

Protokół nr 1
z posiedzenia Komitetu Sterującego IRF
w dniu 31 października 2019 r.

Posiedzenie odbyło się 31 października 2019 r. w Biurze Instytutu Rynku Finansowego w Warszawie.

Uczestnicy:

1. Marcin Dec, Członek Komitetu Sterującego IRF
2. Janusz Jankowiak, Przewodniczący Komitetu Sterującego IRF
3. Tomasz Mironczuk, Prezes Zarządu IRF
4. Piotr Mielus, Dyrektor, Zespół Operacji IRF
5. Krzysztof Gacek, Dyrektor, Biuro IRF
6. Ryszard Krzyckowski-Jesień, radca prawny

Porządek obrad:

- 1) Ukonstytuowanie się Komitetu Sterującego IRF.
- 2) Przyjęcie porządku obrad Komitetu Sterującego IRF.
- 3) Przedstawienie przez Zarząd IRF Zasad Ogólnych Funkcjonowania IRF (Dokument: IRFD 001-2019 – dokument przyjęty Uchwałą nr 2 Zarządu IRF z dnia 25 października 2019 r.) i przekazany do Komitetu Sterującego celem zapoznania.
- 4) Przedstawienie przez Zarząd IRF stanu prac nad Wskaźnikiem Kosztu Finansowania Dokumenty przekazane przez Zarząd IRF:
 - a. Prezentacja: Wskaźnik WKF. Analiza danych, Warszawa 25 marca 2019.
 - b. Prezentacja: Wskaźnik Kosztu Finansowania. Podsumowanie drugiego etapu projektu, Warszawa 12 września 2019.
 - c. Testy ekonometryczne szeregów czasowych związanych z WKF (test reprezentatywności i stabilności).
- 5) Przedstawienie przez Zarząd Regulaminu organizacyjnego Instytutu Rynku Finansowego (IRFD 000-2019) – dokument przyjęty Uchwałą nr 1 Zarządu IRF z dnia 25 października 2019 r. i przekazany do Komitetu Sterującego celem zapoznania.
- 6) Zaopiniowanie Zasad funkcjonowania Komitetu Sterującego IRF (Dokument: IRFD 002-2019) - dokument przyjęty Uchwałą nr 3 Zarządu IRF z dnia 25 października 2019 r. i przekazany do Komitetu Sterującego celem uzyskania opinii.
- 7) Zaopiniowanie projektu Kodeksu postępowania Banku Panelisty (Dokument: IRFD 004-2019) – dokument przygotowany przez Zarząd IRF i przekazany do Komitetu Sterującego celem uzyskania opinii.
- 8) Zaopiniowanie projektu Metody WKF (Dokument: IRFD 005-2019) – dokument przygotowany przez Zarząd IRF i przekazany do Komitetu Sterującego celem uzyskania opinii.
- 9) Przedstawienie Przez Zarząd Polityki i Procedury Zarządzania Konfliktem Interesu (Dokument: IRFD 003-2019) – dokument przyjęty Uchwałą nr 4 Zarządu IRF w dniu 25 października 2019 r. i przekazany do Komitetu Sterującego celem zapoznania.
- 10) Przedstawienie Przez Zarząd Polityki i procedury konsultacji (Dokument: IRFD 006-2019) – dokument przyjęty Uchwałą nr 5 Zarządu IRF z dnia 25 października 2019 r. i przekazany do Komitetu Sterującego celem zapoznania.

