



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: "STRUMENTI FINANZIARI"	10

Table of Contents



<i>INFODATA FEED LAYOUTS: TECHNICAL NOTES.....</i>	<i>3</i>
<i>INFODATA FEED DERIVATIVES LAYOUT: "START AND END RECORD"</i>	<i>7</i>
<i>INFODATA FEED DERIVATIVES LAYOUT: "FINANCIAL INSTRUMENTS".....</i>	<i>10</i>

Tracciati INFODATA FEED: NOTE TECNICHE

INFODATA FEED Layouts: TECHNICAL NOTES



1. Contenuto dei flussi relativi all'anagrafica DERIVATI:
 - il flusso principale è quello denominato "Strumenti Finanziari" il quale contiene una riga per ogni strumento (univocamente individuato dal campo "CODICE BORSA STRUMENTO FINANZIARIO").
2. Per ogni tracciato sono disponibili due tipologie di files.
 - I files "storici" contenenti tutti i dati relativi agli strumenti finanziari presenti nel database anagrafico del gruppo Borsa Italiana. I files storici vengono forniti un tantum a inizio fornitura del servizio INFODATA FEED e contengono tutti gli strumenti "attivi" (negoziati sui mercati di Borsa Italiana e/o accentrati) alla data di inizio fornitura più tutti gli strumenti revocati o disaccentrati dal 01/01/2004 compreso in poi.
 - I files giornalieri contenenti le variazioni (inserimenti/modifiche) rispetto al precedente invio dei dati. Nel corso della giornata sono normalmente schedulati 4 invii (orari indicativi: 09.30, 12.00, 18.30, 21.00).
3. Quando uno strumento finanziario subisce un qualunque tipo di variazione, nei tracciati giornalieri vengono inseriti i dati completi relativi allo strumento (ad. es. se viene inserita una nuova cedola viene reinviato tutto il piano cedole).
4. Associazione tracciato – nome file

Tracciato	Nome files giornalieri	Nome files storici
DERIVATI "STRUMENTI FINANZIARI"	XANADER_PLUS	XANADER_PLUS0

5. Note sul formato dei files:
 - ogni file è in formato ASCII
 - i campi hanno lunghezza fissa
 - il separatore decimale è il punto
 - tutti i campi data sono in formato "aaaammgg".
6. 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 flows relating to the DERIVATIVES register:*
 - *the main flow is the so-called "Financial Instruments" flow, which contains a line for each instrument (univocally identified by the "ISIN code").*
2. *For each layout two types of file are available.*
 - *"Historical" files containing all information on the financial instruments present in the Borsa Italiana group anagraphical database. The historical files are provided once only at the beginning of the INFODATA FEED service supply and include all "active"*

instruments (traded on Borsa Italiana markets and/or centralised) as at the supply start date plus all instruments delisted or decentralised on or after XX/XX/2004.

- *Daily files setting out the changes (additions/modifications) with respect to the previous transmission of data. During the course of the day 4 transmissions are normally scheduled (indicative times: 9.30 a.m., 12.00 a.m., 6.30 p.m., 9.00 p.m.).*
3. *When a financial instrument undergoes any form of change, complete data for the instrument are entered to the daily layouts (for example, if a new coupon is added the entire coupon schedule is re-sent).*
 4. *Layout – file name association.*

Layout	Daily file name	Historical file name
<i>DERIVATIVES "FINANCIAL INSTRUMENTS"</i>	<i>XANA_PLUS_DRV</i>	<i>XANA_PLUS_DRV_1</i>

5. *Notes on the format of files:*
 - *each file is in ASCII format*
 - *fields have a set length*
 - *the decimal separator is a point*
 - *all date fields are in "yyyymmdd" format.*
6. *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
06/08/2004	Versione iniziale del documento.
29/10/2004	Tracciato "STRUMENTI FINANZIARI": aggiunto il campo DATA VERSIONE

**History of document versions**

Date	Description
08/06/2004	Initial version of the document.
29/10/2004	"FINANCIAL INSTRUMENTS" layout: VERSION DATE field added

**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 "START AND END RECORD" layout**

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' record 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*

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



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

Ora Modifica Da/ *Time Modification Effective*

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



The data contained in the file are those which have been modified with effect from the 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 DERIVATI:
"STRUMENTI FINANZIARI"**

