

Transakcyjne Wskaźniki Referencyjne Stopy Procentowej



Informacja o wpływie korekty błędów na WIRON

Q1 2024

Ujawnienie Cykliczne - rozszerzone

Warszawa, kwiecień 2024

W celu zapewnienia przejrzystości procesu opracowywania wskaźnika referencyjnego WIRON Administrator przedstawia informacje ujawnieniowe dotyczące wpływu korekty danych wejściowych na jego przebieg. Niniejszy dokument jest dokumentem cyklicznym (kwartalnym) związanym z ewentualnymi bieżącymi korektami danych wejściowych w okresie opracowywania indeksu WIRON. Informacja ma charakter narastający, tzn. uwzględnia wpływ kwalifikowanych błędów w danych wejściowych przekazanych w kolejnych kwartałach danego roku kalendarzowego.

W styczniu 2024 Administrator opublikował Raport z Rewizji Danych za Q3 i Q4 2023. W Q1 2024 odnotowano korektę danych wejściowych mającą wpływ na historyczne wartości wskaźników referencyjnych. Ponadto w lutym 2024 r. administrator zidentyfikował błąd operacyjny mający nieznaczny wpływ na poziom wyznaczonego Maksymalnego Progu Wolumenowego Pojedynczej Transakcji na 2023 rok¹. W związku z tym Administrator w raporcie za Q1 2024 prezentuje również wpływ wyżej wymienionych zdarzeń na wskaźnik referencyjny WIRON za cały 2023 rok.

Poniższe informacje dotyczące wpływu korekt danych wejściowych dotyczą okresu 2 stycznia 2023 – 29 marca 2024.

Materiał ma charakter informacyjny i nie prowadzi do rewizji historii wskaźnika referencyjnego WIRON. Udostępniane informacje dotyczą odchyleń niemniejszych niż 0,001 p.p. W celu uniknięcia wątpliwości powtórna kalkulacja i powtórne udostępnienie indeksu WIRON może mieć miejsce jedynie w przypadku przekazania informacji o błędach i korekcie danych wejściowych zgodnie z brzmieniem Regulaminu².

Tabela 1 prezentuje zestawienie odchyleń wartości hipotetycznych od wartości historycznych wskaźnika referencyjnego WIRON w podziale na ich zakresy. Informacja o wpływie korekt danych wejściowych uwzględnia korekty od wszystkich podmiotów przekazujących dane na dany dzień. W przypadku wystąpienia kilku korekt danych wejściowych wpływających na wartość wskaźnika referencyjnego w danym dniu, ich wszystkie przyczyny są wymienione w kolumnie Powód.

L.p.	Data	Wartość bezwzględna wpływu korekty danych wejściowych na wartość wskaźnika referencyjnego (w p.p.)				Powód
		0.001 ≤ wpływ ≤ 0.005	0.005 < wpływ ≤ 0.010	0.010 < wpływ ≤ 0.020	0.020 < wpływ	
1	2023-01-02				✓	Korekta danych
2	2023-01-03				✓	Korekta danych
3	2023-01-04				✓	Korekta danych
4	2023-01-05				✓	Korekta danych
5	2023-01-09				✓	Korekta danych
6	2023-01-10				✓	Korekta danych
7	2023-01-11				✓	Korekta danych
8	2023-01-12				✓	Korekta danych
9	2023-01-13				✓	Korekta danych
10	2023-01-16				✓	Korekta danych
11	2023-01-17				✓	Korekta danych
12	2023-01-18				✓	Korekta danych
13	2023-01-19				✓	Korekta danych
14	2023-01-20				✓	Korekta danych
15	2023-01-23				✓	Korekta danych Awaria systemu administratora lub inne czynniki operacyjne
16	2023-01-24				✓	Korekta danych
17	2023-01-25				✓	Korekta danych

¹ [Komunikat GPW Benchmark w sprawie udostępnianej zaktualizowanej bazy danych historycznych WIRON®](#)

² Por. pkt 4. [Regulamin Indeksu Stopy Procentowej WIRON](#)

