

MexFix®

Tablas de Codificación

Versión 2.0

Historia de las revisiones.

Fecha de inicio de vigencia	Versión	Descripción	Autor	Revisó y aprobó
26-Enero-2018	1.14.1	Se agregan bonos JN20, JN22, JN27, NV36, NV47.	Edgar Calderón MexDer	Héctor Javier García Encinas MexDer
5-Marzo-2018	2.0	Las tablas de codificación es actualizada debido a la implementación de la nueva especificación FIX de MexDer.	Héctor Javier García Encinas MexDer	Alberto González García Tecnología

Tablas de Codificación

1.	Introducción.	3
2.	Tablas de codificación	3
	Tabla 12: Tipos de orden FIX	3
	Tabla 13: Vigencia de orden FIX	3
	Tabla 16: Valores de CFICode	4
	Tabla 17: Códigos de Mercado	6
	Tabla 19: Códigos de operación	6
	Tabla 20: Grupos de Contrato	7
3.	Nomenclatura de Contratos para FIX	8
	3.1 Para Futuros	8
	3.2 Para Opciones	10
	3.3 Estrategias	12
	3.3.1 Para Engrapados	12
	3.3.2 Spreads	13
	3.3.3 Para Roll Overs	13

MexFix MexDer	Versión: 2.0
	Inicio vigencia: 5-marzo-2018

Especificación de Diseño

1. Introducción.

Este documento pretende complementar los documentos “MexFix Market Data Specs” y “New MexFix Trading Specifications” de MexDer.

MexFix Market Data Specs:

http://www.mexder.com.mx/wb3/wb/MEX/MEX_Repositorio/vtp/MEX/1f3a_mexfix/rid/21/mt/3/MexFix_Market_Data_Specs.pdf

New MexFix Trading Specifications:

http://www.mexder.com.mx/wb3/wb/MEX/MEX_Repositorio/vtp/MEX/1f3a_mexfix/rid/21/mt/3/MexFix_Trading_Specs.pdf

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
2	Market

Tabla 13: Vigencia de orden FIX

Código	Concepto
0	Day (default value)
3	Immediate or Cancel (IOC)
7	At the Close

Todos los grupos de contrato aceptan la combinación de Tipo de orden “1” con vigencia de orden “0” o “3”. Ver la tabla 20.

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

	XMXXXX	Estrategias
TE28 y CE91	FFDCSX	Futuro financiero estandarizado sobre instrumentos de deuda
	XMXXXX	Estrategias
Swaps	FFDCSW	Swap
	FFWCSX	Futuro financiero estandarizado sobre SWAPS
	XMXXXX	Estrategias
UDI's	FFMCSX	Futuro financiero estandarizado sobre UDI
	XMXXXX	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 "CFIcodeUsage – ISO 10962 Classification of Financial Instrument (CFIcode)" del documento "FinancialInformation Exchange Protocol (FIX) version 4.4 with errata 20030618". (<https://www.fixtrading.org/standards/fix-4-4/>)

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

Tabla 20: Grupos de Contrato

Código	Concepto
01	Instrumentos de IPC
03	Instrumentos de WALMEX
04	Instrumentos de CEMEX
05	Instrumentos de FEMSA
06	Instrumentos de GCARSO
07	Instrumentos de América Móvil
08	Instrumentos de LALA
09	Instrumentos de NAF
11	Instrumentos de MEXCHEM
13	Instrumentos de TELEVISA
14	Instrumentos de GMEXICO
16	Instrumentos de CEMEX AJUSTADO
17	Instrumentos de PEÑOLES
18	Instrumentos de PINFRA
21	Instrumentos de ALFA
22	Opciones de Dollar
25	Instrumentos de MEXTRAC
27	Instrumentos de MAIZ
29	Instrumentos de VIMEX
30	Instrumentos de Mini-IPC
31	Instrumentos de GAP
32	Instrumentos de ASUR
33	Instrumentos de KOF
FD	Futuros de Divisas
FB	Futuros de Bonos
FS	Futuros de SWAP
FT	Futuros de Tasas
FU	Futuros de UDI
FW	Swaps

