



MoNeT Derivados

Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor

Versión 1.7.5

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

Revisiones

Fecha	Versión	Descripción	Autor
Ago 22, 2011	1.0	Versión Inicial.	José Alberto González
Ago 25, 2011	1.2	Observaciones de Rafael Álvarez	José Alberto González
Ago 29, 2011	1.3	Tablas de Cancelación y Modificación de Hechos adicionadas.	José Alberto González
Nov 28, 2011	1.4	<p>Revisión de mensajería de Market data:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Mercados MA, MX, DV eliminados - Eliminación de mensajes de News para informar del estado del mercado. - Eliminación de mensajes de Trading Session. - Nuevo manejo de estado de instrumentos. 	Francisco Javier Ibarra Caballero
Ene9, 2012	1.5	<ul style="list-style-type: none"> - Cambios de versión 1.4 descartados. - Se adiciona especificación de eliminación de mensajes de órdenes a fin de día (sección 2.1). - Se adiciona especificación de mensajes de market data asociados con mensajes de eliminación de órdenes (sección 2.1.1). - Se adición alista de mensajes de error (sección 2.12). - Soporte de opciones de Dólar (sección 2.9). - Elegibilidad de instrumentos para Cross Orders (sección 2.10). - Detalles adicionales respecto a los folios de órdenes y hechos (secciones 2.2 y 2.3). - Grupo de Partyblockajustado en 	Francisco Javier Ibarra Caballero

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

		<p>sección 2.6.</p> <ul style="list-style-type: none"> - CrossTypeeliminado en mensaje de ExecutionReporten confirmación de cruces en sección 2.6. - TimeInForceeliminado de ExecutionReport. 	
Ene 26, 2012	1.6	<ul style="list-style-type: none"> - Especificación complete para mensaje ExecutionReport para expiración de órdenes. - Se indica texto relacionado al tag 102. 	Francisco Javier Ibarra Caballero
Mar 29, 2012	1.7	- Se adiciona sección 2.8 especificando el uso del tagMultiLegReportingType.	Francisco Javier Ibarra Caballero
Abr 17, 2012	1.7.1	- Se adiciona "TradeCorrect" y "TradeBust" a sección 2.8.	Francisco Javier Ibarra Caballero
Ago 1º, 2012	1.7.2	- Se especifica tag válidos para instrumentos de S/MART (secciones: 2.6.5, 2.6.6, 2.6.7)	Francisco Javier Ibarra Caballero
Sep 14, 2012	1.7.3	- Secciones nuevas: Instrumentoen Rollovers de IPC, Modificación de ordenes con valores originales (sin cambios), Contingencia	José Alberto GonzálezGarcía
Oct 1º, 2012	1.7.4	- Contingencia	Héctor Javier García Encinas
Dic 4, 2012	1.7.5	- Concertaciones obsoletas	José Alberto González García

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

Índice

1.	Introducción	1
1.1	Propósito	1
2.	Cambios	1
2.1	Mensajes de Eliminación de Órdenes a Fin de Día	1
2.1.1	Actualizaciones de Market Data para la Eliminación de Órdenes a Fin de Día.	2
2.2	Construcción del OrderIDy SecondaryOrderID	4
2.3	Construcción del tag SecondaryExecID	4
2.4	Soporte para Opciones de Dólar	4
2.5	Elegibilidad de instrumentos para Cruces	4
2.6	Instrumento del Rollover de IPC	5
2.7	Modificación de órdenes con valores originales (sin cambios)	5
2.8	Contingencia	6
2.9	Tags utilizados en el mensaje Execution Report (MsgType= 8)	8
2.9.1	Pending new	8
2.9.2	New	9
2.9.3	Filled	10
2.9.4	Rejected	11
2.9.5	Pending Replace	12
2.9.6	Replaced	13
2.9.7	Pending cancel	14
2.9.8	Canceled	15
2.9.9	Rejected Cancel	16
2.9.10	Cross Order's Pending New	17
2.9.11	New Cross Order	18
2.9.12	Filled Cross Order	19
2.9.13	Rejected Cross Order	20
2.9.14	Trade Cancelled	21
2.9.15	Trade Replaced	22
2.10	Mensajes de error	23
2.11	MultiLegReporting Type	25
2.12	Concertaciones en desuso	25

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor

1. Introducción

1.1 Propósito

Este documento describe los cambios de comportamiento del MexFix los cuales serán implementados con el Nuevo Motor (MoNeT).

2. Cambios

2.1 Mensajes de Eliminación de Órdenes a Fin de Día

El nuevo motor enviará mensajes de Execution Report (MsgType = 8) para informar la cancelación de órdenes expiradas.

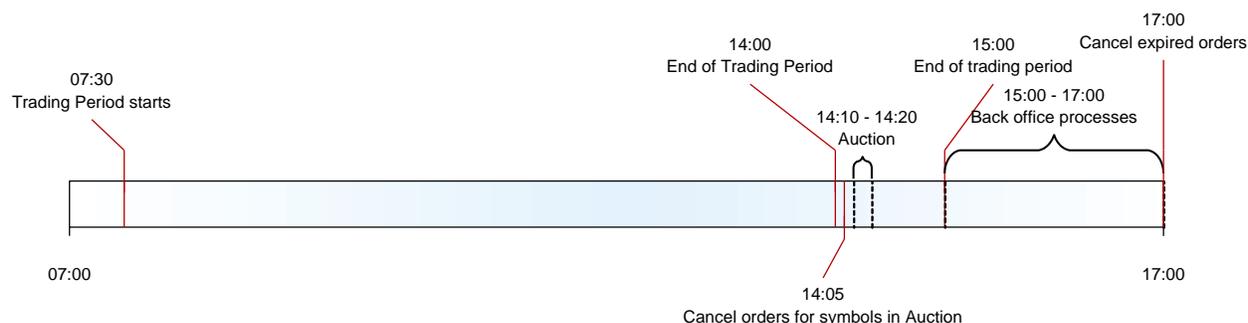
La cancelación de órdenes contendrá los tags indicados en la especificación. Los tags específicos para identificar el tipo de cancelación serán:

