

Informacja na temat systemów wykonywania zleceń oraz jakości wykonywania zleceń za 2024

Zgodnie z wymogiem Rozporządzenia Delegowanego Komisji (UE) 2017/576 z dnia 8 czerwca 2016 r. uzupełniającego dyrektywę Parlamentu Europejskiego i Rady 2014/65/UE w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych dotyczących podawania co roku do wiadomości publicznej przez firmy inwestycyjne informacji o tożsamości systemów wykonywania zleceń i jakości wykonywania zleceń Biuro Maklerskie Alior Bank S.A. przedstawia poniższe informacje.

Informacja na temat pięciu najlepszych systemów wykonywania zleceń – klienci detaliczni

Kategoria instrumentu	Instrumenty udziałowe – akcje i kwity depozytowe Pasma wahań płynności dla minimalnej zmiany ceny od 2 000 transakcji dziennie				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	Nie				
Pięć najlepszych systemów wykonywania zleceń uszeregowanych pod względem wolumenu obrotu (malejąco)	Udział wolumenu obrotu jako odsetek całkowitego wolumenu w tej kategorii	Udział wykonanych zleceń jako odsetek całkowitej liczby zleceń w tej kategorii	Odsetek zleceń pasywnych	Odsetek zleceń agresywnych	Odsetek zleceń ukierunkowanych
GPW-Główny Rynek (MIC: XWAR)	100%	99,85%	64%	36%	100%
GlobalConnect (MIC: XGLO)	0%	0,15%	76%	24%	100%

Kategoria instrumentu	Instrumenty udziałowe – akcje i kwity depozytowe Pasma wahań płynności dla minimalnej zmiany ceny od 80 do 1 999 transakcji dziennie				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	Nie				
Pięć najlepszych systemów wykonywania zleceń uszeregowanych pod względem wolumenu obrotu (malejąco)	Udział wolumenu obrotu jako odsetek całkowitego wolumenu w tej kategorii	Udział wykonanych zleceń jako odsetek całkowitej liczby zleceń w tej kategorii	Odsetek zleceń pasywnych	Odsetek zleceń agresywnych	Odsetek zleceń ukierunkowanych
GPW-Główny Rynek (MIC: XWAR)	74,14%	93,71%	62%	38%	100%
GPW-NewConnect (MIC: XNCO)	25,86%	6,27%	63%	37%	100%
GlobalConnect (MIC: XGLO)	0 %	0,02%	77%	23%	100%

Kategoria instrumentu	Instrumenty udziałowe – akcje i kwity depozytowe Pasma wahań płynności dla minimalnej zmiany ceny od 0 do 79 transakcji dziennie				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	Nie				
Pięć najlepszych systemów wykonywania zleceń uszeregowanych pod względem wolumenu obrotu (malejąco)	Udział wolumenu obrotu jako odsetek całkowitego wolumenu w tej kategorii	Udział wykonanych zleceń jako odsetek całkowitej liczby zleceń w tej kategorii	Odsetek zleceń pasywnych	Odsetek zleceń agresywnych	Odsetek zleceń ukierunkowanych
GPW-NewConnect (MIC: XNCO)	72,97%	56,10%	58%	42%	100%
GPW-Główny Rynek (MIC: XWAR)	27,03%	43,90%	60%	40%	100%

Kategoria instrumentu	Instrumenty dłużne Obligacje				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	Nie				
Pięć najlepszych systemów wykonywania zleceń uszeregowanych pod względem wolumenu obrotu (malejąco)	Udział wolumenu obrotu jako odsetek całkowitego wolumenu w tej kategorii	Udział wykonanych zleceń jako odsetek całkowitej liczby zleceń w tej kategorii	Odsetek zleceń pasywnych	Odsetek zleceń agresywnych	Odsetek zleceń ukierunkowanych
GPW-Catalyst-Główny Rynek (MIC: WBON)	78,30%	58,43%	48%	52%	100%
GPW-Catalyst-Alternatywny System Obrotu (MIC: WMTF)	21,70%	41,57%	42%	58%	100%

