



Producto 29

Analíticos "Precios y Profundidad de Mercado"

Market Data BMV

Version 1.1

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

Contenido

El set de Analíticos de precios y profundidad de mercado se enfocan en analizar el estado de los corros en términos de precios, volumen y el desempeño de la operación en el día. Está compuesto por:

- Benchmark Trade
- Trading Sniper
- Price Leaderboard
- Depth at best prices
- Last Quote

Feed Consolidado: Mensaje @	1
Feed Consolidado: Mensaje ^	2
Feed Consolidado: Mensaje :	3
Feed Consolidado: Mensaje <	4
Feed Consolidado: Mensaje m	5

@:Price Leaderboard

Mide el porcentaje del tiempo que una bolsa posee el mejor precio de compra o venta.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"@"	Price Leaderboard
Origen	1	1	ALFA	M-BMV I-BIVA
T (mejor precio compra)	2	4	Precio(4)	Porcentaje del tiempo de la sesión donde se mantuvo el mejor precio de compra
T (igual precio compra)	6	4	Precio(4)	Porcentaje del tiempo de la sesión en el que se tuvo un empate en el mejor precio de compra
T (sin mejor precio compra)	10	4	Precio(4)	Porcentaje del tiempo de la sesión donde no se tuvo el mejor precio de compra
T (mejor precio venta)	14	4	Precio(4)	Porcentaje del tiempo de la sesión donde se mantuvo el mejor precio de venta
T (igual precio venta)	18	4	Precio(4)	Porcentaje del tiempo de la sesión en el que se tuvo un empate en el mejor precio de venta
T (sin mejor precio venta)	22	4	Precio(4)	Porcentaje del tiempo de la sesión donde no se tuvo el mejor precio de venta
Mercado	26	1	ALFA	L-Local / G-Global/ T-TRAC's / F-Fibras
Sector	27	1	Int8	Ver Clasificación Sectorial
Número de Instrumento	28	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Indice	32	2	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Muestras de Indices_en el documento Conexión y Anexos
	Total:	34		

^:Depth at Best Prices

Identificar que participante posee mayor volumen en el mejor nivel de precios del mercado.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"^"	Depth at best prices
Origen	1	1	ALFA	M-BMV I-BIVA
# Instrumentos (MPC)	2	2	Int16	Número de instrumentos en donde se cuenta con posturas de compra a los mejores precios
# Instrumentos (MV MPC)	4	2	Int16	Número de instrumentos donde se tiene el mayor volumen al nivel de los mejores precios de compra asequibles al momento del mensaje
Proporción (V a MPC)	6	4	Int32	Proporción de volumen a los mejores precios de compra con respecto al total de volumen disponible a los mejores precios entre ambas bolsas
# Instrumentos (MPC)	10	2	Int16	Número de instrumentos en donde se cuenta con posturas de venta a los mejores precios para cada instrumento, al momento de la entrega del mensaje
# Instrumentos (MV MPV)	12	2	Int16	Número de instrumentos donde se tiene el mayor volumen al nivel de los mejores precios de venta asequibles al momento del mensaje
Proporción (V a MPV)	14	4	Int32	Proporción de volumen a los mejores precios de venta con respecto al total de volumen disponible a los mejores precios entre ambas bolsas
Mercado	18	1	ALFA	L-Local / G-Global/ T-TRAC's / F-Fibras
Sector	19	1	Int8	Ver Clasificación Sectorial
Número de Instrumento	20	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Indice	24	2	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Muestras de Indices en el documento Conexión y Anexos
	Total:	26		

::Benchmark Trade

Análisis para medir la operatividad por hecho.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	" : "	Benchmark Trade
Origen	1	1	ALFA	M-BMV I-BIVA
Volumen promedio	2	8	Int64	Volumen promedio por operación
Importe promedio	10	8	Precio(8)	Importe promedio por operación
Mercado	18	1	ALFA	L-Local / G-Global / T-TRAC's / F-Fibras
Sector	19	1	Int8	Ver Clasificación Sectorial
Número de Instrumento	20	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Indice	24	2	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Muestras de Indices en el documento Conexión y Anexos
	Total:	26		

< : Trading Sniper

Análisis de la composición delorro.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"<"	Trading Sniper
Origen	1	1	ALFA	M-BMV I-BIVA
Profundidad (compra)	2	8	Int64	Suma total del volumen del corro de compra
Profundidad (venta)	10	8	Int64	Suma total del volumen del corro de venta
Profundidad (compra) (10N)	18	8	Int64	Suma total de volumen del corro de compra de los primeros 10 niveles
Profundidad (venta) (10N)	26	8	Int64	Suma total de volumen del corro de venta de los primeros 10 niveles
PPV (compra) (10N)	34	8	Precio(8)	Precio ponderado por volumen del corro de compra de los primeros 10 niveles
PPV (venta) (10N)	42	8	Precio(8)	Precio ponderado por volumen del corro de venta de los primeros 10 niveles
PPV (compra)	50	8	Precio(8)	Precio ponderado por volumen del corro de compra
PPV (venta)	58	8	Precio(8)	Precio ponderado por volumen del corro de venta
Mercado	66	1	ALFA	L-Local / G-Global/ T-TRAC's / F-Fibras
Sector	67	1	Int8	Ver Clasificación Sectorial
Número de Instrumento	68	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Indice	72	2	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Muestras de Indices en el documento Conexión y Anexos
	Total:	74		

m: Última Mejor Postura

Mensaje enviado por instrumento cuando se modifica la mejor postura en el libro electrónico por Bolsa Origen, indica el lado que se modifica, la venta o la compra.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"m"	Última Mejor Postura enviada por la Bolsa Origen
Número de Instrumento	1	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Origen	5	1	ALFA	M-BMV I-BIVA
Volumen	6	8	Int64	Volumen de la orden
Precio / Tasa	14	8	Precio (8)	Precio de la mejor postura
Sentido de la postura	22	1	ALFA	C-Compra V-Venta
Tipo de Operación	23	1	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Tipo de Operación en el documento Conexión y Anexos
	Total:	24		