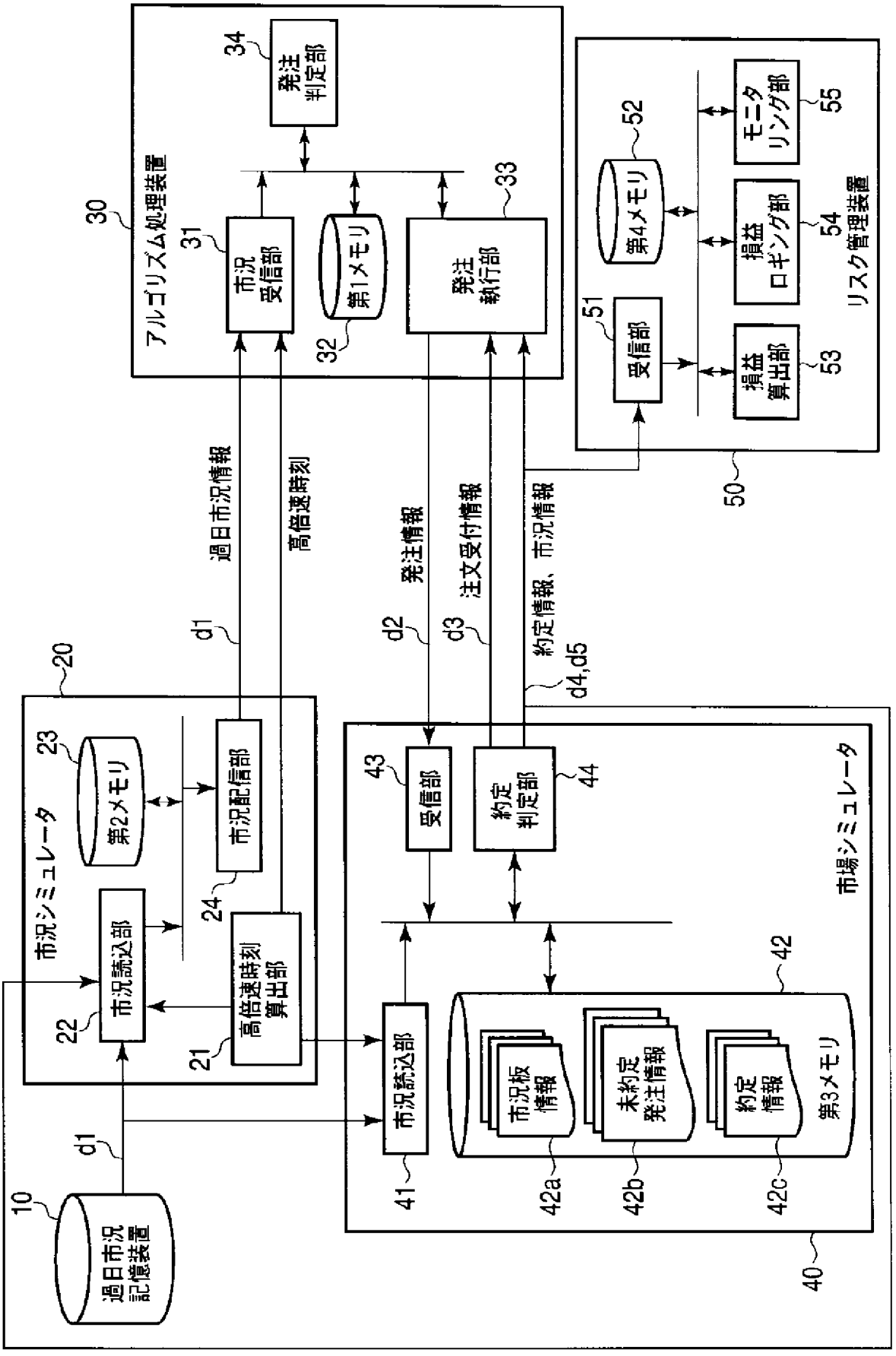
[図1]


過日市況記憶装置
10
d1
市況シミュレータ
20
市況読込部
22
第2メモリ
23
高倍速時刻算出部
21
市況配信部
24
過日市況情報
高倍速時刻
アルゴリズム処理装置
30
市況受信部
31
第1メモリ
32
発注執行部
33
発注判定部
34
d2
発注情報
d3
注文受付情報
d4,d5
約定情報、市況情報
市場シミュレータ
40
市況読込部
41
受信部
43
約定判定部
44
第3メモリ
42
市況板情報
42a
未約定発注情報
42b
約定情報
42c
リスク管理装置
50
受信部
51
第4メモリ
52
損益算出部
53
損益ロギング部
54
モニタリング部
55

[図2]

42a

市況板情報		
番号	項目名	設定値例
	日付	
1	タイムスタンプ	9:00:01,000100
2	銘柄	6502
3	売気配価格1	420
4	⋮	
5	売気配価格10	460
6	売気配数量1	3000
7	⋮	
8	売気配数量10	5000
9	買気配価格1	449
10	⋮	
11	買気配価格10	440
12	買気配数量1	5000
13	⋮	
14	買気配数量10	8000
15	売成行数量	10000
16	買成行数量	12000
17	現在値	460
18	出来高	1,000,5000