Tag	Name	Req	ValidValues	Format	Description
	Standar Header	Y	MsgType = 8		
37	OrderID	Y		String	
11	ClOrdID	N		String(30)	ClOrdID received in New Order message or in the last CancelReplace message
41	OrigClOrdID	N		String(30)	ClOrdID received in New Order message or in the last Cancel Replace message
453	NoPartyIDs	Y	2	NumInGroup	
→ 448	PartyID	Y		String	
→ 447	PartyIDSource	Y	D = Proprietary/Custom code	char	
→ 452	PartyIDRole	Y	13 = OrderOriginationFirm 11 = OrderOriginationTrader	Int	
17	ExecID	Y		String	Execution Report unique identifier assigned by MexFix. It contains 0 if the ExecType field = "I" (Order Status).
150	ExecType	Y	C = Expired	char	Indicates that the order was cancelled by expiration.
39	OrdStatus	Y	C = Expired	char	Indicates that the order was cancelled by expiration.
1	Account	Y	Exact length	String(5)	Account related to order
	Start <Instrument>				
55	Symbol	Y	Instrument's name	String(16)	Contract code related to order
	End <Instrument>				

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

54	Side	Y	1 = Buy 2 = Sell	char	
38	OrderQty	Y	0 <= Qty <= 999999 (no decimals)	Qty	Order volume as indicated in the New Order message or in the modification message.
44	Price	N		Price	Price
151	LeavesQty	Y	0 <= Qty <= 999999 (no decimals)	Qty	Order pending volume. It contains 0 when the ExecType = C (Expired).
14	CumQty	Y	0 <= Qty <= 999999 (no decimals)	Qty	Order's filled quantity.
6	AvgPx	Y		Price	Average price of all the executions of this order. This field should not be taken into account when the CumQty field = 0
60	TransactTime	N		UTCTimestamp	Time in which the transaction related to this Execution Report message took place.
58	Text	N		String	It will indicate that the cancellation obeys to an order's expiration.
	Standard trailer				

Estos mensajes serán enviados al finalizar operaciones el día de la negociación.



2.1.1 Actualizaciones de Market Data para la Eliminación de Órdenes a Fin de Día.

Inmediatamente después de cada mensaje de cancelación, también serán enviadas las actualizaciones de Market Data (35=W) para cada orden eliminada.

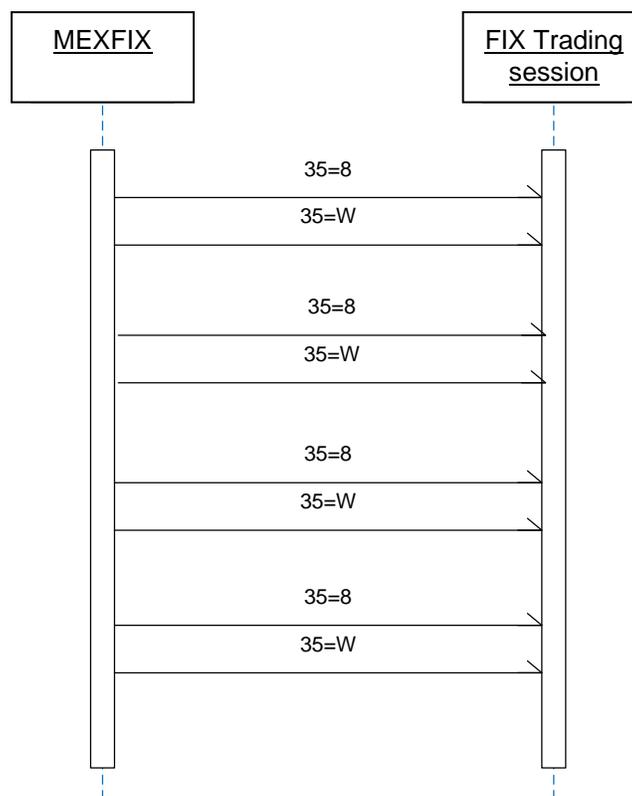
Ejemplo:

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

Suponga que hay 3 compras y 1 venta en IPC SP12 al finalizar el día:

Volumen (Compra)	Precio	Volumen (Venta)
	33350	100
100	33340	
100	33335	
100	33330	

Para limpiar el libro del IPC SP12, esta será la secuencia de mensajes que será enviada:



Las actualizaciones de market data tendrán este aspecto:

268=4 | 269=0 | 270=33340 | 271=100 | 290=1 | 269=0 | 270=33335 | 271=100 | 290=2 | 269=0 | 270=33330 | 271=100 | 290=3 | 269=1 | 270=0 | 271=0 | 290=1 |

268=3 | 269=0 | 270=33340 | 271=100 | 290=1 | 269=0 | 270=33335 | 271=100 | 290=2 | 269=1 | 270=0 | 271=0 | 290=1 |

268=2 | 269=0 | 270=33340 | 271=100 | 290=1 | 269=1 | 270=0 | 271=0 | 290=1 |

268=2 | 269=0 | 270=0 | 271=0 | 290=1 | 269=1 | 270=0 | 271=0 | 290=1 |

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

2.2 Construcción del OrderID y SecondaryOrderID

El tag OrderID (37) será numérico, pero su unicidad será determinada en combinación con el identificador del grupo de negociación.

El tag SecondaryOrderID (198) tendrá el mismo valor que el tag OrderID, sin embargo se sugiere utilizar el OrderID para obtener el folio de la orden asignado por el nuevo motor. El tag SecondaryOrderID será conservador solo para mantener la compatibilidad con el layout anterior.

