

Komunikat 12/2022
z posiedzenia Komitetu Nadzorczego Wskaźników Referencyjnych Stóp Procentowych
z dnia 22 listopada 2022 roku

W dniu 22 listopada 2022 roku odbyło się posiedzenie Komitetu Nadzorczego Wskaźników Referencyjnych Stóp Procentowych działającego przy GPW Benchmark S.A.

W posiedzeniu udział wzięli Członkowie Komitetu Nadzorczego:

1. Małgorzata Smagorowicz – Chojnowska
2. Artur Zwaliński
3. Bartłomiej Dzik
4. Norbert Jeziolowicz
5. Sławomir Panasiuk
6. Małgorzata Rusewicz
7. Michał Pałka
8. Agnieszka Zdziennicka
9. Monika Kruk-Nieznańska

W posiedzeniu uczestniczyli przedstawiciele instytucji pełniących funkcję Obserwatora przy Komitecie Nadzorczym:

1. Stowarzyszenie ACI Polska (ACI)
2. Narodowy Bank Polski (NBP)

Przedmiotem obrad na posiedzeniu Komitetu Nadzorczego były:

- 1) Raport o kształtowaniu się i przebiegu Fixingu Stawek Referencyjnych WIBID i WIBOR oraz o sytuacji na rynku depozytowym.
- 2) Informacja o statusie projektów rozwojowych Systemu Fixingowego w zakresie dotyczącym wyznaczania wskaźników referencyjnych stopy procentowej wolnych od ryzyka (tzw. RFR).
- 3) Informacja o dokonaniu rekalkulacji historycznych wartości indeksu WIRON przy zastosowaniu nowych elementów metody dotyczących progu maksimum dla udziału transakcji pojedynczego podmiotu przekazującego dane w łącznym dziennym wolumenie zakwalifikowanych transakcji oraz procedury przycinania wolumenu w przypadku istotnej koncentracji transakcji u jednego podmiotu przekazującego dane w wybranych zbiorach podmiotowych.
- 4) Publikacja na stronie internetowej suplementu analitycznego do „Podsumowania konsultacji publicznych dotyczących wyboru i metody indeksów stopy procentowej” zaprezentowanego w sierpniu 2022 roku.
- 5) Wznowienie udostępniania danych historycznych indeksów WIRON oraz WRR, indeksów kalkulowanych na terminy predefiniowane oraz indeksów jednopodstawowych.
- 6) Informacja o pracach Narodowej Grupy Roboczej ds. reformy wskaźników referencyjnych.
- 7) Przekazanie informacji o statusie prac nad dokumentacją wewnętrzną związaną z opracowywaniem indeksu WIRON.

- 8) Informacje dotyczące współpracy z dystrybutorami informacji oraz z agentem kalkulacyjnym indeksów na terminy predefiniowane oraz indeksów jednopodstawowych.
- 9) Postęp prac dotyczących Kodeksu Postępowania Rodziny Transakcyjnych Wskaźników Referencyjnych, w tym przystąpienie Podmiotów Przekazujących Dane do Kodeksu.