

MexFix[®]

Fix Clientes

Tablas de contenidos

Versión 1.7

Historia de las revisiones.

Fecha de inicio de vigencia	Versión	Descripción	Autor	Revisó y aprobó
22-Sep-2005	1.0	Primera versión	José Alberto González García/Gerente de Sistemas	Rodolfo Liaño MexDer
13-Feb-2006	1.2	Se hicieron adecuaciones de acuerdo con layout definitivo de MexFix	José Alberto González García/Gerente de Sistemas	Rodolfo Liaño MexDer
20-Jul-2007	1.3	Se actualizó el tipo de órdenes aceptadas en el MexFix	José Alberto González García/Gerente de Sistemas	Irma González MexDer
18-Mar-2009	1.4	Se actualizó tabla de CFI codes	José Alberto González García/Gerente de Sistemas	Irma González MexDer
27-Julio-2009	1.5	Actualización de las tablas en la sección 3.1 y 3.2	José Alberto González García/Gerente de Sistemas	Irma González MexDer

MexFix MexDer	Versión: 1.7
FIX MexDer	Inicio de vigencia: 13-Enero-2012

16-Mzo-2010	1.6	Corrección de la clave asignada para "Call Mayo"	Irma González MexDer	Irma González MexDer
13-Enero-2012	1.7	<ul style="list-style-type: none"> - Adición de concertación de block trade (tabla 19). - Actualización de grupos de contrato (tabla 20). - Actualización tabla de clases de futuro (sección 3.1) - Actualización tabla de clases de opciones (sección 3.2) 	Francisco Javier Ibarra Caballero Especialista Desarrollo MexDer	Irma González MexDer

MexFix MexDer	Versión: 1.7
FIX MexDer	Inicio de vigencia: 13-Enero-2012

Índice.

1. Introducción.	4
2. Tablas de codificación	4
Tabla 12: Tipos de orden FIX	4
Tabla 13: Vigencia de orden FIX	4
Tabla 16: Valores de CFICode	5
Tabla 17: Códigos de Mercado	7
Tabla 19: Códigos de operación	7
Tabla 20: Grupos de Contrato	9
3. Nomenclatura de Contratos para FIX	10
3.1 Para Futuros	10
3.2 Para Opciones	12
3.3 Para Engrapados	14
3.4 Para Estrategia de Dólar o Engrapado de Dólar	14
3.5 Para RollOver	15

MexFix MexDer	Versión: 1.7
FIX MexDer	Inicio de vigencia: 13-Enero-2012

Especificación de Diseño

1. Introducción.

Este documento pretende complementar el documento "Fix Clientes - MexFix Layout FIX" de MexDer.

Los documentos presentan las especificaciones y valores de la Interfaz FIX que se va a utilizar en MexDer.

2. Tablas de codificación

Tabla 12: Tipos de orden FIX

Código	Concepto
1	Limit

Ver tabla 20 para identificar los contratos que operan en SENTRA y S/MART

Tabla 13: Vigencia de orden FIX

Código	Concepto
0	Day (default value)
3	Immediate or Cancel (IOC)

Para S/MART solo se están usando 0 y 3, para SENTRA solo el 0.

MexFix MexDer	Versión: 1.7
FIX MexDer	Inicio de vigencia: 13-Enero-2012

Tabla 16: Valores de CFICode

	CFICode	Descripción
Índice	FFICSX	Futuro financiero estandarizado sobre índice
	FMICXX	Time-spread de futuro sobre índice
	OCEICS	Opción call europea estandarizada sobre índice
	OPEICS	Opción put europea estandarizada sobre índice
	MRIXXX	Instrumento de referencia para índice
	Acciones	FFSPSX
FMSXXX		Time spread de futuros sobre acciones
OCASPS		Opción call americana estandarizada sobre acciones
OPASPS		Opción put americana estandarizada sobre acciones
ESXXXX		Acciones (contado)
Divisas		FFCPSX
	XMXXXX	Estrategias
	OCECCS	Opción call europea estandarizada sobre divisas
	OPECCS	Opción put europea estandarizada sobre divisas
	Bonos	FFDPSX
XMXXXX		Estrategias
Deuda	FFDCSX	Futuro financiero estandarizado sobre instrumentos de deuda

MexFix MexDer	Versión: 1.7
FIX MexDer	Inicio de vigencia: 13-Enero-2012

	XMXXX	Estrategias
Swaps	FFWCSX	Futuro financiero estandarizado sobre SWAPS
	XMXXX	Estrategias
UDI's	FFMCSX	Futuro financiero estandarizado sobre UDI
	XMXXX	Estrategias

En general las estrategias como los time spread se distinguen cuando el segundo carácter del CFI code es "M".

