



Komunikat nr 22/DM/DRPiKO/2018

z dnia 30.04.2018 r.

w sprawie informacji o systemach wykonywania zleceń i jakości wykonywania zleceń za rok 2017

Na podstawie *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 („Rozporządzenie”), Dom Maklerski Pekao przedstawia poniższe informacje.*

§ 1

1. Informację na temat pięciu najlepszych pod względem wolumenu obrotu systemów wykonywania zleceń oraz uzyskanej jakości wykonywania zleceń klientów detalicznych w 2017 r. zawiera załącznik do niniejszego Komunikatu.
2. Dom Maklerski Pekao informuje, że zlecenia, których przedmiotem są zagraniczne instrumenty finansowe notowane na rynkach zagranicznych są wykonywane za pośrednictwem Brokerów, których lista została Podana Do Wiadomości Klientów.

§ 2

Informacja na temat pięciu najlepszych pod względem wolumenu obrotu systemów wykonywania zleceń oraz uzyskanej jakości wykonywania zleceń klientów profesjonalnych w 2017 r.:

Na podstawie Polityki klasyfikowania i reklasyfikowania Klienta w Domu Maklerskim Pekao, wszyscy Klienci są traktowani jako klienci detaliczni.

§ 3

Informacja na temat pięciu najlepszych pod względem wolumenu obrotu systemów wykonywania zleceń dotyczących transakcji finansowania z użyciem papierów wartościowych w 2017 r.

Dom Maklerski Pekao nie wykonuje zleceń dotyczących transakcji finansowania z użyciem papierów wartościowych.

§ 4

W wyniku przeprowadzonego monitorowania uzyskanej jakości wykonywania zleceń w systemach wykonywania zleceń Klientów za rok 2017, Dom Maklerski Pekao przedstawia następujące informacje:

Bank Pekao S.A.
Dom Maklerski Pekao

ul. Wołoska 18
02-675 Warszawa
www.dm.pekao.com.pl



Bank Pekao

Dom Maklerski

- a) Czynniki wykonywania zleceń obejmujące cenę, koszty, szybkość i prawdopodobieństwo wykonania zlecenia zostały uwzględnione według istotności, zgodnie z ustanowioną *Polityką wykonywania zleceń w Domu Maklerskim Pekao („Polityka”)*,
- b) Dom Maklerski Pekao nie ma bliskich powiązań, konfliktów interesu ani wspólnej własności z systemami wykonywania zleceń stosowanych do wykonywania zleceń,
- c) Dom Maklerski Pekao nie prowadzi uzgodnień z systemami wykonywania zleceń w zakresie dokonanych lub otrzymanych płatności, zniżek, rabatów lub korzyści niepieniężnych,
- d) Nie nastąpiła zmiana wykazu systemów wykonywania zleceń zawartego w *Polityce*,
- e) Sposób wykonania zlecenia nie jest uzależniony od kategorii Klientów, ponieważ Dom Maklerski Pekao wszystkich Klientów traktuje jak klientów detalicznych,
- f) W przypadku wykonywania zleceń klientów detalicznych stosowano kryterium ceny i kosztu, zgodnie z postanowieniami *Polityki*; w przypadku instrumentów finansowych notowanych w na terenie Polski w więcej niż jednym systemie obrotu – ma zastosowanie pkt. 10 *Polityki* oraz kryterium ceny i kosztu; w przypadku instrumentów finansowych notowanych zarówno na terenie Polski jak i w systemie obrotu w innym kraju – zastosowanie ma pkt. 12 *Polityki* oraz kryterium ceny i kosztu,
- g) Dom Maklerski Pekao nie zastosował danych ani narzędzi dotyczących jakości wykonywania zleceń publikowanych zgodnie z rozporządzeniem delegowanym (UE) 2017/575 z uwagi na brak ich publikacji na dzień sporządzenia niniejszej informacji,
- h) Dom Maklerski Pekao nie wykorzystał informacji udostępnianych przez dostawcę informacji skonsolidowanych (CTP) w rozumieniu art. 65 dyrektywy 2014/65/UE z uwagi na brak ich publikacji na dzień sporządzenia niniejszej informacji.

