

Komunikat 9/2022

z posiedzenia Komitetu Nadzorczego Wskaźników Referencyjnych Stóp Procentowych z dnia 26 sierpnia 2022 roku

W dniu 26 sierpnia 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. Monika Kruk-Nieznańska

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

1. Narodowy Bank Polski (NBP)
2. Stowarzyszenie ACI Polska
3. Bankowy Fundusz Gwarancyjny (BFG)

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, w tym sytuacji na rynku instrumentów pochodnych stopy procentowej w zakresie oczekiwań dotyczących zmian w parametrach polityki monetarnej.
- 2) Informacja o testach modułów przeznaczonych do wyznaczania tzw. wskaźników referencyjnych stopy procentowej wolnych od ryzyka przeprowadzanych w zewnętrznym środowisku testowym Systemu Fixingowego.
- 3) Omówienie statusu prac nad Kodeksem Postępowania Transakcyjnych Wskaźników Referencyjnych oraz wybranych zagadnień związanych z nim. Przyjęcie przedłożonego Kodeksu Postępowania Transakcyjnych Wskaźników Referencyjnych przez Komitet Nadzorczy.
- 4) Informacja o pracach związanych z weryfikacją historycznych danych o transakcjach po stronie podmiotów przekazujących dane dla celów kalkulacji historycznych wartości indeksu WIRON w tym tzw. proxy data, wykorzystywanych do wyznaczenia spreadu korygującego w oparciu o metodę historyczną.
- 5) Omówienie wyników ankiety skierowanej do podmiotów rynku finansowego dotyczącej momentu i zasad publikacji indeksów RFR.