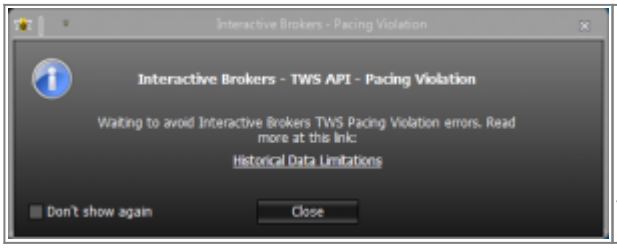
Interactive Brokers - TWS

beeTrader® si interfaccia ad Interactive Brokers attraverso la piattaforma TWS, utilizzando questo datafeed è possibile accedere ai dati storici di quasi tutti gli strumenti finanziari, siano essi titoli, futures o commodities ed è anche possibile ottenere le “Chain Opzioni”. La caratteristica di Interactive Brokers è la quantità limitata di dati storici.



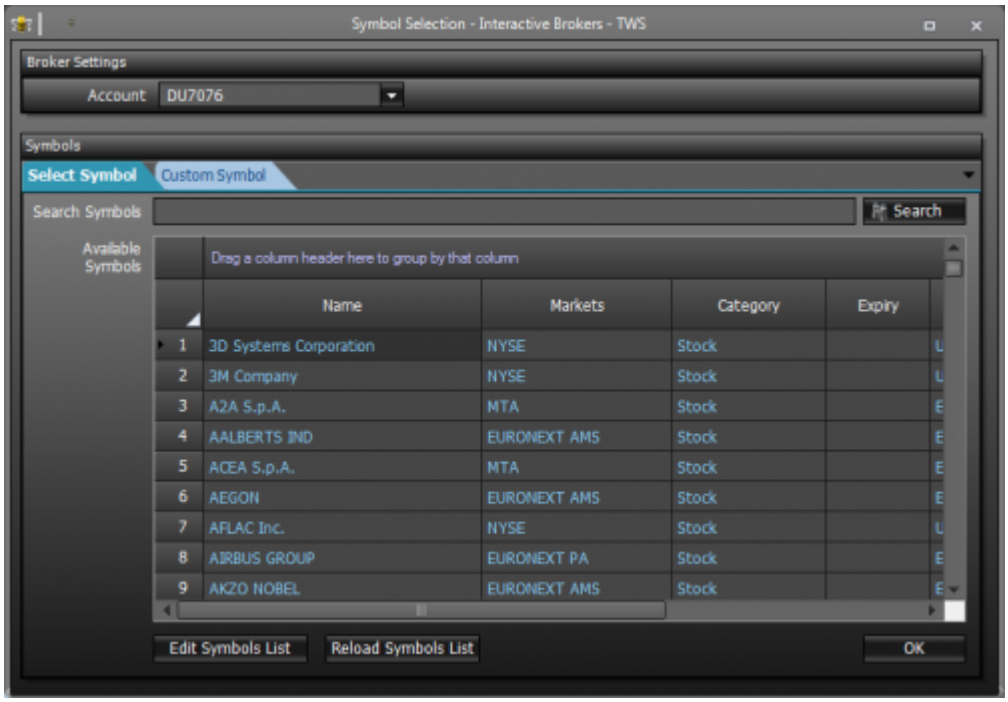
Questa finestra di avvertimento appare nel momento in cui beeTrader® è in attesa di scaricare ulteriori dati storici per rientrare nei limiti imposti da Interactive Brokers. Clicca qui per maggiori informazioni sulle limitazioni di dati storici di Interactive Brokers (Pacing Violation)

Quando da beeTrader collegato a Interactive Brokers si richiede un simbolo, la finestra di selezione è strutturata in due parti: Select Symbol e Custom Symbol, nella prima sono presenti gli strumenti finanziari censiti in Symbol Manager, nella seconda è possibile utilizzare tutti i simboli disponibili su Interactive Brokers attraverso una codifica specifica per ognuno spiegata di seguito.

