



Producto 32

Analíticos "Calidad de Mercado"

Market Data BMV

Version 1.1

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

Contenido

El set de Calidad de Mercado se enfoca en analizar precios, posturas, spread, costos implícitos y lo relacionado al estado del mercado para saber qué, dónde y cuándo operar. Está compuesto por:

- Price Leaderboard
- Effective Spread
- Spread Quality
- Quotes Quality

Feed Consolidado: Mensaje @ 1

Feed Consolidado: Mensaje | 2

Feed Consolidado: Mensaje { 3

Feed Consolidado: Mensaje = 4

@: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 | | |

|:Quotes Quality

Proporción de tiempo en el que se mantienen posturas de ambos lados.

| Tipo de Información | Offset | Tamaño | Valor | Notas |
|-----------------------|---------------|--------|-----------|--|
| Tipo de Mensaje | 0 | 1 | " " | Quotes Quality |
| Origen | 1 | 1 | ALFA | M-BMV I-BIVA |
| # Emisiones | 2 | 2 | Int16 | Número de emisiones donde Bolsa (origen) posee posturas a ambos lados del corro |
| Tiempo | 4 | 4 | Precio(4) | Porcentaje del tiempo en que la Bolsa (origen) mantiene posturas a ambos lados del corro |
| Mercado | 8 | 1 | ALFA | L-Local / G-Global/ T-TRAC's / F-Fibras |
| Sector | 9 | 1 | Int8 | Ver Clasificación Sectorial |
| Número de Instrumento | 10 | 4 | Int32 | Código único durante la vida del instrumento |
| Indice | 14 | 2 | ALFA | Ver tabla de Catálogo de Muestras de Indices en el documento Conexión y Anexos |
| | Total: | 16 | | |

{: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 | | |