Piotr Kozłowski

**Dyrektor
Domu Maklerskiego Pekao**

Bank Pekao S.A.
Dom Maklerski Pekao

ul. Wołoska 18
02-675 Warszawa
www.dm.pekao.com.pl



Załącznik do Komunikatu nr 22/DM/DRPIKO/2018 z dnia 30.04.2018 r.

a) Instrumenty udziałowe – akcje i kwity depozytowe

(i) Pasma wahań płynności dla minimalnej zmiany ceny 5 i 6 (od 2000 transakcji dziennie)

kategoria instrumentu	Instrumenty udziałowe - akcje i kwity depozytowe (i) Pasma wahań płynności dla minimalnej zmiany ceny 5 i 6 (od 2000 transakcji dziennie)				
	N				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	N				
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
WARSAW STOCK EXCHANGE/EQUITIES/MAIN MARKET (XWAR)	99,1904%	99,3817%	59,7869%	40,1924%	0%
WARSAW STOCK EXCHANGE/ EQUITIES/NEW CONNECT-MTF (XNCO)	0,6706%	0,1942%	38,0282%	61,9718%	0%
ELECTRONIC SHARE MARKET (MTAA)	0,0846%	0,3775%	0,0000%	0,0000%	100%
WIENER BOERSE AG (XWBO)	0,0453%	0,0205%	0,0000%	0,0000%	0%
LONDON STOCK EXCHANGE (XLON)	0,0037%	0,0068%	0,0000%	0,0000%	0%



(ii) Pasma wahań płynności dla minimalnej zmiany ceny 3 i 4 (od 80 do 1999 transakcji dziennie)

kategoria instrumentu	Instrumenty udziałowe - akcje i kwity depozytowe (ii) Pasma wahań płynności dla minimalnej zmiany ceny 3 i 4 (od 80 do 1999 transakcji dziennie)				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	N				
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
WARSAW STOCK EXCHANGE/EQUITIES/MAIN MARKET (XWAR)	94,8416%	95,8669%	54,6821%	45,1387%	0%
WARSAW STOCK EXCHANGE/ EQUITIES/NEW CONNECT-MTF (XNCO)	5,1501%	4,1122%	44,4214%	55,4845%	0%
WIENER BOERSE AG (XWBO)	0,0066%	0,0139%	0,0000%	0,0000%	0%
OSLO BORS ASA (XOSL)	0,0016%	0,0008%	0,0000%	0,0000%	100%
SIX SWISS EXCHANGE (XSWX)	0,0001%	0,0062%	0,0000%	0,0000%	0%



(iii) Pasma wahań płynności dla minimalnej zmiany ceny 1 i 2 (od 0 do 79 transakcji dziennie)

kategoria instrumentu	Instrumenty udziałowe - akcje i kwity depozytowe (iii) Pasma wahań płynności dla minimalnej zmiany ceny 1 i 2 (od 0 do 79 transakcji dziennie)				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	N				
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
WARSAW STOCK EXCHANGE/ EQUITIES/NEW CONNECT-MTF (XNCO)	60,9020%	27,1781%	43,3592%	56,5558%	0%
WARSAW STOCK EXCHANGE/EQUITIES/MAIN MARKET (XWAR)	38,9072%	71,5038%	51,8204%	48,0158%	0%
WARSAW STOCK EXCHANGE - IPO BOOK BUILDING - LISTED INSTRUMENTS (WIPO)	0,1822%	1,3116%	0,0000%	0,0000%	0%
OSLO BORS ASA (XOSL)	0,0084%	0,0033%	0,0000%	0,0000%	0%
XETRA (XETR)	0,0003%	0,0033%	0,0000%	0,0000%	100%

b) Instrumenty dłużne

(i) Obligacje

kategoria instrumentu	Instrumenty dłużne (i) Obligacje				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	N				
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
WARSAW STOCK EXCHANGE/BONDS/CATALYST/MTF (WMTF)	59,1452%	59,2749%	95,4128%	4,3833%	0%
WARSAW STOCK EXCHANGE/BONDS/CATALYST/MAIN MARKET (WBON)	38,5915%	38,6103%	97,3396%	2,1909%	0%
WARSAW STOCK EXCHANGE - IPO BOOK BUILDING - LISTED INSTRUMENTS (WIPO)	2,2634%	2,1148%	0,0000%	0,0000%	0%

(ii) instrumenty rynku pieniężnego

Dom Maklerski Pekao nie prowadzi obrotu wskazaną kategorią instrumentów finansowych

Bank Pekao S.A.
Dom Maklerski Pekao

ul. Wołoska 18
02-675 Warszawa
www.dm.pekao.com.pl



Bank Pekao

Dom Maklerski

c) Instrumenty pochodne na stopę procentową

- (i) Kontrakty terminowe typu future i opcje dopuszczone do obrotu w systemie obrotu
- (ii) swapy, kontrakty terminowe typu forward i opcje dopuszczone do obrotu w systemie obrotu

Dom Maklerski Pekao nie prowadzi obrotu wskazaną kategorią instrumentów finansowych

d) Kredytowe instrumenty pochodne

- (i) kontrakty terminowe typu future i opcje dopuszczone do obrotu w systemie obrotu
- (ii) inne kredytowe instrumenty pochodne

Dom Maklerski Pekao nie prowadzi obrotu wskazaną kategorią instrumentów finansowych



