

**INFODATA FEED: DATI
FINANZIARI OBBLIGAZIONI**

***INFODATA FEED: BOND
FINANCIAL DATA***

Borsa Italiana S.p.A.

Sommario



TRACCIATI INFODATA FEED: NOTE TECNICHE	3
TRACCIATO INFODATA FEED DATI FINANZIARI OBBLIGAZIONI "RECORD DI INIZIO E DI FINE"	6
TRACCIATO INFODATA FEED DATI FINANZIARI OBBLIGAZIONI "RENDIMENTI"	9

Table of Contents



<i>INFODATA FEED: TECHNICAL NOTES</i>	3
<i>INFODATA FEED BONDS FINANCIAL DATA "START AND END RECORD" LAYOUT</i>	6
<i>INFODATA FEED BONDS FINANCIAL DATA "YIELDS" LAYOUT</i>	9

Tracciati INFODATA FEED: NOTE TECNICHE

INFODATA FEED: TECHNICAL NOTES



1. Contenuto del flusso DATI FINANZIARI OBBLIGAZIONI:
 - il flusso contiene una riga per ogni strumento (univocamente individuato dal "CODICE ISIN").
2. Il flusso viene estratto una volta al giorno (orario indicativo: 21.00) e contiene dati finanziari relativi agli strumenti quotati sui mercati MOT ed Euromot di Borsa Italiana.
3. Associazione tracciato – nome file.

Tracciato	Nome files giornalieri
OBBLIGAZIONI "RENDIMENTI"	XFINOBB_REND

4. Note sul formato dei files:
 - ogni file è in formato ASCII
 - i campi hanno lunghezza fissa
 - tutti i campi data sono in formato "aaaammgg".
5. E' 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. Content of flow relating to the BOND FINANCIAL DATA:
 - the flow contains a line for each instrument (univocally identified by the "ISIN CODE").
2. The flow is transmitted once per day (indicative time: 9.00 p.m.). It contains financial data relating to bonds negotiated on Borsa Italiana MOT and EUROMOT markets.
3. Layout – file name association.

Layout	Daily file name
BONDS "YIELDS"	XFINOBB_REND

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

***Storia delle versioni del documento***

Data	Descrizione
11/02/2005	Versione iniziale del documento.

***History of document versions***

Date	Description
11/02/2005	Initial version of the document.

**Tracciato INFODATA FEED DATI
FINANZIARI OBBLIGAZIONI
"RECORD DI INIZIO E DI FINE"**

***INFODATA FEED BONDS FINANCIAL
DATA "START AND END RECORD"
Layout***

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

FIELD	TYPE	LENG.	START POS.	VALUE/FORMAT
CAMPO	TIPO	LUNG.	POS. INIZ.	VALORE/FORMATO
TIPO RECORD / <i>RECORD TYPE</i>	N	2	1	ii
TIPO FILE / <i>FILE TYPE</i>	A	3	3	'UP0' 'UP1' 'UP2' ... 'UPn'
DATA MODIFICA DA / <i>DATE MODIFICATION EFFECTIVE</i>	N	8	6	aaaammgg
ORA MODIFICA DA / <i>TIME MODIFICATION EFFECTIVE</i>	N	6	14	hhmiss
DATA ELABORAZIONE FILE / <i>DATE OF FILE PROCESSING</i>	N	8	20	aaaammgg
ORA ELABORAZIONE FILE / <i>TIME OF FILE PROCESSING</i>	N	6	28	hhmiss
CONTATORE RECORD / <i>RECORD COUNTER</i>	N	10	34	iiiiiiii

Tipo Record / Record Type



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



It accepts the values:
'00' start records
'99' end records.

Tipo File / File Type



Assume i valori:
'UP0' flusso storico
'UP1' flusso giornaliero, primo invio della giornata
'UP2' flusso giornaliero, secondo invio della giornata
...
'UPn' flusso giornaliero, ennesimo invio della giornata



It accepts the values:
 'UP0' historical flow
 'UP1' daily flow, day's first transmission
 'UP2' daily flow, day's second transmission
 ...
 'UPn' daily flow, day's nth transmission

Data Modifica Da/ Date Modification Effective

Ora Modifica Da / Time Modification Effective



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



The data contained in the file are those which have been modified with effect from the date-time indicated.

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 anagraphical 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.