- 11) Przedstawienie Przez Zarząd Polityki i procedury zgłaszania niezgodności (Dokument: IRFD 007-2019) – dokument przyjęty Uchwałą nr 6 Zarządu IRF z dnia 25 października 2019 r. i przekazany do Komitetu Sterującego celem zapoznania.
- 12) Przedstawienie Przez Zarząd Polityki i procedury zarządzania ryzykiem operacyjnym (Dokument: IRFD 008-2019) – dokument przyjęty Uchwałą nr 7 Zarządu IRF z dnia 25 października 2019 r. i przekazany do Komitetu Sterującego celem zapoznania.
- 13) Przedstawienie Przez Zarząd Polityki i procedury zarządzania outsourcingiem (Dokument: IRFD 009-2019) – dokument przyjęty Uchwałą nr 8 Zarządu IRF z dnia 25 października 2019 r. i przekazany do Komitetu Sterującego celem zapoznania.
- 14) Przedstawienie Przez Zarząd Polityki i procedura obsługi skarg (Dokument: IRFD 010-2019) – dokument przyjęty Uchwałą nr 9 Zarządu IRF z dnia 25 października 2019 r. i przekazany do Komitetu Sterującego celem zapoznania.
- 15) Przedstawienie Przez Zarząd Polityki i procedury przeglądu, zmiany lub zaprzestania opracowywania wskaźnika (Dokument: IRFD 011-2019) – dokument przyjęty Uchwałą nr 10 Zarządu IRF z dnia 25 października 2019 r. i przekazany do Komitetu Sterującego celem zapoznania.
- 16) Przedstawienie Przez Zarząd Polityki i procedury Audytu wewnętrznego (Dokument: IRFD 012-2019) – dokument przyjęty Uchwałą nr 11 Zarządu IRF z dnia 25 października 2019 r. i przekazany do Komitetu Sterującego celem zapoznania.
- 17) Przedstawienie Przez Zarząd Planu Ciągłości Działania (Dokument: IRFD 013-2019) – dokument przyjęty Uchwałą nr 12 Zarządu IRF z dnia 25 października 2019 r. i przekazany do Komitetu Sterującego celem zapoznania.
- 18) Przedstawienie Przez Zarząd Polityki Zachowania Poufności (Dokument: IRFD 014-2019) – dokument przyjęty Uchwałą nr 13 Zarządu IRF z dnia 25 października 2019 r. i przekazany do Komitetu Sterującego celem zapoznania.
- 19) Przedstawienie Przez Zarząd Polityki i procedury prowadzenia rejestrów (Dokument: IRFD 015-2019) – dokument przyjęty Uchwałą nr 14 Zarządu IRF z dnia 25 października 2019 r. i przekazany do Komitetu Sterującego celem zapoznania.
- 20) Sprawy różne.

Przebieg posiedzenia:

Ad. 1)

Prezes Zarządu IRF Tomasz Mironczuk przedstawił wniosek skierowany do p. Janusza Jankowiaka o zgodę na powołanie p. Janusza Jankowiaka na Członka Komitetu Sterującego IRF (zwanego dalej również KS) i objęcie funkcji Przewodniczącego Komitetu Sterującego IRF. P. Janusz Jankowiak wyraził zgodę na wejście w skład KS i na objęcie funkcji Przewodniczącego Komitetu Sterującego IRF.

Następnie Prezes Zarządu IRF przedstawił wniosek o powołanie p. Marcina Deca na Członka Komitetu Sterującego IRF. Wniosek uzyskał akceptację Przewodniczącego KS p. Janusza Jankowiaka.

Komitet Sterujący IEF został ukonstytuowany w składzie:

- 1) P. Janusz Jankowiak – Przewodniczący KS
- 2) P. Marcin Dec – Członek KS

Członkowie KS oświadczyli¹, że nie nałożono na nich sankcji administracyjnych i karnych w dziedzinie usług finansowych, w szczególności za manipulację lub próbę manipulacji wskaźnikami.

¹ zgodnie z RTS 1637, 1.7; RTS 1637 (8)

Członkowie KS złożyli oświadczenia dotyczące nie występowania konfliktu interesu.

Przewodniczący Komitetu Sterującego IRF przejął prowadzenie posiedzenia.

Ad. 2)

Członkowie KS zaakceptowali porządek obrad

Ad. 3)

Prezes Zarządu IRF przedstawił regulację wewnętrzną Administratora: Zasady Ogólne Funkcjonowania IRF (ZOF) - IRFD 001-2019. Dokument przyjęty Uchwałą nr 2 Zarządu IRF z dnia 25 października 2019 r., został przekazany KS w celu zapoznania.

