

**Zestawienie kluczowych pojęć dotyczących Indeksu Stopy Procentowej WIRON
oraz Rodziny Indeksów Składanych WIRON**

Data publikacji: 16 grudnia 2022

Data aktualizacji: -

Poniżej przedstawiono kluczowe pojęcia, stosowane w Regulaminie Indeksu Stopy Procentowej WIRON oraz Regulaminie Rodziny Indeksów Składanych WIRON oraz Kodeksie Postępowania Wskaźników Transakcyjnych, wraz z ich definicjami.

administrator	GPW Benchmark S.A.
błąd	zdarzenie, które nie stanowi podejrzanym 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 przekazywane administratorowi, dotyczące transakcji zawartych przez podmioty przekazujące dane w segmentach rynku pieniężnego, określone w procedurze przekazywania danych, w tym dane wejściowe
dane dotyczące transakcji	dające się zaobserwować wartości, reprezentujące transakcje między niepowiązаныmi kontrahentami na aktywnym rynku
dane wejściowe	dane przekazywane przez podmiot przekazujący dane administratorowi, wskazane w pkt 6 Kodeksu Postępowania Rodziny Wskaźników Transakcyjnych, które administrator wykorzystuje do wyznaczenia wskaźnika referencyjnego WIRON
data wskaźnika WIRON	data zawarcia transakcji depozytowych, które są danymi wejściowymi do wyznaczenia wartości WIRON
data wskaźnika WIRON Stopa Składana	data końca okresu referencyjnego, czyli kolejny dzień roboczy po dacie wskaźnika WIRON, który jako ostatni wykorzystany jest do wyznaczenia WIRON Stopa Składana
data wskaźnika WIRON Indeks Jednospodstawowy	kolejny dzień roboczy po dacie wskaźnika WIRON, który jako ostatni wykorzystany jest do wyznaczenia WIRON Indeks Jednospodstawowy
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
kluczowy element metody	element metod opracowywania, którego zmiana może być uznana za zmianę istotną, o której mowa w art. 28 ust 2 Rozporządzenia o Wskaźnikach Referencyjnych

kodeks postępowania	kodeks postępowania opracowywany przez administratora w odniesieniu do rodziny wskaźników referencyjnych, w którym wyraźnie określa zakres odpowiedzialności podmiotów przekazujących dane w odniesieniu do przekazywania danych wejściowych (jeśli metoda opracowywania wskaźnika opiera się na danych wejściowych pochodzących od podmiotów przekazujących dane)
kryteria podmiotu przekazującego dane	obligatoryjne kryteria, jakie musi spełniać podmiot, aby uzyskać status podmiotu przekazującego dane
metoda opracowywania/metoda	zebrane zasady przygotowania danych wejściowych oraz wyznaczania wartości indeksu lub wskaźnika
ocena ekspercka	korzystanie przez administratora lub podmiot przekazujący dane ze swobody uznania w odniesieniu do wykorzystania danych przy wyznaczaniu wskaźnika referencyjnego
O/N overnight	termin zapadalności dla transakcji, która zaczyna się w dniu jej zawarcia a kończy w następnym dniu roboczym po jej zawarciu
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
podejrzane dane wejściowe	dane wejściowe, w stosunku do których istnieje podejrzenie próby manipulacji
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 Wskaźników Transakcyjnych
Procedura przekazywania danych	procedura określająca zasady przekazywania do administratora danych, w tym danych wejściowych
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
rynek referencyjny	rynek, którego pomiar jest celem danego indeksu lub wskaźnika transakcyjnego
transakcja depozytowa	transakcja podmiotu przekazującego dane o oprocentowaniu stałym, polegająca na przyjęciu lub złożeniu środków pieniężnych (w odniesieniu do transakcji z instytucjami kredytowymi, instytucjami kredytowymi – loro oraz instytucjami finansowymi – bank zagraniczny) w złotym na określony termin, od których naliczane są odsetki za okres, na jaki środki te zostały przyjęte lub złożone (w odniesieniu do transakcji z instytucjami kredytowymi, instytucjami kredytowymi – loro oraz instytucjami

	finansowymi – bank zagraniczny), 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
WIRON	<i>Warsaw Interest Rate OverNight</i> , 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 6.4 Kodeksu Postępowania Wskaźników Transakcyjnych
WRR®	<i>Warsaw Repo Rate®</i> , wskaźnik transakcyjny będący indeksem przeznaczonym do stosowania jako wskaźnik referencyjny stopy procentowej, dotyczący terminu zapadalności O/N, opracowywany przez Administratora na podstawie transakcji warunkowych zawieranych przez podmioty przekazujące dane z podmiotami wskazanymi w pkt 6.5 Kodeksu Postępowania Wskaźników Transakcyjnych
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, jest wyznaczany w oparciu o stopę, według której banki mogą udzielać pożyczek innym bankom lub pożyczać od innych banków na rynku finansowym
wskaźnik transakcyjny	WIRON lub WRR® oraz inne indeksy w rozumieniu Rozporządzenia o Wskaźnikach Referencyjnych, które administrator opracowuje na podstawie danych wejściowych, lub indeksy opracowywane na podstawie WIRON oraz WRR®, które mogą być wykorzystywane jako wskaźniki referencyjne stóp procentowych, stanowiące rodzinę wskaźników transakcyjnych
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 WIRON