Valor del folio = nnnnxx

Donde:

nnnn – Folio (valor “long”)

xx – Grupo de Negociación (valor numérico, sin ceros a la izquierda)

En el siguiente caso, el folio de alguna orden es 5 y el instrumento trabaja en el grupo de negociación 1:

Tag	S/MART	SENTRA
37 (OrderID)	51	51
198 (SecondaryOrderID)	51	51

2.3 Construcción del tag SecondaryExecID

El tag SecondaryExecID (527) será numérico. La unicidad será garantizada de acuerdo al mismo método descrito para el OrderID.

En el siguiente caso, el siguiente hecho tiene folio 11 en el grupo de negociación 10:

Tag	S/MART	SENTRA
527 (SecondaryExecID)	1110	1110

2.4 Soporte para Opciones de Dólar

Ya que todos los instrumentos de MexDer residirán en un solo motor, no hay necesidad de futuros “falsos” como subyacentes de las opciones de dólar; por tal, todas las opciones de dólar contendrán valores en el tag de UniqueID así como futuros de dólar reales como subyacentes.

2.5 Elegibilidad de instrumentos para Cruces

Al momento de escribir este documento, existen ciertas restricciones para enviar cruces de instrumentos de rollovers de S/MART, ahora, con el nuevo motor, no existirá tal limitación y MexDer estará en condiciones de configurar o no las operaciones sobre dichos instrumentos. En el primer día de

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

negociación todos los instrumentos tendrán permitido operar cruces.

2.6 Instrumento del Rollover de IPC

El instrumento de Rollover de IPC cambiará de acuerdo a la siguiente nomenclatura:

IPC vyvy

IPC: Es la clase para el IPC. Note que hay un espacio en la cuarta posición.

vyvy: son los meses y años de vencimiento de las “patas”.

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

“y” es el último dígito del año en cuestión.

2.7 Modificación de órdenes con valores originales (sin cambios)

En los motores actuales (SENTRA, S/MART), si se emite una modificación de orden (mensaje OrderCancelReplaceRequest), sin cambios con respecto a la orden original, la modificación es rechazada.

En MoNeT, este comportamiento cambiará. La orden será aceptada y el motor responderá con la aceptación de la modificación devolviendo los mismos valores enviados en la modificación.

Solo los tags más representativos son presentados en este ejemplo:

Orden Existente

Instrumento: TE28DC12

Lado: Compra

Precio: 4.7

Volumen: 10

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

Modificación:

35=G

41=120828MERR303MERR303C000000004

11=C000000007

55=TE28DC12

54=1

38=10

44=4.7

Respuesta:

Pending

35=8

11=120828MERR303MERR303C000000007

41=120828MERR303MERR303C000000004

150=E

39=0 (En caso de instrumentos de S/MART el valor es E)

Modified

35=8

11=120828MERR303MERR303C000000007

41=120828MERR303MERR303C000000004

150=5

39=0 (En caso de instrumentos de S/MART el valor es E)

55=TE28DC12

54=1

38=10

44=4.7

151=10

2.8 Contingencia

En el evento de una falla irrecuperable durante el horario de negociación, si es necesario, la negociación regresará a los motores de SENTRA y S/MART.

Para continuar la sesión de negociación, ISV's y desarrollos propios deben realizar el siguiente procedimiento **después de que MexDer informe (por correo electrónico) la situación de contingencia:**

- Con el propósito de que los usuarios de MexDer no requieran regresar sus aplicativos a la versión anterior de los motores, **se sugiere que los sistemas de los clientes soporten los comportamientos actuales y del nuevo motor.**

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

- **Reiniciar secuencias (ENTRADA y SALIDA) a 1;** Las interfaces de MexDer aceptarán y enviarán los números de secuencia 1 en sesiones de Trading y MarketData.
- ISV's y desarrollos propios **deben ser capaces de limpiar el “libro de órdenes”;** todas las ordenes enviadas al mercado, antes de la falla del MoNeT, serán eliminadas de los motores de MexDer.
- **Informar por correo electrónico cuando los dos puntos anteriores se hayan completado:**
 - Héctor García
 - Email: hjgarcia@bmv.com.mx
 - Irma González
 - Email: irmag@bmv.com.mx
- MexDer notificará sobre el ultimo correo, que los motores de MexDer se encuentran listos para aceptar mensajes de “Logon”; en este punto, ISV's y desarrollos propios pueden conectarse nuevamente a MexDer.

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

2.9 Tags utilizados en el mensaje Execution Report (MsgType= 8)

En las tablas siguientes, se indican las diferencias actuales respecto a los tags incluidos en el mensaje "Execution Report" de acuerdo al motor de negociación y estado de la orden. En la columna "Nuevo Motor" se indica si este incluirá o no el tag especificado.

2.9.1 *Pending new*

ExecutionReport - Pending New Message				
Tag	S/MART	SENTRA	Nuevo Motor	Notas
BeginString (8)	✓	✓	✓	
BodyLength (9)	✓	✓	✓	
MsgType (35)	✓	✓	✓	
MsgSeqNum (34)	✓	✓	✓	
SenderCompID (49)	✓	✓	✓	
SenderSubID (50)	✓	✓	✓	
TargetCompID (56)	✓	✓	✓	
TargetSubID (57)	✓	✓	✓	
SendingTime (52)	✓	✓	✓	
OrderID (37)	✓	✓	✓	
SecondaryOrderID (198)	✗	✓	✓	
ClOrdID (11)	✓	✓	✓	
NoPartyIDs (453)	✓	✓	✓	
PartyID (448)	✓	✓	✓	
PartyIDSource (447)	✓	✓	✓	
PartyRole (452)	✓	✓	✓	
ExecID (17)	✓	✓	✓	
ExecType (150)	✓	✓	✓	
OrdStatus (39)	✓	✓	✓	
Account (1)	✓	✓	✓	
Symbol (55)	✓	✓	✓	
Side (54)	✓	✓	✓	
OrderQty (38)	✓	✓	✓	
OrdType (40)	✓	✓	✓	
Price (44)	✓	✓	✓	
TimInForce (59)	✓	✓	✓	
LeavesQty (151)	✓	✓	✓	
CumQty (14)	✓	✓	✓	
AvgPx (6)	✓	✓	✓	
Checksum (10)	✓	✓	✓	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

