

BISTECH Pay Piyasası Veri Analitikleri

“BISTECH Genium Consolidated Feed TIP Specification” dokümanı ekidir.

Versiyon: BIST-1.0
Yayımlanma Tarihi: 2016-03-01

Telif Hakkı © 2016 BISTECH izniyle
Tüm hakları saklıdır.

İçindekiler

Erişim Yöntemi	3
Mesajlar	4
<i>Alıcı Satıcı Analitikleri (Buyer Seller Analytics)</i>	4
<i>Miktar Ağırlıklı Ortalama Fiyat Analitikleri (Volume Weighted Average Price Analytics)</i>	5
<i>Gelen Emir Analitikleri (Order Arrival Analytics)</i>	6
<i>Emir Akış Analitikleri (Order Flow Analytics)</i>	7
<i>Emir İptal Analitikleri (Order Cancellation Analytics)</i>	8

Eriřim Yöntemi

Veri Analitikleri Sistemi (VAS) Sunucularına erişim ve veri analitik mesajlarının alınabilmesi için BISTECH Veri Yayın Sistemi'ne erişim için verilen kullanıcı ve şifreler geçerli olacaktır.

Pay piyasası referans verileri, piyasa ve işlem gören serilerin işlem durumları için BISTECH Veri Yayın Sistemi'nden (VYS) sağlanan TIP mesajları kullanılacaktır. VAS sadece veri analitiklerine ait olan ve bu dokümanda tanımlanmış olan mesajları iletir. VAS sunucularına erişim için kullanılacak IP Adresi/Port bilgileri "Borsa İstanbul Veri Yayın Altyapısı Bağlantı Klavuzu"nda yer almaktadır.

Mesajlar

Tüm veri analitikleri için bazı alanlar “Boş (Null)” değerler alabilmektedir. Bu tür durumlar için ilgili alan, değer içermeyen bir “tag” şeklinde gönderilecektir.

Alıcı Satıcı Analitikleri (Buyer Seller Analytics)

Gerçekleşen işlemlerin sayısına (sözleşme sayısı) ve miktarına ilişkin bilgileri, işlemleri aktif/pasif taraflarına göre ayrıştırarak veren analitiklerdir.

“Buyer Seller” mesajı gün içerisinde tanımlanan aralıklarla gönderilir.

Mesaj tipi: DABSRm

Örnek:

DABSRm;i523;s3;t090031;DABTCf23.45;DASTCf23.45;DABTQf23.45;DASTQf23.45;DABSCRf23.45;DABSQRf23.45;DATBSCRf23.45;DATBSQRf23.45;DABSRm;i523;s3;t090031;Of;

Alan/Analitik	Anahtar	Etiket	Tür	Uzunluk	Açıklama
Kimlik No (Id)	TK	i	Id	10	Enstrümanın VYS'deki kimlik numarasıdır.
Kaynak No (SourceSystem)	TK	s	Integer	2	Kaynak dizgedir. Bu numara, BasicDataSource mesajında tanımlanmıştır.
Hesaplanma Zamanı (TimeExec)		t	Time	10	Hesaplanma zamanıdır.
Alıcı aktif işlem sayısı (Number of buyer-initiated trades)		DABTCf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde gerçekleşen, pasifte bekleyen satım emrinin/emirlerinin gelen alım emri ile eşleştiği işlem sayısı
Satıcı aktif işlem sayısı (Number of seller-initiated trades)		DASTCf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde gerçekleşen, pasifte bekleyen alım emrinin/emirlerinin gelen satım emri ile eşleştiği işlem sayısı
Alıcı aktif işlem miktarı (Quantity of buyer initiated trades)		DABTQf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde gerçekleşen, pasifte bekleyen satım emrinin/emirlerinin gelen alım emri ile eşleştiği işlem miktarı
Satıcı aktif işlem miktarı (Quantity of seller initiated trades)		DASTQf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde gerçekleşen, pasifte bekleyen alım emrinin/emirlerinin gelen satım emri ile eşleştiği işlem miktarı