	24/03/2016	Come Collegare beeTrader® a Interactive Brokers - TWS	7:42

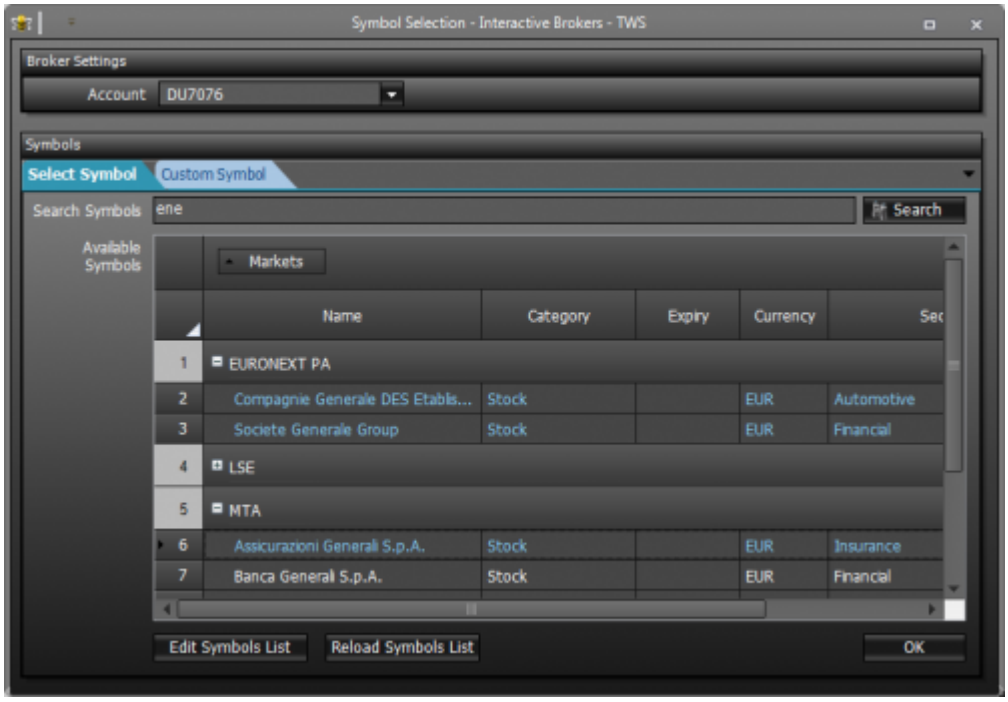
Select Symbol

Nella prima immagine viene rappresentata la finestra così come si presenta, con l'elenco completo di tutti i simboli censiti in Symbol Manager.



Nella seconda immagine viene rappresentata una funzione molto utile per ricercare i simboli: cliccando sulla qualsiasi colonna e trascinandola nella zona immediatamente sopra è possibile raggruppare i simboli, nell'esempio sono stati raggruppati per Market, e come si vede la funzione

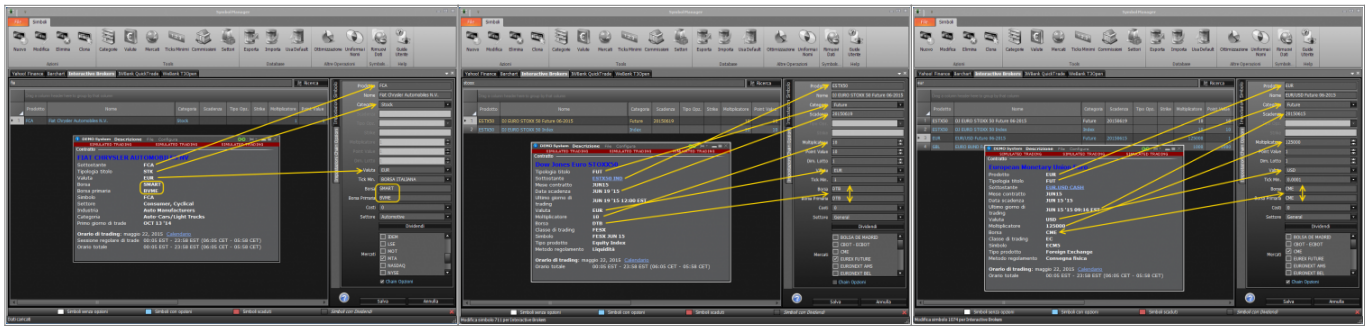
Search attua la ricerca in ogni gruppo.



