

**INFODATA FEED: DERIVATI**

---

***INFODATA FEED: DERIVATIVES***

**Borsa Italiana S.p.A.**

# Sommario



TRACCIATI INFODATA FEED: NOTE TECNICHE .....	3
TRACCIATO INFODATA FEED DERIVATI: "RECORD DI INIZIO E DI FINE" .....	7
TRACCIATO INFODATA FEED DERIVATI: " ANAGRAFICA STRUMENTI FINANZIARI" .....	11
TRACCIATO INFODATA FEED DERIVATI: "RETTIFICHE" .....	30
TRACCIATO INFODATA FEED DERIVATI: "ANNULLI" .....	32
TRACCIATO INFODATA FEED DERIVATI: "VALORI TEORICI DERIVATI" .....	34
TRACCIATO INFODATA FEED DERIVATI: "VALORI TEORICI SOTTOSTANTI" .....	41
TRACCIATO INFODATA FEED DERIVATI: "MARGINI" .....	48
TRACCIATO INFODATA FEED DERIVATI: "PREZZI DI APERTURA SOTTOSTANTI" .....	53

# *Table of Contents*



<i>INFODATA FEED LAYOUTS: TECHNICAL NOTES</i> .....	3
<i>INFODATA FEED DERIVATIVES LAYOUT: "START AND END RECORD"</i> .....	7
<i>INFODATA FEED DERIVATIVES LAYOUT: "FINANCIAL INSTRUMENTS"</i> .....	11
<i>INFODATA FEED DERIVATIVES LAYOUT: "ADJUSTMENTS"</i> .....	30
<i>INFODATA FEED DERIVATIVES LAYOUT: "THEORETICAL VALUES DERIVATIVES" ...</i>	32
<i>INFODATA FEED DERIVATIVES LAYOUT: "MARGINS"</i> .....	34
<i>INFODATA FEED DERIVATIVES LAYOUT: "CANCELLATIONS"</i> .....	41
<i>INFODATA FEED DERIVATIVES LAYOUT: "THEORETICAL VALUES UNDERLYINGS" ..</i>	48
<i>INFODATA FEED DERIVATIVES LAYOUT: "OPENING PRICES UNDERLYINGS" .....</i>	53

# **Tracciati INFODATA FEED: NOTE TECNICHE**

---

## ***INFODATA FEED Layouts: TECHNICAL NOTES***



## 1. Contenuto dei flussi DERIVATI:

<b>Tracciato</b>	<b>Nome file</b>	<b>Descrizione</b>
STRUMENTI FINANZIARI	XANADER_ANAG	Contiene i dati anagrafici degli strumenti derivati quotati sul mercato di Borsa Italiana.
RETTIFICHE	XANADER_RETT	Il flusso viene prodotto a fronte di corporate action che intervengono sulla struttura del capitale (circolante, etc). Il flusso viene fornito prescindendo dal fatto che il coefficiente K modifichi la base dei contratti oggetto di rettifica (K = 1).
ANNULLI	XANADER_ANNU	Il flusso contiene gli strumenti esclusi dal mercato rispetto al giorno precedente.
PREZZI DI APERTURA SOTTOSTANTI	XPRZMTL_APER	Flusso prezzi di apertura relativi ai titoli di capitale quotati su MTL.
MARGINI	XPRZDER_MARG	Contiene i parametri utilizzati per il calcolo dei margini iniziali (un record per ogni sottostante + tipologia strumento (=OPZ/FUT) ) relativi ai contratti derivati.
VALORI TEORICI DERIVATI	XPRZDER_TEOD	Valori teorici per calcolo margini.
VALORI TEORICI SOTTOSTANTI	XPRZDER_TEOS	Valori teorici per calcolo margini di consegna su attività sottostante.

## 2. Orari di invio dei flussi

I seguenti flussi:

STRUMENTI FINANZIARI  
RETTIFICHE  
ANNULLI

vengono inviati prima dell'apertura dei mercati (indicativamente alle ore 8:45).

I seguenti flussi:

PREZZI DI APERTURA SOTTOSTANTI

vengono inviati indicativamente alle ore 9:30.

I seguenti flussi:

MARGINI  
VALORI TEORICI DERIVATI  
VALORI TEORICI SOTTOSTANTI

vengono inviati dopo la chiusura dei mercati (indicativamente alle ore 23:00).

## 3. Note sul formato dei files

- ogni file è in formato ASCII
- i campi hanno lunghezza fissa
- tutti i campi data sono in formato "aaaammgg"
- è possibile che in futuro vengano aggiunti nuovi campi ai tracciati descritti. Essi verranno aggiunti in fondo ai tracciati in modo da minimizzare l'impatto sulle applicazioni degli utenti.



## 1. DERIVATIVES feed content:

<i>Layout</i>	<i>File name</i>	<i>Description</i>
FINANCIAL INSTRUMENTS	XANADER_ANAG	Contains the reference data for derivatives listed on the Borsa Italiana market.
ADJUSTMENTS	XANADER_RETT	The feed is generated by corporate actions involving the capital structure (outstanding, etc.). The feed is provided regardless of whether the K factor modifies the base of Contracts subject to adjustment (K = 1).
CANCELLATIONS	XANADER_ANNU	The feed contains instruments excluded from the market with respect to the previous day.
OPENING PRICE UNDERLYINGS	XPRZMTL_APER	Feed of opening prices relating to capital notes listed on MTL.
MARGINS	XPRZDER_MARG	Contains the parameters used to calculate initial margins (one record for each underlying + type of instrument (=OPT/FUT) ) relating to derivatives contracts.
THEORETICAL VALUES DERIVATIVES	XPRZDER_TEOD	Theoretical values for calculating margins.
THEORETICAL VALUES UNDERLYINGS	XPRZDER_TEOS	Theoretical values for calculating delivery margins on underlying asset.

## 2. Timing of feed transmission

The following feeds:

FINANCIAL INSTRUMENTS  
ADJUSTMENTS  
CANCELLATIONS

are sent prior to the opening of the markets (indicatively 8.45 a.m.).

The following feeds:

OPENING PRICES UNDERLYINGS

are sent at approximately 9.30 a.m..

The following feeds:

MARGINS  
THEORETICAL VALUES DERIVATIVES  
THEORETICAL VALUES UNDERLYINGS

are sent after the close of the markets (indicatively at 11.00 p.m.).

## 3. Notes on the format of files

- each file is in ASCII format
- fields have a set length
- all date fields are in "yyyymmdd" format
- it is possible that in future new fields may be added to the layouts described. These will be added at the end of the layouts so as to minimise the impact on users' applications.

 **Storia delle versioni del documento**

<b>Data</b>	<b>Descrizione</b>
02/03/2006	Versione iniziale del documento.

 ***History of document versions***

<b>Data</b>	<b>Descrizione</b>
02/03/2006	Initial version of the document.

**Tracciato INFODATA FEED  
DERIVATI: "RECORD DI INIZIO E DI  
FINE"**

---

***INFODATA FEED DERIVATIVES  
layout: "START AND END RECORD"***

**Tracciato INFODATA FEED "RECORD DI INIZIO E DI FINE"  
INFODATA FEED layout "START AND END RECORD"**

<b>CAMPO / FIELD</b>	<b>TIPO / TYPE</b>	<b>LUNG. / LENGTH</b>	<b>POS. INIZ. / START POS.</b>	<b>VALORE / FORMATO / VALUE / FORMAT</b>
TIPO RECORD / <i>RECORD TYPE</i>	N	2	1	ii
TIPO FILE / <i>FILE TYPE</i>	A	3	3	'UNI'
DATA MODIFICA / <i>DATE MODIFICATION EFFECTIVE</i>	N	8	6	aaaammgg
FILLER / <i>FILLER</i>	N	6	14	'000000'
DATA ELABORAZIONE / <i>DATE OF FILE PROCESSING</i>	N	8	20	aaaammgg
ORA ELABORAZIONE / <i>TIME OF FILE PROCESSING</i>	N	6	28	hhmmss
COUNTER / <i>RECORD COUNTER</i>	N	10	34	iiiiiiii
SIGLA MKT / <i>MKT ABBREVIATION</i>	N	3	44	iii

### Tipo Record / *Record Type*



Assume i valori:  
'00' record di inizio  
'99' record di fine.