Alıcı/Satıcı oranı 1 (Buyer/Seller Ratio 1)	DABSCRf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde gerçekleşen alıcı aktif işlem sayısının satıcı aktif işlem sayısına oranı
Alıcı/satıcı oranı 2 (Buyer/Seller Ratio 2)	DABSQRf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde gerçekleşen alıcı aktif işlem miktarının satıcı aktif işlem miktarına oranı
Kümülatif alıcı/satıcı oranı 1 (Cumulative Buyer/Seller Ratio 1)	DATBSCRf	Float	13,6	O zamana kadar gerçekleşen alıcı aktif işlem sayısının satıcı aktif işlem sayısına oranı
Kümülatif alıcı/satıcı oranı 2 (Cumulative Buyer/Seller Ratio 2)	DATBSQRf	Float	13,6	O zamana kadar gerçekleşen alıcı aktif işlem miktarının satıcı aktif işlem miktarına oranı
OrderbookFlush	Of	Boolean		Bu alan kendiliğinden gönderilmekte olup, bu mesaja dahil tüm verilerin yeniden ayarlanmak zorunda olduğunu belirtir.

Miktar Ağırlıklı Ortalama Fiyat Analitikleri (Volume Weighted Average Price Analytics)

Gerçekleşen işlemlerin miktarları ile ağırlıklandırılmış ortalama fiyatlarını yansıtan analitiklerdir. “Volume Weighted Average Price” mesajı gün içerisinde tanımlanan aralıklarla gönderilir.

Mesaj tipi: DAVWAPm

Örnek:

DAVWAPm;i523;s3;t090031;DAWTf23.45;DAWATf23.45;DAWBTF23.45;DAWSTf23.45;DAVWAPm;i523;s3;t090031;Of;

Alan/Analitik	Anahtar	Etiket	Tür	Uzunluk	Açıklama
Kimlik No (Id)	TK	i	Id	10	Enstrümanın VYS'deki kimlik numarasıdır.
Kaynak No (SourceSystem)	TK	s	Integer	2	Kaynak dizgedir. Bu numara, BasicDataSource mesajında tanımlanmıştır.
Hesaplanma Zamanı (TimeExec)		t	Time	10	Hesaplanma zamanıdır.
İşlemlerin miktar ağırlıklı ortalama fiyatı (VWAP of trades)		DAWTf	Float	13,6	Son 5 dakikada gerçekleşen işlemlerin miktar ağırlıklı ortalama fiyatı
Tüm işlemlerin		DAWATf	Float	13,6	O ana kadar gerçekleşen

miktar ağırlıklı ortalama fiyatı (VWAP of all trades)					işlemlerin miktar ağırlıklı ortalama fiyatı
Alıcı aktif işlemlerin miktar ağırlıklı ortalama fiyatı (VWAP of buyer-initiated trades)	DAWBTF	Float	13,6		Son 5 dakikada gerçekleşen, pasifte bekleyen satım emrinin/emirlerinin gelen alım emri ile eşleştiği işlemlerin miktar ağırlıklı ortalama fiyatı
Satıcı aktif işlemlerin miktar ağırlıklı ortalama fiyatı (VWAP of seller-initiated trades)	DAWSTF	Float	13,6		Son 5 dakikada gerçekleşen, pasifte bekleyen alım emrinin/emirlerinin gelen satım emri ile eşleştiği işlemlerin miktar ağırlıklı ortalama fiyatı
OrderbookFlush	Of	Boolean			Bu alan kendiliğinden gönderilmekte olup, bu mesaja dahil tüm verilerin yeniden ayarlanmak zorunda olduğunu belirtir.

Gelen Emir Analitikleri (Order Arrival Analytics)

Alım satım sistemine gelen emirlerin sayısı, miktarı ve türü hakkında bilgiler veren analitiklerdir. Değiştirilmiş emirler de dahil edilmektedir.

“Order Arrival” mesajı gün içerisinde tanımlanan aralıklarla gönderilir.

