

PROTOKÓŁ NR 10
z posiedzenia Komitetu Sterującego IRF
w dniu 20 października 2021 r.

Posiedzenie odbyło się 20 października 2021 r. w biurze Instytutu Rynku Finansowego w Warszawie oraz za pośrednictwem środków porozumiewania się na odległość.

Uczestnicy:

1. Prof. Andrzej Sławiński, Przewodniczący Komitetu Sterującego IRF - uczestnictwo telekonferencyjne,
2. Dr Jacek Bartkiewicz Członek Komitetu Sterującego - uczestnictwo telekonferencyjne,
3. Janusz Jankowiak, Członek Komitetu Sterującego IRF - uczestnictwo telekonferencyjne,
4. Tomasz Mironczuk, Prezes Zarządu IRF - uczestnictwo z Biura IRF, na zaproszenie Przewodniczącego KS,
5. Piotr Mielus, Dyrektor Zespołu Operacji - uczestnictwo z Biura IRF, 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 dot. konfliktu interesu.
- 2) Przedstawienie przez Zarząd IRF informacji bieżącej dot. funkcjonowania IRF - Administratora WKF:
 - a) Informacja bieżąca nt. dziennego procesu opracowywania indeksu WKF oraz raport dot. jakości dostarczanych danych (w nawiązaniu do procedury IRFD 002_ZFKS pkt 10);
 - b) Raport nadzorczy WKF dot. realizacji procesów mających na celu monitoring wybranych parametrów jakości rynku referencyjnego.
 - c) Informacja na temat realizowanego procesu rozszerzenia Panelu WKF.
- 3) Informacja Zarządu IRF na temat raportu oraz wyników przeprowadzonego niezależnego audytu zewnętrznego (zgodnie z Załącznikiem I do BMR, pkt. 4).
- 4) Informacja dyr. Zespołu Audytu na temat wyników przeprowadzonych audytów wewnętrznych.
- 5) Sprawy różne.

Przebieg posiedzenia:

Ad. 1)

Porządek posiedzenia został przyjęty.

Członkowie KS złożyli do protokołu oświadczenia o niewystępowaniu konfliktu interesu.

Ad. 2. a), b)

Dyrektor Zespołu Operacji przedstawił „Raport nadzorczy WKF” w tym informację o przebiegu dziennego procesu opracowywania indeksu WKF w II i III kwartale b.r.

Zaprezentowane dane dowodzą stabilności procesu generowania wskaźnika i wysokiej jakości danych nadesłanych przez banki panelistów. Dyrektor Zespołu Operacji złożył również sprawozdanie w zakresie wypełniania obowiązków Administratora dot. monitorowania stanu rynku i jakości danych wejściowych.

Ad 2 c.

Prezes Zarządu IRF przedstawił informację o decyzjach Zarządu o rozszerzeniu Panelu WKF. W dniu 18 czerwca Panel został rozszerzony o trzy banki (Śląski Bank Spółdzielczy Silesia w Katowicach, Spółdzielczy Bank Powiatowy w Piaskach, Bank Spółdzielczy w Niechobrze) natomiast w dniu 24 września w skład panelu weszły cztery nowe banki (BS w Miliczu, BS w Łosicach, BS w Przasnyszu, BS w Otmuchowie). Obecnie WKF jest to jedyny wskaźnik referencyjny stóp procentowych w Europie, w przypadku którego rozszerza się skład panelu.

Prezes Zarządu IRF poinformował ponadto o statusie prac związanych z pozyskaniem nowych banków panelistów WKF (o zawartych kolejnych umowach ws. pełnienia funkcji panelisty z bankami, przygotowaniach banków do roli panelisty jak również prowadzonych rozmowach z kolejnymi bankami). Analiza danych banków, które zadeklarowały chęć pełnienia funkcji banków panelistów wskazuje, że reprezentatywność panelu jak również danych wejściowych i indeksu WKF zostanie zachowana.

Ad. 3)

Prezes Zarządu IRF poinformował Komitet Sterujący IRF o przeprowadzonym audycie zewnętrznym działalności IRF jako Administratora, zgodnie z przepisem pkt. 4 Załącznika I do BMR. Po przeprowadzeniu postępowania konkurencyjnego został wybrany Związek Rewizyjny Banków Spółdzielczych im. Franciszka Stefczyka w Warszawie. ZRBS im. Stefczyka jest firmą audytorską wpisaną na listę firm audytorskich pod nr 1459 prowadzoną przez Polską Agencję Nadzoru Audytowego i jest podmiotem niezależnym od IRF sp. z o.o. w rozumieniu ustawy o biegłych rewidentach, firmach audytorskich oraz nadzorze publicznym. 30 lipca 2021 r. ZRBS im. Stefczyka przedstawił raport z przeprowadzonego audytu. We wniosku w Raporcie końcowym niezależny audytor zewnętrzny zapisał, że nie stwierdził nieprawidłowości w stosowaniu metody opracowywania WKF, a także w działalności IRF.

Członkowie KS po przyjęciu informacji Prezesa Zarządu IRF oraz po zapoznaniu się z Raportem Niezależnego Biegłego Rewidenta dokonali oceny audytu zewnętrznego.

Ad. 4)

Członkowie Komitetu Sterującego zostali poinformowani o przeprowadzonych w 2021 r. kontrolach wewnętrznych oraz o bieżących działaniach audytu wewnętrznego. Zgodnie z przyjętym Planem kontroli wewnętrznej IRF na 2021 r., Zespół Audytu od stycznia do października br. przeprowadził osiem kontroli wewnętrznych z czego dwie są jeszcze w trakcie. 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.

Na tym posiedzenie Komitetu Sterującego zostało zamknięte.