ZOF określa ogólne zasady postępowania w zakresie zarządzania wskaźnikami referencyjnymi w IRF oraz zasady zarządzania i systemy kontroli ustanowione przez Administratora.

Ad. 4)

Prezes Zarządu IRF przedstawił stanu prac nad Wskaźnikiem Kosztu Finansowania (prezentacja: Wskaźnik WKF. Analiza danych, Warszawa 25 marca 2019.; prezentacja: Wskaźnik Kosztu Finansowania. Podsumowanie drugiego etapu projektu, Warszawa 12 września 2019.; Testy ekonometryczne szeregów czasowych związanych z WKF (test reprezentatywności i stabilności).

Omówiono dotychczas zrealizowane etapy projektu oraz aktualny stan gotowości operacyjnej IRF do opracowywania Wskaźnika Kosztu Finansowania. Zarząd przedstawił kluczowe elementy funkcjonowania Systemu WKF, wyniki dotychczasowych testów generowania i przekazywania danych wejściowych od banków panelistów, wyniki testowego opracowywania wskaźnika. Zaprezentowano alokację operacyjną zadań do poszczególnych Zespołów IRF. Omówione zostały realizowane kroki związane z uruchomieniem procesu opracowywania WKF, status zawieranych umów z bankami panelistami jak również użytkownikami WKF. Prezes Zarządu IRF poinformował, że po zakończeniu procesu formalnego przyjęcia kluczowych elementów dokumentacji Administratora, w czasie 2-3 tygodni jest prawdopodobne uruchomienie oficjalnego rozpoczęcia opracowywania WKF oraz skompletowanie wniosku do UKNF i wystąpienie do UKNF ws. wpisania administratora i WKF na listę ESMA.

Ad. 5)

Prezes Zarządu IRF przedstawił regulację wewnętrzną Administratora: Regulamin organizacyjny Instytutu Rynku Finansowego (IRFD 000-2019). Dokument przyjęty Uchwałą nr 1 Zarządu IRF z dnia 25 października 2019 r., został przekazany KS w celu zapoznania.

Ad. 6)

Prezes Zarządu IRF przedstawił dokument: Zasad funkcjonowania Komitetu Sterującego IRF (Dokument: IRFD 002-2019). Dokument przyjęty Uchwałą nr 3 Zarządu IRF z dnia 25 października 2019 r., został przekazany KS w celu uzyskania opinii.

Dokument określa zakres obowiązków i uprawnień Komitetu Sterującego IRF, skład i odpowiedzialność członków, zasady ich powołania i odwołania oraz kluczowe zasady zgodności postępowania członków KS.

Członkowie Komitetu Sterującego IRF pozytywnie zaopiniowali Zasady funkcjonowania Komitetu Sterującego IRF.

Ad. 7)

Prezes Zarządu IRF przedstawił projektu dokumentu Kodeks postępowania Banku Panelisty (Dokument: IRFD 004-2019) – dokument przygotowany przez Zarząd IRF i przekazany do Komitetu Sterującego celem uzyskania opinii

Dokument określa zasady funkcjonowania banków panelistów we współpracy z administratorem wskaźnika, do przestrzegania którego zobowiązują się wszystkie podmioty, których dane są przekazywane do administratora celem opracowywania WKF.

Omówiono wymogi regulacji BMR oraz RTS w zakresie kodeksu postępowania banków panelistów i sposób wypełnienia wymogów regulacyjnych w tym zakresie w procesie opracowywania WKF. Członkowie Komitetu Sterującego pozytywnie zaopiniowali przedstawiony dokument.

Ad.8)

Prezes Zarządu IRF przedstawił projektu dokumentu Metoda WKF (Dokument: IRFD 005-2019) – dokument przygotowany przez Zarząd IRF i przekazany do Komitetu Sterującego celem uzyskania opinii.

Dokument określa definicję WKF, procesy gospodarcze i rynki, do których odnosi się wskaźnik jak również sposób opracowywania WKF. Omówiono wymogi regulacji BMR oraz RTS w zakresie metody opracowywania wskaźników i sposób wypełnienia wymogów regulacyjnych przez Metodę WKF.