Kategoria instrumentu	Walutowe instrumenty pochodne Kontrakty terminowe typu futures i opcje dopuszczone do obrotu w systemie obrotu				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	Nie				
Pięć najlepszych systemów wykonywania zleceń uszeregowanych pod względem wolumenu obrotu (malejąco)	Udział wolumenu obrotu jako odsetek całkowitego	Udział wykonanych zleceń jako odsetek całkowitej	Odsetek zleceń pasywnych	Odsetek zleceń agresywnych	Odsetek zleceń ukierunkowanych

	wolumenu w tej kategorii	liczby zleceń w tej kategorii			
GPW (MIC: WDER)	100%	100%	65%	35%	100%

Kategoria instrumentu	Instrumenty pochodne na akcje Opcje i kontrakty terminowe typu futures dopuszczone do obrotu w systemie obrotu				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	Nie				
Pięć najlepszych systemów wykonywania zleceń uszeregowanych pod względem wolumenu obrotu (malejąco)	Udział wolumenu obrotu jako odsetek całkowitego wolumenu w tej kategorii	Udział wykonanych zleceń jako odsetek całkowitej liczby zleceń w tej kategorii	Odsetek zleceń pasywnych	Odsetek zleceń agresywnych	Odsetek zleceń ukierunkowanych
GPW (MIC: WDER)	100%	100%	63%	37%	100%

Kategoria instrumentu	Produkty będące przedmiotem obrotu giełdowego (fundusze inwestycyjne typu ETF, giełdowe papiery wartościowe i towary będące przedmiotem obrotu giełdowego)				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	Nie				
Pięć najlepszych systemów wykonywania zleceń uszeregowanych pod względem wolumenu obrotu (malejąco)	Udział wolumenu obrotu jako odsetek całkowitego wolumenu w tej kategorii	Udział wykonanych zleceń jako odsetek całkowitej liczby zleceń w tej kategorii	Odsetek zleceń pasywnych	Odsetek zleceń agresywnych	Odsetek zleceń ukierunkowanych
GPW (MIC: WETP)	100%	100%	59%	41%	100%

Kategoria instrumentu	Inne instrumenty (PDA, PP, certyfikaty inwestycyjne)				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	Tak				
Pięć najlepszych systemów wykonywania zleceń uszeregowanych pod względem wolumenu obrotu (malejąco)	Udział wolumenu obrotu jako odsetek całkowitego wolumenu w tej kategorii	Udział wykonanych zleceń jako odsetek całkowitej liczby zleceń w tej kategorii	Odsetek zleceń pasywnych	Odsetek zleceń agresywnych	Odsetek zleceń ukierunkowanych

GPW-Główny Rynek (MIC: XWAR)	100%	100%	47%	53%	100%
---------------------------------	------	------	-----	-----	------

Kategoria instrumentu	Inne instrumenty (Produkty strukturyzowane)				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	Nie				
Pięć najlepszych systemów wykonywania zleceń uszeregowanych pod względem wolumenu obrotu (malejąco)	Udział wolumenu obrotu jako odsetek całkowitego wolumenu w tej kategorii	Udział wykonanych zleceń jako odsetek całkowitej liczby zleceń w tej kategorii	Odsetek zleceń pasywnych	Odsetek zleceń agresywnych	Odsetek zleceń ukierunkowanych
GPW (MIC: WETP)	100%	100%	95%	5%	100%

Kategoria instrumentu	Inne instrumenty (Kontrakty terminowe na indeksy, opcje na indeksy)				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	Nie				
Pięć najlepszych systemów wykonywania zleceń uszeregowanych pod względem wolumenu obrotu (malejąco)	Udział wolumenu obrotu jako odsetek całkowitego wolumenu w tej kategorii	Udział wykonanych zleceń jako odsetek całkowitej liczby zleceń w tej kategorii	Odsetek zleceń pasywnych	Odsetek zleceń agresywnych	Odsetek zleceń ukierunkowanych
GPW (MIC: WDER)	100%	100%	66%	34%	100%

