

Tabela 1 – Informacje umożliwiające identyfikację, które publikuje się zgodnie z art. 3 ust. 1 – rodzaj systemu wykonywania zleceń

| | | |
|------------------------------------|------------------------------|--|
| Państwo siedziby właściwego organu | Rzeczpospolita Polska | |
| Segment rynku | Market Maker | |
| Data dnia sesyjnego | 2020-06-24 | |
| Przerwy | n/a | |
| Zaplanowana aukcja | intraday; 2; 11:22:30.000000 | |
| Transakcje niezrealizowane | brak danych | |

Tabela 2 – Informacje umożliwiające identyfikację, które publikuje się zgodnie z FUS500.

| | |
|---|--|
| Pisemny opis instrumentu finansowego, jeżeli identyfikator nie jest dostępny (w tym waluta instrumentu bazowego, mnożnik ceny, oznaczenie ceny, oznaczenie ilości i rodzaj dostawy) | <p>Kontrakt na różnicę (CFD) notowań futures na indeks S&P500 notowany na giełdzie w Chicago (FUS500.), który jest instrumentem pochodnym, zawarty pomiędzy dwiema stronami, tj. dostawcą (DM BOŚ) a inwestorem (klientem), zgodnie z którym klient otrzyma różnicę (jeżeli będzie dodatnia) pomiędzy kursem kontraktu futures na indeks S&P500 notowany na giełdzie w Chicago (FUS500.) z chwili otwarcia kontraktu a kursem kontraktu futures na indeks S&P500 notowany na giełdzie w Chicago (FUS500.) z chwili zamknięcia kontraktu. Jeżeli różnica jest ujemna wtedy klient zapłaci różnicę dostawcy. Kontrakt opiera się na mnożniku w wysokości 100. Minimalny krok notowania kontraktu jest równy 0.01. Kontrakt na różnicę jest instrumentem bez dostawy aktywów bazowych. Oznaczenie ceny: wartość pieniężna, Oznaczenie ilości: liczba jednostek.</p> |
| Klasyfikacja instrumentu | n/a |
| Waluta | USD |

Tabela 3 – Informacje o cenach, które publikuje się zgodnie z art. 4 lit. a)

| | Zakres wielkości | Wszystkie transakcje wykonane w ciągu pierwszych dwóch minut od czasu T | | Pierwsza transakcja wykonana od czasu T (jeżeli w ciągu pierwszych dwóch minut od czasu T nie wykonano żadnych transakcji) | | | | | | |
|----------|------------------|--|--------------------------------|--|----------------|---------------------|--|-------------|-------------------------|--|
| Czas (T) | | Średnia arytmetyczna zrealizowanej ceny (z wyłączeniem prowizji i naliczonych odsetek) | Całkowita wartość zrealizowana | Cena | Czas wykonania | Wielkość transakcji | System transakcyjny | Tryb obrotu | Platforma obrotu | Najlepsza oferta zakupu i sprzedaży lub odpowiedni kurs odniesienia w czasie wykonania |
| 09:30:00 | 1 | 3119.4 | 13883.75 | n/a | n/a | n/a | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | n/a |
| | 2 | n/a | n/a | 3102.35 | 15:42:25 | 91131.88 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3101.65/3102.35 |
| | 3 | n/a | n/a | 3109.6 | 09:40:14 | 276802.56 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3108.9/3109.6 |
| 11:30:00 | 1 | n/a | n/a | 3087.15 | 11:33:16 | 5496.08 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3087.15/3087.85 |
| | 2 | n/a | n/a | 3102.35 | 15:42:25 | 91131.88 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3101.65/3102.35 |
| | 3 | n/a | n/a | 3094.23 | 12:46:22 | 275434.40 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3093.53/3094.23 |

| | | | | | | | | | | |
|----------|---|--------|----------|---------|----------|------------|--|-----|-------------------------|-----------------|
| 13:30:00 | 1 | n/a | n/a | 3094.1 | 13:33:33 | 2754.23 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3093.4/3094.1 |
| | 2 | n/a | n/a | 3102.35 | 15:42:25 | 91131.88 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3101.65/3102.35 |
| | 3 | n/a | n/a | 3100.28 | 15:14:06 | 137986.47 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3100.28/3100.98 |
| 15:30:00 | 1 | 3097.8 | 46887.12 | n/a | n/a | n/a | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | n/a |
| | 2 | n/a | n/a | 3102.35 | 15:42:25 | 91131.88 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3101.65/3102.35 |
| | 3 | n/a | n/a | 3085.65 | 15:52:31 | 1236017.89 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3085.65/3086.35 |

Tabela 4 – Informacje o cenach, które publikuje się zgodnie z art. 4 lit. b)

| | |
|---|---------|
| Średnia arytmetyczna ceny transakcyjnej | 3064.21 |
| Cena transakcyjna ważona wolumenem | 3056.21 |
| Najwyższa zrealizowana cena | 3127.6 |
| Najniższa zrealizowana cena | 3019.4 |

Tabela 5 – Informacje o kosztach, które publikuje się zgodnie z art. 5

| | |
|---|---|
| Link do strony internetowej lub do innego źródła, w którym dostępne są dalsze informacje o kosztach | http://bossa.pl/informacja-forex/ |
| Całkowita wartość wszystkich rabatów, upustów lub innych oferowanych płatności (jako % całkowitej wartości obrotu w okresie sprawozdawczym) | 0 |
| Całkowita wartość wszystkich kosztów (jako % całkowitej wartości obrotu w okresie sprawozdawczym) | 0.011 |