Mesaj tipi: DAARRm

Örnek:

DAARRm;i523;s3;t090031;DAOCf23.45;DATOCf23.45;DAOQf23.45;DATOQf23.45;DABOCf23.45;DASOCf23.45;DABOQf23.45;DASOQf23.45;DAFAKCF23.45; DAARRm;i523;s3;t090031;Of;

Alan/Analitik	Anahtar	Etiket	Tür	Uzunluk	Açıklama
Kimlik No (Id)	TK	i	Id	10	Enstrümanın VYS’deki kimlik numarasıdır.
Kaynak No (SourceSystem)	TK	s	Integer	2	Kaynak dizgedir. Bu numara, BasicDataSource mesajında tanımlanmıştır.
Hesaplanma Zamanı (TimeExec)		t	Time	10	Hesaplanma zamanıdır.
Gelen emir sayısı (Number of arrived orders)		DAOCf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde gelen emir sayısı
Gelen kümülatif emir sayısı (Cumulative number of arrived orders)		DATOCf	Float	13,6	O zamana kadar gelen toplam emir sayısı

Gelen emir miktarı (Quantity of arrived orders)	DAOQf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde gelen emir miktarı
Gelen kümülatif emir miktarı (Cumulative quantity of arrived orders)	DATOQf	Float	13,6	O zamana kadar gelen toplam emir miktarı
Gelen alım emri sayısı (Number of arrived Buy orders)	DABOCf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde gelen alım emirlerinin sayısı
Gelen satım emri sayısı (Number of arrived Sell orders)	DASOCf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde gelen satım emirlerinin sayısı
Gelen alım emirlerinin miktarı (Quantity of arrived Buy orders)	DABOQf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde gelen alım emirlerinin miktarı
Gelen satım emirlerinin miktarı (Quantity of arrived Sell orders)	DASOQf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde gelen satım emirlerinin miktarı
Gelen "Kalani İptal Et" emirlerinin sayısı (Number of arrived fill and kill orders)	DAFAKCF	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde gelen "Kalani İptal Et" emirlerinin sayısı
OrderbookFlush	Of	Boolean		Bu alan kendiliğinden gönderilmekte olup, bu mesaja dahil tüm verilerin yeniden ayarlanmak zorunda olduğunu belirtir.

Emir Akış Analitikleri (Order Flow Analytics)

Alım satım sistemine gelen emirlerin miktarının ortalaması ve volatilitesi (standart sapma) bilgileri içeren analitiklerdir. Değiştirilmiş emirler de dahil edilmektedir.

"Order Flow" mesajı gün içerisinde tanımlanan aralıklarla gönderilir.

Mesaj tipi: DAORDFm

Örnek:

DAORDFm;i523;s3;t090031;DAABQf23.45;DAASQf23.45;DAVBQf23.45;DAVSQf23.45;
DAORDFm;i523;s3;t090031;Of;

Alan/Analitik	Anahtar	Etiket	Tür	Uzunluk	Açıklama
Kimlik No (Id)	TK	i	Id	10	Enstrümanın VYS'deki kimlik numarasıdır.
Kaynak No (SourceSystem)	TK	s	Integer	2	Kaynak dizgedir. Bu numara, BasicDataSource mesajında tanımlanmıştır.

Hesaplanma Zamanı (TimeExec)	t	Time	10	Hesaplanma zamanıdır.
Alım emirlerinin ortalama miktarı (Average quantity of arrived Buy orders)	DAABQf	Float	13,6	Son 5 dakikada gelen alım emirlerinin ortalama miktarı
Satım emirlerinin ortalama miktarı (Average quantity of arrived Sell orders)	DAASQf	Float	13,6	Son 5 dakikada gelen satım emirlerinin ortalama miktarı
Alım emir miktarının volatilitesi (standart sapma) (Volatility of arrived Buy order quantities)	DAVBQf	Float	13,6	Son 5 dakikada gelen alım emirlerinin miktarının volatilitesi
Satım emir miktarının volatilitesi (standart sapma) (Volatility of arrived Sell order quantities)	DAVSQf	Float	13,6	Son 5 dakikada gelen satım emirlerinin miktarının volatilitesi
OrderbookFlush	Of	Boolean		Bu alan kendiliğinden gönderilmekte olup, bu mesaja dahil tüm verilerin yeniden ayarlanmak zorunda olduğunu belirtir.