Bank Pekao S.A.
Dom Maklerski Pekao

ul. Wołoska 18
02-675 Warszawa
www.dm.pekao.com.pl

Bank Polska Kasa Opieki Spółka Akcyjna z siedzibą w Warszawie, ul. Grzybowska 53/57, 00-950 Warszawa, wpisany do rejestru przedsiębiorców w Sądzie Rejonowym dla m.st. Warszawy w Warszawie, XII Wydział Gospodarczy Krajowego Rejestru Sądowego, KRS: 0000014843, NIP: 526-00-06-841, REGON: 000010205, wysokość kapitału zakładowego i kapitału wpłaconego: 262 470 034 zł.



e) **Walutowe instrumenty pochodne**

(i) Kontrakty terminowe typu future i opcje dopuszczone do obrotu w systemie obrotu

kategoria instrumentu	walutowe instrumenty pochodne (i) 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	N				
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
WARSAW STOCK EXCHANGE/FINANCIAL DERIVATIVES (WDER)	100,0000%	100,0000%	51,3279%	48,6432%	0%

(ii) swapy, kontrakty terminowe typu forward oraz inne walutowe instrumenty pochodne

Dom Maklerski Pekao nie prowadzi obrotu wskazaną kategorią instrumentów finansowych

(f) Instrumenty finansowe będące wynikiem sekurytyzacji

Dom Maklerski Pekao nie prowadzi obrotu wskazaną kategorią instrumentów finansowych



(g) Instrumenty pochodne na akcje

(i) Opcje i kontrakty terminowe typu future dopuszczone do obrotu w systemie obrotu

kategoria instrumentu	Instrumenty pochodne na akcje (i) 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	N				
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
WARSAW STOCK EXCHANGE/FINANCIAL DERIVATIVES (WDER)	100,0000%	100,0000%	54,3257%	45,6379%	0%

(ii) swapy i pozostałe instrumenty pochodne na akcje

Dom Maklerski Pekao nie prowadzi obrotu wskazaną kategorią instrumentów finansowych



(h) Sekurytyzowane instrumenty pochodne

(i) Warranty i certyfikaty

kategoria instrumentu	Sekurytyzowane instrumenty pochodne Sekurytyzowane instrumenty pochodne (i) Warranty i certyfikaty				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	N				
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
WARSAW STOCK EXCHANGE/ ETPS (WETP)	100,0000%	100,0000%	83,8941%	16,1059%	0%

(ii) Inne sekurytyzowane instrumenty pochodne

Dom Maklerski Pekao nie prowadzi obrotu wskazaną kategorią instrumentów finansowych



Bank Pekao

Dom Maklerski

(i) Towarowe instrumenty pochodne i instrumenty pochodne bazujące na uprawnieniach do emisji

(i) Opcje i kontrakty terminowe typu future dopuszczone do obrotu w systemie obrotu

(ii) Inne towarowe instrumenty pochodne i instrumenty pochodne bazujące na uprawnieniach do emisji

Dom Maklerski Pekao nie prowadzi obrotu wskazaną kategorią instrumentów finansowych

(j) Kontrakty różnic kursowych

Dom Maklerski Pekao nie prowadzi obrotu wskazaną kategorią instrumentów finansowych



Bank Pekao S.A.
Dom Maklerski Pekao

ul. Wołoska 18
02-675 Warszawa
www.dm.pekao.com.pl

Bank Polska Kasa Opieki Spółka Akcyjna z siedzibą w Warszawie, ul. Grzybowska 53/57, 00-950 Warszawa, wpisany do rejestru przedsiębiorców w Sądzie Rejonowym dla m.st. Warszawy w Warszawie, XII Wydział Gospodarczy Krajowego Rejestru Sądowego, KRS: 0000014843, NIP: 526-00-06-841, REGON: 000010205, wysokość kapitału zakładowego i kapitału wpłaconego: 262 470 034 zł.



(k) Produkty będące przedmiotem obrotu giełdowego (fundusze inwestycyjne typu ETF, giełdowe papiery wartościowe i towary będące przedmiotem obrotu giełdowego)

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	T				
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
WARSAW STOCK EXCHANGE/ ETPS (WETP)	88,6785%	98,6111%	44,3662%	55,6338%	0%
EURONEXT - EURONEXT PARIS (XPAR)	10,7040%	0,6944%	0,0000%	0,0000%	0%
SIX SWISS EXCHANGE (XSWX)	0,6175%	0,6944%	0,0000%	0,0000%	0%

(l) Uprawnienia do emisji

Dom Maklerski Pekao nie prowadzi obrotu wskazaną kategorią instrumentów finansowych



(m) Inne instrumenty

kategoria instrumentu	Inne instrumenty				
Powiadomienie w przypadku średnio poniżej jednej transakcji na dzień roboczy w poprzednim roku	T				
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
BANK PEKAO S.A. (5493000LKS7B3UTF7H35)	100,0000%	100,0000%	0,0000%	0,0000%	0%