

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

| | | |
|------------------------------------|-------------------------------------|--|
| System wykonywania zleceń | BOSSAFX (LEI: 2594003MRRL1L5OVRZ44) | |
| Państwo siedziby właściwego organu | Rzeczpospolita Polska | |
| Segment rynku | Market Maker | |
| Data dnia sesyjnego | 2020-12-29 | |
| Przerwy | 0 | |
| Zaplanowana aukcja | intraday; 2; 11:22:30.000000 | |
| Transakcje niezrealizowane | 0 | |

Tabela 2 – Informacje umożliwiające identyfikację, które publikuje się zgodnie z art. 3 ust. 2 – rodzaj instrumentu finansowego

| | |
|---|--|
| Instrument finansowy | 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 (kod CFI ISO 10962) | MMSXXX |
| 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 | n/a | n/a | 3746.23 | 09:35:52 | 3334.72 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3745.53/3746.23 |
| | 2 | n/a | n/a | 3738.85 | 15:54:49 | 99844.67 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3738.15/3738.85 |
| | 3 | n/a | n/a | 3742.4 | 12:25:23 | 149909.20 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3742.4/3743.1 |
| 11:30:00 | 1 | n/a | n/a | 3744.65 | 11:46:40 | 3333.32 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3744.65/3745.35 |
| | 2 | n/a | n/a | 3738.85 | 15:54:49 | 99844.67 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3738.15/3738.85 |
| | 3 | n/a | n/a | 3742.4 | 12:25:23 | 149909.20 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3742.4/3743.1 |
| 13:30:00 | 1 | n/a | n/a | 3744.65 | 13:39:37 | 13333.27 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3744.65/3745.35 |
| | 2 | n/a | n/a | 3738.85 | 15:54:49 | 99844.67 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3738.15/3738.85 |
| | 3 | n/a | n/a | 3732.65 | 15:56:42 | 132905.47 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3732.65/3733.35 |
| 15:30:00 | 1 | 3744.98 | 66679.27 | n/a | n/a | n/a | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | n/a |
| | 2 | n/a | n/a | 3738.85 | 15:54:49 | 99844.67 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3738.15/3738.85 |
| | 3 | n/a | n/a | 3732.65 | 15:56:42 | 132905.47 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 3732.65/3733.35 |

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

| | |
|---|---------|
| Średnia arytmetyczna ceny transakcyjnej | 3730.64 |
| Cena transakcyjna ważona wolumenem | 3734.24 |
| Najwyższa zrealizowana cena | 3747.6 |
| Najniższa zrealizowana cena | 3714.4 |

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 | https://bossafx.pl/oferta/dokumenty |
| Całkowita wartość wszystkich rabatów, upustów lub innych oferowanych płatności (jako % całkowitej wartości obrotu w okresie sprawozdawczym) | 0.000 |
| Całkowita wartość wszystkich kosztów (jako % całkowitej wartości obrotu w okresie sprawozdawczym) | 0.009 |

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

| | |
|--|-------------|
| Liczba otrzymanych zleceń lub zapytań o kwotowanie | 702 |
| Liczba wykonanych transakcji | 695 |
| Całkowita wartość wykonanych transakcji | 12009784.51 |
| Liczba otrzymanych zleceń lub zapytań o kwotowanie, które anulowano lub wycofano | 0 |
| Liczba otrzymanych zleceń lub zapytań o kwotowanie, które zmieniono | 7 |
| Mediana wielkości transakcji | 3330.83 |
| Mediana wielkości wszystkich zleceń lub zapytań o kwotowanie | 3330.74 |
| 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 | 3744.53 | 3744.73 | n/a | n/a | n/a |
| 11:30:00 | 3745.15 | 3745.6 | n/a | n/a | n/a |
| 13:30:00 | 3745.28 | 3745.48 | n/a | n/a | n/a |
| 15:30:00 | 3745.53 | 3743.1 | n/a | n/a | n/a |

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

| | |
|---|------------|
| Średni spread efektywny | 0.68 |
| 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 | 22 |
| Wartość transakcji wykonanych w systemie obrotu, które są transakcjami o dużej skali na podstawie art. 4 lub 9 rozporządzenia (UE) nr 600/2014 | 5042069.42 |
| 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 | 673 |
| 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 | 6967715.05 |
| 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 |