

**Zestawienie kluczowych terminów dotyczących Indeksu Stopy Procentowej POLSTR
oraz Rodziny Indeksów Składanych POLSTR**

Administrator	GPW Benchmark S.A. z siedzibą w Warszawie, adres: ul. Książęca 4, 00-498 Warszawa, wpisana do rejestru przedsiębiorców Krajowego Rejestru Sądowego prowadzonego przez Sąd Rejonowy dla m.st. Warszawy w Warszawie, XII Wydział Gospodarczy pod numerem KRS 0000493097; o kapitale zakładowym w wysokości 5 900 000 zł - opłaconym w całości; NIP 5252546511
Anulowanie Transakcji	zdarzenie niestanowiące Błędu, polegające na anulowaniu lub innej zmianie transakcji przez klienta między datą transakcji a datą waluty
Błąd	zdarzenie, które nie stanowi Podejrzanych Danych Wejściowych, a które nosi znamiona nieumyślnej wady występującej na etapie przygotowywania Danych w systemach księgowych lub transakcyjnych Podmiotów Przekazujących Dane lub podczas przekazywania Danych do Administratora
Dane	dane dotyczące transakcji zawartych przez Podmioty Przekazujące Dane w segmentach rynku pieniężnego, określone w Procedurze Przekazywania Danych, w tym Dane Wejściowe
Dane Dodatkowe	Dane, niebędące Danymi Wejściowymi, które nie są objęte Procedurą Korekty Błędów oraz Procedurą Aktualizacji Danych, określone w Procedurze Przekazywania Danych, przekazywane do Administratora z zachowaniem obowiązku dołożenia staranności
dane dotyczące transakcji	ceny, stopy, indeksy lub wartości, reprezentujące transakcje między niepowiązаныmi kontrahentami na aktywnym rynku podlegającym konkurencyjnym siłom podaży i popytu
Dane Wejściowe	Dane przekazywane przez Podmiot Przekazujący Dane Administratorowi, wskazane w pkt 6 Kodeksu Postępowania, stanowiące dane wejściowe w rozumieniu art. 3 ust. 1 pkt 14 Rozporządzenia o Wskaźnikach Referencyjnych
Data Wskaźnika	data zawarcia Transakcji Depozytowych, które są Danymi Wejściowymi do wyznaczenia wartości POLSTR
Data Wskaźnika POLSTR Stopa Składana	data końca Okresu Referencyjnego, czyli kolejny Dzień Roboczy po Dacie Wskaźnika POLSTR, który jako ostatni wykorzystany jest do wyznaczenia POLSTR Stopa Składana
Data Wskaźnika POLSTR Indeks Jednopo podstawowy	kolejny Dzień Roboczy po Dacie Wskaźnika POLSTR, który jako ostatni wykorzystany jest do wyznaczenia POLSTR Indeks Jednopo podstawowy

