

PROTOKÓŁ NR 19

z posiedzenia Komitetu Sterującego IRF w dniu 20 kwietnia 2023 r.

Posiedzenie odbyło się 20 kwietnia 2023 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, Zastępca Przewodniczącego KS IRF - uczestnictwo telekonferencyjne,
3. Grzegorz Taraszkiewicz-Sirocki, Członek Komitetu Sterującego - uczestnictwo telekonferencyjne,
4. Tomasz Mironczuk, Prezes Zarządu IRF - uczestnictwo z Biura IRF, na zaproszenie Przewodniczącego KS,
5. Piotr Mielus, Dyrektor Zespołu Operacji - uczestnictwo telekonferencyjne, na zaproszenie Przewodniczącego KS,
6. Marta Penczar, Dyrektor Zespołu Audytu - uczestnictwo telekonferencyjne, na zaproszenie Przewodniczącego KS,
7. Krzysztof Gacek, Dyrektor Biura IRF - uczestnictwo z Biura IRF, na zaproszenie Przewodniczącego KS.

Porządek obrad:

- 1) Przyjęcie porządku obrad Komitetu Sterującego IRF i złożenie oświadczeń.
- 2) 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 (podstawa: ZFKS pkt. 10).
- 3) Informacja Dyrektora Zespołu Audytu nt. przeprowadzonego w marcu br. audytu wewnętrznego (temat audytu Współpraca z Bankami Panelistami, w tym działalność informacyjna i szkoleniowa)
- 4) Informacja Zarządu nt. wypełnienia zalecenia wydanego przez Komitet Sterujący IRF dotyczącego wdrożenia wskazanych w Dokumencie Konsultacyjnym zmian w Metodzie WKF i Kodeksie Postępowania Banku Panelisty
- 5) Informacja Zarządu nt. przygotowań do przeprowadzenia niezależnego audytu zewnętrznego administratora wskaźników referencyjnych stóp procentowych (BMR Zał. I pkt 4. oraz ZWAZ IRFD018-2019 pkt 12 i 13)
- 6) Informacja bieżąca Zarządu nt. działalności administratora w tym:
 - informacja o umorzeniu prowadzonego przez 14 miesięcy przez organ nadzoru postępowania administracyjnego w związku z stwierdzeniem bezprzedmiotowości postępowania.
 - informacja dot. współpracy z bankami członkami Panelu WKF.
- 7) Sprawy różne.

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 I kwartału 2023 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 przedstawiła informację o wynikach przeprowadzonego Audytu nr 1/2023. Audyt obejmował obszar: Współpraca z Bankami Panelistami, w tym działalność informacyjna i szkoleniowa. W ramach przeprowadzonego audytu nie stwierdzono niezgodności.

Ad. 4

Prezes Zarządu przedstawił informację nt. wypełnienia zalecenia wydanego przez Komitet Sterujący IRF dotyczącego wdrożenia wskazanych w Dokumencie Konsultacyjnym zmian w Metodzie WKF i Kodeksie Postępowania Banku Panelisty. W dniu 14 kwietnia 2023 r. Zarząd IRF podjął Uchwałę w sprawie zmiany Metody WKF oraz Uchwałę w sprawie zmiany Kodeksu Postępowania Banku Panelisty (KPBP). Zgodnie z treścią ww. uchwał, nowe wersje wskazanych dokumentów obowiązywać będą od dnia 23 kwietnia 2023 roku.

Ad. 5

Prezes Zarządu przedstawił informacje na temat przygotowań do przeprowadzenia niezależnego audytu zewnętrznego administratora wskaźników referencyjnych stóp procentowych (po dwóch latach od terminu poprzedniego audytu - BMR Zał. I pkt 4.).

Ad. 6

Omówienie bieżących spraw związanych z działalnością administratora.

Prezes Zarządu poinformował o umorzeniu przez KNF prowadzonego postępowania kontrolnego. Po 14 miesiącach prowadzonego postępowania administracyjnego organ nadzoru podjął decyzję o umorzeniu tego postępowania w związku ze stwierdzeniem bezprzedmiotowości dalszego jego prowadzenia.

Ad. 7

Spraw różnych nie wniesiono.

Na tym posiedzenie Komitetu Sterującego zostało zamknięte.