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

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

NUM.	CAMPO	TIPO	LUNG.	POS. INIZ.	VALORE
1	TIPO RECORD/ <i>RECORD TYPE</i>	A	2	1	'06'
2	CODICE BORSA STRUMENTO FINANZIARIO/ <i>FINANCIAL INSTRUMENT EXCHANGE CODE</i>	N	9	3	iiiiiii
3	CODICE ISIN STRUMENTO FINANZIARIO/ <i>FINANCIAL INSTRUMENT ISIN CODE</i>	A	12	12	'***...***'
4	SERIE/ <i>SERIES</i>	A	32	24	'*****'
5	CODICE ISIN SOTTOSTANTE/ <i>UNDERLYING ISIN CODE</i>	A	12	56	'***...***'
6	SOTTOSTANTE/ <i>UNDERLYING</i>	A	70	68	'***...***'
7	CODICE ALFANUMERICO SOTTOSTANTE/ <i>UNDERLYING ALPHANUMERIC CODE</i>	A	6	138	'*****'
8	DATA SCADENZA/ <i>MATURITY DATE</i>	A	8	144	aaaammgg
9	CONTRACT SIZE/ <i>CONTRACT SIZE</i>	N	13	151	iiiiiiiidddd
10	PREZZO ESERCIZIO/ <i>STRIKE PRICE</i>	N	13	165	iiiiiiiidddd
11	TIPO SOTTOSTANTE/ <i>TYPE OF UNDERLYING</i>	N	3	178	iii
12	INSTRUMENT GROUP/ <i>INSTRUMENT GROUP</i>	N	3	181	iii
13	STATUS/ <i>STATUS</i>	N	3	184	iii
14	DATA MODIFICA/ <i>DATE OF MODIFICATION</i>	A	8	187	aaaammgg
15	ORA MODIFICA/ <i>TIME OF MODIFICATION</i>	A	6	195	'***...***'
16	DATA VERSIONE/ <i>VERSION DATE</i>	D	8	201	aaaammgg

Tipo record/ Record type



Identifica la tipologia del messaggio inviato.

Assume il valore:

'06' Record DERIVATI.




This identifies the type of message transmitted.

It accepts the value:


'06' DERIVATIVES record.


2 Codice Borsa strumento finanziario / Financial instrument exchange code

 Codice Borsa dello strumento cui si riferisce il record.

 *This identifies the financial instrument to which the record refers, by way of the numeric code assigned by SIA (the Interbank Company for Automation).*

3 Codice ISIN strumento finanziario/ Financial instrument ISIN code

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


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

4 Serie/ Series

 Nome della serie.

 *Name of series.*

5 Codice ISIN Sottostante/ Underlying ISIN code

 Codice Isin sottostante.

 *ISIN code of the underlying.*

6 Sottostante/ Underlying

 Sottostante.

 *Underlying.*

7 Codice Alfanumerico Sottostante/ Underlying Alphanumeric Code

 Codice alfanumerico sottostante.


 *Alphanumeric code of the underlying*

8 Data scadenza/ Maturity date

 Data scadenza.

 *Maturity Date.*

9 Contract size/ Contract size

 Rappresenta il valore del punto indice nel caso di serie Future e Index Option; nel caso di Stock option contiene il numero di titoli che compongono il contratto standard.



This represents the index point value in the case of Futures and Index Option series; in the case of Stock options it contains the number of securities comprising a standard contract.

10 Prezzo esercizio/ *Strike price*



Prezzo di esercizio nel caso di opzioni.



Exercise price in the case of options.

11 Tipo sottostante/ *Type of underlying*



Identificativo del tipo di sottostante.

Assume i valori:

'002' AZIONE ITALIANA

'003' INDICE ITALIANO.



Type of underlying ID.

It accepts the values:

'002' ITALIAN SHARE

'003' ITALIAN INDEX.

12 Instrument group/ *Instrument group*



Identificativo dell'instrument group.

Assume i valori:

'001' EUROPEAN CALL OPTION

'002' EUROPEAN PUT OPTION

'003' FUTURES

'004' AMERICAN CALL OPTION

'005' AMERICAN PUT OPTION.



Instrument group ID.

It accepts the values:

'001' EUROPEAN CALL OPTION

'002' EUROPEAN PUT OPTION

'003' FUTURES

'004' AMERICAN CALL OPTION

'005' AMERICAN PUT OPTION.

13 Status/ *Status*



Indica lo status dello strumento finanziario.

Assume i seguenti valori:

'003' Revocato

'004' Negoziato

'007' Out of strike range




This indicates the status of the financial instrument.


It accepts the following values:

'003' Delisted


'004' *Traded*
'007' *Out of strike range*


14 Data Modifica/ *Date of Modification*

 Data in cui è avvenuta l'ultima variazione del record.


 *Date on which the last variation of the record took place*


15 Ora Modifica/ *Time of Modification*

 Ora in cui è avvenuta l'ultima variazione del record.

 *Time at which the last variation of the record took place.*

16 Data versione/ *Version Date*

 (Non ancora Operativo) Data di inizio validità della versione anagrafica.

 *Effective date of the document version.*