2.9.2 New

ExecutionReport - New Message				
Tag	S/MART	SENTRA	Nuevo Motor	Notas
BeginString (8)	✓	✓	✓	
BodyLength (9)	✓	✓	✓	
MsgType (35)	✓	✓	✓	
MsgSeqNum (34)	✓	✓	✓	
SenderCompID (49)	✓	✓	✓	
SenderSubID (50)	✓	✓	✓	
TargetCompID (56)	✓	✓	✓	
TargetSubID (57)	✓	✓	✓	
SendingTime (52)	✓	✓	✓	
OrderID (37)	✓	✓	✓	
SecondaryOrderID (198)	✓	✓	✓	
ClOrdID (11)	✓	✓	✓	
NoPartyIDs (453)	✓	✓	✓	
PartyID (448)	✓	✓	✓	
PartyIDSource (447)	✓	✓	✓	
PartyRole (452)	✓	✓	✓	
ExecID (17)	✓	✓	✓	
ExecType (150)	✓	✓	✓	
OrdStatus (39)	✓	✓	✓	
Account (1)	✓	✓	✓	
Symbol (55)	✓	✓	✓	
Side (54)	✓	✓	✓	
TransactTime (60)	✓	✓	✓	Miliseconds
OrderQty (38)	✓	✓	✓	
OrdType (40)	✓	✓	✓	
Price (44)	✓	✓	✓	
TimInForce (59)	✓	✓	✓	
LeavesQty (151)	✓	✓	✓	
CumQty (14)	✓	✓	✓	
AvgPx (6)	✓	✓	✓	
ExecInst (18)	✓	✗	✓	Solo si se especifica
Checksum (10)	✓	✓	✓	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

2.9.3 *Filled*

ExecutionReport - Trade Message				
Tag	S/MART	SENTRA	Nuevo Motor	Notas
BeginString (8)	✓	✓	✓	
BodyLength (9)	✓	✓	✓	
MsgType (35)	✓	✓	✓	
MsgSeqNum (34)	✓	✓	✓	
SenderCompID (49)	✓	✓	✓	
SenderSubID (50)	✓	✓	✓	
TargetCompID (56)	✓	✓	✓	
TargetSubID (57)	✓	✓	✓	
SendingTime (52)	✓	✓	✓	
OrderID (37)	✓	✓	✓	
SecondaryOrderID (198)	✓	✓	✓	
SecondaryExecID (527)	✓	✓	✓	
ClOrdID (11)	✓	✓	✓	
ExchangeTradeType (5681)	✓	✓	✓	
NoPartyIDs (453)	✓	✓	✓	
PartyID (448)	✓	✓	✓	
PartyIDSource (447)	✓	✓	✓	
PartyRole (452)	✓	✓	✓	
ExecID (17)	✓	✓	✓	
ExecType (150)	✓	✓	✓	
OrdStatus (39)	✓	✓	✓	
Account (1)	✓	✓	✓	
Symbol (55)	✓	✓	✓	
Side (54)	✓	✓	✓	
TransactTime (60)	✓	✓	✓	Miliseconds
OrderQty (38)	✓	✓	✓	
OrdType (40)	✓	✓	✓	
Price (44)	✓	✓	✓	
TimeInForce (59)	✓	✗	✓	
LeavesQty (151)	✓	✓	✓	
CumQty (14)	✓	✓	✓	
AvgPx (6)	✓	✓	✓	
ExecInst (18)	✓	✗	✓	
LastQty (32)	✓	✓	✓	
LastPx (31)	✓	✓	✓	
MultiLegReportingType (442)	✓	✗	✓	
Checksum (10)	✓	✓	✓	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

2.9.4 Rejected

ExecutionReport - Reject Message				
Tag	S/MART	SENTRA	Nuevo Motor	Notas
BeginString (8)	✓	✓	✓	
BodyLength (9)	✓	✓	✓	
MsgType (35)	✓	✓	✓	
MsgSeqNum (34)	✓	✓	✓	
SenderCompID (49)	✓	✓	✓	
SenderSubID (50)	✓	✓	✓	
TargetCompID (56)	✓	✓	✓	
TargetSubID (57)	✓	✓	✓	
SendingTime (52)	✓	✓	✓	
OrderID (37)	✓	✓	✓	
ClOrdID (11)	✓	✓	✓	
NoPartyIDs (453)	✓	✓	✓	
PartyID (448)	✓	✓	✓	
PartyIDSource (447)	✓	✓	✓	
PartyRole (452)	✓	✓	✓	
ExecID (17)	✓	✓	✓	
ExecType (150)	✓	✓	✓	
OrdStatus (39)	✓	✓	✓	
OrdRejReason (103)	✓	✓	✓	
Account (1)	✓	✓	✓	
Symbol (55)	✓	✓	✓	
Side (54)	✓	✓	✓	
TransactTime (60)	✗	✓	✓	Milliseconds
OrderQty (38)	✓	✓	✓	
OrdType (40)	✓	✓	✓	
Price (44)	✓	✓	✓	
TimInForce (59)	✓	✗	✓	
LeavesQty (151)	✓	✓	✓	
CumQty (14)	✓	✓	✓	
AvgPx (6)	✓	✓	✓	
Text (58)	✓	✓	✓	
Checksum (10)	✓	✓	✓	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