Kategoria instrumentu	Sekurytyzowane instrumenty pochodne (Warranty i certyfikaty)				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	Tak				
Pięć najlepszych systemów wykonywania zleceń uszeregowanych pod względem wolumenu obrotu (malejąco)	Udział wolumenu obrotu jako odsetek całkowitego wolumenu w tej kategorii	Udział wykonanych zleceń jako odsetek całkowitej liczby zleceń w tej kategorii	Odsetek zleceń pasywnych	Odsetek zleceń agresywnych	Odsetek zleceń ukierunkowanych
GPW (MIC: WETP)	100%	100%	100%	0%	100%

Kategoria instrumentu	Kontrakty różnic kursowych				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	Nie				
Pięć najlepszych systemów wykonywania zleceń uszeregowanych pod względem wolumenu obrotu (malejąco)	Udział wolumenu obrotu jako odsetek całkowitego wolumenu w tej kategorii	Udział wykonanych zleceń jako odsetek całkowitej liczby zleceń w tej kategorii	Odsetek zleceń pasywnych	Odsetek zleceń agresywnych	Odsetek zleceń ukierunkowanych
X-Trade Brokers DM S.A. LEI: 259400AVUPSABLEXNT19	99.99%	99.99%	0%	100%	0%
Stonex Financial LTD LEI: 549300AWF3TOHRYL7754	0.01%	0.01%	0%	100%	0%

Kategoria instrumentu	Swapy, kontrakty terminowe typu forward oraz inne walutowe kontrakty różnic kursowych				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	Nie				
Pięć najlepszych systemów wykonywania zleceń uszeregowanych pod względem wolumenu obrotu (malejąco)	Udział wolumenu obrotu jako odsetek całkowitego wolumenu w tej kategorii	Udział wykonanych zleceń jako odsetek całkowitej liczby zleceń w tej kategorii	Odsetek zleceń pasywnych	Odsetek zleceń agresywnych	Odsetek zleceń ukierunkowanych
Deutsche Bank LEI: 7LTWFZYICNSX8D621K86	35,37%	31,92%	0%	100%	0%
UBS LEI: BFM8T61CT2L1QCEMIK50	29,01%	28,25%	0%	100%	0%
Standard Chartered LEI: RILFO74KP1CM8P6PCT96	13,98%	17,78%	0%	100%	0%
XTX MARKETS LIMITED LEI: 213800WPTIY9961G2O04	12,86%	12,86%	0%	100%	0%
The Royal Bank of Scotland LEI: 549300WHU4EIHRP28H10	7,00%	7,69%	0%	100%	0%

Informacja na temat pięciu najlepszych systemów wykonywania zleceń – klienci detaliczni – rynki zagraniczne

Kategoria instrumentu	Instrumenty udziałowe – akcje i kwity depozytowe Pasma wahań płynności dla minimalnej zmiany ceny od 2 000 transakcji dziennie				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	Nie				
Pięc najlepszych systemów wykonywania zleceń uszeregowanych pod względem wolumenu obrotu (malejąco)	Udział wolumenu obrotu jako odsetek całkowitego wolumenu w tej kategorii	Udział wykonanych zleceń jako odsetek całkowitej liczby zleceń w tej kategorii	Odsetek zleceń pasywnych	Odsetek zleceń agresywnych	Odsetek zleceń ukierunkowanych
CITADEL SECURITIES (MIC: CDED)	22,12%	17,32%	60%	40%	0%
NYSE ARCA (MIC: ARCX)	13,68%	22,15%	94%	6%	0%
LEVEL ATS (MIC: LEVL)	10,78%	13,63%	62%	38%	0%
NASDAQ (MIC: XNAS)	9,24%	9,44%	95%	5%	0%
J.P. MORGAN SE (MIC: JPEU)	7,94%	3,06%	45%	55%	0%