Para más detalle consúltese el apéndice 6-D "CFI Code Usage – ISO 10962 Classification of Financial Instrument (CFI Code)" del documento "Financial Information Exchange Protocol (FIX) version 4.4 with errata 20030618". (<http://www.fixprotocol.org/specifications/fix4.4spec>)

MexFix MexDer	Versión: 1.7
FIX MexDer	Inicio de vigencia: 13-Enero-2012

Tabla 17: Códigos de Mercado

Código	Concepto
DV	Todo MexDer

Tabla 19: Códigos de operación

Código	Concepto
M	Ejecución de Mercado
H	Cruce en Mercado
T	Autoentrada de Compra
R	Spread
S	Operación asociada a Spread
C	Camas
O	Rondas
X	Cancelación
F	Modificación
D	Split
U	Error
Y	Autoentrada de Venta
AC	Autoentrada de Compra
AV	Autoentrafa de Venta
BE	Cama de Engrapado
CA	Consecuencia de Autoentrada de Compra
CB	Cama de Engrapado
CC	Consecuencia de Cruce
CE	Generado por Engrapado
CM	Cama
CO	Cierre de Ordenes
CR	Cruces
D1	Cruce de Estrategia
D2	Autoentrada de Venta Estrategia de Divisas
D3	Autoentrada de Compra Estrategia de Divisas
D4	Participación en Cruce Estrategia de Divisas
D5	Participación en Autoentrada Venta Estrategia de Divisas
D6	Participación en Autoentrada Compra Estrategia de Divisas
DB	Cama de Estrategia de Divisas
DI	Estrategia de Divisas
DR	Profundidad Estrategia de Divisas
E1	Originado por un X1
E2	Originado por un X2
E3	Originado por un X3
E4	Originado por un X4
E5	Originado por un X5

MexFix MexDer	Versión: 1.7
FIX MexDer	Inicio de vigencia: 13-Enero-2012

E6	Originado por un X6
EB	Engrapado de Cama
ER	Engrapado de Ronda
GR	Engrapados
L1	Cruce de Rollover
L2	Autoentrada de Venta de Rollover
L3	Autoentrada de Compra de Rollover
L4	Participación en Cruce de Rollover
L5	Participación en Autoentrada de Venta de Rollover
L6	Participación en Autoentrada de Compra de Rollover
LB	Cama de Rollover
LR	Profundidad de Rollover
P2	Profundidad Ronda Engrapado
PR	Profundidad de Ronda
RE	Ronda de Engrapado
RL	RollOvers
RO	Rondas
SB	Subastas
VA	Consecuencia Autoentrada de Venta
X1	Cruce de Engrapado
X2	Autoentrada de Venta de Engrapado
X3	Autoentrada de Compra de Engrapado
X4	Participación en Cruce Engrapado
X5	Participación en Autoentrada de Venta de Engrapado
X6	Participación en Autoentrada de Compra Engrapado
BN	Block Trade

MexFix MexDer	Versión: 1.7
FIX MexDer	Inicio de vigencia: 13-Enero-2012

Tabla 20: Grupos de Contrato

Código	Concepto	Sistema
01	Instrumentos de IPC	S/MART
03	Instrumentos de WALMEX	S/MART
04	Instrumentos de CEMEX	S/MART
05	Instrumentos de FEMSA	S/MART
06	Instrumentos de GCARSO	S/MART
07	Instrumentos de AMX	S/MART
09	Instrumentos de NAF	S/MART
10	Instrumentos de QQQ	S/MART
12	Instrumentos de IVV	S/MART
13	Instrumentos de TELEVISA	S/MART
14	Instrumentos de GMEXICO	S/MART
19	Instrumentos de BRTRAC	S/MART
20	Instrumentos de ILCTRAC	S/MART
22	Opciones de Dollar	S/MART
25	Instrumentos de MEXTRAC	S/MART
FD	Futuros de Divisas	SENTRA
FB	Futuros de Bonos	SENTRA
FS	Futuros de SWAP	SENTRA
FT	Futuros de Tasas	SENTRA
FU	Futuros de UDIS	SENTRA

MexFix MexDer	Versión: 1.7
FIX MexDer	Inicio de vigencia: 13-Enero-2012

3. Nomenclatura de Contratos para FIX

La forma en que se van a codificar las claves de los diferentes instrumentos en el “tag” 55 de los formatos FIX será como sigue:

3.1 Para Futuros

La nomenclatura es:

Cccmmaa

En donde:

Cccc : Es la clase

mmaa : Vencimiento

La tabla de clases para futuros es:

Código	Concepto
AXL	Futuro de América Móvil
BRT	Futuro de BRTRAC
CE91	Futuro de CETES a 91 días
CXC	Futuros de CEMEX
DAnn	Futuros del dólar *
EURO	Futuro del Euro
FEM	Futuro de FEMSA
GCA	Futuro de GCARSO
GMEX	Futuro de GMEXICO
IPC	Futuro de IPC
ILC	Futuro de ILCTRAC
M10	Futuro de Bono M10
M20	Futuro de Bono M20
M3	Futuro de Bono M3
M5	Futuro de Bono M5
M30	Futuro de Bono M30
MEXT	Futuro de MEXTRAC
02xx	Futuro de Swap de TIIE 2 años**

MexFix MexDer	Versión: 1.7
FIX MexDer	Inicio de vigencia: 13-Enero-2012

10xx	Futuro de Swap de TIIE 10 años**
TE28	Futuro de TIIE a 28 días
TVES	Futuro de Televisa
UDI	Futuro de UDI
WAL	Futuro de WALMEX

* Para futuro de dólar “nn” es el día de vencimiento del futuro y el valor es del 01 al 31 por ejemplo (DA01, DA02... DA31).

