

Accountants &
business advisersPKF Consult Spółka
z ograniczoną
odpowiedzialnością
Sp. k.

Zarządzanie ryzykiem walutowym w działalności przedsiębiorstw

Numer usługi 2024/08/06/10291/2253885

📍 zdalna w czasie rzeczywistym

📄 Usługa szkoleniowa

🕒 8 h

📅 27.09.2024 do 27.09.2024

1 476,00 PLN brutto

1 200,00 PLN netto

184,50 PLN brutto/h

150,00 PLN netto/h

Informacje podstawowe

| | |
|--|--|
| Kategoria | Biznes / Zarządzanie przedsiębiorstwem |
| Identyfikator projektu | Kierunek - Rozwój |
| Sposób dofinansowania | wsparcie dla osób indywidualnych wsparcie dla pracodawców i ich pracowników |
| Grupa docelowa usługi | <ul style="list-style-type: none">• Właściciele firm oraz osoby odpowiedzialne za realizację transakcji skarbowych w małych, średnich i dużych przedsiębiorstwach• Dyrektorzy finansowi• Kontrolerzy finansowi• Główni księgowi• Kierownicy działu skarbu• Specjaliści w działach finansowych przedsiębiorstw |
| Minimalna liczba uczestników | 5 |
| Maksymalna liczba uczestników | 20 |
| Data zakończenia rekrutacji | 20-09-2024 |
| Forma prowadzenia usługi | zdalna w czasie rzeczywistym |
| Liczba godzin usługi | 8 |
| Podstawa uzyskania wpisu do BUR | Standard Usługi Szkoleniowo-Rozwojowej PIFS SUS 2.0 |

Cel

Cel edukacyjny

Szkolenie przygotowuje uczestników do zarządzania ryzykiem walutowym, uczestnicy poznają niezbędne narzędzia i umieją się nimi posługiwać

Efekty uczenia się oraz kryteria weryfikacji ich osiągnięcia i Metody walidacji

| Efekty uczenia się | Kryteria weryfikacji | Metoda walidacji |
|--|---|-------------------------------------|
| Uczestnik posługuje się wiedzą z zakresu ryzyka walutowego | Charakteryzuje i rozpoznaje poszczególne instrumenty finansowe niezbędne w zarządzaniu ryzykiem walutowym | Wywiad swobodny |
| | zna narzędzia do zabezpieczenia ryzyka rynkowego | Obserwacja w warunkach symulowanych |

Cel biznesowy

Celem szkolenia z zarządzania ryzykiem jest przekazanie uczestnikom wiedzy oraz umiejętności rozpoznawania i wykorzystywania w praktyce, poszczególnych instrumentów finansowych, które oferowane są eksporterom, importerom oraz kredytobiorcom. Podczas spotkania zaprezentujemy zagadnienia dotyczące efektywnego zarządzania ryzykiem walutowym, jak również z wyceny instrumentów pochodnych, notowanych na rynku międzybankowym.

Efekt usługi

Samodzielna umiejętność raportów finansowych, pozytywny wynik testu.

Metoda potwierdzenia osiągnięcia efektu usługi

Test wiedzy na zakończenie szkolenia

Kwalifikacje

Kompetencje

Usługa prowadzi do nabycia kompetencji.

Warunki uznania kompetencji

Pytanie 1. Czy dokument potwierdzający uzyskanie kompetencji zawiera opis efektów uczenia się?

Dokument potwierdzający uzyskanie kompetencji zawiera opis efektów uczenia się.

Pytanie 2. Czy dokument potwierdza, że walidacja została przeprowadzona w oparciu o zdefiniowane w efektach uczenia się kryteria ich weryfikacji?

Dokument potwierdza, że walidacja została przeprowadzona w oparciu o zdefiniowane w efektach uczenia się kryteria ich weryfikacji

Pytanie 3. Czy dokument potwierdza zastosowanie rozwiązań zapewniających rozdzielanie procesów kształcenia i szkolenia od walidacji?

Dokument potwierdza zastosowanie rozwiązań zapewniających rozdzielanie procesów kształcenia i szkolenia od walidacji.