Kategoria instrumentu	Instrumenty udziałowe – akcje i kwity depozytowe Pasma wahań płynności dla minimalnej zmiany ceny od 80 do 1 999 transakcji dziennie				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	Tak				
Pięc najlepszych systemów wykonywania zleceń uszeregowanych pod względem wolumenu obrotu (malejąco)	Udział wolumenu obrotu jako odsetek całkowitego wolumenu w tej kategorii	Udział wykonanych zleceń jako odsetek całkowitej liczby zleceń w tej kategorii	Odsetek zleceń pasywnych	Odsetek zleceń agresywnych	Odsetek zleceń ukierunkowanych
EURONEXT - EURONEXT AMSTERDAM (MIC: XAMS)	65,99%	44,20%	81%	19%	0%
J.P. MORGAN SE (MIC: JPEU)	11,70%	11,82%	56%	44%	0%
XETRA (MIC: XETR)	6,21%	7,50%	84%	16%	0%
LEVEL ATS (MIC: LEVL)	3,33%	3,86%	62%	38%	0%
CBOE EUROPE - DXE ORDER BOOKS (NL) (MIC: CEUX)	2,84%	7,95%	78%	22%	0%

Kategoria instrumentu	Instrumenty udziałowe – akcje i kwity depozytowe Pasma wahań płynności dla minimalnej zmiany ceny od 0 do 79 transakcji dziennie				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	Nie				
Pięć najlepszych systemów wykonywania zleceń uszeregowanych pod względem wolumenu obrotu (malejąco)	Udział wolumenu obrotu jako odsetek całkowitego wolumenu w tej kategorii	Udział wykonanych zleceń jako odsetek całkowitej liczby zleceń w tej kategorii	Odsetek zleceń pasywnych	Odsetek zleceń agresywnych	Odsetek zleceń ukierunkowanych
CITADEL SECURITIES (MIC: CDED)	60,50%	41,42%	54%	46%	0%
NYSE ARCA (MIC: ARCX)	8,73%	12,66%	91%	9%	0%
NASDAQ (MIC: XNAS)	8,17%	6,86%	87%	13%	0%
CBOE EDGX U.S. EQUITIES EXCHANGE (MIC: EDGX)	5,24%	4,62%	87%	13%	0%
LEVEL ATS (MIC: LEVL)	5,20%	9,63%	64%	36%	0%

Kategoria instrumentu	Produkty będące przedmiotem obrotu giełdowego (fundusze inwestycyjne typu ETF, giełdowe papiery wartościowe i towary będące przedmiotem obrotu giełdowego)				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	Nie				
Pięć najlepszych systemów wykonywania zleceń uszeregowanych pod względem wolumenu obrotu (malejąco)	Udział wolumenu obrotu jako odsetek całkowitego wolumenu w tej kategorii	Udział wykonanych zleceń jako odsetek całkowitej liczby zleceń w tej kategorii	Odsetek zleceń pasywnych	Odsetek zleceń agresywnych	Odsetek zleceń ukierunkowanych
LONDON STOCK EXCHANGE (MIC: XLON)	42,92%	44,47%	79%	21%	0%
J.P. MORGAN SE (MIC: JPEU)	38,89%	28,67%	54%	46%	0%
TRADEWEB EUROPE LIMITED (MIC: TREU)	10,58%	0,11%	100%	0%	0%
XETRA (MIC: XETR)	3,82%	4,70%	79%	21%	0%
EURONEXT MILAN (MIC: MTA)	1,46%	9,52%	78%	22%	0%

III. Informacja na temat jakości wykonywania zleceń

1. Wyjaśnienie względnego znaczenia, jakie firma nadała czynnikom wykonywania zleceń obejmującym cenę, koszty, szybkość, prawdopodobieństwo wykonania zlecenia lub wszelkiego rodzaju inne aspekty, w tym czynniki jakościowe, przy ocenie jakości wykonywania zleceń.

