

ORDERVANE

Quantower 大单检测指标

/

DOM — 安装与激活指南

ordervane.com

© 2026 OrderVane. All rights reserved.

目录

开始之前	3
第 1 步 — 找到 Quantower 的 "Indicators" 文件夹	3
第 2 步 — 关闭 Quantower	3
第 3 步 — 复制 OrderVane 文件夹	3
第 4 步 — 重启 Quantower	4
第 5 步 — 把 OrderVane DOM 加到图表	4
第 6 步 — 输入许可证密钥	4
第 7 步 — 确认正常工作	4
读懂梯形	4
成交明细与力量计	5
流量面板	6
持仓显示	6
快捷菜单（图表上）	7
许可证与激活	7
更新到新版本	7
卸载	7
故障排除	7
设置参考	8
支持	10
免责声明	10

OrderVane DOM 读取你图表所用品种的订单簿。它是一个独立指标，在自己的窗口中（或者按你的偏好，在图表右侧）打开与价格对齐的深度梯形：买卖两侧的挂单量、最近几秒新增与撤销的数量、成交与撤单的区分、当数据源提供逐笔订单深度（MBO）时的订单数与补单、梯形旁重建的成交明细，以及显示最近几分钟里每个价格挂单量如何变化的流量面板。

OrderVane DOM 是一款分析与可视化工具。它不会下单、改单或撤单，也不提供买卖信号。下单仍由 Quantower 自带的 DOM Trader 完成；每个决定都由你做出。

速览 — 约 3 分钟。关闭 Quantower -> 把 OrderVane_DOM 文件夹复制到 Quantower 的 Settings\Scripts\Indicators 文件夹 -> 重启 Quantower -> 粘贴许可证密钥。详细步骤见下文。

开始之前

你需要：

- 已安装 Quantower（免费版或券商版；建议最新版本）。
- Windows（Quantower 桌面版）。
- 你的 OrderVane DOM 许可证密钥 — 在购买确认邮件中。
- OrderVane DOM 下载包（一个 .zip 文件）— 来自该邮件中的下载链接。 .zip 包含指标和本指南。
- 首次激活（以及定期重新验证）需要联网。
- 所分析品种的 Level 2（市场深度）数据。梯形由深度事件构建；没有深度时显示 waiting for depth。
- 成交（time & sales）数据，用于成交明细、成交判定和力量计。

OrderVane DOM 可与 OrderVane Lite 或 Pro 并存。它是独立指标、独立密钥；无需安装其他产品。

第 1 步 — 找到 Quantower 的 "Indicators" 文件夹

Quantower 从 Settings\Scripts\Indicators 文件夹加载自定义指标。标准安装下为：

```
C:\Quantower\Settings\Scripts\Indicators
```

如果不确定 Quantower 装在哪里：找到包含 Settings\Scripts\Indicators 的 Quantower 文件夹。

第 2 步 — 关闭 Quantower

如有需要先保存工作区，然后完全退出 Quantower（关闭应用程序，而不只是关闭图表）。Quantower 运行期间无法安装或替换指标文件。

第 3 步 — 复制 OrderVane 文件夹

1. 先解除下载文件的锁定（Windows）。右键点击下载的 .zip -> 属性 -> 若底部有 解除锁定 复选框，勾选并点 确定。Windows 会标记来自互联网的文件；解压前解除锁定，Quantower 才能加载指标。
2. 解压下载包。
3. 把 OrderVane_DOM 文件夹复制到第 1 步的 Indicators 文件夹。

最终结构应完全如下：

```
...\Settings\Scripts\Indicators\OrderVane_DOM\OrderVane_DOM.dll
```

提示 — 如果 Indicators 文件夹不存在，请新建。DLL 要放在自己的 OrderVane_DOM 子文件夹里（不要散放）。

第 4 步 — 重启 Quantower

重新启动 Quantower。它会在启动时扫描 Indicators 文件夹并加载新指标。

第 5 步 — 把 OrderVane DOM 加到图表

1. 打开想观察的品种图表（任意周期 — 梯形按价格对齐，与K线无关）。
2. 打开图表的 指标 列表，搜索 OrderVane DOM。
3. 添加。许可证密钥生效后（第 6 步），梯形会在自己的窗口中打开，窗口标题为 OrderVane DOM · <[]>。请保持图表打开 — 窗口跟随该图表的品种。

