

MexFix[®]

Fix Clientes

Tablas de contenidos

Versión 1.13.1

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
16-Mzo-2010	1.6	Corrección de la clave asignada para "Call Mayo"	Irma González MexDer	Irma González MexDer

MexFix MexDer	Versión: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

13-Enero-2012	1.7	- Adición de concertación de blocktrade (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
23-Marzo-2012	1.7.1	-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)	Héctor Javier García Encinas MexDer	Irma González MexDer
14-Junio-2012	1.7.2	Se agrega CFI code para futuros de divisas con entrega de contado en tabla 16	José Alberto González García/Gerente de Sistemas	Irma González MexDer
11-Julio-2012	1.7.2	Se agrega CFI Code para SWAPS	José Alberto González García/Gerente de Sistemas	Irma González MexDer
5-October-2012	1.7.3	Código de Contrato y CFI Code para Opciones y Futuros del Maíz	Francisco Javier Ibarra Caballero Especialista	Irma González MexDer
10-October-2012	1.7.4	Corrección del CFI Code de Futuros del Maíz	Francisco Javier Ibarra Caballero Especialista	Irma González MexDer
21-Enero-2013	1.7.5	Se agregan concertaciones de Swaps en la tabla 19	José Alberto González García/Gerente de Sistemas	Irma González MexDer
4-Marzo-2013	1.7.5	Se eliminan códigos de concertación obsoletos en la tabla 19	José Alberto González García/Gerente de Sistemas	Irma González MexDer

MexFix MexDer	Versión: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

31-Mayo-2013	1.7.6	Se agrega Código de Futuro de Swap de TIIIE 3 años	Héctor Javier García Encinas MexDer	Irma González MexDer
13-Agosto-2013	1.7.7	Se agrega Códigos de Contrato para la opción de FEMSA UBD y IVV	Héctor Javier García Encinas MexDer	Irma González MexDer
30-Enero-2014	1.7.8	Se agrega Códigos de Contrato y Grupo de Contrato para el Futuro de Mini-IPC	Héctor Javier García Encinas MexDer	José Alberto González García/Gerente de Sistemas
14-Febrero-2014	1.7.9	Se agrega Código de Contrato y Grupo de Contrato para el VIMEX. Se agrega Código de Contrato del Futuro de Bono DC24.	Edgar Calderón García MexDer	Héctor Javier García Encinas MexDer
25-Febrero-2014	1.8	Se modificó Grupo de Contrato para el Futuro Mini-IPC	Edgar Calderón García MexDer	Héctor Javier García Encinas MexDer
15-Agosto-2014	1.8.1	Se agrega Código de Contrato del Futuro de Bono MY31	Edgar Calderón MexDer	Héctor Javier García Encinas MexDer
3-Septiembre-2014	1.8.2	Se elimina futuro de UDI y bono M5	Héctor Javier García Encinas MexDer	Héctor Javier García Encinas MexDer
5-Mayo-2015	1.9	Se agrega nomenclatura para futuros con más de un vencimiento en el mes y se homologa la estrategia "spread" en la Tabla 19 "Códigos de Operación" y en la sección 3.4.2	Alberto González García Bursatec	Héctor Javier García Encinas MexDer
1-Junio-2015	1.9.1	Se agrega Grupo de Contrato y nomenclatura de contrato para el futuro y opción de Acciones de Grupo LALA.	Alberto González García Bursatec	Héctor Javier García Encinas MexDer
25-Agosto-2015	1.10	Se agregan Grupos de Contrato para opciones de MEXICHEM, ICA,	Edgar Calderón García MexDer	Héctor Javier García Encinas MexDer

MexFix MexDer	Versión: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

		PEÑOLES, PINFRA, ALFA. Se eliminan Futuros de BRTRAC, ILCTRAC, MEXTRAC, y opciones de BRTRAC, MEXTRAC.		
25-Septiembre-2015	1.10.1	Se agregan Códigos de Contrato del Futuro de Bono NV42 y DC18	Edgar Calderón MexDer	Héctor Javier García Encinas MexDer
28-Marzo-2016	1.11	Actualización de documento	Edgar Calderón MexDer	Héctor Javier García Encinas MexDer
25-Abril-2016	1.11.1	Actualización de documento	Edgar Calderón MexDer	Héctor Javier García Encinas MexDer
25-Mayo-2016	1.12	Actualización de documento (Futuros de MEXTRAC)	Edgar Calderón MexDer	Héctor Javier García Encinas MexDer
2-Septiembre-2016	1.12.1	Actualización de documento (Bono JN21)	Edgar Calderón MexDer	Héctor Javier García Encinas MexDer
7-Noviembre-2016	1.13	Actualización de documento (Bono MR26)	Edgar Calderón MexDer	Héctor Javier García Encinas MexDer
24-Marzo-2017	1.13.1	Se agregan UDI's.	Edgar Calderón MexDer	Héctor Javier García Encinas MexDer