Esempio di aggiunta simbolo in Symbol Manager

Attenzione: Symbol Manager richiede la connessione alla TWS per la codifica dei simboli.

Come si può vedere i parametri sono diversi in base al tipo di strumento, uno Stock ha meno parametri di un future, manca per esempio la data di scadenza o il moltiplicatore.



Negli esempi di cui sopra vediamo come collegare uno `stock` (Fiat Chrysler Automobiles), un `future su indice o stock` (DJ EURO STOXX 50 - Giugno 2015), ed un `future valutario o su rendimenti` (EUR/USD Giugno 2015) su Symbol Manager. Quasi tutti i parametri sono quindi facilmente reperibili direttamente dalla TWS.
La Borsa Primaria (Primary Exchange) se non è scritta separatamente nella TWS va scritta in Symbol Manager esattamente come la Borsa (Exchange). Per il valore del tick minimo si può fare riferimento a questa pagina Contract Details

---

Esempio aggiunta Chain Opzioni a sottostante in Symbol Manager

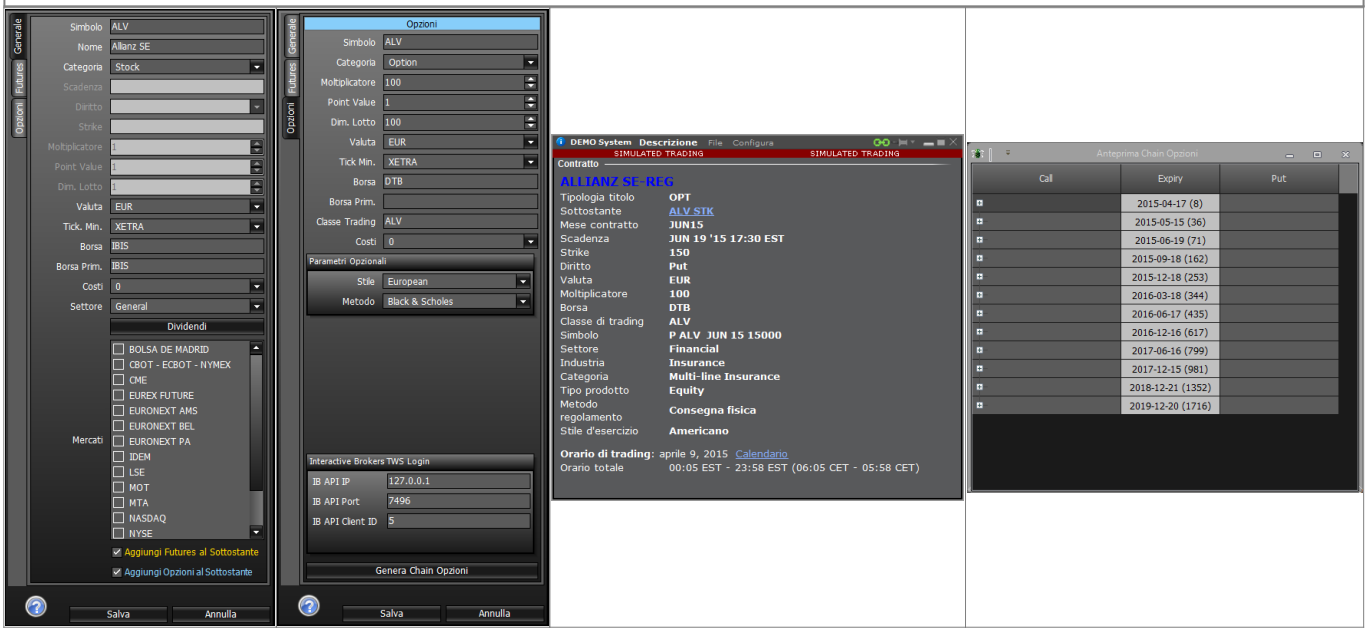
Attenzione: Symbol Manager richiede la connessione alla TWS per la codifica dei simboli.