在输入密钥之前，图表显示水印且窗口不会打开。

想把梯形直接放在图表上？在指标设置中把 DOM surface 设为 Chart。梯形随即绘制在图表右侧，其标题中的 window 按钮可把它移回窗口。

第 6 步 — 输入许可证密钥

1. 打开指标设置（在图表图例中右键点击指标名 -> Settings）。
2. 在 License 区找到 OrderVane: License key (paste after purchase)，粘贴购买邮件中的密钥。
3. 点 Apply / OK。

密钥在线验证通过后，水印几秒内消失。同一区的 License status (auto) 显示当前状态。

第 7 步 — 确认正常工作

- 深度事件到达后，窗口的 Session 字段显示 depth since HH:MM。（在图表表面上，同一行位于梯形标题 DOM · <[]> 下方。）
- 行内左侧为买方挂单量、右侧为卖方挂单量；最优买卖价与 Quantower 自带 DOM Trader 一致。
- 在窗口工具栏中，若数据源提供逐笔订单深度，MBO 前的圆点为实心；否则为空心，并提示在哪里开启。（在图表表面上，标题徽章显示 MBO on 或 MBO off。）

若显示 waiting for depth events 超过一分钟，请确认数据源为该品种提供 Level 2（见故障排除）。

读懂梯形

每一行是一个价格（缩小时会合并多个价格 — 梯形绘制的行永远不低于三像素）。

- bid / ask — 每侧的挂单量。空格表示没有挂单。

- cumulative depth — 开启 DOM column: cumulative depth 后，数字为从最优价向外的累计总量。
- $\pm NsB / \pm NsA$ — 最近 N 秒内该价位新增 (+) 与撤销 (-) 的数量，N 为 DOM add/pull window (sec)，买盘侧与卖盘侧各占一列。短条显示净方向，两列共用同一刻度，因此长度可以互相比。把标题切到 $\pm$ 则从窗口附加时算起。关闭 DOM column: add/pull split by side 会把两侧合回一列：省出宽度，但在价格穿过的行上不得让两侧互相抵消。
- imb — 该行买卖量占比。标题还会汇总每侧前 N 档 (DOM imbalance top-N levels) 并显示买方百分比。
- sess — 本交易时段在该价位的成交量。OrderVane DOM 挂载时会从数据源的逐笔历史载入本时段的成交，之后逐笔累加新成交，因此该列从一开始就覆盖整个时段。历史载入期间该列为空，窗口的 Session vol 字段显示 loading ticks；若数据源不提供逐笔历史，该列改用图表 K 线，字段名称末尾带 chart。Session vol 显示时段总量和 $\square$ (主动买入与主动卖出成交量之差)；无法判断方向的成交计入总量，但不计入 $\square$ 。时段的控制点会整格填充并以粗体绘制。打开 DOM session VWAP line 后，一条点划线标出时段的成交量加权平均价，它由同一批成交在整个时段上计算得出，而不只是这架梯形当前显示的价格区间；末位小数可能与你的经纪商自己的 VWAP 不同。
- trd — 指标加载后在该价位观察到的买入与卖出成交笔数 (仅实时)。
- 大额挂单在超过可见平均值的 DOM large-lot highlight (x avg) 倍时高亮。若买卖墙登记在运行，芯片还会显示该量已挂了多久。
- 吸收芯片 (F 41, 当该行补单次数达到 DOM iceberg min refills 时前面加上补单次数) — 通过成交而非撤单离开该行的数量，以及该行补单的次数。这些是观察，不是结论。

成交与撤单

挂单量减少时，OrderVane DOM 最多等待 DOM fill match window (ms)，看该价位对应一侧是否出现成交。若出现，减少计为成交；否则计为撤单。窗口故意很短 — 过长会把不相关的成交归到不相关的撤单上。

