

PROTOKÓŁ NR 7
z posiedzenia Komitetu Sterującego IRF
w dniu 19 listopada 2020 r.

Posiedzenie odbyło się 19 listopada 2020 r. w biurze Instytutu Rynku Finansowego w Warszawie oraz za pośrednictwem środków porozumiewania się na odległość.

Uczestnicy:

1. Janusz Jankowiak, Przewodniczący Komitetu Sterującego IRF - uczestnictwo telekonferencyjne
2. Prof. Andrzej Sławiński, Członek Komitetu Sterującego IRF - uczestnictwo telekonferencyjne
3. Dr Jacek Bartkiewicz Członek Komitetu Sterującego - uczestnictwo telekonferencyjne
4. Tomasz Mironczuk, Prezes Zarządu IRF - uczestnictwo z Biura IRF, na zaproszenie Przewodniczącego KS
5. Marta Penczar, Zespół Audytu, uczestnictwo telekonferencyjne, na zaproszenie Przewodniczącego KS
6. Piotr Mielus, Dyrektor Zespołu Operacji - uczestnictwo z Biura IRF, 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 dotyczących konfliktu interesu.
- 2) Przyjęcie Sprawozdania z działalności Komitetu Sterującego IRF I Kadencji (X 2019 - X 2020).
- 3) Ukonstytuowanie się Komitetu Sterującego IRF II Kadencji.
- 4) Przedstawienie przez Zarząd IRF informacji bieżącej dot. funkcjonowania IRF:
 - a. Informacja o decyzji KNF w sprawie zgody na pełnienie przez IRF funkcji administratora wskaźnika referencyjnego stopy procentowej;
 - b. Informacja bieżąca nt. dziennego procesu opracowywania indeksu WKF – prezentacja „Raportu nadzorczego WKF”;
- 5) Wniosek Zarządu o wyrażenie zgody na powołanie dr Marty Penczar na stanowisko Dyrektora Zespołu Audytu.
- 6) Wniosek Zarządu o zaopiniowanie przez KS rocznego Planu kontroli IRF na okres 2020/21 r.
- 7) Informacja Zarządu o przeglądzie polityk i procedur wewnętrznych IRF z punktu widzenia ich aktualności.
- 8) Sprawy różne.

Przebieg posiedzenia:

Ad. 1)

Porządek posiedzenia został przyjęty.

Członkowie KS złożyli do protokołu oświadczenia o niewystępowaniu konfliktu interesu.

Ad. 2)

W związku z zakończeniem pierwszej kadencji KS IRF, Przewodniczący Komitetu przedstawił Sprawozdanie z działalności Komitetu Sterującego IRF I Kadencji (X 2019 - X 2020).

Treść Sprawozdania z działalności Komitetu Sterującego IRF I Kadencji (X 2019 - X 2020) została zaakceptowana przez Członków KS.

Ad. 3)

Przewodniczący Komitetu, po uzgodnieniu z Prezesem IRF przedstawił wniosek, aby Komitet Sterujący II kadencji pracował w niezmienionym składzie, tj. Jacek Bartkiewicz, Janusz Jankowiak, Andrzej Sławiński. Wskazane osoby - dotychczasowi Członkowie KS - wyrazili zgodę na pracę w Komitecie Sterującym IRF II Kadencji. Kadencja Członka KS trwa trzy lata.

Na Przewodniczącego Komitetu Sterującego II Kadencji został wybrany prof. Andrzej Sławiński

Komitet Sterujący IRF II kadencji ukonstytuował się w składzie:

1. Prof. Andrzej Sławiński - Przewodniczący
2. dr Jacek Bartkiewicz
3. Janusz Jankowiak

Ad. 4 a.)

Prezes Zarządu IRF poinformował Członków KS IRF o decyzji Komisji Nadzoru Finansowego z dnia 3 listopada 2020 r. „o udzieleniu Instytutowi Rynku Finansowego Zezwolenia na prowadzenie działalności jako administrator wskaźnika referencyjnego stóp procentowych zgodnie ze złożonym wnioskiem.

