

Informativa MIFID II

RTS 28

Year 2017

Cash Equities

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

NO

Controparte	Cod. LEI	% volumi	% numero operazioni
CITIGROUP	XKZZ2JZF41MRHTR1V493	11%	28%
CREDIT SUISSE	DL6FFRRL74S01HE2M14	10%	10%
UBS	REYPIEJN7XZHSUI0N355	9%	17%
MORGAN STANLEY	4PQUHN3JPGFNF3BB653	9%	3%
DEUTSCHE BANK	LTWFZYICNSX8D621K86	8%	4%

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

NO

Controparte	Cod. LEI	% volumi	% numero operazioni
BBVA	K8MS7FD7N5Z2WQ51AZ71	16%	4%
Unicredit	2ZCNRR8UK83OBTEK2170	15%	12%
MPS	V3Z6EZ8Z6KSJBFBIC58	13%	5%
Goldman Sachs	W22LROWP2IHZNBB6K528	12%	7%
CA-CIB	1VUV7VQFKUQSI21A208	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			NO
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
BBVA	K8MS7FD7N5Z2WQ51AZ71	16%	5%
Unicredit	2ZCNRR8UK83OBTEK2170	15%	15%
MPS	V3Z6EZ8Z6KSJBFBIC58	13%	6%
Goldman Sachs	W22LROWP2IHZNBB6K528	12%	9%
CREDIT AGRICOLE	1VUV7VQFKUOQSJ21A208	7%	6%

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
MPS	V3Z6EZ8Z6KSJBFBIC58	25%	7%
Toronto Dominion	PT3QB789TSUIDF371261	25%	63%
BBVA	K8MS7FD7N5Z2WQ51AZ71	24%	4%
JP Morgan	K6Q0W1PS1L1O4IQL9C32	23%	16%
Bank of Montreal	NQQ6HPCNCCU6TUTQYE16	3%	7%

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	851WYG NLUQLFZBSYGB56	51%	43%
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	23%	27%
CREDIT SUISSE	DL6FFRRL74S01HE2M14	9%	14%
UBS	REYPIEJN7XZHSUI0N355	8%	5%
UNICREDIT	2ZCNRR8UK83OBTEK2170	8%	8%

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	99%	99,9%
UNICREDIT	2ZCNRR8UK83OBTEK2170	1%	0,1%

COMMENTO

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

Gruppo	Entità legale	Codice LEI
BANK OF MONTREAL	Bank of Montreal, London Branch	NQQ6HPCNCCU6TUTQYE16
BBVA	BBVA SA	K8MS7FD7N5Z2WQ51A271
CITIGROUP	Citigroup Global Markets Ltd	XKZZ2JZF41MRHTR1V493
COMMERZBANK	Commerzbank AG (Frankfurt)	851WYG NLUQLFZBSYGB56
CREDIT AGRICOLE	CA-CIB	1VUV7VQFKUOQSJ21A208
CREDIT SUISSE	Credit Suisse Securities (Europe) Ltd	DL6FFRRL74S01HE2M14
DEUTSCHE BANK	Deutsche Bank AG	LTWFZYICNSX8D621K86
GOLDMAN SACHS	Goldman Sachs Intl	W22LROWP2IHZNBB6K528
INTERMONTE	Intermonte SIM SpA	YMUU1WGHJKORF9E36I98
JP MORGAN	JP Morgan Securities Plc	K6Q0W1PS1L104IQL9C32
MORGAN STANLEY	Morgan Stanley & Co International PLC	4PQUHN3JPFQFN3BB653
MPS	MPS Capital Services Spa	V3Z6EZ8Z6KSBFBIC58
TORONTO DOMINION	The Toronto Dominion Bank	PT3QB789TSUIDF371261
UBS	UBS Ltd	REYPIEJN7XZHSUI0N355
UNICREDIT	Unicredit AG	2ZCNRR8UK83OBTEK2170