*It accepts the values:*  
'00' start record  
'99' end record

### Tipo File / *File Type*



Assume i valori:  
'UNI' flusso giornaliero



*It accepts the values:*  
'UNI' daily feed

### Data Modifica / *Date Modification Effective*



I dati contenuti nel file sono quelli che hanno subito variazioni a partire dalla data indicata.



*The data contained in the file are those modified with effect from the date indicated.*

### **Filler / Filler**



Codice ad uso interno



*Code for internal use*

### **Data Elaborazione File / Date of File Processing**



Data in cui il file è stato elaborato.



*Date on which file has been processed.*

### **Ora Elaborazione File / Time of File Processing**



Ora in cui il file è stato elaborato.



*Time at which file has been processed.*

### **Contatore Record / Record Counter**



Per i tracciati di tipo anagrafico: indica il numero totale di record (relativi alla tipologia di tracciato contenuta nel file) che il cliente deve aver ottenuto dal file storico e dalla successiva applicazione dei files giornalieri. E' utilizzabile per effettuare un controllo di congruenza sui volumi dei dati.



*For reference data layouts: it indicates the total number of records (in relation to the type of layout contained in the file) that the client must have obtained from the historical file and from the subsequent application of the daily files. This can be used to carry out a congruity control on the volumes of data*

### **Sigla mkt / Mkt Abbreviation**



Sigla flusso:

valori assunti:

901 = anagrafe contratti

902 = rettifica contratti

903 = valori teorici derivati

904 = valori teorici sottostanti

905 = indici/panieri

906 = margini

907 = annulli contratti



*Feed abbreviation:*

*values accepted:*

*901 = contract reference data*

*902 = contract adjustment*

*903 = theoretical values of derivatives*

*904 = theoretical values of underlyings*

*905 = indices/baskets*

*906 = margins*

*907 = contract cancellations*

**Tracciato INFODATA FEED  
DERIVATI: "ANAGRAFICA  
STRUMENTI FINANZIARI"**

---

***INFODATA FEED DERIVATIVES layout:  
"FINANCIAL INSTRUMENTS"***

**Tracciato INFODATA FEED DERIVATI: "STRUMENTI FINANZIARI"  
INFODATA FEED DERIVATIVES layout: "FINANCIAL INSTRUMENTS"**

NUM.	CAMPO / FIELD	TIPO / TYPE	LUNG. / LENGHT	POS. INIZ. / START POS.	VALORE / FORMATO VALUE / FORMAT
1	DATA / DATE	N	8	1	aaaammgg
2	CODICE ISIN / ISIN CODE	A	12	9	\**...**'
3	SERIE / SERIES	A	32	21	\**...**'
4	DATA INIZIO NEGOZIAZIONE / FIRST TRADING DATE	N	8	53	aaaammgg
5	DATA FINE NEGOZIAZIONE / LAST TRADING DATE	N	8	61	aaaammgg
6	DATA SCADENZA / EXPIRY DATE	N	8	69	aaaammgg
7	NUMERO GIORNI REGOLAMENTO / NUMBER DAYS SETTLEMENT	N	3	77	Iii
8	CODICE NAZIONE / COUNTRY CODE	N	3	80	Iii
9	CODICE DIVISA EMISSIONE / ISSUE CURRENCY CODE	A	3	83	\****'
10	CODICE UIC DELL'EMITTENTE / ISSUER UIC CODE	A	11	86	\**...**'
11	INTESTAZIONE 1 DELL'EMITTENTE / ISSUER NAME 1	A	100	97	\**...**'
12	INTESTAZIONE 2 DELL'EMITTENTE / ISSUER NAME 2	A	100	197	\**...**'
13	INDIRIZZO DELL'EMITTENTE / ISSUER ADDRESS	A	100	297	\**...**'
14	CAP DELL'EMITTENTE / ISSUER POST CODE	A	10	397	\**...**'
15	CITTA' DELL'EMITTENTE / ISSUER TOWN	A	50	407	\**...**'
16	PROVINCIA DELL'EMITTENTE / ISSUER PROVINCE	A	50	457	\**...**'
17	CODICE PAESE DELL'EMITTENTE / ISSUER COUNTRY CODE	A	3	507	\****'
18	CODICE MERCATO TRATTAZIONE / RELEVANT MARKET CODE	A	4	510	\****'
19	DESCRIZIONE MERCATO TRATTAZIONE / RELEVANT MARKET DESCRIPTION	A	50	514	\**...**'
20	CODICE DIVISA CONTRATTO / CONTRACT CURRENCY CODE	A	3	564	\****'
21	CODICE TIPOLOGIA CONTRATTO / CONTRACT TYPE CODE	N	3	567	Iii
22	DESCRIZIONE TIPOLOGIA CONTRATTO / CONTRACT TYPE DESCRIPTION	A	100	570	\**...**'
23	CODICE CFI DELL'EMITTENTE / ISSUER CFI CODE	A	6	670	\*****'

INFODATA FEED: DERIVATI

- Borsa Italiana -

24	CODICE ISIN DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING ISIN CODE	A	12	676	'**...**'
25	CODICE COMMODITY DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING COMMODITY CODE	N	6	688	iiiiii
26	CODICE MERCATO DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING MARKET CODE	A	4	694	'*****'
27	CODICE DIVISA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING CURRENCY CODE	A	3	698	'***'
28	DESCRIZIONE DEL SOTTOSTANTE / DESCRIPTION OF UNDERLYING	A	100	701	'**...**'
29	CODICE SIA STRUMENTO FINANZIARIO DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING FINANCIAL INSTRUMENT SIA CODE	N	6	801	iiiiii
30	CODICE ALFANUMERICO DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING ALPHANUMERIC CODE	A	6	807	'*****'
31	CODICE PRODOTTO CASSA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING CC&G PRODUCT CODE	A	3	813	'***'
32	CODICE CLASSE CASSA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING CC&G CLASS CODE	A	5	816	'*****'
33	CODICE SYMBOL CASSA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING CC&G SYMBOL CODE	A	6	821	'*****'
34	CODICE TIPOLOGIA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING TYPE CODE	N	3	827	iii
35	DESCRIZIONE TIPOLOGIA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING TYPE DESCRIPTION	A	50	830	'**...**'
36	CODICE CFI DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING CFI CODE	A	6	880	'*****'
37	CODICE MODIFIER / MODIFIER CODE	N	3	886	iii
38	STRIKE PRICE	N	15	889	iiiiiiiiidddd
39	TICK NUMBER	N	3	904	iii
40	TICK VALUE1	N	15	907	iiiiiiiiidddd
41	TICK SIZE LOWER VALUE1	N	15	922	iiiiiiiiidddd
42	TICK SIZE UPPER VALUE1	N	15	937	iiiiiiiiidddd
43	TICK VALUE2	N	15	952	iiiiiiiiidddd
44	TICK SIZE LOWER VALUE2	N	15	967	iiiiiiiiidddd
45	TICK SIZE UPPER VALUE2	N	15	982	iiiiiiiiidddd
46	TICK VALUE3	N	15	997	iiiiiiiiidddd
47	TICK SIZE LOWER VALUE3	N	15	1012	iiiiiiiiidddd
48	TICK SIZE UPPER VALUE3	N	15	1027	iiiiiiiiidddd
49	TICK VALUE4	N	15	1042	iiiiiiiiidddd
50	TICK SIZE LOWER VALUE4	N	15	1057	iiiiiiiiidddd
51	TICK SIZE UPPER VALUE4	N	15	1072	Iiiiiiiiiidddd
52	TICK VALUE5	N	15	1087	Iiiiiiiiiidddd
53	TICK SIZE LOWER VALUE5	N	15	1102	Iiiiiiiiiidddd
54	TICK SIZE UPPER VALUE5	N	15	1117	Iiiiiiiiiidddd

