



Producto 4

20 Niveles de precio mercado Global

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 Capitales que se operan a través del MoNeT, el motor de negociación de BMV, son:

Multicast: Mensaje 1.....	1
Multicast: Mensaje 2.....	2
Multicast: Mensaje 3.....	2
Multicast: Mensaje 4.....	3
Multicast: Mensaje 5.....	3
Multicast: Mensaje E	4
Multicast: Mensaje H	4
Multicast: Mensaje M	5
Multicast: Mensaje O.....	6
Multicast: Mensaje P	7
Multicast: Mensaje S	8
Multicast: Mensaje V	9
Multicast: Mensaje Z	10

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
...	...	...	...	...

Multicast: Mensaje 2

2: Precio probable de asignación

El mensaje es enviado durante cualquier tipo de subasta (Apertura, Continua, Volatilidad e Intradía) y únicamente en los instrumentos donde ya existe un calce virtual o preasignación.

Contiene el precio probable y el volumen máximo que se asignaría el instrumento al finalizar la subasta. Se envía al instante en que se modifica alguno de esos 2 datos.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"2"	Precio probable de asignación
Número de Instrumento	1	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Precio probable de asignación	5	8	Precio (8)	
Volumen	13	4	Int32	Volumen máximo a operar
Total:		17		

Multicast: Mensaje 3

3: Inicio de subastas continuas

El mensaje es enviado al momento de generarse una de las subastas continuas, de volatilidad o del SIC.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"3"	Inicio de subastas
Número de Instrumento	1	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Hora inicio de la subasta	5	8	Timestamp(2)	Hora en la que inicia la subasta
Hora fin de la subasta	13	8	Timestamp(2)	Hora en la que concluye la subasta
Total:		21		

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, 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		

5: Existencia de posturas A Precio Medio

Este mensaje se genera al momento en que un instrumento ingresa una postura en el libro electrónico oculto A Precio Medio. Al momento en que se retira o se cierran las posturas y el libro oculto del instrumento vuelve a quedar vacío, se reenvía otro mensaje indicando la ausencia de posturas.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"5"	Existencia de posturas A Precio Medio
Número de Instrumento	1	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Existen Posturas	5	1	ALFA	En caso de que el valor sea "1", será tomado como verdadero (hay posturas), en cualquier otro caso será falso (no hay posturas).
Total:		6		

Multicast: Mensaje E

E: Operatividad

Mensaje que se envía cada media hora durante la sesión de remate informando la operatividad general por instrumento.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"E"	Estadística por Instrumento
Número de Instrumento	1	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Número de Operaciones	5	4	Int32	Número de operaciones
Volúmen	9	8	Int64	Volúmen operado
Importe	17	8	Precio (8)	Importe Operado
Apertura	25	8	Precio (8)	Precio de apertura
Máximo	33	8	Precio (8)	Precio máximo
Mínimo	41	8	Precio (8)	Precio mínimo
Promedio	49	8	Precio (8)	Precio promedio del día
Último	57	8	Precio (8)	Precio último del momento
Total:		65		

Multicast: Mensaje H

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		

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		

O: Mejor Postura

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

Se envía desde la primera fase de una sesión de remate hasta la finalización de negociación continua.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"O"	Respuesta de Alta de Ordenes
Número de Instrumento	1	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Volumen	5	4	Int32	Volumen de la orden
Precio/Tasa	9	8	Precio (8)	Precio de la mejor postura
Sentido de la postura	17	1	ALFA	C-Compra V-Venta
Tipo de Operación	18	1	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Tipo de Operación en el documento Conexión y Anexos
Total:		19		

P: Hechos de capitales

Se informa de cualquier operación que fue aceptada en BMV.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"P"	Hechos del Mercado de capitales
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	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
Fija Precio	30	1	ALFA	En caso de que el valor sea 1, será tomado como true, en cualquier otro caso será falso.
Tipo de Operación	31	1	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Tipo de Operación en el documento Conexión y Anexos
Importe	32	8	Precio(8)	
Compra	40	5	ALFA	Clave corta de casa compradora
Vende	45	5	ALFA	Clave corta de casa vendedora
Liquidación	50	1	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Tipos de Liquidación en el documento Conexión y Anexos
Indicador de Subasta	51	1	ALFA	"P" – Subasta de Apertura "S" – Otras Subastas " " – Mercado Continuo "N" – No aplica
Total:		52		

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 envío 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		

V: Hechos virtuales

Cuando una operación ha sido preasignada en los libros electrónicos al cierre y al Precio Promedio del Día se envía un mensaje de hecho virtual con el que se está avisando de esta operación. Al final de la sesión de remate se envía un mensaje P con el que se avisa que la operación deja de ser virtual.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"V"	Hechos Virtuales del Mercado de Capitales y Global BMV
Número de Instrumento	1	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Estado	5	1	ALFA	A- Alta B-Baja
Tipo de Operación	6	1	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Tipo de Operación en el documento Conexión y Anexos
Folio	7	4	Int32	Folio del hecho virtual
Volumen	11	4	Int32	Títulos operados virtualmente
Concertación	15	1	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Tipo de Concertación en el documento Conexión y Anexos
Compra	16	5	ALFA	Clave de la casa compradora
Vende	21	5	ALFA	Clave de la casa vendedora
Total:		26		

Z: Operaciones de registro

Se envía cada que hay una colocación de un instrumento de deuda o capitales.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"Z"	Operaciones de registro
Número de Instrumento	1	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Tipo de oferta	5	1	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Tipos de Oferta Pública en el documento Conexión y Anexos
Renta	6	1	ALFA	V-Renta Variable F-Renta Fija W-Warrants
Tipo de valor	7	4	ALFA	Tipo de valor
Emisora	11	7	ALFA	Clave de la emisora
Serie	18	6	ALFA	Clave de la serie
Volumen máximo	24	8	Int64	
Volumen registrado	32	8	Int64	
Precio/Tasa	40	8	Precio (8)	Precio de la operación de registro
Fecha de Liquidación	48	8	Timestamp(1)	
Casa	56	5	ALFA	Casa colocadora
Movimiento	61	1	ALFA	A-Alta de la operación U-Autorización de la operación C-Colocación de la operación B-Baja de la operación
Total:		62		