

## RTS 28 - ANNO 2021

### 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 |
| UBS EUROPE SE   | 5299007QVIQ7IO64NX37 | 54,3%   | 37,0%  |
| INTERMONTE  | YMUU1WGHJKORF9E36I98 | 25,9%   | 20,5%  |
| INTESA S.PAOLO SPA  | 2W8N8UU78PMDQKZENC08 | 9,7%  | 29,4%  |
| EQUITA  | 815600E3E9BFBC8FAA85 | 4,2%  | 3,2%   |
| MORGAN STANLEY EUROPE SE  | 54930056FHWP7GIWYY08 | 3,3%  | 6,3%   |

#### 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 |
| J.P.MORGAN AG.FRANKFURT   | 549300ZK53CNGEEI6A29 | 13,4%   | 9,2%   |
| GOLDMAN SACHS   | W22LROWP2IHZNBB6K528 | 10,2%   | 7,1%   |
| BANK OF AMERICA SECURITIES  | 549300FH0WJAPEHTIQ77 | 10,0%   | 8,7%   |
| INTERMONTE  | YMUU1WGHJKORF9E36I98 | 9,9%  | 10,8%  |
| BNP PARIBAS EQUITIES  | R0MUWSFPU8MPRO8K5P83 | 7,1%  | 2,5%   |

#### 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 |
| INTESA S.PAOLO SPA  | 2W8N8UU78PMDQKZENC08 | 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 |
| INTESA S.PAOLO SPA  | 2W8N8UU78PMDQKZENC08 | 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 | 37,9%   | 28,9%  |
| MARKETAXESS CAPITAL LIMITED   | 529900CTXON8S5AOCB70 | 19,3%   | 22,4%  |
| BPER BANCA  | N747OI7JINV7RUUH6190 | 5,6%  | 7,8%   |
| INTESA S.PAOLO SPA  | 2W8N8UU78PMDQKZENC08 | 4,3%  | 17,4%  |
| BANK OF AMERICA SECURITIES  | 549300FH0WJAPEHTIQ77 | 3,3%  | 2,8%   |

**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 | 51,0%   | 54,1%  |
| INTESA S.PAOLO SPA  | 2W8N8UU78PMDQKZENC08 | 31,5%   | 43,6%  |
| EQUITA  | 815600E3E9BFC8FAA85  | 17,0%   | 2,1%   |
| UBS EUROPE SE   | 5299007QVIQ7IO64NX37 | 0,5%  | 0,2%   |

**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 | 35,8%   | 29,8%  |
| INTESA S.PAOLO SPA  | 2W8N8UU78PMDQKZENC08 | 29,1%   | 47,7%  |
| UBS EUROPE SE   | 5299007QVIQ7IO64NX37 | 15,7%   | 10,3%  |
| MEDIOBANCA  | PSNL19R2RXX5U3QWHI44 | 10,6%   | 8,7%   |
| SUSQUEHANNA FINANCIAL GROUP   | 549300E8QX0ZMRDC2M81 | 2,8%  | 1,2%   |

**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 |
| INTESA S.PAOLO SPA  | 2W8N8UU78PMDQKZENC08 | 77,1%   | 85,7%  |
| INTERMONTE  | YMUU1WGHJKORF9E36I98 | 22,9%   | 14,3%  |

**COMMENTO**

|  |
|--|
|  |
|--|