55	TICK VALUE6	N	15	1132	Iiiiiiiiiidddd
56	TICK SIZE LOWER VALUE6	N	15	1147	Iiiiiiiiiidddd
57	TICK SIZE UPPER VALUE6	N	15	1162	Iiiiiiiiiidddd
58	TICK VALUE7	N	15	1177	Iiiiiiiiiidddd
59	TICK SIZE LOWER VALUE7	N	15	1192	Iiiiiiiiiidddd
60	TICK SIZE UPPER VALUE7	N	15	1207	Iiiiiiiiiidddd
61	TICK VALUE8	N	15	1222	Iiiiiiiiiidddd
62	TICK SIZE LOWER VALUE8	N	15	1237	Iiiiiiiiiidddd
63	TICK SIZE UPPER VALUE8	N	15	1252	Iiiiiiiiiidddd
64	TICK VALUE9	N	15	1267	Iiiiiiiiiidddd
65	TICK SIZE LOWER VALUE9	N	15	1282	Iiiiiiiiiidddd
66	TICK SIZE UPPER VALUE9	N	15	1297	Iiiiiiiiiidddd
67	TICK VALUE10	N	15	1312	Iiiiiiiiiidddd
68	TICK SIZE LOWER VALUE10	N	15	1327	Iiiiiiiiiidddd
69	TICK SIZE UPPER VALUE10	N	15	1342	Iiiiiiiiiidddd
70	TICK VALUE11	N	15	1357	Iiiiiiiiiidddd
71	TICK SIZE LOWER VALUE11	N	15	1372	Iiiiiiiiiidddd
72	TICK SIZE UPPER VALUE11	N	15	1387	Iiiiiiiiiidddd
73	TICK VALUE12	N	15	1402	Iiiiiiiiiidddd
74	TICK SIZE LOWER VALUE12	N	15	1417	Iiiiiiiiiidddd
75	TICK SIZE UPPER VALUE12	N	15	1432	Iiiiiiiiiidddd
76	CTD CODICE ISIN / CTD ISIN CODE	A	12	1447	'**...**'
77	QUANTITA' MINIMA NEGOZIATA / <i>MINIMUM TRADED QUANTITY</i>	N	15	1459	iiiiiiiiidddd
78	QUANTITA' MASSIMA NEGOZIATA / <i>MAXIMUM TRADED QUANTITY</i>	N	15	1474	Iiiiiiiiiidddd
79	QUANTITA' MINIMA ESERCIZIO / <i>MINIMUM EXERCISE QUANTITY</i>	N	15	1489	Iiiiiiiiiidddd
80	QUANTITA' MASSIMA ESERCIZIO / <i>MAXIMUM EXERCISE QUANTITY</i>	N	15	1504	Iiiiiiiiiidddd
81	CONTRACT SIZE	N	13	1519	iiiiiiiiidddd
82	CODICE CONTAB MARGINI INIZIALI / <i>INITIAL MARGIN ACCOUNTING CODE</i>	A	1	1532	'*'
83	CODICE TIPO REGOLAMENTO MARGINI INIZIALI / <i>INITIAL MARGIN SETTLEMENT TYPE CODE</i>	A	1	1533	'*'
84	FLAG PANIERI / <i>BASKETS FLAG</i>	A	1	1534	'*'
85	CODICE TIPO FUTURE / <i>FUTURES TYPE CODE</i>	A	1	1535	'*'
86	GG REGOL CONTRATTO / <i>CONTRACT SETTLEMENT DAYS</i>	N	3	1536	Iii

**1 Data / Date**

Identifica la data cui si riferiscono le informazioni riportate.



This identifies the date to which the information shown refers.

**2 CODICE ISIN / ISIN CODE**

Codice ISIN contratto derivato.



*Derivative contract ISIN code.*

**3 SERIE / SERIES**

Descrizione CONTRATTO derivato (nome della serie).



*Derivative contract description (name of series).*

**4 DATA INIZIO NEGOZIAZIONE / FIRST TRADING DATE**

Primo giorno di negoziabilità (indica anche inizio esercitabilità delle option americane).



*First day of tradability (also indicates start of exercisability for American style options).*

**5 DATA FINE NEGOZIAZIONE / LAST TRADING DATE**

Ultimo giorno di negoziabilità (option).



*Last day of tradability (options).*

**6 DATA SCADENZA / EXPIRY DATE**

Data scadenza future o ultima /unica data esercitabilità option americane/europee.



*Futures expiry date or last/only exercisability date for American/European style options.*

**7 NUMERO GIORNI REGOLAMENTO / NUMBER DAYS SETTLEMENT**

Numero giorni (lavorativi) di regolamento (da sommare a data scadenza) attività sottostante.



*Number of (business) days for settlement (to be added to expiry date) of underlying asset.*

**8 CODICE NAZIONE / COUNTRY CODE**

Codice del Paese di Emissione.  
Valore fisso = 11



*Code of the Country of Issue.  
Set value = 11*

## **9 CODICE DIVISA EMISSIONE / CURRENCY OF ISSUE CODE**



Codice della Divisa di Emissione.  
Costante = EUR



*Code of the Currency of Issue.  
Constant = EUR*

## **10 CODICE UIC DELL'EMITTENTE / ISSUER UIC CODE**



Codice UIC dell'emittente.



*Issuer's UIC (Italian Exchange Office) Code.*

## **11 INTESAZIONE 1 DELL'EMITTENTE / ISSUER NAME 1**



Prima parte intestazione ente emittente.



*First part of issuing entity's name.*

## **12 INTESAZIONE 2 DELL'EMITTENTE / ISSUER NAME 2**



Seconda parte intestazione ente emittente.



*Second part of issuing entity's name.*

## **13 INDIRIZZO DELL'EMITTENTE / ISSUER ADDRESS**



Indirizzo ente emittente.



*Address of the issuing entity.*

## **14 CAP DELL'EMITTENTE / ISSUER POST CODE**



CAP ente emittente.



*Post code of the issuing entity.*

**15 CITTA' DELL'EMITTENTE / ISSUER TOWN**



Città dell'ente emittente.



*Town of the issuing entity.*

**16 PROVINCIA DELL'EMITTENTE / ISSUER PROVINCE**



Provincia dell'ente emittente.



*Province of the issuing entity.*

**17 CODICE PAESE DELL'EMITTENTE / ISSUER COUNTRY CODE**



Codice ISO del paese dell'ente emittente.



*ISO code for the issuing entity's country.*

**18 CODICE MERCATO TRATTAZIONE DELL'EMITTENTE / ISSUER'S RELEVANT MARKET CODE**



Codice mercato trattazione strumento, secondo la codifica MIC/SWIFT.

Valore assunto:  
'XDMI'



*Instrument's relevant market code, according to MIC/SWIFT coding.*

*Accepted value:*  
'XDMI'

**19 DESCRIZIONE MERCATO TRATTAZIONE DELL'EMITTENTE / ISSUER'S RELEVANT MARKET DESCRIPTION**



Descrizione mercato di trattazione.

Assume i seguenti valori:  
'DERIVATI INDICI'  
'DERIVATI AZIONI'



*Description of relevant market.*

*It accepts the following values:*

'INDEX DERIVATIVES'  
'EQUITY DERIVATIVES'

**20 CODICE DIVISA CONTRATTO / CONTRACT CURRENCY CODE**

Codice ISO della divisa di trattazione dello strumento.



*ISO code for instrument's currency of trading.*

**21 CODICE TIPOLOGIA CONTRATTO / CONTRACT TYPE CODE**

Codice tipologia contratto derivato.

Assume i seguenti valori:

- 1 = European Call Option
- 2 = European Put Option
- 4 = Future
- 6 = American Call Option
- 7 = American Put Option.



*Derivative contract type code.*

*It accepts the following values:*

- 1 = European Call Option*
- 2 = European Put Option*
- 4 = Futures*
- 6 = American Call Option*
- 7 = American Put Option.*

**22 DESCRIZIONE TIPOLOGIA CONTRATTO / CONTRACT TYPE DESCRIPTION**

Descrizione Tipologia contratto.

Assume i seguenti valori:

- 'EUROPEAN CALL OPTION'
- 'EUROPEAN PUT OPTION'
- 'FUTURE'
- 'AMERICAN CALL OPTION'
- 'AMERICAN PUT OPTION'



*Description of contract type.*

*It accepts the following values:*

- 'EUROPEAN CALL OPTION'*
- 'EUROPEAN PUT OPTION'*
- 'FUTURES'*
- 'AMERICAN CALL OPTION'*
- 'AMERICAN PUT OPTION'*

**23 CODICE CFI DELL'EMITTENTE / ISSUER CFI CODE**

Codifica CFI (dall'UIC) contratto.  
Viene aggiornato mensilmente.