逐笔订单深度 (MBO)

有些数据源逐笔发送每一张订单 (Market by Order)，而不是每个价位一个总量。开启 MBO 后，梯形增加 ord 列显示每个价位的挂单笔数，并能区分补单和新订单。

在 AMP/CQG 上这是连接设置：在 CQG 连接设置中开启 Enable "Market by Order" (MBO) mode，然后重新连接。窗口工具栏上的 MBO 圆点 (在图表面上则是标题徽章) 会确认。没有 MBO 时 ord 列直接不绘制 — 绝不会显示代表 "未知" 的零。

你自己的挂单

开启 DOM my orders queue estimate 后，OrderVane DOM 从 Quantower 读取 (只读) 你的限价挂单并标记其所在行。芯片 me 3 · ≤ 41 est 表示：你的 3 手订单，前方估计最多 41 手。估计值从首次看到你的订单时该行的挂单量开始，随着该行成交或撤单而减少。它是上限 — 交易所不会告诉我们你在队列中的确切位置，你身后的撤单看起来与身前的一样。把订单移到另一价位会重新开始估计。

成交明细与力量计

- 成交明细面板 — 停靠在梯形左侧的重建 time & sales，最新一行在最上。同价同向、且在 DOM tape group window (ms) 内到达的成交显示为一行并带 $\times N$ 计数。DOM tape min size (0=all) 隐藏小额行。
- 力量计 — 窗口信息栏中的两个字段 Effort 与 Book ± 5 (在图表面上为梯形标题中的两行)。effort 30s buy 118 · sell 96 · 41 prints 按主动方汇总最近 DOM power meter window (sec) 的成交。book ± 5 5s bid +40 -12 · ask +8 -33

汇总最优买卖价周围五个价位的新增与撤销。两者都是观察到的总量；背后没有任何评分。

流量面板

流量面板位于成交明细与梯形之间，显示最近几分钟里每个价格的挂单量如何变化。行就是梯形上的同一批价格；时间自左向右，最新的一片紧贴梯形，位于右边缘。回溯长度由 DOM window flow panel length (min) 决定。

- 亮度代表挂单量。低于刻度 DOM flow heat lower cutoff % 的部分保留为背景，只画值得看的量；超过 DOM flow heat upper cutoff % 的部分以满亮度绘制。刻度本身以 `=N` 印在面板标题上。
- 绿色与红色区分买盘侧与卖盘侧的行（DOM flow heat bid/ask colors）。
- 圆点是成交，按主动方着色。同样宽度的圆始终代表同样的手数：刻度以 `●=N` 印在标题上，超过刻度的成交会以满宽加一圈外环绘制，而不是被悄悄截断。
- 阶梯线是每一片里最近一笔成交的价格；两条彩色线是最优买价和最优卖价。

读一行：圆点不断打上去而带子仍在，说明扛住了；带子随圆点结束，说明被吃掉；带子没有圆点就结束，说明被撤单；圆点之后带子又回来，说明补挂。这些是观察，不是信号。

记录从 DOM 窗口附加的那一刻开始 —
平台不保存历史盘口，因此没有更早的记录。阴影区域是盘口发送范围之外的价格。

均衡器

窗口工具栏上的 EQ 按钮会在面板上方打开五个滑块，让你边看边调，而不必回到设置对话框：

	作用
FLOOR	低于刻度这一比例的量保持为背景。面板看起来像一片均匀的糊时调高它。
TOP	高于这一比例的量以满亮度绘制。想突出中间区段时调低它。
BUBBLE	最大成交圆的宽度上限。
MIN TRADE	小于这一数量的成交不绘制。
SCALE	把圆填满整个宽度所需的成交量。AUTO 保持一个整数（5、10、20、50...），只有当面板在新水平上停留一段时间后会改动，因此同样的圆始终代表同样的手数。

