



Producto 33

Analíticos "Desempeño de Spread"

Market Data BMV

Version 1.1

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

Contenido

El set de Desempeño de Spread analiza el potencial de mercado que posee el corro en función de la apertura del spread y los costos implícitos de los hechos concertados en la sesión. Está compuesto por:

- Big Picture
- Spread
- Effective Spread
- Spread Quality

Feed Consolidado: Mensaje ' 1
Feed Consolidado: Mensaje ; 2
Feed Consolidado: Mensaje { 3
Feed Consolidado: Mensaje = 4

': Big Picture

Resumen de la participación de cada bolsa en las principales métricas operativas.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	''''	Big Picture
Origen	1	1	ALFA	M-BMV I-BIVA
Operaciones	2	4	Int32	Suma total de operaciones
Volúmen	6	8	Int64	Suma total de volumen
Importe	14	8	Precio(8)	Suma total de importe
Participación (Importe)	22	4	Precio(4)	Participación porcentual en importe
Participación (Operaciones)	26	4	Precio(4)	Participación en número de operaciones
Mercado	30	1	ALFA	L-Local / G-Global / T-TRAC's / F-Fibras
Sector	31	1	Int8	Ver Clasificación Sectorial
Número de Instrumento	32	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Indice	36	2	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Muestras de Indices_en el documento Conexión y Anexos
	Total:	38		

;: Spread

Evolución del spread simple a lo largo de la sesión.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	" ; "	Spread (simple)
Origen	1	1	ALFA	M-BMV I-BIVA
Spread (MXN)	2	4	Precio(4)	Spread en pesos (MXN)
Spread (porcentaje)	6	4	Precio(4)	Spread en porcentaje expresado en puntos base
Spread (promedio)	10	4	Precio(4)	Spread promedio a lo largo de la sesión, expresado en puntos base
Número de spreads	14	4	Int32	Número de Spreads
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		

{:Spread Quality

Calidad del spread simple a lo largo de la sesión.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	" { "	Spread Quality
Origen	1	1	ALFA	M-BMV I-BIVA
Tiempo (mejor spread)	2	4	Precio(4)	Proporción del tiempo de la sesión en que la Bolsa (origen) tuvo el mejor spread
Tiempo (empate mejor spread)	6	4	Precio(4)	Proporción del tiempo de la sesión en que la Bolsa (origen) empató en el mejor spread
Tiempo (sin mejor spread)	10	4	Precio(4)	Proporción del tiempo de la sesión en que la Bolsa (origen) no tuvo el mejor spread
Mercado	14	1	ALFA	L-Local / G-Global/ T-TRAC's / F-Fibras
Sector	15	1	Int8	Ver Clasificación Sectorial
Número de Instrumento	16	4	Int32	Código único durante la vida del instrumento
Indice	20	2	ALFA	Ver tabla de Catálogo de Muestras de Indices en el documento Conexión y Anexos
	Total:	22		

= :Effective Spread

Indicador de la familia de los "Price benchmarks" del análisis de costos de transacción. Sirve para medir los costos de transacción implícitos de una operación bursátil.

Tipo de Información	Offset	Tamaño	Valor	Notas
Tipo de Mensaje	0	1	"="	Effective Spread
Origen	1	1	ALFA	M-BMV I-BIVA
ES (MXN)	2	4	Precio(4)	Effective Spread en pesos
ES (porcentaje)	6	4	Precio(4)	Effective Spread en porcentaje
ES (MXN) (compra)	10	4	Precio(4)	Effective Spread de compra en pesos
ES (porcentaje) (compra)	14	4	Precio(4)	Effective Spread de compra en porcentaje
ES (MXN) (ask)	18	4	Precio(4)	Effective spread de venta en pesos
ES (porcentaje) (ask)	22	4	Precio(4)	Effective Spread de venta en porcentaje
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		