*Contract CFI code (from Italian Exchange Office).  
Updated on a monthly basis.*

**24 CODICE ISIN DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING ISIN CODE**

Codice Isin del sottostante.



Underlying ISIN Code.

**25 CODICE COMMODITY DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING COMMODITY CODE**

Codice underlying assegnato dal mercato di trattazione .



*Code of underlying assigned by the relevant market.*

**26 CODICE MERCATO DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING MARKET CODE**

Codice relativo al mercato dove viene trattata l'attività sottostante.  
Per derivati domestici attualmente :  
'XMIL' (codifica MIC/SWIFT)



*Code for the market where the underlying asset is traded.  
For domestic derivatives currently :  
'XMIL' (MIC/SWIFT code)*

**27 CODICE DIVISA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING CURRENCY CODE**

Codifica ISO Divisa del sottostante



*ISO code for the currency of the underlying.*

**28 DESCRIZIONE DEL SOTTOSTANTE / DESCRIPTION OF UNDERLYING**

Descrizione attività sottostante



*Description of the underlying asset*

**29 CODICE SIA STRUMENTO FINANZIARIO DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING FINANCIAL INSTRUMENT SIA CODE**



Codice sottostante assegnato da Borsa (codice ced) .



*Underlying's code assigned by the Borsa Italiana (ced code).*

**30 CODICE ALFANUMERICO DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING ALPHANUMERIC CODE**



Identifica, attraverso il codice alfanumerico, lo strumento finanziario cui si riferisce il record.



*This identifies the financial instrument to which the record refers, by way of the alphanumeric code.*

**31 CODICE PRODOTTO CASSA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING CC&G PRODUCT CODE**



Codice prodotto di Cassa Compensazione e Garanzia



*Cassa Compensazione e Garanzia product code.*

**32 CODICE CLASSE CASSA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING CC&G CLASS CODE**



Codice classe di Cassa Compensazione e Garanzia



*Cassa Compensazione e Garanzia class code*

**33 CODICE SYMBOL CASSA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING CC&G SYMBOL CODE**



Codice simbolo di Cassa Compensazione e Garanzia



*Cassa Compensazione e Garanzia symbol code*

**34 CODICE TIPOLOGIA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING TYPE CODE**



Codice Tipologia attività sottostante.

1 = Stock

7 = Stock Index



*Underlying asset type code.*

*1 = Stock*

*7 = Stock Index*

### **35 DESCRIZIONE TIPOLOGIA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING TYPE DESCRIPTION**



Descrizione Tipologia Underlying.

Assume i seguenti valori:

'STOCK'

'STOCK\_INDEX'



*Underlying type description.*

*It accepts the following values:*

*'STOCK'*

*'STOCK\_INDEX'*

### **36 CODICE CFI DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING CFI CODE**



Codifica CFI (UIC) Underlying.

Viene aggiornato mensilmente



*Underlying's CFI (UIC) code.*

*It is updated on a monthly basis.*

### **37 CODICE MODIFIER / MODIFIER CODE**



Numero versione della serie (esprime il numero delle rettifiche subite dal contratto originale)



*Series version number (expresses the number of adjustments applied to the original contract).*

### **38 STRIKE PRICE / STRIKE PRICE**



Prezzo di esercizio



*Strike/exercise price.*

### **39 TICK NUMBER / TICK NUMBER**



Numero di TICK VALUE significativi nelle 12 occorrenze successive



*Number of significant TICK VALUES in the 12 successive events*

**40 TICK VALUE1 / TICK VALUE 1**

Valore del 'tick' 1 di negoziazione

*Value of trading tick 1.***41 TICK SIZE LOWER VALUE1 / TICK SIZE LOWER VALUE 1**

Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 1 (prezzo minimo)

*Range of application of trading tick 1 (minimum price)***42 TICK SIZE UPPER VALUE1 / TICK SIZE UPPER VALUE 1**

Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 1 (prezzo massimo)

*Range of application of trading tick 1 (maximum price)***43 TICK VALUE2/ TICK VALUE 2**

Valore del 'tick' 2 di negoziazione

*Value of trading tick 2***44 TICK SIZE LOWER VALUE2/ TICK SIZE LOWER VALUE 2**

Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 2 (prezzo minimo)

*Range of application of trading tick 2 (minimum price)***45 TICK SIZE UPPER VALUE2/ TIC SIZE UPPER VALUE 2**

Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 2 (prezzo massimo)

*Range of application of trading tick 2 (maximum price)***46 TICK VALUE3/ TICK VALUE 3**

Valore del 'tick' 3 di negoziazione



*Value of trading tick 3*

**47 TICK SIZE LOWER VALUE3/ TICK SIZE LOWER VALUE 3**



Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 3 (prezzo minimo)



*Range of application of trading tick 3 (minimum price)*

**48 TICK SIZE UPPER VALUE3/ TICK SIZE UPPER VALUE 3**



Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 3 (prezzo massimo)



*Range of application of trading tick 3 (maximum price)*

**49 TICK VALUE4/ TICK VALUE 4**



Valore del 'tick' 4 di negoziazione



*Value of trading tick 4*

**50 TICK SIZE LOWER VALUE4/ TICK SIZE LOWER VALUE 4**



Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 4 (prezzo minimo)



*Range of application of trading tick 4 (minimum price)*

**51 TICK SIZE UPPER VALUE4/ TICK SIZE UPPER VALUE 4**



Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 4 (prezzo massimo)



*Range of application of trading tick 4 (maximum price)*

**52 TICK VALUE5/ TICK VALUE 5**



Valore del 'tick' 5 di negoziazione



*Value of trading tick 5*

**53 TICK SIZE LOWER VALUE5/ TICK SIZE LOWER VALUE 5**

Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 5 (prezzo minimo)



*Range of application of trading tick 5 (minimum price)*

**54 TICK SIZE UPPER VALUE5/ TICK SIZE UPPER VALUE 5**

Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 5 (prezzo massimo)



*Range of application of trading tick 5 (maximum price)*

**55 TICK VALUE6/ TICK VALUE 6**

Valore del 'tick' 6 di negoziazione



*Value of trading tick 6*

**56 TICK SIZE LOWER VALUE6/ TICK SIZE LOWER VALUE 6**

Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 6 (prezzo minimo)



*Range of application of trading tick 6 (minimum price)*

**57 TICK SIZE UPPER VALUE6/ TICK SIZE UPPER VALUE 6**

Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 6 (prezzo massimo)



*Range of application of trading tick 6 (maximum price)*

**58 TICK VALUE7/ TICK VALUE 7**

Valore del 'tick' 7 di negoziazione



*Value of trading tick 7*

**59 TICK SIZE LOWER VALUE7/ TICK SIZE LOWER VALUE 7**

Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 7 (prezzo minimo)



*Range of application of trading tick 7 (minimum price)*

**60 TICK SIZE UPPER VALUE7 / TICK SIZE UPPER VALUE 7**



Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 7 (prezzo massimo)



*Range of application of trading tick 7 (maximum price)*

**61 TICK VALUE8 / TICK VALUE 8**



Valore del 'tick' 8 di negoziazione



*Value of trading tick 8*

**62 TICK SIZE LOWER VALUE8 / TICK SIZE LOWER VALUE 8**



Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 8 (prezzo minimo)



*Range of application of trading tick 8 (minimum price)*

**63 TICK SIZE UPPER VALUE8 / TICK SIZE UPPER VALUE 8**



Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 8 (prezzo massimo)



*Range of application of trading tick 8 (maximum price)*

**64 TICK VALUE9 / TICK VALUE 9**



Valore del 'tick' 9 di negoziazione



*Value of trading tick 9*

**65 TICK SIZE LOWER VALUE9 / TICK SIZE LOWER VALUE 9**



Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 9 (prezzo minimo)



*Range of application of trading tick 9 (minimum price)*

**66 TICK SIZE UPPER VALUE9/ TICK SIZE UPPER VALUE 9**

Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 9 (prezzo massimo)



*Range of application of trading tick 9 (maximum price)*

**67 TICK VALUE10/ TICK VALUE 10**

Valore del 'tick' 10 di negoziazione



*Value of trading tick 10*

**68 TICK SIZE LOWER VALUE10/ TICK SIZE LOWER VALUE 10**

Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 10 (prezzo minimo)