拖动轨道得到大致数值，或点击数字直接输入精确值 — 20%、14px 和 auto 都可接受，超出允许范围的值会被截到边界而不是被拒绝。

持仓显示

四个可选的只读标记显示你已经在哪里。OrderVane DOM 从不下单、改单或撤单 — 它只画出你的经纪商已经持有的东西。四项默认都关闭。

- DOM position average line — 在你的均价上画一条线，旁边标注数量和价格。如果同一合约同时持有多头和空头，则不画线：没有唯一的均价可以显示。
- DOM position stop / target lines — 已经挂在该持仓上的止损与止盈订单的价格。
- DOM column: P&L ticks — 一系列数字，表示在该价格平仓会盈亏多少跳。只用跳数：平台不公开一跳的现金价值，换算就等于猜测。空仓时该列为空。
- DOM position P&L in ticks — 在工具栏的金额旁边加上以跳数表示的浮动盈亏。

快捷菜单（图表上）

图表左缘一个梯形小按钮打开面板，包含最常用的开关与步进器：各列开关、订单列与队列估计、成交明细面板与力量计、流量面板，以及宽度 / 窗口 / 增撤 / 大额 / 明细步进器。点击一行即可切换；在步进行上使用 $-$ $+$ 按钮或鼠标滚轮。每次更改都随图表保存。

窗口自身的菜单按钮里有 Clear 子菜单。除了全部清除，它还能单独清除当前价上方或下方的近期成交 — 当价格正朝某个水平推进、另一侧的旧痕迹碍事时很有用。

许可证与激活

- 密钥可同时在两台电脑上激活。换机时，在旧机勾选 Release license from this PC 和 Confirm: release license now，再在新机输入密钥。
- 指标会定期重新验证，短暂离线仍可继续使用。
- 密钥丢失？它在购买邮件里；邮件中的下载链接也提供当前安装包。

更新到新版本

有新版本时，图表上的名称徽章显示 $\uparrow$ Update available •
ordervane.com/update。从订单页面下载当前安装包，关闭 Quantower，替换 OrderVane_DOM 文件夹，重启。图表、设置和密钥都会保留。

卸载

关闭 Quantower，从 Settings\Scripts\Indicators 删除 OrderVane_DOM 文件夹，重启。

故障排除

现象	检查什么
waiting for depth events 超过一分钟	数据源没有为该品种发送 Level 2。打开同一品种的 Quantower 自带 DOM Trader — 若同样为空，原因在数据订阅。
窗口的 Session 字段出现 idle Ns（图表标题中为 no depth events Ns）	数据源停止发送深度。通常会自行恢复；重新连接也会重置。
数据源支持，MBO 圆点却一直 是空心（图表表面上显示 MBO off）	在 AMP/CQG 的连接设置中开启 Enable "Market by Order" (MBO) mode 并重新连接。
图表表面上梯形没有绘制	图表太矮（可用高度不足约 140 px）或梯形宽度大于图表。放大图表或降低 DOM ladder width (px)。
每行覆盖不止一个 tick	DOM ladder ticks per row 大于 1。点击窗口工具栏上的 $T \times N$ 逐级切换，或把它设回 1。在图表表面上，行高不足三像素时也会合并。

现象	检查什么
成交明细面板不见了	它需要梯形左侧的空间。在窗口中，窗口宽度小于约 520 px 时它会隐藏 — Tape 按钮的悬停提示会说明这一点；在图表面上，窄图表上会被跳过。加宽窗口或图表，或降低梯形宽度。
输入密钥后水印仍在	检查网络连接，以及密钥是否完整复制。License status (auto) 会显示原因。