La procedura per aggiungere la Chain Opzioni ad un sottostante in Interactive Brokers è molto semplice, in quanto la TWS permette la ricerca direttamente utilizzando il simbolo. E' importante che tutti i parametri siano impostati correttamente, in caso contrario la Chain Opzioni non sarà scaricata dalla TWS. Una volta codificata la Chain Opzioni verranno scaricate tutte le opzioni disponibili per il sottostante sia weekly che monthly.

1. Codificare il sottostante (nell'esempio di cui sotto ALLIANZ SE), utilizzando tutti i parametri disponibili nel Contract Details della TWS accessibile cliccando con il tasto destro del mouse sul titolo;
2. Spuntare la casella “Aggiungi Opzioni al Sottostante” in fondo alla finestra;
3. Si apre la sezione Opzioni della Sidebar nella quale impostare tutti i parametri disponiblli nel Contract Details della TWS accessibile cliccando con il tasto destro del mouse su un'opzione del titolo sottostante;
4. Cliccare su Genera Chain Opzioni: se tutti i parametri sono corretti dalla TWS di Interactive Brokers si riceve un'Anteprima della Chain;
5. Cliccare su Salva. A questo punto il sottostante Allianz SE è codificato con la propria Chain Opzioni e può quindi essere utilizzato con Iceberg in beeTrader®.

**Nota: il campo Moltiplicatore (paramentro richiesto da Interactive Brokers) è molto spesso sempre il prodotto di Point Value e Dim. Lotto. In linea di massima per le stock options il Point Value è 1 e quindi il Moltiplicatore è uguale alla Dim. Lotto, mentre per le index options la Dim. Lotto è 1 e quindi il Moltiplicatore è uguale al Point Value.
Fanno eccezione le options su commodities che pur avendo Dim. Lotto pari a 1 possono avere Moltiplicatore e Point Value diversi**

Nota: la sezione Parametri Opzionali della scheda “Impostazioni Chain Opzioni” serve per impostare i parametri utilizzati nel motore di calcolo per i prezzi teorici. Quindi questi parametri non influenzano in alcun modo i calcoli, le quotazioni delle opzioni, ma solo il valore teorico calcolato. Di default tutte le opzioni sono impostate in Stile “European” e Metodo “Black & Scholes”, questo perchè viene garantita una buona approsimazione ed una notevole velocità di calcolo.