Członkowie Komitetu Sterującego pozytywnie zaopiniowali przedstawiony dokument: Metoda WKF.

Ad. 9)

Prezes Zarządu IRF przedstawił Politykę i Procedurę Zarządzania Konfliktem Interesu (Dokument: IRFD 003-2019). Omówiono założenia i sposób zarządzania konfliktem interesu w procesie opracowywania WKF, omówiono wymogi regulacyjne w tym zakresie oraz sposób wypełnienia ich przez Administratora. Członkowie KS nie zgłosili uwag do przedstawionego dokumentu.

Ad. 10)

Prezes Zarządu IRF przedstawił Politykę i procedury konsultacji (Dokument: IRFD 006-2019). Omówiono dokument, wymogi regulacyjne oraz sposób wypełnienia ich przez Administratora. Członkowie KS nie zgłosili uwag do przedstawionego dokumentu.

Ad. 11)

Prezes Zarządu IRF przedstawił Politykę i procedury zgłaszania niezgodności (Dokument: IRFD 007-2019). Omówiono dokument, wymogi regulacyjne oraz sposób wypełnienia ich przez Administratora. Członkowie KS nie zgłosili uwag do przedstawionego dokumentu.

Ad.12)

Prezes Zarządu IRF przedstawił Politykę i procedury zarządzania ryzykiem operacyjnym (Dokument: IRFD 008-2019). Omówiono dokument, wymogi regulacyjne oraz sposób wypełnienia ich przez Administratora. Członkowie KS nie zgłosili uwag do przedstawionego dokumentu.

Ad.13)

Prezes Zarządu IRF przedstawił Politykę i procedury zarządzania outsourcingiem (Dokument: IRFD 009-2019). Omówiono dokument, wymogi regulacyjne oraz sposób wypełnienia ich przez Administratora. Członkowie KS nie zgłosili uwag do przedstawionego dokumentu.

Ad. 14)

Prezes Zarządu IRF przedstawił Politykę i procedurę obsługi skarg (Dokument: IRFD 010-2019). Omówiono dokument, wymogi regulacyjne oraz sposób wypełnienia ich przez Administratora. Członkowie KS nie zgłosili uwag do przedstawionego dokumentu.

Ad. 15)

Prezes Zarządu IRF przedstawił Politykę i procedury przeglądu, zmiany lub zaprzestania opracowywania wskaźnika (Dokument: IRFD 011-2019). Omówiono dokument, wymogi regulacyjne oraz sposób wypełnienia ich przez Administratora. Członkowie KS nie zgłosili uwag do przedstawionego dokumentu.

Ad. 16)

Prezes Zarządu IRF przedstawił Politykę i procedury Audytu wewnętrznego (Dokument: IRFD 012-2019). Omówiono dokument, wymogi regulacyjne oraz sposób wypełnienia ich przez Administratora. Członkowie KS nie zgłosili uwag do przedstawionego dokumentu.

Ad. 17)

Prezes Zarządu IRF przedstawił Plan Ciągłości Działania (Dokument: IRFD 013-2019). Omówiono dokument, wymogi regulacyjne oraz sposób wypełnienia ich przez Administratora. Członkowie KS nie zgłosili uwag do przedstawionego dokumentu.

Ad. 18)

Prezes Zarządu IRF przedstawił Polityki Zachowania Poufności (Dokument: IRFD 014-2019). Omówiono dokument, wymogi regulacyjne oraz sposób wypełnienia ich przez Administratora. Członkowie KS nie zgłosili uwag do przedstawionego dokumentu.

Ad. 19)

Prezes Zarządu IRF przedstawił Politykę i procedury prowadzenia rejestrów (Dokument: IRFD 015-2019). Omówiono dokument, wymogi regulacyjne oraz sposób wypełnienia ich przez Administratora. Członkowie KS nie zgłosili uwag do przedstawionego dokumentu.

Ad 20).

Innych spraw nie zgłoszono

Na tym posiedzenie Komitetu Sterującego zostało zamknięte.