MexFix MexDer	Versión: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

Tablas de Codificación

1. Introducción.	6
2. Tablas de codificación	6
Tabla 12: Tipos de orden FIX	6
Tabla 13: Vigencia de orden FIX	6
Tabla 16: Valores de CFICode	7
Tabla 17: Códigos de Mercado	9
Tabla 19: Códigos de operación	9
Tabla 20: Grupos de Contrato	10
3. Nomenclatura de Contratos para FIX	11
3.1 Para Futuros	11
3.2 Para Futuros con más de un vencimiento en el mes (Se excluye el futuro del dólar).	14
3.3 Para Opciones	15
3.4 Estrategias	17
3.4.1 Para Engrapados	17
3.4.2 Spreads	18
3.4.3 Para Roll Overs	19

MexFix MexDer	Versión: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

Especificación de Diseño

1. Introducción.

Este documento pretende complementar el documento “Fix Clientes –MexFixLayout 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: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

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
	FFCCSX	Futuro financiero estandarizado sobre divisas entrega de contado
	XMXXXX	Estrategias
	OCECCS	Opción call europea estandarizada sobre divisas
	OPECCS	Opción put europea estandarizada sobre divisas
	Bonos	FFDPSX

MexFix MexDer	Versión: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

	XMXXX	Estrategias
Deuda	FFDCSX	Futuro financiero estandarizado sobre instrumentos de deuda
	XMXXX	Estrategias
Swaps	FFDCSW	Swap
	FFWC SX	Futuro financiero estandarizado sobre SWAPS
	XMXXX	Estrategias
UDI's	FFMCSX	Futuro financiero estandarizado sobre UDI
	XMXXX	Estrategias
Maíz	FCACSM	Futuro estandarizado de <i>Commodity</i> sobre Maíz
	OCATCS	Opción <i>Call</i> americana estandarizado de <i>Commodity</i> sobre Maíz
	OPATCS	Opción <i>Put</i> americana estandarizada de <i>Commodity</i> sobre Maíz

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: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

Tabla 17: Códigos de Mercado

Código	Concepto
DV	Todo MexDer

Tabla 19: Códigos de operación

Código	Concepto
AC	Autoentrada de Compra
AV	Autoentrada de Venta
BE	Cama de Engrapado
CE	Generado por Engrapado
CO	Cierre de Ordenes
CR	Cruces
D1	Pata de un Cruce de Estrategia "Spread"
D2	Pata de una Autoentrada de Venta Estrategia "Spread"
D3	Pata de una Autoentrada de Compra Estrategia "Spread"
DI	Pata de una Estrategia "Spread"
DR	Pata de Profundidad/Ronda de una Estrategia "Spread"
E1	Originado por un X1
E2	Originado por un X2
E3	Originado por un X3
ER	Engrapado de Ronda
GR	Engrapados
L1	Cruce de Rollover
L2	Autoentrada de Venta de Rollover
L3	Autoentrada de Compra de Rollover
LR	Profundidad de Rollover
P2	Profundidad Ronda Engrapado
PR	Profundidad de Ronda
RE	Ronda de Engrapado
RL	RollOvers
RO	Rondas
SB	Subastas
X1	Cruce de Engrapado
X2	Autoentrada de Venta de Engrapado
X3	Autoentrada de Compra de Engrapado
BN	Block Trade
BA	Block Trade de nuevo Swap
BW	Block Trade de Swap con cupón corrido
BU	Unwind de Swap
BC	Sustitución en un Swap
BS	Consecuencia de Engrapado de Block Trade
TE	Block Trade de Engrapado

MexFix MexDer	Versión: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

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
08	Instrumentos de LALA	S/MART
09	Instrumentos de NAF	S/MART
10	Instrumentos de QQQ	S/MART
11	Instrumentos de MEXICHEM	S/MART
12	Instrumentos de IVV	S/MART
13	Instrumentos de TELEVISA	S/MART
14	Instrumentos de GMEXICO	S/MART
15	Instrumentos de ICA	
16	Instrumentos de CEMEX AJUSTADO	S/MART
17	Instrumentos de PEÑOLES	S/MART
18	Instrumentos de PINFRA	S/MART
21	Instrumentos de ALFA	S/MART
22	Opciones de Dollar	S/MART
25	Instrumentos de MEXTRAC	S/MART
27	Instrumentos de MAIZ	S/MART
29	Instrumentos de VIMEX	S/MART
30	Instrumentos de Mini-IPC	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
FW	Swaps	SENTRA

MexFix MexDer	Versión: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

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:

Ccccmmaa

En donde:

