

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

| | | |
|------------------------------------|-------------------------------------|--|
| System wykonywania zleceń | BOSSAFX (LEI: 2594003MRR1L15OVRZ44) | |
| Państwo siedziby właściwego organu | Rzeczpospolita Polska | |
| Segment rynku | Market Maker | |
| Data dnia sesyjnego | 2021-03-04 | |
| Przerwy | 0 | |
| Zaplanowana aukcja | intraday; 1; 09:15:00.000000 | |
| Transakcje niezrealizowane | 0 | |

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

| | |
|---|--|
| Instrument finansowy | FCOFFEE. |
| Pisemny opis instrumentu finansowego, jeżeli identyfikator nie jest dostępny (w tym waluta instrumentu bazowego, mnożnik ceny, oznaczenie ceny, oznaczenie ilości i rodzaj dostawy) | Kontrakt na różnicę (CFD) notowań futures na kawę notowany na giełdzie ICE, 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 kawę notowany na giełdzie ICE z chwili otwarcia kontraktu a kursem kontraktu futures na kawę notowany na giełdzie ICE z chwili zamknięcia kontraktu. Jeżeli różnica jest ujemna wtedy klient zapłaci różnicę dostawcy. Kontrakt opiera się na mnożniku w wysokości 375. 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. |
| 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 | 133.8 | 10:28:38 | 1226.67 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 133.4/133.8 |
| | 2 | n/a | n/a | n/a | n/a | n/a | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | n/a |
| | 3 | n/a | n/a | 131.35 | 16:29:15 | 200701.86 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 130.95/131.35 |
| 11:30:00 | 1 | n/a | n/a | 133.25 | 12:03:29 | 8144.20 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 132.85/133.25 |
| | 2 | n/a | n/a | n/a | n/a | n/a | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | n/a |
| | 3 | n/a | n/a | 131.35 | 16:29:15 | 200701.86 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 130.95/131.35 |
| 13:30:00 | 1 | n/a | n/a | 133.4 | 13:32:33 | 4076.68 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 133/133.4 |
| | 2 | n/a | n/a | n/a | n/a | n/a | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | n/a |
| | 3 | n/a | n/a | 131.35 | 16:29:15 | 200701.86 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 130.95/131.35 |
| 15:30:00 | 1 | n/a | n/a | 131.55 | 15:44:00 | 8040.30 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 131.55/131.95 |
| | 2 | n/a | n/a | n/a | n/a | n/a | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | n/a |
| | 3 | n/a | n/a | 131.35 | 16:29:15 | 200701.86 | system transakcyjny oparty na ciągłym kwotowaniu cen | n/a | platforma elektroniczna | 130.95/131.35 |

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

| | |
|---|--------|
| Średnia arytmetyczna ceny transakcyjnej | 131.95 |
| Cena transakcyjna ważona wolumenem | 131.69 |
| Najwyższa zrealizowana cena | 133.8 |
| Najniższa zrealizowana cena | 130.85 |

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) | 0.152 |

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

| | |
|--|-----------|
| Liczba otrzymanych zleceń lub zapytań o kwotowanie | 33 |
| Liczba wykonanych transakcji | 33 |
| Całkowita wartość wykonanych transakcji | 367844.10 |
| Liczba otrzymanych zleceń lub zapytań o kwotowanie, które anulowano lub wycofano | 0 |
| Liczba otrzymanych zleceń lub zapytań o kwotowanie, które zmieniono | 0 |
| Mediana wielkości transakcji | 2036.81 |
| Mediana wielkości wszystkich zleceń lub zapytań o kwotowanie | 2036.81 |
| 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 | b.d. | b.d. | n/a | n/a | n/a |
| 11:30:00 | 133.25 | 133.6 | n/a | n/a | n/a |
| 13:30:00 | 133.05 | 133.35 | n/a | n/a | n/a |
| 15:30:00 | 132.05 | 132.25 | n/a | n/a | n/a |

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

| | |
|---|-----------|
| Średni spread efektywny | 0.4 |
| Średni wolumen na poziomie najlepszej oferty zakupu i sprzedaży | 0 |
| Średni spread na poziomie najlepszej oferty zakupu i sprzedaży | 0.4 |
| 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 | 1 |
| Wartość transakcji wykonanych w systemie obrotu, które są transakcjami o dużej skali na podstawie art. 4 lub 9 rozporządzenia (UE) nr 600/2014 | 200701.86 |
| 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 | 32 |
| 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 | 167142.25 |
| 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 |