18	2023-01-26				✓	Korekta danych
19	2023-01-27				✓	Korekta danych
20	2023-01-30				✓	Korekta danych
21	2023-01-31	✓				Korekta danych
22	2023-02-01				✓	Korekta danych
23	2023-02-02				✓	Korekta danych
24	2023-02-03				✓	Korekta danych
25	2023-02-06				✓	Korekta danych
26	2023-02-07				✓	Korekta danych
27	2023-02-08				✓	Korekta danych
28	2023-02-09				✓	Korekta danych
29	2023-02-10				✓	Korekta danych
30	2023-02-13				✓	Korekta danych
31	2023-02-14				✓	Korekta danych
32	2023-02-15				✓	Korekta danych
33	2023-02-16				✓	Korekta danych
34	2023-02-17				✓	Korekta danych
35	2023-02-20				✓	Korekta danych
36	2023-02-21				✓	Korekta danych
37	2023-02-22				✓	Korekta danych
38	2023-02-23				✓	Korekta danych
39	2023-02-24				✓	Korekta danych
40	2023-02-27				✓	Korekta danych
41	2023-02-28				✓	Korekta danych
42	2023-03-01				✓	Korekta danych
43	2023-03-02				✓	Korekta danych
44	2023-03-03				✓	Korekta danych
45	2023-03-06				✓	Korekta danych
46	2023-03-07				✓	Korekta danych
47	2023-03-08				✓	Korekta danych
48	2023-03-09				✓	Korekta danych
49	2023-03-10				✓	Korekta danych
50	2023-03-13				✓	Korekta danych
51	2023-03-14				✓	Korekta danych
52	2023-03-15				✓	Korekta danych
53	2023-03-16				✓	Korekta danych
54	2023-03-17				✓	Korekta danych
55	2023-03-20				✓	Korekta danych
56	2023-03-21				✓	Korekta danych
57	2023-03-22				✓	Korekta danych
58	2023-03-23				✓	Korekta danych
59	2023-03-24				✓	Korekta danych
60	2023-03-27				✓	Korekta danych

61	2023-03-28				✓	Korekta danych
62	2023-03-29				✓	Korekta danych
63	2023-03-30				✓	Korekta danych
64	2023-03-31				✓	Korekta danych
65	2023-04-03				✓	Korekta danych
66	2023-04-04				✓	Korekta danych
67	2023-04-05				✓	Korekta danych
68	2023-04-06				✓	Korekta danych
69	2023-04-07				✓	Korekta danych
70	2023-04-11				✓	Korekta danych
71	2023-04-12				✓	Korekta danych
72	2023-04-13				✓	Korekta danych
73	2023-04-14				✓	Korekta danych
74	2023-04-17				✓	Korekta danych
75	2023-04-18				✓	Korekta danych
76	2023-04-19				✓	Korekta danych
77	2023-04-20				✓	Korekta danych
78	2023-04-21				✓	Korekta danych
79	2023-04-24				✓	Korekta danych
80	2023-04-25				✓	Korekta danych
81	2023-04-26			✓		Korekta danych
82	2023-04-27			✓		Korekta danych
83	2023-04-28				✓	Korekta danych
84	2023-05-02				✓	Korekta danych
85	2023-05-04			✓		Korekta danych
86	2023-05-05				✓	Korekta danych
87	2023-05-08				✓	Korekta danych
88	2023-05-09				✓	Korekta danych
89	2023-05-10				✓	Korekta danych Opóźnione przekazanie danych
90	2023-05-11				✓	Korekta danych
91	2023-05-12				✓	Korekta danych
92	2023-05-15				✓	Korekta danych
93	2023-05-16				✓	Korekta danych
94	2023-05-17				✓	Korekta danych
95	2023-05-18				✓	Korekta danych
96	2023-05-19				✓	Korekta danych
97	2023-05-22				✓	Korekta danych
98	2023-05-23				✓	Korekta danych
99	2023-05-24				✓	Korekta danych
100	2023-05-25				✓	Korekta danych
101	2023-05-26				✓	Korekta danych
102	2023-05-29				✓	Korekta danych