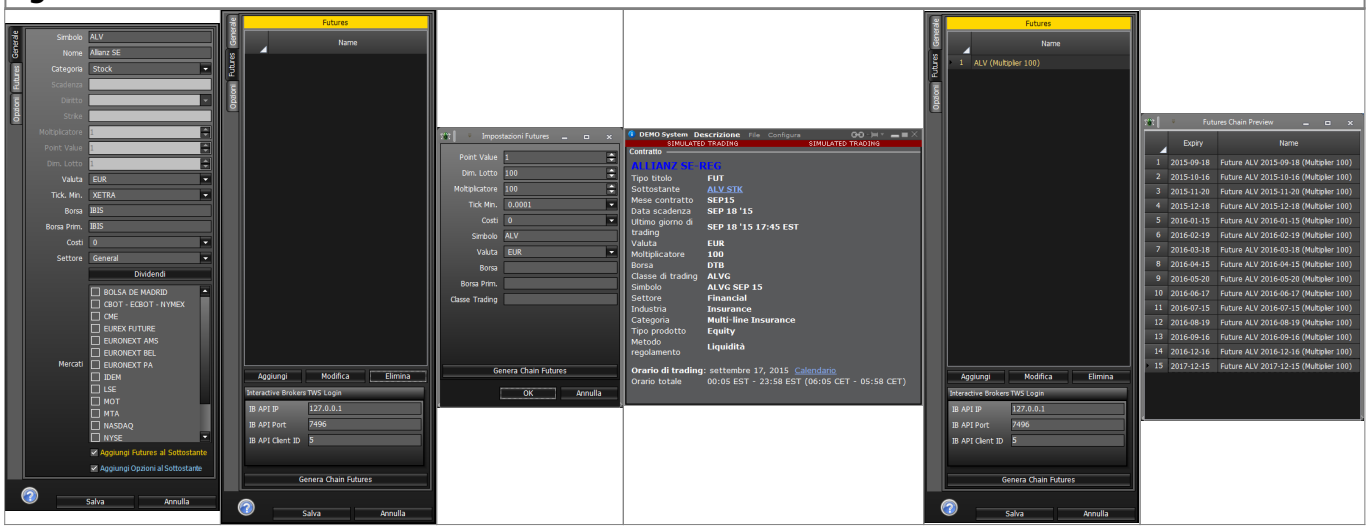
Esempio aggiunta Chain Futures a sottostante in Symbol Manager

Attenzione: Symbol Manager richiede la connessione alla TWS per la codifica dei simboli.

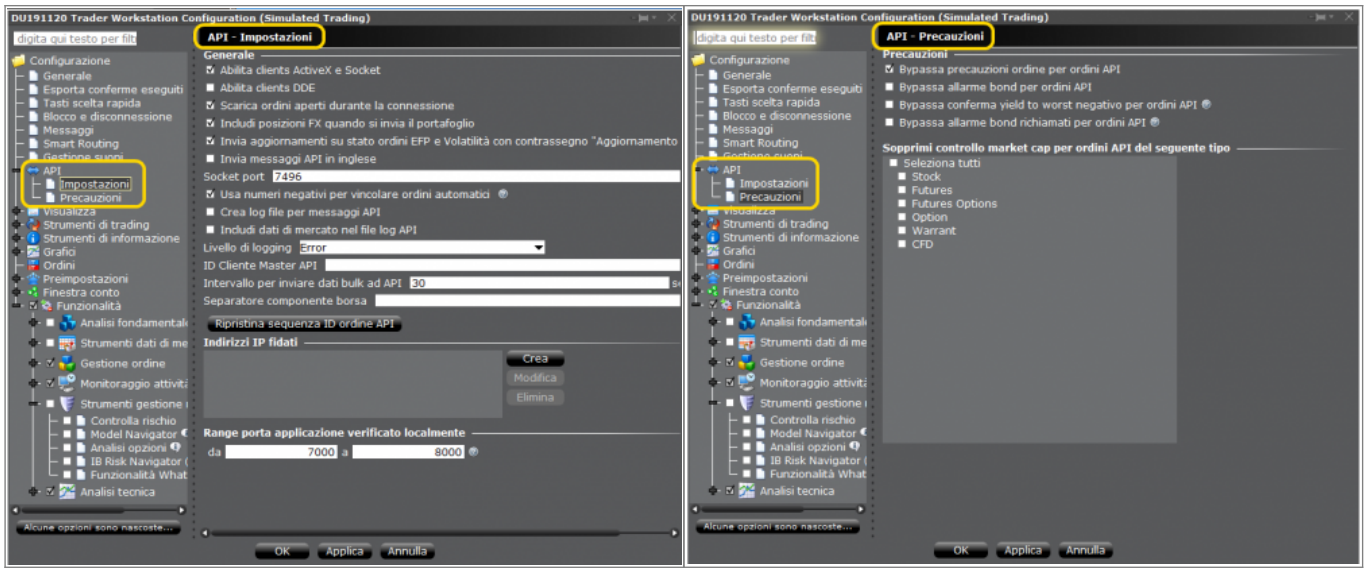
La procedura per aggiungere la Chain Futures ad un sottostante in Interactive Brokers è molto semplice, in quanto la TWS permette la ricerca direttamente utilizzando il simbolo. E' importante che tutti i parametri siano impostati correttamente, in caso contrario la Chain Futures non sarà scaricata dalla TWS.

