

RTS 28 - ANNO 2019

CLIENTELA PROFESSIONALE/ELIGIBILE

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	30,7%	25,4%
UBS EUROPE SE	5299007QVIQ7IO64NX37	24,4%	27,2%
NOMURA	DGQCSV2PHVF7I2743539	20,1%	0,3%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	11,5%	27,0%
UBS	REYPIEJN7XZHSUI0N355	5,9%	7,9%

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
HVB GROUP (UNICREDIT)	2ZCNRR8UK83OBTEK2170	17,3%	6,9%
DEUTSCHE	7LTFWFZYICNSX8D621K86	11,6%	6,4%
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	11,4%	16,8%
JP MORGAN	549300SOGM3USX5DOD03	10,3%	13,1%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	5,3%	12,4%

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	37,3%	20,9%
DEUTSCHE	7LTFWZYICNSX8D621K86	12,7%	3,9%
HVB GROUP (UNICREDIT)	2ZCNRR8UK83OBTEK2170	9,1%	3,8%
UBS EUROPE SE	5299007QVIQ7IO64NX37	7,6%	16,7%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	3,4%	8,6%

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	57,2%	32,2%
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	42,8%	67,8%

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
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	72,0%	95,7%
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	28,0%	4,3%

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
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	37,4%	34,0%
MEDIOBANCA	PSNL19R2RXX5U3QWHI44	22,3%	12,2%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	21,9%	27,9%
UBS EUROPE SE	5299007QVIQ7IO64NX37	5,6%	13,5%
HVB GROUP (UNICREDIT)	2ZCNRR8UK83OBTEK2170	3,2%	0,9%

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
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	89,9%	85,2%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	10,1%	14,8%
COMMENTO			

RTS 28 - ANNO 2019

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
UBS EUROPE SE	5299007QVIQ7IO64NX37	31,2%	30,2%
NOMURA	DGQCSV2PHVF712743539	25,2%	0,3%
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	16,1%	18,9%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	11,7%	25,3%
UBS	REYPIEJN7XZHSUI0N355	6,6%	8,1%

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
TORONTO DOMINION	21380094W2JJY3JDHJ35	17,8%	8,2%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	15,4%	17,3%
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	13,5%	12,8%
JP MORGAN	549300SOGM3USX5DOD03	8,8%	11,9%
DEUTSCHE	7LTWFZYICNSX8D621K86	7,9%	6,1%

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	100%	100%

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)	QV4Q8OGJ70A6PA8SCM14	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
DEUTSCHE	7LTFWZYICNSX8D621K86	27,0%	4,4%
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	20,3%	22,8%
UBS EUROPE SE	5299007QVIQ7IO64NX37	15,3%	24,0%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ70A6PA8SCM14	8,6%	10,6%
ZURCHER	165GRDQ39W63PHVONY02	3,2%	5,0%

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)	QV4Q8OGJ70A6PA8SCM14	76,8%	70,9%
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	23,2%	29,1%

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	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
MEDIOBANCA	PSNL19R2RXX5U3QWHI44	28,9%	22,6%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	28,3%	35,7%
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	19,6%	14,6%
UBS EUROPE SE	5299007QVIQ7IO64NX37	8,9%	13,2%
HVB GROUP (UNICREDIT)	2ZCNRR8UK83OBTEK2170	3,5%	2,1%

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
INTERMONTE	YMUU1WGHJKORF9E36I98	64,0%	74,2%
BANCA CABOTO (BANCA IMI)	QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	36,0%	25,8%

COMMENTO

--