*Range of application of trading tick 10 (minimum price)*

**69 TICK SIZE UPPER VALUE10/ TICK SIZE UPPER VALUE 10**

Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 10 (prezzo massimo)



*Range of application of trading tick 10 (maximum price)*

**70 TICK VALUE11/ TICK VALUE 11**

Valore del 'tick' 11 di negoziazione



*Value of trading tick 11*

**71 TICK SIZE LOWER VALUE11/ TICK SIZE LOWER VALUE 11**

Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 11(prezzo minimo)



*Range of application of trading tick 11 (minimum price)*

**72 TICK SIZE UPPER VALUE11/ TICK SIZE UPPER VALUE 11**

Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 11 (prezzo massimo)



*Range of application of trading tick 11 (maximum price)*

**73 TICK VALUE12 / TICK VALUE 12**

Valore del 'tick' 12 di negoziazione



*Value of trading tick 12*

**74 TICK SIZE LOWER VALUE12/ TICK SIZE LOWER VALUE 12**

Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 12 (prezzo minimo)



*Range of application of trading tick 12 (minimum price)*

**75 TICK SIZE UPPER VALUE12/ TICK SIZE UPPER VALUE 12**

Intervallo di applicazione del tick di negoziazione 12 (prezzo massimo)



*Range of application of trading tick 12 (maximum price)*

**76 CTD CODICE ISIN / CTD ISIN CODE**

Underlying 'cheapest- to-deliver' ISIN (solo per underlying uguali a titoli di debito).  
Sempre fillato a blank non esistendo derivati domestici di questo tipo.



*Underlying's 'cheapest to deliver' ISIN code (only for underlyings akin to debt securities).  
Always left blank since no domestic derivatives of this type exist.*

**77 QUANTITA MINIMA NEGOZIATA/ MINIMUM TRADED QUANTITY**

Quantità minima negoziabile.



*Minimum tradable quantity .*

**78 QUANTITA MASSIMA NEGOZIATA/ MAXIMUM TRADED QUANTITY**

Quantità massima negoziabile.



*Maximum tradable quantity .*

**79 QUANTITA MINIMA ESERCIZIO / MINIMUM EXERCISE QUANTITY**

Quantità minima di esercizio.



*Minimum exercise quantity.*

**80 QUANTITA MASSIMA ESERCIZIO / MAXIMUM EXERCISE QUANTITY**

Quantità massima di esercizio.



*Maximum exercise quantity.*

**81 CONTRACT SIZE / CONTRACT SIZE**

Contract size (moltiplicatore o valore del punto indice).



*Contract size (multiplier or index point value).*

**82 CODICE CONTAB MARGINI INIZIALI / INITIAL MARGIN ACCOUNTING CODE**

Tipologia di contabilizzazione dei MI (margini iniziali).

Valore assunto:

'S' = STOCK STYLE

la liquidazione del premio avviene il primo giorno lavorativo successivo a quello di contrattazione.



*Type of IM (initial margin) accounting.*

*Value accepted:*

*'S' = STOCK STYLE*

*settlement of the premium takes place on the first business day following the trading date.*

**83 CODICE TIPO REGOLAMENTO MARGINI INIZIALI / INITIAL MARGIN SETTLEMENT TYPE CODE**

Tipologia di regolamento dei MI (margini iniziali).

Assume i seguenti valori:

'C' = cash

'T' = titoli.



*Type of IM (initial margin) settlement.*

*It accepts the values:*

*'C' = cash*

*'T' = securities.*

**84 FLAG PANIERI/ BASKETS FLAG**



Indicatore presenza paniere di attività sottostanti.

Valore assunto:

'N' = nessun paniere



*This indicates the presence of a basket of underlying assets.*

*Value accepted:*

*'N' = no basket*

**85 CODICE TIPO FUTURE/ FUTURES TYPE CODE**



Indicatore tipologia contratto future.

Valori assunti:

'F' = future

'M' = mini future



*This indicates the type of futures contract.*

*Values accepted:*

*'F' = futures*

*'M' = mini futures*

**86 GG REGOL CONTRATTO/ CONTRACT SETTLEMENTT DAYS**



Numero giorni regolamento premio (per option)



*Number of days premium settlement (for options)*

# **Tracciato INFODATA FEED DERIVATI: "Rettifiche"**

---

***INFODATA FEED DERIVATIVES  
layout: "Adjustments"***

**Tracciato INFODATA FEED DERIVATI: "Rettifiche"**  
**INFODATA FEED DERIVATIVES layout: "Adjustments"**

NUM.	CAMPO / FIELD	TIPO / TYPE	LUNG. / LENGHT	POS. INIZ. / START POS.	VALORE / FORMATO VALUE / FORMAT
88	DATA/DATE	N	8	1	aaaammgg
89	CODICE ISIN / ISIN CODE	A	12	9	'*** ... ***'
90	COEFF RETTIFICA/ADJUSTMENT FACTOR	N	14	21	iiiiiddddddd
91	CODICE ISIN VECCHIO/ OLD ISIN CODE	A	12	35	'*** ... ***'

**88 Data/ Date**



Identifica la data cui si riferiscono le informazioni riportate.



*This identifies the date to which the information shown refers*

**89 CODICE ISIN / ISIN CODE**



Nuovo Codice ISIN contratto derivato.



*New derivative contract ISIN code.*

**90 COEFF RETTIFICA/ ADJUSTMENT FACTOR**



Coefficiente K (di rettifica).



*K factor (adjustment)*

**91 CODICE ISIN / OLD ISIN CODE**



Codice ISIN contratto derivato rettificato.



*Adjusted derivative contract ISIN code.*

**Tracciato INFODATA FEED  
DERIVATI: "Annulli"**

---

***INFODATA FEED DERIVATIVES  
layout: "Cancellations"***

**Tracciato INFODATA FEED DERIVATI: "Annulli"**  
**INFODATA FEED DERIVATIVES layout: "Cancellations"**

NUM.	CAMPO / FIELD	TIPO / TYPE	LUNG. / LENGHT	POS. INIZ. / START POS.	VALORE / FORMATO VALUE / FORMAT
100	DATA /DATE	N	8	1	aaaammgg
101	CODICE ISIN / ISIN CODE	A	12	9	'**...**'
102	CODICE ANNULLO / CANCELLATION CODE	N	2	21	ii
103	DATA ANNULLO/ CANCELLATION DATE	N	8	23	aaaammgg

**100 Data / Date**



Identifica la data cui si riferiscono le informazioni riportate.



*This identifies the date to which the information shown refers*

**101 CODICE ISIN / ISIN CODE**



Codice ISIN contratto derivato annullato.



*ISIN code of cancelled derivative contract.*

**102 CODICE ANNULLO / CANCELLATION CODE**



Causale annullo:  
 01 scadenza contratto  
 02 esclusione contratto.



*Reason for cancellation:  
 01 contract expiry  
 02 contract delisting*

**103 DATA ANNULLO/ CANCELLATION DATE**



Data annullo CONTRATTO.



*Date of CONTRACT cancellation*

**Tracciato INFODATA FEED  
DERIVATI: "Valori Teorici derivati"**

---

***INFODATA FEED DERIVATIVES  
layout: "Theoretical Values  
Derivatives"***

**Tracciato INFODATA FEED DERIVATI: "Valori Teorici Derivati"**  
**INFODATA FEED DERIVATIVES layout: "Theoretical Values Derivatives"**