1. Codificare il sottostante (nell'esempio di cui sotto ALLIANZ SE), utilizzando tutti i parametri disponibili nel Contract Details della TWS accessibile cliccando con il tasto destro del mouse sul titolo;
2. Spuntare la casella “Aggiungi Futures al Sottostante” in fondo alla finestra;
3. Si apre la sezione Futures della Sidebar nella quale impostare tutti i parametri disponiblli nel Contract Details della TWS accessibile cliccando con il tasto destro del mouse su un'opzione del titolo sottostante;
4. Cliccare su Genera Chain Futures: se tutti i parametri sono corretti dalla TWS di Interactive Brokers si riceve un'Anteprima della Chain;
5. Cliccare su Salva. A questo punto il sottostante Allianz SE è codificato con la propria Chain Futures e può quindi essere utilizzato con Iceberg in beeTrader®.

Nota: il campo Moltiplicatore è sempre il prodotto di Point Value e Dim. Lotto. In linea di massima per gli stock futures il Point Value è 1 e quindi il Moltiplicatore è uguale alla Dim. Lotto, mentre per gl index futures la Dim. Lotto è 1 e quindi il Moltiplicatore è uguale al Point Value.

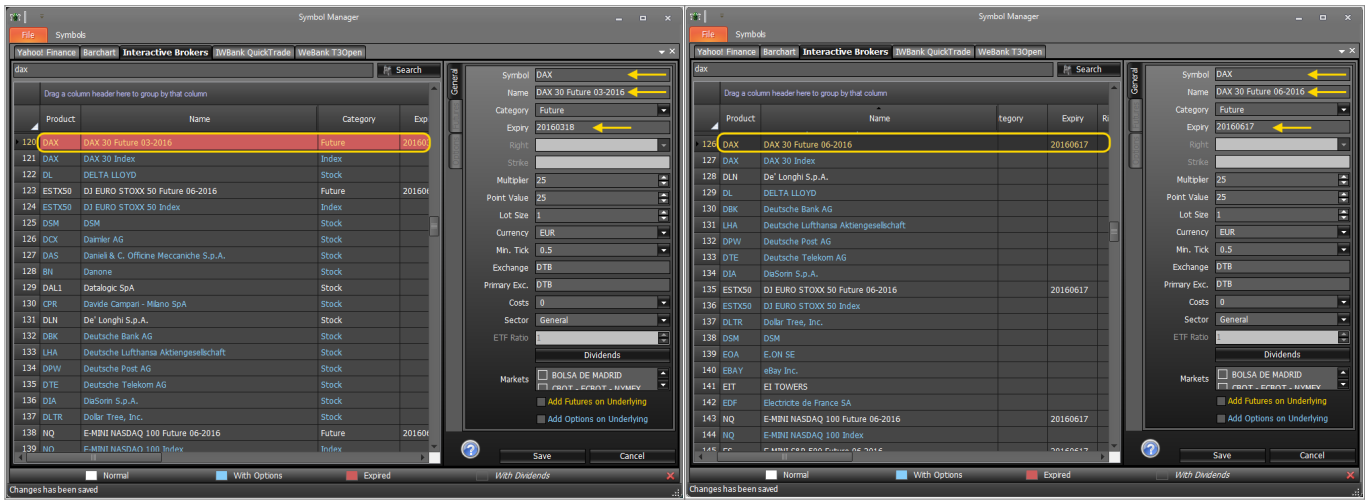


Configurazione API TWS per l'utilizzo di beeTrader®



La scadenza di un Future

Come ben sappiamo, i future, sia su indici che su commodities che su obbligazioni, sono soggetti a scadenza che solitamente avviene ogni tre mesi, ma può avvenire anche ogni mese. In Symbol Manager un future scaduto viene evidenziato di rosso, a questo punto si rende quindi necessaria la sostituzione del simbolo di collegamento del future, del nome e della data di scadenza.