设置参考

除特别说明外，所有设置都在 DOM Ladder 区。标签与设置对话框中完全一致（英文）。

DOM Ladder

设置	默认值	作用
DOM ladder	On	梯形及以下所有功能的总开关。
DOM ladder width (px)	300	面板宽度（160-520）。
DOM ladder window (ticks)	200	内存中价格窗口的半高（每侧 50-1000 tick）。
DOM ladder ticks per row	1	每行合并的 tick 数 — 相当于 DOM 的缩小。窗口工具栏上也有，显示为 T×N。
DOM column: cumulative depth	Off	显示从最优价向外的累计总量。
DOM column: session volume (sess)	On	每个价位的本时段成交量。
DOM column: trades at price	Off	指标加载后每个价位的买卖成交笔数。
DOM column: imbalance	On	每行买卖占比及标题中的 top-N 汇总。
DOM imbalance top-N levels	5	标题每侧汇总的档数（1-50）。
DOM add/pull window (sec)	5	每行显示的新增/撤销秒数（1-30）。
DOM large-lot highlight (x avg)	4.0	超过可见平均值此倍数的挂单量高亮（1.5-20）。
DOM absorption chips	On	显示每行观察到的成交与补单。
DOM column: order count (#ord)	On	每个价位的挂单笔数。仅当数据源提供逐笔订单深度时绘制。
DOM fill match window (ms)	150	量减少后在此窗口内出现匹配成交则计为成交，否则计为撤单（50-1000）。

设置	默认值	作用
DOM iceberg refill window (ms)	800	刚成交的行在此窗口内的新增计为补单（100-5000）。
DOM iceberg min refills	2	补单次数达到此值才显示补单芯片（1-10）。
DOM my orders queue estimate	On	标记你自己的限价挂单并给出前方数量的上限估计。只读。
DOM tape panel	On	梯形左侧的重建 time & sales。
DOM tape rows	20	显示的行数（5-60）。
DOM tape group window (ms)	50	此窗口内同价同向的成交合并为一行（0-500；0 = 不合并）。
DOM tape min size (0=all)	0	隐藏小于此数量的明细行。
DOM power meter	On	梯形标题中的 effort 与 book 两行。
DOM power meter window (sec)	30	effort 行汇总的秒数（5-110）。
DOM window flow panel	On	成交明细与梯形之间的挂单量历史面板。
DOM window flow panel length (min)	3	流量面板回溯的分钟数（1-10）。
DOM flow trade markers	On	把成交画成圆点；刻度印在标题上。
DOM flow marker max size (px)	14	成交圆的最大宽度（6-40）。
DOM flow marker scale (lots, 0=auto)	0	把圆填满整宽所需的成交量。0 = 一个整数，只有在新水平上停留一段时间后才改动。
DOM flow min trade size (0=all)	0	在流量面板中隐藏小于此数量的成交。
DOM flow last price line	On	连接最近成交价的阶梯线。
DOM flow heat scale	Ladder bars	满亮度代表什么：与买卖条相同的刻度，或面板内的最大数量。
DOM flow heat lower cutoff %	20	低于此比例的数量保持为背景（0-80）。
DOM flow heat upper cutoff %	100	高于此比例的数量以满亮度绘制（80-100）。
DOM flow heat bid/ask colors	On	按买卖侧为挂单量着色。
DOM column: add/pull split by side	On	新增与撤销分成两列（每侧一列），而不是合并为一列。

设置	默认值	作用
DOM session VWAP line	Off	时段成交量加权平均价的线，由本时段的成交计算。
DOM position average line	Off	在你的均价上画线。只读。
DOM position stop / target lines	Off	已挂在持仓上的止损与止盈订单价格。只读。
DOM column: P&L ticks	Off	在各价格平仓会盈亏多少跳。空仓时为0。
DOM position P&L in ticks	Off	在工具栏金额旁显示以跳数表示的浮动盈亏。
DOM diagnostic log (support only)	Off	把窗口移动的文本日志写入你的"文档"文件夹。仅在支持人员要求时开启；不会发送到任何地方。

DOM Analysis — 买卖墙

OrderVane Pro 的买卖墙线已包含在内，并为梯形中的墙龄芯片提供数据。其设置（Bid/ask walls (resting size) 及墙的阈值）位于 DOM Analysis 区。

支持

发邮件至 hello@ordervane.com，附上订单号、Quantower 版本、数据源和图表截图。通常一个工作日内回复。

免责声明

OrderVane DOM 只显示市场数据。它不预测价格、不评估交易机会、不下单。期货交易存在重大亏损风险，并非适合所有投资者。屏幕上显示的过往市场活动不代表未来结果。