

PROTOKÓŁ NR 15

z posiedzenia Komitetu Sterującego IRF w dniu 20 października 2022 r.

Posiedzenie odbyło się 20 października 2022 r. w biurze Instytutu Rynku Finansowego w Warszawie oraz za pośrednictwem środków porozumiewania się na odległość.

Uczestnicy:

1. Jacek Więcek, Przewodniczący Komitetu Sterującego IRF - uczestnictwo w biurze IRF,
2. Józef Nasiadka, Wiceprzewodniczący 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. Adam Jaroszyński, Dyrektor Zespołu Infrastruktury - uczestnictwo telekonferencyjne, na zaproszenie Przewodniczącego KS
8. 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) oraz
 - b) informacja bieżąca 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 3/2022; Audyt 4/2022) (podstawa: ZFKS pkt 5 g).
- 4) Informacja Zarządu na temat przebiegu i wniosków z testu Planu Ciągłości Działania (podstawa: ZFKS pkt 7).
- 5) Informacje Zarządu na temat bieżących procesów:
 - a) Informacja dot. składu Panelu WKF.
 - b) Kontrola Administratora dot. przestrzegania przez banki Panelistów WKF Kodeksu Postępowania Banku Panelisty (podstawa: KPBP pkt 87; ZFKS pkt. 9 i 10).
 - c) Informacja z Posiedzenia nr 5 Komitetu ds. Konfliktu Interesu (z dnia 20.10.2022).
 - d) Roczny przegląd Metody WKF - założenia, cele, harmonogram.
 - e) Roczny przegląd polityk i procedur wewnętrznych IRF - założenia, cele, harmonogram.
- 6) 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

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

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

Członkowie KS po przeprowadzonej dyskusji przyjęli informację.

Ad. 3

Dyrektor Zespołu Audytu poinformowała członków Komitetu Sterującego o przeprowadzonych w II i III kwartale kontrolach wewnętrznych oraz o bieżących działaniach audytu wewnętrznego. Zgodnie z przyjętym Planem kontroli wewnętrznej IRF na 2022 r., Zespół Audytu od czerwca do września br. przeprowadził 2 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

Prezes Zarządu przedstawił informację o przebiegu i wnioskach z przeprowadzonego testu Planu Ciągłości Działania.

Członkowie KS przyjęli przedstawioną informację do wiadomości.

Ad. 5 a)

Prezes Zarządu IRF przedstawił informację dotyczącą składu Panelu WKF, poinformował o przeprowadzonym w sierpniu rozszerzeniu Panelu WKF (wcześniej zapowiadany) oraz przedstawił informacje związane z planowanymi w kolejnych miesiącach zmianami w składzie Panelu WKF.

Ad. 5 b)

Prezes Zarządu poinformował o przeprowadzanej we wrześniu i październiku przez Biuro IRF i Zespół Audytu kontroli dot. przestrzegania przez Banki Panelistów WKF Kodeksu Postępowania Banku Panelisty. Podstawą prawną przeprowadzonej kontroli jest KPBP (pkt. 87) oraz Zasady

Funkcjonowania Komitetu Sterującego (pkt. 9 i 10). Końcowa informacja zawierająca podsumowanie i wnioski zostanie przedstawiona KS IRF na kolejnym posiedzeniu.

Ad. 5 c)

Dyrektor Biura IRF przedstawił informację z Posiedzenia nr 5 Komitetu ds. Konflikty Interesu.

Ad. 5 d)

Dyrektor Zespołu Operacji przedstawił założenia i harmonogram rocznego przeglądu Metody WKF. Przegląd obejmuje między innymi badanie adekwatności metody względem realiów gospodarczych, zbadanie reprezentatywności Panelu oraz wskaźnika WKF, odporność na manipulacje. Czas przeprowadzenia przeglądu: październik i listopad br. Informacja zawierająca podsumowanie i wnioski z przeglądu zostanie przedstawiona KS IRF na kolejnym posiedzeniu.

Członkowie KS przyjęli informację.

Ad. 5 e)

Dyrektor Biura IRF przedstawił założenia i harmonogram rocznego przeglądu polityk i procedur wewnętrznych IRF. Przegląd uwzględni: zmiany przepisów prawa powszechnie obowiązującego, informacje z przeprowadzonych kontroli wewnętrznych, wnioski z bieżącej działalności administratora. Czas przeprowadzenia przeglądu: październik i listopad br.

Członkowie KS przyjęli informację.

Ad. 6

W związku z: (i) aktualnie toczącą się publicznie dyskusją na temat obecnie funkcjonujących w Polsce wskaźników referencyjnych stóp procentowych i ich reprezentatywnością, (ii) zasobem transakcyjnym oraz (iii) zapowiedziami zmian na rynku wskaźników referencyjnych i zapowiadany wprowadzeniem z końcem roku nowego indeksu WIRON; w odpowiedzi na stałe 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 wskaźnika WKF. Szczególną uwagę zwrócono na potencjalne konsekwencje formalne oraz ekonomiczne zapowiadanego procesu likwidacji kluczowego w Polsce wskaźnika referencyjnego i wprowadzania nowego indeksu.

Na tym posiedzeniu Komitetu Sterującego zostało zamknięte.