Se i prezzi delle Opzioni non si aggiornano

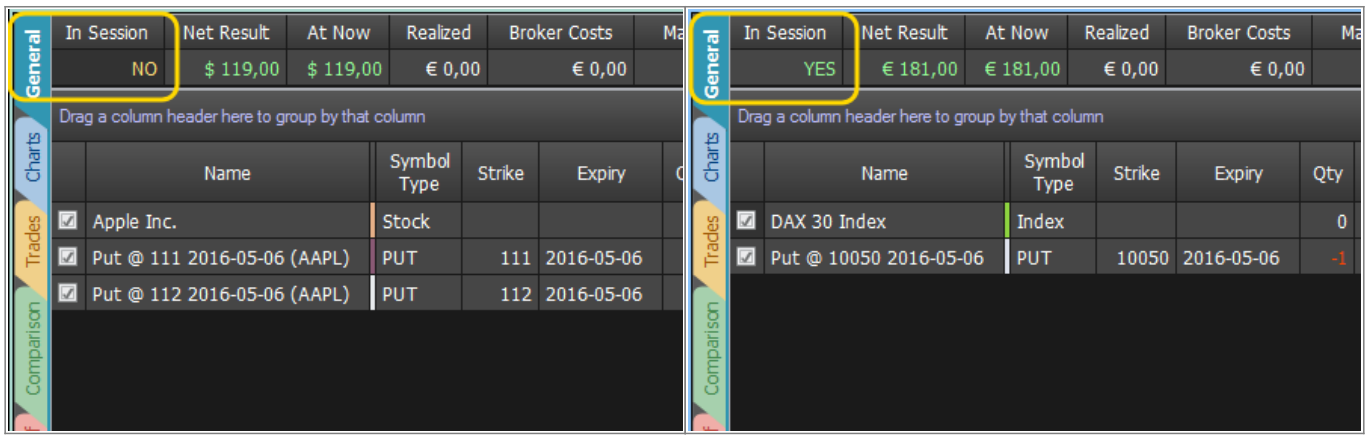
Una volta che il simbolo è stato codificato in Symbol Manager e ad esso è stata correttamente associata la Chain Opzioni (vedi paragrafi precedenti) può verificarsi il caso che i prezzi delle opzioni non si aggiornino, in questo caso possono esserci diversi cause. Di seguito le principali:

Configurazione API della TWS

Verificare che il campo “Enable ActiveX and Socket Clients” sia abilitato e “Socket Port” sia impostato uguale ala finestra di Login di beeTrader (di default è impostato 7496)

Sessione di Mercato

A tutti i simboli censiti in Symbol Manager è associato un Mercato con i relativi orari di negoziazione. I prezzi in realtime vengono ricevuti sia in beeTrader che in Iceberg entro gli orari che sono impostati. Per comodità la prima proprietà della finestra General è proprio quella che informa l'utente se attualmente si è in sessione o meno.



E' possibile modificare gli orari associati ad un Mercato, per maggiori informazione clicca qui.

Classe di Trading

From:
http://manuals.playoptions.it/Iceberg_old/ - **Iceberg Options Solutions**

Permanent link:
http://manuals.playoptions.it/Iceberg_old/interactive_brokers_-_tws?rev=1460712117

Last update: **2016/07/12 16:13**