Tabela 6 – Informacje o prawdopodobieństwie wykonania zlecenia, które publikuje się zgodnie z art. 6

| | |
|--|-------------|
| Liczba otrzymanych zleceń lub zapytań o kwotowanie | 2452 |
| Liczba wykonanych transakcji | 2452 |
| Całkowita wartość wykonanych transakcji | 95481268.00 |
| Liczba otrzymanych zleceń lub zapytań o kwotowanie, które anulowano lub wycofano | n/a |
| Liczba otrzymanych zleceń lub zapytań o kwotowanie, które zmieniono | 0 |
| Mediana wielkości transakcji | 2780.01 |
| Mediana wielkości wszystkich zleceń lub zapytań o kwotowanie | 2780.01 |
| Liczba wyznaczonych animatorów rynku | 1 |

Tabela 7 – Informacje o prawdopodobieństwie wykonania zlecenia, które publikuje się zgodnie z art. 7 ust. 1

| Czas | Najlepsza cena zakupu | Najlepsza cena sprzedaży | Wielkość oferty zakupu | Wielkość oferty sprzedaży | Głębokość arkusza zleceń dla trzech przyrostów cen |
|----------|-----------------------|--------------------------|------------------------|---------------------------|--|
| 09:30:00 | 3119.65 | 3118.6 | n/a | n/a | n/a |
| 11:30:00 | 3086.9 | 3085.48 | n/a | n/a | n/a |
| 13:30:00 | 3096.03 | 3094.6 | n/a | n/a | n/a |
| 15:30:00 | 3099.15 | 3095.85 | n/a | n/a | n/a |

Tabela 8 – Informacje, które publikuje się zgodnie z art. 7 ust. 2 i 3

| | |
|---|-------------|
| Średni spread efektywny | 0.69 |
| Średni wolumen na poziomie najlepszej oferty zakupu i sprzedaży | 0 |
| Średni spread na poziomie najlepszej oferty zakupu i sprzedaży | 0.7 |
| Liczba zleceń anulowanych na poziomie najlepszej oferty zakupu i sprzedaży | - |
| Liczba zleceń zmienionych na poziomie najlepszej oferty zakupu i sprzedaży | - |
| Średnia głębokość arkusza zleceń dla trzech przyrostów cen | n/a |
| Średnia czasu (z dokładnością do milisekundy), jaki upłynął od otrzymania przez system wykonywania zleceń zlecenia agresywnego lub przyjęcia kwotowania do późniejszego pełnego lub częściowego wykonania | - |
| Mediana czasu (z dokładnością do milisekundy), jaki upłynął od otrzymania przez system wykonywania zleceń zlecenia rynkowego do późniejszego pełnego lub częściowego wykonania | - |
| Średnia szybkość wykonania niezmienionych zleceń pasywnych na poziomie najlepszej oferty zakupu i sprzedaży | - |
| Liczba niezrealizowanych zleceń typu wykonaj albo anuluj (ang. Fill or Kill) | - |
| Liczba zleceń typu wykonaj natychmiast lub anuluj (ang. Immediate or Cancel), które zostały wykonane na poziomie zerowym | - |
| Liczba transakcji wykonanych w systemie obrotu, które są transakcjami o dużej skali na podstawie art. 4 lub 9 rozporządzenia (UE) nr 600/2014 | 124 |
| Wartość transakcji wykonanych w systemie obrotu, które są transakcjami o dużej skali na podstawie art. 4 lub 9 rozporządzenia (UE) nr 600/2014 | 71759140.56 |
| Liczba transakcji wykonanych w systemie obrotu na podstawie art. 4 lub 9 MiFIR, z wyłączeniem zleceń przechowywanych w podsystemie zarządzania zleceniami danego systemu obrotu do czasu ujawnienia i niebędących zleceniami o dużej skali | 2328 |
| Wartość transakcji wykonanych w systemie obrotu na podstawie art. 4 lub 9 MiFIR, z wyłączeniem zleceń przechowywanych w podsystemie zarządzania zleceniami danego systemu obrotu do czasu ujawnienia i niebędących zleceniami o dużej skali | 23722127.49 |
| Liczba przerw w obrocie | - |
| Średni czas trwania przerw w obrocie | - |
| Liczba zawieszeń | - |
| Charakter zawieszeń | - |
| Średni czas trwania zawieszeń | - |
| W przypadku systemów opartych na ciągłym kwotowaniu cen – liczba okresów, w trakcie których nie przedstawiono żadnych kwotowań | - |
| W przypadku systemów opartych na ciągłym kwotowaniu cen – średni czas trwania okresów, w trakcie których nie przedstawiono żadnych kwotowań | - |
| Średnia obecność kwotowania | 100% |

Tabela 9 – Informacje, które publikuje się zgodnie z art. 8

| | |
|---|-----|
| Średnia czasu, jaki upłynął od przyjęcia do wykonania | n/a |
| Mediana czasu, jaki upłynął od przyjęcia do wykonania | n/a |
| Średnia czasu, jaki upłynął od zapytania o kwotowanie do dostarczenia jakichkolwiek odpowiednich kwotowań | n/a |
| Mediana czasu, jaki upłynął od zapytania o kwotowanie do dostarczenia jakichkolwiek odpowiednich kwotowań | n/a |