

Program wydarzenia:



Data: 21.02.2025

Miejsce: Stacjonarnie

ZABEZPIECZANIE RYZYKA WALUTOWEGO W FIRMIE

I dzień (piątek):

8:45-9:00	Rejestracja uczestników
09:00-9:15	Informacje o organizatorze- Poznański Park Naukowo-Technologiczny
09.15-10.15	<p>Przegląd bieżących prognoz kursów walut - mapa zbiorcza kilkudziesięciu prognoz autorstwa kilkudziesięciu instytucji finansowych, badawczych, akademickich.</p> <p>Sezonowość kursu EUR/PLN</p> <p>Dostęp do notowań rynku międzybankowego - serwisy Reuters, Bloomberg, kwotowania brokerów walutowych.</p>
10:15-10:25	Przerwa kawowa
10:25-11:25	<p>Umiejętne prowadzenie rozmowy z bankowcami znacząco obniża koszty transakcyjne przy wymianie walut.</p> <p>Wybór optymalnego momentu do przeprowadzenia zaplanowanych transakcji zabezpieczających ryzyko kursowe - analiza techniczna, statystyczne wskaźniki.</p>
11:25-11:30	Przerwa kawowa

Program wydarzenia:



11:30-12:30	Elementy Procesu zarządzania ryzykiem kursu walutowego: <ul style="list-style-type: none">• Audyt w zakresie zarządzania ryzykiem kursowym;• Polityka zarządzania ryzykiem kursowym;• Rachunkowość zabezpieczeń;• Zalety i wady zarządzania ryzykiem w ujęciu księgowym i kasowym;• Dostęp do instrumentów finansowych, terminowych, umożliwiających neutralizację ryzyka kursowego (forwardy walutowe, opcje walutowe, otwarta walutowa linia kredytowa, limity skarbowe udzielone przez banki, depozyty zabezpieczające wymagane przez domy maklerskie); Wyjaśnienie pojęć związanych z „otwartą pozycją walutową”
13:15-14:15	Lunch
14:30-16:00	Rozróżnienie typów ryzyka kursowego występującego w przedsiębiorstwie: <ul style="list-style-type: none">• Ryzyko transakcyjne krótko i średnio terminowe;• Ryzyko ekonomiczne długoterminowe;• Ryzyko księgowo; Jakich instrumentów finansowych należy używać do neutralizacji określonego typu ryzyka, a jakich instrumentów należy się wystrzeżać.
14:20-16:00 (z krótką przerwą w połowie)	Omówienie podstawowych instrumentów terminowych przy zarządzaniu ryzykiem kursowym: <ul style="list-style-type: none">• Otwarta linia walutowa-kredytowa• Forward walutowy;• Opcja walutowa;• Strategie złożone z forwardów oraz opcji; Lokaty dwu-walutowe.

Program wydarzenia:



Data: Do ustlenia

Miejsce: Online

II dzień:

09.00-10.00	<p>Omówienie podstawowych instrumentów terminowych przy zarządzaniu ryzykiem kursowym – ciąg dalszy:</p> <ul style="list-style-type: none">• Otwarta linia walutowa-kredytowa• Forward walutowy;• Opcja walutowa;• Strategie złożone z forwardów oraz opcji;• Lokaty dwu-walutowe.
10.00-10.10	Przerwa
10.10-11.10	<p>Przydatne techniki operacyjne:</p> <ul style="list-style-type: none">• Metoda 50/50;• Rolowanie wprzód zapadających transakcji – oddalenie terminu zapadalności;• Rolowanie wstecz –przybliżanie terminu zapadalności;• Stosowanie zleceń oczekujących: limit (order), stop, itp.;• Metoda SWAPowania – przydatna dla importerów oraz eksporterów.
11.10-11.20	Przerwa
11.20-12.20	<p>Ryzyko walutowe w perspektywie obrazu księgowego.</p> <ul style="list-style-type: none">• Ryzyko walutowe w ujęciu kasowym (ekonomicznym) versus księgowym – porównanie.• Definicja zdarzenia gospodarczego w ujęciu kasowym versus księgowym (odmienne traktowanie).• Miejsce powstawania różnic kursowych w księgach rachunkowych. <p>„Ułomność” różnic kursowych i obrazu księgowego na wybranym przykładzie przepływu walutowego w spółce – zadanie w Excelu.</p>

Program wydarzenia:



12.20-13.00	Lunch
13.00-14.00	<p>Rachunkowość zabezpieczeń.</p> <ul style="list-style-type: none">• Przykład wyceny bilansowej – zasady ogólne wymaganych księgowania i ich ryzyko dla spółki .• Wprowadzenie do rachunkowości zabezpieczeń. Warunki stosowania rachunkowości zabezpieczeń.• Rachunkowość zabezpieczeń jako niezbędne element zasad ogólnych przy wycenie bilansowej.• Ryzyko nieposiadania rachunkowości zabezpieczeń. <p>Przykład z zastosowaniem rachunkowości zabezpieczeń. Podsumowanie i główne korzyści stosowania rachunkowości zabezpieczeń.</p>
14.00-14.10	Przerwa
14.10-15.30	<p>Strategie ubezpieczające ryzyko długoterminowe</p> <ul style="list-style-type: none">• Nabyte opcje PUT / CALL .• KORYTARZ.• PARTYCYPATOR.• Forward ubezpieczony opcją. <p>Przykłady z życia wzięte. Ocena bezpieczeństwa instrumentu.</p>

*Organizator zastrzega sobie możliwość zmiany kolejności poszczególnych części programu