

PROTOKÓŁ NR 8
z posiedzenia Komitetu Sterującego IRF
w dniu 28 stycznia 2021 r.

Posiedzenie odbyło się 28 stycznia 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. 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 z przeglądu procesów i oświadczeń dot. konfliktu interesu przeprowadzonego przez Komitet ds. Konfliktu Interesu (ZFKS pkt 12);
 - b) Informacja dot. skarg, reklamacji oraz niezgodności (ZFKS pkt. 35, 36);
 - c) Raport dot. zarządzania ryzykiem operacyjnym i nadzoru nad procesami zarządzania ryzykiem (ZFKS pkt 7);
 - d) Raport dot. kontroli przestrzegania KPBP przez Banki Panelistów (ZFKS pkt. 9, 10);
 - e) Informacja bieżąca nt. dziennego procesu opracowywania indeksu WKF oraz raport dot. jakości dostarczanych danych (ZFKS pkt 10);
 - f) Raport nadzorczy WKF dot. realizacji procesów mających na celu monitoring wybranych parametrów jakości rynku referencyjnego (Oświadczenie Administratora s. 14).
- 3) Informacja Zarządu IRF dot. procesu wyboru podmiotu do przeprowadzenia niezależnego audytu zewnętrznego.
- 4) Sprawy różne.

Przebieg posiedzenia:

Ad. 1)

Porządek posiedzenia został przyjęty.

Członkowie KS złożyli do protokołu oświadczenia o niewystępowaniu konfliktu interesu.

Ad. 2. a)

Prezes Zarządu IRF przedstawił informację z przeglądu procesów i oświadczeń dot. konfliktu interesu przeprowadzonego przez Komitet ds. Konfliktu Interesu. Materiał był przedmiotem analizy Komitetu ds. Konfliktu Interesu w dniu 28 stycznia 2021. Wszystkie osoby objęte Polityką i Procedurą Zarządzania Konfliktem Interesu złożyły oświadczenia zgodnie z przepisami tej Polityki. 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 z składaniem oświadczeń.

Komitet Sterujący IRF przyjął informację do wiadomości.

Ad. 2. b)

Prezes Zarządu IRF przedstawił informację dot. skarg, reklamacji oraz 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. 2. c)

Prezes Zarządu IRF przedstawił Raport dot. zarządzania ryzykiem operacyjnym i nadzoru nad procesami zarządzania ryzykiem. W okresie sprawozdawczym nie wystąpiły zdarzenia ryzyka operacyjnego.

Komitet Sterujący IRF przyjął informację do wiadomości.

Ad. 2. d)

Prezes Zarządu IRF przedstawił Raport dot. kontroli przestrzegania Kodeksu Postępowania Banku Panelisty przez Banki Panelistów. W okresie sprawozdawczym nie stwierdzono przypadków nie przestrzegania przepisów KPB. .

Komitet Sterujący IRF przyjął informację do wiadomości.

Ad. 2. e, f)

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

Raport obejmuje 4 kw. 2020 r., w tym okres po 3 listopada 2020 r. tj. dniu decyzji KNF dot. zgody na pełnienie funkcji administratora wskaźników referencyjnych stóp procentowych. Zaprezentowane dane stanowią uzupełnienie raportu przedstawionego na posiedzeniu KS w dniu 19 listopada ub.r. Zespół Operacji przedstawił analizy, które będą elementami raportów nadzorczych w cyklu kwartalnym.

Dyrektor Zespołu Operacji zaprezentował również raport w zakresie wypełniania obowiązków Administratora dot. monitorowania stanu rynku i jakości danych wejściowych. W związku z pojawiającymi się informacjami medialnymi związanymi z ograniczonym zasobami transakcyjnymi stanowiącymi podstawę wyznaczania dotychczas funkcjonujących w Polsce wskaźników referencyjnych Komitet dokonał przeglądu stabilności zasobu transakcyjnego stanowiącego podstawę do wyznaczania WKF. Obserwacje II półrocza 2020 wskazują na stabilność otrzymywanych danych wejściowych zarówno pod kątem wolumenu jak również ilości i koncentracji. Niemniej jednak

Członkowie KS wskazali na konieczność stałego monitoringu rynku ze względu na zmianę polityk produktowych kluczowych banków w polskim systemie finansowym.

Ad. 3)

Prezes Zarządu IRF poinformował Komitet Sterujący IRF o przygotowaniach do procesu wyboru podmiotu do przeprowadzenia niezależnego audytu zewnętrznego Administratora. Konieczność przeprowadzenia takiego audytu wynika z przepisu pkt. 4 Załącznika I do BMR. Proces wyboru zostanie przeprowadzony zgodnie z obowiązującymi w IRF „Zasady wyboru audytora Zewnętrznego”.

Ad. 4)

Nie zgłoszono

Na tym posiedzenie Komitetu Sterującego zostało zamknięte.