Dzień Roboczy	dzień kalendarzowy, z wyjątkiem sobót, niedziel oraz dni ustawowo wolnych od pracy, w którym Podmioty Przekazujące Dane prowadzą działalność na polskim rynku pieniężnym
Instytucja Kredytowa	oznacza: a) banki krajowe z uwzględnieniem banków zrzeszających, b) oddziały Zagranicznych Instytucji Kredytowych działających w Polsce oraz oddziały Banków Zagranicznych działających w Polsce, ale z wyłączeniem Banków Zagranicznych oraz Zagranicznych Instytucji Kredytowych. Kategoria Instytucji Kredytowej na potrzeby niniejszego Kodeksu Postępowania nie obejmuje: a) banków centralnych, b) Banków Spółdzielczych, c) Banków Hipotecznych, d) Spółdzielczych Kas Oszczędnościowo-Kredytowych, oraz e) podmiotów, w stosunku do których został wyznaczony zarząd komisaryczny, lub wobec których Bankowy Fundusz Gwarancyjny podjął decyzję o wszczęciu przymusowej restrukturyzacji lub umorzeniu lub konwersji instrumentów kapitałowych lub zobowiązań kwalifikowalnych
Kluczowy Element Metody	element Metody, którego zmiana może być uznana za zmianę istotną, o której mowa w art. 13 ust. 1 lit. c) Rozporządzenia o Wskaźnikach Referencyjnych
Kodeks Postępowania	Kodeks Postępowania Rodziny Transakcyjnych Wskaźników Referencyjnych wraz z załącznikami stanowiącymi jego integralną część, z uwzględnieniem wszelkich zmian i uzupełnień
Komitet Nadzorczy	Komitet Nadzorczy Wskaźników Referencyjnych Stopy Procentowej, wykonujący funkcję jednostki nadzorczej w rozumieniu art. 5 Rozporządzenia o Wskaźnikach Referencyjnych
Konwencja Ustalania Daty Początku Okresu Referencyjnego	przyjęta przez administratora reguła wyznaczania daty początku Okresu Referencyjnego na podstawie daty końca Okresu Referencyjnego
Korekta Główna	parametr Metody, który informuje jaki centralny zakres uporządkowanej struktury Danych Wejściowych jest wykorzystywany do ostatecznego ustalenia wartości POLSTR
Kryteria Podmiotu Przekazującego Dane	obligatoryjne kryteria, jakie musi spełniać podmiot, aby uzyskać status Podmiotu Przekazującego Dane
Maksymalny Próg Wolumenowy Pojedynczej Transakcji	element Metody polegający na ograniczaniu wpływu transakcji wysoko wolumenowych na Zasób Transakcyjny i w konsekwencji na wartość indeksu
Metoda Opracowywania/ Metoda	zasady przygotowania Danych Wejściowych oraz wyznaczania wartości POLSTR
	zasady doboru Danych Wejściowych oraz wyznaczania wszystkich Indeksów Składanych POLSTR

Minimalny Próg Wolumenowy Pojedynczej Transakcji	określenie poziomu nominalu pojedynczej transakcji, poniżej którego transakcje nie są kwalifikowane do dalszego procesu opracowywania indeksu
Okres Referencyjny	okres, dla którego wyznaczana jest stopa procentowa zgodnie z metodą procentu składanego, w oparciu o wartości POLSTR, których Datami Wskaźnika są Dni Robocze wchodzące w skład tego okresu (z wyłączeniem daty końca Okresu Referencyjnego)
ocena ekspercka	korzystanie przez administratora lub podmiot przekazujący dane ze swobody uznania w odniesieniu do wykorzystania danych przy wyznaczaniu wskaźnika referencyjnego
O/N	termin zapadalności dla Transakcji, która zaczyna się w dniu jej zawarcia a kończy w następnym Dniu Roboczym po jej zawarciu (overnight)
opracowywanie wskaźnika referencyjnego	oznacza: a) zarządzanie mechanizmami dotyczącymi wyznaczania wskaźnika referencyjnego; b) gromadzenie, analizę lub przetwarzanie danych wejściowych na potrzeby wyznaczenia wskaźnika referencyjnego; oraz c) wyznaczenie wskaźnika referencyjnego poprzez zastosowanie wzoru lub innej metody obliczania lub poprzez ocenę danych wejściowych przekazanych w tym celu
Podejrzane Dane Wejściowe	Dane Wejściowe, w stosunku do których istnieje podejrzenie manipulacji w rozumieniu MAR
Podmiot Przekazujący Dane	podmiot, który otrzymał potwierdzenie od Administratora o nadaniu statusu Podmiotu Przekazującego Dane i następnie nie utracił tego statusu na zasadach określonych w Kodeksie Postępowania
POLSTR	Polish Short Term Rate, Wskaźnik Transakcyjny będący indeksem przeznaczonym do stosowania jako wskaźnik referencyjny stopy procentowej, dotyczący terminu zapadalności O/N, opracowywany przez Administratora na podstawie Transakcji Depozytowych zawieranych przez Podmioty Przekazujące Dane z podmiotami wskazanymi w pkt 6.6 Kodeksu Postępowania
Procedura Aktualizacji Danych	procedura określająca sposób postępowania w przypadku Anulowania Transakcji
Procedura Korekty Błędów	procedura Podmiotu Przekazującego Dane, dotycząca postępowania w przypadku wykrycia Błędu w Danych na etapie ich przygotowywania
Procedura Powtórznego Wyznaczania i Udostępniania POLSTR	procedura określająca przesłanki i sposób postępowania, w przypadku konieczności powtórznego wyznaczenia i udostępnienia wartości POLSTR
Procedura Przycinania Wolumenów	procedura stosowana w przypadku wystąpienia koncentracji w danym zbiorze transakcji, zgodnie z którą dochodzi do przycinania wolumenów Transakcji Depozytowych Podmiotu Przekazującego Dane, który spełnia kryteria podmiotu dominującego („dominatora”) w danym zbiorze Transakcji Depozytowych

