
Stawki Referencyjne WIBID i WIBOR



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

Q4 2024

Ujawnienie cykliczne

Warszawa, styczeń 2025

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. Informacja ma charakter narastający, tzn. uwzględnia wpływ korekt w danych wejściowych przekazanych w kolejnych kwartałach danego roku kalendarzowego.

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 2024 - 31 grudnia 2024. W okresie tym nie odnotowano błędów w Kwotowaniach Wiążących. Analiza została przeprowadzona na stan bazy danych transakcyjnych na dzień 2 stycznia 2025.

WIBID

Kwartał	Liczba skorygowanych Fixingów	Liczba skorygowanych Kwotowań	Liczba odchyień o 1 pb. ¹	Liczba odchyień o 2 pb. ¹	Liczba odchyień o 3 pb. ¹	Liczba odchyień większych niż 3 pb. ¹	Średnie odchylenie (pb.) ²
Q1 2024	1	7	1	-	-	-	-1
Q2 2024	5	20	5	-	-	-	0,6
Q3 2024	1	6	1	-	-	-	1
Q4 2024	1	31	1	-	-	-	1

Tabela nr 1

WIBOR

Kwartał	Liczba skorygowanych Fixingów	Liczba skorygowanych Kwotowań	Liczba odchyień o 1 pb. ¹	Liczba odchyień o 2 pb. ¹	Liczba odchyień o 3 pb. ¹	Liczba odchyień większych niż 3 pb. ¹	Średnie odchylenie (pb.) ²
Q1 2024	1	7	1	-	-	-	-1
Q2 2024	6	20	6	-	-	-	0,7
Q3 2024	1	6	1	-	-	-	1
Q4 2024	1	31	1	-	-	-	1

Tabela nr 2

¹ Odchylenie jest mierzone jako różnica bezwzględna między opublikowanym Fixingiem a ponownie ustalonym Fixingiem.

² 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 w rozbiciu na kolejne kwartały.

- 1. kwartał 2024

Termin Fixingowy	Wartość bezwzględna różnicy (w p.p.) / liczba przypadków					Średnia różnica odległości ³
	0,01	0,02	0,03	0,04	> 0,04	
ON	1	-	-	-	-	0,010
TN	-	-	-	-	-	-
SW	-	-	-	-	-	-
2W	-	-	-	-	-	-
1M	-	-	-	-	-	-
3M	-	-	-	-	-	-
6M	-	-	-	-	-	-
1Y	-	-	-	-	-	-
Suma	1	-	-	-	-	0,010

Tabela nr 3. Statystyki wpływu rewizji danych transakcyjnych mających wpływ na Kwotowania Modelowe oraz Błędów w Kwotowaniach Wiążących przez poszczególne podmioty na przebieg wartości wskaźnika WIBOR w Q1 2024.

Termin Fixingowy	Wartość różnicy (w p.p.) / liczba przypadków										Średnia różnica ⁴
	< -0,04	-0,04	-0,03	-0,02	-0,01	0,01	0,02	0,03	0,04	> 0,04	
ON	-	-	-	-	1	-	-	-	-	-	-0,010
TN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SW	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2W	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1M	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3M	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6M	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1Y	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Suma	-	-	-	-	1	-	-	-	-	-	-0,010

Tabela nr 4. Statystyki wpływu rewizji danych transakcyjnych mających wpływ na Kwotowania Modelowe oraz Błędów w Kwotowaniach Wiążących przez poszczególne podmioty na przebieg wartości wskaźnika. Wartość różnicy obliczona jest poprzez odjęcie od wartości opublikowanych wskaźnika WIBOR, wartości hipotetycznych wskaźnika WIBOR w Q1 2024.

- 2. kwartał 2024

Termin Fixingowy	Wartość bezwzględna różnicy (w p.p.) / liczba przypadków					Średnia różnica odległości ³
	0,01	0,02	0,03	0,04	> 0,04	
ON	1	-	-	-	-	0,010
TN	-	-	-	-	-	-
SW	2	-	-	-	-	0,010
2W	3	-	-	-	-	0,010
1M	-	-	-	-	-	-
3M	-	-	-	-	-	-
6M	-	-	-	-	-	-
1Y	-	-	-	-	-	-
Suma	6	-	-	-	-	0,010

Tabela nr 5. Statystyki wpływu rewizji danych transakcyjnych mających wpływ na Kwotowania Modelowe oraz Błędów w Kwotowaniach Wiążących przez poszczególne podmioty na przebieg wartości wskaźnika WIBOR w Q2 2024.