NUM.	CAMPO / FIELD	TIPO / TYPE	LUNG. / LENGHT	POS. INIZ. / START POS.	VALORE / FORMATO VALUE / FORMAT
113	DATA / DATE	N	8	1	aaaammgg
114	CODICE ISIN / ISIN CODE	A	12	9	'**...**'
115	SERIE / SERIES	A	32	21	'**...**'
116	MARKPRICE / MARKPRICE	N	17	53	iiiiiiiiiddddd
117	SEGNO DOWNSIDE 05 / DOWNSIDE 05 SIGN	A	1	70	'*'
118	DOWNSIDE 05 / DOWNSIDE 05	N	17	71	iiiiiiiiiddddd
119	SEGNO DOWNSIDE 04 / DOWNSIDE 04 SIGN	A	1	88	'*'
120	DOWNSIDE 04 / DOWNSIDE 04	N	17	89	iiiiiiiiiddddd
121	SEGNO DOWNSIDE 03 / DOWNSIDE 03 SIGN	A	1	106	'*'
122	DOWNSIDE 03 / DOWNSIDE 03	N	17	107	iiiiiiiiiddddd
123	SEGNO DOWNSIDE 02 / DOWNSIDE 02 SIGN	A	1	124	'*'
124	DOWNSIDE 02 / DOWNSIDE 02	N	17	125	iiiiiiiiiddddd
125	SEGNO DOWNSIDE 01 / DOWNSIDE 01 SIGN	A	1	142	'*'
126	DOWNSIDE 01 / DOWNSIDE 01	N	17	143	iiiiiiiiiddddd
127	SEGNO UPSIDE 01 / UPSIDE 01 SIGN	A	1	160	'*'
128	UPSIDE 01 / UPSIDE 01	N	17	161	iiiiiiiiiddddd
129	SEGNO UPSIDE 02 / UPSIDE 02 SIGN	A	1	178	'*'
130	UPSIDE 02 / UPSIDE 02	N	17	179	iiiiiiiiiddddd
131	SEGNO UPSIDE 03 / UPSIDE 03 SIGN	A	1	196	'*'
132	UPSIDE 03 / UPSIDE 03	N	17	197	iiiiiiiiiddddd
133	SEGNO UPSIDE 04 / UPSIDE 04 SIGN	A	1	214	'*'
134	UPSIDE 04 / UPSIDE 04	N	17	215	iiiiiiiiiddddd
135	SEGNO UPSIDE 05 / UPSIDE 05 SIGN	A	1	232	'*'
136	UPSIDE 05 / UPSIDE 05	N	17	233	iiiiiiiiiddddd
137	SEGNO SHORT OPTION ADJUSTMENT / SHORT OPTION ADJUSTMENT SIGN	A	1	250	'*'
138	PERC SHORT OPTION ADJUSTMENT / PERC SHORT OPTION ADJUSTMENT	N	11	251	iiiiiddddd
139	CODICE ALFANUMERICO DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING ALPHANUMERIC CODE	A	6	262	'*****'
140	CODICE SYMBOL CASSA / CC&G SYMBOL CODE	A	6	268	'*****'

141	CODICE MODIFIER / MODIFIER CODE	N	3	274	Iii
-----	------------------------------------	---	---	-----	-----

**113 Data/ Date**

Identifica la data cui si riferiscono le informazioni riportate.



*This identifies the date to which the information shown refers*

**114 CODICE ISIN / ISIN CODE**

Codice ISIN contratto derivato.



*Derivatives contract ISIN code.*

**115 SERIE / SERIES**

Descrizione contratto derivato (nome della serie)



*Derivatives contract description (name of series).*

**116 MARKPRICE/MARKPRICE**

Prezzo della serie



*Price of series.*

**117 SEGNO DOWNSIDE 05 / DOWNSIDE 05 SIGN**

Segno Prezzo downside 5



*Downside price 5 sign.*

**118 DOWNSIDE 05 / DOWNSIDE 05**

Prezzo downside 5




*Downside price 5.*

**119 SEGNO DOWNSIDE 04 / DOWNSIDE 04 SIGN**

Segno Prezzo downside 4

 *Downside price 4 sign.*


**120      DOWNSIDE 04/ DOWNSIDE 04**

 Prezzo downside 4


 *Downside price 4.*

**121      SEGNO DOWNSIDE 03/ DOWNSIDE 03 SIGN**

 Segno Prezzo downside 3

 *Downside price 3 sign.*

**122      DOWNSIDE 03/ DOWNSIDE 03**

 Prezzo downside 3


 *Downside price 3.*

**123      SEGNO DOWNSIDE 02/ DOWNSIDE 02 SIGN**

 Segno Prezzo downside 2

 *Downside price 2 sign.*

**124      DOWNSIDE 02/ DOWNSIDE 02**

 Prezzo downside 2


 *Downside price 2.*

**125      SEGNO DOWNSIDE 01/ DOWNSIDE 01 SIGN**

 Segno Prezzo downside 1

 *Downside price 1 sign.*

**126      DOWNSIDE 01/ DOWNSIDE 01**

 Prezzo downside 1

 *Downside price 1.*

**127      SEGNO UPSIDE 01/ UPSIDE 01 SIGN**

Segno Prezzo upside 1

*Upside price 1 sign.***128      UPSIDE 01/ UPSIDE 01**

Prezzo upside 1

*Upside price 1.***129      SEGNO UPSIDE 02/ UPSIDE 02 SIGN**

Segno Prezzo upside 2

*Upside price 2 sign.***130      UPSIDE 02/ UPSIDE 02**

Prezzo upside 2

*Upside price 2.***131      SEGNO UPSIDE 03/ UPSIDE 03 SIGN**

Segno Prezzo upside 3

*Upside price 3 sign.***132      UPSIDE 03/ UPSIDE 03**

Prezzo upside 3

*Upside price 3.***133      SEGNO UPSIDE 04/ UPSIDE 04 SIGN**

Segno Prezzo upside 4

*Upside price 4 sign.***134      UPSIDE 04/ UPSIDE 04**

 Prezzo upside 4

 *Upside price 4.*

**135      SEGNO UPSIDE 05 / UPSIDE 05 SIGN**

 Segno Prezzo upside 6

 *Upside price 5 sign.*

**136      UPSIDE 05 / UPSIDE 05**

 Prezzo upside 5

 *Upside price 5.*

**137      SEGNO SHORT OPTION ADJUSTMENT / SHORT OPTION ADJUSTMENT SIGN**

 Segno Short Option Adjustment

 *Short Option Adjustment Sign*

**138      PERC SHORT OPTION ADJUSTMENT / PERC SHORT OPTION ADJUSTMENT**

 Short Option Adjustment (scostamento minimo)

 *Short Option Adjustment (minimum variance)*

**139      CODICE ALFANUMERICO DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING ALPHANUMERIC CODE**

 Codice alfanumerico del sottostante.

 Alphanumeric code of the underlying.

**140      CODICE SYMBOL CASSA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING CC&G SYMBOL CODE**

 Codice simbolo di Cassa Compensazione e Garanzia

 *Cassa Compensazione e Garanzia symbol code*

**141 CODICE MODIFIER / MODIFIER CODE**



Numero versione della serie (esprime il numero delle rettifiche subite dal contratto originale)



*Series version number (expresses the number of adjustments applied to the original contract).*

**Tracciato INFODATA FEED  
DERIVATI: "Valori Teorici  
Sottostanti"**

---

***INFODATA FEED DERIVATIVES  
layout: "Theoretical Values  
Underlyings"***

**Tracciato INFODATA FEED DERIVATI: "Valori Teorici Sottostanti"**  
**INFODATA FEED DERIVATIVES layout: "Theoretical Values Underlyings"**