Emir İptal Analitikleri (Order Cancellation Analytics)

Alım-satım sistemine gönderildikten sonra herhangi bir şekilde iptal edilmiş emirlerin sayısı, miktarı, miktar ağırlıklı ortalama fiyatı ve gelen emirlere oranına ilişkin bilgiler içeren analitiklerdir. Değiştirilen emirler ve 'kalanı iptal et' emirlerinin karşılanmayan kısımları da dahildir.

“Order Cancellation” mesajı gün içerisinde tanımlanan aralıklarla gönderilir.

Mesaj tipi: DACXRm

Örnek:

DACXRm;i523;s3;t090031;DACXCf23.45;DACXQf23.45;DACXBCf23.45;DACXSCf23.45;DACXBQf23.45;DACXSQf23.45;DATCXCf23.45;DAWCXf23.45;DAWCXBf23.45;DAWCXSf23.45;DACXCRf23.45;DACXQRf23.45;DATCXCRf23.45;DATCXQRf23.45;DACXRm;i523;s3;t090031;Of;

Alan/Analitik	Anahtar	Etiket	Tür	Uzunluk	Açıklama
Kimlik No (Id)	TK	i	Id	10	Enstrümanın VYS'deki kimlik numarasıdır.
Kaynak No (SourceSystem)	TK	s	Integer	2	Kaynak dizgedir. Bu numara, BasicDataSource mesajında tanımlanmıştır.

Hesaplanma Zamanı (TimeExec)	t	Time	10	Hesaplanma zamanıdır.
İptal edilen emir sayısı (Number of cancelled orders)	DACXCf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde iptal edilen emir sayısı
İptal edilen emir miktarı (Quantity of cancelled orders)	DACXQf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde iptal edilen emir miktarı
İptal edilen alım emri sayısı (Number of cancelled Buy orders)	DACXBCf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde iptal edilen alım emirlerinin sayısı
İptal edilen satım emri sayısı (Number of cancelled Sell orders)	DACXSCf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde iptal edilen satım emirlerinin sayısı
İptal edilen alım emirlerinin miktarı (Quantity of cancelled Buy orders)	DACXBQf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde iptal edilen alım emirlerinin miktarı
İptal edilen satım emirlerinin miktarı (Quantity of cancelled Sell orders)	DACXSQf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde iptal edilen satım emirlerinin miktarı
İptal edilen kümülatif emir sayısı (Cumulative number of cancelled orders)	DATCXCf	Float	13,6	O zamana kadar iptal edilen toplam emir sayısı
İptal edilen emirlerin miktar ağırlıklı ortalama fiyatı (VWAP of cancelled orders)	DAWCXf	Float	13,6	O zamana kadar iptal edilen emirlerin hacim ağırlıklı fiyatı
İptal edilen alım emirlerinin miktar ağırlıklı ortalama fiyatı (VWAP of cancelled Buy orders)	DAWCXBf	Float	13,6	O zamana kadar iptal edilen alım emirlerinin hacim ağırlıklı fiyatı
İptal edilen satım emirlerinin miktar ağırlıklı ortalama fiyatı (VWAP of cancelled Sell orders)	DAWCXSf	Float	13,6	O zamana kadar iptal edilen satım emirlerinin hacim ağırlıklı fiyatı
İptal/emir oranı 1 (Cancel/Order Ratio 1)	DACXCRf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde iptal edilen emir sayısının gelen emir sayısına oranı
İptal/emir oranı 2 (Cancel/Order Ratio 2)	DACXQRf	Float	13,6	Son 60 saniye içerisinde iptal edilen emir miktarının gelen emir miktarına oranı

Kümülatif iptal/emir oranı 1 (Cumulative Cancel / Order Ratio 1)	DATCXCRf	Float	13,6	O zamana kadar iptal edilen emir sayısının o zamana kadar gelen emir sayısına oranı
Kümülatif iptal/emir oranı 2 (Cumulative Cancel / Order Ratio 2)	DATCXQRf	Float	13,6	O zamana kadar iptal edilen emir miktarının o zamana kadar gelen emir miktarına oranı
OrderbookFlush	Of	Boolean		Bu alan kendiliğinden gönderilmekte olup, bu mesaja dahil tüm verilerin yeniden ayarlanmak zorunda olduğunu belirtir.
