

PROTOKÓŁ NR 16

z posiedzenia Komitetu Sterującego IRF w dniu 19 stycznia 2023 r.

Posiedzenie odbyło się 19 stycznia 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 Tarasiewicz-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. Adam Jaroszyński, Dyrektor Zespołu Infrastruktury - uczestnictwo telekonferencyjne, na zaproszenie Przewodniczącego KS,
8. 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) Przedstawienie przez Zarząd Informacji dot. rocznego przeglądu polityk i procedur wewnętrznych obowiązujących w IRF, dokument z 02.11.2022 r., (podstawa: Rozporządzenie BMR oraz polityki wewnętrzne IRF) i wniosek Zarządu do KS o zaopiniowanie wynikających z przeglądu zmian w dokumentach (podstawa: ZOF pkt. 35):
- 3) Przegląd definicji, metody WKF oraz Oświadczenia administratora:
 - a) Przedstawienie przez Zarząd informacji dot. rocznego przeglądu Metody WKF, dokument: Przegląd Metody WKF z 31.10.2022 r. - (podstawa: MWKF pkt. 48-50; PPPZZ pkt. 2 i 11.).
 - b) Wniosek o zatwierdzenie rocznego przeglądu Metody WKF (podstawa: PPPZZ pkt. 3) oraz przeglądu Oświadczenia administratora.
- 4) Informacja Komitetu ds. Konfliktu Interesu dot. Raportu z rocznego Przeglądu procesów i oświadczeń dot. konfliktu interesu, dokumenty z dnia 12 stycznia 2023 oraz 19 stycznia 2023 r. (podstawa: ZFKS pkt. 12).
- 5) Przedstawienie przez Zarząd Raportu dot. przestrzegania KPBP przez Banki Panelistów, dokument z 18 listopada 2022 r. (podstawa: ZFKS pkt. 9, 10);
- 6) Przedstawienie przez Zarząd Informacji dot. skarg, reklamacji oraz Informacji dot. zgłoszonych naruszeń i niezgodności, pisma z dnia 11 stycznia 2023 r. (podstawa: ZFKS pkt. 35, 36).
- 7) Przedstawienie przez Zarząd Raportu dot. zarządzania ryzykiem operacyjnym i nadzoru nad procesami zarządzania ryzykiem, dokument z 09 stycznia 2023 r. (podstawa: ZFKS pkt. 7).

- 8) Przedstawienie przez Zarząd Raportu z audytów wewnętrznych przeprowadzonych w 2022 roku (materiał przygotowany przez Zespół Audytu, 10 stycznia 2023 r.) oraz wniosek Zarządu o ocenę przez KS (podstawa ZFKS pkt. 5g, 6; PPAW pkt. 8).
- 9) Przedstawienie przez Zarząd rocznego Planu kontroli IRF na rok 2023 r. oraz wniosek Zarządu o zaopiniowanie przez KS (podstawa: PPAW pkt. 10-11).
- 10) 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 indeksu WKF oraz raport dot. jakości dostarczanych danych (podstawa: ZFKS pkt. 10).
- 11) Informacja Zarządu nt. wyboru audytora do przeprowadzenia niezależnego audytu zewnętrznego administratora wskaźników referencyjnych stóp procentowych (po dwóch latach od terminu poprzedniego audytu - BMR Zał. I pkt 4. oraz ZWAZ IRFD018-2019 pkt 12 i 13).
- 12) Informacja bieżąca Zarządu nt. składu Panelu WKF (podstawa: KPBP pkt. 55).
- 13) Przedstawienie przez Przewodniczącego KS sprawozdania rocznego z działalności KS za 2022 rok.
- 14) Sprawy różne.

Przebieg posiedzenia:

Ad. 1

Porządek posiedzenia został przyjęty.

Członkowie KS złożyli do protokołu oświadczenia o niewystępowaniu konfliktu interesu.

Ad. 2

Dyrektor Biura IRF przedstawił Informację dot. rocznego przeglądu polityk i procedur wewnętrznych obowiązujących w IRF. Przeląd polityk i procedur wewnętrznych został przeprowadzony po kolejnym - drugim roku funkcjonowania IRF jako Administratora wskaźników referencyjnych stóp procentowych. Przeglądowi poddano wszystkie wewnętrzne przepisy obowiązujące w Instytucie, przy czym roczny przegląd Metody WKF był przedmiotem osobnego procesu i został przedstawiony w osobnym dokumencie. W wyniku przeprowadzonego przeglądu nie stwierdzono potrzeby dokonywania zmian w przepisach wewnętrznych IRF.

Członkowie KS IRF zpoznali się z Informacją Zarządu, Komitet Sterujący IRF pozytywnie zaopiniował ustalenia przeprowadzonego przeglądu.