NUM.	CAMPO / FIELD	TIPO / TYPE	LUNG. / LENGHT	POS. INIZ. / START POS.	VALORE / FORMATO VALUE / FORMAT
151	DATA / DATE	N	8	1	aaaammgg
152	CODICE ISIN / ISIN CODE	A	12	9	'**...**'
153	SERIE / SERIES	A	32	21	'**...**'
154	MARKPRICE / MARKPRICE	N	17	53	iiiiiiiiiddddd
155	SEGNO DOWNSIDE 05 / DOWNSIDE 05 SIGN	A	1	70	'*'
156	DOWNSIDE 05 / DOWNSIDE 05	N	17	71	iiiiiiiiiddddd
157	SEGNO DOWNSIDE 04 / DOWNSIDE 04 SIGN	A	1	88	'*'
158	DOWNSIDE 04 / DOWNSIDE 04	N	17	89	iiiiiiiiiddddd
159	SEGNO DOWNSIDE 03 / DOWNSIDE 03 SIGN	A	1	106	'*'
160	DOWNSIDE 03 / DOWNSIDE 03	N	17	107	iiiiiiiiiddddd
161	SEGNO DOWNSIDE 02 / DOWNSIDE 02 SIGN	A	1	124	'*'
162	DOWNSIDE 02 / DOWNSIDE 02	N	17	125	iiiiiiiiiddddd
163	SEGNO DOWNSIDE 01 / DOWNSIDE 01 SIGN	A	1	142	'*'
164	DOWNSIDE 01 / DOWNSIDE 01	N	17	143	iiiiiiiiiddddd
165	SEGNO UPSIDE 01 / UPSIDE 01 SIGN	A	1	160	'*'
166	UPSIDE 01 / UPSIDE 01	N	17	161	iiiiiiiiiddddd
167	SEGNO UPSIDE 02 / UPSIDE 02 SIGN	A	1	178	'*'
168	UPSIDE 02 / UPSIDE 02	N	17	179	iiiiiiiiiddddd
169	SEGNO UPSIDE 03 / UPSIDE 03 SIGN	A	1	196	'*'
170	UPSIDE 03 / UPSIDE 03	N	17	197	iiiiiiiiiddddd
171	SEGNO UPSIDE 04 / UPSIDE 04 SIGN	A	1	214	'*'
172	UPSIDE 04 / UPSIDE 04	N	17	215	iiiiiiiiiddddd
173	SEGNO UPSIDE 05 / UPSIDE 05 SIGN	A	1	232	'*'
174	UPSIDE 05 / UPSIDE 05	N	17	233	iiiiiiiiiddddd
175	SEGNO SHORT OPTION ADJUSTMENT / SHORT OPTION ADJUSTMENT SIGN	A	1	250	'*'
176	PERC SHORT OPTION ADJUSTMENT / PERC SHORT OPTION ADJUSTMENT	N	9	251	iiiddddd
177	CODICE ALFANUMERIC DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING ALPHANUMERIC CODE	A	6	260	'*****'
178	CODICE SYMBOL CASSA	A	6	268	'*****'
179	CODICE MODIFIER	N	3	274	Iii

**151 Data/ Date**

Identifica la data cui si riferiscono le informazioni riportate.



This identifies the date to which the information shown refers

**152 CODICE ISIN / ISIN CODE**



Codice Isin underlying



*Underlying's ISIN code*

**153 SERIE / SERIES**



Descrizione underlying



*Description of the underlying*

**154 MARKPRICE / MARKPRICE**



Prezzo della serie



*Price of series*

**155 SEGNO DOWNSIDE 05 / DOWNSIDE 05 SIGN**



Segno Prezzo downside 5



*Downside price 5 sign*

**156 DOWNSIDE 05 / DOWNSIDE 05**



Prezzo downside 5



*Downside price 5*

**157 SEGNO DOWNSIDE 04 / DOWNSIDE 04 SIGN**



Segno Prezzo downside 4



*Downside price 4 sign*

**158 DOWNSIDE 04 / DOWNSIDE 04**



Prezzo downside 4



*Downside price 4*

**159      SEGNO DOWNSIDE 03/ DOWNSIDE 03 SIGN**



Segno Prezzo downside 3



*Downside price 3 sign*

**160      DOWNSIDE 03/ DOWNSIDE 03**



Prezzo downside 3



*Downside price 3*

**161      SEGNO DOWNSIDE 02/ DOWNSIDE 02 SIGN**



Segno Prezzo downside 2



*Downside price 2 sign*

**162      DOWNSIDE 02/ DOWNSIDE 02**



Prezzo downside 2



*Downside price 2*

**163      SEGNO DOWNSIDE 01/ DOWNSIDE 01 SIGN**



Segno Prezzo downside 1



*Downside price 1 sign*

**164      DOWNSIDE 01/ DOWNSIDE 01**



Prezzo downside 1



*Downside price 1*

**165      SEGNO UPSIDE 01/ UPSIDE 01 SIGN**



Segno upside 1



*Upside price 1 sign*

**166      UPSIDE 01/ UPSIDE 01**



Prezzo upside 1



*Upside price 1*

**167      SEGNO UPSIDE 02/ UPSIDE 02 SIGN**



Segno upside 2



*Upside price 2 sign*

**168      UPSIDE 02/ UPSIDE 02**



Prezzo upside 2



*Upside price 2*

**169      SEGNO UPSIDE 03/ UPSIDE 03 SIGN**



Segno Prezzo upside 3



*Upside price 3 sign*

**170      UPSIDE 03/ UPSIDE 03**



Prezzo upside 3



*Upside price 3*

**171      SEGNO UPSIDE 04/ UPSIDE 04 SIGN**



Segno Prezzo upside 4



*Upside price 4 sign*

**172 UPSIDE 04/ UPSIDE 04**



Prezzo upside 4



*Upside price 4*

**173 SEGNO UPSIDE 05/ UPSIDE 05 SIGN**



Segno Prezzo upside 5



*Upside price 5 sign*

**174 UPSIDE 05/ UPSIDE 05**



Prezzo upside 5



*Upside price 5*

**175 SEGNO SHORT OPTION ADJUSTMENT/ SHORT OPTION ADJUSTMENT SIGN**



Segno Short Option Adjustment



*Short Option Adjustment Sign*

**176 PERC SHORT OPTION ADJUSTMENT/ PERC SHORT OPTION ADJUSTMENT**



Short Option Adjustment (scostamento minimo)



*Short Option Adjustment (minimum variance)*

**177 CODICE ALFANUMERICO DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING ALPHANUMERIC CODE**



Codice alfanumerico del sottostante.




*Alphanumeric code of the underlying*

**178 CODICE SYMBOL CASSA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING CC&G SYMBOL CODE**

 Codice simbolo di Cassa Compensazione e Garanzia

 *Cassa Compensazione e Garanzia symbol code*

**179 CODICE MODIFIER / MODIFIER CODE**

 Numero versione della serie (esprime il numero delle rettifiche subite dal contratto originale)

 *Series version number (expresses the number of adjustments applied to the original contract).*

**Tracciato INFODATA FEED  
DERIVATI: "Margini"**

---

***INFODATA FEED DERIVATIVES  
Layout: "Margins"***

**Tracciato INFODATA FEED DERIVATI: "Margini  
INFODATA FEED DERIVATIVES layout: "Margins"**

NUM.	CAMPO / FIELD	TIPO / TYPE	LUNG. / LENGHT	POS. INIZ. / START POS.	VALORE / FORMATO VALUE / FORMAT
191	DATA / DATE	N	8	1	aaaammgg
192	CODICE SYMBOL CASSA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING CC&G SYMBOL CODE	A	6	9	'*****'
193	TIPO PRODOTTO / PRODUCT TYPE	A	3	15	'***'
194	CODICE PRODOTTO CASSA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING CC&G PRODUCT CODE	A	3	18	'***'
195	CODICE CLASSE CASSA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING CC&G CLASS CODE	A	5	21	'*****'
196	MARGINI FUTURE STRADDLE SPOT / SPOT FUTURES STRADDLE MARGINS	N	18	26	iiiiiiiidddddddd
197	MARGINI FUTURE STRADDLE NONSPOT / NON-SPOT FUTURES STRADDLE MARGINS	N	18	44	Iiiiiiiiidddddddd
198	MARGINE MIN UNITARIO OPZ / OPTIONS MIN UNITARY MARGIN	N	18	62	Iiiiiiiiidddddddd
199	MARGINE MIN UNITARIO FUT / FUT MIN UNITARY MARGIN	N	18	80	Iiiiiiiiidddddddd
200	PERC FATTORE COMPENSAZIONE / PERC COMPENSATION FACTOR	N	9	98	iiiddddd
201	CONTAB MARGINI INIZIALI / INITIAL MARGIN ACCTNG	A	1	107	'*'
202	TIPO REGOLAMENTO / SETTLEMENT TYPE	A	1	108	'*'
203	CODICE ISIN / ISIN CODE	A	12	109	'***...***'
204	CODICE MODIFIER / MODIFIER CODE	N	3	121	Iii

**191 Data/ Date**



Identifica la data cui si riferiscono le informazioni riportate.



