

LEGENDA

I documenti contenuti nella presente sezione sono redatti ai sensi dell'articolo 27 (3) della Direttiva 2014/65/UE e del Regolamento Delegato (UE) 2017/575
Per gli strumenti finanziari negoziati da parte di Iccrea BancaImpresa (esclusivamente derivati per la copertura dal rischio di tasso d'interesse) sono riportate le seguenti informazioni

1. "PUBBLICAZIONE DELLE INFORMAZIONI SULLA SEDE DI ESECUZIONE E SULLO STRUMENTO FINANZIARIO" (Articolo 3 del Regolamento Delegato UE 2017/575)

Campo 1.1.1

Denominazione e codice di identificazione della sede di esecuzione

Campo 1.1.2

Paese in cui ha sede l'Autorità competente

Campo 1.1.3

Denominazione e codice di identificazione del segmento di mercato

Campo 1.1.4

Data del giorno di negoziazione

2. "PREZZO" (Articolo 4 del Regolamento Delegato UE 2017/575)

2.1 Informazioni infragiornaliere (Articolo 4, comma 1, lett. a) del Regolamento Delegato UE 2017/575)

Campo 2.1.5 Prezzo

Per IRS: (Costi Hedging + Costi Consulenza) x Basis Point Value

Per Floor e Cap: (Fair Value + Costi Hedging + Costi Consulenza) x Basis Point Value

Campo 2.1.6

Ora di esecuzione di ogni operazione

Campo 2.1.7 Valore

Per IRS: (Costi Hedging + Costi Consulenza) x Basis Point Value

Per Floor e Cap: (Fair Value) x Basis Point Value

Campo 2.1.8

Sistema e modalità di negoziazione utilizzati per eseguire le operazioni

2.2. Informazioni giornaliere (Articolo 4, comma 1, lett. b) del Regolamento Delegato UE 2017/575)

Campo 2.2.1

in caso di più di una operazione:

Prezzo medio semplice delle operazioni: (somma dei prezzi giornalieri) / (numero operazioni eseguite)

Prezzo medio ponderato per il volume: somma (prezzo operazione x nozionale operazione) / somma dei nozionali

Campo 2.2.2

In caso di più di due operazioni:

Prezzo di esecuzione massimo

Campo 2.2.3

In caso di più di due operazioni:

Prezzo di esecuzione minimo

3. "COSTI" (Articolo 5 del Regolamento Delegato UE 2017/575)

Campo 3.1.1

Commissioni di esecuzione.

(Costi Hedging + Costi Consulenza) x Basis Point Value

Campo 3.7.1

(Prezzo/Nozionale) x100

4. "PROBABILITÀ DELL'ESECUZIONE" (Articolo 6 del Regolamento Delegato UE 2017/575)

Campo 4.1.1

Numero di ordini o di richieste di quotazione ricevuti

Campo 4.2.1

In caso di più di una operazione:

Numero delle operazioni eseguite e somma dei rispetti Valori (cfr campi 2.1.7)

Campo 4.5.1

Dimensione mediana delle operazioni in quella data

in caso di più di una operazione:

somma dei nozionali delle operazioni eseguite / numero delle operazioni.

Campo 4.6.1

dimensione mediana di tutti gli ordini e di tutte le richieste di quotazione in quella data

Coincide con il campo 4.5.1.

7. “DETERMINAZIONE DEGLI INTERVALLI PER LA COMUNICAZIONE” (Articolo 9 del Regolamento Delegato UE 2017/575)

Campo 7.1.1

Numero di operazioni effettuate nella stessa giornata e riferita alla stessa tipologia di operazione con la stessa durata