103	2023-05-30				✓	Korekta danych
104	2023-05-31			✓		Korekta danych
105	2023-06-01				✓	Korekta danych
106	2023-06-02		✓			Korekta danych
107	2023-06-05				✓	Korekta danych
108	2023-06-06				✓	Korekta danych
109	2023-06-07				✓	Korekta danych
110	2023-06-09				✓	Korekta danych
111	2023-06-12				✓	Korekta danych
112	2023-06-13				✓	Korekta danych
113	2023-06-14				✓	Korekta danych
114	2023-06-15				✓	Korekta danych
115	2023-06-16				✓	Korekta danych
116	2023-06-19				✓	Korekta danych
117	2023-06-20				✓	Korekta danych
118	2023-06-21				✓	Korekta danych
119	2023-06-22				✓	Korekta danych
120	2023-06-23				✓	Korekta danych
121	2023-06-26				✓	Korekta danych
122	2023-06-27				✓	Korekta danych
123	2023-06-28				✓	Korekta danych
124	2023-06-29				✓	Korekta danych
125	2023-06-30			✓		Korekta danych
126	2023-07-03				✓	Korekta danych
127	2023-07-04				✓	Korekta danych
128	2023-07-05				✓	Korekta danych
129	2023-07-06				✓	Korekta danych
130	2023-07-07				✓	Korekta danych
131	2023-07-10				✓	Korekta danych
132	2023-07-11				✓	Korekta danych
133	2023-07-12			✓		Korekta danych
134	2023-07-13				✓	Korekta danych
135	2023-07-14				✓	Korekta danych
136	2023-07-17				✓	Korekta danych
137	2023-07-18				✓	Korekta danych
138	2023-07-19				✓	Korekta danych
139	2023-07-20				✓	Korekta danych
140	2023-07-21				✓	Korekta danych
141	2023-07-24				✓	Korekta danych
142	2023-07-25				✓	Korekta danych
143	2023-07-26				✓	Korekta danych
144	2023-07-27				✓	Korekta danych
145	2023-07-28				✓	Korekta danych

146	2023-07-31				✓	Korekta danych
147	2023-08-01				✓	Korekta danych
148	2023-08-02				✓	Korekta danych
149	2023-08-03				✓	Korekta danych
150	2023-08-04				✓	Korekta danych
151	2023-08-07				✓	Korekta danych
152	2023-08-08				✓	Korekta danych
153	2023-08-09				✓	Korekta danych
154	2023-08-10				✓	Korekta danych
155	2023-08-11				✓	Korekta danych
156	2023-08-14				✓	Korekta danych
157	2023-08-16				✓	Korekta danych
158	2023-08-17				✓	Korekta danych
159	2023-08-18				✓	Korekta danych
160	2023-08-21				✓	Korekta danych
161	2023-08-22				✓	Korekta danych
162	2023-08-23				✓	Korekta danych
163	2023-08-24				✓	Korekta danych
164	2023-08-25				✓	Korekta danych
165	2023-08-28				✓	Korekta danych
166	2023-08-29				✓	Korekta danych
167	2023-08-30				✓	Korekta danych Opóźnione przekazanie danych
168	2023-08-31				✓	Korekta danych
169	2023-09-01		✓			Korekta danych
170	2023-09-04				✓	Korekta danych
171	2023-09-05				✓	Korekta danych
172	2023-09-06			✓		Korekta danych
173	2023-09-07				✓	Korekta danych
174	2023-09-08				✓	Korekta danych
175	2023-09-11				✓	Korekta danych
176	2023-09-12				✓	Korekta danych
177	2023-09-13			✓		Korekta danych
178	2023-09-14			✓		Korekta danych
179	2023-09-15				✓	Korekta danych
180	2023-09-18		✓			Korekta danych
181	2023-09-19		✓			Korekta danych
182	2023-09-20	✓				Korekta danych
183	2023-09-21		✓			Korekta danych
184	2023-09-22		✓			Korekta danych
185	2023-09-25			✓		Korekta danych
186	2023-09-26		✓			Korekta danych
187	2023-09-27	✓				Korekta danych

