

PROTOKÓŁ NR 14

z posiedzenia Komitetu Sterującego IRF w dniu 11 lipca 2022 r.

Posiedzenie odbyło się 11 lipca 2022 r. w biurze Instytutu Rynku Finansowego w Warszawie oraz za pośrednictwem środków porozumiewania się na odległość.

Uczestnicy:

1. Jacek Wiecek, Przewodniczący Komitetu Sterującego IRF - uczestnictwo w Biurze IRF,
2. Józef Nasiadka, Członek Komitetu Sterującego IRF - uczestnictwo telekonferencyjnie,
3. Grzegorz Taraszkiewicz-Sirocki, Członek Komitetu Sterującego IRF - uczestnictwo telekonferencyjnie,
4. Tomasz Mironczuk, Prezes Zarządu IRF - uczestnictwo w Biurze IRF, na zaproszenie Przewodniczącego KS,
5. Piotr Mielus, Dyrektor Zespołu Operacji - uczestnictwo w Biurze IRF, na zaproszenie Przewodniczącego KS,
6. Marta Penczar, Dyrektor Zespołu Audytu - uczestnictwo telekonferencyjne, na zaproszenie Przewodniczącego KS,
7. Krzysztof Gacek, Dyrektor Biura IRF - uczestnictwo w Biurze IRF, na zaproszenie Przewodniczącego KS.

Porządek obrad:

- 1) Przyjęcie porządku obrad Komitetu Sterującego IRF i złożenie oświadczeń dot. konfliktu interesu.
- 2) Przedstawienie przez Zarząd IRF informacji bieżącej dot. funkcjonowania IRF - Administratora WKF:
 - a) Raport nadzorczy dot. realizacji procesów mających na celu monitoring wybranych parametrów jakości rynku referencyjnego (w tym Oświadczenie Administratora s. 14) zawierający informację bieżącą nt. dziennego procesu opracowywania Wskaźnika Kosztu Finansowania oraz raport dot. jakości dostarczanych danych (podstawa: ZFKS pkt. 10).
- 3) Informacja dyr. Zespołu Audytu dot. wyników przeprowadzonych w bieżącym roku audytów wewnętrznych (Audyt 1/2022; Audyt 2/2022; Audyt 3/2022).
- 4) Sprawy różne.
 - a) Informacja i ocena Zarządu dot. aktualnej sytuacji dotyczącej funkcjonowania i stosowania w Polsce wskaźników referencyjnych stopy procentowej oraz w związku z zapowiedzią likwidacji kluczowego wskaźnika stopy procentowej w Polsce.
 - b) Informacja bieżąca nt. procedur administracyjnych.

Przebieg posiedzenia:

Ad. 1

Porządek posiedzenia został przyjęty.

Członkowie KS złożyli do protokołu oświadczenia o niewystępowaniu konfliktu interesu.

Ad. 2 a)

Dyrektor Zespołu Operacji przedstawił Raport nadzorczy dot. realizacji procesów mających na celu monitoring wybranych parametrów jakości rynku referencyjnego zawierający informację bieżącą nt. dziennego procesu opracowywania indeksu WKF oraz raport dot. jakości dostarczanych danych. Raport obejmował okres II kwartału 2022 r.

Zaprezentowane dane wskazują na stabilność procesu generowania wskaźnika i wysoką jakość danych wejściowych nadesłanych przez banki panelistów. Dyrektor Zespołu Operacji złożył również sprawozdanie w zakresie wypełniania obowiązków Administratora dot. monitorowania stanu rynku i jakości danych wejściowych.

Ad. 3

Dyrektor Zespołu Audytu poinformowała członków Komitetu Sterującego o przeprowadzonych w pierwszym półroczu 2022 r. kontrolach wewnętrznych oraz o bieżących działaniach audytu wewnętrznego. Zgodnie z przyjętym Planem kontroli wewnętrznej IRF na 2022 r., Zespół Audytu od stycznia do czerwca br. przeprowadził 3 kontrole wewnętrzne. Dyrektor Zespołu Audytu przedstawiła wyniki przeprowadzonych kontroli.

Członkowie KS po przyjęciu informacji oraz po zapoznaniu się z Raportami pokontrolnymi Zespołu Audytu dokonali oceny przeprowadzonych audytów wewnętrznych.

Ad. 4

W związku z: (i) aktualnie toczącą się publicznie dyskusją na temat obecnie funkcjonujących w Polsce wskaźników referencyjnych stóp procentowych ich reprezentatywnością, (ii) zasobem transakcyjnym oraz (iii) zapowiedziami likwidacji z końcem roku kluczowego wskaźnika referencyjnego w Polsce WIBOR; w odpowiedzi na oczekiwanie członków Komitetu Sterującego Zarząd IRF przedstawił Informację oraz ocenę dot. aktualnej sytuacji funkcjonowania i stosowania w Polsce wskaźników referencyjnych stopy procentowej oraz informację dotyczącą reprezentatywności wskaźnika WKF. Szczególną uwagę zwrócono na potencjalne konsekwencje formalne oraz ekonomiczne zapowiadanego procesu likwidacji kluczowego w Polsce wskaźnika referencyjnego.

Na tym posiedzenie Komitetu Sterującego zostało zamknięte.