*This identifies the date to which the information shown refers*

**192 CODICE SYMBOL CASSA DEL SOTTOSTANTE/ UNDERLYING CC&G SYMBOL CODE**



Codice simbolo di Cassa Compensazione e Garanzia



*Cassa Compensazione e Garanzia symbol code*

**193 TIPO PRODOTTO/ PRODUCT TYPE**



Tipologia del prodotto

Valori possibili:  
'O' Option  
'F' Futures



*Type of product*  
*Possible values:*  
'O' Option  
'F' Futures

**194 CODICE PRODOTTO CASSA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING CC&G PRODUCT CODE**



Codice prodotto di Cassa Compensazione e Garanzia



*Cassa Compensazione e Garanzia product code*

**195 CODICE CLASSE CASSA DEL SOTTOSTANTE / UNDERLYING CC&G CLASS CODE**



Codice classe di Cassa Compensazione e Garanzia



*Cassa Compensazione e Garanzia class code*

**196 MARGINI FUTURE STRADDLE SPOT / SPOT FUTURES STRADDLE MARGINS**



Margini Futures Straddle.  
Spot spread rate



*Futures Straddle Margins.*  
*Spot rate spread*

**197 MARGINI FUTURE STRADDLE NON-SPOT / NON-SPOT FUTURES STRADDLE MARGINS**



Margini Futures Straddle.  
Non Spot spread rate



*Futures Straddle Margins.*  
*Non-spot rate spread*

**198 MARGINE MINIMO UNITARIO OPZ / OPTIONS MIN UNITARY MARGIN**



Margine Minimo Unitario per Opzioni



*Minimum unitary margin for options*

## 199 MARGINE MINIMO UNITARIO FUT / FUT MIN UNITARY MARGIN



Margine Minimo Unitario per Future



*Minimum unitary margin for futures*

## 200 PERC FATTORE COMPENSAZIONE / PERC COMPENSATION FACTOR



Fattore di compensazione (OFFSET).

Da applicare per calcolo della marginazione su gruppi di prodotti correlati



*Compensation factor (OFFSET)*

*To be applied for margining calculation on related product groups*

## 201 CONTAB MARGINI INIZIALI / INITIAL MARGIN ACCTNG



Tipologia di contabilizzazione dei MI (margini Iniziali).

Tipologia di calcolo dei MI (margini iniziali):

S = STOCK STYLE

la liquidazione del premio avviene il primo giorno lavorativo successivo a quello di contrattazione

F = FUTURE STYLE

pagamento del premio alla scadenza o alla data di esercizio

(opzioni su futures)



*Type of IM (initial margin) accounting.*

*Type of IM (initial margin) calculation:*

*S = STOCK STYLE*

*settlement of the premium takes place on the first business day following the trading date*

*F = FUTURE STYLE*

*payment of premium on expiry or exercise date*

*(options on futures)*

## 202 TIPO REGOLAMENTO / SETTLEMENT TYPE



Tipologia di regolamento dei MI (margini iniziali).

C = cash

T = titoli

E = entrambe.



*Type of IM (initial margin) settlement.*

*C = cash*

*T = securities*

*E = both.*

**203 CODICE ISIN / *ISIN CODE***



Codice ISIN Underlying.



*Underlying's ISIN code.*

**204 CODICE MODIFIER / *MODIFIER CODE***



Numero serie.



*Series number.*

**Tracciato INFODATA FEED  
DERIVATI: "Prezzi di apertura  
Sottostanti"**

---

***INFODATA FEED DERIVATIVES  
layout: "Opening Prices Underlyings"***

**Tracciato INFODATA FEED DERIVATI: "Prezzi di apertura Sottostanti"**  
**INFODATA FEED DERIVATIVES layout: "Opening Prices Underlyings"**

NUM.	CAMPO / FIELD	TIPO / TYPE	LUNG. / LENGHT	POS. INIZ. / START POS.	VALORE / FORMATO VALUE / FORMAT
210	DATA / DATE	N	8	1	aaaammgg
211	CODICE ISIN / ISIN CODE	A	12	9	'**...**'
212	CATEGORIA/ CATEGORY	N	3	21	Iii
213	SOTTOCATEGORIA/ SUB-CATEGORY	N	3	24	Iii
214	CODICE ALFANUMERICO/ ALFA CODE	A	6	27	'*****'
215	PREZZO PRIMA APERTURA/ FIRST OPENING PRICE	N	15	33	Iiiiiiiiiidddd
216	ORA APERTURA/ TIME OF OPENING	A	8	48	Hhmisscc
217	SIGLA FASE/ PHASE CODE	A	3	56	'***'
218	INDICATORE PREZZO IDONEO/ APPROPRIATE PRICE FLAG	A	1	59	'*'
219	QUANTITA' APERTURA/ OPENING QUANTITY	N	17	60	iiiiiiiiiiiiidd
220	SEGNO IMBALANCE / IMBALANCE SIGN	A	1	77	'*'
221	IMBALANCE/ IMBALANCE	N	17	78	iiiiiiiiiiiiidd
222	NUMERO CONTRATTI/ NUMBER OR TRADES	N	7	95	Iiiiiii
223	NUMERO APERTURE/ NUMBER OF OPENINGS	N	7	102	Iiiiiii

**210 Data/ Date**



Identifica la data cui si riferiscono le informazioni riportate.



*This identifies the date to which the information shown refers*

**211 CODICE ISIN / ISIN CODE**



Codice ISIN Underlying.



*Underlying's ISIN code.*

**212 Categoria/ Category**



Identificativo della categoria

Assume i valori:

'001' AZIONI  
 '002' OBBLIGAZIONI CONVERTIBILI  
 '003' DIRITTI

'004' FONDI  
'005' WARRANT.



*Category ID.*

*It accepts the values:*

'001' SHARES  
'002' CONVERTIBLE BONDS  
'003' RIGHTS  
'004' FUNDS  
'005' WARRANTS

## 213 Sottocategoria/ *Sub-category*



Identificativo della sotto categoria

Assume i valori:

'001' ORDINARIA  
'002' PRIVILEGIATA  
'003' RISPARMIO  
'004' RISPARMIO CONVERTIBILE  
'005' OBBLIGAZIONI CONVERTIBILI  
'006' DIRITTI  
'007' FONDI CHIUSI MOBILIARI  
'008' WARRANT  
'019' ORDINARIA (OPA)  
'020' PRIVILEGIATA (OPA)  
'021' RISPARMIO (OPA)  
'022' RISPARMIO CONVERTIBILE (OPA)  
'023' WARRANT (OPA)  
'026' ETF  
'027' SICAV  
'028' FONDI INDICIZZATI.



*Sub-category ID.*

*It accepts the values:*

'001' ORDINARY  
'002' PRIVILEGED  
'003' SAVINGS  
'004' CONVERTIBLE SAVINGS  
'005' CONVERTIBLE BONDS  
'006' RIGHTS  
'007' CLOSED-END INVESTMENT FUNDS  
'008' WARRANTS  
'019' ORDINARY (PTB)  
'020' PRIVILEGED (PTB)  
'021' SAVINGS (PTB)  
'022' CONVERTIBLE SAVINGS (PTB)  
'023' WARRANTS (PTB)  
'026' ETF  
'027' SICAV  
'028' INDEXED FUNDS

**214 Codice Alfanumerico Strumento Finanziario / *Financial Instrument Alphanumeric Code***

Identifica, attraverso il codice alfanumerico, lo strumento finanziario cui si riferisce il record.



*This identifies the financial instrument to which the record refers, by way of the alphanumeric code.*

**215 Prezzo Prima apertura/ *First Opening price***

Primo prezzo di apertura determinato durante la seduta.



*First opening price calculated during the session*

**216 Ora Apertura/ *Time of opening***

Ora in cui è avvenuta l'apertura



*Time of opening*

**217 Sigla fase/ *Phase Code***

Sigla fase di mercato



*Market phase code*

**218 Indicatore Prezzo Idoneo / *Appropriate price flag***

Indica se il prezzo è idoneo o meno.

Assume i valori:

'S'

'N'



*This indicates whether or not the price ....*

*It accepts the values:*

'S'

'N'

**219 Quantità apertura/ *Opening volume***


Indica il quantitativo di titoli negoziati durante la prima fase di apertura.



*This indicates the quantity of securities traded during the pre-opening phase*

**220 Segno Imbalance/ *Imbalance Sign***

 Individua il segno della Imbalance


 *This identifies the sign of Imbalance*


**221 Imbalance / *Imbalance***

 Individua l'Imbalance


 *This identifies Imbalance*


**222 Numero contratti/ *Number of contracts***

 Indica il numero totale di contratti stipulati nella seduta.

 *This indicates the total number of contracts concluded during the session*

**223 Numero aperture/ *Number of Openings***

 Indica il numero di aperture nella seduta.

 *This indicates the total number of openings.*