2.9.5 Pending Replace

ExecutionReport - Pending Replace				
Tag	S/MART	SENTRA	Nuevo Motor	Notas
BeginString (8)	✓	✓	✓	
BodyLength (9)	✓	✓	✓	
MsgType (35)	✓	✓	✓	
MsgSeqNum (34)	✓	✓	✓	
SenderCompID (49)	✓	✓	✓	
SenderSubID (50)	✓	✓	✓	
TargetCompID (56)	✓	✓	✓	
TargetSubID (57)	✓	✓	✓	
SendingTime (52)	✓	✓	✓	
OrderID (37)	✓	✓	✓	
ClOrdID (11)	✓	✓	✓	
OrigClOrdID (41)	✓	✓	✓	
NoPartyIDs (453)	✓	✓	✓	
PartyID (448)	✓	✓	✓	
PartyIDSource (447)	✓	✓	✓	
PartyRole (452)	✓	✓	✓	
ExecID (17)	✓	✓	✓	
ExecType (150)	✓	✓	✓	
OrdStatus (39)	✓	✓	✓	
Account (1)	✓	✓	✓	
Symbol (55)	✓	✓	✓	
Side (54)	✓	✓	✓	
OrderQty (38)	✓	✓	✓	
OrdType (40)	✓	✗	ⓘ	Solo en instrumentos de S/MART
Price (44)	✓	✓	✓	
TimeInForce (59)	✓	✗	ⓘ	Solo en instrumentos de S/MART
LeavesQty (151)	✓	✓	✓	
CumQty (14)	✓	✓	✓	
AvgPx (6)	✓	✓	✓	
Checksum (10)	✓	✓	✓	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

2.9.6 Replaced

ExecutionReport - Replace				
Tag	S/MART	SENTRA	Nuevo Motor	Notas
BeginString (8)	✓	✓	✓	
BodyLength (9)	✓	✓	✓	
MsgType (35)	✓	✓	✓	
MsgSeqNum (34)	✓	✓	✓	
SenderCompID (49)	✓	✓	✓	
SenderSubID (50)	✓	✓	✓	
TargetCompID (56)	✓	✓	✓	
TargetSubID (57)	✓	✓	✓	
SendingTime (52)	✓	✓	✓	
OrderID (37)	✓	✓	✓	
SecondaryOrderID (198)	✓	✗	ⓘ	Solo en instrumentos de S/MART
ClOrdID (11)	✓	✓	✓	
OrigClOrdID (41)	✓	✓	✓	
NoPartyIDs (453)	✓	✓	✓	
PartyID (448)	✓	✓	✓	
PartyIDSource (447)	✓	✓	✓	
PartyRole (452)	✓	✓	✓	
ExecID (17)	✓	✓	✓	
ExecType (150)	✓	✓	✓	
OrdStatus (39)	✓	✓	✓	
Account (1)	✓	✓	✓	
Symbol (55)	✓	✓	✓	
Side (54)	✓	✓	✓	
OrderQty (38)	✓	✓	✓	
OrdType (40)	✓	✗	ⓘ	Solo en instrumentos de S/MART
Price (44)	✓	✓	✓	
TimInForce (59)	✓	✗	ⓘ	Solo en instrumentos de S/MART
LeavesQty (151)	✓	✓	✓	
CumQty (14)	✓	✓	✓	
AvgPx (6)	✓	✓	✓	
TransactTime (60)	✓	✓	✓	
ExecInst (18)	✓	✗	✓	Solo si se especifica
Checksum (10)	✓	✓	✓	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

2.9.7 Pending cancel

ExecutionReport - Pending Cancel				
Tag	S/MART	SENTRA	Nuevo Motor	Notas
BeginString (8)	✓	✓	✓	
BodyLength (9)	✓	✓	✓	
MsgType (35)	✓	✓	✓	
MsgSeqNum (34)	✓	✓	✓	
SenderCompID (49)	✓	✓	✓	
SenderSubID (50)	✓	✓	✓	
TargetCompID (56)	✓	✓	✓	
TargetSubID (57)	✓	✓	✓	
SendingTime (52)	✓	✓	✓	
OrderID (37)	✓	✓	✓	
ClOrdID (11)	✓	✓	✓	
OrigClOrdID (41)	✓	✓	✓	
NoPartyIDs (453)	✓	✓	✓	
PartyID (448)	✓	✓	✓	
PartyIDSource (447)	✓	✓	✓	
PartyRole (452)	✓	✓	✓	
ExecID (17)	✓	✓	✓	
ExecType (150)	✓	✓	✓	
OrdStatus (39)	✓	✓	✓	
Account (1)	✓	✓	✓	
Symbol (55)	✓	✓	✓	
Side (54)	✓	✓	✓	
OrderQty (38)	✓	✓	✓	
OrdType (40)	✓	✗	ⓘ	Solo en instrumentos de S/MART
Price (44)	✓	✓	✓	
TimeInForce (59)	✓	✗	ⓘ	Solo en instrumentos de S/MART
LeavesQty (151)	✓	✓	✓	
CumQty (14)	✓	✓	✓	
AvgPx (6)	✓	✓	✓	
Text (58)	✗	✓	✓	
Checksum (10)	✓	✓	✓	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

2.9.8 Canceled

ExecutionReport - Canceled				
Tag	S/MART	SENTRA	Nuevo Motor	Notas
Cancel Reject	✓	✓	✓	
BeginString (8)	✓	✓	✓	
BodyLength (9)	✓	✓	✓	
MsgType (35)	✓	✓	✓	
MsgSeqNum (34)	✓	✓	✓	
SenderCompID (49)	✓	✓	✓	
SenderSubID (50)	✓	✓	✓	
TargetCompID (56)	✓	✓	✓	
TargetSubID (57)	✓	✓	✓	
SendingTime (52)	✓	✓	✓	
OrderID (37)	✓	✓	✓	
ClOrdID (11)	✓	✓	✓	
OrigClOrdID (41)	✓	✓	✓	
NoPartyIDs (453)	✓	✓	✓	
PartyID (448)	✓	✓	✓	
PartyIDSource (447)	✓	✓	✓	
PartyRole (452)	✓	✓	✓	
OrdStatus (39)	✓	✓	✓	
TransactTime (60)	✗	✓	✓	
CxlRejResponseTo (434)	✓	✓	✓	
CxlRejReason (102)	✓	✓	✓	
Text (58)	✓	✓	✓	
Checksum (10)	✓	✓	✓	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