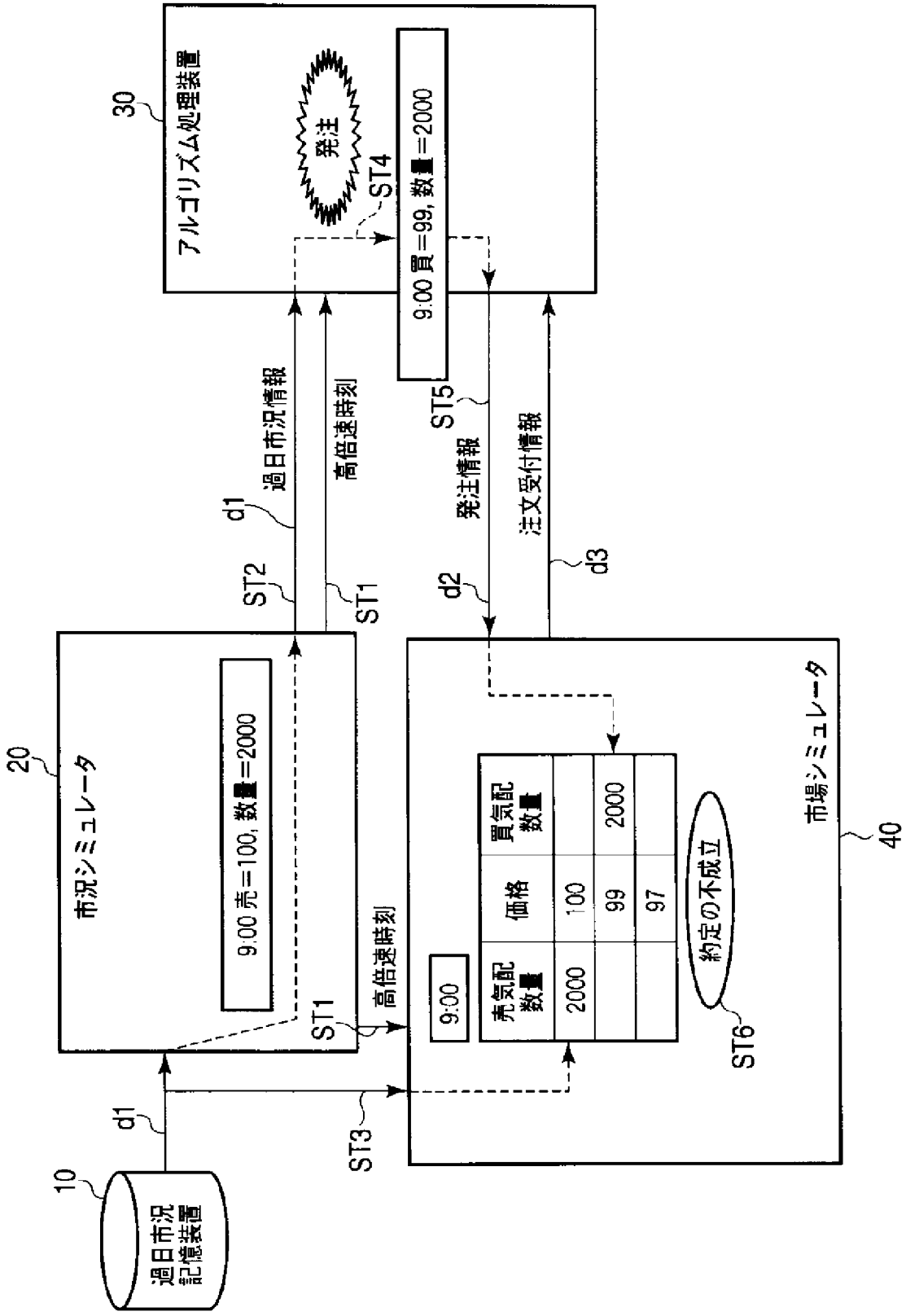
[図3]

Side	価格	約定判定条件及び約定数量
買	指値	指値≧売気配価格～（複数価格）の気配数量分
	成行	最良（最も安い）気配価格～の気配数量
売	指値	指値≦買気配価格～（複数価格）の気配数量分
	成行	最良（最も高い）気配価格～の気配数量

[図4]

	項目名	計算方法
1	買数量	買数量の積算
2	売数量	売数量の積算
3	Net数量(Position)	買数量-売数量
4	買金額	Σ買数量×約定価格
5	売金額	Σ売数量×約定価格
6	ポジション金額	Net数量×現在値
7	損益	ポジション金額－買金額＋売金額
8	VAR	損益の標準偏差

[図5]



