



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 del corro.

| 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 | | |