Termin Fixingowy	Wartość różnicy (w p.p.) / liczba przypadków										Średnia różnica ⁴
	< -0,04	-0,04	-0,03	-0,02	-0,01	0,01	0,02	0,03	0,04	> 0,04	
ON	-	-	-	-	-	1	-	-	-	-	0,010
TN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SW	-	-	-	-	1	1	-	-	-	-	0
2W	-	-	-	-	-	3	-	-	-	-	0,010
1M	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3M	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6M	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1Y	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Suma	-	-	-	-	1	5	-	-	-	-	0,007

Tabela nr 6. Statystyki wpływu rewizji danych transakcyjnych mających wpływ na Kwotowania Modelowe oraz Błędów w Kwotowaniach Wiążących przez poszczególne podmioty na przebieg wartości wskaźnika. Wartość różnicy obliczona jest poprzez odjęcie od wartości opublikowanych wskaźnika WIBOR, wartości hipotetycznych wskaźnika WIBOR w Q2 2024.

- 3. kwartał 2024

Termin Fixingowy	Wartość bezwzględna różnicy (w p.p.) / liczba przypadków					Średnia różnica odległości ³
	0,01	0,02	0,03	0,04	> 0,04	
ON	-	-	-	-	-	-
TN	-	-	-	-	-	-
SW	-	-	-	-	-	-
2W	-	-	-	-	-	-
1M	-	-	-	-	-	-
3M	1	-	-	-	-	0,010
6M	-	-	-	-	-	-
1Y	-	-	-	-	-	-
Suma	1	-	-	-	-	-

Tabela nr 7. Statystyki wpływu rewizji danych transakcyjnych mających wpływ na Kwotowania Modelowe oraz Błędów w Kwotowaniach Wiążących przez poszczególne podmioty na przebieg wartości wskaźnika WIBOR w Q3 2024.

Termin Fixingowy	Wartość różnicy (w p.p.) / liczba przypadków										Średnia różnica ⁴
	< -0,04	-0,04	-0,03	-0,02	-0,01	0,01	0,02	0,03	0,04	> 0,04	
ON	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
TN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SW	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2W	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1M	-	-	-	-	-	1	-	-	-	-	0,010
3M	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6M	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1Y	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Suma	-	-	-	-	-	0,010	-	-	-	-	-

Tabela nr 8. Statystyki wpływu rewizji danych transakcyjnych mających wpływ na Kwotowania Modelowe oraz Błędów w Kwotowaniach Wiążących przez poszczególne podmioty na przebieg wartości wskaźnika. Wartość różnicy obliczona jest poprzez odjęcie od wartości opublikowanych wskaźnika WIBOR, wartości hipotetycznych wskaźnika WIBOR w Q3 2024.

- 4. kwartał 2024

Termin Fixingowy	Wartość bezwzględna różnicy (w p.p.) / liczba przypadków					Średnia różnica odległości ³
	0,01	0,02	0,03	0,04	> 0,04	
ON	-	-	-	-	-	-
TN	-	-	-	-	-	-
SW	-	-	-	-	-	-
2W	1	-	-	-	-	0,010
1M	-	-	-	-	-	-
3M	-	-	-	-	-	-
6M	-	-	-	-	-	-
1Y	-	-	-	-	-	-
Suma	1	-	-	-	-	-

Tabela nr 9. Statystyki wpływu rewizji danych transakcyjnych mających wpływ na Kwotowania Modelowe oraz Błędów w Kwotowaniach Wiążących przez poszczególne podmioty na przebieg wartości wskaźnika WIBOR w Q4 2024.

Termin Fixingowy	Wartość różnicy (w p.p.) / liczba przypadków										Średnia różnica ⁴
	< -0,04	-0,04	-0,03	-0,02	-0,01	0,01	0,02	0,03	0,04	> 0,04	
ON	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
TN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SW	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2W	-	-	-	-	-	1	-	-	-	-	0,010
1M	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3M	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6M	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1Y	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Suma	-	-	-	-	-	0,010	-	-	-	-	-

Tabela nr 10. Statystyki wpływu rewizji danych transakcyjnych mających wpływ na Kwotowania Modelowe oraz Błędów w Kwotowaniach Wiążących przez poszczególne podmioty na przebieg wartości wskaźnika. Wartość różnicy obliczona jest poprzez odjęcie od wartości opublikowanych wskaźnika WIBOR, wartości hipotetycznych wskaźnika WIBOR w Q4 2024.

³ Średnia różnica odległości jest mierzona jako średnia z wartości bezwzględnych różnic dla danego Terminu Fixingowego. W przypadku wiersza sumy jest to wartość średnia z wartości bezwzględnych różnic dla wszystkich Terminów Fixingowych.

⁴ Średnia różnica odległości jest mierzona jako średnia z wartości różnic dla danego Terminu Fixingowego. W przypadku wiersza sumy jest to wartość średnia z wartości różnic dla wszystkich Terminów Fixingowych.

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