

Report Quantitativo CLIENTELA RETAIL

Classe strumento finanziario: AZIONI

Tipologia di strumenti finanziari presenti nella classe azioni: azioni, diritti, azioni estere, diritti esteri

INFORMAZIONI DEGLI ORDINI ESEGUITI TRAMITE BROKER

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente	No				
Prime cinque sedi di esecuzione per volume di contrattazioni (in ordine decrescente)	Volume negoziato in percentuale del totale di classe	Ordini eseguiti in percentuale del totale della classe	Percentuale di ordini passivi	Percentuale di ordini aggressivi	Percentuale di ordini orientati
E13E01: Azioni con fasce di liquidità in base allo scostamento di prezzo 5 e 6 (a partire da 2 000 contrattazioni al giorno)					
Banca IMI QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	100	100	38,68	61,32	39,33
E13E02: Azioni con fasce di liquidità in base allo scostamento di prezzo 3 e 4 (da 80 a 1 999 contrattazioni al giorno)					
Banca IMI QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	100	100	21,65	78,35	21,91
E13E03: Azioni con fasce di liquidità in base allo scostamento di prezzo 1 e 2 (da 0 a 79 contrattazioni al giorno)					
Banca IMI QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	65,88	66,69	58,11	41,89	15,74
Banca Akros 549300GRXFI7D6PNEA68	34,12	33,31	100	0	0

Classe strumento finanziario: OBBLIGAZIONI

Tipologia di strumenti finanziari presenti nella classe obbligazioni: BOT, CCT e BTP, Obbligazioni non di stato, Convertibili, Zero coupon bond, Obbligazioni di stato estere, Obbligazioni non di stato estere, Zero coupon bond estere (E13M01)

INFORMAZIONI DEGLI ORDINI ESEGUITI TRAMITE BROKER

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente	No				
Prime cinque sedi di esecuzione per volume di contrattazioni (in ordine decrescente)	Volume negoziato in percentuale del totale di classe	Ordini eseguiti in percentuale del totale della classe	Percentuale di ordini passivi	Percentuale di ordini aggressivi	Percentuale di ordini orientati
Banca Akros 549300GRXFI7D6PNEA68	60,14	56,61	11,71	88,29	8,38
Banca IMI QV4Q8OGJ70A6PA8SCM14	26,56	21,11	72,77	27,23	80,80
La Cassa di Ravenna 815600A32DA05F693F24	0,10	0,16	80	20	100

La parte restante è rappresentata dalle obbligazioni emesse dalla Banca di Imola, negoziate come unica sede di esecuzione in conto proprio. Dal 2018 negoziati su Hi-Mtf.

Classe strumento finanziario: MONETARIO

Tipologia di strumenti finanziari presenti nella classe monetario: BOT, obbligazioni non di stato, obbligazioni non di stato estere (E13M02)

INFORMAZIONI DEGLI ORDINI ESEGUITI TRAMITE BROKER

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente	Si				
Prime cinque sedi di esecuzione per volume di contrattazioni (in ordine decrescente)	Volume negoziato in percentuale del totale di classe	Ordini eseguiti in percentuale del totale della classe	Percentuale di ordini passivi	Percentuale di ordini aggressivi	Percentuale di ordini orientati
Banca Akros 549300GRXFI7D6PNEA68	77,55	50	0	100	0
Banca IMI QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	22,45	50	0	100	0

Classe strumento finanziario: DERIVATI CARTOLARIZZATI

Tipologia di strumenti finanziari presenti nella classe derivati cartolarizzati: warrant, covered warrant, warrant esteri, covered warrant esteri

INFORMAZIONI DEGLI ORDINI ESEGUITI TRAMITE BROKER

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente	No				
Prime cinque sedi di esecuzione per volume di contrattazioni (in ordine decrescente)	Volume negoziato in percentuale del totale di classe	Ordini eseguiti in percentuale del totale della classe	Percentuale di ordini passivi	Percentuale di ordini aggressivi	Percentuale di ordini orientati
E13E08: Warrant e derivati in forma di certificati					
Banca IMI QV4Q8OGJ70A6PA8SCM14	99,65	99,79	48,04	51,96	45,84
Banca Akros 549300GRXFI7D6PNEA68	0,35	0,21	25	75	25

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente	No				
Prime cinque sedi di esecuzione per volume di contrattazioni (in ordine decrescente)	Volume negoziato in percentuale del totale di classe	Ordini eseguiti in percentuale del totale della classe	Percentuale di ordini passivi	Percentuale di ordini aggressivi	Percentuale di ordini orientati
E13E09: Altri derivati cartolarizzati					
Banca IMI QV4Q8OGJ70A6PA8SCM14	100	100	4,39	95,61	5,07

Classe strumento finanziario: DERIVATI SU STRUMENTI DI CAPITALE

Tipologia di strumenti finanziari presenti nella classe derivati cartolarizzati: warrant, covered warrant, warrant esteri, covered warrant esteri

