

RTS 28 - ANNO 2018

CLIENTELA PROFESSIONALE/ELIGIBLE

a) Strumenti di capitale - Azioni e certificati di deposito

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			NO
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	57,6%	39,8%
UBS	REYPIEJN7XZHSUI0N355	27,7%	44,5%
MORGAN STANLEY	4PQUHN3JPFGFNF3BB653	4,8%	4,8%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	4,7%	7,6%
BANCA AKROS	549300GRXF7D6PNEA68	1,8%	0,6%

b) Strumenti di debito - i) Obbligazioni

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			NO
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
BARCLAYS	213800LBQA1Y9L22JB70	17,5%	4,4%
HVB GROUP (UNICREDIT)	2ZCNR8UK83OBTEK2170	15,7%	4,9%
SOCIETE GENERAL	O2RNE8IBXP4R0TD8PU41	11,8%	3,8%
JP MORGAN	549300SOGM3USX5DOD03	7,3%	6,3%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	6,2%	5,2%

d) Derivati su crediti - i) Future e opzioni ammessi alla negoziazione in una sede di negoziazione

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			SI
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	100,0%	100,0%

e) Derivati su valute - i) Future e opzioni ammessi alla negoziazione in una sede di negoziazione

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			SI
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	100,0%	100,0%

f) Strumenti di finanza strutturata

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			SI
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	55,7%	18,9%
JP MORGAN	549300SOGM3USX5DOD03	5,8%	4,1%
UBS	REYPIEJN7XZHSUI0N355	5,7%	23,9%
CITIGROUP	5493004FUULDQTMX0W20	5,4%	11,1%
TORONTO DOMINION	21380094W2JJY3JDHJ35	5,0%	1,8%

g) Derivati su strumenti di capitale -i) Opzioni e future ammessi alla negoziazione in una sede di negoziazione

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			NO
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	63,2%	49,3%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	36,8%	50,7%

h) Derivati cartolarizzati

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			SI
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	79,5%	49,1%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	16,1%	39,8%
DEPOBANK	815600EE22E1C3F66630	4,4%	11,1%

i) Derivati su merci e derivati su quote di emissione - i) opzioni e future ammessi alla negoziazione in una sede di negoziazione

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			SI
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	100,0%	100,0%

k) Prodotti indicizzati quotati (fondi ETF, note ETN e merci ETC)

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			NO
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	56,0%	51,0%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	12,3%	13,5%
MEDIOBANCA	PSNL19R2RXX5U3QWHI44	11,2%	7,4%
UBS	REYPIEJN7XZHSUION355	10,6%	23,7%
HVB GROUP (UNICREDIT)	2ZCNRR8UK83OBTEK2170	2,4%	1,1%

m) Altri strumenti

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			NO
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	93,1%	20,0%
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	6,9%	80,0%

RTS 28 - ANNO 2018

CLIENTELA RETAIL

a) Strumenti di capitale - Azioni e certificati di deposito

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			NO
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	40,5%	29,5%
UBS	REYPIEJN7XZHSUI0N355	37,5%	48,7%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	9,7%	10,2%
MORGAN STANLEY	4PQUHN3JPFGFNF3BB653	6,4%	6,6%
GOLDMAN SACHS	W22LROWP2IHZNBB6K528	3,0%	3,2%

b) Strumenti di debito - i) Obbligazioni

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			NO
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	21,5%	30,6%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	10,6%	7,3%
TORONTO DOMINION	21380094W2JJY3JDHJ35	9,9%	11,7%
BANCA AKROS	549300GRXF7D6PNEA68	8,9%	5,2%
HVB GROUP (UNICREDIT)	2ZCNRR8UK83OBTEK2170	6,7%	4,2%

d) Derivati su crediti - i) Future e opzioni ammessi alla negoziazione in una sede di negoziazione

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			NO
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	98,8%	100%
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	1,2%	0%

e) Derivati su valute - i) Future e opzioni ammessi alla negoziazione in una sede di negoziazione

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			SI
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	100%	100%

f) Strumenti di finanza strutturata

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			NO
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	20,5%	11,6%
UBS	REYPIEJN7XZHSUI0N355	12,9%	30,0%
CITIGROUP	5493004FUULDQTMX0W20	8,7%	9,0%
HVB GROUP (UNICREDIT)	2ZCNRR8UK83OBTEK2170	8,1%	5,3%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	8,0%	2,2%

g) Derivati su strumenti di capitale -i) Opzioni e future ammessi alla negoziazione in una sede di negoziazione

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			NO
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	80,5%	79,0%
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	19,5%	21,0%
UBS	REYPIEJN7XZHSUI0N355	0,0%	0,0%
MORGAN STANLEY	4PQUHN3JPFGFNF3BB653	0,0%	0,0%

h) Derivati cartolarizzati

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			SI
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	93,0%	96,6%
DEPOBANK	815600EE22E1C3F66630	4,3%	2,1%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	2,7%	1,3%

i) Derivati su merci e derivati su quote di emissione - i) opzioni e future ammessi alla negoziazione in una sede di negoziazione

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			SI
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	100%	100%

k) Prodotti indicizzati quotati (fondi ETF, note ETN e merci ETC)

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			NO
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	36,5%	31,3%
MEDIOBANCA	PSNL19R2RXX5U3QWHI44	19,0%	14,2%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	16,6%	18,0%
UBS	REYPIEJN7XZHSUI0N355	15,7%	27,6%
DEUTSCHE	7LTWFZYICNSX8D621K86	3,6%	1,3%

m) Altri strumenti

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente			NO
Controparte	Codice LEI	volume negoziato in % del totale della classe	ordini eseguiti in % del totale della classe
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	69,4%	29,1%
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	30,6%	70,9%