

AREA COMPLIANCE

Siena, 24 settembre 2018

Spett.le
CONSOB
Divisione Mercati
Ufficio Vigilanza Infrastrutture di Mercato

Inviata tramite pec all'indirizzo dme@pec.consob.it

Vostro riferimento del 01/08/2018 – protocollo 0286389/18 – codice destinatario: 135417;

Prot. Mps: Prot. N° 02243/2018 del 24/09/2018

OGGETTO: Obblighi di cui all'art. 26 del Regolamento UE 2014/600 (MiFIR) e del Regolamento Delegato UE 2017/590.

Ad integrazione della nota inviata dalla Scrivente in data 14/09/2018 in risposta alla richiesta di cui all'oggetto, si forniscono di seguito le informazioni richieste mancanti, riferite alla codifica di errore CON-412.

Le anomalie riscontrate per questa casistica di errore sono riconducibili alle seguenti situazioni:

- Errata valorizzazione, da parte del fornitore che alimenta l'applicativo di reporting della Banca, del codice MIC relativo alla trading venue su cui è stata eseguita l'operazione (campo 36). Gli errori si riferiscono all'operatività sul mercato Equity MTF di Borsa Italiana, sia sul segmento BIT GEM (codice MIC "MTAH" erroneamente codificato con "HMTF" dal nostro fornitore), sia sul segmento Trading After Hour (codice MIC "MTAH" erroneamente codificato con "MTAA" dal nostro fornitore).

Dalle verifiche effettuate sulle casistiche inerenti il codice di errore in esame, è emerso inoltre che nelle segnalazioni effettuate:

- (i) il campo "Transmission of order indicator" (campo 25) viene erroneamente valorizzato con "False" anziché "True" per tutti gli ordini che la Banca trasmette all'intermediario esecutore di Gruppo (MPS Capital Services Banca per le Imprese SpA), sebbene non siano rispettate le condizioni per la trasmissione di cui all'articolo 4 del Regolamento 590/2017;
- (ii) Il campo "Venue" (campo 36) viene erroneamente valorizzato con il codice MIC della sede in cui l'operazione è stata eseguita – con le anomalie sopra evidenziate - anziché con l'indicazione della venue "XOFF", sebbene tali segnalazioni siano riferite ad operazioni trasmesse dalla Banca all'intermediario Esecutore di Gruppo (MPS Capital Services Banca per le Imprese SpA).

A tal proposito, si rappresenta che la Banca sta effettuando gli interventi necessari per la sistemazione delle anomalie evidenziate ai punti (i) e (ii): sarà cura della Banca fornire apposita comunicazione al completamento delle attività.



**MONT
DEI PASCHI
DI SIENA**
BANCA DAL 1472

Nelle more di tali interventi, la Banca ha fatto comunque correggere al fornitore l'errata valorizzazione del codice MIC ("HMTF" e "MTAA"), in modo tale da indicare - a partire dalle segnalazioni del 14/09/18 per l'operatività sul segmento BIT GEM e del 19/09/18 per il segmento Trading After Hour – il codice MIC corretto ("MTAH").

- Errata valorizzazione del codice MIC delle trading venues su cui sono state eseguite le operazioni relative a strumenti azionari negoziati su sedi di negoziazione estere tramite l'intermediario esecutore Goldman Sachs (che fornisce l'accesso indiretto su tali sedi all'intermediario esecutore di Gruppo MPS Capital Services Banca per le Imprese SpA). Gli errori si riferiscono a segnalazioni effettuate con il codice MIC presente nell'anagrafica titoli del Gruppo e non coerente con il codice MIC della sede su cui è stata eseguita l'operazione. Anche per tali operazioni, per le motivazioni esposte al punto precedente, le segnalazioni riportano una errata valorizzazione del campo "Transmission of order indicator" (campo 25) e del campo "Venue" (campo 36). La sistemazione della segnalazione di tali operazioni verrà effettuata con il completamento degli interventi sopra richiamati.

Si rappresenta che gli interventi rappresentanti nella presente comunicazione saranno effettuati con riferimento alle segnalazioni di Banca Monte dei Paschi di Siena, MPS Capital Services per le Imprese SpA e Widiba.

Fatto salvo quanto sopra, al fine di migliorare la qualità delle segnalazioni la Banca sta implementando un controllo, preliminare all'invio delle segnalazioni all'ARM e da applicarsi solo nei casi in cui la Banca esegue operazioni su sedi di esecuzione, volto a verificare la presenza di ciascuna coppia codice ISIN – Codice MIC della sede di esecuzione dell'operazione nel database F.I.R.D.S. di ESMA.

Distinti Saluti.

AREACOMPLIANCE

IL RESPONSABILE