Przy ocenie jakości wykonywania zleceń Biuro Maklerskie uwzględnia: cenę instrumentu finansowego, koszty związane z wykonaniem zlecenia, czas zawarcia transakcji, prawdopodobieństwo zawarcia transakcji, prawdopodobieństwo rozliczenia transakcji, wielkość zlecenia, charakter zlecenia. Czynnikiem o podstawowym znaczeniu są cena instrumentu finansowego i koszty związane z wykonaniem zlecenia.

2. Opis wszelkich bliskich powiązań, konfliktów interesów i wspólnej własności w odniesieniu do wszelkich systemów wykonywania zleceń stosowanych do wykonywania zleceń.

Biuro Maklerskie nie jest blisko powiązane, nie posiada wspólnej własności oraz nie zidentyfikowało konfliktów interesów w odniesieniu do systemów wykonywania zleceń stosowanych do wykonywania zleceń Klientów.

3. Opis wszelkich szczególnych uzgodnień z dowolnymi systemami wykonywania zleceń w odniesieniu do dokonanych lub otrzymanych płatności, zniżek, rabatów lub otrzymanych korzyści niepieniężnych.

Biuro Maklerskie nie dokonywało uzgodnień z systemami wykonywania zleceń w odniesieniu do dokonanych lub otrzymanych płatności, zniżek, rabatów lub otrzymanych korzyści niepieniężnych.

4. Wyjaśnienie czynników, które doprowadziły do zmiany wykazu systemów wykonywania zleceń zawartego w strategii wykonywania zleceń firmy, gdyby taka zmiana nastąpiła.

W 2024 roku Biuro Maklerskie modyfikowało listę podmiotów, w których wykonywane są zlecenia Klientów kupna lub sprzedaży instrumentów finansowych w obrocie na rynkach zagranicznych. Modyfikacje wynikały ze zmian w zakresie listy podmiotów, w których mogą być wykonywane zlecenia kupna lub sprzedaży instrumentów finansowych przez Brokera zagranicznego, przy udziale którego Biuro Maklerskie wykonuje zlecenia Klientów.

5. Wyjaśnienie, w jaki sposób wykonanie zlecenia zależne jest od kategorii klientów, w przypadku gdy firma w różny sposób obsługuje różne kategorie klientów oraz gdy może to wpłynąć na uzgodnienia dotyczące wykonywania zleceń.

Sposób wykonania zleceń przez Biuro Maklerskie nie jest zależny od kategorii, do której należy Klient.

6. Wyjaśnienie, czy w przypadku wykonywania zleceń klientów detalicznych pierwszeństwo nadano innym kryteriom niż bezpośrednia cena i koszt, oraz w jaki sposób te inne kryteria były pomocne w osiągnięciu możliwie najlepszego wyniku dla klienta pod względem całkowitego wynagrodzenia.

Biuro Maklerskie nie nadało pierwszeństwa innym kryteriom niż bezpośrednia cena i koszt związany z wykonaniem zlecenia.

7. Wyjaśnienie, w jaki sposób firma inwestycyjna zastosowała ewentualne dane lub narzędzia dotyczące jakości wykonywania zleceń, w tym wszelkie dane opublikowane zgodnie z rozporządzeniem delegowanym (UE) 2017/575.

Biuro Maklerskie nie wykorzystywało danych i narzędzi dotyczących jakości wykonywania zleceń, w tym danych publikowanych zgodnie z rozporządzeniem delegowanym (UE) 2017/575.

8. Wyjaśnienie, w jaki sposób firma inwestycyjna wykorzystwała informacje udostępniane przez dostawcę informacji skonsolidowanych (CTP) w rozumieniu art. 65 dyrektywy 2014/65/UE.

Biuro Maklerskie nie wykorzystywało informacji udostępnianych przez dostawcę informacji skonsolidowanych (CTP) w rozumieniu art. 65 dyrektywy 2014/65/UE.