Decyzja organu nadzoru oznacza jednocześnie, że opracowywany przez IRF Wskaźnik Kosztu Finansowania został zaakceptowany i uznany za zgodny z przepisami Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) w sprawie indeksów stosowanych jako wskaźniki w instrumentach i kontraktach finansowych (BMR). Tym samym Wskaźnik Kosztu Finansowania jako pierwszy i na razie jedyny wskaźnik referencyjny stopy procentowej w Polsce został przez KNF uznany za spełniający wymogi regulacyjne Rozporządzenia BMR.

Ad. 4 b.)

Dyrektor Zespołu Operacji przedstawił „Raport nadzorczy WKF” w tym informację o przebiegu procesu opracowywania WKF.

Raport jest pierwszym zestawieniem przygotowanym przez IRF na potrzeby KS po uzyskaniu przez IRF statusu administratora wskaźnika stopy procentowej. Raport obejmuje okres pomiędzy pierwszym dniem publikacji indeksu (7.01.2020) a datą uzyskania autoryzacji (3.11.2020). W przypadku danych wejściowych jako początek analizy przyjęto datę utworzenia Panelu WKF (17.12.2019). Raport składa się z dwóch części: część ekonomiczna przedstawia szeregi czasowe indeksu oraz analizę wzajemnych relacji pomiędzy cenami i krzywe dochodowości. Część operacyjno-techniczna prezentuje proces dostarczania danych wejściowych od banków panelistów oraz charakterystykę wolumenów depozytów, które służą do wyznaczania wartości wskaźnika.

Ad. 5)

Prezes Zarządu IRF, na podstawie pkt. 44 Regulaminu Organizacyjnego IRF przedstawił Członkom Komitetu kandydaturę dr Marty Penczar na stanowisko Dyrektora Zespołu Audytu.

Komitet Sterujący wyraził zgodę na powołanie na stanowisko Dyrektora Zespołu Audytu osoby wskazanej przez Prezesa Zarządu.

Ad. 6)

Dyrektor Zespołu Audytu przedstawiła projekt Roczego planu kontroli na 2021 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 2021 r.

Członkowie Komitetu Sterującego pozytywnie zaopiniowali dokument: Roczny plan kontroli na 2021 r.

Ad. 7)

Prezes Zarządu poinformował o przeprowadzonym przeglądzie polityk i procedur wewnętrznych IRF z punktu widzenia ich aktualności.

W ramach informacji wskazano, że wszystkie polityki i procedury, które zostały przyjęte przez Zarząd 25 i 31 października 2019 r. stanowiły załączniki do wniosku złożonego przez Zarząd IRF w Komisji Nadzoru Finansowego w dniu 15 listopada 2019 r. W wyniku zgłoszonych przez KNF w trakcie postępowania administracyjnego uwag i wniosków, dokumenty wewnętrzne IRF podlegały zmianom. W efekcie, akceptując obecnie obowiązujący zbiór polityk i procedur wewnętrznych Administratora, organ nadzoru wydał 3 listopada 2020 r. decyzję o zgodzie na pełnienie przez IRF funkcji administratora wskaźnika referencyjnego stopy procentowej.

Komitet Sterujący uczestnicząc w procesie przygotowania dokumentów wewnętrznych IRF uznał, że - w związku z akceptacją przez KNF tych obecnie obowiązujących przepisów - roczny przegląd polityk i procedur został dokonany.

Ad. 8)

Członkowie KS uzgodnili ramowy harmonogram posiedzeń KS IRF w 2021 r. Planowane posiedzenia będą się odbywały w każdy trzeci czwartek miesiąca po zakończeniu kwartału.

Na tym posiedzenie Komitetu Sterującego zostało zamknięte.