2.9.9 Rejected Cancel

ExecutionReport - Rejected				
Tag	S/MART	SENTRA	Nuevo Motor	Notas
BeginString (8)	✓	✓	✓	
BodyLength (9)	✓	✓	✓	
MsgType (35)	✓	✓	✓	
MsgSeqNum (34)	✓	✓	✓	
SenderCompID (49)	✓	✓	✓	
SenderSubID (50)	✓	✓	✓	
TargetCompID (56)	✓	✓	✓	
TargetSubID (57)	✓	✓	✓	
SendingTime (52)	✓	✓	✓	
OrderID (37)	✓	✓	✓	
NoPartyIDs (453)	✓	✓	✓	
PartyID (448)	✓	✓	✓	
PartyIDSource (447)	✓	✓	✓	
PartyRole (452)	✓	✓	✓	
ClOrdID (11)	✓	✓	✓	
OrigClOrdID (41)	✓	✓	✓	
OrdStatus (39)	✓	✓	✓	
TransactTime (60)	✗	✓	✓	
CxlRejResponseTo (434)	✓	✓	✓	
CxlRejReason (102)	✓	✓	✓	
Text (58)	✓	✓	✓	
Checksum (10)	✓	✓	✓	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

2.9.10 Cross Order's Pending New

ExecutionReport - CrossOrder's PendingNew				
Tag	S/MART	SENTRA	Nuevo Motor	Notas
BeginString (8)	✓	✓	✓	
BodyLength (9)	✓	✓	✓	
MsgType (35)	✓	✓	✓	
MsgSeqNum (34)	✓	✓	✓	
SenderCompID (49)	✓	✓	✓	
SenderSubID (50)	✓	✓	✓	
TargetCompID (56)	✓	✓	✓	
TargetSubID (57)	✓	✓	✓	
SendingTime (52)	✓	✓	✓	
OrderID (37)	✓	✓	✓	
ClOrdID (11)	✓	✓	✓	
SecondaryExecID (527)	✓	✓	✓	
NoPartyIDs (453)	✓	✓	✓	
PartyID (448)	✓	✓	✓	
PartyIDSource (447)	✓	✓	✓	
PartyRole (452)	✓	✓	✓	
CrossID (548)	✓	✓	✓	
ExecID (17)	✓	✓	✓	
ExecType (150)	✓	✓	✓	
OrdStatus (39)	✓	✓	✓	
Account (1)	✓	✓	✓	
Symbol (55)	✓	✓	✓	
Side (54)	✓	✓	✓	
OrderQty (38)	✓	✓	✓	
Price (44)	✓	✓	✓	
LeavesQty (151)	✓	✓	✓	
CumQty (14)	✓	✓	✓	
AvgPx (6)	✓	✓	✓	
Text (58)	✓	✓	✓	
Checksum (10)	✓	✓	✓	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

2.9.11 New Cross Order

ExecutionReport - CrossOrder's New				
Tag	S/MART	SENTRA	Nuevo Motor	Notas
BeginString (8)	✓	✓	✓	
BodyLength (9)	✓	✓	✓	
MsgType (35)	✓	✓	✓	
MsgSeqNum (34)	✓	✓	✓	
SenderCompID (49)	✓	✓	✓	
SenderSubID (50)	✓	✓	✓	
TargetCompID (56)	✓	✓	✓	
TargetSubID (57)	✓	✓	✓	
SendingTime (52)	✓	✓	✓	
OrderID (37)	✓	✓	✓	
SecondaryExecID (527)	✓	✓	✓	
ClOrdID (11)	✓	✓	✓	
CrossID (548)	✓	✓	✓	
ExecID (17)	✓	✓	✓	
ExecType (150)	✓	✓	✓	
OrdStatus (39)	✓	✓	✓	
Account (1)	✓	✓	✓	
Symbol (55)	✓	✓	✓	
Side (54)	✓	✓	✓	
OrderQty (38)	✓	✓	✓	
Price (44)	✓	✓	✓	
LeavesQty (151)	✓	✓	✓	
CumQty (14)	✓	✓	✓	
AvgPx (6)	✓	✓	✓	
TransactTime (60)	✓	✓	✓	
Text (58)	✓	✓	✓	
Checksum (10)	✓	✓	✓	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

2.9.12 Filled Cross Order

ExecutionReport - CrossOrder's Trade				
Tag	S/MART	SENTRA	Nuevo Motor	Notas
BeginString (8)	✓	✓	✓	
BodyLength (9)	✓	✓	✓	
MsgType (35)	✓	✓	✓	
MsgSeqNum (34)	✓	✓	✓	
SenderCompID (49)	✓	✓	✓	
SenderSubID (50)	✓	✓	✓	
TargetCompID (56)	✓	✓	✓	
TargetSubID (57)	✓	✓	✓	
SendingTime (52)	✓	✓	✓	
OrderID (37)	✓	✓	✓	
SecondaryExecID (527)	✓	✓	✓	
ClOrdID (11)	✓	✓	✓	
ExchangeTradeType (5681)	✓	✓	✓	
CrossID (548)	✓	✓	✓	
ExecID (17)	✓	✓	✓	
ExecType (150)	✓	✓	✓	
OrdStatus (39)	✓	✓	✓	
Account (1)	✓	✓	✓	
Symbol (55)	✓	✓	✓	
Side (54)	✓	✓	✓	
OrderQty (38)	✓	✓	✓	
Price (44)	✓	✓	✓	
LastQty (32)	✗	✗	✓	
LastPx (31)	✗	✗	✓	
LeavesQty (151)	✓	✓	✓	
CumQty (14)	✓	✓	✓	
AvgPx (6)	✓	✓	✓	
TransactTime (60)	✓	✓	✓	
Text (58)	✓	✓	✓	
Checksum (10)	✓	✓	✓	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