188	2023-09-28				✓	Korekta danych
189	2023-09-29			✓		Korekta danych Awaria systemu administratora lub inne czynniki operacyjne
190	2023-10-02				✓	Korekta danych
191	2023-10-03				✓	Korekta danych Opóźnione przekazanie danych
192	2023-10-04			✓		Korekta danych
193	2023-10-05				✓	Korekta danych
194	2023-10-06			✓		Korekta danych
195	2023-10-09		✓			Korekta danych
196	2023-10-10		✓			Korekta danych
197	2023-10-11		✓			Korekta danych
198	2023-10-12	✓				Korekta danych
199	2023-10-13			✓		Korekta danych
200	2023-10-16				✓	Korekta danych
201	2023-10-17				✓	Korekta danych
202	2023-10-18		✓			Korekta danych
203	2023-10-19				✓	Korekta danych
204	2023-10-20				✓	Korekta danych
205	2023-10-23				✓	Korekta danych
206	2023-10-24				✓	Korekta danych
207	2023-10-25			✓		Korekta danych
208	2023-10-26			✓		Korekta danych
209	2023-10-27				✓	Korekta danych
210	2023-10-30				✓	Korekta danych
211	2023-10-31				✓	Korekta danych
212	2023-11-02				✓	Korekta danych
213	2023-11-03				✓	Korekta danych
214	2023-11-06				✓	Korekta danych
215	2023-11-07				✓	Korekta danych
216	2023-11-08				✓	Korekta danych
217	2023-11-09	✓				Korekta danych
218	2023-11-10	✓				Korekta danych
219	2023-11-13				✓	Korekta danych
220	2023-11-14				✓	Korekta danych
221	2023-11-15				✓	Korekta danych
222	2023-11-16				✓	Korekta danych
223	2023-11-17				✓	Korekta danych
224	2023-11-20				✓	Korekta danych
225	2023-11-21				✓	Korekta danych
226	2023-11-22				✓	Korekta danych
227	2023-11-23				✓	Korekta danych
228	2023-11-24				✓	Korekta danych
229	2023-11-27				✓	Korekta danych

230	2023-11-28				✓	Korekta danych
231	2023-11-29				✓	Korekta danych
232	2023-11-30		✓			Korekta danych
233	2023-12-01				✓	Korekta danych
234	2023-12-04				✓	Korekta danych
235	2023-12-05			✓		Korekta danych
236	2023-12-06		✓			Korekta danych
237	2023-12-07		✓			Korekta danych
238	2023-12-08				✓	Korekta danych
239	2023-12-11		✓			Korekta danych
240	2023-12-12	✓				Korekta danych
241	2023-12-22	✓				Korekta danych

Tabela 1 Prezentacja wpływu według Daty Wskaźnika; okres od 2 stycznia 2023 roku do 29 marca 2024 roku.

W przypadku 201 dat wskaźnika wartość bezwzględna wpływu korekty danych wejściowych na wartość wskaźnika referencyjnego wyniosła ponad 0,02 p.p. W zbiorze tych dat, średnia bezwzględna wartość wpływu wyniosła 0,083 p.p., mediana wyniosła 0,079 p.p., zaś maksymalne odnotowane odchylenie osiągnęło wartość 0,246 p.p. Dolny kwartył rozkładu odchyleń w tym zbiorze wyniósł 0,054 p.p., zaś górny kwartył wyniósł 0,101 p.p.

W porównaniu z tabelą zaprezentowaną w raporcie za Q3 i Q4 2023, powyższa tabela różni się o informacje o błędach operacyjnych w dniach 23.01.2023 oraz 29.09.2023. Ponadto w dniu 18.10.2023 odnotowano zmniejszenie skali wpływu korekt danych – na dzień publikacji raportu wpływ ten mieścił się w przedziale (0,005; 0,010> w porównaniu do wpływu w przedziale (0,010; 0,020>, który odnotowano w raporcie za Q3 i Q4 2023.

W przypadku aktualizacji historycznych danych transakcyjnych przez podmioty przekazujące dane prezentowane statystyki mogą ulec zmianie.