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
ALF	Futuros de Alfa
AXL	Futuros de América Móvil
ASU	Futuros de ASUR
CE91	Futuros de CETES de 91 días
CXC	Futuros de CEMEX
CXCA	Futuros de CEMEX Ajustado ¹
DAnn	Futuros del dólar *
DC18	Futuros de Bono M181213
DC24	Futuros de Bono M241205
EURO	Futuros de Euro
FEM	Futuros de FEMSA
GAP	Futuros de GAP
GCA	Futuro de GCARSO
GMEX	Futuro de GMEXICO
IPC	Futuro de IPC
JN20	Futuro de Bono M200611
JN21	Futuro de Bono M210610
JN22	Futuro de Bono M220609
JN27	Futuro de Bono M270603
KOF	Futuros de KOF
LALA	Futuros de LALA

M10	Futuro de Bono de 10 años
M20	Futuro de Bono de 20 años
M3	Futuro de Bono de 3 años
M30	Futuro de Bono de 30 años
MAIZ	Futuro de Maíz Amarillo
MCM	Futuros de Mexchem
MEXT	Futuros de MEXTRAC
MIP	Futuros de Mini-IPC
MR26	Futuros de Bono M260305
MY31	Futuros de Bono M310529
NV36	Futuros de Bono M361120
NV42	Futuros de Bono M421113
NV47	Futuros de Bono M471107
PENO	Futuros de PEÑOLES
PIN	Futuros de PINFRA
TE28	Futuro de TIIE a 28 días
UDI	Futuro de UDI
WAL	Futuro de WALMEX
02xx	Futuros de Swap de TIIE 2 años**
10xx	Futuros de Swap de TIIE 10 años**
aX1	SWAP***

* 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 tres caracteres numéricos. p.e. 390X1

¹En caso de que el mercado lo requiera.

El vencimiento se compone de la siguiente manera:

mm es el mes de vencimiento de acuerdo a la tabla siguiente y **aa** son los dos últimos dígitos del año de vencimiento. Por ejemplo, AB19.

Código	Concepto
EN	Enero
FB	Febrero
MR	Marzo
AB	Abril
MY	Mayo
JN	Junio

MexFix MexDer	Versión: 2.0
	Inicio vigencia: 5-marzo-2018

JL	Julio
AG	Agosto
SP	Septiembre
OC	Octubre
NV	Noviembre
DC	Diciembre

Ejemplos de contratos

AXL DC19
 CXC DC19
 FEM DC19
 GCA DC19
 IPC JN19
 CE91MR19
 TE28DC19
 DA14EN19
 M3 SP15
 390X1
 2X1
 MAIZMY19

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

3.2 Para Opciones

La nomenclatura es:

Ccsssstv

Cc: Clave de la clase.

Code	Concept
AL	Opciones de ALFA
AS	Opciones de ASUR
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
GP	Opciones de GAP
IP	Opciones de IPC
KO	Opciones de KOF
LL	Opciones de LALA
MC	Opciones de MEXICHEM
NA	Opciones de IPC Index Tracking Stock (Nafrac 02)
PE	Opciones de PEÑOLES
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

MexFix MexDer	Versión: 2.0
	Inicio vigencia: 5-marzo-2018

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
NA 1550F
IP15000L

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

3.3 Estrategias

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

3.3.1 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 2019 de 1x12 sería

TE28EN191012

MexFix MexDer	Versión: 2.0
	Inicio vigencia: 5-marzo-2018

3.3.2 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 (para corta) contra el vencimiento de marzo de 2018 (pata larga).

DC24FMR18

Un spread de futuro de bono MY31 con vencimiento de hoy (pata corta) contra el vencimiento de diciembre 2018 (pata larga).

MY31FDC18

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

DEUAFNV18

3.3.3 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 2019 y febrero 2019

CE91A9B9