอบ Closing Method ของ account นั้นๆ ก่อน หากพบว่ามี Closing Method แบบ Auto Net ระบบจะทำการ Net Position ใน Portfolio ให้ โดย Portfolio ของ account นั้น จะไม่แสดง Position เป็นแบบ Open Same Series แต่หากมี Closing Method เป็น Manual ก็จะไม่แสดง Portfolio เป็นแบบ Open Same Series ได้ตามปกติ

ตัวอย่าง

การส่งคำสั่งซื้อขายแบบ Auto Position อาจทำให้เกิดกรณีที่หน้าจอ Order Status แสดงผลว่ามีรายการ Open Same Series ได้ แต่เมื่อมีรายการ Match กลับมา ระบบจะทำการตรวจสอบ Closing Method ของ account นั้นๆ ก่อน หากพบว่ามี Closing Method แบบ Auto Net ระบบจะทำการ Net Position ใน Portfolio ให้ โดย Portfolio ของ account นั้น จะไม่แสดงเป็น Open Same Series ดังตัวอย่างดังนี้

Account: 111111

Closing Method: Auto Net

Step 0: Portfolio: ไม่มี Position ใน Port

Step 1: ส่งคำสั่งซื้อขาย Auto Long S50U14 จำนวน 1 สัญญา

>> ระบบส่งคำสั่งเป็น Open

Step 2: รายการยังไม่ Match

Step 3: ส่งคำสั่งซื้อขาย Auto Short S50U14 จำนวน 3 สัญญา

>> ระบบส่งคำสั่งเป็น Open

Step 4: รายการ Auto Long ได้รับการจับคู่

>> Position ของ Deal จะแสดงตามที่ได้รับ Confirm กลับมาจาก ตลาด.

>> Portfolio แสดง position Long S50U14 จำนวน 1 สัญญา

Step 5: รายการ Auto Short ได้รับการจับคู่

>> Position ของ Deal จะแสดงตามที่ได้รับ Confirm กลับมาจาก ตลาด.

>> Portfolio แสดง position ที่ net แล้ว เหลือเป็น Short S50U14 จำนวน 2 สัญญา