Cccc : Es la clase

mmaa : Vencimiento

La tabla de clases para futuros es:

Código	Concepto
AXL	Futuro de América Móvil
CE91	Futuro de CETES a 91 días
CXC	Futuros de CEMEX
CXCA	Futuros de CEMEX Ajustado ¹
DAnn	Futuros del dólar *
DC18	Futuro de Bono M181213
DC24	Futuro de Bono M241205
EURO	Futuro del Euro
FEM	Futuro de FEMSA
GCA	Futuro de GCARSO
GMEX	Futuro de GMEXICO
IPC	Futuro de IPC
JN21	Futuro de Bono M210610
M10	Futuro de Bono M10
M20	Futuro de Bono M20
M3	Futuro de Bono M3
M30	Futuro de Bono M30
MAIZ	Futuro de Maíz
MIP	Futuro de Mini-IPC
MR26	Futuro de Bono M260305
MY31	Futuro de Bono M310529

MexFix MexDer	Versión: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

NV42	Futuro de Bono M421113
02xx	Futuro de Swap de TIIE 2 años**
10xx	Futuro de Swap de TIIE 10 años**
aX1	SWAP***
TE28	Futuro de TIIE a 28 días
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.

***Para el SWAP “a” indica la cantidad de Liquidaciones Periódicas que tendrá el contrato, se integrará hasta por 3 caracteres numéricos.

¹En caso de que el mercado lo requiera.

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

MexFix MexDer	Versión: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

Ejemplos de contratos

AXL DC15
CXC DC15
FEM DC15
GCA DC15
IPC JN15
CE91MR16
TE28DC16
DA19MR16
M3 SP15
390X1
2X1
MAIZMY16

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

MexFix MexDer	Versión: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

3.2 Para Futuros con más de un vencimiento en el mes (Se excluye el futuro del dólar).

La nomenclatura es:

CcccDDMMR

En donde:

Cccc : Es la clase

Código	Concepto
DC24	Futuro de Bono DC24
MY31	Futuro de Bono MY31

DD: Día de vencimiento (De 01 al 31)

MM: Mes de vencimiento

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

R: Último dígito del año de la fecha de vencimiento

Ejemplos de contratos:

Futuro de bono DC24 con fecha de vencimiento 2 de junio del 2015 sería:

MexFix MexDer	Versión: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

DC2402JN5

Futuro de bono DC24 con fecha de vencimiento 30 de junio del 2015 sería:

DC2430JN5

Futuro de bono MY31 con fecha de vencimiento 12 de noviembre del 2015 sería:

MY3112NV5

3.3 Para Opciones

La nomenclatura es:

Ccsssssv

Cc: Clave de la clase.

Code	Concept
AL	Opciones de ALFA
AX	Opciones de AMX L
CX	Opciones de CEMEX CPO
CA	Opciones de CEMEX Ajustado ¹
DA	Opciones de MXP-US Dollar
FE	Opciones de FEMSA UBD
GM	Opciones de GMEXICO B
IC	Opciones de ICA
IP	Opciones de IPC
IV	Opciones de IVV
LL	Opciones de LALA
MC	Opciones de MEXICHEM
NA	Opciones de IPC Index Tracking Stock (Nafrac 02)
PE	Opciones de PEÑOLES

MexFix MexDer	Versión: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

PI	Opciones de PINFRA
TV	Opciones de TLEVISA CPO
WA	Opciones de WALMEX V

¹En caso de que el mercado lo requiera.

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.

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
NA 1550F
IP15000L

MexFix MexDer	Versión: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

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

3.4 Estrategias

En esta sección se incluyen los diferentes tipos de estrategia que se soportan en MexDer.

3.4.1 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.

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

Ejemplos

Un engrapado de TE28 que comienza en Enero de 2018 de 1x12 sería

TE28EN181012

MexFix MexDer	Versión: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

3.4.2 Spreads

La nomenclatura es:

CcccFmmyy

Dónde:

Cccc: Es la clase del instrumento (con excepción del spread del dólar, donde la clase será "DEUA")

F: Indica que es un spread

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

Ejemplos:

Un spread de futuro de bono DC24 con vencimiento de hoy contra el vencimiento de marzo de 2016

DC24FMR16

Un spread de futuro de bono MY31 con vencimiento de hoy contra el vencimiento de diciembre 2015

MY31FDC15

Un spread de futuro de dólar con vencimiento de hoy contra el vencimiento de noviembre 2015

DEUAFNV15

MexFix MexDer	Versión: 1.10.1
FIX MexDer	Inicio de vigencia: Octubre-2015

3.4.3 Para Roll Overs

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 último dígito del año

Ejemplo:

Un Rollover de Cete a 91 días con los vencimientos enero 2016 y febrero 2016
CE91A6B6