Program

1. Funkcjonowanie rynku międzybankowego:
 - rynek walutowy (transakcje Spot, oferty FX, platformy wymiany walut, obroty na rynku FX)
 - rynek pieniężny (lokaty międzybankowe, walutowe depozyty dla przedsiębiorstw, krótkoterminowe instrumenty dłużne)
 - giełdowy oraz pozagiełdowy rynek instrumentów pochodnych
 - czynniki ekonomiczne oraz pozaekonomiczne wpływające na wycenę instrumentów finansowych
 - przegląd prognoz sporządzanych przez ekonomistów światowych oraz krajowe instytucje finansowe
2. Wprowadzenie do wyceny instrumentów notowanych na rynku międzybankowym:
 - kontrakty terminowe FX Forward
 - opcje walutowe (waniliowe, barierowe, azjatyckie)
 - transakcje FX Swap
3. Specyfika walutowych instrumentów pochodnych oferowanych klientom banku:
 - krzywa punktów swapowych i związane z nią konsekwencje wyceny transakcji terminowych
 - transakcje NDF, rollback oraz rollover w praktyce
 - zawieranie oraz zamykanie strategii zbudowanych z opcji walutowych
4. Zabezpieczanie transakcji pochodnych zawieranych z klientami banku:
 - umowy ramowe, umowy zabezpieczające, test adekwatności MiFID
 - limity na transakcje pochodne (procedura przyznawania limitu, wagi ryzyka, wycena rynkowa pakietu transakcji)
5. Lokaty dwu-walutowe jako instrument optymalnego zarządzania płynnością gotówkową
6. Lokaty inwestycyjne jako forma lokowania kapitału (wykorzystanie opcji binarnych)
7. Zarządzanie ryzykiem walutowym w praktyce – jak stworzyć politykę zabezpieczeń i nadzorować efektywność realizacji transakcji zabezpieczających?
8. Ćwiczenia praktyczne:
 - przykłady wycen pakietów transakcji pochodnych (ujemna wycena, sprawozdawczość)
 - przykłady ekspozycji klientów:
 - transakcje FX Forward
 - transakcje FX Swap
 - opcje walutowe (Call, Put, strategie opcyjne dla eksporterów oraz importerów)
 - transakcje IRS
9. Ryzyko księgowe a ryzyko kasowe - różne podejścia do zarządzania ryzykiem walutowym
10. Ekonomiczne systemy informacyjne wykorzystywane w praktyce (bloomberg, reuters, inne)

Harmonogram

Liczba przedmiotów/zajęć: 0

| Przedmiot / temat zajęć | Prowadzący | Data realizacji zajęć | Godzina rozpoczęcia | Godzina zakończenia | Liczba godzin |
|-------------------------|------------|-----------------------|---------------------|---------------------|---------------|
| Brak wyników. | | | | | |

Cennik

Cennik

| Rodzaj ceny | Cena |
|---|--------------|
| Koszt przypadający na 1 uczestnika brutto | 1 476,00 PLN |
| Koszt przypadający na 1 uczestnika netto | 1 200,00 PLN |
| Koszt osobogodziny brutto | 184,50 PLN |
| Koszt osobogodziny netto | 150,00 PLN |

Prowadzący

Liczba prowadzących: 1



1 z 1

Hubert Łąkowski

Doktor nauk ekonomicznych, absolwent Uniwersytetu Przyrodniczego w Poznaniu. Ukończył studia doktoranckie na Wydziale Ekonomii Uniwersytetu Ekonomicznego w Poznaniu. Obecnie pracuje w Departamencie Sprzedaży Rynków Finansowych, jako starszy specjalista ds. sprzedaży instrumentów pochodnych. Aktualną ścieżkę kariery rozpoczął w 2013 roku jako corporate dealer, obsługując klientów korporacyjnych w zakresie transakcji na rynkach finansowych. W przeszłości pracował także w PKO Banku Polskim oraz Banku Zachodnim WBK. Szkolenia prowadzi od 2013 r.

Sam stale się doskonali, ukończył wiele kursów i szkoleń w obszarze finansów przedsiębiorstw oraz rynków finansowych. Jego zainteresowania zawodowe to zarządzanie ryzykiem, analiza ekonomiczno-finansowa przedsiębiorstw, bankowość oraz rynki finansowe.

Informacje dodatkowe

Informacje o materiałach dla uczestników usługi

Materiały szkoleniowe w wersji elektronicznej.

Warunki techniczne

Szkolenie będzie realizowane w formule wirtualnej. Dlatego ważne jest, by mieli Państwo stabilne łącze internetowe. Link do szkolenia otrzymają Państwo na dzień przed jego terminem.

Kontakt



Karolina Łąkowska

E-mail karolina.lakowska@pkfpolska.pl

Telefon (+48) 607 595 131