
Stawki Referencyjne WIBID i WIBOR



Informacja o wpływie korekty błędów na wartości Stawek Referencyjnych WIBID i WIBOR

Q1 2023

Ujawnienie cykliczne

Warszawa, kwiecień 2023

W celu zapewnienia przejrzystości procesu opracowywania i wyznaczania Stawek Referencyjnych WIBID i WIBOR Administrator prezentuje zagregowane informacje na temat wpływu korekty błędów zidentyfikowanych dotychczas w danych wejściowych w postaci Kwotowań Modelowych i Kwotowań Wiążących przekazywanych przez podmioty przekazujące dane użytych do ustalenia Stawek Referencyjnych WIBID i WIBOR w procesie Fixingu. Niniejszy dokument jest dokumentem cyklicznym (kwartalnym) związanym z ewentualnymi bieżącymi korektami danych wejściowych w okresie opracowywania Stawek Referencyjnych WIBID i WIBOR.

Regulamin Stawek Referencyjnych WIBID i WIBOR nie przewiduje procesu ponownego ustalenia raz wyznaczonych Stawek Referencyjnych, w związku z czym informacja zawarta w tym dokumencie nie ma wpływu na historyczne wartości Stawek Referencyjnych WIBID i WIBOR, które zostały opublikowane dotychczas na stronie internetowej Administratora.

Poniższe zestawienie wpływu korekty odnotowanych błędów, w tym błędów odnotowanych w danych transakcyjnych wykorzystywanych w procesie przygotowania Kwotowań Modelowych, obejmuje okres 2 stycznia 2023 - 31 marca 2023. W okresie tym nie odnotowano błędów w Kwotowaniach Wiążących. Analiza została przeprowadzona na stan bazy danych transakcyjnych na dzień 31.03.2023.

WIBID

Kwartał	Liczba skorygowanych Fixingów (% wszystkich Fixingów) ¹	Liczba skorygowanych Kwotowań (% wszystkich Kwotowań) ²	Liczba odchyień o 1 pb. ³	Liczba odchyień o 2 pb. ³	Liczba odchyień o 3 pb. ³	Liczba odchyień większych niż 3 pb. ³	Średnie odchylenie (pb.) ⁴
Q1 2023	0 (0,0%)	2 (0,2%)	0	0	0	0	0

Tabela nr 1

WIBOR

Kwartał	Liczba skorygowanych Fixingów (% wszystkich Fixingów) ¹	Liczba skorygowanych Kwotowań (% wszystkich Kwotowań) ²	Liczba odchyień o 1 pb. ³	Liczba odchyień o 2 pb. ³	Liczba odchyień o 3 pb. ³	Liczba odchyień większych niż 3 pb. ³	Średnie odchylenie (pb.) ⁴
Q1 2023	0 (0,0%)	2 (0,2%)	0	0	0	0	0

Tabela nr 2

1 Liczba wszystkich Fixingów jest obliczana jako liczba ustaleń Stawek Referencyjnych na wszystkie Terminy Fixingowe na wszystkie Dni Fixingu w danym kwartale.

2 Liczba wszystkich Kwotowań jest obliczana jako Kwotowania Wiążące i Kwotowania Modelowe na wszystkie Terminy Fixingowe na wszystkie Dni Fixingu w danym kwartale.

3 Odchylenie jest mierzone jako różnica bezwzględna między opublikowanym Fixingiem a ponownie ustalonym Fixingiem.

4 Średnie odchylenie jest mierzone jako średnia różnic między opublikowanym Fixingiem a ponownie ustalonym Fixingiem.

W celu przybliżenia struktury rozkładu błędów Administrator udostępnia rozkład struktury błędów w podziale na Terminy Fixingowe dla kluczowego wskaźnika referencyjnego WIBOR.

Termin Fixingowy	Wartość bezwzględna różnicy / liczba przypadków				Średnia różnica odległości
	0,01	0,02	0,03	0,04	
ON	-	-	-	-	-
TN	-	-	-	-	-
SW	-	-	-	-	-
2W	-	-	-	-	-
1M	-	-	-	-	-

3M	-	-	-	-	-
6M	-	-	-	-	-
1Y	-	-	-	-	-
Suma	-	-	-	-	-

Tabela nr 3. Statystyki wpływu rewizji danych transakcyjnych mających wpływ na Kwotowania Modelowe oraz Błędów w Kwotowaniach Wiążących przez poszczególne banki na przebieg wartości wskaźnika WIBOR.

Termin Fixingowy	Wartość różnicy / liczba przypadków								Średnia różnica odległości
	-0,04	-0,03	-0,02	-0,01	0,01	0,02	0,03	0,04	
ON	-	-	-	-	-	-	-	-	-
TN	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SW	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2W	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1M	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3M	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6M	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1Y	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Suma	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Tabela nr 4. Statystyki wpływu rewizji danych transakcyjnych mających wpływ na Kwotowania Modelowe oraz Błędów w Kwotowaniach Wiążących przez poszczególne banki na przebieg wartości wskaźnika. Wartość różnicy obliczona jest poprzez odjęcie od wartości opublikowanych wskaźnika WIBOR, wartości hipotetycznych wskaźnika WIBOR.

W przypadku aktualizacji historycznych danych transakcyjnych przez Uczestników Fixingu prezentowane statystyki mogą ulec zmianie.