INFORMAZIONI DEGLI ORDINI ESEGUITI TRAMITE BROKER

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente	No				
Prime cinque sedi di esecuzione per volume di contrattazioni (in ordine decrescente)	Volume negoziato in percentuale del totale di classe	Ordini eseguiti in percentuale del totale della classe	Percentuale di ordini passivi	Percentuale di ordini aggressivi	Percentuale di ordini orientati
E13E06: Derivati su strumenti di capitale – Future e opzioni ammessi alla negoziazione in una sede di negoziazione					
Banca IMI QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	100	100	100	0	0

Classe strumento finanziario: PRODOTTI INDICIZZATI QUOTATI

Tipologia di strumenti finanziari presenti nella classe prodotti indicizzati quotati: ETF, ETF esteri (E13E12)

INFORMAZIONI DEGLI ORDINI ESEGUITI TRAMITE BROKER

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente	No				
Prime cinque sedi di esecuzione per volume di contrattazioni (in ordine decrescente)	Volume negoziato in percentuale del totale di classe	Ordini eseguiti in percentuale del totale della classe	Percentuale di ordini passivi	Percentuale di ordini aggressivi	Percentuale di ordini orientati
Banca IMI QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	100	100	54,03	45,97	8,96

Classe strumento finanziario: STRUMENTI DI FINANZA STRUTTURATA

Le operazioni di strumenti di finanza strutturata riguardano operazioni per l'emissione di tranches di titoli con diverso profilo di rischio, tipicamente in caso di cartolarizzazione cioè vendita agli investitori di titoli di credito suddivisi in tranches emessi a fronte dei flussi monetari generati dalle attività stesse (E13E05)

INFORMAZIONI DEGLI ORDINI ESEGUITI TRAMITE BROKER

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente	Si				
Prime cinque sedi di esecuzione per volume di contrattazioni (in ordine decrescente)	Volume negoziato in percentuale del totale di classe	Ordini eseguiti in percentuale del totale della classe	Percentuale di ordini passivi	Percentuale di ordini aggressivi	Percentuale di ordini orientati
Banca IMI QV4Q8OGJ70A6PA8SCM14	94,87	66,67	0	100	0
Banca Akros 549300GRXFI7D6PNEA68	5,13	33,33	0	100	0

Classe strumento finanziario: ALTRI STRUMENTI

Tipologia di strumenti finanziari presenti nella classe altri strumenti: fondi comuni Italia, fondi immobiliari, fondi comuni esteri, fondi immobiliari esteri (E13E14)

INFORMAZIONI DEGLI ORDINI ESEGUITI TRAMITE BROKER

Indicare se < 1 contrattazione a giorno lavorativo, in media, l'anno precedente	No				
Prime cinque sedi di esecuzione per volume di contrattazioni (in ordine decrescente)	Volume negoziato in percentuale del totale di classe	Ordini eseguiti in percentuale del totale della classe	Percentuale di ordini passivi	Percentuale di ordini aggressivi	Percentuale di ordini orientati
Banca IMI QV4Q8OGJ7OA6PA8SCM14	100	100	11,84	88,16	2,30

Note e glossario

La Direttiva MiFID II, in base al Regolamento Delegato UE 3337, dispone l'obbligo per gli intermediari di pubblicare informazioni circa gli ordini dei clienti eseguiti nelle prime 5 sedi di negoziazione, internalizzatori sistematici, Market Maker o altri fornitori di liquidità o soggetti che in un paese terzo svolgono una funzione analoga a quella di uno dei soggetti citati.

Nel report non sono incluse:

- le operazioni effettuate da Controparti Qualificate;
- le operazioni svolte dall'Intermediario poiché l'art. 27 della MiFID II fa esplicito riferimento alla fattispecie di operazioni disposte da cliente.

I dati calcolati all'interno del report quantitativo sono riferiti al periodo Gennaio-Dicembre 2017.

- I dati sono calcolati sulla base degli ordini eseguiti per conto della clientela Retail e professionale. Sono stati evidenziati anche i calcoli per gli ordini effettuati in conto proprio.
- La Banca provvede a pubblicare e aggiornare la policy di strategia ed esecuzione degli ordini della Banca dove viene esplicitata il processo di selezione delle sedi di esecuzione per tipologia di strumento finanziario.
- I documenti sono resi disponibili alla clientela sul sito della Banca nella sezione Finanza argomento MifidII.

GLOSSARIO

«**Ordine passivo**»: l'ordine iscritto nel book di negoziazione che ha fornito liquidità;

«**Ordine aggressivo**»: l'ordine iscritto nel book di negoziazione che ha assorbito liquidità;

«**Ordine orientato**»: l'ordine in cui il cliente, prima dell'esecuzione dell'ordine, ha indicato una specifica sede di esecuzione.