2.9.13 Rejected Cross Order

ExecutionReport - Rejected CrossOrder				
Tag	S/MART	SENTRA	Nuevo Motor	Notas
BeginString (8)	✓	✓	✓	
BodyLength (9)	✓	✓	✓	
MsgType (35)	✓	✓	✓	
MsgSeqNum (34)	✓	✓	✓	
SenderCompID (49)	✓	✓	✓	
SenderSubID (50)	✓	✓	✓	
TargetCompID (56)	✓	✓	✓	
TargetSubID (57)	✓	✓	✓	
SendingTime (52)	✓	✓	✓	
OrderID (37)	✓	✓	✓	
SecondaryExecID (527)	✓	✓	✓	
ClOrdID (11)	✓	✓	✓	
NoPartyIDs (453)	✓	✓	✓	
PartyID (448)	✓	✓	✓	
PartyIDSource (447)	✓	✓	✓	
PartyRole (452)	✓	✓	✓	
CrossID (548)	✓	✓	✓	
ExecID (17)	✓	✓	✓	
ExecType (150)	✓	✓	✓	
OrdStatus (39)	✓	✓	✓	
OrdRejReason (103)	✓	✓	✓	
Account (1)	✓	✓	✓	
Symbol (55)	✓	✓	✓	
Side (54)	✓	✓	✓	
OrderQty (38)	✓	✓	✓	
Price (44)	✓	✓	✓	
LeavesQty (151)	✓	✓	✓	
CumQty (14)	✓	✓	✓	
AvgPx (6)	✓	✓	✓	
TransactTime (60)	✓	✓	✓	Miliseconds
Text (58)	✓	✓	✓	
Checksum (10)	✓	✓	✓	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

2.9.14 Trade Cancelled

ExecutionReport - Trade Cancelled				
Tag	S/MART	SENTRA	Nuevo Motor	Notas
BeginString (8)	✓	✓	✓	
BodyLength (9)	✓	✓	✓	
MsgType (35)	✓	✓	✓	
MsgSeqNum (34)	✓	✓	✓	
SenderCompID (49)	✓	✓	✓	
SenderSubID (50)	✓	✓	✓	
TargetCompID (56)	✓	✓	✓	
TargetSubID (57)	✓	✓	✓	
SendingTime (52)	✓	✓	✓	
OrderID (37)	✗	✓	✓	
SecondaryOrderID (198)	✗	✓	✓	
SecondaryExecID (527)	✓	✓	✓	
ClOrdID (11)	✓	✓	✓	
ExchangeTradeType (5681)	✓	✓	✓	
NoPartyIDs (453)	✓	✓	✓	
PartyID (448)	✓	✓	✓	
PartyIDSource (447)	✓	✓	✓	
PartyRole (452)	✓	✓	✓	
ExecID (17)	✓	✓	✓	
ExecType (150)	✓	✓	✓	
OrdStatus (39)	✓	✓	✓	
Account (1)	✓	✓	✓	
Symbol (55)	✓	✓	✓	
Side (54)	✓	✓	✓	
OrderQty (38)	✓	✓	✓	
OrdType (40)	✗	✓	✓	
Price (44)	✓	✓	✓	
TimeInForce (59)	✗	✗	✓	
LastQty (32)	✓	✓	✓	
LastPx (31)	✓	✓	✓	
LeavesQty (151)	✗	✓	✓	
CumQty (14)	✗	✓	✓	
AvgPx (6)	✗	✓	✓	
TransactTime (60)	✓	✓	✓	Milliseconds
Text (58)	✓	✓	✓	
ExecInst (18)	✗	✗	✓	
MultiLegReportingType (442)	✗	✓	✓	
Checksum (10)	✓	✓	✓	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

2.9.15 Trade Replaced

ExecutionReport - Trade Replace				
Tag	S/MART	SENTRA	Nuevo Motor	Notas
BeginString (8)	✓	✓	✓	
BodyLength (9)	✓	✓	✓	
MsgType (35)	✓	✓	✓	
MsgSeqNum (34)	✓	✓	✓	
SenderCompID (49)	✓	✓	✓	
SenderSubID (50)	✓	✓	✓	
TargetCompID (56)	✓	✓	✓	
TargetSubID (57)	✓	✓	✓	
SendingTime (52)	✓	✓	✓	
OrderID (37)	✗	✓	✓	
SecondaryOrderID (198)	✗	✓	✓	
SecondaryExecID (527)	✓	✓	✓	
ClOrdID (11)	✓	✓	✓	
ExchangeTradeType (5681)	✓	✓	✓	
NoPartyIDs (453)	✓	✓	✓	
PartyID (448)	✓	✓	✓	
PartyIDSource (447)	✓	✓	✓	
PartyRole (452)	✓	✓	✓	
ExecID (17)	✓	✓	✓	
ExecType (150)	✓	✓	✓	
OrdStatus (39)	✓	✓	✓	
Account (1)	✓	✓	✓	
Symbol (55)	✓	✓	✓	
Side (54)	✓	✓	✓	
OrderQty (38)	✓	✓	✓	
OrdType (40)	✓	✓	✓	
Price (44)	✓	✓	✓	
TimeInForce (59)	✓	✗	✓	
LastQty (32)	✓	✓	✓	
LastPx (31)	✓	✓	✓	
LeavesQty (151)	✗	✓	✓	
CumQty (14)	✗	✓	✓	
AvgPx (6)	✗	✓	✓	
TransactTime (60)	✓	✓	✓	Miliseconds
ExecInst (18)	✓	✗	✓	
MultiLegReportingType (442)	✓	✓	✓	
Checksum (10)	✓	✓	✓	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

2.10 Mensajes de error

Para estos mensajes, el tag 103 (OrdRejReason) contendrá el valor 99 (Others) y el tag 58 (Text):