Procedura Przekazywania Danych	procedura Administratora, określająca zasady przekazywania Danych, w tym Danych Wejściowych, do Administratora, stanowiąca Załącznik nr 9 do Kodeksu Postępowania
publikacja	podanie wartości indeksów do wiadomości publicznej poprzez stronę internetową administratora
rodzina wskaźników referencyjnych	grupa wskaźników referencyjnych opracowanych przez tego samego administratora, wyznaczonych na podstawie danych wejściowych o takim samym charakterze, która pozwala na konkretne pomiary tego samego lub podobnego rynku lub tych samych lub podobnych realiów gospodarczych
Rozporządzenie o Wskaźnikach Referencyjnych	Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2016/1011 z dnia 8 czerwca 2016 r. w sprawie indeksów stosowanych jako wskaźniki referencyjne w instrumentach finansowych i umowach finansowych lub do pomiaru wyników funduszy inwestycyjnych i zmieniające dyrektywy 2008/48/WE i 2014/17/UE oraz rozporządzenie (UE) nr 596/2014
Rynek Referencyjny	rynek, którego pomiar jest celem danego Wskaźnika Transakcyjnego, określony przez Administratora w Regulaminie Wskaźnika Transakcyjnego
Transakcja Depozytowa	transakcja Podmiotu Przekazującego Dane o oprocentowaniu stałym polegająca na przyjęciu lub złożeniu środków pieniężnych w złotych na określony termin, od których naliczane są odsetki za okres, na jaki środki te zostały przyjęte lub złożone bez ustanawiania żadnego prawnego zabezpieczenia na potrzeby wykonania zaciągniętych zobowiązań wynikających z tej transakcji, z wyłączeniem transakcji nienegocjowanych, to jest takich, które nie są zawierane po każdorazowym, indywidualnym uzgodnieniu warunków transakcji, czyli zawieranych według predefiniowanych reguł
udostępnienie	przekazanie wartości indeksów po ich obliczeniu w czasie rzeczywistym dystrybutorom informacji do dystrybucji na zasadach przez nich przyjętych
wskaźnik referencyjny	dowolny indeks stanowiący odniesienie do określenia kwoty przypadającej do zapłaty z tytułu instrumentu finansowego lub umowy finansowej lub do określenia wartości instrumentu finansowego bądź indeks stosowany do pomiaru wyników funduszu inwestycyjnego w celu śledzenia stopy zwrotu takiego indeksu lub określenia alokacji aktywów z portfela, lub obliczania opłat za wyniki
wskaźnik referencyjny stóp procentowych	wskaźnik referencyjny wyznaczany w oparciu o stopę, według której banki mogą udzielać pożyczek innym bankom lub agentom lub pożyczać od innych banków lub agentów na rynku finansowym
wyznaczanie	dokonanie obliczenia wartości danego indeksu lub wskaźnika w danym dniu roboczym, według przyjętej metody wyznaczania
Zasób Transakcyjny	Dane Wejściowe po przeprowadzeniu czynności określonych w pkt 2.5.1 Regulaminu Indeksu Stopy Procentowej POLSTR