



Producto 19

10 Niveles de precio de opciones y futuros
del mercado de derivados

Market Data BMV

Version 1.1

<https://www.bmv.com.mx/es/productos-de-informacion/market-data>

Contenido

Las características del "INTRA Multicast" para los instrumentos del Mercado de Derivados que se operan a través del MoNeT, el motor de negociación de MexDer, son:

- Multicast: Mensaje 1 1
- Multicast: Mensaje 4..... 2
- Multicast: Mensaje H 2
- Multicast: Mensaje I..... 3
- Multicast: Mensaje M 3
- Multicast: Mensaje Q..... 4
- Multicast: Mensaje R 5
- Multicast: Mensaje S 6

1: Profundidad

El mensaje contiene los 20 mejores precios de venta o los 20 mejores precios de compra. Se envía al inicio del día con las posturas vigentes y se actualiza durante la sesión normal de operación.

Cada vez que se modifican los valores de alguno de los 20 niveles de cualquier lado, el mensaje es enviado. Pero no siempre se envían los 20 niveles, eso depende del número de niveles que existan para el instrumento pudiendo llegar a ser menor el número.

Los niveles están agrupados por precio con el número de órdenes y número de acciones a ese nivel de precio. Los Niveles de compra o venta indican cuantos precios se reciben en el mensaje.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"1"	Profundidad del Mercado
Número de Instrumento	1	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Lado	5	1	Int8	0 - Compra, 1 - Venta
Niveles de compra o venta	6	1	Int8	Número de niveles de compra o venta a enviarse
Precio-1	7	8	Precio (8)	Precio del primer nivel
Número de órdenes-1	15	2	Int16	Número de órdenes de primer nivel
Volumen-1	17	4	Int32	Volumen acumulado del primer nivel
		

4: Cambios de estado

Todos los instrumentos se encuentran en algún estado antes y durante la sesión de remate. El mensaje del estado por instrumento se genera al inicio del día y cuando el instrumento entra a alguna fase del remate: Cancelación de Posturas, Subasta de Apertura, Negociación Continua o entra en alguna otra modalidad operativa, como por ejemplo: Subastas y Suspensiones.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"4"	Cambio de Estado del Instrumento
Número de Instrumento	1	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Estado del Instrumento	5	1	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Estado del Instrumento en el documento Conexión y Anexos
Total:		6		

H: Cancelación de Hecho

Este mensaje se envía cuando una operación es cancelada del sistema de BMV, se identifica la operación con los campos Instrumento y Folio. Actualmente solo se puede enviar dentro de la sesión de remate.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"H"	Cancelación de hechos
Número de Instrumento	1	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Folio del Hecho	5	4	Int32	Foliador por instrumento
Total:		9		

I: Interés Abierto

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"I"	Interés abierto
Número de Instrumento	1	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Interés abierto	5	4	Precio (4)	
Total:		9		

M: Precio Promedio Ponderado - Precios de liquidación

En el caso del mercado de capitales este mensaje contendrá el precio promedio ponderado por cada instrumento y se envía por cada operación que se genera dentro del periodo de cálculo del PPP (últimos 20 minutos del remate), cuando dejan de existir hechos en este periodo, el mensaje se envía con el Precio Promedio Ponderado en ceros.

En el caso del mercado de derivados este mensaje se enviará cuando ya se hayan terminado de generar los precios de liquidación definitivos.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"M"	Precio promedio ponderado / Precios Liquidación
Número de Instrumento	1	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Precio promedio ponderado	5	8	Precio (8)	Precio promedio del instrumento.
Volatilidad	13	8	Precio (8)	Volatilidad del instrumento.
Total:		21		

Q: Hechos del mercado de derivados

Se informa de cualquier operación que fue aceptada en MexDer.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"Q"	Hechos del Mercado de derivados
Número de Instrumento	1	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Hora del Hecho	5	8	Timestamp(2)	Hora en que se realizó la operación.
Volumen	13	4	Int32	Acciones negociadas
Precio/Tasa	17	8	Precio (8)	Precio de la operación
Tipo de Concertación	25	1	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Tipo de Concertación en el documento Conexión y Anexos
Folio del Hecho	26	4	Int32	Foliador por instrumento
Tipo de Operación	30	1	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Tipo de Operación en el documento Conexión y Anexos
Importe	31	8	Precio (8)	
Folio del hecho padre	39	4	Int32	Solamente contendrá un valor en caso de que sea pata de una estrategia.
Tipo de pata	43	1	ALFA	L-Pata larga C-Pata corta X-Pata de Engrapado P-Indica que es la estrategia padre "-Es un hecho que no fue generado a partir de una estrategia
Total:		44		

R: Estadísticas de los instrumentos

Mensaje de actualización de estadísticas de derivados que se envía cada que existe una actualización en los corros en cualquier nivel de precio.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"R"	Estadística por Instrumento
Número de Instrumento	1	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Precio Liquidación anterior	5	8	Precio (8)	Precio de liquidación del día anterior
Precio de apertura	13	8	Precio (8)	1er. precio del día o precio de la apertura
Precio máximo del día	21	8	Precio (8)	Precio máximo registrado en el día
Precio mínimo del día	29	8	Precio (8)	Precio mínimo registrado en el día
Precio último del día	37	8	Precio (8)	Precio último registrado en el día
Total:		45		

S: Eventos de sistema

El mensaje de eventos de sistema es usado para informar de que ha ocurrido un evento, el cual necesita ser del dominio público para su atención.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"S"	Evento del sistema
Número de Instrumento	1	4	Int32	Siempre será cero
Código de evento	5	1	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Códigos de Evento del Sistema en el documento Conexión y Anexos
Mercado	6	1	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Mercados (solo se usa en caso de notificaciones de receso administrativo) en el documento Conexión y Anexos
Hora de envió	7	8	Timestamp(2)	Hora de envió de receso administrativo. Solo se usa en caso de notificaciones de receso administrativo.
Hora termino	15	8	Timestamp(2)	Hora de término de receso administrativo. Solo se usa en caso de notificaciones de receso administrativo y en el caso de un receso automático.
Total:		23		