Texto de error (en tag 58)	Descripción del Error	¿Aplica a tag 102?
Date must be the day	La fecha utilizada en el mensaje no corresponde con la fecha de negociación en el motor.	✓
Order does not registred,member of give up,invalid reference	No se proporcionó referencia cuando se utiliza cuenta de Giveup.	
Invalid Operation, duplicated Ciordid	CIOrdID duplicado	✓
Different Member of PartyId	El dueño de la orden no es el mismo que el dueño del mensaje.	✓
Invalid order, symbol does not exist	El instrumento no existe.	✓
Order does not exist to cancel	El valor del OrigCIOrdID utilizado para cancelar una orden no existe como orden vigente.	✓
Invalid volume	El volumen indicado en una orden no es válido.	
Invalid data does not applicable to order	No se identifican cambios para aplicar una modificación.	
Invalid volume must be less	Las modificaciones que incrementen el volumen no se permiten.	
Invalid Symbol or Side	El instrumento y lado no corresponden al de la orden a modificar.	✓
Error order does not exist	El OrigCIOrdID utilizado para modificar una orden no existe como orden vigente.	
Member is suspended	El miembro está suspendido.	✓
Instrument not granted for member	El miembro no tiene permitido operar sobre un instrumento específico.	✓
Price must be different than zero	El precio proporcionado debe ser mayor a cero.	
Invalid volume	El volumen utilizado no es válido.	
Invalid price	El precio utilizado no es válido.	
Price not accepted in this Order type	El precio debe ser cero para Órdenes a Precio de Liquidación.	
Invalid Clearing Member	El valor de la cuenta no pertenece al miembro.	✓
Time to participate is over	La subasta ha terminado.	
The Serie is in Auction period	Se intentó modificar o cancelar una orden durante el periodo de subasta.	✓
Instrument is halted	El instrumento está suspendido para negociación.	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

Trading at Settlement Price period is close	El periodo de órdenes a precio de liquidación se terminó.	
Market is halted	El mercado está suspendido.	
Market is close	El mercado está cerrado.	✓
Trading Session is close	El period de negociación se terminó.	✓
Auction Period for Settlement Price is close	El periodo de subasta se terminó mientras la orden fué enviada.	
Invalid instrument state	Estado de instrumento inválido para negociación.	✓
Trading is halted	Negociación suspendida.	
Invalid schedule	Se intenta enviar una orden fuera del horario de negociación.	
Invalid Tick	El precio no está ajustado a la puja.	
Invalid volume size	El tamaño de lote es menor al mínimo.	
Invalid lot size	El volumen no está ajustado al tamaño del lote.	
Quantity exceeds market filter	El volumen excede el filtro establecido por MexDer.	
Quantity exceeds last minutes market filter	El volumen excede el filtro de mercado de "ultimos minutos".	
Filter Parameters does not exist for this instrument	Nos se han configurado parámetros de filtro para el miembro.	
Price exceeds market filter	El precio indicado en la orden excede el filtro de mercado.	
Price exceeds last minutes market filter	El precio indicado en la orden excede el filtro de mercado de "ultimos minutos".	
Give up member, invalid reference	Se especificó una orden Give Up con espacios en el tag de referencia.	
Trade executed and exist contrary position	Miembro no autorizado a operar consigo mismo.	
Error duplicated register	El ClOrdID proporcionado en una orden ya existe.	
Trade is not executed	Error interno al intentar negociar una orden.	
Invalid request, time to participate is over	Se terminó el periodo de participación de ondenes den subasta durante el envío de la orden.	
Order does not exist	The referred order does not exist.	✓
Price modification not allowed in this order type	Modificación de precio no permitida para ordenes en subasta.	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

New price must be better	El precio en una modificación debe mejorar el precio de la orden original.	
Price must be different than zero	El precio utilizado en la orden debe ser mayor a cero.	
Clearing Member suspended	Miembro liquidador (identificado por la cuenta) está suspendido.	
Internal Error [xxxx]	Otro error. Código de error mostrado en [xxxx].	✓

2.11 MultiLegReporting Type

Cada que un mensaje de Execution Report (35=8) es enviado, especificando un Hecho / Corrección de Hecho / Cancelación de Hecho (tag 150=F/G/H), el tag MultiLegReporting Type (442) será enviado con el valor correspondiente (de acuerdo a la especificación MexFix).

2.12 Concertaciones en desuso

En el nuevo motor algunas claves de concertación serán eliminadas debido a que iban a ser usadas para funcionalidades que nunca se desarrollaron, otras porque la funcionalidad de “cama” no se implementará en el nuevo motor.

Para claves que se refieren a la misma concertación en S/MART y Sentra prevalecerá la clave usada en Sentra.

Los siguientes valores para el tag 5681 del mensaje “Execution Report” ya no serán usadas:

Clave de concertación eliminada	Descripción	Valor usado en su lugar
M	Ejecución de mercado	CO
H	Cruce en mercado	CR
T	Autoentrada de Compra	AC
R	Spread	
S	Operación asociada a spread	
C	Cama	
O	Ronda	RO
X	Cancelación	
F	Modificación	
D	Split	
U	Error	
Y	Autoentrada de Venta	AV
CA	Consecuencia de Autoentrada de Compra	
CB	Cama de engrapado	
CC	Consecuencia de cruce	

Proyecto MoNeT Derivados	Versión: 1.7.5
Cambios de comportamiento de MexFix con el Nuevo Motor	Fecha: Diciembre, 2012
	Autor: JAGG/RAV

CM	Cama	
D4	Participación en Cruce de Estrategia de Divisas	
D5	Participación en Autoentrada Venta Estrategia de Div.	
D6	Participación en Autoentrada Compra Estrategia de Div.	
DB	Cama de Estrategia de Divisas	
E4	Originado por un X4	
E5	Originado por un X5	
E6	Originado por un X6	
EB	Engrapado de cama	
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	
VA	Consecuencia de Autoentrada de Venta	
X4	Participación en Cruce de Engrapado	
X5	Participación en Autoentrada de Venta de Engrapado	
X6	Participación en Autoentrada de Compra Engrapado	