Ad. 3 a), b)

Dyrektor Zespołu Operacji przedstawił Informację dot. rocznego przeglądu Metody WKF. Przegląd metody obejmował następujące elementy: (i) Adekwatność Metody względem realiów gospodarczych, które opisuje WKF (ii) Parametryzacja Metody względem Danych Wejściowych (iii) Alternatywne źródła danych (iv) Rozmiar i płynność rynku opisywanego przez WKF (v) Adekwatność procesu opracowywania WKF (vi) Reprezentatywność Panelu i WKF (vii) Odporność WKF na manipulacje.

Członkowie KS IRF zapoznali się również informacją o przeglądzie Oświadczenia administratora.

W wyniku przeglądu stwierdzono, że Metoda WKF oraz Oświadczenie administratora w dotychczasowym kształcie nie wymagają zmian, tym samym Komitet Sterujący IRF zatwierdził roczny przegląd Metody WKF i Oświadczenie administratora.

Ad. 4

Prezes Zarządu IRF przedstawił informację z rocznego przeglądu procesów i oświadczeń dot. konfliktu interesu przeprowadzonego przez Komitet ds. Konfliktu Interesu. Materiał był przedmiotem analizy Komitetu ds. Konfliktu Interesu w dniu 19 stycznia 2023 r. Wszystkie osoby objęte Polityką i Procedurą Zarządzania Konfliktem Interesu złożyły oświadczenia zgodnie z przepisami PPZKI. Nikt nie złożył oświadczenia o wystąpieniu konfliktu interesu.

W materiale zawarta została również Informacja o wywiązaniu się Banków Panelistów oraz Dostawców Danych z obowiązków związanych ze składaniem oświadczeń.

Członkowie KS IRF dokonali również przeglądu mapy przyczyn i potencjalnych przyczyn występowania konfliktu interesu i działania zapobiegawcze.

Komitet Sterujący IRF przyjął informację do wiadomości.

Ad. 5

Dyrektor Biura IRF przedstawił Raport dot. kontroli przestrzegania Kodeksu Postępowania Banku Panelisty przez Banki Panelistów. Raport obejmuje roczny okres funkcjonowania IRF (X 2021-X2022) jako Administratora. W okresie sprawozdawczym nie stwierdzono przypadków nieprzestrzegania przepisów KPBP.

Komitet Sterujący IRF przyjął do wiadomości i pozytywnie zaopiniował informację.

Ad. 6

Prezes Zarządu IRF przedstawił Informację dot. skarg i reklamacji oraz Informację dot. naruszeń i niezgodności. W okresie sprawozdawczym do Administratora nie została zgłoszona żadna skarga lub reklamacja. Nie została również zgłoszona żadna informacja dot. niezgodności (w rozumieniu Polityki i procedury zgłaszania niezgodności IRF).

Komitet Sterujący IRF przyjął informację do wiadomości.

Ad. 7

Prezes Zarząd przedstawił roczny Raport dot. zarządzania ryzykiem operacyjnym i nadzoru nad procesami zarządzania ryzykiem.

Komitet Sterujący IRF przyjął informację do wiadomości.

Ad. 8

Dyrektor Zespołu Audytu przedstawiła Raport z audytów wewnętrznych przeprowadzonych w 2022 roku. Zgodnie z przyjętym Planem kontroli wewnętrznej IRF na 2022 r., Zespół Audytu od stycznia do grudnia ub.r. przeprowadził siedem kontroli wewnętrznych obejmujących wszystkie obszary funkcjonowania IRF jako Administratora wskaźników referencyjnych stóp procentowych. Dyrektor Zespołu Audytu przedstawiła wyniki przeprowadzonych kontroli.

Członkowie KS IRF zapoznali się z przedstawioną informacją i pozytywnie ocenili wyniki przeprowadzonych audytów wewnętrznych w 2022 roku.

Ad. 9

Dyrektor Zespołu Audytu przedstawiła projekt Planu kontroli IRF na rok 2023 r. Materiał zawiera założenia przyjęte do skonstruowania planu audytu, opis obszarów mających podlegać audytowi, identyfikację ryzyk występujących w działalności administratora WKF, przyjęte miary istotności oraz prawdopodobieństwa wystąpienia zdarzeń w poszczególnych obszarach. Na podstawie powyższych założeń został przygotowany projekt rocznego Planu kontroli IRF na 2023 r.

Komitet Sterujący IRF pozytywnie zaopiniował Roczny plan kontroli na 2023 r.

Ad. 10

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 IV 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. 11

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

Ad. 12

Prezes Zarządu IRF przedstawił informację nt. zmian w składzie Panelu WKF.

Ad. 13

Członkowie Komitetu Sterującego IRF przyjęli Sprawozdanie z działalności KS IRF w 2022 r.

Ad. 14

Omówienie bieżących spraw związanych z działalnością administratora.

Na tym posiedzenie Komitetu Sterującego zostało zamknięte.