

## RTS 28

Year 2018

### Cash Equities

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			<b>NO</b>
Controparte	Cod. LEI	% volumi	% numero operazioni
CREDIT SUISSE	DL6FFRRLF74S01HE2M14	13%	10%
CITIGROUP	XKZZ2JZF41MRHTR1V493	12%	22%
UBS	REYPIEJN7XZHSUI0N355	10%	16%
MORGAN STANLEY	4PQUHN3JPFQFN3BB653	9%	7%
DEUTSCHE BANK	LTWFZYICNSX8D621K86	7%	5%

#### COMMENTO

*L'operatività sui mercati è ben distribuita su controparti di primario standing, con copertura globale*

### OBBLIGAZIONI (totale)

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			<b>NO</b>
Controparte	Cod. LEI	% volumi	% numero operazioni
MPS	V3Z6EZ8Z6KSBFBIC58	22%	2%
BNP	ROMUWSFPU8MPRO8K5P83	12%	7%
UNICREDIT	2ZCNRR8UK83OBTEK2170	12%	8%
BANCA IMI	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	7%	6%
CREDIT AGRICOLE	1VUV7VQFKUOQSJ21A208	6%	5%

#### COMMENTO

*L'operatività è ben distribuita su controparti di primario standing, prettamente ma non esclusivamente con copertura continentale dei mercati.*

#### DETTAGLI ULTERIORI SULLA NEGOZIAZIONE OBBLIGAZIONARIA

### OBBLIGAZIONI VIA MTF

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			<b>NO</b>
Sede di Esecuzione (MTF)	Cod. LEI	% volumi	% numero operazioni
Bloomberg MTF	n/a	100%	100%

COMMENTO

*Bloomberg è al momento la sede di esecuzione principale ed è una piattaforma ad asta competitiva, che quindi garantisce il perseguimento della best execution.*

**OBBLIGAZIONI VIA MTF PER CONTROPARTE**

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			NO
Controparte	Cod. LEI	% volumi	% numero operazioni
MPS	V3Z6EZ8Z6KSBJFBIC58	20%	3%
BNP	ROMUWSFPU8MPRO8K5P83	11%	10%
UNICREDIT	2ZCNRR8UK83OBTEK2170	11%	10%
BANCA IMI	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	6%	7%
CREDIT AGRICOLE	1VUV7VQFKUOQSJ21A208	5%	5%

COMMENTO

*L'operatività è ben distribuita su controparti di primario standing, prettamente ma non esclusivamente con copertura continentale dei mercati.*

**OBBLIGAZIONI NON VIA MTF PER CONTROPARTE**

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			NO
Controparte	Cod. LEI	% volumi	% numero operazioni
TORONTO DOMINION	PT3QB789TSUIDF371261	60%	52%
JP MORGAN	K6Q0W1PS1L1O4IQL9C32	28%	28%
DAIWA	MIM2K09LFYD4IB163W58	9%	15%
DEUTSCHE BANK	LTWFZYICNSX8D621K86	1%	2%
MORGAN STANLEY	4PQUHN3JPFQFN3BB653	1%	1%

COMMENTO

*L'operatività è ben distribuita su controparti di primario standing, con ampia copertura dei mercati.*

**ETF**

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			NO
Controparte	Cod. LEI	% volumi	% numero operazioni
COMMERZBANK	851WYGNLUQLFZBSYGB56	31%	29%
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	17%	18%
FLOW TRADERS	549300CLIJ9XDH12XV51	12%	11%
BANCA IMI	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	9%	10%
GOLDMAN SACHS	W22LROWP2IHZNBB6K528	9%	6%

COMMENTO

*L'operatività, peraltro alquanto residuale, è comunque distribuita su controparti di primario standing.*

**DERIVATI SU VALUTE**

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente	SI
---	----

Controparte	Cod. LEI	% volumi	% numero operazioni
GOLDMAN SACHS	W22LROWP2IHZNBB6K528	100%	100,0%

**COMMENTO**

*L'operatività, alquanto residuale, è distribuita su controparti di primario standing, con copertura globale dei mercati.*

Gruppo	Entità legale	Codice LEI
BANCA IMI	Banca IMI SpA	QV4Q8OGJ70A6PA8SCM14
BNP	BNP Paribas SA	ROMUWSFPU8MPRO8K5P83
CITIGROUP	Citigroup Global Markets Ltd	XKZZ2JZF41MRHTR1V493
COMMERZBANK	Commerzbank AG (Frankfurt)	851WYGNLUQLFZBSYGB56
CREDIT AGRICOLE	CA-CIB	1VUV7VQFKUOQSJ21A208
CREDIT SUISSE	Credit Suisse Securities (Europe) Ltd	DL6FFRRLF74S01HE2M14
DAIWA	Daiwa Capital Markets Europe Ltd	MIM2K09LFYD4IB163W58
DEUTSCHE BANK	Deutsche Bank AG	LTWFZYICNSX8D621K86
FLOW TRADERS	Flow Traders B.V.	549300CLJI9XDH12XV51
GOLDMAN SACHS	Goldman Sachs Intl	W22LROWP2IHZNBB6K528
INTERMONTE	Intermonte SIM SpA	YMUU1WGHJKORF9E36I98
JP MORGAN	JP Morgan Securities Plc	K6Q0W1PS1L1O4IQL9C32
MORGAN STANLEY	Morgan Stanley & Co International PLC	4PQUHN3JPFGFNF3BB653
MPS	MPS Capital Services Spa	V3Z6EZ8Z6KSBJBFBIC58
TORONTO DOMINION	The Toronto Dominion Bank	PT3QB789TSUIDF371261
UBS	UBS Ltd	REYPIEJN7XZHSUI0N355
UNICREDIT	Unicredit AG	2ZCNRR8UK83OBTEK2170