

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	2020-12-04	
Przerwy	0	
Zaplanowana aukcja	intraday; 2; 10:52:30.000000	
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	3676.65	09:32:13	3272.79	system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen	n/a	platforma elektroniczna	3676.65/3677.35
	2	n/a	n/a	3679.1	10:46:26	98249.07	system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen	n/a	platforma elektroniczna	3678.4/3679.1
	3	n/a	n/a	3675.48	10:00:02	327174.65	system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen	n/a	platforma elektroniczna	3674.78/3675.48
11:30:00	1	n/a	n/a	3676.73	11:40:00	3272.86	system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen	n/a	platforma elektroniczna	3676.03/3676.73
	2	n/a	n/a	3686.9	20:27:02	98457.36	system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen	n/a	platforma elektroniczna	3686.9/3687.6
	3	n/a	n/a	3670.03	14:30:01	326689.51	system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen	n/a	platforma elektroniczna	3670.03/3670.73
13:30:00	1	n/a	n/a	3676.4	13:33:07	3272.57	system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen	n/a	platforma elektroniczna	3676.4/3677.1
	2	n/a	n/a	3686.9	20:27:02	98457.36	system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen	n/a	platforma elektroniczna	3686.9/3687.6
	3	n/a	n/a	3670.03	14:30:01	326689.51	system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen	n/a	platforma elektroniczna	3670.03/3670.73
15:30:00	1	3674.82	42524.49	n/a	n/a	n/a	system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen	n/a	platforma elektroniczna	n/a
	2	n/a	n/a	3686.9	20:27:02	98457.36	system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen	n/a	platforma elektroniczna	3686.9/3687.6
	3	n/a	n/a	3682.03	15:42:16	327757.70	system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen	n/a	platforma elektroniczna	3682.03/3682.73

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

Średnia arytmetyczna ceny transakcyjnej	3684.73
Cena transakcyjna ważona wolumenem	3684.21
Najwyższa zrealizowana cena	3698.85
Najniższa zrealizowana cena	3665.53

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)	0.010

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

Liczba otrzymanych zleceń lub zapytań o kwotowanie	824
Liczba wykonanych transakcji	816
Całkowita wartość wykonanych transakcji	11074941.39
Liczba otrzymanych zleceń lub zapytań o kwotowanie, które anulowano lub wycofano	0
Liczba otrzymanych zleceń lub zapytań o kwotowanie, które zmieniono	8
Mediana wielkości transakcji	3286.51
Mediana wielkości wszystkich zleceń lub zapytań o kwotowanie	3286.48
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	3677.4	3677.23	n/a	n/a	n/a
11:30:00	3674.03	3674.1	n/a	n/a	n/a
13:30:00	3677.15	3676.98	n/a	n/a	n/a
15:30:00	3676.53	3672.6	n/a	n/a	n/a

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

Średni spread efektywny	0.67
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	7
Wartość transakcji wykonanych w systemie obrotu, które są transakcjami o dużej skali na podstawie art. 4 lub 9 rozporządzenia (UE) nr 600/2014	2500701.80
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	809
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	8574239.67
Liczba przerw w obrocie	-
Średni czas trwania przerw w obrocie	-
Liczba zawiesznień	-
Charakter zawiesznień	-
Średni czas trwania zawiesznień	-
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