

Warszawa, dnia 5 grudnia 2014 r.

Bank Handlowy w Warszawie S.A.

ul. Senatorska 16

00-923 Warszawa

Zarząd Stowarzyszenia

Rynków Finansowych ACI Polska

ul. Wilcza 31 lok. 1A

00-544 Warszawa

Oświadczenie o zgodności z Wytycznymi ESMA-EBA ws. wyznaczania stawek
referencyjnych w Unii Europejskiej

(ESMA-EBA Principles for Benchmark-Setting Processes in the EU)

Bank Handlowy w Warszawie S.A. (dalej „Bank”), będący Uczestnikiem Fixingu stawki referencyjnej WIBID/WIBOR, w rozumieniu Regulaminu Fixingu Stawek Referencyjnych WIBID i WIBOR, wydane przez Stowarzyszenie Rynków Finansowych ACI Polska, obowiązującego od dnia 1 lipca 2013 roku, tj. podmiotem działającym jako *Benchmark Submitter* w rozumieniu Wytycznych ESMA-EBA ws. wyznaczania stawek referencyjnych w Unii Europejskiej z dnia 6 czerwca 2013 r. (*ESMA-EBA Principles for Benchmark-Setting Processes in the EU*) (dalej „Wytyczne ESMA-EBA”), w celu wypełnienia obowiązku wynikającego z wytycznej C.11 Wytycznych ESMA-EBA, niniejszym oświadcza, iż co do zasady spełnia Wytyczne ESMA-EBA, z zastrzeżeniem opisanym w Aneksie do niniejszego dokumentu.

Ponadto, Bank wskazuje, że w związku z tym, iż Wytyczne ESMA-EBA nie zostały opublikowane w polskiej wersji językowej, istnieje ryzyko, iż poszczególne Wytyczne, z uwagi na możliwe rozbieżności tłumaczeń oraz odmienności w zakresie fixingów poszczególnych europejskich benchmarków, mogą być interpretowane w sposób niejednolity. Dlatego też, interpretacja Wytycznych ESMA-EBA przyjęta przez Bank może różnić się w szczególności od interpretacji regulatorów lub instytucji nadzorczych.

Z poważaniem

Wiceprezes Zarządu
Szef Sub-Sektora Rynków Finansowych

Maciej Kropidłowski

Aneks

Wytyczna C.4

“The conflict of interest policy should include: [...] rules to avoid collusion [...] between Benchmark Submitters and Benchmark Administrators [...].”

Powyższa wytyczna wskazuje na obowiązek ustalenia w polityce konfliktu interesów, zasad mających na celu uniknięcie potencjalnych zmów pomiędzy *Benchmark Submitter*'ami, tj. Bankami – Uczestnikami Fixingu stawek referencyjnych WIBID/WIBOR a *Benchmark Administrator*'ami, tj. ACI Polska, jako Organizatorem Fixingu. Regulacje wewnętrzne Banku zawierają ogólne zasady w zakresie zarządzania konfliktem interesów i przewidują generalne zakazy wpływania w jakikolwiek sposób na kwotowanie stawek referencyjnych WIBID/WIBOR przez wszelkie podmioty, niemniej jednak nie regulują literalnie kwestii zapobiegania zmomom pomiędzy Bankiem a ACI Polska, jako Organizatorem Fixingu. Szczegółowa regulacja obowiązku wskazanego w powyższej wytycznej może wymagać uzgodnień pomiędzy Bankiem a ACI Polska, dlatego też Bank wyraża gotowość przystąpienia do takich uzgodnień.