

Informacja na temat systemów wykonywania zleceń oraz jakości wykonywania zleceń za 2020 r.



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.

**I. Informacja na temat pięciu najlepszych systemów wykonywania zleceń – klienci detaliczni**

Kategoria instrumentu	<b>Instrumenty udziałowe – akcje i kwity depozytowe</b> 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 LEI: 25940039ZHD3Z37GKR71	100%	71	63	37	100%

Kategoria instrumentu	<b>Instrumenty udziałowe – akcje i kwity depozytowe</b> 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 LEI: 25940039ZHD3Z37GKR71	100%	68	60	40	100%

Kategoria instrumentu	<b>Instrumenty udziałowe – akcje i kwity depozytowe</b> 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 LEI: 25940039ZHD3Z37GKR71	100%	61	57	43	100%

Kategoria instrumentu	<b>Instrumenty dłużne</b> 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 LEI: 25940039ZHD3Z37GKR71	100%	57	42	58	100%

Kategoria instrumentu	<b>Walutowe instrumenty pochodne</b> Kontrakty terminowe typu future 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 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 LEI: 25940039ZHD3Z37GKR71	100%	73	64	36	100%

Kategoria instrumentu	<b>Instrumenty pochodne na akcje</b> Opcje i kontrakty terminowe typu future 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 LEI: 25940039ZHD3Z37GKR71	100%	70	64	36	100%

Kategoria instrumentu	<b>Produkty będące przedmiotem obrotu giełdowego (fundusze inwestycyjne typu ETF, giełdowe papiery wartościowe i towary będące przedmiotem obrotu giełdowego)</b>				
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 LEI: 25940039ZHD3Z37GKR71	100%	70	47	53	100%

<b>Kategoria instrumentu</b>	<b>Inne instrumenty (PDA)</b>				
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 LEI: 25940039ZHD3Z37GKR71	100%	67	62	38	100%

<b>Kategoria instrumentu</b>	<b>Inne instrumenty (Prawa poboru)</b>				
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 LEI: 25940039ZHD3Z37GKR71	-	-	0	0	-

<b>Kategoria instrumentu</b>	<b>Inne instrumenty (Certyfikaty inwestycyjne bez ETF, Produkty strukturyzowane)</b>				
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 LEI: 25940039ZHD3Z37GKR71	100%	65	46	54	100%

<b>Kategoria instrumentu</b>	<b>Inne instrumenty (Kontrakty terminowe na indeksy)</b>				
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 LEI: 25940039ZHD3Z37GKR71	100%	72	67	33	100%

<b>Kategoria instrumentu</b>	<b>Inne instrumenty (Opcje na indeksy)</b>				
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 LEI: 25940039ZHD3Z37GKR71	100%	58	44	56	100%
<b>Kategoria instrumentu</b>					
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
GAIN CAPITAL UK LIMITED LEI: 549300NKG8WR6UWSZS80	94,28%	94,28%	0%	100%	0%
X-Trade Brokers DM S.A. LEI: 259400AVUPSABLEXNT19	5,72%	5,72%	0%	100%	0%

<b>Kategoria instrumentu</b>		<b>Swapy, kontrakty terminowe typu forward oraz inne walutowe instrumenty pochodne</b>			
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
UBS LEI: BFM8T61CT2L1QCCEMIK50	23,07%	18,78%	0%	100%	0%
Deutsche Bank LEI: 7LTFWZYICNSX8D621K86	19,90%	17,58%	0%	100%	0%
Standard Chartered LEI: RILFO74KP1CM8P6PCT96	19,67%	17,97%	0%	100%	0%
BNP Paribas LEI: ROMUWSFPU8MPRO8K5P83	14,74%	10,56%	0%	100%	0%
RBS LEI: RR3QWICWWIPCS8A4S074	13,49%	11,06%	0%	100%	0%

## II. Informacja na temat jakości wykonywania zleceń

- 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.

- 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 2020 roku wykaz systemów wykonywania zleceń na rynkach OTC został pomniejszony o jeden podmiot w związku z rezygnacją tego podmiotu ze świadczenia usług w zakresie płynności na rynku walutowym.

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.