[図6]

d1

タイムスタンプ	銘柄コード	売気配値	売気配数量
09 : 00 : 01. 234	6502	100	2000

[図7]

d2

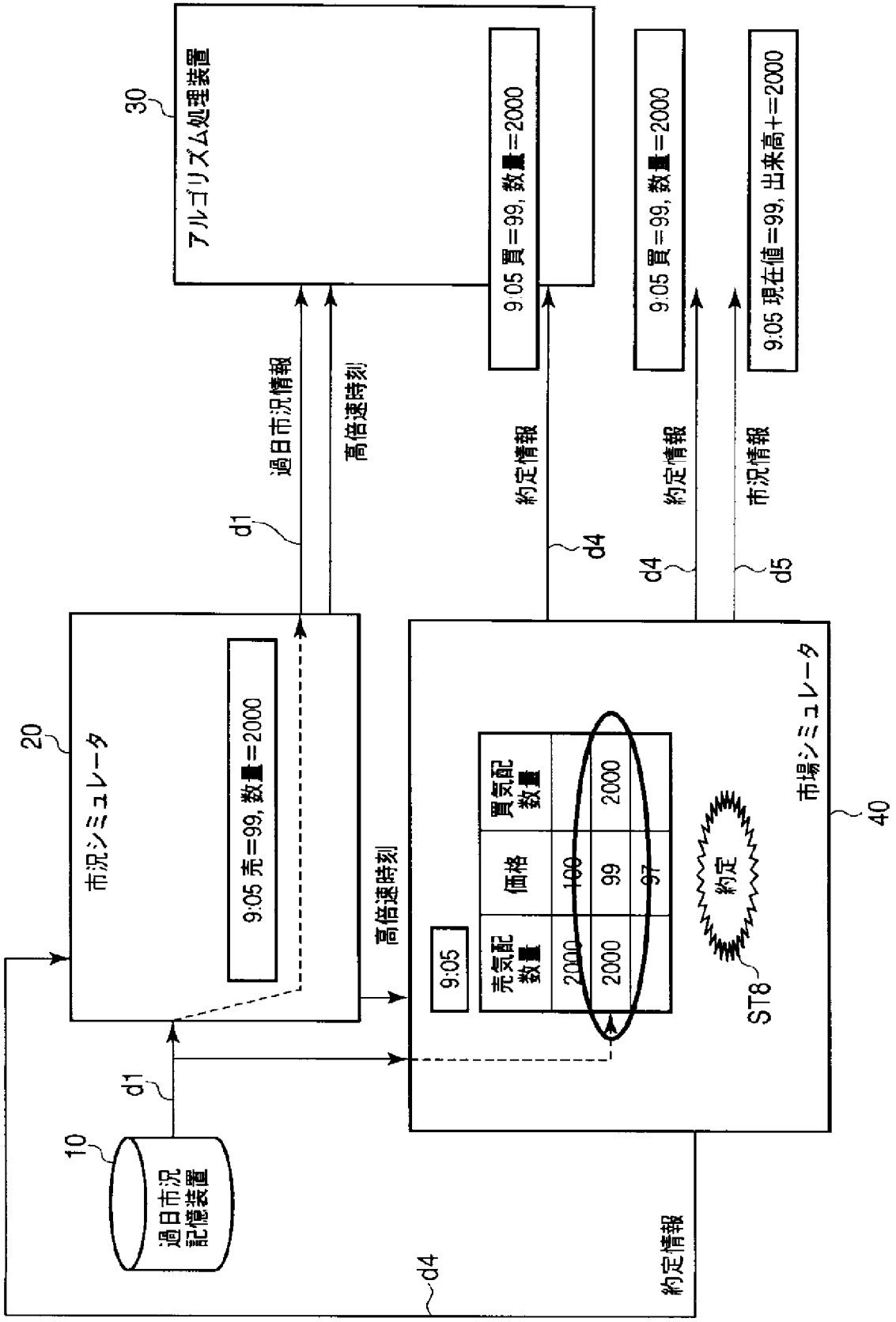
発注タイムスタンプ	銘柄コード	売買	価格	数量
09：00：03.000	6502	2：買	99	2000

[図8]

d3

発注タイムスタンプ	銘柄コード	売買	価格	数量
09：00：03.000	6502	2：買	99	2000

[図9]


30
アルゴリズム処理装置
9:05 買=99, 数量=2000
9:05 買=99, 数量=2000
9:05 現在値=99, 出来高+=2000
過日市況情報
高倍速時刻
約定情報
約定情報
市況情報
d1
d4
d4
d5
20
市況シミュレータ
9:05 売=99, 数量=2000
高倍速時刻
9:05
売気配 数量
価格
買気配 数量
2000
100
2000
2000
99
2000
97
約定
ST8
市場シミュレータ
40
d1
10
過日市況 記憶装置
d4
約定情報

[図10]

d1

タイムスタンプ	銘柄コード	売気配値	売気配数量
09：05：02.001	6502	99	2000

[図11]

d4

タイムスタンプ	銘柄コード	約定価格	買数量
09：05：03.000	6502	99	2000

[図12]

d5

タイムスタンプ	銘柄コード	現在値	出来高
09：05：04.000	6502	99	2000