**Tracciato INFODATA FEED DATI
FINANZIARI OBBLIGAZIONI
“RENDIMENTI”**

**INFODATA FEED *BONDS FINANCIAL*
DATA “YIELDS” Layout**

**Tracciato INFODATA DATI FINANZIARI OBBLIGAZIONI "RENDIMENTI"
INFODATA FEED BOND FINANCIAL DATA "YIELDS" Layout**

NUM.	CAMPO/ FIELD	TIPO/ TYPE	LUNG./ LENGTH	POS. INIZ.	VALORE/FORMATO
1	TIPO RECORD/RECORD TYPE	N	2	1	'95'
2	CODICE BORSA STRUMENTO FINANZIARIO /FINANCIAL INSTRUMENT EXCHANGE CODE	N	6	3	iiii
3	CODICE ISIN/ISIN CODE	A	12	9	'***...***'
4	ULTIMO PREZZO/ LAST PRICE	N	8	21	iiiiddd
5	IMPORTO DEL RATEO LORDO/GROSS ACCRUAL	N	8	29	iiiiddd
6	PREZZO TEL QUEL/PRICE CUM DIVIDEND	N	8	37	iiiiddd
7	IMPOSTA SOSTITUTIVA/TAX	N	8	45	iiiiddd
8	RENDIMENTO EFF. LORDO 365/ GROSS YIELD 365	N	8	53	iiiiddd
9	RENDIMENTO EFF. NETTO 365/ NET YIELD 365	N	8	61	iiiiddd
10	RENDIMENTO EFF. LORDO 360/ GROSS YIELD 360	N	8	69	iiiiddd
11	RENDIMENTO EFF. NETTO 360/ NET YIELD 360	N	8	77	iiiiddd
12	DURATION/ DURATION	N	8	85	iiiiddd
13	VOLATILITA'/ VOLATILITY	N	8	93	iiiiddd
14	DATA ULTIMO PREZZO/ DATE OF LAST PRICE	D	8	101	aaaammgg
15	DATA FLUSSO/ DATE OF FEED	D	8	109	aaaammgg

1 TIPO RECORD/ RECORD TYPE



Indica per ciascun record il feed di provenienza al fine di consentire al cliente fruitore di diversi XID PLUS di distinguere i record di provenienza del file XFINOBB_REND rispetto ad altri.



This indicates the source feed for each record in order to enable customers using more than one XID PLUS to distinguish the records originating from the XFINOBB_REND file with respect to others.

Assume i valori - *It accepts the values:*

'95' Record Obbligazioni Rendimenti.

2 CODICE BORSA STRUMENTO FINANZIARIO / FINANCIAL INSTRUMENT EXCHANGE CODE



Identifica, attraverso il codice numerico assegnato da Borsa Italiana, lo strumento finanziario cui si riferisce il record. Le tavole del feed REDDITO FISSO "STRUMENTI FINANZIARI" possono essere messe in relazione anche tramite tale codice.



This indicates the univocal internal code assigned by Borsa Italiana to each instrument. The other tables of the feed FIXED INCOME "FINANCIAL INSTRUMENTS" can be linked also by way of such code.

3 CODICE ISIN/ISIN CODE



Identifica, attraverso il codice isin, lo strumento finanziario.



Isin code of the financial instrument.

4 ULTIMO PREZZO/ LAST PRICE



Identifica il prezzo ufficiale dell'ultima chiusura disponibile.



Last official price.

5 IMPORTO DEL RATEO LORDO/ GROSS ACCRUAL



Identifica l'importo del rateo lordo su base 100. Impostato a 00000000 per i titoli quotati tel quel.



This indicates the gross accrual on 100 basis. For securities traded CUM DIVIDEND shows value 00000000.

6 PREZZO TEL QUEL/ PRICE CUM DIVIDEND



Identifica la somma del prezzo ultimo e del rateo lordo.



Sum of the last price plus gross accrual.

7 IMPOSTA SOSTITUTIVA/TAX



Identifica la somma del disaggio di emissione e dell'imposta sul rateo.



Sum between disagio on issue and tax on accrual.

8 RENDIMENTO EFF. LORDO 365/ GROSS YIELD 365



Identifica il rendimento effettivo lordo calcolato su 365 giorni.
E' indicato come valore percentuale (ad es. 00037100 indica un rendimento pari al 3.71%).



This indicates the gross yield computed on a 365 days basis. It is expressed as a percentage.

9 RENDIMENTO EFF. NETTO 365/ NET YIELD 365



Identifica il rendimento effettivo netto calcolato su 365 giorni.
E' indicato come valore percentuale (ad es. 00037100 indica un rendimento pari al 3.71%).



This indicates the net yield computed on a 365 days basis. It is expressed as a percentage.

10 RENDIMENTO EFF. LORDO 360/ GROSS YIELD 360



Identifica il rendimento effettivo lordo calcolato su 360 giorni.

E' indicato come valore percentuale (ad es. 00037100 indica un rendimento pari al 3.71%).



This indicates the gross yield computed on a 360 days basis. It is expressed as a percentage.

11 RENDIMENTO EFF. NETTO 360/ NET YIELD 360



Identifica il rendimento effettivo netto calcolato su 360 giorni.

E' indicato come valore percentuale (ad es. 00037100 indica un rendimento pari al 3.71%).



This indicates the net yield computed on a 360 days basis. It is expressed as a percentage.

12 DURATION/ DURATION



E' calcolata in base al prezzo tel quel lordo.



Computed using gross CUM DIVIDENDO price.

13 VOLATILITA'/ VOLATILITY



Indica la percentuale di variazione del prezzo del titolo a fronte della variazione di un punto del rendimento effettivo netto.



This indicates the fluctuation of the security price compared with fluctuation of net yield. Is is expressed in percentage terms.

14 DATA ULTIMO PREZZO/ DATE OF LAST PRICE



Data in cui è stata effettuata l'ultima rilevazione del prezzo ufficiale.



This indicates the date of the last official price.

15 DATA FLUSSO/ DATE OF FEED



Data del flusso (uguale per tutti i record).



This indicates the date of the feed (it has the same value on every record).