**Para los futuros del SWAP “xx” es el día de vencimiento del futuro.

El vencimiento se compone de la siguiente manera:

mm es el mes de maduración de acuerdo a la tabla siguiente y **aa** son los dos últimos dígitos del año de maduración. Por ejemplo AB07.

Código	Concepto
EN	Enero
FB	Febrero
MR	Marzo
AB	Abril
MY	Mayo
JN	Junio
JL	Julio
AG	Agosto
SP	Septiembre
OC	Octubre
NV	Noviembre
DC	Diciembre

Ejemplos de contratos

AXL DC05

CXC DC05

FEM DC05

GCA DC05

TXL MR06

IPC JN06

CE91MR07

MexFix MexDer	Versión: 1.7
FIX MexDer	Inicio de vigencia: 13-Enero-2012

TE28DC08
DA19MR07
M3 SP09

Si la clave de la clase es de menos de cuatro caracteres hay que usar espacios.

3.2 Para Opciones

La nomenclatura es:

Ccsssssv

Cc: Clave de la clase.

Code	Concept
AX	Opciones de AMX L
BR	Opciones de BRTRAC
CX	Opciones de CEMEX CPO
DA	Opciones de MXP-US Dollar
GM	Opciones de GMEXICO B
IP	Opciones de IPC
ME	Opciones de MEXTRAC
NA	Opciones de IPC Index Tracking Stock (Naftrac 02)
TV	Opciones de TLEVISA CPO
WA	Opciones de WALMEX V

sssss: Es el strike, son 5 dígitos, si son menos de 5 dígitos se deberá justificar a la derecha con espacios en el lado izquierdo "1450".

v : Es una letra que nos indicara el tipo de opción y su mes de maduración.

MexFix MexDer	Versión: 1.7
FIX MexDer	Inicio de vigencia: 13-Enero-2012

Código	Concepto
A	Call Enero
B	Call Febrero
C	Call Marzo
D	Call Abril
E	Call Mayo
F	Call Junio
G	Call Julio
H	Call Agosto
I	Call Septiembre
J	Call Octubre
K	Call Noviembre
L	Call Diciembre
M	Put Enero
N	Put Febrero
O	Put Marzo
P	Put Abril
Q	Put Mayo
R	Put Junio
S	Put Julio
T	Put Agosto
U	Put Septiembre
V	Put Octubre
W	Put Noviembre
X	Put Diciembre

Ejemplos de contratos:

AX 1200F

IV 1350R

QQ42000X

NA 1550F

IP15000L

El strike no contiene puntos por ejemplo 13.5 será " 1350".

MexFix MexDer	Versión: 1.7
FIX MexDer	Inicio de vigencia: 13-Enero-2012

3.3 Para Engrapados

La nomenclatura es:

CccmmaapNnn

Donde

Cccc : Es la clase igual que en los futuros

mmaa : Es el primer vencimiento de los futuros que componen el engrapado (la nomenclatura es la misma de los futuros)

p: Es el tamaño del plazo del engrapado 1=mensual, 2=bimensual, 3=trimestral, etc.

nnnn : Es el número de vencimientos que abarca el contrato, incluyendo ceros a la izquierda

Ejemplos

Un engrapado de TE28 que comienza en Enero de 2007 de 1x12 sería

TE28EN071012

3.4 Para Estrategia de Dólar o Engrapado de Dólar

La nomenclatura es:

DEUAFmmaa

Donde

DEUAF : Es fijo para este tipo de estrategias

mmaa : Es el vencimiento de la pata larga (la nomenclatura es la misma de los futuros)

Ejemplos

Un engrapado de dólar del vencimiento del dólar de hoy contra el de marzo de 2007

MexFix MexDer	Versión: 1.7
FIX MexDer	Inicio de vigencia: 13-Enero-2012

DEUAFMR07

3.5 Para RollOver

La nomenclatura es:

Ccccvava

Cccc : Es la clase del instrumento (igual que los futuros)

vava : es el mes y año del vencimiento

Para **v** los valores pueden ser:

Código	Concepto
A	Enero
B	Febrero
C	Marzo
D	Abril
E	Mayo
F	Junio
G	Julio
H	Agosto
I	Septiembre
J	Octubre
K	Noviembre
L	Diciembre

a es el ultimo dígito del año

Ejemplo:

Un RollOver de Cete a 91 días con los vencimientos enero 2007 y febrero 2007

CE91A7B7