

Program szkolenia

„Zabezpieczenie ryzyka walutowego w firmie”

Data szkolenia:

6-7.10.2022 r. od godz. 8.45 do godz. 16.00

Miejsce:

Centrum Biznesu, ul. Wrocławska 133, 45-837 Opole

I dzień 06.10.2022 (czwartek)

08.45–9.00	Rejestracja uczestników
09.00–9.15	<p>Powitanie uczestników Marta Stylska, Advisor Enterprise Europe Network Opole</p> <p>Fundacja Rozwoju Śląska – prezentacja oferty dla firm Pan Piotr Jurkowski, Kierownik Działu Pożyczek</p>
09.15–10.30	<p>Proces zarządzania ryzykiem kursu walutowego - z jakich elementów się składa?</p> <p>Dokumentacja formalna: "Audyt w zakresie zarządzania ryzykiem kursowym", " Polityka zarządzania ryzykiem kursowym", "Rachunkowość zabezpieczeń" - jako element uzupełniający proces zarządzania ryzykiem.</p> <p>Sprawny przepływ informacji pomiędzy działami gospodarczymi (dział zamówień importowych, dział sprzedaży eksportowej),które generują powstawanie ryzyka kursowego oraz działem finansowym, odpowiedzialnym za neutralizację powstającego ryzyka kursowego.</p>

	<p>Wybór celu jaki chce osiągnąć podmiot gospodarczy - czy koncentrujemy się na zarządzaniu ryzykiem w ujęciu księgowym, czy też w ujęciu kasowym? Zalety i wady każdej z metod.</p> <p>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).</p> <p>Konieczność ciągłego dokształcania się pracowników odpowiedzialnych za proces zarządzania ryzykiem kursowym.</p> <p>Możliwość korzystania z zewnętrznych wyspecjalizowanych firm doradczych przy realizacji procesu zarządzania ryzykiem kursowym - zalety i wady, ile to kosztuje, ile można zaoszczędzić.</p> <p>Wyjaśnienie pojęć:</p> <ul style="list-style-type: none"> • otwarta pozycja walutowa; • zamknięta pozycja walutowa; • długa pozycja walutowa; • krótka pozycja walutowa. <p>Zdarzenia gospodarcze wywołujące powstawanie otwartej pozycji walutowej oraz zdarzenia zamykające pozycję walutową.</p>
10.30–10.45	Przerwa kawowa
10.45–12.00	<p>Omówienie podstawowych instrumentów terminowych przy zarządzaniu ryzykiem kursowym:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Forward walutowy; • Opcja walutowa; • Strategie złożone z forwardów oraz opcji; • Lokaty dwu-walutowe.
12.00–12.15	Przerwa kawowa
12.15–13.30	<p>Rozróżnienie typu ryzyka kursowego występującego w przedsiębiorstwie:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Ryzyko transakcyjne krótko i średnio terminowe; • Ryzyko ekonomiczne długoterminowe;

	<ul style="list-style-type: none"> • Ryzyko księgowo; • Jakich instrumentów finansowych należy używać do neutralizacji określonego ryzyka, a jakich instrumentów należy się wystrzeżać. <p>Wybór optymalnego momentu do przeprowadzenia zaplanowanych transakcji zabezpieczających ryzyko kursowe - analiza techniczna, statystyczne wskaźniki.</p>
13.30–14.15	Lunch
14.15–16.00	<p>Przydatne techniki operacyjne:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Metoda 50/50; • Rolowanie w przód zapadających transakcji - oddalenie terminu zapadalności; • Rolowanie wstecz - przybliżanie terminu zapadalności; • Stosowanie zleceń oczekujących: limit (order), stop, itp.; • Metoda SWAPowania - przydatna dla importerów oraz eksporterów.

II dzień 07.10.2022 (piątek)

08.45–9.00	Rejestracja uczestników
09.00–9.15	<p>Powitanie uczestników</p> <p>Marta Stylska, Advisor Enterprise Europe Network Opole</p>
09.15–10.30	<p>Przegląd bieżących prognoz kursów walut - mapa zbiorcza kilkudziesięciu prognoz autorstw kilkudziesięciu instytucji finansowych, badawczych, akademickich.</p> <p>Dostęp do notowań rynku międzybankowego - serwisy Reuters, Bloomberg, kwotowania brokerów walutowych.</p>
10.30–10.45	Przerwa kawowa
10.45–12.00	<p>Sezonowość (w obrębie roku) kursu EUR/PLN - okresy gdy złoty tradycyjnie jest silny oraz tradycyjnie jest słaby. Przegląd danych statystycznych.</p> <p>Metody wyznaczania długookresowych kursów budżetowych oraz sposoby obrony kursów budżetowych.</p>
12.00–12.15	Przerwa kawowa
12.15–13.30	Ryzyko walutowe w perspektywie obrazu księgowego.

	<p>Ryzyko walutowe w ujęciu kasowym (ekonomicznym) versus księgowym - porównanie</p> <p>Definicja zdarzenia gospodarczego w ujęciu kasowym versus księgowym (odmienne traktowanie)</p> <p>Miejsce powstawania różnic kursowych w księgach rachunkowych</p> <p>„Ułomność” różnic kursowych i obrazu księgowego na wybranym przykładzie przepływu walutowego w spółce - zadanie w Excelu.</p> <p>Podsumowanie.</p>
13.30–14.15	Lunch
14.15–16.00	<p>Rachunkowość zabezpieczeń.</p> <p>Wycena bilansowa - zasady ogólne wymaganych księgowości i ich ryzyko dla spółki (przykład)</p> <p>Wprowadzenie do rachunkowości zabezpieczeń</p> <p>Warunki stosowania rachunkowości zabezpieczeń</p> <p>Rachunkowość zabezpieczeń jako niezbędne "lekarstwo na ułomności" zasad ogólnych przy wycenie bilansowej</p> <p>Ryzyko nieposiadania rachunkowości zabezpieczeń</p> <p>Przykład z zastosowaniem rachunkowości zabezpieczeń</p> <p>Podsumowanie i główne korzyści stosowania rachunkowości zabezpieczeń.</p>

Organizator zastrzega sobie możliwość zmiany kolejności poszczególnych części programu.

Projekt Enterprise Europe Network finansowany przez Komisję Europejską ze środków pochodzących z programu Single Market na lata 2022 – 2025 oraz ze środków budżetu państwa w ramach dotacji celowej Ministerstwa Rozwoju i Technologii.

een.opole.pl
westpoland.pl
een.org.pl
een.ec.europa.eu

NDM
Niezależny Dom Maklerski

SPP

enterprise
europe
network
Wspieranie dla biznesu w zasięgu ręki



30lat | Fundacja Rozwoju Śląska
Stiftung für die Entwicklung Schlesiens